



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۶

منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۰۸



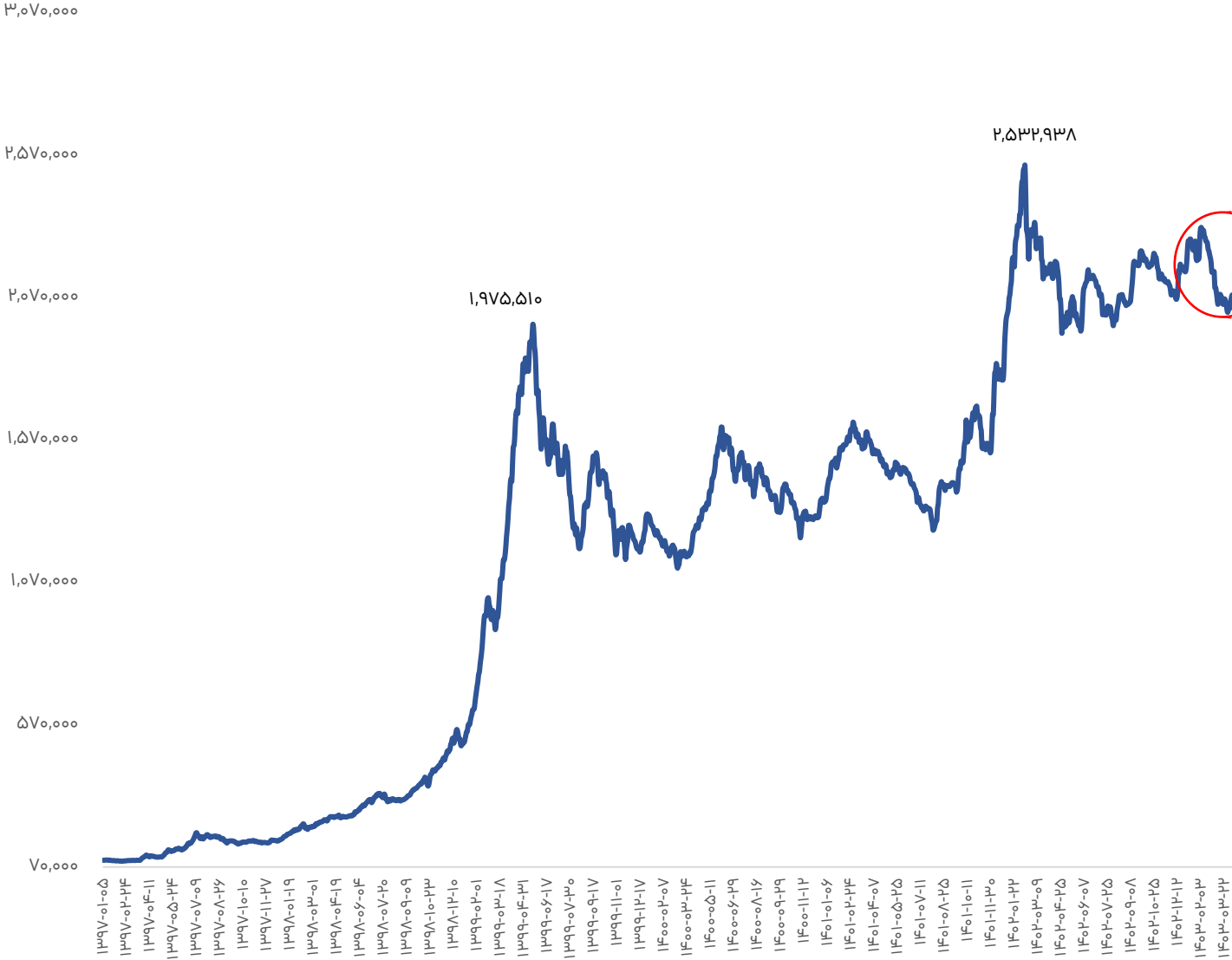
♦ بخش اول

بازار سرمایه

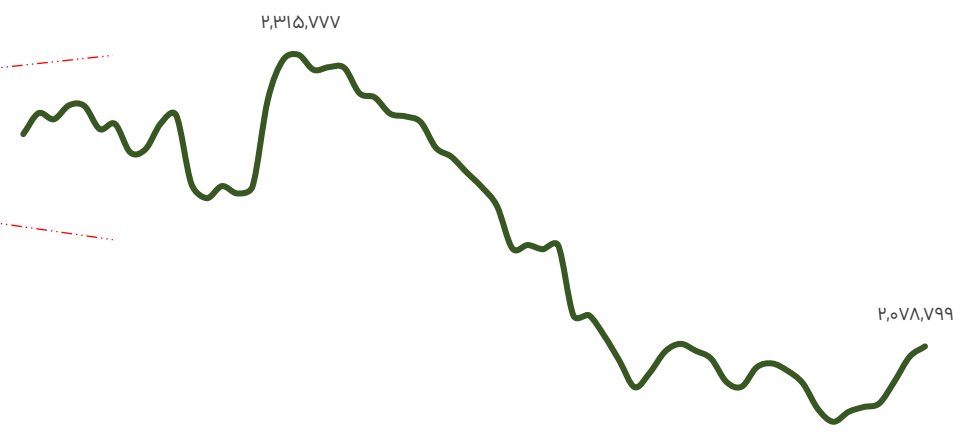


شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷

بازدهی از ابتدای سال	-۵.۹%
بازدهی هفته اخیر	۲.۶%



شاخص کل از ابتدای سال

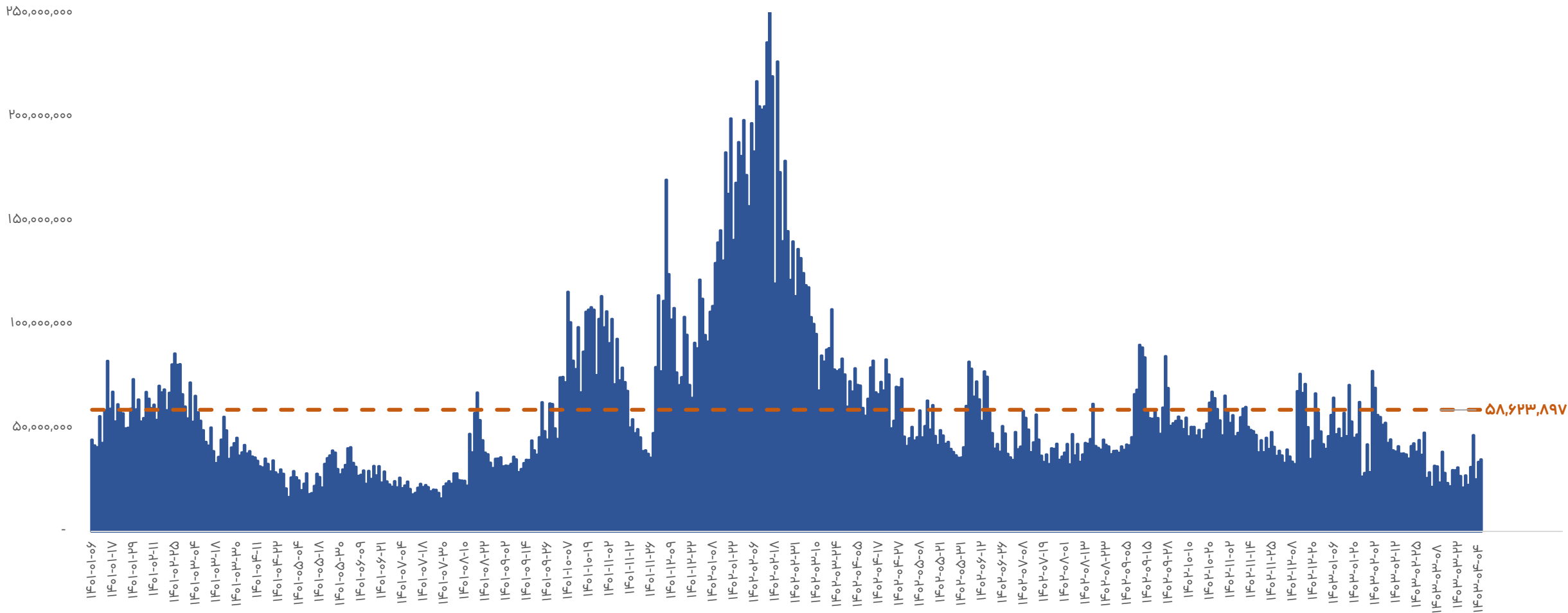


بازار سهام در این هفته برخلاف چند هفته گذشته بازدهی مثبتی را به ثبت رساند. بازدهی بازار در این هفته ۲.۶ درصد بود و از سطح ۲,۰۲۵,۶۵۲ واحد به ۲,۰۷۸,۷۹۹ واحد رسید. همچنین از ابتدای سال بازدهی شاخص کل منفی ۵.۹ درصد بوده است.



ارزش معاملات خرد در این هفته نوسان اندکی نسبت به هفته قبل داشت و همچنان از میانگین دوسال گذشته پایین تر می‌باشد. محدودیت دامنه نوسان نیز در این هفته تداوم یافت و از هفته بعد پایان می‌یابد.

