



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

انتظار رشد بازار سرمایه با اهرم نرخ ارز

نتایج جدیدترین دور مذاکرات وین در آخرین روز هفته اخیر، تیترا خبری اصلی رسانه‌ها را رقم زد. بر این اساس، اخبار ضد و نقیض از میزان پیشرفت مذاکرات، نرخ ارز را در روز کاری نخست هفته جاری دچار نوسان کرد. در این بین واکنش‌های فعالان بازار به نوسانات نرخ ارز، سرعت اثر خود را بر عرضه و تقاضا در نمادهای گروه‌های مختلف شرکت‌ها نشان داد. بنابراین هم‌اکنون محرک اصلی بازار سرمایه را می‌توان نرخ ارز دانست، که گمانه‌زنی‌ها در خصوص تحولات آتی آن سبب ورود/خروج پول حقیقی خواهد شد.

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۸۳ - هفته منتهی به ۱۳ آذر ۱۴۰۰

گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی: شیوع ریسک‌گریزی در بازارهای جهانی - پیش‌بینی کوچ سرمایه‌گذاران از دارایی‌های پرریسک، در پی ریزش ۲۰ درصدی نرخ بیت‌کوین؛
- تصویر اقتصاد کلان - رفتار معکوس تورم و بیکاری در آمریکا و منطقه یورو؛
- اقتصاد کلان: بازار مسکن - جان گرفتن دوباره آهنگ صعودی قیمت مسکن؛
- بورس و انرژی: هفته منفی نفت و محصولات پتروشیمی؛
- فلزات گرانبها و ارز: شنبه بد بیت‌کوین؛
- بازار کالاهای خام: تداوم رشد شاخص بالتیک خشک در آستانه سال نو میلادی؛
- بررسی صندوق‌ها و بازدهی آنها: ثبات سهم صندوق‌های سهامی؛
- بررسی بورس کالا: کاهش نرخ جهانی پت و باقی ماندن شکاف قیمتی نرخ جهانی با نرخ دلاری آن در بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - از دست رفتن کف قبلی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - شکست کانال صعودی؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - شکست خط روند صعودی و ادامه روند نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - کماکان در فاز اصلاحی؛
- 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 چشم‌انداز اقتصاد جهانی

شیوع ریسک‌گریزی در بازارهای جهانی

پیش‌بینی کوچ سرمایه‌گذاران از دارایی‌های پرریسک، در پی ریزش ۲۰ درصدی نرخ بیت‌کوین

اشاره
؟؟؟

بلومبرگ
Bloomberg

- ریزش ۲۰ درصدی صبح روز شنبه (۱۳ آذر ۱۴۰۰) بیت‌کوین نشان داد که رفتار سرمایه‌گذاران در حال تغییر به سوی ریسک‌گریزتر شدن است.
- نمایندگان اتحادیه اروپا با اعلام وجود «مشکلات و اختلافات بزرگ»، پایان مذاکرات وین را اعلام کردند.
- موارد ابتلاء به کرونا در آفریقای جنوبی، در عرض ۴ روز، تقریباً ۴ برابر شده است.
- نمایندگان قطر و بریتیش پترولیوم، کنفرانس جهانی نفت را در اعتراض به تصمیمات مورد بحث ترک کردند.
- با شدت گرفتن گسترش اومیکرون، نفت طولانی‌ترین توالی منفی هفتگی از ۲۰۱۸ را تجربه کرد.
- نرخ تورم ترکیه، به بیشترین میزان از سال ۲۰۱۸ رسیده است.
- بانک مرکزی ترکیه، اقدامات و دخالت‌هایش در بازار برای حفظ ارزش لیر را از سر گرفت.
- احزاب مخالف ترکیه مدعی شدند که دولت نرخ تورم واقعی را عنوان نمی‌کند.
- اقدام اوکراین در خرید پهپادهای رزمی از ترکیه، خشم روسیه را برانگیخته است. اوکراین اعلام کرد در پی خرید تجهیزات بیشتر از ترکیه است.
- فایزر اعلام کرد احتمالاً بتوان با کمی بهبود بخشیدن در عملکرد واکسن، مقاومت در مقابل اومیکرون را بالا برد.
- امارات در قراردادی ۱۹ میلیارد دلاری، اقدام به خرید ۸۰ هواپیمای جنگنده رافال از فرانسه کرد.
- موارد ابتلاء به اومیکرون در ایالات متحده در حال افزایش است.
- بایدن اظهار داشت مذاکراتی طولانی با پوتین حول محور فعالیتهای روسیه در مرز اوکراین در پیش داریم.
- اومیکرون پایان جهش‌های کرونا نخواهد بود، جهان باید به واقعیت جدید خو بگیرد.
- برکشایر هاتاوی اعلام کرد وضعیت بازارهای سهام جهانی ملتهب‌تر از زمان «حباب دات‌کام» در ابتدای قرن ۲۱ است.
- اپل به تأمین‌کنندگان قطعات اعلام کرد تقاضای خرید آیفون در فصل تعطیلات کمتر از حد انتظار است.

BUSINESS
INSIDER

بیزینس اینسایدر

- رکورد مرگ‌ومیر کرونا در روسیه شکسته شد.
- بدترین سقوط سهام بخش املاک کانادا از ماه ژانویه رخ داد.
- با سقوط بازار سهام تکنولوژی آمریکا، ثروت ایلان ماسک ۱۵ میلیارد دلار افت کرد.
- آرژانتین در پی تقویت پولش با جذب سرمایه‌گذاران خرد آنلاین خارجی است.
- با افزایش کمتر از ۱/۵ درجه سانتیگراد میانگین دما، در ۱۰۰ سال آینده نیز می‌توان رشد اقتصادی جهانی داشت.
- دیپلمات‌ها در واکاوی برجام ۲۰۱۵ و تطابقش با نیازهای امروز به بن‌بست خوردند.
- ایران در مذاکرات برجام با اروپا، بر سر روابطش با چین نیز ریسک کرد.
- محبوب‌ترین سهام وال‌استریت از تسلا تا انویدیا، در حال سقوط هستند.
- انگلستان اولین اخطار افزایش مصرف انرژی این زمستان را صادر کرد.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۲۶۵,۱۹۵,۳۱۰ +۱/۶۵%

جان‌باختگان

۵,۲۵۸,۰۳۶ +۰/۹۹%

بهبودیافتگان

۲۳۸,۸۹۰,۸۲۳ +۱/۳۶%

منبع: www.worldometers.info

فایننشال تایمز



- دولت ایالات متحده اعلام کرد روسیه می‌تواند در ۳ ماهه اول ۲۰۲۲ به اوکراین حمله کند.
- دول اروپایی اعلام کردند زمان امکان احیای برجام در حال به پایان رسیدن است.
- بانک‌های مرکزی جهان وقت زیادی برای مقابله‌ی جدی با تورم و مهار آن ندارند.
- تورم کره‌جنوبی، بالاترین نرخ دهه گذشته را ثبت کرد.
- فورد بدنبال تصاحب جایگاه دوم تولید خودروهای الکتریکی پس از تسلا است.
- توییت، اپل و خطوط هواپیمایی، مقاصد محبوب سرمایه‌گذاران در حال حاضر هستند.
- مذاکرات دیپلماتیک بین عربستان سعودی و آمریکا، موجب هموار کردن راه برای افزایش تولید فراتر از انتظار اوپک پلاس شد.
- با افزایش تورم و قیمت گوشت در برزیل، سوپرمارکت‌ها برای پیشگیری از سرقت، قفسه‌های محصولات پروتئینی خود را قفل و زنجیر کردند.
- میلیارد آمریکایی، بری استرنلینچ، گفت حدود ۳ درصد از ثروت ۴/۵ میلیارد دلاری خود را در رمزارزها سرمایه‌گذاری کرده است.

تصویر اقتصاد کلان رفتار معکوس تورم و بیکاری در آمریکا و منطقه یورو

مقایسه بازدهی بازارها

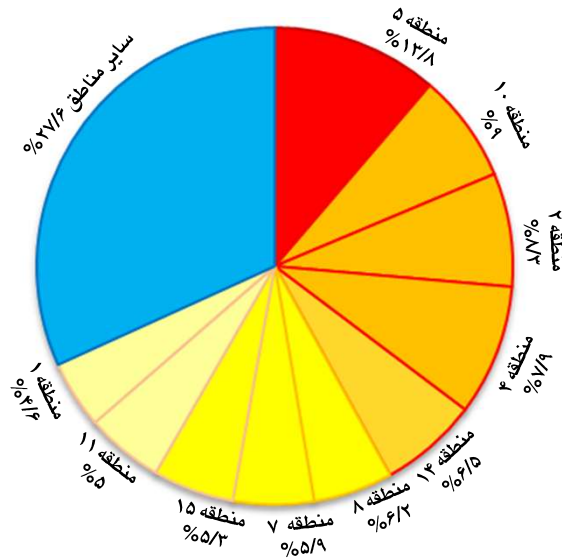
بازار	هفتگی	ماهانه	۱۴۰۰	یکساله
دلار (ریالی)	%-۵/۲۲	%-۱/۰۰	%۱۰/۳۷	%۶/۶۹
سکه (ریالی)	%۰/۴۴	%۷/۲۷	%۱۲/۵۵	%۵/۲۳
بورس (شاخص)	%-۳/۹۲	%-۱/۵۷	%۲/۳۳	%-۹/۰۷
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	%-۲/۶۰	%-۱۲/۱۰	%۳۵/۶۹	%۳۱۹/۳۸
مسکن (ریالی - تهران)	-	%۱/۲	-	%۱۷/۷

طی هفته اخیر، آمار نرخ تورم منطقه یورو منتشر شد، که خبر از افزایش آن دارد. در عین حال، به تازگی آمار نرخ بیکاری در آمریکا و منطقه یورو منتشر شد، که نشان از کاهش آنها دارد. این رفتار معکوس برای اقتصاددانان یادآور منحنی معروف فیلیپس است، که در حالت اشتغال ناقص در اقتصاد، تأکید بر رفتار معکوس نرخ تورم و نرخ بیکاری دارد.

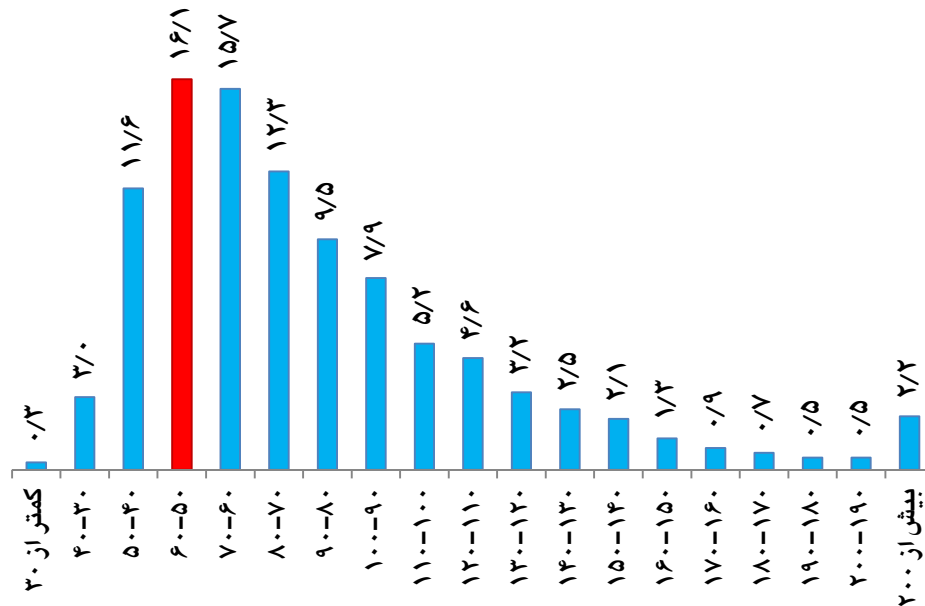
حوزه جغرافیایی متغیر	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	درآمد سرانه (دلار)	میانگین سالانه			نقطه به نقطه (ماهانه)		فصلی	نرخ بهره (درصد)	نسبت بدهی خالص به GDP (درصد)	نسبت کل سرمایه‌گذاری به GDP (درصد)	جمعیت (هزار نفر)
			نرخ رشد اقتصادی - به قیمت‌های ثابت (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ رشد اقتصادی (درصد)					
جهان												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	-	-	-	-	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۸۴،۵۳۷،۶۹۰	۱۰،۸۴۵	-	-	-	-	-	-	-	-	%۲۶/۵۷	۷،۷۹۵،۰۰۰
پیش‌بینی (۲۰۲۱)			%۵/۹	-	%۴/۳							
آمریکا												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۲۰،۹۳۲،۷۵۰	۶۳،۴۱۶	%-۳/۴	%۸/۱۱	%۱/۲۵	%۴/۲	%۶/۲	%۲/۱	%۰/۲۵	%۹۸/۷۲	%۲۱/۱۵	۳۲۹،۷۷۰
پیش‌بینی (۲۰۲۱)			%۶	%۵/۴	%۴/۳							
چین												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۱۴،۷۲۳،۸۳۷	۱۰،۴۸۵	%۲/۳	%۳/۸	%۲/۳۹	%۴/۹	%۱/۵	%۰/۲	%۳/۸۵	-	%۴۳/۱۲	۱،۴۱۴،۳۵۳
پیش‌بینی (۲۰۲۱)			%۸	%۳/۸	%۱/۱							
منطقه یورو												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۱۹	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۱۲،۹۱۶،۶۱۸	۳۷،۷۲۳	%-۶/۳	%۷/۹۲	%۰/۲۵	%۷/۳	%۴/۹	%۲/۲	%۰/۰۰	%۸۰/۷۲	%۲۱/۸۶	۳۴۲،۴۱۰
پیش‌بینی (۲۰۲۱)			%۵	%۸	%۲/۲							
ایران												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۱۹۱،۷۱۸	۷،۵۵۵	%۳/۴	%۱۰/۸۲	%۳۶/۵	%۹/۶	%۳۵/۷	%۷/۶	%۱۸	%۳۰/۲۹	%۴۶/۲۲	۸۴،۱۳۹
۲۰۲۱			%۲/۵	%۱۰	%۳۹/۳							

بازار مسکن جان گرفتن دوباره آهنگ صعودی قیمت مسکن

توزیع مناطق شهر تهران بر حسب سهم از تعداد معاملات انجام شده (آبان ۱۴۰۰)

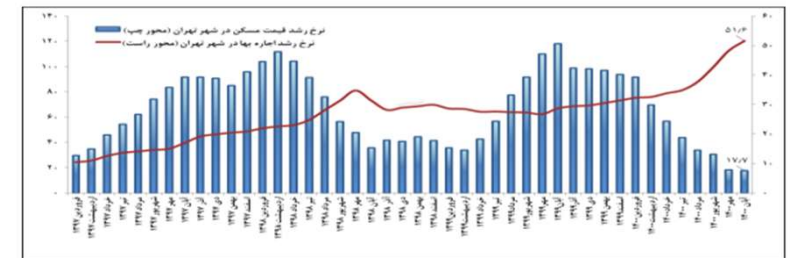


توزیع فراوانی معاملات مسکن انجام شده در شهر تهران بر حسب مترائ (آبان ۱۴۰۰)



بنا بر گزارش بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، در آبان ماه سال ۱۴۰۰ تعداد معاملات آپارتمان‌های مسکونی تهران به ۷/۳ هزار واحد مسکونی رسید که نسبت به ماه قبل و ماه مشابه سال قبل به ترتیب ۳۳/۵ و ۶۳/۵ درصد افزایش داشته است. در آبان ماه سال ۱۴۰۰ متوسط قیمت خرید و فروش یک مترمربع زیربنای واحد مسکونی معامله‌شده از طریق بنگاه‌های معاملات ملکی تهران ۳۲۰/۱ میلیون ریال بود که نسبت به ماه قبل ۱/۲ درصد افزایش و نسبت به ماه مشابه سال قبل ۱۷/۷ درصد افزایش را نشان می‌دهد. در میان مناطق ۲۲ گانه شهر تهران در آبان ماه، بیشترین متوسط قیمت یک مترمربع زیربنای مسکونی معامله‌شده ۷۲۷/۵ میلیون ریال به منطقه ۱ و کمترین آن با ۱۴۵/۲ میلیون ریال به منطقه ۱۸ تعلق داشته که نسبت به ماه مشابه سال ۱۳۹۹ به ترتیب ۳۲/۲ و ۲۰/۶ درصد افزایش داشته‌اند. بررسی شاخص کرایه مسکن اجاری در شهر تهران و در کل مناطق شهری در آبان ماه سال ۱۴۰۰ به ترتیب نشان‌دهنده رشد ۵۱/۶ و ۵۴/۹ درصدی نسبت به ماه مشابه سال قبل است. بررسی توزیع تعداد واحدهای مسکونی معامله شده در شهر تهران به تفکیک عمر بنا حاکی از آن است که واحدهای تا ۵ سال ساخت با سهم ۳۲ درصد بیشترین سهم را به خود اختصاص داده‌اند.

روند رشد قیمت مسکن و اجاره بها در شهر تهران نسبت به ماه مشابه سال قبل





منبع

بازده
یکساله

بازده
ماهانه

بازده
هفتگی

معادل

آخرین قیمت

عنوان

ردیف

بورس و انرژی

هفته منفی نفت و محصولات پتروشیمی

بورس‌های جهانی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
۱	Dow Jones	۳۴,۵۷۴	واحد	-۰.۵۵%	-۴.۳۵%	۱۵.۳۶%
۲	Nasdaq	۱۵,۷۱۲	واحد	-۱.۹۸%	-۲.۶۸%	۲۶.۰۳%
۳	S&P 500	۴,۵۳۷	واحد	-۱.۱۷%	-۲.۵۸%	۲۳.۷۸%
۴	FTSE 100	۷,۱۲۸	واحد	۱.۴۷%	-۱.۵۵%	۱۰.۵۱%
۵	DAX	۱۵,۱۷۰	واحد	-۰.۵۷%	-۴.۹۵%	۱۴.۴۷%
۶	CAC 40	۶,۷۶۶	واحد	۰.۳۸%	-۲.۶۶%	۲۱.۳۷%
۷	NIKKEI 225	۲۸,۰۳۰	واحد	-۲.۵۱%	-۵.۰۵%	۴.۵۵%
۸	SHANGHAI	۳,۶۰۷	واحد	۱.۲۲%	۳.۱۱%	۴.۸۰%
۹	Moex	۳,۹۱۳	واحد	۲.۶۸%	-۶.۲۷%	۱۸.۹۷%

TeleTrader

TradingEconomics

نفت و انرژی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
۱۰	نفت خام WTI	۶۹.۹۲	دلار/بشکه	-۳.۸۵%	-۱۳.۱۹%	۴۰.۹۸%
۱۱	نفت خام برنت	۶۶.۳۲	دلار/بشکه	-۳.۱۸%	-۱۵.۹۱%	۴۵.۷۶%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۴.۰۹	دلار/MMBtu ۱۴/۴۹ سنت/مترمکعب	-۲۵.۴۸%	-۳۱.۳۱%	۳۹.۴۴%
۱۳	گازوئیل	۶۱۳	دلار/تن	۲.۲۱%	-۱۱.۶۰%	۴۵.۸۴%
۱۴	اتانول	۲.۸۵	دلار/گالن ۹۵۰	-۱۷.۳۹%	-۲.۳۲%	۵۴.۰۱%
۱۵	متانول (داخلی چین)	۲,۷۵۷	یوان/تن ۴۳۳	۰.۳۳%	-	-
۱۶	CFR متانول	۳۲۵	دلار/تن	-۲.۴۶%	-۳۰.۷۷%	۳۶.۹۲%
۱۷	اوره گرانول خاورمیانه	۸۷۰.۰۰	دلار/تن	-۵.۰۷%	۲۲.۱۳%	۷۲.۴۰%
۱۸	نفثا	۶۸۳.۸۵	دلار/تن	-۱۲.۶۹%	-۱۳.۶۴%	۴۷.۶۴%
۱۹	سبد اوپک	۷۰.۰۳	دلار/بشکه	Waiting	-۱۴.۹۶%	۴۰.۵۸%
۲۰	نفت سنگین ایران	۶۷.۲۱	دلار/بشکه	-۱.۸۰%	-۱۳.۵۸%	۴۳.۵۸%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۱.۰۶۰	دلار/تن	-۷.۵۵%	-۳.۲۱%	۳۸.۲۱%

نفت و محصولات پتروشیمی

در پی هفته ملتهب پیشین که ترس گسترش سویه اومیکرون و ویروس کرونا تمام بازارهای جهان را فراگرفت و شاهد ریزش قابل توجه قیمت سهام شرکت‌ها و شاخص‌ها بودیم، پیش‌بینی می‌شد که روند این سقوط با توجه به نامعلوم بودن قدرت اومیکرون ادامه‌دار باشد. اما در ابتدای هفته دیدیم که بازارهای جهانی به تعادل رسیده و پس از کاهش اندک، شروع به روند افزایشی کردند.

بازارهای اروپایی در مجموع همین رنج مثبت آهسته را ادامه داده و این هفته را با برآیندی مثبت به پایان رساندند. در بازارهای آسیای شرقی نیز شاهد همین روند بودیم که با توجه به تمهیدات خوب دولت‌ها درباره ممنوعیت مسافرت‌ها و عدم مشاهده اومیکرون در این کشورها، بازارها در سایه این خوش‌بینی جان تازه‌ای به خود گرفتند. همچنین اخبار آمار تلفات پایین اومیکرون با وجود آمار ابتلای بالای آن در آفریقای جنوبی، امیدها را به بازیابی تقاضای هفته‌های آتی افزایش داد.

