

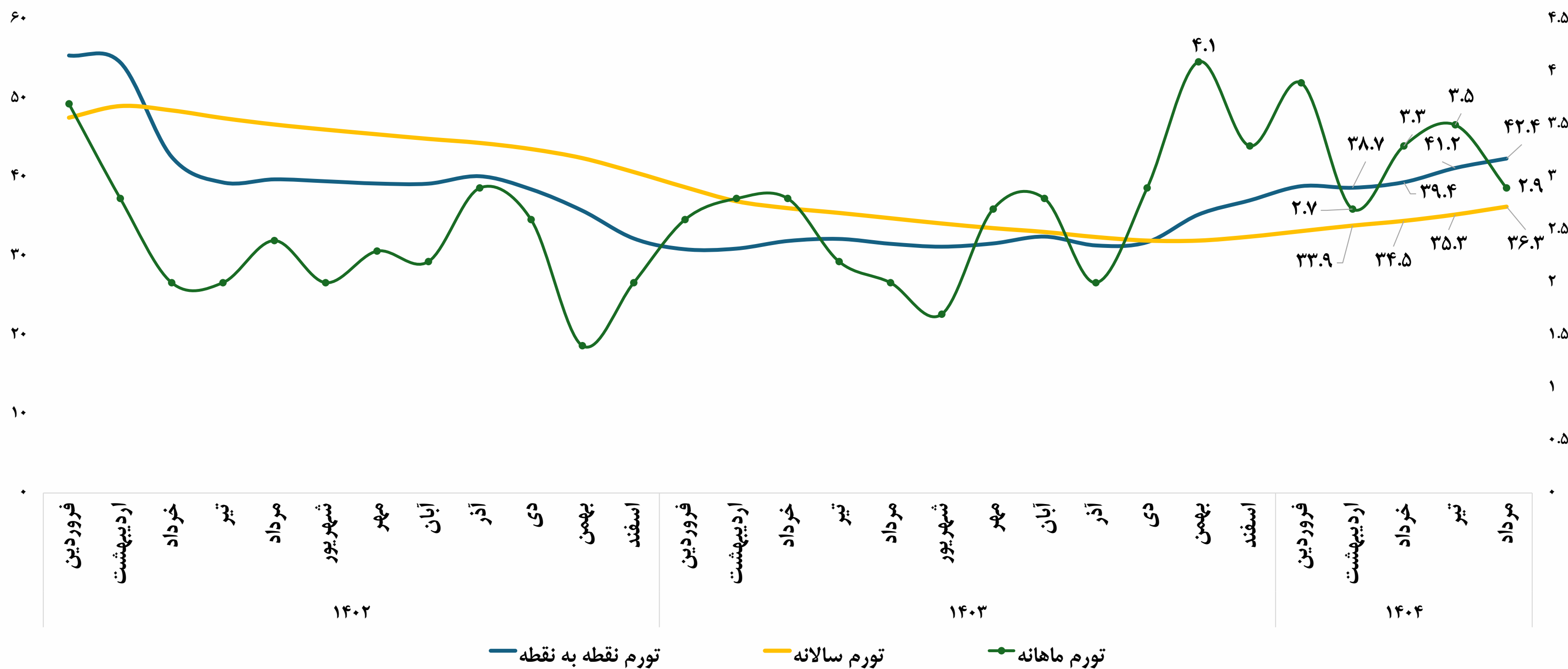
تامین سرمایه امین



بررسی شرایط بازار سرمایہ

۱۵ شهریور
۱۴۰۴

نرخ تورم

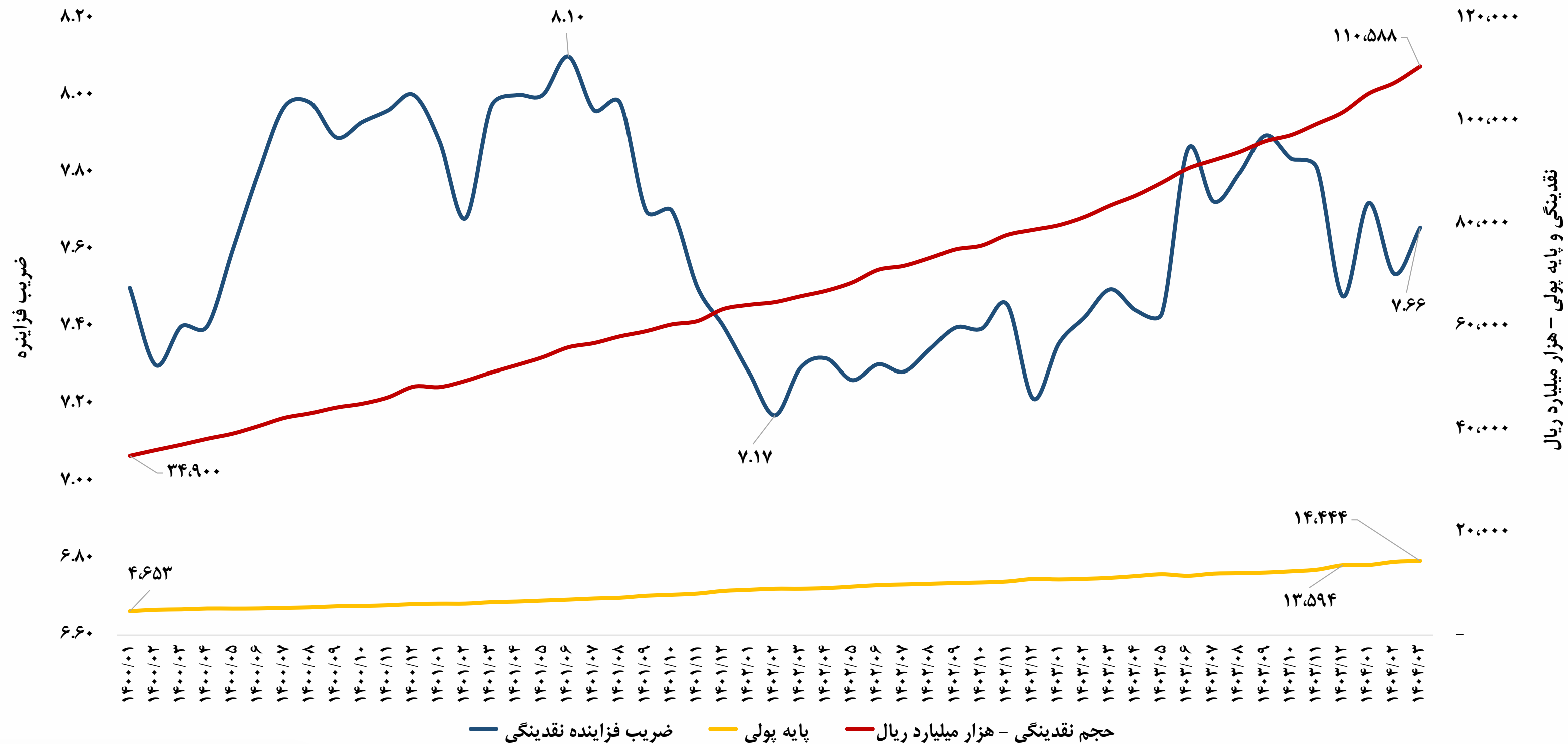


تورم نقطه به نقطه

تورم سالانه

تورم ماهانه

رشد حجم نقدینگی و پایه پولی و ضریب فزاینده



نقدینگی و پایه پولی - هزار میلیارد ریال

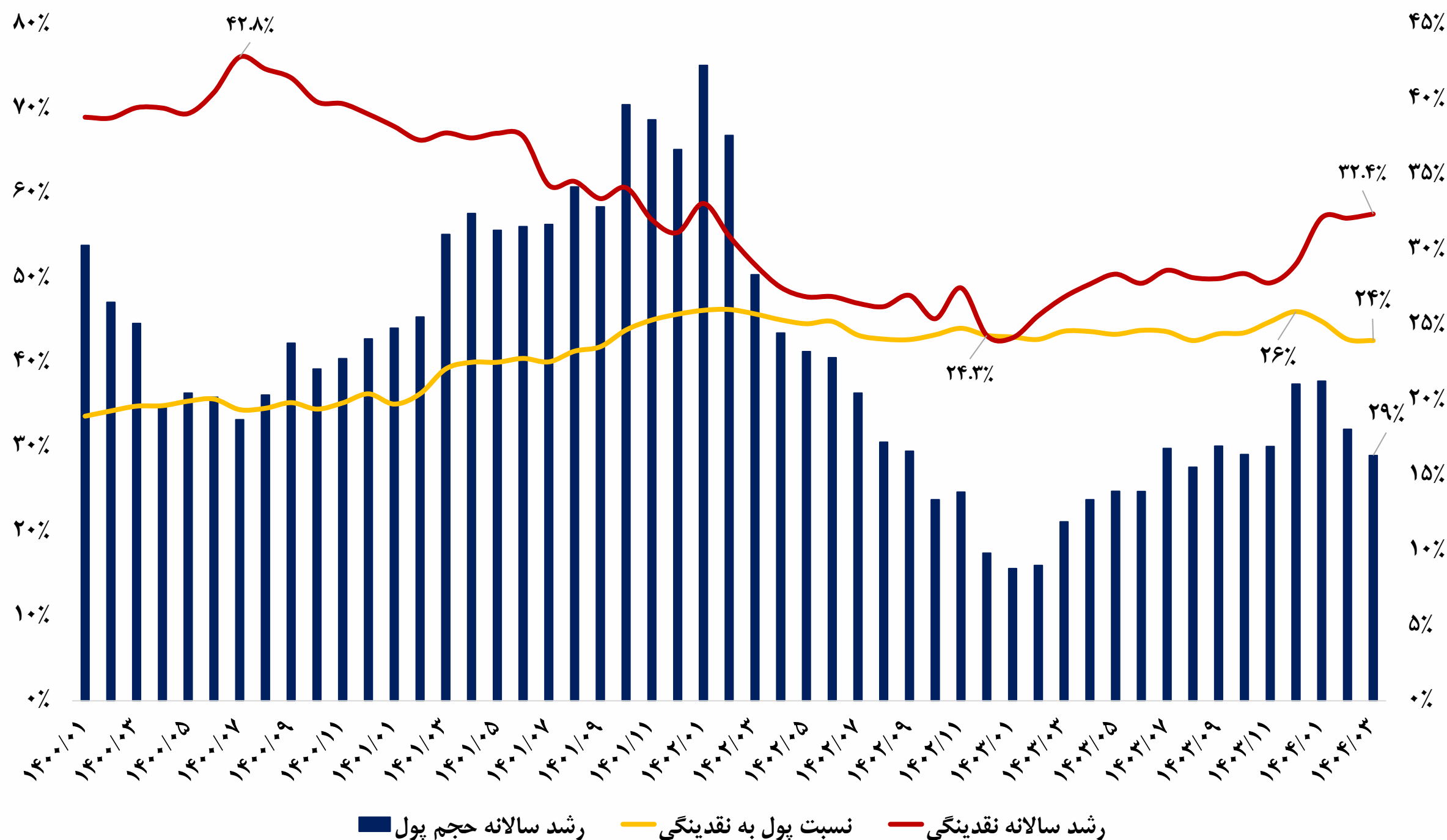
ضریب فزاینده

— ضریب فزاینده نقدینگی — پایه پولی — حجم نقدینگی - هزار میلیارد ریال

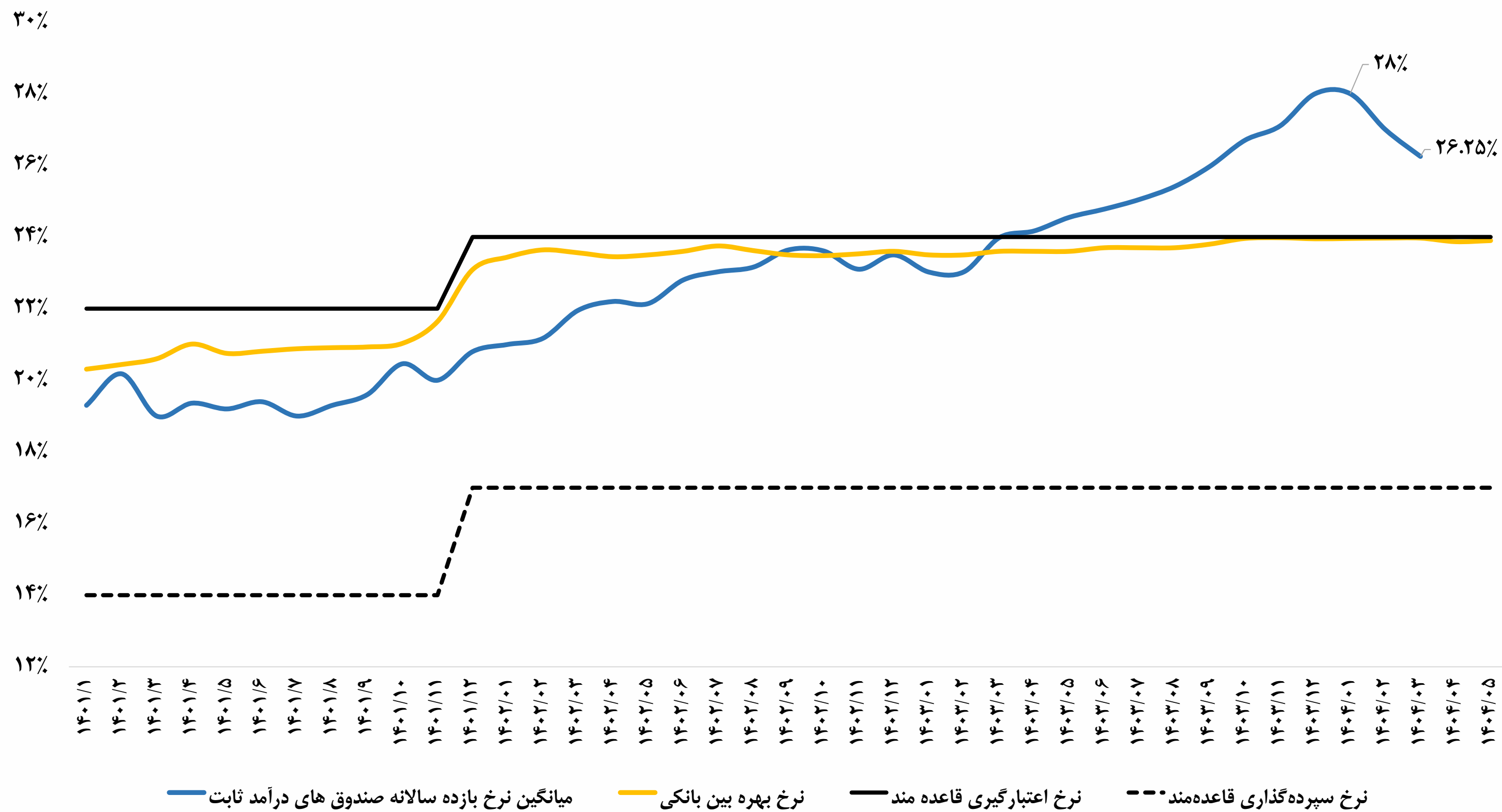
بررسی پارامترهای اقتصادی

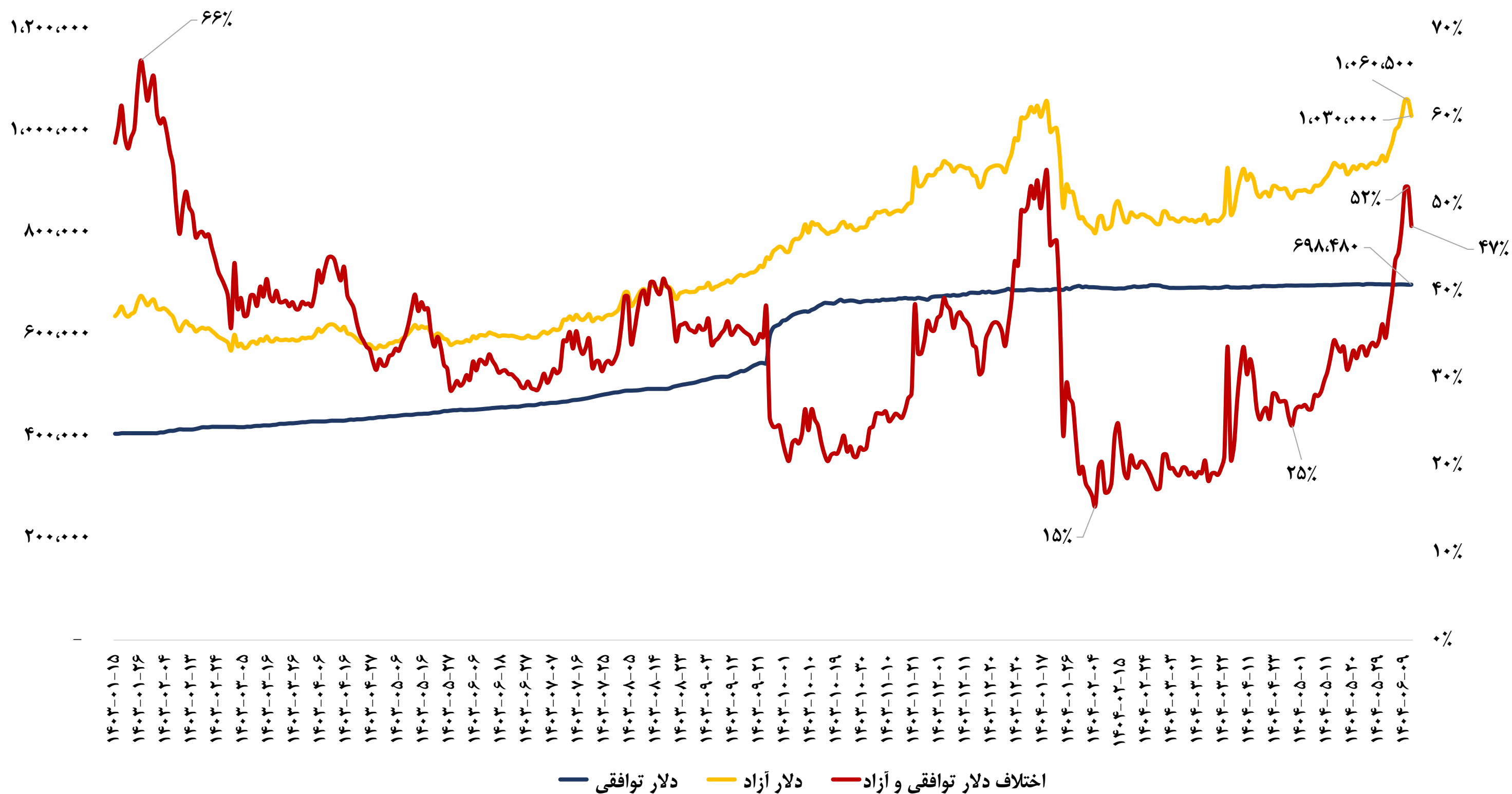
❖ نقدینگی در پایان خرداد ۱۴۰۴ به ۱۱,۰۵۹ هزار میلیارد تومان رسیده که نسبت به اسفند ۱۴۰۳ به میزان ۸.۸ درصد و نسبت به خرداد ۱۴۰۳ ۳۲.۴ درصد رشد داشته است.

❖ طبق گزارش بانک مرکزی، در سال ۱۴۰۳ به دلایلی نظیر انتشار اوراق بدهی دولت مازاد بر مقدار مصوب قانون بودجه و خرید بخشی قابل توجهی از اوراق دولت توسط بانکها، آزادسازی سپرده قانونی به منظور پرداخت تسهیلات قرض الحسنه ازدواج و فرزندآوری، افزایش ذخایر طلای بانک مرکزی با ریال، اجرای بخشی از ماده ۴۶ قانون رفع موانع تولید (تسویه بخشی از مطالبات بانکها از بانک مرکزی)، رشد نقدینگی از مسیر هدف‌گذاری شده فاصله گرفته که آثار آن در سه ماه ابتدایی سال ۱۴۰۴ نیز استمرار یافته است. استفاده دولت از تنخواه‌گردان خزانه مبتنی بر قانون بودجه سال ۱۴۰۴ نیز سهم معنی‌داری (۲.۷ درصد) در رشد نقدینگی سه ماهه نخست سال ۱۴۰۴ داشته است.



نرخ بهره بین بانکی





نرخ دلار آزاد

آخرین 1030000 کمترین 1029000 بیشترین 1035500 باز 1029500 کامودیتی و ارز - دلار آزاد

حجم



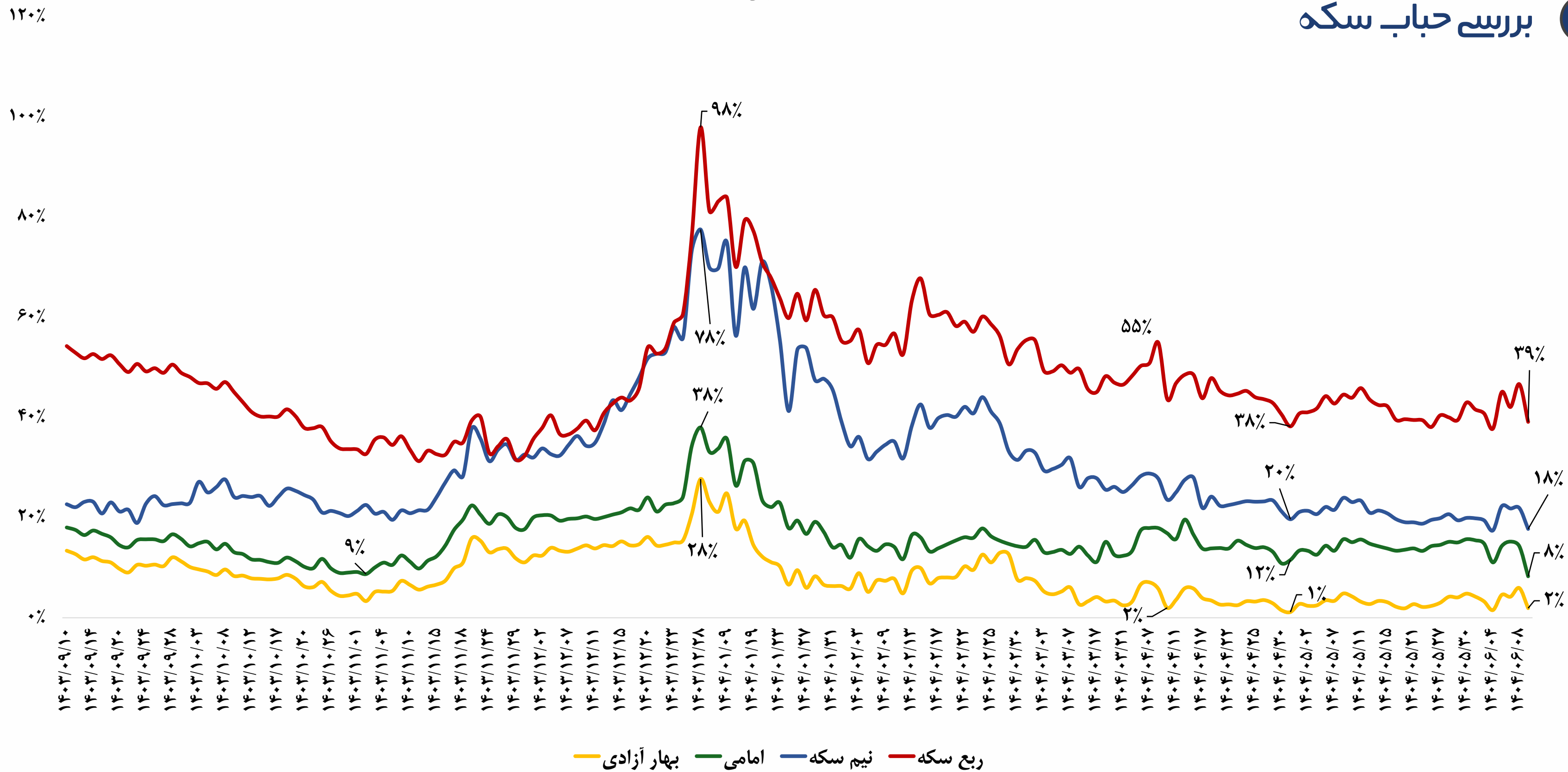
^

نرخ دلار براساس قراردادهای آتی صندوق طلا لوتوس پارسیان



بررسی حساب سکه

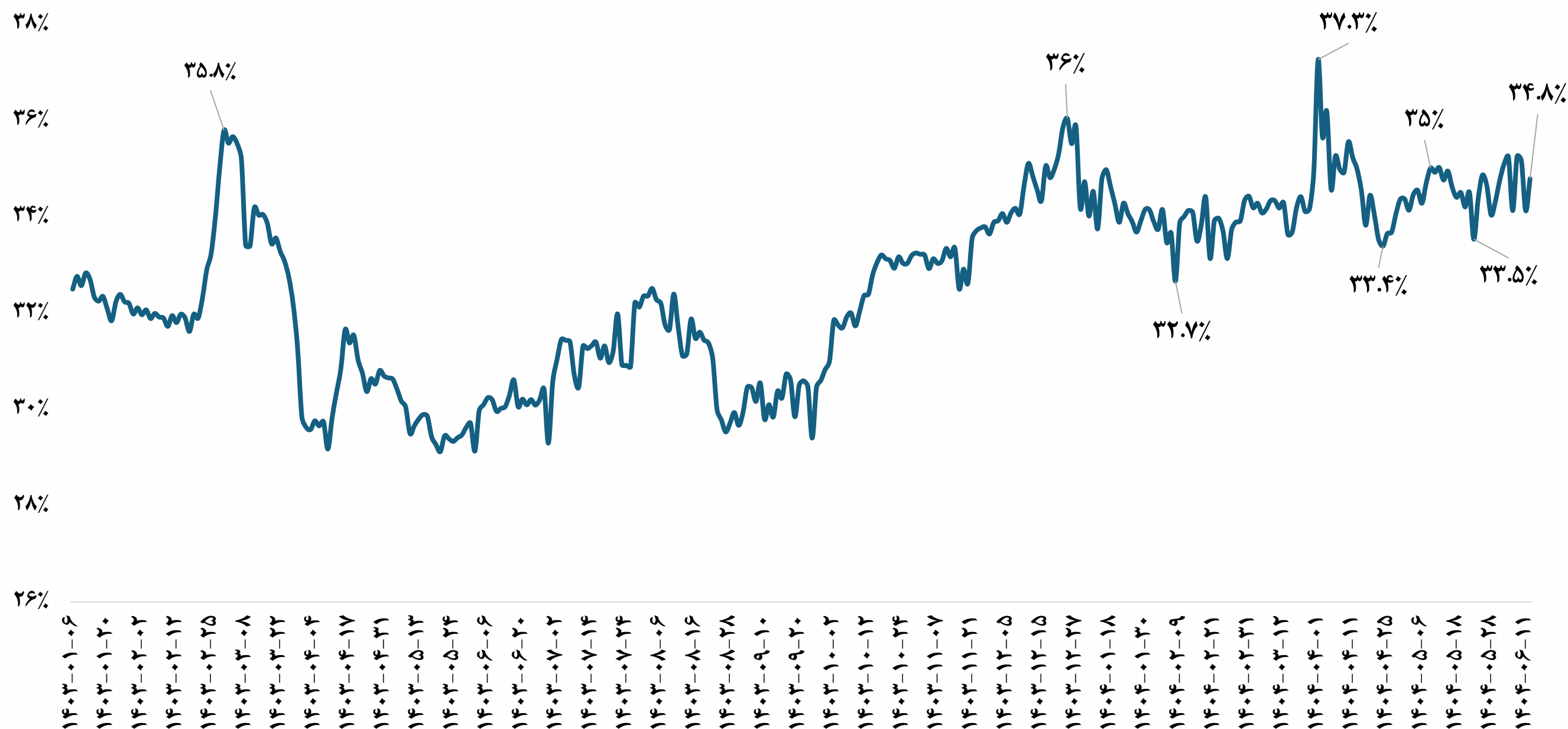
حساب انواع سکه



ربع سکه نیم سکه امامی بهار آزادی

نرخ اخزا

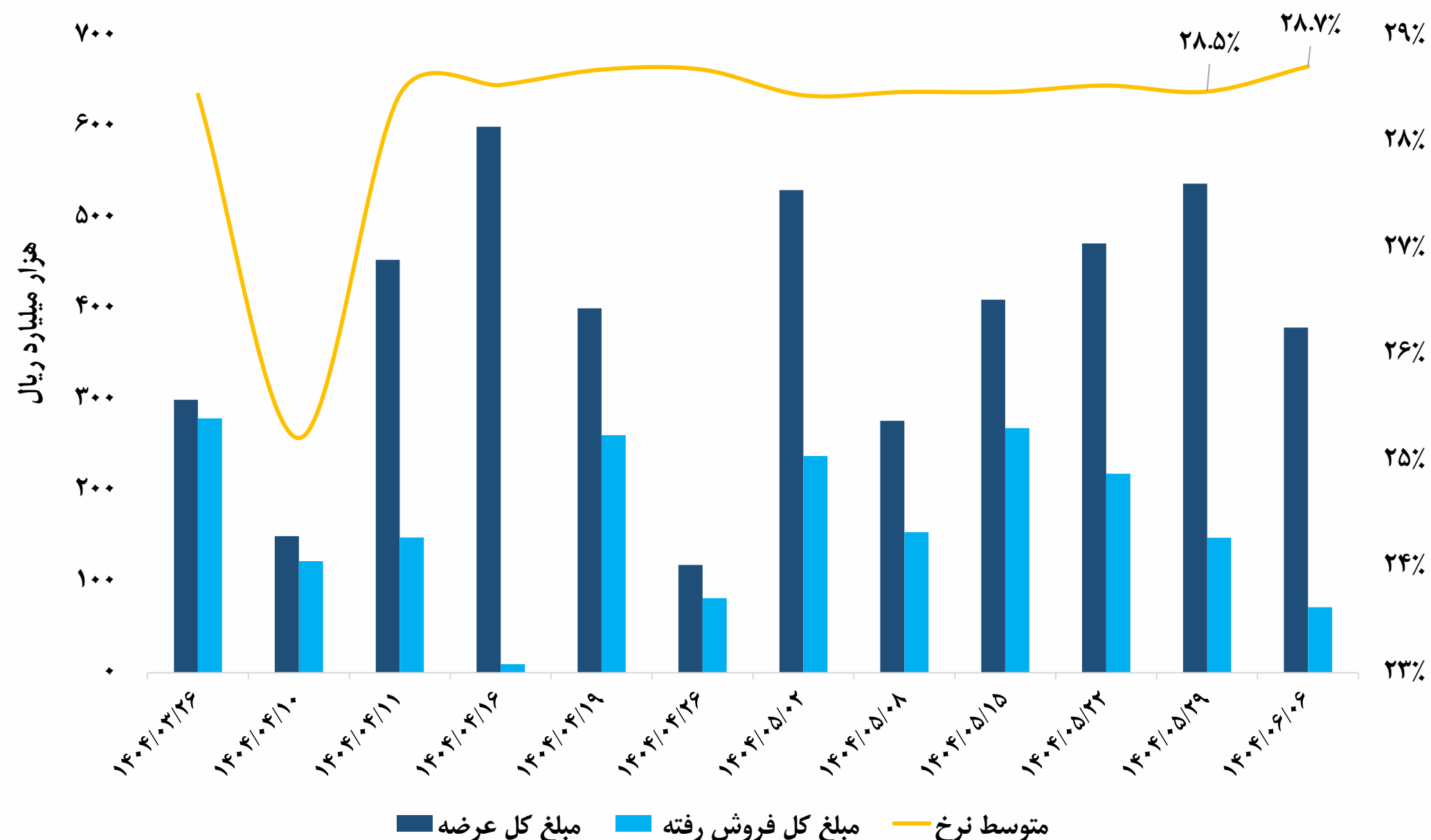
میانگین نرخ



نماد	سررسید	روز تا سررسید	YTM
اخزا ۱۰۷۱	۱۳-۰۷-۱۴۰۴	۳۲	۲۸.۹٪
اخزا ۱۰۸۱	۲۷-۰۷-۱۴۰۴	۴۶	۳۶.۹٪
اخزا ۱۰۹۱	۲۵-۰۸-۱۴۰۴	۷۴	۳۶.۴٪
اخزا ۲۰۷۱	۱۰-۰۹-۱۴۰۴	۸۹	۳۴.۱٪
اخزا ۱۰۴۱	۱۶-۰۹-۱۴۰۴	۹۵	۳۴.۴٪
اخزا ۱۰۵۱	۱۴-۱۰-۱۴۰۴	۱۲۳	۳۶.۳٪
اخزا ۲۰۸۱	۱۱-۱۲-۱۴۰۴	۱۸۰	۳۴.۹٪
اخزا ۲۰۱۱	۲۵-۰۳-۱۴۰۵	۲۸۵	۳۴.۶٪
اخزا ۲۱۱۱	۲۰-۰۷-۱۴۰۵	۴۰۴	۳۴.۸٪
اخزا ۲۰۳۱	۱۸-۰۸-۱۴۰۵	۴۳۲	۳۴.۵٪
اخزا ۲۱۲۱	۱۶-۰۹-۱۴۰۵	۴۶۰	۳۵.۰٪
اخزا ۲۰۲۱	۲۳-۰۹-۱۴۰۵	۴۶۷	۳۵.۰٪
اخزا ۲۰۴۱	۲۱-۱۰-۱۴۰۵	۴۹۵	۳۵.۰٪
اخزا ۲۱۳۱	۲۱-۱۰-۱۴۰۵	۴۹۵	۳۵.۰٪
اخزا ۲۱۰۱	۱۲-۱۱-۱۴۰۵	۵۱۶	۳۵.۰٪
اخزا ۳۰۱۱	۱۵-۰۶-۱۴۰۶	۷۳۳	۳۵.۸٪

آمار حراج اوراق مالی اسلامی دولتی

آمار حراج اوراق مالی اسلامی دولتی



❖ از ابتدای سال ۱۴۰۴ و در طی دوازده حراج برگزار شده، ۴۶۳ هزار میلیارد

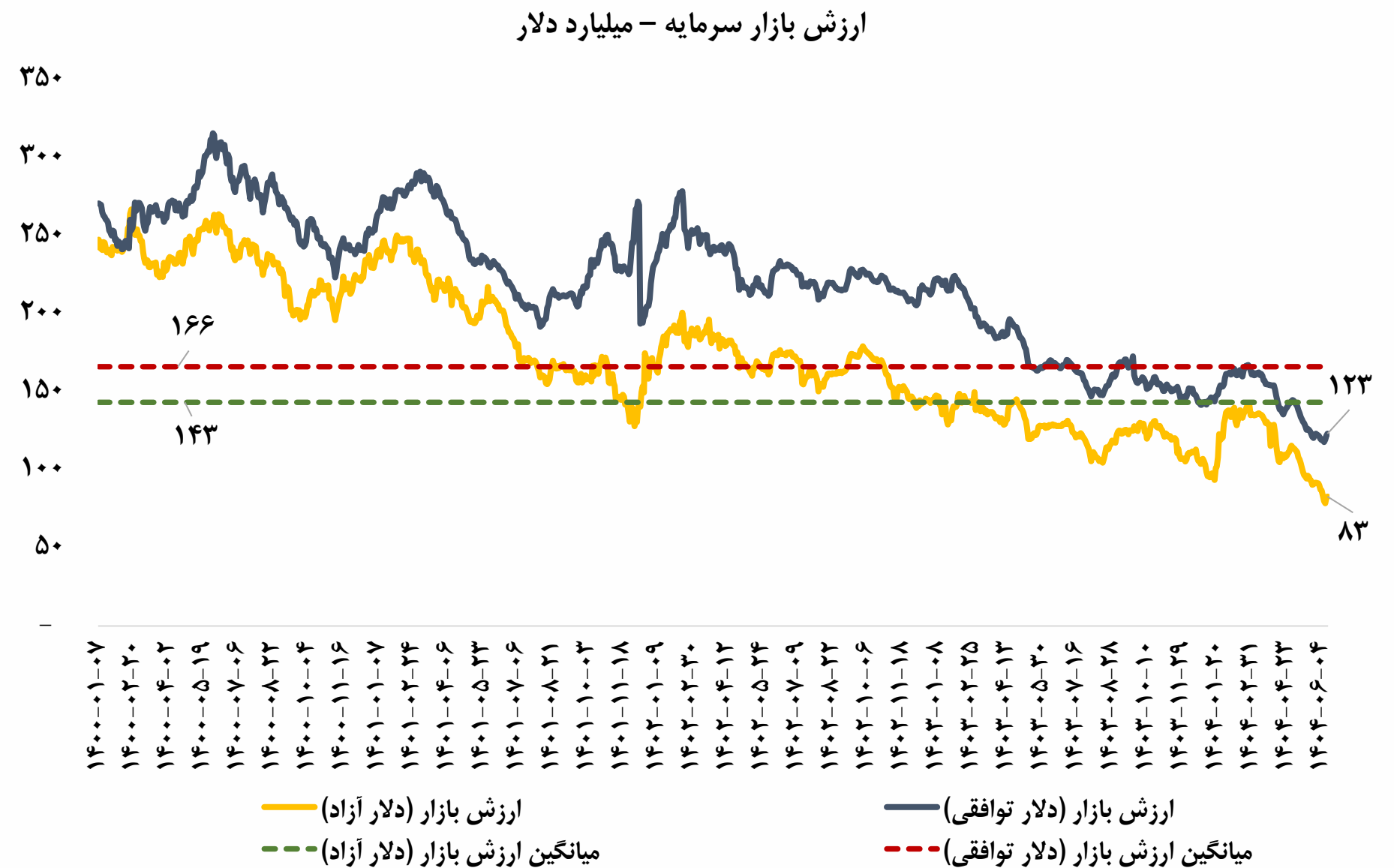
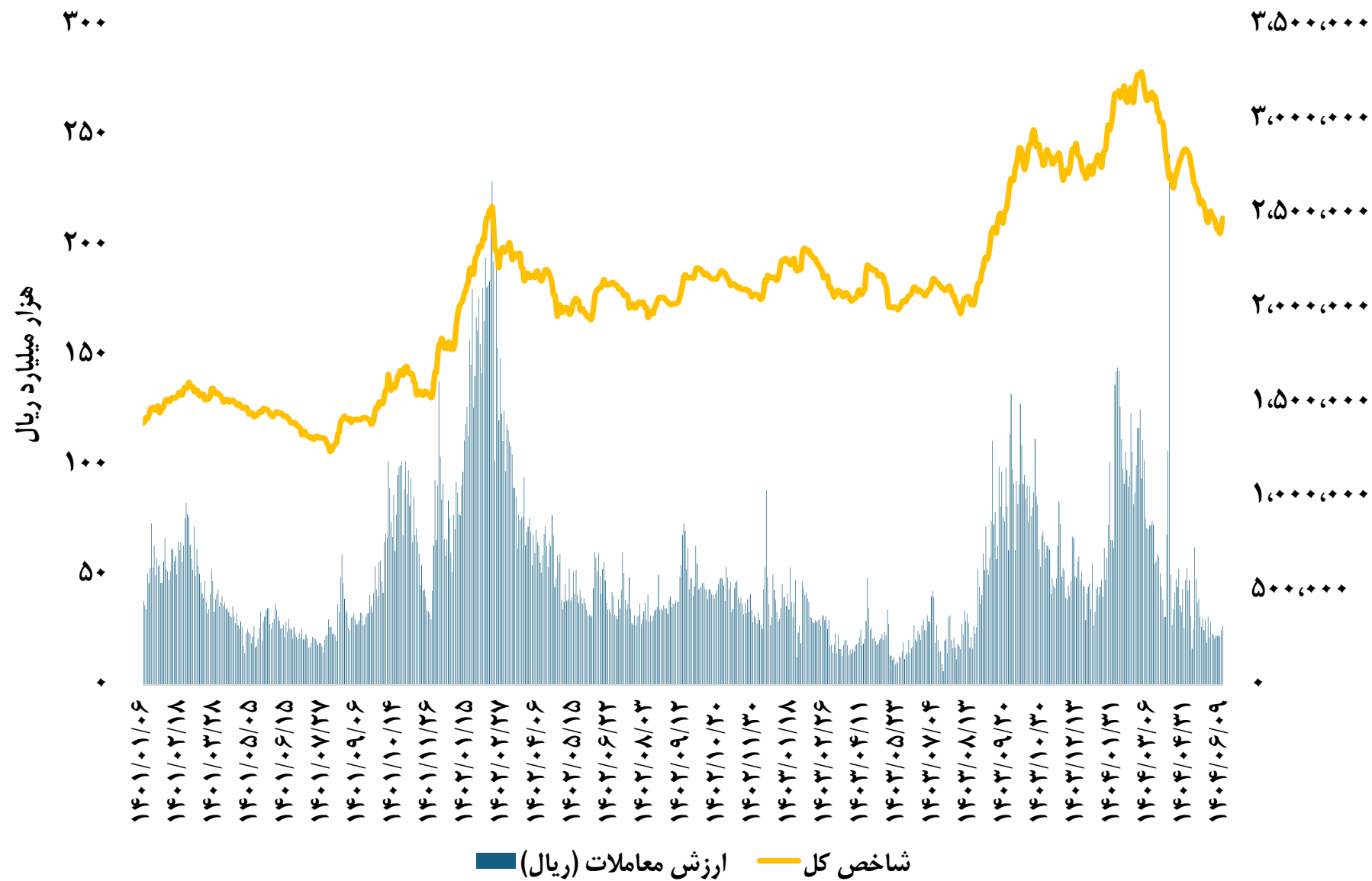
تومان اوراق مالی اسلامی دولتی (اراد) عرضه شده است که ارزش کل

فروش اوراق ۲۰۰ هزار میلیارد تومان می‌باشد.

❖ ۵۹ درصد خرید اوراق توسط بانک‌ها و موسسات مالی غیربانکی و ۴۱

درصد توسط خریداران حقیقی و حقوقی در بازار سرمایه انجام شده است.

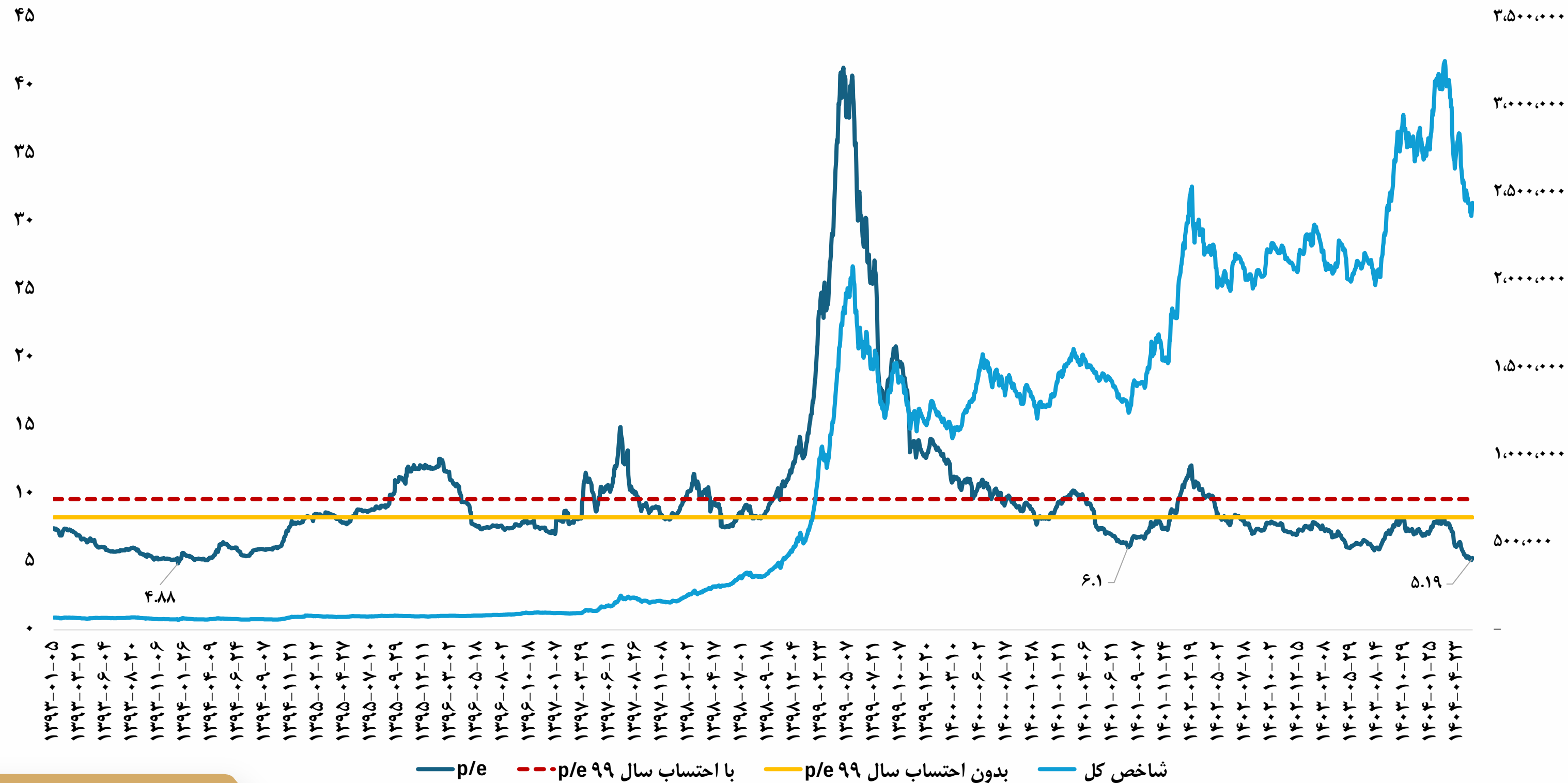
❖ متوسط نرخ دوازده حراج برگزار شده، ۲۸.۲۶٪ می‌باشد.



❖ ارزش معاملات در ۱۱ تیرماه در محدوده ۲۴ همت (خریدهای حمایتی و جمع‌آوری صفهای فروش)

❖ میانگین از سال ۱۳۹۳ در نظر گرفته شده است.

روند P/E بازار



❖ خروج ایران از NPT در مجلس بررسی شد و تصمیمی در این زمینه اتخاذ نگردید.

❖ انتشار اوراق فروش تبعی توسط صندوق توسعه و تثبیت

❖ رییس جمهور و وزیر امور خارجه به نیویورک سفر خواهند کرد.

❖ تجارت غیرنفتی کشور در ۵ ماهه ۱۴۰۴ به میزان ۷۶.۵ میلیون تن و به ارزش ۴۴ میلیارد دلار بوده است. از مجموع تجارت غیرنفتی کشور در این مدت ۶۱ میلیون تن به ارزش ۲۱ میلیارد دلار به صادرات

غیرنفتی و ۱۵ میلیون تن به ارزش ۲۳ میلیارد دلار به واردات اختصاص داشت. بیشترین میزان صادرات غیرنفتی کشور به مقصد کشورهای چین، عراق، امارات متحده عربی، ترکیه، افغانستان، عمان و پاکستان انجام گرفته است.

بررسی ورود و خروج نقدینگی

ورود و خروج پول حقیقی از بازار در یکسال گذشته



بازگشایی بعد از جنگ

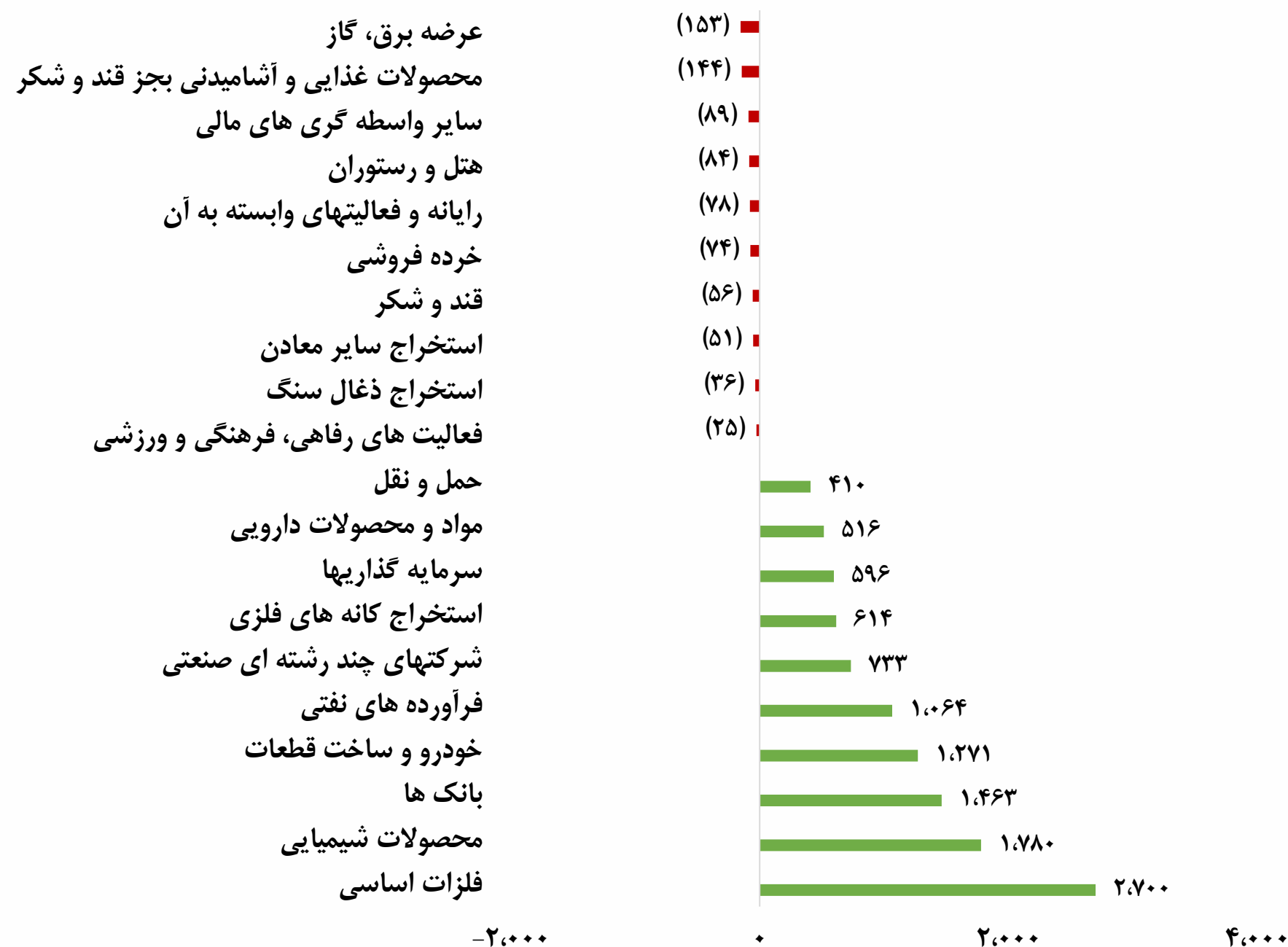
(۱۱۹،۴۷۵)

❖ ۱،۲۳۳ میلیارد تومان ورود نقدینگی در یک هفته گذشته

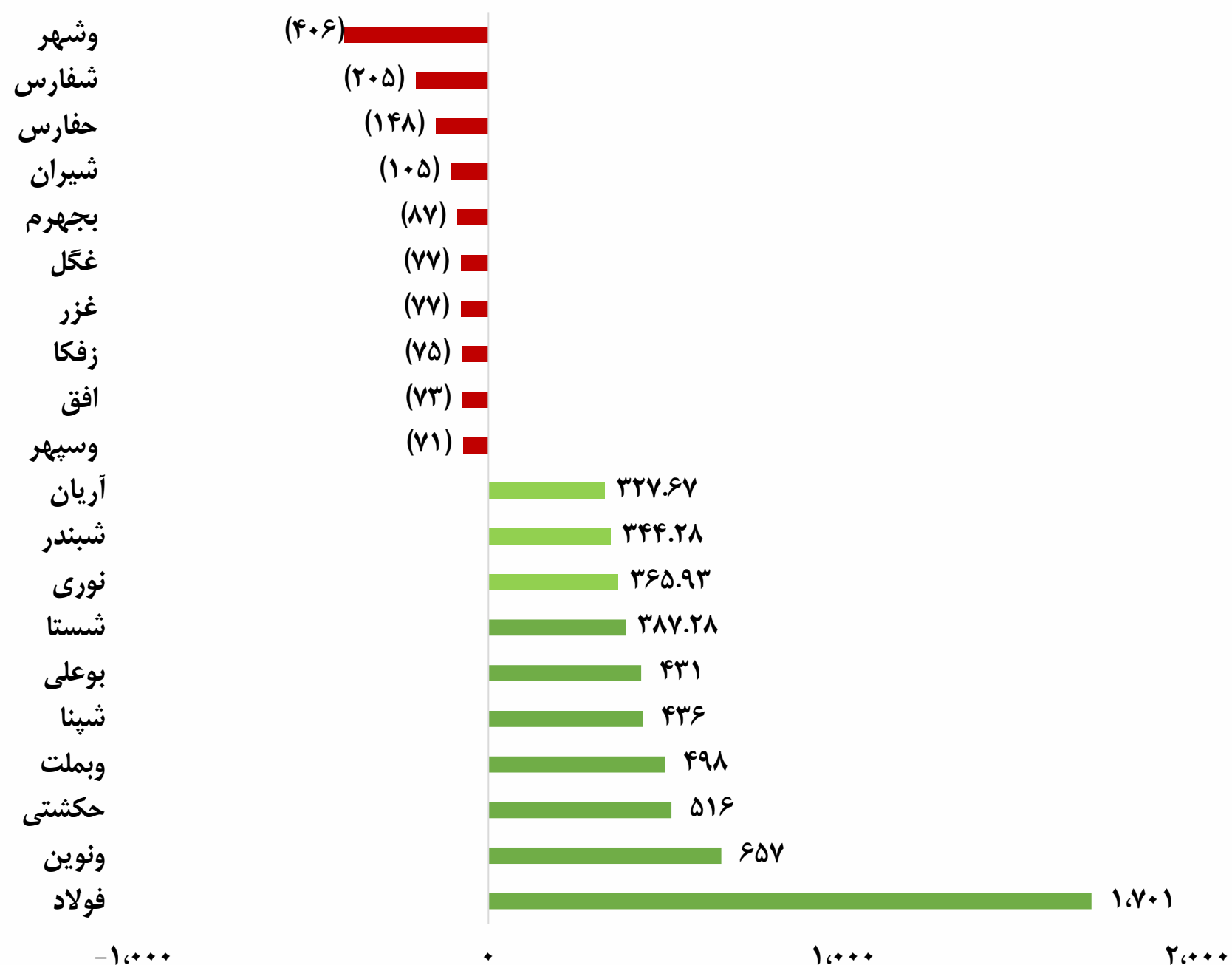
❖ ۴۶ همت خروج نقدینگی از زمان بازگشایی پس از جنگ تاکنون

بررسی ورود و خروج نقدینگی

ورود و خروج پول حقیقی صنایع در یک هفته گذشته (۸-۱۲ شهریور) - میلیارد ریال



ورود و خروج پول حقیقی شرکتها در یک هفته گذشته (۸-۱۲ شهریور) - میلیارد ریال



شاخص کل

تایم فریم هفتگی

۱۸



شاخص کل

تایم فریم روزانه

۱۹

شاخص کل 02496903 H2523539 L2496903 C2523539

Volume 11,418B

Ichimoku 2530310 2690067

EMA 2540777

^



شاخص هموزن

تایم فریم روزانه

۲۰



شاخص ۳۰ شرکت بزرگ

شاخص ۳۰ شرکت بزرگ O155328 H157334 L155328 C157334

Volume 8,418B

Ichimoku 156708 165285

EMA 155144

^



شاخص گروه بانکی

تایم فریم هفتگی

شاخص بانکی 014333 H15015 L14153 C15015

Volume 8.941B

Ichimoku 15232 13041

EMA 15137

^

۲۲



شاخص گروه بانکی

تایم فریم روزانه

۲۳



شاخص فرآورده های نفتی



شاخص شیمیایی

۲۵

شاخص شیمیایی 0231435 H234725 L231435 C234725

Volume 463.117M

Ichimoku 234198 248851

EMA 233324



شاخص فلزات O1537120 H1661410 L1533547 C1661410

Volume 6,462B

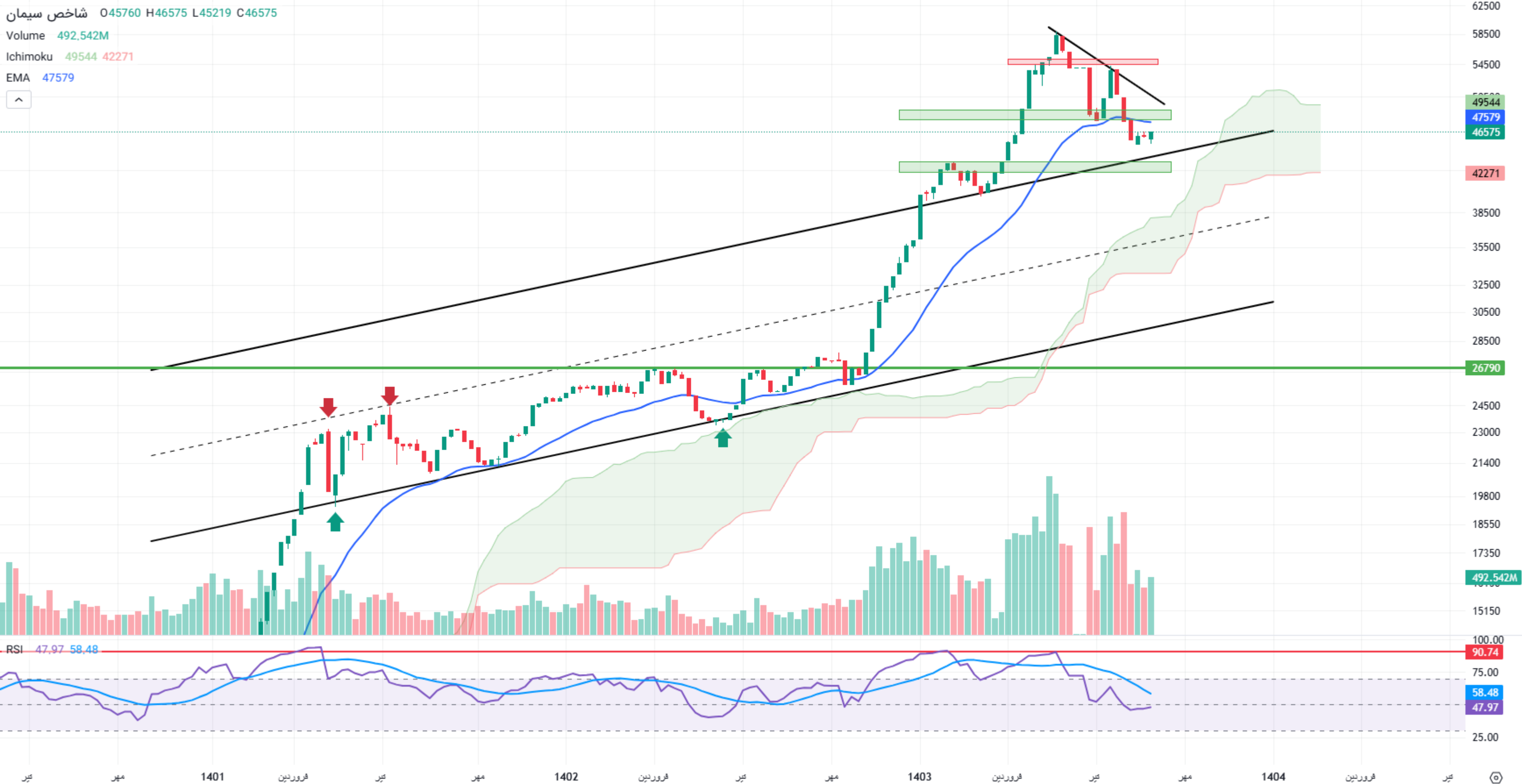
Ichimoku 1810362 1878377

EMA 1833232

^



شاخص سیمان تایم فریم هفتگی



شاخص سیمان
تایم فریم روزانه



شاخص دارو

شاخص دارویی O185149 H185885 L185149 C185885
 Volume 462.428M
 Ichimoku 187645 202241
 EMA 186681







21 43 692 000



Info@aminib.com



www.aminib.com



Tehran, Mirdamad St
W Qobadiyan St



AminInvestmentBank