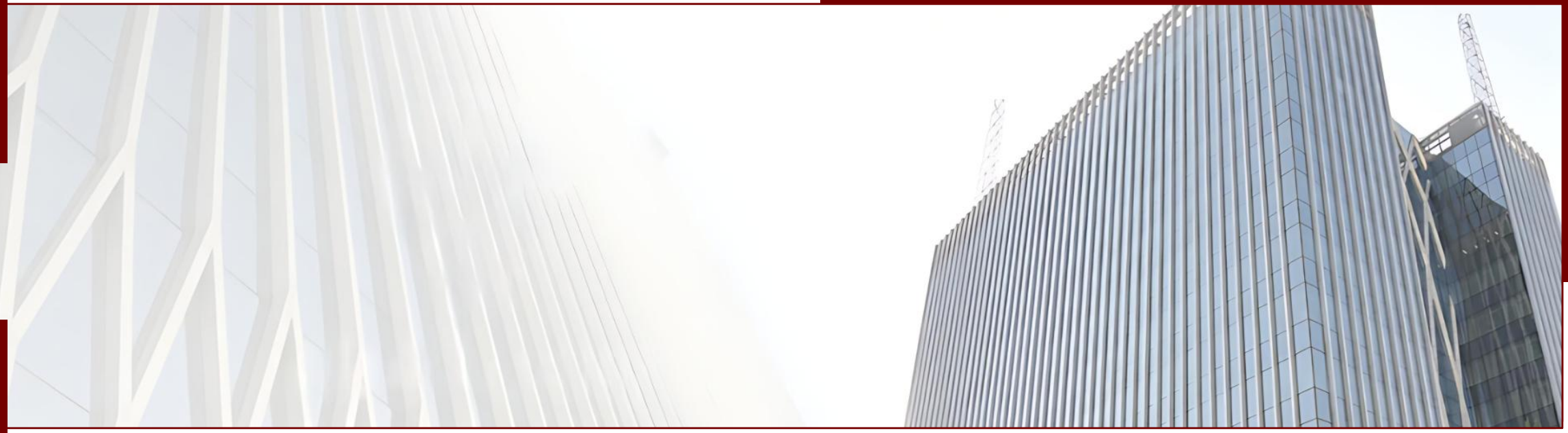


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۲۳ آبان۱۴۰۴"

کارگزاری بانک ملت
Mellat Bank Brokerage co.

www.mellatbroker.ir

فهرست مطالب

- مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر ۳
- بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر ۵
- روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن ۶
- ارزش دلاری بازار ۷
- نسبت قیمت به سود کل بازار ۸
- ارزش معاملات خرد سهام ۹
- ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت ۱۰
- ارزش معاملات صندوق‌های طلا ۱۱
- خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم ۱۲
- خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت ۱۳
- خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا ۱۴
- ترین‌های بازار در هفته اخیر ۱۵
- بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه ۱۷
- روند نرخ بهره بین بانکی ۲۰
- اوراق با درآمد ثابت ۲۱
- روند ارزش معاملات بورس کالا ۲۲
- آمار معاملات بازار فیزیکی بورس کالا در یک هفته گذشته ۲۳
- آمار معاملات سایر بازارهای بورس کالا در یک هفته گذشته ۲۴
- وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه ۲۵
- بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار ۲۶

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



گروه ۷ خواهان مذاکره مستقیم ایران با آمریکا شد

گروه ۷ اعلام کرد کمک‌های نظامی ایران، چین و کره شمالی به روسیه در ادامه جنگ اوکراین نقش مهمی دارد و این کمک‌ها را محکوم کرد. این گروه از ایران خواست به تعهدات خود طبق قطعنامه‌های شورای امنیت و پیمان منع گسترش سلاح‌های هسته‌ای پایبند بماند، همکاری کامل با آژانس اتمی را از سر بگیرد و با پشتیبانی سه کشور اروپایی وارد مذاکره مستقیم با آمریکا شود. همچنین تأکید شد همه کشورهای عضو سازمان ملل باید پس از فعال شدن مکانیسم ماشه به تعهدات بین‌المللی خود عمل کنند.



جلسه این هفته شورای حکام آژانس درباره ایران چهارشنبه ۲۸ آبان برگزار خواهد شد

آژانس بین‌المللی انرژی اتمی اعلام کرد نشست شورای حکام چهارشنبه ۲۸ آبان در وین برگزار می‌شود و موضوعاتی مانند عضویت کشورها، همکاری‌های فنی، ایمنی و حمل‌ونقل مواد رادیواکتیو، وضعیت راستی‌آزمایی در کره شمالی و سوریه، پرونده پیشرانه هسته‌ای استرالیا و برزیل و اجرای توافق‌نامه‌های پادمانی ـ ازجمله درباره ایران ـ بررسی خواهد شد. در دستورکار نشست اشاره‌ای به قطعنامه ۲۲۳۱ یا تعهدات مربوط به برجام نشده و نام ایران تنها در بخش پادمان آمده است. این نشان می‌دهد پیگیری مسائل برجام از دستور کار شورای حکام کنار گذاشته شده؛ زیرا با پایان دوره ۱۰ساله قطعنامه ۲۲۳۱ در مهر ۱۴۰۴، گزارش‌دهی مدیرکل درباره تعهدات برجامی ایران نیز خاتمه یافته است. آژانس همچنین در گزارش فصلی خود تأکید کرده که ایران باید گزارشی درباره مواد و تأسیسات هسته‌ای آسیب‌دیده در جنگ ۱۲ روزه ارائه کند.



استقرار بزرگ‌ترین ناو جهان در آمریکای لاتین و آماده باش ۲۰۰ هزار سرباز ونزوئلا

نیروی دریایی آمریکا اعلام کرد ناو هواپیمابر «یواس‌اس جرالد فورد»، بزرگ‌ترین و جدیدترین ناو جهان، همراه با ده‌ها ناوشکن وارد منطقه آمریکای لاتین شده است؛ اقدامی که بزرگ‌ترین استقرار نظامی آمریکا در این منطقه از سال ۱۹۸۹ محسوب می‌شود. این ناو با بیش از ۴ هزار ملوان و ده‌ها هواپیمای تاکتیکی، اواخر اکتبر از مدیترانه به این منطقه اعزام شده است. در واکنش، دولت ونزوئلا به رهبری نیکولاس مادورو اعلام کرد برای مقابله با حضور آمریکا، نیروهای گسترده‌ای از ارتش، نیروی دریایی، هواپیماها، واحدهای رودخانه‌ای و موشکی و همچنین نیروهای مردمی را مستقر کرده است. وزارت دفاع ونزوئلا نیز از اعزام ۲۰۰ هزار سرباز برای تمرین‌های آمادگی مقابله با تهدیدات آمریکا خبر داد.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



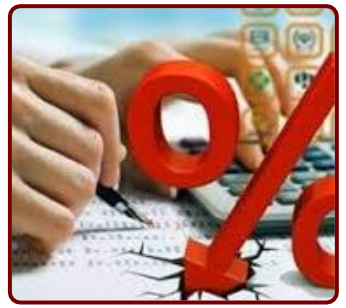
شرکت‌های برتر بورس کالا از نظر ارزش معاملات در هفته اخیر معرفی شدند

آمار معاملات بازار فیزیکی بورس کالای ایران نشان می‌دهد در هفته منتهی به ۲۳ آبان ماه حدود ۲ میلیون و ۶۸۳ هزار تن انواع کالا و محصول به ارزش بالغ بر ۴۷/۹ هـزار میلیـارد تومـان معامله شد. همچنین ارزش معاملات ۱۰ شرکت برتر به بیش از ۱۸/۷ هزار میلیارد تومان رسید. برترین‌های بورس کالای ایران در هفته اخیر براساس ارزش فروش شرکت‌ها شامل: ملی صنایع مس ایران با معامله ۴ هزار و ۷۲۰ تن انواع مس و سولفور مولیبدن به ارزش ۴ هزار و ۸۷۲۵۰۸ میلیارد تومان در رتبه نخست ایستاد. معدنی و صنعتی چادرملو با فروش ۲۰۵ هزار و ۴۰ تـن کنسانتره و گندله سنگ آهن، شمش بلوم و آرگون به ارزش ۲ هزار و ۱۰۲ میلیارد تومان دوم شد. پـالایش نفـت اصـفهان ۷۸ هـزار تـن وکیـوم بـاتوم و لـوب کـات سـبک بـه ارزش ۲ هـزار و ۵۷ میلیارد تومان فروخت و رتبه سوم را به خود اختصاص داد. فولاد خوزستان با معامله ۴۷ هزار و ۶۰ تن تختال، شمش بلوم و آرگون به ارزش یک هزار و ۵۵۸ میلیارد تومان چهارم شد.



پیش فروش جدید سکه تمام و ربع از امروز ۲۴ آبان ماه اعلام شد

طبق آخرین برنامه مرکز مبادله، فرآیند پیش فروش جدید سکه تمام و ربع از امروز شنبه ۲۴ آبان ماه آغاز می‌شود و بعـد از مهلـت دو روزه واریـز وجـه (شـنبه و یکشـنبه) دوشـنبه ۲۶ آبـان نیز پیش‌فروش سکه به روش حراج برگزار خواهد شد. متقاضیان می‌توانند بعد از واریز وجه از ساعت ۸ الی ۱۶ دوشنبه اقدام به ثبت سفارش کنند. سررسید ششمین مرحله پیش فروش سکه هم ۳۰ بهمن سال جاری خواهد بود. سقف خرید هم مانند گذشته ۵ قطعه سکه برای هر متقاضی است. براساس این گزارش، نتایج آخرین حراج سکه در چهارشنبه گذشـته هـم نشـان داد ۴۳,۴۰۵ انواع سکه ضرب سال ۱۳۸۶ بانک مرکزی تخصیص یافته و طی آن قیمت هر سکه تمام بیش از ۱۱۲.۳ میلیون تومـان (شـامل بـیش از ۱۸.۲ هـزار قطعـه) و سـکه نـیم و ربـع هـم ۵۷.۴ و ۳۲.۸ میلیون تومان و با موعد تحویل ۴ تا ۱۲ آذر بود.



نرخ سود بین بانکی برای هفتمین هفته بدون تغییر در ۲۴ درصد ثابت ماند

طبق اعلام بانک مرکزی، نرخ سود در بازار بین بانکی برای هفتمین هفته متوالی بدون تغییر در همان نرخ ۲۴ درصد ثابت ماند. همچنـین نـرخ ریپـو هماننـد هفتـه‌های گذشـته ۲۳ درصـد اعلام گردید.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

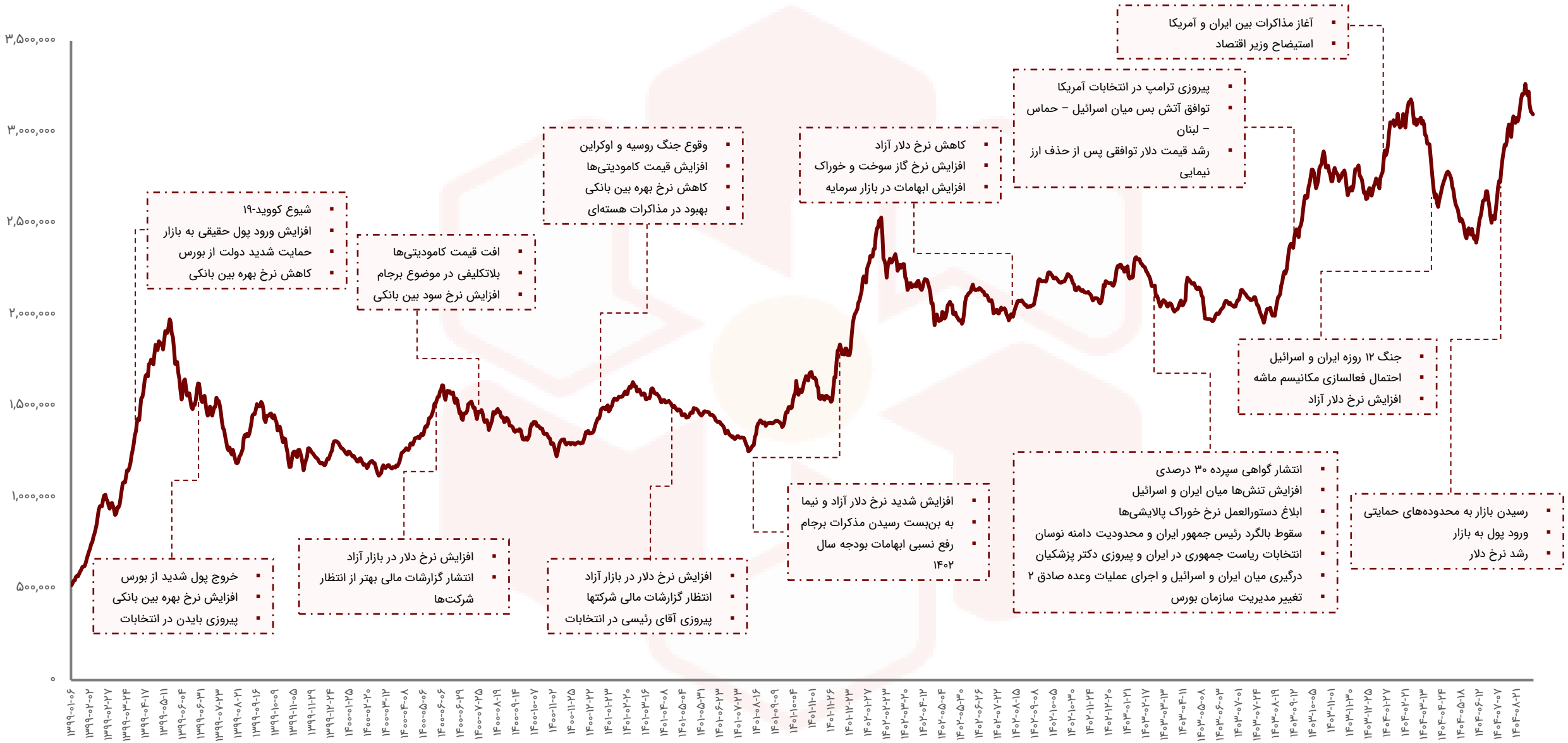
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

شاخص کل بورس در پایان هفته اخیر بر ارتفاع ۳،۰۹۸،۷۶۳ واحد قرار گرفت و افت هفتگی ۳.۲ درصدی را ثبت کرد همچنین شاخص کل هم‌وزن نیز افت ۲ درصدی داشت و بر ارتفاع ۹۰۳،۶۵۳ واحد ایستاد. ارزش معاملات خرد با افت ۲۸ درصدی روبرو شد و حدود ۳۰،۴۴۲ میلیارد تومان ثبت شد. میانگین ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم با افت ۲۸ درصدی از ۸،۴۶۱ میلیارد تومان به ۶،۰۸۸ میلیارد تومان رسید. در هفته اخیر، خالص ورود/خروج پول حقیقی سهام، حق تقدم و صندوق‌های سهامی (۵،۱۹۷) میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های با درآمد ثابت ۱،۹۹۶ میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های طلا ۵،۹۲۳ میلیارد تومان ثبت شد. رسیدن شاخص کل به سقف تاریخی خود با کاهش ارزش معاملات و خروج پول حقیقی از بازار همراه شد و منابع به سمت صندوق‌های درآمد ثابت و طلا رفت؛ رشد دلار نیما در هفته اخیر نیز نتوانست باعث تغییر روند بازار شود. از سوی دیگر، با انتشار داده‌های بانک مرکزی، احتمال افزایش نرخ بهره در ماه‌های آتی و تا پایان سال افزایش یافته است که این امر، پول را به سمت دارایی‌های بدون ریسک منتقل می‌کند. در بازارهای موازی، گواهی‌های سپرده زعفران پس از رشد شدید در هفته‌های اخیر، متعادل ماندند و صندوق‌های طلا، با بازگشایی مثبت اونس جهانی و افزایش نرخ دلار، بازدهی بیش از ۷% در دو روز پایانی هفته داشتند.

تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۳،۲۰۲،۸۸۹	۳،۰۹۸،۷۶۳	(۱۰۴،۱۲۶)	(%۳.۲)
شاخص هم وزن (واحد)	۹۲۲،۱۰۸	۹۰۳،۶۵۳	(۱۸،۴۵۵)	(%۲)
ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم (میلیارد تومان)	۳۰،۴۴۲		(۱۱،۸۶۵)	(%۲۸)
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۵،۱۹۷)		(۱،۸۷۷)	-

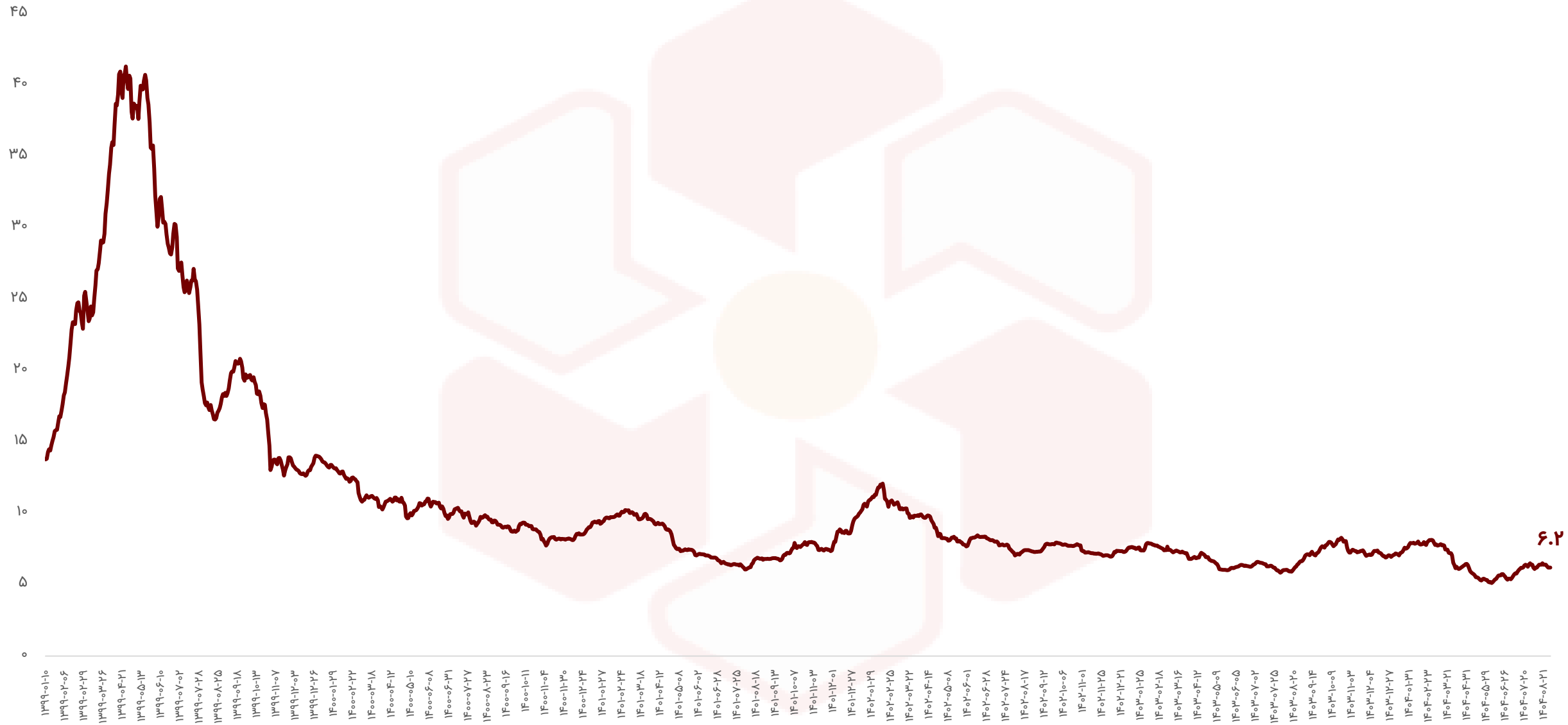
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



