



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته بیست و پنجم منتهی به

۱۸ شهریور ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

واردات خودرو تا آخر سال به ۷۰ هزار محصول خواهد رسید / عرضه در بورس کالا
وزارت صنعت اعلام کرد: واردات خودرو از اول مهر با ۱۰ تا ۲۰ هزار یورویی بعلاوه عوارض و عرضه در بورس کالا انجام و تا آخر سال به ۷۰ هزار محصول خواهد رسید.



آخرین مواضع آمریکا در خصوص برجام:
آمریکا با اعلام آخرین مواضع درباره احیای برجام، اعلام کرد: پاسخ ایران واشنگتن را در موقعیت توافق قرار نداده و اختلافات در مورد پیش نویس باقی است.



رضا عیوضلو به عنوان عضو جدید هیئت مدیره سازمان بورس منصوب شد:
در ۲۳۳ امین جلسه شورای عالی بورس ضمن قدردانی از زحمات جناب آقای خدابخش، عضو و نایب رئیس هیئت مدیره سازمان بورس جناب آقای رضا عیوضلو به عنوان عضو موظف هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار منصوب شد.



سومین عرضه خودرو در سامانه یکپارچه نهایی شد:
ثبت نام سومین دوره قرعه‌کشی یکپارچه خودرو از روز چهارشنبه ۱۶ شهریور به مدت سه روز آغاز گردید. در این دوره حدود ۶۰ هزار محصول عرضه می‌شود که شامل ۵۰ درصد برای طرح جوانی و ۲۰ درصد برای خودروهای فرسوده بوده و فراتر از ۱۰ درصد مندرج در قانون بودجه سال جاری است.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

سقوط یورو به زیر یک دلار در پی تشدید بحران انرژی در اروپا:

بلومبرگ اعلام کرد: با عمیق تر شدن بحران انرژی اروپا، یورو به زیر ۹۹ سنت آمریکا سقوط کرد و به پایین ترین سطح در دو دهه اخیر رسید. واحد پول رایج اروپا روز دوشنبه تا ۰.۷ درصد کاهش به ۹۸.۸۰ سنت آمریکا رسید که ضعیف‌ترین نرخ از سال ۲۰۰۲ است.



سقف انتقال وجه غیرحضوری حساب‌های تجاری ۵۰۰ میلیون تومان شد:

بانک مرکزی برای صاحبان حساب‌های تجاری، آستانه روزانه نقل و انتقالات غیر حضوری را به ۵۰۰ میلیون تومان و ماهانه ۳ میلیارد تومان افزایش داد. همچنین صاحبان حساب‌های تجاری دیگر لازم نیست برای نقل و انتقالات بیش از ۲۰۰ میلیون تومان به بانک مستند ارائه کنند بلکه بانک‌ها فقط برای نقل و انتقالات بالاتر از مبلغ یک میلیارد تومان باید از این اشخاص مستندات مطالبه کنند.



طرح شناورسازی ساعت کاری ادارات تهران از اول مهر اجرا خواهد شد:

استاندار تهران گفت: در جلسه شورای ترافیک از اول مهرماه طرح شناورسازی ساعت کاری ادارات، بانک‌ها و مدارس تصویب شد.



قطع روابط دیپلماتیک ایران و آلبانی:

ادی راما، نخست‌وزیر آلبانی با انتشار پیامی تصویری در رسانه اجتماعی اعلام کرد که در پی حمله سایبری گسترده ایران در ماه جولای علیه این کشور، روابط دیپلماتیک خود با تهران را قطع کرده است. در همین راستا آمریکا وزیر و وزارت اطلاعات ایران را به دلیل "اقدامات مخرب سایبری" تحریم کرد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

قیمت نفت در سراسر آسیا:

هفته گذشته قیمت نفت با کاهشی محسوس درگیر بود به طوری که قیمت سبد نفتی اوپک از ۱۰۳ دلار به ۹۶ دلار و قیمت نفت برنت از ۹۷ دلار به ۸۹ دلار کاهش یافت. افزایش نرخ بهره و سیاست انقباضی بانک مرکزی آمریکا و همچنین کاهش مصرف چین به دلیل سیاست کرونای صفر در این کشور از عوامل اصلی کاهش قیمت نفت بوده است.



شورای حکام قطعنامه ای علیه ایران صادر نخواهد کرد:

خبرنگار وال استریت ژورنال در توئیتر اعلام کرد: در جلسه هفته آینده شورای حکام آژانس، قطعنامه‌ای علیه ایران صادر نخواهد شد. براساس این گزارش، رافائل گروسی مدیر کل آژانس رافائل گروسی در دو گزارش جدید اعلام کرد: هیچ پیشرفتی در حل و فصل پرونده پیدا شدن آثار اورانیوم غنی شده با منشا انسانی در مکان‌های مختلف ایران حاصل نشده و امکان تضمین برنامه هسته‌ای صلح آمیز نیست. آژانس از تصمیم گذشته ایران در حذف تعدادی از دوربین‌های نظارتی برای راستی آزمایی ماهیت غیرنظامی برنامه هسته‌ای ابراز تاسف می‌شود و انباشت اورانیوم غنی شده در ماه‌های اخیر ادامه یافته که ۱۹ برابر حد مجاز توافق سال ۲۰۱۵ است.



عضو کمیسیون عمران مجلس: تولید مسکن با تامین مالی از بورس افزایش می‌یابد

کمیسیون عمران مجلس و کاهش تولید دو علت اصلی آشفتگی بازار مسکن است. بنابراین، اگر تامین مالی مسکن در بازار سرمایه و بورس انجام شود هر دو مشکل حل خواهد شد. بازار سرمایه با حفظ اصول بازار در حوزه مسکن، محل مناسبی برای جمع‌آوری سرمایه‌های خرد و حمایت از تولید کننده واقعی است.



بورس در هفته ای که گذشت

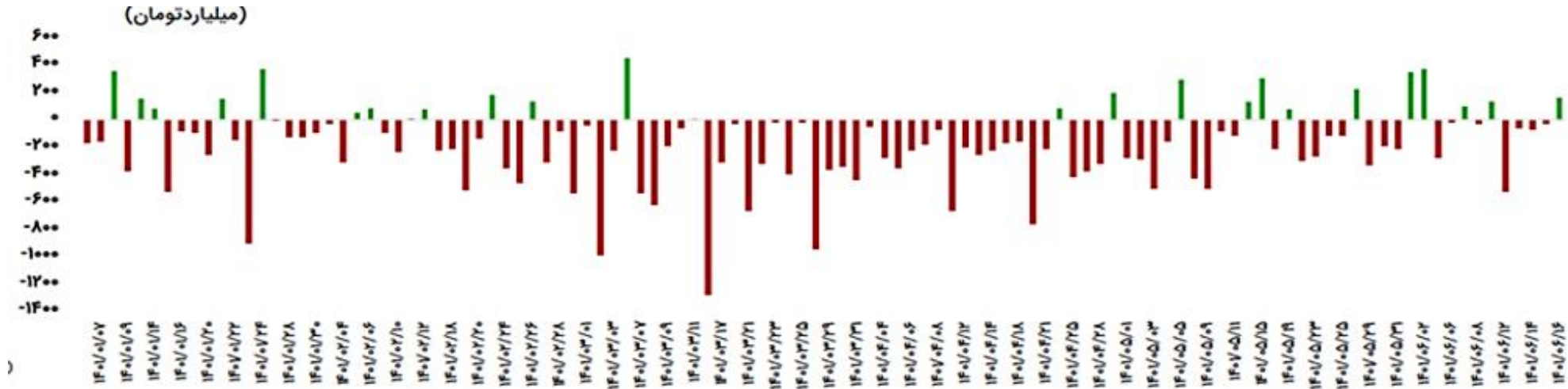
شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با حدود ۲۶۵۰۰ واحد کاهش نسبت به هفته ماقبل، بر ارتفاع ۱ میلیون و ۴۱۲ هزار واحد قرار گرفت و افتی ۲.۱ درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن با ۱۵۷۴ هزار واحد کاهش در ارتفاع ۴۱۰.۳۲۵ هزار واحدی قرار گرفت. از جمله مهم‌ترین عواملی که بر وضعیت بازار طی هفته گذشته اثرگذار بود می‌توان به بلاتکلیف ماندن نتیجه توافق احیای برجام اشاره داشت که باعث شد وضعیت کلان اقتصادی و سیاسی از دیدگاه فعالین بازار در هاله ای از ابهام قرار بگیرد. همچنین کاهش قیمت کامودیتی‌ها در بازارهای جهانی ناشی از سیاست‌های ضد تورمی و کاهش نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا از دیگر عواملی بود که بر روند بازار اثرگذار بود. افزایش نرخ دلار در بازار آزاد نیز عامل دیگری بود که بر بازار اثر گذاشت.

تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۴۳۹,۳۹۶	۱,۴۱۲,۸۵۶	-۲۶,۵۴۰	-۲.۱٪
شاخص هم‌وزن (واحد)	۴۱۱,۸۹۹	۴۱۰,۳۲۵	-۱,۵۷۴	-۰.۴٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۲۷,۰۳۱	۲۷,۰۳۱	۷۸۳	۲.۹٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

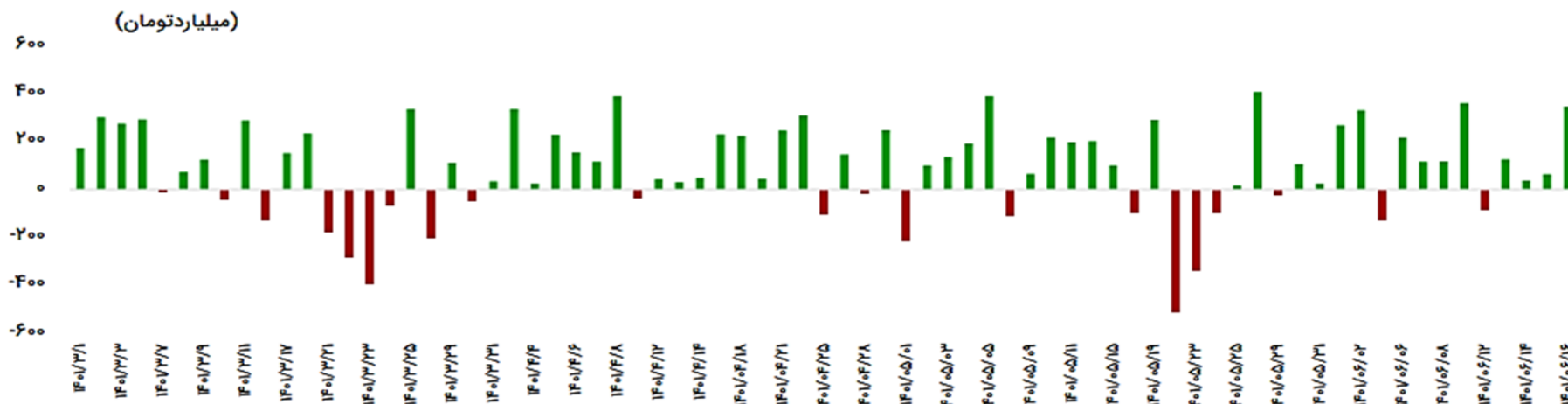


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
1401/06/16	161
1401/06/15	-24
1401/06/14	-65
1401/06/13	-60
1401/06/12	-526
جمع	-514

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال 1401 تا 1401/06/16	110	-19,645
ماهانه (1401/05/16 تا 1401/06/16)	23	-1,000
هفتگی (1401/06/12 تا 1401/06/16)	5	-514

ورود و خروج جریان نقد به صندوق‌های با درآمد ثابت

خالص ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در صندوق و اوراق با درآمد ثابت از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۱۶ شهریور ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می‌باشد:

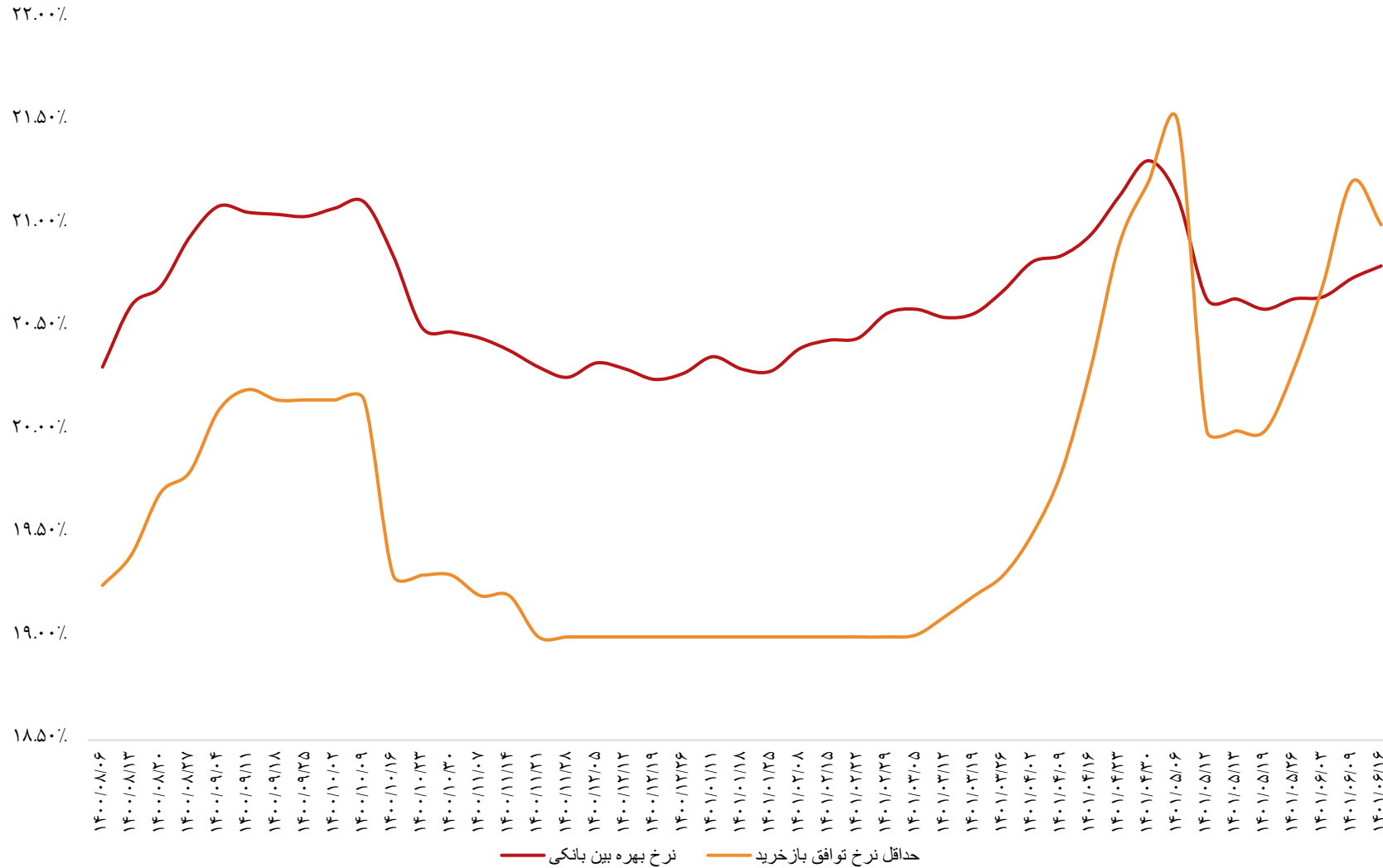


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۶/۱۶	۳۴۶.۷۴
۱۴۰۱/۰۶/۱۵	۶۴.۷
۱۴۰۱/۰۶/۱۴	۳۷.۵۶
۱۴۰۱/۰۶/۱۳	۱۲۵.۹۸
۱۴۰۱/۰۶/۱۲	-۸۱.۸۲
جمع	۴۹۳.۱۶

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۶/۱۶	۱۱۰	۴.۵۴۱.۸
ماه‌بانه (۱۴۰۱/۰۵/۱۶ تا ۱۴۰۱/۰۶/۱۶)	۲۳	۱.۶۶۵.۳۴
هفتگی (۱۴۰۱/۰۶/۱۲ تا ۱۴۰۱/۰۶/۱۶)	۵	۴۹۳.۱۶

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته دوم شهریور ماه ۱۴۰۱ با افزایش به ۲۰.۸ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	پتروشیمی ممسنی	ممسنی	۷۳.۴۷
2	پتروشیمی کازرون	کازرو	۶۳.۶۰
3	صنایع پتروشیمی دهدشت	دهدشت	۲۳.۶۱
4	آریان کیمیا تک	کیمیاتک	۱۸.۵۷
5	کاشی تکسرام	کترام	۱۷.۶۴

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	پلاستیران	پلاست	-۲۱.۶۵
2	سیمان آرتا اردبیل	ساربیل	-۱۲.۹۴
3	سیمان کردستان	سکرد	-۱۲.۵۰
4	فراورده های نسوز ایران	کفرا	-۱۲.۱۳
5	فراپورس ایران	فراپورس	-۱۰.۱۲

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	اطلاعات و ارتباطات	۱۰۰.۰۱
۲	پیمانکاری صنعتی	۶.۷
۳	محصولات چرمی	۶.۵۷
۴	خرده فروشی	۳.۹
۵	سایر واسطه‌گری های مالی	۲.۶۶

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	محصولات کامپیوتری الکترونیکی	-۸.۲۱
۲	حمل و نقل انبارداری	-۵.۴۸
۳	فعالیت‌های فرهنگی و ورزشی	-۵.۱۶
۴	نهادهای مالی واسط	-۴.۶۹
۵	بانک ها و موسسات اعتباری	-۴.۰۶

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
سپاها	۹,۳۶۰	۲.۸
شبندر	۷,۰۹۰	۳.۵
شپنا	۵,۸۴۰	۳.۶
شیراز	۷,۰۹۵۰	۳.۶
سآبیک	۱۱,۵۴۰	۳.۷

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۹۴۰	۲۵%
وسپهر	۶,۸۵۰	۲۸.۵%
ثمسکن	۲,۸۸۲	۲۸.۹%
وملی	۱۲۴,۷۷۰	۳۰.۹%
ختوقا	۲,۷۱۹	۳۲.۵%

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۲,۴۴۶
۲	شیمیایی	۲,۰۴۶
۳	فلزات اساسی	۱,۲۵۷
۴	بیمه و بازنشستگی	۱,۰۹۰
۵	بانکها و موسسات اعتباری	۸۸۱

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۱۰۱
۲	چاپ	۴۰۸
۳	سایر واسطه‌گری های مالی	۵۰۴
۴	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش	۸۰۹
۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۹۰۶

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
مس	۷.۵۸۵	۷.۹۸۴	۵.۳%
متانول	۳۰۶	۳۱۸	۳.۹۲%
روی	۳.۱۴۴	۳.۲۲۲	۲.۵%
پروپیلن	۸۷۶	۸۹۱	۱.۷۱%
سرب	۱.۸۸۸	۱.۹۱۷	۱.۵۳%
اونس طلای جهانی	۱.۷۱۲	۱.۷۱۵	۰.۱۷%
بیلت	۴۶۰	۴۶۰	۰%
اتیلن	۱.۰۰۱	۱.۰۰۱	۰%
پی‌وی‌سی	۹۰۶	۹۰۶	۰%
آلومینیوم	۲.۲۹۵	۲.۲۹۰	-۰.۲۲%
نفت برنت	۹۳.۲۸	۹۲.۴۲	-۰.۹۲%
پلاتین	۸۴۰	۸۷۳	-۳.۹۳%
اوره	۷۵۵	۶۹۲	-۸.۳۴%

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۳۹,۳۱۰,۰۰۰	۱۳۹,۶۰۰,۰۰۰	٪۰.۲
طلای ۱۸ عیار	۱۲,۸۴۵,۰۰۰	۱۲,۶۵۶,۰۰۰	٪۱.۰۴
نرخ دلار نیما	۲۶۶,۰۰۵	۲۶۹,۰۱۰	٪۱.۱۲

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۶/۲۱	دوشنبه	تغییرات ماهیانه تولید ناخالص داخلی انگلستان
۱۴۰۱/۰۶/۲۲	سه شنبه	نرخ تورم سالیانه آمریکا، نرخ بیکاری انگلستان، شاخص تمایلات اقتصادی آلمان
۱۴۰۱/۰۶/۲۳	چهارشنبه	نرخ تورم سالانه انگلستان، شاخص قیمت تولید کننده آمریکا
۱۴۰۱/۰۶/۲۴	پنج شنبه	نرخ بیکاری استرالیا، شاخص خرده فروشی آمریکا
۱۴۰۱/۰۶/۲۵	جمعه	آمار تولیدات صنعتی چین، شاخص خرده فروشی انگلستان



پیش بینی بازار در هفته جاری

در حالیکه بازار سرمایه در هفته گذشته روند چندان مثبتی را طی نکرد، ابهام در مذاکرات برجام، سیاست های انقباضی بانک مرکزی آمریکا، ادامه محدودیت های کرونایی چین از عوامل خارجی و ازطرفی نزدیک شدن به پایان شهریور و تسویه اعتبار کارگزاری ها ، فروش سهام توسط شرکت های سرمایه گذاری برای شناسایی سود سال مالی، خروج پول اشخاص حقیقی و کم بودن حجم معاملات از عوامل داخلی هستند که می توانند هفته نه چندان مناسبی برای بازار سهام رقم بزنند. البته شاخص کل در یک قدمی حمایت یک میلیون و ۴۰۰ هزار واحد بوده و در صورت از دست دادن این حمایت عدد یک میلیون و ۳۵۰ هزار واحد می تواند حمایتی مناسب جهت جلوگیری از ریزش بیشتر بازار باشد.