



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

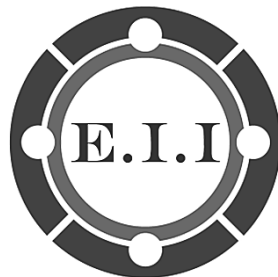
تداوم سایه ابهامات بر سر بازار سرمایه

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۲۱ - هفته منتهی به ۱۹ شهریور ۱۴۰۱
گروه تحلیل گران شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.ir

eii.co.ir



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

جناب آقای دکتر احمدزاد اصل

با کمال تأسف و تأثر درگذشت پدر گرامیتان را به شما و خانواده محترم تسلیت عرض نموده، از خداوند متعال برای آن مرحوم طلب مغفرت و برای بازماندگان صبر و شکیبایی مسالت داریم.

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی: افزایش نرخ بهره توسط بانک مرکزی اروپا؛
- تصویر اقتصاد کلان: افزایش نرخ بهره بانک مرکزی اروپا؛
- بورس و انرژی: تلاطم شدید در بازارها نفت و بورسهای جهانی؛
- فلزات گرانبها و ارز: سایه تغییرات نرخ بهره در اروپا و آمریکا بر سر طلا؛
- بازار کالاهای خام: افزایش فولاد و سنگ آهن؛
- بررسی صندوقها و بازدهی آنها؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - به سمت کف کانال نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت کوین - بازگشت پر قدرت از کف کانال بلند مدت؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - شکست خط روند نزولی؟؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - شروع روند اصلاحی؛
- 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 توسط بانک مرکزی اروپا

بلومبرگ

Bloomberg

اشاره

در پایان این هفته فوت ملکه الیزابت دوم، صدر اخبار تمامی شبکه‌های خبری بود.

فرزند ارشد ملکه الیزابت دوم، پس بیش از نیم قرن سال ولیعهدی، اکنون در سن ۷۳ سالگی به پادشاهی رسیده و چارلز سوم، اکنون پادشاه بریتانیاست.

دولت عربستان سعودی در حال افزایش نفوذ خود در بازارهای سهام غربی و به دست گرفتن سهام مدیریتی شرکت‌های مهم آمریکاییست.

وزرای انرژی کشورهای اتحادیه اروپا خواستار دخالت دولت‌ها در بازار هستند و قطعی برق و قیمت‌های سرسام آور هنوز گریبانگیر اروپاست.

۵ کشور مهم اتحادیه اروپا خواهان تعیین کف مالیات برای شرکت‌ها هستند.

و کاهش قیمت مسکن در آسیای شرقی نشان از کند شدن اقتصاد جهان دارد.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۶۱۳,۰۳۲,۲۲۳	+۰,۵۹%
جان باختگان ۶,۵۱۴,۵۵۸	+۰,۲۰%
بهبود یافتگان ۵۹۱,۱۸۱,۲۱۷	+۰,۹۴%

فایننشال تایمز



New York Times منبع:

- در پی فوت ملکه الیزابت، چارلز سوم، پسر او، اکنون پادشاه بریتانیاست و در ماه‌های آتی تاجگذاری می‌شود.
- نفت برنت دوباره به کانال ۹۰ دلار بازگشت.
- اف‌بی‌آی نگران اعتراضات خشونت آمیز حامیان ترامپ به خاطر بازرسی منزل اوست.
- در پی فوت ملکه، بانک مرکزی انگلستان جلسه تصمیم‌گیری درباره نرخ بهره را به آینده موکول کرد.
- با توقف حرکت صعودی شاخص دلار و کاهش ۱ واحدی آن در سه روز اخیر، معامله‌گران بار دیگر با خوشبینی شروع به خرید دارایی در بازار سهام کردند.
- ارتش اوکراین پیشروی قابل ملاحظه‌ای در بازپسگیری جبهه شمالی از روسها داشته و با آزاد سازی ۱۸۰۰ کیلومتر مربع از خاک خود، تلفات سنگینی به نیروهای رزمی روسیه وارد کرده و ضمن بدست آوردن غنائم بسیار بعضی شهرهای اشغال شده توسط روسیه را تحت محاصره درآورده.
- با افزایش ریسک در بازارها، نفت بخشی از سقوط هفتگی‌اش را جبران کرد.
- با تغییر شاخصهای تعیین تورم در ترکیه توسط دولت، محاسبات نرخ تورم اقتصاد دانان و پیشبینی‌های مربوط به آن بهم ریخت.
- شاه چارلز سوم، در اولین سخنرانی‌اش به عنوان پادشاه، سوگند یاد کرد که تا پایان عمر به مردم بریتانیا خدمت کند.
- هم‌زمان با افزایش وحشت سرمایه‌گذاران غربی از رکود، دولت عربستان ۷ میلیارد دلار دیگر سهام در بازارهای آمریکا خریداری کرد.
- ایالات متحده شرکت ایرانی را به اتهام فروش پهپاد به روسیه تحریم کرد.
- خاموشی‌های پی در پی به خاطر افزایش مصرف برق، از لندن تا لس‌آنجلس، به امری طبیعی تبدیل شده اند.
- یکی از بزرگترین مجموعه‌های صنعتی هند به دنبال پیوستن به تولیدکنندگان آیفون در آسیا.

BUSINESS INSIDER

بیزینس اینسایدر

- وزرای کشورهای اتحادیه اروپا از دولت‌هایشان تقاضا کردند تا با دخالت در بازار انرژی جلوی افزایش سرسام‌آور قیمت‌ها را بگیرد.
- با گذشت ۲۰۰ روز از جنگ و افزایش ۷ ماهه قیمت‌ها در اوکراین، تورم این کشور به ۲۳٪ رسید.
- بیت‌کوین هم زمان با شکستن رکورد معاملات چند ماهه، بیشترین میزان افزایش روزانه از ماه ژوئن را تجربه کرد.
- بانک آمریکا: با افزایش روز افزون روند بازگشت به دفاتر کار، بازار خدمات مراقبت از کودکان به وضعیت پیش از کرونا بازگشت.
- دولت عربستان با جمع آوری سهام مدیریتی شرکت‌های بزرگ جهان در حال تبدیل به یک هلدینگ بزرگ است.
- کمیسیون نظارت بر اوراق بهادار آمریکا با دخالت در روند معاملاتی دو شرکت بزرگ فعال در معاملات اوراق قرضه، افسار این بازار را کشید.
- سازمان ملل متحد معتقد است که هم زمان با افزایش خسارتهای تغییرات اقلیمی، کشورها باید هزینه‌های بیشتر بابت آلاینده‌گی از شرکتها بگیرند.
- کالیفرنیا: وضعیت اضطراری و تحت فشار شبکه توزیع برق تا پایان موج فعلی گرما باقی خواهد ماند.
- بامو اعلام کرد که به تکنولوژی جدیدی جهت تولید باتری‌های قوی‌تر با سرعت شارژ بیشتر برای خودروهای برقی دست یافته.

- آلمان، فرانسه، ایتالیا، اسپانیا و هلند قول دادند که قانونب برای تعیین کف میزان مالیات پرداختی برای شرکت‌های بزرگ و چند ملیتی وضع کنند.
- سیستم نوین کاهش مصرف سوخت شبکه نیروگاهی و تولید برق انگلیس، تا پایان زمستان هم وارد مدار نخواهد شد.
- اولین نشانه‌های کند شدن اقتصاد جهان: قیمت مسکن در آسیا در حال کاهش است.
- مرسدس بنز با سرمایه‌گذاری ۳ میلیارد دلاری در شرکت تولید خودروهای الکتریکی آمریکایی "ریویان"، قصد تولید خودروهای تجاری الکتریکی با این شرکت در کارخانه‌ای جدید در اروپا را دارد.
- مدیر سابق دزینی: پخش تلویزیونی سنتی در حال نزدیک شدن به لبه‌ی پرتگاه است.
- جاستین تروود نخست وزیر کانادا با سیاستهای انبساطی ادامه دارش در حال ریختن بنزین در آتش تورم این کشور است.
- کلمبیا و ونزوئلا پس از سالهای متمادی جنگ و درگیری، در حال بازگشایی گذرگاه‌های مرزی مشترک هستند.
- صندوق مدیریت ثروت خاندان سعودی، به دنبال خرید مجموعه بین‌المللی "استارباکس".
- ارزش بازار مسکن آمریکا هم زمان با کاهش چند هفته اخیر شاخصهای سهام، نزولی شایان توجهی را تجربه کرد.
- مدیران ارشد فدرال رزرو، به شکل لفظی از افزایش نرخ بهره در ماه سپتامبر حمایت کردند.
- نهادهای قانون‌گذار اتحادیه اروپا خواهان آند که نتفلیکس و سایر سرویس‌های پخش محتوا، هزینه‌ی بیشتری بابت تامین زیرساخت‌های اینترنت اروپا بپردازند.
- نحوه قیمت‌گذاری برق در اروپا در آینده نزدیک تغییر خواهد کرد.



تصویر اقتصاد کلان

افزایش نرخ بهره بانک مرکزی اروپا

نرخ بهره (درصد)	فصلی نرخ رشد اقتصادی (درصد)	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین سالانه			درآمد سرانه (دلار)	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	حوزه جغرافیایی متغیر
		نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ رشد اقتصادی - قیمت ثابت (درصد)			
جهان									
-	-	-	-	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
-	-	-	-	%۴/۷	-	%۶/۱	۱۰.۸۴۵	۹۶,۲۹۲,۵۷۰	مقدار شاخص
				%۷/۴	-	%۳/۲	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
آمریکا									
۲۲-جولای	ژوئن-۲۲	جولای-۲۲	آگوست-۲۲	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
%۲,۵	-%۰,۶	%۸/۵	%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-آگوست	ژوئن-۲۰۲۲	جولای-۲۲	جولای-۲۲	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
%۳,۶۵	-%۲,۶	%۲/۷	%۵,۴	%۰/۹	%۴/۲	%۸/۱	۱۲,۳۵۹	۱۷,۴۵۸,۰۴۰	مقدار شاخص
				%۲/۱	%۳/۷	%۳,۳	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
منطقه یورو									
۲۲-سپتامبر	ژوئن-۲۲	آگوست-۲۲	جولای-۲۲	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۱۹	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۱,۲۵	-%۰,۶	%۹,۱	%۶,۶	%۲/۶	-	%۵/۳	۳۷,۷۲۳	۱۲,۹۱۶,۶۱۸	مقدار شاخص
				%۵/۳	%۷/۷	%۲,۶	پیش‌بینی (۲۰۲۱)		
ایران									
۲۲-می	زمستان ۱۴۰۰	مرداد ۱۴۰۱	بهار ۱۴۰۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۱,۸	%۲,۳	%۵۲,۲	%۹,۲	%۴۰/۱	%۹/۸	%۴,۳	۷,۵۵۵	۲۳۱,۵۴۷/۵۷	مقدار شاخص
				%۳۲/۳	%۱۰/۲	%۳	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		

مقایسه بازدهی بازارها

یکساله	۱۴۰۱	ماه‌به‌ماه	هفتگی	بازار
%۸,۷۴	%۱۵,۴۱	-%۳,۰۱	%۱,۶۵	دلار (ریالی)
%۱۴,۴۹	%۱۲,۸۲	-%۶,۲۵	%۰,۲۱	سکه (ریالی)
-%۷,۲۴	%۲,۸۱	-%۲,۶۹	-%۱,۸۶	بورس (شاخص)
-%۴۹,۵۹	-%۴۳,۵۵	-%۳,۵۱	%۷,۴۱	ارزش بازار رمزارزها (دلاری)
%۱۶,۴۰	-	%۰,۴۰	-	مسکن (ریالی - تهران)

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

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

بورسهای جهانی

بازارهای جهانی تحت تاثیر خبرهای و موضع گیری های مختلف از جمله تصمیم بانک مرکزی اروپا برای افزایش نرخ بهره و اظهار نظر مقامات فدرال رزرو در جهت پایداری نرخ بهره بود که در ابتدای هفته باعث نزول بازارها شد. در ادامه هفته اما کاهش شاخص دلار و اخبار حوزه انرژی به همراه PMI آمریکا و سرمایه گذاری های خارجی موجب صعود قابل توجه شاخصها شد.

نفت و محصولات پتروشیمی

این هفته یکی از پرتلاطم ترین بازارهای انرژی چند ماه اخیر را شاهد بودیم که عوامل متعددی در فشارهای مثبت و منفی آن نقش داشتند. معضل انرژی اتحادیه اروپا اکنون و در آستانه زمستان بیش از هر زمان دیگر به چشم آمده و دول اروپایی به دنبال راهکاری مختلف برای حل این موضوع هستند.

از یک طرف دولت آمریکا با حمایت از سقف قیمتی تعیین شده برای انرژی روسیه توسط گروه ۷ اعلام کرد که کشورهایی که مبادرت به خرید نفت و گاز به قیمت بالاتری از روسیه کنند مشمول تحریمهای اقتصادی آمریکا خواهند شد. این خبر و سایر حواشی خود در ابتدای هفته باعث کاهش شدید قیمت نفت و سقوط برنت به پایینتر از ۹۰ دلار شد. در ادامه هم زمان با افزایش کرونا در چین و کاهش سفارشات این کشور، هفته پوتین تهدید کرد که در صورت انجام این اقدام فروش نفت و گاز به اروپا را به طور کامل متوقف میکند و غیر از این قرارداد اجازه صادرات غلات از اوکراین را نیز ملغی می کند که این تهدید موجب وحشت در بازار شد. اجلاس اوپک پلاس و کاهش فروش نفت توسط این سازمان هم شوک مثبت دیگری به نفت بود که خبر دستور بایدن برای صادرات بیشتر از دختراستراتژیک آمریکا را کم اهمیت جلوه داد. اختلاف طرفین در مذاکرات برجام نیز از دیگر دلایل افزایش قیمت نفت در این هفته بود که در نهایت بخش عمده سقوط ابتدای هفته خود را جبران کرده و در ساعات پایانی هفته کمتر از ۱٪ پایینتر از نرخ هفته گذشته معامله شد.

شایان ذکر است تولید برق هسته ای فرانسه کاهش ۵۰٪ ای داشته و باعث نگرانی شدید در این حوزه شده، و به خاطر افزایش تقاضا برای زغالسنگ حرارتی، قیمت این محصول به بالاتر از قیمت زغالسنگ کک شو رسیده است!



ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
بورسهای جهانی						
۱	Dow Jones	۳۲,۱۵۷	واحد	۲,۶۸٪	-۱,۹۵٪	-۷,۸۰٪
۲	Nasdaq	۱۲,۵۸۸	واحد	۴,۰۵٪	-۳,۳۳٪	-۱۹,۱۰٪
۳	S&P ۵۰۰	۴,۰۶۵	واحد	۳,۶۲٪	-۱,۳۶٪	-۹,۳۲٪
۴	FTSE ۱۰۰	۷,۳۸۴	واحد	۲,۵۷٪	-۱,۳۳٪	۵,۱۲٪
۵	DAX	۱۳,۰۸۸	واحد	۰,۲۹٪	-۳,۳۰٪	-۱۶,۲۳٪
۶	CAC ۴۰	۶,۲۱۲	واحد	۰,۷۳٪	-۴,۲۸٪	-۷,۰۷٪
۷	NIKKEI ۲۲۵	۲۸,۲۱۵	واحد	۲,۰۴٪	۰,۷۷٪	-۵,۹۸٪
۸	SHANGHAI	۳,۲۶۲	واحد	۲,۳۷٪	۰,۴۵٪	-۱۱,۶۷٪
۹	Moex	۲,۴۲۶	واحد	-۱,۸۴٪	۱۲,۷۶٪	۳۹,۳۹٪

TeleTrader

TradingEconomics

نفت و انرژی

۱۰	نفت خام برنت	۹۲,۲۷	دلار/بشکه	-۰,۸۰٪	-۴,۱۱٪	۲۶,۵۵٪
۱۱	نفت خام WTI	۸۶,۱۲	دلار/بشکه	-۰,۷۵٪	-۵,۴۶٪	۲۳,۶۶٪
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۸,۰۳	دلار / MMBtu	-۸,۵۹٪	-۲,۰۸٪	۶۲,۶۴٪
۱۳	سبب اوپک	۹۵,۹۶	دلار/بشکه	-۵,۲۹٪	-۷,۵۴٪	۲۵,۱۶٪
۱۴	نفت سنگین ایران	۹۰,۸	دلار/بشکه	-۱,۱۳٪	-۰,۸۳٪	۳۳,۳۳٪
۱۵	گازوئیل	۱,۰۷۷	دلار/تن	-۲,۴۵٪	۹,۵۹٪	۸۱,۴۲٪
۱۶	اتانول	۲,۴۴	دلار/گالن	۰,۰۲٪	-۷,۶۰٪	-۴,۲۹٪
۱۷	نفتا	۶۳۲	دلار/تن	-۳,۱۰٪	-۲,۴۳٪	-۱۳,۵۹٪
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۷۹۰	یوان/تن	۳,۵۸٪	۸,۱۷٪	-۰,۰۶٪
۱۹	متانول CFR	۳۱۹	دلار/تن	۴,۳۹٪	۳,۱۳٪	-۵,۹۶٪
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۶۸۰	دلار/تن	-۱,۱۶٪	۱۳,۵۸٪	۶۱,۵۲٪
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۱۱۴۰	دلار/تن	-۱,۷۵٪	-۳,۵۱٪	۱۳,۰۷٪

سنت/متر
مکعب

۲۸,۴۱

فلزات گرانبها و ارز

سایه تغییرات نرخ بهره در اروپا و آمریکا

بر سر طلا

بازار فلزات گرانبها

طی هفته اخیر، با توجه به تنش‌های میان روسیه، اروپا و آمریکا و همچنین تحولات اقتصادی کلان در کشورهای مختلف، اونس جهانی طلا دچار نوسان شده و هفته‌ی کاری خود را با بازده ۰.۳۱ درصد به پایان رساند. از جمله مسایل اقتصادی تاثیرگذار می‌توان به اظهارات پاول در خصوص افزایش نرخ بهره آمریکا، افزایش بی سابقه‌ی نرخ بهره بانک مرکزی اروپا به میزان ۰.۷۵ درصد و رسیدن آن به عدد ۱.۲۵ درصد و افزایش ۰.۷۵ درصدی نرخ بهره در کانادا اشاره کرد که در پی آن شاهد تضعیف شاخص دلار و تقویت ارزش یورو در مقابل دلار و همچنین افزایش اونس جهانی طلا بودیم. آنچه که مانع افزایش بیشتر اونس طلا شد، انتظارات مربوط به افزایش ۰.۷۵ درصدی نرخ بهره آمریکا در جلسه‌ی آتی فدرال رزرو در تاریخ ۲۱ سپتامبر بود.

سکه و ارز (داخلی)

با توجه به سیگنال‌های منفی منتشر شده حول مسئله برجام، بازار ارز نوسانات زیادی را تجربه کرد و با رشد ۱.۳۲ درصدی، هفته‌ی خود را به پایان رساند. در بازار سکه و طلای داخلی نیز با توجه به رشد نسبی اونس جهانی طلا، نرخ‌ها با افزایش همراه بودند و با بازده هفته‌ی نزدیک به ۲ درصد به کار خود پایان دادند.

رمزارز

هفتم سپتامبر ۲۰۲۲ (۱۶ شهریور) مصادف با سالگرد یکسالگی پذیرش بیت‌کوین بعنوان ارز قانونی توسط السالوادور که اولین کشور جهان در حوزه‌ی پذیرش قانونی بیت‌کوین نیز لقب گرفت، بود. نایب بوکله رئیس‌جمهور السالوادور، با حمایت از بیت‌کوین به عنوان ارز قانونی در سال گذشته، وعده داد که پذیرش بیت‌کوین به نفع ۷۰ درصد از جمعیت محلی است که از سال ۲۰۲۱ به خدمات بانکی دسترسی نداشتند. دولت السالوادور همچنین بیت‌کوین را به عنوان ابزاری برای جذب سرمایه‌گذاری خارجی، ایجاد مشاغل جدید و کاهش اتکا به دلار آمریکا در اقتصاد این کشور معرفی کرد. شاید بتوان مزایای واقعی فعلی پذیرش بیت‌کوین در السالوادور را زیر سوال برد، چرا که بیت‌کوین تقریباً ۶۰ درصد از ارزش خود را از زمانی که این کشور این رمزارز را به عنوان پول قانونی پذیرفته است، از دست داده. دقیقاً یک سال پیش در چنین روزی، بیت‌کوین در حدود ۴۶۰۰۰ دلار معامله می‌شد. در ۶ سپتامبر ۲۰۲۱ (۱۵ شهریور ۱۴۰۰)، دولت السالوادور اولین خرید بیت‌کوین خود را انجام داد و ۲۰۰ عدد بیت‌کوین را به قیمت ۱۰.۳۶ میلیون دلار یا با قیمت متوسط ۵۱۸۰۰ دلار خریداری کرد که امروز بیش از ۶۴ درصد نسبت به سال گذشته کاهش داشته است. دولت السالوادور تاکنون در مجموع ۲۳۸۱ بیت‌کوین خریداری کرده است که به قیمت فعلی ۶۲ میلیون دلار کمتر از قیمتی است که السالوادور برای دارایی‌های BTC خود پرداخت کرده است. الخاندرو زلایا وزیر دارایی السالوادور، قبلاً تأکید کرده بود که علیرغم کاهش قیمت، این کشور هیچ ضرری در خرید بیت‌کوین خود تجربه نکرده است، زیرا آنها کوینی را نفروخته‌اند. لازم به ذکر است که دولت السالوادور بارها پروژه اوراق قرضه بیت‌کوین خود را به دلیل شرایط نامطلوب بازار و مسائل ژئوپلیتیکی به تعویق انداخته است.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۷۱۶	دلار/اونس	۰.۳۱٪	-۴.۳۴٪	-۴.۳۴٪	TeleTrader
۲	نقره	۱۸,۸۳	دلار/اونس	۴.۴۴٪	-۸.۱۹٪	-۲۱.۷۰٪	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۱۷ شهریور							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۲,۸۲۷,۰۰۰	ریال	۲.۰۹٪	-۵.۹۳٪	۸.۶۵٪	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۳۹,۶۰۰,۰۰۰	ریال	۲.۲۴٪	-۵.۷۱٪	۱۴.۶۷٪	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۱۷ شهریور							
۵	دلار آزاد	۳۰۲,۴۱۰	ریال	۱.۳۲٪	-۳.۰۱٪	۹.۲۵٪	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۶۶,۵۸۸	ریال	۰.۶۰٪	۰.۷۹٪	۱۷.۲۸٪	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۶۹,۰۱۰	ریال	۰.۶۰٪	۰.۸۰٪	۱۷.۲۸٪	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۰۲,۶۱۰	ریال	۱.۵۵٪	-۶.۶٪	-۳.۹۱٪	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۴,۹۷۳	ریال	-۰.۶۸٪	-۱.۸۴٪	-۱.۳۵٪	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۶۷,۳۸۰	ریال	-۰.۶۸٪	-۱.۸۴٪	-۱.۳۵٪	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۷,۳۲۰	ریال	۱.۲۸٪	-۰.۵۶٪	۷.۸۷٪	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۲,۵۹۰	ریال	۰.۶۰٪	۰.۷۹٪	۱۷.۲۸٪	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۷۳,۲۵۰	ریال	۰.۶۰٪	۰.۷۹٪	۱۷.۲۸٪	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت‌کوین	۲۱,۲۹۳	دلار	۷.۷۵٪	-۱۲.۱۵٪	-۵۲.۸۸٪	Tradingview
۱۵	اتریوم	۱,۷۲۱	دلار	۱۰.۸۸٪	-۹.۵۰٪	-۴۷.۳۰٪	Tradingview

بازار کالاهای خام افزایش فولاد و سنگ آهن

ردیف عنوان آخرین قیمت معادل بازده هفتگی بازده ماهانه بازده سالانه

محصولات کشاورزی								
۱	ذرت	۶۸۵	سنت / بوشل	۲۷۰	دلار/تن	۳،۱۲٪	۱۱،۶۵٪	۳۹،۱۶٪
۲	کتان (پنبه)	۱۰۳،۸۵	سنت / پوند	۲۲۹۰	دلار/تن	۰،۶۲٪	۴،۸۶٪	۲۶،۲۵٪
۳	سویا	۱،۴۱۳	سنت / بوشل	۵۱۹	دلار/تن	-۰،۴۶٪	-۱،۰۷٪	۱۳،۹۳٪
۴	شکر	۱۷،۹۰	سنت / پوند	۳۹۵	دلار/تن	-۱،۳۲٪	-۰،۲۸٪	-۴،۲۳٪
۵	گندم	۸۵۰	سنت / بوشل	۳۱۲	دلار/تن	۴،۹۱٪	۸،۷۰٪	۲۳،۴۷٪
۶	کانولا	۷۷۱	دلار کانادا/تن	۶۰۹	دلار/تن	-۵،۶۲٪	-۹،۹۱٪	-۹،۹۶٪

کالاهای صنعتی								
۷	مس	۷۶۶۸،۵	دلار/تن			۴،۱۹٪	-۱،۰۹٪	-۱۶،۲۵٪
۸	قیر	۴،۳۵۰	یوان/تن	۶۹۶	دلار/تن	۳،۱۳٪	۱،۴۰٪	۴۷،۵۶٪
۹	فولاد	۳،۹۱۸	یوان/تن	۶۲۷	دلار/تن	۳،۱۹٪	-۴،۲۸٪	-۳۰،۰۹٪
۱۰	آلومینیوم	۲،۲۸۹	دلار/تن			-۰،۶۹٪	-۷،۴۰٪	-۱۹،۲۹٪
۱۱	سرب	۱،۹۳۳	دلار/تن			۲،۴۹٪	-۱۰،۶۹٪	-۱۵،۷۳٪
۱۲	روی	۳،۱۹۲	دلار/تن			۱،۷۷٪	-۹،۴۳٪	۳،۸۲٪
۱۳	سنگ آهن	۱۰۴،۵۰	دلار/تن			۶،۶۳٪	-۶،۲۸٪	-۱۹،۳۱٪
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۵۲۸	دلار/تن			۰،۳۸٪	۱،۵۲٪	-۱۳،۸۵٪
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۴۶۰	دلار/تن			-۱،۰۸٪	-۲،۱۳٪	-۲۶،۵۲٪

شاخص‌های کالایی								
۱۶	بالتیک خشک	۱،۱۷۸	واحد			۸،۴۷٪	-۲۴،۲۴٪	-۷۱،۶۸٪
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۰۵	واحد			-۰،۰۷٪	-۱،۵۶٪	۲۹،۹۹٪
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۳،۶۶۵	واحد			۱،۵۶٪	-۶،۳۶٪	-۱۷،۲۶٪
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳،۴۹۷	واحد			-۲،۵۱٪	-۴،۰۰٪	۳۴،۳۸٪

بازار محصولات کشاورزی

شرایط آب و هوایی گرم و خشک در ایالات متحده، وضعیت محصولات الیاف طبیعی را تهدید کرده و نگرانی‌های در خصوص عرضه را افزایش داده است. همچنین در هند نیز محصولات زراعی به دلیل شرایط نامساعد جوی و حملات آفات در معرض تهدید قرار دارند. کشور چین با ۲۰ درصد جمعیت جهان پس از گذشت دو سال ذخیره‌سازی، تا پایان سال میلادی ۶۵ درصد ذرت و ۵۳ درصد گندم جهان را ذخیره کرده است.

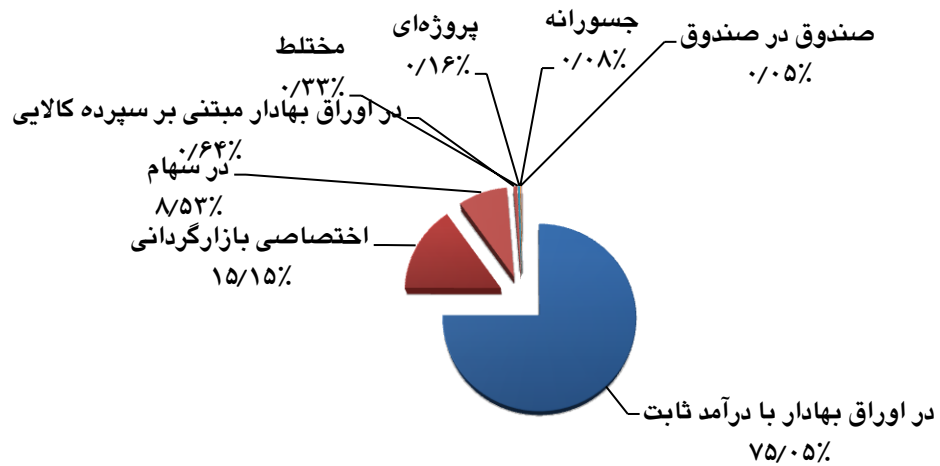
بازار کالاهای صنعتی

فولاد جهانی بالاخره از خواب بیدار شد و اکثر قیمت‌های شرق و غرب در هفته گذشته روندی صعودی طی کردند... بازار سنگ آهن جهانی نیز با انتشار آمار صعودی واردات چین و افزایش قیمت فولاد امروز جان تازه‌ای گرفت. با تعطیلی تعداد زیادی از واحدهای فولادسازی اروپا به دلیل کمبود انرژی و افزایش قیمت برق و انرژی باعث شده مصرف قراضه در این قاره کاهش یافته و قیمت جهانی قراضه را کاهش داده است. از طرف دیگر، فولاد مصرفی اروپا حالا بایستی از طریق واردات تامین شود و این موضوع محرک قیمت‌های فولاد ناحیه مدیترانه و دریای سیاه CIS است سود این گردش بازار ابتدا به جیب فولادسازان ترکیه که تامین کننده عمده فولاد اروپا هستند، خواهد رفت و در ادامه شامل ایران نیز شده و قیمت‌های فوب بندرعباس را تحریک می‌کند.

شاخص‌های کالایی

شاخص بالتیک خشک پس از طی کردن روند سه ماهه منفی خود با رسیدن به محدوده حمایتی ۱۰۰۰ واحد مورد حمایت قرار گرفت و با رشدی ۸ درصدی نسبت به هفته گذشته با سطح ۱۱۷۸ واحد رسید. شاخص Capesize که محموله های سنگ آهن و زغال سنگ ۱۵۰۰۰۰ تنی را ردیابی می‌کند، با افزایش ۳ درصدی به ۶۷۲ واحد رسید. با توجه به این موضوع می‌توان دریافت که رشد اخیر شاخص بالتیک خشک بیشتر به دلیل رشد محموله های سنگ آهن و زغال سنگ در هفته گذشته بوده است.

بررسی وضعیت صندوق‌ها



در هفته منتهی به شنبه ۱۹ شهریور ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت، خصوصی و جسورانه مثبت و بازدهی صندوق‌های اختصاصی بازارگردانی، در سهام، صندوق در صندوق مبتنی بر سپرده کالایی و مختلط منفی و بازدهی صندوق‌های پروژه‌ای صفر بود.

درعین‌حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های درآمد ثابت با ۰.۳۶ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های در سهام با ۲.۱۳- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۵/۰۵ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۵/۱۵ درصد و سهامی با ۸/۵۲ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	میانگین بازدهی هفتگی (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی 3 ماهه (%)	میانگین بازدهی 6 ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
صندوق درصندوق	۳,۳۶۷.۶۰	۰.۰۰%	۱.۲۳%-	۰.۱۴%	۱.۷۶%-	۰.۱۴%	۹.۱۵%	۴.۴۹%
خصوصی	۱,۶۱۹.۸۵	۰.۰۱%	۰.۱۱%	۰.۴۳%	۱.۳۴%	۰.۴۳%	۲.۹۶%	۵.۱۶%
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۹۳۲,۴۵۱.۹۸	۰.۰۹%	۰.۳۶%	۱.۶۴%	۴.۳۰%	۱.۶۴%	۸.۹۱%	۱۶.۱۶%
اختصاصی بازارگردانی	۹۹۵,۶۶۰.۷۲	۱.۹۹%	۱.۳۱%-	۱.۴۳%	۴.۶۹%-	۱.۴۳%	۱۰.۴۵%	۷.۲۸%-
در سهام	۵۶۰,۷۷۱.۸۷	۰.۱۴%	۲.۱۳%-	۰.۴۶%-	۵.۱۵%-	۰.۴۶%-	۷.۹۴%	۵.۸۴%-
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۴۲,۳۶۵.۶۳	۰.۰۰%	۰.۳۴%-	۸.۷۸%-	۱۰.۶۲%-	۸.۷۸%-	۷.۵۳%	۲۴.۶۵%
مختلط	۲۲,۰۰۱.۱۶	۰.۰۳%	۰.۷۶%-	۰.۶۵%	۱.۱۸%-	۰.۶۵%	۴.۸۰%	۰.۲۸%-
پروژه‌ای	۱۰,۵۷۶.۱۰	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%
جسورانه	۵,۰۳۴.۰۱	۰.۹۷%	۰.۰۷%	۱۷.۹۳%	۱۸.۲۱%	۱۷.۹۳%	۱.۴۶%	۲۲.۵۶%
صندوق درصندوق	۶,۵۷۳,۸۴۹							

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	بازدهی ساده	
اخزا ۹۰۱	۹۹۷۰۷۰	۱۴۰۱-۰۶-۱۶	۱۴۰۱-۰۶-۲۱	۲۳.۸۹٪	۲۱.۴۵٪	
اخزا ۰۱۰	۶۱۴۶۴۰	۱۴۰۱-۰۶-۱۹	۱۴۰۳-۱۱-۱۵	۲۲.۴۵٪	۲۶.۰۹٪	
اخزا ۹۰۷	۸۲۷۶۰۰	۱۴۰۱-۰۶-۱۹	۱۴۰۲-۰۷-۰۴	۱۹.۸۷٪	۱۹.۹۶٪	
میانگین بازدهی					۲۱.۹۳٪	۲۲.۸۷٪

منبع: فرابورس ایران

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

طی هفته اخیر، بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سرسید نشده به ترتیب متعلق به نمادهای اخزا ۹۰۱ و اخزا ۰۱۰ با سرسید ۱۴۰۱/۰۶/۲۱ و ۱۴۰۳/۱۱/۱۵ و ۱۴۰۳/۱۱/۱۵ و بازدهی ۲۳/۸۹ و ۲۶/۰۹ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخزا ۹۰۷ با سرسید ۱۴۰۲/۰۷/۰۴ و بازدهی ۱۹/۸۷ و ۱۹/۹۶ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۱/۹۳ و ۲۲/۸۷ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
اراد ۲۳	۹۰۸۱۳۰	۱۴۰۱-۰۶-۱۶	۱۴۰۲-۱۲-۲۵	۲۷.۳۴٪
تابان ۰۱	۱۰۹۳۰۰۰	۱۴۰۱-۰۶-۱۵	۱۴۰۲-۱۲-۰۶	۱۱.۵۴٪

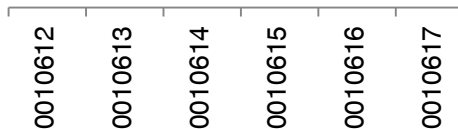
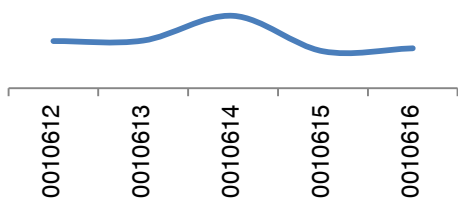
منبع: فرابورس ایران

اوراق تأمین مالی

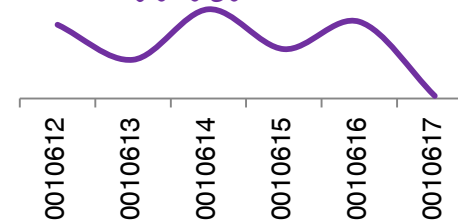
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد تابان ۰۱ به میزان ۱۱.۵۴ درصد با سرسید ۱۴۰۲/۱۲/۲۵ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اراد ۲۳ به میزان ۲۷.۳۴ درصد با سرسید ۱۴۰۲/۱۲/۲۵ بوده است.

بورس کالا

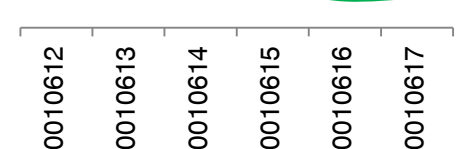
بازار فیزیکی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)

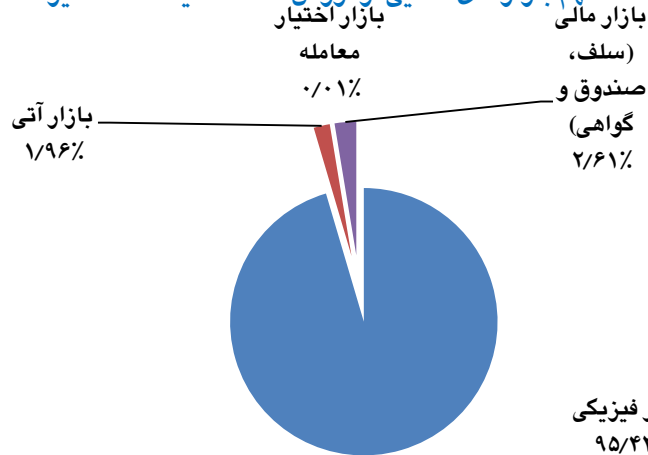


بازار اختیار معامله



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

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۷.۳ 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 ۴.۱۰ درصد و حجم معاملات ۳۸۲ 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	۷۶,۵۷۳,۸۱۳	۱,۶۲۹,۸۹۵	۵۷/۶%
پتروشیمی و قتی	۵۲,۸۸۵,۹۹۱	۳۰۹,۸۲۶	۳۹/۸%
معدنی	۱,۸۸۲,۲۷۱	۲۴,۵۰۰	۱/۴%
بازار فرعی	۱,۶۷۸,۵۶۵	۱۳,۲۸۴	۱/۳%
جمع	۱۳۳,۰۲۰,۶۴۰	۱,۹۷۷,۵۰۵	۱۰۰%

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

در خصوص 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 کاند مس از نرخهای جهانی است.

مقایسه نرخهای بورس کالا با نرخهای جهانی

محصول	نرخ ریالی	میانگین هفتگی (قیمای دلاری)	میانگین هفتگی (دلار آزاد)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نیما)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ آزاد)	نرخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نیما)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ آزاد)	تغییرات هفتگی (نرخ ریالی)
یک تن اوره گرانول	۱۲۱,۷۰۹,۰۰۰	۲۶۶,۴۱۰	۳۰۲,۵۰۰	۴۵۷	۴۰۲	۷۰۳	۶۵/۰%	۵۷/۲%	-۰/۶%
یک تن کاند مس	۲,۱۷۵,۲۸۰,۰۰۰	۲۶۶,۴۱۰	۳۰۲,۵۰۰	۸,۱۶۵	۷,۱۹۱	۷,۶۶۸	۱۰۶/۵%	۹۳/۸%	-۴/۸%
یک تن پت شهید تندگویان	۲۹۳,۴۸۰,۰۰۰	۲۶۶,۴۱۰	۳۰۲,۵۰۰	۱,۱۰۲	۹۷۰	۱,۱۶۰	۹۵/۰%	۸۳/۶%	-۱۷/۰%
یک تن بیلت فخور	۱۲۱,۰۴۲,۰۰۰	۲۶۶,۴۱۰	۳۰۲,۵۰۰	۴۵۴	۴۰۰	۵۲۸	۸۶/۱%	۷۵/۸%	-۰/۷%
یک تن سیمان ۲۵ قه	۶,۵۶۰,۰۰۰	۲۶۶,۴۱۰	۳۰۲,۵۰۰	۲۵	۲۲	-	-	-	-۱/۵%

تحلیل تکنیکال شاخص کل

به سمت کف کانال نزولی



- شاخص کل طی هفته گذشته به روند نزولی خود ادامه داد و کف ۱/۴۲۳/۰۰۰ واحد را که پیش از این دو بار به آن واکنش مثبت نشان داده بود را شکست و امروز با ۱۵/۴۲۲ واحد کاهش به ۱/۳۹۷/۴۳۴ واحد رسید و بدین ترتیب محدوده حمایتی ۱/۴۰۰/۰۰۰ واحد را نیز از دست داد.
- انتظار می‌رود شاخص کل به روند فعلی خود تا محدوده ۱/۳۵۰/۰۰۰ واحد که کف کانال نزولی و محدوده حمایتی معتبری محسوب می‌شود ادامه پیدا کند و سپس در این محدوده مورد حمایت قرار گرفته و شاهد تغییر روند آن باشیم.

❖ 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 (BTCUSD)

بازگشت پر قدرت از کف کانال بلند مدت

- در روز جمعه شاهد کندلی قوی و مثبت از بیت کوین بودیم که رشدی ۱۲ درصدی را به ثبت رساند.
- بیت کوین با برگشت از محدوده ۱۸.۵۰۰ دلار موفق به حفظ کف کانال صعودی بلند مدت خود شد و بدین ترتیب کف جدیدی را به ثبت رساند.
- در صورتی که بیت کوین موفق به شکست خط روند نزولی خود شود، هدف بعدی آن محدوده مقاومتی ۲۵ هزار دلار خواهد بود.



❖ 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 طلا (XAUUSD)

شکست خط روند نزولی؟



- همان طور که انتظار می‌رفت پس از رسیدن انس جهانی طلا به محدوده حمایتی ۱۶۸۰ دلار موجی صعودی را شروع کرد.
- اولین هدف طلا خط روند نزولی و مقاومت استاتیک در محدوده ۱۷۵۰ دلار خواهد بود.
- طلا برای تغییر روند و شروع موجی صعودی میان مدتی نیاز به شکست مقاومت ۱۸۰۰ دلار و تثبیت بر بالای آن دارد. در غیر این صورت هر موج صعودی صرفاً اصلاحی در روند نزولی تلقی خواهد شود.

❖ 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 شاخص دلار (DXY)

شروع روند اصلاحی



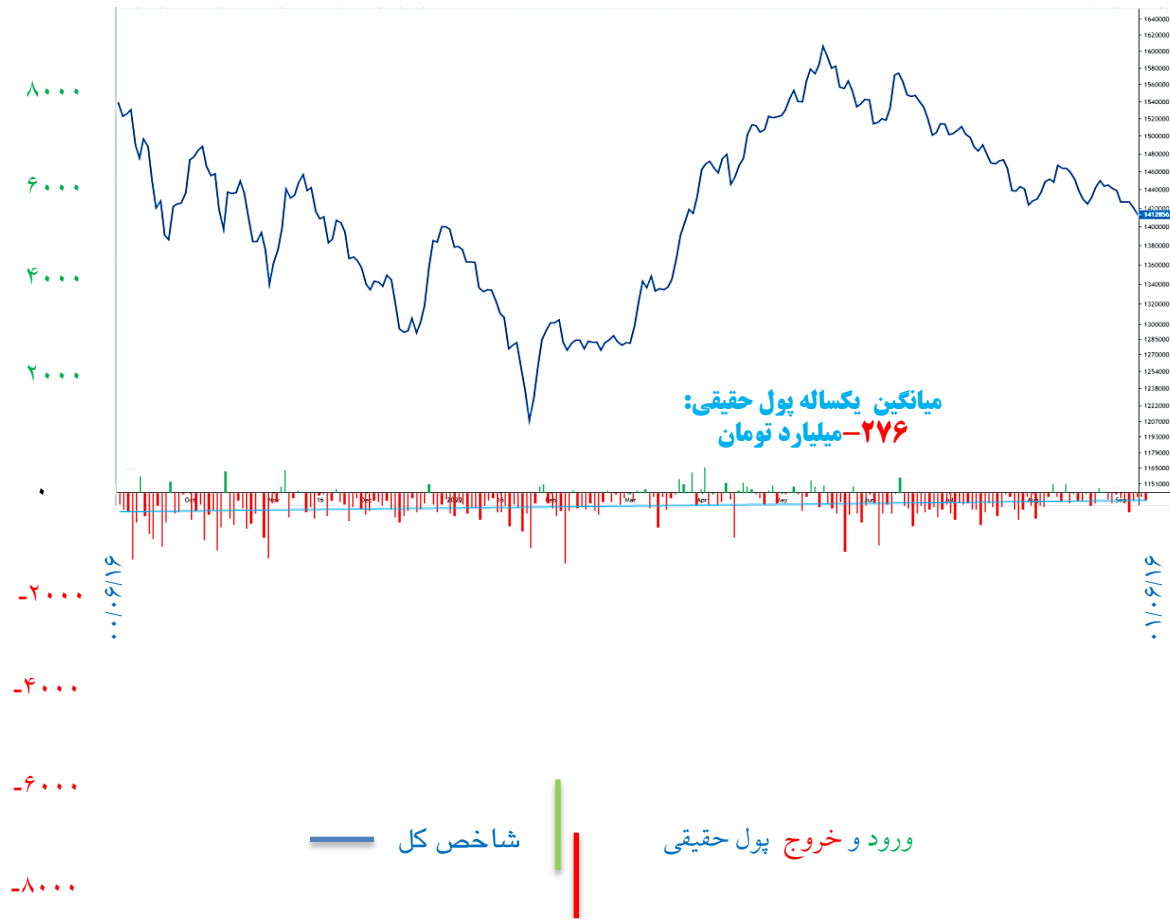
- شاخص دلار با رسیدن به محدوده ۱۱۰ واحد تغییر روند داد و وارد روندی اصلاحی شد.
- مادامی که شاخص دلار محدوده ۱۰۷ واحدی خود را از دست ندهد گارد صعودی خود را حفظ خواهد کرد و می‌تواند مجدداً به سمت محدوده سقف کانال صعودی خود خیز بردارد.
- محدوده ۱۱۲ الی ۱۱۵ واحد آخرین هدف صعودی شاخص دلار محسوب می‌شود زیرا که این محدوده سقف کانال صعودی بلند مدت و همچنین مقاومت استاتیک سال ۲۰۰۰ میلادی بوده و به همین دلیل مقاومت بسیار مهمی برای شاخص دلار خواهد بود.

❖ 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)

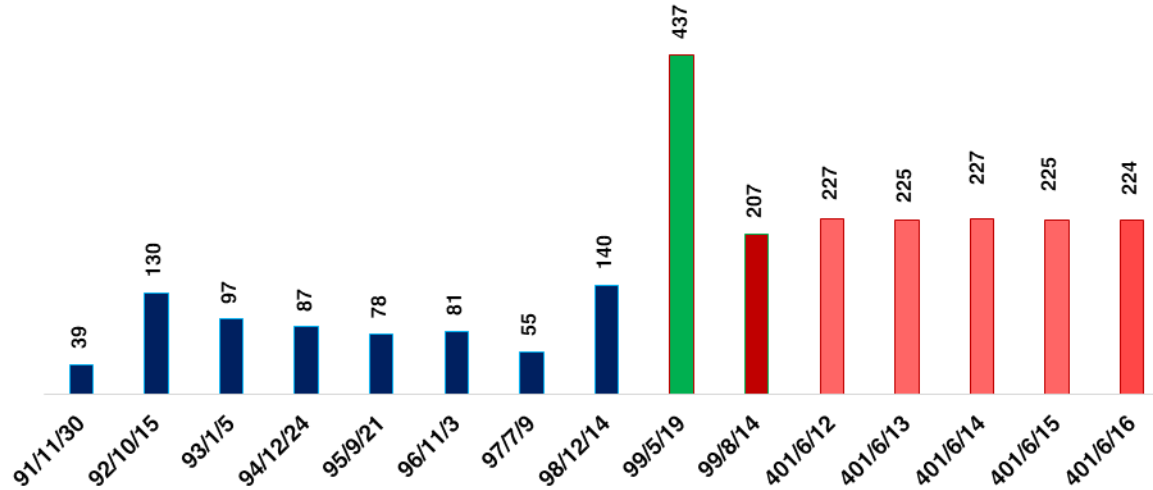


- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۴۱۲,۸۵۶ واحدی و بازده هفتگی ۱.۸۴- درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۹۷۳ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱، نشان دهنده‌ی خروج ۲۲,۰۴۸ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی به طور میانگین، روزانه ۲۱۲ تومان پول از بازار خارج شده است.
- خالص پول اشخاص حقیقی کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹ که در قله خود (۱۹ مرداد ۹۹) به عدد ۱۱۸,۲۴۲ میلیارد تومان رسیده بود، به عدد ۳۹,۸۷۹- میلیارد تومان افول کرد.

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

شنبه	۰۱/۰۶/۱۲	: ۴۳۰-	میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۰۶/۱۳	: ۱۸۲-	میلیارد تومان
دوشنبه	۰۱/۰۶/۱۴	: ۹۸-	میلیارد تومان
سه شنبه	۰۱/۰۶/۱۵	: ۸۳-	میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۰۶/۱۶	: ۱۸۱-	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 ۲۲۴ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۴۹ 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 ۱۲۰ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص برای آمریکا در تاریخ ۲ سپتامبر سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۲.۵ تریلیون دلار بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۵۰.۰ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۱۷۰ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال) (TTM)	P (ریال)	P/E (پیش‌بینی)	EPS (ریال) (پیش‌بینی)	سال مالی	P/NAV
شستا	۶.۷۰	۱۳۹	۹۳۱	۵.۸۶	۱۵۹	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۸۷٪
وبانک	تحقق یافته		۹,۸۹۰	۵.۵۲	۱,۷۹۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۷۳٪
وصندوق	تحقق یافته		۱۰,۸۷۰	۴.۲۱	۲,۵۸۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۴۸٪
وامید	۹.۱۳	۱,۳۷۱	۱۲,۵۲۰	۷.۱۰	۱,۷۶۴	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۰٪
وغدیر	۶.۲۹	۲,۲۱۷	۱۳,۹۴۰	۴.۸۴	۲,۸۷۸	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۰٪
ونیکی	۲.۳۱	۱,۸۸۵	۴,۳۵۲	-	-	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۴۷٪

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.