ارزش دلاری بازار*

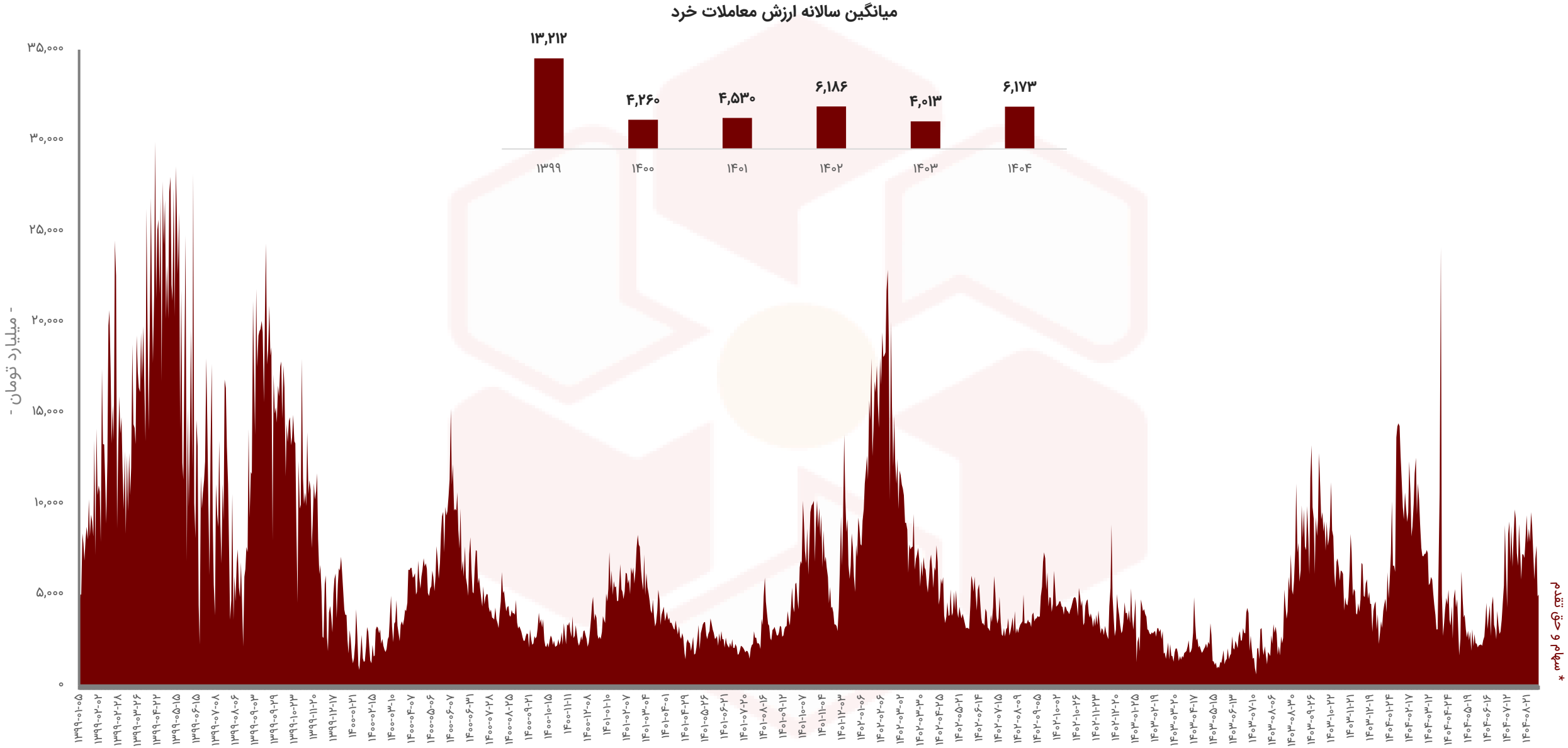


نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)

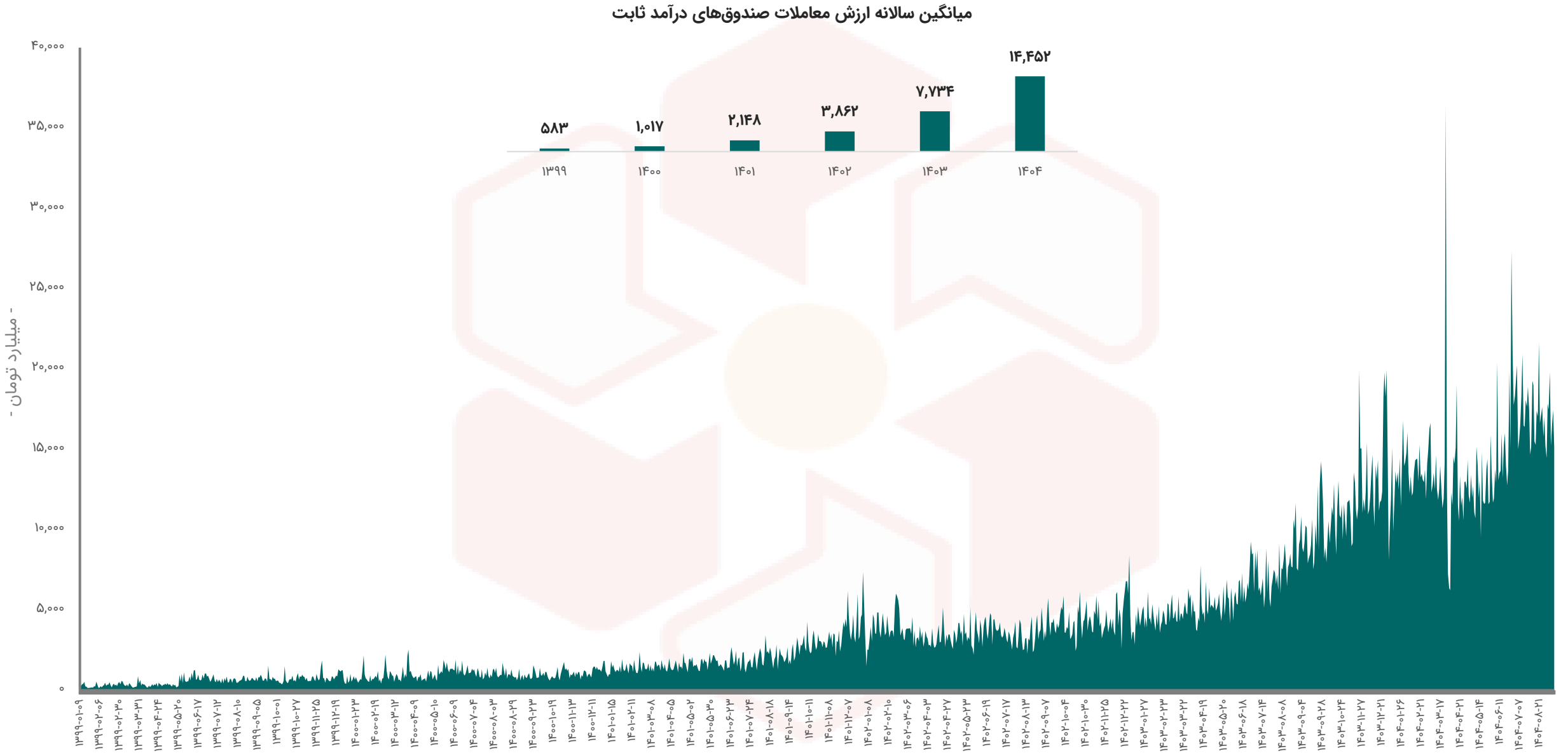


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

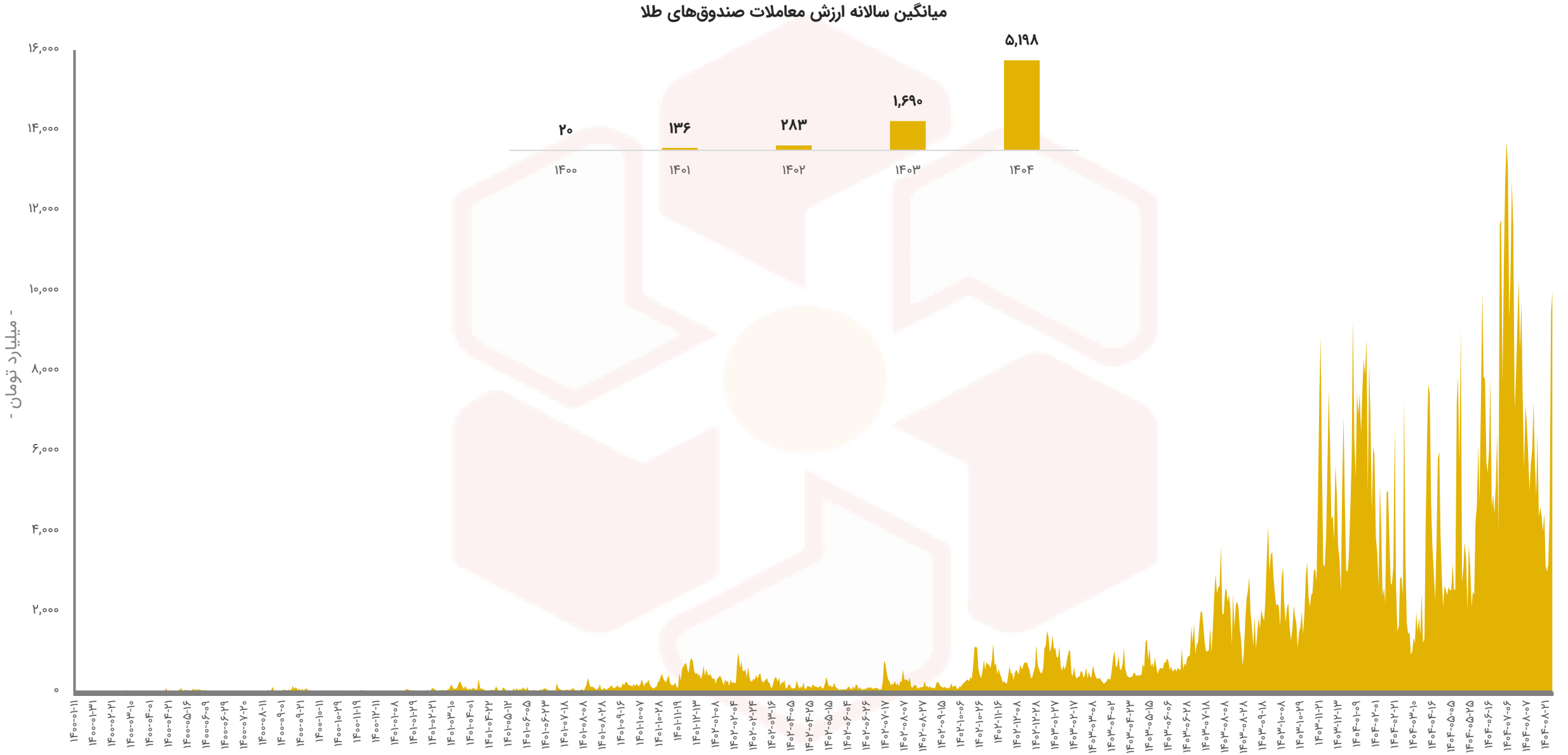
ارزش معاملات خرد سهام*



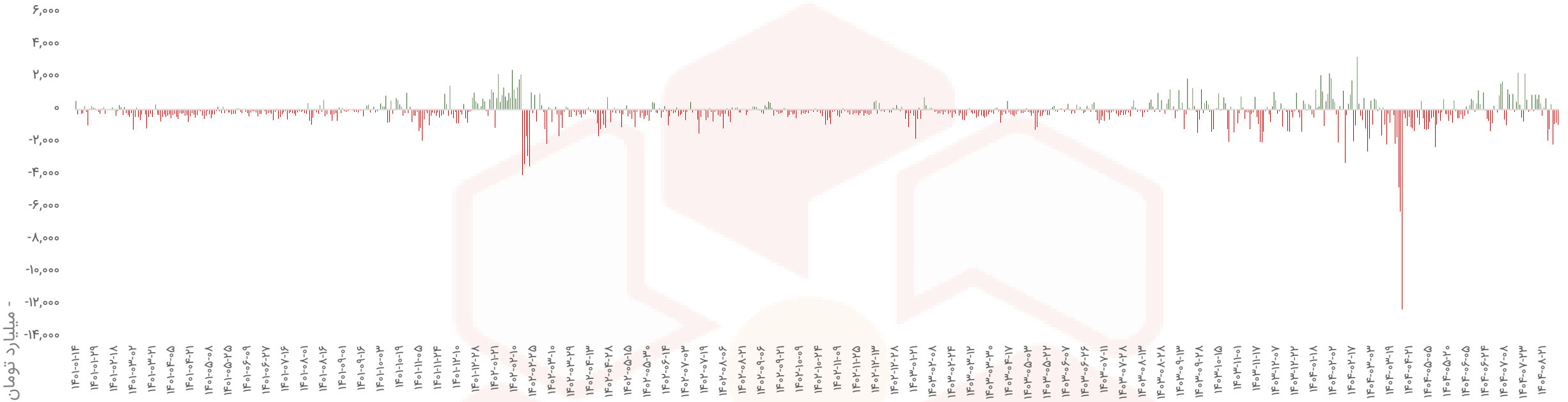
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



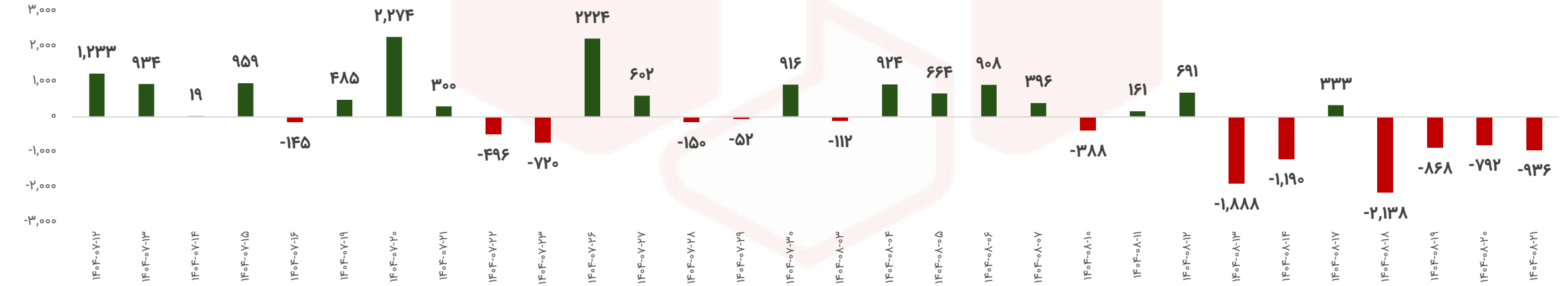
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



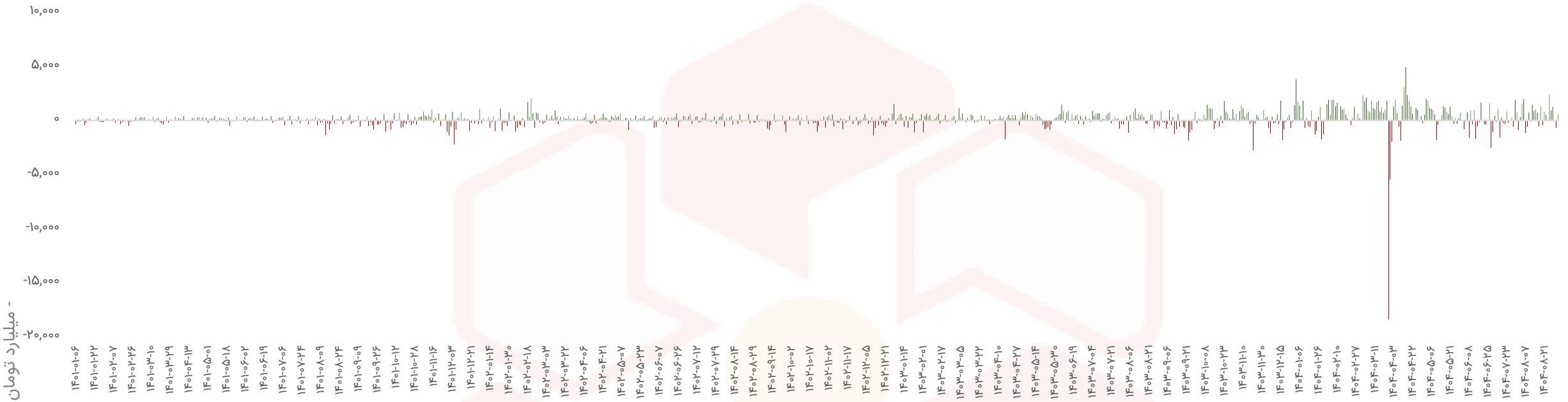
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



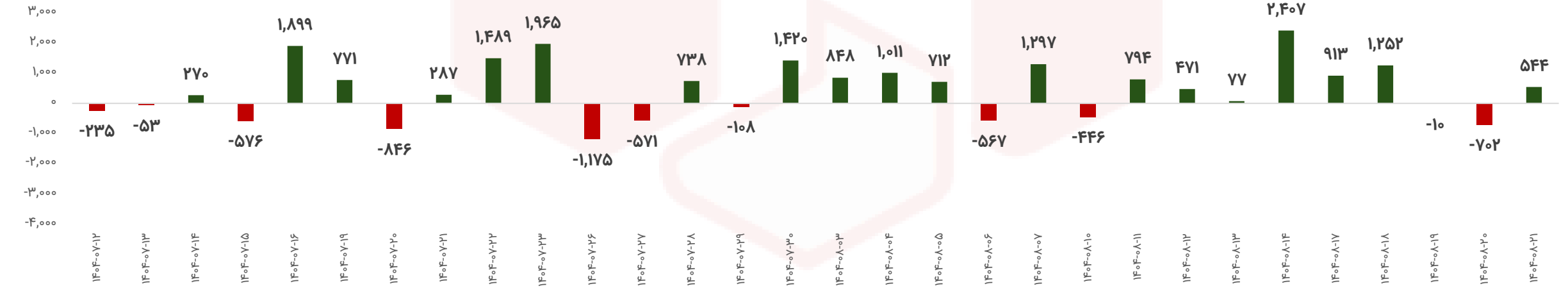
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



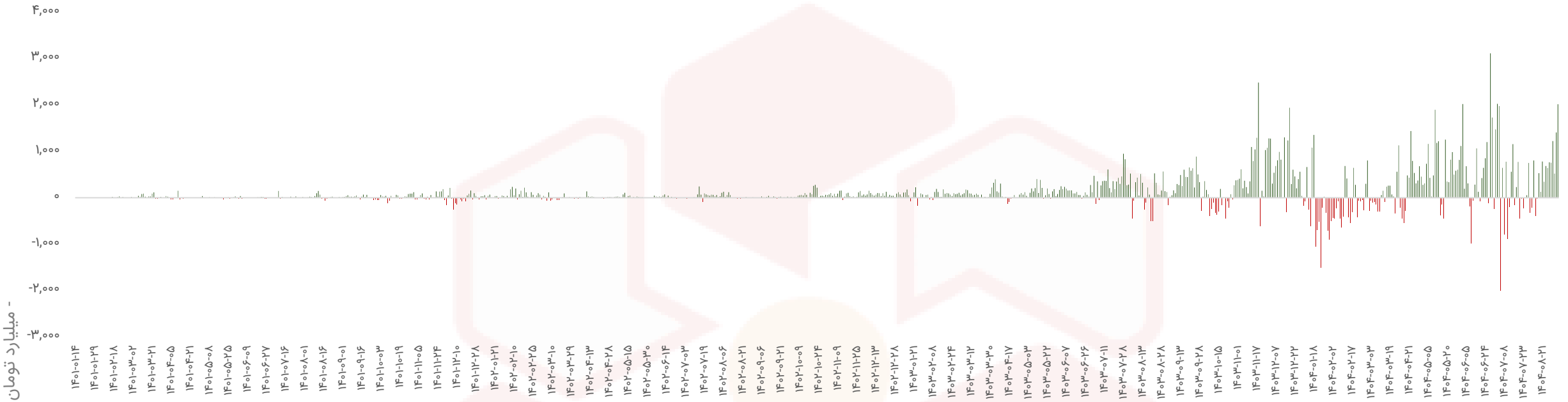
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



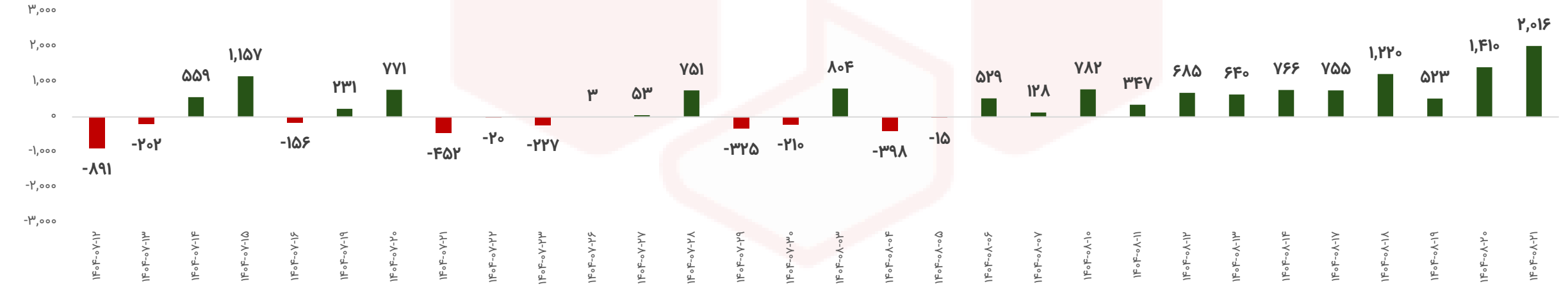
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



ترین‌های بازار در هفته اخیر

صنایع با بیشترین بازدهی

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	منسوجات	%۲.۸
۲	سیمان آهک گچ	%۰.۹

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	نوش پونه مشهد	غپونه	%۱۷.۶
۲	سیمان غرب آسیا	سجام	%۱۶.۱
۳	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا	%۱۵.۸
۴	داروسازی کوثر	دکوثر	%۱۵.۶
۵	کشت و صنعت و دامپروری پگاه فارس	زفارس	%۱۵.۶

صنایع با کمترین بازدهی

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	خودرو و قطعات	(%۵.۶)
۲	واسطه‌گریهای مالی و پولی	(%۵.۶)
۳	شیمیایی	(%۵)
۴	بانکها و موسسات اعتباری	(%۴.۳)
۵	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	(%۳.۴)

نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	تامین مسکن جوانان	ثجوان	(%۱۵.۸)
۲	شکر شاهرود	قشکر	(%۱۴.۶)
۳	رینگ‌سازی مشهد	خرینگ	(%۱۳.۷)
۴	بهمن لیزینگ	ولبهمن	(%۱۳.۴)
۵	سر.سایپا	وساپا	(%۱۳.۲)

ترین‌های بازار در هفته اخیر

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	بانکها و موسسات اعتباری	۸،۱۴۷
۲	فلزات اساسی	۷،۱۳۶
۳	شیمیایی	۶،۶۲۳
۴	خودرو و قطعات	۵،۲۸۲
۵	فرآورده‌های نفتی	۴،۸۷۰

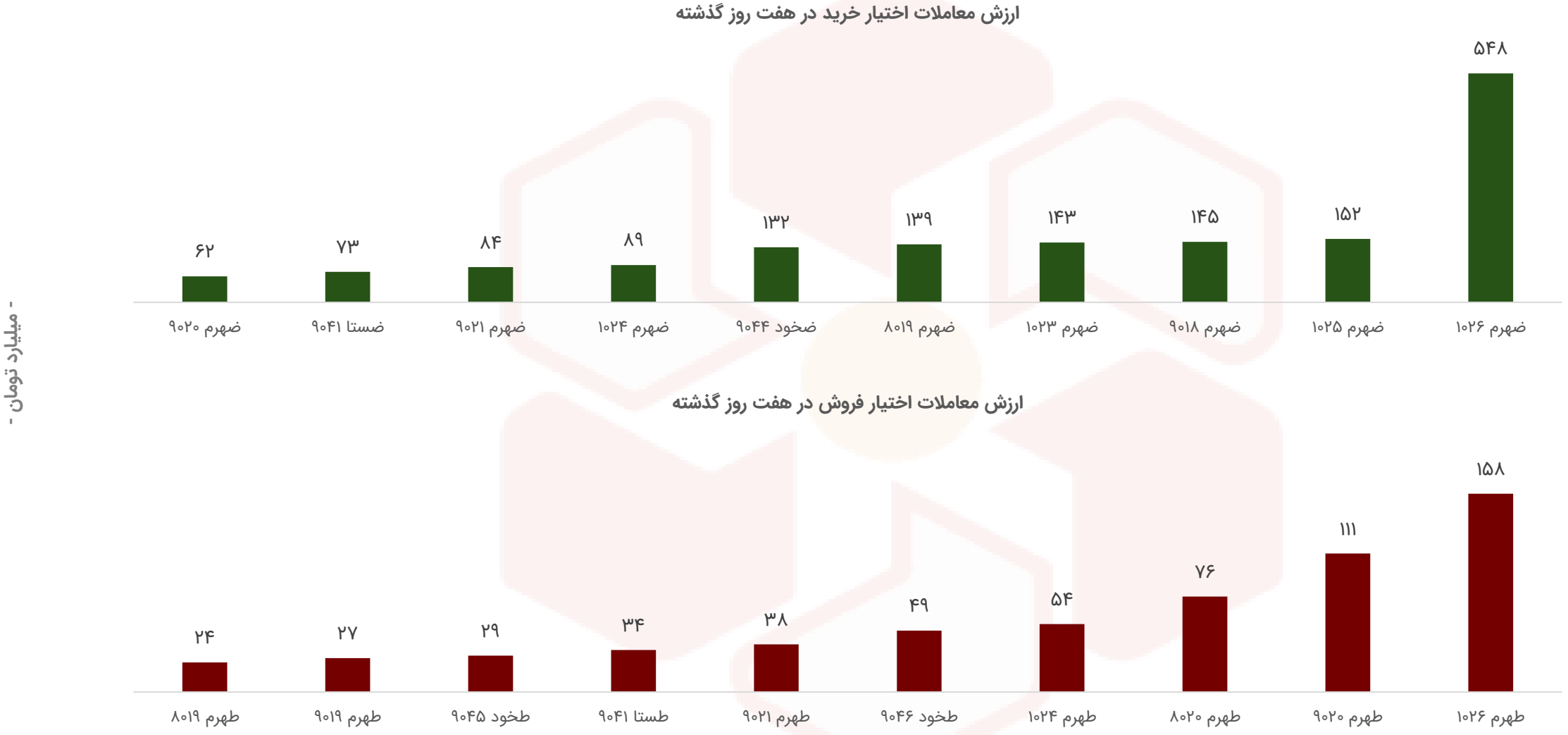
کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	چاپ	۶
۲	محصولات کاغذی	۶۸
۳	استخراج زغال سنگ	۷۰
۴	پیمانکاری صنعتی	۱۴۹
۵	خرده فروشی	۱۷۳

نمادهای با کمترین P/E

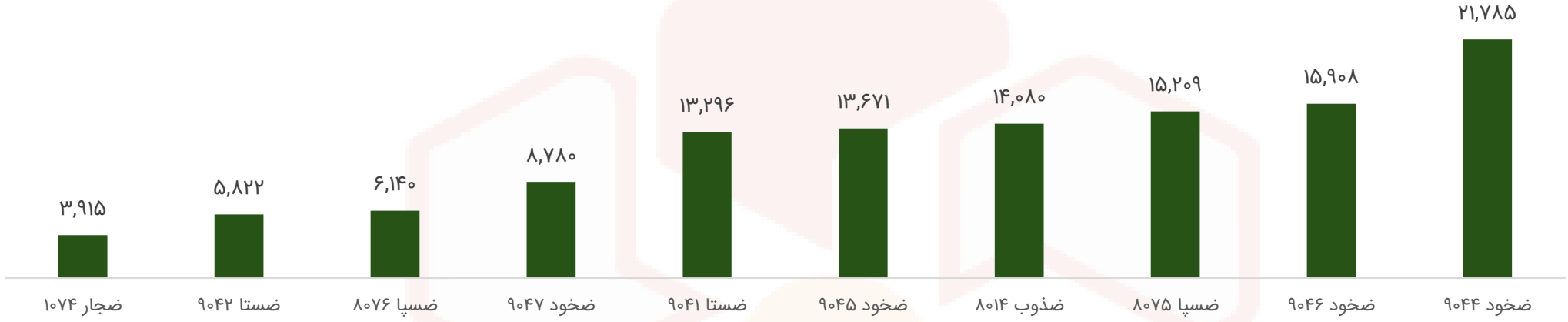
نماد	قیمت (ریال)	P/E
وپارس	۲،۷۵۶	۱
وبملت	۱،۱۹۰	۱.۵
حآفرین	۱،۴۸۶	۱.۷
ولساپا	۶۰۹	۲
کوثر	۱،۸۴۹	۲.۲
نوین	۱،۹۷۶	۲.۲
شساخت	۷,۹۲۰	۲.۴
ثبهساز	۲،۲۸۰	۲.۵
البرز	۲،۳۳۶	۲.۵
ثامید	۱،۷۶۶	۲.۶

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه



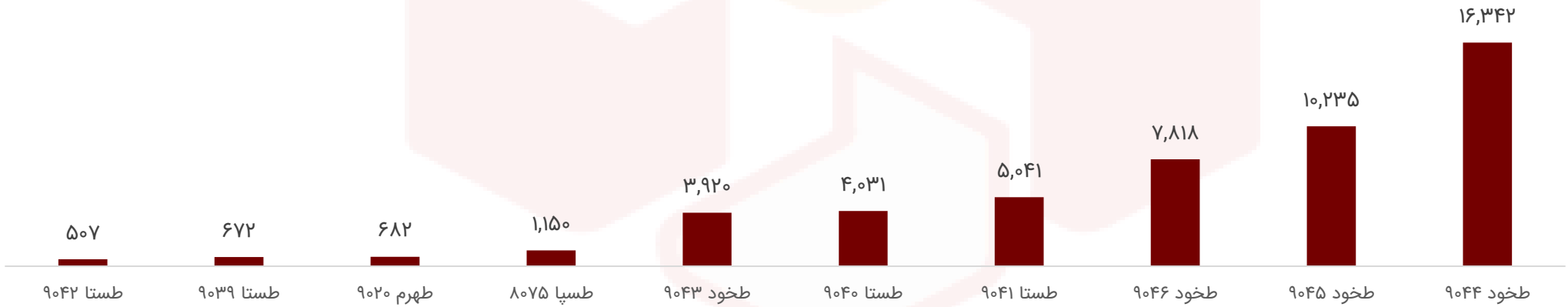
بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



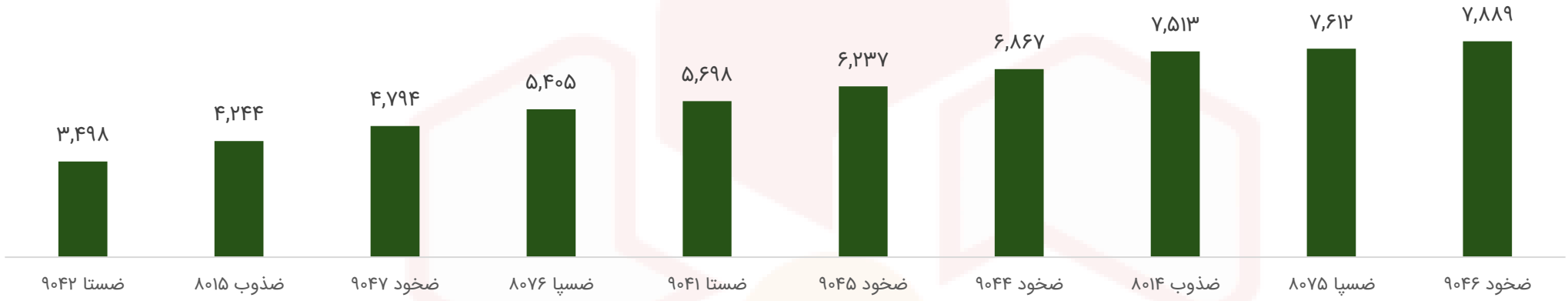
- هزار برگ سهم -

بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته

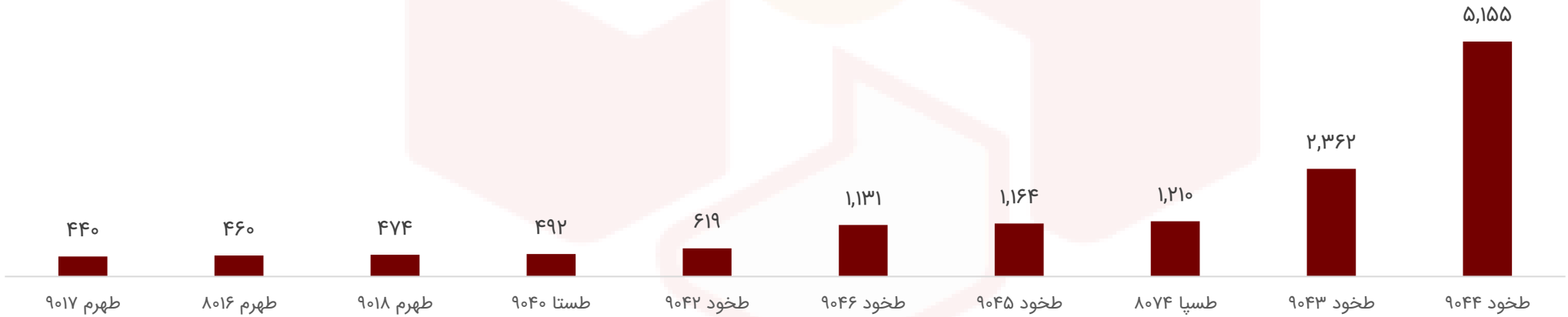


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار خرید در هفت روز گذشته

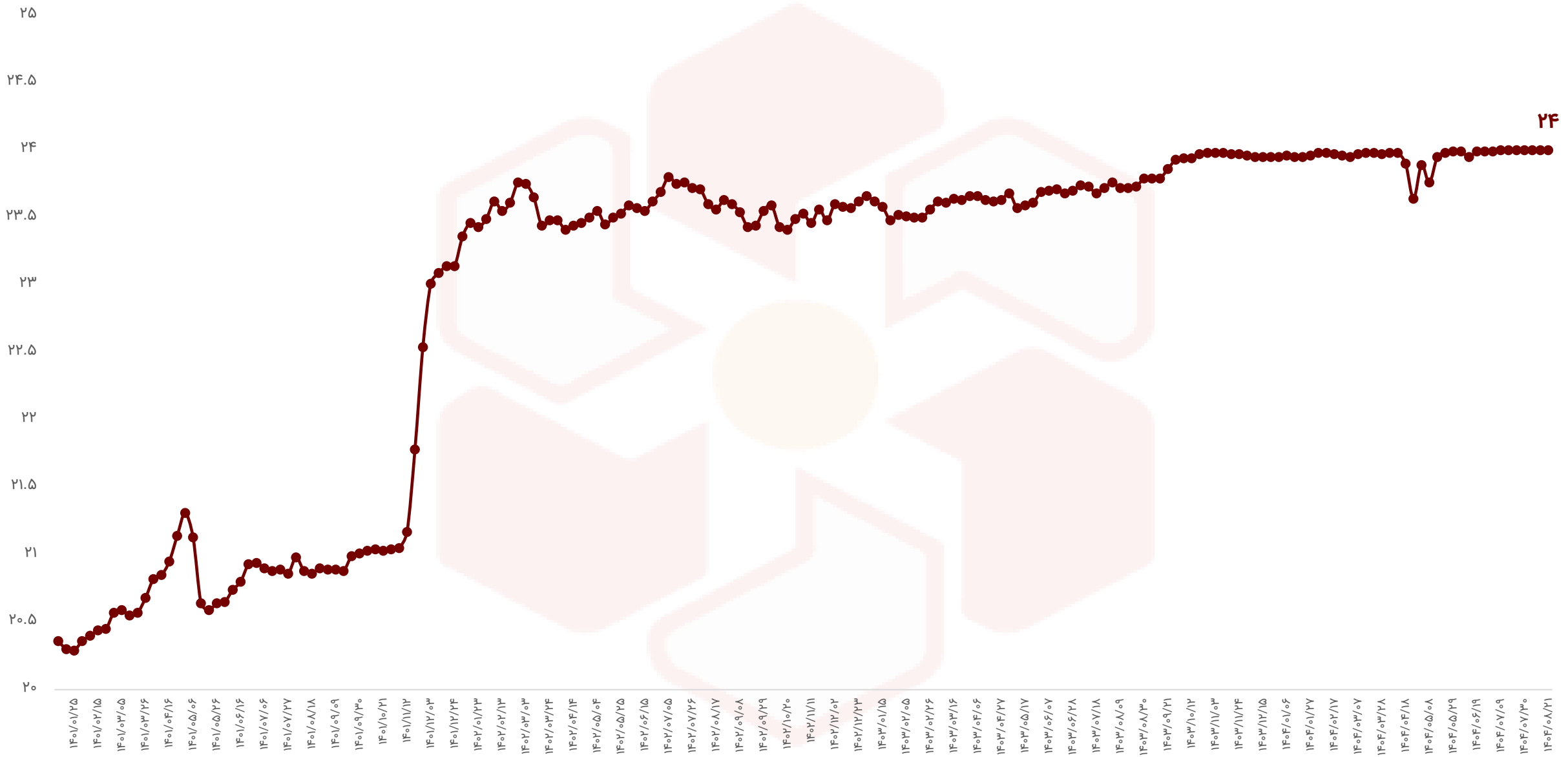


بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار موقعیت باز -

روند نرخ بهره بین بانکی (%)

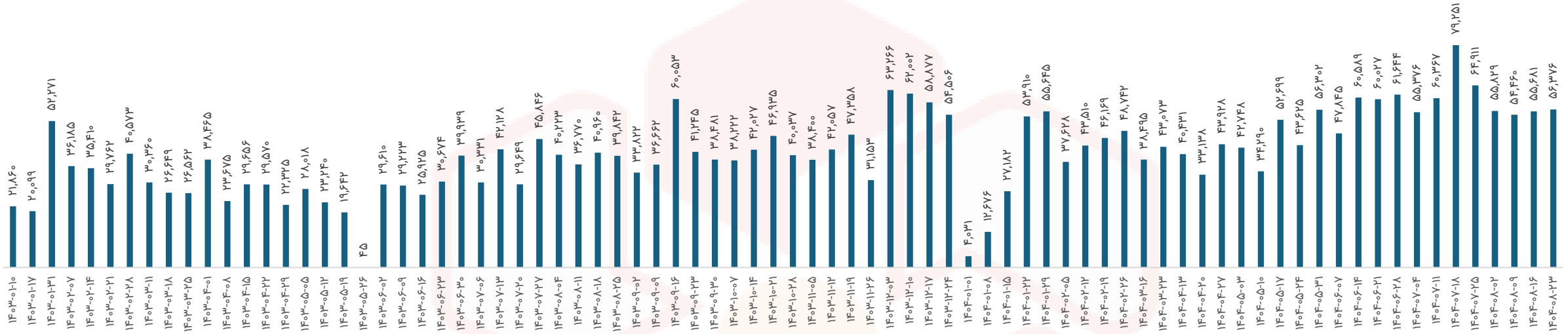


اوراق با درآمد ثابت

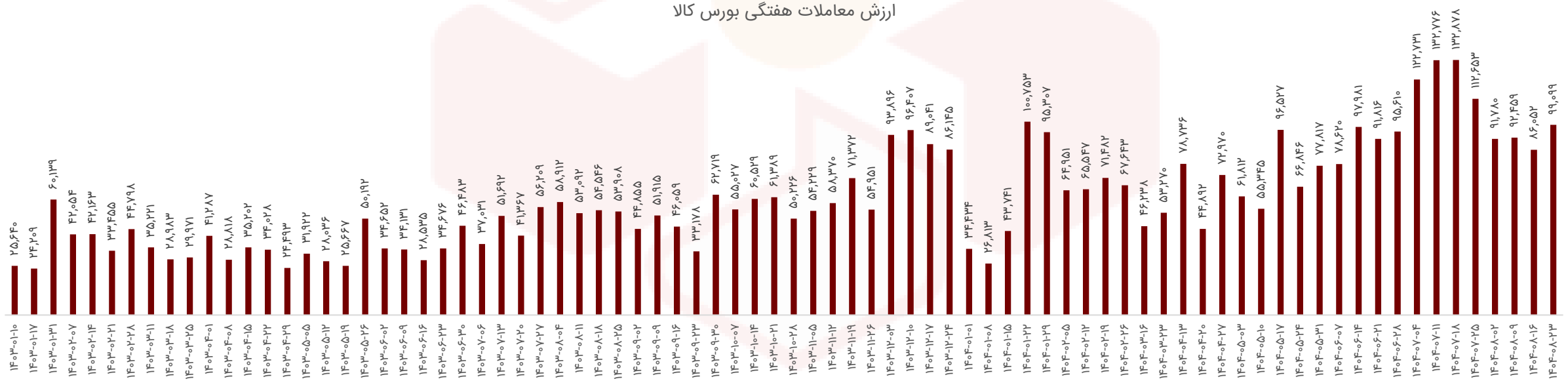
نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۱۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۰۹-۱۶	۲۲	۱۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۷,۰۰۰	۴۵.۳۸%
اخزا۲۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۰۹-۱۰	۱۶	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۸۳,۱۵۰	۴۴.۴۱%
اخزا۱۰۹	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۰۸-۲۶	۲	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۹۳,۳۶۰	۴۱.۴۹%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۶۶۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۶۹,۳۰۰	۳۶.۳۵%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۳۸۷	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۲۰,۶۷۰	۳۵.۹۸%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۴۴۳	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۸۶,۱۲۰	۳۵.۹۳%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۴۲۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۰۰,۸۰۰	۳۵.۸۲%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۲۱۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۳۷,۱۰۰	۳۵.۷۶%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۳۹۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۳,۵۰۰	۳۵.۵۷%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۳۳۱	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۵۷,۴۲۰	۳۵.۴۶%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۴۲۲	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۰۰,۰۰۰	۳۵.۰۶%
اخزا۱۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۱۰-۱۴	۵۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۵۴,۵۹۰	۳۴.۹۷%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۳۵۹	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۳۸,۵۰۰	۲۹.۵۱%

روند ارزش معاملات بورس کالا

ارزش معاملات هفتگی بازار فیزیکی بورس کالا



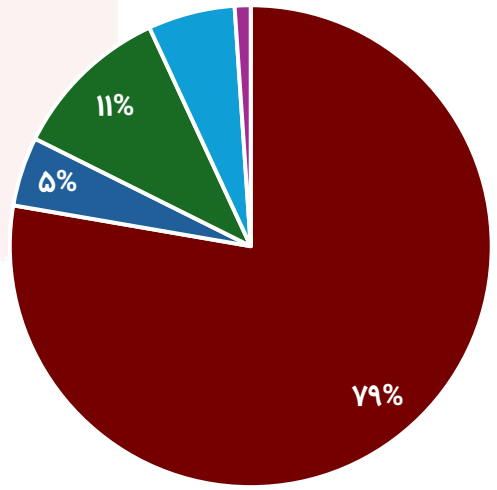
ارزش معاملات هفتگی بورس کالا



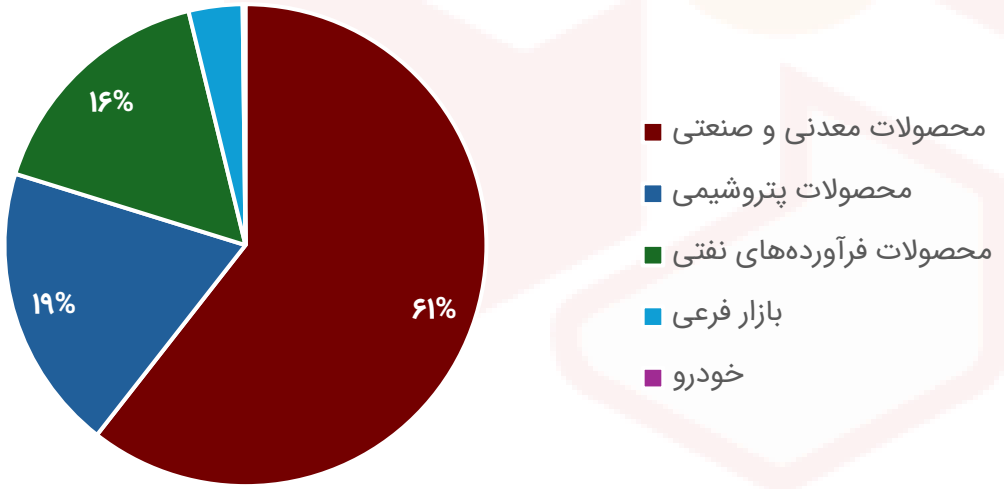
آمار معاملات بازار فیزیکی بورس کالا در یک هفته گذشته

بازار فیزیکی	حجم (هزارتن)	ارزش (میلیارد تومان)
محصولات معدنی و صنعتی	۲,۵۴۲	۳۴,۱۴۵.۷
محصولات پتروشیمی	۱۵۲	۱۰,۸۳۴.۹
محصولات فرآورده‌های نفتی	۳۵۱	۹,۲۵۲.۱
بازار فرعی	۱۹۱	۲,۰۳۵.۲
خودرو (عدد)	۳۵	۱۰۷.۹
جمع بازار فیزیکی	**۳,۲۳۷**	**۵۶,۳۷۶**

سهم محصولات در حجم معاملات طی هفته گذشته



سهم محصولات در ارزش معاملات طی هفته گذشته



آمار معاملات سایر بازارهای بورس کالا در یک هفته گذشته

بازار مشتقه	تعداد قرارداد	ارزش (میلیارد تومان)
قراردادهای آتی	۷۷,۸۰۲	۷۰۴
قراردادهای اختیار معامله	۱,۳۵۱,۶۶۸	۳۲
جمع قراردادهای مشتقه	**۱,۴۲۹,۴۷۰**	**۷۳۶**

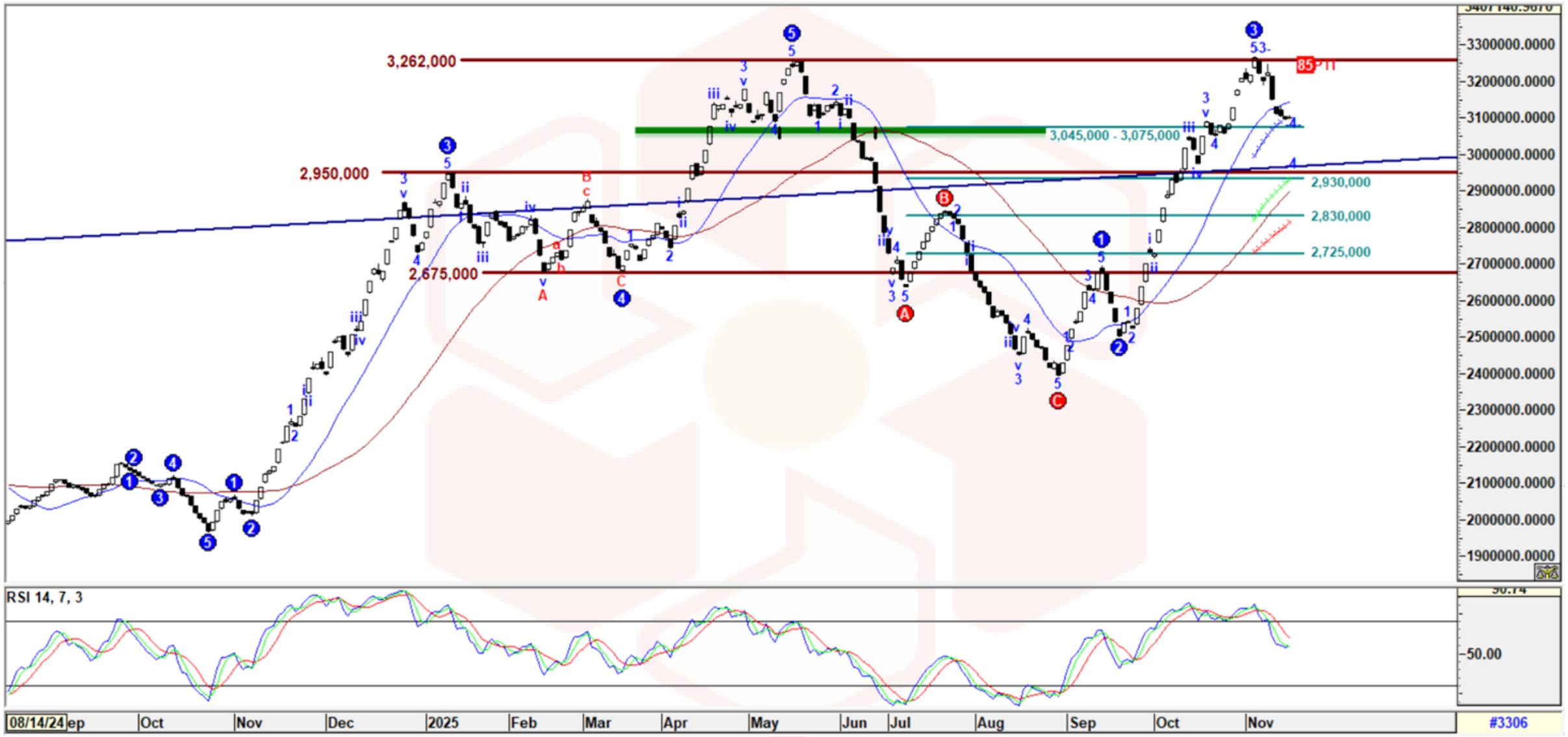
بازار ابزارهای مالی	تعداد قرارداد	ارزش (میلیارد تومان)
سلف موازی استاندارد	۴۷,۸۵۶	۱۳.۵
گواهی سپرده سکه طلا	۱۲,۰۶۰,۹۵۳	۱,۵۹۲.۶
صندوق سرمایه‌گذاری زعفران	۴,۳۴۴,۱۷۲,۴۹۲	۳۰,۹۳۱.۱
جمع بازار ابزارهای مالی	**۴,۳۵۶,۲۸۱,۳۰۱**	**۳۲,۵۳۷.۳**

بازار گواهی سپرده بورس کالا	حجم (تعداد گواهی)	ارزش (میلیارد تومان)
گواهی سپرده شمش طلا	۷,۷۶۲,۳۱۲	۹,۴۴۹

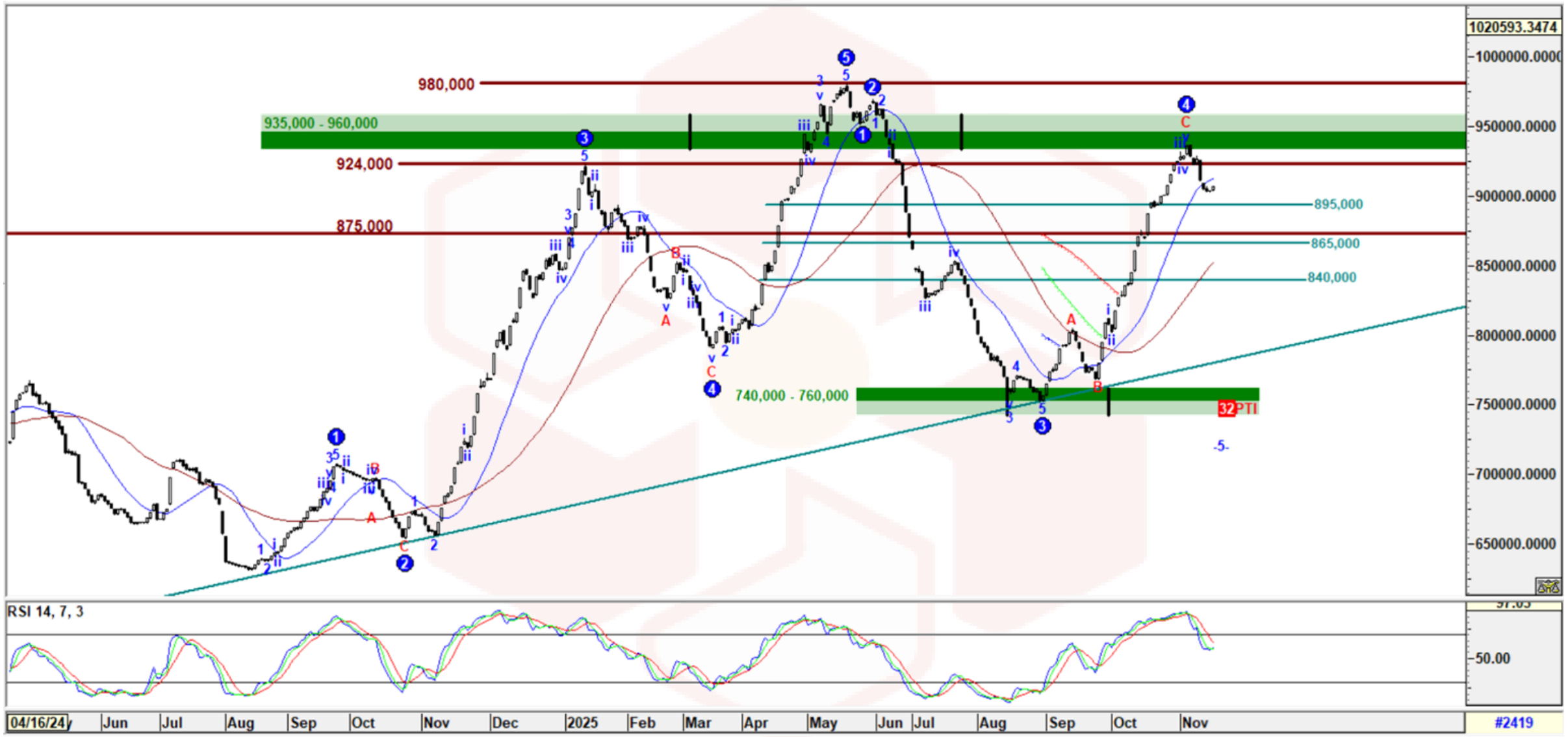
وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۰۷۶	۳,۹۹۸	۲%	۴,۲۱۰	(۳.۲%)
سکه امامی (ریال)	۱,۱۹۵,۰۵۰,۰۰۰	۱,۱۱۴,۱۰۰,۰۰۰	۷.۳%	۱,۱۲۲,۹۰۰,۰۰۰	۶.۴%
دلار آزاد (ریال)	۱,۱۲۱,۰۰۰	۱,۰۷۹,۵۰۰	۳.۸%	۱,۰۸۶,۵۰۰	۳.۲%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۶۴.۲	۶۳.۶	۱%	۶۲.۴	۲.۹%
بیت کوین (دلار)	۹۵,۱۰۴	۱۰۳,۱۲۸	(۷.۸%)	۱۱۱,۴۶۳	(۱۴.۷%)
آلومینیوم LME (دلار)	۲,۸۶۰	۲,۸۵۷	۰.۱%	۲,۷۴۷	۴.۱%
مس LME (دلار)	۱۰,۸۳۵	۱۰,۶۹۶	۱.۳%	۱۰,۶۲۰	۲%
روی LME (دلار)	۳,۰۱۹	۳,۰۶۷	(۱.۶%)	۲,۹۴۲	۲.۶%
سرب LME (دلار)	۲,۰۷۰	۲,۰۵۲	۰.۸%	۱,۹۸۷	۴.۲%
انس پلاتین (دلار)	۱,۵۵۹	۱,۵۵۰	۰.۶%	۱,۶۹۵	(۸%)
اوره فوب خاورمیانه (دلار)	۴۰۸	۳۹۷	۲.۸%	۳۹۳	۳.۸%

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل هم‌وزن



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege