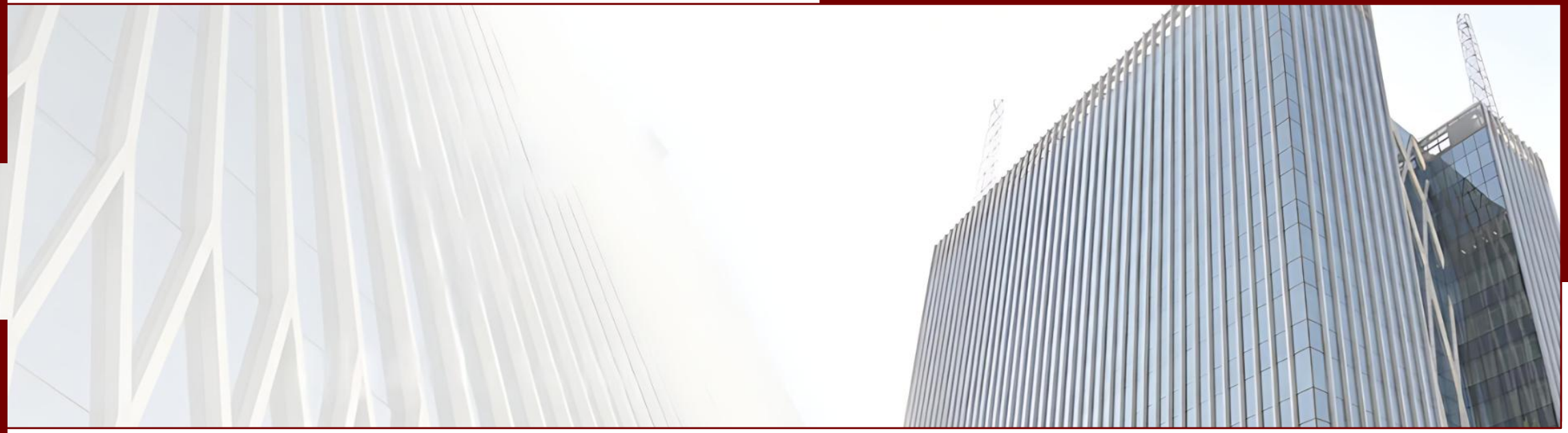


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۱۸ اردیبهشت ۱۴۰۵"

کارگزاری بانک ملت
Mellat Bank Brokerage co.

فهرست مطالب

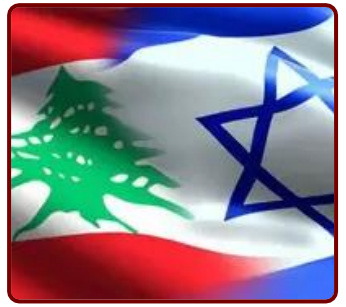
- مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر ۳
- بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر ۵
- روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن ۶
- ارزش دلاری بازار ۷
- نسبت قیمت به سود کل بازار ۸
- ارزش معاملات خرد سهام ۹
- ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت ۱۰
- ارزش معاملات صندوق‌های طلا ۱۱
- خالص ورود و خروج پول 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



وال استریت ژورنال: ایران و آمریکا در آستانه دستیابی به توافق ۱۴ بندی هستند

وال‌استریت ژورنال در گزارشی درباره تلاش‌های تازه دیپلماتیک میان ایران و آمریکا می‌نویسد دو کشور با میانجی‌گری در حال کار روی یک توافق اولیه هستند که می‌تواند به پایان درگیری‌ها و آغاز مذاکرات رسمی منجر شود، اما همزمان اختلاف‌های جدی و تهدیدهای نظامی همچنان پابرجاست. بر اساس این گزارش، ایران و آمریکا در حال کار با میانجی‌ها برای نهایی کردن یک «یادداشت تفاهم ۱۴ بندی» هستند؛ سندی که قرار است چارچوبی برای یک دوره یک‌ماهه مذاکره به‌منظور پایان دادن به جنگ فراهم کند. منابع آگاه گفته‌اند این مذاکرات ممکن است از اوایل هفته آینده در اسلام‌آباد از سر گرفته شود. به گفته همین منابع، ایران اکنون نسبت به گذشته انعطاف بیشتری نشان داده و آمادگی خود را برای گفت‌وگو درباره برنامه هسته‌ای اعلام کرده؛ موضوعی که پیش‌تر با مقاومت بیشتری از سوی تهران مواجه بود.



دور جدید مذاکرات اسرائیل و لبنان در آمریکا برگزار می‌شود

وزارت خارجه آمریکا می‌گوید که دور سوم گفت‌وگوها میان نمایندگان اسرائیل و لبنان روزهای ۱۴ و ۱۵ مه در واشنگتن برگزار خواهد شد. دو دور قبلی این مذاکرات نیز در سطح سفرا برگزار شده بود؛ در حالی که بیروت درخواست آمریکا برای دیدار مستقیم ژوزف عون، رئیس‌جمهور لبنان، با بنیامین نتانیاهو، نخست‌وزیر اسرائیل را رد کرده است. عون گفته تا زمانی که به توافقی امنیتی دست نیافته‌اند و حملات اسرائیل به لبنان متوقف نشده، چنین دیداری مناسب نیست. دو طرف در این مذاکرات در حال بررسی چارچوبی برای یک توافق احتمالی هستند؛ توافقی که می‌تواند شامل خروج نیروهای اسرائیلی از لبنان، خلع سلاح حزب‌الله توسط دولت لبنان و در نهایت عادی‌سازی روابط دیپلماتیک میان دو کشور باشد.



آمریکا ۱۰ فرد و شرکت را به اتهام ارتباط با برنامه پهپادی ایران تحریم کرد

وزارت خزانه‌داری آمریکا روز جمعه از اعمال تحریم‌هایی علیه ۱۰ فرد و شرکت، از جمله چند شرکت مستقر در چین و هنگ‌کنگ، خبر داد. این افراد و شرکت‌ها متهم شده‌اند که به تلاش‌های ایران برای تهیه سلاح و مواد خام مورد نیاز برای ساخت پهپادهای شاهد و موشک‌های بالستیک کمک کرده‌اند. این اقدام تنها چند روز پیش از سفر دونالد ترامپ، رئیس‌جمهوری آمریکا به چین انجام می‌شود. آقای ترامپ قرار است هفته آینده با شی جین‌پینگ، رئیس‌جمهوری چین در پکن دیدار کند. وزارت خزانه‌داری آمریکا در این بیانیه اعلام کرد که با هدف جلوگیری از بازسازی ظرفیت تولید نظامی تهران، برای اقدام اقتصادی علیه پایگاه صنعتی نظامی ایران آماده است.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



تصمیم جدید شورای عالی بورس برای بازار سهام: تداوم تعطیلی تا دوشنبه

طبق مصوبه شورای‌عالی بورس، فعالیت بازار سرمایه در سه روز ابتدایی هفته جاری و تا پایان روز دوشنبه ۲۱ اردیبهشت مانند هفته قبل خواهد بود. بنابر این گزارش، پس از آغاز جنگ ۴۰ روزه، خرید و فروش سهام در بازار سرمایه از ۹ اسفند ماه تا کنون متوقف شده است. با این حال معاملات صندوق‌های املاک و مستغلات، صندوق‌های درآمد ثابت، صندوق‌های طلا و گواهی سپرده برقرار است.



حراج امروز شمش طلای مرکز مبادله با پرداخت ۵ میلیارد تومانی

یکصد و چهل و پنجمین جلسه حراج شمش طلا مرکز مبادله تا ساعت ۲۴ امروز ۱۹ اردیبهشت ماه برگزار می شود. متقاضیان می توانند با واریز ۵ میلیارد تومان به عنوان وجه الضمان به ازای هر قطعه شمش طلا در این حراج حضور یابند. بر اساس این گزارش، گروه‌های مجاز به خرید شامل فروشندگان عمده شمش طلا، تولیدکنندگان مصنوعات طلا، خرده‌فروشان طلای آبشده، سکوهای آنلاین خرید و فروش طلا آب شده، مصنوعات طلا و جواهر هستند.

ساعت پایان معاملات صندوق های طلا و آپشن تغییر کرد

مدیریت بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی بورس کالا، اطلاعیه تغییر ساعت معاملات بازارهای مالی این بورس را به کلیه فعالان اعلام کرد. بر اساس این گزارش، ساعت پایان معاملات بازار صندوق های کالایی، گواهی سپرده کالایی، اوراق سلف موازی استاندارد و قراردادهای اختیار معامله از شنبه ۱۹ اردیبهشت، راس ساعت ۱۷ خواهد بود.

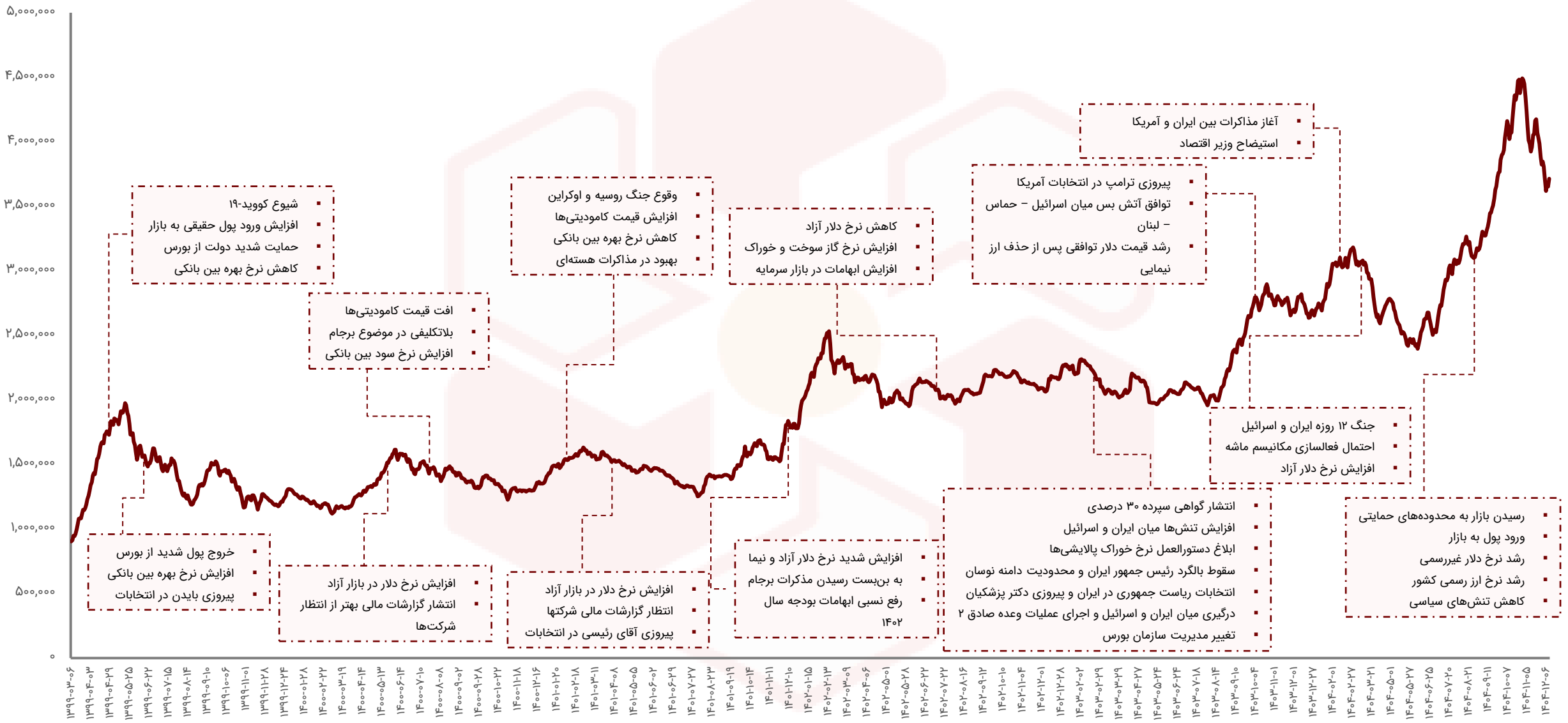
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته گذشته، با انتشار خبری در خصوص نزدیکی توافق میان ایالات متحده آمریکا و جمهوری اسلامی ایران، شاهد ریزش قیمت‌ها در بـازار طـلا و ارز بـودیم؛ قیمـت دلار آمریکـا از محـدوده ۱۸۶ هزارتومان با کاهشی شدید، به ۱۷۵ هزارتومان رسید؛ هر گرم طلای ۱۸ عیار نیز از ۲۰ میلیون و ۸۵۰ هزارتومان تا ۱۹ میلیون و ۱۵۰ هزارتومان کاهش یافت. از سوی دیگر، در طول هفته همچنان شاهد خروج نقدینگی حقیقی از صندوق‌های درآمد ثابت بودیم. در این هفته، ارزش معاملات این صندوق‌ها به ۱۶۴ هزار میلیارد تومان رسید و ۱۱.۸ هزارمیلیارد تومـان خـروج نقـدینگی از آن ثبـت گردیـد. ارزش معاملات صندوق‌های طلا و نقره نیز به بیش از ۱۴۰ همت رسید و ورود پولی ۱۷.۸ همتی ثبت کردند. در هفته پیش‌رو، ساعت پایان معاملات بازار صندوق های کالایی، گـواهی سـپرده کـالایی، اوراق سلف موازی استاندارد و قراردادهای اختیار معامله از روز شنبه ۱۹ اردیبهشت، راس ساعت ۱۷ خواهد بود.

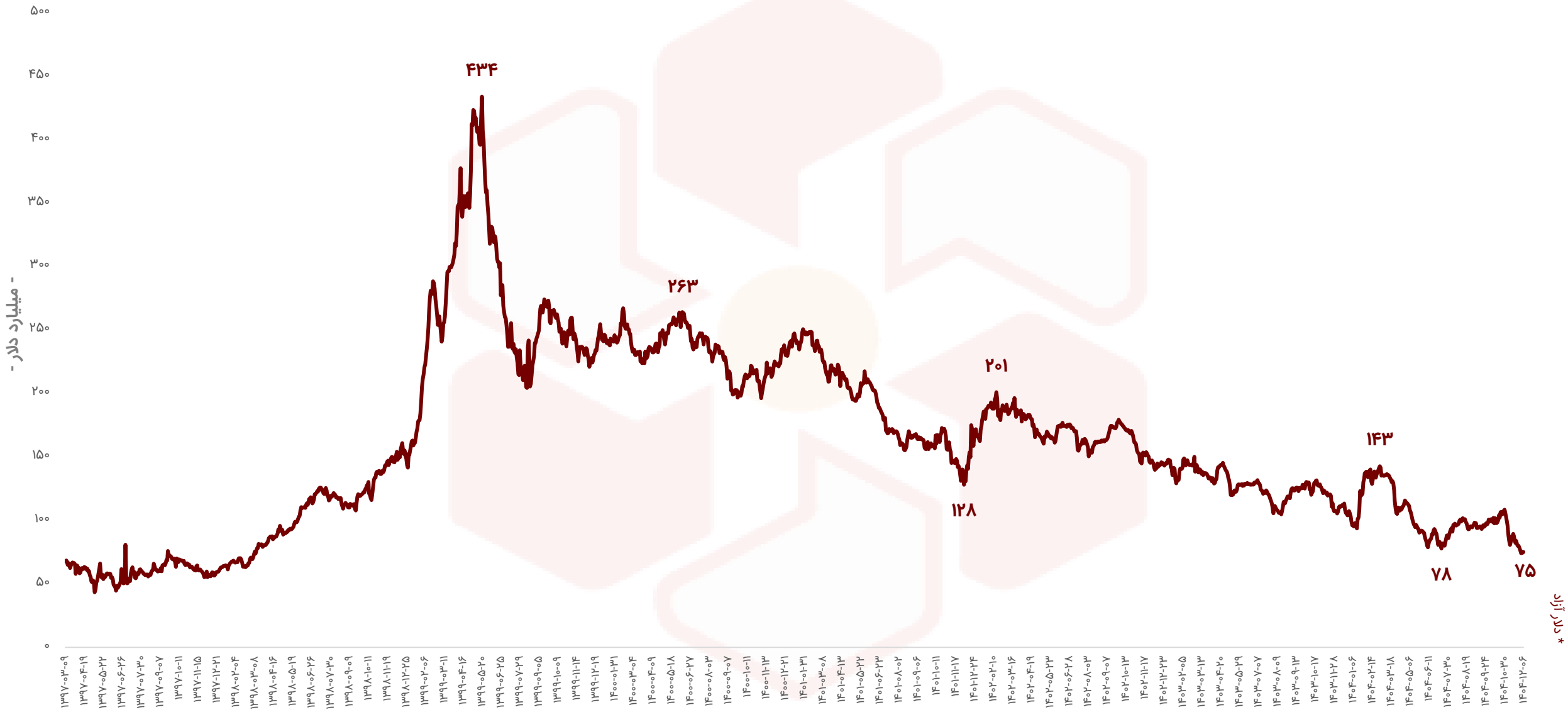
تغییرات هفتگی شاخص ها

	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)		۱۶۴,۲۲۶	-	-
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)		(۱۱,۸۴۱)	-	-

روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن

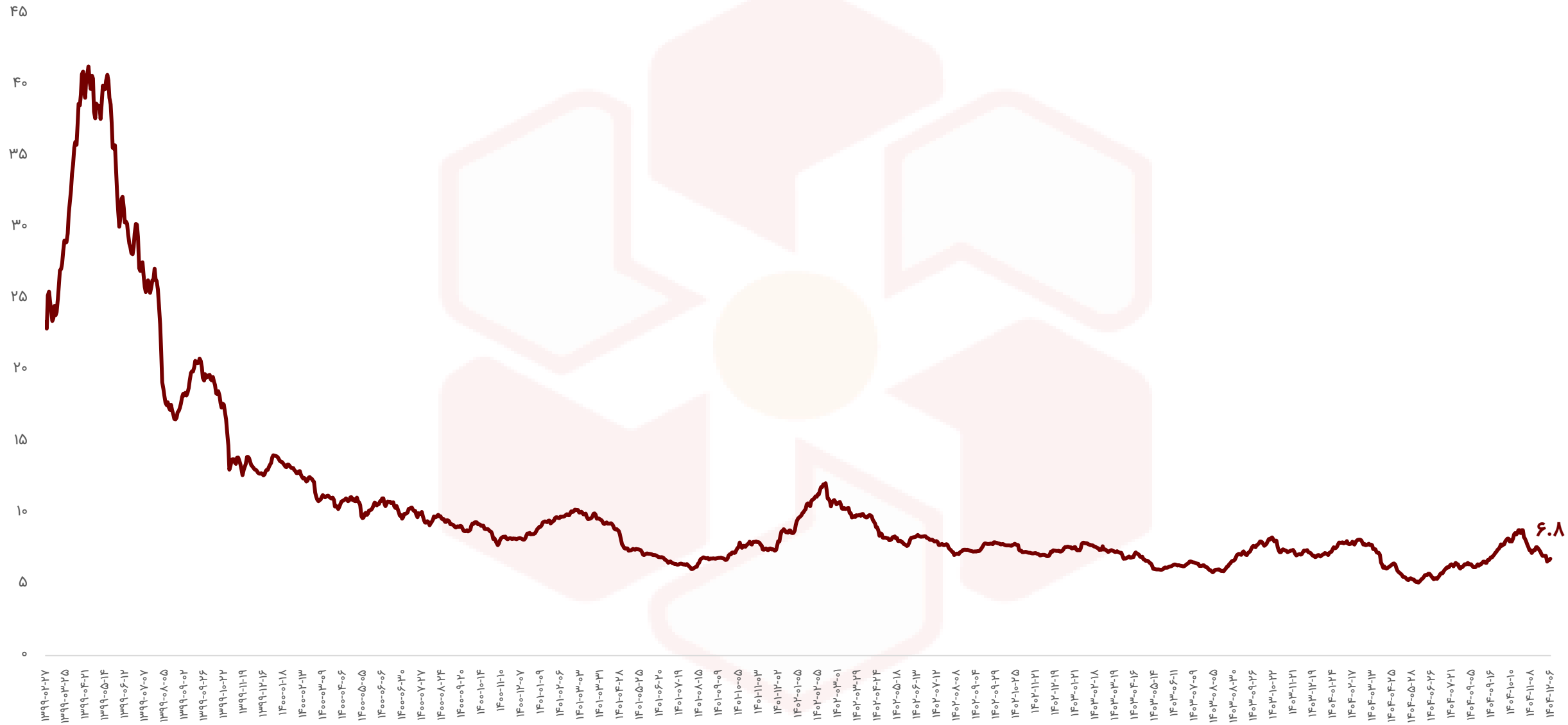


ارزش دلاری بازار*

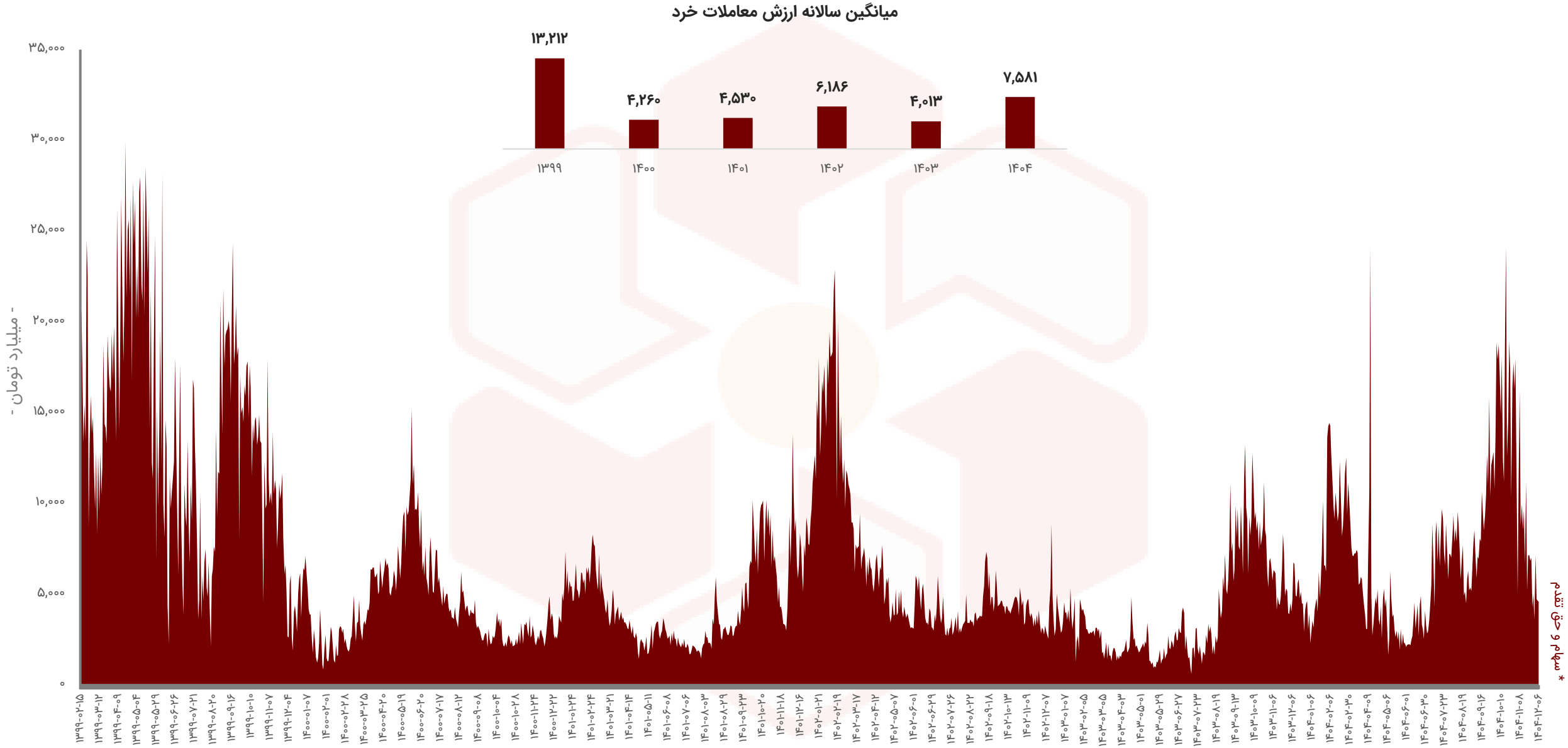


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

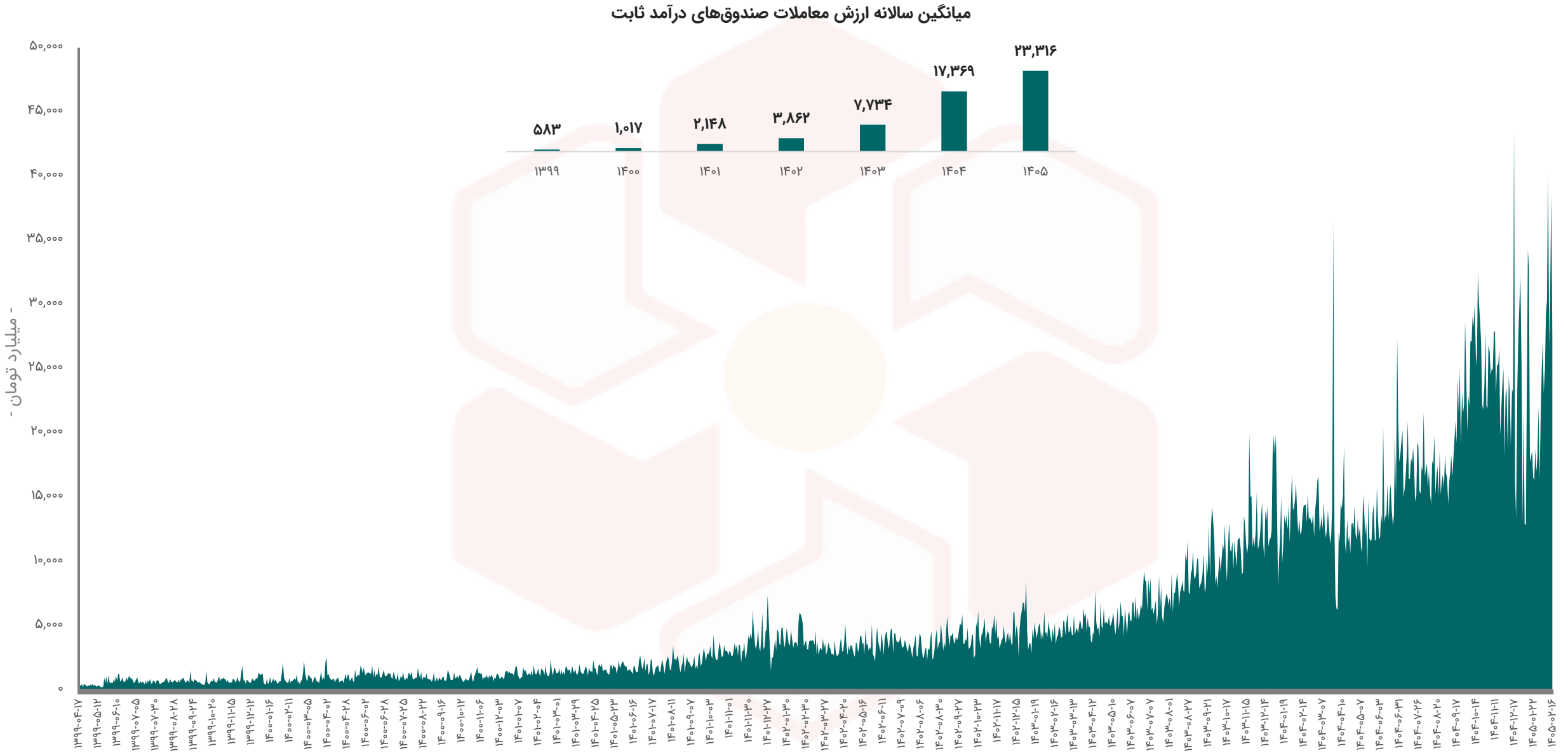
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



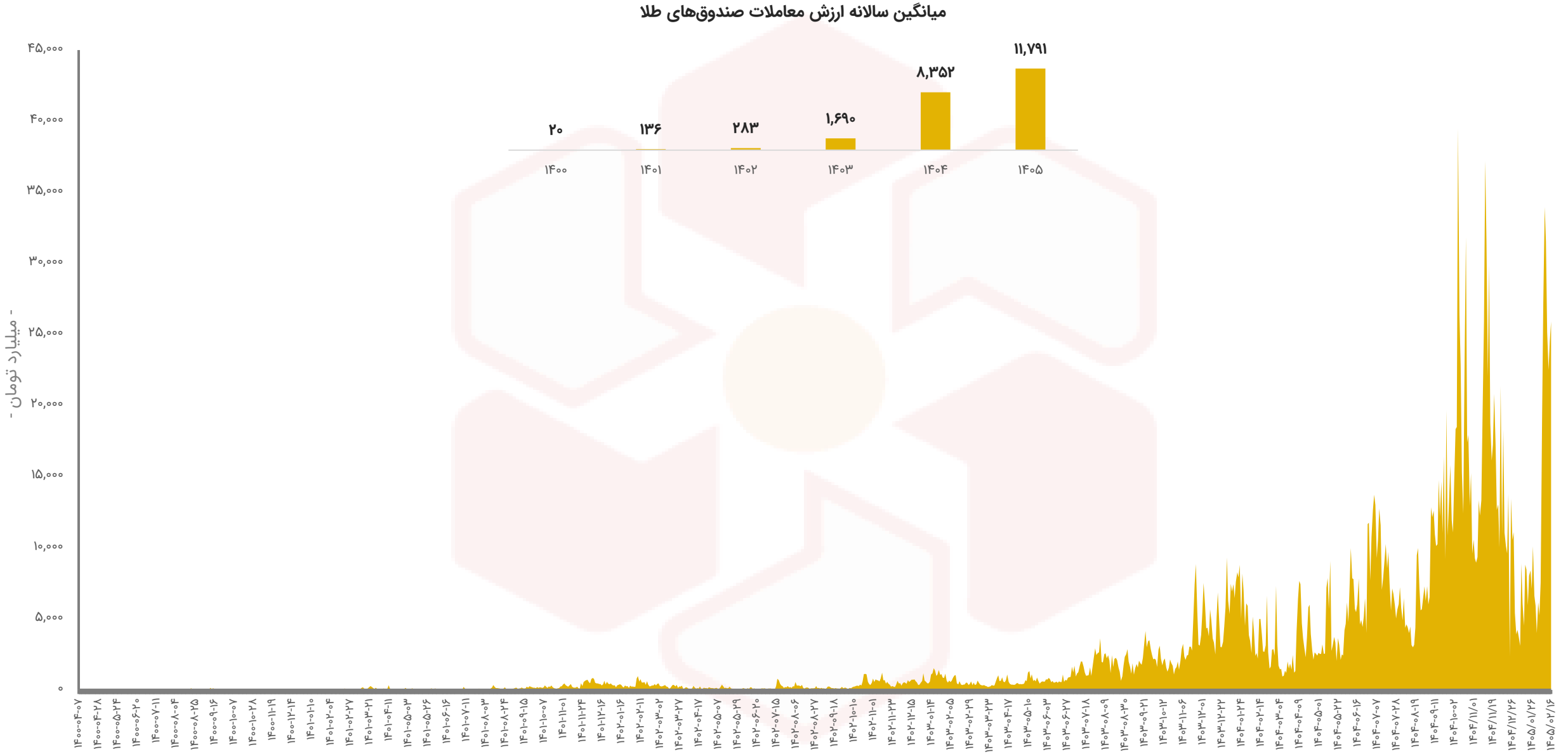
ارزش معاملات خرد سهام*



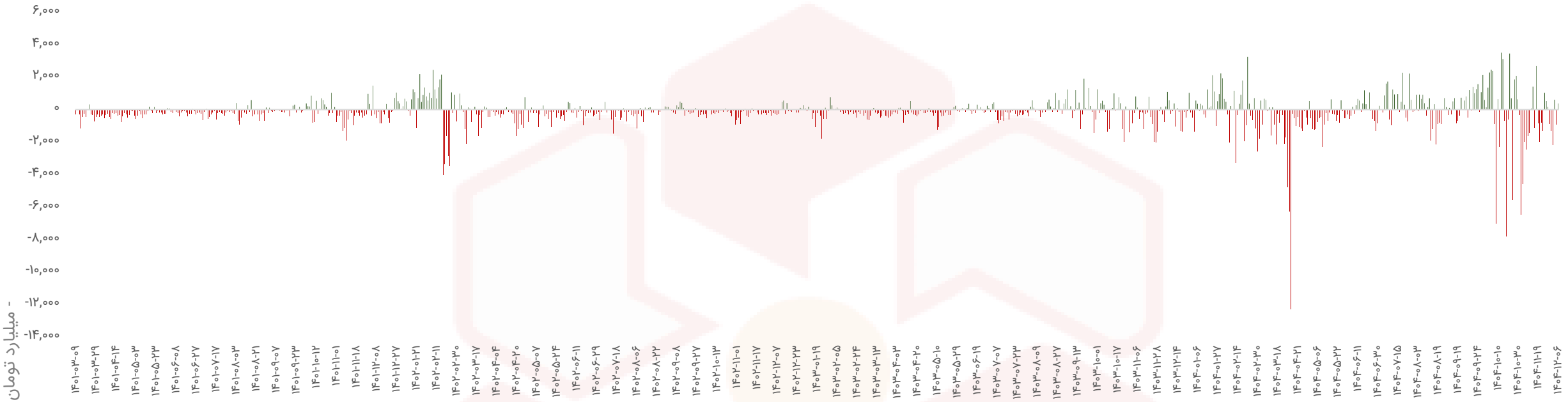
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



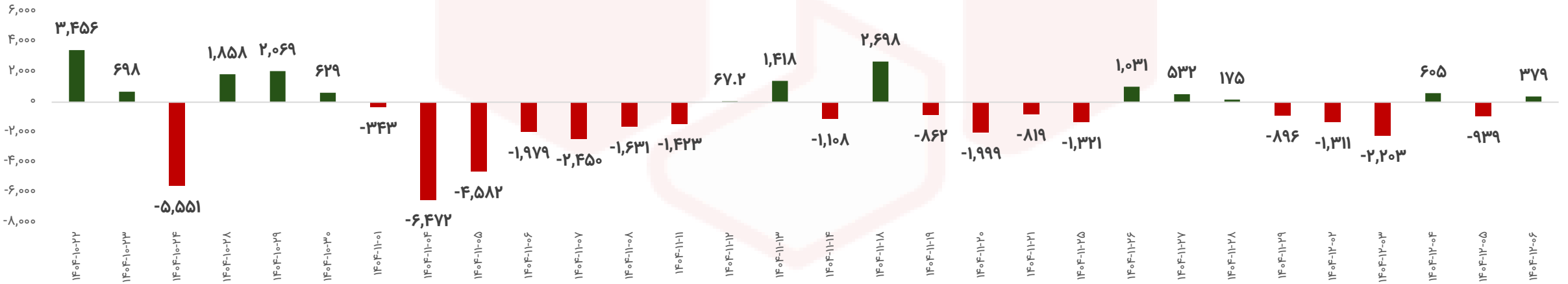
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



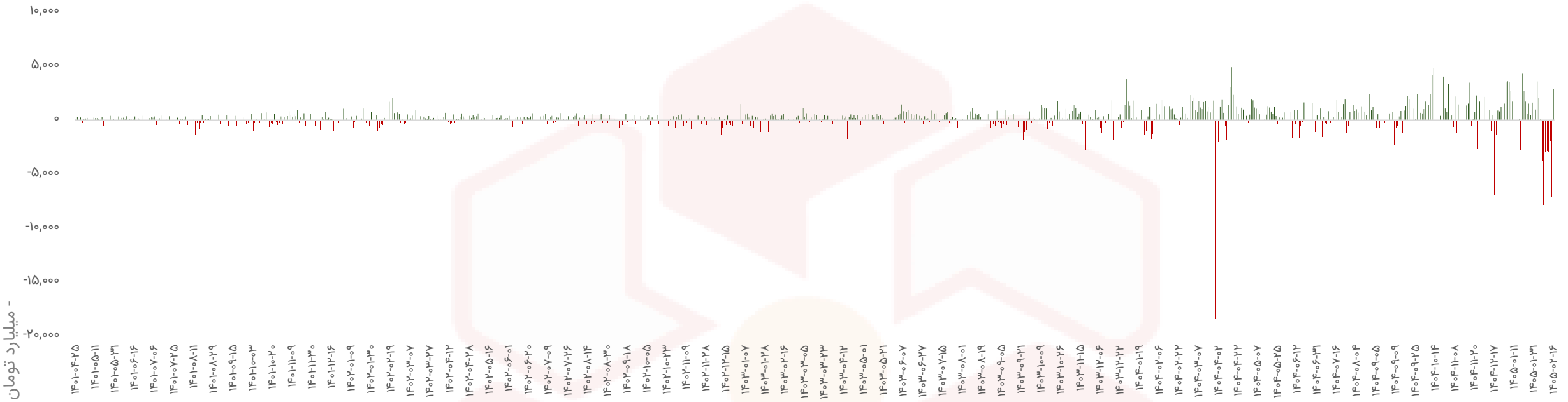
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



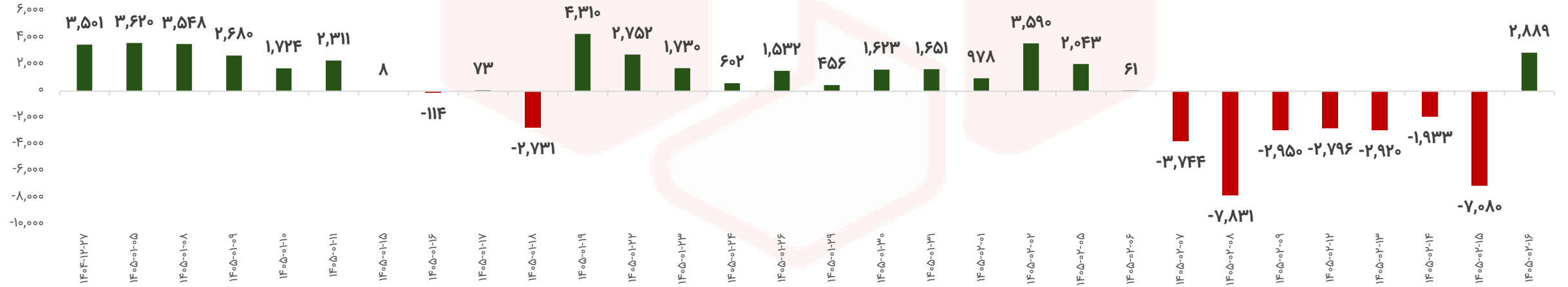
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



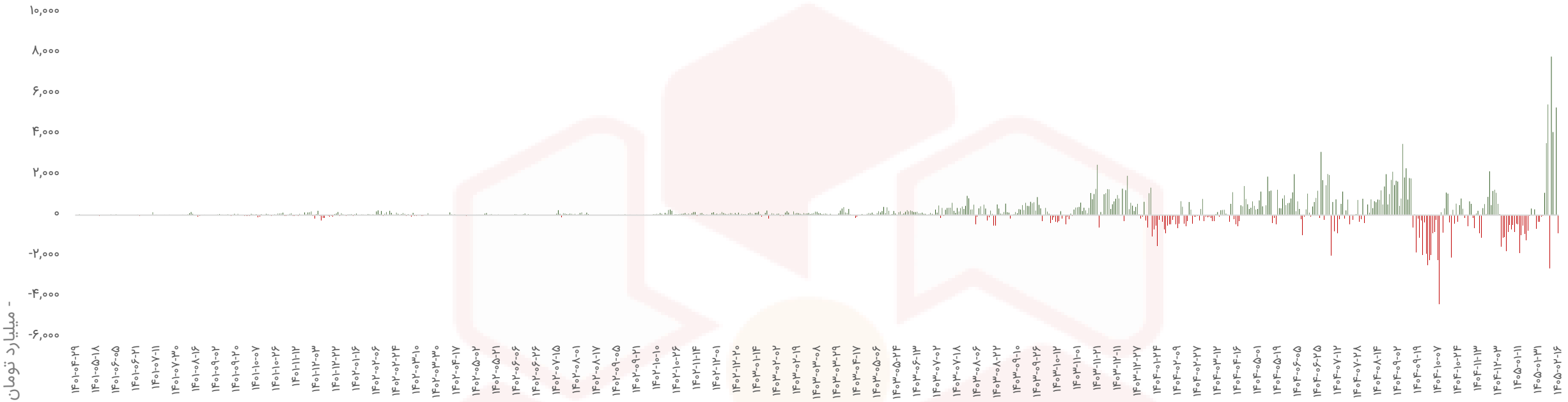
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



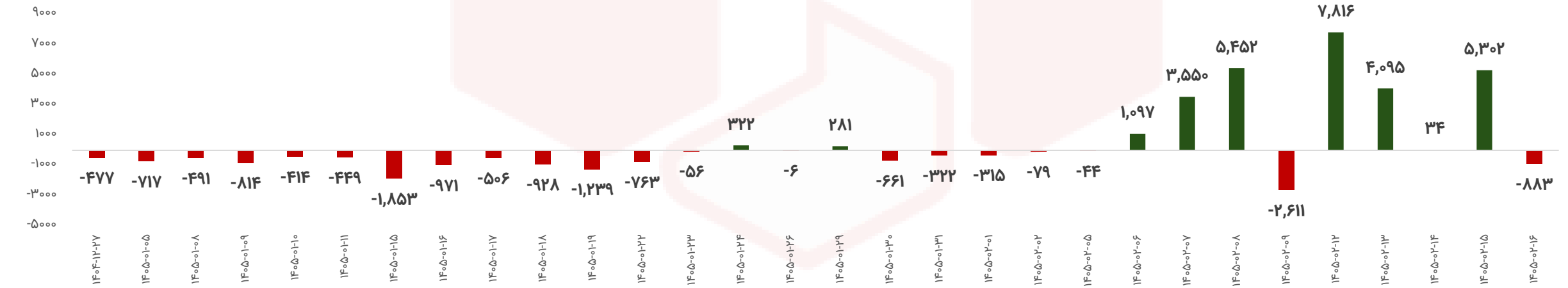
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

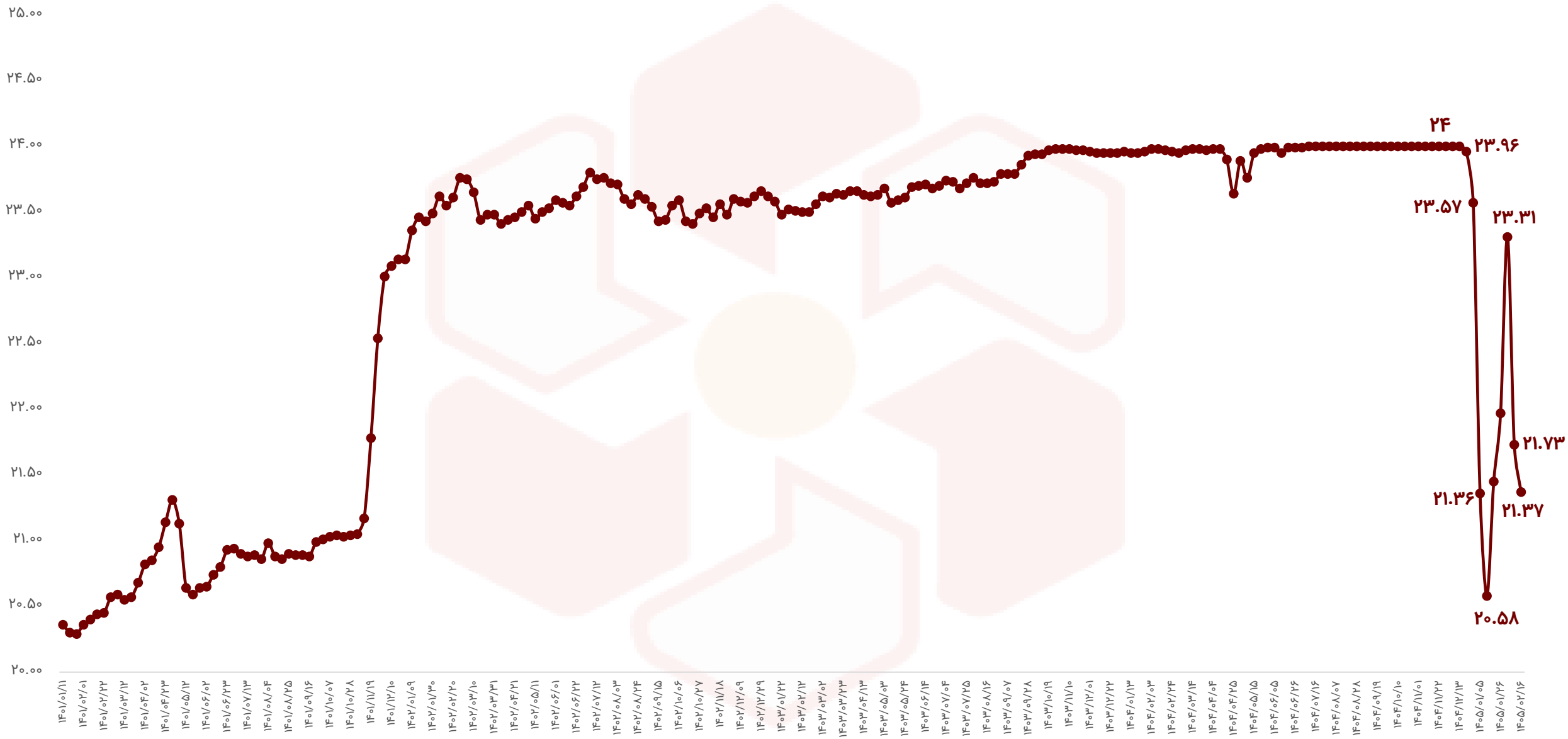
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های طلا



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)
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۱۸۷	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۶,۲۲۰	۳۹.۸۹%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۹۱۵	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۳۳,۷۹۰	۳۹.۳۸%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۸۸۷	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۶,۹۰۰	۳۹.۲۸%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۸۵۲	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۶۲,۵۶۰	۳۹.۱۱%
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۴۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶۳,۸۸۰	۳۹.۰۷%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۷۱	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۸۳,۶۲۰	۳۸.۱۸%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۲۱۵	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۶,۵۸۰	۳۸.۰۵%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۵۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۰۲,۴۲۰	۳۷.۸۸%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۴۸۸	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۴۹,۸۵۰	۳۷.۸۶%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۲۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۲,۲۴۰	۳۷.۷۴%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۱۵۹	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۷۳,۵۴۰	۳۶.۲۳%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۵۰	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۱۶,۴۴۰	۳۴.۴۲%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۷۱۳	۴,۵۹۲	۲.۶%	۴,۷۰۷	۰.۱%
سکه امامی (تومان)	۱۹۴,۵۰۰,۰۰۰	۱۹۷,۰۰۰,۰۰۰	(۱.۳%)	۱۸۵,۵۰۰,۰۰۰	۴.۸%
دلار آزاد (تومان)	۱۷۴,۹۹۰	۱۷۳,۴۹۰	۰.۹%	۱۶۱,۲۲۰	۸.۵%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۱۰۰.۳	۱۰۸.۵	(۷.۵%)	۱۰۸	(۷.۱%)
بیت کوین (دلار)	۸۰,۳۹۷	۷۸,۵۶۷	۲.۳%	۷۰,۵۰۱	۱۴%
اتریم (دلار)	۲,۳۱۶	۲,۳۰۷	۰.۴%	۲,۱۶۴	۷%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۴۸۹	۳,۵۱۲	(۰.۶%)	۳,۴۶۴	۰.۷%
مس LME (دلار)	۱۳,۸۸۱	۱۳,۲۰۵	۵.۱%	۱۲,۳۴۳	۱۲.۵%
روی LME (دلار)	۳,۴۱۳	۳,۳۴۶	۲%	۳,۲۹۳	۳.۶%
سرب LME (دلار)	۱,۹۶۷	۱,۹۵۷	۰.۵%	۱,۹۳۹	۱.۴%
انس پلاتین (دلار)	۲,۰۵۹	۲,۰۱۵	۲.۲%	۲,۳۷۴	(۱۳.۳%)

کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege