



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۱۰

منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۰۵



♦ بخش اول

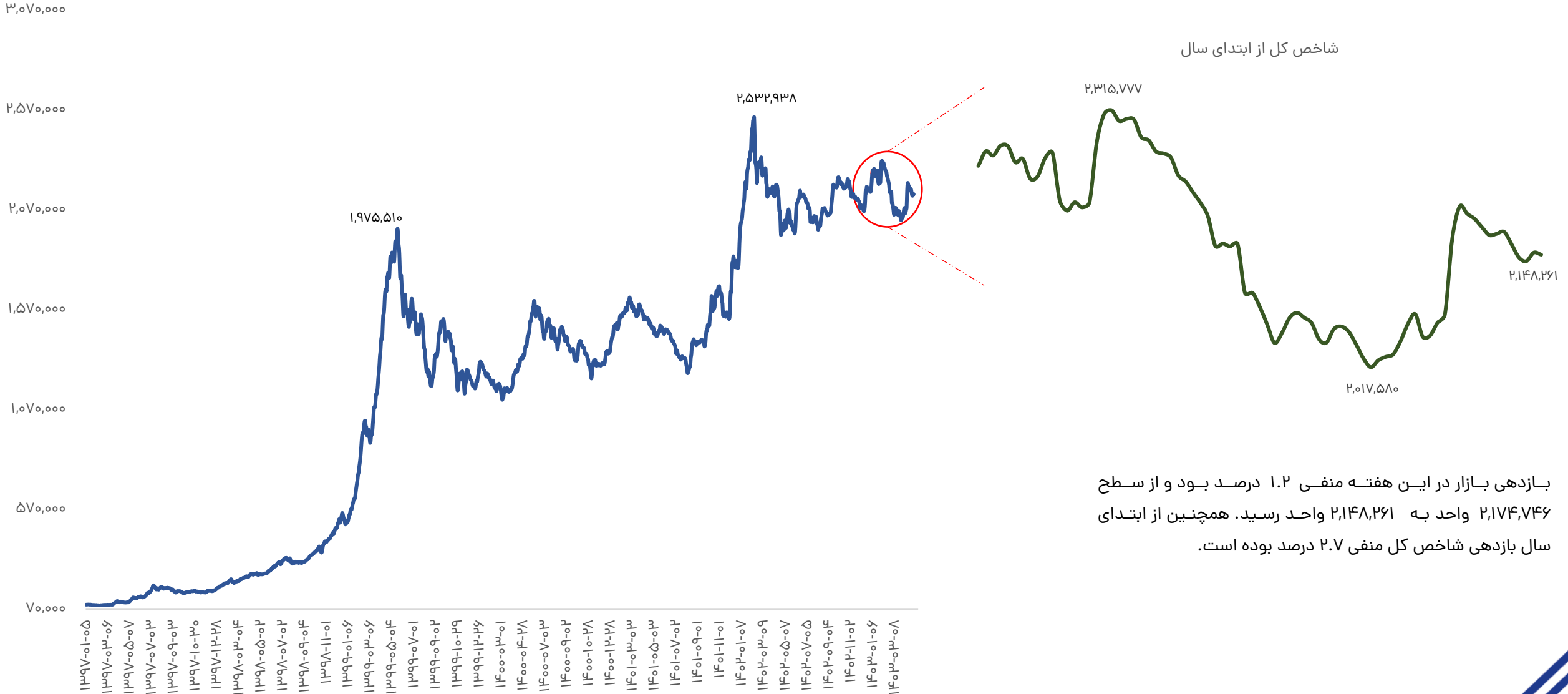
بازار سرمایه



شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷

بازدهی از ابتدای سال	-۲.۷%
بازدهی هفته اخیر	-۱.۲%

شاخص کل از ابتدای سال

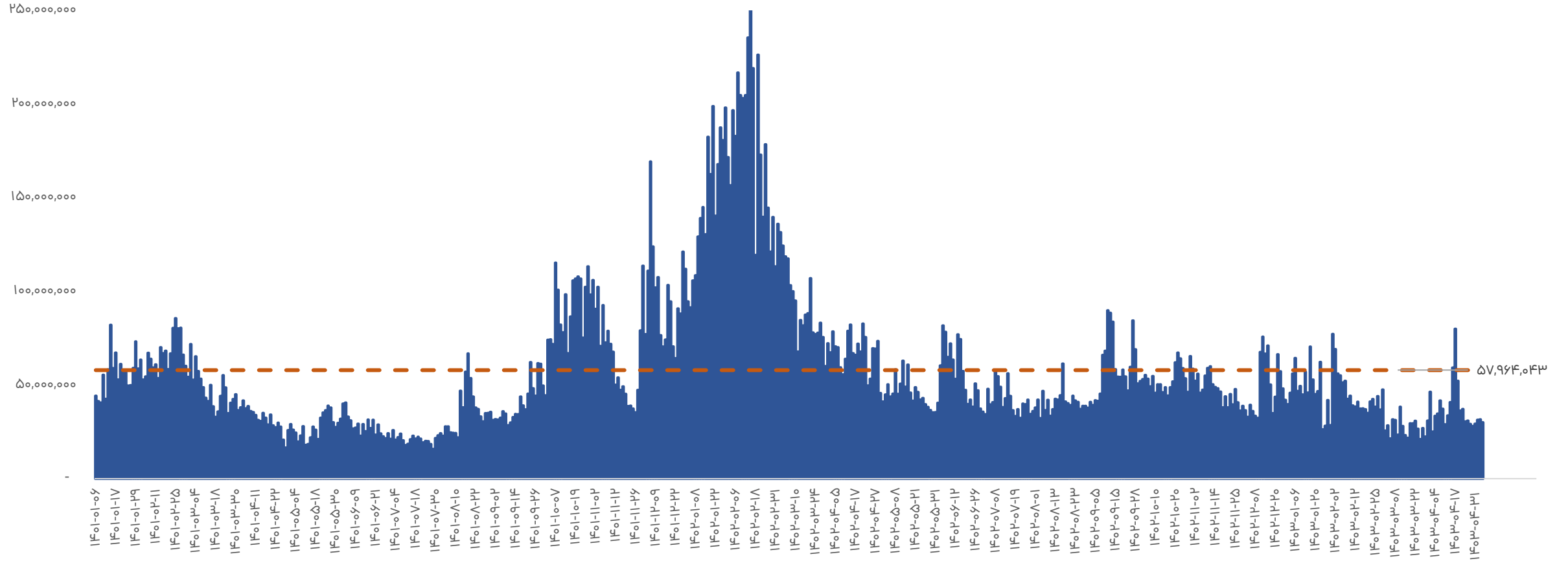


بازدهی بازار در این هفته منفی ۱.۲ درصد بود و از سطح ۲,۱۷۴,۷۴۶ واحد به ۲,۱۴۸,۲۶۱ واحد رسید. همچنین از ابتدای سال بازدهی شاخص کل منفی ۲.۷ درصد بوده است.



ارزش معاملات در این هفته نیز مطلوب نبود و در حدود ۳ همت نوسان داشت

ارزش معاملات خرد از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال

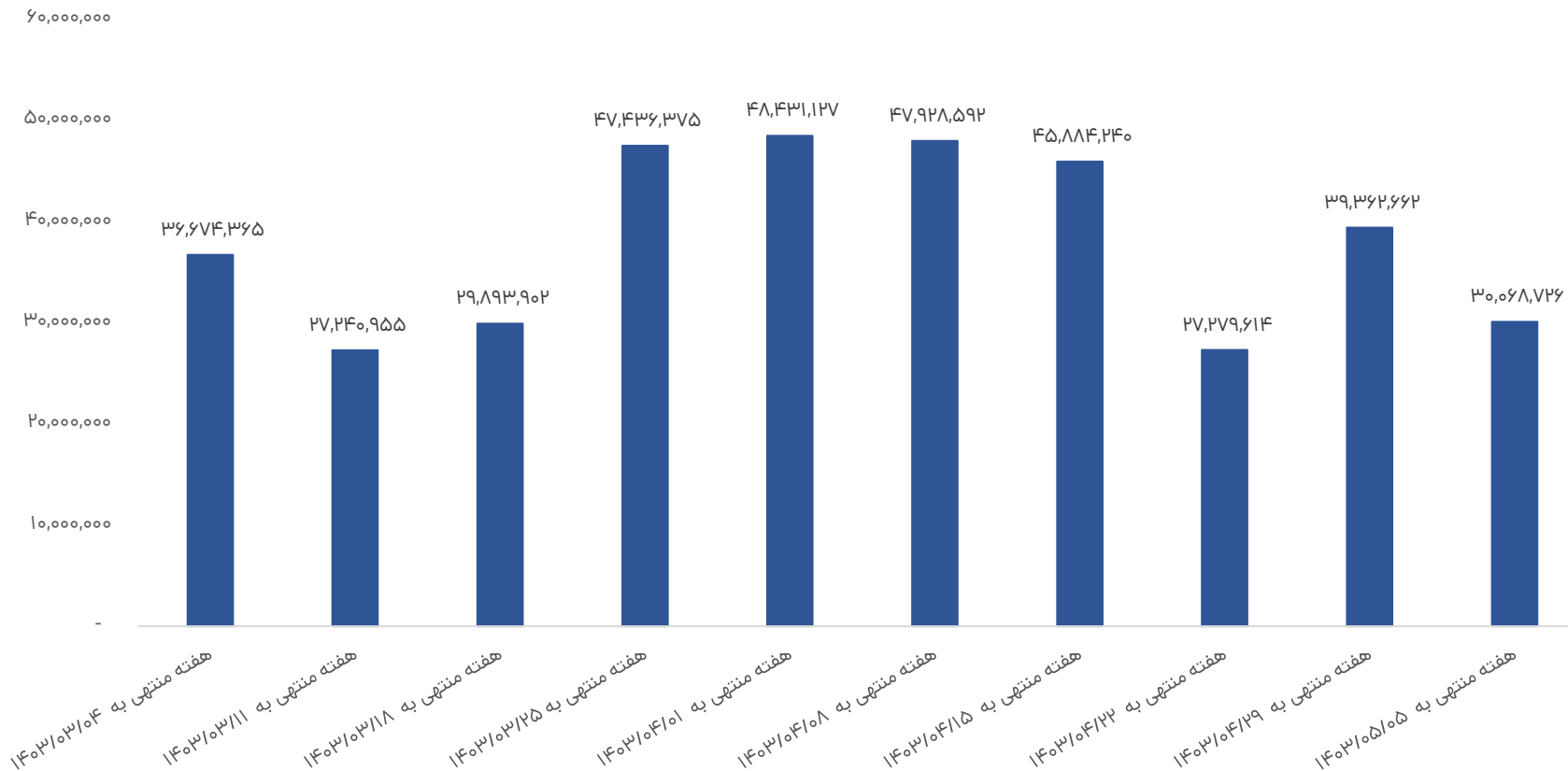


۵۷,۹۶۴,۰۴۳

میانگین ارزش معاملات هفتگی

میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته به ۳۰,۰۶۸,۷۲۶ میلیون ریال رسید و نسبت به هفته گذشته با افت ۲۴ درصدی مواجه گردید.

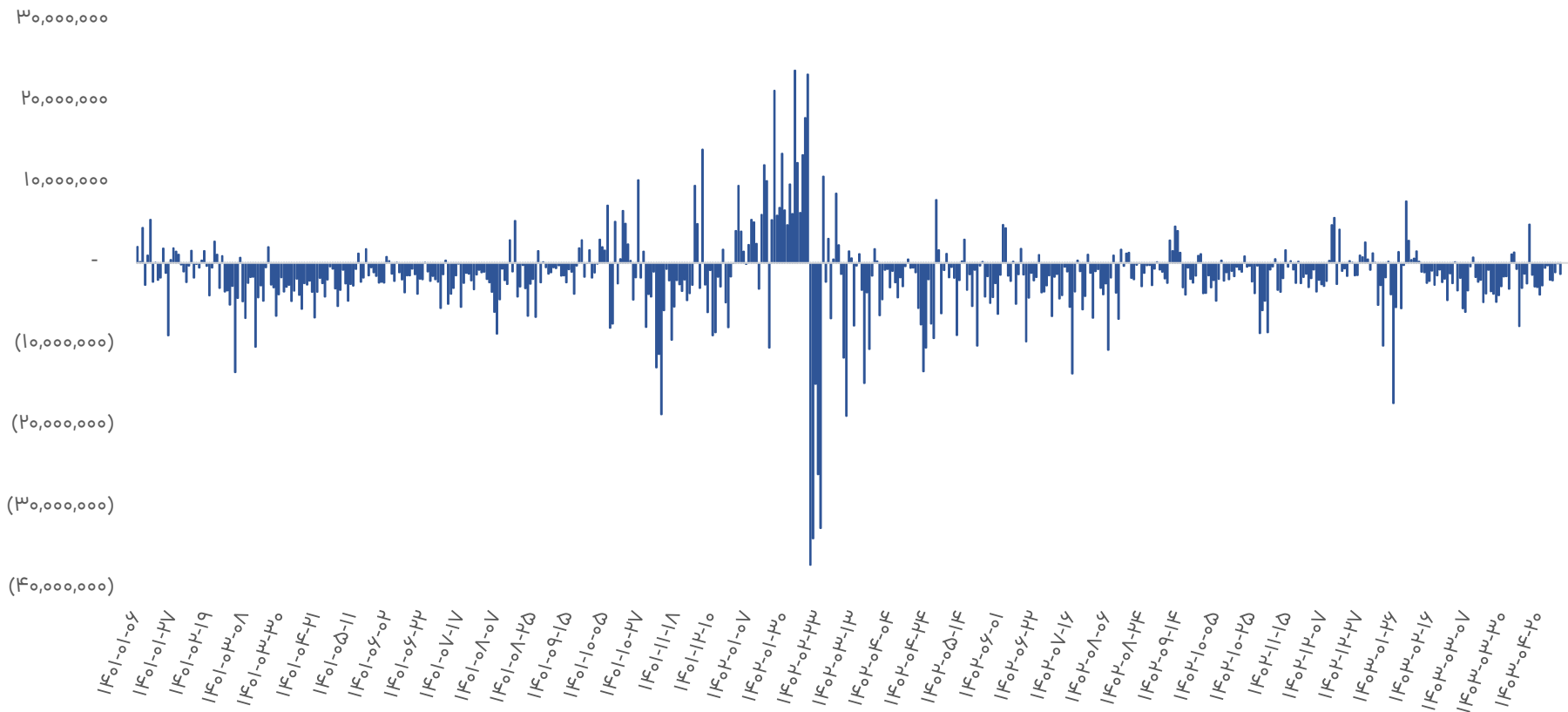
ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال





میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۷۲۱,۹۸۲,۶۴۹
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۱۵۲,۱۰۹,۸۹۹
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	-۶,۸۹۸,۰۸۲

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



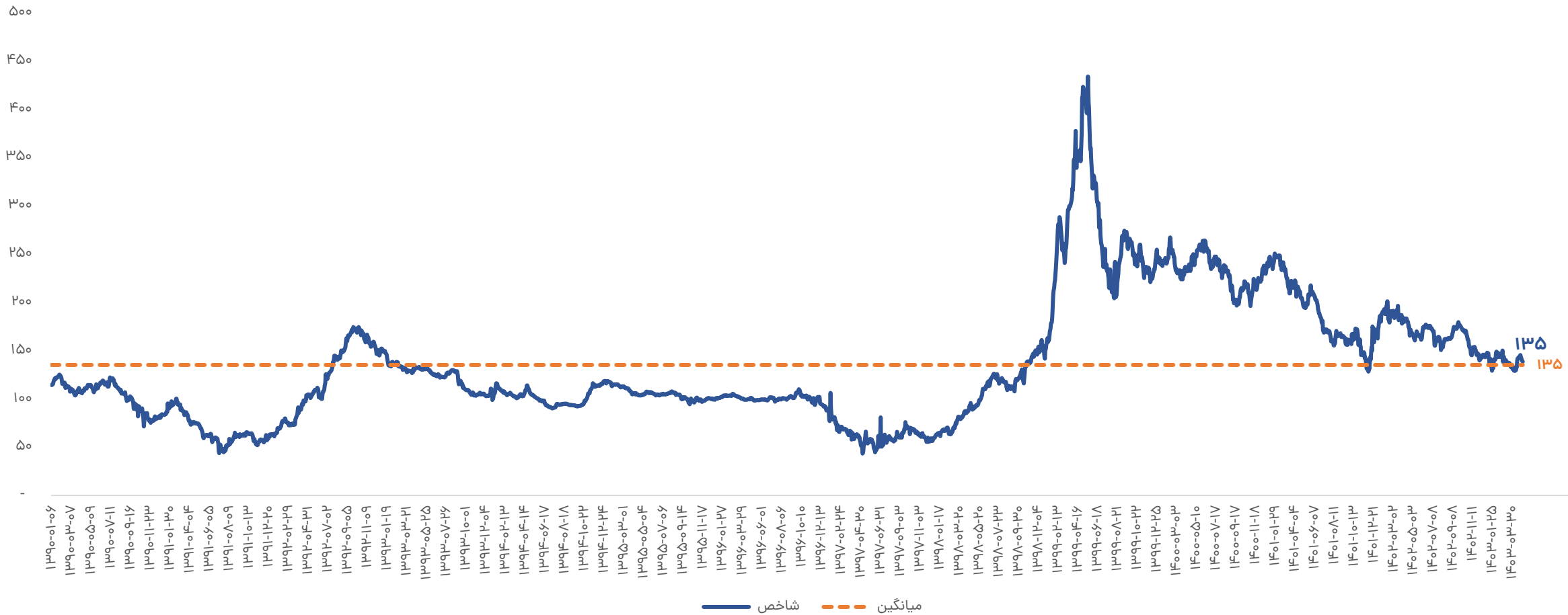
هفته گذشته اشخاص حقیقی ۶,۸۹۸,۰۸۲ میلیون ریال پول از بازار سهام خارج کردند. خالص خروج نقدینگی اشخاص حقیقی در سال جاری تاکنون بیش از ۱۵ همت بوده است.

همچنین از تاریخ ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ و با شروع اصلاح شاخص کل، میزان خروج پول اشخاص حقیقی از ۷۲ همت فراتر رفته است.



در این هفته ارزش بازار سرمایه بر حسب دلار با افت سه درصدی نسبت به هفته گذشته به محدوده ۱۳۵ میلیارد دلار رسید.

ارزش دلاری بازار سرمایه از ابتدای سال ۱۳۹۰ - میلیارد دلار

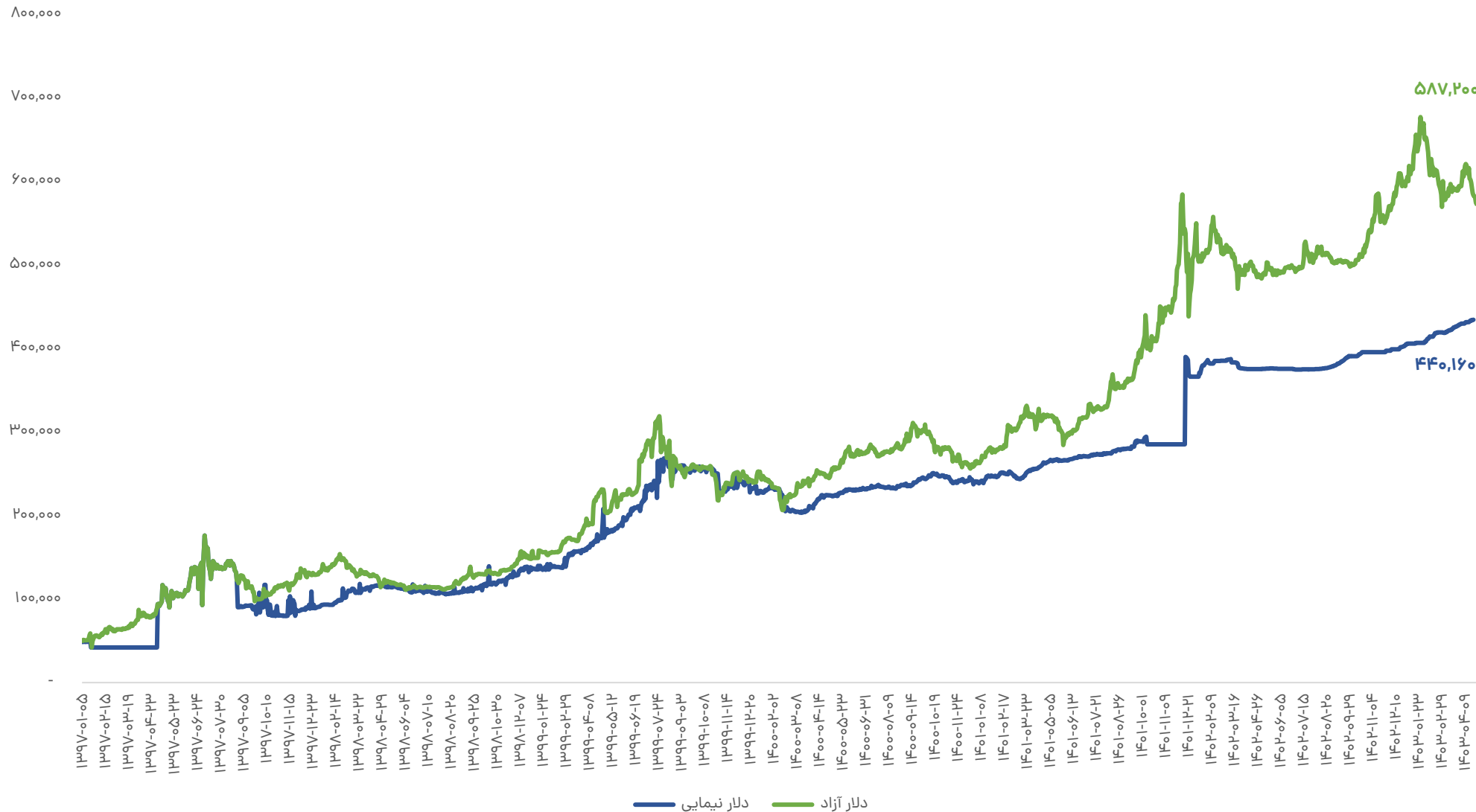


روند دلار نیمایی و دلار آزاد



گروه مالی کیمیا

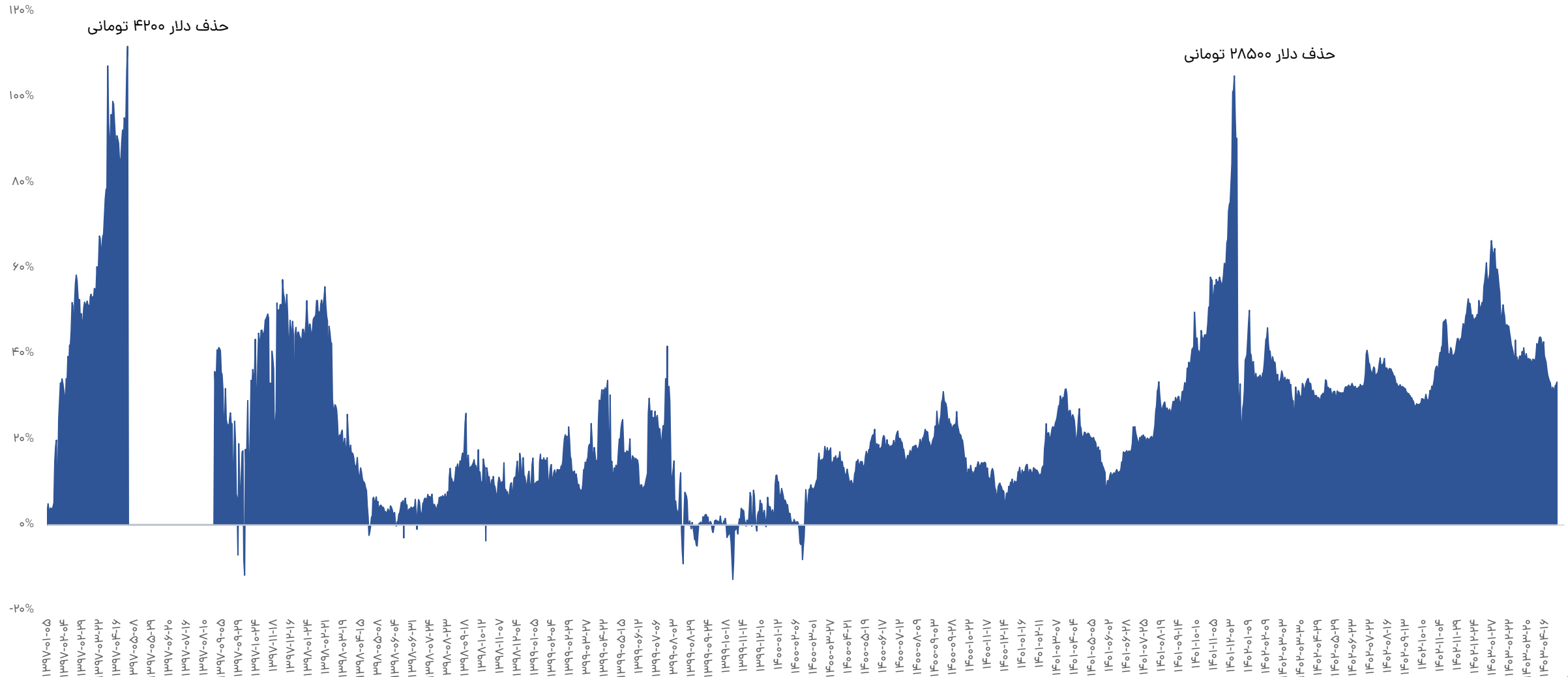
دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۵۸۷,۲۰۰ ریال رسید که نسبت به هفته ۲ درصد افزایش یافت. دلار نیما نیز در این هفته ۳,۰۲۸ ریال افزایش یافت.



اختلاف میان دلار نیما و بازار آزاد این هفته به ۳۳ درصد افزایش یافت.



اختلاف دلار آزاد و نیما





پس از کاهش شدید نرخ اوراق از نزدیک ۳۶ درصد به ۳۰ درصد شاهد ثبات آن در محدوده ۳۰ درصد بوده ایم.

نرخ بهره بدون ریسک



♦ بخش دوم

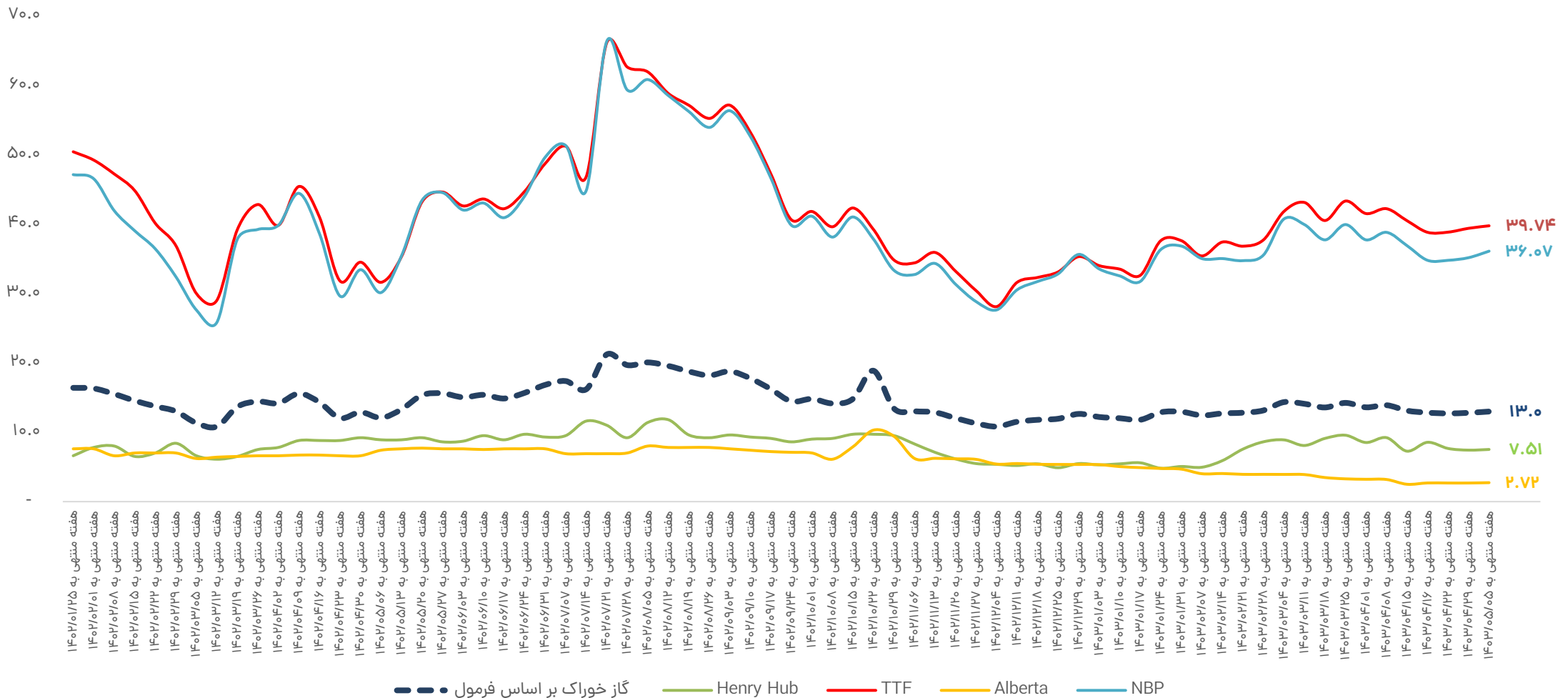
تغییرات قیمت جهانی مس و سایر کالاها

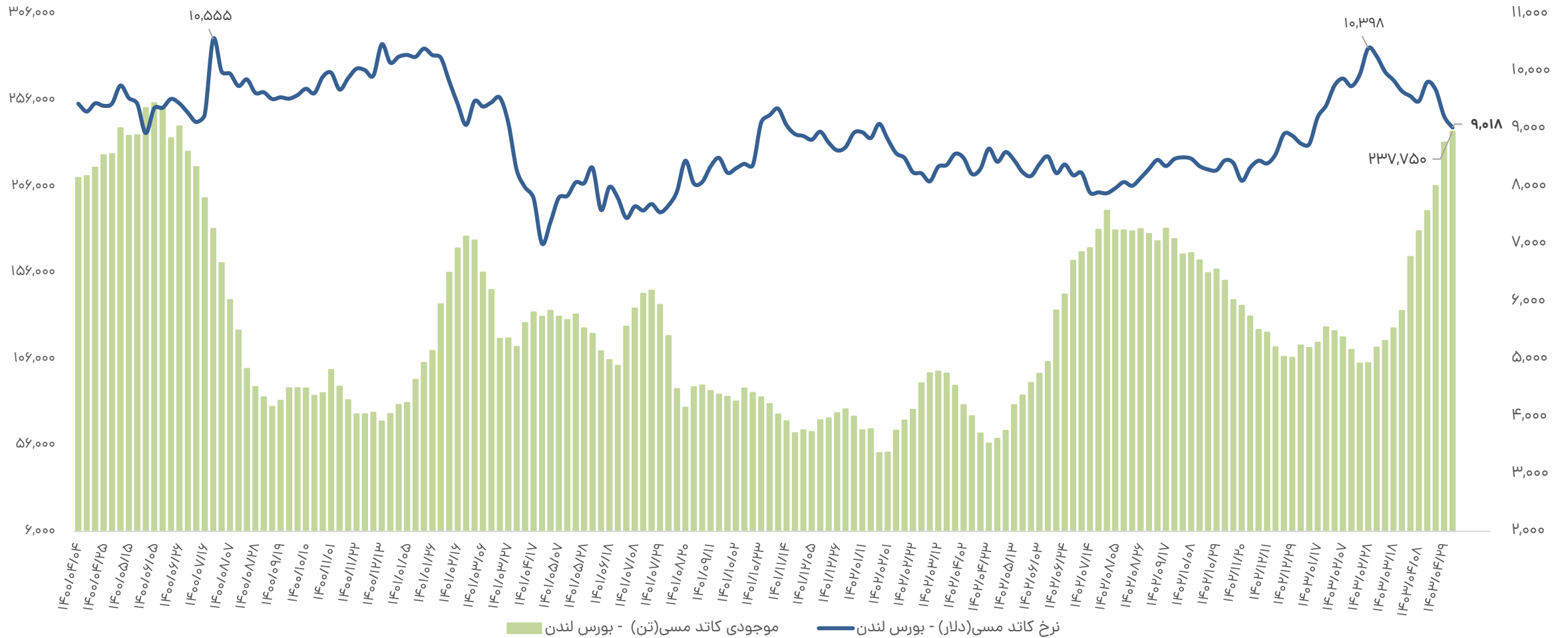


%Y	%M	%W	آخرین نرخ (دلار)	قرارداد	نام کالا
۱.۶	-۲.۱	-۲.۱	۹,۰۱۸	بورس لندن	کاتد مسی
۱.۲	-۳.۶	-۳.۶	۲,۲۲۹	بورس لندن	شمش آلومینیوم
-۱.۰	-۱.۰	۰.۰	۴۷۵	ایران FOB	بلوم و بیلت فولادی
-۳.۶	-۰.۲	۰.۰	۴۵۵	ایران FOB	اسلب فولادی
-۳.۶	-۰.۹	-۰.۹	۱۰۷	چین CFR	سنگ آهن ۶۲%
-۵.۱	-۰.۳	۰.۰	۶۳۸	CIS دریای سیاه FOB	ورق سرد
-۱.۸	-۰.۵	۰.۰	۵۴۵	CIS دریای سیاه FOB	ورق گرم
-۷.۲	-۱.۸	-۱.۸	۸۱	برنت	نفت برنت
-۱.۷	-۰.۸	-۰.۸	۱,۱۲۶	چین - Spot	استایرن منومر داخلی
-۷.۹	۰.۲	۰.۲	۸۵۵	شمال شرق آسیا CFR	اتیلن
۱۰.۶	-۱.۰	-۲.۴	۱,۱۲۰	خلیج فارس FOB	پلی اتیلن سبک تزریقی
-۴.۴	-۵.۱	-۴.۳	۹۰۵	خلیج فارس FOB	پلی اتیلن سنگین فیلم
۳.۶	۱.۷	۰.۰	۸۷۵	چین CFR	پروپیلن
-۱.۹	۲.۱	-۰.۲	۱,۱۱۱	خلیج فارس FOB	پلی پروپیلن تزریقی
۷.۴	-۰.۵	-۲.۸	۸۴۶	چین CFR	پلی وینیل کلراید
-۳.۳	۳.۶	-۰.۷	۷۰۰	ژاپن CFR	نفتا
-۱۳.۱	۰.۲	-۲.۹	۸۲۶	سنگاپور FOB	MTBE
-۳.۴	-۳.۱	-۱.۸	۹۸۶	کره FOB	پارازایلین
-۴.۶	-۴.۴	-۲.۳	۹۹۸	کره FOB	بنزن
۲.۸	۰.۷	۳.۶	۱,۴۵۰	خلیج فارس FOB	آلکیل بنزن خطی
۱۲.۲	۴.۰	۰.۰	۱,۵۶۰	چین CFR	بوتادین
۱.۸	-۰.۳	-۰.۲	۹۱۹	چین CFR	تولوئن
-۴.۴	-۳.۴	-۲.۷	۲۸۶	چین CFR	متانول
-۵.۹	-۰.۳	-۱.۲	۳۲۰	چین FOB	اوره
۱.۱	-۰.۱	-۰.۵	۹۶۵	جنوب شرق آسیا FOB	پلی اتیلن ترفتالات
۴.۷	۰.۰	۰.۰	۱,۴۴۵	چین CFR	اکریلو نیتریل بوتادین استایرن
۶.۰	-۱.۳	-۱.۳	۷۸۰	رتردام FOB	اتانول
۲.۱	۷.۶	-۱.۷	۶۲۰	خلیج فارس FOB	بنزین پیرولیز
-۴.۵	۴.۸	-۰.۸	۷۶	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 سنت در هر مترمکعب رسیده است که نسبت به هفته گذشته با افزایش مواجه گردید. باتوجه به نرخ دلار نیما ۴۴۰.۱۶۰ ریالی نرخ هر متر مکعب گاز حدود ۵۷,۲۲۰ 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 ۹۰۱۸ دلار رسید. همچنین موجودی انبار LME با افزایش ۶,۳۲۵ تنی به ۲۳۷,۷۵۰ تن رسید



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده ماهانه	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۰%	۳۶,۶۰۰	-۳%	۰%	۳۶,۶۰۰	کنسانتره
۰%	۵۲,۳۳۷	-۴%	۰%	۵۲,۳۳۷	گندله
۰%	۱۲۱,۱۴۱	۰%	۰%	۱۲۱,۱۴۱	آهن اسفنجی
۰%	۲۳۸,۵۸۳	۵%	۵%	۲۳۸,۵۸۳	بیلت
۰%	۴۳۷,۳۸۴	-۴%	-۱%	۴۳۸,۰۷۸	ورق گالوانیزه
۲۷%	۱,۱۱۵,۴۶۷	۷%	۰%	۱,۴۱۸,۲۰۴	شمش آلومنیوم
۰%	۵,۱۰۴,۰۰۰	۰%	۰%	۵,۱۰۴,۰۰۰	کاند
۰%	۱,۴۰۹,۱۲۲	۱%	-۲%	۱,۴۰۹,۱۲۲	شمش روی
۱۶%	۱۰,۸۵۵	۱۱%	۵%	۱۲,۵۶۶	سیمان



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده ماهانه	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۴۸%	۳۰۲,۲۳۲	-۴%	-۳%	۴۴۷,۶۱۷	پت
۱%	۱۲۸,۱۶۵	۱۷%	۱%	۱۳۰,۰۸۳	اوره
۴%	۴۹۲,۴۵۱	-۲%	-۲%	۵۱۱,۹۹۹	پلی پروپیلن
۱%	۳۷۸,۲۱۸	-۳%	۱%	۳۸۱,۳۷۵	PVC
۲%	۳۳۲,۴۴۶	-۲%	-۱%	۳۳۷,۸۶۴	روغن پایه
۴%	۳۷۶,۴۰۴	-۲%	-۲%	۳۹۰,۳۱۱	پلی اتیلن
۰%	۶۰۵,۹۸۳	۴%	۵%	۶۰۵,۹۸۳	LAB
۰%	۱۵۱,۰۰۰	۴%	-۱%	۱۵۱,۰۲۷	وکیوم باتوم
۰%	۲۳۶,۵۸۰	۵%	۱%	۲۳۶,۵۸۰	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.

473197.95





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.





➤ کاهش تولید ۸ درصدی Codelco از معادن شیلی و تولیدکنندگان بزرگ جهانی نسبت به مدت مشابه سال گذشته

منبع: bloomberg

➤ رشد سالانه ۱۸۷ درصدی صادرات مس جهان به دلیل انقباض ساخت و ساز در چین

منبع: tradingeconomic

➤ تشکیک در چشم انداز رشد هوش مصنوعی و تقاضای آن برای مس پس از ریزش قیمت سهام مرتبط به فناوری هوش مصنوعی مانند nvidia

منبع: mining.com

با توجه به قرار گرفتن RSI در منطقه اشباع فروش احتمال وامنش به حمایت روانی ۹۰۰۰ دلار و فیبوا ۶۱ درصد و پولبک به حمایت شکسته شده ۹۵۰۰ دار وجود دارد.



♦ بخش سوم

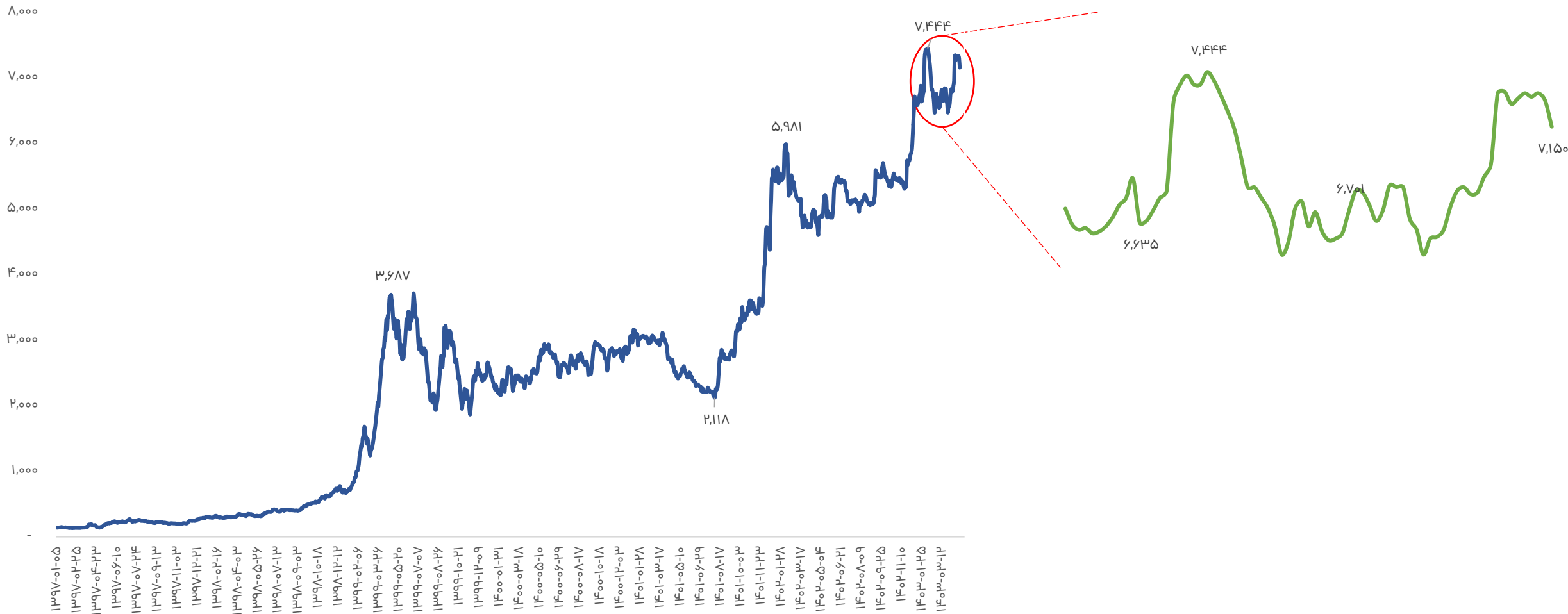
ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه

تغییرات قیمت نماد فملی



گروه مالی کیمیا

بازدهی از ابتدای سال	۹.۶۶%
بازدهی هفته اخیر	-۱.۹۴%

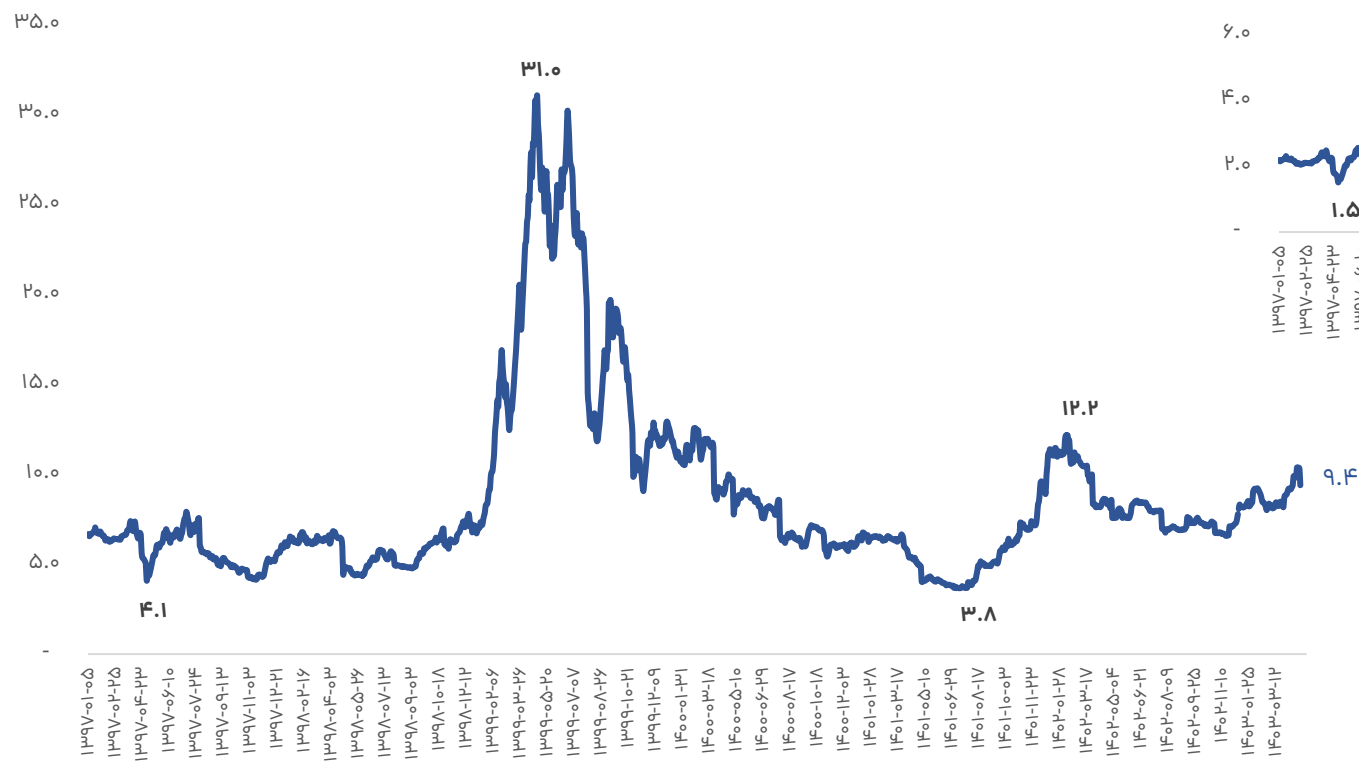


نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر

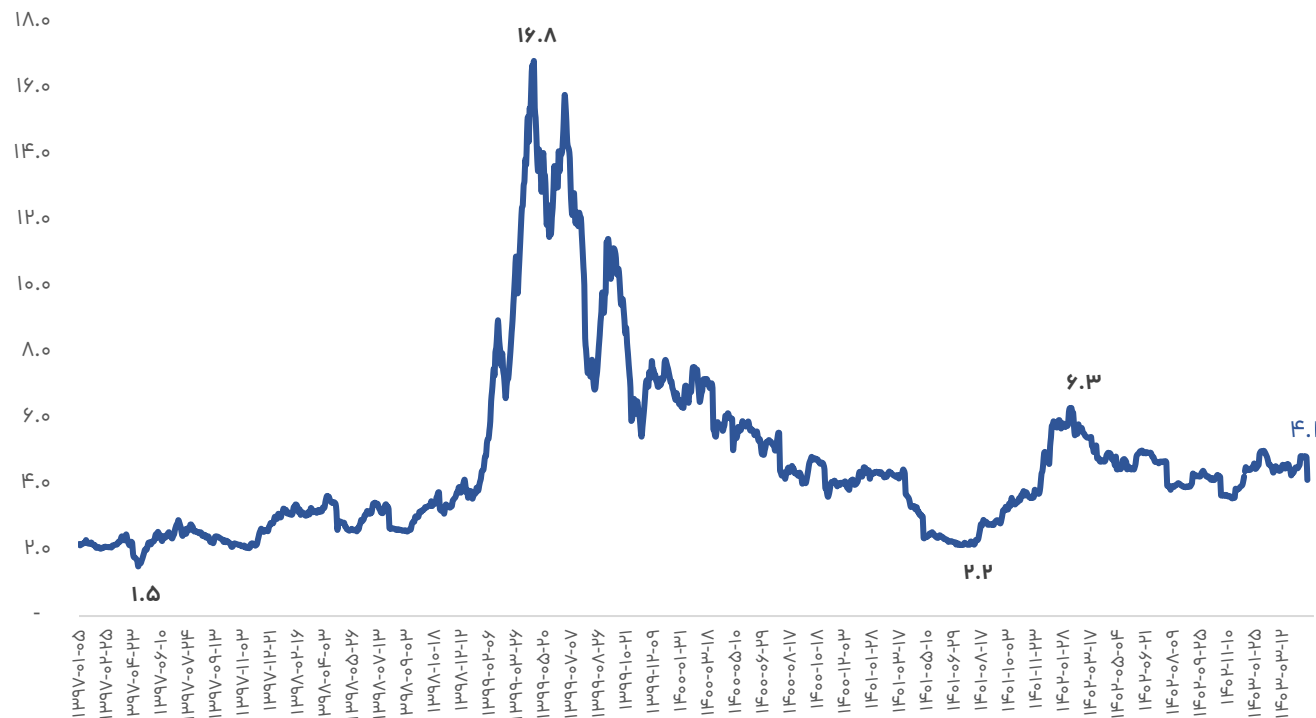


گروه مالی کیمیا

P/E-ttm



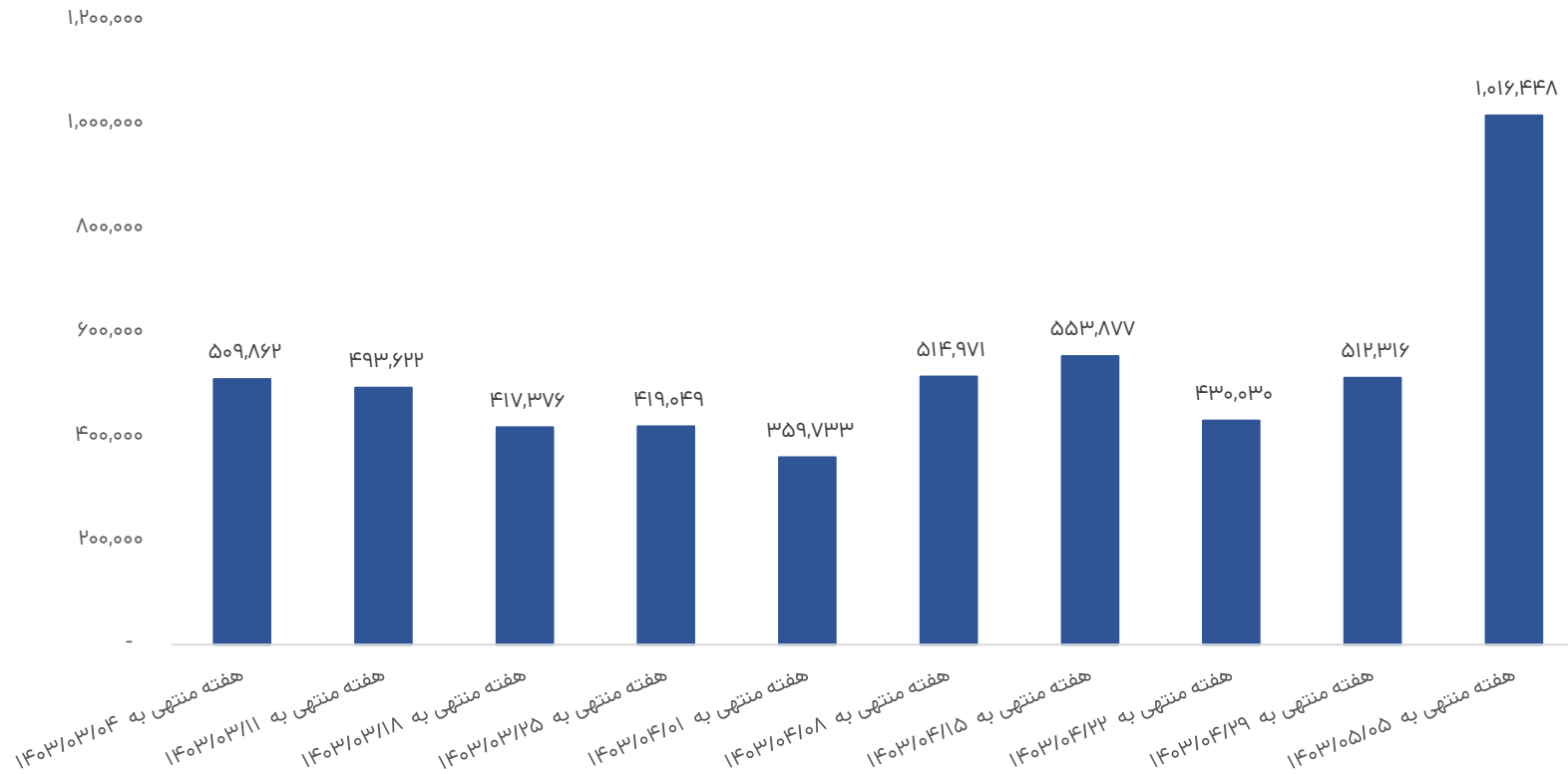
P/S





طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۰۵ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۱.۰۱۶.۴۴۸ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با افزایش مواجه گردید.

میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

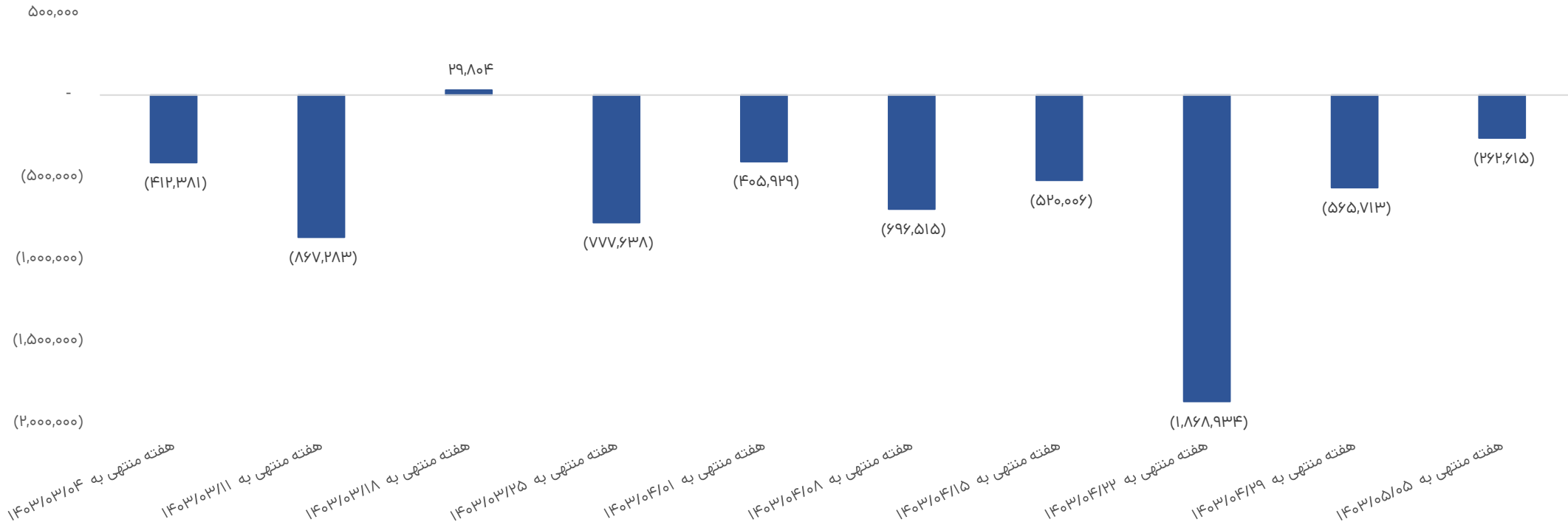


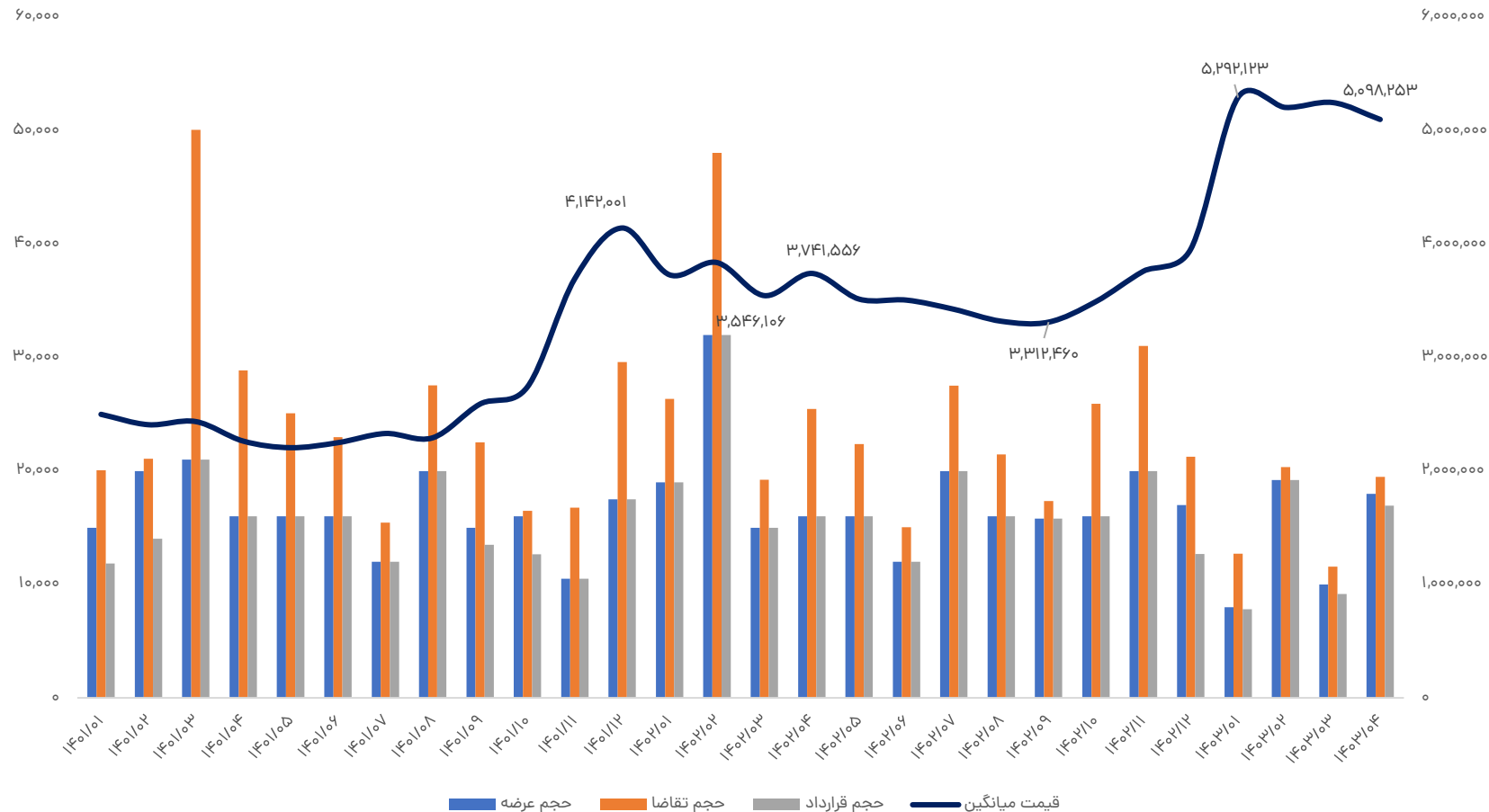


میزان ورود پول در نماد فملی

طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۰۵ ،
خروج پول اشخاص حقیقی از نماد
فملی به میزان ۲۶۲.۶۱۵ میلیون ریال
بوده است.

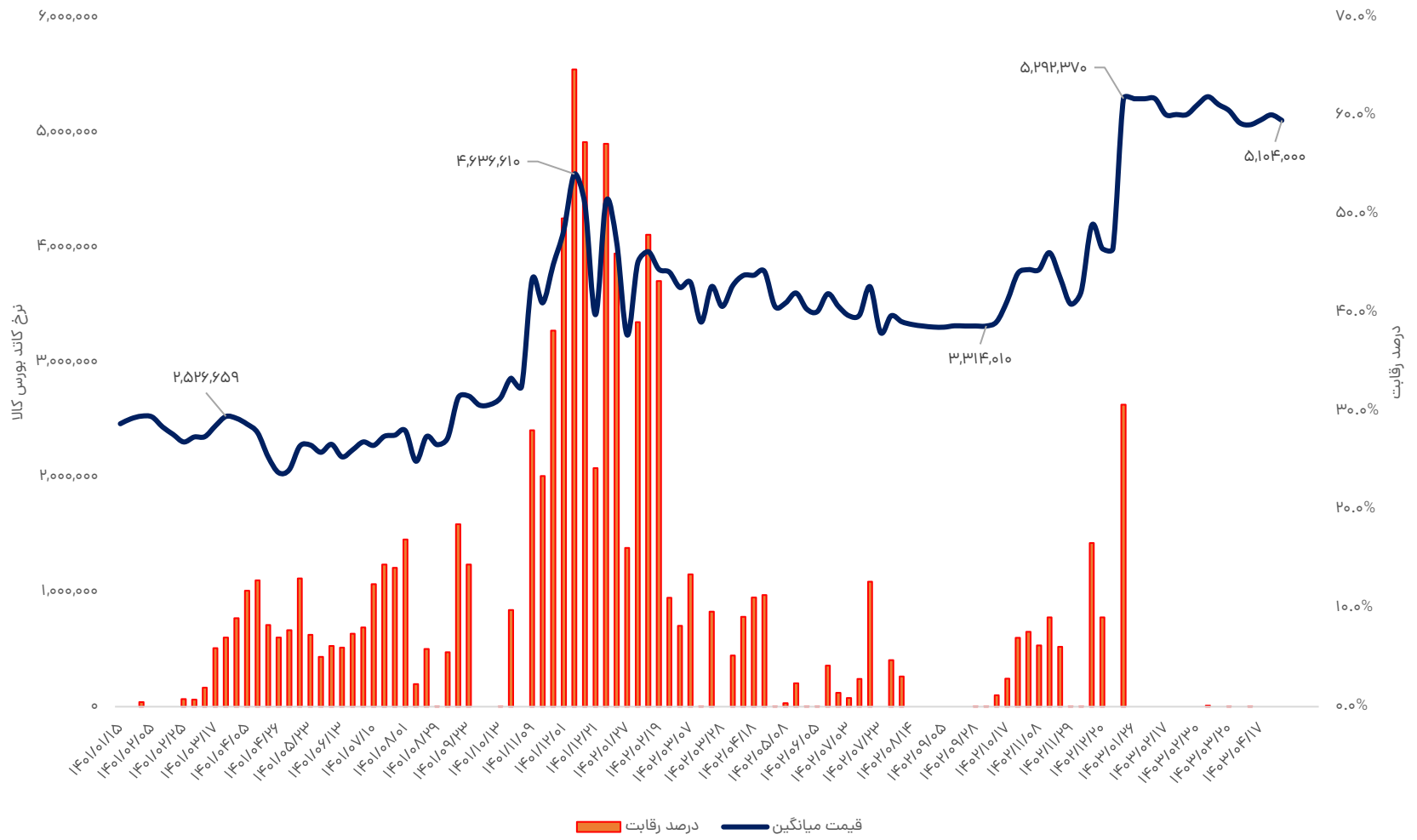
ورود پول (میلیون ریال)





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

در ماه تیر تا کنون مجموعاً ۱۸۰۰۰ تن عرضه کانتد توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۱۹۴۸۰ تن بود و با میانگین قیمت ۵,۰۹۸,۲۵۳ ریال معامله گردید.



این هفته کاند مس با قیمت ۵,۱۰۴,۰۰۰ ریال بر کیلوگرم معامله گردید که نسبت به معاملات هفته گذشته بانگبیر خاصی مواجه گردید . همچنین ۳۰۰۰ تن عرضه صورت گرفت که با تقاضا به میزان ۱۹۴۰ تن پاسخ داده شد.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۰۲۱ - ۵۸۶۱۹۰۰۰

دور نگار: ۰۲۱ - ۸۰۴۷۲۹۳