



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و هشتم منتهی به

۱۸ آذرماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

گزارش بانک مرکزی از آمار مهر ماه و هفت ماهه تعداد و ارزش معاملات بورس:

طبق گزارش بانک مرکزی در مهر سال جاری بالغ بر ۷۸.۹ میلیارد سهم به ارزش بیش از ۲۸.۹ هزار میلیارد تومان در بورس تهران معامله شد. شاخصهای تعداد و ارزش سهام معامله شده به ۳۷۴.۸ و ۶۴۵.۲ رسید که در مقایسه با ماه قبل ۱۲.۷ و ۳۶.۶ درصد و مدت مشابه سال قبل ۱۶.۳ و ۶۰.۷ درصد کاهش نشان میدهد. همچنین در هفت ماه سال جاری بالغ بر ۹۵۴.۶ میلیارد سهم به ارزش ۴۲۴.۶ هزار میلیارد تومان در بورس تهران معامله شد.



واردات طلا، نقره و پلاتین توسط مسافران و سرمایه‌گذاران خارجی آزاد شد:

مصوبه هیات وزیران مبنی بر امکان ورود فلزات گران بها از جمله طلا، نقره و پلاتین از سوی مسافران و سرمایه‌گذاران خارجی بدون ثبت سفارش و با اظهار به گمرک از سوی معاون اول رئیس‌جمهور ابلاغ شد.



شرایط خرید ۸۰۶ دستگاه فیدلیتی و دیگنیتی ابلاغ شد:

طبق اطلاعیه عرضه بازار فیزیکی بورس کالا، دوشنبه تا چهارشنبه هفته آینده ۸۰۶ دستگاه فیدلیتی ۷ نفره، دیگنیتی و دیگنیتی پرستیژ متعلق به بهمن موتور با موعد تحویل ۲۳ بهمن عرضه می‌شود.



هشدار قطع گاز نیروگاه‌ها و محدودیت صنایع بورسی:

شرکت ملی گاز با اشاره به رشد ۶ درصدی افزایش مصرف گاز در بخش خانگی و تجاری، اعلام کرد: مصرف گاز در ایران به سطح هشدار رسیده و در صورت تداوم این وضع، احتمال قطع گاز نیروگاه‌ها وجود دارد. طبق اعلام برخی منابع، گاز مصرفی روزانه دو صنعت مهم بورسی فولاد و سیمان از ۴۰ و ۲۴ به ۱۵ و ۶ میلیون متر مکعب کاهش یافته است



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

کنترل نرخ " اخزا " با مصوبه شورای عالی بورس درباره اوراق دولتی:

با توجه به مصوبه شورای عالی بورس صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت ضمن رعایت تخصیص ۴۰ درصد از منابع به اوراق با درآمد ثابت، باید ۲۵ درصد دارایی‌ها را صرف سرمایه‌گذاری در اوراق دولتی می‌کردند. با بررسی این موضوع اوراق خزانه بعنوان اوراق دولتی با پشتوانه و ضمانت سازمان برنامه و بودجه قرار گرفت. بنابراین اگر صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت در اسناد خزانه نیز سرمایه‌گذاری کنند، نصاب سرمایه‌گذاری ۲۵ درصد دارایی‌ها در اوراق دولتی را رعایت کردند.



دستورالعمل راه اندازی بازار توافقی در فرابورس تصویب شد :

دستورالعمل راه اندازی بازار توافقی فرابورس از سوی سازمان بورس تصویب شد که کلیه اشخاص به جز برخی صندوق‌ها امکان انجام معامله خواهند داشت. این مقررات در فرایند ابلاغ جهت اجرا قرار دارد و متعاقب ابلاغ دستورالعمل در پایگاه قوانین و مقررات بازار سرمایه نیز منتشر و بارگذاری خواهد شد.



بورس انرژی به دنبال راه اندازی بزرگترین بازار گاز منطقه:

بورس انرژی ایران در راستای مأموریت خود به عنوان مرجعی در زمینه قیمت‌گذاری حامل‌های انرژی و همچنین کمک به اجرایی شدن سیاست‌های کلان اقتصادی، از جمله سیاست‌های اقتصاد مقاومتی، درصدد راه‌اندازی بازار گاز در قالب مدل‌های پیشنهادی است؛ تا بتواند علاوه بر کمک به شفافیت معاملات گاز طبیعی در کشور، زمینه تبدیل شدن این بازار به عنوان بزرگ‌ترین بازار گاز منطقه را فراهم آورد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

تک‌نرخ شدن خودرو با استمرار عرضه‌ها در بورس کالا :

دبیر انجمن خودروسازان می‌گوید: عرضه خودروها در بورس کالا، زمینه خروج خودروسازان از زیان را فراهم می‌کند و سبب تعدیل قیمت‌های کاذب در بازار می‌شود. وی اضافه کرد: قیمت گذاری خودرو در بورس به تدریج به واقعی شدن قیمت‌ها و تک‌نرخ شدن خودرو خواهد انجامید و کم‌کم خودروسازان باید به فکر ارائه طرح‌های تشویقی برای فروش محصولاتشان باشند.



تداوم رشد طلا و سکه :

روند صعودی قیمت‌ها طلا و سکه همچنان ادامه دارد و با وجود بازگشت دلار آزاد به کانال ۳۶ هزار تومانی، بهای هر سکه طرح جدید با افزایش ۱۲۰ هزار تومان نسبت به روز قبل به ۱۷.۴۵ میلیون تومان رسید تا رکورد دیگری ثبت شود. براساس این گزارش، سکه تمام طرح قدیم نیز با گرانی ۱۰۰ هزار تومانی به ۱۶.۷ میلیون تومان بالغ شد و بهای هر نیم و ربع سکه هم با رشد ۲۰۰ هزار تومانی از ۹.۷ و ۶.۷ میلیون تومان عبور کرد.



نرخ مالیات سال آینده ۲۰ درصد خواهد بود:

معاون اقتصادی رییس‌جمهور گفت: نرخ مالیات در بودجه سال آینده بیشتر نشده و همان ۲۰ درصد خواهد بود اما از طریق افزایش مودیان جدید و دریافت مالیات از دلار و طلا، افزایش می‌یابد.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با **۱۴,۵۴۱** واحد کاهش نسبت به هفته قبل، در ارتفاع ۱ میلیون و ۴۰۲ هزار واحد قرار گرفت و کاهش **۱.۰۲** درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن اما با رشد **۳,۹۷۰** واحدی در ارتفاع ۴۱۷,۰۸۵ واحدی قرار گرفته و افزایش **۰.۹۶** درصدی را ثبت نمود. هفته گذشته دستخوش خبرهای تاثیرگذار بسیاری بود. افزایش قیمت کامودیتی‌ها ناشی از تعدیل سیاستهای انقباضی بانک مرکزی آمریکا، کاهش قیمت نفت، خبر قطع گاز پتروشیمی‌ها و خبر عرضه سهام خودرویی‌ها از مهمترین بود.

