



گزارش روزانه بازار

۱۳۹۴/۰۶/۲۹

واحد تحلیل



بخش اول) بررسی وضعیت بورس و

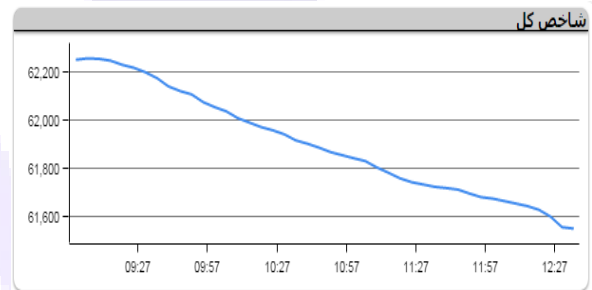
فرا بورس در یک نگاه

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران با افت 701 واحدی در پایان معاملات امروز، به رقم 61553 واحد رسید به طوری که این نماگر بورس نسبت به روز گذشته، 1.14 درصد افت داشت. همچنین شاخص کل فرا بورس نیز طی روز جاری با 2.1 واحد کاهش به رقم 682.20 واحد رسید. با توجه به آمار مربوطه، ارزش کل معاملات در بازار بورس به مبلغ 1,845.306 میلیارد ریال و حجم معاملات به میزان 508.314 میلیون سهم بوده است در مقابل ارزش کل معاملات در بازار فرا بورس نیز به مبلغ 529.783 میلیارد ریال و حجم معاملات در این بازار به میزان 124.245 میلیون سهم بوده است.

جدول ۱- وضعیت شاخص های منتخب

شاخص	آخرین مقدار	تغییر	درصد
شاخص کل بورس	61,553.20	701.49	1.14
شاخص کل فرا بورس	682.2	2.10	0.31
شاخص قیمت (هم وزن)	8,197	98.40	1.20
شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	24,165.20	275.40	1.14
شاخص ۵۰ شرکت فعالتر	2,508.50	30.50	1.22
شاخص ۳۰ شرکت بزرگ	2,634.30	39.20	1.49
شاخص صنعت	50,637.20	512.11	1.01

نمودار ۱- روند شاخص کل بورس



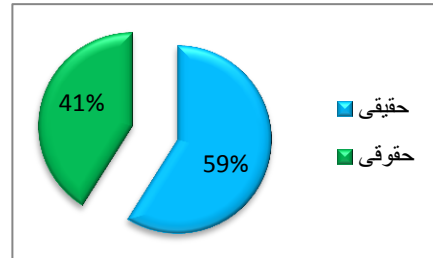
جدول ۳- تاثیر گذارترین نمادها بر شاخص کل فرا بورس

تاثیر گذارترین نمادها بر شاخص فرا بورس			
نماد	تاثیر	نماد	تاثیر
مارون	7.85	پترول	2.08
هرمز	1.09	شتران	1.84
وکوثر	0.19	میدکو	1.17

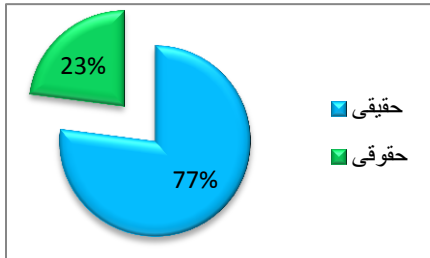
جدول ۲- تاثیر گذارترین نمادها بر شاخص کل بورس

تاثیر گذارترین نمادها بر شاخص بورس			
نماد	تاثیر	نماد	تاثیر
وکار	7.74	حکشتی	79.57
فایرا	0.77	شبندر	49.91
شستهران	0.44	وبملت	49.47
چکارن	0.42	فولاد	43.17
غمهرا	0.35	وپاسار	36.46

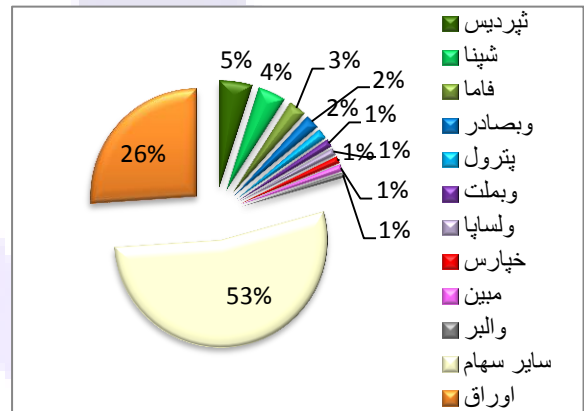
نمودار ۲- وضعیت خرید سهامداران (میلیون ریال)



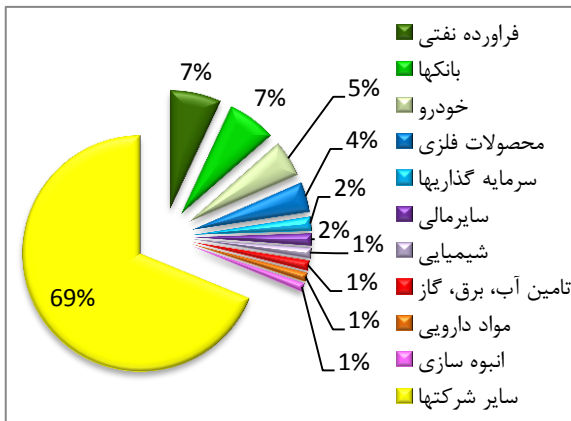
نمودار ۳- وضعیت فروش سهامداران (میلیون ریال)



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 گروه انبوه سازی، املاک و مستغلات می باشد که از این صنعت، "تپردیس" برترین نماد به لحاظ ارزش معاملاتی با ارزش 114.58 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	9,175,000	-0.05%
دلار آزاد	33,910	0.18%
دلار مبادلاتی	29,955	0.00%

جدول ۵- قیمت کالاهای جهانی به دلار

کالای پایه	قیمت امروز (\$)	درصد تغییر
طلا (انس)	1,138.30	0.72%
آلومینیوم (تن)	1,603.00	0.56%
سرب (تن)	1,675.00	-1.41%
روی (تن)	1,664.00	-2.23%
مس (تن)	5,239.00	-2.38%
نفت (برنت)	47.75	-3.14%

• در خصوص جدول ۵، با توجه به تعطیل بودن بازارهای جهانی در روزهای شنبه و یکشنبه، آمار مربوط به این جدول بر اساس اطلاعات آخرین روز معاملاتی می باشد.

بخش دوم) اخبار سیاسی و
اقتصادی

اخبار سیاسی:

- روحانی در دیدار با آمانو گفت: ما در اجرای برجام به طور داوطلبانه پروتکل الحاقی را اجرا می‌کنیم و امیدواریم شما نیز منصفانه بر اجرای توافق برجام نظارت داشته باشید.
- رئیس‌جمهور گفت: حقانیت فعالیت‌های صلح‌آمیز هسته‌ای ایران در طول سال‌های گذشته و نظارت‌ها و بازرسی‌های سرزده آژانس بین‌المللی انرژی اتمی، آن را اثبات و بر این نکته تأکید شده که ایران هرگز انحرافی از برنامه صلح‌آمیز خود نداشته است.
- جلسه کمیسیون ویژه بررسی برجام با مدیر کل آژانس بین‌المللی انرژی اتمی طی روز جاری برگزار شد. طبق آنچه سخنگوی کمیسیون ویژه بررسی برجام گفته، قرار بود در این نشست مدیر کل آژانس بین‌المللی انرژی اتمی توضیحاتی درباره برجام به نمایندگان ارائه و سپس به سؤالات نمایندگان و اعضای کمیسیون ویژه بررسی برجام پاسخ بگویند. مدیر کل آژانس بین‌المللی انرژی اتمی بنا به دعوت اعضای کمیسیون ویژه برجام و موافقت وزارت خارجه به مجلس آمده است.
- یک سناتور جمهوری خواه آمریکایی گفت، بازگرداندن تحریم‌های ایران در صورت نقض توافق هسته‌ای از سوی تهران «تقریباً غیرممکن» خواهد بود.
- در دیدار روسای گروه‌های دوستی پارلمانی ایران و ویتنام بر گسترش همکاری‌های دوستانه فیما بین در حوزه‌های گوناگون تأکید شد.

اخبار اقتصادی:

- اتاق‌های بازرگانی، تعاون و اصناف بیانیه مشترکی در خصوص اصلاح قانون مالیات‌های مستقیم منتشر کردند.
- مدیر عملیات تولید شرکت نفت فلات قاره گفت: کاهش تکلیفی ۵۰ تا ۶۰ هزار بشکه ای نفت میادین خلیج فارس، در صورت رفع تحریم‌ها، طی ۴۵ روز جبران شده و افزایش می‌یابد.
- شورای اقتصاد با حذف عوارض صادراتی سنگ آهن کنسانتره تا پایان سال جاری موافقت کرد.
- روسای سازمان توسعه تجارت ایران و ژاپن در نظر دارند در راستای گسترش روابط تجاری و اقتصادی مه‌ماه سال جاری در تهران با یکدیگر دیدار و گفت‌وگو کنند.

- آفریقای جنوبی که تا پیش از اعمال تحریم ها، بزرگترین خریدار آفریقایی نفت ایران بود، در نظر دارد بلافاصله پس از رفع تحریم ها، خرید نفت از ایران را آغاز کند و در این راستا، قرار است یک هیات از این کشور در اواخر مهرماه به تهران سفر کرده و درباره جزییات از سرگیری خرید نفت مذاکره کند.
- رئیس سازمان توسعه تجارت با بیان این که در حال حاضر به دلیل مشکل تورم تقاضای داخلی را نمی توان تحریک کرد گفت: بهترین راه خروج رکود ایجاد تقاضای خارجی برای کالاهای خودمان است.
- سخنگوی کمیسیون ویژه حمایت از تولید ملی و اصل ۴۴ مجلس درباره سرمایه گذاری خارجی در بورس ایران اظهار نظر کرد . اسماعیل جلیلی در خصوص سرمایه گذاری خارجی در بورس ایران به خانه ملت گفت: حضور سرمایه گذاران خارجی در بورس تهران می تواند یک اقدام مناسب باشد که به تقویت بازار سرمایه کشور منتهی می شود.وی ادامه داد: تامین امنیت سرمایه گذاری و ثبات اقتصادی از لازمه های جذب سرمایه گذار خارجی است که باید این موضوع در دستور کار مسئولان قرار گیرد.
- اولین گروه از ۳۱ هزار و ۴۶۳ سهامدار سرمایه گذاری مسکن پردیس بعد از کسب ۱۰ سود ناخالص خارج شدند و در ۵ دقیقه نخست معاملات امروز اقدام به فروش بیش از ۶ میلیون سهم کردند.
- با تصمیم جدید بانک مرکزی آمریکا، وضعیت بانک های این کشور و بازار سهام سخت تر و با کاهش ۶ درصدی سود بزرگترین بانک آمریکا همراه شده است. بانک مرکزی آمریکا طی چند روز گذشته تشکیل جلسه داد و نرخ سود بانکی را برای چند ماه آینده ثابت نگه داشت.

**بخش سوم) بررسی روند گروه ها
در بازار**

گروه محصولات شیمیایی:

تمامی نمادهای این گروه به جز "مارون" و "شسینا" با افت قیمت در دقایق ابتدایی روز جاری مواجه شدند. افزون بر این برخی نمادهای این گروه نیز همانند روند سایر نمادها در روز جاری، با صف فروش روبرو شدند. شایان ذکر است "شسینا" مطابق روال روزهای گذشته طی دقایق ابتدایی با صف خرید همراه شد. اگرچه معاملات در این نماد در اولین دقایق بسیار کم حجم بود.

با تداوم بازار، همچنان تمامی نمادهای این گروه به جز "مارون" و "شسینا" با کاهش قیمت پایانی روبرو شدند. افزون بر این برخی نمادهای این گروه با صف فروش بسته شدند. اگرچه در مقابل "شسینا" صف خرید خود را حفظ کرد و به استقبال فردا رفت. افزون بر این "مارون" نیز بیشترین رشد قیمت پایانی را طی روز جاری در این گروه داشت.

"پارسان" نیز طی روز جاری با روند نزولی قیمت همراه بود به طوری که با افت قیمت پایانی به میزان **1.37%** بسته شد. "فارس" نیز طی دقایق ابتدایی با افت قیمت روبرو شد اما با تداوم بازار حرکت صعودی را آغاز کرد. اگرچه در نهایت شاهد افت **0.37%** در قیمت پایانی این سهم بودیم.

"پترول" با معامله 25.479 میلیون سهم پر حجم ترین نماد این گروه محسوب می شود.

"مارون" و در مقابل "پترول" به ترتیب بیشترین تاثیر مثبت و منفی را بر شاخص فرا بورس طی روز جاری داشتند. از جمله اخبار تاثیر گذار بر این گروه می توان به موارد زیر اشاره کرد:

○ دبیر انجمن پتروشیمی با اعلام آخرین رویدادها و مواضع درباره نرخ خوراک پتروشیمی از دریافت صورت حساب 13 سنتی شرکت های پتروشیمی و پیگیری موضوع در ریاست جمهوری خبر داد. مهدوی با بیان اینکه صنعت پتروشیمی متأسفانه فاقد برنامه و استراتژی بوده و مسولان قبلی و جدید اعتقادات متفاوتی دارند، خاطر نشان کرد: در حالی نرخ خوراک 13 سنتی مربوط به قانون بودجه سال 93 است که این قانون برای سال جاری تنفیذ نشده اما در سال جاری صورت هایی که به شرکت ها ارسال می شود با نرخ 13 سنتی بوده و شرکت ها هم آن را به دلیل نبود مستندات در عدم پرداخت، علی الحساب پرداخت کرده اند تا بعد از نهایی شدن قیمت ها از طریق تهاجر یا برگشت یا لحاظ کردن در آینده محاسبه شود. وی ادامه داد: اگر قانون به درستی اجرا شود، همه برنامه های صنعت برای پسا تحریم عملیاتی می شود اما واقعیت این است صنعت پتروشیمی آنقدر که از مسائل داخلی رنج دید از مقوله تحریم ها آسیب ندید. چرا که عامل مهم و اصلی عدم رونق در فضای کسب و کار، تصمیمات عجولانه و آنی و عدم ثبات و امنیت اقتصادی است که موجب وضعیت سخت و پیچیده

صنعت پتروشیمی شده است. این مقام مسئول افزود: با این همه حوزه ریاست جمهوری و شخص آقای ویسه پیگیر این موضوع هستند. علاوه بر این گروه مشورتی معاون اول رئیس جمهور هم توصیه کرده قیمت گذاری خوراک پتروشیمی باید هر چه زودتر نهایی و تعیین تکلیف شود.

- دبیر انجمن کارفرمایی پتروشیمی گفت: 7 ماه است که مجلس قانون خوبی در قالب تنظیم مقررات مالی دولت وضع کرده و شش ماه برای تعیین آیین نامه آن مهلت داده است، اما آیین نامه ای بیرون آمده که اصل موضوع یعنی تعیین نرخ خوراک در آن وجود ندارد. وی اظهار داشت: سرمایه گذار داخلی و خارجی سرگردان است و خواهش ما از دولت محترم که با شعار تدبیر جلو آمده آن است که بعد از 2 سال در کشور همه سرگردان نباشند. وی تصریح کرد: ما حتی حاضریم به عنوان بخش خصوصی پتروشیمی در قالب یک کنسرسیوم برای توسعه فازهای پارس جنوبی سرمایه گذاری کنیم و البته یک شریک خارجی با درصد مشارکت پایین را هم می آوریم تا از فاینانس آنها بهره مند شویم.
- دبیرکل انجمن صنفی کارفرمایان صنعت پتروشیمی با اشاره به سهم 33.8 درصدی محصولات پتروشیمی در سبد صادرات غیرنفتی کشور، گفت: سرمایه گذاران صنعت پتروشیمی در دو سال اخیر به دلیل روشن نشدن نرخ خوراک سرگردان شده اند.

گروه بانکی:

تمامی نمادهای این گروه به جز "وکوثر" و "وکار" به تبعیت از کل بازار با افت قیمت طی دقایق ابتدایی مواجه شدند. گفتنی است "وخاور" نیز در دقایق میانی بازار، با صف فروش همراه شد. همچنان با تداوم بازار، در تمامی نمادهای این گروه شاهد افت قیمت پایانی بودیم اگرچه دو نماد "وکار" و "وکوثر" از این امر مستثنی بودند. گفتنی است "وخاور" و "وانصار" دو نمادی بودند که با صف فروش بسته شدند. "وبصادر" با معامله 59.067 میلیون سهم پر حجم ترین نماد این گروه محسوب می شود. "وکار" بیشترین تاثیر مثبت را بر شاخص بورس طی روز جاری داشت و در مقابل "وبملت" و "وپاسار" بیشترین تاثیر منفی را بر نماگر بورس طی روز جاری گذاشتند. همچنین "وکوثر" بیشترین تاثیر مثبت را بر شاخص فرا بورس طی روز جاری داشت.

از جمله اخبار تاثیر گذار بر این گروه می توان به موارد زیر اشاره کرد:

- رئیس کانون بانکهای خصوصی از دستور جدید معاون اول رئیس جمهور به "نوبخت، سیف، طیب نیا و نیلی" برای گنجاندن پیشنهاد این کانون در لایحه اصلاح نظام بانکی خبر داد و گفت: بانک پارسیمان دخالتی در خرید و فروش ارز نداشته است.

- زمان مجمع عادی بطور فوق العاده بانک سرمایه مشخص شد تا طی آن در مورد تصویب صورت های مالی اسفند 93 و سایر موارد تصمیم گیری شود. ، این بانک 400 میلیارد تومانی زمان مجمع عادی بطور فوق العاده را ساعت 9 صبح روز چهارشنبه 8 مهر تعیین کرده است.
- رییس اتاق بازرگانی صنایع معادن و کشاورزی ایران گفت: میزان بدهی دولت به نظام بانکی تا پایان سال گذشته به رقم 100 هزار میلیارد تومان رسیده درحالی که مهمترین مشکل واحدهای تولیدی تامین سرمایه در گردش است.

◀ تحلیل تکنیکال "فاراک":

همانطور که مشاهده می کنید ، نوسانات قیمتی سهم در یک روند صعودی کانالیزه شده و این روند بلند مدت صعودی شامل دو پروسه صعودی و اصلاحی بوده ، به طوری که روند اصلاحی سهم تقریباً به صورت خنثی پیگیری شده است. در چارت ۷ ساله شرکت شاهد ۲ روند صعودی شارپ و دو روند اصلاحی هستیم که نوسانات اخیر روند اصلاحی دوم محسوب می شود .

سهم تقریباً ترند پذیر بوده و دقیقاً به حمایت ها و مقاومت ها واکنش مناسبی داده است. اگر توجه نمایید یک خط روند داخلی معتبر در روند سهم نقش ایفا می نماید که در حال حاضر شاهد شکسته شدن و حتی پولبک لازم نیز هستیم و عملاً پروسه اصلاحی دوم شروع شده است.

♣ مهمترین حمایت و نقطه ایده آل برای خرید سهم که می توان به آن فکر کرد محدوده ۲۱۰ تومان ، حمایت معتبر خط روند صعودی ، با توجه به شیب حرکتی قیمتی خواهد بود ، اما یک حمایت خیلی جزئی حوالی ۲۳۲ تومان است که باید میزان تقاضا در این محدوده بررسی شود .

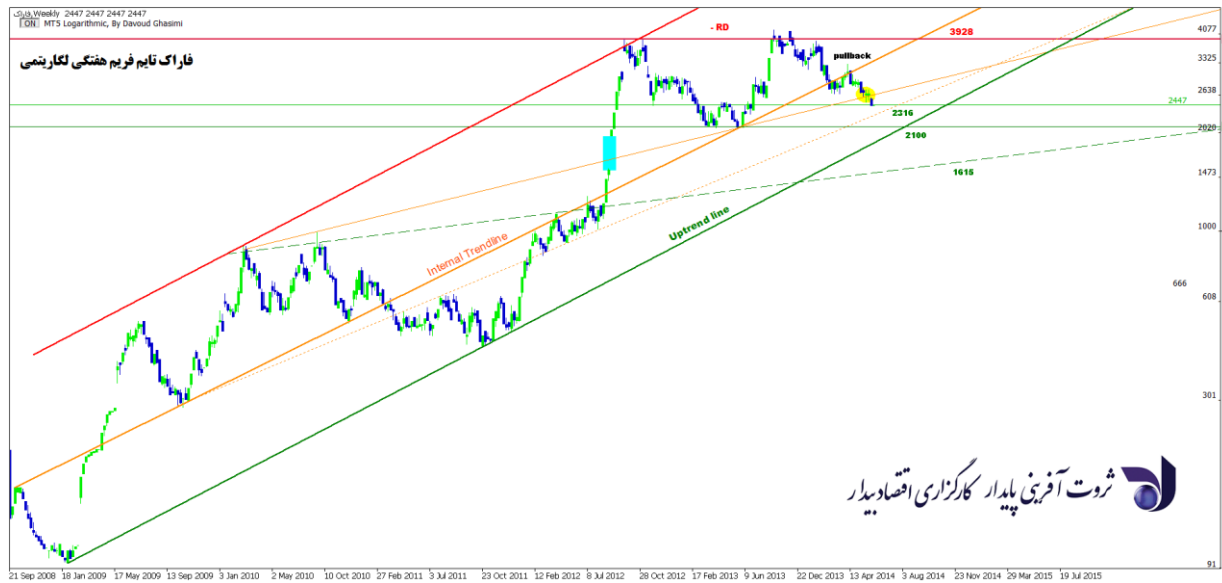
در صورتی که خط روند صعودی توان حمایت از سهم را نداشته باشد محدوده ۱۶۱ تومان به عنوان آخرین منطقه حمایتی سهم خواهد بود که در نقش تبدیل سطح مقاومتی به حمایتی نقش خود را ایفا خواهد نمود .

♣ مهمترین مقاومت های پیش روی فعلی :

خط روند داخلی به عنوان مقاومت

سقف قیمتی تاریخی روی ۳۹۲۸ ریال به عنوان مقاومت های مهم پیش روی سهم خواهد بود .

نمودار ۶- تحلیل تکنیکال "فاراک"



ثروت آفرینی پایدار کارگزاری اقتصادیدار

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.