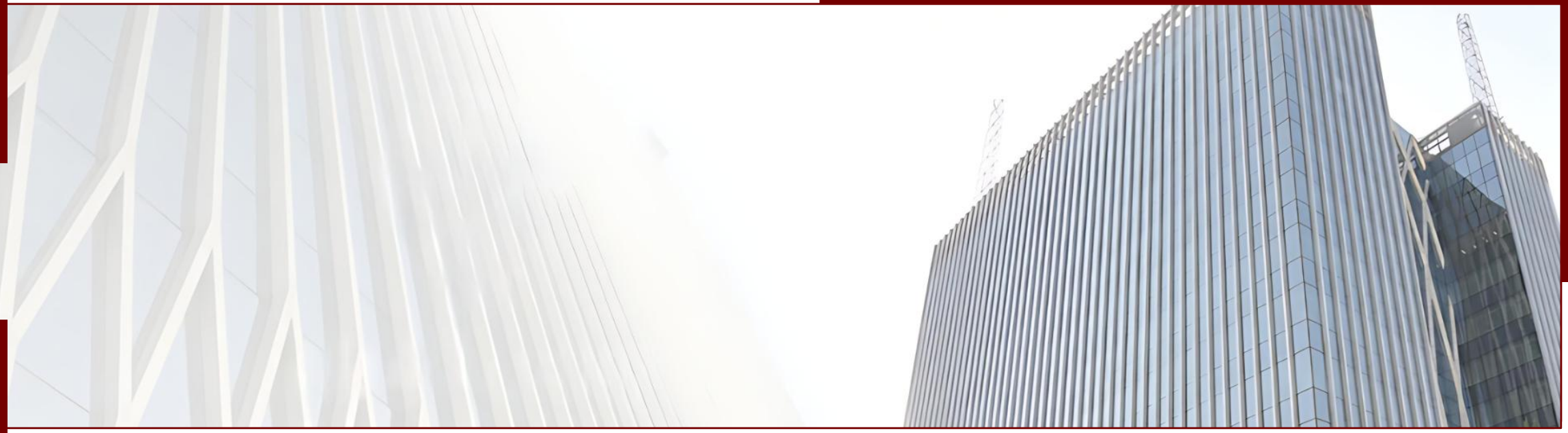


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۱۱ شهریور ۱۴۰۵"

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
- روند نرخ بهره بین بانکی ۱۶
- اوراق با درآمد ثابت ۱۷
- وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه ۱۸
- آمار معاملات گواهی‌های سپرده بورس کالا ۱۹
- بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه ۲۰
- بررسی تکنیکال شاخص کل ۲۳

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



آقای عراقچی خواهان بازگشت آمریکا به تعهدات اسلام آباد شد

آقای عراقچی، در پی حضور هیئت بلندپایه ایران به ریاست آقای پزشکیان در نشست سران سازمان همکاری شانگهای در بیشکک، با اشاره به برگزاری دیدارهای کاری و تمرکز بر همکاری‌های اقتصادی، بر ضرورت بازگشت ایالات متحده به تعهدات بین‌المللی خود تأکید کرد. وی با انتقاد از نقض تفاهم‌نامه اسلام‌آباد توسط آمریکا و بررسی تبعات حملات اخیر، تصریح کرد که تنها راه برون‌رفت از وضعیت کنونی و پایان‌بخشی به مناقشات، پایبندی عملی واشنگتن به توافقات پیشین (به‌ویژه موارد امضا شده در دوره ترامپ) است.



توافق مهم نفتی آمریکا با ونزوئلا

بر اساس گزارش ایرنا به نقل از رویترز، در راستای توافق گسترده دونالد ترامپ با ونزوئلا برای دسترسی به حدود ۶۴ میلیارد بشکه از ذخایر نفتی این کشور، شرکت آمریکایی «نورث امریکن بلو انرژی پارتنرز» (NABEP)کنترل۱۴ پروژه نفتی جدید را بر عهده می‌گیرد که پیش از این برخی از آن‌ها توسط شرکت‌های بزرگ چینی و روسی اداره می‌شدند. بر طبق این سازوکار، آمریکا علاوه بر تصاحب ۳۵ درصد از سهام این شرکت و دسترسی ترجیحی به ۲۰ درصد تولیدات، از حق اولویت خرید برای کل تولیدات بهره‌مند شده و بدین ترتیب حضور چین و روسیه را در صنعت انرژی ونزوئلا تضعیف می‌کند. این توافق، با هدف هدایت نفت ونزوئلا به پالایشگاه‌های آمریکا و ترغیب غول‌های نفتی مانند اکسون‌موبیل و شورون برای سرمایه‌گذاری مجدد در ونزوئلا صورت گرفته است؛ هرچند نقش مستقیم دولت آمریکا در ساختار مالکیت و تولید، نگرانی‌هایی را در میان سرمایه‌گذاران خصوصی درباره رقابت با دولت ایالات متحده ایجاد کرده است.



نامه ایران به شورای امنیت در پی تجاوز جدید آمریکا به جزیره لارک

آقای غلامحسین درزی، کاردار نمایندگی ایران در سازمان ملل، در نامه‌ای رسمی به دبیرکل و شورای امنیت، حمله نظامی ایالات متحده به جزیره لارک در ۸ شهریور ۱۴۰۵ را نقض آشکار حاکمیت ملی و تمامیت ارضی ایران و منشور سازمان ملل خواند و آن را به‌شدت محکوم کرد. وی با تأکید بر اینکه اقدامات بی‌ثبات‌کننده آمریکا و رژیم صهیونیستی، از جمله محاصره دریایی و تروریسم اقتصادی، ریشه اصلی ناامنی در منطقه است، تصریح کرد که ایران در پاسخ به این تجاوز و در راستای حق ذاتی دفاع مشروع طبق ماده ۵۱ منشور سازمان ملل، پایگاه‌های آمریکا در اردن را هدف قرار داده است. در این نامه، ضمن هشدار نسبت به مسئولیت حقوقی و بین‌المللی آمریکا و حامیانش برای تبعات این اقدامات، از شورای امنیت خواسته شده است تا برای توقف تجاوزات واشنگتن و تضمین صلح و امنیت بین‌المللی وارد عمل شود؛ همچنین تأکید شده که جمهوری اسلامی ایران برای حفاظت از امنیت و تمامیت ارضی خود در برابر هرگونه تجاوز، قاطعانه و متناسب پاسخ خواهد داد.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



"تابان" با ۱,۲۸۰ تومان کشف قیمت شد

فرآیند عرضه اولیه ۲ درصد از سهام گروه پتروشیمی تابان فردا به عنوان بزرگترین عرضه اولیه تاریخ بورس و چهاردهمین شرکت جدید سال آغاز و در نهایت هر سهم "تابان" ۱,۲۸۰ تومان کشف قیمت شد. بر اساس این گزارش این عرضه شامل ۶ میلیارد سهم "تابان" با محدوده قیمتی ۱۱,۳۵۱ تا ۱۲,۸۰۰ ریالی هر سهم و سهمیه ۱۳ هزار و ۲۸۰ سهمی هر فرد حقیقی و حقوقی بود که به هر کد معاملاتی، ۳,۶۹۷ سهم تخصیص داده شد و به این ترتیب، یک میلیون و ۹۹۲ هزار و ۹۲۴ نفر خریدار "تابان" شدند.



عرضه اولیه ۱۲ درصد سهام فنرسازی زر گلپایگان چهارشنبه ۱۱ شهریور

پانزدهمین شرکت جدید سال با عرضه اولیه ۱۲ درصد سهام فنرسازی زر گلپایگان به روش ترکیبی، چهارشنبه ۱۱ شهریور در فرابورس وارد می شود. بر اساس این گزارش، ۲۱۶ میلیون سهم معادل ۱۲ درصد سهام "خگلپا" در دو مرحله با قیمت ارزش گذاری ۳,۱۸۵ ریالی در تابلو رشد بازار نو آفرین فرابورس عرضه می شود که در مرحله اول ۷۲ میلیون سهم معادل ۴ درصد با حداکثر سهمیه ۹۰۰ هزار سهمی به سرمایه گذاران واجد شرایط به روش حراج عرضه می شود. در مرحله دوم، ۱۴۴ میلیون سهم معادل ۸ درصد دیگر همان روز با حداکثر سهمیه ۲۸۸ سهمی به سهامداران حقیقی و حقوقی به روش قیمت ثابت کشف شده تعلق می گیرد. مشاور عرضه هم کارگزاری بانک صنعت و معدن و متعهد خرید تامین سرمایه لوتوس پارسیان است.



سازمان بورس ضریب اعتباری خرید سهام را ۵ درصد کمتر کرد

سازمان بورس و اوراق بهادار در راستای مصوبه کمیته پایش ریسک بازار، ضریب اعتباری خرید اوراق بهادار را از ۷۰ به ۶۵ درصد کاهش داد. این تغییر که با ابلاغ آقای عبدالرضا سیدی، مدیر نظارت بر کارگزاران به تمامی شرکت‌های کارگزاری اعلام شده است، از روز شنبه ۱۴ شهریورماه در سامانه‌های نظارتی بورس و فرابورس عملیاتی می‌شود و مستقیماً بر نحوه محاسبه حساب تضمین معاملات اعتباری تأثیر خواهد گذاشت.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

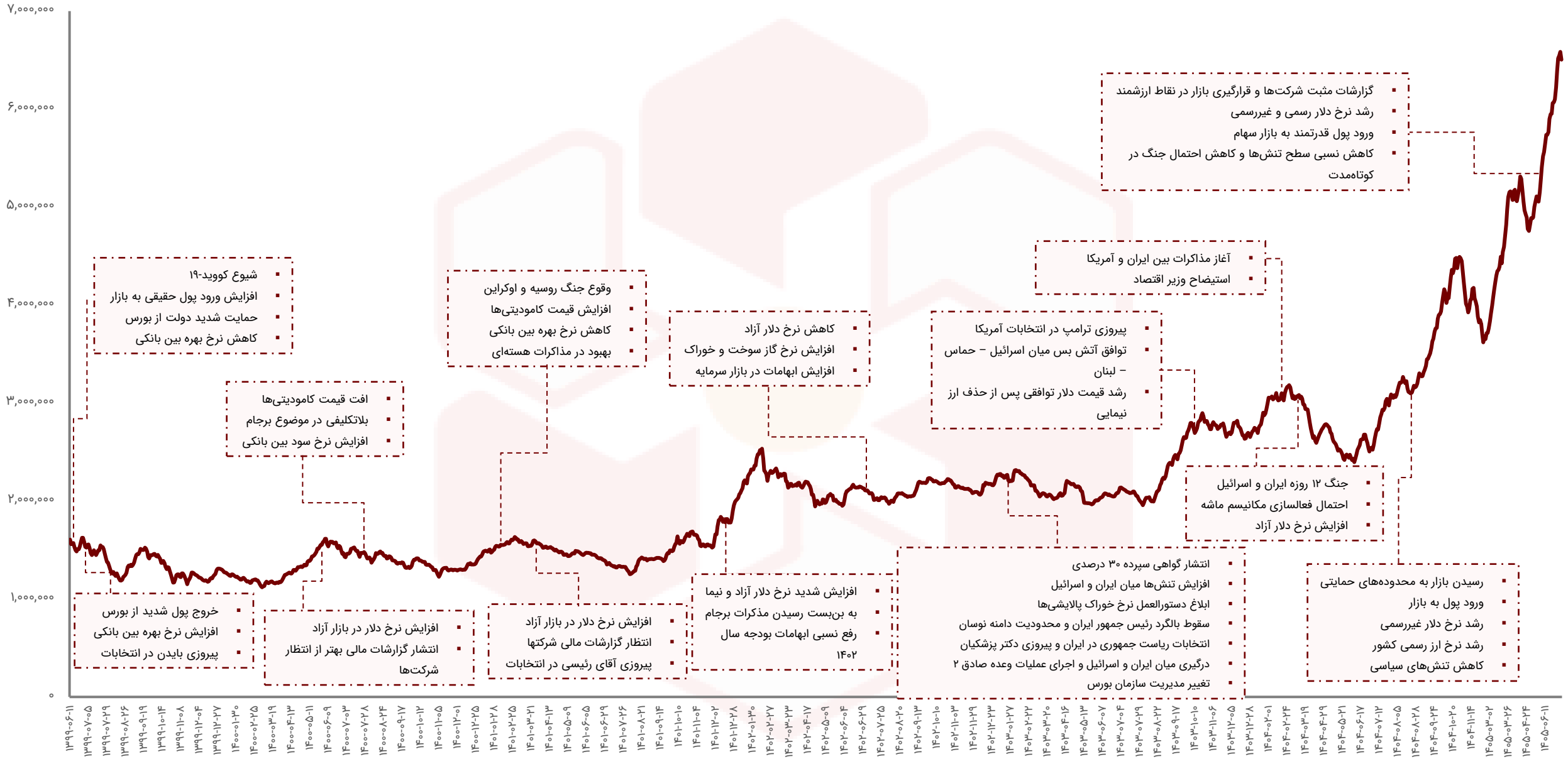
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

بازار سهام در هفته گذشته روندی پرنوسان و دوگانه را سپری کرد؛ به‌طوری‌که برآیند معاملات تحت تأثیر آغاز قدرتمند هفته، بازدهی مثبت را ثبت نمود و شاخص کل با رشد هفتگی ۱,۹ درصدی در سطح ۶,۵۰۳,۹۷۰ واحد به کار خود پایان داد. معاملات روز شنبه با غلبه پرقدرت تقاضا و تشکیل صف‌های خرید گسترده آغاز شد و در نهایت ۸۰ درصد نمادهای بازار در محدوده مثبت بسته شدند. با این حال، با ازسرگیری تنش‌ها میان جمهوری اسلامی و ایالات متحده در تنگه هرمز از روز دوشنبه، جدال سنگین خریداران و فروشندگان شکل گرفت و ارزش معاملات خرد در این روز از مرز ۵۱ هزار میلیارد تومان (همت) فراتر رفت. در ادامه، روز سه‌شنبه با بروز اختلال در سامانه و هسته معاملات و کندی محسوس ارسال سفارش‌ها—که فضای روزهای پایانی رالی صعودی سال ۱۳۹۹ را تداعی می‌کرد—فشار فروش در نمادها تشدید شد. این روند منفی در روز چهارشنبه نیز به دلیل تبعات عرضه‌های سنگین روز قبل و سایه تنش‌های نظامی در جنوب کشور ادامه یافت و بازار با صف‌های فروش سنگین آغاز به کار کرد، هرچند در طول ساعات معاملاتی تقابل میان طرفین عرضه و تقاضا مجدداً شدت گرفت. در بازارهای موازی، شاهد رشد افسارگسیخته دلار در طول هفته بودیم؛ بطوریکه قیمت دلار از ۲۰۳ هزارتومان در ابتدای هفته، به بیش از ۲۲۰ هزارتومان افزایش یافت. در بازار طلا نیز، تحت تأثیر رشد قیمت دلار، شاهد رشد قیمت هر گرم طلای ۱۸ عیار به ۲۲ میلیون و ۴۸۰ هزارتومان بودیم.

تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۶,۳۸۶,۵۷۶	۶,۵۰۳,۹۷۰	۱۱۷,۳۹۴	%۱.۹
شاخص هم وزن (واحد)	۱,۸۰۲,۷۷۳	۱,۷۹۸,۷۵۲	(۴,۰۲۱)	%۰.۲
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۱۳۴,۱۴۵		(۴۱,۹۹۶)	%۲۳.۸
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۱۱,۳۴۸)		-	-

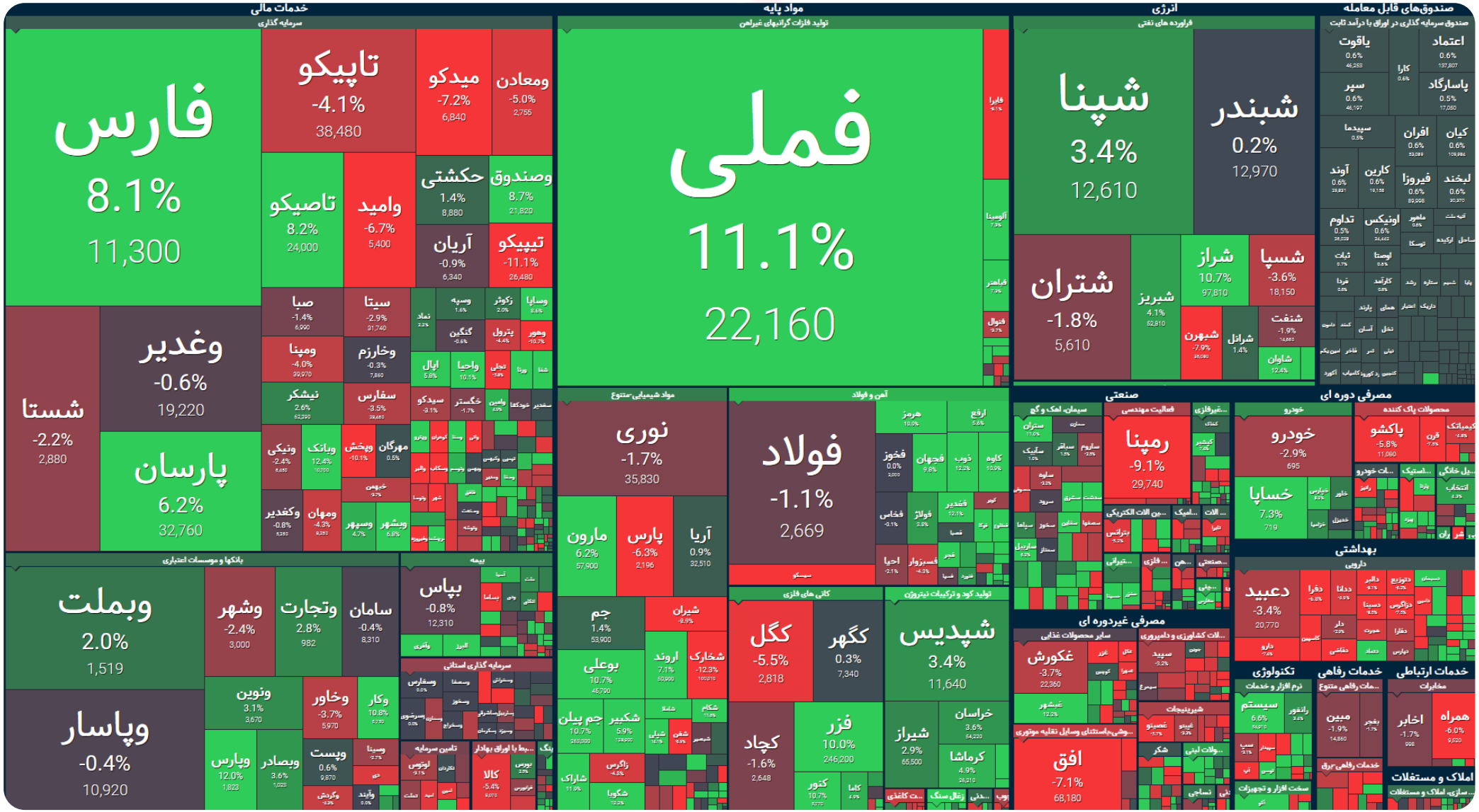
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



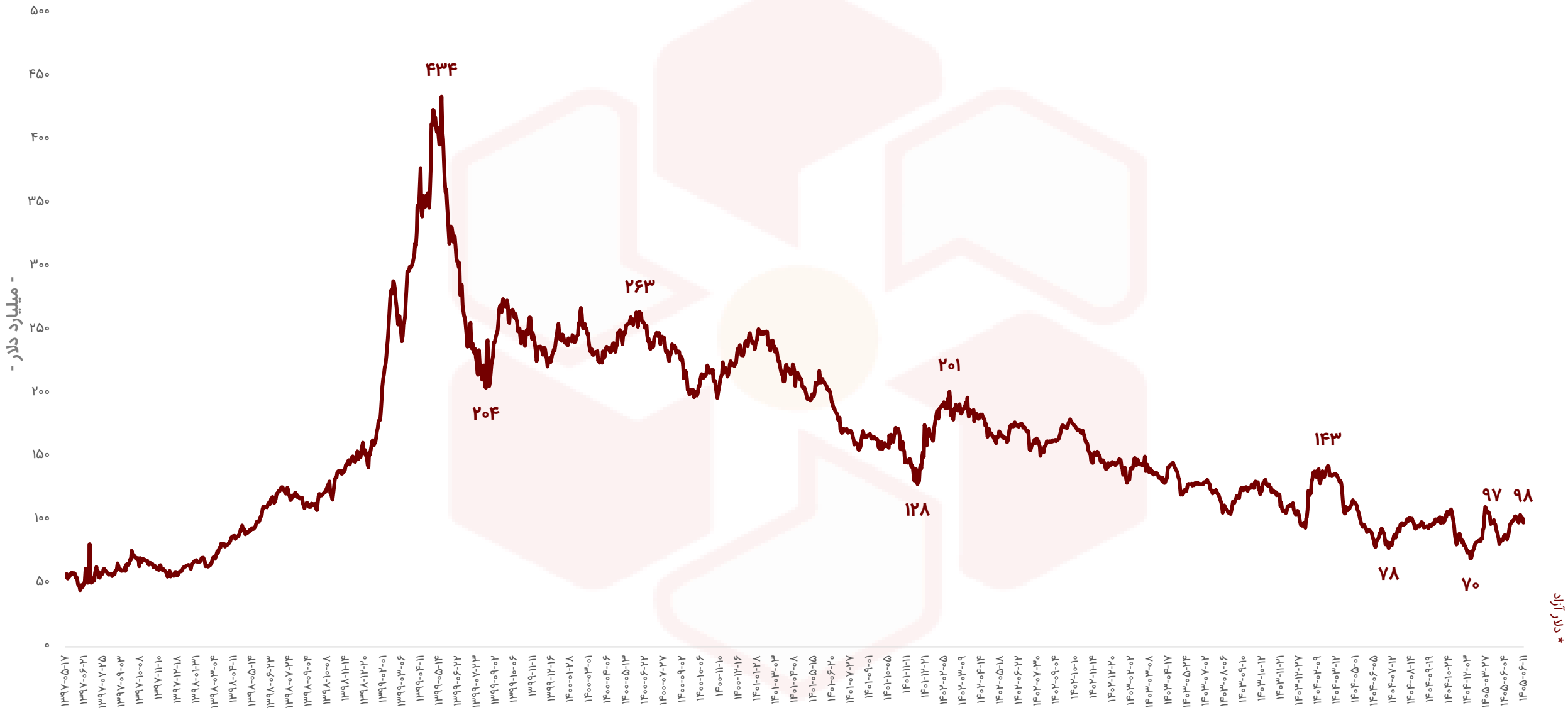
خیابان قائم مقام فراهانی – خیابان خدری – پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

نقشه بازار سهام در هفته گذشته

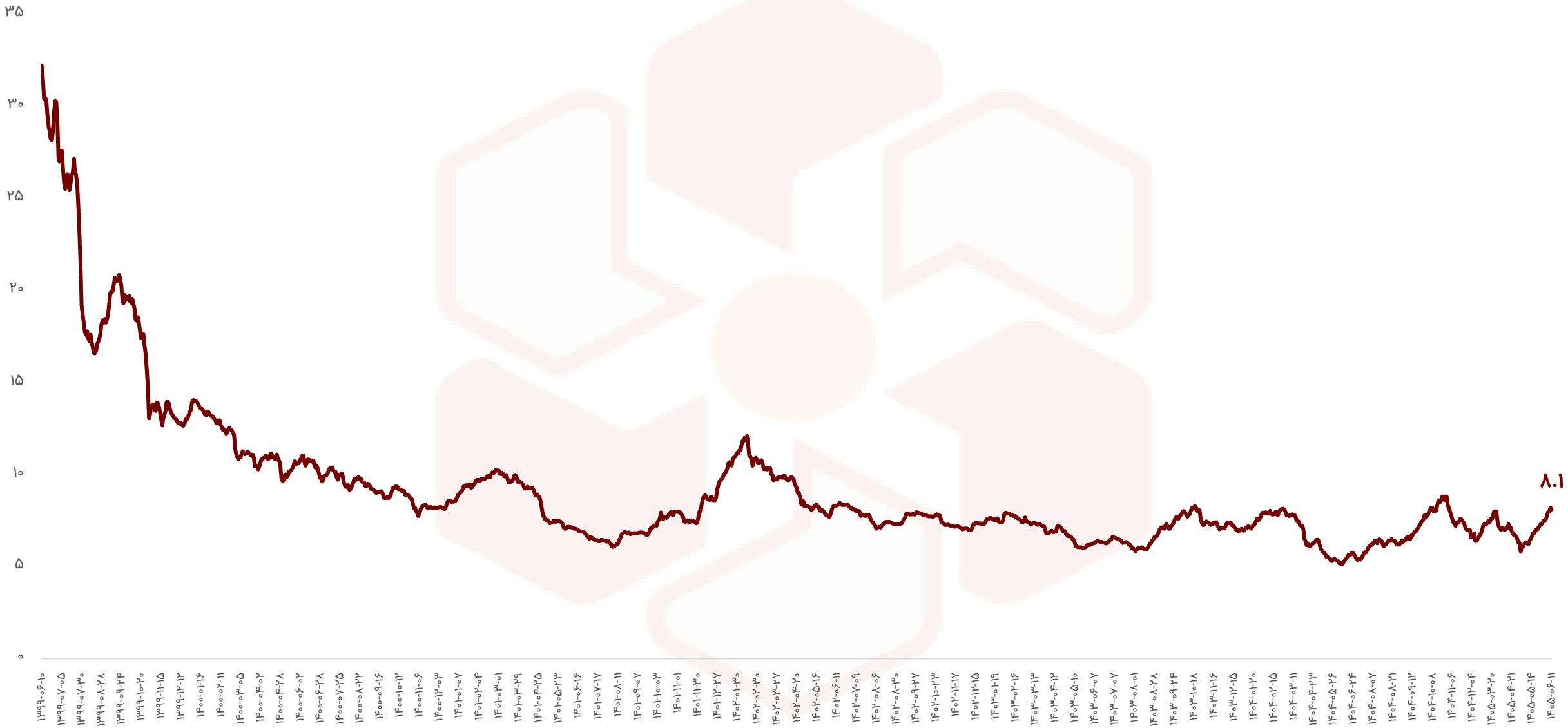


ارزش دلاری بازار*

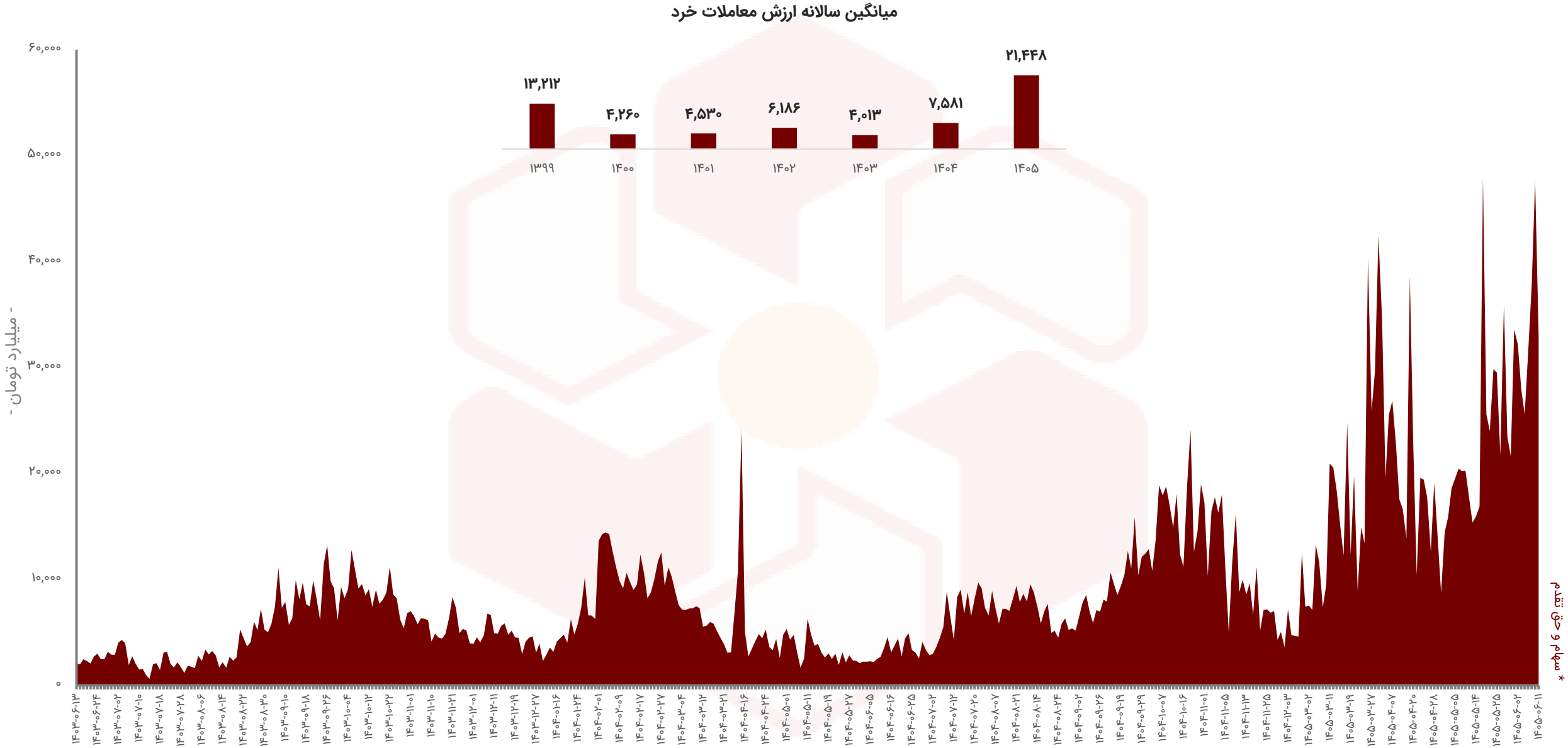


* دلار آزاد

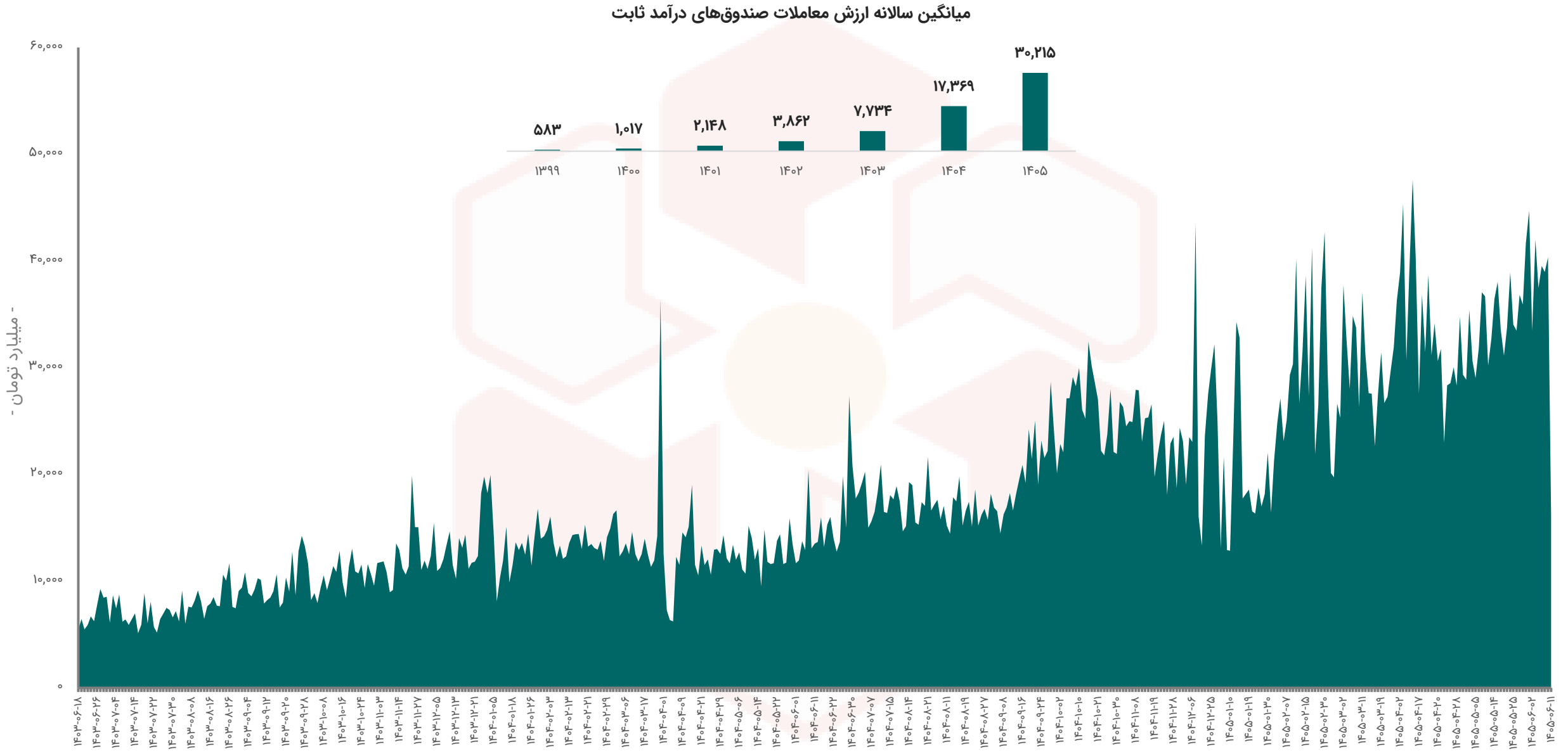
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



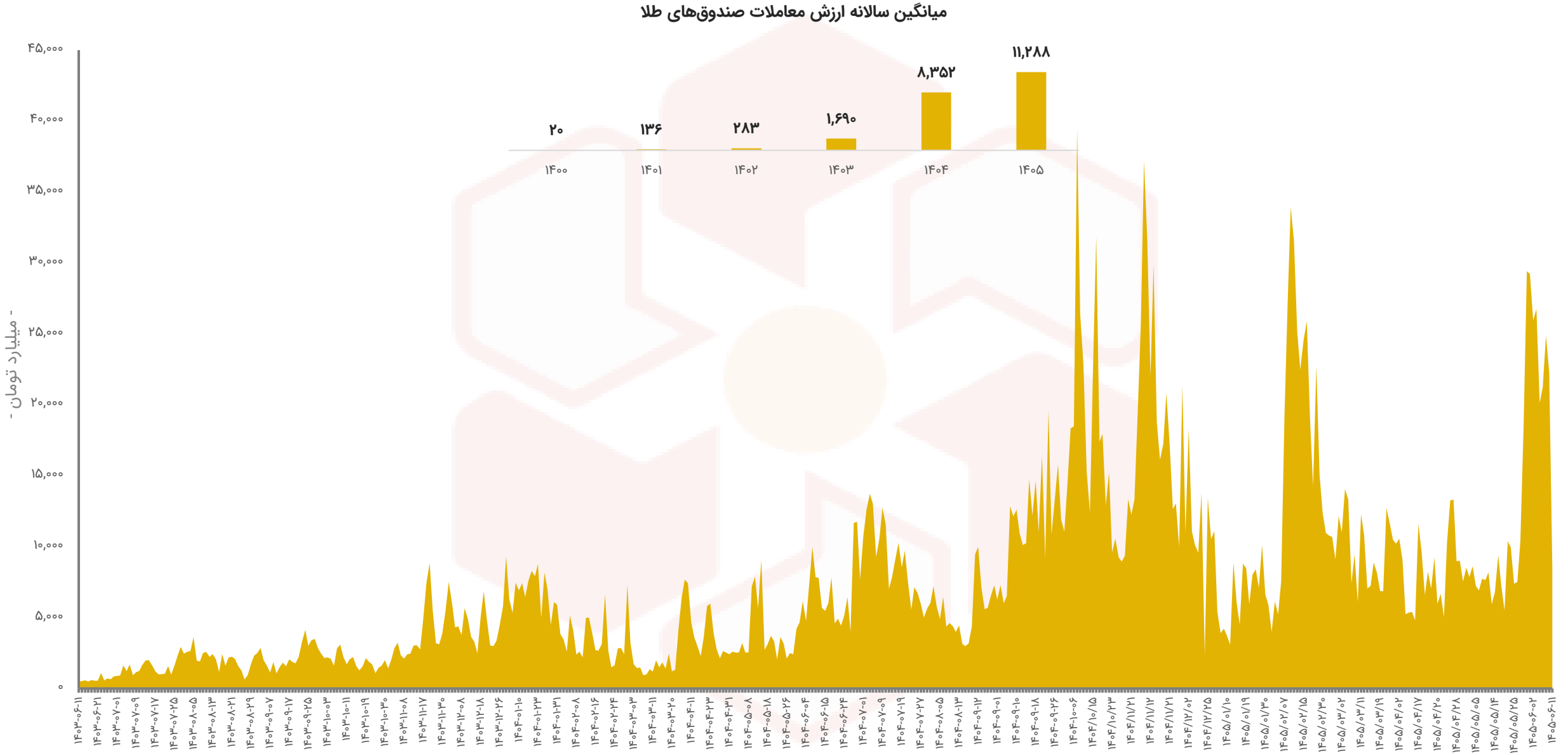
ارزش معاملات خرد سهام*



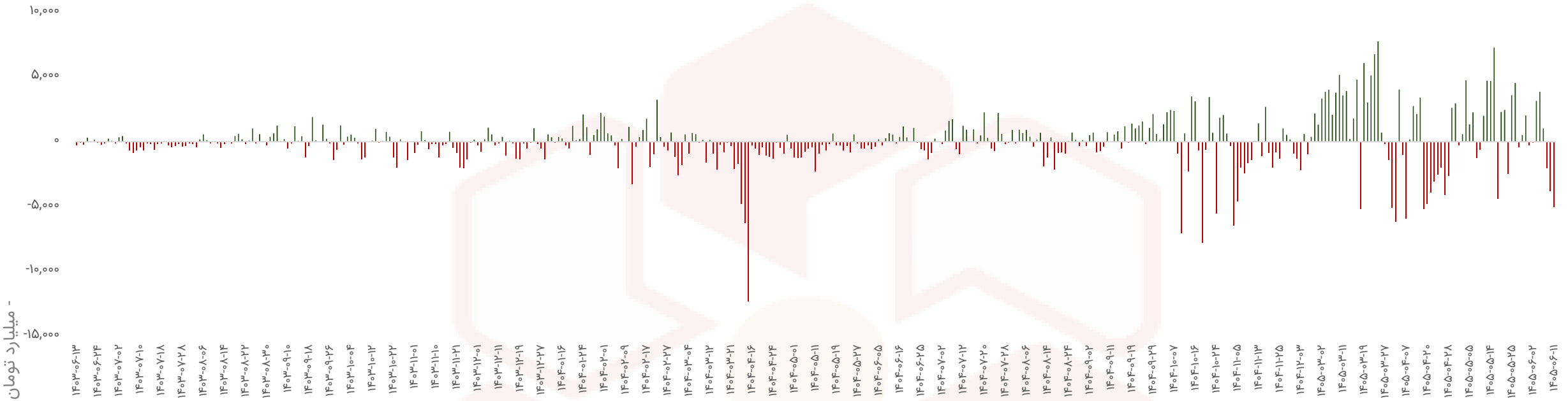
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



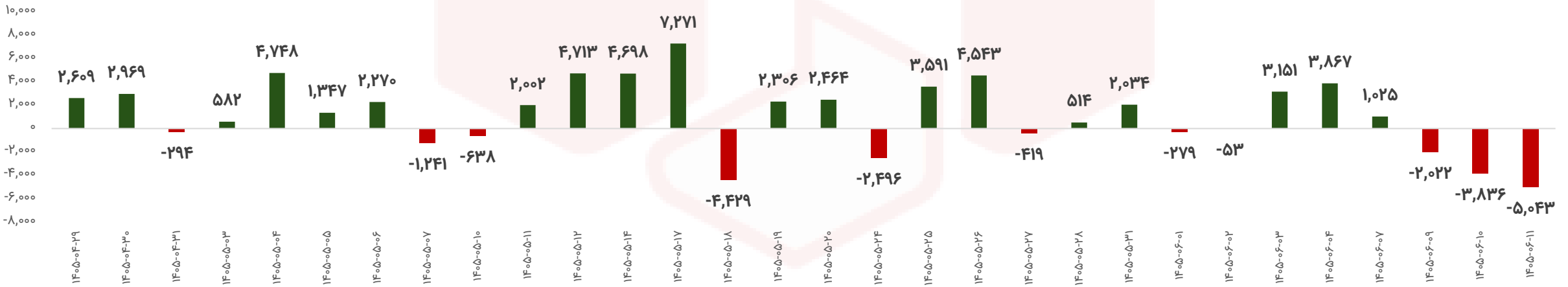
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



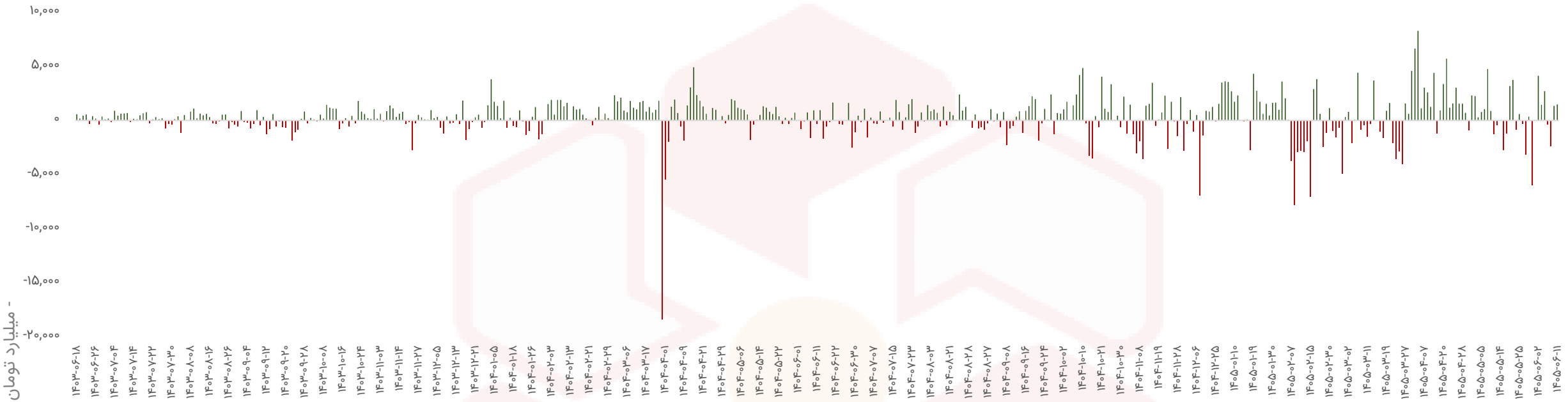
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



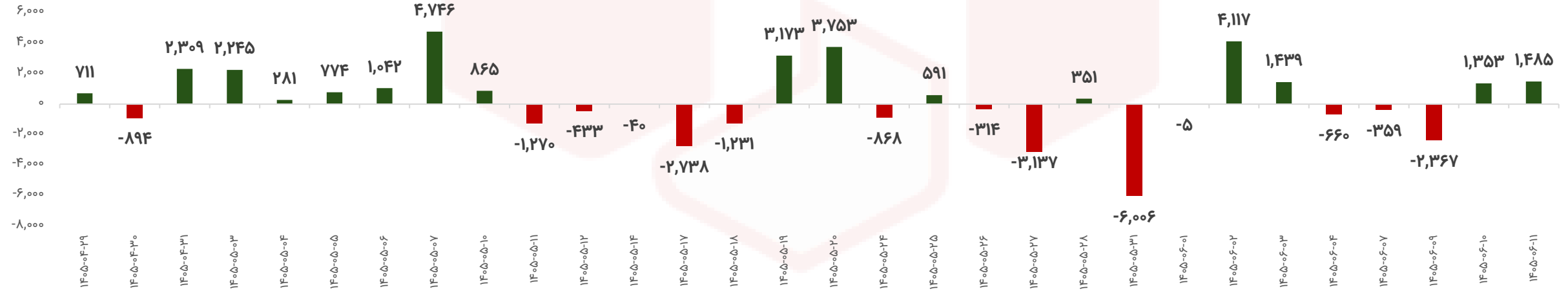
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

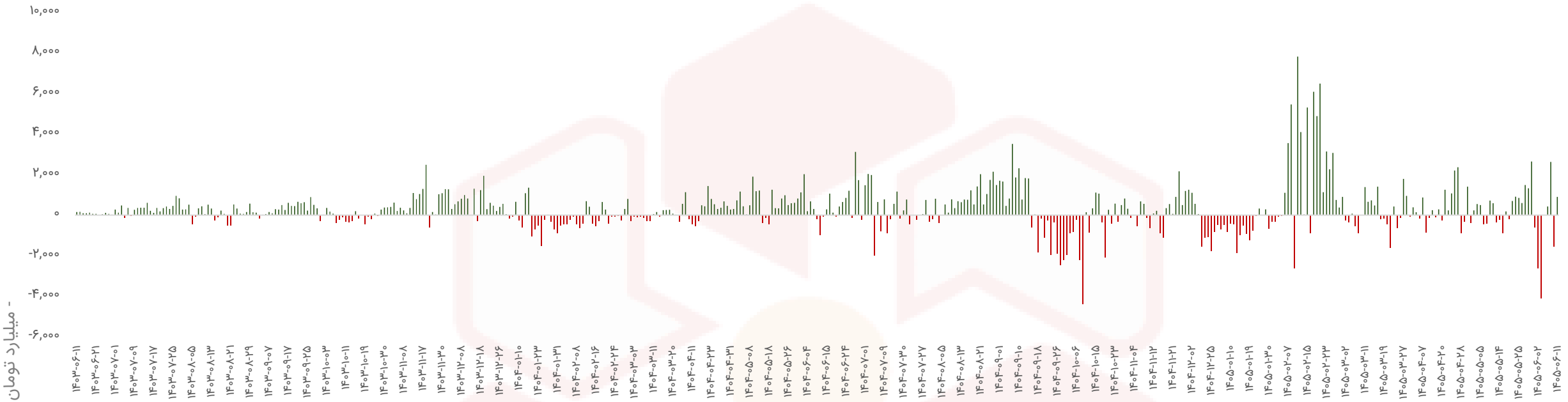
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



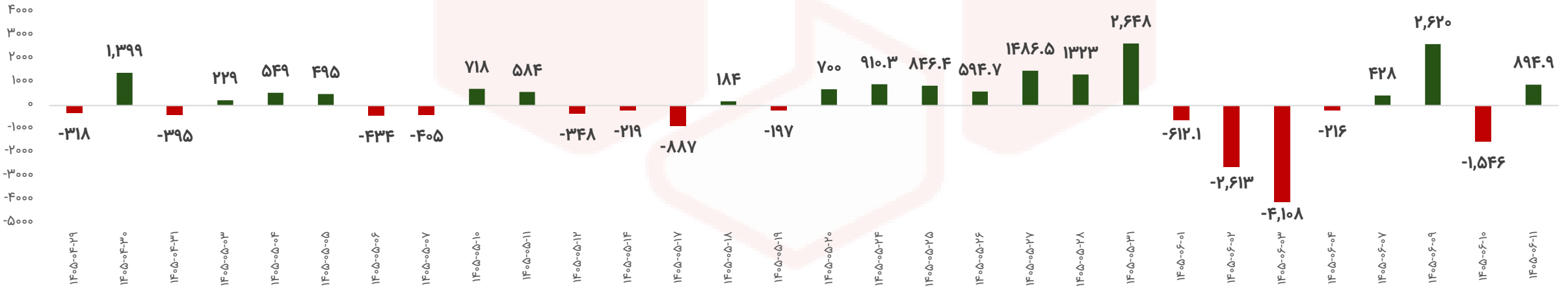
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



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



ترین‌های بازار در هفته اخیر

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	زاگرس فارمد پارس	ددام	%۲۲.۲
۲	ص.س. مبتنی بر کالای فارابی	سینرژی	%۱۵.۳
۳	تأمین سرمایه خلیج فارس	تفارس	%۱۳.۷
۴	آبگینه	کابگن	%۱۲.۵
۵	صنعتی معدنی تجارت مهریز	سمهریز	%۱۲.۵

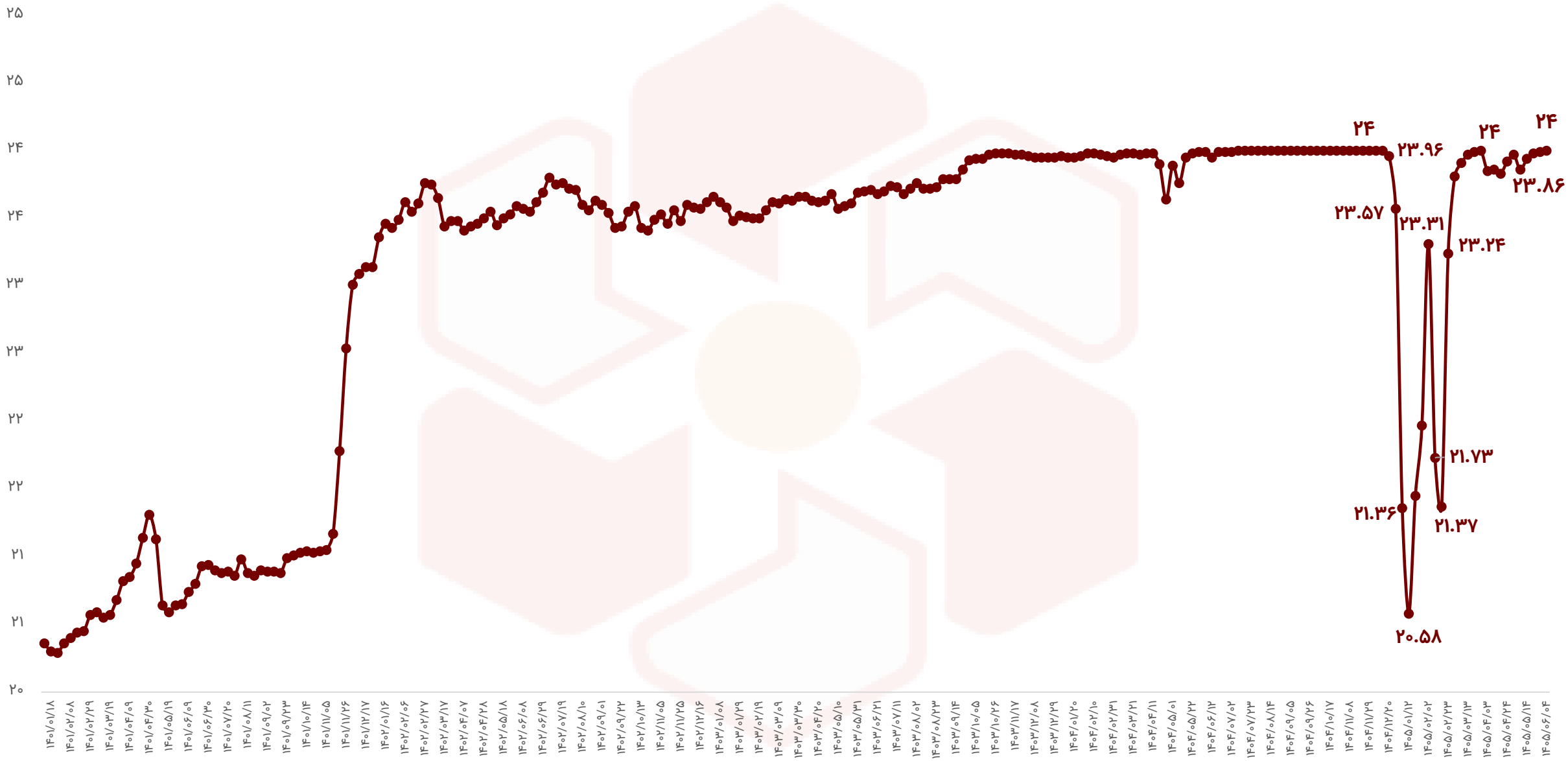
نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	افرانت	افرا	(%۱۱.۲)
۲	تولید انرژی برق شمس پاسارگاد	شمس	(%۱۱)
۳	گروه سرمایه‌گذاری انرژی امید تابان هور	وهور	(%۱۰.۹)
۴	مگسال	زمگسا	(%۱۰.۷)
۵	ص.س.بازده سهام	سهامدار	(%۱۰.۷)

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/E
وگردش	۱,۷۴۱	۱.۶
پارسیان	۱,۷۲۲	۱.۹
آسیا	۳,۹۸۰	۲
حفاری	۵,۵۳۰	۲.۱
وپارس	۱,۷۷۰	۲.۴
شصفها	۳,۰۴۰	۲.۵
ثجنوب	۱۶,۹۷۰	۲.۶
وبملت	۱,۵۶۵	۲.۸
البرز	۲,۳۲۷	۲.۹
ثبهساز	۱,۹۵۰	۲.۹

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۴۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۰-۱۹	۸۶۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۶,۵۱۰	۴۰.۹۸%
اخزا۴۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۱-۱۰	۸۸۱	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۳۶,۴۹۰	۴۰.۹۱%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۱۵۳	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۸,۱۷۰	۴۰.۷۵%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۷۳۴	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۲,۲۱۰	۴۰.۶۲%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۱۳۲	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۸۴,۵۱۰	۴۰.۴۰%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۷۹۷	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۷۶,۸۰۰	۴۰.۴۰%
اخزا۴۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۴-۲۰	۶۷۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۳۲,۱۸۰	۴۰.۴۰%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۱۰۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۰۶,۰۲۰	۴۰.۳۰%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۶۹	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۳۸,۱۶۰	۴۰.۱۷%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۳۷۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۱,۶۵۰	۴۰.۱۰%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۹۷	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۱,۹۱۰	۳۷.۹۸%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۱۳۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۸۷,۹۶۰	۳۷.۵۹%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۴۱	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۳,۱۷۰	۳۷.۳۴%

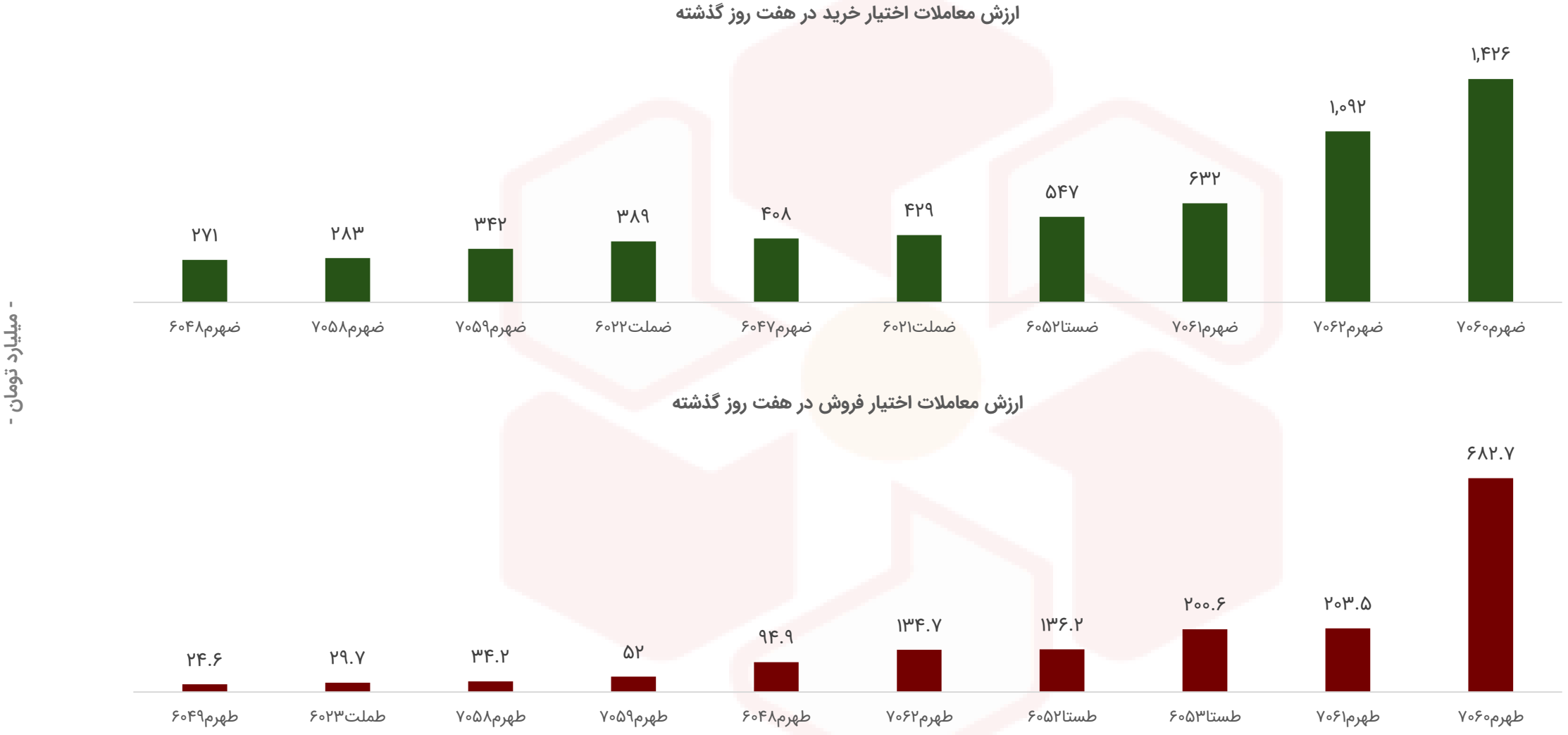
وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۳۲۰	۴,۶۱۰	(۶.۳%)	۴,۰۵۴	۶.۶%
نقره (دلار/انس)	۶۴	۶۸.۲	(۶.۱%)	۵۸.۱	۱۰.۱%
سکه امامی (تومان)	۲۲۵,۹۹۵,۰۰۰	۲۱۶,۰۱۰,۰۰۰	۴.۶%	۱۸۳,۹۹۰,۰۰۰	۲۲.۸%
دلار آزاد (تومان)	۲۱۸,۵۰۰	۲۰۰,۵۰۰	۹%	۱۹۱,۰۰۰	۱۴.۴%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۹۵.۶	۸۷	۹.۸%	۸۳.۶	۱۴.۳%
بیت کوین (دلار)	۷۷,۵۹۸	۷۷,۹۳۴	(۰.۴%)	۶۳,۴۸۲	۲۲.۲%
اتریم (دلار)	۲,۴۱۲	۲,۴۴۴	(۱.۳%)	۱,۸۸۲	۲۸.۲%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۲۷۸	۳,۲۲۰	۱.۸%	۳,۲۲۶	۱.۶%
مس LME (دلار)	۱۴,۱۰۹	۱۴,۲۸۳	(۱.۲%)	۱۴,۰۶۵	۰.۳%
روی LME (دلار)	۳,۸۵۸	۳,۹۰۷	(۱.۳%)	۳,۶۳۶	۶.۱%
سرب LME (دلار)	۱,۹۱۶	۱,۹۰۹	۰.۴%	۱,۸۶۹	۲.۵%
انس پلاتین (دلار)	۱,۷۳۲	۱,۸۶۰	(۶.۹%)	۱,۶۲۳	۶.۷%

آمار معاملات گواهی‌های سپرده بورس کالا

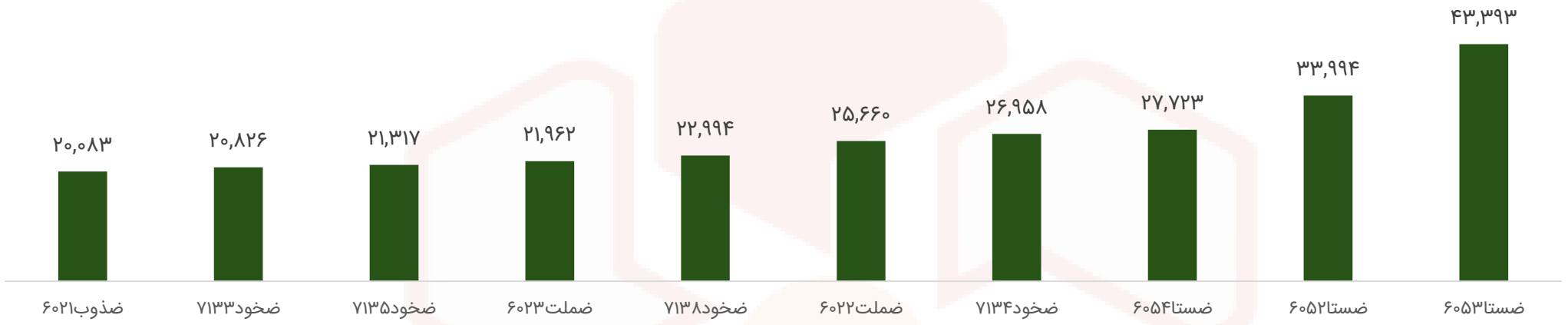
شرح	آخرین	هفته گذشته	
		قیمت	تغییرات
گواهی سپرده شمش طلا	۳۰,۰۴۴,۰۰۰	۲۸,۶۵۵,۰۰۰	۴.۸%
گواهی سپرده سکه طلا	۲,۲۴۹,۹۹۹,۹۰۰	۲,۱۲۳,۵۰۰,۰۰۰	۶%
گواهی سپرده نقره	۴,۸۸۹,۹۹۰	۴,۶۱۹,۹۰۰	۵.۸%
گواهی سپرده مس کاتد	۲۴,۵۵۵,۱۰۰	۲۳,۸۰۰,۰۰۰	۳.۲%
گواهی سپرده شمش روی	۶,۴۱۵,۰۰۰	۶,۰۹۰,۱۳۰	۵.۳%
گواهی سپرده شمش سرب	۴,۳۰۱,۰۰۰	۴,۰۳۸,۹۸۰	۶.۵%
گواهی سپرده میلگرد	۶۶۴,۹۹۰	۶۴۱,۰۰۰	۳.۷%
گواهی سپرده گندله سنگ آهن	۱۲۳,۰۰۰	۱۲۴,۰۰۰	(۰.۸%)
گواهی سپرده قیر	۱,۸۸۱,۰۰۰	۱,۵۰۵,۰۰۰	۲۵%
گواهی سپرده وانت T۹	۷,۱۷۴,۹۴۰	۶,۷۶۰,۳۸۰	۶.۱%

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

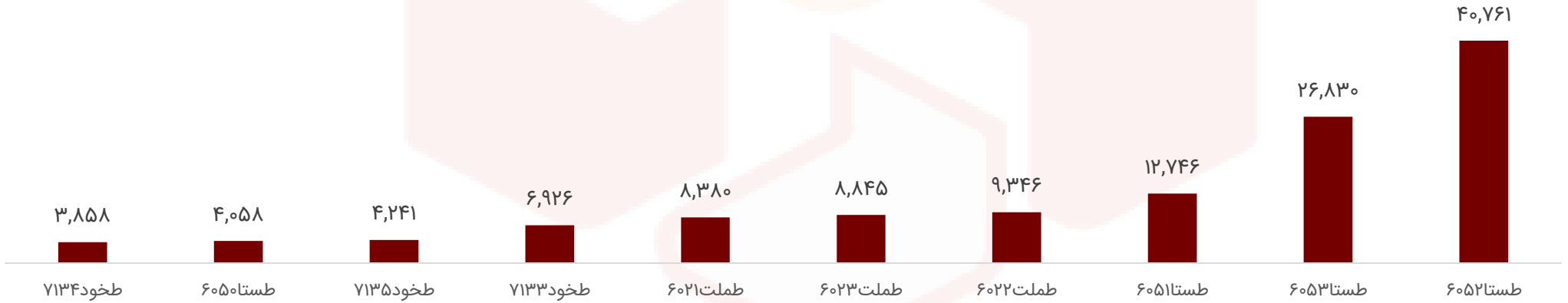


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته

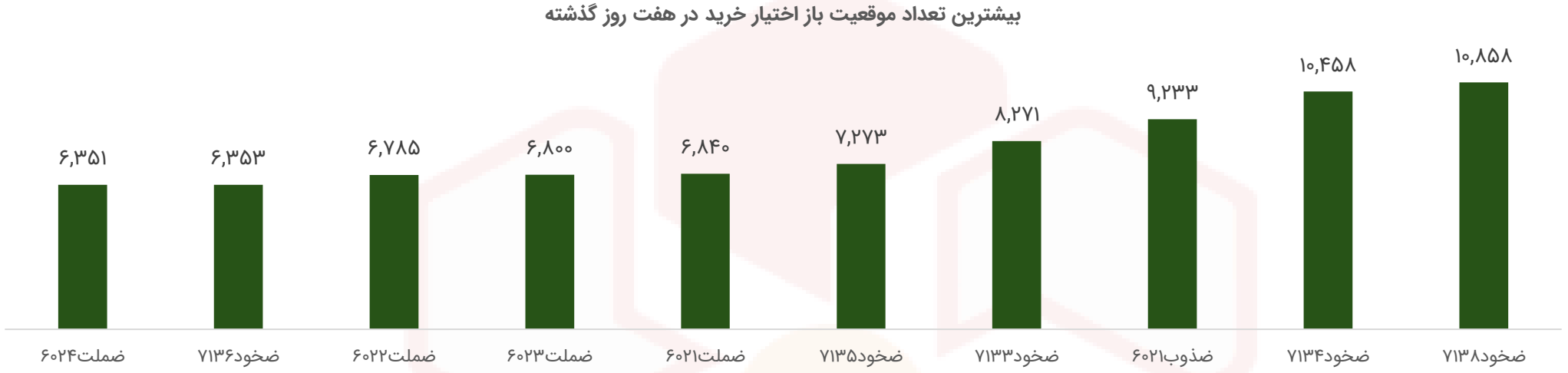


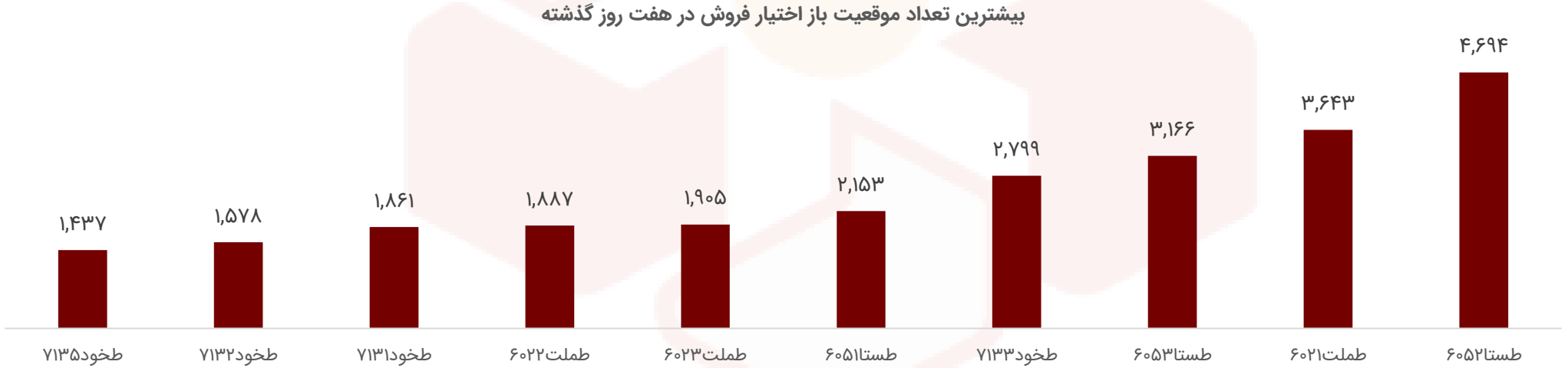
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار برگه سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه





بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege