



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

بازار سرمایه در محاصره اخبار

سرنوشت برجام و نرخ ارز، فرجام وزارت صمت و آینده بازارهای جهانی

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۱۱ - هفته منتهی به ۱۱ تیر ۱۴۰۱
گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.ir

eii.co.ir

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی: دومینوی صعود تورم در اروپا!؛
- تصویر اقتصاد کلان: رتبه نخست بیشترین بازدهی ماهیانه دارایی ها به مسکن تعلق گرفت!؛
- بازار مسکن: رشد نرخ ها؛
- بورس و انرژی: نوسانات مثبت و منفی، در هفته پرخبر بازارهای سهام و انرژی؛
- فلزات گرانبها و ارز: تداوم نزول طلا، ریزش مجدد بیت کوین؛
- بازار کالاهای خام: امید به از بین رفتن ترس از کمبود مواد غذایی در زمستان پیش رو؛
- بررسی وضعیت صندوق ها؛
- بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - شکست کف قبلی و ادامه روند نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت کوین - کف سازی در محدوده فعلی؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - نشانه هایی از تغییر روند؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - بازپس گیری سقف قبلی؛
- بررسی شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار؛
- ارزیابی دلاری شاخص کل و محاسبه شاخص وارن بافت؛
- مقایسه نسبت های مالی هلدینگ های چندرشته ای صنعتی.

حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی

دومینوی صعود تورم در اروپا!

بلومبرگ
Bloomberg

اشاره

تیتربزرگ اخبار این هفته توقف مذاکرات دوحه و موکول شدن ادامه آن به بعد از سفر بایدن به منطقه خلیج فارس بود. همچنین دلیل دیگر سفر بایدن به منطقه گفت‌وگو با شرکتهای سرمایه‌گذاری گسترده صندوقهای پوشش ریسک در امارات و سایر کشورهای حاشیه خلیج فارس در کنار تبلیغ گسترده این سرمایه‌گذاری‌ها در خبرگزاری‌های مختلف نیز ذکر می‌شود. افزایش تورم منطقه یورو به ۸/۶ درصد در کنار نگرانی‌های کشورهای صنعتی اروپا جهت تأمین ذخایر گاز برای زمستان و اقدام بانک مرکزی این قاره جهت سروسامان‌دادن گسترده به بازار رمزارزها نیز از عناوین مهم این هفته بود. در نهایت کاهش تعداد معاملات وال‌استریت، معامله مس زیر ۸,۰۰۰ یورو و کاهش تأمین مالی شرکتهای بزرگ از دیگر اخبار مهم و نگران‌کننده این هفته به شمار می‌آید.

- مذاکرات هسته‌ای ایران احتمالاً بعد از سفر بایدن به کشورهای حاشیه خلیج فارس ادامه پیدا خواهد کرد.
- امارات متحده تبدیل به پایتخت سرمایه‌گذاری جدید صندوق‌های کاهش ریسک کشورهای غربی شده است.
- شرکتهای چندملیتی در حال استخدام نیروهای متخصص در بازارهای خاورمیانه جهت توسعه صندوق‌های پوشش ریسک خود در این منطقه هستند و شروع این روند با بزرگترین هج‌فاندهای آمریکایی بوده است.
- بایدن گفت نیت اصلی او از سفر به خلیج فارس، تقاضا از کشورهای عربی حاشیه خلیج جهت افزایش تولید نفت است.
- قیمت نفت پس از یک افت شدید در صبح جمعه، با اخبار مربوط به کاهش تولید لیبی، کمی افزایش یافت.
- با افزایش نرخ تورم، دولت ترکیه حداقل دستمزد را برای دومین بار طی شش ماه اخیر افزایش داد.
- ضربه تورم بر بازارهای انرژی که تاکنون در مقابل تورم مقاومت کرده بودند، باعث ترس سهام‌داران و افزایش قیمت اوراق قرضه شد.
- در سه ماهه اخیر، برای اولین بار از آغاز کرونا، فروشندگان ملک قیمت‌های خود را کاهش دادند.
- ۲۵ فرد ثروتمند جهان در ۶ ماه اخیر، بیش از ۱۴۰۰ میلیارد دلار از ثروت خود را از دست دادند.
- اتحادیه اروپا ۱/۴ میلیارد دلار جهت کمک به کاهش آلاینده‌گی تأسیسات صنعتی به نیجریه کمک می‌کند.

- با عقب‌نشینی کشورهای اروپایی از شعارهای دموکراتیک‌شان و قبول چند پیش‌شرط مهم ترکیه در مورد تحریم گروه‌های مخالف دولت این کشور که مقیم در کشورهای اسکاندیناوی هستند و تروریستی اعلام کردن آنها، روند پیوستن سوئد و فنلاند به ناتو تسریع شده و چند قدم جلوتر رفت.
- وال‌استریت در حال دست‌وپنجه‌نرم‌کردن با کاهش شدید تعداد معاملات است؛ پدیده‌ای که بسیاری از فعالان بازار را نگران کرده.
- شرکتهای هواپیمایی آمریکا جهت جبران کمبود نیرو برای فصل سفرهای توریستی، پیشنهاد افزایش حقوق ۱۶/۹ درصدی و در مواردی تا ۶۴,۰۰۰ دلار را به خلبانان جهت بازگشت به خدمت و افزایش ساعات پروازی آنان در هفته کرده‌اند.
- بایدن از قوانین موافق سقط جنین در آمریکا و تلاش جهت احیای آنان حمایت کرد.
- مارک زاکربیرگ علی‌رغم تمام شعارهایش در رابطه با امید به آینده‌ی متاورس، در حال تعدیل نیروی شرکت متا است.
- FBI جهت دریافت هرگونه اطلاعات درباره سارق و کلاهبردار بلغار رمزارزها، معروف به ملکه رمزارز، ۱۰۰,۰۰۰ دلار جایزه تعیین کرد.
- امارات متحده با افزایش دوباره قیمت بنزین، فاصله نرخ سوخت خود را با بقیه کشورهای حوزه خلیج فارس بیشتر کرد.
- شرکت اینترنت ماهواره‌ای استارلینک، چراغ سبز کمیسیون فدرال ارتباطات را جهت ارائه خدمات به هواپیماها، کشتی‌ها و خودروهای تجاری خودران دریافت کرده، که این خود مبین کیفیت بالا و پایداری سرویس اینترنت این شرکت است.

BUSINESS
INSIDER
بیزینس اینسایدر

- تورم منطقه یورو رکورد ۸/۶ درصدی را در ماه ژوئن از خود بجا گذاشت.
- اتحادیه اروپا در حال تدوین قوانین گسترده‌ای جهت رام کردن فضای «غرب وحشی‌گونه» دنیای رمزارزهاست.
- دویی تبدیل به یک سوییس آزاد جدید برای معاملات کالاهای صنعتی روس شده است.
- پوتین در حال خلع ید پیمانکاران غربی در پروژه‌های صنایع نفت و گاز روسیه و تحویل آنها به شرکتهای این کشور است.
- با افزایش ترس از رکود، قیمت هر تن مس به زیر ۸,۰۰۰ یورو سقوط کرد.
- دولت تندروری مودی، در حال تحکیم سلطه خود بر ایالت‌های ثروتمند هندوستان در انتخابات پارلمانی است.
- میزان تأمین مالی شرکتهای بزرگ در سال ۲۰۲۲ تاکنون ۲۵ درصد کاهش یافته است.
- گونه جدید اومیکرون، آمار افراد مبتلا به کرونا را در انگلستان ۳۴ درصد افزایش داد.
- سازمان ملل پس از زلزله افغانستان اعلام کرد با وجود مخالفت این سازمان با طالبان، خود را موظف می‌داند که در این بحران به مردم این کشور کمک کند.
- با افزایش تعرفه صادرات بنزین از سوی دولت، به صنایع پالایشگاهی هندوستان ضربه سنگینی وارد خواهد شد.
- بریتانیا، دوره طولانی‌تری از سایر کشورهای اروپایی درگیر تورم خواهد بود.

فایننشال تایمز



موارد ابتلاء به ویروس کرونا

| | |
|------------------------------|--------|
| ۵۵۳,۷۰۴,۹۰۲ | +۱,۰۰% |
| جان باختگان ۶,۳۶۰,۱۲۲ | +۷۶% |
| بهبود یافتگان ۵۲۸,۳۹۸,۷۴۶ | +۱,۰۰% |

تصویر اقتصاد کلان

**رتبه نخست بیشترین بازدهی ماهیانه
دارایی‌ها به مسکن تعلق گرفت!**

مقایسه بازدهی بازارها

| یکساله | ۱۴۰۱ | ماهیانه | هفتگی | بازار |
|-----------------------------|---------|---------|---------|--------|
| دلار (ریالی) | %۲۸/۳۸ | %۲۲/۲۳ | %۰/۴۷ | %۳/۹۶ |
| سکه (ریالی) | %۴۵/۲۳ | %۲۶/۰۹ | %۰/۲۸ | %۵/۰۴ |
| بورس (شاخص) | %۲۱/۲۴ | %۱۰/۱۵ | %۱/۲۸- | %۱/۵۴- |
| ارزش بازار رمزارزها (دلاری) | %۳۶/۲۷- | %۵۳/۴۲- | %۲۰/۳۱- | %۸/۸۸- |
| مسکن (ریالی - تهران) | ۳۲/۸% | - | ۸/۴% | - |

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) | 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 | - | %۳/۶ | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |
| آمریکا | | | | | | | | | |
| ۲۲ | ۲۲-ژوئن | ۲۲-مارس | ۲۲-می | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | بازه زمانی |
| %۱/۷۵ | | %-۱/۵ | %۸/۶ | %۴/۷ | %۵/۴ | %۵/۷ | ۶۹,۲۳۱ | ۲۲,۹۹۷,۵۰۰ | مقدار شاخص |
| | | | | %۷/۷ | %۳/۵ | %۳/۷ | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |
| چین | | | | | | | | | |
| ۲۲ | ۲۲-ژوئای | ۲۰۲۲-مارس | ۲۲-می | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۰ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | بازه زمانی |
| %۳/۷ | | %۱/۳ | %۲/۱ | %۰/۹ | %۴/۲ | %۸/۱ | ۱۲,۳۵۹ | ۱۷,۴۵۸,۰۴۰ | مقدار شاخص |
| | | | | %۲/۱ | %۳/۷ | %۴/۴ | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |
| منطقه یورو | | | | | | | | | |
| ۲۲ | ۲۲-ژوئن | ۲۲-مارس | ۲۲-ژوئن | ۲۰۲۱ | - | ۲۰۲۱ | ۲۰۱۹ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| %۰/۰۰ | | %۰/۶ | %۸/۶ | %۲/۶ | - | %۵/۳ | ۳۷,۷۲۳ | ۱۲,۹۱۶,۶۱۸ | مقدار شاخص |
| | | | | %۵/۳ | %۷/۷ | %۳/۷ | پیش‌بینی (۲۰۲۱) | | |
| ایران | | | | | | | | | |
| ۲۲ | ۲۲-می | ۱۴۰۰-زمستان | ۱۴۰۱-خرداد | ۱۴۰۰-زمستان | ۲۰۲۱ | ۲۰۲۱ | ۱۴۰۰ | ۲۰۲۰ | بازه زمانی |
| %۱۸ | | %۲/۳ | %۵۲/۵ | %۹/۴ | %۴۰/۱ | %۹/۸ | %۴/۳ | ۷,۵۵۵ | ۲۰,۳,۴۷۱ |
| | | | | %۳۲/۳ | %۱۰/۲ | %۳ | پیش‌بینی (۲۰۲۲) | | |

منبع:

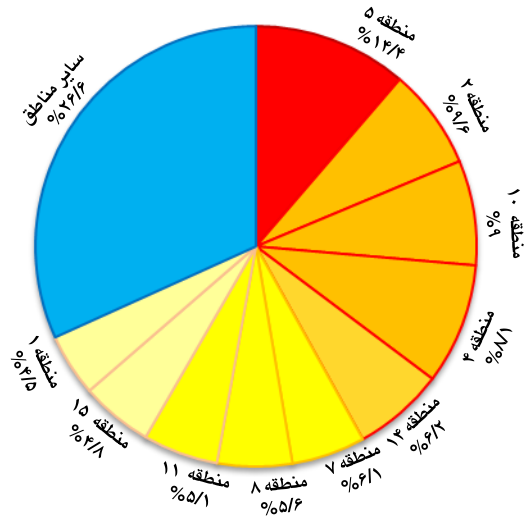
مستدوق بین‌المللی پول: پیش‌بینی ۲۰۲۲ و داده‌های مربوط به تولید ناخالص داخلی و درآمد سرانه ۲۰۲۰
 وبسایت TradingEconomics : آمارهای میانگین سالیانه، نقطه‌نقطه و فصلی کشورها (به جز ایران) و همچنین آمار مربوط به نرخ بهره
 مرکز آمار ایران: آمارهای میانگین سالیانه، نقطه‌به‌نقطه و فصلی ایران

بازار مسکن

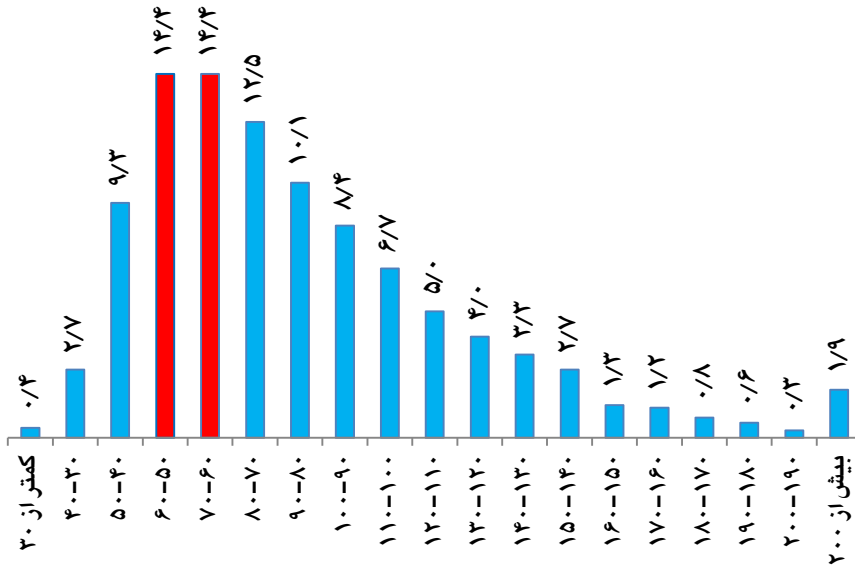
رشد نرخ‌ها

بنا بر گزارش بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، در خردادماه سال ۱۴۰۱ تعداد معاملات آپارتمان‌های مسکونی تهران به ۱۳/۹ هزار واحد مسکونی رسید که نسبت به ماه قبل و ماه مشابه سال قبل به ترتیب ۳۲/۳ و ۱۷۱/۹ درصد افزایش داشته است. در خردادماه سال ۱۴۰۱ متوسط قیمت خرید و فروش یک مترمربع زیربنای واحد مسکونی معامله شده از طریق بنگاه‌های معاملات ملکی تهران ۳۹۴/۱ میلیون ریال بود که نسبت به ماه قبل ۸/۴ درصد و نسبت به ماه مشابه سال قبل ۳۲/۸ درصد افزایش را نشان می‌دهد. در میان مناطق ۲۲ گانه شهر تهران در خردادماه ۱۴۰۱، بیشترین متوسط قیمت یک مترمربع زیربنای مسکونی معامله شده معادل ۸۱۱ میلیون ریال به منطقه ۱ و کمترین آن با ۱۹۵/۹ میلیون ریال به منطقه ۱۸ تعلق داشته که نسبت به ماه مشابه سال ۱۴۰۰ به ترتیب ۲۲/۳ و ۵۵/۳ درصد افزایش داشته‌اند. بررسی شاخص کرایه مسکن اجاری در شهر تهران و در کل مناطق شهری در خردادماه سال ۱۴۰۱ به ترتیب نشان‌دهنده رشد ۴۶/۵ و ۵۱/۲ 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 ۳۰/۱ درصد بیشترین سهم را به خود اختصاص داده‌اند.

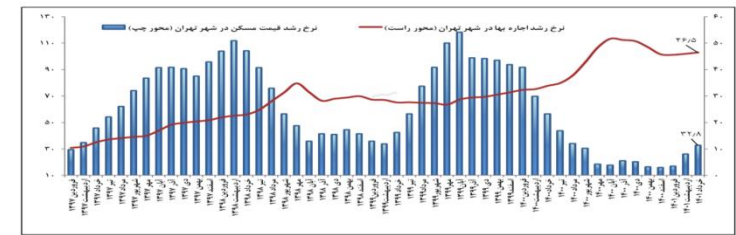
توزیع مناطق شهر تهران بر حسب سهم از تعداد معاملات انجام شده (خرداد ۱۴۰۱)



توزیع درصد فراوانی معاملات مسکن انجام شده در شهر تهران بر حسب مترمراژ (خرداد ۱۴۰۱)



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



نگرانی‌های مربوط به تورم جهانی و منتهی شدن آن به رکود تورمی این هفته نیز کام سهامداران بازارهای جهانی را تلخ کرد. پس از خوش‌بینی هفته پیش به عدم افزایش نرخ بهره در تابستان و موقوف شدن پله بعدی افزایش آن به فصول پاییز و زمستان پیش‌رو، روند بازار سهام در ابتدای هفته مثبت شد و رشد ۴ تریلیون دلاری ارزش بازار سهام جهان را در پی داشت، اما با کاهش قیمت نفت و افت سهام شرکت‌های حوزی انرژی، که تاکنون مقاومت خوبی در مقابل رکود جهانی از خود نشان داده بودند، خوش‌بینی‌ها کنار گذاشته و در اکثر کشورهای تحت بررسی از میانه هفته به بعد شاخص بورس کاهش شد. بازارهای شرق آسیا نیز که با محرک‌های دولتی، پولی و تورمی ماه بهتری را نسبت به بازارهای غربی پشت سر گذاشته بودند، در برابر موج بدبینی این هفته بازارها سر تعظیم فرود آورده و منفی شدند.

نفت و محصولات پتروشیمی

خبر افزایش ۶۵۰ هزار بشکه‌ای تولید روزانه اوپک پلاس در روز جمعه برای شوک منفی اساسی به قیمت نفت کافی بود. اما اخبار مهم این هفته‌ی بازار نفت به این افزایش تولید محدود نبود: عدم نتیجه‌بخش بودن گفت‌وگوهای دوحه، در وضعیتی که ظرفیت افزایش تولید کشورهای حاشیه خلیج فارس محدود بوده و به زعم بعضی سیاست‌یون دنیا به نفت ایران نیاز دارد، در کنار سفر قریب‌الوقوع بایدن به کشورهای عربی حاشیه خلیج فارس، که به گفته دولت آمریکا هدف اصلی آن گفت‌وگو حول محور افزایش تولید نفت است، و همچنین جلسات اتحادیه اروپا درباره تصویب سقفی برای نرخ پرداختی بابت نفت روسیه، همگی در حال‌وهوای بازار این هفته نفت تأثیرات مهمی داشتند. ادامه تعطیلی ترمینال صادرات LNG فری‌پورت آمریکا برای تعمیرات، در کنار کاهش دمای کلی این کشور موجب نزول قیمت گاز در آمریکا شد، که طی یک ماه اخیر بیش از ۳۰ درصد کاهش داشته است. در کنار این موضوع، افزایش حدوداً ۵۰ درصدی قیمت گاز اروپا در ماه سپاه کامودیتی‌ها، که ناشی از کاهش عرضه روسیه و تنش‌های جاری در این قاره است، نیز همچنان موضوعی بااهمیت قلمداد می‌شود. این هفته چین در تولید برق از منابع تجدیدپذیر از اروپا پیشی گرفت، که با توجه به سرمایه‌گذاری گسترده این کشور در این حوزه پیش‌بینی می‌شود روند افزایشی مذکور ادامه‌دار باشد.



| ردیف | عنوان | آخرین قیمت | معادل | بازده هفتگی | بازده ماهانه | بازده یکساله |
|------|------------|------------|-------|-------------|--------------|--------------|
| ۱ | Dow Jones | ۳۱,۰۹۹ | واحد | -۱.۳۰% | -۵.۲۲% | -۱۰.۲۰% |
| ۲ | Nasdaq | ۱۱,۵۸۶ | واحد | -۴.۳۰% | -۷.۶۷% | -۲۰.۴۳% |
| ۳ | S&P 500 | ۳,۸۲۳ | واحد | -۲.۲۶% | -۶.۷۵% | -۱۱.۴۶% |
| ۴ | FTSE 100 | ۷,۲۳۴ | واحد | -۰.۰۹% | -۴.۱۴% | ۱.۶۴% |
| ۵ | DAX | ۱۲,۸۱۳ | واحد | -۲.۳۳% | -۱۰.۶۵% | -۱۷.۸۹% |
| ۶ | CAC 40 | ۵,۹۳۱ | واحد | -۲.۳۴% | -۷.۶۰% | -۹.۵۰% |
| ۷ | NIKKEI 225 | ۲۵,۹۳۶ | واحد | -۲.۱۰% | -۵.۵۴% | -۹.۶۵% |
| ۸ | SHANGHAI | ۳,۳۸۸ | واحد | ۱.۱۳% | ۶.۴۶% | -۵.۶۰% |
| ۹ | Moex | ۲,۲۰۷ | واحد | -۷.۷۳% | -۵.۷۱% | -۴۲.۹۱% |

TeleTrader

TradingEconomics

| ردیف | عنوان | آخرین قیمت | معادل | بازده هفتگی | بازده ماهانه | بازده یکساله |
|------|------------------------|------------|--------------|-------------|--------------|--------------|
| ۱۰ | نفت خام برنت | ۱۱۱.۶۳ | دلار/بشکه | ۲.۳۲% | -۲.۹۶% | ۴۴.۲۷% |
| ۱۱ | نفت خام WTI | ۱۰۸.۴۳ | دلار/بشکه | ۰.۷۵% | -۵.۱۴% | ۴۶.۵۵% |
| ۱۲ | گاز طبیعی (هنری هاب) | ۵.۷۳ | دلار / MMBtu | -۷.۸۸% | -۳۲.۳۸% | ۵۴.۸۶% |
| ۱۳ | سبب اوپک | ۱۱۵.۶۱ | دلار/بشکه | ۰.۶۳% | ۰.۸۶% | ۳۵.۲۷% |
| ۱۴ | نفت سنگین ایران | ۱۰۷.۶۶ | دلار/بشکه | -۱.۱۰% | -۵.۴۸% | ۵۴.۴۶% |
| ۱۵ | گازوئیل | ۱,۱۷۳ | دلار/تن | -۶.۲۸% | -۲.۴۷% | ۹۸.۴۸% |
| ۱۶ | نفتا | ۸۱۱.۷۲ | دلار/تن | ۱.۱۱% | -۴.۲۱% | ۸.۵۱% |
| ۱۷ | اتانول | ۲.۵۴ | دلار/گالن | -۹.۷۷% | -۸.۸۰% | ۱۹.۹۱% |
| ۱۸ | متانول (داخلی چین) | ۲,۶۲۰ | یوان/تن | -۱.۷۲% | ۴.۴۰% | ۳.۹۱% |
| ۱۹ | متانول CFR | ۳۱۵ | دلار/تن | -۰.۳۲% | -۱۱.۷۵% | ۲.۲۲% |
| ۲۰ | اوره گرانول خاورمیانه | ۵۵۳.۳۳ | دلار/تن | ۲.۷۵% | -۵.۸۷% | ۲۷.۳۵% |
| ۲۱ | پت - فوب جنوب شرق آسیا | ۹۶۶ | دلار/تن | ۰% | ۰.۷۸% | ۲۲.۴۸% |

سنت / مترم
کعب ۲۰.۲۷

فلزات گرانبها و ارز

تداوم نزول طلا، ریزش مجدد بیت‌کوین

| ردیف | عنوان | آخرین قیمت | معادل | بازده هفتگی | بازده ماهانه | بازده سالانه | منبع |
|--|---------------------|-------------|-----------|-------------|--------------|--------------|-------------|
| فلزات گرانبها | | | | | | | |
| ۱ | طلا | ۱,۸۰۷ | دلار/اونس | -۱.۰۳% | -۳.۲۷% | ۱.۱۲% | TeleTrader |
| ۲ | نقره | ۱۹.۸۶ | دلار/اونس | -۶.۱۴% | -۱۰.۹۸% | -۲۴.۹۷% | TeleTrader |
| طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۹ تیر | | | | | | | |
| ۳ | یک گرم طلای ۱۸ عیار | ۱۴,۳۴۱,۰۰۰ | ریال | -۰.۷۲% | ۰.۸۷% | ۳۳.۷۳% | tgju/org |
| ۴ | سکه امامی | ۱۵۶,۰۲۰,۰۰۰ | ریال | ۰.۲۸% | ۳.۰۴% | ۴۴.۱۰% | tgju/org |
| ارز - پنجشنبه ۹ تیر | | | | | | | |
| ۵ | دلار آزاد | ۳۲۰.۵۰۰ | ریال | ۰.۴۷% | ۳.۹۶% | ۲۶.۱۸% | tgju/org |
| ۶ | دلار حواله (خرید) | ۲۵۴,۲۵۵ | ریال | ۰.۶۹% | ۵.۴۴% | ۱۷.۰۱% | sanarate/ir |
| ۷ | دلار حواله (فروش) | ۲۵۶,۵۶۵ | ریال | ۰.۶۹% | ۵.۴۴% | ۱۷.۰۱% | sanarate/ir |
| ۸ | یورو آزاد | ۳۳۳,۶۰۰ | ریال | -۰.۸۰% | ۱% | ۱۴.۰۵% | tgju/org |
| ۹ | یورو حواله (خرید) | ۲۶۶,۳۱۰ | ریال | -۰.۳۵% | ۲.۸۹% | ۳.۴۱% | sanarate/ir |
| ۱۰ | یورو حواله (فروش) | ۲۶۸,۷۲۹ | ریال | -۰.۳۵% | ۲.۸۹% | ۳.۴۱% | sanarate/ir |
| ۱۱ | درهم آزاد | ۷۴,۵۳۲ | ریال | ۰.۵۵% | ۸.۲۰% | ۱۱.۶۶% | sanarate/ir |
| ۱۲ | درهم حواله (خرید) | ۶۹,۲۳۳ | ریال | ۰.۶۹% | ۵.۴۴% | ۱۷.۰۱% | sanarate/ir |
| ۱۳ | درهم حواله (فروش) | ۶۹,۸۶۲ | ریال | ۰.۶۹% | ۵.۴۴% | ۱۷.۰۱% | sanarate/ir |
| رمزارز | | | | | | | |
| ۱۴ | بیت‌کوین | ۱۹,۱۴۵ | دلار | -۱۰.۸۳% | -۳۷.۱۷% | -۴۳.۳۸% | Tradingview |
| ۱۵ | اتریوم | ۱,۰۴۴ | دلار | -۱۶.۰۲% | -۴۳.۲۲% | -۵۱.۶۵% | Tradingview |

بازار فلزات گرانبها

هفته گذشته نیز اونس جهانی طلا در مسیر نزولی خود باقی ماند و با تداوم روند ریزشی، افت ۱/۰۳ درصدی را به نام خود ثبت کرد. از علل افت اخیر اونس جهانی طلا می‌توان به نشست اخیر روسای بانک‌های مرکزی آمریکا، انگلیس و اروپا اشاره کرد که مواردی را با لحن انتقاب‌ی در راستای کنترل تورم مطرح کردند.

سکه و ارز (داخلی)

طی هفته اخیر بازار سکه و ارز کار خود را با ریزش آغاز کردند، که علت آن خوش‌بینی نسبت به مذاکرات هسته‌ای در نشست دوروزه قطر در اواسط هفته بود. اما با پایان رسیدن مذاکرات دوروزه، سیگنال‌های منفی منتشر شده که سبب بالا رفتن نرخ دلار و افزایش تقاضا در بازار سکه داخلی و افزایش قیمت آن گردید.

رمزارز

به گزارش فایننشال تایمز، گری گنسلر، رئیس SEC، «یک کتاب قانون» برای تنظیم کریپتو پیشنهاد کرده است. گنسلر با این پیشنهاد بدنبال دستیابی به توافق‌هایی با سایر ناظران مالی، از جمله کمیسیون معاملات آتی کالا (CFTC) است، تا از شکاف‌هایی در نظارت بر بخش کریپتو جلوگیری کند. رئیس کمیسیون بورس و اوراق بهادار توضیح داد که این قانون باید علاوه بر شفافیت در مورد لیست سفارشات، از سرمایه‌گذاران در برابر تقلب، پیشروی و دستکاری نیز محافظت کند. رئیس SEC فاش کرد که در حال کار روی یک «یادداشت تفاهم» با همتایان خود در CFTC است، که یک توافق رسمی برای اطمینان از اینکه تجارت در دارایی‌های دیجیتال دارای پادمان‌ها و شفافیت کافی خواهد بود، محسوب می‌شود. او توضیح داد که اگر یک توکن کالا در پلتفرمی که توسط تنظیم‌کننده اوراق بهادار نظارت می‌شود، فهرست شود، SEC آن اطلاعات را به CFTC ارسال می‌کند. در ادامه گری گنسلر، موضع خود را در مورد رمزارزها، بویژه بیت‌کوین، در مصاحبه با CNBC روشن کرد. گنسلر تأکید کرد که بسیاری از «دارایی‌های مالی رمزارزی» واجد «ویژگی‌های کلیدی یک اوراق قرضه» هستند. او افزود تنها چیزی که می‌خواهم بگویم این است که برخی دیگر از رمزارزها، مانند بیت‌کوین، شبیه کامودیتی‌ها هستند. رئیس SEC خاطرنشان کرد که علاوه بر بیت‌کوین، قرار نیست بطور خاص درباره سایر توکن‌های رمزنگاری شده بحث کند. بیانیه گنسلر با رئیس کمیسیون معاملات آتی کالا (CFTC)، روستین بهنام، که ماه گذشته گفته بود بیت‌کوین یک کالا محسوب می‌شود، هم راستاست. با این حال، بهنام در ادامه بیان داشته که اتریوم نیز یک کالا است. رئیس SEC سپس به استیبل‌کوین‌ها اشاره و خاطرنشان کرد «کارهایی وجود دارد که باید در مورد استیبل‌کوین‌ها انجام شود. کارهای زیادی برای محافظت از عموم سرمایه‌گذاران باید انجام شود.»



بازار کالاهای خام امید به از بین رفتن ترس از کمبود مواد غذایی در زمستان پیش‌رو

بازار محصولات کشاورزی

قیمت گندم با کاهش بیش از ۲۰ درصدی طی یک ماه اخیر، اکنون در مجدوده روند صعودی پیش از شروع تهدیدها، هیاهوی جنگ اوکراین و وقوع جنگ واقعی معامله می‌شود. با وجود اعمال فشار روسیه در محاصره صادرات گندم اوکراین، سایر کشورهای اروپایی اعلام کرده‌اند هرچه در توان دارند برای توفیق روند صادرات این کشور انجام خواهند داد. پر بودن انبارهای غله کشورهای آمریکای جنوبی، وضع خوب کشت ذرت و برداشت بهتر از انتظار در کشورهای مختلف کمک کرده تا وحشت ناشی از قحطی و تقاضای شدید خرید که در ماه‌های اخیر بر بازار حکمفرما بود، فرونشیند و محصولات خوراکی در محدوده‌های قیمتی عاقلانه‌تری معامله شوند. امید است که با ادامه این روند و افزایش برداشت‌ها در نیم‌کره شمالی، ترس از کمبود مواد غذایی در زمستان پیش‌رو به شکل کلی از بازارها رخت بپندد. افت شدید موقعیت‌های خرید فیوچرز گندم از مبینات این امر است.

بازار کالاهای صنعتی

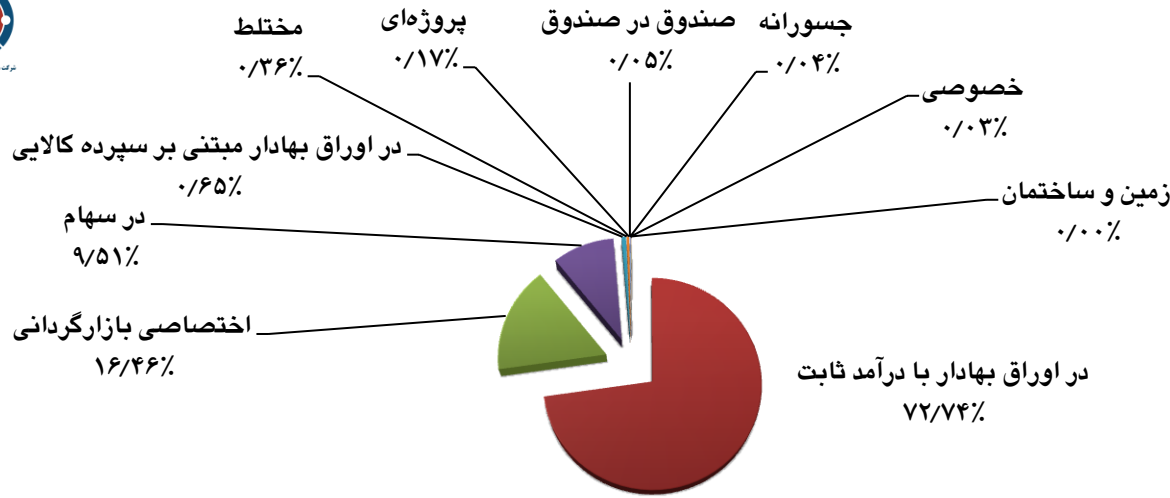
کاهش قراردادهای معاملات آتی محصولات صنعتی و فلزات ارزشمند و مواد غذایی که طی دو هفته اخیر به ۱۰ میلیارد دلار می‌رسد، گواهی دیگر بر ترس گسترده از رکود یا رکود تورمی در بازارهاست. کاهش شدید قیمت فلزات اساسی که در سقوط ۲۵ درصد میانگین ماهانه قیمت آنها نمایان شده، در کنار بازدهی ۱۰- درصد و پایین‌تر شاخص‌های اصلی مصرف‌کننده، منجر به نمای قرمز رنگ بازارهای کامودیتی این هفته شد. بین فلزات اساسی، روی با کاهش ۹ درصدی قیمت، بدترین بازار را داشته و آلومینیوم پس از سقوط هفته گذشته، اندکی افزایش قیمت را تجربه کرد. سنگ آهن، که در پی اقبال کم‌رونق صنایع به جز در چین با کاهش شدید تقاضا نسبت به آنچه برآورد شده بود و انتظار می‌رفت مواجه است، روند بسیار کم‌رمتی داشته و برای مشخص شدن وضعیت تقاضای آن باید منتظر رونق بیشتر صنایع کشور چین باشیم. در نهایت فولاد منطقه دریای سیاه با فشار فروش شدید روسیه همچنان کاهش یافته و این هفته در محدوده ۵۰۰ دلار، و حتی برای مقطع کوتاهی در کانال ۴۹۰ دلار، نیز معامله شد.

شاخص‌های کالایی

در کنار کاهش پیوسته شاخص‌های اصلی مصرف‌کننده جهانی طی یک ماه اخیر، شاهد هستیم که با کم‌رونق شدن بازارها و کاهش ۵ درصدی شاخص بالتیک خشک، میانگین شاخص قیمت حمل‌ونقل کانتینری دریایی اکنون با ۶۰۰ دلار کاهش از دو هفته پیش به ۷,۰۰۰ دلار به‌ازای هر کانتینر رسیده است.

| ردیف | عنوان | آخرین قیمت | معادل | بازده هفتگی | بازده ماهانه | بازده سالانه |
|------------------------|---|------------|----------------|-------------|--------------|------------------------|
| محصولات کشاورزی | | | | | | |
| ۱ | ذرت | ۶۰۷ | سنت / بوشل | ۲۳۹ | دلار/تن | ۹۰.۸۷٪ -۱۲.۵۰٪ ۲۰.۸۶٪ |
| ۲ | کتان (پنبه) | ۹۸.۹۶ | سنت / پوند | ۲۱۸۲ | دلار/تن | ۱.۱۰٪ -۱۷.۵۵٪ ۲۴.۷۹٪ |
| ۳ | سویا | ۱,۵۱۰.۵۰ | سنت / بوشل | ۵۵۵ | دلار/تن | -۰.۹۶٪ -۸.۹۵٪ ۱۲.۲۰٪ |
| ۴ | شکر | ۱۸.۴۷ | سنت / پوند | ۴۰۷ | دلار/تن | ۰.۹۸٪ -۵.۳۳٪ ۱۳.۱۷٪ |
| ۵ | گندم | ۸۴۱.۰۰ | سنت / بوشل | ۳۰۹ | دلار/تن | -۱۰.۲۵٪ -۲۱.۶۰٪ ۲۴.۵۹٪ |
| ۶ | کانولا | ۹۲۸.۹۰ | دلار کانادا/تن | ۷۳۴ | دلار/تن | ۵.۵۳٪ -۲۱.۵۷٪ ۶.۸۳٪ |
| کالاهای صنعتی | | | | | | |
| ۷ | مس | ۸۰۵۵ | دلار/تن | | | -۳.۲۱٪ -۱۵.۳۹٪ -۱۴.۱۲٪ |
| ۸ | قبر | ۴,۴۵۹ | یوان/تن | ۷۱۳ | دلار/تن | ۲.۰۸٪ -۲.۶۰٪ ۳۱.۴۶٪ |
| ۹ | فولاد | ۴,۵۰۰ | یوان/تن | ۷۲۰ | دلار/تن | ۴.۶۳٪ ۰.۷۸٪ -۸.۳۱٪ |
| ۱۰ | آلومینیوم | ۲,۴۶۸ | دلار/تن | | | ۰.۷۶٪ -۳۵.۰۸٪ -۳.۴۸٪ |
| ۱۱ | سرب | ۱,۹۳۰ | دلار/تن | | | -۰.۴۹٪ -۹.۳۸٪ -۱۵.۹۶٪ |
| ۱۲ | روی | ۳,۰۴۵ | دلار/تن | | | -۹.۰۰٪ -۲۱.۳۷٪ ۳.۷۳٪ |
| ۱۳ | سنگ آهن | ۱۱۸.۰۰ | دلار/تن | | | ۱.۲۹٪ -۱۷.۴۸٪ -۴۵.۷۵٪ |
| ۱۴ | بیلت CIS (فوب دریای سیاه) | ۵۰۲ | دلار/تن | | | -۲.۲۰٪ -۲۲.۳۵٪ -۲۰.۵۵٪ |
| ۱۵ | بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران) | ۵۱۷ | دلار/تن | | | -۳.۰۰٪ -۶.۸۵٪ -۱۴.۷۰٪ |
| شاخص‌های کالایی | | | | | | |
| ۱۶ | بالتیک خشک | ۲,۲۱۴ | واحد | | | -۵.۰۲٪ -۱۵.۶۶٪ -۳۲.۶۰٪ |
| ۱۷ | شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB) | ۳۱۱ | واحد | | | -۲.۲۲٪ -۹.۵۷٪ ۳۶.۲۷٪ |
| ۱۸ | شاخص بورس فلزات لندن (LME) | ۳,۸۷۹ | واحد | | | -۲.۹۱٪ -۱۴.۵۱٪ -۵.۹۷٪ |
| ۱۹ | شاخص کالاهای اساسی گلدامن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI) | ۳,۷۶۸ | واحد | | | -۲.۰۹٪ -۷.۶۴٪ ۴۳.۸۳٪ |

بررسی وضعیت صندوق‌ها



در هفته منتهی به شنبه ۱۱ تیر ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های در سهام، اوراق مبتنی بر سپرده کالایی، مختلط، صندوق درصندوق و جسورانه منفی و بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت و بازارگردانی مثبت و بازدهی صندوق‌های پروژه‌ای و خصوصی صفر بود. در عین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های بازارگردانی با ۰/۵۹ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های مبتنی بر سپرده کالایی با ۵/۴۸- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۲/۷۴ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۶/۴۶ درصد و سهامی با ۹/۵۱ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

| نوع صندوق | خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال) | میانگین دارایی‌های نقدی (%) | میانگین بازدهی هفتگی (%) | میانگین بازدهی ماه (%) | میانگین بازدهی ماهه (%) | میانگین بازدهی 3 ماهه (%) | میانگین بازدهی 6 ماهه (%) | میانگین بازدهی سالانه (%) |
|---------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------|------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| در اوراق بهادار با درآمد ثابت | ۴,۵۷۱,۷۶۵.۰۳ | ۰.۱۱٪ | ۰.۳۳٪ | ۱.۲۷٪ | ۴۴۳.۰۰٪ | ۸.۵۷٪ | ۱۵.۱۷٪ | |
| اختصاصی بازارگردانی | ۱,۰۳۴,۲۳۲.۸۳ | ۲.۳۶٪ | ۰.۵۹٪ | ۱.۴۴٪- | ۹۳۷.۰۰٪ | ۱۲.۵۸٪ | ۹.۷۵٪ | |
| در سهام | ۵۹۷,۳۹۹.۳۳ | ۰.۳۸٪ | ۱.۲۴٪- | ۲.۳۱٪- | ۶۲۳.۰۰٪ | ۹.۲۹٪ | ۱۵.۵۱٪ | |
| در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی | ۴۰,۶۸۴.۴۹ | ۰.۰۱٪ | ۵.۴۸٪- | ۱.۹۴٪- | ۱۴۳.۰۰٪ | ۸.۱۳٪ | ۳۸.۴۲٪ | |
| مختلط | ۲۲,۴۷۳.۹۴ | ۰.۰۲٪ | ۰.۷۲٪- | ۱.۱۵٪- | ۶۰۵.۰۰٪ | ۹.۵۱٪ | ۱۶.۷۲٪ | |
| پروژه‌ای | ۱۰,۵۷۶.۴۳ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | |
| صندوق در صندوق | ۳,۳۸۷.۰۵ | ۰.۰۰٪ | ۱.۰۸٪- | ۱.۵۰٪- | ۴۳۵.۰۰٪ | ۲.۹۲٪ | ۶.۴۹٪ | |
| جسورانه | ۲,۸۱۲.۶۰ | ۱.۲۱٪ | ۰.۱۸٪- | ۰.۰۱٪ | ۱۰۰.۰۰٪ | ۱۲.۸۶٪ | ۲۴.۳۶٪ | |
| خصوصی | ۱,۶۰۶.۴۴ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۱.۶۴ | ۰.۰۴ | ۰.۰۵ | |
| زمین و ساختمان | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | |
| املاک و مستغلات | ۶,۲۸۳,۳۳۲ | | | | | | | |

بررسی وضعیت بازار بدهی

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

| بازده ساده | YTM | تاریخ سررسید | تاریخ آخرین روز معاملاتی | قیمت معامله شده هر سهم | شاد |
|------------|--------|--------------|--------------------------|------------------------|----------------|
| ۲۶.۴۴% | ۲۲.۹۷% | ۱۴۰۳-۰۷-۲۳ | ۱۴۰۱-۰۴-۱۱ | ۶۲۳۱۲۰ | اخزا ۰۰۶ |
| ۲۰.۵۰% | ۲۰.۵۰% | ۱۴۰۳-۰۶-۱۹ | ۱۴۰۱-۰۴-۰۷ | ۶۶۳۰۹۰ | اخزا ۰۱۱ |
| ۲۷.۲۹% | ۲۲.۹۱% | ۱۴۰۳-۱۱-۱۵ | ۱۴۰۱-۰۴-۱۱ | ۵۸۵۵۰۰ | اخزا ۰۱۰ |
| ۱۹.۲۹% | ۲۱.۱۴% | ۱۴۰۱-۰۵-۰۳ | ۱۴۰۱-۰۴-۱۱ | ۹۸۷۹۹۰ | اخزا ۸۱۶ |
| ۲۳.۲۱% | ۲۲.۲۱% | | | | 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 اخزا۰۰۶ و اخزا۰۱۰ با سرسیدهای ۱۴۰۳/۰۷/۲۳ و ۱۴۰۳/۱۱/۱۵ و بازدهی‌های ۲۲/۹۷ و ۲۷/۲۹ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد های اخزا۰۱۱ و اخزا۸۱۶ با سرسیدهای ۱۴۰۳/۰۶/۱۹ و ۱۴۰۱/۰۵/۰۳ و بازدهی‌های ۲۰/۵۰ و ۱۹/۲۹ درصد بود.

از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۲/۲۱ و ۲۳/۲۱ درصد بود.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

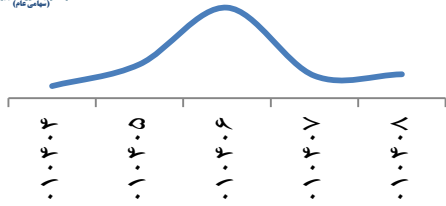
| شاد | قیمت معامله شده هر سهم | تاریخ آخرین روز معاملاتی | تاریخ سررسید | YTM |
|---------|------------------------|--------------------------|--------------|--------|
| اراد ۹۱ | ۹۹۱۰۰۰ | ۱۴۰۱-۰۴-۰۸ | ۱۴۰۱-۰۵-۲۵ | ۲۴.۱۲% |
| افاد ۷۳ | ۱۰۰۰۰۰۰ | ۱۴۰۱-۰۴-۰۵ | ۱۴۰۲-۰۴-۱۱ | ۱۸.۷۲% |

منبع: فرابورس ایران

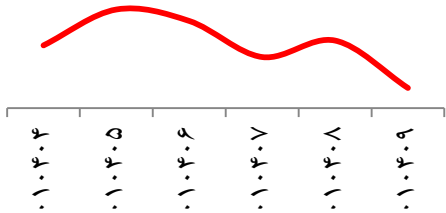
اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد افاد۷۳ با میزان ۱۸/۷۲ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۴/۱۱ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اراد۹۱ با میزان ۲۴/۱۲ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۰۵/۲۵ بوده است.

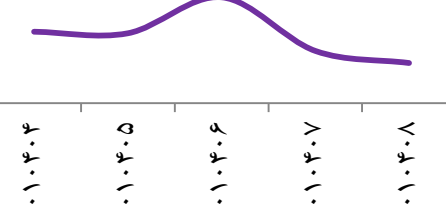
بازار فیزیکی



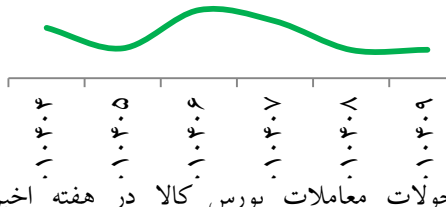
بازار آتی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)



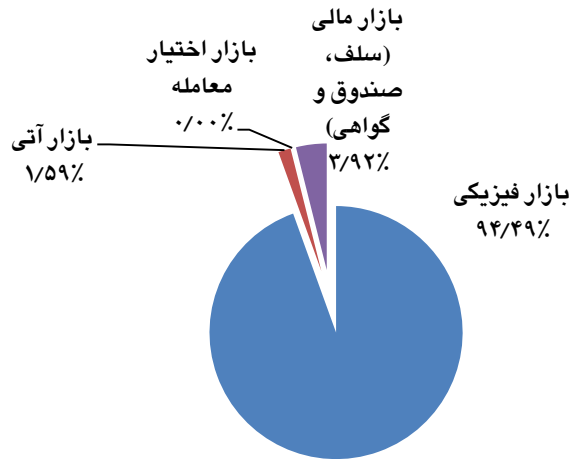
بازار اختیار معامله



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

بورس کالا

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۶/۷ 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 ۳/۱۵ درصد و حجم معاملات ۲/۱۷ 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 | ۹۸,۰۰۲,۹۸۷ | ۲,۱۲۱,۲۴۱ | ۶۸/۴% |
| پتروشیمی و نفتی | ۴۲,۲۴۵,۹۴۹ | ۱۶۶,۸۵۰ | ۲۹/۵% |
| نقدی | . | . | ۰/۰% |
| بازار فرعی | ۲,۹۳۰,۷۱۵ | ۱۸,۷۱۲ | ۲/۰% |
| جمع | ۱۴۳,۱۷۹,۶۵۱ | ۲,۳۰۶,۸۰۳ | ۱۰۰% |

همچنین بررسی تحولات براساس نرخ ارز حواله ارزی نیز حاکی از عقب ماندن نرخ بیلت فخوز و نرخ اوره گرانول و پیشی گرفتن نرخ کاتد مس و نرخ پت گرید بطری شهید تندگویان نسبت به 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 تمامی کالاهای تحت بررسی نسبت به نرخ‌های جهانی است.

مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

| مصول | نرخ ریلی | میانگین هفتگی نرخ (نمایی دلار) | میانگین نرخ در بورس کالا (نرخ آزاد) | ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ آزاد) | ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نمایی) | نرخ جهانی (دلار) | نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ آزاد) | نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نمایی) | تغییرات هفتگی نرخ ریلی |
|------------------------|---------------|--------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------|---|--|------------------------|
| یک تن اوره گرانول | ۱۱۳,۶۱۳,۰۰۰ | ۲۵۴,۲۵۵ | ۳۱۷,۱۵۰ | ۴۴۷ | ۲۵۸ | ۵۷۱ | ۷۸۳% | ۶۲۸% | -۱/۳% |
| یک تن کاتد مس | ۲,۴۶۰,۴۵۴,۰۰۰ | ۲۵۴,۲۵۵ | ۳۱۷,۱۵۰ | ۹,۶۷۷ | ۷,۷۵۸ | ۸,۰۵۵ | ۱۲۰/۱% | ۹۶/۳% | -۳/۰% |
| یک تن پت شهید تندگویان | ۲۸۵,۲۷۲,۰۰۰ | ۲۵۴,۲۵۵ | ۳۱۷,۱۵۰ | ۱,۵۱۵ | ۱,۲۱۵ | ۱,۲۹۰ | ۱۱۷/۵% | ۹۴/۲% | ۱۶/۵% |
| یک تن بیلت فخوز | ۱۰۱,۳۷۳,۰۰۰ | ۲۵۴,۲۵۵ | ۳۱۷,۱۵۰ | ۳۹۹ | ۳۲۰ | ۵۱۰ | ۷۸۲% | ۶۲/۷% | -۳/۱۶% |
| یک تن سیمان تپ ۲ هه | ۶,۶۱۸,۰۰۰ | ۲۵۴,۲۵۵ | ۳۱۷,۱۵۰ | ۲۶ | ۲۱ | - | - | - | -۳۳/۱% |

تحلیل تکنیکال شاخص کل

شکست کف قبلی و ادامه روند نزولی



- هفته گذشته شاخص کل کف قبلی خود در محدوده ۱,۵۱۲,۰۰۰ واحد را روبه پایین شکست و پولبک خود را نیز به این محدوده تکمیل کرد.
- به نظر می‌رسد روند نزولی شاخص کل کماکان ادامه داشته باشد و در ادامه شاهد سطوح پایین‌تری از شاخص کل باشیم.
- در حال حاضر مهمترین محدوده حمایتی پیش روی شاخص کل محدوده ۱,۴۴۰,۰۰۰ الی ۱,۴۷۰,۰۰۰ واحد است.
- انتظار می‌رود با رسیدن شاخص کل به این محدوده شاهد واکنش مثبت و شروع موجی صعودی باشیم که بتواند تا خط روند نزولی تشکیل شده ادامه پیدا کند.

❖ 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)

کف سازی در محدوده فعلی



- بیت کوین در حال حاضر در محدوده ۱۸ هزار دلار، که یک محدوده حمایتی بسیار مهم برای آن محسوب می شود، قرار دارد.
- در این محدوده سقف قبلی بیت کوین در سال ۲۰۱۷ و میانگین متحرک ۲۰۰ هفته ای قرار دارد. (شاهد بودیم بیت کوین همیشه طی روند خود واکنشی مثبت به آن نشان می داده است)
- انتظار می رود طی هفته های آتی بیت کوین با طی کردن اصلاح زمانی در محدوده قیمتی فعلی، کف سازی مناسبی را در این محدوده انجام دهد.

❖ 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)

نشانه‌هایی از تغییر روند



- اونس جهانی طلا با رسیدن به محدوده قیمتی ۱,۷۸۰ دلار واکنشی مثبت نشان داد و بسیار سریع به بالای محدوده قیمتی ۱,۸۰۰ دلار بازگشت.
- به نظر می‌رسد آخرین کندل روزانه طلا می‌تواند آغازگر موجی صعودی باشد و موجب افزایش قیمت آن در هفته جاری شود.
- طلا جهت تغییر روند نیاز به شکست خط روند نزولی و عبور از محدوده مقاومت استاتیک ۱,۸۷۰ و تثبیت بر بالای آن دارد.
- در غیر این صورت قیمت می‌تواند مجدداً موجی نزولی را در پیش گیرد.

❖ توضیحات:

- نمودار از زوایای گوناگون و با توجه به اندیکاتورهای مختلف مورد بررسی قرار گرفته‌اند، سپس جهت زیبایی بصری، قاطبه اندیکاتورها، خطوط روند و کانال‌ها حذف شده است.
- در جهت فهم عموم تلاش شده نتایج تحلیل‌های فوق به زبانی ساده و به طور مختصر نگاشته و تنها به نکات مهم و روند آتی اشاره شود.

تحلیل تکنیکال شاخص دلار (DXY)

بازپس‌گیری سقف قبلی



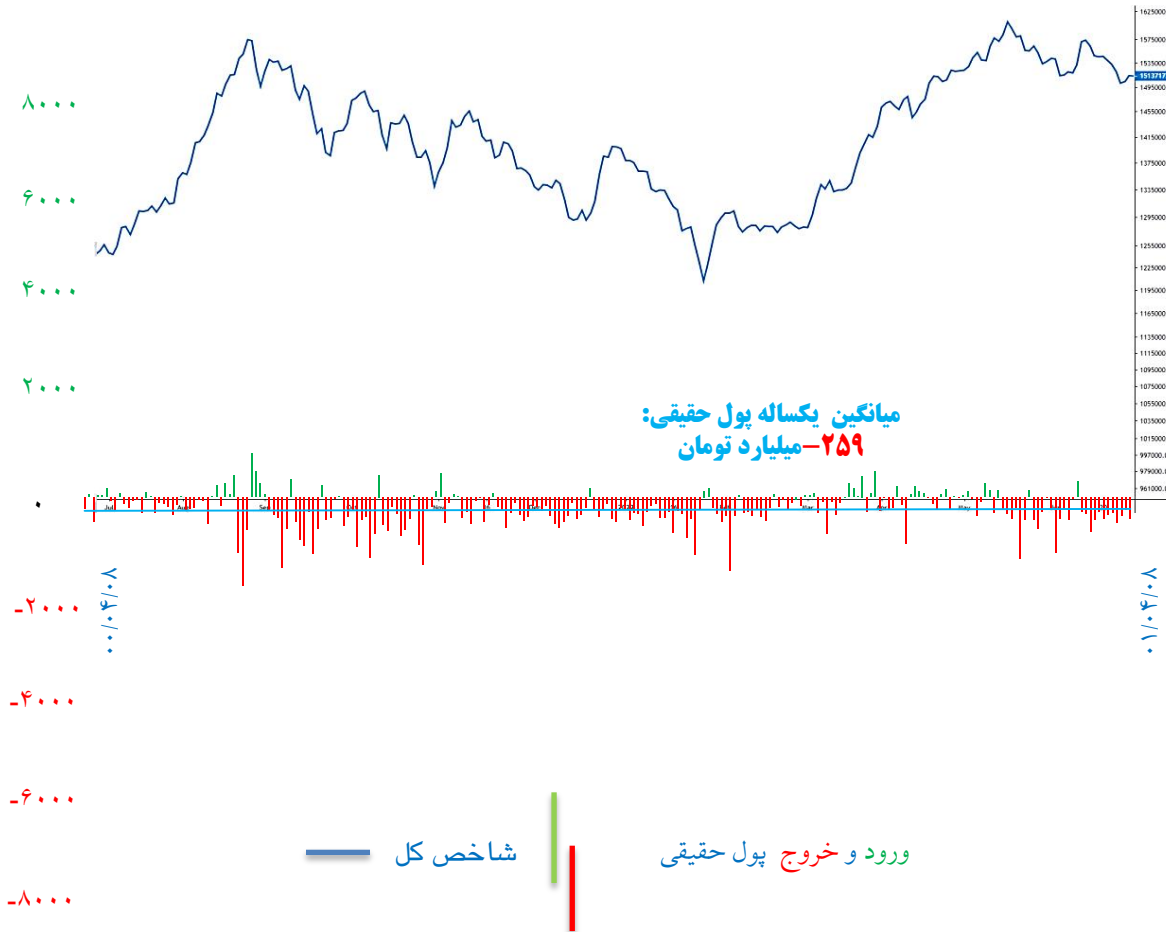
- همانطور که انتظار می‌رفت، شاخص دلار مجدداً موجی صعودی را شروع و موفق به بازپس‌گیری محدوده مقاومتی ۱۰۵ واحد شد.
- بطورکلی روند بلندمدت شاخص دلار صعودی ارزیابی می‌شود. در صورتیکه شاخص دلار موفق به تثبیت بر بالای محدوده مذکور گردد، انتظار می‌رود این شاخص به هدف قیمتی ۱۰۸ واحد در آینده‌ای نزدیک دست پیدا کند.

❖ 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 روندهای 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 ۱,۵۱۳,۷۱۷ واحدی و بازده هفتگی ۱/۲۸- درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۱,۹۰۴ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱، نشان دهنده خروج ۱۱,۹۱۹ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۱۸۶ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.
- خالص پول اشخاص حقیقی کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹، که در قله خود (۱۹امرداد ۱۳۹۹) به عدد ۱۱۸,۲۴۲ میلیارد تومان رسیده بود، به عدد ۲۹,۷۴۹- میلیارد تومان افول کرد.

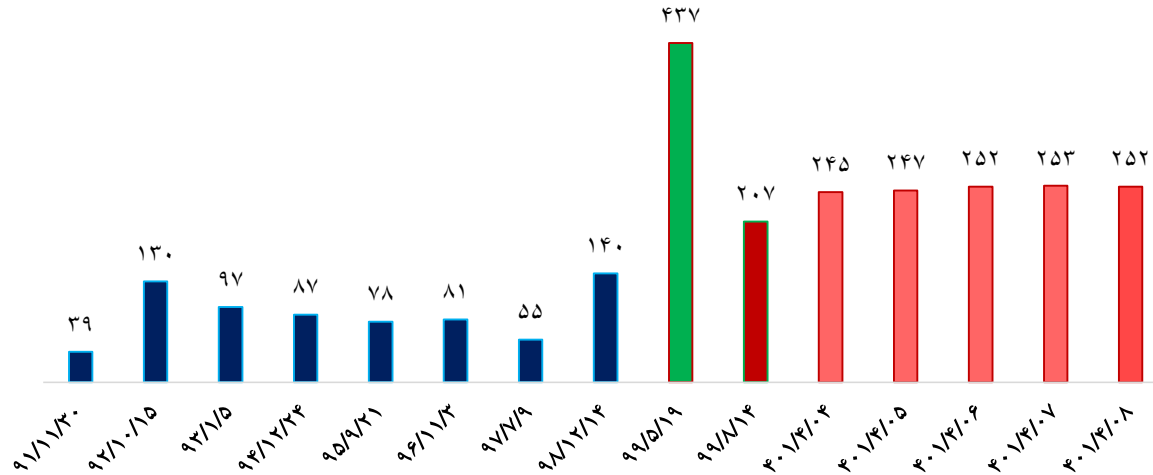
خالص ورود و خروج پول حقیقی کل بازار طی هفته گذشته:

| | | | |
|----------|----------|--------|---------------|
| شنبه | ۰۱/۰۴/۰۴ | : ۳۰۵- | میلیارد تومان |
| یکشنبه | ۰۱/۰۴/۰۵ | : ۵۳۲- | میلیارد تومان |
| دوشنبه | ۰۱/۰۴/۰۶ | : ۳۷۰- | میلیارد تومان |
| سه شنبه | ۰۱/۰۴/۰۷ | : ۲۶۲- | میلیارد تومان |
| چهارشنبه | ۰۱/۰۴/۰۸ | : ۴۳۶- | میلیارد تومان |

منبع: شرکت بورس (TSE.ir)

ارزش دلاری شاخص کل

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



طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۴۳ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله خود در سال ۱۳۹۹ معادل ۴۵ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ ارزش GDP ایران معادل ۲۰۳ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۱۲۰ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که در تاریخ ۲۴ ژوئن سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۱/۷ تریلیون دلار بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۴/۴ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۱۷۱ 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 (۱۴۰۱/۰۴/۱۱) |
|--------|------------|------------------|----------|----------------|-----------------------|------------|--------------------|
| شستا | ۶.۶۹ | ۱۳۹ | ۹۳۰ | ۵.۸۱ | ۱۶۰ | ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ | ۶۴٪ |
| وبانک | تحقق یافته | | ۹,۸۶۰ | ۴.۷۳ | ۲,۰۸۴ | ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ | ۵۶٪ |
| وسندوق | تحقق یافته | | ۱۳,۵۲۰ | ۵.۷۹ | ۲,۳۳۷ | ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ | ۴۸٪ |
| وامید | ۱۰.۰۳ | ۱,۳۶۷ | ۱۳,۷۱۰ | ۷.۰۱ | ۱,۹۵۵ | ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ | ۵۳٪ |
| وغدیر | ۶.۴۰ | ۲,۲۱۷ | ۱۴,۱۹۰ | ۴.۸۲ | ۲,۹۴۷ | ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ | ۵۳٪ |
| ونیکو | ۴.۷۹ | ۱,۸۸۵ | ۹,۰۲۰ | - | - | ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ | ۴۳٪ |

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 و بردیا وکیلی

راهبری و نظارت بر محتوا:
رضا جعفری

استفاده از محتوای این گزارش، با ذکر منبع، مجاز است.