



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته چهارم منتهی به

۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

تولید روزانه نفت ایران با افزایش تولید ۶۳۰ هزار تایی به ۳,۲ میلیون بشکه رسید:

اداره اطلاعات انرژی آمریکا در جدیدترین گزارش از تولید روزانه ۳.۲۵ میلیون بشکه نفت خام ایران در سومین ماه سال ۲۰۲۴ خبر داد که نسبت به ماه قبل ۳۰ هزار بشکه در روز افزایش داشت. بر اساس این گزارش، ایران در سه ماهه نخست سال جاری میلادی بطور متوسط ۳.۲۳ میلیون بشکه در روز نفت تولید کرد که نسبت به مدت مشابه سال قبل ۶۳۰ هزار بشکه در روز افزایش داشت و رکورددار افزایش تولید در میان اعضای اوپک شد.



ثبات بالاترین میزان تولید فولاد میانی با ۳۲,۱ میلیون تن و رشد ۵,۵ درصدی:

مجموع تولید بیلت، بلوم و اسلب طی سال گذشته به ۳۲,۱ میلیون تن رسید که بالاترین میزان در تاریخ تولید فولاد است و رشد ۵,۵ درصدی نسبت به مدت مشابه قبل داشت. به گزارش پایگاه خبری بورس پرس، طبق آمار انجمن فولاد در سال گذشته، بیشترین رشد تولید در زیرمجموعه فولاد میانی به بیلت و بلوم با ۹,۲ درصد تعلق داشت و از ۱۸,۷ به ۲۰,۴ میلیون تن رسید. بر اساس این گزارش، تولید اسلب هم از ۱۱,۶۹ به ۱۱,۶۴ میلیون تن رسید که افت ۰,۴ درصدی داشت. مجموع تولید فولاد میانی ۳۲,۱ میلیون تن ثبت شد که افزایش ۵,۵ درصدی را ثبت کرد.



افزایش قیمت جدید پایه محصولات پتروشیمی به دلار ۴۰۶,۴۸۳ ریالی اعلام شد:

قیمت پایه محصولات پلیمری و شیمیایی در شرایطی اعلام شد که مبنای قیمت گذاری برای کالاها، دلار ۴۰ هزار و ۶۴۸ تومانی بود که نسبت به دلار ۴۰ هزار و ۵۸۵ تومانی ۱۹ فروردین افزایش ۰,۱۵ داشته است. در حالی که نرخ دلار مبنای قیمت گذاری طی دو هفته متوالی تغییر چندانی نداشته، قیمت پایه اغلب محصولات پلیمری و شیمیایی افزایشی بود.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

خرید ۲,۵ هزار میلیارد تومانی سهام در فروردین و وعده استفاده از ابزارهای مالی جدید:

روح‌اله شریفیان مدیرعامل صندوق تثبیت بازار سرمایه درباره عملکرد این صندوق که از سال ۱۳۹۶ با هدف حمایت از بازار در مواعید خاص و مخاطرات راه‌اندازی و به تدریج با منابع دولت، سازمان بورس، صندوق توسعه ملی فعال شده به سنا، اعلام کرد: صندوق توسعه ملی ماه گذشته ۱,۷ هزار میلیارد تومان طی دو روز کاری به این صندوق واریز کرد تا مجموع واریزی‌های نقدی طی ۴ سال گذشته به حدود ۱۰ هزار میلیارد تومان برسد. مجموع دارایی فعلی صندوق تثبیت بازار سرمایه هم حدود ۲۳ هزار میلیارد تومان بوده که صرف حمایت و سرمایه‌گذاری در بورس و فرابورس شده است. طی ۱۱ روز کاری فروردین هم حدود ۲,۵ هزار میلیارد تومان برای خرید حمایتی از بازار سهام صرف شد و به هیچ عنوان فروش خرد رخ نداد و در صورت لزوم، حمایت‌ها ادامه خواهد داشت. برای معاملات بلوکی هم سعی شده مراداتی با نهادهای مالی فعال انجام و منابع حاصل از فروش سهام بلوکی صرف خرید خرد سهام شود.



نتیجه دهمین حراج طلا با معامله ۷۲۱۸ سکه تمام، نیم و ربع سکه اعلام گردید:

دهمین حراج سکه طلا دوشنبه ۲۷ فروردین با سکه تمام، نیم و ربع سکه ضرب سال ۸۶ بانک مرکزی و بدون بسته بندی از طریق سامانه معاملات مرکز ارز و طلا برگزار شد. بر اساس این گزارش از مجموع ۱۳ هزار و ۳۰۲ قطعه ربع سکه ثبت سفارش شده توسط ۴۵۹۹ شرکت کننده، ۴۶۷۵ قطعه با میانگین قیمت ۱۴ میلیون و ۱۱۶ هزار تومان به متقاضیان تخصیص داده شد. همچنین ۱۰۱۶ و ۱۵۲۷ قطعه نیم و سکه تمام با میانگین قیمت ۲۳,۶ و ۴۱ میلیون تومان معامله شد.



نرخ سود بازار بین بانکی با افزایش به ۲۳,۵۲ درصد رسید:

نرخ بهره بین بانکی که از ابتدای فروردین ماه روند کاهشی داشت در هفته پایانی فروردین با افزایش همراه شده است. نرخ سود بین بانکی در هفته منتهی به ۲۹ فروردین ماه با ۴ صدم درصد افزایش نسبت به هفته قبل از آن به ۲۳,۵۲ درصد رسیده است.



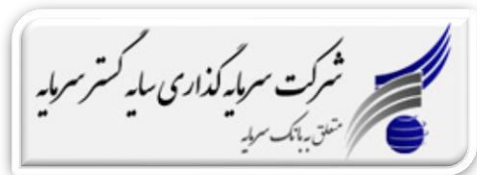
بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

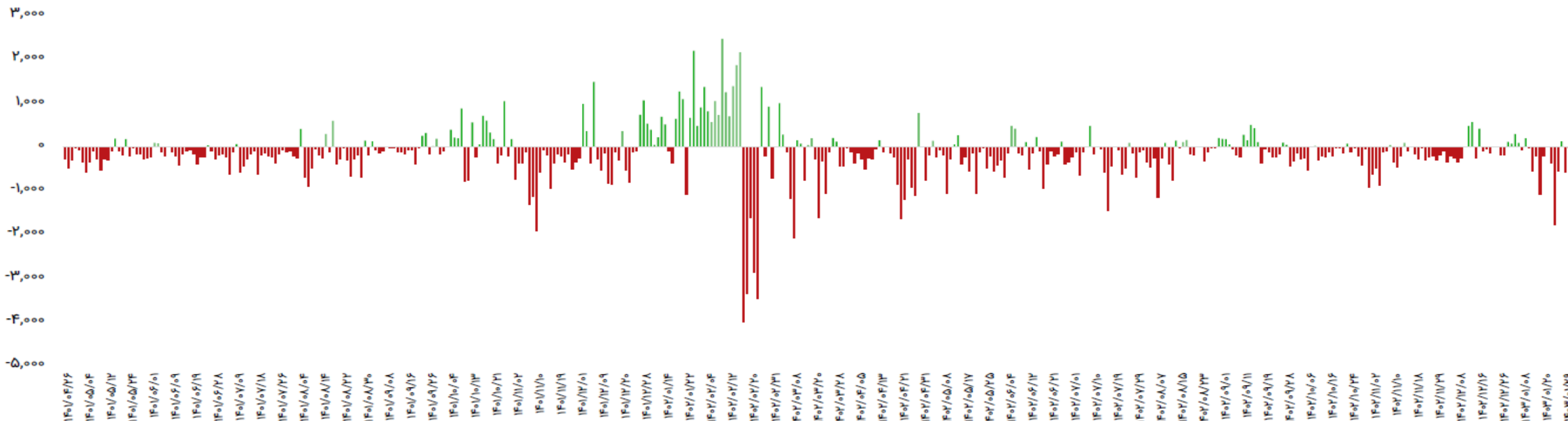
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با **۴۸,۱۶۰** واحد کاهش نسبت به ابتدای هفته، در عدد **۲,۲۰۸,۲۱۴** هزار واحد قرار گرفت و کاهش تقریبی **۲- درصدی** را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن هم نیز با کاهش **۲۴,۷۶۳** واحد در عدد **۷۲۳,۵۶۶** واحدی قرار گرفته و کاهش **۳.۳۱-** درصدی را ثبت نمود که نشان می‌دهد شرکت‌های متوسط و کوچک نیز در هفته گذشته افت قیمتی داشته‌اند. قیمت اونس طلا در پایان هفته گذشته با افزایش به سطح **۲۳۹۲** دلار در هر اونس رسید و نسبت به هفته گذشته **۴۸** دلار معادل تقریبی **۲ درصد** افزایش قیمت را تجربه کرد. شاخص دلار نیز در هفته گذشته با افزایش به **۱۰۵.۹۶** واحد رسید. در خصوص جو حاکم بر بازار نفت، قیمت نفت برنت تحت تاثیر درگیری‌های روسیه و اوکراین و مناقشات نظامی بین اسرائیل و ایران و غزه با افزایش اندکی معادل **۰.۵۸** دلار در هر بشکه روبرو شد و قیمت در هر بشکه به **۹۰.۷۳** دلار رسید که انتظار می‌رود تنش‌های جنگی کمتر گردد. در فضای اقتصاد کلان حاکم بر بازار جهانی نیز به دلیل نگرانی‌ها از افزایش تورم شدت درگیری‌ها و گسترش جنگ در سطح جهان، قیمت کامودیتی‌ها در هفته گذشته افزایش را تجربه کردند. تغییرات واحد ارزش معاملات خرد (میلیارد تومان) نیز طی هفته گذشته با کاهش در حدود **۲,۷۹۶** واحد بود که با کاهش حجم و عدم ورود پول خرد سرمایه‌گذاران به بازار سرمایه، همراه بود.

تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۲,۲۵۶,۳۷۴	۲,۲۰۸,۲۱۴	(۴۸,۱۶۰)	-۲.۱۳%
شاخص هم‌وزن (واحد)	۷۴۸,۳۲۹	۷۲۳,۵۶۶	(۲۴,۷۶۳)	-۳.۳۱%
ارزش معاملات خرد (میلیارد تومان)	۲۱,۵۱۴	۱۸,۷۱۸	(۲,۷۹۶)	-۱۳%



ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

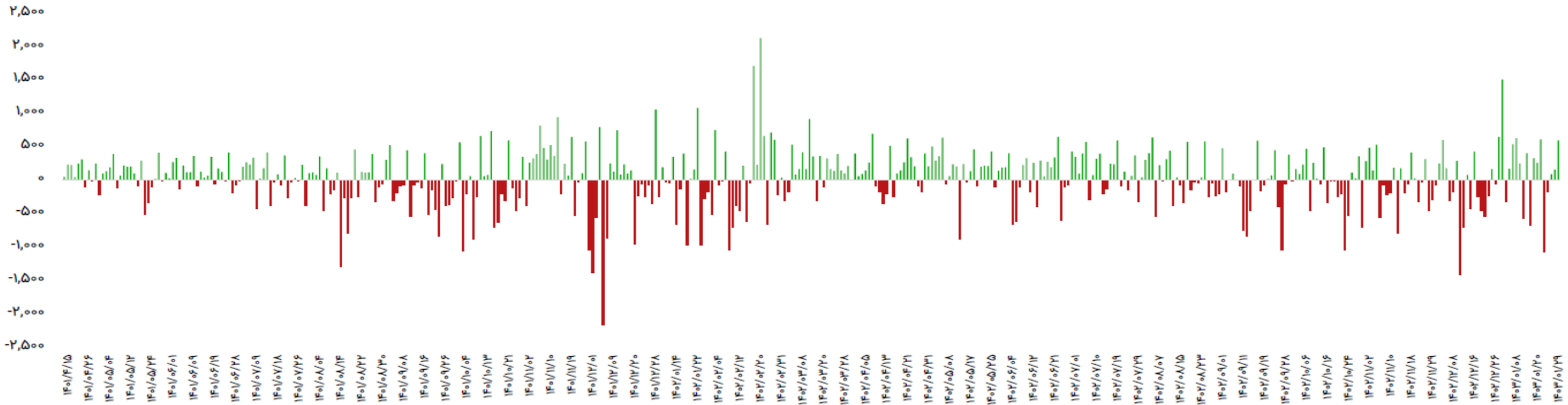


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۳/۰۱/۲۵	-۱,۷۸۳
۱۴۰۳/۰۱/۲۶	-۵۷۱
۱۴۰۳/۰۱/۲۷	۱۲۰
۱۴۰۳/۰۱/۲۸	-۵۸۰
۱۴۰۳/۰۱/۲۹	-۴۴
جمع	-۲,۸۵۸

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
سالانه (۱۴۰۲/۰۱/۲۹ تا ۱۴۰۳/۰۱/۲۹)	۲۴۳	-۴۹,۴۲۳
ماهیهانه (۱۴۰۲/۱۲/۲۹ تا ۱۴۰۳/۰۱/۲۹)	۱۷	-۴,۸۱۸
هفتگی (۱۴۰۳/۰۱/۲۹ تا ۱۴۰۳/۰۱/۲۵)	۵	-۲,۸۵۸

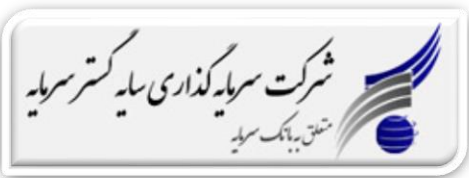


ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت



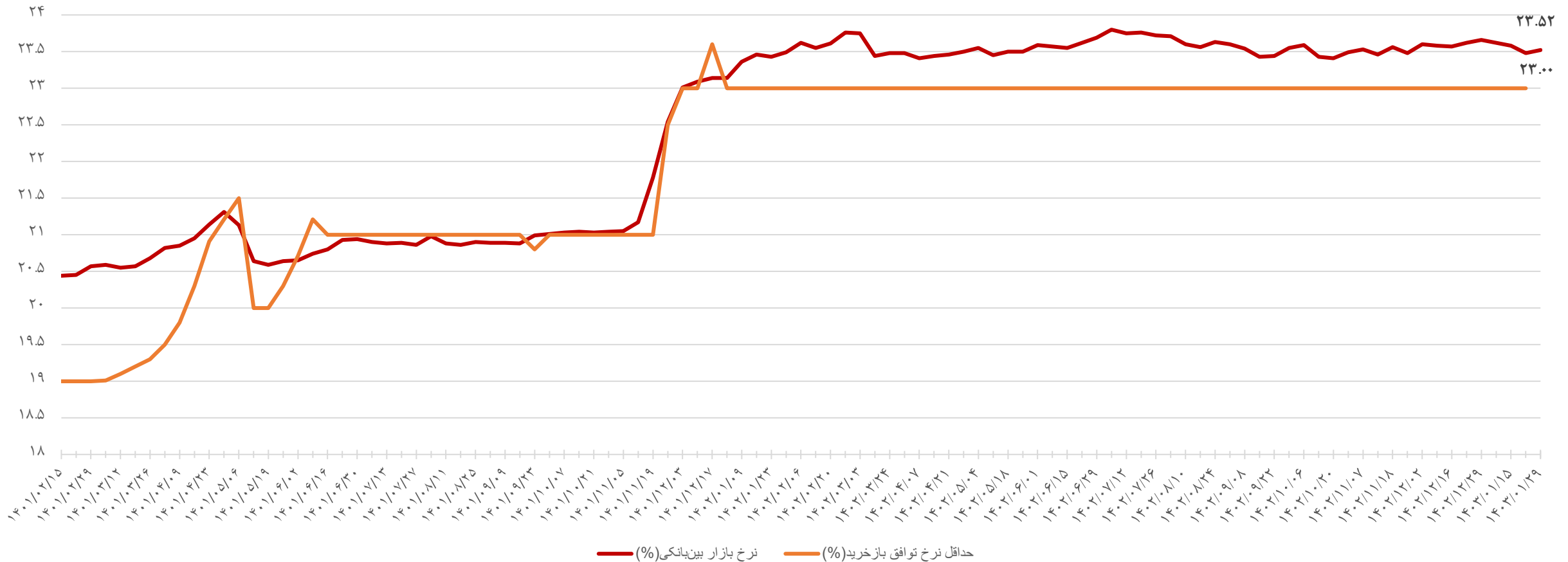
تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۳/۰۱/۲۵	-۱۰۷۸
۱۴۰۳/۰۱/۲۶	-۱۸۲
۱۴۰۳/۰۱/۲۷	۸۹
۱۴۰۳/۰۱/۲۸	۱۵۵
۱۴۰۳/۰۱/۲۹	۵۹۲
جمع	-۴۲۴

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
سالانه (۱۴۰۳/۰۱/۲۹ تا ۱۴۰۲/۰۱/۲۹)	۲۴۳	۱۴,۱۱۹
ماهیهانه (۱۴۰۳/۰۱/۲۹ تا ۱۴۰۲/۱۲/۲۹)	۱۷	۲,۶۶۹
هفتگی (۱۴۰۳/۰۱/۲۹ تا ۱۴۰۳/۰۱/۲۵)	۵	-۴۲۴



روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می دهد. در هفته چهارم فروردین ماه ۱۴۰۳ با افزایش به ۲۳.۵۲ رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	حمل و نقل بار زمینی	-۲٪
۲	وسایل خانگی	-۲٪
۳	نساجی	-۱٪
۴	محصولات لبنی	-۱٪
۵	پیمانکاری صنعتی	-۱٪

کم بازده ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	تولید فلزات گرانبهای غیر آهن	۱٪
۲	زغال سنگ	۱٪
۳	فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار	۱٪
۴	آهن و فولاد	۰٪
۵	خودرو	۰٪

پر بازده ترین صنایع

رتبه	نماد	درصد بازدهی
۱	لکما	-۶٪
۲	قنیشا	-۴٪
۳	قمرو	-۴٪
۴	قشهد	-۴٪
۵	دامین	-۴٪

بیشترین اصلاح نماد

رتبه	نماد	درصد بازدهی
۱	همراه	۵٪
۲	شراز	۴٪
۳	البرز	۴٪
۴	وتوصا	۴٪
۵	مبین	۴٪

بیشترین بازده نماد

ترین های بازار سهام

P / NAV	قیمت (ریال)	نماد	نمادهای با کمترین P/NAV
۰.۴۵	۷,۲۰۰	تمسکن	
۰.۴۷	۱۶,۳۹۰	شوینده	
۰.۵۱	۳۶۲,۵۰۰	وامیر	
۰.۵۲	۴,۸۸۰	ومدیر	
۰.۵۳	۷,۶۱۰	ونیکی	

p/e (ttm)	قیمت (ریال)	نماد	نمادهای با کمترین P/E
۱.۸	۱۳,۰۸۰	وشهر	
۲.۰	۲,۰۹۰	وسین	
۲.۱	۹۵۲	های وب	
۲.۱	۳,۱۶۰	ونوین	
۲.۷	۲۷,۸۰۰	وآفر	

تغییرات قیمتی بازارهای موازی و کامودیتی‌ها

شرح	آخرین قیمت	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۲,۳۸۸	۲,۳۴۴	۲%	۲,۱۸۲	۹.۴%
سکه امامی (ریال)	۴۴۹,۰۲۰,۰۰۰	۴۳۷,۰۶۰,۰۰۰	۲.۷%	۳۸۸,۰۶۰,۰۰۰	۱۵.۷%
دلار آزاد (ریال)	۶۶۹,۰۰۰	۶۴۵,۰۰۰	۳.۷%	۶۰۵,۰۰۰	۱۰.۶%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۸۷.۲	۹۰.۲	-۳.۳%	۸۵.۷	۱.۷%
بیت کوین (دلار)	۶۴,۲۶۵	۶۱,۹۲۵	۳.۸%	۶۳,۶۲۵	۱%
آلومینیوم LME	۲,۶۱۷	۲,۴۷۶	۵.۷%	۲,۳۱۰	۱۳.۳%
مس LME	۹,۷۴۶	۹,۴۱۳	۳.۵%	۸,۹۷۰	۸.۷%
روی LME	۲,۸۱۸	۲,۷۴۴	۲.۷%	۲,۵۳۳	۱۱.۳%
سرب LME	۲,۱۸۷	۲,۱۶۸	۰.۹%	۲,۰۵۸	۶.۳%
انس پلاتین	۹۴۴	۹۹۳	-۵%	۹۱۳	۳.۴%
اوره گرانوله (فوب خاورمیانه)	۳۱۰	۳۱۵	-۱.۶%	۳۶۵	-۱۵.۱%

تقویم اقتصادی هفته جاری :

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۳/۰۲/۰۳	دوشنبه	ضریب اطمینان مصرف‌کننده آئی اتحادیه اروپا، (تغییرات سالیانه) شاخص قیمت تولیدکننده کانادا
۱۴۰۳/۰۲/۰۴	سه‌شنبه	PMI تولید ژاپن، PMI خدمات اتحادیه اروپا
۱۴۰۳/۰۲/۰۵	چهارشنبه	تغییرات سهام نفت خام مؤسسه نفت آمریکا (API)، سخنرانی بانک مرکزی اروپا
۱۴۰۳/۰۲/۰۶	پنج‌شنبه	شاخص اقتصادی ژاپن، تغییرات دوره‌ای نرخ رشد تولید ناخالص داخلی آمریکا
۱۴۰۳/۰۲/۰۷	جمعه	(تغییرات سالیانه) CPI ژاپن، (تغییرات سالیانه) عرضه پول اتحادیه اروپا

تحلیل تکنیکال هفتگی دلار آزاد

دلار



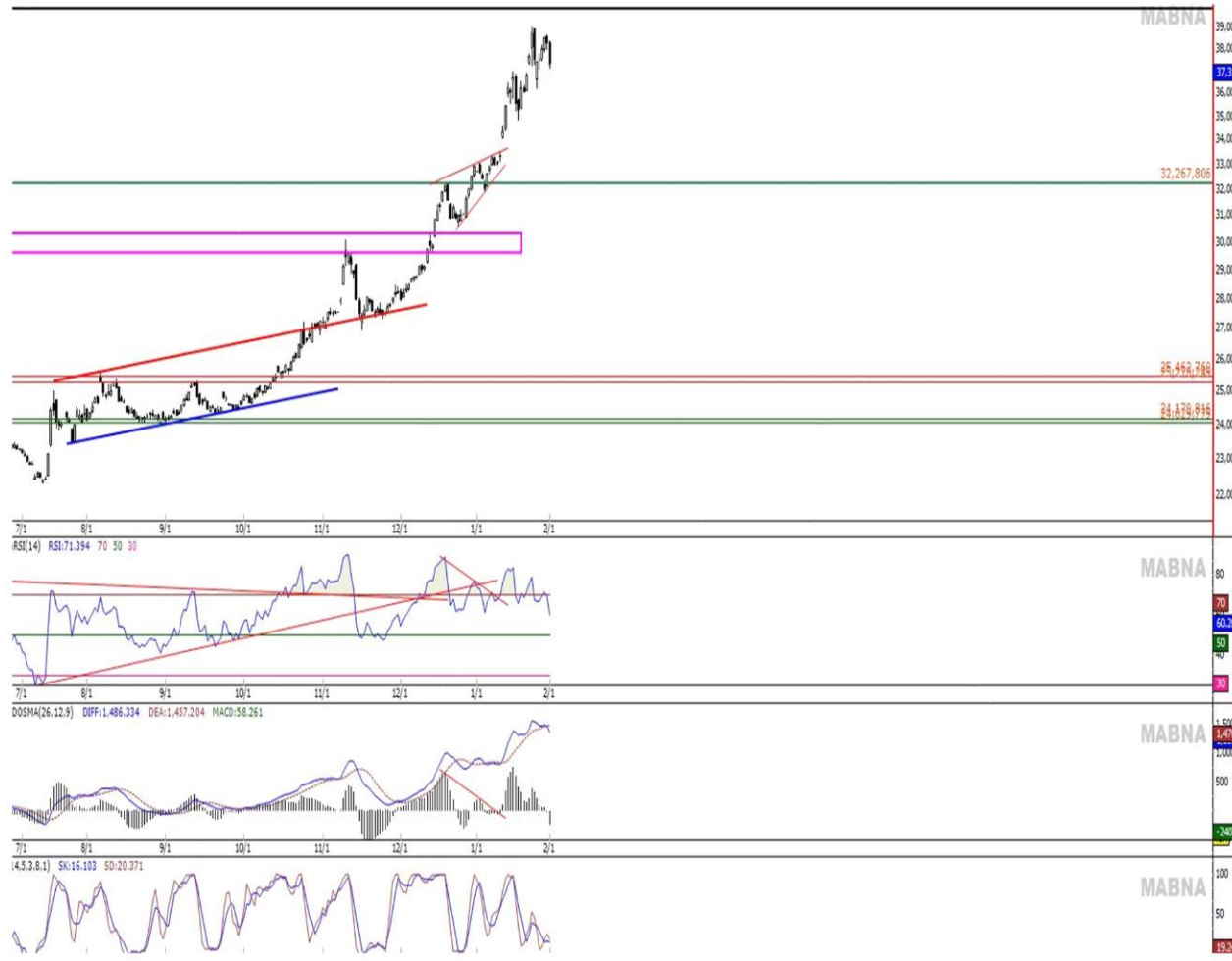
در حال حاضر در محدوده ۶۴۸,۰۰۰ ریال قرار دارد، مهمترین ناحیه مقاومت پیش رو در حال حاضر، محدوده ۷۰۰,۰۰۰ ریال می باشد. چنانچه این قیمت را دوباره پشت سر بگذارد اولین هدف قیمت ۷۵۰,۰۰۰ خواهد بود. دلار پس از شکستن سقف کانال فرضی کوتاه مدت در ۵۹۶,۵۰۰ وارد فاز رشد گشته است، اما نتوانست محدوده ۷۰۰,۰۰۰ ریال را در معاملات رسمی به ثبت برساند و وارد فاز اصلاح گردیده است. همچنین محدوده ۶۲۰,۰۰۰ ریال واحد به عنوان حمایت روانی مهم را در هفته جاری پیش رو خواهد داشت. طبق تحلیل دلار از سال گذشته، در مدار صعود قرار گرفت و شاهد رشد آن تا ۷۴۰,۰۰۰ ریال در معاملات غیر رسمی شده بودیم. هم اکنون انتظار داریم با فروکش کردن اخبار نظامی در کوتاه مدت دلار مسیر اصلاحی تا قیمت ۶۲۰,۰۰۰ ریال را پیش بگیرد.



تحلیل تکنیکال هفتگی طلا ۱۸ عیار

طلا ۱۸ عیار

بازار طلا، پیرو تحلیل های قبل، توانست سقف کوتاه مدت خود را بشکند و وارد مدار صعود شده تا محدوده ۳۹،۰۰۰،۰۰۰ رشد قیمتی را تجربه کند. هم اکنون انتظار داریم قیمت وارد محدوده اصلاحی شود و تا محدوده حمایتی ۳،۴۵۰،۰۰۰ تومان اصلاح کند. همچنین محدوده ۳،۲۵۰،۰۰۰ تومان به عنوان حمایت مهم پیش رو خواهد بود. فعلا معاملات طلا تحت تاثیر عوامل درگیری در منطقه و انس جهانی و تحرکات قیمت دلار شرایط اقتصاد داخلی و آمارهای مربوط به بانک مرکزی در مسیر صعود بلند مدت قرار دارد. لازم به ذکر است که به لحاظ نموداری انتظار رشد راهمچنان داریم. چنانچه در این مرحله اقدام به خرید گردد باید حد ضرر ۳،۷۰۰،۰۰۰ ریال در کوتاه مدت با توجه به اخبار دلار رعایت گردد. همچنان بازار صعودی ارزیابی می گردد. هر منفی در بازار طلا را فرصت ورود می دانیم.





تحلیل تکنیکال روزانه سکه

سکه



در حال حاضر در محدوده ۴۳۶،۰۰۰،۰۰۰ ریال قرار دارد، مهمترین مقاومت پیش رو با توجه به قیمت دلار و رشد انس جهانی در محدوده ۴۶۵،۰۰۰،۰۰۰ تا ۴۷۰،۰۰۰،۰۰۰ ریال می باشد. در صورت شکست و تثبیت در محدوده مقاومتی میتواند تا ۵۰۰،۰۰۰،۰۰۰ ریال صعود را تجربه کند. همچنین محدوده ۴۱۰،۰۰۰،۰۰۰ تا ۴۰۰،۰۰۰،۰۰۰ ریال واحد به عنوان حمایت مهم پیش رو خواهد بود. لذا چنانچه در این قیمت ها خرید انجام گردد حتما باید به حد ضرر ۴۰۰،۰۰۰،۰۰۰ ریال پایبند بود. در پایان در اصلاح های روزهای آتی میتواند هر منفی فرصت ورود باشد. هم اکنون پس از رشد که پیش بینی شد! انتظار داریم کوتاه مدت در مدار اصلاح تا اعداد یاد شده قرار گیرد .