



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۷

منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۱۵



♦ بخش اول

بازار سرمایه



شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷

بازدهی از ابتدای سال	-۵.۸%
بازدهی هفته اخیر	۰.۴%

۳,۰۷۰,۰۰۰

۲,۵۷۰,۰۰۰

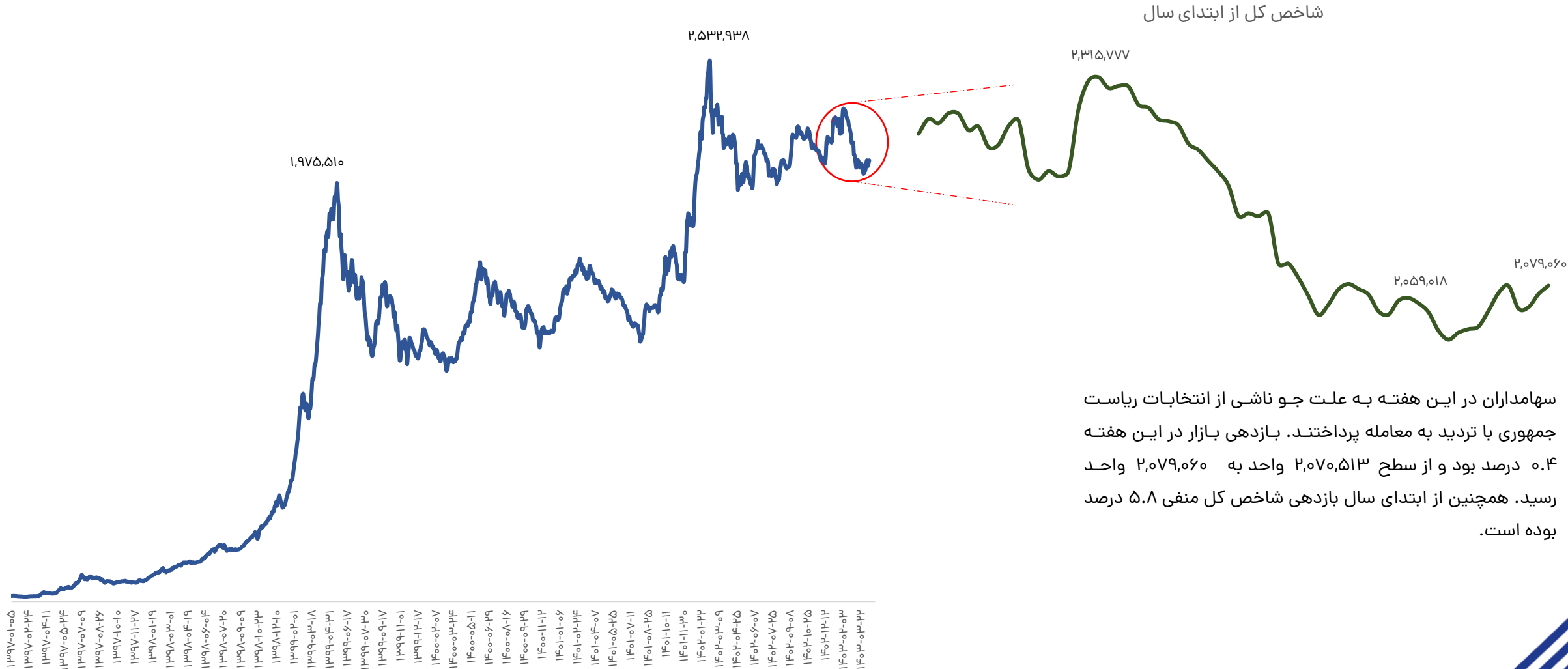
۲,۰۷۰,۰۰۰

۱,۵۷۰,۰۰۰

۱,۰۷۰,۰۰۰

۵۷۰,۰۰۰

۷۰,۰۰۰

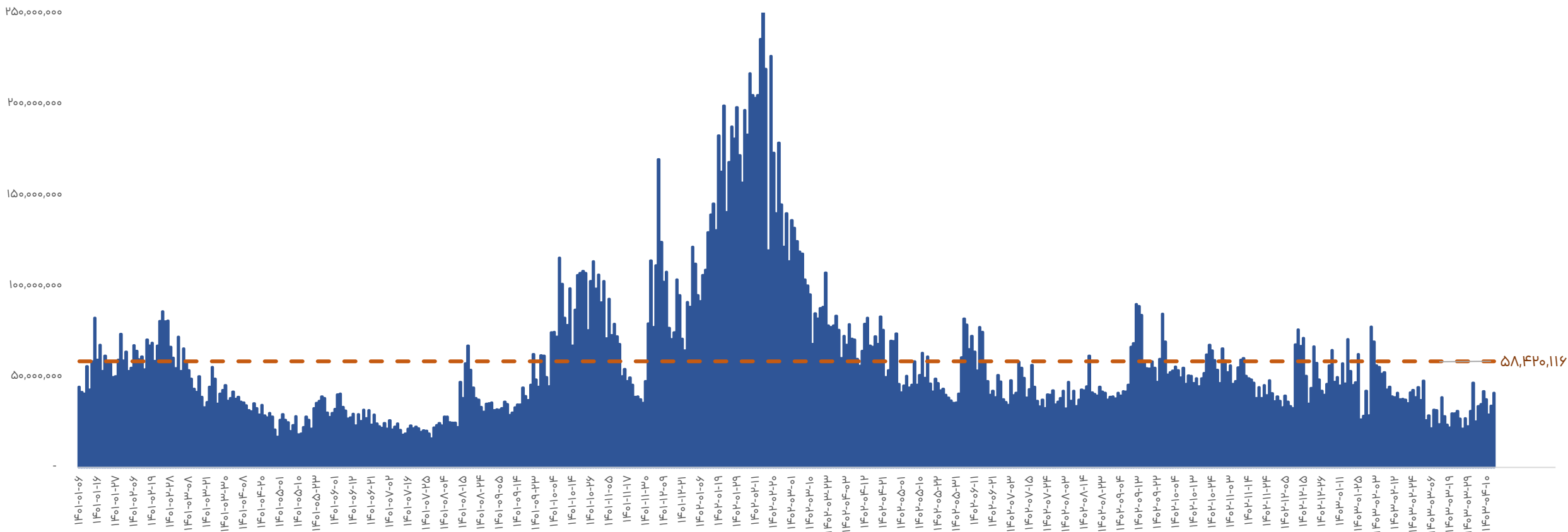


سهامداران در این هفته به علت جو ناشی از انتخابات ریاست جمهوری با تردید به معامله پرداختند. بازدهی بازار در این هفته ۰.۴ درصد بود و از سطح ۲,۰۷۰,۵۱۳ واحد به ۲,۰۷۹,۰۶۰ واحد رسید. همچنین از ابتدای سال بازدهی شاخص کل منفی ۵.۸ درصد بوده است.



ارزش معاملات خرد در این هفته نوسان اندکی نسبت به هفته قبل داشت و همچنان با توجه با ابهامات موجود سرمایه گذاران با تردید معامله می‌کنند. ارزش معاملات خرد همچنان از میانگین دو سال گذشته پایین تر می‌باشد ولی انتظار بهبود آن از هفته بعد وجود دارد.

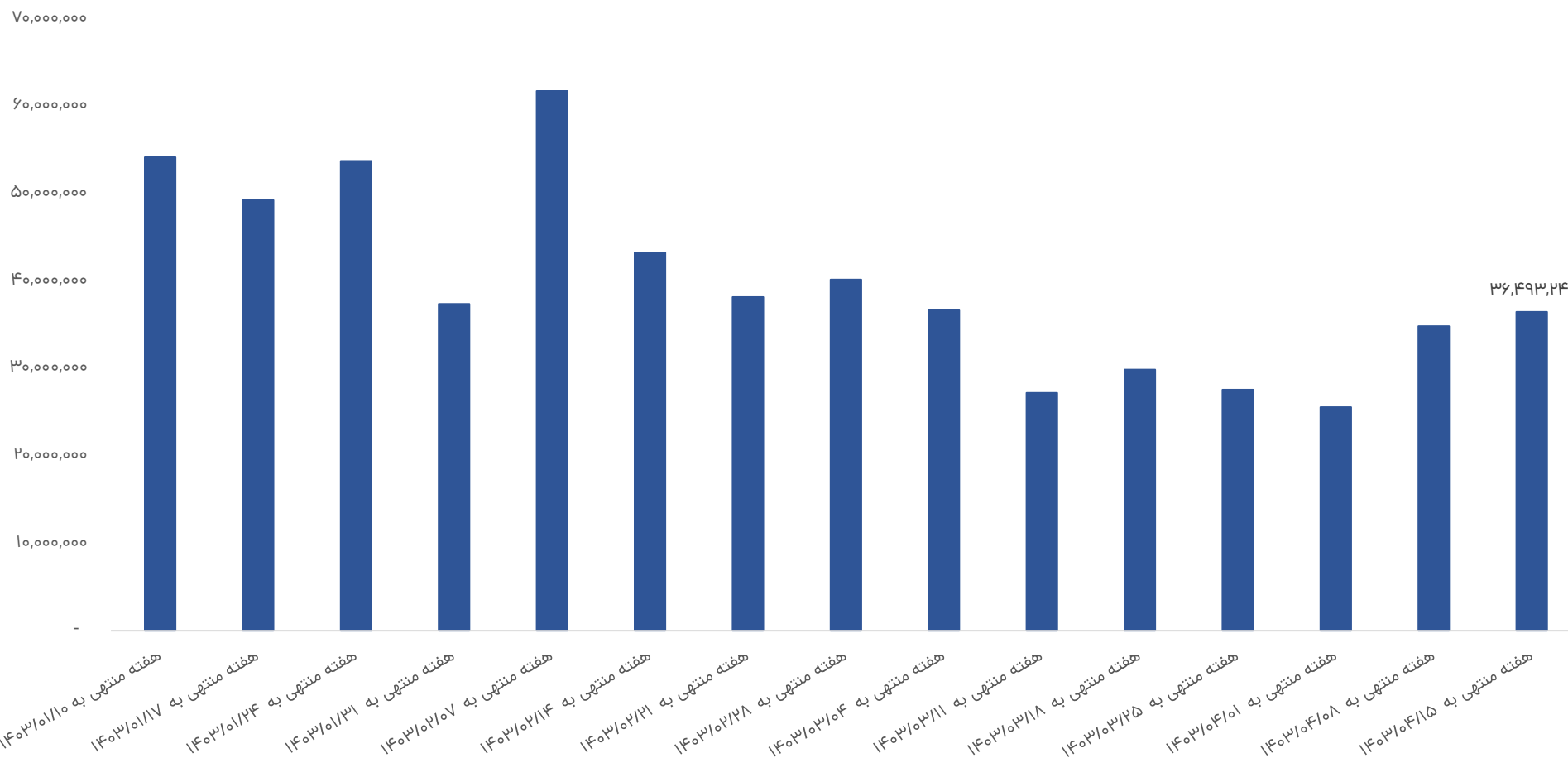
ارزش معاملات خرد از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال



میانگین ارزش معاملات هفتگی

میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته به ۳۶,۴۹۳,۲۴۷ میلیون ریال رسید و نسبت به هفته گذشته با رشد ۵ درصدی مواجه گردید.

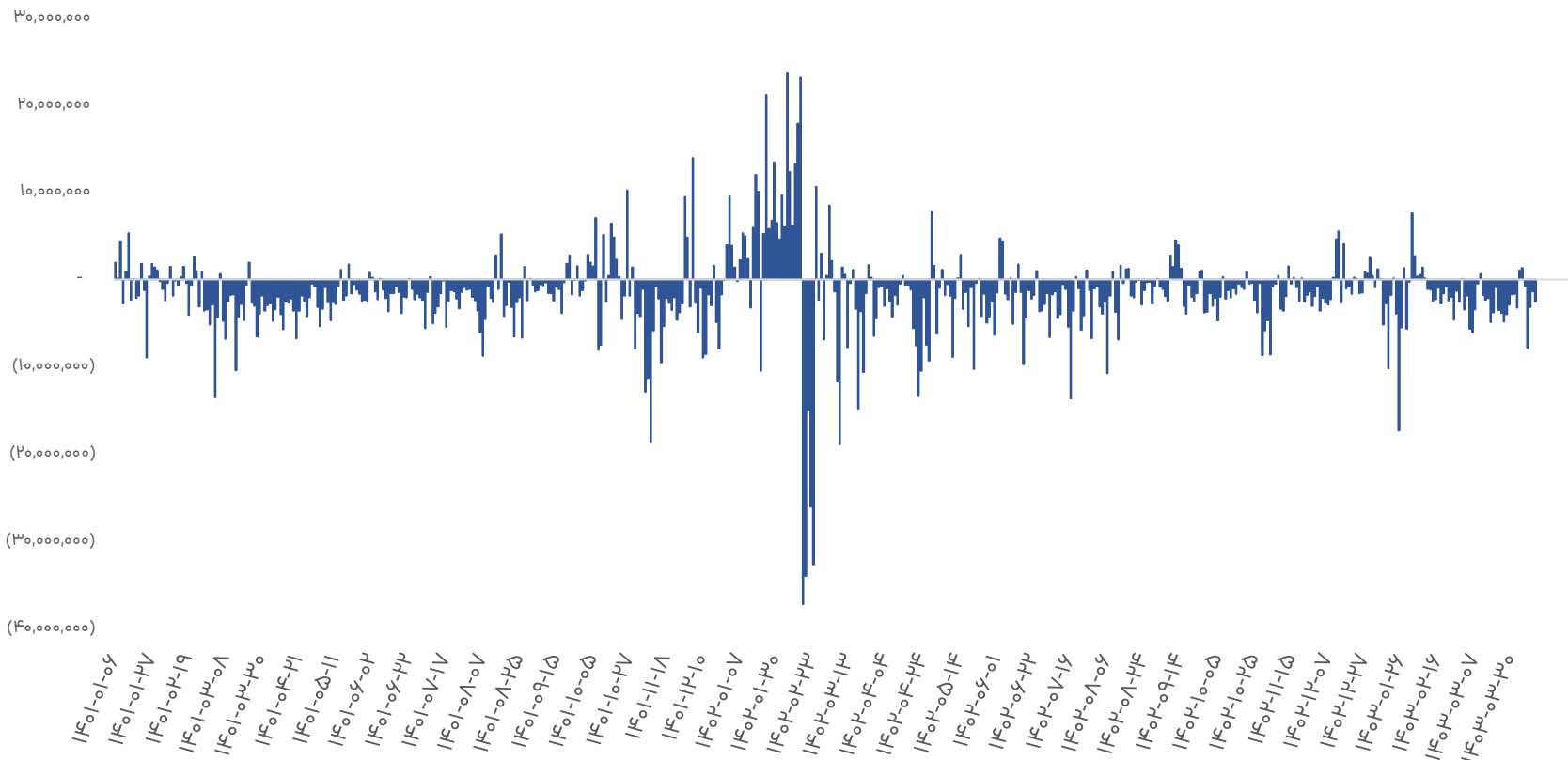
ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال





میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۷۰۴,۷۹۱,۰۰۴
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۱۳۴,۹۱۸,۲۵۵
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	-۱۵,۵۵۷,۹۵۲

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



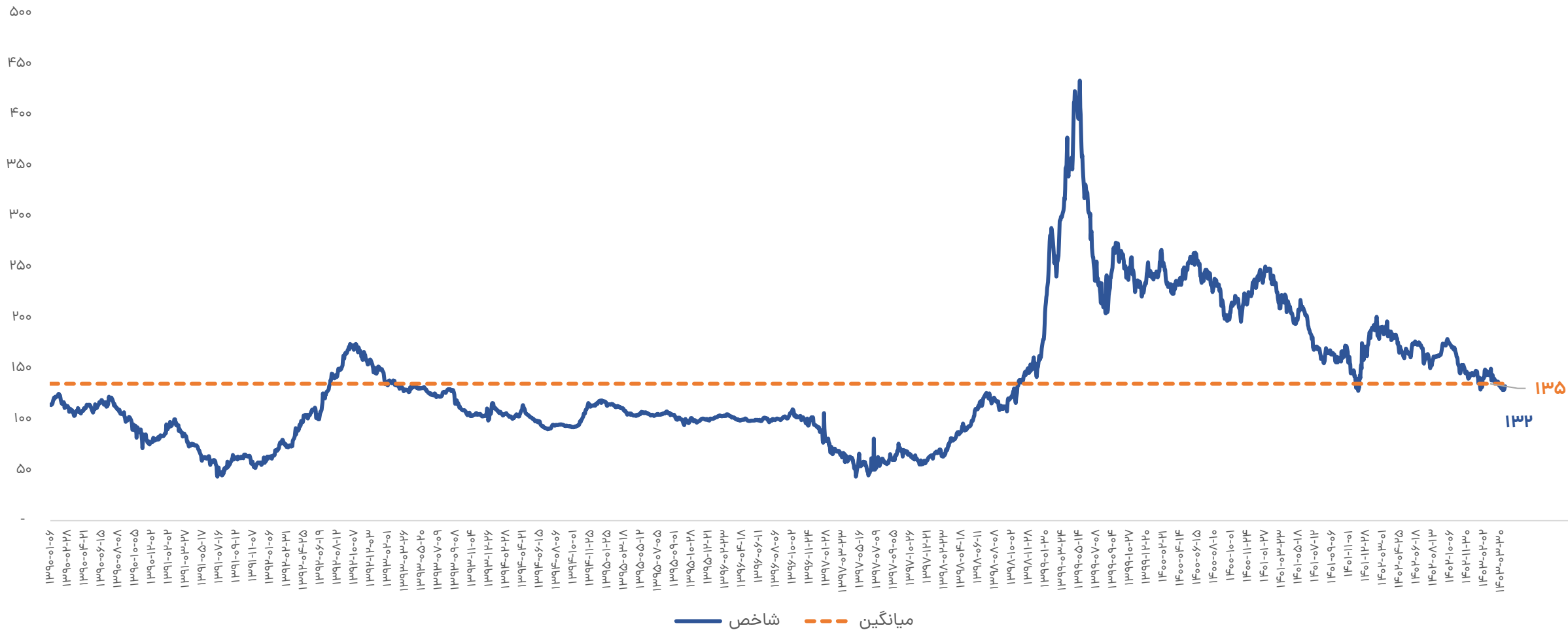
هفته گذشته اشخاص حقیقی ۱۵,۵۵۷,۹۵۲ میلیون ریال پول از بازار سهام خارج کردند. خالص خروج نقدینگی اشخاص حقیقی در سال جاری تاکنون بیش از ۱۳ همت بوده است.

همچنین از تاریخ ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ و با شروع اصلاح شاخص کل ، میزان خروج پول اشخاص حقیقی از ۷۰ همت فراتر رفته است.



در این هفته ارزش بازار سرمایه بر حسب دلار بدون تغییری محسوس نسبت به هفته گذشته در محدوده ۱۳۲ میلیارد دلار باقی ماند.

ارزش دلاری بازار سرمایه از ابتدای سال ۱۳۹۰ - میلیارد دلار

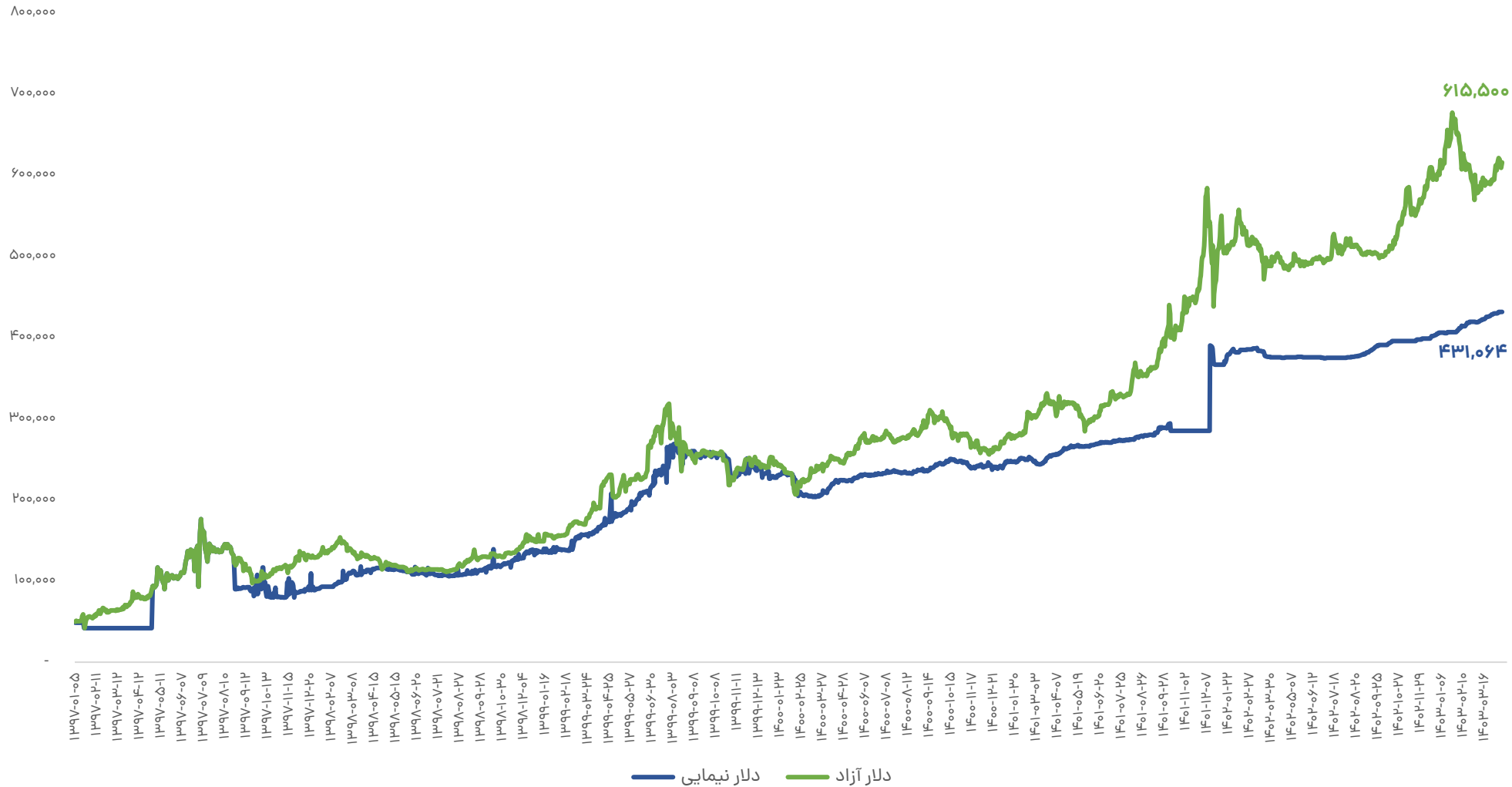


روند دلار نیمایی و دلار آزاد



گروه مالی کیمیا

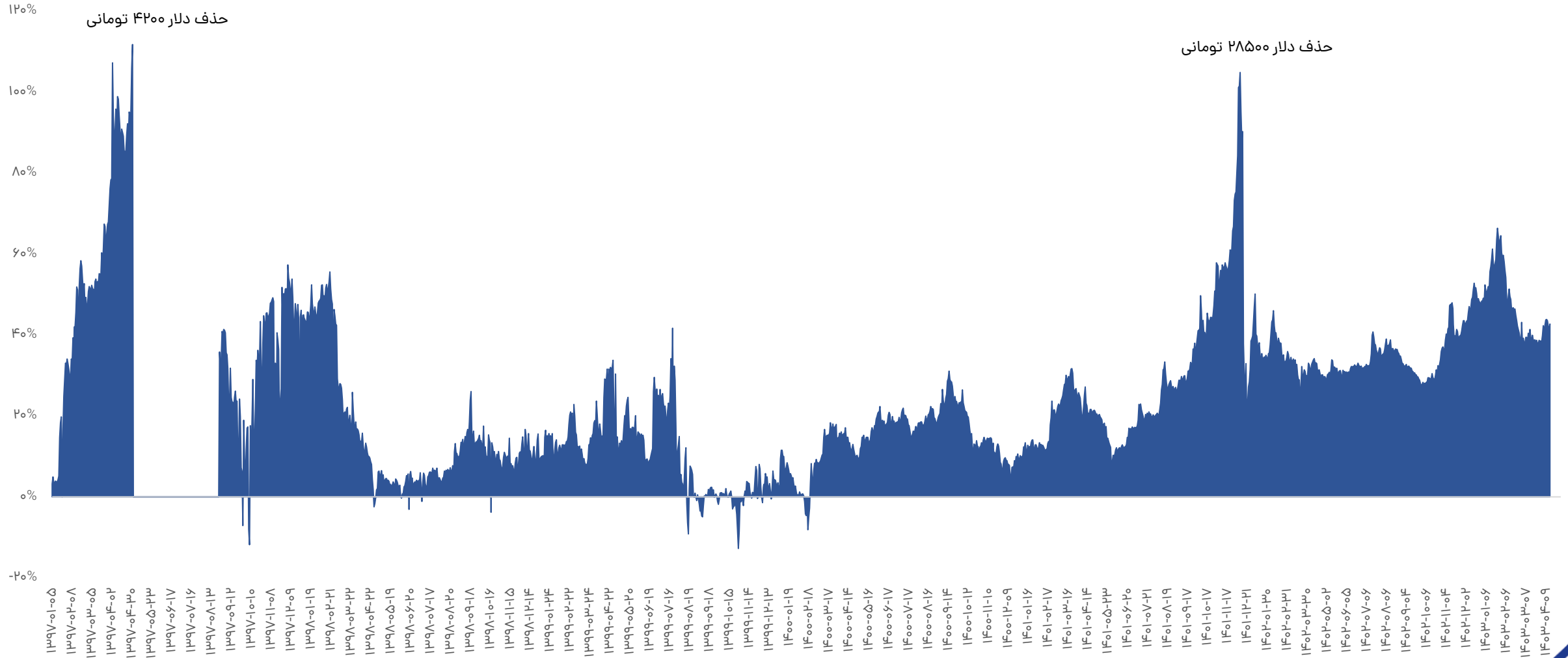
دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۶۱۵,۵۰۰ ریال رسید که نسبت به هفته گذشته شاهد تغییر خاصی نداشت. دلار نیما نیز در این هفته تنها ۸۹۰ ریال افزایش یافت.





اختلاف میان دلار نیمای و بازار آزاد این هفته به ۴۳ درصد افزایش یافت.

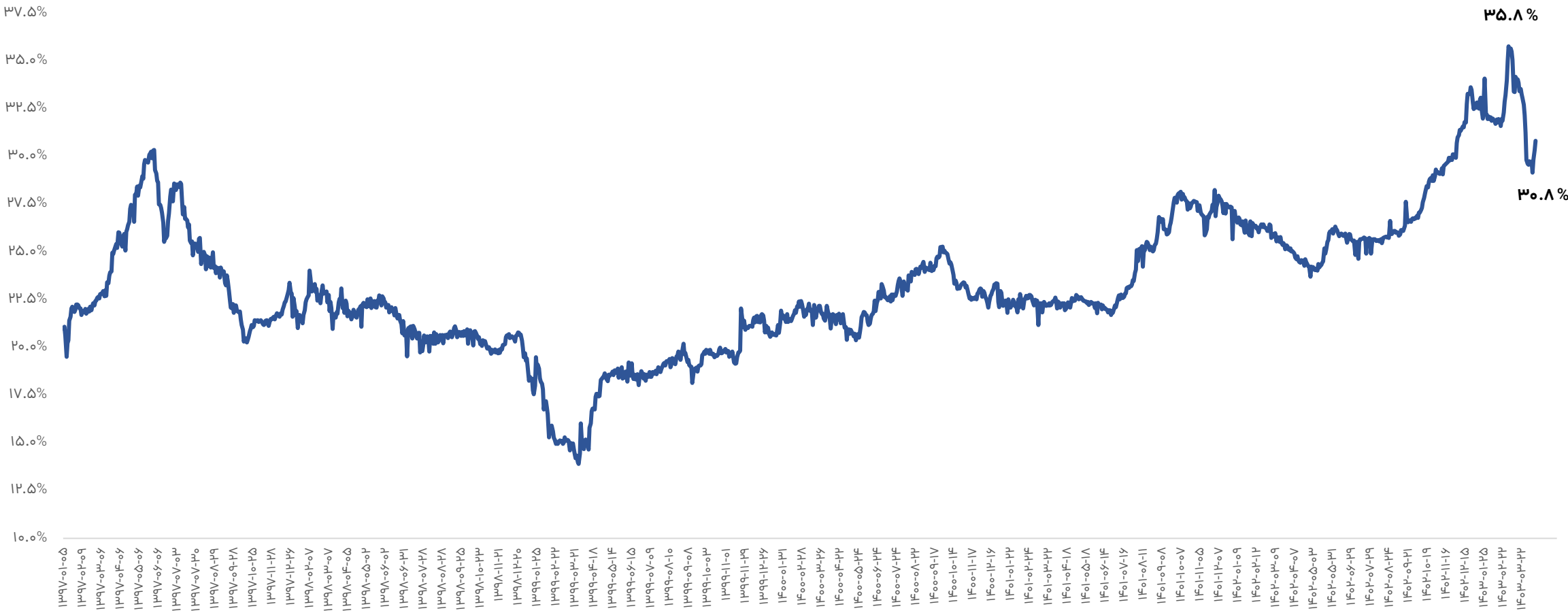
اختلاف دلار آزاد و نیمای





پس از کاهش شدید نرخ اوراق از نزدیک ۳۶ درصد به زیر ۳۰ درصد شاهد رشد آن در هفته گذشته تا سطح ۳۰.۸ درصد بودیم.

نرخ بهره بدون ریسک



♦ بخش دوم

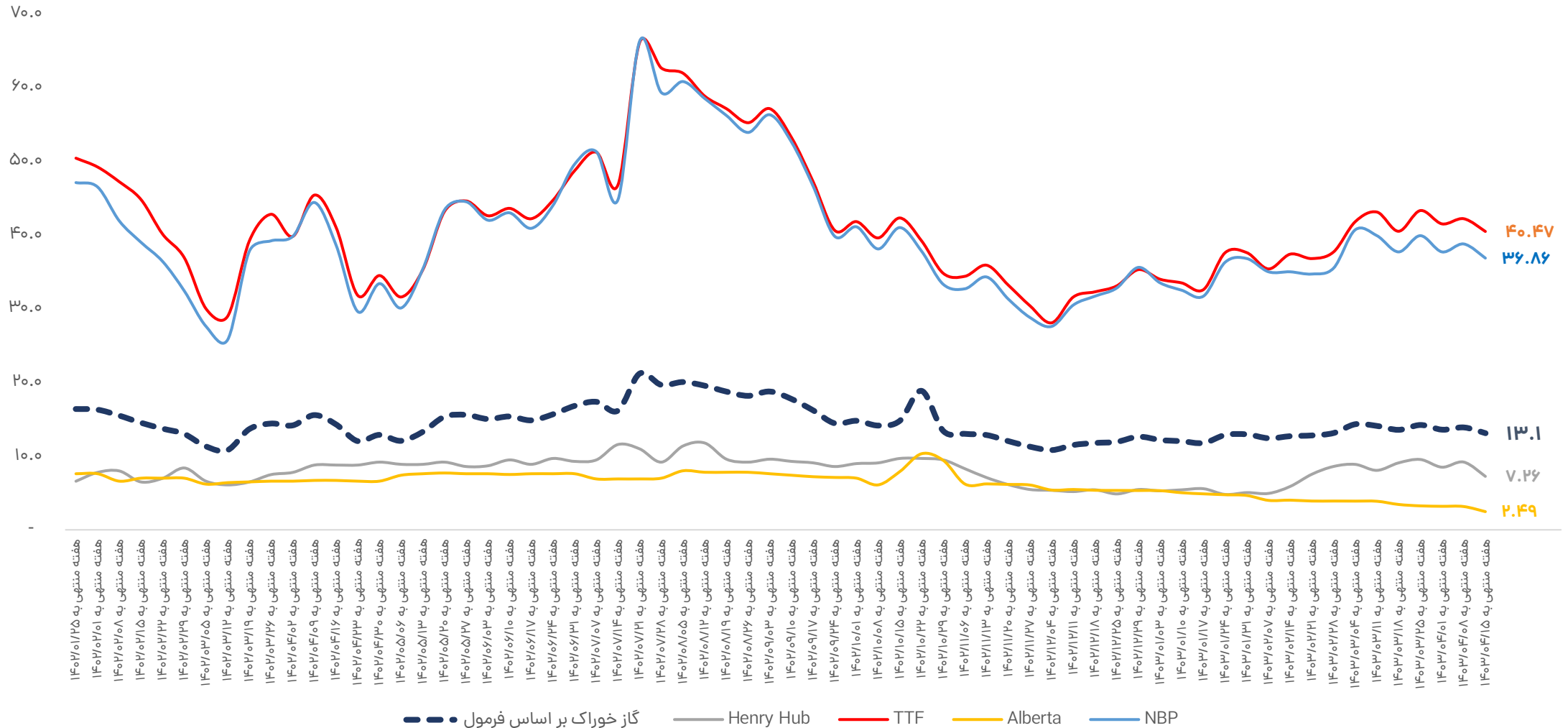
تغییرات قیمت جهانی مس و سایر کالاها

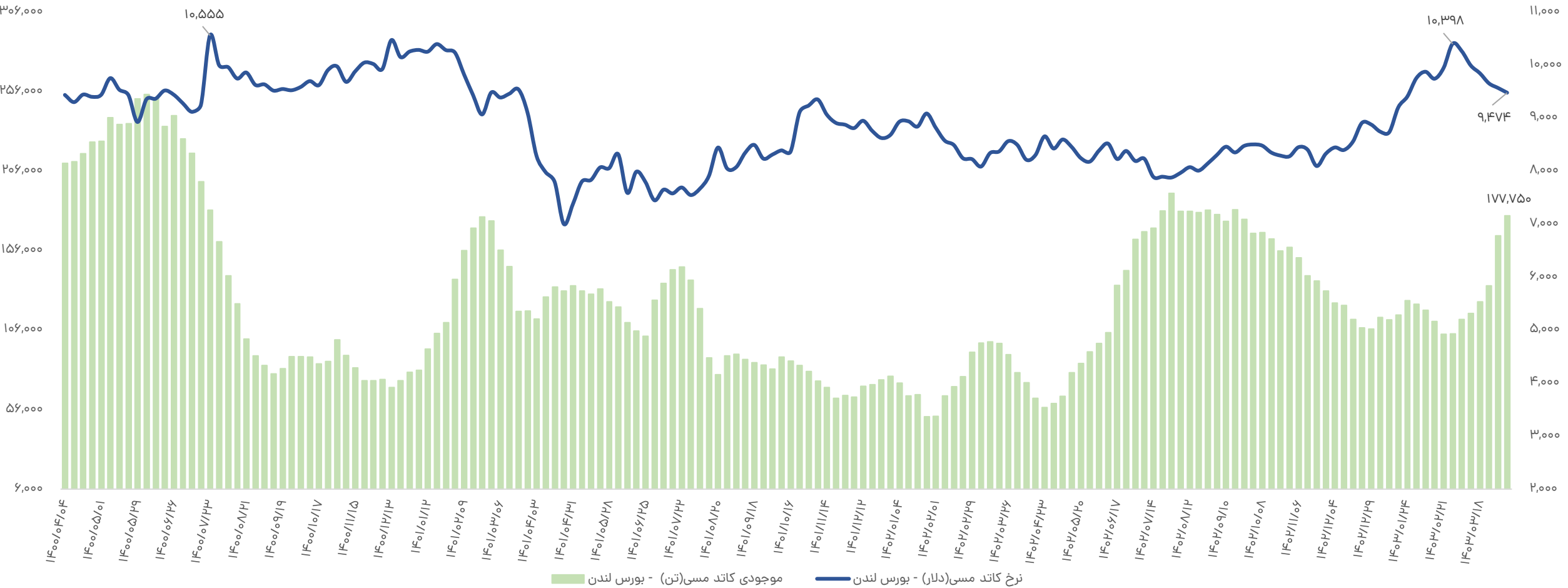


نام کالا	قرارداد	آخرین نرخ (دلار)	%W	%M	%Y
کاتد مسی	بورس لندن	۹,۸۰۹	۳.۵	۱.۷	۱۰.۵
شمش آلومینیوم	بورس لندن	۲,۵۳۶	۰.۵	۰.۶	۱۱.۸
بلوم و بیلت فولادی	ایران FOB	۴۸۰	۰.۰	۰.۰	۰.۰
اسلب فولادی	ایران FOB	۴۵۶	۰.۰	۰.۰	-۳.۴
سنگ آهن ۶۲%	چین CFR	۱۱۱	۳.۷	۳.۷	۰.۰
ورق سرد	CIS دریای سیاه FOB	۶۳۸	-۰.۳	-۰.۳	-۵.۱
ورق گرم	CIS دریای سیاه FOB	۵۴۵	-۰.۵	-۰.۵	-۱.۸
نفت برنت	برنت	۸۷	۰.۱	۰.۹	-۱.۰
استایرن منومر داخلی	چین - Spot	۱,۱۳۴	۰.۵	-۰.۴	-۱.۰
اتیلن	شمال شرق آسیا CFR	۸۵۰	۰.۵	۱.۰	-۸.۴
پلی اتیلن سبک تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۱۴۵	-۰.۸	۱.۲	۱۳.۰
پلی اتیلن سنگین فیلم	خلیج فارس FOB	۹۵۴	۰.۴	۰.۰	۰.۷
پروپیلن	چین CFR	۸۷۵	۰.۶	۱.۷	۳.۶
پلی پروپیلن تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۰۸۸	۰.۰	۰.۰	-۳.۹
پلی وینیل کلراید	چین CFR	۸۷۵	-۰.۳	۲.۹	۱۱.۰
نفتا	ژاپن CFR	۷۱۹	۲.۳	۶.۴	-۰.۷
MTBE	سنگاپور FOB	۸۷۹	۱.۹	۶.۷	-۷.۶
پارازاپیلین	کره FOB	۱,۰۲۷	۰.۹	۰.۹	۰.۶
بنزن	کره FOB	۱,۰۴۰	۴.۲	-۰.۴	-۰.۶
آلکیل بنزن خطی	خلیج فارس FOB	۱,۴۱۵	-۱.۷	-۱.۷	۰.۴
بوتادین	چین CFR	۱,۵۸۰	۰.۰	۵.۳	۱۳.۷
تولوئن	چین CFR	۹۱۵	۱.۲	-۰.۸	۱.۳
متانول	چین CFR	۲۹۱	۱.۰	-۱.۷	-۲.۷
اوره	چین FOB	۳۲۷	۱.۹	۱.۹	-۳.۸
پلی اتیلن ترفتالات	جنوب شرق آسیا FOB	۹۶۰	-۰.۶	-۰.۶	۰.۵
اکریلو نیتریل بوتادین استایرن	چین CFR	۱,۴۳۵	۰.۰	-۰.۷	۴.۰
اتانول	رتردام FOB	۷۹۳	-۰.۶	-۰.۴	۷.۷
بنزین پیرولیز	خلیج فارس FOB	۶۱۹	۳.۲	۷.۵	۲.۰
میعانات گازی	پارس جنوبی	۷۸	۱.۷	۷.۳	-۲.۳
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 ۱۳.۱ سنت در هر مترمکعب رسیده است که نسبت به هفته گذشته با کاهش مواجه گردید. باتوجه به نرخ دلار نیما ۴۳۱,۰۶۴ ریالی نرخ هر متر مکعب گاز حدود ۵۶,۴۶۹ 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	۳۷,۵۳۳	-۲%	-۱%	۳۷,۵۳۳	۰%
گندله	۵۱,۹۰۵	-۱%	۱%	۵۱,۹۰۵	۰%
آهن اسفنجی	۱۲۰,۶۹۷	-۲%	-۵%	۱۲۱,۱۶۱	۰%
بیلت	۲۲۶,۶۶۹	۲%	۶%	۲۲۱,۴۴۶	۲%
ورق گرم	۳۱۶,۷۸۹	۵%	-۲%	۳۱۶,۷۸۹	۰%
ورق گالوانیزه	۴۶۵,۵۵۹	۵%	۳%	۴۶۲,۶۰۳	۱%
شمش آلومینیوم	۱,۴۰۹,۰۶۷	-۱%	-۱%	۱,۱۴۱,۴۲۱	۲۳%
کاتد	۵,۰۶۶,۰۱۳	۰%	-۳%	۵,۰۶۶,۰۰۰	۰%
شمش روی	۱,۴۱۳,۷۶۷	۳%	۰%	۱,۴۱۳,۱۶۱	۰%
سیمان فله	۱۰,۶۱۴	-۴%	۵%	۹,۹۶۶	۷%
سیمان کیسه	۱۱,۸۸۸	-۲%	۵%	۱۱,۱۴۹	۷%



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده ماهانه	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۶۱%	۲۹۸,۸۰۸	-۲%	۴%	۴۸۰,۱۳۴	پت
۰%	۱۲۶,۹۶۵	۱۶%	۱%	۱۲۶,۹۶۵	اوره
۹%	۴۷۳,۴۳۹	-۳%	۲%	۵۱۶,۶۷۷	پلی پروپیلن
۵%	۳۷۲,۲۳۹	-۴%	-۴%	۳۸۹,۹۴۸	PVC
۲%	۳۳۳,۶۹۳	-۳%	-۳%	۳۳۹,۶۷۱	روغن پایه
۲%	۳۹۳,۰۷۶	۴%	۱%	۴۰۰,۵۵۴	پلی اتیلن
۰%	۵۸۱,۴۴۳	-۳%	-۱%	۵۸۱,۴۴۳	LAB
۰%	۶۱۸,۰۰۰	-۱%	۰%	۶۱۸,۰۰۰	دوده
۰%	۱۵۹,۴۷۲	۱%	-۲%	۱۵۹,۴۷۲	قیر
۱%	۱۴۴,۷۰۸	۱%	۱%	۱۴۵,۸۴۰	وکیوم باتوم
۰%	۲۱۸,۶۸۰	-۳%	۰%	۲۱۸,۶۸۰	لوبکات

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.





➤ بهترین عملکرد هفتگی مس با بیش از ۵ درصد بازدهی از ماه می به دلیل داده های ضعیف از بازار کار آمریکا و کانادا و احتمال کاهش نرخ بهره

منبع: tradingeconomic

➤ انتظارات مثبت از نشست آتی حزب کمونیست چین در اواسط ماه جولای به دلیل تصویب بسته های حمایتی در حوزه انرژی های تجدید پذیر و مسکن

منبع: mining.com

➤ طبق داده های بورس شانگهای ذخایر مس در چین برای سومین هفته متوالی پس از ثبت افزایش شدید از آغاز سال ۲۰۲۴ کاهش یافت. موجودی مس در انبارهای تحت نظارت LME به ۱۸۶۴۵۰ تن رسید که بالاترین میزان از اکتبر ۲۰۲۳ است

منبع: mining.com

➤ داده های ضعیف از بازار کار آمریکا و دستمزدها و انتظار کاهش نرخ بهره سبب افزایش قیمت طلا در هفته قبل گردید.

منبع: investing.com



مطابق با تحلیل هفته های قبل به کف ۹۵۰۰ دلار واکنش مثبت نشان داد. به نظر می رسد حرکت جدید در قالب موج ۵ تا محدوده ۱۰۵۰۰ دلار ادامه یابد.



♦ بخش سوم

ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه



تغییرات قیمت نماد فملی

بازدهی از ابتدای سال	۶.۵۷%
بازدهی هفته اخیر	۲.۱۰%

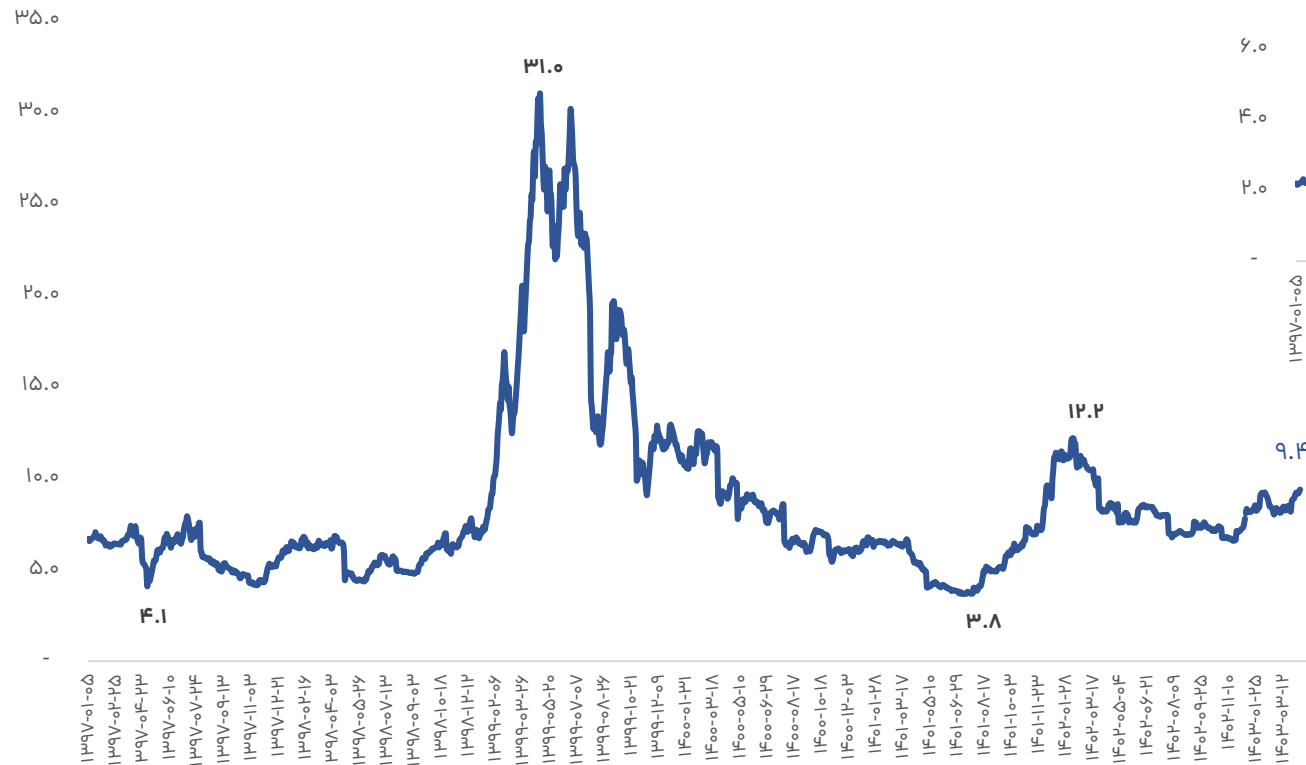


نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر

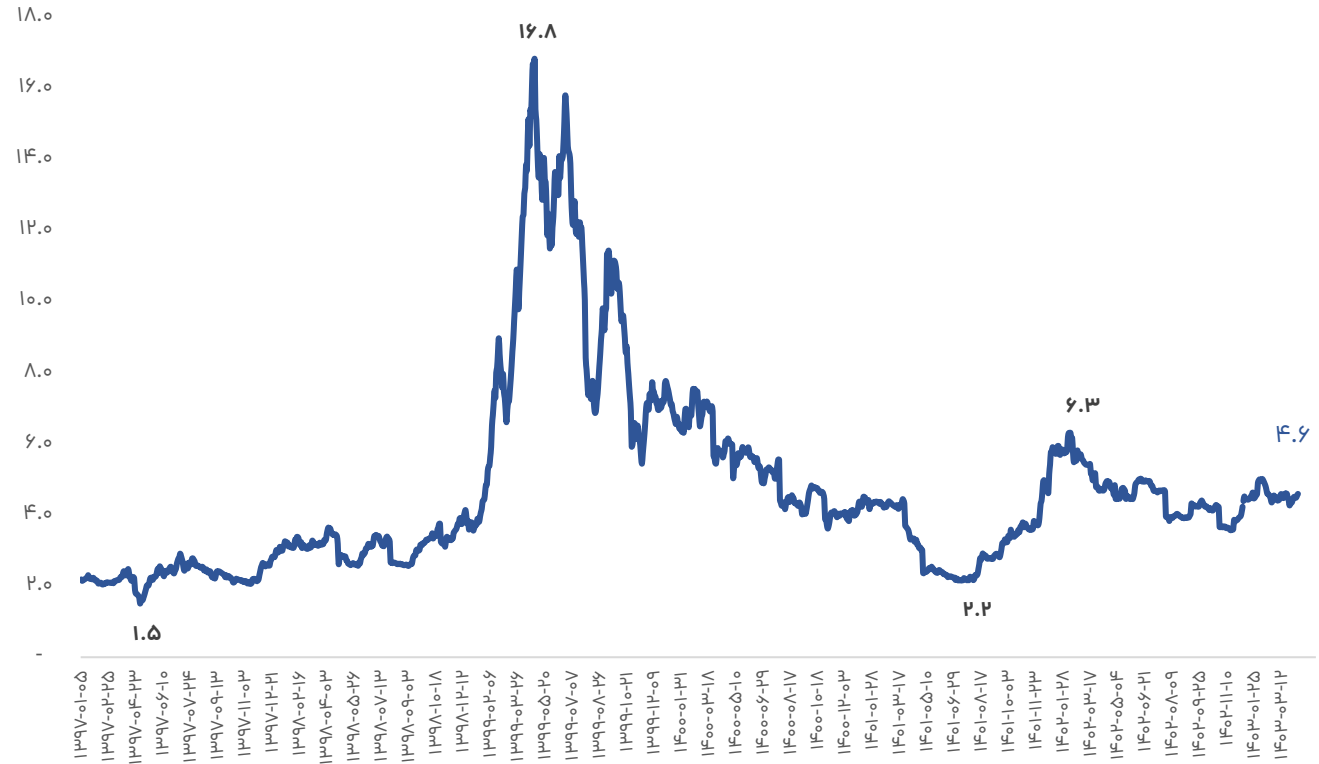


گروه مالی کیمیا

P/E-ttm



P/S

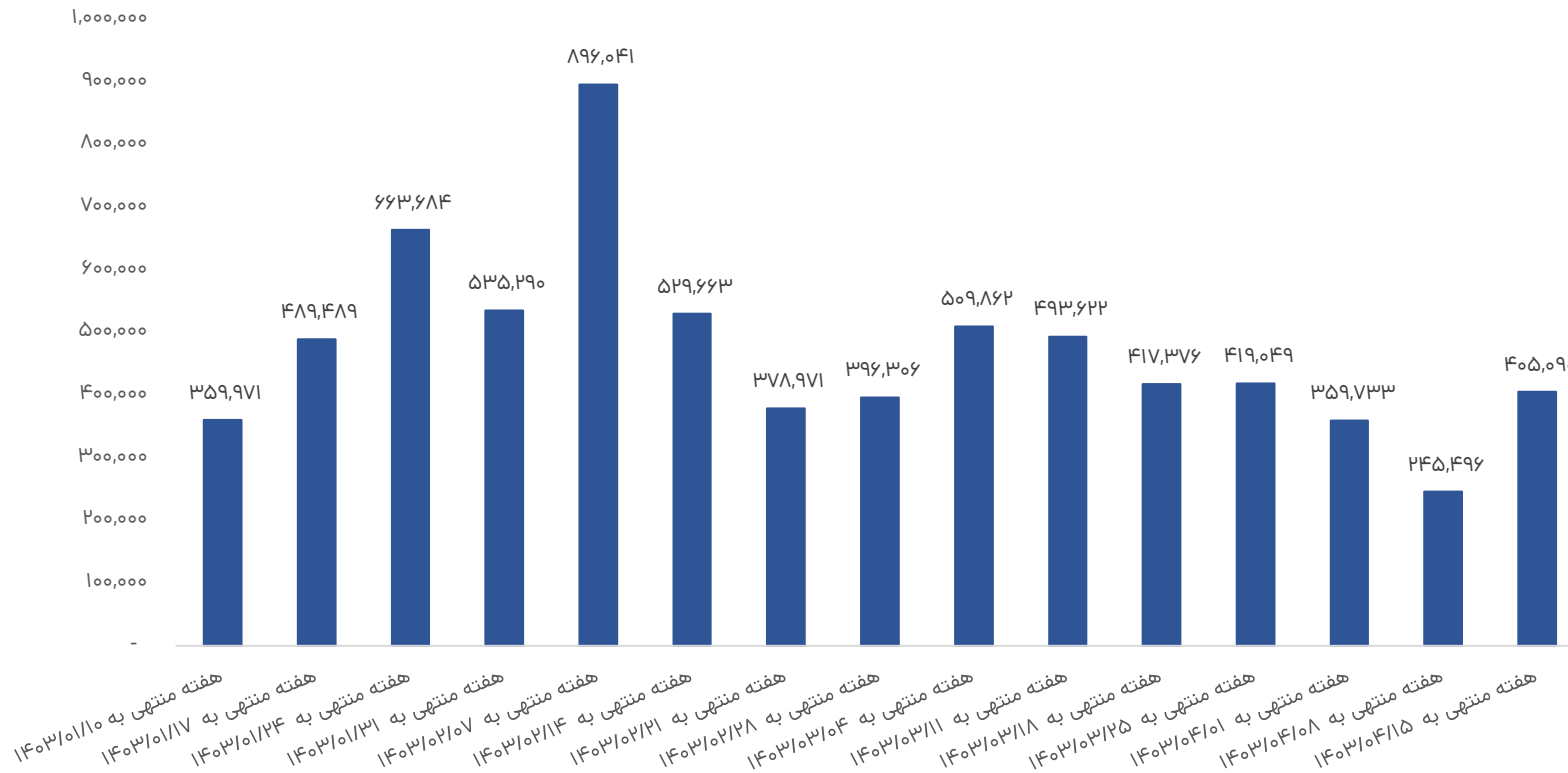


1397-01-05
1397-04-25
1397-07-15
1397-10-05
1397-12-25
1398-03-15
1398-06-05
1398-08-25
1398-11-15
1399-02-05
1399-04-25
1399-07-15
1399-09-05
1399-11-25
1400-02-15
1400-04-05
1400-06-25
1400-09-15
1400-11-05
1401-01-25
1401-04-15
1401-06-05
1401-08-25
1401-11-15
1402-01-05
1402-03-25
1402-06-15
1402-08-05
1402-10-25
1403-01-15
1403-03-05
1403-05-25
1403-08-15
1403-10-05
1403-12-25



طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۱۵ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۴۰۵.۰۹۰ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با افزایش مواجه گردید.

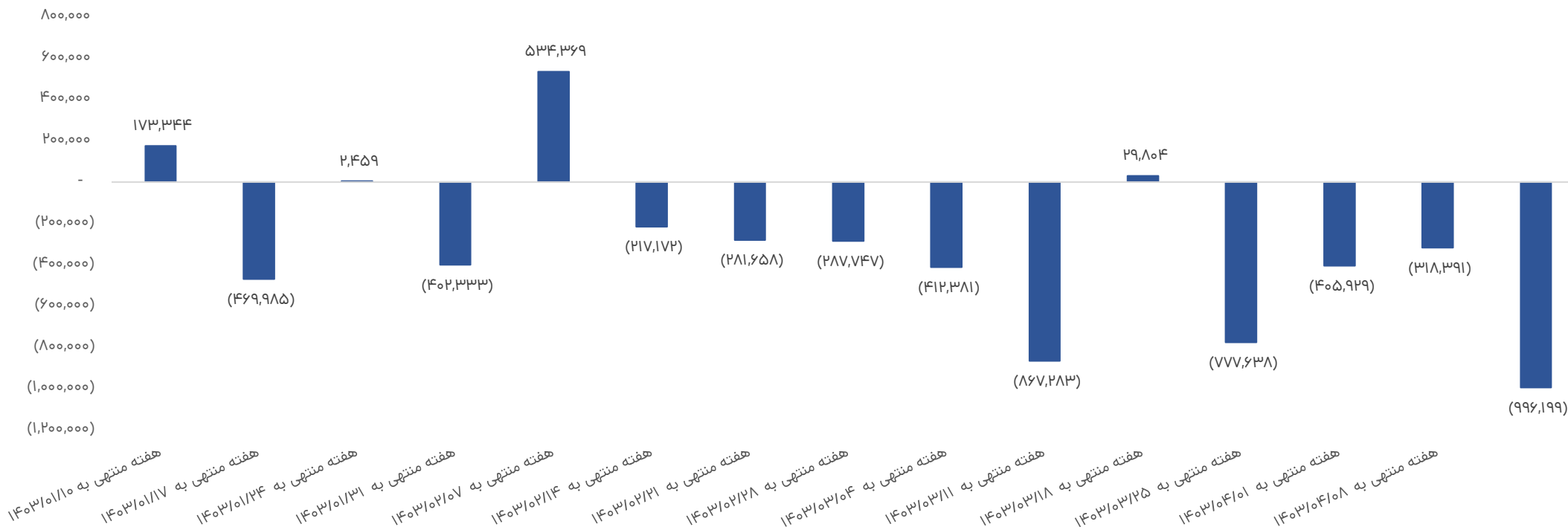
میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

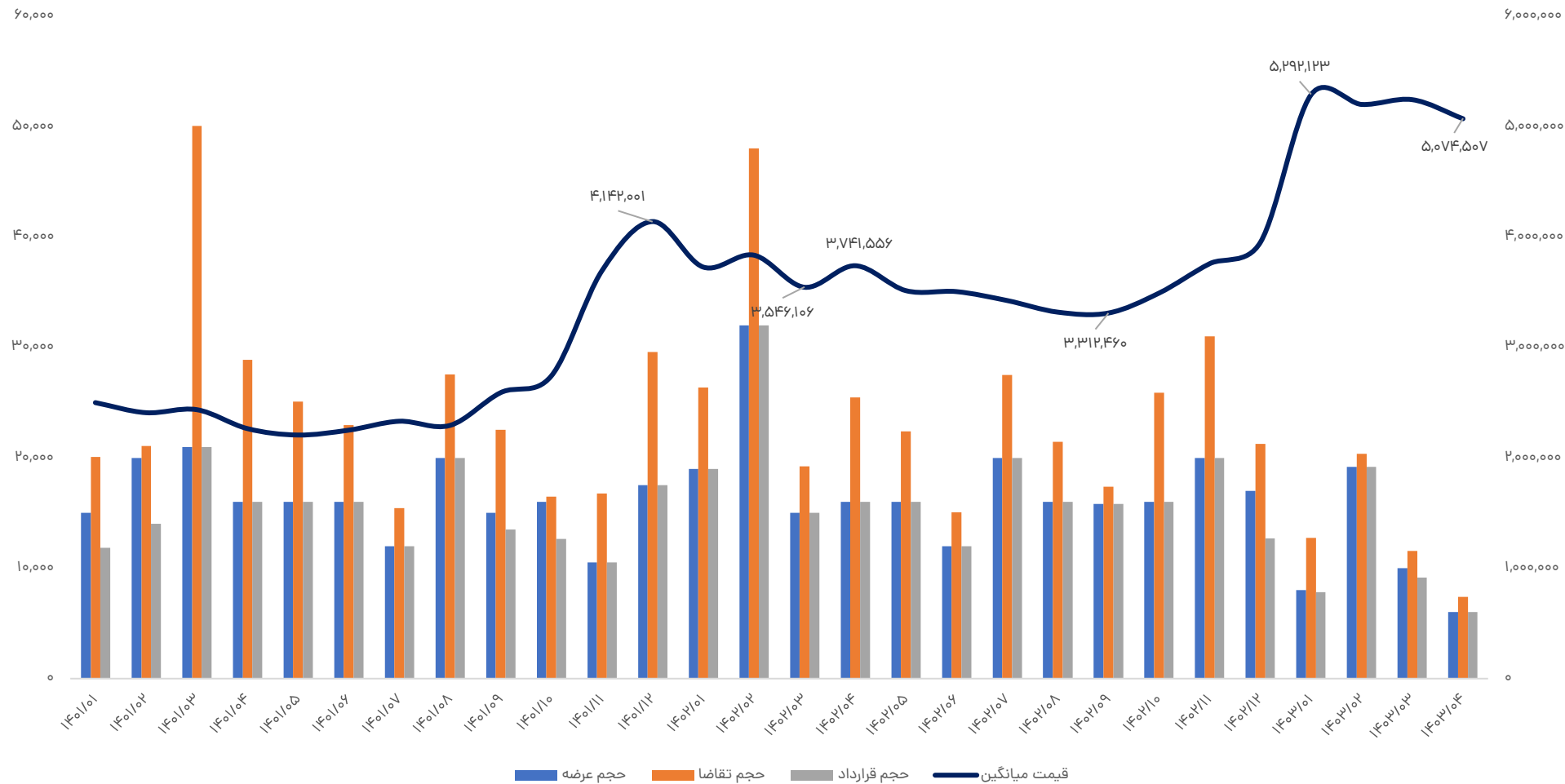




طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۱۵ ، خروج پول اشخاص حقیقی از نماد فملی به میزان ۹۹۶.۱۹۹ میلیون ریال بوده است.

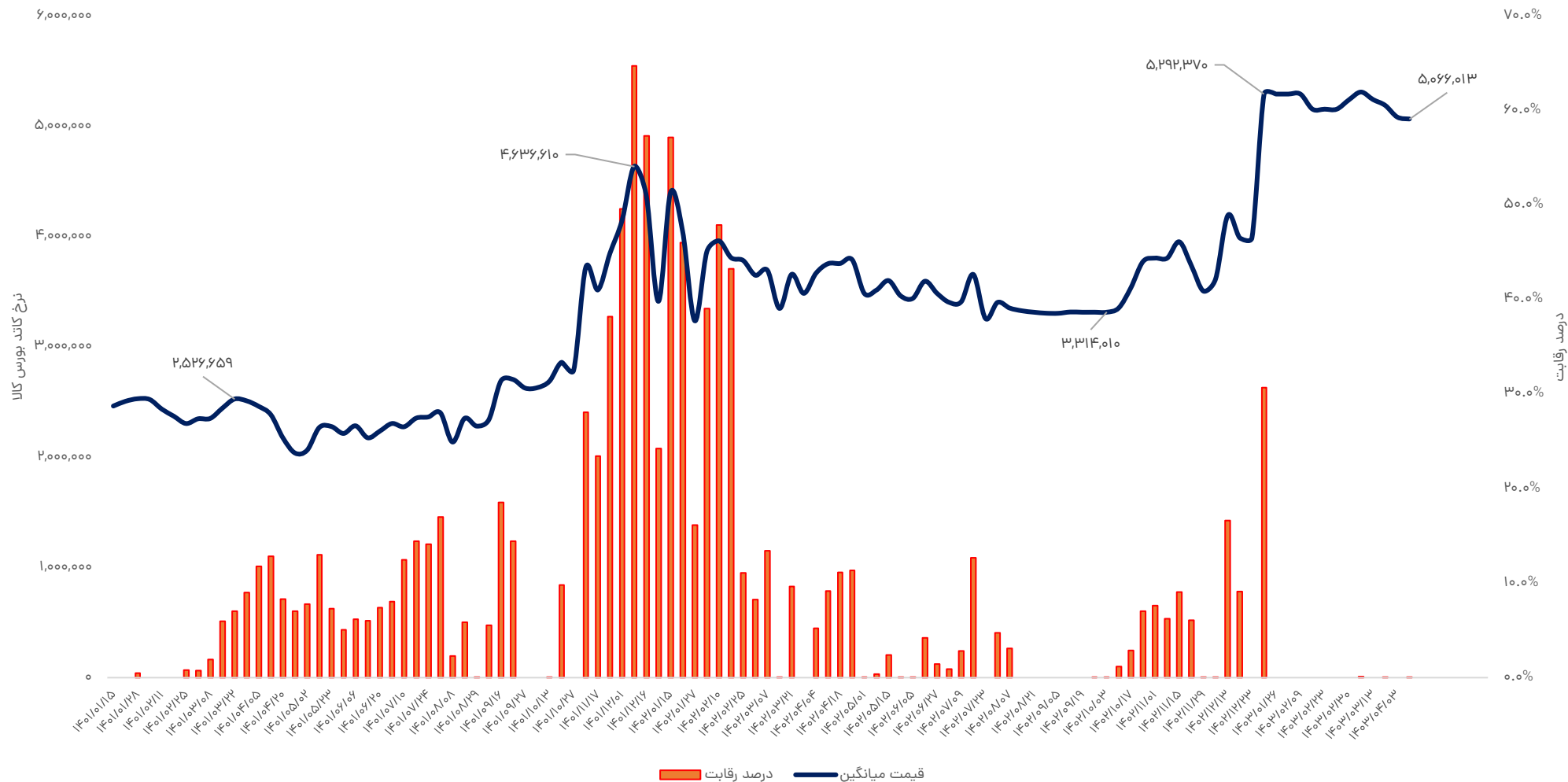
ورود پول (میلیون ریال)





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

در ماه تیر تا کنون مجموعاً ۶۰۰۰ تن عرضه کاتد توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۶۰۰۰ تن بود و با میانگین قیمت ۵,۰۷۴,۵۰۷ ریال معامله گردید.



این هفته کاند مس با قیمت ۵.۰۶۶.۰۱۳ ریال بر کیلوگرم معامله گردید که نسبت به معاملات هفته گذشته با تغییر خاصی مواجه گردید. همچنین کل حجم عرضه شده بدون رقابت نزدیک به قیمت پایه معامله گردید.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۵۸۶۱۹۰۰۰ - ۲۱

دور نگار: ۸۰۴۷۲۹۳ - ۲۱