



گزارش روزانه بازار

۱۳۹۴/۰۶/۱۰

واحد تحلیل



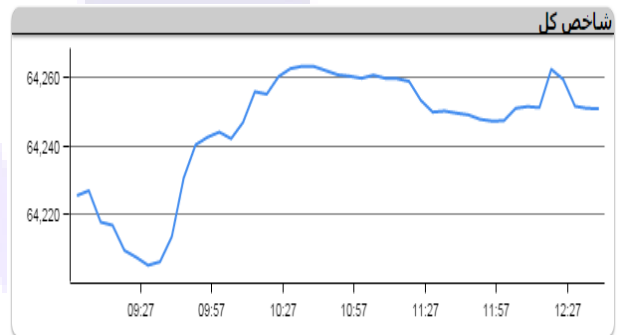
**بخش اول) بررسی وضعیت بورس و
فرا بورس در یک نگاه**

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران با رشد 25 واحدی در پایان معاملات امروز، به رقم 64251 واحد رسید به طوری که این نماگر بورس نسبت به روز گذشته، 0.04 درصد رشد داشت. همچنین شاخص کل فرا بورس نیز طی روز جاری با 0.30 واحد افزایش به رقم 730.6 واحد رسید. با توجه به آمار مربوطه، ارزش کل معاملات در بازار بورس به مبلغ 863.137 میلیارد ریال و حجم معاملات به میزان 401.844 میلیون سهم بوده است در مقابل ارزش کل معاملات در بازار فرا بورس نیز به مبلغ 466.314 میلیارد ریال و حجم معاملات در این بازار به میزان 69.912 میلیون سهم بوده است.

جدول ۱- وضعیت شاخص های منتخب

شاخص	آخرین مقدار	تغییر	درصد
شاخص کل بورس	64,251.00	25.18	0.04
شاخص کل فرا بورس	730.60	0.30	0.04
شاخص قیمت (هم وزن)	8,417.30	5.00	0.06
شاخص قیمت(وزنی-ارزشی)	25,399.20	10.00	0.04
شاخص ۵۰ شرکت فعالتر	2,637.60	0.90	0.03
شاخص ۳۰ شرکت بزرگ	2,835.50	2.20	0.08
شاخص صنعت	52,888.00	16.72	0.03

نمودار ۱- روند شاخص کل بورس



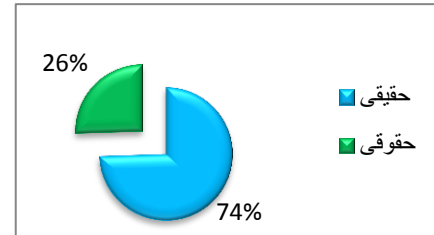
جدول ۳- تاثیرگذارترین نمادها بر شاخص کل فرا بورس

تاثیر گذارترین نمادها بر شاخص فرا بورس			
نماد	تاثیر	نماد	تاثیر
پترول	1.27	مارون	3.1
میدکو	0.53		
هرمز	0.48	شپاس	0.34
شتران	0.33		

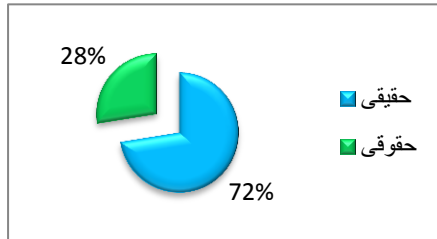
جدول ۲- تاثیرگذارترین نمادها بر شاخص کل بورس

تاثیر گذارترین نمادها بر شاخص بورس			
نماد	تاثیر	نماد	تاثیر
شپنا	15.82	رانفور	26.64
وبملت	14.89	شبهرن	18.75
وبصادر	13.44	شیراز	4.51
وخواور	10.42	وچارزم	3.49
وتجارت	6.38	سفارس	3.45

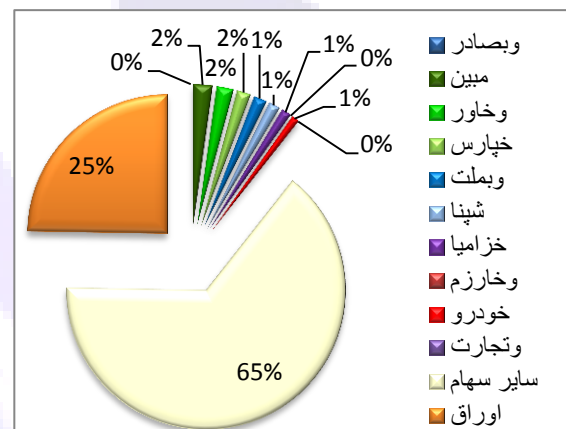
نمودار ۲- وضعیت خرید سهامداران (میلیون ریال)



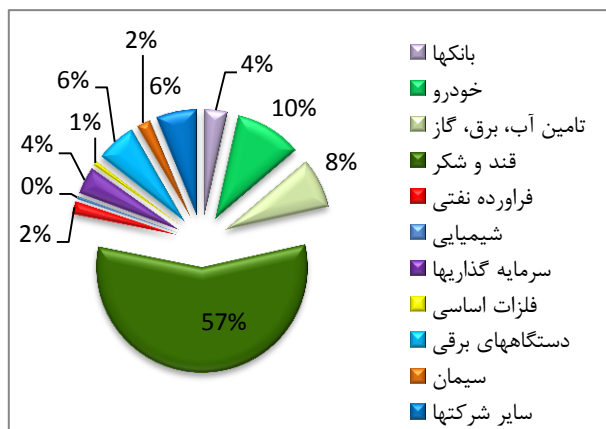
نمودار ۳- وضعیت فروش سهامداران (میلیون ریال)



نمودار ۴- درصد ارزش معاملاتی ۱۰ نماد برتر بازار (میلیارد ریال)



نمودار ۵- نسبت ارزش صنایع برتر به ارزش معاملات امروز (درصد)



❖ با توجه به نمودار 4 می توان اظهار کرد که بیشترین ارزش معاملاتی 10 نماد برتر به لحاظ ارزش معاملاتی، متعلق به صنعت بانکی می باشد که از این صنعت، " و بصادر " برترین نماد به لحاظ ارزش معاملاتی با ارزش 33.94 میلیارد ریال، طی روز جاری بوده است.

جدول ۴- قیمت سکه و طلا در بازار (ریال)

ارز و طلای داخلی	قیمت امروز (ریال)	تغییر (درصد)
سکه طرح جدید	9,250,000	0.65%
دلار آزاد	34,100	0.98%
دلار مبادلاتی	29,956	-0.01%

جدول ۵- قیمت کالاهای جهانی به دلار

کالای پایه	قیمت امروز (\$)	درصد تغییر
طلا(انس)	1,143.10	0.81%
آلومینیوم(تن)	1,544.00	-1.34%
سرب(تن)	1,684.00	-0.36%
روی(تن)	1,812	0.83%
مس(تن)	5,078.00	-1.03%
نفت(برنت)	53.33	0.64%

**بخش دوم) اخبار سیاسی و
اقتصادی**

اخبار سیاسی:

- جان کری، وزیر امور خارجه آمریکا، فردا (چهارشنبه ۱۱ شهریور ماه) به ایالت 'پنسیلوانیا' سفر می کند تا در دفاع از توافق هسته ای ایران و گروه ۵+۱ سخنرانی کند.
- مدالین آلبرایت، وزیر خارجه آمریکا در دولت بیل کلینتون گفت: توافقنامه هسته ای امضا شده با ایران، یک توافق برد - برد و ابتکار عمل بدیع دیپلماسی است که نباید آن را از دست داد.
- نایب رئیس کمیسیون ویژه بررسی برجام از ارائه گزارش نهایی این کمیسیون تا ۲ هفته آینده به هیئت رئیسه مجلس خبر داد.
- رئیس مجلس در جریان سفرش به نیویورک با دبیرکل سازمان ملل متحد دیدار و گفت و گو کرد که در این دیدار سفر بان کی مون به تهران در آینده مطرح شد.

اخبار اقتصادی:

- براساس محاسبات دبیرخانه اوپک که روز سه شنبه اعلام شد، قیمت نفت این سازمان دیروز (دوشنبه) پس از اعلام آمادگی آن برای مذاکره با دیگر تولیدکنندگان در راستای دستیابی به یک قیمت منصفانه، با چهار درصد افزایش نسبت به روز قبل، به ۴۷,۰۱ دلار در هر بشکه رسید.
- بلمبرگ اعلام کرد با افزایش ۵۰ هزار بشکه در روز، تولید نفت ایران به ۲,۹ میلیون بشکه در روز رسید که بالاترین رقم از جولای ۲۰۱۲ به این سو است.
- رئیس کل بانک مرکزی از طرح جدید بانک مرکزی برای تقویت تولید ملی خبر داد و به صرافها هشدار داد با دستورالعمل جدید این بانک منطبق شوند.
- وزیر امور اقتصادی و دارایی از تدوین بسته سیاستی سهام عدالت خبر داد و گفت: لایحه ای در این راستا به مجلس شورای اسلامی ارائه می شود.
- دبیرکل کانون نهادهای سرمایه گذاری ایران پیش بینی کرد: از پایان امسال رونق به بازار بازگردد و از سال آینده حضور سرمایه گذاران خارجی و رشد و رونق اقتصادی را شاهد باشیم.
- مطالعات انجام شده برای شاخص تولید صنعتی نشان از رشد منفی ۱۹,۳ درصدی تولید صنعتی در شرکت های صنعتی عضو بورس اوراق بهادار تهران طی بهار سال جاری دارد.

- حجم مبادلات بازرگانی ایران و ترکیه در ۷ ماه نخست نخست سال ۲۰۱۵ میلادی با توجه به کاهش نرخ جهانی نفت و تاثیر آن در تجارت بین دو کشور با ۲۱,۸ درصد کاهش نسبت به دوره مشابه سال گذشته، به ۶ میلیارد و ۷۹ میلیون و ۶۹۴ هزار دلار رسید.
- رئیس کل بانک مرکزی از طرح جدید بانک مرکزی برای تقویت تولید ملی خبر داد و به صرافها هشدار داد با دستورالعمل جدید این بانک منطبق شوند.

بخش سوم) بررسی روند گروه ها در بازار

گروه خودرو:

اکثر نمادهای این گروه در دقایق ابتدایی در بازه مثبت قیمتی معامله شدند و شاهد رشد قیمت در نمادها بودیم. این در حالیست که "ختور" و "خمهر" در آستانه صف فروش طی دقایق ابتدایی قرار گرفتند. با تداوم بازار نیز این روند ادامه یافت و شاهد رشد قیمت پایانی اکثر نمادهای این گروه بودیم. به طوری که لیدر گروه، "خودرو"، با رشد 0.36 درصدی قیمت پایانی خود همراه شد. اگرچه "خنصیر" و "خمهر" در آستانه صف فروش، "خفنر" با صف فروش و در مقابل "خاذین" با صف خرید همراه شدند.

گفتنی است "خپارس" با معامله 22.776 میلیون سهم پرچم ترین نماد این گروه محسوب می شود. افزون بر این "خپارس" و "خودرو" به ترتیب سومین و پنجمین نمادهای پربیننده روز جاری بودند. در خصوص اخبار حاکی بر نمادهای این گروه می توان به دو مورد اشاره کرد:

○ شایان ذکر است بر اساس آمار منتشره، مقدار تولید شرکت سایپا از ابتدای سال جاری تا انتهای مرداد ماه به میزان 132952 دستگاه و میزان فروش این شرکت در مدت مذکور، به میزان 102117 دستگاه بوده است. همچنین، مقدار تولید شرکت مذکور طی مرداد ماه سال جاری به میزان 25859 دستگاه و مقدار فروش نیز طی مدت یاد شده به میزان ۲۳۷۹۱ دستگاه بوده است.

○ همچنین شرکت سایپا آذین، بر اساس اطلاعیه مورخ 1 مرداد ماه سال جاری، 80 درصد از زیان منتهی به سال مالی 1394/12/29 را بر اساس عملکرد سه ماهه پوشش داده است. گفتنی است سازمان بورس از مسئولان "خاذین" درباره پوشش 80 درصدی مبالغ زیان خالص توضیح خواست. در این خصوص امیر رضا نخعی مدیرعامل سایپا آذین نیز در واکنش به این درخواست توضیحاتی را به شرح ذیل ارائه کرد:

با توجه به اینکه بخش عمده ای از ارقام هزینه های دستمزد مستقیم و سربار ثابت بوده و تابع تیراژ تولید نمی باشد و با عنایت به اینکه در سه ماه اول سال 1394 به دلیل رکود در بازار خودرو، حدود 70 درصد تیراژ پیش بینی شده محقق شد، لذا سرانه هزینه های تبدیل بالاتر از حد متعارف بوده و دلیل زیان سه ماه اول ناشی از این امر بوده است.

لیکن با توجه به اینکه برنامه ابلاغی اصلاحی گروه سایپا بر اساس سه ماهه واقعی و نه ماهه پیش بینی، مبین حدود 90 درصد برنامه اولیه می باشد، لذا در ماه های بعد در صورت تحقق برنامه های اعلامی گروه سایپا، سرانه هزینه های تبدیل، کاهش قابل ملاحظه یافته و به وضعیت عادی بر می گردد.

گروه فرآورده های نفتی:

در اکثر نمادهای این گروه به جز "شبهرن" طی دقایق ابتدایی روز جاری، شاهد روندی متعادل و صعودی بودیم. این در حالیست که "شبهرن" با صف فروش مواجه شد. اما با تداوم بازار، اکثر نمادهای گروه با روندی نزولی مواجه شدند و شاهد افت قیمت در اکثر نمادهای گروه بودیم.

گفتنی است "شپنا" و در مقابل "شبهرن" تاثیر گذارترین نمادها بر نماگر بورس طی روز جاری بودن که به ترتیب تاثیری مثبت و منفی بر شاخص بورس گذاشتند. همچنین "شتران" و در مقابل "شپاس" نیز دو نمادی هستند که به ترتیب بیشترین تاثیر مثبت و منفی را بر شاخص فرابورس داشتند.

شایان ذکر است "شپنا" با معامله 7.175 میلیون سهم پرچم ترین نماد این گروه طی روز جاری محسوب می گردد. افزون بر این، نماد مذکور ششمین نماد پربیننده روز جاری بود. از جمله اخبار تاثیر گذار بر این گروه، می توان به خبر زیر اشاره نمود:

○ دو مقام مسئول در دو پالایشگاه از تصمیم جدید و مثبت وزارت نفت و یک رویداد مهم اما مقطعی برای پالایشگاه ها خبر دادند که در صورت تداوم می تواند به حل مشکلات این گروه کمک شایانی کند. در این رابطه یک مقام مسئول در پالایشگاه اصفهان با اشاره به اصلاح گزارش سه ماه اول این شرکت به بورس پرس گفت: طی چند روز گذشته شرکت ملی پالایش و پخش اطلاعیه ایی داده که طی آن قیمت فروش نفت خام برای طی دو ماه اول سال را یک دلار کاهش داده است. وی ادامه داد: به همین دلیل با ارسال گزارش عملکرد سه ماه جدید و اصلاح شده ایی، پوشش 17 درصدی و 72 ریالی سود 42 تومانی هر سهم پالایشگاه اصفهان (با سرمایه دو هزار میلیارد تومانی) در سه ماه اول سال به 93 ریال معادل 22 درصد افزایش یافت.

○ همچنین یک مدیر در پالایشگاه بندرعباس هم با تایید تصمیم جدید وزارت نفت، به افزایش فشارهای سهامداران در ماه های اخیر اشاره کرد. وی ادامه داد: به همین دلیل طی اعلامیه قیمت فروش نفت خام به

پالایشگاه بندرعباس برای تحویل در دو ماه اول سال و منتهی به تیرماه نیم دلار کاهش یافته است. این تصمیم برای سایر پالایشگاه ها هم گرفته شده و قیمت فروش نفت خام آنها نیز یک دلار کاهش یافته است. وی با اعلام اثر مثبت این تصمیم در آینده پالایشگاه ها خاطر نشان کرد: با توجه به این رویکر جدید و در صورت ادامه دار بودن برخورد های منطقی وزارت نفت، اگر قیمت های جدید و واقعی و بر اساس فوب خلیج فارس برای ماه های آینده هم تکرار شود می توان شاهد بهبود سودآوری پالایشگاه ها بود.

گفتنی است "شپنا" درآمد هر سهم خود را برای سال مالی منتهی به 1394/12/29 به میزان 420 ریال پیش بینی کرده است. همچنین، این شرکت توانسته بر اساس عملکرد سه ماهه منتهی به 1394/03/31 ، 22 درصد از بودجه خود را پوشش دهد.

تحلیل تکنیکال "ولسایا":

نوسانات قیمتی ۷ سال گذشته سهم ، حکایت از یک روند بلند مدت صعودی را نشان می دهد که همچنان سهم در حال ثبت سقف ها و کف های قیمتی بالاتر است.

سهم در چارت لگاریتمی فوق العاده ترند پذیر بوده و از یک خط روند مقاومتی بسیار قدرتمند برخوردار می باشد که در موج کوتاه صعودی اخیر برای بار سوم مانع ادامه روند حرکتی صعودی سهم شد و توان عبور از این مقاومت را نداشت. یه طوری که در قیمت ۲۵۰۸ ریال توسط بازار عرضه شد .

نوسانات اخیر ۳ ساله سهم در قالب الگوی کلاسیک دنبال می شود. احتمال حمایت سهم در کف الگو محدوده قیمتی ۱۹۶ تا ۲۰۰ تومان می توان انتظار برگشت قیمتی را داشت، اما این محدوده حمایتی به لحاظ شکست الگوی کنج صعودی بسیار مهم است که قیمت می تواند به سمت پایین شکسته شود.

دو خط روند داخلی بسیار معتبر در چارت لگاریتمی قابل دسترس است که نقش حمایتی خواهند داشت. محدوده اول کف الگوی کنج و حمایت خط روند داخلی بعدی محدوده ۱۸۳۱ ریال خواهد بود که با تغییر روند شیب قیمتی احتمال تغییر جزئی خواهد داشت.

۱۶۸ تومان می تواند به عنوان یک منطقه تبدیل سطح مقاومتی به حمایتی نقش ایفا نماید که کمی بعید است قیمت تا این حوالی نزول نماید .

محدوده قیمتی ۱۸۳ تا مرز روانی ۲۰۰ تومان به نظر یک خرید ایده آل در صورت رسیدن به این حوالی خواهد بود .

نمودار ۶- تحلیل تکنیکال "ولساپا"



ثروت آفرینی پدیدار کارگزاری اقتصادیار

مطالب ارائه شده صرفاً تحلیل کارشناس شرکت کارگزاری اقتصاد بیدار بوده و به هیچ عنوان توصیه به خرید و فروش و یا نگهداری سهم نمی باشد.