



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

اینترنت گران، کند و بی کیفیت!

گزارش تحلیل بازارها-شماره ۸- هفته منتهی به تاریخ ۱۴۰۲-۱۰-۰۸
گروه تحلیل گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

Ehtemamlranian.com

Ehtemamlranian.ir

eii.co.ir



عناوین

- ❖ حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی
- ❖ نرخ های جهانی: بورس و انرژی، فلزات گرانبها و ارز، بازار کالاهای خام
- ❖ آخرین وضعیت طلا و دلار
- ❖ ارزشمندترین شرکت های جهان
- ❖ سیاست پولی بانک مرکزی
- ❖ اخبار تاثیر گذار هفته گذشته
- ❖ هفت گروه با بیشترین ارزش معاملات طی هفته
- ❖ بررسی وضعیت صندوقها
- ❖ بررسی وضعیت بازار بدهی
- ❖ بررسی بورس کالا
- ❖ ورود و خروج پول حقیقی
- ❖ ارزیابی دلاری و ریالی شاخص کل



حقایق پیرامون چشم انداز جهانی

اخبار پیرامون جهان

- خودروساز چینی (BYD) با پشت سر گذاشتن تسلا به عنوان محبوب ترین سازنده خودروهای برقی در جهان شناخته شد.
- تقریباً برای هر بانکی که نام او جی پی مرگان نبود، سال سختی بود.
- قیمت آتی گاز اروپا با خطر گسترش جنگ در خاورمیانه افزایش یافت.
- نیجریه در حال نزدیک شدن به اولین قرارداد برای تامین گاز آفریقای جنوبی است.
- اگرچه مشکلات تورمی چین ادامه دارد ولی سود بخش صنعتی چین جهش کرد.
- چین پس از شکست ۸۰ میلیارد دلاری، مواضع خود را در قبال بازی های آنلاین کاهش می دهد.
- شرکت OpenAI در حال مذاکره برای جذب سرمایه جدید با ارزش ۱۰۰ میلیارد دلار یا بیشتر است.
- طرح مصر برای پایان دادن به جنگ اسرائیل و حماس با استقبال جالبی رو به رو شد.

Bloomberg

بلومبرگ

طبق گزارش IISS (International Institute for Strategic Studies) در سال ۲۰۲۳، ۱۸۳ درگیری نظامی در جهان در حال رخ دادن است که بیشترین مقدار خود در سی سال گذشته است و در کل این درگیری ها را به پنج دلیل عمده بیان کرده است که عبارتند از:

- درگیری ها بر سر مرزها
- افزایش حکومت های مستبد
- خلافتکاری و جنایت سازمان یافته
- افزایش گروه های شبه نظامی
- تغییرات محیط زیستی

BUSINESS INSIDER

بیزینس اینسایدر

و همان گونه که مشاهده می شود با ادامه شرایط رکودی در جهان و دریافت کمک های جهانی کمتر در مناطق محروم، این روند خشونت بار رو به افزایش خواهد بود و همچنین به دلیل تغییرات اقلیمی و محدود شدن منابع؛ باید شاهد افزایش این نوع درگیری ها در جهان باشیم.



فایننشال تایمز

- کارشناس انرژی می گوید: اوپک پلاس نمی تواند تولید نفت را به اندازه ای کاهش دهد که قیمت نفت خام را بالاتر ببرد.
- هند در نظر داشت در معاملات نفتی دلار آمریکا را کنار بگذارد و با روسیه به توافق رسیدند ولی به علت پیدا نکردن بانکی که این معامله را قبول کند، موفق به انجام آن نشدند.
- به گفته وزیر دفاع انگلیس، روسیه در ۴ ماه گذشته یک پنجم ناوگان مستقر خود در دریای سیاه را از دست داده است.
- یک مقام ارشد سابق فدرال رزرو می گوید که ایالات متحده در سال ۲۰۲۳ از زیر بار رکود فرار کرد و احتمال زیادی دارد که در ۲۰۲۴ دوباره همین کار را انجام دهد.
- اسرائیل نسبت به افزایش خطر درگیری منطقه ای با ایران هشدار داد.
- تولیدات و ذخایر زعفران ایران به عنوان بزرگ ترین تولید کننده زعفران، در حال کاهش است. که با این حال تولید آن از ۴۰۰ تن به حدود ۱۷۰ تن کاهش یافته است.
- روابط اسرائیل و سازمان ملل متحد با ادامه جنگ غزه به پایین ترین سطح خود رسید.
- جی پی مورگان تقریباً یک پنجم کل سود بانک های ایالات متحده را به خود اختصاص داد.
- وزیر محیط زیست برزیل خواستار توقف "سقف" تولید نفت شد.
- اوکراین قصد دارد گام مهمی برای عضویت در اتحادیه اروپا بردارد.
- ارمنستان در حال مخالفت با حامی سیاسی خود، روسیه است.
- هند شاهد یک رونق عظیم در صنعت هوانوردی است.

منبع	بازده	بازده	بازده	آخرین قیمت	عنوان	ردیف	
	سالانه	ماهانه	هفتگی				
بورس های جهانی							
TeleTrader	۱۲.۹۹%	۶.۲۳%	۱.۲۸%	واحد	۳۷,۵۳۴.۷۵	Dow Jones	۱
	۵۵.۹۶%	۵.۷۴%	۱.۹۶%	واحد	۱۶,۸۷۸.۴۶	Nasdaq	۲
	۲۴.۷۴%	۴.۹۲%	۱.۶۴%	واحد	۴,۷۷۴.۵۲	S & P ۵۰۰	۳
	۲.۶۳%	۳.۸۸%	۱.۱۴%	واحد	۷,۷۴۴.۱۵	FTSE ۱۰۰	۴
	۱۹.۶۱%	۴.۸۴%	۰.۰۴%	واحد	۱۶,۷۳۹.۰۵	DAX	۵
	۱۵.۷۷%	۴.۳۸%	۰.۰۰%	واحد	۷,۵۸۳.۷۷	CAC ۴۰	۶
	۲۷.۳۵%	۰.۷۰%	۰.۰۲%	واحد	۳۳,۶۸۱.۲۴	NIKKEI ۲۲۵	۷
	-۵.۸۵%	-۳.۸۶%	۰.۴۳%	واحد	۲,۹۱۴.۶۱	SHANGHAI	۸
	۴۵.۱۴%	-۲.۸۴%	۰.۰۳%	واحد	۳,۱۰۵.۰۰	Moex	۹
نفت و انرژی							
TeleTrader	۰.۲۱%	-۰.۲۸%	۰.۷۱%	دلار / بشکه	۷۹.۶۹	نفت خام برنت	۱۰
	-۵.۰۳%	-۰.۲۰%	۱.۶۵%	دلار / بشکه	۷۵.۲۳	نفت خام WTI	۱۱
tradingeconomics	-۴۰.۰۸%	-۱۰.۱۹%	۷.۰۷%	دلار / MMBtu	۲.۵۱	گاز طبیعی (هنری هاب)	۱۲
OilPrice	-۰.۵۵%	-۲.۳۱%	۳.۰۲%	دلار / بشکه	۸۰.۸۴	سبب اوپک	۱۳
	۰.۷۰%	-۲.۰۷%	-۰.۰۴%	دلار / بشکه	۷۸.۹۷	نفت سنگین ایران	۱۴
tradingeconomics	-۹.۲۲%	-۱.۶۶%	-۲.۰۲%	دلار / گالن	۲.۱۶	گازوئیل	۱۵
	-۲۳.۸۰%	-۱۰.۵۶%	۰.۱۵%	دلار / گالن	۱.۶۷	اتانول	۱۶
	۷.۵۵%	۱.۶۷%	۰.۱۴%	دلار / تن	۶۳۶.۳۹	نفتا	۱۷
PLATTS	-۸.۹۱%	-۰.۵۶%	-۰.۹۱%	دلار / تن	۲۸۵.۳۸	متانول CFR (چین)	۱۸

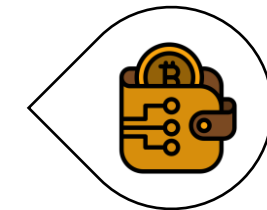
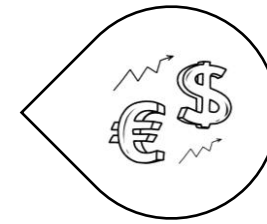
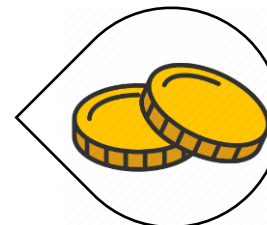
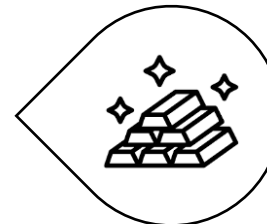
تعریف واحد MMBtu

Metric Million British Thermal Unit

گاز طبیعی هنری هاب

این نرخ گاز مخصوص استفاده در راستای
مصارف خانگی بوده که با نرخی متفاوت از گاز
مورد استفاده در شرکت ها و مصارف صنعتی
عرضه می شود.

منبع	بازده			آخرین قیمت	عنوان	ردیف
	سالانه	ماهانه	هفتگی			
فلزات گرانبها						
TeleTrader	۱۴.۶۰٪	۱.۳۰٪	۱.۸۹٪	دلار / اونس	۲,۰۶۷.۵۱	طلا
	۲.۳۴٪	-۳.۸۰٪	-۰.۳۱٪	دلار / اونس	۲۴.۰۶	نقره
طلا و سکه (داخلی)						
tgju.org	۳۲.۶۲٪	۱.۳۷٪	۱.۵۰٪	ریال	۲۴,۹۱۷,۰۰۰	یک گرم طلای ۱۸ عیار
	۴۲.۱۷٪	۱.۴۳٪	۱.۴۲٪	ریال	۲۹۳,۴۷۰,۰۰۰	سکه امامی
	۳۲.۴۱٪	۱.۲۱٪	۱.۵۹٪	ریال	۲۶۰,۲۰۰,۰۰۰	سکه بهار آزادی
	۲۴.۴۲٪	۱.۹۱٪	۰.۴۹٪	ریال	۱۵۴,۹۰۰,۰۰۰	نیم سکه
	۱۰.۰۰٪	۱.۴۱٪	-۰.۰۵٪	ریال	۱۰۳,۹۵۰,۰۰۰	ربع سکه
	۵۳.۲۵٪	۱.۵۹٪	۰.۹۶٪	ریال	۲,۹۴۵,۰۰۰	تمام سکه رفاه (بورس)
ارز						
tgju.org	۲۶.۲۰٪	-۰.۷۴٪	۰.۲۹٪	ریال	۵۰۱,۳۴۰	دلار آزاد
	۲۶.۷۶٪	-۰.۰۵٪	۱.۰۶٪	ریال	۵۵۵,۳۸۰	یورو آزاد
رمز ارز						
tgju.org	۱۵۷.۹۹٪	۱۳.۰۱٪	-۰.۸۶٪	دلار	۴۳,۰۷۶.۲۱	بیت کوین
	۸۸.۶۹٪	۱۱.۰۲٪	۰.۷۷٪	دلار	۲,۲۸۵.۵۶	اتریوم
شاخص های داخلی ۶ دی						
shakhesban	۳۲.۱۵٪	۷.۴۵٪	-۱.۴۹٪	واحد	۲,۱۷۷,۰۰۰.۰۰	شاخص کل بورس
	۵۷.۱۳٪	۶.۲۶٪	-۰.۸۰٪	واحد	۷۵۵,۲۹۶.۰۷	شاخص کل بورس (هم وزن)
	۲۹.۱۵٪	۴.۸۴٪	-۰.۷۹٪	واحد	۲۶,۳۶۸.۹۸	شاخص کل فرابورس



منبع	بازده	بازده	بازده	معادل	آخرین قیمت	عنوان	ردیف		
	سالانه	ماهانه	هفتگی						
محصولات کشاورزی									
TeleTrader	-۲۱.۹۶٪	۰.۶۸٪	۱.۸۱٪	دلار / تن	۱۹۰	دلار / بوشل	۴۷۸.۷۵	ذرت (خارجی)	۱
	-۱.۶۰٪	۰.۷۶٪	۰.۹۱٪	دلار / تن	۱۸۶۰	دلار / پوند	۸۰.۰۵	کتان (پنبه)	۲
	-۵.۰۵٪	-۲.۳۹٪	-۰.۰۸٪	دلار / تن	۴۷۷	دلار / بوشل	۱,۳۱۵.۵۰	سویا	۳
	۱۳.۸۶٪	-۲۴.۶۷٪	-۲.۰۱٪	دلار / تن	۶۰۳	دلار / پوند	۲۰.۴۶	شکر	۴
	-۲۲.۳۶٪	۱۲.۳۱٪	۲.۹۹٪	دلار / تن	۲۱۱	دلار / بوشل	۶۲۹.۵۰	گندم	۵
	-۲.۰۰٪	۰.۰۶٪	-۲.۵۸٪	دلار / تن	۱۴۷	دلار / بوشل	۳۶۸.۹۶	جو	۶
TradingEconomics	-۲۴.۵۴٪	-۸.۳۹٪	-۰.۰۲٪	دلار / تن	۴۹۵	دلار کانادا / تن	۶۴۸.۲۰	کانولا	۷
کالاهای صنعتی									
tgju.org	۲.۹۸٪	۲.۰۶٪	۰.۶۳٪			دلار / تن	۸,۶۳۰.۰۰	مس	۸
TradingEconomics	-۱.۵۳٪	۳.۵۵٪	۰.۱۱٪	دلار / تن	۵۷۳	یوان / تن	۳,۶۷۸.۰۰	قیر	۹
	-۱.۱۲٪	۰.۹۷٪	۲.۵۱٪	دلار / تن	۵۴۸	یوان / تن	۳,۹۵۶.۰۰	فولاد (جهانی)	۱۰
	-۱.۳۰٪	۶.۰۰٪	۴.۸۶٪			دلار / تن	۲,۳۵۰.۰۰	آلومینیوم	۱۱
	-۱۲.۵۹٪	-۵.۰۷٪	۰.۰۴٪			دلار / تن	۲,۰۳۰.۰۰	سرب	۱۲
	-۱۲.۴۴٪	۳.۷۰٪	۲.۲۷٪			دلار / تن	۲,۶۳۱.۵۰	روی	۱۳
	۲۵.۰۰٪	۵.۱۷٪	۵.۵۶٪			دلار / تن	۱۴۲.۵۰	سنگ آهن	۱۴
شاخص‌های کالایی									
TradingEconomics	۳۸.۲۲٪	۱۲.۸۸٪	-۲.۶۰٪			واحد	۲,۰۹۴.۰۰	بالتیک خشک	۱۵
	۱.۹۷٪	-۱.۴۴٪	۰.۹۳٪			واحد	۳۰۶.۷۶	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۱۶
	-۵.۷۶٪	۳.۱۹٪	۰.۳۶٪			واحد	۳,۷۳۶.۹۰	شاخص بورس فلزات در لندن (LME)	۱۷
	-۱.۶۱٪	۰.۵۸٪	۱.۰۰٪			واحد	۳,۴۴۱.۹۷	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اندپي	۱۸

بوشل (Bushel)

واحد اندازه گیری وزن مواد خشک می باشد. یک بوشل معادل ۰/۰۲۷ تن است.

CRB

شاخص CRB که مخفف عبارت Commodity Research Bureau Index است نشانگر تغییرات بازارهای کالاهای جهانی است.

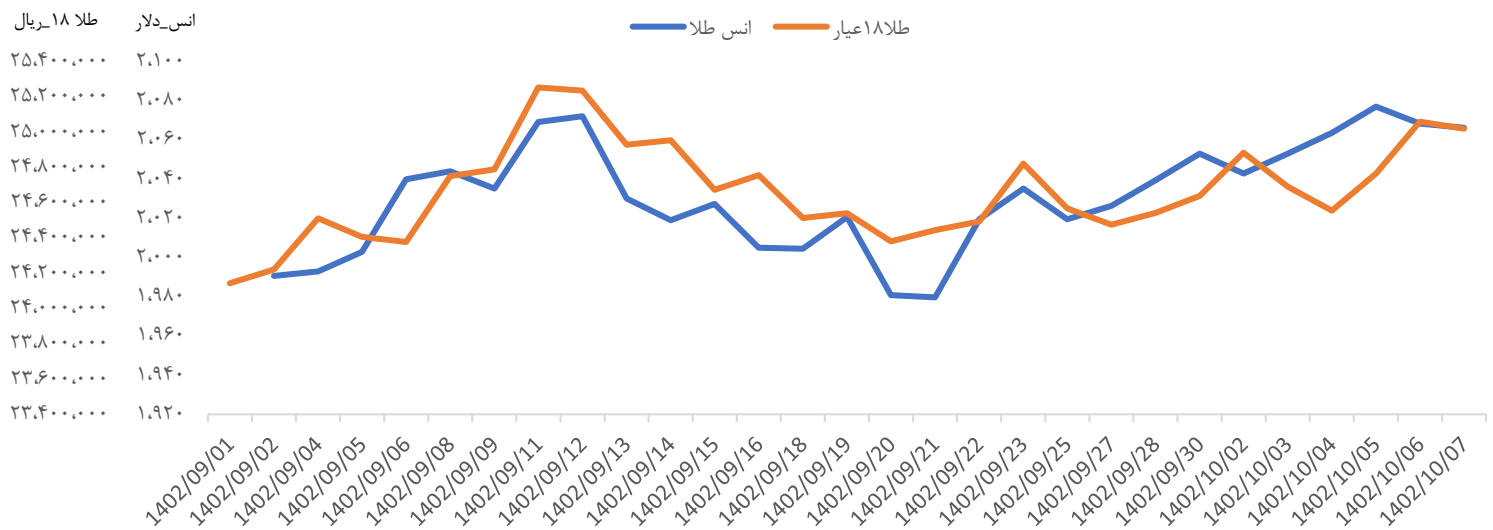
LME

بورس فلزات لندن (LME) یکی از قدیمی ترین بورس های کالایی در دنیاست که فلزات غیر آهنی، فلزات مینور (کبالت و مولیبیدن)، بیلت (شمش) فولاد در آن معامله می شوند. لازم به ذکر است که در این بورس علاوه بر کالاهای مذکور شاخص قیمت بورس فلزات لندن (LMEX) نیز که شاخصی از قیمت ۶ فلز اصلی آلومینیوم، مس، سرب، نیکل، قلع و روی است، قابل معامله است.



اقتصاد

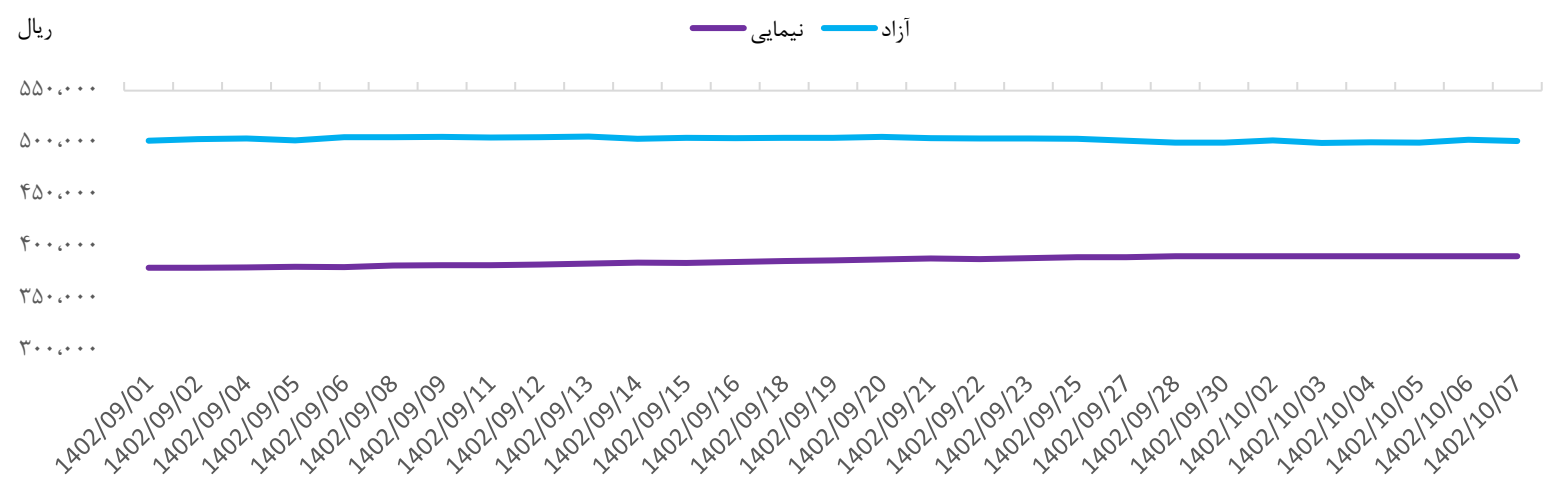
انس و طلای ۱۸ عیار



آخرین وضعیت طلا و دلار

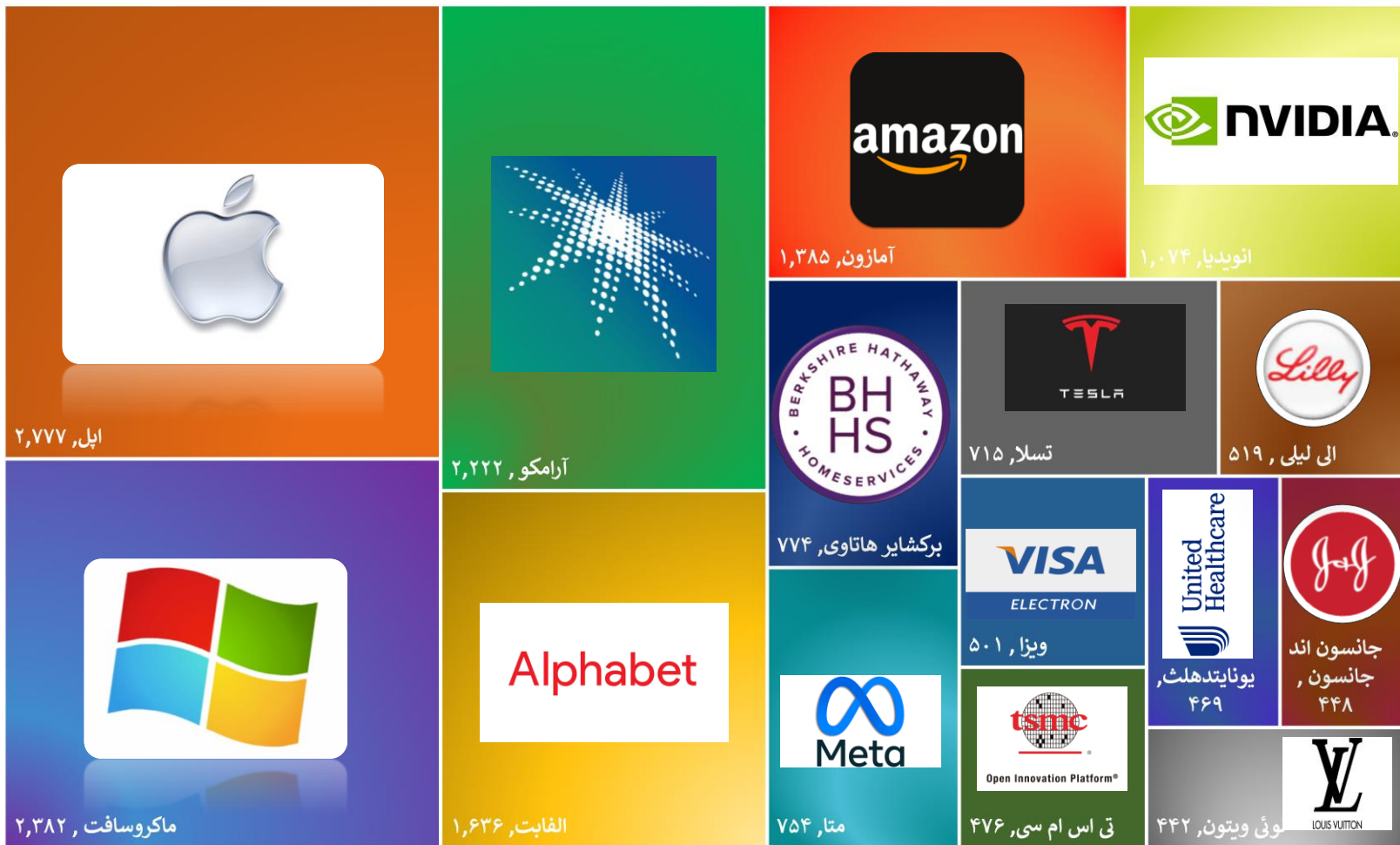
- در هفته گذشته روند قیمت انس طلا نوسانی بوده و در مجموع نسبت به هفته گذشته ۰/۶۴ درصد رشد داشته است.
- هر گرم طلای ۱۸ عیار در آخرین روز هفته به نرخ ۲،۵۰۱،۹۰۰ تومان معامله شد و رشد چندانی نیز نسبت به هفته قبل نداشته است.

دلار آزاد و نیمایی



- روند قیمت بازار دلار آزاد و نیمایی نسبت به هفته گذشته تغییر محسوسی نداشته اند.

ده شرکت ارزشمند جهان



ارزشمندترین شرکت های جهان

ارزش بازار هر شرکت یکی از معیارهای ارزشگذاری می باشد که توسط مکانیزم عرضه و تقاضا تعیین می شود. در این گزارش، نموداری ارائه می شود که ۱۵ شرکت برتر جهان را بر اساس ارزش بازار، با استفاده از داده های ۱۶ آگوست ۲۰۲۳ نشان می دهد.

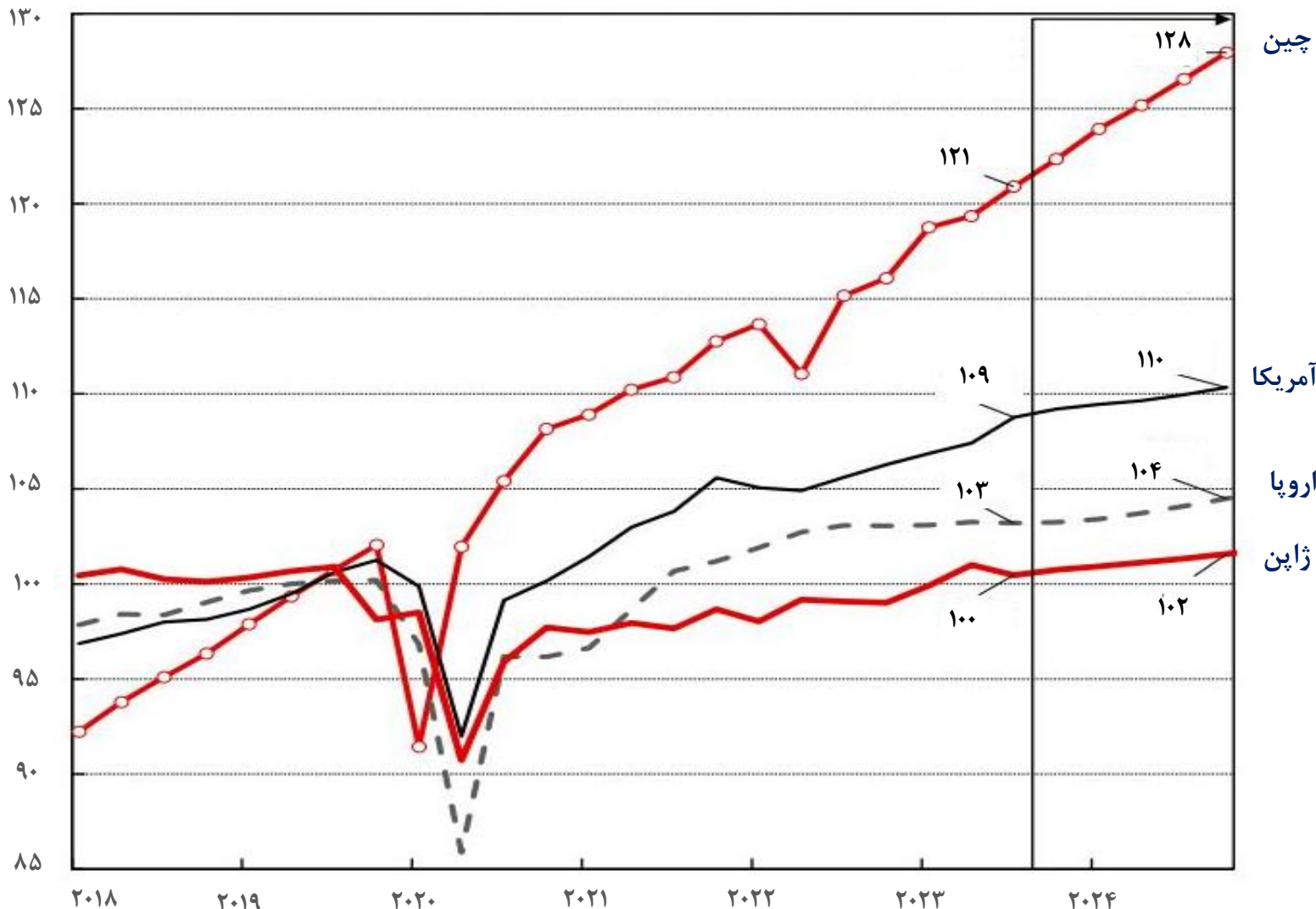
از این داده ها می توان دریافت که تنها تعداد انگشت شماری از شرکت های تریلیون دلاری در جهان وجود دارد، از جمله اپل، مایکروسافت، آرامکو، آمازون، آلفابت و انویدیا.

دو شرکت متا و تسلا قبلا در گروه تریلیون دلاری ها بودند؛ اما در سال ۲۰۲۲، متا به علت کاهش درآمد و تسلا به جهت کمبود تقاضا، با افت شدید ارزش شرکت مواجه شدند. به همین دلیل این دو شرکت در حال حاضر از نظر ارزش بازار در حدود ۷۰۰ میلیارد دلار هستند.

در مجموع، این ۱۵ شرکت، ارزش بازاری بیش از ۱۶.۵ تریلیون دلار دارند؛ که از این میزان حدود ۸۱ درصد آن (معادل ۱۳.۴ تریلیون دلار) متعلق به شرکت های آمریکایی است.

پیش بینی رشد اقتصادی

سال پایه : ۲۰۱۹



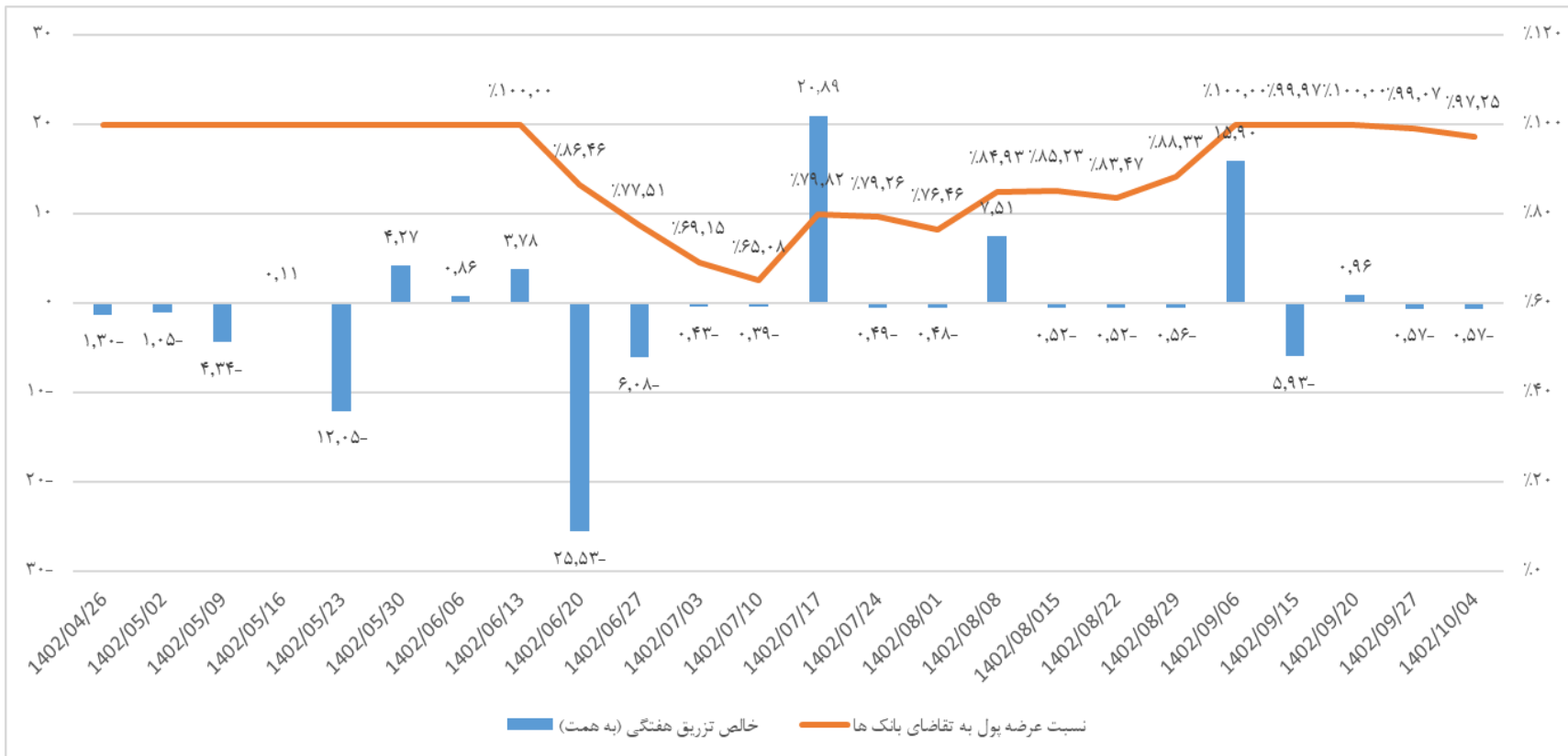
اکنون که در مرحله نهایی اجرای سیاست انقباضی پول (از سال ۲۰۲۰) می باشیم؛ باید خاطر نشان کرد که این سیاست تاثیر زیادی بر اقتصاد و بازار های جهانی داشته است.

پس از کاهش تورم در نتیجه سیاست انقباضی پول، پیش بینی می شود اقتصاد جهانی مجدداً با نرخ متوسط رشد خواهد کرد.

مطالعات انجام شده توسط یکی از بانک های مطرح ژاپن به نتایج زیر رسیده است:

- اقتصاد جهانی در سال ۲۰۲۴ ، ۲/۴ درصد رشد خواهد کرد.
- رشد اقتصادی در اقتصاد های بزرگی همچون آمریکا، اروپا، ژاپن و چین به ترتیب ۱/۶ ، ۰/۷ ، ۰/۷ و ۴/۶ درصد پیش بینی می شود.

سیاست های پولی بانک مرکزی



با توجه به پیش‌بینی بانک مرکزی از وضعیت نقدینگی در بازار بین‌بانکی، موضع عملیاتی بانک مرکزی در این هفته توافق با خرید بود. از این رو، این بانک به اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق با خرید به مبلغ ۱۲۷.۸ همت اقدام کرد.

مطابق عملیات اجرایی سیاست پولی هفته اول دی، بانک مرکزی به ۹۷.۲۵٪ تقاضای پول بانک پاسخ مثبت داد که از لحاظ نسبی ۱.۸۲٪ کمتر از هفته قبل بوده است و خالص تزریق هفتگی پول پس از کسر تعهدات سر رسید شده برابر با منفی ۰.۵۷ همت بوده است.

نکته قابل توجه این است که میانگین ماهانه تقاضای پول بانک ها و موسسات اعتباری در شهریور ۱۱۵.۵ همت و مهر ماه و ۱۳۶.۵ همت و ابان ماه ۱۴۰.۳ همت بوده است و در اذر ماه ۱۳۱.۴ همت بوده است که نشان دهنده تغییر روند میباشد، همچنین در دو هفته اخیر بانک مرکزی مبلغ ۱۲۷.۸ همت سفارشات را پذیرفت که کمتر از هفته گذشته بوده و مانند رفتاری که در اوایل مهر نشان داد عمل می‌کند که در صورت ادامه پیدا کردن این روند می‌توان شاهد افزایش دوباره قبولی درخواست ها تا آخر سال بود.



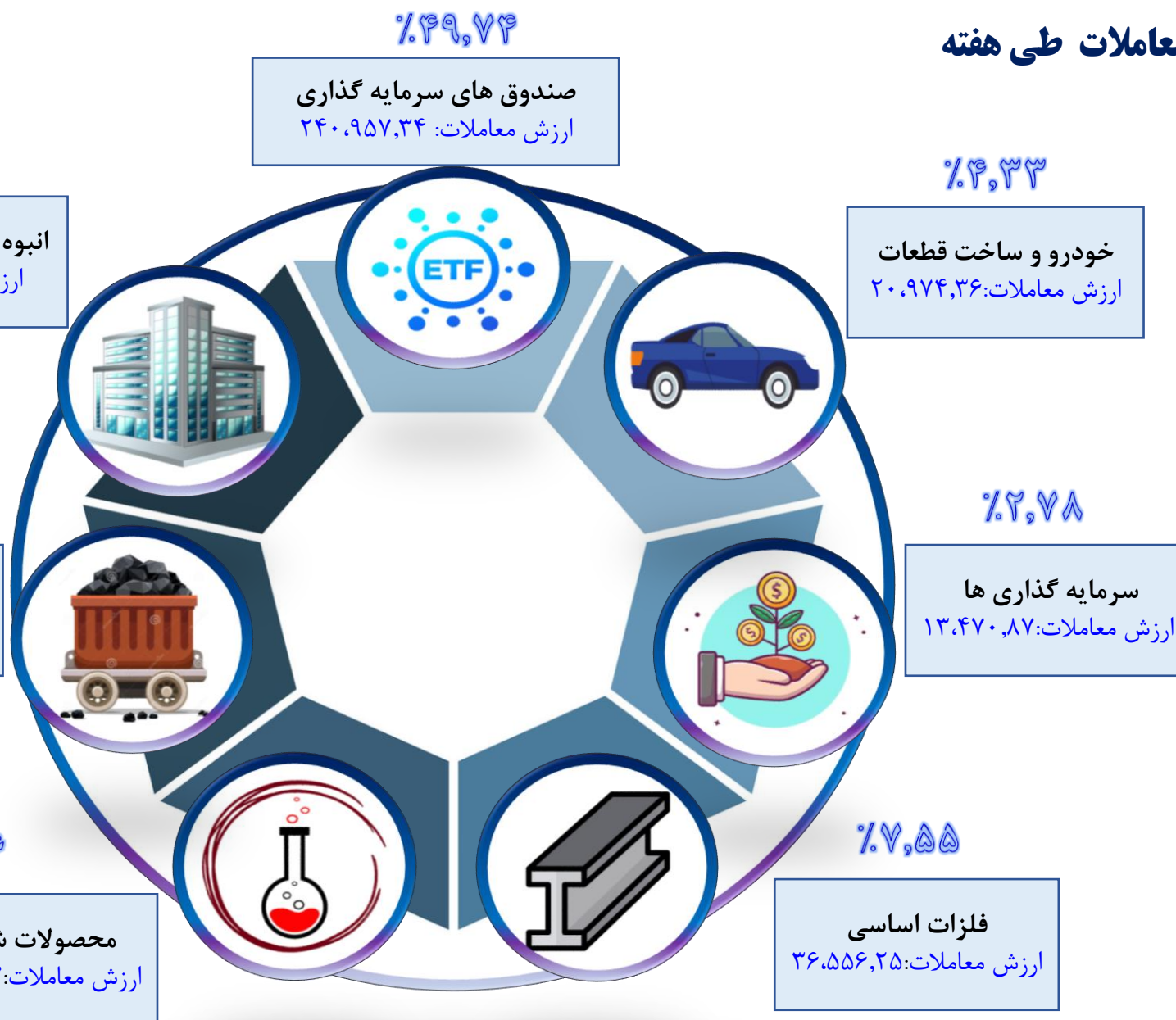
بازار سرمایه

اخبار تاثیر گذار هفته گذشته

- ❖ طبق اعلام شورای رقابت ، قیمت گذاری خودرو تغییری نخواهد کرد و خودروساز مجاز به تعیین قیمت خودرو نمی باشد.
- ❖ دریافت مالیات ۲۵ درصدی از فروش طلا تکذیب شد .
- ❖ نحوه محاسبه قیمت سیمان در بورس کالا تغییر کرد.
- ❖ طبق اعلام رییس اداره امور صندوق های سرمایه گذاری سازمان بورس و اوراق بهادار، از ابتدای سال ۱۴۰۲ تا انتهای آذر ماه، مجوز فعالیت ۵۱ صندوق سرمایه گذاری در اختیار ۴۲ نهاد مالی مختلف قرار گرفته است.
- ❖ در روز چهارشنبه عرضه اولیه گروه مالی داتام انجام گرفت.
- ❖ سازمان تنظیم مقررات رسماً از افزایش حدود ۳۰ درصدی تعرفه اینترنت اپراتورهای ارتباطی خبر داد.
- ❖ مجمع عمومی به طور فوق العاده بانک ملت با حضور ۶۵ درصد سهامداران برگزار شد. در این مجمع با افزایش سرمایه ۱۰۱ درصدی موافقت شد.
- ❖ به گفته وزیر اقتصاد امسال معادل بخشودگی مالیاتی شرکت های دانش بنیان به رقم ۲۵۰۰ میلیارد تومان خواهد رسید.



هفت گروه با بیشترین ارزش معاملات طی هفته

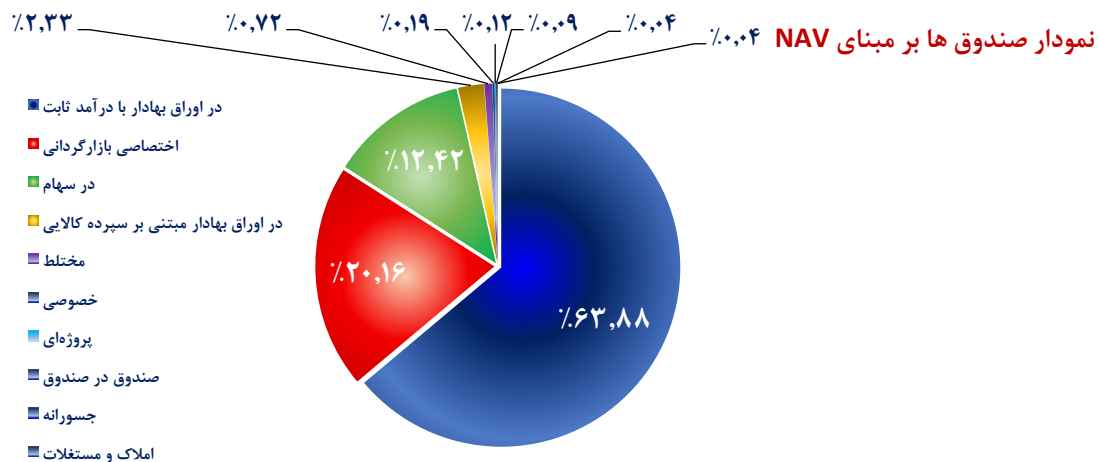


طبق نمایه رو به رو هفت گروه بورسی با بیشترین ارزش معاملات به شرح مقابل می باشند. صندوق های سرمایه گذاری با بالا ترین ارزش معاملات معادل ۲۴۰,۹۵۷,۳۴ میلیارد ریال، ۴۹/۷۴ درصد از کل ارزش معاملات طی هفته را به خود اختصاص دادند. پس از آن به ترتیب: فلزات اساسی، انبوه سازی، املاک و مستغلات، خودرو و ساخت قطعات، محصولات شیمیایی، سرمایه گذاری ها، محصولات کانی غیر فلزی بیشترین ارزش معاملات را در روز فوق الذکر داشته اند.

منبع: مدیریت فناوری بورس کالا

بررسی وضعیت صندوق‌ها

نوع صندوق	مجموع ارزش خالص دارایی‌ها	تعداد صندوق‌ها	میانگین وجه نقد	میانگین اوراق سهامی	میانگین اوراق سپرده بانکی	میانگین اوراق مشارکت	میانگین بازده روزانه	میانگین بازده هفتگی	میانگین بازده یک ماهه	میانگین بازده سه ماهه	میانگین بازده شش ماهه	میانگین بازده یک ساله	میانگین بازده از ابتدای فعالیت
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۵,۶۷۰,۷۴۱	۱۳۹	۰.۷۶٪	۶.۷۷٪	۴۲.۵۱٪	۴۷.۶۰٪	۰.۰۵٪	۰.۴۳٪	۱.۹۴٪	۵.۶۷٪	۱۰.۷۴٪	۲۰.۷۹٪	۱۶۱.۶۶٪
اختصاصی بازارگردانی	۱,۷۸۹,۹۴۹	۱۰۰	۱.۶۵٪	۷۲.۸۷٪	۴.۴۹٪	۱.۷۶٪	-۰.۶۹٪	-۰.۹۵٪	۴.۶۷٪	۲.۶۷٪	-۱.۸۱٪	۵۷.۱۶٪	۲۱۲.۱۳٪
در سهام	۱,۱۰۲,۸۴۰	۱۲۳	۰.۱۰٪	۹۱.۳۵٪	۵.۵۴٪	۱.۳۳٪	-۱.۴۲٪	-۲.۰۳٪	۶.۴۷٪	۳.۰۸٪	۰.۸۶٪	۳۷.۴۳٪	۴۹۶۴.۴۷٪
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۲۰۷,۱۳۲	۱۵	۰.۱۷٪	۱۹.۶۹٪	۳.۶۰٪	۱٪	۰.۴۵٪	۰.۹۰٪	۱.۱۴٪	۸.۵۷٪	۶.۳۵٪	۳۷.۸۸٪	۱۲۳۳.۵۰٪
مختلط	۶۳,۸۲۹	۲۶	۰.۰۸٪	۵۷.۵۴٪	۲۲.۰۶٪	۱۸.۵۵٪	-۰.۳۱٪	-۰.۶۰٪	۴.۰۴٪	۲.۶۲٪	۳.۹۳٪	۳۶.۴۸٪	۱۶۲۳.۷۵٪
خصوصی	۱۶,۷۷۹	۵	۰.۰۰٪	۷.۷۷٪	۱۴.۳۳٪	۶.۲۵٪	۰.۰۴٪	۰.۲۵٪	۲.۸۳٪	۵.۲۲٪	۱۲.۵۹٪	۷.۱۳٪	۱۳.۸۱٪
پروژه‌ای	۱۰,۸۹۸	۱	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۵٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۳.۰۵٪	۹.۸۵٪
صندوق در صندوق	۸,۰۴۵	۴	۰.۰۲٪	۰.۰۰٪	۰.۹۱٪	۰.۰۰٪	-۰.۵۶٪	-۰.۷۳٪	۵.۰۵٪	۴.۰۵٪	۳.۸۴٪	۳۹.۲۱٪	۷۸.۲۴٪
جسورانه	۳,۶۶۵	۱۶	۰.۰۲٪	۰.۰۰٪	۳۵.۱۹٪	۱۰.۹۳٪	۰.۰۱٪	۰.۱۲٪	۱.۰۵٪	-۳.۱۱٪	۳.۸۸٪	۲۸.۹۱٪	۱۳۴.۱۲٪
املاک و مستغلات	۳,۳۵۲	۲	۰.۵۷٪	۲۴.۷۵٪	۳۱.۰۷٪	۰٪	-۰.۰۵٪	-۰.۱۶٪	۰.۶۵٪	۳.۲۵٪	۰.۸۸٪	۱.۶۶٪	۴.۷۴٪
زمین و ساختمان		۴											
مجموع ارزش خالص دارایی‌ها:	۸,۸۷۷,۲۳۱	۴۳۵											



صندوق های سرمایه گذاری در مجموع برابر ۴۳۵ عدد می باشند.

در هفته منتهی به هشتم دی ۱۴۰۲ بازدهی هفتگی صندوق های درآمد ثابت ، سپرده کالایی ، خصوصی و جسورانه مثبت بودند ؛

بازده صندوق های املاک و مستغلات ، صندوق در صندوق ، در سهام ، بازارگردانی و مختلط منفی و

هم چنین بازدهی صندوق های پروژه ای صفر بودند.

درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق های سپرده کالایی با ۰/۹ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق های در سهام با ۲/۰۳- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق های با درآمد ثابت با ۶۳/۸۸ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۲۰/۱۶ درصد و سهامی با ۱۲/۴۲ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق ها بودند.

بررسی وضعیت بازار بدهی منتهی به تاریخ ۶ دی

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

خزانه‌داری کل کشور پرداخت مبلغ اسمی اسناد خزانه اسلامی را در تاریخ سررسید تعهد می‌کند. این تعهدنامه به امضای وزیر امور اقتصادی و دارایی نیز رسیده است. طی هفته اخیر، بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سررسید نشده متعلق به نماد اخزا ۲۰۲ با سررسید ۱۴۰۵/۰۹/۲۳ و بازدهی‌های ۲۷/۳۱ و ۳۵/۲۹ درصد بود. همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا ۱۰۹ با سررسید ۱۴۰۴/۰۸/۲۶ و بازدهی‌های ۲۷ و ۳۰/۲۲ درصد بود.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخرزا ۲۰۲	۴۸۸,۴۹۰	۱۴۰۲-۱۰-۰۶	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۷.۳۱٪	۳۵.۲۹٪
اخرزا ۱۰۹	۶۳۶,۰۶۰	۱۴۰۲-۱۰-۰۶	۱۴۰۴-۰۸-۲۶	۲۷.۰۰٪	۳۰.۲۲٪

اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر بیشترین بازدهی متعلق به اراد۱۳۹ به میزان ۲۷/۱۵ درصد با سررسید ۱۴۰۴/۰۸/۰۴ و کمترین بازدهی متعلق به نماد نوآفرین ۰۶ به میزان ۱۷/۵۹ درصد با سررسید ۱۴۰۶/۱۲/۱۰ بوده است. صکوک مباحه دولتی اراد ۱۳۹ به منظور تأمین نقدینگی مورد نیاز برای خرید کالاها و خدمات مورد نیاز دستگاه‌های اجرایی موضوع اعتبارات هزینه‌ای و عمرانی، قانون بودجه سال ۱۴۰۰ کل کشور توسط وزارت امور اقتصادی و دارایی منتشر شده است.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	ضامن	متعهد پذیره نویس
اراد۱۳۹	۹۳۱,۱۲۰	۱۴۰۲-۱۰-۰۶	۱۴۰۴-۰۸-۰۴	۲۷.۱۵٪	سازمان برنامه و بودجه کل کشور	فاقد متعهدپذیره نویس
نوآفرین ۰۶	۱,۰۳۳,۲۸۰	۱۴۰۲-۱۰-۰۶	۱۴۰۶-۱۲-۱۰	۱۷.۵۹٪	بانک کارآفرین	شرکت تأمین سرمایه خلیج فارس



بورس کالا

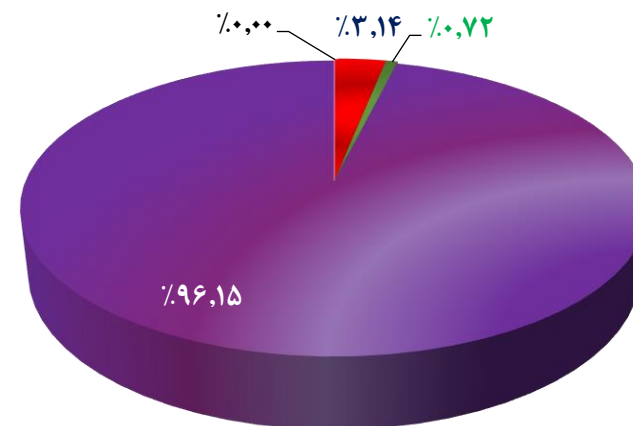
بورس کالا

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروه‌های کالایی در بازار فیزیکی

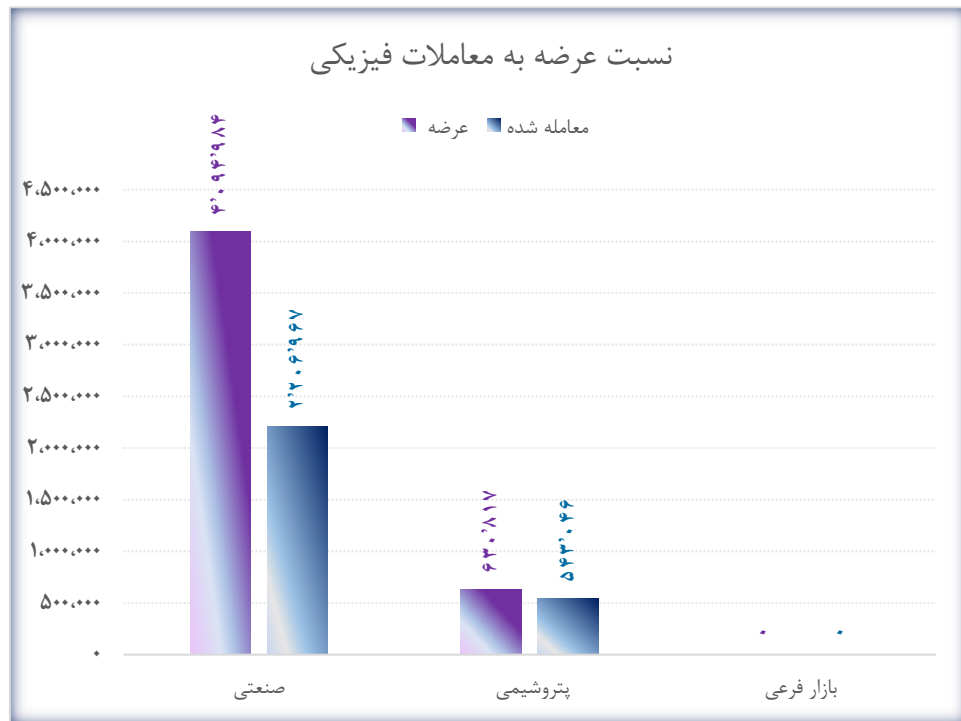
مهم ترین گروه ها	ارزش معاملات (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل (ارزش)	درصد از کل (حجم)
صنعتی	۱۶۲,۲۲۴,۷۵۲	۲,۲۰۶,۹۶۷	۶۱.۴۵%	۸۰.۱۱%
پتروشیمی و...نفتی	۱۰۰,۳۴۵,۶۵۶	۵۴۳,۰۴۶	۳۸.۰۱%	۱۹.۷۱%
بازار فرعی	۱,۴۰۸,۶۵۴	۴,۷۴۲	۰.۵۳%	۰.۱۷%
جمع	۲۶۳,۹۷۹,۰۶۲	۲,۷۵۴,۷۵۵	۱۰۰%	۱۰۰%

در این هفته ۶۱/۴۵ درصد از ارزش معاملات در بازار فیزیکی مربوط به گروه کالاهای صنعتی بوده است که نسبت به هفته پیش ۳۰/۴۷ درصد کاهش یافته است. همچنین ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۱۶/۵ درصد و حجم معاملات ۲/۷۳ درصد کاهش پیدا کرده است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات هفتگی منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۰۸



- بازار اختیار معاملات
- بازار مالی (سلف، صندوق و گواهی)
- بازار آتی
- بازار فیزیکی



بیشترین نسبت عرضه به معاملات فیزیکی مربوط به گروه صنعتی معادل ۱/۸۶ می باشد. پس از آن این نسبت در گروه پتروشیمی معادل ۱/۱۶ می باشد.



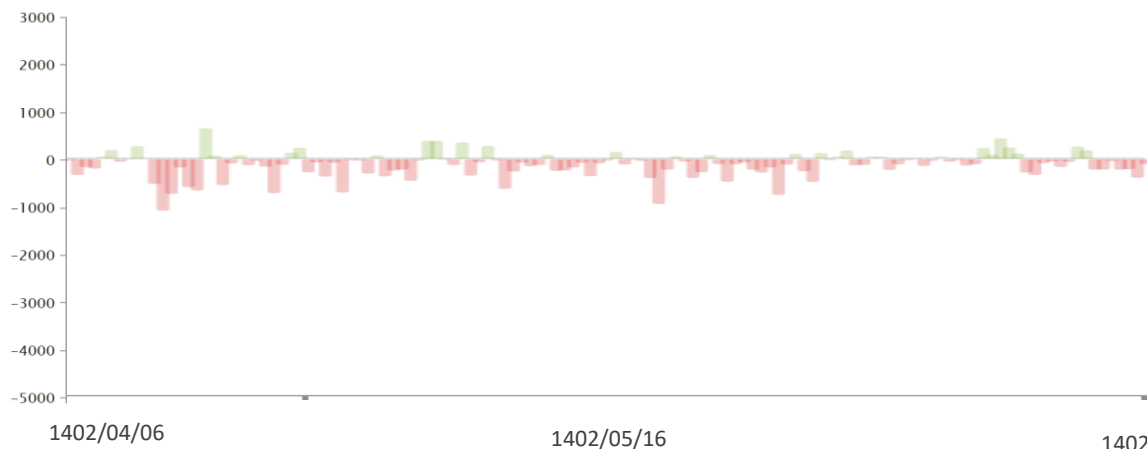
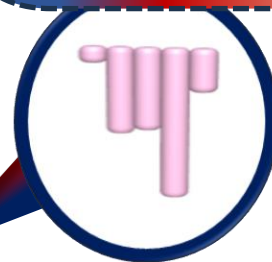
وضعیت بازار

ورود و خروج پول حقیقی

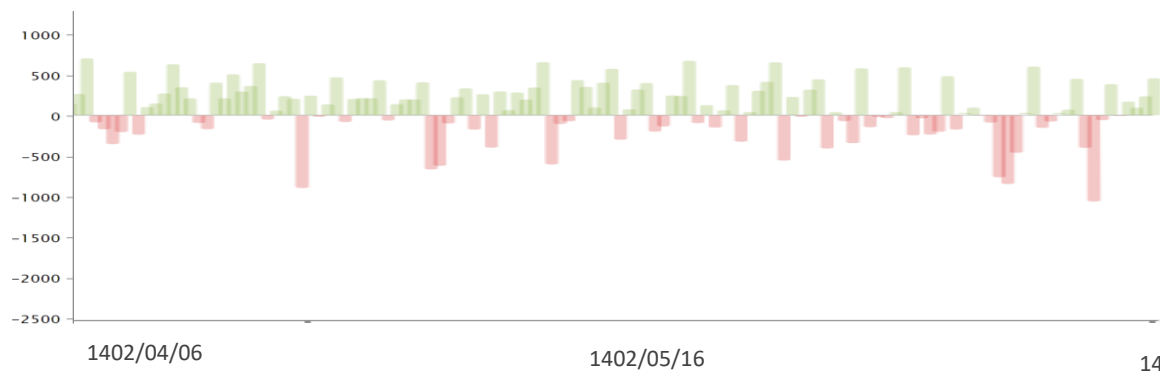
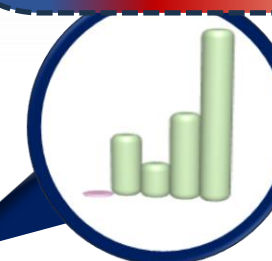
با توجه به نمودار بازار طی شش ماه گذشته ، غالباً شاهد خروج پول حقیقی از بازار بوده ایم. بیشترین خالص ورود و خروج پول حقیقی از بازار طی هفته اخیر برای روز ۵ دی ماه به میزان **-۶۳۵,۳۶** میلیارد تومان بوده است. جمع خالص ورود و خروج پول حقیقی هفتگی به بازار معادل **-۱,۵۹۰,۷۵** میلیارد تومان بوده است.

ملاحظه می گردد بین ورود و خروج پول حقیقی به بازار و ورود و خروج پول حقیقی به صندوق های با درآمد ثابت غالباً ضریب همبستگی منفی وجود دارد. به عبارتی زمانی که پول حقیقی از بازار بورس خارج می گردد ، معمولاً در همان زمان به صندوق های با درآمد ثابت وارد می شود.

ورود و خروج پول حقیقی به بازار طی هفته اخیر



ورود و خروج پول حقیقی به صندوق های درآمد ثابت طی هفته اخیر



ارزش بازار بورس (ریالی و دلاری)



ارزش بازار بورس (ریالی و دلاری)

ارزش دلاری بورس در تاریخ ششم دی ماه ۱۴۰۲، ۱۸۰/۶۲ میلیارد دلار می باشد، که نسبت به هفته پیش ۵/۹ درصد کاهش داشته است. از ابتدای سال جاری شاهد کاهش ۶/۹ درصدی ارزش دلاری و کاهش ۲/۵ درصدی ارزش ریالی بازار بوده ایم.



بیانیه سلب مسئولیت:

شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)، هیچگونه مسئولیتی در برابر صحت اطلاعات موجود در گزارش های تحلیلی تهیه شده توسط کارشناسان این شرکت، که با نام و نشان اهتمام ایرانیان منتشر می شود، بر عهده نمی گیرد و نظرات ارائه شده در این گزارش ها به هیچ وجه به عنوان توصیه ای جهت خرید، فروش یا نگهداری سهام شرکت ها و سایر ابزارهای معاملاتی نیست و مسئولیت استفاده از این اطلاعات برعهده خوانندگان محترم است.

شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

۰۲۱-۸۸۵۴۷۳۵۰

تهران، خیابان احمد قصیر، کوچه دهم
غربی، پلاک ۱۴، طبقه چهارم

شناسنامه:

محتوای سری گزارش های «تحلیل بازارها»، حاصل تلاش گروهی تیم تحلیل گران شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام) است.

اسامی تحلیل گران، به ترتیب حروف الفبا عبارت است از:

زهرا اصلانی، محمدرضا عالی، محسن کیا، علیرضا میدانی، فاطمه نیکوئی

نظارت و راهبری: زهرا اصلانی

استفاده از محتوای این گزارش، با ذکر منبع، مجاز است.



www.eii.co.ir



Ehtemam Iranian



ehtemam_iranian