



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

بارقه‌های امید در بازار سرمایه

پس از یک دوره نفس‌گیر افت شاخص کل، که در نهایت منجر به کاهش نزدیک به ۱۸ درصدی (۲۸۰ هزار واحدی) آن طی کمتر از ۴ ماه شد، از اواسط هفته گذشته و هم‌زمان با برخورد شاخص کل به کف کانال ۱,۲۹۰,۰۰۰ واحدی و جدی شدن حمایت دولت از بورس در قالب طرح ۱۰ بندی، روند نوسانات شاخص کل معکوس شد. به این ترتیب طی ۴ روز کاری منتهی به شنبه ۴ دی ۱۴۰۰، شاخص کل بالغ بر ۸۰ واحد صعود را تجربه کرد.

یک تفاوت مهم به لحاظ مؤلفه‌های بنیادی در صعود اخیر شاخص کل نسبت به صعود قبلی آن را می‌توان جنس هزینه‌ای بودن این صعود دانست. چنانکه در صعود پیشین، عامل محرک، عمدتاً انتظار برای افزایش درآمد شرکت‌ها و در صعود اخیر عامل محرک، عمدتاً انتظار برای کاهش هزینه شرکت‌ها (در قالب کاهش هزینه گاز خوراک، تخفیف مالیاتی و غیره) بوده است. با توجه به این نکته، با فرض ثبات نسبی سایر عوامل اثرگذار بر بازار سرمایه (نظیر نرخ ارز و غیره)، مادامی که دولت خلف وعده نکرده و به نرخ‌ها و تخفیفات اعلامی خود پایبند باشد، می‌توان انتظار داشت اثر این عامل محرک بر افزایش سودآوری شرکت‌ها و در نتیجه افزایش اقبال به خرید سهام آنها تداوم داشته باشد.

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۸۶ - هفته منتهی به ۴ دی ۱۴۰۰

گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی: اهمیت اثر واکسن بر کاهش عوارض اومیکرون - تعطیلی معاملات فیوچرز محصولات کشاورزی در هندوستان؛
- تصویر اقتصاد کلان - مثبت شدن بازدهی هفتگی رمزارزها پس از ۵ هفته؛
- تورم - مرکز آمار نرخ تورم نقطه‌به‌نقطه آذر ۱۴۰۰ را معادل ۳۵/۲ درصد اعلام کرد - کندشدن آهنگ کاهش تورم نقطه‌به‌نقطه: روند آتی انتظارات تورمی در گرو عمل و اظهارات مسئولان!؛
- بورس و انرژی: بازیابی سهام و نفت؛
- فلزات گرانبها و ارز: مرکز تجارت جهانی دبی در خدمت رمزارزها؛
- بازار کالاهای خام: سنگ آهن در مدار صعود؛
- بررسی صندوق‌ها و بازدهی آنها؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - حرکت به سمت سقف کانال نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - شکست سقف کانال نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - صعود در کوتاه‌مدت؛
- 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 اهمیت اثر واکسن بر کاهش عوارض اومیکرون

تعطیلی معاملات فیوچرز محصولات کشاورزی در هندوستان

اشاره

مشخص شدن تأثیرات واکسیناسیون بر کاهش اثرات منفی و بویژه بستری شدن ناشی از ابتلاء به سویه اومیکرون کرونا، خبر مهمی بود که بر بازارهای جهانی مؤثر بود. همچنین تصویب کمک ۱ میلیارد دلاری بایدن برای شرکت‌های فعال در حوزه هیدروژن، خبر مهمی بود که نشان از اهمیت این عنصر دارد. در نهایت، تعطیلی معاملات فیوچرز محصولات کشاورزی در هند، ناشی از خبر دیگری بود که طی هفته اخیر بوقوع پیوست.

بلومبرگ

Bloomberg

- آمریکا در حال باختن بازی جذب استعدادهای جهان به کشورهای آسیای شرقی و اروپا است.
- پوتین در مورد اوکراین تنها دارد ژست «مرد دیوانه» را می‌گیرد و برای حمله جدی نیست.
- برنامه اسرائیل برای تزریق دوز چهارم واکسن با سرعت کافی جهت مقابله با اومیکرون پیش نمی‌رود.
- تعداد مبتلایان روزانه در بریتانیا رکورد زد.
- مطالعات انگلیس هم نشان می‌دهد که احتمال انتقال به بیمارستان بعلت ابتلا به اومیکرون پایین است.
- تعداد مبتلایان روزانه در امارات، برای اولین بار از مرداد ماه به بالای ۱۰۰۰ مورد رسید.
- دخالت بی خبر دولت ترکیه در بازار ارز موجب نابودی میلیاردها دلار سرمایه مردم شد.
- اردوغان اعلام کرد ترکیه دیگر برای مهار تورم از ابزار افزایش نرخ بهره استفاده نخواهد کرد.
- وزیر اقتصاد ترکیه گفت نوسانات اخیر لیر، سرمایه‌گذاران کوچک را نبود کرد.
- افزایش مبتلایان در استرالیا هم زمان با بهبود شرایط در نیویورک رقم خورد.
- ایالات متحده قصد دارد محدودیت‌های سفر به کشورهای آفریقایی را در هفته آتی سبک‌تر کند.
- صرافی بایننس، مدیرعامل خود در سنگاپور را به مقام ریاست نمایندگی این کشور در خاورمیانه منصوب کرد.
- چین قصد دارد در مورد قوانین عرضه اولیه شرکت‌های خارجی سختگیری‌های بیشتری اعمال کند.
- با صدور ویزای دیپلمات‌های ایرانی، مذاکرات ایران و عربستان وارد مراحل جدیدی شد.
- چین بدنال تصویب قوانین سخت‌گیرانه‌تر در مورد ممنوعیت استخراج رمزارزها است.
- ۲۰۲۲ شاید سال تغییرات بنیادین نظام اقتصادی جهان باشد.
- جو بایدن مهلت پرداخت ۱/۶ تریلیون دلار از بدهی‌های معوقه وام‌های دانشجویی را تمدید کرد.
- بایدن ۱ میلیارد دلار کمک‌هزینه برای شرکت‌های فعال در زمینه هیدروژن تصویب کرد.

**BUSINESS
INSIDER**

بیزینس اینسایدر

- با تسهیل وحشت ناشی از اومیکرون، بازارهای سهام آمریکا هفته را با رکوردشکنی به پایان رساندند.
- دانشمندان معتقدند دلیل عوارض اندک اومیکرون روی افراد، واکسینه‌بودن آنهاست.
- ۳۰۰۰ پرواز به خاطر اومیکرون کنسل شده است.
- وال‌استریت، که در جست‌وجوی استعدادهاست، گاهی بعضی شرکت‌ها بمنظور جذب کارمندان سایر مؤسسات، پیشنهاد پاداش‌های چندبرابری می‌دهند.
- در آستانه تعطیلات، بیت‌کوین برای اولین بار در دو هفته اخیر به بالای ۵۱ هزار دلار رسید.
- مطالعات نشان می‌دهد که دوز بوستر واکسن، مقاومت بدن در برابر علائم اومیکرون را تنها ۱۰ هفته بالا می‌برد، که این خود می‌تواند به معنی دفعات بالاتر تزریق واکسن در ۲۰۲۲ باشد.
- تغییرات اقلیمی، افغانستان و همسایگانش را خشک‌تر از پیش می‌کند.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۲۷۹,۳۶۱,۲۹۴ +۱/۹۶%

جان باختگان

۵,۴۰۹,۴۴۸ +۰/۹۰%

بهبودیافتگان

۲۴۹,۶۶۲,۳۶۵ +۱/۵۲%

منبع: www.worldometers.info

فایننشال تایمز



- یونان به اتحادیه اروپا هشدار داد: هزینه‌های انرژی اتحادیه در سال آتی قریب به ۴۰۰ میلیارد دلار افزایش می‌یابد.
- شرکت‌های هوایی آمریکایی و استرالیایی در آستانه تعطیلات کریسمس، پروازهای زیادی را به خاطر محدودیت‌های اومیکرون و بیمار بودن کارکنان لغو کردند.
- ماکرون و نخست‌وزیر ایتالیا اعلام کردند قوانین مالی و بودجه‌ای اتحادیه اروپا باید تغییر کند.
- استارت‌آپ‌های عمرانی، بدنال طراحی خانه‌هایی با توانایی تحمل شرایط طاقت‌فرسای ماه و مریخ برای آینده بشر هستند.
- پوتین گفت آمریکا و روسیه در ماه ژانویه در باره اوکراین گفت‌وگو خواهند کرد.
- مؤسسه اعتباری کردیت سویس یک شکایت نیم میلیارد دلاری علیه سافت بانک ژاپن تنظیم کرد.
- بحران اوکراین، قول‌های بایدن برای رویارویی با اتوکرات‌هایی مثل پوتین را به چالش می‌کشد.
- یک شرکت مدیریت دارایی‌های دولتی چینی، ۲۴ درصد از سهام شرکت اعتباری «آنت»، که یکی از مهمترین دارایی‌های علی‌بابا است، را بدست گرفت.
- اروپا بدنال ممنوع کردن واردات هرگونه کالایی است که با کارگری اجباری در کشورهای فقیر ساخته شده باشد.
- هند به خاطر ترس از القای تورم، معاملات فیوچرز محصولات کشاورزی را موقتاً متوقف کرد.

تصویر اقتصاد کلان

مثبت شدن بازدهی هفتگی رمزارزها پس از ۵ هفته

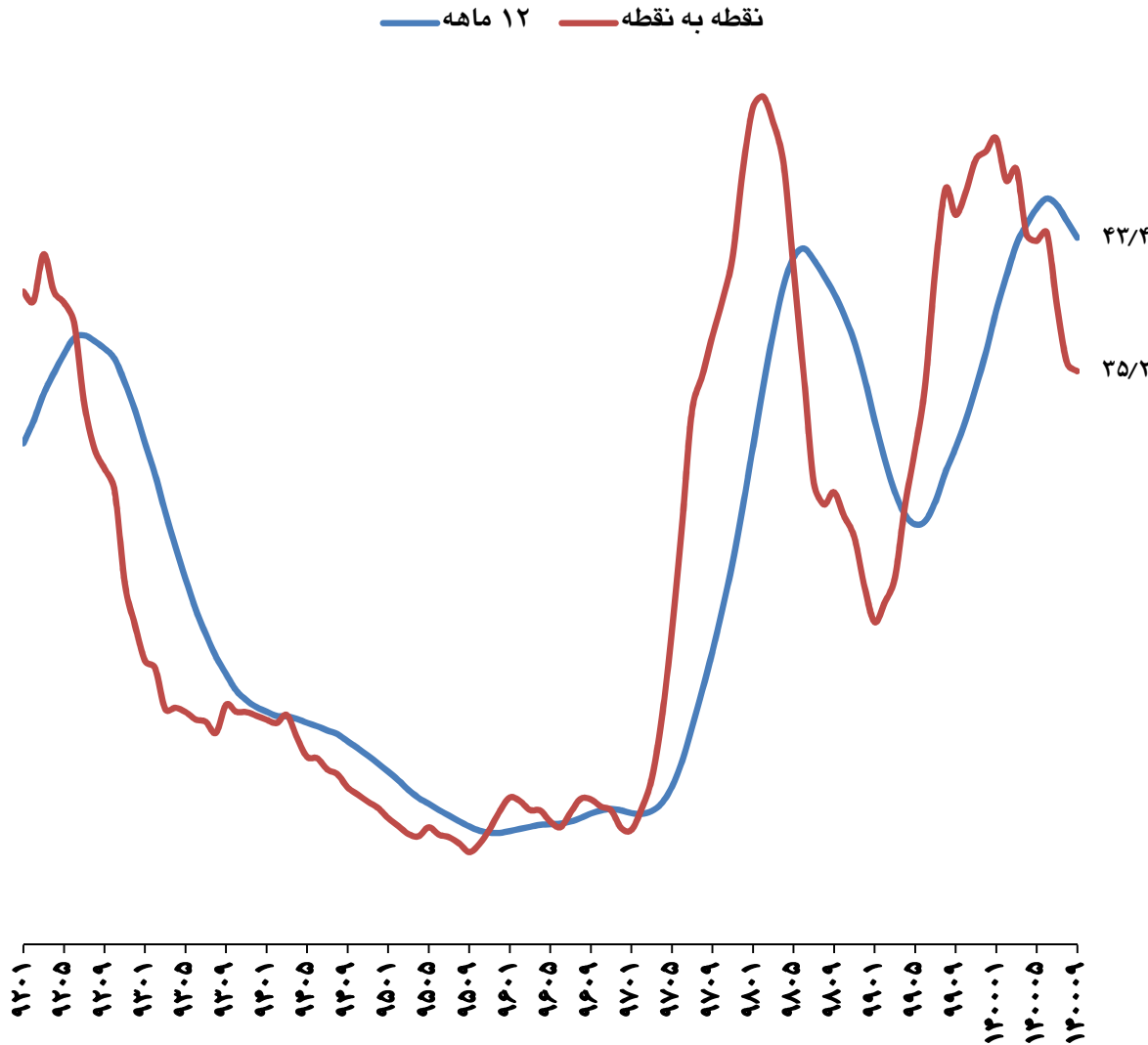
مقایسه بازدهی بازارها

بازار	هفتگی	ماهانه	یکساله
دلار (ریالی)	%۰/۰۵-	%۴/۱۹-	%۱۰/۶۹
سکه (ریالی)	%۰/۱۸	%۶/۳۶	%۱۲/۰۷
بورس (شاخص)	%۵/۵۱	%۲/۴۲-	%۵/۹۵-
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	%۸/۳۴	%۸/۶۷-	%۲۳/۵۵
مسکن (ریالی - تهران)	-	%۱/۲	-

حوزه جغرافیایی	متغیر	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	درآمد سرانه (دلار)	میانگین سالانه			نقطه به نقطه (ماهانه)		فصلی	نسبت بدهی خالص به GDP (درصد)	نسبت سرمایه‌گذاری به GDP (درصد)	جمعیت (هزار نفر)
				نرخ رشد اقتصادی - به قیمت‌های ثابت (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)				
جهان												
بازه زمانی												
مقدار شاخص												
پیش‌بینی (۲۰۲۱)												
آمریکا												
بازه زمانی												
مقدار شاخص												
پیش‌بینی (۲۰۲۱)												
چین												
بازه زمانی												
مقدار شاخص												
پیش‌بینی (۲۰۲۱)												
منطقه یورو												
بازه زمانی												
مقدار شاخص												
پیش‌بینی (۲۰۲۱)												
ایران												
بازه زمانی												
مقدار شاخص												
۲۰۲۱												

مرکز آمار نرخ تورم نقطه به نقطه آذر ۱۴۰۰ را معادل ۳۵/۲ درصد اعلام کرد:

کند شدن آهنگ کاهش تورم نقطه به نقطه: روند آتی انتظارات تورمی در گرو عمل و اظهارات مسئولان!



مرکز آمار ایران نرخ تورم آذر ۱۴۰۰ را اعلام کرد. بر این اساس، نرخ تورم نقطه به نقطه با کاهش ۰/۵ واحد درصدی نسبت به آبان ۱۴۰۰، به عدد ۳۵/۲ درصد رسید. نرخ تورم میانگین سالیانه نیز با کاهش ۱ واحد درصدی نسبت به آبان ۱۴۰۰ به عدد ۴۳/۴ درصد رسید.

نرخ تورم ماهانه شاخص کل قیمت کالاها و خدمات مصرفی خانوارهای کل کشور در ماه آذر نسبت به آبان ۱۴۰۰ با کاهش ۰/۸ واحد درصدی از ۲/۵ درصد به ۱/۷ درصد کاهش یافته است. در این بین، بیشترین نرخ تورم ماهانه در بین گروه‌های کالایی مربوط به دخانیات با نرخ تورم ماهیانه ۳/۹ درصد و کمترین آن مربوط به زیرگروه کالایی میوه و خشکبار با نرخ تورم ۱/۱- درصد بوده است.

بطور کلی بنا بر آمار منتشره رسمی مرکز آمار ایران، می‌توان گفت اگرچه روند صعودی نرخ تورم نقطه نقطه (بعنوان پیش‌نگر نرخ تورم میانگین سالیانه)، از فروردین ۱۴۰۰ به این سوی، متوقف شده و طی دو ماه مهر و آبان دچار افت محسوسی شده، اما آهنگ کاهش آن در ماه آذر کند شده است. لذا، به نظر می‌رسد انتظارات تورمی همچنان پتانسیل تغییر روند و صعودی شدن مجدد آهنگ رشد نرخ تورم را دارد. به عبارت دیگر، ریسک وقوع جرقه در انبار باروت تورم همچنان به قوت خود باقی است و ممکن است هر نوع خبر تأثیرگذاری، اعم از سیاسی یا اقتصادی در رابطه با برجام یا بودجه ۱۴۰۱، نقش جرقه مژگور را ایفاء کند. در چنین مواقعی، عملکرد مسئولان در مذاکرات و بررسی لایحه بودجه در کنار اظهارات آنها می‌تواند خوراک خبری لازم برای مسیر آتی نرخ تورم را مشخص کند. بنابراین، چنانچه مسئولان بدنبال اجتناب از افزایش مجدد نرخ تورم هستند، می‌بایست سیاست‌های مدیریت انتظارات تورمی را با توجه ویژه به عملکرد و اظهارات خود در پیش گیرند.



منبع

بازده
بازده
بازده

یکساله
ماهانه
هفتگی

معادل

آخرین قیمت

عنوان

ردیف

بورس و انرژی

بازیابی سهام و نفت

بورس های جهانی

	۱۹.۱۱٪	۰.۲۶٪	۱.۵۱٪	واحد	۳۵,۹۰۶	Dow Jones	۱
	۲۸.۳۰٪	-۰.۳۶٪	۳.۲۱٪	واحد	۱۶,۳۰۸	Nasdaq	۲
	۲۷.۷۹٪	۰.۴۶٪	۲.۱۳٪	واحد	۴,۷۱۵	S&P 500	۳
TeleTrader	۱۴.۰۱٪	-۰.۹۳٪	۱.۸۲٪	واحد	۷,۳۶۳	FTSE 100	۴
	۱۵.۹۶٪	-۰.۷۷٪	۱.۴۵٪	واحد	۱۵,۷۵۳	DAX	۵
	۲۸.۳۳٪	۰.۶۳٪	۲.۳۱٪	واحد	۷,۰۸۷	CAC 40	۶
	۷.۹۳٪	-۱.۷۷٪	-۰.۸۳٪	واحد	۲۸,۷۸۳	NIKKEI 225	۷
	۸.۳۳٪	۱.۴۱٪	-۰.۳۰٪	واحد	۳,۶۴۳	SHANGHAI	۸
TradingEconomics	۱۲.۵۸٪	-۶.۲۱٪	-۰.۵۵٪	واحد	۳,۷۰۳	Moex	۹

نفت و انرژی

TeleTrader	۵۰.۹۰٪	-۶.۱۳٪	۳.۶۵٪	دلار / بشکه	۷۵.۵۱	نفت خام برنت	۱۰
TeleTrader	۳۹.۳۳٪	-۶.۱۰٪	۳.۴۶٪	دلار / بشکه	۷۲.۳۸	نفت خام WTI	۱۱
TeleTrader	۷۰.۹۸٪	-۲.۱۷٪	۱.۷۴٪	دلار / MMBtu	۱۳.۲۱	سنت / مترمکعب	۱۲
OilPrice	۴۳.۹۴٪	-۹.۰۸٪	-۰.۵۸٪	دلار / بشکه	۷۴.۲۳	سبب اوپک	۱۳
OilPrice	۵۲.۸۱٪	-۱۲.۱۱٪	-۰.۵۴٪	دلار / بشکه	۷۰.۲۰	نفت سنگین ایران	۱۴
TeleTrader	۴۲.۱۱٪	-۷.۳۶٪	-۲.۲۳٪	دلار / تن	۶۳۵	گازوئیل	۱۵
TradingEconomics	۶۰.۹۴٪	-۶.۱۷٪	۰.۵۶٪	دلار / تن	۶۹۶.۳۸	نفتا	۱۶
TradingEconomics	۱۲۴.۷۹٪	-۱۰.۳۹٪	۱.۳۴٪	دلار / تن	۱۰۰۷	گالان	۱۷
Sunsirs	-	-	-۶.۹۱٪	دلار / تن	۳۸۴	یوان / تن	۱۸
PLATTS	-	-۵/۴۱٪	-۱/۵۶٪	دلار / تن	۳۱۵	متانول (CFR)	۱۹
Fertilizerworks	۷۱.۰۸٪	-۴.۵۲٪	-۳.۹۳٪	دلار / تن	۸۳۴.۶۷	اوره گرانول خاورمیانه	۲۰
PLATTS	-	-۱۴.۶۲٪	۲/۸۳٪	دلار / تن	۱۰۹۰	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۲۱

بورس های جهانی

بازارها که هفته پیش را در ترس (Panic) ناشی از گسترش اومیکرون و آغاز این هفته نیز هنوز در وهم و نوسان ناشی از نگرانی از تأثیرات اومیکرون سپری کردند، در پایان هفته با انتشار نتیجه تحقیقات مؤسسات مبنی بر اینکه، احتمال بستری شدن بر اثر ابتلا به اومیکرون بین ۶۶ تا ۸۰ درصد کمتر از گونه دلتا است، دچار شفاف و طمع خرید گسترده شدند. رشد ناشی از این خبر خوش، اخبار بد افزایش قیمت گاز اروپا را به حاشیه برد و باعث افزایش ۱ تا ۳ درصدی بازارهای کشورهای غربی شد.

در چین اما خبر کاهش رتبه اعتباری شرکت بحران زده اورگرند توسط موسسه S&P باعث القای جو منفی به بازار شد که با کاهش ۷ درصدی سهام این شرکت همراه بود. همچنین این موج منفی با تسری به سایر شرکت های ساختمانی چین موجب کاهش ارزش سهام غول عمرانی «سوناک» این کشور تا ۱۵ درصد شد. از طرف دیگر شرکت های دولتی و کوچکتر در حال خریداری املاک و پروژه های نیمه تمام اورگرند از این شرکت برای کمک به پایان بحران هستند.

مطلب شایان توجه دیگر اینکه بازارهای مالی جهان در سال ۲۰۲۱ به میزان ۱ تریلیون دلار سرمایه جدید جذب کردند که این میزان، برابر با جذب سرمایه تجمعی ۲۱ سال اخیر این بازارهاست!

نفت و محصولات پتروشیمی

در ادامه شدت گرفتن بحران انرژی در اروپا، قیمت گاز در این قاره به ازای هر متر مکعب با افزایش ممتد چند ماهه در کشورهای مختلف در حال شکستن رکورد تاریخی خود است. قیمت گاز انگلستان ۱۶ برابر زمان مشابه سال گذشته و در فرانسه نزدیک به ۱۲ برابر این مقدار است. این قیمت ها در صورت عدم حل مشکل نیروگاه های هسته ای در حال تعمیر فرانسه و اختلافات با روسیه همچنان پابرجا خواهد ماند. برنامه آلمان برای کاهش ۵۰ درصدی تولید برق هسته ای خود تا پایان امسال و همچنین قیمت های فیوچرز ژانویه سال ۲۰۲۳ گاز، که بالای ۹۰ یورو به ازای هر مگاوات است، خبر از تداوم بحران در میان مدت می دهد.

اخبار مربوط به کم خطر بودن اومیکرون نسبت به گونه دلتا به سود بازار نفت خام نیز عمل کرده و باعث افزایش تقاضا و قیمت در این بازار شد، که تأثیرات آن را در جدول مقابل مشاهده می کنید. افزایش قیمت نفت در هفته جاری هم زمان با این امر رخ داد که به اذعان تحلیلگران نشریه پلتس، علی رغم روند راکد و ساکن مذاکرات، خوش بینی بالایی به ادامه مذاکرات ایران و طرف های اروپایی در مورد برجام وجود دارد و احتمال می رود که در سال آتی میلادی معادل ۷۰۰ هزار بشکه به ظرفیت تولید نفت ایران و بازار جهانی افزوده شود.

فلزات گرانبها و ارز

مرکز تجارت جهانی دبی در خدمت رمزارزها

بازار فلزات گرانبها

اونس جهانی طلا هفته کاری خود را با افت ۹ دلاری آغاز کرد و به عدد ۱,۷۸۸ دلار رسید. اما در ادامه در واکنش به داده‌های تورم ایالات متحده در روز پنجشنبه و با توجه به افت ۰/۶ درصدی شاخص دلار، قیمت اونس جهانی طلا در آستانه تعطیلات کریسمس رشد کرده و به بالاترین سطح هفتگی خود، یعنی عدد ۱,۸۱۰ دلار رسید. آنچه که مانع رشد بیشتر این فلز زردرنگ شد، بازده اوراق قرضه ۱۰ ساله خزانه‌داری ایالات متحده بود که به محدوده ۱/۵ درصد رسید. تحلیل‌گران برای دو هفته آتی، بدلیل حجم اندک معاملات، نوسانات بالایی را برای طلا پیش‌بینی می‌کنند و علت آن را تعطیلی دفاتر بسیاری از شرکت‌ها برای تعطیلات سال نو می‌دانند.

سکه و ارز (داخلی)

هفته گذشته شاهد نوسانات محدودی در بازار ارز و سکه بودیم، که در اواسط هفته، قیمت سکه متأثر از رشد اونس جهانی طلا افزایش یافت. اما با توجه به ثبات نسبی نرخ ارز و کاهش تقاضا و افت ۱۰۰ هزار تومانی حساب، افزایش قیمت سکه محدود شد. بازار ارز و طلای داخلی چشم به دور هشتم مذاکرات وین، که دوشنبه هفته جاری آغاز می‌شود، دوخته‌اند.

رمزارز

روز دوشنبه مسئولین دبی اعلام کردند که بزودی مرکز تجارت جهانی دبی (DWTC) به منطقه‌ای جامع و تنظیم‌کننده مقررات ارزهای دیجیتال، محصولات، اپراتورها و صرافی‌ها تبدیل خواهد شد. DWTC اعلام کرد که اولویت اول این پروژه، استانداردهای سختگیرانه برای حمایت از سرمایه‌گذاران، اقدامات ضد پولشویی و مبارزه با تأمین مالی تروریسم است. پس از این خبر، صرافی بایننس روز سه‌شنبه اعلام کرد که قرارداد همکاری با سازمان مرکز تجارت جهانی دبی، که در حال کار برای ایجاد یک اکوسیستم دارایی مجازی بین‌المللی است، امضا کرده است. خبر مثبت بعدی برای بازار کریپتو از سوی سوئیفت (SWIFT) بود، که اعلام کرد قصد دارد چگونگی پشتیبانی از قابلیت همکاری در بازار دارایی‌های توکن‌شده را بررسی کند. پس از این اخبار، خبر تدوین لایحه جامع رمزارزی در سال ۲۰۲۲ منتشر شد. سیتیا لومیس (Cynthia Lummis)، سناتور وایومینگ (Wyoming)، که یکی از قانون‌گذاران حامی رمزارز ایالات متحده است، در حال برنامه‌ریزی برای ارائه یک لایحه جامع در سال آینده جهت رسیدگی به دارایی‌های دیجیتال است. در گزارش روز پنجشنبه ۲ دی ۱۴۰۰، بلومبرگ اعلام کرد که لایحه پیشنهادی لومیس با هدف ارائه شفافیت نظارتی در مورد استیبل کوین‌ها، راهنمایی تنظیم‌کننده‌ها در مورد اینکه کدام رمزارزها به کلاس‌های دارایی مختلف تعلق دارند و ارائه حمایت از مصرف‌کننده است. علاوه بر این، گزارش شده که سناتور آمریکایی پیشنهاد ایجاد سازمانی تحت صلاحیت مشترک کمیسیون بورس و اوراق بهادار و کمیسیون معاملات آتی کالا را برای نظارت بر بازار ارزهای دیجیتال ارائه کرده است.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۸۰۸	دلار/اونس	۰.۵۹%	۱%	-۳.۷۸%	TeleTrader
۲	نقره	۲۲.۸۵	دلار/اونس	۲۰.۱%	-۳.۱۸%	-۱۱.۴۳%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۲۵ آذر							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۳,۰۱۹,۰۰۰	ریال	۰.۲۲%	۵.۳۵%	۱۳.۹۹%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۳۲,۲۲۰,۰۰۰	ریال	۰.۱۸%	۶.۳۶%	۱۲.۰۷%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۲۵ آذر							
۵	دلار آزاد	۲۷۴,۰۲۰	ریال	-۰.۰۵%	-۴.۱۹%	۷.۳۹%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۴۱,۶۰۳	ریال	۰.۴۸%	۲.۸۱%	-۵.۰۱%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۴۳,۷۹۸	ریال	۰.۴۸%	۲.۸۱%	-۴.۳۷%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۰۴,۲۵۲	ریال	۰%	۲.۰۶%	۰.۳۱%	sanarate/ir
۹	یورو حواله (خرید)	۲۷۳,۵۵۶	ریال	۱.۰۵%	۳.۳۸%	-۱۱.۵%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۷۶,۰۴۱	ریال	۱.۰۵%	۳.۳۸%	-۱۱.۶۵%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۳,۱۶۹	ریال	-۰.۵۷%	۱.۵%	۹.۷۳%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۶۵,۷۸۷	ریال	۰.۴۸%	۲.۸۱%	-۵.۷۳%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۶۶,۳۸۵	ریال	۰.۴۸%	۲.۸۱%	-۵.۴۵%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت کوین	۵۰,۹۳۲	دلار	۸.۶۴%	-۱۳.۶۶%	۱۰.۶۱۶%	Tradingview
۱۵	اتریوم	۴,۰۴۳	دلار	۲.۰۷%	-۱۰.۶۶%	۵۴۵.۰۲%	Tradingview

بازار کالاهای خام سنگ آهن در مدار صعود



ردیف عنوان آخرین قیمت معادل بازده هفتگی بازده ماهانه بازده سالانه

محصولات کشاورزی

1	ذرت	۶۰۶.۷۵	سنت/بوشل	۲۳۹	دلار/تن	۲.۴۱%	۳.۷۲%	۴۱.۴۳%	TeleTrader
2	کتان (پنبه)	۱۰۹.۱۵	سنت/پوند	۲,۴۰۶	دلار/تن	۱.۶۲%	-۵.۸۶%	۴۷.۲۰%	TeleTrader
3	سویا	۱,۳۴۲.۵۰	سنت/بوشل	۴۹۳	دلار/تن	۴.۲۳%	۱۵.۱۹%	۱۵.۴۶%	TeleTrader
4	شکر	۱۹.۲۳	سنت/پوند	۴۲۴	دلار/تن	۰.۵۲%	-۳.۴۶%	۳۷.۱۶%	TeleTrader
5	گندم	۸۱۵.۲۵	سنت/بوشل	۳۰۰	دلار/تن	۵.۲۳%	-۴.۳۴%	۲۹.۴۰%	TeleTrader
6	کانولا	۱۰۰.۹۷	دلار کانادا/تن	۷۹۸	دلار/تن	۰.۸۷%	-۱.۹۹%	۶۰.۴۰%	TradingEconomics

کالاهای صنعتی

7	مس	۹۵۹۷.۰۰	دلار/تن			۱.۶۰%	-۲.۵۲%	۲۲.۵۶%	TeleTrader
8	قیر	۳,۰۶۶	یوان/تن	۴۹۰.۵۶	دلار/تن	۲.۸۲%	-۰.۲۶%	۲۸.۷۲%	TradingEconomics
9	فولاد	۴,۶۴۱	یوان/تن	۷۴۲.۵۶	دلار/تن	-۰.۸۳%	۶.۳۰%	۹.۹۸%	TradingEconomics
10	آلومینیوم	۲,۸۲۰	دلار/تن			۳.۱۶%	۳.۸۷%	۳۸.۹۲%	TeleTrader
11	سرب	۲,۲۷۲	دلار/تن			-۱.۳۷%	-۰.۴۲%	۱۴.۱۷%	TeleTrader
12	روی	۳,۵۱۷	دلار/تن			۴.۰۲%	۶.۲۴%	۲۴.۰۱%	TeleTrader
13	سنگ آهن	۱۲۰.۰۰	دلار/تن			۶.۱۹%	۱۹.۴۰%	-۲۴.۲۹%	Platts
14	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۶۰۱.۰	دلار/تن			-۰.۶۷%	-۴.۶۰%	۳۰.۷۸%	Metal Bulletine
15	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۵۴۱	دلار/تن			-۰.۷۳%	-۱۲.۷۴%		Metal Bulletine

شاخص‌های کالایی

16	بالتیک خشک	۲,۲۱۷	واحد			-۱۱.۲۵%	-۱۶.۷۸%	۶۳%	tgju.org
17	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۲۴۵	واحد			۱.۶۱%	-۳.۱۳%	۳۷.۶۷%	TradingEconomics
18	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۴,۴۷۵	واحد			۲.۴۸%	-۰.۲۱%	۳۱.۰۶%	TradingEconomics
19	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۲,۷۶۱	واحد			۲.۲۵%	-۳.۷۴%	۳۹.۶۴%	TradingEconomics

بازار محصولات کشاورزی

روند افزایش قیمت مواد غذایی در جهان، با شدت ادامه دارد و این امر موجب نگرانی کشورها جهت دسترسی تمام اقشار به ضروریات زندگی در سایه تورم جهانی شده است. مشکلات زنجیره تأمین خود به این امر دامن زده و باعث بیشتر شدن نگرانی‌های توری می‌شود. قیمت گندم، سویا و ذرت در هفته جاری بین ۳ تا ۵ درصد افزایش یافت، که در صورت ادامه‌دار بودن این روند در هفته‌های آتی می‌تواند آغازگر یک بحران جهانی باشد. قیمت سایر محصولات خوراکی و کشاورزی نیز در این هفته با شیب کمتری افزایشی بود.

بازار کالاهای صنعتی

توقف کار دو نیروگاه هسته‌ای بزرگ در فرانسه بعثت تعمیرات و نقص فنی، که ممکن است تا بهار سال جاری طول بکشد، خبر دیگری بود که هفته گذشته قیمت‌های انرژی در اروپا را به شدت افزایشی کرد و ادامه این روند به هفته جاری نیز رسید. قیمت انرژی در کشورهای صنعتی اروپایی اکنون بین ۱۰ الی ۱۶ برابر مقطع مشابه سال گذشته است که این امر موجب توقف فعالیت واحدهای صنعتی بیشتری شده است. گفتنی است خاموش شدن اسملترهای آلومینیوم بعثت مصرف بالای‌شان و عدم صرفه اقتصادی، باعث موج صعودی سنگین قیمتی این فلز خواهد شد. پیش‌بینی قیمت مس برای سال جاری در محدوده میانگین ۹۸۰۰ دلار بوده، که این خبر خوشی برای معادن و واحدهای تولیدکننده آن در سطح جهان است. انتخاب دو رئیس‌جمهور چپ‌گرا به ریاست دول کشورهای پرو و شیلی (بزرگترین تولیدکنندگان مس جهان) که باعث افزایش حقوق کارگران و مالیات‌های دولتی می‌شود، در کنار افزایش تقاضای شبکه توزیع نیروی برق جهان، به صعود قیمت مس دامن خواهد زد. قیمت سنگ آهن در بندر چین، اواسط این هفته به نقطه اوج دو ماه اخیر خود، یعنی قیمت ۱۲۳/۵ دلار، رسید که این مسأله ناشی از انتظار بالا رفتن ظرفیت تولید فولاد این کشور به خاطر به پایان رسیدن سال میلادی و کاهش سختگیری‌های دولت این کشور نسبت به تولید فولاد صادراتی، در کنار چشم‌انداز بهبود صنایع جهان و مصرف فولاد آنهاست. پایان یافتن محدودیت‌های ناشی از سیاست آسمان آبی دولت چین احتمالاً تا پایان مارس ۲۰۲۲ به طول انجامد.

شاخص‌های کالایی

کاهش ۱۱ درصدی شاخص بالتیک خشک در ابتدای هفته و سپس سکون آن در محدوده ۲۴۰۰ واحد، آن هم در آستانه تعطیلات سال نو، امری بدشگون و منادی ادامه‌دار بودن بحران‌های زنجیره تأمین جهانی در سال جاری است. این امر، که سرتیتر بسیاری از رسانه‌های حوزه تجارت جهان را به خود اختصاص داده در صورت ادامه وخامت، تأثیر سنگینی نه از طریق افزایش نرخ کرایه‌ها، بلکه به خاطر کمبود کالاها روی تورم فعلی جهانی می‌گذارد.

بررسی بازدهی صندوقهای سرمایه‌گذاری

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	میانگین بازدهی هفتگی (%)	میانگین بازدهی ماهانه (%)	میانگین بازدهی ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ۶ ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
در سهام	۵۶۹,۶۹۲	۱۹,۸۳	۱,۶۵	-۴,۵۹	-۲,۱۹	۱۲,۸۷	۲۹,۲۹
با درآمد ثابت	۸۴۰,۸۹۹	۸۵,۳۹	-۰,۵۷	۱,۳۹	۴,۳۸	۸,۵۴	۱۵,۷۷
مختلط	۹,۳۰۶	۴۰,۰۹	۱,۰۲	۲,۴۶	۴,۶۴	۱۷,۵۱	۱,۴۸
جمع کل صندوقها	۱,۲۱۸,۰۷۶	۳۱,۴۴	۱,۰۶	-۲,۷۲	-۱,۴۶	۸,۷۶	-۰,۳۲



صندوقهای سرمایه‌گذاری
در این هفته بازدهی هفتگی همه صندوقها مثبت بود، همچنین در این هفته سهم ارزش صندوقهای سهامی با ۱ درصد افزایش نسبت به هفته گذشته به ۴۰ درصد رسید که این ارزش از صندوقهای با درآمد ثابت به صندوقهای سهامی منتقل شد.

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
اخزا۸۱	۹۹۷,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۳۰	۱۴۰۰-۱۰-۰۶	۲۰,۰۵%	۱۸,۳۰%
اخزا۰۰۴	۵۴۵,۷۹۰	۱۴۰۰-۱۰-۰۱	۱۴۰۳-۰۵-۲۲	۲۵,۷۷%	۳۱,۵۱%
اخزا۰۰۷	۵۰۹,۵۰۰	۱۴۰۰-۱۰-۰۱	۱۴۰۳-۰۹-۱۲	۲۵,۷۰%	۳۲,۶۶%
میانگین بازدهی					۲۶,۹۰%

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 اخزا۸۱ با سررسید ۱۴۰۰/۱۰/۰۶ و با بازدهی‌های ۲۰/۰۵ و ۱۸/۳۰ درصد بود. همچنین بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخزا۰۰۴ و اخزا۰۰۷ با سررسیدهای ۱۴۰۳/۰۵/۲۲ و ۱۴۰۳/۰۹/۱۲ و بازدهی‌های ۲۵/۷۷ و ۳۲/۶۶ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب معادل ۲۵/۰۲ و ۲۶/۹۰ درصد است.

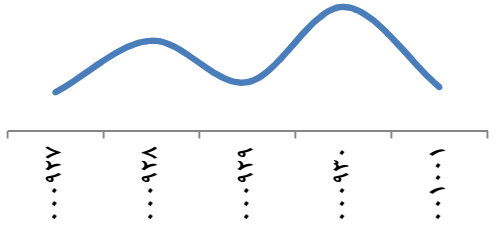
بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
افاد۷۴	۱,۰۴۰,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۳۰	۱۴۰۲-۰۴-۱۱	۱۵/۴۵%
اروند۱۰	۹۷۰,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۹-۳۰	۱۴۰۰-۱۲-۲۲	۳۷/۰۶%

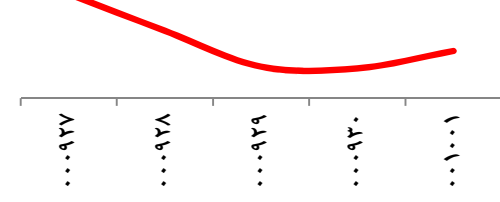
منبع: فرابورس ایران

اوراق تأمین مالی
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد افاد۷۴ بمیزان ۱۵/۴۵ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۴/۱۱ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اروند۱۰ بمیزان ۳۷/۰۶ درصد با سررسید ۱۴۰۰/۱۲/۲۲ بوده است.

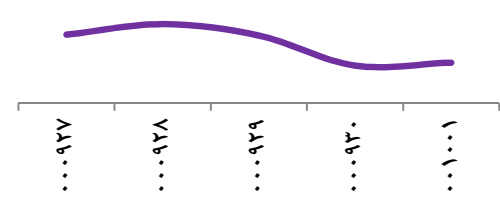
بازار فیزیکی



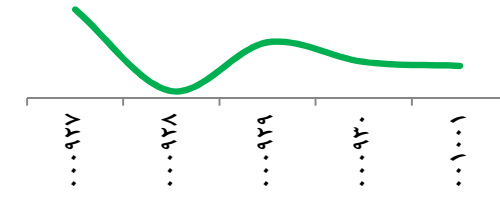
بازار آتی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)

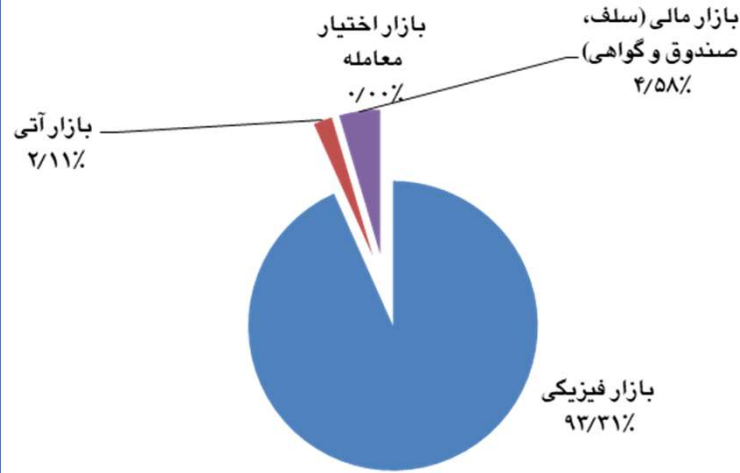


بازار اختیار معامله



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

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۷ 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 ۲۱/۶۳ و همچنین حجم معاملات ۱۷/۱۴ درصد کاهش پیدا کرده است.

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروه‌های کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	رزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۸۱,۹۱۲,۷۰۲	۱,۵۴۶,۹۹۵	۵۵/۱%
پتروشیمی و نفتی	۶۵,۷۲۵,۵۸۶	۵۲۳,۶۴۰	۴۴/۲%
بازار فرعی	۱,۰۱۱,۱۷۹	۵,۳۹۵	۰/۷%
جمع	۱۴۸,۶۴۹,۴۶۸	۲,۰۷۶,۰۳۰	۱۰۰%

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 سنا، حاکی از عقب ماندن نرخ اوره گرانول، شمش بیلت فولاد خوزستان، مس کاتد و 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 سنا)	نرخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نیمایی)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ سنا)
یک تن اوره گرانول	۱۹۲,۷۹۹,۰۰۰	۲۴۴,۳۰۲	۳۰۰,۴۶۷	۷۸۹	۶۴۲	۸۳۵	۹۴/۶%	۷۶/۹%
یک تن کاتد مس	۲,۲۷۱,۱۷۶,۰۰۰	۲۴۴,۳۰۲	۳۰۰,۴۶۷	۹,۲۹۷	۷,۵۵۹	۹,۵۹۷	۹۶/۹%	۷۸/۸%
یک تن پت شهید تندگویان	۲۸۷,۷۳۷,۴۷۹	۲۴۴,۳۰۲	۳۰۰,۴۶۷	۱,۱۷۸	۹۵۸	۱,۰۹۰	۱۰۸/۱%	۸۷/۹%
یک تن بیلت فخور	۱۲۸,۸۴۲,۰۰۰	۲۴۴,۳۰۲	۳۰۰,۴۶۷	۵۲۷	۴۲۹	۵۴۱	۹۷/۵%	۷۹/۳%
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۴,۷۵۱,۷۱۷	۲۴۴,۳۰۲	۳۰۰,۴۶۷	۱۹	۱۶	-	-	-

تحلیل تکنیکال بورس

حرکت به سمت سقف کانال نزولی

شاخص کل



- همان‌طور که انتظار می‌رفت، شاخص کل با رسیدن به محدوده بازگشتی (PRZ) مشخص شده (۱,۳۱۰,۰۰۰) الی (۱,۲۸۰,۰۰۰ واحد) تغییر روند داد و این محدوده را به کف قابل اتکایی برای شاخص کل تبدیل کرد و موفق به شکست خط روند نزولی خود شد.
- پس از ثبت ۴ کندل صعودی پیاپی، شاخص کل امروز به محدوده مقاومت استاتیک ۱,۳۹۰,۰۰۰ الی ۱,۴۰۰,۰۰۰ و سقف کانال نزولی رسید که می‌تواند موجب واکنش منفی از سوی شاخص در روزهای آینده شود.
- شکست کانال نزولی و تثبیت بر بالای میانگین متحرک ۱۰۰ روزه می‌تواند نویدبخش زمستانی صعودی برای بازار باشد، که در این صورت، موج صعودی قابل توجهی را می‌توان برای شاخص کل متصور شد.

❖ 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 سقف کانال نزولی

بیت کوین (BTCUSD)



- هفته گذشته بیت کوین در محدوده ۴۵,۶۰۰ دلار مورد حمایت قرار گرفت و حرکت صعودی را شروع کرد.
- بیت کوین در ابتدا موفق به شکست سقف کانال نزولی خود شد و سپس در ادامه از خط روند نزولی خود در تایم فریم روزانه نیز عبور کرد.
- اما باید توجه داشت که بیت کوین کماکان زیر میانگین متحرک ۱۰۰ روزه و خط روند صعودی شکسته شده خود در حال حرکت است و مادامی که در این وضعیت قرار دارد، نمی توان انتظار صعود قابل توجهی برای آن داشت.
- ۵۳الی ۵۴ هزار دلار محدوده مقاومتی مهمی برای بیت کوین محسوب می شود و احتمال می رود از ادامه روند صعودی بیت کوین در این موج جلوگیری کند.

❖ 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 کانال ها 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

صعود در کوتاه مدت

اونس طلا (XAUUSD)



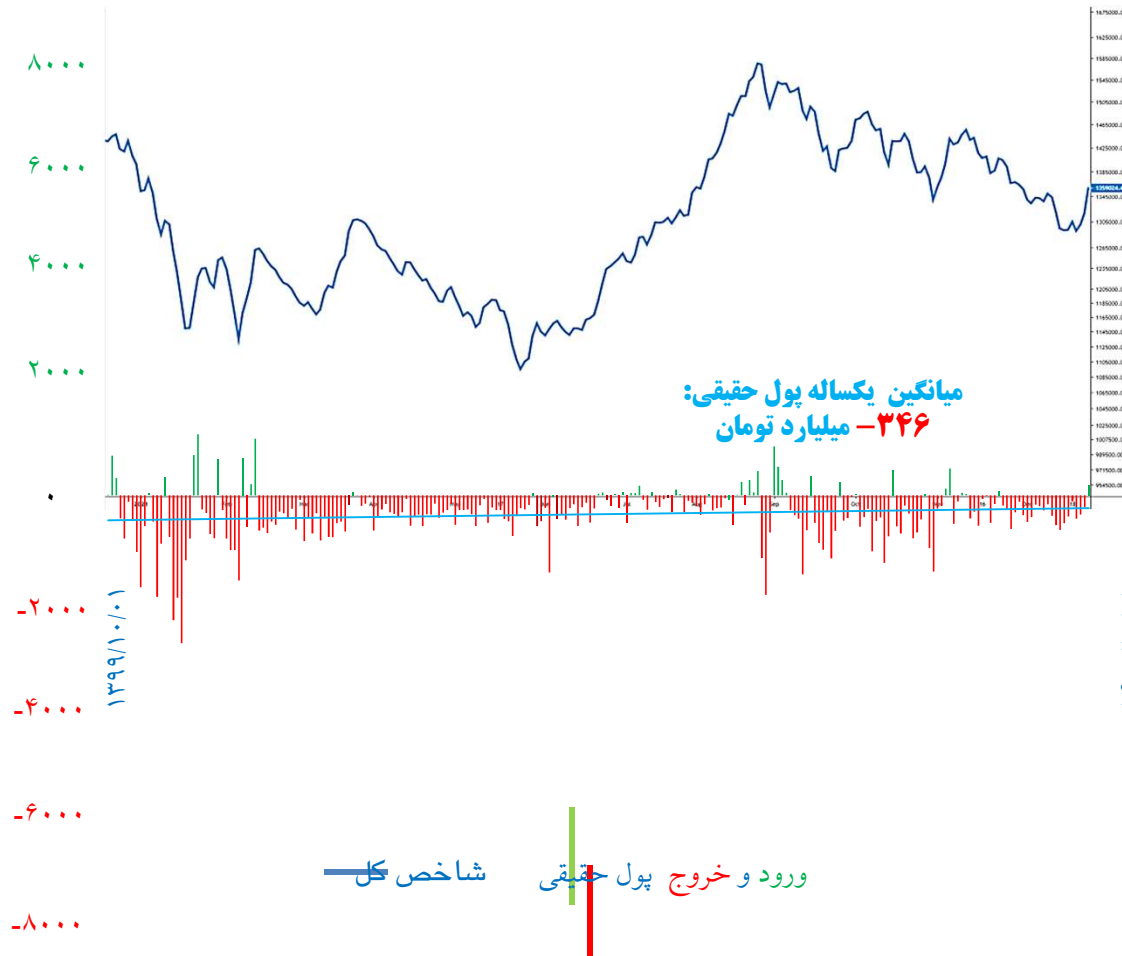
- اونس جهانی طلا هفته گذشته به کف قبلی خود در محدوده ۱,۷۶۰ دلار واکنش مناسبی نشان داد و شاهد بازگشت قیمت از آن محدوده بودیم.
- قیمت اونس طلا در حال حاضر در محدوده ۱,۸۰۸ دلار قرار گرفته و انتظار می‌رود روند صعودی طلا تا محدوده مقاومتی ۱,۸۳۰ دلار نیز ادامه پیدا کند. اما شکست خط روند نزولی میان مدت کماکان دور از دسترس به نظر 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.

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 ۱,۳۵۹,۰۱۱ واحدی و بازده هفتگی ۵/۰۸+ درصد بسته شد.
- برآیند هفتگی، حاکی از خروج ۹۲۳ میلیارد تومان پول حقیقی از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۰، نشان‌دهنده خروج ۵۲,۳۴۰ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۹۱ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.
- میانگین روزانه خالص پول حقیقی به کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹ تا چهارشنبه یکم دی ۱۴۰۰ به ما خروج یک 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 -۳۴۶ میلیارد تومان افول کرده است.

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

شنبه	۱۴۰۰/۰۹/۲۷	۱۰۸ - میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۰۹/۲۸	۴۲۹ - میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	۳۵۴ - میلیارد تومان
سه‌شنبه	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۲۱۹ - میلیارد تومان
چهارشنبه	۱۴۰۰/۱۰/۰۱	۱۸۶ + میلیارد تومان

ارزش دلاری شاخص کل

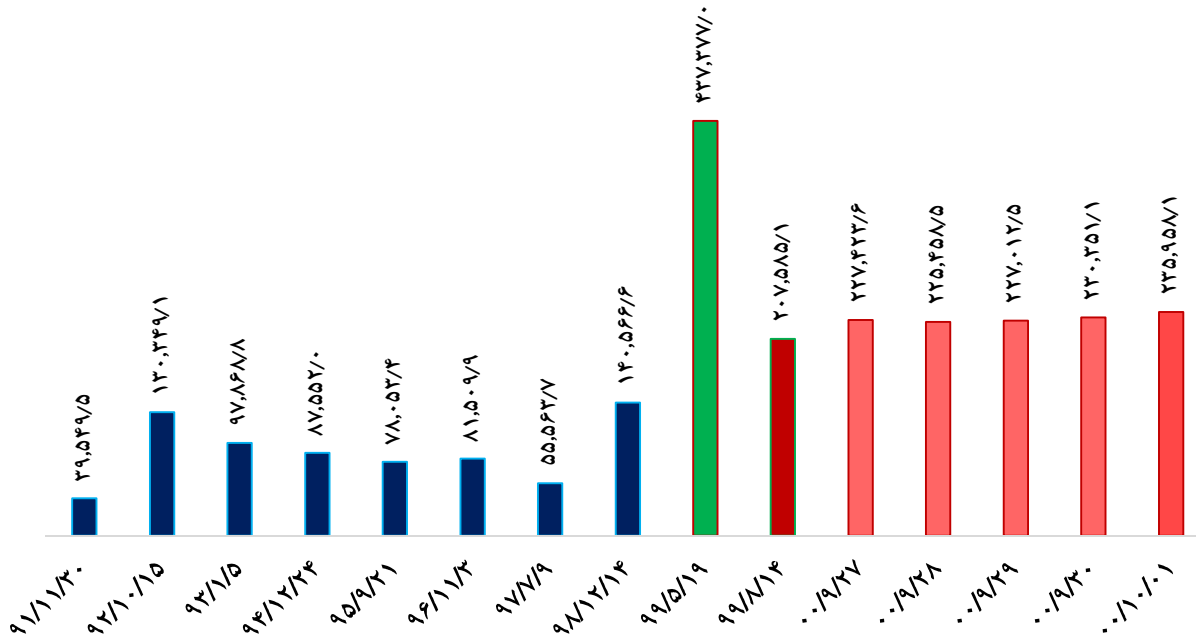
نمودار ارزش دلاری قله‌های شاخص کل طی سال‌های ۹۱-۱۴۰۰ (میلیون دلار)

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۳۶ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله یکساله معادل ۴۶ 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 ۱۲۲ درصد محاسبه می‌شود.

گفتنی است که این شاخص برای آمریکا در تاریخ ۲۴ دسامبر سال ۲۰۲۱ با توجه به ارزش ۵۰/۲ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۳/۶ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۲۱۳ 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	۵.۸۵	۱,۸۹۵	۱۱,۰۹۰	۳.۵۱	۳,۱۶۳	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۷۹%
وبانک	۵.۵۷	۱,۵۵۱	۸,۶۴۰	۵.۰۱	۱,۷۲۴	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۶%
وصندوق	۶.۰۵	۲,۰۹۲	۱۲,۶۵۰	۳.۶۹	۳,۴۲۴	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۷۱%
وامید	۱۱.۸۶	۱,۱۸۰	۱۴,۰۰۰	۱۱.۲۰	۱,۲۵۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۸%
وغدیر	۱۲.۶۷	۱,۲۱۲	۱۵,۳۵۰	۷.۰۹	۲,۱۶۵	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۸۳%
ونیکی	۵.۸۰	۱,۶۵۳	۹,۵۸۰	-	-	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	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، رکسانا ثابت‌قدم، رضا جعفری، عبدالکریم جهاندار و بردیا وکیلی

راهبری و نظارت بر محتوا:
احسان برین