

# گزارش روزانه بازار سهام

۳ خرداد ماه ۱۴۰۲ | گزارش شماره ۳۱

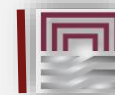


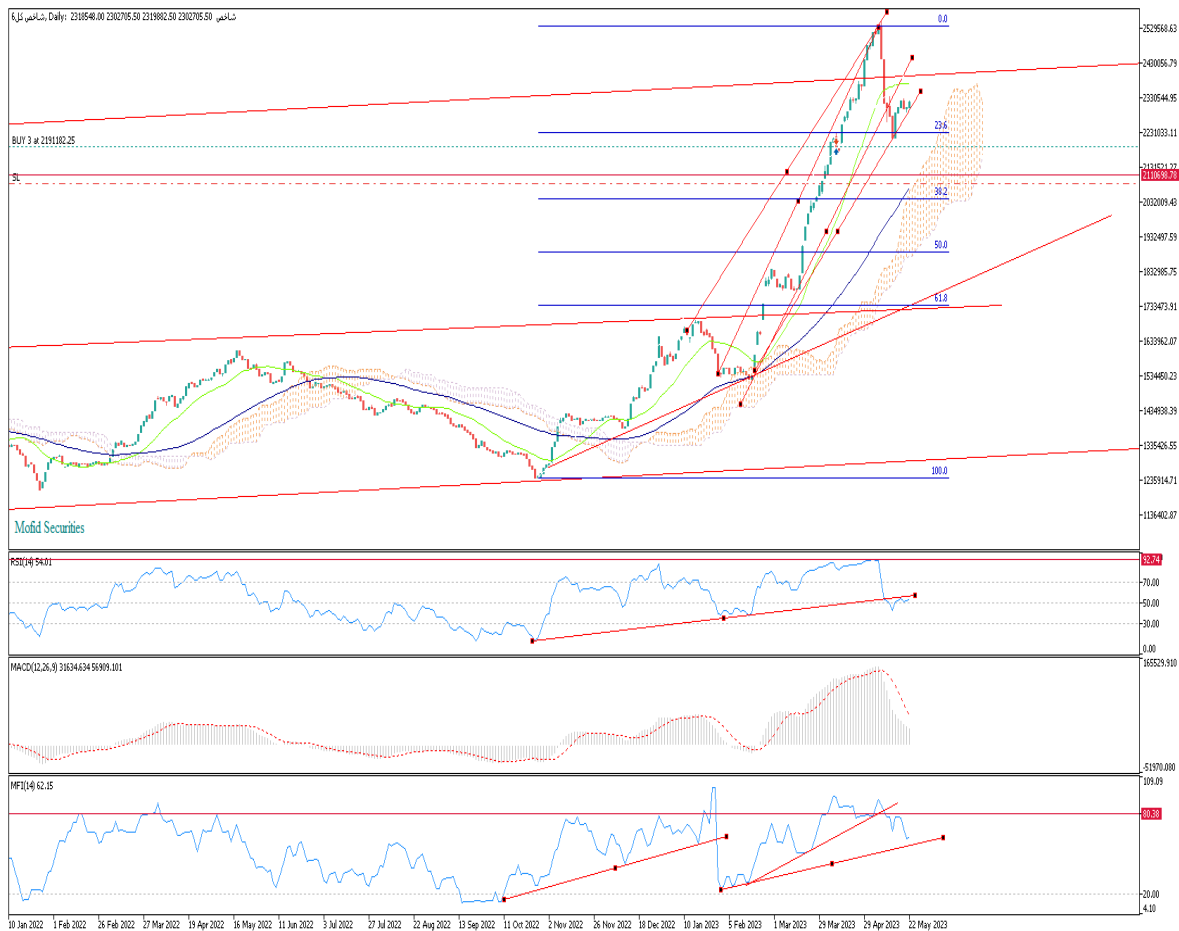
## پرتو تابان

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)	۲,۳۴۵,۹۷۰	۲۴,۶۲۲	۱.۰۶%
شاخص هم وزن (واحد)	۷۹۲,۹۰۷	۲۷,۷۲۰	۳.۶۲%
مجموع ارزش معاملات (میلیارد تومان)	۳۵,۸۹۲	-۷,۴۰۶	-۱۷.۱%
دلار آزاد (تومان)	۵۲,۲۲۰	۱,۰۲۰	۲.۰%
دلار نیما (تومان)	۳۸,۶۲۲	۱۲۰	۰.۳%
تفاوت دلار آزاد و نیما	۱۳,۵۹۸	-	۳۵%
طلا (USD/t oz)	۱,۹۷۵	-۱۱.۰۶	-۰.۵۶%
نفت برنت (USD/BBL)	۷۸	۳.۰۳	۴.۰۵%





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 بالای ۵۰ واحدی در نوسان میباشد. که نشان از کاهش شدت فروش میباشد.

✓ MFI از سطح ۸۰ واحد پایینتر آمده است که نشان از کاهش ورود پول و قدرت خریداران نسبت به هفته های قبلی است.

✓ کماکان خط signal زیر خط MACD قرار گرفته 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: ۲,۲۵۰,۰۰۰ واحد

**S2:** حمایت دوم محدوده: ۲,۱۰۰,۰۰۰ واحد

✓ شاخص پس از کاهش جدی از مقاومت محدوده ۲,۴۵۰,۰۰۰ تا ۲,۵۰۰,۰۰۰ واحدی و هیجان فروش شدید به حمایت فیبو ۲,۲۵۰,۰۰۰ واحدی واکنش مثبت نشان داد، و

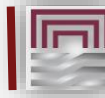
فعلا با انتشار گزارشات سالانه و بهبود معاملات فعلا این سطح حفظ شده است.

همینطور حمایت مهم ۲,۱۰۰,۰۰۰ واحدی از نظر فیبو، ایچیموکو، میانگین متحرک و

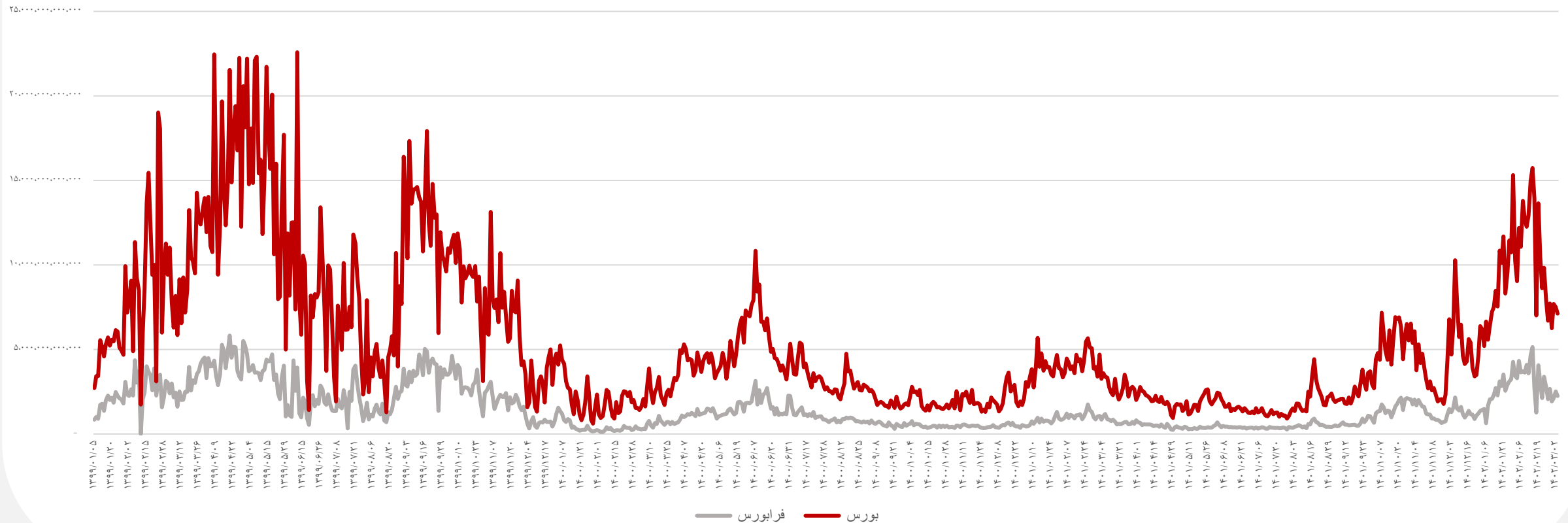
سقف روانی سال ۹۹، میتواند حمایت محکمی باشد.

✓ نزدیکی به مجامع، ارزندگی سهام بنیادی، انتشار گزارشات سالانه و عقب ماندگی بورس

از رقبا و حفظ ارزش پول می تواند باعث توجه دوباره به بازار شود.



مجموع ارزش معاملات در بورس و فرابورس ۳۵،۸۹۲ میلیارد تومان بوده است. ارزش معاملات بلوکی ۱۸،۶۳۶ میلیارد تومان معادل ۵۱.۹۲ درصد معاملات و ارزش معاملات عادی ۱۷،۲۵۵ میلیارد تومان معادل ۴۸.۰۸ درصد بوده است که سهام ۱۰،۶۳۵ میلیارد تومان معادل ۲۹.۶۳ درصد از ارزش معاملات عادی داشته است.



— بورس — فرابورس



برترین و بیشترین تأثیر بر شاخص را صنایع خودرو با ارزش ۱,۱۱۲، فرآورده‌های نفتی با ارزش ۹۶۴، شیمیایی با ارزش ۷۴۹، بانک‌ها با ارزش ۶۲۱ و انبوه‌سازی با ارزش ۵۷۶ میلیارد تومان داشته است.

تأثیرگذارترین‌های بورس و فرابورس					
تأثیرگذارترین‌های فرابورس			تأثیرگذارترین‌های بورس		
قیمت	واحد	نماد	قیمت	واحد	نماد
۷۶۶	-۴۳	وسپهر	۱,۴۷۸	۳,۰۲۲	شبندر
۱,۹۰۱	-۴۲	شگویا	۱,۰۰۱	۲,۹۵۳	شپنا
۹,۴۵۰	۲۷	آریا	۶۱۶	۱,۷۸۹	شتران
۱۸,۸۲۰	۲۴	زاگرس	۱۵,۳۹۴	۱,۷۷۸	نوری
۳,۱۳۵	۲۰	شاون	۱,۹۸۳	۱,۶۲۳	تاپیکو

پرتراکنش‌ترین‌های بورس و فرابورس					
پرتراکنش‌ترین‌های فرابورس			پرتراکنش‌ترین‌های بورس		
قیمت	ارزش	نماد	قیمت	ارزش	نماد
۱۶۱	۱۱۶	دی	۲,۱۱۳	۳۰۷	پی‌پاد
۱۶۶	۶۴	کرمان	۵۰۵	۳۳۲	وبملت
۱۰,۲۱۰	۷۵	چخزر	۳۶۸	۲۳۸	خودرو
۵۸۴	۱۲۰	خاور	۶۱۶	۲۸۸	شتران
۱,۱۹۸	۵۷	گدنا	۱,۰۰۱	۳۰۸	شپنا

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

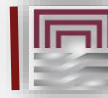


ارزش بازار سهام ایران (بورس تهران و فرابورس) به ۹۸.۵۳ میلیون میلیارد تومان در پایان معاملات امروز رسید، ۹۱.۷۸ میلیون میلیارد تومان بالاترین میزان این شاخص در ۱۹ مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است که سقف آن در روز شنبه ۱۹ فروردین ۱۴۰۲ شکسته شده بود. هم چنین خالص خروج پول حقیقی در این هفته ۵۷۱ میلیارد تومان بوده است.

بیشترین خالص خرید حقوقی		
قیمت	خالص خرید حقوقی	نماد
۲۸,۲۷۳	۵۴	وملی
۱۴۱	۴۶	شستا
۳۳۱	۴۰	خساپا
۲۹۴	۳۵	وبصادر
۸۶۴	۳۱	خزامیا

بیشترین خالص خرید حقیقی		
قیمت	خالص خرید حقیقی	نماد
۶۰۳	۴۶	شتران
۳۶۶	۴۴	خودرو
۲,۵۳۳	۳۵	کنور
۳۱۴	۲۹	تملت
۹۸۲	۲۸	شپنا

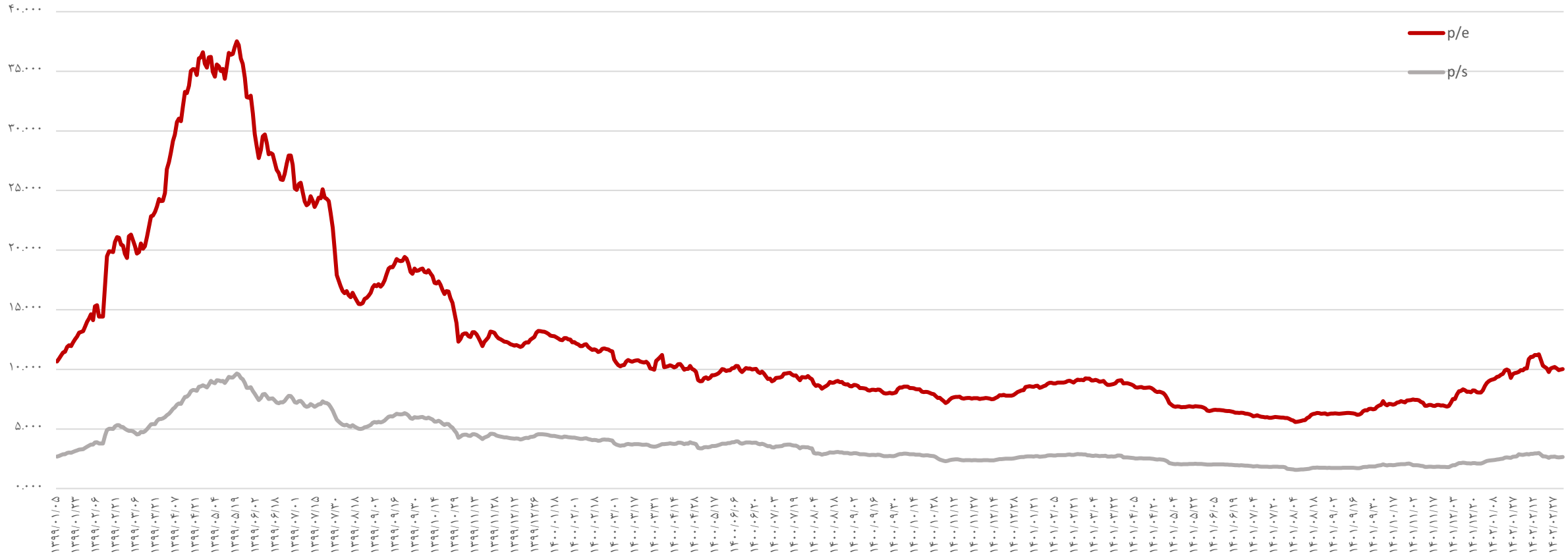
❖ خالص خرید حقیقی و حقوقی براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می باشد.



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	۴۱,۱۰۲	۹۰٪	۱۵,۴۱	۷,۵۶	۶۶,۴۹	۳۱,۱۲	۱۸۶,۹٪	۵۵,۶٪	۲۱,۱٪	چوب	بالاترین بازدهی هفتگی
۱	۲۶,۸۵۴	۱۱٪	۹,۱۹	۱۴,۸۵	۵۰۲,۰۰	۳۰,۵۲	۲۳۱,۵٪	۴۹,۷٪	۱۶,۸٪	سایر مواد معدنی	
۴	۱۲۴,۱۳۹	۳۴٪	۴,۸۵	۱۱,۳۲	۶۴,۶۱	۳۵,۳۵	۷۰,۳٪	۵,۳٪	۱۱,۱٪	سخت افزار و تجهیزات	
۵	۱,۵۱۸,۶۴۱	۵۱٪	۶,۶۹	۲,۹۴	۴۳,۳۸	۹,۰۸	۷۱,۰٪	-۰,۴٪	۹,۸٪	مخابرات	
۳	۸۶,۴۹۶	۵٪	۶,۹۴	۵,۰۵	۷۵۶,۲۱	۲۰۲,۴۷	۱۰۳,۳٪	۱۰,۰٪	۸,۷٪	تجهیزات صنعتی	
۲	۳۵,۲۷۷	۵۵٪	۲۳,۲۸	۹,۳۱	۱۴۸,۵۸	۷۳,۸۴	۷۳,۷٪	۱۱,۷٪	۸,۰٪	نساجی	
۴	۱۵۷,۹۲۸	۹۳٪	۸,۴۴	۴,۳۳	۱۲,۱۵	۱۳,۴۵	۲۶,۰٪	-۶,۴٪	-۵,۲٪	زغال سنگ	پایین ترین بازدهی هفتگی
۲۲	۹,۶۲۹,۱۲۰	۵۷٪	۳,۹۸	۲,۴۲	۱۳,۱۰	۱۰,۵۰	۳۱,۸٪	۲,۰٪	-۳,۳٪	آهن و فولاد	
۳	۶۱,۸۳۳	۱۵٪	۱۲,۶۰	۲,۵۸	۵۸,۹۱	۳۳,۲۸	۲۷,۸٪	-۱,۱٪	-۲,۹٪	حمل و نقل بار زمینی	
۱۱	۶,۶۷۸,۳۵۷	۷۱٪	۵,۲۳	۵,۵۰	۱۱,۳۸	۱۳,۶۸	۲۳,۷٪	-۶,۶٪	-۲,۵٪	کانی های فلزی	
۱۵	۵,۵۳۱,۵۸۵	۵۵٪	۴,۹۳	۴,۸۶	۱۷,۲۵	۱۰,۹۴	۲۸,۸٪	-۳,۰٪	-۲,۳٪	تولید فلزات گرانبهای غیر آهن	
۶	۶۴۲,۲۷۸	۶۹٪	۴,۰۵	۷,۱۲	۱۴,۵۷	۱۰,۲۳	۲۱,۷٪	-۴,۵٪	-۱,۸٪	تامین سرمایه	

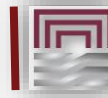


در پایان معاملات امروز P/E ttm بازار به ۱۰.۰۳ واحد و P/S ttm بازار به ۲.۶۷ واحد رسید. بالاترین میزان شاخص به ترتیب ۳۷.۵۱ و ۹.۶۴ در مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است.





- رییس مجلس طی نامه ای به رییس جمهور، مصوبه هیئت وزیران در مورد موضوع "تعیین نرخ تسعیر ارز شرکت های پالایش نفت و پتروشیمی" توسط بانک مرکزی را مغایر قانون دانست.
- سامانه املاک و مستغلات به صورت رسمی رونمایی شد.
- سرپرست وزارت صمت اعلام کرد که این وزارتخانه در حوزه تنوع بخشی و ورود کالاهای جدید به بورس کالا، برنامه های مهمی پیش رو دارد.
- وزارت کشاورزی افزایش شیرخام را به میزان ۲۵ درصد مصوب کرد.
- نماینده مجلس از تداوم حضور دولت در سهامداری صنایع و عدم اجرای خصوصی سازی انتقاد کرد.
- شش خودروساز از عرضه محصولات در بورس کالا توانستند ۱۷.۵ همت درآمد کسب کنند.
- قائم مقام بیمه مرکزی اعلام کرد شرکت کارگزاری بیمه سایپا و شرکت نمایندگی بیمه ایران خودرو در رتبه های نخست بدهکاران عمده شبکه فروش صنعت بیمه قرار دارند.



- با توجه به خبر شناوری ارز، حرکت قوی و مثبت شاخص به سمت بالا انتظار می رفت. در ابتدای بازار پالایشی ها و اکثر شیمیایی ها با تقاضای خوبی روبه رو شدند و به صف نشستند اما در ادامه بازار نتوانست بر عرضه غلبه کند و بسیاری از صف ها عرضه شد. البته در نامه ابهاماتی مثل اینکه کدام نرخ به رسمت شناخته می شود و یا پس از سپری شدن ۲ ماه از ابتدای سال، عدم النفع شرکت ها چطور پرداخت می شود و ... وجود دارد.
- شگویا چون ماده اولیه خود را با ارز ۲۸۵۰۰ تومان دریافت می کند، شناوری ارز، حاشیه سود آن را بیش از بقیه تحت تاثیر قرار می دهد و آن را در صف فروش نشانده.
- شاخص در نهایت توانست ۱۵ هزار واحد رشد و در ۲،۳۴۵،۹۶۷ هزار بایستد، بیش از ۴۰ درصد نمادها سبز بودند و در مجموع هفته تقریبا سبزی را شاهد بودیم؛ هرچند که ارزش معاملات همچنان پایین است.
- احتمالا در روزهای آتی بازار با خبرهای بیشتری در خصوص نرخ ارز درگیر خواهد بود و نوسان همچنان در بازار ادامه خواهد داشت.