ارزش معاملات خرد از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال



۵۸,۶۲۳,۸۹۷

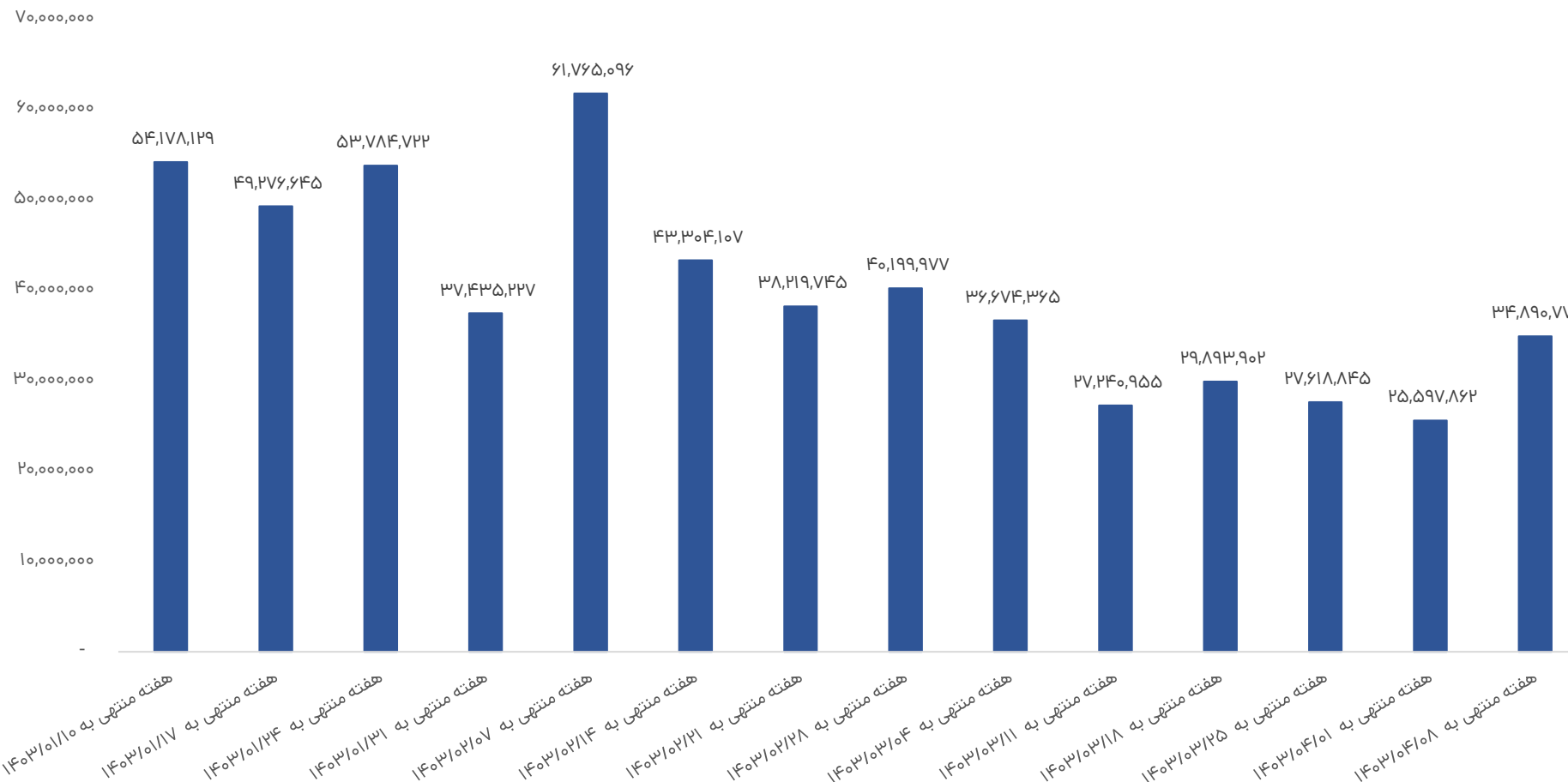
میانگین ارزش معاملات هفتگی

میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته با افزایش چشم گیری نسبت به هفته گذشته مواجه گردید و به ۳۴,۸۹۰,۷۷۷ میلیون ریال رسید.



گروه مالی کیمیا

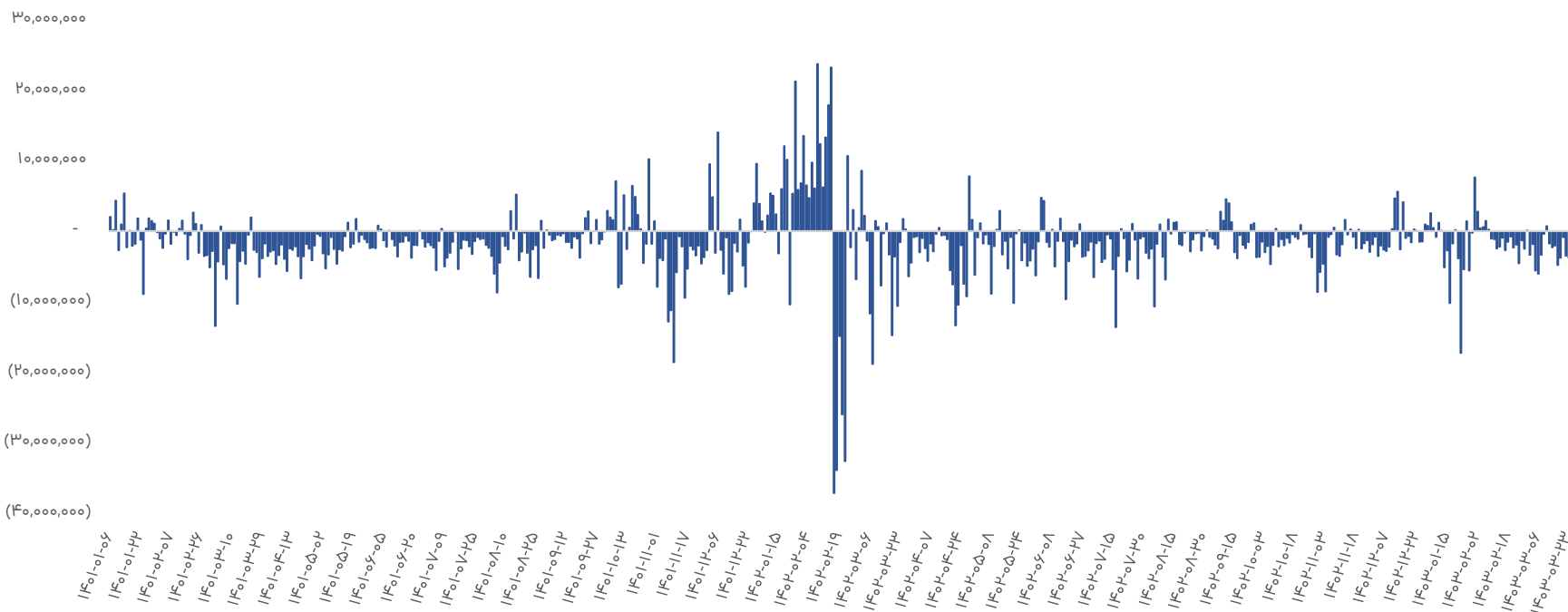
ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال





میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۶۸۹,۲۳۳,۰۵۳
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۱۱۹,۳۶۰,۳۰۳
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	-۲,۴۷۹,۶۱۹

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



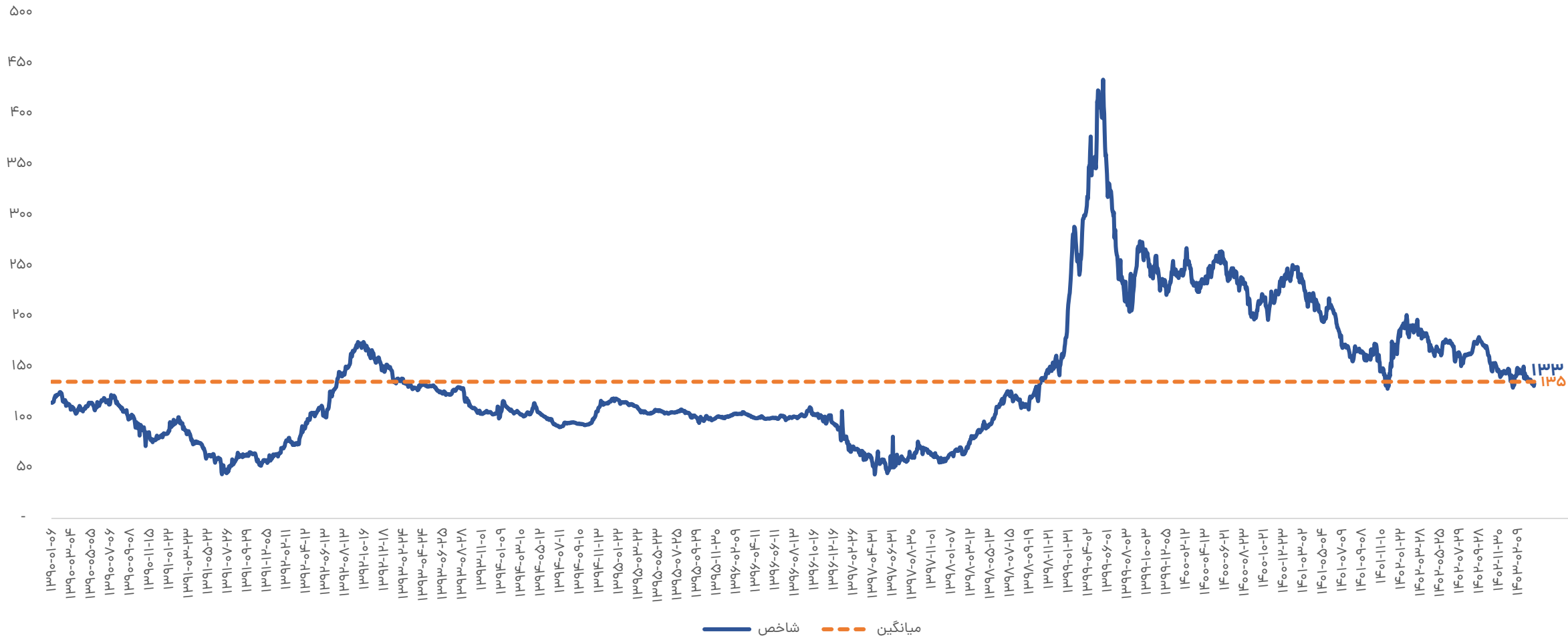
هفته گذشته اشخاص حقیقی ۲,۴۷۹,۶۱۹ میلیون ریال پول از بازار سهام خارج کردند. خالص خروج نقدینگی اشخاص حقیقی در سال جاری تاکنون نزدیک به ۱۲ هزار میلیارد تومان بوده است.

همچنین از تاریخ ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ و با شروع اصلاح شاخص کل ، میزان خروج پول اشخاص حقیقی از ۶۸ همت فراتر رفته است.



در این هفته ارزش بازار سرمایه بر حسب دلار بدون تغییری محسوس نسبت به هفته گذشته در محدوده ۱۳۳ میلیارد دلار باقی ماند.

ارزش دلاری بازار سرمایه از ابتدای سال ۱۳۹۰ - میلیارد دلار

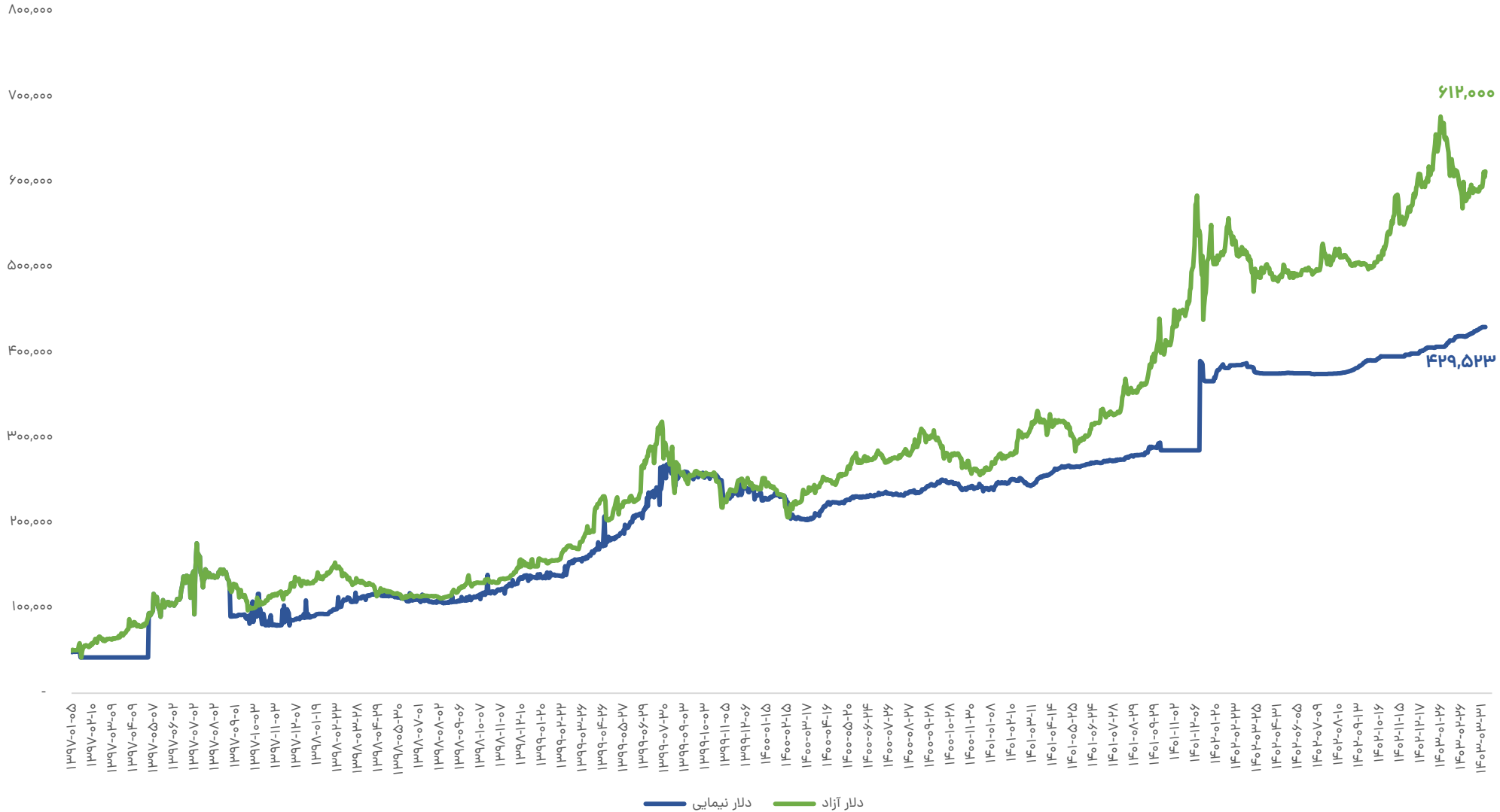


روند دلار نیمایی و دلار آزاد



گروه مالی کیمیا

دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۶۱۲,۰۰۰ ریال رسید که نسبت به هفته گذشته شاهد سه درصد نوسان مثبت بودیم.
دلار نیما نیز در این هفته تنها ۵۲۵ ریال افزایش یافت.



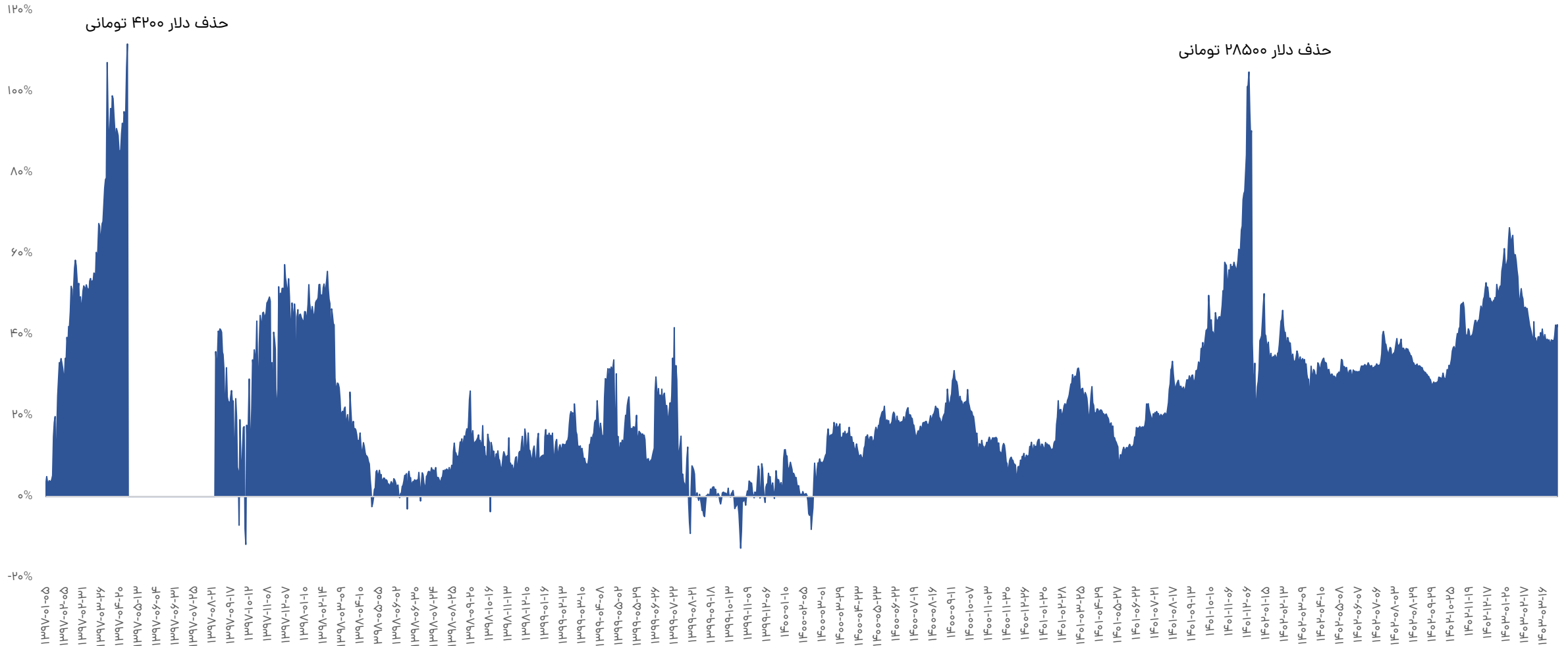
اختلاف دلار نیمایی و دلار آزاد

اختلاف میان دلار نیما و بازار آزاد این هفته به علت ثابت ماندن دلار نیما و افزایش دلار آزاد به ۴۲ درصد افزایش یافت.



گروه مالی کیمیا

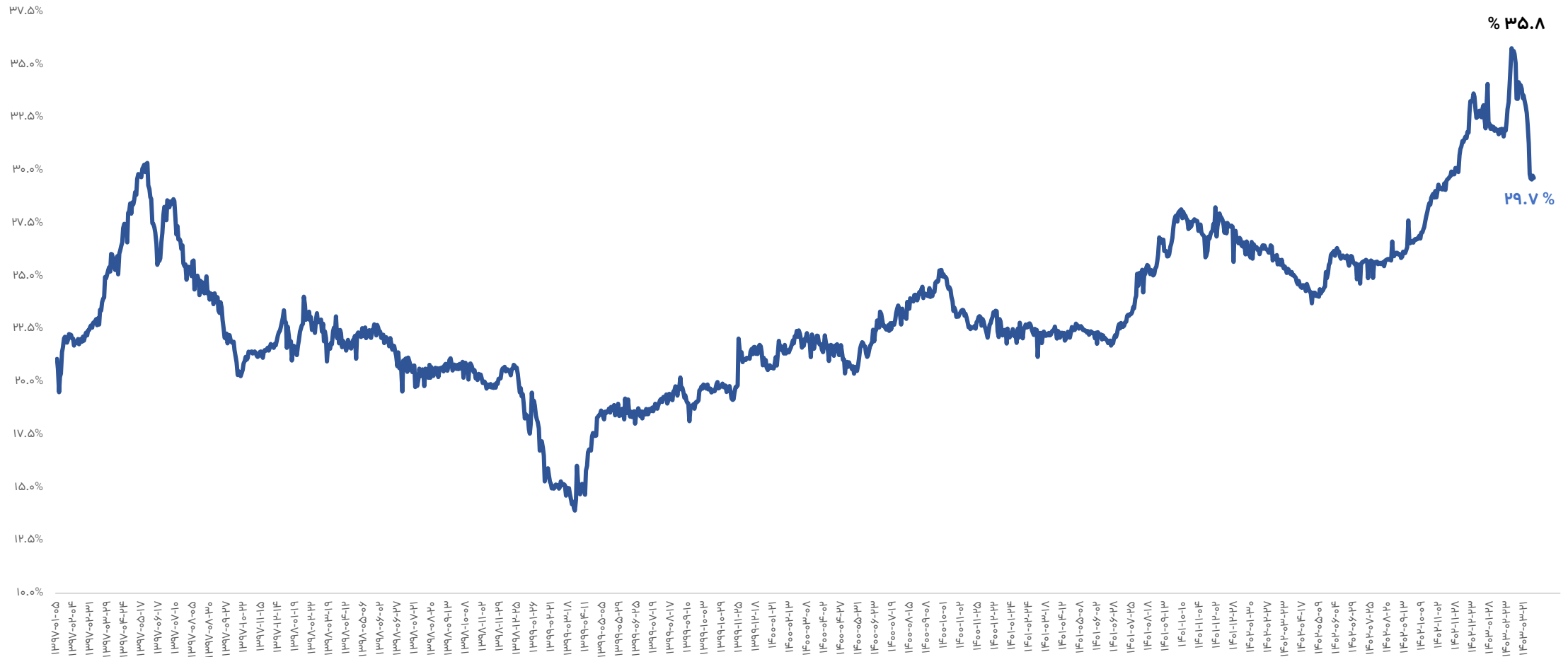
اختلاف دلار آزاد و نیما





پس از کاهش شدید نرخ اوراق از نزدیک ۳۶ درصد به زیر ۳۰ درصد شاهد ثبات آن در هفته گذشته بودیم.

نرخ بهره بدون ریسک



۳۵.۸%

۲۹.۷%

♦ بخش دوم

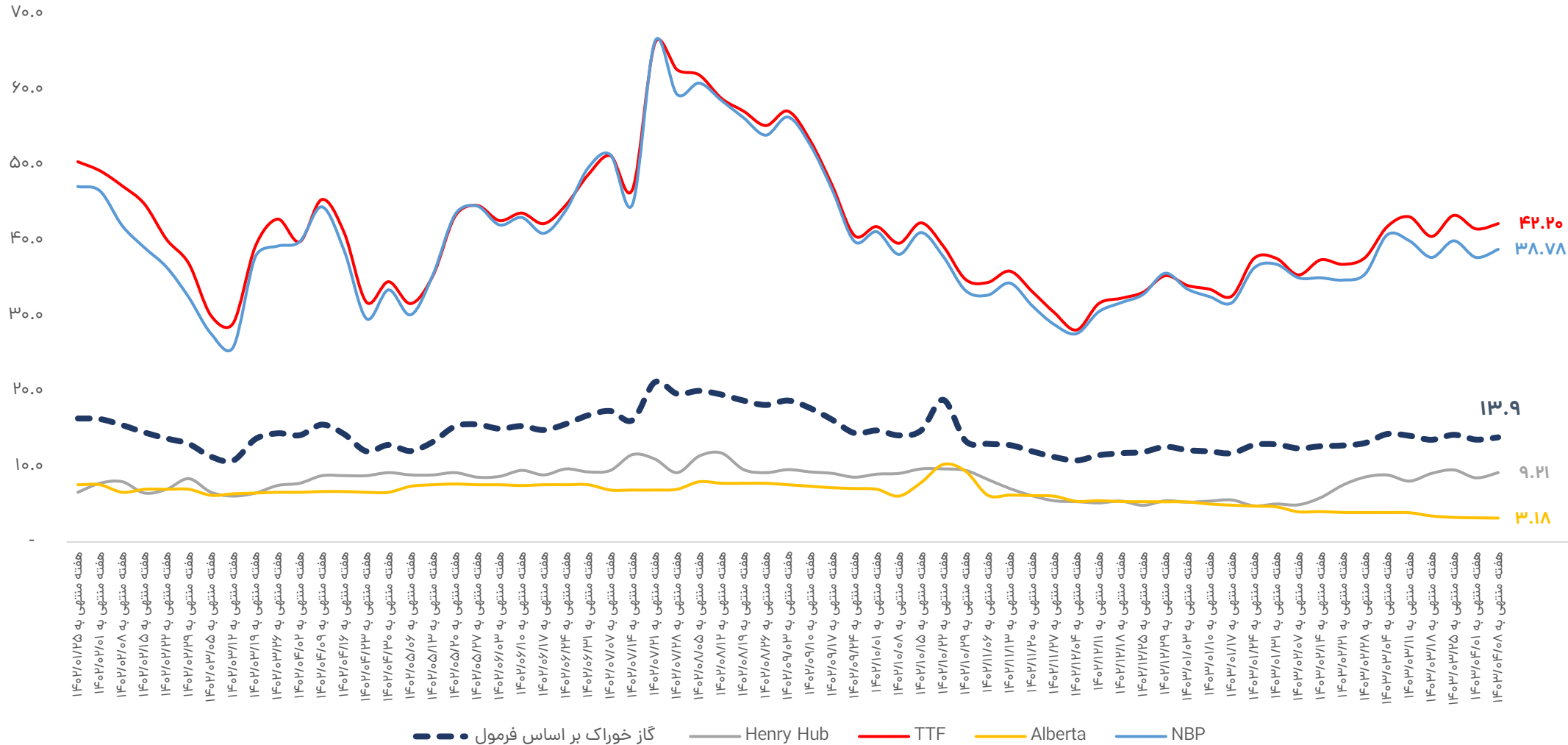
تغییرات قیمت جهانی مس و سایر کالاها

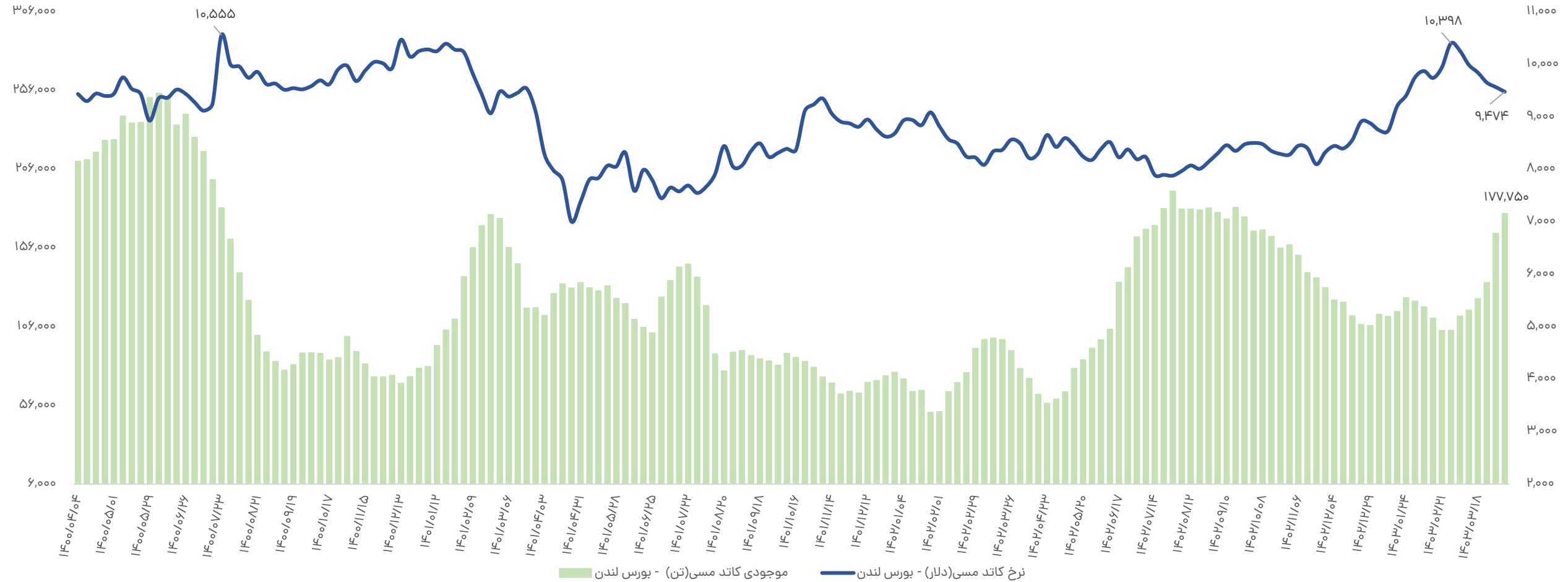


%Y	%M	%W	آخرین نرخ (دلار)	قرارداد	نام کالا
۶.۸	-۱.۸	-۰.۹	۹,۴۷۶	بورس لندن	کاتد مسی
۱۱.۲	۰.۱	۰.۴	۲,۵۲۴	بورس لندن	شمش آلومینیوم
۰.۰	۰.۰	۰.۰	۴۸۰	ایران FOB	بلوم و بیلت فولادی
-۳.۴	۰.۰	۰.۰	۴۵۶	ایران FOB	اسلب فولادی
-۳.۶	۰.۰	۰.۰	۱۰۷	چین CFR	سنگ آهن ۶۲%
-۵.۱	-۰.۳	-۰.۳	۶۳۸	CIS دریای سیاه FOB	ورق سرد
-۱.۸	-۰.۵	-۰.۵	۵۴۵	CIS دریای سیاه FOB	ورق گرم
-۱.۱	۰.۸	۱.۴	۸۶	برنت	نفت برنت
-۱.۵	-۰.۹	-۰.۴	۱,۱۲۸	چین - Spot	استایرن منومر داخلی
-۸.۸	۰.۵	۰.۴	۸۴۶	شمال شرق آسیا CFR	اتیلن
۱۳.۹	۲.۰	۲.۰	۱,۱۵۴	خلیج فارس FOB	پلی اتیلن سبک تزریقی
۰.۳	-۰.۴	-۰.۴	۹۵۰	خلیج فارس FOB	پلی اتیلن سنگین فیلم
۳.۶	۱.۷	۰.۶	۸۷۵	چین CFR	پروپیلن
-۳.۹	۰.۰	۰.۰	۱,۰۸۸	خلیج فارس FOB	پلی پروپیلن تزریقی
۱۱.۰	۲.۹	-۰.۳	۸۷۵	چین CFR	پلی وینیل کلراید
-۰.۷	۶.۴	۲.۳	۷۱۹	ژاپن CFR	نفتا
-۷.۶	۶.۷	۱.۹	۸۷۹	سنگاپور FOB	MTBE
۰.۶	۰.۹	۰.۹	۱,۰۲۷	کره FOB	پاراژایلین
-۰.۶	-۰.۴	۴.۲	۱,۰۴۰	کره FOB	بنزن
۲.۱	۰.۰	۰.۰	۱,۴۴۰	خلیج فارس FOB	آلکیل بنزن خطی
۱۳.۷	۵.۳	۰.۰	۱,۵۸۰	چین CFR	بوتادین
۱.۳	-۰.۸	۱.۲	۹۱۵	چین CFR	نولوئن
-۲.۷	-۱.۷	۱.۰	۲۹۱	چین CFR	متانول
-۱۴.۲	۰.۳	۰.۹	۳۳۲	چین FOB	اوره
۰.۵	-۰.۶	-۰.۶	۹۶۰	جنوب شرق آسیا FOB	پلی اتیلن ترفتالات
۴.۰	-۰.۷	۰.۰	۱,۴۳۵	چین CFR	اکریلو نیتریل بوتادین استایرن
۸.۴	۰.۱	۰.۴	۷۹۸	رتردام FOB	اتانول
-۱.۲	۴.۲	۴.۲	۶۰۰	خلیج فارس FOB	بنزین پیرولیز
-۲.۳	۷.۳	۱.۷	۷۸	پارس جنوبی	میعانات گازی
۱.۱	۰.۰	۰.۰	۹۶۰	خلیج فارس FOB	دوده صنعتی



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 ۱۳.۹ سنت در هر مترمکعب رسیده است. باتوجه به نرخ دلار نیما ۴۲۹.۵۲۳ ریالی نرخ هر متر مکعب گاز حدود ۵۹,۷۰۳ 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 در ادامه روند اصلاحی به ۹۴۷۴ دلار رسید. همچنین موجودی انبار LME با افزایش ۱۲.۵۷۵ تنی به ۱۷۷.۷۵۰ تن رسید



نام محصول	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	بازده ماهانه	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	میزان رقابت
کنسانتره	۳۷,۷۲۰	۱%	۱%	۳۷,۷۲۰	۰%
گندله	۵۲,۵۳۰	۱%	۲%	۵۲,۵۳۰	۰%
آهن اسفنجی	۱۲۳,۱۸۴	-۷%	-۳%	۱۲۳,۶۰۴	۰%
بیلت	۲۲۲,۳۹۸	۱%	۴%	۲۲۰,۰۳۲	۱%
اسلب	۲۲۵,۷۵۰	۰%	۰%	۲۲۵,۰۰۰	۰%
ورق گرم	۳۰۱,۹۹۵	-۷%	-۷%	۳۰۱,۹۹۵	۰%
ورق گالوانیزه	۴۴۴,۳۹۵	۰%	-۲%	۴۴۱,۳۶۲	۱%
شمش آلومینیوم	۱,۴۱۷,۹۷۳	-۴%	۰%	۱,۱۳۱,۵۷۸	۲۵%
کاتد	۵,۰۸۳,۰۰۰	۰%	-۳%	۵,۰۸۳,۰۰۰	۰%
شمش روی	۱,۳۷۳,۷۳۰	۲%	-۲%	۱,۳۷۳,۷۳۰	۰%
سیمان فله	۱۱,۰۸۶	۱%	۱۰%	۹,۴۴۳	۱۷%
سیمان کیسه	۱۲,۰۸۹	۱%	۷%	۱۰,۸۳۰	۱۲%



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده ماهانه	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۰%	۱۲۵,۴۳۱	۱۵%	۶%	۱۲۵,۴۳۱	اوره
۷%	۴۷۱,۰۹۵	-۵%	-۲%	۵۰۶,۳۱۷	پلی پروپیلن
۷%	۳۷۷,۰۹۹	-۱%	۲%	۴۰۴,۹۸۸	PVC
۴%	۳۳۵,۶۷۵	۰%	۱%	۳۵۰,۴۷۷	روغن پایه
۱%	۳۹۳,۴۳۱	۳%	۱%	۳۹۷,۵۱۸	پلی اتیلن
۰%	۵۹۰,۱۸۴	-۲%	-۵%	۵۹۰,۱۸۴	LAB
۰%	۶۱۶,۰۰۰	-۱%	-۱%	۶۱۶,۰۰۰	دوده
۰%	۱۶۲,۵۲۲	۳%	۳%	۱۶۲,۵۲۴	قیر
۰%	۱۴۳,۹۹۵	۰%	۰%	۱۴۴,۰۹۷	وکیوم بانوم
۰%	۲۱۸,۸۹۶	-۳%	-۴%	۲۱۸,۸۹۶	لوپکات

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 هفته قبل نوسان چندانی نداشته است.





دلار محاسبه شده در معاملات سکه امامی نسبت به هفته گذشته نوسان خاصی را تجربه نکرده است و در کانال ۷۰ هزار تومانی معامله میشود.





➤ داده های بورس آتی شانگهای نشان داد که موجودی مس بورس شاگهای در هفته گذشته از حدود ۳۰,۰۰۰ تن در ژانویه به ۳۲۲,۹۱۰ تن افزایش یافت که نشان دهنده عرضه قوی در چین است. مس طی هفته اخیر همچین تحت تاثیر دلار قوی به دلیل گفته هتای فدرال رزرو مبنی بر تمایل بر ۲ بار افزایش نرخ بهره برای کنترل تورم نیز قرار گرفت.

منبع: Trading economic

➤ دولت اندونزی کارخانه ذوب مس Gresik را به ارزش ۳.۷ میلیارد دلار در جاوه شرقی راه اندازی کرد تا زیرساخت انرژی های تجدیدپذیر را برآورده کند. ظرفیت کل ورودی کارخانه ذوب ۱.۷ میلیون تن کنسانتره مس است و ظرفیت خروجی به حدود ۶۵۰,۰۰۰ تن کاتد مس و ۵۰ تا ۶۰ تن طلا خواهد رسید.

منبع: mining.com

➤ به گزارش کمیسیون مس شیلی معادن مس قدیمی شیلی برای حفظ تولید مس خود به دلیل کاهش کیفیت سنگ معدن نیاز به افزایش مصرف آب و انرژی در دهه آینده دارند. این گزارش نشان می-دهد تقاضای برق مصرفی بخش مس ۳۱.۴ درصد و تولید مس ۲۰.۷ درصد افزایش یابد.

منبع: mining.com

➤ صادرات مس تصفیه شده چین به اوج ۸ ساله خود رسیده و صادرات بالا همچنان ادامه دارد. چین در ماه می ۷۳۸۶۰ تن مس تصفیه شده صادر کرد که ۲۰۰.۷۰ درصد نسبت به آوریل افزایش داشت که بالاترین میزان صادرات از جولای ۲۰۱۶ بود. فعالان بازار کمبود تقاضا در بازار داخلی چین را دلیل افزایش صادرات می دانند.

منبع: mining.com



➤ برخی تحلیلگران اذعان دارند در سال هایی که هاوینگ بیت کوین اتفاق می افتد، بیت کوین به طور متوسط حدود ۱۲۵ درصد افزایش می یابد. اگر این موضوع در سال جاری صادق باشد، به این معنی است که می توانیم انتظار داشته باشیم که بیت کوین تا پایان سال ۲۰۲۴ به نزدیک به ۱۰۰،۰۰۰ دلار برسد.

منبع: yahoofinance

➤ وزارت خزانه داری ایالات متحده روز جمعه قانونی را نهایی کرد که بر اساس آن کارگزاران ارزهای دیجیتال، از جمله صرافی ها و پردازشگرهای پرداخت، باید اطلاعات جدید در مورد فروش و مبادلات دارایی های دیجیتال کاربران را گزارش دهند.

منبع: yahoofinance

➤ بر اساس پرسش نامه های جدیدی که شورای جهانی طلا منتشر کرده، بیش از هشت نفر از هر ده نفر (۸۱ درصد) از پاسخ دهندگان اظهار داشته اند که انتظار دارند مدیران، ذخایر طلای خود را در ۱۲ ماه آینده افزایش دهند. این بالاترین رکورد ثبت شده از زمان نظرسنجی سالانه ما در سال ۲۰۱۹ است.

منبع: شورای جهانی طلا



انتظار می رود قیمت در محدوده حمایتی تراز ۵درصد فیبو مطابق با ۹۵۰۰ دلار طی هفته آتی حمایت گردد .



♦ بخش سوم

ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه

تغییرات قیمت نماد فملی



گروه مالی کیمیا

بازدهی از ابتدای سال	۴.۳۸%
بازدهی هفته اخیر	۳.۹۲%

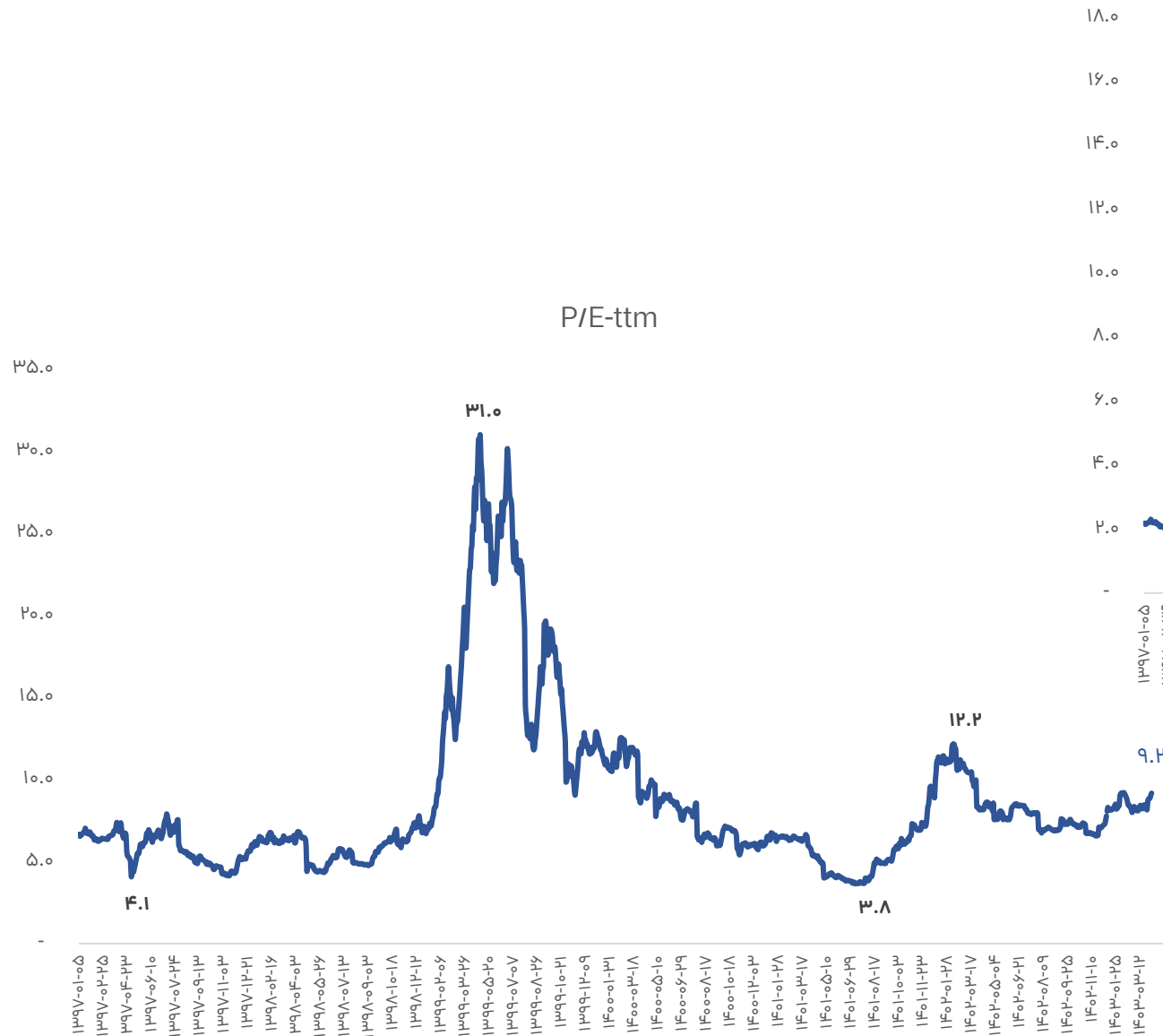


نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر

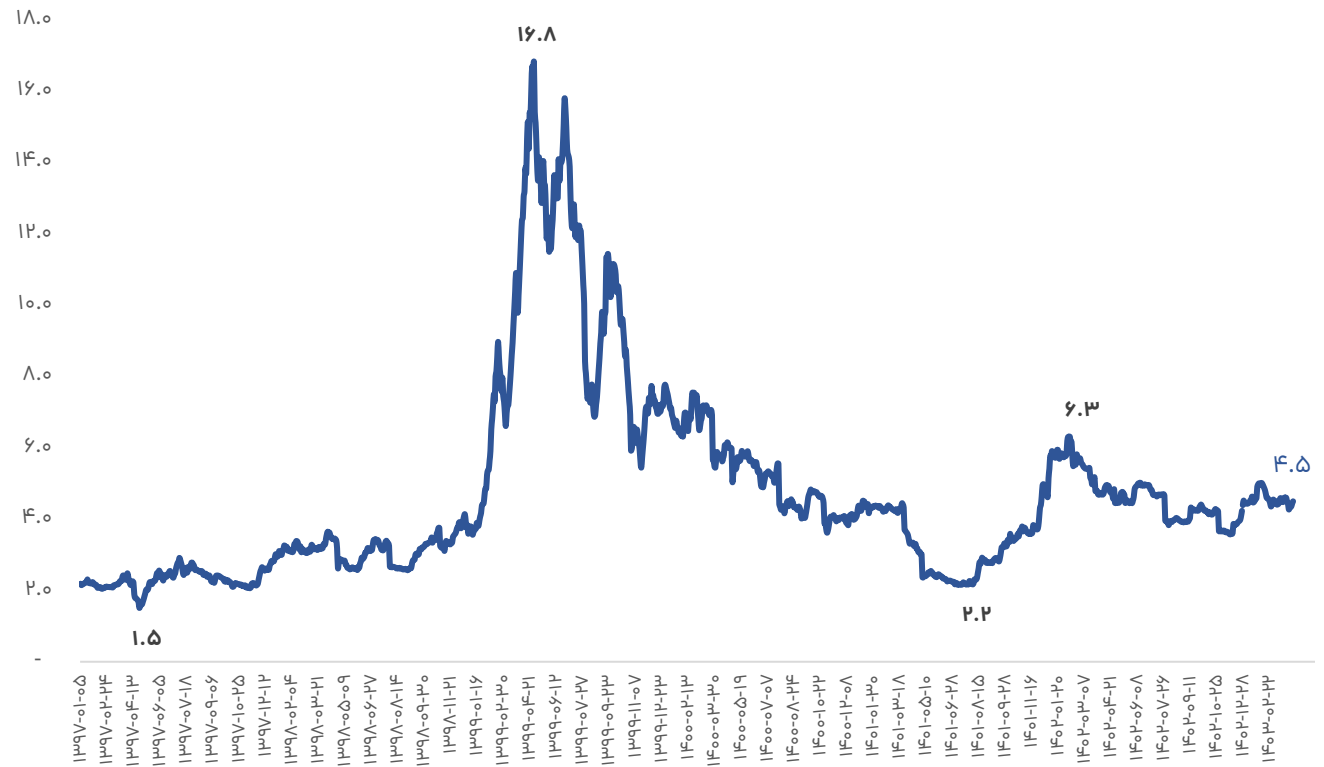


گروه مالی کیمیا

P/E-ttm

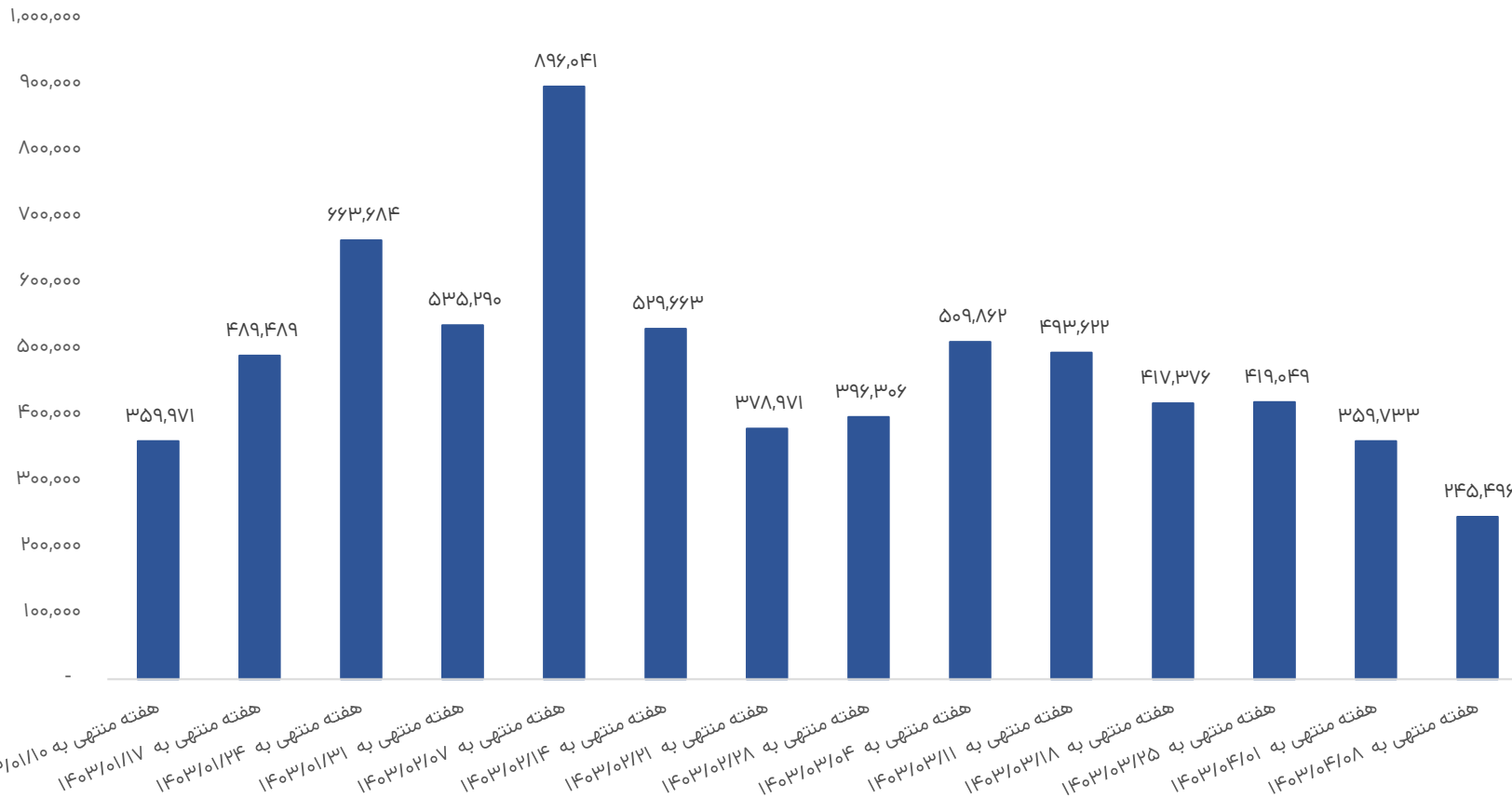


P/S





میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

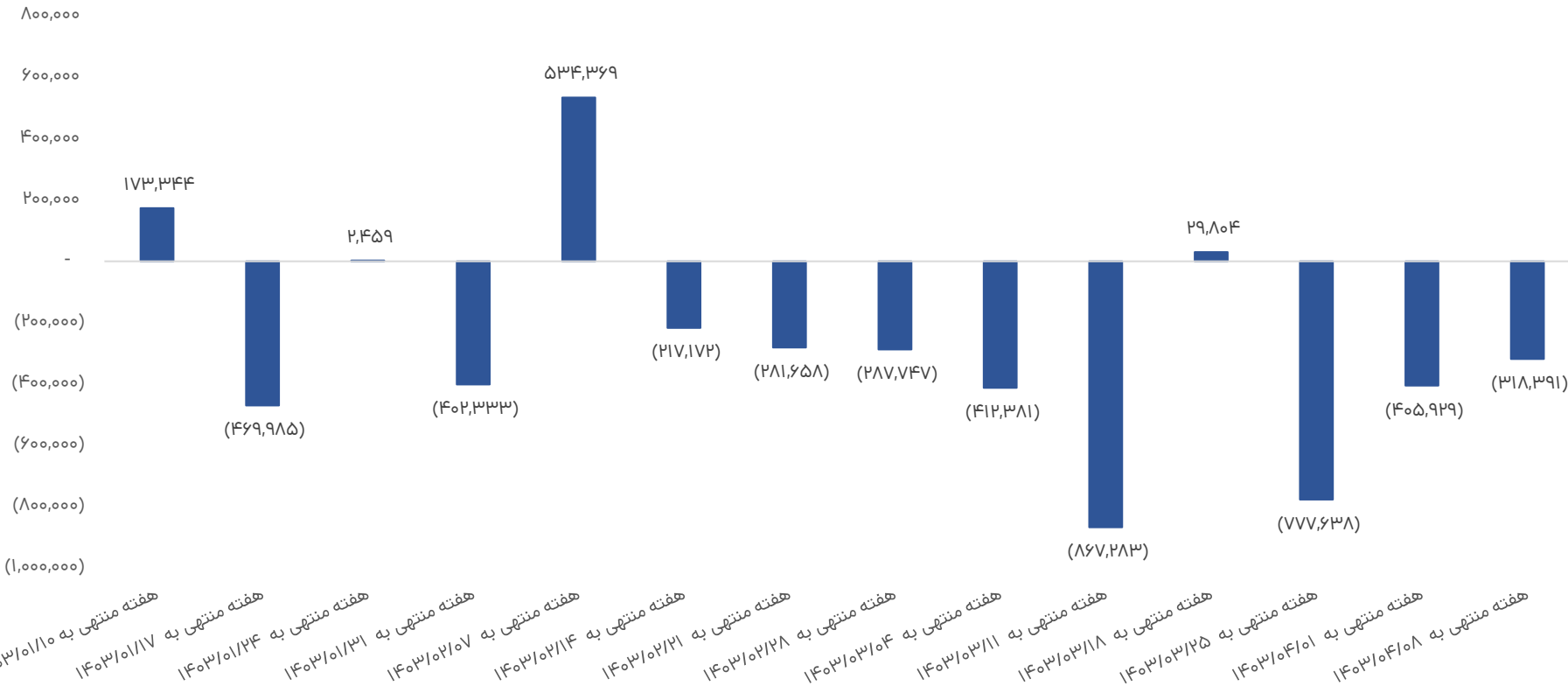


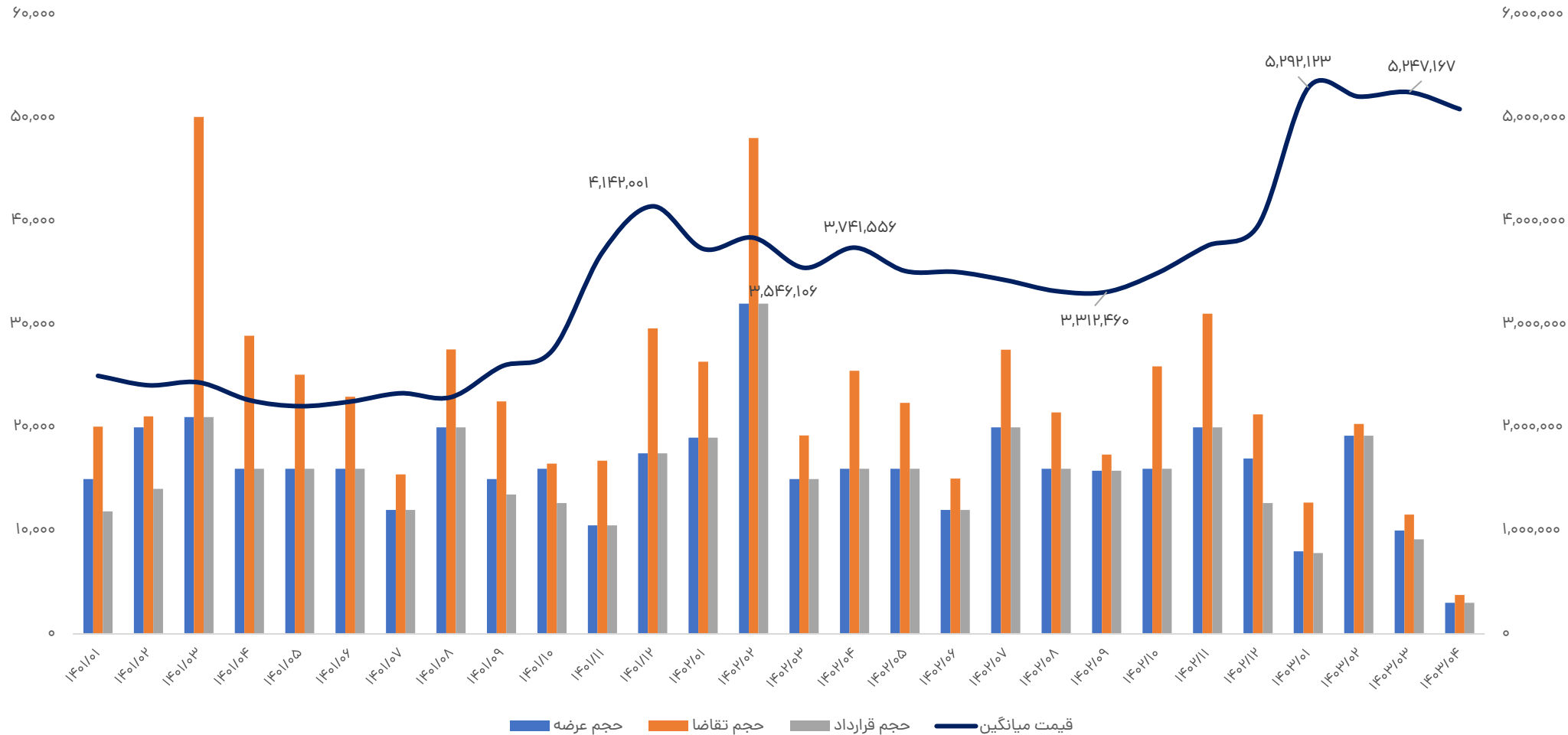
طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۰۸ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۲۴۵.۴۹۶ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با کاهش مواجه گردید.



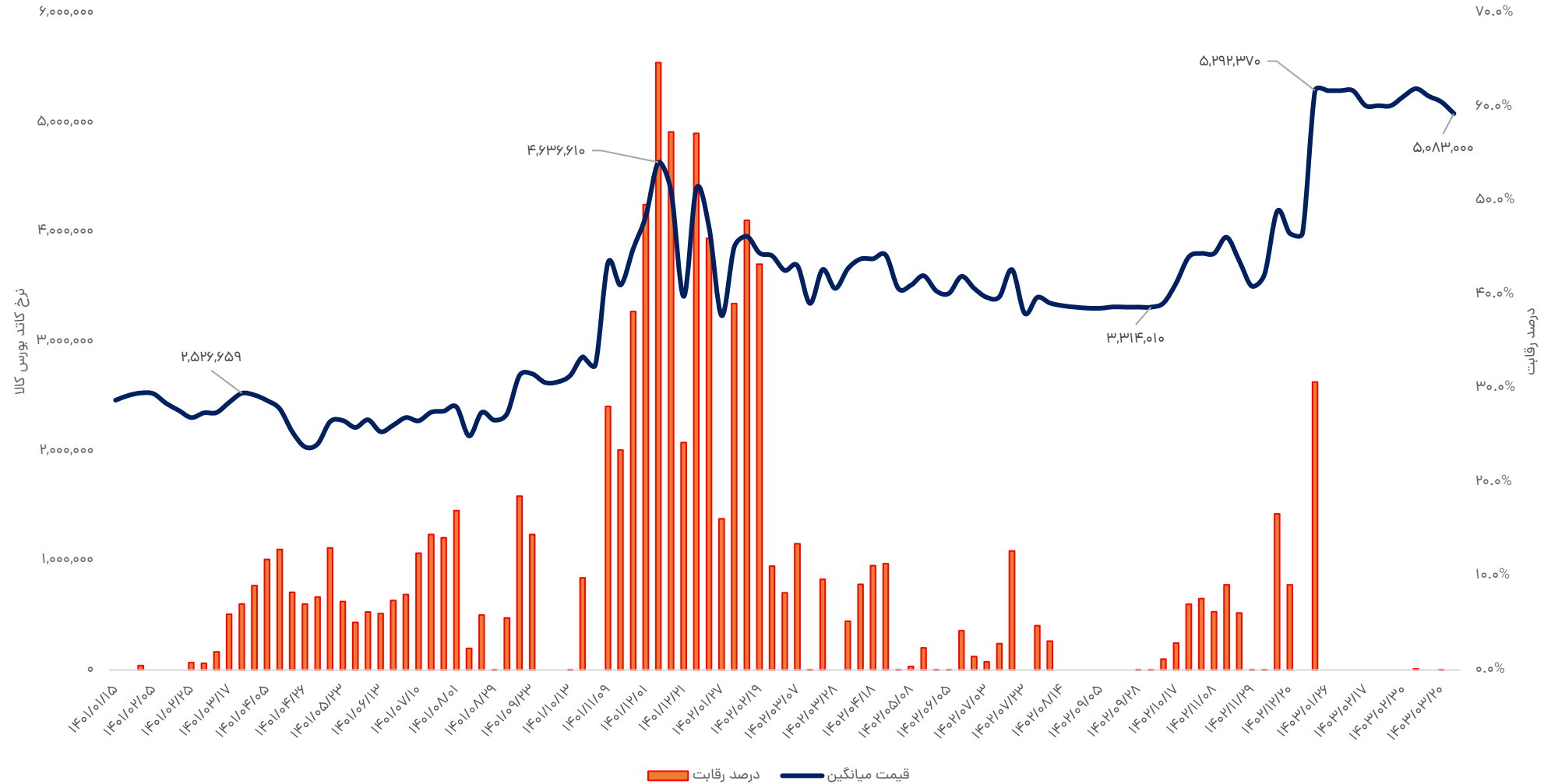
طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۰۸، خروج پول اشخاص حقیقی از نماد فملی به میزان ۳۱۸.۳۹۱ میلیون ریال بوده است.

ورود پول (میلیون ریال)





در نمودار بالا روند معاملات ماهانه کاتد مس در بورس کالا آورده شده است. در ماه خرداد مجموعاً ۱۰۰۰۰ تن عرضه کاتد توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۱۱۵۰۰ تن بود و با میانگین قیمت ۵,۲۴۷,۱۶۷ ریال معامله گردید.



این هفته کاتد مس با قیمت ۵.۰۸۳.۰۰۰ ریال بر کیلوگرم معامله گردید که نسبت به معاملات هفته گذشته با کاهش دو درصدی مواجه گردید. همچنین کل حجم عرضه شده با رقابتی اندک نزدیک به قیمت پایه معامله گردید.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۰۲۱ - ۵۸۶۱۹۰۰۰

دور نگار: ۰۲۱ - ۸۰۴۷۲۹۳