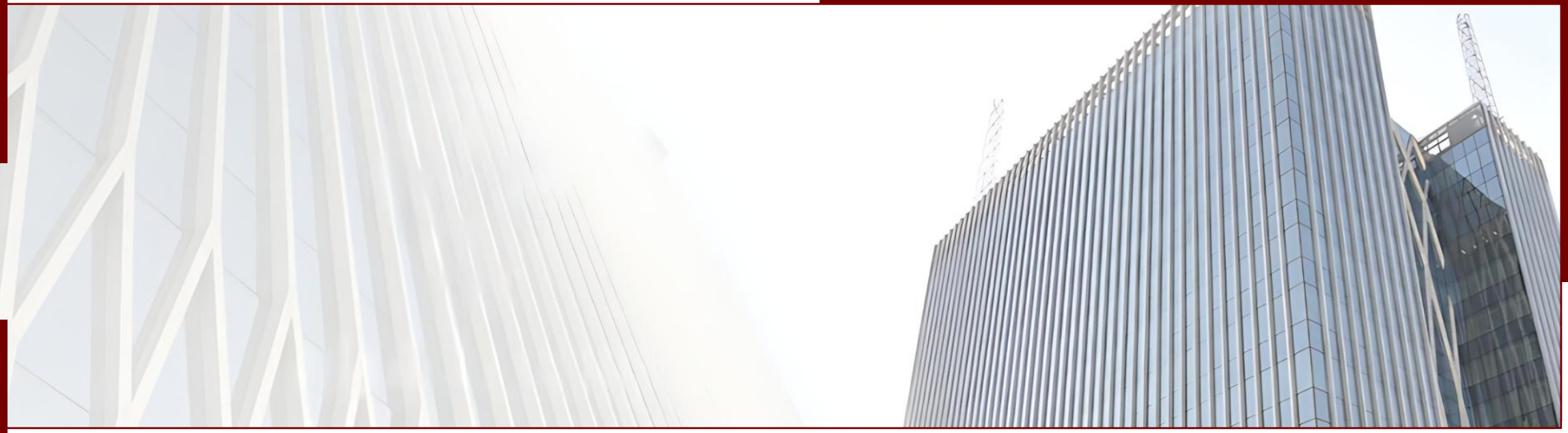


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۴ اردیبهشت 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



سومین ناو هواپیمابر آمریکا وارد خاورمیانه شد

ناو هواپیمابر «یواس‌اس جرج اچ. دبلیو. بوش» به حوزه فرماندهی مرکزی آمریکا وارد شد، به این ترتیب شمار ناوهای هواپیمابر آمریکایی حاضر در خاورمیانه در بحبوحه آتش‌بس شکننده با ایران به سه فروند رسیده است. بر اساس اعلام فرماندهی نظامی آمریکا در شبکه‌های اجتماعی این ناو هم‌اکنون در اقیانوس هند مستقر است. ناو «یواس‌اس آبراهام لینکلن» در دریای عرب و «یواس‌اس جرالد آر. فورد» در دریای سرخ حضور دارند. ناو «یواس‌اس جرج اچ. دبلیو. بوش» که در پایان ماه مارس بندر نورفک در ایالت ویرجینیا را ترک کرده بود ابتدا از اقیانوس اطلس عبور کرد اما سپس در مسیری غیرمعمول به سمت جنوب تغییر مسیر داد و پس از دور زدن دماغه آفریقا به سوی آب‌های خاورمیانه حرکت کرد.



معافیت تحریمی نفت ایران تمدید نمی‌شود

وزیر خزانه‌داری آمریکا روز جمعه در گفتگو با اسوشیتدپرس گفت که این وزارتخانه تصمیم ندارد معافیت نفت تحریم‌شده ایران و روسیه را که در حال حاضر روز نفتکش‌ها بارگیری‌شده و روی آب است را تمدید کند. آقای بسنت گفت: «ما در حال اعمال محاصره هستیم و هیچ نفتی [از ایران] خارج نمی‌شود.» او افزود: «فکر می‌کنم ظرف دو سه روز آینده آن‌ها مجبور خواهند شد تولید را متوقف کنند که این موضوع برای چاه‌هایشان بسیار بد خواهد بود.»



مذاکرات ایران و ایالات متحده در هاله‌ای از ابهام

به گزارش اکسیوس به نقل از دو منبع آگاه، آقای عباس عراقچی، وزیر خارجه جمهوری اسلامی ایران که در راس هیاتی به پاکستان سفر کرده، قرار است از اسلام‌آباد به مسقط، عمان و مسکو سفر کند و ممکن است روز دوشنبه، پس از برگزاری دیدارهای جداگانه با میانجی‌گران پاکستانی، با استیو ویتکاف و جرد کوشنر، فرستادگان آمریکا دیدار کند. این در حالی است که ساعاتی پیش، سخنگوی وزارت خارجه جمهوری اسلامی ایران اعلام کرد که هیچ دیداری میان ایران و آمریکا برنامه‌ریزی نشده است و هیات ایرانی دیدگاه‌های خود را به پاکستان منتقل خواهد کرد. بنابر اعلام کاخ سفید، انتظار می‌رود که استیو ویتکاف و جرد کوشنر روز شنبه عازم اسلام‌آباد شوند.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر

تکرار روال قبلی بازار سرمایه در هفته جاری: تعطیلی بازار سهام و فعالیت سایر بورس‌ها

سازمان بورس اعلام کرد: طبق مصوبه شورای‌عالی بورس، فعالیت بورس‌ها در هفته جاری مانند هفته سپری‌شده تداوم خواهد داشت و شرایط فعالیت بازارها و ابزارهای بازار سرمایه تغییری نخواهد کرد. به این ترتیب معاملات بازار سهام که از ۹ اسفند تعطیل شده از امروز شنبه تا چهارشنبه ۹ اردیبهشت متوقف بوده و معاملات بورس‌های کالایی و سایر ابزارهای بازار سرمایه بدون تغییر ادامه خواهد داشت. براساس این گزارش، طبق اعلام اخیر رئیس سازمان بورس، احتمال دارد بازار سهام در یک مرحله و بدون تکیه بر روش مرحله‌ایی طی هفته آینده (۱۲ تا ۱۷ اردیبهشت) بازگشایی شود. در این مرحله نماد شرکت‌های خسارت دیده مستقیم باز نخواهد شد ولی نماد سایر شرکت ها باز می‌شود.

تحقق ۸۷ درصدی پیش بینی فروش اوراق با ۷۰۶.۶ هزار میلیارد تومان



دولت در سال ۱۴۰۴، در مجموع ۷۰۶.۶ هزار میلیارد تومان اوراق فروخت که معادل ۸۷ درصد پیش بینی فروش (۸۱۰ هزار میلیارد تومان) در قانون بودجه بود. بر اساس این گزارش، حدود ۶۰ درصد اوراق توسط بانک ها و ۴۰ درصد توسط سایر سرمایه گذاران (عمدتا صندوق های سرمایه گذاری) خریداری شد. نرخ بازده تا سررسید اوراق در آخرین عرضه و مربوط به اواخر اسفند به ۳۱ درصد رسید.

ابلاغ توقف صادرات محصولات پتروشیمی و صنایع پایین دستی تا اطلاع ثانوی



مدیر کل دفتر مقررات صادرات و واردات وزارت صنعت با صدور نامه‌ای به سرپرست دفتر صادرات گمرک، مصوبه توقف صادرات محصولات پتروشیمی، محصولات تولیدی صنایع پایین دستی و ... تا اطلاع ثانوی را با هدف تامین نیاز بازار داخلی و جلوگیری از کمبود مواد اولیه در صنایع پایین‌دستی، ابلاغ کرد.

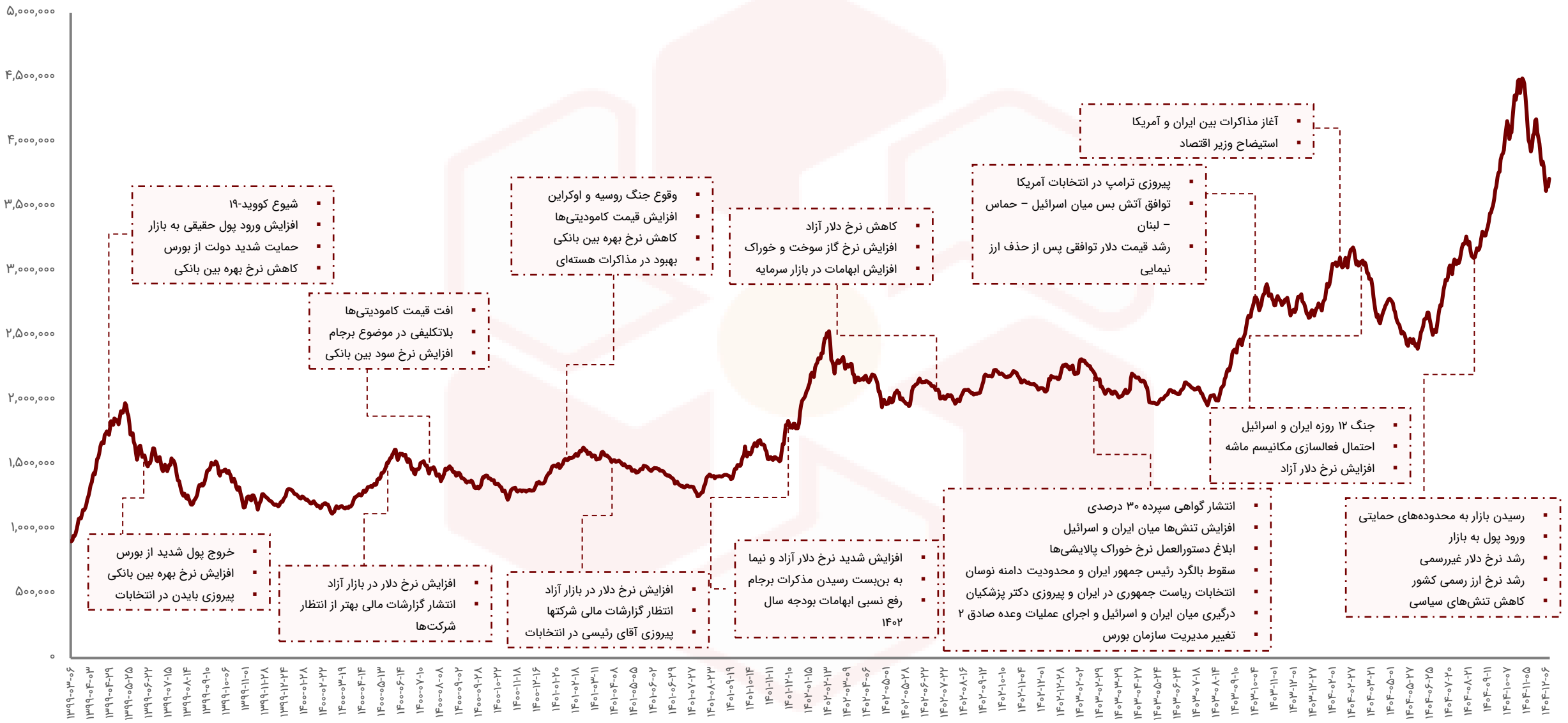
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته گذشته، با نزدیک‌شدن به موعد پایان آتش بس دو هفته‌ای، این‌بار شاهد تمدید آتش‌بس میان ایالات متحده و جمهوری اسلامی ایران، بدون اشاره به مهلت نهایی آن بودیم؛ دونالد ترامپ، رییس جمهور آمریکا هدف از تمدید مجدد آتش‌بس را، رسیدن به پاسخ نهایی در طرف مقابل دانست؛ همچنین اعلام کرد که محاصره دریایی تا حصول نتیجه ادامه خواهد داشت. این امر به رشد قیمت دلار آمریکا در بازار غیررسمی از حدود ۱۵۰ هزارتومان به ۱۵۴ هزارتومان منجر گردید. در بازار سرمایه، شاهد ادامه روند ورود پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت بودیم؛ ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت به بیش از ۱۰۲ هزارمیلیارد تومان رسید و ورود پولی ۸.۳ همتی را ثبت کردند. صندوق‌های طلا و نقره نیز در طول هفته گذشته، ارزش معاملاتی ۳۴.۳ هزارمیلیاردتومانی را ثبت کردند. در هفته پیش‌رو، معاملات سهام و مشتقات آن همچنان متوقف خواهد بود و بازگشایی مجدد آن، مشروط به افشای اطلاعات شرکت‌ها در هفته‌های آتی خواهد بود.

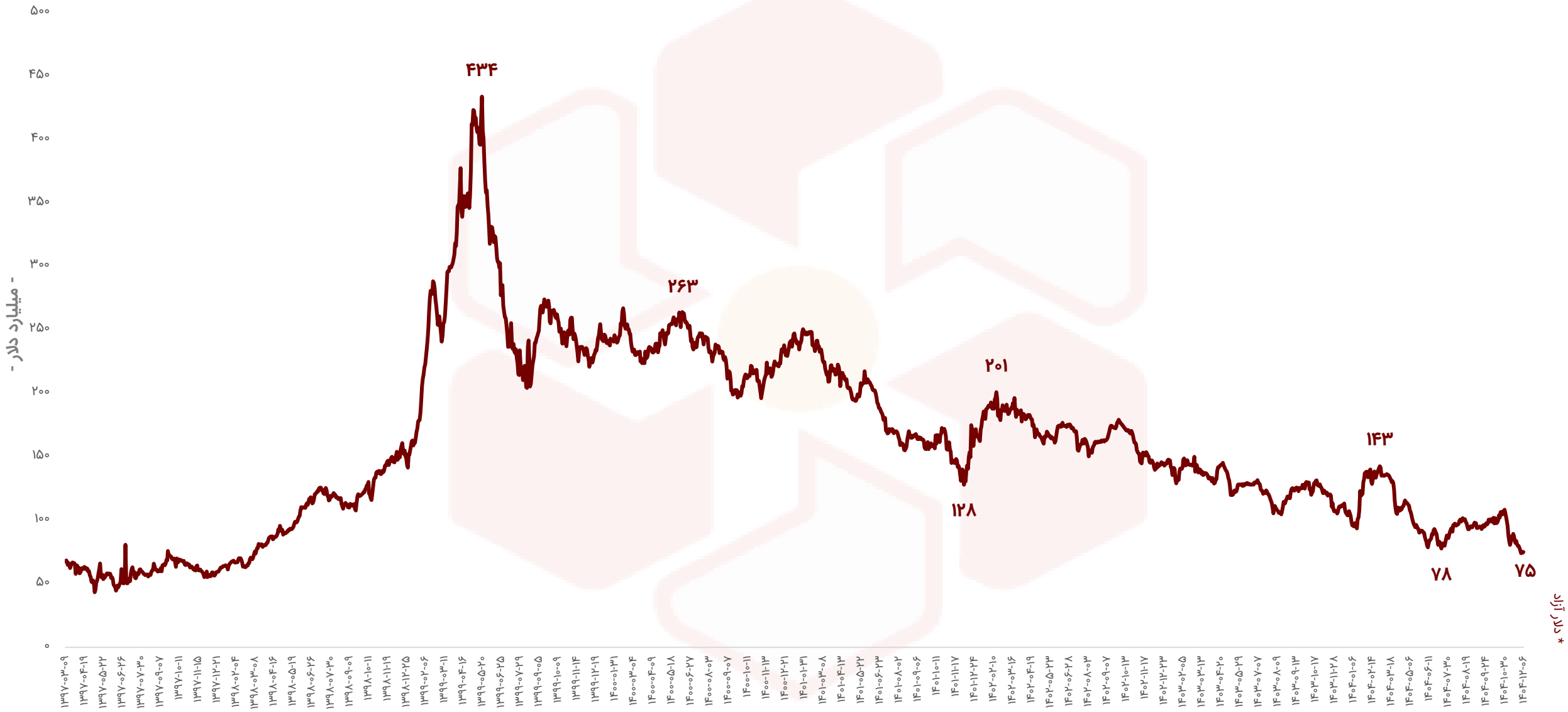
تغییرات هفتگی شاخص ها

	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)		۱۰۲,۸۰۴	-	-
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)		۸,۲۹۷	-	-

روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن

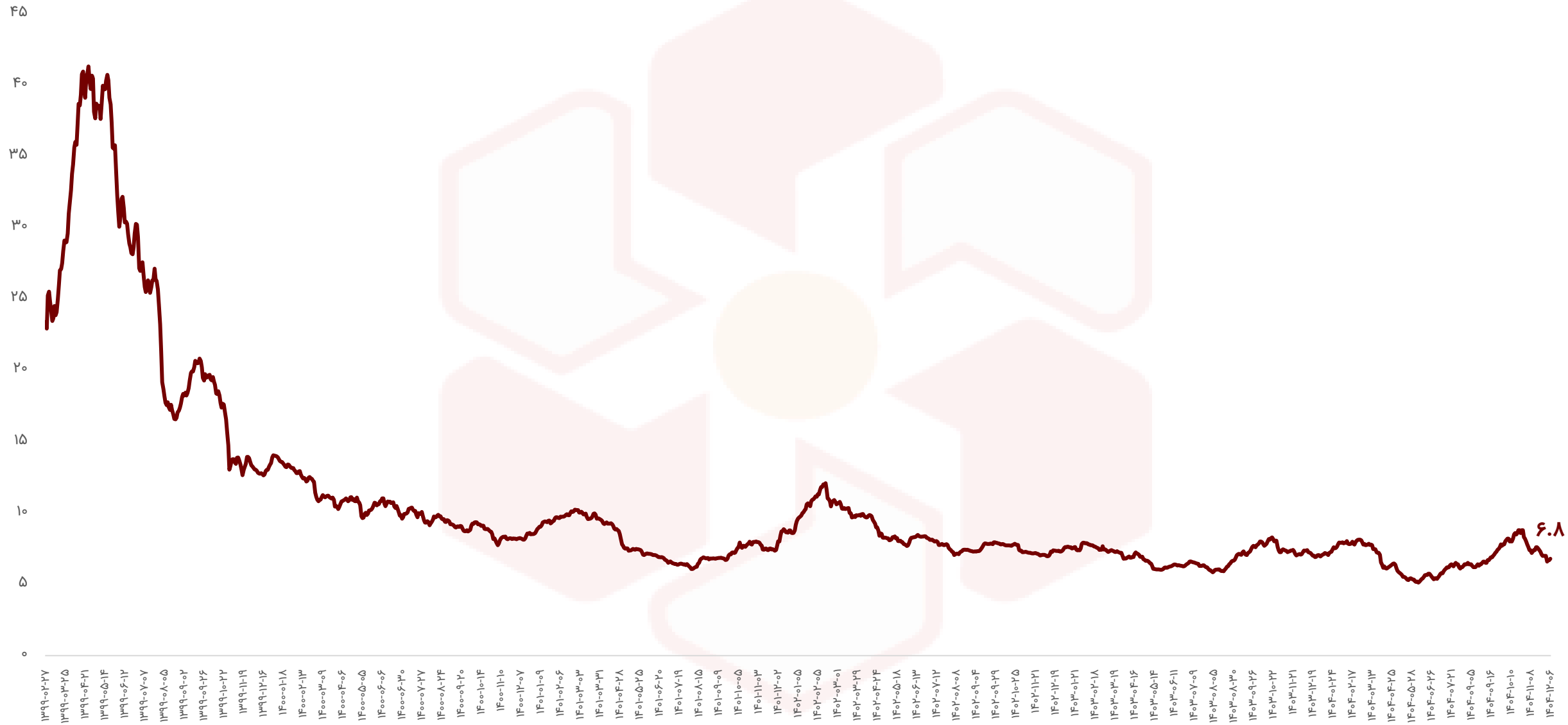


ارزش دلاری بازار*

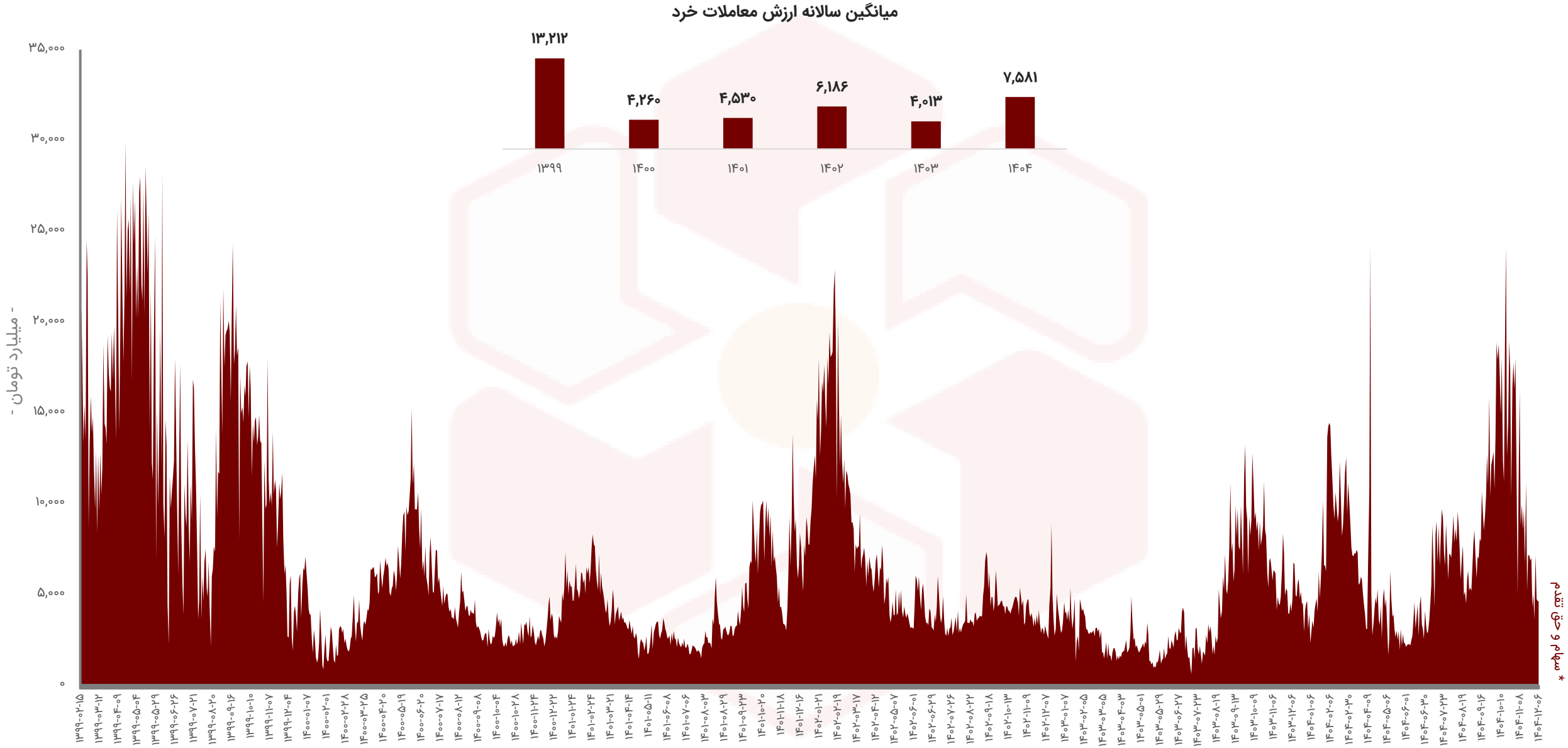


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

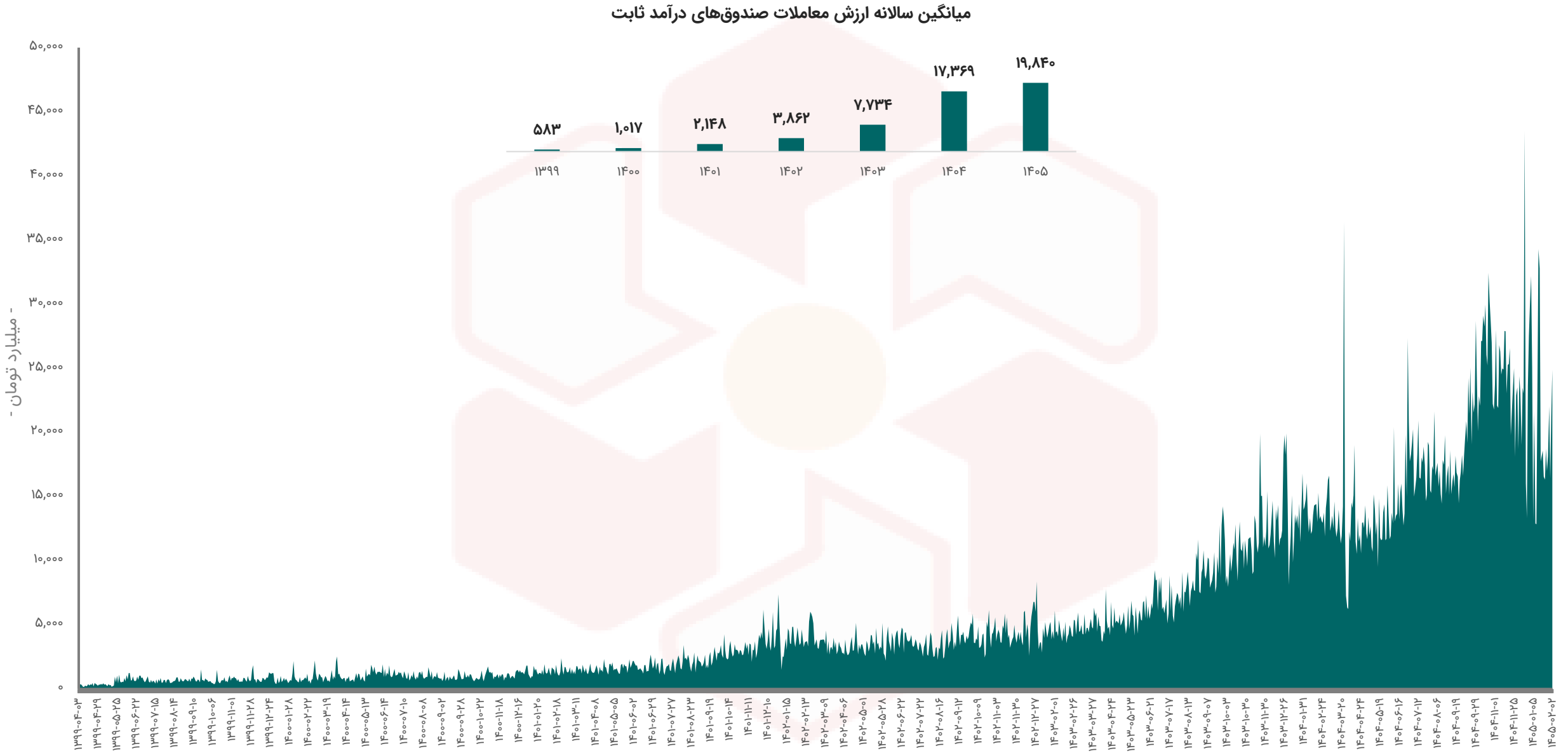
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



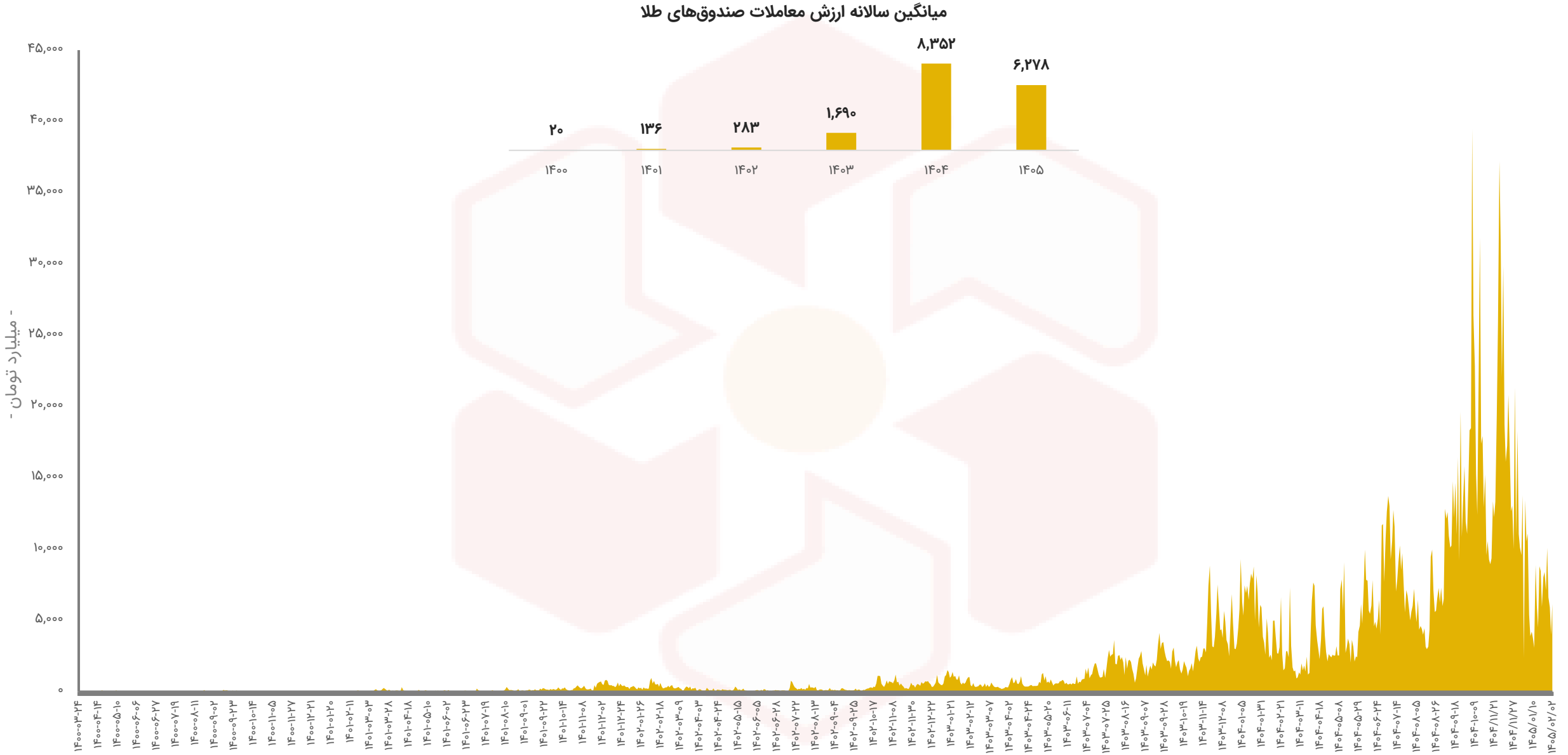
ارزش معاملات خرد سهام*



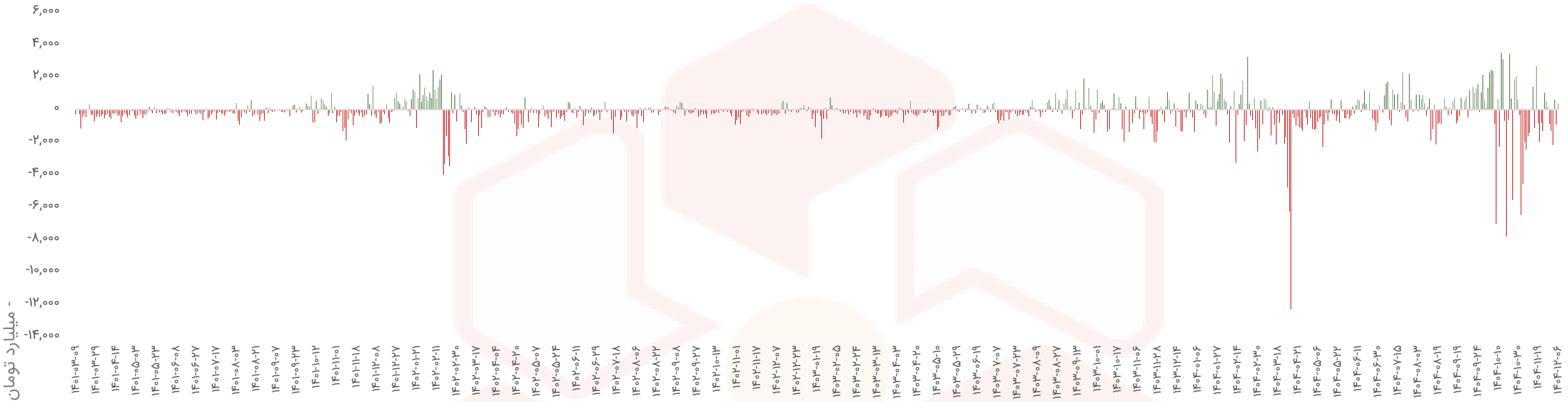
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



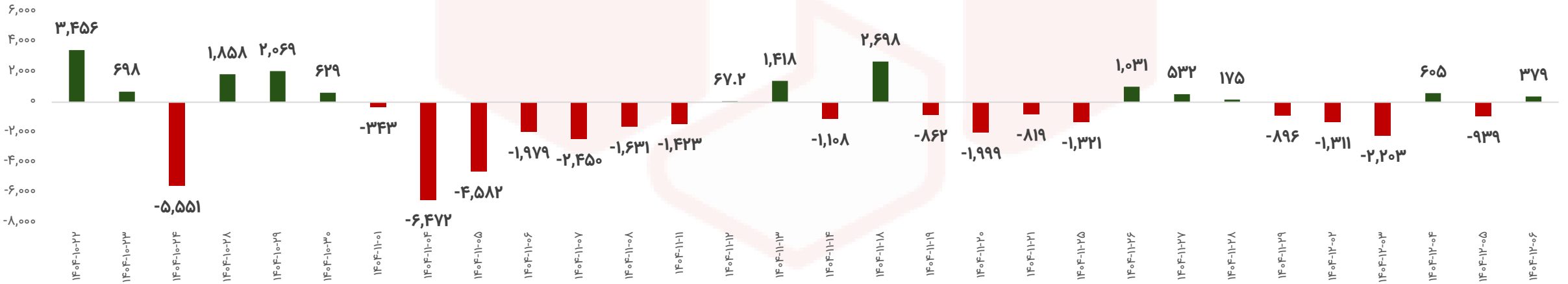
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



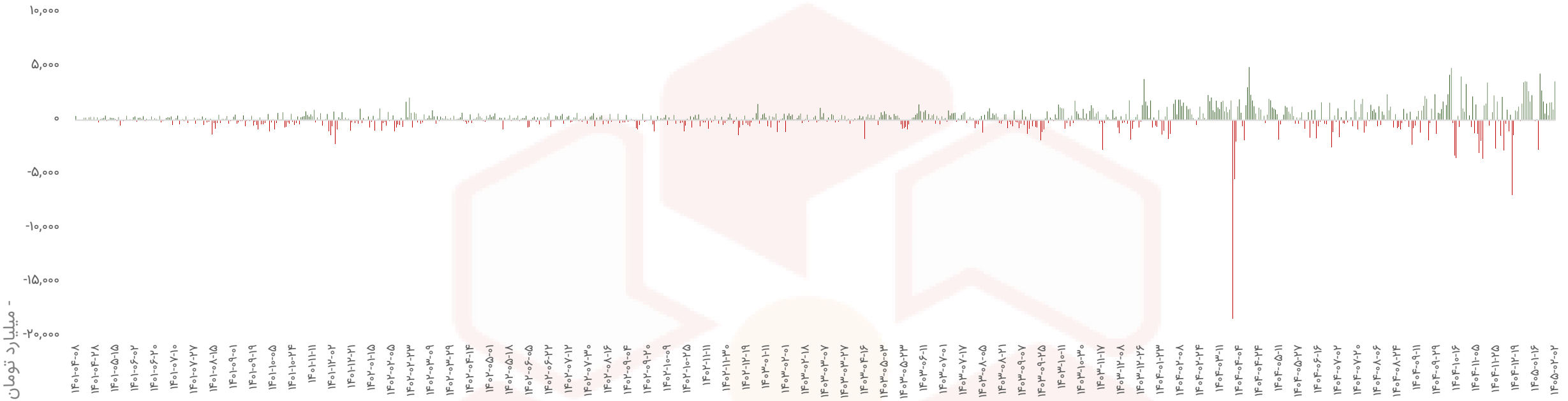
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



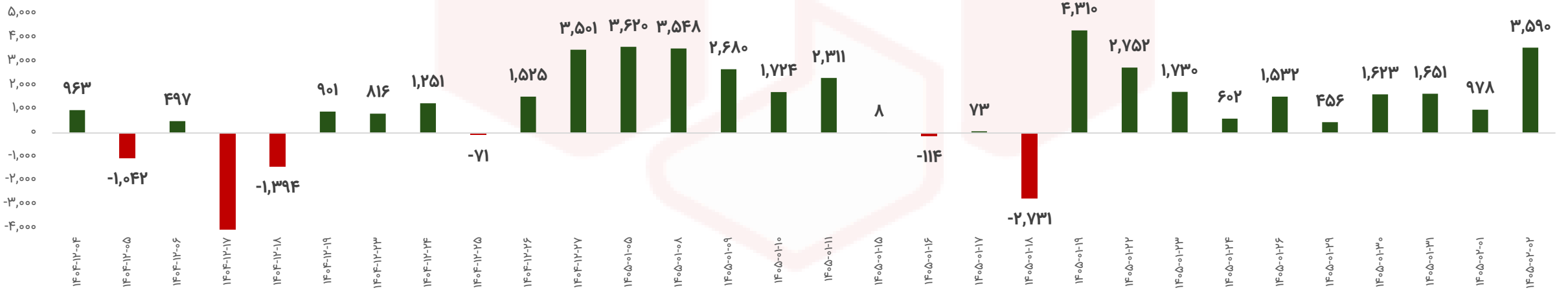
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



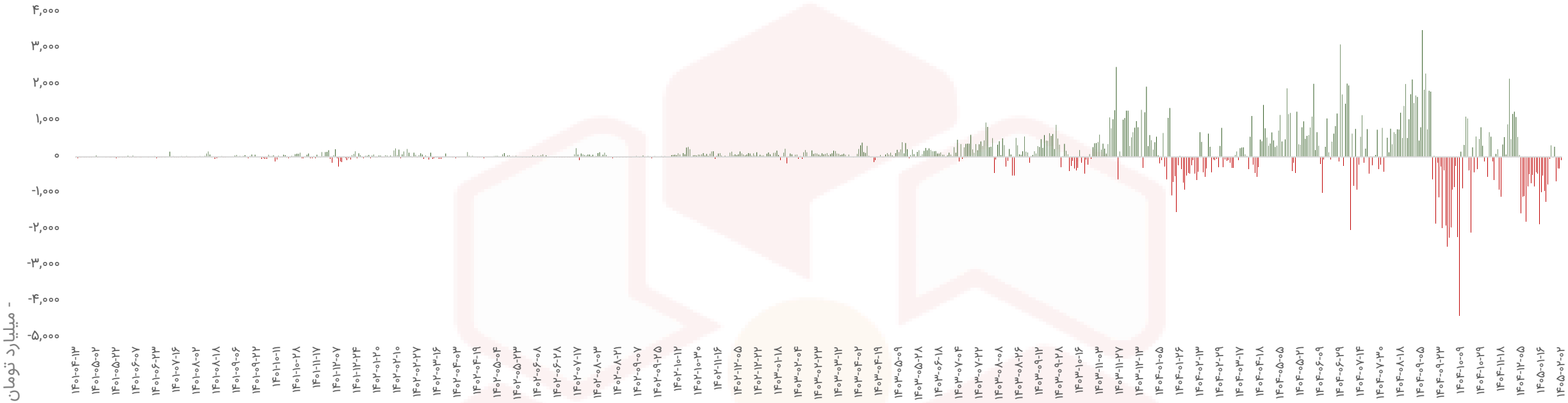
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



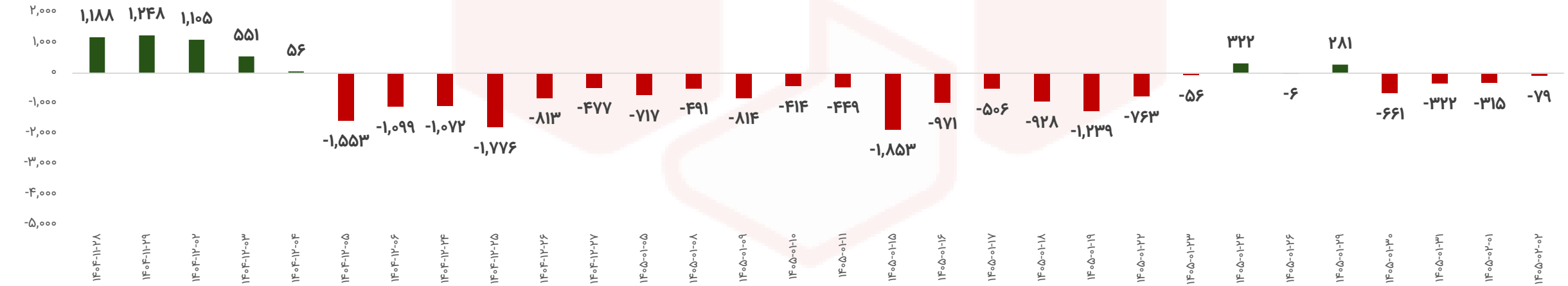
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



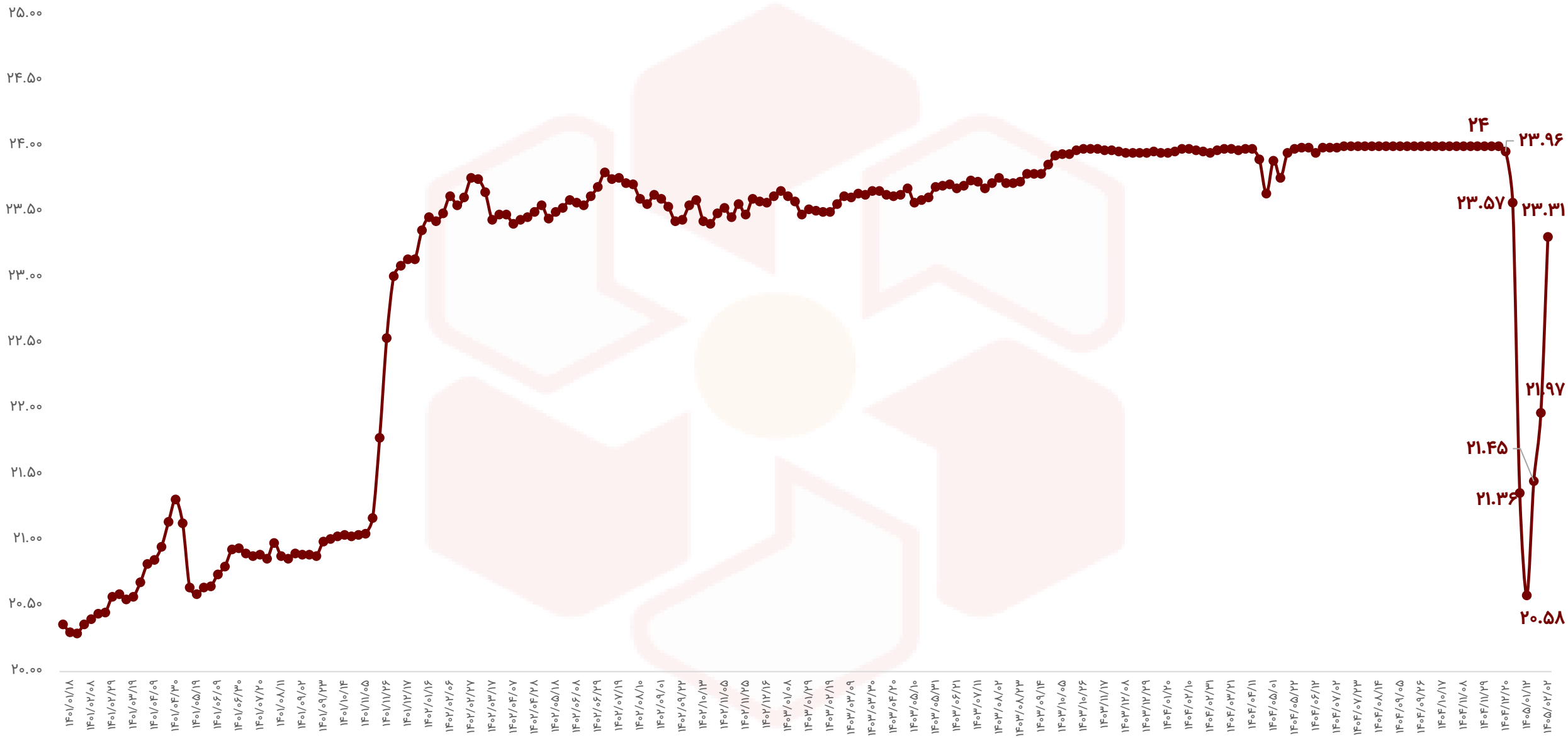
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



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)
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۴۹۹	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۳۱,۰۸۰	۴۰.۰۴%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۸۶۳	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۵۰,۵۶۰	۴۰.۰۴%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۹۲۶	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۳,۹۴۰	۴۰%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۵۱	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۵۳,۴۸۰	۳۹.۴۵%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۸۹۸	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۷,۸۱۰	۳۹.۱۰%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۶۱	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۹۶,۱۲۰	۳۸.۲۶%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۱۹۸	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۳۹,۴۸۰	۳۸.۰۶%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۲۲۶	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۰,۳۸۰	۳۸.۰۳%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۱۷۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۲,۹۹۰	۳۷.۲۱%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۳۳	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۱۳,۹۳۰	۳۷.۱۶%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۶۱	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۹۳,۸۳۰	۳۷.۱۴%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۸۲	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۸۳,۵۳۰	۳۷.۱۳%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۷۰۸	۴,۸۶۰	(۳.۱%)	۴,۵۱۰	۴.۴%
سکه امامی (تومان)	۱۷۶,۰۰۰,۰۰۰	۱۷۲,۵۰۰,۰۰۰	۲%	۱۸۵,۵۰۰,۰۰۰	(۵.۱%)
دلار آزاد (تومان)	۱۵۴,۷۰۰	۱۵۱,۹۶۰	۱.۸%	۱۶۶,۳۶۰	(۷%)
نفت برنت (دلار/بشکه)	۱۰۶.۱	۹۰.۶	۱۷.۱%	۱۰۲.۶	۳.۹%
بیت کوین (دلار)	۷۷,۶۶۳	۷۷,۳۱۷	۰.۴%	۷۰,۵۰۱	۱۰.۱%
اتریم (دلار)	۲,۳۱۸	۲,۴۳۴	(۴.۸%)	۲,۱۶۴	۷.۱%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۵۸۰	۳,۶۱۶	(۱%)	۳,۵۱۹	۱.۷%
مس LME (دلار)	۱۳,۳۱۴	۱۳,۱۸۰	۱%	۱۲,۹۸۵	۲.۵%
روی LME (دلار)	۳,۴۴۹	۳,۳۳۹	۴.۸%	۳,۳۱۶	۴%
سرب LME (دلار)	۱,۹۵۰	۱,۹۳۸	۰.۶%	۱,۹۳۹	۰.۶%
انس پلاتین (دلار)	۲,۰۳۰	۲,۳۷۳	(۱۴.۴%)	۲,۳۷۴	(۱۴.۴%)

کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege