



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

حکایت شرکت های بورسی و کسری بودجه دولت!

گزارش تحلیل بازارها-شماره ۱۲- هفته منتهی به تاریخ ۱۱-۰۶-۱۴۰۲
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
- ❖ درآمد های معاملات بازار سهام چین
- ❖ دریای سرخ
- ❖ سیاست های پولی بانک مرکزی
- ❖ اخبار تاثیر گذار هفته گذشته
- ❖ هفت گروه با بیشترین ارزش معاملات طی هفته
- ❖ بررسی وضعیت صندوق ها
- ❖ بررسی وضعیت بازار بدهی
- ❖ بررسی بورس کالا
- ❖ ورود و خروج پول حقیقی
- ❖ ارزش ریالی و دلاری شاخص کل



حقایقی پیرامون چشم انداز جهانی

اخبار پیرامون جهان

- ممکن است تونس امسال با کمک صندوق بین المللی پول (IMF)، ریسک نکول را کاهش دهد.
- فدرال رزرو (Fed) از از احتمال روی کار آمدن ترامپ نگران است.
- اسپانیا قصد دارد ۲.۴ میلیارد یورو برای توسعه فرودگاه مادرید سرمایه گذاری کند.
- تایوان اقدام به ساخت یک مدل زبان هوش مصنوعی انحصاری کرده است تا در برابر نفوذ چین مقاومت کند.
- سود صنعتی چین در سال ۲۰۲۳ کاهش یافت زیرا تقاضا همچنان کاهشی است.
- آمریکا قصد دارد از توافق بین اسرائیل و حماس برای آغاز مذاکرات صلح گسترده تر استفاده کند.
- ترامپ به دلیل هتک حرمت ۸۳.۳ میلیون دلار جریمه شد.
- آمریکا فروش جنگنده F-16 به ترکیه را پس از توافق ناتو و سوئد، تایید کرد.

Bloomberg

بلومبرگ

- به گفته جاناتان گری (رئیس بلک استون) ارزش املاک تجاری در حال کاهش است و این بدان معناست که اکنون زمان خرید است، به همین دلیل این شرکت در حال خرید ملک است .
- ثروتمندترین فرد آفریقا یک پالایشگاه ۱۹ میلیارد دلاری نفت افتتاح کرد تا در راستای کاهش واردات سوخت به نجریه کمک کند.
- با افزایش قابل توجه داده هایی درباره عملکرد قوی تولید ناخالص داخلی آمریکا ، سهام آمریکا افزایش می یابد.

BUSINESS
INSIDER

بیزینس اینسایدر

- دادگاه قانون اساسی فرانسه، بخش هایی از پیشنهاد قانون مهاجرت امانوئل ماکرون را رد کرد.
- جامعه یهودیان آفریقای جنوبی، از پرونده نسل کشی اسرائیل ناراحت است.
- مشاور ارشد سیاست گذاری (کجا) می گوید که اصلاحات مهاجرتی در انگلستان تأثیری در پایین بودن حقوق کارگران خارجی نخواهد داشت.
- قیمت لیتیوم به دلیل کاهش تقاضای چینی ها برای خودروهای الکتریکی به شدت سقوط کرده است.
- چین دسترسی به صندوق های سرمایه گذاری خارجی را به دلیل ناکامی بازار داخلی محدود می کند.



فایننشال تایمز

منبع	بازده	بازده	بازده	آخرین قیمت	عنوان	ردیف	
	سالانه	ماهانه	هفتگی				
بورس های جهانی							
TeleTrader	۱۲.۱۷%	۱.۱۶%	۰.۶۶%	واحد	۳۸,۱۰۵.۲۷	Dow Jones	۲
	۴۳.۱۹%	۳.۰۴%	۰.۶۲%	واحد	۱۷,۴۲۱.۰۰۹	Nasdaq	۳
	۲۰.۱۲%	۲.۱۲%	۱.۰۴%	واحد	۴,۸۸۷.۰۶	S & P ۵۰۰	۴
	-۱.۴۹%	-۱.۰۰%	۲.۱۶%	واحد	۷,۶۴۷.۴۱	FTSE ۱۰۰	۵
	۱۱.۹۶%	۱.۳۱%	۲.۴۵%	واحد	۱۶,۹۶۱.۳۹	DAX	۶
	۷.۵۷%	۰.۸۲%	۳.۵۶%	واحد	۷,۶۳۴.۱۴	CAC ۴۰	۷
	۳۰.۵۶%	۶.۱۵%	-۰.۵۹%	واحد	۳۵,۷۵۱.۰۷	NIKKEI ۲۲۵	۸
	-۱۰.۸۶%	-۰.۱۵%	۲.۷۵%	واحد	۲,۹۱۰.۲۲	SHANGHAI	۹
	۴۴.۴۸%	۲.۱۲%	-۰.۱۰%	واحد	۳,۱۶۳.۰۰	Moex	۱۰
نفت و انرژی							
TeleTrader	-	۵.۳۱%	۶.۲۵%	دلار / بشکه	۷۸.۰۱	نفت خام برنت	۱۲
	۱.۴۱%	۵.۵۲%	۶.۴۴%	دلار / بشکه	۸۳.۶۹	نفت خام WTI	۱۳
tradingeconomics	-۵.۶۱%	۱۱.۴۷%	۷.۸۴%	دلار / MMBtu	۲.۷۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۱۴
OilPrice	-۲.۹۵%	۱.۵۷%	۲.۱۳%	دلار / بشکه	۸۱.۹۸	سبب اوپک	۱۵
	-۴.۶۳%	-۱.۱۴%	۱.۷۹%	دلار / بشکه	۷۸.۰۷	نفت سنگین ایران	۱۶
tradingeconomics	-۱۶.۹۱%	۶.۰۸%	۶.۰۴%	دلار / گالن	۲.۲۹	گازوئیل	۱۷
	-۲۷.۵۱%	-۵.۲۲%	۰.۰۰%	دلار / گالن	۱.۵۹	اتانول	۱۸
	-۷.۷۹%	۰.۴۳%	۱.۴۸%	دلار / تن	۶۳۹.۱۲	نفثا	۱۹
PLATTS	-۱۷.۵۹%	-۳.۴۷%	-۲.۴۶%	دلار / تن	۲۷۸.۰۰	متانول CFR (چین)	۲۰

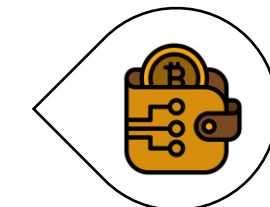
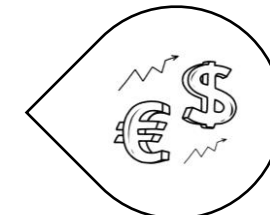
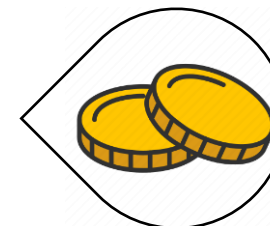
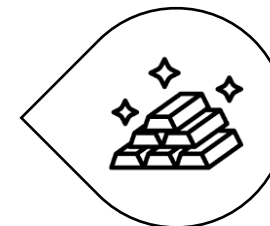
تعریف واحد MMBtu

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	۴.۶۹%	-۲.۸۹%	-۰.۵۲%	دلار / اونس	۲,۰۱۸.۱۴	طلا
	-۳.۲۷%	-۶.۱۳%	۰.۹۳%	دلار / اونس	۲۲.۸۰	نقره
طلا و سکه (داخلی)						
tgju.org	۳۰.۰۰%	۹.۸۵%	۰.۸۶%	ریال	۲۷,۱۶۱,۰۰۰	یک گرم طلای ۱۸ عیار
	۳۸.۳۲%	۱۱.۸۳%	۴.۲۵%	ریال	۳۲۸,۹۲۰,۰۰۰	سکه امامی
	۲۹.۶۳%	۱۴.۶۸%	۴.۵۸%	ریال	۲۹۸,۱۰۰,۰۰۰	سکه بهار آزادی
	۲۷.۷۸%	۱۸.۷۹%	۳.۶۶%	ریال	۱۸۴,۰۰۰,۰۰۰	نیم سکه
	۲۴.۵۹%	۹.۶۷%	۵.۵۶%	ریال	۱۱۴,۰۰۰,۰۰۰	ربع سکه
	۵۲.۴۲%	۱۲.۴۴%	۳.۹۵%	ریال	۳,۳۰۷,۹۹۹	تمام سکه رفاه (بورس)
ارز						
tgju.org	۳۰.۶۹%	۱۰.۳۶%	۲.۴۸%	ریال	۵۵۴,۵۹۰	دلار آزاد
	۲۴.۹۸%	۸.۳۴%	۲.۹۷%	ریال	۶۰۶,۶۶۰	یورو آزاد
رمز ارز						
tgju.org	۷۹.۲۷%	-۳.۱۸%	۰.۱۲%	دلار	۴۱,۸۰۶.۰۳	بیت کوین
	۴۱.۱۶%	-۳.۱۲%	-۷.۸۵%	دلار	۲,۲۷۴.۳۶	اتریوم
شاخص های داخلی ۴ بهمن						
shakhesban	۰.۲۹%	-۰.۰۲%	-۰.۰۳%	واحد	۱,۱۲۳,۴۹۱.۴۱	شاخص کل بورس
	۰.۳۹%	-۰.۰۴%	-۰.۰۵%	واحد	۷۲۷,۹۶۴.۵۹	شاخص کل بورس (هم وزن)
	۰.۱۹%	-۰.۴۰%	-۰.۴۰%	واحد	۲۵,۲۷۹.۷۵	شاخص کل فرابورس





منبع	بازده			آخرین قیمت	عنوان	ردیف	
	بازده سالانه	بازده ماهانه	بازده هفتگی				
	محصولات کشاورزی						
TeleTrader	-۲۴.۸۳٪	-۶.۳۰٪	+۰.۲۸٪	دولار / بوشل	۴۴۶.۵۰	ذرت (خارجی)	۱
	-۱.۵۰٪	+۴.۷۵٪	+۰.۶۸٪	دولار / پوند	۸۴.۴۶	کتان (پنبه)	۲
	-۱۰.۲۵٪	-۸.۴۸٪	-۰.۴۳٪	دولار / بوشل	۱,۲۰۸.۷۵	سویا	۳
	+۲۷.۴۹٪	+۱۵.۵۶٪	+۱.۱۹٪	دولار / پوند	۲۳.۸۴	شکر	۴
	-۲۳.۶۲٪	-۳.۵۷٪	+۱.۳۹٪	دولار / بوشل	۶۰.۱۵۰	گندم	۵
	-۶.۳۱٪	-۲.۵۴٪	-۴.۲۱٪	دولار / بوشل	۳۶۳.۳۰	جو	۶
TradingEconomics	-۲۲.۷۲٪	-۵.۵۲٪	-۰.۶۵٪	دولار کانادا / تن	۶۲۴.۲۰	کانولا	۷
	کالاهای صنعتی						
tgju.org	-۸.۷۹٪	-۲.۵۴٪	۱.۶۸٪	دولار / تن	۸,۵۳۱.۰۰	مس	۸
TradingEconomics	-۱.۹۷٪	۱.۶۹٪	۰.۵۹٪	یونان / تن	۳,۷۴۰.۰۰	قیر	۹
	-۵.۴۳٪	-۰.۱۰٪	۱.۹۱٪	یونان / تن	۳,۹۵۲.۰۰	فولاد (جهانی)	۱۰
	-۱۳.۸۶٪	-۵.۱۹٪	۴.۴۸٪	دولار / تن	۲,۲۶۳.۰۰	آلومینیوم	۱۱
	-۲.۰۷٪	۶.۴۰٪	۵.۳۳٪	دولار / تن	۲,۱۵۹.۸۴	سرب	۱۲
	-۲۴.۲۱٪	-۲.۰۶٪	۵.۰۸٪	دولار / تن	۲,۵۸۷.۰۰	روی	۱۳
	۱۰.۴۴٪	-۳.۵۱٪	۶.۵۹٪	دولار / تن	۱۳۷.۵۰	سنگ آهن	۱۴
	شاخص های کالایی						
TradingEconomics	۱۲۴.۵۶٪	-۲۷.۴۷٪	-۱.۲۰٪	واحد	۱,۵۱۸.۰۰	بالتیک خشک	۱۵
	۳.۸۱٪	۲.۴۲٪	۳.۱۹٪	واحد	۳۱۳.۸۲	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۱۶
	-۱۵.۳۱٪	-۰.۲۱٪	۳.۴۵٪	واحد	۳,۷۲۹.۲۰	شاخص بورس فلزات در لندن (LME)	۱۷
	-۰.۷۸٪	۲.۱۴٪	۳.۴۴٪	واحد	۳,۵۱۵.۵۱	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.

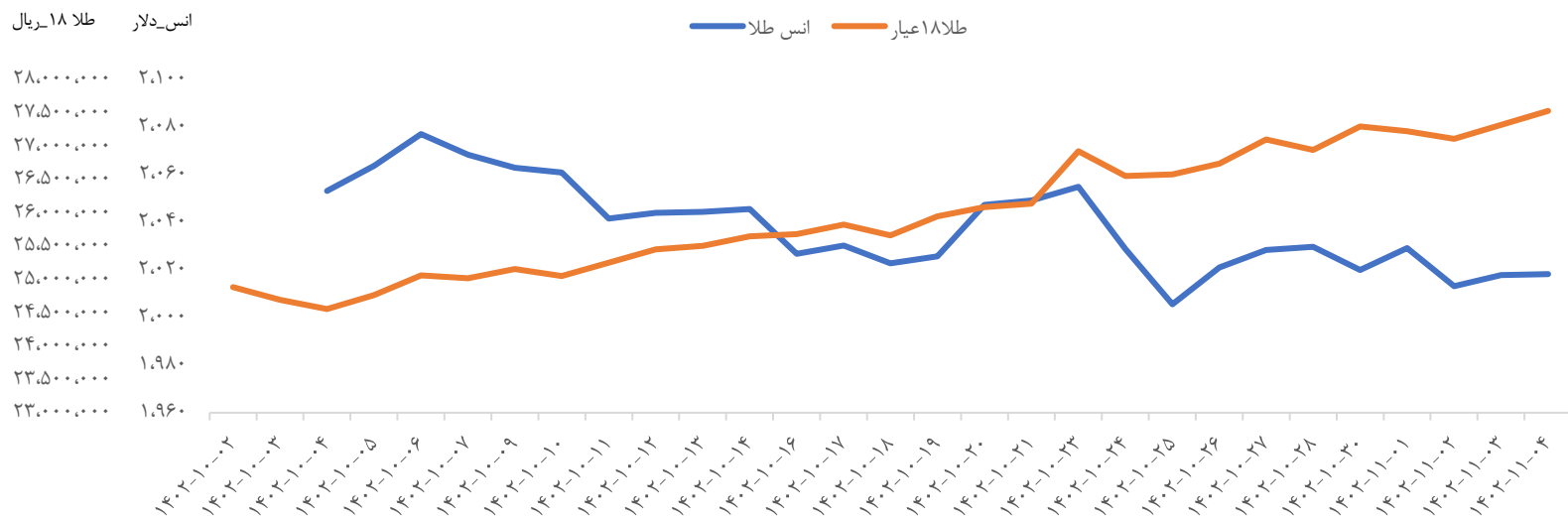
LME

بورس فلزات لندن (LME) یکی از قدیمی ترین بورس های کالایی در دنیاست که فلزات غیرآهنی، 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.

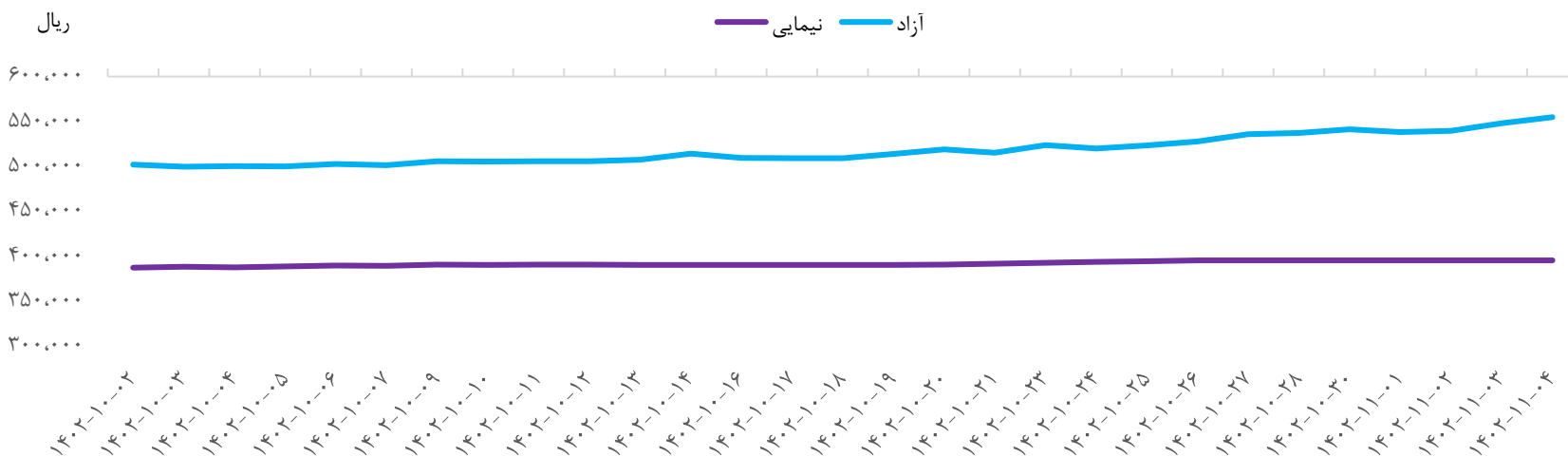


اقتصاد

انس و طلای ۱۸ عیار



دلار آزاد و نیمایی

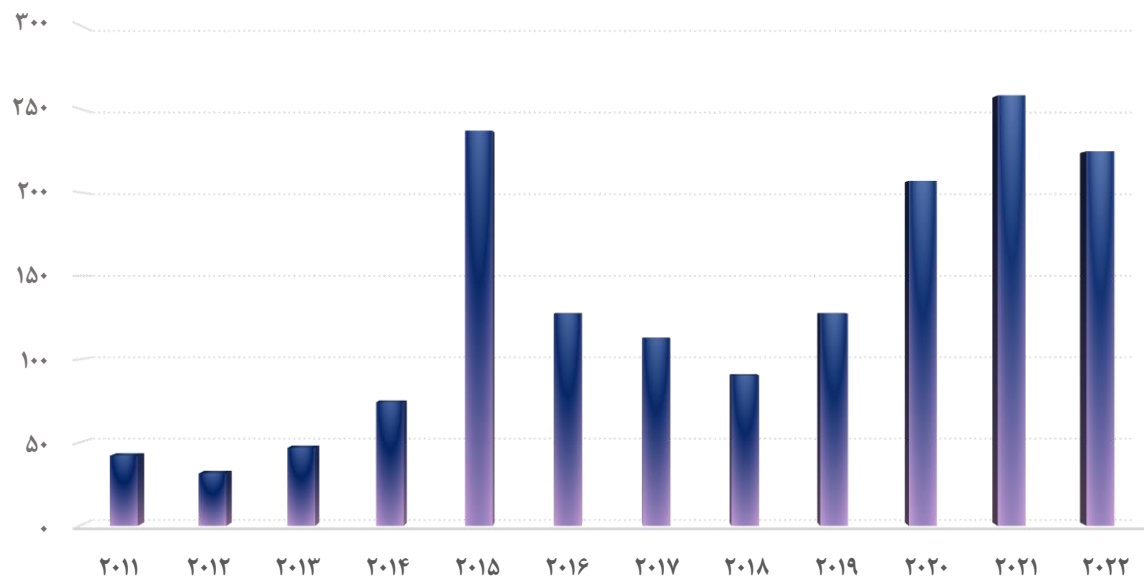


آخرین وضعیت طلا و دلار

- در هفته گذشته روند قیمت انس طلا کاهش یافته و در مجموع نسبت به هفته گذشته ۰/۵۶ درصد کاهش یافته است.
- هر گرم طلای ۱۸ عیار در آخرین روز هفته به نرخ ۲,۷۵۲,۸۰۰ تومان معامله شد و نسبت به هفته قبل ۲/۱۶ درصد افزایش داشته است. این امر بدین دلیل است که در بازار ایران طلای ۱۸ عیار همبستگی بیشتری با تغییرات دلار دارد تا انس جهانی.

- روند قیمت بازار دلار نیمایی نسبت به هفته گذشته بلا تغییر و قیمت دلار آزاد ۳/۲۸ درصد افزایش یافته است.

درآمد معاملات بازار سهام چین ۲۰۱۱-۲۰۲۲

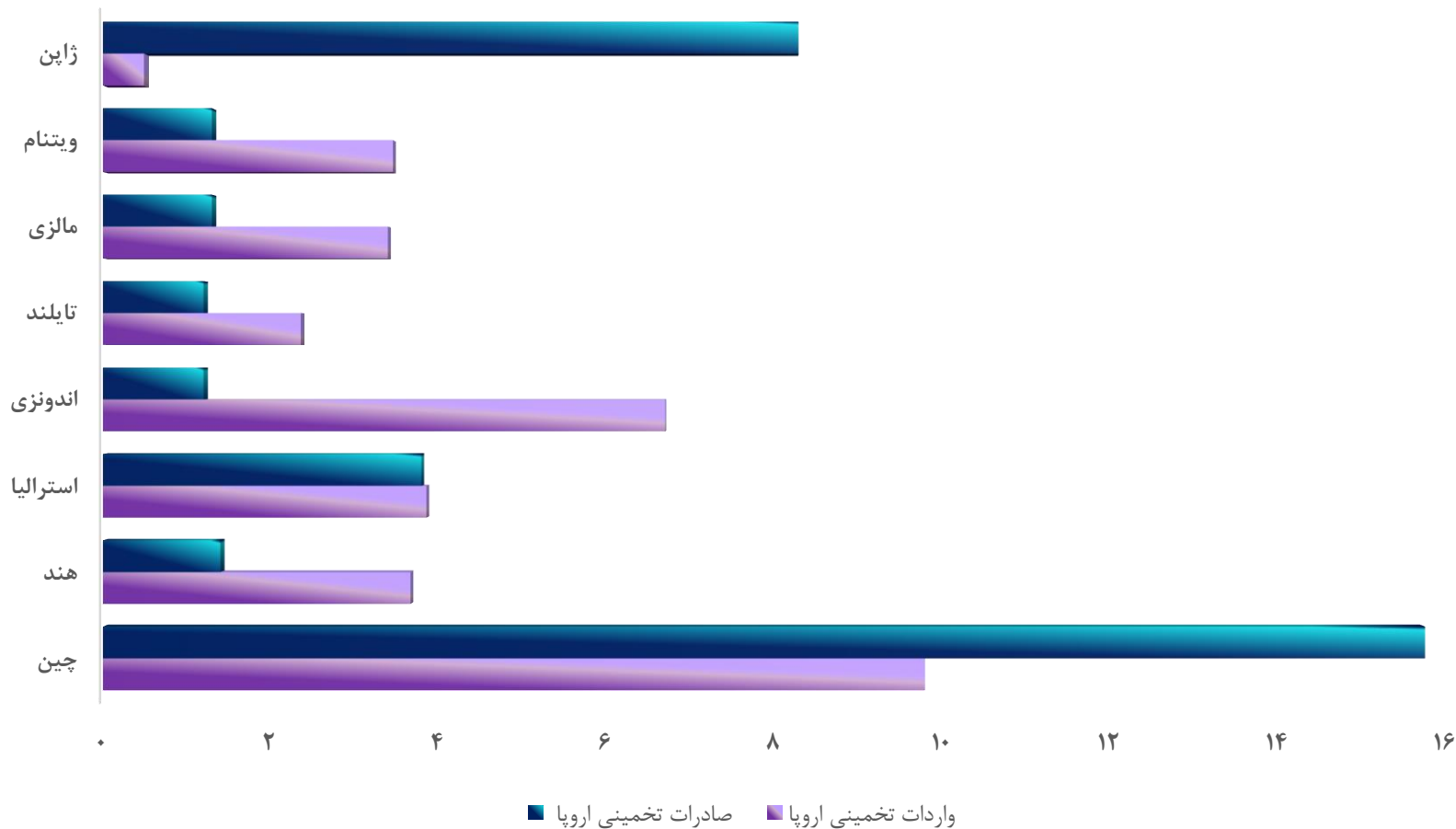


درآمد معاملات بازار سهام چین

در سال ۲۰۲۲، درآمد بازار سهام چین بیش از ۲۲۵ تریلیون یوان (حدوداً ۳۱ تریلیون دلار) بوده است. در سال ۲۰۱۵، با افزایش شدید قیمت سهام، سرمایه گذاران بسیاری جذب این بازار شدند که این امر منجر به تلاطم بازار سهام و زیان های قابل توجه برای بسیاری از فعالان بازار سرمایه شد.



دریای سرخ



ناآرامی دریای سرخ خبر بدی برای عرضه مواد غذایی ضروری در جهان است.

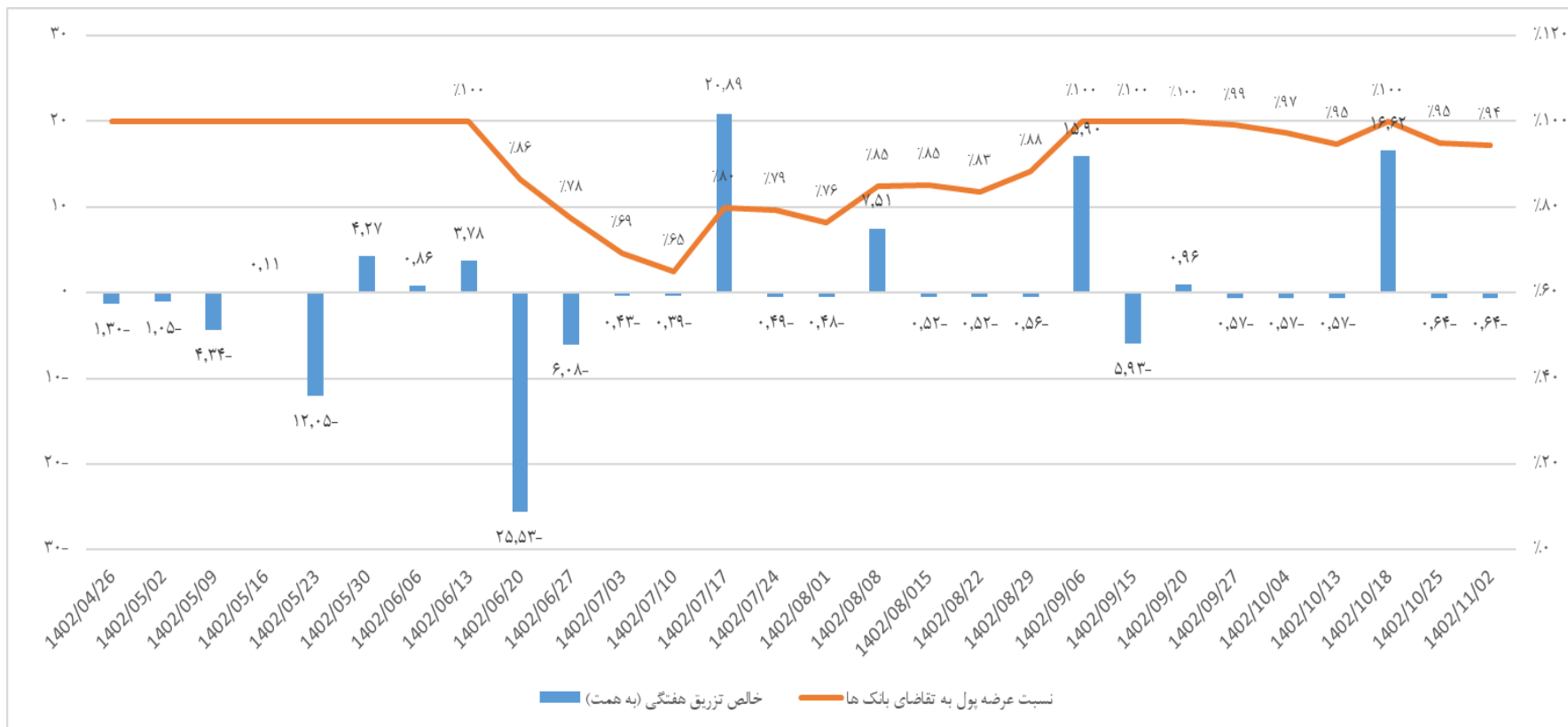
اختلالات دریای سرخ تقریباً ۷۰ میلیارد یورو از واردات و صادرات کالاهای کشاورزی و غذایی اتحادیه اروپا را تحت تاثیر قرار می دهد .

طبق تخمین جی پی مورگان، در صورت ادامه اختلالات حمل و نقل در دریای سرخ، قیمت کالاها در سراسر جهان در نیمه اول سال جاری ۰.۷ درصد افزایش خواهد یافت.

به گفته کارشناسان این اتفاقات می تواند تورم سال ۲۰۲۴ را بدتر نماید.

اعداد برحسب سال ۲۰۲۲ می باشند اطلاعات جدید در دسترس نمی باشد.

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 بازخريد بود. از این رو، این بانک به اجرای عملیات بازار باز در قالب توافق بازخريد به مبلغ ۱۴۴.۹ همت اقدام کرد.

- مطابق عملیات اجرایی سیاست پولی هفته آخر دی، بانک مرکزی به ۹۴.۴۸٪ تقاضای پول بانک پاسخ مثبت داد که از لحاظ نسبی ۰.۴۹٪ کمتر از هفته قبل بوده است و خالص تزریق هفتگی پول پس از کسر تعهدات سر رسید شده برابر با منفی ۰.۶۴ 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 این در حالی است که میانگین دی ماه ۱۴۱ همت می باشد.



بازار سرمایه

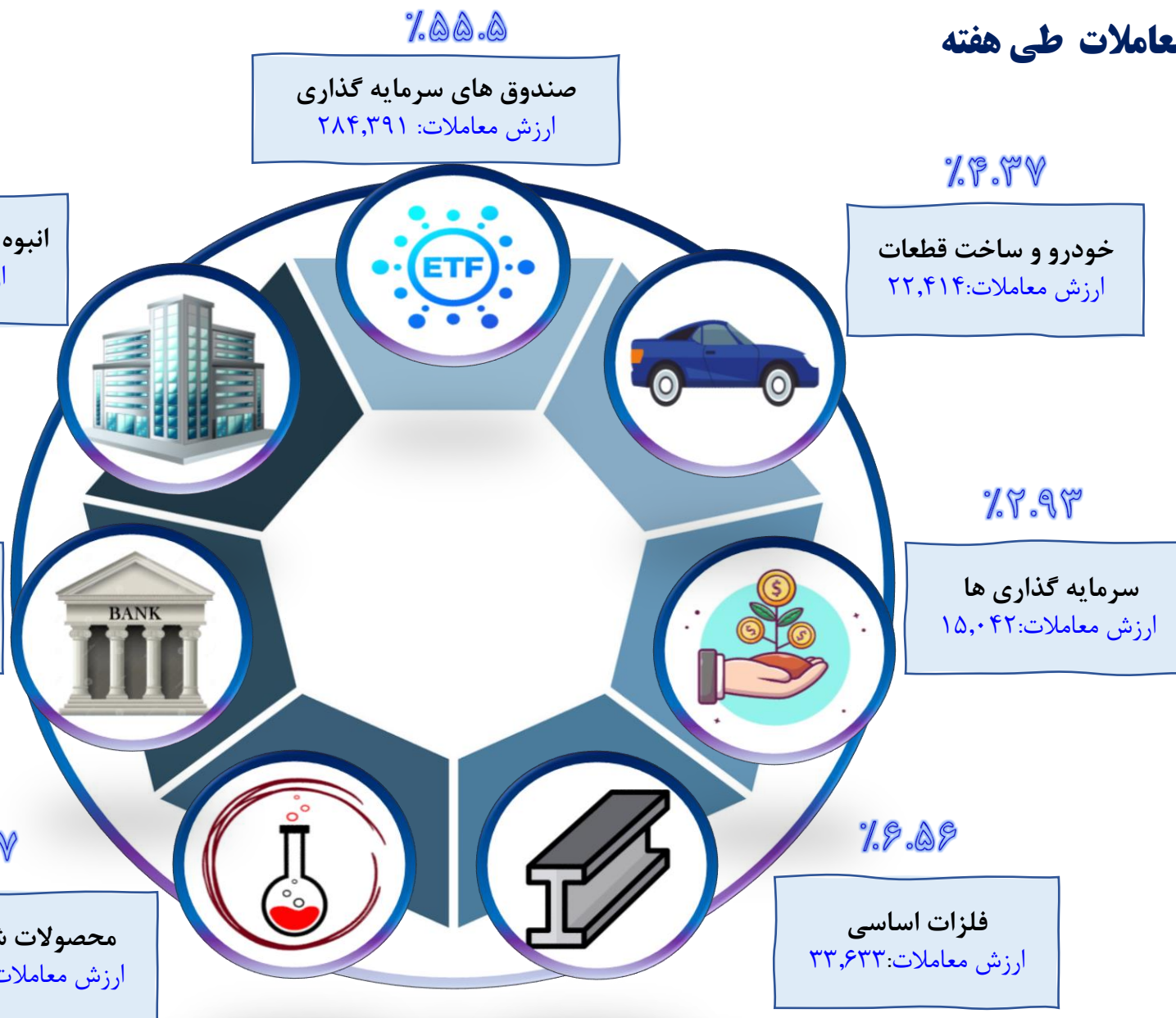
اخبار تاثیر گذار هفته گذشته

- ❖ سهمیه بنزین ۳۰۰۰ تومانی در کارت های سوخت شخصی از ۱۵۰ لیتر به ۱۰۰ لیتر کاهش یافت.
- ❖ شرکت سپرده‌گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه اعلام کرد: در هفته چهارم دی ماه، ۱۱ ناشر ۱۱۰۰ میلیارد تومان سود به حساب سهامداران واریز کردند.
- ❖ مجلس با معافیت مالیاتی اوراق مالی اسلامی دولت و شهرداری ها موافقت کرد.
- ❖ ۵۰ دستگاه وانت کاپرا هفته آینده در بورس کالا با قیمت پایه ۸۶۲ میلیون تومان عرضه می گردد.
- ❖ وزیر اقتصاد: رفتار سیاسی FATF همچنان درباره ایران باقی است.
- ❖ مدیر عامل بانک ملت که سال گذشته به عنوان چهره ماندگار نظام بانکی معرفی شد ، درگذشت.
- ❖ دستور العمل نرخ خوراک و فرآورده های اصلی پالایشگاه ها تا پایان سال ۱۴۰۴ ابلاغ شد. طبق دستورالعمل جدید، پالایشگاه ها با تولید بنزین اکتان ۸۷ بیشتر متضرر خواهند شد.
- ❖ طبق آمار موسسه کپلر در سال ۲۰۲۳ ، ۹۱ درصد نفت خام ایران به مقصد چین صادر شده است در حالی که قبل از تحریم ایران این عدد ۲۶ درصد بوده است.
- ❖ نماد ذوب طی اطلاعیه ای از افشای با اهمیت اطلاعات نوع ب برای گزارش کارشناسی تجدید ارزیابی زمین در کدال خبر داد.
- ❖ شرکت پالایش نفت بندرعباس طبق اطلاعیه ای افشا کرد که کاهش قیمت بنزین اکتان ۸۷ در محاسبات سود منظور شده و اثر با اهمیتی در سود ندارد.
- ❖ اصلاحیه صورت های مالی پالایش نفت تبریز مطابق با دستورالعمل جدید منتشر شد و تعدیل منفی ۱۱۰۰ میلیارد تومانی باعث کاهش ۲۳ درصدی سود خالص شد.
- ❖ مالیات بر ارزش افزوده در سال ۱۴۰۳، به میزان یک واحد درصد افزایش می یابد.
- ❖ دامنه نوسان گواهی سکه مثبت و منفی یک شد.
- ❖ به گزارش مرکز آمار تورم نقطه به نقطه در دی ماه ۱۴۰۲ با ۱.۷ واحد درصد کاهش به ۳۸.۵ رسیده است .



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 ۲۸۴,۳۹۱ میلیارد ریال ، ۵۵/۵۰ درصد از کل ارزش معاملات طی هفته را به خود اختصاص دادند. پس از آن به ترتیب: فلزات اساسی، خودرو و ساخت قطعات، انبوه سازی ، املاک و مستغلات، محصولات شیمیایی، سرمایه گذاری ها، و بانک ها و موسسات اعتباری، 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	۵,۶۲۵,۶۳۷	۱۴۱	۰.۴۰%	۶.۰۲%	۴۱.۴۵%	۴۹.۴۴%	۰.۰۵%	۰.۴۱%	۱.۹۰%	۵.۶۵%	۱۰.۸۲%	۲۱.۱۸%	۱۶۱.۶۷%
اختصاصی بازارگردانی	۱,۷۵۵,۷۲۲	۱۰۰	۱.۹۱%	۷۱.۶۲%	۴.۶۹%	۱.۹۳%	-۱.۳۶%	-۲.۹۹%	-۳.۳۷%	۳.۴۹%	-۱.۶۷%	۳۳.۳۱%	۱۹۴.۹۰%
در سهام	۱,۰۸۸,۰۵۲	۱۲۵	۰.۱۴%	۹۱.۶۰%	۵.۰۳%	۱.۴۱%	-۱.۴۰%	-۳.۸۶%	-۳.۷۳%	۶.۲۴%	۳.۵۶%	۲۶.۷۷%	۴۸۰۲.۷۲%
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۲۶۲,۳۷۵	۱۵	۰.۱۷%	۱۹.۳۴%	۳.۱۵%	۱%	۱.۲۶%	۲.۶۵%	۱۱.۲۰%	۱۲.۶%	۱۴.۹۹%	۴۰.۴۷%	۱۳۶۰.۰۹%
مختلط	۶۴,۳۷۰	۲۶	۰.۶۶%	۵۵.۷۶%	۲۲.۹۲%	۱۹.۱۳%	-۰.۶۸%	-۲.۲۰%	-۲.۱۷%	۳.۷۷%	۳.۴۷%	۲۸.۸۲%	۱۵۹۱.۷۴%
خصوصی	۱۶,۶۹۱	۵	۰.۰۰%	۷.۶۶%	۱۴.۶۶%	۶.۲۷%	-۰.۰۵%	-۰.۱۶%	۰.۰۷%	۲.۸۶%	۱۳.۰۱%	۴.۵۵%	۱۳.۸۳%
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	۸,۴۱۴	۴	۰.۰۱%	۰.۰۰%	۰.۸۶%	۰.۰۰%	-۰.۱۸%	-۰.۷۲%	۰.۹۹%	۸.۷۹%	۷.۹۱%	۳۴.۳۴%	۷۹.۸۱%
جسورانه	۳,۶۸۱	۱۶	۰.۰۱%	۰.۰۰%	۳۵.۲۹%	۱۰.۱۶%	۰.۰۴%	۰.۱۲%	۰.۲۶%	-۳.۳۱%	-۲.۲۱%	۲۸.۲۷%	۱۳۴.۴۶%
املاک و مستغلات	۳,۳۷۷	۲	۰.۵۷%	۱۹.۷۵%	۲۴.۰۳%	۰%	-۰.۰۶%	۰.۰۷%	۰.۸۸%	۳.۲۱%	۰.۸۸%	۱.۶۶%	۵.۵۴%
زمین و ساختمان		۴											
مجموع ارزش خالص دارایی‌ها:	۸,۸۳۹,۲۱۹	۴۳۹											

صندوق های سرمایه گذاری در مجموع برابر ۴۳۹ عدد می باشند. که از این تعداد ۱۷۵ صندوق قابل معامله و ۲۶۴ صندوق صدور و ابطالی می باشند.

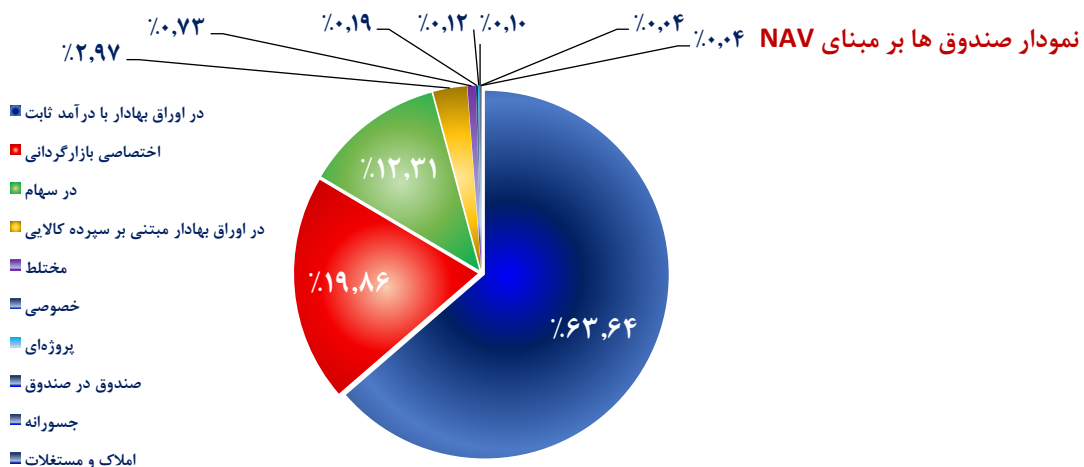
در هفته منتهی به بیست و نهم دی ۱۴۰۲ بازدهی هفتگی صندوق های درآمد ثابت ، سپرده کالایی ، املاک و مستغلات و جسورانه مثبت بودند ؛ هم چنین

بازده صندوق خصوصی ، صندوق در صندوق ، در سهام، اختصاصی بازارگردانی و مختلط منفی ؛

و بازدهی صندوق پروژه ای صفر بود.

درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق های سپرده کالایی با ۲/۶۵ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق های سهامی با ۳/۸۶- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق های با درآمد ثابت با ۶۳/۶۴ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۹/۸۶ درصد و سهامی با ۱۲/۳۱ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق ها بودند.



بررسی وضعیت بازار بدهی منتهی به تاریخ ۴ بهمن

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 ۲۹/۴۳ و ۳۸/۴۴ درصد بود. همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا ۰۰۳ با سررسید ۱۴۰۳/۰۸/۱۸ و بازدهی‌های ۲۸/۹۴ و ۲۶/۹ درصد بود.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخرزا ۲۰۲	۴۷۳,۸۹۰	۱۴۰۲-۱۱-۰۴	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۹/۴۳٪	۳۸/۴۴٪
اخرزا ۰۰۳	۸۸۸,۸۴۰	۱۴۰۲-۱۱-۰۴	۱۴۰۳-۰۴-۱۸	۲۸/۹۴٪	۲۶/۹٪

اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر بیشترین بازدهی متعلق به کرمان ۳۹ به میزان ۳۰/۵ درصد با سررسید ۱۴۰۳/۰۹/۱۵ و کمترین بازدهی متعلق به نماد تابان ۰۶ به میزان ۱۹/۲۴ درصد با سررسید ۱۴۰۴/۱۰/۱۵ بوده است. صکوک مراجه کرمان موتور به منظور تأمین مالی بانی توسط ناشر جهت خرید قطعات و مجموعه‌های تولید خودرو منتشر شده است. صکوک اجاره تابان کاردان به منظور خرید سهام شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس (سهامی عام) از شرکت گروه پتروشیمی تابان فردا (سهامی عام) توسط نهاد واسط و اجاره به شرط تملیک آن به شرکت مذکور منتشر شده است.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	ضامن	متعهد پذیره نویسی
کرمان ۳۹	۹۲۴,۷۲۰	۱۴۰۲-۱۱-۰۴	۱۴۰۳-۰۹-۱۵	۳۰/۵٪	بانک تجارت	تأمین سرمایه تمدن
تابان ۰۶	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۴۰۲-۱۱-۰۴	۱۴۰۴-۱۰-۱۵	۱۹,۲۴٪	توثیق سهام	تأمین سرمایه کاردان

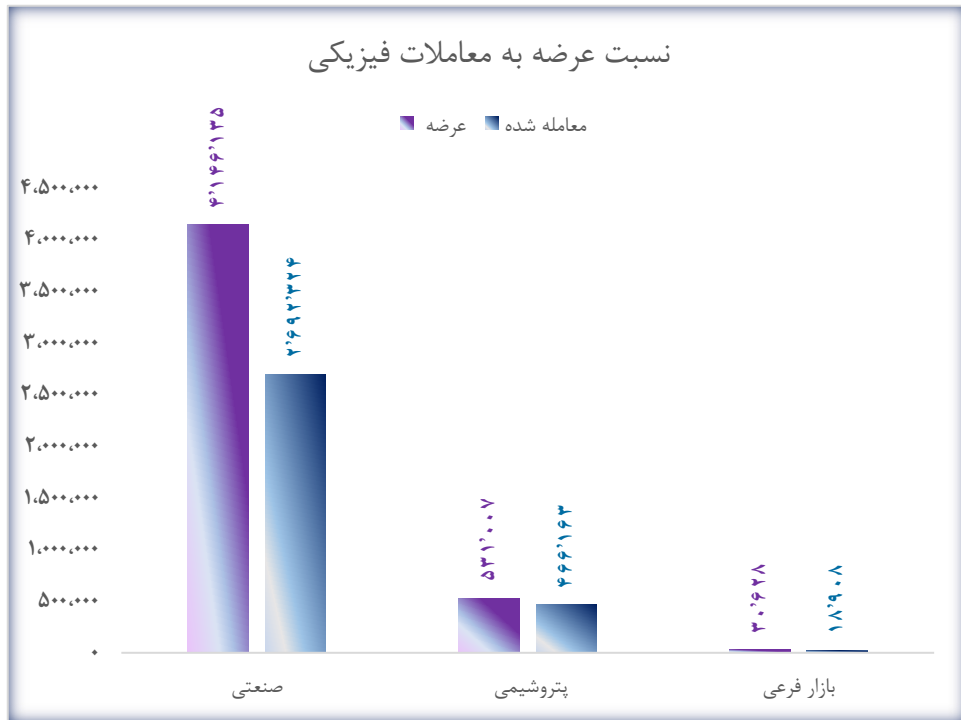


بورس کالا

بورس کالا

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروه‌های کالایی در بازار فیزیکی

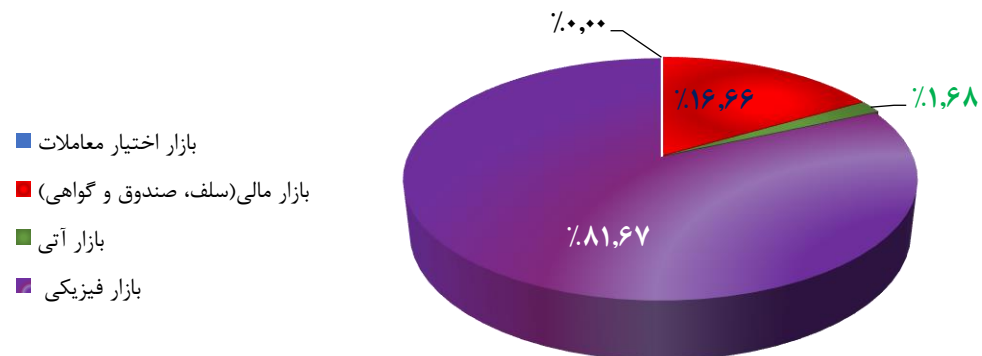
مهم ترین گروه ها	ارزش معاملات (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل (ارزش)	درصد از کل (حجم)
صنعتی	۱۹۸,۷۰۹,۷۶۸	۲,۶۹۲,۳۲۴	۶۶.۳۱٪	۸۴.۷۳٪
پتروشیمی و... نفتی	۹۷,۶۹۱,۵۲۳	۴۶۶,۱۶۳	۳۲.۶۰٪	۱۴.۶۷٪
بازار فرعی	۳,۲۵۲,۹۰۷	۱۸,۹۰۸	۱.۰۹٪	۰.۶۰٪
جمع	۲۹۹,۶۵۴,۱۹۸	۳,۱۷۷,۳۹۵	۱۰۰٪	۱۰۰٪



بیشترین نسبت عرضه به معاملات فیزیکی مربوط به گروه بازار فرعی معادل ۱/۶۲ می باشد. پس از آن این نسبت در گروه صنعتی معادل ۱/۵۴ و در گروه پتروشیمی معادل ۱/۱۴ می باشد.

در این هفته ۶۶/۳۱ درصد از ارزش معاملات در بازار فیزیکی مربوط به گروه کالاهای صنعتی بوده است که نسبت به هفته پیش ۰.۵۷٪ درصد کاهش یافته است. همچنین ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۴/۶۶ درصد و حجم معاملات ۱۸/۷ درصد کاهش پیدا کرده است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات هفتگی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۰۶





وضعیت بازار

ورود و خروج پول حقیقی

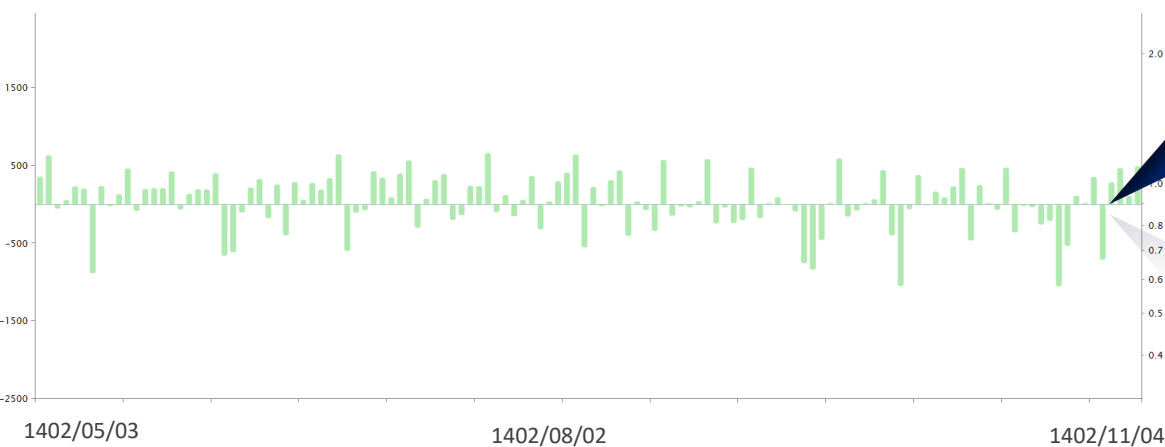
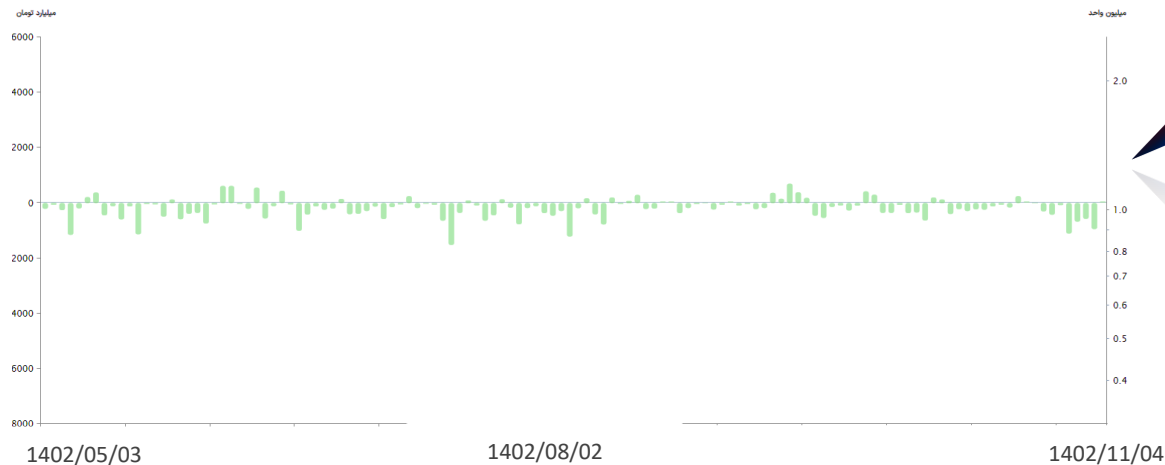
با توجه به نمودار بازار طی شش ماه گذشته ، غالباً شاهد خروج پول حقیقی از بازار بوده ایم.
بیشترین خالص ورود و خروج پول حقیقی از بازار طی هفته اخیر برای روز ۳۰ دی ماه به میزان **-۱,۱۰۷.۲۴** میلیارد تومان بوده است. جمع خالص ورود و خروج پول حقیقی هفتگی به بازار معادل **-۳,۲۷۴.۸۱** میلیارد تومان بوده است.

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 دلار بورس در تاریخ چهارم بهمن ۱۴۰۲، ۱۵۸/۳ میلیارد دلار می باشد، که نسبت به هفته پیش ۱۱ درصد کاهش داشته است. از ابتدای سال جاری شاهد کاهش ۵/۶ درصدی ارزش ریالی و کاهش ۱۸/۴ درصدی ارزش دلار 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

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



www.eii.co.ir



Ehtemam Iranian



ehtemam_iranian