



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته بیست و نهم منتهی به

۱۵ مهرماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

آغاز فروش متری مسکن در بورس کالا از اواخر آبان ماه:

رئیس سازمان نوسازی شهر تهران با بیان اینکه تلاش کردیم برای افرادی که سرمایه کمی دارند شرایطی فراهم کنیم که بتوانند خانه‌دار شوند، گفت: از اواخر آبان سال جاری فروش متری مسکن آغاز می‌شود، به این معنا که قرار است مسکن را در بورس کالا عرضه کنیم. این اقدام در جهت جذب سرمایه‌های خرد است تا بتوانیم سرمایه‌ها را به سمت مسکن بیاوریم.



انتقال منابع ارزی ایران به کشور همسایه:

به گزارش نور نیوز رسانه: توافق برای انتقال منابع ارزی آزاد شده ایران به یک کشور همسایه نهایی شد. همچنین آزادی باقر نمازی به دلایل انسان دوستانه انجام شده و ربطی به توافق در خصوص تبادل زندانی در ایران با چهار زندانی در آمریکا به علاوه آزادسازی منابع ارزی ایران در کره جنوبی ندارد.



مسیر رفع تحریم‌ها درست و آمریکا با درک بهتر در تبادل پیام‌ها حضور دارد:

حسین امیرعبداللهیان گفت: اقدامات در حال انجام برای لغو تحریم‌ها در مسیر و تبادل پیام درست قرار دارد. آمریکا درک درستی از شرایط نداشت اما اکنون با درک بهتری در تبادل پیام‌ها حضور دارد و می‌توان در گام‌های نهایی توافقی با سرعت بیشتری عمل کرد.



علت حذف سامانه یکپارچه قرعه‌کشی خودرو:

امید قالیباف سخنگوی وزارت صنعت درباره اظهارات اخیر وزارت صنعت مبنی بر عدم فعالیت سامانه یکپارچه فروش خودرو مانند سابق، گفت: پیش از این حدود ۱۰ خودرو ساز، محصولات را در این سامانه عرضه می‌کردند اما با توجه به خروج اغلب خودروها از فرایند قرعه‌کشی، موضوعیت سامانه از دست رفت و صرفاً برخی محصولات ایران خودرو در قالب قرعه‌کشی، عرضه می‌شود.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

دوازدهمین عرضه اولیه با تخصیص صرف به صندوق‌ها:

۲۰ درصد از سهام سرمایه‌گذاری اقتصاد شهر طوبی عرضه اولیه و طی آن ۶۰۰ میلیون سهم با قیمت ارزش گذاری ۱۵۲۹ ریالی و حداکثر سهمیه ۲۹ میلیون سهمی به سرمایه‌گذاران واجد شرایط شامل صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله و صندوق‌های سرمایه‌گذاری مشترک ثبت شده نزد سازمان بورس در زمان سفارش‌گیری واگذار می‌شود.



رضایت وزیر نفت از بازارهای جذاب برای فروش نفت ایران:

جواد اوجی گفت: فروش و صادرات نفت، میعانات و فرآورده‌های نفتی بدون وقفه در حال انجام است و ارسال محصولات بدون هیچ‌گونه مشکلی جریان دارد. وی افزود: با شناسایی بازارهای تازه و فرآیندهای جدید صادراتی امکان تحول نفت و میعانات گازی نسبت به چند سال گذشته فراهم شده و هیچ توقفی در صادرات نفت ایجاد نشده است.



بعید بودن ساخت ۴ میلیون مسکن و پیشنهاد افزایش وام به ۵۵۰ میلیون تومان:

عضو هیئت مدیره انبوه‌سازان اعلام کرد: برنامه دولت برای ساخت ۴ میلیون واحد مسکونی در چهارسال به علت افزایش چند برابری هزینه‌ها، تورم و کاهش تمکن مالی خانواده‌ها در تامین آورده، ناممکن بوده و دولت باید با قید فوریت نسبت به افزایش تسهیلات بانکی اقدام کنند تا با کاهش سهم متقاضی بتوان به اجرای این طرح امیدوار بود.



بن بست در مذاکرات برجام صحت ندارد:

ناصر کنعانی در تشریح آخرین تحولات در حوزه سیاست خارجی گفت: برای مذاکرات رفع تحریم‌ها، تلاش‌های اروپا و برخی واسطه‌ها از جمله وزیران خارجه کشورهای همسایه برای تبادل پیام‌ها و تحقق توافق در جریان است. وی ادامه داد: مجمع سازمان ملل هم فرصت مناسبی برای برخی مذاکرات جانبی بود و گفت‌وگوهای دو و چندجانبه انجام شد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

پیش‌بینی نماینده مجلس از اثر خنثی واردات یک میلیارد یورو خودرو خارجی بر بازار:

علی‌اکبر کریمی در خصوص آیین‌نامه واردات خودرو گفت: با توجه به اینکه سقف ارزش تعیین‌شده برای واردات هر خودرو ۲۰ هزار دلار تعیین شد با رقم یک میلیارد دلاری برای واردات سال جاری، حدود ۵۰ هزار دستگاه وارد خواهد شد. عرضه خودرو داخلی هم حدود یک میلیون دستگاه پیش‌بینی شده و به فرض واردات ۵۰ هزار دستگاه، تاثیر چندانی در بازار نخواهد داشت.



صادرات ۱۷۵ میلیون دلاری لوازم خانگی در پنج ماه / روس‌ها مشتری محصولات ایرانی:

دبیر کل انجمن صنایع لوازم خانگی: گروه‌های مختلفی از روسیه برای واردات لوازم خانگی به تهران سفر کردند و باید از این فرصت استفاده کرد. همچنین روسیه با توجه به جمعیت بالا و شرایط خاص سیاسی می‌تواند برای دو تا سه سال آینده بازار مناسبی برای صنعتگران ایرانی باشد.



پیش‌بینی دو بانک آمریکایی از اثر تصمیم اوپک پلاس بر قیمت نفت:

به گزارش بلومبرگ، بانک مورگان استنلی درباره تصمیم اخیر اوپک پلاس مبنی بر کاهش تولید روزانه دو میلیون بشکه، اعلام کرد: در صورت عملی شدن حذف ۱.۵ میلیون بشکه نفت روسیه در روز به دلیل تحریم‌ها و اجرای تصمیم اوپک، کمبود عرضه سال میلادی آینده از ۲۰۰ به ۹۰۰ هزار بشکه در روز خواهد رسید. بنابراین قیمت نفت از ۹۵ به ۱۰۰ دلار افزایش خواهد یافت. براساس این گزارش، بانک گلدمن ساکس هم پیش‌بینی نفت برنت در سه ماه جاری را با افزایش ۱۰ دلاری به ۱۱۰ دلار رساند.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با ۳۲,۷۱۰ واحد کاهش نسبت به هفته قبل، بر ارتفاع ۱ میلیون و ۳۱۳ هزار واحد قرار گرفت و افتی ۲.۴- درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن با ۱۲,۱۴۹ واحد کاهش در ارتفاع ۳۸۰,۳۴۹ واحدی قرار گرفته و افت ۳.۰۹ درصدی را ثبت نمود. تنش‌های سیاسی داخلی و عدم اطمینان ناشی از ریسک سیستماتیک را می‌توان مهم‌ترین عامل کاهش محسوس دماسنج اقتصادی هفته گذشته دانست. از طرفی دیگر نوسان سهم‌داران نسبت به حمایت دولت از بازار سرمایه و رشد تقاضا در بازارهای موازی مانند ارز و طلا، منجر به خروج پول اشخاص حقیقی از بازار و در نتیجه رکود معاملات و کاهش شاخص بازار گردیده است.

تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۳۴۶,۵۶۳	۱,۳۱۳,۸۵۳	-۳۲,۷۱۰	-۲.۴%
شاخص هم‌وزن (واحد)	۳۹۲,۴۹۸	۳۸۰,۳۴۹	-۱۲,۱۴۹	-۳.۰۹%
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۱۵,۱۶۱	۲۱۵۳	۲۱۵۳	۱۷.۱%

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

خالص ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۱۵ مهر ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد:



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۷/۰۹	(۱,۰۱۶)
۱۴۰۱/۰۷/۱۰	(۴۴۳)
۱۴۰۱/۰۷/۱۱	(۱۲۴)
۱۴۰۱/۰۷/۱۲	۲۲۹

بازه زمانی	ورود پول میلیارد تومان
ورود و خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال	(۲۲,۱۵۷)
ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بازه یک ماهه	(۳,۱۲۱)
ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در هفته گذشته	(۱,۳۵۳)

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

خالص ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۱۵ مهر ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد:



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۷/۱۲	۴۰۹.۹
۱۴۰۱/۷/۱۱	۱۷۰.۹
۱۴۰۱/۷/۱۰	۹.۱
۱۴۰۱/۷/۰۹	-۴۲۲.۷

بازه زمانی	ورود پول (میلیارد تومان)
ورود و خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال	۶,۴۵۴
ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بازه یک ماهه	۲,۰۴۶
ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در هفته گذشته	۱۶۷

ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	دنا آفرین فدک	گدنا	۲۲.۲۲
2	سیمان اصفهان	ساصفها	۱۸.۴۵
3	بیمه دانا	دانا	۱۵.۰۲
4	لیزینگ ایران و شرق	ولشرق	۱۴.۱۲
5	پگاه آذربایجان غربی	غشاذر	۱۲.۶۵

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	کشاورزی مکانیزه اصفهان	زکشت	-۱۸.۲۵
۲	معدنی دماوند	کدما	-۱۶.۶۵
۳	کشت و صنعت پیاذر	غاذر	-۱۵.۹۶
۴	شیشه و گاز	کگاز	-۱۵.۷۸
۵	خوراک دام پارس	غدام	-۱۵.۰۴

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی	۲.۶۶

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	عرضه بخار و گاز	-۱۱.۰۷
۲	محصولات کامپیوتری و الکترونیکی	-۱۱.۵۴
۳	پیمانکاری صنعتی	-۱۱.۳۴
۴	استخراج سایر معادن	-۹.۴
۵	چاپ	-۷.۴۴

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
سپاها	۸,۶۰۰	۲.۶
دلر	۱۷,۷۲۰	۳.۷
شیراز	۶۸,۲۵۰	۳.۸
سصوفی	۱۷,۲۶۰	۳.۹
کحافظ	۴,۶۶۰	۳.۹

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۳۳۴	٪۲۲.۱
وملی	۱۰۵,۳۵۰	٪۲۶.۱
ثمسکن	۲,۵۶۰	٪۲۷.۵
وسپهر	۶,۸۵۰	٪۲۸.۹
پترول	۱,۸۹۲	٪۳۱.۸

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۱,۰۸۰
۲	شیمیایی	۷۱۹
۳	فلزات اساسی	۶۶۴
۴	فراورده های نفتی	۴۶۴
۵	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی	۴۵۰

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۰,۷
۲	فعالیت های مهندسی، تجزیه و تحلیل	۱,۱
۳	فعالیت های سرگرمی و هنری	۱,۲
۴	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۱,۵
۵	چاپ	۲,۷

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
نفت برنت	۸۵	۹۸	۱۵.۴۲
سرب	۱,۸۷۶	۲,۰۳۵	۸.۴۸
آلومینیوم	۲,۱۵۵	۲,۳۰۲	۶.۸۲
پلاتین	۸۵۹	۹۱۵	۶.۵۲
اونس جهانی طلا	۱,۶۶۲	۱,۶۹۵	۱.۹۹
بیلت	۴۵۸	۴۶۱	۰.۶۶
روی	۲,۹۷۲	۲,۹۷۳	۰.۰۳
متانول (پلتس)	۳۳۱	۳۳۱	۰.۰۰
پروپیلن (پلتس)	۸۹۵	۸۹۵	۰.۰۰
پی‌وی‌سی (پلتس)	۸۲۰	۸۲۰	۰.۰۰
مس	۷,۵۰۷	۷,۴۶۳	-۰.۵۹
اوره (خلیج فارس)	۶۵۴	۶۴۵	-۱.۳۸
اتیلن (پلتس)	۸۵۰	۸۳۰	-۲.۳۵

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۴۶,۰۵۰,۰۰۰	۱۵۰,۷۹۰,۰۰۰	۳.۲٪
طلای ۱۸ عیار	۱۳,۲۹۸,۰۰۰	۱۳,۸۲۴,۰۰۰	۳.۹٪
نرخ دلار نیما	۲۷۰,۱۳۲	۲۷۲,۵۶۷	۰.۹٪

تقویم اقتصادی 

رویداد	روز	تاریخ
شاخص اطمینان مصرف کننده استرالیا	دوشنبه	۱۴۰۱/۰۷/۱۸
نرخ بیکاری انگلستان	سه شنبه	۱۴۰۱/۰۷/۱۹
شاخص قیمت تولید کننده آمریکا-تغییرات تولید ناخالص داخلی انگلستان	چهارشنبه	۱۴۰۱/۰۷/۲۰
نرخ تورم سالانه آمریکا	پنج شنبه	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
نرخ تورم سالانه چین- آمار تغییرات ماهیانه خرده فروشی آمریکا	جمعه	۱۴۰۱/۰۷/۲۱

پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری، متغیرهایی همچون رشد قیمت جهانی نفت، رشد دلار نیما، خبر تعیین تکلیف فروش بلوکهای دولت در خودروسازان و عدم بن بست در مذاکرات برجام بتواند محرکی برای تغییر روند و شروع حرکت شاخص به مدار مثبت باشد. البته فروکش کردن تنش های داخلی وزن بسیاری بر بازار سهام ایفا می نماید. شاخص کل در ارتفاع یک میلیون و ۳۱۳ هزار واحد است که بسیار نزدیک به حمایت یک میلیون ۲۹۰ هزار واحد (خط روند صعودی بلند مدت) می باشد. به نظر می رسد در صورت کاهش تنش داخلی با وجود متغیرهای مطروحه بازار در این هفته با معاملات متعادل و مثبت رو به رو باشد.