

کارگزاری خبرگان سهام

گزارش تحلیلی بازارها

به همراه گزارش ویژه

ما خبرگان بازار هستیم

مجله شماره بیست و سوم



کارگزاری خبرگان سهام

فهرست

- | | |
|----|---------------------------------------|
| ۱ | اخبار هفته ای که گذشت |
| ۲ | گزارش بازار سرمایه در هفته ای که گذشت |
| ۱۱ | گنجینه خبرگان |
| ۱۲ | تحلیل شرکت نفت سپاهان |
| ۱۴ | کامودیتی ها |
| ۱۵ | تحلیل هفتگی بورس کالا |
| ۱۶ | تحلیل هفتگی اختیار معامله |
| ۱۸ | هفته ای که گذشت |
| ۱۹ | نماد های زیر ذربین |



شبکه های اجتماعی

 khobregan.com

 021-42382

 @khobregan_saham

صفحه آرایی:

صدیقه کرمی

نویسندگان و تحلیلگران:

نیلا قاسمی، غلامرضا ترابی زاده،

مهدی مالکی

تهیه شده توسط:

کارگزاری خبرگان سهام

سردبیر:

مریم نصر



نیویورک تایمز به نقل از منابع آمریکایی نوشت که سند پیشنهادی آمریکا به ایران شامل نقاط مختصر و محرمانه است و پیش‌نویس توافق کامل محسوب نمی‌شود. نیویورک تایمز به نقل از مقامات مطلع نوشت که این سند از ایران می‌خواهد که تمامی فعالیت‌های غنی‌سازی اورانیوم را متوقف کند. به گفته مقامات آمریکایی، این سند پیشنهاد ایجاد یک ائتلاف منطقه‌ای برای تولید انرژی هسته‌ای را مطرح می‌کند/فارس.

کشورهای عضو و ناظر گروه منطقه ای مبارزه با پولشویی اوراسیا خواستار تصویب CFT در ایران هستند. وزیر امور خارجه در جلسه امروز هیات دولت گزارشی از آخرین وضعیت مذاکرات و نامه‌ای که اخیراً آمریکایی‌ها از طریق کشور عمان برای ایران فرستاده‌اند ارائه و اظهار داشت: پاسخ این نامه در دست تهیه است. کاخ سفید به نهادهای دولتی آمریکا دستور داده تا هر فعالیت منجر به تحریم‌های جدید علیه ایران را متوقف کنند.

سید علی مدنی زاده به عنوان وزیر پیشنهادی اقتصاد به مجلس معرفی شد. همتی: باز هم اگر به عقب برگردم رانت ارز نیمایی را حذف می‌کنم زیرا به صلاح کشور است حتی اگر بدانم استیضاح می‌شوم

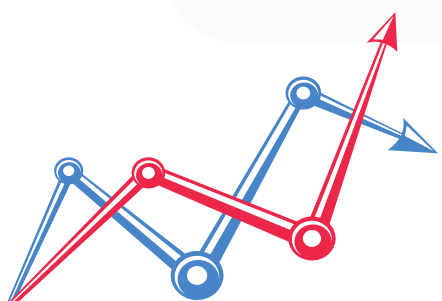
مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش وعده افزایش تولید روزانه ۱۲ میلیون لیتری بنزین در سال آینده داد. طبق آمار سازمان بورس ۳۳.۶ هزار میلیارد تومان اوراق بدهی در دومین ماه سال منتشر شد که سهم دولت ۷۴ درصد بود.

وزارت برق عراق تأکید کرد که کاهش گاز وارداتی از ایران، همراه با توقف واردات برق از این کشور به دلیل تحریم‌ها، موجب از دست رفتن ۵ هزار مگاوات از ظرفیت تولید برق عراق شده است. معاون وزیر صنعت از اختصاص سهمیه ارزی برای زنجیره خودرو تا پایان آبان و وعده حذف قیمت گذاری دستوری در خرداد داد.

قیمت مصوب هر کیلو شکر بسته بندی شده با احتساب ۱۰ درصد مالیات بر ارزش افزوده و سایر هزینه ها ۶۵ هزار تومان اعلام شد.

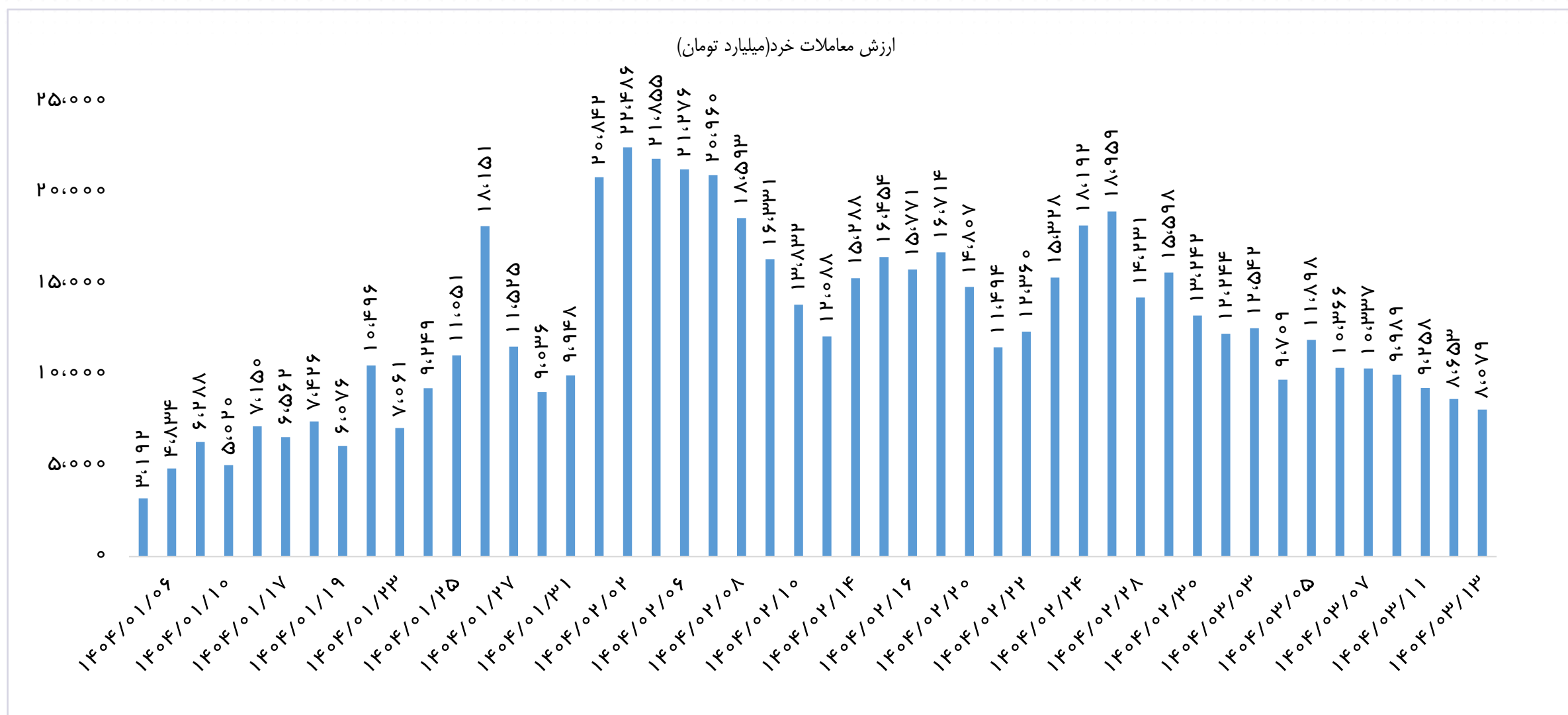
مخالفت پالایشگاه اصفهان با تعدیل قیمت بنزین بابت هزینه لایت اند مصرفی صنایع شیمیایی ایران، منجر به توقف و تعلیق این دو نماد شد.

وزارت نفت و شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی طبق مصوبات هیات مقررات زدایی، مجوز واردات بنزین سوپر را دریافت کردند.

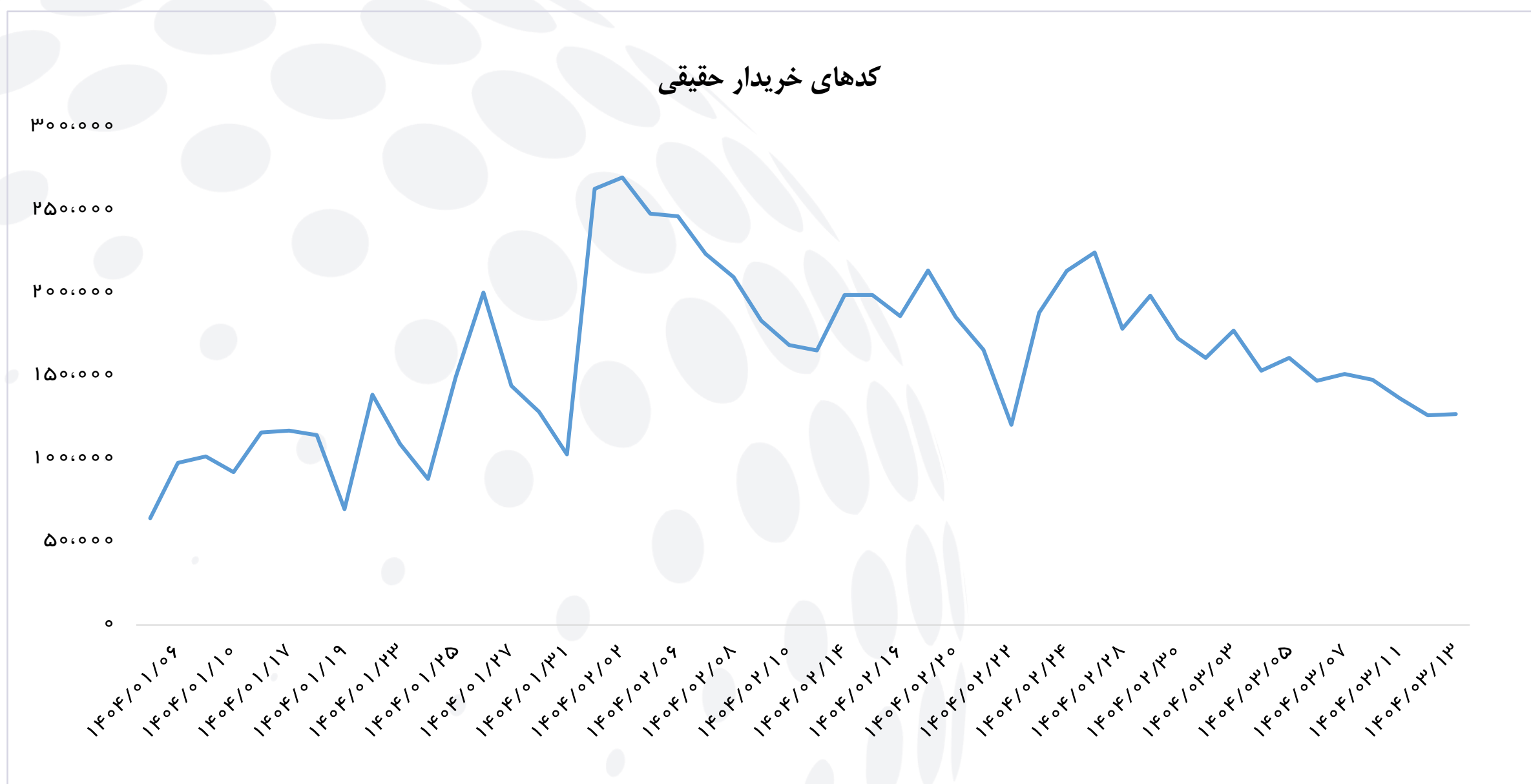




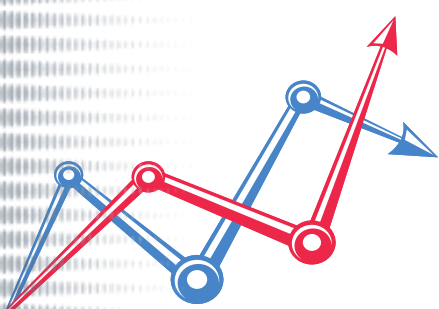
بازار در هفته ای که گذشت



نمودار فوق روند ارزش معاملات خرد بازار را در هفته دوم خرداد ماه نشان می‌دهد. جمع کل معاملات هفته فوق با کاهش ۱۸۰۸۷۱ میلیارد تومان نسبت به هفته قبل به ۳۵۰۹۸۰ میلیارد تومان رسید.

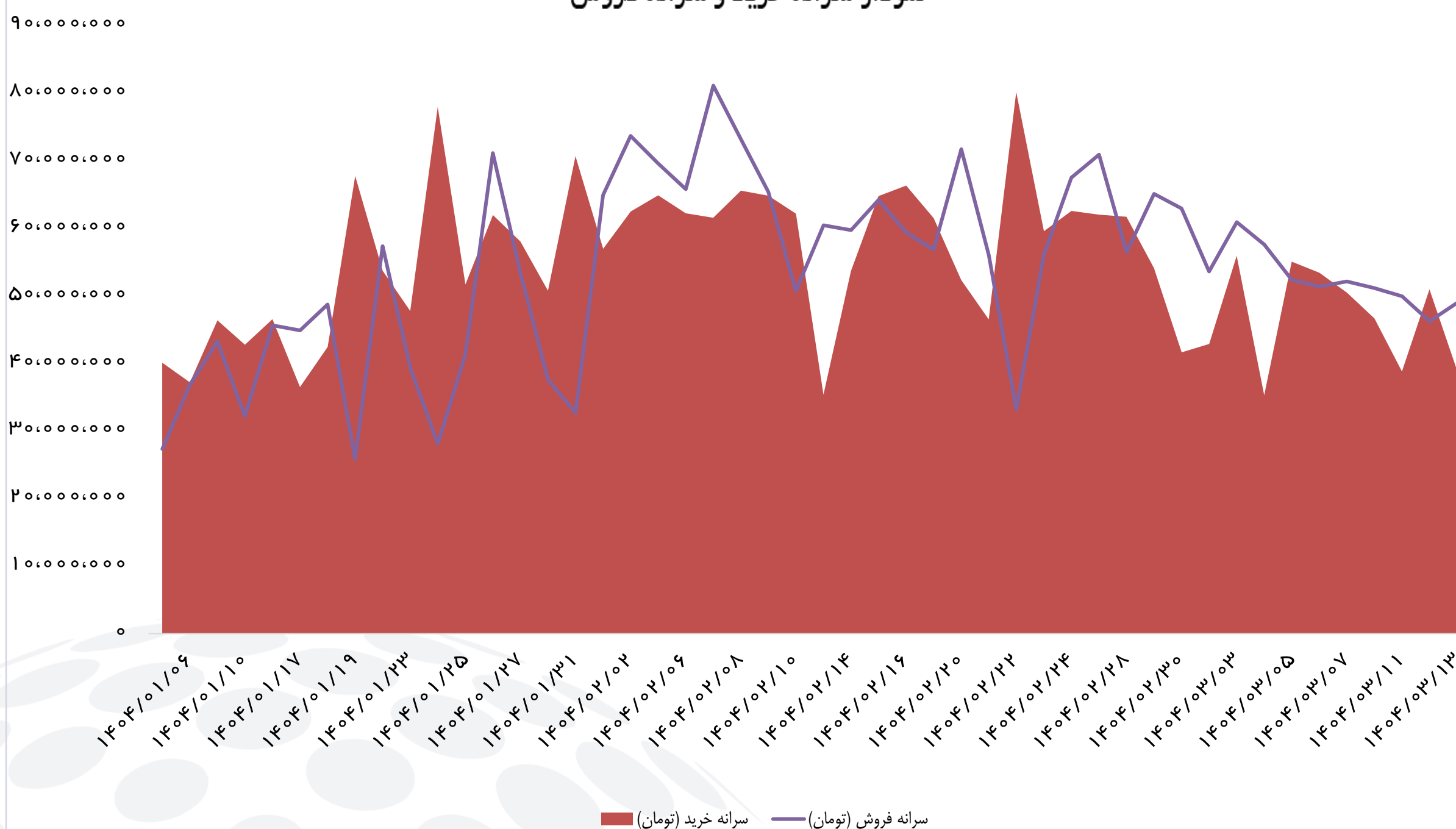


جمع کل کدهای خریدار سهام در هفته قبل برابر با ۷۹۰۰۶۱۶ نفر و در هفته اخیر برابر با ۵۳۸۰۱۷۸ نفر است. این یعنی تعداد خریداران در این هفته نسبت به هفته قبل حدود ۲۵۲۰۴۲۹ نفر کاهش یافته است.





نمودار سرانه خرید و سرانه فروش

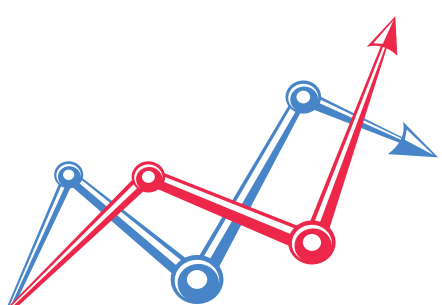


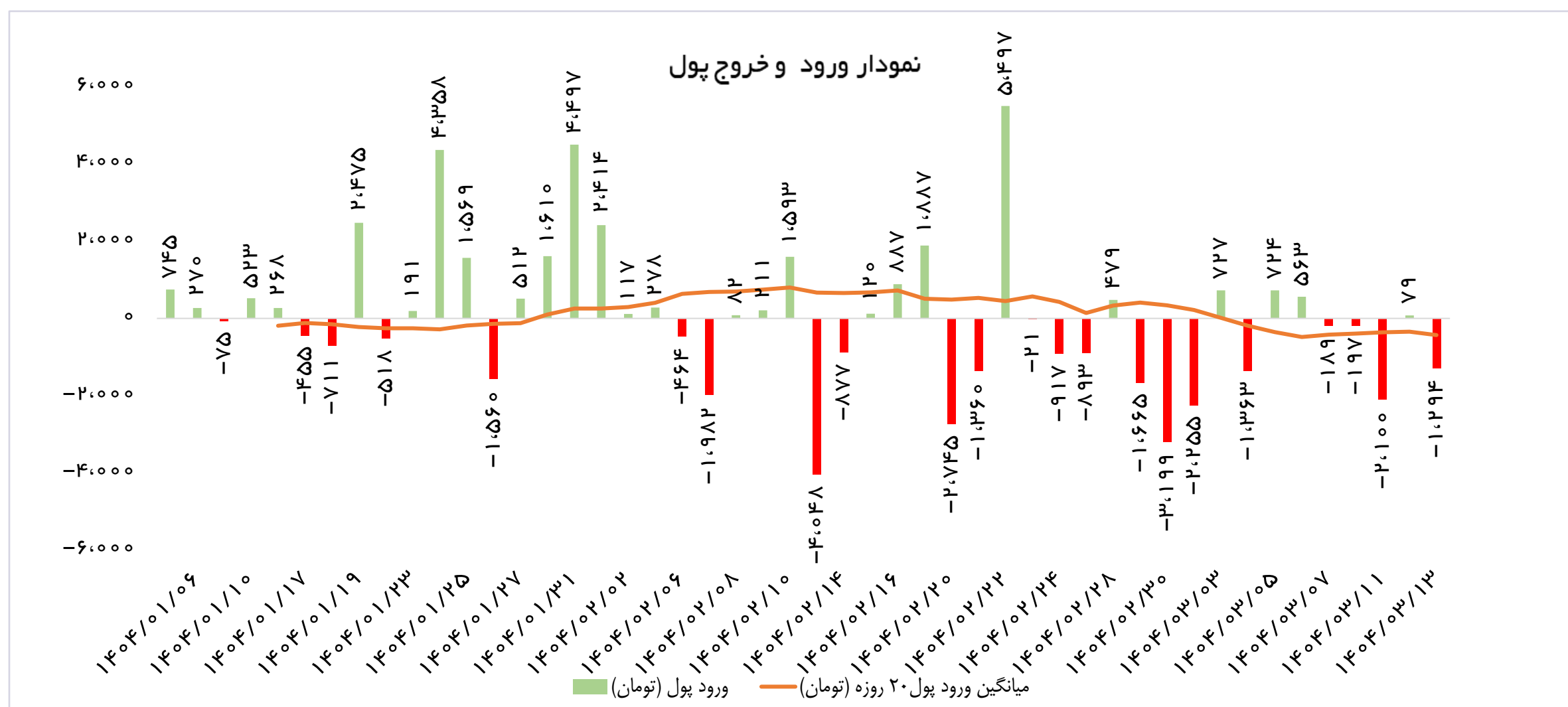
در هفته جاری، سرانه فروش حقیقی در اغلب روزها از سرانه خرید بیشتر بود که نشان‌دهنده برتری فروشندگان و تمایل بازار به اصلاح است.

سرانه خرید نسبت به فروش حدود ۲۱ میلیون تومان کمتر است.

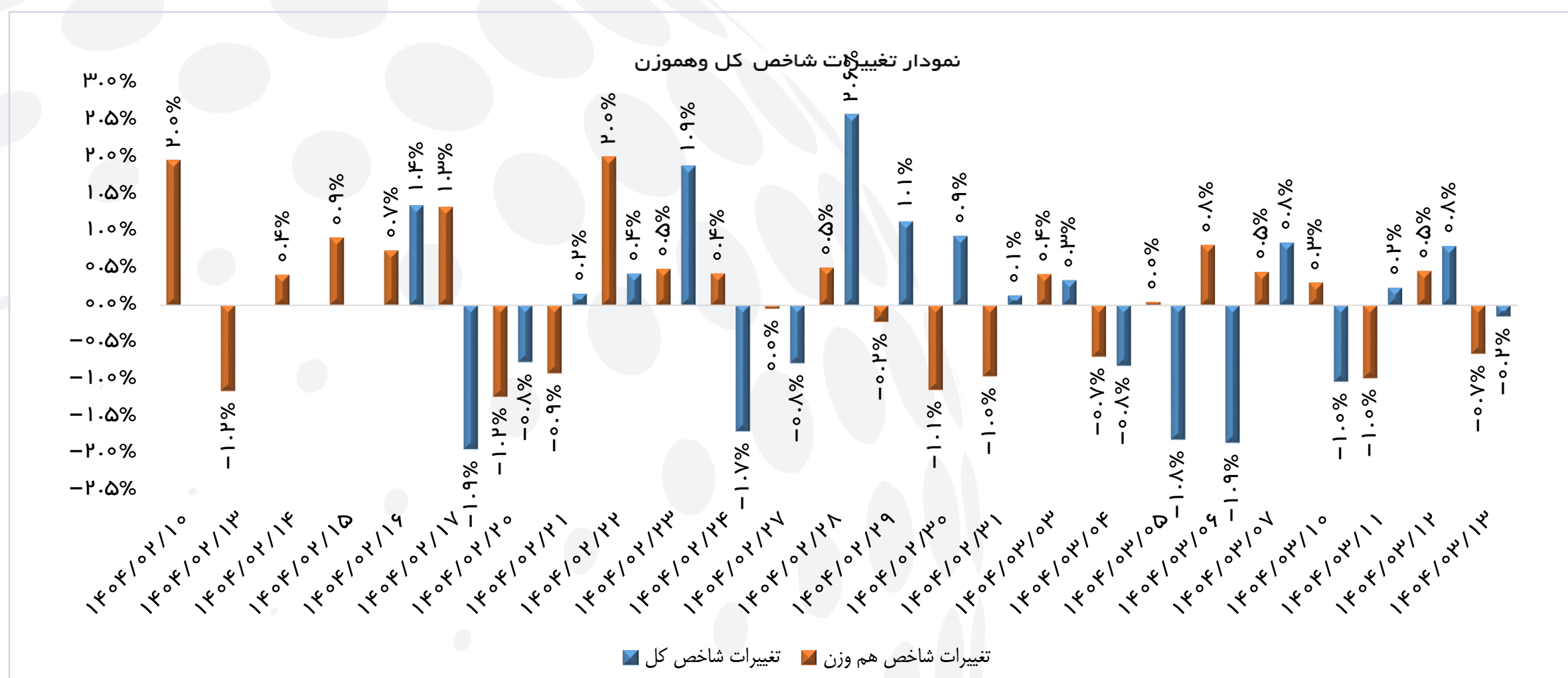
در مجموع، قدرت خریداران نسبت به هفته قبل کاهش یافته است.

این تغییر می‌تواند نشانه‌ای از افزایش احتیاط در بین معامله‌گران حقیقی باشد.

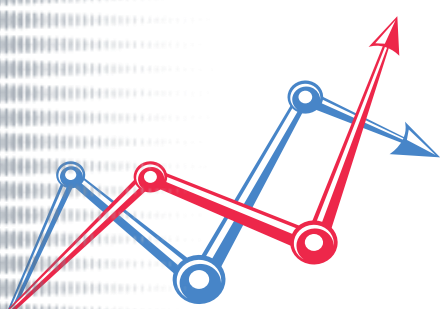




در هفته قبل، خروج پول حقیقی، ۴۶۲ میلیارد تومان و در هفته اخیر، ۳۵۱ میلیارد تومان ورود پول بوده است. بیشترین خروج پول در هفته اخیر، روز یکشنبه ۱۱ خرداد ماه ۱۳۹۳ میلیارد تومان بوده است.



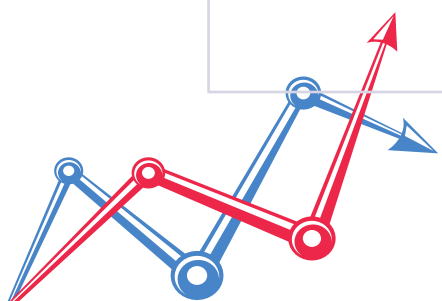
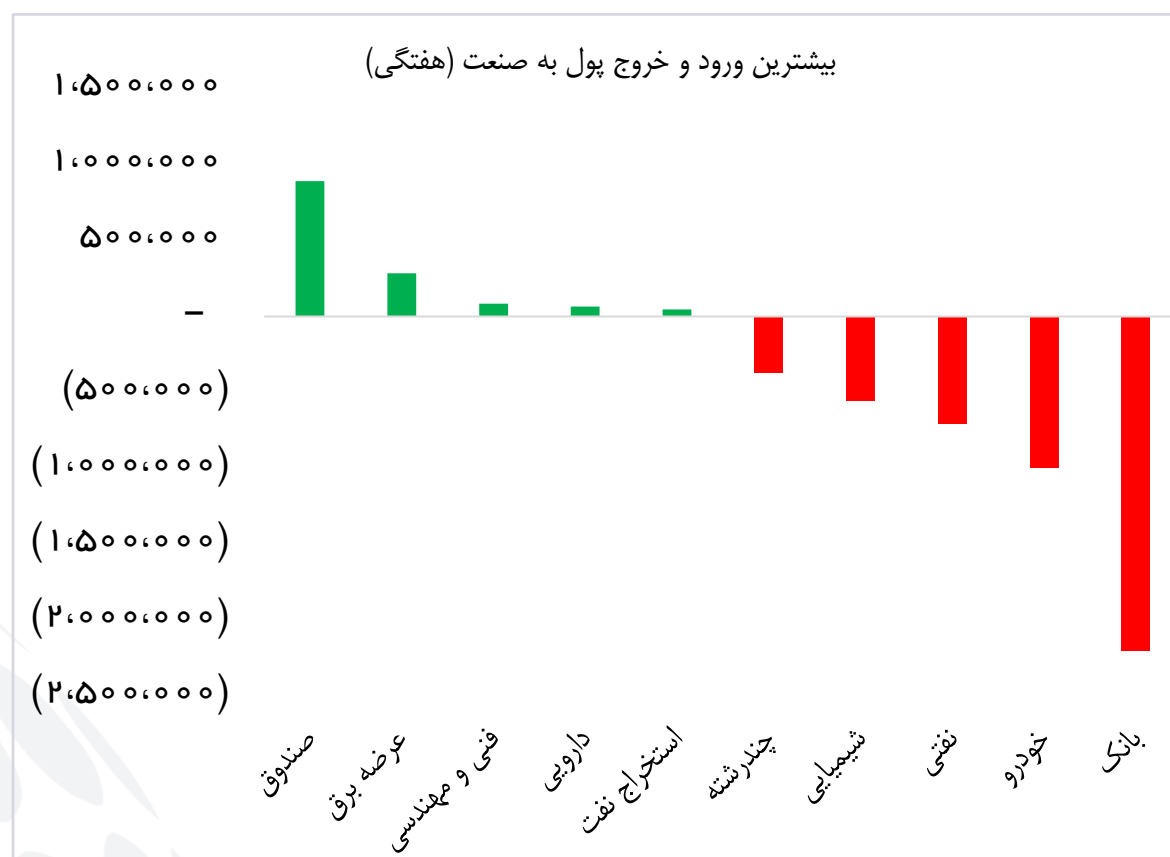
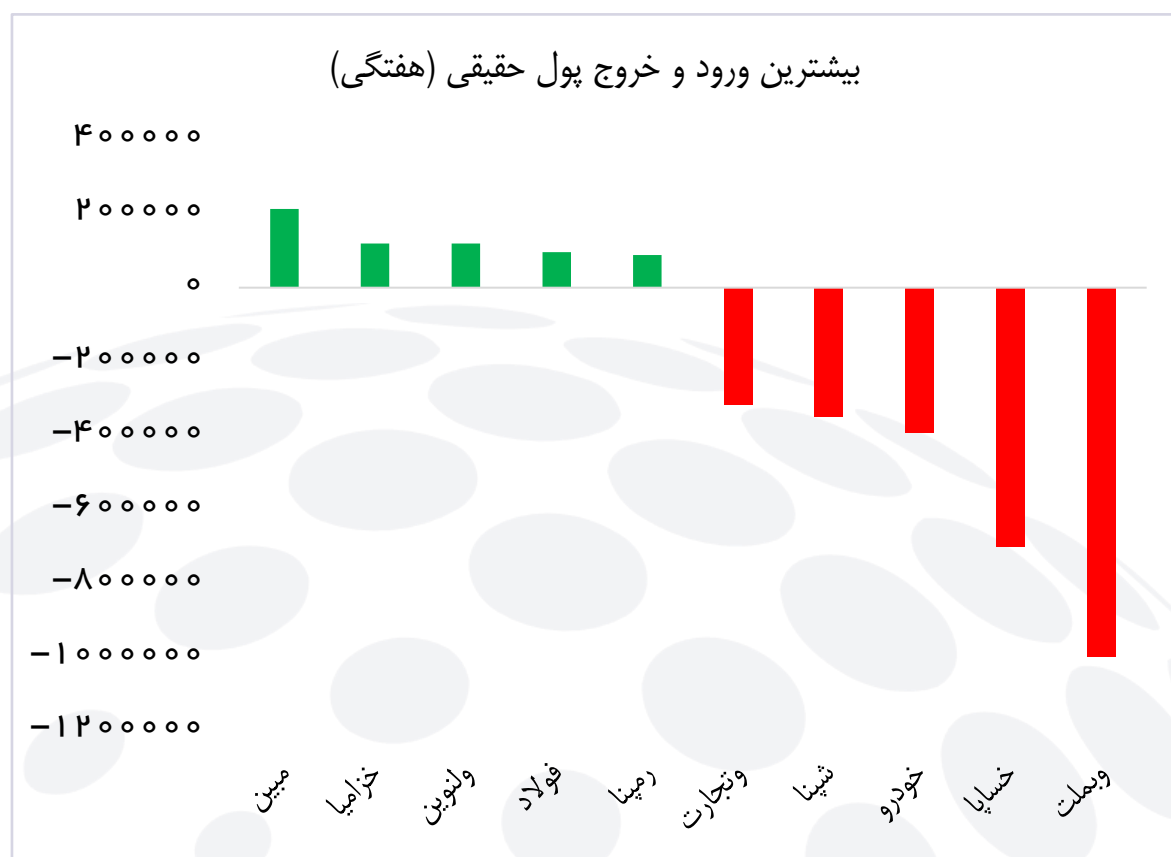
در هفته گذشته شاخص کل ۰.۷ درصد و شاخص هم وزن ۱ درصد بازدهی مثبت داشتند. در هفته اخیر شاخص کل و شاخص هم وزن هر دو روند نزولی داشته و هر کدام ۰.۹ درصد بازدهی منفی ثبت کردند.





بیشترین ریزش ۷ روز اخیر		
نماد	درصد تغییر	ارزش بازار(همت)
مهر	-۱۱	۱۰۱۲
قشرینچ	-۱۱	۰.۶۶۹
خنور	-۱۱	۴۰۱۲۸
فن آواح	-۱۱	۰.۳۰۳
شفارس	-۱۰	۲۰۷۵۴
کرومیت	-۱۰	۱۰۸۱۱
خبرنا	-۹	۳۰۴۷۵
گدنا	-۹	۰.۷۵۱
کاما	-۹	۸۰۲۲۹

بیشترین رشد ۷ روز اخیر		
نماد	درصد تغییر	ارزش بازار(همت)
قنیشا	۱۲	۱۰۲
بالبر	۱۲	۱۰.۳۳۳
آلومینا	۱۱	۲۰۰۵۴۵
شخارک	۱۱	۶۲۰۹۸۸
بزندگی	۱۰	۰.۸۷۸
دلقما	۱۰	۱۰.۳۶۱
فرآور	۱۰	۲۰۷۱۶
وسنا	۱۰	۵۰۵۱۶
کاذر	۹	۱۰۰۲۴

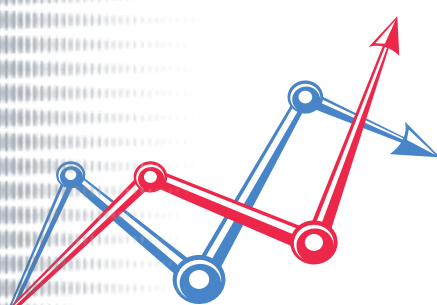




بازدهی هفتگی بازار ها



بازدهی هفتگی





صندوق های سهامی



بازده زمانی	اطلس	انار	پادا	خبرگان
بازده هفتگی	%۰.۱۶	%۰.۱۶	%-۰.۱	%-۰.۹۱
بازده ماهانه	%۲.۹۲	%۲.۰۵	%-۰.۶۶	%۲.۵۳
بازده ۳ ماهه	%۱۵.۹۲	%۱۳.۴۵	%۹.۱۳	%۲۰.۳
بازده ۶ ماهه	%۳۱.۴۱	%۲۴.۹۳	%۲۳.۴	%۳۷.۶۳
بازده یکساله	%۶۶.۶۶	%۶۱	%۴۷.۵	%۶۳.۶۸
ضریب بتا	۰.۴۲	۰.۷۲	۰.۷۸	۰.۹۵

صندوق های مختلط

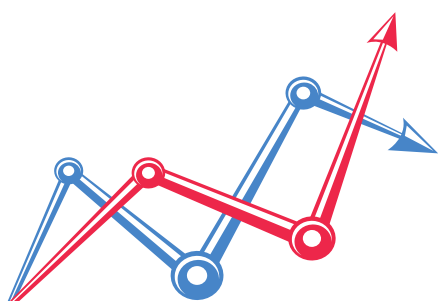


بازده زمانی	هیبرید	زیتون	صنوین
بازده هفتگی	%۰.۸۲	%۰.۷۲	%-۰.۰۸
بازده ماهانه	%۰.۲۳	%۲.۶۲	%۰.۸۸
بازده ۳ ماهه	%۱۵.۰۷	%۸.۳۱	%۱۲.۵۴
بازده ۶ ماهه	%۳۰.۵	%۱۷.۲۲	%۲۶.۶۶
بازده یکساله	%۶۱.۱۲	%۳۵.۳۳	%۴۳.۳۱

صندوق های اهرمی



بازده زمانی	پیشران	دوایکس	توان
بازده هفتگی	%-۱.۲	%-۱.۲۱	%-۲.۲۳
بازده ماهانه	%-۱.۰۳	%-۱.۳۱	%-۰.۵۲
بازده ۳ ماهه	%۱۴.۹۴	-	%۱۲.۵۱
بازده ۶ ماهه	%۲۵.۶۹	-	%۲۹.۹۵
بازده یکساله	%۵۱.۳۳	-	%۷۹

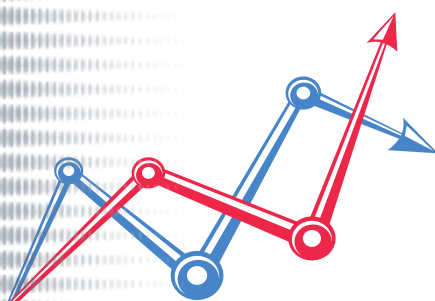
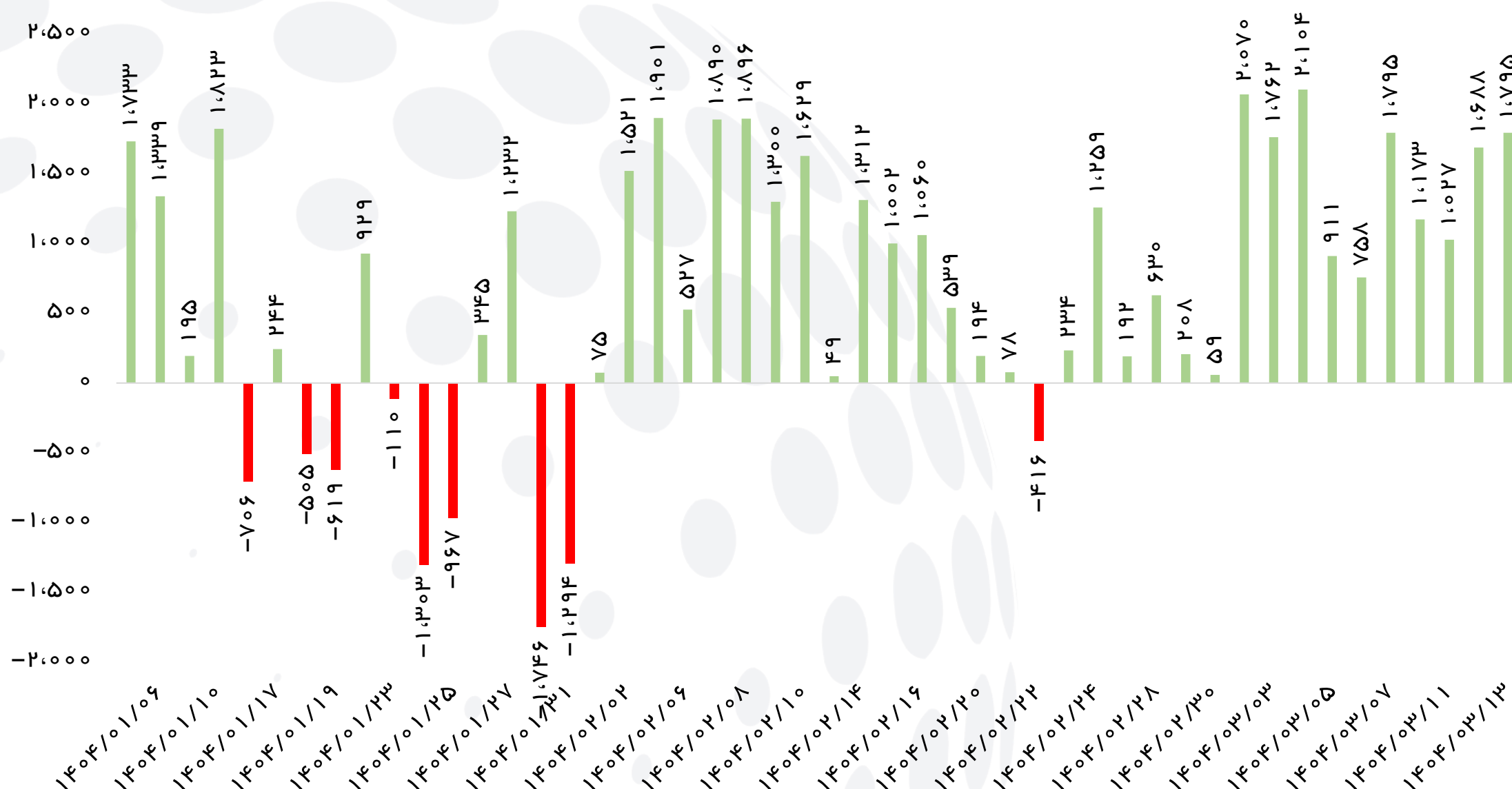




صندوق های درآمد ثابت

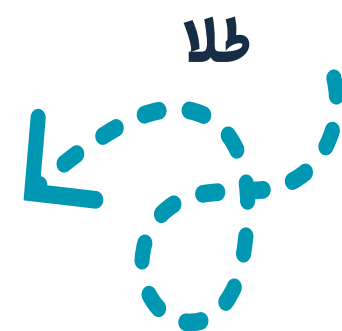
بازده زمانی	سام	آسان	هامرز
بازده هفتگی	۲۰.۸۹%	۲%	۱۰.۲۹%
بازده ماهانه	۳۰.۲۱%	۳.۷۵%	۱۰.۹۵%
بازده ۳ ماهه	۷۰.۶۷%	۶.۴۴%	۶۰.۷۱%
بازده ۶ ماهه	۱۴۰.۶۳%	۱۹۰.۴۹%	۱۱۰.۲۷%
بازده یکساله	۳۲۰.۸۳%	۳۳۰.۲%	۲۴۰.۲۹%

ورود و خروج پول به درآمد ثابت(میلیارد تومان)



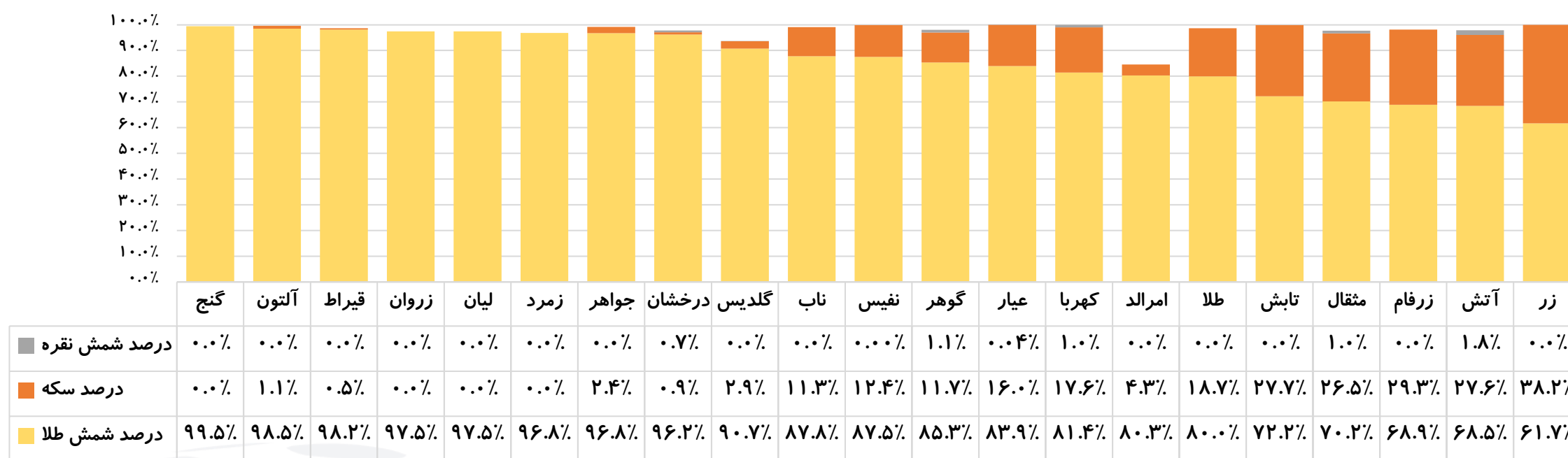


صندوق های طلا

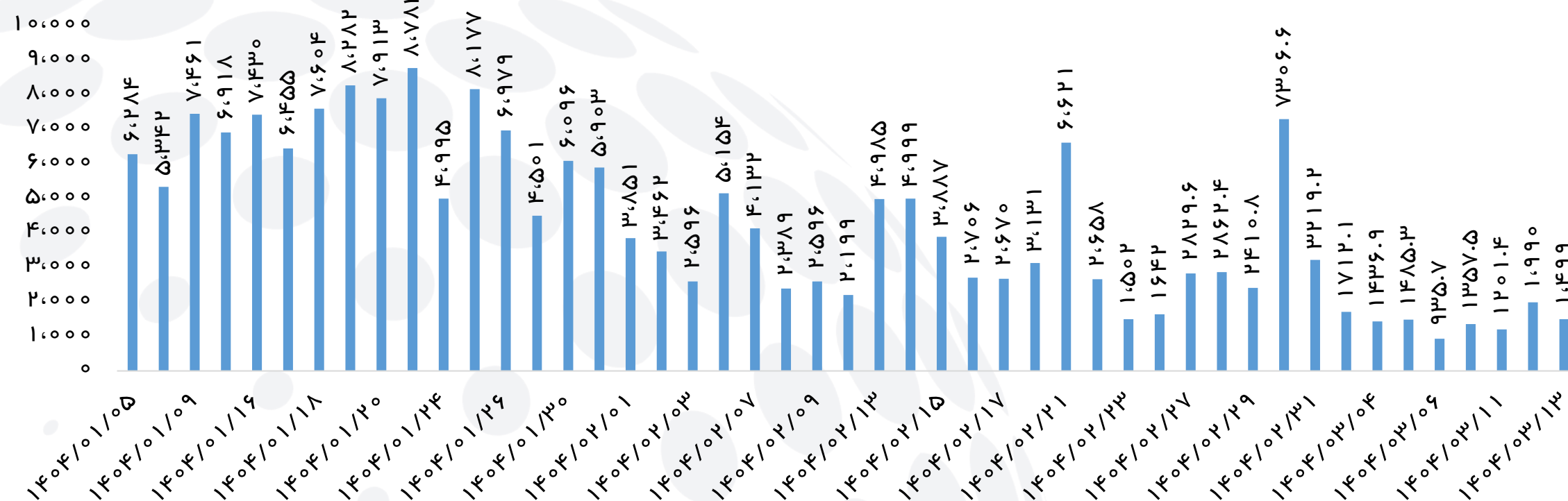


بازده زمانی	زر	تابش	زرفام
بازده هفتگی	۱۰.۱۳%	۱۰.۱۵%	۱۰.۱۶%
بازده ماهانه	۴.۶۲%-	۴.۲%-	۴.۵۱%-
بازده ۳ ماهه	۰.۴۱%	۰.۶۱%	۰.۵۴%-
بازده ۶ ماهه	۳۴.۳۶%	۳۸.۶۵%	۳۶.۳%
بازده یکساله	۷۴.۲۷%	۸۴.۷۳%	۸۶.۴%

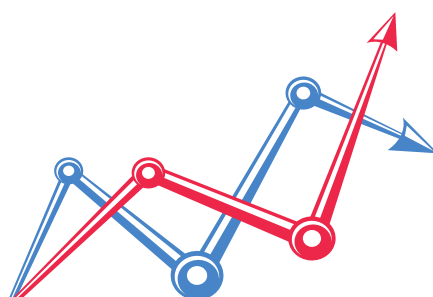
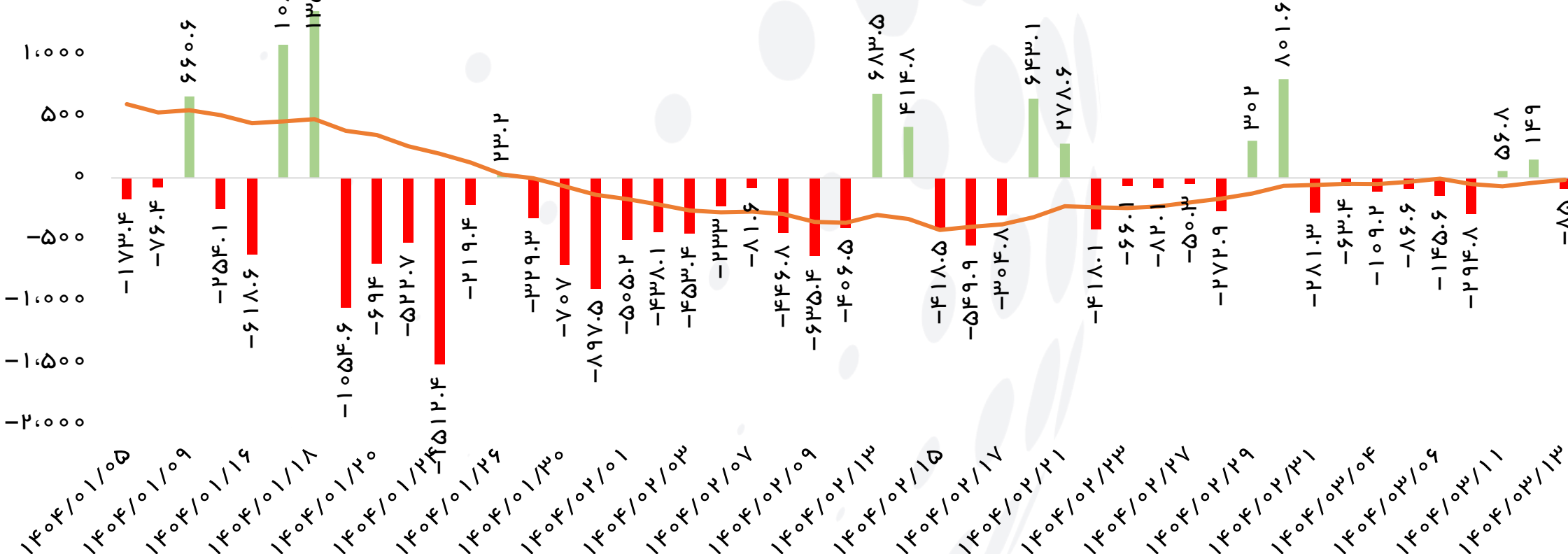
درصد طلا از کل دارایی



ارزش معاملات خرد صندوق های طلا(میلیارد تومان)



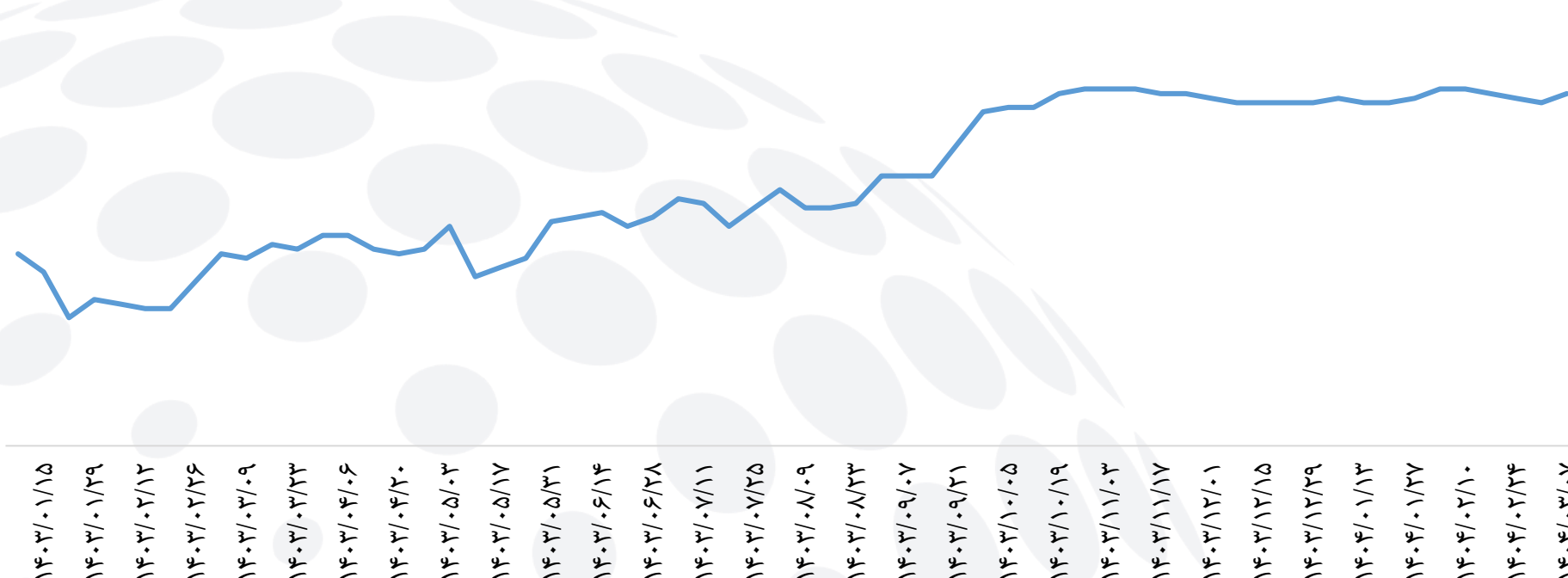
ورود و خروج پول حقیقی به صندوق های طلا





نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	قیمت پایانی	حجم	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخزا ۱۰۹	۸۷۳،۹۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۱	۸۷۳،۹۰۰	۰	۱۴۰۴-۰۸-۲۶	۳۳/۷۹%	۳۱/۱۶%
اخزا ۲۰۴	۶۲۳،۱۹۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۱	۶۲۲،۸۶۰	۰	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۳۴/۰۵%	۳۷/۴۷%
اخزا ۱۰۱	۹۸۶،۵۳۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۹۸۷،۸۹۰	۸۰۶۰	۱۴۰۴-۰۳-۲۶	۷۳/۳۳%	۵۵/۳۷%
اخزا ۱۰۳	۹۴۵،۳۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۹۴۵،۱۶۰	۰	۱۴۰۴-۰۵-۲۰	۳۷/۱۵%	۳۲/۴۹%
اخزا ۱۰۷	۹۰۲،۸۶۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۹۰۲،۸۶۰	۴۹	۱۴۰۴-۰۷-۱۴	۳۶/۱%	۳۲/۴۶%
اخزا ۱۰۸	۸۹۶،۲۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۸۹۸،۰۸۰	۲۱۲۴	۱۴۰۴-۰۷-۲۸	۳۴/۴۹%	۳۱/۳۱%
گام ۱۰۴۰۸۶	۸۷۰،۵۳۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۸۷۰،۵۳۰	۵۰۰۰۰۰	۱۴۰۴-۰۸-۳۰	۳۵/۴%	۳۲/۵۱%
اخزا ۲۰۷	۸۶۸،۱۵۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۸۶۸،۴۴۰	۱۷۲۱	۱۴۰۴-۰۹-۱۰	۳۳/۸۵%	۳۱/۳۲%
اخزا ۱۰۴	۸۶۹،۶۹۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۸۶۹،۸۷۰	۱،۷۵۳	۱۴۰۴-۰۹-۱۷	۳۱/۹۱%	۲۹/۷۲%
اخزا ۱۰۵	۸۵۱،۳۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۸۵۰،۷۸۰	۱۶۵۰	۱۴۰۴-۱۰-۱۵	۳۱/۹۴%	۳۰/۰۷%
اخزا ۲۰۸	۸۰۴،۹۹۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۸۰۴،۹۹۰	۱۱۴۰۲	۱۴۰۴-۱۲-۱۱	۳۴/۳۷%	۳۲/۹۹%
اخزا ۲۰۱	۷۴۰،۰۳۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۷۴۱،۰۹۰	۲۰۶۲۸	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۳۴/۲۶%	۳۴/۳۸%
اخزا ۲۱۱	۶۷۴،۱۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۶۷۳،۸۵۰	۴۸،۹۵۲	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۳۳/۹۹%	۳۵/۸۷%
اخزا ۲۰۳	۶۶۱،۹۸۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۶۵۹،۳۱۰	۱۹۰۳۰	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۳۳/۵۸%	۳۵/۸۴%
اخزا ۲۱۲	۶۴۲،۳۵۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۶۴۳،۷۷۰	۲۳۷۶۸	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۳۴/۲۹%	۳۷/۰۹%
اخزا ۲۰۲	۶۴۳،۰۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۶۴۳،۰۹۰	۱۱،۸۳۰	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۳۳/۷%	۳۶/۵۱%
اخزا ۲۱۳	۶۲۶،۰۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۶۲۵،۹۷۰	۲۴،۷۹۵	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۳۴/۰۸%	۳۷/۴%
اخزا ۲۱۰	۶۱۵،۰۰۰	۱۴۰۴-۰۳-۱۷	۶۱۵،۵۴۰	۱۵۲۲۱	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۳۴/۱۵%	۳۷/۸۳%

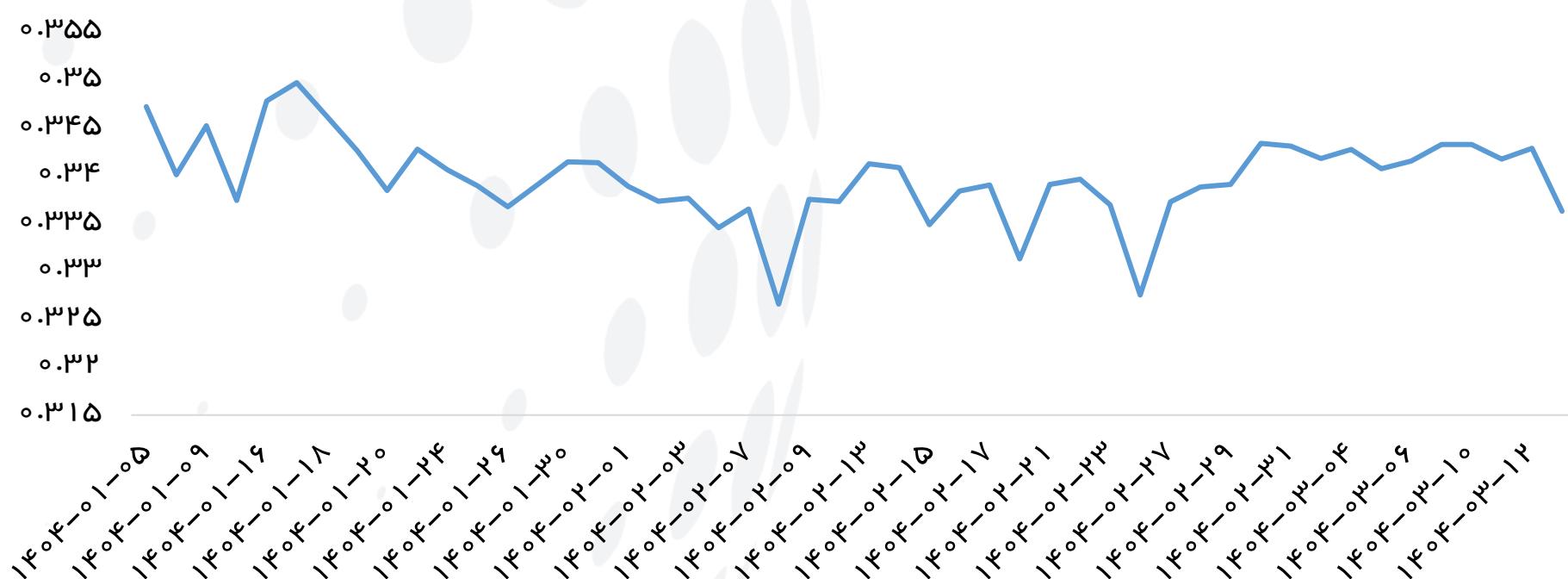
نرخ بازار بین بانکی (%)



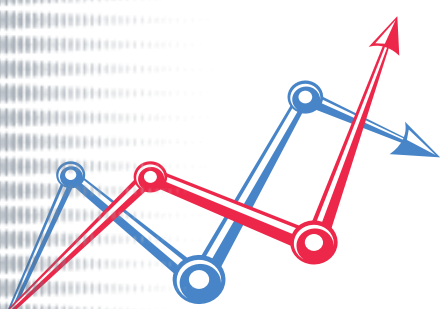
نرخ بهره بین بانکی

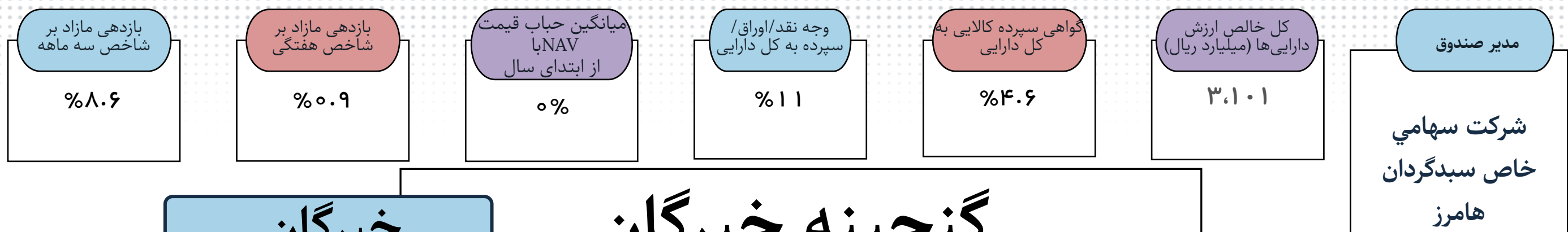


میانگین نرخ بهره بدون ریسک



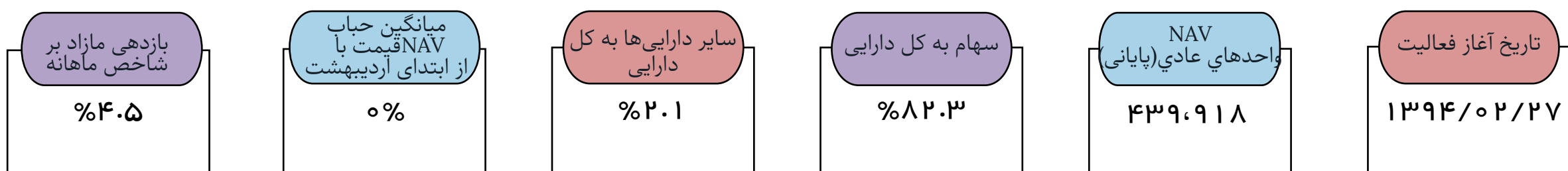
میانگین نرخ بهره بدون ریسک





گنجینه خبرگان

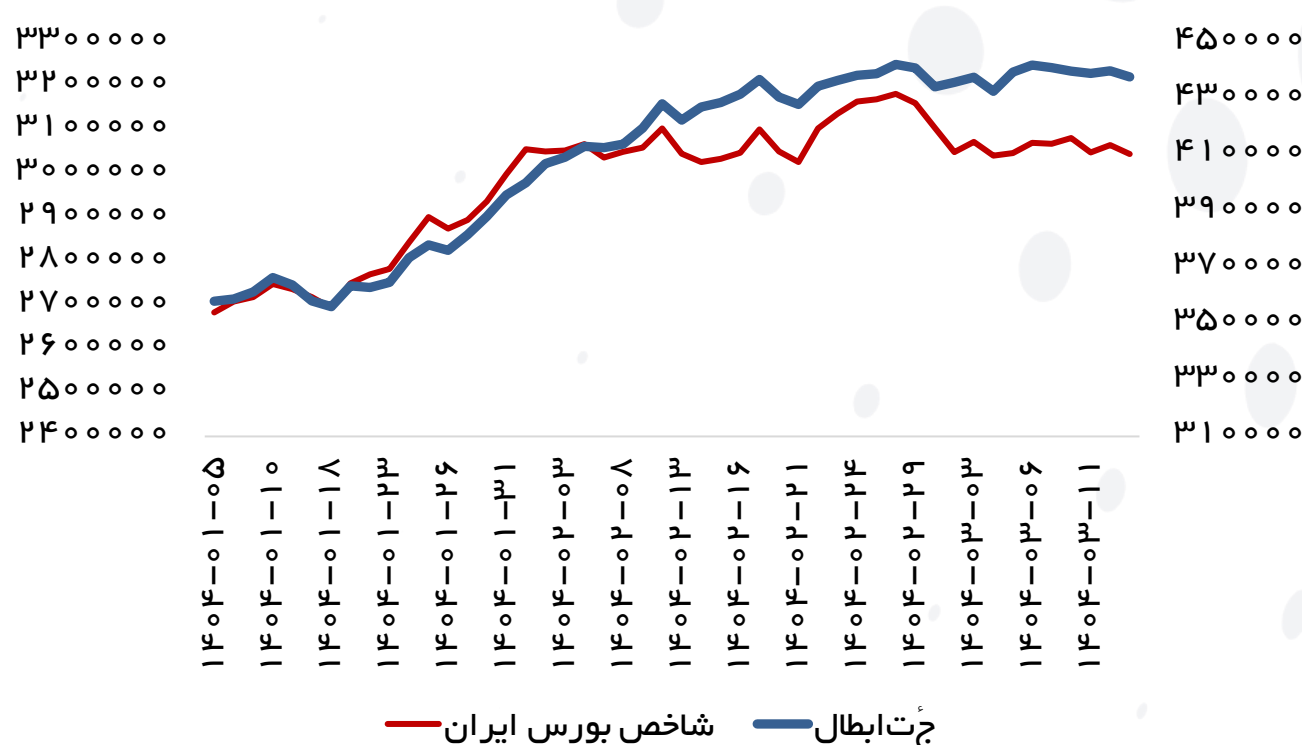
خبرگان



صندوق سرمایه‌گذاری خبرگان، پیش‌تاز بازدهی در بین صندوق‌های قابل معامله سهامی

در میان صندوق‌های قابل معامله سهامی با ارزش خالص دارایی بین ۱۰۰۰ تا ۵۰۰۰ میلیارد ریال، صندوق سرمایه‌گذاری خبرگان با ثبت بازدهی ۶۴.۵۳ درصدی سالانه در صدر قرار گرفته است.

شایان ذکر است که این صندوق طی دوره مورد بررسی، ۱۵.۹ درصد بازدهی مازاد نسبت به شاخص کل کسب کرده و عملکردی فراتر از بازار داشته است.





در شرایط فعلی که قیمت جهانی نفت در محدوده زیر ۷۰ دلار قرار دارد و نرخ روغن پایه افت قابل توجهی نداشته، حاشیه سود شرکت افزایش یافته و نفت سپاهان در موقعیتی بسیار مناسب برای سودآوری بالا قرار دارد. سبد محصولات شرکت ترکیبی از کالاهای مشمول نرخ گذاری دستوری و آزاد است که انعطاف پذیری آن را در مدیریت درآمدها بالا می برد.

نکته قابل توجه دیگر، سیاست تقسیم سود مناسب شرکت است؛ به طوری که در سال های اخیر درصد بالایی از سود خالص بین سهامداران توزیع شده است که این موضوع، جذابیت سرمایه گذاری در سهام شرکت را افزایش داده است.

سهامدار اصلی شرکت، تابان فردا و سهامدار نهایی آن صندوق بازنشستگی و پس انداز کارکنان صنعت نفت است؛ پشتوانه ای نهادینه که ثبات مالکیتی و جایگاه راهبردی شرکت در صنعت انرژی کشور را تقویت می کند.

شرکت نفت سپاهان در سال ۱۳۷۸ تأسیس شده و اکنون به عنوان بزرگ ترین تولیدکننده روغن پایه در ایران شناخته می شود. این شرکت در نزدیکی پالایشگاه نفت اصفهان قرار دارد و خوراک اصلی خود، یعنی لوبکات را به صورت پایدار از همین پالایشگاه تأمین می کند. موقعیت جغرافیایی مناسب، همراه با دسترسی مستمر به خوراک، مزیتی رقابتی برای شرکت ایجاد کرده است.

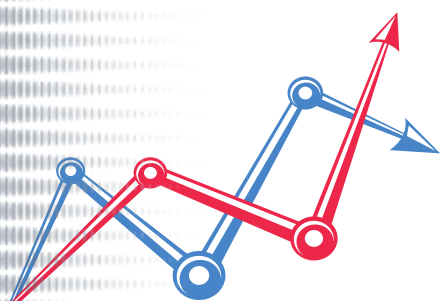
روغن پایه یکی از محصولات اصلی شرکت و ماده اولیه کلیدی برای تولید انواع روانکارهاست. این ماده از پالایش لوبکات به دست می آید و در صنایع مختلف از جمله تولید روغن موتور کاربرد دارد. روغن موتور نیز که در سبد محصولات شرکت قرار دارد، از جمله کالاهایی است که به دلیل نیاز دائمی خودروها و ماشین آلات، از تقاضای پایدار برخوردار است و نرخ آن با توجه به تورم، روندی افزایشی دارد؛ به همین دلیل منبع درآمدی باثبات برای شرکت محسوب می شود.

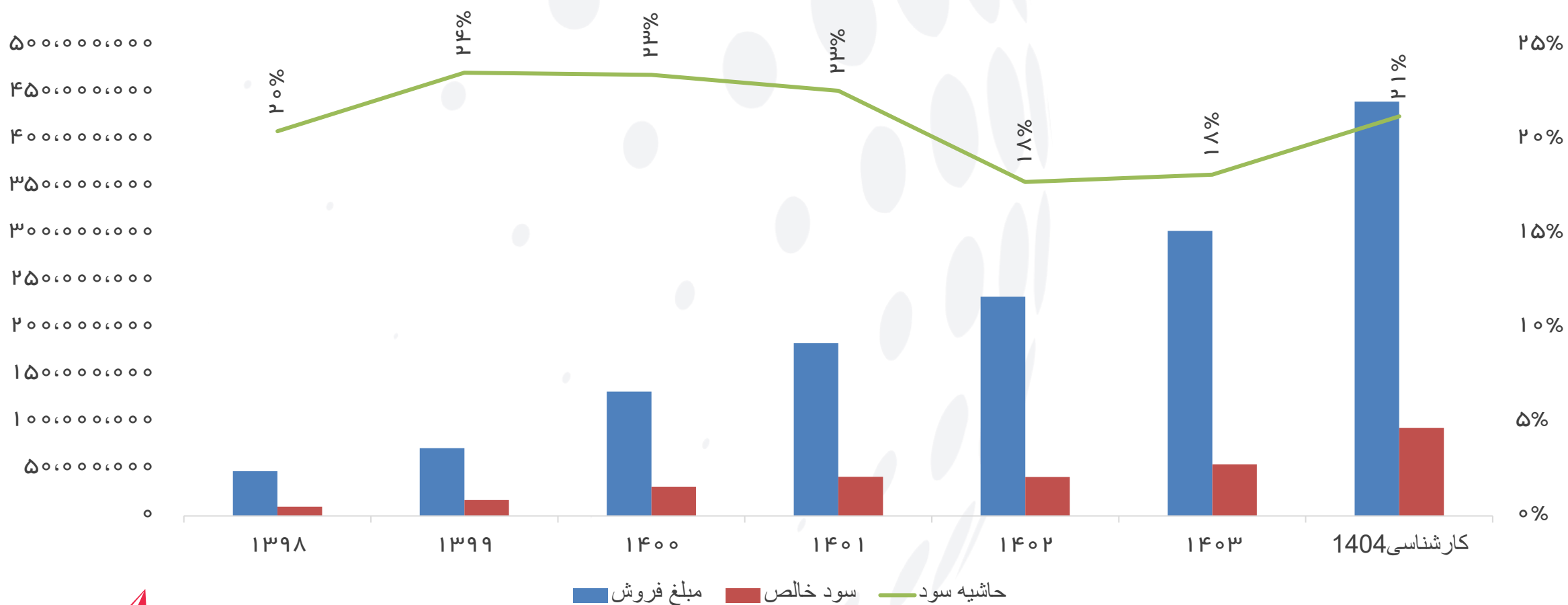
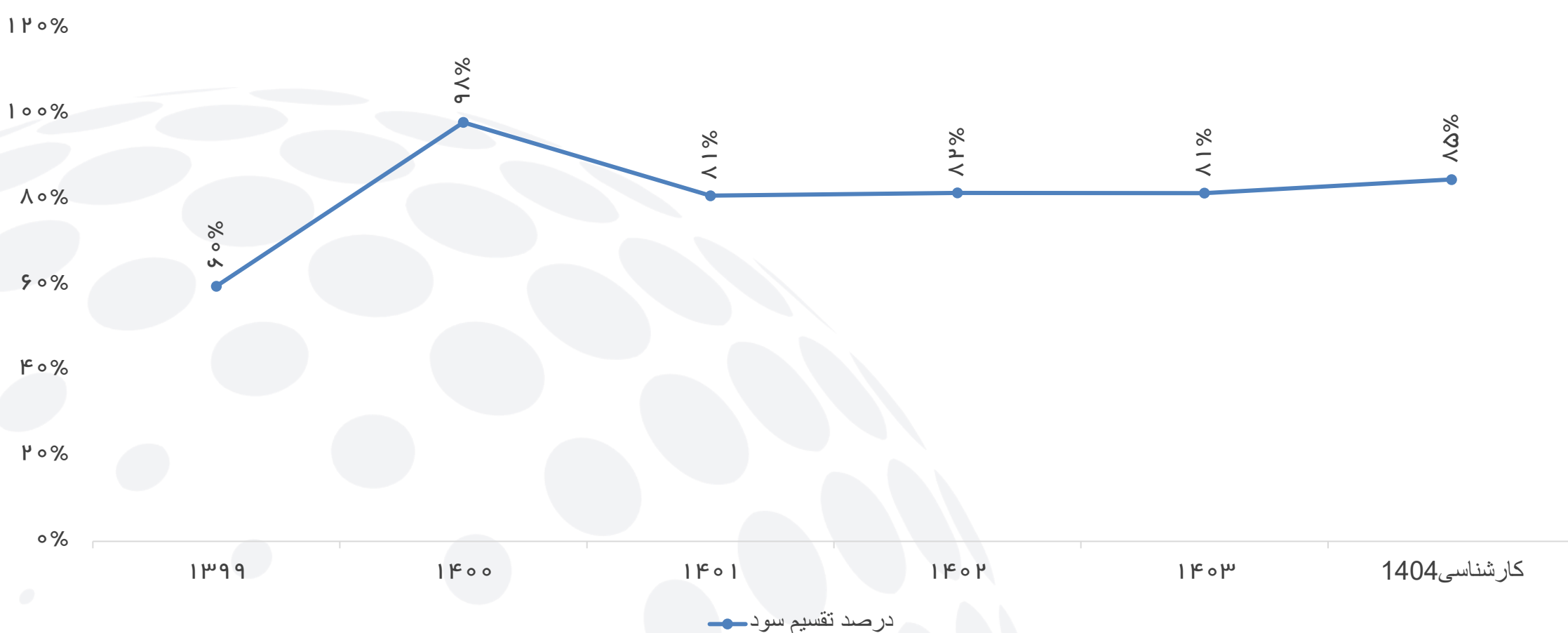
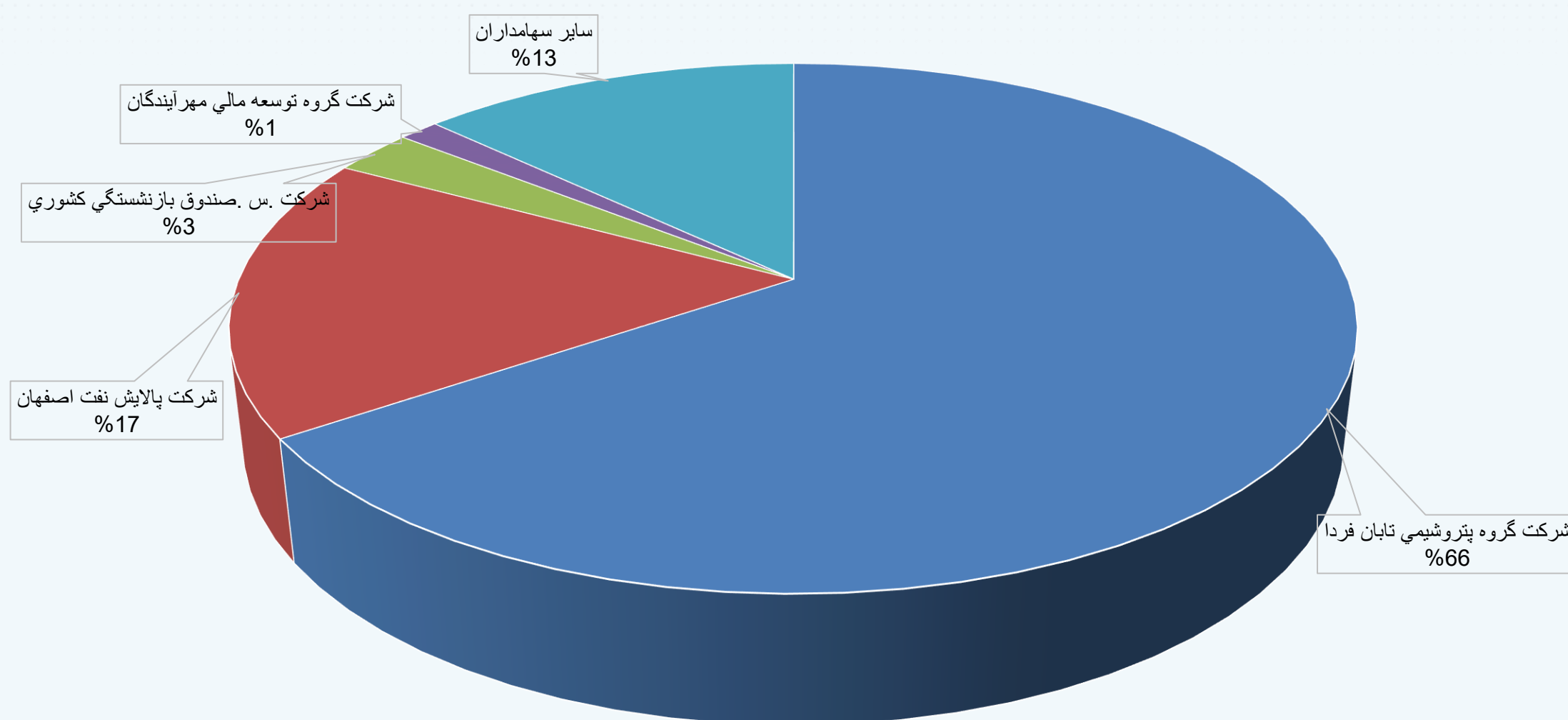
EPS(FW):
۹۷۸ ریال

P/E(FW):
۷/۱۷

قیمت:
۶/۹۱۰ ریال

کارشناسی ۱۴۰۴	۱۴۰۳	۱۴۰۲	۱۴۰۱	۱۴۰۰	
۴۳۹۰۸۰۹۰۸۶۷	۳۰۲۰۴۸۵۰۶۶۰	۲۳۲۰۵۸۱۰۱۸۱	۱۸۳۰۵۴۴۰۸۵۳	۱۳۱۰۹۷۷۰۴۶۰	فروش
(۳۱۲۰۱۶۳۰۲۵۳)	(۲۲۹۰۵۱۲۰۵۸۶)	(۱۷۴۰۴۰۵۰۴۸۹)	(۱۳۵۰۵۲۱۰۵۱۱)	(۹۶۰۳۵۶۰۳۷۲)	بهای تمام شده کالای فروش رفته
۱۲۷۰۶۴۶۰۶۱۴	۷۲۰۹۷۳۰۰۷۴	۵۸۰۱۷۵۰۶۹۲	۴۸۰۰۲۳۰۳۴۲	۳۵۰۶۲۱۰۰۸۸	سود (زیان) ناخالص
(۲۸۰۶۴۰۰۵۱۳)	(۲۴۰۲۰۲۰۰۸۷)	(۱۵۰۳۲۹۰۵۱۲)	(۷۰۸۳۰۰۷۲۲)	(۵۰۵۴۱۰۲۱۵)	هزینه های عمومی، اداری و تشکیلاتی
۲۰۰۰۰۰۰۰۰	۳۰۵۱۰۰۵۷۳	۹۰۹۰۱۲۹	۸۲۵۰۵۲۲	۵۲۲۰۸۹۳	خالص سایر درآمدها (هزینه ها) ی عملیاتی
۱۰۱۰۰۰۶۰۱۰۱	۵۲۰۲۸۱۰۵۶۰	۴۳۰۷۵۵۰۳۰۹	۴۱۰۰۱۸۰۱۴۲	۳۰۰۶۰۲۰۷۶۶	سود (زیان) عملیاتی
(۳۰۵۰۰۰۰۰۰)	(۲۰۰۶۲۰۳۵۱)	(۲۰۰۵۸۰۰۴۱)	(۶۳۱۰۱۸۴)	۰	هزینه های مالی
۹۰۰۰۰۰۰۰۰	۹۰۴۵۷۰۶۸۷	۶۰۱۹۹۰۲۷۸	۷۰۳۹۵۰۱۰۷	۴۰۴۹۷۰۷۴۴	خالص سایر درآمدها و هزینه های غیر عملیاتی
۱۰۶۰۵۰۶۰۱۰۱	۵۹۰۶۷۶۰۸۹۶	۴۷۰۸۹۶۰۵۴۶	۴۷۰۷۸۲۰۰۶۵	۳۵۰۱۰۰۰۵۱۰	سود (زیان) عملیات در حال تداوم قبل از مالیات
(۱۳۰۱۹۴۰۲۹۶)	(۴۰۸۸۷۰۰۳۹)	(۶۰۶۶۲۰۱۷۶)	(۶۰۳۵۱۰۱۷۱)	(۴۰۱۹۸۰۹۱۷)	مالیات
۹۳۰۳۱۱۰۸۰۵	۵۴۰۷۸۹۰۸۵۷	۴۱۰۲۳۴۰۳۷۰	۴۱۰۴۳۰۰۸۹۴	۳۰۰۹۰۱۰۵۹۳	سود (زیان) خالص
۱۰۶۷۳	۹۸۲	۷۳۸	۷۴۰	۵۵۲	سود هر سهم پس از کسر مالیات
۵۵۰۷۷۰۰۱۳۵	۵۵۰۷۸۹۰۸۱۱	۵۵۰۸۶۶۰۳۳۳	۵۵۰۹۶۴۰۵۶۷	۵۶۰۰۰۰۰۰۰	سرمایه

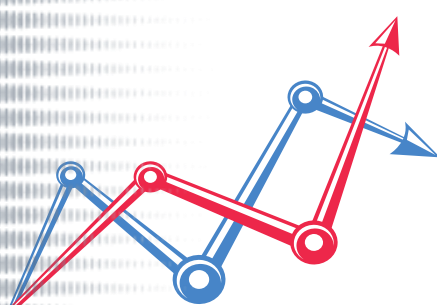






کامودیتی ها

محصول	نرخ هفته گذشته-\$	نرخ این هفته-\$	درصد تغییرات
اتیلن - CFR CHINA	۸۵۱	۸۵۱	۰%
پروپیلن - CFR CHINA	۷۷۶	۷۷۶	۰%
بوتادین - CFR CHINA	۱۱۵۱	۱۱۰۱	-۴%
جنوب شرق آسیا - PVC	۶۷۶	۶۷۶	۰%
ABS-CFR CHINA	۱۳۴۱	۱۳۴۱	۰%
پلی اتیلن سنگین - جنوب شرق آسیا	۸۸۴	۸۸۴	۰%
پلی اتیلن سبک - جنوب شرق آسیا	۱۰۸۱	۱۰۸۱	۰%
پلی پروپیلن - جنوب شرق آسیا	۹۰۱	۹۰۱	۰%
متانول - CFR CHINA	۲۵۶	۲۶۲	۲%
بنزن - CFR CHINA	۷۲۳	۷۲۰	۰%
اورتوزایلین - CFR CHINA	۸۷۱	۸۵۶	-۲%
پارازایلین - CFR CHINA	۸۴۲	۸۱۸	-۳%
استایرن - CFR CHINA	۸۹۶	۸۷۶	-۲%
اوره گرانوله - فوب جنوب شرق آسیا	۳۸۵	۳۷۵	-۳%





گزارش تحلیل هفتگی بورس کالا

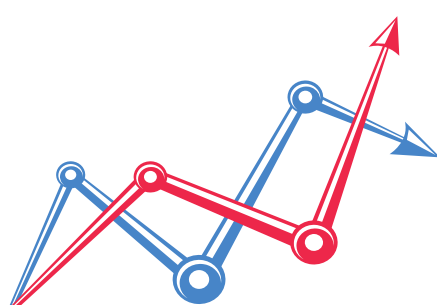


آمار معاملات محصولات فلزی در تالار صنعتی بورس کالا هفته دوم خرداد ماه

نام کالا	نماد	تاریخ معامله	حجم معامله شده	قیمت پایه	قیمت معامله	رقابت	قیمت قبلی معامله	تغییرات قیمت	تغییرات نسبت به ماه مشابه سال قبل	قیمت جهانی	دلار محاسباتی
بلوم و بیلت	فخوز	۱۴۰۴/۰۳/۱۲	۱،۳۰۰	۲۹۳،۵۸۲	۲۹۳،۵۸۲	۰%	۲۸۹،۸۵۳	۱%	۳۶%	۴۳۰	۶۸،۲۷۵
ورق سرد	فولاد	۱۴۰۴/۰۳/۰۵	۱۹،۸۵۰	۴۱۷،۱۱۸	۴۱۷،۱۱۸	۰%	۴۱۷،۱۱۸	۰%	۸%	۵۷۵	۷۲،۵۴۲
ورق گالوانیزه	فجر	۱۴۰۴/۰۳/۱۳	۱،۸۰۰	۴۹۳،۵۲۳	۴۹۳،۵۲۳	۰%	۴۹۶،۷۶۹	-۱%	۸%		
مس کاتد	فملی	۱۴۰۴/۰۳/۱۱	۳،۰۰۰	۶،۸۶۹،۰۰۰	۶،۸۸۰،۴۴۷	۰%	۶،۸۱۶،۳۸۷	۱%	۳۰%	۹،۶۸۶	۷۱،۰۳۵
شمش روی	فاسمین	۱۴۰۴/۰۳/۰۴	۳۰۰	۲،۰۲۱،۹۳۲	۲،۰۴۰،۴۹۲	۱%	۲،۰۴۰،۴۹۲	۰%	۴۰%	۲،۶۶۷	۷۶،۵۰۹
سیمان پرتلند نوع 2 رده 32/5-فله	ستران	۱۴۰۴/۰۳/۱۱	۲۰،۰۰۰	۲۱۰،۲۰۷	۴۶،۴۰۲	۱۱۹%	۳۳،۴۷۵	۳۹%	۳۷۹%	۳۱	۱۴۹،۶۸۴
کنسانتره	کچاد	۱۴۰۴/۰۳/۰۴	۵۰،۰۰۰	۵۴،۵۰۰	۵۴،۵۰۰	۰%	۵۴،۵۰۰	۰%	۴۵%	۱۱۹	۴۵،۷۹۸
گندله سنگ آهن	کچاد	۱۴۰۴/۰۳/۱۱	۳۰،۰۰۰	۶۷،۶۸۱	۶۷،۸۱۷	۰%	۶۷،۸۱۷	۰%	۲۸%	۱۱۶	۵۸،۴۶۳
آهن اسفنجی	فسبزوار	۱۴۰۴/۰۳/۱۱	۷۰،۰۰۰	۱۶۲،۰۰۰	۱۶۲،۰۰۰	۰%	۱۶۴،۰۰۰	-۱%	۳۱%		

آمار معاملات محصولات پتروشیمی در تالار پتروشیمی بورس کالا هفته دوم خرداد ماه

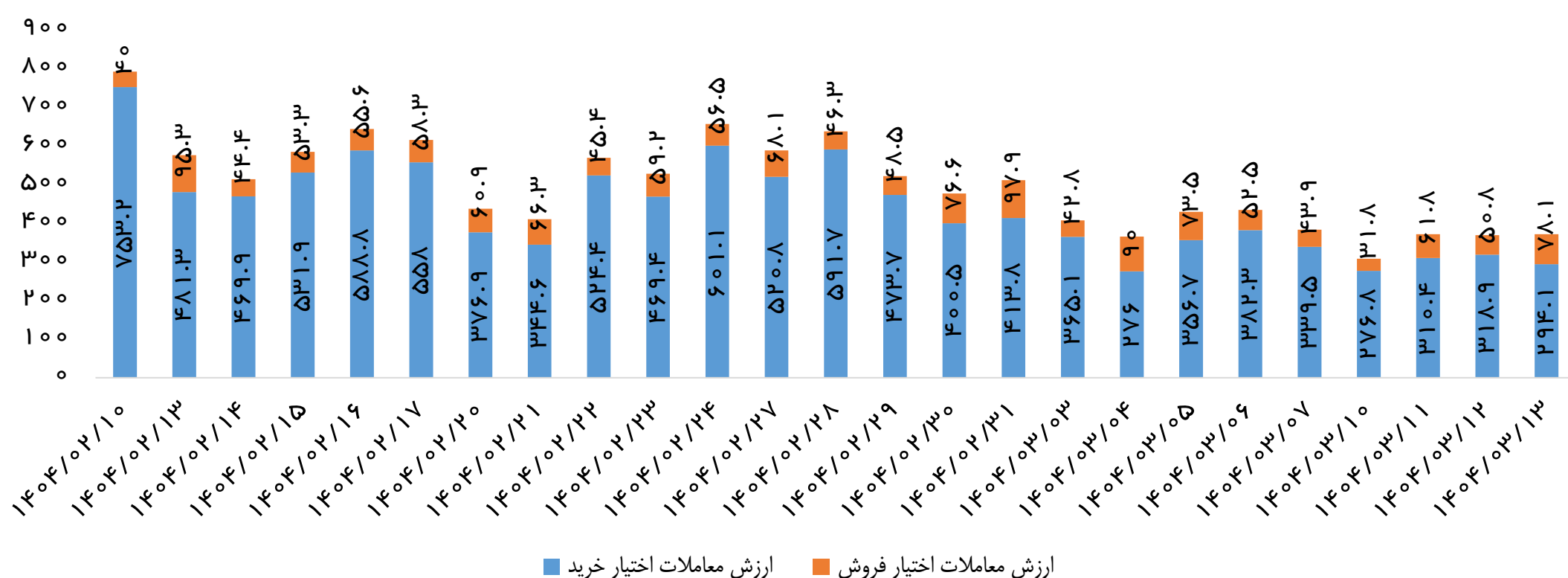
نام کالا	نماد	تاریخ معامله	حجم معامله شده	قیمت پایه	قیمت معامله	رقابت	قیمت قبلی معامله	تغییرات قیمت	تغییرات نسبت به ماه مشابه سال قبل	قیمت جهانی	دلار محاسباتی
وکیوم باتوم	شتران	۱۴۰۴/۰۳/۱۱	۱۲۰۰۰	۲۰۰۳۰۰	۲۴۰۱۹۴	۲۰%	۲۴۵۷۹۵	-۲%	۷۰%	۲۳۴	۱۰۵،۰۴۱
لوب کات سبک	شتران	۱۴۰۴/۰۳/۱۱	۳۰۰۰	۲۹۰۳۸۲	۲۹۰۳۸۲	۰%	۲۹۰۳۸۲	۰%	۲۶%	۲۷۷	۱۰۴،۸۳۱
پلی اتیلن سنگین لوله CRP100N	جم	۱۴۰۴/۰۳/۱۳	۳۶۷۴	۶۰۰۱۸۶	۶۰۰۱۸۶	۰%	۶۰۲۸۹۰	۰%	۴۶%		
اوره گرانول	شیراز	۱۴۰۴/۰۳/۱۰	۴۵۰	۲۲۳۴۹۳	۲۲۳۴۹۳	۰%	۲۲۳۴۴۲	۰%	۱۲۰%	۳۷۵	۵۹،۵۸۵
آمونیاک (مایع)	شیراز	۱۴۰۴/۰۳/۱۰	۱۵۰	۱۷۵۸۱۰	۱۷۵۸۱۰	۰%	۲۰۴۷۹۵	-۱۴%	۶۴%	۱۷۴	۱۱۷،۶۹۸
الکیل بنزن خطی	شیران	۱۴۰۴/۰۳/۱۳	۱۰۰۰	۹۴۰۱۳۱	۹۴۰۱۳۱	۰%	۹۳۴۲۴۷	۱%	۵۴%	۷۳۲	۱۲۷،۶۲۹
استایرن بوتادین رابر-روشن	پتروشیمی بندرامام	۱۴۰۴/۰۳/۱۳	۳۰۱	۱۱۴۸۷۳۵	۱۱۴۸۷۳۵	۰%	۱۱۵۳۹۰۹	۰%	۵۲%	۹۰۶	۱۲۷،۳۶۳
اسید استیک	شفن	۱۴۰۴/۰۳/۱۳	۱۲۰۰	۲۱۷۴۴۶	۲۱۷۴۴۶	۰%	۲۱۹۱۶۰	-۱%	۳۳%		
روغن پایه SN500	شبهرن	۱۴۰۴/۰۳/۱۲	۵۰۶	۵۳۶۷۱۷	۵۹۷۴۶۹	۱۱%	۶۶۸۶۰۲	-۱۱%	۶۸%		
پلی وینیل کلراید S65	شغدیر	۱۴۰۴/۰۳/۱۲	۱۴۰۰	۴۹۸۱۲۸	۴۹۸۱۲۸	۰%	۴۷۰۵۵۱	۶%	۳۰%	۶۷۶	۶۹،۶۰۸



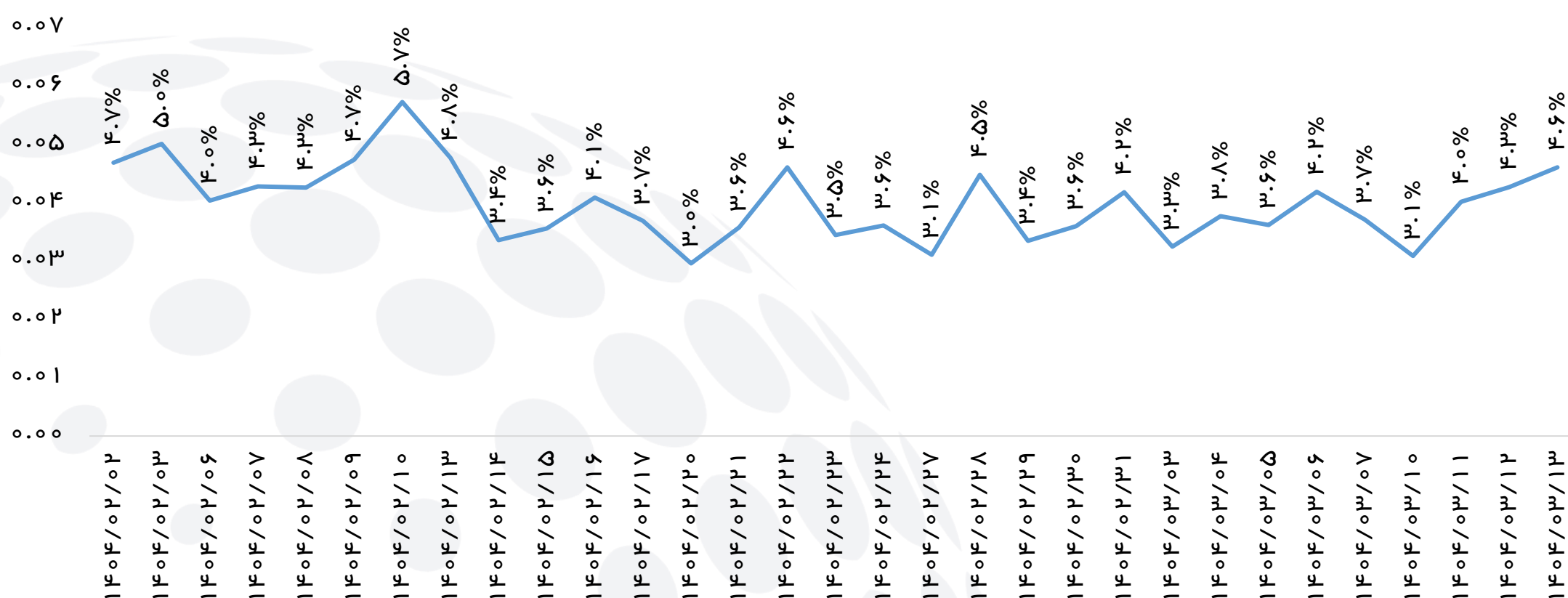


گزارش تحلیل هفتگی بازار اختیار معامله

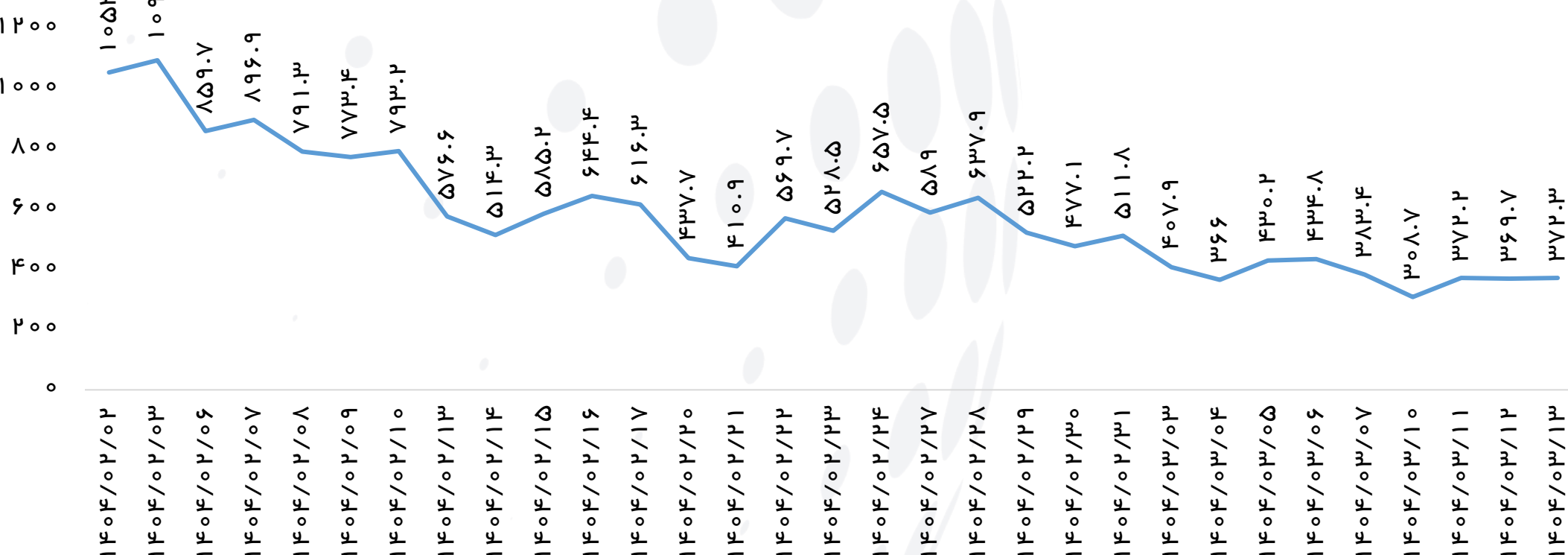
ارزش معاملات اختیار خرید و فروش به تفکیک (میلیارد ریال)



درصد معاملات اختیار به معاملات خرد

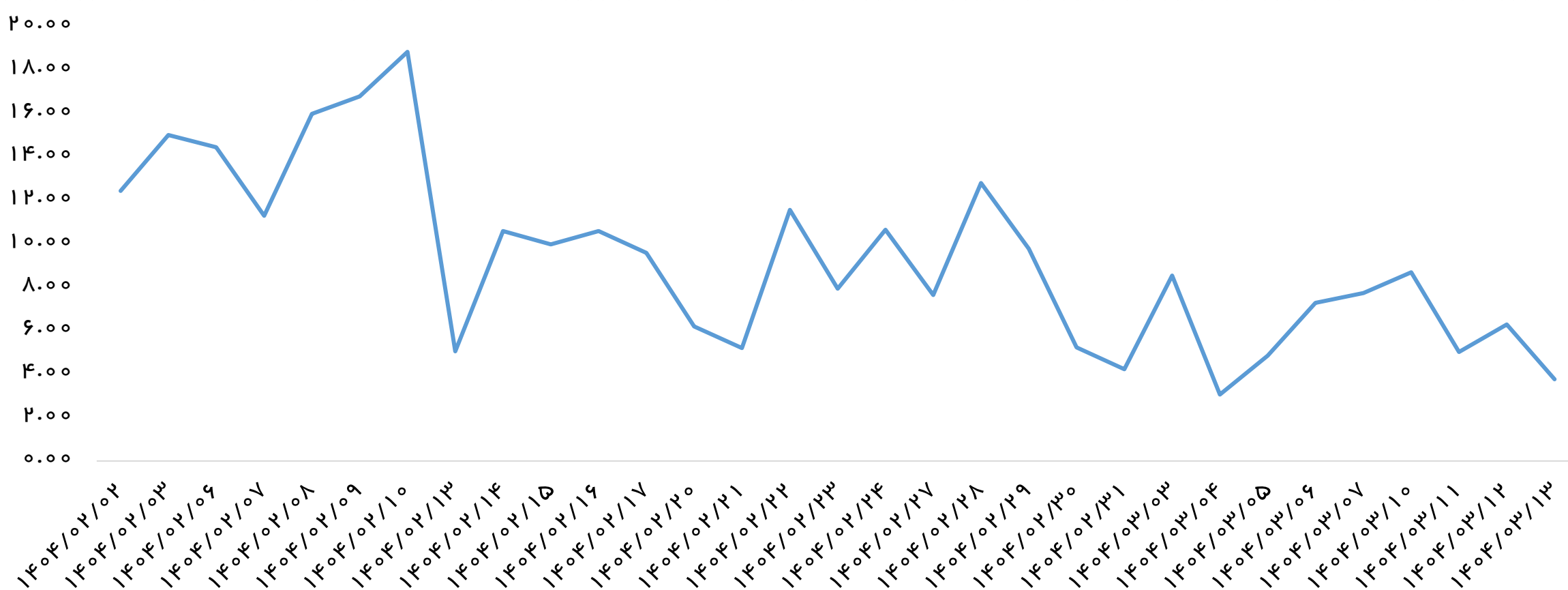


ارزش معاملات اختیار (میلیارد ریال)

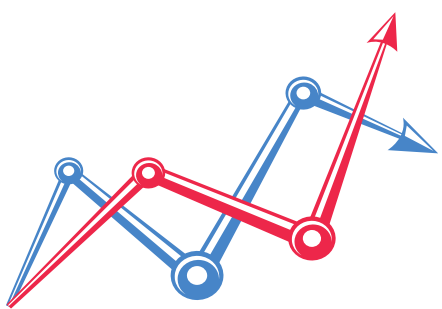
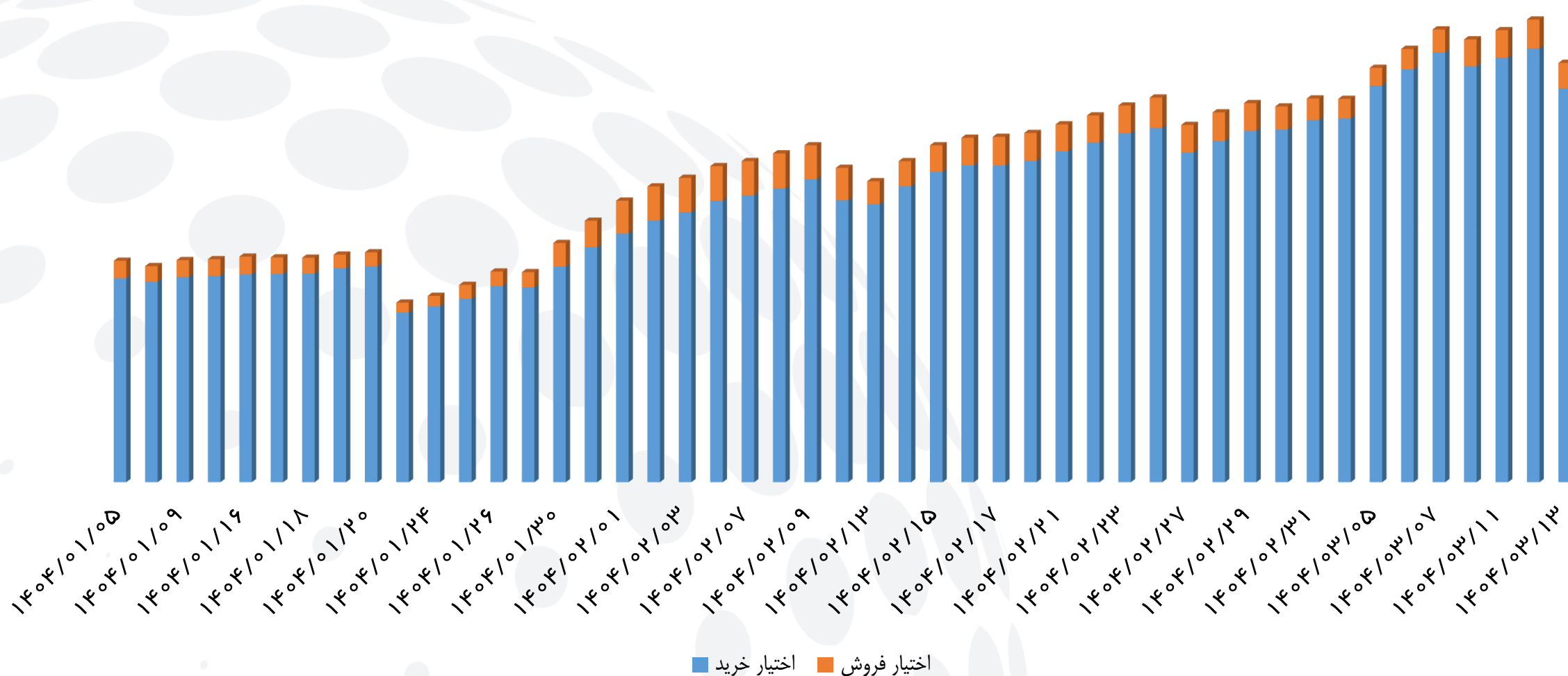




نسبت ارزش معاملات اختیار خرید به اختیار فروش



موقعیت های باز خرید و فروش اختیار معامله بازار (x1000)





بازار سه شنبه یکی از منفی‌ترین و سنگین‌ترین روزهای خود را تجربه کرد؛ فروشندگان به شدت غالب بودند و خریداران دچار سردرگمی. فضای بازار تحت تأثیر اخبار متضاد سیاسی قرار داشت و سرمایه‌گذاران ترجیح دادند با احتیاط رفتار کنند. صندوق‌های اهرمی بیشترین نقش منفی را ایفا کردند و بازار را به شدت تحت فشار قرار دادند.

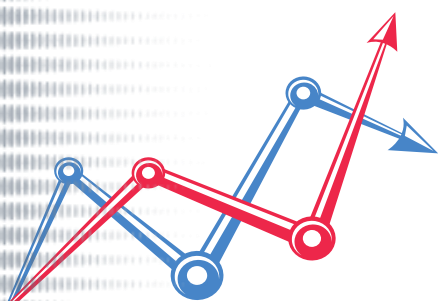
با وجود روند کاهش ریسک‌های سیستماتیک، ریسک‌های مدیریتی موجب زیان سهامداران شده است. صندوق‌های اهرمی به دلیل تصمیم ناگهانی کاهش ضریب اعتباری تحت فشار قرار گرفتند و برخی مدیران آن‌ها نه تنها برای کاهش حباب منفی تلاش نکرده‌اند، بلکه ظاهراً از شرایط فعلی برای فشار به سازمان بورس استفاده می‌کنند که این رفتار می‌تواند اعتماد بازار را نابود کند.

حل‌وفصل مسأله واگذاری خودروسازان به یک موضوع حیثیتی برای سازمان بورس تبدیل شده است. این نهاد باید با قاطعیت بیشتری برای شفاف‌سازی و تعیین تکلیف ایران‌خودرو و سایپا عمل کند، وگرنه اعتماد بازار بیشتر از این آسیب خواهد دید.

در تازه‌ترین آمار معاملات بورس کالا، مشاهده می‌شود که در اردیبهشت ۱۴۰۴ نسبت به اردیبهشت سال گذشته، مجموع معاملات با کاهش ۲۰ درصدی مواجه شده که عمده‌ترین دلیل آن افت ۲۵ درصدی حجم معاملات در بخش محصولات صنعتی است.

در حوزه پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی اگرچه در اردیبهشت امسال نسبت به پارسال رشد ۱۰ درصدی ثبت شده، اما مقایسه عملکرد دوماهه اول سال نشان می‌دهد این بخش نیز نسبت به مدت مشابه سال قبل با کاهش ۹ درصدی مواجه بوده است. در مقابل، تنها بخشی که در بورس کالا رشد داشته، حوزه خودرو بوده است.

به‌طور کلی، آمار تجمیعی دو ماه نخست ۱۴۰۴ نسبت به مدت مشابه ۱۴۰۳، کاهش ۱۴ درصدی در معاملات محصولات صنعتی را نشان می‌دهد؛ عددی که سهم اصلی را در افت ۱۳ درصدی معاملات بورس کالا داشته است. این کاهش قابل توجه، نشانه‌ای از افت وضعیت بنیادی صنایع بزرگ است؛ موضوعی که می‌تواند به چشم‌انداز ضعیف‌تر گزارش‌های بهار این شرکت‌ها منجر شود و زنگ هشدار برای سودآوری آن‌ها در فصل پیش‌رو باشد.





نمادهای زیر ذره بین



- نمادهای زیر ذره بین از ۳ زاویه مورد بررسی قرار گرفته اند
1. نمادهای ریشه دار (بنیادی) در این میان برای انتخاب سهام بنیادی سعی شده شرکتهایی که کمترین تاثیر را از انرژی میپذیرند به عنوان برگزیده های این هفته معرفی گردند.
 2. صدای بازار : نمادهایی که این روزها با اخبار و حواشی رو به رو هستند.
 3. ردیاب روند (تکنیکال) : نمادهایی که بر اساس فیلتر های تکنیکال این هفته انتخاب شده اند

سیگنال اندیکاتور MACD و RSI بالای ۵۰

بکهنوج

سیگنال اندیکاتور MACD و RSI بالای ۵۰

قنیشا

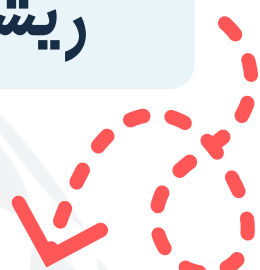
سیگنال اندیکاتور MACD و RSI بالای ۵۰

ودی

ردیاب روند



ریشه دار



حآفرین

پکویلر

غمهرا

معرفی و تحلیل حآفرین در بولتن شماره ۸ صورت گرفته است.

معرفی و تحلیل پکویلر در بولتن شماره ۱۵ صورت گرفته است.

در بولتن ۱۴، تحلیل غمهرا گزارش شده بود و سود شرکت با انحراف تنها ۲٪ این هفته روی کدال منتشر شد.

قچار

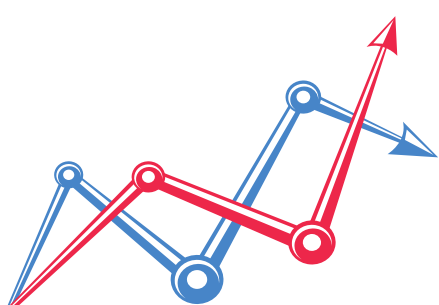
شسپا

غویتا

معرفی و تحلیل قچار به تفسیر در بولتن بعدی ارائه میگردد

معرفی و تحلیل شسپا در همین بولتن ارائه گشته است.

معرفی و تحلیل ویتانا در بولتن شماره ۲۲ صورت گرفته است.





نمادهای زیر ذره بین

صدای بازار



قند

صنعت قند در دو ماهه اول ۱۴۰۴ نسبت به ۱۴۰۳ بیشترین رشد تجمعی فروش را در میان صنایع بازار داشته است. به همین دلیل ما در بولتن بعدی به سراغ این گروه برای بررسی بیشتر رفتیم.

سرب و روی

بیشتر شرکت‌های این صنعت عملکرد خوبی داشته‌اند و توی گزارش اردیبهشت، نمادهای فرآور و فروی واقعاً با قدرت و عالی ظاهر شدند و به‌عنوان ستاره‌های گروه حساب می‌شن.

ثاخذ

شنیده‌ها حاکیه که ثاخذ برنامه افزایش سرمایه ۱۰۰۰٪ از محل تجدید ارزیابی دارایی‌ها رو در دستور کار داره. اگه این موضوع تایید بشه، می‌تونه توجه بازار رو به خودش جلب کنه.

ثمسکن

شنیده‌ها حاکیه که ثمسکن برنامه افزایش سرمایه بیش از ۷۰۰٪ از محل تجدید ارزیابی دارایی‌ها رو در دستور کار داره. اگه این موضوع تایید بشه، می‌تونه توجه بازار رو به خودش جلب کنه.

وبشهر

شنیده‌ها حاکی از اینکه که وبشهر در حال انجام چند معامله مهمه؛ از جمله واگذاری بخشی از سهام بانک اقتصاد نوین با ارزش حدود ۵۰ همت و همچنین فروش مارگارین به گروه مدلل. این تحولات اگه نهایی بشن، می‌تونن مسیر سهم رو به‌طور محسوسی تغییر بدن.

پالایشی

شبریز و شرار کاهش جزئی تخفیف کیفی‌سازی خوراک را اعلام کردند، اما پیگیری‌ها نشان می‌دهد تخفیف که توسط شرکت پالایش و پخش و بر اساس پیشرفت طرح‌های کیفی‌سازی تعیین می‌شود، همچنان پابرجاست.

اهرمی‌ها

بر اساس شنیده‌ها با هماهنگی‌های صورت گرفته بین سازمان بورس و صندوق‌های اهرمی، اقداماتی برای کاهش حباب صندوق‌های اهرمی صورت خواهد گرفت.

در نهایت، هنوز هم «صدای بازار» شماره قبلی را زیر نظر داریم و منتظر مشخص شدن ابعاد احتمالی اخبار و حواشی مرتبط با آن هستیم. با این حال، لازم به تأکید است که «صدای بازار» صرفاً بازتاب شنیده‌ها و شایعات فضای بازار است و به هیچ عنوان نباید مبنای تصمیم‌گیری یا معاملات قرار گیرد.





کارگزاری خبرگان سهام

خبرگان بازار در کنار شما

۲۵%

بازگشت کارمزد

تخصیص اعتبار

به صورت آنی و ۲۴ ساعته
در فرآیندی تمام اتوماتیک



باشگاه بازاریابان

تا سقف ۲۵% با تسویه
۲۴ ساعته



اکسیر / اومکس

کاربری حرفه‌ای +
امنیت و دقت بالا



برداشت وجه آنی

به صورت ۲۴ ساعته
در ۷ روز هفته



جونیور بروکر

سرمایه‌گذاری برای
کودکان زیر ۱۸ سال

تهران، میدان ونک، خیابان نلسون ماندلا، خیابان ناوک، پلاک ۱۸

