



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان

ارزندگی و رونق در بازار سرمایه

انتشار گزارش‌های ماهانه تولید و فروش و همچنین ارائه صورت‌های مالی سالانه بخش قابل توجهی از شرکت‌های حاضر در بازار سرمایه طی روزهای اخیر، همگی حکایت از وضعیت بنیادی مناسب و نسبت‌های P/E فوروارد جذاب شرکت‌ها دارند. از سوی دیگر، چند هفته‌ای است که شاهد افزایش تعداد کندل‌های سبز ورود پول حقیقی به بازار سرمایه هستیم. این موضوع حکایت از رونق گرفتن معاملات و افزایش اقبال سرمایه‌گذاران حقیقی به بازار دارد. همه این موارد امیدها را برای رونق بازار سرمایه در سایه ارزندگی سهام شرکت‌ها زنده نگه می‌دارد.

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۶۲ - هفته منتهی به ۱۹ تیر ۱۴۰۰

گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی: ریزش سهام در شرق، نوسان در غرب - استفاده روزافزون از رمزارزها بعنوان ابزار مبادله: معامله یک الماس ۱۲ میلیون دلاری از طریق رمزارزها؛
- تصویر اقتصاد کلان - بورس در صدر بازدهی هفتگی بازارها؛
- بورس و انرژی: سایه سنگین کرونای دلتا بر بورس ها، همزمان با توقف روند صعودی نفت خام؛
- فلزات گرانبها و ارز: رشد طلا، انتظار برای صعود بیت کوین؛
- بازار کالاهای خام: هفته منفی بازار محصولات کشاورزی؛
- بررسی صندوق ها و بازدهی آنها: بازدهی مثبت اما نزدیک به صفر صندوق های سهامی؛
- بررسی بورس کالا: همگامی نرخ بیلت داخلی و صادراتی؛
- اقتصاد کلان - بررسی وضعیت شاخص مدیران خرید (PMI) در ایران و جهان؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص کل و شاخص هم وزن - شاخص هم وزن در پی جبران جاماندگی خود از موج صعودی اخیر شاخص کل؛
- تحلیل تکنیکال: بیت کوین - نوسان با شیب نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - در آستانه شروع روند اصلاحی؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - انتهای روند نزولی؛
- 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 چشم انداز اقتصاد جهانی

ریزش سهام در شرق، نوسان در غرب استفاده روزافزون از رمزارزها بعنوان ابزار مبادله: معامله یک الماس ۱۲ میلیون دلاری از طریق رمزارزها!

اشاره:

طی هفته اخیر، مذاکرات برجامی یکی از عناوین خبری مهم بود. در این راستا، آمریکا هشدار داد که زمان برای احیای برجام در حال از دست رفتن است. وضعیت وخیم بحران سیاسی-اجتماعی در لبنان، نیروگاه‌های این کشور در حال خاموش شدن هستند. از سوی دیگر با توجه به افزایش فشار در شبکه توزیع برق در اثر گسترش موج گرما، این بار نوبت ایالت کالیفرنیا در آمریکا شد که بحران قطعی برق گریبانگیرش شود. همچنین طی هفته اخیر شاهد ریزش بازارهای سهام آسیایی، تحت تأثیر ریزش ارزش بازار سهام شرکت‌های تکنولوژی محور چین بودیم. در هفته اخیر، رکورد تازه‌ای به رکوردهای قبلی رمزارزها نیز اضافه شد، که آن معامله یک الماس ۱۲ میلیون دلاری بود. همچنین بنا بر خبر دیگری در حوزه رمزارزها اعلام شد که تعداد استفاده‌کنندگان از یوان دیجیتال چین به مرز ۱۰ میلیون نفر رسید. خرید سهام شرکت‌های صنعت هتل‌داری کره جنوبی از سوی سافت‌بانک ژاپن، خبری دیگری بود که طی هفته اخیر توجهات را به خود جلب کرد.

بلومبرگ Bloomberg

- آمریکا با دلخوری هشدار داد که زمان برای احیای برجام در حال از دست رفتن است.
- نفت اولین هفته منفی خود از ماه می را پس از به نتیجه نرسیدن مذاکرات اوپک پلاس به پایان رساند.
- با وسیع‌تر شدن و تعمیق بحران در لبنان، نیروگاه‌های این کشور یک‌به‌یک در حال خاموش شدن هستند.
- تجدید حیات و عملیات گسترده طالبان، از مسکو تا پکن را در وحشت فرو برده است.
- سقوط تریلیون دلاری بازار سهام شرکت‌های تکنولوژی چینی، باعث رفتار دست‌به‌عصا تر سرمایه‌گذاران شده است.
- آمریکا و روسیه توافق کردند کوریور کمک‌های انسان‌دوستانه به سوریه را باز نگه دارند.
- قطعی‌های برق برنامه‌ریزی شده برای کاهش فشار در شبکه توزیع، در اثر افزایش مصرف به خاطر موج گرما، به کالیفرنیا هم رسید!
- گروه G20 هشدار داد واگرایی در بازیابی و واکسیناسیون، ریسک همه‌گیری مجدد ویروس را بدنبال دارد.
- دانشمند ارشد سازمان بهداشت جهانی اعلام کردند سرعت همه‌گیری هنوز کم نشده است.
- با افزایش دوباره آمار مبتلایان، سیدنی در آستانه قرنطینه مجدد قرار گرفت.
- تاکنون ۳.۴ میلیارد دوز واکسن در سطح جهان تزریق شده و نزدیک به ۶۰۰ میلیون نفر کاملاً واکسینه شده‌اند.
- هزینه خرید یک الماس ۱۲ میلیون دلاری در حراج ساوث‌بایز تماماً از طریق رمزارزها پرداخت شد.
- تحلیل‌گران بازار رمزارزها اعلام کردند موج نزولی بعدی بیت‌کوین می‌تواند قیمت آن را به محدوده ۱۰ هزار دلار برساند.
- همزمان با رشد و بزرگ شدن صرافی آنلاین بایننس، کشورهای بیشتری شروع به اعمال محدودیت روی آن می‌کنند.
- تعدادی از مناطق شدیداً جمهوری‌خواه آمریکا و حامیان ترامپ، هنوز در مقابل دریافت واکسن مقاومت می‌کنند.
- فعالان بازار مسکن آمریکا، با رشد شدید این بازار، در پی کسب سود ۱۰۰ میلیارد دلاری در سال جدید هستند.
- رکورد مرگ‌ومیر بر اثر کرونا در تایلند شکسته شد.
- با وجود رشد ۱۵ درصدی شاخص S&P500، سهام تسلا در سال ۲۰۲۱ حدود ۹ درصد افت داشته و با عبور میانگین متحرک ۵۰ روزه از ۲۰۰ روزه آن به سمت پایین، الگوی صلیب مرگ را شکل داده است. تحلیل‌گران بازار منتظر شروع موج فروش سهامداران در این سهم هستند.

بیزینس اینسایدر BUSINESS INSIDER

موارد ابتلاء به ویروس کرونا	
۱۸۶,۸۳۹,۵۷۳	+۱/۶۰٪
جان‌باختگان ۴,۰۳۵,۱۶۴	+۱/۳۶٪
بهبودیافتگان ۱۷۰,۸۸۷,۷۴۴	+۱/۵۳٪

- مقام ارشد وزارت بهداشت آمریکا گفت گونه دلتای ویروس کرونا، تهدیدی برای اقتصاد آمریکا و بازیابی جهانی است.
- حضور نمایندگانه کنگره آمریکا در قطر برای سفر تفریحی به پشتیبانی یک گروه سیاسی، در میانه همه‌گیری کرونا، حاشیه‌ساز شد.
- آرکانزاس، مرکز شیوع گونه دلتای کرونا در آمریکا شد.
- بایدن در آستانه امضای طرحی برای مقابله با انحصار و عظمت غول‌های اصلی تکنولوژی قرار گرفت.
- رئیس سازمان تأمین اجتماعی آمریکا، که از منصوبان ترامپ بود، بدست بایدن اخراج شد.
- فزونی کالا و کمبود نیروی کار برای پردازش آنها، تبدیل به مشکل امروز بازار آمریکا شده است.
- امیدهایی برای افزایش قیمت نجومی رمزارزهای غیرمتمرکز تا پایان تابستان جاری شکل گرفته است.
- اتحادیه اروپا بدنبال پایان دادن به دوران موتورهای بنزینی تا پایان ۲۰۳۵ است.
- رشد ۶۵ درصدی مرگ‌ومیر بر اثر کرونا در ماه می در روسیه، حاکی از وخامت وضعیت در این کشور است.
- پالایشگاه‌های آمریکا منتظر افزایش تقاضای بازار برای بنزین هستند.
- تعداد استفاده‌کنندگان یوان دیجیتال چین به ۱۰ میلیون نفر رسید.

فایننشال تایمز FT FINANCIAL TIMES

- گروه G20 همچنان بدنبال تصویب کف مالیات جهانی برای شرکت‌های چندملیتی است.
- با مرگ رئیس‌جمهور هائیتی، روند آشوب‌های این کشور رو به وخامت گذاشته است.
- علی‌رغم شایعات، واکسن‌های استرازنکا و فایزر در مقابل گونه دلتا نیز مقاومت دارند.
- با افزایش تعداد حملات هک‌های باج‌خواه روسی در جهان، بایدن از پوتین خواست برای مقابله با آنها گامی اساسی بردارد.
- سافت‌بانک ژاپن، شروع به خرید سهام شرکت‌های صنعت هتل‌داری کره قبل از وارد شدن آنها به بورس آمریکا کرده است.
- نوسان مثبت بازارهای سهام آمریکا هم‌زمان با سقوط بازارهای شرق آسیا رخ داد.
- هفته نزولی اوراق بدهی جهان رقم خورد.
- بانک‌های مرکزی جهان باید هرچه سریع‌تر موضع خود را درباره رمزارزها مشخص کنند.





مركز آمار ايران

تصویر اقتصاد کلان

بورس در صدر بازدهی هفتگی بازارها!

مقایسه بازدهی بازارها

بازار	هفتگی	ماهانه	۱۴۰۰	یکساله
دلار (ریالی)	۰/۵۲-	۶/۰۴%	۱۰/۰۶%	۱۲/۶۹%
سکه (ریالی)	۰/۴۲-	۰/۳۹-	۴/۳۸-	۳/۲۴%
بورس (شاخص)	۲/۰۰%	۱۰/۷۹%	۲/۱۰-	۲۶/۶۲-
رمزارزها (دلاری)	۰/۲۲%	۱۴/۱۶-	۲۱/۲۷-	۴۱۶/۸۵%
مسکن (ریالی - تهران)	-	۳+	-	۵۶/۵۷%

حوزه جغرافیایی	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	درآمد سرانه (دلار)	میانگین سالیانه			نقطه به نقطه (ماهانه)		فصلی	نرخ بهره (درصد)	نسبت بدهی خالص به GDP (درصد)	نسبت کل سرمایه‌گذاری به GDP (درصد)	جمعیت (هزار نفر)
			نرخ رشد اقتصادی - به قیمت‌های ثابت (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ تورم (درصد)					
جهان												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	-	۲۰۲۰	-	-	-	-	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۸۴،۵۳۷،۶۹۰	۱۰،۸۴۵	۳/۲۷-	-	۳/۲	-	-	-	-	-	۲۶/۳۳%	۷،۷۹۵،۰۰۰
آمریکا												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۲۰،۹۳۲،۷۵۰	۶۳،۴۱۶	۳/۵-	۸/۱۱%	۱/۲۵%	۵/۹%	۵%	۶/۴%	۰/۲۵%	۱۰۳/۱۷%	۲۰/۹۹%	۳۳۰،۰۸۶
چین												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۱۴،۷۲۳،۸۳۷	۱۰،۴۸۵	۲/۲۷%	۳/۸%	۲/۳۹%	۵%	۱/۱%	۰/۶%	۳/۸۵%	-	۴۳/۶۶%	۱،۴۰۴،۳۳۱
منطقه یورو												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۱۹	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۱۲،۹۱۶،۶۱۸	۳۷،۷۲۳	۶/۶-	۷/۹۳%	۰/۲۵%	۷/۹%	۱/۹%	۰/۳-	۰%	۸۰/۷۶%	۲۱/۳۷%	۳۴۲،۴۱۰
ایران												
بازه زمانی	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰
مقدار شاخص	۶۳۵،۷۲۴ (دلار نیمايي)	۷،۵۵۵	۱/۵۲%	۱۰/۸۲%	۳۶/۵%	-	۴۷/۶%	-	۱۸%	۳۵/۶۸%	۴۲/۶۷%	۸۴،۱۴۹
	۱۸۱،۱۹۰ (دلار آزاد)											



منبع

بازده
یکسالهبازده
ماهانهبازده
هفتگی

معادل

آخرین قیمت

عنوان

ردیف

بورس های جهانی

TeleTrader

TradingEconomics

نفت و انرژی

Sunsirs

Fertilizerworks

TradingEconomics

OilPrice

OilPrice

PLATTS

PLATTS

بورس و انرژی

سایه سنگین کرونای دلتا بر بورس ها
همزمان با توقف روند صعودی نفت خام

بورس های جهانی

بعد از رشد چند هفته ای، در ابتدای هفته اخیر شاهد اصلاح کوچکی در شاخص بورس های جهانی بودیم، که با توجه به اخبار منفی شدید مرتبط با کرونای دلتا و بازتاب سنگین رسانه ای آن به همراه بیانیه های متعدد مقامات سازمان بهداشت جهانی و وزارت بهداشت آمریکا دور از ذهن نبود. این اصلاح کوتاه، اما در نهایت به بازگشت قیمتی منتهی شد تا هفته مثبت دیگری برای بازارهای کشورهای غربی رقم بخورد. اوضاع در شرق آسیا اما چندان باب میل سرمایه گذاران نبوده و این هفته اصلاح شایان توجهی را در شاخص های اصلی بازارهای آسیا شاهد بودیم که بسیاری آن را با اخبار شیوع مجدد کرونا به همراه گونه دلتا در آسیای جنوب شرقی مرتبط می دانند. در این بین برخی کارشناسان بازار اصلاح هفته های اخیر بورس چین را نشانگر «اولین ترک ها» در روند سریع بازیابی جهانی، که تا به امروز شاهد آن بودیم، می دانند.

نفت و محصولات پتروشیمی

جدیدترین نظرسنجی پلتس نشان داد اوپک و متحدانش در ماه ژوئن ۵۴۰ هزار بشکه در روز به تولیدشان اضافه کردند. نظرسنجی اس اند پی گلوبال پلتس نشان داد اوپک، که متشکل از ۱۳ کشور عضو است، در ژوئن ۲۶/۱۹ میلیون بشکه در روز نفت تولید کرد که ۴۸۰ هزار بشکه در روز بالاتر از ماه می بود و عمده این افزایش مربوط به احیای تدریجی کاهش تولید داوطلبانه عربستان سعودی است. ۹ کشور تولیدکننده متحد اوپک شامل روسیه در ژوئن مجموعاً ۱۳/۲۷ میلیون بشکه در روز نفت تولید کردند که ۶۰ هزار بشکه در روز بالاتر از ماه می بود. موجودی نفت در مخازن ذخیره آمریکا برای دهمین هفته متوالی نزولی بوده و به ۴۴۵ میلیون بشکه رسیده و در حال فاصله گیری از میانگین پنج ساله به سوی کف موجودی است. بیکرهیوز در گزارش روز جمعه (۱۸ تیرماه) خود آورده است که مجموع دکل های حفاری آمریکا در این هفته نسبت به هفته پیش از آن، با چهار دستگاه افزایش، به ۴۷۵ دستگاه رسید. این تعداد بالاترین رقم از ماه آوریل ۲۰۲۰ است. بر اساس این گزارش، مجموع دکل های آمریکا نسبت به مدت مشابه پارسال ۲۲۱ دستگاه، یعنی ۸۵/۷ درصد افزایش یافته است. تعداد دکل های حفاری نیز ۴۹ درصد نسبت به ماه آگوست ۲۰۲۰ - کاهش بی سابقه دکل ها - افزایش داشته است. مجموع دکل های نفتی آمریکا در هفته منتهی به نهم جولای (جمعه، ۱۸ تیرماه) نسبت به هفته پیش از آن دو دستگاه افزایش یافت و به ۳۷۸ دستگاه رسید، درحالی که شمار دکل های گازی هم دو دستگاه افزایش یافت و به ۱۰۱ دستگاه رسید. انتشار این گزارش که سرمایه گذاران را به چشم انداز تقاضای نفت در آمریکا امیدوار کرد، باعث شد تا موقتاً نگرانی ها از اختلافات اوپک پلاس، که در روزهای اخیر باعث سقوط قیمت ها شده بود، فراموش شود.

قیمت متانول هفته گذشته اندکی کاهش یافت. قیمت متانول داخلی چین و متانول CFR چین به ترتیب به ۲۵۳۲/۵ یوان به ازای هر تن (معادل ۳۹۰/۹۳ دلار) و ۳۰۴ دلار به ازای هر تن رسیدند.

نرخ اوره گرانول خاورمیانه هفته گذشته روند صعودی خود را کماکان ادامه داد و با رشد هفتگی ۲/۲۹ درصدی به ۴۴۴/۶۷ دلار به ازای هر تن رسید. فیوچرز اوره FOB خلیج فارس نیز حوالی قیمت ۴۹۰ دلار به ازای هر تن در حال معامله است. قیمت اوره ایران نیز با ۴۰ دلار رشد به ۳۷۵-۳۷۰ دلار به ازای هر تن رسیده است.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله	منبع
۱	Dow Jones	۳۴,۸۶۲	واحد	%۰,۲۲	%۱,۱۱	%۳۵,۶۳	
۲	Nasdaq	۱۴,۸۲۶	واحد	%۰,۶۷	%۷,۳۲	%۳۷,۸۶	
۳	S&P 500	۴,۳۶۸	واحد	%۰,۳۷	%۳,۴۳	%۳۸,۵۹	
۴	FTSE 100	۷,۱۱۶	واحد	%-۰,۲۵	%۰,۳۸	%۱۷,۲۱	TeleTrader
۵	DAX	۱۵,۶۸۷	واحد	%۰,۲۴	%۰,۶۹	%۲۵,۶۱	
۶	CAC 40	۶,۵۲۹	واحد	%-۰,۳۶	%-۰,۵۲	%۳۲,۶۸	
۷	NIKKEI 225	۲۷,۹۴۰	واحد	%-۲,۹۳	%-۳,۱۹	%۲۴,۰۲	
۸	SHANGHAI	۳,۵۱۹	واحد	%-۲,۴۶	%-۲,۱۸	%۱۳,۸۵	
۹	Moex	۳,۸۵۵	واحد	%-۰,۲۶	%۰,۷۲	%۱۷,۲۲	TradingEconomics
۱۰	نفت خام WTI	۷۴/۶	دلار / بشکه	%-۰,۶۵	%۶,۶۹	%۷۷,۲۴	TeleTrader
۱۱	نفت خام Brent	۷۵/۶	دلار / بشکه	%-۰,۵۱	%۵,۰۷	%۶۷,۴۰	TeleTrader
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۳/۶۷۵	دلار / MMBtu	%-۰,۷۳	%۱۶,۱۱	%۴۴,۹۱	TeleTrader
۱۳	گازوئیل	۶۰۹	دلار / تن	%-۰,۳۷	%۳,۱۸	%۵۲,۵۷	TeleTrader
۱۴	اتانول	۲/۳	دلار / گالن	%-۶,۴۵	%-۵,۶۹	%۶۱,۹۰	TradingEconomics
۱۵	متانول (داخلی چین)	۲۵۳۲	یوان / تن	%-۰,۸۸	-	-	Sunsirs
۱۶	اوره گرانول خاورمیانه	۴۴۵	دلار / تن	%۲,۲۹	-	-	Fertilizerworks
۱۷	نفتا	۶۷۸	دلار / تن	%۰,۱۴	%۹,۴۵	%۵۶,۶۹	TradingEconomics
۱۸	سبد اوپک	۷۲	دلار / بشکه	%-۳,۸	%۱,۴۸	%۳۹,۷۲	OilPrice
۱۸	نفت سنگین ایران	۶۹/۷	دلار / بشکه	%۰	-	-	OilPrice
۱۹	پت فوب شمال شرق آسیا (میانگین)	۹۳۵	دلار / تن	%۰	-	-	PLATTS
۲۰	پت فوب جنوب شرق آسیا (میانگین)	۱۰۰۰	دلار / تن	%۰	-	-	PLATTS



بنگاه داده‌های مالی ایران

فلزات گرانبها و ارز رشد طلا انتظار برای صعود بیت‌کوین

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معاذل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۸۰۸	دلار/اونس	۱,۱۶%	۴,۲۷%-	۰,۲۷%	TeleTrader
۲	نقره	۲۶,۱	دلار/اونس	۱,۳۶%-	۶,۱%-	۳۹,۹۳%	
طلا و سکه (داخلی) – پنجشنبه ۱۷ تیر							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۰,۶۴۱,۰۰۰	ریال	۰,۳۵%-	۱,۹۵%-	۱۳,۳۸%	Tgju/org
۴	سکه امامی	۱۰۷,۱۱۰,۰۰۰	ریال	۰,۷۷%-	۱,۷۴%-	۵,۲۴%	
ارز – پنجشنبه ۱۷ تیر							
۵	دلار آزاد	۲۵۰,۱۹۰	ریال	۰,۵۲%-	۶,۰۴%	۱۵,۰۲%	Tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۲۰,۸۷۶	ریال	۱,۳۹%	۹,۶۱%	۳۰,۵۴%	Sanarate.ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۲۲,۸۸۲	ریال	۱,۳۹%	۹,۶۱%	۳۲,۱۳%	
۸	یورو آزاد	۲۸۵,۱۸۱	ریال	۱,۹۵%-	۱,۱۶%	۱۹,۴۷%	
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۱,۹۴۲	ریال	۱,۴۸%	۶,۵۶%	۳۸,۱۶%	
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۶۴,۳۲۱	ریال	۱,۴۸%	۶,۵۶%	۴۰,۵۲%	
۱۱	درهم آزاد	۶۵,۴۷۹	ریال	۲,۰۳%-	۴,۰۶%	۱۴,۹۰%	
۱۲	درهم حواله (خرید)	۶۰,۱۴۳	ریال	۱,۳۹%	۹,۶۱%	۲۵,۴۴%	
۱۳	درهم حواله (فروش)	۶۰,۶۹۰	ریال	۱,۳۹%	۹,۶۱%	۲۸,۰۱%	
رمزارز							
۱۴	بیت‌کوین	۳۳,۸۲۳	دلار	۰,۲۸%	۹,۲۶%-	۲۶۶,۶۳%	TeleTrader
۱۵	اتریوم	۲,۱۵۳	دلار	۰,۰۷%	۱۷,۳%-	۷۹۰,۱۸%	

بازار فلزات گرانبها

طلا هفته کاری خود را در بازارهای جهانی با عدد ۱۷۶۷ دلار آغاز و با رشد ۲/۳ درصدی و رسیدن به نرخ ۱۸۰۷ دلار به پایان رساند. از علل این رشد می‌توان به نگرانی‌های جهانی از گسترش ویروس کرونا، دلتا و همچنین انتشار صورتجلسه اخیر فدرال رزرو که در آن بحث محدودسازی خرید اوراق قرضه از سوی بانک مرکزی طی سال جاری مطرح شده بود، اشاره کرد. به سبب این بحث سود اوراق قرضه افت کرده و تقاضا برای خرید طلا بالا رفته که بموجب آن شاهد رشد قیمت در این فلز بودیم.

سکه و ارز (داخلی)

هفته گذشته با توجه به محدودیت‌های کرونایی و تعطیلی بازار، تقاضا برای خرید طلا کاهش یافت و به سبب آن قیمت سکه افت ۰/۷ درصدی را برای خود ثبت کرد. دلار نیز طی این مدت در کانال ۲۵ هزار تومان نوسان کرده و در پایان هفته با توجه به خبر تعطیلی پنجشنبه بانک‌ها، شاهد افت قیمت دلار بودیم، بطوریکه نرخ این ارز، ۲۴۹۰۰ تومان را نیز به خود دید.

رمزارز

نیکولاس پانیگیرتزوگلو (Nikolaos Panigirtzoglou) تحلیل‌گر جی‌پی‌مورگان پیش‌بینی کرده که وقتی نرخ dominance بیت‌کوین به بالای ۵۰ درصد برسد، به احتمال زیاد رکود این رمزارز پایان پذیرفته و بازار از حالت خرسی به گاوی تغییر جهت می‌دهد. مایک مک‌گلون، تحلیل‌گر بلومبرگ، در حساب توییتر خود در مورد پیش‌بینی بازگشت روند صعودی بیت‌کوین در نیمه دوم سال ۲۰۲۱ و ۱۰۰ هزار دلاری شدن لیدر بازار کریپتو صحبت کرد. او معتقد است که در نیمه دوم سال جاری، بازار صعودی بیت‌کوین دوباره ظاهر شده و حرکت به سوی ۱۰۰ هزار دلار را از سر می‌گیرد و انتظار دارد که طی تحولات عمیق اقتصادی در سطح کلان در نیمه دوم سال ۲۰۲۱، قیمت نفت به محدوده ۵۰ دلار رسیده و این دقیقاً همزمان با گاوی شدن بیت‌کوین می‌شود.

بازار کالاهای خام

هفته منفی بازار محصولات کشاورزی

محصولات کشاورزی

۱	سویا	۱,۴۰۴	سنت/بوشل	۵۱۶	دلار/تن	۳,۱۰۰	۸,۹۹-	۵۶,۶۲	
۲	گندم	۶۱۰	سنت/بوشل	۲۲۴	دلار/تن	۵,۶۸-	۱۰,۵۹-	۱۲,۵۴	
۳	کتان (پنبه)	۸۸	سنت/پوند	۱,۹۳۶	دلار/تن	۰,۷۶	۱,۷۶-	۴۷,۰۷	TeleTrader
۴	شکر	۱۷,۲	سنت/پوند	۳۸۰	دلار/تن	۵,۳۳-	۲,۸۷-	۴۳,۶۷	
۵	ذرت	۶۲۷	سنت/بوشل	۲۴۷	دلار/تن	۱۰,۸۰-	۱۰,۲۷-	۷۱,۶۶	
۶	کانولا	۹۰۴	دلار کانادا/تن	۶۳۳	دلار/تن	۳,۹۴	۳,۶۷	۴۳,۵۷	TradingEconomics

کالاهای صنعتی

۷	مس	۹,۴۹۳	دلار/تن			۱,۲۲	۴,۷۹-	۵۰,۷۵	TeleTrader
۸	قیر	۳,۳۲۶	یوان/تن	۴۹۹	دلار/تن	۱,۹۵-	۹,۴۱	۳۹,۶۳	TradingEconomics
۹	فولاد	۴,۹۰۱	یوان/تن	۷۳۵	دلار/تن	۰,۱۴-	۰,۰۶	۱۶,۱۴	TradingEconomics
۱۰	آلومینیوم	۲,۴۹۴	دلار/تن			۲,۴۸-	۰,۶۵	۴۷,۶۶	TeleTrader
۱۱	سرب	۲,۳۲۹	دلار/تن			۱,۴۲	۶,۵۹	۲۵,۵۵	TeleTrader
۱۲	روی	۲,۹۷۸	دلار/تن			۱,۴۵	۰,۷۷-	۳۶,۰۴	TeleTrader
۱۳	سنگ آهن	۲۱۸	دلار/تن			۰,۲۳	۱,۸۷	۳۷,۵۴	TradingEconomics
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۶۳۷	دلار/تن			۱/۹۲	-	-	Metal Bulletine
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بنادر ایران)	۵۹۵-۶۰۹	دلار/تن			۰/۶۶-	-	-	Metal Bulletine

شاخص‌های کالایی

۱۶	بالتیک خشک	۳,۳۰۱	واحد			۰,۴۹	۲۸,۵۴	۷۸,۳۴	tgju.org
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۲۲۵	واحد			۱,۲۹-	۰,۳۰	۲۶,۲۵	TradingEconomics
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۴,۱۰۶	واحد			۰,۴۶-	۳,۸۶-	۲۰,۲۵	TradingEconomics
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس اند پی (S&P GSCI)	۲,۵۴۸	واحد			۲,۷۵-	۰,۷۹-	۲۸,۸۴	TradingEconomics

بازار محصولات کشاورزی

قیمت ذرت طی هفته گذشته به پایین‌ترین حد ۶ هفته اخیر خود رسید. این واقعه متأثر از آبهوای تقریباً مساعد آمریکا و بازده بیش از حد انتظار در آمریکای جنوبی، حتی در شرایطی که محصول در آبهوای نامساعد قرار داشت، بوده است.

وزارت کشاورزی آمریکا در گزارش سالانه خود اعلام کرد که کاشت ذرت در مقایسه با پیش‌بینی دولت کمی بالاتر است.

گندم در بورس شیکاگو طی هفته گذشته حدود ۶.۱ دلار معامله شد که کمترین میزان از ۲ آوریل محسوب می‌شود.

بر اساس پیش‌بینی هواشناسی مبنی بر وقوع بارندگی در مرزهای زراعی ایالات متحده و عدم بارندگی و خشکی در مناطق شمالی و غربی، با آغاز برداشت گندم زمستانی در نیم‌کره شمالی، تأمین گندم با سختی روبرو خواهد شد؛ به ویژه آنکه پیش‌بینی می‌شود صادرکننده برتر گندم در سال آینده روسیه باشد.

بازار کالاهای صنعتی

خالی از لطف نیست که بررسی بازار کالاهای صنعتی را با این خبر شروع کنیم که هزینه حمل‌ونقل دریایی همچنان به روند رویه‌رشد خود ادامه می‌دهد و شاخص هزینه حمل ترکیبی برای یک کانتینر ۴۰ فوتی به ۸۰۰,۸ دلار رسیده که ۶ برابر میانگین پنج‌ساله آن است! این مطلب خود حاکی از افزایش شدید تقاضای بازار برای کالا بوده و همچنین تأثیر بسزایی در بهای تمام‌شده کالاهایی که تقاضای اصلی‌شان پوشش داده شده یا بازارشان متعادل گشته نیز دارد.

قیمت سنگ‌آهن در ادامه روند ماه گذشته خود در محدوده ۲۱۵ الی ۲۲۰ دلار ثابت بوده و با توجه به پیش‌بینی هفته گذشته و پیش‌بینی‌های فعالان بازار، انتظار داریم روند اصلاح قیمتی آن از هفته‌های آتی شروع شود. خبر بالاتر رفتن موجودی سنگ‌آهن و آهن و فولاد در انبارهای بنادر چین خود می‌تواند نویددهنده این اصلاح باشد. افزایش قیمت این هفته کامودیتی‌ها را باید با کاهش شاخص دلار نیز مرتبط دانست.

در بازار فلز مس شاهد افزایش قیمت در هفته اخیر بودیم که این خود ناشی از افزایش تقاضا به همراه روند ورود پول به بازار آتی مس و افزایش ۴۳ درصدی موقعیت خرید به حدود ۲.۹ میلیارد دلار رسید. شایان ذکر است اقدام روسیه در تصویب مالیات ۱۵ درصدی روی عمده کالاهای صنعتی از جمله مس و فولاد نیز در این افزایش قیمت بی‌تأثیر نبوده است.

در مورد فلز روی نیز شاهد افزایش قیمت برای چندمین هفته متوالی بودیم. دولت چین سعی کرد با آزادسازی ۳۰ هزار تن از ذخایر استراتژیک روی خود و عرضه آنها به بازار قیمت این فلز را کنترل کند، اما با توجه به تقاضای بالا و فزاینده روی، این تلاش مشرثر نبود و به توفیق نینجامید.

شاخص‌های کالایی

کلیه شاخص‌های کالایی طی هفته اخیر بازدهی منفی داشتند، به غیر از شاخص بالتیک خشک، که بازدهی مثبت نزدیک به صفر را از خود بر جای گذاشت.

صندوقها و بازار بدهی

بازدهی مثبت اما نزدیک به صفر

صندوقهای سهامی

بررسی بازدهی صندوقهای سرمایه گذاری

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین بازدهی های نقدی (%)	میانگین بازدهی ماهانه (%)	میانگین بازدهی ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ۶ ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
در سهام	۵۱۴,۵۳۱	۱۵/۱۱	۰/۳۱	۶/۹۸	۱/۵۲	۲/۲۷- ۱۲/۲۱
با درآمد ثابت	۳,۴۷۲,۳۹۷	۸۴/۷۵	۰/۳۲	۱/۸۱	۴/۳۱	۸/۴۲- ۱۸/۴۴
مختلط	۲۳,۱۸۴	۴۵/۴۳	۱/۴۳	۵/۴۹	۳/۱۵	۲/۵۲- ۷/۰۶
جمع کل صندوقها	۴,۵۸۸,۴۵۳	۳۸/۸	۱/۲۲	۵/۴۳	۲/۴۴	۰/۷۱- ۶-



منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

صندوقهای سرمایه گذاری

طی هفته اخیر، بازدهی کلیه صندوقها مثبت بود و بیشترین بازدهی متعلق به صندوقهای سرمایه گذاری مختلط به میزان ۱/۴۳ درصد بود. همچنین نسبت سهم صندوقها از کل در مقایسه با هفته قبل ثابت باقی مانده است.

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخزا ۸۰۵	۹۹۹,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۴-۱۹	۱۴۰۰-۰۴-۲۲	۱۲/۹۴%	۱۲/۱۸%
اخزا ۷۲۲	۹۹۳,۹۶۸	۱۴۰۰-۰۴-۱۹	۱۴۰۰-۰۴-۲۸	۲۷/۸۱%	۲۴/۶۱%
اخزا ۸۲۰	۶۳۰,۳۳۴	۱۴۰۰-۰۴-۱۹	۱۴۰۲-۰۸-۰۶	۲۲/۲۱%	۲۵/۴۸%
میانگین بازدهی				۲۱.۲۱%	۲۱.۶۰%

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 ۷۲۲ و اخزا ۸۲۰ با سررسیدهای ۱۴۰۰/۰۴/۲۸ و ۱۴۰۲/۰۸/۰۶ و بازدهیهای ۲۷/۸۱ و ۲۵/۴۸ درصد بود. همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا ۸۰۵ با سررسید ۱۴۰۰/۰۳/۲۲ و ۱۴۰۰/۰۷/۲۸ و بازدهیهای ۱۲/۹۴ و ۱۲/۱۸ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۱/۲۱ و ۲۱/۶۰ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

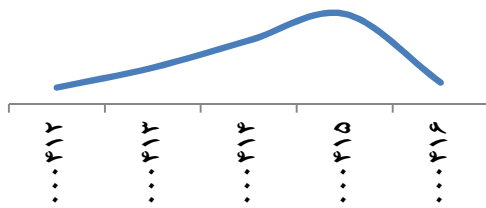
نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
افاد ۴	۱,۰۷۰,۷۸۱	۱۴۰۰-۰۴-۱۵	۱۴۰۱-۰۷-۲۹	۱۲/۲۹%
افاد ۵۴	۸۳۱,۰۰۰	۱۴۰۰-۰۴-۱۵	۱۴۰۱-۰۸-۱۸	۳۷/۶۶%
میانگین بازدهی				۲۱.۰۳%

منبع: فرابورس ایران

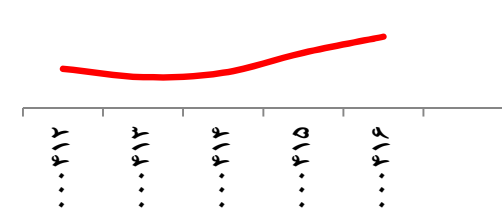
اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته گذشته (منتهی به چهارشنبه ۱۴۰۰/۰۴/۱۶) بیشترین بازدهی متعلق به نماد افاد ۵۳ به میزان ۳۷/۶۶ درصد و کمترین بازدهی متعلق به نماد افاد ۳ به میزان ۱۲/۲۹ درصد بوده است. همچنین میانگین بازدهی اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته گذشته معادل ۲۱/۰۳ درصد بوده است.

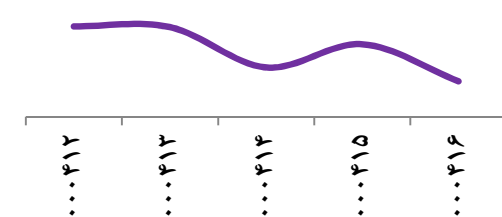
بازار فیزیکی



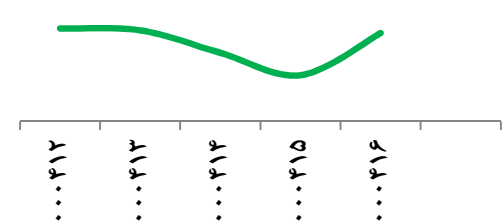
بازار آتی



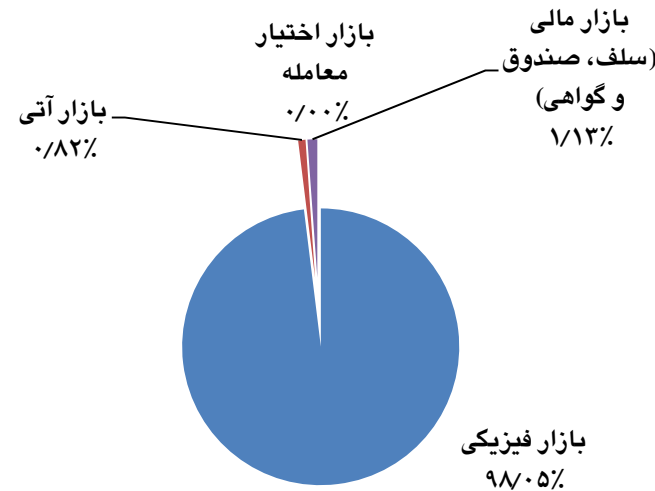
بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)



بازار اختیار معامله



سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



مقایسه نرخهای بورس کالا با نرخهای جهانی

محصول	نرخ ریالی	میانگین هفتگی نرخ نیمایی دلار	ارزش دلاری در بورس کالا	نرخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی
یک تن اوره گرانول	۷۰,۱۵۷,۰۰۰	۲۱۹,۸۰۵	۳۱۹	۴۴۵	۷۲٪
یک تن کاند مس	۲,۰۰۳,۴۳۴,۰۰۰	۲۱۹,۸۰۵	۹,۱۱۵	۹,۴۹۳	۹۶٪
یک تن بیلت صادراتی ایران (فولاد خوزستان)	۱۳۲,۳۱۶,۰۰۰	۲۱۹,۸۰۵	۶۰۲	۶۰۲	۱۰۰٪
یک تن پت گرید بطری تندگویان	۲۷۴,۹۲۲,۸۷۳	۲۱۹,۸۰۵	۱,۲۵۱	۹۶۸	۱۲۹٪
سیمان تیپ ۲ فله (فوب)	۴,۵۳۲,۳۰۵	۲۱۹,۸۰۵	۲۱	۳۴	۶۱٪

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروههای کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	ارزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۷۱,۴۳۲,۷۳۰	۹۱۷,۰۱۵	۶۰/۴٪
پتروشیمی و نفتی	۴۳,۴۷۵,۸۴۵	۳۷۲,۰۰۷	۳۶/۸٪
معدنی	۲,۵۴۹,۱۷۳	۲۸,۵۰۰	۲/۲٪
بازار فرعی	۷۴۳,۵۳۲	۵,۰۸۰	۰/۶٪
جمع	۱۱۸,۲۰۱,۲۸۰	۱,۳۲۲,۶۰۲	۱۰۰٪

بازار فیزیکی بورس کالا و بازار اختیار معامله طی هفته گذشته، دارای نوساناتی بودند. این در حالی است که بازار آتی در این هفته روندی صعودی داشت و بازار مالی نیز هفته گذشته را با روندی نزولی پشت سر گذاشت.

در این هفته ۹۷/۲ درصد از معاملات در بازار فیزیکی مربوط به دو گروه کالاهای صنعتی و پتروشیمی و نفت بود.

درخصوص پنج مورد از مهمترین کالاهای خام جهانی می توان اظهار داشت که در این هفته قیمت گذاری هر تن اوره گرانول معادل ۷۲ درصد از بازار جهانی (خاورمیانه) بود که این امر نشان دهنده وجود اختلاف قیمت بازار داخل و بازار جهانی است، همچنین قیمت هر تن کاند مس معادل ۹۶ درصد قیمت در بازار جهانی بود که این نشان دهنده پیروی تقریبی قیمت بازار داخل از بازار جهانی است. قیمت هر تن بیلت فخور نیز در این هفته معادل ۱۰۰ درصد قیمت بیلت در بازار جهانی بود که این نشان دهنده پیروی کامل قیمت بازار داخلی از بازار جهانی است. قیمت هر تن پت نیز معادل ۱۲۹ درصد بازار داخلی از قیمت آن در بازار جهانی است. در نهایت قیمت هر تن سیمان معادل ۶۱ درصد قیمت جهانی آن است که این امر نشان دهنده وجود اختلاف بین قیمت بازار داخلی و بازار جهانی است.

ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۱۵ درصد افزایش و همچنین حجم معاملات نسبت به هفته گذشته ۳۱ درصد رشد پیدا کرده است.

اقتصاد کلان

شاخص مدیران خرید (PMI)

شامخ کل اقتصاد و شامخ صنعت ایران

جهان

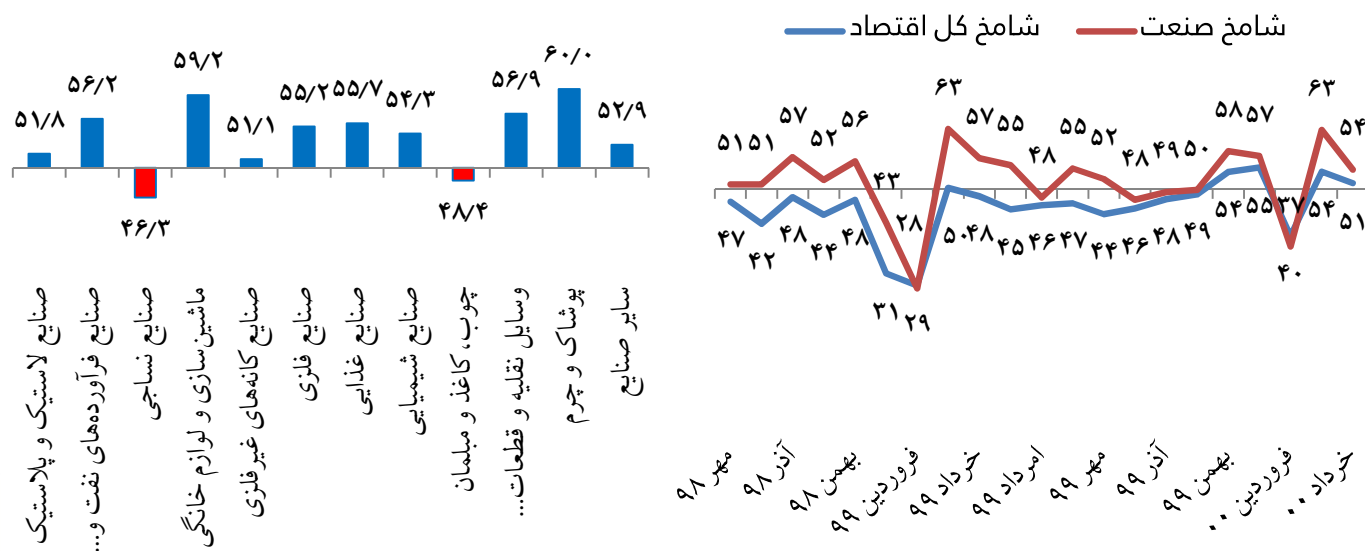
گزارش PMI ماه ژوئن کشورهای دنیا، بیانگر افت هفت درصدی این شاخص در آمریکا و سنگاپور است. برزیل با تکرار بهبود ۱۰ درصدی ماه قبل، خود را به عدد بالای پنجاه رساند که بیانگر وضعیت خوب با چشم‌انداز روشن برای این کشور است. در منطقه یورو کشورهای آلمان و ایتالیا به ترتیب با ۷ و ۴ درصد، بیشترین تغییرات مثبت را به نام خود ثبت کردند. نکته دیگری که در جدول PMI ماه ژوئن به چشم می‌خورد این است که به‌غیر از ژاپن، سایر کشورها خود را به عدد بالای ۵۰ رسانده‌اند.

ایران

هفته گذشته گزارش شامخ خرداد ماه کل اقتصاد ایران منتشر شد که با وجود افت ۴ درصدی نسبت به ماه قبل، همچنان عدد خوب ۵۱/۲۷ را به ما نشان می‌دهد. از علل این افت می‌توان به کاهش سفارشات جدید مشتریان، افزایش قیمت مواد اولیه و همچنین قطعی برق اشاره کرد. در بخش زیرشاخص‌های اصلی شامخ اقتصاد، همانند ماه قبل، کمترین مقدار مربوط به شاخص موجودی مواد اولیه یا لوازم خریداری‌شده به مقدار ۴۵/۷۳ است و شاخص سرعت انجام و تحویل سفارش بیشترین مقدار را با عدد ۵۶/۱۹ به خود اختصاص داد. در بخش زیرشاخص‌های فرعی شامخ اقتصاد، بیشترین مقدار، همانند ماه‌های قبل، مربوط به شاخص قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم خریداری‌شده با مقدار ۷۷/۱۹ است و کمترین مقدار زیرشاخص‌های فرعی متعلق به شاخص میزان صادرات کالا یا خدمات با عدد ۴۸/۴۰ است. در بخش صنعت نیز سی‌وسومین گزارش شامخ منتشر شد که با افت ۱۳ درصدی، به عدد ۵۴/۲۱ رسید که همچنان بیانگر رونق در صنعت است. بیشترین مقدار زیرشاخص اصلی شامخ صنعت متعلق به شاخص سرعت انجام و تحویل سفارش به مقدار ۵۹/۲۳ و کمترین آن مربوط به موجودی مواد اولیه خریداری‌شده با عدد ۴۷/۵۲ است. در بخش زیرشاخص‌های فرعی شامخ صنعت، بیشترین مقدار همانند ماه‌های قبل متعلق به قیمت خرید مواد اولیه با عدد ۷۳/۸۳ است. همچنین کمترین مقدار در این بخش مربوط به شاخص میزان صادرات کالا با عدد ۴۷/۸۶ است. در بخش گزارش شامخ صنایع منتخب، شامخ گروه پوشاک و چرم با عدد ۶۰ در صدر قرار گرفت. پس از آن، شامخ گروه ماشین‌سازی و لوازم خانگی و گروه وسایل نقلیه و قطعات وابسته، به‌ترتیب با مقادیر ۵۹/۲۰ و ۵۶/۸۵ قرار گرفتند. کمترین مقدار متعلق به شامخ گروه صنایع نساجی با عدد ۴۶/۲۵ است.

ردیف	کشور	PMI آخرین	PMI قبلی	تغییر ماهانه	تاریخ محاسبه
۱	آمریکا	۶۳/۷	۶۸/۷	-۷٪	ژوئن ۲۰۲۱
۲	انگلیس	۶۲/۲	۶۲/۹	-۱٪	ژوئن ۲۰۲۱
۳	آلمان	۶۰/۱	۵۶/۲	۷٪	ژوئن ۲۰۲۱
۴	منطقه یورو	۵۹/۵	۵۷/۱	۴٪	ژوئن ۲۰۲۱
۵	ایتالیا	۵۸/۳	۵۵/۷	۴٪	ژوئن ۲۰۲۱
۶	فرانسه	۵۷/۴	۵۷	۱٪	ژوئن ۲۰۲۱
۷	استرالیا	۵۶/۷	۵۸	-۲٪	ژوئن ۲۰۲۱
۸	روسیه	۵۵	۵۶/۲	-۲٪	ژوئن ۲۰۲۱
۹	برزیل	۵۴/۶	۴۹/۲	۱۰٪	ژوئن ۲۰۲۱
۱۰	ایران	۵۱/۲۷	۵۳/۸۴	-۴٪	ژوئن ۲۰۲۱
۱۱	آفریقای جنوبی	۵۱	۵۳/۲	-۴٪	ژوئن ۲۰۲۱
۱۲	سنگاپور	۵۰/۱	۵۴/۴	-۷٪	ژوئن ۲۰۲۱
۱۳	چین	۵۰/۶	۵۳/۸	-۶٪	ژوئن ۲۰۲۱
۱۴	ژاپن	۴۸/۹	۴۸/۸	۰/۲٪	ژوئن ۲۰۲۱

روند تغییرات شاخص مدیران خرید (شامخ) ایران



تحلیل تکنیکال

شاخص کل و شاخص هموزن

شاخص هموزن در پی جبران جاماندگی خود از موج صعودی اخیر شاخص کل

شاخص کل



Time Frame: Daily

شاخص کل (هم وزن)



Time Frame: Daily

- شاخص کل پس از رسیدن به محدوده ۱,۲۸۴,۷۰۰ واحد در روز چهارشنبه (۱۶ تیر ۱۴۰۰) دچار اصلاح شد و امروز (شنبه ۱۹ تیر ۱۴۰۰) نیز با ادامه دادن روند اصلاحی خود به محدوده ۱,۲۷۰,۷۰۰ واحد رسید.
- اولین حمایت مهم در مسیر اصلاح شاخص کل، محدوده ۱,۲۶۰,۰۰۰ واحد است.
- با توجه به جریان مثبت ورود نقدینگی و حجم معاملات مناسب هفته‌های اخیر، انتظار نمی‌رود شاخص کل اصلاح خیلی عمیقی را تجربه کند.
- از سوی دیگر، همان‌طور که پیش‌بینی شده بود، به نظر می‌رسد شاخص هموزن در پی جبران جاماندگی خود از شاخص کل است و طی هفته گذشته رشد مناسبی را تجربه کرد.
- اولین محدوده مقاومتی مهم در مسیر رشد شاخص هموزن محدوده ۳۹۷,۰۰۰ واحد 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 شاخص کل اشاره شود.

تحلیل تکنیکال بیت کوین

نوسان با شیب نزولی

بیت کوین (BTCUSD)



Time Frame: 4 Hours

- بیت کوین کماکان در حال نوسان در بازه قیمتی ۳۱ الی ۳۶ هزار دلار است.
- با توجه به شیب نزولی روند قیمتی، انتظار می رود قیمت بیت کوین بار دیگر محدوده ۳۱ هزار دلار را به خود ببیند.
- در صورتیکه محدوده ۳۱ هزار دلار رو به پایین شکسته شود، محدوده حمایتی بعدی ۲۸ هزار دلار خواهد بود.
- با توجه به داده های درون شبکه، رسیدن قیمت بیت کوین به محدوده ۲۸ هزار دلار و حتی شکست روبه پایین این محدوده دور از انتظار نیست.

❖ 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 شاخص کل اشاره شود.

تحلیل تکنیکال اونس طلا

در آستانه شروع روند اصلاحی

طلا (XAUUSD)



Time Frame: 4 Hours

- اونس طلا هفته گذشته تا محدوده ۱,۸۱۸ دلار رشد و سپس شروع به نوسان در محدوده قیمتی ۱,۷۹۵ الی ۱,۸۱۰ دلار کرد.
- با توجه به ضعف مشهود روند صعودی و واگرایی منفی اندیکاتور RSI به نظر می‌رسد قیمت طلا در آستانه شروع حرکتی نزولی است.
- در صورت اصلاح قیمت، اولین محدوده حمایتی مهم در مسیر اصلاح طلا، محدوده ۱,۷۸۵ دلار 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 شاخص‌کل اشاره شود.

تحلیل تکنیکال شاخص دلار

انتهای روند نزولی

شاخص دلار (DXY)



Time Frame: Daily

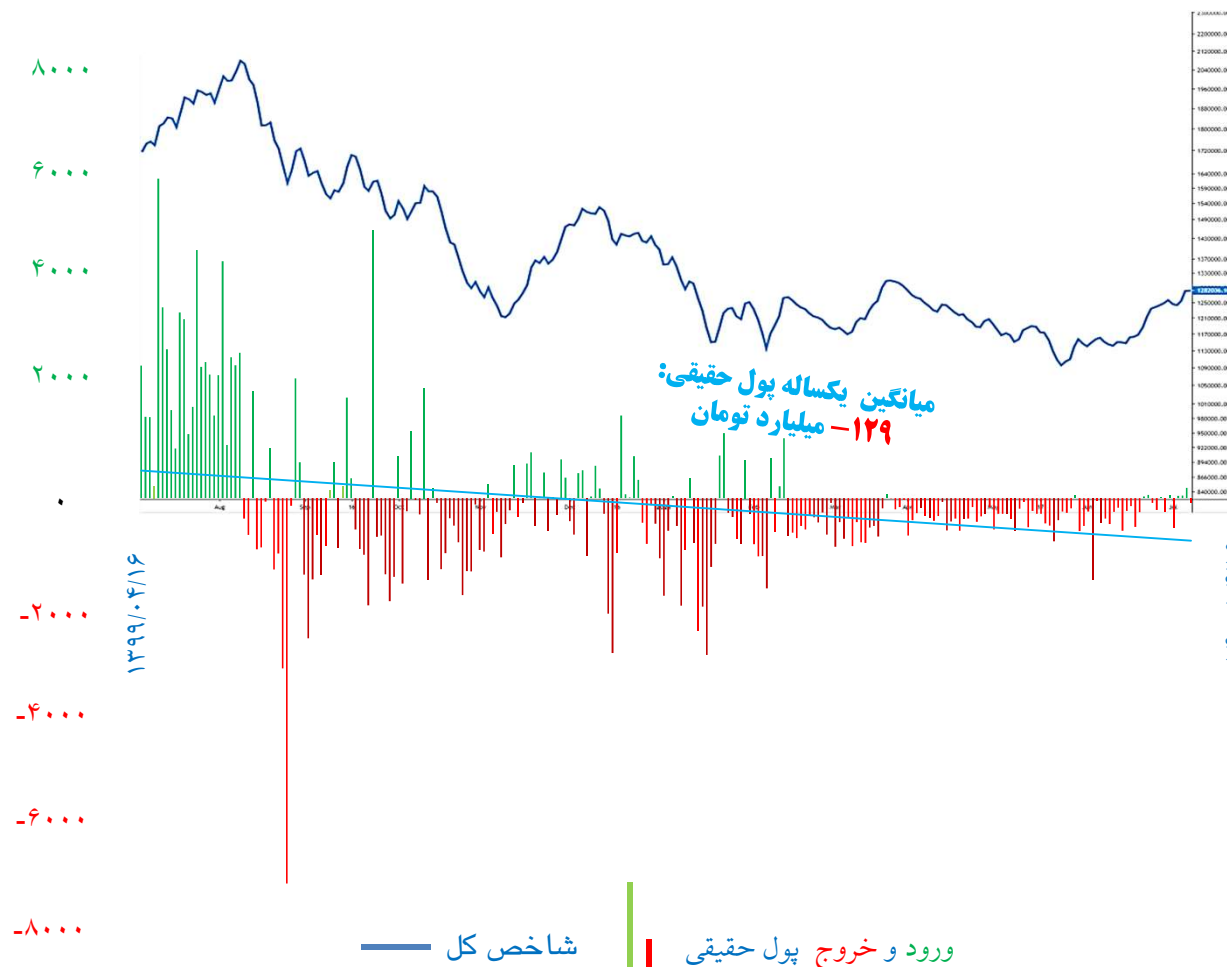
- به نظر می‌رسد شاخص دلار به انتهای روند اصلاحی خود رسیده و به زودی باید شاهد تغییر روند آن باشیم.
- محدوده حمایتی ۹۲/۱۰۰ الی ۹۲/۰۰۰ واحد، محدوده‌ای است که انتظار می‌رود شاخص دلار تغییر روند داده و بار دیگر به سمت مقاومت داینامیک خود در محدوده ۹۲/۳۰۰ الی ۹۲/۵۰۰ واحد حرکت کند.
- در صورت شکست روبه‌بالای مقاومت داینامیک، هدف بعدی شاخص دلار محدوده ۹۳/۳۰۰ واحد خواهد بود که این محدوده خط گردن الگوی کف دوقلو برای چارت شاخص دلار محسوب می‌شود و از این حیث مقاومتی بسیار بااهمیت 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 شاخص‌کل اشاره شود.

شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار

شاخص کل، خالص ورود و خروج پول حقیقی (هزار میلیارد تومان)



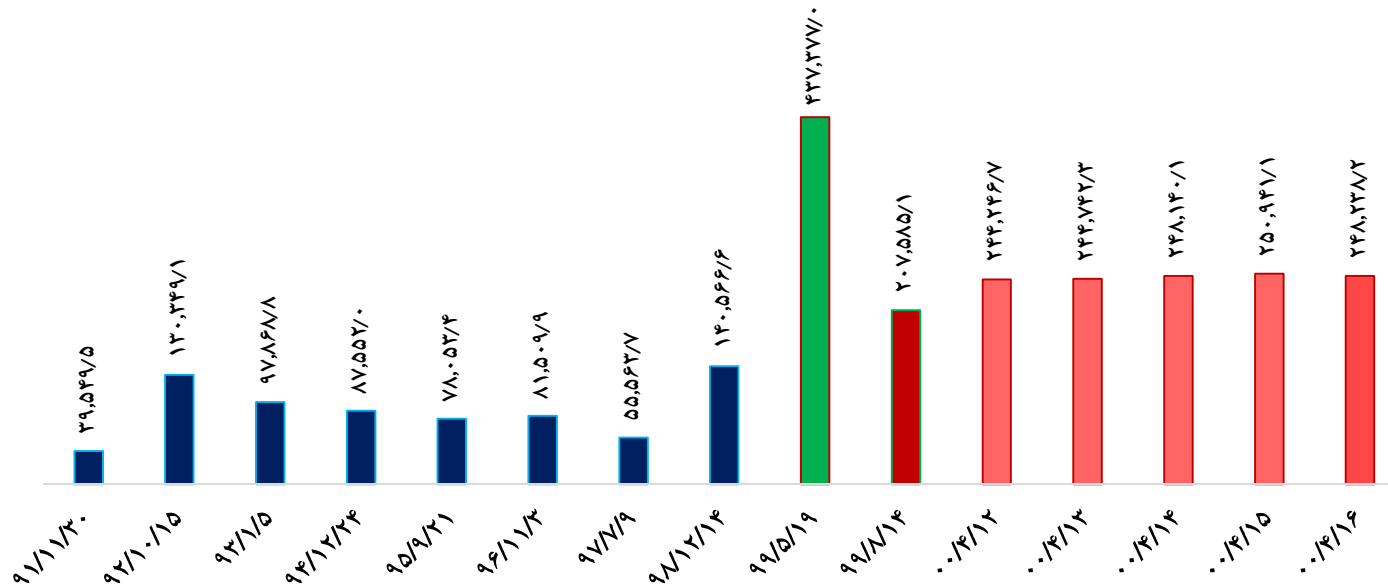
- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۲۸۲,۰۳۶ واحدی و بازده هفتگی ۱/۹۹ درصد بسته شد.
- برآیند هفتگی، حاکی از خروج ۳۲۳ میلیارد تومان پول حقیقی از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۰، نشان‌دهنده خروج ۲۰,۱۴۱ میلیارد تومان از بازار است. یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۸۴ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.
- میانگین روزانه خالص ورود پول حقیقی به کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹ تا چهارشنبه شانزدهم تیر ۱۴۰۰ به عدد ۱۰۰ میلیارد تومان را نشان می‌دهد. همچنین طی این مدت خالص ورود/خروج پول حقیقی کل بازار به عدد ۳۱,۶۱۵ میلیارد تومان افول کرده است.

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

شنبه	۱۴۰۰/۰۴/۱۲	۵۰۶- میلیارد تومان
یکشنبه	۱۴۰۰/۰۴/۱۳	۴۰+ میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۰۴/۱۴	۴۴+ میلیارد تومان
سه‌شنبه	۱۴۰۰/۰۴/۱۵	۱۷۸+ میلیارد تومان
چهارشنبه	۱۴۰۰/۰۴/۱۶	۷۹- میلیارد تومان

منبع: شرکت بورس (TSE.ir)

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



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۴۸ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله یکساله معادل ۴۳/۲ درصد شد. علت روند نزولی ارزش دلاری بازار علی‌رغم صعودی بودن شاخص کل را می‌توان در افزایش نرخ دلار طی هفته اخیر جست‌وجو کرد.

شاخص وارن بافت

بر مبنای دلار ۲۱ هزار تومانی و GDP برابر با ۵۰۲۹۹ هزار میلیارد ریال، ارزش دلاری تولید ناخالص داخلی ایران معادل ۲۴۰ میلیارد دلار در سال ۱۳۹۹ محاسبه می‌شود. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۱۰۳ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص برای آمریکا در تاریخ ۱ جولای سال ۲۰۲۱ با توجه به ارزش ۵۳/۷ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۲/۹ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۲۳۴ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هلدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال) (TTM)	P (ریال)	P/E (پیش‌بینی / تحقق یافته)	EPS (ریال) (پیش‌بینی / تحقق یافته)	سال مالی	P/NAV ۱۴۰۰/۰۴/۰۵
شستا	۷.۷	۱۷۰۱	۱۳۱۷۰	۵.۸	۲,۲۵۴	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۱۱۳٪
وبانک	۵.۴	۱۵۶۱	۸۴۵۰	۵.۴	۱,۵۶۲	۱۳۹۹/۱۲/۳۰	۵۷٪
وصندوق	۸.۰	۲۰۵۵	۱۶۴۴۰	۸.۰	۲,۰۵۵	۱۳۹۹/۱۲/۳۰	۶۵٪
وامید	۱۳.۹	۸۰۶	۱۱۲۳۰	۱۱.۸	۹۴۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۶۶٪
وغدیر	۱۲.۲	۱۰۴۰	۱۲۷۱۰	۷.۴	۱,۷۲۸	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۵۸٪
ونیکی	۸.۵	۱۱۳۵	۹۶۲۰	-	-	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۵۱٪

بیانیه سلب مسئولیت:

شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی خاص)، 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 است. اسامی تحلیل‌گران، به ترتیب حروف الفبا، عبارت است از:
صدرا آدم‌عارف، رکسانا ثابت‌قدم، رضا جعفری، عبدالکریم جهاندار و بردیا وکیلی

راهنبری و نظارت بر محتوا:

احسان برین

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