

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۱ دی ماه ۱۴۰۲

در هفته‌ای که گذشت، مجموع ارزش ریالی بورس و فرابورس، ۲/۷ درصد و شاخص کل بورس ۲/۴ درصد افزایش یافت. P/Ettm بازار ۷/۹۲ می‌باشد. این هفته، ارزش معاملات روزانه بازار بد نبود هرچند نسبت به روزهای رونق بازار، ارزش معاملات هنوز پایین است. در کل بازار سهام آذر ماه خوبی را سپری کرد و شاخص کل بورس در این ماه توانست ۹/۵ درصد رشد کند و خود را به بالای مقاومت ۲/۲۰۰/۰۰۰ واحد برساند. این رشد با خبرهای تجدید ارزیابی دارائی‌ها آغاز شد و هر چند از تب و تاب روزهای اول اندکی کاسته شده اما همچنان ارزش معاملات روزانه بالاتر از چند هفته گذشته می‌باشد. این بالاترین سطح شاخص کل در ۶ ماه گذشته می‌باشد.

یکی از خبرهای این هفته بازار، معامله بلوک وبملت بود. گروه مالی ملت در حالی اسفند سال گذشته از عرضه ۲/۸۳ درصدی بانک ملت منصرف شده بود که دوشنبه هفته گذشته بلوک ۷ درصدی این بانک را معامله کرد. این بلوک شامل ۲۴ میلیارد و ۷۱۰ میلیون سهم "وبملت" بود که از سوی کارگزاری سینا با قیمت ۵۲۹۱ ریالی هر سهم عرضه و به ارزش ۱۳ هزار میلیارد تومان از سوی کارگزاری بانک ملت برای صندوق بازنشتگی بانک‌ها خریداری شد. خبر دیگر بازار در هفته گذشته مربوط به واگذاری دو باشگاه پرسپولیس و استقلال بود. خبر غیررسمی مربوط به اینکه شستا متقاضی خرید ۵۱ درصد باشگاه پرسپولیس و هلدینگ خلیج فارس متقاضی خرید باشگاه استقلال می‌باشد. تاریخ عرضه بلوک این دو باشگاه ۱۲ دی ماه می‌باشد.

این هفته بازار سرمایه میزبان عرضه اولیه ۱۰ درصد از سهام گروه مالی دیتام با نماد داتام خواهد بود. حداکثر میزان نقدینگی مورد نیاز برای شرکت در این عرضه اولیه ۲۳۲ هزار و ۵۰۰ تومان می‌باشد.

در بازار جهانی، مس ۸/۵۷۶، روی ۲/۶۰۰ دلار و نفت برنت ۷۹ دلار می‌باشد. نتیجه آخرین جلسه فدرال رزرو، عدم افزایش نرخ بهره بود. در جلسه فدرال رزرو، پاول ضمن رضایت از بازار کار عنوان کرد اشتغال در حال رسیدن به تعادل است. همچنین نرخ بهره در نزدیکی اوج خود برای چرخه فعلی اقتصادی است.

این هفته، قیمت و تجارت ۶/۵ درصد و وبملت ۴/۵ درصد افزایش داشت. نماد وبصادر برای افزایش سرمایه بسته می‌باشد. در عملیات اجرایی سیاست پولی بانک مرکزی در این هفته ارزش سفارش‌های ارسال شده عملیات بازار باز ۱۲۹ همت بوده که ۱۲۷ همت پذیرفته شده است. همچنین ارزش توافق بازخريد سررسيد شده در این هفته ۱۲۸ همت بوده است. ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند در این هفته ۱/۷ همت و ارزش توافق بازخريد سررسيد شده ۲/۳ همت بود.