



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته چهارم منتهی به

دی ماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

گزارش بانک مرکزی از رشد اقتصادی ۳.۶ درصدی در سه ماهه دوم سال:

بانک مرکزی اعلام کرد: تولید ناخالص داخلی در سه ماه دوم سال نسبت به سه ماه دوم سال گذشته، ۳.۶ درصد بیشتر شد و رشد اقتصادی بدون نفت هم ۳.۱ درصد بود. راساس این گزارش، بررسی عملکرد رشد اقتصادی بر حسب فعالیت‌های عمده اقتصادی نشان می‌دهد رشد عملکرد تولید ناخالص داخلی در سه ماه دوم سال ۱۴۰۱ حاصل تحقق رشد مثبت ارزش افزوده تمام گروه‌های کشاورزی، نفت و گاز، صنایع و معادن و خدمات به ترتیب ۰.۸، ۱۰.۴، ۶.۹ و ۲.۴ درصد نسبت به دوره مشابه سال گذشته است.



نرخ سود بازار بین بانکی از مرز ۲۱ درصد عبور کرد:

بانک مرکزی در تازه‌ترین گزارش اعلام کرد: نرخ سود بازار بین بانکی با رشد ۰.۰۲ درصدی نسبت به آخرین نرخ هفتگی به ۲۱.۰۱ درصد رسید. این در حالی است که نرخ سود در بازار بین بانکی از ۱۲ مرداد ماه کاهش یافت و به سطح ۲۰ درصدی بازگشت اما با گذشت بیش از چهار ماه دوباره به سطح ۲۱ درصدی ورود کرد.



عرضه ۵۰۶ دستگاه خودرو شاسی بلند در بورس کالا:

طبق اطلاعیه عرضه بورس کالا، دوشنبه ۵ دیماه ۵۰۶ دستگاه دیگنیتی پرستیژ شامل ۲۱۶ دستگاه دیگنیتی پرستیژ سفید (تریم مشکی)، ۲۱۶ دستگاه دیگنیتی پرستیژ سفید (تریم قرمز)، ۲۱۷ دستگاه دیگنیتی پرستیژ مشکی (تریم مشکی) و ۲۱۷ دستگاه دیگنیتی پرستیژ مشکی (تریم مشکی) در تالار خودرو عرضه می‌شود.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

چهار رقم متفاوت برای پرداخت سود علی‌الحساب مشمولان سهام عدالت:

فرایند پرداخت مرحله نخست سود سهام عدالت از ۳۰ آذر آغاز شد. در این راستا، سود علی‌الحساب به حساب هر دو گروه مستقیم و غیرمستقیم مشمولان سهام عدالت واریز می‌شود. در مرحله نخست سهامدارانی که در پرتفوی سهام ۴۵۲، ۴۹۲ و ۵۳۲ هزار تومان دارند به ترتیب ۵۱۰، ۵۵۵ و ۶۰۰ هزار تومان و افرادی که پرتفوی یک میلیون تومانی در اختیار دارند، مبلغ یک میلیون و ۱۲۸ هزار تومان سود علی‌الحساب دریافت می‌کنند.



مصوبه نحوه ورود شمش طلا، نقره و پلاتین بدون اخذ ثبت سفارش ابلاغ شد:

گمرک مصوبه هیات وزیران اعلام کرد: ورود فلزات گرانبها شامل طلا، نقره و پلاتین به هر میزان و بصورت شمش استاندارد به عنوان یکی از انواع سرمایه‌های خارجی قابل ورود به کشور توسط سرمایه‌گذاران خارجی با ارائه مجوز سازمان سرمایه‌گذاری و کمک‌های اقتصادی و فنی پس از اظهار به گمرک و بدون ثبت سفارش بلامانع است.



احتمال تصویب بودجه سه دوازدهم در مجلس و طرح پلکانی معکوس حقوق:

نماینده مجلس با بیان اینکه اگر تا پایان سال بررسی برنامه هفتم و بودجه تمام نشود، احتمالاً بودجه دو یا سه دوازدهم به تصویب برسد به تسنیم گفت: افزایش حقوق ۵ تا ۲۵ درصدی طرحی بود که در لایحه ارائه شد و مجلس تغییراتی در آن ایجاد کرد. وی افزود: تکرار این نوع افزایش حقوق سال گذشته منطقی نیست و باید براساس طرح پلکانی معکوس حقوق‌ها افزایش یابد. البته ممکن است طرحی که از سوی دولت ارائه می‌شود در مجلس تغییرات جدی داشته باشد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

گزارش دبیر انجمن پتروشیمی: درآمد و تزریق ۵۴ و ۱۴ میلیارد دلاری: شرکت های پتروشیمی در پی اجرای سیاست های جدید ارزی از سال ۹۷ تا ۶ ماه اول سال جاری قادر به کسب بیش از ۵۴ میلیارد دلار درآمد صادراتی و تأمین بیش از ۲۲ میلیارد دلار نیاز صنایع تکمیلی و بیش از ۳ میلیارد دلار کود اوره بخش کشاورزی شدند. همچنین در این مدت بیش از ۴۲ میلیارد دلار ارز مورد نیاز ایران در سامانه نیما از طریق شرکت های پتروشیمی تأمین شد.



پیش بینی آژانس بین المللی از افزایش قیمت نفت :

آژانس بین‌المللی انرژی به احتمال افزایش قیمت نفت تا سال آینده اشاره کرده است؛ چرا که تحریم‌ها عرضه روسیه را در مضیقه گذاشته و تقاضا بیش از انتظارات پیشین زیاد شده است. آژانس در گزارشی در روز چهارشنبه گفت که تولیدات روسیه تا پایان سه ماهه اول سال (اواخر اسفند و اوایل فروردین ۱۴۰۲) ۱۴ درصد کاهش پیدا خواهد کرد. این موضوع پیش‌بینی‌های قبلی آژانس درباره سقوط در سال جاری را به چالش می‌کشد.



آخرین موضع آمریکا با اعلام مرگ برجام، حذف آخرین امید و عدم دستیابی به توافق: رابرت مالی در واکنش به اعلام آمادگی ایران برای از سرگیری مذاکرات و برگزاری جلسه وزیران خارجه طرف های مذاکره در تویتر اعلام کرد: اولین باری نبود که رهبران ایران به توافق روی میز و مورد تأیید همگان، پشت کردند اما این آخرین مورد، امید جمعی را برای بازگشت سریع و متقابل به اجرای کامل برجام از بین برد. جان کربی سخنگوی شورای امنیت ملی کاخ سفید هم گفت: چندین ماه پیشرفتی در مذاکرات نبوده و در آینده نزدیک هم نخواهد بود. بنابراین برجام در تمرکز دولت نیست.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

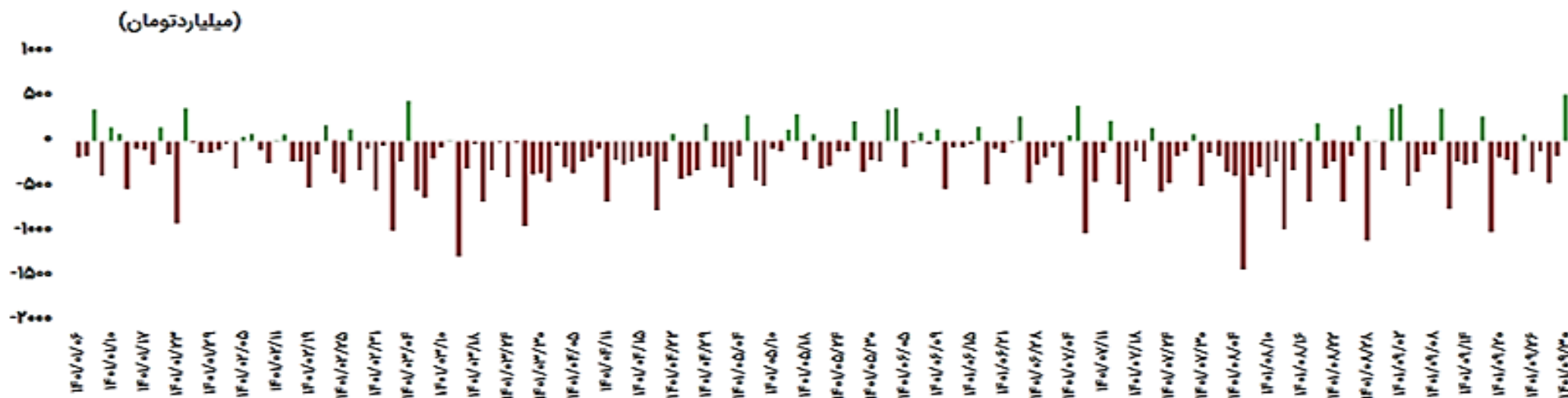
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با **۲۳,۴۴۰** واحد افزایش نسبت به هفته قبل، در ارتفاع ۱ میلیون و ۴۹۶ هزار واحد قرار گرفت و افزایش **۱.۶** درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن هم با رشد **۱۱,۹۵۸** واحدی در ارتفاع ۴۴۵,۷۲۱ واحدی قرار گرفته و افزایش **۲.۷۵** درصدی را ثبت نمود. افزایش قیمت های جهانی کامودیتی ها ناشی اخبار مثبت از سوی چین، رشد قیمت نفت و همچنین افزایش چشمگیر نرخ ارز در بازار موجب تحریک تقاضا در بازار سهام گردیده و رشد مناسبی را برای نماگر بازار سرمایه رقم زد. ارزش معاملات نیز طی هفته گذشته حدود ۴۰ هزار میلیارد تومان بود که افزایش حجم معاملات نشانگر اقبال سرمایه گذاران به بازار سرمایه بود.

تغییرات هفتگی شاخص ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۴۷۲,۷۶۰	۱,۴۹۶,۲۰۰	۲۳,۴۴۰	۱.۶٪
شاخص هم وزن (واحد)	۴۳۳,۷۶۳	۴۴۵,۷۲۱	۱۱,۹۵۸	۲.۷۵٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۳۹,۵۷۶		۳,۵۶۲	۹.۸٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

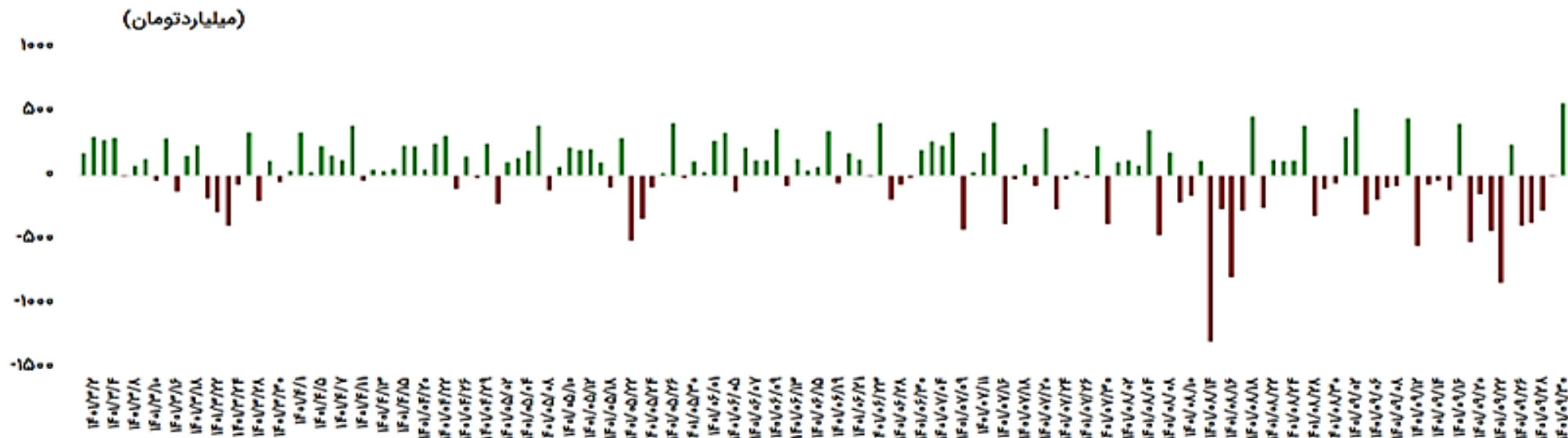
خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۳۰ آذر ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد :



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۹/۲۶	-۳۲۳
۱۴۰۱/۰۹/۲۷	-۹۹
۱۴۰۱/۰۹/۲۸	-۴۵۸
۱۴۰۱/۰۹/۲۹	-۱۵۱
۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۲۲
جمع	-۵۰۹

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۱۸۱	-۳۶،۵۷۷
ماهینانه (۱۴۰۱/۰۸/۳۰ تا ۱۴۰۱/۰۹/۳۰)	۲۳	-۳،۶۱۶
هفتگی (۱۴۰۱/۰۹/۲۶ تا ۱۴۰۱/۰۹/۳۰)	۵	-۵۰۹

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

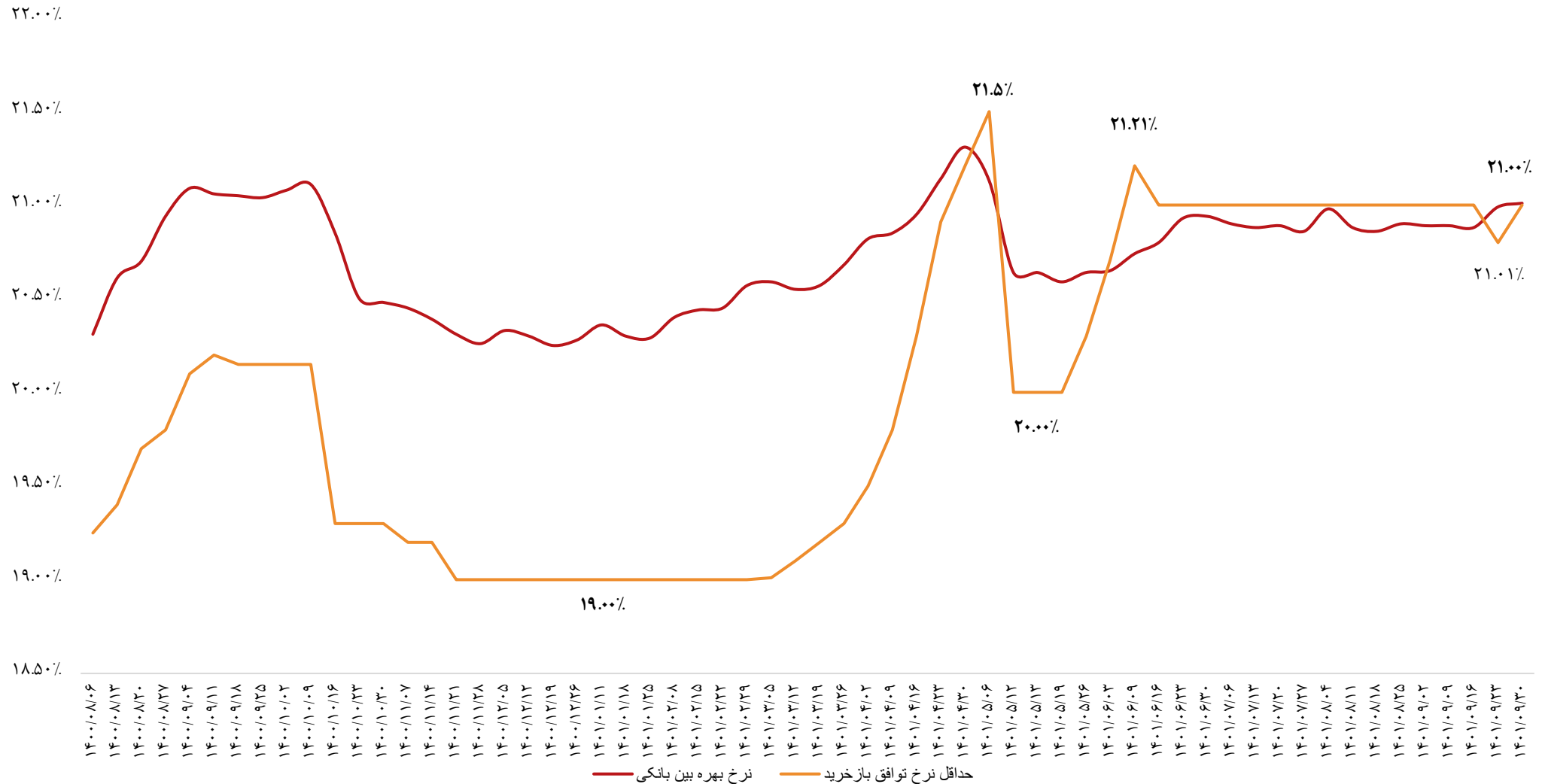


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۹/۲۶	-۳۸۶.۴
۱۴۰۱/۰۹/۲۷	-۳۷۱.۱
۱۴۰۱/۰۹/۲۸	-۲۷۱.۱
۱۴۰۱/۰۹/۲۹	-۹.۶
۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۶۳
جمع	-۴۷۵.۲

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۱۸۱	۱.۷۲۵.۸۲
ماهیناه (۱۴۰۱/۰۸/۳۰ تا ۱۴۰۱/۰۹/۳۰)	۲۳	-۱.۹۷۳.۶
هفتگی (۱۴۰۱/۰۹/۲۶ تا ۱۴۰۱/۰۹/۳۰)	۵	-۴۷۵.۲

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می دهد. در هفته انتهایی آذرماه ۱۴۰۱ با افزایش به ۲۱.۰۱ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	آسیا سیر ارس	حاسا	۳۸.۹
2	فنر سازی خاور	خفنر	۲۷.۳
3	گروه صنعتی سدید	وسدید	۲۵
4	سبحان آنکولوژی	دسانکو	۲۴.۰۵
5	قند مرودشت	قمرو	۲۳.۳

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	داروسازی رازک	درازک	-۸.۹
۲	سر. توسعه آذربایجان	وآذر	-۷.۹
۳	کاشی پارس	کپارس	-۷.۷
۴	معادن روی ایران	کروی	-۷.۴
۵	پیشگامان فن آوری آرامیس	تپسی	-۷.۲

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	استخراج زغال سنگ	۸
۲	محصولات چوبی	۵
۳	مخابرات	۵
۴	ماشین آلات و تجهیزات	۴.۵
۵	اطلاعات و ارتباطات	۴.۱

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	-۳.۳
۲	محصولات چرمی	-۲.۹
۳	بیمه و بازنشستگی	-۱.۳
۴	خرده فروشی	-۱.۲
۵	خودرو و قطعات	-۰.۹

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شاوان	۲۰,۳۰۰	۳.۵
سپاها	۹,۸۱۰	۳.۸
شکبیر	۷۹,۲۵۰	۳.۸
فسپا	۱۲,۶۸۰	۳.۹
شبندر	۹,۵۶۰	۳.۹

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۹۴۷	٪۲۵.۵
وسپهر	۷,۱۵۰	٪۲۹.۵
وملی	۱۳۶,۱۸۰	٪۳۳.۳
وتوشه	۶,۰۱۰	٪۳۶.۷
پترول	۵,۶۲۰	٪۳۹.۵

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۳,۹۲۸
۲	شیمیایی	۲,۸۵۸
۳	فلزات اساسی	۲,۴۹۶
۴	سرمایه گذاریها	۲,۱۱۳
۵	بانکها و موسسات اعتباری	۱,۵۹۶

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	فعالیت های هنری, سرگرمی	۲
۲	چاپ	۶
۳	مهندسی, تجزیه و تحلیل	۸
۴	سایر حمل و نقل	۱۲
۵	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۱۳

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	۷۹	۸۴	۶.۳۳
بیلت (فوب ایران)	۴۵۵	۴۷۱	۳.۵۲
پلاتین	۱۰۰۱	۱۰۳۴	۳.۳۰
سرب	۲,۱۵۳	۲,۲۱۶	۲.۹۳
مس	۸,۳۰۰	۸,۳۸۰	۰.۹۶
اونس جهانی طلا	۱,۷۹۴	۱,۷۹۶	۰.۱۱
روی	۳,۰۳۴	۲,۹۸۶	-۱.۵۸

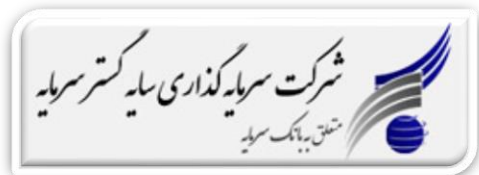
اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۸۴,۰۲۰,۰۰۰	۱۸۹,۹۷۰,۰۰۰	۳.۲٪
طلای ۱۸ عیار	۱۶,۹۰۲,۰۰۰	۱۸,۰۰۱,۰۰۰	۶.۵٪
نرخ دلار نیما	۲۸۹,۱۶۸	۲۸۸,۳۴۲	-۰.۲٪

تقویم اقتصادی 

رویداد	روز	تاریخ
نرخ بیکاری ژاپن	دوشنبه	۱۴۰۱/۱۰/۵
شاخص قیمت و بهای مسکن آمریکا-سود صنعتی چین	سه شنبه	۱۴۰۱/۱۰/۶
شاخص خرید آمریکا- تولید ناخالص داخلی روسیه	چهارشنبه	۱۴۰۱/۱۰/۷
نرخ تورم کره جنوبی- عرضه پول اتحادیه اروپا	پنج شنبه	۱۴۰۱/۱۰/۸
تعداد دکل های نفتی آمریکا-نرخ تورم روسیه	جمعه	۱۴۰۱/۱۰/۹



پیش بینی بازار در هفته جاری

در خصوص پیش بینی بازار در هفته جاری؛ انتشار گزارشات عملکرد ماهانه شرکتهای بورسی، تصمیم گیری نهایی در خصوص نرخ سود بانکی توسط شورای پول و اعتبار، و تشدید تحریم های اتحادیه اروپا علیه ایران از عوامل تاثیرگذار بر بازار سرمایه در این هفته است. البته با رشد قیمت دلار نگاه بازار معطوف صنایع صادرات محور خواهد بود.