



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

اتمام موج صعودی؟ اثر تغییر رییس کل بانک مرکزی بر بازار سرمایه!

در ساعات پایانی روز پنجشنبه ۸ دی ۱۴۰۱، زمانی که کلیه بازارها در کشور تعطیل شده بود، خبر تغییر ریاست کل بانک مرکزی منتشر شد. بر این اساس، گفته شد علی صالح‌آبادی استعفاء خود را تقدیم رئیس‌جمهور کرده و هیأت دولت نیز نیز سریعاً رأی به تحویل سکان بانک مرکزی به محمدرضا فرزین، عضو هیأت علمی گروه مالی و بانکداری دانشکده مدیریت و حسابداری دانشگاه علامه طباطبائی، داده است. محمدرضا فرزین، که در دولت محمود احمدی‌نژاد دبیر ستاد هدفمندسازی یارانه‌ها بود، در دولت سیدابراهیم رئیسی بعنوان رئیس بانک ملی منصوب شد. او در نخستین اظهارنظر خود بعنوان رئیس کل بانک مرکزی خبر از ثابت نگه داشتن ارز نیمایی در نرخ ۲۸۵,۰۰۰ ریال برای یک سال آتی داد و همین خبر تیر خلاصی بود که بر پیکره بورس وارد شد و هیجانات هفته گذشته را که با افزایش نرخ ارز و در راستای خرید انواع سهام شرکت‌های صادرات‌محور با درآمد ارزی در بورس شکل گرفته بود، تخلیه کرد! این امر باعث شد شاخص کل بورس تهران، که طی هفته گذشته با ورود پولی بمیزان ۱,۶۲۹ میلیارد تومان مسیر صعودی را طی کرده و تنها در پایان معاملات روز چهارشنبه ۷ دی ۱۴۰۱ با رشد بالغ بر ۷۰,۹۱۸ واحدی در یک روز به عدد ۱,۶۴۷,۳۱۵/۵ واحد رسیده بود، با یک عقب‌نشینی محسوس، در پایان معاملات روز شنبه ۱۰ دی ۱۴۰۱ سقوطی ۵۶,۸۱۹/۱۸ واحدی را تجربه کرده و بخش زیادی از رشد روز معاملاتی قبل خود را پس بگیرد.

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۳۶ - هفته منتهی به ۱۰ دی ۱۴۰۱

گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.ir

eii.co.ir

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی: تجدید بیعت دو یار قدیمی - در واپسین روزهای سال ۲۰۲۲ میلادی، روسیه و چین در مورد همکاری‌های سیاسی آتی با یکدیگر به تفاهم رسیدند؛
- تصویر اقتصاد کلان - بازدهی هفتگی شگفت‌انگیز سکه طلای داخلی؛
- بورس و انرژی: پیش‌بینی سال نزولی برای بازارهای سهام جهان؛
- فلزات گرانبها و ارز: دلار ۴۴۰ هزار ریالی، سکه‌ی ۲۳۰ میلیون ریالی؛
- بازار کالاهای خام: رکورد شکنی روسیه در تولید غلات؛
- بررسی وضعیت صندوق‌ها؛
- بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - عدم تثبیت بر بالای مقاومت ۱.۶۰۰.۰۰۰ واحد؛
- 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

تجدید بیعت دو یار قدیمی

در واپسین روزهای سال ۲۰۲۲ میلادی، روسیه و چین در مورد همکاری‌های سیاسی آتی با یکدیگر به تفاهم رسیدند!

اشاره

برنامه‌های مفصل ترکیه برای خروج از بحران پولی حادث در این کشور، که به ظاهر تفاوت چندانی با برنامه‌های سال گذشته دولت اردوغان ندارد، که موجب به ورطه بحران کشیده شدن بیشتر ترکیه شده بود، اعلام شد.

روسیه و چین در مورد همکاری‌های سیاسی آتی با یکدیگر تجدید بیعت کردند. پیش‌بینی ۲۰ درصد سقوط بازارهای مالی کشورهای غربی در سال ۲۰۲۳. سختگیری اروپاییان به مسافرانی که به مناسبت سال نوی میلادی از کشور چین به این قاره سفر می‌کنند، از ترس همه‌گیری دوباره کرونا در این قاره و جهش دوباره این بیماری به گونه‌ای جدید، اعمال شد. کاهش ۳۰ تریلیون دلاری ارزش بازارهای مالی دنیا در سال ۲۰۲۳ رخ داد. افزایش نرخ بهره در تمام جهان و پایان دوران وام‌های ارزان به وقوع پیوست. برنامه‌های گسترده چین برای بیابان‌زدایی خبر مهم دیگر بود و در نهایت بحران بخش استارت‌آپ‌های هند، بلای جان نیروی کار جوان این کشور شد.

بloomberg
Bloomberg

بیزینس اینسایدر
BUSINESS
INSIDER

فایننشال تایمز



- بانک مرکزی ترکیه اعلام کرد بزرگترین هدفش در سال ۲۰۲۳ جایگزینی دخایش از دلار به لیر خواهد بود!
- شرط فرانسه برای ورود مسافران چینی به خاک این کشور تست کرونا منفی اعلام شد.
- احتمال جهش جدید در ویروس کرونا دلیل اصلی سختگیری‌ها و قوانین جدید برای مسافران چینی است.
- در میانه دست‌وپازدن روسیه در باتلاق اوکراین، پوتین و شی جین‌پینگ در حال تجدید روابط دو کشور و قوت بخشیدن به آنها هستند.
- ایالات متحده توان پایان بخشیدن به بحران مسکن خود را با ساخت خانه‌های بیشتر خواهد داشت.
- آمریکا الحاقیه جدیدی به بسته کمک‌هایش به اوکراین را تصویب کرد.
- انتظار می‌رود نفت در سال آتی ضمن نوسانات متعدد افزایش قیمت اندکی تا پایان سال داشته باشد.
- سرمایه‌گذاری مردم روسیه در بانک‌های خارجی و روند خروج پول از این کشور در سه ماهه پایان سال افزایش شدید داشته است.
- ترکیه قصد دارد ۱۳ میلیارد دلار برای تأمین هزینه بازنشستگی زودهنگام بخشی از نیروی کارش اختصاص دهد.
- تونس برای مهار تورم نرخ بهره را دوباره افزایش می‌دهد.
- شرکت دارویی هانت که بدنبال ساخت واکسن سرطان است، گزارش از پیشرفت پروسه ساخت این محصول داد.
- پوتین ضمن تبریک تشکیل دولت و کابینه اسرائیل توسط ناتانیاو، برای قدرت گرفتن روابط بین روسیه و اسرائیل در این دولت ابراز امیدواری و آمادگی کرد.
- ترکیه اعلام کرد میزان ذخایر گاز طبیعی این کشور در دریای سیاه بسیار بیشتر از پیش‌بینی‌های قبلی است.
- طبق نظرسنجی‌ها میل برای دورکاری در سال ۲۰۲۳ بیشتر شده است.
- ۳۷۲ میلیون دلار از دارایی‌های صرافی FTX پس از اعلان ورشکستگی ناپدید شده و پلیس بدنبال یافتن آن است.
- چین پروژه عظیم بیابان‌زدایی ۱۱ میلیارد دلاری را در سال ۲۰۲۳ شروع می‌کند.
- بازارهای سهام برزیل بهترین عملکرد را بین سایر کشورهای جهان در سال ۲۰۲۲ داشتند.
- وزیر بهداشت ایتالیا گفت هنوز گونه جدیدی از ویروس کرونا در این کشور مشاهده نشده است.
- قراردادهای معاملات آتی بازارهای سهام آمریکا با عبور از عدد ۱۰ میلیارد عدد در سال ۲۰۲۲ رکوردشکنی کردند.
- کورواسی همچنان بدنبال پیوستن به اتحادیه اروپا برای تأمین آینده خود است.

- طبق اسناد منتشرشده، دونالد ترامپ به اداره مالیات آمریکا اعلام کرده که طی سال‌های ریاست جمهوری‌اش چند ده میلیون دلار از ثروتش را از دست داده است.
- اداره اطلاعات دانمارک اعلام کرد پوتین طی ۱۵ ماه گذشته برای مقابله با سرطان داروهایی مصرف می‌کرده که روند تصمیم‌گیری او در مورد مسائل اوکراین را شدیداً تحت تأثیر قرار داده و این پروسه‌ها را پیچیده کرده است.
- مردم سرتاسر آمریکا با سرعت روزافزونی در جست‌وجوی آب‌وهوای خوب و مالیات کمتر، در حال کوچ به فلوریدا هستند.
- پاندمی کرونا موجب مرگ خرده‌فروشی حضوری و مغازه‌ها نشد، ولی این صنعت هیچ‌وقت به وضع قبلی خود باز نخواهد گشت.
- بازار سهام آمریکا با سقوط در روز آخر معاملاتی سال ۲۰۲۲ بدترین بازدهی خود از سال ۲۰۰۸ را رقم زدند.
- گول‌های بازار سهام آمریکا از مورگان استتلی تا BOA انتظار افت ۲۰ درصدی بازار سهام این کشور در سال جاری را دارند.

- بازارهای سهام و اوراق بهادار دنیا در سال سخت ۲۰۲۲ بیش از ۳۰ تریلیون دلار از ارزش خود را از دست دادند.
- نبرد بانک‌های مرکزی جهان با تورم و بحران اوکراین باعث نوسانات شدید در اقتصاد جهانی شده است.
- پایان یک عصر: افزایش بهره بانکی میخ تابوت بیش از یک دهه «پول ارزان» در غرب بود.
- انتشار عمومی اطلاعات مالیاتی ترامپ دودستگی تحلیل‌گران در مورد راهیابی او به انتخابات آتی ریاست جمهوری آمریکا را باعث شده است.
- با افزایش اختلاف نظر کشورهای اروپایی در مورد قوانین پذیرش مسافران بین‌المللی، اسپانیا پروسه‌های کنترلی سختی برای مسافران از مبدأ کشور چین وضع و اجرا می‌کند.
- امسال، یکی از بدترین سال‌های عملکردی شرکت‌های مدیریت سرمایه و سبدگردان در قرن ۲۱ بود.
- رئیس پارلمان اروپا گفت یارانه‌های دولتی در راستای حمایت از محیط زیست وضع شده از سوی بایدن، ممکن است آثار مخرب بلندمدت در تجارت خارجی بگذارد.
- رویای آینده روشن شرکت‌های استارت‌آپی هندوستان، با اخراج گسترده کارکنان این مجموعه‌ها به کام‌شان تلخ شد.
- تقابل جنگنده چینی و هواپیمای گشت‌زنی آمریکایی، که با مانورهای خطرناک طرف چینی صورت گرفته، موجب اظهارنظر تند پنتاگون شد.
- بانک ژاپن برای سومین روز متوالی بدون اعلان و برنامه قبلی اقدام به خرید اوراق بدهی کرد.
- کاهش بیشتر از حد انتظار نرخ تورم اسپانیا، آن را به ۵/۸ درصد رساند!
- سقوط تند تعداد قراردادهای تجاری جدید در جهان، رونق دوران پساکرونا را به پایان رساند.



مرکز پژوهش‌های اقتصادی ایران
(مجموعه‌های تخصصی)

تصویر اقتصاد کلان

بازدهی هفتگی شگفت‌انگیز سکه طلای داخلی!

مقایسه بازدهی بازارها

بازار	هفتگی	ماه‌یانه	۱۴۰۱	یکساله
دلار (ریالی)	٪۶،۶۰	٪۱۸،۴۰	٪۶۳،۲۳	٪۴۴،۰۱
سکه (ریالی)	٪۱۹،۴۷	٪۳۰،۸۷	٪۸۳،۴۱	٪۷۴،۰۹
بورس (شاخص)	٪۹،۷۷	٪۱۶،۹۷	٪۱۸،۴۴	٪۱۷،۶۷
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	٪۲،۰۷-	٪۷،۰۴-	٪۵۷،۲۰-	٪۶۳،۹۹-
مسکن (ریالی - تهران)	-	۶/۸٪	-	۴۵/۹٪

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 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	بازه زمانی
-	-	-	-	٪۴/۷	-	٪۶/۱	۱۲،۲۶۳	۹۶،۱۰۰،۰۹۱	مقدار شاخص
				٪۷/۴	-	٪۳/۲	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
آمریکا									
۲۲-دسامبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-نوامبر	۲۲-نوامبر	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۴/۵	٪۳/۲	٪۷/۱	٪۳/۷	٪۴/۷	٪۵/۴	٪۵/۷	۶۹،۲۸۷	۲۲،۹۹۶،۱۰۰	مقدار شاخص
				٪۸/۱	٪۳/۵	٪۱/۶	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
چین									
۲۲-دسامبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-نوامبر	۲۲-نوامبر	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۳/۶۵	٪۳/۹	٪۱/۶	٪۵/۷	٪۰/۹	٪۴/۲	٪۸/۱	۱۲،۵۵۶	۱۷،۷۳۴،۰۶۳	مقدار شاخص
				٪۲/۲	٪۳/۷	٪۳/۲	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
منطقه									
۲۲-دسامبر	۲۲-سپتامبر	۲۲-نوامبر	۲۲-اکتبر	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۲/۵	٪۰/۳	٪۱۰/۱	٪۶/۵	٪۲/۶	٪۷/۷	٪۵/۳	۴۲،۳۰۸	۱۴،۴۹۳،۲۱۲	مقدار شاخص
				٪۸/۳	٪۶/۸	٪۳/۱	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
ایران									
۲۲-می	تابستان ۱۴۰۱	آذر ۱۴۰۱	تابستان ۱۴۰۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۱۴۰۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
٪۱۸	٪۲/۵	٪۴۸/۵	٪۸/۹	٪۴۰/۱	٪۹/۲	٪۴/۳	۲،۷۵۶/۷	۲۳۱،۵۴۷/۵۷	مقدار شاخص
				٪۴۰	٪۹/۴	٪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

بورس‌های جهانی

با رسیدن به پایان سال، شاهد انتشار آمار و ارقام مختلف بازدهی بازارها و شرکت‌ها طی هفته اخیر بودیم، که به طور خلاصه در جدول حاضر هم قابل مشاهده است! ۲۰۲۲ بدترین سال قرن اخیر برای شرکت‌های مدیریت سرمایه و بدترین سال بازارهای مالی از زمان سال ۲۰۰۸ و بحران اقتصادی بزرگ این سال است، که این دو مطلب خود گویای فضاقت وقایع حادث شده در تمامی بازارها، از سهام تا رمزارز و اوراق بدهی، هستند. جنگ اوکراین، تلاش کشورها برای مدیریت تورم و رسیدن بازارها به روند رکودی، که منجر به سنگین‌تر شدن مداوم سایه این پدیده بر اقتصاد جهان شد، از زمره عوامل اصلی ناکامی فعالیت بازارهای مالی در سال ۲۰۲۲، علی‌الخصوص طی ماه‌های اخیر، بود. با وجود این عملکرد رضایت‌بخش شرکت‌های نفتی و پتروشیمی در سال ۲۰۲۲، چه در اروپا و چه آمریکا، مسأله شایان‌توجهی بود، که در حال حاضر این روند سوددهی ادامه دارد. پیش‌بینی شرکت‌های بزرگ حوزه مدیریت سرمایه جهان نیز حاکی از سقوط ۲۰ درصدی بازارهای سهام در سال ۲۰۲۳ است.

نفت، گاز و محصولات پتروشیمی

قیمت گاز طبیعی اروپا در هفته گذشته یک سقوط تقریباً ۴۰ درصدی داشته و به محدوده قبل از جنگ اوکراین نزدیک شد. فشار بر قیمت گاز با توجه به توسعه واردات LNG و صرفه‌جویی گاز طبیعی از سوی مصرف‌کنندگان اروپایی رخ داده است. بازار انرژی و محصولات پتروشیمی، که پیش‌بینی می‌شد این هفته با فورارسیدن تعطیلات سال نوی میلادی رفتار آرام‌تری داشته باشند، بدلیل هیجان‌ناشی از آخرین معاملات پیش از سال نو و تلاش روسیه برای فشار به اروپا با حمله به زیرساخت‌های اوکراین، پرنوسان‌تر از پیش‌بینی‌ها رفتار کردند. تمهیدات روسیه برای فشار به بازار انرژی به دلایل فوق درمورد گاز کارگر نیافتاد، اما شاهد افزایش قیمت نفت برای چهارمین هفته متوالی بودیم. نرخ گاز طبیعی آمریکا با تداوم تعطیلی ترمینال صادراتی LNG فریپورت این کشور و پایان هجوم سرمایه قطبی به این قاره و گرم‌تر شدن هوا، همچنان نزولی است و قیمت‌ها با سقوط حدوداً ۱۱ درصدی، این هفته به محدوده ۱۵ سنت بر مترمکعب رسیدند، که کمترین میزان طی ۱۱ ماه اخیر است. همچنین با پایان یافتن وضعیت نامناسب آب‌وهوایی در ایالات متحده و برقراری دوباره پروازها، تقاضا برای سوخت جت در این کشور بالا رفت، که هم‌زمان با افزایش پروازهای سال نو در سایر نقاط جهان، بالاخص ۱۰ برابر شدن پروازهای خارجی کشور چین، بوده که از دیگر محرک‌های قیمت سوخت و نفت است.



ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
۱	Dow Jones	۳۳,۱۸۴	واحد	-۰,۰۳%	-۳,۹۷%	-۸,۹۶%
۲	Nasdaq	۱۰,۹۴۰	واحد	-۰,۴۲%	-۹,۰۶%	-۳۳,۴۱%
۳	S&P ۵۰۰	۳,۸۳۵	واحد	-۰,۱۸%	-۵,۸۸%	-۱۹,۹۰%
۴	FTSE ۱۰۰	۷,۴۴۹	واحد	-۰,۹۰%	-۲,۰۴%	-۰,۴۲%
۵	DAX	۱۳,۹۲۴	واحد	-۱,۱۲%	-۳,۲۹%	-۱۲,۳۵%
۶	CAC ۴۰	۶,۴۷۴	واحد	-۰,۴۸%	-۳,۹۳%	-۹,۷۵%
۷	NIKKEI ۲۲۵	۲۹,۰۹۵	واحد	-۰,۵۴%	-۶,۷۰%	-۹,۳۷%
۸	SHANGHAI	۳,۰۸۹	واحد	۱,۳۹%	-۱,۹۷%	-۱۴,۶۴%
۹	Moex	۲,۱۵۴	واحد	۱,۴۲%	-۱,۵۲%	-۴۴,۰۹%

نفت و انرژی

۱۰	نفت خام برنت	۸۶,۱۷۵	دلار/بشکه	۱,۹۸%	-۰,۷۳%	۱۱,۴۱%
۱۱	نفت خام WTI	۸۰,۵۵۸۶	دلار/بشکه	۱,۲۹%	-۰,۶۸%	۷,۶۲%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۴,۴۳۶	دلار / MMBtu	-۱۰,۹۱%	-۳۳,۰۹%	۱۸,۹۵%
۱۳	سبید اوپک	۸۱,۱۴	دلار/بشکه	-۴,۰۱%	-۳,۲۸%	۸,۵۲%
۱۴	نفت سنگین ایران	۷۸,۵۲	دلار/بشکه	۰,۷۶%	-۶,۴۱%	۷,۱۷%
۱۵	گازوئیل	۹۲۷	دلار/تن	۱,۲۶%	-۰,۳۸%	۴۳,۴۲%
۱۶	اتانول	۲,۳۳	دلار/گالن	۶,۶۴%	-۹,۶۴%	-۲۲,۳۳%
۱۷	نفتا	۶۴۸	دلار/تن	۹,۶۶%	۰,۶۳%	-۷,۱۱%
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۳۴۰	یوان/تن	-۳,۹۷%	-۱۵,۶۵%	-۱۳,۸۲%
۱۹	متانول CFR	۰	دلار/تن	۰,۰۰%	-۵,۲۶%	-۸,۵۵%
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۴۶۶	دلار/تن	۰,۰۰%	-۵,۰۲%	-۴۴,۹۱%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۰	دلار/تن	۰,۰۰%	۰,۰۰%	-۲۵,۲۶%

فلزات گرانبها و ارز

دلار ۴۴۰ هزار ریالی، سکه‌ی ۲۳۰ میلیون ریالی

بازار فلزات گرانبها

طی هفته‌ی اخیر، با توجه به افت ۰.۸۲ درصدی شاخص دلار و نزدیک شدن به تعطیلات آغاز سال جدید میلادی، اونس جهانی طلا رشد کرده و با بازدهی ۱.۴۱ درصد و با رسیدن به عدد ۱۸۲۲ دلار، سال ۲۰۲۲ را به پایان رساند. طی یکسال اخیر این فلز زرد رنگ در بالاترین مقدار به عدد ۲۰۷۰ دلار (۸ مارس ۲۰۲۲) رسید و عدد ۱۶۱۴ دلار (۲۸ سپتامبر ۲۰۲۲) نیز کمترین نرخ بود که اونس جهانی طلا به خود دید. شایان ذکر است که یکی از تاثیرگذارترین عوامل بر روی طلا در طی سال ۲۰۲۲، افزایش نرخ بهره آمریکا بود که از ۰.۲۵ درصد در ابتدای سال به عدد ۴.۵ درصد در انتهای دسامبر رسید.

سکه و ارز (داخلی)

در ادامه‌ی روند رو به رشد بازار ارز و طلای داخلی، هفته گذشته نیز شاهد افزایش نرخها در این دو بازار بودیم به طوری که دلار آمریکا با عدد ۴۴ هزار تومان و سکه امامی با عدد ۲۳ میلیون تومان به بالاترین نرخهای تاریخ خود دست یافتند. با بررسی بازدهی شش ماهه‌ی بازار طلا مشاهده می‌شود که ربع سکه با ۶۶ درصد، نیم سکه با ۳۶ درصد و سکه امامی با ۲۹ درصد بهترین عملکرد را به نام خود ثبت کردند.

رمزارز

طی هفته اخیر، ارزش کل بازار کریپتو با افت ۱۴ میلیاردی نسبت به هفته گذشته، به عدد ۷۹۶ میلیارد دلار رسید. سال ۲۰۲۲، سال خوبی برای بیت کوین و بازار کریپتو نبود. اما بازار رمزارز بارها در این موقعیت قرار داشته است. به گزارش BeinCrypto، در عمر ۱۲ ساله بیت کوین، چهار چرخه را شاهد بوده‌ایم. هر بار و طی هر دوره نزولی، این ارز و حوزه بازار کریپتو توسط رسانه‌ها مورد انگاشته می‌شوند. طبق اطلاعات سایت ۹۹ Bitcoins، بیت کوین تاکنون ۴۶۷ بار مرده خوانده شده است. نخستین «مرگ بیت کوین» در دسامبر ۲۰۱۰ و آخرین آن در ۳۰ نوامبر ۲۰۲۲ به ثبت رسید. سالی که بیشترین میزان نوسان و مرگ را به خود دید، سال ۲۰۱۷ بود. در این سال رسانه‌ها ۱۲۴ بار مرگ بیت کوین را اعلام کردند. صندوق Grayscale، چند سقوط بزرگی که بیت کوین از آن سر بلند بیرون آمده است را اینگونه لیست کرد: نخستین سقوط بزرگ قیمت بیت کوین در سال ۲۰۱۱ رخ داد؛ در این سال قیمت بیت کوین ۹۹ درصد ریخت. هک صرافی گاکس سبب شد تا قیمت BTC از ۳۲ دلار به ۱ سنت کاهش یابد. در سال ۲۰۱۳، تنها یک روز پس از ممنوعیت پرداخت به وسیله بیت کوین توسط دولت چین، قیمت این دارایی با ۸۰ درصد کاهش روبرو شد. در فوریه ۲۰۱۴، بار دیگر صرافی گاکس هک شد و سبب سقوط ۶۰ درصدی قیمت شد. در آن زمان، ۸۰ درصد از حجم مبادلات بیت کوین در این صرافی صورت می‌گرفت. هک DAO در میانه سال ۲۰۱۵، هر دو ارز اتریوم و بیت کوین را تحت تاثیر قرار داد. افزون بر این، صرافی بیتفینکس نیز در سال ۲۰۱۶ مورد حمله قرار گرفت که باعث افت قیمت شد. برخورد شدید قانونگذاران با موج عرضه اولیه از طریق کوین (ICO) در سال ۲۰۱۸، سبب کاهش ۸۴ درصدی قیمت در انتهای سال شد. قیمت بیت که در آن سال به ۲۰۰،۰۰۰ دلار رسیده بود، تنها در عرض چند ماه به ۳۲۰۰ دلار رسید. در مارس ۲۰۲۰، پس از شروع پاندمی کرونا، بازار جهانی تحت تاثیر قرار گرفت. بیت کوین نیز از این قاعده مستثنی نبود و نیمی از ارزش خود را از دست داد. بیت کوین در سالی که گذشت نیز دستخوش اتفاقات ناگوار شد؛ در دو برهه و در پی سقوط لونا و صرافی FTX، قیمت این ارز به ترتیب ۵۰ و ۲۵ درصد کاهش یافت.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۸۲۲	دلار/اونس	۱,۴۱٪	۲,۹۹٪	-۰,۲۵٪	TeleTrader
۲	نقره	۲۳,۹۲	دلار/اونس	۰,۸۰٪	۷,۷۵٪	۲,۷۹٪	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۸ دی							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۹,۱۵۳,۰۰۰	ریال	۶,۴۰٪	۲۵,۳۸٪	۴۸,۷۳٪	tgju/org
۴	سکه امامی	۲۲۶,۹۵۰,۰۰۰	ریال	۱۹,۴۷٪	۳۳,۸۱٪	۷۳,۷۵٪	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۸ دی							
۵	دلار آزاد	۴۱۶,۱۵۰	ریال	۶,۵۷٪	۱۷,۳۹٪	۵۱,۷۰٪	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۹۱,۳۴۸	ریال	۱,۹۸٪	۵,۰۹٪	۱۹,۴۰٪	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۹۳,۹۹۴	ریال	۱,۹۸٪	۵,۰۹٪	۱۹,۴۰٪	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۴۵۹,۲۹۰	ریال	۹,۴۲٪	۲۴,۲۰٪	۳۶,۳۶٪	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۳۰۹,۴۰۹	ریال	۲,۱۸٪	۷,۴۶٪	۱۲,۰۹٪	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۳۱۲,۲۱۹	ریال	۲,۱۸٪	۷,۴۶٪	۱۲,۰۹٪	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۸۲,۸۲۳	ریال	۱,۱۹٪	۵,۵۹٪	۱۲,۷۳٪	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۹,۳۳۲	ریال	۱,۹۸٪	۵,۰۹٪	۱۹,۴۰٪	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۸۰,۰۵۳	ریال	۱,۹۸٪	۵,۰۹٪	۱۹,۴۰٪	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت کوین	۱۶,۵۶۳	دلار	-۱,۷۸٪	-۳,۵۹٪	-۶۴,۱۶٪	Tradingview
۱۵	اتریوم	۱,۱۹۵	دلار	-۲,۱۴٪	-۷,۷۰٪	-۶۷,۴۹٪	Tradingview

بازار کالاهای خام

رکورد شکنی روسیه در تولید غلات!

بازار محصولات کشاورزی

تحلیلگران و کارشناسان بین‌المللی بر این باورند که اگر اختلالات ایجاد شده بر اثر طوفان در مسیر دریای سیاه محدود شود، صادرات گندم روسیه در ماه دسامبر رکورد شکنی خواهد کرد.

پیش‌بینی می‌شود روسیه امسال بیش از ۱۵۰ میلیون تن انواع غلات تولید کند که یک رکورد جدید به شمار می‌رود که ۱۰۰ میلیون آن گندم خواهد بود.

بازار کالاهای صنعتی

در طی هفته گذشته با توجه به نزدیک شدن به تعطیلات سال نوی میلادی برخی کالاها در بازار کالای صنعتی نوسان بسیار اندکی را تجربه کردند اما سنگ آهن بر خلاف سایر کالاها صنعتی نوسان مثبت قابل توجهی را به ثبت رساند. در حالی که افزایش تعداد مبتلایان کرونا در چین، واهمه تشدید سیاست‌های کنترلی از سوی دولت این کشور را مطرح کرده بود، کمیسیون ملی بهداشت چین از کاهش بیشتر محدودیت‌های عملی به منظور جلوگیری از شیوع بیماری خبر داده است و تصمیم اخیر دولت چین، سیگنال مثبت موثری برای بازار آهن و فولاد به همراه داشت.

تقاضای چین برای مس در نیمه دوم سال جاری از عرضه آن بیشتر بود. این در کاهش موجودی در انبارهای شانگهای منعکس شد و موجودی SHFE از پایان ژوئن ۲۰۲۲ تا ۴۷.۴۸۶ تن کاهش یافت. از سوی دیگر شرکت گنلکور یکی از بزرگترین شرکت‌های معدنی دنیا به تازگی پیش‌بینی را در خصوص کاهش ۵۰ میلیون تنی عرضه مس در سال ۲۰۲۳ منتشر کرده که در صورت تحقق می‌تواند قیمت مس را در بلند مدت تحت تاثیر قرار دهد.

شاخص‌های کالایی

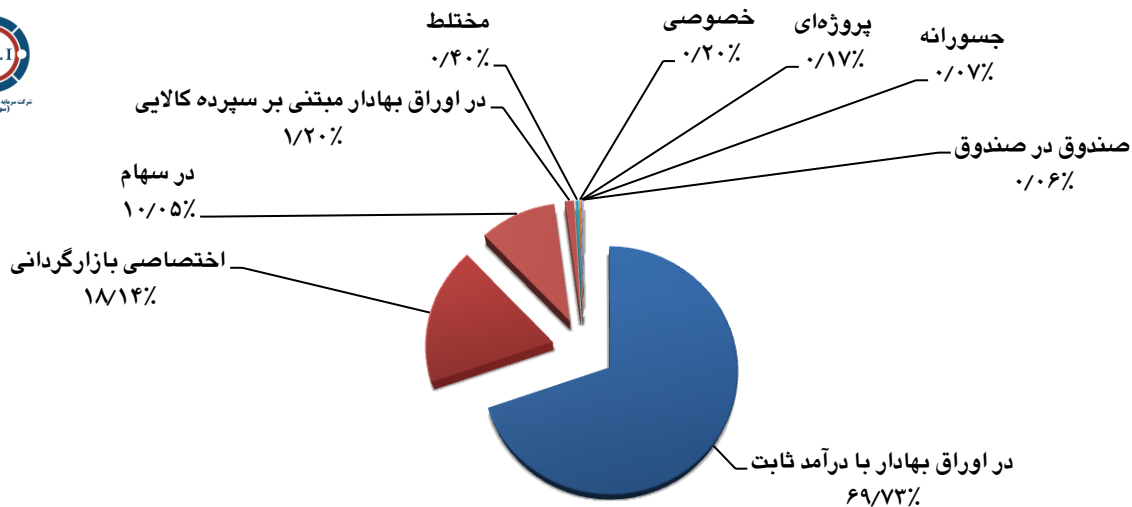
برای تحلیل نوسانات شاخص بالتیک به بررسی عوامل موثر بر آن، یعنی شاخص شناورهای Capesize، Panamax و Supramax می‌پردازیم. طی هفته‌ی گذشته، شاخص Capesize که محموله‌های سنگ آهن و زغال سنگ ۱۵۰۰۰۰ تن را دنبال می‌کند، با ۱۳.۹ درصد کاهش به ۲۲۶۱ واحد رسید. و شاخص Panamax که حدود ۶۰ تا ۷۰ هزارتن محموله زغال سنگ و غلات را دنبال می‌کند، ۱.۸ واحد کاهش یافت و به ۱۵۳۵ واحد رسید. همچنین شاخص حمل و نقل با شناورهای کوچکتر Supramax با افت ۲۱ واحدی به ۱۰۳۲ واحد رسید. و در نتیجه شاخص بالتیک به دلیل کاهش تقاضا برای کشتی‌ها، در هفته گذشته ۲.۸۸ درصد کاهش یافت و به ۱۵۱۵ واحد رسید.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه
محصولات کشاورزی						
۱	ذرت	۶۷۸	سنت /بوشل	۲۶۷	دلار/تن	۱.۸۲٪
۲	کتان (پنبه)	۸۳،۴۵	سنت /پوند	۱۸۴۰	دلار/تن	-۲،۰۳٪
۳	سویا	۱،۵۱۹	سنت /بوشل	۵۵۸	دلار/تن	۲،۶۹٪
۴	شکر	۲۰،۰۴	سنت /پوند	۴۴۲	دلار/تن	-۴،۴۸٪
۵	گندم	۷۹۱	سنت /بوشل	۲۹۱	دلار/تن	۱،۹۴٪
۶	کانولا	۸۵۸	دلار کانادا/تن	۶۲۳	دلار/تن	-۱،۰۵٪
کالاهای صنعتی						
۷	مس	۸۳۷۴	دلار/تن			-۰،۰۵٪
۸	قیر	۳،۶۰۰	یوان/تن	۴۹۹	دلار/تن	-۰،۴۴٪
۹	فولاد	۴،۰۱۹	یوان/تن	۵۵۷	دلار/تن	۲،۷۴٪
۱۰	آلومینیوم	۲،۳۸۹	دلار/تن			-۰،۲۹٪
۱۱	سرب	۲،۲۹۲	دلار/تن			۱،۴۸٪
۱۲	روی	۲،۹۶۸	دلار/تن			-۰،۴۰٪
۱۳	سنگ آهن	۱۱۷،۵	دلار/تن			۴،۹۱٪
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۵۱۲	دلار/تن			۱،۵۴٪
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۴۷۸	دلار/تن			۱،۶۰٪
شاخص‌های کالایی						
۱۶	بالتیک خشک	۱،۵۱۵	واحد			-۲،۰۷٪
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۰۱	واحد			-۰،۰۵٪
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۴،۰۰۸	واحد			۱،۰۸٪
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳،۴۵۴	واحد			-۰،۴۲٪

بررسی وضعیت صندوق‌ها



گروه سرمایه‌گذاری اعتباری ایران (E.I.I.)



نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (هیلارد ریال)	میانگین دارایی های میانگین (%)	میانگین بازدهی هفته (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی 3 ماهه (%)	میانگین بازدهی 6 ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
جسورانه	۴,۳۰۸.۵۹	۰.۱۲٪	۰.۹۷٪	۲.۶۵٪	۴.۶۸٪	۵.۳۲٪	۱۷.۳۵٪
صندوق درصندوق	۳,۵۵۲.۹۱	۰.۰۰٪	۳.۳۰٪	۱۰.۱۹٪	۱۵.۲۲٪	۱۱.۰۹٪	۸.۷۱٪
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۴۸۷,۶۳۰.۲۸	۰.۰۴٪	۰.۴۹٪	۱.۸۶٪	۴.۹۲٪	۸.۶۷٪	۱۶.۰۶٪
اختصاصی بازارگردانی	۱,۱۶۷,۳۹۹.۷۰	۲.۳۴٪	۶.۷۲٪	۷.۵۴٪	۸.۴۶٪	۲.۲۰٪	۱۱.۹۵٪
در سهام	۶۴۶,۶۵۵.۱۵	۰.۱۱٪	۵.۴۵٪	۱۱.۲۴٪	۱۸.۱۸٪	۷.۹۵٪	۱۵.۴۴٪
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۷۷,۲۷۵.۳۹	۲.۳۷٪	۲.۱۰٪	۸.۸۳٪	۲۰.۳۲٪	-	-
مختلط	۲۵,۵۵۴.۵۱	۰.۰۶٪	۳.۲۲٪	۷.۷۱٪	۱۱.۷۳٪	۸.۰۵٪	۱۶.۳۳٪
خصوصی	۱۲,۶۰۳.۷۶	۰.۰۰٪	۰.۱۱٪	۰.۴۹٪	۱.۲۳٪	۲.۵۶٪	۷.۱۰٪
پروژه‌ای	۱۰,۸۹۸.۲۷	۰.۰۵٪	۰.۰۰٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪
جمع کل	۶,۳۳۷,۵۲۸						

در هفته منتهی به شنبه ۱۰ دی ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های جسورانه، درآمد ثابت، مبتنی بر سپرده کالایی، مختلط، خصوصی، بازارگردانی، صندوق درصندوق و در سهام مثبت و بازدهی صندوق‌های پروژه‌ای صفر بود.

درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های اختصاصی بازارگردانی با ۶/۷۲ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های پروژه‌ای با صفر درصد بود. از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۶۹/۷۳ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۸/۱۴ درصد و سهامی با ۱۰/۰۵ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

با توجه به بازدهی سالانه، صندوق‌های جسورانه، مختلط و درآمد ثابت به ترتیب با بازده ۱۷/۳۵ درصد، ۱۶/۳۳ درصد و ۱۶/۳۳ درصد دارای بیشترین بازدهی و صندوق‌های پروژه‌ای با بازده صفر درصد دارای کمترین بازدهی بودند.

همچنین جمع کل خالص ارزش دارایی صندوق‌ها نسبت به هفته گذشته ۰/۲۷ درصد کاهش داشته است.

بررسی وضعیت بازار بدهی

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملات	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخزا۲	۹۹۲۱۳۰	۱۴۰۱-۱۰-۱۰	۱۴۰۱-۱۰-۱۹	۳۷.۷۷٪	۳۲.۱۷٪
اخزا۱	۸۰۰۰۰۰	۱۴۰۱-۱۰-۰۷	۱۴۰۲-۰۹-۰۶	۲۷.۶۲٪	۳۵.۵۹٪
اخزا۸	۸۷۰۰۰۰	۱۴۰۱-۱۰-۱۰	۱۴۰۲-۰۶-۰۶	۲۳.۵۹٪	۲۲.۷۳٪
اخزا۳	۵۱۸۱۱۰	۱۴۰۱-۱۰-۱۰	۱۴۰۴-۰۵-۲۰	۲۸.۶۱٪	۲۲.۷۳٪
میانگین بازدهی				۲۸.۳۲٪	۲۹.۳۲٪

منبع: فرابورس ایران

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملات	تاریخ سررسید	YTM
تابان۰۳	۹۴۶۱۰۰	۱۴۰۱-۱۰-۰۴	۱۴۰۲-۱۲-۰۶	۲۵.۵۶٪
صبا۰۴	۱۰۰۳۰۷۰	۱۴۰۱-۱۰-۱۰	۱۴۰۴-۰۱-۲۸	۱۸.۶۷٪

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 اخزا۲/۹۰ و اخزا۱/۸۲ با سررسیدهای ۱۴۰۱/۱۰/۱۹ و ۱۴۰۲/۰۹/۰۶ و بازدهی‌های ۳۷/۷۷ و ۳۵/۵۹ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نمادهای اخزا۸/۹۰ و اخزا۳/۱۰ با سررسیدهای ۱۴۰۲/۰۶/۰۶ و ۱۴۰۴/۰۵/۲۰ و بازدهی‌های ۲۳/۵۹ و ۲۲/۷۳ درصد بود.

از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب معادل ۲۸/۳۲ و ۲۹/۳۲ درصد است.

اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد صبا۰۴ بمیزان ۱۸/۶۷ درصد با سررسید ۱۴۰۴/۰۱/۲۸ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد تابان۰۳ بمیزان ۲۵/۵۶ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۱۲/۰۶ بوده است.

بورس کالا

بازار فیزیکی



بازار آتی



بازار مالی
(سلف، صندوق و موازی)

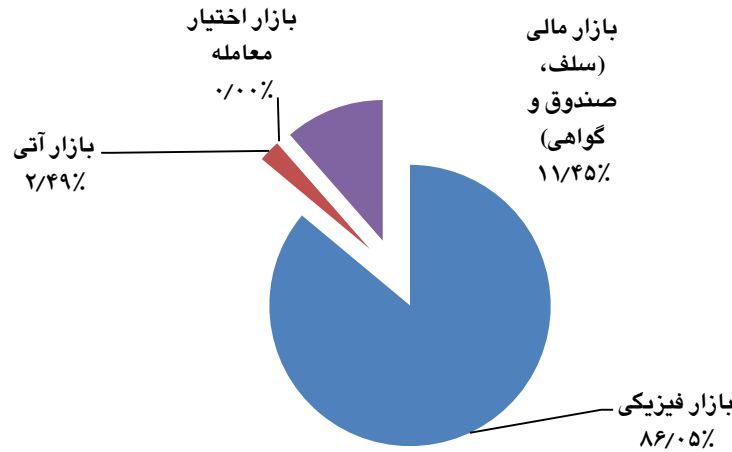


بازار اختیار معامله



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

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۳/۹ 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 معادل ۲۰/۷۵ درصد و حجم معاملات ۱۳/۵۸ 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	۹۲,۵۷۲,۲۱۲	۱,۶۲۱,۰۰۴	۵۲/۷٪
پتروشیمی و نفتی	۷۲,۲۷۸,۸۴۲	۴۱۲,۶۳۷	۴۱/۲٪
اموال غیر منقول	۰	۰	۰/۰٪
معذنی	۳,۷۱۷,۷۹۹	۲۲۳,۵۰۰	۲/۱٪
بازار فرعی	۷,۰۷۴,۵۵۶	۴۷,۹۴۸	۴/۰٪
جمع	۱۷۵,۶۴۳,۴۰۹	۲,۳۰۵,۰۸۹	۱۰۰٪

همچنین بررسی تحولات براساس نرخ ارز حواله ارزی نیز، حاکی از عقب ماندن نرخ اوره گرانول و پیشی گرفتن نرخ بیلت فخوز، کاند مس و 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، نرخ بیلت فخوز، 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 نرخ (نیمایی دلار)	میانگین هفتگی نرخ (دلار آزاد)	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
یک تن اوره گرانول	۱۲۶,۱۳۱,۰۰۰	۲۸۲,۴۳۵	۴۲۰,۸۱۷	۳۰۰	۴۷۴	۹۴/۲٪	۶۳/۲٪	۲/۰٪
یک تن کاند مس	۲,۶۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸۲,۴۳۵	۴۲۰,۸۱۷	۶,۲۵۰	۸,۳۷۴	۱۱۱/۲٪	۷۴/۶٪	-۰/۲٪
یک تن پت شهید تندگویان	۳۳۶,۱۰۷,۰۰۰	۲۸۲,۴۳۵	۴۲۰,۸۱۷	۷۹۹	۹۶۰	۱۲۴/۰٪	۸۲/۲٪	۲۴/۶٪
یک تن بیلت فخوز	۱۶۷,۰۱۷,۰۰۰	۲۸۲,۴۳۵	۴۲۰,۸۱۷	۳۹۷	۴۷۷	۱۲۴/۰٪	۸۲/۲٪	۱۳/۶٪
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۶,۴۴۰,۰۰۰	۲۸۲,۴۳۵	۴۲۰,۸۱۷	۱۵	۲۳	-	-	۱/۷٪

تحلیل تکنیکال شاخص کل

عدم تثبیت بر بالای مقاومت ۱/۶۰۰/۰۰۰ واحد



- هفته گذشته شاخص کل با ثبت کندلی صعودی و قدرتمند موفق به شکست محدوده مقاومتی ۱/۶۰۰/۰۰۰ واحد شد اما امروز نتوانست کندل تثبیت را بر بالای این محدوده به ثبت برساند.
- شاخص کل امروز ۵۶/۸۱۹ واحد افت کرد و از ۱/۶۱۹/۸۴۱ واحد به ۱/۵۹۰/۵۹۵ واحد رسید و بدین ترتیب مجدداً به زیر مقاومت ۱/۶۰۰/۰۰۰ واحد بازگشت. به نظر می‌رسد موج صعودی به اتمام رسیده و شاهد شروع یک موج اصلاحی جدید هستیم.
- حمایت‌های مهم پیش روی شاخص کل عبارتند از محدوده ۱/۵۵۰/۰۰۰ الی ۱/۵۶۰/۰۰۰ و محدوده ۱/۴۸۰/۰۰۰ الی ۱/۵۰۰/۰۰۰ واحد.

❖ توضیحات:

- 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 ۱,۶۴۷,۳۱۴ واحدی و بازده هفتگی ۱۰/۰۹+ درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از ورود ۱,۶۲۹ میلیارد تومان به بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱، نشان‌دهنده خروج ۳۳,۸۱۱ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۱۸۳ 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 ۵۱,۶۴۱- میلیارد تومان افول کرد.

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

شنبه	۰۱/۱۰/۰۳	+۳۷۸	میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۱۰/۰۴	+۲۰۰	میلیارد تومان
دوشنبه	۰۱/۱۰/۰۵	+۱۸۵	میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۱۰/۰۷	+۸۶۶	میلیارد تومان

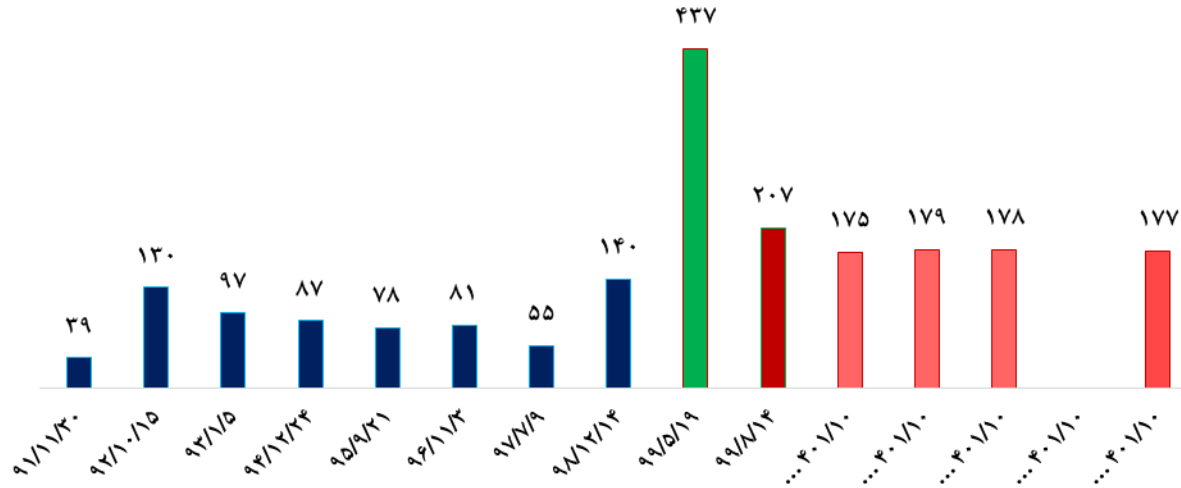
ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۱۷۷ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۵۹ 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 ۷۶ درصد محاسبه می‌شود. اما چنانچه GDP ریالی مرکز آمار برای سال ۱۴۰۰ را ملاک قرار داده و آن را بر میانگین نرخ ارز در سال ۱۴۰۰ تقسیم کنیم، عدد ۲۸۱ میلیارد دلار برای GDP محاسبه خواهد شد. در این صورت شاخص وارن بافت برای ایران براساس GDP محاسباتی سال ۱۴۰۰ معادل ۶۳ درصد خواهد شد. گفتنی است که این شاخص در تاریخ ۲۳ دسامبر سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۱ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۶ تریلیون دلاری در این کشور، معادل ۱۵۸ درصد محاسبه شده است.

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



مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال)	P (ریال)	P/E (پیش‌بینی)	EPS (ریال)	سال مالی	P/NAV
شستا	۷.۵۴	۱۲۹	۹۷۳	۵.۹۷	۱۶۳	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۷۹٪
وبانک	۵.۹۵	۲,۰۵۱	۱۲,۲۱۰	۶.۵۹	۱,۸۵۳	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۸۰٪
وصندوق	۵.۷۲	۲,۵۲۶	۱۴,۴۴۰	۵.۹۸	۲,۴۱۶	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۵۵٪
وامید	۷.۱۵	۱,۸۳۵	۱۳,۱۲۰	۷.۰۶	۱,۸۵۹	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۲٪
وغدیر	۹.۱۷	۲,۰۷۱	۱۹,۰۰۰	۶.۴۳	۲,۹۵۵	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۶۱٪
ونیکو	۴.۵۳	۹۳۲	۶,۴۵۰	-	-	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۴٪

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.