



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

استراحت برجای بازار سرمایه!

پس از فروکش کردن سیل اخبار مثبت و منفی (داخلی و خارجی) و در رأس آنها برجام طی هفته‌های اخیر، شاخص کل هفته‌ای نسبتاً کم‌نوسان را پشت سر گذاشت؛ که این استراحت یک‌هفته‌ای را می‌توان «استراحت برجای بازار سرمایه» نام‌گذاری کرد. اما با آغاز هفته جدید، این بار اخبار بین‌المللی بودند که بیش‌ازپیش اذهان را متوجه خود ساختند. در رأس اخبار بین‌المللی می‌توان به بحران اوکراین و صف‌آرایی روسیه در برابر غرب اشاره کرد، که موجب افزایش قابل‌توجه نرخ نفت خام و همچنین اونس جهانی طلا شد. از سوی دیگر، همچنان بحث تصویب/عدم‌تصویب بسته حمایتی دولت از بازار سرمایه و تأثیر آن بر صنایع گوناگون باز است و گمانه‌زنی‌ها در این خصوص در جریان است.

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۹۳ - هفته منتهی به ۲۳ بهمن ۱۴۰۰

گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی: اوکراین: جبهه جنگ روسیه با غرب - تنش بین روسیه و اوکراین به بالاترین حد ۵ سال اخیر رسیده و تمام اروپا در تب نگرانی می‌سوزد؛
- تصویر اقتصاد کلان: تداوم افزایش نرخ تورم در آمریکا؛
- بورس و انرژی: رشد مجدد نفت در پی افزایش تنش‌ها پیرامون مسأله اوکراین؛
- فلزات گرانبها و ارز: اوج‌گیری طلا؛
- بازار کالاهای خام: اثر بحران اوکراین بر بازار کالاهای خام؛
- بررسی صندوق‌ها و بازدهی آنها؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - صعودی کم‌رنگ و احتمال اصلاح مجدد؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - نزول از محدوده ۴۵ هزار دلار؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - شکست خط روند نزولی میان‌مدت؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - سناریوهای پیش روی شاخص دلار؛
- بررسی شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار؛
- ارزیابی دلاری شاخص کل و محاسبه شاخص وارن بافت؛
- مقایسه نسبت‌های مالی هلدینگ‌های چندرشته‌ای صنعتی.

حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی

اوکراین: جبهه جنگ روسیه با غرب

تنش بین روسیه و اوکراین به بالاترین حد ۵ سال اخیر رسیده و تمام اروپا در تب نگرانی می‌سوزد

اشاره

طی چند هفته اخیر، کشمکش‌های روسیه و غرب بر سر اوکراین بالا گرفته و هرروز خبر جدیدی مبنی بر شکل‌گیری آرایش نظامی تازه و اعزام نیرو به اطراف این کشور به گوش می‌رسد. تحولات هفته‌های اخیر در بازار کامودیتی‌ها نشان داده که واکنش بازارها به وقوع یک جنگ احتمالی، افزایش قیمت کالاهای خام خواهد بود.

بلومبرگ

Bloomberg

BUSINESS INSIDER
بیزینس اینسایدر

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۴۰۸,۶۹۶,۹۹۹ +۴/۳۵%

جان باختگان

۵,۸۲۰,۰۴۸ +۱/۳۱%

بهبود یافتگان

۳۲۸,۷۱۱,۸۱۳ +۵/۸۶%

منبع: www.worldometers.info

- قیمت نفت برنت به بالای ۹۵ دلار رسید!
- سود شرکت‌های حوزه انرژی سر به فلک کشیده است.
- نزول قیمت سهام شرکت‌های بزرگ حوزه تکنولوژی، بازارها را به دنبال خود پایین کشید.
- تا فرارسیدن انتخابات ۲۰۲۳ ترکیه، تورم این کشور کاهش یافته و یک رقمی خواهد شد.
- خطوط هوایی، به بازگشت مسافران و اوج گرفتن دوباره فعالیت‌هایشان خوش بین هستند.
- برای کاهش حرارت اقتصاد ایالات متحده، نیاز به شوک درمانی برنامه‌ریزی شده توسط فدرال رزرو نیست.
- هنگ‌کنگ نمی‌تواند هزینه‌ها و صدمات وارده یک قرنطینه تمام‌عیار مانند وهوان را تحمل کند. سرعت گسترش اومیکرون در آن کم نخواهد شد.
- قانون‌گذاران و نمایندگان کنگره آمریکا نباید در معاملات سهام دست داشته باشند.
- باشگاه‌های فوتبال اروپایی، در تلاش برای پول‌سازی و جذب اسپانسر، به تبلیغ رمازرها روی آورده‌اند.
- آمار عرضه بیت‌کوین بین استخراج‌کنندگان آن افزایش یافته است.
- قیمت بالای مسکن در آمریکا، خریداران جوان را مایل به خرید خانه‌های کلنگی و بازسازی آنها جهت زندگی کرده است.
- سازندگان قطعات خودرو در جهان از حاشیه سود پایین‌شان و طمع خودروسازان برای تحصیل سود بیشتر شکایت دارند و این روند را در حال پیشروی نیز می‌دانند.

- صعود سرسختانه نفت به سمت صد دلاری شدن.
- علی‌رغم اینکه افغانستان در مرز قحطی است، بایدن قصد دارد با بخشی از دارایی‌های بلوکه‌شده این کشور، به خانواده قربانیان ۱۱ سپتامبر غرامت پرداخت کند.
- سه ایالت مهم آمریکا از کابینه بایدن بابت افزایش حداقل دستمزد افراد تحت قرارداد مستقیم با دولت، شکایت کردند.
- یک کارآفرین و سرمایه‌گذار آمریکایی، با ۴/۵ میلیارد دلاری بیت‌کوین دزدی و حاصل از پول‌شویی دستگیر شد.
- رئیس بایننس امیدوار است آژانس‌های خبری، پرداخت‌های آنلاین با رمازرها برای حق اشتراک‌شان را شروع کنند.
- اسرائیل، مقامات کنسولگری‌اش را از اوکراین خارج کرد.
- بزرگترین شرکت عمرانی ابوظبی، برنامه دارد ۱/۴ میلیارد دلار در سال ۲۰۲۲ سرمایه‌گذاری در پروژه‌های داخلی امارات داشته باشد.
- بزرگترین شرکت سرمایه‌گذاری حوزه انرژی امارات، در همین بازار داغ و ملتهب امروز هم در حال خرید عمده و بالابردن قیمت سهام شرکت‌های حوزه انرژی است.
- مدیران صنعت تغذیه اعلام کردند حتی بحران کرونا و مصائب اقتصادی ناشی از آن نیز نتوانست میل مردم به شیرینی‌جات و خوراکی‌های مفرح را کم کند.
- رویای سبز شیلی برای بازآفرینی صنایعش جهت همگام بودن‌شان با محیط زیست، موجب ترس سرمایه‌گذاران و عقب‌نشینی از فرصت‌های سرمایه‌گذاری در این کشور شده است.

- تنش‌های بین روسیه و اوکراین به بالاترین حد ۵ سال اخیر رسیده و تمام اروپا در تب نگرانی می‌سوزد.
- بایدن به شهروندان آمریکایی دستور داد اوکراین را ترک کنند.
- افزایش تورم در آمریکا، قدرت خرید مصرف‌کنندگان را به پایین‌ترین حد ۹ سال اخیر رسانده است.
- بایدن دستور داد ۷ میلیارد دلار دیگر از دارایی‌های افغانستان در آمریکا مسدود شود.
- پکن آماده است قرنطینه سخت‌تری را در هنگ‌کنگ اعمال کند.
- روابط گرم چین و صندوق بین‌المللی پول، بنفع کشورهای آمریکای جنوبی است.
- با عبور از پیک اومیکرون، بلژیک قوانین قرنطینه کرونایی خود را تسهیل کرد.
- ایتالیا به ادامه کاهش بدهی‌هایش امیدوار است.
- بیت‌کوین با پشت سر گذاشتن سومین هفته صعودی، به نظر می‌رسد یک روند مثبت مخفی را آغاز کرده است.
- مدیرعامل اوپر گفت برنامه‌هایی برای قبول رمازرها در اپلیکیشن این شرکت در آینده دارد!
- بدقولی تولیدکنندگان خودرو در تحویل خودروهای سفارشی به مشتریان، موجب نارضایتی جهانی شده است.
- پوتین و بایدن، امروز درباره تنش‌های اوکراین گفت‌وگو خواهند کرد.

فایننشال تایمز



تصویر اقتصاد کلان

تداوم افزایش نرخ تورم در آمریکا

مقایسه بازدهی بازارها

| یکساله | ۱۴۰۰ | ماهیانه | هفتگی | بازار |
|-----------------------------|--------|---------|---------|--------|
| دلار (ریالی) | ۷/۳۰% | ۷/۰۵% | ۳/۲۸-% | ۲۸-% |
| سکه (ریالی) | ۲/۲۸-% | ۳/۲۴% | ۴/۷۸-% | ۴/۹۲-% |
| بورس (شاخص) | ۵/۷۴% | ۱/۹۴-% | ۳/۶۵-% | ۱/۲۸-% |
| ارزش بازار رمزارزها (دلاری) | ۳۲/۲۸% | ۷/۲۳% | ۱۵/۲۲-% | ۰/۲۵-% |
| مسکن (ریالی - تهران) | ۲۰/۲% | - | ۱/۱% | - |

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

| نرخ بهره (درصد) | فصلی | نقطه به نقطه (ماهانه) | | میانگین سالیانه | | | 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 | | | | | | | | | |
| - | - | - | - | ۲۰۲۰ | - | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| - | - | - | - | ۳/۱۸% | - | ۵/۹% | ۱۰،۸۴۵ | ۸۴،۵۳۷،۶۹۰ | مقدار شاخص |
| | | | | - | - | ۴/۴% | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |
| آمریکا | | | | | | | | | |
| ۲۲-زائویه | ۲۱-دسامبر | ۲۲-زائویه | ۲۲-زائویه | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| ۰/۲۵% | ۶/۹% | ۷/۵% | ۴% | ۴/۷% | ۳/۹% | ۵/۵% | ۶۳،۴۱۶ | ۲۰،۹۳۲،۷۵۰ | مقدار شاخص |
| | | | | - | - | ۴% | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |
| چین | | | | | | | | | |
| ۲۱-فوریه | ۲۱-دسامبر | ۲۱-دسامبر | ۲۱-دسامبر | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| ۳/۷% | ۱/۶% | ۱/۵% | ۵/۱% | ۰/۹% | ۵/۱% | ۴% | ۱۰،۴۸۵ | ۱۴،۷۲۳،۸۳۷ | مقدار شاخص |
| | | | | - | - | ۴/۸% | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |
| منطقه یورو | | | | | | | | | |
| ۲۲-فوریه | ۲۱-دسامبر | ۲۲-زائویه | ۲۱-دسامبر | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۰ | ۲۰۱۹ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| ۰/۰۰% | ۰/۳% | ۵/۱% | ۷% | ۲/۶% | ۷/۹۲% | ۶/۳-% | ۳۷،۷۲۳ | ۱۲،۹۱۶،۶۱۸ | مقدار شاخص |
| | | | | ۲/۲% | ۸% | ۵% | پیش‌بینی (۲۰۲۱) | | |
| ایران | | | | | | | | | |
| ۲۱-دسامبر | تابستان ۱۴۰۰ | دی ۱۴۰۰ | پاییز ۱۴۰۰ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| ۱۸% | ۴/۲% | ۳۵/۹% | ۸/۹% | ۴۴% | ۸/۹% | ۲/۵% | ۷،۵۵۵ | ۲۰،۳،۴۷۱ | مقدار شاخص |
| | | | | - | - | ۲% | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |

منبع:

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

بورس و انرژی

رشد مجدد نفت در پی افزایش تنش‌ها پیرامون مسأله اوکراین

بورس‌های جهانی

جریان مثبت ابتدای این هفته در بازارهای جهانی با گزارش عملکرد بسیار مطلوب آمازون و گوگل شروع شد و این شرکت‌ها باعث ایجاد هیجان مثبت در بازار شدند. در ادامه هفته نیز کاهش ۱ درصدی شاخص دلار موجب افزایش ارزش بازارهای سهام و شاخص وارن بافت شد. در این روزها شاهد رسیدن ارزش بازارهای مالی جهان به ۱۱۷ درصد GDP جهان بودیم. بازار روسیه اما بعثت ریسک جنگ، که این روزها سایه آن بر سر اقتصاد این کشور سنگینی می‌کند، حال و روز خوشی ندارد. شاخص بورس این کشور، که همیشه با قیمت نفت همبستگی خوبی داشت، در هفته‌های آخر دچار واگرایی شدید با این روند قیمتی شده و اکنون به قیمت نفت بی‌اعتناست. با شدت گرفتن تهدیدها در اروپا و روبه‌خامت گذاشتن اوضاع مرز روسیه و اوکراین در پایان هفته، شاهد ترس (Panic) گسترده در بازارهای جهان بودیم که اخبار منفی حول محور سخت‌گیری‌های اتحادیه اروپا به شرکت فیس‌بوک و زیرمجموعه‌های آن در این قاره، کمکی به بهبود وضعیت بازارها نکرد. موج منفی که با اخبار حول محور شرکت‌های تکنولوژیک در پایان هفته شروع شد، با ترس از جنگ در هم پیچید و نتیجه آن کندل‌های منفی و درنهایت بازدهی منفی در چند بازار مطرح جهان بود. از طرف دیگر بازار کشور چین با دخالت بازارگردان و اقدام به حمایت گسترده هفته خوبی را پشت سر گذاشت و علی‌رغم اخبار مربوط به قرنطینه در هنگ کنگ، بازدهی هفتگی مثبت در ادامه یک ماه خوب را ثبت کرد.

نفت و محصولات پتروشیمی

نفت، که اکنون در اوج یک رالی صعودی دو هفته‌ای قرار دارد، در ابتدای هفته با رسیدن اخبار خوب از افزایش ظرفیت استخراج در ایالات متحده و عرضه سهام آرامکو، برای سه روز شاهد کاهش قیمت بود. در انتهای هفته اما با شدت گرفتن تنش‌ها در اروپا و بی‌حاصل بودن ملاقات ماکرون و پوتین، نفت برنت با افزایش قیمت ۴ دلاری در یک روزنیم، قله ۹ ساله ۹۵ دلاری را فتح نمود تا هفته را با فاصله‌ای ناچیز با سقف ۱۰۰ دلاری به پایان ببرد. در صورت عدم بهبود شرایط در اروپا یا عدم حصول هرگونه بهبود در مذاکرات ایران و ۱+۴ باید شاهد قیمت‌های بالاتر از این در هفته‌های پیش رو باشیم. با کاهش موج سرما در آمریکا و اروپا و اندکی گرم‌تر شدن هوا، قیمت گاز در سه هفته اخیر به شکل قابل‌ملاحظه‌ای کاهش یافت و در هنری هاب به زیر ۱۴ سنت به ازای هر مترمکعب رسید. نرخ اووه و متانول نیز با تبعیت از قیمت گاز شاهد کاهش قابل‌ملاحظه‌ای بودند. در محصولات پایین‌دستی پتروشیمی بعثت تقاضای بالای بازار و مشکلات عدیده‌ی زنجیره تأمین جهانی، شاهد پایداری و حتی افزایش قیمت بودیم.



منبع

| ردیف | عنوان | آخرین قیمت | معادل | بازده هفتگی | بازده ماهانه | بازده یکساله |
|----------------|------------------------|------------|-------------|-------------|--------------|--------------|
| بورس‌های جهانی | | | | | | |
| ۱ | Dow Jones | ۳۴,۷۳۳ | واحد | -۱.۰۳% | -۴.۲۰% | ۱۰.۵۰% |
| ۲ | Nasdaq | ۱۴,۲۵۴ | واحد | -۳.۰۰% | -۱۰.۰۴% | ۳.۷۸% |
| ۳ | S&P 500 | ۴,۴۱۴ | واحد | -۱.۸۶% | -۶.۳۰% | ۱۲.۸۰% |
| ۴ | FTSE 100 | ۷,۵۸۸ | واحد | -۰.۷۳% | ۰.۸۷% | ۱۶.۶۲% |
| ۵ | DAX | ۱۵,۴۲۵ | واحد | ۲.۱۶% | -۳.۲۴% | ۹.۸۶% |
| ۶ | CAC 40 | ۷,۰۱۲ | واحد | ۰.۸۷% | -۲.۳۹% | ۲۳.۶۷% |
| ۷ | NIKKEI 225 | ۲۷,۶۹۶ | واحد | -۰.۹۳% | -۱.۸۷% | -۶.۳۱% |
| ۸ | SHANGHAI | ۳,۴۴۶ | واحد | ۳.۰۲% | -۲.۹۳% | -۵.۲۶% |
| ۹ | Moex | ۳,۵۴۷ | واحد | ۲.۱۸% | -۷.۴۰% | ۳.۴۹% |
| نفت و انرژی | | | | | | |
| ۱۰ | نفت خام برنت | ۹۵.۱۰ | دلار/بشکه | ۲.۷۹% | ۱۴.۵۴% | ۶۸.۴۷% |
| ۱۱ | نفت خام WTI | ۹۲.۰۵ | دلار/بشکه | ۲.۴۷% | ۱۴.۸۸% | ۵۴.۷۳% |
| ۱۲ | گاز طبیعی (هنری هاب) | ۳.۹۰ | دلار/MMBtu | -۱۴.۶۳% | -۱۹.۶۴% | ۳۴.۰۳% |
| | | | سنت/مترمکعب | | | |
| ۱۳ | سبب اوپک | ۹۲.۸۷ | دلار/بشکه | ۲.۹۰% | ۲۰.۰۷% | ۳۴.۸۱% |
| ۱۴ | نفت سنگین ایران | ۸۶.۷۵ | دلار/بشکه | ۲.۱۲% | ۱۳.۴۱% | ۶۸.۵۸% |
| ۱۵ | گازوئیل | ۸۴۳ | دلار/تن | ۲.۰۳% | ۱۵.۴۸% | ۸۳.۱۶% |
| ۱۶ | نفتا | ۷۱۳.۳۳ | دلار/تن | ۵.۰۳% | -۰.۱۲% | ۲۷.۰۰% |
| ۱۷ | اتانول | ۸۳۹.۱۹ | دلار/گالن | ۱.۷۲% | ۱۲.۳۴% | ۵۷.۶۳% |
| ۱۸ | متانول (داخلی چین) | ۲,۷۴۵ | یوان/تن | ۲.۳۳% | ۶.۳۴% | ۲۲.۰۰% |
| ۱۹ | متانول (CFR) | ۳۵۹ | دلار/تن | -۲.۲۳% | ۹.۴۷% | ۱۶.۴۳% |
| ۲۰ | اووه گرانول خاورمیانه | ۵۵۱.۰۰ | دلار/تن | -۱۳.۲۱% | -۲۱.۳۸% | ۳۸.۱۳% |
| ۲۱ | پت - فوب جنوب شرق آسیا | ۱,۲۱۵ | دلار/تن | ۳.۲۹% | ۱۰.۲۹% | ۲۹.۶۳% |

فلزات گرانبها و ارز

اوج گیری طلا



گروه سرمایه گذاری طلا و ارز ایران
(میانگین سالانه)

| منبع | بازده سالانه | بازده ماهانه | بازده هفتگی | معادل | آخرین قیمت | عنوان | ردیف |
|--|--------------|--------------|-------------|-----------|-------------|---------------------|------|
| فلزات گرانبها | | | | | | | |
| TeleTrader | ۲.۱۸٪ | ۱.۸۱٪ | ۲.۹۲٪ | دلار/اونس | ۱,۸۶۰ | طلا | ۱ |
| TeleTrader | -۱۳.۳۹٪ | ۱.۸۱٪ | ۴.۹۳٪ | دلار/اونس | ۲۳.۶۱ | نقره | ۲ |
| طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۲۱ بهمن | | | | | | | |
| tgju/org | ۲.۰۹٪ | -۵.۰۴٪ | -۳.۹۱٪ | ریال | ۱۱,۶۳۶,۰۰۰ | یک گرم طلای ۱۸ عیار | ۳ |
| tgju/org | ۰.۱۶٪ | -۵.۲۷٪ | -۴.۰۴٪ | ریال | ۱۱۶,۲۹۰,۰۰۰ | سکه امامی | ۴ |
| ارز - پنجشنبه ۲۱ بهمن | | | | | | | |
| tgju/org | ۸.۸۱٪ | -۱.۷۹٪ | -۳.۸۱٪ | ریال | ۲۶۲,۲۷۰ | دلار آزاد | ۵ |
| sanarate/ir | -۰.۲۳٪ | -۴.۴۵٪ | -۰.۸۸٪ | ریال | ۲۳۶,۶۳۱ | دلار حواله (خرید) | ۶ |
| sanarate/ir | ۱.۱۶٪ | -۴.۴۵٪ | -۰.۸۷٪ | ریال | ۲۳۸,۷۸۱ | دلار حواله (فروش) | ۷ |
| sanarate/ir | ۳.۰۸٪ | -۵.۸۶٪ | -۲.۵۰٪ | ریال | ۲۹۹,۹۶۰ | یورو آزاد | ۸ |
| sanarate/ir | -۳.۵۷٪ | -۳.۵۷٪ | ۰.۲۹٪ | ریال | ۲۷۰,۴۹۹ | یورو حواله (خرید) | ۹ |
| sanarate/ir | -۴.۶۴٪ | -۳.۵۷٪ | ۰.۲۹٪ | ریال | ۲۷۲,۹۵۶ | یورو حواله (فروش) | ۱۰ |
| sanarate/ir | -۳.۰۴٪ | -۶.۶۶٪ | -۱.۵۰٪ | ریال | ۶۶,۲۰۶ | درهم آزاد | ۱۱ |
| sanarate/ir | -۰.۲۲٪ | -۴.۴۵٪ | -۰.۸۸٪ | ریال | ۶۴,۴۳۳ | درهم حواله (خرید) | ۱۲ |
| sanarate/ir | ۰.۶۲٪ | -۴.۴۵٪ | -۰.۸۸٪ | ریال | ۶۵,۰۱۹ | درهم حواله (فروش) | ۱۳ |
| رمزارز | | | | | | | |
| Tradingview | -۱۰.۷۱٪ | -۳.۶۷٪ | ۲.۱۶٪ | دلار | ۴۲,۳۲۰ | بیت کوین | ۱۴ |
| Tradingview | ۵۸.۷۵٪ | -۱۳.۰۷٪ | -۲.۷۲٪ | دلار | ۲,۹۳۲ | اتریوم | ۱۵ |

بازار فلزات گرانبها
هفته گذشته با توجه انتشار آمار تورم ۷/۵ درصدی آمریکا، که بالاترین مقدار این شاخص طی ۴۰ سال اخیر است، و همچنین بالا گرفتن تنش‌های بین روسیه و اوکراین و افزایش احتمال جنگ قریب‌الوقوع بین دو کشور، قیمت طلا روند صعودی به خود گرفت بطوریکه روز گذشته به بالاترین میزان خود طی دو ماه اخیر یعنی عدد ۱,۸۶۵ دلار دست یافت.

سکه و ارز (داخلی)
همانند هفته گذشته، طی روزهای اخیر نیز اخبار مثبت منتشر شده حول مذاکرات احیای برجام، سبب نزولی شدن نرخ ارز شده که همین عامل بعلاوه پایین آمدن تقاضا برای سکه، منجر به افت قیمت طلای داخلی شد.

رمزارز
هفته گذشته روزنامه روسی کورسانت گزارش داد که دولت و بانک مرکزی روسیه در مورد نحوه تنظیم ارزهای دیجیتال به توافق رسیده‌اند و در حال آماده کردن پیش‌نویس قانونی هستند که انتظار می‌رود تا ۱۸ فوریه (۲۹ بهمن) کریپتو را بعنوان «چیزی مشابه ارزها» به جای دارایی‌های مالی دیجیتال تعریف کند. در ادامه این گزارش آمده که استفاده از رمزارز «در بخش حقوقی» تنها با شناسایی کامل، از طریق سیستم بانکی یا از طریق واسطه‌های مجاز امکان‌پذیر خواهد بود. این خبر تنها چند هفته پس از آن منتشر شد که بانک مرکزی روسیه در گزارشی که در ژانویه منتشر شد، برای ممنوعیت کامل رمزارزها فشار آورد و استدلال کرد که ماهیت سفته‌بازی این صنعت تهدیدی قابل توجه برای ثبات مالی شهروندان است. بعنوان بخشی از این پیشنهاد، بانک مرکزی گفت که موسسات مالی باید از تسهیل تراکنش‌های ارزهای دیجیتال جلوگیری کنند. همچنین در این گزارش آمده که تراکنش‌های ارز دیجیتال بیش از ۶۰۰,۰۰۰ روبل (تقریباً ۸,۰۰۰ دلار) باید اعلام شوند و در غیر این صورت جرم کیفری به حساب می‌آیند و جریمه‌هایی نیز برای کسانی که بطور غیرقانونی رمزارز را بعنوان وسیله پرداخت می‌پذیرند، اعمال می‌شود.

ردیف عنوان آخرین قیمت معادل بازده هفتگی بازده ماهانه بازده سالانه

محصولات کشاورزی

| | | | | | | | | | |
|---|-------------|----------|------------------|-------|-----------|--------|--------|--------|------------------|
| 1 | ذرت | ۶۴۹.۷۵ | سنت / بوشل | ۲۵۶ | دلار / تن | ۴.۳۴% | ۸.۳۴% | ۴۱.۶۳% | TeleTrader |
| ۲ | کتان (پنبه) | ۱۲۳.۲ | سنت / پوند | ۲,۷۱۶ | دلار / تن | -۰.۴۵% | ۷.۲۳% | ۴۸.۶۳% | TeleTrader |
| ۳ | سویا | ۱,۵۸۸.۷۵ | سنت / بوشل | ۵۸۴ | دلار / تن | ۱.۸۴% | ۱۲.۸۴% | ۴۰.۲۹% | TeleTrader |
| ۴ | شکر | ۱۷.۹۳ | سنت / پوند | ۳۹۵ | دلار / تن | ۰.۹۶% | -۰.۸۳% | ۲۴.۶۰% | TeleTrader |
| ۵ | گندم | ۸۰۴.۷۵ | سنت / بوشل | ۲۹۶ | دلار / تن | ۴.۳۴% | ۴.۳۴% | ۲۵.۹۴% | TeleTrader |
| ۶ | کانولا | ۱۰۱۶.۵ | دلار کانادا / تن | ۸۰۳ | دلار / تن | -۰.۰۵% | -۱.۷۵% | ۳۹.۱۷% | TradingEconomics |

کالاهای صنعتی

| | | | | | | | | | |
|----|--------------------------------------|--------|-----------|--------|-----------|--------|--------|--------|------------------|
| ۷ | مس | ۹۸۳۰۰ | دلار / تن | | | -۰.۴۶% | -۱.۵۶% | ۱۸.۱۸% | TeleTrader |
| ۸ | قیر | ۳,۵۸۸ | یوان / تن | ۵۷۴.۰۸ | دلار / تن | -۵.۱۲% | ۹.۶۸% | ۱۳.۰۲% | TradingEconomics |
| ۹ | فولاد | ۴,۹۹۹ | یوان / تن | ۷۹۹.۸۴ | دلار / تن | ۳.۹۷% | ۱۰.۱۳% | ۱۶.۴۲% | TradingEconomics |
| ۱۰ | آلومینیوم | ۳,۱۹۹ | دلار / تن | | | ۳.۶۳% | ۸.۶۲% | ۵۲.۹۵% | TeleTrader |
| ۱۱ | سرب | ۲,۲۸۷ | دلار / تن | | | ۳.۴۳% | -۲.۱۲% | ۷.۳۹% | TeleTrader |
| ۱۲ | روی | ۳,۶۵۵ | دلار / تن | | | ۱.۱۲% | ۳.۴۲% | ۲۸.۸۵% | TeleTrader |
| ۱۳ | سنگ آهن | ۱۴۵.۵۰ | دلار / تن | | | ۱.۳۹% | ۱۷.۸۱% | -۸.۷۸% | TradingEconomics |
| ۱۴ | بیلت CIS (فوب دریای سیاه) | ۶۷۰.۰۰ | دلار / تن | | | ۰.۷۵% | ۱۱.۵۸% | ۲۳.۴۴% | Metal Bulletin |
| ۱۵ | بیلت صادراتی ایران (فوب بنادر ایران) | ۵۹۰ | دلار / تن | | | ۵.۳۶% | ۷.۸۶% | | Metal Bulletin |

شاخص‌های کالایی

| | | | | | | | | | |
|----|--|-------|------|--|--|--------|-------|--------|------------------|
| ۱۶ | بالتیک خشک | ۱,۹۷۷ | واحد | | | ۳۸.۹۳% | ۵.۴۳% | ۵۰.۷۹% | tgiu.org |
| ۱۷ | شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB) | ۲۷۸ | واحد | | | ۰.۶۲% | ۸.۲۹% | ۴۲.۵۲% | TradingEconomics |
| ۱۸ | شاخص بورس فلزات لندن (LME) | ۴,۸۷۸ | واحد | | | ۴.۲۸% | ۶.۴۱% | ۳۳.۸۸% | TradingEconomics |
| ۱۹ | شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI) | ۳,۱۷۵ | واحد | | | ۰.۶۸% | ۸.۹۸% | ۴۳.۸۹% | TradingEconomics |

بازار محصولات کشاورزی

خطر یک جنگ جدی در اروپا، اثرش را بیش از هر چیز در رشد قیمت ضروری‌ترین کالاهای، یعنی گندم، دانه‌های روغنی و اقلام خوراکی اساسی، نشان داد. در هفته‌ای که گذشت، با رشد جدی تقاضای خرید غلات توسط چین و کشورهای اروپایی شاهد افزایش قیمت محصولات کشاورزی بودیم. محصولات کشاورزی که طی ماه‌های اخیر اوضاع خوبی از نظر قیمت داشتند، ولی چند هفته‌ای به نظر می‌رسید که در یک سقف قیمتی متوقف شده باشند، در پایان هفته اخیر با رشد قیمتی محسوس به سقف چندماهه خود نزدیک شدند تا بار دیگر یادآور شرایط بحرانی ژئوپولیتیک اروپا باشند.

بازار کالاهای صنعتی

رسیدن قیمت سنگ آهن به مرز ۱۵۰ دلار و سپس چند دلار عقب‌نشینی، از وقایع حائز اهمیت این هفته بود، که نشانگر حرکت مجدد ماشین صنعتی چین و چرخیدن چرخ‌دنده‌های آن است. افزایش قیمت فولاد داخلی چین پس از سکون چندماهه، بدلیل تعدیل سیاست‌های سخت‌گیرانه محیط‌زیستی دولت این کشور با افزایش دما و نزدیک‌تر شدن به بهار و افزایش قیمت گاز و تضعیف بحران انرژی از نشانه‌های بهبود وضعیت است. خطرات ناشی از تهدید نظامی در دریای سیاه باعث شده قیمت بیلت فولادی در این منطقه به ۶۷۰ دلار به ازای هر تن برسد، که دنبال‌کننده روند افزایشی چند هفته اخیر است و به نظر نمی‌رسد که در صورت عدم تسهیل بحران، قصدی برای کاهش داشته باشد. قیمت آلومینیوم بعلت هزینه بالای تولید آن طی ماه‌های اخیر، خالی شدن انبارها و همچنین مخاطرات فوق‌الذکر، که در ابتدای هفته سقف قیمت تاریخی خود را شکسته بود، با تخلیه شدن بخشی از هیجانات بازار و کاهش تقاضا با اندکی کاهش، ۳,۱۹۹ دلار به ازای هر تن معامله شد.

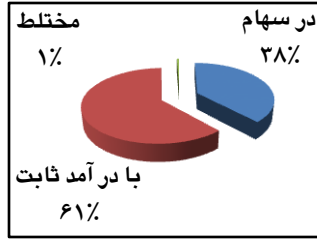
روی اما با کاهش صادرات روسیه، که از تولیدکنندگان اصلی آن است، شاهد افزایش اندک در طول این هفته بود.

شاخص‌های کالایی

شاخص بالتیک خشک با افزایش ۴۰ درصدی در طول این هفته، روایتگر رونق بیش‌ازپیش حمل‌ونقل دریایی، با وجود کرایه‌های بالای این مسیرها، بود. البته به نظر می‌رسد بحران اوکراین و افزایش تنش میان غرب و روسیه نیز در این افزایش بی‌تأثیر نبوده باشد.

بررسی بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

| نوع صندوق | خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال) | میانگین دارایی‌های نقدی (%) | میانگین بازدهی هفتگی (%) | میانگین بازدهی ماه (%) | میانگین بازدهی ۳ ماهه (%) | میانگین بازدهی ۶ ماهه (%) | میانگین بازدهی سالانه (%) |
|-----------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------|------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| در سهام | ۵۵۷,۰۳۹ | ۲۱ | ۰/۸ | ۴/۵- | ۴/۲- | ۶/۲ | ۳۱/۴ |
| با درآمد ثابت | ۸۹۵,۹۲۶ | ۸۶ | ۰/۲ | ۱/۳ | ۴/۱ | ۷/۶ | ۱۶/۹ |
| مختلط | ۸,۱۸۸ | ۴۸ | ۰/۹- | ۱/۸- | ۰/۲ | ۲/۱ | ۲۷/۹ |
| جمع کل صندوق‌ها | ۱,۲۸۰,۶۱۰ | ۳۴ | ۱/۰- | ۲/۱- | ۳/۲- | ۳/۹- | ۱۱/۵ |



منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

صندوق‌های سرمایه‌گذاری

در این هفته بازدهی هفتگی صندوق‌های سهامی و درآمد ثابت، مثبت و بازدهی هفتگی صندوق‌های مختلط منفی بود. سهم صندوق‌ها نیز تقریباً بدون تغییر باقی ماند.

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

| نماد | قیمت معامله شده هر سهم | تاریخ آخرین روز معاملاتی | تاریخ سررسید | YTM | بازده ساده |
|----------------|------------------------|--------------------------|--------------|--------|------------|
| اخز۱۶۴ | ۸۰۶,۸۳۰ | ۱۴۰۰-۱۱-۱۸ | ۱۴۰۲-۰۵-۲۸ | ۱۵,۰۷% | ۱۵,۶۶% |
| اخز۰۴ | ۵۹۰,۰۰۰ | ۱۴۰۰-۱۱-۲۳ | ۱۴۰۳-۰۵-۲۲ | ۲۳,۵۱% | ۲۷,۸۱% |
| اخز۰۲ | ۵۳۹,۹۱۰ | ۱۴۰۰-۱۱-۲۳ | ۱۴۰۳-۱۰-۲۴ | ۲۳,۵۰% | ۲۹,۱۸% |
| میانگین بازدهی | | | | | ۲۳,۹۲% |

منبع: فرابورس ایران

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

طی هفته اخیر، کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سررسید نشده متعلق به نماد اخز۱۶۴ با سررسید ۱۴۰۲/۰۵/۲۸ به ترتیب با بازدهی‌های YTM و ساده ۱۵/۰۷ و ۱۵/۶۶ درصد بود. همچنین بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخز۰۴ و اخز۰۲ با سررسیدهای ۱۴۰۳/۰۵/۲۲ و ۱۴۰۳/۱۰/۲۴ و بازدهی‌های YTM و ساده ۲۳/۵ و ۲۳/۵ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۳/۳۳ و ۲۳/۹۲ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

| نماد | قیمت معامله شده هر سهم | تاریخ آخرین روز معاملاتی | تاریخ سررسید | YTM |
|---------|------------------------|--------------------------|--------------|--------|
| حکمت ۰۱ | ۱,۰۲۲,۰۲۰ | ۱۴۰۰-۱۱-۲۰ | ۱۴۰۱-۰۷-۰۲ | ۱۳,۰۳% |
| اشاد ۱۰ | ۹۹۰,۳۱۰ | ۱۴۰۰-۱۱-۲۰ | ۱۴۰۰-۱۲-۲۶ | ۲۸,۶۰% |

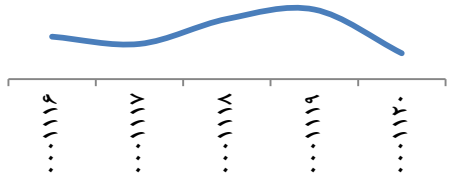
منبع: فرابورس ایران

اوراق تأمین مالی

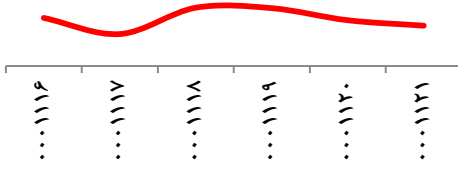
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد حکمت ۰۱ بمیزان ۱۳/۰۳ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۰۷/۰۲ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اشاد ۱۰ بمیزان ۲۸/۶ درصد با سررسید ۱۴۰۰/۱۲/۲۶ بوده است.

بورس کالا

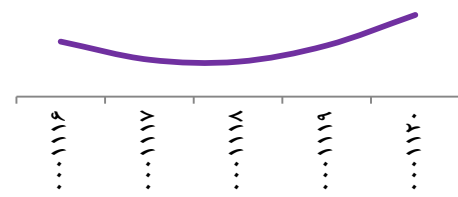
بازار فیزیکی



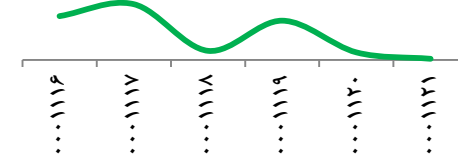
بازار آتی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)

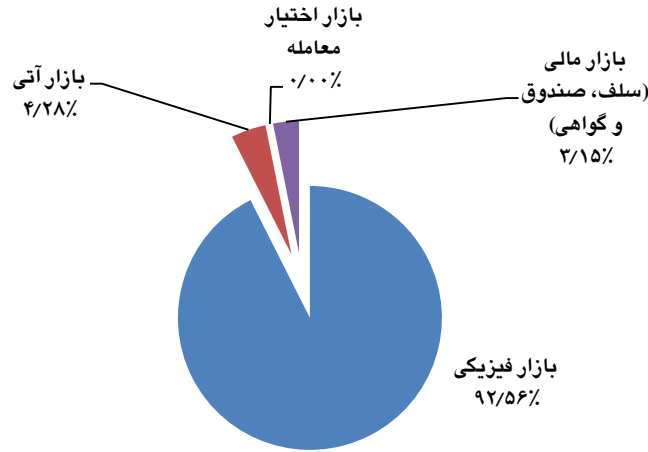


بازار اختیار معامله



تحولات معاملات بورس کالا در هفته اخیر، نشان‌دهنده روند نوسانی و نسبتاً ثابت بازار فیزیکی و بازار آتی و روند صعودی بازار مالی و همچنین روند نزولی بازار اختیار معامله است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۶/۷ 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 ۴۰/۸۲ و حجم معاملات ۱۱/۵۲ 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 | ۵۷,۳۹۷,۲۶۸ | ۱,۳۳۹,۹۸۹ | ۴۵/۲٪ |
| پتروشیمی و نفتی | ۶۵,۳۲۴,۴۰۴ | ۴۴۶,۱۳۴ | ۵۱/۵٪ |
| معدنی | ۵۴,۲۴۹ | ۱,۰۰۰ | ۰/۰٪ |
| بازار فرعی | ۴,۰۹۱,۸۴۷ | ۱۸,۶۸۵ | ۲/۲٪ |
| جمع | ۱۲۶,۸۶۷,۷۶۸ | ۱,۸۰۵,۸۰۸ | ۱۰۰٪ |

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

مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

| محصول | نرخ ریالی | میانگین هفتگی نرخ نیمایی دلار | میانگین هفتگی 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 هفتگی نرخ ریالی |
|------------------------|---------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|------------------|---|---|-------------------------|
| یک تن اوره گرانول | ۱۳۸,۳۴۷,۰۰۰ | ۲۳۹,۵۴۶ | ۲۶۳,۱۲۰ | ۵۷۸ | ۵۲۶ | ۵۵۱ | ۱۰۲/۸٪ | ۹۵/۴٪ | -۶/۲٪ |
| یک تن کاتد مس | ۲,۳۶۹,۷۴۵,۴۵۸ | ۲۳۹,۵۴۶ | ۲۶۳,۱۲۰ | ۹,۸۹۳ | ۹,۰۰۶ | ۹,۸۳۰ | ۱۰۰/۶٪ | ۹۱/۶٪ | -۱/۶٪ |
| یک تن پت شهید تندگویان | ۲۸۰,۳۵۵,۳۴۶ | ۲۳۹,۵۴۶ | ۲۶۳,۱۲۰ | ۱,۵۸۸ | ۱,۴۴۶ | ۱,۲۱۵ | ۱۳۰/۷٪ | ۱۱۹/۰٪ | ۱/۸٪ |
| یک تن بیلت فخوز | ۱۳۳,۴۹۷,۰۰۰ | ۲۳۹,۵۴۶ | ۲۶۳,۱۲۰ | ۵۵۷ | ۵۰۷ | ۵۹۰ | ۹۴/۵٪ | ۸۶/۰٪ | ۲/۶٪ |
| یک تن سیمان تیپ 2 فله | ۴,۳۱۲,۴۲۲ | ۲۳۹,۵۴۶ | ۲۶۳,۱۲۰ | ۱۸ | ۱۶ | - | - | - | ۴/۱٪ |

تحلیل تکنیکال بورس

صعودی کم رقیق و احتمال اصلاح مجدد

شاخص کل



- همانطور که انتظار می‌رفت با خمیده شدن قامت موج صعودی شاخص کل و افزایش قدرت فروشندگان نسبت به خریداران، هفته گذشته شاخص کل از محدوده ۱,۳۰۶,۰۰۰ واحد دچار اصلاح شد و تا محدوده حمایتی ۱,۲۷۴,۰۰۰ واحد نیز افت کرد.
- در حال حاضر (شنبه ۲۳ بهمن ۱۴۰۰) شاخص کل در محدوده ۱,۲۸۴,۰۰۰ واحد قرار دارد و توانسته ۱۰ هزار واحد از کف ۱,۲۷۴,۰۰۰ واحدی خود فاصله بگیرد اما حرکت آن بسیار کم‌رقیق بوده و نشانه‌ای از یک موج صعودی قدرتمند به چشم نمی‌خورد.
- با توجه به کندلی که امروز (شنبه ۲۳ بهمن ۱۴۰۰) شکل گرفته، این احتمال وجود دارد که شاخص کل طی روزهای آتی مجدداً به روند نزولی خود ادامه دهد، که در این صورت شکست کف ۱,۲۷۴,۰۰۰ واحد نیز محتمل است و هدف بعدی شاخص محدوده حمایتی ۱,۲۵۰,۰۰۰ الی ۱,۲۳۰,۰۰۰ واحد خواهد بود.
- شاخص کل کماکان در فاز نزولی است و روند کارکشن خود را حفظ کرده، اما به نظر می‌رسد این روند کارکشن نزولی در حال رسیدن به پایان راه خود است و در آینده‌ای نه‌چندان دور می‌توان انتظار یک رشد میان‌مدتی را از شاخص کل داشت.

❖ 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.

تحلیل تکنیکال بیت کوین

نزول از محدوده ۴۵ هزار دلار

بیت کوین (BTCUSD)



- طبق پیش بینی گزارش هفته گذشته، قیمت بیت کوین موفق به شکست خط روند نزولی خود شد و رشد خود را تا محدوده مقاومتی ۴۴ الی ۴۵ هزار دلار ادامه داد.
- بیت کوین با رسیدن به سطح قیمتی ۴۵,۸۵۰ دلار تغییر روند داد و وارد روندی اصلاحی شد.
- انتظار می رود قیمت بیت کوین بار دیگر با رسیدن به محدوده ۴۰ الی ۳۹ هزار دلار مورد حمایت قرار گرفته و تغییر روند دهد، که در این صورت تشکیل یک الگوی برگشتی هارمونیک بسیار محتمل است و می توان انتظار یک رشد قابل توجه را از این محدوده داشت. در غیر این صورت اهداف قیمتی پایین تر محتمل است.

❖ توضیحات:

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

تحلیل تکنیکال اونس طلا

شکست خط روند نزولی میان مدت

اونس طلا (XAUUSD)



- هفته گذشته اونس جهانی طلا موفق به شکست خط روند نزولی میان مدت خود در محدوده قیمتی ۱,۸۵۰ دلار شد.
- در حال حاضر قیمت طلا به محدوده خط میانی کانال صعودی و مقاومت استاتیک ۱,۸۵۰ الی ۱,۸۷۰ دلار رسیده است.
- در صورتیکه بدنه کندل روزانه طلا موفق به بسته شدن بالای خط روند نزولی شود و سپس بر بالای این محدوده با تکمیل یک پولبک شود، می توان انتظار داشت که طلا به روند صعودی خود ادامه و تا هدف قیمتی ۱,۹۰۰ دلار ادامه دهد.

❖ توضیحات:

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

تحلیل تکنیکال شاخص دلار

سناریوهای پیش روی شاخص دلار

شاخص دلار (DXY)



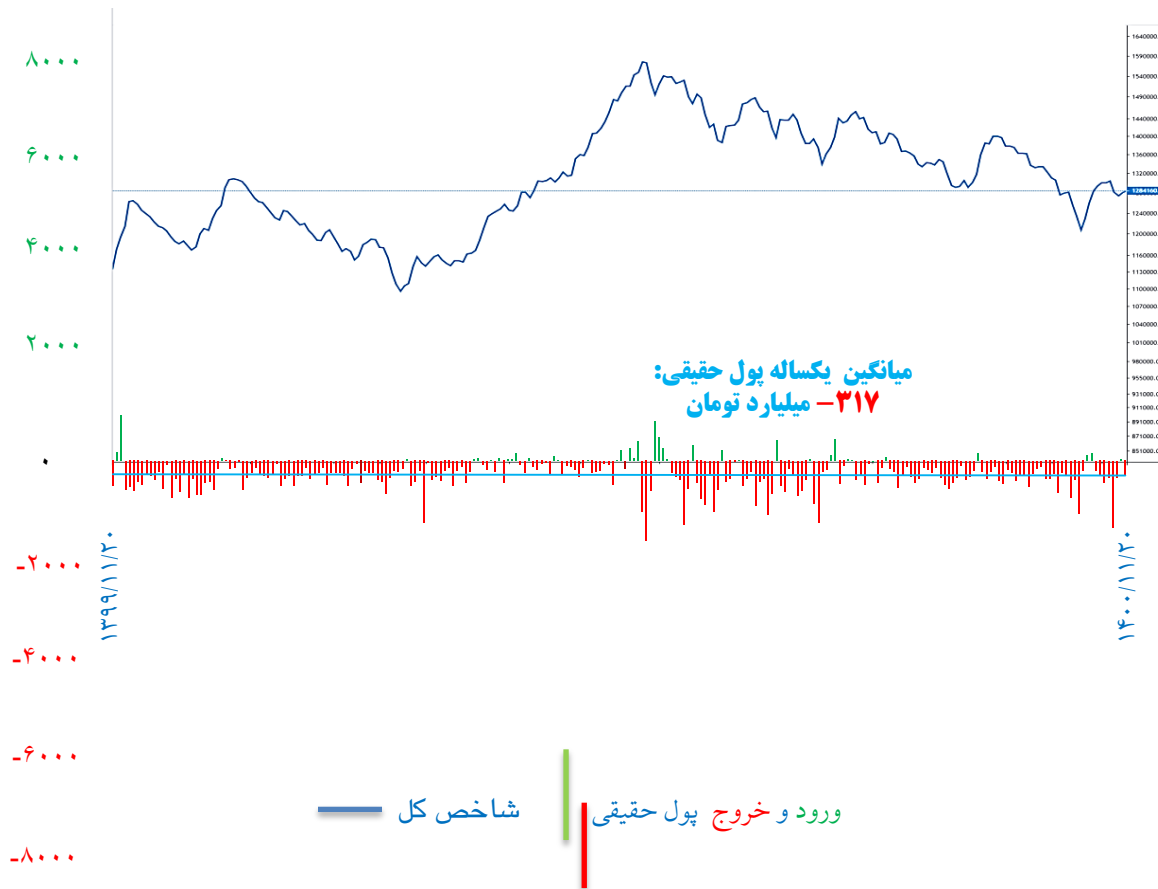
- شاخص دلار با رسیدن به خط روند صعودی خود مورد حمایت قرار گرفت و از محدوده ۹۵/۱۳۷ واحد حرکت صعودی را شروع کرده و در حال حاضر در محدوده ۹۶/۰۳۴ واحد قرار دارد.
- انتظار می‌رود این روند صعودی تا محدوده ۹۶/۳۵۰ واحد ادامه داشته باشد اما برای ادامه روند دو سناریو مطرح خواهد بود:
 - با رسیدن به محدوده ۹۶/۳۵۰ واحد ۵۰ درصد موج نزولی قبل تکمیل شده و شاخص دلار مجدداً به روند نزلی خود ادامه خواهد داد، که در این صورت امکان شکست خط روند صعودی میان مدت آن وجود دارد.
 - شاخص دلار محدوده مقاومتی ۹۶/۳۵۰ واحد را روبه‌بالا خواهد شکست و به سمت قله قیمتی خود حرکت خواهد کرد.

❖ 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)

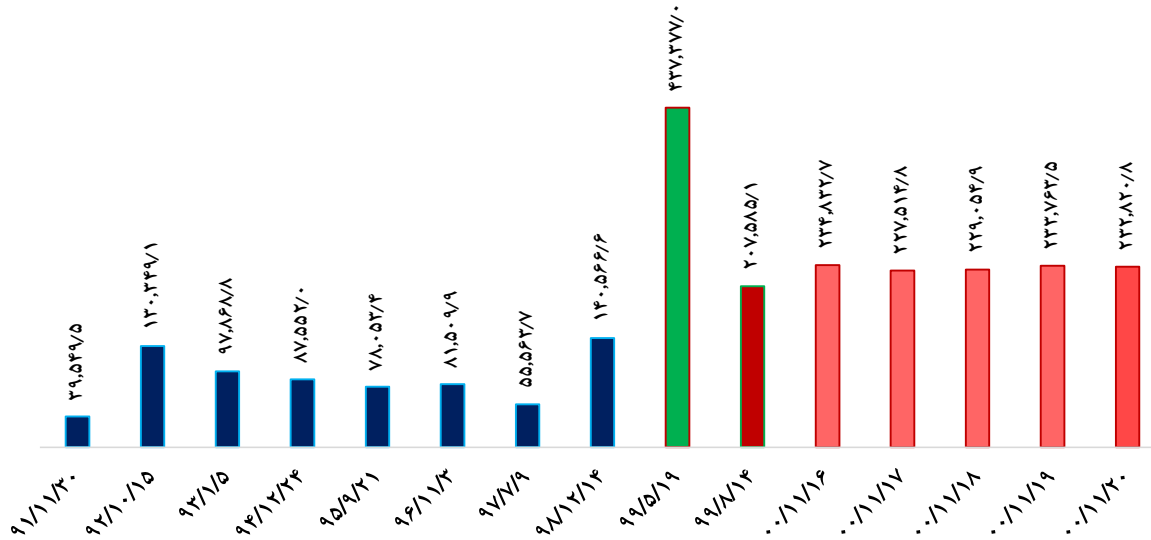


- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۲۸۴,۱۶۰ واحدی و بازده هفتگی ۱/۳- درصد بسته شد.
- برآیند هفتگی، حاکی از خروج ۲,۵۶۱ میلیارد تومان پول حقیقی از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۰، نشان دهنده خروج ۶۵,۵۵۲ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۳۰۵ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.

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

| | | | |
|----------|------------|-------|---------------|
| شنبه | ۱۴۰۰/۱۱/۱۶ | -۳۸۴ | میلیارد تومان |
| دوشنبه | ۱۴۰۰/۱۱/۱۷ | -۱۵۱۰ | میلیارد تومان |
| دوشنبه | ۱۴۰۰/۱۱/۱۸ | -۳۸۴ | میلیارد تومان |
| سه شنبه | ۱۴۰۰/۱۱/۱۹ | +۴۱ | میلیارد تومان |
| چهارشنبه | ۱۴۰۰/۱۱/۲۰ | -۳۲۴ | میلیارد تومان |

منبع: شرکت بورس (TSE.ir)



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۳۳ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله سال گذشته خود معادل ۴۶/۷ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ GDP ایران معادل ۲۰۳ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۱۱۵ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص برای آمریکا در تاریخ ۱۲ فوریه سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۹/۱ تریلیون دلارهای مالی و GDP برابر با ۲۴ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۲۰۵ 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 | ۰.۶۸ | ۱,۳۹۵ | ۹۵۰ | ۰.۳۰ | ۳,۱۶۳ | ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ | ۷۷% |
| وبانک | ۴.۹۳ | ۱,۵۳۶ | ۷,۵۷۰ | ۴.۳۹ | ۱,۷۲۴ | ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ | ۵۲% |
| وسندوق | ۵.۱۸ | ۲,۰۹۹ | ۱۰,۸۷۰ | ۳.۱۷ | ۳,۴۲۴ | ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ | ۶۷% |
| وامید | ۱۱.۷۷ | ۱,۱۸۰ | ۱۳,۸۹۰ | ۱۱.۱۱ | ۱,۲۵۰ | ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ | ۵۹% |
| وغدیر | ۱۰.۷۴ | ۱,۲۱۲ | ۱۳,۰۲۰ | ۶.۰۱ | ۲,۱۶۵ | ۱۴۰۰/۰۹/۳۰ | ۸۱% |
| ونیکی | ۵.۱۸ | ۱,۶۵۳ | ۸,۵۷۰ | - | - | ۱۴۰۰/۰۹/۳۰ | ۴۳% |

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، رکسانا ثابت‌قدم، رضا جعفری، عبدالکریم جهاندار و بردیا وکیلی

راهبری و نظارت بر محتوا:
احسان برین

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