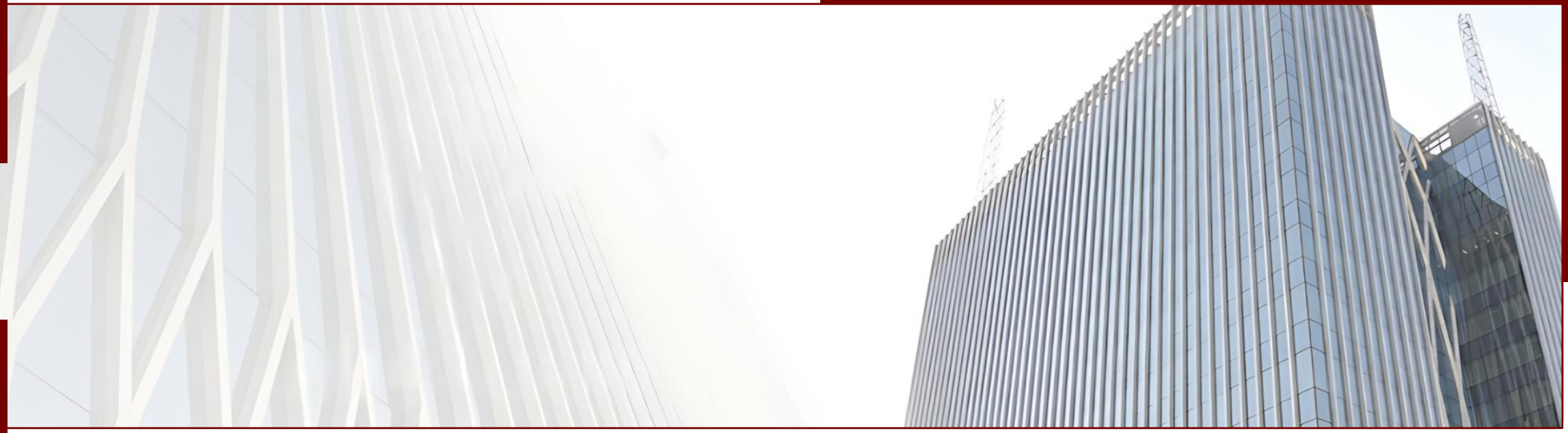


هفته‌نامه تحلیلی بازار سرمایه

"هفته منتهی به ۱۹ 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



مهلت ۲۴ ساعته «اقرار به اشتباه»؛ آمریکا از ایران خواست بازبودن هرمز و توقف حملات را علنا اعلام کند

به گفته سه مقام آمریکایی، واشنگتن هم به صورت مستقیم و هم از طریق میانجی‌ها از ایران خواسته است به صورت علنی اعلام کند تنگه هرمز باز است و متعهد شود که شلیک به کشتی‌های تجاری را متوقف کند. به گفته یک مقام آمریکایی، واشنگتن انتظار دارد ایران این اقدام را پس از مذاکرات روز شنبه انجام دهد.



ترامپ: آتش‌بس با ایران دیگر تمام شده اما به مذاکره با تهران ادامه می‌دهیم

دونالد ترامپ، رئیس‌جمهوری آمریکا، اعلام کرد تهران از واشنگتن درخواست کرده است مذاکرات میان دو کشور ادامه پیدا کند و آمریکا نیز با این درخواست موافقت کرده، اما به گفته او، ایالات متحده به صراحت به ایران اعلام کرده که آتش‌بس دیگر پایان یافته است. ترامپ روز جمعه در شبکه اجتماعی خود نوشت: «جمهوری اسلامی ایران از ما خواسته است مذاکرات را ادامه دهیم. ما نیز با این درخواست موافقت کرده‌ایم، اما ایالات متحده بدون هیچ ابهامی به آنها اعلام کرده است که آتش‌بس دیگر تمام شده است.»



سفر امروز آقای عراقچی به عمان با محور تنگه هرمز و تفاهم نامه خاتمه جنگ

سخنگوی وزارت خارجه گفت: سفر امروز آقای عراقچی به عمان در ادامه رایزنی‌های دو کشور درباره موضوع تنگه هرمز و اجرای مفاد یادداشت تفاهم خاتمه جنگ انجام می شود. گفت و گوهای ایران و عمان درباره تنگه هرمز طی یک تا دو ماه گذشته آغاز شده و این موضوع یکی از محورهای کلیدی یادداشت تفاهم خاتمه جنگ بود. وی افزود: بر اساس توافق، ایران مسئولیت مشخصی در زمینه ایجاد ترتیبات عادی و ارائه خدمات دریایی مرتبط با تردد کشتی‌ها در آب های عمان را بر عهده گرفته و با جدیت و قاطعیت آن را دنبال می‌کند. مقرر شد دو کشور در این زمینه بصورت مستمر با یکدیگر مشورت و همکاری داشته باشند. آقای بقائی ادامه داد: سفر وزیر خارجه به عمان نیز در همین چارچوب و با هدف ادامه رایزنی ها و تقویت همکاری‌ها برای تسهیل تردد ایمن کشتی‌ها در تنگه هرمز انجام می شود. رویکرد ایران تعهد در برابر تعهد است. اگر آمریکا تعهدات را نقض متقابلا ایران همان کار را انجام خواهد داد.

مهم‌ترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی در هفته اخیر



رشد ۶۱ درصدی در یک‌سال؛ ارزش بازار اوراق بهادار در ۴ بورس ایران از مرز ۲۱ هزار همت فراتر رفت

بر اساس داده‌های آماری اداره تحلیل‌های اقتصادی و ریسک سازمان بورس و اوراق بهادار مجموع ارزش بازار اوراق بهادار در ۴ بورس فعال ایران، در پایان بهار امسال، با رشد ۶۱ درصدی مواجه شده و از ۱۳٫۲۳۱ همت در خرداد پارسال به ۲۱٫۳۳۵ همت در خرداد امسال رسیده است. بر اساس این گزارش، ارزش بازار بورس تهران با ۶۱ درصد افزایش، از ۹٫۸۵۴ در خرداد پارسال به ۱۵٫۸۸۳ همت در پایان خرداد امسال افزایش یافته است. همچنین ارزش بازار فرابورس ایران با ۵۱ درصد افزایش، از ۳٫۲۱۴ در خرداد سال ۱۴۰۴ به ۴٫۸۳۸ همت در پایان خرداد ۱۴۰۵ افزایش یافته است. طبق این داده‌های آماری، ارزش بازار اوراق بهادار در ۲ بورس کالایی ایران، شامل: بورس کالا و بورس انرژی نیز با ۲۷۸ درصد رشد مواجه شده و از ۱۶۲ همت در پایان خرداد پارسال، به ۶۱۴ همت در پایان خرداد امسال، افزایش یافته است.



شروع پذیره نویسی سه روزه صندوق جدید نقره با نماد "پلاتا" در بورس کالا

پذیره نویسی واحدهای صندوق سرمایه گذاری چند کالایی کیمیا شاخه فلز نقره با مجوز سازمان بورس و نماد "پلاتا" از امروز شنبه ۲۰ تیرماه به مدت سه روز کاری در بورس کالا آغاز می شود. براساس این گزارش، تعداد واحدهای سرمایه گذاری قابل انتشار این صندوق، ۲۰۰ میلیون واحد و مبلغ اسمی هر ورقه ۱,۰۰۰ تومان است که در قالب واحدهای سرمایه گذاری عادی پذیره نویسی می شود. معاملات ثانویه واحدهای سرمایه گذاری این صندوق بعد از پایان دوره پذیره نویسی و ثبت صندوق در بازار صندوق های سرمایه گذاری بورس کالا آغاز می شود.



زمان معارفه دو شرکت ۷ و ۳.۵ هزار میلیارد تومانی برای عرضه اولیه

دو شرکت ۷ و ۳.۵ هزار میلیارد تومانی مهندسی فکور صنعت تهران و سرمایه گذاری دنیای سرمایه ایرانیان، یکشنبه و دوشنبه هفته جاری معارفه می شوند تا آماده عرضه اولیه سهام شوند. بر اساس این گزارش، معارفه "فکور و وسرمایه" ساعت ۱۲ و ۱۴ یکشنبه و دوشنبه ۲۱ و ۲۲ تیر از طریق www.faraboursetv.comبصورت زنده پخش خواهد شد.. متقاضیان سوالات را تا ساعت ۱۶ فردا از طریق سامانه مختص عرضه‌های اولیه به نشانی www.ifb.irارسال کنند.

بررسی وضعیت بازار در هفته‌ی اخیر

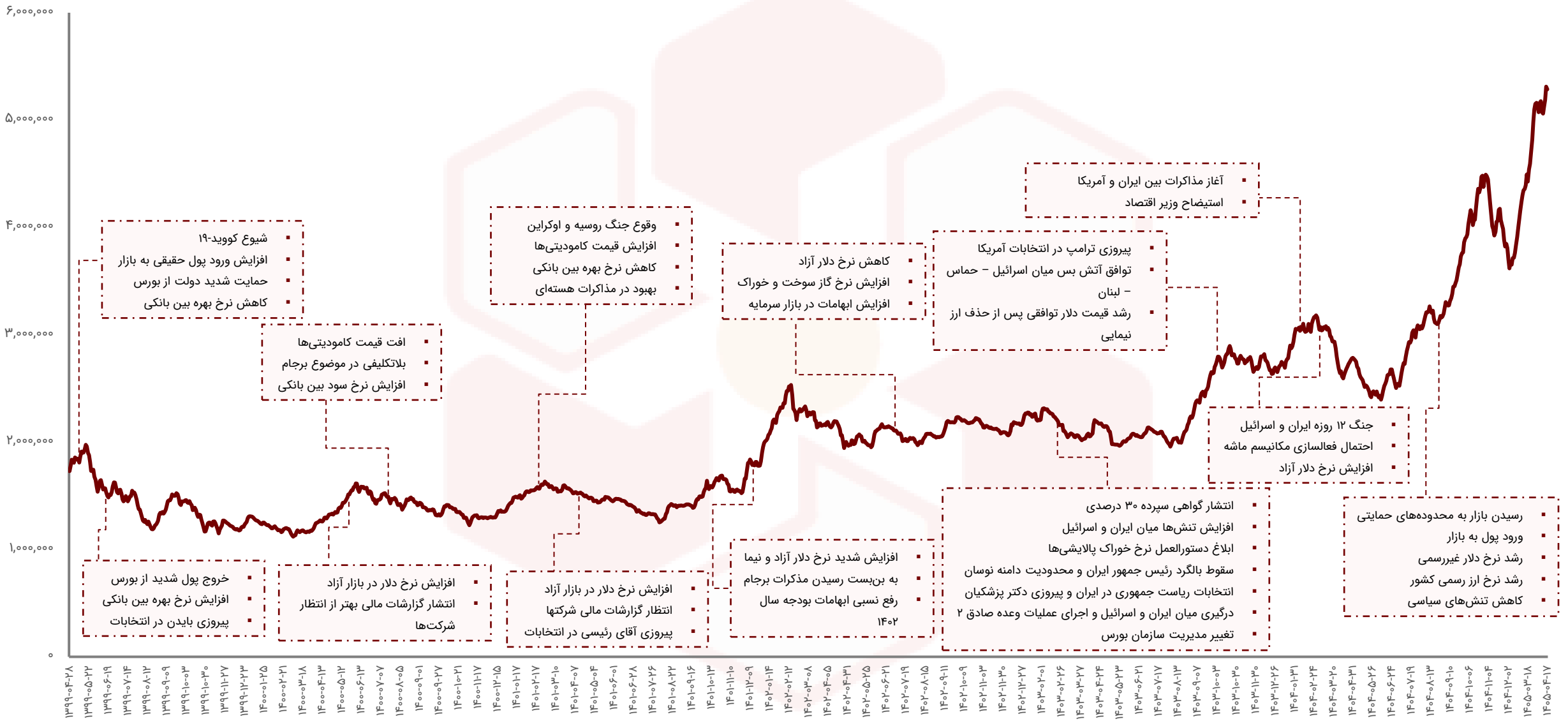
شرح وقایع بازار در هفته گذشته

در هفته معاملاتی اخیر که نسبتاً نیمه تعطیل دنبال شد، شاخص کل بورس اوراق بهادار با رشدی ۱.۹ درصدی، بر ارتفاع ۵,۲۸۶,۷۸۳ واحد ایستاد. بازگشایی بازار سهام در روز سه‌شنبه و پس از وقفه‌ای پنج روزه، با تقاضای خریداران و تشکیل صف‌های خرید در اکثریت بازار همراه بود؛ در این روز، ارزش معاملات به ۱۷ همت رسید و شاهد باقی‌ماندن حدود ۱۰ همت نقدینگی در صف‌های خرید در پایان معاملات بودیم. بروز التهابات ژئوپلیتیک در تنگه هرمز و مورد هدف قرارگرفتن سه کشتی تجاری توسط سپاه پاسداران و متعاقب آن، حملات تلافی‌جویانه ایالات متحده به اهداف نظامی و راداری در خاک ایران در روز سه شنبه و بامداد چهارشنبه، سطح ریسک سیستماتیک را افزایش داد. با این وجود، رفتار بازار سهام در ابتدای معاملات روز چهارشنبه حاکی از تاب‌آوری نسبی در مقابل این تحولات بود؛ خریداران در بازار حضوری فعال داشتند و ارزش معاملات در این روز به بیش از ۵۰ همت افزایش یافت؛ اگرچه در پایان معاملات، با انتشار اظهارات دونالد ترامپ مبنی بر عدم امیدواری به حصول توافق با ایران و مسدود بودن مسیر دیپلماسی، عرضه در بازار به شدت افزایش یافت و شاهد تشکیل صف‌های فروش در اکثریت نمادها بودیم. در بازارهای موازی، قیمت دلار آمریکا و طلای داخلی (علیرغم افت قیمت اونس جهانی)، با افزایش همراه گردید و دلار آمریکا به ۱۸۱ هزارتومان و هرگرم طلای ۱۸ عیار به ۱۷ میلیون و ۹۰۰ هزارتومان رسید.

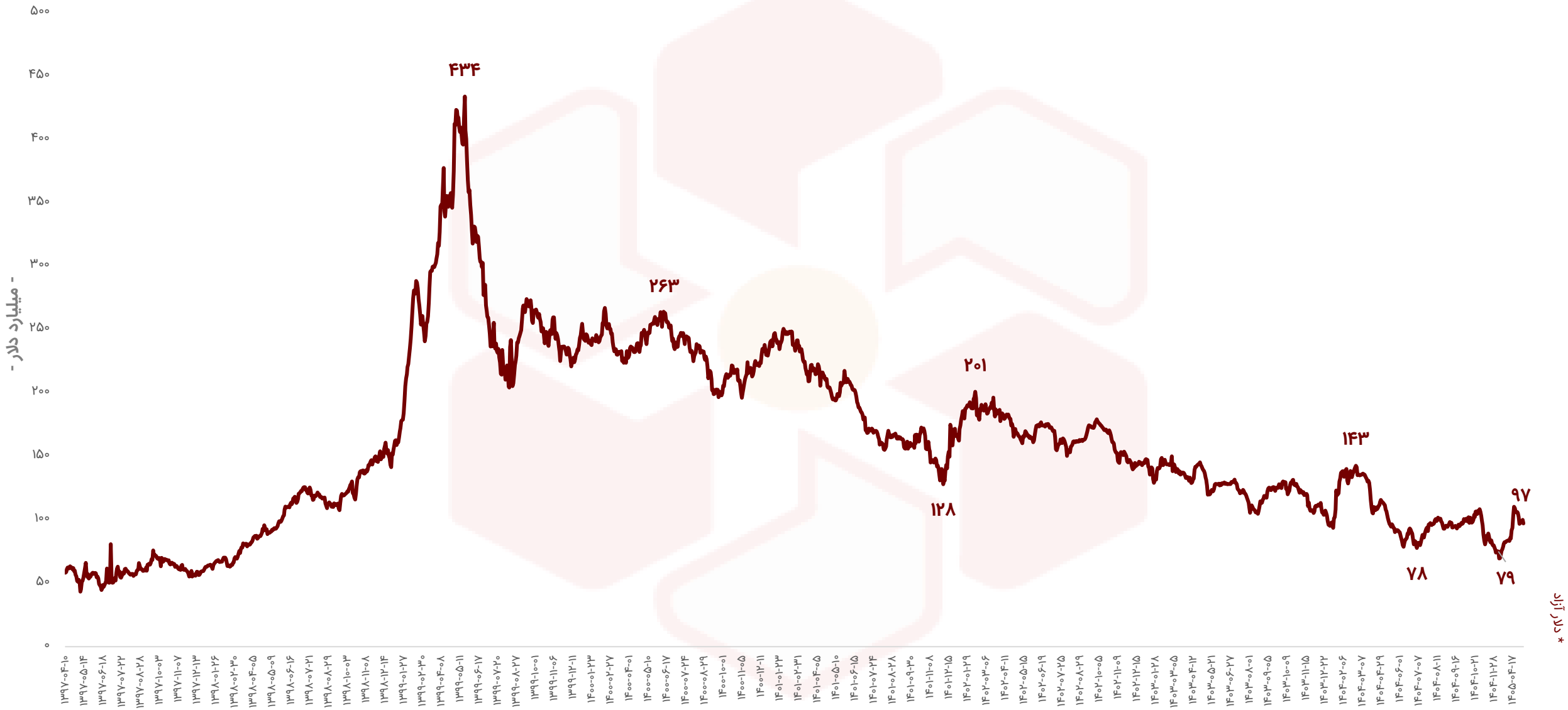
تغییرات هفتگی شاخص ها

	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۵,۱۸۷,۲۶۴	۵,۲۸۶,۸۵۶	۹۹,۵۹۲	%۱.۹
شاخص هم وزن (واحد)	۱,۳۶۱,۳۴۰	۱,۳۸۴,۲۵۰	۲۲,۹۱۰	%۱.۷
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت (میلیارد تومان)	۶۵,۳۳۷		(۱۰۹,۵۲۲)	%۶۲.۶
خالص ورود/خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)	(۲,۸۱۴)		-	-

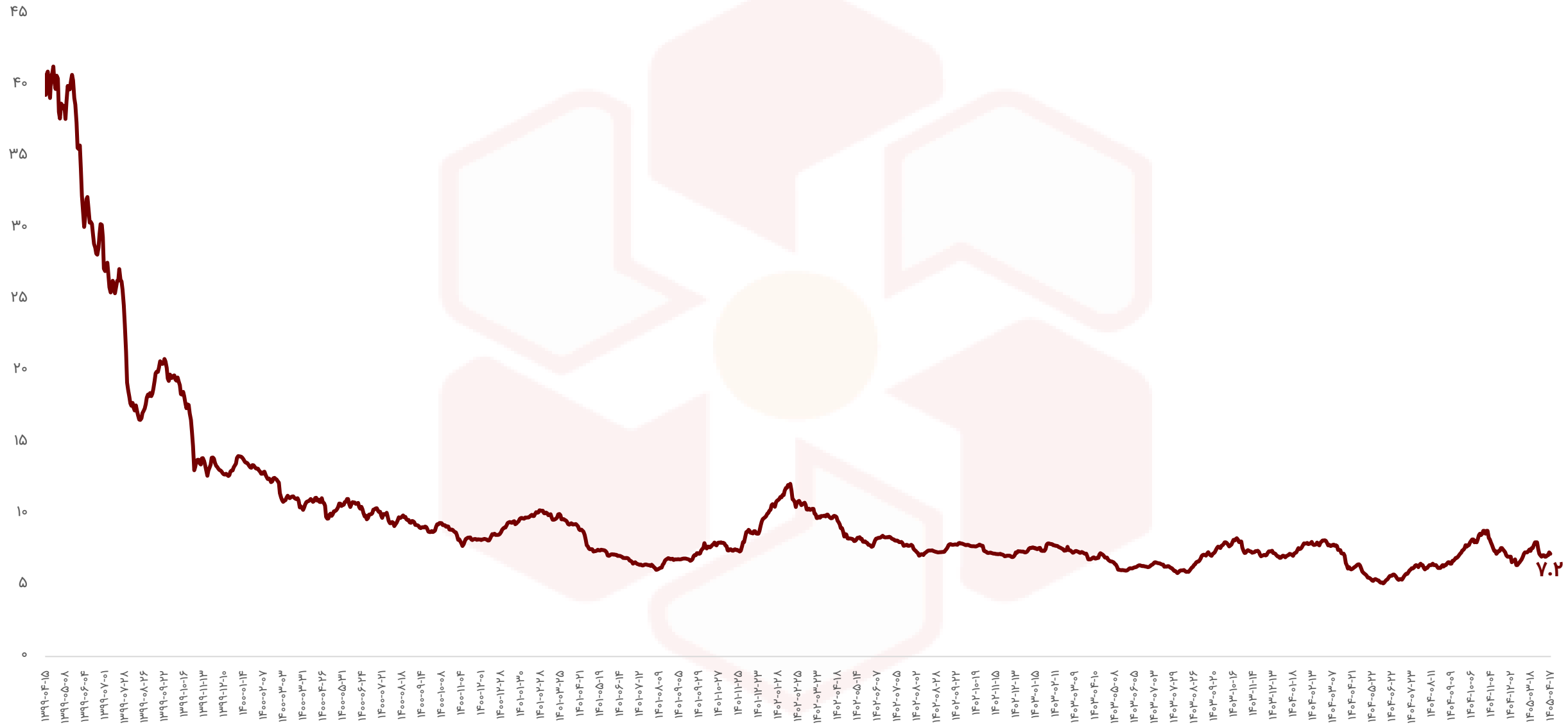
روند شاخص کل و متغیرهای اثرگذار بر آن



ارزش دلاری بازار*

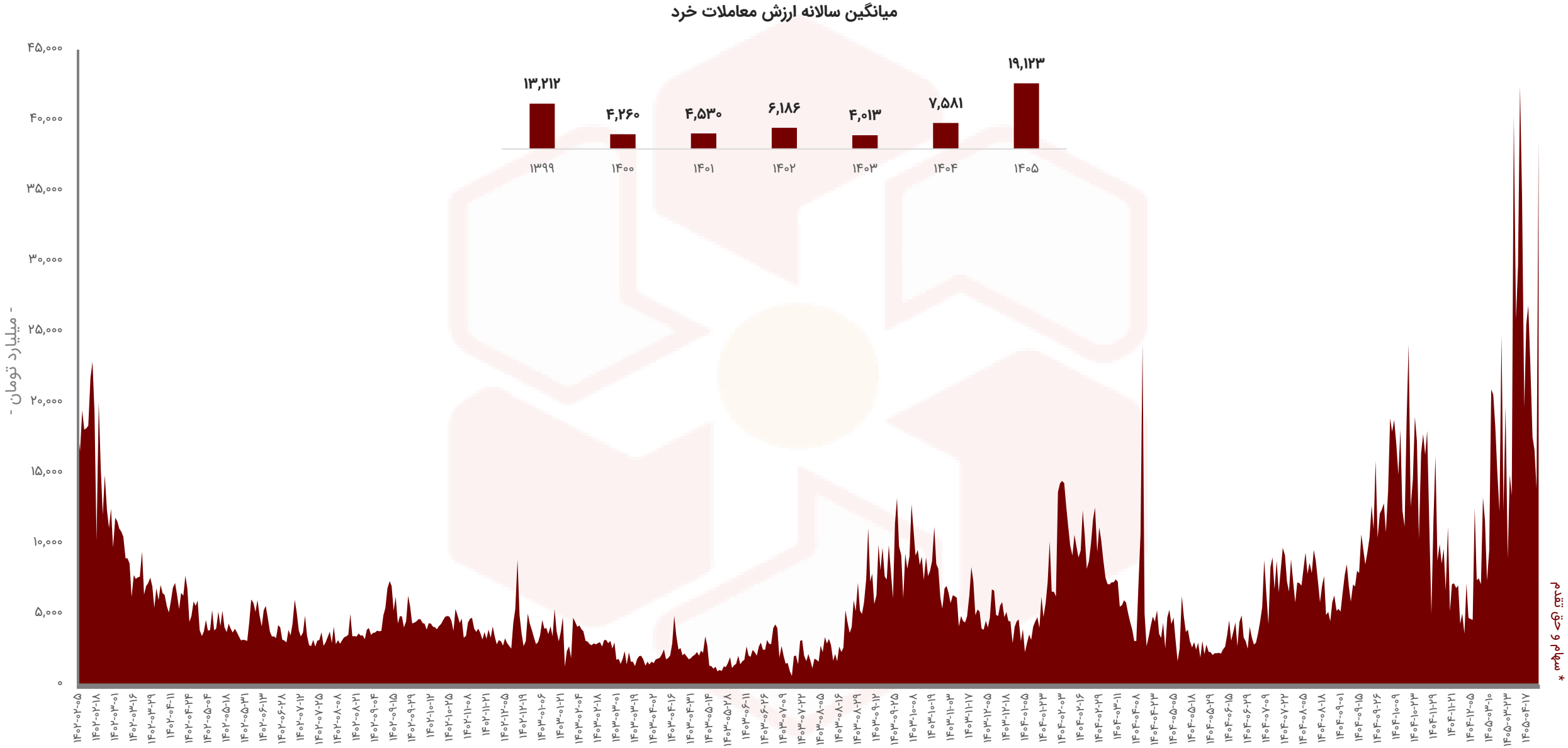


نسبت قیمت به سود کل بازار (P/E ttm)

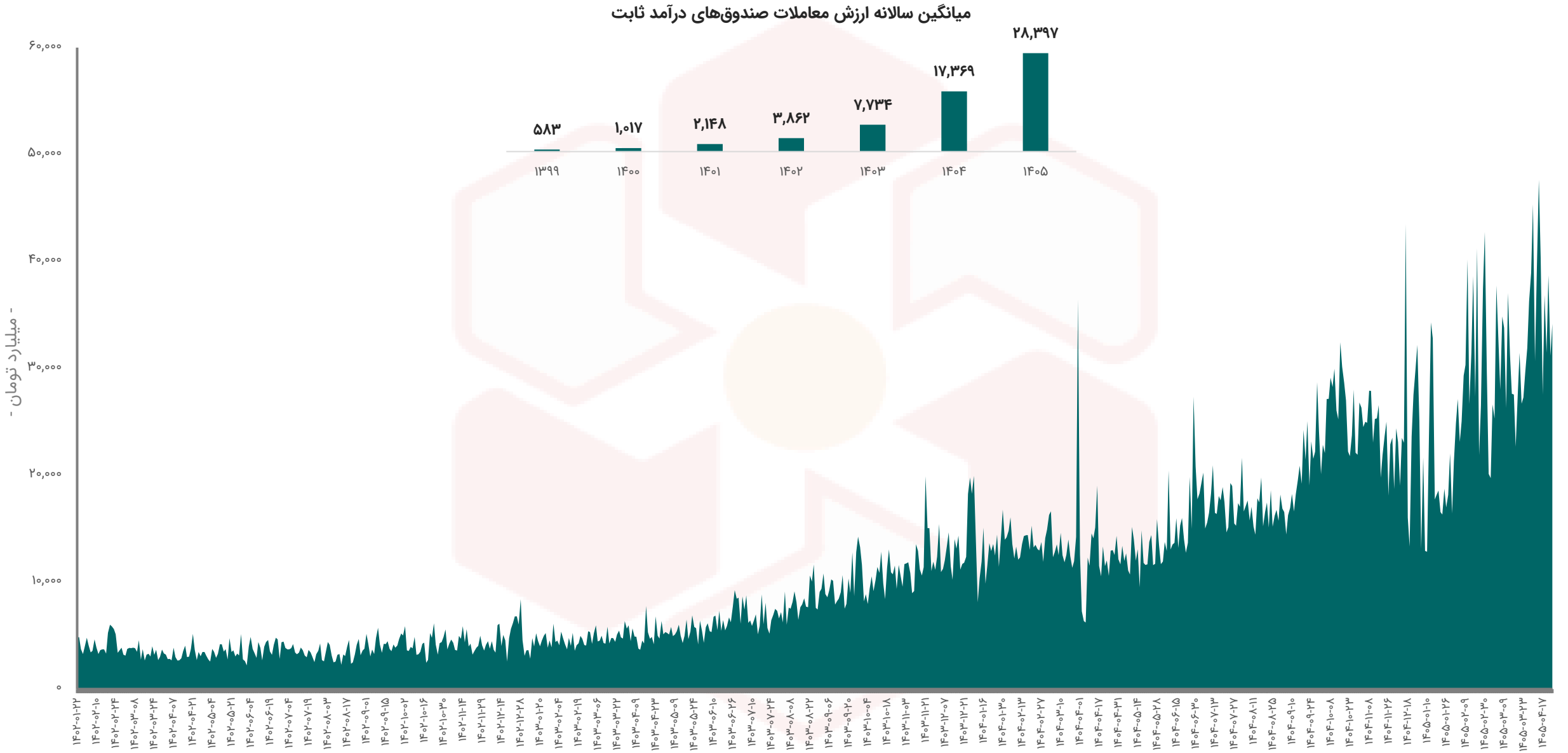


خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶
۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

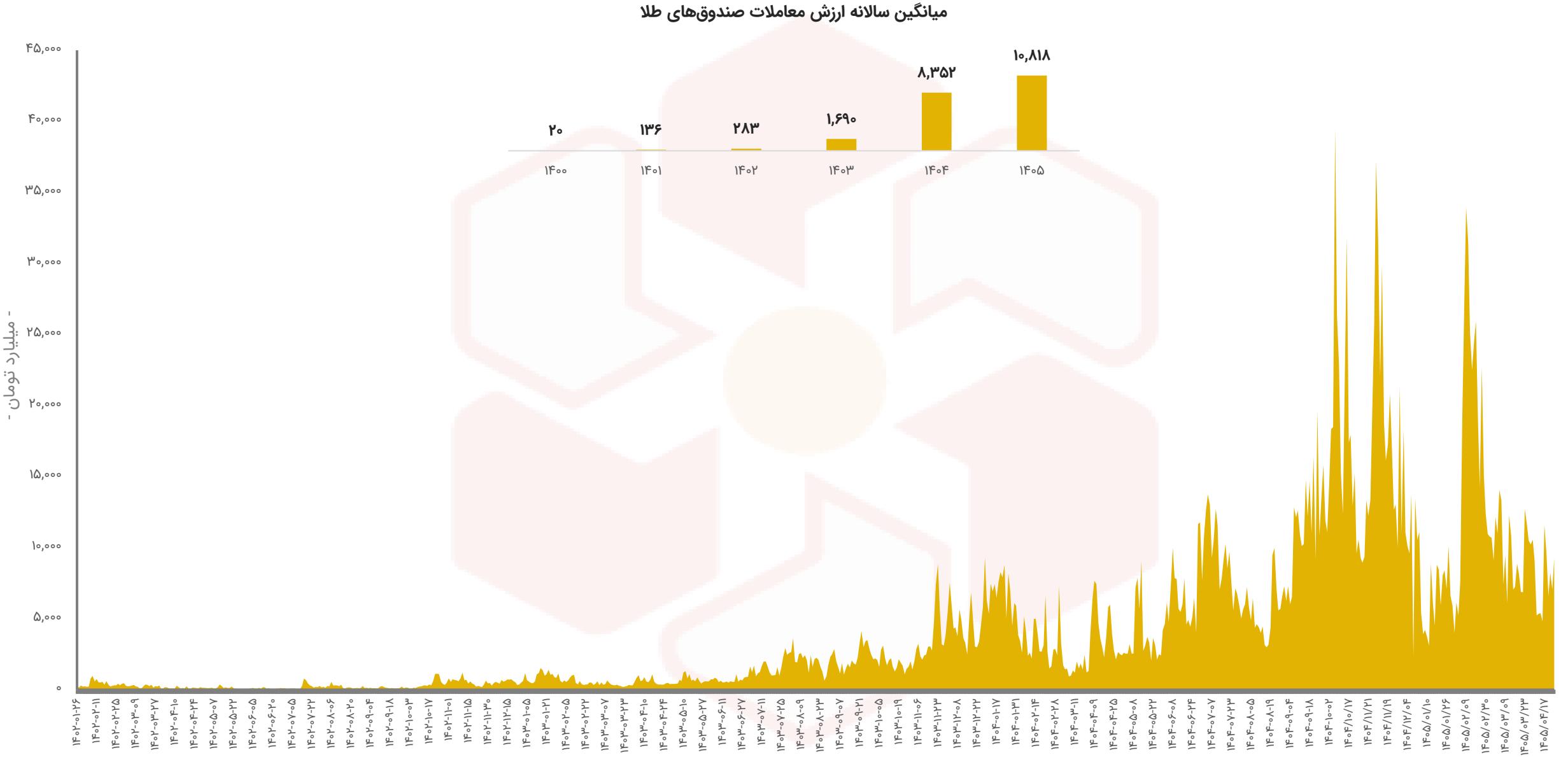
ارزش معاملات خرد سهام*



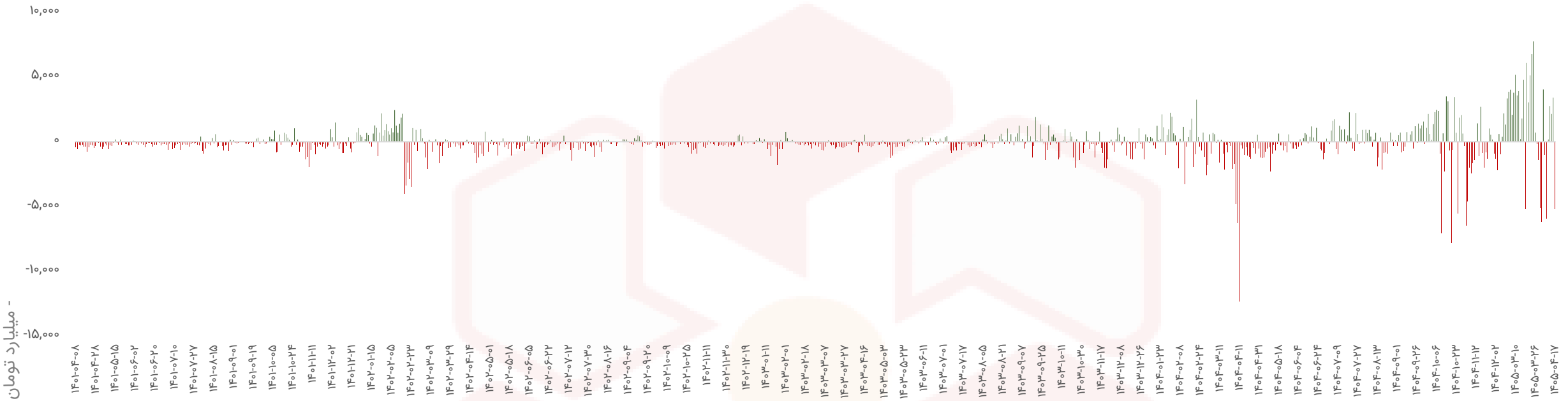
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت



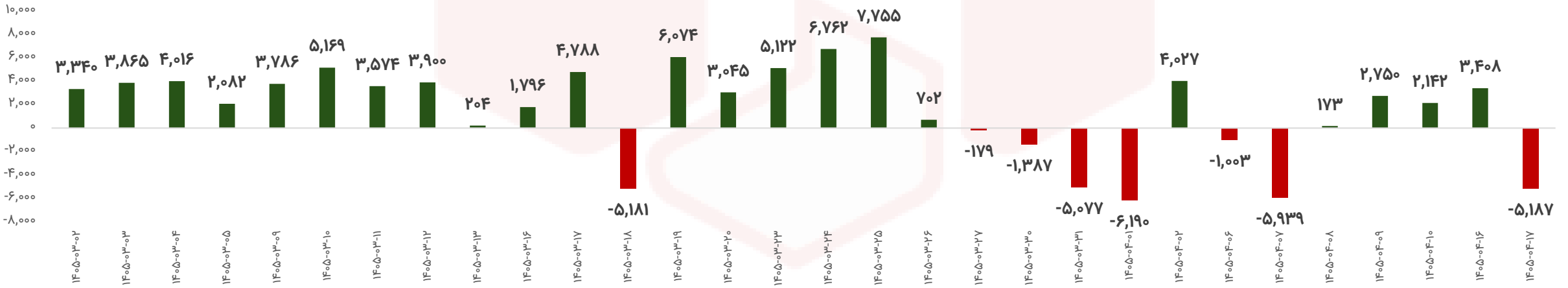
ارزش معاملات صندوق‌های طلا



خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق و تقدم



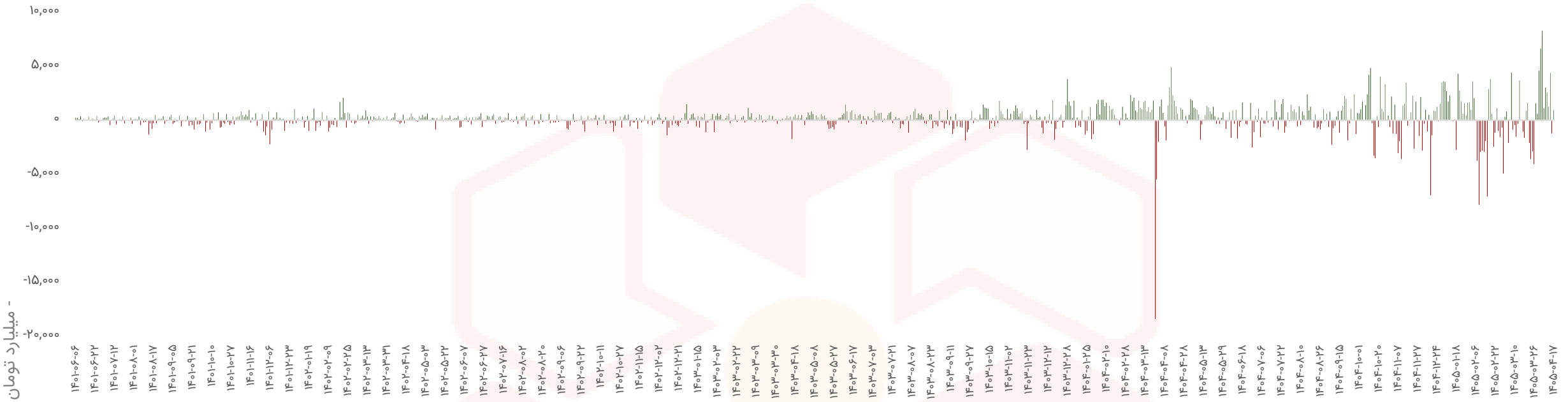
خالص ورود و خروج پول حقیقی به سهام حق تقدم در ۳۰ روز کاری اخیر



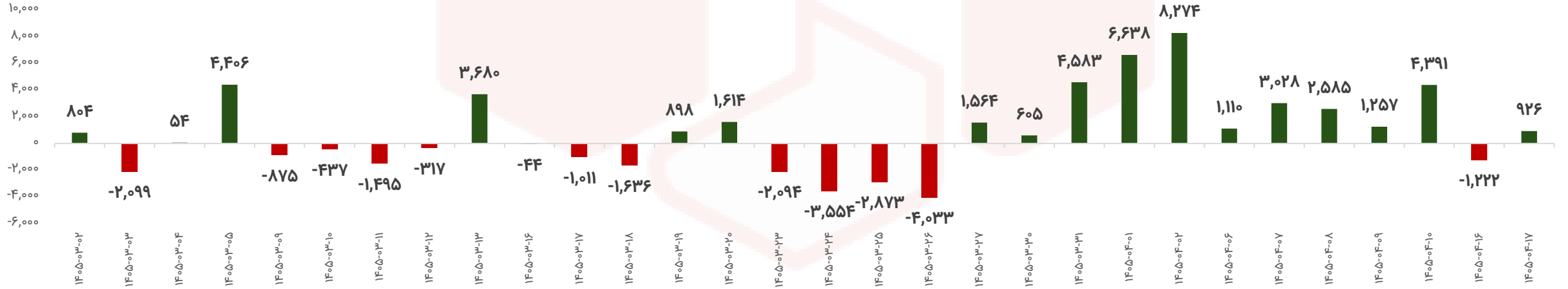
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

۰۲۱ - ۴۲۱۱۶۰۰۰

خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت



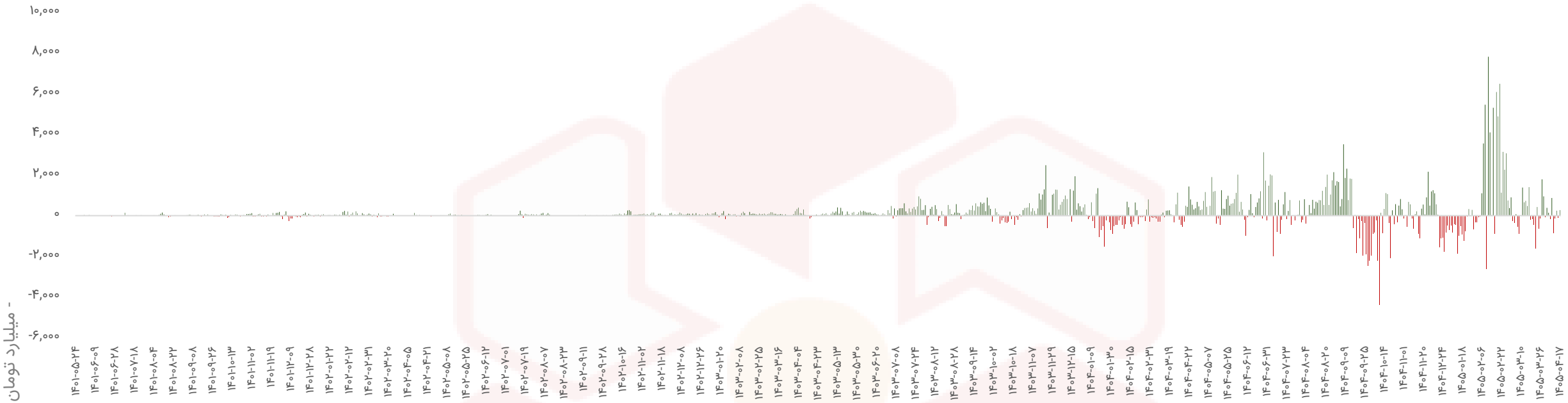
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت در ۳۰ روز کاری اخیر



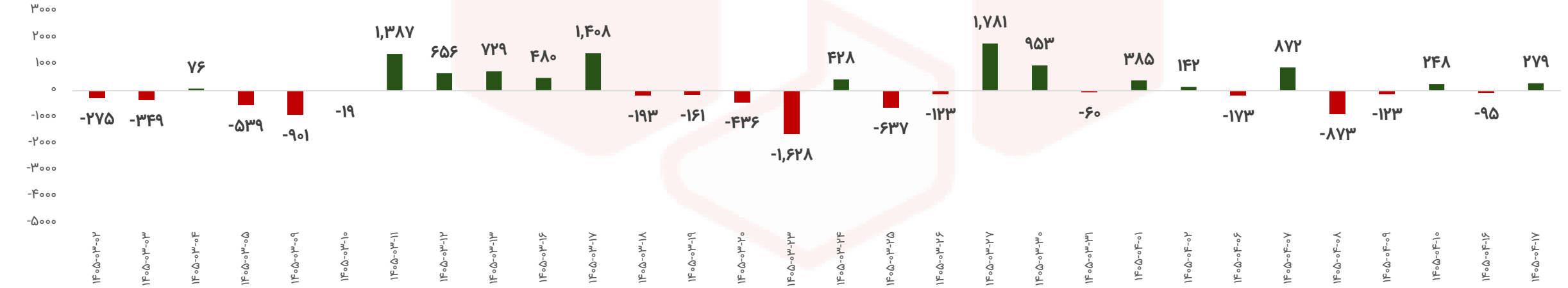
خیابان قائم مقام فراهانی - خیابان خدری - پلاک ۳۶

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

نمادها با بیشترین بازدهی

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	خط دریا بندر	حبندر	%۲۵.۱
۲	سرمایه‌گذاری امین مهرگان	وامین	%۲۱.۲
۳	سرمایه‌گذاری صدر تأمین	تاصیکو	%۱۲
۴	صندوق خصوصی ثروت آفرین فیروزه	ثروت	%۱۰
۵	صندوق سرمایه‌گذاری مبتنی بر کالای فارابی	سینرژی	%۸.۵

نمادها با کمترین بازدهی

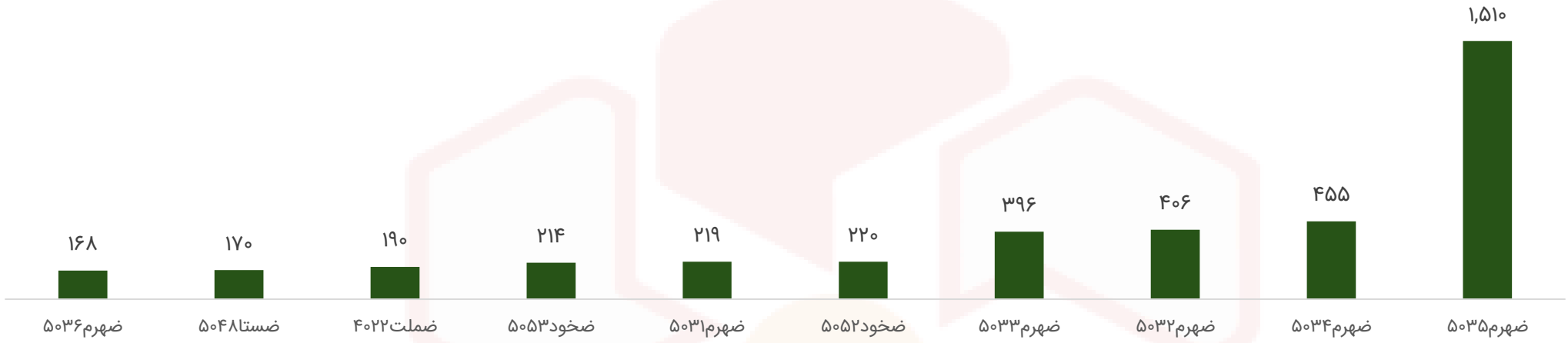
رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (%)
۱	کارگزاران پارس	گپارس	(%۵.۹)
۲	سرمایه‌گذاری توسعه و عمران زاگرس	ثزاگرس	(%۵.۸)
۳	واسپاری عصر اعتماد	ولاعتماد	(%۵.۸)
۴	افرانت	افرا	(%۵.۸)
۵	کارخانجات اتمسفر	تاتمس	(%۵.۷)

نمادهای با کمترین P/E

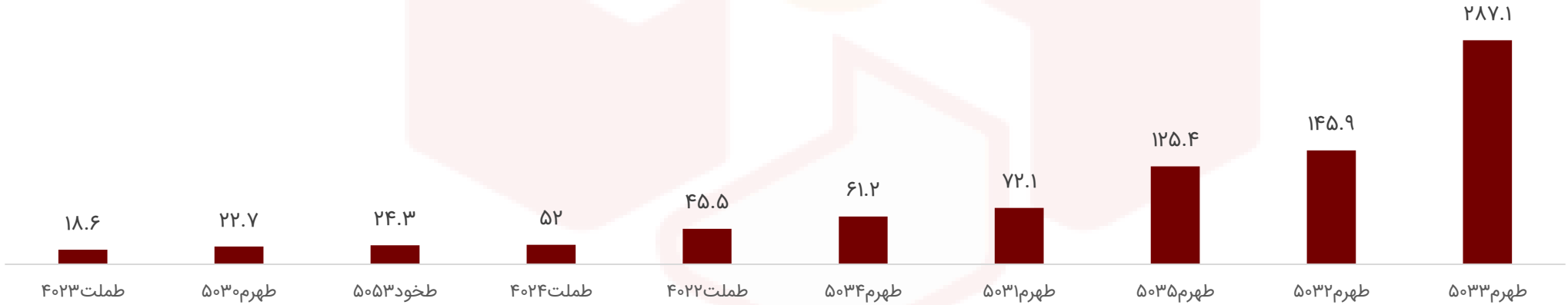
نماد	قیمت (ریال)	P/E
وپارس	۱,۹۹۸	۱.۳
لازما	۷۴,۸۷۰	۱.۵
وگردش	۱,۵۲۳	۱.۵
پارسیان	۱,۳۳۸	۱.۶
وبملت	۱,۳۰۹	۱.۷
حفاری	۴,۷۷۰	۱.۸
حآفرین	۱,۷۹۷	۲.۴
شساخت	۲۱,۱۶۰	۲.۴
شصفها	۲,۸۴۰	۲.۴
اتکام	۲,۰۴۹	۲.۵

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

ارزش معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته



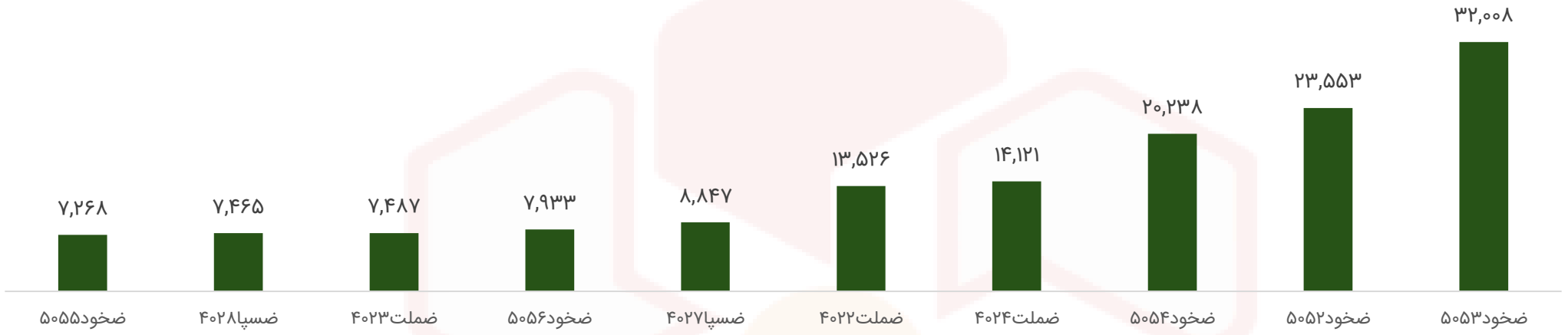
ارزش معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته



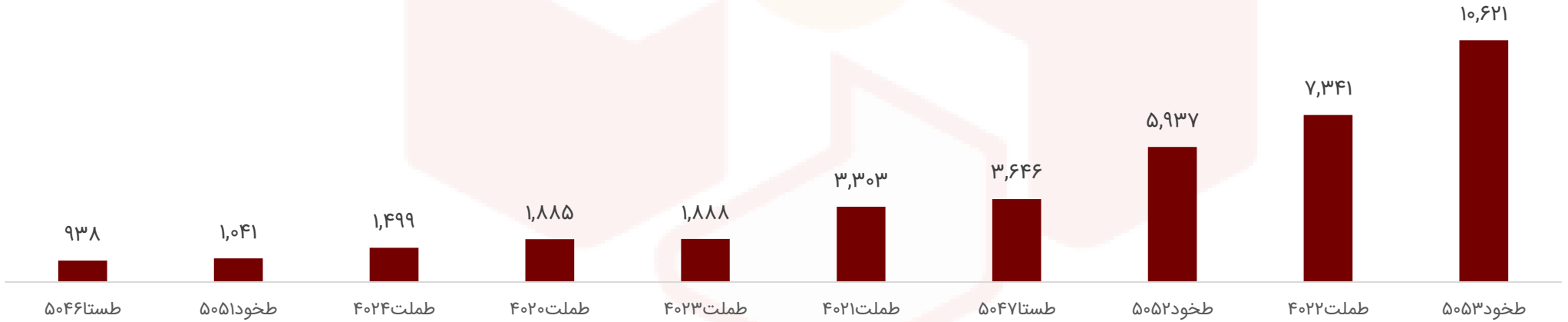
- میلیارد تومان -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه

بیشترین حجم معاملات اختیار خرید در هفت روز گذشته

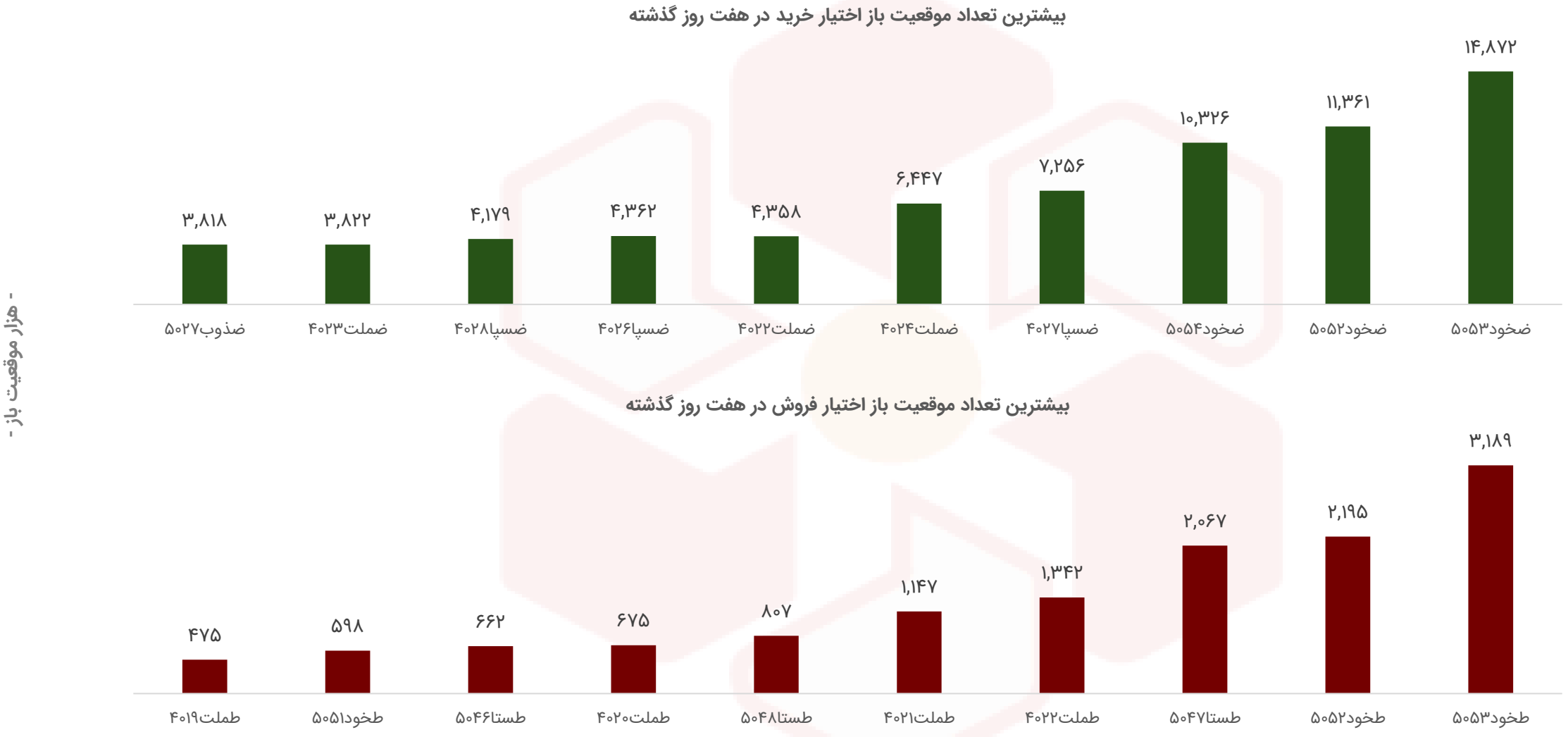


بیشترین حجم معاملات اختیار فروش در هفت روز گذشته

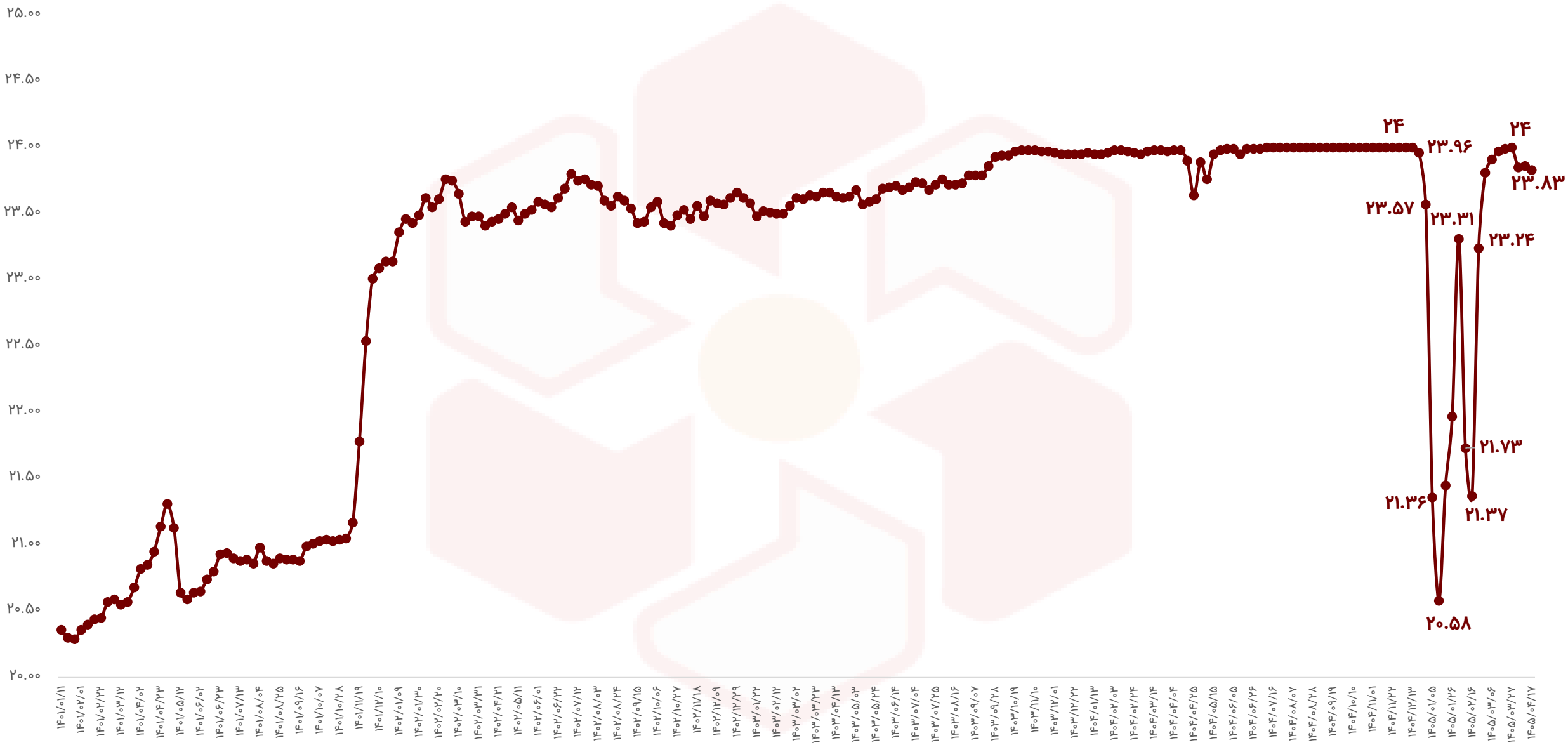


- هزار برگ سهم -

بررسی وضعیت بازار ابزارهای مشتقه



روند نرخ بهره بین بانکی (%)



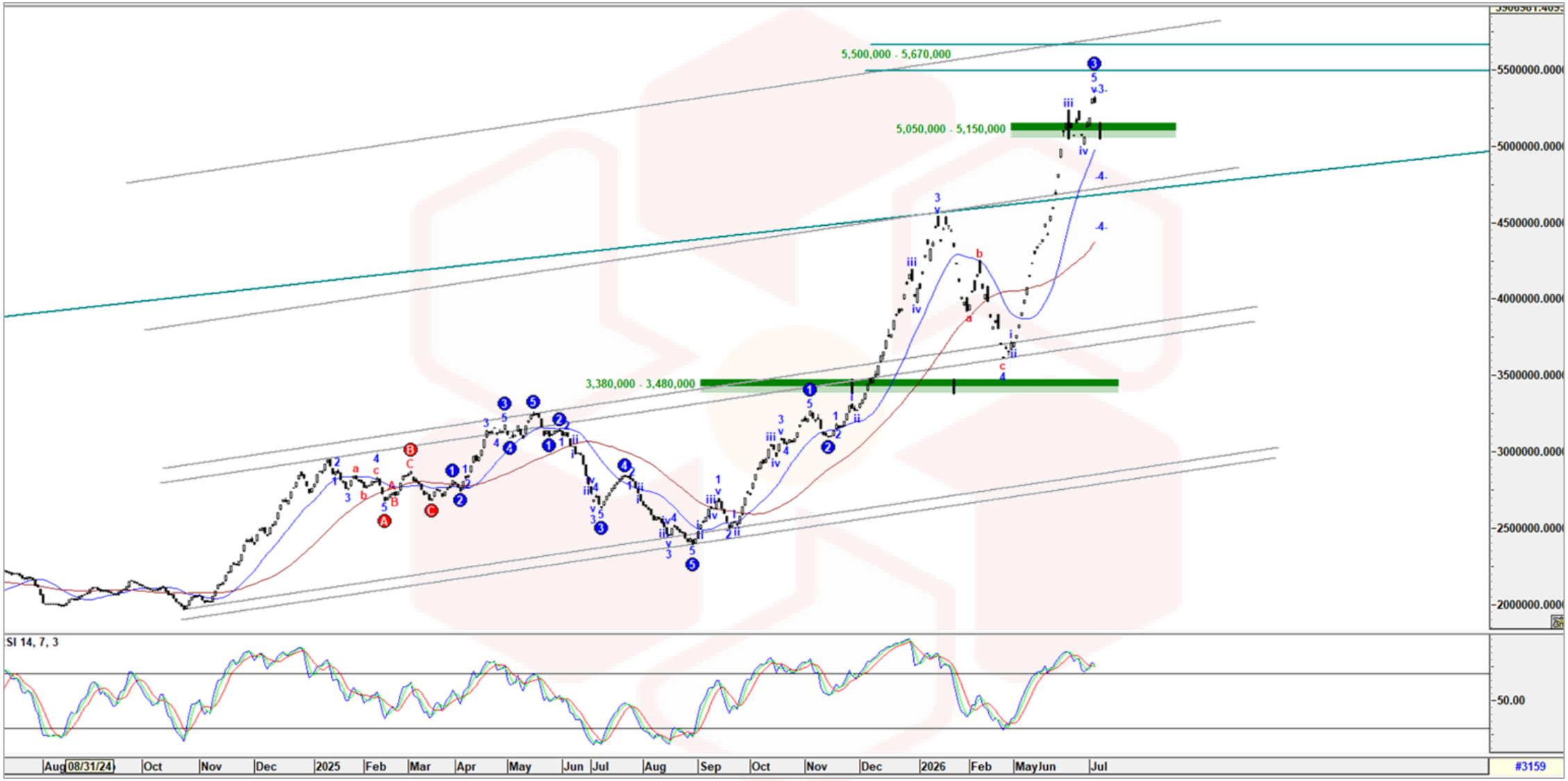
اوراق با درآمد ثابت

نماد	قیمت اسمی	نوع	سررسید	روز تا سررسید	تعداد انتشار	قیمت پایانی	YTM(last)
اخزا۲۱۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۱۴۹	۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۶,۶۲۰	۴۲%
اخزا۲۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۹۳	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۵,۷۳۰	۴۱.۲۷%
اخزا۲۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۱۲۱	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۹۳,۲۶۰	۴۰.۵۶%
اخزا۴۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۰-۱۹	۹۱۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۷,۶۷۰	۴۰.۴۹%
اخزا۴۰۷	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۱۱-۱۰	۹۳۳	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۰,۴۴۰	۴۰.۳۵%
اخزا۴۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۸-۱۶	۸۴۹	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۵۶,۰۸۰	۴۰.۱۵%
اخزا۲۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۱۵۶	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۶,۴۵۰	۳۹.۸۵%
اخزا۲۰۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۱۸۴	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۴,۴۹۰	۳۹.۸۳%
اخزا۲۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۱۸۴	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۴۴,۹۳۰	۳۹.۶۹%
اخزا۴۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۴-۲۰	۷۳۰	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۱۵,۰۱۰	۳۹.۳۵%
اخزا۳۰۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۴۲۲	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۸۱,۵۶۰	۳۹.۳۲%
اخزا۴۰۲	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۶-۱۴	۷۸۶	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۸۹,۹۷۰	۳۹.۲۸%
اخزا۴۰۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۷-۰۷-۱۸	۸۲۱	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۷۵,۰۰۰	۳۹.۲۳%
اخزا۲۱۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۲۰۵	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۸۳۱,۲۲۰	۳۸.۹۸%

وضعیت بازارهای موازی در یک نگاه

شرح	آخرین	هفته گذشته		ماه گذشته	
		قیمت	تغییرات	قیمت	تغییرات
طلا (دلار/انس)	۴,۱۱۱	۴,۱۷۵	(۱.۵%)	۴,۲۵۹	(۳.۵%)
سکه امامی (تومان)	۱۸۱,۴۸۵,۰۰۰	۱۷۶,۹۸۰,۰۰۰	۲.۵%	۱۸۲,۹۹۰,۰۰۰	(۰.۸%)
دلار آزاد (تومان)	۱۸۲,۵۰۰	۱۷۶,۲۰۰	۳.۶%	۱۷۷,۰۰۰	۳.۱%
نفت برنت (دلار/بشکه)	۷۶	۷۱.۹	۵.۷%	۹۱.۸	(۱۷.۲%)
بیت کوین (دلار)	۶۳,۷۱۰	۶۲,۶۲۸	۱.۷%	۶۲,۰۵۰	۲.۷%
اتریم (دلار)	۱,۷۹۰	۱,۷۵۰	۲.۳%	۱,۶۵۸	۸%
آلومینیوم LME (دلار)	۳,۱۴۶	۳,۰۹۳	۱.۷%	۳,۵۲۶	(۱۰.۸%)
مس LME (دلار)	۱۳,۵۰۳	۱۳,۳۸۰	۰.۹%	۱۳,۵۶۸	(۰.۵%)
روی LME (دلار)	۳,۶۱۴	۳,۵۵۰	۱.۸%	۳,۵۴۴	۲%
سرب LME (دلار)	۱,۸۹۷	۱,۸۹۴	۰.۱%	۱,۹۸۰	(۴.۲%)
انس پلاتین (دلار)	۱,۶۳۷	۱,۶۵۲	(۰.۹%)	۱,۷۲۷	(۵.۲%)

بررسی تکنیکال شاخص‌های بازار - شاخص کل



کارگزاری بانک ملت

bank mellat brokerage co.

Mellatcollege

Mellatcollege