

# گزارش روزانه بازار سهام

۶ اردیبهشت ماه ۱۴۰۲ | گزارش شماره ۱۲



**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)	۲,۳۶۵,۲۸۹	۳۸,۷۹۵	۱.۶۷%
شاخص هم وزن (واحد)	۷۸۶,۴۹۵	۱۸,۰۰۷	۲.۳۴%
مجموع ارزش معاملات (میلیارد تومان)	۵۴,۱۷۹	-۲۰۱,۱۲۳	-۷۸.۸%
خالص ورود پول حقیقی (میلیارد تومان)	۷۱۴	۱۶۱	۲۹.۱%
دلار آزاد (تومان)	۵۲,۲۰۰	۴۵۰	۰.۹%
دلار نیما (تومان)	۳۸,۱۵۰	-۱۴۰	-۰.۴%
تفاوت دلار آزاد و نیما	۱۴,۰۵۰	۵۹۰	۳۷%
طلا (USD/t oz)	۱,۹۹۷.۷	۱۲.۵۸	۰.۶۳%
نفت برنت (USD/BBL)	۸۱.۲	-۰.۲۵	-۰.۳۰%



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.

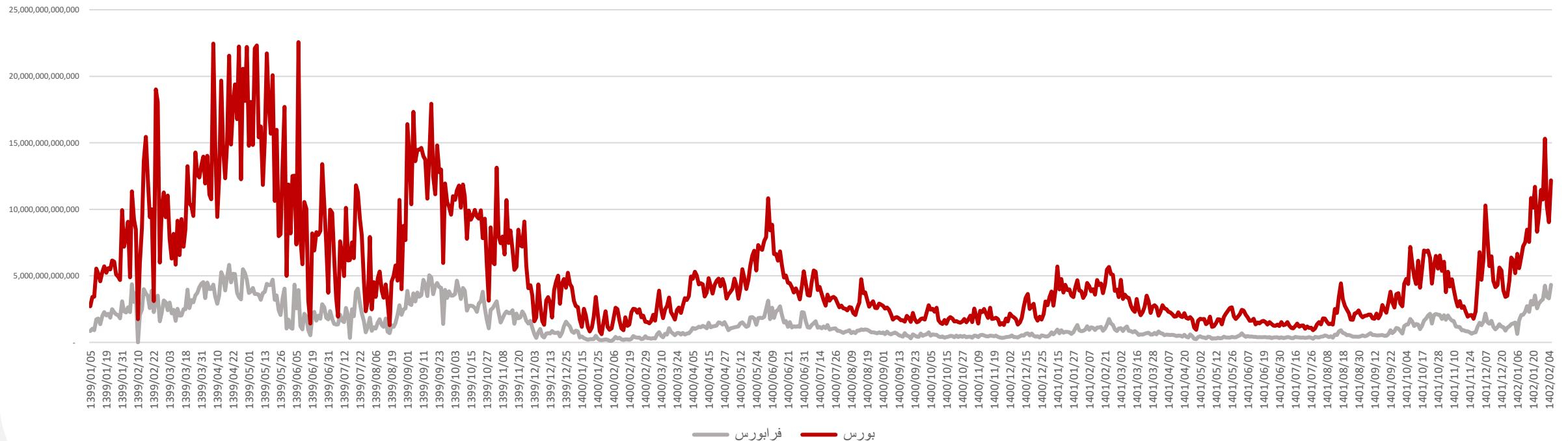
در حال حاضر سطوح حمایت و مقاومت شاخص به ترتیب زیر است:

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

- ✓ شاخص پس از عبور از سقف سال ۹۹، یعنی ۲,۱۰۰,۰۰۰ در حال نزدیک شدن به محدوده مقاومت ۲,۳۵۰,۰۰۰ میباشد.
- ✓ توجه و ورود پول قوی در هفته های اخیر میتواند کماکان روند صعودی شاخص را حفظ نماید و حتی سهام دارایی محور را با رشد مواجه کند. اما با توجه به نزدیک شدن به محدوده مقاومتی مذکور، بازار با عرضه هم روبرو خواهد بود.



مجموع ارزش معاملات در بورس و فرابورس ۵۴،۱۷۹ میلیارد تومان بوده است. ارزش معاملات بلوکی ۳۳،۴۶۷ میلیارد تومان معادل ۶۱.۷۷ درصد معاملات و ارزش معاملات عادی ۲۰،۷۱۱ میلیارد تومان معادل ۳۸.۲۳ درصد بوده است که سهام ۱۶،۱۹۳ میلیارد تومان معادل ۲۹.۸۹ درصد از ارزش معاملات عادی داشته است.



برترین و بیشترین تأثیر بر شاخص را صنایع خودرو با ارزش ۱,۹۳۲، شیمیایی با ارزش ۱,۵۸۲، فلزات اساسی با ارزش ۱,۱۸۰، بانک‌ها با ارزش ۵۳۱ و انبوه‌سازی با ارزش ۵۳۰ میلیارد تومان داشته است.

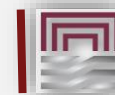
### تأثیرگذارترین‌های بورس و فرابورس

تأثیرگذارترین‌های فرابورس			تأثیرگذارترین‌های بورس		
قیمت	واحد	نماد	قیمت	واحد	نماد
۲۱,۸۱۵	۱۳۲	مارون	۱۴,۶۹۴	۱,۵۵۲	نوری
۳,۵۲۵	۳۲	انتخاب	۸۰۳	-۱,۴۶۴	فملی
۱,۹۳۹	۳۱	شگویا	۳۹۳	-۱,۳۴۹	خودرو
۱,۰۳۶	۲۸	هرمز	۲,۶۴۳	-۱,۲۶۹	وغدیر
۲,۵۷۵	۲۰	ارفع	۴۵۲	۱,۲۴۷	فخوز

### پرتراکنش‌ترین‌های بورس و فرابورس

پرتراکنش‌ترین‌های فرابورس			پرتراکنش‌ترین‌های بورس		
قیمت	ارزش	نماد	قیمت	ارزش	نماد
۱۴۷	۱۸۹	دی	۱,۱۲۷	۶۳	پی‌پاد
۱۶۸	۱۲۶	کرمان	۳۲۳	۴۰۷	خساپا
۴۰۵	۲۱۴	کوثر	۳۹۳	۳۸۵	خودرو
۱,۲۱۰	۱۰۴	گدنا	۵۸۹	۲۹۰	خگستر
۴۹۲	۱۱۸	خاور	۳۱۷	۴۷۲	پترول

❖ ارزش براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می‌باشد.



ارزش بازار سهام ایران (بورس تهران و فرابورس) به ۹۹.۸۴ 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 هفتگی ۲،۶۰۴ میلیارد تومان بوده است.

بیشترین خالص خرید حقوقی		
قیمت	خالص خرید حقوقی	نماد
۳۱۹	۷۰	خساپا
۳۸۹	۶۰	خودرو
۲،۸۷۹	۵۱	وگدیر
۲۴۸	۴۷	وبصادر
۵۷۲	۴۰	شتران

بیشترین خالص خرید حقیقی		
قیمت	خالص خرید حقیقی	نماد
۳۱۸	۱۴۵	پترول
۳۴۱	۱۰۱	تملت
۴۵۷	۸۹	فخوز
۲،۱۱۳	۸۸	اپال
۴۰۳	۸۱	کوئر

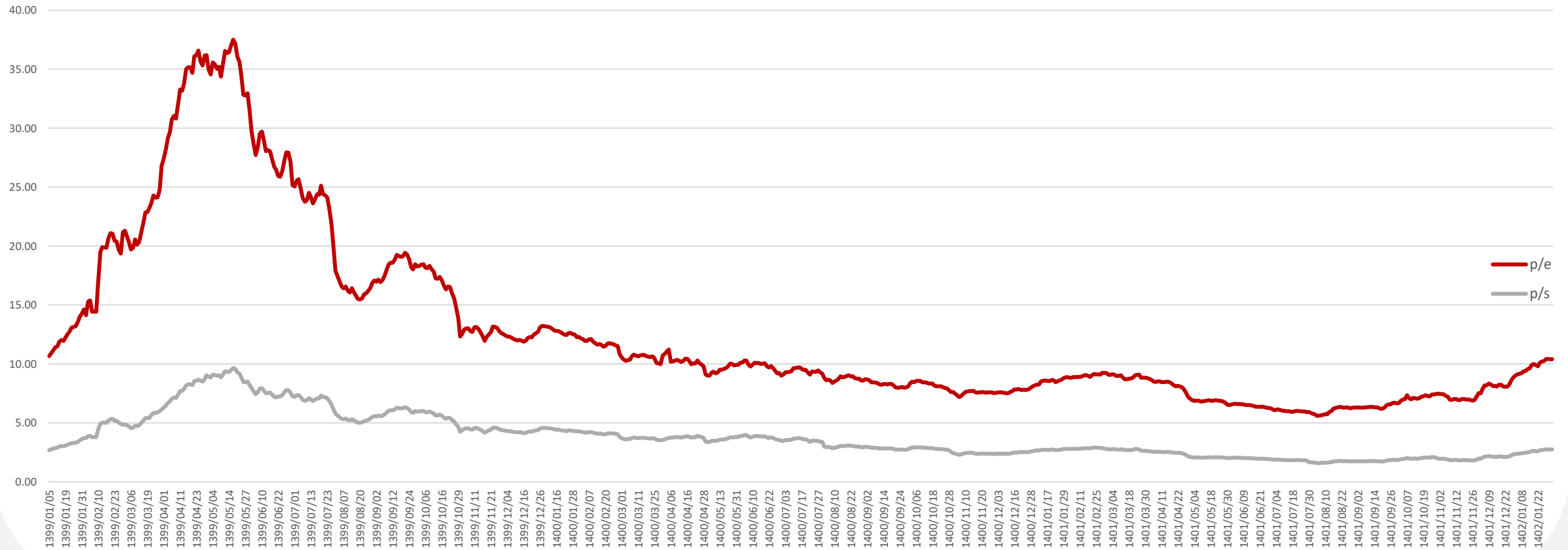
❖ خالص خرید حقیقی و حقوقی براساس میلیارد تومان و قیمت براساس تومان می باشد.



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		
۱	۴۲,۸۸۸	۸۹٪	۴۴.۵۲	۷۴.۱۳	۱۲۶.۰۷	۱۳۹.۲۱	۹۴.۸٪	۶۵.۰٪	۱۵.۸٪	تجهیزات مخابراتی	بالاترین بازدهی هفتگی
۱	۱۶,۹۸۴	۷۷٪	۵.۳۲	۳.۲۱	۲۵.۵۵	۱۳.۸۹	۶۲.۳٪	۴۵.۶٪	۱۳.۵٪	چاپ و نشر	
۱	۷,۱۴۰	۲۲٪	۲۸.۸۲	۳.۵۱	۱۱۳۳.۷۵	۳۳۳.۸۲	۴۷.۸٪	۴۰.۷٪	۱۲.۲٪	پیمانکاری صنعتی	
۳	۸۲,۸۰۳	۵٪	۶.۳۱	۴.۵۹	۷۹۳.۲۶	۱۹۱.۸۰	۸۰.۴٪	۵۳.۵٪	۱۱.۸٪	تجهیزات صنعتی	
۱۷	۴۷۳,۳۲۷	۴۴٪	۳.۲۸	۵.۷۹	۲۶.۳۱	۱۱.۵۱	۷۷.۴٪	۵۲.۶٪	۱۰.۹٪	انبوه سازی، املاک و مستغلات	
۲	۳۲,۶۹۲	۵۵٪	۲۵.۰۹	۹.۱۰	۱۳۵.۹۹	۱۰۳.۱۶	۶۰.۸٪	۵۷.۵٪	۱۰.۰٪	نساجی	
۴	۲,۲۴۷,۶۵۱	۱۰٪	۵.۸۳	-۰.۹۲	۱۴۵.۱۸	۱۴.۸۹	۳۶.۶٪	۲۲.۸٪	-۲.۶٪	خودرو	پایین ترین بازدهی هفتگی
۹	۲۹۸,۶۵۴	۸۴٪	۶.۷۰	۱.۵۴	۲۹.۹۷	۲۳.۵۷	۴۳.۴٪	۳۶.۷٪	-۲.۳٪	لاستیک و پلاستیک	
۲	۱,۴۴۲,۶۷۴	۹۷٪	۸.۴۶	۲.۷۶	۶.۶۸	۸.۸۷	۳۵.۰٪	۲۷.۵٪	-۲.۰٪	خدمات رفاهی متنوع	
۴	۶۶۶,۵۳۶	۲۱٪	۱۳.۴۴	۴۷.۴۳	۲۵۸.۸۰	۵۱.۹۵	۵۲.۵٪	۲۷.۵٪	-۱.۴٪	فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار	
۱۲	۴,۸۷۲,۳۳۶	۱۳٪	۲.۲۳	۲.۵۲	۷۳.۶۲	۶.۷۴	۴۵.۲٪	۲۰.۲٪	-۱.۰٪	بانکها و موسسات اعتباری	
۱۱	۷,۸۰۰,۲۴۳	۷۰٪	۴.۰۷	-۰.۶۹	۱۱.۸۳	۶.۲۴	۴۷.۱٪	۱۳.۶٪	-۰.۹٪	فراورده های نفتی	

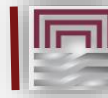


در پایان معاملات امروز P/E ttm بازار به ۱۰.۳۹ واحد و P/S ttm بازار به ۲.۷۳ واحد رسید. بالاترین میزان شاخص به ترتیب ۳۷.۵۱ و ۹.۶۴ در مرداد ماه ۱۳۹۹ بوده است.





- نرخ بهره بدون ریسک به ۲۵.۸۸ درصد رسید.
- نماینده مردم تهران اعلام کرد تعطیلی شنبه ها به جای پنج شنبه ها و بهره مندی تمامی نیروهای کار اعم از دولتی و بخش خصوصی، مطالبه بخشی از فعالان اقتصادی و مردم از مجلس است.
- بنیانگذار هلدینگ غذایی "شیرین عسل" از ورود این هلدینگ به تولید خودرو خبر داد.
- استاندار تهران: از نیمه شهریور ماه قانون مالیات بر خانه های خالی در تهران عملیاتی خواهد شد.
- مدیر نظارت بر صندوق های سرمایه گذاری اعلام کرد مازاد سهام صندوق های درآمد ثابت، تنها ۱۰ هزار میلیارد تومان است.
- مدیر عامل فرابورس ایران از موافقت پذیرش یک شرکت پروژه جدید در فرابورس در راستای تزریق منابع به طرح های تولیدی و ورود سرمایه ها به بازار اولیه خبر داد.
- وزیر نفت اعلام کرد بنزین گران نمی شود و افزایش قیمت در دستور کار دولت نیست.
- لایحه تشکیل وزارت بازرگانی در دولت تصویب شد.
- وزیر اقتصاد از ابلاغ جزییات بسته ۱۰ بندی مهر تورم و رشد تولید ظرف روزهای آینده خبر داد.



- بازار با افزایش عرضه نسبت به روزهای گذشته کار خود را شروع کرد و میل به خرید در منفی های امروز بازار مشهود و علی رغم خبر کاهش حد نصاب صندوق های درآمد ثابت بازار خوبی را شاهد بودیم و بیش از ۵۰ درصد نمادها رنگ سبز به خود گرفتند.
- امروز در نماد های خودرویی شاهد صف فروش برخی نماد ها (خساپا، خودرو و...) بودیم اما نتوانست مانع حجم خوبی در سایر بخش های بازار شود.
- شاخص کل امروز رفت و برگشت های زیادی را تجربه کرد و در نهایت با ۳۴۰۰ واحد منفی به کار خود پایان داد.
- ۸۳ درصد خریدها توسط حقیقی ها و ۱۷ درصد توسط حقوقی ها انجام شده است.

