



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

ابلاغ بسته ۱۰ بندی حمایت از بازار سرمایه:

آیا شاهد توقف روند نزولی شاخص کل خواهیم بود؟

- ۱- بیمه کردن سهام حاضر در پوررتفوی اشخاص حقیقی تا سقف ۱۰۰ میلیون تومان برای هر نفر (که حدود ۹۶ درصد از تعداد کدهای حقیقی فعال حاضر در بازار را تشکیل می دهند) از طریق انتشار عمومی اوراق تبعی و خرید توسط سرمایه گذاران صورت می گیرد. سررسید اعمال این اوراق یک ساله بوده و مبلغ تعهد خرید ۲۰ درصد بالاتر از ارزش ترکیب سبد افراد در آخرین روز معاملاتی چهارشنبه ۴ آبان ۱۴۰۱ است و بر اساس ترتیباتی که سازمان بورس اعلام می کند اعمال و اجرایی خواهد شد؛
- ۲- انتشار اوراق اختیار تبعی فروش روی سهام موجود در صندوق های درآمد ثابت تا سقف ۴۰۰ هزار میلیارد ریال با تضمین اصل ارزش سبد سهام در ابتدای دوره بر اساس ترتیباتی که سازمان بورس اعلام می نماید؛
- ۳- تزریق منابع جدید توسط صندوق های حاکمیتی برای خرید سهام در بازار سرمایه و به مرور افزایش مبلغ مذکور؛
- ۴- واریز منابع مندرج در ردیف بودجه سال ۱۴۰۱ به صندوق تثبیت از روز شنبه جمعاً به مبلغ حدود ۵۰ هزار میلیارد ریال؛
- ۵- هماهنگی، نظارت و پایش مستقیم و مستمر فعالیت اشخاص حقوقی بازار سرمایه شامل شرکت ها و نهادهای مالی شبه دولتی، صندوق های بازنشستگی و نهادهای نظامی و حمایت این نهادها از سهام ناشران تحت مدیریت خود و توقف فروش تا زمان ثبات در بازار و انجام اقدامات حمایتی از جمله خرید سهام و انتشار اوراق تبعی حمایتی؛
- ۶- همکاری مشترک بانک مرکزی و وزارت اقتصاد جهت مدیریت نرخ سود؛
- ۷- افزایش سپرده گذاری مستقیم سازمان بورس نزد صندوق تثبیت؛
- ۸- محدود کردن بخش فروش بازارگردان ها تا اطلاع ثانوی؛
- ۹- توقف پذیرهنویسی اوراق بهادار و عرضه های اولیه تا زمان بازگشت ثبات به بازار سرمایه؛
- ۱۰- بازگشت زمان جلسه معاملاتی در فرابورس به روال سابق از ساعت ۱۳:۰۰ به ۱۲:۳۰.

منبع: فارس

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۲۷ - هفته منتهی به ۷ آبان 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: آتش در خرمن شرکت‌های بزرگ حوزه تکنولوژی؛
- تصویر اقتصاد کلان: افزایش نرخ رشد اقتصادی در آمریکا و چین، افزایش نرخ بهره در منطقه یورو و کاهش نرخ تورم نقطه‌به‌نقطه در ایران؛
- بورس و انرژی: هفته سیاه حوزه تکنولوژی؛
- فلزات گرانبها و ارز: رشد بازار کریپتوکارنسی؛
- بازار کالاهای خام: افت بالتیک تحت فشار کاهش تقاضا؛
- بررسی وضعیت صندوق‌ها؛
- بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - ریزش شدید شاخص کل و شکست پر قدرت حمایت ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحدی؛
- 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

آتش در خرمن شرکت‌های بزرگ حوزه تکنولوژی

اشاره

شمارت غول‌های نفتی آمریکا بخاطر زراندوزی و کسب سود هنگفت از بازار انرژی، سپس تقسیم آن بین سهامداران به جای هزینه در تحقیق و توسعه، که از هفته‌های پیش شروع شده بود، این هفته از زبان رئیس جمهور این کشور نیز بیان شد.

سقوط آزاد بازار سهام چین در سایه برگزیده شدن شی جین‌پینگ برای مرتبه سوم به ریاست جمهوری و تداوم افزایش ذخایر طلا و خرید نفت ارزان از روسیه توسط این کشور و تجار آن، خیرساز شد.

خریداری توئیتر توسط ایلان ماسک و تسلط او بر این شبکه اجتماعی و رسانه مهم پس از کشمکش‌ها، به‌مراه آزادسازی اکانت دونالد ترامپ، خبر دیگری بود که منتشر شد. سرمایه‌گذاری جدید و گسترده عربستان سعودی در بانک کردیت سوییس خبر مهم دیگر جهان بود.

ابراز نگرانی برخی از مقامات فدرال رزرو از روند افزایش نرخ بهره و ضرر آن برای اقتصاد جهانی و در نهایت اعتراف رئیس جمهور آلمان به اشتباه بودن سیاست‌های کشورش در قبال جنگ روسیه و اوکراین، پایان‌بخش اخبار این هفته بودند.

بلومبرگ Bloomberg

BUSINESS INSIDER بیزینس اینسایدر

- مدیر شرکت نفتی پائونیر گفت قیمت نفت به ۱۲۰ دلار افزایش خواهد یافت.
- شرکت‌های بزرگ نفتی به خاطر تقسیم سود بالا بین سهامداران از سوی دولت‌های غربی مؤاخذه می‌شوند.
- یک فرد عضو گروه‌های راست‌گرای افراطی به خانه رئیس کنگره آمریکا، نانسی پلوسی، حمله و همسر او را مجروح کرد.
- موج اخیر خرید نفت از سوی چین برای پر کردن ذخایر، کمی به قیمت نفت در جهان جان داد.
- خلاصه بازارهای آسیا در این هفته: افت قیمت سهام و آب رفتن قیمت طلا.
- بایدن در سخنرانی عمومی، گول نفتی اکسان موبیل را با وجود ساخت سود بالای سالانه به خاطر عدم هزینه آن در تحقیق و توسعه و تقسیم آن بین سهامداران سرزنش کرد.
- افزایش شدید اجاره در سنگاپور بعضی شرکت‌ها را مجبور به کوچک‌تر کردن دفاتر نمایندگی‌شان و حتی مهاجرت به هنگ‌کنگ واداشته است.
- بانک «کردیت سوییس» با سرمایه‌گذاری گسترده و پشتیبانی دولت سعودی به بازرراحی سیاست‌های کلی خود می‌پردازد.
- با وجود بازار مثبت سهام، این هفته، هفته بدی برای شرکت‌های بزرگ حوزه تکنولوژی بود.
- آمریکا یک بنیاد ایرانی را به خاطر تعیین جایزه برای سر سلمان رشدی تحریم کرد.
- هزینه سیاست اصلی حفظ ارزش لیر ترکیه در سال جاری به ۸ میلیارد دلار رسیده است.
- حفظ کانال ۲۰,۰۰۰ هزار دلاری توسط بیت‌کوین، به سرمایه‌گذاران امید شروع روند صعودی داده است.
- شدت گرفتن بحران اعتبار در کره جنوبی موجب وحشت مردم از تکرار وقایع دهه ۹۰ شده است.
- بذر بهبود وضعیت بازار سهام جهانی، در هفته فاجعه‌بار شرکت‌های حوزه تکنولوژی کاشته شد.
- ایلان ماسک پس از خرید توئیتر، مدیر عامل، برخی اعضای هیأت مدیره و بخشی از مهندسان نرم‌افزار این شرکت را اخراج کرد.
- روسیه در حال جبران کردن افت فروش نفت خود با پناه گرفتن در بازار چین و فروش نفت به یوان است.
- مردم جمهوری چک در اعتراض به بحران افزایش هزینه زندگی به خیابان‌ها آمدند.
- قوانین کاری جدید بریتانیا، درخواست برای کار مختلط و متناوب «حضور/مجازی» در طول هفته را برای کارمندان آسان‌تر می‌کند.
- با وجود افزایش آمار افرادی که خواهان دورکاری و کار در خانه هستند، آمار شغل‌هایی که با این شرایط آگهی می‌شوند در حال کاهش است.

- تصاحب توئیتر توسط ایلان ماسک و کاهش ارزش سهام این شرکت و تسلا، ۱۰ میلیارد دلار از ثروت شخصی او کاست.
- برخی مقامات فدرال رزرو معتقدند، افزایش سریع نرخ بهره تا ۵ درصد می‌تواند عامل رکود جهانی شود.
- صرافی رمزارز جنسیس گفت اعطای وام‌های کریپتویی در سه‌ماهه اخیر ۸۰ درصد کاهش داشته است.
- لاگارد، رئیس بانک مرکزی اروپا، گفت اعمال پوتین به قدری شنیع و فجیع است که گویی توسط نیروهای شیطانی هدایت می‌شود.
- نخست وزیر سوئد اعلام کرد قانع کردن ترکیه برای پذیرش پیوستن سوئد به ناتو کار آسانی نیست.
- با بازنشسته شدن نسل مدیران متولد دهه ۶۰ میلادی، هیات مدیره شرکت‌های بزرگ بین‌المللی در حال جوان‌تر شدن است.
- طبق تحقیقات، آمار استعفای خاموش، با انجام کار حداقلی با بازده پایین به خاطر دستمزد دریافتی پایین همچنان در حال افزایش است.
- افزایش قیمت رمزارزها در پایان اکتبر، شاید نقطه عطفی برای تغییر روند نزولی این بازار باشد.

- تسلط «ایلان ماسک» بر توئیتر در بحبوحه فشار فروش گسترده سهام شرکت‌های حوزه تکنولوژی او را به سلطان رسانه‌های اجتماعی بدل کرد.
- تصمیمات مدیریتی غلط «مارک زاکربرگ» یکی از عوامل اصلی توقف رشد تصاعدی آمار کاربران و ارزش بازار شبکه‌های اجتماعی است.
- چارلی مانگر، سرمایه‌گذار افسانه‌ای و همکار وارن بافت، هنوز معتقد است سهام ارزش سرمایه‌گذاری بیشتر در مقابل سایر دارایی‌ها دارد.
- سهام شرکت آمازون بعد از انتشار پیش‌بینی آمار فروش در تعطیلات پیش‌روی سال نو، ۱۰ درصد سقوط کرد.
- سود شرکت نفتی اکسان موبیل سه برابر شده و به ۲۰ میلیارد دلار رسید.
- اشتاین‌مایر، رئیس جمهور آلمان، شکست تلخ سیاست‌های کشورش در قبال بحران روسیه را پذیرفت.
- بانک مرکزی روسیه به پوتین هشدار داد اعلام وظیفه عمومی و فراخوان جوانان به میدان جنگ، باعث افزایش تورم می‌شود.
- ژاپن یک بسته محرک ۲۰۰ میلیارد دلاری را از چندین کانال به بازار تزریق کرد.
- گرمای شدید تابستان امسال، چند تریلیون دلار درآمد را از چنگ اقتصادهای نوظهور خارج کرده است.
- کانادا بدنبال جذب سرمایه‌گذارهای حقیقی و فردی برای تأمین مالی بزرگترین صندوق کمک‌های انسان‌دوستانه به اوکراین است.
- جست‌وجوی اینترنتی عبارت «بهانه‌هایی برای سر کار نرفتن» در سال ۲۰۲۲ چند برابر شده است.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

فایننشال تایمز



۶۳۵,۰۷۰,۱۳۴ +۰,۴۸%

جان باختگان
۶,۵۹۲,۶۵۱ +۰,۱۷%

بهبودیافتگان
۶۱۴,۰۱۲,۰۴۸ +۰,۴۶%

تصویر اقتصاد کلان

افزایش نرخ رشد اقتصادی در آمریکا و چین
افزایش نرخ بهره در منطقه یورو
کاهش نرخ تورم نقطه به نقطه در ایران

مقایسه بازدهی بازارها

بازار	هفتگی	ماهانه	۱۴۰۱	یکساله
دلار (ریالی)	٪۱،۲۰	٪۲،۷۱	٪۲۵،۹۳	٪۱۹،۳۹
سکه (ریالی)	٪۰،۸۳	٪۲،۸۳	٪۲۱،۳۷	٪۲۶،۱۸
بورس (شاخص)	٪۵،۱۶-	٪۷،۰۰-	٪۲،۸۷-	٪۱۰،۳۶-
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	٪۱۰،۲۵	٪۹،۲۰	٪۴۵،۵۰-	٪۶۱،۰۰-
مسکن (ریالی - تهران)	-	۱/۱٪	-	۳۶/۳٪

منبع داده‌ها:

وبسایت TGJU : بازدهی دلار و سکه
 وبسایت TSETMC : بازدهی شاخص کل بورس تهران
 بانک مرکزی ج.ا.ا. : بازدهی مسکن
 وبسایت TradingView : بازدهی رمزارزها

نرخ بهره (درصد)	فصلی	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین 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- سپتامبر	۲۲- سپتامبر	۲۲- سپتامبر	۲۲- سپتامبر	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۳/۲۵	٪۲/۶	٪۸/۲	٪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- اکتبر	۲۲- سپتامبر	۲۲- سپتامبر	۲۲- سپتامبر	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۳/۶۵	٪۳/۹	٪۲/۸	٪۵/۵	٪۰/۹	٪۴/۲	٪۸/۱	۱۲،۳۵۹	۱۷،۴۵۸،۰۴۰	مقدار شاخص
				٪۲/۱	٪۳/۷	٪۳/۳	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
منطقه یورو									
۲۲- اکتبر	۲۲- ژوئن	۲۲- سپتامبر	۲۲- اگوست	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۱۹	۲۰۲۰	بازه زمانی
٪۲	٪۰/۸	٪۹،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	۱۴۰۱ بهار	۱۴۰۱ مهر	۱۴۰۱ تابستان	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۱۴۰۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
٪۱۸	٪۳/۸	٪۴۸/۶	٪۸/۹	٪۴۰/۱	٪۹/۸	٪۴/۳	۷،۵۵۵	۲۳۱،۵۴۷/۵۷	مقدار شاخص
				٪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، نقطه نقطه و فصلی کشورها (به جز ایران) و همچنین آمار مربوط به نرخ بهره
 مرکز آمار ایران: آمارهای میانگین سالیانه، نقطه به نقطه و فصلی ایران

بورس و انرژی

هفته سیاه حوزه تکنولوژی

بورس‌های جهانی

این هفته، هفته‌ای بواقع تلخ برای شرکت‌های حوزه تکنولوژی بود. پس از انتشار گزارش‌های بسیار بد فصلی و پیش‌بینی وضعیت بدتر برای فصل آینده، سهامداران به شکل دسته‌ای شروع به فروش سهام این شرکت‌ها کردند. گزارشات در نتیجه کُند شدن روند اقتصاد جهانی بود که به وضعیت فروش این شرکت‌ها به شکلی اسفبار صدمه زده بود. شرکت‌های فعال در حوزه قطعات و ریزپردازنده‌ها (مانند اینتل) که در دو سال اخیر با موج شدید تقاضا و عدم توان همگام با درخواست بازار روبرو بودند، اقدام به سرمایه‌گذاری گسترده برای خرید ماشین‌آلات جدید و راه‌اندازی خطوط تولید کردند، که بخاطر کمبودهای فوق‌الذکر برای تهیه این ماشین‌آلات نیز هزینه زیادی پرداختند. اکنون با مازاد عرضه، این خطوط تولید بلااستفاده و از تأمین هزینه راه‌اندازی خود بازمانده و فروش بطور مثال شرکت اینتل، که از هم‌پایی با رقبای کره‌ای و تایوانی خود به شدت جا مانده است، بسیار بدتر از بدترین پیش‌بینی‌ها بود. همچنین افزایش ارزش دلار باعث کاهش ۱۷ میلیارد دلاری درآمد خارجی شرکت آمازون شده و پیش‌بینی ناخوشایند فروش تعطیلات کریسمس نیز ضربه آخر به ارزش سهام این شرکت بود، که منجر به افت ۱۰ درصدی آن شد. درنهایت و در پایان هفته، صورت‌های مالی، سود، فروش خوب و پیش‌بینی‌های بسیار قوی و به شکل محسوس سلامت‌تر شرکت اپل، بعنوان بزرگترین شرکت دنیا، به یاری این بازار شتافت و به جز افزایش قیمت سهام خود، موج امیدی در سایر سهام حوزه تکنولوژی ایجاد کرد و با روی آوردن مجدد خریداران به شرکت‌هایی که در آغاز هفته سهام‌شان را فروخته بودند، بازار سهام ایالات متحده این هفته را با بازدهی مثبت به پایان رساند.

نفت و محصولات پتروشیمی

هم‌زمان با انتقاد ماکرون از قیمت LNG صادراتی اروپا به آمریکا، که بیشترین میزان تاریخ است، قیمت گاز هنری‌هاب با ۶ درصد رشد نسبت به هفته پیشین دوباره به ۲۰ سنت رسیده و بازدهی سالانه آن دوباره مثبت شد، که دلیل عمده آن آغاز فصل سرمای جدی در اغلب مناطق شمالی جهان است. همچنین قیمت گاز در اروپا، که هفته پیش، پس از کاهش ۷۰ درصدی دوماهه، به مقادیر پیش از حمله به اوکراین رسیده بود، این هفته با ۵ درصد افزایش در غرب اروپا و ۱۵ درصد افزایش در بریتانیا دوباره صعود کرد، که دلیل آن نیز افزایش مصرف بدلیل نزدیک شدن به فصل سرماست. همچنین با افزایش دوباره قیمت نفت در این هفته، بعضی از مدیران مجدداً صحبت از رسیدن نفت به محدوده ۱۲۰ دلار پیش از پایان زمستان را به میان آوردند.



منبع

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
بورس‌های جهانی						
۱	Dow Jones	۳۲,۸۶۶	واحد	۵.۷۴%	۱۰.۶۵%	-۸.۰۳%
۲	Nasdaq	۱۱,۵۴۶	واحد	۲.۰۹%	۰.۴۶%	-۲۶.۸۲%
۳	S&P 500	۳,۸۹۹	واحد	۳.۹۵%	۴.۹۸%	-۱۵.۰۹%
۴	FTSE 100	۷,۰۷۰	واحد	۰.۹۸%	۰.۵۷%	-۲۱.۱۸%
۵	DAX	۱۳,۲۴۳	واحد	۴.۰۳%	۸.۷۰%	-۱۵.۶۳%
۶	CAC 40	۶,۲۷۳	واحد	۳.۹۴%	۸.۸۱%	-۷.۸۱%
۷	NIKKEI 225	۲۷,۱۰۵	واحد	۰.۸۰%	۳.۵۶%	-۵.۹۶%
۸	SHANGHAI	۲,۹۱۶	واحد	-۴.۰۵%	-۴.۲۴%	-۱۷.۱۲%
۹	Moex	۲,۱۶۶	واحد	۶.۰۷%	۱۰.۹۵%	-۴۷.۷۷%
نفت و انرژی						
۱۰	نفت خام برنت	۹۵.۱۶	دلار/بشکه	۲.۹۹%	۹.۲۰%	۲۵.۸۵%
۱۱	نفت خام WTI	۸۷.۹	دلار/بشکه	۳.۷۱%	۸.۸۷%	۲۳.۲۳%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۵.۷۹	دلار/ MMBtu	۵.۸۲%	-۱۸.۹۲%	۶.۷۲%
۱۳	سید اوپک	۹۴.۸۳	دلار/بشکه	۲.۴۸%	۲.۱۸%	۱۳.۱۰%
۱۴	نفت سنگین ایران	۸۹.۲۳	دلار/بشکه	۳.۲۵%	۷.۰۷%	۱۴.۴۳%
۱۵	گازوئیل	۱,۰۳۸	دلار/تن	۳.۶۷%	۱۲.۶۴%	۵۸.۵۱%
۱۶	اتانول	۲,۴۶۵	دلار/گالن	-۰.۵۰%	۰.۹۳%	-۵.۱۹%
۱۷	نفتا	۶۶۹	دلار/تن	۰.۳۵%	۷.۰۰%	-۱۲.۲۷%
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۸۶۳	یوان/تن	-۰.۶۹%	-۱.۰۰%	-۳۰.۴۳%
۱۹	متانول CFR	۳۱۳	دلار/تن	-۲.۲۴%	-۵.۷۵%	-۲۱.۴۱%
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۵۸۶.۵	دلار/تن	-۴.۱۱%	-۶.۴۶%	-۲۳.۲۳%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۹۸۰	دلار/تن	-۵.۱۰%	-۹.۱۸%	-۱۱.۶۳%

نقد سربانه انرژی و سهام ایران (مجموعی)

TeleTrader

TradingEconomics

TeleTrader

TeleTrader

TeleTrader

OilPrice

OilPrice

TeleTrader

TradingEconomics

TradingEconomics

Sunsirs

PLATTS

Fertilizerworks

PLATTS

سنت/متر
مکعب

۲۰.۴۹

فلزات گرانبها و ارز

رشد بازار کریپتوکارنسی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۶۴۵	دلار/اونس	-۰.۶۸%	-۰.۹۲%	-۸.۰۱%	TeleTrader
۲	نقره	۱۹.۲۷	دلار/اونس	-۰.۴۱%	۲.۳۹%	-۱۹.۵۷%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۵ آبان							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۳,۶۱۶,۰۰۰	ریال	۱.۵۷%	۳.۸۴%	۱۶.۲۴%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۵۰,۱۸۰,۰۰۰	ریال	۰.۸۳%	۵.۶۶%	۲۶.۰۹%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۵ آبان							
۵	دلار آزاد	۳۳۰,۵۲۰	ریال	۱.۲۲%	۴.۳۳%	۱۹.۴۲%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۷۱,۱۱۷	ریال	۰.۳۸%	۱.۲۰%	۱۷.۱۹%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۷۳,۵۸۰	ریال	۰.۳۸%	۱.۲۰%	۱۷.۱۹%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۳۰,۴۰۰	ریال	۳.۲۵%	۸.۴%	۲.۸۴%	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۷۲,۸۴۸	ریال	۳.۲۷%	۵.۸۲%	۱.۷۷%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۷۵,۳۲۶	ریال	۳.۲۷%	۵.۸۲%	۱.۷۷%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۷,۷۳۷	ریال	۰.۰۶%	۰.۵۶%	۷.۶۰%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۳,۸۲۴	ریال	۰.۳۸%	۱.۲۰%	۱۷.۲۰%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۷۴,۴۹۵	ریال	۰.۳۹%	۱.۲۰%	۱۷.۱۹%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت کوین	۲۰,۹۰۲	دلار	۸.۷۶%	۶.۷%	-۶۶.۴۳%	Tradingview
۱۵	اتریوم	۱,۶۲۷	دلار	۲۳.۵۹%	۲۱.۶۵%	-۶۳.۲۲%	Tradingview

بازار فلزات گرانبها

طی هفته گذشته اونس جهانی طلا با افت ۰.۸ درصدی به عدد ۱,۶۴۵ دلار رسید. آنچه که طی هفته آتی می‌تواند جهت طلا را تعیین کند، جلسه روز چهارشنبه (۲ نوامبر) فدرال رزرو بمنظور تعیین نرخ بهره آمریکا است. طبق نظرسنجی‌های انجام شده، ۸۲ درصد از کارشناسان افزایش ۰/۷۵ واحد درصدی و رسیدن به عدد ۴ درصد را برای نرخ بهره آمریکا پیش‌بینی کرده‌اند که این افزایش می‌تواند موجب تضعیف شدن اونس جهانی طلا گردد.

سکه و ارز (داخلی)

طی هفته اخیر شاهد افزایش نرخ‌ها در بازار ارز، سکه و طلای داخلی بودیم. در بازار ارز، افزایش قیمت یورو با ۳/۲۵ درصد محسوس بوده که علت آن تقویت یورو در بازار جهانی و افزایش ۲/۵ درصدی این ارز طی دو هفته اخیر بود، بطوریکه طی هفته کاری گذشته، جفت ارز یورو به دلار توانست بار دیگر عدد بالای ۱ را لمس کند. لازم به ذکر است که یکی از علل تقویت یورو، افزایش ۰/۷۵ درصدی نرخ بهره بانک مرکزی اروپا و رسیدن به عدد ۲ درصد طی جلسه روز پنجشنبه ۱۲۷ اکتبر بود.

رمزارز

طی هفته اخیر، ارزش کل بازار کریپتو با افزایش نزدیک به ۱۰ درصد به عدد ۹۸۲ میلیارد دلار رسید که نسبت به هفته گذشته رشد ۸۵ میلیارد دلاری را به ما نشان می‌دهد. طی این مدت شاهد رشد ۲۳ درصدی اتریوم و رشد ۸/۷۶ درصدی قیمت بیت‌کوین بودیم. از علل این رشد می‌توان به هشدار شرایط رکودی در اقتصاد دنیا اشاره کرد. بدین صورت که طی هفته گذشته برترین بانکدارهای وال استریت نسبت به رکود اقتصادی آمریکا و اروپا هشدار صادر کردند که انتشار آن سبب رشد بازار سهام و کریپتو گردید.

در ادامه هفته با خبر قطعی شدن خریداری توئیتر توسط ایلان ماسک، شاهد پامپ شدن رمزارز محبوب ایلان ماسک یعنی دوچ‌کوین بودیم بطوریکه با نگاه به نمودار هفتگی این رمزارز، رشد ۸۱ درصدی آن مشاهده می‌شود. لازم به ذکر است که با توجه به این رشد، مارکت دوچ‌کوین به عدد ۱۴ میلیارد دلار رسید و این رمزارز توانست با عبور از سولانا و کاردانو به جایگاه هشتم در کوین مارکت کپ دست یابد.

بازار کالاهای خام افت بالتیک تحت فشار کاهش تقاضا

بازار محصولات کشاورزی

معاملات آتی پنبه بدلیل شرایط چالش برانگیز اقتصادی، به پایین‌ترین سطح ۲۲ ماهه خود کاهش یافت. در بخش عرضه پنبه، طبق آخرین گزارش وزارت کشاورزی آمریکا، مشخص شد که تولید جهانی پنبه برای سال ۲۰۲۳ ۲۰ معادل ۱۱۸/۱ میلیون عدل پیش‌بینی شده که ۲ درصد از سال قبل بالاتر است و این تولید بالاتر، مربوط به هند، برزیل و چین است که کاهش تولید آمریکا و پاکستان را جبران می‌کنند. قیمت آتی گندم به ۸۳۰ سنت در هر بوشل کاهش یافت، که تحت فشار تقاضاهای ضعیف و نگرانی‌های ناشی از عرضه ضعیف بوده است. در همین حال سازمان ملل خوش‌بینی خود را در مورد گسترش کریدور تجاری امن برای بنادر دریای سیاه ادامه داد و امیدوار بود که اوکراین بتواند گندم صادر کند.

بازار کالاهای صنعتی

معاملات آتی میلگرد فولادی در هفته چهارم اکتبر از ۳،۵۵۰ یوان در هر تن گذشت، که پایین‌ترین رقم از سال ۲۰۲۰ بود. در میان کاهش تقاضا برای مواد اولیه صنعتی و ساختمانی، داده‌های تازه نشان می‌دهد که محموله‌ها از مبدأ دو صادرکننده برتر جهان، یعنی استرالیا و برزیل، از ابتدای ماه جاری به ترتیب ۲۰ و ۱۱ درصد کاهش یافته است. علاوه بر این، داده‌های مصرف‌کننده بزرگ دنیا، یعنی چین، نشان داد که سرمایه‌گذاری در بخش املاک این کشور در ۹ ماه اول سال ۲۰۲۲ بیش از ۸ درصد کاهش یافته است و این نشان‌دهنده استفاده کمتر از فولاد است. معاملات آتی روی، در این هفته حدود ۳،۰۰۰ دلار در هر تن معامله می‌شد، که در بحبوحه نگرانی ناشی از عرضه محدود روسیه، از پایین‌ترین سطح یک‌ساله ۲،۸۰۰ دلاری که در اواخر سپتامبر به آن رسیده بود، بهبود یافت. روی نیز تقریباً ۳۰ درصد نسبت به زمان اوج خود در آوریل در بحبوحه نگرانی‌های ناشی از رکود تقاضا، کاهش یافته است.

شاخص‌های کالایی

شاخص بالتیک خشک، که هزینه حمل‌ونقل کالا در سراسر جهان را اندازه‌گیری می‌کند، به ۱،۵۳۴ واحد رسید. بدتر شدن چشم‌انداز اقتصاد جهانی منجر شد که شاخص Capesize که محموله‌های سنگ‌آهن ۱۵۰،۰۰۰ تنی را دنبال می‌کند، در بحبوحه تضعیف تقاضای جهانی فولاد با ۴/۵ درصد کاهش به ۱،۶۷۰ واحد رسید. شاخص Panamax نیز، که حدود ۶ تا ۷۰ هزار تن محموله زغال‌سنگ و غلات را دنبال می‌کند، حدوداً ۴/۱ درصد کاهش یافت و به ۱،۸۱۷ واحد رسید، که بیشترین کاهش در نزدیک به دو ماه گذشته است. همچنین شاخص Supramax با افت ۸۹ واحدی به ۱،۴۸۳ واحد رسید. بنابراین شاخص بالتیک خشک ۱۶ درصد در این هفته کاهش یافت، که عمدتاً تحت فشار تقاضای کم برای کشتی‌های بزرگ و پانامکس است.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع		
محصولات کشاورزی									
۱	ذرت	۶۸۰	سنت / بوشل	۲۶۸	دلار/تن	-۰.۵۵%	۱.۵۱%	۱۹.۶۳%	TeleTrader
۲	کتان (پنبه)	۷۲.۱۱	سنت / پوند	۱۵۹۰	دلار/تن	-۹.۱۸%	-۸.۲۷%	-۱۵.۳۷%	TeleTrader
۳	سویا	۱،۴۰۰	سنت / بوشل	۵۱۴	دلار/تن	-۰.۱۲%	-۱.۶۳%	۱۲.۳۰%	TeleTrader
۴	شکر	۱۷.۶۳	سنت / پوند	۳۸۹	دلار/تن	-۴.۰۳%	-۴.۶۶%	-۸.۷۷%	TeleTrader
۵	گندم	۸۳۰	سنت / بوشل	۳۰۵	دلار/تن	-۲.۰۹%	-۷.۴۸%	۷.۳۱%	TeleTrader
۶	کانولا	۹۰۹	دلار کانادا/تن	۶۶۰	دلار/تن	۱.۱۳%	۶.۷۰%	-۱۱.۹۰%	TradingEconomics
کالاهای صنعتی									
۷	مس	۷۵۵۷	دلار/تن			-۱.۲۲%	۱.۰۵%	-۲۱.۶۰%	TeleTrader
۸	قیر	۴،۳۱۹	یوان/تن	۵۹۸	دلار/تن	۳.۷۲%	۱.۶۵%	۳۷.۶۴%	TradingEconomics
۹	فولاد	۳،۵۷۱	یوان/تن	۴۹۵	دلار/تن	-۳.۶۷%	-۱۰.۱۴%	-۲۵.۷۰%	TradingEconomics
۱۰	آلومینیوم	۲،۲۳۴	دلار/تن			۰.۷۰%	۰.۰۹%	-۱۸.۲۷%	TeleTrader
۱۱	سرب	۱،۹۹۲	دلار/تن			۴.۶۸%	۶.۸۱%	-۱۶.۲۷%	TeleTrader
۱۲	روی	۲،۸۵۱	دلار/تن			-۴.۴۱%	-۴.۰۳%	-۱۶.۹۸%	TeleTrader
۱۳	سنگ آهن	۸۴.۰۰	دلار/تن			-۱۱.۱۱%	-۱۶.۸۳%	-۲۱.۸۶%	TradingEconomics
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۵۰۴	دلار/تن			-۴.۱۷%	-۴.۵۷%	-۲۸.۶۰%	Metal Bulletin
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۴۷۸	دلار/تن			-۰.۲۱%	۴.۲۶%	-۲۶.۵۴%	Metal Bulletin
شاخص‌های کالایی									
۱۶	بالتیک خشک	۱،۶۱۲	واحد			-۱۲.۲۵%	-۸.۴۱%	-۵۵.۴۸%	tgu.org
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۲۹۴	واحد			۰.۱۷%	۰.۸۳%	۱۶.۲۰%	TradingEconomics
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۳،۶۲۵	واحد			۱.۹۶%	۱.۹۳%	-۱۷.۵۰%	TradingEconomics
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳،۶۰۳	واحد			۱.۸۳%	۵.۲۴%	۲۴.۵۹%	TradingEconomics



بررسی وضعیت صندوق‌ها

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (بیلیارد ریال)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	میانگین بازدهی هفته (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی 3 ماهه (%)	میانگین بازدهی 6 ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
جسورانه	۴,۲۵۵.۹۱	۱.۱۲٪	۰.۰۲٪	۰.۲۶٪-	۰.۵۷٪	۱.۷۵٪	۲۲.۸۴٪	
صندوق درصندوق	۳,۲۴۶.۱۲	۰.۰۰٪	۲.۱۳٪-	۲.۶۹٪-	۴.۱۴٪-	۶.۷۶٪-	۴.۵۹٪	
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۸۵۲,۲۸۸.۸۳	۰.۹۶٪	۰.۱۷٪	۱.۲۶٪	۴.۱۹٪	۷.۹۷٪	۱۵.۹۰٪	
اختصاصی بازارگردانی	۸۹۷,۵۸۸.۵۱	۲.۲۸٪	۴.۰۵٪-	۶.۵۸٪-	۷.۷۹٪-	۱۱.۷۰٪-	۵.۴۴٪-	
در سهام	۵۰۴,۳۰۵.۰۶	۰.۹۸٪	۴.۸۶٪-	۶.۵۹٪-	۹.۳۵٪-	۱۵.۳۲٪-	۶.۷۸٪-	
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۴۹,۳۴۲.۲۸	۰.۰۰٪	۰.۳۴٪-	۳.۲۱٪	۵.۲۷٪-	۶.۲۰٪	۲۱.۸۵٪	
مختلط	۲۲,۲۹۰.۸۹	۱.۳۷٪	۲.۵۳٪-	۲.۹۶٪-	۳.۲۷٪-	۴.۶۵٪-	۱.۹۲٪-	
خصوصی	۱۲,۴۶۹.۲۳	۰.۰۰٪	۰.۰۹٪	۰.۳۸٪	۱.۲۰٪	۲.۸۸٪	۳.۷۷٪	
پروژه‌های	۱۰,۸۹۸.۲۹	۰.۰۰٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	
جمع کل	۶,۳۵۶,۶۸۵							

در هفته منتهی به شنبه ۷ آبان ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های جسورانه، درآمد ثابت، خصوصی و پروژه‌های مثبت و بازدهی صندوق‌های مبتنی بر سپرده‌های کالایی، صندوق در صندوق، اختصاصی بازارگردانی، در سهام و مختلط منفی بود. درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های پروژه ای با ۳/۰۵ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های در سهام با ۴/۸۶- درصد بود. از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۶/۳۷ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۴/۱۲ درصد و سهامی با ۷/۹۴ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند. شایان ذکر است که صندوق پروژه‌های آرمان پرنده مینا به مدیریت مشاوره سرمایه‌گذاری آرمان آتی و ارزش دارایی ۱۰,۸۱۸ میلیارد ریال، در این هفته به بازدهی مثبت رسیده است. با توجه به بازدهی سالانه، صندوق‌های جسورانه، مبتنی بر سپرده کالایی و درآمد ثابت با بازده ۲۲/۸۴ درصد، ۲۱/۸۵ درصد و ۱۵/۹۰ درصد دارای بیشترین بازدهی و صندوق‌های در سهام، بازارگردانی و مختلط به ترتیب با بازده ۶/۷۸- درصد، ۵/۴۴- درصد و ۱/۹۲- درصد دارای کمترین بازدهی سالانه بودند. همچنین جمع کل خالص ارزش دارایی صندوق‌ها نسبت به هفته گذشته ۱/۱۵ درصد کاهش داشته است.

منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

بررسی وضعیت بازار بدهی

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده	
اخزا۱۱	۷۷۷۹۹۰	۱۴۰۱-۰۸-۰۳	۱۴۰۲-۰۹-۰۶	۲۵.۸۹%	۲۶.۱۷%	
اخزا۱۱	۵۴۶۰۰۰	۱۴۰۱-۰۸-۰۴	۱۴۰۴-۰۳-۲۶	۲۵.۷۵%	۳۱.۴۸%	
اخزا۵	۸۹۹۹۰۰	۱۴۰۱-۰۸-۰۴	۱۴۰۲-۰۲-۱۸	۲۱.۹۵%	۲۰.۹۳%	
میانگین بازدهی					۲۴.۶۱%	۲۵.۸۲%

منبع: فرابورس ایران

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
اراد ۶۴	۹۸۰۰۰۰	۱۴۰۱-۰۸-۰۴	۱۴۰۱-۱۱-۰۹	۲۶.۳۶%
اراد ۳۳	۱۰۲۹۹۹۰	۱۴۰۱-۰۸-۰۳	۱۴۰۳-۰۳-۲۷	۱۳.۴۸%

منبع: فرابورس ایران

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

طی هفته اخیر، بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سررسید نشده متعلق به نمادهای اخزا۱۱ و اخزا۱۱ با سررسیدهای ۱۴۰۲/۰۹/۰۶ و ۱۴۰۴/۰۳/۲۶ با بازدهی‌های ۲۵/۸۹ و ۳۱/۴۸ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا۵ با سررسید ۱۴۰۲/۰۲/۱۸ و بازدهی‌های ۲۱/۹۵ و ۲۰/۹۳ درصد بود.

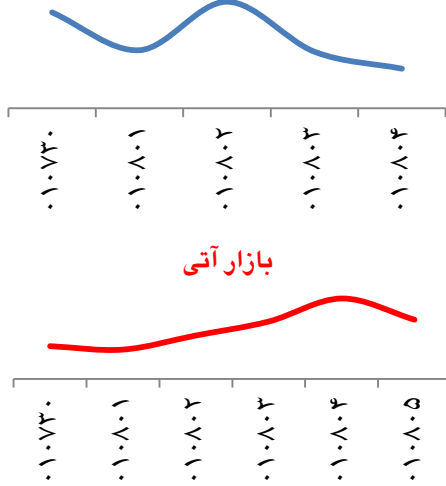
از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۴/۶۱ و ۲۵/۸۲ درصد است.

اوراق تأمین مالی

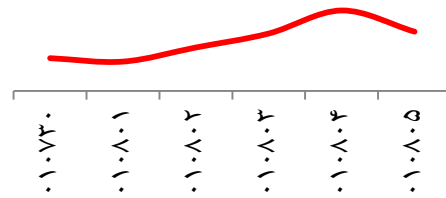
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد اراد۳۳ بمیزان ۱۳/۳۸ درصد با سررسید ۱۴۰۳/۰۳/۲۷ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اراد۶۴ بمیزان ۲۶/۳۶ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۱۱/۰۹ بوده است.

بورس کالا

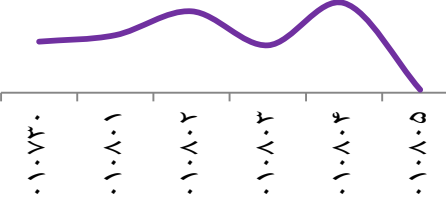
بازار فیزیکی



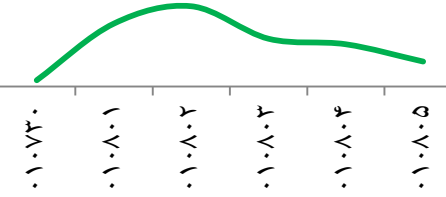
بازار آتی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)

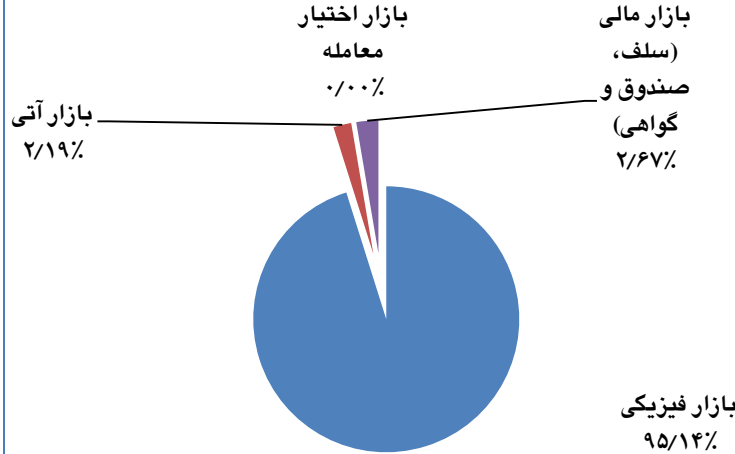


بازار اختیار معامله



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

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 ۲۳/۹۷ درصد و حجم معاملات ۱/۱۳ 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	۱۰۷,۲۱۳,۷۵۶	۲,۴۹۸,۰۷۱	۶۳/۵%
پتروشیمی و نفتی	۵۶,۱۵۴,۴۵۰	۳۷۲,۵۶۰	۲۳/۲%
اموال غیرمنقول	.	.	۰/۰%
معننی	۳۷۴,۷۵۹	۴,۵۰۰	۰/۲%
بازار فرعی	۵,۲۱۱,۳۲۲	۳۵,۹۳۶	۳/۱%
جمع	۱۶۸,۹۵۴,۲۸۷	۲,۹۱۱,۰۶۷	۱۰۰%

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

درخصوص مهمترین کالاهای خام جهانی، تحولات ارزش دلاری آنها در بورس کالا بر مبنای نرخ ارز بازار آزاد، حاکی از عقب ماندن نرخ اوره گرانول، نرخ بیلت فخور، نرخ پت گرید بطری شهید تندگویان و نرخ کاتد مس از نرخ‌های جهانی است.

مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

محصول	نرخ ریالی	میانگین هفتگی نرخ (نیمایی دلار)	میانگین هفتگی نرخ (دلار آزاد)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نیمایی)	ارزش دلاری (نرخ آزاد)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی	تغییرات هفتگی
یک تن اوره گرانول	۱۴۰,۶۸۳,۰۰۰	۲۷۱,۱۱۴	۳۲۸,۳۰۰	۵۱۹	۴۲۹	۸۵/۸%	۶۰۵	-۱/۳%
یک تن کاتد مس	۲,۴۰۲,۲۴۹,۰۰۰	۲۷۱,۱۱۴	۳۲۸,۳۰۰	۸۸۶۱	۷,۳۱۷	۱۱۷/۳%	۷,۵۵۷	۱/۶%
یک تن پت شهید تندگویان	۲۹۵,۹۹۸,۰۰۰	۲۷۱,۱۱۴	۳۲۸,۳۰۰	۱,۰۹۲	۹۰۲	۱۱۱/۴%	۹۸۰	۲/۵%
یک تن بیلت فخور	۱۳۳,۲۴۴,۰۰۰	۲۷۱,۱۱۴	۳۲۸,۳۰۰	۴۹۱	۴۰۶	۱۰۲/۰%	۴۷۷	۱/۸%
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۶,۵۰۰,۰۰۰	۲۷۱,۱۱۴	۳۲۸,۳۰۰	۲۴	۲۰	-	-	-۰/۳%

تحلیل تکنیکال شاخص کل

ریزش شدید شاخص کل و شکست پر قدرت حمایت ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحدی



- هفته گذشته شاخص کل با ریزش ۵/۵ درصدی روبرو شد و از ۱,۳۱۰,۰۰۰ واحد تا ۱,۲۴۱,۰۰۰ واحد افت کرد.
- شاخص کل در وضعیت مناسبی قرار ندارد و هیچ نشانه مثبتی از تغییر روند در آن دیده نمی‌شود. شاخص کل زیر خط روند نزولی میان مدت خود قرار دارد و هفته گذشته محدوده حمایتی ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحد را با قدرت روبه پایین شکست.
- ارزش معاملات کماکان بسیار پایین است و جریان ورود پول حقیقی به بازار به شکل مداوم منفی بوده و همه روزه شاهد خروج پول حقیقی هستیم.
- محدوده حمایتی بعدی شاخص کل را می‌توان کف قبلی آن در محدوده ۱,۲۰۷,۰۰۰ واحد در نظر گرفت.
- با توجه به ابلاغ بسته ۱۰ بندی حمایت از بازار سرمایه و تصمیم به تزریق منابع جدید این احتمال وجود دارد که شاخص کل در محدوده‌های فعلی ریزموج صعودی را شروع نماید، اما شایان ذکر است مادامی که شاخص کل خط روند نزولی میان مدت خود را نشکند و شاهد افزایش قابل توجه ارزش معاملات در بازار نباشیم، هر ریزموج صعودی صرفاً یک حرکت اصلاحی در روند نزولی است.

❖ 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)



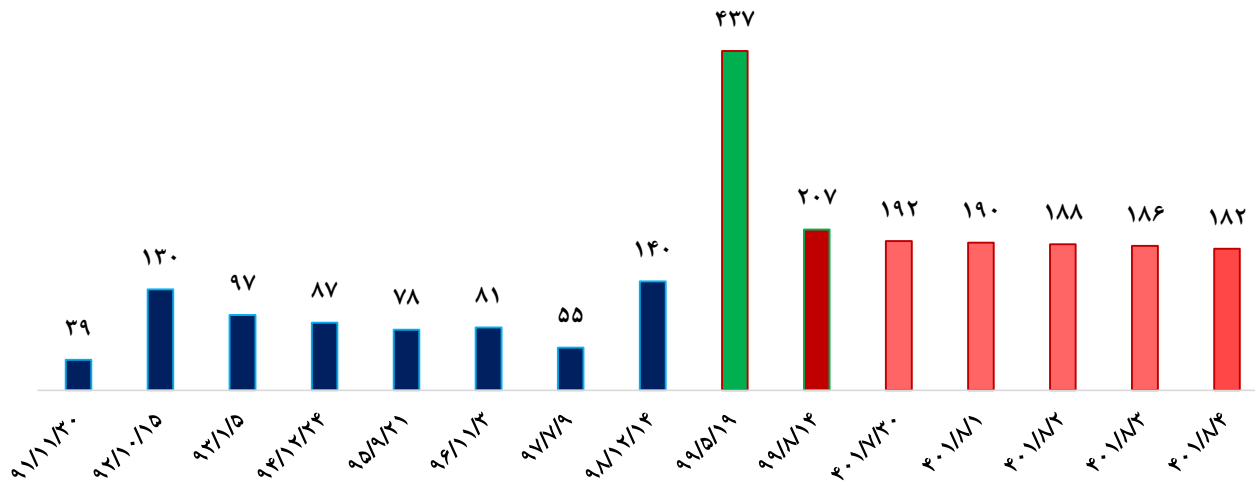
- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۲۴۱,۰۶۷ واحدی و بازده هفتگی ۵/۲۳- درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۱,۶۷۳ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱ نشان دهنده خروج ۳۰,۲۱۹ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۲۴ میلیارد تومان پول از بازار خارج شده است.
- خالص پول اشخاص حقیقی کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹، که در قله خود (۱۹ مرداد ۱۳۹۹) به عدد ۱۱۸,۲۴۲ میلیارد تومان رسیده بود، به عدد ۴۸,۰۴۹- میلیارد تومان افول کرد.

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

شنبه	۰۱/۰۷/۳۰	: ۹۸- میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۰۸/۰۱	: ۲۱۰- میلیارد تومان
دوشنبه	۰۱/۰۸/۰۲	: ۲۶۵- میلیارد تومان
سه شنبه	۰۱/۰۸/۰۳	: ۳۹۹- میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۰۸/۰۴	: ۷۰۱- میلیارد تومان

منبع: شرکت بورس (TSE.ir)

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



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۱۸۲ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۵۸ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ GDP ایران معادل ۲۳۱/۵۵ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۷۹ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص در تاریخ ۲۱ اکتبر سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۰/۲ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۵/۵ تریلیون دلار در این کشور، معادل ۱۵۸ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال)	P (ریال)	P/E (پیش بینی)	EPS (ریال)	سال مالی	P/NAV
شستا	۵.۷۳	۱۲۹	۷۳۹	۳.۸۷	۱۹۱	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۷۹٪
وبانک	۳.۷۷	۲,۰۵۱	۷,۷۴۰	۳.۸۵	۲,۰۱۳	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۵٪
وصندوق	۴.۲۵	۲,۵۰۸	۱۰,۶۶۰	۴.۰۳	۲,۶۴۷	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۴۹٪
وامید	۶.۰۰	۱,۸۲۷	۱۰,۹۷۰	۵.۸۰	۱,۸۹۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۳٪
وغدیر	۶.۲۴	۲,۰۷۱	۱۲,۹۳۰	۴.۵۲	۲,۸۵۹	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۰٪
ونیکی	۴.۵۳	۹۳۲	۴,۲۲۵	-	-	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۰٪

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.