



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۱۹

منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۰۶



♦ بخش اول

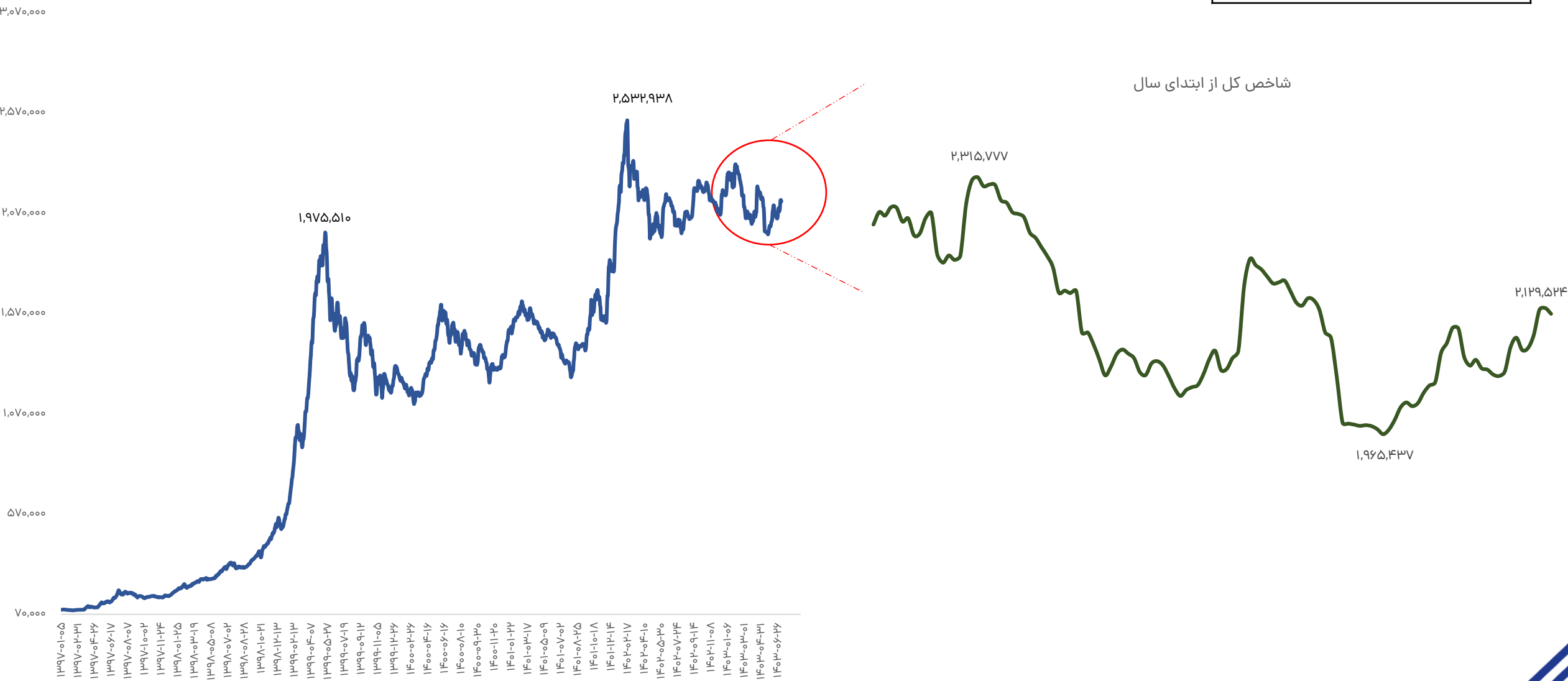
بازار سرمایه



شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷

بازدهی از ابتدای سال	-۳.۶%
بازدهی هفته اخیر	۱.۹%

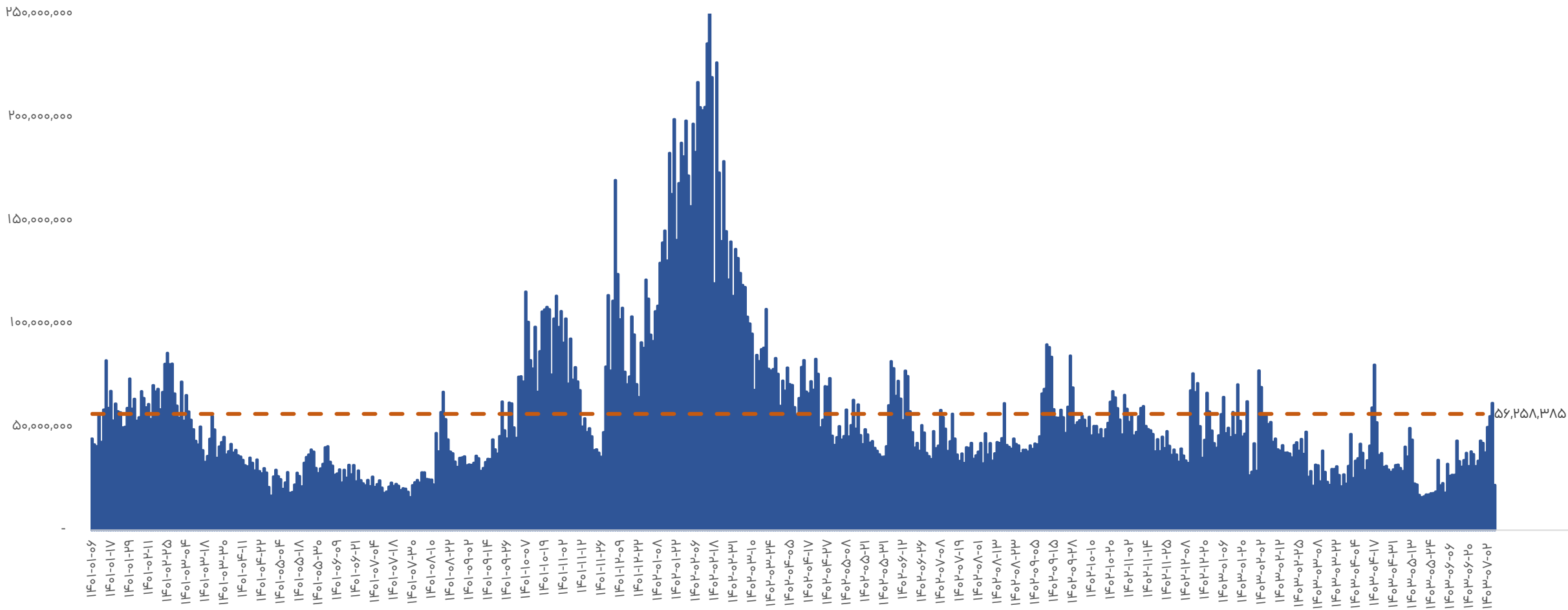
شاخص کل از ابتدای سال





ارزش معاملات در این هفته افزایش قابل ملاحظه ای داشت..

ارزش معاملات خرد از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال



۵۶,۲۵۸,۳۸۵

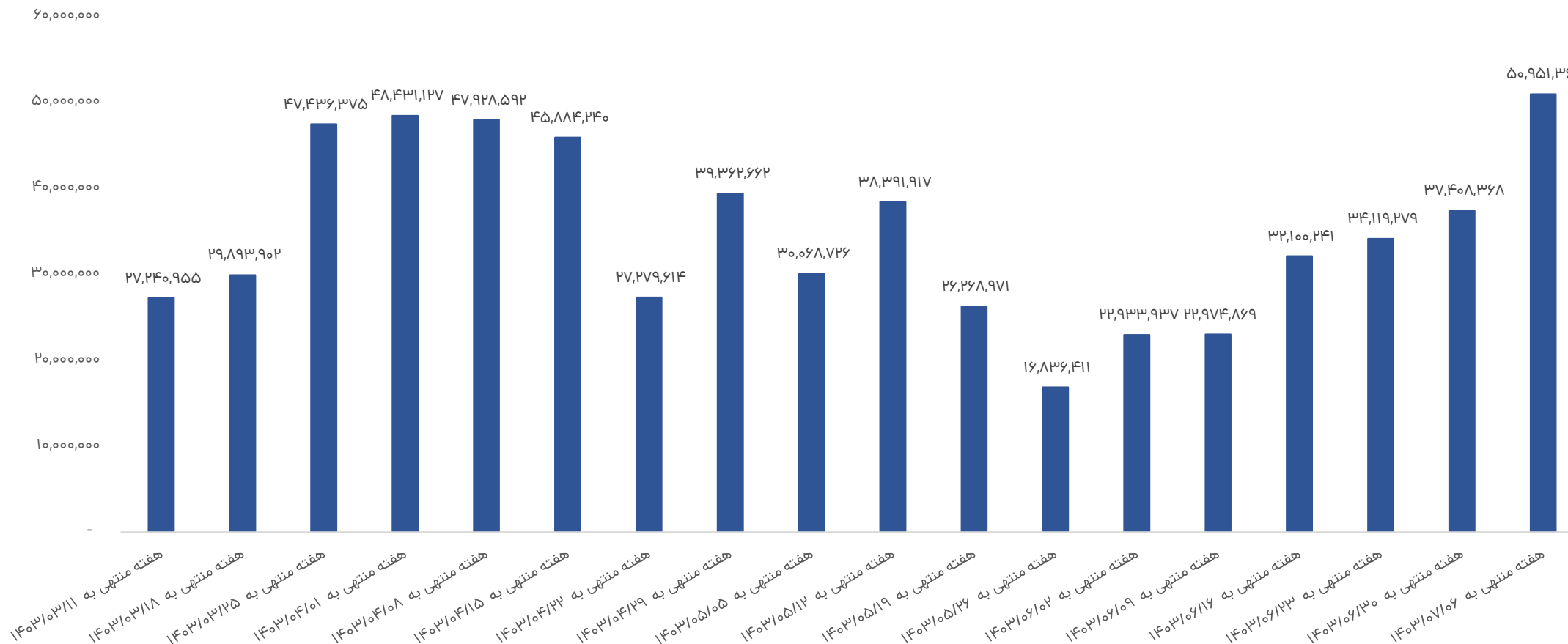
میانگین ارزش معاملات هفتگی



گروه مالی کیمیا

میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته به بیش از ۵ همت رسید که بیشترین مقدار طی سه ماه اخیر می باشد.

ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال

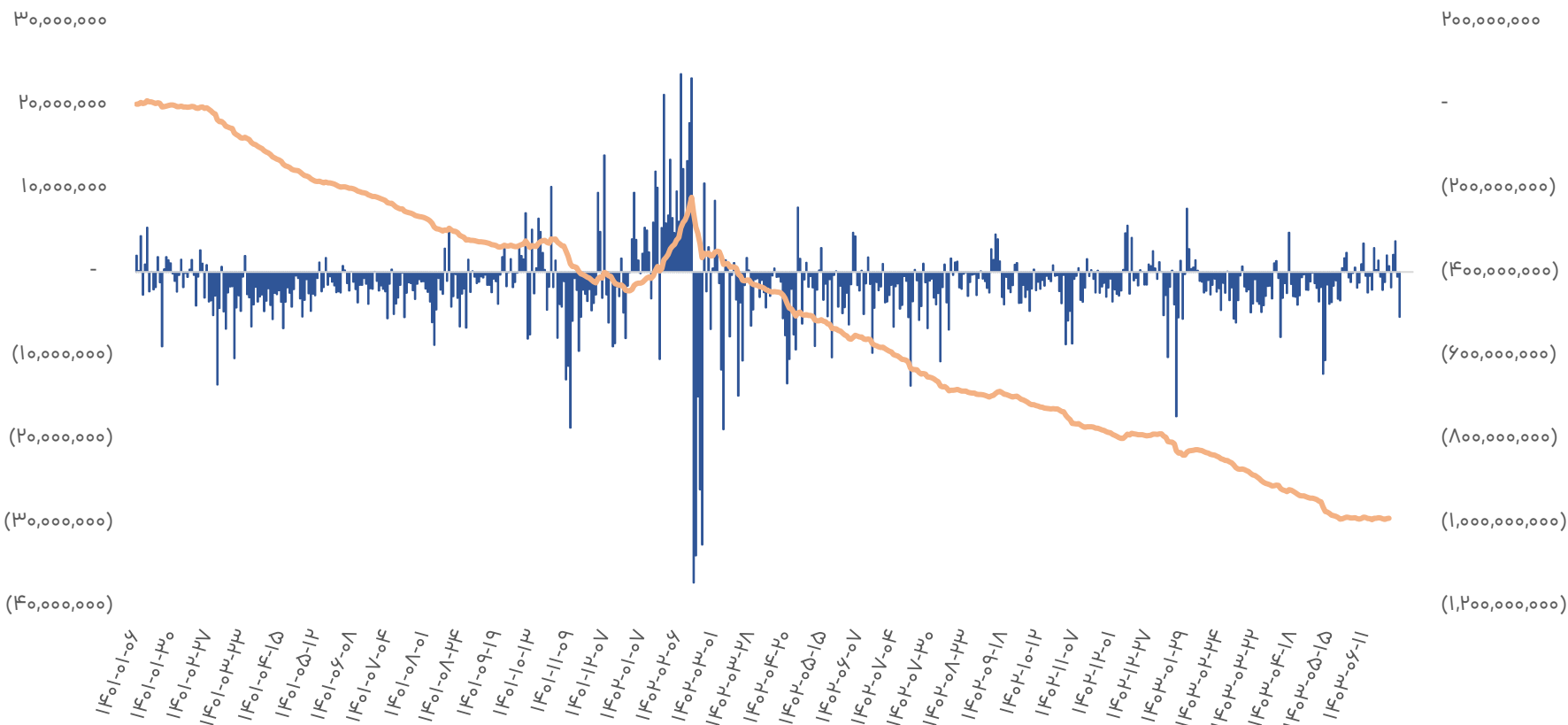




میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۷۷۰,۴۸۲,۰۳۱
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۲۰۰,۶۰۹,۲۸۲
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	۳,۳۶۳,۰۰۸

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

ورود و خروج پول حقیقی - تجمعی (Blue line)
 ورود و خروج پول حقیقی (Orange line)



هفته گذشته اشخاص حقیقی ۳,۳۶۳,۰۰۸ 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 ۷۷ همت فراتر رفته است.



در این هفته ارزش بازار سرمایه بر حسب دلار نسبت به هفته گذشته تغییری نداشت و در محدوده ۱۲۸ میلیارد دلار باقی ماند.

ارزش دلاری بازار سرمایه از ابتدای سال ۱۳۹۰ - میلیارد دلار



روند دلار نیمایی و دلار آزاد

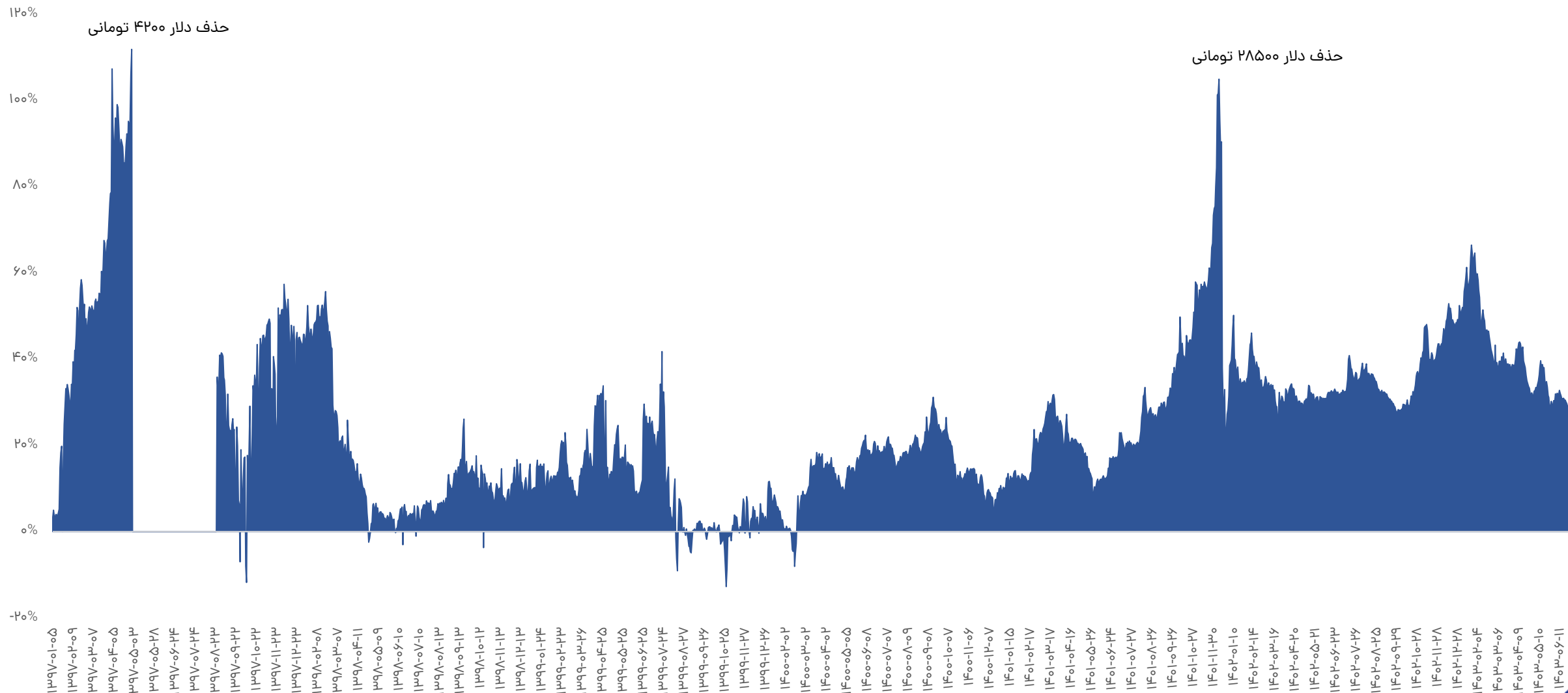
دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۶۰۶,۳۰۰ ریال رسید. دلار نیما نیز در این هفته ۳,۵۰۷ ریال افزایش یافت.





اختلاف میان دلار نیمای و بازار آزاد بدون تغییر در محدوده ۳۲٪ ماند.

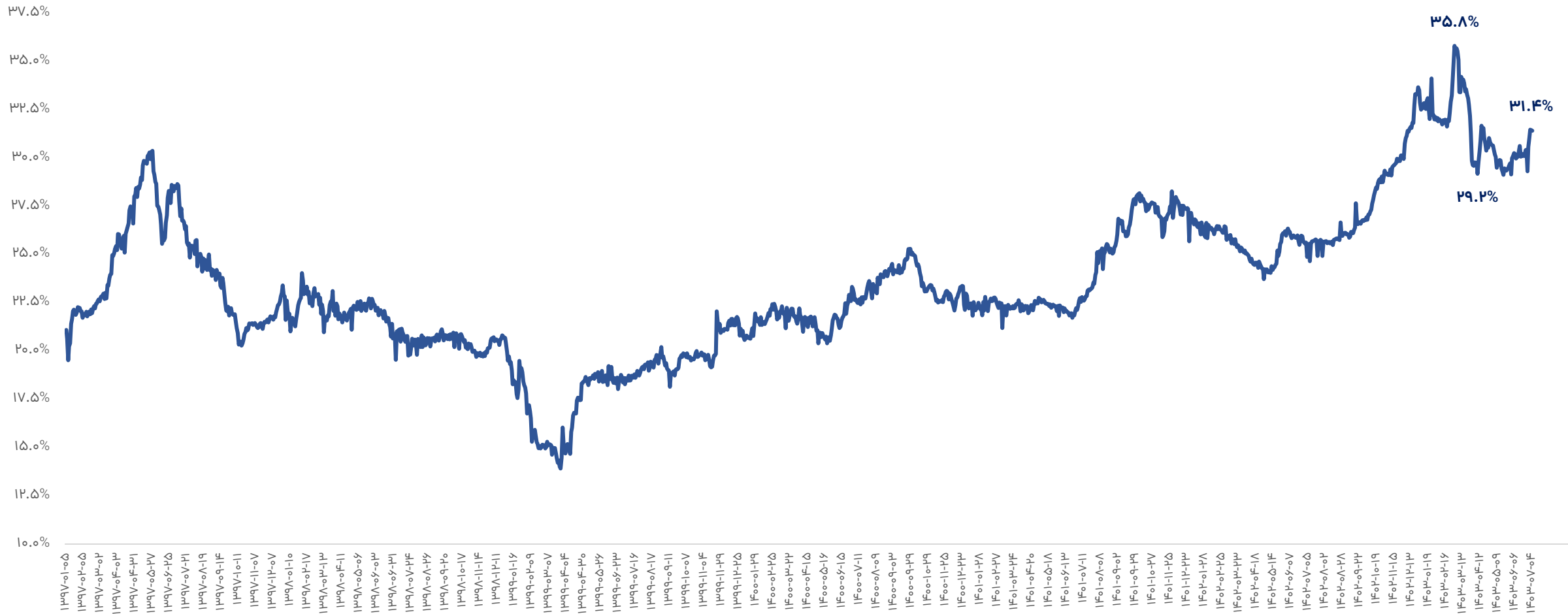
اختلاف دلار آزاد و نیما



در این هفته نرخ اوراق با افزایش یک درصدی به ۳۱.۴ درصد رسید.



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	۹,۸۶۰	۵.۰	۵.۰	۱۱.۱
بلوم و بیلت فولادی	ایران FOB	۴۵۳	۰.۹	۰.۹	-۵.۶
اسلب فولادی	ایران FOB	۴۳۲	۰.۰	۰.۰	-۸.۵
سنگ آهن ۶۲%	چین CFR	۹۳	۱.۲	۱.۲	-۱۶.۲
ورق سرد	CIS دریای سیاه FOB	۵۷۵	۰.۹	۰.۹	-۱۴.۴
ورق گرم	CIS دریای سیاه FOB	۴۷۰	۰.۰	۰.۰	-۱۵.۳
نفت برنت	برنت	۷۳	۰.۷	-۲.۷	-۱۷.۰
استایرن منومر داخلی	چین - Spot	۱,۱۱۷	-۱.۹	-۱.۹	-۲.۵
اتیلن	شمال شرق آسیا CFR	۸۵۸	۰.۰	-۰.۷	-۷.۵
پلی اتیلن سبک تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۱۱۹	۰.۶	۰.۶	۱۰.۵
پلی اتیلن سنگین فیلم	خلیج فارس FOB	۹۰۳	۰.۰	۰.۰	-۴.۷
پروپیلن	چین CFR	۸۵۰	۰.۰	۰.۰	۰.۶
پلی پروپیلن تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۰۷۶	-۰.۶	-۰.۶	-۵.۰
پلی وینیل کلراید	چین CFR	۷۶۷	۰.۷	۰.۷	-۲.۷
نفتا	ژاپن CFR	۶۴۶	-۰.۹	-۰.۹	-۱۰.۸
MTBE	سنگاپور FOB	۷۲۱	-۵.۱	-۵.۱	-۲۴.۲
پاراژایلین	کره FOB	۸۴۶	۳.۳	۳.۳	-۱۷.۱
بنزن	کره FOB	۹۳۶	۰.۳	۰.۳	-۱۰.۵
آلکیل بنزن خطی	خلیج فارس FOB	۱,۴۱۰	-۱.۴	-۱.۴	۰.۰
بوتادین	چین CFR	۱,۵۹۰	۰.۶	۰.۶	۱۴.۴
تولوئن	چین CFR	۷۴۳	-۰.۱	-۰.۱	-۱۷.۷
متانول	چین CFR	۲۹۱	۲.۸	۲.۸	-۲.۷
اوره	چین FOB	۲۶۸	-۲.۲	-۲.۲	-۲۱.۲
پلی اتیلن ترفتالات	جنوب شرق آسیا FOB	۸۷۵	-۰.۶	-۰.۶	-۸.۴
اکریلو نیتریل بوتادین استایرن	چین CFR	۱,۴۴۰	-۰.۳	-۰.۳	۴.۴
اتانول	رتردام FOB	۷۰۳	۰.۰	-۰.۳	-۴.۵
بنزین پیرولیز	خلیج فارس FOB	۵۷۹	-۰.۷	-۰.۷	-۴.۶
میعانات گازی	پارس جنوبی	۶۷	-۳.۰	-۳.۰	-۱۵.۷
دوده صنعتی	خلیج فارس FOB	۹۶۰	۰.۰	۰.۰	۱.۱



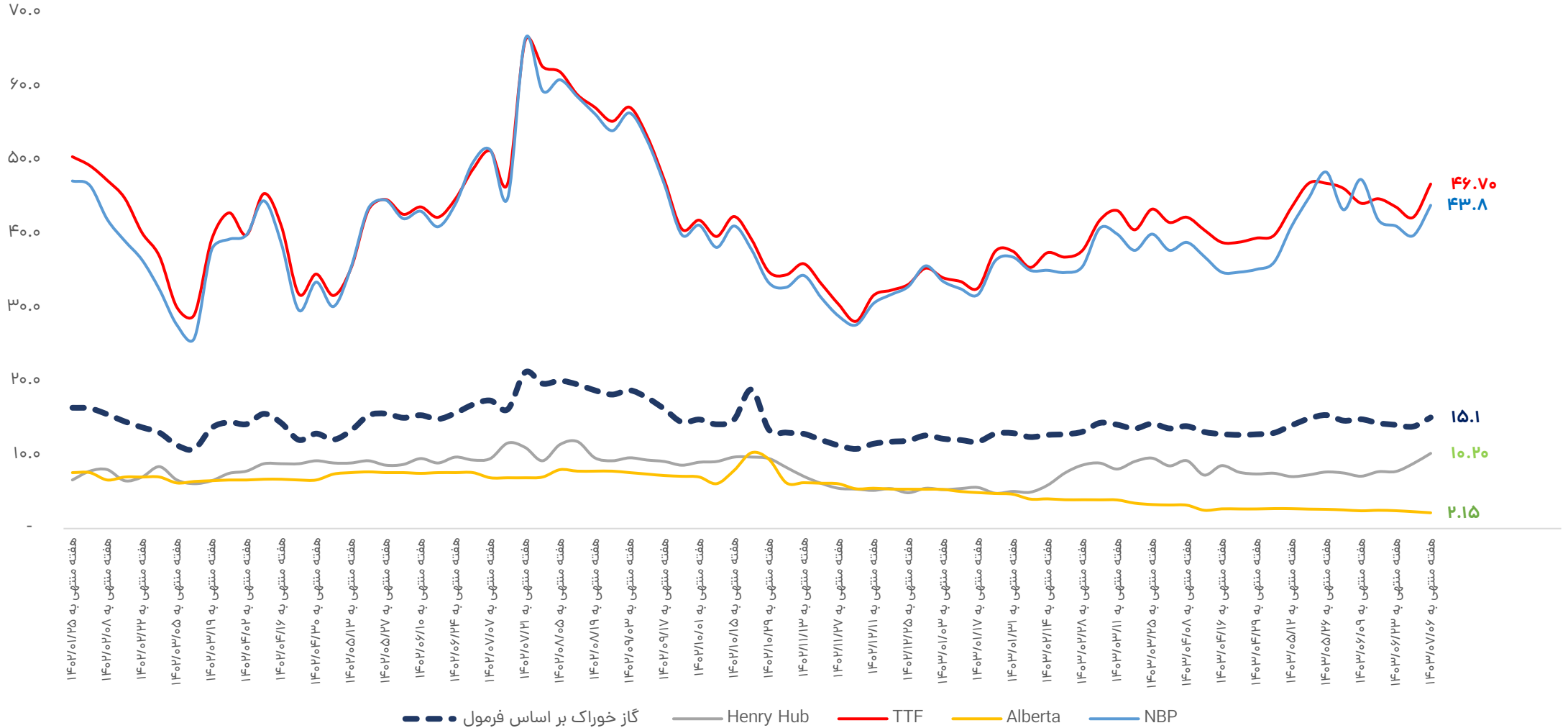
میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۰%	۳۸,۸۷۰	۳%	۳۸,۸۷۰	کنسانتره
۰%	۵۴,۴۷۹	۳%	۵۴,۴۹۱	گندله
۱%	۱۲۳,۷۸۰	-۲%	۱۲۴,۵۹۴	آهن اسفنجی
۰%	۲۱۹,۴۱۵	-۳%	۲۲۰,۳۸۴	بیلت
۰%	۲۸۴,۵۷۱	-	-	ورق گرم
۰%	۴۲۴,۱۷۳	-۱%	۴۲۴,۱۷۳	ورق گالوانیزه
۲۷%	۱,۲۴۲,۶۳۴	۳۵%	۱,۵۸۲,۱۸۲	شمش آلومنیوم
۰%	۴,۹۶۸,۰۶۴	۰%	۴,۹۶۸,۰۷۴	کاتد
۶%	۱۳,۲۰۱	۱%	۱۴,۰۴۱	سیمان



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۹%	۴۴۶,۶۶۰	-۱%	۴۸۵,۹۵۱	پت
۱%	۱۳۰,۸۴۸	-۵%	۱۳۱,۹۴۶	اوره
۳%	۴۸۶,۰۶۸	۰%	۵۰۱,۸۰۰	پلی پروپیلن
۱%	۳۶۶,۷۳۷	۵%	۳۶۸,۵۸۴	PVC
۱%	۳۳۱,۹۹۵	-۱%	۳۳۵,۹۶۲	روغن پایه
۱۸%	۳۹۸,۷۳۵	۴%	۴۷۲,۳۷۰	پلی اتیلن
۰%	۶۲۸,۵۷۱	۰%	۶۲۸,۵۷۱	LAB
۱۵%	۱۳۱,۱۸۸	۷%	۱۵۰,۲۹۷	وکبوم باتوم
۰%	۲۰۴,۵۵۹	-۶%	۲۰۴,۵۵۹	لوبکات



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 ۱۵.۱ سنت در هر مترمکعب رسیده است که نسبت به هفته گذشته با کاهش مواجه گردید. باتوجه به نرخ دلار نیما ۴۶۶,۱۵۵ ریالی نرخ هر متر مکعب گاز حدود ۷۰,۳۸۹ ریال به دست می آید.



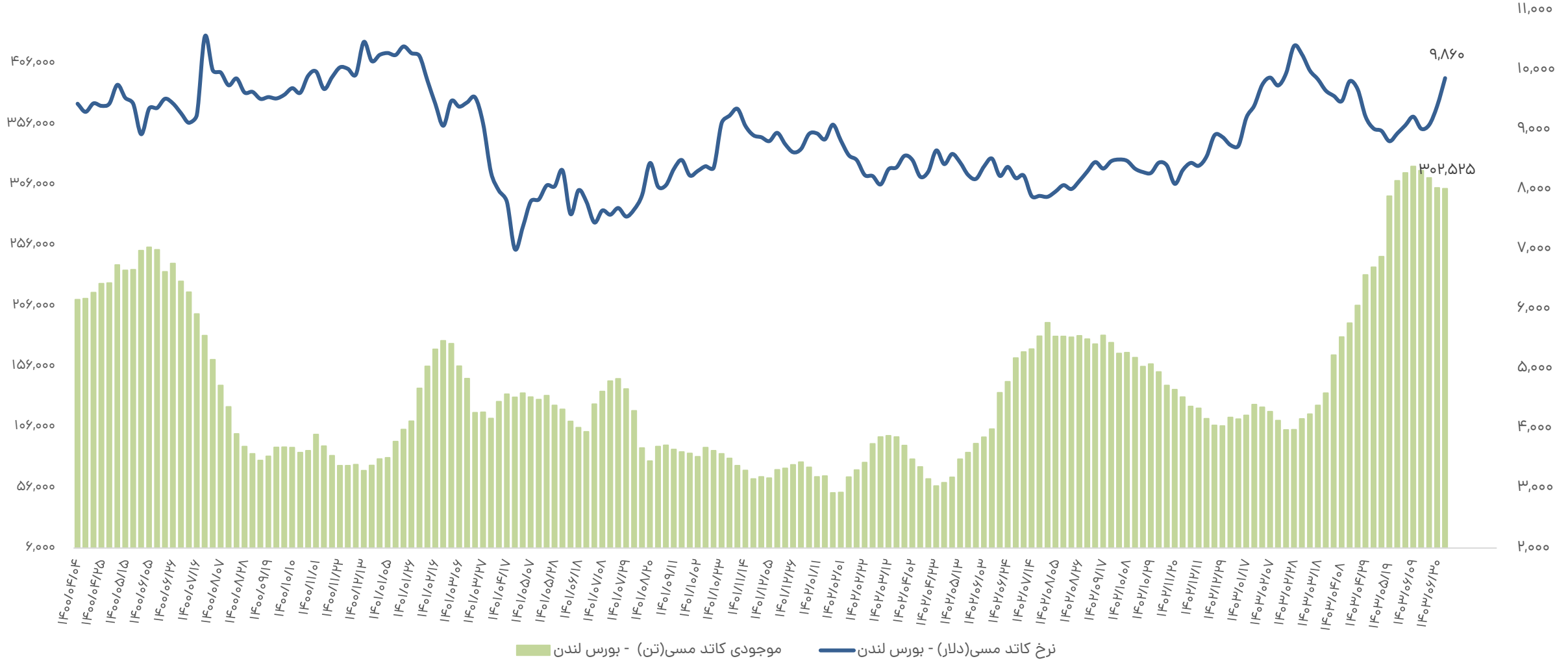
۴۶.۷۰
۴۳.۸

۱۵.۱

۱۰.۲۰

۲.۱۵

گاز خوراک بر اساس فرمول (Dashed Black) Henry Hub (Grey) TTF (Red) Alberta (Yellow) NBP (Blue)



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 ۹۸۶۰ دلار رسید. همچنین در ماه گذشته موجودی انبار LME، ۸۲۵ تن کاهش یافت.



نام ارز	ارزش بازار (میلیارد دلار)	قیمت (دلار)	بازده هفتگی
بیت کوین	۱,۲۵۶	۶۳,۵۳۹	۸%
اتریوم	۳۱۸	۲۶۴۸	۱۵%
بایننس	۸۷	۶۰۱	۱۱%
سولانا	۶۸	۱۴۷	۱۱%
ریپل	۳۳	۰.۵۹	۰%

دلار کشف شده شمش فولاد خوزستان در بورس کالا



گروه مالی کیمیا



دلار محاسبه شده در معاملات شمش فولاد با
۸٪ افزایش نسبت به هفته قبل به ۵۲,۰۰۰
تومان رسید



1W - SEKKE S: Gold Coin Equivalent Dollar Price ● O821756.53 H821409.04 L819882.34 C819077.97 +5509.49 (+0.68%)



900000.00
850000.00
819077.97
800000.00
750000.00
700000.00
650000.00
600000.00
550000.00
500000.00
450000.00
400000.00
350000.00
300000.00
250000.00
200000.00
150000.00
100000.00
50000.00

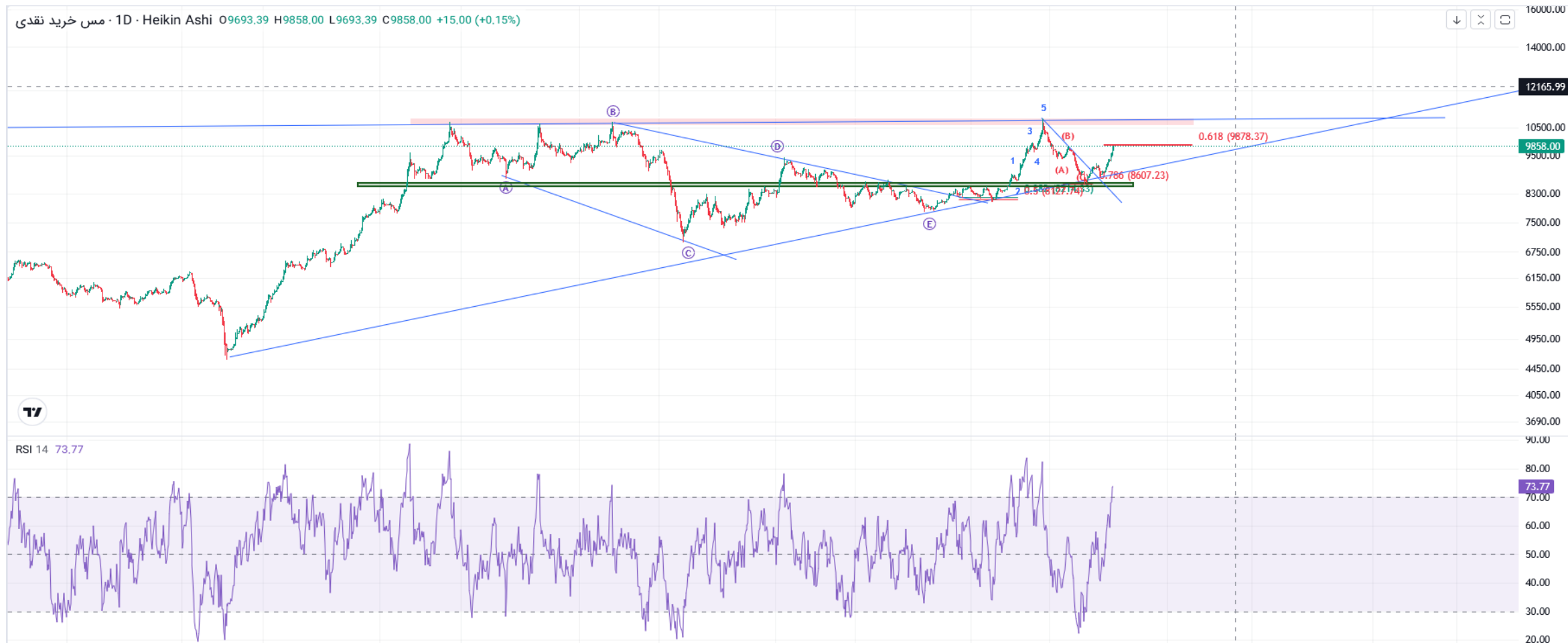




- کاهش ۵۰ واحدی نرخ بهره فدرال رزرو مطابق با انتظارات سبب تقویت قیمت مس شد. این حرکت به عنوان پاسخی به نرم شدن بخش تولید در ایالات متحده تلقی می شود. (منبع: Investing)
- ، موجودی مس در انبارهای بورس آتی شانگهای ۱۳.۹ درصد نسبت به جمعه گذشته کاهش یافت که نشان دهنده کاهش ۴۵ درصدی در سه ماه گذشته به ۱۸۵۵۲۰ تن است که کمترین میزان از فوریه است. (منبع: Investing)
- گروه مطالعات بین المللی مس CSG |مآزاد مس را ۹۵۰۰۰ تن در ژوئن گزارش داد که بالاتر از مآزاد ۶۳۰۰۰ تنی در ماه مه است.
- کمبود انرژی در زامبیا، یکی از تامین کنندگان عمده سنگ مس، تولید را تحت فشار قرار داده و بر نگرانی های عرضه افزوده است. . (منبع: Investing)



سطح فیبو ۱۹ درصد و همچنین مقاومت روانی ۱۰۰۰۰ دلار می تواند در این هفته سد راه افزایش قیمت مس گردد.



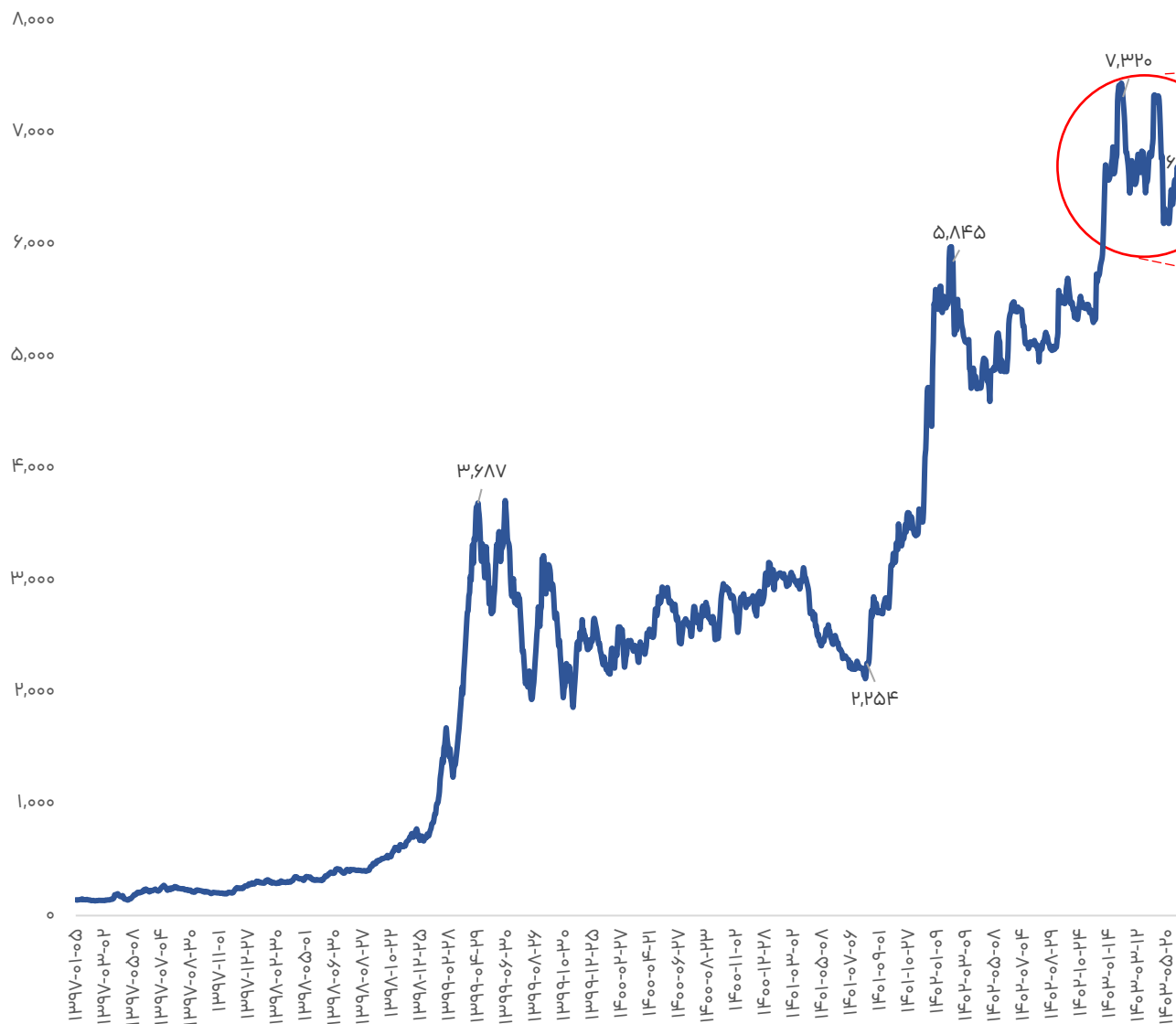
♦ بخش سوم

ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه

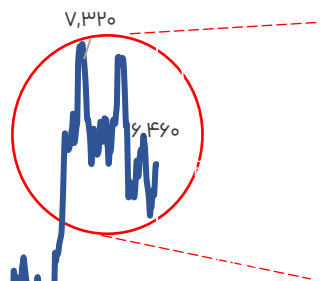
تغییرات قیمت نماد فملی



گروه مالی کیمیا

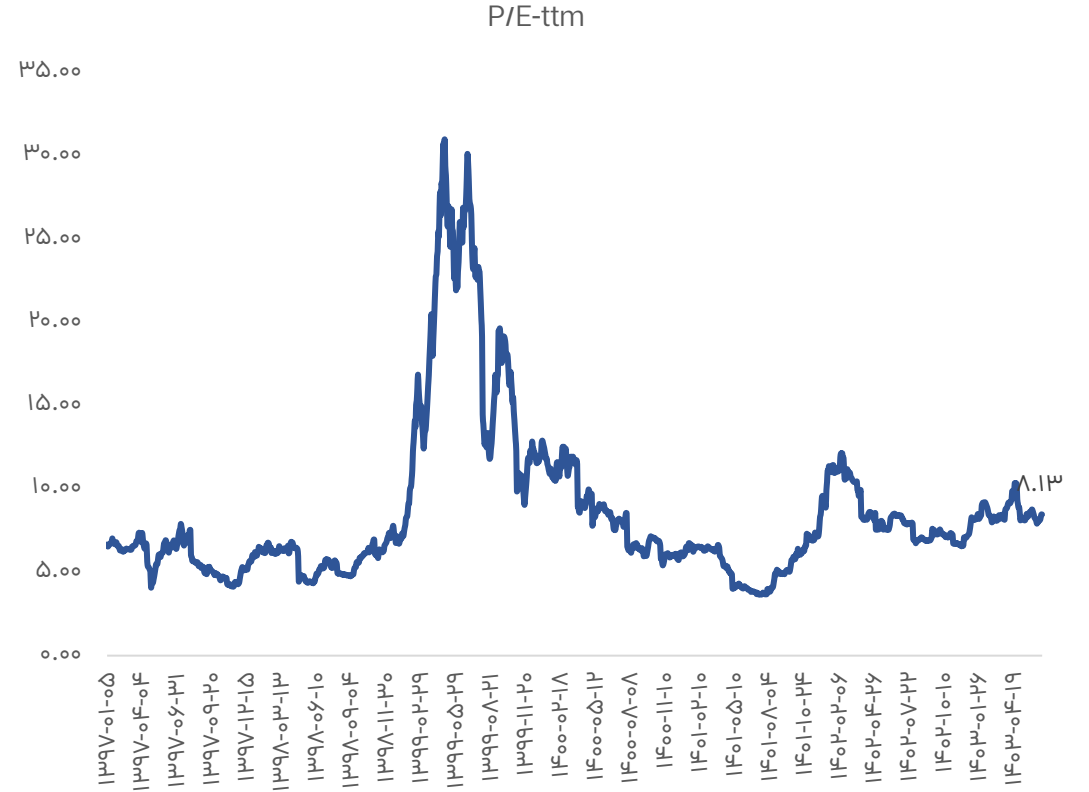


بازدهی از ابتدای سال	-۰.۹۳%
بازدهی هفته اخیر	۴.۱۹%
بازدهی ماه اخیر	-۱.۲۲%





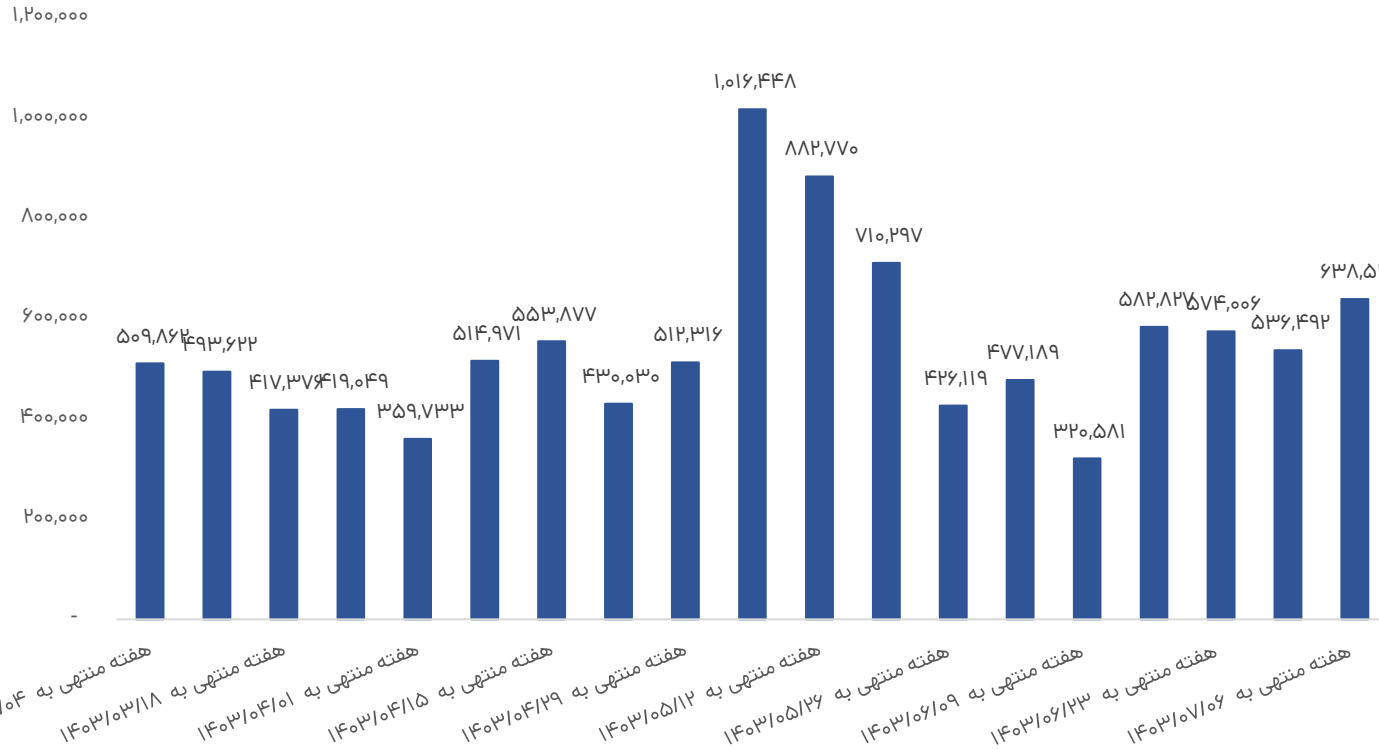
نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر



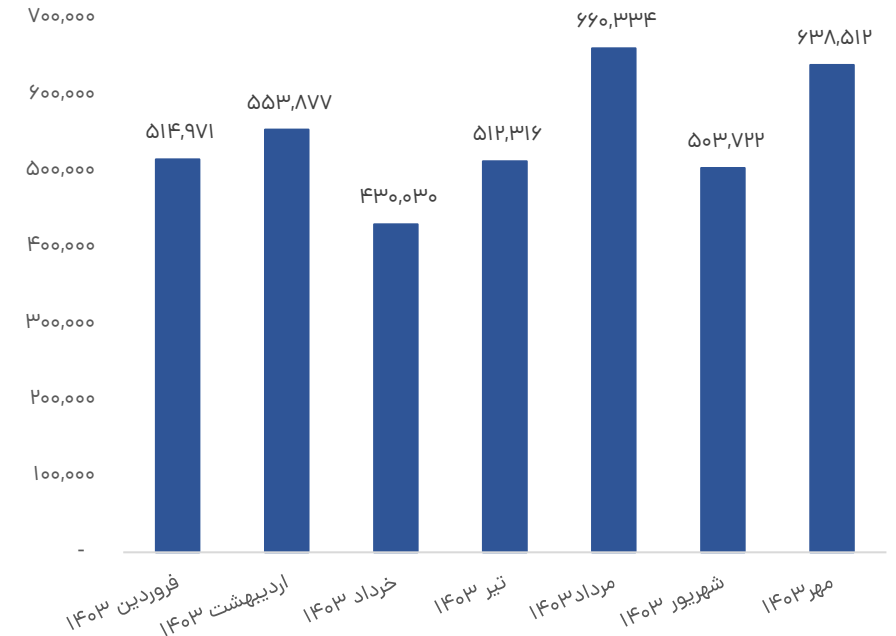


طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۰۶ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۶۳۸,۵۱۲ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با افزایش مواجه گردید.

میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)



میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

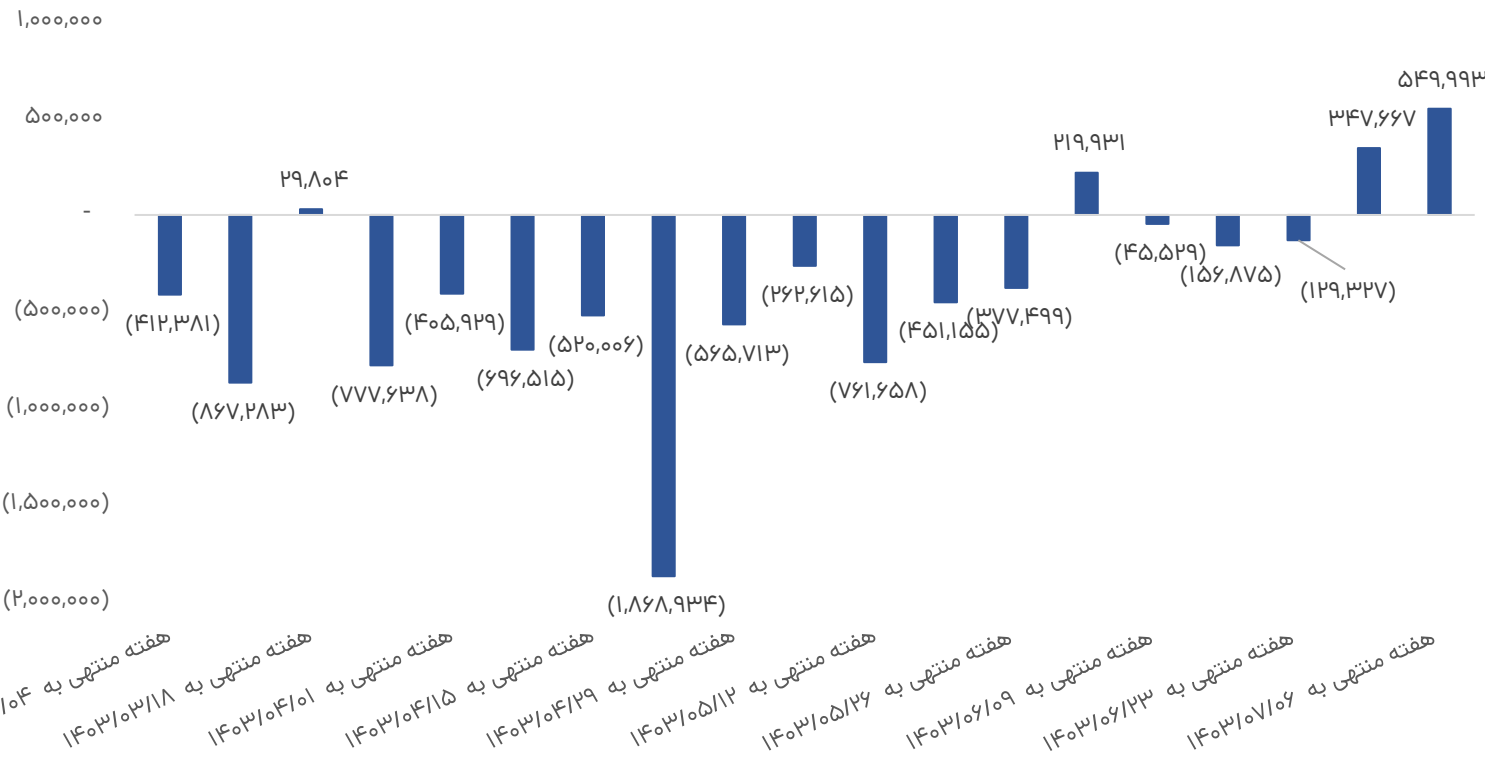




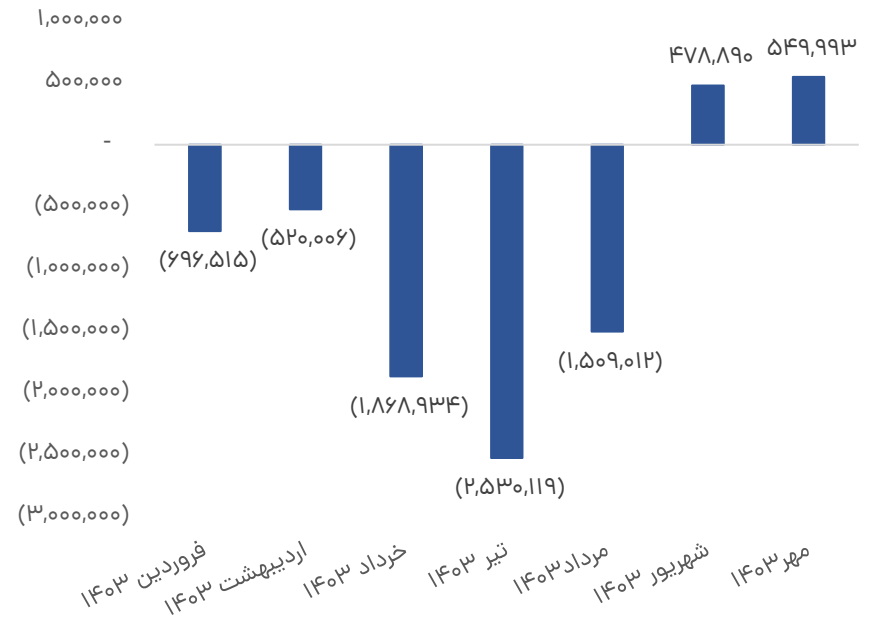
میزان ورود پول در نماد فملی

طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۳۰ ، ورود پول افراد حقیقی به میزان ۳۴۷,۶۶۷ میلیون ریال بوده است.

ورود پول (میلیون ریال)

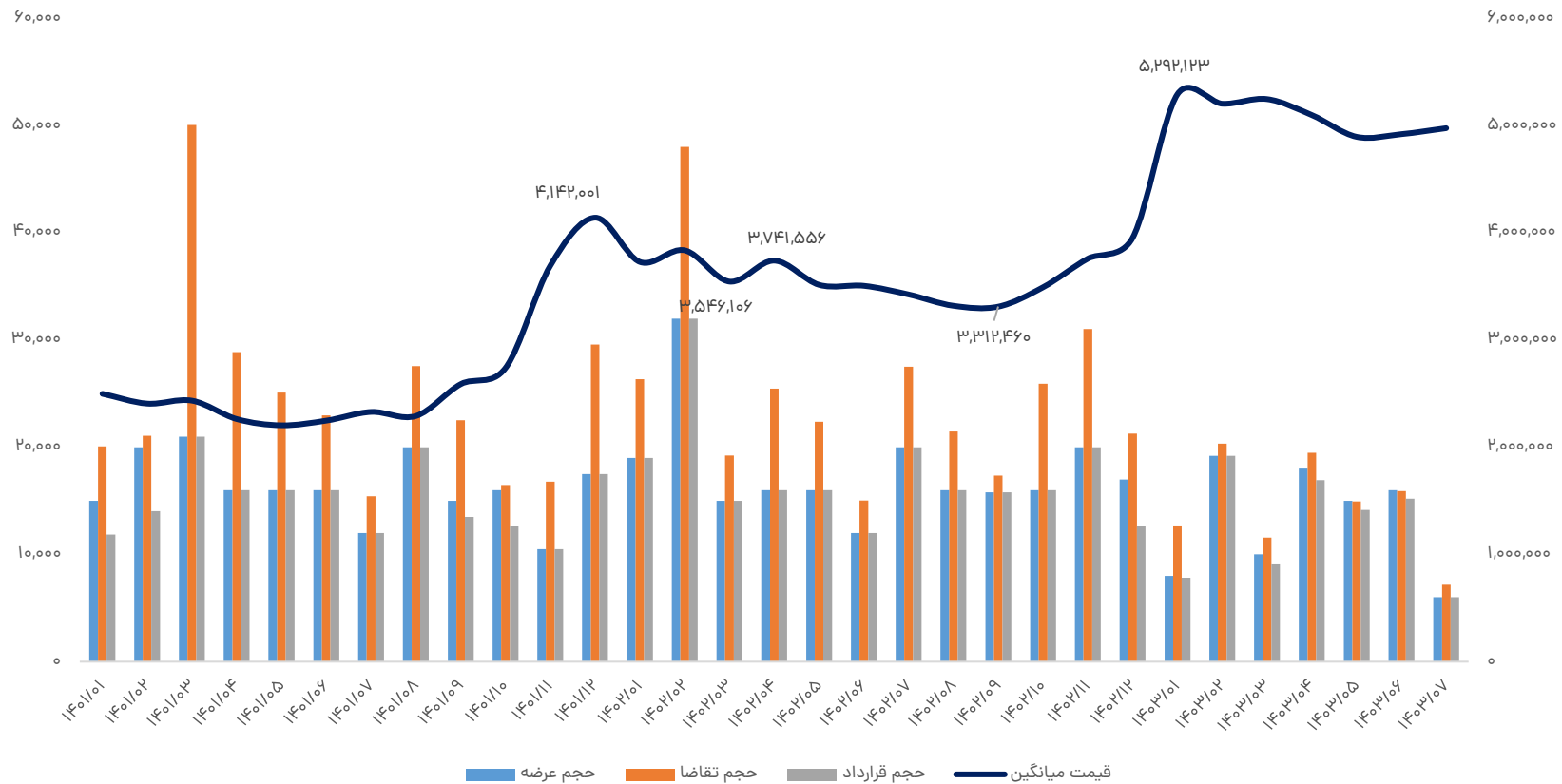


ورود پول (میلیون ریال)

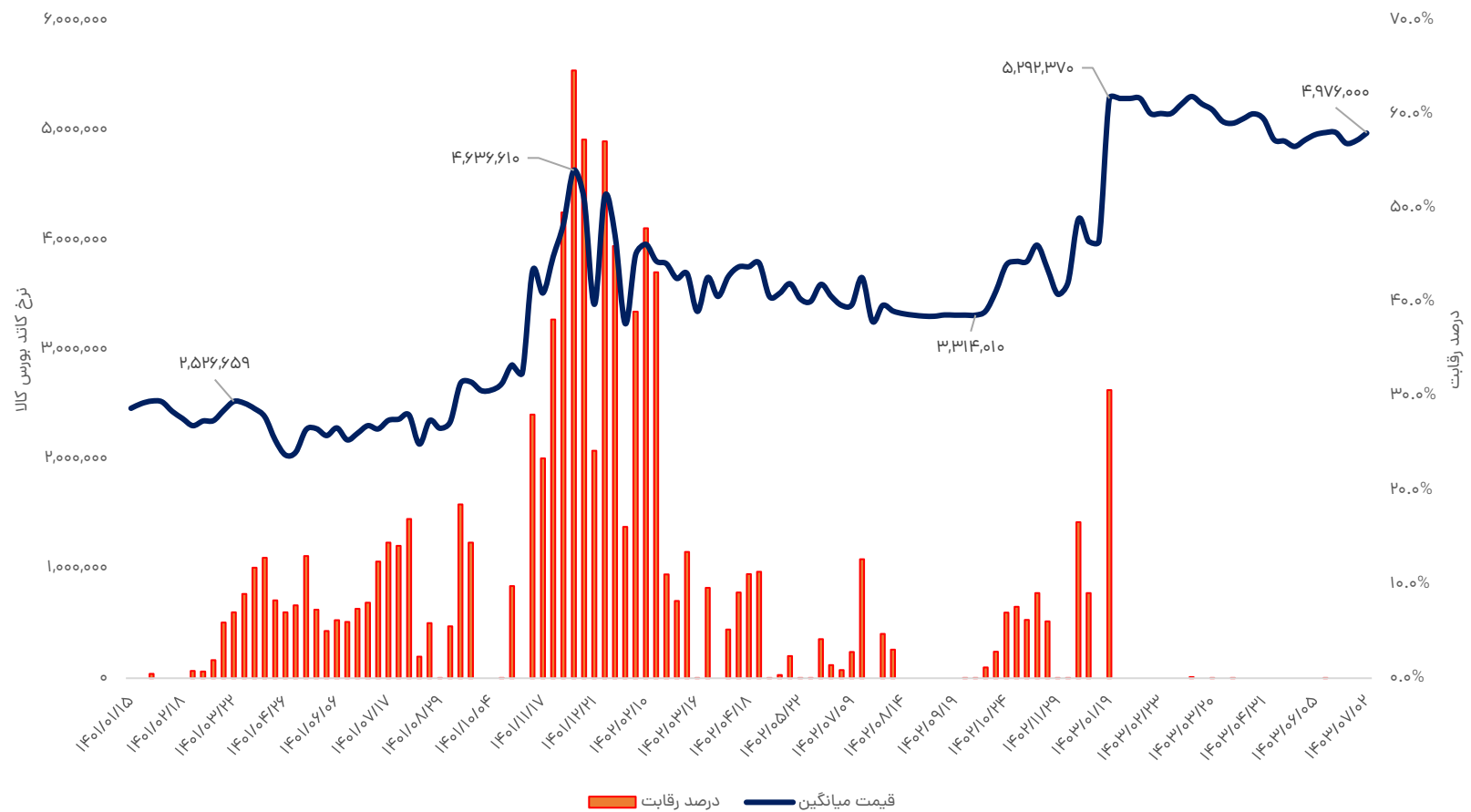


۱۴۰۳/۰۳/۰۴ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۳/۱۸ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۴/۰۱ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۴/۱۵ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۴/۲۹ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۵/۱۲ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۵/۲۶ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۶/۰۹ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۶/۲۳ هفته منتهی به
۱۴۰۳/۰۷/۰۶ هفته منتهی به

فروردین ۱۴۰۳
اردیبهشت ۱۴۰۳
خرداد ۱۴۰۳
تیر ۱۴۰۳
مرداد ۱۴۰۳
شهریور ۱۴۰۳
مهر ۱۴۰۳



در نمودار بالا روند معاملات ماهانه کاند مس در بورس کالا آورده شده است. در ماه مهر مجموعاً ۶۰۰ تن عرضه کاند توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۷۱۶ تن بود و با میانگین قیمت ۴,۹۷۶,۰۰۰ ریال معامله گردید.



این هفته کاتد مس با قیمت ۴,۹۷۶,۰۰۰ ریال بر کیلوگرم معامله گردید که نسبت به معاملات هفته گذشته تغییر خاصی نداشت. همچنین ۳۰۰ تن عرضه صورت گرفت که با تقاضا به میزان ۳۵۸۰ تن پاسخ داده شد.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۰۲۱ - ۵۸۶۱۹۰۰۰

دور نگار: ۰۲۱ - ۸۰۴۷۲۹۳