



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و چهارم منتهی به

۱۴۰۴ آبان ماه



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی



■ گروه ۷ خواهان مذاکره مستقیم ایران با آمریکا شد

گروه ۷ اعلام کرد کمک‌های نظامی ایران، چین و کره شمالی به روسیه در ادامه جنگ اوکراین نقش مهمی دارد و این کمک‌ها را محکوم کرد. این گروه از ایران خواست به تعهدات خود طبق قطعنامه‌های شورای امنیت و پیمان منع گسترش سلاح‌های هسته‌ای پایبند بماند، همکاری کامل با آژانس اتمی را از سر بگیرد و با پشتیبانی سه کشور اروپایی وارد مذاکره مستقیم با آمریکا شود. همچنین تأکید شد همه کشورهای عضو سازمان ملل باید پس از فعال شدن مکانیسم ماشه به تعهدات بین‌المللی خود عمل کنند.



■ جلسه این هفته شورای حکام آژانس درباره ایران چهارشنبه ۲۸ آبان برگزار خواهد شد

آژانس بین‌المللی انرژی اتمی اعلام کرد نشست شورای حکام چهارشنبه ۲۸ آبان در وین برگزار می‌شود و موضوعاتی مانند عضویت کشورها، همکاری‌های فنی، ایمنی و حمل‌ونقل مواد رادیواکتیو، وضعیت راستی‌آزمایی در کره شمالی و سوریه، پرونده پیشرفته هسته‌ای استرالیا و برزیل و اجرای توافق‌نامه‌های پادمانی - از جمله درباره ایران - بررسی خواهد شد. در دستورکار نشست اشاره‌ای به قطعنامه ۲۲۳۱ یا تعهدات مربوط به برجام نشده و نام ایران تنها در بخش پادمان آمده است. این نشان می‌دهد پیگیری مسائل برجام از دستور کار شورای حکام کنار گذاشته شده؛ زیرا با پایان دوره ۱۰ ساله قطعنامه ۲۲۳۱ در مهر ۱۴۰۴، گزارش‌دهی مدیرکل درباره تعهدات برجامی ایران نیز خاتمه یافته است. آژانس همچنین در گزارش فصلی خود تأکید کرده که ایران باید گزارشی درباره مواد و تأسیسات هسته‌ای آسیب‌دیده در جنگ ۱۲ روزه ارائه کند.

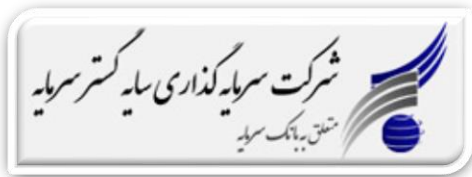


■ استقرار بزرگ‌ترین ناو جهان در آمریکای لاتین و آماده باش ۲۰۰ هزار سرباز ونزوئلا

نیروی دریایی آمریکا اعلام کرد ناو هواپیمابر «یواس اس جرالد فورد»، بزرگ‌ترین و جدیدترین ناو جهان، همراه با ده‌ها ناوشکن وارد منطقه آمریکای لاتین شده است؛ اقدامی که بزرگ‌ترین استقرار نظامی آمریکا در این منطقه از سال ۱۹۸۹ محسوب می‌شود. این ناو با بیش از ۴ هزار ملوان و ده‌ها هواپیمای تاکتیکی، اواخر اکتبر از مدیترانه به این منطقه اعزام شده است. در واکنش، دولت ونزوئلا به رهبری نیکولاس مادورو اعلام کرد برای مقابله با حضور آمریکا، نیروهای گسترده‌ای از ارتش، نیروی دریایی، هواپیماها، واحدهای رودخانه‌ای و موشکی و همچنین نیروهای مردمی را مستقر کرده است. وزارت دفاع ونزوئلا نیز از اعزام ۲۰۰ هزار سرباز برای تمرین‌های آمادگی مقابله با تهدیدات آمریکا خبر داد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی



■ شرکت‌های برتر بورس کالا از نظر ارزش معاملات در هفته اخیر معرفی شدند

آمار معاملات بازار فیزیکی بورس کالای ایران نشان می‌دهد در هفته منتهی به ۲۳ آبان ماه حدود ۲ میلیون و ۶۸۳ هزار تن انواع کالا و محصول به ارزش بالغ بر ۴۷/۹ هزار میلیارد تومان معامله شد. همچنین ارزش معاملات ۱۰ شرکت برتر به بیش از ۱۸/۷ هزار میلیارد تومان رسید. برترین‌های بورس کالای ایران در هفته اخیر براساس ارزش فروش شرکت‌ها شامل: ملی صنایع مس ایران با معامله ۴ هزار و ۷۲۰ تن انواع مس و سولفور مولیبدن به ارزش ۴ هزار و ۸۷۲۵۰۸ میلیارد تومان در رتبه نخست ایستاد. معدنی و صنعتی چادرملو با فروش ۲۰۵ هزار و ۴۰ تن کنسانتره و گندله سنگ آهن، شمش بلوم و آرگون به ارزش ۲ هزار و ۱۰۲ میلیارد تومان دوم شد. پالایش نفت اصفهان ۷۸ هزار تن وکیوم باتوم و لوب کات سبک به ارزش ۲ هزار و ۵۷ میلیارد تومان فروخت و رتبه سوم را به خود اختصاص داد. فولاد خوزستان با معامله ۴۷ هزار و ۶۰ تن تختال، شمش بلوم و آرگون به ارزش یک هزار و ۵۵۸ میلیارد تومان چهارم شد.



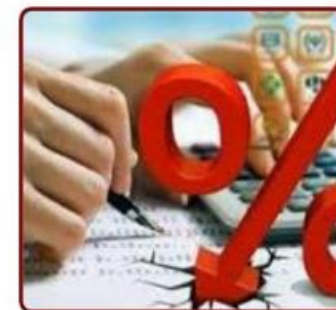
■ پیش فروش جدید سکه تمام و ربع از امروز ۲۴ آبان ماه اعلام شد

طبق آخرین برنامه مرکز مبادله، فرآیند پیش فروش جدید سکه تمام و ربع از امروز شنبه ۲۴ آبان ماه آغاز می‌شود و بعد از مهلت دو روزه واریز وجه (شنبه و یکشنبه) دوشنبه ۲۶ آبان نیز پیش‌فروش سکه به روش حراج برگزار خواهد شد. متقاضیان می‌توانند بعد از واریز وجه از ساعت ۸ الی ۱۶ دوشنبه اقدام به ثبت سفارش کنند. سررسید ششمین مرحله پیش‌فروش سکه هم ۳۰ بهمن سال جاری خواهد بود. سقف خرید هم مانند گذشته ۵ قطعه سکه برای هر متقاضی است. براساس این گزارش، نتایج آخرین حراج سکه در چهارشنبه گذشته هم نشان داد ۴۳,۴۰۵ انواع سکه ضرب سال ۱۳۸۶ بانک مرکزی تخصیص یافته و طی آن قیمت هر سکه تمام بیش از ۱۱۲.۳ میلیون تومان (شامل بیش از ۱۸.۲ هزار قطعه) و سکه نیم و ربع هم ۵۷.۴ و ۳۲.۸ میلیون تومان و با موعد تحویل ۴ تا ۱۲ آذر بود.



■ نرخ سود بین بانکی برای هفتمین هفته بدون تغییر در ۲۴ درصد ثابت ماند

طبق اعلام بانک مرکزی، نرخ سود در بازار بین بانکی برای هفتمین هفته متوالی بدون تغییر در همان نرخ ۲۴ درصد ثابت ماند. همچنین نرخ ریپو همانند هفته‌های گذشته ۲۳ درصد اعلام گردید.



بورس در هفته ای که گذشت

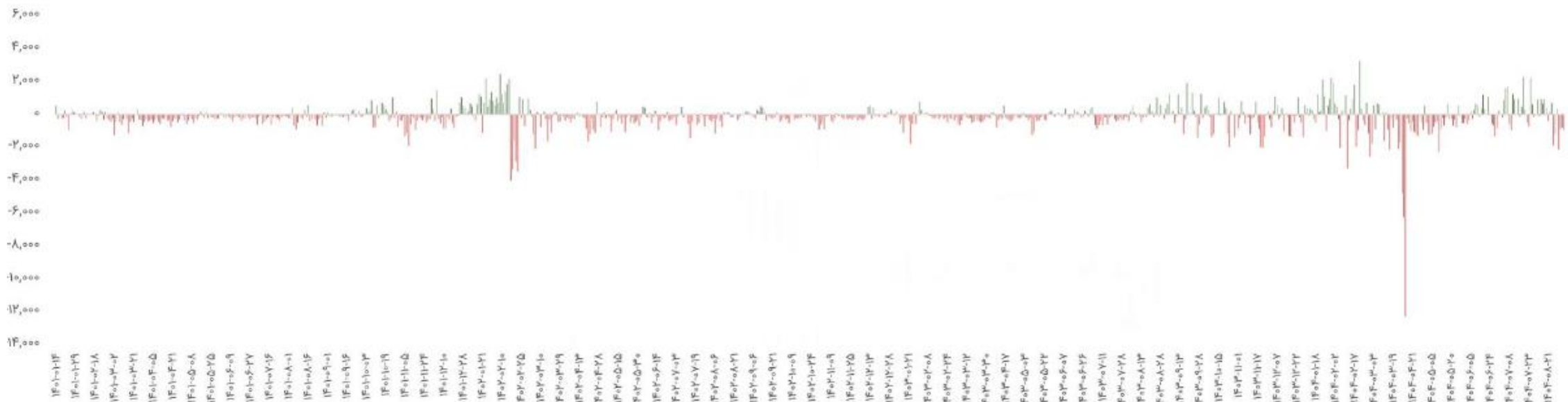
شرح وقایع

شاخص کل بورس در پایان هفته اخیر بر ارتفاع ۳,۰۹۸,۷۶۳ واحد قرار گرفت و افت هفتگی ۳.۲ درصدی را ثبت کرد. همچنین شاخص کل هم‌وزن نیز افت ۲ درصدی داشت و بر ارتفاع ۹۰۳,۶۵۳ واحد ایستاد. ارزش معاملات خرد با افت ۲۸ درصدی روبرو شد و حدود ۳۰,۴۴۲ میلیارد تومان ثبت شد. میانگین ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم با افت ۲۸ درصدی از ۸,۴۶۱ میلیارد تومان به ۶,۰۸۸ میلیارد تومان رسید. در هفته اخیر، خالص ورود/خروج پول حقیقی سهام، حق تقدم و صندوق‌های سهامی (۵,۱۹۷) میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های با درآمد ثابت ۱,۹۹۶ میلیارد تومان ثبت شد. خالص ورود/خروج پول حقیقی صندوق‌های طلا ۵,۹۲۳ میلیارد تومان ثبت شد. رسیدن شاخص کل به سقف تاریخی خود با کاهش ارزش معاملات و خروج پول حقیقی همراه بود و منابع به سمت صندوق‌های درآمد ثابت و طلا رفت. رشد دلار نیما در هفته اخیر نیز نتوانست باعث تغییر روند بازار شود. از سوی دیگر، با انتشار داده‌های بانک مرکزی، احتمال افزایش نرخ بهره در ماه‌های آتی و تا پایان سال افزایش یافته است که این امر، پول را به سمت دارایی‌های بدون ریسک منتقل می‌کند. در بازارهای موازی، گواهی‌های سپرده عیار پس از رشد شدید در هفته‌های اخیر، متعادل ماندند و صندوق‌های طلا، با بازگشایی مثبت اونس جهانی و افزایش نرخ دلار، با رشد بیش از ۷ درصد در دو روز پایانی هفته داشتند.

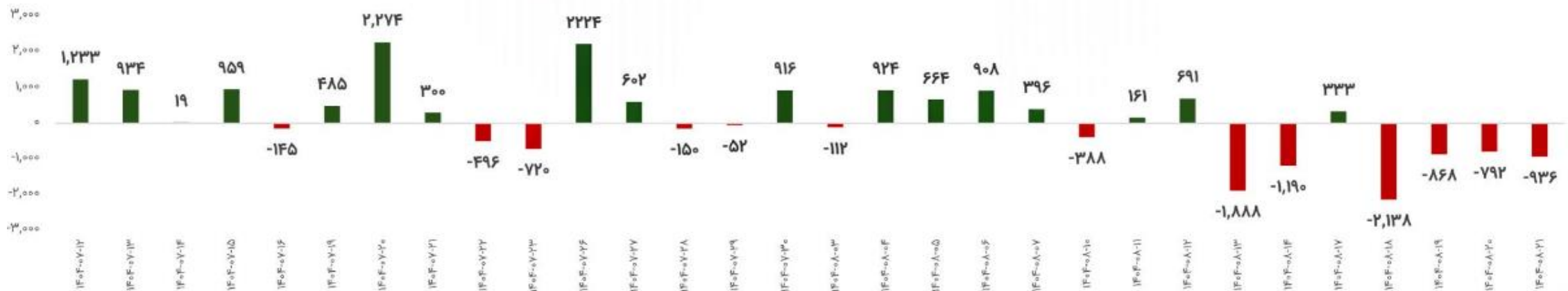
تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۳,۲۰۲,۸۸۹	۳,۰۹۸,۷۶۳	(۱۰۴,۱۲۶)	-۳.۲٪
شاخص هم‌وزن (واحد)	۹۲۲,۱۰۸	۹۰۳,۶۵۳	(۱۸,۴۵۵)	-۲٪
ارزش معاملات خرد (میلیارد تومان)	۴۲,۳۰۷	۳۰,۴۴۲	(۱۱,۸۶۵)	-۲۸٪

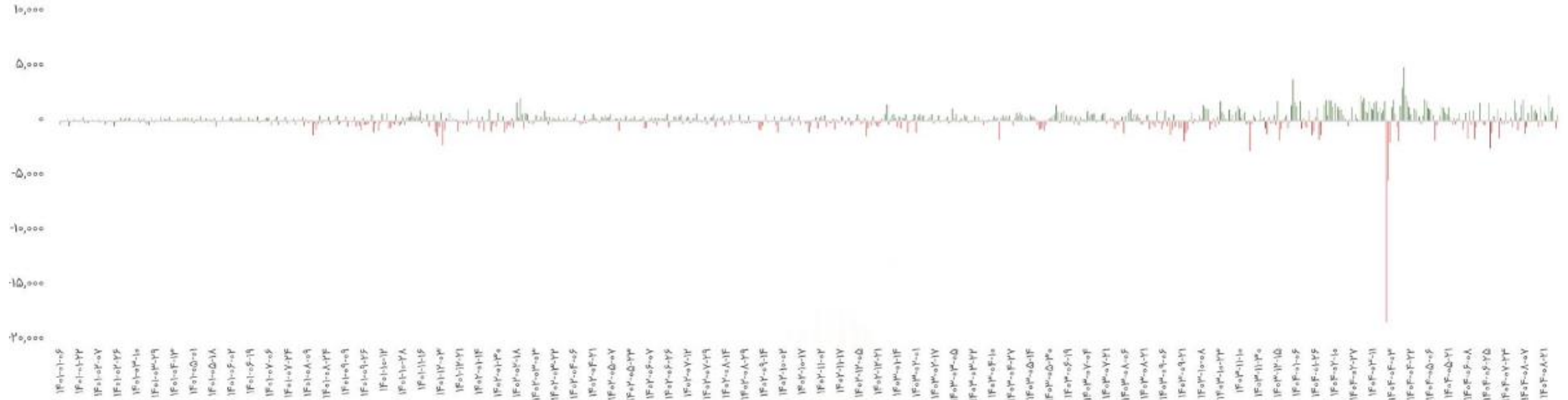
ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام



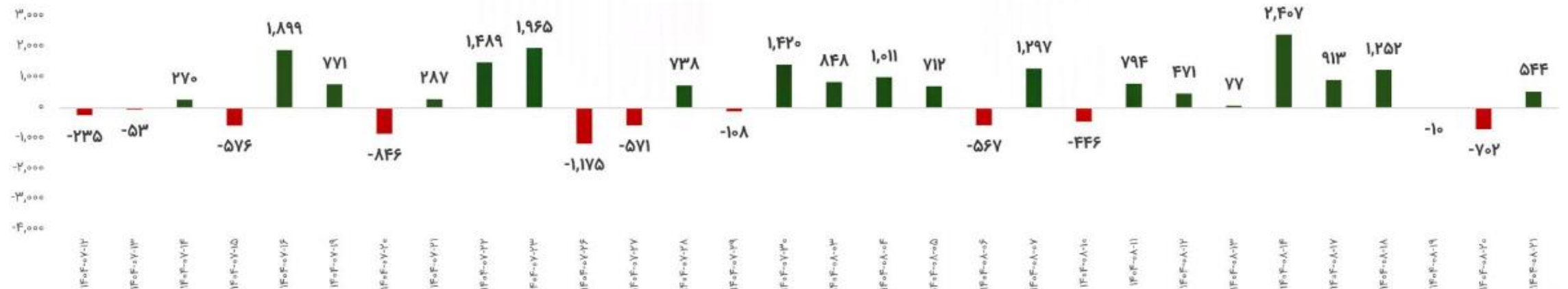
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

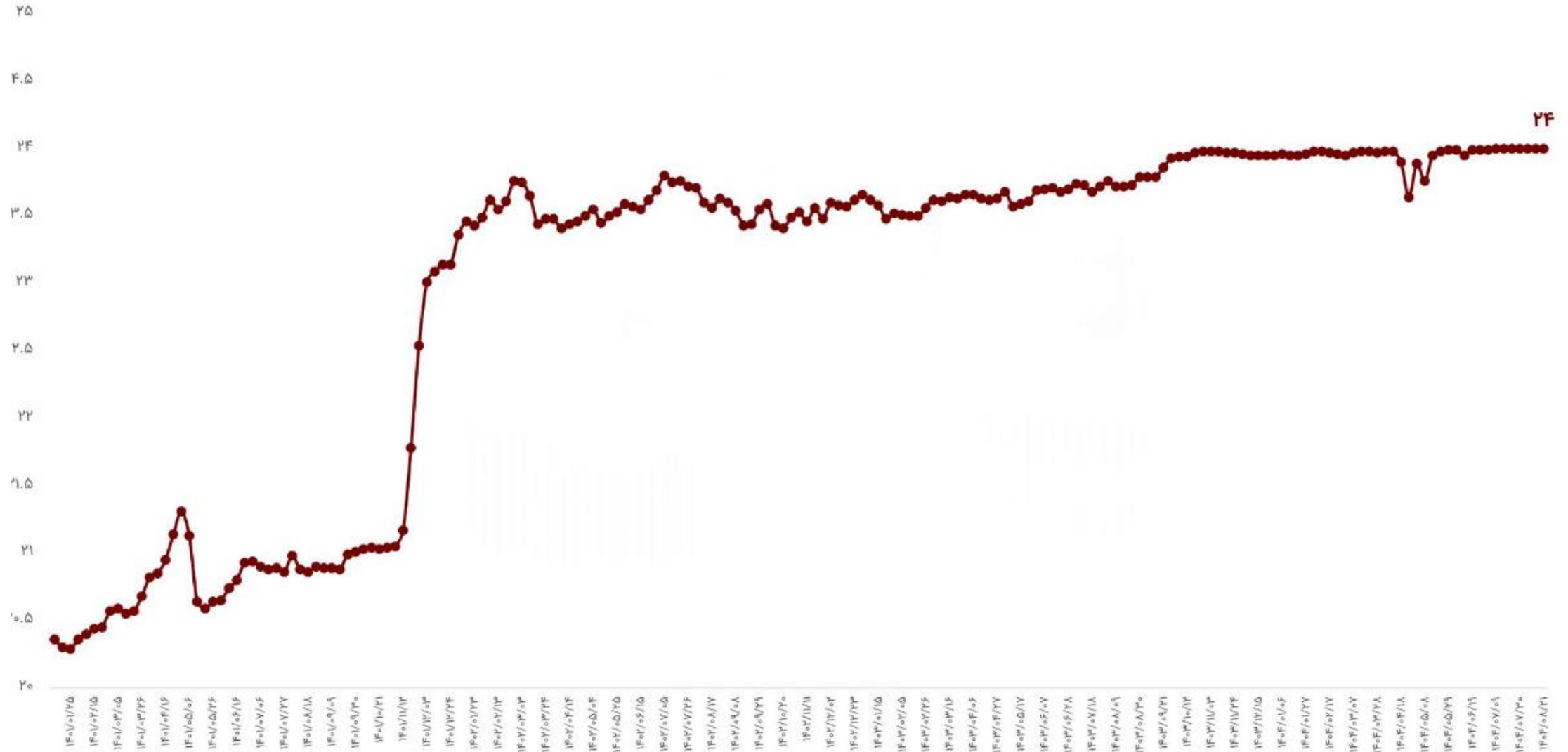


خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته چهارم آبان ماه ۱۴۰۴ با افزایش، به نرخ ۲۴ رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	نوش پونه مشهد	غپونه	۱۷.۶%
۲	سیمان غرب آسیا	سجام	۱۶.۱%
۳	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا	۱۵.۸%
۴	داروسازی کوثر	دکوثر	۱۵.۶%
۵	کشت و صنعت و دامپروری پگاه فارس	زفارس	۱۵.۶%

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	تامین مسکن جوانان	ثجوان	(۱۵.۸%)
۲	شکر شاهرود	قشکر	(۱۴.۶%)
۳	رینگ سازی مشهد	خرینگ	(۱۳.۷%)
۴	بهمن لیزینگ	ولبهمن	(۱۳.۴%)
۵	سر.سایپا	وساپا	(۱۳.۲%)

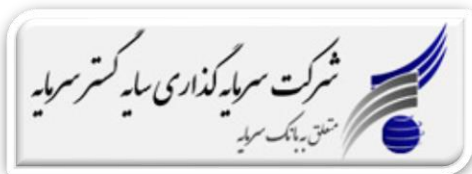
نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	منسوجات	۲.۸%
۲	سیمان آهک گچ	۰.۹%

صنایع با بیشترین بازدهی

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	خودرو و قطعات	(۵.۶%)
۲	واسطه‌گریهای مالی و پولی	(۵.۶%)
۳	شیمیایی	(۵%)
۴	بانکها و موسسات اعتباری	(۴.۳%)
۵	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	(۳.۴%)

صنایع با کمترین بازدهی



ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
وپارس	۲,۷۵۶	۱
وبملت	۱,۱۹۰	۱.۵
حآفرین	۱,۴۸۶	۱.۷
ولسپا	۶۰۹	۲
کوثر	۱,۸۴۹	۲.۲
نوبین	۱,۹۷۶	۲.۲
شساخت	۷,۹۲۰	۲.۴
ثبهساز	۲,۲۸۰	۲.۵
البرز	۲,۳۳۶	۲.۵
ثامید	۱,۷۶۶	۲.۶

نمادهای با کمترین P/E

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	بانکها و موسسات اعتباری	۸,۱۴۷
۲	فلزات اساسی	۷,۱۳۶
۳	شیمیایی	۶,۶۲۳
۴	خودرو و قطعات	۵,۲۸۲
۵	فرآورده‌های نفتی	۴,۸۷۰

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	چاپ	۶
۲	محصولات کاغذی	۶۸
۳	استخراج زغال سنگ	۷۰
۴	پیمانکاری صنعتی	۱۴۹
۵	خرده فروشی	۱۷۳

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

تغییرات قیمتی بازارهای موازی و کامودیتی ها

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۰۷۶	۳,۹۹۸	۲%	۴,۲۱۰	(۳.۲%)
سکه امامی (ریال)	۱,۱۹۵,۰۵۰,۰۰۰	۱,۱۱۴,۱۰۰,۰۰۰	۷.۳%	۱,۱۲۲,۹۰۰,۰۰۰	۶.۴%
دلار آزاد (ریال)	۱,۱۲۱,۰۰۰	۱,۰۷۹,۵۰۰	۳.۸%	۱,۰۸۶,۵۰۰	۳.۲%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۶۴.۲	۶۳.۶	۱%	۶۲.۴	۲.۹%
بیت کوین (دلار)	۹۵,۱۰۴	۱۰۳,۱۲۸	(۷.۸%)	۱۱۱,۴۶۳	(۱۴.۷%)
آلومینیوم LME (دلار)	۲,۸۶۰	۲,۸۵۷	۰.۱%	۲,۷۴۷	۴.۱%
مس LME (دلار)	۱۰,۸۳۵	۱۰,۶۹۶	۱.۳%	۱۰,۶۲۰	۲%
روی LME (دلار)	۳,۰۱۹	۳,۰۶۷	(۱.۶%)	۲,۹۴۲	۲.۶%
سرب LME (دلار)	۲,۰۷۰	۲,۰۵۲	۰.۸%	۱,۹۸۷	۴.۲%
انس پلاتین (دلار)	۱,۵۵۹	۱,۵۵۰	۰.۶%	۱,۶۹۵	(۸%)
اوره فوب خاورمیانه (دلار)	۴۰۸	۳۹۷	۲.۸%	۳۹۳	۳.۸%



تحلیل تکنیکال روزانه شاخص کل

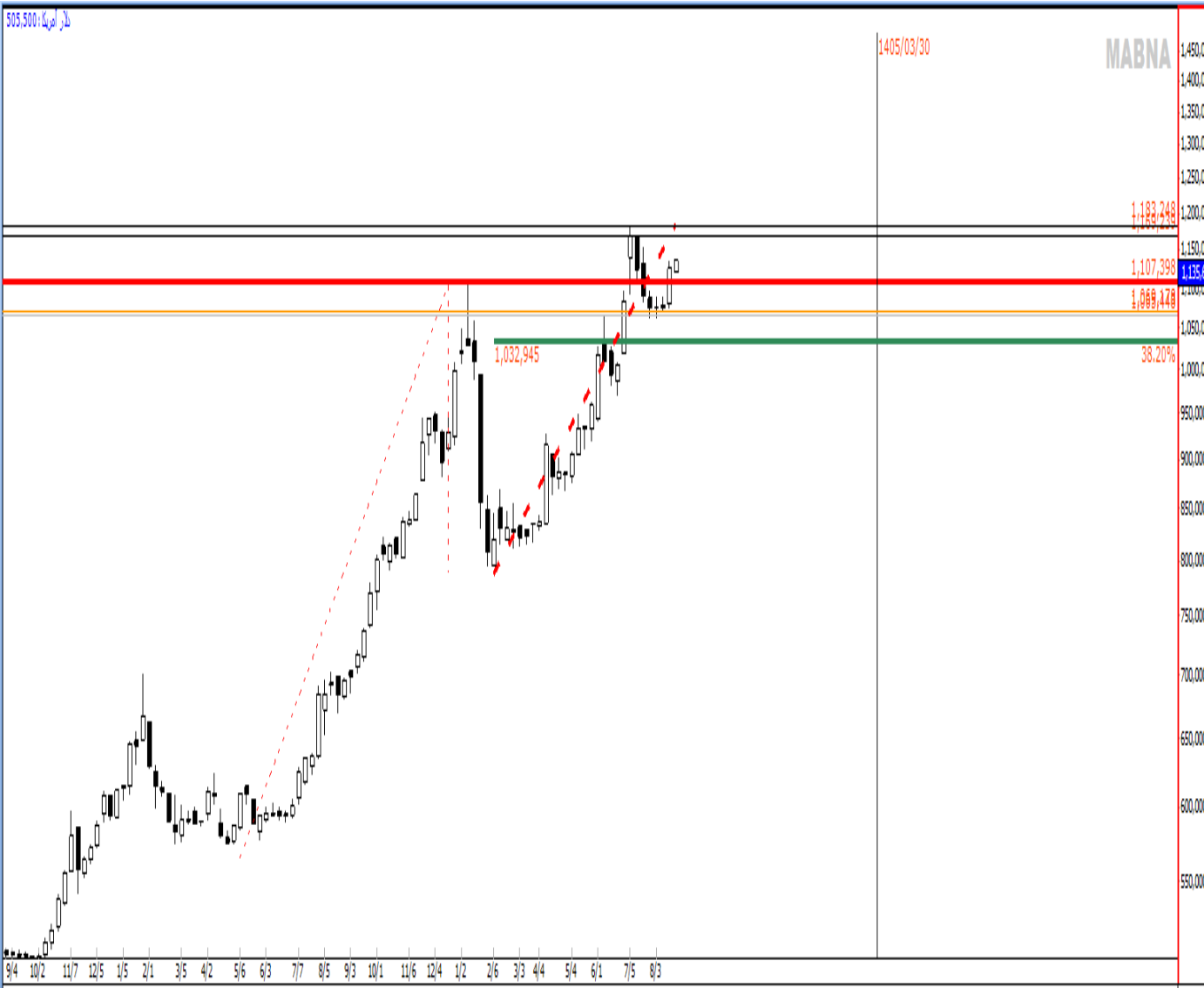
شاخص کل

در حال حاضر در محدوده ۳,۱۰۵,۳۶۴ واحد قرار دارد. اولین مقاومت کوتاه مدت پیشرو: محدوده ۳,۱۷۰,۰۰۰ واحد قرار دارد. اولین حمایت هفته جاری: محدوده ۳,۰۵۰,۰۰۰ واحد می باشد. در صورت شکست حمایت، احتمال اصلاح تا ۲,۹۰۰,۰۰۰ واحد وجود دارد. در صورت عبور از مقاومت ۳,۲۷۰,۰۰۰ میلیون واحد، امکان رشد شاخص تا ۳,۵۰۰,۰۰۰ واحد در گام بعدی وجود دارد.

با توجه به آرامش در فضای سیاسی فعلی و حمایت بسیار کم حقوقی‌ها، شاخص کل در مسیر صعود قرار گرفته است و انتظار می‌رود بازار طی هفته پیش‌رو اعداد بالاتری را لمس کند.



تحلیل تکنیکال هفتگی دلار آزاد



دلار

در حال حاضر، نرخ دلار در بازار آزاد در محدوده ۱,۱۳۴,۰۰۰ ریال قرار دارد. بررسی‌های تکنیکال نشان می‌دهد که مهم‌ترین سطح حمایتی پیش‌رو در محدوده ۱,۱۰۰,۰۰۰ ریال واقع شده است. در صورتی که این سطح حیاتی شکسته شود، احتمال افت قیمت تا محدوده ۱,۰۶۰,۰۰۰ ریال وجود دارد. با این حال، با توجه به شرایط فعلی اقتصادی، پایداری قیمت در این سطوح پایین بعید به نظر می‌رسد. از سوی دیگر، نخستین مقاومت جدی در مسیر صعودی دلار، سطح ۱,۱۵۰,۰۰۰ ریال خواهد بود. در صورت عبور از این مقاومت، هدف بعدی قیمت می‌تواند محدوده ۱,۲۰۰,۰۰۰ ریال باشد که از نظر روانی نیز سطحی مهم تلقی می‌شود. عوامل مؤثر بر روند بازار با توجه به فضای سیاسی و اقتصادی مبهم، انتظار می‌رود دلار در کوتاه‌مدت با فشار خرید مواجه شده و در مسیر صعودی قرار گیرد. این شرایط می‌تواند نوسانات قیمتی را افزایش دهد و فرصت‌هایی برای معامله‌گران ایجاد کند. محدوده کم‌ریسک برای ورود: بر اساس تحلیل‌های انجام‌شده، بازه قیمتی ۱,۰۸۰,۰۰۰ تا ۱,۱۰۰,۰۰۰ ریال به‌عنوان ناحیه‌ای با ریسک پایین برای ورود به بازار ارز در نظر گرفته می‌شود. در همین راستا، انتظار می‌رود در هفته جاری شاهد اصلاح قیمتی دلار تا سطوح یادشده باشیم.

تحلیل تکنیکال هفتگی طلا ۱۸ عیار

طلا ۱۸ عیار

وضعیت فعلی بازار: طلای داخلی در حال حاضر با قیمت ۱۱۲,۶۴۵,۰۰۰ ریال معامله می‌شود. مطابق انتظار تحلیل هفته گذشته، بازار شاهد رشد قیمتی بود و انتظار می‌رود در هفته پیش رو اصلاح جزئی را تجربه نماید. روند فعلی نشان‌دهنده آغاز مجدد حرکت صعودی قیمت است. سطوح حمایتی و مقاومتی: حمایت اول: در صورت اصلاح قیمت، اولین سطح حمایتی ۱۱۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال خواهد بود. حمایت مهم‌تر: محدوده ۱۰۵,۰۰۰,۰۰۰ ریال به عنوان حمایت کلیدی برای معاملات کوتاه‌مدت در نظر گرفته می‌شود. **مقاومت کوتاه‌مدت:** طلا با مقاومت ۱۱۵,۰۰۰,۰۰۰ ریال مواجه است و در صورت عبور از این سطح، هدف بعدی ۱۱۸,۰۰۰,۰۰۰ ریال در هر گرم خواهد بود. **چشم‌انداز کلی بازار:** بر اساس تحلیل نموداری، انتظار می‌رود که بازار داخلی طلا همچنان در یک بازه صعودی قیمتی حرکت کند. **در افق بلندمدت**، با توجه به شرایط اقتصادی داخلی و احتمال تشدید تحریم‌ها، روند بازار صعودی ارزیابی می‌شود. بنابراین، هر کاهش قیمت در بازار طلا به عنوان فرصت ورود برای سرمایه‌گذاران در نظر گرفته خواهد شد. تحلیل فوق بر مبنای داده‌های فعلی بازار و شرایط اقتصادی تنظیم و پیشنهاد می‌شود.



تحلیل تکنیکال روزانه سکه

سکه



در حال حاضر در محدوده ۱,۱۷۲,۰۵۰,۰۰۰ ریال قرار دارد، و همانطور که انتظار داشتیم قیمت در هفته گذشته بازاری با دامنه محدود و رنج مثبت قیمتی را تجربه نمود و انتظار میرود در هفته پیش رو یک اصلاح کوچک تا قیمت ۱,۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال انجام دهد و مجدداً به مدار صعود با هدف ۱,۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال برگردد و مدتی در این کانال رنج به بازی ادامه دهد، شایان ذکر است اولین مقاومت در راه رشد و رها شدن در این کانال قیمتی در محدوده ۱,۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال خواهد بود. همچنین محدوده ۱,۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال واحد به عنوان حمایت مهم پیش رو در معاملات کوتاه مدت خواهد بود. لذا چنانچه در این قیمت ها خرید انجام گردد حتماً باید به حد ضرر ۱,۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال پایبند بود.