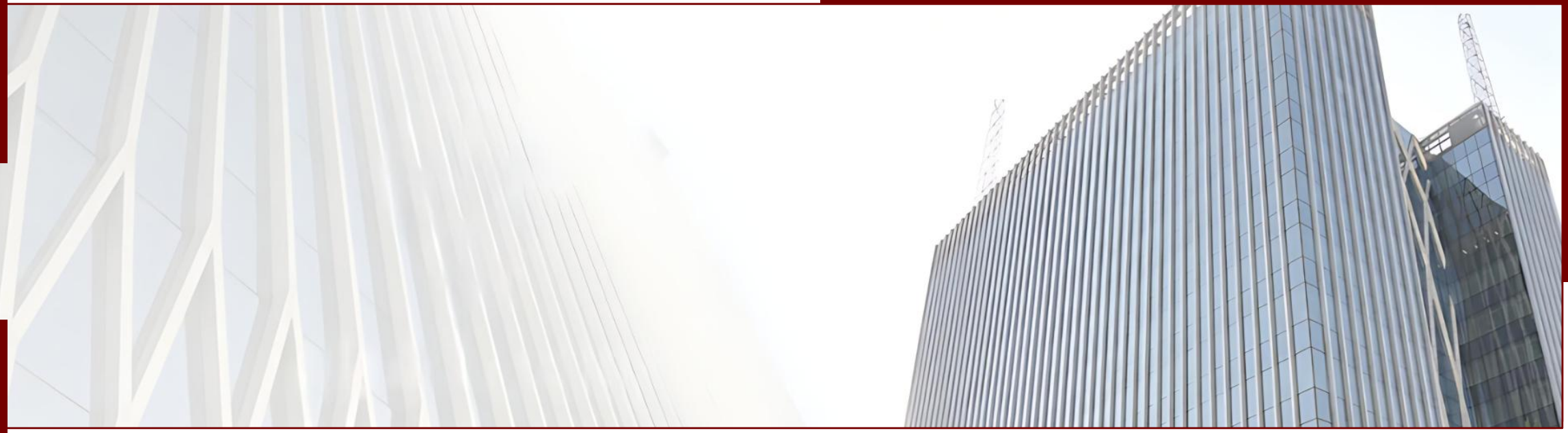


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۲۱ 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



دور جدید فروش بنزین با قیمت هر لیتر ۵,۰۰۰ تومان از امروز شروع شد

طبق اعلام قبلی دولت، نرخ سوم و ۵ هزار تومانی بنزین از بامداد امروز اجرا شد ولی سهمیه‌های ۶۰ و ۱۰۰ لیتری با نرخ های ۱,۵۰۰ و ۳,۰۰۰ تومان همچنان برقرار بوده و مصرف مازاد با نرخ ۵,۰۰۰ تومان محاسبه خواهد شد. سهمیه خودروهای پلاک دولتی به جز آمبولانس‌ها، خودروهای وارداتی و خودروهای دارای پلاک مناطق آزاد حذف شده و نرخ ۵,۰۰۰ تومان برای کارت‌های جایگاه اعمال می‌شود. بر اساس این گزارش، خودروهای صفر داخلی با قیمت کمتر از یک میلیارد تومان همچنان سهمیه یارانه‌ای دریافت می‌کنند. برای رانندگان سکوهای اینترنتی نیز سهمیه اعتباری اضافه شامل ۲۰۰ لیتر برای خودروهای بنزینی، ۹۵ لیتر برای خودروهای دوگانه سوز و ۴۰ لیتر برای موتورسیکلت‌ها در نظر گرفته شد. مابه‌التفاوت نرخ ۳,۰۰۰ و ۵,۰۰۰ تومان پس از ثبت پیمایش به حساب رانندگان واریز خواهد شد. سکوهای اینترنتی نیز متعهد شده‌اند که با وجود تغییر نرخ بنزین، هیچگونه افزایش قیمتی در کرایه‌ها اعمال نکنند.



بیروت از احتمال حمله گسترده اسرائیل علیه لبنان خبر داد

وزیر امور خارجه لبنان اعلام کرد این کشور از سوی طرف‌های عربی و بین‌المللی هشدارهایی درباره آمادگی اسرائیل برای انجام عملیات گسترده نظامی علیه لبنان دریافت کرده است. وی گفت لبنان برای جلوگیری از هرگونه حمله، تماس‌های دیپلماتیک خود را افزایش داده و تأکید کرد نشست‌های کمیته نظارت بر آتش‌بس به‌معنای مذاکره یا حرکت به‌سوی صلح با اسرائیل نیست، بلکه صرفاً تلاشی برای بازگشت به توافق آتش‌بس است.



"بانیان" با ۱۶,۵۰۲ ریال وارد بازار سهام شد

فرآیند عرضه اولیه ۱۲ درصد از سهام شرکت نیان باتری خاوران با قیمت ارزش گذاری ۱۴,۱۸۰ ریالی به روش ترکیبی در فرابورس انجام و در مرحله اول با عرضه ۴ درصدی هر سهم با قیمت ۱۶,۵۰۲ ریال به صندوق‌های سرمایه گذاری معامله شد. براساس این گزارش، عرضه "بانیان" شامل سهمیه ۵۱۵ هزار سهمی به سرمایه‌گذاران واجد شرایط بود که ۸۰ صندوق متقاضی قادر به خرید این سهم شدند. در مرحله دوم، ۸ درصد دیگر با حداکثر سهمیه ۱۶۴ سهمی به یک میلیون و ۱۳۴ هزار و ۳۰۸ سهامدار حقیقی و ۱۱۳۹ سهامدار حقوقی به روش قیمت ثابت کشف شده تعلق گرفت. مشاور عرضه هم کارگزاری مفید و متعهد خرید تامین سرمایه کاردان بود.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



عرضه اولیه ۹ درصد از سهام هامون نایزه شنبه ۲۲ آذر ماه

امروز شنبه ۲۲ آذرماه، ۹ درصد از سهام شرکت هامون نایزه عرضه اولیه و طی آن ۵۸۹ میلیون و ۵۰۰ هزار سهم در دو مرحله با قیمت ارزش گذاری ۷,۹۴۹ ریالی در بازار دوم معاملات فرابورس زمان سفارش گیری واگذار می شود. بر اساس این گزارش در مرحله اول ۱۹۶ میلیون و ۵۰۰ هزار سهم معادل ۳ درصد با حداکثر سهمیه دو میلیون و ۴۵۷ هزار سهمی به سرمایه گذاران واجد شرایط به روش حراج عرضه می‌شود. در مرحله دوم، ۳۹۳ میلیون سهم معادل ۶ درصد دیگر همان روز با حداکثر سهمیه ۷۸۶ سهمی به سهامداران حقیقی و حقوقی به روش قیمت ثابت کشف شده تعلق می گیرد. مشاور عرضه هم کارگزاری آتیه و متعهد خرید تامین سرمایه تمدن است. خریداران سهام در مرحله دوم عرضه اولیه به تعداد تخصیص داده شده در آن روز دارای اختیار فروش تبعی این سهام با قیمت اعمال ۳۰ درصد بالاتر از قیمت کشف شده روز عرضه اولیه در سررسید ۲۲ آذر سال ۱۴۰۵ خواهند بود.



دور جدید فروش انواع سکه با سررسید فروردین سال آینده، سه‌شنبه ۲۵ آذرماه اعلام شد

هفتمین حراج پیش فروش سکه تمام، نیم و ربع سکه بهار آزادی ضرب سال ۱۳۸۶ بدون بسته بندی با سررسید پنجم فرودین سال ۱۴۰۵، سه شنبه جاری در مرکز مبادله برگزار می‌شود. براساس این گزارش، زمان واریز وجه از ساعت ۸ امروز تا ساعت ۲۳ دوشنبه ادامه دارد. کلیه اشخاص حقیقی با تابعیت ایرانی بیش از ۱۸ سال تمام می توانند در این حراج مشارکت کنند. هر فرد می تواند حداقل یک و حداکثر ۱۵ قطعه سکه (شامل حداکثر ۳ سکه تمام، ۵ نیم و ۷ ربع) خریداری کند. ثبت سفارش برای سکه تمام، نیم و ربع از ساعت ۸ صبح تا ۱۶ بعداظهر سه شنبه انجام می شود.



عرضه یکشنبه ۲۵ ون فوتون وانا در بورس کالا با قیمت پایه ۲.۹۷۲ میلیاردی اعلام شد

بورس کالا شرایط خرید ۲۵ دستگاه ون فوتون وانا برای عرضه ۲۳ آذر ماه در تالار خودرو و موعد تحویل ۵ اسفند ماه را ابلاغ کرد. بر اساس این گزارش، مهلت ثبت سفارش ساعت ۸:۳۰ یکشنبه ۲۳ آذر ماه بوده و به منظور مدیریت سفارش‌های دریافتی مشتریان، کارگزاران امکان مسدودسازی سفارش‌های دریافتی را تا ساعت ۸:۵۰ همان روز خواهند داشت. میزان پیش دریافت خرید محصول به میزان ۱۰ درصد و قیمت پایه ۲.۹۷۲ میلیارد تومان تعیین شده است. هر کد ملی (اشخاص حقیقی) و هر شناسنامه ملی (اشخاص حقوقی) صرفا امکان ثبت سفارش یک دستگاه خودرو را دارد.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

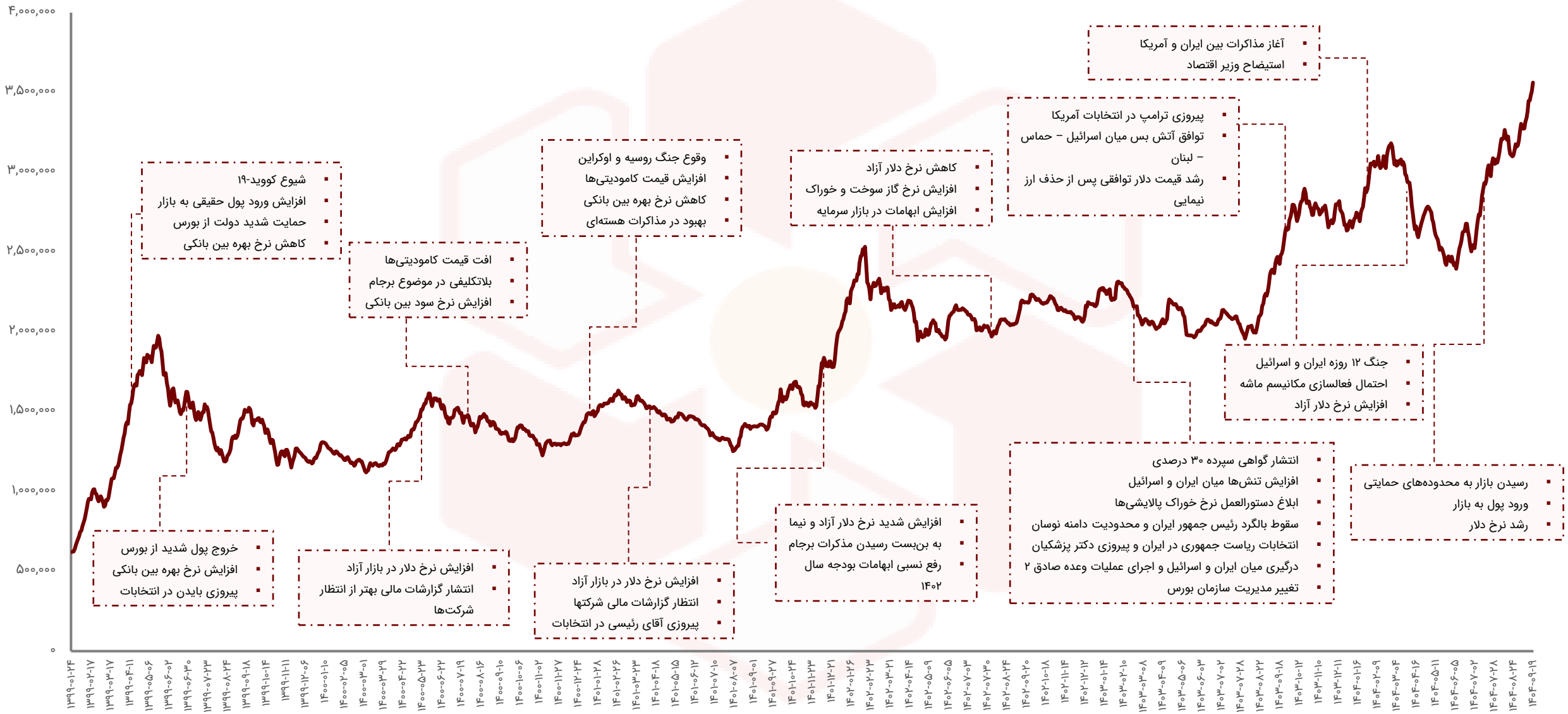
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

بازار سهام در هفته اخیر، روند صعودی قدرتمندی را پشت سر گذاشت و شاخص کل با رشدی ۵.۴ درصدی، بر ارتفاع ۳,۵۶۱,۴۷۸ واحد ایستاد؛ شاخص کل هم‌وزن نیز موفق به عبور از سقف تاریخی خود گردید و با رشدی ۴.۲ درصدی، بر ارتفاع ۱,۰۰۰,۷۴۴ واحد ایستاد. ارزش معاملات خرد با رشد ۳۱.۵ درصدی روبرو شد و حدود ۴۶,۰۱۸ میلیارد تومان ثبت شد. میانگین ارزش معلات خرد سهام و حق تقدم با رشد ۳۱.۵ درصد از ۷،۰۰۱ میلیارد تومان به ۹,۲۰۴ میلیارد تومان رسید. در هفته اخیر، خالص ورود/خروج پول حقیقی سهام، حق تقدم و صندوق‌های سهامی ۳,۵۷۵ میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های با درآمد ثابت ۵,۲۶۰ میلیارد تومان ثبت شد. بازار سهام هفته را در آرامش نسبی سیاسی آغاز کرد و پس از معاملات خوب روز شنبه، در روز یک‌شنبه با افزایش عرضه مواجه گردید اما مجدداً از روز دوشنبه به مدار صعود بازگشت و تا پایان هفته، روندی مثبت و صعودی داشت. مهم‌ترین متغیرهای اثرگذار بر بازار این هفته، رکوردشکنی‌های پیاپی نرخ ارز در بازار غیررسمی و همچنین اخبار مثبت مرتبط با صنایع پالایشی، پتروشیمی و فولادی بود. از سوی دیگر، بازارساز نیز با حمایت از سهم‌های بزرگ و شاخص‌ساز، به ادامه روند صعودی بازار کمک کرد. در بازار موازی، صندوق‌های طلا علیرغم رشد در طول هفته، با رسیدن نرخ ارز به محدوده‌های مقاومتی، با افزایش عرضه مواجه شدند و بازدهی هفتگی آنها بطور میانگین (۰.۷%) ثبت گردید.

تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۳،۳۷۹،۸۵۶	۳،۵۶۱،۴۷۷	۱۸۱،۶۲۱	%۵.۴
شاخص هم وزن (واحد)	۹۵۹،۹۷۱	۱،۰۰۰،۷۴۱	۴۰،۷۷۰	%۴.۲
ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم (میلیارد تومان)	۴۶،۰۱۸		۱۱،۰۱۱	%۳۱.۵
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	۳،۵۷۵		-	-

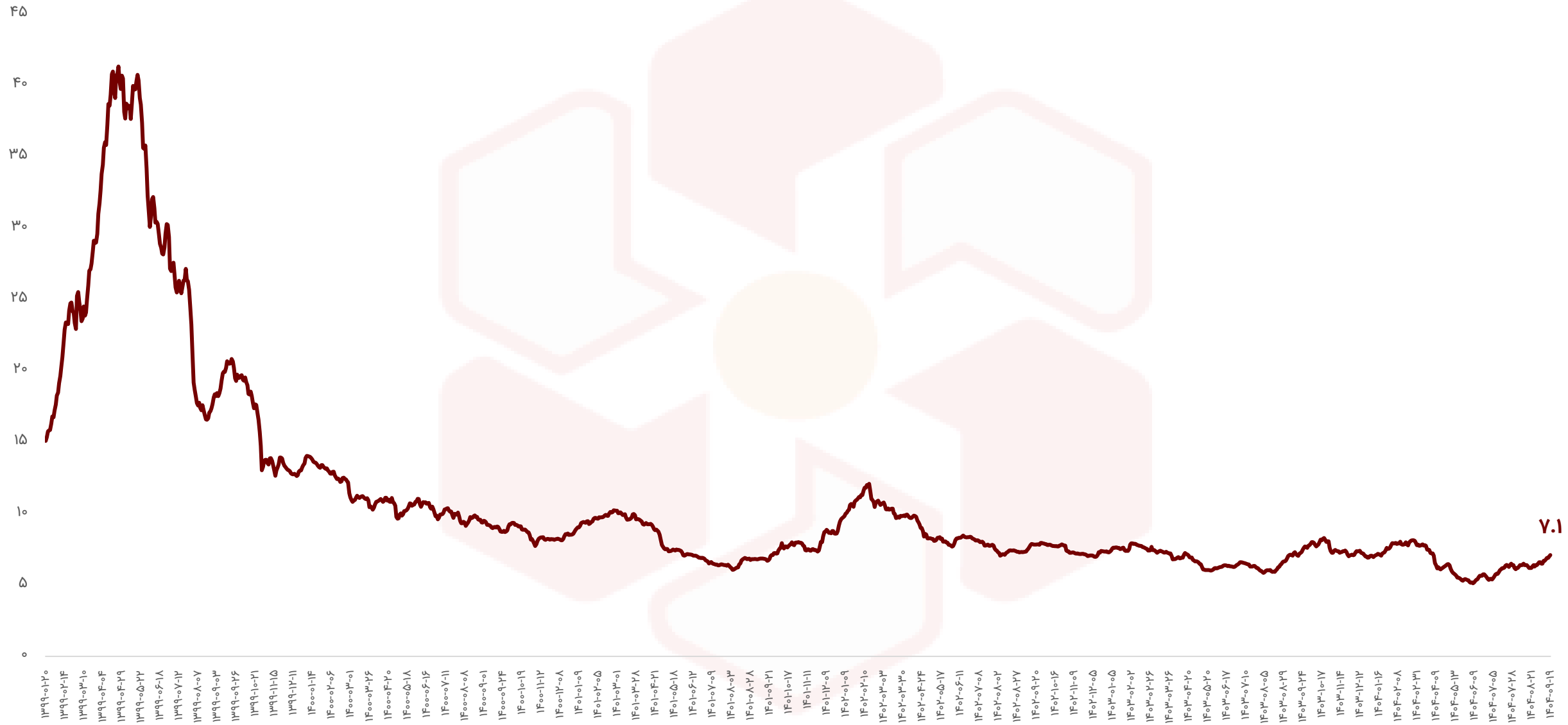
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



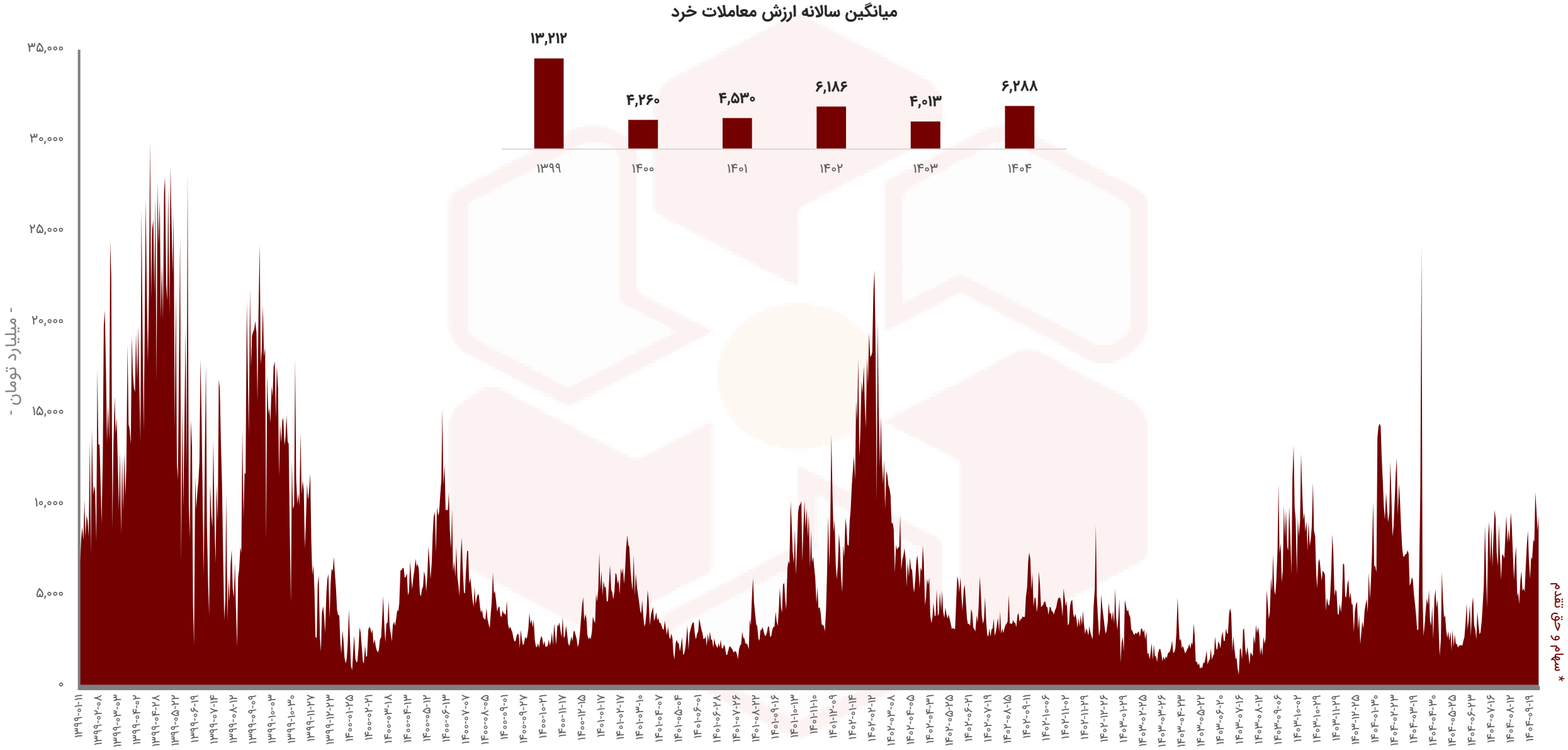
ارزش دلاری بازار*



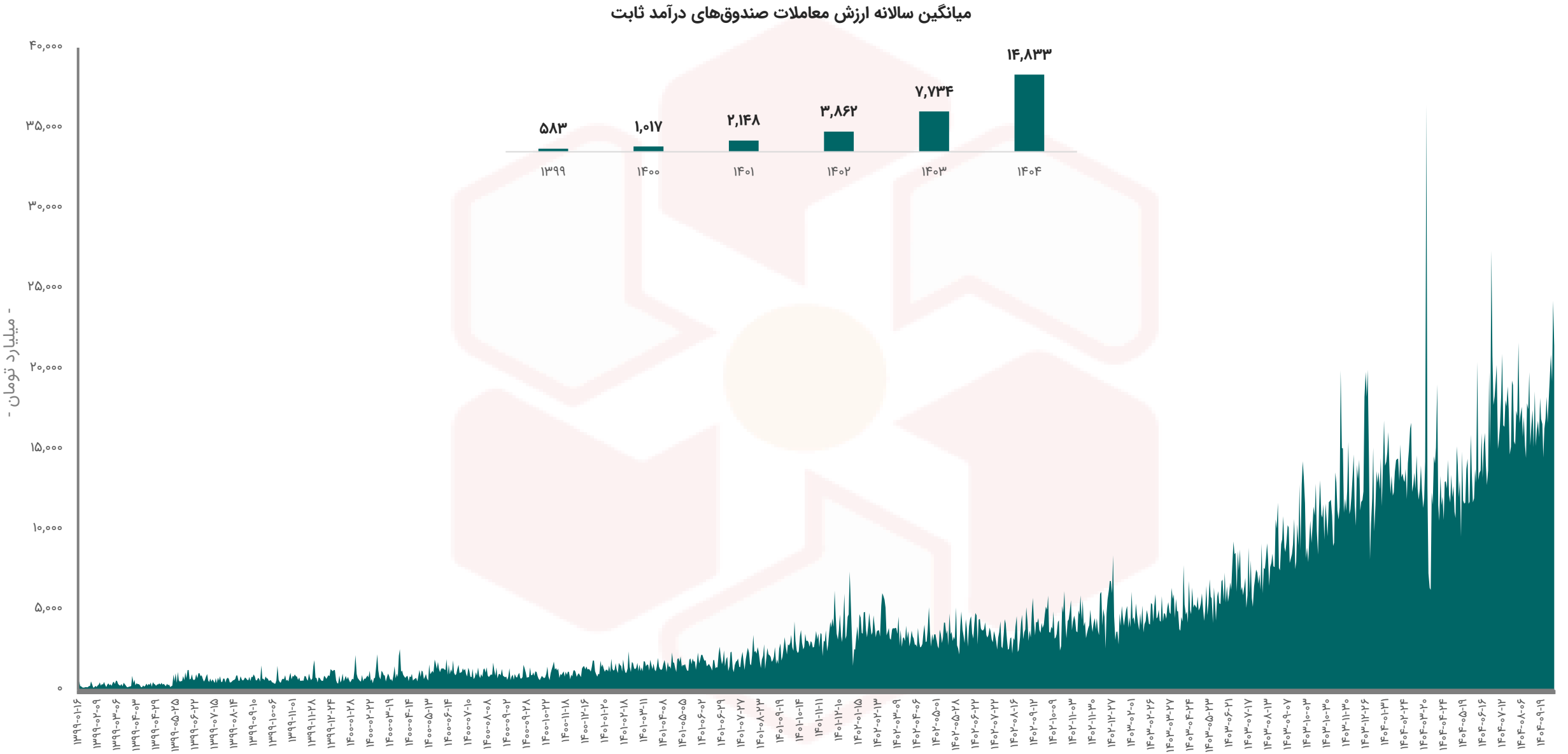
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



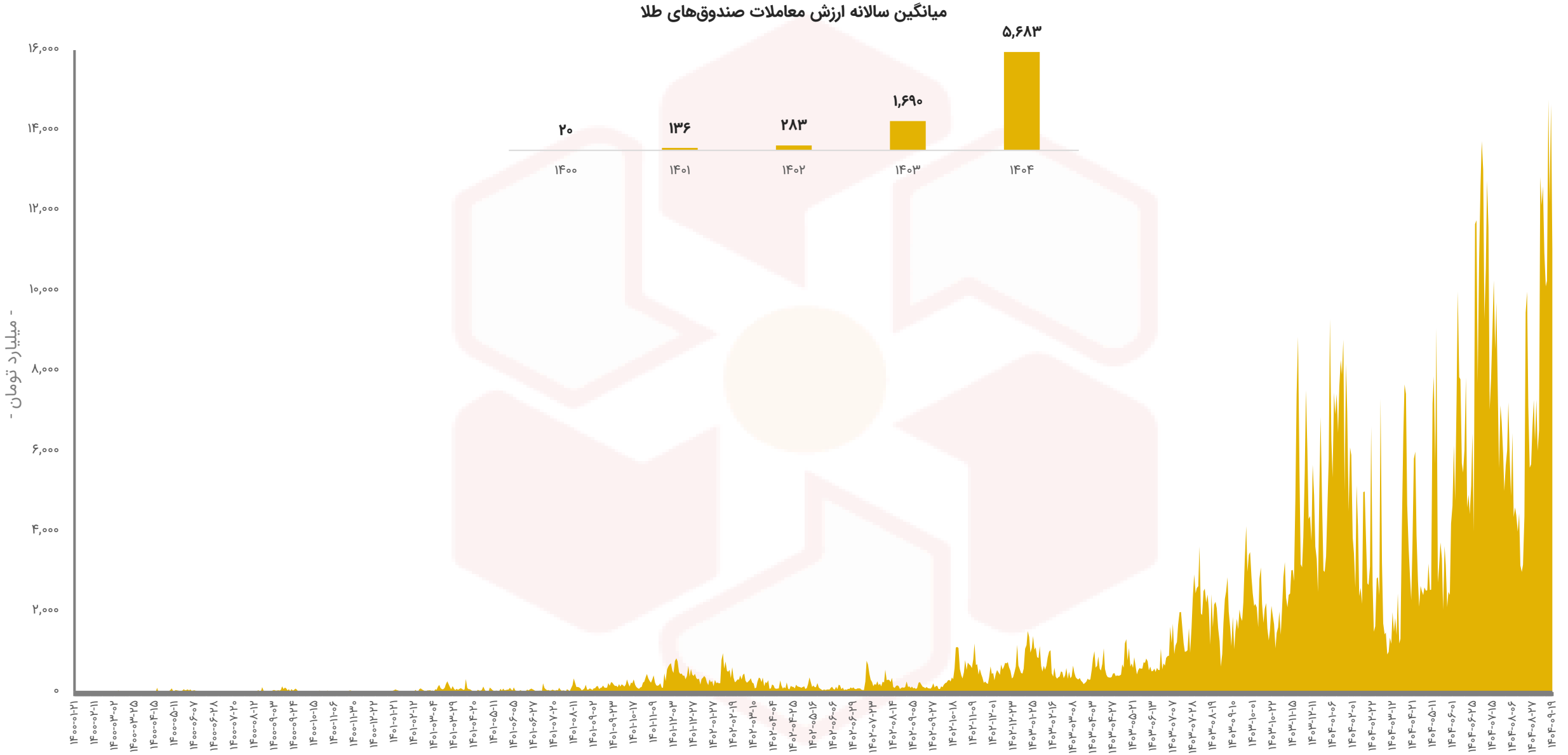
ارزش معاملات خرد سهام*



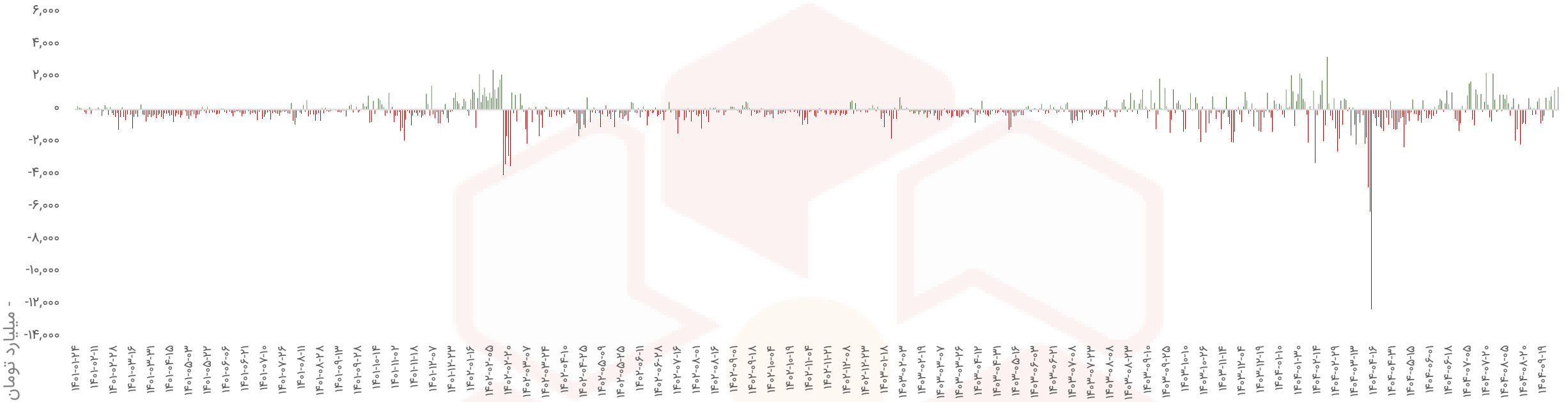
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



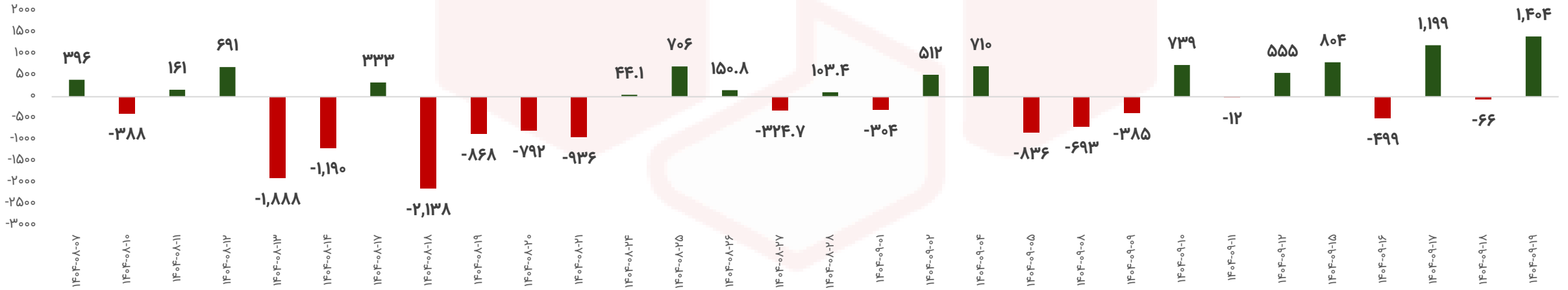
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



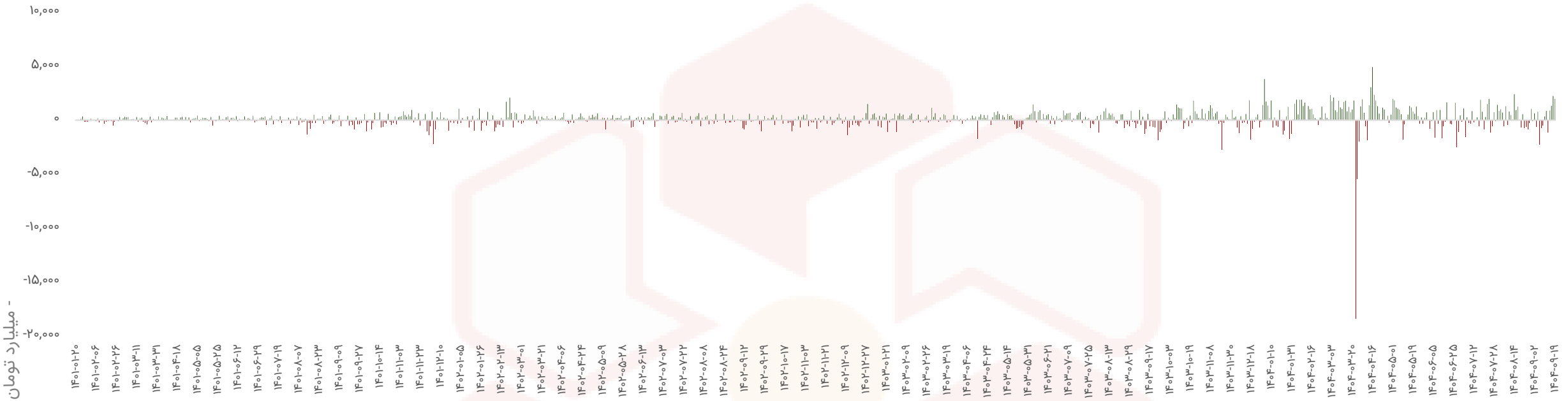
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



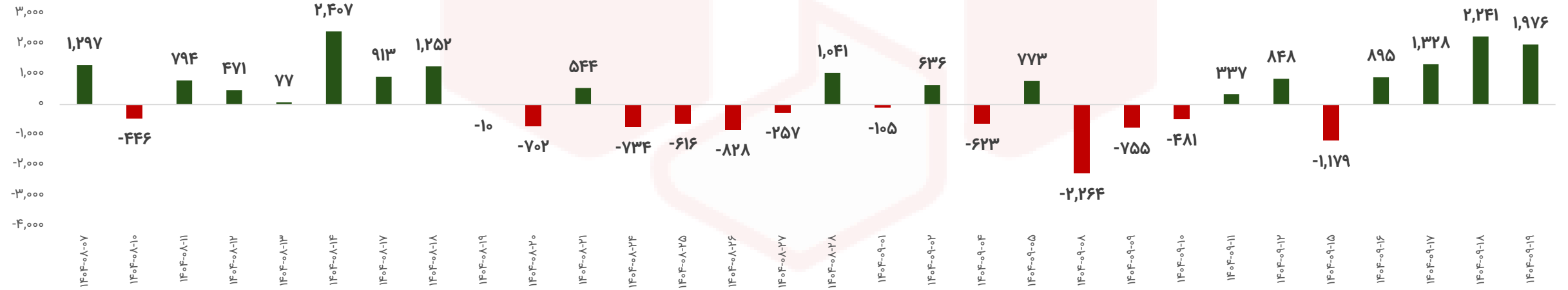
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



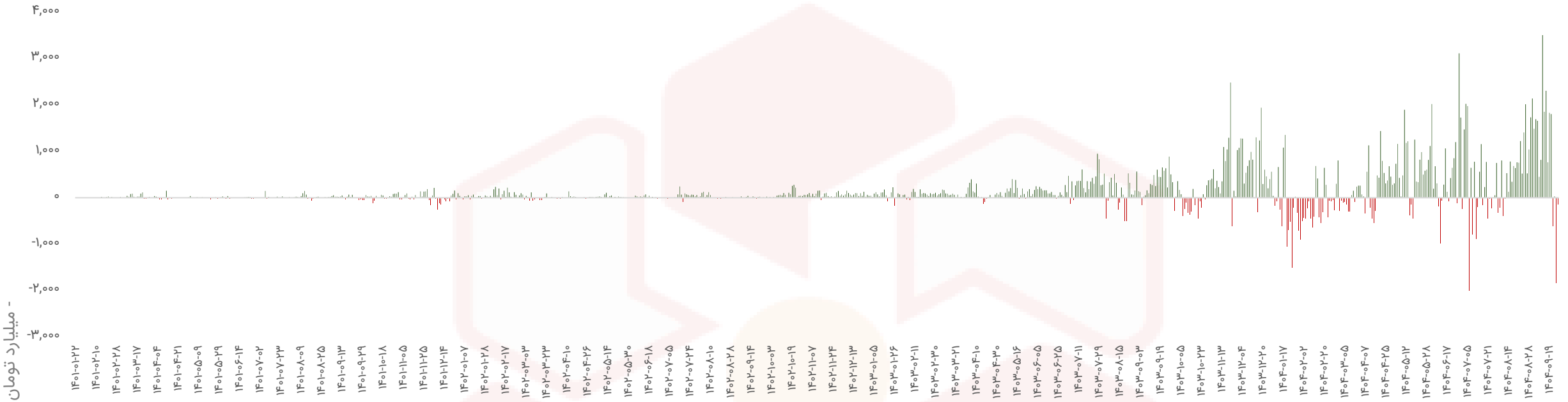
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



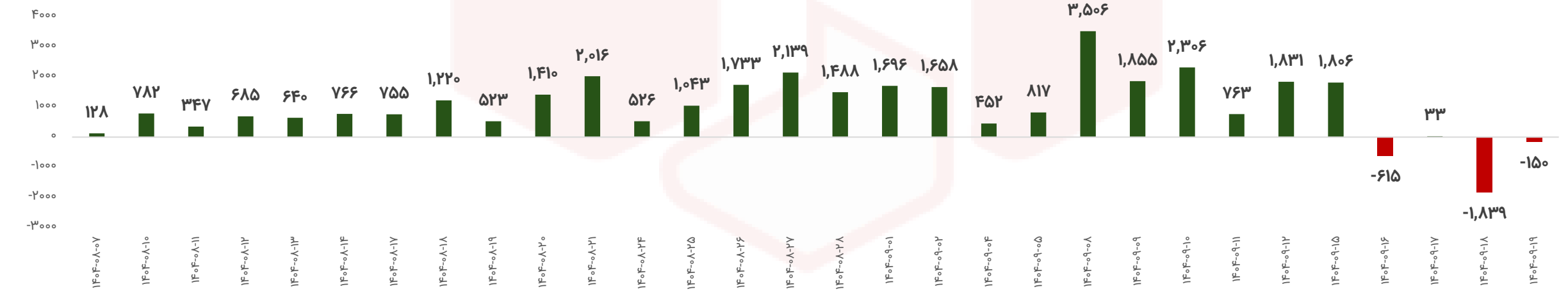
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



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	شرکت	بازدهی (%)
۱	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	%۱۰.۸
۲	فرآورده‌های نفتی	%۹
۳	استخراج زغال سنگ	%۹
۴	دارویی	%۸.۳
۵	هتل و رستوران	%۷.۴

صنایع با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	بازدهی (%)
۱	منسوجات	(%۲.۵)
۲	سیمان آهک گچ	%۰.۱
۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	%۲.۱
۴	سرمایه‌گذاریها	%۲.۷
۵	زراعت و خدمات وابسته	%۲.۹

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	آترا زیست آرای	داترا	%۱۹.۳
۲	سیمان کارون	سکارون	%۱۹.۳
۳	خمیرمایه رضوی	غمایه	%۱۹
۴	فرآورده‌های نسوز ایران	کفرا	%۱۹
۵	گروه صنعتی و معدنی امیر	وامیر	%۱۸.۹

نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	سر.تدبیرگران فارس و خوزستان	خفولا	(%۱۳.۳)
۲	سر.توسعه و عمران استان اردبیل	فن‌آوا	(%۱۲.۸)
۳	تولیدی و صنعتی آبگینه	کابگن	(%۱۰.۹)
۴	داروسازی کوثر	دکوثر	(%۸.۶)
۵	گروه فن آوا	فن‌آوا	(%۸.۱)

ترین‌های بازار در هفته اخیر

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	بانک‌ها و موسسات اعتباری	۸،۶۰۰
۲	فلزات اساسی	۶،۸۵۱
۳	شیمیایی	۶،۵۳۳
۴	استخراج کانه‌های فلزی	۶،۰۱۳
۵	فرآورده‌های نفتی	۴،۵۵۸

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

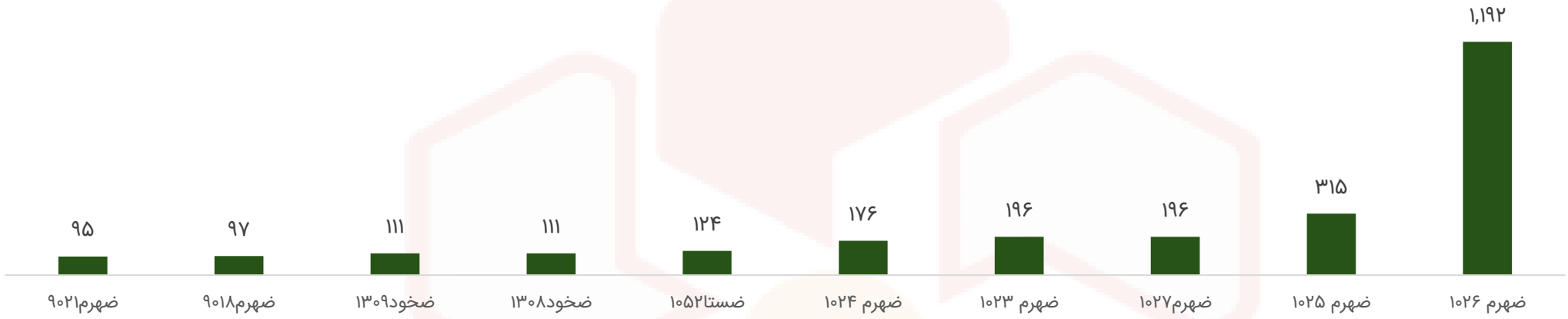
رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	چاپ	۵
۲	محصولات کاغذی	۱۱۵
۳	استخراج زغال سنگ	۱۲۰
۴	پیمانکاری صنعتی	۱۲۹
۵	منسوجات	۱۷۲

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/E
وپارس	۳،۱۰۲	۱.۱
وگردش	۹۲۴	۱.۲
وبملت	۱،۳۶۷	۱.۷
حآفرین	۱،۷۴۱	۲
کوثر	۲،۰۴۸	۲.۴
ولساپا	۷۳۸	۲.۵
نوین	۲،۲۹۰	۲.۶
البرز	۲،۴۳۲	۲.۷
ثبهساز	۲،۶۲۴	۲.۸
ثامید	۱،۹۶۴	۲.۸

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

ارزش معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



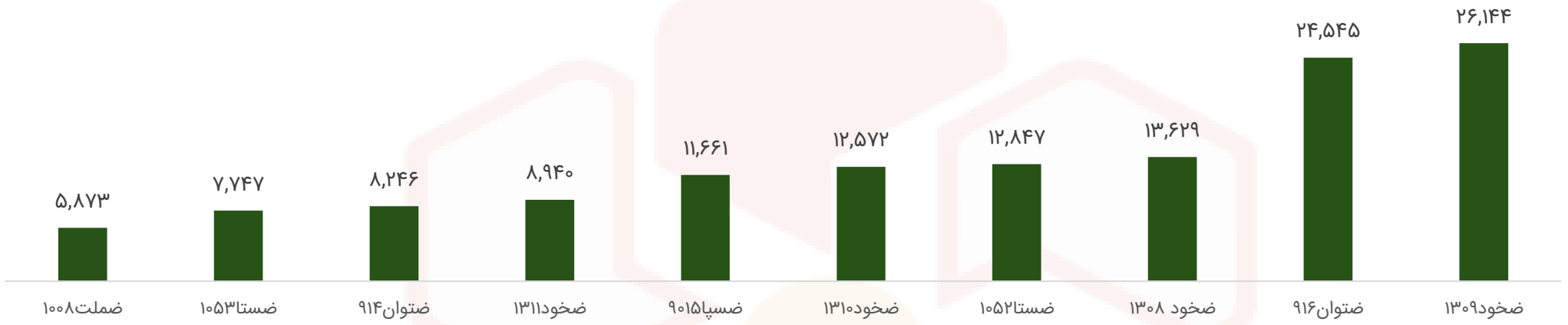
- میلیارد تومان -

ارزش معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته

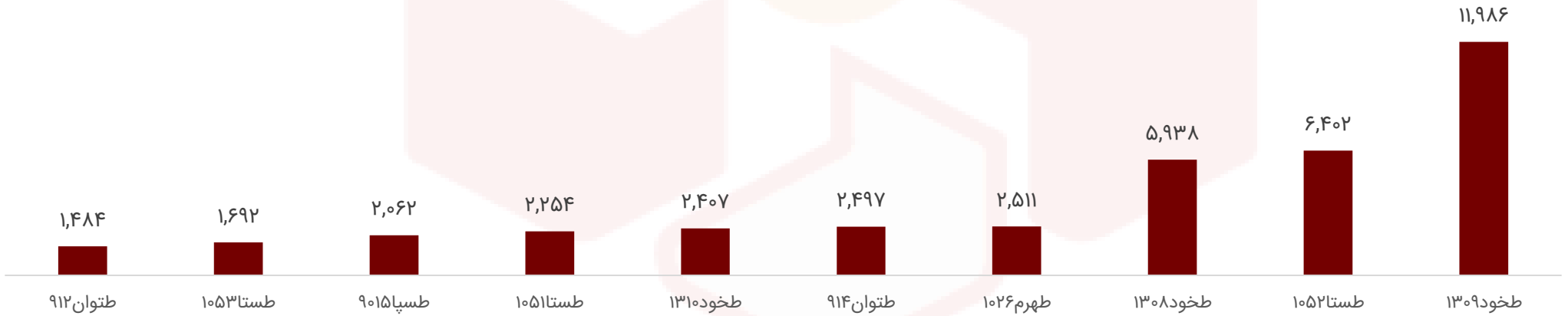


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



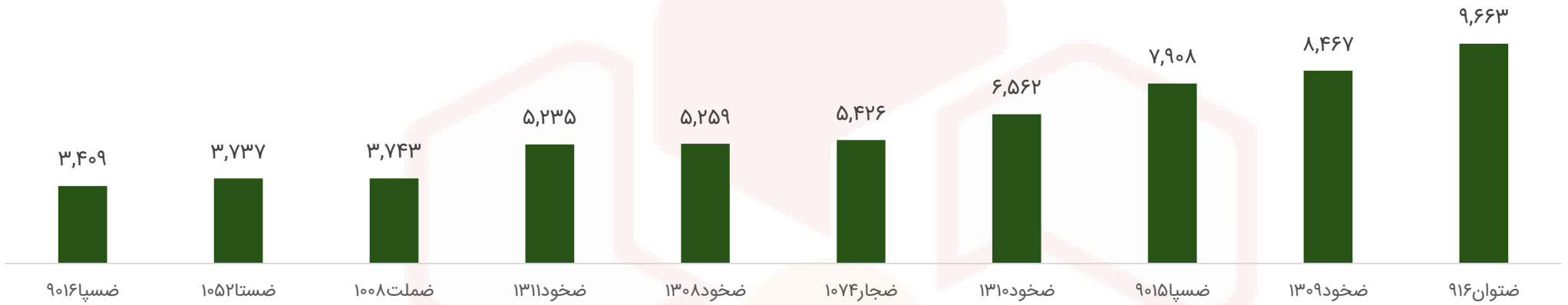
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



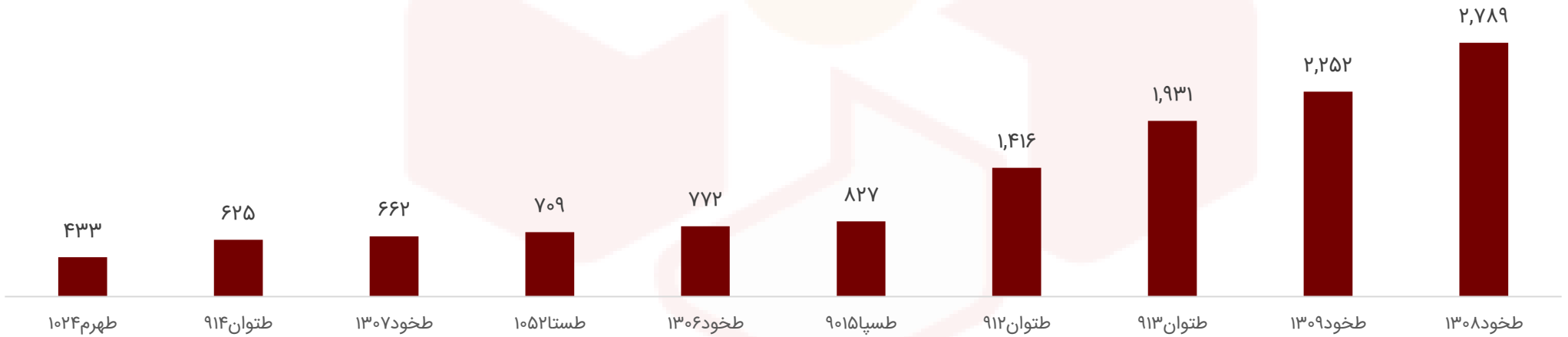
- هزار برگ سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار خرید در هفت روز گذشته

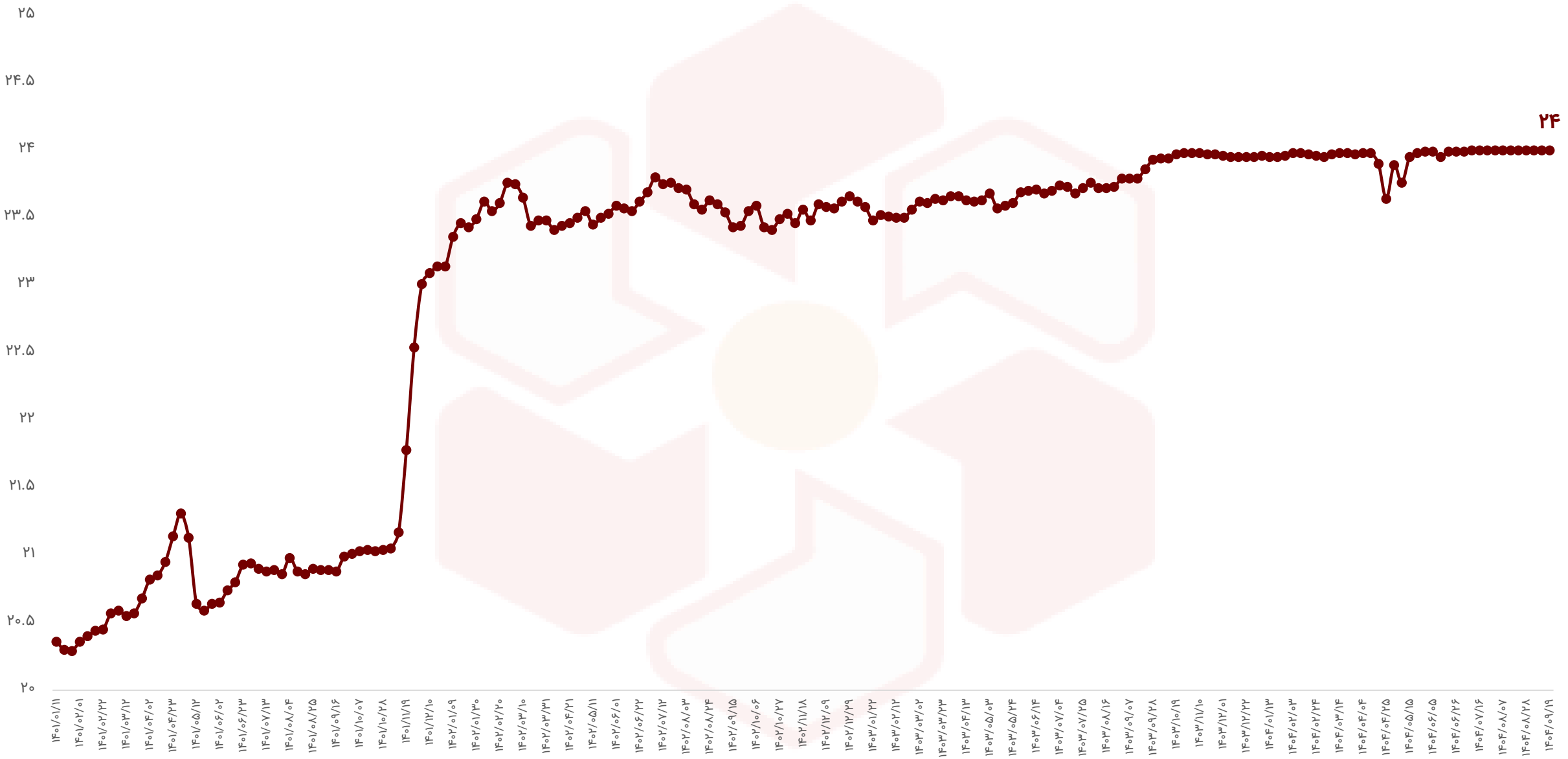


بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار موقعیت باز -

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



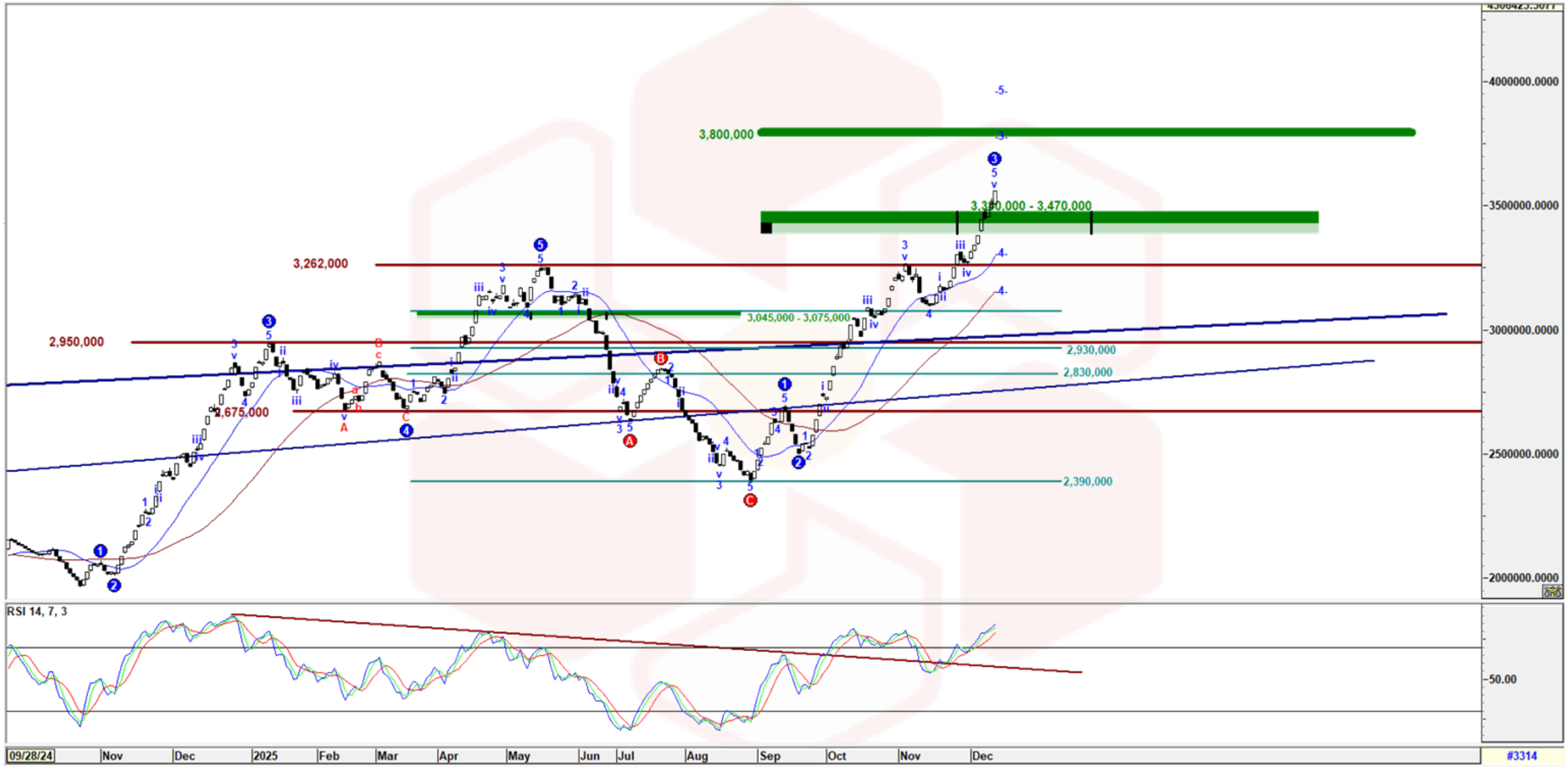
اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۶۳۲	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۷۶,۵۶۰	۳۷.۵۳%
اخزا۱۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۱۰-۱۴	۲۲	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۷,۳۸۰	۳۷.۴۷%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۳۹۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۴,۷۲۰	۳۶.۴۵%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۳۶۶	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۳۳,۲۴۰	۳۶.۳۱%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۳۵۹	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۳۴,۴۷۰	۳۶.۲۰%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۴۱۵	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۰۸,۳۱۰	۳۶.۱۶%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۳۰۳	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۷۴,۲۴۰	۳۶.۱۰%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۱۸۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۴,۲۸۰	۳۵.۸۱%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۳۳۱	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۵۲,۲۵۰	۳۴.۵۶%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۳۹۴	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۳,۰۰۰	۳۲.۱۷%
اخزا۲۰۸	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴-۱۲-۱۱	۷۹	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۳۳,۲۷۰	۲۹.۷۴%

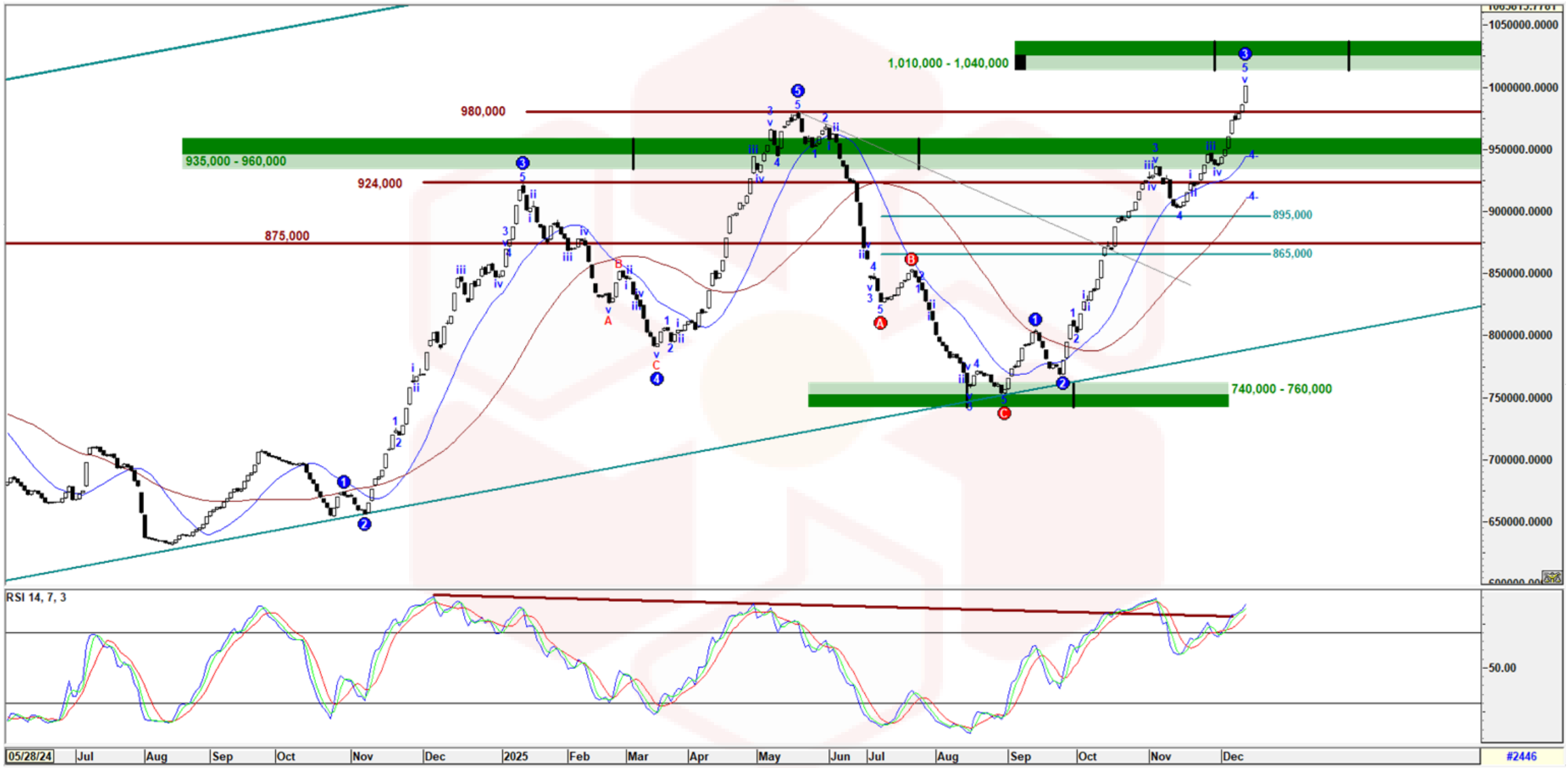
وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۲۹۳	۴,۲۰۵	۲.۱%	۴,۱۹۵	۲.۳%
سکه امامی (ریال)	۱,۳۴۸,۰۵۰,۰۰۰	۱,۲۷۲,۹۵۰,۰۰۰	۵.۹%	۱,۱۵۳,۱۰۰,۰۰۰	۱۶.۹%
دلار آزاد (ریال)	۱,۲۵۷,۰۰۰	۱,۱۹۸,۰۰۰	۴.۹%	۱,۱۰۲,۵۰۰	۱۴.۰%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۶۱	۶۳.۷	(۴.۲%)	۶۲.۷	(۲.۷%)
بیت کوین (دلار)	۹۰,۰۴۳	۸۹,۶۸۶	۰.۴%	۱۰۱,۶۰۲	(۱۱.۴%)
آلومینیوم LME (دلار)	۲,۸۷۷	۲,۹۰۹	(۱.۱%)	۲,۸۹۳	(۰.۵%)
مس LME (دلار)	۱۱,۵۷۲	۱۱,۶۴۲	(۰.۶%)	۱۰,۹۱۰	۶.۱%
روی LME (دلار)	۳,۱۳۱	۳,۰۹۷	۱.۱%	۳,۰۷۶	۱.۸%
سرب LME (دلار)	۱,۹۷۰	۲,۰۰۵	(۱.۸%)	۲,۰۹۴	(۵.۹%)
انس پلاتین (دلار)	۱,۷۶۱	۱,۶۶۱	۶%	۱,۶۳۶	۷.۷%
اوره فوب خاورمیانه (دلار)	۳۹۱	۳۹۲	(۰.۳%)	۴۰۸	(۴.۲%)

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل هم‌وزن



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege