



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و پنجم منتهی به

۲۷ آبان ماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

نخستین خودروهای خارجی بزودی وارد ایران خواهد شد:

رضا فاطمی‌امین با بیان اینکه دولت وظیفه مربوط به واردات خودرو انجام داده و اگر مشکلی فراروی واردکنندگان باشد رفع خواهد شد به ایرنا گفت: واردکنندگان در مسیر واردات خودرو و انعقاد قرارداد هستند و باید خدمات پس از فروش را تضمین کرده و یا نماینده رسمی بوده و یا انتقال فناوری انجام دهند. پیش‌بینی می‌شود تا پایان سال ۹۰ هزار خودرو با اولویت محصولات کمتر از ۱۰ هزار یورو وارد شود.



رشد سنگ آهن با وعده حمایتی چین:

سنگ آهن معیار پلتس در اولین روز بازگشایی بازارها طی هفته قبل با ثبت رشد ۳/۳ درصدی با نرخ ۹۵ دلار و ۳۰ سنت به فروش رفت. ظرف روزهای پایانی هفته قبل، بانک خلق چین و کمیسیون تنظیم مقررات بانکی این کشور، چند اقدام محرک را برای تقویت بخش املاک به امید تقویت اقتصاد چین تصویب کردند. انتشار این خبر از رشد بهای سنگ آهن حمایت کرد.



عرضه فولاد در نیمه نخست امسال در بورس کالا دو برابر شد:

وزیر صمت از عرضه دوبرابری فولاد در بورس کالا طی نیمه نخست امسال در مقایسه با مدت مشابه سال گذشته خبر داد و گفت: اصرار وزارت صمت بر این است که همه زنجیره فولاد به بورس کالا بیاید.



عوارض صادرات برای برخی محصولات صیفی اعلام شد:

وزارت صنعت برای کنترل بازار و صادرات محصولات صیفی گوجه‌فرنگی، پیاز و سیب زمینی به منظور تنظیم بازار داخلی این محصولات و پیشگیری از نوسان قیمت و عوارض جدید تعیین کرد. براساس ابلاغ وزارت جهاد کشاورزی میزان عوارض صادراتی از تاریخ ابلاغ تا پایان آذر برای محصولات کشاورزی سیب زمینی ۷۰ درصد، گوجه فرنگی ۱۰۰ درصد و پیاز ۱۲۰ درصد از قیمت پایه صادراتی وضع شد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

موافقت کمیسیون امنیت ملی مجلس با عضویت ایران در سازمان شانگهای:

عضو کمیسیون امنیت ملی مجلس با اشاره به موافقت مجلس با لایحه عضویت ایران در سازمان شانگهای گفت: در دو جلسه فوق العاده اخیر بحث و تبادل نظر بین اعضای کمیسیون و نمایندگان دستگاهها از جمله وزارت خارجه، ستاد کل نیروهای مسلح، وزارت اطلاعات و وزارت دفاع و مرکز پژوهش‌های مجلس درباره لایحه عضویت ایران در سازمان شانگهای و جزئیات آن صورت گرفت. وی افزود: با توجه به اینکه دولت لایحه الحاق دولت ایران به سازمان همکاری شانگهای را برای طی تشریفات قانونی به مجلس ارسال کرد این لایحه برای بررسی به کمیسیون امنیت ملی و سیاست خارجی به عنوان کمیسیون اصلی ارجاع شد.



افزایش حداقل ۳۵ درصدی قیمت پایه سیمان در بورس کالا از هفته جاری:

دبیر انجمن صنعت سیمان از اجرای افزایش حداقل ۳۵ درصدی قیمت پایه سیمان خاکستری در انواع مختلف محصولات در بورس کالا در هفته جاری خبر داد. لذا افزایش قیمت‌های پایه از عرضه هفته جاری اجرایی خواهد شد.



دولت موظف به پرداخت زیان ۱۵۰ هزار میلیارد تومانی ایران خودرو و سایپا است:

حجم زیان انباشته خودروسازان در سال‌های اخیر روند به‌شدت رو به رشدی به خود گرفته و به ۱۵۰ هزار میلیارد تومان رسید. اخیراً مطرح شده قیمت‌گذاری دستوری عامل ایجاد چنین زیانی بود. این در شرایطی است که طبق ماده ۹۰ اصل ۴۴ قانون اساسی، نانچه دولت به هر دلیل قیمت فروش کالاها یا خدمات بنگاه‌های مشمول واگذاری یا سایر بنگاه‌های بخش غیردولتی را به قیمتی کمتر از قیمت بازار تکلیف کند دولت مکلف است مابه‌التفاوت قیمت تکلیفی و هزینه تمام‌شده را تعیین و از محل اعتبارات و منابع دولت در سال جاری پرداخت کند یا از بدهی این بنگاه‌ها به سازمان مالیات کسر کند.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

سبد سهام ۱۷۰ هزار نفر طی ۴ روز بیمه شد:

با آغاز طرح بیمه سبد سهام از شنبه ۲۱ آبان تا سه شنبه ۲۴ آبان بالغ بر ۱۷۰ هزار نفر سهام را بیمه کردند. صندوق تثبیت نیز آمادگی دارد برای ۱۰ میلیون نفر "سهام یار" منتشر کند. با اجرای بیمه سبد سهام و بیمه سبد صندوق‌های با درآمد ثابت که در روزهای آینده نهایی می‌شود، قرار است منابع مورد نیاز از بودجه دولت اخذ شود.



ضوابط اجرایی اوراق ارزی ابلاغ شد:

جوزپ بورل درباره آخرین وضعیت مبهم برجام، گفت: اوضاع به درستی پیش نمی‌رود و مواضع طرف‌ها هنوز به هم نزدیک نشده و ایران باید با آژانس تعامل سازنده داشته باشد. انتظار می‌رود وزیر خارجه این موضوع را پیگیری و پیش ببرد. براساس این گزارش، حسین امیرعبداللہیان هم با اشاره به تماس تلفنی با بورل در توئیتر اعلام کرد: مجدداً بر آمادگی ایران برای جمع‌بندی مذاکرات در اسرع وقت تأکید شد. آمریکا باید سیاست یک بام و دو هوا را متوقف کرده و اراده واقعی نشان دهد.



۳۰۰ دستگاه از سه محصول کرمان موتور در بورس کالا عرضه می‌شود:

طبق اطلاعیه عرضه بازار فیزیکی بورس کالا، ۱۰۰ دستگاه خودرو کی‌ام‌سی ۸T و ۱۰۰ دستگاه خودرو جک S۵ و ۱۰۰ دستگاه خودرو جک L۴ متعلق به شرکت کرمان موتور، ۲۸ آبان ماه در این بورس عرضه می‌شود.

بر اساس این گزارش، مبلغ پیش پرداخت ثبت سفارش خرید ۲۵ درصد قیمت پایه در نظر گرفته شده است.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با ۷۸۳ واحد کاهش نسبت به هفته قبل، در ارتفاع ۱ میلیون و ۴۱۳ هزار واحد قرار گرفت و کاهش جزئی ۰.۰۵- درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن اما با ۳,۸۹۸ واحد افزایش در ارتفاع ۴۰۱,۴۶۶ واحدی قرار گرفته و افزایش ۰.۹۸ درصدی را ثبت نمود. معاملات بازار سرمایه در هفته گذشته بصورت نوسانی و منفی‌های جزئی دنبال شد که البته پس از رشد سریع و مناسب هفته‌های گذشته این استراحت کاملاً طبیعی بود. با توجه به مشخص شدن قیمت گذاری نرخ خوراک پتروشیمی و ثبات نسبی قیمت دلار در محدوده ۳۴ تا ۳۶ هزار تومان به نظر بازار در شرایط مساعدی به سر می‌برد.

تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۴۱۴,۳۵۶	۱,۴۱۳,۵۷۳	-۷۸۳	-۰.۰۵٪
شاخص هم‌وزن (واحد)	۳۹۷,۵۶۸	۴۰۱,۴۶۶	۳,۸۹۸	۰.۹۸٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۲۷,۸۰۴		-۱۱,۳۴۴	-۲۹٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

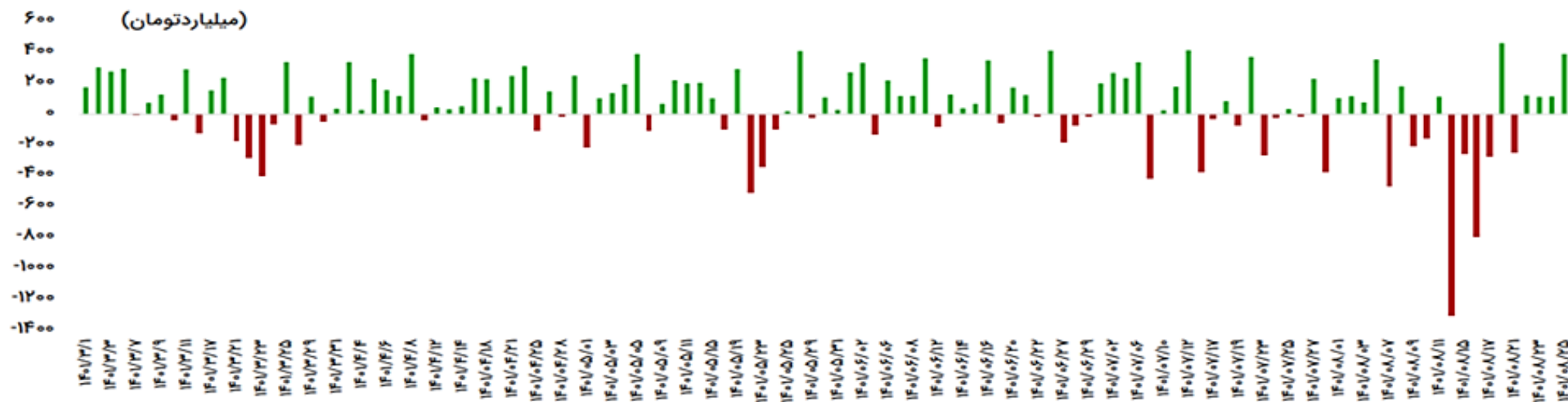
خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۲۵ آبان ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد :



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۸/۲۱	-۳۰۴
۱۴۰۱/۰۸/۲۲	-۲۲۶
۱۴۰۱/۰۸/۲۳	-۶۶۰
۱۴۰۱/۰۸/۲۴	-۱۶۰
۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۱۷۱
جمع	-۱،۱۷۹

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۱۵۶	-۳۱،۸۵۶
ماهانه (۱۴۰۱/۰۷/۲۵ تا ۱۴۰۱/۰۸/۲۵)	۲۳	-۷،۲۷۶
هفتگی (۱۴۰۱/۰۸/۲۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۲۵)	۵	-۱،۱۷۹

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

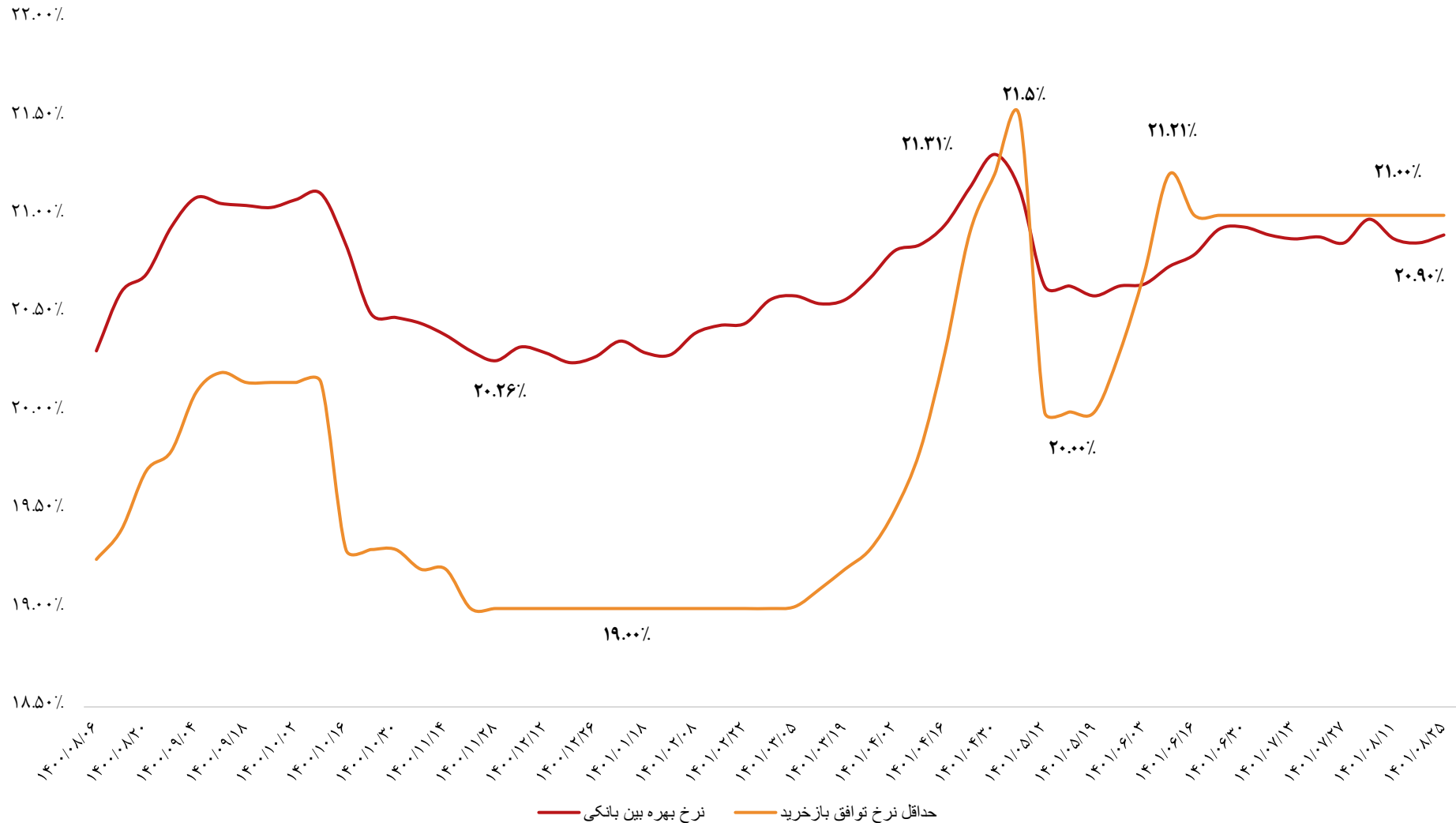


ورود پول (میلیارد تومان)	تاریخ
-250.08	1401/08/21
120.69	1401/08/22
110.41	1401/08/23
114.01	1401/08/24
388.05	1401/08/25
۴۸۳.۰۸	جمع

ورود پول (میلیارد تومان)	تعداد روز معاملاتی	بازه زمانی
۴,۱۱۹.۴۷	۱۵۶	ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۲۵
-۱,۶۹۱.۷۵	۲۳	ماهیهانه (۱۴۰۱/۰۷/۲۵ تا ۱۴۰۱/۰۸/۲۵)
۴۸۳.۰۸	۵	هفتگی (۱۴۰۱/۰۸/۲۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۲۵)

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته سوم آبان ماه ۱۴۰۱ با افزایش به ۲۰.۹۰ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	س. مسکن شمالغرب	ثغرب	۲۳.۸۲
2	دارو لقمان	دلقما	۲۱.۵۸
3	قند نیشابور	قنیشا	۱۹.۵۱
4	بیمه میهن	میهن	۱۸.۱۲
5	پگاه خراسان	غشان	۱۷.۰۱

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	پتروشیمی سازند	شاراک	-۱۰.۴
۲	خط دریا بندر	حبندر	-۱۰
۳	س. توسعه تجارت هیرمند	بهیر	-۸.۹۴
۴	بانک گردشگری	وگردش	-۸.۷۲
۵	مرآت فولاد	تیولا	-۸.۳۴

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	چاپ	۱۰.۸۱
۲	محصولات کامپیوتری الکترونیکی	۸.۴۱
۳	محصولات چرمی	۷.۱۸
۴	استخراج سایر معادن	۴.۸۳
۵	دارویی	۴.۲۵

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	اطلاعات و ارتباطات	-۴.۲۶
۲	کمکی به نهادهای مالی واسط	-۳.۴۱
۳	سایر حمل و نقل	-۳.۰۹
۴	پیمانکاری صنعتی	-۲.۷۶
۵	بانکها و موسسات اعتباری	-۲.۴۱

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۸,۸۵۰	۳.۳
شاوان	۱۹,۸۰۰	۳.۵
شپنا	۶,۹۶۰	۳.۵
فولاز	۷,۶۷۰	۳.۸
سپاها	۱۰,۰۰۰	۳.۹

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۴۷۰	٪۲۲.۶
وملی	۱۰۵,۳۱۰	٪۲۵.۹
وسپهر	۶,۹۴۰	٪۲۸.۳
تمسکن	۳,۰۹۳	٪۳۱.۷
پترول	۱,۸۹۳	٪۳۲.۳

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۲,۶۷۹
۲	فرآورده های نفتی	۱,۸۹۱
۳	شیمیایی	۱,۶۷۵
۴	فلزات اساسی	۱,۵۷۳
۵	بانکها و موسسات اعتباری	۱,۳۱۷

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۱,۵
۲	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۲,۹
۳	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۵
۴	سابر واسطه گری های مالی	۸,۳
۵	فعالیت مهندسی، تجزیه و تحلیل	۸,۵

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
پروپیلن	۸۳۰	۸۶۶	۴.۳۴
سرب	۲,۱۵۵	۲,۱۷۵	۰.۹۳
پی وی سی	۷۶۰	۷۶۶	۰.۷۹
اوره (خلیج فارس)	۵۸۵	۵۸۸	۰.۵۱
متانول (پلتس)	۳۰۴	۳۰۵	۰.۳۳
روی	۳,۰۰۶	۳,۰۰۷	۰.۰۳
اونس جهانی طلا	۱,۷۵۳	۱,۷۴۹	-۰.۲۳
آلومینیوم	۲,۴۶۳	۲,۳۹۴	-۲.۸۰
بیلت (فوب ایران)	۴۶۳	۴۴۹	-۳.۰۲
مس	۸,۴۴۰	۸,۰۴۶	-۴.۶۷
پلاتین	۱۰۳۵	۹۸۱	-۵.۲۲
نفت برنت	۹۶	۸۸	-۸.۳۳

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۵۹,۰۲۰,۰۰۰	۱۶۲,۷۵۰,۰۰۰	۲.۳۴%
طلای ۱۸ عیار	۱۴,۶۶۰,۰۰۰	۱۴,۸۵۶,۰۰۰	۱.۳۳%
نرخ دلار نیما	۲۷۷,۳۰۰	۲۷۸,۳۱۴	۰.۳۶%

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۸/۳۰	دوشنبه	شاخص قیمت تولیدکننده آلمان- شاخص فعالیتهای ملی بانک فدرال شیکاگو آمریکا
۱۴۰۱/۰۹/۰۱	سه شنبه	شاخص تولید و خدمات ریچموند فدرال آمریکا- تغییرات شاخص مسکن کانادا
۱۴۰۱/۰۹/۰۲	چهارشنبه	سخنرانی بانک مرکزی اروپا- شاخص بازار وام مسکن آمریکا- عداد دکل های نفتی آمریکا
۱۴۰۱/۰۹/۰۳	پنج شنبه	شاخص مدیران خرید ژاپن- تغییرات شاخص مصرف کننده ژاپن
۱۴۰۱/۰۹/۰۴	جمعه	رشد ناخالص داخلی فصلی آلمان- تولید سالانه خودرو انگلیس

پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری؛ روزهای پایانی هفته قبل شاهد اخبار تاثیرگذاری بود، گسترش خارج از انتظار ویروس کرونا در چین تاثیر منفی محسوسی بر بازارهای جهانی و بخصوص نفت داشت. این کاهش قیمت نفت و کامودیتی ها می تواند در ابتدای هفته تاثیر منفی بر بازار سرمایه داشته باشد. اما از میان هفته در صورت نبود متغیرهای منفی تاثیر گذار با پایان رسیدن ماه آبان و انتشار گزارشات ماهانه از سوی شرکتهای انتظار بر آن است بازار سهام جهت خود را به سمت مثبت تغییر دهد.