



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۱۷

منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۲۳



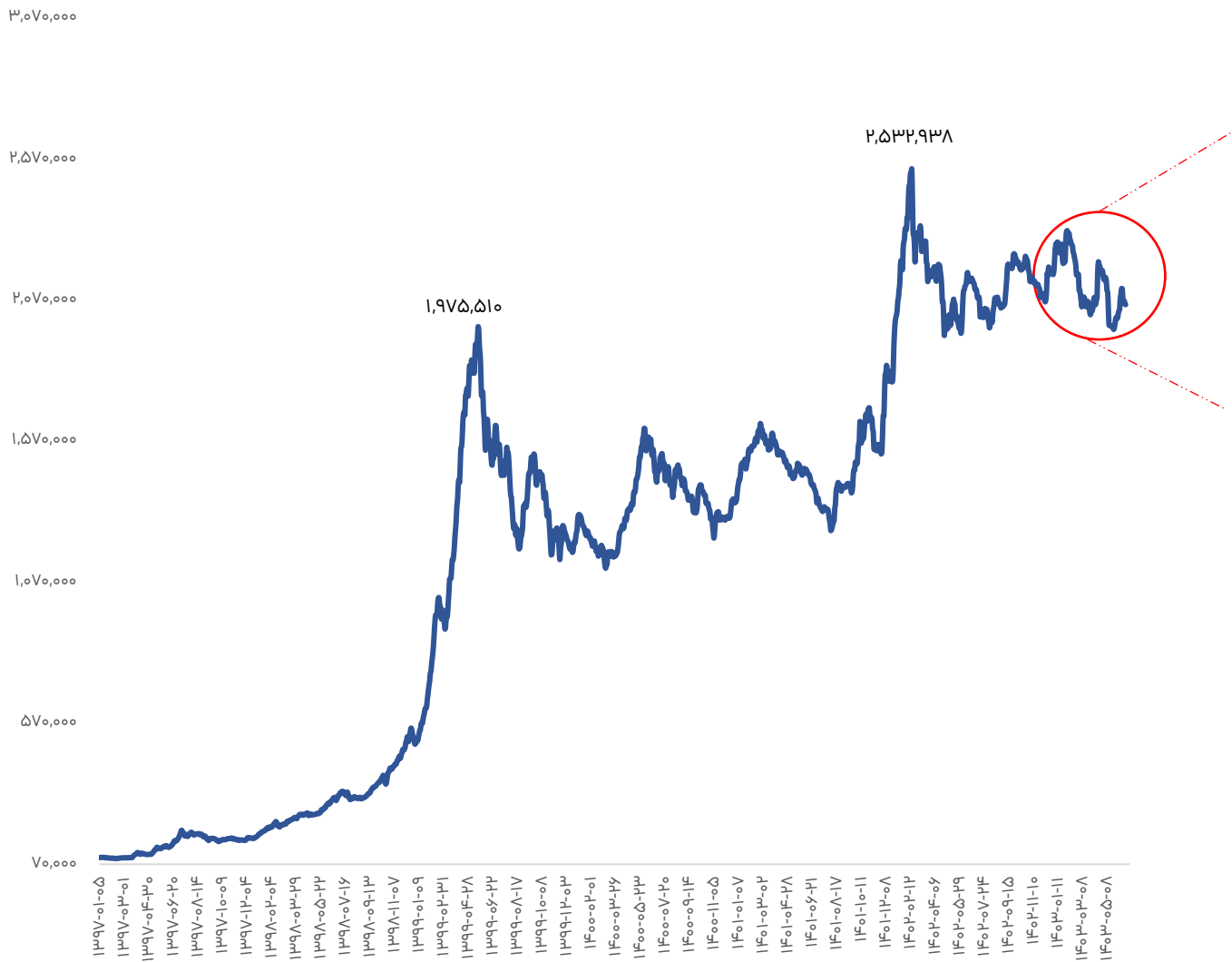
♦ بخش اول

بازار سرمایه



بازدهی از ابتدای سال	-۷.۰%
بازدهی هفته اخیر	-۲.۶%

شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷



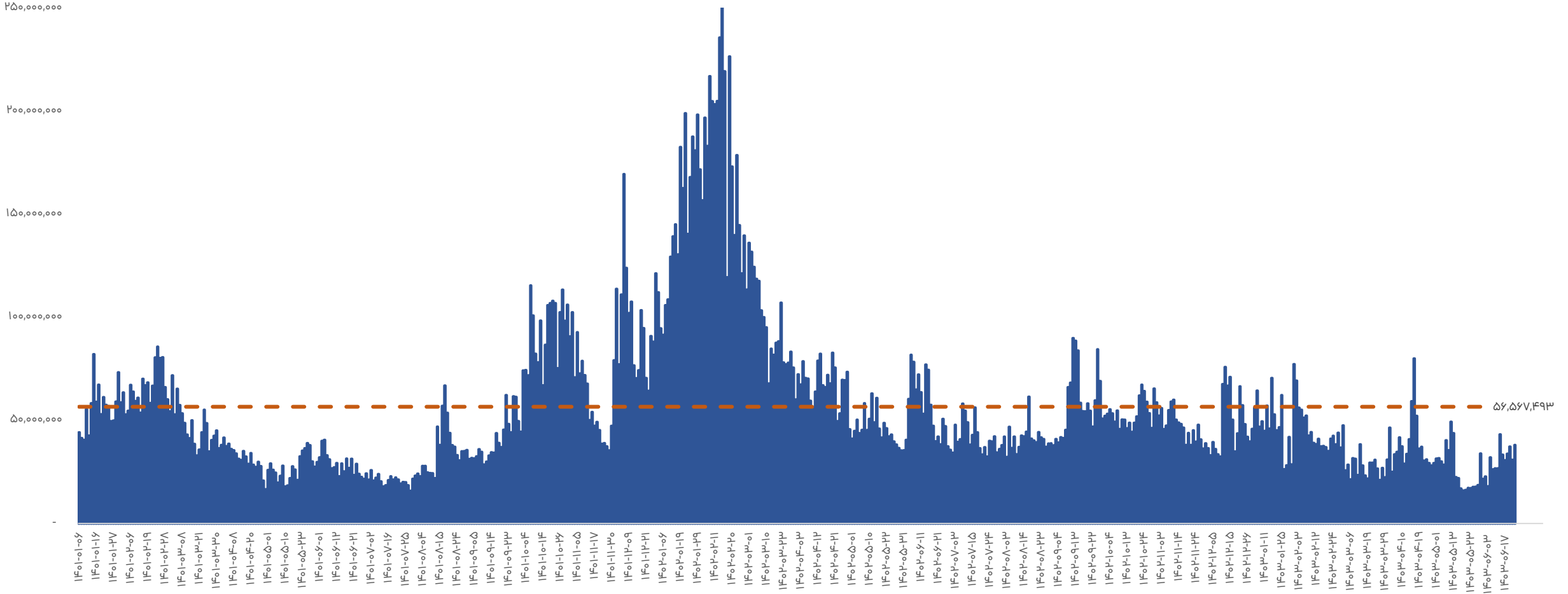
شاخص کل از ابتدای سال





ارزش معاملات در این هفته نیز به علت محدودیت دامنه نوسان مطلوب نبوده است.

ارزش معاملات خرد از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال

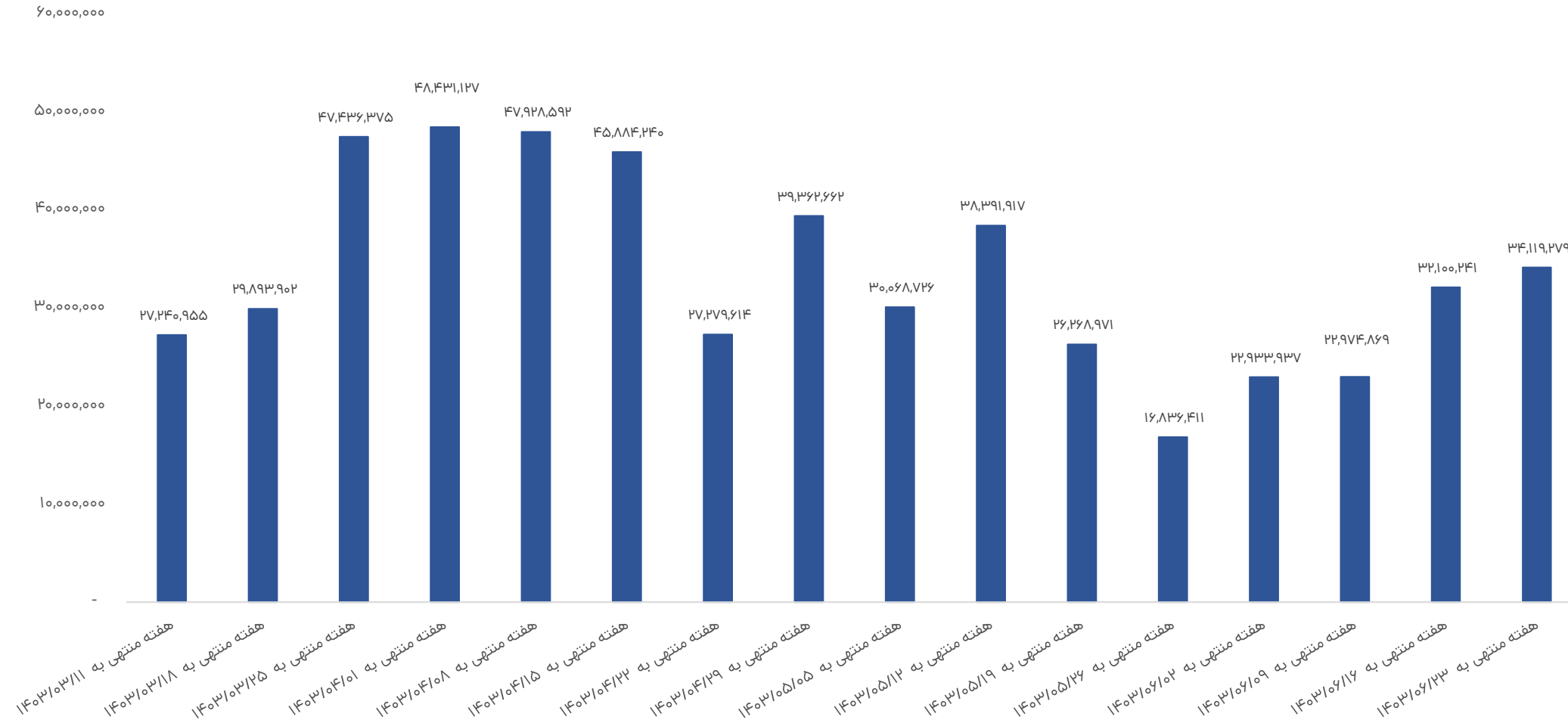


۵۶,۵۶۷,۱۴۹.۳



میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته نسبت به هفته قبل
%۶ افزایش یافت.

ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال

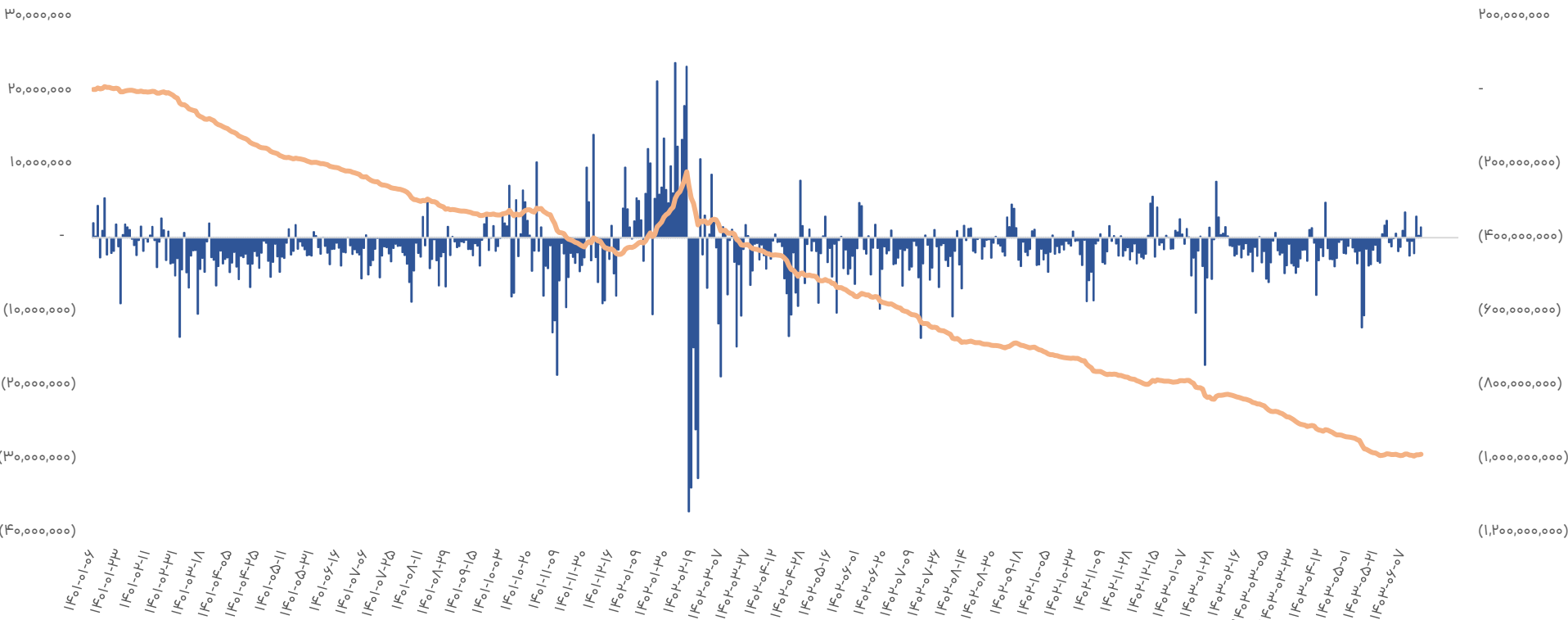




میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۷۶۷,۲۵۳,۵۳۶
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۱۹۷,۳۸۰,۷۸۶
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	۱,۹۱۶,۰۳۲

ورود و خروج پول حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال

ورود و خروج پول حقیقی-تجمعی (نوار نارنجی) ورود و خروج پول حقیقی (نوار آبی)



هفته گذشته اشخاص حقیقی ۱,۹۱۶,۰۳۲ میلیون ریال پول به بازار سهام تزریق کردند. خالص خروج نقدینگی اشخاص حقیقی در سال جاری تاکنون ۲۰ همت بوده است.

همچنین از تاریخ ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ و با شروع اصلاح شاخص کل، میزان خروج پول اشخاص حقیقی از ۷۶ همت فراتر رفته است.

روند دلار نیمایی و دلار آزاد

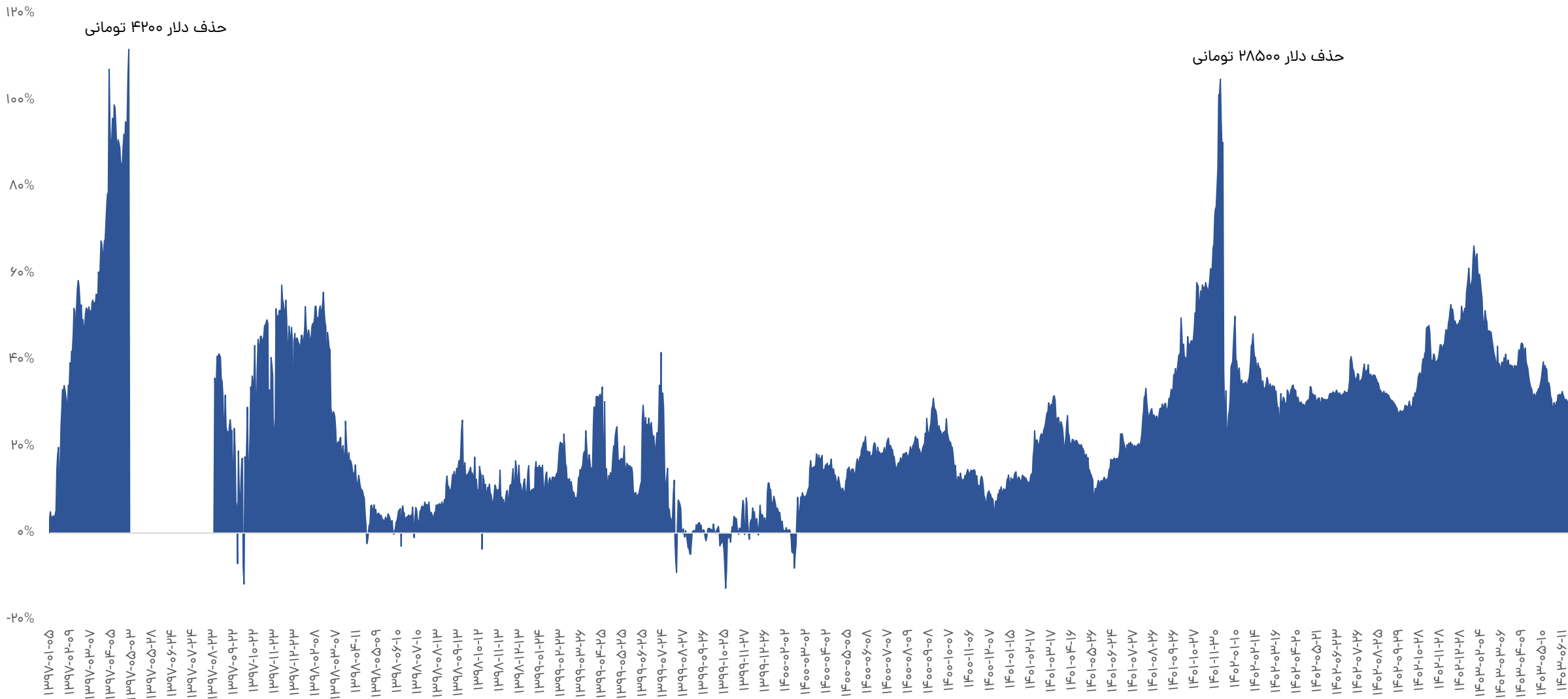
دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۵۹۶,۵۰۰ ریال رسید. دلار نیما نیز در این هفته ۲,۱۰۶ ریال افزایش یافت.





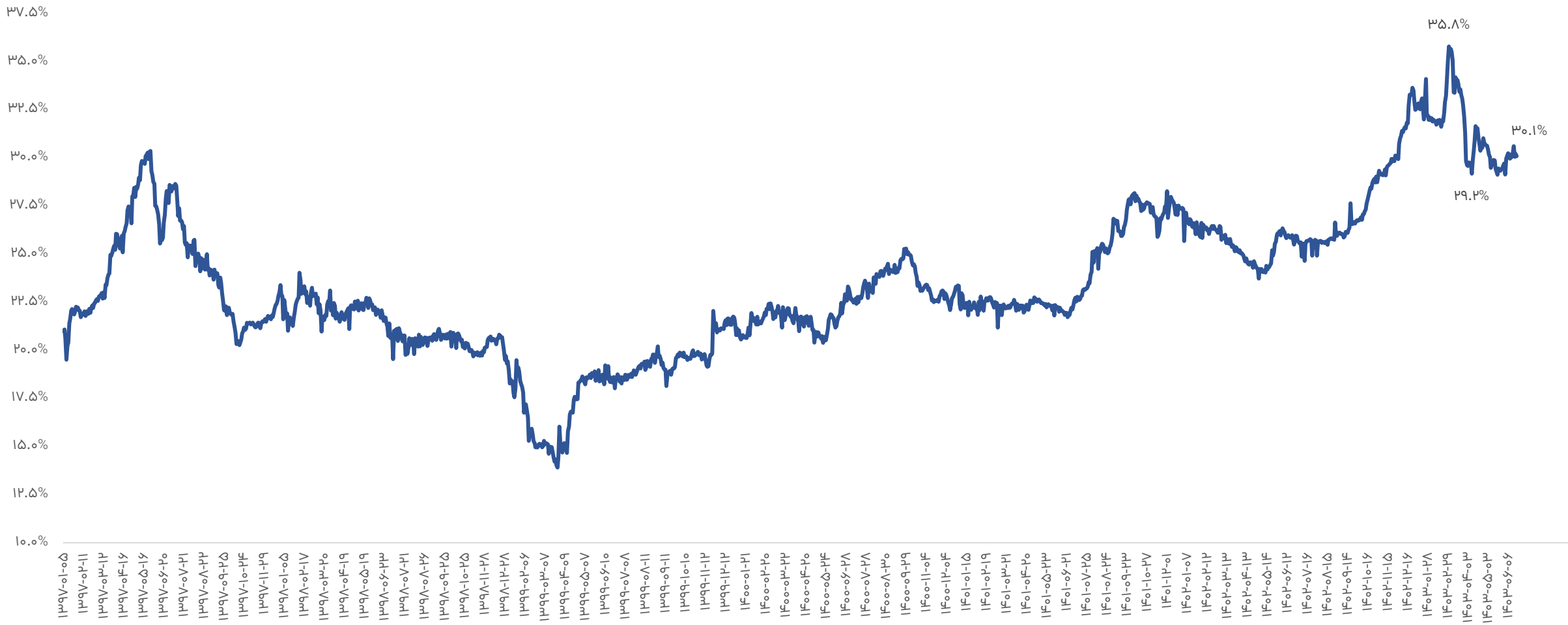
اختلاف میان دلار نیما و بازار آزاد به ۳۰ درصد کاهش یافت.

اختلاف دلار آزاد و نیما





نرخ بهره بدون ریسک



♦ بخش دوم

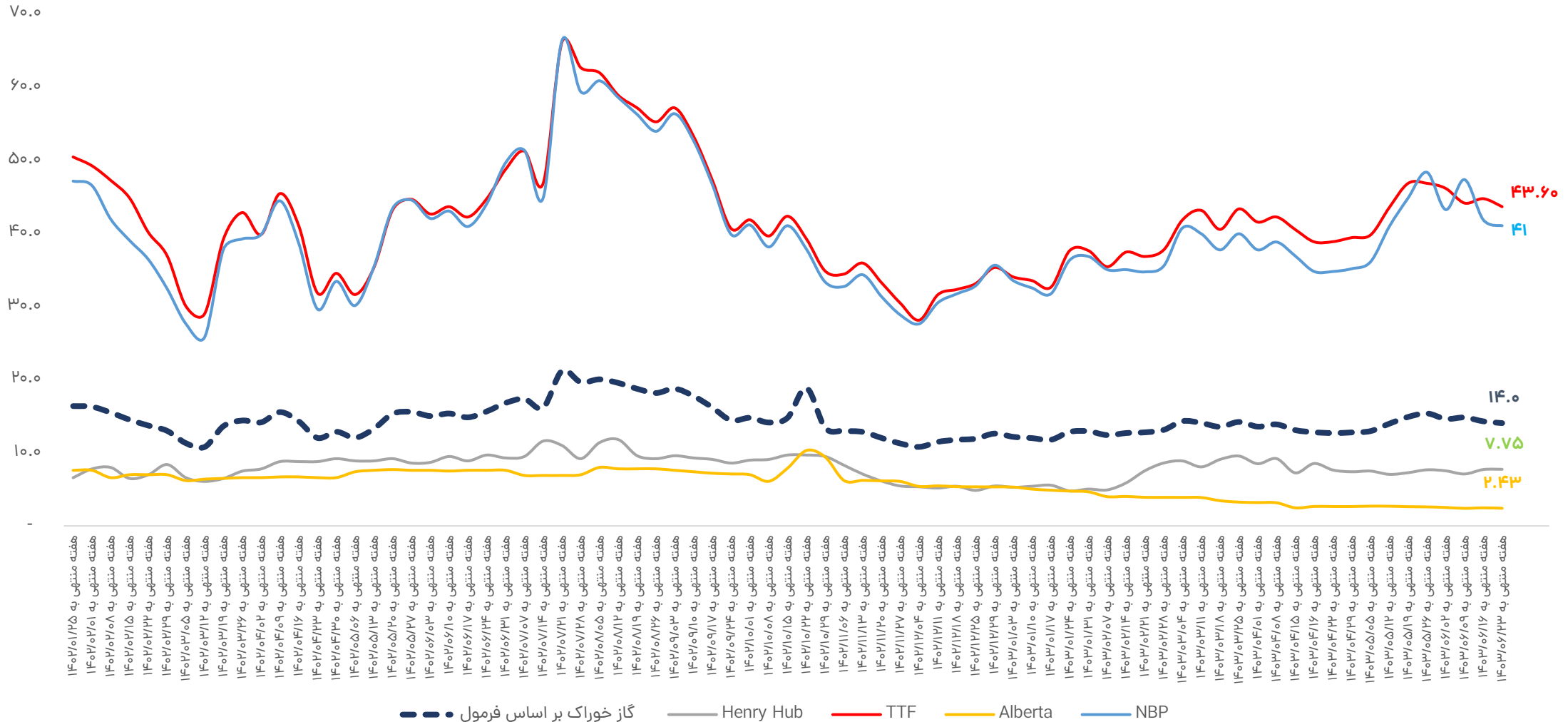
تغییرات قیمت جهانی مس و سایر کالاها

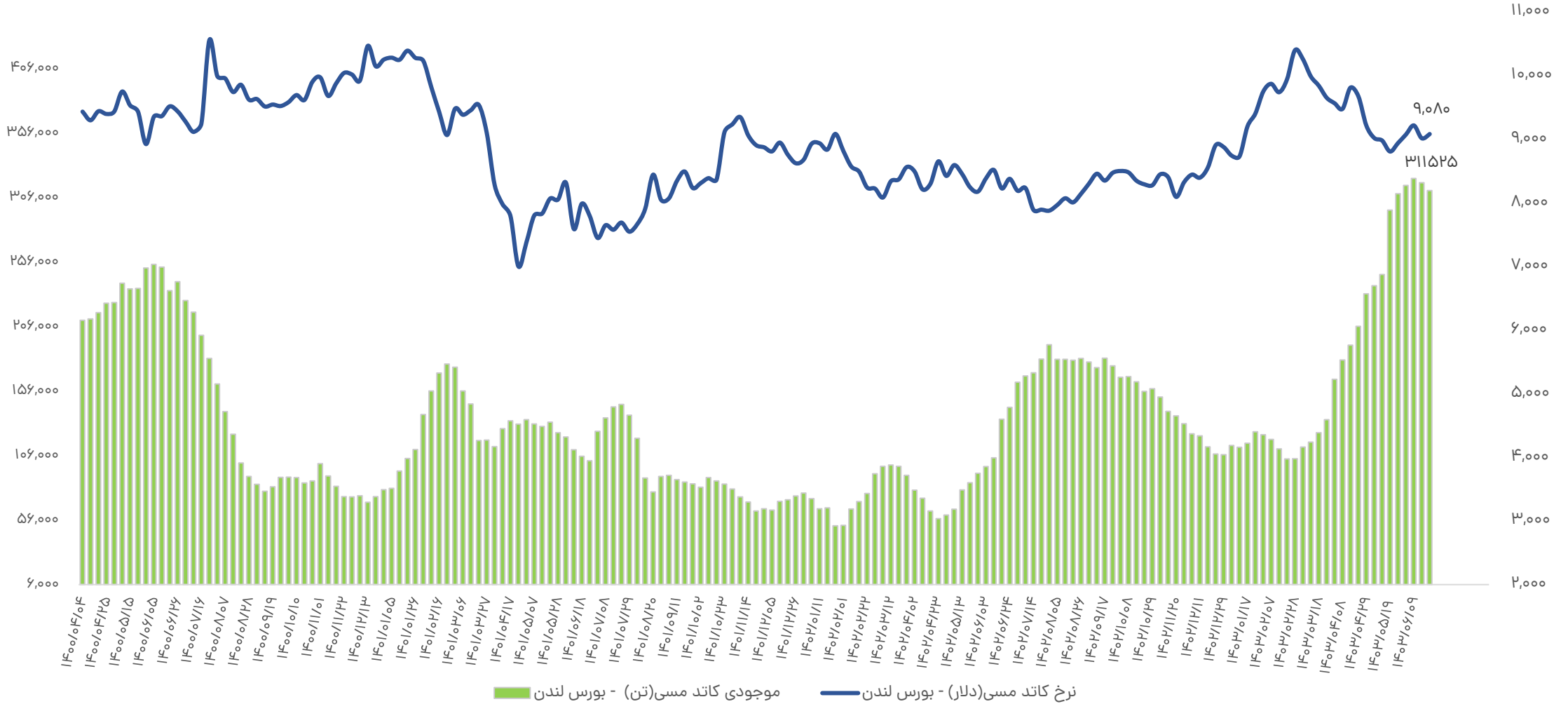
نام کالا	قرارداد	آخرین نرخ (دلار)	%W	%M	%Y
کاتد مسی	بورس لندن	۹,۵۸۰	۰.۷	-۰.۶	۲.۳
شمش آلومینیوم	بورس لندن	۲,۴۷۱	۵.۵	-۰.۶	۸.۹
بلوم و بیلت فولادی	ایران FOB	۴۵۰	-۰.۴	-۲.۶	-۶.۳
اسلب فولادی	ایران FOB	۴۳۲	۰.۰	۰.۰	-۸.۵
سنگ آهن ۶۲%	چین CFR	۹۲	۰.۸	-۶.۲	-۱۶.۸
ورق سرد	CIS دربیای سیاه FOB	۵۷۰	۰.۰	-۶.۳	-۱۵.۲
ورق گرم	CIS دربیای سیاه FOB	۴۷۰	-۱.۱	-۸.۷	-۱۵.۳
نفت برنت	برنت	۷۲	۰.۷	-۵.۸	-۱۸.۱
استایرن منومر داخلی	چین - Spot	۱,۱۲۵	-۲.۱	-۲.۰	-۱.۸
اتیلن	شمال شرق آسیا CFR	۸۶۴	-۱.۵	-۱.۸	-۶.۹
پلی اتیلن سبک تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۱۲۰	۳.۵	۵.۶	۱۰.۶
پلی اتیلن سنگین فیلم	خلیج فارس FOB	۹۰۴	۱.۱	۳.۰	-۴.۵
پروپیلن	چین CFR	۸۴۵	-۱.۷	-۲.۳	۰.۰
پلی پروپیلن تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۰۹۶	-۰.۴	-۱.۰	-۳.۲
پلی وینیل کلراید	چین CFR	۷۶۲	۰.۵	-۴.۴	-۳.۳
نفتا	ژاپن CFR	۶۴۶	۱.۱	-۴.۲	-۱۰.۸
MTBE	سنگاپور FOB	۷۱۰	۲.۰	-۷.۶	-۲۵.۳
پارازایلین	کره FOB	۸۱۷	-۳.۱	-۱۲.۸	-۲۰.۰
بنزن	کره FOB	۹۴۵	-۳.۶	-۵.۵	-۹.۷
آلکیل بنزن خطی	خلیج فارس FOB	۱,۴۴۰	-۰.۷	-۰.۷	۲.۱
بوتادین	چین CFR	۱,۵۷۰	۳.۳	۶.۸	۱۲.۹
تولوئن	چین CFR	۷۵۶	۰.۱	-۱۱.۴	-۱۶.۳
متانول	چین CFR	۲۸۲	۲.۶	۰.۰	-۵.۷
اوره	چین FOB	۲۷۶	-۲.۸	-۸.۰	-۱۸.۸
پلی اتیلن ترفتالات	جنوب شرق آسیا FOB	۹۱۰	-۲.۲	-۴.۷	-۴.۷
اکریلو نیتریل بوتادین استایرن	چین CFR	۱,۴۴۵	-۰.۷	-۱.۰	۴.۷
اتانول	رتردام FOB	۷۰۱	-۱.۱	-۵.۹	-۴.۸
بنزین پیرولیز	خلیج فارس FOB	۵۸۸	-۳.۹	-۴.۹	-۳.۱
میعانات گازی	پارس جنوبی	۶۷	-۰.۷	-۶.۲	-۱۵.۶
دوده صنعتی	خلیج فارس FOB	۹۶۰	۰.۰	۰.۰	۱.۱





در نمودار زیر روند نرخ فرمول گاز خوراک صنایع به همراه روند چهار هاب موجود در فرمول آورده شده است، همان طور که مشاهده می شود نرخ گاز صنایع در هفته گذشته طبق فرمول به حدود ۱۴ سنت در هر مترمکعب رسیده است که نسبت به هفته گذشته با کاهش مواجه گردید. باتوجه به نرخ دلار نیما ۴۵۸،۵۳۶ ریالی نرخ هر متر مکعب گاز حدود ۶۵،۵۱۹ ریال به دست می آید.





در نمودار بالا روند نرخ کاتد مس در بورس لندن به همراه روند میزان موجودی انبار بورس لندن آورده شده است.
در آخرین روز کاری هفته گذشته کاتد مسی به ۹۰/۸۰ دلار رسید. همچنین در ماه گذشته موجودی انبار LME، ۶۰۵۰ تن کاهش یافت.



نام محصول	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	بازده ماهانه	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	میزان رقابت
کنسانتره	۳۸,۱۱۰	۱%	۳%	۳۸,۱۱۰	۰%
گندله	۵۳,۶۰۹	۱.۱%	۳%	۵۳,۶۰۹	۰%
آهن اسفنجی	۱۲۳,۱۹۲	۱%	۲%	۱۲۰,۶۸۰	۲%
بیلت	۲۲۲,۸۹۲	۱%	۱-	۲۲۰,۵۴۰	۲%
ورق گرم	۲۹۶,۰۰۰	۱۴.۶-	۶-	۲۹۶,۰۰۰	۰%
ورق گالوانیزه	۴۲۹,۶۳۴	۷/۵-	۱-	۴۲۸,۸۶۹	۰%
شمش آلومنیوم	۱,۴۱۹,۲۵۴	۳-	۰	۱,۱۷۵,۴۹۴	۱۹%
کاتد	۴,۸۸۳,۰۰۷	۲-	۰	۴,۸۸۳,۰۰۰	۰%
سیمان	۱۴,۲۷۸	۲.۵%	۱%	۱۲,۹۱۴	۱۰%



نام محصول	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	بازده ماهانه	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	میزان رقابت
پت	۴۸۶،۹۴۵	-۱%	-۵%	۴۵۵،۹۷۱	۷%
اوره	۱۳۱،۸۱۷	-۵%	-۱۵%	۱۳۱،۶۸۶	۸%
پلی پروپیلن	۴۹۷،۵۵۹	-۱%	-۱%	۴۸۵،۹۲۳	۲%
PVC	۳۴۹،۷۵۵	۰.۳%	-۴%	۳۴۹،۳۵۴	۰%
روغن پایه	۳۴۵،۰۱۶	۱%	۱%	۳۴۳،۸۵۲	۵%
پلی اتیلن	۴۲۴،۷۴۵	۶%	۹%	۳۹۱،۲۴۷	۸%
LAB	۶۲۸،۴۸۴	۰%	۲%	۶۲۸،۴۸۴	۰%
وکیوم باتوم	۱۴۰،۵۶۸	۰%	-۲.۵%	۱۲۹،۹۷۲	۸%
لوبکات	۲۱۰،۸۲۰	۳%	۶%	۲۱۰،۸۲۰	۰%



نام ارز	ارزش بازار (میلیارد دلار)	قیمت (دلار)	بازده هفتگی
بیت کوین	۱,۱۸۸	۶۰,۱۵۲	%۱۰
اتریوم	۲۹۱	۲,۴۲۰	%۶
بایننس	۸۰	۵۵۴	%۱۱
سولانا	۶۴	۱۳۷	%۷
ریپل	۳۳	۰,۵۹	%۱۱

دلار کشف شده شمش فولاد خوزستان در بورس کالا



گروه مالی کیمیا



دلار محاسبه شده در معاملات شمش فولاد خوزستان در بورس کالا نسبت به ماه قبل تغییر چندانی نداشت.



دلار محاسبه شده در معاملات سکه امامی نسبت به ماه گذشته ۶٪ افزایش یافته است.





➤ شی جین پینگ، رئیس جمهور چین بر نیاز به دستیابی به اهداف اقتصادی سالانه این کشور تاکید کرد، که باعث خوش بینی نسبت به افزایش تقاضا

برای مس شد. (منبع: Investing)

➤ موجودی مس در انبارهای بورس آتی شانگهای ۱۳.۹ درصد نسبت به جمعه گذشته کاهش یافت که نشان دهنده کاهش ۴۵ درصدی در سه ماه

گذشته به ۱۸۵۵۲۰ تن است که کمترین میزان از فوریه است. (منبع: Investing)



همچنان خط روند صعودی برای مس جهانی کار میکند نوسان مثبت تا تراز ۳۸ درصد ریزش قبلی مطابق ۹۳۵۰ دلار در کوتاه مدت محتمل می باشد



♦ بخش سوم

ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه

تغییرات قیمت نماد فملی



گروه مالی کیمیا

۸,۰۰۰
۷,۰۰۰
۶,۰۰۰
۵,۰۰۰
۴,۰۰۰
۳,۰۰۰
۲,۰۰۰
۱,۰۰۰
۰

۱۳۹۷-۰۱-۰۵
۱۳۹۷-۰۳-۰۲
۱۳۹۷-۰۵-۰۷
۱۳۹۷-۰۷-۰۴
۱۳۹۷-۰۹-۰۳
۱۳۹۷-۱۱-۰۱
۱۳۹۸-۰۱-۲۷
۱۳۹۸-۰۳-۰۶
۱۳۹۸-۰۵-۰۱
۱۳۹۸-۰۶-۰۳
۱۳۹۸-۰۸-۰۲
۱۳۹۸-۱۰-۲۲
۱۳۹۹-۰۲-۲۵
۱۳۹۹-۰۴-۲۱
۱۳۹۹-۰۶-۲۷
۱۴۰۰-۰۸-۲۳
۱۴۰۰-۱۰-۰۲
۱۴۰۰-۱۲-۲۸
۱۴۰۱-۰۲-۰۲
۱۴۰۱-۰۵-۰۸
۱۴۰۱-۰۷-۰۶
۱۴۰۱-۰۹-۰۱
۱۴۰۱-۱۰-۲۷
۱۴۰۲-۰۱-۰۹
۱۴۰۲-۰۳-۰۹
۱۴۰۲-۰۵-۰۸
۱۴۰۲-۰۷-۰۴
۱۴۰۲-۰۸-۲۹
۱۴۰۲-۱۰-۲۴
۱۴۰۳-۰۱-۱۴
۱۴۰۳-۰۳-۱۲
۱۴۰۳-۰۵-۲۰

۳,۶۸۷

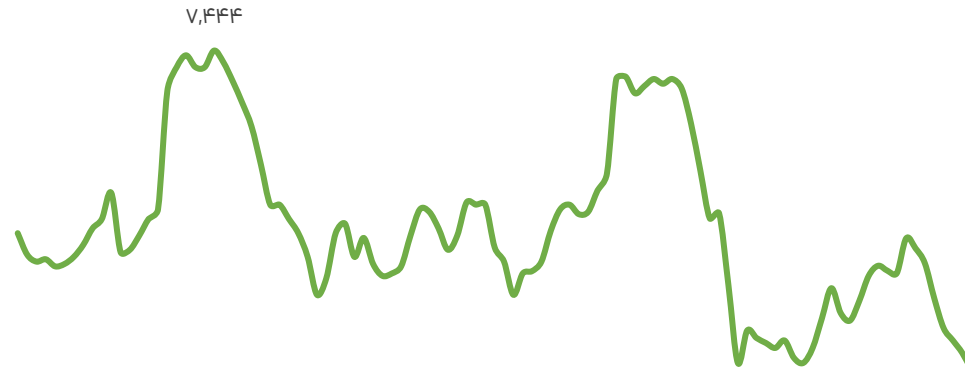
۲,۲۵۴

۵,۸۴۵

۷,۳۲۰

۷,۴۴۴

بازدهی از ابتدای سال	-۵.۵۳%
بازدهی هفته اخیر	-۶.۵۳%
بازدهی ماه اخیر	-۱.۴۴%

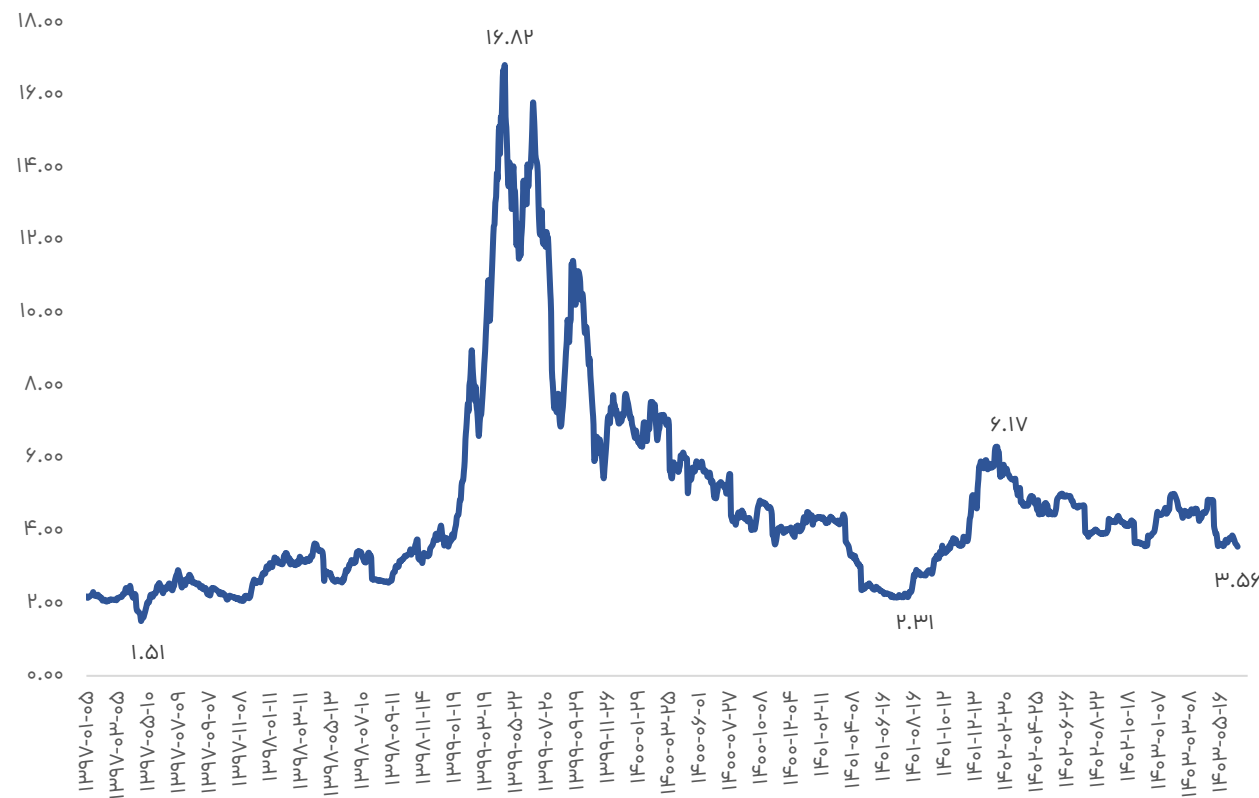


نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر

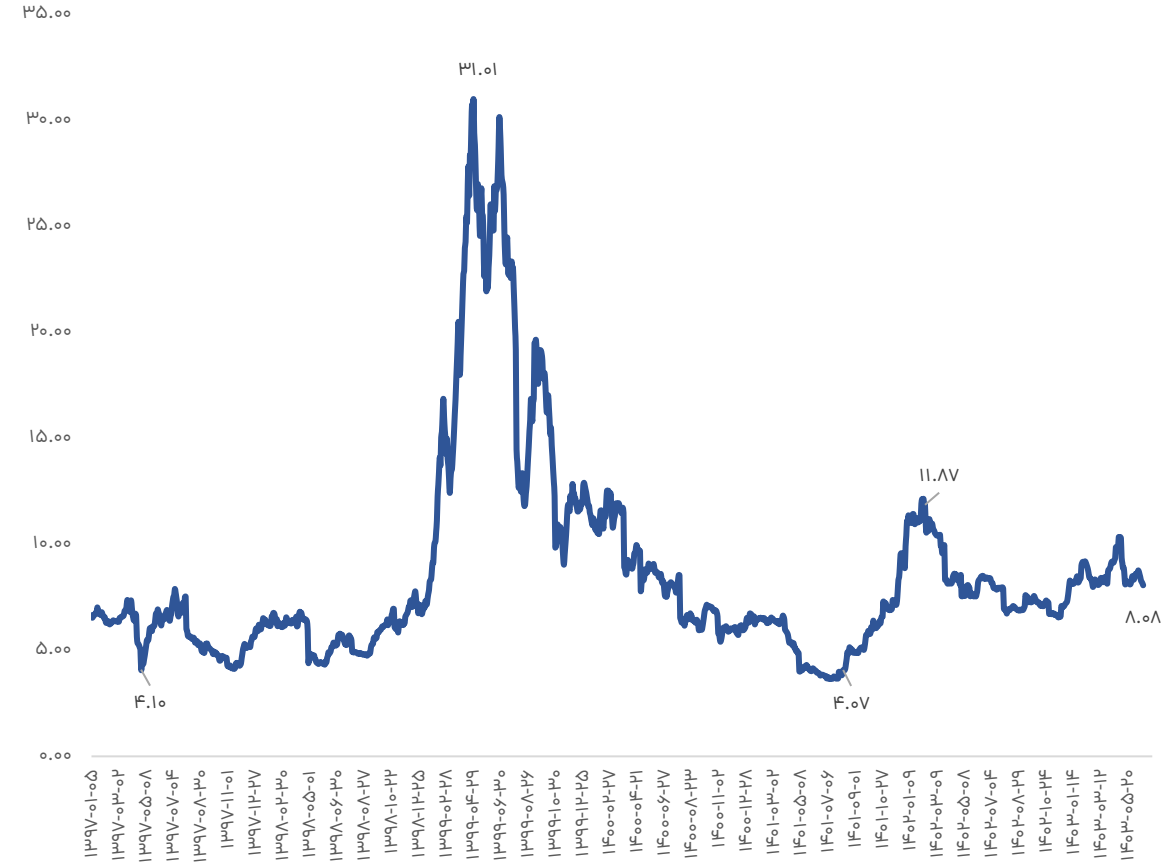


گروه مالی کیمیا

P/S



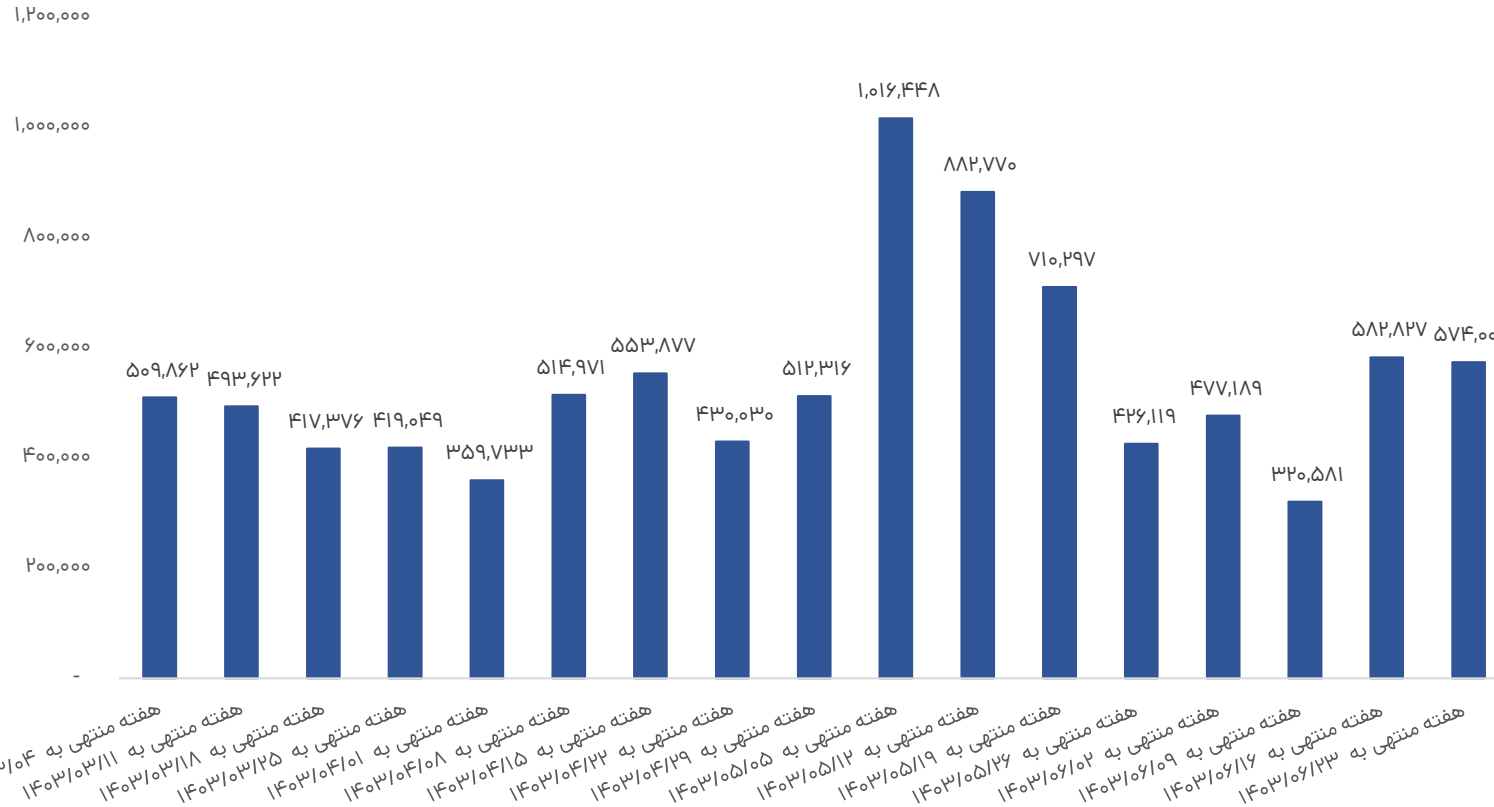
P/E-ttm



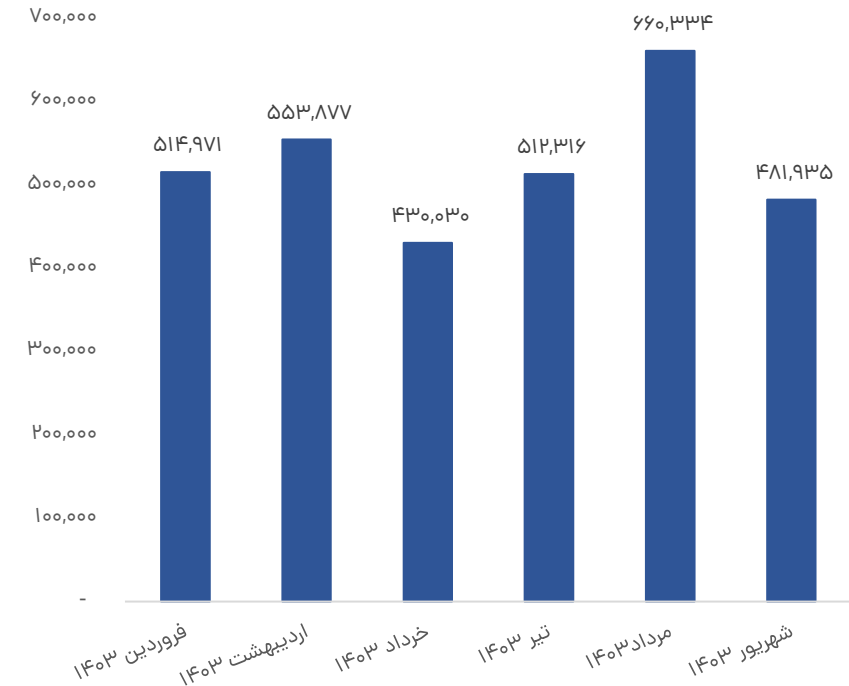


طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۲۳ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۵۷۴,۰۰۶ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با کاهش مواجه گردید.

میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)



میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

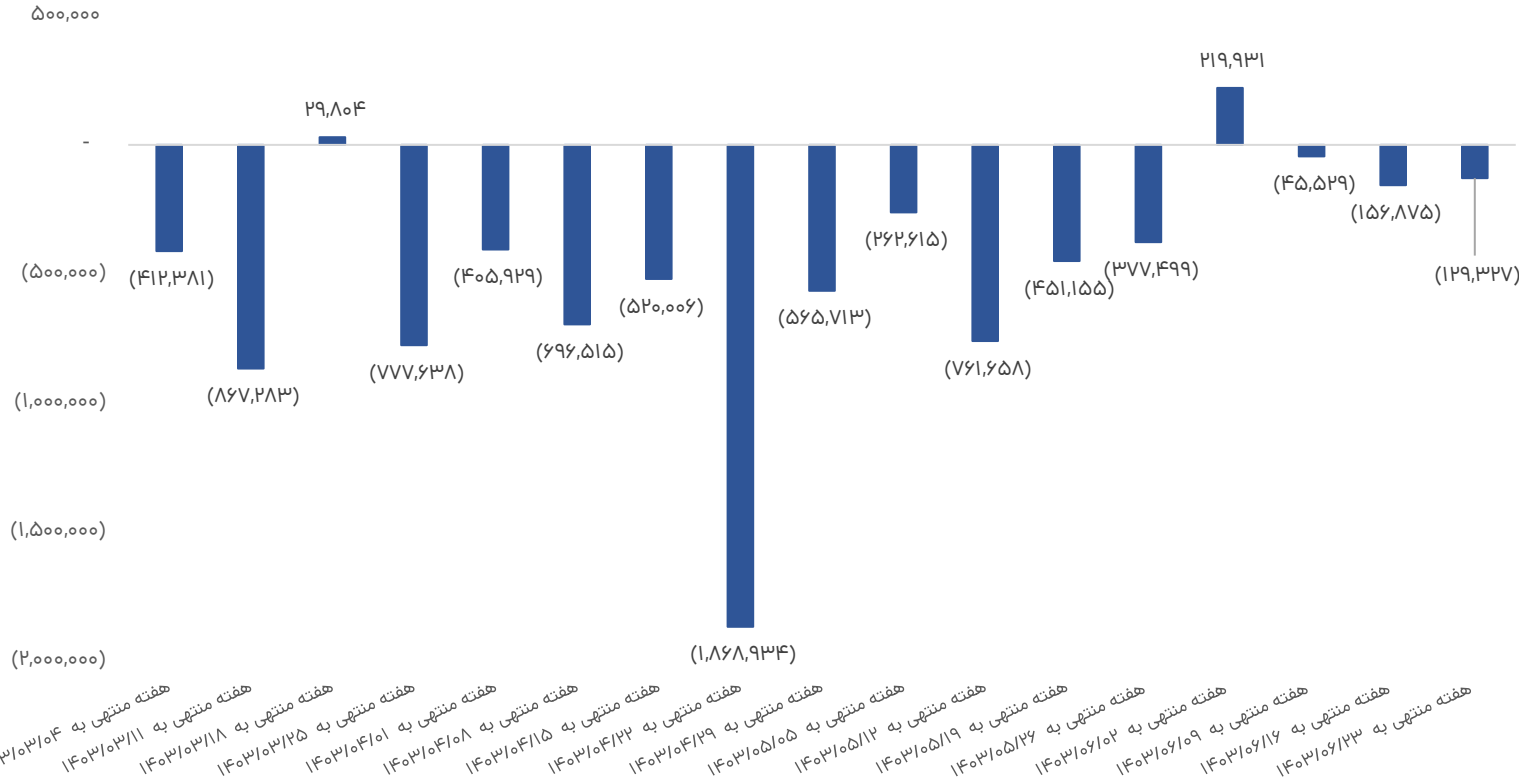




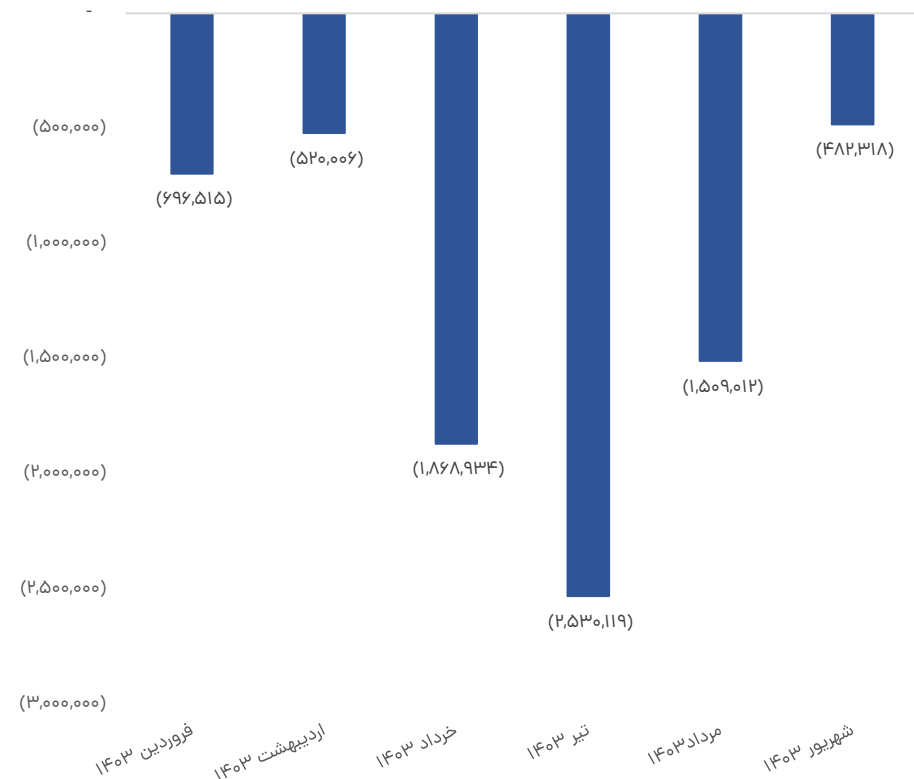
میزان ورود پول در نماد فملی

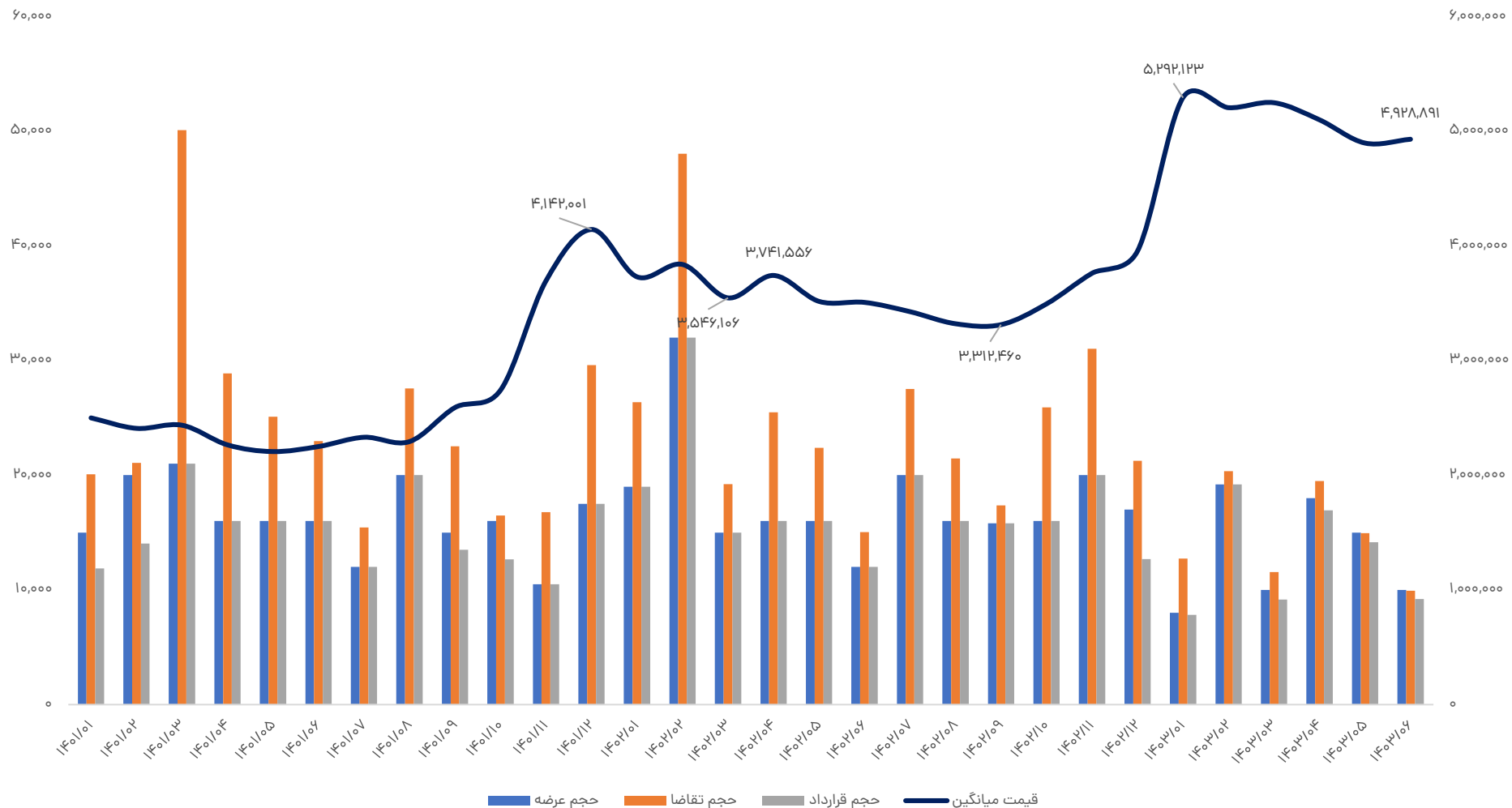
طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۲۳ ، خروج پول افراد حقیقی به میزان ۱۲۹,۳۲۷ میلیون ریال بوده است.

ورود پول (میلیون ریال)



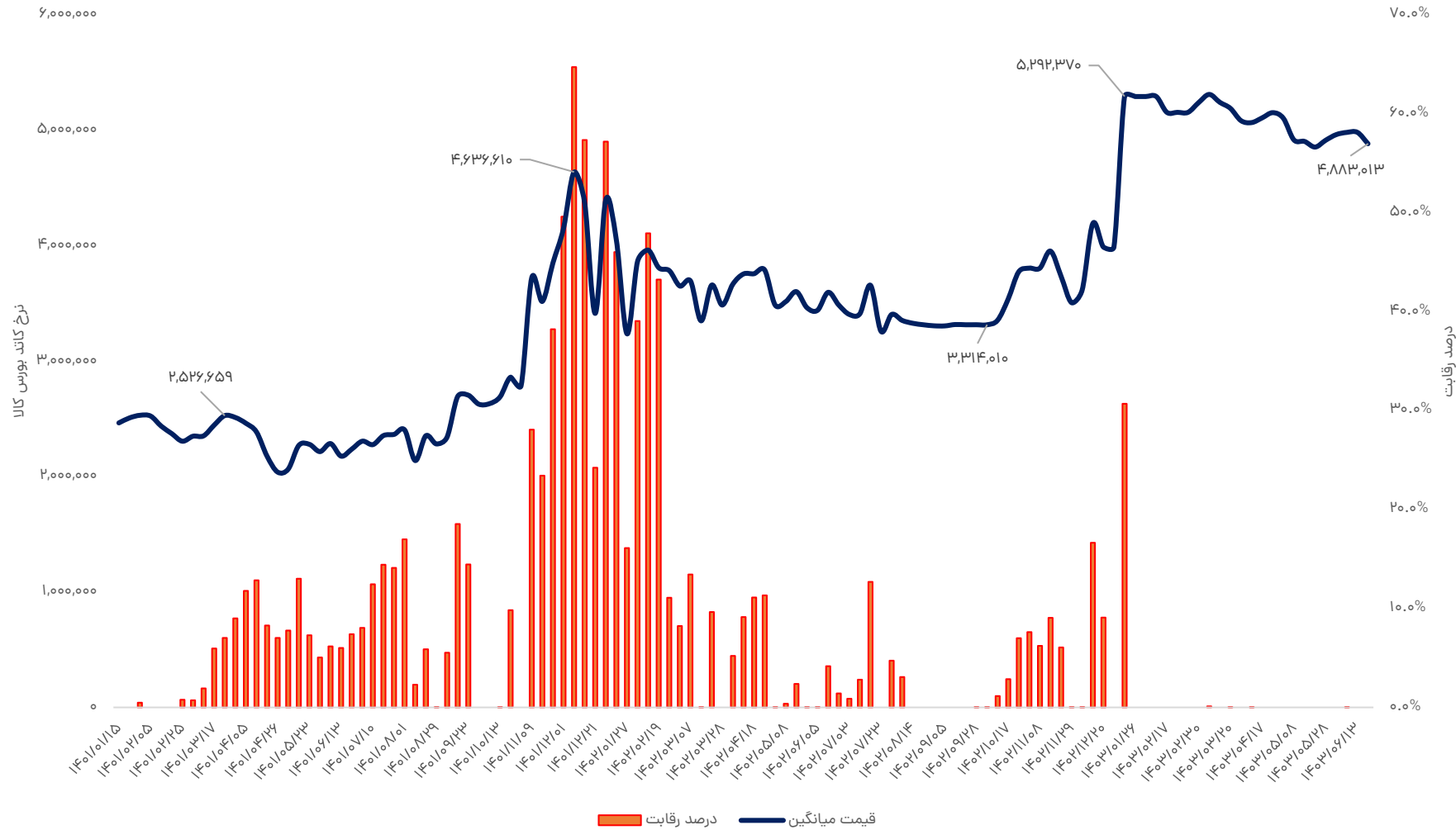
ورود پول (میلیون ریال)





در نمودار بالا روند معاملات ماهانه کاتد مس در بورس کالا آورده شده است.

در ماه شهریور تاکنون مجموعاً ۱۰۰۰۰ تن عرضه کاتد توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۹۹۲۰ تن بود و با میانگین قیمت ۴,۹۲۸,۸۹۱ ریال معامله گردید.



این هفته کاتد مس با قیمت ۴,۸۸۳,۰۱۳ ریال بر کیلوگرم معامله گردید که نسبت به معاملات هفته گذشته تغییر خاصی نداشت. همچنین ۳۵۰۰ تن عرضه صورت گرفت که با تقاضا به میزان ۲۷۸۰ تن پاسخ داده شد.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۰۲۱ - ۵۸۶۱۹۰۰۰

دور نگار: ۰۲۱ - ۸۰۴۷۲۹۳