



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۸

منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۲۲



♦ بخش اول

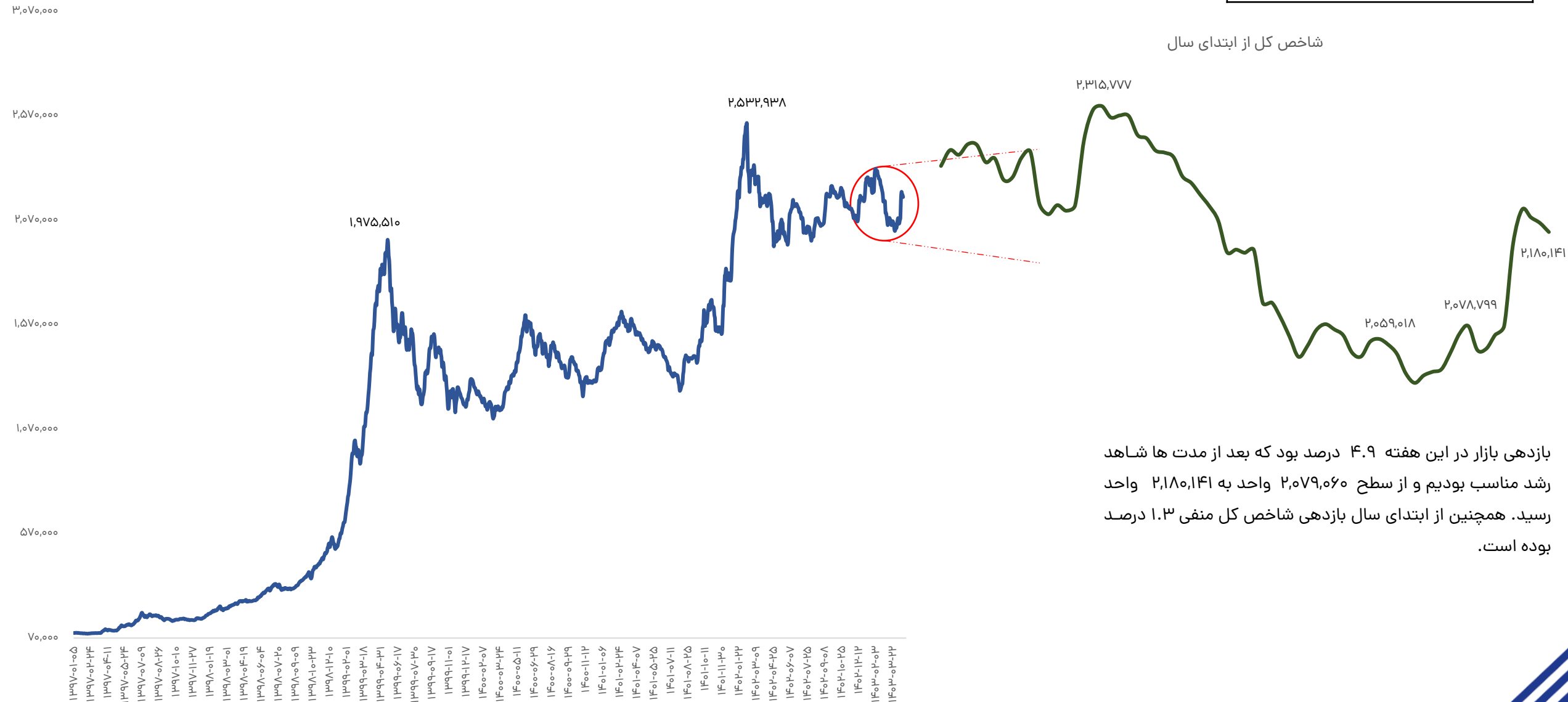
بازار سرمایه



شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷

بازدهی از ابتدای سال	-۱.۳%
بازدهی هفته اخیر	۴.۹%

شاخص کل از ابتدای سال

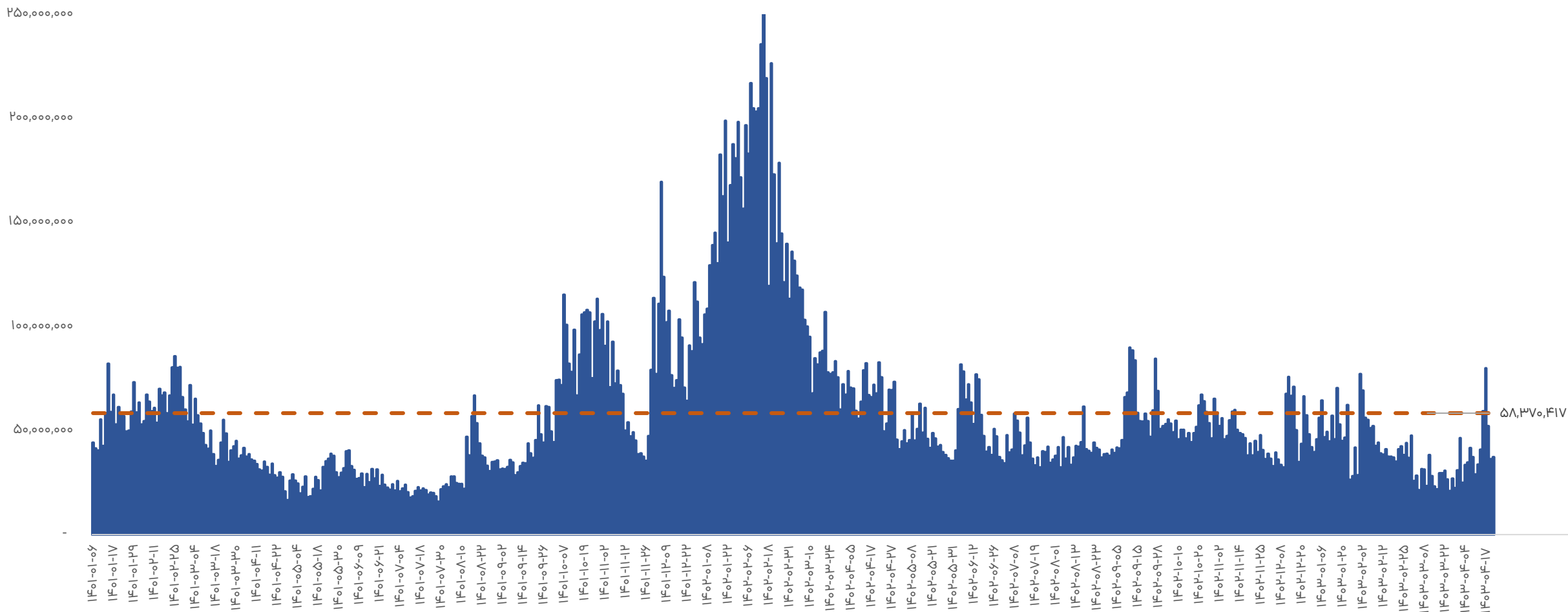


بازدهی بازار در این هفته ۴.۹ درصد بود که بعد از مدت ها شاهد رشد مناسب بودیم و از سطح ۲,۰۷۹,۰۶۰ واحد به ۲,۱۸۰,۱۴۱ واحد رسید. همچنین از ابتدای سال بازدهی شاخص کل منفی ۱.۳ درصد بوده است.



ارزش معاملات خرد در ابتدای هفته به ۸ همت رسید ولی با فروکش کردن هیجانانگاشی از نتایج انتخابات مجدداً کاهش یافت و به سطح ۳.۷ همت در انتهای هفته رسید.

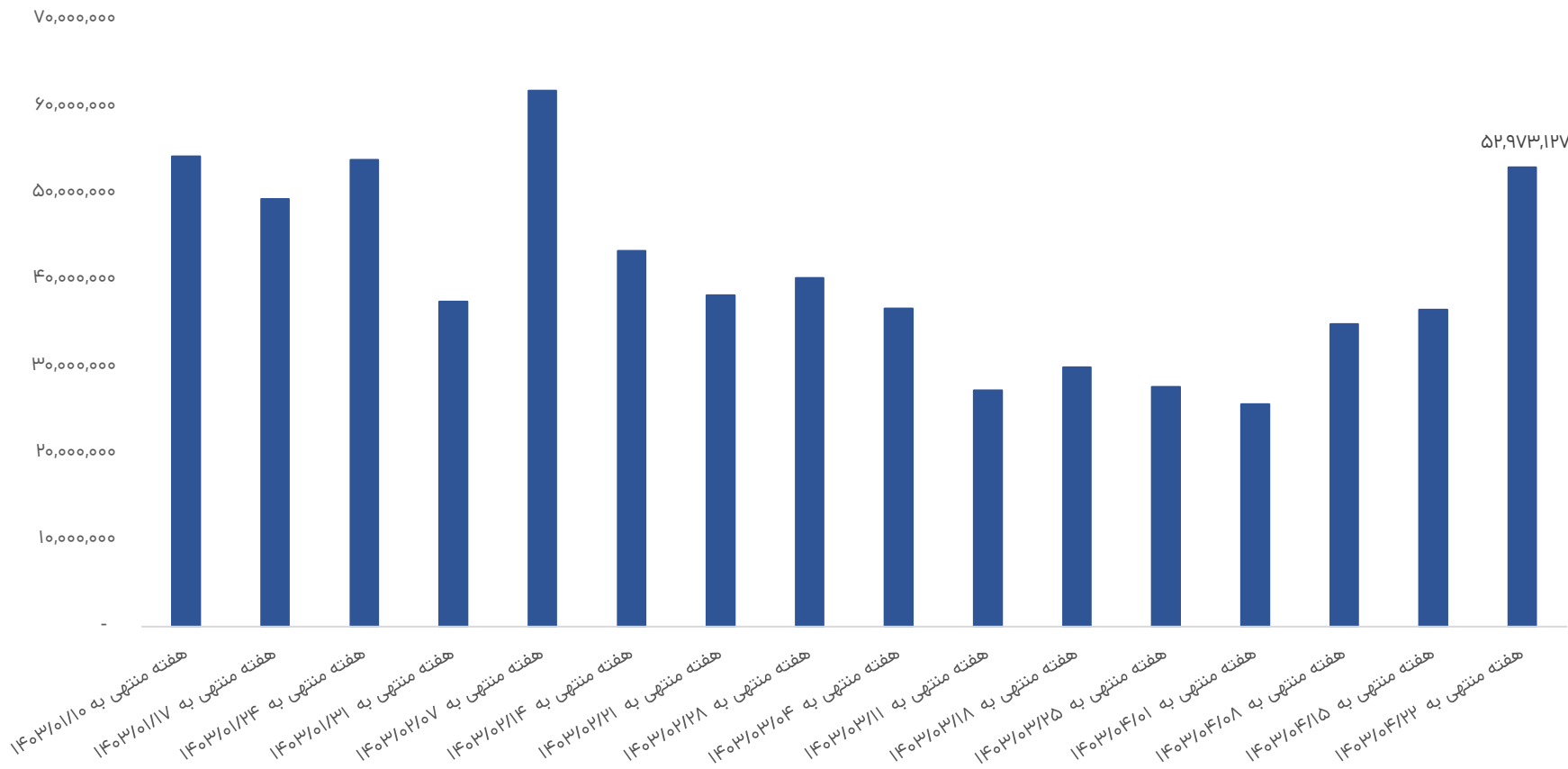
ارزش معاملات خرد از ابتدای سال ۱۴۰۱ - میلیون ریال



میانگین ارزش معاملات هفتگی

میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته به ۵۲,۹۷۳,۱۲۷ میلیون ریال رسید و نسبت به هفته گذشته با رشد ۴۵ درصدی مواجه گردید.

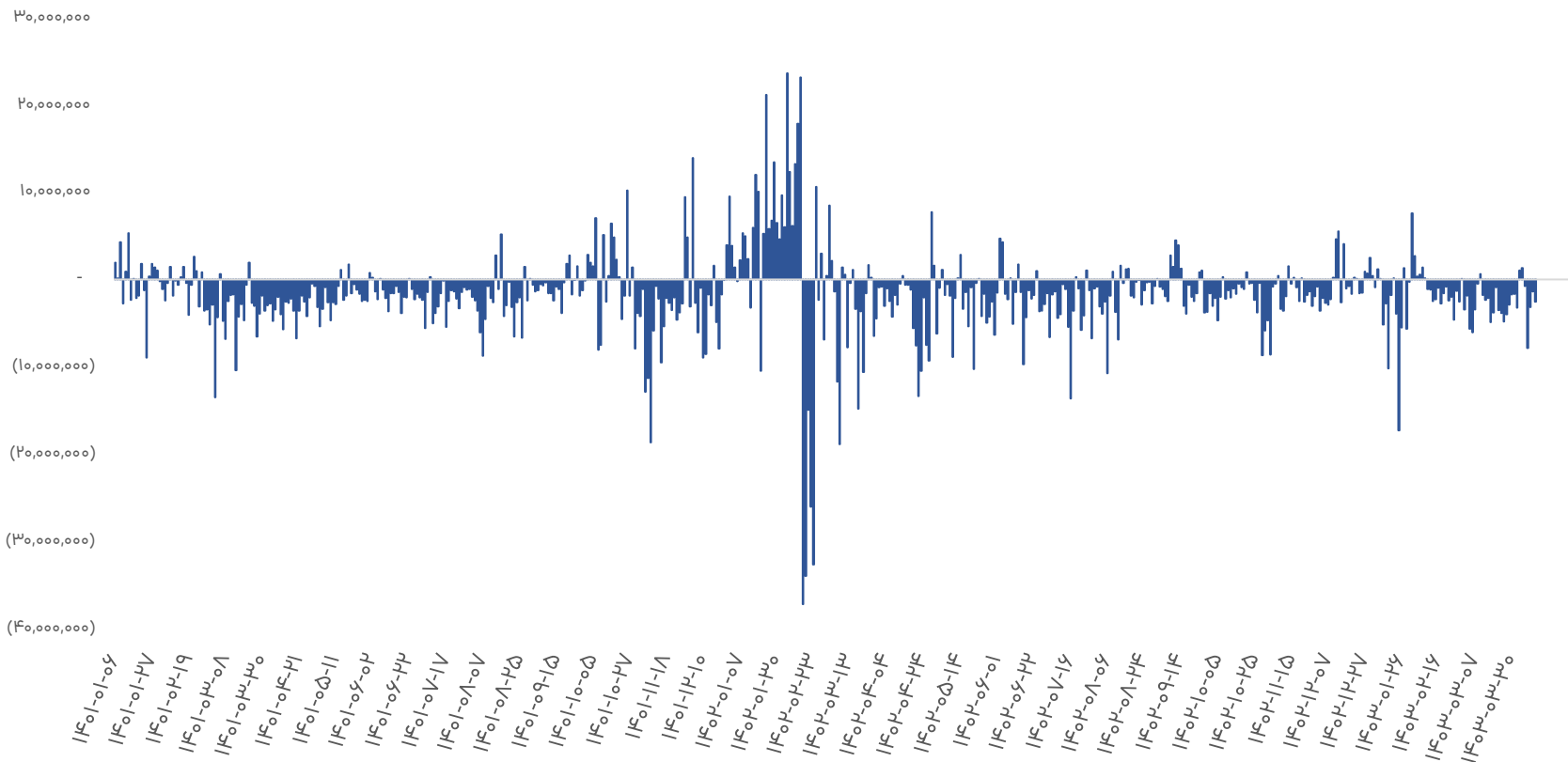
ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال





میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۷۱۱,۳۵۶,۶۸۰
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۱۴۱,۴۸۳,۹۳۰
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	-۶,۵۶۵,۶۷۵

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

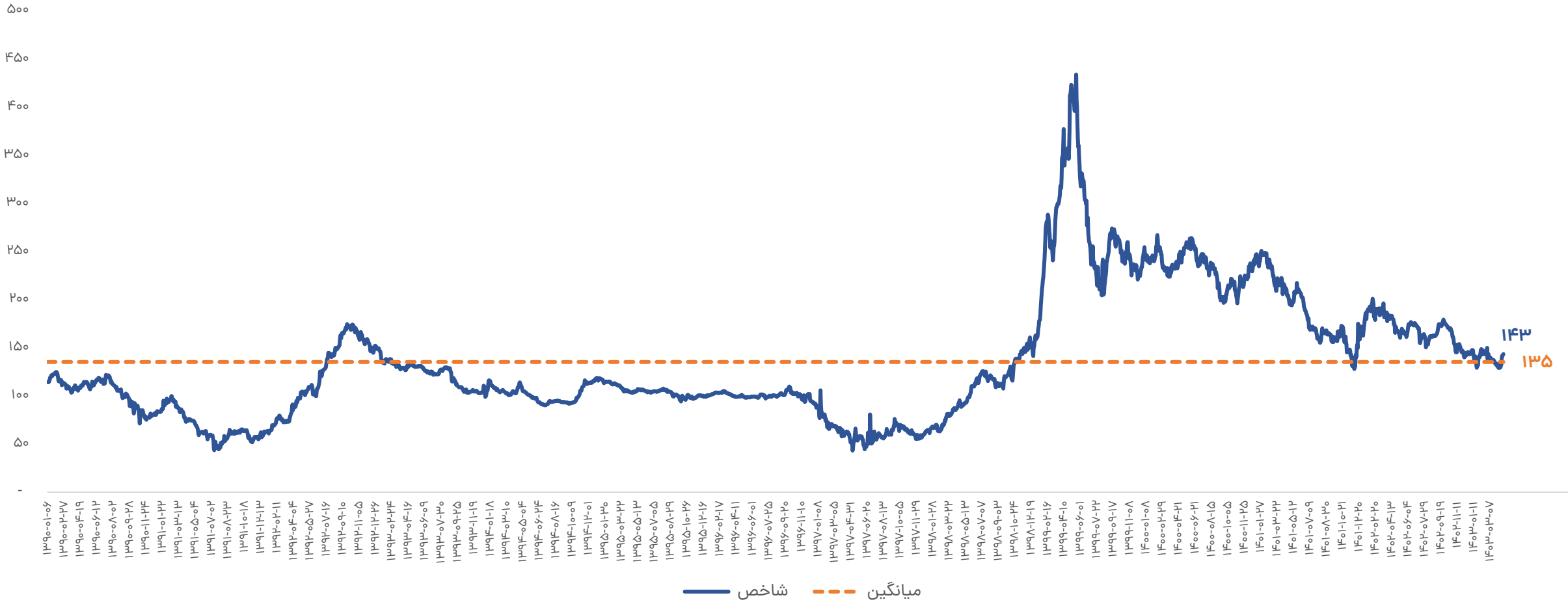


هفته گذشته اشخاص حقیقی ۶,۵۶۵,۶۷۵ میلیون ریال پول از بازار سهام خارج کردند. خالص خروج نقدینگی اشخاص حقیقی در سال جاری تاکنون بیش از ۱۴ همت بوده است. همچنین از تاریخ ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ و با شروع اصلاح شاخص کل ، میزان خروج پول اشخاص حقیقی از ۷۱ همت فراتر رفته است.



در این هفته ارزش بازار سرمایه بر حسب دلار با رشد هشت درصدی نسبت به هفته گذشته به محدوده ۱۴۳ میلیارد دلار رسید.

ارزش دلاری بازار سرمایه از ابتدای سال ۱۳۹۰ - میلیارد دلار

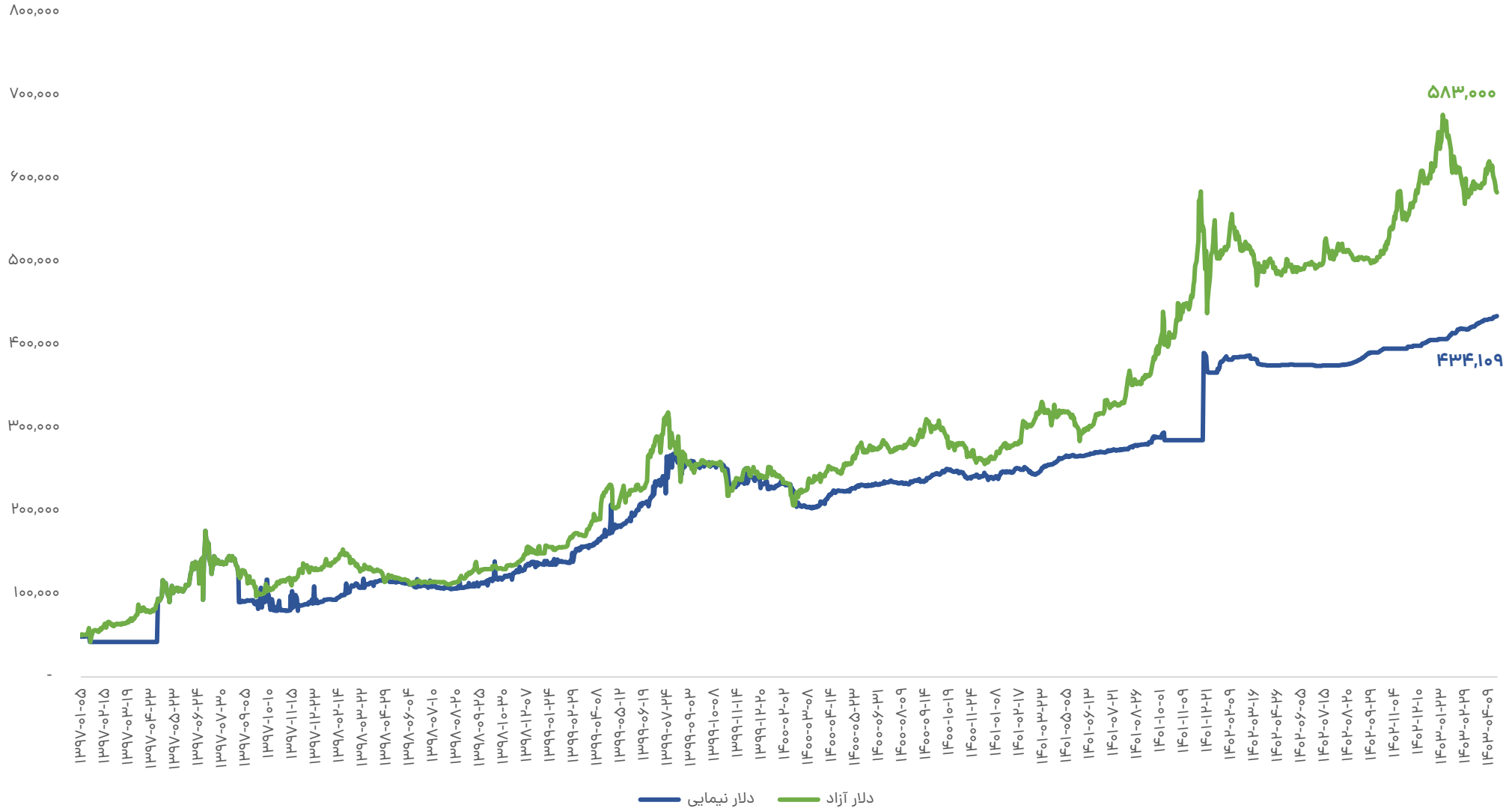


روند دلار نیمایی و دلار آزاد



گروه مالی کیمیا

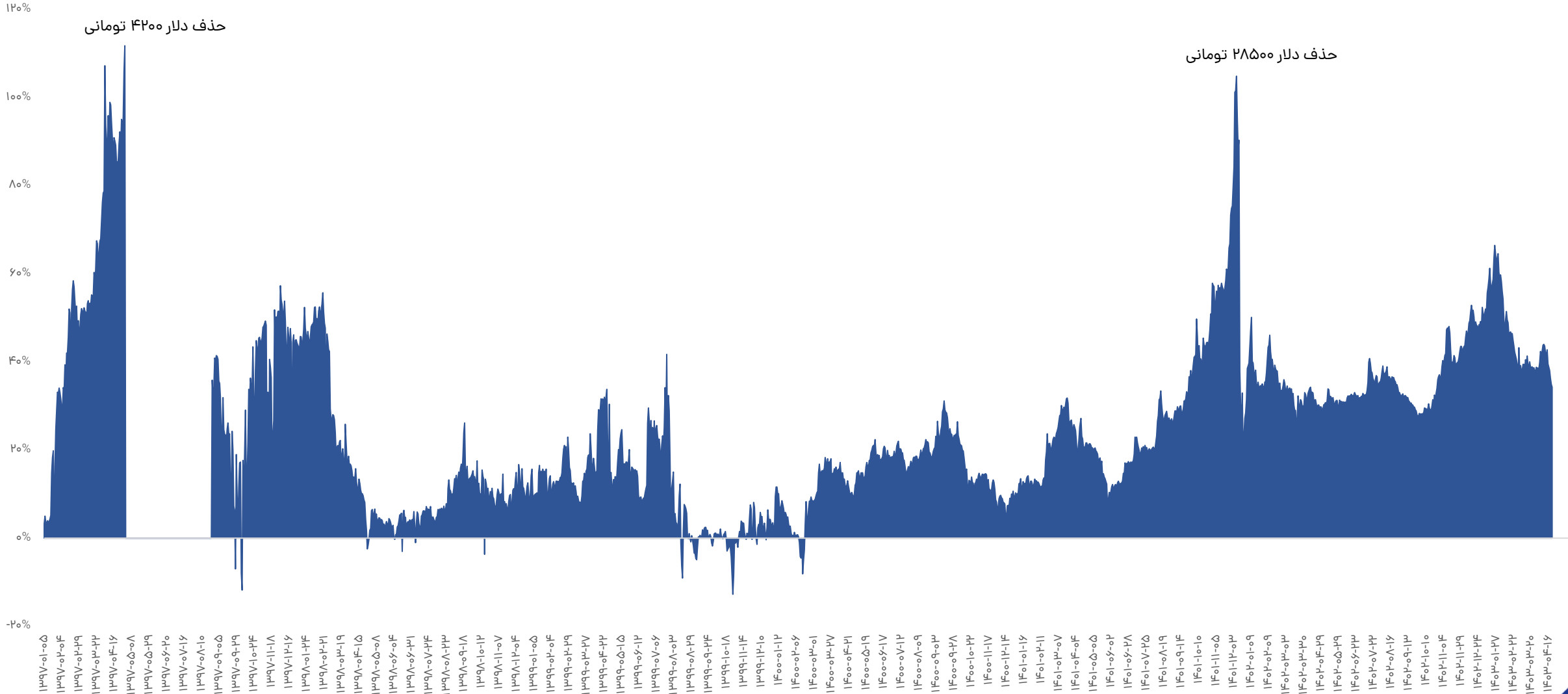
دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۵۸۳.۰۰۰ ریال رسید که نسبت به هفته ۵ درصد افت را شاهد بودیم. دلار نیمای نیز در این هفته ۳۰۴۵ ریال افزایش یافت.





اختلاف میان دلار نیما و بازار آزاد این هفته به ۳۴ درصد افزایش یافت.

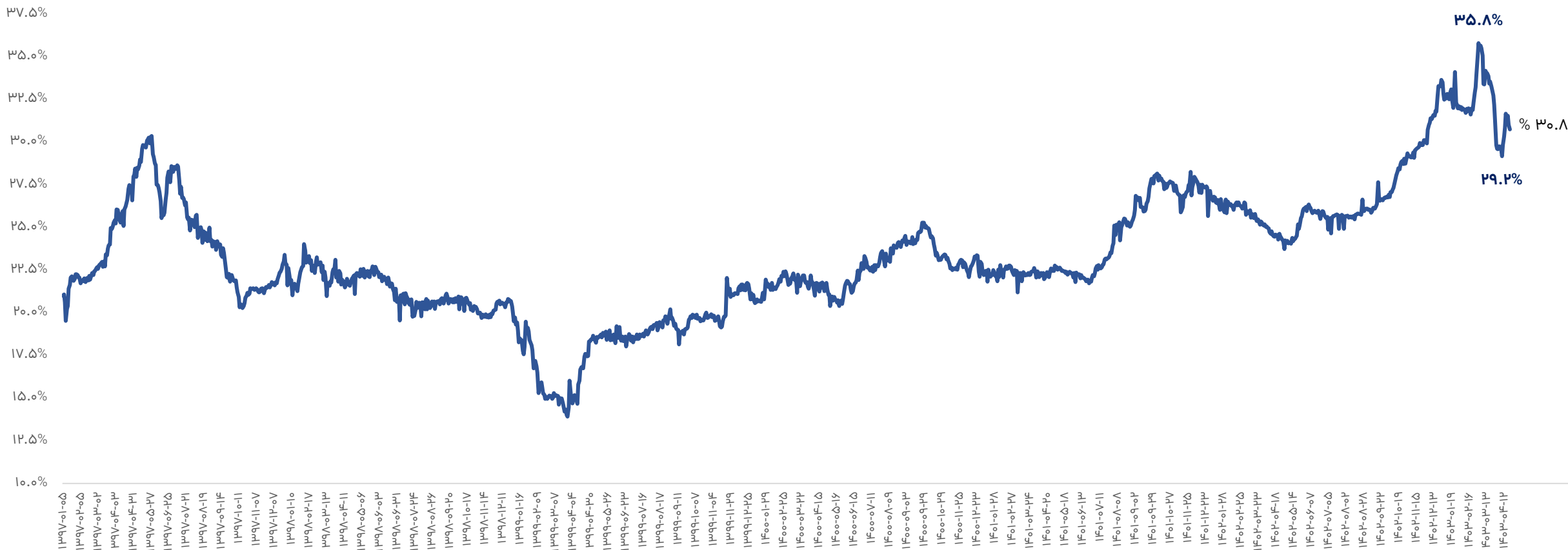
اختلاف دلار آزاد و نیما





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



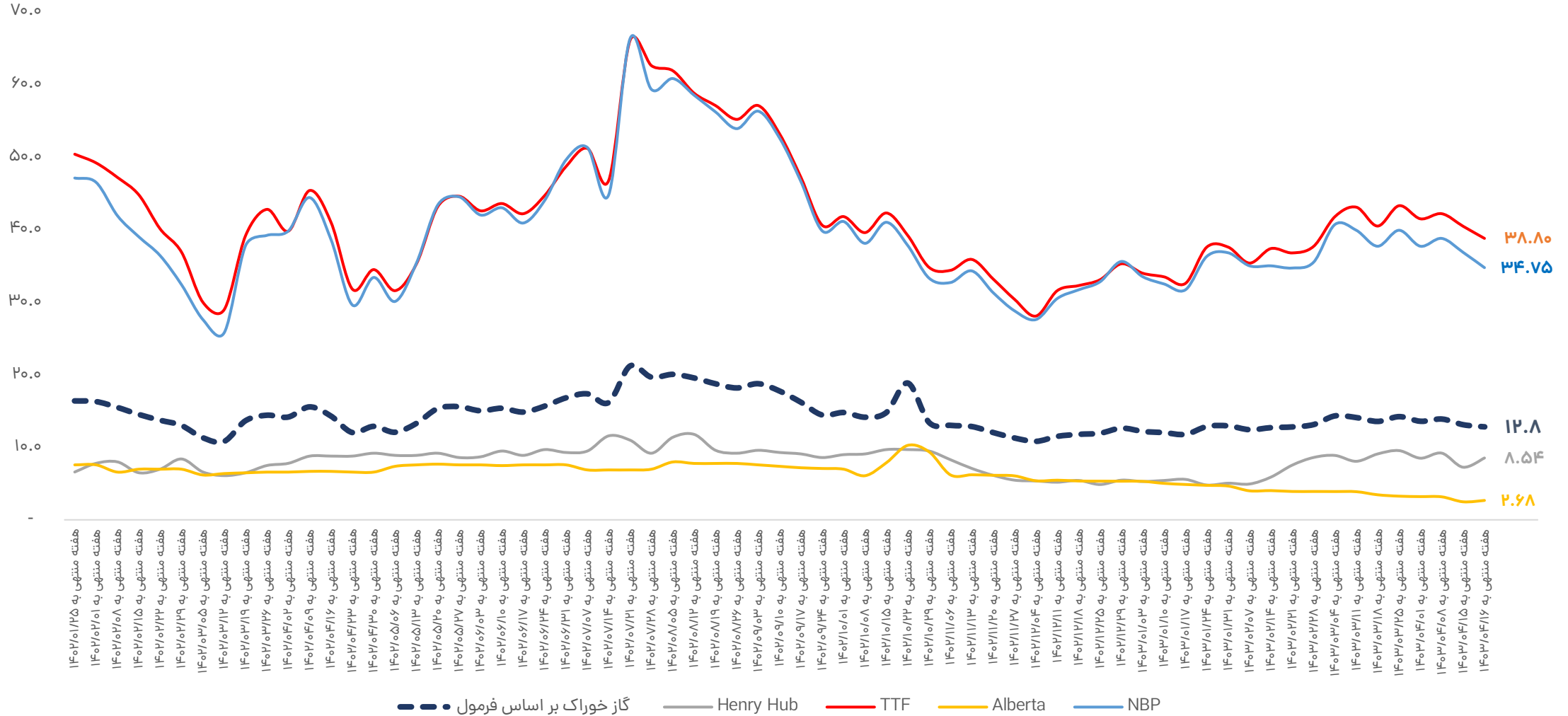
نام کالا	قرارداد	آخرین نرخ (دلار)	%W	%M	%Y
کاند مسی	بورس لندن	۹,۶۷۳	-۱.۴	۰.۳	۹.۰
شمش آلومینیوم	بورس لندن	۲,۴۸۱	-۲.۲	-۱.۶	۹.۳
بلوم و بیلت فولادی	ایران FOB	۴۸۰	۰.۰	۰.۰	۰.۰
اسلب فولادی	ایران FOB	۴۵۶	۰.۰	۰.۰	-۳.۴
سنگ آهن ۶۲%	چین CFR	۱۱۰	-۰.۹	۲.۸	-۰.۹
ورق سرد	CIS دریای سیاه FOB	۶۳۸	۰.۰	-۰.۳	-۵.۱
ورق گرم	CIS دریای سیاه FOB	۵۴۵	۰.۰	-۰.۵	-۱.۸
نفت برنت	برنت	۸۵	-۱.۷	-۰.۸	-۲.۸
استایرن منومر داخلی	چین - Spot	۱,۱۴۱	۰.۶	۰.۳	-۰.۳
اتیلن	شمال شرق آسیا CFR	۸۵۳	۰.۴	۱.۳	-۸.۱
پلی اتیلن سبک تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۱۴۸	۰.۳	۱.۵	۱۳.۳
پلی اتیلن سنگین فیلم	خلیج فارس FOB	۹۴۶	-۰.۸	-۰.۸	-۰.۱
پروپیلن	چین CFR	۸۷۵	۰.۰	۱.۷	۳.۶
پلی پروپیلن تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۱۱۳	۲.۳	۲.۳	-۱.۷
پلی وینیل کلراید	چین CFR	۸۷۰	-۰.۶	۲.۴	۱۰.۴
نفتا	ژاپن CFR	۷۲۲	۰.۴	۶.۸	-۰.۳
MTBE	سنگاپور FOB	۸۶۵	-۱.۶	۵.۰	-۹.۰
پارازابیلین	کره FOB	۱,۰۱۵	-۱.۲	-۰.۳	-۰.۶
بنزن	کره FOB	۱,۰۱۶	-۲.۳	-۲.۷	-۲.۹
آلکیل بنزن خطی	خلیج فارس FOB	۱,۴۰۰	-۱.۱	-۲.۸	-۰.۷
بوتادین	چین CFR	۱,۵۸۰	۰.۰	۵.۳	۱۳.۷
تولوئن	چین CFR	۹۲۷	۱.۳	۰.۵	۲.۷
متانول	چین CFR	۳۲۶	-۰.۳	۱.۶	-۴.۱
اوره	چین FOB	۲۸۶	-۱.۷	-۳.۴	-۴.۴
پلی اتیلن ترفتالات	جنوب شرق آسیا FOB	۹۶۵	۰.۵	-۰.۱	۱.۱
اکریلو نیتریل بوتادین استایرن	چین CFR	۱,۴۴۵	۰.۷	۰.۰	۴.۷
اتانول	رتردام FOB	۷۹۵	۰.۳	-۰.۱	۸.۰
بنزین پیرولیز	خلیج فارس FOB	۶۳۱	۱.۹	۹.۶	۴.۰
میعانات گازی	پارس جنوبی	۷۸	۰.۸	۸.۲	-۱.۵
دوده صنعتی	خلیج فارس FOB	۹۶۰	۰.۰	۰.۰	۱.۱

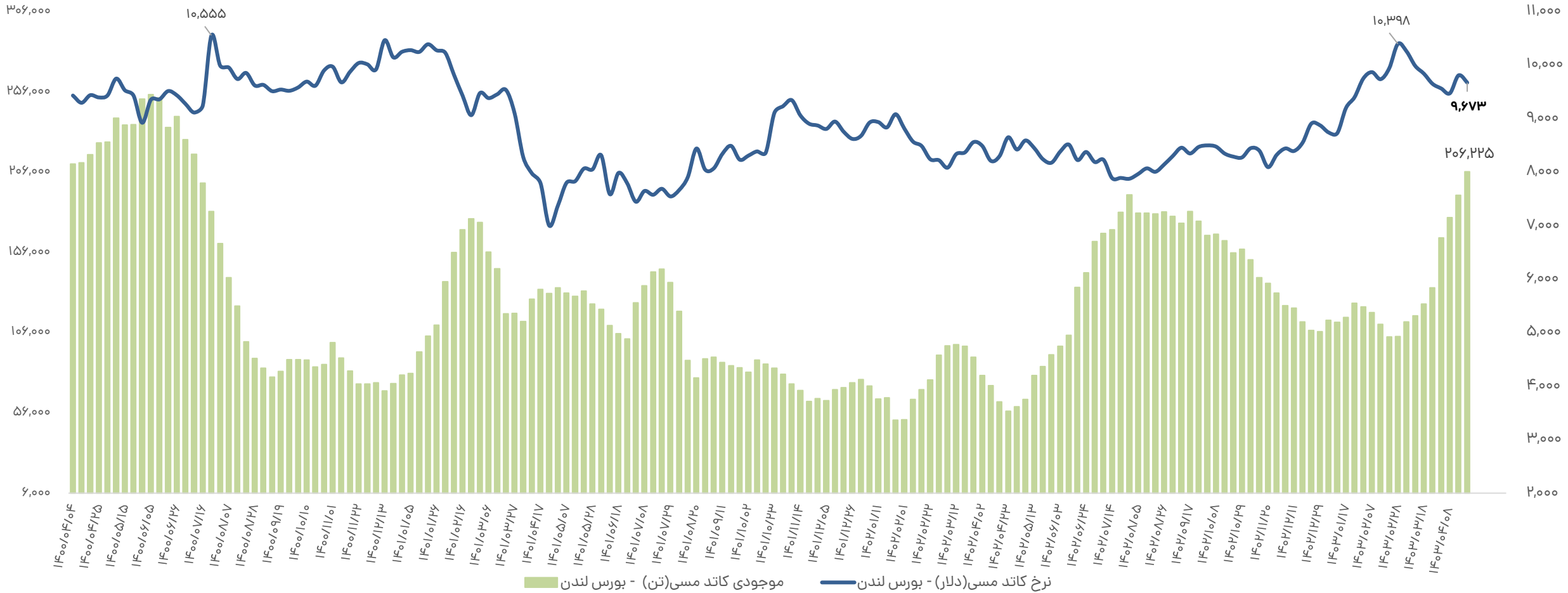


نام ارز	قیمت(دلار)	بازده هفتگی	ارزش بازار (میلیارد دلار)
بیت کوین	۵۷,۹۴۲	%۲.۶۳	۱,۱۴۲
اتریوم	۳,۱۳۲	%۵	۳۷۶
بایننس	۵۳۵	%۶.۶	۷۸
سولانا	۱۳۸	%۲.۴۸	۶۴
ریپل	۰.۵	%۱۸	۱۸
دوج کوین	۰.۱۰	%۲.۱۶	۱۵
شیا اینو	۰.۰۰۰۰۱۶	%۴	۱۰



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 ۱۲.۸ 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 ۵,۵۵۶ 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 ۹۶۷۳ دلار رسید. همچنین موجودی انبار LME با افزایش ۱۴۶۰۰ تنی به ۲۰۶۲۲۵ تن رسید



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده ماهانه	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۰%	۳۶,۲۷۰	۳۰۰%	-۲%	۳۶,۲۷۰	کنسانتره
۰%	۵۱,۵۸۲	۰%	-۱%	۵۱,۵۸۲	گندله
۰%	۱۲۳,۳۱۳	-۳%	۲%	۱۲۳,۲۱۸	آهن اسفنجی
۲%	۲۲۳,۷۹۷	۷%	۰%	۲۲۷,۳۷۹	بیلت
۱%	۲۲۵,۰۰۰	۱%	۰%	۲۲۷,۱۰۰	اسلب
۰%	۳۱۳,۲۳۱	-۳%	-۱%	۳۱۳,۲۳۱	ورق گرم
۰%	۴۴۱,۸۹۷	-۲%	-۵%	۴۴۱,۸۹۷	ورق گالوانیزه
۲۱%	۱,۱۵۸,۵۶۶	-۱%	۰%	۱,۴۰۶,۸۷۵	شمش آلومینیوم
۰%	۵,۱۰۷,۰۰۰	-۲%	۱%	۵,۱۰۷,۰۰۰	کاتد
۰%	۱,۴۴۷,۲۸۱	۳%	۲%	۱,۴۴۷,۲۸۱	شمش روی
۱۵%	۱۰,۰۵۱	۱۴%	۹%	۱۱,۵۲۴	سیمان فله
۱۰%	۱۱,۱۸۰	۹%	۴%	۱۲,۳۳۴	سیمان کیسه



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده ماهانه	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۵۶%	۳۰۱,۰۸۵	-۴%	-۲%	۴۷۱,۱۵۰	پت
۲%	۱۲۹,۰۲۸	۲۰%	۴%	۱۳۱,۴۸۸	اوره
۹%	۴۸۴,۷۶۹	۰%	۳%	۵۳۰,۵۹۲	پلی پروپیلن
۵%	۳۷۴,۹۲۷	-۳%	۱%	۳۹۳,۹۲۰	PVC
۱%	۳۴۶,۴۶۶	۰%	۳%	۳۴۹,۷۱۶	روغن پایه
۲%	۳۹۱,۵۵۷	۳%	۰%	۳۹۹,۹۴۲	پلی اتیلن
۰%	۵۷۷,۴۷۰	-۴%	-۱%	۵۷۷,۴۷۰	LAB
۰%	۱۶۲,۴۷۵	۳%	۲%	۱۶۲,۴۷۵	قیر
۰%	۱۵۳,۵۹۲	۶%	۵%	۱۵۳,۵۹۲	وکیوم بانوم
۰%	۲۳۳,۱۰۰	۳%	۷%	۲۳۳,۱۰۰	لوبکات

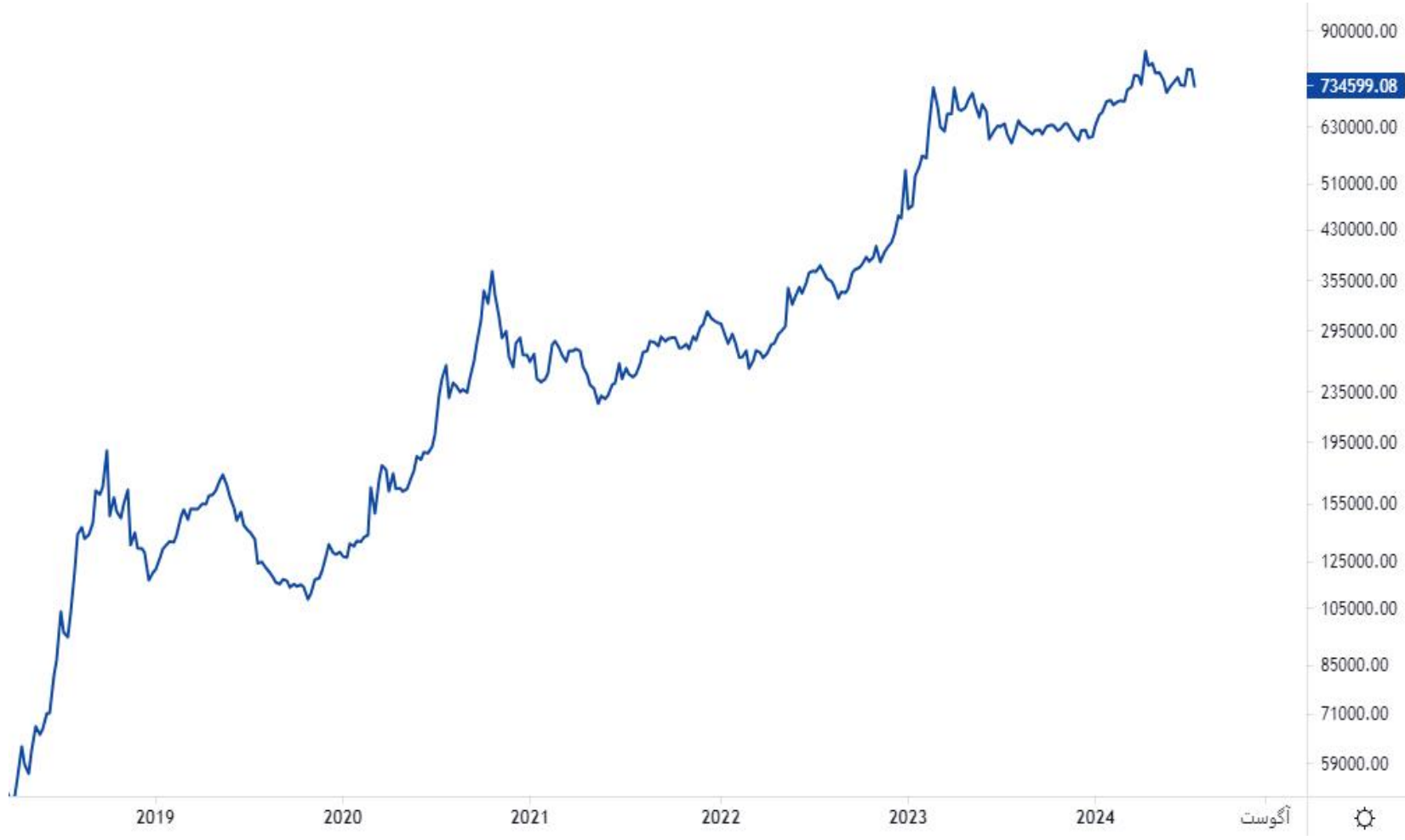


دلار کشف شده شمش فولاد خوزستان در بورس کالا



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.





➤ افزایش موجودی انبارها در کره جنوبی و تایوان (مقاصد اصلی صادرات مس چین) و همچنین افزایش موجودی در بورس LME به بالاترین مقدار از اکتبر ۲۰۲۱، کاهش واردات چین و افزایش صادرات چین به دلیل ضعف تقاضای داخلی بزرگترین مصرف کننده مس.

منبع : tradingeconomic

➤ انتشار داده های تورم ماهانه آمریکا و تورم ماهانه منفی ۱.۰ درصدی انتظارات برای کاهش نرخ بهره را به اوج رساند که سبب افزایش قیمت طلای جهانی گردید.

منبع : tradingeconomic

➤ مطابق با آخرین نظرسنجی جهانی معدن و کالاهای دویچه بانک، سرمایه گذاران در کوتاه مدت طلا و در میان مدت مس را ترجیح می دهند.

منبع : investing.com

➤ اتمام موجودی مهمات اکرابین و روسیه طی دو سال جنگ و افزایش تولید کارخانه های نظامی جهت ادامه جنگ تقاضای مس را تقویت می کند. هر گلوله توپ ۱۵۵ میلیمتری حاوی ۰.۵ کیلو مس می باشد. روسیه سالانه ۴.۵ میلیون گلوله تولید می کند که طی یک سال اخیر رشد ۱۵۰ درصدی داشته است.

منبع : fastmarket



به نظر میرسد ریز موج ۱ از موج ۵ تا قیمت ۹۸۰۰ دلار شکل گرفت و پس از آن قیمت وارد فاز اصلاحی ریزموج ۱ شده است که میتواند در قیمت ۹۶۰۰ دلار خاتمه یابد.



♦ بخش سوم

ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه



تغییرات قیمت نماد فملی

بازدهی از ابتدای سال	۱۲.۴۱%
بازدهی هفته اخیر	۵.۴۸%

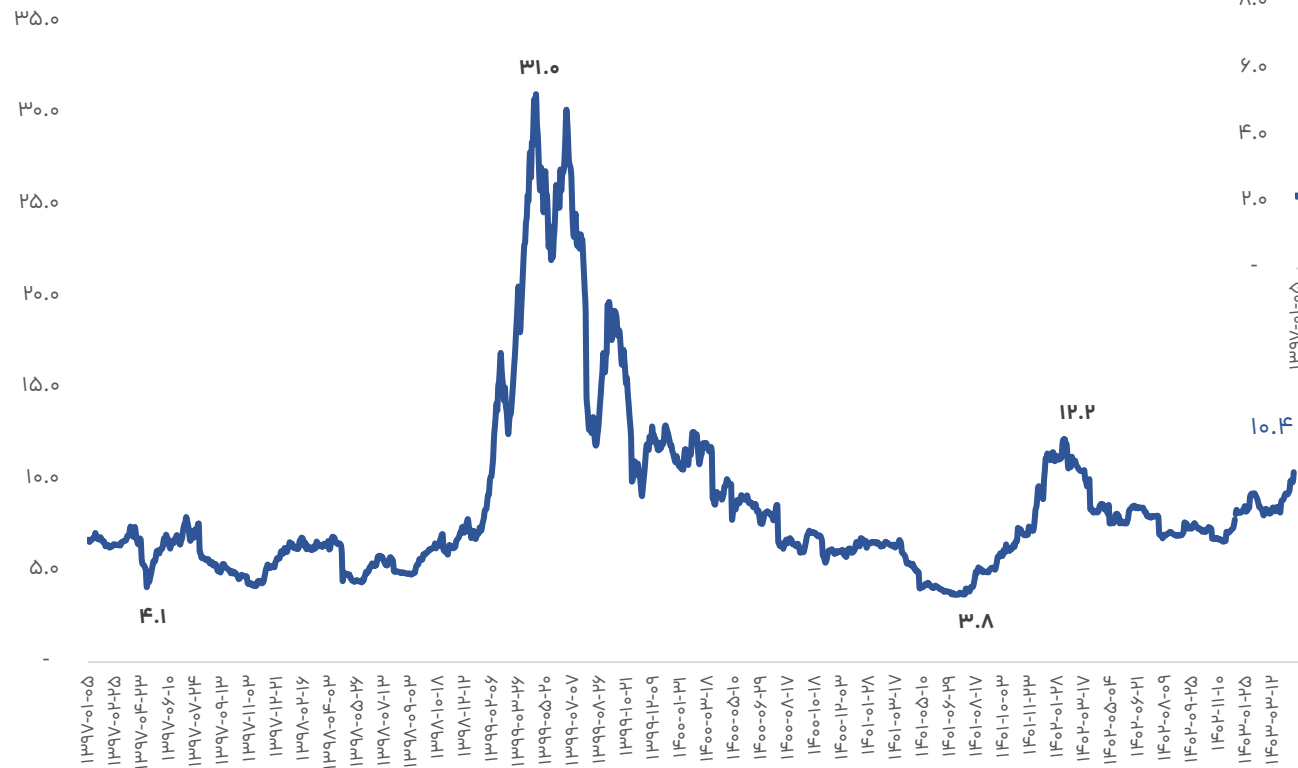


نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر

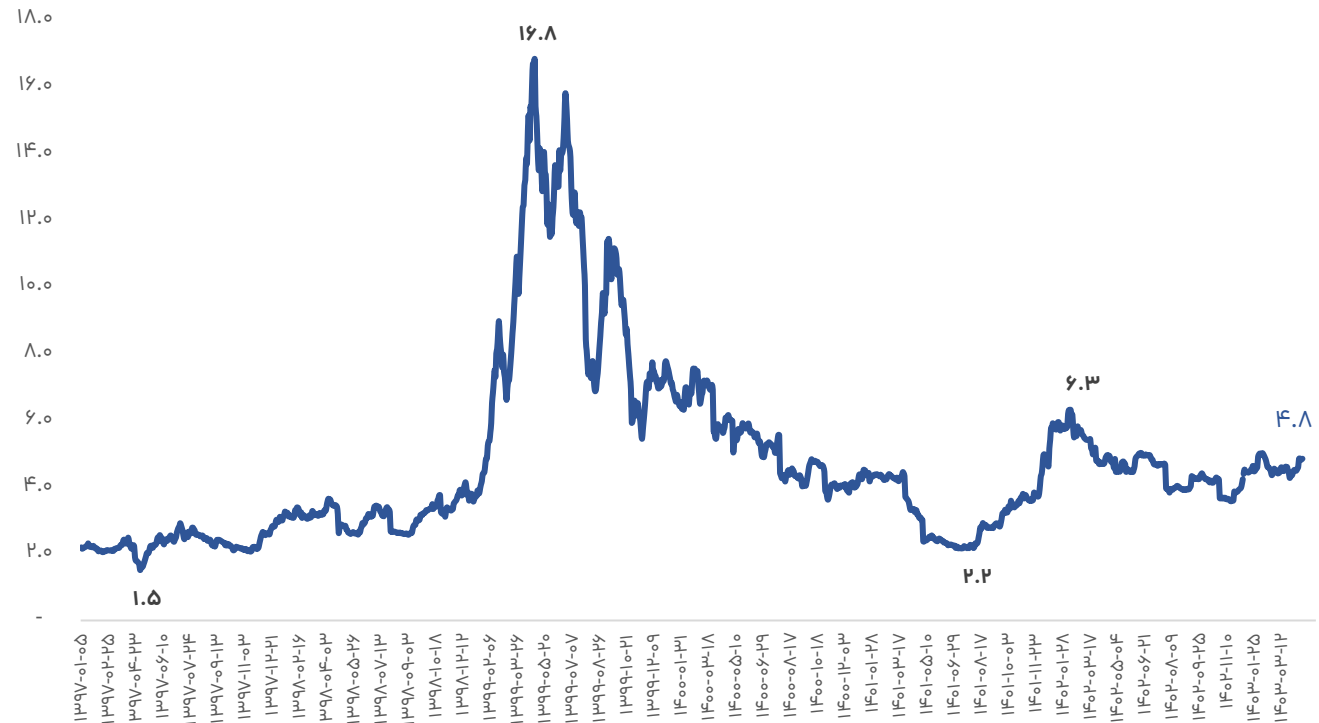


گروه مالی کیمیا

P/E-ttm



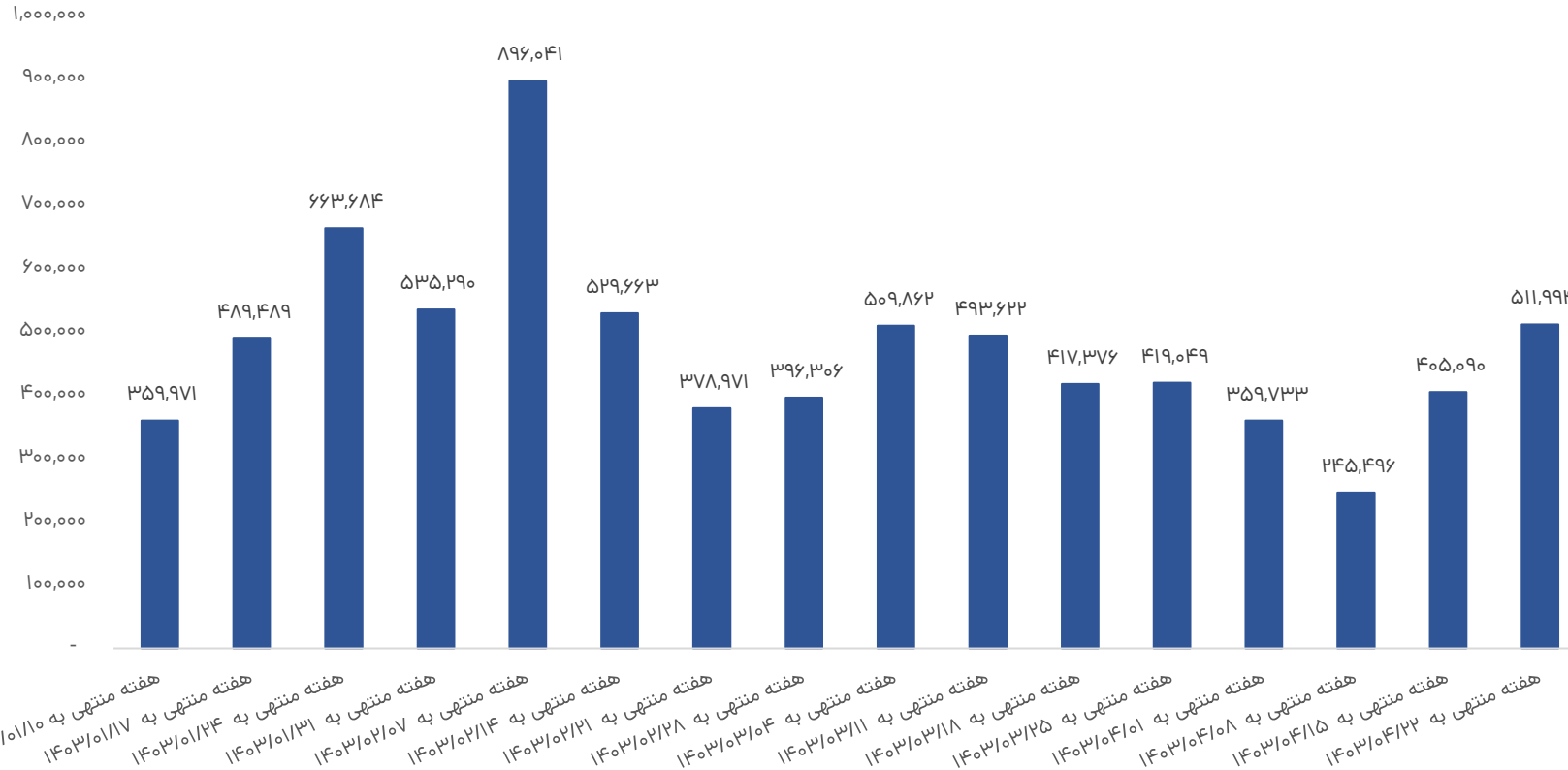
P/S





طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۲۲ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۵۱۱.۹۹۴ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با افزایش مواجه گردید.

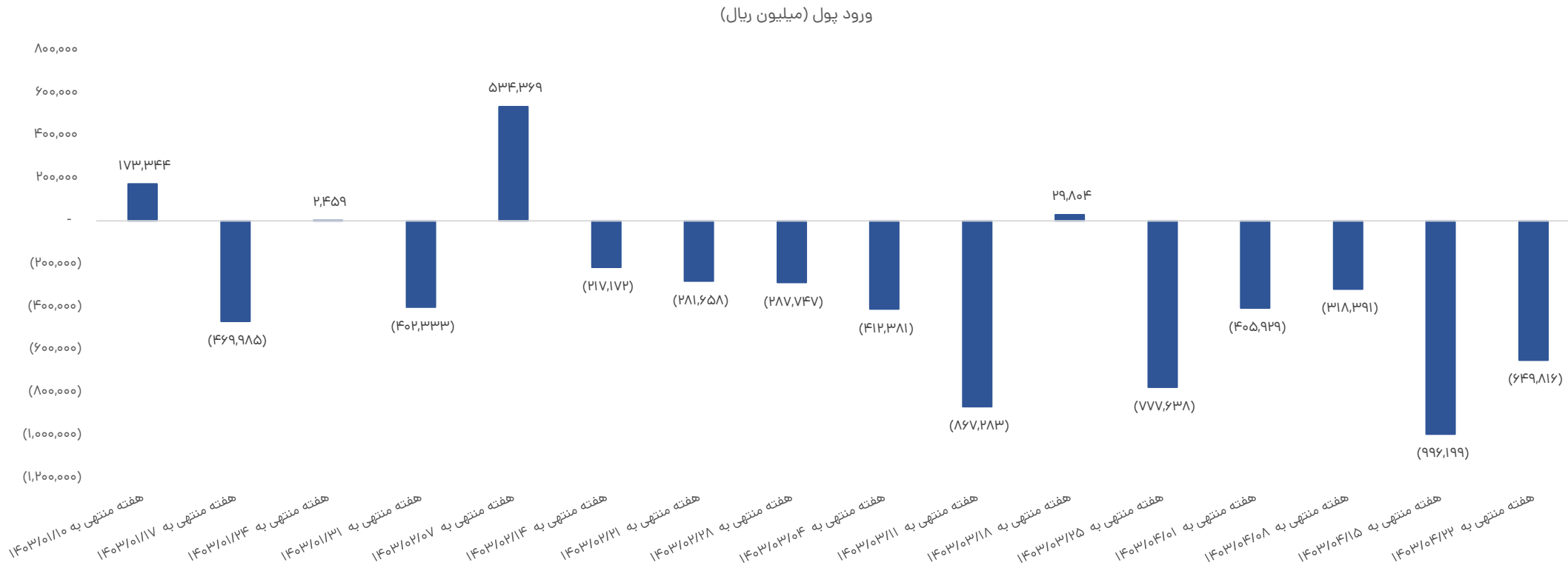
میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

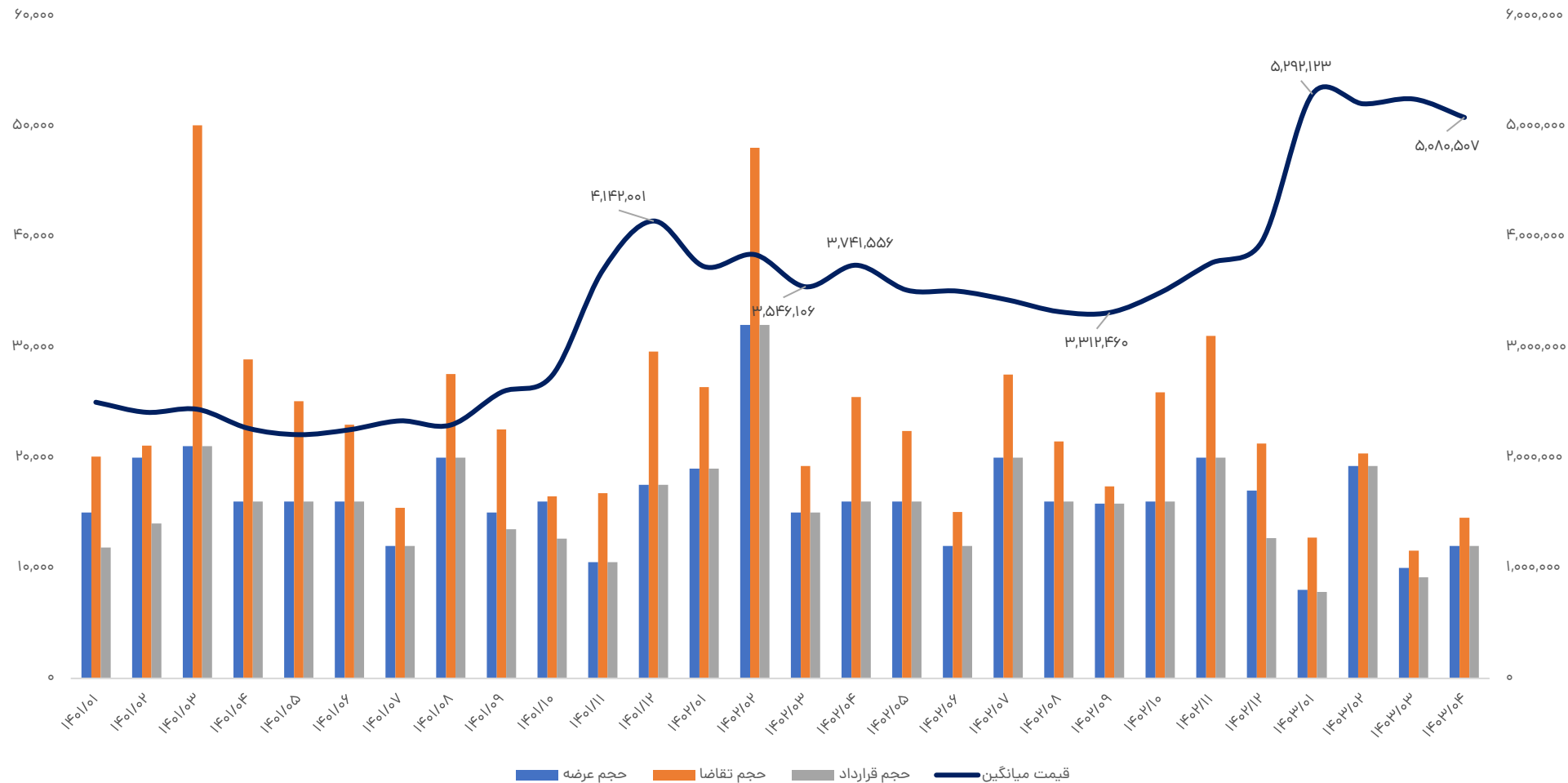




میزان ورود پول در نماد فملی

طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۲۲، خروج پول اشخاص حقیقی از نماد فملی به میزان ۶۴۹.۸۱۶ میلیون ریال بوده است.





در نمودار بالا روند معاملات ماهانه کاتد مس در بورس کالا آورده شده است. در ماه تیر تا کنون مجموعاً ۱۲۰۰۰ تن عرضه کاتد توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۱۴۵۲۰ تن بود و با میانگین قیمت ۵,۰۸۰,۵۰۷ ریال معامله گردید.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۵۸۶۱۹۰۰۰ - ۲۱

دور نگار: ۸۰۴۷۲۹۳ - ۲۱