



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

عبور از ترافیک مجامع و انتظار برای بهبود جو بازار

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۱۴ - هفته منتهی به ۱ مرداد 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: توافق روسیه و اوکراین در مورد بازگشایی بنادر اوکراین؛
- تصویر اقتصاد کلان: افزایش نرخ بهره اروپا؛
- اقتصاد کلان: تورم - مرکز آمار نرخ تورم نقطه‌به‌نقطه تیر ۱۴۰۱ را معادل ۵۴ درصد اعلام کرد! - رکوردشکنی مجدد تورم؛
- بورس و انرژی: بازگشت رونق به بورس!؛
- فلزات گرانبها و ارز: بازگشت ارزش بازار رمزارزها به عدد ۱ تریلیون دلار؛
- بازار کالاهای خام: بازگشایی مجدد بنادر اوکراین جهت صادرات محصولات کشاورزی؛
- بررسی وضعیت صندوق‌ها؛
- بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - شاخص کل در کف کانال نزولی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - ناکام در عبور از مقاومت ۲۴ هزار دلاری؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - محدوده ۱,۶۸۰ نقطه بازگشت طلا؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - به سمت سقف کانال صعودی بلندمدت؛
- 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.

- شاید میزان افزایش نرخ بهره توسط بانک مرکزی اروپا برای مبارزه با تورم کافی نباشد.
- فعالیت تجاری منطقه یورو به کمترین میزان ۱۷ ماه اخیر سقوط کرده و ترس از رکود را فزونی بخشید.
- توییت، اعمال و اقدامات ایلان ماسک در پیشنهاد خرید این شرکت و پس گرفتن این پیشنهاد را دلیل کاهش درآمد سه ماهه خود اعلام کرد.
- آلمان ۱۵ میلیارد دلار دیگر به شرکت یونیپیر، تأمین‌کننده بزرگ انرژی این کشور، وام داد.
- سریع‌ترین سقوط ارزش روپیه پاکستان در مقابل دلار طی دو دهه اخیر رخ داد.
- جی‌پی مورگان اعلام کرد وام‌دهندگان از دولت اوکراین خواسته‌اند برای تمدید مهلت وام‌هایش، ساختار آنها را کاملاً بازتنظیم کند.
- کمبود نقدینگی در بازار املاک تجاری، مسأله جدی پیش روی کشورهای غربی قرار داد.
- آلمان برای مبارزه با بحران سوخت، قیمت بلیط‌های حمل‌ونقل عمومی را کاهش داد.
- چند شرکت نوآور ایتالیایی که در جهت ساخت‌وساز مسکن سازگار با محیط زیست فعالیت می‌کردند، متهم به کلاهبرداری ۵ میلیارد دلاری شدند.
- با نگاه به نوار غزه می‌توان راه‌حلی برای زندگی در شهرهای شلوغ آینده یافت.
- لوکزامبورگ بدنبال رایگان کردن کامل حمل‌ونقل عمومی است!

- بانک مرکزی اروپا نرخ بهره را ۰/۵ درصد افزایش خواهد داد.
- معاون وزیر خزانه‌داری آمریکا برای مذاکره با هیأت‌های اروپایی جهت تعیین سقف قیمت برای خرید نفت روسیه به بروکسل سفر می‌کند.
- عربستان سعودی و عراق برای جبران کسری نفت خام پالایشگاه‌های اروپا وارد عمل شدند.
- کشتی‌هایی که پیش از این به قاچاق نفت ایران مشغول بودند اکنون حامل نفت خام روسیه هستند.
- اوکراین و روسیه جهت تسهیل روند صادرات غلات اوکراین، که به دلیل جنگ متوقف شده، توافق کردند.
- کمبود در کفه عرضه، باعث رشد اندک و آرام نفت شد.
- کاهش ارزش قیمت سهام بخش تکنولوژی، باعث منفی خوردن بازارها در روز پایانی هفته شد.
- فولکس‌واگن مدیرعامل پورشه را به سمت رئیس هیأت‌مدیره خود برگزید تا سیاست‌های ورود این مجموعه به بازار خودروهای الکتریکی را تسریع کند.
- بانک‌های مرکزی جهان دچار گنگی در سیاست‌های پولی و ناتوان در مهار تورم بدون جلوگیری از رکود هستند.
- برخی از مدیران وال‌استریت عقیده دارند تقاضای نفت طی ماه‌های آتی افزایش قابل توجهی خواهد داشت.
- پوتین و بن‌سلمان در اینکه فعالیت اوپک پلاس باید ادامه پیدا کند، توافق نظر دارند.
- فرستاده ویژه دولت مجارستان در حال تلاش برای مطمئن شدن از تأمین گاز این کشور توسط روسیه در زمستان است. بعضی تحلیل‌گران انتظار دارند که کشورهای دیگری از اروپا نیز با نزدیک شدن به فصل سرما در این جهت تلاش کنند.

- ترامپ در مراسم خاکسپاری همسر سابقش اعلام کرد که قصد نامزد شدن در انتخاب ریاست جمهوری پیش رو را دارد.
- دادگاهی در آمریکا در حال بررسی لحظه‌به‌لحظه حمله شانزدهم ژانویه به ساختمان کنگره جهت یافتن کوتاهی‌های انجام‌گرفته در مقابله با آشوب توسط ترامپ است.
- بن‌سلمان به بایدن وعده داد ظرفیت تولید روزانه نفت عربستان را تا سال ۲۰۲۷ به ۱۳ میلیون بشکه در روز برساند.
- یک مورد بیماری فلج اطفال برای اولین بار طی ۱۰ سال گذشته در غرب آمریکا مشاهده شد.
- بعضی تحلیل‌گران معتقدند روزهای خوب بازارهای مالی هنوز به پایان نرسیده است.
- صادرات غلات اوکراین در ماه‌های آتی در گروهی پاکسازی میادین مین، پیدا کردن کشتی‌های حاضر به پهلوگیری در منطقه جنگی و اعتماد به پوتین است!
- بیت‌کوین خیز بزرگی به سمت ۲۵,۰۰۰ دلار برداشت.
- بازار رمزارزها تحت تأثیر حمایت و تبلیغات صرافی کوین‌بیس در حال جلب اعتماد دوباره معامله‌کنندگان هستند.
- با افزایش نرخ بهره در آمریکا، آگهی‌های فروش واحدهای مسکونی و صنعتی افزایش یافت.
- شهر آمستردام به خاطر ترس از شیوع دوباره کرونا در حال تلاش برای مهار کردن موج گردشگران است.

حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی

فایننشال تایمز



توافق روسیه و اوکراین در مورد بازگشایی بنادر اوکراین

اشاره

افزایش نرخ بهره از سوی بانک مرکزی اروپا، خبر مهمی بود که این هفته منتشر شد. همچنین روسیه و اوکراین در استانبول توافق کردند جهت تسهیل روند صادرات غلات اوکراین، بنادر این کشور بازگشایی شوند. دونالد ترامپ برای اولین بار صراحتاً اعلام کرد که قصد شرکت در انتخابات ریاست‌جمهوری پیش روی آمریکا را دارد. بن‌سلمان که قول افزایش ۴ میلیون بشکه‌ای تولید نفت خود به بایدن در سفیر اخیر او به خاورمیانه را داده بود، در مذاکرات خود با ولادیمیر پوتین گفت که همکاری‌های اوپک پلاس باید ادامه پیدا کند. بازار رمزارزها دوباره گرم شده و بیت‌کوین بالای ۲۲,۰۰۰ دلار معامله می‌شود و برخی تحلیل‌گران انتظار قیمت‌های بالاتر را نیز دارند. سقوط فعالیت تجاری منطقه یورو به کمترین میزان ۱۷ ماه اخیر خود نیز خبر نگران‌کننده این هفته بود.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

BUSINESS INSIDER

بیزینس اینسایدر

۵۷۳,۹۹۰,۳۰۳	+۱,۳۸%
جان باختگان ۶,۴۰۱,۳۴۲	+۰,۲۵%
بهبود یافتگان ۵۴۳,۷۲۱,۱۰۰	+۱,۱۵%

تصویر اقتصاد کلان

افزایش نرخ بهره اروپا

مقایسه بازدهی بازارها

یکساله	۱۴۰۱	ماه‌بانه	هفتگی	بازار
دولار (ریالی)	٪۲۹،۲۰	٪۲۱،۸۵	٪۱،۴۳	٪۱،۱۱
سکه (ریالی)	٪۳۹،۴۹	٪۱۹،۶۹	٪۳،۸۲-	٪۱،۷۷-
بورس (شاخص)	٪۱۱،۲۲	٪۷،۱۱	٪۴،۸۷-	٪۱،۲۲-
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	٪۲۱،۵۴-	٪۴۳،۵۴-	٪۱۷،۱۱	٪۱۳،۴۶
مسکن (ریالی - تهران)	۳۲/۸٪	-	۸/۴٪	-

منبع داده‌ها:

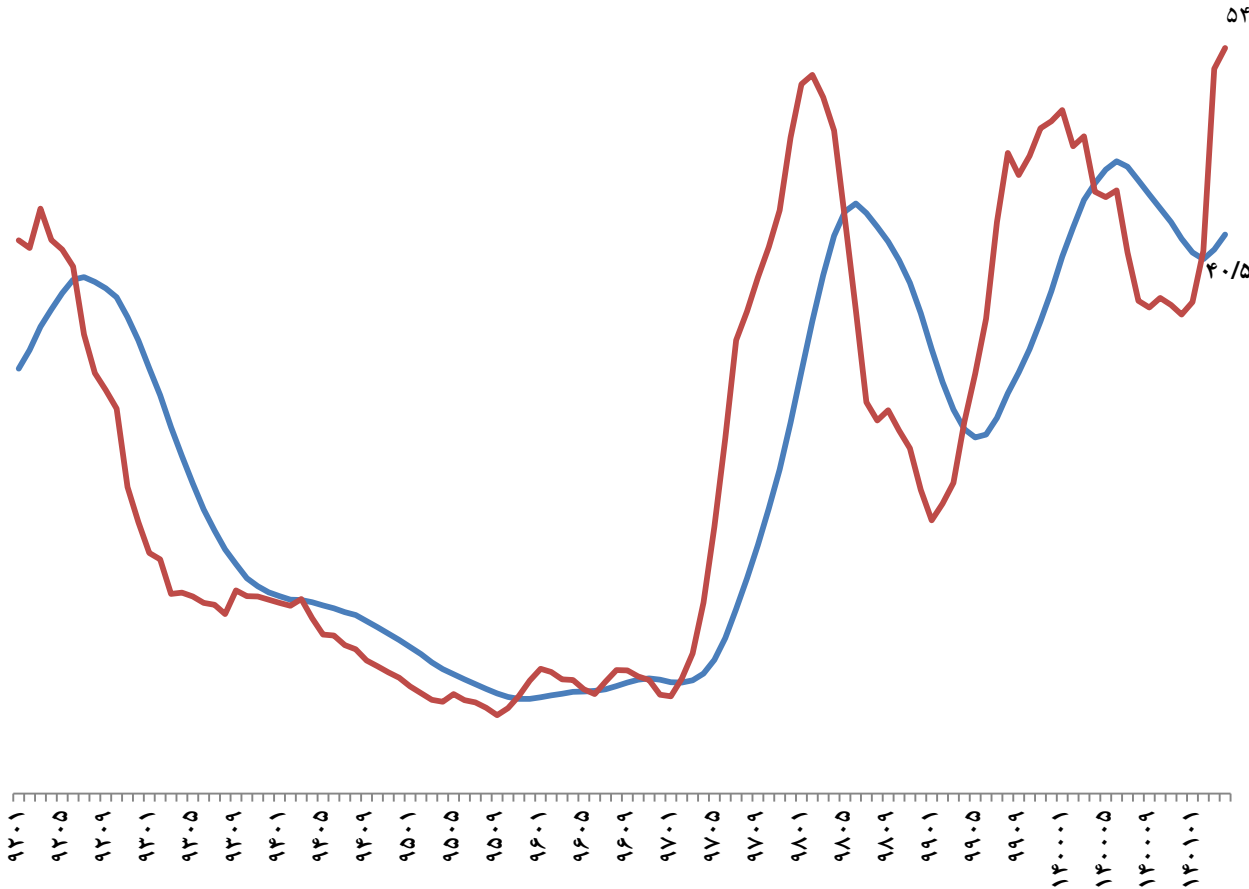
وبسایت TGJU : بازدهی دلار و سکه
 وبسایت TSETMC : بازدهی شاخص کل بورس تهران
 بانک مرکزی ج.ا.ا. : بازدهی مسکن
 وبسایت TradingView : بازدهی رمزارزها

نرخ بهره (درصد)	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	-	٪۳/۶			پیش‌بینی (۲۰۲۲)
آمریکا									
۲۲-ژوئن	۲۲-مارس	۲۲-ژوئن	۲۲-ژوئن	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۱/۷۵	٪-۱/۶	٪۹/۱	٪۳/۶	٪۴/۷	٪۵/۴	٪۵/۷	۶۹,۲۳۱	۲۲,۹۹۷,۵۰۰	مقدار شاخص
				٪۷/۷	٪۳/۵	٪۳/۷			پیش‌بینی (۲۰۲۲)
چین									
۲۲-ژولای	۲۰۲۲-ژوئن	۲۲-ژوئن	۲۲-ژوئن	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
٪۳/۷	٪-۲/۶	٪۲/۵	٪۵/۵	٪۰/۹	٪۴/۲	٪۸/۱	۱۲,۳۵۹	۱۷,۴۵۸,۰۴۰	مقدار شاخص
				٪۲/۱	٪۳/۷	٪۴/۴			پیش‌بینی (۲۰۲۲)
منطقه یورو									
۲۲-ژولای	۲۲-مارس	۲۲-ژوئن	۲۲-می	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۱۹	۲۰۲۰	بازه زمانی
٪۰/۵	٪۰/۶	٪۸/۶	٪۶/۶	٪۲/۶	-	٪۵/۳	۳۷,۷۲۳	۱۲,۹۱۶,۶۱۸	مقدار شاخص
				٪۵/۳	٪۷/۷	٪۳/۷			پیش‌بینی (۲۰۲۱)
ایران									
۲۲-می	زمستان ۱۴۰۰	تیر ۱۴۰۱	بهار ۱۴۰۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۱۴۰۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
٪۱۸	٪۲/۳	٪۵۴	٪۹/۲	٪۴۰/۱	٪۹/۸	٪۴/۳	۷,۵۵۵	۲۰۳,۴۷۱	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، نقطه‌نقطه و فصلی کشورها (به جز ایران) و همچنین آمار مربوط به نرخ بهره
 مرکز آمار ایران: آمارهای میانگین سالیانه، نقطه‌به‌نقطه و فصلی ایران

نقطه به نقطه — ۱۲ ماهه



مرکز آمار ایران نرخ تورم تیر ۱۴۰۱ را اعلام کرد. بر این اساس، نرخ تورم نقطه به نقطه با افزایش ۱/۵ واحد درصدی در ماه تیر نسبت به خرداد ۱۴۰۱، بار دیگر رکوردشکنی کرد و به عدد تاریخی ۵۴ درصد رسید. نرخ تورم میانگین سالیانه نیز با افزایش ۱/۱ واحد درصدی نسبت به ماه قبل به عدد ۴۰/۵ درصد رسید.

نرخ تورم ماهانه شاخص کل قیمت کالاها و خدمات مصرفی خانوارهای کل کشور در ماه تیر نسبت به خرداد ۱۴۰۱ با کاهش ۷/۶ واحد درصدی از ۱۲/۲ درصد به ۴/۶ درصد رسیده است. در این بین، بیشترین نرخ تورم ماهانه در بین گروه‌های کالایی مربوط به گروه بهداشت و درمان با نرخ تورم ماهیانه ۶/۱ درصد و کمترین آن مربوط به گروه کالایی ارتباطات با نرخ تورم ۱ درصد بوده است.

با توجه به شوک اخیر افزایش قیمت‌ها ناشی از حذف ارز ترجیحی ۴,۲۰۰ تومانی، همچنان انتظار می‌رود آثار تورمی این سیاست بطور کامل متبلور نشده و در نتیجه احتمالاً طی ماه‌های آتی شاهد ثبت رکوردهای جدید در این زمینه باشیم.

در این بین، با توجه به تحولات بین‌المللی و افزایش ارزش دلار در بازارهای جهانی، به نظر می‌رسد باید در آینده نزدیک خواه‌ناخواه شاهد افزایش نرخ ارز (بویژه دلار آمریکا) نیز باشیم، که در این صورت، یک شوک ارزی جدید، در صورت ثابت ماندن سایر شرایط، می‌تواند اوضاع متغیرهای اصلی اقتصاد کلان ایران، بویژه نرخ تورم، را از حالت فعلی نیز بدتر کند.

بورس و انرژی

بازگشت رونق به بورس!



منبع

بازده هفتگی بازده ماهانه بازده یکساله

معادل

آخرین قیمت

عنوان

ردیف

بورس های جهانی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
۱	Dow Jones	۳۱,۹۰۵	واحد	۲.۰۰٪	۴.۶۷٪	-۸.۳۸٪
۲	Nasdaq	۱۲,۳۹۶	واحد	۳.۴۵٪	۷.۵۴٪	-۱۷.۰۳٪
۳	S&P 500	۳,۹۶۱.۹	واحد	۲.۶۳٪	۵.۵۲٪	-۹.۲۶٪
۴	FTSE 100	۷,۲۴۹	واحد	۱.۰۸٪	۲.۵۳٪	۴.۲۶٪
۵	DAX	۱۳,۲۵۴	واحد	۳.۰۲٪	۰.۸۳٪	-۱۴.۵۷٪
۶	CAC 40	۶,۲۱۷	واحد	۳.۰۰٪	۵.۰۷٪	-۴.۰۹٪
۷	NIKKEI 225	۲۷,۹۱۲	واحد	۴.۲۰٪	۶.۷۵٪	۱.۳۳٪
۸	SHANGHAI	۳,۲۷۰	واحد	۱.۳۰٪	۰.۰۸٪	-۸.۵۳٪
۹	Moex	۲,۰۹۷	واحد	-۰.۶۱٪	-۱۲.۸۰٪	-۴۳.۸۶٪

TeleTrader

TradingEconomics

نفت و انرژی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
۱۰	نفت خام برنت	۱۰۳.۲	دلار/بشکه	۲.۰۲٪	-۳.۰۶٪	۳۹.۲۷٪
۱۱	نفت خام WTI	۹۴.۷	دلار/بشکه	۰.۱۴٪	-۶.۷۷٪	۳۱.۴۰٪
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۸.۲۹۹	دلار/MM Btu	۱۸.۲۹٪	۳۲.۰۹٪	۱۰۴.۴۱٪
۱۳	سبب اوپک	۱۰۷.۵	دلار/بشکه	۲.۸۹٪	-۳.۳۴٪	۳۱.۹۵٪
۱۴	نفت سنگین ایران	۹۹.۶۶	دلار/بشکه	۶.۸۹٪	-۸.۴۵٪	۴۳.۹۵٪
۱۵	گازوئیل	۱,۰۰۸	دلار/تن	-۵.۵۹٪	-۱۷.۱۰٪	۷۵.۷۳٪
۱۶	اتانول	۲,۴۹۷	دلار/گالن	-۱.۶۷٪	-۱۰.۹۶٪	۱۲.۷۵٪
۱۷	نفتا	۷۶۵.۶۱	دلار/تن	-۰.۸۱٪	-۴.۴۲٪	۱۳.۹۲٪
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۵۶۸	یوان/تن	۰.۰۸٪	-۳.۷۴٪	-۰.۲۷٪
۱۹	متانول CFR	۳۰۳	دلار/تن	۱.۹۸٪	-۴.۲۹٪	-۱.۶۵٪
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۵۱۴.۳۳	دلار/تن	-۳.۳۸٪	-۴.۴۹٪	۱۶.۸۹٪
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۱۲۰۰	دلار/تن	-۱/۶۷	-۷/۵	۱۶/۶۷

۲۹.۳۶ سنت/متر مکعب

بورس های جهانی

هفته خوب پیشین بازارهای سهام که با اعلام پیش بینی های پایین تر از انتظار نرخ بهره فدرال رزرو شروع شد بود، این هفته را نیز تحت تأثیر قرار داد. بازارها که در ابتدای هفته با بدبینی و موج فروش پس از یک هفته خوب بازگشایی شده بودند، این هفته نیز پس از تخلیه هیجانات روند صعودی در پیش گرفتند و حتی اخبار مالی بد بعضی از شرکت های تکنولوژی و فروش پایین تر از انتظار آنها نتوانست روند هفتگی بازارها را منفی کند.

با وجود افزایش روزه روز نگرانی ها در مورد حوزه مسکن چین، بورس هنگ کنگ به پشتوانه وعده های خوب و مشوق های مالی دولت این هفته نیز عملکردی مثبت به جای گذاشت که وضعیت در بورس شانگهای با توجه به ماهیت شرکت های فعال در آن متفاوت بود. بازارهای کشورهای اروپایی با وجود وعده بانک مرکزی اروپا برای افزایش نرخ بهره باز هم عملکردی خوب از خود نشان داده و مثبت بودند.

نفت و محصولات پتروشیمی

هفته بسیار مهم نفت که شامل مذاکرات آشکار و پشت پرده زیادی بین کشورهای اوپک پلاس، اروپا و آمریکا بود، در نهایت بازده مثبت قیمت نفت برنت، وست تگزاس و سبب نفتی اوپک را رقم زد. همچنین نباید این مسأله را نیز نادیده گرفت که بازار کنونی نفت و محصولات آن زیر سایه دو وحشت عظیم از رکود سراسری جهانی و موج جدید کرونا و تعطیلی های گسترده قرار دارد! با وجود این طی هفته جاری اوپک پلاس اعلام کرد که با نرخ تولید کنونی، سال آتی دنیا با نزدیک به ۷۰۰ هزار بشکه در روز کسری عرضه روبرو خواهد بود.

در اروپا و آمریکا تحت تأثیر موج گرمای LNG قیمت گاز طبیعی و وحشتناک و بالاتر رفتن درصد استفاده مردم از تجهیزات سرمایشی (به خصوص در اروپا) این هفته نیز شدیداً افزایشی بود. تقاضای داخلی نیروگاه ها و سامانه های سرمایشی آمریکا برای گاز به قدری بالا رفته که به گزارش خبرگزاری ها، بیشترین عدد شاخص قیمت گاز طبیعی تاریخ این کشور در این فصل از سال را شاهدیم! با وجود این امیدی به کاهش قیمت گاز بدون کاهش دما نیست.

فلزات گرانبها و ارز

بازگشت ارزش بازار رمزارزها به عدد ۱ تریلیون دلار

بازار فلزات گرانبها

طی هفته اخیر با توجه به ریزش ۱/۳۵ درصدی شاخص دلار، اونس جهانی طلا پس از طی کردن ۵ هفته متوالی ریزشی و افت نزدیک به ۱۶۰ دلار، رشد ۱/۱۵ درصدی را تجربه کرد و به عدد ۱,۷۲۶ رسید. آنچه که می‌تواند جهت طلا را تعیین کند، جلسه آئی فدرالرزرو برای تعیین نرخ بهره در روز ۲۷ جولای است، که پیش‌بینی می‌شود با توجه به ثبت رکورد جدید تورم، یعنی عدد ۹/۱ درصد، اعضای آن با موافقت افزایش ۰/۷۵ درصدی، نرخ بهره را به ۲/۵ درصد برسانند که این اتفاق برای طلا بد تلقی می‌شود.

سکه و ارز (داخلی)

هفته گذشته با توجه به سفر رئیس جمهور روسیه، نرخ ارز نوسانی شد. اما در ادامه هفته شاهد ثبات نسبی در بازار ارز داخلی بودیم و بازار همچنان منتظر تعیین تکلیف شدن مذاکرات برای جهت گرفتن خود است. اما در بازار طلا و سکه، با توجه به ریزش‌های اخیر اونس جهانی طلا و ثبات بازار ارز، تقاضا در این بازار با کاهش همراه شده و قیمت‌ها کاهش یافته‌اند.

رمزارز

هفته گذشته گزارشات مالی ۳ ماهه شرکت‌های آمریکایی منتشر شد. شرکت تسلا طی گزارش درآمد خود اعلام کرد که تقریباً ۷۵ درصد (معادل حدوداً ۳۳ هزار بیت‌کوین) از خریدهای پیشین بیت‌کوین خود را به فروش رسانده است و در اثر این فروش طی سه ماهه دوم، ۹۳۶ میلیون دلار پول نقد به ترازنامه خود اضافه کرد. با توجه به میانگین خریدهای اولیه تسلا که در قیمت ۳۲,۶۱۰ دلار انجام شده، این شرکت با فروش دارایی بیت‌کوین خود در حدود ۲۸ هزار دلار با کاهش ارزش آنها روبرو شده که این کاهش ارزش دارایی‌ها را در گزارش خود اعلام نکرد. ایلان ماسک، مدیرعامل شرکت تسلا، در جریان گزارش درآمد این شرکت گفت شرکت سازنده خودروهای الکتریکی تسلا، اکثر دارایی‌های بیت‌کوین خود را در سه ماهه دوم به منظور تقویت موقعیت نقدی خود با توجه به عدم اطمینان در مورد قرنطینه‌های کووید در چین، فروخته است. اما ماسک گفت تسلا آماده افزایش ذخایر بیت‌کوین خود در آینده است و خاطر نشان کرد که فروش سه ماهه دوم نباید به عنوان قضاوت منفی در مورد بیت‌کوین تلقی شود و تأکید کرد که «ما نگران نقدینگی کلی شرکت با توجه به کووید و تعطیلی در چین بودیم». گفتنی است که تسلا در پایان سال ۲۰۲۱ حدود ۲ میلیارد دلار بیت‌کوین در اختیار داشت، که معادل ۴۳,۲۰۰ بیت‌کوین بود. از لحاظ گزارش درآمدی، سود هر سهم این شرکت معادل ۲/۲۷ دلار اعلام شد که از برآورد ۱/۸۰ دلاری بیشتر است. همچنین، درآمد این شرکت ۱۶/۹۳۴ میلیارد دلار اعلام شد در حالی که انتظار می‌رفت درآمد آن ۱۷/۲ میلیارد دلار باشد. حاشیه سود ناخالص تسلا معادل ۲۷/۹ درصد بود، درحالی‌که این رقم در سال گذشته معادل ۲۸/۴ درصد گزارش شد.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۷۲۶	دلار/اونس	۱.۱۵%	-۵.۳۰%	-۴.۱۹%	TeleTrader
۲	نقره	۱۸.۶۱	دلار/اونس	-۰.۴۳%	-۱۱.۲۱%	-۲۶.۱۲%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۳۰ تیر							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۳,۵۳۶,۰۰۰	ریال	-۱.۹۸%	-۵.۵۱%	۲۸.۱۸%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۴۸,۱۰۰,۰۰۰	ریال	-۱.۷۷%	-۳.۸۲%	۳۹.۷۷%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۳۰ تیر							
۵	دلار آزاد	۳۱۹,۵۰۰	ریال	۱.۱۱%	۱.۴۳%	۲۹.۲۰%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۶۰,۸۰۸	ریال	-۰.۱۵%	۳.۲۶%	۱۷.۶۶%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۶۳,۱۷۷	ریال	-۰.۱۵%	۳.۲۶%	۱۷.۶۶%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۲۵,۹۵۰	ریال	۱.۴۰%	-۳.۰۸%	۱۲.۸۶%	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۶,۳۸۹	ریال	۱.۴۸%	-۰.۶۸%	۲۰.۰۸%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۶۸,۸۰۹	ریال	۱.۴۸%	-۰.۶۸%	۲۰.۰۸%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۶,۳۸۸	ریال	-۰.۲۲%	۲.۹۷%	۱۸.۱۴%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۱,۰۱۷	ریال	-۰.۱۵%	۳.۲۶%	۱۷.۶۶%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۷۱,۶۶۲	ریال	-۰.۱۵%	۳.۲۶%	۱۷.۶۶%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت‌کوین	۲۲,۷۸۶	دلار	۷.۲۲%	۷.۹۸%	-۳۲.۳۷%	TradingEconomics
۱۵	اتریوم	۱,۵۸۳	دلار	۱۶.۵۳%	۳۸.۳۷%	-۲۵.۵۹%	TradingEconomics



بازار کالاهای خام بازگشایی مجدد بنادر اوکراین جهت صادرات محصولات کشاورزی

بازار محصولات کشاورزی

با گذشت ۱۵۱ روز از شروع تخاصم روسیه به اوکراین و مشاهده فراز و نشیب‌های بسیاری حول محوری این درگیری در یکی از بزرگترین و حاصل‌خیزترین مراتع تولید محصولات کشاورزی و غلات جهان، اکنون با متعادل شدن قیمت محصولات کشاورزی خیرهای خوبی نیز در این حوزه مخابره شده است. بر این اساس روسیه برای عدم سنگ‌اندازی این کشور در مسیر صادرات گندم اوکراین به توافق رسیده و به زودی شاهد عرضه راحت‌ترین غلات از مبدأ این کشور در بازارهای صادراتی جهان خواهیم بود، هرچند که خود این امر دشواری‌های بسیار تا تحقق بر سر راه دارد. قیمت روغن پالم نیز در مسیر نزولی شدید قرار گرفته و گویا سر ساکن شدن ندارد. تأثیر کاهش شدید قیمت پالم (پس از یک دوره اقبال شدید قیمتی این محصول به خاطر کاهش عرضه اندونزی) را اکنون در سایر دانه‌های روغنی مثل کانولا هم شاهدیم که بازده سالیانه آنها منفی شده است.

بازار کالاهای صنعتی

بازار فلزات اساسی بجز فولاد، این هفته، از هفته پیش وضع بهتری داشت. پر شدن انبارهای فولاد بنادر چین موجب کاهش قیمت معاملات فولاد داخلی این کشور شده است. افزایش قیمت زغال‌سنگ بدلیل اقبال عمومی کشورها جهت استفاده از آن بعنوان سوخت نیروگاه‌ها در کمبود گاز طبیعی و تعطیلی نیروگاه‌های هسته‌ای، باعث بالاتر رفتن قیمت سنگ آهن از هفته پیش در بازار نسبتاً ساکن این محصول، به خصوص در چین، شد. تولیدکنندگان آلومینیوم و روی امید دارند که با افزایش قیمت انرژی و کم شدن صرفه اقتصادی آن و تعطیلی واحدها در زمان کنونی، ضعیف شدن کفه عرضه، افزایش قیمت روی و آلومینیوم در سال آتی را رقم بزند. قیمت مس نیز پس از یک ماه و نیم کاهش، هفته‌ای مثبت را به ثبت رساند.

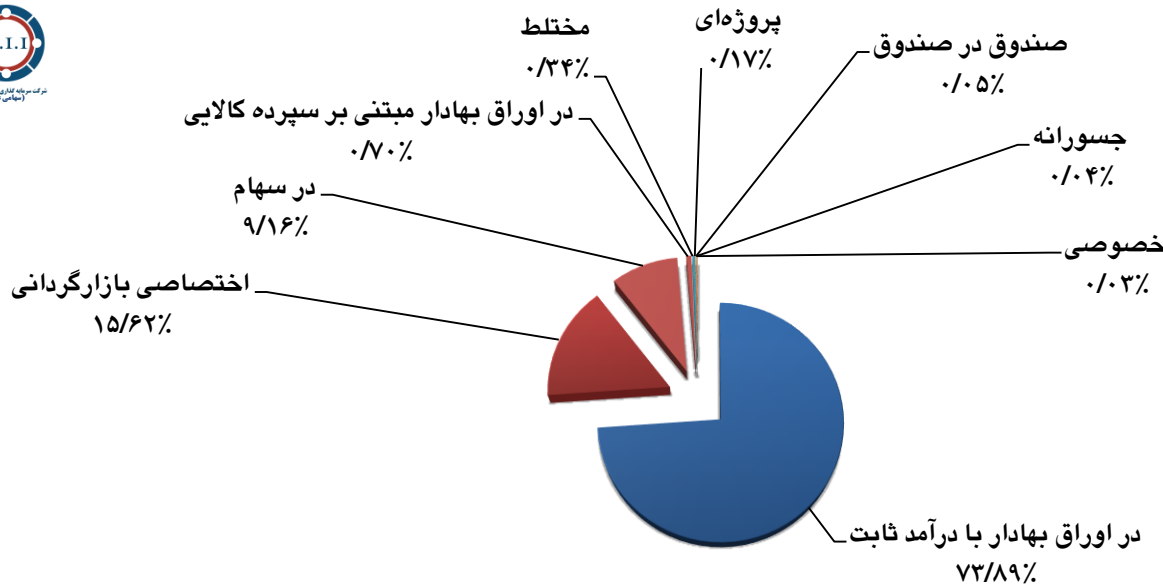
شاخص‌های کالایی

شاخص‌های کالایی نیز این هفته، با فروغ بازارها مثبت بودند و شاهد وضع بهتر معاملات بازار LME نسبت به هفته‌های اخیر هستیم. با توجه به انتشار روزانه اخبار مهم حوزه صنعت و سیاست‌های پولی و موقعیت خطیر بازارهای جهانی در کساکش رکود و تورم، پیش بینی متقنی از وضع این شاخص‌ها طی هفته آتی نمی‌توان ارائه کرد.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه
محصولات کشاورزی						
۱	ذرت	۵۶۲.۵	سنت /بوشل	۲۲۱	دلار/تن	۱۳.۹۲٪ -۷.۰۲٪ -۱۴.۱۹٪
۲	کتان (پنبه)	۹۱.۶۴	سنت /پوند	۲۰۲۰	دلار/تن	۱۳.۸۴٪ -۳.۳۰٪ -۱۵.۰۳٪
۳	سویا	۱.۴۳۲.۵۰	سنت /بوشل	۵۲۶	دلار/تن	۸.۵۲٪ -۲.۵۳٪ -۴.۹۳٪
۴	شکر	۱۸.۳۵	سنت /پوند	۴۰۵	دلار/تن	۱۰.۹۴٪ -۴.۲۳٪ ۰.۱۱٪
۵	گندم	۷۵۵.۵۰	سنت /بوشل	۲۷۸	دلار/تن	۸.۹۸٪ -۳.۲۷٪ -۲۳.۳۰٪
۶	کانولا	۸۰۲.۴۰	دلار کانادا/تن	۶۳۴	دلار/تن	TradingEconomics -۹.۱۷٪ -۸.۸۴٪ -۴.۸۶٪
کالاهای صنعتی						
۷	مس	۷۳۸۹.۵	دلار/تن			TeleTrader -۲۱.۸۸٪ -۱۵.۸۹٪ ۳.۰۰٪
۸	قیر	۴.۱۲۴.۰۰	یوان/تن	۶۶۰	دلار/تن	TeleTrader ۳۱.۲۵٪ -۵.۹۷٪ -۶.۲۷٪
۹	فولاد	۳.۸۲۹.۰۰	یوان/تن	۶۱۳	دلار/تن	TradingEconomics -۳۱.۵۹٪ -۱۰.۷۳٪ -۲.۵۷٪
۱۰	آلومینیوم	۲.۴۵۹	دلار/تن			TeleTrader -۱.۹۷٪ -۰.۳۶٪ ۵.۰۹٪
۱۱	سرب	۲.۰۱۰	دلار/تن			TeleTrader -۱۵.۲۸٪ ۳.۵۰٪ ۳.۶۶٪
۱۲	روی	۲.۹۹۲	دلار/تن			TeleTrader ۱.۹۱٪ -۱۵.۷۵٪ ۱.۶۸٪
۱۳	سنگ آهن	۱۰۳.۰۰	دلار/تن			TradingEconomics -۵۰.۷۲٪ -۸.۰۴٪ -۱.۹۰٪
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۵۶۷	دلار/تن			Metal Bulletin -۱۵.۴۹٪ ۹.۴۱٪ ۰.۰۰٪
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بنادر ایران)	۴۸۰	دلار/تن			Metal Bulletin -۲۵.۲۳٪ -۹.۹۴٪ -۴.۳۸٪
شاخص‌های کالایی						
۱۶	باتیک خشک	۲.۱۴۶	واحد			tgju.org -۳۲.۳۲٪ -۸.۶۴٪ ۶.۷۷٪
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۰۰	واحد			TradingEconomics ۳۰.۶۱٪ -۷.۵۶٪ ۲.۹۴٪
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۳,۶۱۸	واحد			TradingEconomics -۱۳.۵۹٪ -۱۲.۰۸٪ ۴.۱۸٪
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳,۶۱۸	واحد			TradingEconomics ۳۹.۵۴٪ -۸.۲۰٪ ۲.۷۶٪

بررسی وضعیت صندوق‌ها

در هفته منتهی به شنبه ۱ مرداد ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت، در سهام و جسورانه بازدهی صندوق‌های بازارگردانی، مختلط، صندوق‌درصندوق و مبتنی بر سپرده کالایی منفی و بازدهی صندوق‌های خصوصی و پروژه‌ای صفر بود. درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های درآمد ثابت با ۰/۳۲ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های اختصاصی بازارگردانی با ۱/۳۳- درصد بود. از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۳/۸۹ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۵/۶۲ درصد و سهامی با ۹/۱۶ 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 ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ۶ ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
خصوصی	۱,۶۱۰.۵۸	۰.۰۱٪	۰.۰۰٪	۰.۲۱٪	۱۳.۸۳٪	۰.۰۱٪	۰.۰۵٪
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۷۰۳,۰۸۱.۵۷	۰.۱۳٪	۰.۳۲٪	۱.۳۲٪	۴.۲۴٪	۸.۹۳٪	۱۳.۷۷٪
اختصاصی بازارگردانی	۹۹۴,۲۵۸.۸۷	۲.۲۱٪	۱.۳۳٪-	۴.۸۵٪-	۱۱۶.۰۰٪-	۱۳.۵۲٪	۱.۵۵٪
در سهام	۵۸۲,۸۳۵.۲۱	۰.۳۱٪	۰.۰۸٪	۳.۳۴٪-	۲۱۰.۰۰٪-	۱۷.۶۰٪	۸.۰۱٪
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۴۴,۳۹۲.۷۱	۰.۰۰٪	۰.۰۳٪-	۱.۷۰٪-	۱۲۸۶.۰۰٪	۲۰.۰۳٪	۴۹.۳۳٪
مختلط	۲۱,۸۷۰.۰۲	۰.۰۶٪	۰.۵۴٪-	۲.۲۳٪-	۲۱.۰۰٪	۱۳.۱۳٪	۱۲.۶۹٪
پروژه‌ای	۱۰,۵۷۶.۳۳	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
صندوق درصندوق	۳,۴۰۸.۳۶	۰.۰۰٪	۰.۱۰٪-	۲.۰۲٪-	۲۶.۰۰٪-	۷.۰۰٪	۵.۷۹٪
جسورانه	۲,۸۱۵.۲۲	۱.۷۸٪	۰.۰۲٪	۰.۰۲٪	۱۱۰.۰۰٪	۱۱.۸۸٪	۲۴.۴۷٪
خصوصی	۶,۳۶۴,۸۴۹						

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخزا ۸۱۶	۹۹۶۰۵۰	۱۴۰۱-۰۴-۲۸	۱۴۰۱-۰۵-۰۳	۲۷.۲۲%	۲۴.۱۲%
اخزا ۹۰۴	۸۸۵۰۰۰	۱۴۰۱-۰۴-۲۹	۱۴۰۱-۱۲-۱۵	۲۱.۵۰%	۲۰.۷۱%
اخزا ۰۱	۵۸۸۴۰۰	۱۴۰۱-۰۵-۰۱	۱۴۰۳-۱۱-۱۵	۲۳.۲۵%	۲۷.۵۷%
اخزا ۸۱۷	۹۹۲۴۰۰	۱۴۰۱-۰۴-۲۹	۱۴۰۱-۰۵-۱۲	۲۲.۰۱%	۱۹.۹۷%
میانگین بازدهی					۲۳.۸۵%

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 ۸۱۶ و اخزا ۰۱ با سررسید ۱۴۰۱/۰۵/۰۳ و ۱۴۰۳/۱۱/۱۵ و بازدهی ۲۷/۲۲ و ۲۷/۵۷ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نمادهای اخزا ۹۰۴ و اخزا ۸۱۷ با سررسید ۱۴۰۱/۱۲/۱۵ و ۱۴۰۱/۰۴/۲۹ با بازدهی ۲۱/۵۰ و ۱۹/۹۷ درصد بود.

از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۲/۷۸ و ۲۳/۸۵ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
افاد ۸۳	۸۱۳۵۰۰	۱۴۰۱-۰۴-۲۸	۱۴۰۲-۰۵-۰۵	۴۶.۶۵%
تابان ۰۱	۱۰۶۴۷۰۰	۱۴۰۱-۰۴-۲۸	۱۴۰۲-۱۲-۰۶	۱۴.۱۷%

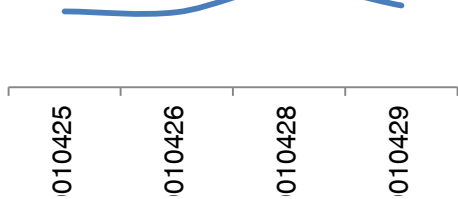
منبع: فرابورس ایران

اوراق تأمین مالی

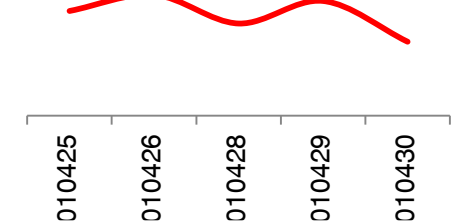
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد تابان ۰۱ بمیزان ۱۴/۱۷ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۱۲/۰۶ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد افاد ۸۳ بمیزان ۴۶/۶۵ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۵/۰۵ بوده است.

بورس کالا

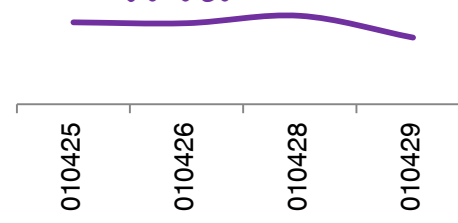
بازار فیزیکی



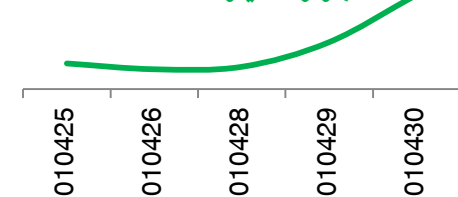
بازار آتی



بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)



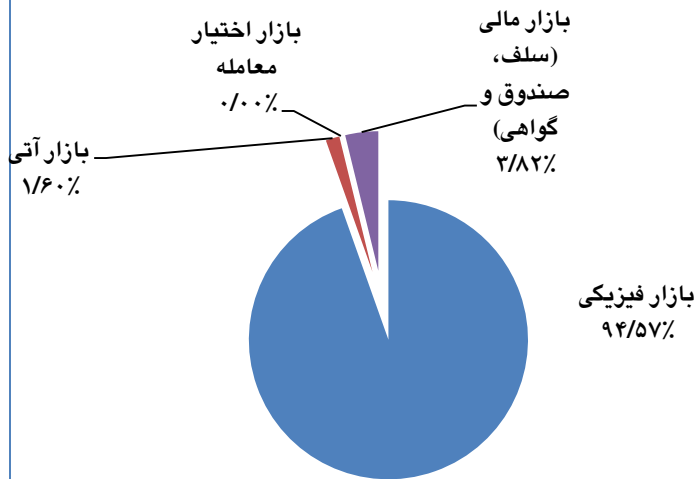
بازار اختیار معامله



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

منبع: وبسایت بورس کالا

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۹/۱ 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 ۹/۵۴ درصد کاهش و حجم معاملات ۴۹/۱۴ درصد افزایش پیدا کرده است.

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروه‌های کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	ارزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۷۳,۸۶۰,۸۴۴	۱,۶۸۵,۲۱۷	۶۲/۷٪
پتروشیمی و نفتی	۴۲,۸۳۱,۰۲۶	۲۰۳,۱۱۷	۳۶/۴٪
معذنی	.	.	۰/۰٪
بازار فرعی	۱,۰۹۴,۶۷۱	۶,۰۳۴	۰/۹٪
جمع	۱۱۷,۷۸۶,۵۴۱	۱,۸۹۴,۳۶۸	۱۰۰٪

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

مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

محصول	نرخ ریالی	میانگین هفتگی نرخ (نیمایی دلار)	میانگین هفتگی نرخ (دلار آزاد)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نیمایی)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ آزاد)	نرخ جهانی به قیمت جهانی (نرخ نیمایی)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ آزاد)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نیمایی)	تغییرات هفتگی نرخ ریالی
یک تن اوره گرانول	۱۱۶,۳۸۶,۰۰۰	۲۶۱,۳۵۰	۳۱۹,۸۰۰	۴۴۵	۳۶۴	۵۳۷	۸۲/۹٪	۶۷/۸٪	۰/۰٪
یک تن کاتد مس	۲,۰۳۴,۵۵۵,۰۰۰	۲۶۱,۳۵۰	۳۱۹,۸۰۰	۷,۷۸۵	۶,۳۶۲	۷,۳۸۹	۱۰۵/۴٪	۸۶/۱٪	۱/۳٪
یک تن پت شهید تندگویان	۴۲۷,۵۶۱,۰۰۰	۲۶۱,۳۵۰	۳۱۹,۸۰۰	۱,۶۳۶	۱,۳۳۷	۱,۲۲۰	۱۳۴/۱٪	۱۰۹/۶٪	۶/۴٪
یک تن بیلت فخوز	۱۳۸,۱۴۲,۰۰۰	۲۶۱,۳۵۰	۳۱۹,۸۰۰	۵۲۹	۴۳۲	۵۶۳	۹۳/۹٪	۷۶/۷٪	۰/۴٪
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۶,۸۱۴,۰۰۰	۲۶۱,۳۵۰	۳۱۹,۸۰۰	۲۶	۲۱	-	-	-	-۷/۱٪

تحلیل تکنیکال شاخص کل

شاخص کل در کف کانال نزولی



- شاخص کل با ادامه دادن روند نزولی طی هفته گذشته به کف کانال نزولی خود در محدوده ۱,۴۷۰,۰۰۰ واحد رسید و به این محدوده واکنشی مثبت نشان داد.
- همان طور که قبل تر نیز ذکر شده بود محدوده ۱,۴۴۰,۰۰۰ الی ۱,۴۷۰,۰۰۰ واحد حمایتی مهم برای شاخص کل محسوب می شود.
- با توجه به قرارگیری شاخص کل در محدوده حمایتی ذکر شده و همچنین محدوده کف کانال نزولی انتظار می رود به زودی شاهد ریز موجی صعودی تا سقف کانال نزولی باشیم
- افزایش حجم و ارزش معاملات می تواند یک نشانه بسیار مهم در جهت تأیید پایان موج نزولی فعلی و شروع یک حرکت صعودی باشد.
- با توجه به کلیت روند شاخص کل به نظر می رسد روند نزولی کماکان ادامه دار بوده و هر موج صعودی در قالب موجی اصلاحی شکل گیرد و در میان مدت این روند حفظ شود.

❖ 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 کانالها 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 بیت کوین (BTCUSD)

ناکام در عبور از مقاومت ۲۴ هزار دلاری



- بیت کوین طی هفته گذشته طی ریزموجی صعودی توانست خود را تا محدوده ۲۴,۲۸۰ دلار برساند اما مجددا دچار اصلاح شد و روندی نزولی را در پیش گرفت.
- در صورتی که بیت کوین موفق به تثبیت بر بالای محدوده ۲۲ هزار دلار شود این احتمال وجود دارد که باری دیگر موفق به حرکت به سمت محدوده مقاومتی ۲۴ هزار دلار شود و از آن عبور کند. در غیر این صورت به محدوده حمایتی ۱۸ هزار دلاری خود باز خواهد گشت.
- با توجه به این که میانگین متحرک ۲۰۰ هفته ای و سقف سال ۲۰۱۷ در محدوده ۱۷ الی ۲۰ هزار دلار قرار گرفته است این محدوده حمایتی بسیار مهم برای بیت کوین تلقی می شود.

❖ 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 کانالها 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)

محدوده ۱,۶۸۰ نقطه بازگشت طلا



- همانطور که پیش‌بینی شده بود، هفته گذشته اونس طلا با رسیدن به محدوده حمایتی ۱,۶۸۰ دلار واکنشی مثبت نشان داد و توانست پس از ۵ هفته متوالی کندلی مثبت به ثبت برساند.
- انتظار می‌رود طلا در هفته پیش رو طی ریز موجی صعودی بتواند خود را تا محدوده خط روند نزولی خود و مقاومت استاتیک ۱,۷۸۰ دلار برساند.

❖ 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)

به سمت سقف کانال صعودی بلندمدت



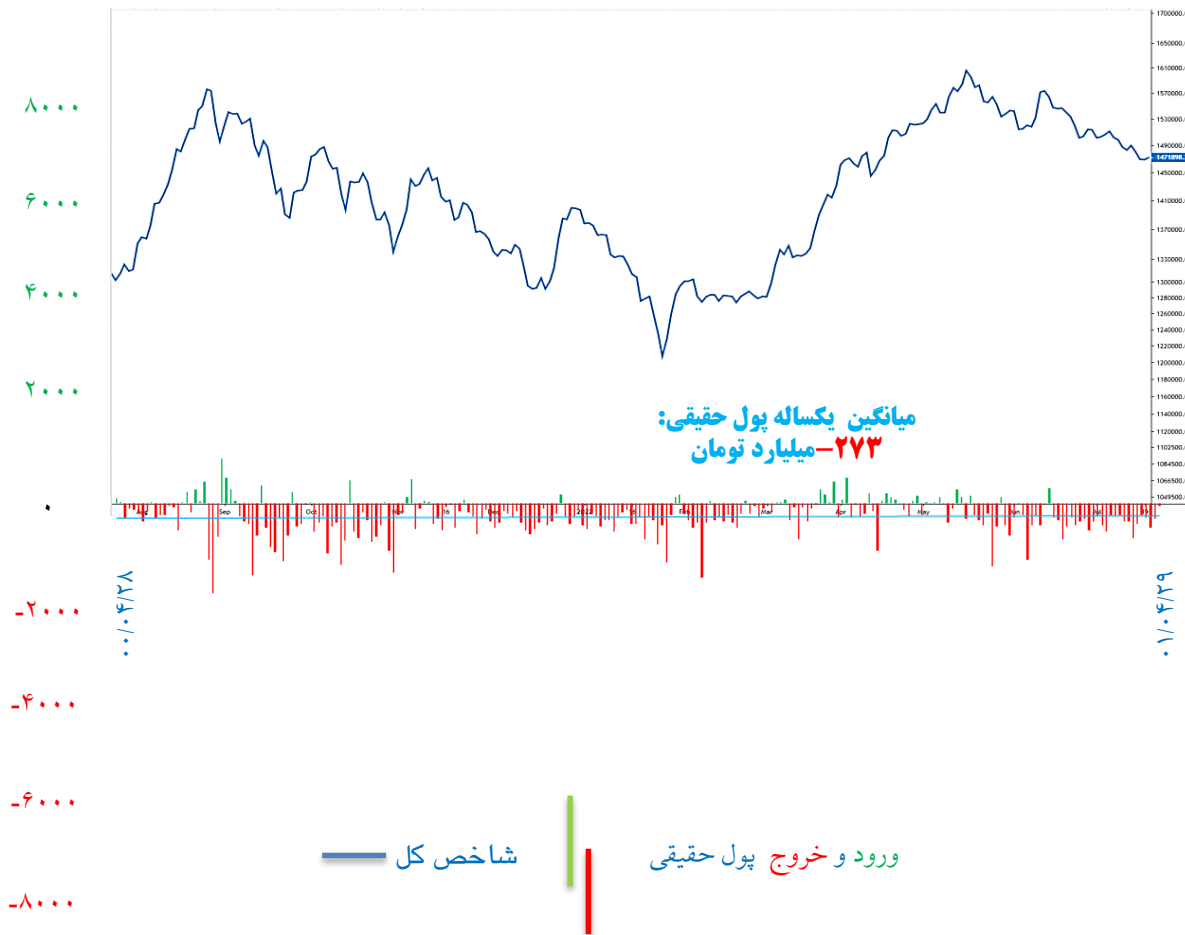
- شاخص دلار پس از رسیدن به محدوده ۱۰۹/۲۹۴ واحد دچار اصلاح شد و به سمت پایین حرکت کرد. انتظار می‌رود با رسیدن شاخص دلار به محدوده حمایتی ۱۰۵/۵۰۰ واحد همزمان با جلسه تعیین نرخ بهره فدرال رزرو، شاهد واکنشی مثبت و تغییر روند در این شاخص باشیم.
- با توجه به این که شاخص دلار توانسته در بلندمدت روند نزولی خود را بشکند و در حال حرکت در کانالی صعودی است، به نظر می‌رسد روند فعلی می‌تواند در میانمدت تا محدوده سقف کانال و مقاومت استاتیک مشخص شده در محدوده ۱۱۶ الی ۱۱۸ واحد 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 روندهای اشاره شود.

شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار

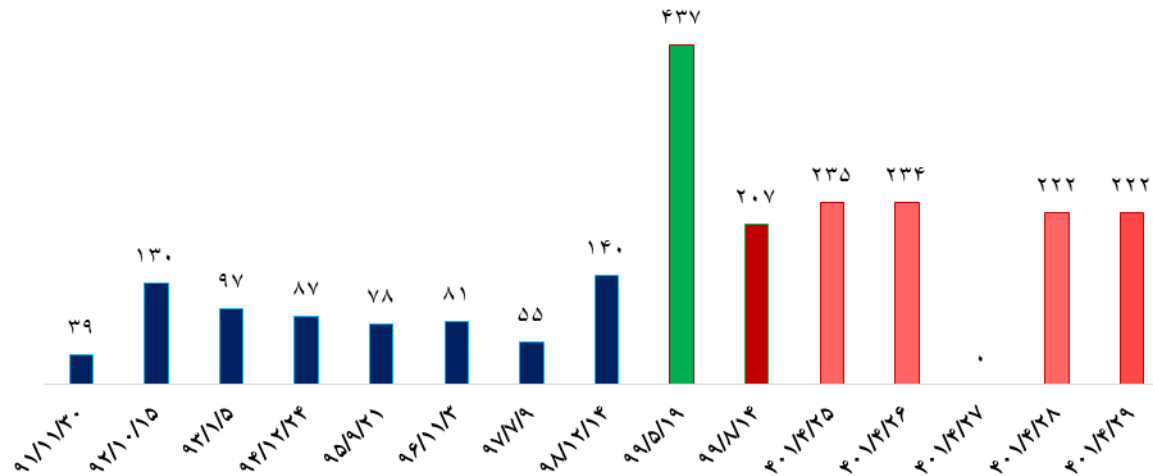
شاخص کل، خالص ورود و خروج پول حقیقی (هزار میلیارد تومان)



- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۴۷۱,۸۹۸ واحدی و بازده هفتگی ۱/۲۱- درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۱,۱۴۵ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱ نشان دهنده خروج ۱۶,۴۲۵ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۱۳ 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 ۳۴,۲۵۵- میلیارد تومان افول کرد.

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

شنبه	۰۱/۰۴/۲۵	۲۹۷-	میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۰۴/۲۶	۴۹۲-	میلیارد تومان
سه شنبه	۰۱/۰۴/۲۸	۳۱۷-	میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۰۴/۲۹	۴۰-	میلیارد تومان



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۲۴ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۴۹ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ 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 ۱۵ جولای سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۱/۳ تریلیون دلاری بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۴/۳ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۱۷۰ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

P / NAV ۱۴۰۱/۰۵/۰۱	سال مالی	EPS (ریال) (پیش‌بینی)	P / E (پیش‌بینی)	P (ریال)	EPS (ریال) (TTM)	P / E (TTM)	نماد
۶۵٪	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۱۵۹	۶۰.۱	۹۵۵	۱۳۹	۶.۸۷	شستا
۶۲٪	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱,۹۴۴	۴.۴۵	۸,۶۶۰	۲,۰۷۸	۴.۱۷	وبانک
۵۲٪	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱۶۰	۸۵.۴۴	۱۳,۶۷۰	۲,۵۳۲	۵.۴۰	وصندوق
۵۹٪	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱,۹۵۵	۶.۹۷	۱۳,۶۲۰	۱,۳۷۱	۹.۹۳	وامید
۵۱٪	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۲,۹۴۷	۴.۸۷	۱۴,۳۴۰	۲,۲۱۷	۶.۴۷	وغدیر
۴۴٪	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	-	-	۸,۶۵۰	۱,۸۸۵	۴.۵۹	ونیکي

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.