در آمریکا اما صحبت‌های آقای پاول، رئیس فدرال رزرو، در مورد کنترل تورم با سیاست‌های انقباضی و افزایش اشتغال و تولید برای تقویت دلار، موجب ادامه شوک قیمتی شد و سهام شرکت‌های محبوبی مانند انویدیا و تسلا را، که بخش زیادی از افزایش قیمت‌شان با توجه به اقبال هیجانی بازار به آنها بود، کاهش داد و موجب قرمز رنگ شدن نماگر بازارهای آمریکایی شد.

سقوط وحشتناک قیمت نفت در هفته گذشته و برخورد آن با کف قیمت مجازش در بورس انرژی چین، تحلیل‌گران را متقاعد کرده بود که این هفته نفت نیز با یک منفی روزانه قابل توجه شروع می‌شود. اما خبر ممنوعیت مسافرت‌های جاری و کم بودن کشندگی گونه اومیکرون در کنار سرمای هوا و خبر جلسات مهم اوپک، موجب خوش‌بینی بازار شده که در میانه هفته با خبر تن دادن عربستان به خواسته آمریکا مبنی بر افزایش ۴۰۰ هزار بشکه‌ای تولید روزانه اوپک (با وجود پایین آمدن قابل توجه قیمت نفت در هفته پیشین و کاهش ۷ میلیون بشکه‌ای تقاضای جهانی نفت با توجه به گسترش اومیکرون) موجب ادامه رنج منفی نفت ولی با شدت و سرعتی کمتر شد. حال باید ببینیم واکنش بازار انرژی طی هفته‌های آتی به پایان نامیدکننده مذاکرات برجام چه خواهد بود.

قیمت محصولات پتروشیمی نیز به تبعیت از قیمت نفت و گاز کاهشی هرچند کم‌رنگ را تجربه کرد؛ به جز اتانول که نسبت به اواسط هفته کاهش قیمت ۱۷ درصدی را شاهد بود.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱۷۸۳	دلار / اونس	-۰.۳۱%	-۰.۷۶%	-۳.۲%	TeleTrader
۲	نقره	۲۲.۵۳	دلار / اونس	-۲.۵۹%	-۴.۲۵%	-۶.۶۳%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۱۱ آذر							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۲,۵۸۹,۰۰۰	ریال	-۰.۶۸%	۷.۷۵%	۱۳.۶۳%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۲۶,۲۶۰,۰۰۰	ریال	-۰.۴۴%	۷.۲۷%	۵.۲۳%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۱۱ آذر							
۵	دلار آزاد	۲۷۳,۲۴۰	ریال	-۵.۱۵%	-۱%	۶.۶۷%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۳۲,۷۷۹	ریال	-۱.۳۱%	۱.۰۶%	-۸.۶۸%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۳۴,۸۹۴	ریال	-۱.۳۱%	۱.۰۶%	-۸.۰۸%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۲۹۶,۲۸۲	ریال	-۲.۷۵%	-۲.۵۳%	-۰.۲%	sanarate/ir
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۳,۶۳۰	ریال	-۰.۱۶%	-۱.۲۴%	-۱۴.۲۲%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۶۶,۰۲۵	ریال	-۰.۱۶%	-۱.۲۴%	-۱۳.۷۳%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۱,۲۳۵	ریال	-۳.۸۷%	-۰.۲۶%	۶.۴۱%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۶۳,۳۸۵	ریال	-۱.۳۱%	۱.۰۶%	-۹.۱۱%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۶۳,۹۶۱	ریال	-۱.۳۱%	۱.۰۶%	-۸.۹۴%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت کوین	۴۷,۷۱۵	دلار	-۱۲.۷۸%	-۲۲.۲۶%	۱۵۵.۸۴%	Tradingview
۱۵	اتریوم	۳,۹۶۹	دلار	-۳.۱۸%	-۱۲.۵۱%	۵۹۹.۱۵%	Tradingview

بازار فلزات گرانبها
هفته گذشته با توجه به اظهارات مقامات بانک مرکزی آمریکا برای تعدیل برنامه خرید اوراق قرضه و افزایش نرخ‌های بهره، اونس جهانی طلا کاهش یافت. ژروم پاول، رییس بانک مرکزی آمریکا، طی اظهاراتی که برابر کنگره داشت، اعلام کرد تصمیم درباره تعدیل سریع‌تر برنامه خرید اوراق قرضه ممکن است در نشست سیاست پولی ۱۴ و ۱۵ دسامبر گرفته شود. آنچه که افت بیشتر اونس جهانی طلا را محدود کرد، ترس از سویه جدید ویروس کرونا بود.

سکه و ارز (داخلی)
هفته گذشته با برگزاری مذاکرات وین و انتشار اخبار منفی از این نشست، نرخ دلار آزاد افزایش یافته و شکاف دو هزار تومانی میان نرخ رسمی و آزاد را شاهد بودیم. در پی بالا رفتن قیمت دلار، قیمت سکه نیز افزایش یافت.

رمزارز
هفته منفی خبری برای بازار کریپتو با انتشار شایعه ارسال لایحه ممنوعیت ارزهای دیجیتال توسط خزانه‌داری آمریکا به سنای، تکمیل شد؛ بطوریکه خزانه‌داری آمریکا معتقد است ارزهای دیجیتال به زیان دلار و تورم‌زا هستند. اخباری نظیر شیوع سویه اومیکرون، ممنوعیت‌های جدید بانک مرکزی چین و سرکوب حوزه‌های متاورس و NFT، تورم آمریکا و کاهش نرخ بیکاری و رسیدن این نرخ به ۴/۲ درصد و احتمال افزایش نرخ بهره و حرکت به سمت کاهش هرچه بیشتر خرید دارایی‌ها (تیرینگ)، انتشار بیانیه‌ای از غول املاک و مستغلات چین، یعنی شرکت اورگرند، مبنی بر عدم انجام تعهداتش نسبت به سرمایه‌گذاران در رابطه با نگهداری اوراق بهادار این شرکت و ارسال لایحه ممنوعیت ارزهای دیجیتال به سنای آمریکا، همگی باعث ریزش قیمت بیت‌کوین شدند. اما شایعه آخر بود که ریزش سنگین قیمت بیت‌کوین را به همراه داشت، بطوریکه قیمت غول بازار کریپتو ظرف چند دقیقه دچار ریزش ۲۵ درصدی شده و به ۴۰,۸۸۸ دلار نیز رسید. در پی این ریزش سنگین، ۲/۳۴ میلیارد دلار سرمایه نقد (Liquid) شده، اما از آنجایی که صرافی‌ها آمار نقد (Liquid) شدن‌ها را محدود منتشر می‌کنند، تخمین زده می‌شود که این عدد بالای ۴ میلیارد دلار است.

بازار کالاهای خام تداوم رشد شاخص بالتیک خشک در آستانه سال نو میلادی

بازار محصولات کشاورزی

قیمت محصولات کشاورزی در این هفته با کمی تأخیر دنبال رو مسیر هفته گذشته سایر کالاهای اساسی بود. در بیشتر این محصولات شاهد افت قیمت ۱ الی ۷ درصدی بودیم که با توجه به کاهش نرخ فیوچرز اوره، پیش بینی می شود این افت قیمت طی هفته های آتی نیز دنبال شود. گفتنی است شکر، که رکورد قیمت ۱۰ ساله خود را ۳ هفته پیش شکسته بود، اکنون از قله بیش از ۲۰ سنتی اش نزدیک ۲ سنت عقب نشسته و در میانه کانال ۱۸ سنتی معامله می شود.

بازار کالاهای صنعتی

افزایش محیرالعقول قیمت برق در اروپا بدنال کاهش ذخایز گازی و عدم افزایش صادرات روسیه به این کشورها علی رغم وعده های پوتین، موجب توقف تولید و تعطیلی موقت بسیاری از واحدهای تولیدی شد. افزایش بهای تمام شده فروآلیاژها، آلومینیوم و روی که برای تولید و پردازش شان برق زیادی مصرف می شود، منتج به عدم صرفه اقتصادی تولید این محصولات در اروپا شده و در کنار افزایش تورم در قاره سبز، بانک های مرکزی را به انجام اقدامی ضروری پیش از پایان سال میلادی واداشته است. پیش بینی می شود قیمت روی، آلومینیوم و فروآلیاژها افزایش محسوسی نسبت به قیمت های فعلی در ۳ ماهه اول سال ۲۰۲۲ داشته باشد.

روند کاهشی چند هفته ای قیمت زغال سنگ در چین، موجب افزایش قابل توجه حاشیه سود فولادسازان این کشور شده که بنابراین انتظار می رود منتهی به پایین تر رفتن کف قیمت فولاد در این کشور شود. همچنین آربیتراز قیمت سنگ آهن وارداتی و سنگ آهن داخلی این کشور بعلت کاهش تقاضای واردات بسیار پایین آمده که خود موجب کاهش بیش از پیش واردات از بنادر این کشور طی هفته آتی خواهد شد.

شاخص های کالایی

افزایش شاخص بالتیک خشک که در دو هفته اخیر روند ثابتی به خود گرفته را هم می توان نشانه افزایش تقاضای کالای جهانی در آستانه فصل تعطیلات سال نو میلادی دانست و هم زنگ خطری برای اوج گیری دوباره بحران زنجیره تأمین جهانی. باید دید که در هفته دوم ماه دسامبر، روند این شاخص چه حالتی به خود میگیرد.

محصولات کشاورزی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه
۱	ذرت	۵۸۵	سنت/بوشل	۲۳۰	دلار/تن	۴۰.۵۴%
۲	کتان (پنبه)	۱۰۳.۶۴	سنت/پوند	۲,۲۸۵	دلار/تن	-۷.۴۰%
۳	سویا	۱,۲۶۹.۵۰	سنت/بوشل	۴۶۶	دلار/تن	۲.۰۵%
۴	شکر	۱۸.۶۵	سنت/پوند	۴۱۱	دلار/تن	-۳.۸۷%
۵	گندم	۸۰۵	سنت/بوشل	۲۹۶	دلار/تن	-۴.۷۳%
۶	کانولا	۱۰۳۲.۹	دلار کانادا/تن	۸۱۶	دلار/تن	-۰.۵۸%

کالاهای صنعتی

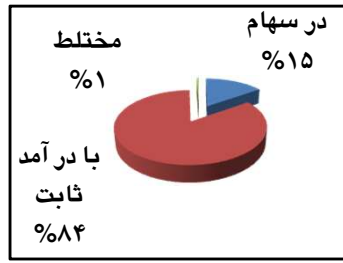
۷	مس	۹۴۱۷.۰	دلار/تن			۲۲.۹۶%
۸	قیر	۲,۷۶۰	یوان/تن	۴۴۱.۶۰	دلار/تن	-۷.۱۳%
۹	فولاد	۴,۳۰۱	یوان/تن	۶۸۸.۱۶	دلار/تن	-۱.۴۹%
۱۰	آلومینیوم	۲,۶۱۶	دلار/تن			۰.۹۳%
۱۱	سرب	۲,۱۹۷	دلار/تن			-۷.۶۷%
۱۲	روی	۳,۱۵۸	دلار/تن			-۴.۵۲%
۱۳	سنگ آهن	۹۹.۰۰	دلار/تن			۵.۸۸%
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۶۱۱	دلار/تن			۱.۸۰%
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بنادر ایران)	۵۶۵	دلار/تن			-۳.۴۲%

شاخص های کالایی

۱۶	بالتیک خشک	۳,۱۱۵	واحد			۱۶.۳۲%
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۲۳۵	واحد			-۷.۴۴%
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۴,۳۲۷	واحد			-۳.۳۵%
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس اند پی (S&P GSCI)	۲,۵۸۸	واحد			-۹.۷۸%

بررسی بازدهی صندوق های سرمایه گذاری

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی های نقدی (%)	میانگین بازدهی ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ماه ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ۶ ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
در سهام	۵۷۲,۸۸۷	۲۰,۱۲	۰,۵۱	-۲,۷۱	-۳,۵۵	۳۰,۱۵
با درآمد ثابت	۳,۲۱۸,۸۲۰	۸۲,۴	۰,۸۹	۲,۱	۵,۴۱	۱۸,۱۱
مختلط	۲۰۰,۰۶۶	۴۲,۰۴	۰,۶۹	۰,۱۳	۰,۹۷	۹,۰۹
جمع کل صندوقها	۴,۱۸۸,۰۰۶	۳۹,۷۴	۰,۹۶	-۰,۱	-۰,۶۸	۶,۱۶



صندوق های سرمایه گذاری
در این هفته بازدهی هفتگی همه صندوقها مثبت بود، همچنین سهم صندوق های سهامی و مختلط و درآمد ثابت نسبت به هفته گذشته تغییری نداشت.

منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخزا۸۲۰	۶۷۵,۷۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۱۰	۱۴۰۲-۰۸-۰۶	۲۲,۸۲%	۲۵,۱۷%
اخزا۸۱۰	۹۸۵,۱۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۱۰	۱۴۰۰-۱۰-۰۶	۲۳,۴۶%	۲۱,۲۳%
اخزا۰۰۲	۴۹۱,۲۹۰	۱۴۰۰-۰۹-۱۰	۱۴۰۳-۱۰-۲۴	۲۵,۵۸%	۳۳,۱۸%
میانگین بازدهی					۲۶,۰۱%

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 اخزا۸۲۰ و اخزا۸۱۰ با سررسیدهای ۱۴۰۲/۰۸/۰۶ و ۱۴۰۰/۱۰/۰۶ و بازدهی های ۲۲/۸۲ و ۲۱/۲۳ درصد بود.

همچنین بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخزا۰۰۲ با سررسید ۱۴۰۳/۱۰/۲۴ و بازدهی های ۲۵/۵۸ و ۳۳/۱۸ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۶/۰۱ و ۲۴/۱۵ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
اراد۳۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۰۷	۱۴۰۲-۱۱-۱۳	۱۵,۵۹%
اروند۱۱	۹۷۳,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۰۶	۱۴۰۰-۱۲-۲۲	۳۱,۷۶%

منبع: فرابورس ایران

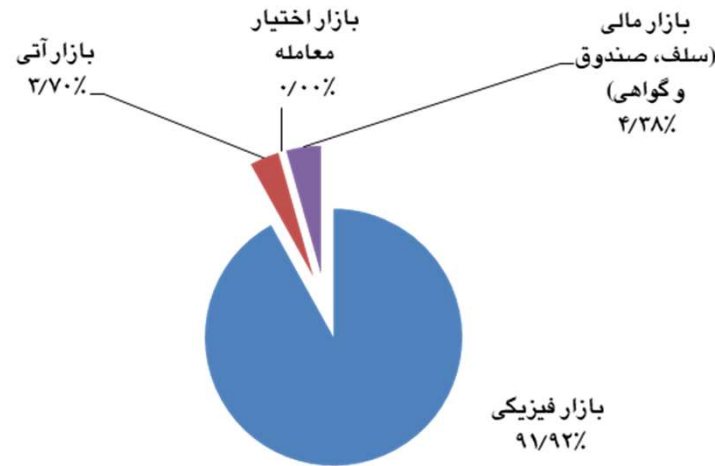
اوراق تأمین مالی
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد اراد۳۲ بمیزان ۱۵/۵۹ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۱۱/۱۳ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اروند۱۱ بمیزان ۳۱/۷۶ درصد با سررسید ۱۴۰۰/۱۲/۲۲ بوده است.

در این هفته ۹۵/۷ 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 ۳۴/۴۰ و همچنین حجم معاملات ۱۰/۳۸ درصد کاهش پیدا کرده است.

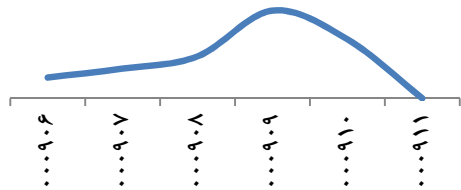
ارزش و حجم معاملات مهمترین گروه‌های کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	ارزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۶۴,۸۶۹,۳۴۷	۱,۴۹۵,۲۷۱	۵۱/۹%
پتروشیمی و نفتی	۵۴,۷۱۴,۳۷۱	۳۳۱,۷۷۴	۴۳/۸%
معدنی	۳,۰۸۹,۵۶۶	۳۰,۰۰۰	۲/۵%
بازار فرعی	۲,۳۴۵,۶۰۲	۱۱,۲۷۴	۱/۹%
جمع	۱۲۵,۰۱۸,۸۸۶	۱,۸۶۸,۳۱۹	۱۰۰%

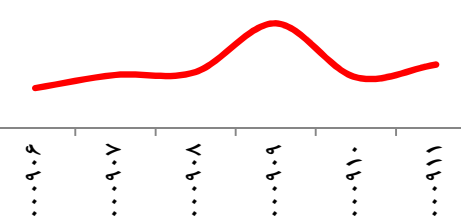
سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



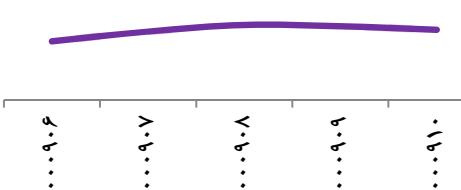
بازار فیزیکی



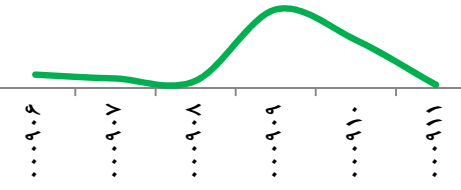
بازار آتی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)



بازار اختیار معامله



تحولات بازار فیزیکی و آتی و مالی و اختیار معامله بورس کالا در هفته اخیر، حاکی از روندی نوسانی و ثابت بود.

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

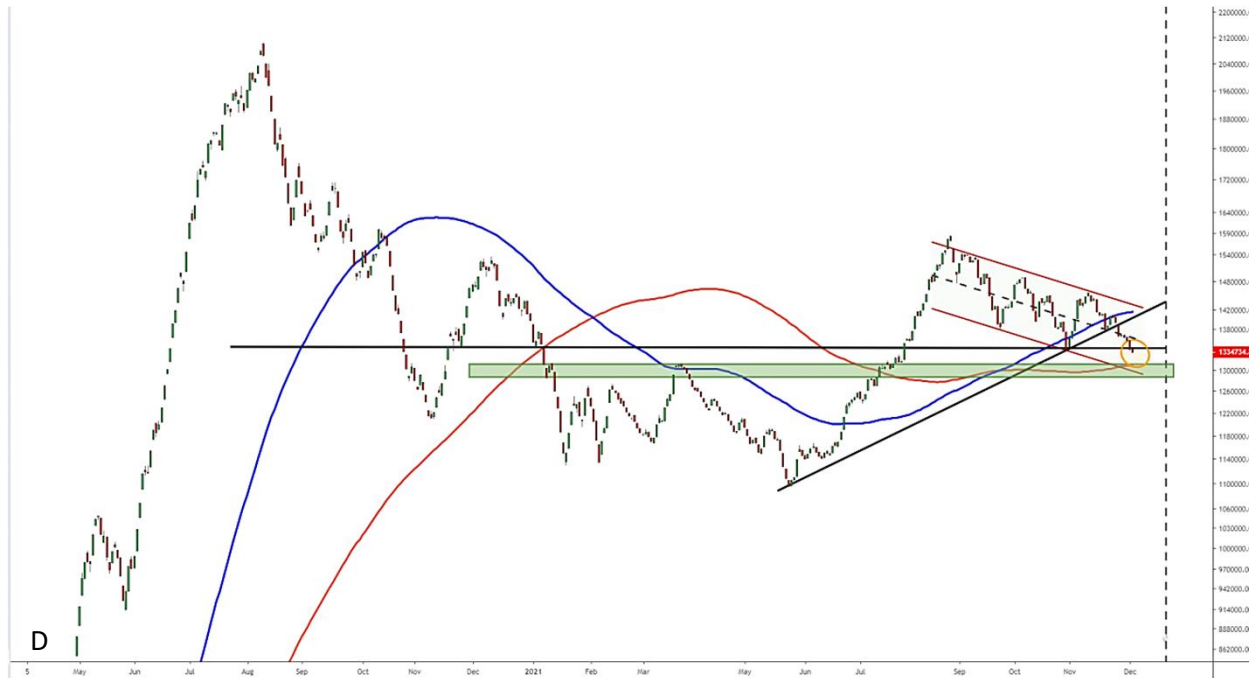
مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

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)
یک تن اوره گرانول	۱۷۲,۵۰۶,۰۰۰	۲۳۵,۴۱۵	۲۷۹,۲۴۷	۷۳۳	۶۱۸	۸۷۰	۸۴/۲%	۷۱/۰%
یک تن کاتد مس	۲,۳۰۷,۴۶۲,۰۰۰	۲۳۵,۴۱۵	۲۷۹,۲۴۷	۹,۸۰۲	۸,۲۶۳	۹,۴۱۷	۱۰۴/۱%	۸۷/۷%
یک تن پت شهید تندگویان	۳۲۲,۰۹۸,۱۱۲	۲۳۵,۴۱۵	۲۷۹,۲۴۷	۱,۳۶۸	۱,۱۵۲	۱,۰۶۰	۱۲۹/۱%	۱۰۸/۸%
یک تن بیلت فخوز	۱۳۰,۹۴۱,۰۰۰	۲۳۵,۴۱۵	۲۷۹,۲۴۷	۵۵۶	۴۶۹	۵۶۵	۹۸/۴%	۸۳/۰%
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۴,۳۵۵,۶۸۰	۲۳۵,۴۱۵	۲۷۹,۲۴۷	۱۹	۱۶	-	-	-

تحلیل تکنیکال بورس

از دست رفتن کف قبلی

شاخص کل



- امروز (شنبه ۱۳ آذر ۱۴۰۰) شاخص کل با افت ۵,۳۳۷ واحدی محدوده کف قبلی خود در آبان ماه را، که در حدود ۱,۳۴۰,۰۰۰ واحد بود، از دست داد و کار خود را در ۱,۳۳۴,۷۳۴ واحد به پایان رساند.
- شاخص کل مجدداً یک حمایت دیگر را از دست داد و فعلاً نشانه مثبتی از تغییر روند به چشم نمی‌خورد. در حال حاضر شاخص کل در حال حرکت به سمت محدوده کف کانال نزولی‌اش است.
- انتظار می‌رود محدوده ۱,۳۱۰,۰۰۰ الی ۱,۲۸۰,۰۰۰ واحد، نقش محدوده بازگشتی (PRZ) را برای شاخص کل بازی کرده و شاخص کل با رسیدن به این محدوده واکنشی مثبت نشان دهد. زیرا علی‌رغم اینکه شاخص کل در این محدوده به کف کانال نزولی خود خواهد رسید، در عین حال به میانگین متحرک ۲۰۰ روزه و یکی از مهمترین حمایت‌های استاتیک خود نیز می‌رسد.

❖ 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

شکست کانال صعودی

بیت کوین (BTCUSD)



- بیت کوین دقیقاً مطابق با تحلیل هفته گذشته اما کمی تندوتیزتر، بدلیل شایعه منتشر شده از سوی خزانه داری آمریکا، به روند نزولی خود ادامه داد.
- در تحلیل هفته گذشته ذکر شده بود که بیت کوین به حمایت کف کانال و میانگین متحرک ۱۰۰ روزه در محدوده ۵۳ الی ۵۴ هزار دلار واکنش مثبتی نشان خواهد داد و سپس طی چند کندل مثبت روزانه تا محدوده مقاومتی ۵۹ الی ۶۰ هزار دلار صعود خواهد کرد و در صورتیکه بر بالای این محدوده تثبیت نگردد، مجدداً وارد فاز نزولی شده و محدوده کف کانال صعودی را نیز خواهد شکست و تا حمایت استاتیک ۴۵ الی ۴۶ هزار دلار افت خواهد کرد.
- امروز (شنبه ۱۳ آذر ۱۴۰۰) شاهد بودیم که بیت کوین با ریزشی حدود ۲۰ درصد تنها در چند دقیقه کف کانال صعودی خود را شکست و تا محدوده ۴۲ هزار دلار نیز نزول کرد، سپس به سرعت به بالای محدوده ۴۵ هزار دلار رسید و سایه‌ای بلند را زیر کندل روزانه خود به ثبت رساند.
- با توجه به خروج قیمت از کانال صعودی، به نظر می‌رسد روند نزولی بیت کوین ادامه دار خواهد بود اما احتمال می‌رود قیمت بیت کوین طی هفته پیش رو بار دیگر تا محدوده حمایتی شکسته شده ۵۳ هزار دلار تحت عنوان پولبک صعودی یابد.

❖ 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 اونس طلا

شکست خط روند صعودی و ادامه روند نزولی

اونس طلا (XAUUSD)



- اونس جهانی طلا هفته گذشته با عبور از سطح ۱,۷۹۰ دلار حمایت داینامیک خط روند صعودی کوتاه مدت خود را شکست و به روند نزولی خود تا محدوده حمایتی ۱,۷۶۰ دلار ادامه داد و به این ترتیب سناریوی دوم در تحلیل هفته گذشته مبنی بر ادامه روند نزولی تحقق یافت.
- ریزش اخیر قیمت اونس جهانی طلا موجب عبور قیمت از هر دو میانگین متحرک ۱۰۰ و ۲۰۰ روزه خود شد و در پی آن میانگین متحرک ۱۰۰ روزه، میانگین متحرک ۲۰۰ روزه را رو به پایین شکست که این اتفاق به نوعی سیگنال فروش تلقی شده و تأییدی بر ادامه روند نزولی است.
- در حال حاضر قیمت طلا در حال تکمیل پولبک خود به محدود خط روند صعودی شکسته شده و دو میانگین متحرک ۱۰۰ و ۲۰۰ روزه در محدوده ۱,۷۹۰ تا ۱,۸۰۰ دلار است. پس از تکمیل پولبک، واکنش منفی و ثبت کندل نزولی به سمت زیر این محدوده اولین تأیید بر ادامه روند نزولی خواهد بود.
- اولین محدوده حمایتی مهم برای اونس جهانی طلا، محدوده ۱,۷۶۰ دلار و دومین محدوده حمایتی مهم، که از اعتبار بیشتری نیز برخوردار است، در حدود ۱,۷۲۰ دلار قرار دارد.

❖ 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

کماکان در فاز اصلاحی

شاخص دلار (DXY)



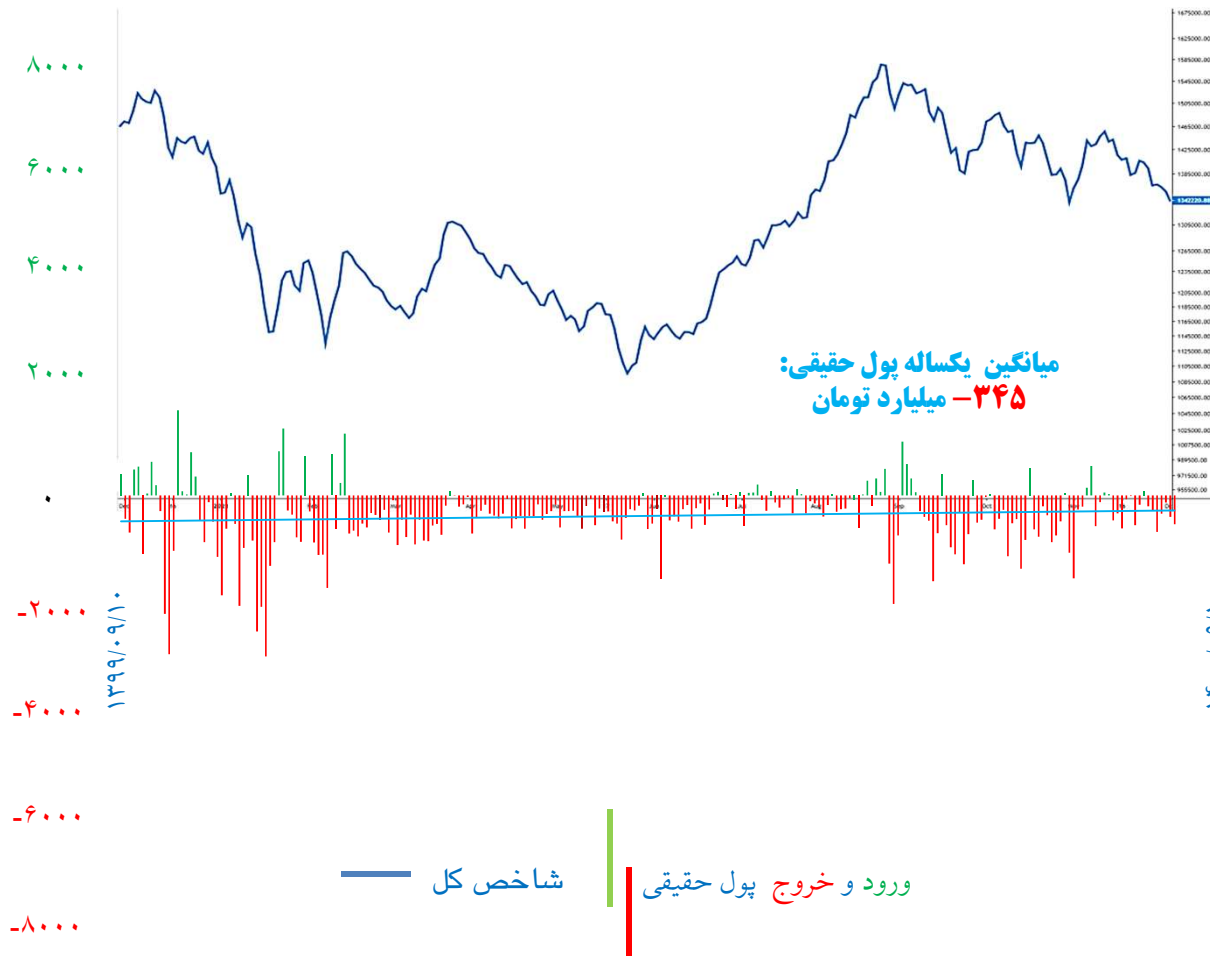
- شاخص دلار کماکان در فاز اصلاحی قرار دارد و هنوز اصلاح خود را به اتمام نرسانده است.
- پس از طی کردن موج صعودی بلندی که از محدوده ۸۹/۰۰۰ واحد تا ۹۷/۰۰۰ واحد به طول انجامید، شاخص دلار نیز به یک اصلاح متناسب با موج صعودی خود، هم از منظر قیمتی و هم از منظر زمانی، نیاز دارد تا بتواند نیروی لازم را جهت دستیابی به هدف قیمتی بعدی (TP2) بدست آورد.
- روند اصلاحی شاخص دلار می‌تواند تا محدوده حمایتی ۹۵/۰۰۰ الی ۹۴/۸۰۰ ادامه داشته باشد، که در این صورت حدود ۶۱/۸ درصد آخرین موج صعودی خود را اصلاح و به خط روند صعودی خود خواهد رسید.

❖ 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)



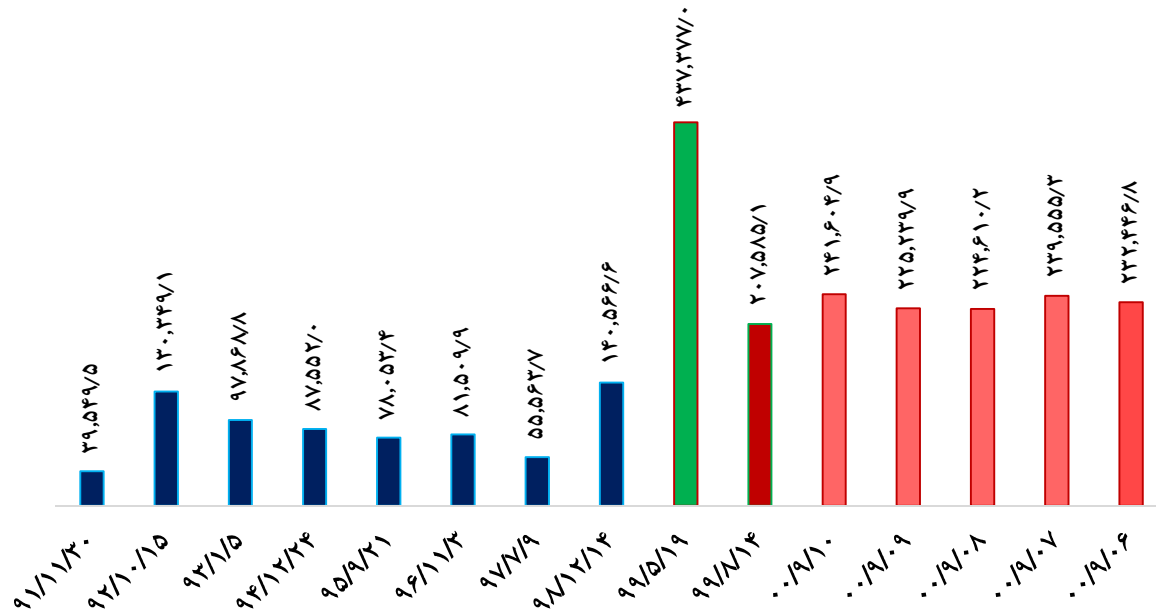
- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۳۴۰,۱۲۰ واحدی و بازده هفتگی ۳/۹- درصد بسته شد.
- برآیند هفتگی، حاکی از خروج ۱,۸۸۴ میلیارد تومان پول حقیقی از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۰، نشان‌دهنده خروج ۴۷,۷۷۶ میلیارد تومان از بازار است. یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۹۰ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.
- میانگین روزانه خالص پول حقیقی به کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹ تا چهارشنبه دهم آذر ۱۴۰۰ به ما ورود ۹ میلیارد تومان را نشان می‌دهد. همچنین طی این مدت خالص ورود/خروج پول حقیقی کل بازار، که در قله خود به عدد ۱۱۸,۲۴۲ میلیارد تومان رسیده بود، به عدد ۳,۹۸۰ میلیارد تومان افول کرده است.

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

شنبه	۱۴۰۰/۰۹/۰۶	: ۶۱۴- میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۰۹/۰۷	: ۳۰۸- میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۰۹/۰۸	: ۱۱۸- میلیارد تومان
سه‌شنبه	۱۴۰۰/۰۹/۰۹	: ۳۶۰- میلیارد تومان
چهارشنبه	۱۴۰۰/۰۹/۱۰	: ۴۸۵- میلیارد تومان

منبع: شرکت بورس (TSE.ir)

نمودار ارزش دلاری قله‌های شاخص کل طی سال‌های ۹۱-۱۴۰۰ (میلیون دلار)



طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۳۲ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله یکساله معادل ۴۶/۹ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی و بروزرسانی عدد GDP ایران، در سال ۲۰۲۰ GDP ایران معادل ۱۹۲ 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 ۲۷ نوامبر سال ۲۰۲۱ با توجه به ارزش ۵۱/۱ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۳/۷ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۲۱۶ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال)	P (ریال)	P/E (پیش‌بینی)	EPS (ریال)	سال مالی	P/NAV
شستا	۵.۷۳	۱,۸۹۵	۱۰,۸۵۰	۳.۴۳	۳,۱۶۳	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۹۳%
وبانک	۵.۱۶	۱,۵۵۱	۸,۰۱۰	۴.۶۵	۱,۷۲۴	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۹%
وصندوق	۶.۰۷	۲,۰۹۲	۱۳,۷۰۰	۳.۷۱	۳,۴۲۴	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۳%
وامید	۱۱.۲۰	۱,۱۸۰	۱۳,۲۲۰	۱۰.۵۸	۱,۲۵۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۹%
وغدیر	۱۱.۵۵	۱,۲۱۲	۱۴,۰۰۰	۶.۴۷	۲,۱۶۵	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۸۳%
ونیکي	۶.۰۷	۱,۶۵۳	۱۰,۰۴۰	-	-	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۵۸%

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 بر عهده 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