

گزارش روزانه بازار سهام

۲۲ فروردین ماه ۱۴۰۲ | گزارش شماره ۴

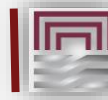


پرتو تابان

شرکت سرمایه گذاری پرتو تابان معادن و فلزات
(سهامی خاص)

تهیه شده در واحد سرمایه گذاری
شرکت پرتو تابان معادن و فلزات
(سهامی خاص)

شاخص/کالا	مقدار	تغییرات	درصد
شاخص کل (واحد)	۲,۱۷۹,۹۹۲	-۲۲,۳۹۵	-%۱/۰۲
شاخص هم وزن (واحد)	۶۹۲,۹۴۵	۱۶,۳۹۹	%۲/۴۲
ارزش معاملات (میلیارد تومان)	۶۶,۵۵۰	-۱۱,۹۸۷	-%۱۵/۳
ورود پول (میلیارد تومان)	۵,۶۸۲	۴,۶۵۱	%۴۵۱/۱
دلار آزاد (تومان)	۵۰,۸۰۰	۱۰۰	%۰/۲
دلار نیما (تومان)	۳۷,۹۲۰	۹۷۵	%۲/۶
تفاوت دلار آزاد و نیما	۱۲,۸۸۰	-۸۷۵	%۳۴
طلا (USD/t oz)	۲۰۰۴/۲۶	-۴	-%۰/۱۹
نفت برنت (USD/BBL)	۸۵/۲۶	۰/۲۶۲	%۰/۳۱





در نمودار روبرو، تایم فریم روزانه نمودار شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران به همراه اندیکاتور و اسیلاتورهای زیر نشان داده شده است:

- ❖ RSI(14)
- ❖ MACD(12,26,9)
- ❖ MFI(14)

✓ اسیلاتور RSI در سطح بالای ۷۰ واحدی و اشباع خرید و در حال کاهش میباشد.
 ✓ همچنین MFI نتوانست از محدوده ۸۰ عبور کند.

در حال حاضر سطوح حمایت و مقاومت شاخص به ترتیب زیر است:

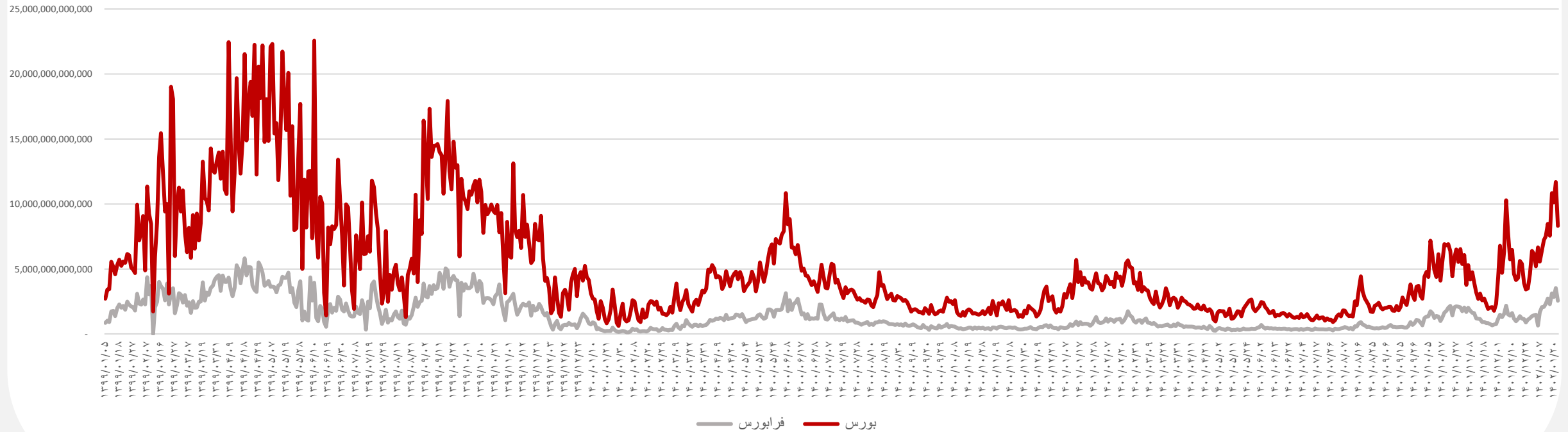
- R1:** مقاومت اول محدوده: ۲,۳۰۰,۰۰۰ واحد
- S1:** حمایت اول محدوده: ۲,۰۰۰,۰۰۰ واحد
- S2:** حمایت اول محدوده: ۱,۸۴۰,۰۰۰ واحد

✓ شاخص پس از عبور از سقف سال ۹۹، یعنی ۲,۱۰۰,۰۰۰ در حال نزدیک شدن به محدوده مقاومت ۲,۳۰۰,۰۰۰ میباشد که با عرضه روبرو خواهد بود.

✓ توجه و ورود پول قوی در روزهای اخیر میتواند کماکان روند صعودی شاخص را حفظ نماید.



مجموع ارزش معاملات در بورس و فرابورس ۶۶،۵۵۰ میلیارد تومان بوده است. ارزش معاملات بلوکی ۴۹۱،۰۵ میلیارد تومان معادل ۷۳.۷۹ درصد معاملات و ارزش معاملات عادی ۱۷۴،۴۲ میلیارد تومان معادل ۲۶.۲۳ درصد بوده است که سهام ۱۲۰،۰۵ میلیارد تومان معادل ۱۸.۰۳ درصد از ارزش معاملات عادی داشته است.



برترین و بیشترین تاثیر بر شاخص را صنایع خودرو با ارزش ۱,۶۰۱، فلزات اساسی با ارزش ۹۹۴، چند رشته ای با ارزش ۷۱۰، شیمیایی با ارزش ۵۲۲ و بانک ها با ارزش ۵۰۶ میلیارد تومان داشته است.

تأثیرگذارترین های بورس و فرابورس					
تأثیرگذارترین های فرابورس			تأثیرگذارترین های بورس		
قیمت	واحد	نماد	قیمت	واحد	نماد
۲۰,۶۷۵	۱۲۶	مارون	۱,۲۹۳	-۲,۷۷۵	فارس
۴۴۶	۳۷	خاور	۱,۹۱۰	-۲,۲۱۹	تاپیکو
۳,۰۵۰	۱۵	انتخاب	۷۹۲	-۲,۱۰۵	فملی
۴۲۴	-۱۳	صبا	۷۰۳	-۱,۳۳۶	کگل
۱۱,۳۲۵	-۱۳	آریا	۶۲۰	-۱,۲۹۵	فولاد

پرتراکنش ترین های بورس و فرابورس					
پرتراکنش ترین های فرابورس			پرتراکنش ترین های بورس		
قیمت	ارزش	نماد	قیمت	ارزش	نماد
۱۰۹	۹۹	دی	۲,۶۸۳	۴۶۸	وکغدیر
۱۵۰	۱۰۷	کرمان	۵۶۴	۴۱۵	خگستر
۵۴۸	۴۱	وسپهر	۱۳۵	۱۶۳	شستا
۹۱۹	۵۴	گدنا	۵۵۷	۲۲۶	فباهنر
۴۴۶	۱۲۵	وخور	۲۸۷	۲۰۲	خساپا

❖ ارزش براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می باشد.

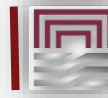


ارزش بازار سهام ایران (بورس تهران و فرابورس) به ۹۲.۳۶ میلیون میلیارد تومان در پایان معاملات امروز رسید، ۹۱.۷۸ میلیون میلیارد تومان بالاترین میزان این شاخص در ۱۹ مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است که سقف آن در روز شنبه ۱۹ فروردین شکسته شده بود. هم چنین خالص ورود پول حقیقی در این هفته ۶،۹۸۳ میلیارد تومان بوده است.

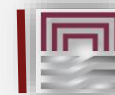
بیشترین خالص خرید حقوقی		
قیمت	خالص خرید حقوقی	نماد
۱,۳۰۲	۴۶	فارس
۸۹۱	۳۵	شپنا
۳۳۶	۲۸	وبملت
۲,۵۹۰	۲۸	وغدیر
۷۹۰	۲۵	فملی

بیشترین خالص خرید حقیقی		
قیمت	خالص خرید حقیقی	نماد
۷,۱۷۰	۲۲۸	زپارس
۳۷۰	۹۳	کوثر
۴۸۴	۶۳	تنوین
۵۶۹	۴۲	فبهنر
۴,۰۳۰	۳۵	فزر

❖ خالص خرید حقیقی و حقوقی براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می باشد.

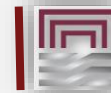
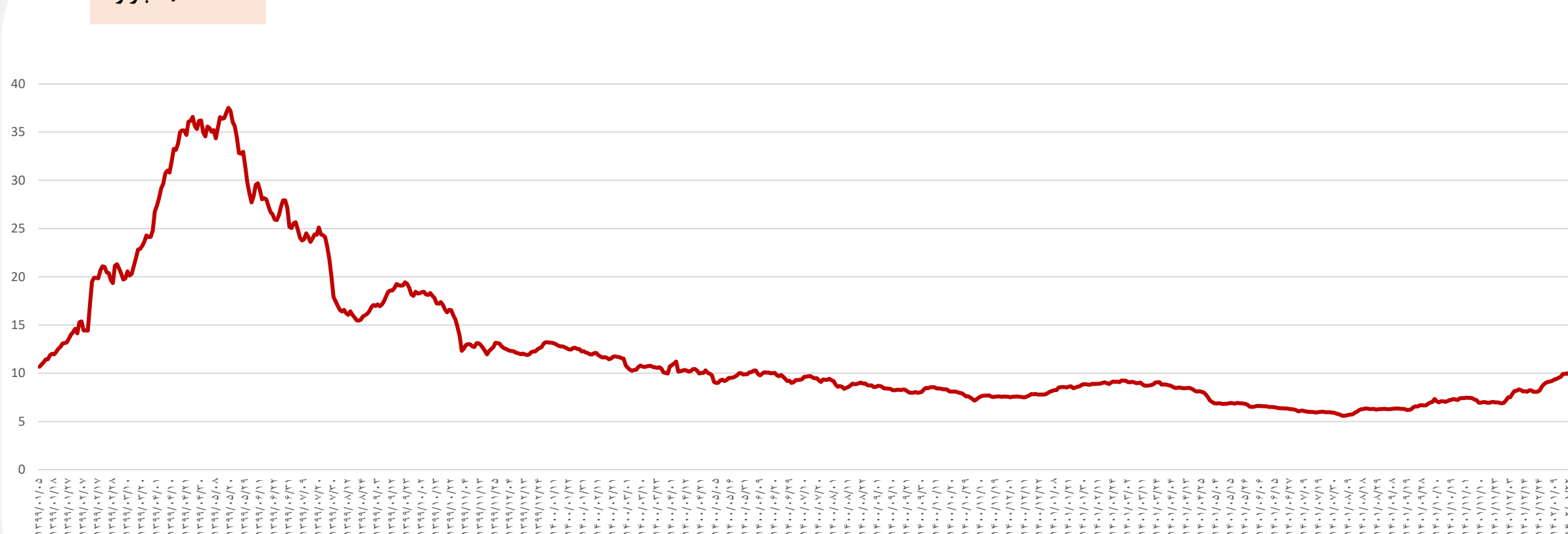


تعداد شرکت	ارزش بازار میلیارد ریال	D/E	P/B	P/S	P/D	P/E ttm	بازدهی			صنعت / شرح	ردیف
							۳ ماهه	۱ ماهه	هفتگی		
۱	۵۸.۴۱۰	۸۲٪	۲.۰۸	۳.۲۴	۳۴.۴۲	۱۸.۹۴	۴۲.۲٪	۴۶.۰٪	۱۸.۹٪	حفاری	۱
۲	۱.۳۵۷.۰۳۶	۹۷٪	۷.۶۹	۲.۵۱	۶.۰۷	۸.۰۷	۲۴.۵٪	۲۶.۵٪	۱۸.۲٪	خدمات رفاهی متنوع	۲
۴	۱۰۲.۵۰۲	۳۴٪	۳.۹۳	۱۴.۰۵	۵۰.۶۰	۳۰.۶۶	۳۴.۰٪	۳۰.۷٪	۱۷.۵٪	سخت افزار و تجهیزات	۳
۱۲	۲۳۹.۲۴۲	۵۸٪	۵.۹۸	۲.۷۶	۳۵.۷۵	۱۷.۷۷	۳۶.۶٪	۳۶.۵٪	۱۷.۴٪	شکر	۴
۹	۱۲۲.۱۷۲	۳۷٪	۲.۷۴	۴.۸۲	۲۶.۶۳	۱۳.۷۱	۲۴.۱٪	۳۱.۴٪	۱۷.۰٪	لیزینگ	۵
۳	۷۳.۴۶۸	۵٪	۵.۸۱	۴.۱۹	۶۹۴.۰۱	۱۷۶.۷۴	۴۳.۳٪	۳۳.۲٪	۱۵.۲٪	تجهیزات صنعتی	۶
۵	۱.۳۸۱.۹۱۹	۵۱٪	۶.۵۱	۲.۷۶	۳۸.۸۶	۹.۰۷	۳۷.۱٪	۴۵.۷٪	۱۳.۷٪	مخابرات	۷
۲	۲۶.۶۱۱	۵۵٪	۲۰.۵۱	۷.۴۴	۱۱۱.۱۵	۸۴.۳۱	۴۷.۱٪	۲۵.۸٪	۱۳.۵٪	نساجی	۸
۸	۲۴۶.۳۷۸	۱۸٪	۴.۸۵	۲.۷۲	۱۰۳.۸۸	۱۷.۲۲	۳۳.۶٪	۲۸.۴٪	۱۳.۵٪	سایر محصولات غذایی	۹
۶	۱۹۷.۷۲۶	۳۶٪	۲.۹۸	۳.۹۶	۶۲.۹۴	۱۹.۲۶	۷۸.۶٪	۴۲.۵٪	۱۳.۲٪	محصولات فلزی	۱۰
۱۰	۱۶۳.۰۹۶	۷۹٪	۹.۳۲	۱.۰۶	۴۷.۸۰	۱۹.۱۱	۴۱.۸٪	۲۴.۵٪	۱۲.۱٪	محصولات لبنی	۱۱
۲۰	۵۶۹.۶۵۹	۲۷٪	۵.۲۶	۱.۶۷	۱۰۶.۸۷	۲۰.۳۳	۳۹.۷٪	۳۳.۲٪	۱۱.۹٪	قطعات خودرو	۱۲
۵	۳۳۰.۹۰۶	۴۱٪	۳.۲۱	۴.۲۰	۳۸.۰۰	۱۴.۴۳	۶۵.۵٪	۵۳.۷٪	۱۱.۵٪	ماشین الات الکتریکی	۱۳
۱	۱۹۶.۱۴	۱۱٪	۷.۳۰	۱۱.۸۷	۳۴۹.۰۰	۲۷.۴۹	۱۴۰.۹٪	۴۸.۱٪	۱۱.۱٪	سایر مواد معدنی	۱۴
۳	۱۳۱.۵۰۰	۶۷٪	۴.۶۹	۴.۱۷	۱۶.۷۹	۹.۶۷	۳۶.۲٪	۲۴.۷٪	۱۱.۰٪	بنادر و کشتیرانی	۱۵



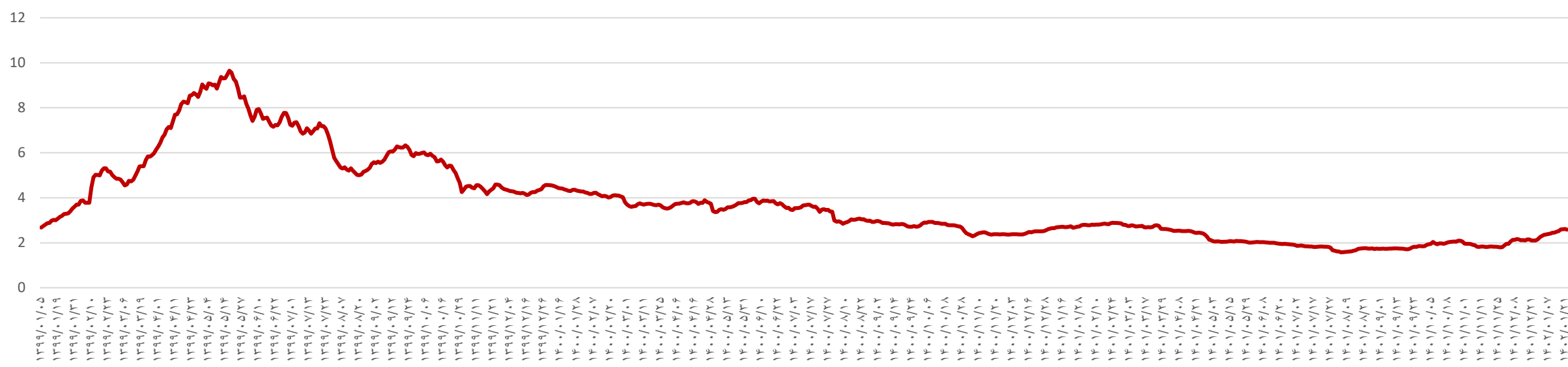
P/E ttm بازار

P/E ttm بازار به ۹.۹۰ واحد در پایان معاملات امروز رسید. ۳۷.۵۱ واحد بالاترین میزان این شاخص در مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است.

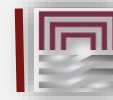


P/S ttm بازار

P/S ttm بازار به ۲.۶۱ واحد در پایان معاملات امروز رسید. ۹.۶۴ واحد بالاترین میزان این شاخص در مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است.



- رییس کل بانک مرکزی: هدف گذاری نرخ رشد نقدینگی برای سال ۱۴۰۲، ۲۵ درصد است.
- شرکت صنایع سیمان نهبوند در بازار دوم فرابورس با نماد سناوند به عنوان ۲۹۶ امین نماد معاملاتی درج شد.
- نرخ بهره بدون ریسک در ۲۱ فروردین به ۲۶.۳۹ درصد برگشت و در پایین تری نرخ از ابتدای اسفند ماه سال گذشته قرار گرفت.
- روسیه برای سرمایه گذاری در فولاد، نفت و پتروشیمی ایران اعلام آمادگی کرد.
- رییس سازمان بورس تاسیس سه شرکت سهامی عام پروژه را اعلام کرد.
- فروش ربع سکه در مرکز مبادلات به علت بازنگری در فرآیند عرضه متوقف شد.
- سخنگوی دولت امروز اسامی تغییرات در کابینه دولت را اعلام خواهد کرد. این تغییرات احتمالاً ۴ نفر خواهد بود.



- بازار کار خود را با منفی شروع کرد اما رفته رفته عرضه با تقاضا برابری کرد.
- در بازار امروز اکثر گروه های کوچک تر بازار و گروه خودرویی با استقبال خریداران همراه شد.
- شاخص کل در آخرین روز معاملاتی هفته روند منفی را تجربه کرد و بیش از ۱۰ هزار واحد ریزش داشت، اما از آن سو شاخص هم وزن با افزایش تقاضایی که ایجاد شد روند بهتری را تجربه کرد و توانست ۵ هزار واحد صعود کند.
- ارزش معاملات خرد بازار سهام امروز به ۱۴،۲۰۰ میلیارد تومان رسید که با اینکه نسبت به روزهای گذشته کاهش یافته است، اما همچنان در سطح قابل قبولی است و شرایط و فضای فعلی بازار همچنان امیدوار کننده است.

