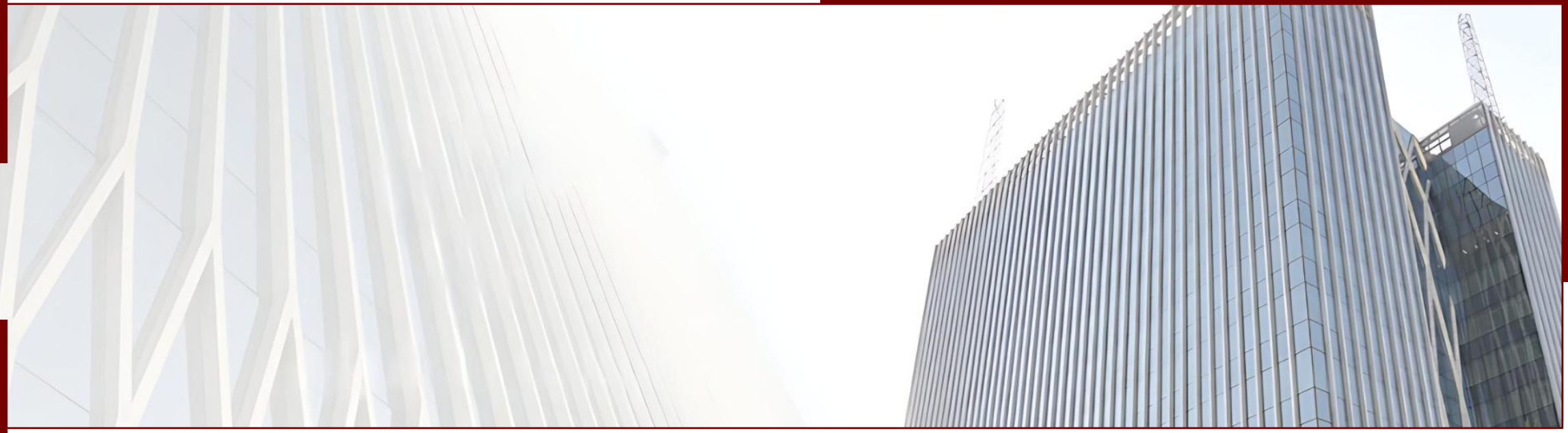


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۶ آبان 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



سفر هیئت امنیتی عربستان، پاکستان و ترکیه به تهران با محوریت کاهش تنش‌ها

معاون وزارت خارجه عربستان سفر هیئت سه‌جانبه عربستان، پاکستان و ترکیه به تهران را با هدف کاهش تنش‌ها، حمایت از راه‌حل‌های دیپلماتیک و تلاش‌های قطر و پاکستان و همچنین تأکید بر نقش محوری این کشورها در تأمین امنیت منطقه دانست؛ سفری که پیش‌تر معاون دبیر شورای عالی امنیت ملی ایران نیز آن را در راستای اجرای ایده امنیت درون‌زا و رایزنی مقامات ارشد این سه کشور (از جمله وزیر دفاع عربستان، فرمانده ارتش پاکستان و رئیس دستگاه اطلاعاتی ترکیه) با مقام‌های ایرانی از جمله رئیس‌جمهور و دبیر شورای عالی امنیت ملی ارزیابی کرده بود.



ادعای ترامپ: جنگ علیه ایران خیلی زود پایان خواهد یافت

ترامپ، رئیس‌جمهور آمریکا، در گردهمایی انتخاباتی جمهوری‌خواهان در تگزاس، در حالی که در جنگ با ایران گرفتار شده و راه خروج از آن را نمی‌داند، بار دیگر مدعی شد که این تجاوز هر زمان که او بخواهد «خیلی زود» و با پیروزی قاطع به پایان خواهد رسید؛ او با تکرار ادعاهای خود و مقایسه این وضعیت با ونزوئلا، تأکید کرد که این درگیری هر لحظه قابل‌ختم است، اما باید به‌گونه‌ای تمام شود که اطمینان حاصل گردد ایران هرگز به سلاح هسته‌ای دست نخواهد یافت.



مشارکت در انتخابات اسرائیل به ۷۷٫۷ درصد رسید

شبکه ۱۲ تلویزیون رژیم صهیونیستی از ثبت مشارکت بی‌سابقه ۷۷٫۷ درصدی در انتخابات سراسری این رژیم خبر داد که بالاترین نرخ مشارکت از سال ۱۹۹۹ میلادی به شمار می‌رود؛ رویدادی که با حضور چشمگیر ۸۰ درصدی رأی‌دهندگان عرب و دستاورد تاریخی ائتلاف احزاب عربی همراه شد تا جایی که رهبران عرب تأکید کردند که هیچ کابینه‌ای بدون آن‌ها شکل نخواهد گرفت.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



عرضه اولیه ۵ درصد سهام پتروشیمی تبریز چهارشنبه ۶ آبان

چهارشنبه ۶ آبان‌ماه، ۵ درصد از سهام شرکت پتروشیمی تبریز به عنوان بیست و هفتمین سهم جدید وارد بازار شده و طی آن ۲۴۹ میلیون و ۱۰۰ هزار سهم با دامنه قیمت ۵۷,۶۴۲ تا ۶۵,۰۰۰ ریالی هر سهم و به روش ثبت سفارش به عموم مردم واگذار می شود. بر اساس این گزارش، سهمیه هر سهامدار حقیقی و حقوقی برای خرید "شتبریز" ۸۰۰سهم بوده که احتمال کاهش این سهمیه وجود دارد. بنابراین در حالت اولیه، حداکثر نقدینگی مورد نیاز حدود ۵.۲ میلیون تومان خواهد بود.



ثبت ارزش معاملات ۴۹۴ هزار میلیارد تومانی در بورس کالا طی مهر ۱۴۰۵

بازار فیزیکی بورس کالای ایران در مهر ۱۴۰۵ با ثبت ارزش معاملات ۴۹۴ هزار میلیارد تومانی و حجم قرارداد بیش از ۱۰/۵ میلیون تن در سه رینگ محصولات صنعتی، پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی همراه بود که در این میان، رینگ صنعتی با حدود ۲۹۵ هزار میلیارد تومان ارزش و نزدیک به ۹ میلیون تن حجم (پیشتازی سیمان با بیش از ۵/۳ میلیون تن) سهم عمده‌ای را به خود اختصاص داد و در رینگ‌های پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی نیز به ترتیب پلی‌اتیلن با بیش از ۴۸ هزار میلیارد تومان (با پیشتازی حجمی کود و مواد شیمیایی پایه) و مواد سنگین پالایشی با ۴۳ هزار میلیارد تومان بیش‌ترین ارزش معاملات را ثبت کردند.



رشد معاملات برق سبز و رونق بازارهای بورس انرژی در مهر ۱۴۰۵

عملکرد بورس انرژی ایران در مهر ۱۴۰۵ با رویدادهایی چون آغاز معاملات ثانویه صندوق سرمایه‌گذاری پروژه «پایدار انرژی هورسان» و تأمین مالی ۱۱۰ هزار میلیارد ریالی شرکت‌های انرژی از طریق اوراق سلف همراه بود؛ در این مدت، ارزش معاملات در بازار فیزیکی داخلی و بین‌المللی نفت، گاز و حامل‌های انرژی به ترتیب به ۳۷۵ هزار و ۹۶۶ میلیارد ریال و ۴۸۲ هزار و ۴۴۶ میلیارد ریال رسید، بخش برق سبز شاهد جهش چشمگیر حجم و ارزش معاملات فیزیکی (رشد ۲۳۷ درصدی حجم و ۴۹۳ درصدی ارزش) بود، در حالی که معاملات برق عادی کاهشی گزارش شد، و در بازار ابزارهای مالی نیز ارزش معاملات صندوق‌های سرمایه‌گذاری با رشد ۲۰ درصدی به ۲۰۹ هزار و ۲۳ میلیارد ریال بالغ گشت و گواهی‌های سپرده حامل‌های انرژی و صرفه‌جویی نیز رشد مناسبی را ثبت کردند.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

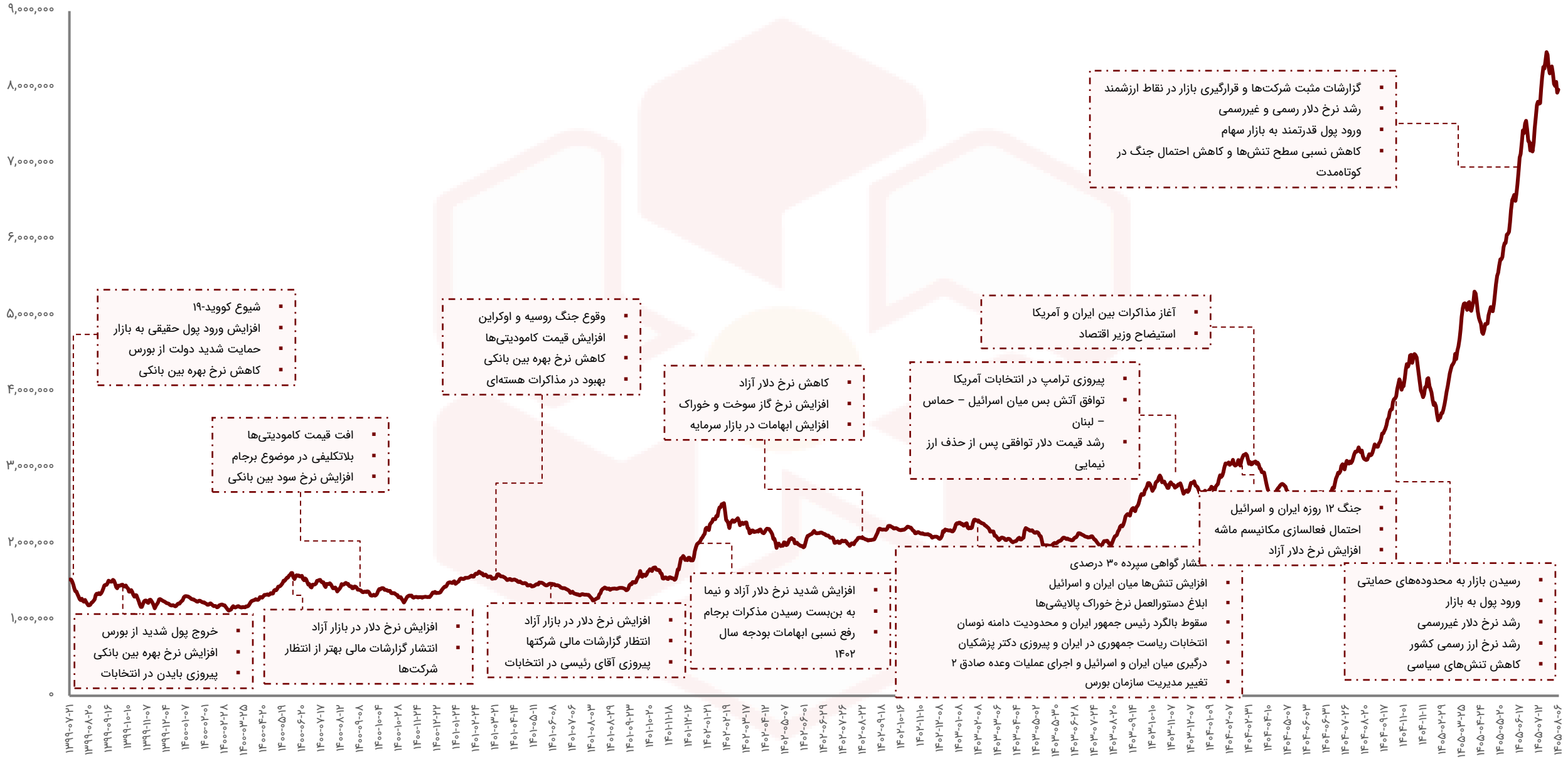
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

بازار سهام در این هفته، تمایل بیشتری به اصلاح از خود نشان داد و در ادامه روند نزولی هفته گذشته، با افت ۲/۵ درصدی، شاخص کل معاملات هفتگی را در سطح ۷,۹۶۷,۵۴۰ واحد به پایان رساند. در روز شنبه، بازار سهام تحت‌تأثیر فضای جنگی حاکم بر رسانه‌های مجازی در شب قبل، افزایش قیمت نفت و افت بازارهای جهانی سهام، طلا و کامودیتی‌ها، با فشار شدید عرضه مواجه شد و خروج بیش از ۸ همت نقدینگی را ثبت کرد. این وضعیت در حالی رقم خورد که گزارش‌های میان‌دوره‌ای شرکت‌ها برای فصل تابستان منتشر شده و نسبت قیمت به سود گذشته‌نگر بازار به محدوده ۷/۴ واحد رسیده بود. فشار عرضه در سایر روزهای هفته نیز ادامه یافت و فروشندگان تا روز چهارشنبه، با وجود حمایت‌های صندوق تثبیت بازار، همچنان دست برتر را در معاملات داشتند. بااین‌حال، برخی گروه‌ها، ازجمله دارویی‌ها، لاستیکی‌ها و تعدادی از نمادهای سیمانی و زنجیره فولاد، عملکرد معاملاتی بهتری از خود نشان دادند. در روز چهارشنبه، همزمان با رسیدن شاخص کل به محدوده‌های حمایتی و انتشار گزارشات ماهانه شرکتها، وضعیت بازار بهبود یافت و خریداران بار دیگر در معاملات حضور پررنگ‌تری پیدا کردند؛ به‌طوری‌که پس از حدود ۱۰ روز، قدرت خرید حقیقی در بازار مثبت شد. در بازارهای موازی نیز دلار آمریکا در اواسط هفته تا محدوده ۲۷۴ هزار تومان افزایش یافت، اما تا ظهر روز چهارشنبه، به حوالی ۲۶۹ هزارتومان رسید. همچنین، هر گرم طلای ۱۸ عیار، تحت‌تأثیر افت قیمت جهانی اونس طلا در پایان هفته گذشته، به سطح ۲۶ میلیون و ۴۸۰ هزار تومان کاهش یافت.

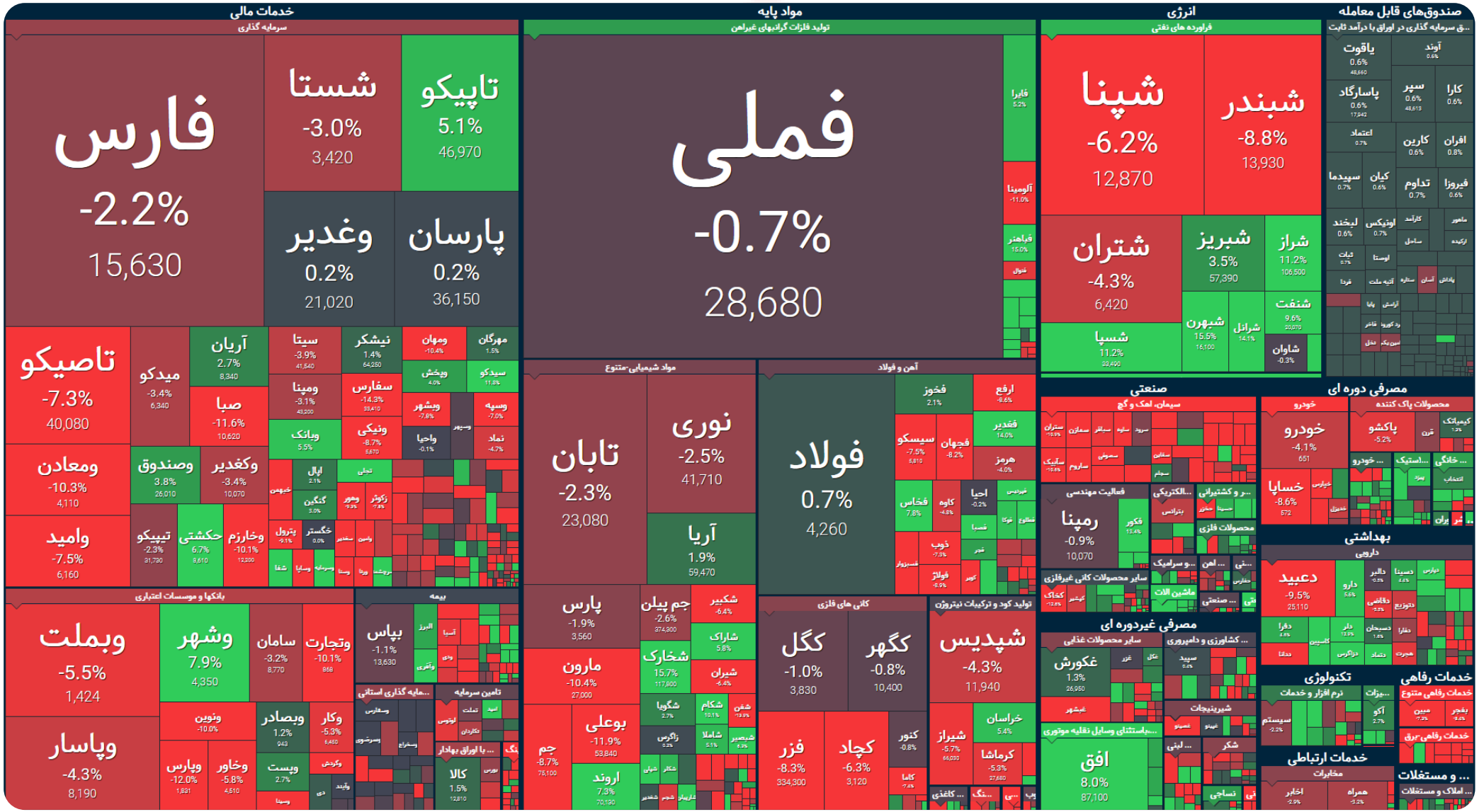
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۸,۱۷۳,۷۶۷	۷,۹۶۷,۵۴۰	(۲۰۶,۲۲۷)	(%۲.۵)
شاخص هم وزن (واحد)	۲,۲۵۵,۶۵۰	۲,۲۰۹,۷۴۴	(۴۵,۹۰۶)	(%۲)
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۱۷۱,۲۳۲		(۶,۳۹۲)	(%۳.۶)
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۱۰,۵۳۳)		-	-

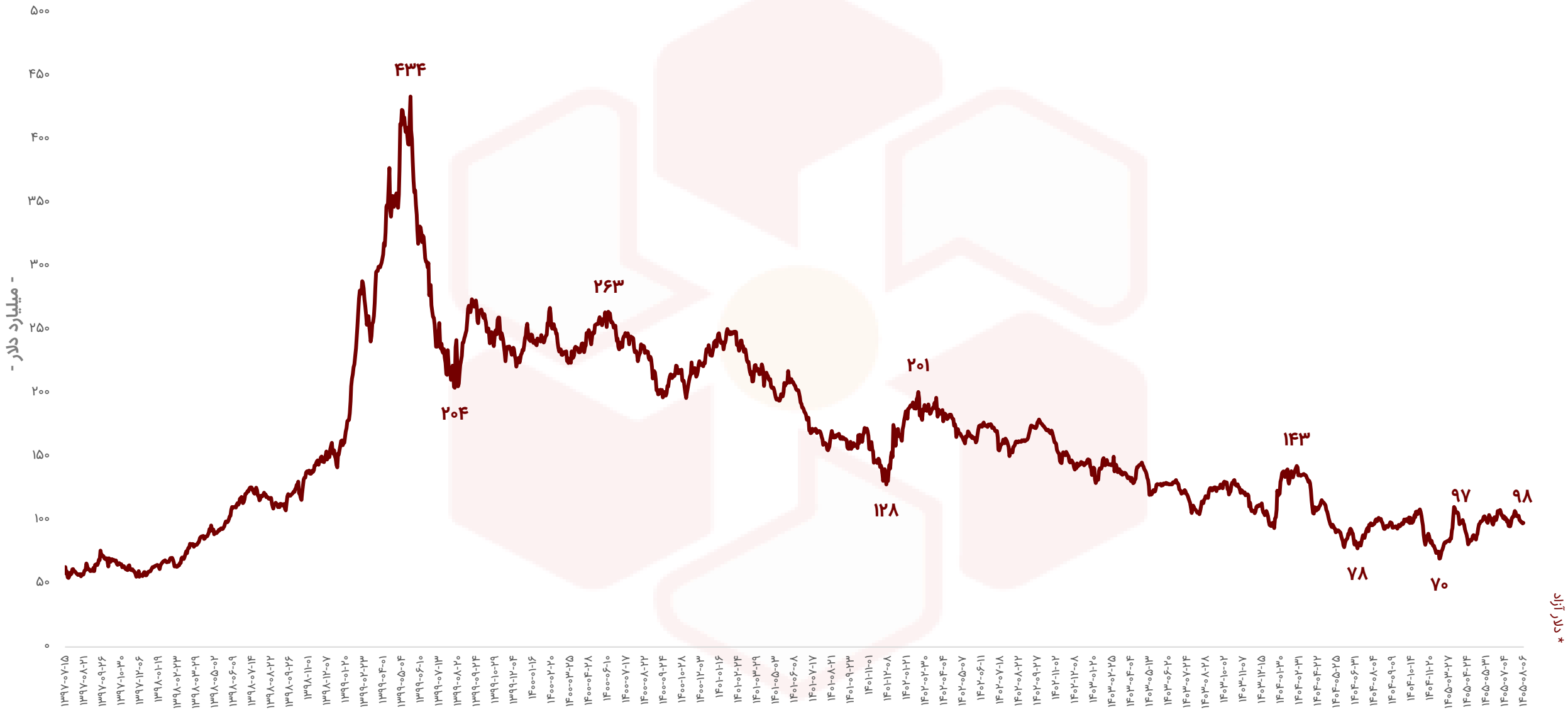
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



نقشه بازار سهام در هفته گذشته

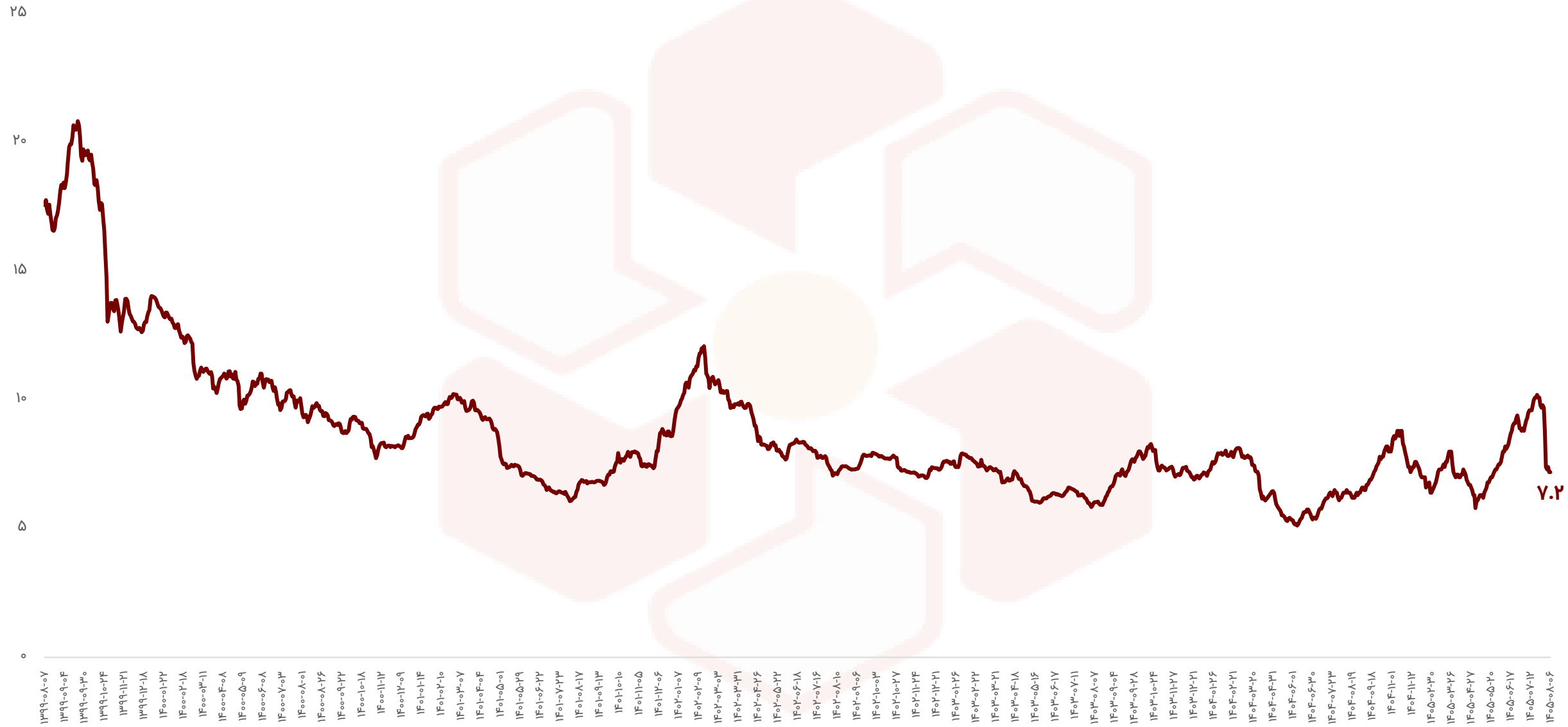


ارزش دلاری بازار*



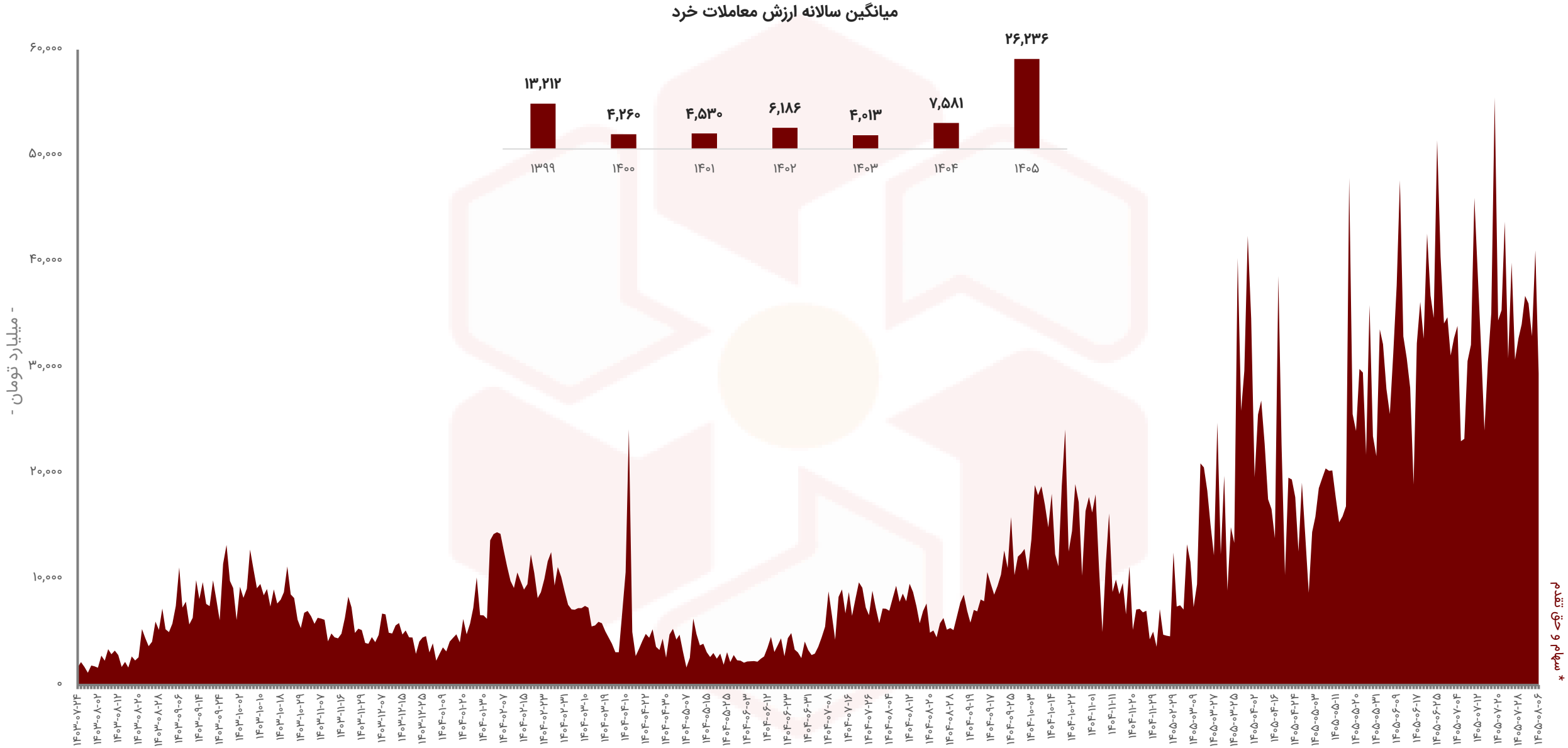
* دلار آزاد

نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)

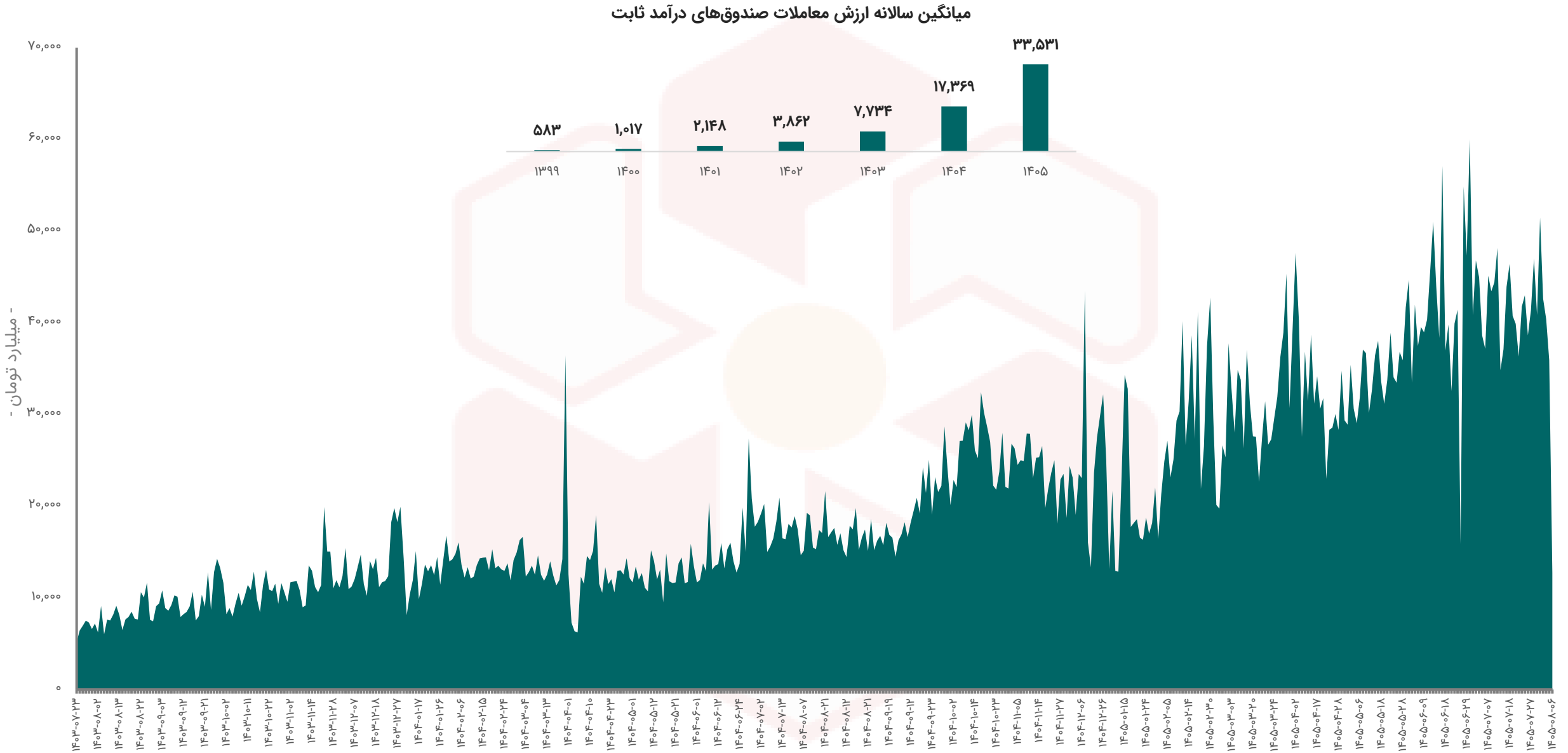


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

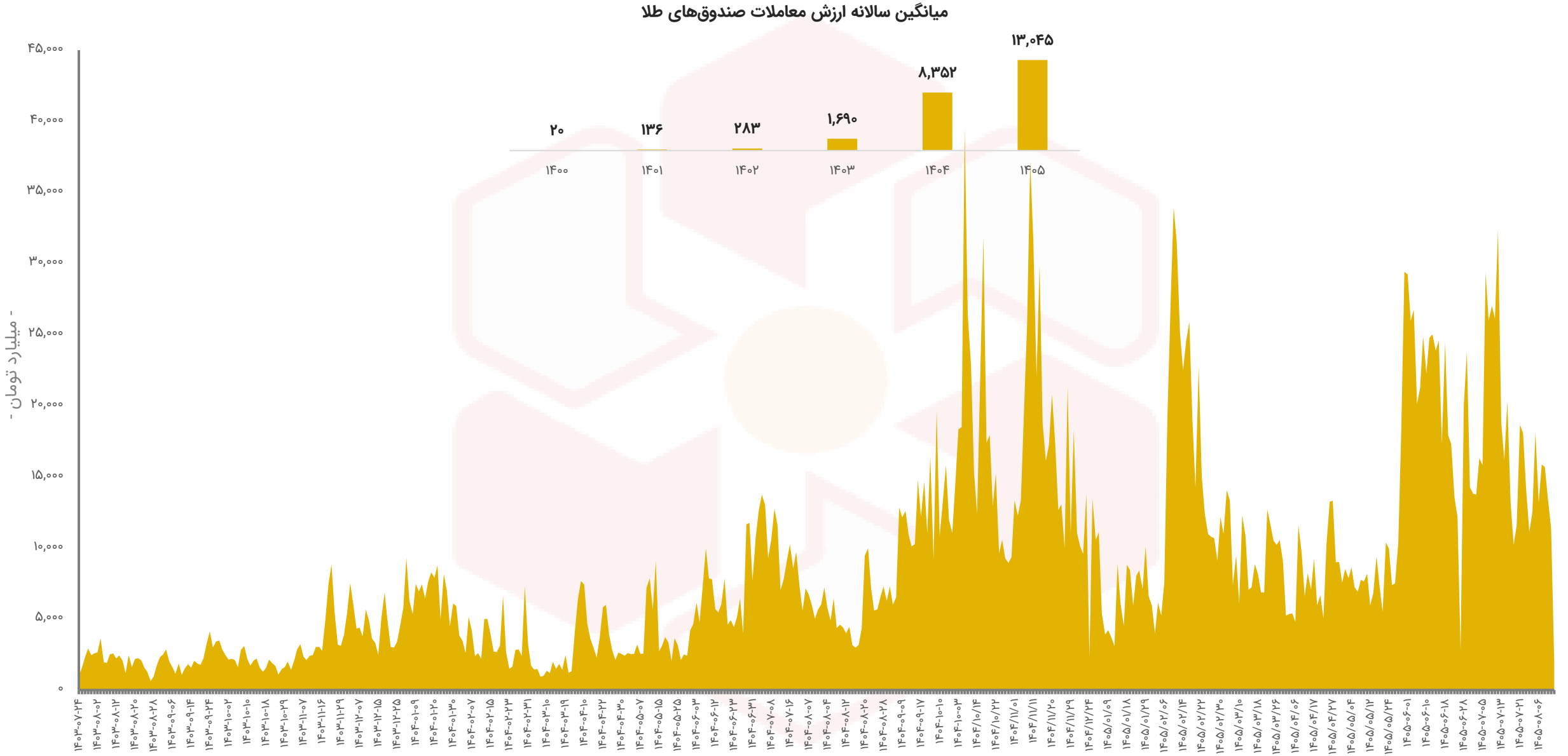
ارزش معاملات خرد سهام*



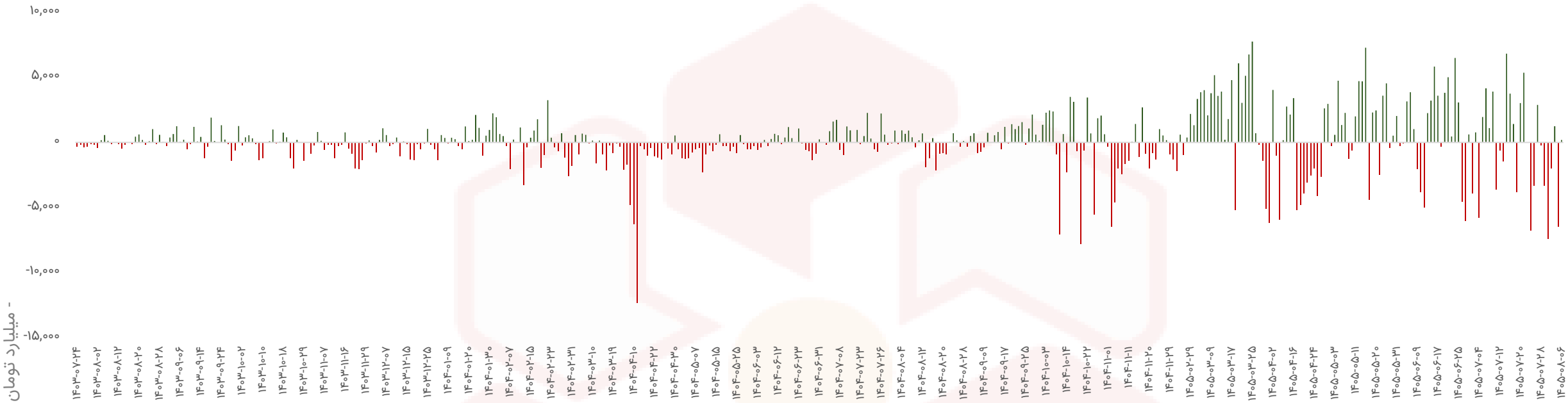
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



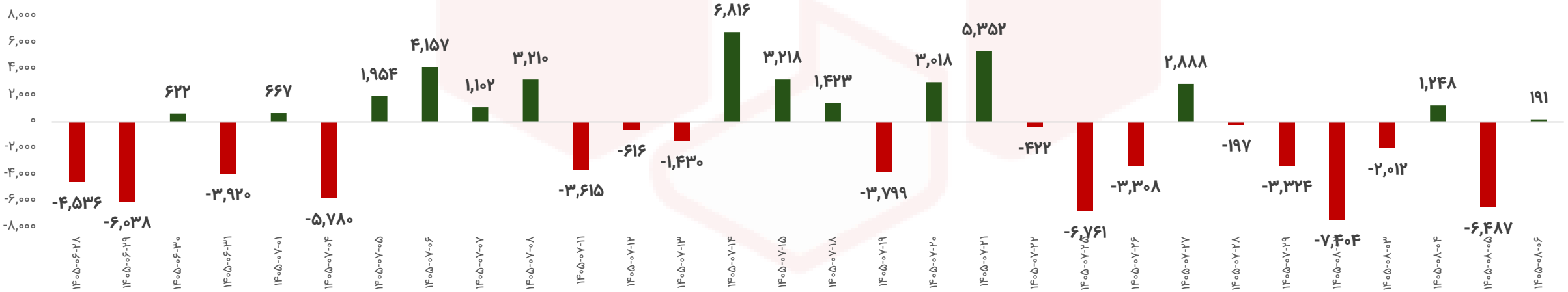
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



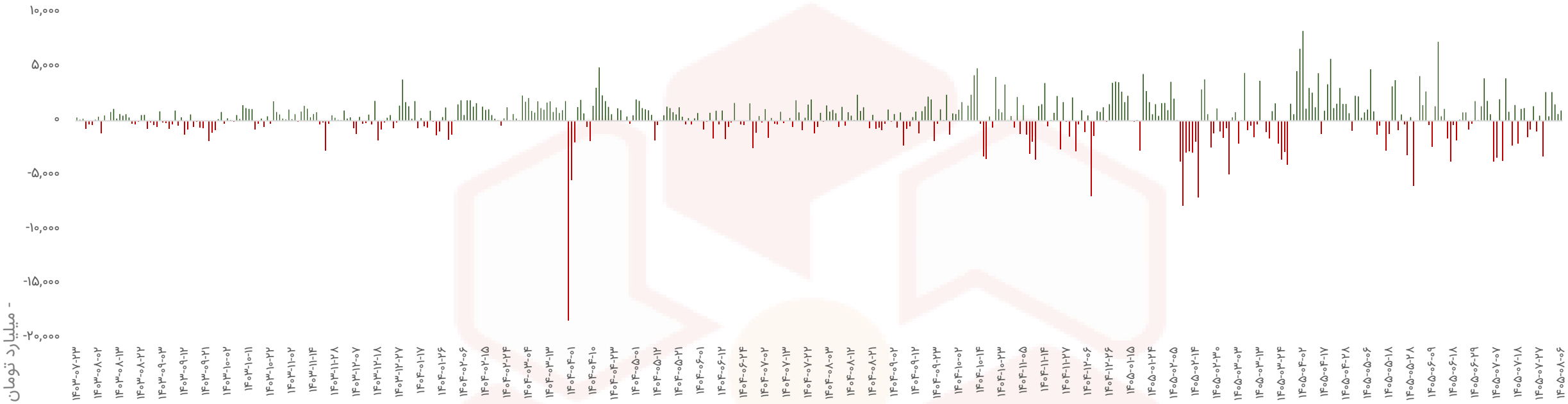
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



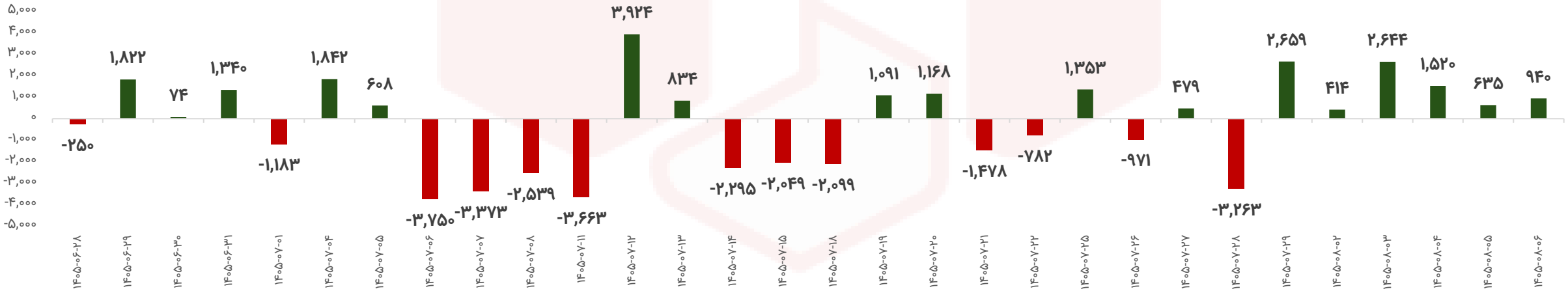
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



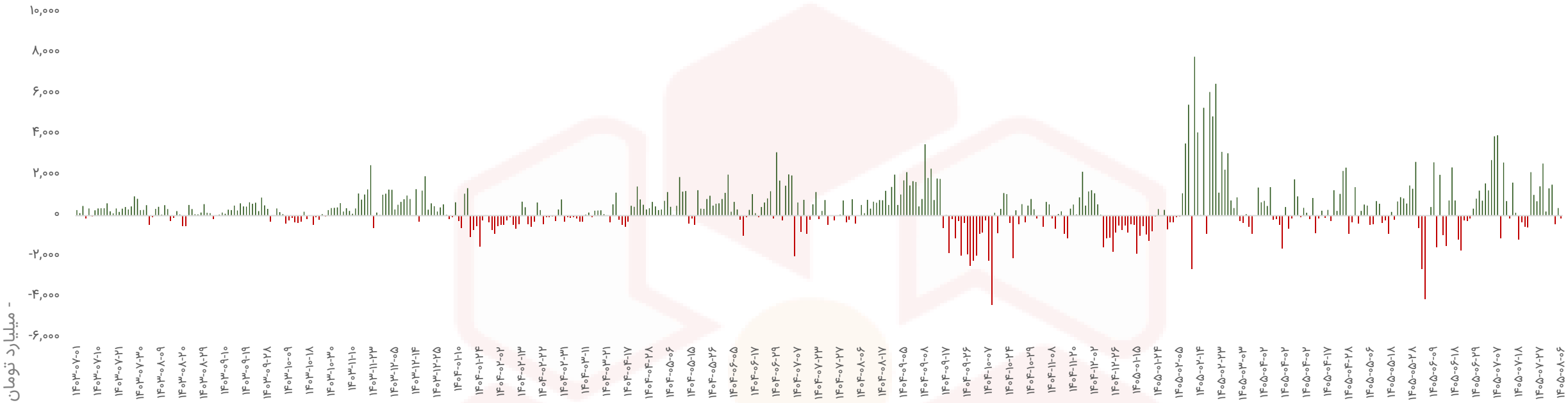
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



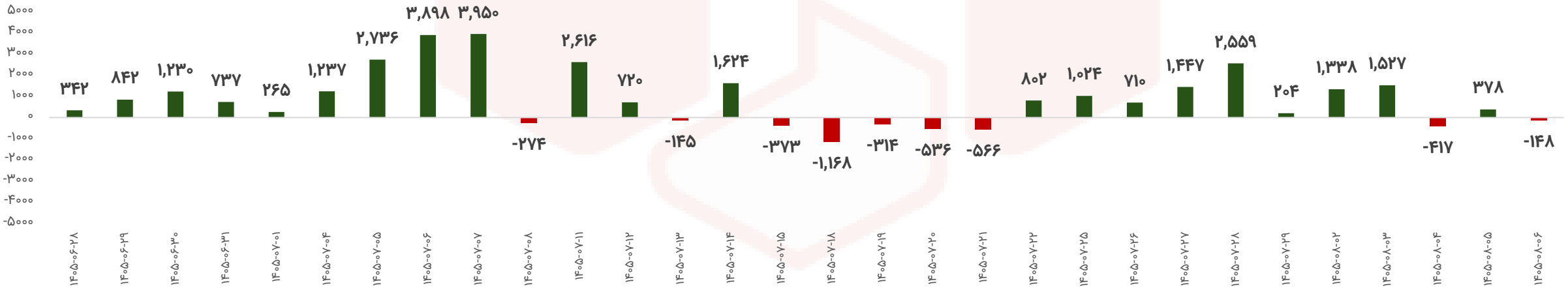
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



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



خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

ترین‌های بازار در هفته اخیر

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	دارو ابوریحان	دابور	%۱۵.۹
۲	سیم و کابل تبریز	سیمکات	%۱۵.۹
۳	لوازم خانگی پارس	لخانه	%۱۵.۸
۴	چرخشگر	خچرخش	%۱۵.۸
۵	گاز لوله	پلوله	%۱۵.۷

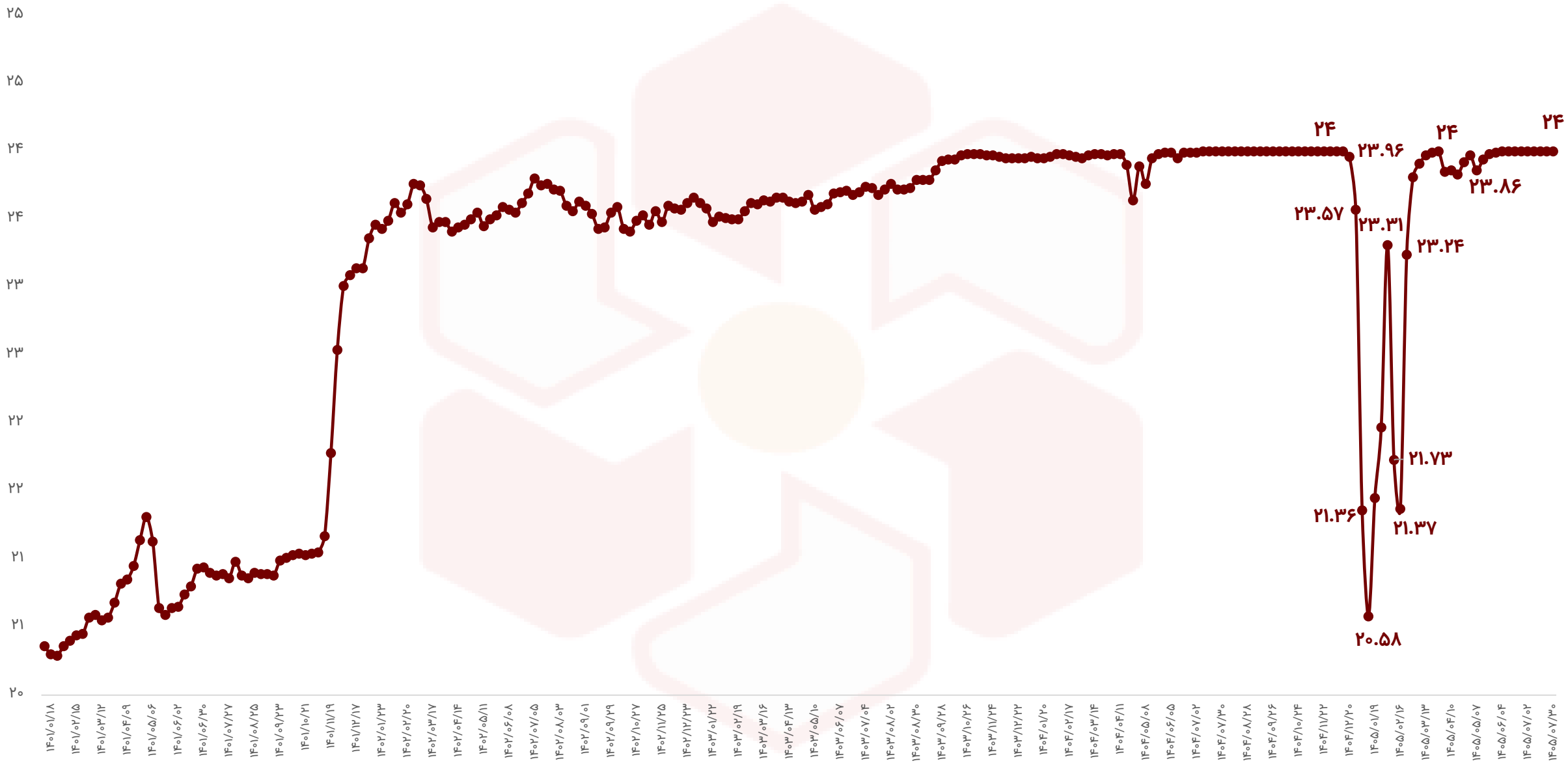
نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	سیمان فارس نو	سفانو	(%۱۴.۱)
۲	واسپاری ملت	ولملت	(%۱۴.۱)
۳	آ.س.پ	آ س پ	(%۱۴.۱)
۴	دوده صنعتی پارس	شدوص	(%۱۴.۱)
۵	لیزینگ رایان سایپا	ولساپا	(%۱۴)

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/E
وگردش	۱,۶۰۱	۱.۵
حآفرین	۳,۴۶۰	۱.۶
حفاری	۶,۰۲۰	۱.۸
پارسیان	۱,۷۶۵	۲
وبصادر	۹۳۰	۲
آسیا	۴,۶۸۰	۲
شصفها	۳,۳۲۰	۲.۱
وپارس	۱,۸۳۴	۲.۳
وبملت	۱,۴۰۷	۲.۳
ومعلم	۴,۳۱۰	۲.۴

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۵۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۲-۲۵	۹۲۹	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۸۸,۹۹۰	۴۳.۹۷%
اخزا۵۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۳-۰۸	۹۴۳	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۸۳,۰۰۰	۴۳.۹۷%
اخزا۴۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۰-۱۹	۸۰۳	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۳,۰۲۰	۴۳.۹۰%
اخزا۴۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۱-۱۰	۸۲۴	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۳۹,۹۸۰	۴۳.۸۶%
اخزا۵۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۵-۰۹	۱۰۰۶	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۵۶,۰۱۰	۴۳.۱۲%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۷۴۰	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۸۲,۱۴۰	۴۳.۰۲%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۶۷۷	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۱۰,۰۰۰	۴۲.۵۷%
اخزا۴۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۴-۲۰	۶۲۱	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۵۳,۰۰۰	۴۱.۵۰%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۷۱۲	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۱۱,۰۰۰	۴۰.۹۴%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۴۷	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۵۵,۰۵۰	۴۰.۶۸%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۳۱۳	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۴۲,۰۳۰	۴۰.۴۱%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۱۲	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۸۹,۰۰۰	۴۰.۰۰%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۴۰	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۱,۳۸۰	۳۸.۵۵%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۷۵	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۳۰,۰۰۰	۳۷.۶۱%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۹۶	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۱,۲۸۰	۳۷.۲۵%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۷۵	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۳۴,۰۰۰	۳۵.۱۴%

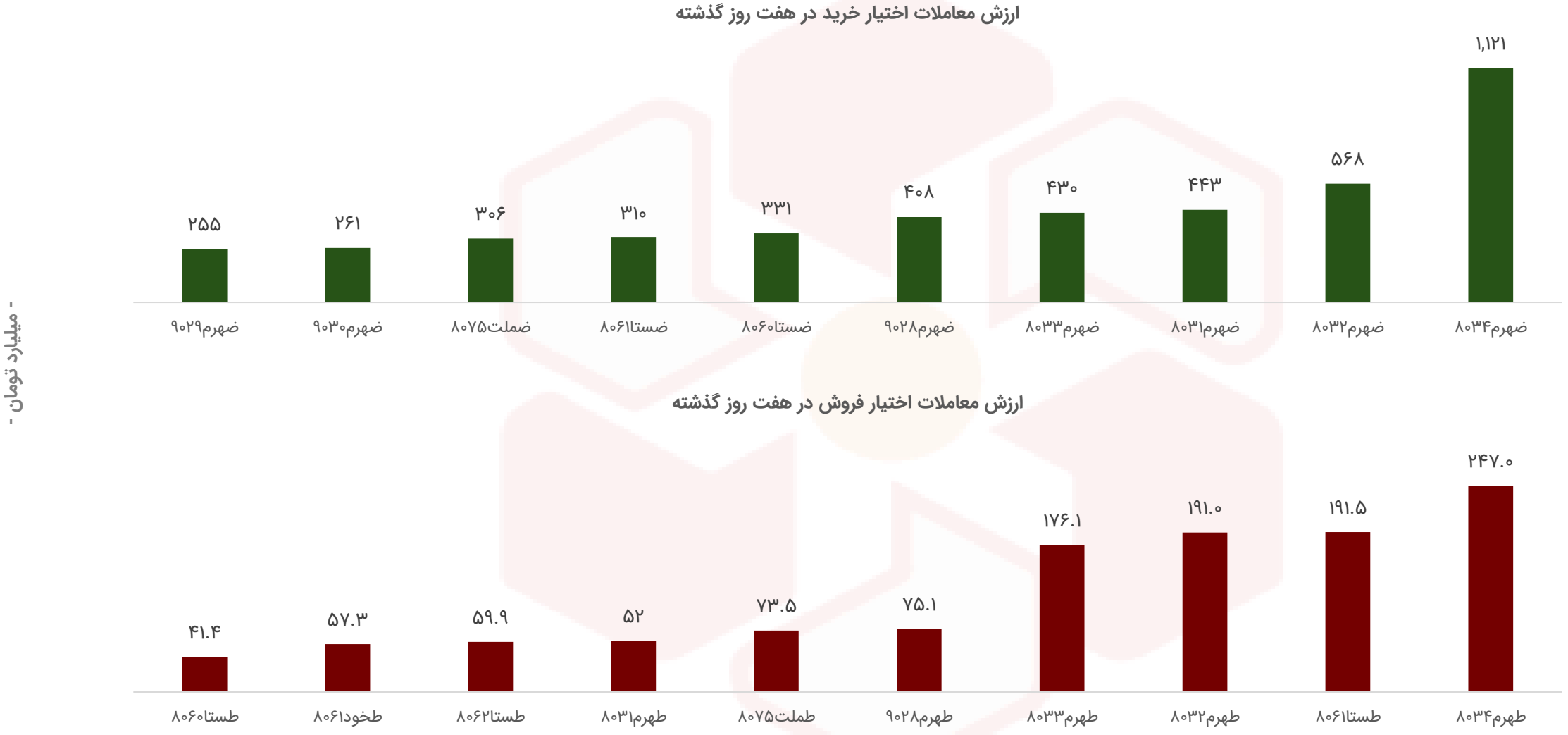
وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۰۴۹	۴,۱۳۳	(۲%)	۴,۱۱۹	(۱.۷%)
نقره (دلار/انس)	۵۳.۸	۵۷.۸	(۶.۹%)	۶۰.۷	(۱۱.۴%)
سکه امامی (تومان)	۲۶۷,۶۹۰,۰۰۰	۲۷۱,۴۲۵,۰۰۰	(۱.۴%)	۲۴۶,۹۸۵,۰۰۰	۸.۴%
دلار آزاد (تومان)	۲۶۹,۶۹۵	۲۶۹,۴۰۰	۰.۱%	۲۴۴,۸۰۰	۱۰.۲%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۱۱۵.۱	۱۰۹.۶	۵%	۱۰۵.۹	۸.۷%
بیت کوین (دلار)	۸۰,۹۸۸	۸۴,۵۶۴	(۴.۲%)	۸۳,۵۵۲	(۳.۱%)
اتریم (دلار)	۲,۳۵۴	۲,۴۹۳	(۵.۶%)	۲,۶۸۲	(۱۲.۲%)
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۱۱۰	۳,۰۳۸	۲.۴%	۳,۲۵۱	(۴.۳%)
مس LME (دلار)	۱۴,۴۶۷	۱۴,۳۵۴	۰.۸%	۱۴,۴۵۳	۰.۱%
روی LME (دلار)	۳,۸۵۴	۳,۷۵۰	۲.۸%	۳,۸۶۱	(۰.۲%)
سرب LME (دلار)	۱,۹۳۴	۱,۹۱۰	۱.۳%	۱,۹۱۱	۱.۲%
انس پلاتین (دلار)	۱,۵۳۵	۱,۶۳۴	(۶.۱%)	۱,۷۱۶	(۱۰.۵%)

آمار معاملات گواهی‌های سپرده بورس کالا

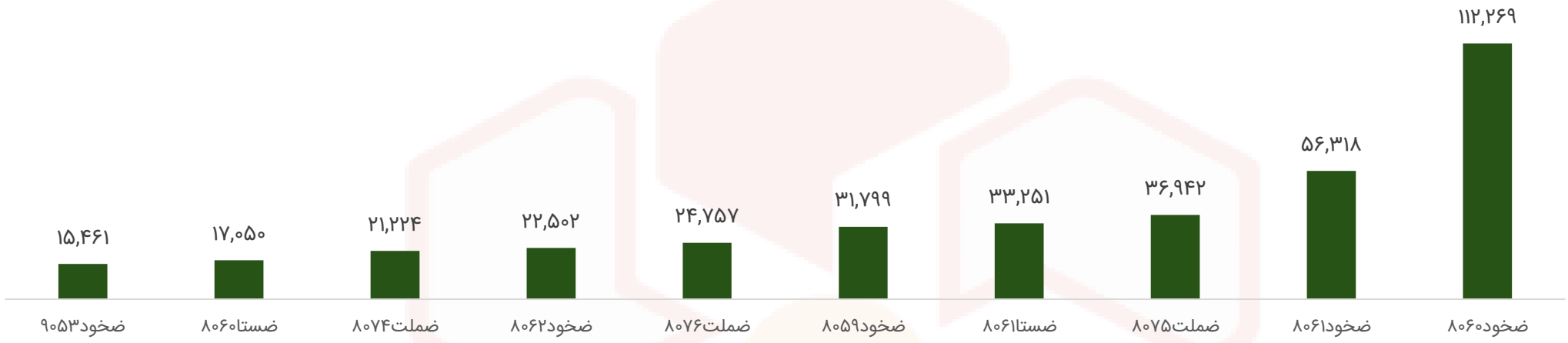
شرح	آخرین	هفته گذشته	
		قیمت	تغییرات
گواهی سپرده شمش طلا	۳۴,۶۸۱,۹۹۰	۳۵,۲۱۰,۰۰۰	(۱.۵%)
گواهی سپرده سکه طلا	۲,۶۴۸,۰۰۰,۰۰۰	۲,۶۶۸,۰۲۳,۰۰۰	(۰.۸%)
گواهی سپرده نقره	۴,۹۰۴,۰۰۰	۴,۹۵۹,۰۰۰	(۱.۱%)
گواهی سپرده مس کاتد	۳۵,۵۵۰,۰۰۰	۳۶,۲۹۸,۶۷۰	(۲.۱%)
گواهی سپرده شمش روی	۸,۱۴۸,۶۸۰	۸,۱۹۰,۰۰۰	(۰.۵%)
گواهی سپرده شمش سرب	۴,۸۳۰,۳۳۰	۴,۹۷۱,۰۱۰	(۲.۸%)
گواهی سپرده میلگرد	۱,۱۲۰,۰۳۰	۱,۱۲۹,۹۵۰	(۰.۹%)
گواهی سپرده گندله سنگ آهن	۲۳۳,۹۶۰	۲۱۸,۰۰۰	۷.۳%
گواهی سپرده قیر	۱,۴۵۰,۹۷۰	۱,۵۹۹,۷۰۰	(۹.۳%)
گواهی سپرده وانت T۹	۱۱,۵۲۰,۰۱۰	۱۱,۵۰۰,۰۰۰	۰.۲%

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

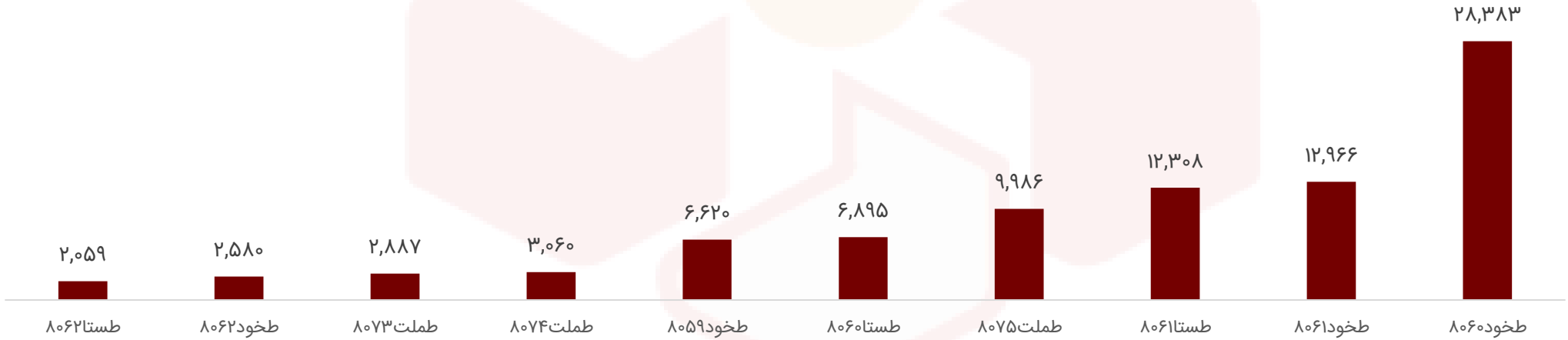


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته

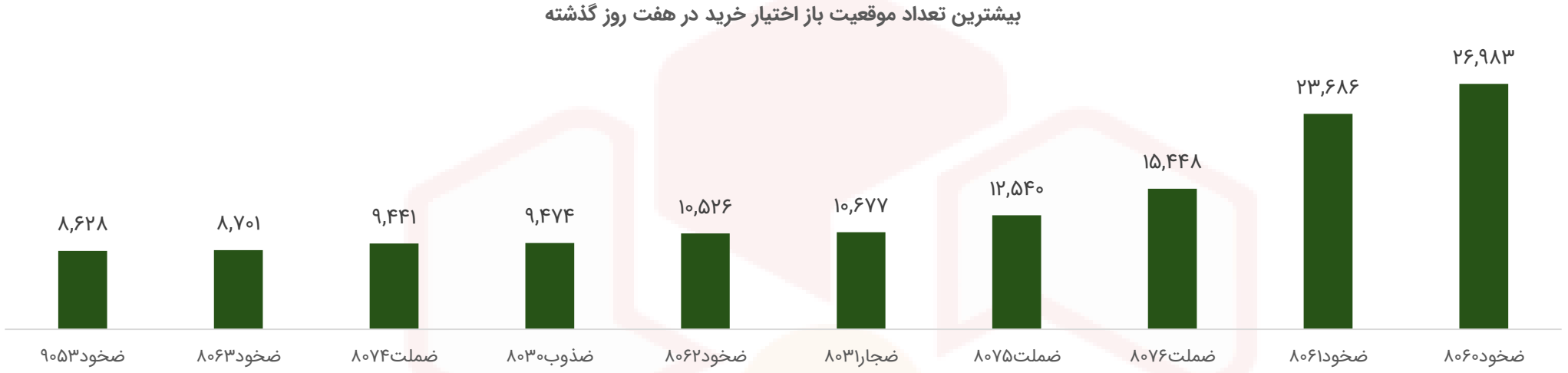


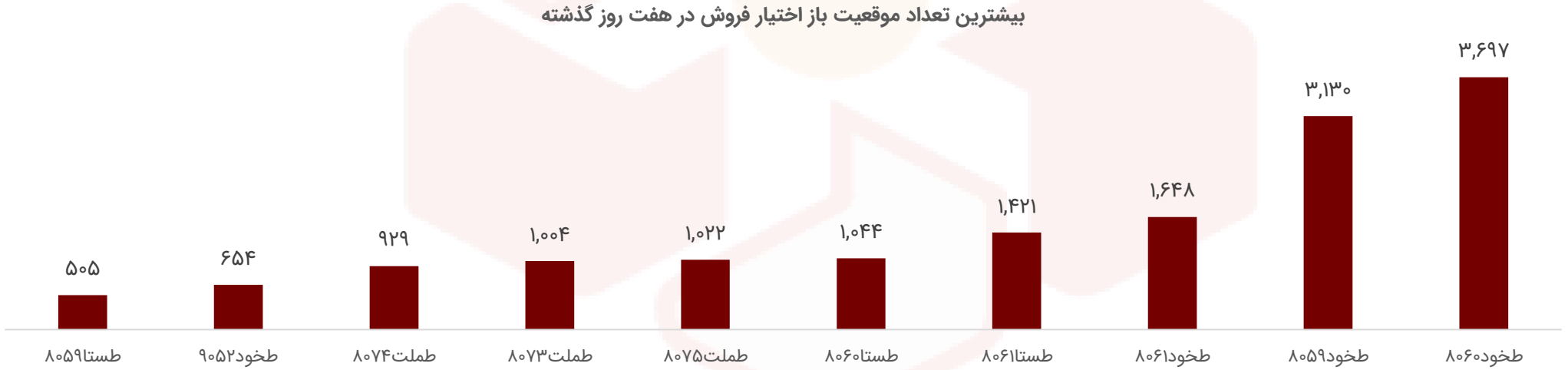
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



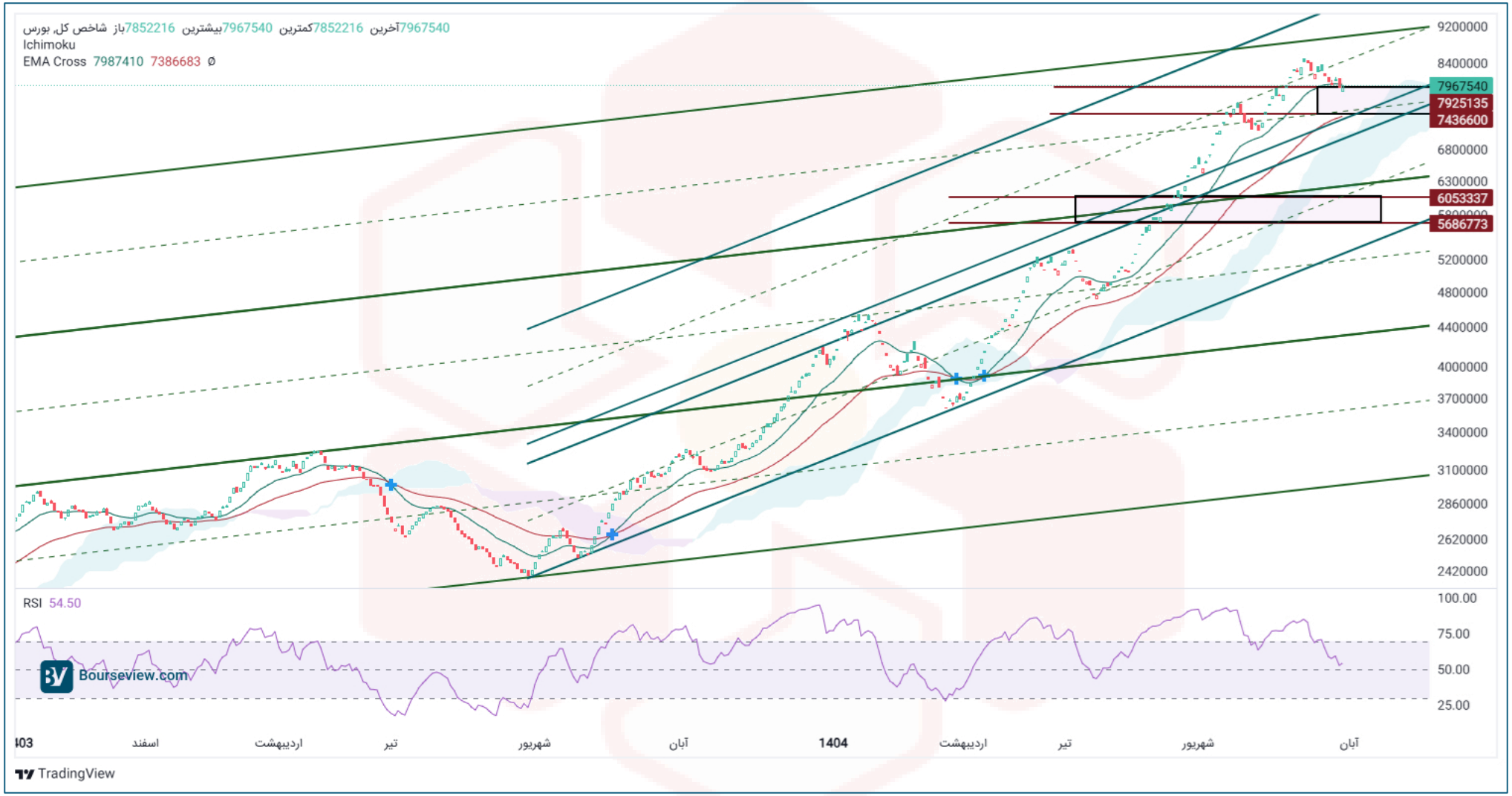
- هزار برگ سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه





بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege