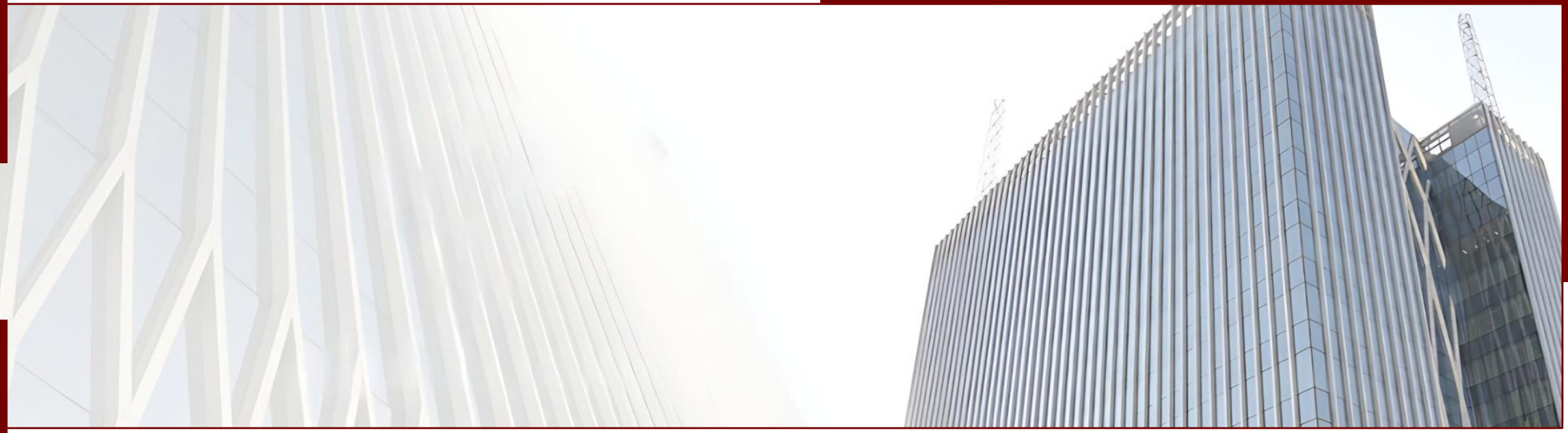


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۱۲ تیر 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 ۱۶
- روند نرخ بهره بین بانکی ۱۹
- اوراق با درآمد ثابت ۲۰
- وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه ۲۱
- بررسی تکنیکال شاخص کل ۲۲

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



حمله گسترده موشکی و پهپادی روسیه به پایتخت اوکراین؛ دست‌کم ۱۰ نفر در کی‌یف کشته شدند

موجی از حملات موشکی و پهپادی روسیه شامگاه یکشنبه کی‌یف، پایتخت اوکراین را هدف قرار داد و در نتیجه آن دست‌کم ۱۰ نفر کشته شدند. این حملات تا اوایل صبح دوشنبه همچنان ادامه داشت. تیمور تکاچنکو، رئیس مدیریت نظامی شهر کی‌یف، در پستی در تلگرام اعلام کرد که یک ساختمان مسکونی در منطقه پودیل‌سکی تا حدی فرو ریخته است. در منطقه دارنیسیا نیز چندین ساختمان چندطبقه آسیب دیده‌اند و احتمال می‌رود افرادی زیر آوار گرفتار شده باشند.



ترامپ: یا با ایران توافق می‌کنیم یا کار را تمام می‌کنیم؛ هدف از جنگ تغییر حکومت ایران نبود

دونالد ترامپ، رئیس‌جمهور آمریکا گفت ایران در مذاکرات هسته‌ای امتیازاتی ارائه کرده است، اما اذعان کرد که این پیشنهادها هنوز نهایی نشده‌اند. ترامپ روز دوشنبه ۶ ژوئن (۱۵ تیر) در گفت‌وگو با خبرنگاران در دفتر کاخ سفید گفت: «ما امتیازاتی گرفته‌ایم، حالا آن‌ها باید به همان امتیازها پایبند بمانند.» او همچنین مدعی شد که آمریکا اجازه خواهد داشت ذخایر اورانیوم با غنای بالای ایران را از این کشور خارج کند؛ ادعایی که تهران هرگز موافقت خود با آن را تأیید نکرده است.



برخورد پرتابه ناشناس به یک نفتکش در نزدیکی عمان

سازمان عملیات تجارت دریایی بریتانیا (UKMTO) بامداد سه‌شنبه از برخورد یک پرتابه ناشناس به یک نفتکش در نزدیکی «لیمه» عمان خبر داد و گفت که اصابت این پرتابه منجر به آتش‌سوزی شده است. همزمان اکسیوس به نقل از یک مقام آمریکایی از حمله موشکی سپاه به دو کشتی در تنگه هرمز خبر داد. در این اطلاعیه آمده است: «یک نفتکش گزارش داده که هنگام حرکت به سمت جنوب، یک پرتابه ناشناس به سمت چپ کشتی برخورد کرده و این برخورد باعث آتش‌سوزی شده است.» این سازمان افزود: «هیچ تلفات جانی یا آسیب زیست‌محیطی گزارش نشده است.»

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



رشد ۹۵ درصدی تامین مالی جمعی سه ماهه با جذب ۵.۶ هزار میلیارد تومان

گزارش آماری اداره تحلیل‌های اقتصادی و ریسک سازمان بورس نشان می دهد در سه ماه نخست سال جاری ۵.۶ هزار میلیارد تومان برای ۲۴۴ طرح تامین مالی شده که نسبت به مدت مشابه سال قبل با ۲.۸ هزار میلیارد تومان برای ۱۴۸ طرح حکایت از رشد ۹۵.۲ درصدی عملکرد سکوهای تامین مالی جمعی دارد. بر اساس این گزارش، بررسی روند یک ساله تعداد طرح‌ها و ارزش تامین مالی انجام شده از طریق سکوهای تامین مالی نشان می دهد در خرداد ماه حدود ۲.۳ هزار میلیارد تومان برای ۹۶ طرح از طریق سکوها تامین مالی شد. در دوره سه ماهه سکوهای ایستاتیس کراد، زیما و پولسار به ترتیب با ۶۰۴.۸ میلیارد تومان برای ۲۷ طرح، ۵۳۸ میلیارد تومان برای ۲۴ طرح و ۴۰۰ میلیارد تومان برای ۱۳ طرح رتبه‌های اول تا سوم را از نظر ارزش تامین مالی داشته‌اند.



زمان بندی بورس کالا برای عرضه انواع محصول در دو روز آخر این هفته

بورس کالا با اشاره به تعطیلی شنبه تا دوشنبه هفته جاری، اعلام کرد: از امروز سه شنبه در حوزه صنعتی محصولاتی مانند سیمان نوع یک و دو، آهن اسفنجی، کنسانتره و گندله سنگ آهن، شمش بلوم (3SP و SSP) ارائه خواهد شد. بر اساس این گزارش در بخش پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی، محصولات پلی پروپیلن و آف های آن، پی وی سی و آف های آن، وکیوم باتوم، لوبکات، اسلاک واکس و گوگرد کلوخه در دسترس خریداران قرار می گیرد. چهارشنبه نیز سایر سیمان ها، تیر آهن ساختمانی، نبشی و ناودانی، LAB، ABS، محصولات پلیمری و آف های آن (به‌جز پلی پروپیلن و پلی وینیل کلراید) در حوزه پتروشیمی و صنعتی وارد تالار معاملات خواهند شد. در بخش فرآورده‌های نفتی، PDA-TARو محصولات گروه روغن، گوگرد گرانوله و سایر گوگردها هم به مشتریان عرضه می شود.



بورس نحوه اعمال اوراق اختیار فروش از نوع تامین مالی را اصلاح کرد

مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین مالی بورس در اطلاعیه‌ای، اعلام کرد: با توجه به اصلاح رویه اعمال اوراق اختیار فروش تبعی منتشر شده با هدف تامین مالی توسط شرکت سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه و اعلام آن در نامه مصوب ۷ تیر به شرکت‌های کارگزاری، دریافت درخواست‌های اعمال اوراق اختیار فروش تبعی منتشره از چهارشنبه این هفته ۱۷ تیر با هدف تامین مالی صرفاً از طریق سامانه کارا و طبق رویه اعلامی شرکت سپرده‌گذاری مرکزی انجام خواهد شد.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

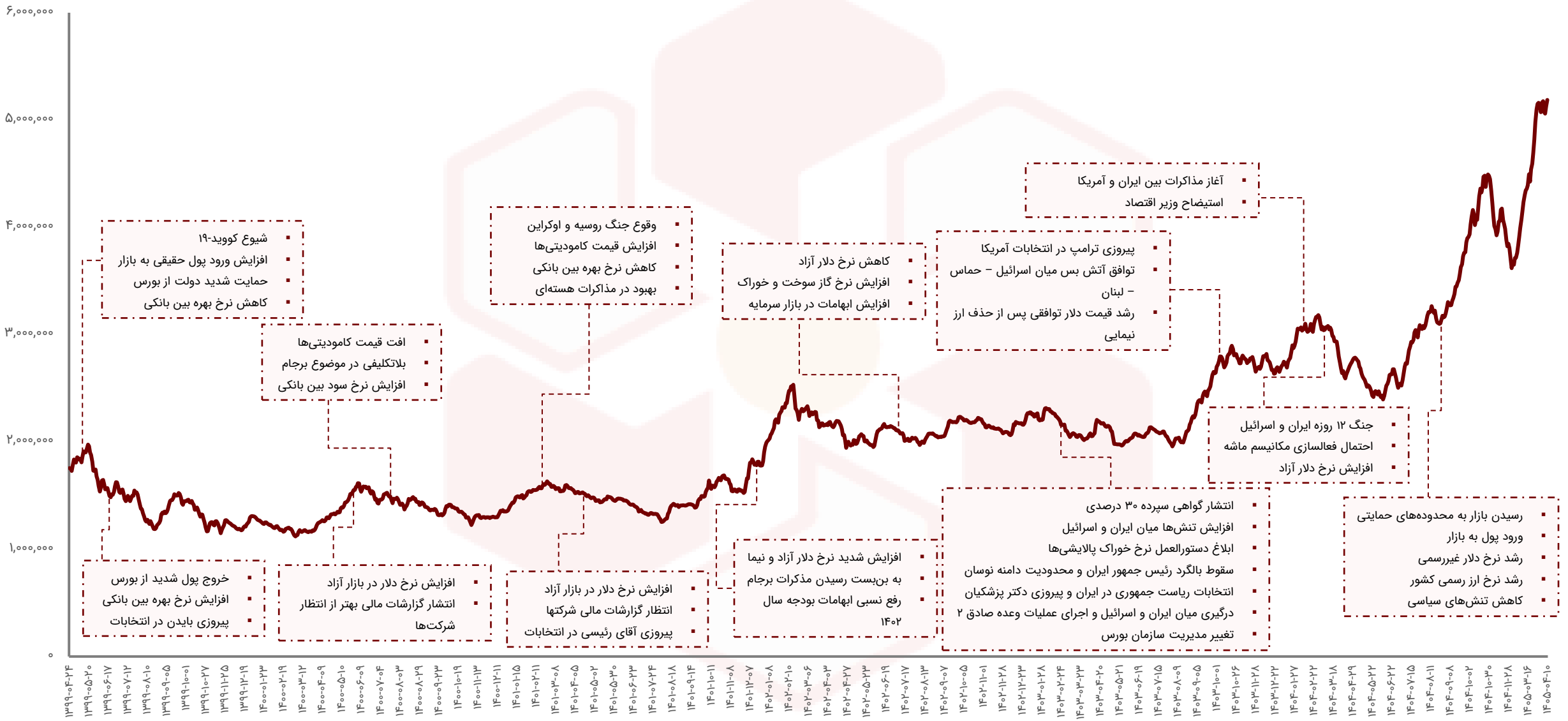
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته اخیر، بازار سهام با نوساناتی همراه شد که نشان از تغییر رفتار فعالان بازار داشت و در پایان هفته شاخص کل بر ارتفاع ۵,۱۸۷,۲۶۳ واحد ایستاد و رشد جزئی ۰.۵ درصدی را ثبت کرد؛ شروع هفته با انتشار مجدد شایعاتی پیرامون احتمال افزایش نرخ سود سپرده‌های بانکی و نرخ بهره اوراق دولتی و احتمال تعویق مذاکرات میان ایران و ایالات متحده، موجی از عرضه را به بازار تحمیل کرد. این موضوع در کنار احتیاط فعالان بازار که ریشه در ذهنیت و تجربیات تلخ ریزش‌های گذشته داشت، دست به دست هم داد تا در دو روز ابتدایی هفته، خروج سنگین نقدینگی حقیقی به ارزش تقریبی ۹ هزار میلیارد تومان به ثبت برسد. اگرچه این وضعیت از روز دوشنبه تغییر کرده و تقاضا در بازار افزایش یافت؛ در روزهای سه‌شنبه و چهارشنبه نیز معاملات روندی روان و نسبتاً متعادل را طی کرد. بررسی رفتار فعالان بازار در معاملات دو هفته اخیر نشان می‌دهد که مومنتوم بازار تغییر کرده و معامله‌گران به خرید نمادهایی با گزارشات ماهانه و میان‌دوره‌ای مناسب علاقه دارند. با این حال، ارزش معاملات نسبت به هفته‌های گذشته کاهش یافت؛ که این امر می‌تواند نشان‌دهنده ورود بازار به فاز استراحت پس از رشد شدید دو ماه اردیبهشت و خرداد باشد. در بازارهای موازی، شاهد رشد قیمت دلار آمریکا تا ۱۷۶ هزارتومان بودیم. بازار طلا نیز با رشد دلار همراه شد و هر گرم طلای ۱۸ عیار به کانال ۱۷ میلیون وارد شد.

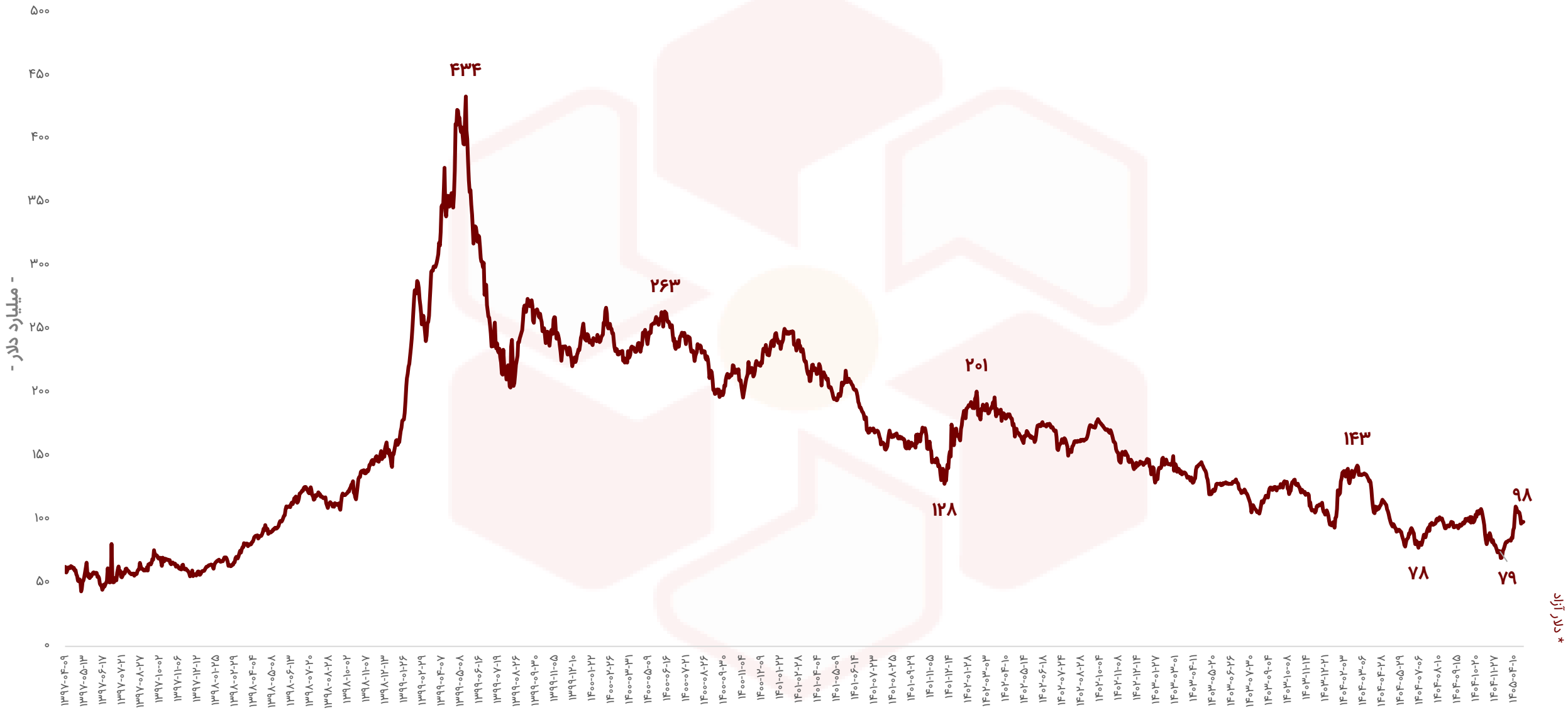
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۵,۱۶۰,۹۰۳	۵,۱۸۷,۲۶۴	۲۶,۳۶۱	%۰.۵
شاخص هم وزن (واحد)	۱,۳۳۷,۴۷۹	۱,۳۶۱,۳۴۰	۲۳,۸۶۱	%۱.۸
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۱۷۴,۸۵۸		۱۲,۰۳۱	%۷.۴
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	۸,۳۱۳		-	-

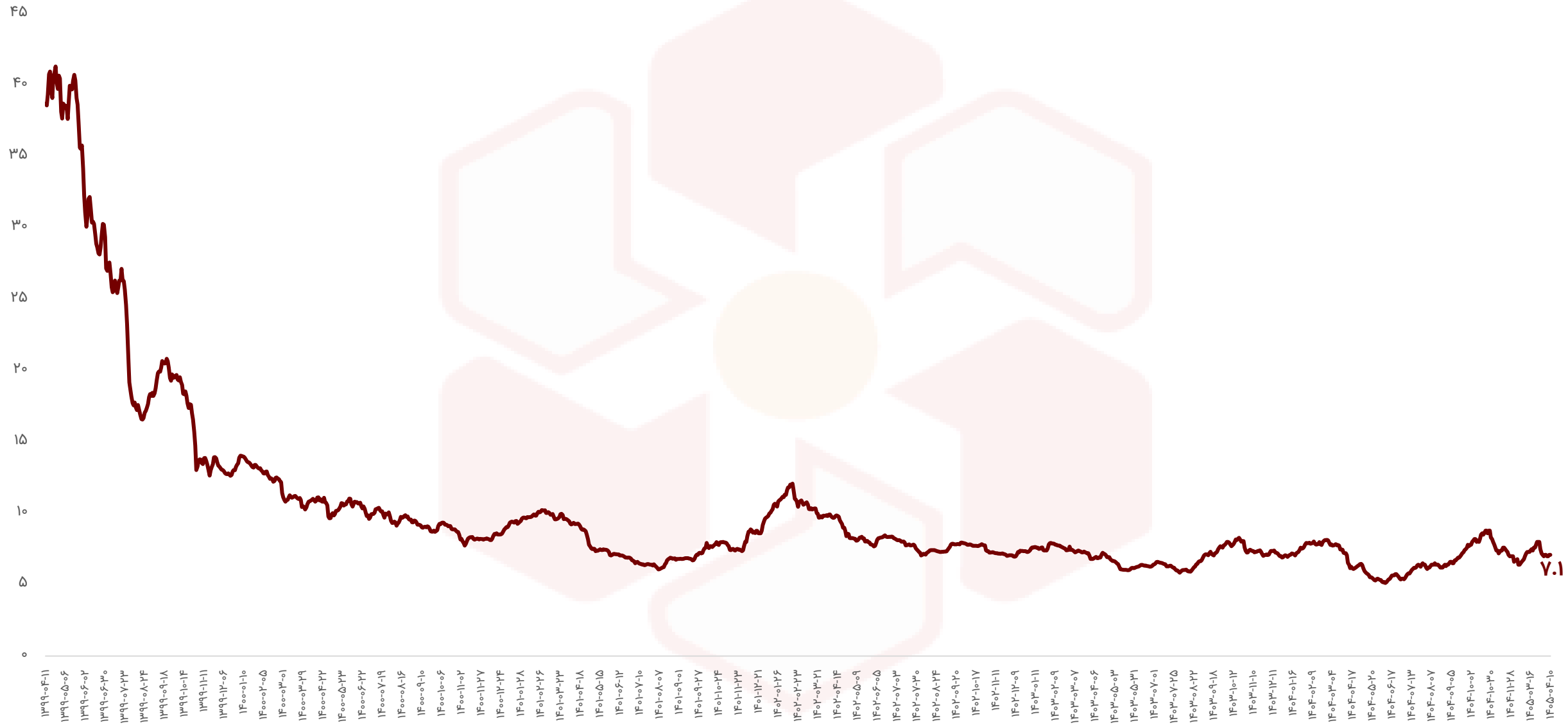
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



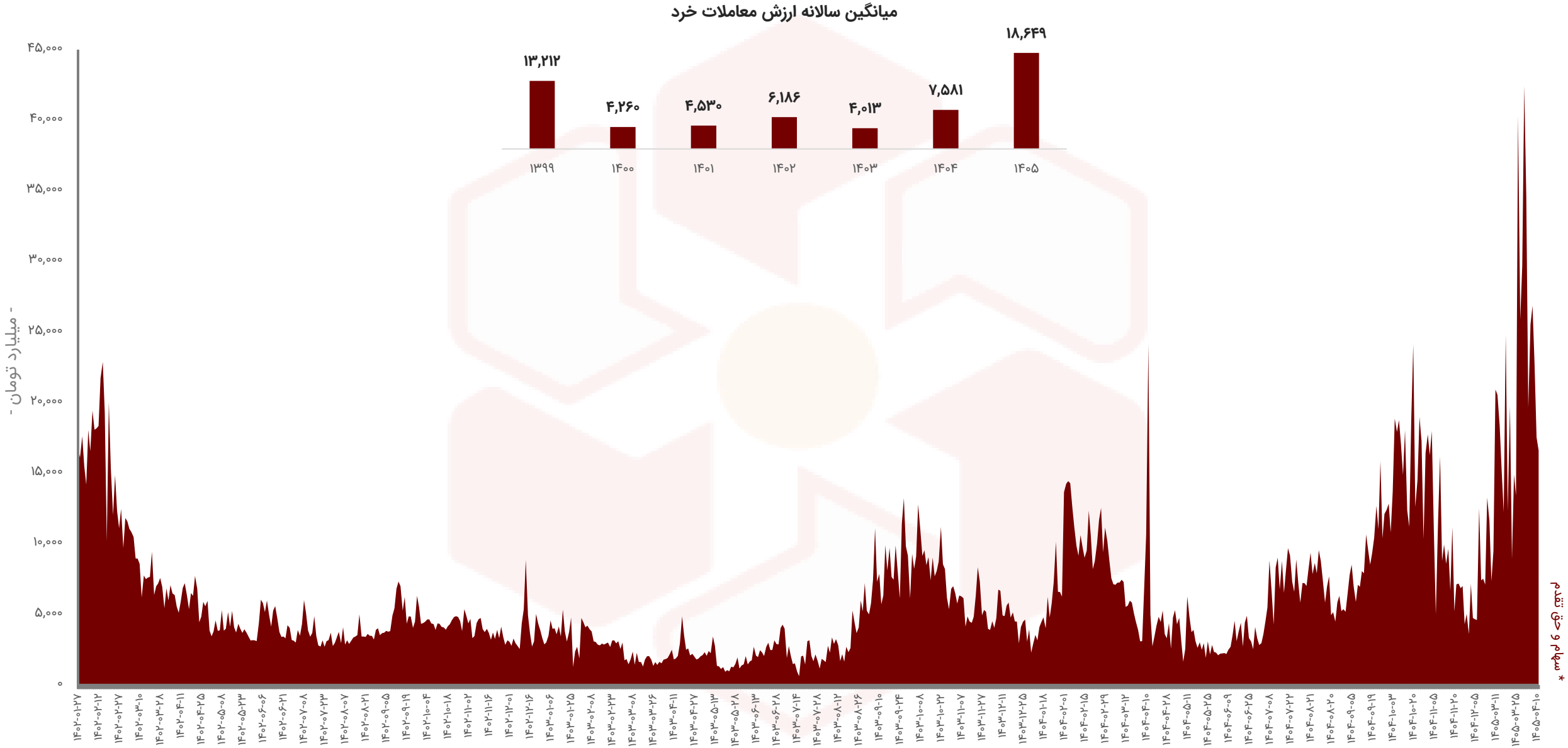
ارزش دلاری بازار*



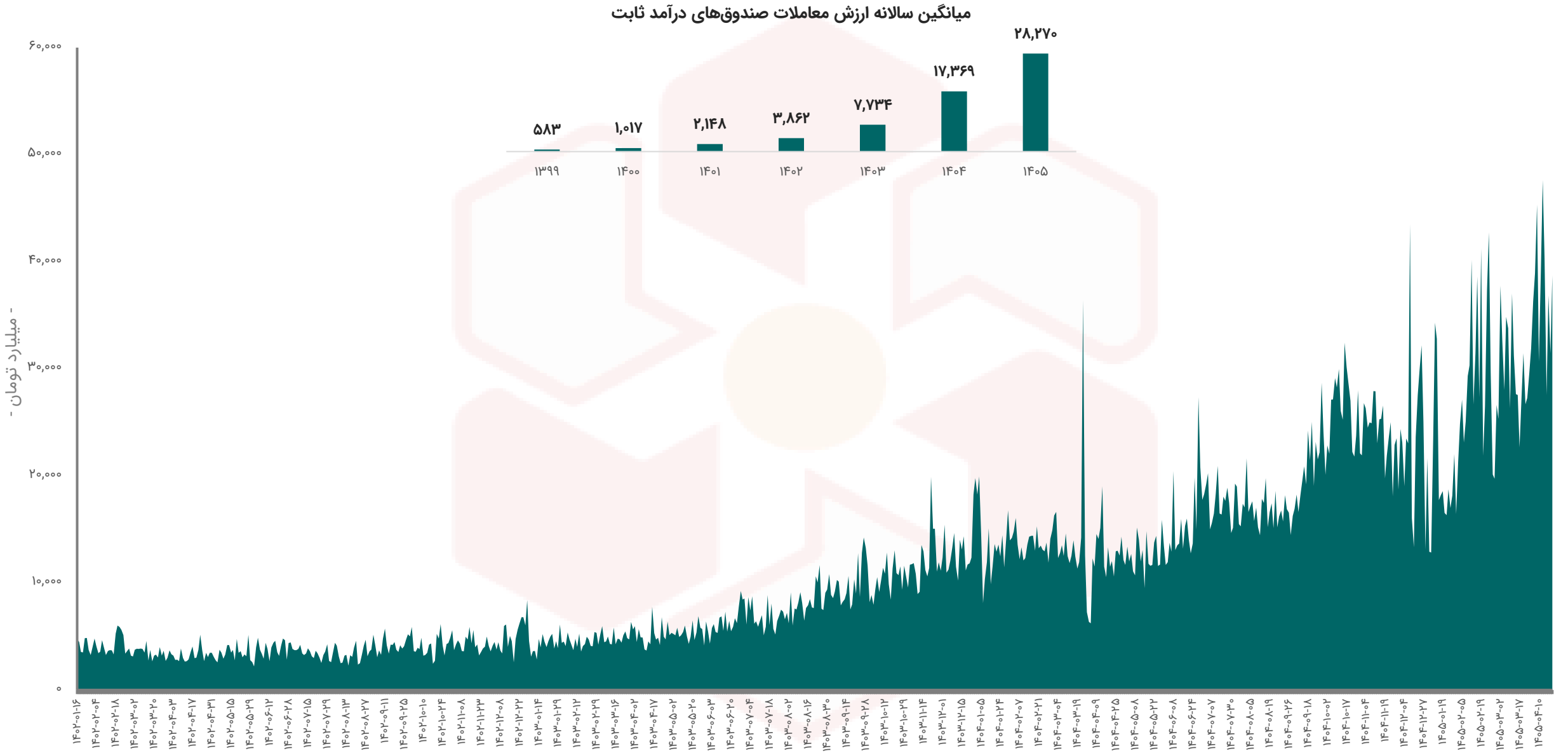
نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)



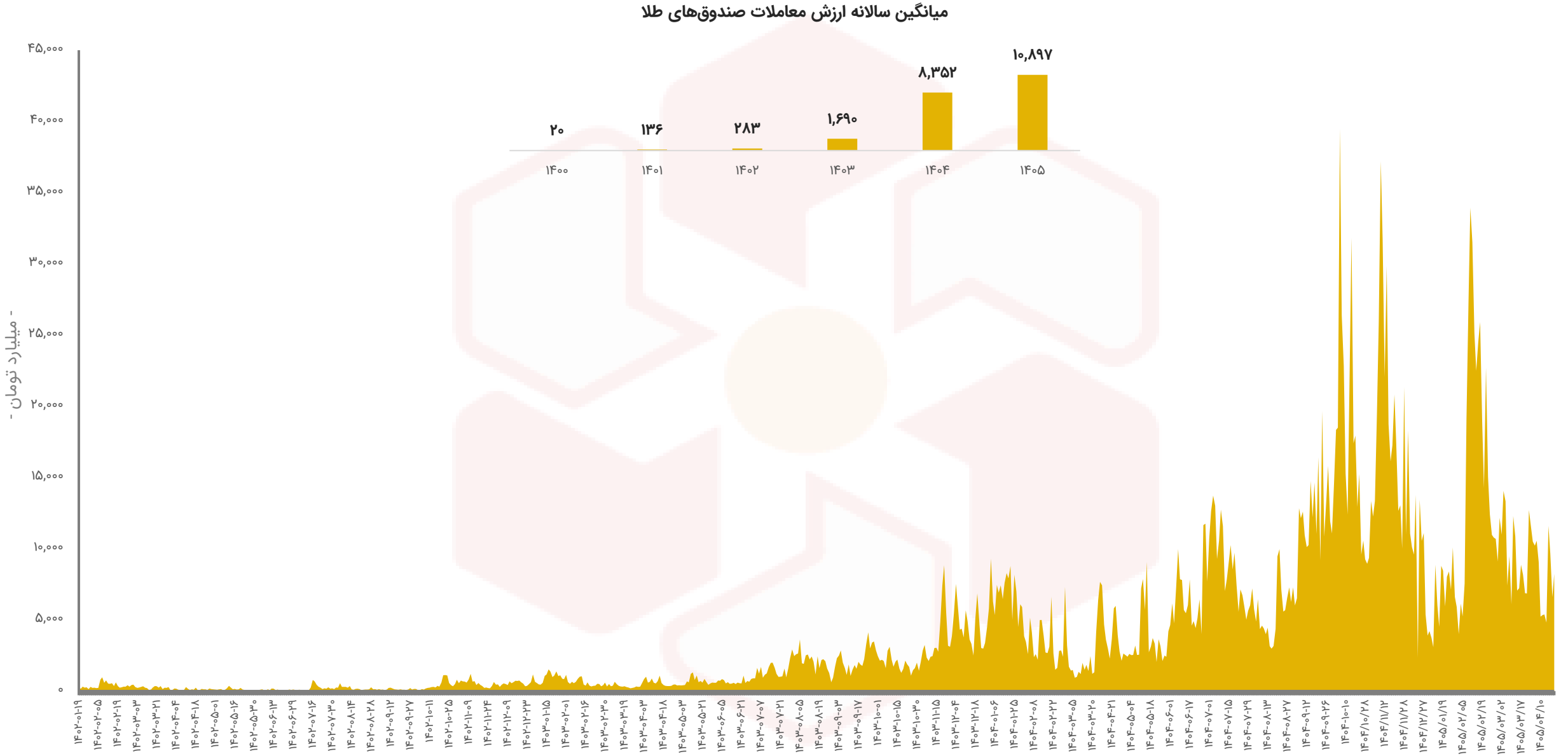
ارزش معاملات خرد سهام*



ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



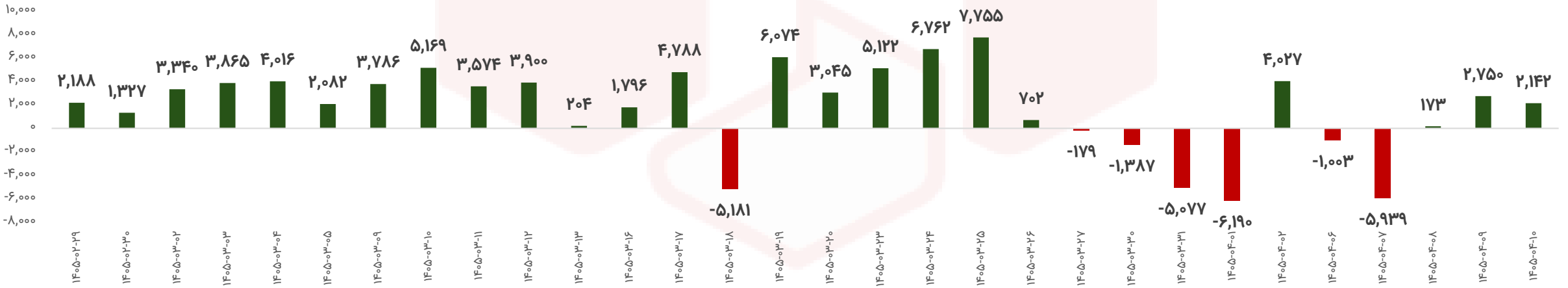
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



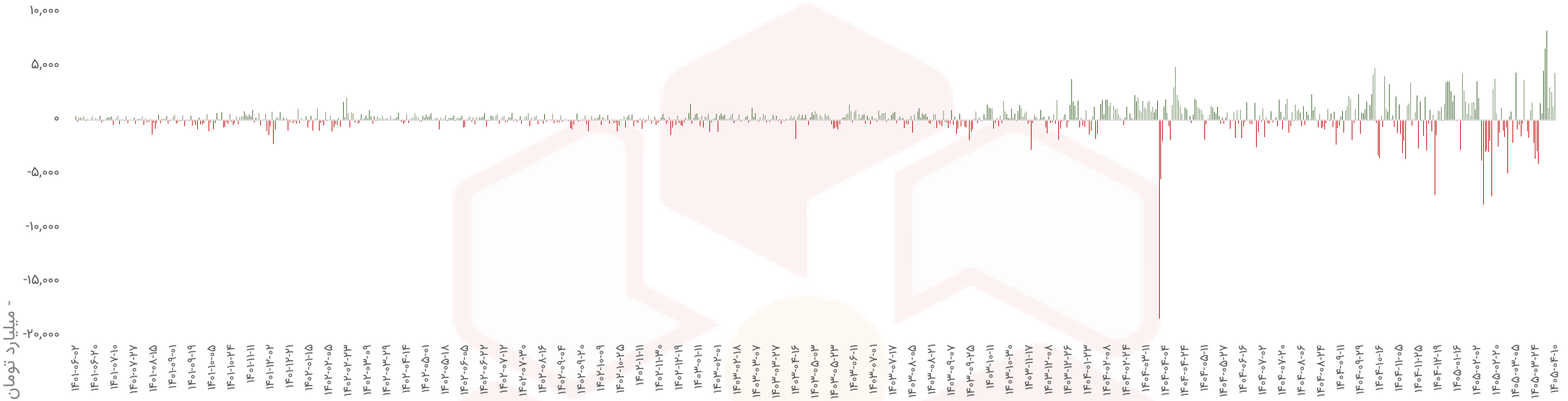
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام و حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



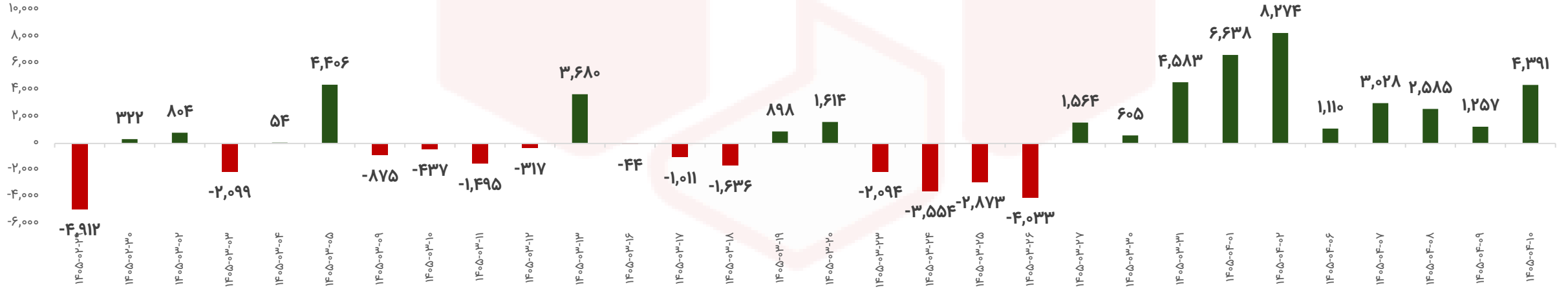
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



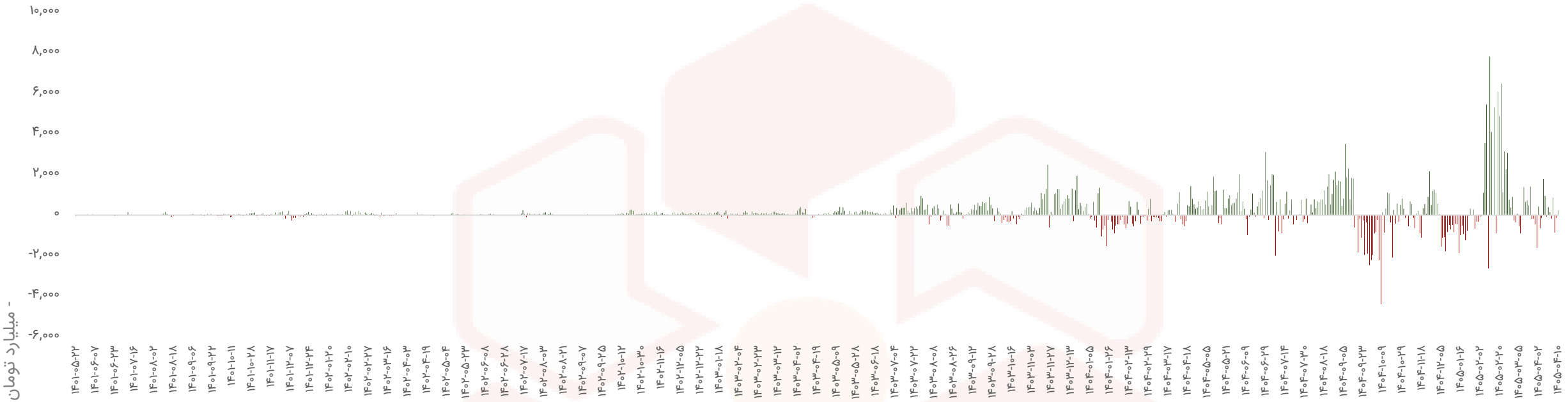
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



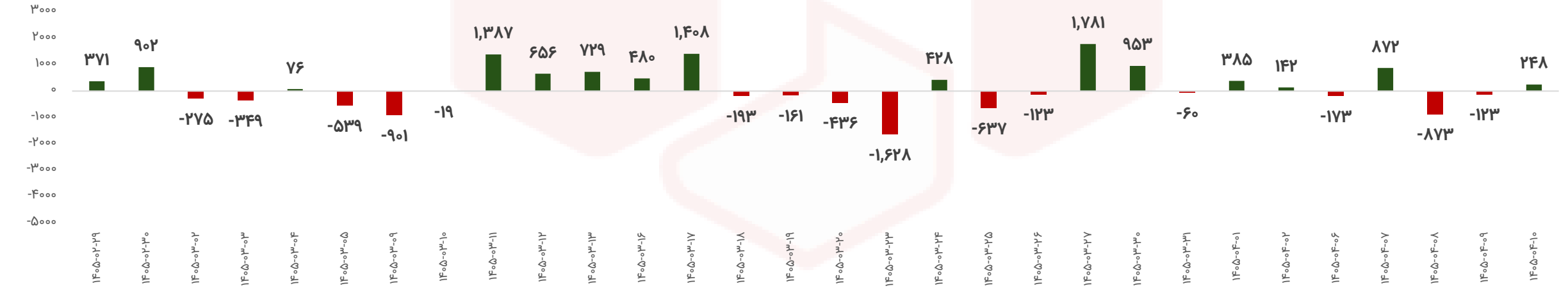
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

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



ترین‌های بازار در هفته اخیر

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	صنعتی دریایی	خصدرا	%۳۵
۲	پخش هجرت	هجرت	%۲۰.۳
۳	صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	%۱۵.۹
۴	کشت و صنعت هلال	زهلال	%۱۵.۹
۵	کشاورزی و دامپروری فجر اصفهان	زفجر	%۱۵.۹

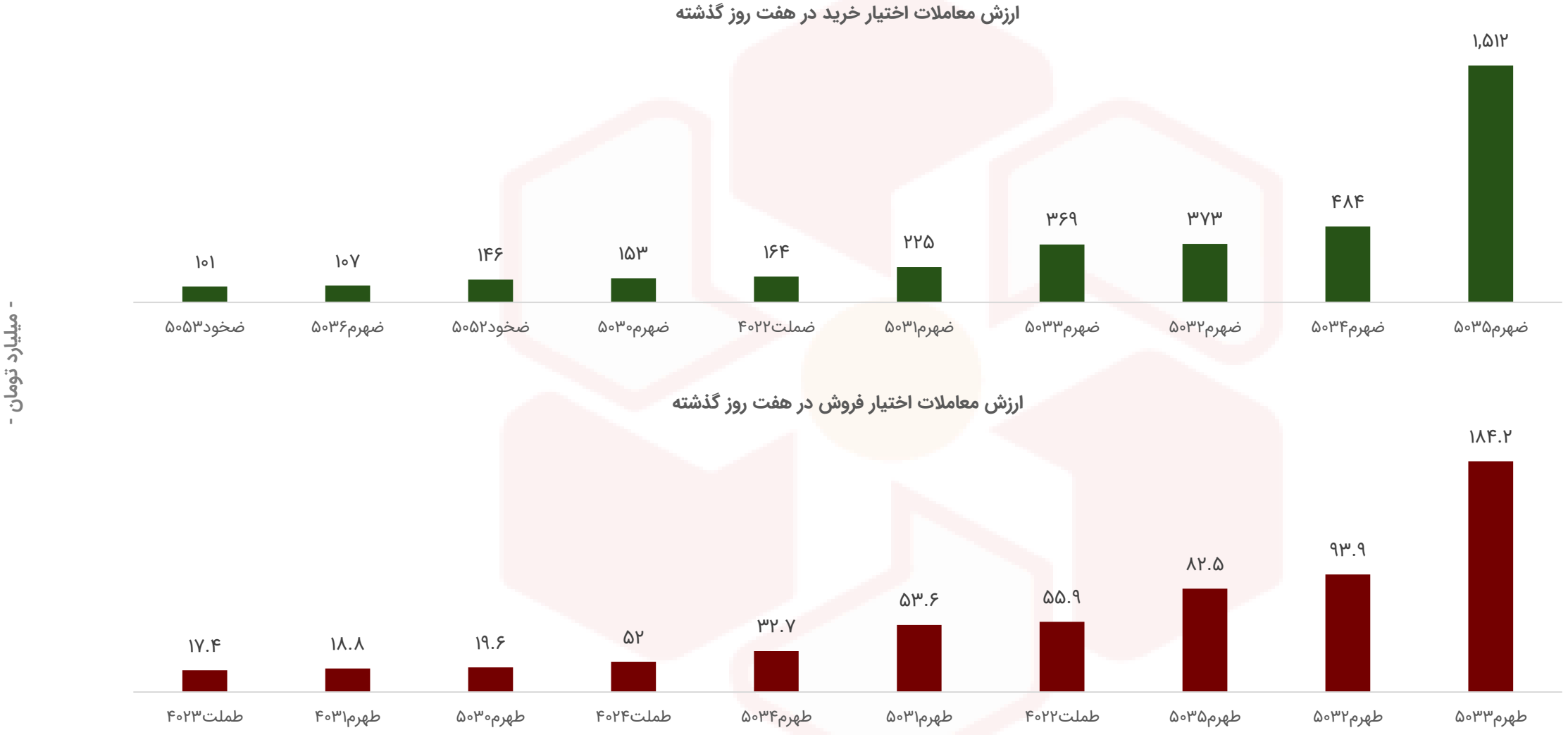
نمادها با کمترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	بهنوش	غبهنوش	(%۱۴.۱)
۲	واسپاری عصر اعتماد	ولاعتماد	(%۱۴)
۳	سیمان ساوه	ساوه	(%۱۳.۸)
۴	سیمان آرتا اردبیل	ساربیل	(%۱۳.۶)
۵	تأسیسات راه آهن	بالاس	(%۱۳.۴)

نمادهای با کمترین P/E

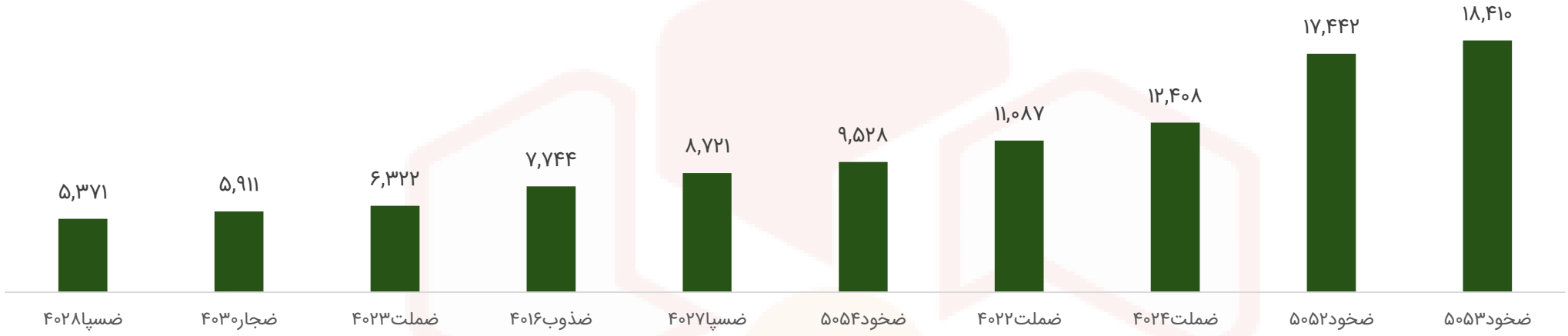
نماد	قیمت (ریال)	P/E
وپارس	۱,۹۹۱	۱.۳
لازما	۷۴,۲۲۰	۱.۵
وگردش	۱,۴۷۱	۱.۵
پارسیان	۱,۳۳۲	۱.۵
وبملت	۱,۳۰۳	۱.۷
حفاری	۴,۵۶۰	۱.۹
آسیا	۳,۴۴۰	۲.۱
شصفها	۲,۸۴۰	۲.۲
شساخت	۱۹,۹۷۰	۲.۳
حآفرین	۱,۷۴۱	۲.۴

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

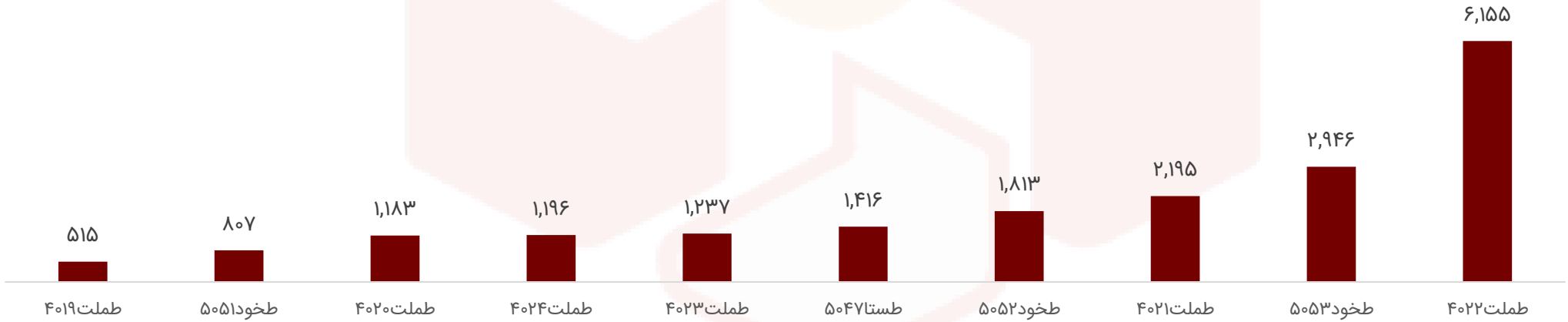


بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



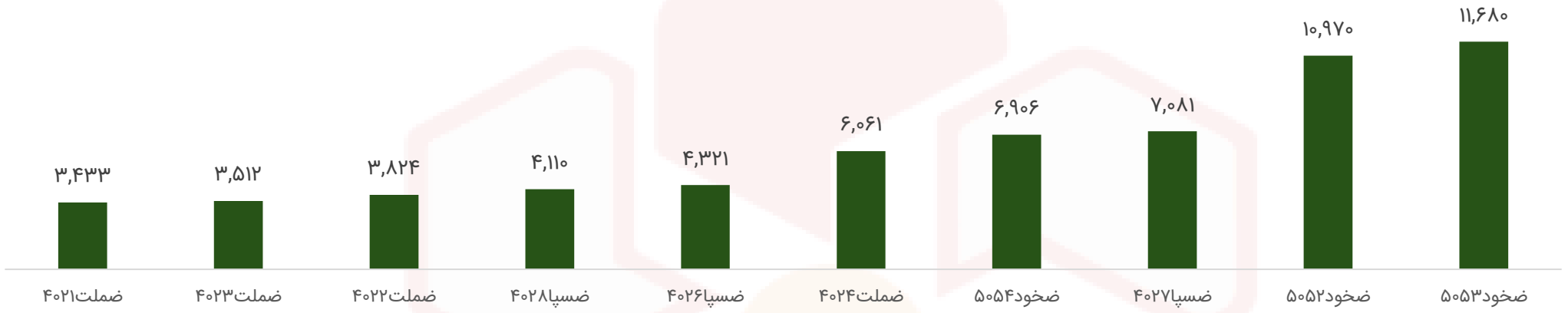
بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



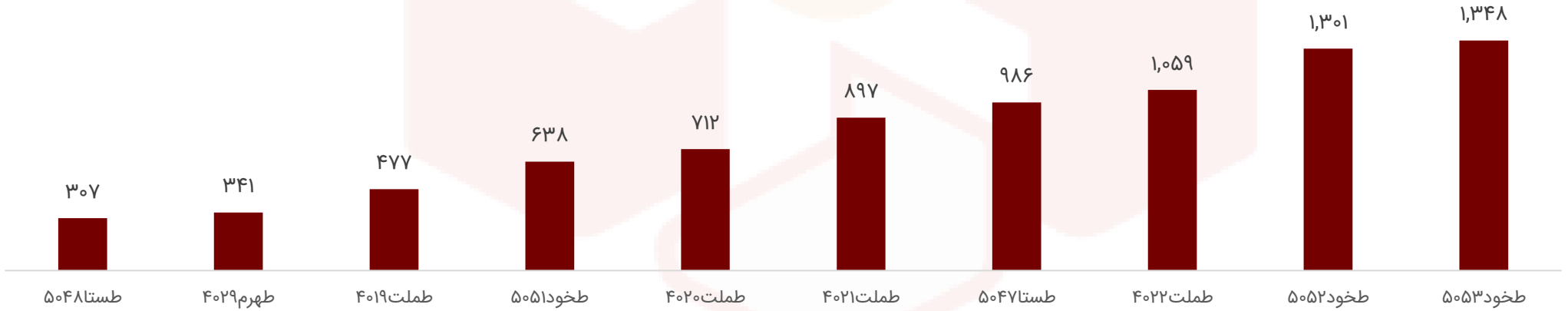
- هزار برگ سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار خرید در هفت روز گذشته

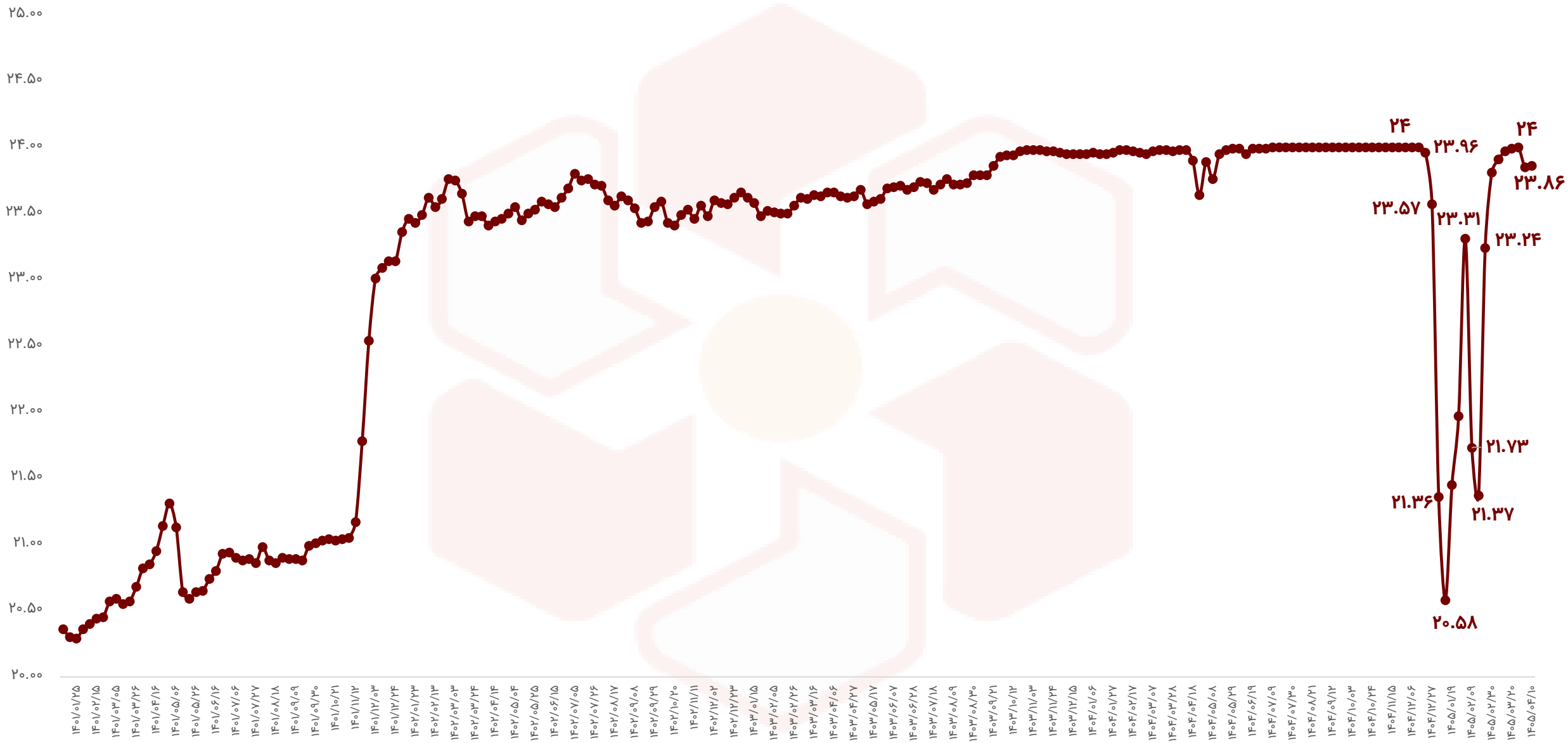


بیشترین تعداد موقعیت باز اختیار فروش در هفت روز گذشته



- هزار موقعیت باز -

روند نرخ بهره بین بانکی (%)



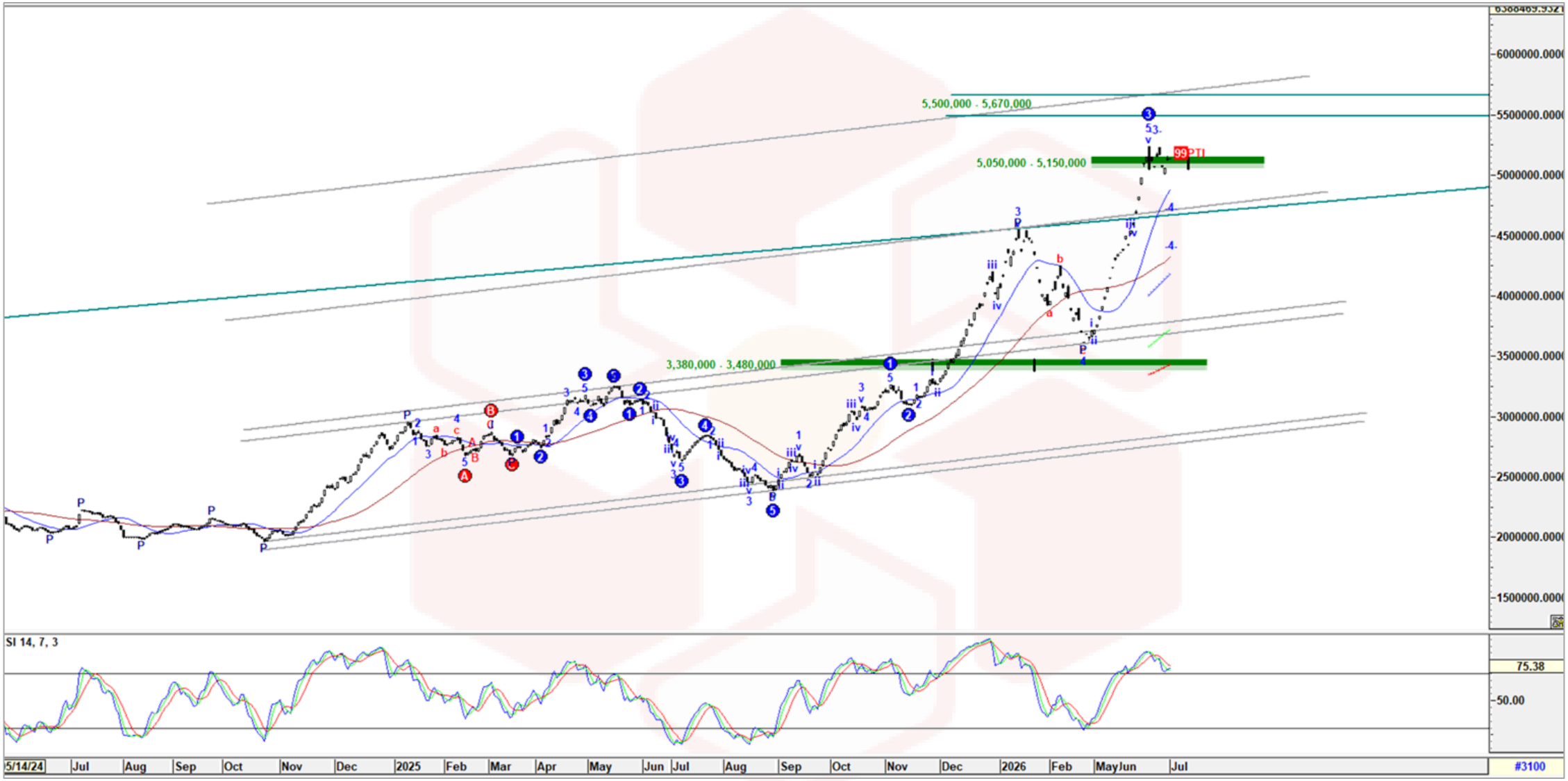
اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۴۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۰-۱۹	۹۱۶	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۵,۶۳۰	۴۰.۱۳%
اخزا۴۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۱-۱۰	۹۳۷	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۶,۸۷۰	۳۹.۹۵%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۸۵۳	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۵۳,۱۶۰	۳۹.۹۱%
اخزا۴۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۴-۲۰	۷۳۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۱۰	۳۹.۰۹%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۷۹۰	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۸۹,۹۳۰	۳۹.۰۵%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۱۶۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۴,۲۰۰	۳۸.۸۵%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۸۲۵	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۷۰,۸۵۰	۳۸.۷۵%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۴۲۶	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۷۸,۰۷۰	۳۸.۳۲%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۹۷	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۹,۲۷۰	۳۷.۳۶%
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۱۵۳	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۱,۰۱۰	۳۵.۶۸%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۱۸۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۳,۱۹۰	۳۵.۵۵%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۰۹	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۲۸,۳۷۰	۳۵.۳۴%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۱۸۸	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۵۳,۹۳۰	۳۴.۱۱%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۱۲۲	۴,۰۱۳	۲.۷%	۴,۳۲۹	(۴.۸%)
سکه امامی (تومان)	۱۷۸,۵۱۰,۰۰۰	۱۶۹,۰۵۰,۰۰۰	۵.۶%	۱۸۱,۰۱۰,۰۰۰	(۱.۴%)
دلار آزاد (تومان)	۱۷۵,۷۰۰	۱۷۲,۰۰۰	۲.۱%	۱۷۴,۸۰۰	۰.۵%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۷۲.۶	۷۳.۴	(۱.۱%)	۹۳.۱	(۲۲%)
بیت کوین (دلار)	۶۳,۱۷۹	۵۸,۷۲۶	۷.۶%	۶۰,۶۰۸	۴.۲%
اتریم (دلار)	۱,۷۶۹	۱,۵۷۷	۱۲.۲%	۱,۵۵۲	۱۴%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۱۱۱	۳,۰۹۹	۰.۴%	۳,۵۹۸	(۱۳.۵%)
مس LME (دلار)	۱۳,۳۵۶	۱۳,۳۸۶	(۰.۲%)	۱۳,۵۰۸	(۱.۱%)
روی LME (دلار)	۳,۵۸۸	۳,۵۵۸	۰.۸%	۳,۵۲۶	۱.۷%
سرب LME (دلار)	۱,۸۷۸	۱,۸۷۷	۰.۱%	۲,۰۰۶	(۶.۴%)
انس پلاتین (دلار)	۱,۶۱۷	۱,۵۶۶	۳.۲%	۱,۷۹۸	(۱۰.۱%)

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege