

## وضعیت بازار سرمایه در هفته منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۲۷

در روز چهارشنبه ارزش معاملات خرد بالغ بر ۲ هزار و ۴۴۰ میلیارد تومان بود که نسبت به معاملات روز دوشنبه ۱۰ درصد افزایش داشت. پرمعامله ترین گروه های بازار به ترتیب استخراج کانه های فلزی، فلزات اساسی، خودرو و قطعه ساز، محصولات شیمیایی و فرآورده های نفتی بودند. از بین سهم ها فرز، تجلی، فملی، فولاد، اتکای، خودرو، ومعدن، شتران، حفارس و سپید صدرنشین ارزش معاملات شدند. از لحاظ حجمی اما تجلی، خاورخ، خودرو، خساپا، کراز، خاور، خپارس، کرمان، فرز و کیسون نیز در صدر بودند.

تراز نقدینگی حقیقی در بازار منفی ۳۳۶ میلیارد تومان بود. حقیقی ها بیشتر در نمادهای فملی، اتکای، فرز، شتران، شبندر، سمگا، فولاد، خودرو، واحیا و شپنا خروج زدند. اما در نمادهای تجلی، سپید، سیمرغ، شرنکی، تاپیکو، ددام، وتوصا، کلر، تنوین و ذوب شاهد ورود سرمایه های خرد بودیم. تراز نقدینگی حقیقی ها در صندوق های با درآمد ثابت مثبت ۳۴ میلیارد تومان شد. در ابتدای بازار، ارزش صفوف خرید بیش از فروش بود اما در انتها این رابطه معکوس شد. ارزش ابتدایی صفوف خرید حدود ۵۵۰ میلیارد تومان و فروش نزدیک به ۱۷۰ میلیارد تومان. در پایان ارزش صفوف خرید به ۲۰۰ میلیارد تومان و فروش به ۲۴۵ میلیارد تومان تغییر یافت.

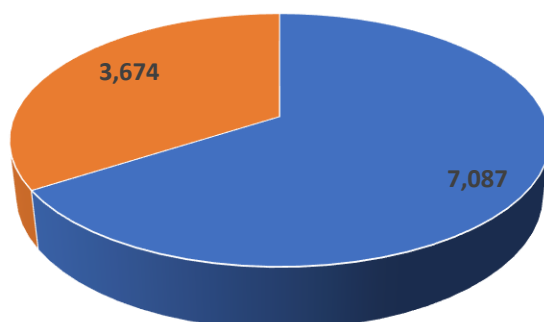
برآیند معاملات روز چهارشنبه بازار به کاهش ۸۴۵ واحدی شاخص کل منتهی شد. بدین ترتیب شاخص با هفت صدم درصد اصلاح در ارتفاع ۱ میلیون و ۲۸۲ هزار واحد قرار گرفت. نمادهای شتران، خودرو، شپنا، شبندر و تجارت بیشترین اثر منفی و ومعدن و نوری بیشترین تاثیر مثبت را داشتند. شاخص هموزن نیز با ۲۱۸ واحد کاهش در همان محدوده روز گذشته یعنی ۳۲۵ هزار واحد ایستاد. شاخص فرابورس نیز تنها یک واحد منفی خورد.

| وضعیت بازار در بهمن ماه- کلیه مبالغ به میلیارد تومان است |             |               |                  |              |              |                            |           |            |
|----------------------------------------------------------|-------------|---------------|------------------|--------------|--------------|----------------------------|-----------|------------|
| روز                                                      | اوراق دولتی | ارزش کل بازار | ارزش معاملات خرد | سهم حقیقی ها | سهم حقوقی ها | برآیند ورود و خروج پول خرد | شاخص کل   | شاخص هموزن |
| ۲ بهمن                                                   | ۱,۷۳۰       | ۵,۵۲۷         | ۲,۵۰۰            | ۴۵%          | ۵۵%          | -۲۷۲                       | ۱,۲۸۱,۸۰۳ | ۳۳۴,۱۹۳    |
| ۳ بهمن                                                   | ۳,۷۶۰       | ۵,۳۶۷         | ۲,۹۶۰            | ۵۵%          | ۴۵%          | -۷۸۷                       | ۱,۲۵۶,۵۴۷ | ۳۲۸,۲۴۴    |
| ۴ بهمن                                                   | ۱۵۵,۶۴۲     | ۵,۳۷۰         | ۲,۲۴۰            | ۴۲%          | ۵۸%          | -۴۱۵                       | ۱,۲۳۴,۶۸۸ | ۳۲۳,۹۷۳    |
| ۵ بهمن                                                   | ۵۰۳         | ۶,۴۸۳         | ۳,۵۰۰            | ۵۴%          | ۴۶%          | -۱,۱۲۷                     | ۱,۲۰۸,۰۴۸ | ۳۱۷,۰۶۶    |
| ۶ بهمن                                                   | ۳۸۵         | ۵,۲۱۹         | ۲,۸۳۰            | ۵۴%          | ۴۶%          | -۸۲                        | ۱,۲۲۹,۴۲۲ | ۳۱۸,۷۵۸    |
| ۹ بهمن                                                   | ۱,۷۱۶       | ۵,۵۳۲         | ۲,۲۷۰            | ۴۱%          | ۵۹%          | ۱۱۴                        | ۱,۲۵۸,۹۶۲ | ۳۲۵,۱۳۴    |
| ۱۰ بهمن                                                  | ۹۴۵         | ۵,۵۴۷         | ۳,۴۰۰            | ۶۱%          | ۳۹%          | -۱۷۷                       | ۱,۲۸۴,۵۷۴ | ۳۲۷,۷۵۵    |
| ۱۱ بهمن                                                  | ۱۵۳,۹۶۸     | ۵,۹۷۴         | ۳,۳۰۰            | ۵۵%          | ۴۵%          | -۲۱۸                       | ۱,۲۹۴,۶۶۹ | ۳۳۰,۷۲۶    |
| ۱۲ بهمن                                                  | ۲۲۲         | ۶,۹۳۰         | ۳,۵۰۰            | ۵۱%          | ۴۹%          | -۳۴۴                       | ۱,۳۰۱,۲۹۷ | ۳۳۳,۲۸۴    |
| ۱۳ بهمن                                                  | ۲,۹۵۴       | ۵,۹۷۵         | ۳,۰۳۰            | ۵۱%          | ۴۹%          | -۴۵۵                       | ۱,۳۰۱,۱۹۵ | ۳۳۳,۰۱۸    |
| ۱۶ بهمن                                                  | ۶,۲۳۴       | ۶,۳۶۵         | ۲,۹۰۰            | ۴۶%          | ۵۴%          | -۳۴۰                       | ۱,۳۰۴,۴۲۰ | ۳۳۲,۷۰۹    |
| ۱۷ بهمن                                                  | ۵,۱۹۱       | ۶,۵۴۷         | ۳,۹۰۰            | ۶۰%          | ۴۰%          | -۱,۴۰۰                     | ۱,۲۸۲,۰۳۴ | ۳۲۶,۵۰۰    |
| ۱۸ بهمن                                                  | ۱۵۷,۵۹۳     | ۵,۱۳۸         | ۲,۶۲۰            | ۵۱%          | ۴۹%          | -۴۲۰                       | ۱,۲۷۴,۴۸۸ | ۳۲۳,۹۸۴    |
| ۱۹ بهمن                                                  | ۲,۵۲۴       | ۶,۱۵۷         | ۲,۸۰۰            | ۴۵%          | ۵۵%          | -۴۵                        | ۱,۲۸۱,۱۶۹ | ۳۲۵,۶۲۱    |
| ۲۰ بهمن                                                  | ۶۳۷         | ۵,۴۲۹         | ۲,۷۰۰            | ۵۰%          | ۵۰%          | -۳۱۴                       | ۱,۲۸۴,۱۲۰ | ۳۲۶,۲۴۴    |
| ۲۳ بهمن                                                  | ۶,۷۳۳       | ۷,۲۵۸         | ۲,۹۰۰            | ۴۰%          | ۶۰%          | -۲۶۵                       | ۱,۲۸۴,۱۰۷ | ۳۲۶,۲۹۱    |
| ۲۴ بهمن                                                  | ۷۴۳         | ۵,۲۱۱         | ۲,۴۰۰            | ۴۶%          | ۵۴%          | -۳۴۵                       | ۱,۲۷۶,۰۴۳ | ۳۲۴,۸۶۷    |
| ۲۵ بهمن                                                  | ۱۴۸,۰۸۱     | ۱۵,۷۷۹        | ۲,۲۰۰            | ۱۴%          | ۸۶%          | -۱۶۲                       | ۱,۲۸۳,۳۵۷ | ۳۲۵,۵۰۰    |
| ۲۷ بهمن                                                  | ۶۴۳         | ۸,۴۶۲         | ۲,۴۴۰            | ۲۹%          | ۷۱%          | -۳۳۶                       | ۱,۲۸۲,۴۷۵ | ۳۲۵,۲۸۳    |
| مجموع                                                    | ۶۵۰,۲۰۴     | ۱۲۴,۲۷۰       | ۵۴,۳۹۰           | ۴۴%          | ۵۶%          | -۷,۳۹۰                     | ۰.۲%      | -۲.۱%      |

| آمار معاملات                                                               |       |
|----------------------------------------------------------------------------|-------|
| ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (با در نظر گرفتن اوراق، صندوق‌ها و بلوک‌ها) | ۴,۹۲۷ |
| ارزش معاملات خرد بورس                                                      | ۱,۵۴۲ |
| ارزش معاملات خرد فرابورس                                                   | ۱,۰۵۱ |
| ارزش کل معاملات خرد (بدون بلوک‌ها، اوراق مشارکت و صندوق با درآمد ثابت)     | ۲,۵۹۳ |
| ارزش کل معاملات معاملات بلوکی، اوراق و صندوق‌های درآمد ثابت                | ۲,۳۳۴ |
| درصد تغییرات در ارزش معاملات نسبت به روز گذشته                             |       |
| ارزش معاملات خرد روز کاری گذشته                                            | ۲,۴۳۳ |
| درصد تغییرات                                                               | ۷٪    |
| سهم بازار از ارزش معاملات ۴ نماد برتر                                      |       |
| فزر - تجلی - پالایش - فملی                                                 | ۵۶۹   |
| سهم ۴ نماد برتر از کل ارزش معاملات                                         | ۲۲٪   |
| (ورود/خروج) نقدینگی (میلیارد تومان)                                        | (۳۳۶) |

| خلاصه اتفاقات بازار (شاخص‌ها) |                                                                                                          |                                    |                      |                      |
|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|----------------------|----------------------|
| آخرین وضعیت شاخص‌ها           | پایان معاملات روز قبل                                                                                    | پایان معاملات امروز                | میزان تغییرات (واحد) | میزان تغییرات (درصد) |
| شاخص کل                       | ۱,۲۸۳,۳۲۴                                                                                                | ۱,۲۸۲,۴۷۸                          | ۸۴۶                  | -۰.۰۷٪               |
| شاخص هم‌وزن                   | ۳۲۵,۵۰۲                                                                                                  | ۳۲۵,۲۸۳                            | ۲۱۹                  | -۰.۰۷٪               |
| شاخص فرابورس                  | ۱۷,۵۲۹                                                                                                   | ۱۷,۵۲۸                             | ۱                    | -۰.۰۱٪               |
| نمادهای تاثیرگذار             |                                                                                                          |                                    |                      |                      |
| نمادهای موثر در رشد TEPIX     | ومعادن - نوری                                                                                            | نمادهای موثر در رشد IFX            | تجلی - فزر           |                      |
| نمادهای موثر در افت TEPIX     | شتران - خودرو - شپنا                                                                                     | نمادهای موثر در افت IFX            | شرانل - فرابورس      |                      |
| شاخص صنایع مثبت               | زراعت - کانه فلزی - قند و شکر - داروسازی - کانی غیرفلزی                                                  |                                    |                      |                      |
| شاخص صنایع منفی               | زغالسنگ - فرآورده‌های نفتی - دستگاه‌های برقی - خودروسازی - کاشی و سرامیک - لیزینگ - انبوه‌سازی - استخراج |                                    |                      |                      |
| روند شاخص                     | از ابتدا تا ساعت ۹:۳۰ صعودی / از ۹:۳۰ تا انتهای ساعت معاملات نزولی                                       |                                    |                      |                      |
| بازار P/E                     | ۷.۱۷                                                                                                     |                                    |                      |                      |
| بازار P/S                     | ۲.۲۹                                                                                                     |                                    |                      |                      |
| نرخ ارز                       | ۲۷,۱۰۰                                                                                                   | ارزش دلاری کل بازار (میلیارد دلار) | ۲۲۵                  |                      |

ارزش معاملات خرد بورس و فرابورس (میلیارد تومان)



ارزش معاملات خرد بورس    ارزش معاملات خرد فرابورس

برآیند ورود و خروج پول حقیقی در یک ماه اخیر (میلیارد تومان)



تغییرات بازارهای جهانی در هفته منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۲۹

| درصد تغییرات | تاریخ      |            | واحد       | نام محصول |
|--------------|------------|------------|------------|-----------|
|              | ۱۴۰۰/۱۱/۲۹ | ۱۴۰۰/۱۱/۲۳ |            |           |
| -۱,۵۷٪       | \$ ۹۳,۶۱   | \$ ۹۵,۱۰   | بشکه/دلار  | نفت برنت  |
| ۲,۱۰٪        | \$ ۱,۸۹۸   | \$ ۱,۸۵۹   | مئقال/دلار | طلا       |
| ۱,۹۲٪        | \$ ۲,۳۳۲   | \$ ۲,۲۸۸   | تن/دلار    | سرب       |
| -۱۲,۰۸٪      | \$ ۱۳۱     | \$ ۱۴۹     | تن/دلار    | سنگ آهن   |
| -۱,۹۳٪       | \$ ۳,۶۰۳   | \$ ۳,۶۷۴   | تن/دلار    | روی       |
| ۳,۴۵٪        | \$ ۲,۲۹۸   | \$ ۲,۱۸۸   | تن/دلار    | آلمینیوم  |
| -۰,۸۴٪       | \$ ۳۵۳     | \$ ۳۵۶     | تن/دلار    | متانول    |
| ۰,۴۰٪        | \$ ۹,۹۵۱   | \$ ۹,۹۱۱   | تن/دلار    | مس        |
| ۱,۶۵٪        | \$ ۶۷۸     | \$ ۶۶۷     | تن/دلار    | بیلت      |
| ۲,۶۴٪        | \$ ۶۲۱     | \$ ۶۰۵     | تن/دلار    | اوره      |