



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

تلاش بازار سرمایه برای خروج از روند نزولی

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۱۹ - هفته منتهی به ۵ شهریور ۱۴۰۱
گروه تحلیل گران شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.ir

eii.co.ir

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی: اثر سخنرانی رییس فدرال رزرو بر بازارهای سهام؛
- تصویر اقتصاد کلان: بهبود ۰/۱ واحد درصدی نرخ بیکاری در چین؛
- اقتصاد کلان: تورم - مرکز آمار نرخ تورم نقطه‌به‌نقطه امرداد ۱۴۰۱ را معادل ۵۲/۲ درصد اعلام کرد؛
- بورس و انرژی: نوسانات نامتقارن بازارهای سهام و انرژی؛
- فلزات گرانبها و ارز: سایه اظهارات رییس فدرال رزرو بر سر طلا و بیت‌کوین؛
- بازار کالاهای خام: رشد سراسری محصولات کشاورزی؛
- بررسی وضعیت صندوق‌ها؛
- بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - رسیدن به سقف کانال نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - حرکت نزولی به سمت کف قبلی؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - تداوم روند نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - شاخص دلار در مسیر صعود؛
- 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.

- رالی تابستانی بازارهای سهام رسماً پایان یافته است.
- هشدارهای کاهش قیمت برای بازار املاک انگلیس به صدا درآمده است.
- بانک مرکزی اروپا هنوز روی افزایش ۰/۷۵ درصدی نرخ بهره به توافق نرسیده است.
- چین و آمریکا به قراردادی مهم در راستای مجوز فعالیت شرکت‌های حساسی آمریکا در چین و بررسی شرکت‌های این کشور توسط این موسسه‌ها برای جلوگیری از تعلیق یا اخراج نماد شرکت‌های چینی در بورس آمریکا دست یافتند.
- با افزایش قیمت خانه در شهرهای خوش‌آب‌وهوای آمریکا، مردم این کشور برای خرید خانه دوم به کشور مکزیک روی آورده‌اند.
- فولکس واگن بدنال ساختن کامیون‌های برقی برای حمل الوار در جنگل‌های شمالی اروپا و آمریکا است.
- قلیل‌ترین میزان برداشت ذرت تاریخ آمریکا، هشدار قیمت‌های بالاتر مواد غذایی در ماه‌های آتی را می‌دهد.
- ارزش واقعی بازار رمزارزها هیچ‌گاه ۳ تریلیون دلار نبوده است.
- کاهش ذخیره بنزین ایالات شرق آمریکا به حدی رسید که کاخ سفید رسماً در این باره هشدار داد.
- صندوق قابل معامله حوزه انرژی UNG امسال ۱۵۰ درصد به‌ازای هر یونیت سود تقسیم کرد!
- برنده رقابت کاندیداهای آتی نخست‌وزیری انگلیس را برنامه آنها برای تأمین انرژی سال آتی این کشور مشخص می‌کند.

- مردم بریتانیا به دولت این کشور در پی افزایش ۸۰-۱۰۰ درصدی هزینه انرژی و عدم واکنش دولت به آن اعتراض کردند.
- تأمین انرژی اروپا در زمستان پیش رو بسیار سخت خواهد بود.
- برنامه بایدن برای کاهش بدهی دانشجویان برای آینده سیاست آمریکا مضر است.
- بزرگترین پلتفرم مدیریت پسموردهای جهان هک شده است!
- رومن آبراموویچ، میلیارد روس، نیز برای سکونت و فعالیت اقتصادی به دوبی پناه آورده است.
- منابع آبی، رودخانه‌ها و کانال‌های جهان در حال تبدیل شدن به بستر خاکی خشک هستند.
- هشدار نشت مواد رادیواکتیو در اوکراین به درجه بالاتری ارتقاء پیدا کرد.
- با فرا رسیدن موج جدید گرما، بخش‌هایی از اروپا دچار خاموشی شدند.
- جنون جدید استخراج رمزارزها در تگزاس می‌تواند به اندازه کل ایالت نیویورک برق مصرف کند.
- بیت‌کوین برای دومین هفته متوالی منفی بود.
- تأثیر روانی تغییرات جدید پلتفرم اتریوم روی بازار رمزارزها در حال ناپدید شدن است.
- سنگاپور تحقیقات و نظارت بر فعالیت رمزارزی شرکت‌های مالی را جدی‌تر کرد.

- ژروم پاول، رئیس فدرال رزرو، به‌صورت رسمی خبر از تداوم بالا ماندن نرخ بهره برای مدت زیاد داد. او در سخنرانی خود گفت: «کم کردن تورم، قطعاً بیکاری و رکود و رنج را برای مردم به همراه خواهد داشت و مردم آمریکا و جهان باید برای تحمل این مسائل آماده باشند».
- اولین اقتصاددانی که روند افزایشی تورم در سال گذشته را پیش از شروع آن پیش‌بینی کرده بود، گفت فدرال رزرو باید روند توقف افزایش نرخ بهره را شروع کند.
- هنوز هم عده‌ای از فعالان وال استریت برای ورود به حوزه رمزارزها از شغل خود استعفا می‌دهند.
- موکش آمبانی، میلیارد هندی (مالک شرکت ریلاینس)، با تقویت حضورش در دوبی گران‌ترین خانه شهر را خریداری کرد.
- شواهد حاصله از بازرسی خانه ترامپ توسط FBI نشان می‌دهد که او پروتکل‌های مربوط به طبقه‌بندی و حفاظت اطلاعات را به هیچ عنوان رعایت نمی‌کرده است.
- ترکیه، سوئد و فنلاند بر سر عضویت این دو کشور اسکاندیناوی در ناتو مذاکرات بیشتری در پیش دارند.
- پورشه برای عرضه اولیه در بازار آمریکا ۸۵ میلیارد دلار ارزشگذاری شد (به اندازه تمام گروه فولکس واگن، مالک این شرکت)!
- واکسن‌های کرونای مدرنا و فایزر، تنها بخش کوچکی از پتانسیل واکسن‌های mRNA برای مهار بیماری‌هاست.
- گروه زنان سازمان ملل همکاری خود با بزرگترین شرکت مدیریت سرمایه جهان «بلک راک» را بدلیل تناقض ارزش‌ها پایان داد.
- شاخص S&P 500 بدترین روز خود در ۴ ماه گذشته را پشت سر گذاشت.
- فعالان وال استریت به برنامه ۲۰۲۳ فدرال رزرو اعتراض دارند.
- دوبی مرکز جدید فعالیت صندوق‌های پوشش ریسک است.

حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی

فایننشال تایمز



اثر سخنرانی رییس فدرال رزرو بر بازارهای سهام

اشاره

طی هفته اخیر مهمترین خبر بازارهای مالی مربوط به سخنرانی ژروم پاول، رییس فدرال رزرو، بود که در آن از استمرار سیاست افزایش نرخ بهره تا رسیدن به هدف کاهش نرخ تورم و سختی‌های این مسیر سخن گفت. همچنین بحران گرما در اروپا و خاموشی بخش‌هایی از این قاره، خبر مهم دیگر هفته اخیر بود.

جذاب شدن مجدد بازار رمزارزها و استعفا و ورود فعالان وال استریت به این بازار در کنار افزایش استخراج رمزارز در تگزاس و نگرانی از مصرف برق زیاد از این محل، خبر مهم دیگر بود.

مذاکرات ترکیه، سوئد و فنلاند برای پیوستن این دو کشور اسکاندیناوی به ناتو خبر دیگر بود.

درنهایت ارزشگذاری ۸۵ میلیارد دلاری پورشه برای ورود به بازار سهام آمریکا خبری بود که توجهات را به سوی خود جلب کرد.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

بلومبرگ
Bloomberg

۶۰۵,۱۳۰,۵۶۵	+۰,۸۵%
جان باختگان ۶,۴۸۶,۰۶۵	+۰,۲۵%
بهبودیافتگان	+۱,۰۵%

تصویر اقتصاد کلان

بهبود ۰/۱ واحد درصدی نرخ بیکاری در چین

نرخ بهره (درصد)	فصل	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین سالیانه			درآمد سرانه (دلار)	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	حوزه جغرافیایی
		نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ رشد اقتصادی- قیمت ثابت (درصد)			
جهان									
-	-	-	-	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	جولای-۲۲	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
%۲/۵	-%۰/۶	%۸/۵	%۳/۵	%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-جولای	ژوئن-۲۲	جولای-۲۲	ژوئن-۲۲	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۱۹	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۰/۵	%۰/۶	%۸/۹	%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	تیر ۱۴۰۱	بهار ۱۴۰۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۱۴۰۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۱۸	%۲/۳	%۵۴	%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	ماه‌بانه	هفتگی	بازار
۹/۶۸%	۱۱/۹۴%	-۸/۱۴%	-۱/۵۸%	دلار (ریالی)
۱۴/۲۱%	۱۲/۵۸%	-۵/۹۴%	۱/۵۹%	سکه (ریالی)
-۶/۵۵%	۴/۹۶%	۰/۲۱%	-۰/۶۲%	بورس (شاخص)
-۵۲/۰۸%	-۴۷/۹۳%	-۷/۷۴%	-۵/۸۲%	ارزش بازار رمزارزها (دلاری)
۳۸/۸%	-	۵/۸%	-	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:

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

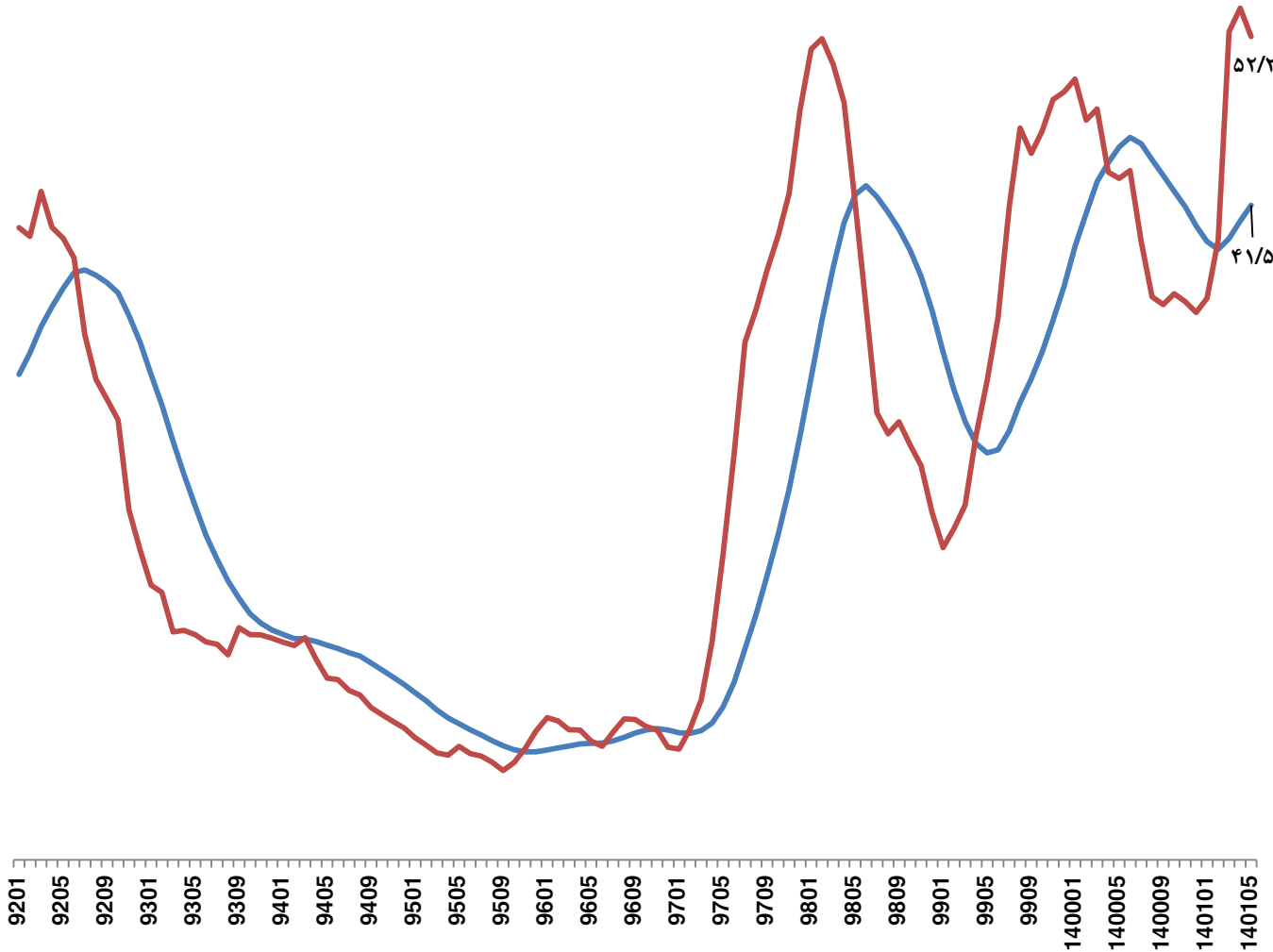
نرخ تورم ایران

نقطه به نقطه — ۱۲ ماهه

اقتصاد کلان

تورم

مرکز آمار نرخ تورم نقطه به نقطه امرداد ۱۴۰۱ را معادل **۵۲/۲ درصد اعلام کرد!**



مرکز آمار ایران نرخ تورم تیر ۱۴۰۱ را اعلام کرد. بر این اساس، نرخ تورم نقطه به نقطه با کاهش ۱/۸ واحد درصدی در ماه امرداد نسبت به تیر ۱۴۰۱، به ۵۲/۲ درصد رسید. نرخ تورم میانگین سالیانه نیز با افزایش ۱ واحد درصدی نسبت به ماه قبل به عدد ۴۱/۵ درصد رسید. نرخ تورم ماهانه شاخص کل قیمت کالاها و خدمات مصرفی خانوارهای کل کشور در ماه امرداد نسبت به تیر ۱۴۰۱ با کاهش ۲/۶ واحد درصدی به ۲ درصد رسیده است. در این بین، بیشترین نرخ تورم ماهانه در بین گروه‌های کالایی مربوط به گروه بهداشت و درمان با نرخ تورم ماهیانه ۳/۶ درصد و کمترین آن مربوط به گروه کالایی گوشت قرمز و گوشت ماکیان با نرخ تورم ۰/۶- درصد بوده است.



ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
------	-------	------------	-------	-------------	--------------	--------------

بورس و انرژی

نوسانات نامتقارن بازارهای سهام و انرژی

بورس های جهانی

سخنرانی شدیدالحن رئیس فدرال رزرو و تأکید او روی بالا ماندن نرخ بهره، خود را در نزول بورس های غربی در هفته اخیر نشان داد. بسیاری از کارشناسان با تضعیف روند صعودی در هفته های اخیر نسبت به این موضوع هشدار می دادند، اما مواضع دولت آمریکا ضربه های محکم به روند کم توان بازارها بود. روز پایانی هفته اخیر بدترین روز S&P 500 در ۴ ماه اخیر و هفته گذشته یکی از بدترین هفته های ۶ ماه اخیر برای بازارها بود. در اروپا نیز عدم تصمیم قطعی بانک مرکزی اروپا روی افزایش نرخ بهره و پایین آمدن تولیدات کارخانه ها و مجموعه های صنعتی بدلیل قیمت افسارگسیخته برق دست به دست هم دادند تا شاخص های اصلی این قاره نیز در این هفته قرمز رنگ باشند.

نفت و محصولات پتروشیمی

بازار نفت متأثر از خبرهای حول محور مذاکرات ایران، ۴+۱ و آمریکا و در انتظار حصول توافق و بازگشت نفت ایران به بازار این هفته را نزولی آغاز کرد. کارشناسان نیز با ارائه تخمین های متعدد از میزان نفتی که ایران در صورت بازگشت به بازار می تواند عرضه کند و افزایش تولید احتمالی ایران و انتشار مقالاتی با این موضوع به جو روانی کاهشی بازار دامن زدند. اواسط هفته با خبر پاسخ آمریکا به درخواست های ایران و پیش از معلوم شدن محتوای پاسخ، شوک منفی شدیدی به نفت وارد شد و قیمت نفت خام را به کانال ۸۰ دلار بازگرداند، که روز بعد با اخبار مربوط به عدم پذیرش خواسته های جدید ایران از سوی آمریکا، بازار بار دیگر صعودی شد. در این بین اوپک پلاس نیز با اعلام این موضوع که در صورت احیای برجام و بازگشت نفت ایران به بازار از تولید روزانه خود می کاهد، امیدها به افزایش معنی دار عرضه در بازار را کمرنگ تر کرد. انتشار گزارش هفتگی وزارت انرژی آمریکا مبنی بر کاهش ذخائر و کاهش تولید این کشور در روز چهارشنبه دلیل دیگر افزایش قیمت نفت وست تگزاس تا ۹۵ دلار و نفت برنت تا ۱۰۲ دلار بود. در پایان هفته با آرام تر شدن بازارها و منطقی شدن روند، قیمت نفت خام WTI به پایین ۹۳ دلار و برنت به کمتر از ۱۰۱ دلار افت کرد. در همین حال شاهد افزایش قیمت برق در اروپا تا میانگین ۶۵۰ یورو بر مگاوات ساعت و حداکثر بیش از ۱,۰۰۰ یورو برای هر مگاوات ساعت در بعضی کشورها بودیم. این قیمت برای برق معادل قیمت انرژی با نفت بشکه ای مثبت ۱,۰۰۰ دلار است. قیمت گاز در هاب های اروپایی در بالاترین میزان تاریخ خود قرار دارد و عملاً از کنترل خارج شده است! قیمت گاز طبیعی در هاب هلند هم اکنون بیش از ۴ برابر بالاترین قیمت ۲۰۲۱ است. کاهش عرضه کود شیمیایی و افزایش تقاضا در بازار نیز موجب افزایش بیش از ۱۲ درصدی اوره گرانول فوب خلیج فارس طی این هفته شد.

بورس های جهانی

۱	Dow Jones	۳۲,۲۸۷	واحد	-۴.۲۱%	۱.۶۵%	-۸.۳۱%
۲	Nasdaq	۱۲,۶۰۵	واحد	-۴.۸۲%	۴.۲۹%	-۱۷.۵۰%
۳	S&P 500	۴,۰۵۸	واحد	-۳.۹۹%	۲.۵۴%	-۹.۴۹%
۴	FTSE 100	۷,۳۹۹	واحد	-۱.۹۸%	۱.۲۶%	-۳.۸۴%
۵	DAX	۱۲,۹۷۱	واحد	-۴.۲۳%	-۰.۹۶%	-۱۷.۸۷%
۶	CAC 40	۶,۲۷۴	واحد	-۳.۴۱%	۱.۰۱%	-۵.۸۸%
۷	NIKKEI 225	۲۸,۶۴۱	واحد	-۱.۰۰%	۳.۵۷%	-۳.۲۴%
۸	SHANGHAI	۳,۲۳۶	واحد	-۰.۶۷%	۱.۲۶%	-۷.۵۸%
۹	Moex	۲,۲۶۹	واحد	-۳.۳۶%	۳.۳۱%	-۴۱.۶۳%

نفت و انرژی

۱۰	نفت خام برنت	۱۰۰,۷۴	دلار/بشکه	۱.۱۶%	-۵.۵۱%	-۳۸.۵۷%
۱۱	نفت خام WTI	۹۲,۹۵	دلار/بشکه	۲.۷۸%	-۲.۴۵%	-۳۵.۲۳%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۹,۳۳	دلار/MM Btu	۰.۰۴%	۷.۵۱%	-۱۱۲.۸۴%
۱۳	سبب اوپک	۱۰۴,۶۳	دلار/بشکه	۶.۱۳%	-۵.۹۷%	-۳۲.۴۰%
۱۴	نفت سنگین ایران	۹۷,۵۷	دلار/بشکه	۶.۸۲%	-۵.۵۷%	-۵۹.۸۵%
۱۵	گازوئیل	۱,۱۹۰	دلار/تن	۹.۱۲%	-۱۰.۳۴%	-۱۰۵.۸۸%
۱۶	اتانول	۲,۵۵	دلار/گالن	۰.۵۹%	۱.۳۹%	-۱۳.۰۸%
۱۷	نفتا	۶۵۷,۲۳	دلار/تن	-۱.۴۴%	-۱۴.۰۷%	-۱.۷۶%
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۵۸۰	یوان/تن	-۰.۱۲%	۰.۶۹%	-۴.۴۰%
۱۹	متانول CFR	۳۱۱	دلار/تن	۲.۵۷%	۱.۹۳%	-۲.۸۹%
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۶۳۰,۵	دلار/تن	۱۲.۴۹%	۱۹.۴۹%	۵۱.۵۶%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۱۱۸۰	دلار/تن	۰.۰۰%	-۱.۶۹%	-۱۵.۲۵%

فلزات گرانبها و ارز

سایه اظهارات رییس فدرال رزرو

بر سر طلا و بیت‌کوین

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۷۳۸	دلار/اونس	-۰.۵۳%	-۰.۰۴%	-۴.۳۷%	TeleTrader
۲	نقره	۱۸.۸۹	دلار/اونس	-۰.۸۹%	-۱.۳۶%	-۲۱.۳۳%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۳ شهریور							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۲,۸۴۵,۰۰۰	ریال	۰.۷۴%	-۴.۵۵%	۹.۶۱%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۳۹,۳۱۰,۰۰۰	ریال	۱.۵۹%	-۵.۷۸%	۱۴.۵۵%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۳ شهریور							
۵	دلار آزاد	۲۹۳,۵۰۰	ریال	-۱.۵۸%	-۸.۱۴%	۹.۶۸%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۶۳,۶۱۰	ریال	۰.۱۶%	۰.۵۶%	۱۵.۱۵%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۶۶,۰۰۵	ریال	۰.۱۶%	۰.۵۶%	۱۵.۱۵%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۲۹۷,۰۰۰	ریال	-۱.۸۳%	-۸.۸۸%	-۶.۲۶%	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۲,۷۴۳	ریال	-۱.۷۸%	-۱.۸۲%	-۲.۳۹%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۶۵,۱۳۰	ریال	-۱.۷۸%	-۱.۸۲%	-۲.۳۹%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۵,۱۳۷	ریال	-۲.۹۷%	-۲.۰۷%	۳.۹۳%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۱,۷۸۰	ریال	۰.۱۶%	۰.۵۶%	۱۵.۱۶%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۷۲,۴۳۲	ریال	۰.۱۶%	۰.۵۶%	۱۵.۱۵%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت‌کوین	۲۰,۲۰۵	دلار	-۲.۸۶%	-۱۵.۸۷%	-۵۸.۶۵%	Tradingview
۱۵	اتریوم	۱,۴۹۶	دلار	-۲.۰۳%	-۱۴.۵۳%	-۵۳.۷۶%	Tradingview

بازار فلزات گرانبها

طی هفته اخیر اونس جهانی طلا کار خود را با نوسانات مثبت آغاز کرد و تا اواخر هفته با رشد ۱/۱۲ درصدی، به ۱,۷۶۵ دلار نیز دست یافت. اما با برگزاری سمپوزیوم اقتصادی جکسون هول (Jackson Hole) در روز جمعه (۲۶ آگوست) و آغاز سخنرانی ۸ دقیقه‌ای ژروم پاول، رییس بانک مرکزی آمریکا، طلا دچار ریزش شد و بازدهی طول هفته خود را پس گرفت. پاول در این جلسه احتمال افزایش شدیدتر نرخ بهره بمنظور کنترل تورم در جلسه آتی را مطرح کرد، که همین موضوع سبب تقویت شاخص دلار و ریزش طلا شد.

سکه و ارز (داخلی)

هفته گذشته با توجه به سیگنال‌های مثبت و منفی منتشر شده حول مسأله برجام، بازار سکه و ارز نوسانی بوده که انتظار می‌رود تا نهایی شدن نتیجه قطعی مذاکرات، همچنان شاهد تداوم یافتن این نوسانات باشیم.

رمزارز

ژروم پاول، رئیس فدرال رزرو، طی سخنرانی خود در نشست اقتصادی جکسون هول، پیش‌بینی کرد اعمال سیاست‌های پولی سختگیرانه احتمالاً برای مدتی مورد نیاز خواهد بود. آقای پاول همچنین عنوان کرد: «ثبات مجدد قیمت‌ها برای مدتی زمان خواهد برد و این نیازمند بکارگیری ابزارهای ما است تا تقاضا و عرضه را به تعادل بهتری برسانیم». در پی این اظهارات، بزرگترین رمزارز جهان کف حمایتی خود را از دست داد و افت ۶ درصدی را تجربه کرد که در پی آن شاهد لیکوئید شدن ۷۱,۷۲۶ معامله‌گر با مجموع ارزشی ۲۳۷/۰۷ میلیون دلار پوزیشن خرید بودیم.

کاهش ارزش این رمزارز بدان معنی بود که بازارها برای اظهارات سختگیرانه و تند ژروم پاول آماده نبودند. شایان ذکر است که بدنبال این ریزش‌ها، ارزش کل بازار کریپتو نیز مجدداً به زیر ۱ تریلیون دلار، یعنی عدد ۹۵۱ میلیارد دلار، نزول کرد.

بازار کالاهای خام

رشد سراسری محصولات کشاورزی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه
محصولات کشاورزی						
۱	ذرت	۶۶۵	سنت / بوشل	۲۶۲	دلار/تن	۲۹.۲۵٪
۲	کتان (پنبه)	۱۱۷.۸۴	سنت / پوند	۲۵۹۸	دلار/تن	۴۰.۵۵٪
۳	سویا	۱.۴۶۴.۷۵	سنت / بوشل	۵۳۸	دلار/تن	۱۵.۵۸٪
۴	شکر	۱۸.۴۶	سنت / پوند	۴۰۷	دلار/تن	۰.۲۲-٪
۵	گندم	۷۹۰.۰۰	سنت / بوشل	۲۹۰	دلار/تن	۹.۷۶٪
۶	کانولا	۸۵۵.۸۰	دلار کانادا/تن	۶۷۶	دلار/تن	۶.۲۳-٪
کالاهای صنعتی						
۷	مس	۸۱۲۹	دلار/تن			۱۲.۵۸-٪
۸	قیر	۴.۲۴۴	یوان/تن	۶۷۹	دلار/تن	۳۶.۶۴٪
۹	فولاد	۴۰۰۷۶	یوان/تن	۶۵۲	دلار/تن	۱۹.۶۷-٪
۱۰	آلومینیوم	۲.۴۹۰	دلار/تن			۶.۱۸-٪
۱۱	سرب	۲۰.۰۰۰	دلار/تن			۱۲.۵۳-٪
۱۲	روی	۳.۵۵۸	دلار/تن			۱۹.۱۰٪
۱۳	سنگ آهن	۱۰۸.۵۰	دلار/تن			۳۰.۰۰-٪
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۵۲۱	دلار/تن			۱۹.۴۷-٪
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بنادر ایران)	۴۵۹	دلار/تن			۲۵.۳۷-٪
شاخص‌های کالایی						
۱۶	بالتیک خشک	۱.۰۸۲	واحد			۱۵.۴۰-٪
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۲۰	واحد			۳۷.۴۷٪
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۳.۸۷۱	واحد			۸.۵۵-٪
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳.۷۹۱	واحد			۴۶.۵۷٪

بازار محصولات کشاورزی

طی هفته اخیر شاهد نوسانات مثبت در بازار محصولات کشاورزی بودیم، که در رأس آنها بازار ذرت با رشد ۶/۴ درصد هفتگی بود.

علت اصلی رشد محسوس نرخ ذرت در بازارهای جهانی، ترس ناشی از کمبود عرضه در اثر انتشار گزارش USDA درخصوص حادث شدن وضعیت برداشت ذرت در غرب میانه و زمین‌های زراعی در دشت‌ها بود.

نرخ گندم نیز با بازدهی مثبت ۴/۶۴ درصدی طی یک هفته همراه شد. علت اصلی افزایش نرخ گندم نیز به نگرانی از وضعیت آب‌وهوایی در مناطق زیر کشت در آمریکا بازمی‌گردد که باعث بیم کمبود عرضه شده است.

بازار کالاهای صنعتی

قیمت سنگ‌آهن طی هفته اخیر صعودی بوده که مرتبط با امید به رشد تولید فولادسازان چین و رشد و تقاضای سنگ‌آهن است. قطعی برق در سیچوان چین بیش از ۷۰ درصد کارخانه‌های فولاد محلی را تحت تأثیر قرار داده است، چه از طریق توقف تولید یا جیره‌بندی. این امر بر قیمت سنگ‌آهنی که برای تولید فولاد استفاده می‌شود، فشار می‌آورد. تولید فولاد ممکن است در کوتاه‌مدت تحت فشار بیشتری قرار گیرد زیرا چین با موج گرما دست‌وپنجه نرم می‌کند که باعث کمبود برق شده و مقامات را مجبور به اعمال قطعی‌های برق کرده است. می‌توان گفت که بازار جهانی سنگ‌آهن بین این واقعیت‌ها گیر افتاده است که تولید فولاد چین ضعیف است، آمار اقتصادی مطلوب نیست و هزینه تأمین انرژی بالاست. همچنین موجودی بازار فولاد نیز صعودی است و اینکه در ادامه سال ۲۰۲۲ و سال آینده همه این فاکتورها کم‌رنگ می‌شوند چون تقاضای صعودی خواهد بود. همچنین NDRC (شورای برنامه‌ریزی چین) نیز گفته است که قیمت‌های ادامه سال ۲۰۲۲ و نیمه اول ۲۰۲۳، بدلیل محدودیت‌های کرونایی و برنامه‌های توسعه زیرساختی دولت، بالاتر از گذشته خواهد بود.

بحران برق و انرژی در اروپا باعث تعطیلی برخی صنایع انرژی‌بر، از جمله روی، شده و پرمیوم این فلز در این قاره در حال ثبت رکورد قیمت‌های باورنکردنی است.

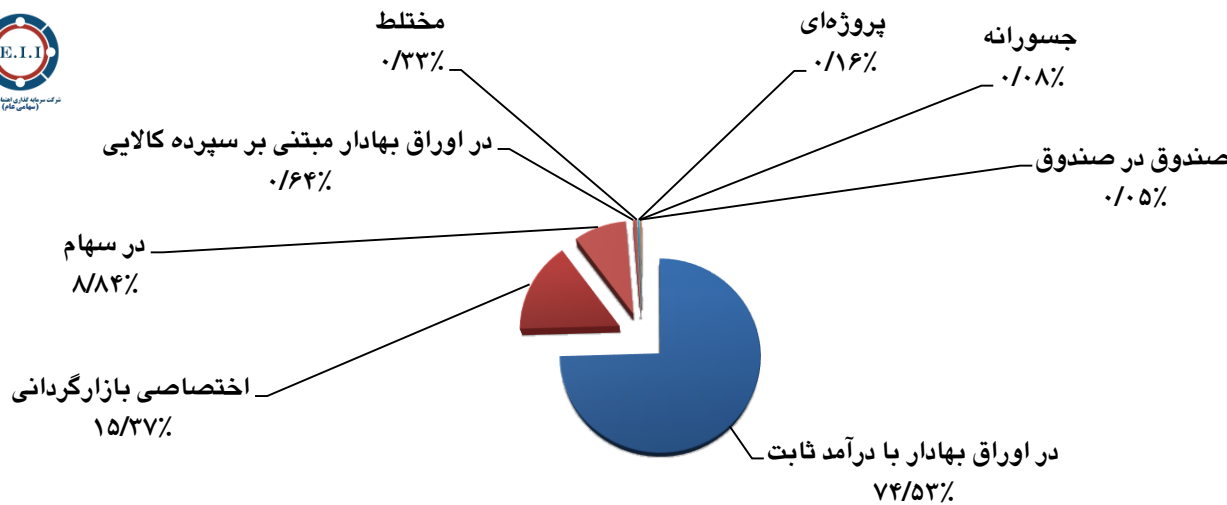
شاخص‌های کالایی

پیش‌بینی می‌شود شاخص بالتیک خشک همچنان روند نزولی خود را ادامه دهد. نرخ کرایه حمل دریایی نیز در هفته گذشته نزولی بود.

بررسی وضعیت صندوق‌ها

در هفته منتهی به شنبه ۵ شهریور ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت، خصوصی، جسورانه، مختلط، پروژه‌ای، در سهام، اختصاصی بازارگردانی و صندوق‌درصندوق مثبت، بازدهی صندوق‌های مبتنی بر سپرده کالایی منفی و بازدهی صندوق‌های پروژه‌ای صفر بود.

درعین‌حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های اختصاصی بازارگردانی با ۰/۷۸ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های اوراق مبتنی بر سپرده کالایی با ۲/۲۹- درصد بود. از سوی دیگر به‌ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۴/۵۳ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۵/۳۷ درصد و سهامی با ۸/۸۴ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.



نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی های نقدی (%)	میانگین بازدهی هفتگی (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی 3 ماهه (%)	میانگین بازدهی 6 ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
صندوق در صندوق	۳,۳۸۹/۴۹	۰/۰۰٪	۰/۳۵٪	۱/۴۸٪	۳/۱۲٪-	۸/۹۵٪	۴/۲۹٪
خصوصی	۱,۶۱۸/۶۲	۰/۰۱٪	۰/۱۱٪	۰/۴۳٪	۱/۳۳٪	۲/۹۲٪	۵/۳۱٪
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۹۳۴,۹۳۵/۶۵	۰/۱۱٪	۰/۴۰٪	۱/۶۷٪	۴/۳۳٪	۹/۰۵٪	۱۴/۸۴٪
اختصاصی بازارگردانی	۱,۰۱۷,۴۳۳/۹۰	۲/۰۱٪	۰/۷۸٪	۳/۱۲٪	۵/۴۴٪-	۱۴/۸۸٪	۵/۷۵٪-
در سهام	۵۸۵,۴۷۶/۱۶	۰/۱۹٪	۰/۶۰٪	۲/۵۷٪	۵/۶۱٪-	۱۴/۸۴٪	۶/۰۴٪-
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۴۲,۰۸۸/۰۵	۰/۰۱٪	۲/۲۹٪-	۱۰/۰۰٪-	۷/۳۰٪-	۱۱/۸۱٪	۲۱/۷۸٪
مختلط	۲۲,۱۱۲/۸۷	۰/۰۳٪	۰/۴۷٪	۱/۹۸٪	۱/۷۳٪-	۷/۴۴٪	۱/۰۸٪-
پروژه‌ای	۱۰,۵۷۶/۱۸	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪
جسورانه	۵,۰۳۳/۸۶	۰/۹۷٪	۰/۱۳٪	۱۸/۰۰٪	۱۸/۲۷٪	۰/۹۶٪	۲۲/۴۵٪
جمع کل	۶,۶۲۲,۶۶۵						

بررسی وضعیت بازار بدهی

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

بازدهی ساده	YTM	تاریخ سررسید	تاریخ آخرین روز معاملاتی	قیمت معامله شده هر سهم	شماره
۲۰.۳۰٪	۲۲.۸۸٪	۱۴۰۳-۱۱-۰۱	۱۴۰۱-۰۶-۰۵	۶۰۹۵۰۰	اخزا ۰۰۹
۲۶.۶۶٪	۲۰.۶۹٪	۱۴۰۲-۰۳-۲۱	۱۴۰۱-۰۵-۳۱	۸۵۹۸۹۰	اخزا ۹۰۶
۲۶.۶۴٪	۲۰.۲۵٪	۱۴۰۲-۱۰-۲۵	۱۴۰۱-۰۶-۰۵	۷۷۴۳۹۰	اخزا ۹۱۴
۱۹.۵۸٪	۲۲.۸۲٪	۱۴۰۳-۰۹-۱۹	۱۴۰۱-۰۶-۰۵	۶۲۴۸۶۰	اخزا ۰۰۸
۲۳.۱۷٪	۲۲.۱۷٪				میانگین بازدهی

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 به ترتیب متعلق به نمادهای اخزا ۰۰۹ و اخزا ۹۰۶ با سررسیدهای ۱۴۰۳/۱۱/۰۱ و ۱۴۰۲/۰۳/۲۱ و بازدهی‌های ۲۲/۸۸ و ۲۶/۶۶ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نمادهای اخزا ۹۱۴ و اخزا ۰۰۸ با سررسیدهای ۱۴۰۲/۱۰/۲۵ و ۱۴۰۳/۰۹/۱۹ و بازدهی‌های ۲۰/۲۵ و ۱۹/۵۸ درصد بود.

از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۲/۱۷ و ۲۳/۱۷ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

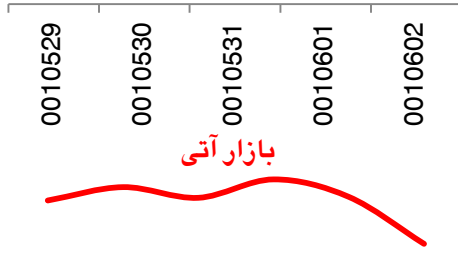
بازدهی ساده	YTM	تاریخ سررسید	تاریخ آخرین روز معاملاتی	قیمت معامله شده هر سهم	شماره
۴۵.۳۴٪		۱۴۰۲-۰۵-۰۵	۱۴۰۱-۰۵-۲۹	۸۳۳۵۰۰	افاد ۸۳
۱۷.۱۴٪		۱۴۰۱-۰۷-۲۱	۱۴۰۱-۰۵-۳۱	۱۰۰۰۰۰۰	اراد ۴۵

منبع: فرابورس ایران

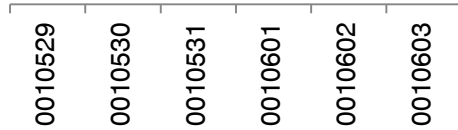
اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد اراد ۴۵ بمیزان ۱۷/۱۴ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۰۷/۲۱ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد افاد ۸۳ بمیزان ۴۵/۳۴ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۵/۰۵ بوده است.

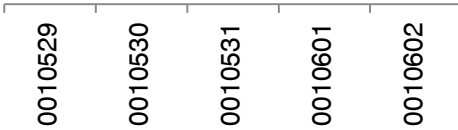
بازار فیزیکی



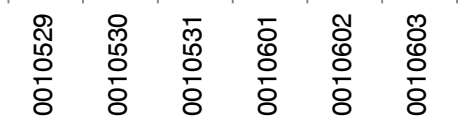
بازار آتی



بازار مالی
(سلف، صندوق و موازی)



بازار اختیار معامله

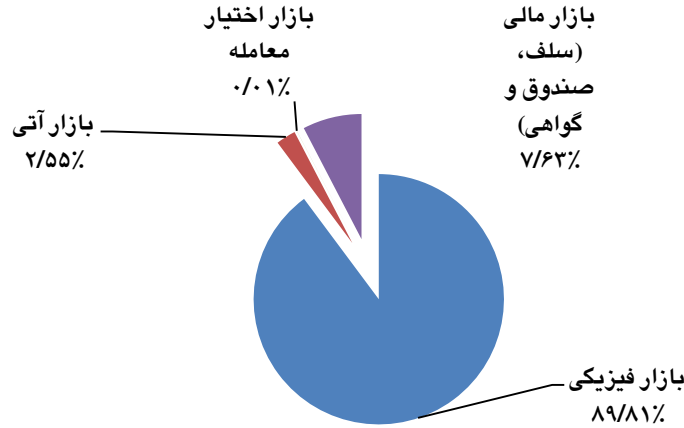


تحولات معاملات بورس کالا در هفته اخیر، نشان‌دهنده روند نزولی بازارهای فیزیکی و آتی و روند نوسانی بازارهای مالی و اختیار معامله بوده است.

منبع: وبسایت بورس کالا

بورس کالا

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۹/۵ 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 ۴۹/۷۱ درصد و حجم معاملات ۲۷/۶۷ 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	۵۹,۹۹۵,۶۲۵	۱,۵۴۸,۰۴۳	۵۷/۶٪
پتروشیمی و نفت	۴۳,۷۳۹,۹۱۷	۳۰۰,۶۴۴	۴۲/۰٪
معدنی	۱۹۲,۵۹۶	۲,۰۰۰	۰/۲٪
بازار فرعی	۳۰۰,۰۳۷	۱۱,۱۵۵	۰/۳٪
جمع	۱۰۴,۲۲۸,۱۷۵	۱,۸۶۱,۸۴۲	۱۰۰٪

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

مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

مصول	نرخ ریالی	میانگین هفته‌ای نرخ (نیمایی دلار)	میانگین هفته‌ای نرخ (دلار آزاد)	ارزش دلاری در بورس کالا (نوخ نیمایی)	ارزش دلاری در بورس کالا (نوخ آزاد)	نوخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نوخ نیمایی)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نوخ آزاد)	تغییرات هفته‌ای نرخ ریالی
بک تی اوره گرانول	۱۱۸,۲۱۲,۰۰۰	۲۶۳,۲۴۰	۲۹۴,۳۰۰	۴۴۹	۴۰۲	۶۲۴	۷۲/۰٪	۶۴/۴٪	۱/۵٪
بک تی کاتد مس	۲,۲۱۴,۸۴۵,۰۰۰	۲۶۳,۲۴۰	۲۹۴,۳۰۰	۸,۴۱۴	۷,۵۲۶	۸,۱۲۹	۱۰۳/۵٪	۹۲/۶٪	۴/۳٪
بک تی پت شهید تندگویان	۳۲۱,۹۲۲,۰۰۰	۲۶۳,۲۴۰	۲۹۴,۳۰۰	۱,۲۲۳	۱,۰۹۴	۱,۱۸۰	۱۰۳/۶٪	۹۲/۷٪	-۱/۸٪
بک تی بلت فحوز	۱۲۶,۸۳۶,۰۰۰	۲۶۳,۲۴۰	۲۹۴,۳۰۰	۴۸۲	۴۳۱	۵۲۱	۹۲/۵٪	۸۲/۷٪	-۱/۸٪
بک تی سیمان 2 تی ۴۵	۶,۵۶۱,۰۰۰	۲۶۳,۲۴۰	۲۹۴,۳۰۰	۲۵	۲۲	-	-	-	-۲/۶٪

تحلیل تکنیکال شاخص کل

رسیدن به سقف کانال نزولی



- همانطور که پیش‌بینی شده بود شاخص کل با رسیدن به کف قبلی و محدوده حمایتی ۱,۴۲۰,۰۰۰ واحد با واکنشی مثبت به این محدوده تغییر روند داد و طی ۳ کندل صعودی به سقف کانال نزولی خود رسید.
- محدوده ۱,۴۵۰,۰۰۰ واحد از چند منظر مقاومتی مهم برای شاخص کل محسوب می‌شود که از جمله آنها می‌توان به سقف کانال نزولی، مقاومت استاتیک، میانگین متحرک ۵۰ روزه و محل تلاقی *tenkan sen* و *kijun sen* اندیکاتور ایچی موکو اشاره کرد.
- در صورتیکه شاخص کل موفق به عبور از محدوده مقاومتی مذکور گردد، انتظار می‌رود روند صعودی تا سطح ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد ادامه پیدا کند.
- در غیر این صورت شاخص کل مجدداً به روند نزولی خود ادامه خواهد داد.

❖ 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)

حرکت نزولی به سمت کف قبلی



- بیت کوین پس از برخورد با خط روند نزولی میان مدت و مقاومت استاتیک خود در محدوده ۲۵ هزار دلار مجدداً وارد فاز نزولی شد و طی دو هفته متوالی به محدوده ۲۰ هزار دلار رسید.
- به نظر می رسد روند نزولی فعلی می تواند تا محدوده کف قبلی نیز ادامه پیدا کند و سپس در این محدوده مجدداً مورد حمایت قرار گیرد و بار دیگر به سمت خط روند نزولی خود حرکت 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 طلا (XAUUSD)

تداوم روند نزولی



- همانطور که پیش بینی شده بود اونس جهانی طلا با رسیدن به محدوده حمایت استاتیک ۱,۷۳۰ دلار مورد حمایت قرار گرفت و پس از اصلاح ۳۸ درصدی موج نزولی قبل مجدداً وارد روند نزولی شد.
- انتظار می رود طی هفته های آتی روند نزولی طلا تا محدوده حمایتی ۱,۶۸۰ دلار ادامه پیدا 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 شاخص دلار (DXY)

شاخص دلار در مسیر صعود



- شاخص دلار در حال حاضر در محدوده سقف قبلی خود قرار گرفته و در تایم فریم هفتگی سایه قله قبلی خود را به خوبی پوشش داده است.
- انتظار می‌رود روند صعودی شاخص دلار تداوم داشته باشد و این شاخص موفق به دستیابی به سقف کانال صعودی بلندمدت خود و مقاومت استاتیک سال ۲,۰۰۰ میلادی گردد.

❖ 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)

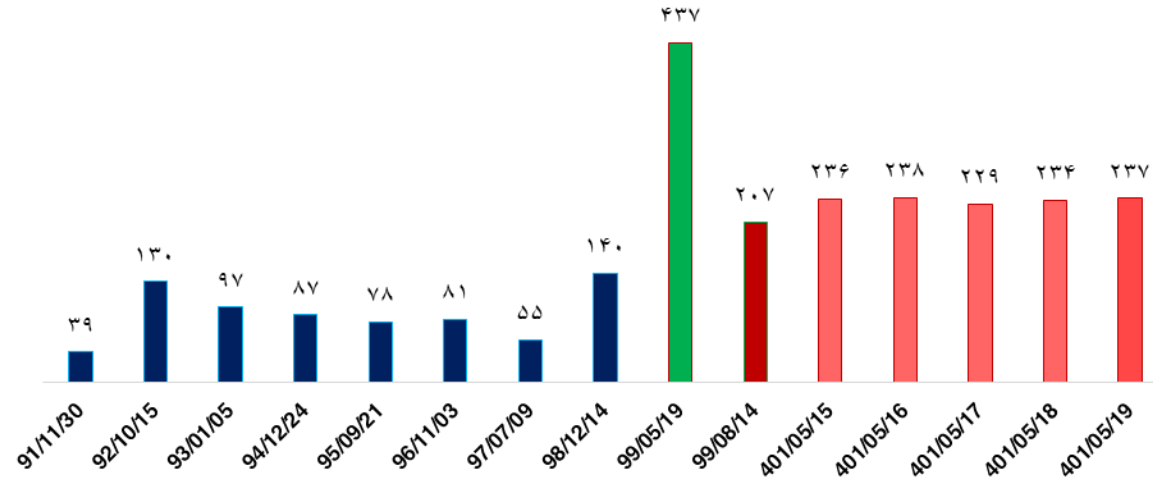


- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۴۴۲,۳۷۲ واحدی و بازده هفتگی ۰/۶۲ - درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۴۱۰ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱، نشان دهنده خروج ۲۰,۳۵۹ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۱۶ میلیارد 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 ۳۸,۱۸۹ - میلیارد تومان افول کرد.

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

شنبه	۰۱/۰۵/۲۹	-۲۹	میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۰۵/۳۰	-۲۶۹	میلیارد تومان
دوشنبه	۰۱/۰۵/۳۱	-۲۳۵	میلیارد تومان
سه شنبه	۰۱/۰۶/۰۱	+۹۵	میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۰۶/۰۲	+۲۷	میلیارد تومان

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



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۳۷ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۴۶ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس بروزرسانی جدید گزارش بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ ارزش GDP ایران معادل ۲۳۱/۵ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۱۰۲/۴ درصد محاسبه می‌شود.

گفتنی است که در تاریخ ۱۹ آگوست سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۵/۳ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۴/۹ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۱۸۲ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال) (TTM)	P (ریال)	P/E (پیش بینی)	EPS (ریال) (پیش بینی)	سال مالی	P/NAV
شستا	۷/۰۶	۱۳۹	۹۸۱	۵/۱۴	۱۹۱	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۸۸٪
وبانک	۴/۸۳	۲,۰۷۸	۱۰,۰۴۰	۴/۹۹	۲,۰۱۳	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۷۱٪
وصندوق	۴/۴۳	۲,۵۴۶	۱۱,۲۸۰	۴/۲۶	۲,۶۴۷	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۴۸٪
وامید	۶/۸۷	۱,۸۲۹	۱۲,۵۷۰	۶/۶۵	۱,۸۹۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۵۷٪
وغدیر	۶/۹۱	۲,۰۷۳	۱۴,۳۲۰	۵/۰۱	۲,۸۵۹	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۱٪
ونیک	۴/۵۱	۱,۹۶۳	۸,۸۵۰	-	-	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۴۶٪

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.