



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته بیست و چهارم منتهی به

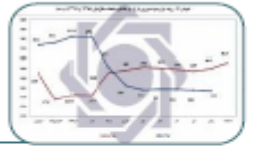
۱۱ شهریور ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

افزایش نرخ بهره بین بانکی:

طبق اعلام بانک مرکزی، هفته گذشته نرخ بهره بین بانکی با ۰.۰۹ درصد افزایش، به ۲۰.۷۴ درصد رسید.



صنایع تا ۳ سال آینده از برق شبکه سراسری بی‌نیاز می‌شوند:

مدیرعامل شرکت مدیریت شبکه برق ایران گفت: صنایع بزرگ تا سه سال آینده با احداث ۱۴ هزار مگاوات نیروگاه اختصاصی، از برق شبکه سراسری بی‌نیاز خواهند شد.



مزایده بلوکی استقلال و پرسپولیس:

رئیس خصوصی سازی اعلام کرد: حدود ۱۰ تا ۱۱ درصد از سهام این ۲ باشگاه فروخته شده و برای کنترل اینکه دولت کاهش پیدا کند باید ۴۱ درصد دیگر از سهام آن‌ها فروخته شود. ما امکان عرضه تدریجی و مزایده بلوکی این ۲ باشگاه را داریم. ما در حال حاضر برای مزایده بلوکی مذاکراتی را انجام می‌دهیم چرا که در این مورد باید اهلیت‌ها ثابت شود. ما به این ۲ باشگاه گفته ایم که اگر پیشکشوتان آن‌ها یا کارمندان‌شان می‌خواهند در این مزایده شرکت کنند باید یک شخصیت حقوقی داشته باشند، همچنین سایر شرکت‌ها نیز می‌توانند در این مزایده شرکت کنند.



سایپا خودروهای اقتصادی رنو را وارد می‌کند:

مدیرعامل شرکت سایپا اعلام کرد: وظیفه واردات از برند رنو مانند خودروی مگان ۲۰۲۲، ساندرو بر عهده سایپاست. زیر ساخت‌های تولید HR ۳C در کشور تا ۷۰ درصد فراهم است. در حال مذاکره هستیم تا این خودرو را وارد کشور کنیم.



کاهش ۱۰۰ لیتری سهمیه بنزین ۳۰۰۰ تومانی کارت‌های سوخت:

معاون وزیر نفت از کاهش ۱۰۰ لیتری سهمیه بنزین ۳۰۰۰ تومانی کارت‌های سوخت شخصی خبر داد و گفت: سهمیه بنزین ۳۰۰۰ تومانی کارت‌های سوخت شخصی در سراسر کشور به ۱۵۰ لیتر کاهش یافت.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

تعرفه واردات خودرو شناور خواهد بود:

وزیر صمت اعلام کرد: تعرفه واردات خودرو شناور خواهد بود و محدوده آن باز و بسته به اینکه خودرو چگونه فروخته شود، متغیر خواهد بود. تعرفه واردات خودروها، با توجه به نوع خودرو که چه میزان اقتصادی باشد، مشخص خواهد شد. جهت‌گیری آیین‌نامه، حمایت از واردات خودروهای اقتصادی است تا بتواند کمک‌کننده به طبقات متوسط به پایین جامعه باشد.



رئیس بانک مرکزی مکلف به ارائه گزارش عملکرد ۶ ماهه به مجلس شد:

مجلس، رئیس بانک مرکزی را مکلف کرد که در اردیبهشت و آبان ماه هر سال گزارش عملکرد بانک مرکزی، برنامه‌ها و تحولات اقتصادی را به مجلس ارائه کند. بانک مرکزی اردیبهشت و آبان هر سال، گزارش عملکرد می‌دهد؛ با تصویب اصل ماده ۵۳، رئیس‌کل بانک مرکزی مکلف شد اردیبهشت و آبان هر سال، گزارش عملکرد خود را به مجلس و مردم ارائه کند.



دامنه نوسان بورس از دوشنبه هفته گذشته به مثبت و منفی ۷ درصد تغییر نمود:

بر اساس مصوبه هفته گذشته هیات مدیره سازمان بورس، دامنه نوسان از (دوشنبه) هفته گذشته از مثبت و منفی ۶ درصد به مثبت و منفی ۷ درصد تغییر نمود.



امضای ۱۲ تفاهم‌نامه خودرویی با روسیه:

سخنگوی دولت اعلام کرد: در حوزه قطعه‌سازی اخیراً ۱۲ تفاهم‌نامه با روسیه به ارزش ۷۰۰ میلیون یورو منعقد شده و اجرای آن‌ها با شیوه روبری آغاز شده است. برای رقابتی شدن خودروها یک هم‌افزایی خوبی بین خودروسازها در حال شکل‌گیری است.



ذخایر نفت خام آمریکا ۳.۳ میلیون بشکه کاهش یافت:

اداره اطلاعات انرژی در گزارش خود اعلام کرد، ذخایر نفت خام تجاری در ایالات متحده، بدون احتساب ذخایر نفت استراتژیک، در هفته منتهی به ۲۶ اوت با ۳.۳ میلیون بشکه کاهش به ۴۱۸.۳ میلیون بشکه رسیده است.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

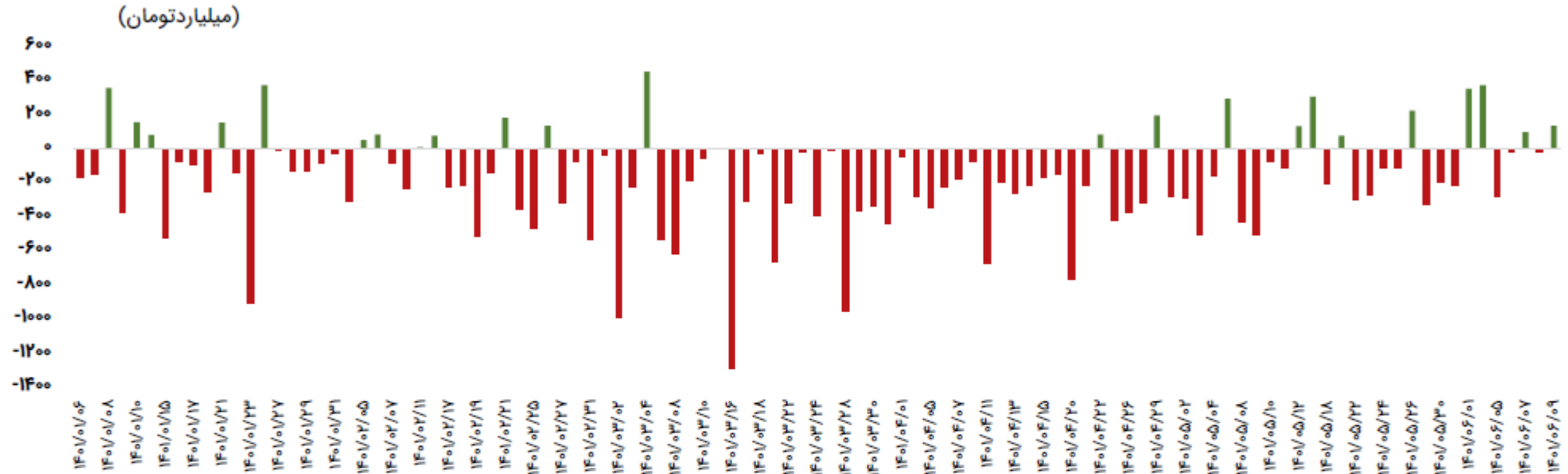
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با افتی حدوداً ۳ هزار واحدی، بر ارتفاع ۱ میلیون و ۴۳۹ هزار واحد به کار خود پایان داد و ۰.۲۱ درصد کاهش را ثبت کرد. شاخص کل هم وزن اما در هفته گذشته، ۳.۶ هزار واحد افزایش یافت و با رشدی ۰.۹ درصد، بر ارتفاع ۴۱۱ هزار واحدی قرار گرفت. بازار سهام طی هفته گذشته، روندی متعادل را دنبال کرد و در انتظار اخبار مرتبط با برجام مانده بود؛ هرچند که در اواسط هفته، اخبار مثبتی از روند مذاکرات احیای برجام به گوش نرسید و بازار پس از آن واکنشی منفی نشان داد و روندی نزولی را شروع کرد؛ در بازارهای موازی همچون ارز و دلار نیز جذابیت چندانی وجود نداشت و اوضاع آرام بود. در طول هفته گذشته، بیشترین بازدهی را در بین صنایع مختلف، گروه های "محصولات کامپیوتری"، "فعالیت های کمکی به نهاد های مالی" و "حمل و نقل" ثبت کردند. همچنین نمادهای "ثرو" ، "دکیمی" و "ثغرب" نیز بیشترین بازدهی را در بین نمادها داشتند. روند ورود و خروج پول حقیقی به بازار نشان می دهد که طی هفته گذشته، بازار سهام ۸۴ میلیارد تومان خروج پول را ثبت کرده است؛ صندوق های درآمد ثابت اما ورود پولی معادل ۶۸۴ میلیارد تومان را ثبت کردند.

تغییرات هفتگی شاخص ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۴۴۲,۳۷۲	۱,۴۳۹,۳۹۶	-۲,۹۷۶	-۰.۲۱%
شاخص هم وزن (واحد)	۴۰۸,۲۵۰	۴۱۱,۸۹۹	۳,۶۴۹	۰.۹%
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۲۴,۲۱۴		-۲,۰۳۴	-۸%

ورود جریان نقد اشخاص حقیقی

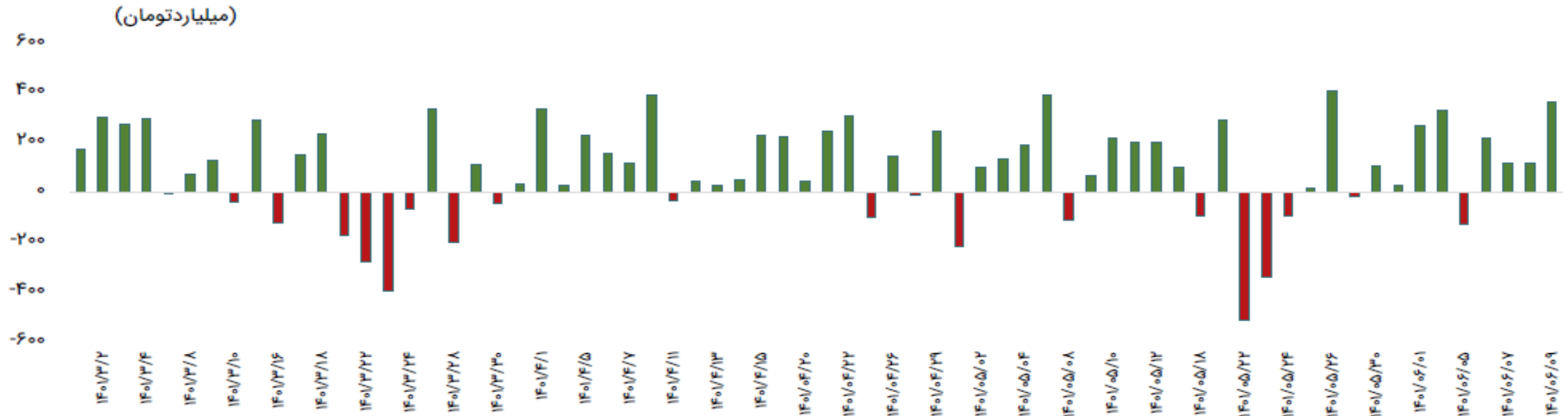
خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۹ شهریور ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد :



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۶/۰۹	۱۳۳
۱۴۰۱/۰۶/۰۸	-۲۲
۱۴۰۱/۰۶/۰۷	۹۷
۱۴۰۱/۰۶/۰۶	-۱۵
۱۴۰۱/۰۶/۰۵	-۲۷۷
۱۴۰۱/۰۶/۰۴	-۱۴

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۶/۰۹	۱۰۵	-۱۹,۱۳۱
ماهیانه (۱۴۰۱/۰۵/۰۹ تا ۱۴۰۱/۰۶/۰۹)	۲۲	-۱,۰۴۴
هفتگی (۱۴۰۱/۰۶/۰۵ تا ۱۴۰۱/۰۶/۰۹)	۵	-۸۴

ورود جریان نقد صندوق‌های با درآمد ثابت

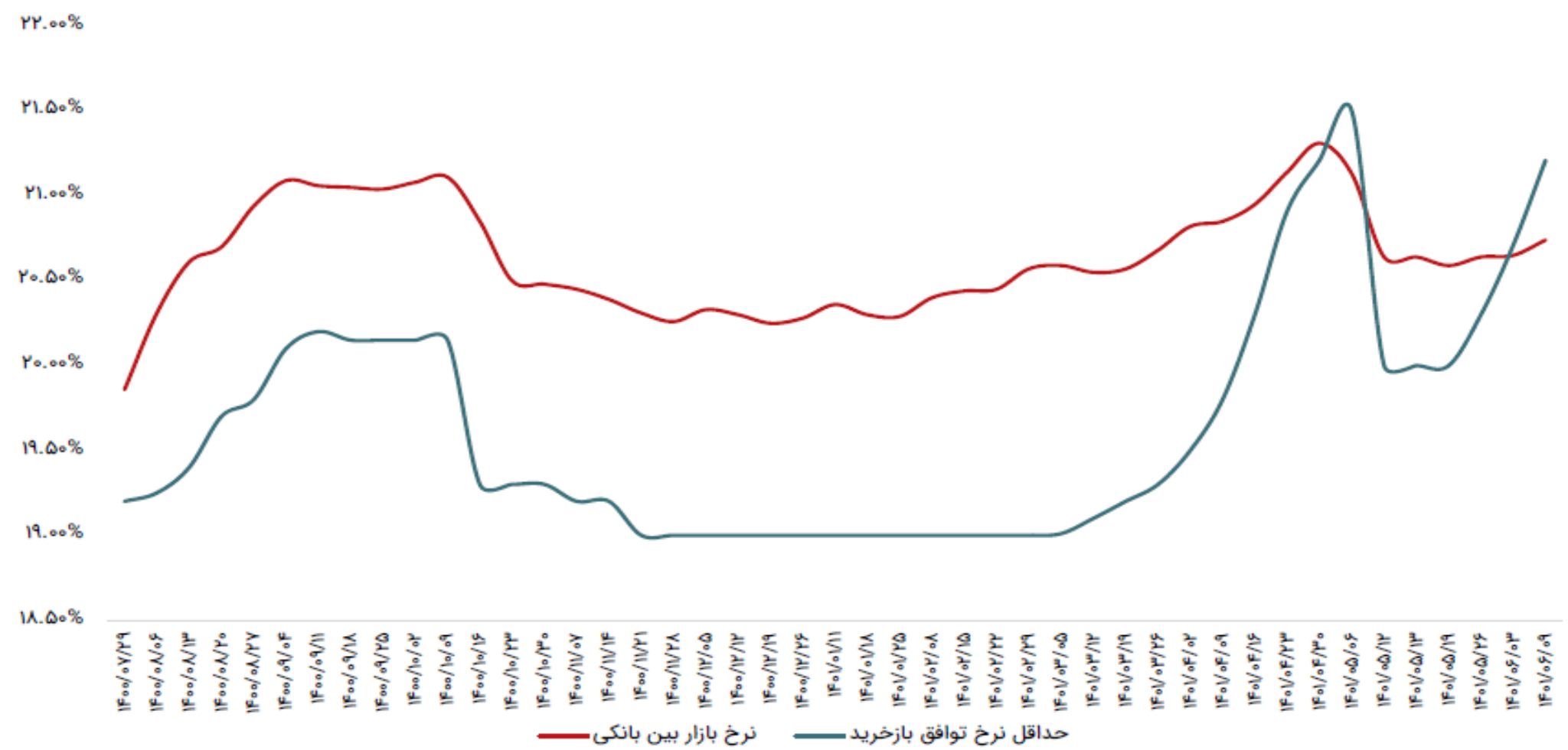


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۶/۰۹	۳۶۰.۵۱
۱۴۰۱/۰۶/۰۸	۱۱۷.۶۵
۱۴۰۱/۰۶/۰۷	۱۱۶.۲۷
۱۴۰۱/۰۶/۰۶	۲۱۶.۹۸
۱۴۰۱/۰۶/۰۵	-۱۲۶.۹۴
جمع	۶۸۴.۴۷

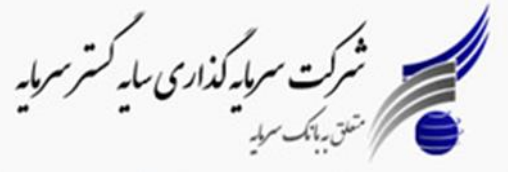
بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۶/۰۹	۱۰۵	۴,۰۴۸.۶۲
ماه‌بانه (۱۴۰۱/۰۶/۰۹ تا ۱۴۰۱/۰۵/۰۹)	۲۲	۱,۸۵۵.۰۳
هفتگی (۱۴۰۱/۰۶/۰۹ تا ۱۴۰۱/۰۶/۰۵)	۵	۶۸۴.۴۷

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در دومین هفته شهریور ماه ۱۴۰۱ با افزایش به ۲۰.۷۴ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام



رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۸.۲۲
۲	فعالیت‌های کمکی به نهاد های مالی واسط	۳.۶۱
۳	سایر حمل و نقل	۳.۴۴
۴	پیمانکاری صنعتی	۲.۶۵
۵	چاپ	۲.۱۲

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	فعالیت‌های فرهنگی و ورزشی	-۳.۴۹
۲	محصولات چوبی	-۲.۹
۳	استخراج زغال سنگ	-۲.۶۲
۴	خودرو و قطعات	-۲.۱
۵	بانکها و موسسات اعتباری	-۱.۸۶

کم بازده‌ترین صنایع

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	سر. مسکن زاینده رود	ثرود	۲۱.۸
۲	کیمیدارو	دکیمی	۱۶.۹۸
۳	سر. مسکن شمالغرب	ثغرب	۱۵.۳۵
۴	کابل البرز	بالبر	۱۵.۱۵
۵	مگسا	زمگسا	۱۵.۱

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	کشت و صنعت پیادر	غاذر	-۱۳.۶۹
۲	سیمان کردستان	سکرد	-۱۳.۴۶
۳	نورد قطعات فولادی	فنورد	-۱۲.۹۴
۴	کاشی صدف سرام استقلال آباده	کصدف	-۱۱.۴۲
۵	قند لرستان	قلرست	-۹.۹۶

کم بازده‌ترین نمادها

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
فولاد	۵,۱۳۰	۲.۹۹
ثامید	۱,۴۳۷	۳.۱۲
شبندر	۷,۴۷۰	۳.۴۲
وبملت	۲,۹۸۶	۳.۵۴
هرمز	۱۱,۱۲۰	۳.۶۷

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وکارزم	۳,۹۸۹	۲۵.۴%
وسپهر	۶,۸۷۰	۲۸.۴%
وملی	۱۲۱,۰۸۰	۲۹.۴%
ثمسکن	۲,۹۸۳	۲۹.۸%
ختوقا	۲,۹۰۶	۳۴.۱%

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۲,۴۵۰
۲	شیمیایی	۱,۷۱۳
۳	فلزات اساسی	۱,۲۰۶
۴	بانکها و موسسات اعتباری	۱,۱۹۹
۵	استخراج کانه های فلزی	۹۰۰

پیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۲
۲	سایر واسطه گریهای مالی	۳
۳	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۵
۴	چاپ	۱۱
۵	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱۳

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
اتیلن	۹۴۱	۱,۰۰۱	۶.۴%
پروپیلن	۸۷۱	۸۷۶	۰.۵۷%
پی وی سی	۹۰۶	۹۰۶	۰.۰۰%
اوره	۷۶۰	۷۵۵	-۰.۶۶%
پلاتین	۸۵۱	۸۴۰	-۱.۳%
اونس طلای جهانی	۱,۷۳۶	۱,۷۱۲	-۱.۳۸%
متانول	۳۱۲	۳۰۶	-۱.۹۲%
سرب	۱,۹۸۵	۱,۸۸۸	-۴.۸۸%
مس	۸,۱۶۰	۷,۵۸۵	-۷.۰۴%
نفت برنت	۱۰۰.۸	۹۳.۲۸	-۷.۴۶%
آلومینیوم	۲,۴۹۳	۲,۲۹۵	-۷.۹۴%
بیلت	۵۱۵	۴۶۰	-۱۰.۷%
روی	۳,۵۶۵	۳,۱۴۴	-۱۱.۸۰%

اهم رویدادهای هفته جاری


 تغییرات بازارهای موازی

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار (طرح جدید)	۱۳۹,۳۱۰,۰۰۰	۱۳۸,۳۷۰,۰۰۰	-۰.۶۷%
طلای ۱۸ عیار	۱۲,۸۴۵,۰۰۰	۱۲,۵۶۴,۰۰۰	-۲.۱۹%
نرخ دلار نیما	۲۶۶,۰۰۵	۲۶۷,۴۱۲	۰.۵۳%


 تقویم اقتصادی

رویداد	روز	تاریخ
شاخص PMI ژاپن، شاخص PMI چین	دوشنبه	۱۴۰۱/۰۶/۱۴
ذخایر ارزی خارجی ژاپن، اعلام نرخ بهره استرالیا	سه شنبه	۱۴۰۱/۰۶/۱۵
تغییرات سالیانه صادرات و واردات چین، تغییرات سالیانه نرخ رشد تولید ناخالص داخلی اتحادیه اروپا	چهارشنبه	۱۴۰۱/۰۶/۱۶
اعلام نرخ بهره بانک مرکزی اروپا، سخنرانی فدرال رزرو آمریکا	پنج شنبه	۱۴۰۱/۰۶/۱۷
نرخ تورم سالانه چین، شاخص قیمت تولیدکننده چین	جمعه	۱۴۰۱/۰۶/۱۸

پیش بینی بازار در هفته جاری

بازار سهام طی هفته گذشته روند مثبتی را دنبال نکرد و در انتظار نتیجه مذاکرات هسته‌ای، روندی نوسانی را دنبال کرد؛ در هفته پیش‌رو اما، همچنان تکلیف برخی از ابهامات روشن نشده و مشخص نیست سرمایه‌گذاران می‌توانند با خیال راحت به خرید و فروش سهام بپردازند یا خیر؛ اخبار و شایعات پیرامون مذاکرات هسته‌ای، چندان مثبت نبوده است و خبر از تعویق مذاکرات به آبان ماه می‌دهند؛ از سوی دیگر، افزایش نرخ بهره بین بانکی نیز خبری بود که بر بازار اثرگذار خواهد بود و رشد بازار را به تعویق خواهد انداخت. مجموع ارزش معاملات نیز در هفته گذشته کاهش یافته بود که با توجه به وضعیت فعلی، انتظار افزایش ارزش معاملات نمی‌رود. شاخص هموزن اما روندی مثبت را طی هفته گذشته دنبال کرد و بازدهی مثبتی را از خود به جا گذاشت اما ادامه این روند صعودی با توجه به وضعیت کلی بازار، مورد انتظار نیست. اخبار اقتصاد کلان جهانی نیز چندان مناسب نیست و قیمت کامودیتی‌ها مجدداً کاهش یافته اند که این امر می‌تواند بر کلیت بازار که شرکت‌های کامودیتی محور هستند، اثرگذار باشد؛ چشم انداز اقتصاد جهانی از قریب الوقوع بودن رکود خبر می‌دهد که اتفاق ناخوشایندی برای جهان و همچنین ایران خواهد بود