

گزارش روزانه بازار سهام

۱۳ اردیبهشت ماه ۱۴۰۲ | گزارش شماره ۱۷



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)	۲,۵۱۴,۶۷۴	۷۶,۱۲۵	۳.۱۲٪
شاخص هم وزن (واحد)	۸۵۵,۸۸۷	۵۴,۹۳۱	۶.۸۶٪
مجموع ارزش معاملات (میلیارد تومان)	۳۸,۶۱۰	-۲۲,۸۴۷	-۳۷.۲٪
خالص ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)	۱,۸۵۱	-۵۷۸	-۲۳.۸٪
دلار آزاد (تومان)	۵۴,۰۵۰	-۵۵۰	-۱.۰٪
دلار نیما (تومان)	۳۸,۴۶۰	۳۱۰	۰.۸٪
تفاوت دلار آزاد و نیما	۱۵,۵۹۰	-۸۶۰	۴۱٪
طلا (USD/t oz)	۲,۰۱۶	۲۶.۳۰	۱.۳۲٪
نفت برنت (USD/BBL)	۷۳	-۷.۱۷	-۸.۹۵٪

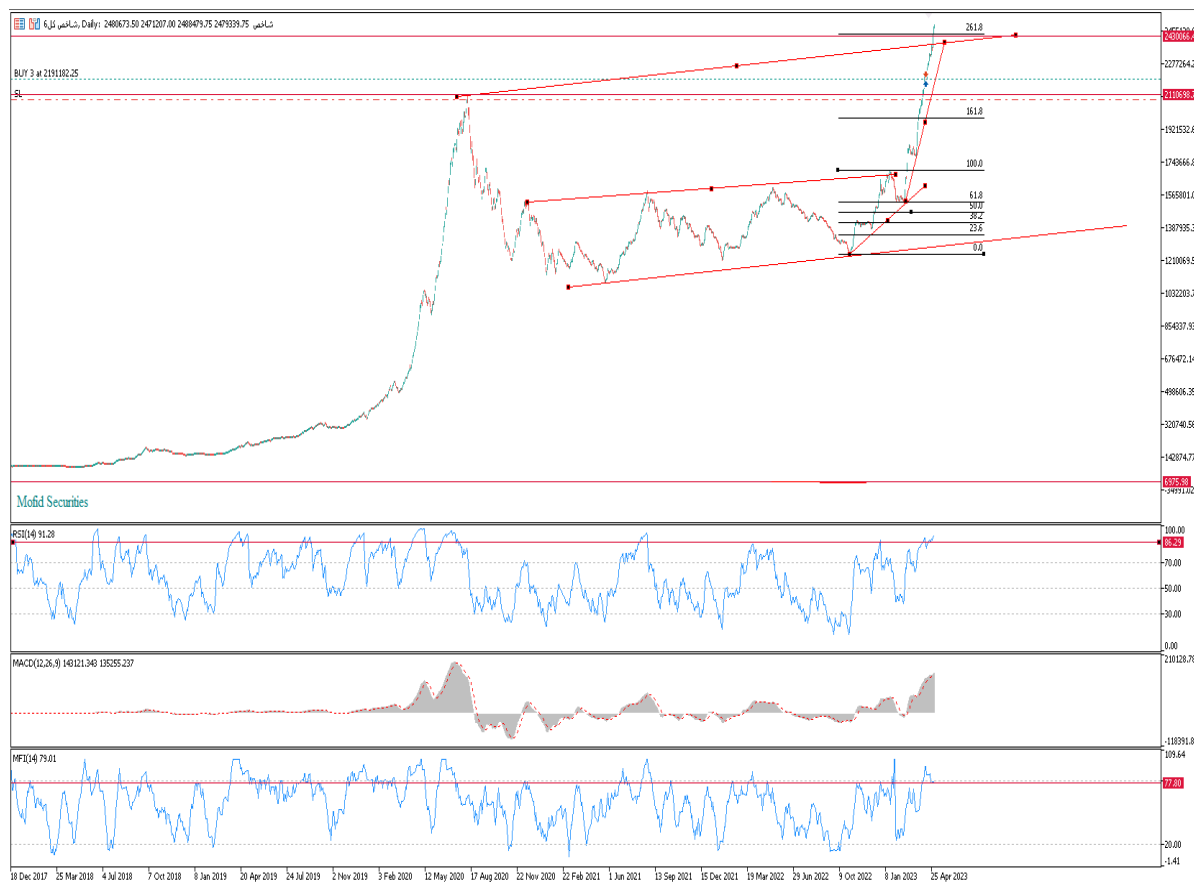


در نمودار روبرو، تایم فریم روزانه نمودار شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران به همراه اندیکاتور و اسیلاتورهای زیر نشان داده شده است:

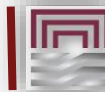
- ❖ RSI(14)
- ❖ MACD(12,26,9)
- ❖ MFI(14)

✓ اسیلاتور RSI کماکان در سطح بالای ۷۰ واحدی ست که نشان از هیجان خرید است.
 ✓ همچنین MFI کمی از سطح ۸۰ واحد پایینتر آمده است.
 در حال حاضر سطوح حمایت و مقاومت شاخص به ترتیب زیر است:

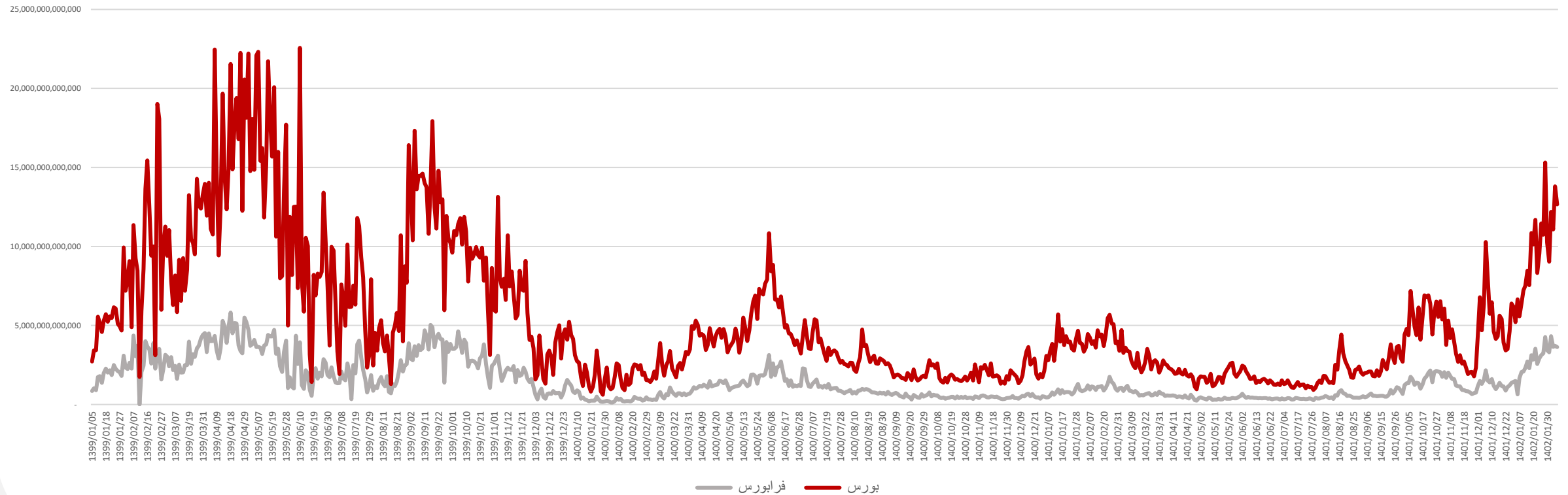
- R1:** مقاومت اول محدوده: ۲,۴۵۰,۰۰۰ واحد
- S1:** حمایت اول محدوده: ۲,۳۵۰,۰۰۰ واحد
- S2:** حمایت اول محدوده: ۲,۰۰۰,۰۰۰ واحد
- S3:** حمایت دوم محدوده: ۱,۸۴۰,۰۰۰ واحد



✓ شاخص پس از عبور از سقف سال ۹۹، یعنی ۲,۱۰۰,۰۰۰ و عبور از مقاومت بعدی ۲,۳۵۰,۰۰۰ در حال تست محدوده مقاومت نزدیک ۲,۴۵۰,۰۰۰ میباشد.
 ✓ توجه و ورود پول قوی در هفته های اخیر و انتظار رشد دوباره نرخ ارز پس از رشد ۵۰ به ۵۵۰۰۰ تومانی، میتواند کماکان روند صعودی شاخص را حفظ نماید و حتی سهام دارایی محور را با رشد مواجه کند. اما با توجه به نزدیک شدن دوباره به محدوده مقاومتی پی در پی، میتواند سهام شاخص ساز را با عرضه مواجه کند.



مجموع ارزش معاملات در بورس و فرابورس ۳۸،۶۱۰ میلیارد تومان بوده است. ارزش معاملات بلوکی ۱۳،۷۹۳ میلیارد تومان معادل ۳۵.۷۲ درصد معاملات و ارزش معاملات عادی ۲۴،۸۱۷ میلیارد تومان معادل ۶۴.۲۸ درصد بوده است که سهام ۱۸،۳۲۲ میلیارد تومان معادل ۴۷.۴۵ درصد از ارزش معاملات عادی داشته است.



برترین و بیشترین تأثیر بر شاخص را صنایع خودرو با ارزش ۳,۱۶۸، فلزات اساسی با ارزش ۱,۴۷۳، بانک‌ها با ارزش ۱,۳۱۷، شیمیایی با ارزش ۱,۱۶۱ و فرآورده‌های نفتی با ارزش ۱,۰۴۹ میلیارد تومان داشته است.

تأثیرگذارترین‌های بورس و فرابورس					
تأثیرگذارترین‌های فرابورس			تأثیرگذارترین‌های بورس		
قیمت	واحد	نماد	قیمت	واحد	نماد
۷۰۷	۶۰	وسپهر	۸۳۷	۴,۶۲۷	کچاد
۵۳۹	۴۶	خاور	۸۶۲	-۲,۲۷۲	فملی
۱۰,۱۵۵	-۴۳	آریا	۱,۳۹۷	-۱,۸۵۳	فارس
۵,۸۴۵	-۳۳	کگهر	۱۵۱	-۱,۴۶۰	شستا
۱,۱۹۲	-۳۰	هرمز	۴۲۰	۱,۳۱۳	خودرو

پرتراکنش‌ترین‌های بورس و فرابورس					
پرتراکنش‌ترین‌های فرابورس			پرتراکنش‌ترین‌های بورس		
قیمت	ارزش	نماد	قیمت	ارزش	نماد
۱۸۶	۶۹۰	دی	۴۲۰	۱,۰۱۷	خودرو
۱۹۷	۱۲۳	کرمان	۱۵۱	۲۹۷	شستا
۱,۸۰۱	۱۶۹	فرابورس	۳۵۸	۷۸۸	خسپا
۵۳۹	۲۱۳	خاور	۶۹۰	۳۹۵	خگستر
۴,۶۶۰	۷۱	شاروم	۱,۴۳۷	۱۱	پی‌پاد

❖ ارزش براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می‌باشد.

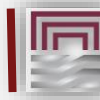


ارزش بازار سهام ایران (بورس تهران و فرابورس) به ۱۰۶.۳۹ میلیون میلیارد تومان در پایان معاملات امروز رسید، ۹۱.۷۸ میلیون میلیارد تومان بالاترین میزان این شاخص در ۱۹ مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است که سقف آن در روز شنبه ۱۹ فروردین ۱۴۰۲ شکسته شده بود. هم چنین خالص ورود پول حقیقی در این هفته ۷،۵۵۶ میلیارد تومان بوده است.

بیشترین خالص خرید حقوقی		
قیمت	خالص خرید حقوقی	نماد
۲,۹۱۵	۳۷	کالا
۲,۷۰۹	۳۲	وغدیر
۱,۹۲۷	۲۷	حکشتی
۱۵۱	۲۳	شستا
۱,۳۹۹	۲۲	فارس

بیشترین خالص خرید حقیقی		
قیمت	خالص خرید حقیقی	نماد
۴۲۴	۴۸۶	خودرو
۳۶۰	۳۳۰	خساپا
۱۸۷	۱۳۹	دی
۶۹۹	۱۳۷	خگستر
۲,۰۶۰	۱۰۶	شبریز

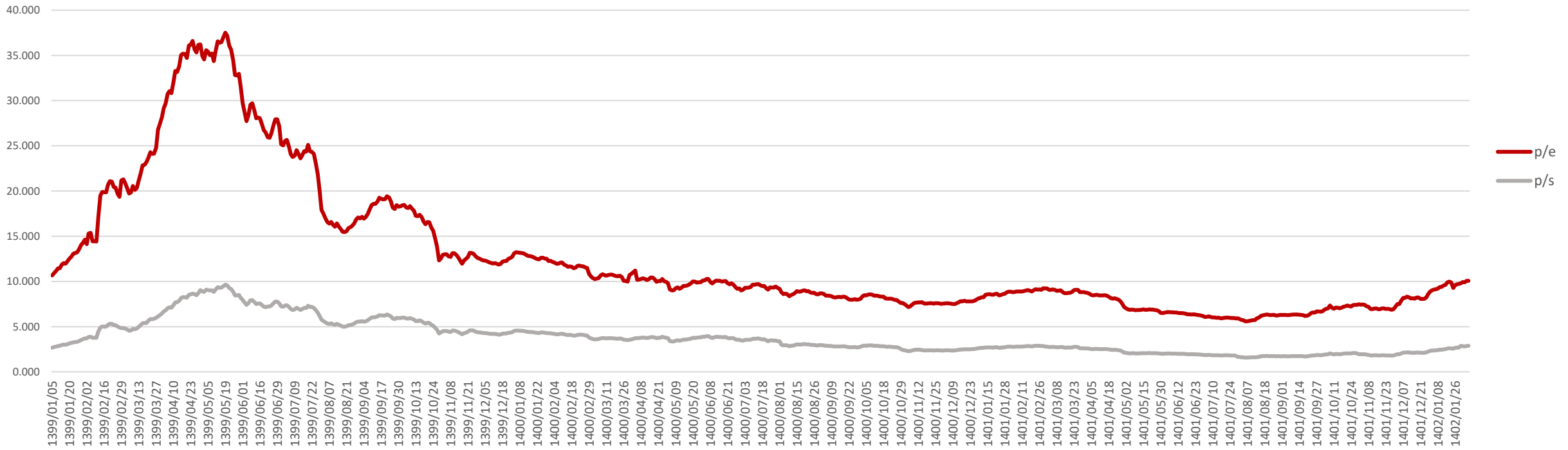
❖ خالص خرید حقیقی و حقوقی براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می باشد.



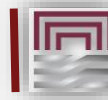
تعداد شرکت	ارزش بازار میلیارد ریال	D/E	P/B	P/S	P/D	P/E ttm	بالاترین / پایین ترین بازدهی			صنعت / شرح	
							سه ماهه	ماهانه	هفتگی		
۲	۳۷,۴۵۴	۸۷٪	۱۴,۰۴	۶,۸۹	۷۷,۶۸	۲۵,۸۷	۱۵۰,۰٪	۶۸,۱٪	۳۱,۹٪	چوب	بالاترین بازدهی هفتگی
۱	۲۵,۰۴۴	۱۱٪	۸,۵۷	۱۳,۸۵	۴۵۲,۰۰	۲۷,۴۸	۲۱۳,۳٪	۴۱,۷٪	۳۰,۹٪	سایر مواد معدنی	
۱۷	۵۹۳,۰۶۶	۴۴٪	۴,۲۳	۷,۵۱	۳۳,۱۸	۱۴,۳۵	۱۲۹,۰٪	۷۰,۳٪	۲۰,۴٪	انبوه سازی، املاک و مستغلات	
۱	۶۹,۸۴۰	۸۲٪	۲,۴۶	۳,۸۴	۳۸,۲۶	۲۱,۰۶	۹۷,۲٪	۴۱,۹٪	۱۸,۳٪	حفاری	
۳	۱۵۳,۳۶۳	۲۳٪	۵,۲۹	۱,۳۳	۸۷,۵۷	۱۶,۹۶	۹۶,۱٪	۴۰,۲٪	۱۶,۱٪	وسایل خانگی	
۱	۵۱,۹۰۳	۸۹٪	۵۶,۵۶	۹۴,۱۹	۱۵۳,۲۲	۱۶۹,۱۹	۱۴۱,۷٪	۷۰,۲٪	۱۵,۳٪	تجهیزات مخابراتی	
۷	۵۸۰,۹۹۵	۴۴٪	۵,۵۴	۳,۰۴	۸۹,۵۷	۲۶,۷۰	۳۸,۰٪	۲۶,۶٪	۰,۵٪	محصولات پاک کننده	پایین ترین بازدهی هفتگی
۱	۷,۵۲۳	۲۲٪	۳۱,۸۸	۳,۸۸	۱۲۸۱,۲۵	۳۷۷,۲۵	۴۴,۱٪	۲۱,۳٪	۱,۱٪	پیمانکاری صنعتی	
۲	۱,۴۴۲,۵۸۰	۹۷٪	۸,۴۴	۲,۷۶	۶,۶۸	۸,۸۷	۴۳,۵٪	۲۶,۳٪	۱,۸٪	خدمات رفاهی متنوع	
۵	۲,۴۸۲,۶۴۲	۵۴٪	۳,۹۷	۲,۸۷	۱۲,۲۹	۵,۰۶	۴۰,۲٪	۱۵,۵٪	۱,۸٪	تولید کود و ترکیبات نیتروژن	
۷	۲۶۳,۹۲۴	۵۲٪	۵,۵۵	۳,۳۷	۳۸,۹۷	۱۳,۶۹	۵۹,۸٪	۳۵,۴٪	۲,۸٪	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	
۳۲	۱,۴۵۲,۳۱۶	۹۲٪	۹,۸۲	۴,۹۶	۱۶,۹۵	۱۱,۹۵	۸۱,۸٪	۲۶,۴٪	۳,۵٪	سیمان، آهک و گچ	



در پایان معاملات امروز P/E ttm بازار به ۱۱.۲۰ واحد و P/S ttm بازار به ۲.۹۶ واحد رسید. بالاترین میزان شاخص به ترتیب ۳۷.۵۱ و ۹.۶۴ در مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است.



- در بازارهای جهانی طلا کانال ۲ هزار دلار را به دست آورد. افزایش قیمت هر انس طلا امروز با ۰.۰۶ درصد افزایش به ۲۰۱۷ دلار و ۹۳ سنت رسید.
- قیمت شکر تا ۱۰ روز آینده اعلام می شود و این خبر برای گروه قند و شکر بسیار با اهمیت است.
- تولید کنندگان دارو و تجهیزات پزشکی به هر مقدار که تولیدشان افزایش یابد، مجوز صادرات می گیرند.
- روند افزایشی نرخ دلار تغییر مسیر داد و علت آن را می توان آغاز همکاری ایران و آژانس بین المللی با نصب دوربین در سایت هسته ای دانست.
- قرارداد صادرات سه مدل خودرو به روسیه و بلاروس منعقد شد.
- سازمان بورس تعلیق تمام سرمایه گذاری های استانی را تا ۳۱ خرداد تمدید کرد.



- امروز به علت تحولات بازارهای جهانی و آخرین روز کاری هفته، عرضه ها بیش از تقاضا بود.
- بازار امروز بیشتر به نفع سهام های کوچک بود و شاخص هم وزن توانست برتری خود را با ۱.۲۴ درصد نسبت به روز گذشته نشان دهد و شاخص کل با عرضه های زیاد سهام بزرگ، امروز با کاهش ۰.۱۵ درصدی به کار خود پایان داد. یکی از دلایل این موضوع می تواند افت مختصر دردلار بازار آزاد باشد.
- نکته مهم ورود پر قدرت پول در گروه های مختلف به خصوص بانک و خودرو است. گروه خودرو و بانک بیشترین تقاضا را به خود اختصاص و اکثریت سهام این گروه مثبت و در صف خرید بودند. ۱ همت ارزش معاملات خودرو بود.
- بازار همچنان در روند بلند مدت صعودی قرار دارد و تصویب قانون مالیات بر عایدی می تواند این روند را ادامه دار نماید.
- در پایان معاملات امروز سرانه خرید حقیقی ۴۱.۴ و سرانه فروش حقیقی ۳۰.۳ میلیون تومان بوده است.

