



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group

گزارش هفتگی گروه مالی کیمیا مس ایرانیان

شماره ۱۵

منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۱۶



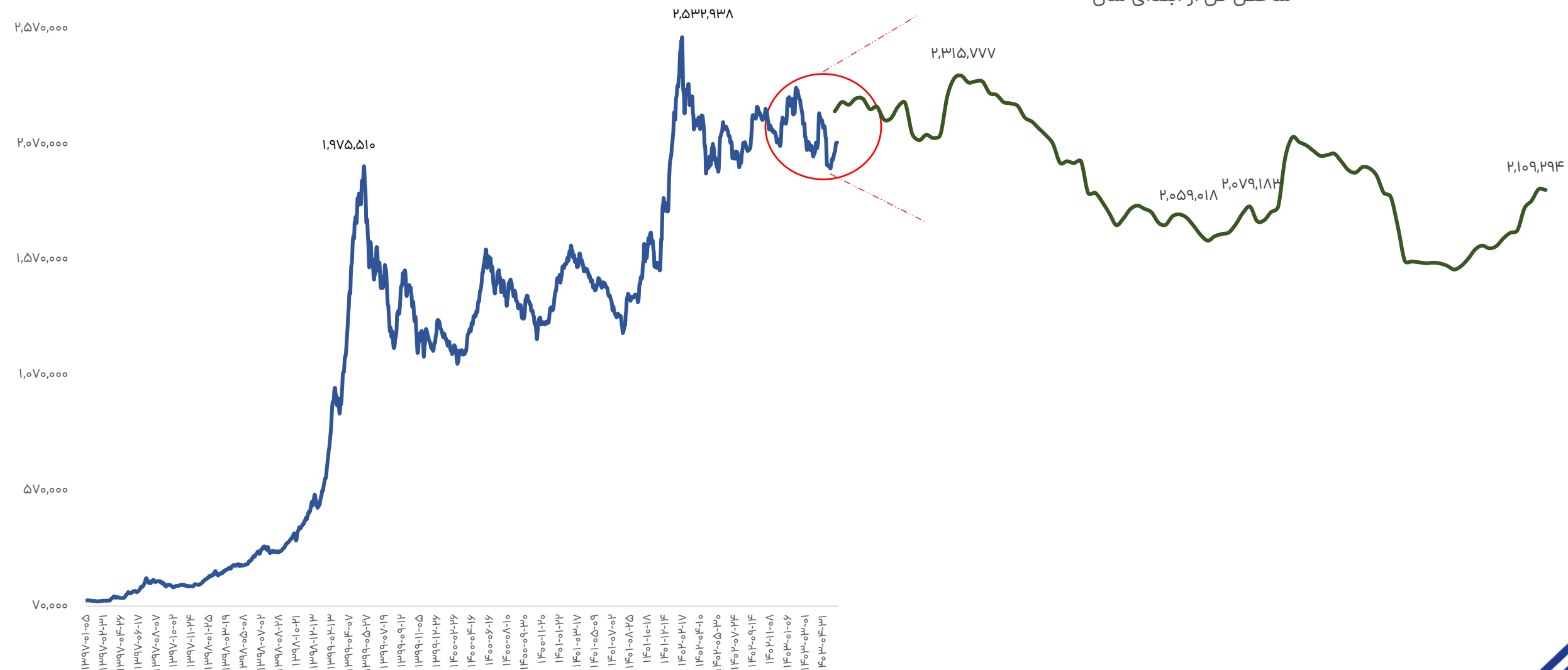
♦ بخش اول

بازار سرمایه

شاخص کل از ابتدای سال ۱۳۹۷

بازدهی از ابتدای سال	-۴.۵%
بازدهی هفته اخیر	۱.۶%

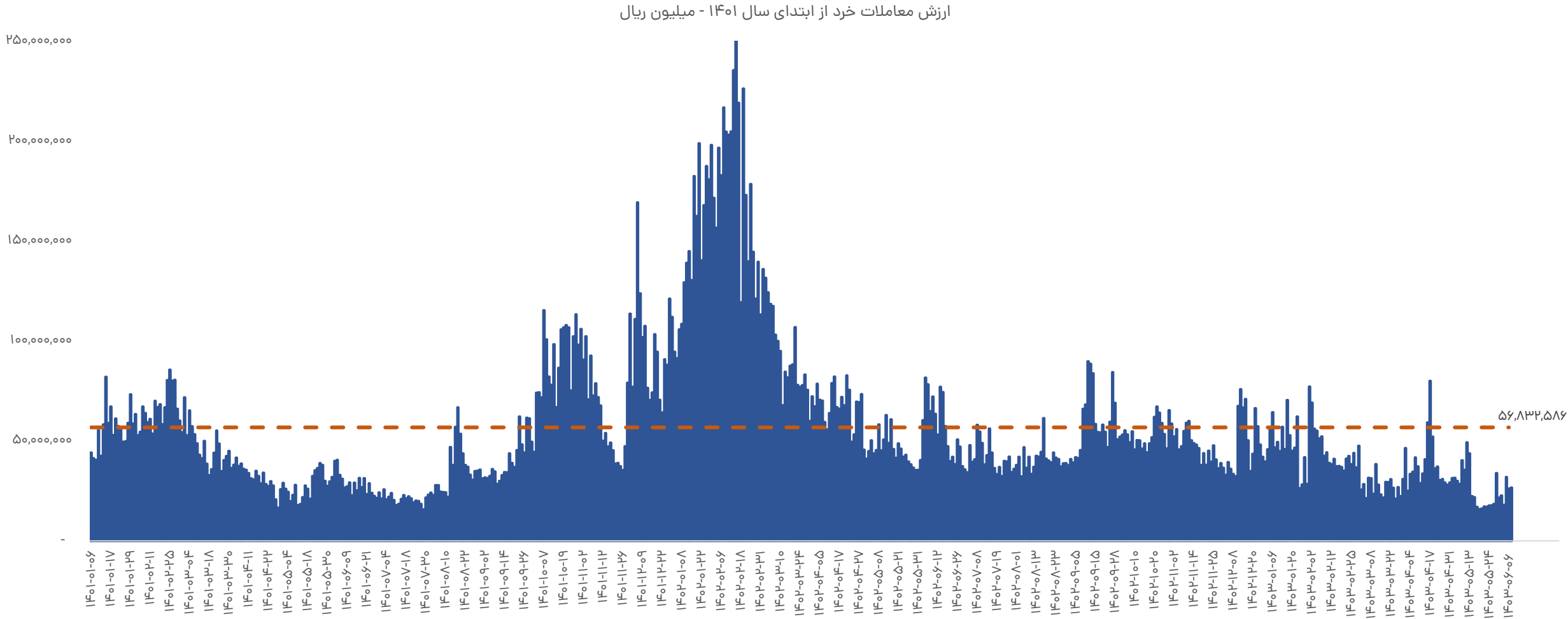
شاخص کل از ابتدای سال



۳,۰۷۰,۰۰۰
گروه مالی کیمیا



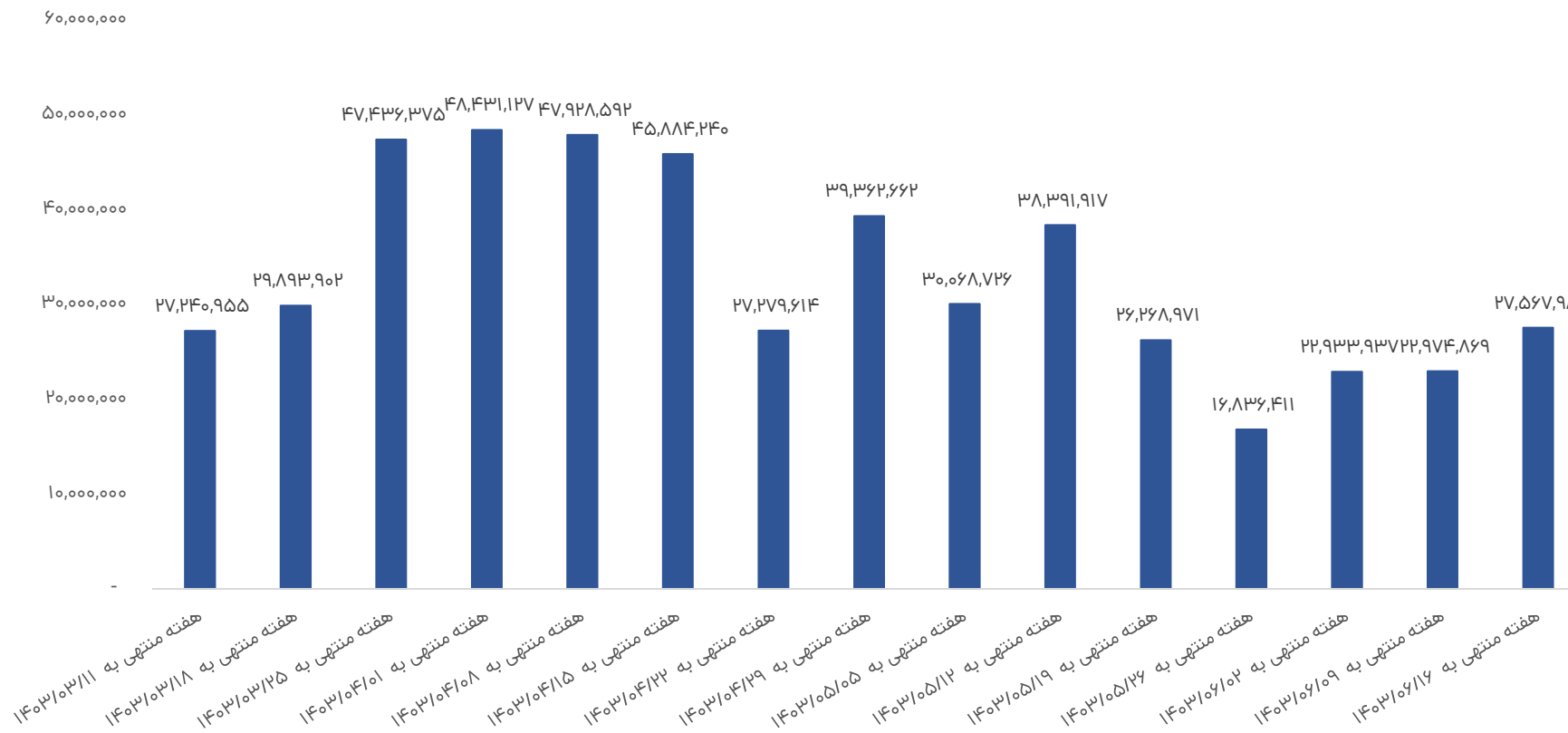
ارزش معاملات در این هفته نیز به علت محدودیت دامنه نوسان مطلوب نبوده است.





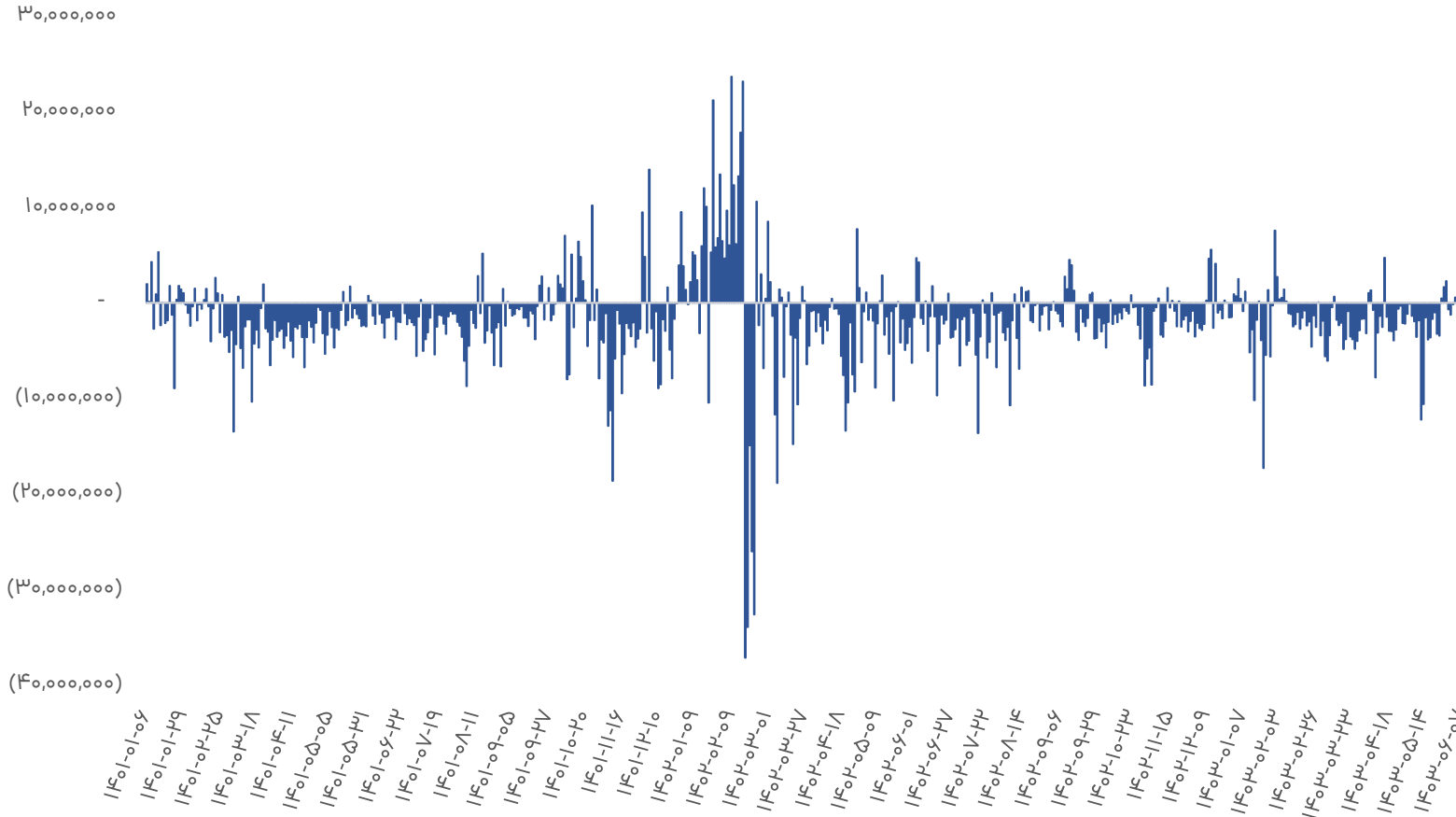
میانگین ارزش معاملات روزانه در این هفته با وجود ایام تعطیل نسبت به هفته قبل ۲۰٪ افزایش یافت.

ارزش معاملات هفتگی - میلیون ریال





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



میزان ورود پول از ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ (میلیون ریال)	-۷۶۸,۷۰۱,۷۸۹
میزان ورود پول از ابتدای سال ۱۴۰۳ (میلیون ریال)	-۱۹۸,۸۲۹,۰۳۹
میزان ورود پول هفته اخیر (میلیون ریال)	۹۷۳,۴۲۸

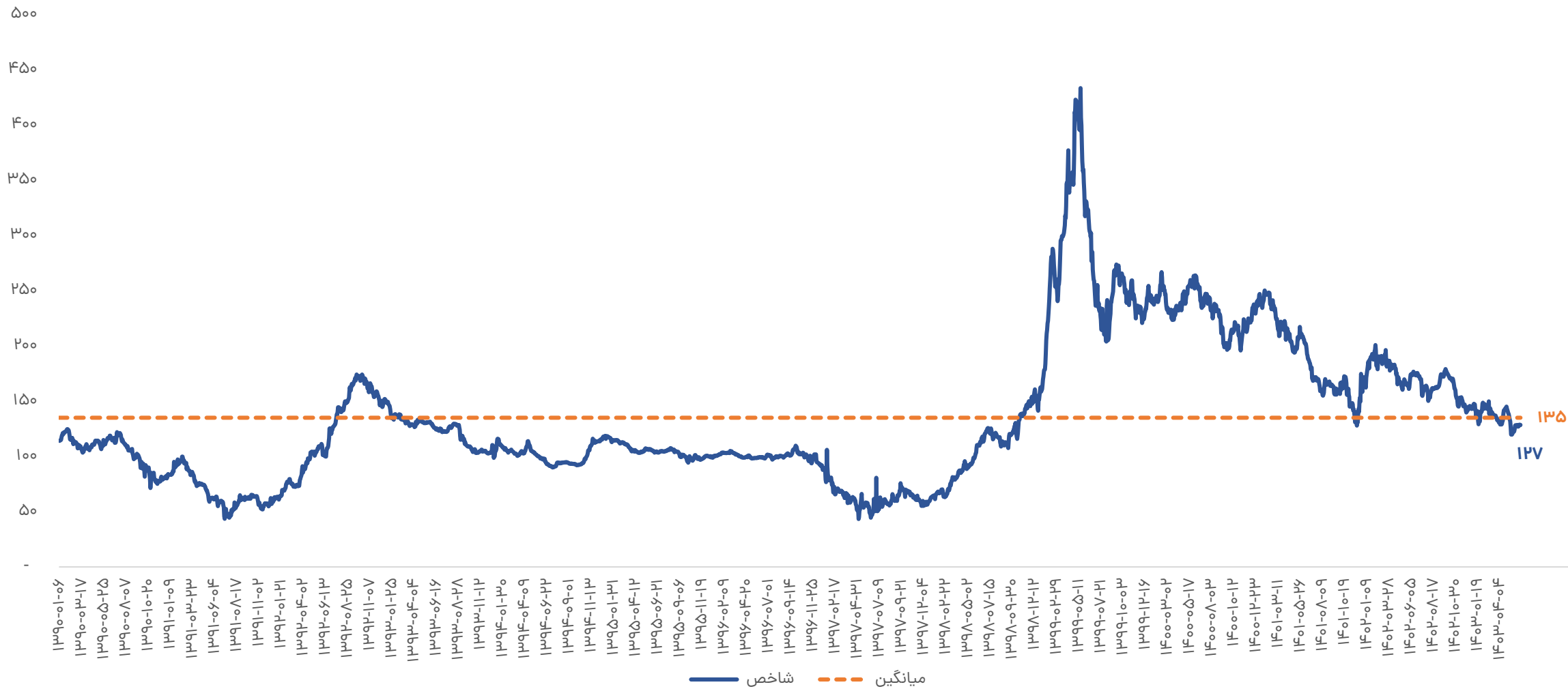
هفته گذشته اشخاص حقیقی ۹۷۳,۴۲۸ میلیون ریال پول به بازار سهام تزریق کردند. خالص خروج نقدینگی اشخاص حقیقی در سال جاری تاکنون ۲۰ همت بوده است.

همچنین از تاریخ ۱۷ اردیبهشت سال ۱۴۰۲ و با شروع اصلاح شاخص کل ، میزان خروج پول اشخاص حقیقی از ۷۶ 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



گروه مالی کیمیا

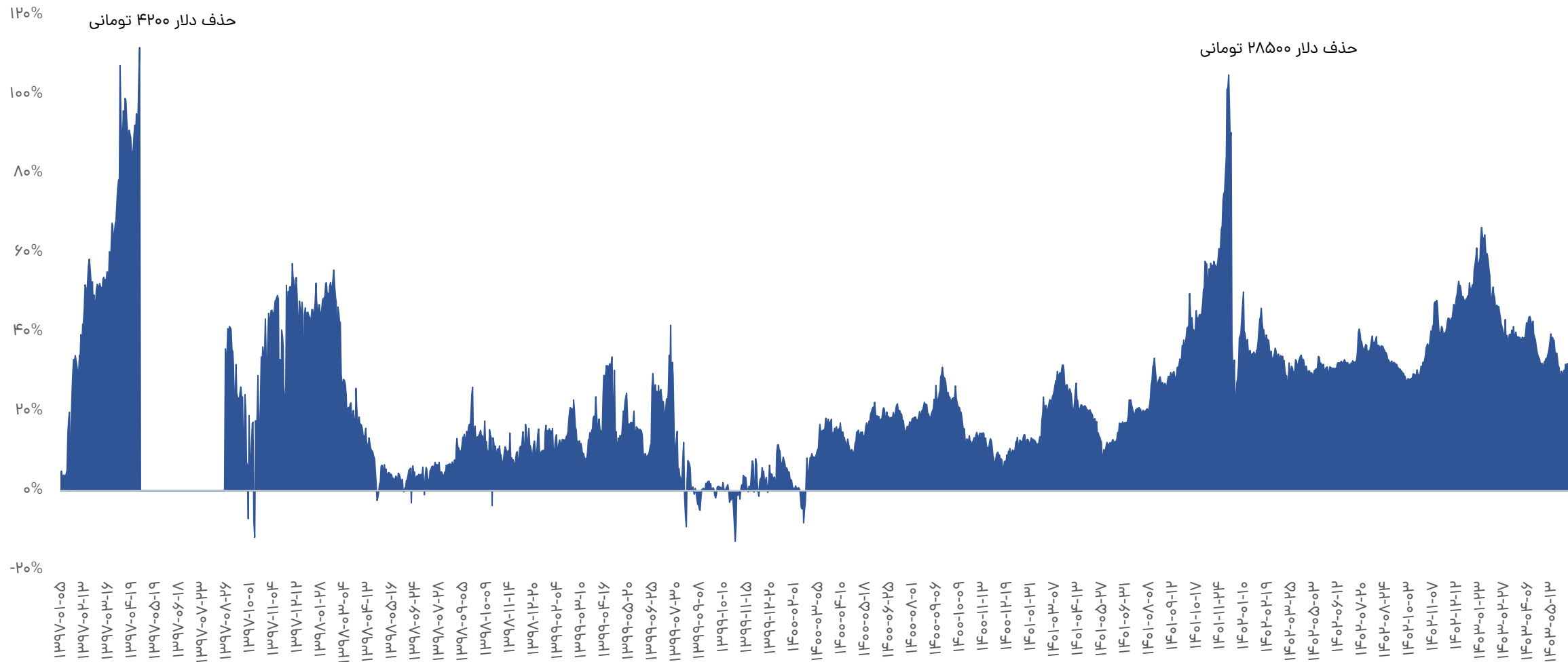
دلار آزاد در آخرین روز هفته به ۶۰۱,۰۰۰ ریال رسید. دلار نیما نیز در این هفته ۲,۴۶۴ ریال افزایش یافت.





اختلاف میان دلار نیما و بازار آزاد بدون تغییر در محدوده ۳۳٪ ماند.

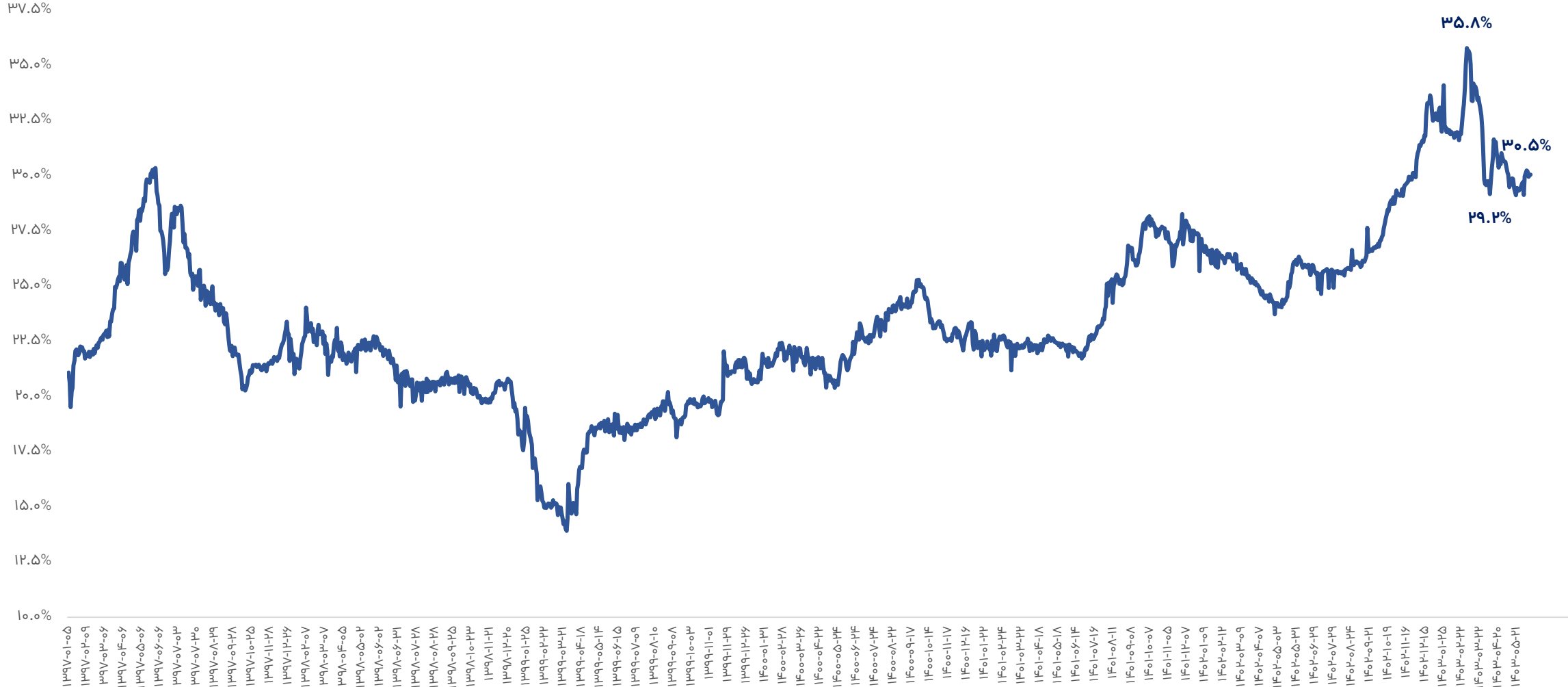
اختلاف دلار آزاد و نیما



نرخ بازدهی تا سررسید اوراق

در این هفته نرخ اوراق با کاهش جزئی به ۳۰.۵ درصد رسید.

نرخ بهره بدون ریسک



◆ بخش دوم

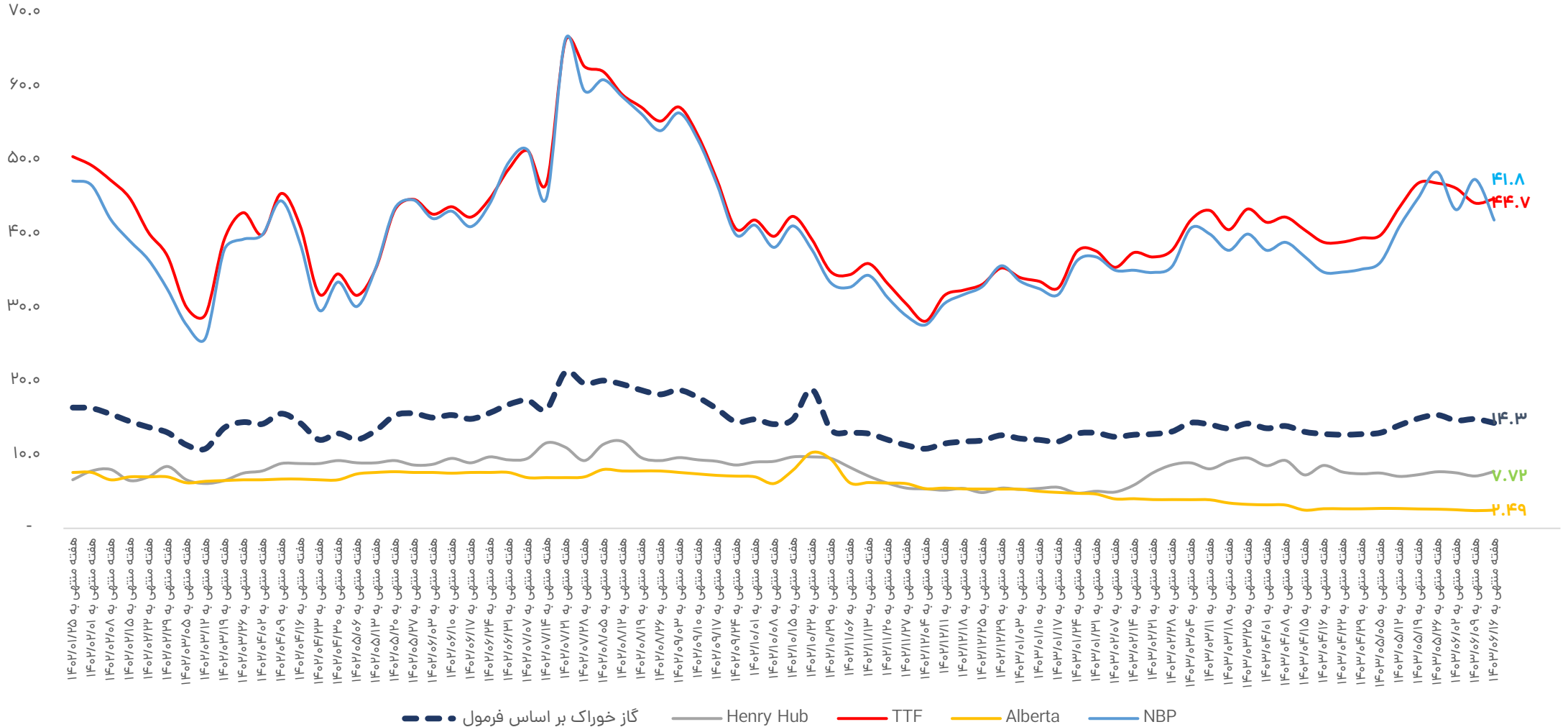
تغییرات قیمت جهانی مس و سایر کالاها



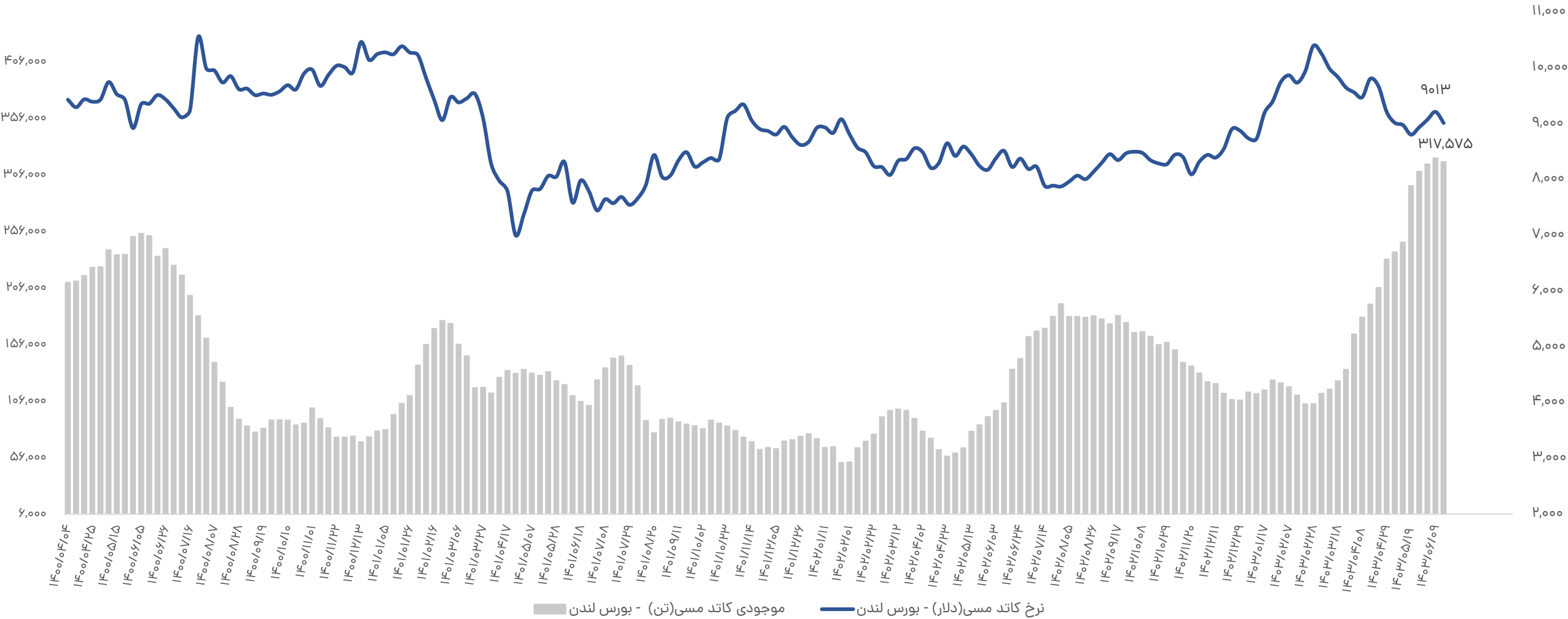
نام کالا	قرارداد	آخرین نرخ (دلار)	%W	%M	%Y
کاتد مسی	بورس لندن	۹,۰۱۳	-۲.۲	-۱.۴	۱.۶
شمش آلومینیوم	بورس لندن	۲,۳۴۲	-۴.۳	-۵.۸	۳.۲
بلوم و بیلت فولادی	ایران FOB	۴۵۲	۰.۹	-۲.۲	-۵.۸
اسلب فولادی	ایران FOB	۴۳۲	۰.۰	۰.۰	-۸.۵
سنگ آهن ۶۲%	چین CFR	۹۲	-۷.۲	-۶.۹	-۱۷.۵
ورق سرد	CIS دریای سیاه FOB	۵۷۰	۰.۰	-۶.۳	-۱۵.۲
ورق گرم	CIS دریای سیاه FOB	۴۷۵	-۰.۶	-۷.۸	-۱۴.۴
نفت برنت	برنت	۷۱	-۹.۸	-۶.۵	-۱۸.۶
استایرن منومر داخلی	چین - Spot	۱,۱۴۹	-۰.۴	۰.۱	۰.۳
اتیلن	شمال شرق آسیا CFR	۸۸۵	۰.۵	۰.۶	-۴.۶
پلی اتیلن سبک تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۰۸۲	۲.۰	۲.۰	۶.۸
پلی اتیلن سنگین فیلم	خلیج فارس FOB	۸۹۴	۱.۸	۱.۸	-۵.۶
پروپیلن	چین CFR	۸۶۰	-۰.۶	-۰.۶	۱.۸
پلی پروپیلن تزریقی	خلیج فارس FOB	۱,۱۰۰	-۰.۶	-۰.۶	-۲.۸
پلی وینیل کلراید	چین CFR	۷۵۸	۰.۰	-۴.۹	-۳.۸
نفتا	ژاپن CFR	۶۳۹	-۶.۲	-۵.۲	-۱۱.۷
MTBE	سنگاپور FOB	۶۹۶	-۱۰.۰	-۹.۴	-۲۶.۸
پارازایلین	کره FOB	۸۴۳	-۷.۳	-۱۰.۰	-۱۷.۴
بزن	کره FOB	۹۸۰	-۴.۸	-۲.۰	-۶.۳
آلکیل بزن خطی	خلیج فارس FOB	۱,۴۵۰	۰.۰	۰.۰	۲.۸
بوتادین	چین CFR	۱,۵۲۰	۲.۷	۳.۴	۹.۴
تولوئن	چین CFR	۷۵۵	-۸.۸	-۱۱.۵	-۱۶.۴
متانول	چین CFR	۲۷۵	-۴.۸	-۲.۵	-۸.۰
اوره	چین FOB	۲۸۴	-۳.۴	-۵.۳	-۱۶.۵
پلی اتیلن ترفتالات	جنوب شرق آسیا FOB	۹۳۰	۰.۰	-۲.۶	-۲.۶
اکریلو نیتریل بوتادین استایرن	چین CFR	۱,۴۵۵	۰.۰	-۰.۳	۵.۴
اتانول	رتردام FOB	۷۰۷	-۴.۶	-۵.۱	-۳.۹
بنزین پیرولیز	خلیج فارس FOB	۶۱۲	-۱.۰	-۱.۰	۰.۸
میعانات گازی	پارس جنوبی	۶۸	-۷.۷	-۵.۵	-۱۵.۰
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 ۱۴.۳ سنت در هر مترمکعب رسیده است که نسبت به هفته گذشته با کاهش مواجه گردید. باتوجه به نرخ دلار نیمای ۴۵۶,۴۳۰ ریالی نرخ هر متر مکعب گاز حدود ۶۵,۲۱۸ ریال به دست می آید.



گاز خوراک بر اساس فرمول Henry Hub TTF Alberta NBP



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 ۹۰۱۳ دلار رسید. همچنین موجودی انبار LME ۳,۳۵۰ تن کاهش یافت



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۰%	۳۷,۷۳۵	۱%	۳۷,۷۳۵	کنسانتره
۰%	۵۳,۰۲۸	۱.۱%	۵۳,۱۲۵	گندله
۰%	۱۲۷,۷۷۸	۱%	۱۲۷,۷۰۱	آهن اسفنجی
۲%	۲۲۴,۷۰۱	۱%	۲۲۸,۰۹۴	بیلت
۰%	۳۱۰,۳۰۰	-۲%	۳۱۰,۳۰۰	ورق گرم
۰%	۴۶۴,۵۵۵	۷.۲۸%	۴۶۴,۵۵۵	ورق گالوانیزه
۱۹%	۱,۲۲۶,۴۴۶	-۱%	۱,۴۶۴,۹۰۵	شمش آلومنیوم
۰%	۴,۹۸۱,۰۰۰	۱۱%	۴,۹۸۱,۰۹۱	کاتد
۷%	۱۲,۹۶۰	-۱%	۱۳,۹۳۰	سیمان



میزان رقابت	قیمت پایه (ریال به کیلوگرم)	بازده هفتگی	قیمت معامله (ریال به کیلوگرم)	نام محصول
۷%	۴۶۱,۱۱۶	-۱%	۴۹۱,۳۷۷	پت
۸%	۱۲۹,۲۶۸	-۱۰%	۱۳۹,۱۴۸	اوره
۱%	۴۹۸,۲۵۸	۱%	۵۰۰,۸۳۷	پلی پروپیلن
۰%	۳۵۱,۴۹۵	۰.۳%	۳۵۱,۴۹۵	PVC
۵%	۳۸۳,۴۲۷	۲%	۴۰۱,۰۴۵	روغن پایه
۴%	۳۸۰,۵۷۲	۱%	۳۹۶,۸۸۸	پلی اتیلن
۰%	۶۲۸,۵۷۱	۱%	۶۲۸,۵۷۱	LAB
۳%	۱۳۶,۶۴۷	۰%	۱۴۰,۵۸۳	وکیوم باتوم
۰%	۲۱۷,۷۵۴	۰%	۲۱۷,۷۵۴	لوبکات



نام ارز	ارزش بازار (میلیارد دلار)	قیمت (دلار)	بازده هفتگی
بیت کوین	۱,۰۷۵	۵۴,۴۴۵	-۶%
اتریوم	۲۷۵	۲,۲۹۰	-۷%
بایننس	۷۲	۴۹۸	-۴%
سولانا	۵۹	۱۲۸	-۳%
ریپل	۲۹	۰.۵۲	-۵%

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 تغییر چندانی نداشت.



دلار محاسبه شده در معاملات سکه امامی نسبت به هفته گذشته اندکی کاهش داشت.





➤ سیتی‌گروپ پیش‌بینی‌های سه‌ماهه خود را ۹۵۰۰ دلار برای مس و ۲۵۰۰ دلار برای آلومینیوم اعلام کرد و گفت که بهبود نهایی رشد جهانی باید به افزایش

قیمت‌ها کمک کند

منبع: mining.com

➤ گلدمن ساکس به دلیل ضعف تقاضای چین پیش‌بینی خود برای قیمت مس در سال ۲۰۲۵ را با کاهش ۵۰۰۰ دلاری، ۱۰۱۰۰ دلار برای هر تن مس اعلام کرد

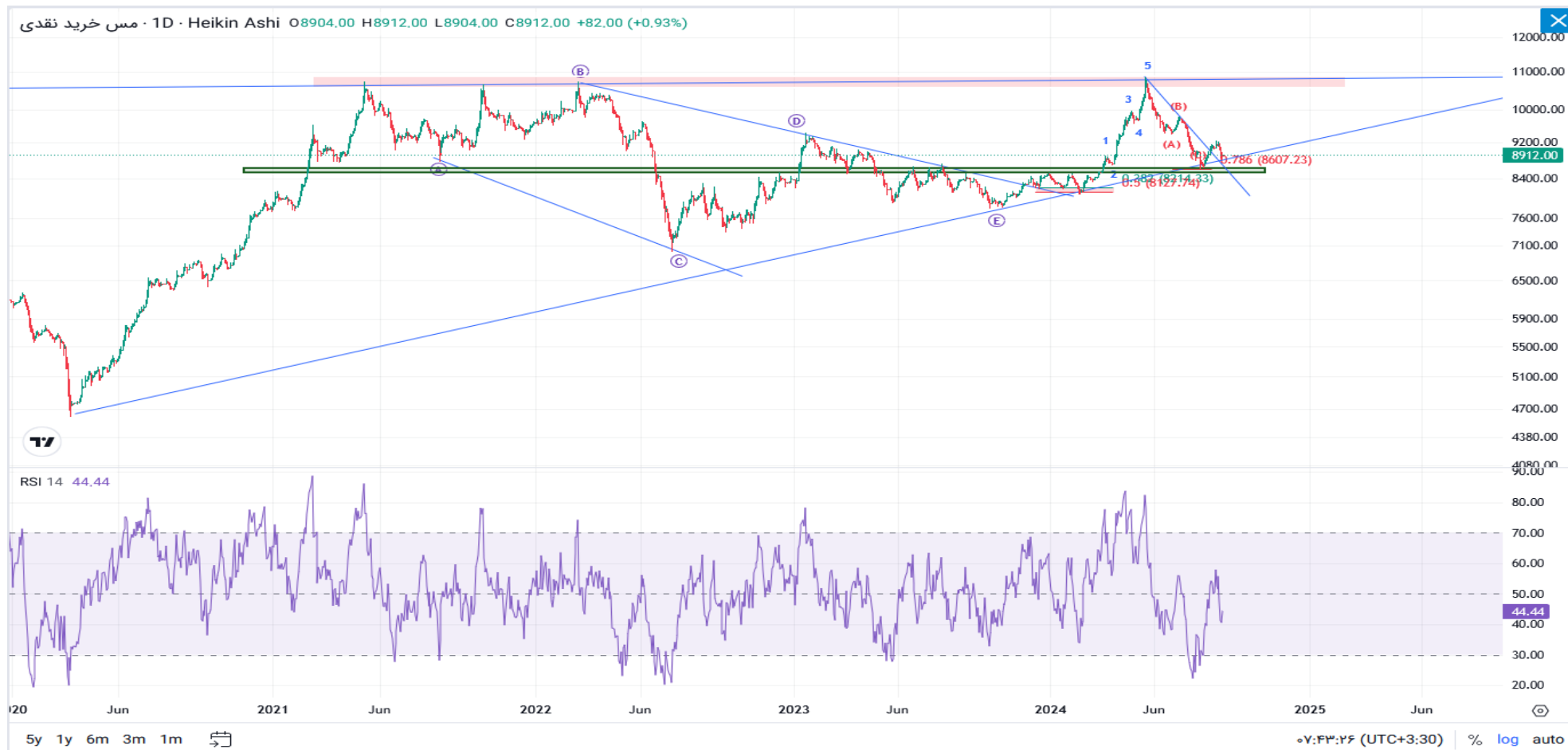
منبع: Bloomberg

➤ سرمایه‌گذاری ۳.۵ میلیارد دلاری کانادا در معادن مس آرژانتین

منبع: mining.com



به نظر می رسد قیمت مس پوبلیک به خط روند نزولی شکسته شده را داشته است با وجود حمایت روانی ۹۰۰۰ دلار و خط روند صعودی بلند مدت و حمایت تراز فیبو می توان انتظار نوسان مثبت برای هفته پیش رو داشت



♦ بخش سوم

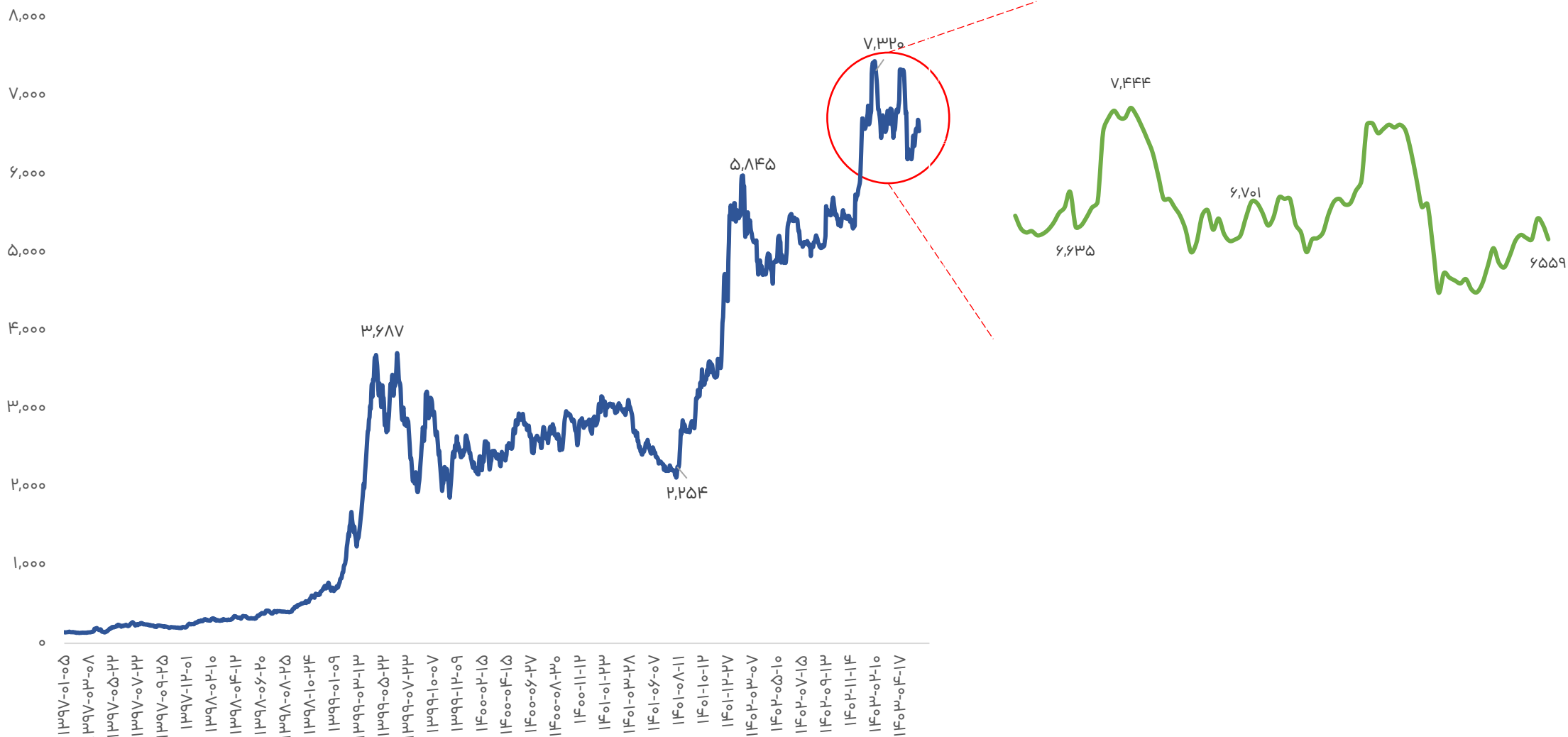
ملی صنایع مس ایران در بازار سرمایه

تغییرات قیمت نماد فملی



گروه مالی کیمیا

بازدهی از ابتدای سال	۱.۷%
بازدهی هفته اخیر	۰.۶۱%

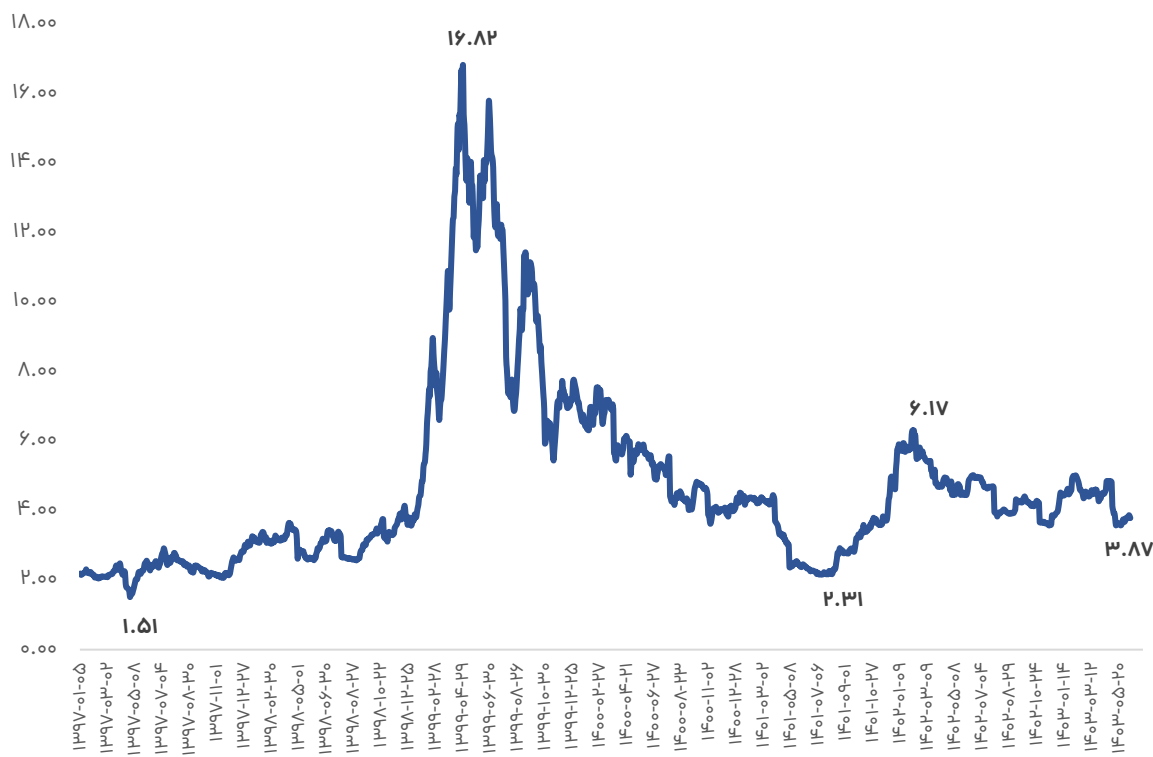


نسبت های قیمت به سود و قیمت به درآمد گذشته نگر



گروه مالی کیمیا

P/S



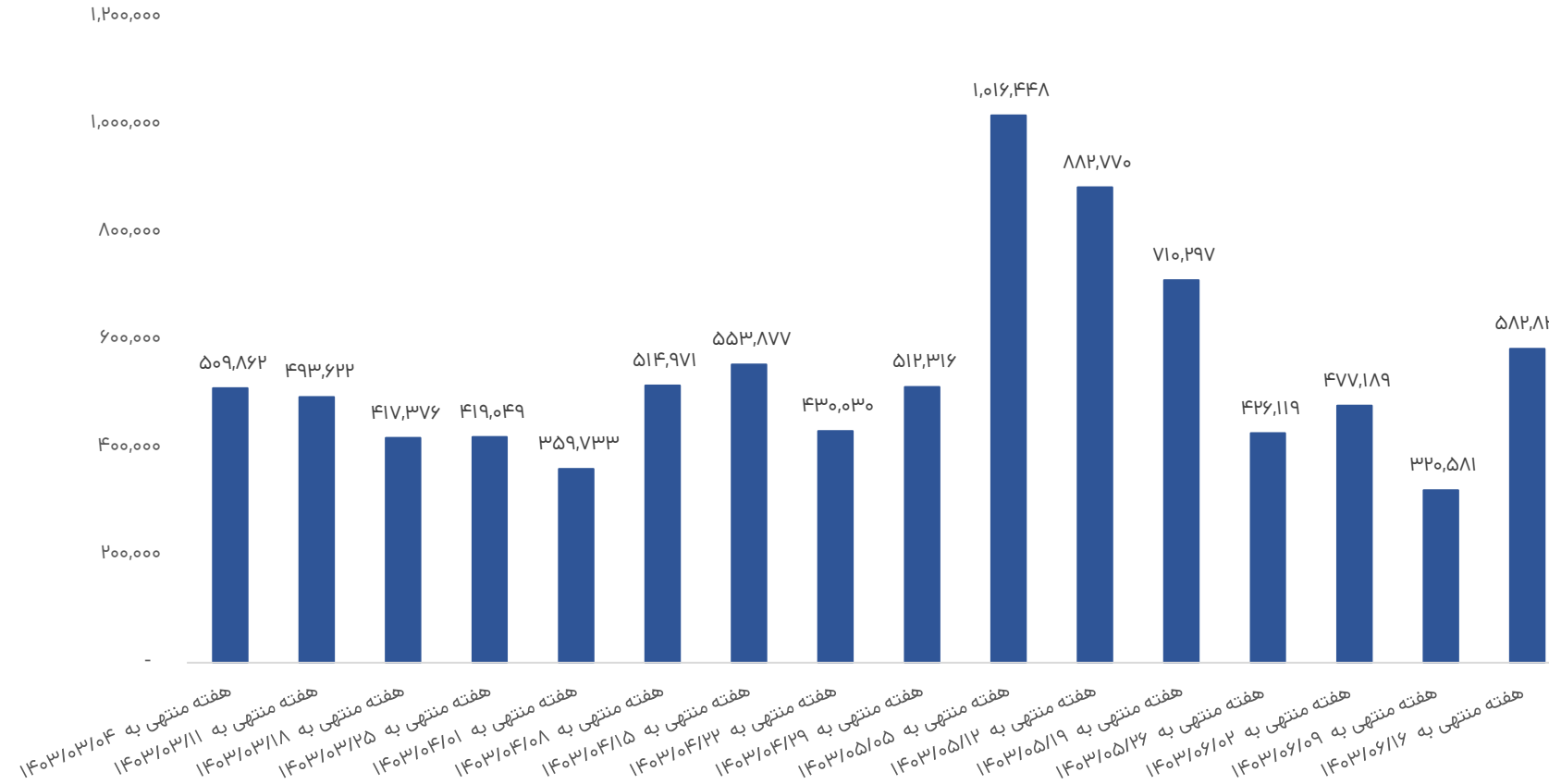
P/E-ttm





طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۱۶ میانگین ارزش معاملات روزانه نماد فملی ۵۸۲,۸۲۷ میلیون ریال بوده است که نسبت به هفته گذشته با افزایش مواجه گردید.

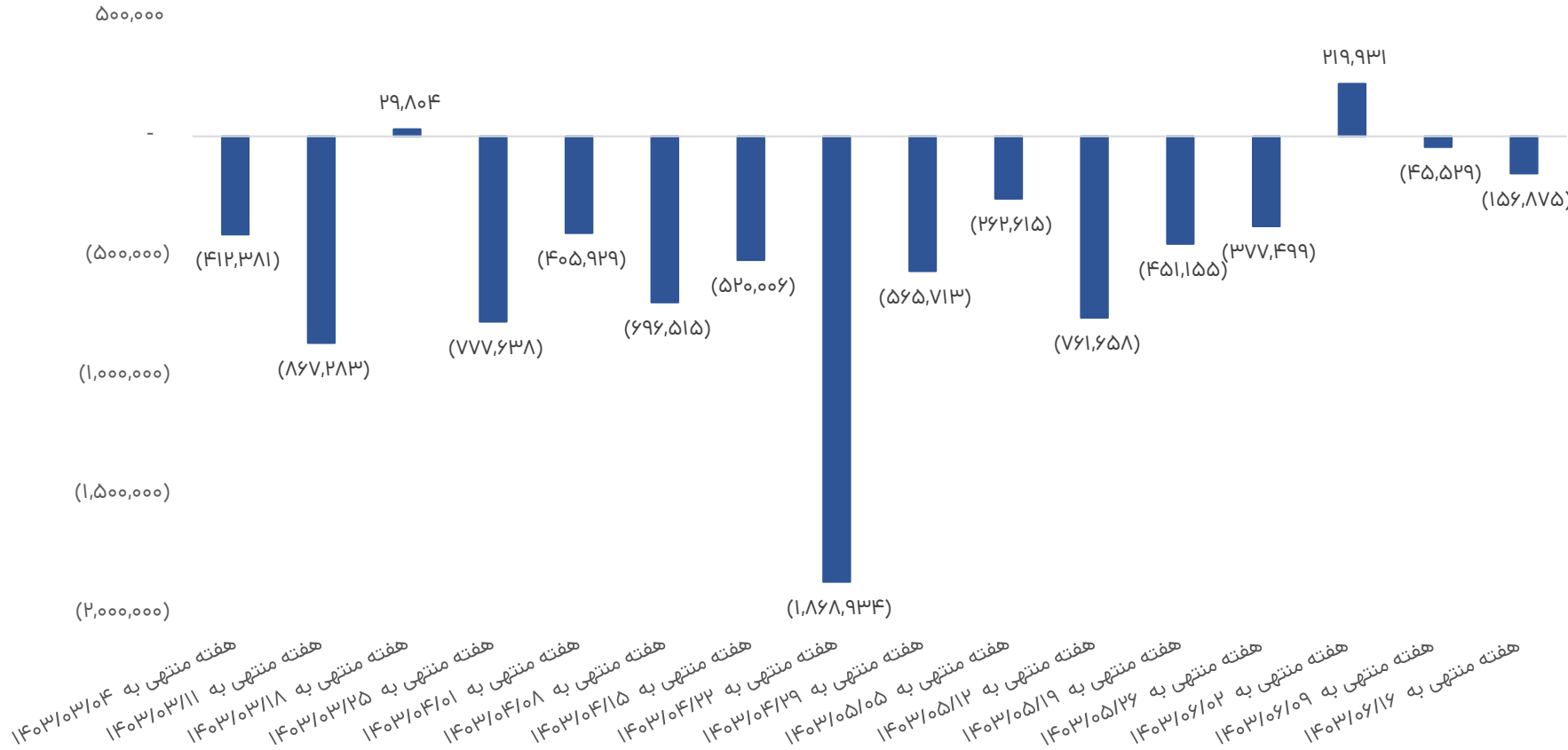
میانگین ارزش معاملات (میلیون ریال)

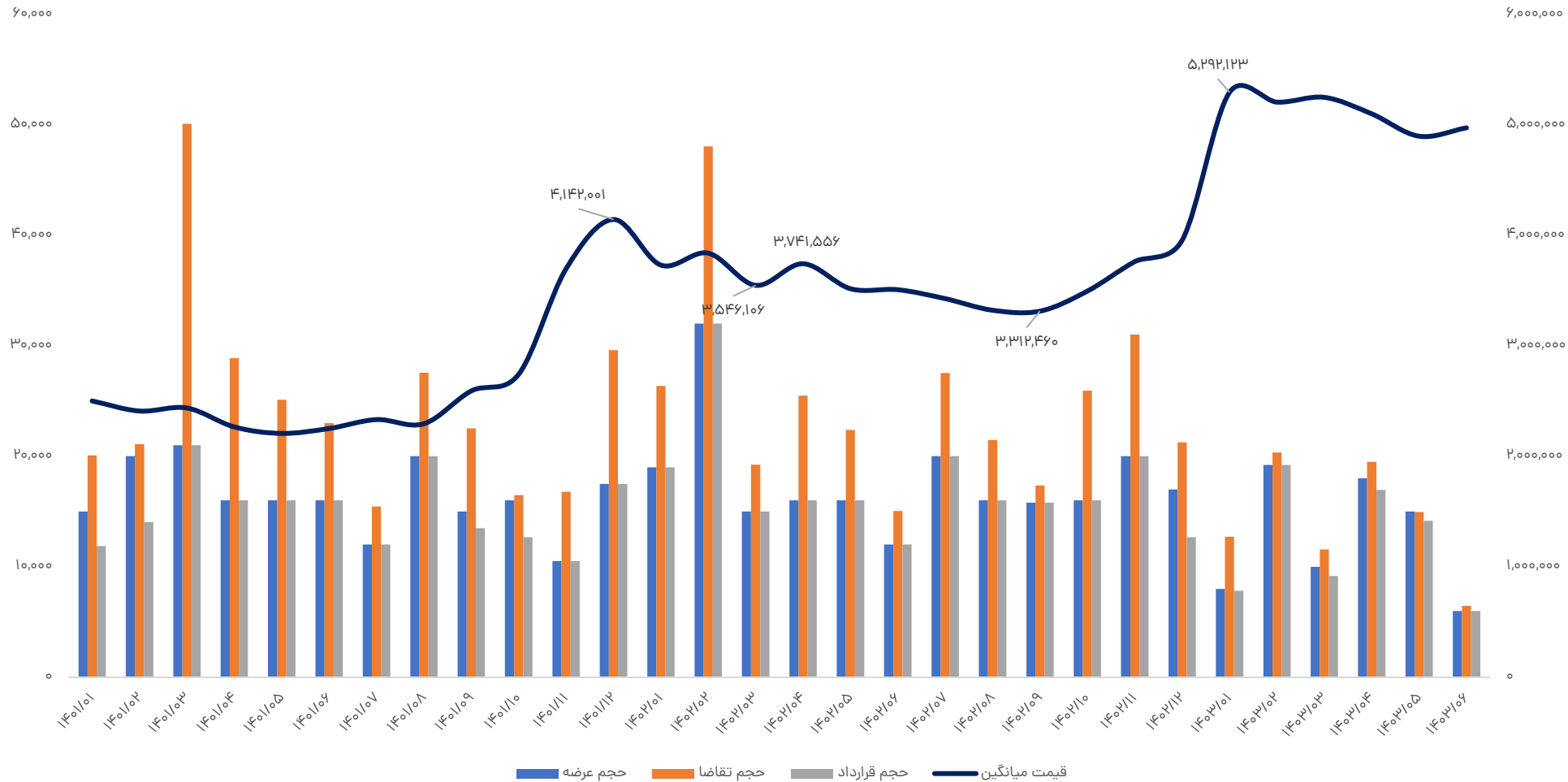




طی هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۱۶ ، خروج پول افراد حقیقی به میزان ۱۵۶،۸۷۵ میلیون ریال بوده است.

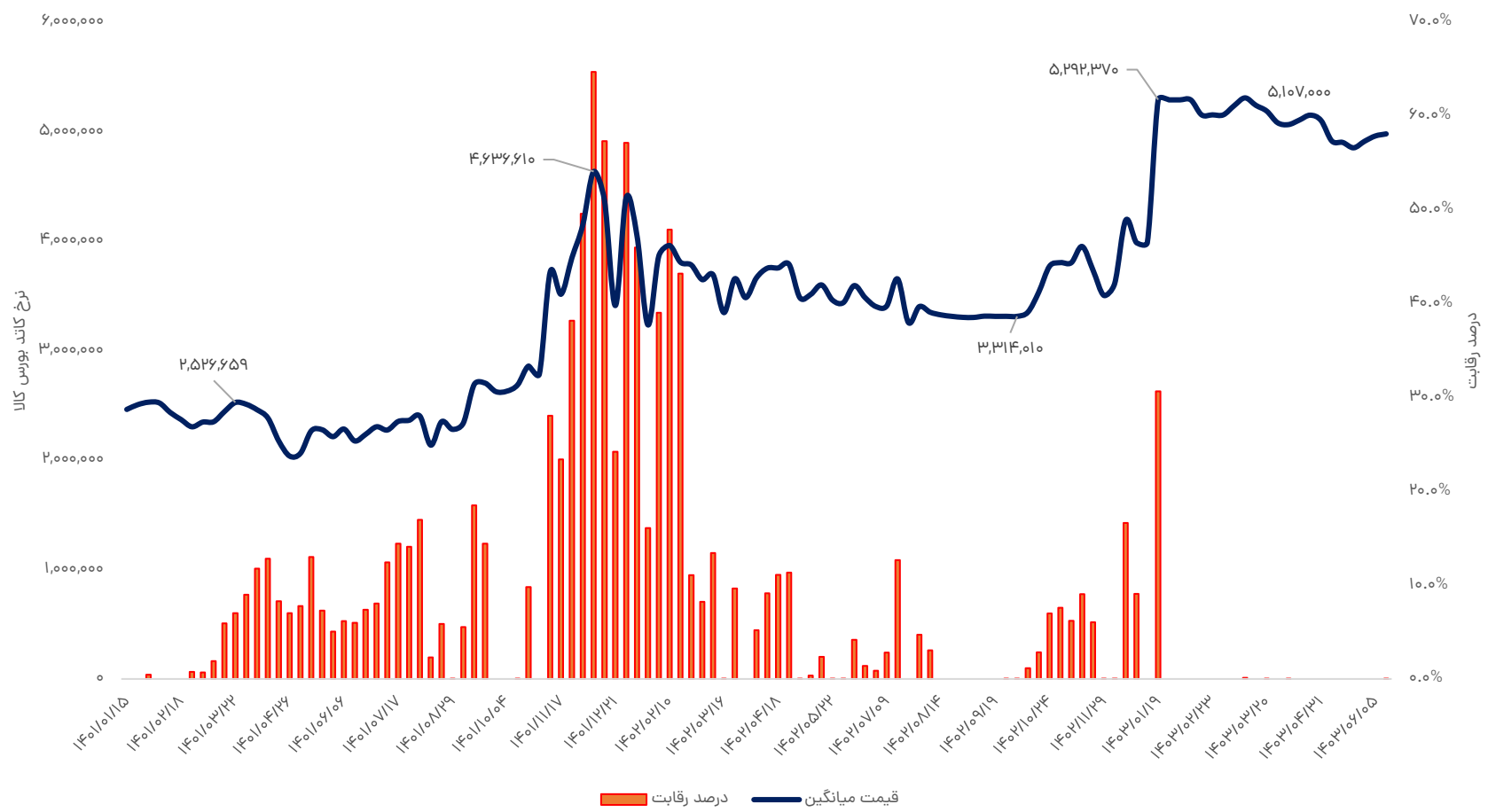
ورود پول (میلیون ریال)





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

در ماه شهریور تاکنون مجموعاً ۶۵۰۰ تن عرضه کاتد توسط شرکت ملی صنایع مس صورت گرفت و کل تقاضا به میزان ۷،۱۴۰ تن بود و با میانگین قیمت ۴۹۷۴۷۶۹ ریال معامله گردید.



این هفته کاتد مس با قیمت ۴۹۸۱۲۴۰ ریال بر کیلوگرم معامله گردید که نسبت به معاملات هفته گذشته تغییر خاصی نداشت. همچنین ۵۰۰ تن عرضه صورت گرفت که با تقاضا به میزان ۶۸۰ تن پاسخ داده شد.



گروه مالی کیمیا

kimia Financial Group



ایمیل: info@kimiafg.com

تماس: ۰۲۱ - ۵۸۶۱۹۰۰۰

دور نگار: ۰۲۱ - ۸۰۴۷۲۹۳