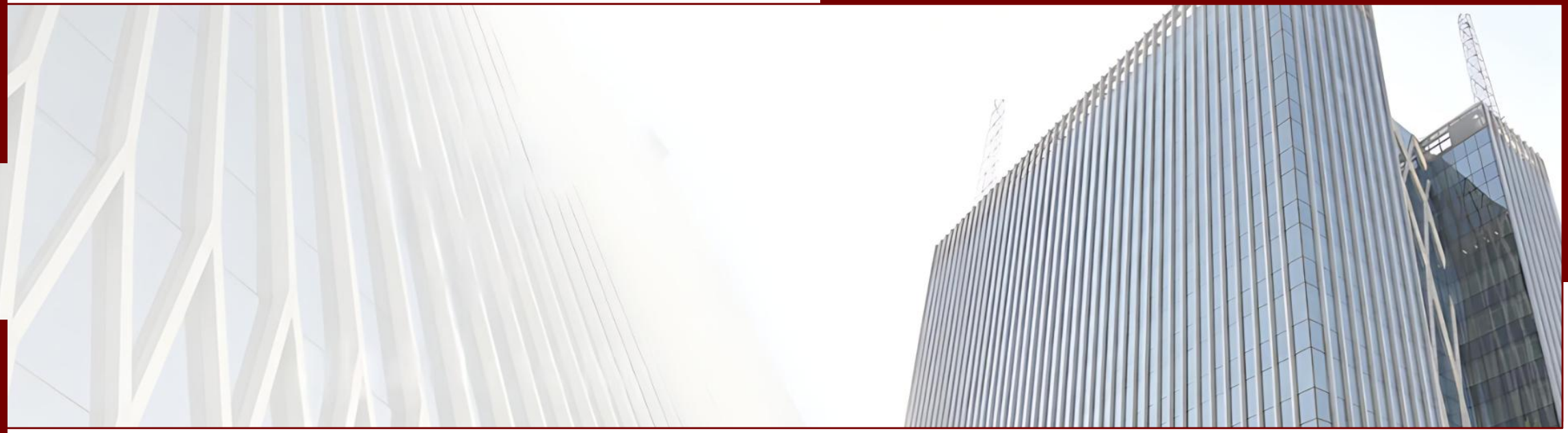


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۱ خرداد 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
- ترین‌های بازار در هفته اخیر ۱۵
- بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه ۱۷
- روند نرخ بهره بین بانکی ۲۰
- اوراق با درآمد ثابت ۲۱
- وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه ۲۲
- بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار ۲۳

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



دیدار و گفت وگوی فرمانده ارتش پاکستان با عراقچی در تهران

فیلد مارشال عاصم منیر فرمانده ارتش پاکستان که به‌منظور رایزنی و تبادل نظر با مقام‌های جمهوری اسلامی ایران به تهران سفر کرده است با وزیر امور خارجه دیدار و گفت وگو کرد. در این دیدار که روز گذشته (جمعه) صورت گرفت و تا پاسی از شب ادامه داشت، طرفین درباره آخرین تلاش‌ها و ابتکارات دیپلماتیک برای جلوگیری از تشدید تنش و خاتمه جنگ تحمیلی آمریکا و رژیم صهیونیستی علیه ایران، و همچنین راهکارهای تقویت صلح، ثبات و امنیت در منطقه غرب آسیا تبادل نظر کردند. ارتش هدف از سفر عاصم منیر را بخشی از تلاش‌های جاری میانجی گری توصیف کرد.



زمینه‌چینی اروپا برای تحریم ایرانی‌ها به بهانه تحولات هرمز

شورای اروپا روز جمعه اعلام کرد که چارچوب تحریم‌های خود را برای هدف قرار دادن افرادی که طبق ادعای این نهاد «آزادی تردد دریایی در تنگه هرمز را تهدید می‌کنند» گسترش داده است. این تصمیم به اتحادیه اروپا اجازه می‌دهد علیه برخی افراد ممنوعیت سفر و مسدودسازی دارایی‌ها اعمال شود. این چارچوب تحریمی در ابتدا بر مبنای «حمایت نظامی ایران از روسیه» ایجاد شده بود اما کنون دامنه شمول خودش را افزایش داده است. جمهوری اسلامی ایران در واکنش به تجاوز آمریکا و رژیم صهیونیستی اعلام کرده که به کشتی‌های مرتبط با طرف‌های متجاوز اجازه عبور از تنگه هرمز را نمی‌دهد. ایالات متحده آمریکا در واکنش از ۱۳ آوریل (۲۴ فروردین‌ماه) اعلام کرده بنادر ایران را تحت محاصره دریایی قرار داده است. تصمیم جدید شورای اروپا در حالی اتخاذ شده که کشورهای عضو اتحادیه اروپا تا کنون اقدام آمریکا در جنگ افروزی و همچنین محاصره دریایی ایران را محکوم نکرده‌اند.



جلسه ترامپ با مشاوران امنیت ملی درباره ایران

پایگاه خبری آکسیوس گزارش داد که در بحبوبه احتمال افزایش درگیری با ایران، ترامپ روز جمعه با مشاوران ارشد امنیت ملی خود دیدار کرده است. در این نشست که با حضور مقامات کلیدی از جمله جِی‌دی ونس، معاون رئیس‌جمهوری، پیت هگزث، وزیر جنگ و جان راتکلیف، رئیس سیا، برگزار شد، ترامپ در جریان آخرین وضعیت دیپلماسی با ایران قرار گرفت. این گزارش مدعی شده که ترامپ به طور جدی در حال بررسی اقدام نظامی است مگر اینکه روند مذاکرات بهبود یابد. با این حال آکسیوس نوشته که هنوز هیچ نشانه‌ای مبنی بر تصمیم ترامپ برای از سرگیری جنگ وجود ندارد. یک مقام آمریکایی این گفتگوها را "طاقت‌فرسا" توصیف کرده؛ با پیش‌نویس‌هایی که "هر روز رد و بدل می‌شوند" و "پیشرفت چندانی" ندارند. ترامپ طی شش هفته گذشته بارها تا آستانه از سرگیری اقدام نظامی پیش رفته بود اما در نهایت از این کار عقب نشینی کرده است. آکسیوس همچنین ادعا کرده که منابع مطلع از تفکر ترامپ می‌گویند که او اکنون متمایل‌تر به اقدام نظامی است، مگر اینکه مذاکرات به یک پیشرفت غیرمنتظره منجر شود.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



زمان و نحوه فعالیت بورس و فرابورس، صندوق‌ها و مشتقات تا سه شنبه هفته جاری

معاونت عملیات بازار شرکت بورس در خصوص بازگشایی بازارها در اطلاعیه‌ای، اعلام کرد: از سه‌شنبه ۲۹ اردیبهشت ماه، کلیه نمادهای بازار سهام، سرمایه گذاری حرفه‌ای، صندوق‌های سرمایه‌گذاری سهامی و مختلط و مشتقات آنها بازگشایی می‌شود. زمان معاملات نمادها در بازارها تا ۵ خرداد با یک ساعت افزایش همراه و از ساعت ۸:۴۵ تا ۱۳:۳۰ تعیین شده و تا آن روز مرحله معاملات پایانی (TAL) برگزار نخواهد شد. زمان جلسه معاملاتی صندوق‌های درآمد ثابت از ۸:۲۵ تا ۱۵ تعیین شده است. فرابورس هم اعلام کرد: ساعت معاملاتی در بازار سهام و صندوق‌های سرمایه‌گذاری سهامی و مختلط و ابزارهای مشتقه تا ۵ خرداد از ۸:۴۵ تا ۱۳:۳۰ تعیین شده است. ساعت معاملاتی صندوق‌های سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات، جسورانه و خصوصی و اوراق گواهی حق تقدم استفاده از تسهیلات مسکن از ۸:۴۵ تا ۱۵ است. ساعت معاملاتی اوراق و صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت از ۸:۲۵ تا ۱۵ تعیین می‌شود.



نحوه و شروط دریافت وام تا ۲۰۰ میلیون تومانی سهامداران اعلام شد

طبق برنامه سازمان بورس و با هماهنگی بانکها، سهامداران می توانند با مشارکت در طرح نقدینه و مراجعه به dara.csdiran.ir، زمینه دریافت وام تا ۲۰۰ میلیون تومانی و با سود ۲۳ درصدی و بازپرداخت ۲۴ ماهه از محل وثیقه سهام شرکتهای بورسی و فرابورسی (معادل حداکثر ۵۰ درصد ارزش سبد سهام متقاضیان در ۶ اسفند) را به صورت آنلاین فراهم کنند. حداکثر زمان دریافت وام ۶ روز کاری و بدون معرفی ضامن یا ارائه وثایق دیگر بوده و منافع سهام از جمله سود نقدی، سهام جایزه و حق تقدم همچنان متعلق به سهامدار باقی می‌ماند و بانک‌های ملت، تجارت، صادرات رفاه کارگران و پست بانک در این طرح مشارکت دارند. استفاده‌کنندگان از طرح نقدینه شامل حداقل ۱۸ سال سن و ثبت‌نام و احراز هویت در در سامانه سجام، امکان بهره‌مندی همزمان از سایر طرح‌های حمایتی از جمله بیمه سهام را نخواهند داشت. همچنین متقاضیان نباید دارای بدهی معوق یا چک برگشتی بدون رفع سوءاثر در شبکه بانکی باشند.



انجام اولین معامله ۱۰۰ دستگاه تجهیزات برق خورشیدی در بورس کالا

برای نخستین بار در روز چهارشنبه ۳۰ اردیبهشت ماه ۴۰۰ دستگاه سبد تجهیزات برق خورشیدی (پنل و اینورتر) در بورس کالای ایران عرضه و ۱۰۰ دستگاه آن با قیمت پایه مورد معامله قرار گرفت. این تجهیزات که متعلق به شرکت مهندسی توان پژوهان فناور پاسارگاد است از سوی سازمان انرژی‌های تجدید پذیر و بهره وری انرژی برق (ساتبا) عرضه شد. گفتنی است پذیرش این کالا پس از بررسی مدارک و مستندات در چهارصد و شصت و چهارمین جلسه کمیته عرضه در تاریخ ۲۸ بهمن در بازار فرعی به تصویب رسیده بود.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته اخیر، بازار سهام پس از حدود ۸۰ روز تعطیلی، با روند مثبتی آغاز به کار کرد و برخلاف انتظار بسیاری از فعالان، شاهد تشکیل صف‌های خرید در اکثر صنایع بودیم. صنایعی مانند سیمان، دارو، غذایی، زراعت و انبوه سازی که عمدتاً از نمادهای کوچک و متوسط تشکیل شده‌اند، با تقاضای شدیدی روبرو شدند. در مقابل، برخی گروه‌های بزرگ مانند پالایشی، خودروسازی و صندوق‌های اهرمی، شاهد عرضه شدید و تشکیل صف فروش بودند.

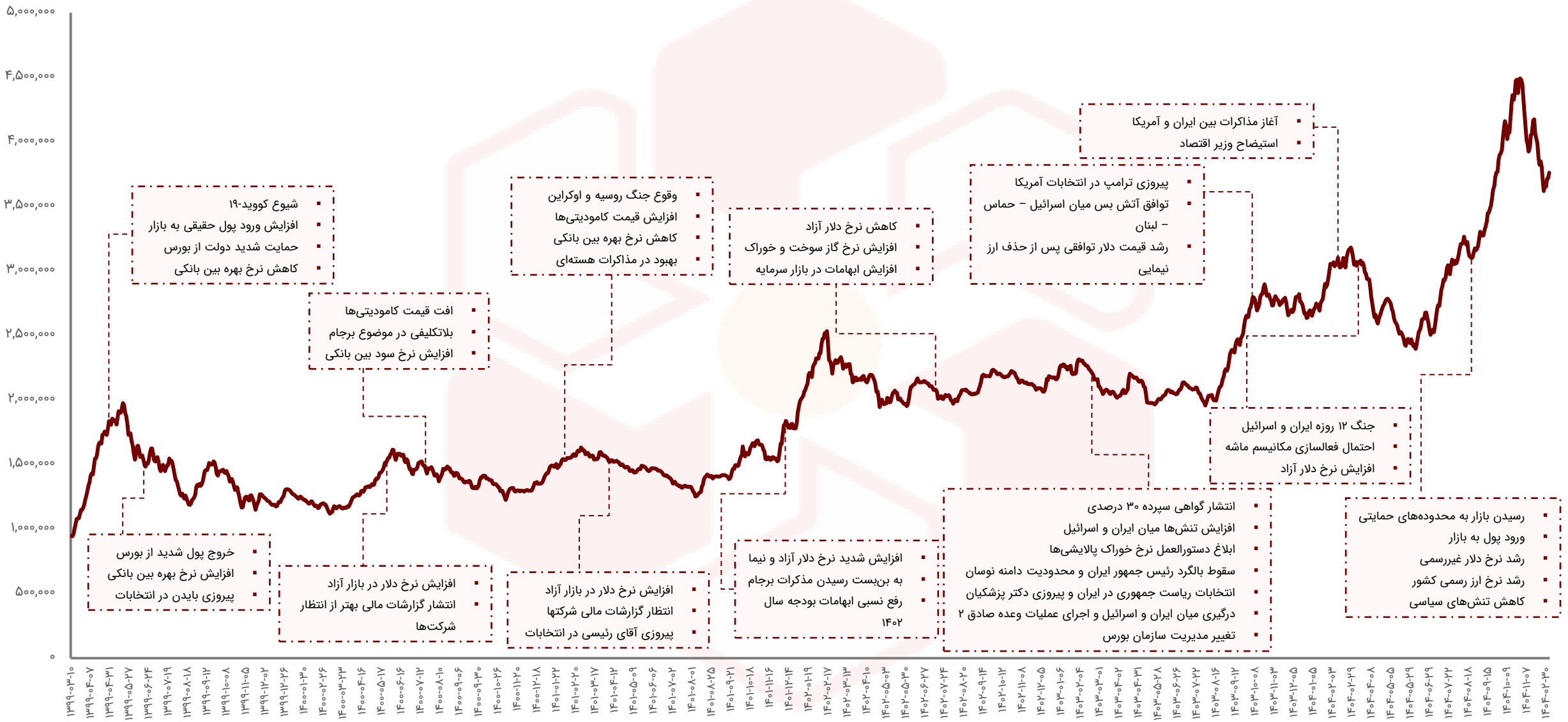
عواملی همچون انتشار گزارشات میان‌دوره‌ای و ماهانه شرکت‌ها، رشد نرخ دلار رسمی کشور و طولانی شدن روند آتش بس میان جمهوری اسلامی و ایالات متحده آمریکا، به وضعیت فعلی بازار منجر شدند. این در حالی است که تعداد زیادی از نمادها همچنان بسته هستند و در روزهای آینده بازگشایی خواهند شد، مگر آن دسته که مستقیماً از جنگ آسیب دیده‌اند.

در بازارهای موازی، در روزهای اخیر شاهد افت قیمت طلا بودیم که ناشی از کاهش قیمت جهانی و ثبات نرخ ارز در محدوده ۱۸۰ هزار تومان است.

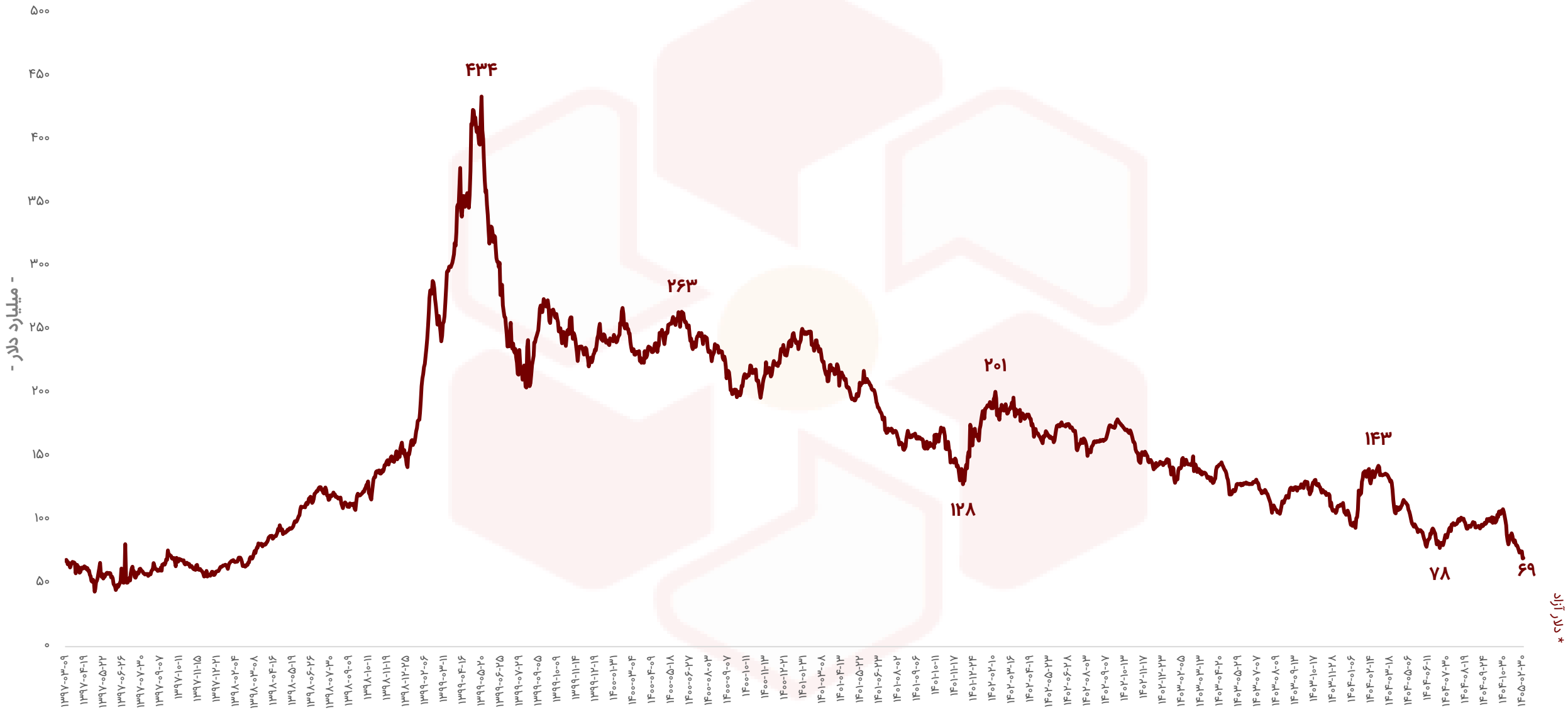
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۳,۷۱۳,۹۵۵	۳,۷۶۱,۳۰۴	۴۷,۳۴۹	%۱.۳
شاخص هم وزن (واحد)	۹۵۲,۶۸۱	۹۶۸,۵۹۵	۱۵,۹۱۴	%۱.۷
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۱۲۱,۴۰۸		(۴۸,۳۷۴)	%۲۸.۵
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	۷۷۵		-	-

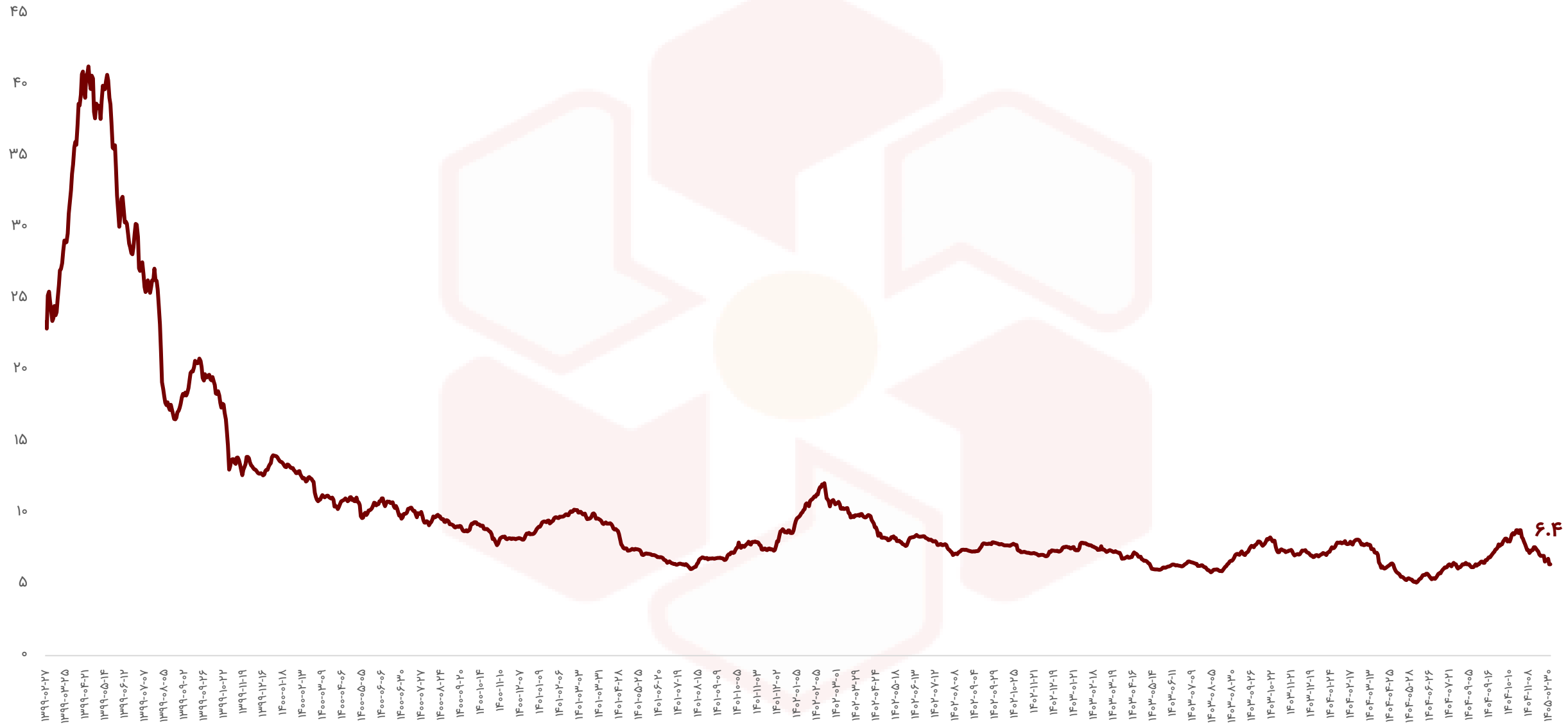
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



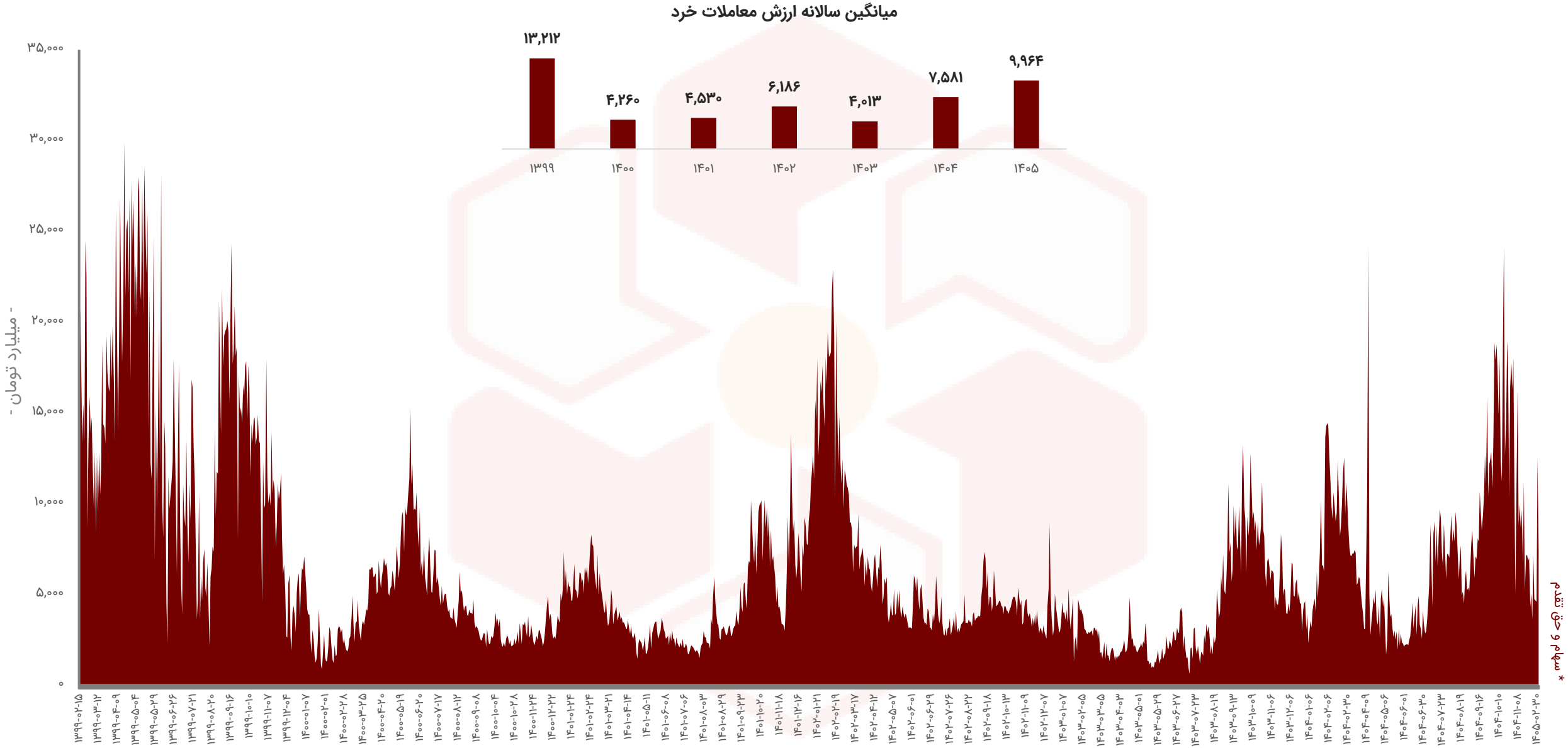
ارزش دلاری بازار*



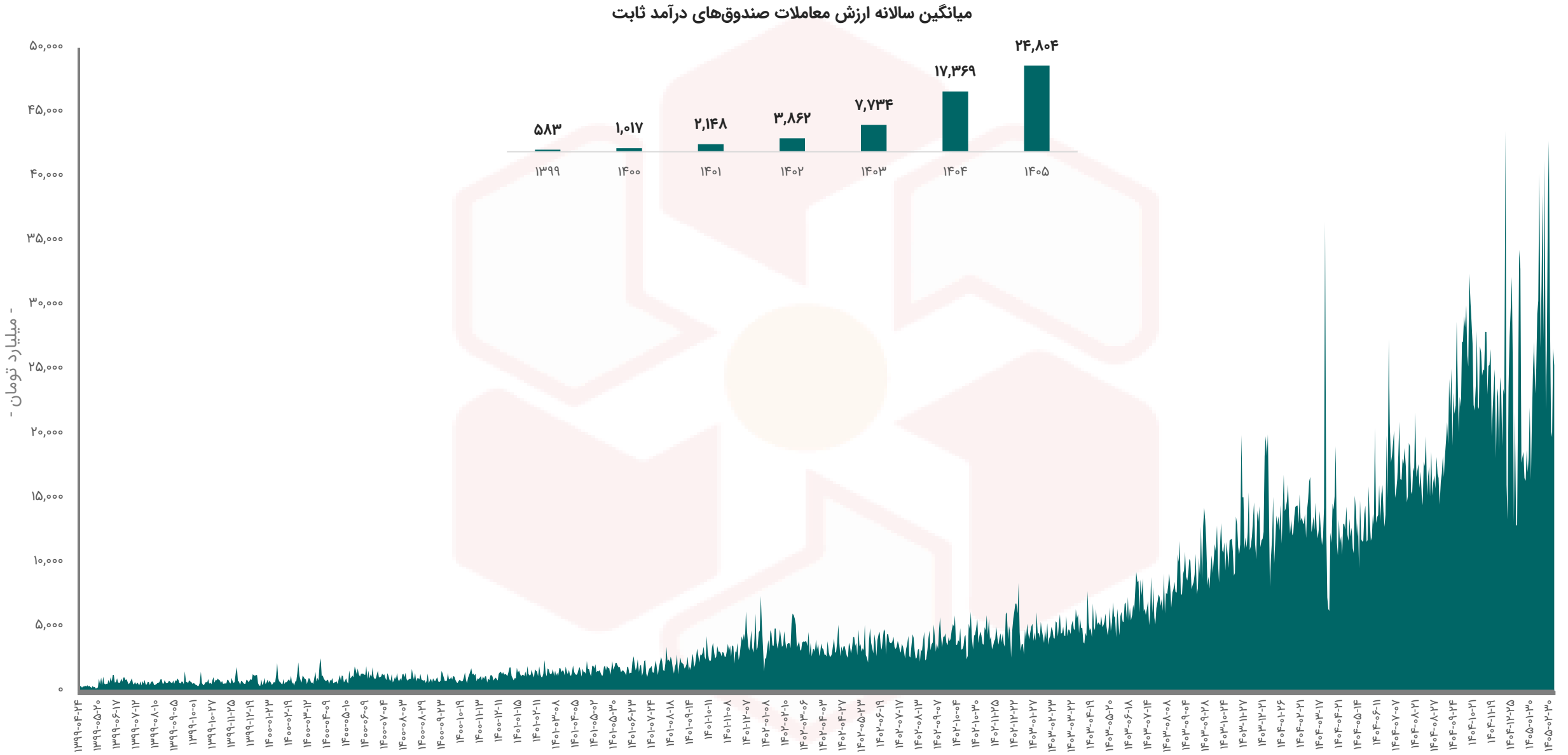
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



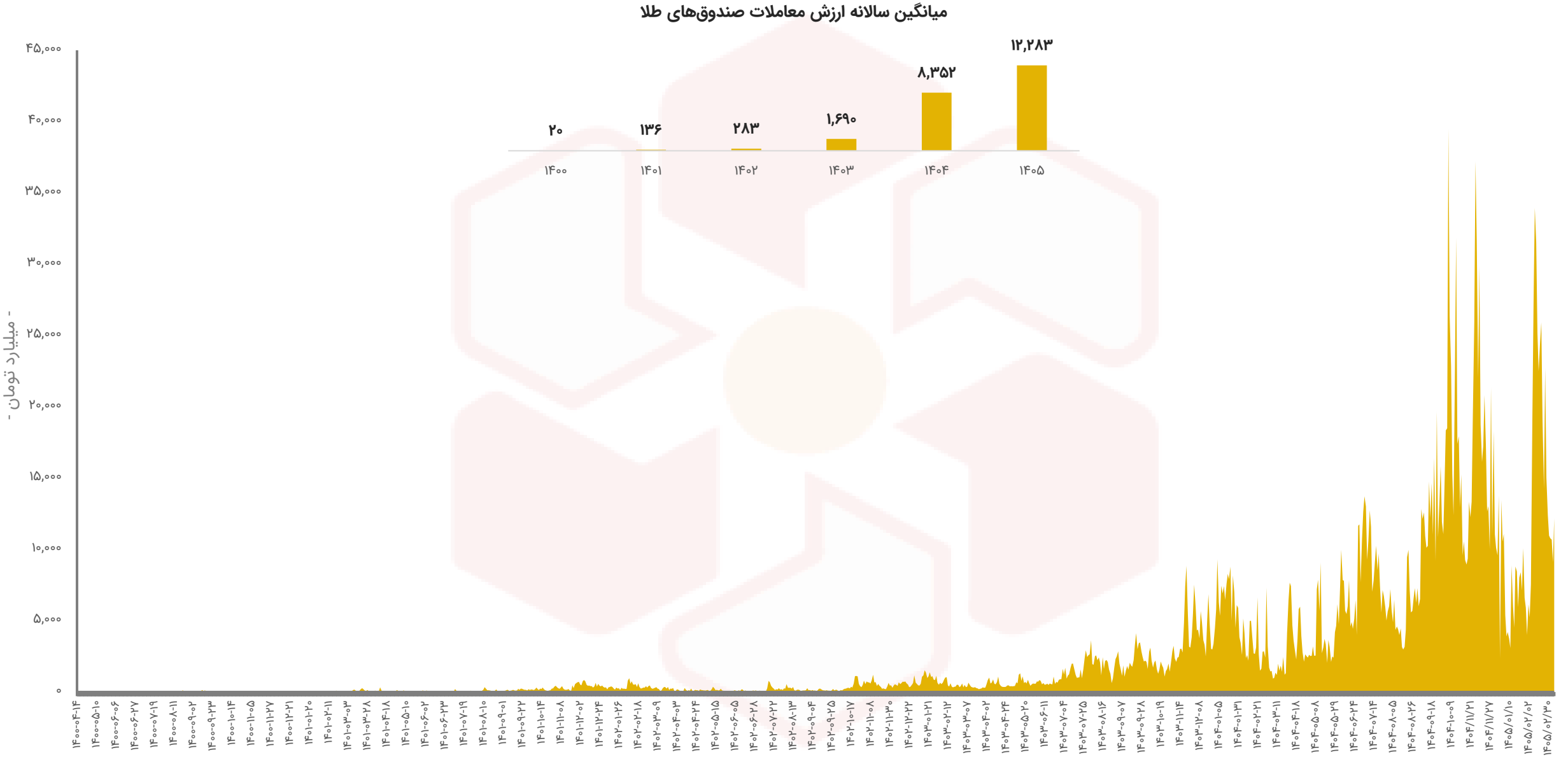
ارزش معاملات خرد سهام*



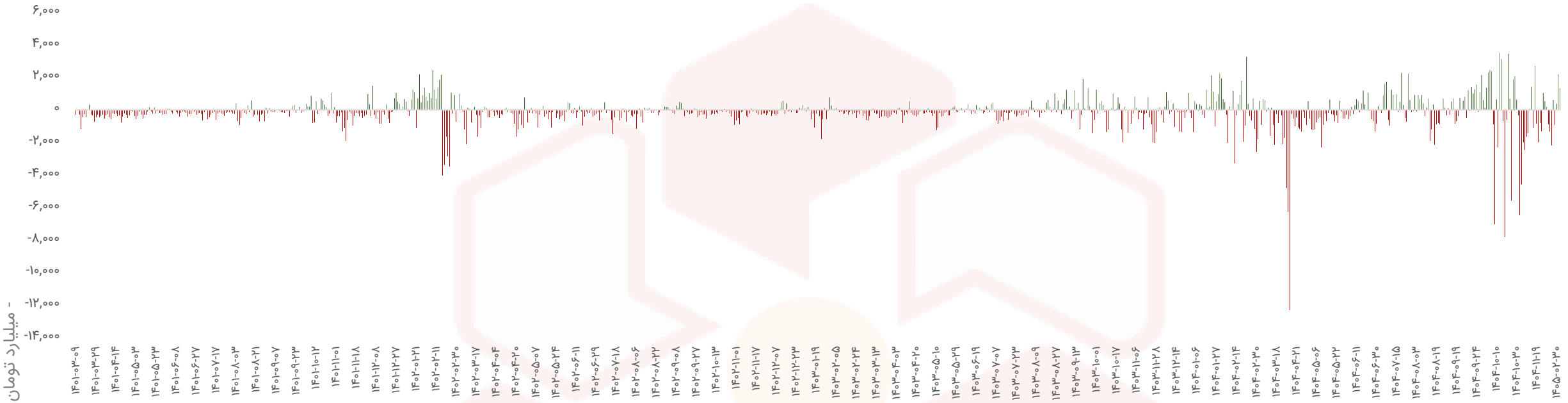
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



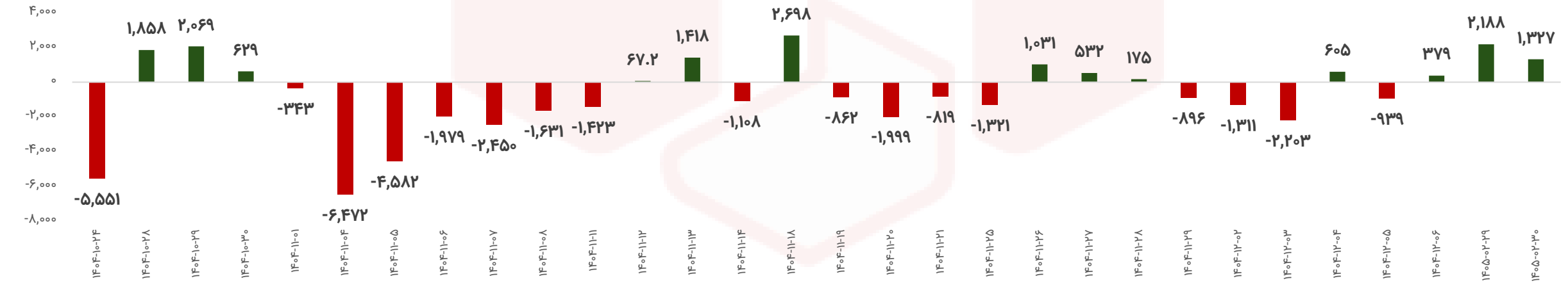
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



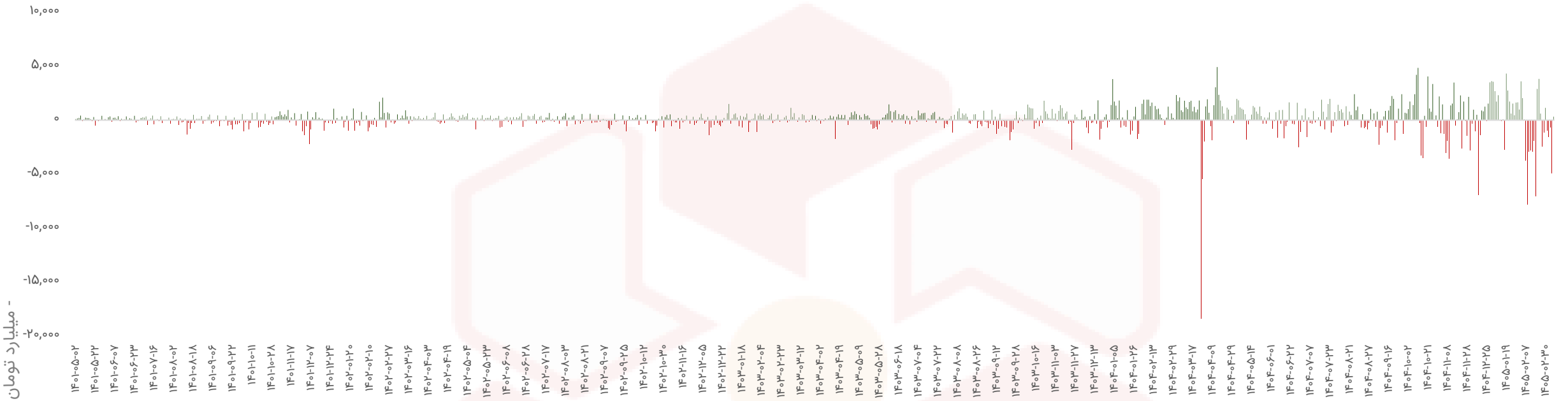
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



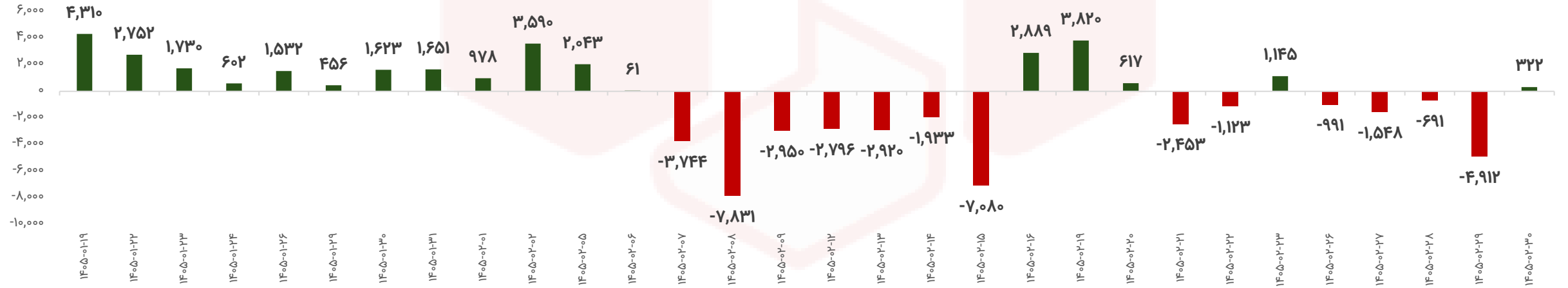
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



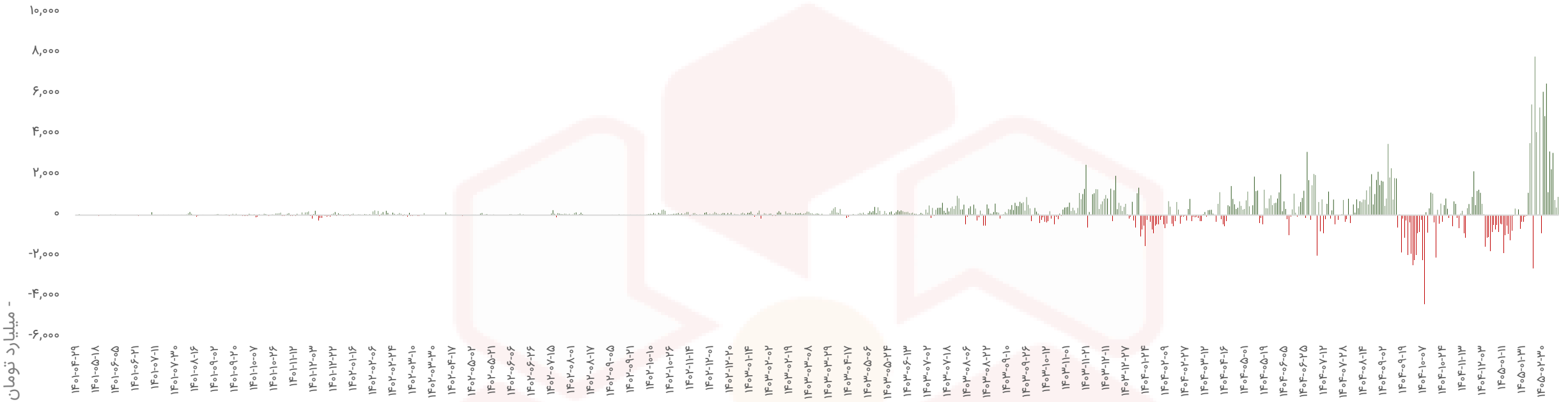
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



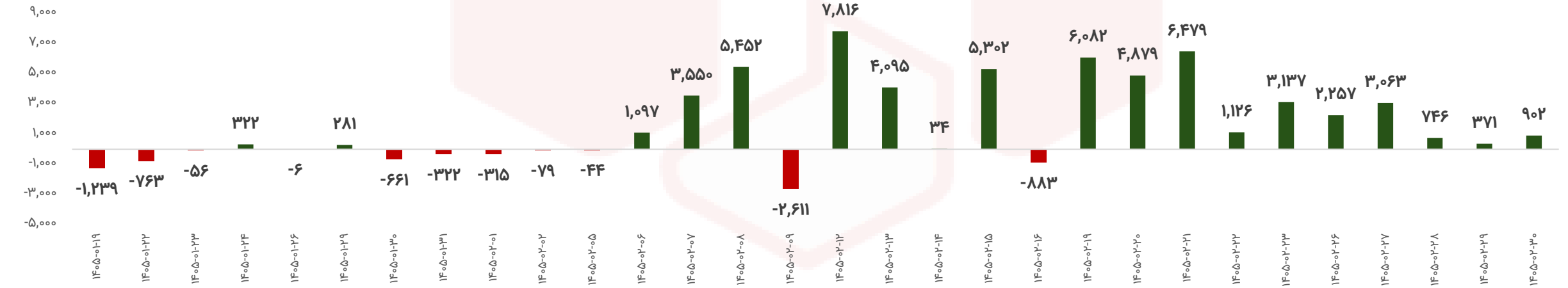
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

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

ترین‌های بازار در هفته اخیر

صنایع با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	بازدهی (%)
۱	زراعت و خدمات وابسته	%۴.۴
۲	خرده فروشی	%۳.۷
۳	مخابرات	%۳
۴	سیمان، آهک گچ	%۲.۶
۵	قند و شکر	%۲.۵

صنایع با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	بازدهی (%)
۱	چاپ	(%۲.۸)
۲	لاستیک و پلاستیک	(%۲.۶)
۳	بانکها و موسسات اعتباری	(%۱.۱)
۴	خودرو و قطعات	(%۰.۹)
۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	(%۰.۶)

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	شیر و گوشت زاگرس شهرکرد	زشگزا	%۳۶.۸
۲	کشاورزی مکانیزه اصفهان کشت	زکشت	%۳۰.۷
۳	سیمان شمال	سشمال	%۲۷.۸
۴	نوش پونه مشهد	غپونه	%۲۵.۳
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف	%۲۴.۷

نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	توسعه خدمات دریایی و بندری سینا	حسینا	(%۵.۸)
۲	فولاد امیرکبیر کاشان	فجر	(%۵.۸)
۳	کابل البرز	بالبر	(%۵.۸)
۴	سر.سامان گستر اصفهان	ثامان	(%۵.۸)
۵	محور خودرو	خمحور	(%۵.۸)

ترین‌های بازار در هفته اخیر

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	فرآورده‌های نفتی	۳,۷۷۹
۲	بانکها و موسسات اعتباری	۳,۱۲۲
۳	فلزات اساسی	۲,۴۰۶
۴	استخراج کانه‌های فلزی	۱,۵۶۶
۵	خودرو و قطعات	۱,۵۴۲

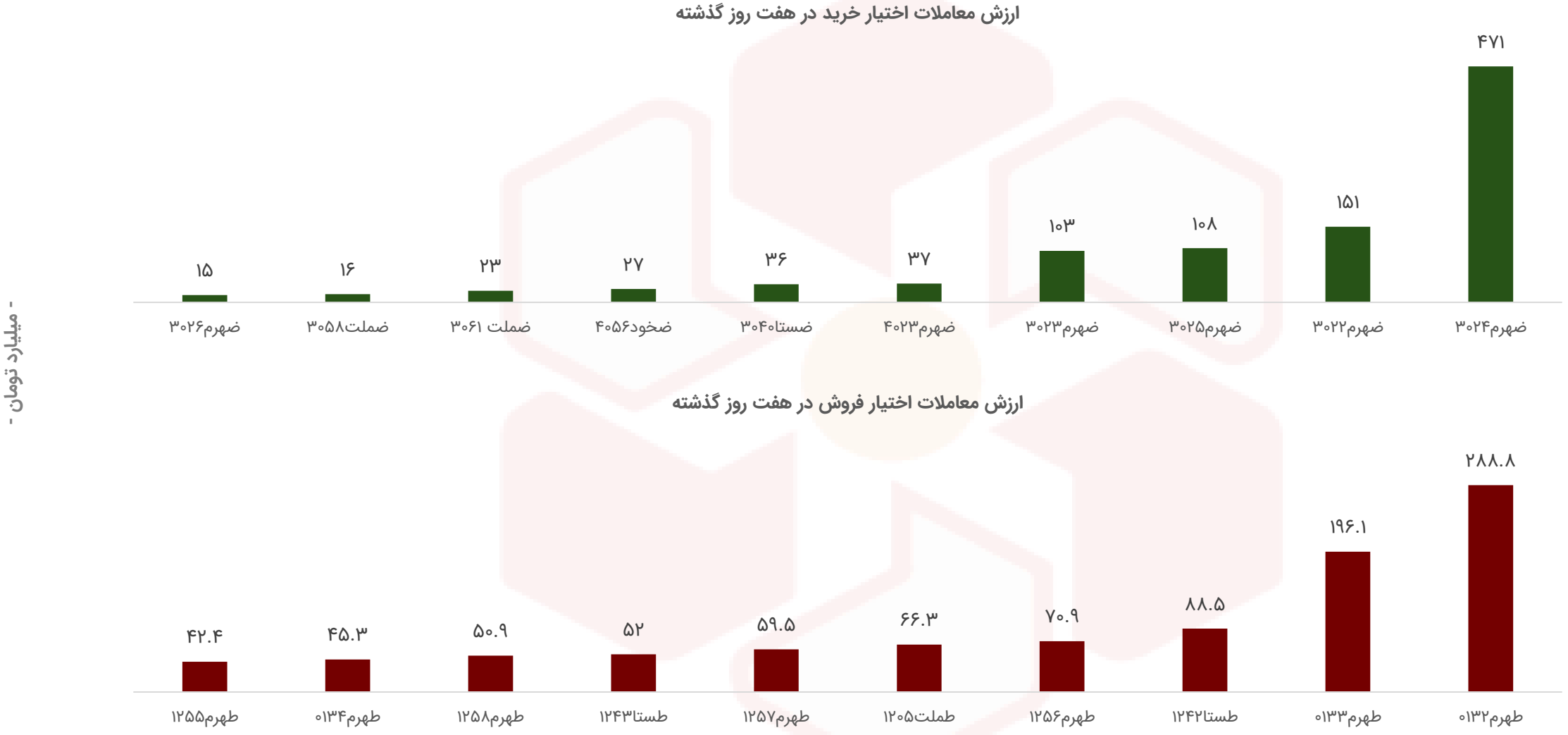
کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیاردتومان)
۱	محصولات کاغذی	۸
۲	منسوجات	۱۱
۳	چاپ	۱۷
۴	هتل و رستوران	۲۸
۵	استخراج زغال سنگ	۴۱

نمادهای با کمترین P/E

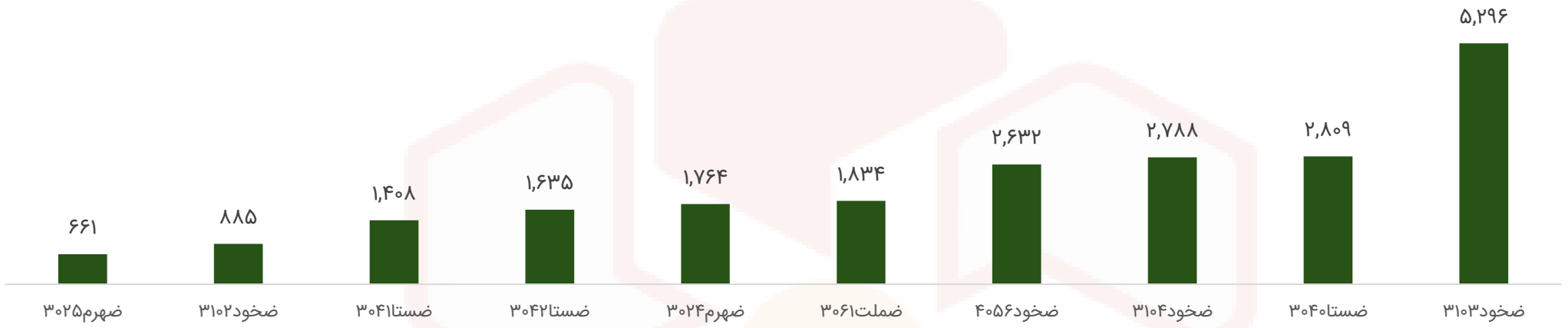
نماد	قیمت (ریال)	P/E
آسیا	۱,۹۸۲	۱.۲
حفاری	۳,۴۶۹	۱.۴
پارسیان	۱,۲۷۴	۱.۵
وبملت	۹۳۵	۱.۷
ولساپا	۶۳۴	۱.۷
توسن	۳,۰۰۷	۲
فن افزار	۲,۱۵۲	۲.۲
فاراک	۱,۰۶۶	۲.۳
اتکام	۱,۸۳۷	۲.۳
البرز	۲,۱۰۸	۲.۴

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

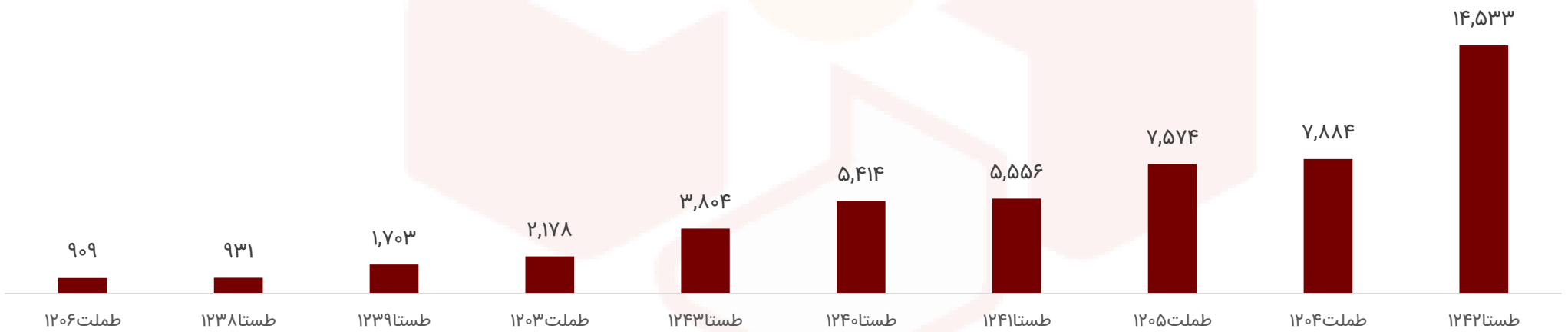


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



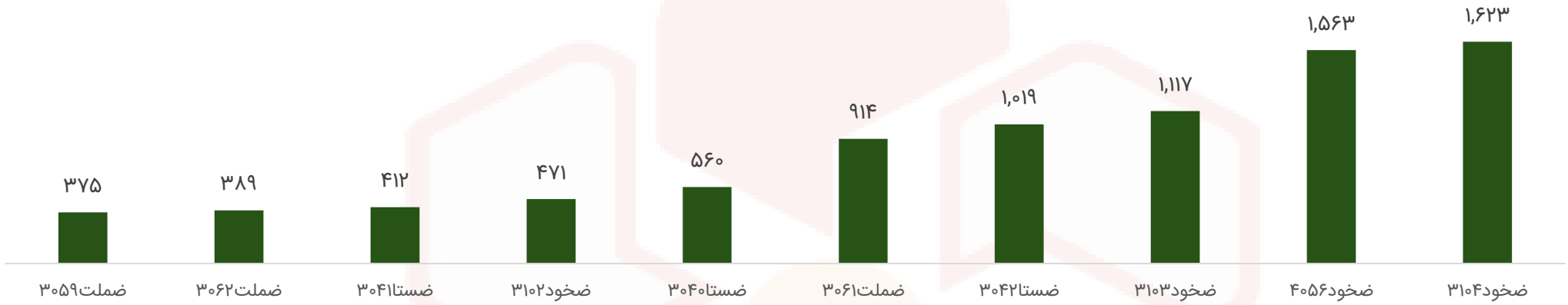
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



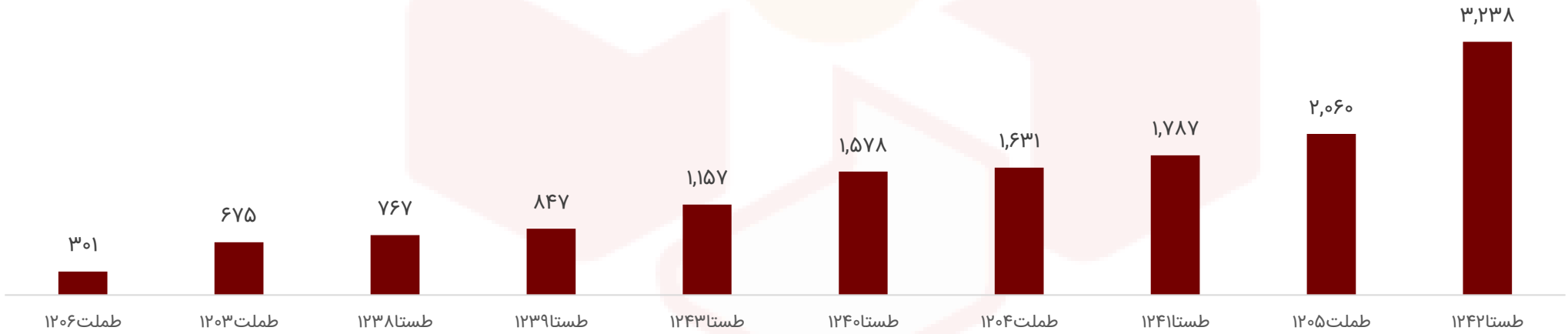
- هزار برگ سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار خرید در هفت روز گذشته

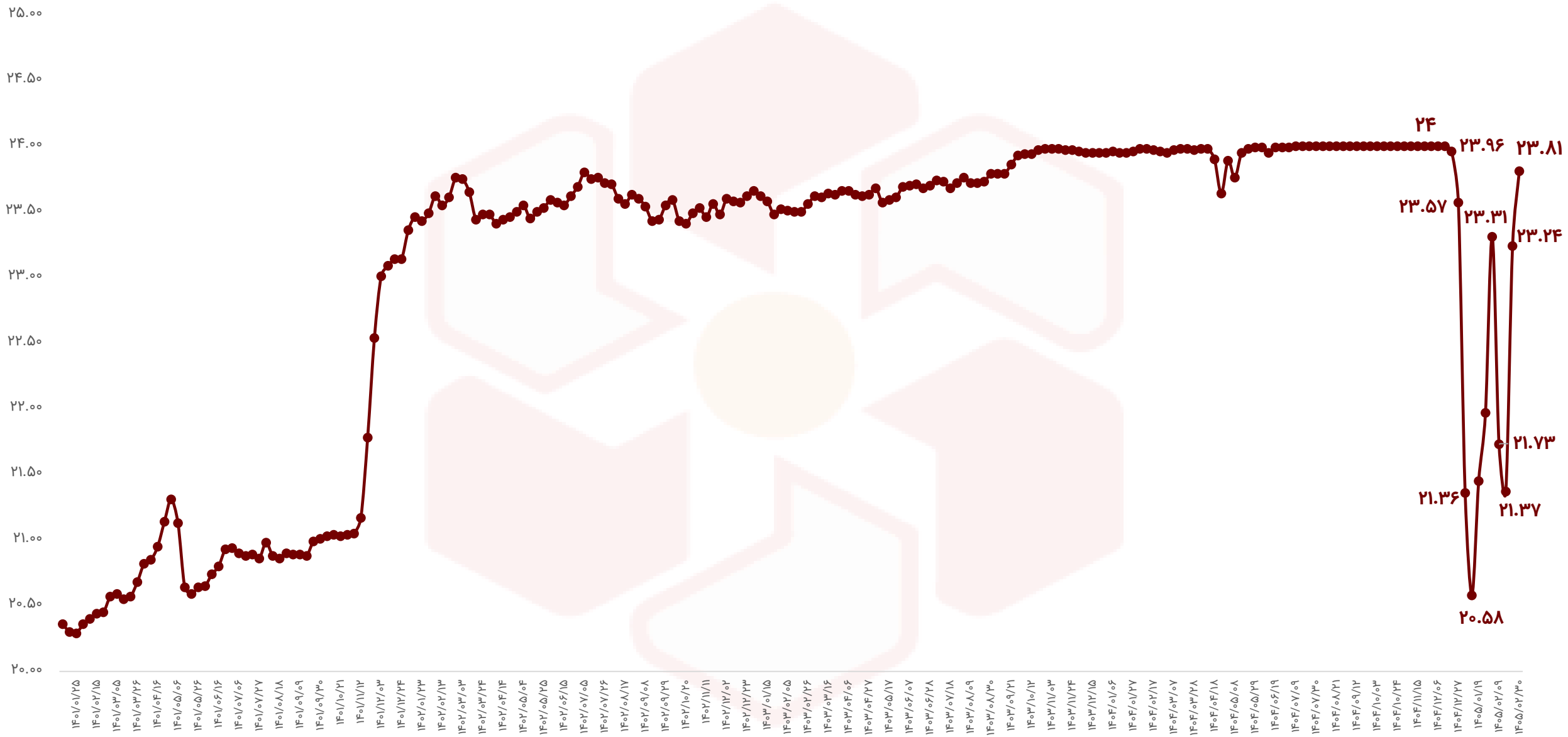


بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار موقعیت باز -

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۲۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۲۳	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۷,۳۹۰	۴۴.۱۷%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۱۹۸	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۳۱,۸۹۰	۴۲.۲۱%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۱۷۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۱,۵۱۰	۴۱.۲۱%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۳۳	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۰۶,۱۶۰	۴۱.۰۰%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۱۴۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۷۹,۹۰۰	۴۰.۸۵%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۰۵	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۶,۰۴۰	۴۰.۵۱%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۲۳۳	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۰,۵۰۰	۴۰.۱۹%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۸۷۰	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۷,۱۸۰	۳۹.۷۹%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۸۳۵	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۶۵,۰۰۰	۳۹.۷۳%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۴۷۱	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۵۲,۹۸۰	۳۹.۶۳%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۸۹۸	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴۰,۳۲۰	۳۹.۶۱%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۵۴	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۹۰,۷۹۰	۳۹.۵۵%

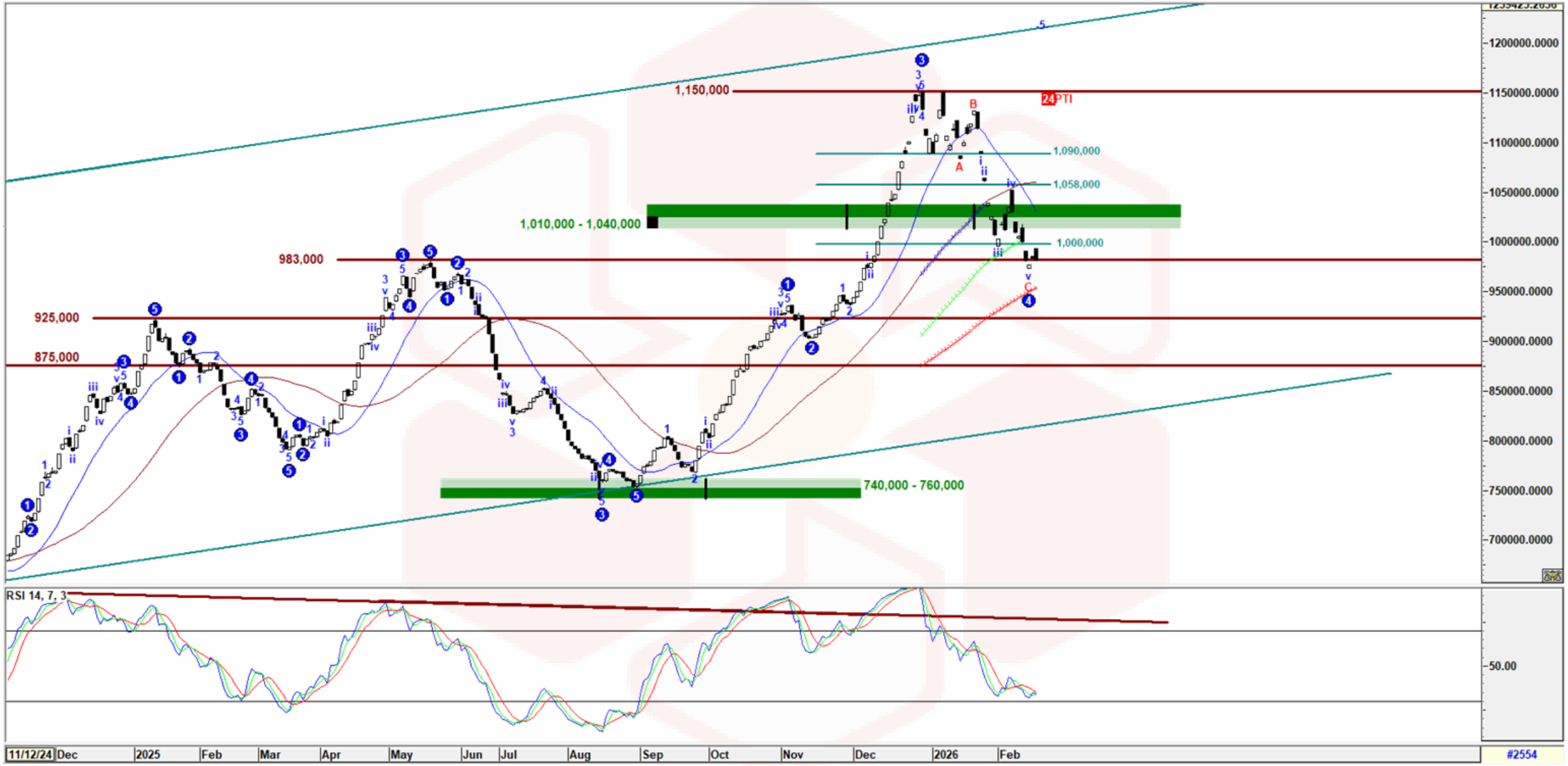
وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۵۰۹	۴,۵۵۲	(۰.۹%)	۴,۷۰۶	(۴.۲%)
سکه امامی (تومان)	۱۹۲,۵۱۰,۰۰۰	۱۹۵,۵۰۰,۰۰۰	(۱.۵%)	۱۷۳,۹۵۰,۰۰۰	۱۰.۷%
دلار آزاد (تومان)	۱۷۹,۰۸۰	۱۸۰,۳۳۰	(۰.۷%)	۱۵۴,۰۰۰	۱۶.۳%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۱۰۳.۵	۱۰۹.۲	(۵.۲%)	۹۸.۹	۴.۶%
بیت کوین (دلار)	۷۵,۴۹۱	۷۹,۲۹۶	(۴.۸%)	۷۵,۷۲۹	(۰.۳%)
اتریم (دلار)	۲,۰۶۲	۲,۲۲۸	(۷.۴%)	۲,۳۲۰	(۱۱.۱%)
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۶۵۰	۳,۵۶۰	۲.۵%	۳,۵۳۲	۳.۳%
مس LME (دلار)	۱۳,۶۶۹	۱۳,۹۷۸	(۲.۲%)	۱۳,۲۲۶	۳.۳%
روی LME (دلار)	۳,۵۴۲	۳,۵۱۳	۰.۸%	۳,۴۵۱	۲.۶%
سرب LME (دلار)	۲,۰۱۹	۱,۹۷۳	۲.۳%	۱,۹۶۶	۲.۷%
انس پلاتین (دلار)	۱,۹۴۰	۱,۹۹۱	(۲.۶%)	۲,۰۴۱	(۴.۹%)

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل هم‌وزن



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege