



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

بازار سرمایه همچنان کم رقیق!

گزارش تحلیل بازارها-شماره ۱۱- هفته منتهی به تاریخ ۲۹-۱۰-۱۴۰۲
گروه تحلیل گران شرکت سرمایه گذاری 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
- ❖ سرمایه گذاری خارجی در پروژه های زیست محیطی
- ❖ آخرین وضعیت حمل کلا در 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

- سرمایه‌گذاری خارجی جدید در چین به کمترین سطح سه سال گذشته خود کاهش یافته است.
- بیتکوین به کمترین سطح یک ماه گذشته خود رسیده است، زیرا هیجانات مرتبط با صندوق‌های معاملات بورسی (ETF) کاهش یافته است.
- جدیدترین عضو ناتو - فنلاند - ۹۰ درصد آرا در این اتحاد پذیرفته شد.
- در پی تبادل درگیری میان ایران و پاکستان، مقامات دو کشور برای کاهش تنش‌ها اقداماتی را به عمل آورند.
- چین در حال خرید زمین‌های کشاورزی ایالات متحده است، اما مقدار آن مشخص نیست.
- اسرائیل از جهان، برای آزادی گروگان‌های اسرائیلی در غزه کمک می‌خواهد.
- هزاران نفر در اسلواکی در اعتراض به تلاش‌های نخست‌وزیر برای اصلاح و بازسازی قوه قضاییه تظاهرات کردند.
- حوثی‌ها به یک کشتی دیگر آمریکایی حمله کردند و در پی این حملات، ایالات متحده با شدت بیشتری با آنها مقابله کرد.
- کره شمالی در مقابل رزمایش مشترک آمریکا، ژاپن و کره جنوبی، یک سیستم تسلیحات اتمی زیر دریایی را آزمایش کرد.
- اتحادیه اروپا پیشنهاد بازسازی ۵ میلیارد دلاری صندوق کمک نظامی به اوکراین را مطرح کرده است.
- مجمع جهانی اقتصاد هیچ چیز عادی در مورد اقتصاد جهانی برای سال ۲۰۲۴ نمی‌بیند.
- اولین فضاورد ترک با موشک SpaceX به فضا پرواز کرد.

Bloomberg

بلومبرگ

- به دستور ایلان ماسک، استفاده از هوش مصنوعی در تسلا تا زمان کنترل نسبی متوقف خواهد شد.
- چین و رئیس‌جمهور جدید تایوان هم عقیده نیستند.
- شاخص S&P500 به دلیل انتظارات کاهش نرخ بهره به بالا ترین سطح تاریخی خود رسید.
- پل کروگمن اقتصاددان و دارنده نوبل اقتصاد می‌گوید چین وارد دوره‌ای از رکود خواهد شد که احتمالاً مانند ژاپن قابل حل نباشد.

BUSINESS
INSIDER

بیزینس اینسایدر

- فرستاده ایالات متحده، مذاکرات توافق بین اسرائیل و حزب الله را رهبری می‌کند اما به دلیل عدم اعتماد هر دو طرف، موانع بزرگی باقی مانده است.
- خطرات ژئوپلیتیکی بر خوش بینی اقتصادی در داوس^۱ سایه افکنده است. و بحث‌ها در مجمع جهانی اقتصاد بر جنگ‌های غزه و اوکراین و چشم انداز ریاست جمهوری ترامپ متمرکز شده است.
- کریسنوفر والر (رئیس فدرال رزرو) درباره تعجیل در کاهش نرخ بهره هشدار داد.
- قطر در قرارداد کمک‌های بشردوستانه بین حماس و اسرائیل میانجی‌گری می‌کند.
- طبق اعلام وزیر امور خارجه بریتانیا در رابطه با امور مهاجرت غیرقانونی، لایحه پناهندگی رواندا مجدداً رای‌گیری خواهد شد.

FT
FINANCIAL
TIMES

فایننشال تایمز

منبع	بازده	بازده	بازده	آخرین قیمت	عنوان	ردیف	
	سالانه	ماهانه	هفتگی				
بورس های جهانی							
TeleTrader	۱۳.۴۲%	۲.۱۴%	۰.۷۴%	واحد	۳۷,۸۵۳.۹۴	Dow Jones	۱
	۴۹.۰۱%	۴.۵۹%	۲.۸۶%	واحد	۱۷,۳۱۴.۰۱	Nasdaq	۲
	۲۱.۸۴%	۲.۹۷%	۱.۱۷%	واحد	۴,۸۳۶.۷۰	S & P ۵۰۰	۳
	-۳.۹۶%	-۲.۲۴%	-۱.۸۹%	واحد	۷,۴۸۵.۳۷	FTSE ۱۰۰	۴
	۱۰.۱۲%	-۱.۰۶%	-۰.۸۹%	واحد	۱۶,۵۵۵.۱۳	DAX	۵
	۵.۳۷%	-۲.۷۹%	-۱.۲۵%	واحد	۷,۳۷۱.۶۴	CAC ۴۰	۶
	۳۵.۴۴%	۶.۷۹%	۱.۰۹%	واحد	۳۵,۹۶۳.۲۷	NIKKEI ۲۲۵	۷
	-۱۳.۲۵%	-۲.۴۱%	-۱.۷۲%	واحد	۲,۸۳۲.۲۸	SHANGHAI	۸
	۴۶.۱۴%	۱.۹۹%	-۰.۵۹%	واحد	۳,۱۶۶.۰۰	Moex	۹
نفت و انرژی							
TeleTrader	-۹.۹۵%	-۱.۰۸%	۰.۶۵%	دلار / بشکه	۷۸.۸۰	نفت خام برنت	۱۰
	-۹.۴۹%	۵.۳۳%	-۱.۳۹%	دلار / بشکه	۷۲.۹۱	نفت خام WTI	۱۱
tradingeconomics	-۱۶.۹۱%	۷.۲۷%	-۲۴.۰۱%	دلار / MMBtu	۲.۵۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۱۲
OilPrice	-۳.۴۸%	۱.۱۷%	-۰.۹۹%	دلار / بشکه	۷۹.۳۹	سبب اوپک	۱۳
	-۶.۵۹%	-۳.۹۴%	-۰.۷۱%	دلار / بشکه	۷۵.۸۱	نفت سنگین ایران	۱۴
tradingeconomics	-۲۲.۴۴%	-۱.۶۲%	۲.۴۱%	دلار / گالن	۲.۱۷	گازوئیل	۱۵
	۲۸.۱۷%	-۴.۳۰%	۰.۴۷%	دلار / گالن	۱.۵۹	اتانول	۱۶
	-۸.۵۰%	-۰.۸۹%	۰.۵۹%	دلار / تن	۶۲۹.۸۲	نفتا	۱۷
PLATTS	-۱۵.۲۳%	-۱.۰۴%	۰.۰۰%	دلار / تن	۲۸۵.۰۰	متانول CFR (چین)	۱۸

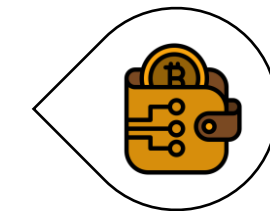
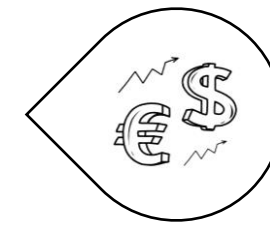
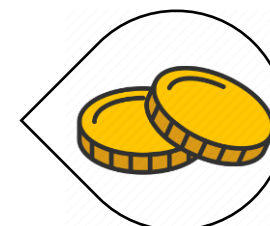
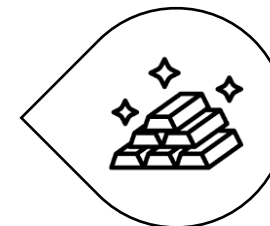
تعریف واحد MMBtu

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	بازده	بازده	آخرین قیمت	عنوان	ردیف
	سالانه	ماهانه	هفتگی			
فلزات گرانبها						
TeleTrader	۵.۳۴%	۰.۰۱%	-۰.۹۴%	دلار / اونس	۲,۰۲۹.۴۸	۱ طلا
	-۵.۵۹%	-۶.۳۰%	-۲.۴۱%	دلار / اونس	۲۲.۶۱	۲ نقره
طلا و سکه (داخلی)						
tgju.org	۳۲.۵۰%	۹.۷۸%	۰.۰۹%	ریال	۲۶,۹۴۴,۰۰۰	۳ یک گرم طلای ۱۸ عیار
	۳۴.۲۶%	۹.۶۸%	-۴.۶۸%	ریال	۳۱۷,۵۱۰,۰۰۰	۴ سکه امامی
	۲۹.۲۵%	۱۲.۰۱%	-۲.۳۸%	ریال	۲۸۶,۹۰۰,۰۰۰	۵ سکه بهار آزادی
	۳۰.۳۶%	۱۶.۷۰%	-۴.۲۶%	ریال	۱۷۹,۹۰۰,۰۰۰	۶ نیم سکه
	۱۵.۷۴%	۵.۷۲%	-۷.۵۷%	ریال	۱۰۹,۹۵۰,۰۰۰	۷ ربع سکه
	۵۳.۶۲%	۸.۵۰%	-۵.۱۰%	ریال	۳,۱۶۵,۰۰۰	۸ تمام سکه رفاه (بورس)
ارز						
tgju.org	۲۷.۸۴%	۷.۴۲%	۲.۵۷%	ریال	۵۳۶,۹۶۰	۹ دلار آزاد
	۲۶.۷۶%	۶.۹۱%	۲.۲۹%	ریال	۵۸۷,۵۵۰	۱۰ یورو آزاد
رمز ارز						
tgju.org	۹۰.۲۰%	-۴.۲۷%	-۲.۷۶%	دلار	۴۱,۵۹۵.۹۲	۱۱ بیت کوین
	۵۲.۳۱%	۹.۳۵%	-۳.۴۷%	دلار	۲,۴۸۰.۰۹	۱۲ اتریوم
شاخص های داخلی ۲۷ دی						
shakhesban	۰.۳۰%	-۰.۰۱%	۰.۰۱%	واحد	۲,۱۸۵,۹۷۷.۳۷	۱۳ شاخص کل بورس
	۰.۴۶%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	واحد	۷۶۳,۲۱۱.۵۵	۱۴ شاخص کل بورس (هم وزن)
	۰.۲۳%	-۰.۰۱%	۰.۰۰%	واحد	۲۶,۲۷۵.۱۴	۱۵ شاخص کل فرابورس



منبع	بازده	بازده	بازده	معادل	آخرین قیمت	عنوان	ردیف		
	سالانه	ماهانه	هفتگی						
محصولات کشاورزی									
TeleTrader	-۲۵.۹۵%	-۵.۳۲%	-۰.۷۸%	دلار / تن	۱۹۰	دلار / بوشل	۴۴۵.۲۵	ذرت (خارجی)	۱
	-۰.۴۷%	۵.۷۵%	۳.۳۴%	دلار / تن	۱۸۶۰	دلار / پوند	۸۳.۸۹	کتان (پنبه)	۲
	-۹.۹۴%	-۷.۷۹%	-۱.۰۰%	دلار / تن	۴۷۷	دلار / بوشل	۱,۲۱۴.۰۰	سویا	۳
	۳۱.۹۹%	۱۲.۸۴%	۸.۹۲%	دلار / تن	۶۰۳	دلار / پوند	۲۳.۵۶	شکر	۴
	-۲۴.۴۰%	-۲.۹۴%	-۰.۶۳%	دلار / تن	۲۱۱	دلار / بوشل	۵۹۳.۲۵	گندم	۵
	۱.۳۵%	-۷۲.۰۰%	۱.۹۷%	دلار / تن	۱۴۷	دلار / بوشل	۳۷۶.۰۱	جو	۶
TradingEconomics	-۲۲.۷۱%	-۳.۰۹%	۱.۶۷%	دلار / تن	۴۹۵	دلار کانادا / تن	۶۲۸.۳۰	کانولا	۷
کالاهای صنعتی									
tgju.org	-۱۰.۲۱%	-۲.۲۰%	۱.۰۵%			دلار / تن	۸,۳۸۷.۰۰	مس	۸
TradingEconomics	-۲.۶۷%	۱.۲۰%	۱.۴۲%	دلار / تن	۵۷۳	یوان / تن	۳,۷۱۸.۰۰	قیر	۹
	-۵.۹۹%	۰.۴۹%	۱.۵۷%	دلار / تن	۵۴۸	یوان / تن	۳,۸۷۸.۰۰	فولاد (جهانی)	۱۰
	-۱۶.۵۷%	-۲.۸۱%	-۱.۸۷%			دلار / تن	۲,۱۷۸.۰۰	آلومینیوم	۱۱
	-۴.۳۶%	۱.۰۵%	-۰.۸۱%			دلار / تن	۲,۰۵۰.۵۰	سرب	۱۲
	-۲۷.۷۰%	-۳.۸۹%	-۱.۶۳%			دلار / تن	۲,۴۷۳.۰۰	روی	۱۳
	۳.۶۱%	-۴.۴۴%	-۵.۸۴%			دلار / تن	۱۲۹.۰۰	سنگ آهن	۱۴
شاخص های کالایی									
TradingEconomics	۹۶.۹۹%	-۳۰.۰۹%	۲.۹۵%			واحد	۱,۵۰۳.۰۰	بالتیک خشک	۱۵
	۰.۴۰%	۰.۰۶%	۰.۴۸%			واحد	۳۰۴.۱۱	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۱۶
	-۱۷.۰۹%	-۳.۱۹%	-۱.۰۷%			واحد	۳,۶۰۴.۸۰	شاخص بورس فلزات در لندن (LME)	۱۷
	-۳.۱۰%	-۰.۲۷%	۰.۸۸%			واحد	۳,۳۹۸.۷۲	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.

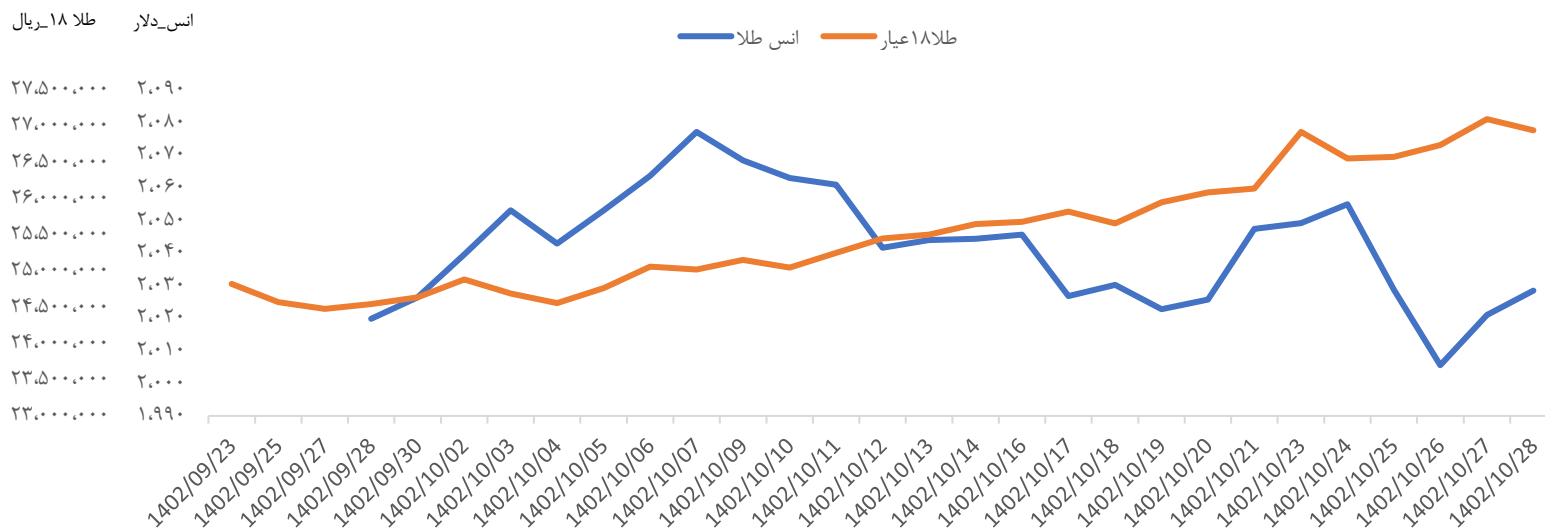
LME

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

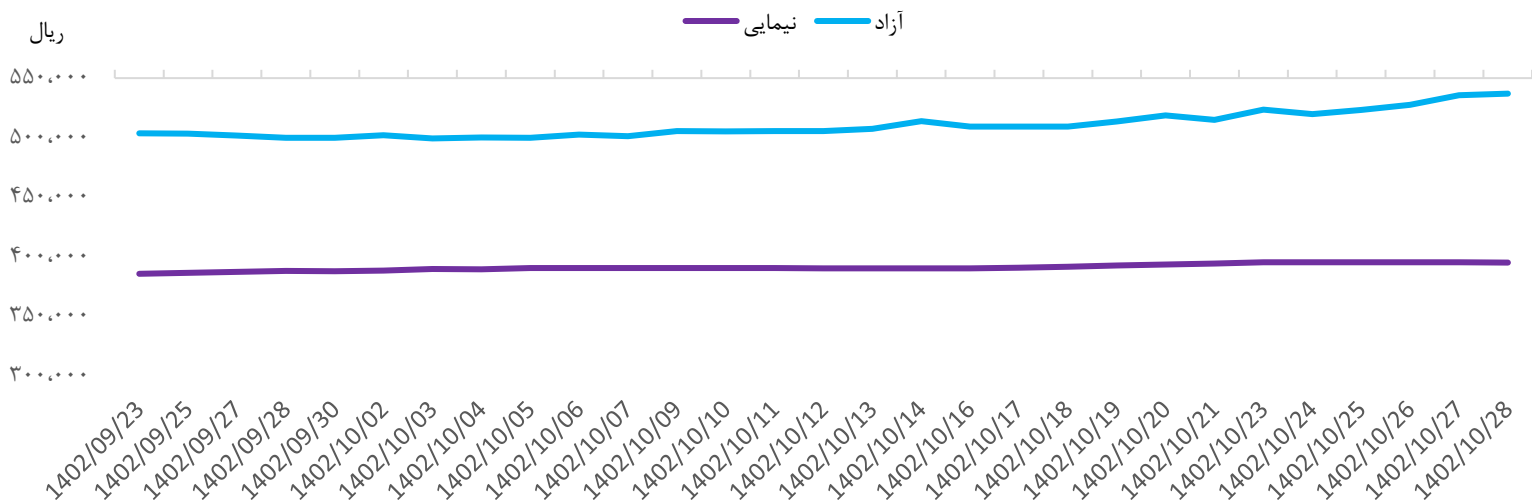


اقتصاد

انس و طلای ۱۸ عیار



دلار آزاد و نیمایی



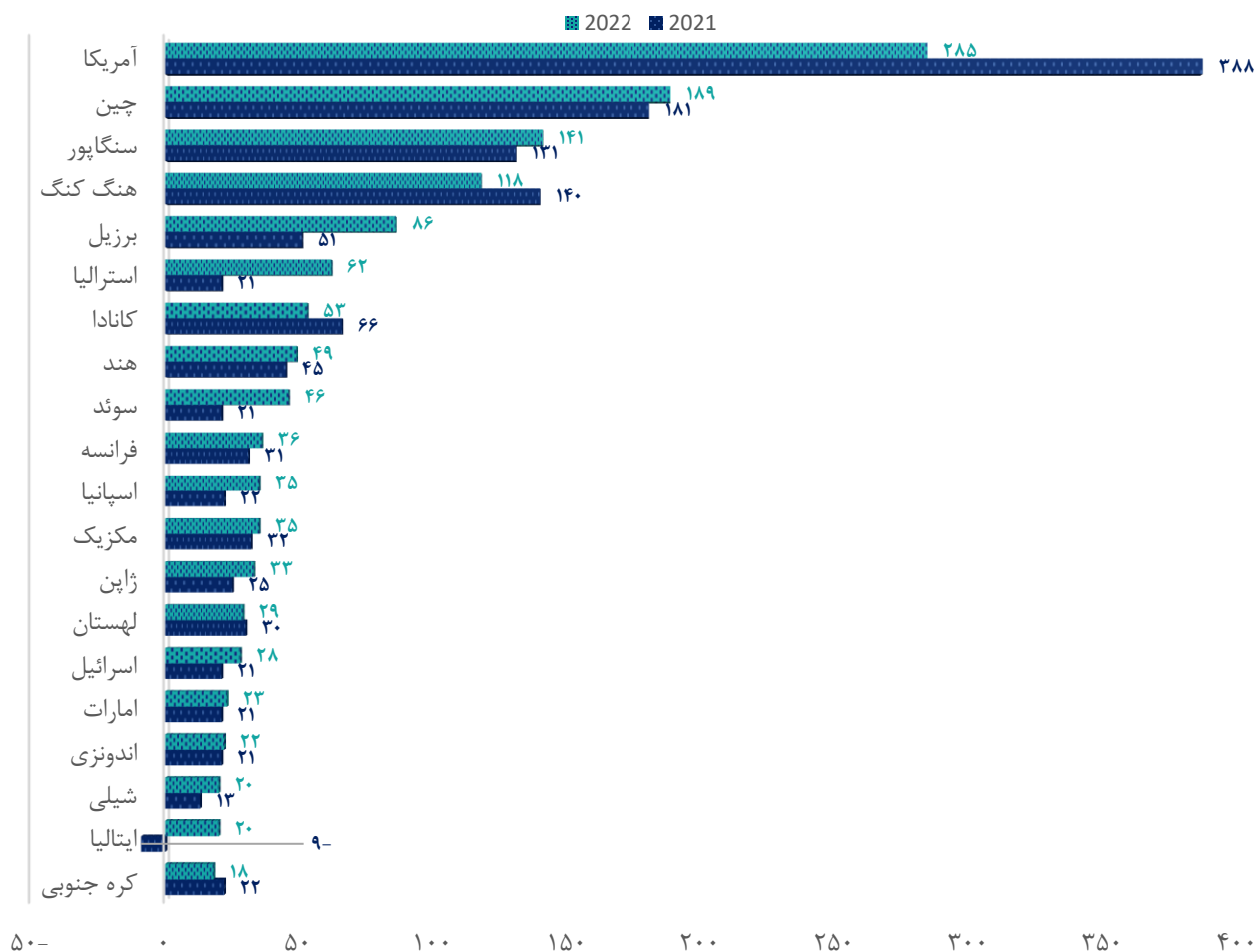
آخرین وضعیت طلا و دلار

- در هفته گذشته روند قیمت انس طلا نوسانی بوده و در مجموع نسبت به هفته گذشته افت ناچیزی داشته است.
- هر گرم طلای ۱۸ عیار در آخرین روز هفته به نرخ ۲۶۹۴،۴۰۰ تومان معامله شد و نسبت به هفته قبل ۳/۰۸ درصد افزایش داشته است. این امر بدین دلیل است که در بازار ایران طلای ۱۸ عیار همبستگی بیش تری با تغییرات دلار دارد تا انس جهانی.

- روند قیمت بازار دلار نیمایی نسبت به هفته گذشته بلا تغییر و قیمت دلار آزاد ۴/۲۶ درصد افزایش یافته است.

سرمایه گذاری خارجی در پروژه های زیست محیطی

بیشترین کشور برتر در جذب سرمایه خارجی ۲۰۲۱ و ۲۰۲۲



منظور از سرمایه گذاری مستقیم خارجی ، سرمایه گذاری توسط فرد ، شرکت و یا دولت سایر کشور ها در یک کشور دیگر(میزبان) می باشد .

مقصود از کشور میزبان، کشوری است که در آن شرکتی با ملیت خارجی مستقر است و به فعالیت تجاری می پردازد. بدین ترتیب کشور میزبان با ایجاد مشاغل جدید، مهارت های جدید و همچنین فناوری های به روز منتفع خواهد شد؛ و زمانی که هزینه های تولید در کشور میزبان افزایش می یابد، شرکت خارجی می تواند به راحتی فعالیت های خود را به کشور دیگری منتقل کند.

نمایه روبرو به طور مشخص سرمایه گذاری خارجی در پروژه های سبز را برای دو سال ۲۰۲۱ و ۲۰۲۲ نمایش می دهد:

در اکثر مناطق دنیا به جز ایالات متحده ، هنگ کنگ ، کره جنوبی و کانادا روند این سرمایه گذاری ها افزایشی بوده است و بیشترین رشد مربوط به جنوب آسیا بوده است.

در اتحادیه اروپا، تعداد پروژه ها، به دلیل افزایش قابل توجه در ایتالیا و اسپانیا (۱۰ درصد)، ۲۷ درصد افزایش یافته است .

علی رغم کاهش ۳۶ درصدی جریان نقدی خارجی ، ایالات متحده همچنان بزرگترین میزبان برای پروژه های سبز می باشد و پس از آن چین، سنگاپور و هنگ کنگ در رتبه های دوم تا چهارم قرار دارند.

آخرین وضعیت حمل کالا در دریای سرخ

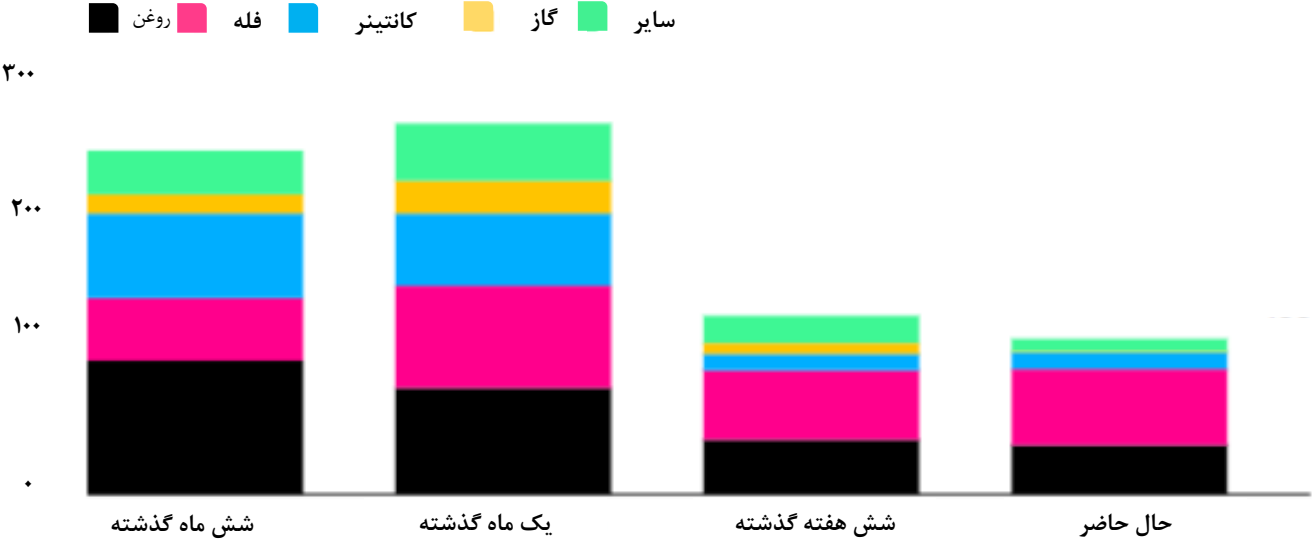
پس از حمله شبه نظامیان حوثی ، تعداد زیادی از کشتی های تجاری از مسیر جنوب دریای سرخ تردد می کنند.

پس از بمباران نقاطی در یمن توسط بریتانیا و ایالات متحده جهت فرونشاندن حملات شبه نظامیان حوثی به کشتی های تجاری ، ناوگان دریایی بریتانیا و ایالات متحده به کشتی های تجاری توصیه کردند که همچنان از تردد در منطقه باب المندب اجتناب نمایند. به دنبال این توصیه تعداد زیادی از کشتی ها از مسیر جنوب دریای سرخ عبور می کند.

داده های بلومبرگ نشان می دهد که پس از بمباران یمن توسط بریتانیا و ایالات متحده، تعداد عبور و مرور از باب المندب در مقایسه با دوره مشابه یک ماه قبل، بیش از ۵۰ درصد کاهش یافته است.

داده ها نشان می دهد که ۱۱۴ کشتی از جمله تانکرهای نفت، کشتی های فله بر و کشتی های کانتینری ، همچنان از طریق این تنگه به دریای سرخ عبور راه می یابند. این در حالی است که ، در مدت مشابه یک ماه قبل و شش ماه گذشته به ترتیب از این تنگه ۲۷۲ کشتی و ۲۵۲ کشتی عبور می کرده است.

تعداد کشتی هایی که از تنگه باب المندب عبور کرده اند

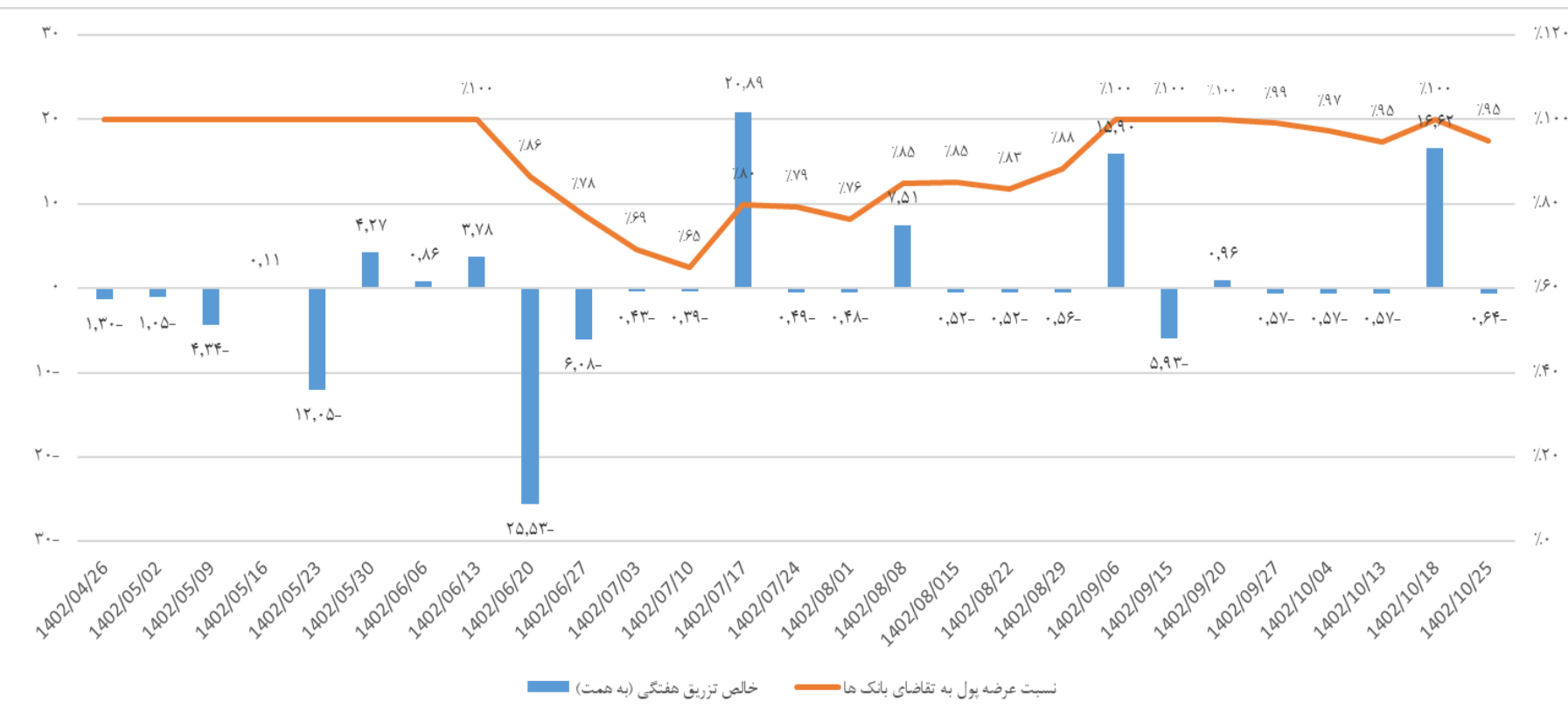


سیاست های پولی بانک مرکزی

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 ۹۴.۹۷٪ تقاضای پول بانک پاسخ مثبت داد که از لحاظ نسبی ۵.۰۳٪ 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 که نشان دهنده تغییر روند سیاست انقباضی هستیم اما این موضوع به صورت آرامی در حال صورت گرفتن می‌باشد.





بازار سرمایه

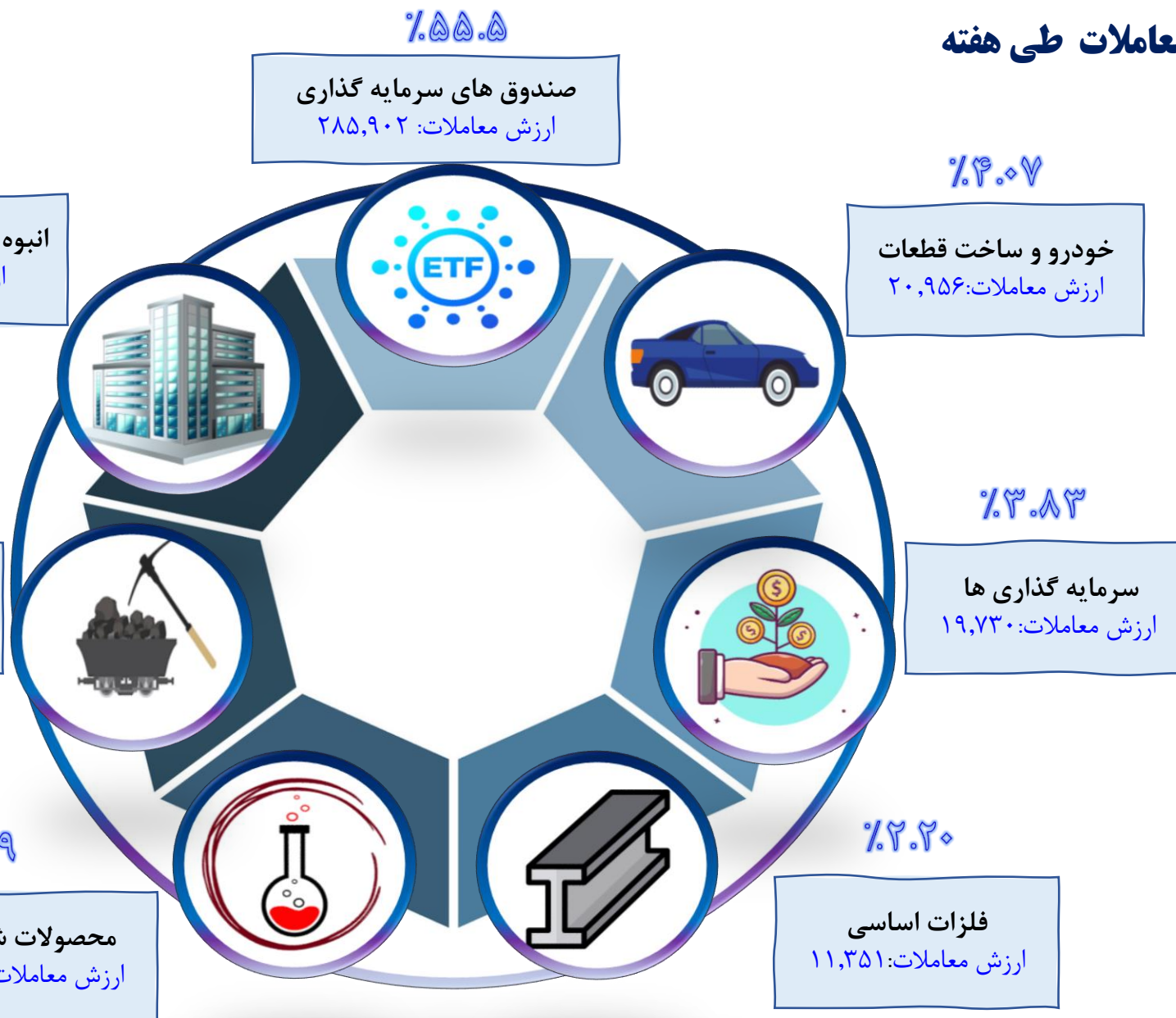
اخبار تأثیر گذار هفته گذشته

- ❖ بورس کالا در واکنش به تصمیم روز دوشنبه بانک مرکزی با صدور اطلاعیه‌ای تأکید کرد: معاملات بازارهای اوراق بهادار مبتنی بر طلا صرفاً در قالب قوانین و مقررات بازار سرمایه اجرایی می‌شود، هم چنین معاملات بازارهای اوراق بهادار مبتنی بر طلا با موافقت قبلی بانک مرکزی صورت می‌پذیرد. در ضمن تمام طلاهای موجود در انبارهای بورسی دارای شناسنامه و تایید مالکیت بوده و و انجام هرگونه سوء استفاده جهت قاچاق کالا در این بازار غیرممکن است. پس از انتشار این اعلامیه‌ها، شورای عالی بورس با فعالیت هرگونه بازار طلا خارج از بورس مخالفت کرده و مراتب را به بانک مرکزی اعلام کرده است.
- ❖ عوارض صادراتی ۰/۵ درصدی زعفران از قانون بودجه حذف شد.
- ❖ یارانه نقدی برای سال بعد افزایش پیدا نمی‌کند.
- ❖ سخنگوی شورای نگهبان گفت: مصوبه افزایش سن بازنشستگی در بررسی‌های صورت گرفته مخالف موازین شرع و قانون اساسی شناخته نشد و مورد تایید قرار گرفت.
- ❖ رئیس اداره امور کارگزاران سازمان بورس و اوراق بهادار اظهار داشت: مطابق مصوبه هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار برای کارگزاری‌هایی که تا کنون نتوانستند الزامات دستورالعمل صدور مجوز تأسیس و فعالیت کارگزاری را انجام دهند، محدودیت‌های عملکردی اعمال می‌شود.
- ❖ رئیس سازمان خصوصی سازی: عرضه ۴۵ فقره از امالک مزاد دولتی در دستور کار قرار گرفته است.
- ❖ وزیر صمت: مشکلی در خصوص واردات خودروهای دست دوم به کشور نداریم و این امر به زودی اجرا می‌شود.
- ❖ نخستین حراج حضوری شمش طلا از روز چهارشنبه در مرکز مبادله ارز و طلای ایران آغاز شد.
- ❖ طبق مصوبه کمیسیون تلفیق، مالیات‌های واحد‌های تولیدی در سال ۱۴۰۳ از ۲۵ درصد به ۱۸ درصد کاهش یافت.
- ❖ در هفته منتهی به ۲۷ دی ۱۴۰۲، نرخ بهره بانکی به ۲۳.۴۹ درصد رسید.



هفت گروه با بیشترین ارزش معاملات طی هفته

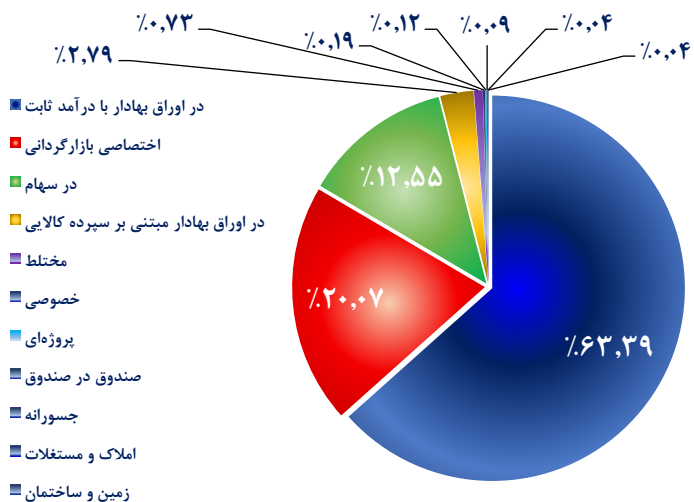
طبق نمایه رو به رو هفت گروه بورسی با بیشترین ارزش معاملات به شرح مقابل می باشند. صندوق های سرمایه گذاری با بالا ترین ارزش معاملات معادل ۲۸۵,۹۰۲ میلیارد ریال ، ۵۵/۵۰ درصد از کل ارزش معاملات طی هفته را به خود اختصاص دادند. پس از آن به ترتیب: انبوه سازی ، املاک و مستغلات، خودرو و ساخت قطعات، سرمایه گذاری ها، محصولات شیمیایی، استخراج کانه های فلزی، و فلزات اساسی 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	۵,۶۸۴,۲۱۷	۱۴۰	۰.۳۹%	۶.۲۵%	۴۲.۶۳%	۴۸.۱۰%	۰.۰۶%	۰.۴۳%	۱.۹۵%	۵.۶۱%	۱۰.۸۳%	۲۰.۶۳%	۱۶۱.۱۱%
اختصاصی بازارگردانی	۱,۷۹۹,۶۶۴	۱۰۰	۱.۷۸%	۷۱.۲۰%	۴.۳۸%	۱.۹۹%	-۰.۵۱%	۰.۰۷%	۰.۲۵%	۶.۲۴%	۰.۸۵%	۳۹.۰۶%	۲۰۸.۶۸%
در سهام	۱,۱۲۵,۰۰۶	۱۲۵	۰.۱۰%	۹۲.۳۷%	۴.۷۵%	۱.۲۵%	-۰.۳۲%	۱.۲۲%	۱.۱۳%	۹.۰۲%	۷.۲۶%	۳۰.۱۸%	۴۹۸۶.۲۶%
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۲۵۰,۰۸۴	۱۵	۰.۱۹%	۱۹.۲۷%	۲.۷۱%	۱%	۰.۳۱%	۳.۵۵%	۸.۷۷%	۹.۴۸%	۱۴.۷۲%	۳۹.۰۹%	۱۳۳۹.۸۱%
مختلط	۶۵,۱۱۴	۲۶	۰.۰۶%	۵۸.۴۴%	۲۲.۳۰%	۱۸.۱۷%	-۰.۴۰%	۰.۲۵%	۰.۶۵%	۵.۴۸%	۴.۹۵%	۳۱.۳۱%	۱۶۳۱.۹۸%
خصوصی	۱۶,۷۷۷	۵	۰.۰۰%	۷.۷۶%	۱۴.۴۹%	۶.۲۵%	-۰.۰۵%	-۰.۱۸%	۰.۴۵%	۳.۶۹%	۱۲.۷۳%	۴.۷۸%	۱۳.۹۳%
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	۸,۱۹۴	۴	۰.۰۲%	۰.۰۰%	۱.۰۹%	۰.۰۰%	-۰.۰۸%	۱.۳۱%	۲.۱۵%	۸.۸۸%	۹.۱۳%	۳۷.۳۱%	۸۱.۷۱%
جسورانه	۳,۶۶۵	۱۶	۰.۰۲%	۰.۰۰%	۳۵.۱۷%	۱۰.۹۳%	۰.۰۲%	۰.۰۴%	۰.۹۹%	-۳.۲۱%	۳.۶۲%	۲۸.۴۰%	۱۳۳.۹۶%
املاک و مستغلات	۳,۳۷۲	۲	۰.۵۷%	۱۹.۷۳%	۲۳.۶۲%	۰%	-۰.۰۶%	۰.۰۶%	۰.۶۸%	۳.۳۳%	۰.۸۸%	۱.۶۶%	۵.۳۶%
زمین و ساختمان		۴								----	----	----	----
مجموع ارزش خالص دارایی‌ها:	۸,۹۶۶,۹۹۲	۴۳۸											



نمودار صندوق‌ها بر مبنای NAV

صندوق‌های سرمایه‌گذاری در مجموع برابر ۴۳۸ عدد می‌باشند. که از این تعداد ۱۷۳ صندوق قابل معامله و ۲۶۵ صندوق صدور و ابطالی می‌باشند.

در هفته منتهی به نهم دی ۱۴۰۲ بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت، صندوق در صندوق، در سهام، مختلط، سپرده کالایی، اختصاصی بازارگردانی، جسورانه و املاک و مستغلات مثبت بودند؛ هم چنین

بازده صندوق خصوصی منفی؛

و بازدهی صندوق پروژه‌ای صفر بود.

درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های سپرده کالایی با ۳/۵۵ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های خصوصی با ۰/۱۸- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۶۳/۳۹ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۲۰/۰۷ درصد و سهامی با ۱۲/۵۵ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

بررسی وضعیت بازار بدهی منتهی به تاریخ ۲۷ 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 ۲۹/۴۳ و ۳۸/۴۴ درصد بود. همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده متعلق به نماد اخزا ۰۰۴ با سررسید ۱۴۰۳/۰۸/۱۴ و بازدهی‌های ۲۸/۹۴ و ۲۷/۳۵ درصد بود.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخرزا ۲۰۲	۴۷۴,۱۱۰	۱۴۰۲-۱۰-۲۷	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۲۹.۴۳٪	۳۸.۴۴٪
اخرزا ۰۰۴	۸۵۶,۳۷۰	۱۴۰۲-۱۰-۲۷	۱۴۰۳-۰۸-۱۴	۲۸.۹۴٪	۲۷.۳۵٪

اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر بیشترین بازدهی متعلق به اراد ۱۲۶ به میزان ۲۸/۱۶ درصد با سررسید ۱۴۰۳/۱۲/۲۳ و کمترین بازدهی متعلق به نماد طب نوین ۰۵ به میزان ۱۹/۲۴ درصد با سررسید ۱۴۰۳/۰۹/۱۲ بوده است. صکوک مباحه دولتی اراد ۱۲۶ به منظور تأمین نقدینگی مورد نیاز برای خرید کالاها و خدمات مورد نیاز دستگاه‌های اجرایی برای هزینه‌های عمرانی قانون بودجه سال ۱۴۰۱ کل کشور، توسط وزارت امور اقتصادی و دارایی منتشر شده است. صکوک مباحه طب پلاستیک نوین به منظور تأمین سرمایه در گردش مورد نیاز منظور خرید مواد اولیه مورد نیاز شرکت منتشر شده است.

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	تاریخ سررسید	YTM	ضامن	متعهد پذیره نویس
اراد ۱۲۶	۹۲۱,۳۰۰	۱۴۰۲-۱۰-۲۷	۱۴۰۳-۱۲-۲۳	۲۸.۱۶٪	سازمان برنامه و بودجه کل کشور	فاقد متعهدپذیره نویس
طب نوین ۰۵	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۴۰۲-۱۰-۲۷	۱۴۰۳-۰۹-۱۲	۱۹.۲۴٪	بانک صنعت و معدن	فاقد متعهدپذیره نویس

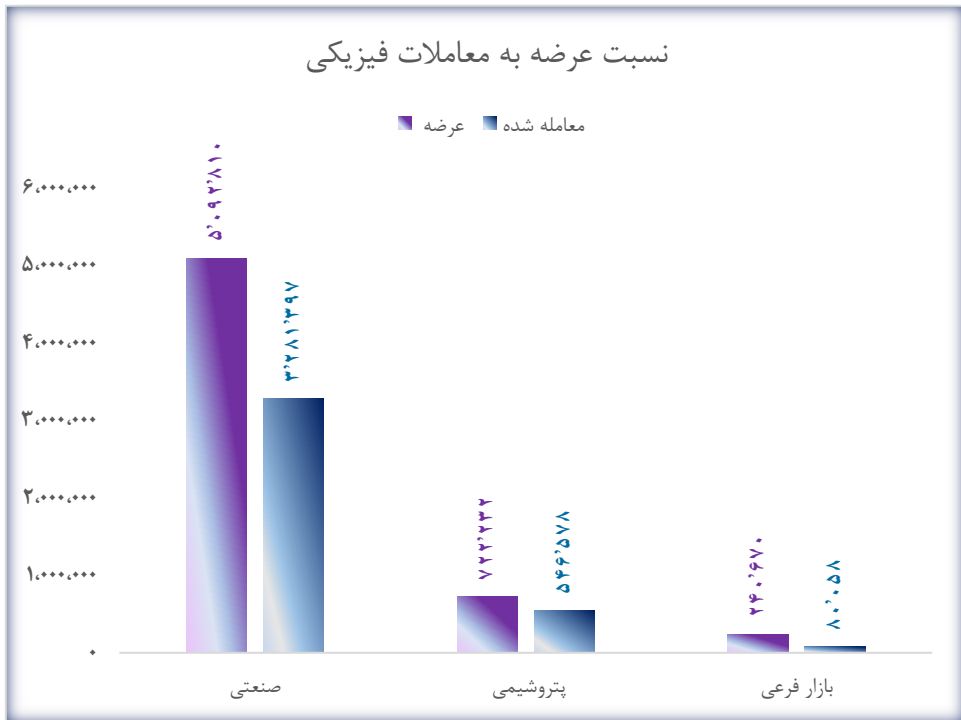


بورس کالا

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	۱۹۹,۸۴۶,۵۲۰	۳,۲۸۱,۳۹۷	۶۳.۵۹%	۸۳.۹۷%
پتروشیمی و... نفتی	۱۰۸,۰۱۴,۵۲۸	۵۴۶,۵۷۸	۳۴.۳۷%	۱۳.۹۹%
اموال غیر منقول	.	.	۰.۰۰%	۰.۰۰%
بازار فرعی	۶,۴۳۴,۳۹۹	۸۰,۰۵۸	۲.۰۵%	۲.۰۵%
جمع	۳۱۴,۲۹۵,۴۴۷	۳,۹۰۸,۰۳۳	۱۰۰%	۱۰۰%

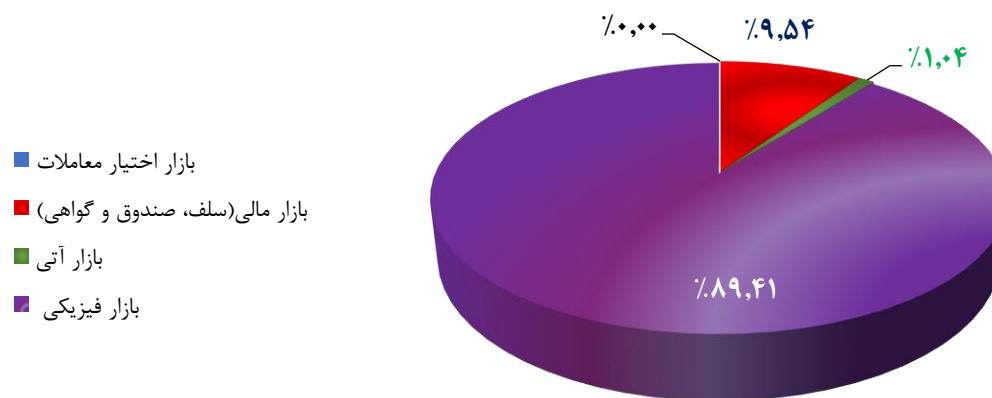


بیشترین نسبت عرضه به معاملات فیزیکی مربوط به گروه بازار فرعی معادل ۳/۰۱ می باشد. پس از آن این نسبت در گروه صنعتی معادل ۱/۵۵ و در گروه پتروشیمی معادل ۱/۳۲ می باشد.

در این هفته ۶۳/۵۹ درصد از ارزش معاملات در بازار فیزیکی مربوط به گروه کالاهای صنعتی بوده است که نسبت به هفته پیش ۲۲/۰۵ درصد کاهش یافته است.

همچنین ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۱۴/۰۴ درصد کاهش و حجم معاملات ۱۹/۳۶ درصد افزایش پیدا کرده است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات هفتگی منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۲۹





وضعیت بازار

ورود و خروج پول حقیقی

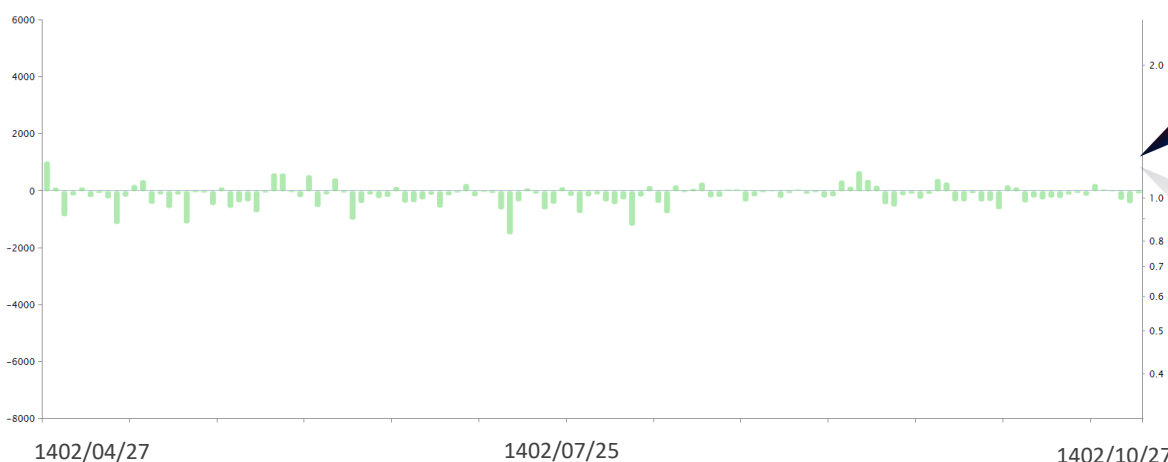
با توجه به نمودار بازار طی شش ماه گذشته ، غالباً شاهد خروج پول حقیقی از بازار بوده ایم.
بیشترین خالص ورود و خروج پول حقیقی از بازار طی هفته اخیر برای روز ۲۶ دی ماه به میزان **-۴۲۶.۷۶** میلیارد تومان بوده است. جمع خالص ورود و خروج پول حقیقی هفتگی به بازار معادل **-۷۹۵.۷۶** میلیارد تومان بوده است.

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

میلیون واحد

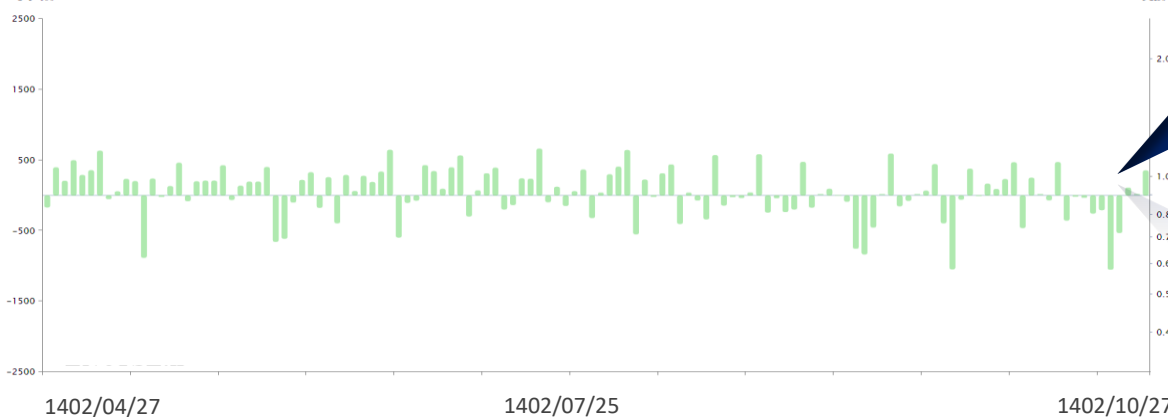
میلیارد تومان



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

میلیون واحد

میلیارد تومان



ارزش بازار بورس (ریالی و دلاری)



ارزش بازار بورس (ریالی و دلاری)

ارزش دلار بازار بورس در تاریخ بیست و هفتم دی ماه ۱۴۰۲، ۱۷۷/۹ میلیارد دلار می باشد، که نسبت به هفته پیش ۱/۸ درصد کاهش داشته است. از ابتدای سال جاری شاهد افزایش ۱/۸ درصدی ارزش ریالی و کاهش ۸/۳ 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