



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

بازار سرمایه؛ رکود و سکوت

گزارش تحلیل بازارها-شماره ۶-هفته منتهی به تاریخ ۲۴-۰۹-۱۴۰۲

گروه تحلیل گران شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.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
- ❖ چین؛ طلایه دار بازار ربات صنعتی
- ❖ انتظار برای رشد تولید ناخالص داخلی
- ❖ 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/خروج پول حقیقی کل بازار
- ❖ ارزیابی دلاری و ریالی شاخص کل
- ❖ تحلیل تکنیکال شاخص



حقایقی پیرامون چشم انداز جهانی

اخبار پیرامون جهان

مذاکرات اقلیمی COP28¹ در دبی با توافقی به پایان رسید که برای اولین بار متعهد به دور شدن از تمام سوخت های فسیلی بود. آرژانتین کاهش ارزش ماهانه ۲٪ پزو را هدف قرار داد سقوط سنگ آهن پس از ناامید شدن سیاست چین در مورد محرک های قیمتی گروه آدانی (با نماد ADE:IN) در طول دهه آینده ۱۰۰ میلیارد دلار در استفاده از انرژی سبز در عملیات بنادر، برق و سیمان خود سرمایه گذاری خواهد کرد و قصد دارد تا سال ۲۰۵۰ انتشار گازهای گل خانه ای را به صفر برساند.

ورود ناگهانی نفت ونزوئلا به بازارهای آسیایی باعث کنترل قیمت شد. بانک مرکزی چین قصد دارد با اعطای وام ، یک سیاست انبساطی پولی را اجرا کند تا رکودی که بابت فروش اوراق قرضه دولتی به بازار سرمایه تحمیل کرده است را جبران کند. مجارستان در صدد اجرای یک سیاست جدید است به نحوی که به سرمایه گذاران املاک خارجی اجازه می دهد مجوز اقامت در کشور اتحادیه اروپا را بگیرند. با کاهش کنترل قیمت توسط رئیس جمهور آرژانتین ، پیش بینی می شود که تولید گندم در کشور رشد شصت درصدی داشته باشد. چین سرمایه گذاری میلیارد دلاری برای گرفتن بازار نیمه رسانا ها از امریکا انجام داده است. دو شرکت خاورمیانه ای در عرضه اولیه خود پیشنهاد های بالغ بر ۸۷ میلیارد دلار دریافت کردند. با تمام شدن طوفان در دریا سیاه و آرام شدن بنادر روسیه، فروش نفت روسیه افزایش یافت. در حالی که سرمایه گذاران منتظر آخرین تصمیم فدرال رزرو در سال جاری بودند، معاملات آتی بورس ایالات متحده افزایش یافت.

مدیر عامل انوبدیا بیان کرد سازندگان تراشه ها به ویتنام به عنوان دومین قطب تولید تراشه ها نگاه می کنند. تولید نفت ایالات متحده در سال ۲۰۲۴ به رونق خود ادامه خواهد داد و یک تعارض احتمالی با عربستان سعودی در این باره خواهد داشت. یک کارشناس انرژی ونزوئلایی مدعی است گویان سریع ترین رشد توسعه نفت میادین آبی را در تاریخ جهان خواهد داشت. اوکراین احتمالاً تا پایان سال از اتحادیه اروپا ۱,۶ میلیارد دلار بودجه دریافت خواهد کرد. مجمع عمومی سازمان ملل متحد با اکثریت آرا به درخواست آتش بس در غزه رای داد. کره جنوبی ۲۹ میلیارد دلار به سازندگان باتری تسهیلات می دهد. بایدن با خانواده های گروگان های آمریکایی که توسط حماس نگه داری می شوند ملاقات خواهد کرد. درگیری دیپلماتیک بر سر ادعای ارسال سلاح از امارات به سودان شکل گرفته است. اتحادیه اروپا گام های اولیه را برای بهره برداری و اعطای دارایی های تحریم شده روسیه به نفع اوکراین بر می دارد. قانون گذاران مجارستان از طرح اعطای ویزای طلایی برای سرمایه گذاری املاک حمایت کردند.

شی جین پینگ با فشار آمریکا، اقدام به تقویت روابط چین با ویتنام کرد. برخی از صندوق های ارزهای دیجیتال که توسط بزرگترین مدیر رمزارز جهان مدیریت می شوند، در شرایطی بی سابقه، هشت برابر خالص ارزش دارایی های خود معامله شدند. مکرون هشدار داد که قانون جدید اتحادیه اروپا در رابطه با هوش مصنوعی ، نوآوری در این زمینه را دچار اختلال خواهد کرد. هند در صدد است تا به جایگاه هنگ کنگ در بین بزرگترین بازارهای جهان برسد. دونالد تاسک به عنوان نخست وزیر لهستان انتخاب شد .

-
-
-
-
-
-
-
-
-
-

Bloomberg

بلومبرگ

طبق گزارش مرکز آمار امریکا (BLS²) نرخ تورم سالانه امریکا در ماه نوامبر برابر ۳.۱ درصد اعلام شد که پایین ترین مقدار در ۵ ماهه اخیر است . تورم نوامبر نسبت به پیش اکتبر (۳.۲ درصد) کمتر و مطابق با پیش بینی ها و انتظارات بوده است.

-
-
-
-
-
-
-
-
-
-

BUSINESS INSIDER

بیزینس اینسایدر

همچنین در ژاپن در پی رسوایی بزرگ فساد مالی در حزب حاکم (مرسوم به ابه) چندین وزیر مجبور به استعفا شدند. نکته قابل توجه این است که مبلغ گم شده برابر با پانصد میلیون ین معادل ۳.۵ میلیون دلار بوده و به سبب همین موضوع، حمایت عمومی مردم از نخست وزیر به حدود ۲۳٪ رسید این درصد کمترین میزان محبوبیت وی از زمان تصدی وی به نخست وزیری است. شایان ذکر است که این فساد مالی در مقایسه با فساد مالی چای دیش کمتر از یک درصد است درحالی که تولید ناخالص ژاپن حدود ده برابر ایران است.

-
-
-
-
-
-



فایننشال تایمز

²BLS: Bureau of Labor Statistics

¹Conference of the Parties United Nations Climate Change Conference

منبع	بازده	بازده	بازده	آخرین قیمت	عنوان	ردیف	
	سالانه	ماهانه	هفتگی				
بورس های جهانی							
TeleTrader	۷.۳۱٪	۶.۶۵٪	۱.۵۲٪	واحد	۳۶,۶۰۹.۰۲	Dow Jones	۱
	۳۸.۱۹٪	۵.۶۳٪	۳.۵۹٪	واحد	۱۶,۳۵۴.۲۵	Nasdaq	۲
	۱۵.۶۱٪	۵.۳۷٪	۲.۱۶٪	واحد	۴,۶۴۷.۰۵	S & P ۵۰۰	۳
	۱.۱۱٪	۱.۹۳٪	۰.۹۹٪	واحد	۷,۵۷۱.۳۵	FTSE ۱۰۰	۴
	۱۶.۱۰٪	۹.۶۹٪	۱.۰۵٪	واحد	۱۶,۸۳۱.۴۹	DAX	۵
	۱۲.۳۳٪	۶.۹۱٪	۱.۸۹٪	واحد	۷,۵۷۶.۴۹	CAC ۴۰	۶
	۱۷.۷۸٪	۱.۰۵٪	-۱.۵۵٪	واحد	۳۲,۹۲۶.۳۵	NIKKEI ۲۲۵	۷
	-۶.۵۳٪	-۲.۵۵٪	-۰.۰۱٪	واحد	۲,۹۶۸.۷۶	SHANGHAI	۸
	-۲.۳۹٪	-۴.۸۷٪	۱.۶۹٪	واحد	۱,۰۶۲.۹۷	Moex	۹
نفت و انرژی							
TeleTrader	-۶.۲۹٪	-۱۱.۲۷٪	-۱.۶۰٪	دلار / بشکه	۷۳.۰۹	نفت خام برنت	۱۰
	-۱۹.۷۱٪	-۱۲.۲۷٪	-۱.۲۱٪	دلار / بشکه	۶۸.۷۲	نفت خام WTI	۱۱
tradingeconomics	-۵۸.۸۲٪	-۳۰.۲۱٪	-۹.۹۲٪	دلار / MMBtu	۲.۳۱	گاز طبیعی (هنری هاب)	۱۲
OilPrice	-۲.۴۹٪	-۷.۲۵٪	-۰.۴۲٪	دلار / بشکه	۷۷.۹۸	سبب اوپک	۱۳
	-۶.۶۸٪	-۱۲.۴۵٪	-۲.۲۴٪	دلار / بشکه	۷۳.۱۹	نفت سنگین ایران	۱۴
tradingeconomics	-۱۲.۰۷٪	-۹.۹۵٪	-۲.۳۹٪	دلار / گالن	۱.۹۸	گازوئیل	۱۵
	-۲۲.۲۵٪	-۹.۶۰٪	-۳.۱۴٪	دلار / گالن	۱.۷۰	اتانول	۱۶
	۲.۵۹٪	-۲.۵۱٪	-۲.۴۳٪	دلار / تن	۶۱۲.۶۰	نفثا	۱۷
PLATTS	-۶.۳۴٪	۰.۳۵٪	-۰.۶۹٪	دلار / تن	۲۳۹.۹۰	متانول CFR (چین)	۱۸

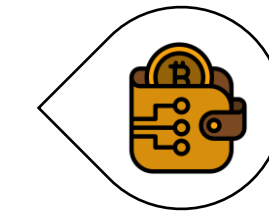
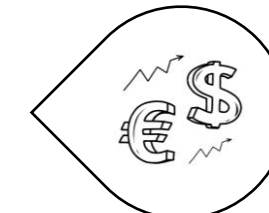
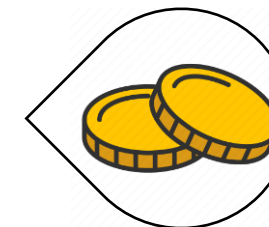
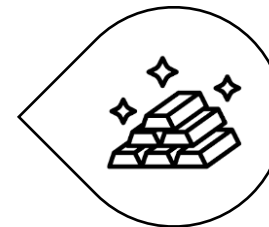
گاز طبیعی هنری هاب

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.

تعریف واحد MMBtu

Metric Million British Thermal Unit

منبع	بازده	بازده	بازده	آخرین قیمت	عنوان	ردیف
	سالانه	ماهانه	هفتگی			
فلزات گرانبها						
TeleTrader	۹.۴۷%	۱.۸۱%	-۲.۲۱%	دلار / اونس	۱,۹۸۱.۹۸	۱ طلا
	-۴.۳۸%	۱.۶۶%	-۵.۲۶%	دلار / اونس	۲۲.۶۸	۲ نقره
طلا و سکه (داخلی)						
tgju.org	۴۴.۱۹%	۱.۴۵%	-۰.۷۸%	ریال	۲۴,۴۸۱,۰۰۰	۳ یک گرم طلای ۱۸ عیار
	۵۶.۰۳%	۰.۵۳%	-۰.۳۹%	ریال	۲۹۰,۹۷۰,۰۰۰	۴ سکه امامی
	۴۰.۴۴%	۰.۳۶%	-۰.۰۳%	ریال	۲۵۶,۹۹۰,۰۰۰	۵ سکه بهار آزادی
	۲۸.۵۷%	۰.۳۳%	-۰.۳۳%	ریال	۱۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۶ نیم سکه
	۱۶.۰۷%	۰.۲۹%	-۰.۱۹%	ریال	۱۰۳,۳۰۰,۰۰۰	۷ ربع سکه
	۶۲.۲۱%	۰.۲۴%	-۰.۳۸%	ریال	۲,۹۲۰,۰۰۰	۸ تمام سکه رفاه (بورس)
ارز						
tgju.org	۳۴.۶۱%	-۱.۵۲%	-۰.۰۸%	ریال	۵۰۳,۹۰۰	۹ دلار آزاد
	۳۳.۲۰%	-۰.۵۴%	-۰.۰۵%	ریال	۵۴۳,۹۸۰	۱۰ یورو آزاد
رمز ارز						
TradingView	۱۳۱.۵۳%	۱۱.۵۳%	-۶.۷۷%	دلار	۴۱,۰۶۷.۹۸	۱۱ بیت کوین
	۶۴.۹۳%	۳.۳۹%	-۴.۱۵%	دلار	۲,۱۶۹.۵۹	۱۲ اتریوم
شاخص های داخلی ۲۲ آذر						
shakhesban	۴۶.۵۳%	۶.۳۶%	-۰.۶۰%	واحد	۲,۱۵۸,۰۰۰.۰۰	۱۳ شاخص کل بورس
	۷۳.۳۹%	۷.۱۵%	۰.۶۴%	واحد	۷۵۲,۱۱۱.۲۶	۱۴ شاخص کل بورس (هم وزن)
	۳۹.۲۳%	۵.۲۴%	۰.۲۳%	واحد	۲۶,۲۵۵.۶۷	۱۵ شاخص کل فرابورس



منبع	بازده			معادل	آخرین قیمت	عنوان	ردیف		
	بازده سالانه	بازده ماهانه	بازده هفتگی						
محصولات کشاورزی									
TeleTrader	-۲۰.۱۸٪	-۲.۲۳٪	-۰.۴۷٪	دلار / تن	۱۹۰	دلار / بوشل	۴۸۱.۵۰	ذرت (خارجی)	۱
	۲.۳۱٪	۲.۱۳٪	۱.۷۶٪	دلار / تن	۱۸۶۰	دلار / پوند	۸۱.۱۴	کتان (پنبه)	۲
	-۴.۱۶٪	-۴.۷۲٪	۱.۱۶٪	دلار / تن	۴۷۷	دلار / بوشل	۱,۳۳۱.۵۰	سویا	۳
	۲۶.۳۹٪	-۱۸.۷۷٪	-۲.۷۲٪	دلار / تن	۶۰۳	دلار / پوند	۲۲.۵۱	شکر	۴
	-۲۱.۹۸٪	۲.۷۰٪	-۲.۱۷٪	دلار / تن	۲۱۱	دلار / بوشل	۶۱۸.۵۰	گندم	۵
	۰.۴۳٪	-۸.۷۰٪	-۷.۶۶٪	دلار / تن	۱۴۷	دلار / بوشل	۳۴۳.۷۵	جو	۶
TradingEconomics	-۲۴.۲۸٪	-۵.۰۴٪	۱.۹۷٪	دلار / تن	۴۹۵	دلار کانادا / تن	۶۶۲.۷۰	کانولا	۷
کالاهای صنعتی									
tgju.org	-۱.۷۴٪	۱.۴۹٪	۰.۷۸٪			دلار / تن	۸,۳۱۳.۰۰	مس	۸
TradingEconomics	۵.۹۲٪	-۶.۱۲٪	-۱.۷۱٪	دلار / تن	۵۷۳	یوان / تن	۳,۶۰۰.۰۰	قیر	۹
	۱.۲۲٪	۲.۸۵٪	۲.۲۹٪	دلار / تن	۵۴۸	یوان / تن	۳,۹۷۲.۰۰	فولاد (جهانی)	۱۰
	-۱۲.۸۳٪	-۴.۳۵٪	-۲.۱۵٪			دلار / تن	۲,۱۳۱.۵۰	آلومینیوم	۱۱
	-۸.۴۵٪	-۷.۲۳٪	-۴.۹۷٪			دلار / تن	۲,۰۰۲.۰۰	سرب	۱۲
	-۲۳.۱۴٪	-۴.۷۳٪	-۲.۱۸٪			دلار / تن	۲,۴۱۲.۰۰	روی	۱۳
	۲۵.۳۴٪	۶.۱۳٪	۴.۹۲٪			دلار / تن	۱۳۸.۵۰	سنگ آهن	۱۴
شاخص های کالایی									
TradingEconomics	۸۷.۹۹٪	۵۴.۱۴٪	-۱۸.۸۴٪			واحد	۲,۵۵۱.۰۰	بالتیک خشک	۱۵
	-۱.۸۱٪	-۶.۵۹٪	-۰.۵۲٪			واحد	۲۹۴.۱۲	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۱۶
	-۱۱.۲۸٪	-۱.۲۲٪	-۰.۱۵٪			واحد	۳,۵۸۰.۴۰	شاخص بورس فلزات در لندن (LME)	۱۷
	-۴.۹۰٪	-۷.۹۱٪	-۳.۶۱٪			واحد	۳,۲۴۳.۴۴	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اندپی	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.

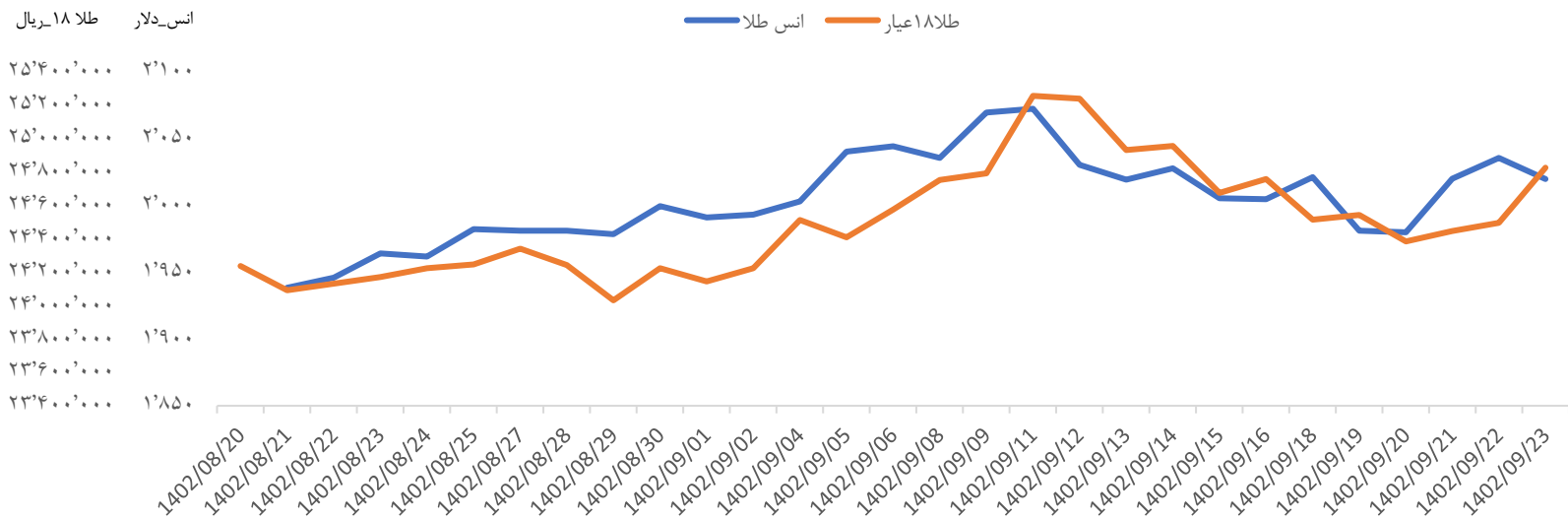
LME

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 متشکل از قیمت ۶ فلز اصلی آلومینیوم، مس، سرب، نیکل، قلع و روی است، قابل معامله می باشد.



اقتصاد

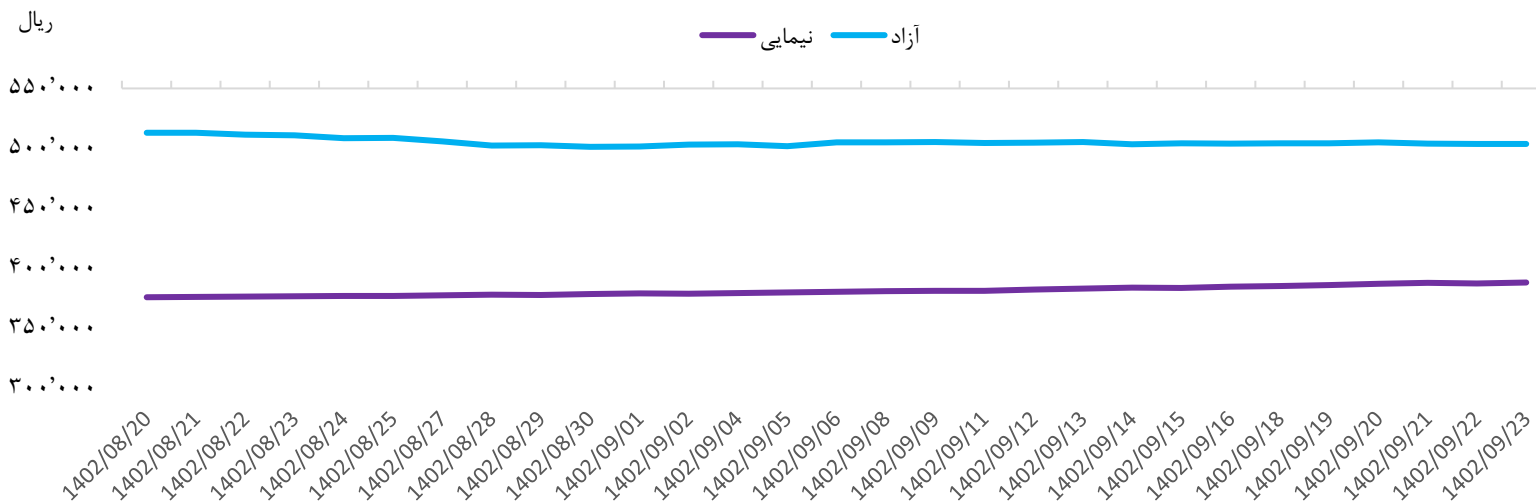
انس و طلای ۱۸ عیار



آخرین وضعیت طلا و دلار

- در هفته گذشته روند قیمت انس طلا نوسانی بوده است اما در انتهای هفته در بالای کانال ۲۰۰۰ دلار تثبیت شده است.
- هر گرم طلای ۱۸ عیار در آخرین روز هفته به نرخ ۲,۴۸۲,۳۰۰ تومان معامله شد.

دلار آزاد و نیمایی



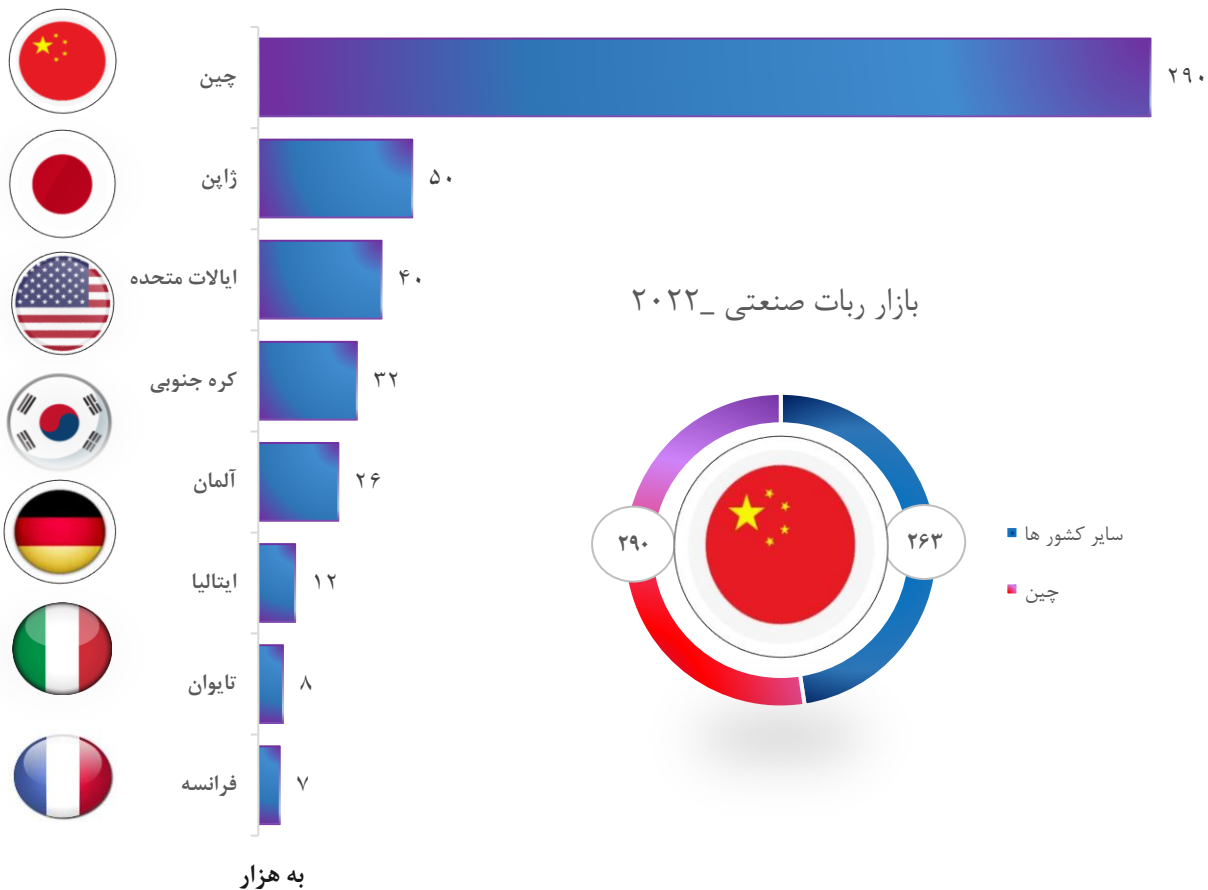
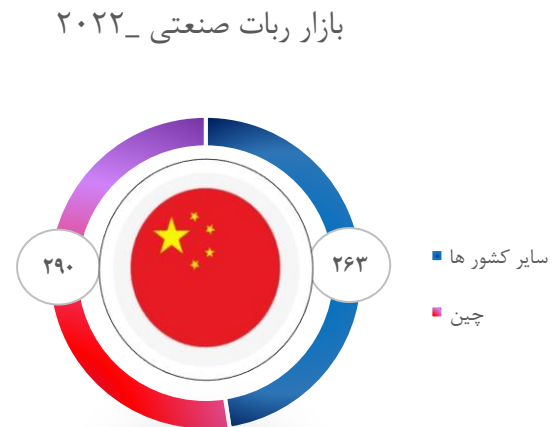
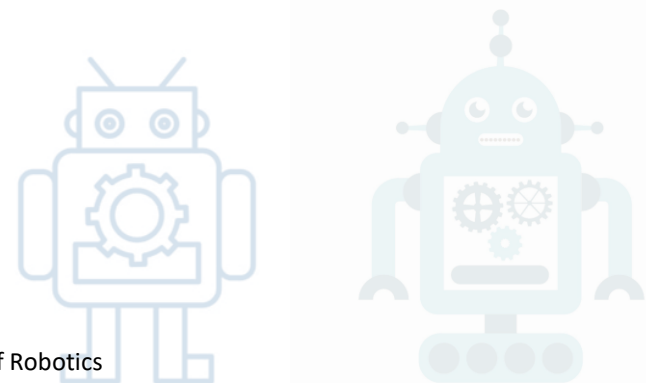
- بازار آزاد و نیمایی ارز همانند هفته گذشته روند ثابت و کم نوسانی داشته است. به همین علت تغییر خاص و یا چشم گیری را مشاهده نکردیم.

چین؛ طلایه دار بازار ربات صنعتی

براساس آخرین گزارش جهانی رباتیک که توسط فدراسیون بین المللی رباتیک منتشر شده است، تعداد بی سابقه ۵۵۳۰۰۰ ربات صنعتی در سال گذشته به تازگی شروع به کار کردند و این تعداد تا پایان سال ۲۰۲۲ به ۳/۹ میلیون عدد رسید. بار دیگر، آسیا بزرگ ترین محرک رشد بوده و ۷۳ درصد از ربات های تازه تولید شده، در آسیا به کار گرفته شده اند.

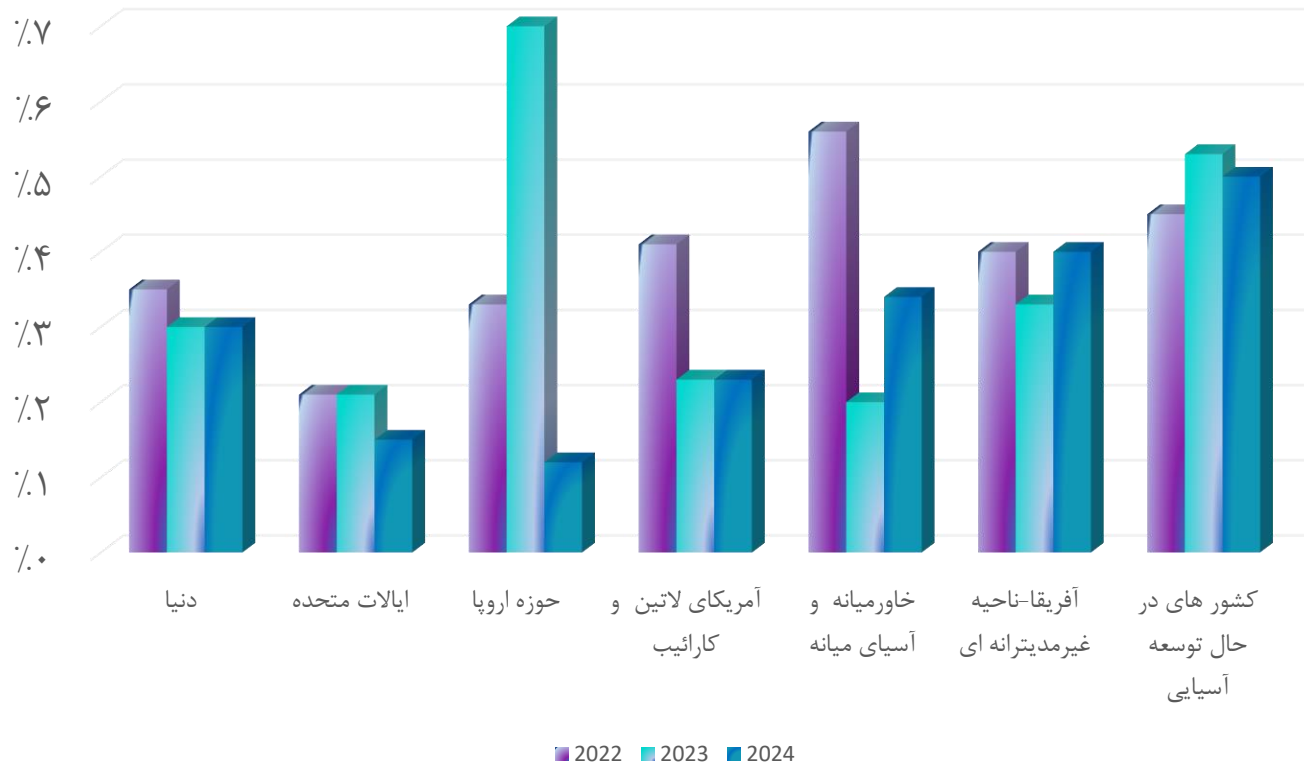
همانطور که نمایه مقابل نشان می دهد، چین به تنهایی بیش از نیمی از تاسیسات رباتیک جدید در سال ۲۰۲۲ را به خود اختصاص داده و آن را به بزرگ ترین بازار جهان تبدیل کرده است. ژاپن با به کار گیری بیش از ۵۰ هزار ربات جدید، سال گذشته در رتبه دوم قرار گرفت و پس از آن به ترتیب ایالات متحده و کره جنوبی در رتبه های بعدی قرار گرفتند. براساس گزارش IRF¹، ژاپن همچنان بزرگ ترین تولیدکننده ربات های صنعتی است که ۴۶ درصد از تولید جهانی را در سال ۲۰۲۲ به خود اختصاص داده است.

در حالی که چین به طور مطلق و از نظر رشد، بزرگ ترین بازار است، کره جنوبی و ژاپن از نظر تراکم استفاده ربات، یعنی به کارگیری ربات به ازای هر ۱۰ هزار کارگر تولیدی، از ابرقدرت تولید جهان جلوتر هستند. براساس گزارش IRF، کره جنوبی به ازای هر ۱۰ هزار کارمند در صنعت تولید ۱۰۰۰ ربات دارد، در حالی که این رقم برای ژاپن ۳۹۹ و برای چین ۳۲۲ ربات است.



انتظار برای رشد اقتصاد جهانی

نرخ رشد تولید ناخالص داخلی

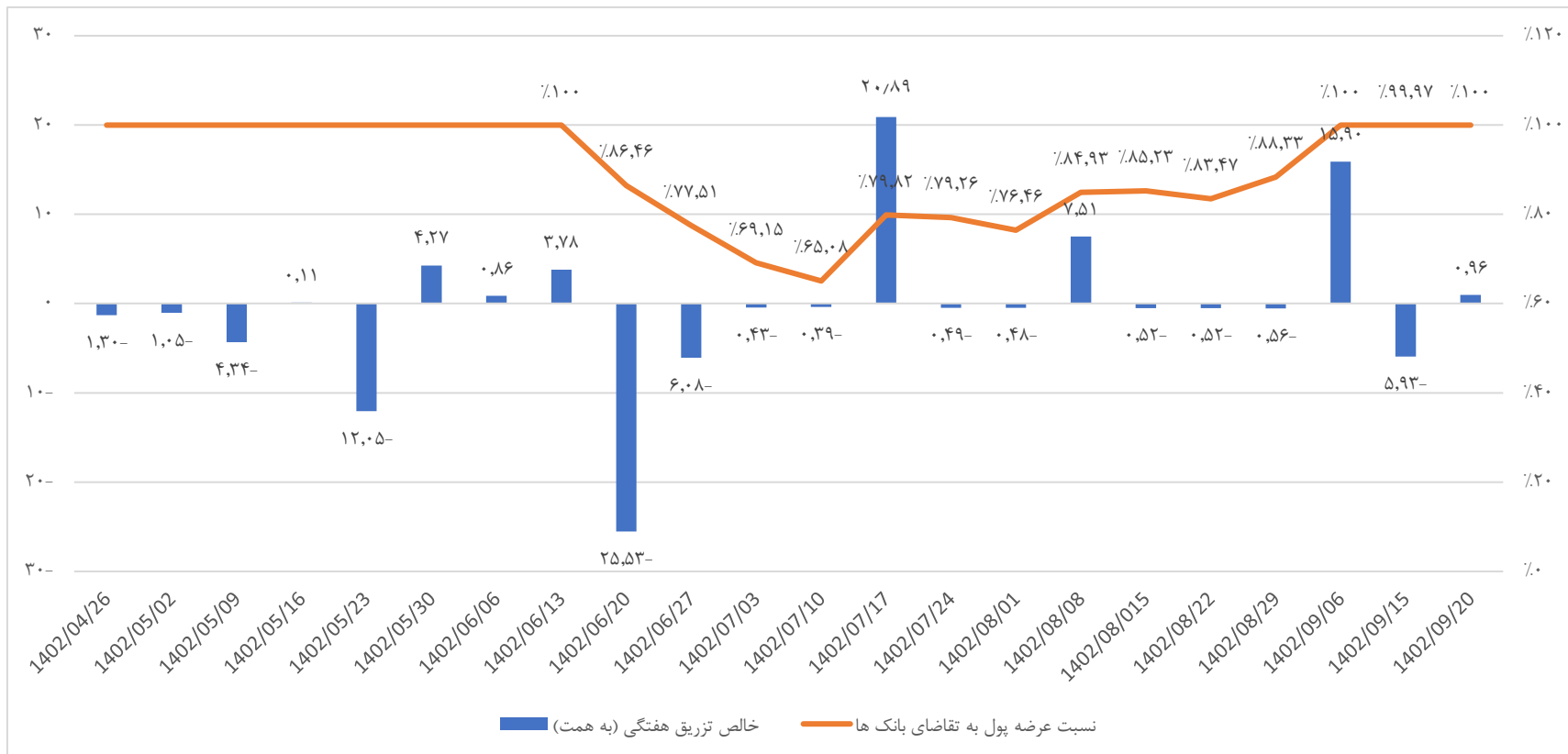


آخرین برآورد صندوق بین المللی پول نشان می دهد که ممکن است رشد اقتصادی جهان تا پایان سال ۲۰۲۴ کند باشد. صندوق بین المللی پول انتظار دارد تولید ناخالص داخلی جهان در سال ۲۰۲۴ ، به میزان ۳ درصد رشد کند.

با نگاه منطقه ای به نمودار رو به رو بیشترین نرخ رشد، برای کشورهای در حال توسعه آسیایی پیش بینی می شود و انتظار می رود در سال ۲۰۲۴ ، ۵ درصد افزایش یابد. از سوی دیگر، پیش بینی می شود که ایالات متحده در این دوره شاهد افت بیش تری باشد و از ۲/۱ درصد در سال ۲۰۲۲ به تنها ۱ درصد در سال ۲۰۲۴ برسد.

منبع:

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 بازخرید بود. از این رو، این بانک به اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخرید به مبلغ ۱۳۱.۴۸ همت اقدام کرد. همچنین به دلیل کمبود اوراق مالی اسلامی برای یک بانک و همچنین عدم امکان معامله در یک نماد از اوراق مالی اسلامی برای بانکی دیگر، در نهایت مبلغ ۱۲۷.۸ همت در اختیار بانک‌ها و موسسات اعتباری غیربانکی شرکت کننده در حراج قرار گرفت.

مطابق عملیات اجرایی سیاست پولی هفته اول آبان، بانک مرکزی به تمامی تقاضای پول بانک پاسخ مثبت داد که از لحاظ نسبی ۰.۳٪ بیشتر از هفته قبل بوده است و خالص تزریق هفتگی پول پس از کسر تعهدات سر رسید شده برابر با ۰.۹۶ همت بوده است.

نکته قابل توجه این است که میانگین ماهانه تقاضای پول بانک‌ها و موسسات اعتباری در شهریور ۱۱۵.۵ همت و مهر ماه و ۱۳۶.۵ همت و آبان ماه ۱۴۰.۳ همت بوده است و در دو هفته اول آذر ۱۳۲.۲ همت بوده است که نشان دهنده تغییر روند می باشد



بازار سرمایه



سازمان بورس و اوراق بهادار
SECURITIES & EXCHANGE ORGANIZATION



فرا بورس ایران



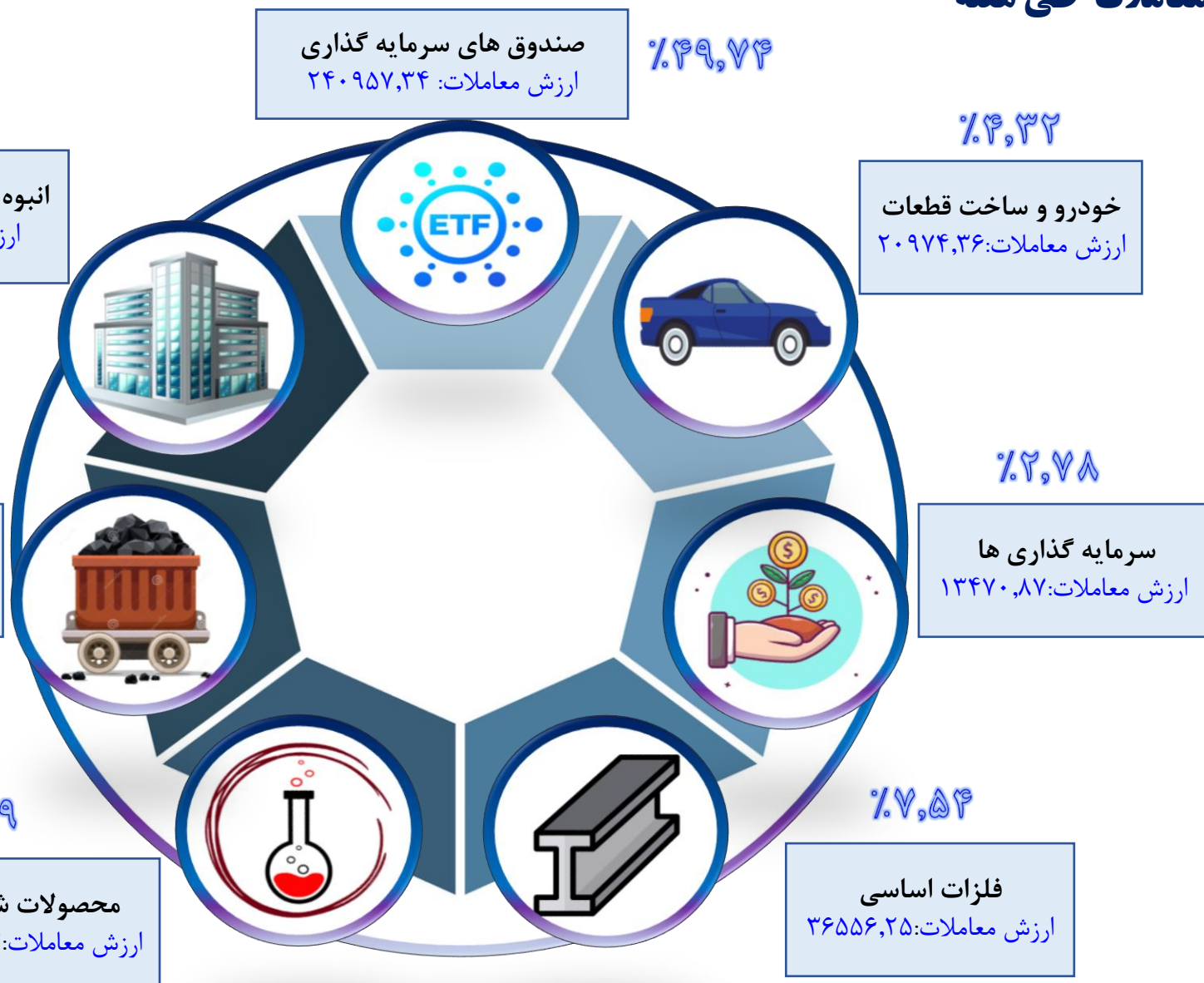
بورس انرژی
(سهامی عام)



اخبار تاثیر گذار هفته گذشته

- ❖ نخستین پذیره نویسی صندوق بازنشستگی تکمیلی تحت عنوان آتی مفید روز یکشنبه انجام شد.
- ❖ بزرگترین تأمین مالی تاریخ بازار سرمایه در بازار اولیه فرابورس در روز شنبه با اتمام پذیره نویسی ۴۴۵۰ میلیارد تومانی ناشی از سلب حق تقدم شرکت صبا فولاد خلیج فارس محقق شد.
- ❖ نماد تپسی در روز دوشنبه به دلیل تاخیر در افشای به موقع اطلاعات با اهمیت تعلیق شد. روز بعد تپسی اعلام کرد: انتقال بلوکی سهام طی روزهای معاملاتی اخیر، مطابق درخواست سهامداران شرکت به هیات پذیرش فرابورس جهت رفع توثیق سهام و موافقت هیئت مذکور و در نتیجه تجمیع سهام در کد اصلی سهامداران می باشد.
- ❖ بانک دی در بازار پایه زرد فرابورس درج شد.
- ❖ سازمان خصوصی سازی با صدور اطلاعیه ای جزئیات واگذاری ۵۱ درصد سهام دو باشگاه پرسپولیس و استقلال را اعلام کرد.
- ❖ با اعلام شرکت ملی گاز در خصوص کاهش سهم مصرف واحد های تولیدی، پتروشیمی زاگرس به دلیل محدودیت گاز و در نتیجه قطع بخشی از گاز ورودی به شرکت، واحد دوم تولیدی این شرکت تا اطلاع ثانوی از سرویس خارج گردید، هم چنین شرکت پتروشیمی پردیس نیز به دلیل محدودیت مصرف گاز، از توقف بخشی از فعالیت های شرکت و کاهش ظرفیت تولید خبر داد.
- ❖ پس از تصویب کلیات لایحه بودجه در کمیسیون تلفیق بودجه، این موضوع در جلسه علنی مجلس شورای اسلامی روز سه شنبه مطرح و رد شد. به گفته محمدباقر قالیباف دولت ۷ روز فرصت دارد، لایحه ارجاع شده را اصلاح و مجدداً تقدیم مجلس نماید.
- ❖ هیئت تخصصی صنایع و بازرگانی دیوان عدالت اداری در تاریخ ۳۰ مرداد ماه دستور توقف عملیات اجرایی وصول عوارض از صادرات را صادر کرده بود. با لغو دستور توقف پیرو بخشنامه صادره در تاریخ ۲۱ آذر ماه، عوارض صادراتی مواد خام و نیمه خام، مجدداً برقرار خواهد شد.

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 ۲۴۰۹۵۷,۳۴ 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، 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 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	۵,۶۸۵,۹۱۴	۱۳۷	۰.۷۲٪	۶.۹۹٪	۴۰.۸۸٪	۴۸.۶۳٪	۰.۰۶٪	۰.۴۵٪	۱.۹۶٪	۵.۷۵٪	۱۰.۹۰٪	۲۱.۰۱٪	۱۶۱.۸۵٪
اختصاصی بازارگردانی	۱,۷۵۶,۰۲۱	۱۰۰	۱.۷۹٪	۷۲.۴۲٪	۴.۸۰٪	۲.۰۹٪	-۰.۰۶٪	-۰.۴۴٪	۴.۱۸٪	۱.۴٪	-۲.۸۱٪	۶۸.۹۹٪	۲۱۰.۷۹٪
در سهام	۱,۰۶۸,۴۰۰	۱۲۱	۰.۰۹٪	۹۲.۴۴٪	۴.۷۷٪	۱.۱۰٪	-۰.۱۸٪	-۰.۷۸٪	۵.۳۴٪	۱.۶۳٪	۰.۳۰٪	۴۹.۹۷٪	۵۰۱۷.۸۰٪
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۲۰۲,۱۶۴	۱۵	۰.۱۱٪	۱۹.۵۴٪	۳.۵۵٪	۱٪	۰.۱۳٪	-۱.۰۵٪	۰.۴۴٪	۴.۳۹٪	۵.۵۵٪	۴۲.۸۷٪	۱۵۵۳.۵۰٪
مختلط	۶۲,۹۲۰	۲۵	۰.۰۵٪	۵۹.۲۷٪	۲۰.۹۵٪	۱۸.۲۰٪	-۰.۰۶٪	۰.۰۰٪	۴.۶۷٪	۱.۸۶٪	۴.۰۱٪	۴۳.۱۰٪	۱۶۱۵.۵۴٪
خصوصی	۱۶,۳۷۰	۵	۰.۰۰٪	۷.۵۶٪	۱۴.۳۴٪	۶.۲۵٪	-۰.۰۱٪	-۰.۰۵٪	۰.۳۲٪	۶.۷۶٪	۱۰.۷۵٪	۱.۰۷٪	۱۱.۱۲٪
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	۷,۹۶۳	۴	۰.۰۲٪	۰.۰۰٪	۰.۶۳٪	۰.۰۰٪	-۰.۰۳٪	-۰.۲۲٪	۳.۸۴٪	۱.۷۹٪	۲.۸۷٪	۳۴.۴۲٪	۷۷.۰۶٪
جسورانه	۴,۱۹۲	۱۶	۰.۰۲٪	۰.۰۰٪	۲۹.۷۶٪	۱۲.۲۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۵٪	۰.۳۰٪	۱.۸۴٪	۱۲.۸۳٪	۲۹.۴۶٪	۱۳۸.۲۰٪
املاک و مستغلات	۳,۳۴۸	۲	۰.۶۰٪	۲۴.۵۱٪	۳۰.۵۵٪	۰٪	۰.۰۳٪	۰.۳۱٪	۱.۵۰٪	۰.۴۹٪	۰.۸۴٪	۱.۹۷٪	۴.۶۰٪
زمین و ساختمان		۴	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
مجموع ارزش خالص دارایی‌ها:	۸,۸۱۸,۱۹۱	۴۳۰											

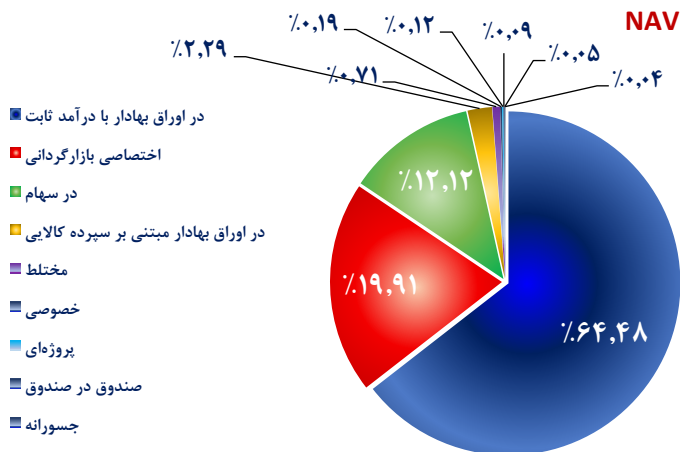
صندوق های سرمایه گذاری در مجموع برابر ۴۳۰ عدد می باشند.

در هفته منتهی به ۲۴ آذر ۱۴۰۲ بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت، جسورانه و املاک و مستغلات مثبت بودند؛ هم چنین بازدهی صندوق‌های: سپرده کالایی، صندوق در صندوق، در سهام، صندوق خصوصی و بازارگردانی منفی؛ و بازدهی صندوق‌های پروژه‌ای و مختلط صفر بودند.

درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های درآمد ثابت با ۰/۴۵ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های مبتنی بر سپرده کالایی با ۱/۰۵- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۶۴/۴۸ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۹/۹۱ درصد و سهامی با ۱۲/۱۲ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

نمودار صندوق‌ها بر مبنای NAV



بررسی وضعیت بازار بدهی منتهی به تاریخ ۲۲ آذر

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 ۹۱۴ با سررسید ۱۴۰۲/۱۰/۲۵ و بازدهی‌های ۳۱/۳۵ و ۲۷/۶ درصد بود. همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا ۰۰۸ با سررسید ۱۴۰۳/۰۹/۱۹ و بازدهی‌های ۲۵/۸۷ و ۲۵/۸۴ درصد بود.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخرزا ۹۱۴	۹۷۵,۶۵۰	۱۴۰۲-۰۹-۲۲	۱۴۰۲-۱۵-۲۵	۳۱.۳۵٪	۲۷.۶٪
اخرزا ۰۰۸	۷۹۶,۰۰۰	۱۴۰۲-۰۹-۲۲	۱۴۰۳-۰۹-۱۹	۲۵.۸۷٪	۲۵.۸۴٪

اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر بیشترین بازدهی متعلق به تابان ۱۱ به میزان ۲۵/۰۴ درصد با سررسید ۱۴۰۶/۰۶/۲۷ و کمترین بازدهی متعلق به نماد غدیر ۰۵ به میزان ۱۸/۱۴ درصد با سررسید ۱۴۰۵/۰۱/۱۴ بوده است.

صکوک اجاره تابان ۱۱ به منظور خرید سهام شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس توسط نهاد واسط از بانی و سپس اجاره به شرط تملیک آن به بانی منتشر شده است. صکوک اجاره غدیر ۰۵ خرید تجهیزات و ماشین آلات خط احیا مستقیم کارخانه تولید آهن اسفنجی توسط نهاد واسط از بانی و سپس اجاره به شرط تملیک آن ها به بانی منتشر شده است.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	ضامن	متعهد پذیره نویس
تابان ۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۴۰۲-۰۹-۲۲	۱۴۰۶-۰۶-۲۷	۲۵.۰۴٪	شرکت سرمایه گذاری اهداف	تأمین سرمایه خلیج فارس
غدیر ۰۵	۱,۰۲۷,۴۳۰	۱۴۰۲-۰۹-۲۲	۱۴۰۵-۰۱-۱۴	۱۸.۸۴٪	توثیق سهم	شرکت تأمین سرمایه دماوند

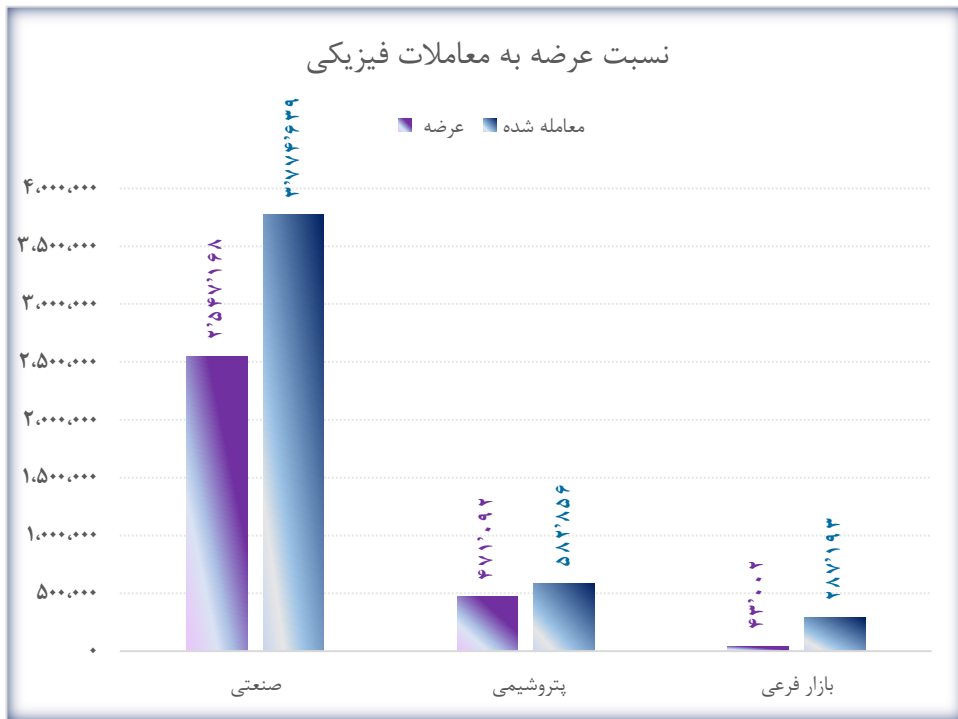


بورس کالا

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	۲۰۵,۰۵۲,۵۰۹	۲,۵۴۷,۱۶۸	۶۷.۶۳%	۸۳.۲۱%
پتروشیمی و...نفتی	۹۱,۰۰۷,۴۵۰	۴۷۱,۰۹۲	۳۰.۰۲%	۱۵.۳۹%
بازار فرعی	۷,۱۳۰,۲۷۰	۴۳,۰۰۲	۲.۳۵%	۱.۴۰%
جمع	۳۰۳,۱۹۰,۲۲۹	۳,۰۶۱,۲۶۲	۱۰۰%	۱۰۰%

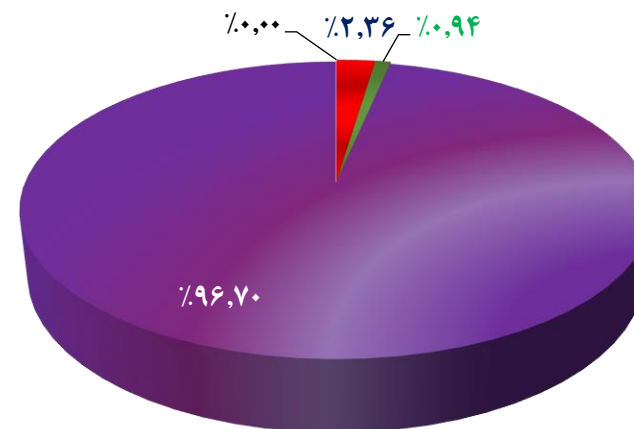


بیشترین نسبت عرضه به معاملات فیزیکی مربوط به گروه پتروشیمی معادل ۰/۸۱ می باشد. پس از آن این نسبت به ترتیب در گروه صنعتی و گروه بازار فرعی معادل ۰/۶۷ و ۰/۱۵ می باشد.

در این هفته ۶۷/۶۳ درصد از ارزش معاملات در بازار فیزیکی مربوط به گروه کالاهای صنعتی بوده است که نسبت به هفته پیش ۱۳/۱۵ درصد افزایش یافته است. همچنین ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۹/۵۸ درصد کاهش و حجم معاملات ۰/۲۴ درصد افزایش پیدا کرده است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات هفتگی منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۲۴

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





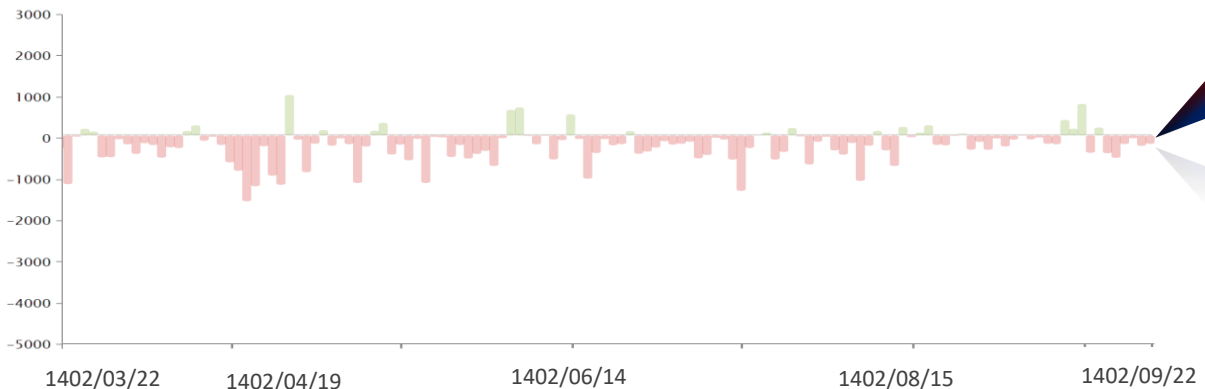
وضعیت بازار

ورود و خروج پول حقیقی

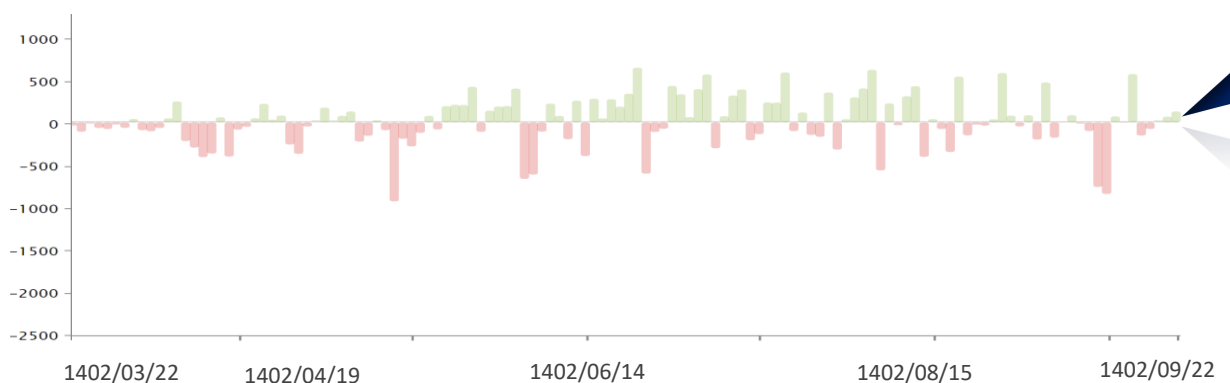
با توجه به نمودار بازار طی شش ماه گذشته ، غالباً شاهد خروج پول حقیقی از بازار بوده ایم. بیشترین خالص ورود و خروج پول حقیقی از بازار طی هفته اخیر برای روز ۱۸ آذر ماه به میزان **۵۴۰/۰۷** میلیارد تومان بوده است. جمع خالص ورود و خروج پول حقیقی هفتگی به بازار معادل **-۱,۲۷۹/۴۶** میلیارد تومان بوده است.

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



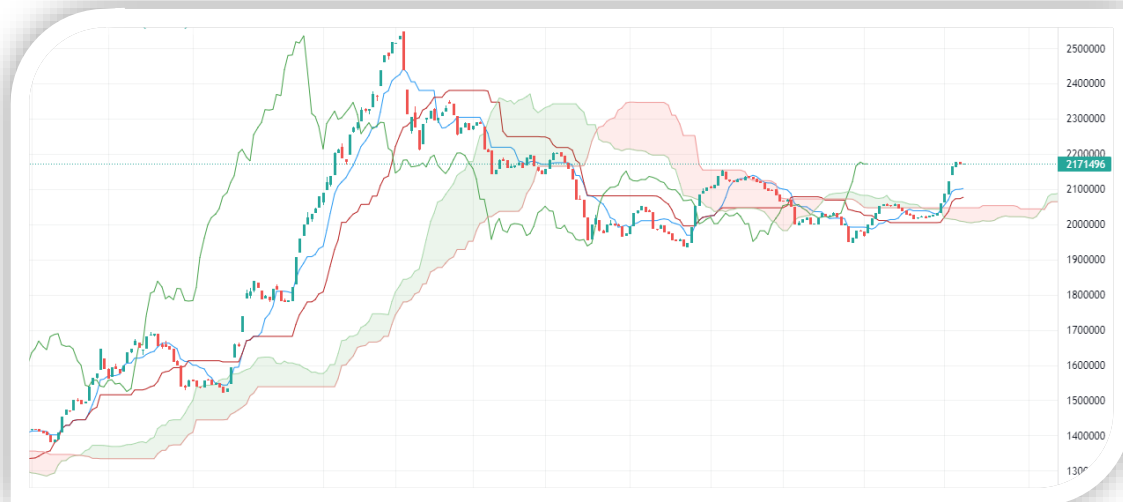
ارزش بازار بورس (ریالی و دلاری)



ارزش بازار بورس (ریالی و دلاری)

ارزش دلاری بورس در تاریخ بیست و دوم آذر ماه ۱۴۰۲، ۱۸۵ میلیارد دلار می باشد، که نسبت به هفته پیش ۰/۸ درصد کاهش یافته است. از ابتدای سال جاری شاهد کاهش ۴/۳ درصدی ارزش دلاری و کاهش ۰/۶ درصدی ارزش ریالی بازار بوده ایم.

تحلیل تکنیکال شاخص



مطابق تحلیل هفته پیش شاخص بعد از شکستن سطح مقاومتی دومیلیون و پنجاه هزار واحد (سنکو بی افقی) یک روند صعودی به خود گرفته و از لحاظ تکنیکالی باید یک پولبک (pull back) به مقاومت شکسته شده بزند و به حرکت خود ادامه دهد.

همانطور که مشاهده می‌شود سطح مقاومت با حجم خوبی شکسته شده و طی هفته شاهد پولبک بودیم، احتمال دارد در هفته پیش رو نیز این اصلاح جزئی به سمت مقاومت شکسته شده ادامه پیدا کند ولی در کل با توجه به پرامترهای تحلیلی ایچیموکو، صعودی بودن کیجونسن، صعودی بودن تنکانسن، سبز شدن ابر پیش رو و قرار گرفتن چیکو اسپن در فضای آزاد انتظار می‌رود روند اصلاحی که اواسط اردیبهشت ماه شروع شده خاتمه پیدا کند و شاهد تغییر روند در شاخص کل باشیم.





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:

عطالله آقاسی، 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