



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و سوم منتهی به

۱۳ آبان ماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

صندوق بین‌المللی پول اعلام کرد: ایران ۱۲۲ میلیارد دلار ذخیره ارزی دارد:

صندوق بین‌المللی پول در جدیدترین گزارش ذخایر ارزی واقعی ایران را ۱۲۲ میلیارد دلار اعلام و دارنده سومین کشور بزرگ ذخایر ارزی در خاور میانه و آسیای مرکزی اعلام نمود. این رقم نسبت به سال قبل ۱۳ میلیارد دلار افزایش داشته است و پیش‌بینی شده در سال آینده میلادی این افزایش به رقم ۴۲ میلیارد دلار برسد.



روش عرضه ارز صرافی‌ها تغییر کرد:

به منظور تسهیل فروش ارز به مردم و جلوگیری از اتلاف وقت متقاضیان خرید، صرافی‌های عضو بازار متشکل ارزی از شنبه مورخ ۱۴ آبان باید متقاضیان معرفی شده از طریق سامانه MY.ICE.IR را در اولویت فروش ارز قرار داده و متعهد به ارائه خدمات در زمان مقرر باشند. متقاضیان پس از ورود به سامانه و تکمیل اطلاعات هویتی و درخواست خرید، پس از دریافت پیامک با همراه داشتن کارت ملی به صرافی معرفی شده مراجعه می‌کنند.



مذاکرات ایران و غنابرای ورود خودروسازان از سر گرفته خواهد شد:

سفیر غنا امکان تجارت و تبلیغات محصولات ایرانی فراهم بوده و معافیت‌هایی برای تجارت کشاورزی، معدن و انرژی با هدف تاسیس کارخانه در هر شهرستان و روستا، مدنظر است.



دومین عرضه محصول شاسی بلند ایران خودرو:

۲۰۰ دستگاه هایما ۷S مشکی و ۵۰ دستگاه هایما ۷S مشکی سفارشی متعلق به ایران خودرو با قیمت پایه ۷۴۲.۵ و ۷۵۶.۵ میلیون تومانی در بورس کالا عرضه شد. بر اساس این گزارش، ۵۰ دستگاه هایما ۷S مشکی سفارشی پس از ۳۰ دقیقه با تقاضای ۲۶۹ دستگاهی و رقابت ۱۱.۵ درصدی به قیمت کشف شده ۸۴۹ میلیون تومان فروخته شد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

دلگرمی سهامداران با بیمه سهام:

عضو سابق شورای عالی بورس: در خصوص اجرایی شدن بیمه سبد سهام از طریق انتشار اوراق تبعی: به طور کلی با دو نوع سرمایه‌گذار در بازار سرمایه مواجه هستیم، یک بخش، سرمایه‌گذاران خرد هستند که عمدتاً افراد ریسک‌پذیری نیستند و بنا به دلایل مختلف وارد بازار سرمایه شدند؛ بنابراین بیمه سهام یا اوراق فروش تبعی می‌تواند آنها را دلگرم کند که حداقل سودی را در حدود سیستم بانکی بتوانند از بازار سهام به دست بیاورند.



مالیات بر سود سپرده‌های حقوقی در بانکها حذف خواهد شد:

رئیس بانک مرکزی اعلام کرد مالیات بر سود سپرده‌های حقوقی در بانکها با کمک مجلس از بودجه سال ۱۴۰۱ حذف می‌شود. وی در خصوص وضعیت ارزی افزود: تامین ارز برای واردات در بازه زمانی یاد شده معادل ۳۸.۵ میلیارد دلار بوده که مدت به دوره مشابه سال گذشته ۲۲ درصد افزایش داشته است



معافیت مالیاتی شرکت‌های تولید نرم افزار:

بخشنامه معافیت مالیاتی شرکتهای تولید کننده نرم افزار دارای پروانه بهره برداری تا پایان سال قبل، جهت اجرا به ادارات مالیاتی ابلاغ گردیده شد که برای شرکت های بورسی مانند خدمات انفورماتیک، کارت اعتباری ایران کیش، سامان پرداخت، ایران ارقام، تجارت الکترونیک پارسپان و.. رویدادی مناسب می باشد



برجام حتی در دستور کار واشنگتن نیست:

رابرت مالی گفت: واشنگتن با این امید که ممکن است روزی توافق هسته‌ای با ایران حاصل شود دست‌ها را نمی‌بندد. طی دو ماه اخیر اقدامی در خصوص مذاکرات صورت نگرفته و حتی در دستور کار آمریکا نیست. نمی‌توان در برابر اتفاقات دیگر بر روی مسائل راکد تمرکز کرد.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با ۴۲.۴۷۳ واحد افزایش نسبت به هفته قبل، بر ارتفاع ۱ میلیون و ۲۸۳ هزار واحد قرار گرفت و افزایش ۳.۴ درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن با $۴,۳۹۰$ واحد افزایش در ارتفاع $۳۶۵,۷۵۰$ واحدی قرار گرفته و افزایش ۱.۲ درصدی را ثبت نمود. شروع هفته با خبرهای حمایت از بازار سرمایه شروع شد. صندوق تثبیت بازار به عنوان خریدار عمل کرده و تزریق منابع به بازار انجام گردید. البته سهامداران حقیقی اعتماد کامل به این اقدام نداشته و آمار نشان دهنده خروج پول حقیقی از بازار بود اما رسیدن بازار به محدوده ارزندگی و افزایش قیمت دلار بازار آزاد موجب افزایش قیمت‌ها گردید.

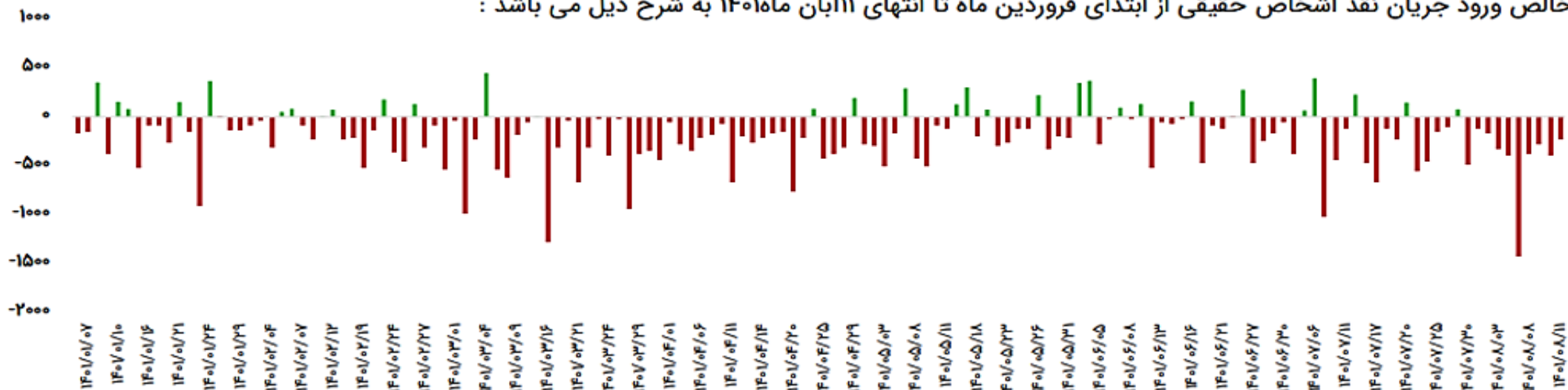
تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۲۴۱,۰۶۷	۱,۲۸۳,۵۴۰	۴۲,۴۷۳	۳.۴٪
شاخص هم‌وزن (واحد)	۳۶۱,۳۶۰	۳۶۵,۷۵۰	۴,۳۹۰	۱.۲٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۲۲,۷۱۹		۱,۹۲۸	۹.۳٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

(میلیارد تومان)

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



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۸/۰۷	-۱,۴۲۶
۱۴۰۱/۰۸/۰۸	-۳۷۶
۱۴۰۱/۰۸/۰۹	-۲۷۸
۱۴۰۱/۰۸/۱۰	-۳۹۰
۱۴۰۱/۰۸/۱۱	-۲۲۶
جمع	-۲,۶۹۶

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۱۱	۱۴۶	-۲۸,۹۳۹
ماه‌هایانه (۱۴۰۱/۰۷/۱۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۱۱)	۲۲	-۶,۵۸۱
هفتگی (۱۴۰۱/۰۸/۰۷ تا ۱۴۰۱/۰۸/۱۱)	۵	-۲,۶۹۶

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

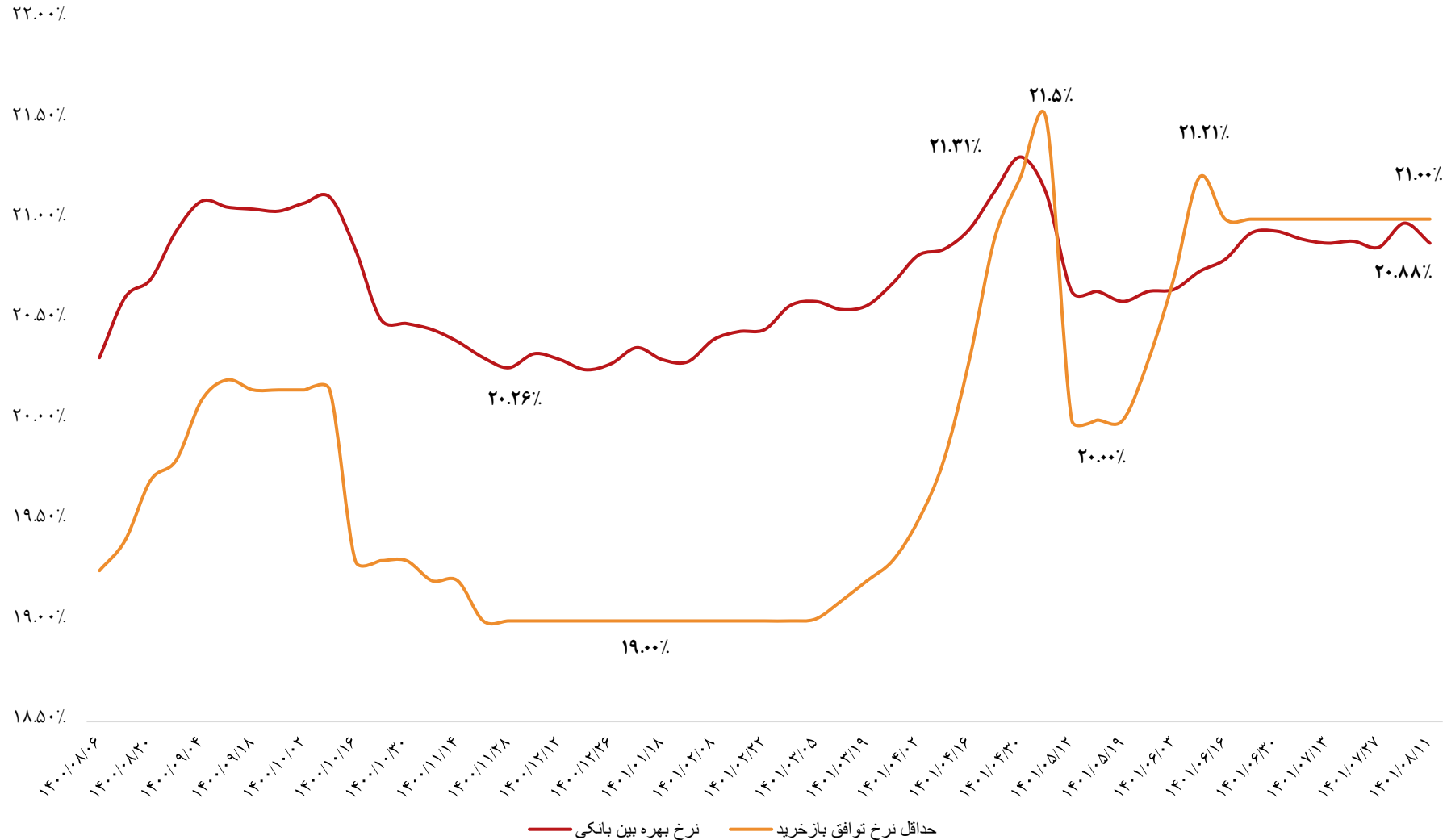


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۸/۰۷	-۴۶۳.۲۳
۱۴۰۱/۰۸/۰۸	۱۷۹.۱۵
۱۴۰۱/۰۸/۰۹	-۲۰۷.۴۴
۱۴۰۱/۰۸/۱۰	-۱۵۲.۸۲
۱۴۰۱/۰۸/۱۱	۱۱۲.۶۸
جمع	-۵۳۱.۷

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۱۱	۱۴۶	۵,۷۹۶.۱
ماه‌بانه (۱۴۰۱/۰۷/۱۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۱۱)	۲۲	۲۵۴.۹
هفتگی (۱۴۰۱/۰۸/۰۷ تا ۱۴۰۱/۰۸/۱۱)	۵	-۵۳۱.۷

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته دوم آبان ماه ۱۴۰۱ با کاهش به ۲۰.۸۸ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	دنا آفرین فدک	گدنا	۱۷.۸
2	س.مسکن زاینده رود	ثرود	۱۶.۱
3	س. توسعه صنعت و تجارت	وصنعت	۱۶
4	بیمه تعاون	وتعاون	۱۵.۳
5	س.مسکن شمال غرب	ثغرب	۱۴.۸

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	ت الکترونیک پارسیان کیش	تاپکیش	-۱۳.۷
۲	صنعت غذایی کوروش	غکوروش	-۱۰.۹
۳	بیمه اتکایی سامان	اتکاسا	-۱۰
۴	لیزینگ خودرو غدیر	ولغدر	-۹.۹
۵	بیمه سرمد	وسرمد	-۹.۹

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	حمل و نقل انبارداری	۸.۱
۲	فعالیت مهندسی، تجزیه و تحلیل	۵.۸
۳	محصولات کاغذی	۵.۱
۴	زراعت و خدمات وابسته	۴.۲
۵	فنی و مهندسی	۳.۸

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	پیمانکاری صنعتی	-۴.۷
۲	اطلاعات و ارتباطات	-۳.۵
۳	فعالیت‌های فرهنگی و ورزشی	-۲.۶
۴	بیمه و بازنشستگی	-۱.۶
۵	سایر حمل و نقل	-۱.۵

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۸,۷۴۰	۳.۷
غمینو	۶,۵۳۰	۳.۸
شاوان	۲۰,۲۹۰	۳.۹
کاسپین	۱۰,۷۷۰	۴
دشیمی	۱۰,۸۰۰	۴

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۳۹۱	٪۲۲.۶
وملی	۹۸,۳۶۰	٪۲۴.۵
وسپهر	۶,۸۷۰	٪۲۸.۵
تمسکن	۲,۹۲۴	٪۳۱.۸
پترول	۱,۸۷۶	٪۳۲.۲

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	شیمیایی	۱,۷۲۸
۲	خودرو و قطعات	۱,۶۶۱
۳	فلزات اساسی	۱,۶۲۴
۴	فرآورده های نفتی	۱,۳۴۴
۵	سرمایه گذاریها	۸۱۰

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۱
۲	چاپ	۲,۸
۳	فعالیت مهندسی، تجزیه و تحلیل	۴,۶
۴	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۵,۳
۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۶,۷

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
مس	۷,۵۵۸	۸,۱۰۹	۷.۲۹
اوره (خلیج فارس)	۵۷۸	۶۱۸	۶.۹۲
آلومینیوم	۲,۲۲۴	۲,۳۵۱	۵.۷۱
سرب	۱,۸۸۹	۱,۹۸۸	۵.۲۴
نفت برنت	۹۴.۱۲	۹۸.۶۷	۴.۸۳
روی	۲,۸۲۲	۲,۹۰۴	۲.۹۱
پی‌وی‌سی	۷۶۰	۷۸۱	۲.۷۶
اونس جهانی طلا	۱,۶۴۴	۱,۶۸۱	۲.۲۵
پلاتین	۹۴۹	۹۶۸	۲.۰۰
متانول (پلتس)	۳۱۲	۳۱۱	-۰.۳۲
بیلت (فوب ایران)	۴۷۸	۴۶۸	-۲.۰۹
پروپیلن	۸۶۰	۸۳۱	-۳.۳۷

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۵۰,۱۸۰,۰۰۰	۱۶۰,۰۵۰,۰۰۰	٪ ۶.۶
طلای ۱۸ عیار	۱۳,۶۱۶,۰۰۰	۱۳,۹۳۰,۰۰۰	٪ ۲.۳
نرخ دلار نیما	۲۷۳.۵۸۰	۲۷۴.۳۹۸	٪ ۰.۳

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۸/۱۶	دوشنبه	سخنرانی بانک مرکزی اروپا- تغییرات شاخص قیمت مسکن انگلستان
۱۴۰۱/۰۸/۱۷	سه شنبه	خرده فروشی اتحادیه اروپا- شاخص اقتصادی ژاپن- گزارش سیاست پولی روسیه
۱۴۰۱/۰۸/۱۸	چهارشنبه	نرخ تورم سالانه و ماهانه چین- شاخص قیمت تولید کننده چین
۱۴۰۱/۰۸/۱۹	پنج شنبه	نرخ تورم سالانه و ماهانه آمریکا-
۱۴۰۱/۰۸/۲۰	جمعه	نرخ تورم آلمان- تولید ناخالص داخلی انگلستان- تعداد دکل های نفتی آمریکا

پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری، دو عامل مثبت قابل توجه یعنی افزایش قیمت دلار و افزایش قیمت کامودیتی ها را داریم. نرخ دلار در بازار آزاد به محدوده ۳۶ هزار تومان رسیده است و همچنان در مسیر رشد قرار دارد. از طرفی اخبار مثبت از کاهش زمان قرنطینه در چین عاملی برای رشد کامودیتی ها و تضعیف نسبی شاخص دلار گردیده است. درخصوص عوامل داخلی نیز اعلام حمایت وزیر اقتصاد و مدیر سازمان بورس از بازار و همچنین کاهش تنش های سیاسی داخلی بیانگر این مطلب هستند که هفته مثبتی برای نماگر اقتصادی رقم خواهد خورد. به نظر می رسد در صورت ادامه دار بودن حمایتها و با بازگشت اعتماد سلب شده سرمایه گذاران شاهد افزایش حجم و ارزش معاملات خواهیم بود.