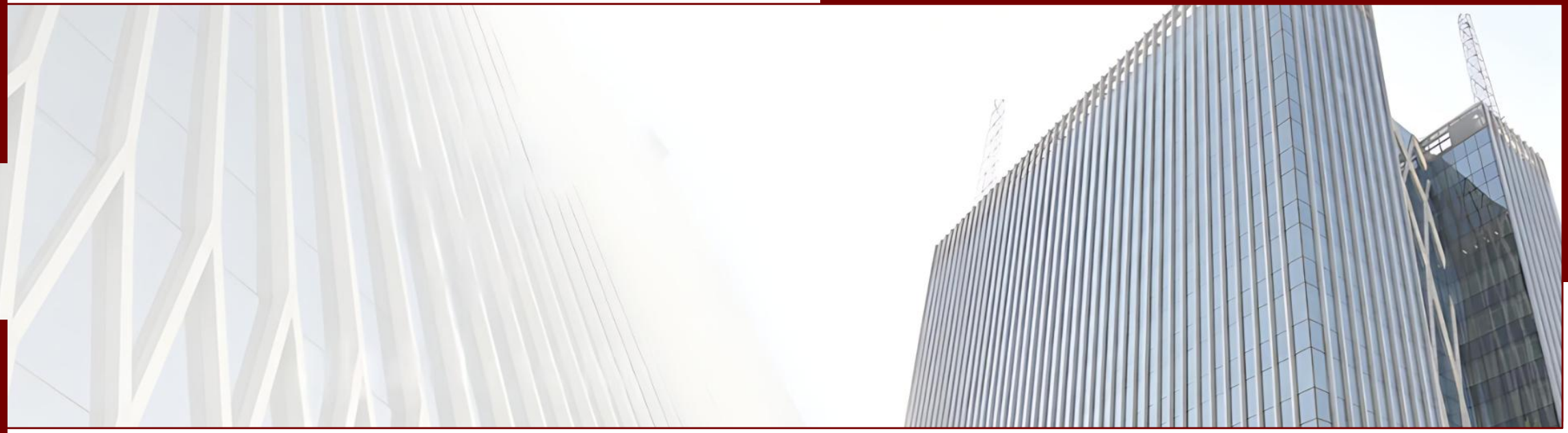


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۷ آذر "۱۴۰۴

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
- وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه ۲۲
- بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار ۲۳

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



سخنرانی رهبر انقلاب درباره ارسال پیغام به آمریکا

رهبر انقلاب در یک سخنرانی تلویزیونی اعلام کردند که ادعای ارسال پیام از طرف ایران به آمریکا از راه واسطه‌ها کاملاً دروغ است و آمریکا را «شایسته ارتباط و همکاری با جمهوری اسلامی» ندانستند. ایشان با اشاره به جنگ ۱۲ روزه گفتند آمریکا با وجود استفاده از پیشرفته‌ترین تجهیزات نظامی شامل زیردریایی‌ها، جنگنده‌ها و سامانه‌های پدافندی، به اهدافش نرسید و متحمل ضرر شد. به گفته رهبر انقلاب، آمریکا قصد داشت افکار عمومی ایران را فریب دهد، اما نتیجه برعکس شد و اتحاد ملت ایران در برابر آمریکا بیشتر شد و توانستند آمریکا را ناکام کنند.



پیشنهاد آمریکا برای پایان جنگ روسیه و اوکراین

تلگراف گزارش داده آمریکا در حال بررسی به رسمیت شناختن کنترل روسیه بر کریمه و برخی مناطق اشغالی اوکراین برای پایان جنگ است. نمایندگان ترامپ برای ارائه این پیشنهاد به پوتین به مسکو رفته‌اند. طرح آمریکا شامل به رسمیت شناختن ضمنی کریمه، دونتسک، لوگانسک، خرسون و زاپوریژیا پس از آتش‌بس است. اوکراین طبق قانون اساسی نمی‌تواند بدون همه‌پرسی سرزمین واگذار کند. این طرح باعث نگرانی اروپا شده، چون آنها تغییر مرز با زور را نمی‌پذیرند. روسیه قصد دارد مناطق اشغالی را در یک دهه آینده به‌طور کامل در خاک خود ادغام کند.



ترامپ فرمان‌های اجرایی دوران بایدن را لغو کرد

ترامپ در شبکه اجتماعی تروث‌سوشال اعلام کرده که تمام اسنادی را که با دستگاه «اتوپن» و بدون امضای مستقیم بایدن امضا شده‌اند، از اعتبار ساقط می‌داند. او مدعی است که حدود ۹۲ درصد اسناد دولت بایدن با این دستگاه امضا شده و این کار فقط وقتی قانونی است که رئیس‌جمهور شخصاً آن را تأیید کند. ترامپ ادعا کرده که اطرافیان بایدن بدون دخالت او از اتوپن استفاده کرده‌اند و این یعنی آنها عملاً «ریاست‌جمهوری را از او گرفته‌اند». به گفته او، اگر بایدن بگوید که در این روند حضور داشته، «شهادت دروغ» محسوب می‌شود. بر اساس گزارش راشا تودی، ترامپ پیش از این نیز دولت بایدن را به توطئه برای استفاده غیرقانونی از اتوپن متهم کرده و خواهان تحقیق درباره این موضوع شده بود.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



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

آمار معاملات بازار فیزیکی بورس کالای ایران نشان می‌دهد در هفته گذشته حدود ۳ میلیون و ۹۳ هزار تن انواع کالا و محصول به ارزش بالغ بر ۶۷/۵ هزار میلیارد تومان معامله شد. همچنین ارزش معاملات ۱۰ شرکت برتر به بیش از ۳۵/۹ هزار میلیارد تومان رسید. برترین‌های بورس کالای ایران در هفته اخیر براساس ارزش فروش شرکت‌ها شامل: فولاد مبارکه اصفهان با معامله ۳۵۹ هزار و ۵۰۰ تن انواع ورق فولادی و آرگون به ارزش ۱۸ هزار و ۵۹۷ میلیارد تومان در رتبه نخست ایستاد. ملی صنایع مس ایران با فروش ۵ هزار و ۲۴۲ تن انواع مس، سولفور مولیبدن و کنسانتره فلزات گرانبها به ارزش ۵ هزار و ۳۷۲ میلیارد تومان دوم شد. فولاد خوزستان ۷۲ هزار و ۲۰ تن شمش بلوم، تختال بلوم و آرگون به ارزش ۲ هزار و ۵۶۵ میلیارد تومان فروخت و رتبه سوم را به خود اختصاص داد. معدنی و صنعتی چادرملو با معامله ۲۱۵ هزار تن کنسانتره و گندله سنگ آهن و شمش بلوم به ارزش ۲ هزار و ۴۲۴ میلیارد تومان چهارم شد.



نرخ تورم سالانه در آبان ماه ۴۰.۴ درصد اعلام شد

مرکز آمار اعلام کرد: شاخص قیمت مصرف کننده خانوارها در آبان ماه به ۴۱۷/۵ رسیده که نسبت به ماه و سال قبل ۳/۴ و ۴۹/۴ درصد افزایش یافته و طی ۱۲ ماه منتهی به آبان هم با رشد ۱.۵ درصدی به ۴۰/۴ درصد رسیده است. براساس این گزارش، تورم نقطه به نقطه هم به ۴۹.۴ درصد افزایش یافته و خانوارها به طور میانگین، ۴۹.۴ درصد بیشتر از آبان سال قبل و ۸ دهم درصد بیشتر از ماه گذشته برای خرید کالاها و خدمات یکسان هزینه کرده‌اند. تورم ماهانه خوراکی‌ها، آشامیدنی‌ها و دخانیات ۴/۷ درصد و کالاهای غیرخوراکی و خدمات هم ۲/۶ درصد رشد کرد.



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

طبق اعلام بانک مرکزی، نرخ سود در بازار بین بانکی برای نهمین هفته متوالی بدون تغییر در همان نرخ ۲۴ درصد ثابت ماند. همچنین نرخ ریپو همانند هفته‌های گذشته ۲۳ درصد اعلام گردید.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

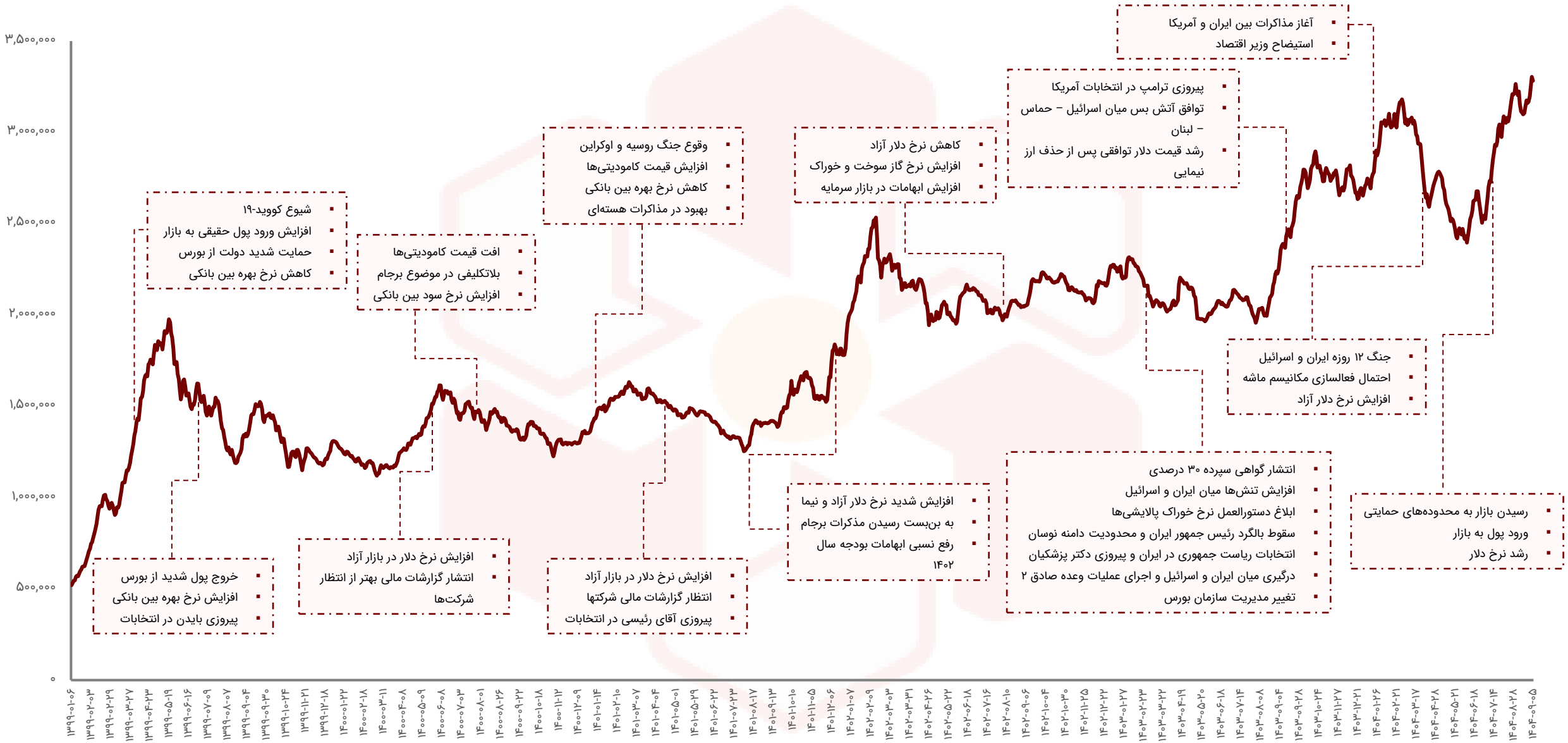
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

بازار سهام در هفته اخیر، علیرغم تعطیلی روز دوشنبه، روند معاملاتی خوبی را پشت سر گذاشت و شاخص کل با ثبت قله‌ای جدید، در پایان هفته، با ثبت رشد هفتگی ۳.۶ درصدی، بر ارتفاع ۳,۲۸۲,۳۴۴ واحد ایستاد. شاخص کل هم‌وزن نیز رشدی ۱.۸ درصدی داشت و بر ارتفاع ۹۴۱،۰۹۴ واحد ایستاد. ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم با ۲.۶ درصد رشد، به ۲۸ هزار میلیارد تومان رسید. میانگین ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم با رشد ۲۸.۳ درصدی از ۵،۴۵۳ میلیارد تومان به ۶،۹۹۵ میلیارد تومان رسید. در هفته اخیر، خالص ورود/خروج پول حقیقی سهام، حق تقدم و صندوق‌های سهامی (۳۶۲) میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های با درآمد ثابت ۶۸۰ میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های طلا ۴،۶۲۳ میلیارد تومان ثبت شد. در روزهای ابتدایی هفته، انتشار خبر حذف عوارض مالیات اوره‌سازها، افزایش نرخ دلار نیما، خبرهای مثبت از گروه‌های پالایشی و خودرویی و انتشار گزارشات ماهانه شرکت‌ها، باعث افزایش ارزش معاملات و عبور شاخص کل از سقف تاریخی خود شد؛ اگرچه در روز چهارشنبه، پس از تأیید افزایش نرخ بنزین و از سوی دیگر، تشدید ریسک‌های سیاسی و افزایش نگرانی‌ها، شاهد افت شاخص کل و تغییر وضعیت بازار از مثبت به منفی بودیم. در بازار موازی با سهام، صندوق‌های طلا ورود پولی بیش از ۴ همتی را در این هفته ثبت کردند.

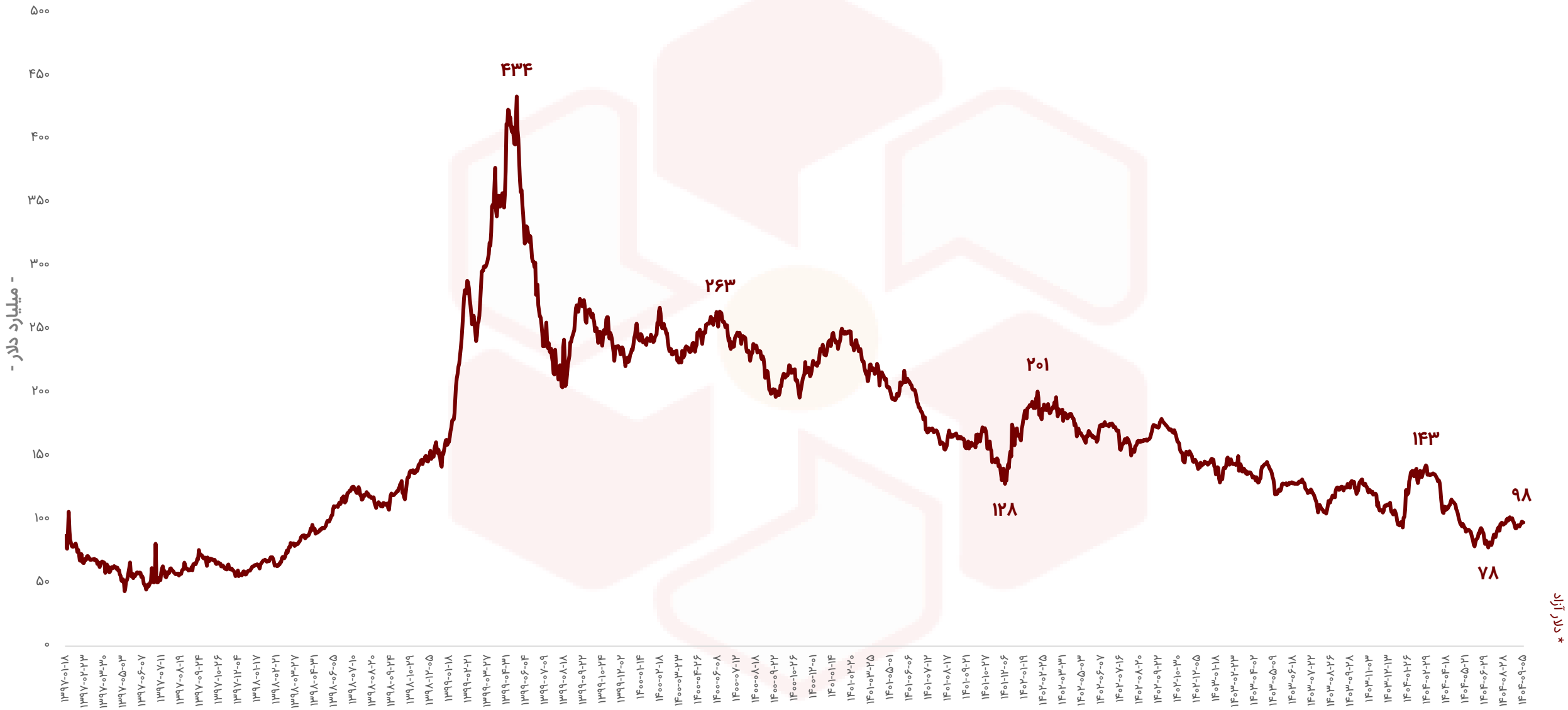
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۳،۱۶۸،۵۶۳	۳،۲۸۲،۳۴۴	۱۱۳،۷۸۱	%۳.۶
شاخص هم وزن (واحد)	۹۲۳،۷۸۴	۹۴۱،۰۹۴	۱۷،۳۱۰	%۱.۸
ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم (میلیارد تومان)	۲۷،۹۸۱		۷۱۵	%۲.۶
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۳۶۲)		-	-

روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن

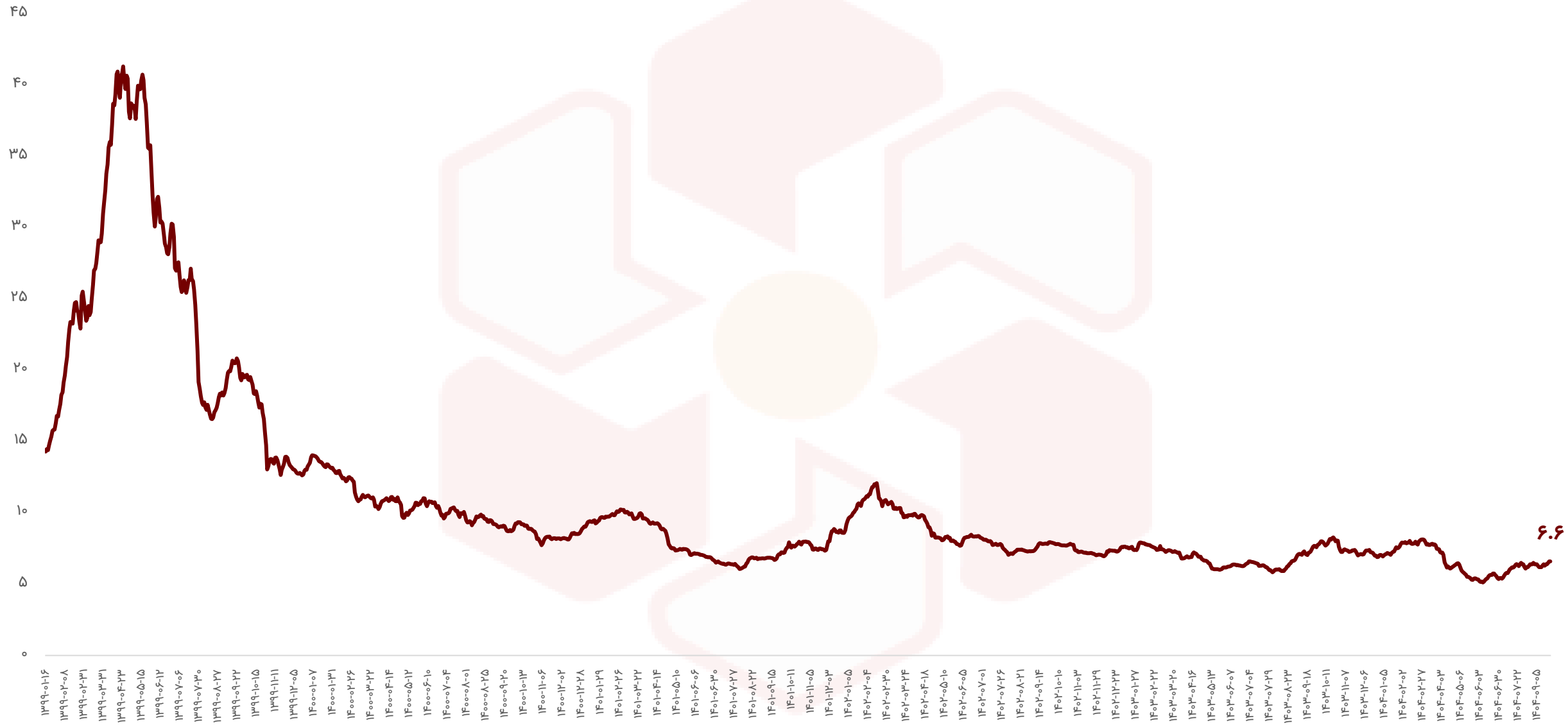


ارزش دلاری بازار*



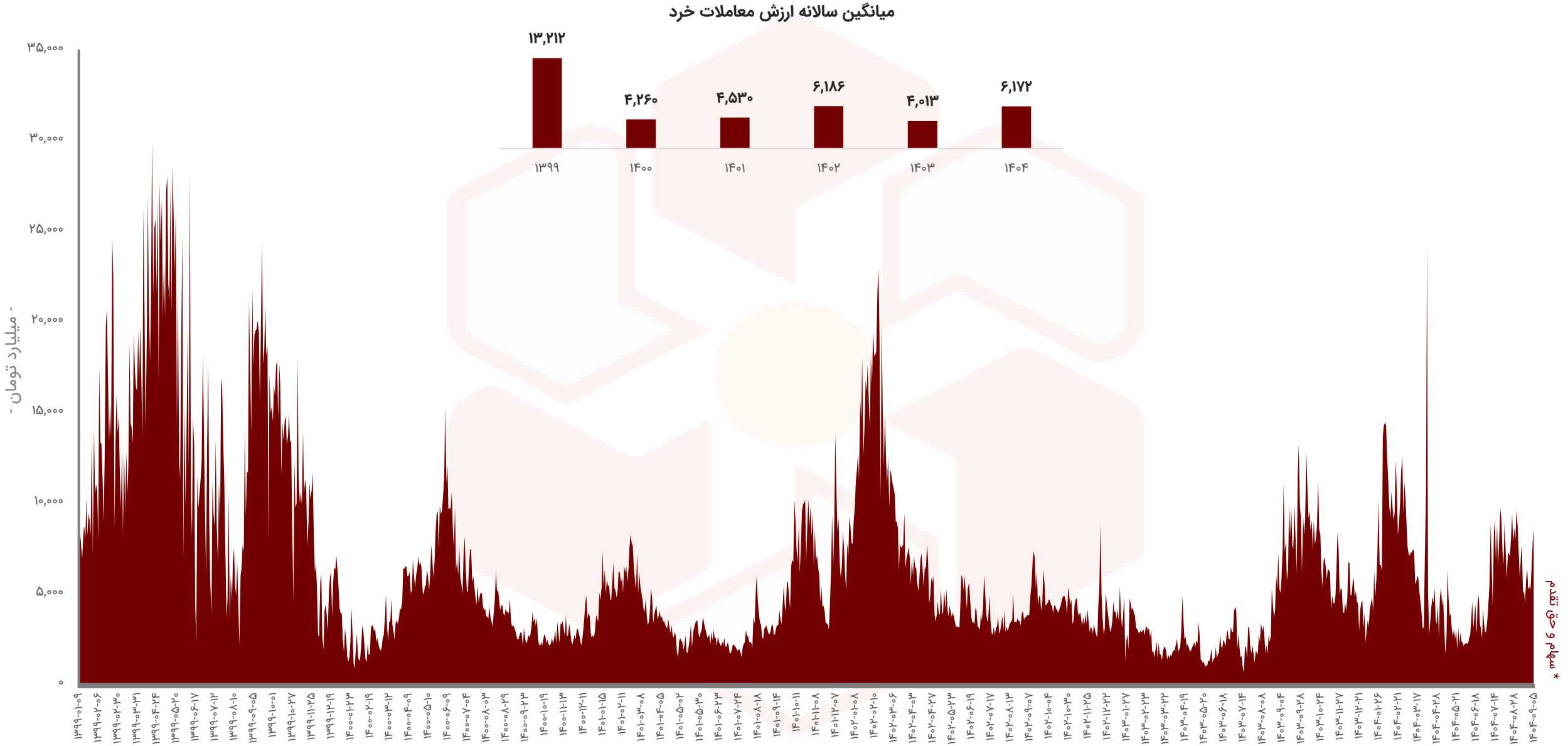
* دلار آزاد

نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)

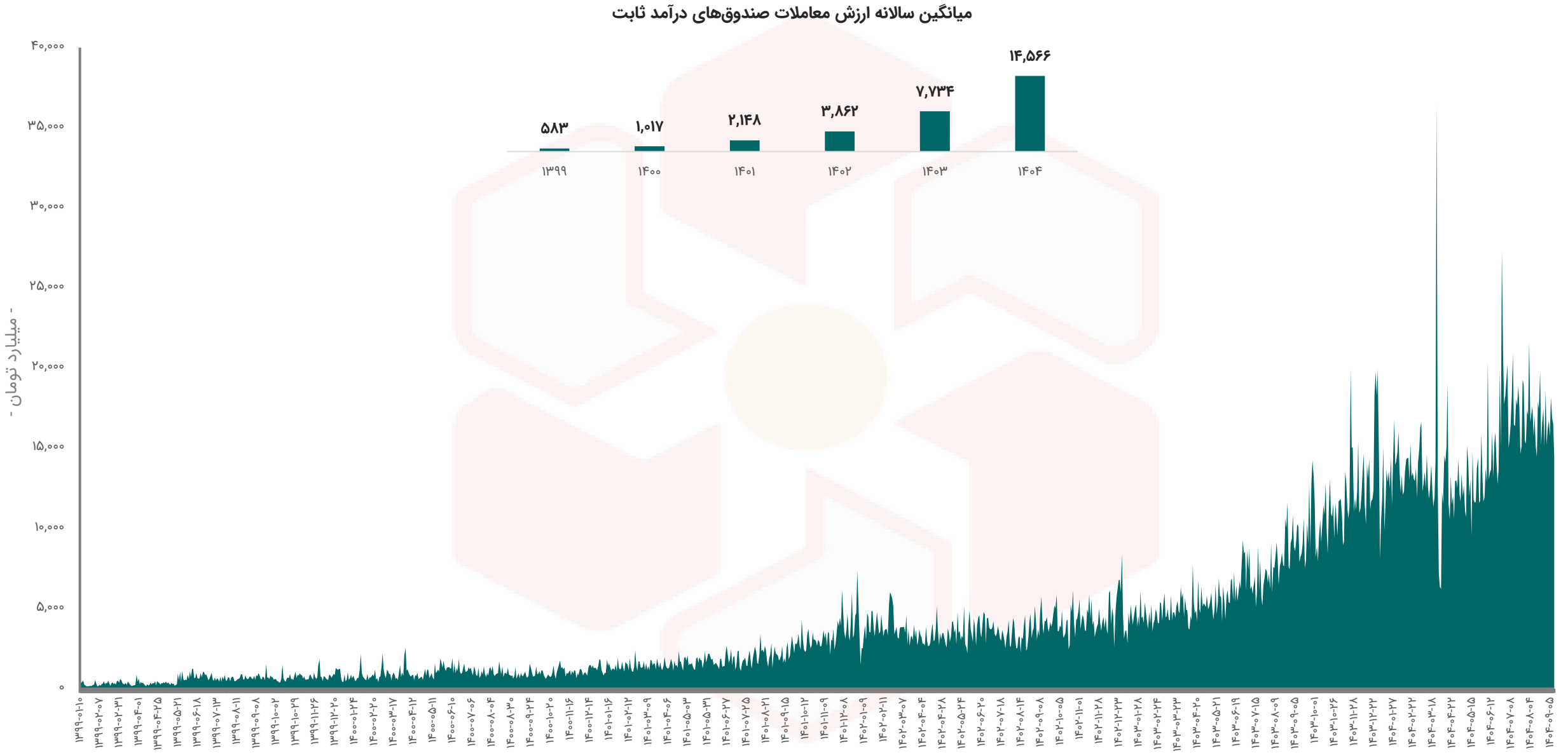


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

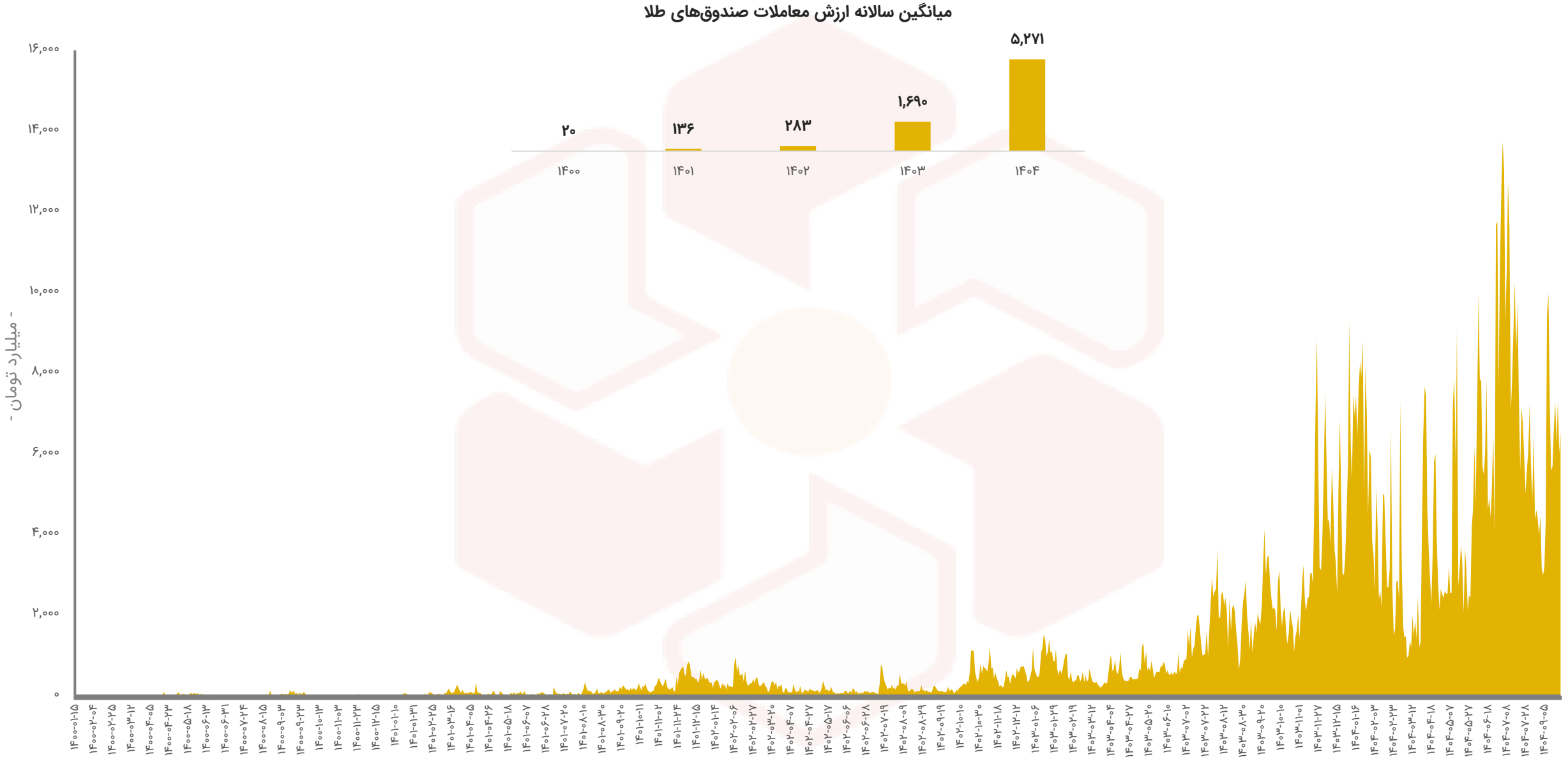
ارزش معاملات خرد سهام*



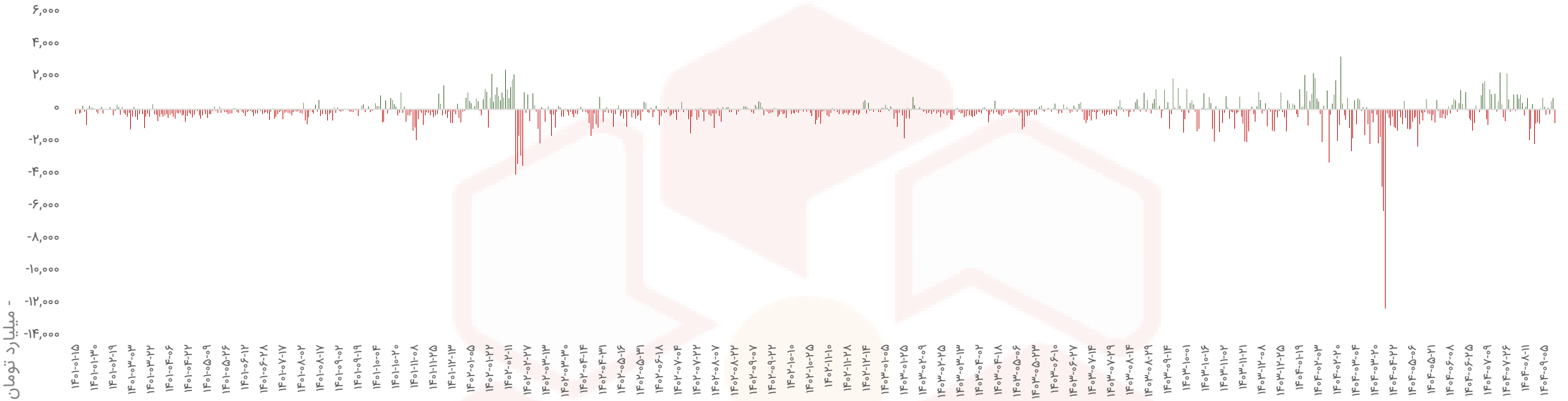
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



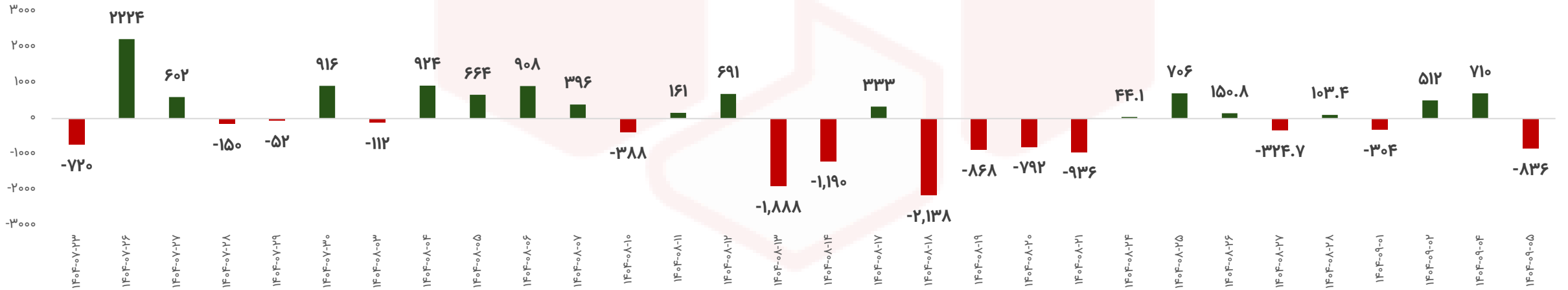
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



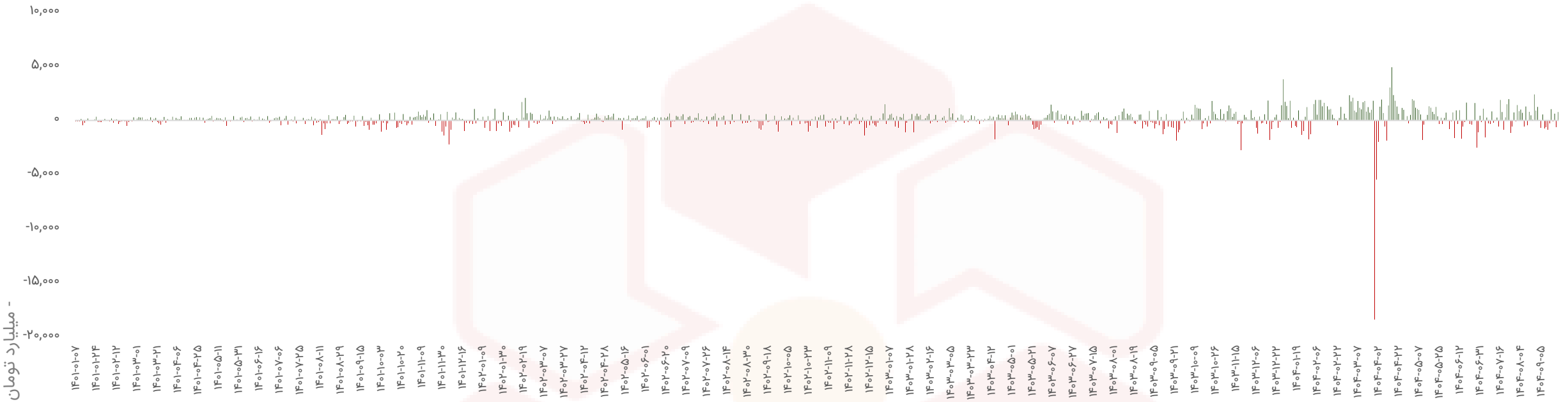
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



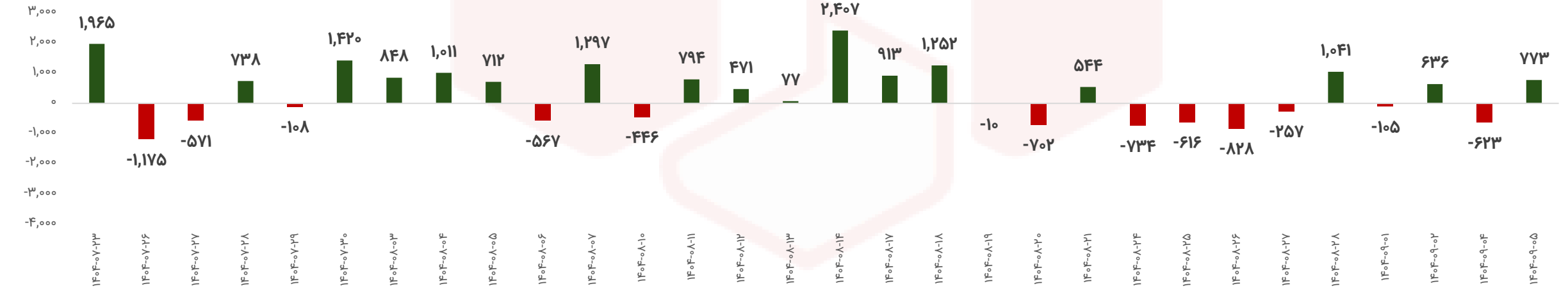
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



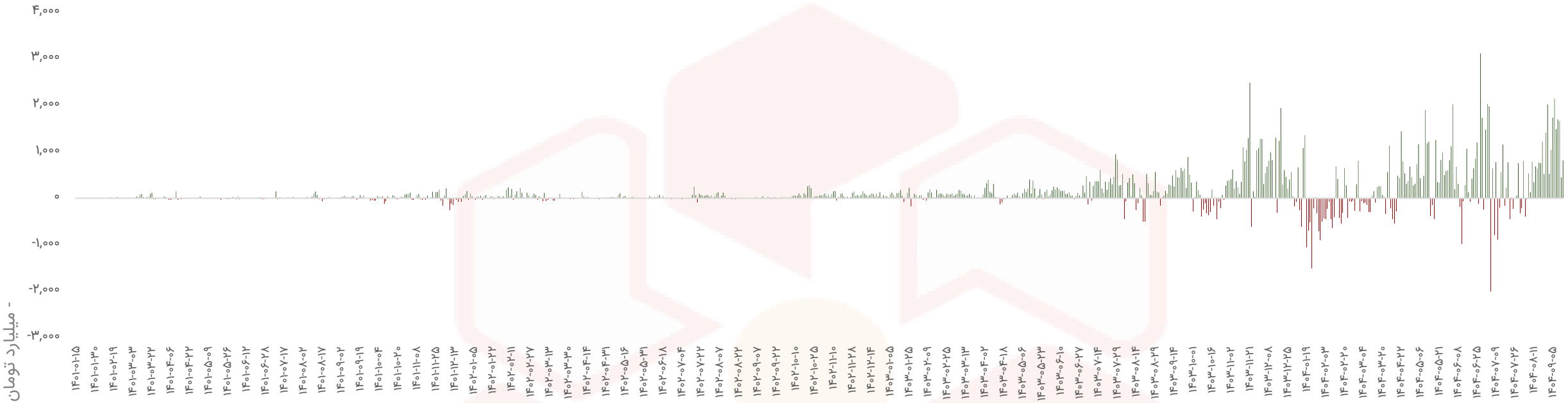
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



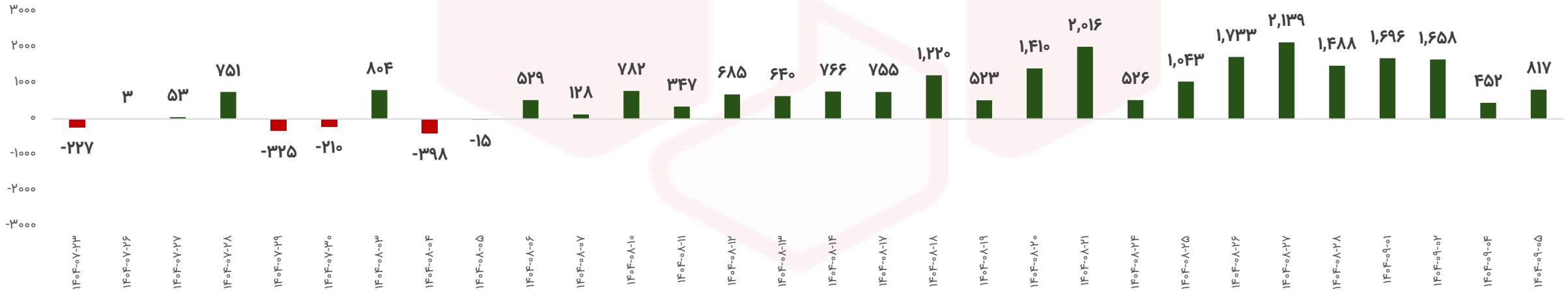
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

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

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	پالایش نفت بندرعباس	شبندر	%۱۷.۲
۲	قند لرستان	قلرست	%۱۵.۳
۳	کابلسازی ایران	بایکا	%۱۵.۳
۴	سر. توسعه صنعتی ایران	وتوصا	%۱۵
۵	سر. ارس صبا	وارس	%۱۴.۸

نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	پرداخت الکترونیک بانک پاسارگاد	پی‌پاد	(%۱۱.۷)
۲	لوازم خانگی پارس	لخانه	(%۱۱.۷)
۳	زغال سنگ پروده طبس	کزغال	(%۱۰.۷)
۴	خدمات فنی فولاد یزد	خفولا	(%۱۰.۵)
۵	واسپاری تجار ایرانیان	ولتجار	(%۸.۸)

ترین‌های بازار در هفته اخیر

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	شیمیایی	۵،۷۱۸
۲	بانکها و موسسات اعتباری	۴،۰۰۱
۳	فلزات اساسی	۳،۵۶۹
۴	فرآورده‌های نفتی	۳،۴۰۷
۵	استخراج کانه‌های فلزی	۲،۸۱۳

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

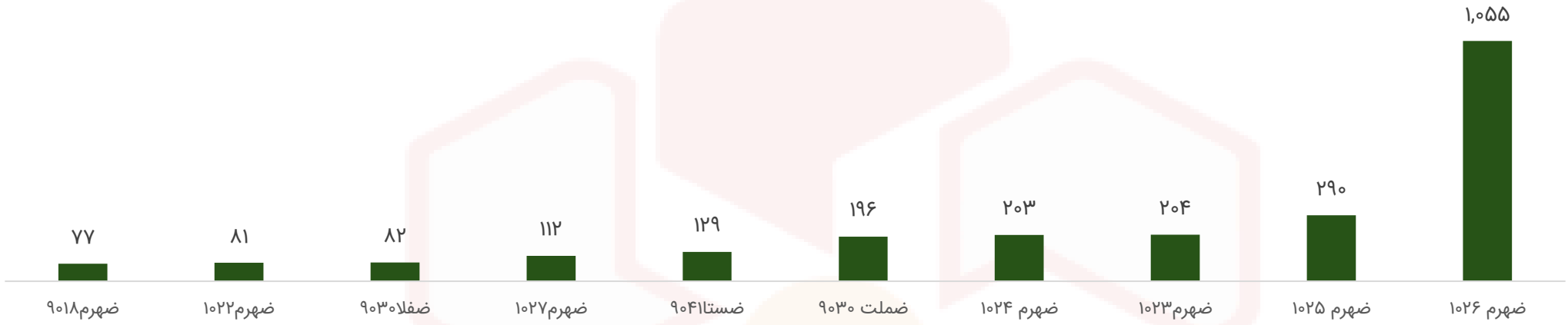
رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	چاپ	۱۴
۲	استخراج زغال سنگ	۵۸
۳	پیمانکاری صنعتی	۱۰۰
۴	منسوجات	۱۰۴
۵	محصولات کاغذی	۱۰۷

نمادهای با کمترین P/E

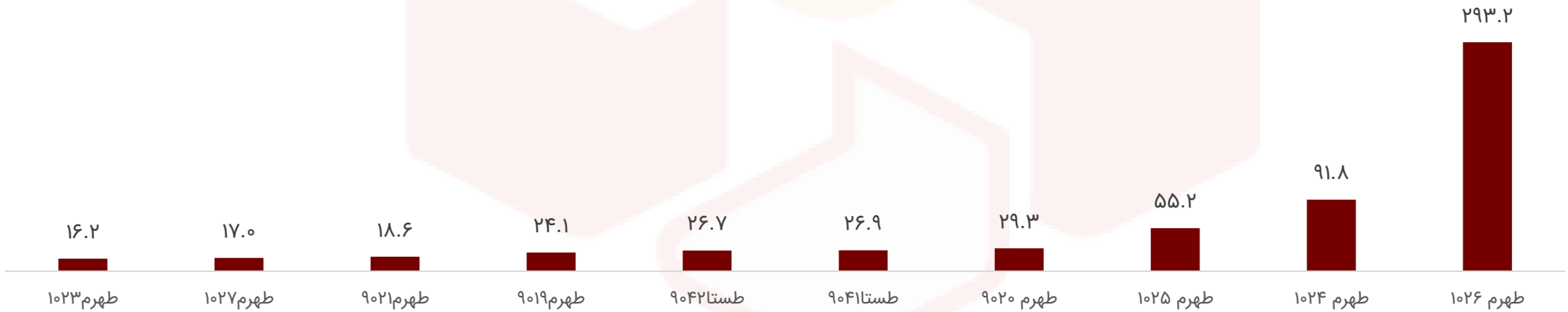
نماد	قیمت (ریال)	P/E
وپارس	۲،۹۵۹	۱
وبملت	۱،۲۰۱	۱.۵
حآفرین	۱،۵۹۳	۱.۸
کوثر	۲،۰۲۸	۲.۳
ولساپا	۷۲۰	۲.۴
نوین	۲،۲۴۰	۲.۵
البرز	۲،۳۰۶	۲.۵
ثامید	۱،۷۸۴	۲.۶
شساخت	۸،۵۹۰	۲.۷
دانا	۲،۷۵۰	۲.۸

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

ارزش معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



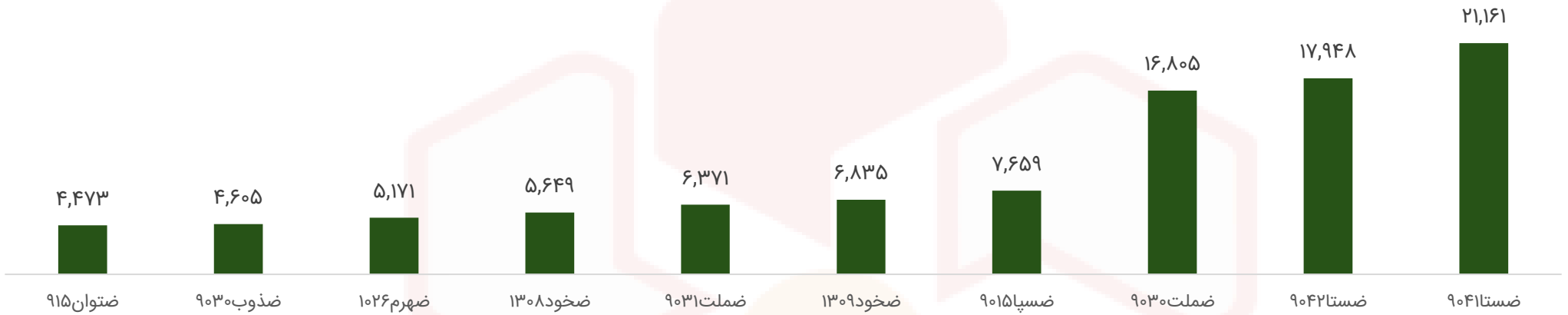
ارزش معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



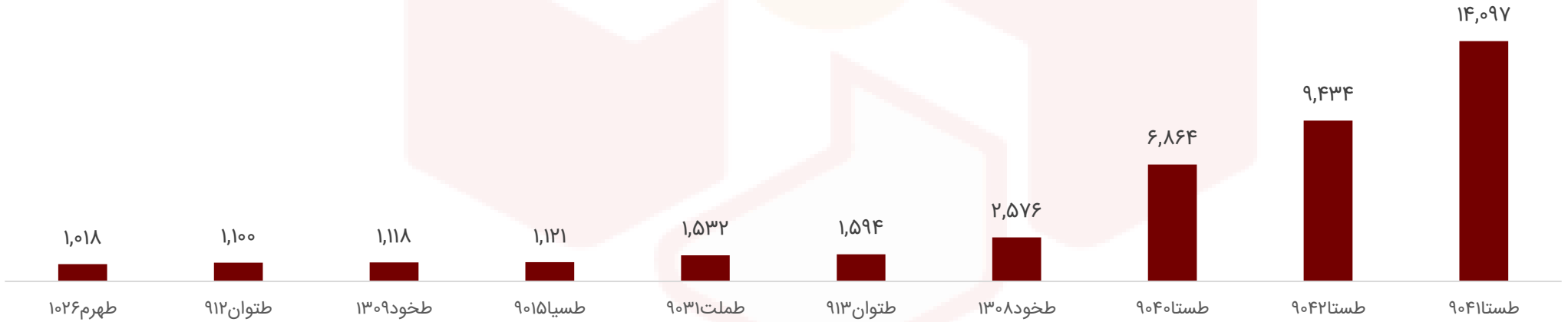
- میلیارد تومان -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



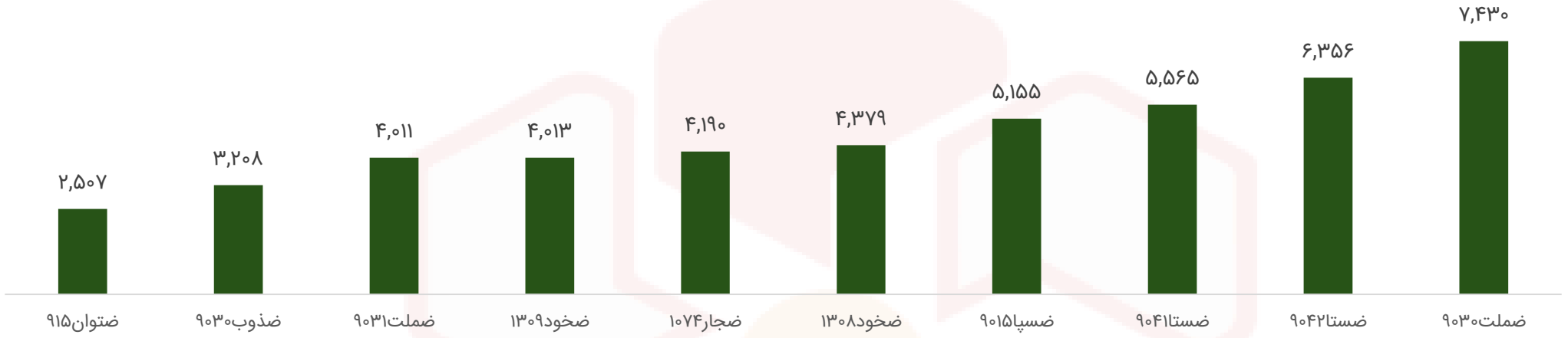
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



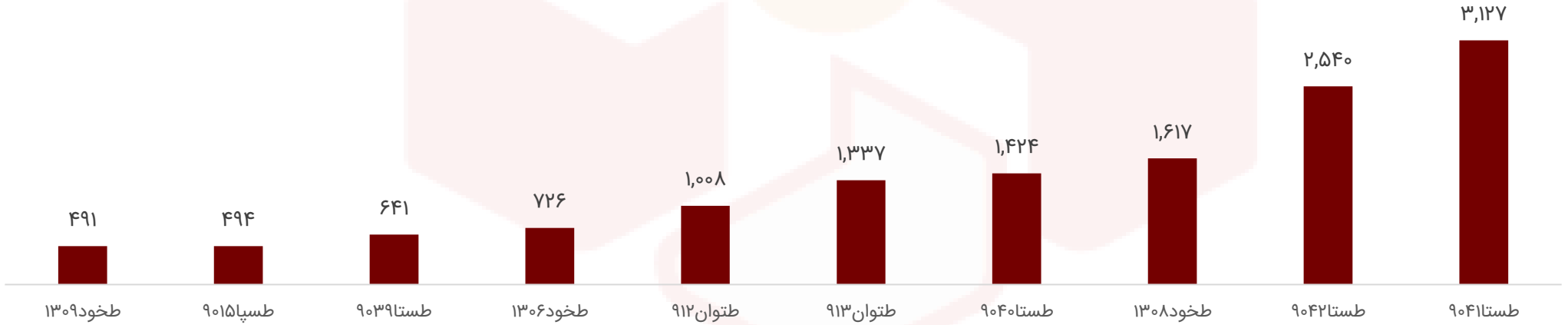
- هزار برگه سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار خرید در هفت روز گذشته

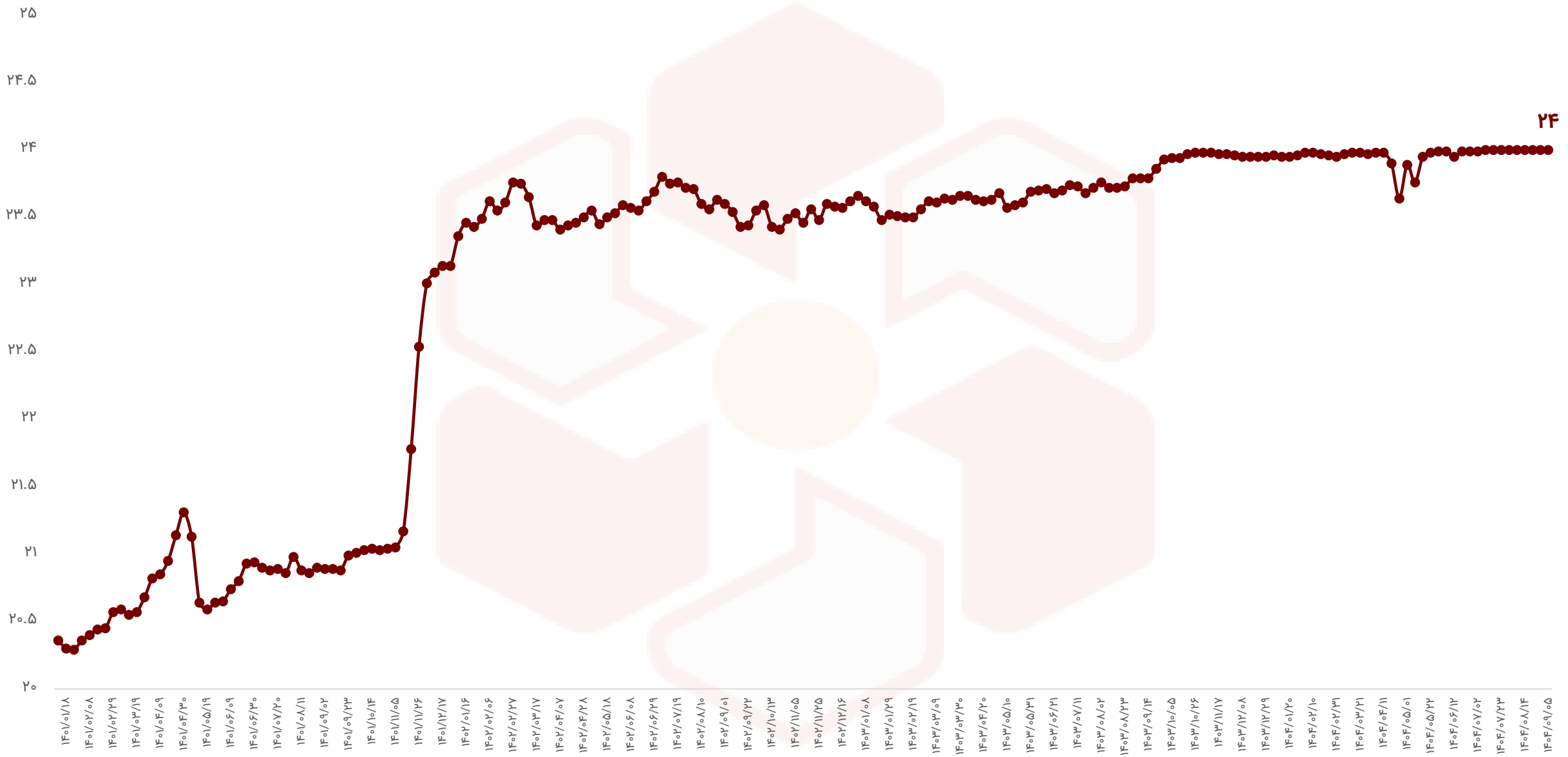


بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار موقعیت باز -

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



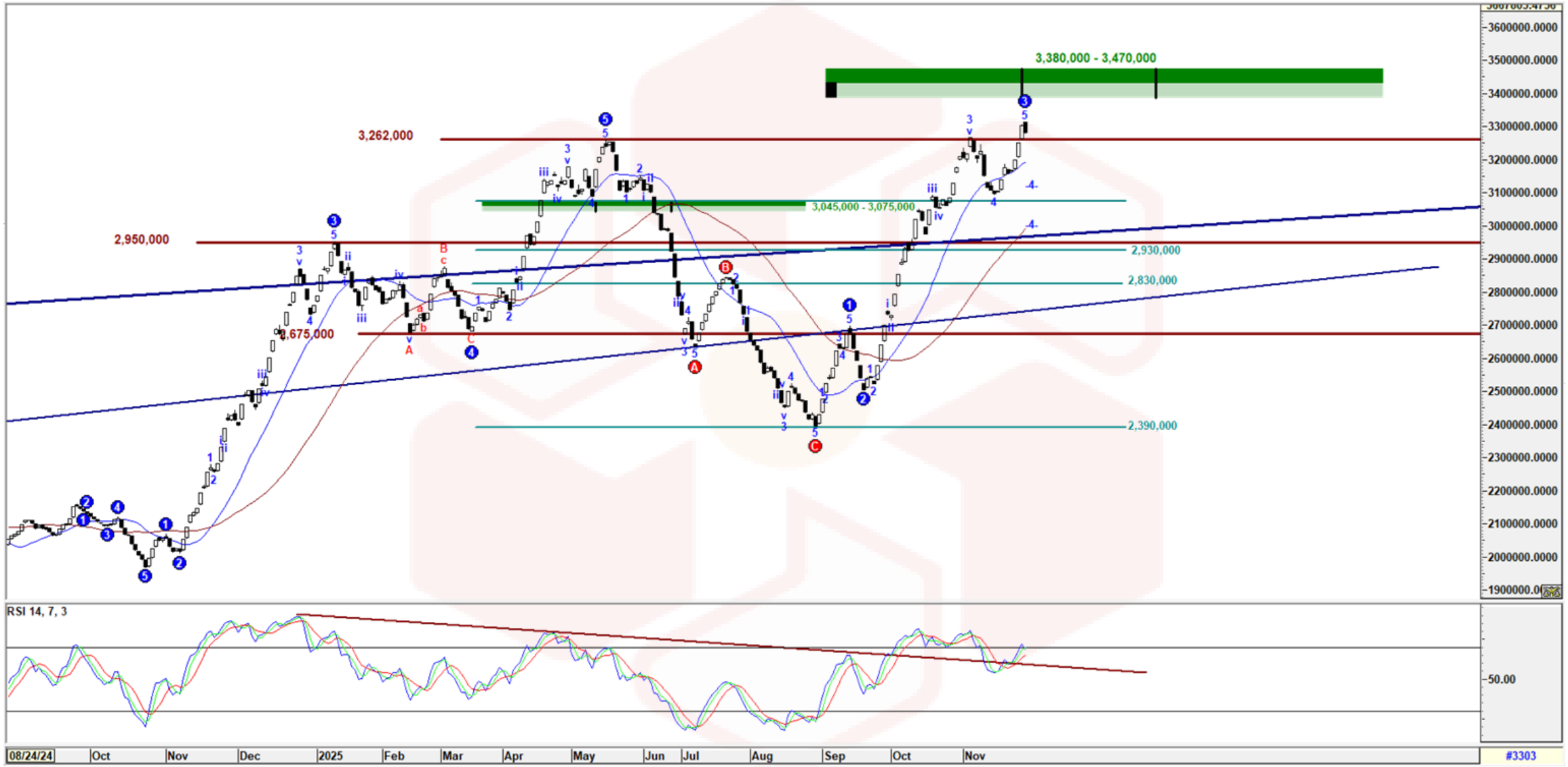
اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۱۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۱۰-۱۴	۳۶	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۶,۶۱۰	۳۹.۰۶%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۶۴۶	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۷۱,۲۱۰	۳۷.۲۲%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۳۷۳	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۲۳,۶۵۰	۳۶.۹۸%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۳۸۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۹,۷۸۰	۳۶.۸۹%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۴۰۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۰۳,۸۴۰	۳۶.۷۱%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۴۲۹	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۹۲,۳۸۰	۳۶.۶۳%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۳۱۷	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۶۰,۰۰۰	۳۶.۵۴%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۱۹۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۵,۹۷۰	۳۶.۱۲%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۳۴۵	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۴۰,۰۵۰	۳۱.۸۹%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۴۰۸	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۲۲,۸۱۰	۲۹.۳۵%

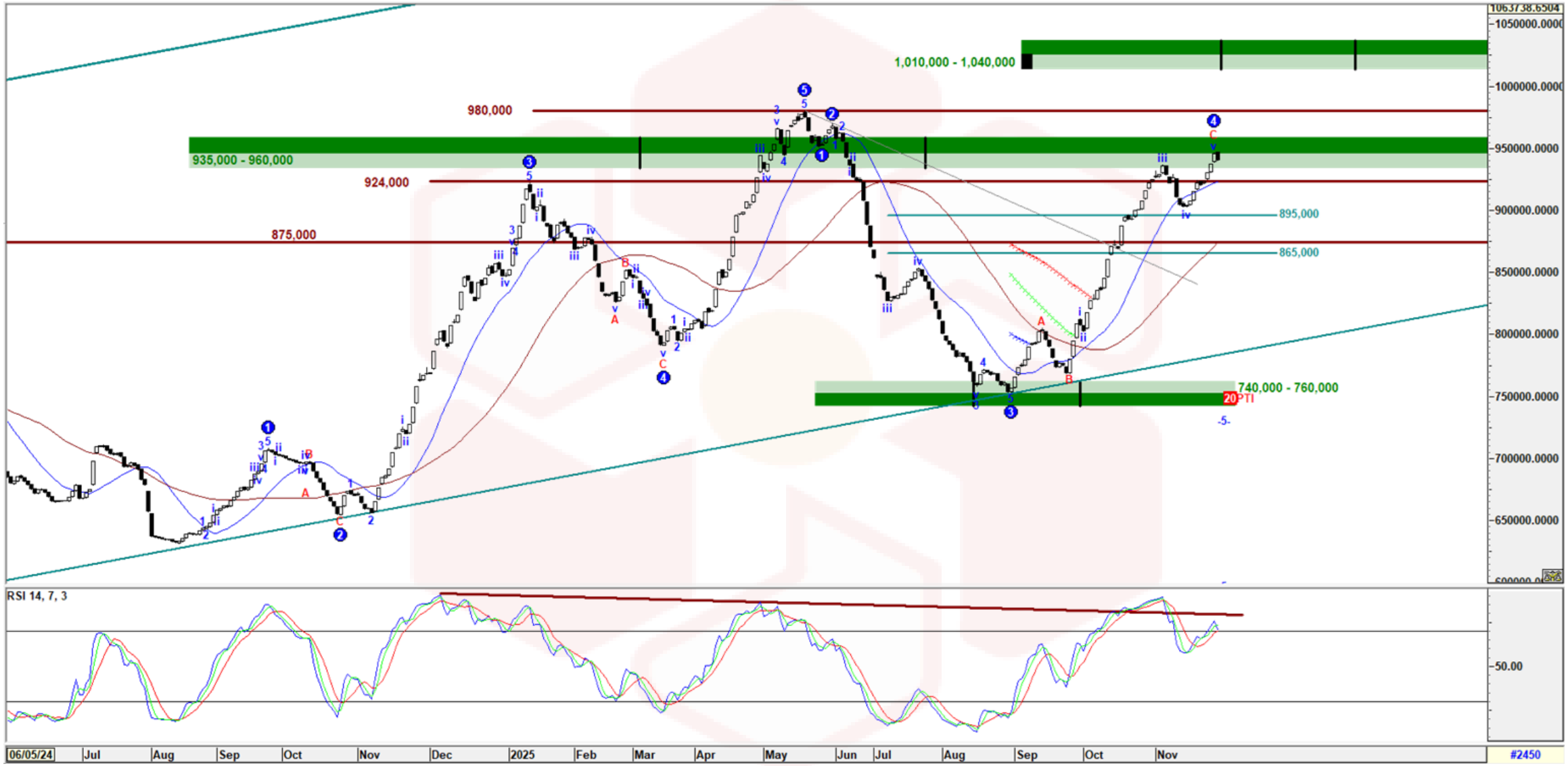
وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۲۱۹	۴,۰۷۱	۳.۶%	۳,۹۴۲	۷%
سکه امامی (ریال)	۱,۱۹۰,۰۵۰,۰۰۰	۱,۱۷۵,۰۵۰,۰۰۰	۱.۳%	۱,۰۹۶,۸۵۰,۰۰۰	۸.۵%
دلار آزاد (ریال)	۱,۱۴۰,۰۰۰	۱,۱۳۵,۰۰۰	۰.۴%	۱,۰۶۹,۰۰۰	۶.۶%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۶۲.۳	۶۲.۵	(۰.۲%)	۶۴.۲	(۳%)
بیت کوین (دلار)	۹۱,۱۲۰	۸۳,۸۱۴	۸.۷%	۱۱۱,۲۵۱	(۱۸.۱%)
آلومینیوم LME (دلار)	۲,۸۷۴	۲,۸۰۶	۲.۴%	۲,۸۸۵	(۰.۴%)
مس LME (دلار)	۱۱,۲۰۳	۱۰,۷۹۵	۳.۸%	۱۱,۱۵۹	۰.۴%
روی LME (دلار)	۳,۰۶۰	۲,۹۹۳	۲.۳%	۳,۰۸۱	(۰.۷%)
سرب LME (دلار)	۱,۹۸۰	۱,۹۹۰	(۰.۵%)	۲,۰۲۵	(۲.۲%)
انس پلاتین (دلار)	۱,۶۸۴	۱,۵۲۰	۱۰.۸%	۱,۵۸۲	۶.۵%
اوره فوب خاورمیانه (دلار)	۳۹۰	۴۱۱	(۵.۱%)	۳۹۵	(۱.۳%)

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل هم‌وزن



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege