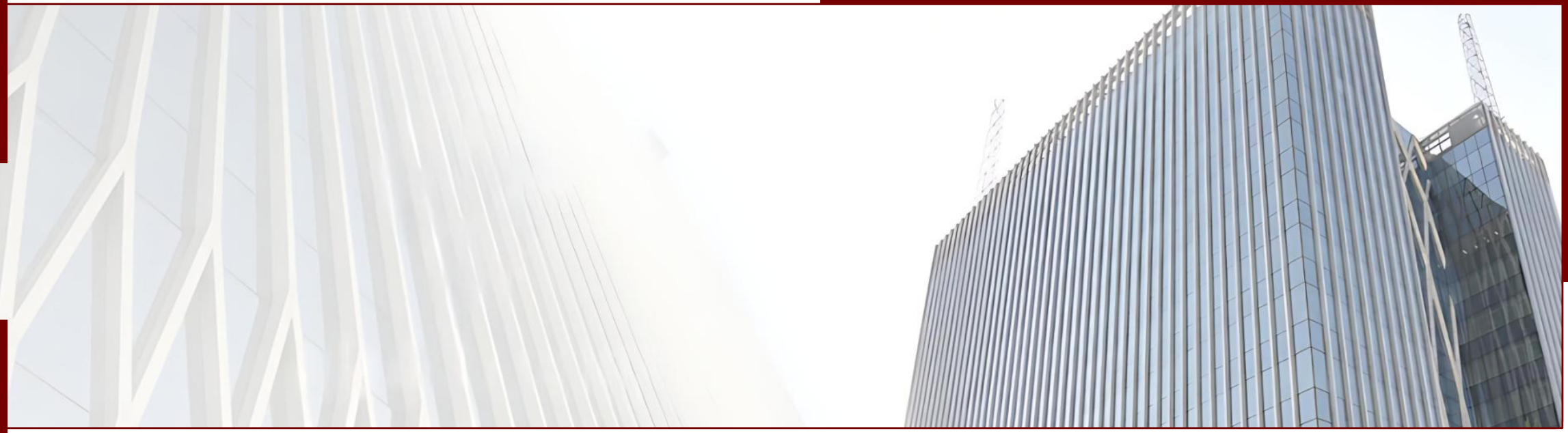


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۱۳ 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



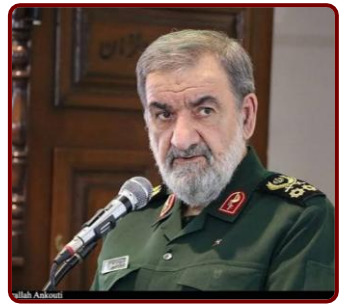
پیشتازی دموکرات‌ها در نتایج اولیه انتخابات میان‌دوره‌ای کنگره آمریکا

همزمان با پایان رأی‌گیری و شروع شمارش آرای انتخابات میان‌دوره‌ای کنگره آمریکا، نتایج اولیه نشانگر پیشتازی چشمگیر دموکرات‌ها در هر دو مجلس است؛ به‌طوری‌که سی‌ان‌ان از بازپس‌گیری اکثریت مجلس نمایندگان خبر داده و نیویورک‌تایمز احتمال کنترل کامل کنگره توسط حزب رقیب را بیش از ۹۵ درصد ارزیابی کرده است. با وجود تفاوت قوانین و سرعت شمارش در ایالت‌های مختلف که تعیین تکلیف نهایی مناطق رقابتی را زمان‌بر می‌سازد، بسته شدن زنجیره‌ای حوزه‌های رأی‌گیری در سراسر کشور، روند رو به رشد دموکرات‌ها و تحولات سرنوشت‌ساز این دوره را کلید زده است.



انهدام ۴ نفتکش متخلف و سرنگونی پنجاه‌وششمین پهپاد MQ۹ در تنگه هرمز

سپاه پاسداران از انهدام چهار نفتکش متخلف بر اثر برخورد با مین دریایی در جنوب تنگهٔ هرمز، توقف دو شناور دیگر و همچنین سرنگونی پنجاه‌وششمین پهپادMQ۹ آمریکا بر فراز این منطقه خبر داد و تأکید کرد که نیروهای مسلح برای وارد کردن ضربهٔ نهایی به رژیم صهیونیستی و آمریکا در آماده‌باش کامل به سر می‌برند.



شرط ایران برای بازگشایی تنگهٔ هرمز: پذیرش کامل ۷ شرط توسط آمریکا

دبیر شورای‌عالی امنیت ملی با اشاره به دریافت پاسخ‌های آمریکا به مطالبات ایران اعلام کرد که این پاسخ‌ها به هیچ وجه قانع‌کننده نبوده و طرف آمریکایی باید به‌طور کامل و صریح هر ۷ شرط جمهوری اسلامی ایران را بپذیرد و به آن‌ها عمل کند؛ وی تأکید کرد که تنها در صورت تحقق این شرایط و پذیرش عمل‌گرایانه مطالبات بحق ایران، مسیر تردد و بازگشایی تنگهٔ هرمز فراهم خواهد شد.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



دامنه نوسان صندوق‌های اهرمی بورس از شنبه ۱۶ آبان بیشتر خواهد شد

شرکت بورس در اطلاعیه‌ای اعلام کرد که با هدف رفع حباب منفی صندوق‌های اهرمی و اصلاح ساختار آن‌ها، دامنه نوسان قیمت این صندوق‌ها از شنبه ۱۶ آبان از ۴± به ۶± درصد افزایش می‌یابد؛ تصمیمی که در راستای مصوبات سازمان بورس شامل افزودن رکن بازارگردان، اصلاح نحوه محاسبه کارمزد مدیران، بازنگری در تعیین نرخ بازدهی واحدهای عادی و افزایش دامنه نوسان اتخاذ شده است.



جهش ۱۹۸ درصدی تأمین مالی جمعی در بورس؛ ثبت ۲۴/۲ همت منابع در ۷ ماهه

بر اساس بررسی‌های اداره تحلیل‌های اقتصادی و ریسک سازمان بورس و اوراق بهادار، عملکرد سکوهای تأمین مالی جمعی در هفت ماهه امسال در مقایسه با مدت مشابه سال گذشته با رشدی معادل ۱۹۸ درصد همراه بوده است. بنابر آمارهای این اداره، در این مدت ۲۴/۲ همت برای تأمین مالی ۹۰۵ طرح تخصیص یافته است؛ این در حالی است که در مدت مشابه سال پیش از آن، ۸/۱ همت برای ۳۳۶ طرح تأمین مالی صورت گرفته بود. همچنین، بررسی‌ها نشان می‌دهد که در مهرماه امسال نیز مبلغ ۵/۲ همت برای ۱۶۶ طرح از طریق این سکوها تأمین مالی شده است.



آغاز معاملات ثانویه صندوق پروژه "نور" با دامنه نوسان ۳ درصدی از چهارشنبه ۱۳ آبان

معاملات ثانویه واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری پروژه برق خورشیدی با نماد "نور" با توجه به صدور مجوز فعالیت از چهارشنبه ۱۳ آبان تا پایان عمر صندوق در تابلو صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله آغاز می‌شود. بر اساس این گزارش، سقف حجم هر سفارش ۵ میلیون واحد سرمایه‌گذاری و حد نوسان روزانه قیمت مثبت و منفی ۳ درصد است. معاملات با حراج تک قیمتی آغاز و با حراج پیوسته ادامه می‌یابد.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

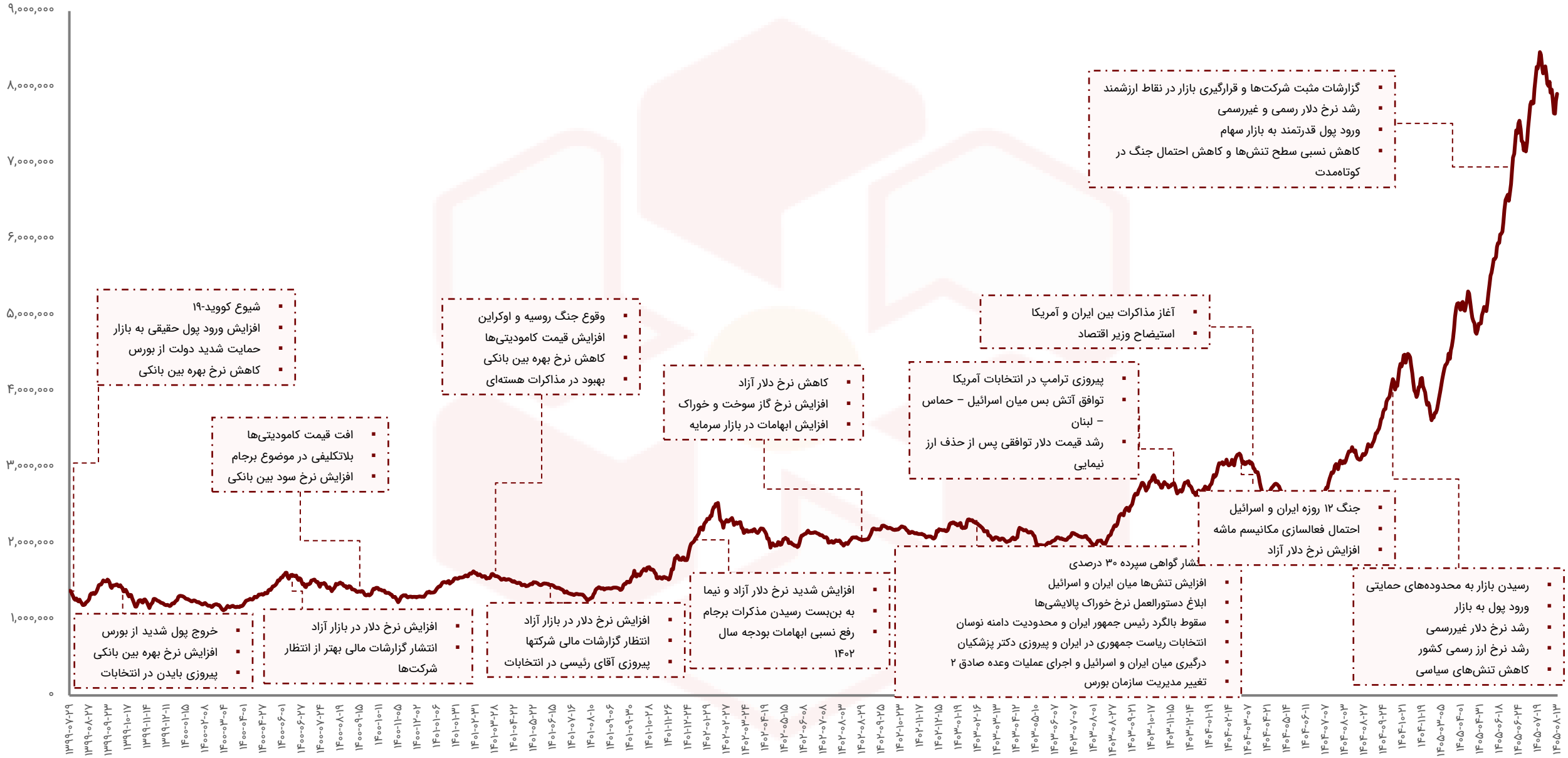
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

بازار سهام در هفته گذشته روندی دوگانه را پشت سر گذاشت؛ به‌طوری‌که با وجود تداوم فشار فروش تا اواسط هفته، معاملات در روزهای سه‌شنبه و چهارشنبه با بهبود همراه شد. شاخص کل نیز در پایان معاملات هفتگی در سطح ۷,۹۱۲,۶۴۹ واحد قرار گرفت و افت ۰/۷ درصدی را به ثبت رساند. در روز شنبه، هم‌زمان با افزایش شایعات درباره احتمال وقوع مجدد درگیری گسترده میان ایران و ایالات متحده، فشار فروش بر بازار حاکم شد و با وجود جمع‌آوری چندباره صف‌های فروش، همچنان عرضه‌ها بر تقاضا غلبه داشتند. روز یکشنبه نیز فشار فروش ناشی از نگرانی‌های جنگی ادامه یافت و در این روز، خروج پول ۷/۸ همتی از بازار به ثبت رسید. با این حال، از میانه معاملات روز دوشنبه و در پی انتشار اخبار مربوط به مذاکرات و احتمال دستیابی به توافق، فضای بازار تا حدودی بهبود یافت. این روند در روزهای سه‌شنبه و چهارشنبه نیز ادامه پیدا کرد و معاملات، به‌ویژه در نمادهای کوچک و متوسط بازار، با وضعیت نسبتاً مثبتی همراه شد. در این هفته، ارزش معاملات نیز با کاهش قابل‌توجهی مواجه شد؛ به‌طوری‌که مجموع ارزش معاملات هفتگی به حدود ۱۶۰ همت رسید که نزدیک به ۳۰ درصد کمتر از میانگین هشت هفته اخیر بود. به نظر می‌رسد بخشی از نقدینگی که پس از جنگ به بازار سهام وارد شده بود، در شرایط فعلی در موضع انتظار قرار گرفته است تا با روشن‌تر شدن چشم‌انداز تحولات کشور، تصمیم‌گیری درباره ورود مجدد به بازار با اطمینان بیشتری صورت گیرد. در بازارهای موازی، دلار آمریکا پس از رشد تا محدوده ۲۷۴ هزار تومان در طول هفته، در روز چهارشنبه و در پی پیروزی دموکرات‌ها در انتخابات میان‌دوره‌ای، تا سطح ۲۶۸ هزار تومان عقب‌نشینی کرد. هر گرم طلای ۱۸ عیار نیز با وجود رشد بیش از ۱۶۰ دلاری اونس جهانی، بیش از آنکه از افزایش قیمت طلای جهانی تأثیر بپذیرد، تحت تأثیر افت نرخ دلار قرار گرفت و در ظهر روز چهارشنبه با قیمت ۲۵ میلیون و ۸۶۰ هزار تومان معامله شد.

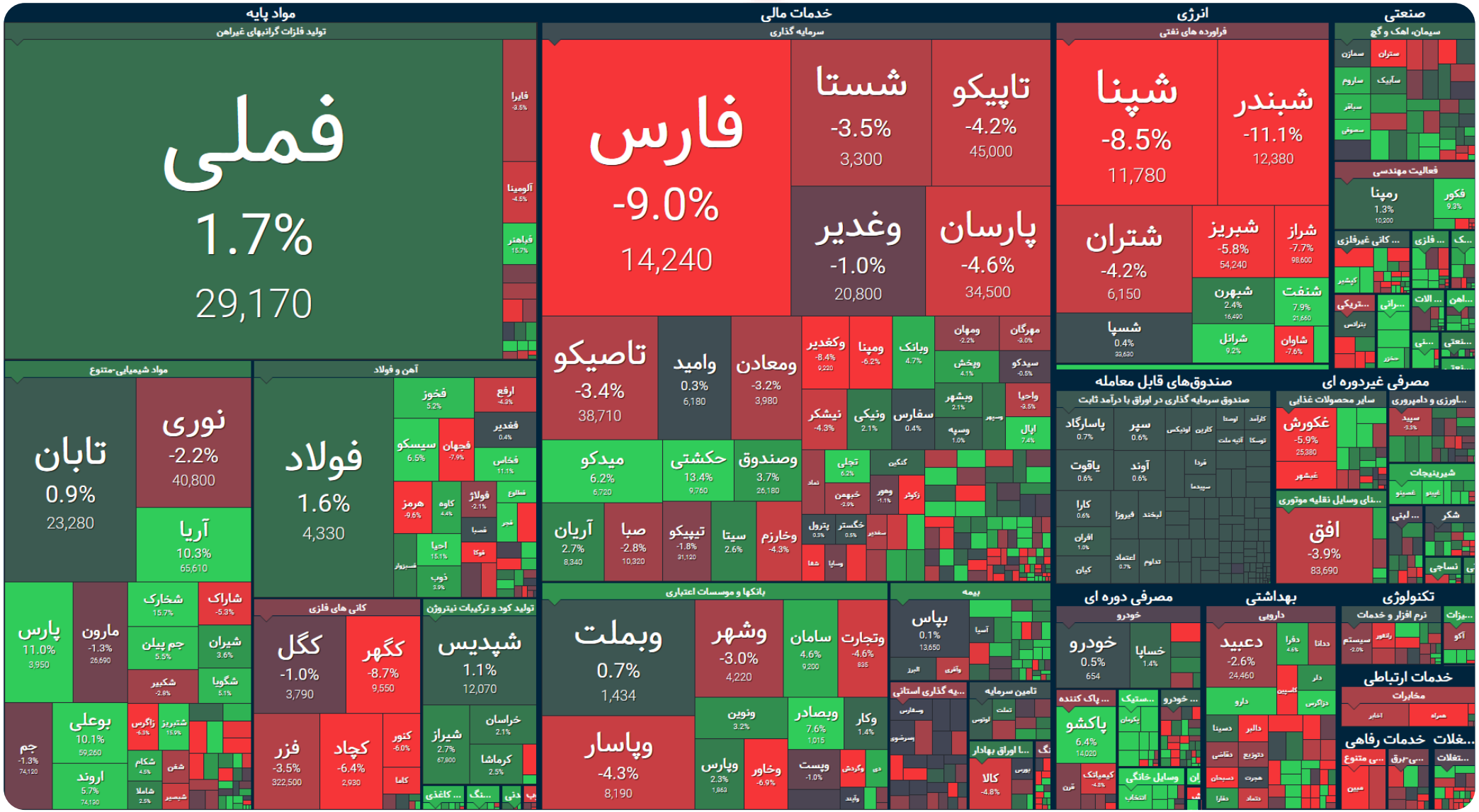
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۷,۹۶۷,۵۵۱	۷,۹۱۲,۶۴۹	(۵۴,۹۰۲)	(%۰.۷)
شاخص هم وزن (واحد)	۲,۲۰۹,۷۴۶	۲,۲۲۹,۰۶۶	۱۹,۳۲۰	%۰.۹
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۱۸۹,۰۷۳		۱۷,۸۴۱	%۱۰.۴
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۲,۵۷۳)		-	-

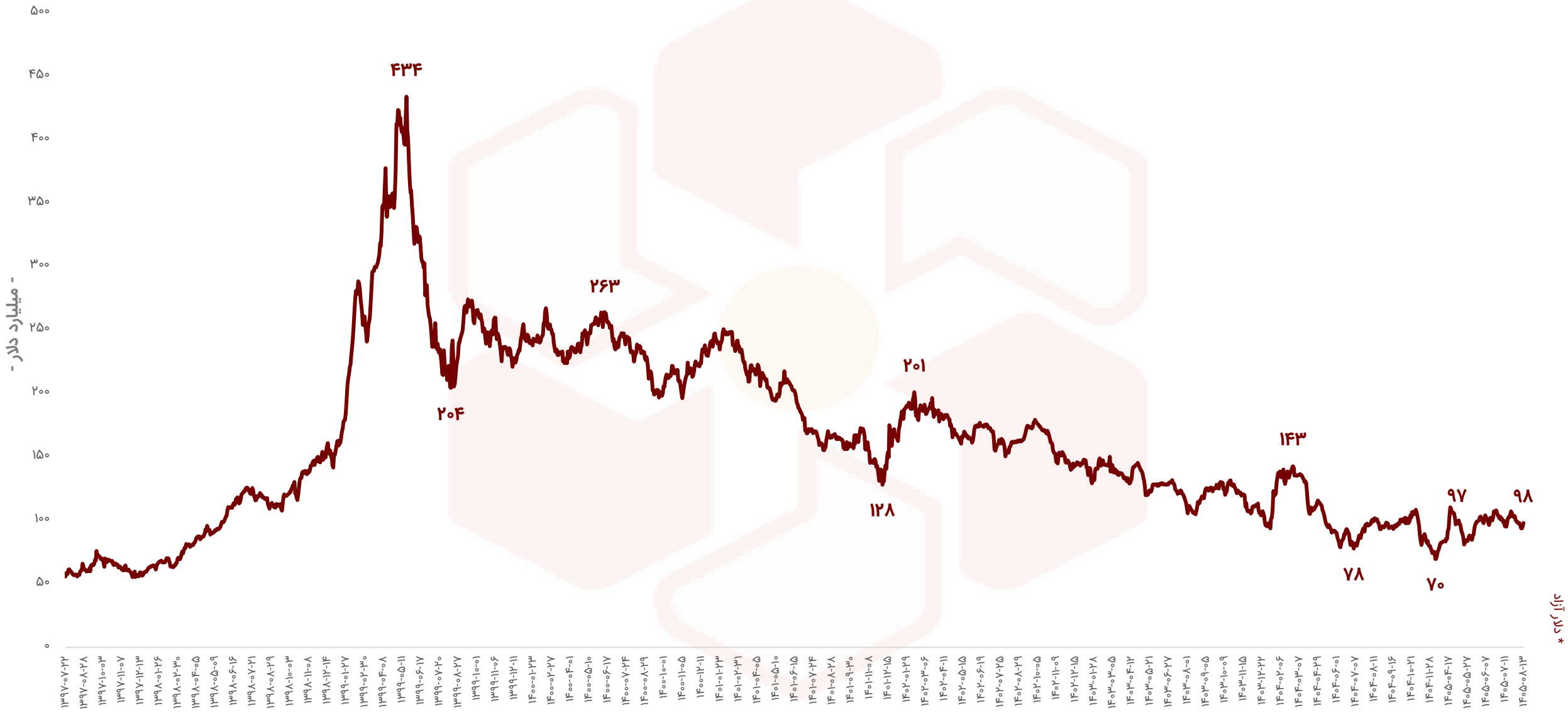
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



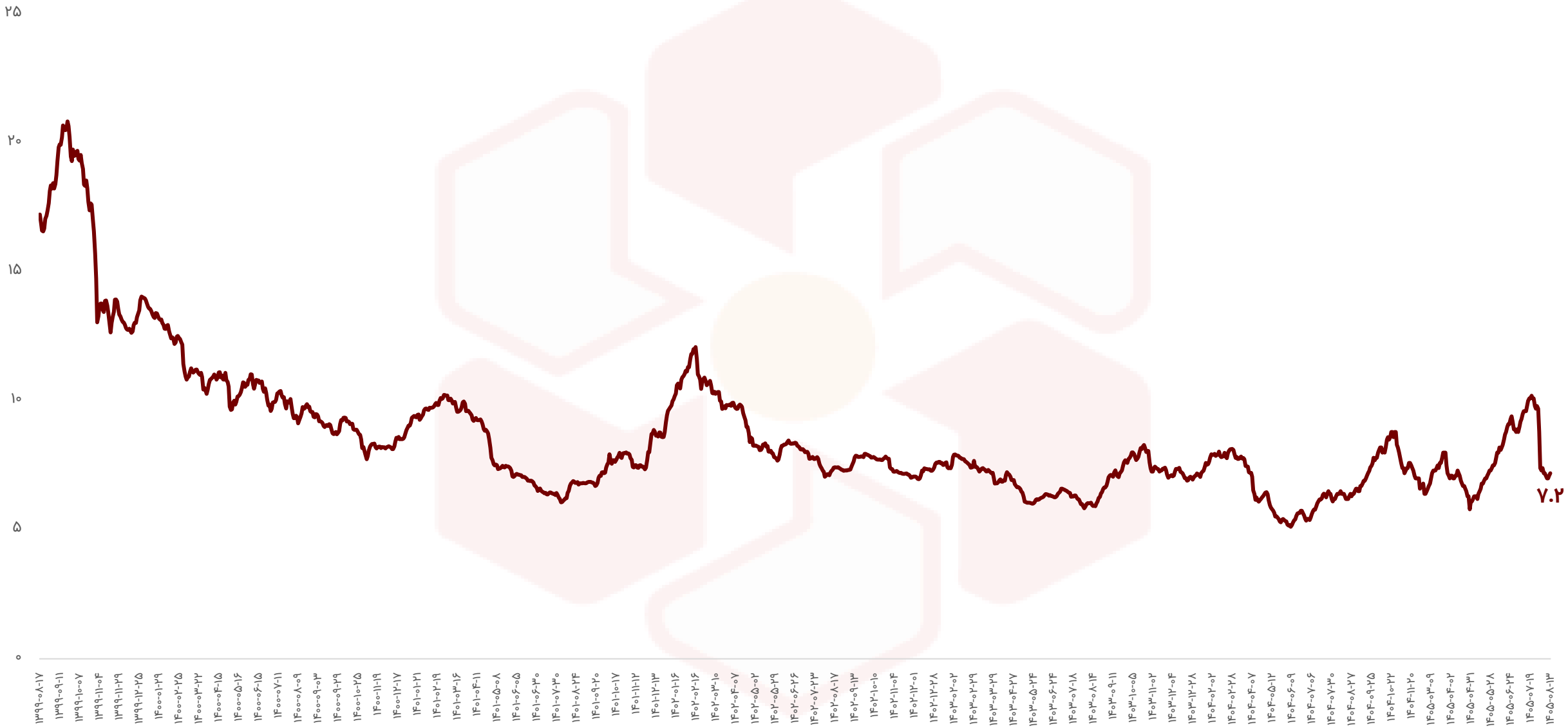
نقشه بازار سهام در هفته گذشته



ارزش دلاری بازار*

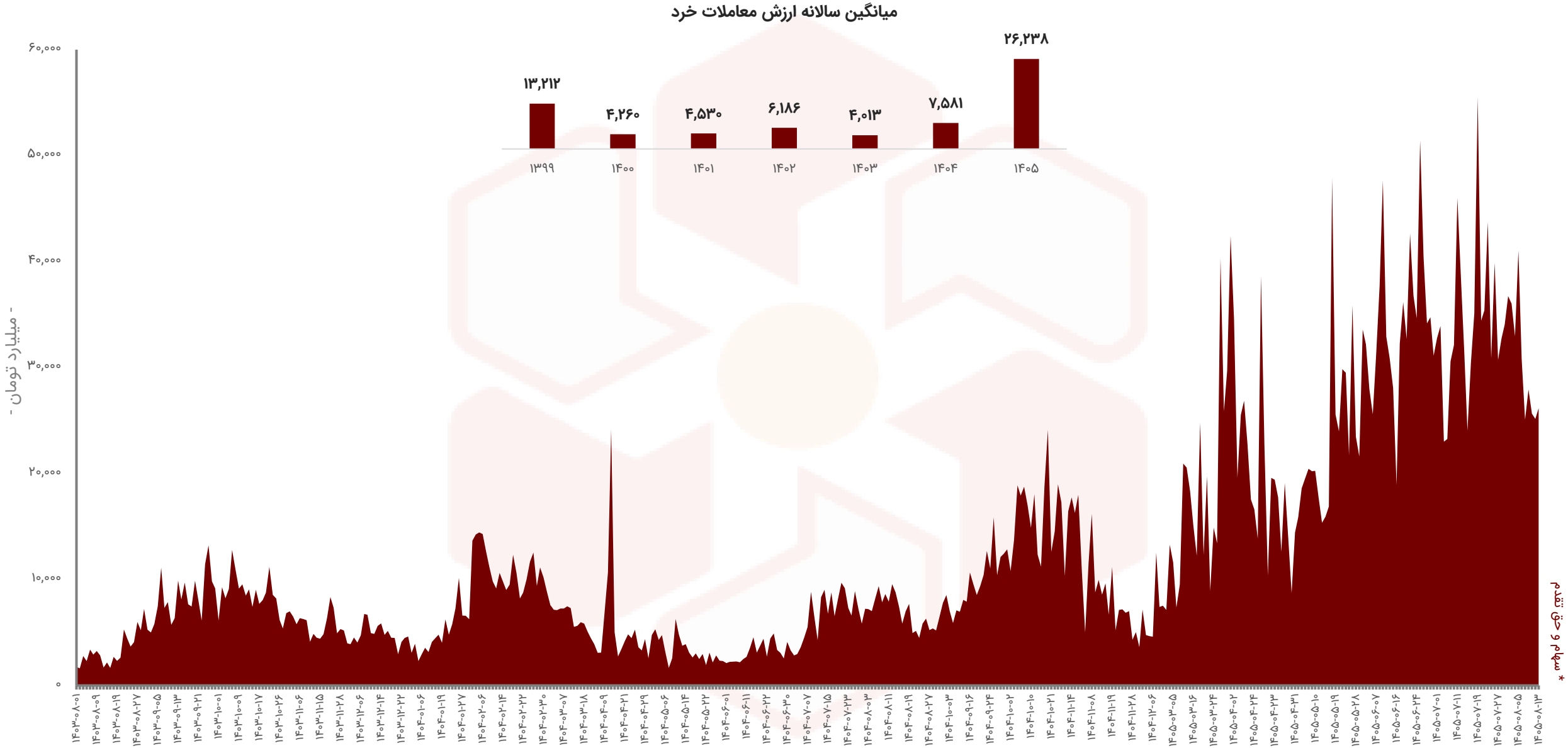


نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)

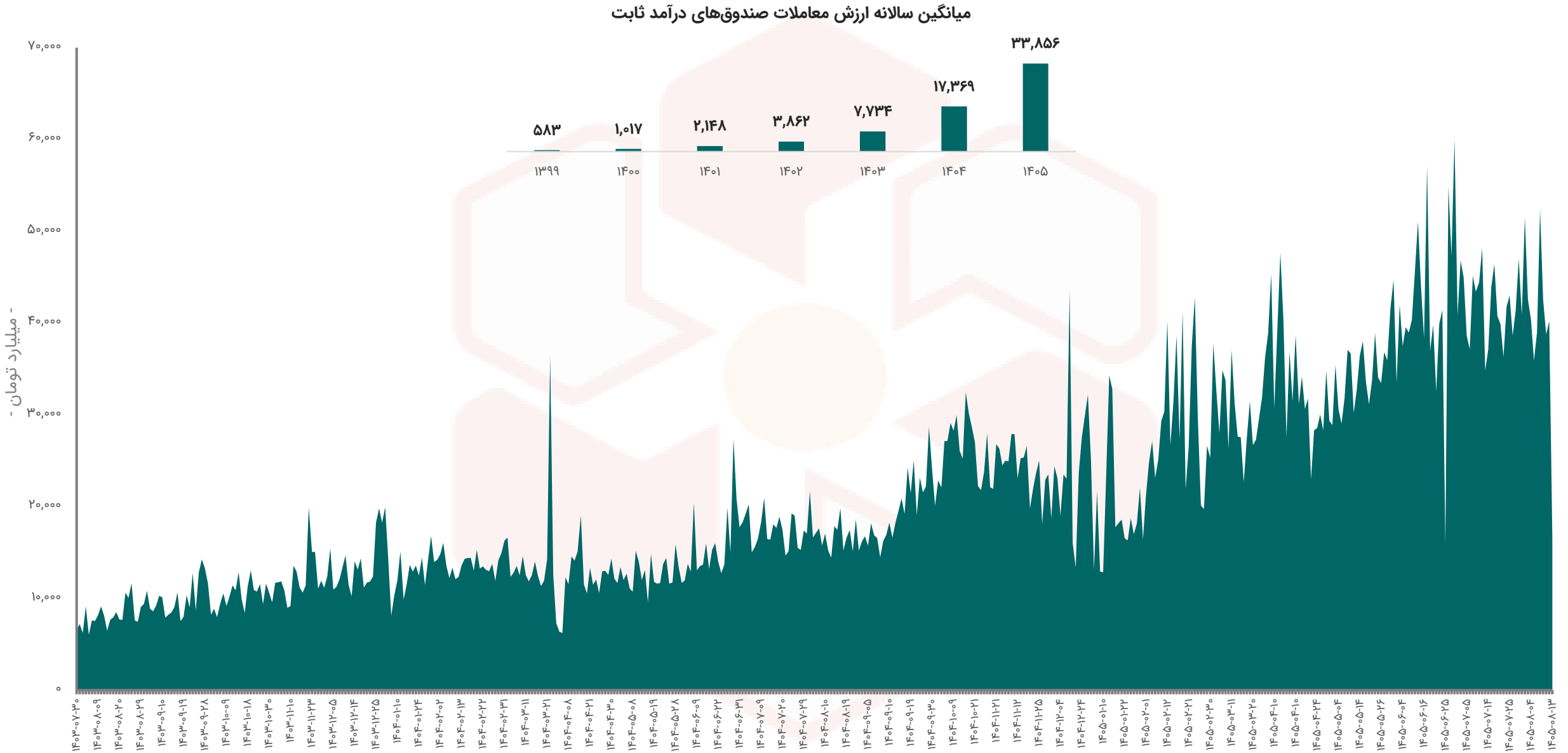


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

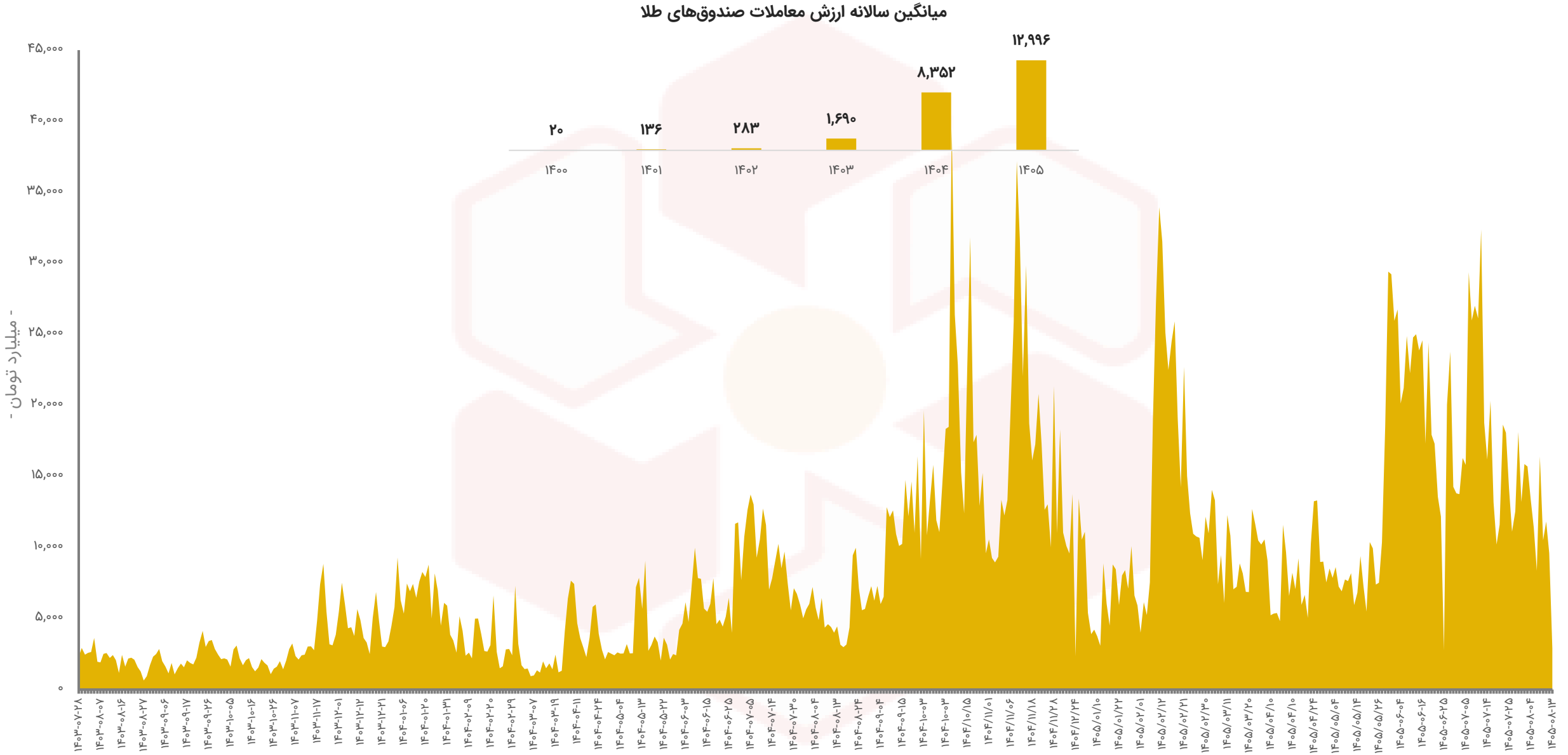
ارزش معاملات خرد سهام*



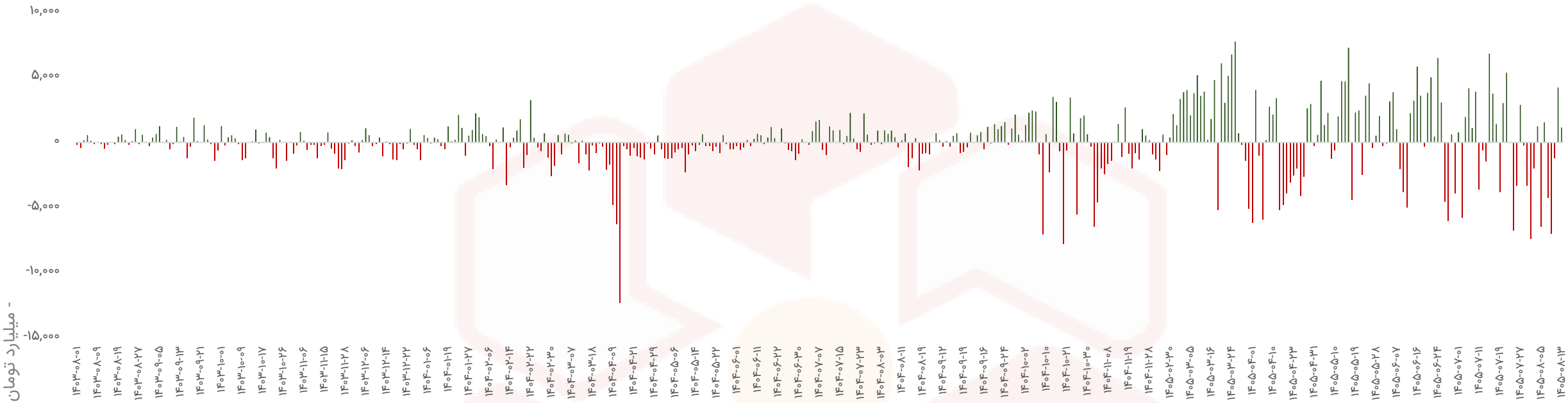
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



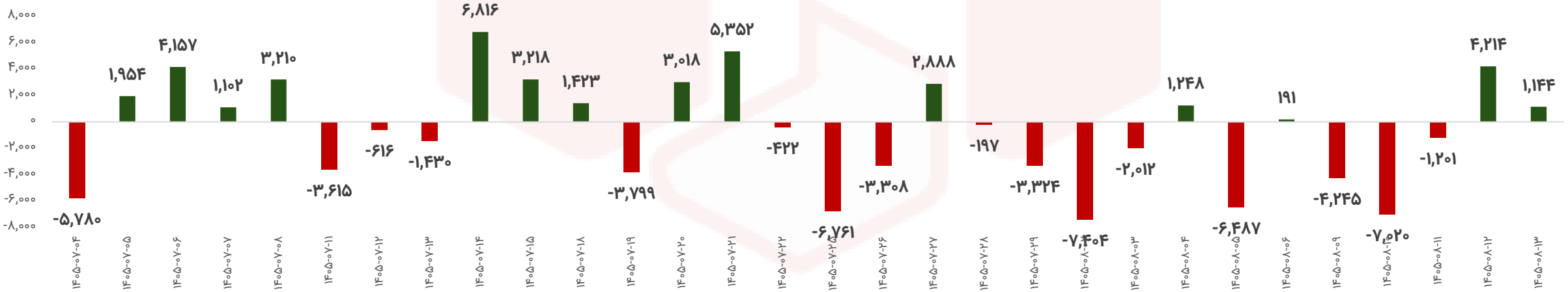
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



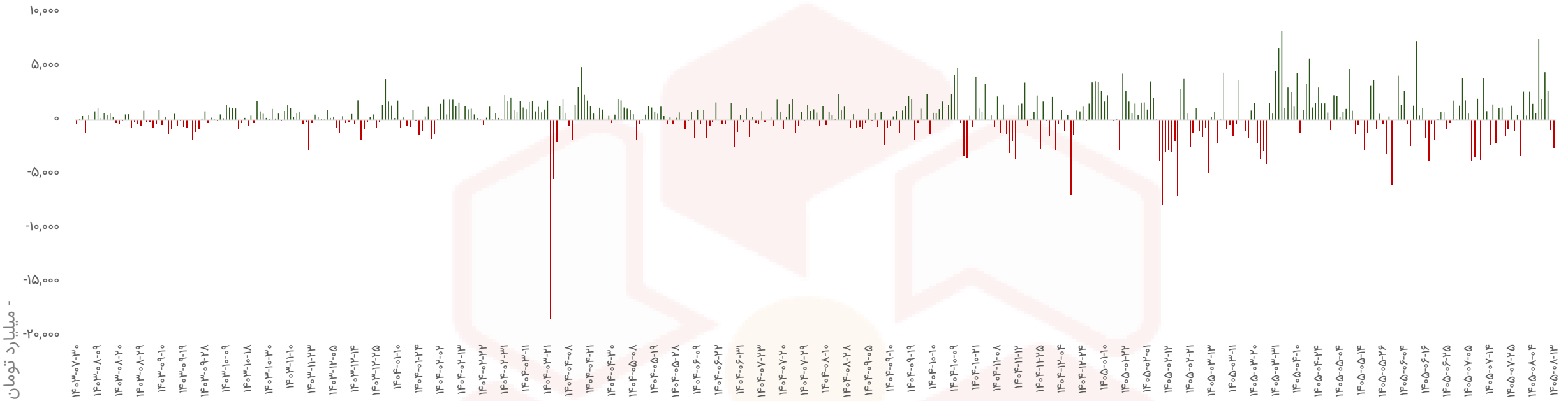
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



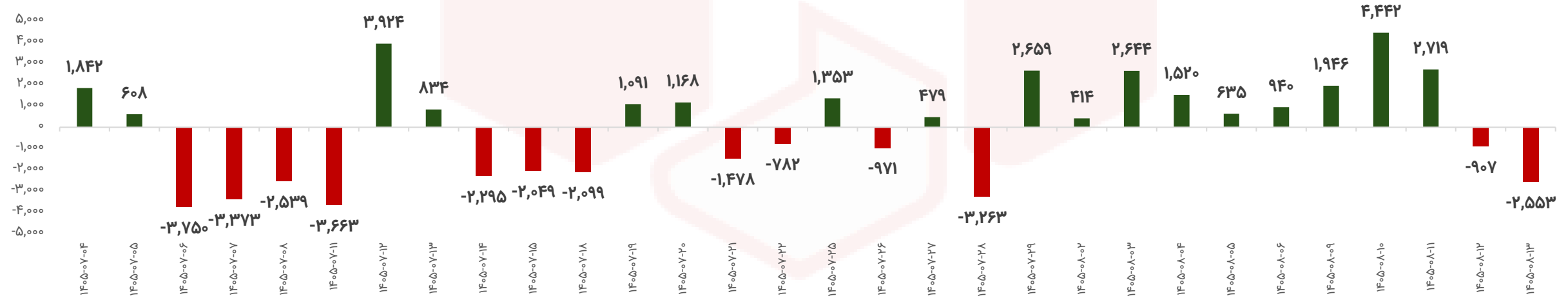
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

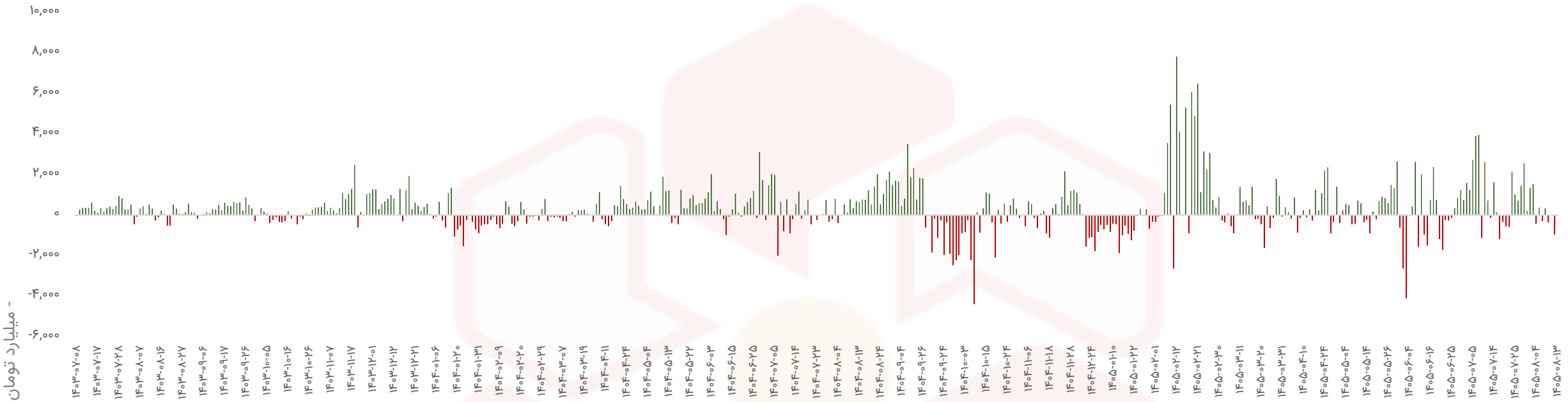
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



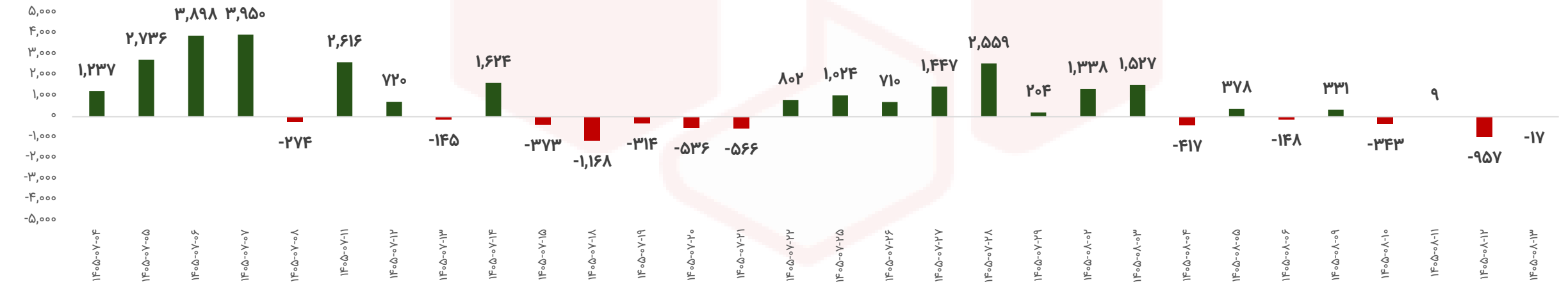
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



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	ص. س. سهامی اهرمی پیشران پارسیان	پیشران	%۱۶
۲	سیم و کابل تبریز	سیمکات	%۱۵.۹
۳	آنتی بیوتیک سازی ایران	بیوتیک	%۱۵.۹
۴	پتروشیمی تبریز	شتبریز	%۱۵.۹
۵	نشاسته و گلوکز آردینه	آردینه	%۱۵.۹

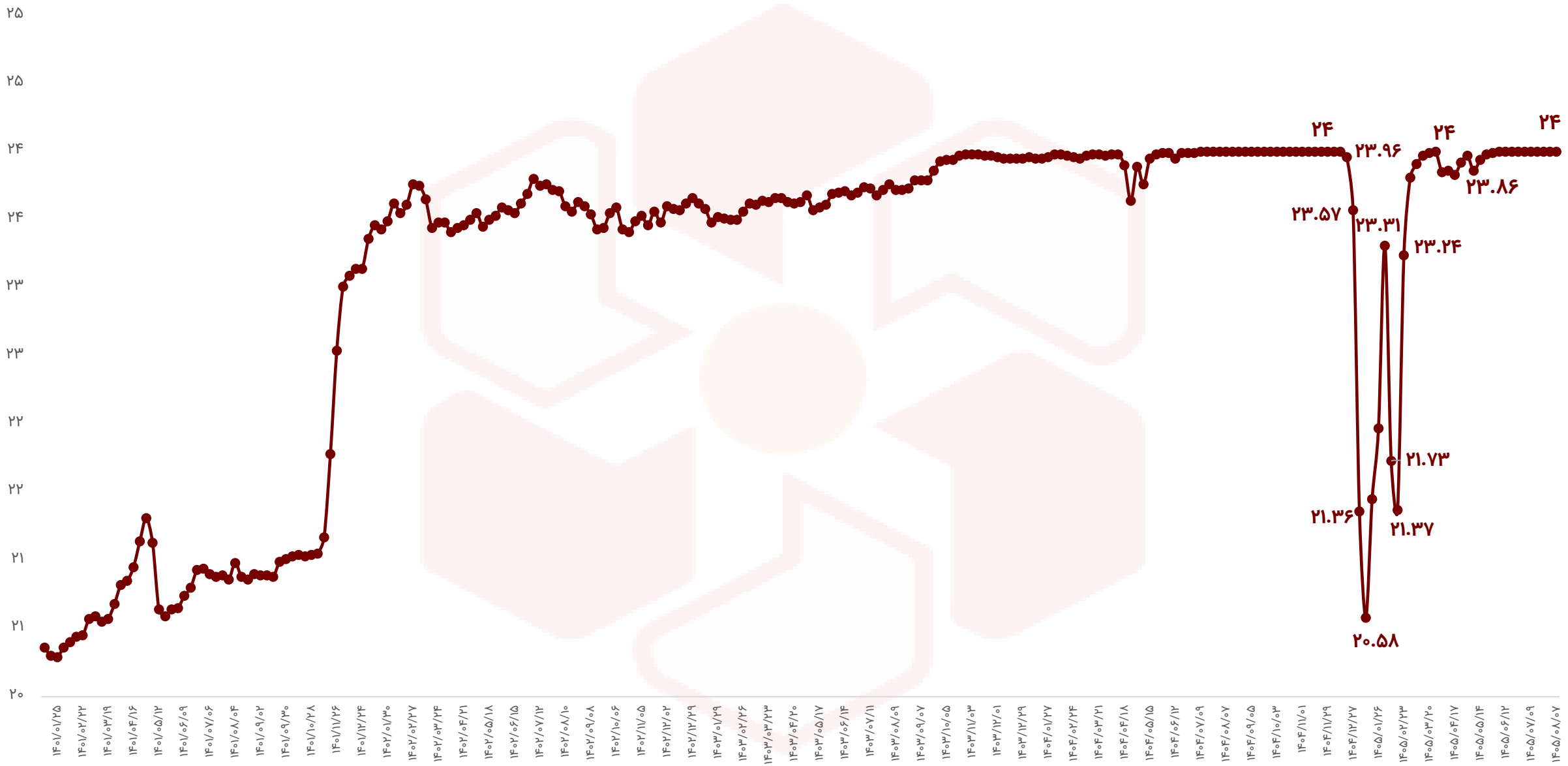
نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	سر. مسکن شمالغرب	ثغرب	(%۱۴)
۲	واسپاری ملت	ولملت	(%۱۴)
۳	کاشی سعدی	کسعدی	(%۱۳.۷)
۴	کی بی سی	کی بی سی	(%۱۳.۵)
۵	دارو اسوه	داسوه	(%۱۳.۱)

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/E
وگردش	۱,۶۰۱	۱.۵
حآفرین	۳,۴۹۰	۱.۶
حفاری	۶,۲۸۰	۱.۹
آسیا	۴,۷۷۰	۲
پارسیان	۱,۸۷۰	۲.۱
شصفها	۳,۴۴۰	۲.۲
وبصادر	۱,۰۱۵	۲.۲
وپارس	۱,۸۶۸	۲.۳
وبملت	۱,۴۲۴	۲.۳
شتران	۶,۱۴۰	۲.۶

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۳۳	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۰,۱۲۰	۴۸.۳۰%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۶۸	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴۰,۴۶۰	۴۵.۸۴%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۶۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴۰,۴۶۰	۴۵.۸۴%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۸۹	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۲۲,۹۹۰	۴۵.۱۶%
اخزا۴۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۱-۱۰	۸۱۷	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۳۶,۵۱۰	۴۴.۸۸%
اخزا۴۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۰-۱۹	۷۹۶	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۶,۵۱۰	۴۴.۶۸%
اخزا۵۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۳-۰۸	۹۳۶	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۹۰,۴۲۰	۴۴.۶۶%
اخزا۵۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۵-۰۹	۹۹۹	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۸,۹۱۰	۴۴.۵۲%
اخزا۵۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۸-۰۲-۲۵	۹۲۲	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۹۵,۸۷۰	۴۴.۴۰%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۷۳۳	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۹۰,۰۰۰	۴۴.۳۲%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۶۷۰	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۲۰,۴۱۰	۴۴.۲۳%
اخزا۴۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۴-۲۰	۶۱۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۶۲,۵۰۰	۴۳.۲۹%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۳۰۶	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۴۴,۰۰۰	۴۲.۵۲%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۴۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۴,۲۰۰	۳۹.۷۳%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

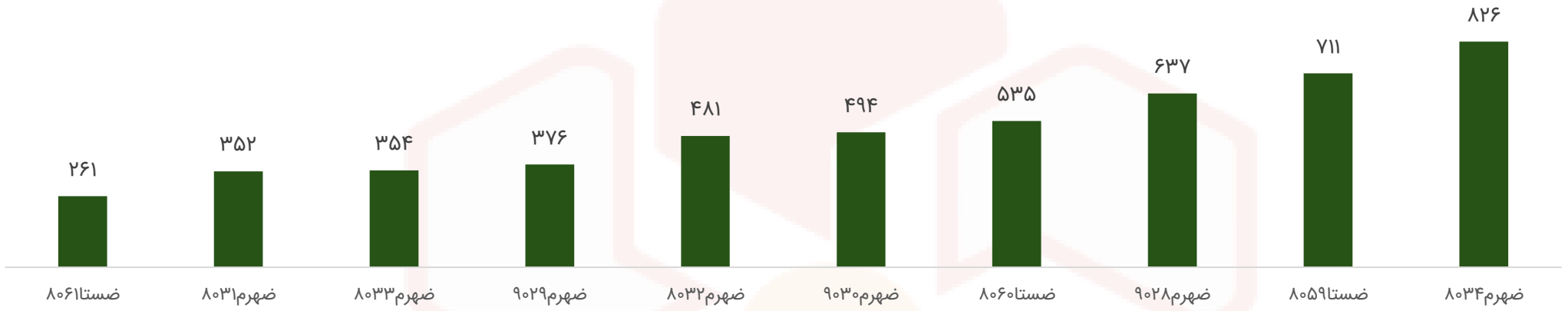
شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۰۳۵	۴,۰۶۰	(۰.۶%)	۴,۱۴۱	(۲.۶%)
نقره (دلار/انس)	۵۱.۶	۵۴	(۴.۴%)	۶۱	(۱۵.۴%)
سکه امامی (تومان)	۲۶۳,۱۵۵,۰۰۰	۲۶۷,۶۷۰,۰۰۰	(۱.۷%)	۲۷۰,۹۳۰,۰۰۰	(۲.۹%)
دلار آزاد (تومان)	۲۶۸,۹۰۰	۲۶۹,۵۰۰	(۰.۲%)	۲۶۸,۷۰۰	۰.۱%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۱۰۳.۱	۱۱۳.۸	(۹.۴%)	۱۰۰.۲	۲.۹%
بیت کوین (دلار)	۷۸,۴۱۲	۸۱,۱۸۰	(۳.۴%)	۸۵,۷۹۳	(۸.۶%)
اتریم (دلار)	۲,۲۹۹	۲,۳۵۷	(۲.۵%)	۲,۷۱۲	(۱۵.۲%)
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۰۴۵	۳,۰۷۸	(۱.۱%)	۳,۱۲۵	(۲.۶%)
مس LME (دلار)	۱۴,۰۲۰	۱۴,۴۷۸	(۳.۲%)	۱۴,۳۹۶	(۲.۶%)
روی LME (دلار)	۳,۷۹۸	۳,۸۶۶	(۱.۸%)	۳,۷۴۲	۱.۵%
سرب LME (دلار)	۱,۸۸۴	۱,۹۰۱	(۰.۹%)	۱,۸۷۳	۰.۶%
انس پلاتین (دلار)	۱,۴۵۷	۱,۵۴۵	(۵.۷%)	۱,۷۲۹	(۱۵.۷%)

آمار معاملات گواهی‌های سپرده بورس کالا

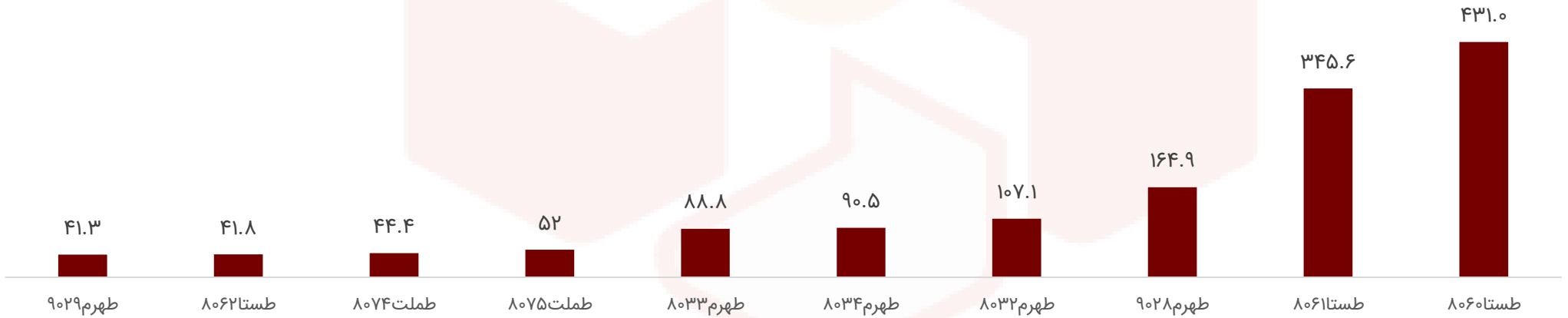
شرح	آخرین	هفته گذشته	
		قیمت	تغییرات
گواهی سپرده شمش طلا	۳۳,۸۹۹,۶۶۰	۳۴,۶۱۹,۹۴۰	(۲.۱%)
گواهی سپرده سکه طلا	۲,۵۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۶۵۲,۹۹۹,۹۰۰	(۲.۸%)
گواهی سپرده نقره	۴,۶۲۳,۹۷۰	۴,۸۷۸,۴۰۰	(۵.۲%)
گواهی سپرده مس کاتد	۳۳,۴۷۰,۰۰۰	۳۵,۳۰۰,۰۰۰	(۵.۲%)
گواهی سپرده شمش روی	۷,۹۹۹,۹۹۰	۸,۰۳۴,۸۹۰	(۰.۴%)
گواهی سپرده شمش سرب	۴,۷۱۸,۸۸۰	۴,۹۴۵,۹۸۰	(۴.۶%)
گواهی سپرده میلگرد	۱,۱۰۰,۰۲۰	۱,۱۲۷,۹۵۰	(۲.۵%)
گواهی سپرده گندله سنگ آهن	۲۲۶,۳۱۰	۲۳۳,۹۶۰	(۳.۳%)
گواهی سپرده قیر	۱,۳۷۰,۰۰۰	۱,۴۲۲,۸۰۰	(۳.۷%)
گواهی سپرده وانت T۹	۱۴,۰۷۷,۵۱۰	۱۱,۸۹۷,۹۶۰	۱۸.۳%

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

ارزش معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



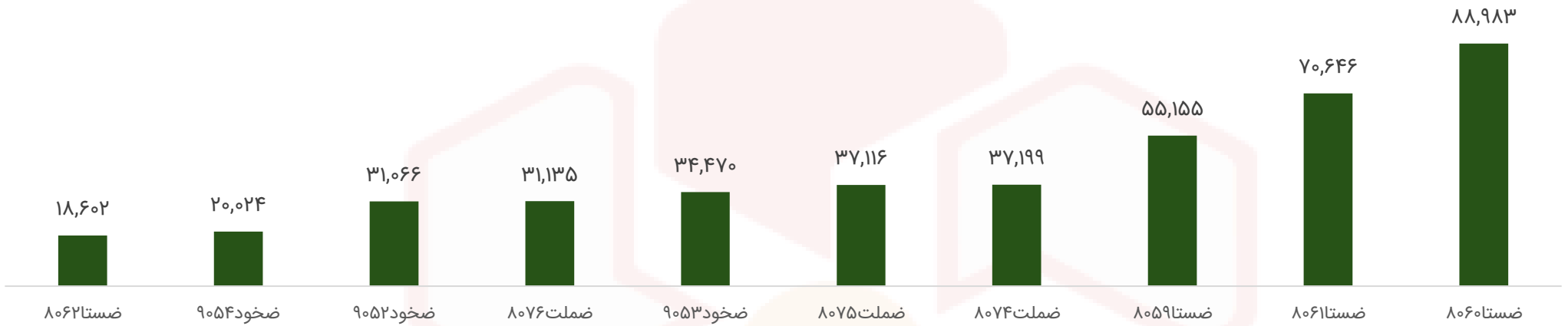
ارزش معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



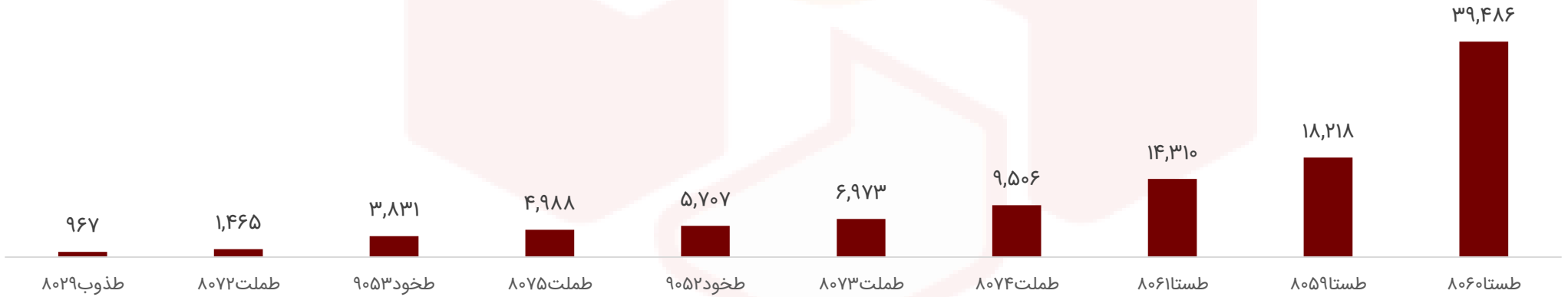
- میلیارد تومان -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته

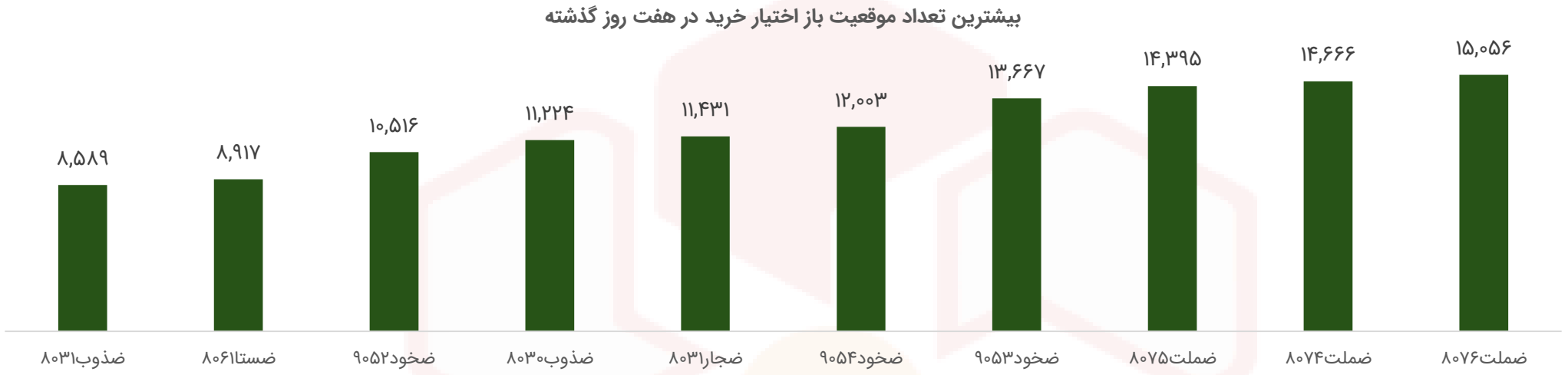


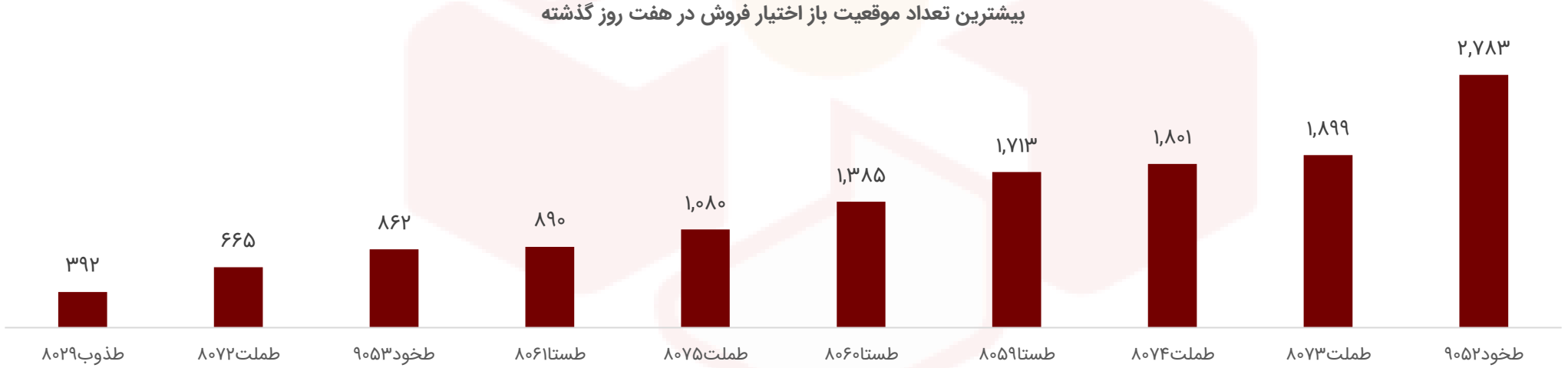
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار برگ سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه





بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege