



DARIC

دانش بازار؛ سود سرشار

www.darikpars.ir

گزارش هفتگی

هفته منتهی به ۲۰ بهمن ۱۴۰۰

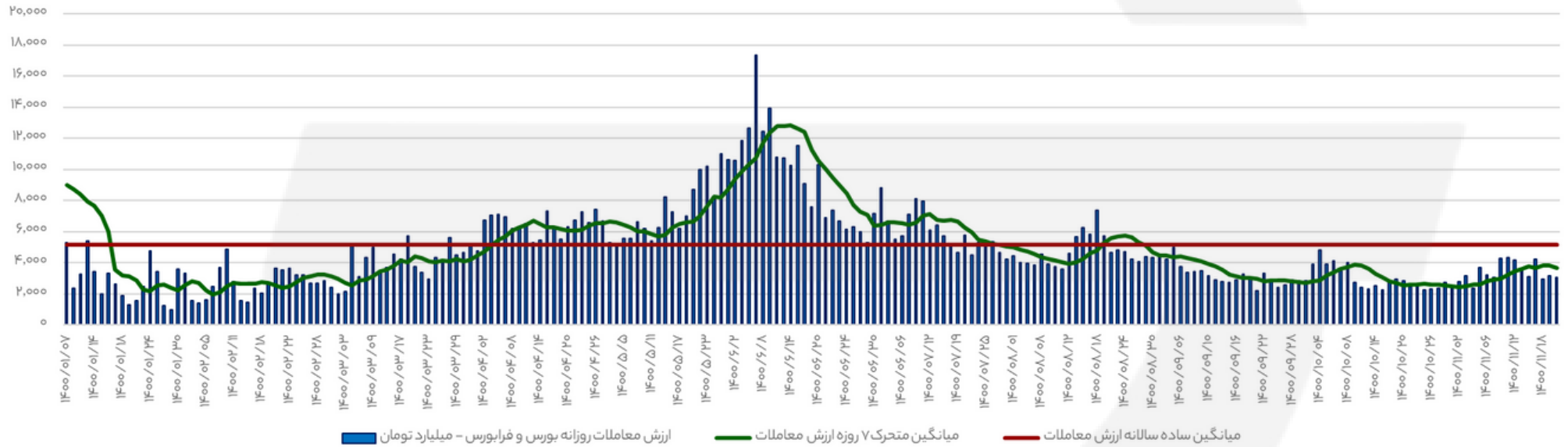
تهیه شده در واحد معاملات سبدگردان داریک

Darik Weekly Bulletin

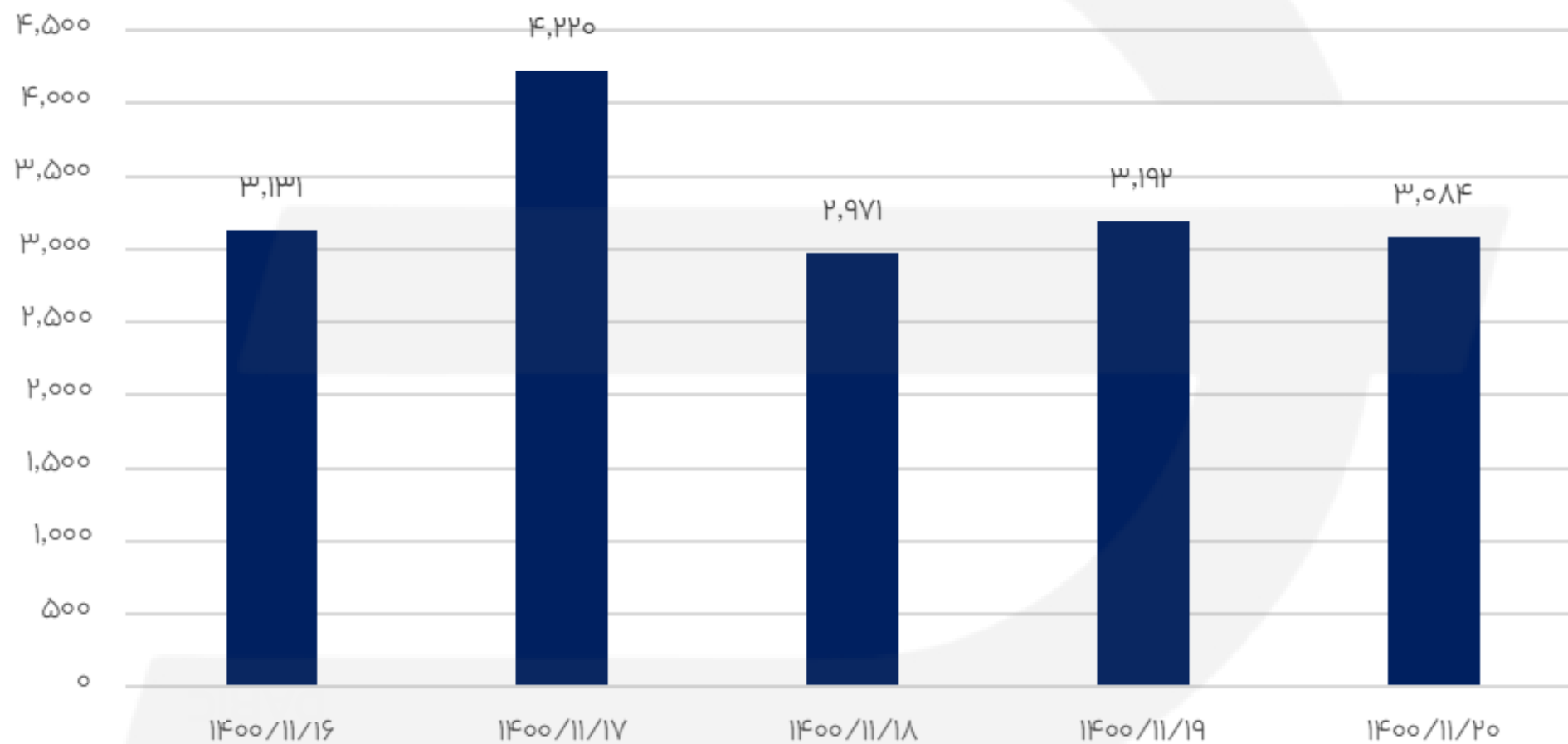
۰۲	نمای هفتگی بازار
۰۳	روند ارزش روزانه معاملات خرد سهام
۰۴	ارزش معاملات سهام خرد طی هفته گذشته
۰۵	مقایسه شاخص کل و ورود و خروج پول حقیقی
۰۶	ورود و خروج پول حقیقی
۰۷	گزارش اوراق در آمد ثابت
۰۸	۵ نماد اوراق بدهی دارای بیشترین YTM
۰۹	۵ نماد اوراق بدهی دارای بیشترین ارزش معاملات
۱۰	مقایسه خالص خرید (فروش) اوراق درآمد ثابت
۱۱	اخبار مهم هفته
۱۵	صندوق های سرمایه گذاری
۱۶	پرتفوی پیشنهادی
۱۷	ارتباط با داریک

بازده سالانه	بازده ماهانه	بازده هفتگی	آخرین اطلاعات	نمای هفتگی بازار
۸% -۲۲% ۱%	-۴% -۷% -۲%	-۱% -۲% ۰%	۱,۲۸۴,۱۱۹ ۳۲۶,۲۴۴ ۲۳۸,۳۹۷	شاخص کسل شاخص هم وزن شاخص کل فرابورس
۱% ۲%	-۳% -۴%	۰% -۴%	۲۳۸,۳۹۷ ۱۱۶,۷۶۰,۰۰۰	دلار نیما سکه امامی
۵۰% ۲۱% ۴۲%	۱۲% ۳% ۳%	۱% -۱% ۰%	۹۱ ۹,۸۰۲ ۳,۶۴۵	نفت برنت مس LME روی LME

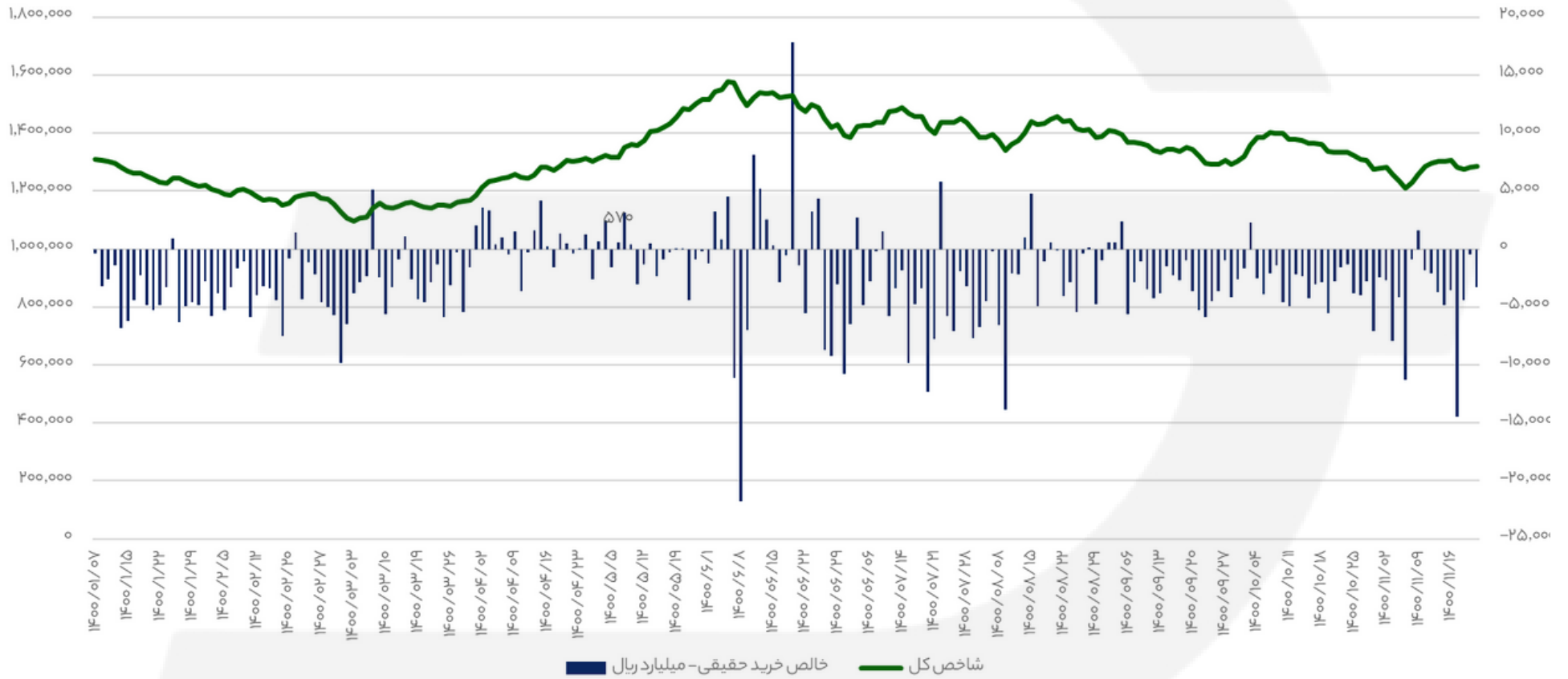
روند ارزش روزانه معاملات خرد سهام



ارزش معاملات سهام خرد طی هفته گذشته (میلیارد تومان)

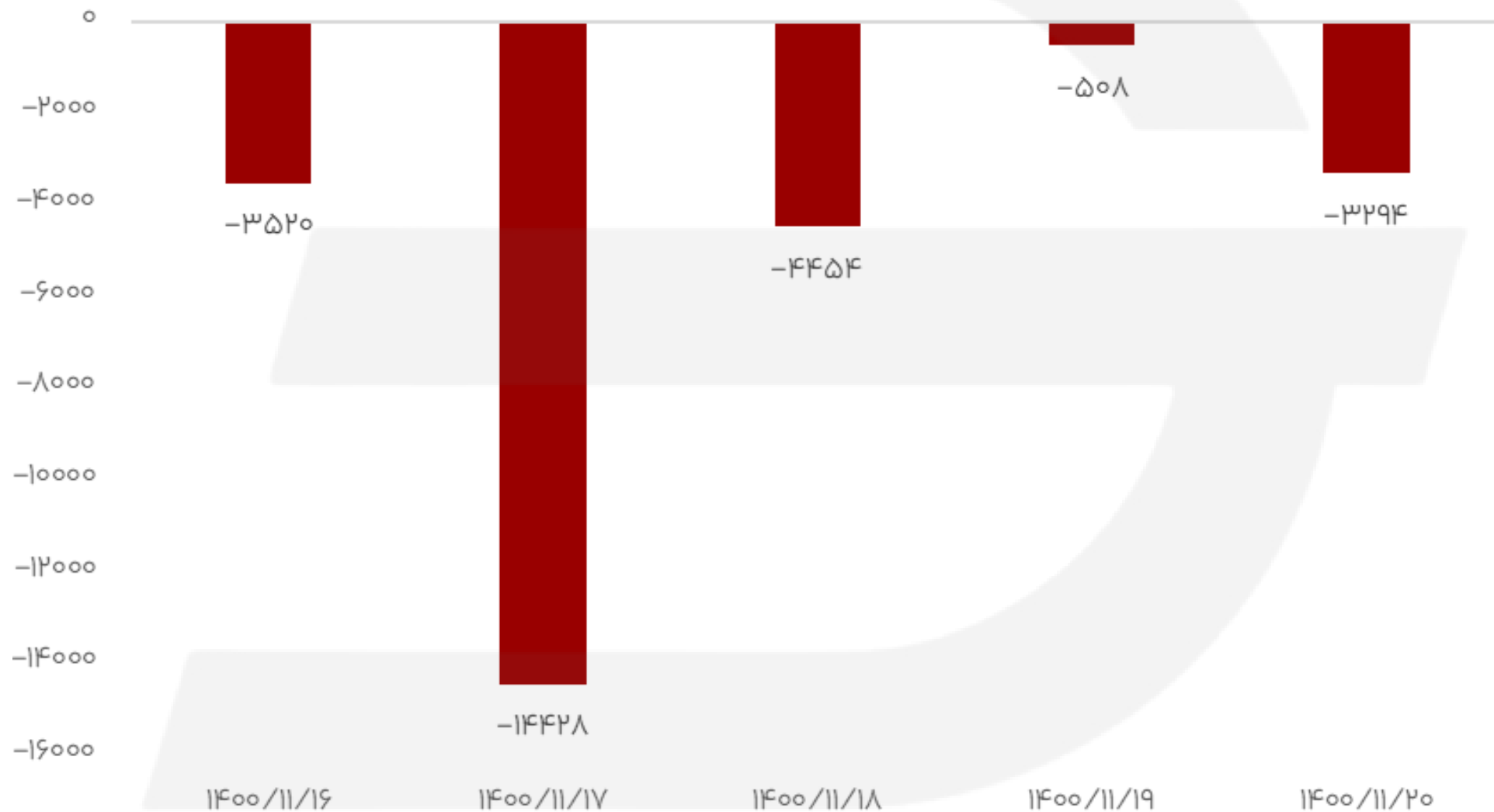


مقایسه شاخص کل و ورود و خروج پول حقیقی



ورود و خروج پول حقیقی (میلیارد تومان)

06



۲۲.۷%	میانگین موزون نرخ YTM	میانگین نرخ بهره در اوراق بهادار در ۲۰ بهمن ۱۴۰۰
۲۰.۵%	میانگین موزون معادل نرخ بهره بانکی معاملات	
۲۰.۴%	نرخ بهره بین بانکی	



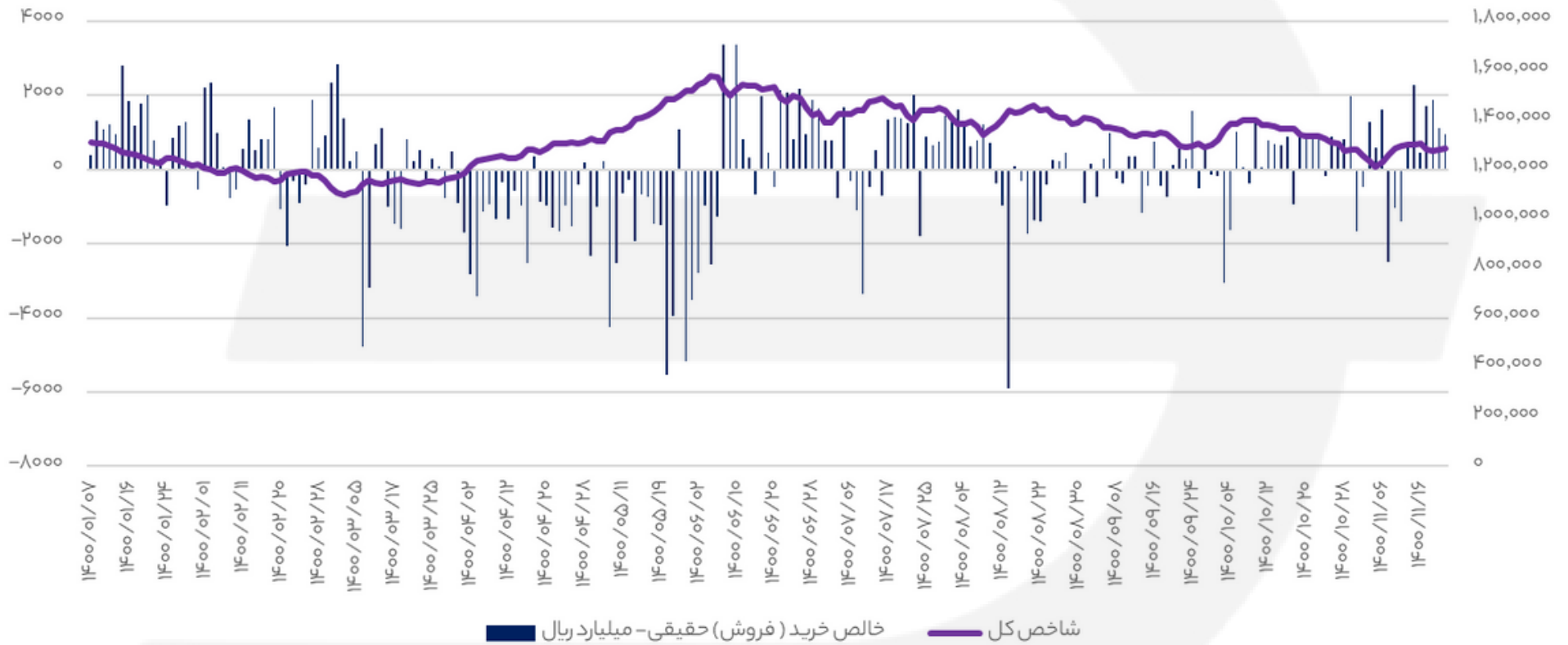
۵ نماد اوراق بدهی دارای بیشترین YTM در ۱۳ بهمن ۱۴۰۰

YTM	معادل بازده بانکی	ارزش معاملات (میلیون ریال)	سررسید شمسی	مانده تا سررسید	قیمت آخرین معامله	نماد
۲۳.۵۰	۲۱.۲۲	۵,۷۸۱	۱۴۰۱/۰۳/۲۳	۱۲۴	۹۲۹,۴۵۰	اخزا۱۸۱
۲۳.۴۹	۲۱.۲۱	۸۱,۴۶۲	۱۴۰۳/۰۸/۲۱	۱۰۰۶	۵۵۸,۲۰۰	اخزا۱۰۰
۲۳.۴۷	۲۱.۲۰	۸۶,۲۶۶	۱۴۰۳/۱۰/۲۴	۱۰۶۹	۵۳۸,۵۱۰	اخزا۱۰۰۲
۲۳.۴۷	۲۱.۱۹	۵۰,۸۰۵	۱۴۰۳/۰۵/۲۲	۹۱۵	۵۸۸,۶۷۰	اخزا۱۰۰۴
۲۳.۴۷	۲۱.۱۹	۵۳,۵۴۱	۱۴۰۳/۰۹/۱۲	۱۰۲۷	۵۵۱,۸۰۰	اخزا۱۰۰۷

۵۰۹ نماد اوراق بدهی دارای بیشترین ارزش معاملات در ۱۳ بهمن ۱۴۰۰

YTM	معادل بازده بانکی	ارزش معاملات (میلیون ریال)	سررسید شمسی	مانده تا سررسید	قیمت آخرین معامله	نماد
۲۳.۴۰	۲۱.۱۳	۱۵۹,۷۶۶	۱۴۰۳/۰۷/۲۳	۹۷۸	۵۶۸,۵۰۰	اخزا۰۰۶
۲۳.۴۷	۲۱.۲۰	۸۶,۲۶۶	۱۴۰۳/۱۰/۲۴	۱۰۶۹	۵۳۸,۵۱۰	اخزا۰۰۲
۲۲.۳۲	۲۰.۲۵	۸۴,۴۴۶	۱۴۰۲/۰۹/۰۶	۶۵۶	۶۹۵,۲۰۰	اخزا۱۱۱
۲۳.۴۹	۲۱.۲۱	۸۱,۴۶۲	۱۴۰۳/۰۸/۲۱	۱۰۰۶	۵۵۸,۲۰۰	اخزا۰۰۰
۲۲.۳۶	۲۰.۲۸	۷۵,۱۴۹	۱۴۰۲/۰۸/۰۷	۶۲۷	۷۰۶,۰۰۰	اخزا۰۱۰

10 مقایسه خالص خرید (فروش) اوراق درآمد ثابت توسط مشتریان حقیقی و شاخص کل



اخبار مهم هفته



MARKETING STRATEGY TEAMWORK

BLOG # CHAT NETWORK

GROWTH

FREE! SAVE \$50 \$100

0% 15% 50% 75%

Mon Tue Wed Thu Fri Sat Sun

max!

team

idea

product

work

قیمت نفت در روز چهارشنبه پس از دو جلسه کاهش، افزایش یافت. داده‌های صنعت نشان داد کاهش غیرمنتظره ذخایر نفت خام و سوخت ایالات متحده متوقف شده و نگرانی‌ها از افزایش احتمالی عرضه از ایران را خنثی کرد.

بهای معاملات آتی نفت برنت با ۲۳ سنت یا ۰.۳ درصد افزایش به ۹۱.۰۱ دلار در هر بشکه رسید، در حالی که ایالات متحده آمریکا. نفت خام وست تگزاس اینترمدیت با ۱۱ سنت یا ۰.۱ درصد افزایش، به ۸۹.۴۷ دلار در هر بشکه رسید.

تینا تنگ، تحلیلگر CMC Markets می‌گوید: کمبود عرضه عامل کلیدی است که قیمت نفت را افزایش داده است.

به گفته منابع بازار با استناد به آمار موسسه امریکن پترولیوم در روز سه‌شنبه، ذخایر نفت خام، بنزین و میعانات آمریکا هفته گذشته کاهش یافت. بر اساس گزارش API، ذخایر نفت خام بر خلاف انتظارات تحلیلگران برای افزایش ۴۰۰۰۰۰ بشکه ای، ۲ میلیون بشکه کاهش یافت.

با این حال، نگرانی‌ها در مورد توافق هسته‌ای احتمالی ایران که می‌تواند نفت بیشتری را وارد بازارهای جهانی کند، بر قیمت‌ها تاثیر گذاشته است.

در حالی که واشنگتن مذاکرات غیرمستقیم با ایران برای احیای توافق هسته‌ای را از سر گرفت، برنت و وست تگزاس در روز سه‌شنبه حدود ۲ درصد کاهش یافتند که برای دومین جلسه متوالی کاهش یافت. چنین توافقی می‌تواند تحریم‌های آمریکا بر نفت ایران را لغو کند و به سرعت عرضه‌ها را به بازار بیافزاید، اگرچه تعدادی از مسائل حیاتی هنوز باید برطرف شوند.

اداره اطلاعات انرژی از ایالات متحده انتظار دارد تولید نفت خام در سال ۲۰۲۲ با ۷۷۰ هزار بشکه افزایش به ۱۱.۹۷ میلیون بشکه در روز خواهد رسید.

جریمه ۲۰ درصدی در انتظار شرکت‌هایی که سود مجامع را سجامی نمی‌دهند

سیدمحسن دهنوی نائب رئیس کمیسیون تلفیق لایحه بودجه سال ۱۴۰۱ اعلام کرد: از ابتدای سال آینده، شرکت‌ها در صورت تخلف در واریز سود مجامع به حساب سهامداران از طریق سجام، باید سود را با جریمه ۲۰ درصدی به مردم بپردازند. / تسنیم

معافیت مالیاتی بانک‌ها از درآمد تسعیر ارزی

کاظم چاوشی، عضو هیات مدیره بانک ملت در خصوص مالیات بانک‌ها گفت: از آنجایی که سازمان امور مالیاتی برگ تشخیص مالیات عملکرد بانکها را در سال ۱۳۹۹ با نرخ نیمایی محاسبه کرده و نرخ نیما در پایان سال قبل ۲۲ هزار و ۳۰۰ تومان با اجرایی شدن محتوای ابلاغیه معاون اول رئیس جمهور، احتمالاً بانک‌ها برای عملکرد سال مالی ۱۴۰۰ انتظار می‌رود از محل درآمد تسعیر ارز مشمول پرداخت مالیات نباشند و این خبر بسیار مساعدی برای سهامداران بانکهای دارای وضعیت مثبت باز ارزی است. به هر حال هم اثر مثبت نرخ تسعیر ارز و هم اثر بسیار خوب مالیاتی مذکور منوط به ابلاغ نهایی از سوی بانک مرکزی و سازمان امور مالیاتی است.

ادامه سیگنالهای کاهش بانک مرکزی به نرخ بهره بین بانکی

بانک مرکزی در جدیدترین عملیات بازار باز، با تزریق ذخائر در قالب ریپو(توافقات باخرید) با نرخ ۱۹ درصد بازهم به کاهش بیشتر نرخ بهره بین بانکی که بانکها مبتنی بر آن از یکدیگر ذخیره گیری میکنند، سیگنال داد.

لازم به ذکر است که کاهش نرخ بهره بین بانکی میتواند از سه جهت برای رشد بورس مفید باشد:

۱. تثبیت نرخ سود سپرده های بانکی در کرانه های پایین
۲. کاهش هزینه تأمین مالی بنگاه های اقتصادی از کانال تثبیت نرخ سود تسهیلات
۳. افزایش توان اعتبار دهی بازار پول به بازار سرمایه

صندوق سهامی فراز داریک

صندوق درآمد ثابت اعتماد داریک

صندوق بازارگردانی اختصاصی میزان داریک

صندوق های
سرمایه گذاری

امنیت در مسیر سودآوری

صندوق بازارگردانی اختصاصی میزان داریک



میزان داریک

تحت مدیریت شرکت سپدگردان داریک

اعتماد، تجربه شیرین سرمایه گذاری

صندوق درآمد ثابت اعتماد داریک (ETF)



اعتماد داریک

تحت مدیریت شرکت سپدگردان داریک
کسب سود حداقل ۲۰٪ سالانه

قابل معامله با نماد **داریک**

سبز ماندن اتفاقی نیست

صندوق سهامی فراز داریک (ETF)



فراز داریک

تحت مدیریت شرکت سپدگردان داریک
بازده شش ماهه: ۳۶/۳۶٪ درصد

قابل معامله با نماد **فراز**

درصد از پرتفوی	توضیحات	هدف قیمتی	قیمت روز	نماد شرکت	افق زمانی
۱۵	بهبود وضعیت عملیات	۴۰۰۰	۳۲۳۶	وبملت	میان مدت
۱۵	بهبود وضعیت عملیات	۲۶۰۰	۲۰۸۸	خودرو	
۱۵	وضعیت بنیادی مناسب	۱۳۵۰۰	۱۰۳۳۰	فولاد	
۱۵	نسبت P/NAV مطلوب و مناسب	۷۵۰۰	۴۱۲۰	و خارزم	
۱۰	بهبود وضعیت عملیات	۲۵۰۰	۱۳۲۸	قثابت	
۱۰	بهبود وضعیت عملیات	۱۷۰۰	۱۳۳۸	خاور	بلند مدت
۱۰	بازدهی مناسب و کم ریسک	۱۸۵۰۰	۱۴۲۷۴	صندوق سرمایه گذاری فراز داریک	
۱۰	کاهش ریسک پرتفو	۱۴۶۰۰	۱۲۱۲۸	صندوق سرمایه گذاری اعتماد داریک	



DARIC

دانش بازار، سود سرشار



www.daricpars.ir



info@daricpars.ir



[@daricpars](https://www.instagram.com/daricpars)



۰۲۱-۲۲۹۲۱۶۴۰

تهران، خیابان دستگردی (ظفر) شرقی، پلاک ۲۰۹