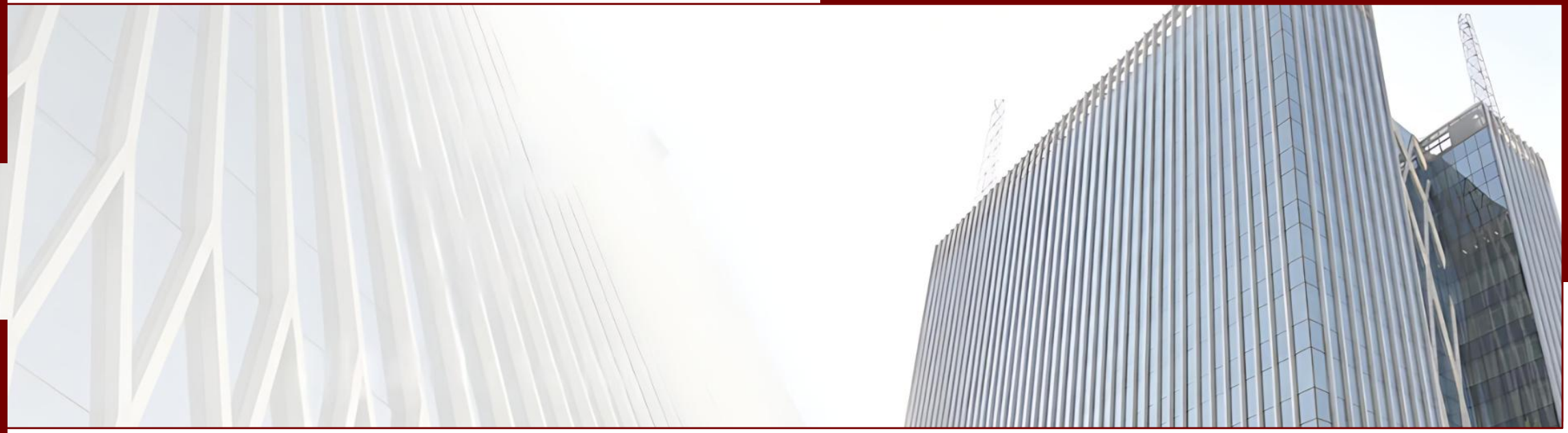


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۲۱ فروردین 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
- روند نرخ بهره بین بانکی ۱۵
- اوراق با درآمد ثابت ۱۶
- وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه ۱۷

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



قالیباف: آمریکا آماده توافق واقعی باشد ما هم آمادگی داریم

رئیس‌مجلس شورای اسلامی که سرپرستی هیات مذاکره‌کننده ایران در گفتگو با آمریکا را برعهده دارد، شامگاه جمعه در بدو ورود به اسلام‌آباد درباره مذاکرات روز شنبه با آمریکا گفت: «ما حسن نیت داریم، اما اعتماد نداریم.» آقای قالیباف افزود: «در مذاکرات پیش رو، اگر طرف آمریکایی آماده توافق واقعی و دادن حقوق ملت ایران باشند، از ما هم آمادگی برای توافق خواهند دید.» رئیس مجلس شورای اسلامی همچنین گفت: «اگر بخواهند از مذاکره برای اجرای یک نمایش بی حاصل و عملیات فریب استفاده کنند، ما آماده‌ایم تا حقوق خود را با ایمان به خدا و تکیه بر توان ملتمان محقق کنیم.»



ژاپن ذخایر نفتی بیشتری را آزاد می‌کند

ژاپن اعلام کرد که در ماه مه، در دومین مرحله از اقداماتش در راستای مقابله با بحران انرژی معادل ۲۰ روز دیگر از ذخایر نفتی خود را آزاد خواهد کرد. نخست‌وزیر ژاپن گفت آزادسازی برنامه‌ریزی‌شده ذخایر دولتی از اوایل ماه مه آغاز می‌شود؛ این اقدام پس از مرحله قبلی آزادسازی در ماه گذشته صورت می‌گیرد. ژاپن در ماه مارس نیز آزادسازی حدود ۵۰ روز ذخایر نفتی را آغاز کرده بود که شامل ذخایر متعلق به دولت، بخش خصوصی و کشورهای تولیدکننده نفت حوزه خلیج فارس می‌شد. بر اساس اعلام آژانس منابع طبیعی و انرژی، ژاپن تا تاریخ ۶ آوریل در مجموع معادل ۲۳۰ روز ذخایر نفتی در اختیار داشت که از این میزان، ۱۴۳ روز مربوط به ذخایر دولتی بود. نخست‌وزیر ژاپن گفت دولت او در حال تلاش برای تامین واردات نفت از مسیرهایی است که شامل تنگه هرمز نمی‌شود و همزمان ژاپن به دنبال متنوع‌سازی تامین‌کنندگان خود است.



مذاکرات ایران و آمریکا در اسلام‌آباد ابتدا غیرمستقیم و سپس مستقیم خواهد بود

به گزارش سی‌ان‌ان به نقل از یک مقام آمریکایی و یک منبع منطقه‌ای، مذاکرات روز شنبه ایران و آمریکا در اسلام‌آباد پاکستان قرار است هم به صورت غیرمستقیم و هم مستقیم برگزار شود. به گفته منبع منطقه‌ای، دو طرف احتمالا ابتدا از طریق میانجی‌های پاکستانی بر سر دستور کار مذاکرات توافق خواهند کرد و سپس انتظار می‌رود در ادامه روز وارد گفتگوهای رو در رو شوند.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



شروط واجب سازمان بورس برای بازگشایی بازار سهام و ۴ سناریو اعلام شد

رییس سازمان بورس اعلام کرد: بازار سهام در هفته‌ای که از ۲۲ فروردین آغاز می‌شود، همچنان تعطیل خواهد بود مگر این که جنگ پایان پیدا کند. شرایط بازگشایی معاملات سهام منوط به آن است که حداقل نیمی از بازار و شامل حدود ۶۰۰ شرکت امکان افشای اطلاعات را بدست آورند. شرکت‌های خسارت‌دیده به دو دسته شرکت‌های تابعه و اصلی تقسیم می‌شوند. باید اطلاعات شرکت‌های خسارت دیده در خصوص میزان کاهش تولید و زمان لازم برای بازسازی افشا شود. نکته مهم تداوم و ثبات شرایط برای بازگشایی بازار سهام است. چهار سناریو برای فعالیت بازار سرمایه شامل: نخست ادامه شرایط فعلی یعنی فقط معامله صندوق‌ها یا بازگشایی بازار با شرایط فعلی بدون افشا، دوم تشدید جنگ و احتمال توقف کلیه معاملات حتی در صندوق‌ها، سوم آتش بس با توافق کتبی و بازگشایی بازار و چهارم آتش بس بدون توافق و بازگشایی گام به گام است.

آمار فرابورس از تامین مالی ۱.۶ هزار میلیارد تومانی ۶ شرکت و ۲۳ طرح اعلام شد

معاون توسعه بازار شرکت فرابورس، اعلام کرد: از آغاز جنگ تحمیلی سوم تاکنون و از طریق انتشار اوراق مرابحه و سکوهای تأمین مالی جمعی بیش از ۱/۶ هزار میلیارد تومان تأمین مالی برای شرکت‌ها و طرح‌های اقتصادی انجام شده است. وی افزود: ۴ شرکت با انتشار اوراق مرابحه استاندارد ۹۵۰ میلیارد تومان و دو شرکت هم از طریق انتشار اوراق مرابحه کوچک و کوتاه‌مدت ۲۷۰ میلیارد تومان تأمین مالی کردند. همچنین ۲۳ طرح به ارزش ۴۷۶ میلیارد تومان از بستر سکوهای کرادفاندینگ فرابورس تامین مالی کردند. به گفته وی علاوه بر این یک صندوق سرمایه‌گذاری در سهام که قبلا از نوع صدور و ابطالی بود در بازار ابرازهای نوین مالی فرابورس، درج و پذیرش شد.



تغییر زمان معاملات صندوق های کالایی و ... بورس کالا از ۲۲ فروردین ماه

مدیریت بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی بورس کالا طی اطلاعیه‌ای از تغییر زمان معاملات بازارهای مالی این بورس خبر داد. معاملات بازار همه صندوق‌های کالایی، گواهی سپرده کالایی، اوراق سلف موازی استاندارد و قراردادهای اختیار معامله از شنبه ۲۲ فروردین از ساعت ۱۱:۴۵ تا ۱۵:۳۰ (۱۱:۴۵ تا ۱۲:۰۰ پیش گشایش) برگزار خواهد شد. با توجه به تعطیلی روز سه شنبه ۲۵ فروردین ماه جاری، تغییرات روزهای عرضه برخی از محصولات در هفته منتهی به ۲۶ فروردین، براساس جدول روبرو خواهد بود.

تاریخ	روز	صنعتی	پتروشیمی	فرآورده های نفتی
۱۴۰۵/۰۱/۲۴	دوشنبه	نخ‌تال ورق سرد و گالوانیزه	آف های پلی پروپیلن استایرن مونومر (مختص شرکتهای پلی استایرن) ارتوزایلین (مخصوص تولیدکنندگان انیدرید فتالیک)	کوکرد کلوخه
۱۴۰۵/۰۱/۲۶	چهارشنبه	سایر سیمان ها تیراهن ساختمانی، نبشی و ناودانی سیم و مفتول مسی مفتول و بیلت آلومینیوم شمشهای آلیاژی آلومینیوم مقاطع مسی و برنجی	LAB محصولات پلیمری آف گریدهای پلیمری (به غیر از پلی وینیل کلراید)	
عرضه مابقی محصولات، طبق روال عادی هر هفته صورت خواهد پذیرفت.				

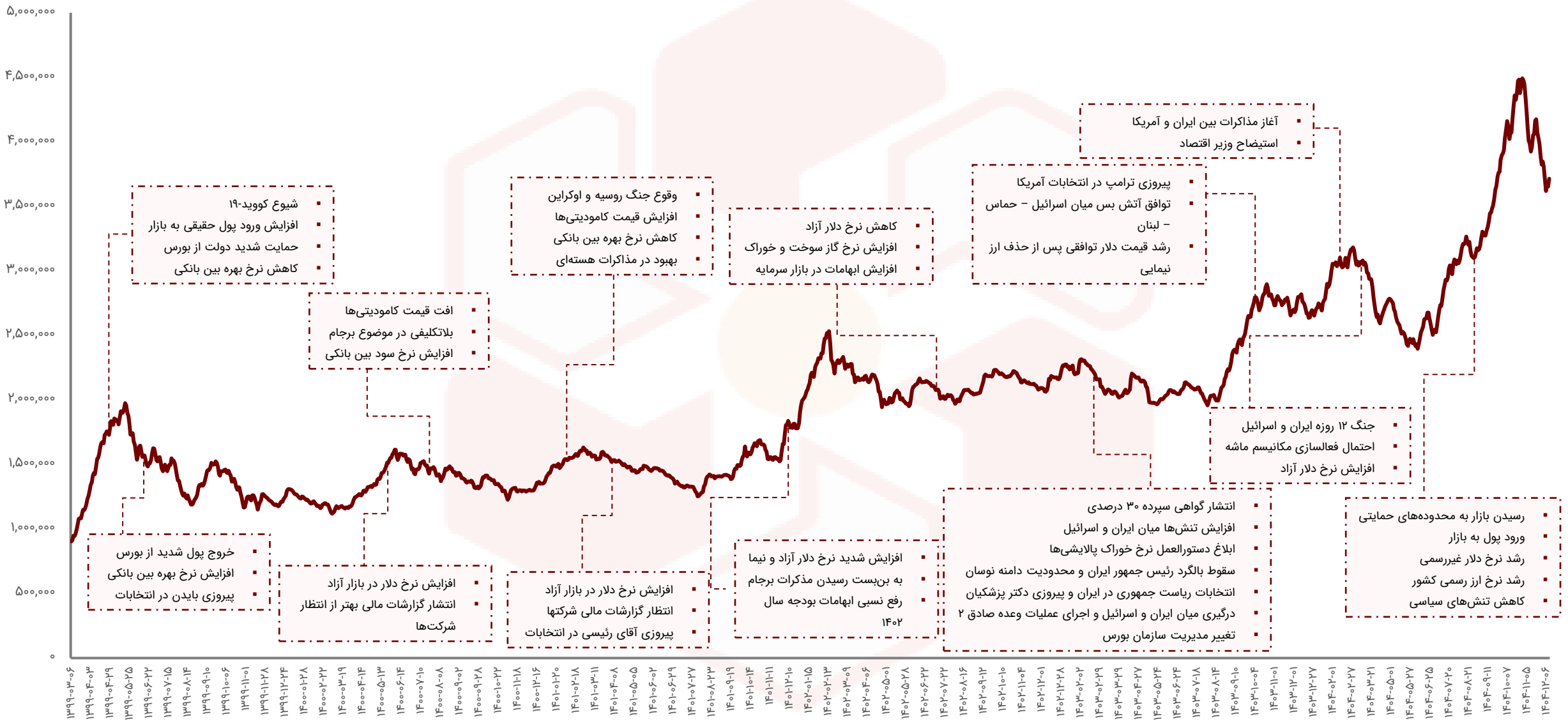
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته گذشته، شاهد تداوم جنگ بین ائتلاف آمریکایی/اسرائیلی و جمهوری اسلامی ایران تا روز سه شنبه بودیم و در بامداد چهارشنبه، آتش بسی دو هفته میان طرف‌های درگیری اعلام گردید؛ و تحت تأثیر همین امر، معاملات بازارهای سهام و حق تقدم و ابزارهای مرتبط با آن همچنان متوقف بود. این توقف معاملات تا پایان هفته پیش‌رو (مورخ ۱۴۰۵/۰۱/۲۷) تمدید شده است. از سوی دیگر، معاملات صندوق‌های درآمد ثابت، بازارهای کالایی و صندوق‌های مرتبط با آن ادامه داشت. در هفته اخیر، ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت به بیش از ۱۲۱ هزارمیلیارد تومان رسید و ورود پولی ۱,۵۴۶ میلیارد تومانی ثبت کردند. ارزش معاملات صندوق‌های مبتنی بر طلا و نقره نیز به بیش از ۴۱.۲ هزار میلیارد تومان رسید. در روز شنبه هفته‌پیش رو، اولین جلسه از مذاکرات صلح و پایان جنگ میان ایالات متحده آمریکا و جمهوری اسلامی در اسلام آباد پاکستان برگزار خواهد شد. هیئت آمریکایی به نمایندگی جی.دی.ونس و هیئت ایرانی به نمایندگی آقای قالیباف خواهد بود.

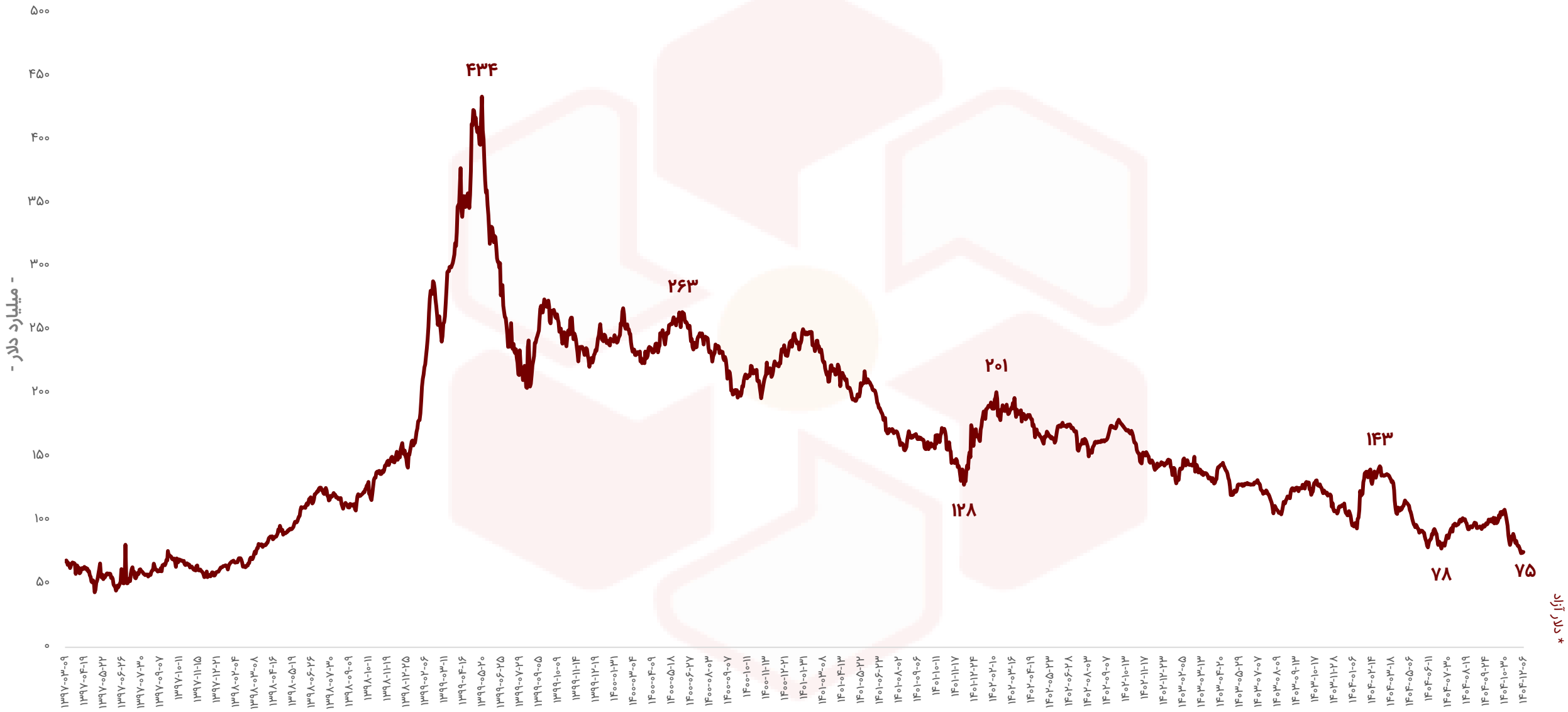
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	-	۳,۷۱۳,۹۵۵	-	-
شاخص هم وزن (واحد)	-	۹۵۲,۶۸۱	-	-
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)		۱۲۱,۵۸۶	-	-
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)		۱,۵۴۶	-	-

روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن

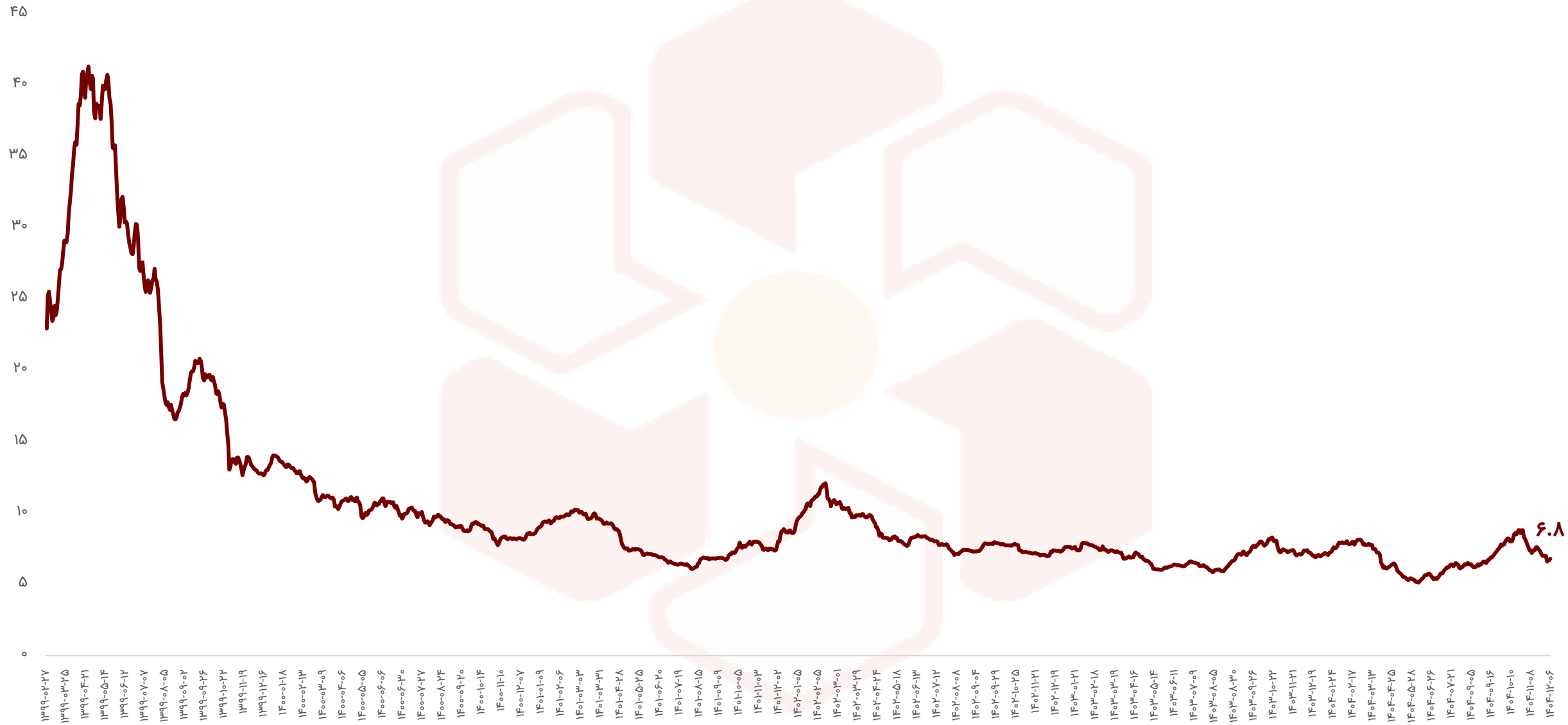


ارزش دلاری بازار*

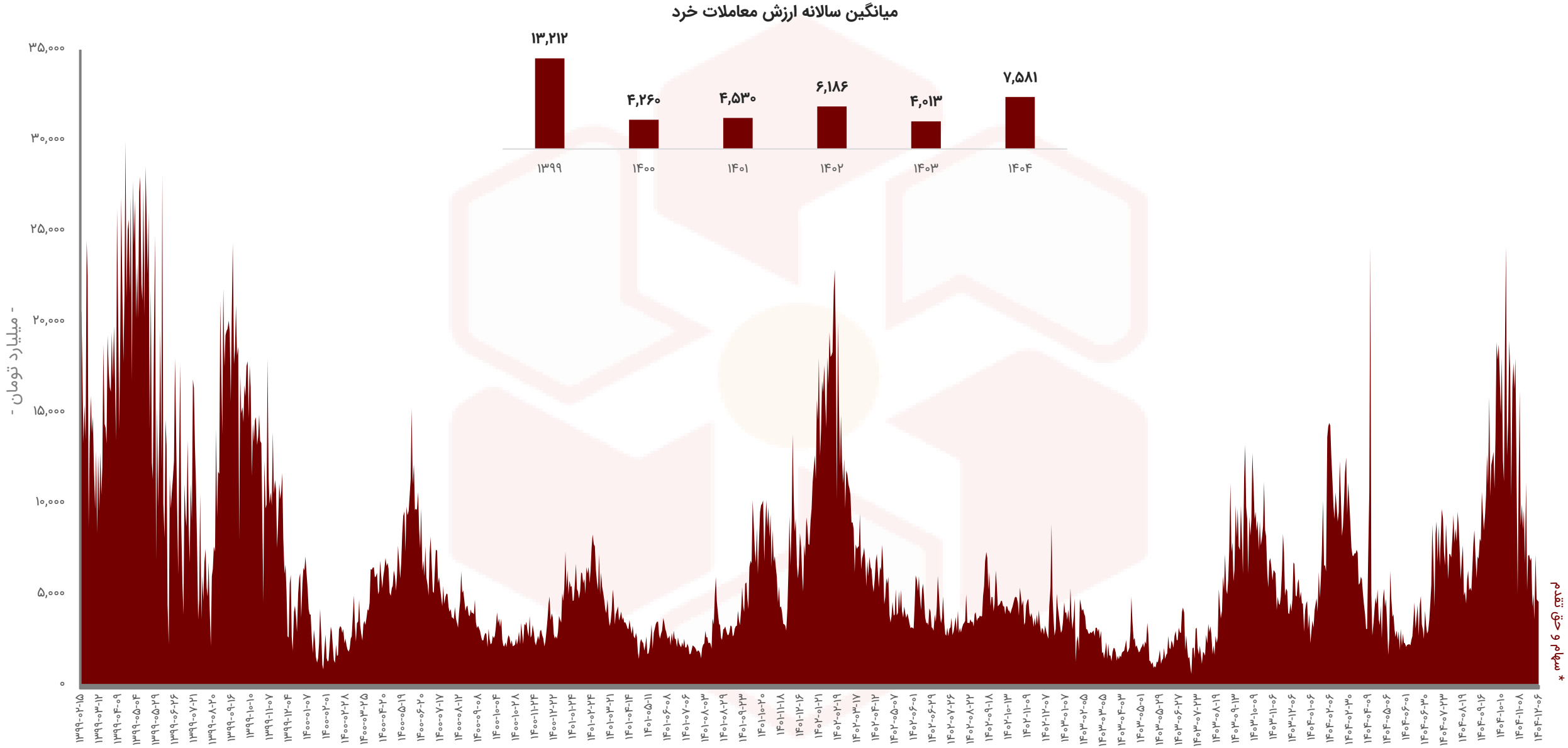


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

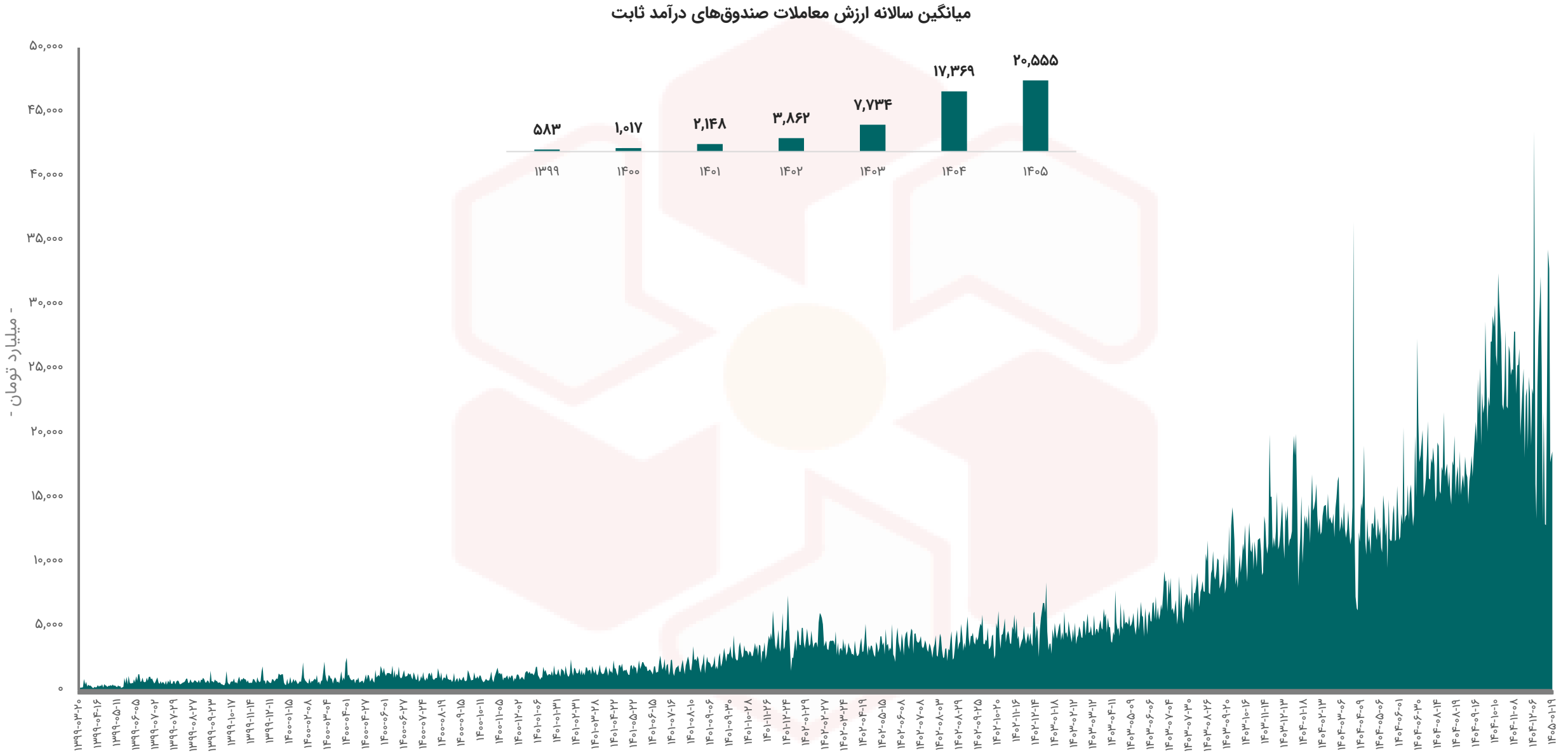
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



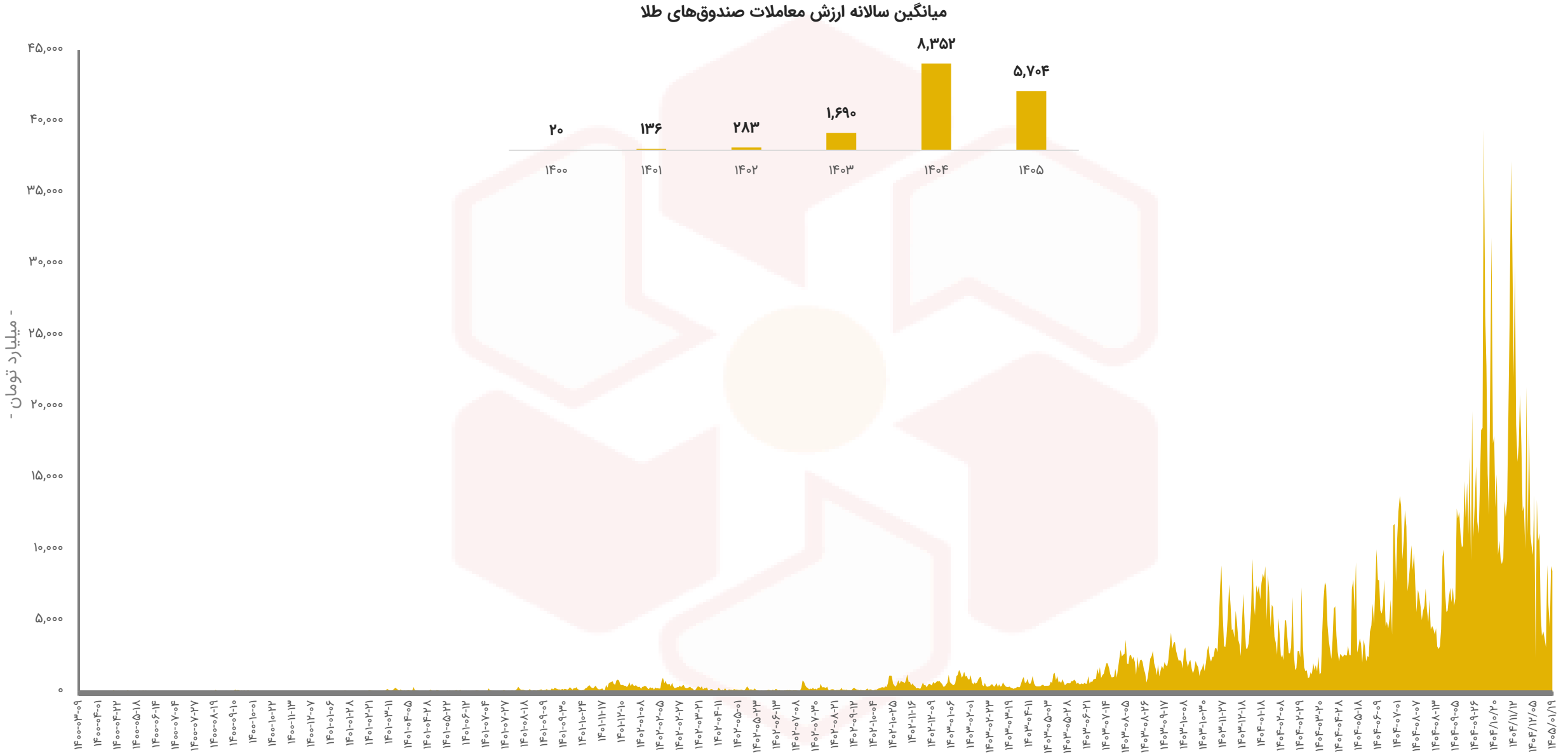
ارزش معاملات خرد سهام*



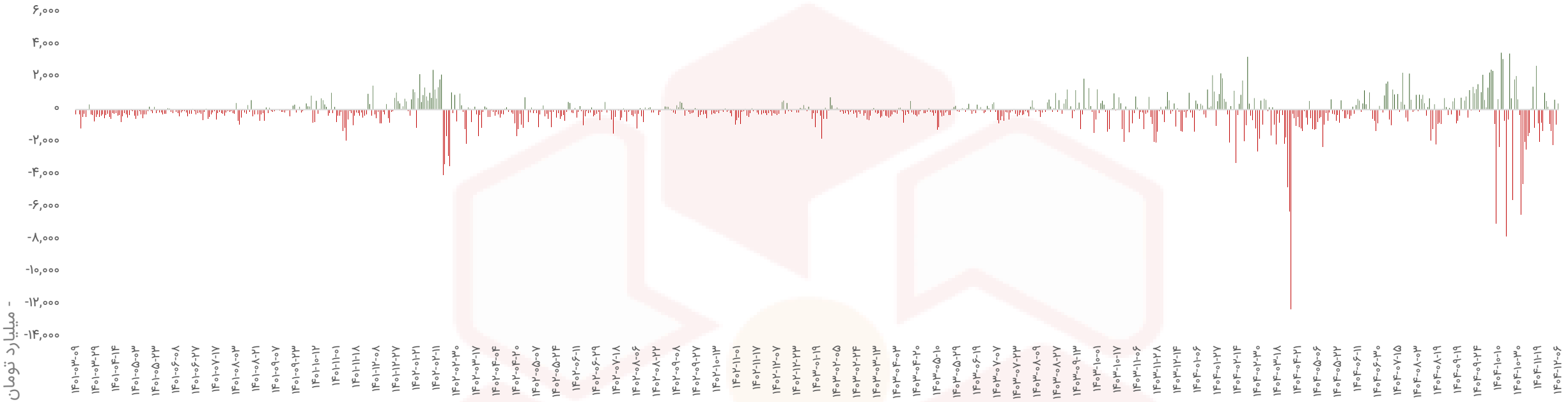
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



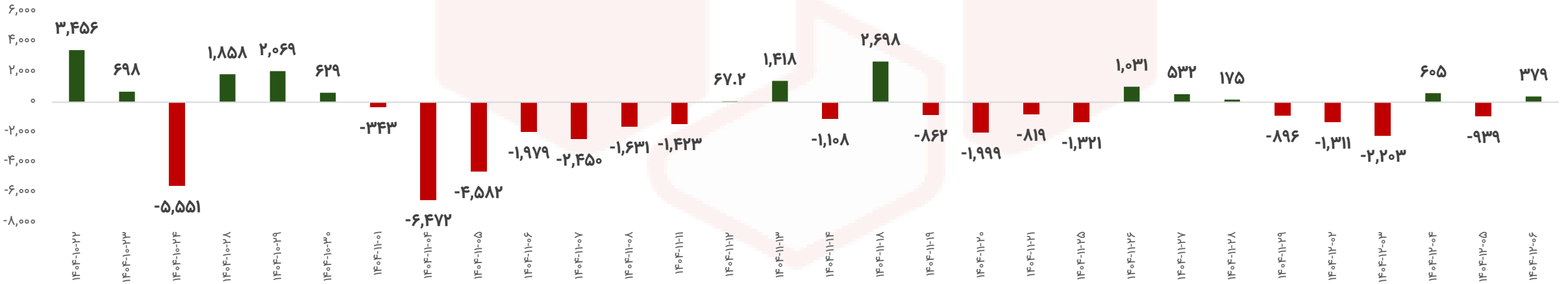
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



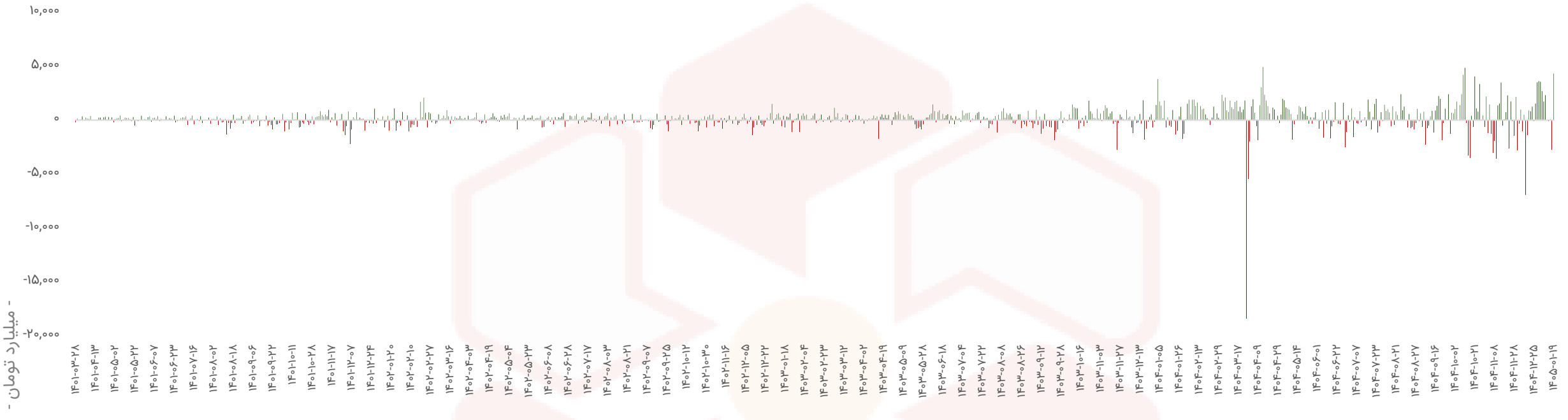
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



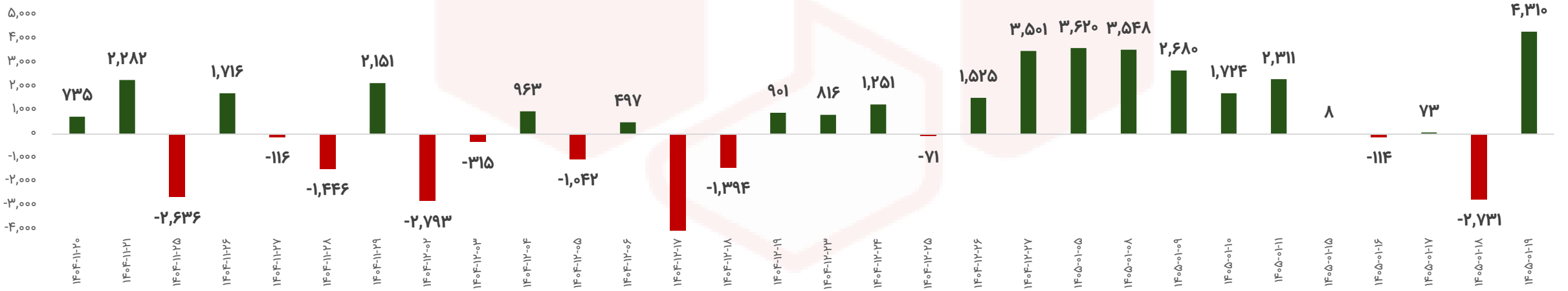
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



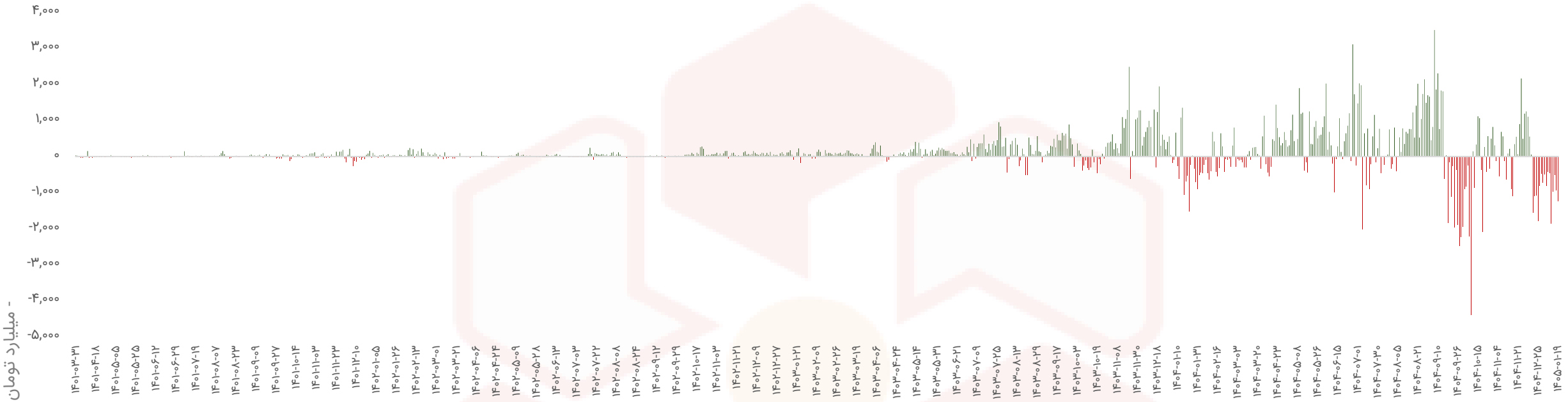
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



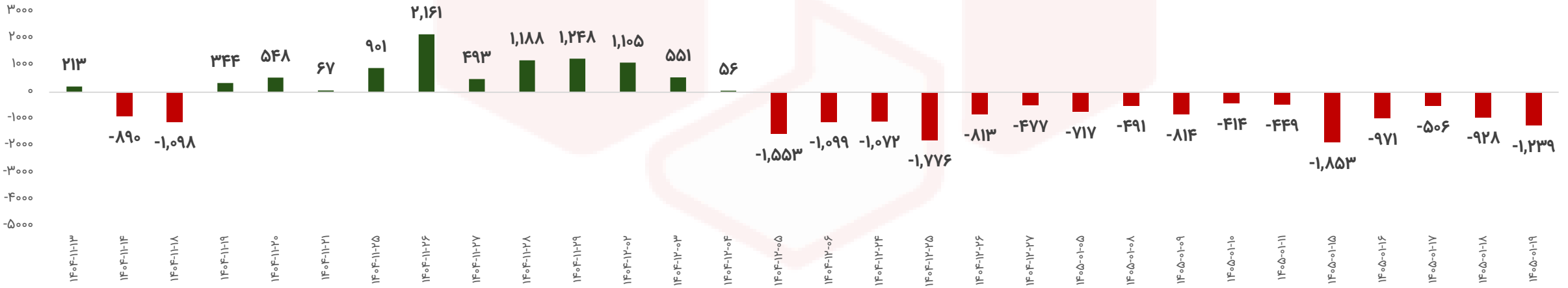
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



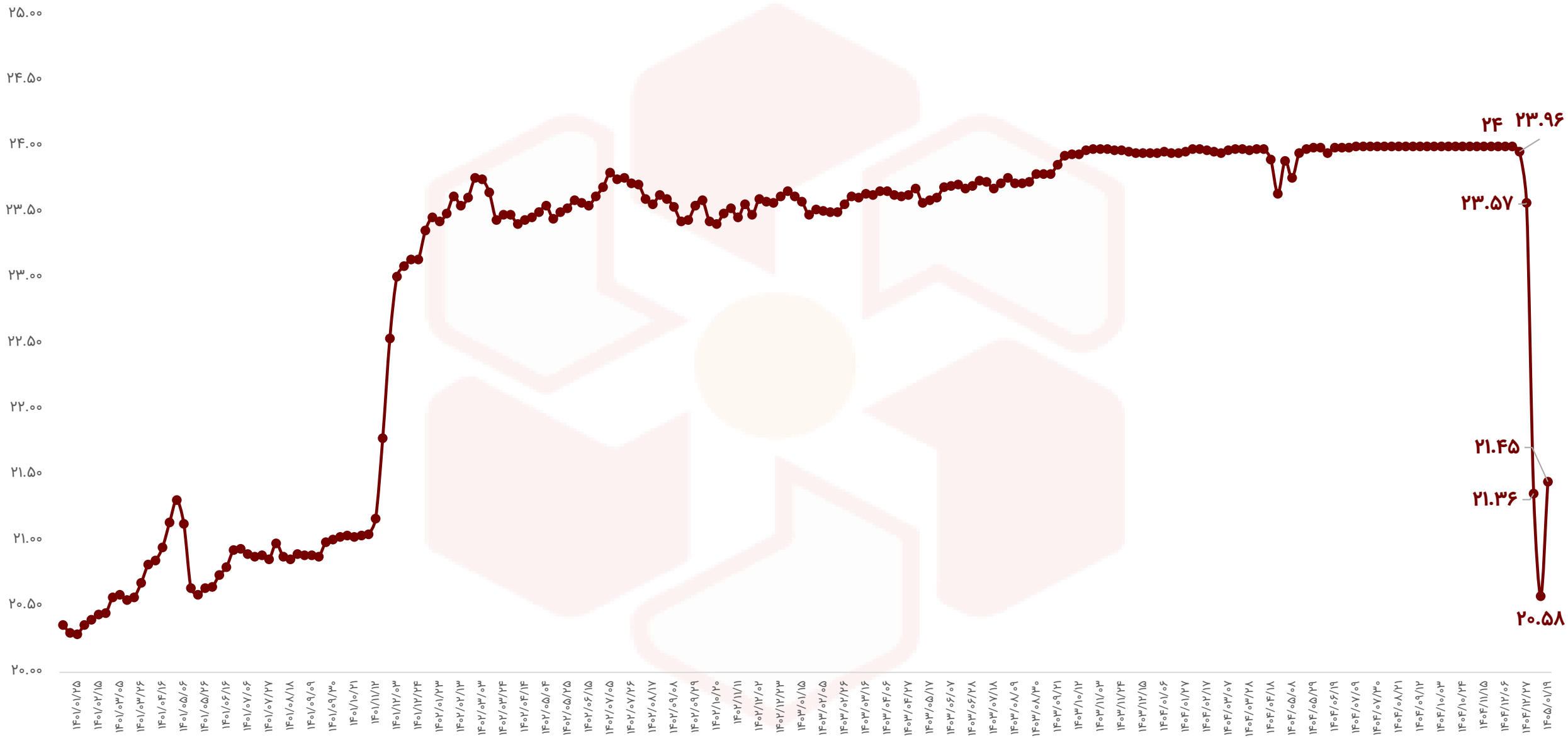
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا در ۳۰ روز کاری اخیر



خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۲۱۲	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۱,۰۰۰	۴۰.۴۹%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۹۴۰	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۵,۰۰۰	۳۹.۷۷%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۴۷	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۹۹,۵۱۰	۳۹.۴۳%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۷۵	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۷۸,۵۰۰	۳۹.۳۵%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۲۴۰	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۰۴,۱۸۰	۳۹.۳۴%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۱۸۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۶,۰۴۰	۳۹.۳۰%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۵۱۳	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۲۸,۳۳۰	۳۹.۱۷%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۹۶	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۶۵,۵۸۰	۳۹.۱۴%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۸۷۷	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۵۳,۷۳۰	۳۹.۱۰%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۷۵	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۸۳,۳۰۰	۳۹.۰۶%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۶۵	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴۴,۶۸۰	۳۷.۰۲%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۷۴۹	۴,۶۷۲	۱.۶%	۵,۰۱۵	(۵.۳%)
سکه امامی (تومان)	۱۸۵,۵۰۰,۰۰۰	۱۸۷,۰۰۰,۰۰۰	(۰.۸%)	۱۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۳.۱%
دلار آزاد (تومان)	۱۵۲,۵۰۰	۱۵۶,۶۹۰	(۲.۷%)	۱۳۹,۴۴۹	۹.۴%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۹۴.۳	۱۰۸.۷۵	(۱۳.۳%)	۱۰۲.۷	(۸.۲%)
بیت کوین (دلار)	۷۲,۶۴۶	۶۶,۷۰۰	۸.۹%	۷۱,۴۳۰	۱.۷%
اتریم (دلار)	۲,۲۳۱	۲,۰۵۳	۸.۷%	۲,۱۱۲	۵.۶%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۵۱۱	۳,۲۷۵	۷.۲%	۳,۵۱۹	(۰.۲%)
مس LME (دلار)	۱۲,۸۵۷	۱۲,۱۳۹	۵.۹%	۱۲,۹۸۵	(۱%)
روی LME (دلار)	۳,۳۲۷	۳,۱۱۹	۶.۷%	۳,۳۱۶	۰.۳%
سرب LME (دلار)	۱,۹۲۷	۱,۹۰۴	۱.۲%	۱,۹۳۹	(۰.۶%)
انس پلاتین (دلار)	۲,۰۶۵	۲,۳۷۴	(۱۳%)	۲,۳۷۳	(۱۳%)

کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege