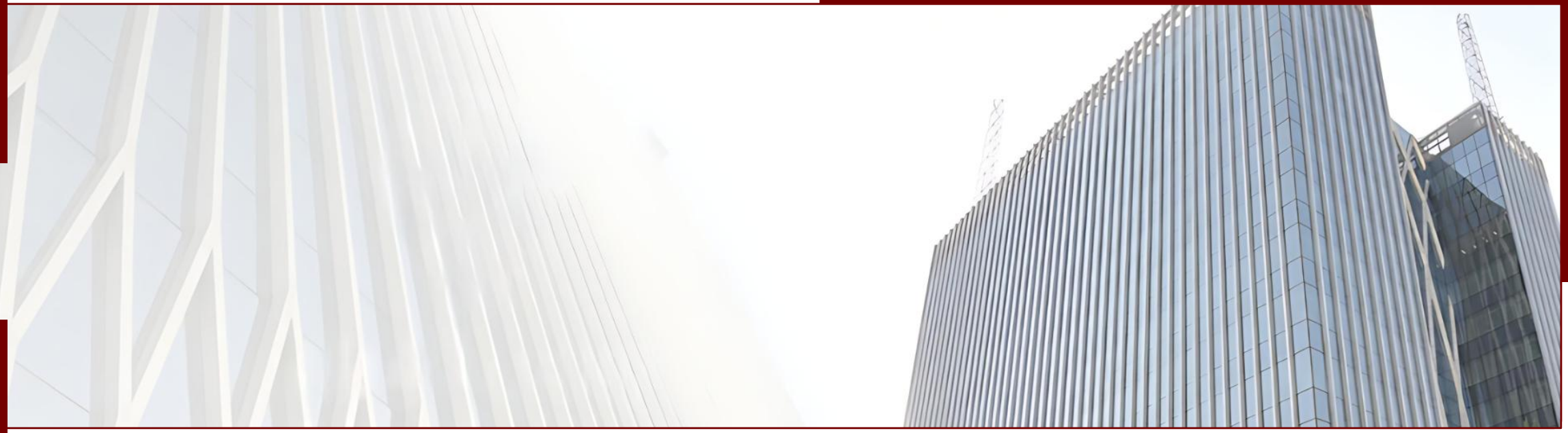


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۲۹ مهر ۱۴۰۵"

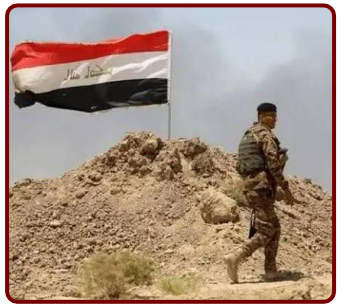
کارگزاری بانک ملت
Mellat Bank Brokerage co.

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



دستور ناگهانی نخست‌وزیر عراق برای بستن مرز چذابه و چند گذرگاه دیگر

در پی تصمیمی ناگهانی و بدون اعلام علت از سوی مقامات عراقی، یک منبع آگاه دولتی به الجزیره اعلام کرد که به دستور مستقیم نخست‌وزیر این کشور، گذرگاه مرزی «الشیب» (هم‌مرز با پایانه چذابه در استان خوزستان) از روز چهارشنبه تا اطلاع ثانوی به‌طور کامل بسته شده است. این مقام عراقی همچنین افشا کرد که این اقدام محدود به یک پایانه نبوده و قرار است طی روزهای آینده چند گذرگاه زمینی دیگر میان دو کشور نیز به‌تدریج مسدود شوند؛ تصمیمی که تاکنون از سوی مقامات بغداد و مسئولان مربوطه ایرانی بدون ذکر دلیل رسمی باقی مانده است.



جهش نفت به آستانه ۱۱۰ دلار و سفر ناگهانی فرمانده ارتش پاکستان به تهران

همزمان با جهش قیمت نفت به محدوده ۱۱۰ دلار در هر بشکه، خبر سفر عاصم منیر، فرمانده ارتش پاکستان، به تهران منتشر شد؛ حضور او در تهران تا شامگاه یکشنبه تقریباً منتفی بود، اما ظهر دوشنبه و همزمان با صعود قیمت نفت به سطح مقاومتی ۱۱۰ دلار به‌یکباره نهایی شد. اگرچه سفرهای پیشین میانجی‌گران به تهران زمینه ریزش موقت قیمت نفت را فراهم کرده بود اما هیچ پیشرفت قابل‌ملاحظه‌ای در پرونده مذاکره ایجاد نکرد، و اکنون در حالی که بهای نفت خام برنت به محدوده ۱۰۹ دلار رسیده و بلومبرگ پیش‌تر هشدار داده بود که نفت ۱۱۰ دلاری آغاز فشار سنگین بر اقتصاد آمریکاست، بار دیگر انتشار اخبار مربوط به مذاکره و میانجیگری در آستانه رسیدن قیمت نفت به محدوده‌های حساس، بازار را تحت تأثیر قرار داده است.



گفتگوی وزیرامور خارجه ایران با شبکه الاخباریه

وزیر امور خارجه با اشاره به ادامه مذاکرات غیرمستقیم از طریق واسطه‌ها، از ارائه «طرح هفت‌روزه» با شرط بازگشایی تنگه هرمز در روز ششم خبر داد و گفت آمریکایی‌ها با این طرح موافقت کرده اما خواستار افزودن بندهای جدیدی شده‌اند. آقای عراقچی با تأکید بر اینکه شرط ایران پایبندی کامل واشنگتن به یادداشت تفاهم اسلام‌آباد است، تصریح کرد که با وجود بی‌اعتمادی ریشه‌دار به بدعهدی‌های آمریکا، این ابتکار برای اثبات حسن‌نیت و باز بودن درهای دیپلماسی ارائه شده است؛ وی همچنین با تأکید بر اینکه تا زمان حصول توافق نهایی، تنگه هرمز بسته خواهد ماند و شناورهای عبوری با مشکل مواجه خواهند شد، یادآور شد که ادعای آمریکا درباره باز بودن تنگه در عمل با چالش‌های جدی روبه‌روست.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



عرضه اولیه ۱۲ درصد سهام سیم و کابل تبریز "سیمکات" چهارشنبه ۲۹ مهر

بیست و ششمین شرکت جدید با عرضه اولیه ۱۲ درصد سهام سیم و کابل تبریز "سیمکات" به روش ترکیبی، چهارشنبه ۲۹مهر در فرابورس وارد می شود. بر اساس این گزارش، ۹۷ میلیون و ۳۳۴ هزار و ۴۷۱ سهم معادل ۱۲ درصد سهام "سیمکات" در دو مرحله با قیمت ارزش گذاری ۲۵,۳۳۷ ریالی در بازار دوم معاملات فرابورس عرضه می شود که در مرحله اول ۳۲ میلیون و ۴۴۴ هزار و ۸۲۴ سهم معادل ۴ درصد با حداکثر سهمیه ۴۰۵ هزار و ۶۰۰ سهمی به سرمایه گذاران واجد شرایط به روش حراج عرضه می شود. در مرحله دوم، ۶۴ میلیون و ۸۸۹ هزار و ۶۴۷ سهم معادل ۸ درصد دیگر همان روز با حداکثر سهمیه ۱۳۰ سهمی به سهامداران حقیقی و حقوقی به روش قیمت ثابت کشف شده تعلق می گیرد. مشاور عرضه هم کارگزاری بورس بهگزین و متعهد خرید تامین سرمایه کاردان است.



آغاز پذیره‌نویسی دومین صندوق ارزی بازار سرمایه؛ سود ۵ درصدی «ملی کیمیا» با ضمانت بانک ملی

پذیره‌نویسی «ملی کیمیا» به عنوان دومین صندوق سرمایه‌گذاری ارزی با درآمد ثابت در بازار سرمایه، از سه‌شنبه ۲۸ مهر با مشارکت بانک ملی ایران به عنوان امین ارزی و تأمین سرمایه کیمیا به عنوان مدیر عرضه آغاز شد. سرمایه‌گذاری در این صندوق که با اسکناس دلار یا حواله ارزی و با تعیین ارزش ۱۰ دلار برای هر واحد امکان‌پذیر است، حداقل ۱۰۰ دلار و حداکثر ۵۰۰ هزار دلار تعیین شده و سود سالانه روزشمار آن ۵ درصد به‌صورت ارزی پرداخت خواهد شد؛ ضمن اینکه بانک ملی ایران ضمانت نقدشوندگی و مدیریت عملیات ارزی آن را بر عهده دارد و علاقه‌مندان می‌توانند برای ثبت درخواست به شعب ارزی منتخب این بانک مراجعه کنند.



پیش دریافت خرید برخی محصولات در بورس کالا به ۵۰ و ۷۰ درصد رسید

بورس کالا، موضوع تغییر میزان پیش دریافت برای خرید برخی محصولات تالار صنعتی را به مدیران عامل شرکت‌های کارگزاری ابلاغ کرد.

بر اساس این گزارش از سه شنبه ۲۸ مهر تا اطلاع ثانوی میزان پیش دریافت خرید برخی محصولات تالار صنعتی در بورس کالا ۵۰ و ۷۰ درصد است.

ردیف	زیر گروه کالا	میزان پیش دریافت
۱	آهن اسفنجی	۷۰
۲	بلوم و بیلت فولادی	۵۰
۳	تیرآهن سبک	۵۰
۴	تیرآهن سنگین	۵۰
۵	تیرآهن صنعتی	۵۰
۶	تیرآهن متوسط	۵۰
۷	تیرآهن نیمه سنگین	۵۰
۸	میلگرد سبک	۵۰
۹	میلگرد سنگین	۵۰
۱۰	میلگرد متوسط	۵۰
۱۱	میلگرد فوق سنگین (صنعتی)	۵۰

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

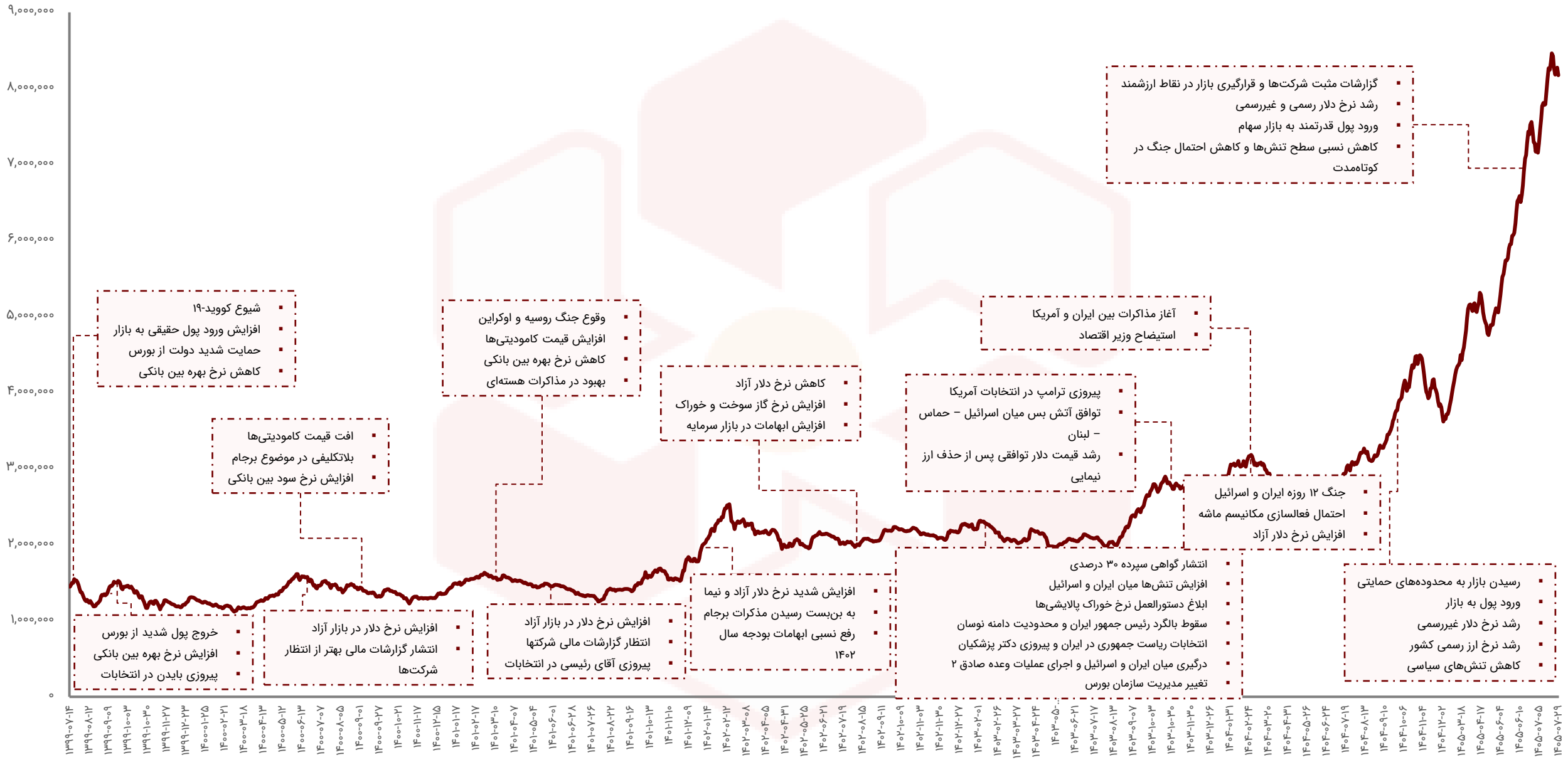
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

بازار سهام در این هفته کار خود را با فشار فروش آغاز کرد، اما در ادامه به تعادل رسید. با این وجود، در پایان هفته مجدداً با افت مواجه شد و شاخص کل در پایان معاملات هفتگی، با ثبت کاهش ۳ درصدی، در ارتفاع ۸,۱۷۳,۳۶۱ واحدی ایستاد. در روز شنبه، در پی افزایش تنش‌ها، انتشار شایعاتی مبنی بر احتمال وقوع درگیری از شب قبل و بسته شدن حریم هوایی در خاورمیانه، فشار فروش بر بازار حاکم شد؛ به طوری که در این روز، ۸۱ درصد از نمادها در محدوده منفی به کار خود پایان دادند و خروج پولی ۸ همتی ثبت گردید. در روز یکشنبه، بازار کمی متعادل شد و در نهایت در محدوده مثبت به کار خود پایان داد. طی روزهای دوشنبه و سه‌شنبه، روند معاملات نوسانی بود و علی‌رغم شکل‌گیری صف‌های خرید، عرضه قابل‌توجهی نیز در بازار وجود داشت. با این حال، در ساعات پایانی معاملات روز سه‌شنبه، جو منفی تعطیلات آخر هفته، زودتر از موعد همیشگی، بر بازار حاکم شد و شدت عرضه‌ها را افزایش داد؛ وضعیتی که در روز چهارشنبه نیز ادامه یافت. در مجموع طی این هفته، نمادهای کوچک بازار عملکرد بهتری از خود نشان دادند، در حالی که نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز با فشار عرضه بیشتری همراه بودند. در بازارهای موازی نیز، دلار آمریکا با روندی صعودی در ظهر روز چهارشنبه به ۲۶۸ هزارتومان رسید و قیمت هر گرم طلای ۱۸ عیار نیز تا ۲۶ میلیون و ۷۲۰ هزارتومان افزایش یافت.

تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۸,۴۲۵,۷۲۵	۸,۱۷۳,۳۶۱	(۲۵۲,۳۶۴)	(%۳)
شاخص هم وزن (واحد)	۲,۲۲۵,۷۹۰	۲,۲۵۵,۶۱۵	۲۹,۸۲۵	%۱.۳
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۱۸۳,۸۵۹		۳۳۷	%۰.۲
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۱۴,۹۸۴)		-	-

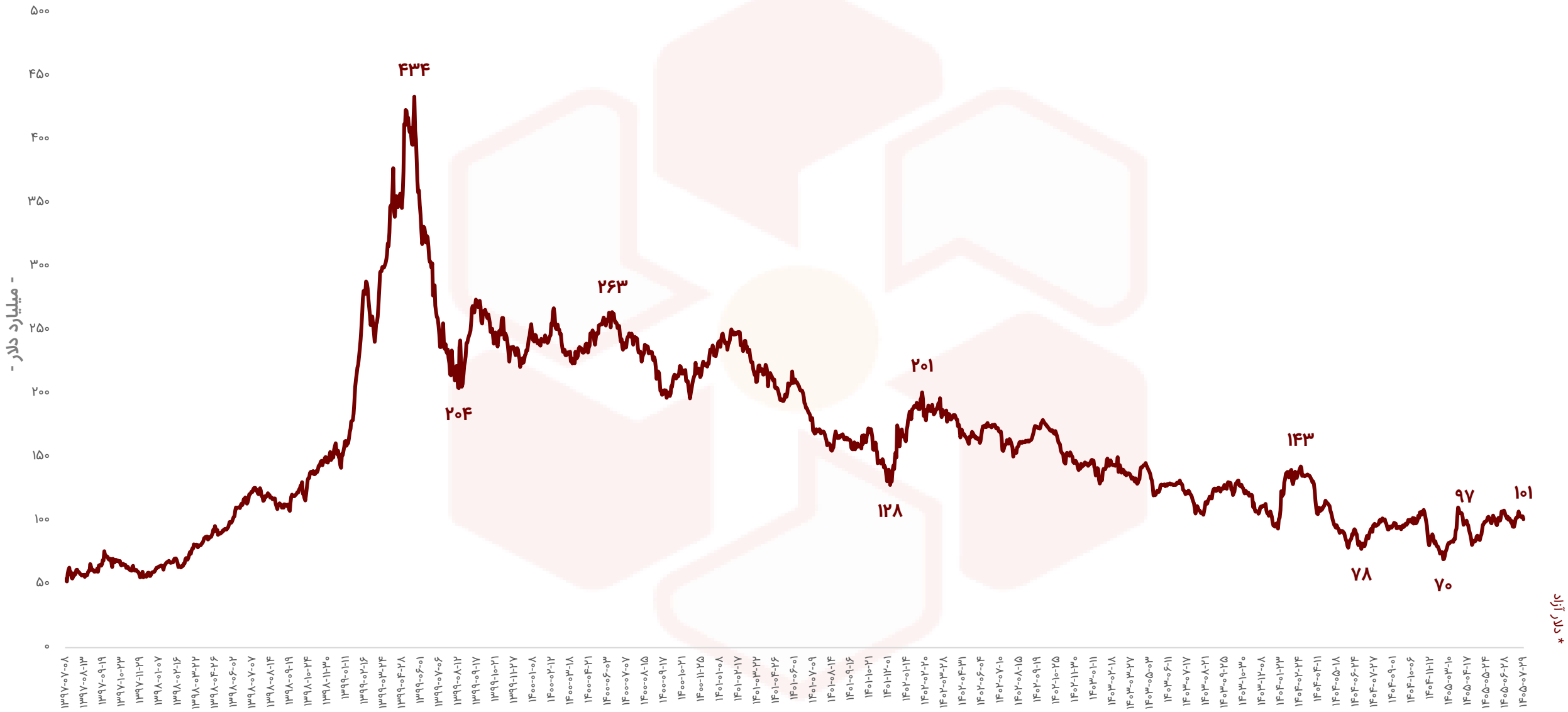
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



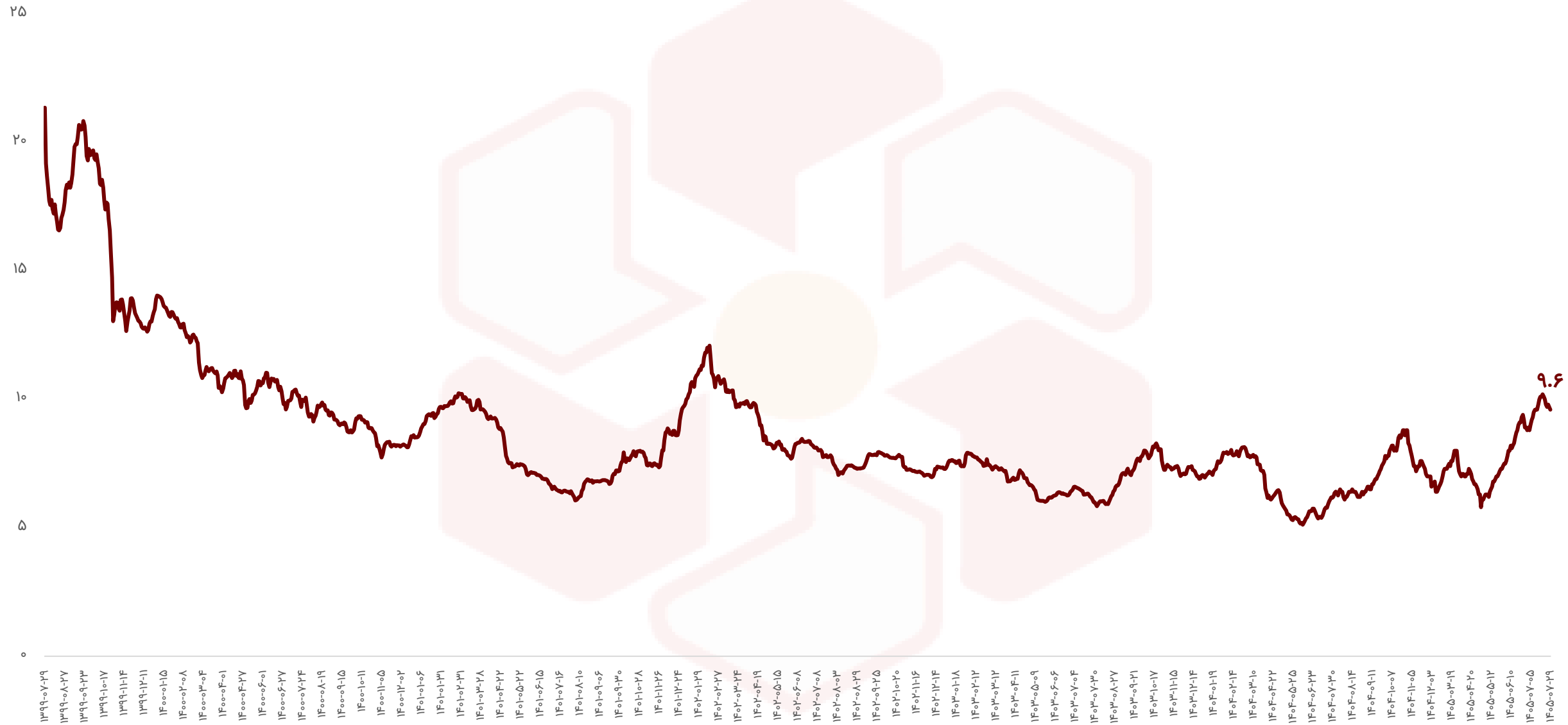
نقشه بازار سهام در هفته گذشته



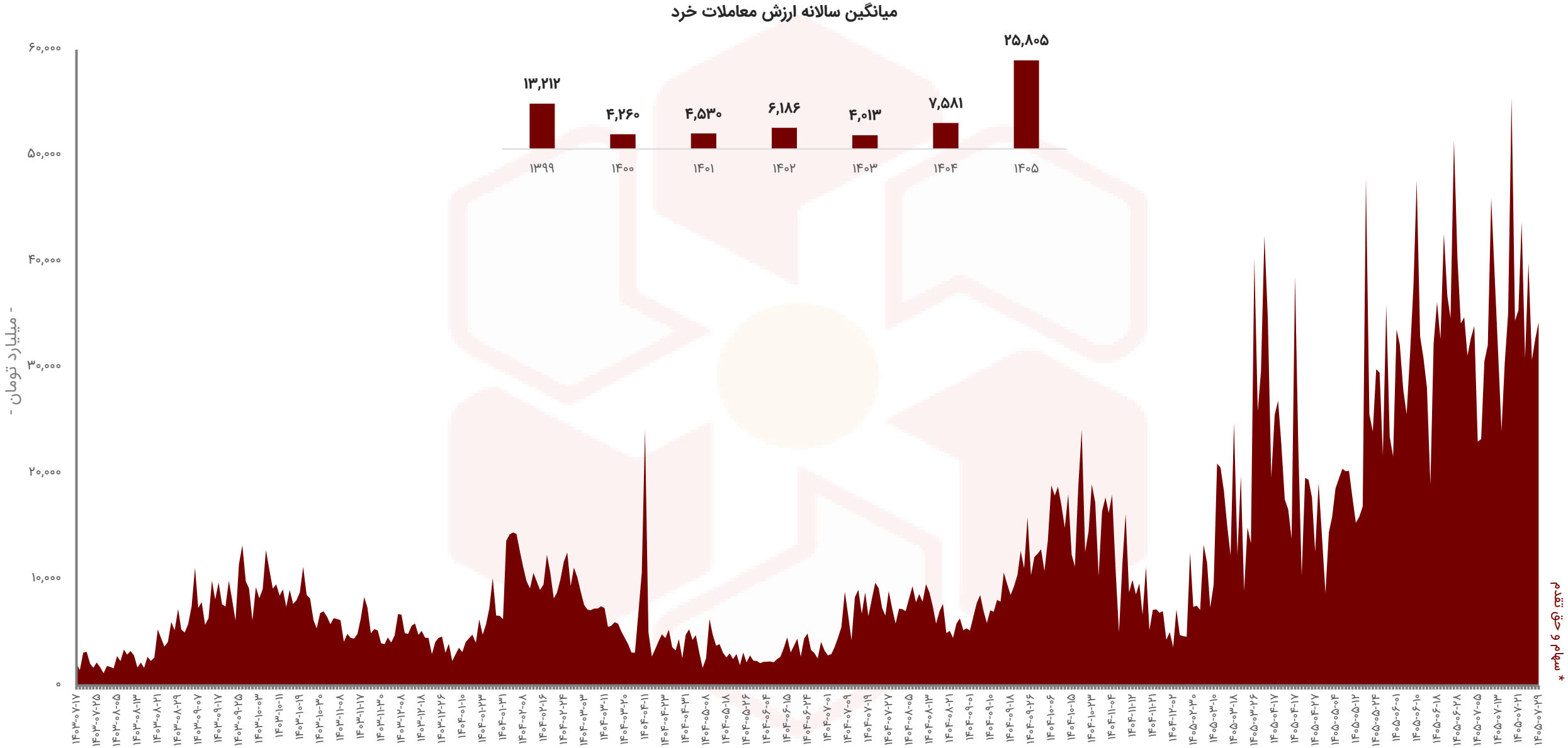
ارزش دلاری بازار*



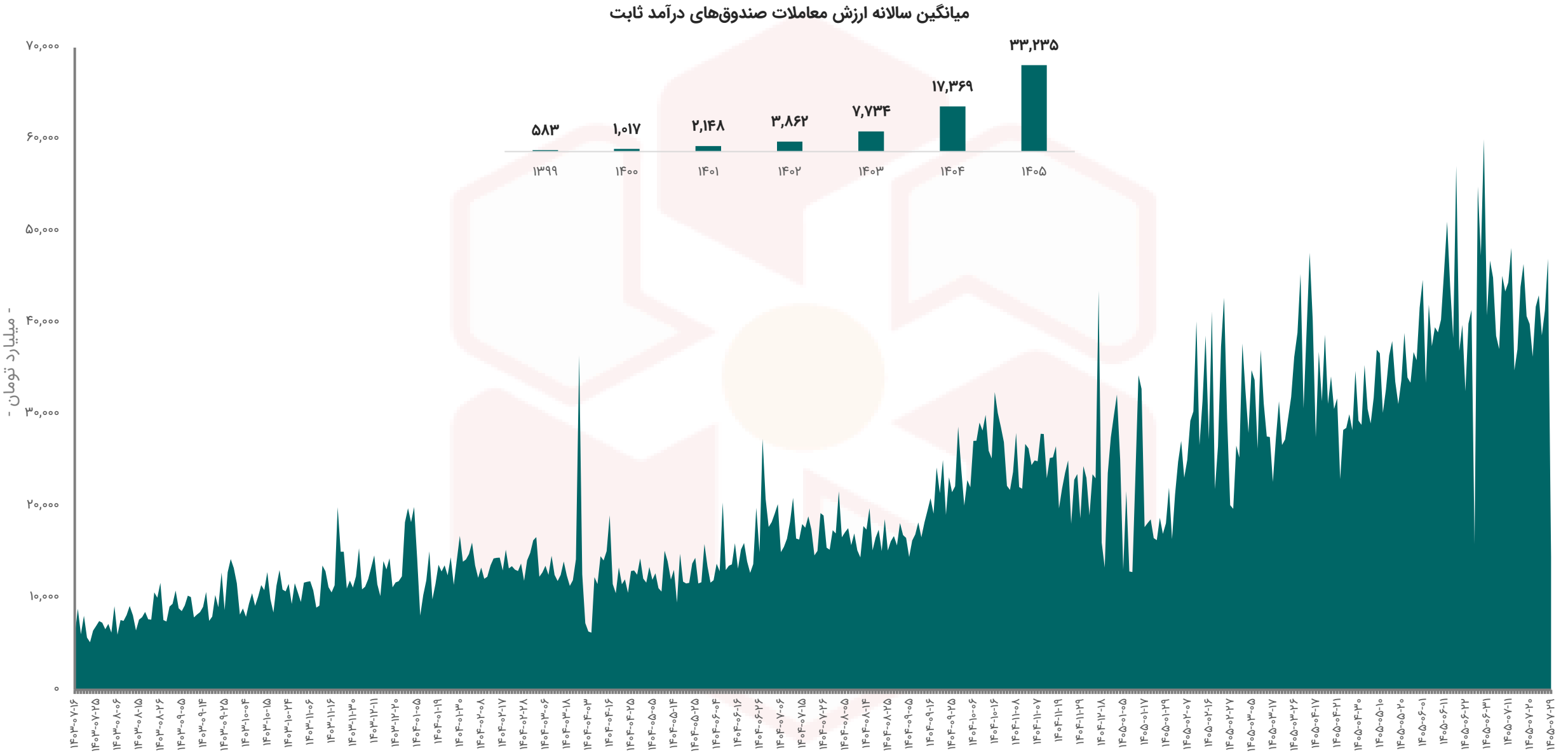
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



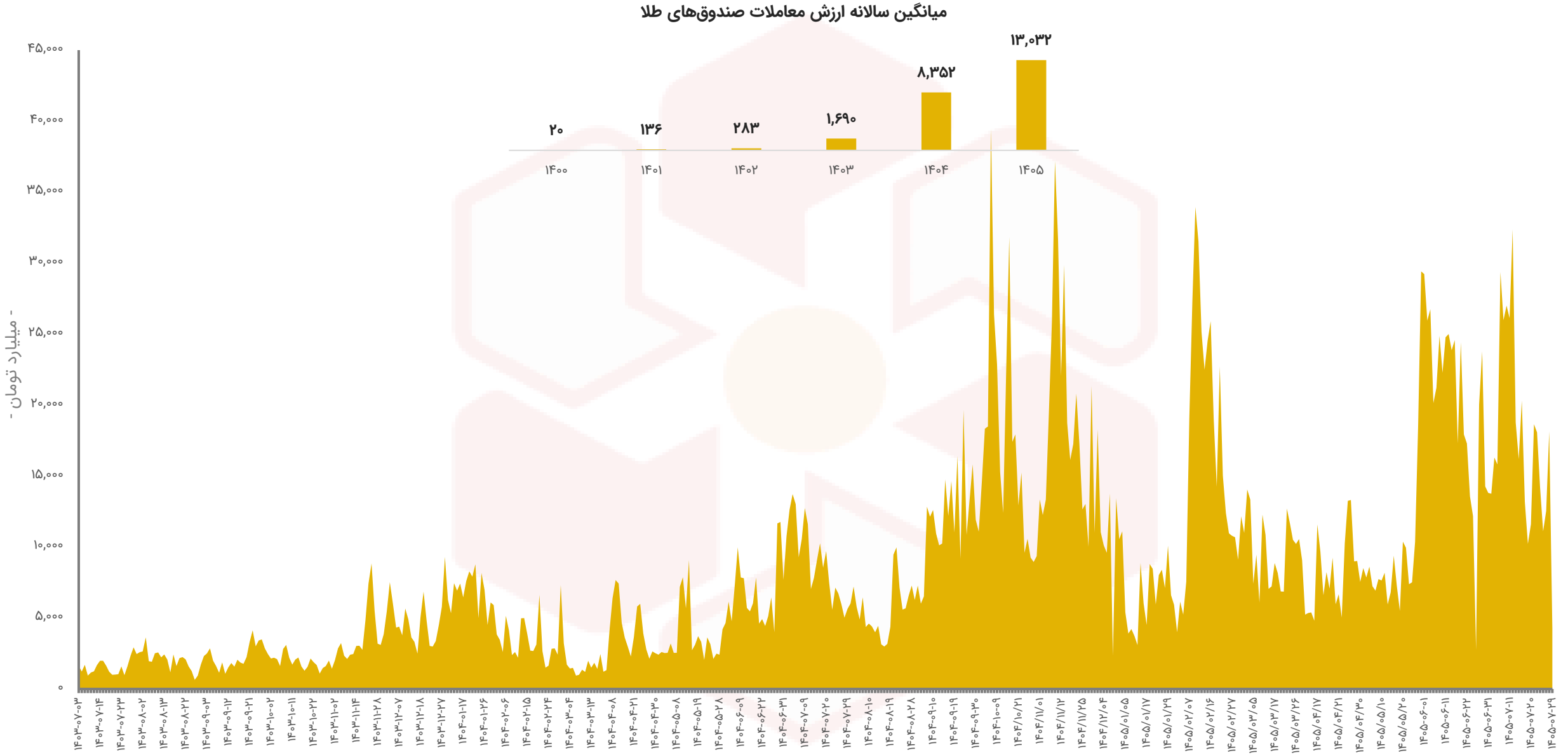
ارزش معاملات خرد سهام*



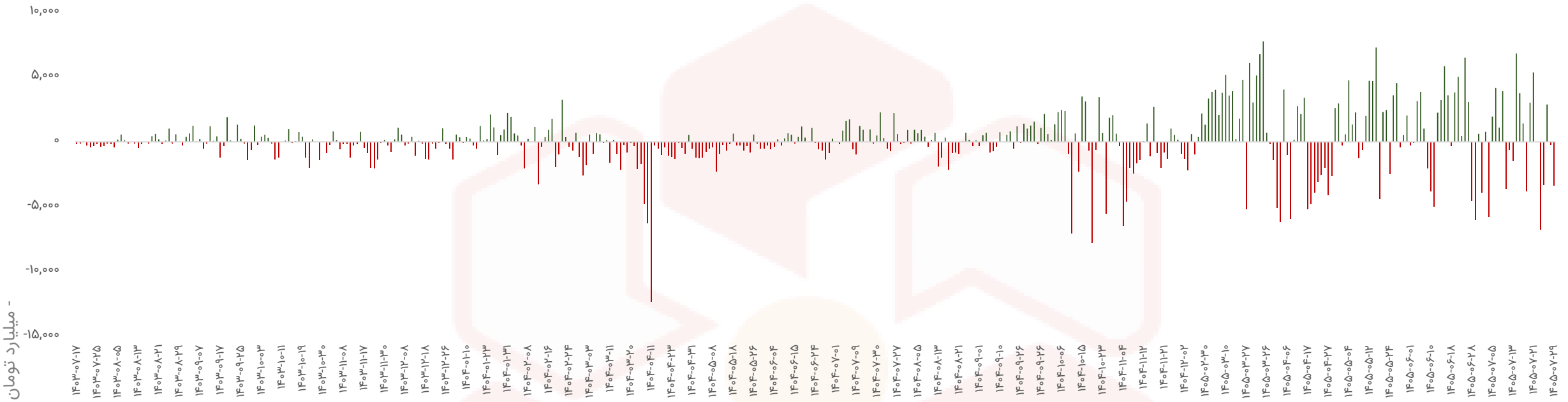
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



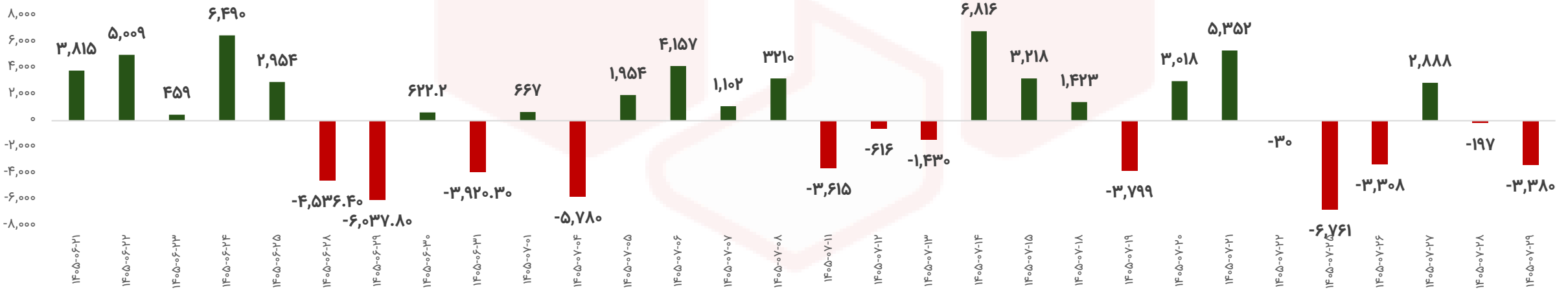
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



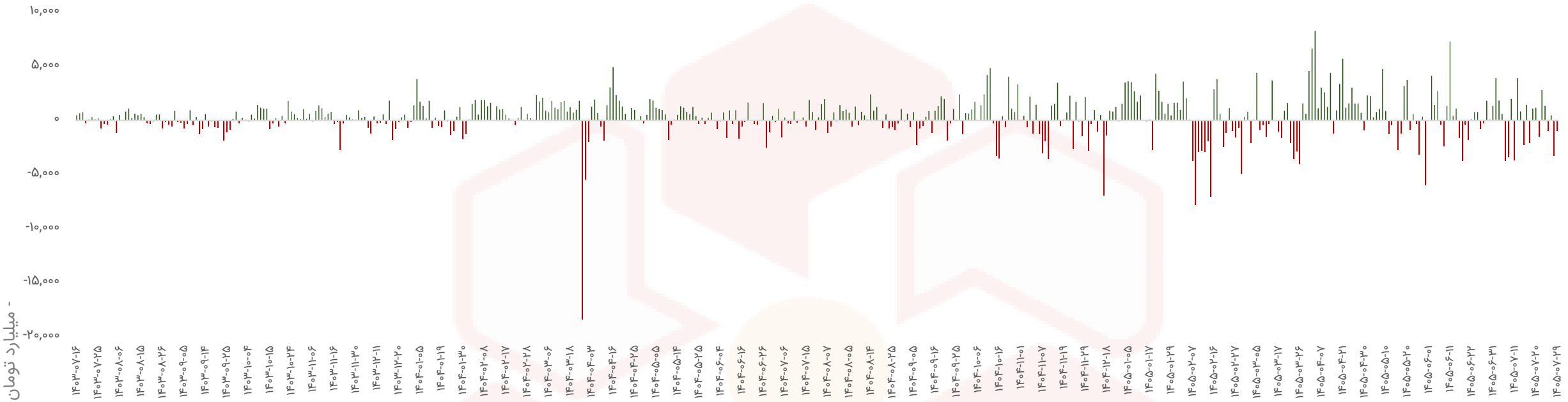
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



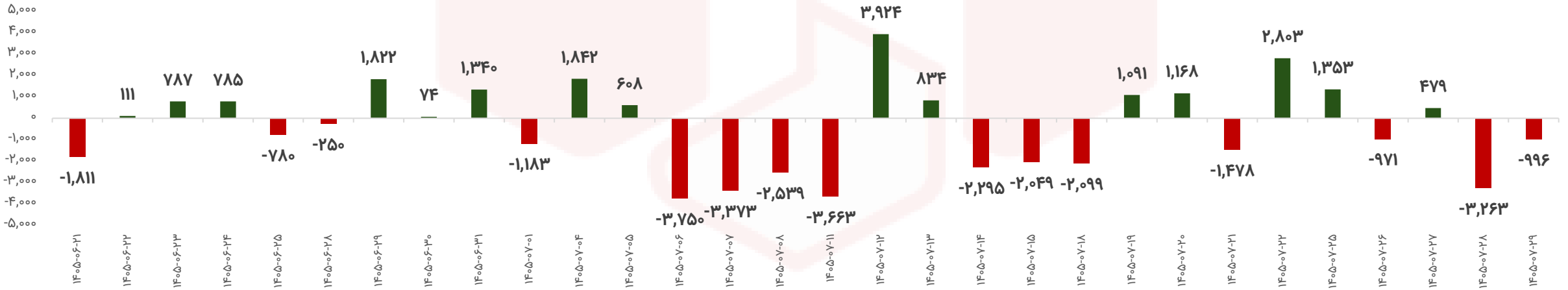
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

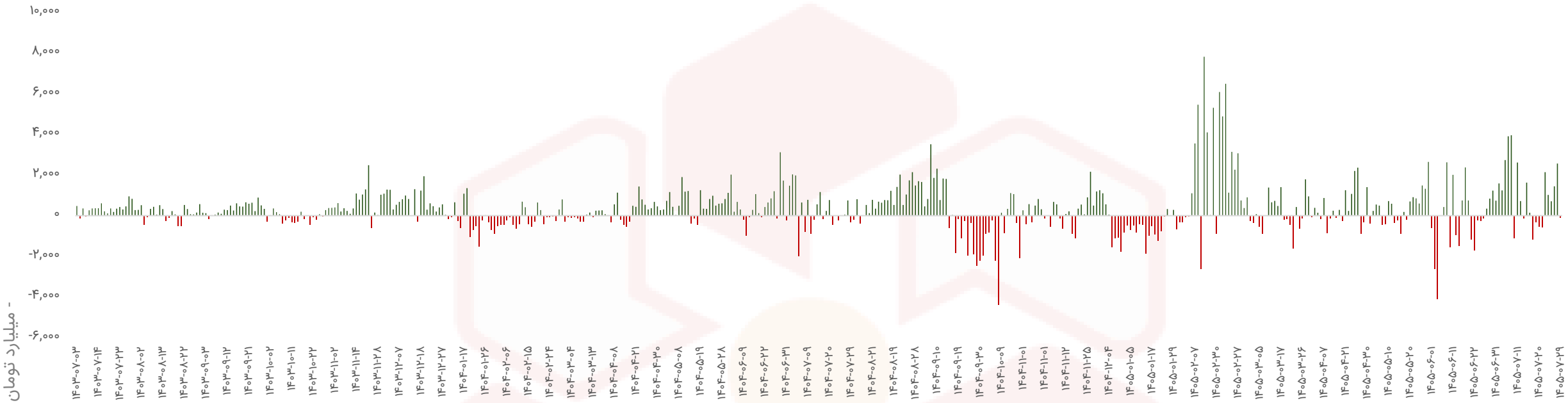
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



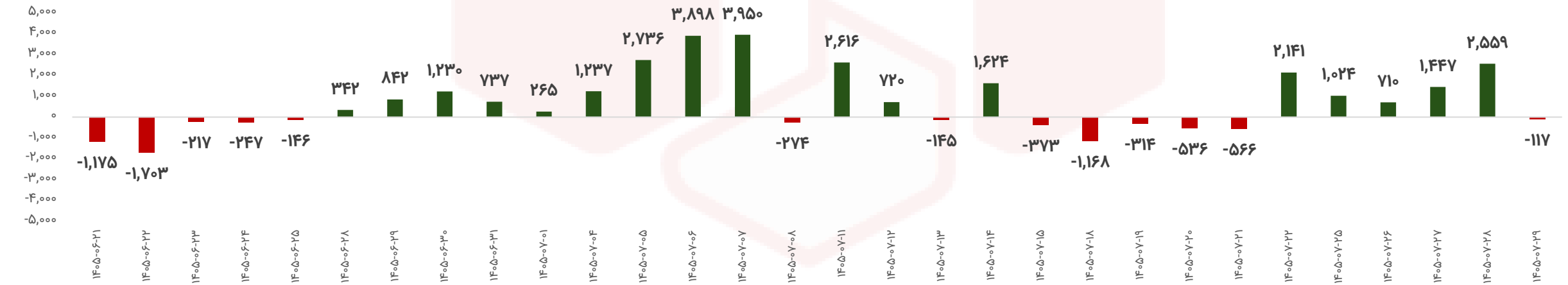
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



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	صنعت تجارت پردیس آذربایجان	فپردیس	%۱۵.۹
۲	تجلی توسعه معادن و فلزات	تجلی	%۱۵.۸
۳	ذوب گران رنگین فلز	فنقره	%۱۵.۸
۴	شهداب ناب خراسان	غشهداب	%۱۵.۸
۵	سرمایه‌گذاری هامون صبا	وهامون	%۱۵.۸

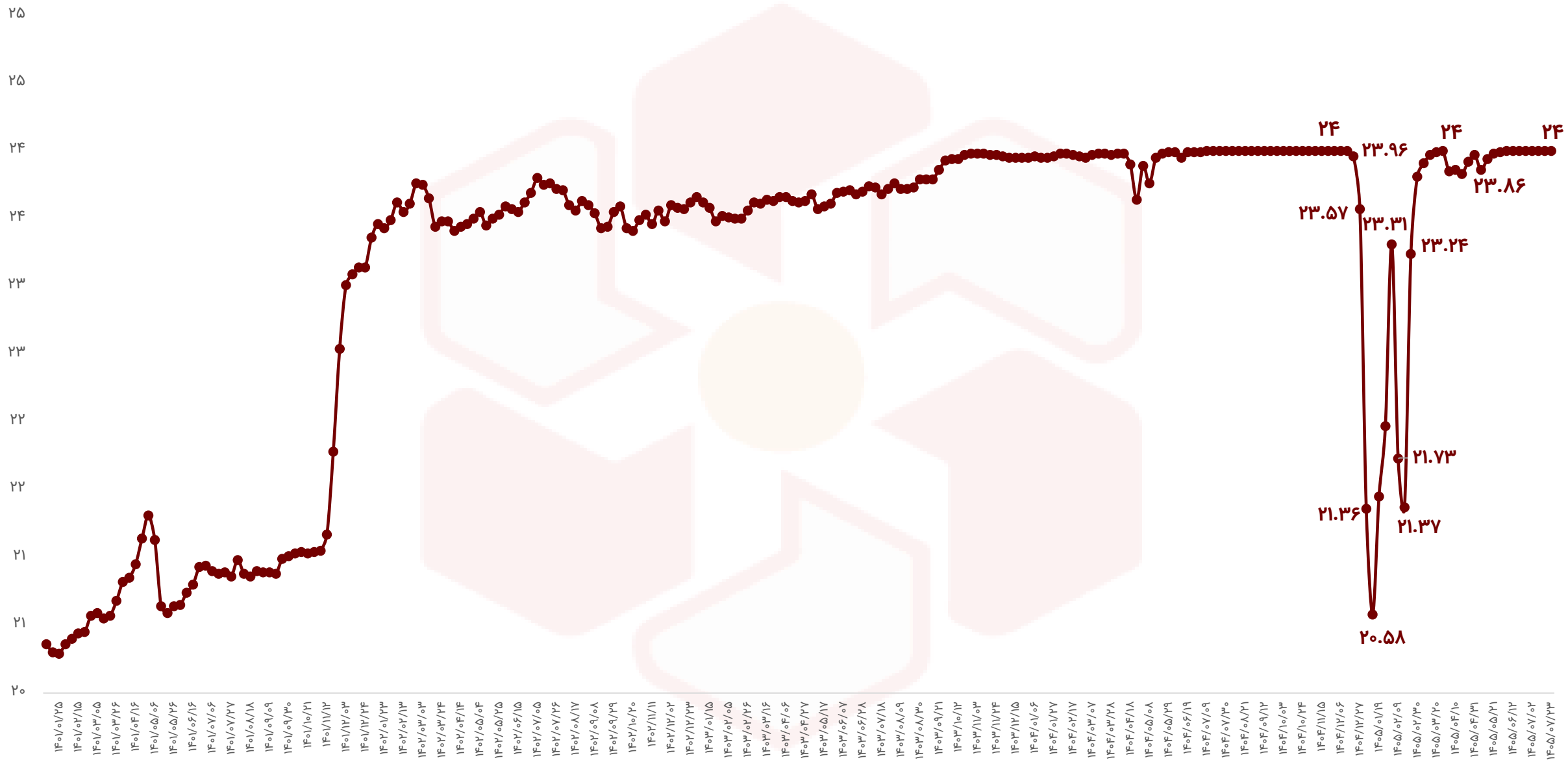
نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	ص.س. املاک و مستغلات کاشانه امید خلیج فارس	کاشانه	(%۱۴.۱)
۲	آ.س.پ	آ س پ	(%۱۳.۷)
۳	لیزینگ رایان سایپا	ولساپا	(%۱۳.۶)
۴	انتخاب الکترونیک آرمان	انتخاب	(%۱۳.۶)
۵	تأمین ماسه ریخته‌گری	کماسه	(%۱۳.۵)

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/E
وگردش	۱,۶۰۱	۱.۵
پارسیان	۱,۸۷۶	۲.۱
ومعلم	۴,۰۳۰	۲.۲
آسیا	۴,۹۶۰	۲.۶
وپارس	۲,۰۶۳	۲.۷
شصفها	۳,۳۲۰	۲.۷
وبملت	۱,۵۱۸	۲.۸
ثبهساز	۲,۰۱۹	۳
ثجنوب	۲۱,۹۲۰	۳.۵
ثامید	۲,۰۸۵	۳.۷

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۴۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۰۷	۶۷۷	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۱۰,۰۲۰	۴۶.۱۴%
اخزا۵۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۵-۰۹	۱۰۱۳	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۵۶,۱۶۰	۴۵.۰۶%
اخزا۵۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۲-۲۵	۹۳۶	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۸۹,۸۱۰	۴۴.۷۷%
اخزا۵۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۳-۰۸	۹۵۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۸۳,۲۲۰	۴۴.۵۴%
اخزا۴۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۱-۱۰	۸۳۱	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۳۴,۸۲۰	۴۴.۲۰%
اخزا۴۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۰-۱۹	۸۱۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۴,۲۰۰	۴۴.۱۹%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۷۴۷	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۸۱,۰۰۰	۴۴.۱۵%
اخزا۴۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۴-۲۰	۶۲۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۴۹,۹۰۰	۴۴.۰۹%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۶۸۴	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۱۱,۳۱۰	۴۳.۳۸%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۷۱۹	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۶,۹۹۰	۴۳.۳۷%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۸۲	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۲۳,۳۴۰	۴۲.۵۱%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۵۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴۹,۰۰۰	۴۲.۳۵%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۴۷	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۵۴,۰۰۵	۴۲.۰۵%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۸۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۲۳,۵۴۶	۴۱.۹۶%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۳۲۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۳۴,۹۸۰	۴۱.۷۲%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۱۰۳	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۰۹,۶۹۰	۴۰.۷۷%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۱۲۲	۴,۱۰۰	۰.۵%	۴,۳۸۳	(۶%)
نقره (دلار/انس)	۵۷.۳	۵۵.۶	۳.۱%	۶۶.۲	(۱۳.۴%)
سکه امامی (تومان)	۲۶۹,۰۴۰,۰۰۰	۲۶۷,۰۹۰,۰۰۰	(۰.۷%)	۲۳۹,۰۵۰,۰۰۰	۱۲.۵%
دلار آزاد (تومان)	۲۶۷,۱۱۰	۲۶۳,۹۰۰	۱.۲%	۲۳۰,۶۰۰	۱۵.۸%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۱۱۰.۲	۱۰۵.۸	۴.۲%	۱۰۳.۸	۶.۲%
بیت کوین (دلار)	۸۳,۳۳۹	۸۱,۹۴۶	۱.۷%	۸۱,۱۲۵	۲.۷%
اتریم (دلار)	۲,۴۵۳	۲,۴۳۰	۰.۹%	۲,۶۳۲	(۶.۸%)
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۰۲۶	۲,۹۹۰	۱.۲%	۳,۲۶۶	(۷.۳%)
مس LME (دلار)	۱۴,۲۷۳	۱۴,۴۲۲	(۱%)	۱۴,۶۵۳	(۲.۶%)
روی LME (دلار)	۳,۷۳۴	۳,۷۲۱	۰.۳%	۳,۹۳۱	(۵%)
سرب LME (دلار)	۱,۹۰۵	۱,۸۹۹	۰.۳%	۱,۹۴۴	(۲%)
انس پلاتین (دلار)	۱,۶۴۰	۱,۶۰۷	۲.۱%	۱,۸۰۶	(۹.۲%)

آمار معاملات گواهی‌های سپرده بورس کالا

شرح	آخرین	هفته گذشته	
		قیمت	تغییرات
گواهی سپرده شمش طلا	۳۵,۰۵۸,۲۶۰	۳۴,۶۴۸,۵۸۰	۱.۲%
گواهی سپرده سکه طلا	۲,۶۴۳,۵۲۷,۲۰۰	۲,۶۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۱%
گواهی سپرده نقره	۴,۹۳۵,۱۱۰	۵,۰۸۰,۷۰۰	(۲.۹%)
گواهی سپرده مس کاتد	۳۶,۴۵۷,۴۴۰	۳۶,۰۵۱,۰۶۰	۱.۱%
گواهی سپرده شمش روی	۸,۱۹۹,۵۴۰	۸,۳۹۹,۹۹۰	(۲.۴%)
گواهی سپرده شمش سرب	۴,۹۵۰,۰۱۰	۴,۹۷۹,۸۹۰	(۰.۶%)
گواهی سپرده میلگرد	۱,۱۱۳,۹۷۰	۱,۰۵۲,۴۰۰	۵.۹%
گواهی سپرده گندله سنگ آهن	۲۱۷,۹۰۰	۱۹۵,۰۰۰	۱۱.۷%
گواهی سپرده قیر	۱,۵۹۹,۹۹۰	۱,۴۵۸,۴۹۰	۹.۷%
گواهی سپرده وانت T۹	۱۱,۸۹۹,۹۸۰	۱۲,۳۰۲,۰۲۰	(۳.۳%)

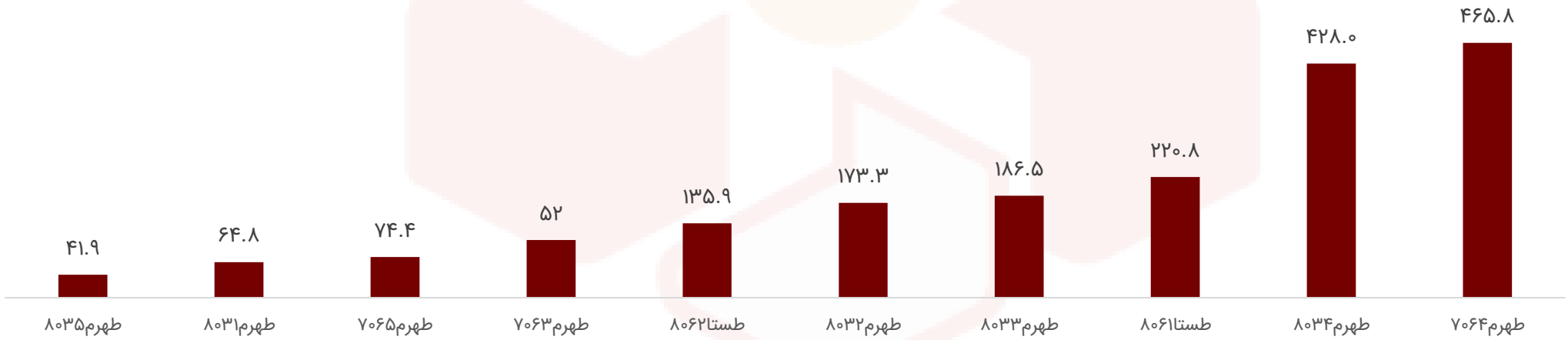
بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

ارزش معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



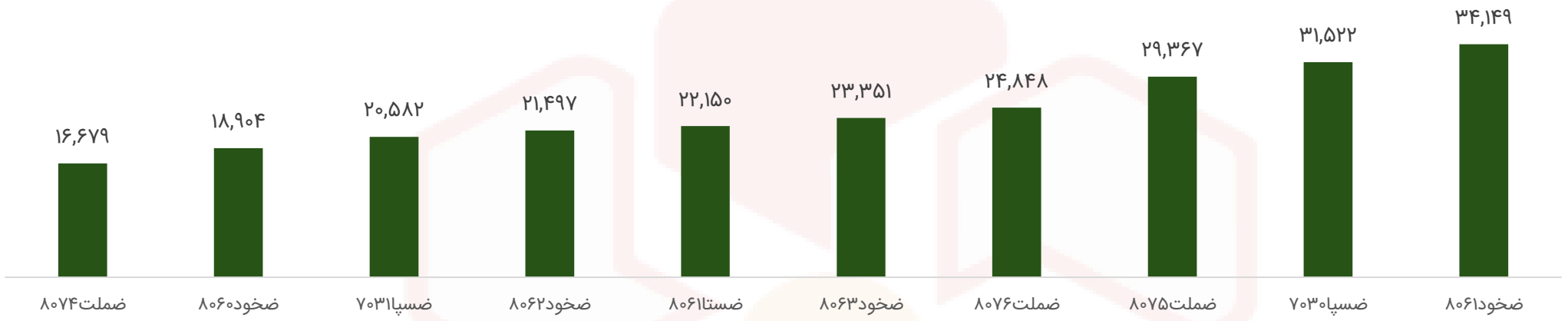
- میلیارد تومان -

ارزش معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



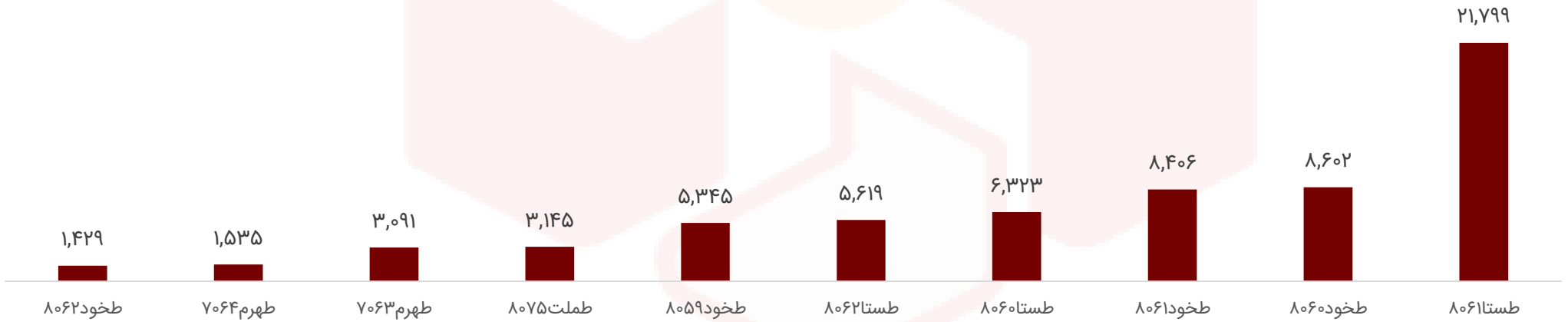
بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



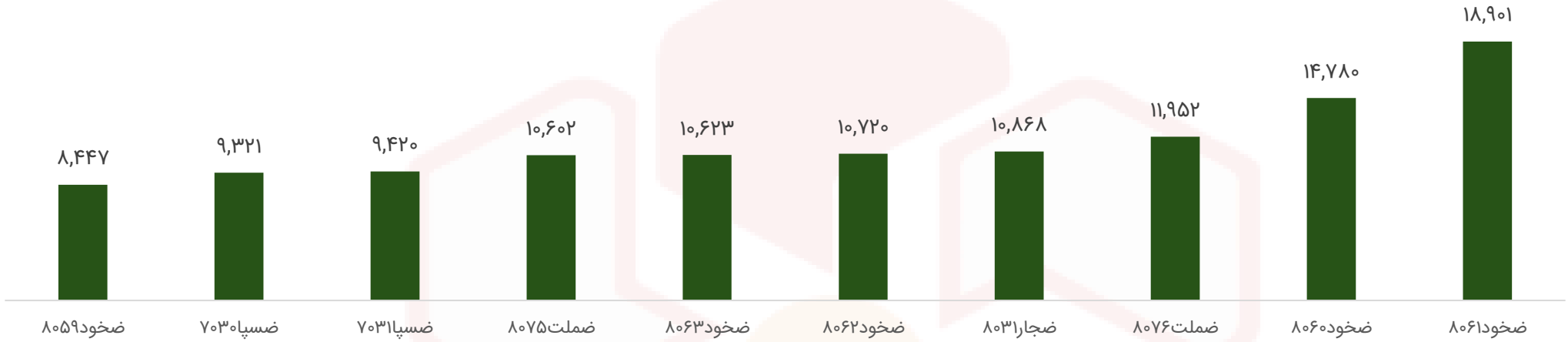
- هزار برگ سهم -

بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته

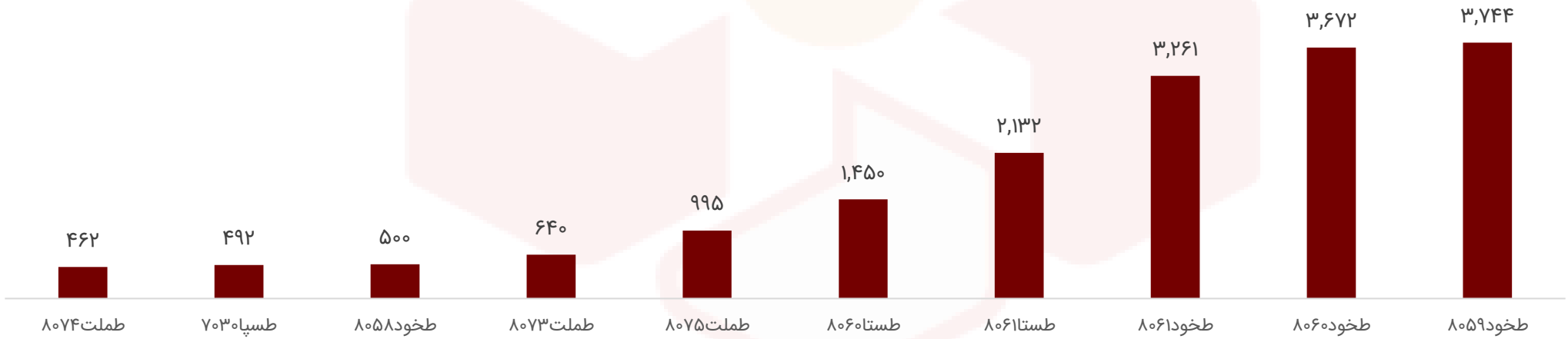


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار خرید در هفت روز گذشته

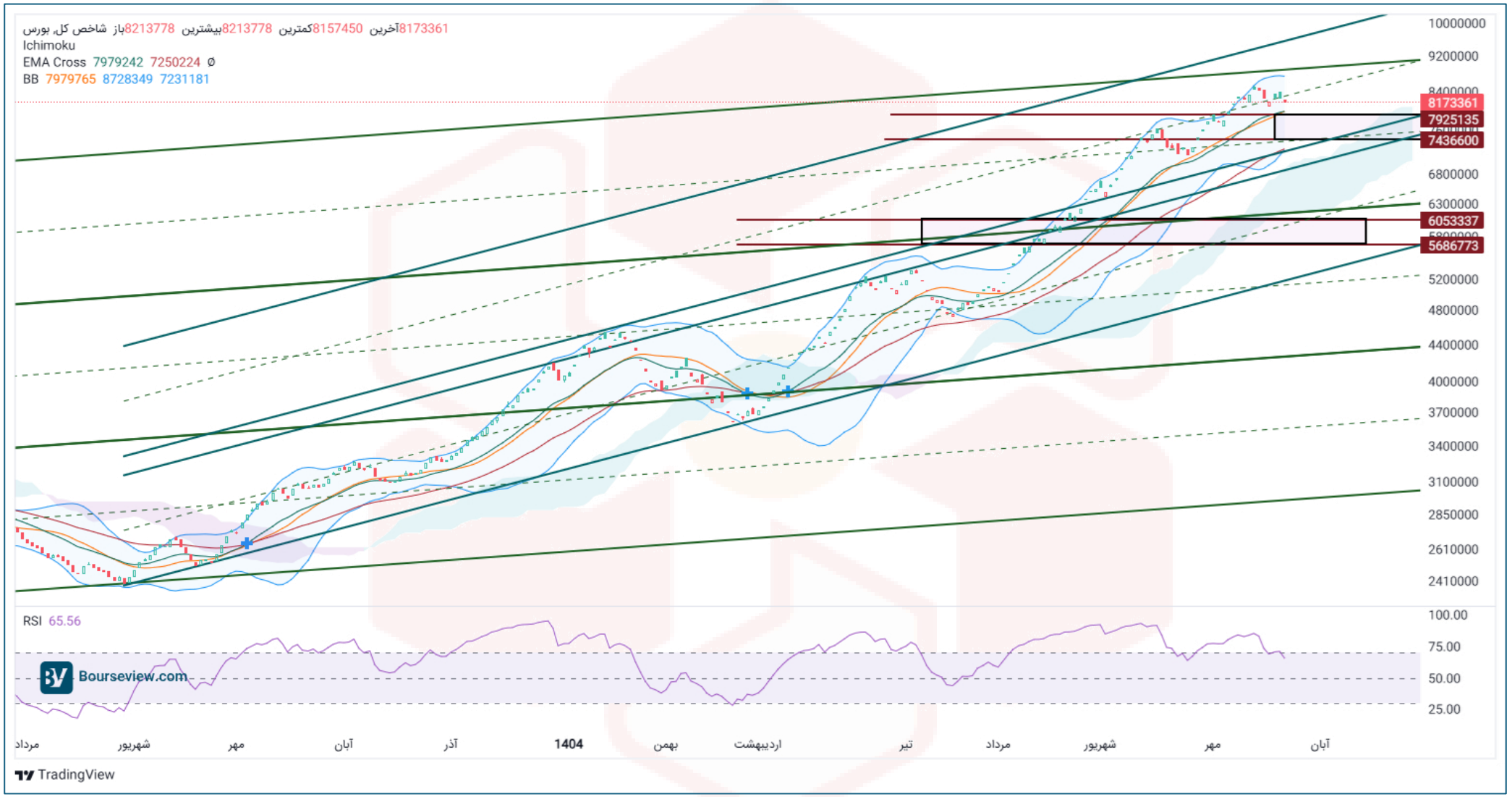


بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار موقعیت باز -

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege