

سود دم غروب

(گزارش تحلیلی کارگزاری خبرگان سهام)

شماره: ۱۰

تهیه کننده: واحد تحلیل و
مشاوره سرمایه گذاری
1403/09/03

کارگزاری خبرگان سهام

آنچه در بازار امروز رقم خورد:

- امروز بازار تقریباً پر عرضه ای را شاهد بودیم. در بازار پرحرضه و تقریباً قرمز امروز اما تعداد نماد هایی که قدرت خرید بالایی داشتند کم نبود که این موضوع نکته مثبت و امیدوار کننده ای است و می تواند مانع خروج نقدینگی از بازار شود.
- امروز ارزش معاملات حدود ۱۰ همت بود و ارزش صفوف خرید و فروش تقریباً ۱ همت و این یعنی همانند روز های گذشته معاملات انجام شده (۱۰ همت هم روز چهارشنبه معامله شد) و فقط نکته ی منفی بازار امروز کاهش ارزش صفوف خرید و افزایش در ارزش صفوف فروش بوده است.
- در روز های آینده اگر ارزش صفوف فروش به بیش از ۳ همت برسد این یعنی بازار برای چند روزی نیاز به استراحت دارد.
- بنظر می رسد در روز های آینده نماد های کوچک و بنیادی بازار بیشتر از بزرگان مورد توجه باشند و فعالان حرفه ای بازار کمی از نوسانات بالای نماد های تاثیر گذار فاصله بگیرند.
- برای فردا بازار پرنوسان و پرحرضه ای را باید انتظار داشت.

گزیده ای از اخبار روز:

- رئیس سازمان بورس: شیوهنامه توکن سازی تهیه شده که به زودی منتشر می شود و در حال حاضر مراحل آن در کمیته فقهی سازمان بورس گذرانده شده است.
- صیدی، رئیس سازمان بورس در رویداد ملی رمزآتی: اوراق بهادار سازی ارز دیجیتال به عنوان ردیف دارایی باید انجام شود.
- رأی نمایندگان به متناسب سازی حقوق بازنشستگان لشکری و کشوری
- نرخ سود بین بانکی برای سومین هفته متوالی (۲۳.۷۹) بدون تغییر ماند.
- نظر به اختیارات و وظایف قانونی بانک مرکزی در تنظیم گری حوزه رمپول ها (توکن های معاملاتی)، سند پیشنهادی بانک مرکزی با عنوان «چارچوب سیاست گذاری و تنظیم گری بانک مرکزی در حوزه رمپول ها» در جلسه سیزدهم آذرماه ۱۴۰۳ هیئت عالی بانک مرکزی، با موافقت تمامی اعضا به تصویب رسید.
- نرخ دلار در سامانه نیما امروز با افزایش قیمت ۳۰۰ تومانی به ۵۳,۱۳۹ تومان رسید.

تحلیل بنیادی روز: بررسی NAV شرکت سرمایه گذاری تامین اجتماعی

شرکت سرمایه گذاری تامین اجتماعی (شستا) بعنوان یک مجموعه تخصصی در امر سرمایه گذاری در تاریخ ۱۳۶۵/۰۱/۰۶ بصورت یک شرکت سهامی خاص با سرمایه اولیه ۲۰ میلیارد ریال تأسیس گردید. هدف اصلی شستا مدیریت کارآمد منابع مالی تخصیص یافته با رویکرد سودآوری و ارزش افزوده حداکثری در بازارهای سرمایه داخلی و خارجی از طریق فعالیت های تولید هدف اصلی شستا مدیریت کارآمد منابع مالی تخصیص یافته با رویکرد سودآوری و ارزش افزوده حداکثری در بازارهای سرمایه داخلی و خارجی از طریق فعالیت های تولیدی، خدماتی و بازرگانی می باشد. امروز پس از گذشت بیش از ۳ دهه فعالیت مستمر ، شستا به یکی از شرکت های بزرگ اقتصادی در سطح خاورمیانه تبدیل شده است با تدوین چشم انداز و افق های آرمانی خود و برنامه ریزی استراتژیک می رود تا در آینده ای نه چندان دور به یک بنگاه اقتصادی تراز اول در سطح جهانی تبدیل شود.

دارایی بورسی

ارقام به میلیون ریال

دارایی	نماد	سرمایه	ارزش اسمی هر سهم	تعداد سهام	بهای تمام شده (میلیون ریال)	مالکیت	بهای تمام شده هر سهم	ارزش روز هر سهم	ارزش روز پرتفو	درصد از پرتفو	افزایش (کاهش)
س. نفت و گاز و پتروشیمی تامین	تاپیکو	۱۰۱,۵۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۷۱,۱۵۳,۳۸۶,۱۲۰	۸۲۳,۱۲۰,۹۹۵	۰.۷۰	۱۱,۵۶۸	۱۶,۹۰۰	۱,۲۰۲,۴۹۲,۲۲۵	۰.۵۳	۳۷۹,۳۷۱,۲۳۰
سرمایه گذاری صدرتامین	تاصیکو	۶۷,۵۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۲۱,۷۴۶,۳۹۱,۰۰۰	۱۲۳,۸۴۷,۳۹۱	۰.۳۲	۵,۶۹۵	۱۰,۵۲۰	۲۲۸,۷۷۲,۰۳۳	۰.۱۰	۱۰۴,۹۲۴,۶۴۲
گروه مالی صبا تامین	صبا	۱۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۹۷,۷۸۰,۱۸۸,۳۹۳	۳۴۸,۱۸۳,۵۹۸	۰.۸۵	۳,۵۶۱	۳,۳۰۶	۳۲۳,۲۶۱,۳۰۳	۰.۱۴	-۲۴,۹۲۲,۲۹۵
سرمایه گذاری دارویی تامین	تیپیکو	۱۱,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۳,۸۶۷,۶۷۱,۳۱۲	۷۴,۵۱۸,۴۲۵	۰.۳۵	۱۹,۲۶۷	۲۳,۷۸۰	۹۱,۹۷۳,۲۲۴	۰.۰۴	۱۷,۴۵۴,۷۹۹
کشتیرانی جمهوری اسلامی ایران	حکشتی	۸۲,۵۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۲۰,۳۰۵,۴۳۱,۲۹۱	۴۰,۴۸۵,۷۹۸	۰.۲۵	۱,۹۹۴	۱۰,۰۳۰	۲۰۳,۶۶۳,۴۷۶	۰.۰۹	۱۶۳,۱۷۷,۶۷۸
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱,۸۲۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۹۹۹	۰	۰.۰۰	۰	۳۹,۲۱۰	۳۹	۰.۰۰	۳۹
فولاد مبارکه اصفهان	فولاد	۱,۰۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۳۹,۲۹۵,۶۷۹	۱۰۹,۷۶۳	۰.۰۰	۲,۷۹۳	۵,۱۸۰	۲۰۳,۵۵۲	۰.۰۰	۹۳,۷۸۹
سرمایه گذاری سیمان تامین	سیتا	۲۲,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱۹,۶۸۵,۳۳۱,۵۴۴	۱۰۴,۶۰۶,۵۳۰	۰.۸۹	۵,۳۱۴	۱۱,۷۷۰	۲۳۱,۶۹۶,۳۵۲	۰.۱۰	۱۲۷,۰۸۹,۸۲۲
سیمان فارس و خوزستان	سفارس	۵,۶۲۵,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱	۰.۰۰	۱,۰۰۰	۴۵,۴۶۰	۴۵	۰.۰۰	۴۴
لوازم خانگی پارس	لخانه	۹۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱,۴۹۳	۶	۰.۰۰	۴,۰۱۹	۹,۵۰۰	۱۴	۰.۰۰	۸
سولیران	فسلیر	۱۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱	۰.۰۰	۱,۰۰۰	۲۶,۵۷۱	۲۷	۰.۰۰	۲۶
									۰	۰.۰۰	۰
جمع					۱,۵۱۴,۸۷۲,۵۰۸				۲,۲۸۲,۰۶۲,۲۹۰	۱.۰۰	۷۶۷,۱۸۹,۷۸۲

ارقام به میلیون ریال

دارایی	سرمایه	ارزش اسمی هر سهم	تعداد سهام	بهای تمام شده (میلیون ریال)	مالکیت	بهای تمام شده هر سهم	ارزش روز هر سهم	ارزش روز پرتفو	درصد از پرتفوی	افزایش (کاهش)
ملی نفتکش ایران	۸,۳۶۵,۰۰۰	۱,۰۰۰	۲,۵۰۹,۵۰۰,۰۰۰	۱,۴۱۶,۵۹۵	۰.۳۰	۵۶۴	۱۷,۹۳۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۲۳	۱۴۸,۵۸۳,۴۰۵
انتشارات علمی و فرهنگی	۲۵۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱۲۲,۴۹۹,۸۵۰	۳۷۴,۰۵۳	۰.۴۹	۳,۰۵۳	۱,۴۹۶	۳۷۴,۰۵۳	۰.۰۰	۰
شرکت سنگ آهن مرکزی ایران	۵,۳۷۵,۳۰۶	۱۰,۰۰۰	۴۹,۶۹۱,۴۱۰	۶,۲۴۳,۰۵۸	۰.۰۰	۱۲۵,۶۳۷	۲,۰۹۳	۱۱,۲۵۰,۰۰۰	۰.۰۲	۵,۰۰۶,۹۴۲
صنایع کاغذسازی قائمشهر	۶,۹۰۰	۱,۰۰۰	۶۱,۴۱۰	۴,۷۷۳	۰.۰۱	۷۷,۷۲۳	۶۹۲	۴,۷۷۳	۰.۰۰	۰
مدیریت توسعه انرژی تامین	۱۱,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۹,۸۹۹,۹۹۹,۷۰۰	۱۰۸,۱۷۲,۴۸۰	۰.۹۰	۱۰,۹۲۷	۲۰,۴۵۵	۲۲۵,۰۰۰,۰۰۰	۰.۳۵	۱۱۶,۸۲۷,۵۲۰
خدمات ارتباطی رایتل	۴۶,۷۵۵,۲۳۰	۱۰,۰۰۰	۴,۶۷۵,۵۱۱,۰۵۱	۱۳۰,۶۹۲,۲۶۵	۰.۰۱	۲۷,۹۵۳	۳,۲۰۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۲۳	۱۹,۳۰۷,۷۳۵
مجتمع صنعتی لاستیک ارگ کرمان	۱۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۲,۴۰۰,۰۰۰	۲۴,۰۰۰	۰.۰۰	۱۰,۰۰۰	۲۴۰	۲۴,۰۰۰	۰.۰۰	۰
سرمایه گذاری صنایع عمومی تامین	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۱۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۱,۴۷۱,۲۰۰	۱.۰۰	۵,۴۳۱	۶,۰۰۰	۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۱۴	۸,۵۲۸,۸۰۰
سایر شرکت های خارج از بورس	۰	۰	۲	۱۵,۳۰۸,۶۳۶	۰.۰۰	۰	۰	۱۵,۳۰۸,۶۳۶	۰.۰۲	۰
جمع				۳۴۳,۷۰۷,۰۶۰				۶۴۱,۹۶۱,۴۶۲		۲۹۸,۲۵۴,۴۰۲

مقدار تولیدات شرکت نسبت به مدت مشابه سال قبل رشد ۷ درصدی داشته است، از طرفی شرکت از لحاظ مبلغ فروش تجمعی نسبت به مدت مشابه سال قبل با رشد ۲۰ درصدی وارد آذرماه شده است.

بررسی اخبار و رویدادهای مهم بازار سرمایه ایران

خالص ارزش دارایی ها

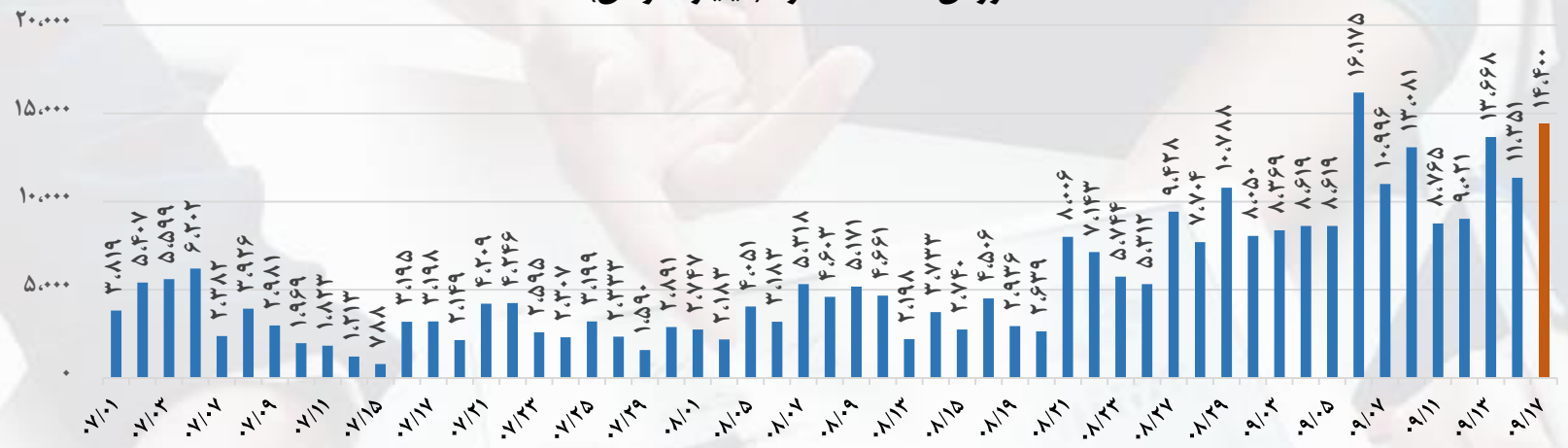
ارقام به میلیون ریال

شرح	بورسی (میلیون ریال)	غیر بورسی (میلیون ریال)	جمع
ارزش جاری	۲,۲۸۲,۰۶۲,۲۹۰	۶۴۱,۹۶۱,۴۶۲	۲,۹۲۴,۰۲۳,۷۵۲
بهای تمام شده	۱,۵۱۴,۸۷۲,۵۰۸	۳۴۳,۷۰۷,۰۶۰	۱,۸۵۸,۵۷۹,۵۶۸
ارزش افزوده	۷۶۷,۱۸۹,۷۸۲	۲۹۸,۲۵۴,۴۰۲	۱,۰۶۵,۴۴۴,۱۸۴
حقوق صاحبان سهام			۲,۰۵۹,۶۱۴,۴۹۲
ذخیره کاهش ارزش			-
خالص ارزش دارایی ها			۳,۱۲۵,۰۵۸,۶۷۶
سرمایه			۱,۶۳۶,۰۱۳,۴۵۷
NAV			۱,۹۱۰
قیمت بازار			۱,۲۹۶
قیمت بازار به NAV			۶۸٪

با توجه به قیمت سهم (۱۲۹۶ریال)، NAV این سهم ۱.۹۱۰ ریال می باشد. P/NAV سهم حدود ۶۸ درصد است.

بررسی اخبار و رویدادهای مهم بازار سرمایه ایران

ارزش معاملات خرد (میلیارد تومان)



شاخص کل: ۲,۴۶۸,۷۵۷

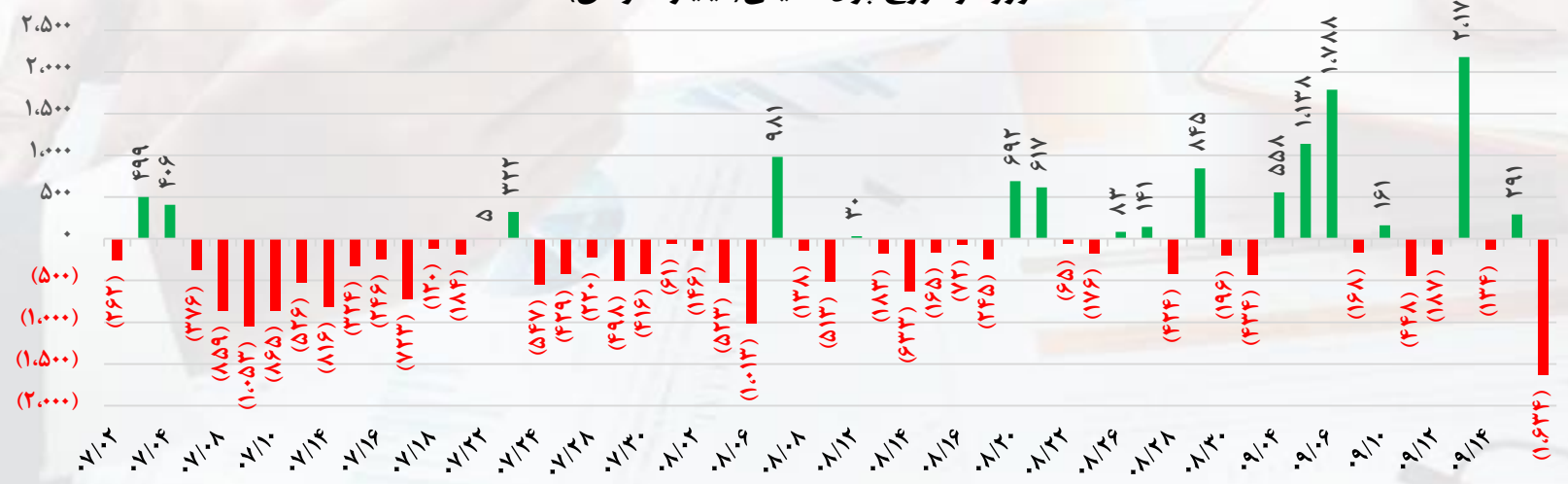
معاملات خرد سهام: ۱۴۴,۰۰۰ میلیارد ریال

تراز پول حقیقی در سهام منفی ۱۶,۳۴۰

درآمدنابتهای منفی ۱۱,۳۷۳ میلیارد ریال

سرانه خرید و فروش حقیقی: ۶۲۶ در مقابل ۷۰۳

ورود و خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)



بررسی اخبار و رویدادهای مهم بازار سرمایه ایران



خودرو

با رسیدن قیمت خودرو به محدوده مقاومت کانال فیبوناچی در قیمت ۳۶۰ تومان ، شاهد اصلاح قیمت در این محدوده می باشیم.
 انتظار می رود این اصلاح حداکثر تا محدوده ۳۱۵-۳۲۰ تومان انجام شده و بعد از اتمام اصلاح زمانی که انتظار می رود حداقل تا اوایل دی ماه طول بکشد این سهم آماده
 رشد تا محدوده ۴۲۰ تومان در گام اول و سپس تا ۵۵۰ تومان در گام دوم گردد.