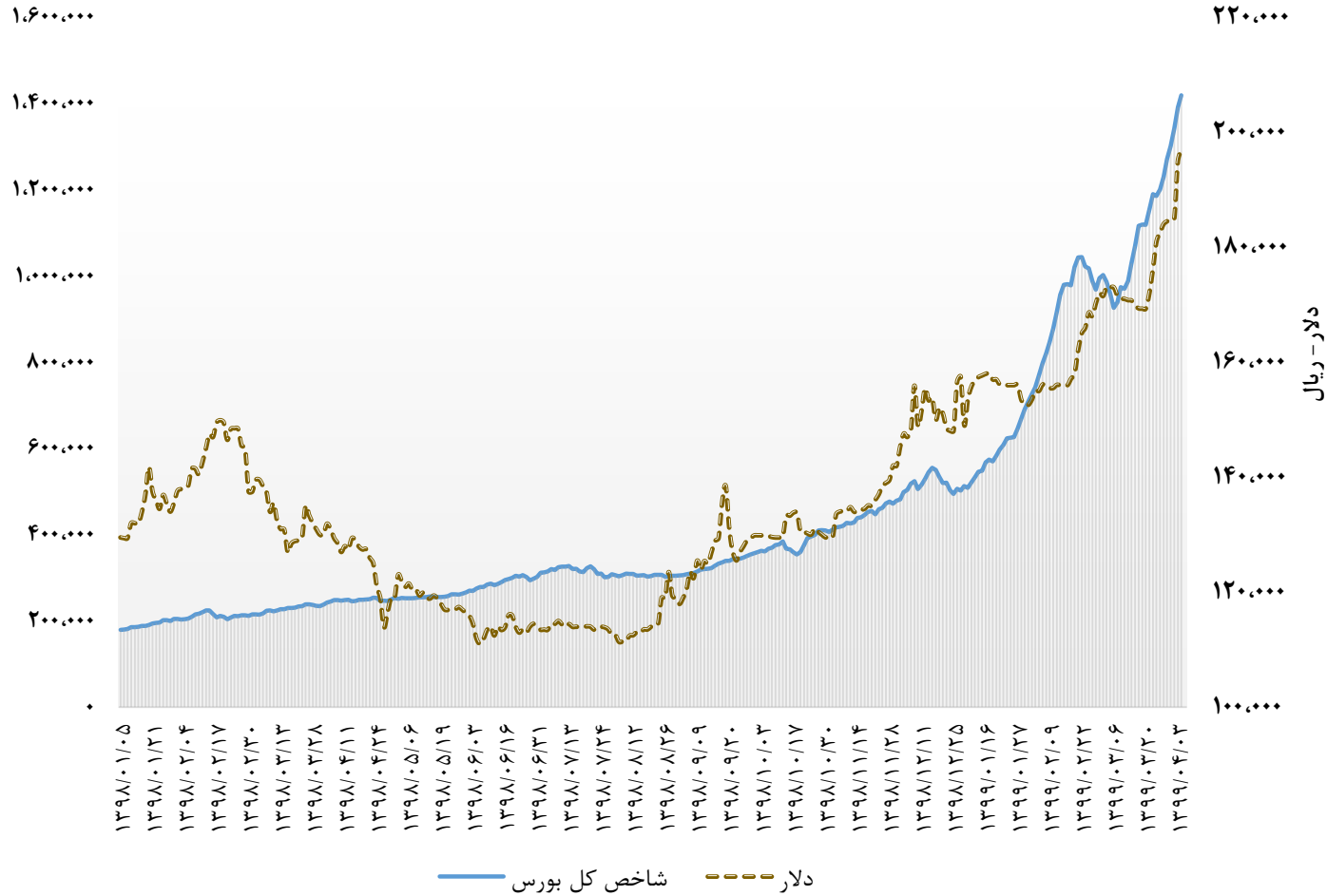


گزارش، همگامی تحلیل بازار

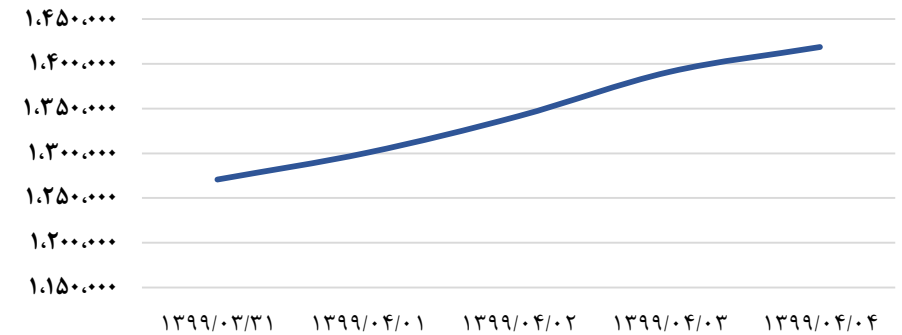
امین
هوشمندی مالی

شاخص کل بورس

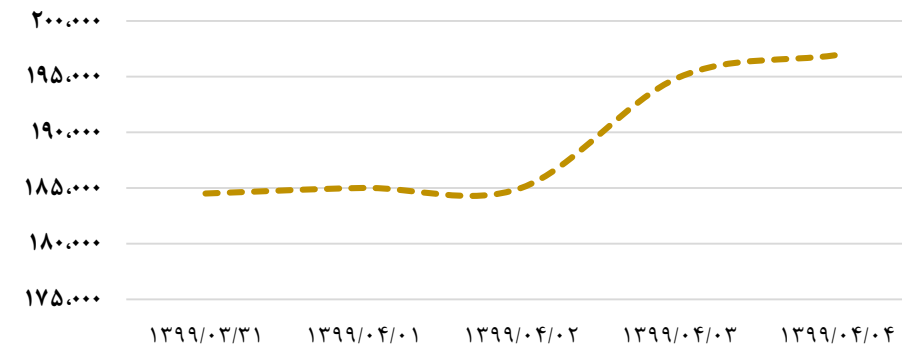


- صعود شاخص به محدوده ۱,۴۱۹,۰۰۰ واحدی در آخرین روز معاملاتی هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹ و عبور از مقاومت روانی ۱,۴۰۰,۰۰۰ واحد؛
- افزایش نرخ دلار از ۱۸۴,۰۰۰ ریال به ۱۹۷,۰۰۰ ریال و رشد ۷ درصدی در هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹.

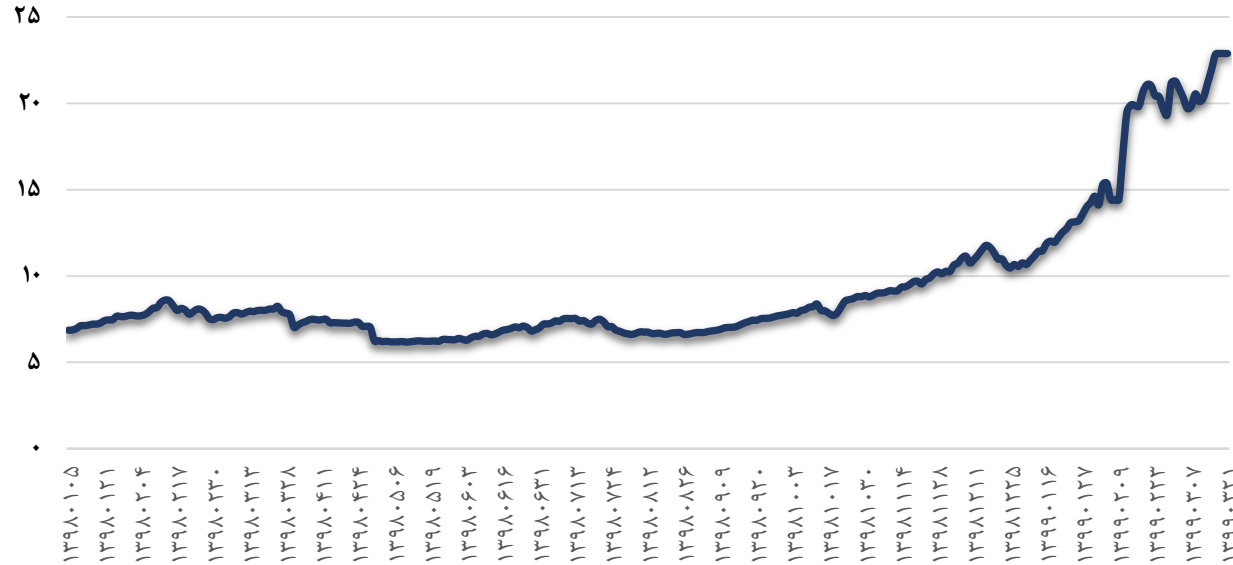
روند شاخص در هفته جاری



روند نرخ دلار در هفته جاری - ریال

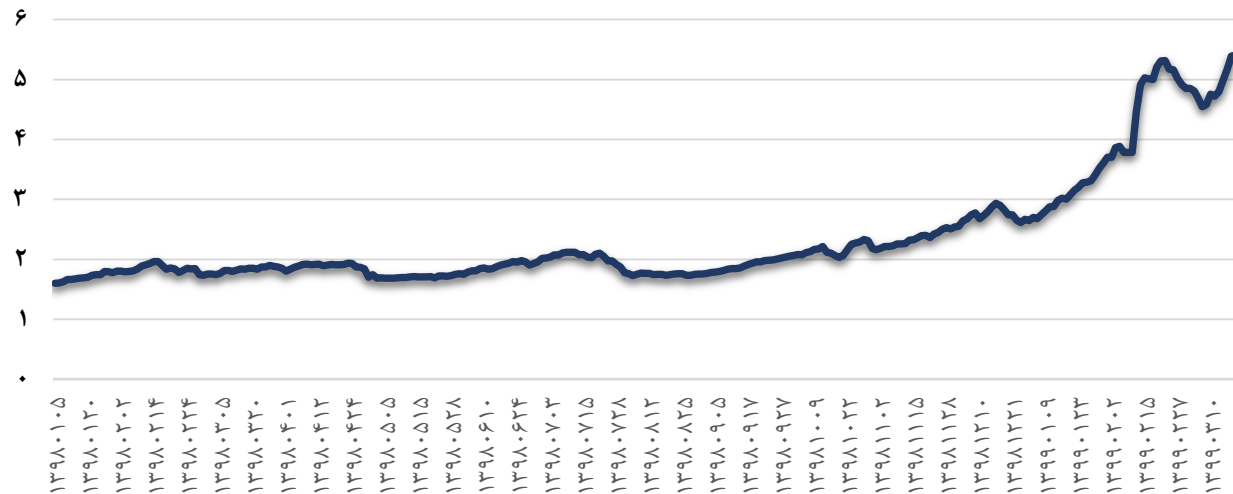


(نسبت قیمت به درآمد) P/E-ttm



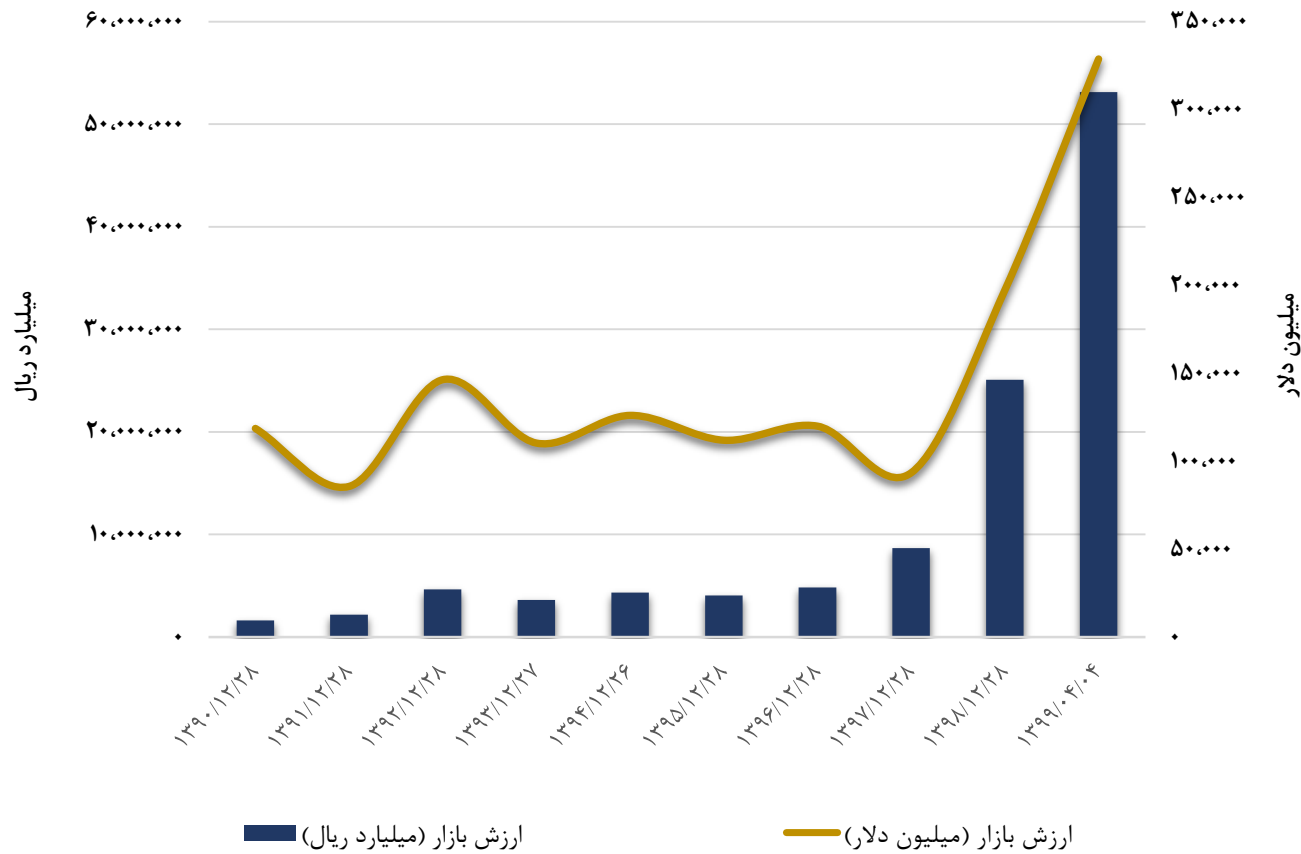
- صعود P/E-ttm بازار به عدد ۲۹.۷ و این در شرایطی است که میانگین P/E-ttm بازار از ابتدای سال ۱۳۸۱ تا هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹ معادل ۶.۸۶ می‌باشد.

(نسبت قیمت به فروش) P/S-ttm



- صعود P/S-ttm بازار به عدد ۶.۸ و این در شرایطی است که میانگین P/S-ttm بازار از ابتدای سال ۱۳۸۱ تا هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹ معادل ۱.۵۲ می‌باشد.

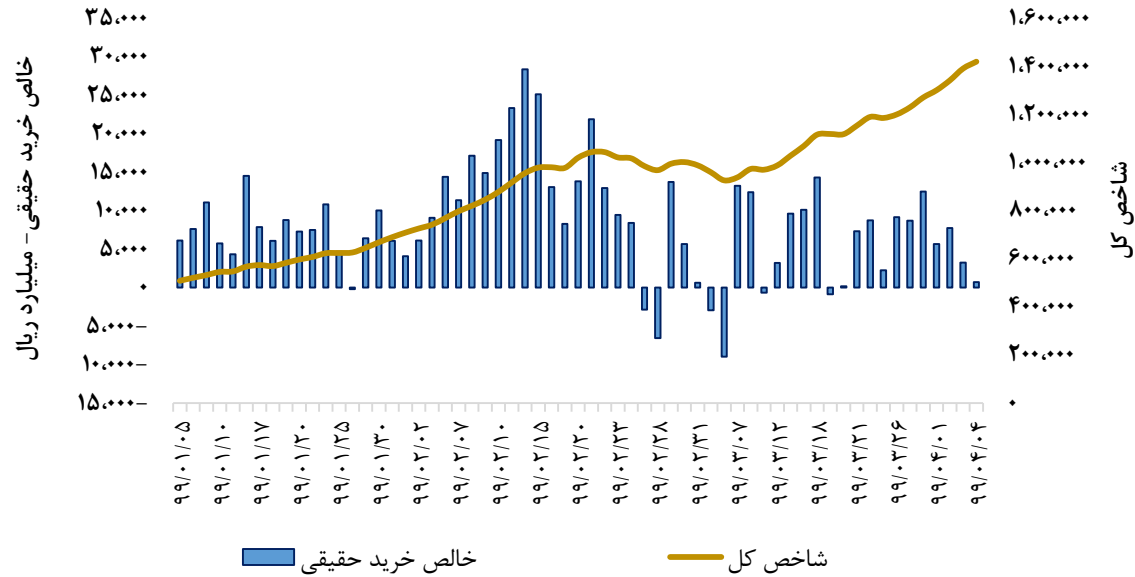
ارزش بازار سالانه



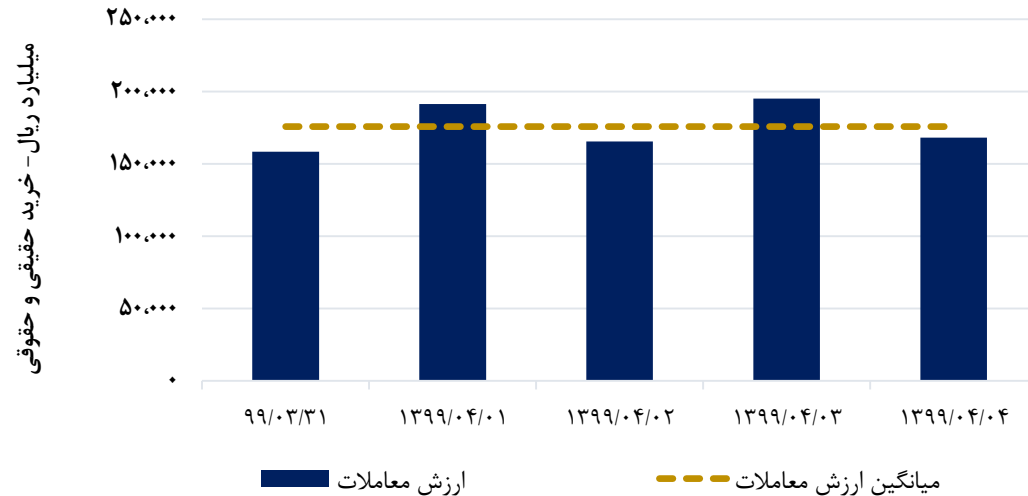
- در نمودار پیش رو، ارزش بازار به ریال و دلار از سال ۹۰ تا ۹۹ مقایسه شده است. همانطور که مشخص است هر دو مؤلفه صعودی بوده‌اند. مرجع نرخ دلار در نمودار، دلار نیمایی می‌باشد.

❖ تأثیر عرضه اولیه ها در نمودار حذف نشده است.

شاخص - خالص خرید حقیقی



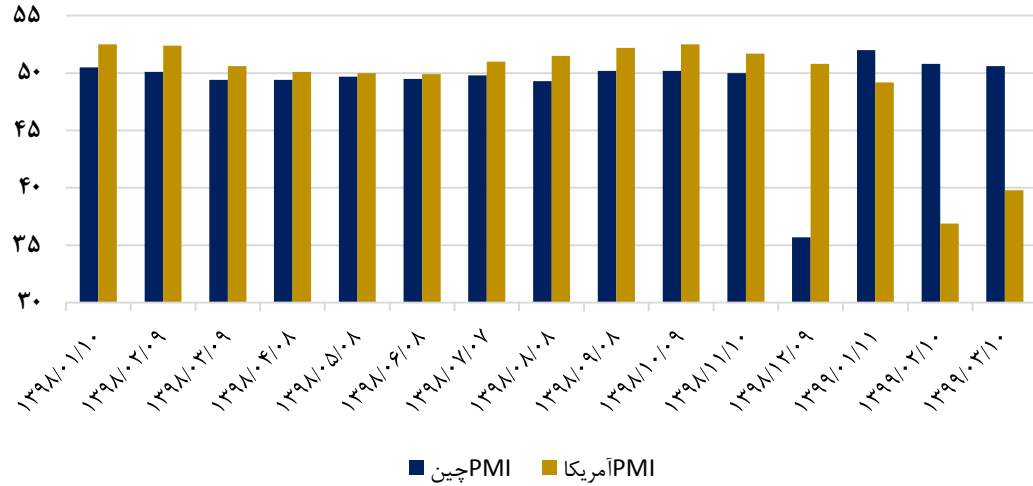
ارزش معاملات - هفته اخیر



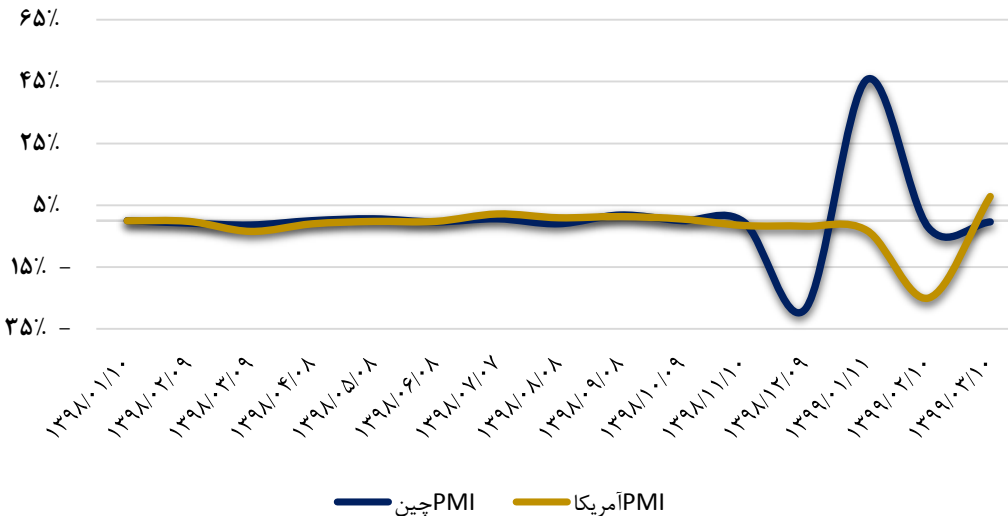
نکات حائز اهمیت:

- همبستگی خالص خرید حقیقی با شاخص کل در بازه زمانی مورد نظر کاملاً مشهود است؛
- خالص خرید حقیقی در هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹ معادل ۲۹,۸۷۷ میلیارد ریال؛
- میانگین ارزش معاملات در هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹ معادل ۱۷۵,۶۶۱ میلیارد ریال.

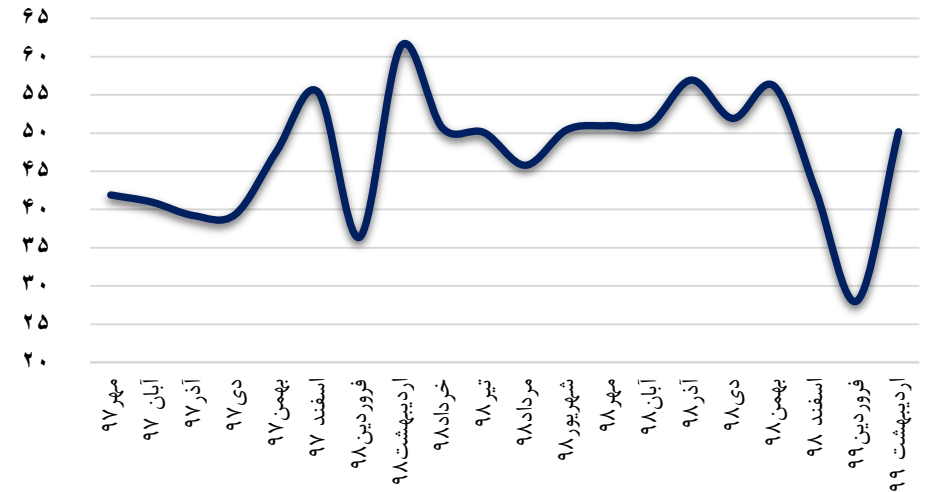
PMI چین و آمریکا - ماهانه



درصد تغییرات PMI چین و آمریکا - ماهانه

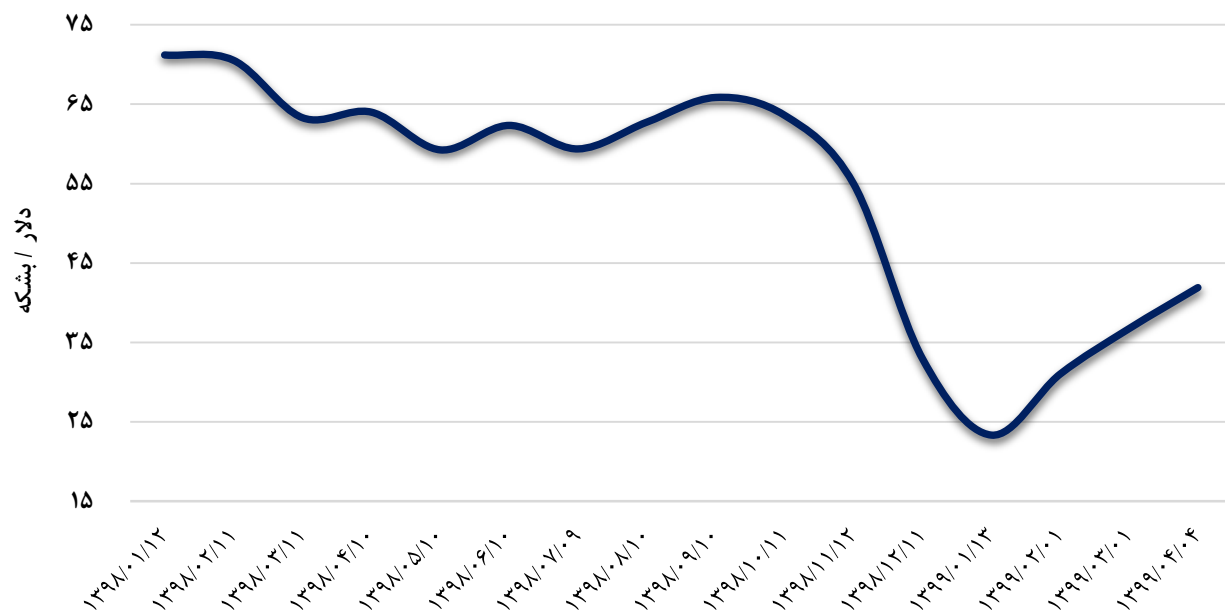


شامخ PMI کل صنعت ایران - ماهانه

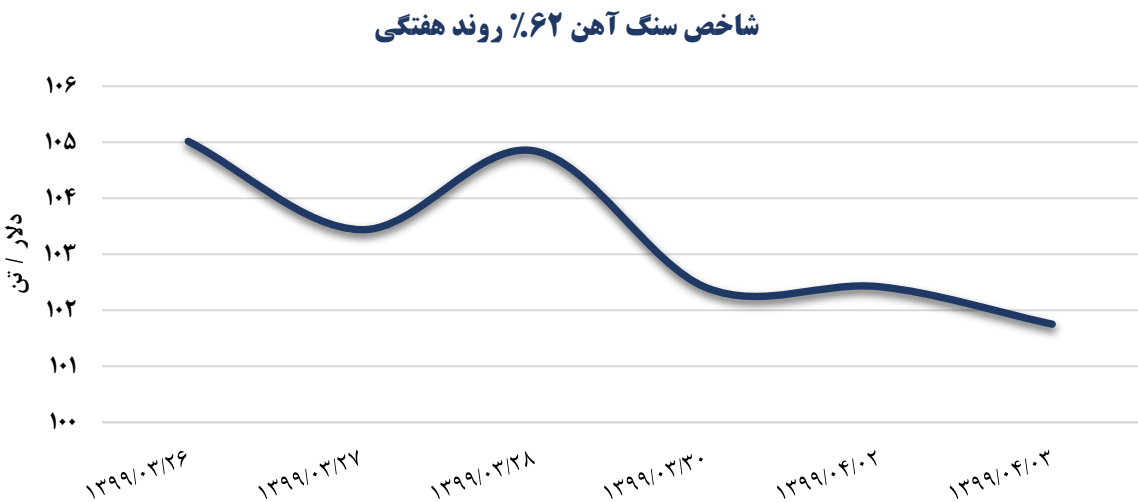
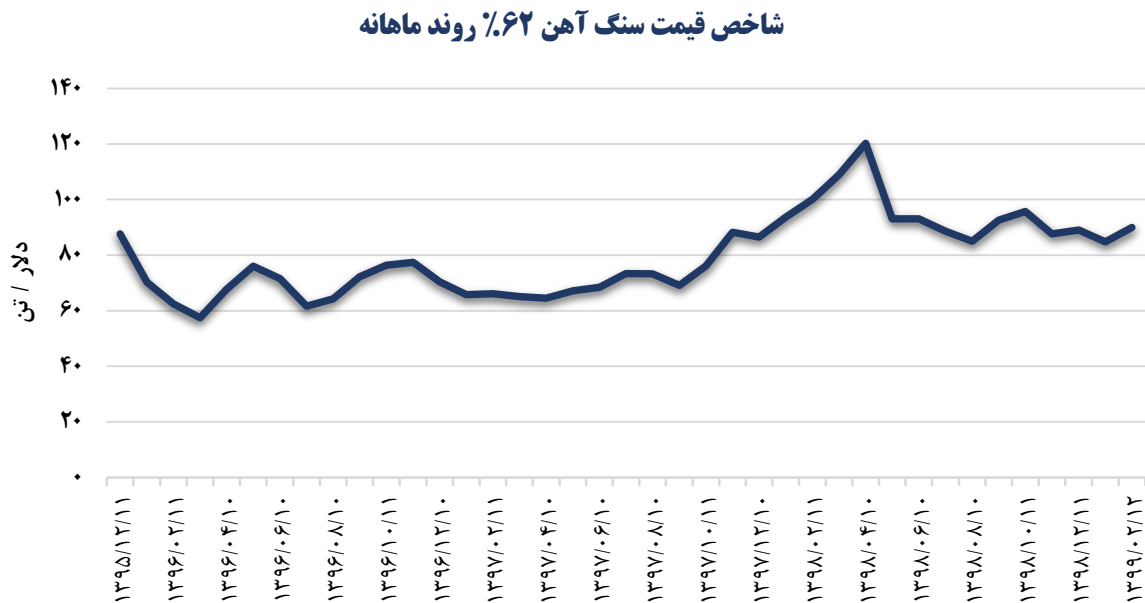


- شامخ (شاخص مدیران خرید) که اوایل همراه منتشر می‌شود، رونق، رکود یا ثبات کسب‌وکارهای مورد بررسی و چشم‌انداز انتظاری آنها در آینده را نشان می‌دهد. اگر عدد شامخ بیش از ۵۰ واحد باشد، نشان می‌دهد که اقتصاد در حال توسعه است، در حالی که هر رقمی زیر ۵۰ واحد، از قرار داشتن اقتصاد در شرف انقباض و رکود حکایت دارد.
- بهبود نسبی شاخص PMI ایران و جهان، پس از شیوع ویروس کرونا.

روند قیمت نفت برنت



- کاهش عرضه از سوی اوپک از یک سو و نگرانی از شیوع موج دوم ویروس کرونا از سوی دیگر بهای نفت را با افزایش اندکی مواجه کرده است.



- شروع فصل بارش در چین و کاهش تقاضای فولاد برای کارهای زیربنایی سبب کاهش تقاضا در بخش سنگ آهن و در نتیجه کاهش قیمت گردید.

۹۹.۰۴.۰۳	۹۹.۰۳.۲۷	ابتدای ۹۸	دلار در هر تن
۱۰۲	۱۰۳	۸۶	سنگ آهن

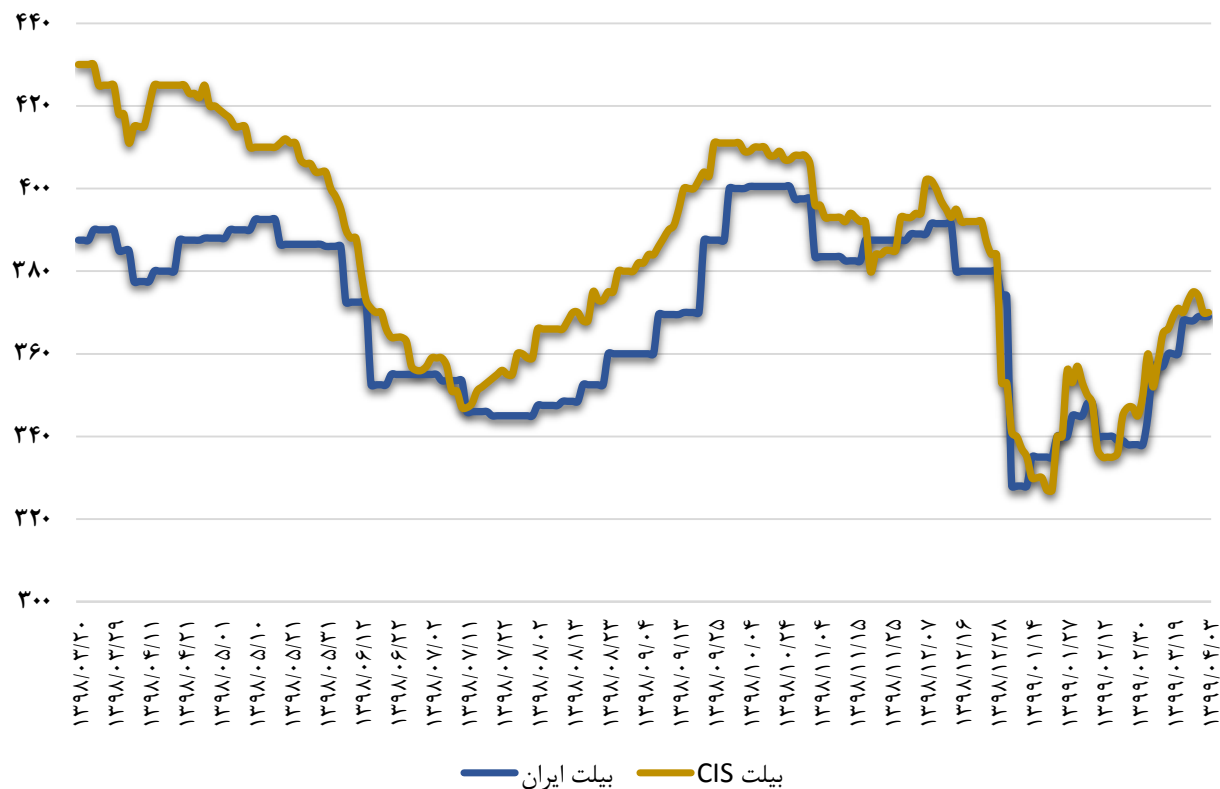
- ▲ ۱۸٪ تغییرات قیمت در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹ نسبت به ابتدای سال ۹۸
- ▼ ۱.۶۳٪ تغییرات قیمت در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹ نسبت به هفته قبل

۰. افزایش ۰.۲۷ درصدی قیمت بیلت صادراتی ایران در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹.

۹۹.۰۴.۰۳	۹۹.۰۳.۲۷	ابتدای ۹۸	دلار در هر تن
۳۷۰	۳۷۳	۴۵۶	بیلت CiS
۳۶۹	۳۶۸	۴۰۰	بیلت صادراتی ایران

تغییر قیمت بیلت صادراتی ایران در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹
نسبت به ابتدای سال ۹۸

تغییر قیمت بیلت صادراتی ایران در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹ نسبت به هفته قبل ۰.۲۷٪ ▲



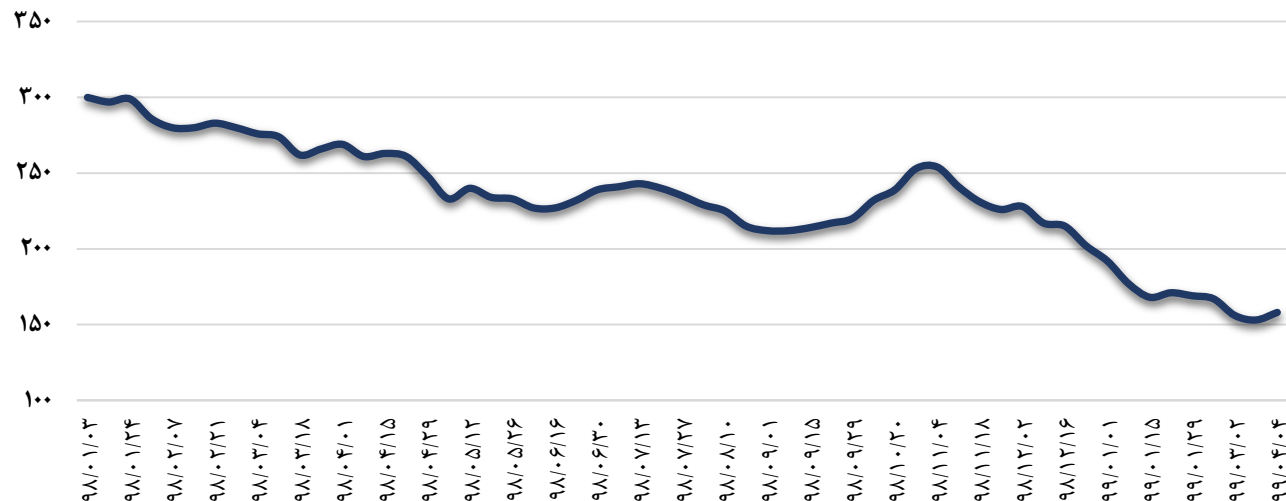
با افزایش مبتلایان به ویروس کرونا در آمریکای جنوبی، عرضه مس با نگرانی همراه شده است. همین امر سبب افزایش قیمت مس در هفته منتهی به ۴ تیر ۱۳۹۹ گردید.



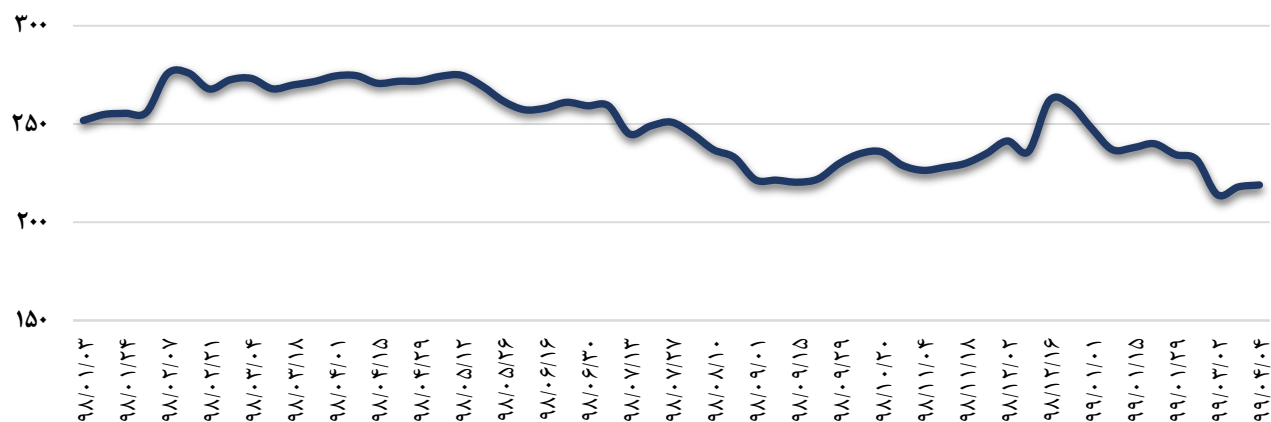
تغییر قیمت روی در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹ نسبت به هفته قبل

تغییر قیمت مس در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹ نسبت به هفته قبل

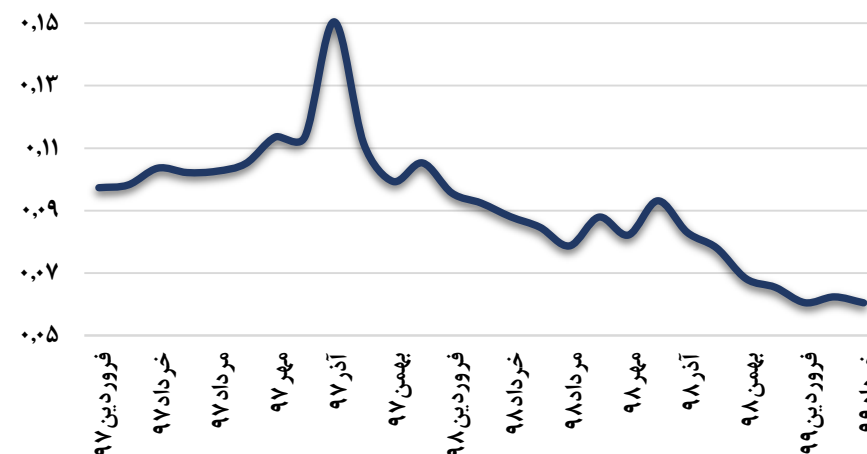
روند نرخ متانول



روند نرخ اوره



- براساس فرمول نرخ خوراک پتروشیمی های گازی ، ۵۰ درصد نرخ گاز متان (خوراک) براساس متوسط ۴ هاب بین المللی تعیین می شود. نرخ گاز در این چهار هاب نسبت به متوسط سال ۹۸ حدودا ۵۰ درصد کاهش یافته است.
- با توجه به نتایج حاصل از کنفرانس اطلاع رسانی شرکت نفت و گاز پارسیان نرخ خوراک از ۸،۲۱۲ ریال به ۷،۲۸۹ ریال کاهش یافته است که در نتیجه این کاهش قیمت، سود شرکت های مصرف کننده خوراک گاز طبیعی تحت تاثیر قرار خواهد گرفت.

Henry Hub
(\$/ m3)

معاملات محصولات فلزی در بورس کالا

کالا- ریال در هر کیلوگرم	عرضه کننده	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۲۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۰۴	درصد تغییر
ورق گرم	فولاد مبارکه اصفهان	۶۹,۱۹۰	۷۴,۱۰۹	۷٪
ورق سرد	فولاد مبارکه اصفهان	۹۲,۵۲۳	۱۰۰,۲۰۳	۸٪
بیلت	فولاد خوزستان	۵۴,۸۷۷	۶۸,۷۱۷	۲۵٪
مس کاتد	ملی صنایع مس ایران	۹۰۳,۱۰۶	۹۲۹,۱۶۴	۳٪
شمش روی	فرآوری مواد معدنی ایران	۳۱۴,۵۸۹	۳۲۴,۲۴۲	۳٪

معاملات محصولات شیمیایی در بورس کالا

کالا- ریال در هر کیلوگرم	عرضه کننده	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۲۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۰۴	درصد تغییر
پلی وینیل کلراید	پتروشیمی غدیر	۱۴۴,۷۹۲	۱۶۸,۱۹۵	۱۶٪
پلی اتیلن سنگین	پتروشیمی مارون	۱۱۰,۷۴۹	۱۱۶,۳۸۱	۵٪
پلی اتیلن سبک	پتروشیمی شازند	۱۱۰,۹۸۷	۱۱۶,۵۵۰	۵٪
اوره گرانول	صنایع پتروشیمی کرمانشاه	۲۵,۲۹۳	۲۶,۰۸۱	۳٪
استایرن منومر	پتروشیمی پارس	۸۷,۹۷۸	۹۱,۵۹۸	۴٪

نرخ محصولات فلزی و شیمیایی در بورس کالا در هفته منتهی به ۴ تیر ۹۹ ، تحت تاثیر افزایش نرخ دلار افزایش یافت.

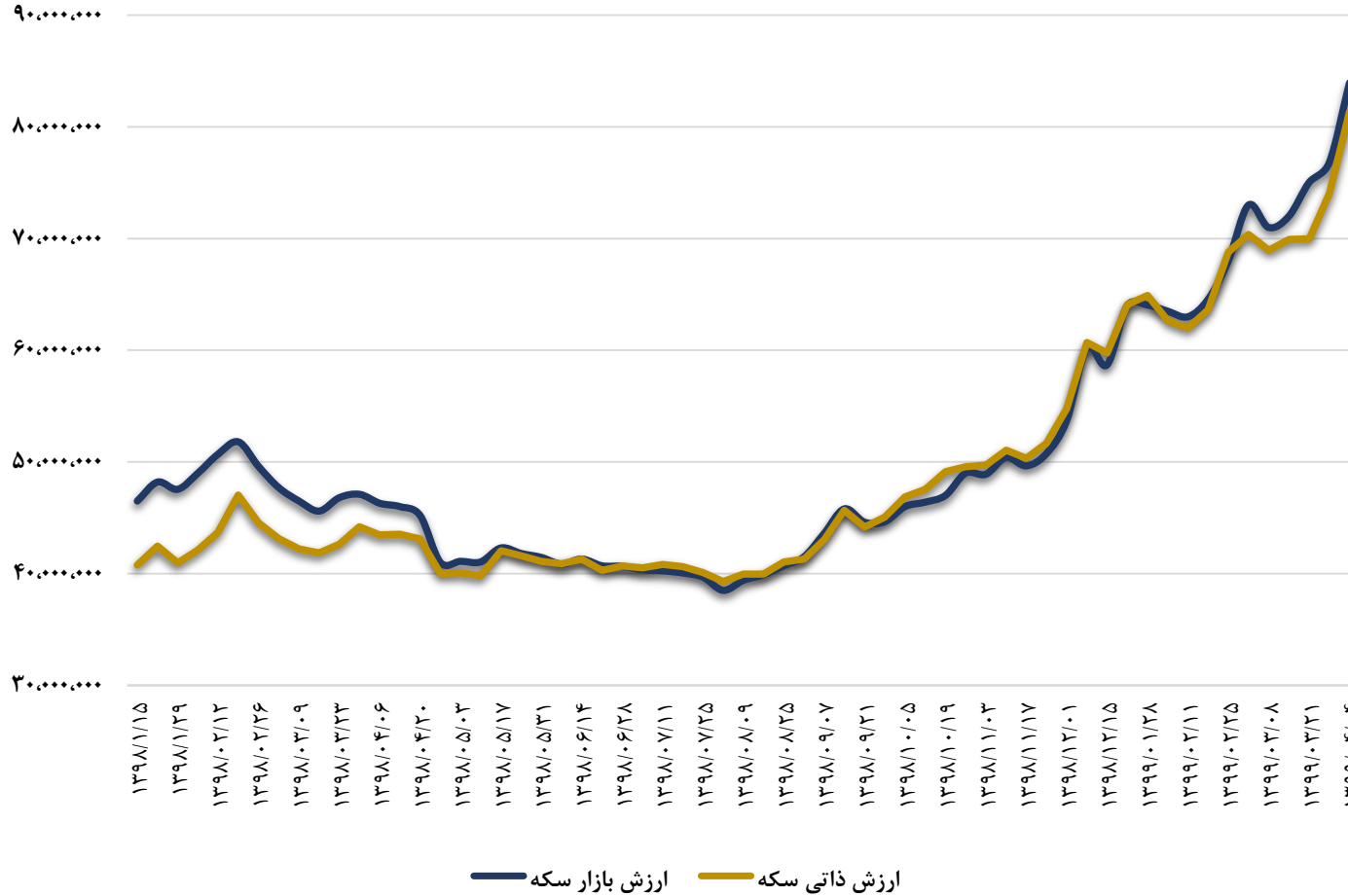
• قیمت بیلت فولاد خوزستان ۶۸,۷۱۷ ریال در هر کیلوگرم معامله شد که نسبت به هفته قبل ۲۵٪ افزایش داشته است.

• ورق سرد فولاد مبارکه نیز با رشد ۸ درصدی همراه بود.

• پلی وینیل کلراید پتروشیمی غدیر ۱۶۸,۱۹۵ ریال در هر کیلوگرم معامله شد که نسبت به معاملات هفته قبل ۱۶ درصد افزایش داشته است.

• پلی اتیلن سنگین و پلی اتیلن سبک نیز رشد ۵ درصدی داشتند.

ارزش بازار و ارزش ذاتی سکه - ریال



- افزایش ۹ درصدی قیمت سکه بهار آزادی از ۷۷,۰۰۰,۰۰۰ ریال در تاریخ ۹۹/۰۳/۲۸، به ۸۴,۰۰۰,۰۰۰ ریال در تاریخ ۹۹/۰۴/۰۴؛
- قیمت ذاتی سکه بهار آزادی ۸۱,۰۰۰,۰۰۰ ریال؛
- حباب سکه ۲,۶۰۹,۶۹۴ ریال.