کارگزاری بانک ملت
bank mellat brokerage co.



هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

هفته پنجاهم منتهی به ۱۸ اسفند ۱۴۰۲

فهرست مطالب

- مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر ۳
- بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر ۵
- شاخص کل ۶
- ارزش معاملات خرد سهام ۷
- روند P/E-ttm بازار ۸
- ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم ۹
- ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت ۱۰
- روند نرخ بهره بین بانکی ۱۱
- ترین‌های بازار در هفته اخیر ۱۲
- اخبار بورس کالا در هفته اخیر ۱۴
- وضعیت سایر بازارها ۱۶
- تقویم اقتصادی ۱۷
- تحلیل تکنیکال شاخص‌های بازار ۱۸

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر

- **زمان چهارمین حراج ربع سکه با امکان ثبت سفارش حداکثر ۵ قطعه برای هر فرد اعلام شد:**



مرکز مبادله ارز و طلا، اعلام کرد: چهارمین جلسه حراج سکه طلا طبق شیوه نامه برگزاری حراج سکه طلا، یکشنبه ۲۰ اسفند برگزار خواهد شد. براساس این گزارش، حراج از طریق سامانه معاملات market.ice.ir بوده و دارایی موضوع سومین حراج، ربع سکه بهار آزادی ضرب سال ۱۳۸۶ بانک مرکزی و بدون بسته بندی است. هر متقاضی مجاز به ثبت سفارش حداکثر ۵ قطعه است. شروع جلسه حراج ساعت ۱۲ است و بازه ثبت سفارش نیز از ساعت ۱۲ الی ۱۵ خواهد بود. بازه نظارت و تخصیص نیز از ساعت ۱۵ تا ۱۶ همان روز است و ساعت ۱۶ نیز نتایج حراج اعلام می‌شود. متقاضیان شرکت در حراج‌های سکه طلای سامانه معاملات مرکز مبادله ایران، می‌توانند طی ۷ روز هفته و ۲۴ ساعت شبانه روز اقدام به ثبت نام و احراز هویت کنند.

- **آمار ۱۱ ماهه حجم و ارزش صادرات زنجیره فولاد با رشد ۶۸ و ۲۰ درصدی اعلام شد:**



انجمن تولیدکنندگان فولاد، حجم و ارزش صادرات ۱۱ ماهه زنجیره فولاد به ۲۷ میلیون تن و ۱.۲ میلیارد دلار رسید که نسبت به مدت مشابه سال گذشته با رشد ۶۸ و ۲۰ درصدی روبرو شد. همچنین افزایش ۷.۴ درصدی حجم صادرات فولاد میانی به دلیل رشد ۳۰ درصدی حجم صادرات اسلب ثبت شد. علاوه بر این افزایش ۵.۸ درصدی حجم صادرات میلگرد همزمان با افت ۵ درصدی ارزش صادراتی آن (کاهش ۷۰ میلیون دلاری ارزش صادرات میلگرد) و رشد ۸۰۰ درصدی (۹ برابر شدن) حجم صادرات کنسانتره سنگ آهن رقم خورد.

- **نرخ سود بازار بین بانکی با کاهش جزئی به ۲۳.۵۷ درصد رسید:**



بانک مرکزی اعلام کرد: نرخ سود بازار بین بانکی با کاهش ۰.۰۱ درصدی نسبت به آخرین نرخ هفتگی به ۲۳.۵۷ درصد رسید اما نرخ ریپو همچون هفته‌های اخیر بدون تغییر ۲۳ درصد باقی ماند.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر

- **نتیجه عرضه خودرو در بورس کالا در تاریخ ۱۵ اسفند با فروش ۲۰ کامیون و رقابت ۵.۶ درصدی اعلام شد:**



طبق اعلام قبلی، قرار بود ۱۵ اسفند ۲۰ دستگاه کامیون کشنده فوتون H۵ متعلق به ایران خودرو دیزل با موعد تحویل اول اردیبهشت در بورس کالا عرضه شود. میزان پیش دریافت خرید ۱۰ درصد تعیین شده بود و هر کد ملی صرفاً امکان ثبت سفارش یک دستگاه خودرو و هر شناسه ملی امکان ثبت سفارش حداکثر سه دستگاه خودرو را داشت. با عرضه ۲۰ دستگاه کامیون کشنده فوتون H۵ به قیمت پایه ۴.۱۰۸ میلیارد تومان و ثبت تقاضای ۶۳ دستگاهی، محصول با قیمت ۴.۳۴۰ میلیارد تومان و رقابت ۵.۶ درصدی معامله شد. قیمت نهایی این کامیون علاوه بر قیمت کشف شده، ۹ درصد مالیات بر ارزش افزوده و ۸۰.۷ میلیون تومان هزینه‌های جانبی شامل بیمه، پلاک، شماره‌گذاری و ... است.

- **مهلت دریافت سهام ۱.۵ میلیون تومانی نوزادان متولد ۱۴۰۱ تا پایان اسفند اعلام شد:**



وزیر اقتصاد در حاشیه جلسه هیات دولت با بیان اینکه فرآیند واریز منابع لازم برای خرید سهام متولدین سال ۱۴۰۱ از سمت سازمان و برنامه و بودجه و سازمان بورس کاملا آماده است، گفت: از والدین نوزادان ۱۴۰۱ درخواست می شود حداکثر تا پایان اسفند به پنجره ملی خدمات دولت الکترونیک مراجعه و ثبت نام کنند. وی افزود: متولدین سال جاری از سال ۱۴۰۳ ثبت نام خواهند شد. به محض ثبت نام مراحل به شکل خودکار و الکترونیکی برای تخصیص بندهای لازم جهت واریز ۱.۵ میلیون تومان سهام برای نوزادان ۱۴۰۱ انجام خواهد شد.

- **مبادله ۸۸ میلیارد دلاری ایران با ۱۰ شریک تجاری اعلام شد:**



طبق آمار منتشر شده از گمرک، از مجموع تجارت خارجی کشور در ۱۱ ماهه سال جاری ۱۳۶ میلیون تن کالا به ارزش ۸۸ میلیارد دلار با ۱۰ شریک تجاری ایران بوده است. چین، امارات، ترکیه، عراق، هند، پاکستان، روسیه، عمان، آلمان و افغانستان به عنوان مهمترین شرکای تجاری ایران محسوب می شوند که ۸۴ درصد از ارزش کل مبادلات را تشکیل می‌دهند و ۱۶ درصد دیگر نیز مربوط سایر کشورها است؛ در این بین ۶ شریک تجاری ایران یعنی چین، افغانستان، روسیه،امارات، پاکستان وعمان در ۱۱ ماهه امسال به لحاظ وزن و حجم افزایش مبادلات را با ایران داشته اند. بیشترین افزایش مبادلات با کشور روسیه در این بازه زمانی رقم خورده که به لحاظ وزن ۵۴درصد و به از نظر ارزش ۲۴درصد افزایش داشته است.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

شرح وقایع

شاخص کل بورس در پایان هفته اخیر، بر ارتفاع ۲،۱۶۵،۷۵۲ واحد قرار گرفت و رشد هفتگی ۵.۴ درصدی را ثبت کرد همچنین شاخص کل هم‌وزن رشد ۳.۴ درصدی داشت و بر ارتفاع ۷۳۸،۶۴۱ واحد ایستاد. ارزش معاملات خرد رشد حدود ۱۳۶ درصدی داشت و حدود ۲۷،۲۵۹ میلیارد تومان ثبت شد. میانگین ارزش معلات خرد سهام و حق تقدم با رشد ۸۹ درصدی از ۲،۸۹۱ میلیارد تومان به ۵،۴۵۲ میلیارد تومان رسید. میانگین ارزش معاملات خرد از ابتدای سال تاکنون ۶،۲۸۱ میلیارد تومان بوده است. در هفته گذشته، با رشد ارزش معاملات، شاهد رشد شاخص‌های کل و هم‌وزن و سهم‌های بزرگ بودیم که در رأس این امر، نمادهای خودرویی قرار داشتند. همچنین دلار نیما نیز به کانال ۴۰ هزارتومان راه یافت. رشد بازارهای موازی همچون طلا و رمز ارز نیز از اتفاقات مهم هفته گذشته بود. در این هفته، بیشترین بازدهی را در بین صنایع فعال در بازار، گروه‌های "فرآورده‌های نفتی"، "خودرو و قطعات" و " فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط" همچنین بیشترین بازدهی در بین نمادهای فعال در بازار نیز به ترتیب به "پارسیان"، "وبانک" و "وپارس" اختصاص داشت.

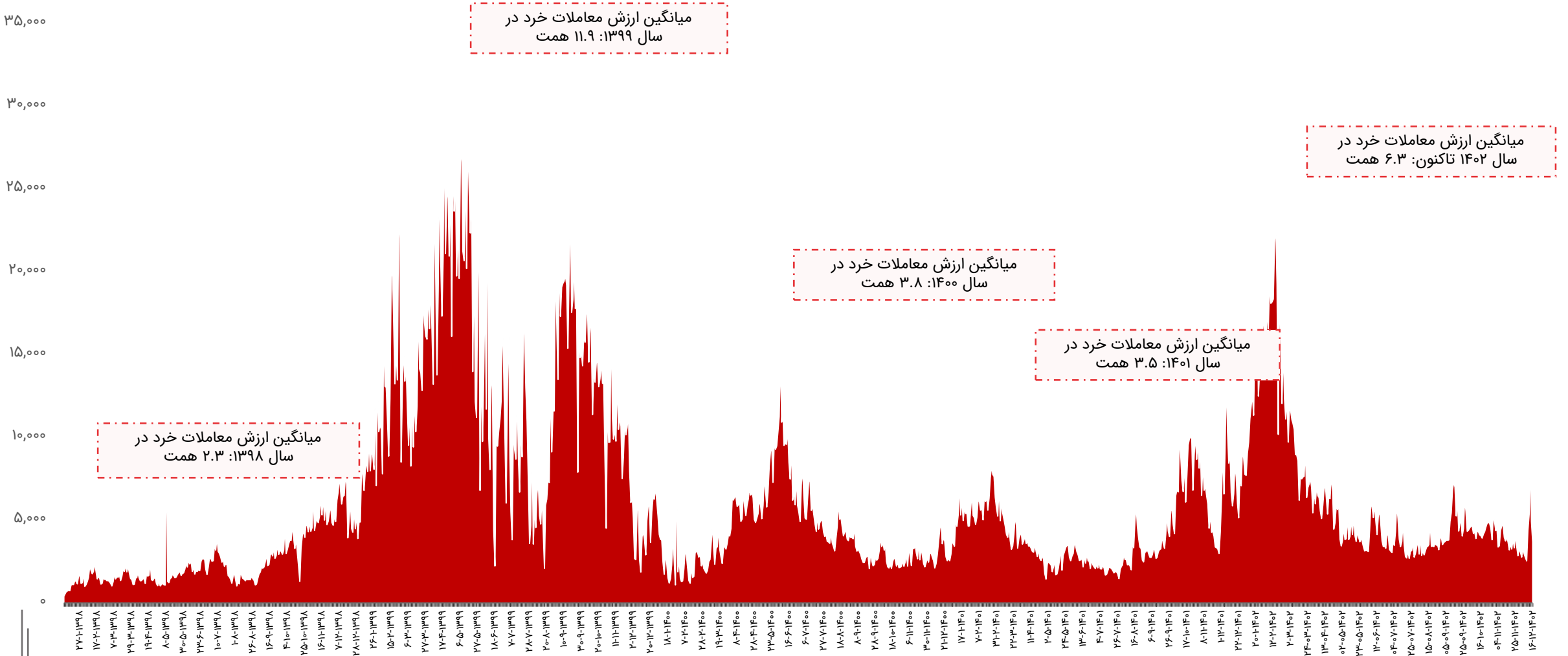
تغییرات هفتگی شاخص ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۲،۰۵۴،۸۲۷	۲،۱۶۵،۷۵۲	۱۱۰،۹۲۵	۵.۴%
شاخص هم وزن (واحد)	۷۱۴،۱۷۳	۷۳۸،۶۴۱	۲۴،۴۶۸	۳.۴%
ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم (میلیارد تومان)		۲۷،۲۵۹	۱۵،۶۹۶	۱۳۶%

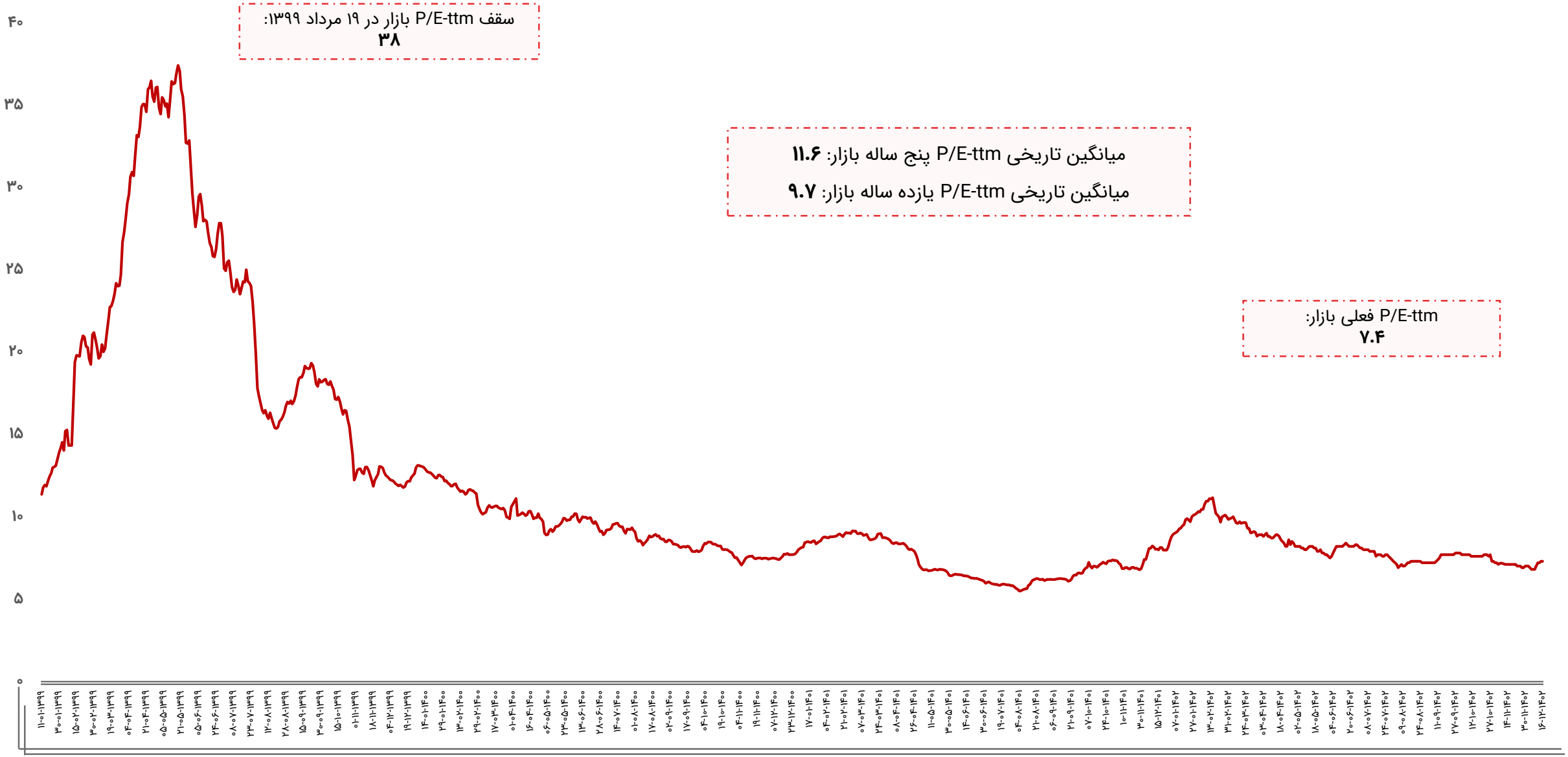
شاخص کل


۲,۸۰۰,۰۰۰
۲,۴۰۰,۰۰۰
۱,۶۰۰,۰۰۰
۱,۲۰۰,۰۰۰
۸۰۰,۰۰۰
۴۰۰,۰۰۰
۰
• حمایت سران دولت از بورس
• وقوع پدیده کووید-۱۹
• کاهش نرخ بهره بین بانکی
• افزایش ورود پول حقیقی به بازار
• پیروزی بایدن در انتخابات آمریکا
• افزایش نرخ بهره بین بانکی
• خروج شدید پول حقیقی از بازار
• افزایش نرخ دلار در بازار آزاد
• انتظار گزارشات مالی شرکتها
• پیروزی آقای رئیسی در انتخابات
• وقوع جنگ روسیه و اوکراین
• افزایش قیمت کامودیتی‌ها
• کاهش نرخ بهره بین بانکی
• بهبود در مذاکرات هسته‌ای
• افت قیمت کامودیتی‌ها
• بلاتکلیفی در موضوع برجام
• افزایش نرخ سود بین بانکی
• گزارشات ضعیف فصلی و سالانه شرکتها
• روند صعودی نرخ بهره
• بلاتکلیفی مذاکرات برجام
• وقوع اعتراضات و ناآرامی‌ها در کشور
• افزایش شدید نرخ دلار آزاد و نیما
• به بن‌بست رسیدن مذکرات برجام
• رفع نسبی ابهامات بودجه سال ۱۴۰۲
• کاهش نرخ دلار آزاد
• افزایش نرخ گاز سوخت و خوراک
• افزایش ابهامات در بازار سرمایه

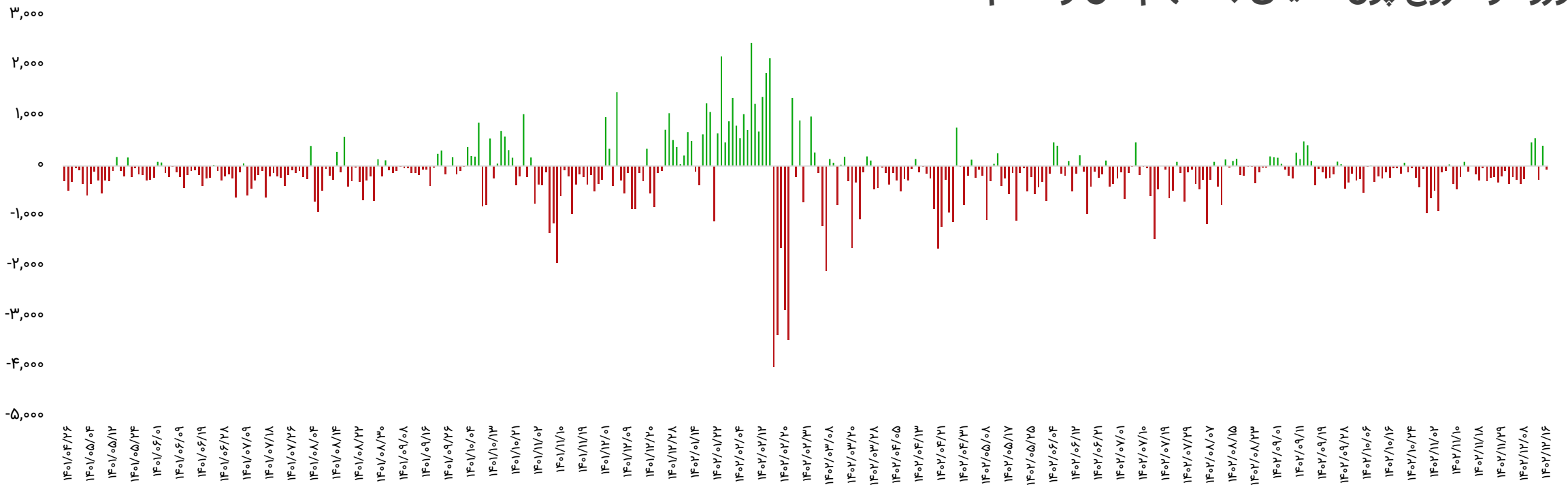
ارزش معاملات خرد سهام



روند P/E-ttm بازار



ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
سالیانه (۱۴۰۱/۱۲/۱۶ تا ۱۴۰۲/۱۲/۱۶)	۲۴۲	-۳۵،۶۴۰
ماهیانه (۱۴۰۲/۱۱/۱۶ تا ۱۴۰۲/۱۲/۱۶)	۲۱	-۲،۱۹۶
هفتگی(۱۴۰۲/۱۲/۱۲ تا ۱۴۰۲/۱۲/۱۶)	۵	۱،۰۹۲

تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۲/۱۲/۱۲	۴۷۰
۱۴۰۲/۱۲/۱۳	۵۵۲
۱۴۰۲/۱۲/۱۴	-۲۶۶
۱۴۰۲/۱۲/۱۵	۴۰۴
۱۴۰۲/۱۲/۱۶	-۶۸
جمع	۱،۰۹۲

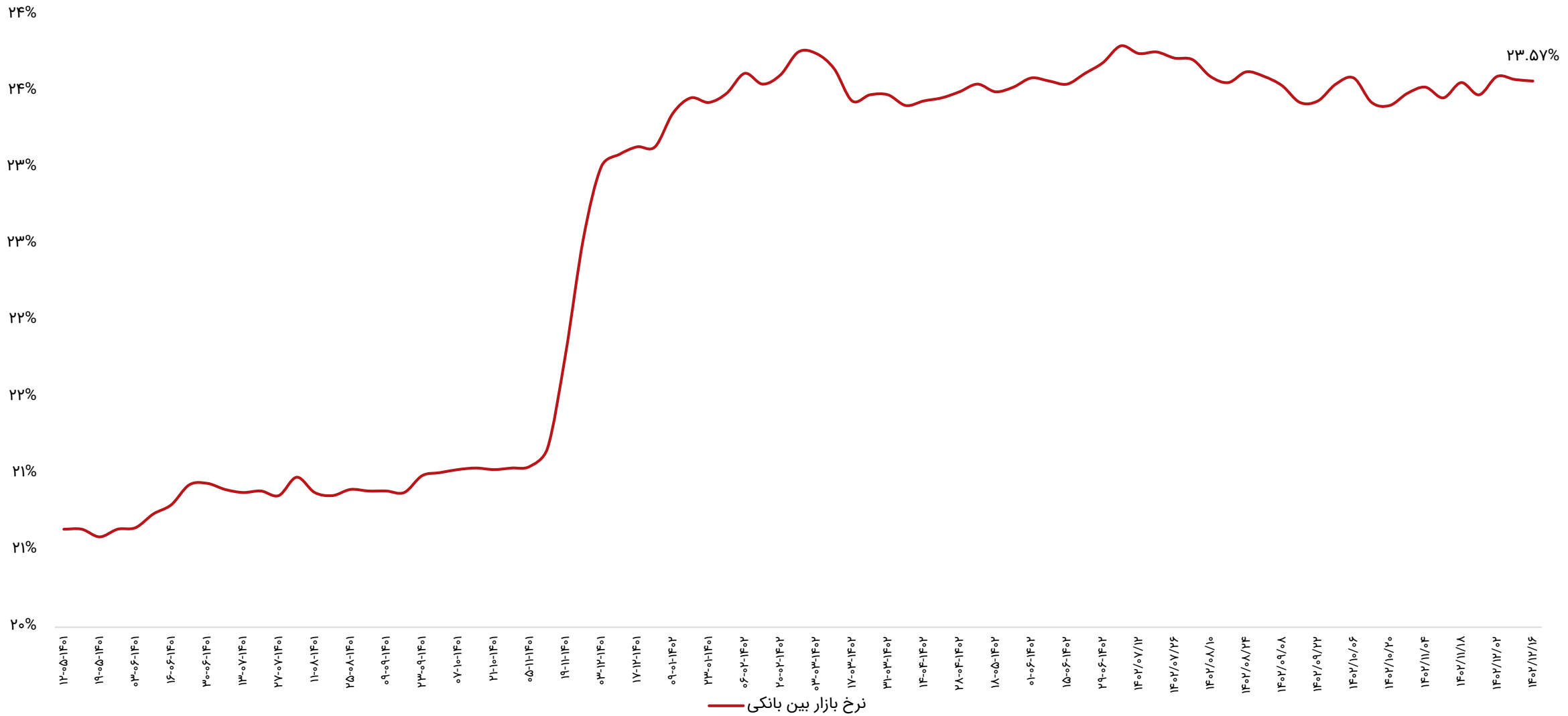
ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
سالیانه (۱۴۰۱/۱۲/۱۶ تا ۱۴۰۲/۱۲/۱۶)	۲۴۲	۱۰،۱۱۲
ماهیانه (۱۴۰۲/۱۱/۱۶ تا ۱۴۰۲/۱۲/۱۶)	۲۱	-۱،۸۶۸
هفتگی(۱۴۰۲/۱۲/۱۲ تا ۱۴۰۲/۱۲/۱۶)	۵	-۲،۰۳۶

تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۲/۱۲/۱۲	-۱،۴۱۵
۱۴۰۲/۱۲/۱۳	-۷۰۰
۱۴۰۲/۱۲/۱۴	۷۷
۱۴۰۲/۱۲/۱۵	-۴۲۴
۱۴۰۲/۱۲/۱۶	۴۲۶
جمع	-۲،۰۳۶

روند نرخ بهره بین بانکی



ترین‌های بازار در هفته اخیر

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	فرآورده‌های نفتی	۱۰.۲
۲	خودرو و قطعات	۶.۷
۳	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۴.۸
۴	چند رشته‌ای صنعتی	۴.۱
	بیمه و بازنشستگی	۴

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	بیمه پارسیان	پارسیان	۳۲.۳
۲	سر. گروه توسعه ملی	وبانک	۲۲.۱
۳	بانک پارسیان	وپارس	۲۱.۷
۴	پارس سرام	کسرام	۲۱
۵	سر. رنا	ورنا	۲۰.۴

کم بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	چاپ	-۵.۸
۲	محصولات چرمی	-۵.۳
۳	اطلاعات و ارتباطات	-۲.۵
۴	منسوجات	-۱.۷
۵	خرده فروشی	-۱.۶

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	سر. تدبیرگران فارس و خوزستان	سدبیر	-۱۴.۴
۲	رنگین	شرنگی	-۱۳.۷
۳	سیمان دشتستان	سدشت	-۱۱.۸
۴	نرم افزاری نگین	توسن	-۱۱.۱
۵	بیمه حکمت صبا	وحکمت	-۱۰.۸

ترین‌های بازار در هفته اخیر

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	بانکها و موسسات اعتباری	۶،۹۰۸
۲	خودرو و قطعات	۴،۷۵۹
۳	فلزات اساسی	۳،۷۹۷
۴	شیمیایی	۲،۳۶۰
۵	سرمایه‌گذاریها	۲،۱۷۲

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	چاپ	۲۰
۲	استخراج زغال سنگ	۳۱
۳	محصولات چرمی	۳۹
۴	محصولات چوبی	۴۵
۵	پیمانکاری صنعتی	۵۳

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/E
های وب	۱،۹۵۳	۲.۱
ونوین	۲،۹۶۳	۲.۵
وبملت	۲،۲۶۸	۲.۷
وتجارت	۱،۳۸۸	۲.۸
میهن	۶،۱۷۰	۳.۱

نمادهای با کمترین P/NAV

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۱،۸۰۹	%۲۴.۲
حکشتی	۱۲،۱۷۰	%۲۹.۵
وبشهر	۴،۲۱۹	%۳۳.۱
زکوثر	۲۳،۶۲۰	%۳۳.۳
وسپهر	۴،۲۴۷	%۳۳.۸

اخبار بورس کالا در هفته اخیر

- **تامین مالی یک همتی پتروشیمی لاله از بستر بورس کالا:**

شرکت پتروشیمی لاله ۱۵ اسفند به منظور تامین سرمایه در گردش برای تولید ۳۲ هزار و ۵۷۲ تن پلی اتیلن سبک گرید فیلم، اقدام به انتشار اوراق سلف موازی استاندارد به ارزش یک هزار میلیارد تومان در بورس کالا کرد که با استقبال خوب سرمایه گذاران این تامین مالی در همان ثانیه نخست با موفقیت انجام شد. براساس اعلام مدیریت بازارهای مشتقه و صندوق‌های کالایی بورس کالای ایران عرضه اولیه اوراق سلف موازی استاندار پلی اتیلن سبک گرید فیلم متعلق به شرکت پتروشیمی لاله در نمادهای «علاله۱» و «علاله۲» به تعداد ۲ میلیون و ۶۸۳ هزار قرارداد و با قیمت ۳ میلیون و ۷۲۷ هزار و ۱۳۰ ریال در هر قرارداد ۱۰ کیلوگرمی از طریق شرکت کارگزاری بانک تجارت انجام شد و به توجه به استقبال خوب سرمایه گذاران با موفقیت به پایان رسید.

- **۲۰ دستگاه کامیون کشنده فوتون در بورس کالا معامله شد:**

در روز ۱۵ اسفند ماه در تالار خودرو بورس کالا ۲۰ دستگاه کامیون کشنده فوتون 5H متعلق به شرکت ایران خودرو دیزل برای تحویل اول اردیبهشت ۱۴۰۳ معامله شد. در مقابل ۲۰ دستگاه عرضه، ۶۳ دستگاه تقاضا شکل گرفت و این خودرو در نهایت با رقابت ۵.۶۵ درصدی با قیمت پایانی ۴ میلیارد و ۳۴۰ میلیون تومان معامله شد. قیمت پایه عرضه ۴ میلیارد و ۱۰۸ میلیون تومان اعلام شده بود و به قیمت پایانی ۹ درصد مالیات بر ارزش افزوده به اضافه ۸۰.۷ میلیون تومان هزینه های جانبی افزوده می شود.

اخبار بورس کالا در هفته اخیر

- **عرضه آهن اسفنجی در قالب ۱۵ قرارداد بلندمدت در بورس کالا:**

انعقاد قراردادهای بلندمدت میان تولیدکنندگان و مصرف کنندگان زنجیره فولاد با هدف رفع دغدغه های تولید و فروش و امکان برنامه ریزی تولیدکنندگان صنایع بالادست و پایین دست از ظرفیت‌های مهم بورس کالای ایران است؛ از این رو یکشنبه هفته جاری ۲۰ اسفند ماه ۲ میلیون و ۱۱۰ هزار تن آهن اسفنجی شرکت فولاد خوزستان در قالب ۱۵ قرارداد کشف پریمیوم روی تابلو می‌رود. کشف پریمیوم قراردادی است که در بازار فیزیکی بورس کالای ایران معامله می‌شود و به موجب آن، طرفین متعهد می‌شوند که در زمان مشخصی در آینده (تحویل، حمل یا بارگیری) کالا را براساس قیمت نهایی (قیمت مبنا به علاوه مابه التفاوت توافق شده) معامله کنند. این قرارداد از ابزارهای کارآمد در جهت برنامه ریزی تولید به شمار می رود که یکشنبه هفته جاری در حوزه یک محصول معدنی در بورس کالا به کار گرفته می شود. طبق اطلاعیه عرضه، یکشنبه هفته جاری ۲۰ اسفند ماه ۲ میلیون و ۱۱۰ هزار تن آهن اسفنجی شرکت فولاد خوزستان در قالب ۱۵ قرارداد کشف پریمیوم روی تابلو می‌رود. تاریخ معامله نهایی این قراردادها از ۷ فروردین ۱۴۰۳ آغاز و تا ۳۰ بهمن سال ۱۴۰۳ ادامه دارد.

- **پذیرش دو هتل برای فروش در بورس کالای ایران:**

مدیریت پذیرش بورس کالای ایران در دو اطلاعیه جداگانه از پذیرش هتل صدف و هتل مریم واقع در جزیره کیش متعلق به شرکت اس‌سی‌تی بانکرز کیش برای فروش در بورس کالای ایران خبر داد. پذیرش این دو هتل پس از بررسی مدارک و مستندات در چهارصد و نهمین جلسه کمیته عرضه در تاریخ ۱۵ اسفند ۱۴۰۲ در بازار فرعی بورس کالا مورد تصویب قرار گرفت. هتل صدف به پلاک ثبتی ۱۴۳۴۹/۵۶۲۱ دارای کاربری تجاری بوده و مساحت عرصه ۱۴ هزار و ۸۷۷ مترمربع و مساحت اعیان ۶ هزار و ۴۳۵ مترمربع است.هتل مریم به پلاک ثبتی ۱۴۳۹۳/۵۶۲۱ دارای کاربری تجاری بوده و مساحت عرصه ۷ هزار و ۸۱ مترمربع و مساحت اعیان ۵ هزار و ۶۲۵ مترمربع است.

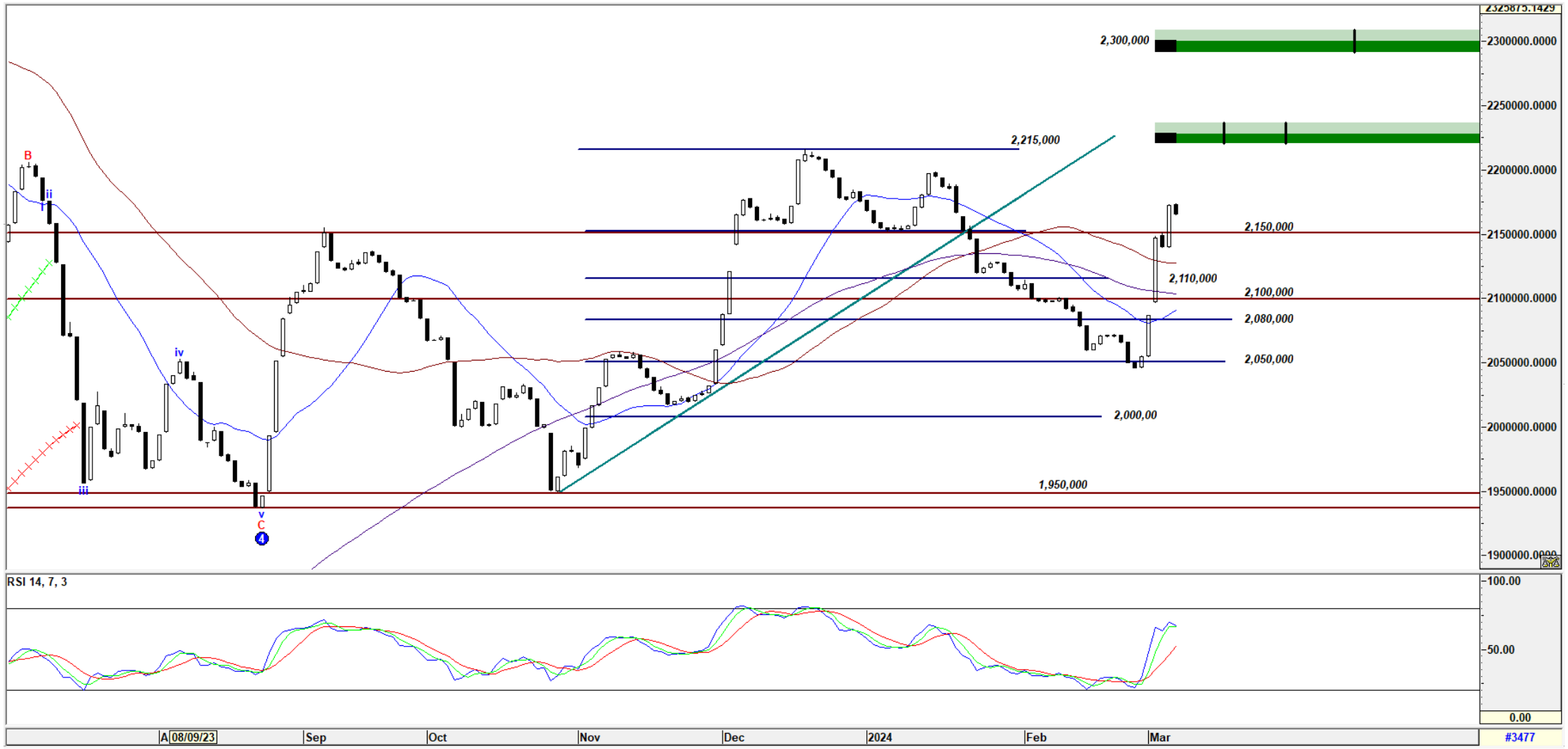
سایر بازارها

شرح	آخرین قیمت	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۲,۱۷۷	۲,۰۸۵	۴.۴%	۲,۰۳۲	۷.۱%
سکه امامی (ریال)	۳۷۰,۸۵۰,۰۰۰	۳۳۷,۴۹۰,۰۰۰	۹.۹%	۳۲۲,۸۵۰,۰۰۰	۱۴.۹%
دلار آزاد (ریال)	۶۰۹,۰۰۰	۵۸۵,۰۰۰	۴.۱%	۵۵۲,۵۰۰	۱۰.۲%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۸۲	۸۳.۵	-۱.۸%	۷۹.۳	۳.۴%
بیت کوین (دلار)	۶۹,۲۴۹	۶۲,۴۵۱	۱۰.۹%	۴۴,۴۵۰	۵۵.۸%
آلومینیوم LME	۲,۲۳۹	۲,۲۴۰	-۰.۰۴%	۲,۲۳۴	۰.۲%
مس LME	۸,۵۷۱	۸,۵۲۵	۰.۵%	۸,۳۳۵	۲.۸%
روی LME	۲,۵۲۴	۲,۴۳۱	۳.۸%	۲,۴۰۲	۵.۱%
سرب LME	۲,۱۰۳	۲,۰۳۷	۳.۲%	۲,۱۱۳	-۰.۵%
انس پلاتین	۹۱۵	۸۹۱	۲.۷%	۸۸۶	۳.۳%
اوره گرانوله (فوب خاورمیانه)	۳۶۶	۳۷۵	-۲.۴%	۳۸۰	-۳.۷%

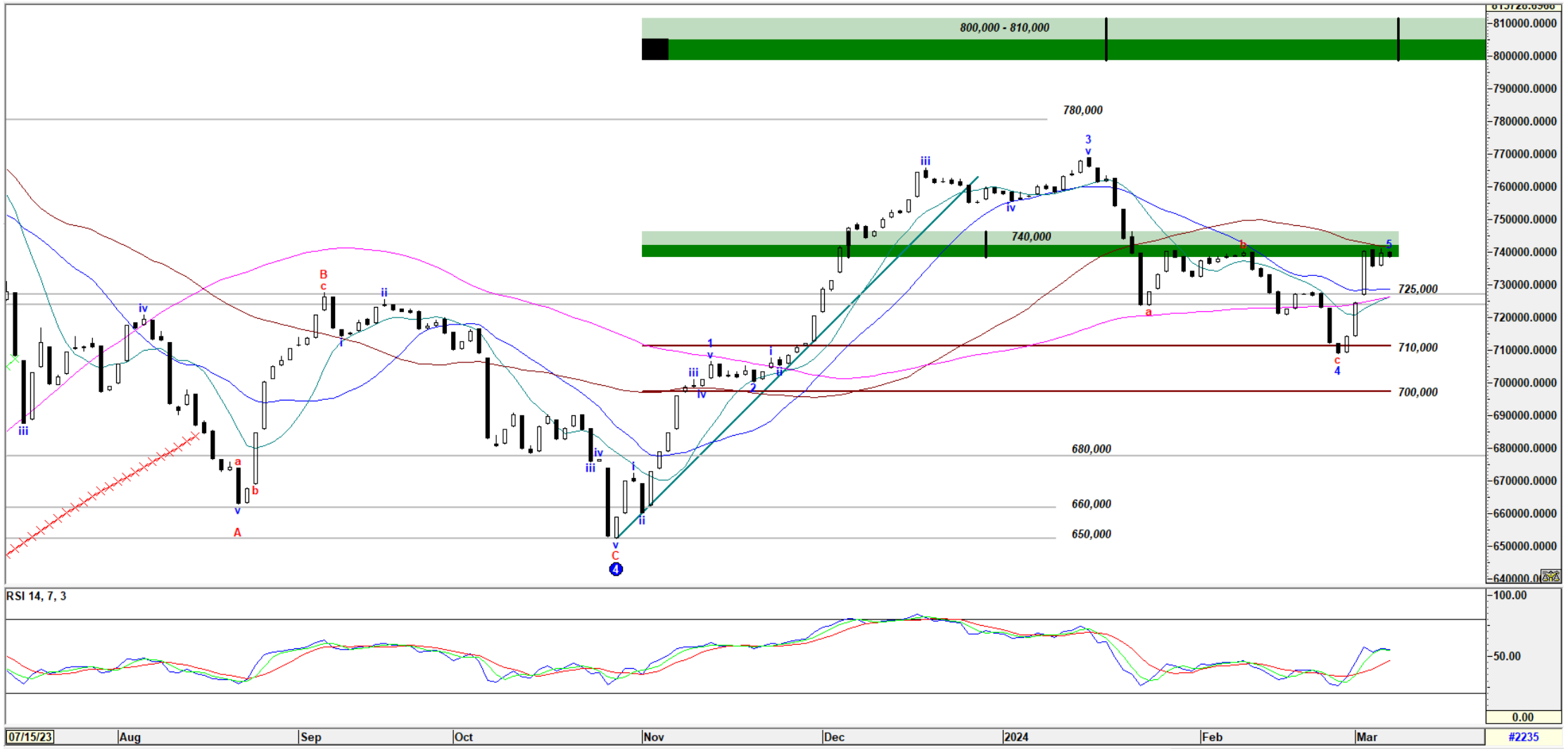
تقویم اقتصادی

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۲/۱۲/۲۱	دوشنبه	رشد تولید ناخالص داخلی (سالانه) ژاپن، انتظارات تورم مصرف کننده آمریکا
۱۴۰۲/۱۲/۲۲	سه‌شنبه	(تغییرات سالیانه) شاخص قیمت تولیدکننده ژاپن، نرخ تورم (سالانه) آمریکا
۱۴۰۲/۱۲/۲۳	چهارشنبه	تغییرات سهام نفت خام مؤسسه نفت آمریکا (API)، (تغییرات سالیانه) تولیدات صنعتی اتحادیه اروپا
۱۴۰۲/۱۲/۲۴	پنج شنبه	سخنرانی رئیس بانک مرکزی اروپا، (تغییرات سالیانه) شاخص قیمت تولید کننده خالص آمریکا
۱۴۰۲/۱۲/۲۵	جمعه	(تغییرات سالیانه) تولیدات صنعتی آمریکا، شاخص بهای مسکن (سالانه) چین

تحلیل تکنیکال – شاخص کل



تحلیل تکنیکال – شاخص کل هم‌وزن



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege