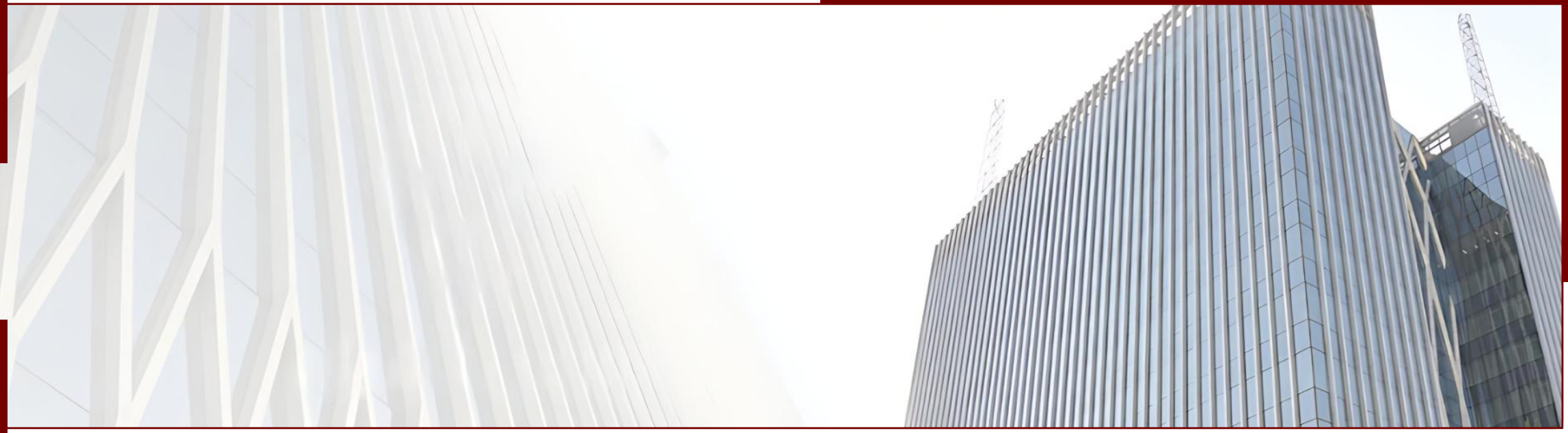


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۲۸ 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



ادعای احتمال توافق ایران و ایالات متحده توسط ترامپ

ترامپ، رئیس جمهوری آمریکا، در ادامه مصاحبه‌ها و وفرسته‌های پشت‌سر هم روز جمعه خود در شبکه‌های اجتماعی، مدعی شد که ایران در گفت‌وگوهای خود با ایالات متحده بـا «همـه» موارد مورد بحث، از جمله همکاری مشترک برای خارج کردن اورانیوم غنی‌شده از ایران و انتقال آن به خاک آمریکا «موافقت کرده است.» او افزود: «ما همراه با آن‌ها به پایین می‌رویم و آن را درمی‌آوریم و سپس آن را برمی‌داریم. ما این کار را با هم انجام خواهیم داد، چرا که تا آن زمان دیگه به توافق رسیدیم، که در این صورت نیازی به دعوا و درگیری نیست. خوبه، مگـه نـه؟ اینجوری بهتر است.»



ناو هواپیمابر جرالد فورد آمریکا بار دیگر به خاورمیانه بازگشت

جرالد فورد، بزرگ‌ترین ناو هواپیمابر جهان بار دیگر وارد آب‌های خاورمیانه شده است. دو مقام دفاعی این موضوع را به خبرگزاری آسوشیتدپرس اعلام کردند. به گفته یکـی از ایـن مقامـات، ناو فورد که تا همین اواخر در شرق دریای مدیترانه فعالیت می‌کـرد، از کانـال سـوئز عبـور کـرده و بـه همـراه دو ناوشـکن یـواس‌اس ماهـان و وینسـتون چرچیـل اکنـون در دریـای سـرخ مستقر شده است. هر دو مقام به دلیل حساس بودن عملیات نظامی، به شرط ناشناس ماندن با این خبرگزاری صحبت کرده‌انـد. نـاو فـورد پـس از بـیش از یـک مـاه حضـور در مدیترانـه، بار دیگر به دریای سرخ بازمی‌گردد. این ناو پیش‌تر به دلیـل آتش‌سـوزی بزرگـی در بخـش رختشـوی‌خانه، مجبـور شـده بـود بـرای تعمیـرات بـه بنـدر بـازگردد؛ حادثـه‌ای کـه باعـث شـد ۶۰۰ ملوان محل خواب خود را از دست بدهند.



پاسخ رئیس مجلس به اظهارات ترامپ

آقای قالیباف، رئیس مجلس و سرپرست هیئت مذاکره‌کننده جمهوری اسلامی، بامداد شنبه، ۲۹ فروردین‌ماه، با انتشار پیامی در اکس نوشت: رئیس جمهور آمریکا در یک ساعت هفت ادعـا مطرح کرد که هر هفت ادعا کذب است. با این دروغگویی‌ها در جنگ پیروز نشدند و حتما در مذاکره هم راه به جایی نخواهند برد». او در ادامه نوشت: با ادامـه محاصـره، تنگـه هرمـز بـاز نخواهد ماند. عبور و مرور در تنگه هرمز بر اساس مسیر تعیین شده و با مجوز ایران انجام خواهد شد. باز یا بسته بودن تنگه و مقررات حاکم بر آن را میدان مشخص می‌کنـد نـه شـبکه‌های اجتماعی. او در پایان گفت: جنگ رسانه‌ای و مهندسی افکار عمومی بخش مهمی از جنگ است و ملت ایران تحت تاثیر این تردستی‌ها قرار نمی‌گیرد.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



بورس این هفته هم تعطیل است/ شرط مهم بازگشایی بازار سهام

سازمان بورس اعلام کرد: در هفته پیش رو، تغییری در شرایط فعالیت بازارها و ابزارهای بازار سرمایه ایجاد نخواهد شد. این تصمیم بر مبنای مصوبه شورای‌عالی بورس اخذ شده و بر اساس آن در روزهای شنبه ۲۹ فروردین تا پایان روز کاری چهارشنبه دوم اردیبهشت، فعالیت بازار سرمایه مشابه هفته جاری بوده و شرایط فعالیت بازارها تغییری نخواهد کرد. هفته گذشته، برگزاری جلسات مختلف مدیریتی، کارشناسی و فنی برای تحقق الزامات پیش‌بینی‌شده برای بازگشایی بازار سهام ادامه داشت که پس از تحقق شرایط پیش‌بینی‌شده که مهم‌ترین آن شفاف‌سازی و ارائه اطلاعات لازم از سوی شرکت‌های پذیرفته شده با ملاحظات امنیت اطلاعات است، بازار سهام بازگشایی خواهد شد.



ورود ۷۰ هزار میلیارد تومانی به صندوق‌های با درآمد ثابت

طبق آمار مرکز نظارت بر صندوق‌های سرمایه‌گذاری سازمان بورس، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت از ابتدای جنگ یعنی از ۹ اسفند تا ۲۲ فروردین حدود ۷۰ هزار میلیارد تومان منابع جذب کردند. بر اساس این گزارش از مجموع ۷۰ هزار میلیارد تومان منابع جدید وارد شده به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، حدود ۳۷ هزار میلیارد تومان به صندوق های صدور و ابطالی و ۳۳ هزار میلیارد تومان دیگر نیز به صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله (ETF) وارد شده است.



راه‌اندازی قرارداد اختیار معامله شمش نقره سررسید شهریور و شمش طلا سررسید آبان ۱۴۰۵

براساس اطلاعیه بورس کالا قراردادهای اختیار معامله شمش نقره سررسید شهریور ۱۴۰۵، از روز سه شنبه اول اردیبهشت ماه راه اندازی می‌شود؛ تاریخ سررسید این معاملات ۲۴ شهریور ۱۴۰۵ اعلام شده است. همچنین قرارداد اختیار معامله شمش طلا سررسید آبان ۱۴۰۵، از روز چهارشنبه ۲ اردیبهشت ماه راه اندازی می‌شود و تاریخ سررسید این معاملات ۱۹ آبان ۱۴۰۵ اعلام شده است. گفتنی است قراردادهای اختیار معامله بدون حد نوسان قیمتی، با دوره گشایش به مدت ۱۵ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و با دوره عادی معاملاتی ادامه می یابد.

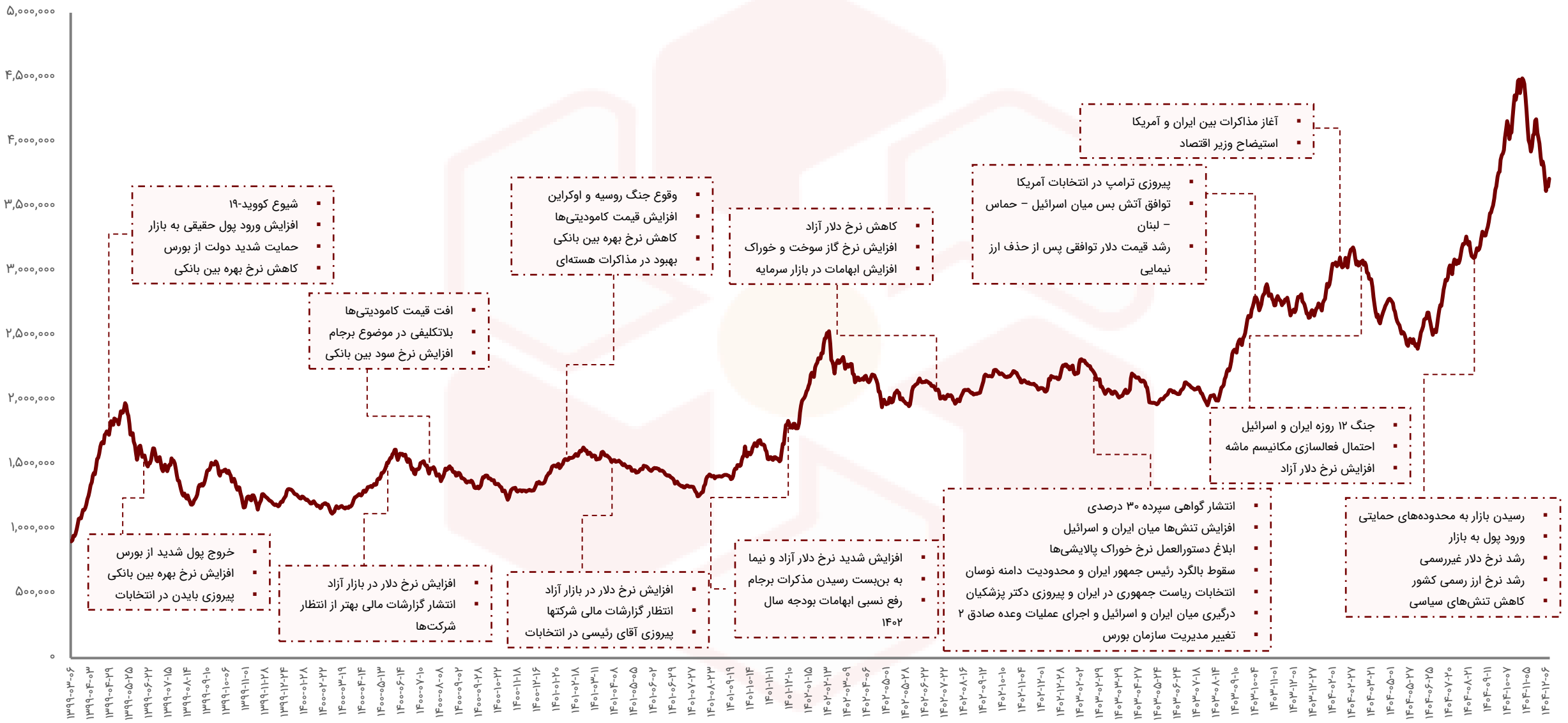
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته گذشته، پس از اعلام آتش‌بس میان جمهوری اسلامی ایران و ائتلاف ایالات‌متحده/اسرائیل، شاهد برگزاری مذاکرات میان دوطرف درگیری در اسلام‌آباد پاکستان بودیم که به نتیجه خاصی نرسید و پس از آن، محاصره دریایی ایران از سوی ایالات متحده در روزهای پایانی هفته آغاز گردید؛ از سوی دیگر، رایزنی‌ها از کانال‌های غیرمستقیم میان ایالات متحده و جمهوری اسلامی ادامه داشته و انتظار می‌رود در هفته آتی، مجدداً شاهد برگزاری دور دیگری از مذاکرات در پاکستان باشیم. در هفته اخیر، معاملات سهام، حق تقدم و مشتقات مبتنی بر آن همچنان متوقف بود؛ ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت به بیش از ۶۸ هزار میلیارد تومان رسید و ورود پولی ۶.۶ هزارمیلیاردتومانی را ثبت کرد. صندوق‌های طلا و نقره نیز در این هفته ارزش معاملاتی بیش از ۳۰ هزارمیلیارد تومانی را ثبت کردند.

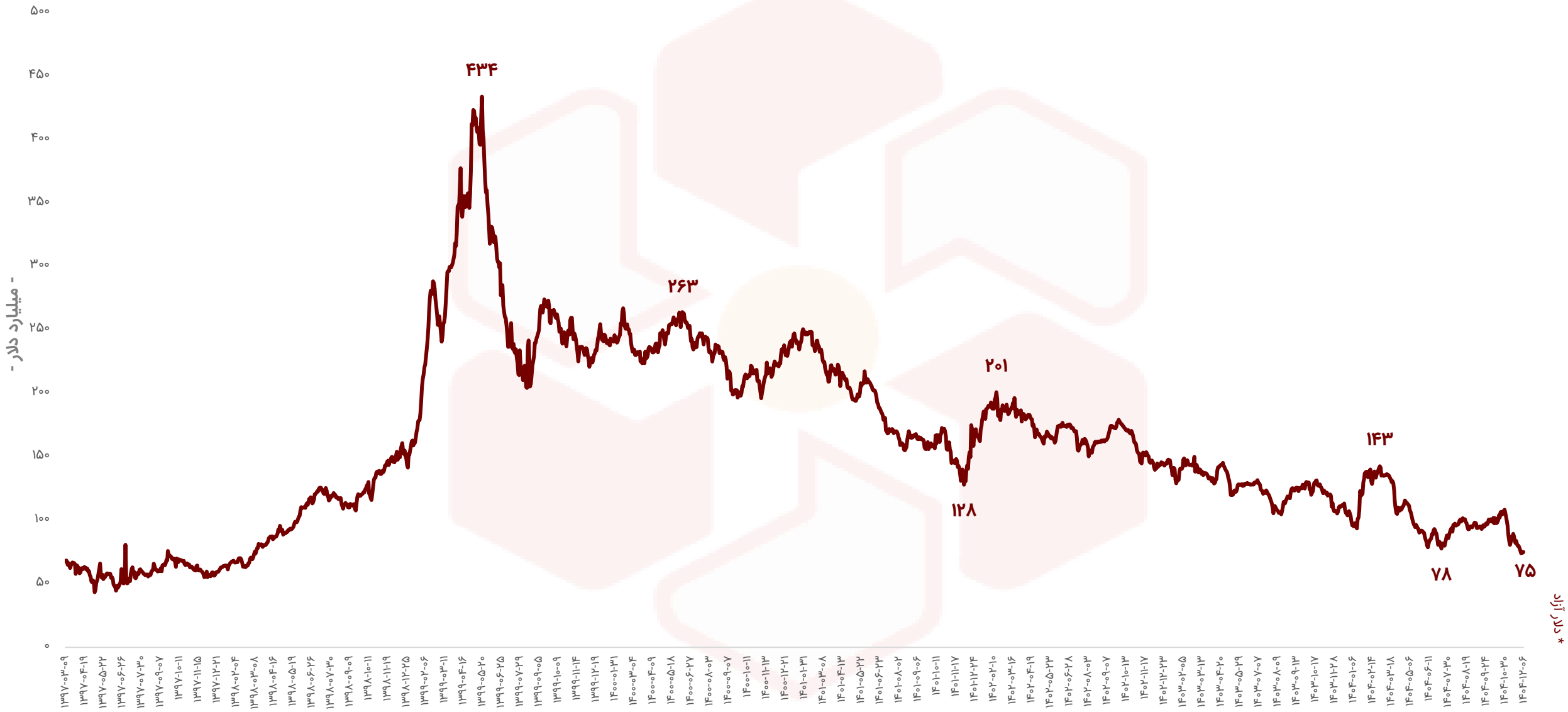
تغییرات هفتگی شاخص ها

	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)		۶۸,۶۱۱	-	-
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)		۶,۶۱۶	-	-

روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن

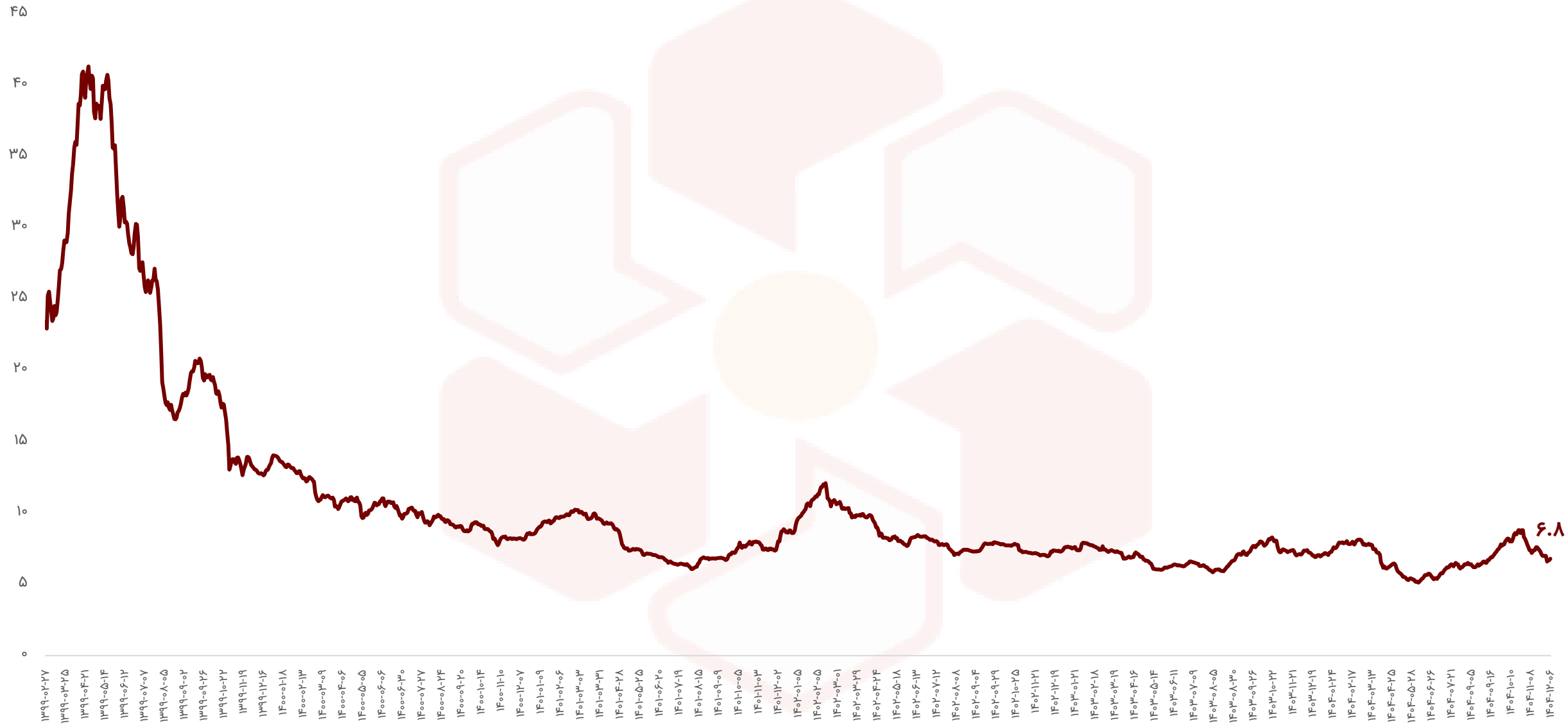


ارزش دلاری بازار*

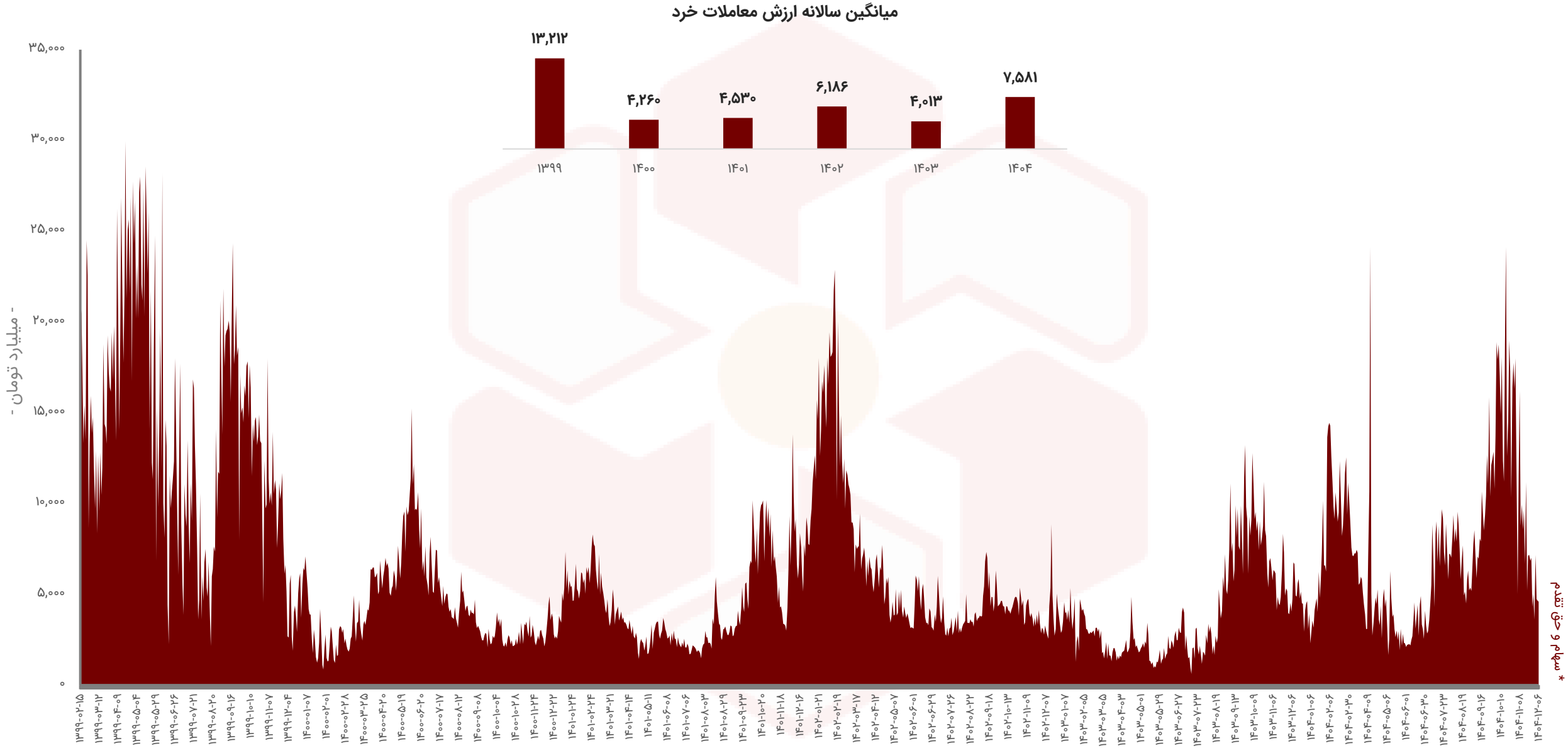


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

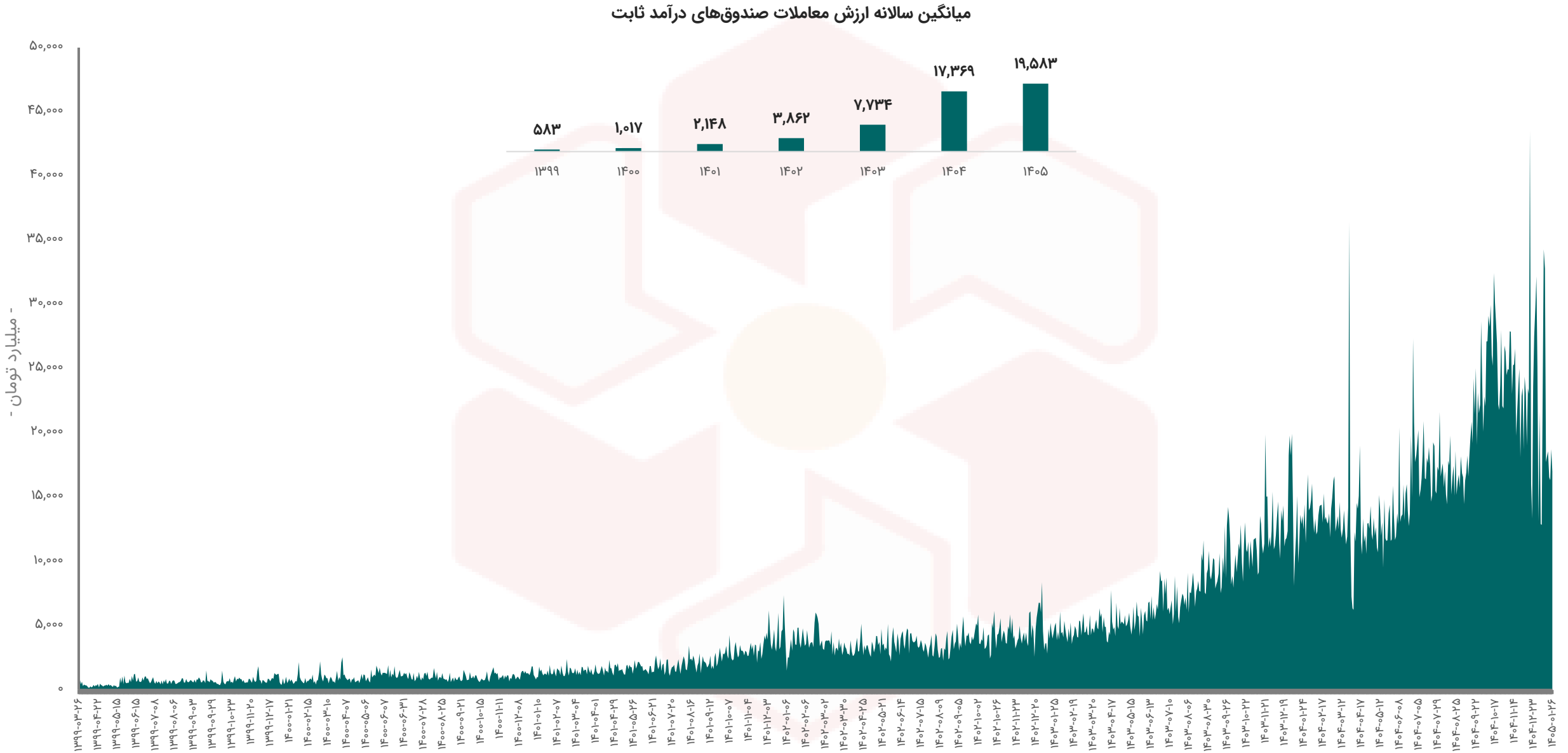
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



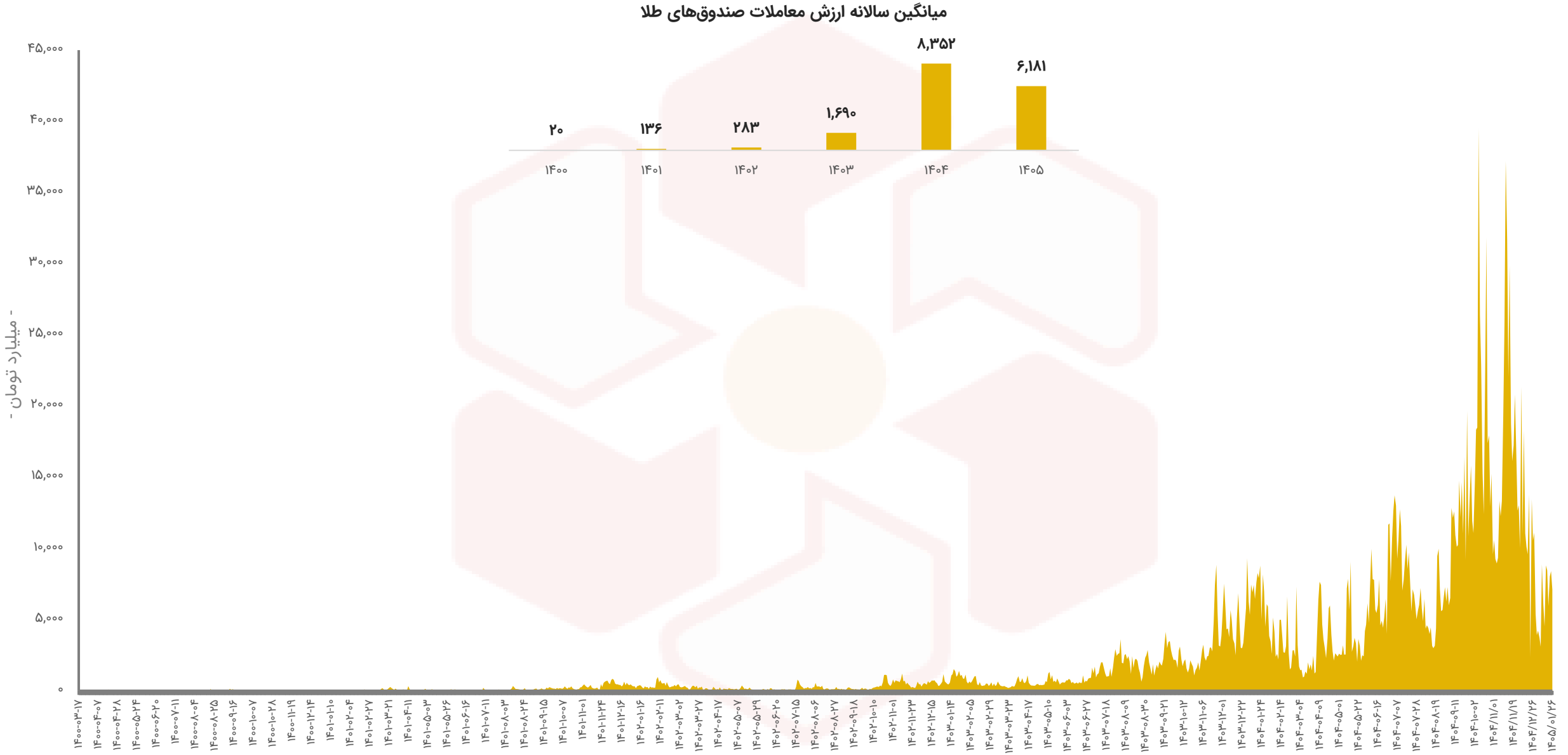
ارزش معاملات خرد سهام*



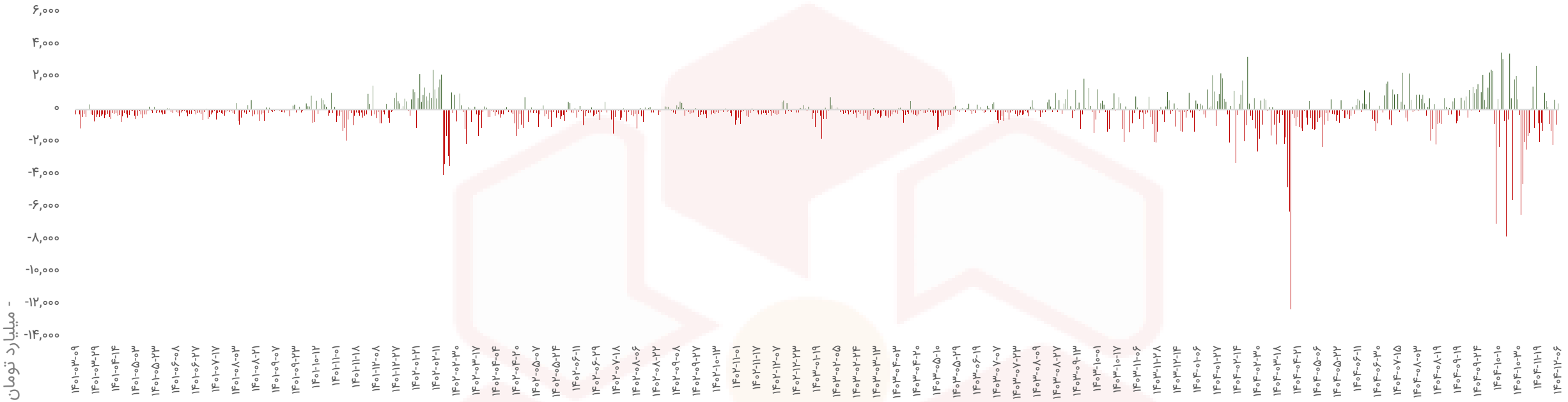
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



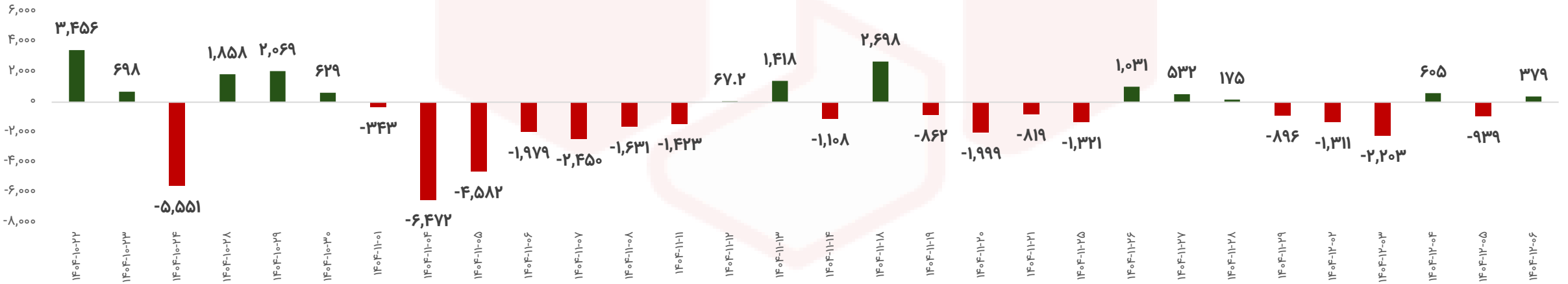
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



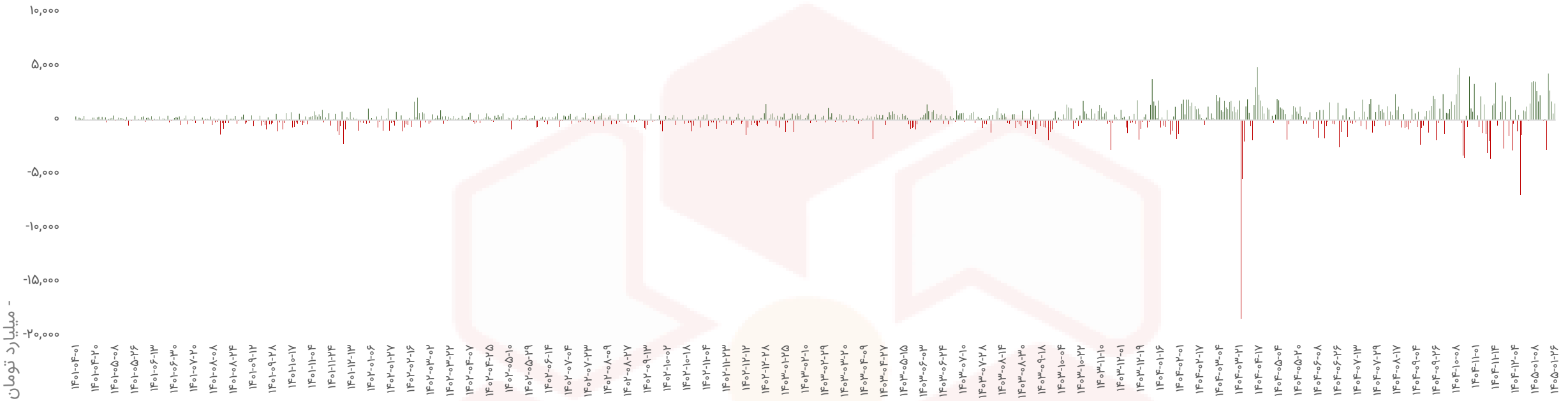
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



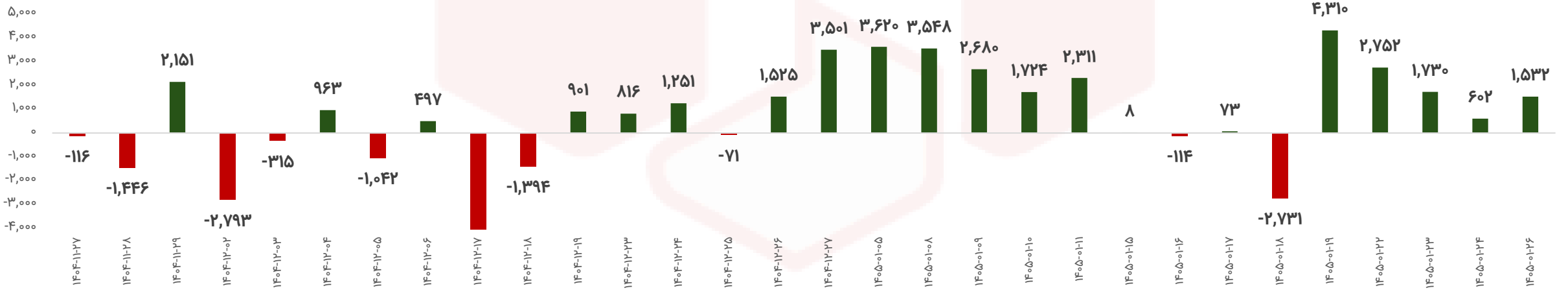
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



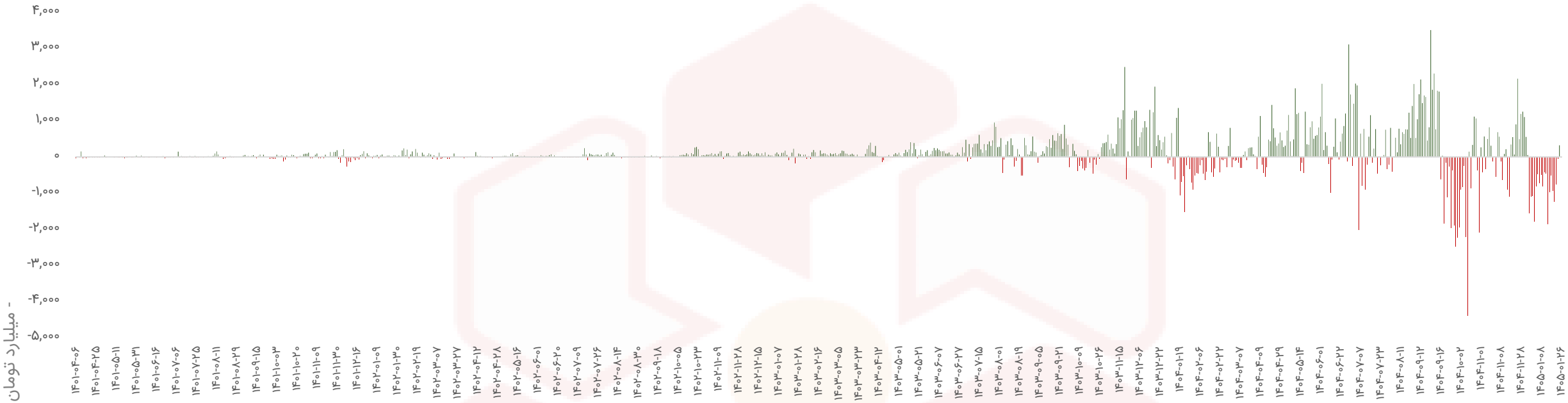
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



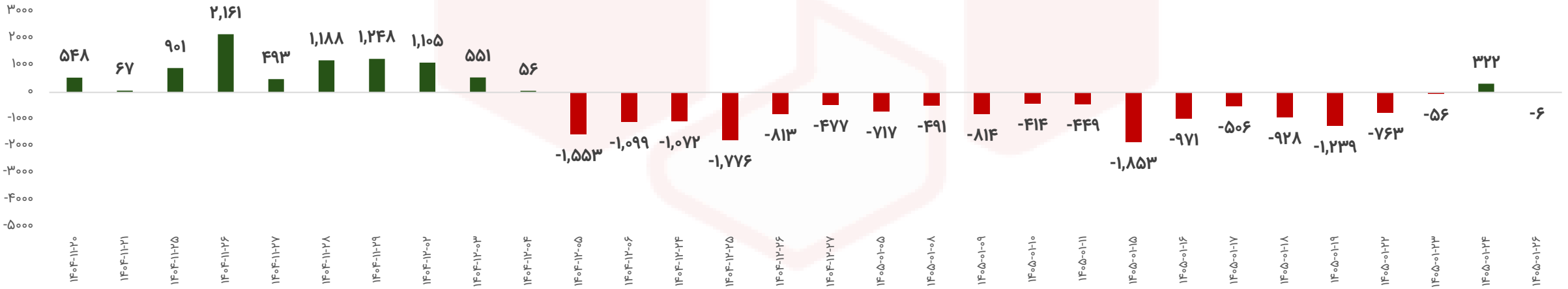
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

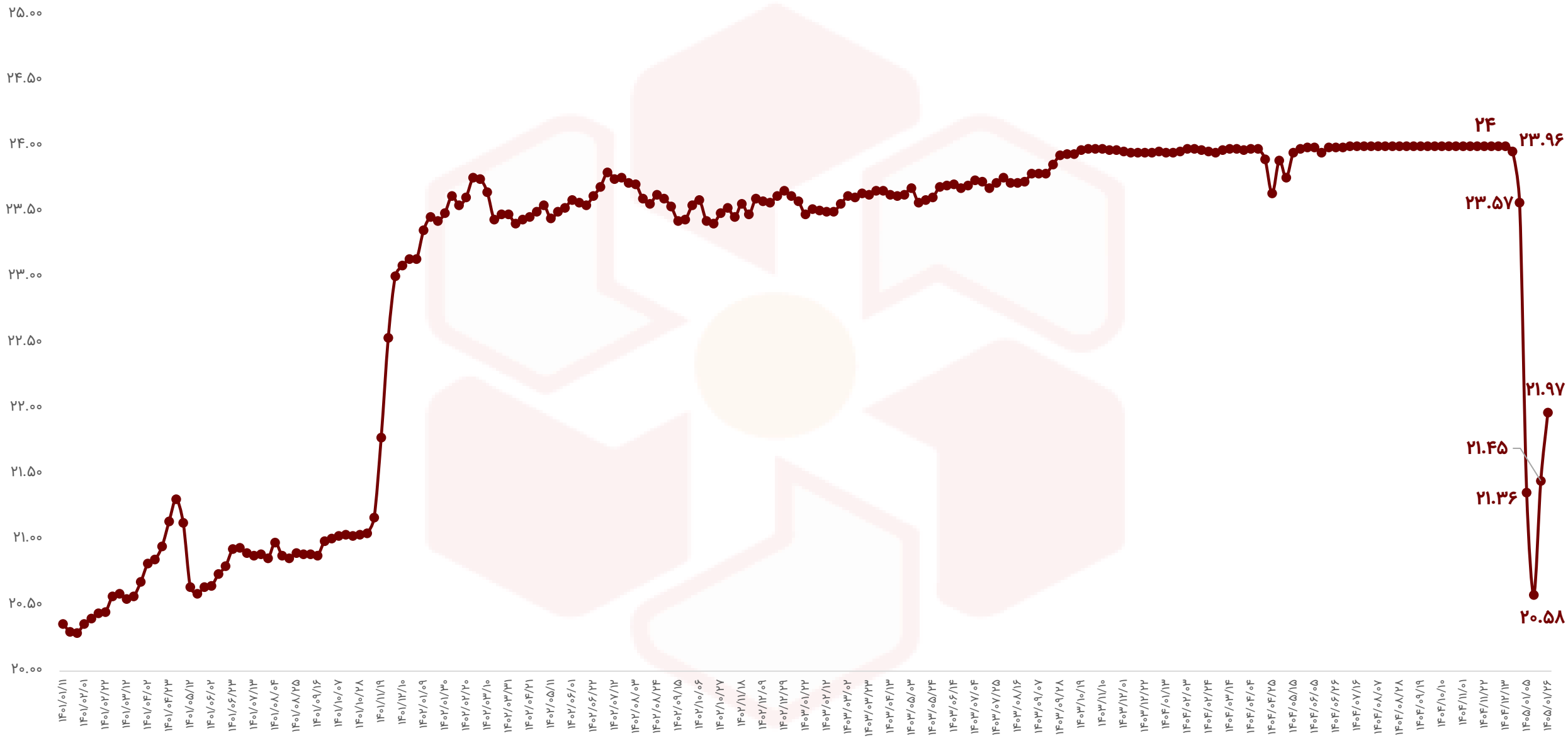
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



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



روند نرخ بهره بین بانکی (%)



اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۹۳۳	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۱۷,۷۷۰	۴۲.۳۴%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۲۳۳	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۰۷,۱۵۰	۴۱.۲۴%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۸۷۰	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۵,۰۳۰	۴۱.۱۲%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۵۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴۸,۷۸۰	۳۹.۹۴%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۲۰۵	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۸,۲۶۰	۳۹.۸۵%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۵۰۶	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۳۰,۲۰۰	۳۹.۶۲%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۴۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۰۳,۰۴۰	۳۹.۵۸%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۱۷۷	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۸,۳۹۰	۳۹.۴۷%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۸۹	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۶۹,۰۶۰	۳۹.۳۴%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۶۸	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۸۹,۴۵۰	۳۷.۹۷%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۸۶۰	۴,۷۴۹	۲.۳%	۴,۷۸۲	۱.۶%
سکه امامی (تومان)	۱۷۲,۵۰۰,۰۰۰	۱۸۵,۵۰۰,۰۰۰	(۷%)	۱۸۵,۵۰۰,۰۰۰	(۷%)
دلار آزاد (تومان)	۱۵۱,۹۶۰	۱۵۲,۵۰۰	(۰.۳%)	۱۵۳,۴۸۱	(۱%)
نفت برنت (دلار/بشکه)	۹۰.۶	۹۴.۳	(۳.۹%)	۱۱۱.۱	(۱۸.۴%)
بیت کوین (دلار)	۷۷,۳۱۷	۷۲,۶۴۶	۶.۴%	۷۰,۳۱۱	۱۰%
اتریم (دلار)	۲,۴۳۴	۲,۲۳۱	۹.۱%	۲,۱۶۷	۱۲.۳%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۶۱۶	۳,۵۱۱	۳%	۳,۵۱۹	۲.۷%
مس LME (دلار)	۱۳,۱۸۰	۱۲,۸۵۷	۲.۵%	۱۲,۹۸۵	۱.۵%
روی LME (دلار)	۳,۳۳۹	۳,۳۲۷	۰.۴%	۳,۳۱۶	۰.۷%
سرب LME (دلار)	۱,۹۳۸	۱,۹۲۷	۰.۶%	۱,۹۳۹	(۰.۱%)
انس پلاتین (دلار)	۲,۳۷۳	۲,۰۶۵	۱۴.۹%	۲,۳۷۳	۰

کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege