



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

بازار سرمایه بر مدار صعود؟!!!

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۲۸ - هفته منتهی به ۱۴ آبان ۱۴۰۱
گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.ir

eii.co.ir

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی: افزایش نرخ بهره، آمار خوب اشتغال و صعود بازارهای سهام در آمریکا؛
- تصویر اقتصاد کلان: افزایش نرخ بیکاری و نرخ بهره در آمریکا، افزایش نرخ تورم در منطقه یورو و رشد ۱/۲ درصدی مسکن تهران؛
- بورس و انرژی: صعود دوباره نفت خام؛
- فلزات گرانبها و ارز: جهش شش درصدی دلار و ورود به کانال ۳۵ هزار تومان؛
- بازار کالاهای خام: بازدهی مثبت چشمگیر محصولات کشاورزی در سایه رشد مناسب مس و افت شدید بالتیک خشک؛
- بررسی وضعیت صندوقها؛
- بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - کندل سبز ۴۵ هزار واحدی شاخص کل؛
- بررسی شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار؛
- ارزیابی دلاری شاخص کل و محاسبه شاخص وارن بافت؛
- مقایسه نسبت های مالی هلدینگ های چندرشته ای صنعتی.

حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی

افزایش نرخ بهره، آمار خوب اشتغال و صعود بازارهای سهام در آمریکا

اشاره

افزایش نرخ بهره آمریکا از ۳/۲۵ به ۴ درصد و واکنش‌ها به این سیاست فدرال رزرو، حواشی خرید توییت از سوی ایلان ماسک و اخراج گسترده کارکنان آن، تداوم روند صعودی تورم در ترکیه، ثبت آمار خوب اشتغال در آمریکا، مشکلات شبکه تأمین برق در تگزاس بدلیل استخراج رمزارزها در این ایالت و افول بازار خودرو در بریتانیا، از جمله مهمترین اخبار هفته اخیر بودند.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۶۳۷,۳۲۵,۳۱۲	+۰.۳۶%
جان باختگان ۶,۶۰۴,۴۹۷	+۰.۱۸%
بهبودیافتگان ۶۱۶,۷۶۲,۶۱۰	+۰.۴۵%

منبع: New York Times

- BUSINESS
- INSIDER
- بی‌زنس اینسایدر
-
-

فایننشال تایمز



-
-
-
-
-
-
-
-
-
-

بلومبرگ
• Bloomberg

ماسک معتقد است که تحت پرچم مدیریت او، توییت می‌تواند به ارزشمندترین کمپانی جهان بدل شود! بعد از آمار خوب اشتغال آمریکا، بازارهای سهام صعودی شدند.

سازمان اطلاعات اوکراین اعلام کرد سربازان روسی دستور دارند به هم‌زمان‌شان که خودسرانه عقب‌نشینی می‌کنند شلیک کنند. رنو بدنبال ارزش‌گذاری ۱۰ میلیارد دلاری زیرمجموعه ساخت خودروهای الکتریکی خود است. ایلان ماسک نیمی از کارمندان توییت، یعنی ۳۷۰۰ نفر، را در یک روز از طریق ایمیل اخراج کرد! افزایش استخراج بیت‌کوین و سایر رمزارزها توسط شرکت‌ها در تگزاس، شبکه تأمین برق این ایالت را تحت فشار قرار داد.

آمریکا در ادامه نمایش بازار توانمند اشتغالش به جهان، ۲۶۱,۰۰۰ شغل دیگر در ماه گذشته ایجاد کرده است. بازار خودرو بریتانیا در حال حاضر به سمت بدترین فصل فروش خود از سال ۱۹۸۲ پیش می‌رود!

سوناک، نخست‌وزیر بریتانیا، در حال تلاش برای بازگرداندن اعتماد ازدست‌رفته به بازار در دوره لیز تراس است. واردات فلزات سبک از کنگو بدون گرفتاری در درگیری‌های نظامی جاری در این کشور روز بروز سخت‌تر می‌شود.

افزایش نرخ بهره توسط فدرال رزرو ۵/۱ میلیارد دلار برای استفاده‌کنندگان از کارت‌های اعتباری در آمریکا هزینه دارد. اخبار مربوط به حوزه گرمایش جهانی و تغییرات آب و هوایی بعثت وقوع وقایعی مانند تورم گسترده، کاهش رشد اقتصاد جهانی و انتخابات میان‌دوره‌ای آمریکا مورد بی‌توجهی قرار گرفته است

فلزات مورد نیاز برای ساخت باطری و موتور خودروهای الکتریکی در گره‌های زنجیره تأمین جهانی و خطوط انتقال آن گیر کرده است. مشاور امنیت ملی کاخ سفید در راستای نمایش حمایت دولتش از اوکراین، به این کشور سفر کرد.

با افزایش تهاجم روسیه به زیرساخت‌های اوکراین، مقامات این کشور در حال تلاش برای جذب سرمایه‌گذار در این حوزه‌ها و حوزه IT هستند. با به تعویق افتادن روند پرداخت هزینه‌های شرکت استارلینک توسط دولت آمریکا، اینترنت ۱,۳۰۰ پایانه ماهواره‌ای فعال در این کشور قطع شد.

بانک مرکزی آمریکا نرخ بهره را ۰/۷۵ واحد درصد دیگر افزایش داد و آن را به ۴ درصد رساند.

جو بایدن گفت ماسک پلتفرمی را خریداری کرده که به دروغ‌پراکنی در سرتاسر جهان می‌پردازد.

ایلان ماسک تنها یک هفته پس از خرید شرکت توییت، تعدیل گسترده و کاهش کارمندان آن را آغاز کرد.

هجوم گردباد به تگزاس با تعطیل کردن صنایع، خسارت گسترده و مجروحین زیادی بر جای گذاشت.

با وجود پایان اعتصابات کارگران خطوط ریلی در آمریکا و اروپا، هنوز وضعیت حرکت قطارها در آمریکا به وضعیت عادی باز نگشته است.

با رسیدن تورم مواد غذایی ترکیه به نزدیک ۱۰۰ درصد این کشور در محدوده خطر ورود به بحران اعتبارات قرار دارد.

تصمیمات پاول، رئیس بانک مرکزی آمریکا، کار تحلیل‌گران در ارزش‌گذاری سهام بازارهای این کشور را بسیار دشوار کرده است.

مدیر سرمایه‌گذاری شرکت خدمات مالی چند ملیتی بلک‌راک گفت بانک مرکزی آمریکا در حال زیاده‌روی در روند افزایش نرخ بهره است.

یکی از مقامات فدرال رزرو گفت داده‌های جدید بدست آمده از وضعیت اقتصادی، تأثیر مثبتی روی روند افزایش نرخ بهره داشت.

شرکت اسرائیلی پگاسوس، سازنده نرم‌افزارهای جاسوسی که در این مدت رسوایی‌های سیاسی و شکایت‌های متعدد جهانی در این حوزه بعلاوه جنایات مختلف در سطح شهروندی به شکل بین‌المللی به خاطر استفاده از محصولاتش رخ داده، در حال توسل به دولت این کشور برای حفظ موجودیت خود و کسب پیروزی قضایی است.

دوبی ارزش و اندازه عرضه اولیه شرکت «امپاور» که یکی از موتورهای توسعه اقتصادی این کشور است را یک بار دیگر بدلیل تقاضای بالای جهانی برای شرکت در آن افزایش داد.

با کم شدن نرخ رشد اقتصاد جهانی، عربستان سعودی قیمت نفت را برای مشتریان آسیایی خود کاهش داد.

بایدن قصد رویارویی اساسی با شرکت‌های نفتی و ضبط بخشی از سود بالای امسال آنان به نفع دولت با تصویب قوانین مالیاتی را بار دیگر اعلام کرد.

انقلاب و تحول اقتصادی ۳۰۰ میلیون دلاری بیت‌کوین محور در السالوادور در حال شکست خوردن به شکلی دردناک است.

سقوط ارزش سهام شرکت متا نشان می‌دهد دوره سلطه شرکت‌های بزرگ حوزه تکنولوژی بر اقتصاد جهانی در حال پایان یافتن است.

چین و آمریکا اکنون بجای کمک به رشد کیک اقتصاد جهان، مشغول جنگیدن برای تصاحب تکه‌های بیشتری از آن هستند.

تصویر اقتصاد کلان

افزایش نرخ بیکاری و نرخ بهره در آمریکا
افزایش نرخ تورم در منطقه یورو
رشد ۱/۲ درصدی مسکن تهران

مقایسه بازدهی بازارها

بازار	هفتگی	ماهانه	۱۴۰۱	یکساله
دلار (ریالی)	٪۶،۲۴	٪۶،۴۶	٪۳۳،۷۹	٪۲۶،۸۷
سکه (ریالی)	٪۶،۸۷	٪۶،۷۰	٪۲۹،۷۱	٪۳۵،۶۴
بورس (شاخص)	٪۳،۳۹	٪۲،۶۷-	٪۰،۴۵	٪۶،۷۳-
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	٪۵،۱۹	٪۱۰،۷۷	٪۴۲،۶۷-	٪۶۰،۲۴-
مسکن (ریالی - تهران)	-	۱/۲٪	-	۳۸/۲٪

منبع داده‌ها:

وبسایت TGJU : بازدهی دلار و سکه
 وبسایت TSETMC : بازدهی شاخص کل بورس تهران
 بانک مرکزی ج.ا.ا. : بازدهی مسکن
 وبسایت TradingView : بازدهی رمزارزها

مطابق اعلام بانک مرکزی ج.ا.ا. در مهر ماه ۱۴۰۱ هر مترمربع مسکن در تهران بطور متوسط معادل ۴۳/۷۲۵ میلیون تومان معامله شده، که این نرخ نسبت به شهریور ماه معادل ۱/۲ درصد و نسبت به مهر ماه سال ۱۴۰۰ معادل ۳۸/۲ درصد رشد داشته است.

نرخ بهره (درصد)	فصلی	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین سالانه			درآمد سرانه (دلار)	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	حوزه جغرافیایی
		نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ رشد اقتصادی-قیمت ثابت (درصد)			
جهان									
-	-	-	-	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	جهان
-	-	-	-	٪۴/۷	-	٪۶/۱	۱۰.۸۴۵	۹۶،۲۹۲،۵۷۰	مقدار شاخص
				٪۷/۴	-	٪۳/۲			پیش‌بینی (۲۰۲۲)
آمریکا									
۲۲-نوامبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-اکتبر	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	آمریکا
٪۴	٪۲/۶	٪۸/۲	٪۳/۷	٪۴/۷	٪۵/۴	٪۵/۷	۶۹،۲۳۱	۲۲،۹۹۷،۵۰۰	مقدار شاخص
				٪۷/۷	٪۳/۵	٪۲/۳			پیش‌بینی (۲۰۲۲)
چین									
۲۲-اکتبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-اکتبر	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	چین
٪۳/۶۵	٪۳/۹	٪۲/۸	٪۵/۵	٪۰/۹	٪۴/۲	٪۸/۱	۱۲،۳۵۹	۱۷،۴۵۸،۰۴۰	مقدار شاخص
				٪۲/۱	٪۳/۷	٪۳/۳			پیش‌بینی (۲۰۲۲)
منطقه یورو									
۲۲-اکتبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-اکتبر	۲۲-سپتامبر	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۱۹	۲۰۲۰	منطقه یورو
٪۲	٪۰/۲	٪۱۰/۷	٪۶/۶	٪۲/۶	-	٪۵/۳	۳۷،۷۲۳	۱۲،۹۱۶،۶۱۸	مقدار شاخص
				٪۵/۳	٪۷/۷	٪۲/۶			پیش‌بینی (۲۰۲۱)
ایران									
۲۲-مئی	۱۴۰۱ بهار	۱۴۰۱ مهر	۱۴۰۱ تابستان	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۱۴۰۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	ایران
٪۱۸	٪۳/۸	٪۴۸/۶	٪۸/۹	٪۴۰/۱	٪۹/۸	٪۴/۳	۷،۵۵۵	۲۳۱،۵۴۷/۵۷	مقدار شاخص
				٪۳۲/۳	٪۱۰/۲	٪۳			پیش‌بینی (۲۰۲۲)

منبع:

صندوق بین‌المللی پول: پیش‌بینی ۲۰۲۲ و داده‌های مربوط به تولید ناخالص داخلی و درآمد سرانه ۲۰۲۰
 وبسایت TradingEconomics : آمارهای میانگین سالانه، نقطه‌نقطه و فصلی کشورها (به جز ایران) و همچنین آمار مربوط به نرخ بهره
 مرکز آمار ایران: آمارهای میانگین سالانه، نقطه‌نقطه و فصلی ایران

بورس و انرژی

صعود دوباره نفت خام

بورس های جهانی

همانطور که هفته گذشته به سمع و نظرتان رساندیم، ماه های گذشته، مقطع خوبی برای شرکت های حوزه تکنولوژی نبوده اند. بطوریکه از ابتدای سال ۲۰۲۲ تاکنون، قریب به ۳ تریلیون دلار از ارزش ۷ غول تکنولوژی جهان کاسته شده و ارزش سهام بعضی مانند تسلا به نصف یا مانند نتلیکس به کمتر از نصف زمان اوج شان سقوط کرده است. در مورد عملکرد شرکت اپل همین بس که ارزش بازار آن اکنون بیش از مجموع ارزش بازار شرکت های آمازون، متا (فیس بوک) و آلفابت (گوگل) است و مایکروسافت، که در سال ۲۰۲۱ شانه به شانه اپل پیش می آمد، اکنون با سقوط ۳۶ درصدی حدود ۷۲۵ میلیارد دلار از ارزش بازار خود را از دست داده است. بازار این هفته اما بیش از همه چیز تحت تأثیر دو خبر مهم بود: نخست افزایش ۰/۷۵ واحد درصدی نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا و رسیدن آن به ۴ درصد و دوم آمار رضایت بخش اشتغال، که حاکی از افزوده شدن ۲۶۱,۰۰۰ شغل در ماه اکتبر است، که تعداد فرصت های شغلی در آمریکا را به دو برابر آمار بیکاران این کشور رساند. مجموع تأثیر این دو خبر به همراه عملکرد بد درآمدی شرکت ها، بازده حدوداً ۶- درصدی نزدک، ۳-۵- درصدی S&P500 و ۱/۵- درصدی داوجونز بود. گفتنی است هر سه این شاخص ها در اواسط هفته کاهشی بیش از این را تجربه کردند، که آمار اشتغال موجب بهبود نسبی نگاه خریداران به بازارها شد. بازار انگلستان اما با واکنش مثبت به انتصاب سوناک به مقام نخست وزیری و قول او به ترمیم صدمات وارد شده در دوران لیز تراس، قریب به ۳/۸ درصد بازدهی مثبت ثبت کرد. سایر بازارهای اروپایی نیز در واکنش مثبت به کاهش قیمت گاز در این قاره و بازگشت واحدهای تولیدی به مدار تولید و کاهش ارزش یورو، این هفته بازدهی مثبت داشتند. در چین نیز زمزمه های تغییر سیاست کووید- صفر دولت و در اولویت قرار دادن دوباره اقتصاد کافی بود تا شاهد رشد ۵/۴ درصدی بورس شانگهای باشیم.

نفت و محصولات پتروشیمی

این هفته، شروع برنامه کاهش تولید اوپک که سایه آن طی دو هفته اخیر بر سر بازار انرژی بود، تأثیر به مراتب بیشتری بر قیمت نفت و گاز داشت، بطوریکه در پایان هفته شاهد افزایش ۵ درصدی قیمت نفت و ۱۴ درصدی قیمت گاز در آمریکا بودیم. البته هجوم طوفان و گردباد به تگزاس/خلیج مکزیک و تعلیق بخشی از عملیات استخراج ریزارز نیز تأثیرگذار بود. قیمت اوره با توجه به افزایش تولید آن در اروپا با بازگشت بعضی کارخانجات پتروشیمی به مدار طیق روند جاری ماه گذشته، کاهش قابل توجهی را تجربه کرد. شایان ذکر است که برخی از سرمایه گذاران در کوتاه مدت برآورد نفت ۱۰۰ دلاری کردند و برای موعد ۱۲ ماهه در انتظار نفت ۱۲۰ دلاری هستند.



منبع

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
بورس های جهانی						
۱	Dow Jones	۳۲,۳۵۸	واحد	-۱.۵۵%	۶.۷۴%	-۱۰.۹۰%
۲	Nasdaq	۱۰,۸۵۷	واحد	-۵.۹۷%	-۶.۲۶%	-۳۳.۵۸%
۳	S&P 500	۳,۷۶۴	واحد	-۳.۴۸%	-۰.۷۰%	-۱۹.۵۵%
۴	FTSE 100	۷,۳۳۷	واحد	۳.۷۸%	۳.۸۵%	۱.۱۴%
۵	DAX	۱۳,۴۶۰	واحد	۱.۶۳%	۶.۲۳%	-۱۶.۰۳%
۶	CAC 40	۶,۴۱۶	واحد	۲.۲۹%	۶.۲۴%	-۸.۱۸%
۷	NIKKEI 225	۲۷,۲۰۰	واحد	-۰.۳۵%	۰.۷۷%	-۸.۷۱%
۸	SHANGHAI	۳,۰۷۱	واحد	۵.۳۱%	۱.۵۳%	-۱۲.۹۳%
۹	Moex	۲,۱۵۶	واحد	-۰.۴۰%	۵.۳۵%	-۴۸.۳۶%
نفت و انرژی						
۱۰	نفت خام برنت	۹۸.۴۱	دلار/بشکه	۴.۹۵%	۷.۴۲%	۱۸.۹۴%
۱۱	نفت خام WTI	۹۲.۴۵	دلار/بشکه	۵.۱۸%	۶.۴۶%	۱۵.۳۹%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۶.۴۷	دلار/ MMBtu	۱۳.۸۴%	-۱۰.۵۸%	۱۷.۳۱%
۱۳	سید اوپک	۹۳.۵۱	دلار/بشکه	-۰.۳۶%	-۰.۱۶%	۱۲.۹۳%
۱۴	نفت سنگین ایران	۹۳.۲۷	دلار/بشکه	۴.۵۳%	-۰.۹۵%	۱۹.۸۴%
۱۵	گازوئیل	۱,۰۶۲	دلار/تن	۲.۳۱%	۸.۸۷%	۶۲.۹۳%
۱۶	اتانول	۲,۷۴۵	دلار/گالن	۱۱.۳۶%	۱۴.۳۸%	-۸.۸۰%
۱۷	نفتا	۶۷۱	دلار/تن	-۰.۰۶%	-۰.۰۶%	-۹.۲۹%
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۸۷۷	یوان/تن	۰.۴۶%	-۰.۰۳%	-۱۸.۸۹%
۱۹	متانول CFR	۳۱۰	دلار/تن	-۰.۹۷%	-۴.۸۴%	-۱۹.۰۳%
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۵۶۰	دلار/تن	-۴.۴۶%	-۹.۶۲%	-۳۵.۵۲%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۹۵۰	دلار/تن	-۳.۱۶%	-۸.۴۲%	-۱۶.۸۴%

TeleTrader

TradingEconomics

TeleTrader

TeleTrader

TeleTrader

OilPrice

OilPrice

TeleTrader

TradingEconomics

TradingEconomics

Sunsirs

PLATTS

Fertilizerworks

PLATTS

سنت /متر
مکعب

۲۲.۸۹

فلزات گرانبها و ارز

جهش شش درصدی دلار و ورود به کانال ۳۵ هزار تومان

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۶۸۰	دلار/اونس	۲.۱۶%	-۲۰.۰۸%	-۷.۵۳%	TeleTrader
۲	نقره	۲۰.۸۷	دلار/اونس	۸.۳۰%	۱.۰۷%	-۱۳.۵۸%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۱۲ آبان							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۳,۹۳۰,۰۰۰	ریال	۲.۳۱%	-۰.۴۰%	۱۸.۹۰%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۶۰,۰۵۰,۰۰۰	ریال	۶.۵۷%	۴.۵۰%	۳۵.۲۸%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۱۲ آبان							
۵	دلار آزاد	۳۵۰,۸۰۰	ریال	۶.۱۴%	۵.۹۸%	۲۵.۷۵%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۷۱,۹۲۸	ریال	۰.۳۰%	-۰.۷۹%	۱۸.۰۲%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۷۴,۳۹۸	ریال	۰.۳۰%	-۰.۷۹%	۱۸.۰۲%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۴۰,۷۱۰	ریال	۳.۱۲%	۳.۱۰%	۵.۳۹%	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۸,۴۳۲	ریال	-۱.۶۲%	۱.۴۵%	۰.۶۰%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۷۰,۸۷۰	ریال	-۱.۶۲%	۱.۴۵%	۰.۶۰%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۷,۹۱۸	ریال	۰.۲۳%	-۰.۵۴%	۸.۴۶%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۴,۰۴۴	ریال	۰.۳۰%	-۰.۷۹%	۱۸.۰۱%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۷۴,۷۱۷	ریال	۰.۳۰%	-۰.۷۹%	۱۸.۰۱%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت کوین	۲۱,۴۲۳	دلار	۲.۸۴%	۶.۲۹%	-۶۴.۸۸%	Tradingview
۱۵	اتریوم	۱,۶۵۲	دلار	۱.۹۱%	۲۲.۲۳%	-۶۳.۱۱%	Tradingview

بازار فلزات گرانبها

طی هفته گذشته اونس جهانی طلا نوساناتی با برآیند منفی را تجربه کرد و با افت ۱/۶۳ درصدی، عدد ۱,۶۱۶ دلار را نیز به خود دید. از علل این افت می‌توان به افزایش نرخ بهره آمریکا در جلسه روز چهارشنبه (۲ نوامبر، ۱۱ آبان) فدرال رزرو اشاره کرد. اما در پایان هفته با انتشار آمار مربوط به اشتغال و بیکاری در آمریکا، شاخص دلار تضعیف گردید. در نقطه مقابل اونس جهانی طلا با رشد ۳ درصدی، افت هفته خود را جبران کرد و با نرخ ۱,۶۸۰ دلار به کار خود پایان داد. شایان ذکر است که یکی دیگر از دلایل رشد طلا، فرا رسیدن زمان اعمال تحریم‌های سنگین‌تر ضد روسی بود.

سکه و ارز (داخلی)

با توجه به افزایش تقاضا در بازار ارز، هفته گذشته شاهد جهش ۶ درصدی نرخ دلار در بازار آزاد بودیم. این تقاضا در بازار سکه و طلای داخلی نیز ایجاد گردید و سکه امامی با ۶/۵۷ درصد رشد نسبت به نرخ هفته قبل خود، به کانال ۱۶ میلیون تومان وارد شد.

رمزارز

طی هفته اخیر، ارزش کل بازار کریپتو با افزایش نزدیک به ۴/۴ درصد، به عدد ۱/۰۱ تریلیون دلار رسید که نسبت به هفته قبل از آن رشد ۴۲ میلیارد دلاری را به ما نشان می‌دهد. هفته گذشته تولد نه سالگی اولین دستگاه ATM بیت‌کوین بود. در تاریخ ۲۹ اکتبر سال ۲۰۱۳ نخستین دستگاه خودپرداز بیت‌کوین در یک کافی‌شاپ در ونکوور کانادا راه اندازی شد، که طی گذشت یک هفته پس از نصب، ۳۴۸ تراکنش به ارزش ۱۰۰ هزار دلار در این ATM صورت گرفت. اما حالا Robocoin شرکت اپراتور این ATM پس از ۹ سال، تمام فعالیت‌های خود را به حالت تعلیق درآورده است و احتمالاً اولین دستگاه ATM بیت‌کوین نیز برداشته و یا تعویض شده است. آمارها به ما نشان می‌دهد که امروز ۳۸,۸۰۴ دستگاه خودپرداز بیت‌کوین در سراسر دنیا نصب شده است که ایالات متحده آمریکا سهم ۸۸ درصدی از آن دارد. پس از این کشور، کانادا و اسپانیا به ترتیب در رتبه‌های بعدی قرار دارند. شایان ذکر است که در ماه میلادی گذشته (اکتبر ۲۰۲۲)، از میان ۲۰۵ دستگاه جدید در سطح جهان، ۱۲۹ عدد در ایالات متحده قرار داشت. طبق پیش‌بینی‌ها ارزش ATM‌های بیت‌کوین تا سال ۲۰۲۷ از ۴۶/۴ میلیون دلار به ۴۷۲ میلیون دلار خواهد رسید.

بازار کالاهای خام

بازدهی مثبت چشمگیر محصولات کشاورزی

در سایه رشد مناسب مس و افت شدید بالتیک خشک

بازار محصولات کشاورزی

وزارت زیرساخت اوکراین اعلام کرد ۷ کشتی حامل محصولات کشاورزی روز پنجشنبه بنادر دریای سیاه این کشور را ترک و ۲۹۰ هزار تن محصولات غذایی را به کشورهای اروپایی و آسیایی حمل کردند. با توجه به افزایش عرضه در جهان، نگرانی‌ها در خصوص کمبود جهانی غذا کاهش یافت.

قراردادهای آبی دانه سویا در اوایل نوامبر بالای ۱,۴۰۰ سنت در هر بوشل معامله شد، نزدیک به بالاترین سطح ۶ هفته اخیر، که بدلیل اختلال در عرضه (برزیل) و افزایش صادرات به مصرف‌کننده اصلی چین بود. جاده اصلی دسترسی به بندر پاراناگوآ، دومین جاده برزیل برای صادرات غلات، توسط تظاهرکنندگان معترض به نتایج انتخابات این کشور مسدود شده است. در سمت تقاضا، واردات سویای چین، با افزایش ۱۲ درصدی نسبت به سال قبل و همچنین بالاتر از واردات دو ماه گذشته بوده، که این موضوع بدلیل درخواست این کشور برای بازسازی ذخایر است.

بازار کالاهای صنعتی

معاملات آبی مس تقریباً ۷ درصد افزایش یافت و به سطوحی بی‌سابقه‌ای طی دو ماه گذشته رسید. علت این امر انتشار گزارش‌هایی مبنی بر این بود که دولت چین در نظر دارد از سیاست‌های خود برای مقابله با کووید صفر دوری گزیند و به همین دلیل امیدها به تقاضای بالاتر برای صنعت و ساخت‌وساز افزایش یافت.

معاملات آبی میلگرد فولادی، در ابتدای ماه نوامبر به ۳,۵۰۰ یوان رسید، زیرا تقاضا برای فولاد و سایر فلزات اساسی بدلیل نگرانی‌های رکود کم‌رنگ است. همچنین انجمن جهانی فولاد، پیش‌بینی خود را از تقاضای جهانی برای سال جاری به‌میزان ۲/۳ درصد کاهش داد.

شاخص‌های کالایی

شاخص بالتیک خشک، که شامل نرخ حمل‌ونقل کالا با شناورهای شاخص Panamax، Capesize و Supramax می‌شود، با کاهش ۲/۶ درصدی به ۱,۳۲۳ واحد رسید. شاخص Capesize که محموله‌های سنگ آهن و زغال سنگ ۱۵۰,۰۰۰ تن را دنبال می‌کند، با ۹/۶ درصد افزایش به ۱,۳۴۶ واحد رسید. همچنین شاخص Panamax که حدود ۶۰ تا ۷۰ هزار تن محموله زغال سنگ و غلات را دنبال می‌کند، حدود ۱ درصد کاهش یافت و به ۱,۷۰۰ واحد رسید. در نهایت شاخص حمل‌ونقل با شناورهای کوچک‌تر Supramax با افت ۱۹ واحدی به ۱,۲۶۸ واحد رسید. شاخص بالتیک خشک، در دومین افت هفتگی متوالی حدوداً ۱۸ درصد کاهش یافت.

محصولات کشاورزی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع		
۱	ذرت	۶۸۰	سنت/بوشل	۲۶۸	دلار/تن	۰.۰۵٪	۰.۵۳٪	۲۳.۰۴٪	TeleTrader
۲	کتان (پنبه)	۸۵.۶۷	سنت/پوند	۱۸۸۹	دلار/تن	۱۸.۶۰٪	۲.۹۳٪	-۲۶.۷۰٪	TeleTrader
۳	سویا	۱,۴۵۱	سنت/بوشل	۵۳۳	دلار/تن	۴.۵۹٪	۵.۹۷٪	۲۱.۷۴٪	TeleTrader
۴	شکر	۱۸.۷۱	سنت/پوند	۴۱۲	دلار/تن	۶.۴۳٪	۴.۲۳٪	-۶.۱۷٪	TeleTrader
۵	گندم	۸۴۸	سنت/بوشل	۳۱۱	دلار/تن	۲.۲۳٪	-۶.۰۱٪	۱۰.۶۰٪	TeleTrader
۶	کانولا	۹۲۶	دلار کانادا/تن	۶۷۳	دلار/تن	۱.۹۰٪	۶.۰۷٪	-۷.۱۷٪	TradingEconomics

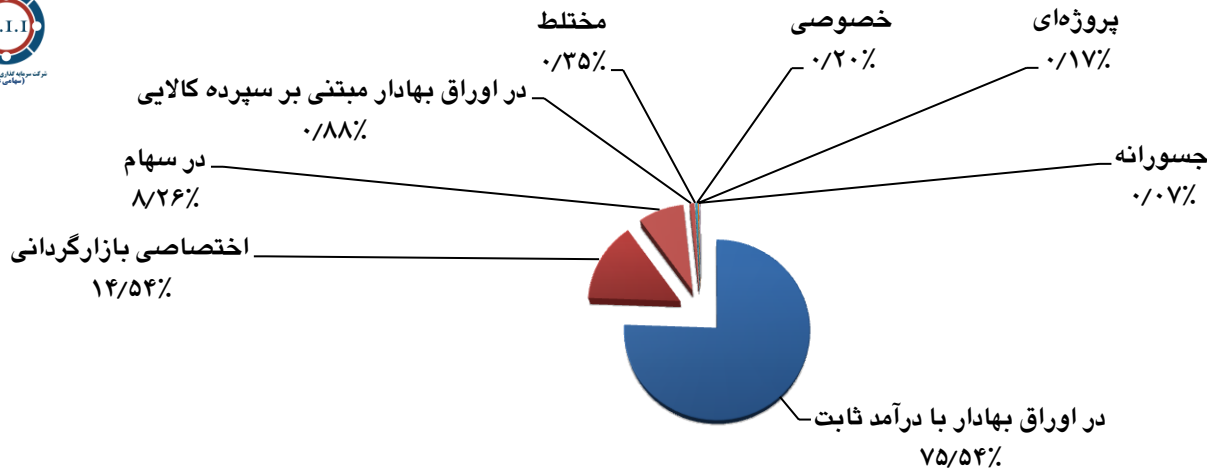
کالاهای صنعتی

۷	مس	۸۱۳۳	دلار/تن			۷.۶۲٪	۵.۸۰٪	-۱۳.۶۰٪	TeleTrader
۸	قیر	۴,۴۰۰	یوان/تن	۶۰۹	دلار/تن	۱.۸۸٪	۰.۴۸٪	۴۹.۹۷٪	TradingEconomics
۹	فولاد	۳,۵۲۹	یوان/تن	۴۸۹	دلار/تن	-۱.۱۸٪	-۱۰.۶۶٪	-۲۱.۴۰٪	TradingEconomics
۱۰	آلومینیوم	۲,۳۵۰	دلار/تن			۵.۱۹٪	۰.۱۷٪	-۷.۹۷٪	TeleTrader
۱۱	سرب	۱,۹۸۶	دلار/تن			-۰.۳۳٪	۲.۳۵٪	-۱۵.۳۸٪	TeleTrader
۱۲	روی	۲,۹۱۱	دلار/تن			۳.۱۹٪	-۵.۴۱٪	-۹.۶۵٪	TeleTrader
۱۳	سنگ آهن	۸۵	دلار/تن			-۴.۵۰٪	-۱۳.۲۷٪	-۷.۶۱٪	TradingEconomics
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۴۹۳	دلار/تن			-۲.۲۳٪	-۷.۳۴٪	-۲۵.۸۵٪	Metal Bulletin
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۴۶۹	دلار/تن			-۱.۷۸٪	۱.۸۵٪	-۲۱.۱۸٪	Metal Bulletin

شاخص‌های کالایی

۱۶	بالتیک خشک	۱,۳۲۳	واحد			-۱۷.۹۳٪	-۳۲.۲۲٪	-۵۲.۲۶٪	tgju.org
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۰۰	واحد			۰.۶۳٪	-۰.۴۴٪	۲۰.۸۷٪	TradingEconomics
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۳,۵۴۵	واحد			-۲.۲۵٪	-۳.۱۸٪	-۱۷.۵۴٪	TradingEconomics
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳,۶۵۳	واحد			۰.۲۴٪	۲.۲۷٪	۲۹.۵۲٪	TradingEconomics

بررسی وضعیت صندوق‌ها



نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	میانگین بازدهی هفتگی (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی 3 ماهه (%)	میانگین بازدهی 6 ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
جسورانه	۴,۲۵۶.۹۲	۱.۱۲٪	۰.۰۶٪	۰.۳۶٪-	۰.۴۴٪	۱.۴۶٪	۲۲.۷۱٪
صندوق در صندوق	۳,۲۹۸.۸۹	۰.۰۰٪	۲.۱۰٪	۰.۱۱٪-	۲.۵۷٪-	۵.۶۵٪-	۴.۸۲٪
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۷۸۲,۵۱۶.۵۸	۱.۰۸٪	۰.۴۸٪	۱.۴۶٪	۴.۳۸٪	۸.۰۵٪	۱۶.۰۱٪
اختصاصی بازارگردانی	۹۲۰,۲۳۴.۲۹	۲.۱۸٪	۰.۹۳٪	۴.۴۸٪-	۷.۳۰٪-	۱۱.۹۳٪-	۴.۶۲٪-
در سهام	۵۲۲,۸۶۵.۸۱	۱.۰۵٪	۳.۱۲٪	۱.۶۶٪-	۷.۹۶٪-	۱۴.۵۶٪-	۴.۵۱٪-
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۵۵,۶۴۷.۶۷	۰.۰۰٪	۴.۹۲٪	۳.۰۴٪	۰.۷۳٪	۹.۹۵٪	۲۱.۵۶٪
مختلط	۲۲,۲۵۰.۹۷	۰.۶۰٪	۱.۴۴٪	۰.۵۰٪-	۲.۳۸٪-	۴.۴۳٪-	۰.۲۷٪-
خصوصی	۱۲,۴۸۷.۹۲	۰.۰۰٪	۰.۱۲٪	۰.۴۳٪	۱.۳۳٪	۲.۹۳٪	۴.۰۴٪
پروژه‌های	۱۰,۸۹۸.۲۷	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪
جمع کل	۶,۳۳۴,۴۵۷						

در هفته منتهی به شنبه ۱۴ آبان ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های جسورانه، درآمد ثابت، خصوصی، مبتنی بر سپرده‌های کالایی، صندوق در صندوق، اختصاصی بازارگردانی، در سهام و مختلط مثبت و بازدهی صندوق‌های پروژه‌های صفر بود.

درعین‌حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های مبتنی بر سپرده کالایی با ۴/۹۲ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های پروژه ای با صفر درصد بود. از سوی دیگر به‌ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۵/۵۴ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۴/۵۴ درصد و سهامی با ۸/۲۶ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

با توجه به بازدهی سالانه، صندوق‌های جسورانه، مبتنی بر سپرده کالایی و درآمد ثابت به‌ترتیب با بازده ۲۲/۷۱ درصد، ۲۱/۵۶ درصد و ۱۶/۰۱ درصد دارای بیشترین بازدهی و صندوق‌های بازارگردانی، در سهام و مختلط با بازده ۴/۶۲- درصد، ۴/۵۱- درصد و ۰/۲۷- درصد دارای کمترین بازدهی بودند.

همچنین جمع کل خالص ارزش دارایی صندوق‌ها نسبت به هفته گذشته ۰/۳ درصد کاهش داشته است.

منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

بررسی وضعیت بازار بدهی

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده	
اخزا۰۲	۹۵۹۰۰۰	۱۴۰۱-۰۸-۱۴	۱۴۰۱-۱۰-۱۹	۲۶.۵۰٪	۲۴.۰۱٪	
اخزا۱۱	۵۵۲۰۴۰	۱۴۰۱-۰۸-۱۴	۱۴۰۴-۰۳-۲۶	۲۵.۵۲٪	۳۱.۰۵٪	
اخزا۰۸	۸۵۵۰۰۰	۱۴۰۱-۰۸-۱۱	۱۴۰۲-۰۶-۰۶	۲۱.۰۷٪	۲۰.۷۰٪	
میانگین بازدهی					۲۴.۸۵٪	۲۶.۰۲٪

منبع: فرابورس ایران

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
گام۰۲۰۴۵۶	۸۴۱۳۴۰	۱۴۰۱-۰۸-۰۷	۱۴۰۲-۰۴-۳۱	۲۵.۸۸٪
اراد۸۶	۹۹۹۰۰۰	۱۴۰۱-۰۸-۱۰	۱۴۰۲-۰۴-۰۴	۱۶.۹۷٪

منبع: فرابورس ایران

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

طی هفته اخیر، بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سررسید نشده متعلق به نمادهای اخزا۱۱ و اخزا۰۲ و اخزا۰۸ با سررسیدهای ۱۴۰۱/۱۰/۱۹ و ۱۴۰۴/۰۳/۲۶ و ۱۴۰۴/۰۳/۲۶ با بازدهی‌های ۲۶/۵۰ و ۳۱/۰۵ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا۰۸ با سررسید ۱۴۰۲/۰۶/۰۶ و بازدهی‌های ۲۱/۰۷ و ۲۰/۷۰ درصد بود.

از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۴/۸۵ و ۲۶/۰۲ درصد است.

اوراق تأمین مالی

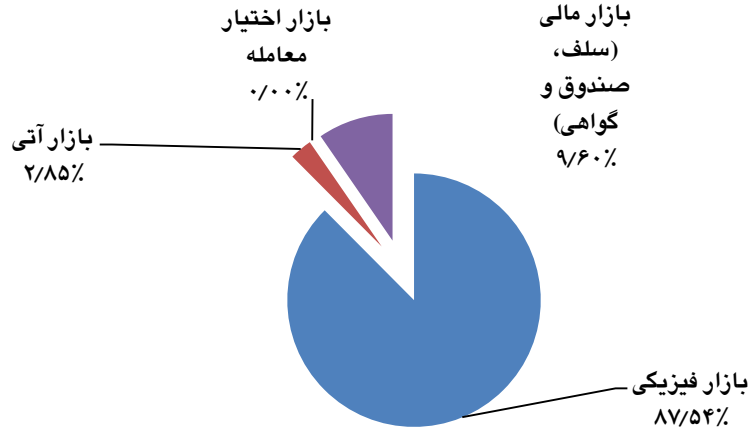
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد اراد۸۶ بمیزان ۱۶/۹۷ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۴/۰۴ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد گام۰۲۰۴۵۶ بمیزان ۲۵/۸۸ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ بوده است.

بورس کالا

بازار فیزیکی



سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۸/۴ درصد از معاملات در بازار فیزیکی مربوط به دو گروه کالاهای صنعتی و پتروشیمی و نفت بود. همچنین ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۱۸/۲۳ درصد و حجم معاملات ۳۰/۲۰ درصد کاهش پیدا کرده است.

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروههای کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	ارزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۷۱,۵۲۷,۱۵۱	۱,۵۸۳,۱۳۴	۵۱/۸%
پتروشیمی و نفتی	۶۴,۴۲۲,۵۶۰	۴۲۸,۹۵۸	۴۶/۶%
اموال غیر منقول	.	.	۰/۰%
معدنی	۹۶۱,۷۲۸	۱۴,۰۰۰	۰/۷%
بازار فرعی	۱,۲۴۴,۸۹۴	۵,۹۳۴	۰/۹%
جمع	۱۳۸,۱۵۷,۳۳۳	۲,۰۳۲,۰۲۶	۱۰۰%

همچنین بررسی تحولات براساس نرخ ارز حواله ارزی نیز، حاکی از عقب ماندن نرخ اوره گرانول و کاتد مس و پیشی گرفتن نرخ بیلت فخور و پت گرید بطری تندگویان از نرخهای جهانی است.

درخصوص مهمترین کالاهای خام جهانی، تحولات ارزش دلاری آنها در بورس کالا بر مبنای نرخ ارز بازار آزاد، حاکی از عقب ماندن نرخ اوره گرانول، نرخ بیلت فخور، نرخ پت گرید بطری شهید تندگویان و نرخ کاتد مس از نرخهای جهانی است.

مقایسه نرخهای بورس کالا با نرخهای جهانی

محصول	نرخ ریالی	میانگین هفته‌ای نرخ (نیمایی دلار)	میانگین هفته‌ای نرخ (دلار آزاد)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نیمایی)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ آزاد)	نرخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نیمایی)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ آزاد)	تغییرات هفته‌ای (نرخ ریالی)
یک تن اوره گرانول	۱۳۸,۲۵۶,۰۰۰	۲۷۱,۵۱۵	۲۳۷,۸۵۰	۵۰۹	۴۰۹	۵۶۰	۹۰/۹%	۷۳/۱%	-۲/۰%
یک تن کاتد مس	۲,۱۳۷,۰۸۸,۰۰۰	۲۷۱,۵۱۵	۲۳۷,۸۵۰	۷,۸۷۱	۶,۳۲۶	۸,۱۳۳	۹۶/۸%	۷۷/۸%	-۹/۶%
یک تن پت شهید تندگویان	۲۹۵,۱۵۹,۰۰۰	۲۷۱,۵۱۵	۲۳۷,۸۵۰	۱,۰۸۷	۸۷۴	۹۵۰	۱۱۴/۴%	۹۲/۰%	۲/۲%
یک تن بیلت فخور	۱۳۴,۳۰۲,۰۰۰	۲۷۱,۵۱۵	۲۳۷,۸۵۰	۴۹۵	۳۹۸	۴۶۹	۱۰۵/۵%	۸۴/۸%	۲/۶%
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۶,۴۷۴,۰۰۰	۲۷۱,۵۱۵	۲۳۷,۸۵۰	۲۴	۱۹	-	-	-	-۰/۷%

تحولات معاملات بورس کالا طی هفته اخیر، نشان‌دهنده روند نوسانی بازار فیزیکی، روند نوزلی بازار آتی و روند صعودی بازارهای مالی و اختیار معامله است.

تحلیل تکنیکال شاخص کل

کندل سبز ۴۵ هزار واحدی شاخص کل



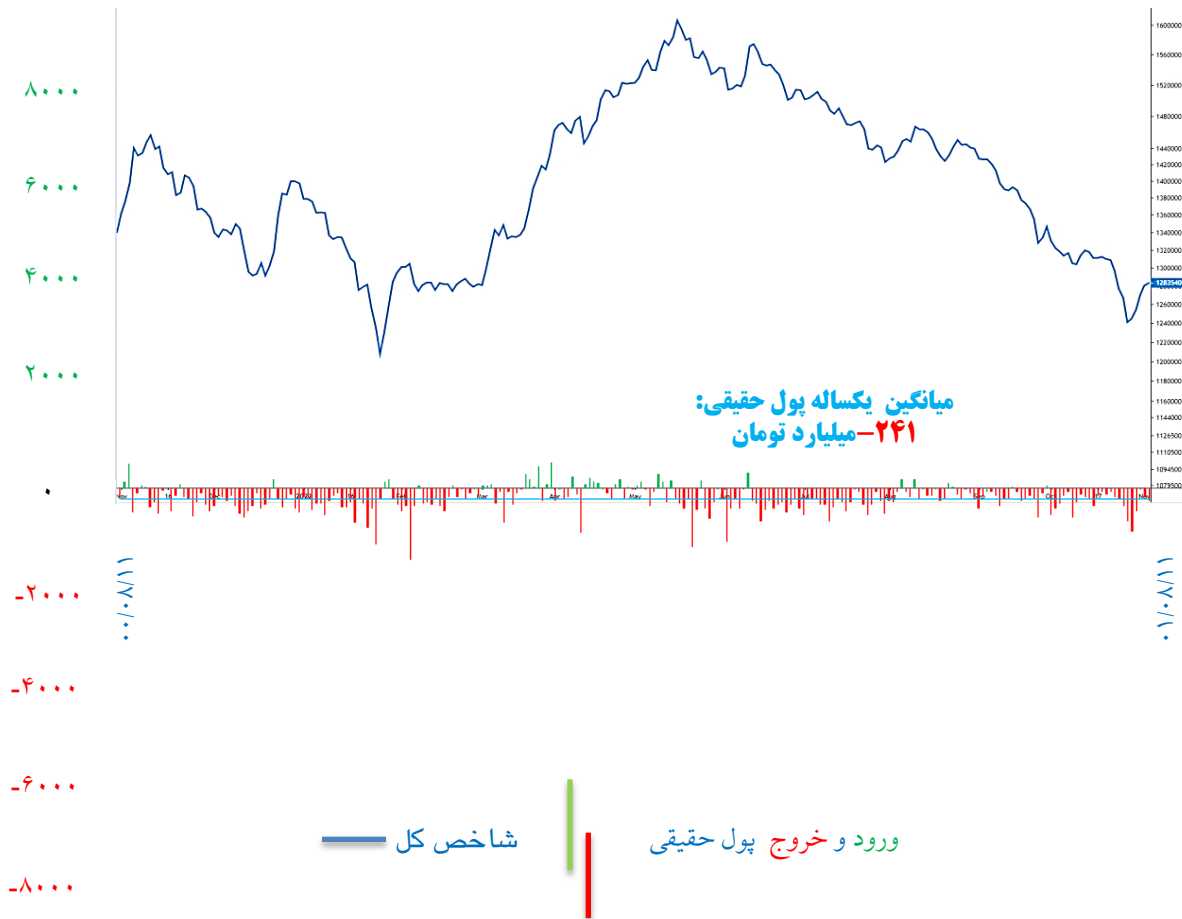
- شاخص کل هفته گذشته با رسیدن به محدوده ۱,۲۴۰,۰۰۰ واحد با واکنشی مثبت همراه شد و با ثبت ۵ کندل سبز روزانه خود را به ۱,۲۸۰,۰۰۰ واحد رساند.
- اما امروز (شنبه ۱۴ آبان ۱۴۰۱) تنها در یک کندل رشدی ۴۵ هزار واحدی را به ثبت رساند و به محدوده ۱,۳۲۸,۰۰۰ واحد رسید.
- ارزش معاملات نیز با رشد همراه بود، اما کماکان شاهد خروج پول حقیقی از بازار هستیم.
- شاخص کل در آستانه رسیدن به خط روند نزولی میان مدت خود است که می‌تواند مانعی جدی برای ادامه رشد آن باشد. به همین دلیل شکست خط روند نزولی و تثبیت بر بالای آن مهم‌ترین نشانه تغییر روند محسوب می‌شود.

❖ توضیحات:

- نمودار از زوایای گوناگون و با توجه به اندیکاتورهای مختلف مورد بررسی قرار گرفته‌اند، سپس جهت زیبایی بصری، قاطبه اندیکاتورها، خطوط روند و کانال‌ها حذف شده است.
- در جهت فهم عموم تلاش شده نتایج تحلیل‌های فوق به زبانی ساده و به طور مختصر نگاشته و تنها به نکات مهم و روند آتی اشاره شود.

شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار

شاخص کل، خالص ورود و خروج پول حقیقی (هزار میلیارد تومان)

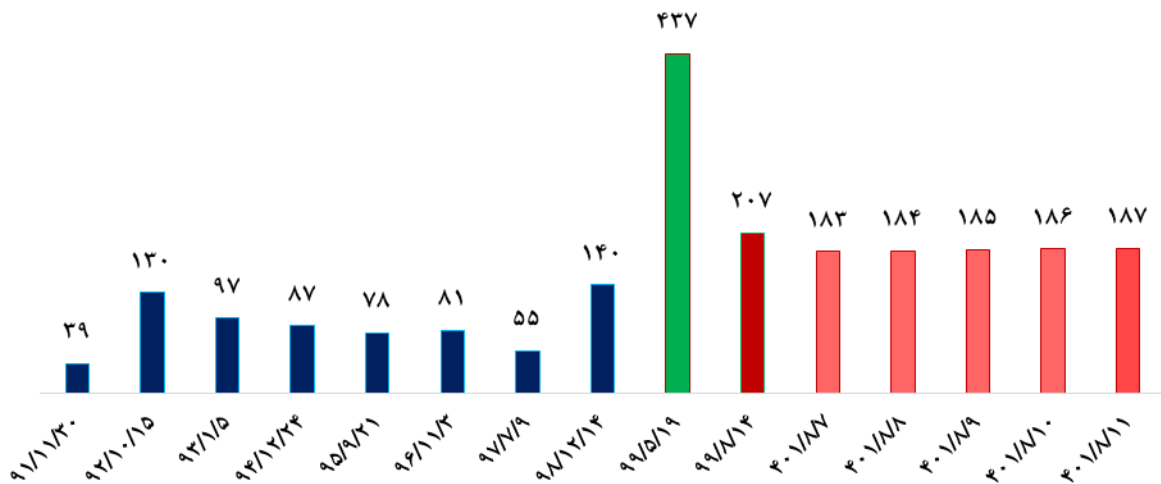


- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۲۸۳,۵۴۰ واحدی و بازده هفتگی ۳/۴۲+ درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۱,۹۲۴ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱ نشان دهنده خروج ۳۲,۱۴۴ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۲۹ میلیارد تومان پول از بازار خارج شده است.
- خالص پول اشخاص حقیقی کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹، که در قله خود (۱۹ امرداد ۱۳۹۹) به عدد ۱۱۸,۲۴۲ میلیارد تومان رسیده بود، به عدد ۴۹/۹۷۴- میلیارد تومان افول کرد.

خالص ورود و خروج پول حقیقی کل بازار طی هفته گذشته:

شنبه	۰۱/۰۷/۰۷	: ۹۱۴-	میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۰۸/۰۸	: ۴۹۹-	میلیارد تومان
دوشنبه	۰۱/۰۸/۰۹	: ۵۰-	میلیارد تومان
سه شنبه	۰۱/۰۸/۱۰	: ۱۹۱-	میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۰۸/۱۱	: ۲۷۲-	میلیارد تومان

نمودار ارزش دلاری قله‌های شاخص کل طی سال‌های ۹۱-۱۴۰۱ (میلیون دلار)



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۱۸۷ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۵۷ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ GDP ایران معادل ۲۳۱/۵۵ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۸۱ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص در تاریخ ۲۸ اکتبر سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۱/۸ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۵/۷ تریلیون دلاری در این کشور، معادل ۱۶۳ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال) (TTM)	P (ریال)	P/E (پیش بینی)	EPS (ریال) (پیش بینی)	سال مالی	P/NAV
شستا	۶.۲۶	۱۲۹	۸۰۷	۴.۲۳	۱۹۱	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۷۸٪
وبانک	۴.۴۲	۲,۰۵۱	۹,۰۶۰	۴.۵۰	۲,۰۱۳	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۸٪
وصندوق	۴.۵۰	۲,۵۰۸	۱۱,۲۸۰	۴.۲۶	۲,۶۴۷	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۵۰٪
وامید	۶.۶۲	۱,۸۲۷	۱۲,۱۰۰	۶.۴۰	۱,۸۹۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۵٪
وغدیر	۶.۹۰	۲,۰۷۱	۱۴,۲۹۰	۵.۰۰	۲,۸۵۹	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۲٪
ونیکي	۴.۵۳	۹۳۲	۴,۵۶۹	-	-	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۴۶٪

بیانیه سلب مسئولیت:

شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)، هیچگونه مسئولیتی در برابر صحت اطلاعات موجود در گزارش‌های تحلیلی تهیه شده توسط کارشناسان این شرکت، که با نام و نشان اهتمام ایرانیان منتشر می‌شود، بر عهده نمی‌گیرد و نظرات ارائه شده در این گزارش‌ها به هیچ وجه به عنوان توصیه‌ای جهت خرید، فروش یا نگهداری سهام شرکت‌ها و سایر ابزارهای معاملاتی نیست و مسئولیت استفاده از این اطلاعات برعهده خوانندگان محترم است.

شناسنامه:

محتوای سری گزارش‌های «تحلیل بازارها»، حاصل تلاش گروهی تیم تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام) است. اسامی تحلیل‌گران، به ترتیب حروف الفبا، عبارت است از:
صدرا آدم‌عارف، احسان برین، عبدالکریم جهاندار، زهرا عزیزپور و بردیا وکیلی

راهبری و نظارت بر محتوا:
رضا جعفری

استفاده از محتوای این گزارش، با ذکر منبع، مجاز است.