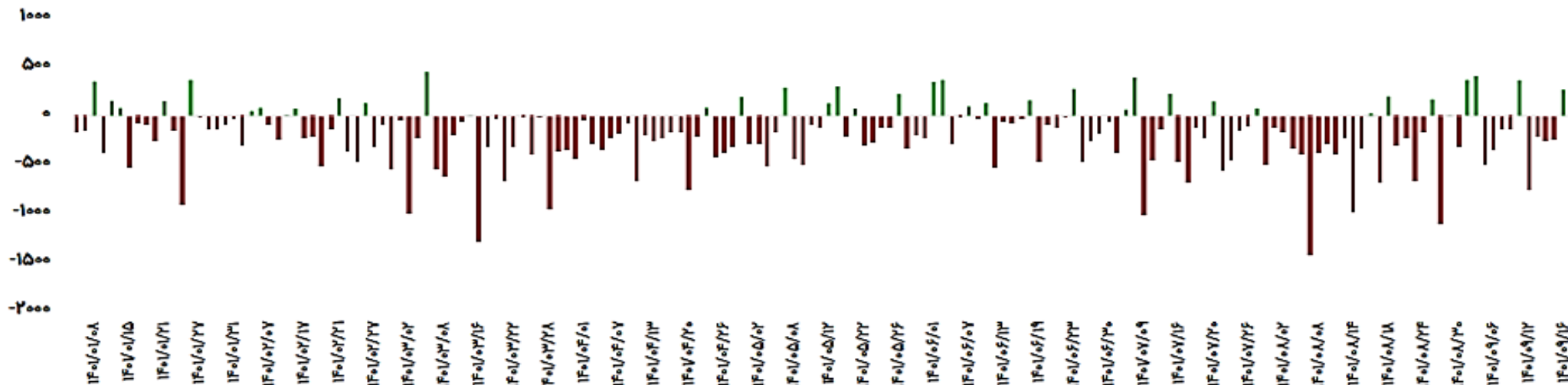
تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۴۱۷,۳۷۱	۱,۴۰۲,۸۰۳	-۱۴,۵۴۱	-۱.۰۲٪
شاخص هم‌وزن (واحد)	۴۱۳,۱۱۵	۴۱۷,۰۸۵	۳,۹۷۰	۰.۹۶٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۲۷,۸۷۱		-۱۱۶	-۰.۴٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۱۶ آذر ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد :

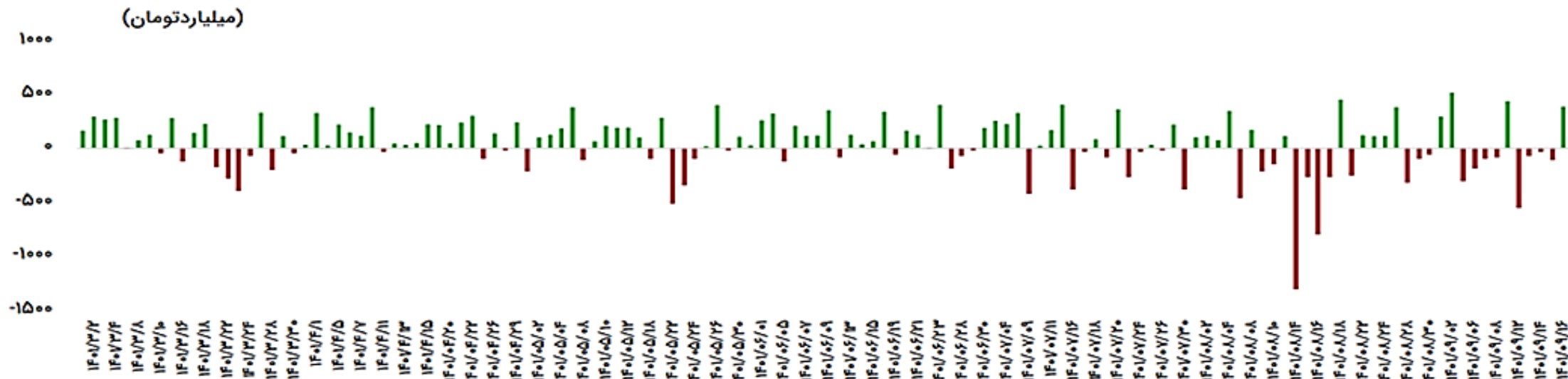
(میلیارد تومان)



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۹/۱۲	-۷۴۷
۱۴۰۱/۰۹/۱۳	-۲۰۹
۱۴۰۱/۰۹/۱۴	-۲۵۶
۱۴۰۱/۰۹/۱۵	-۲۳۲
۱۴۰۱/۰۹/۱۶	۲۶۹
جمع	-۱.۱۷۵

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۱۶	۱۷۱	-۳۴.۴۰۹
ماهیهانه (۱۴۰۱/۰۸/۱۶ تا ۱۴۰۱/۰۹/۱۶)	۲۳	-۴.۱۷۵
هفتگی (۱۴۰۱/۰۹/۱۲ تا ۱۴۰۱/۰۹/۱۶)	۵	-۱.۱۷۵

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

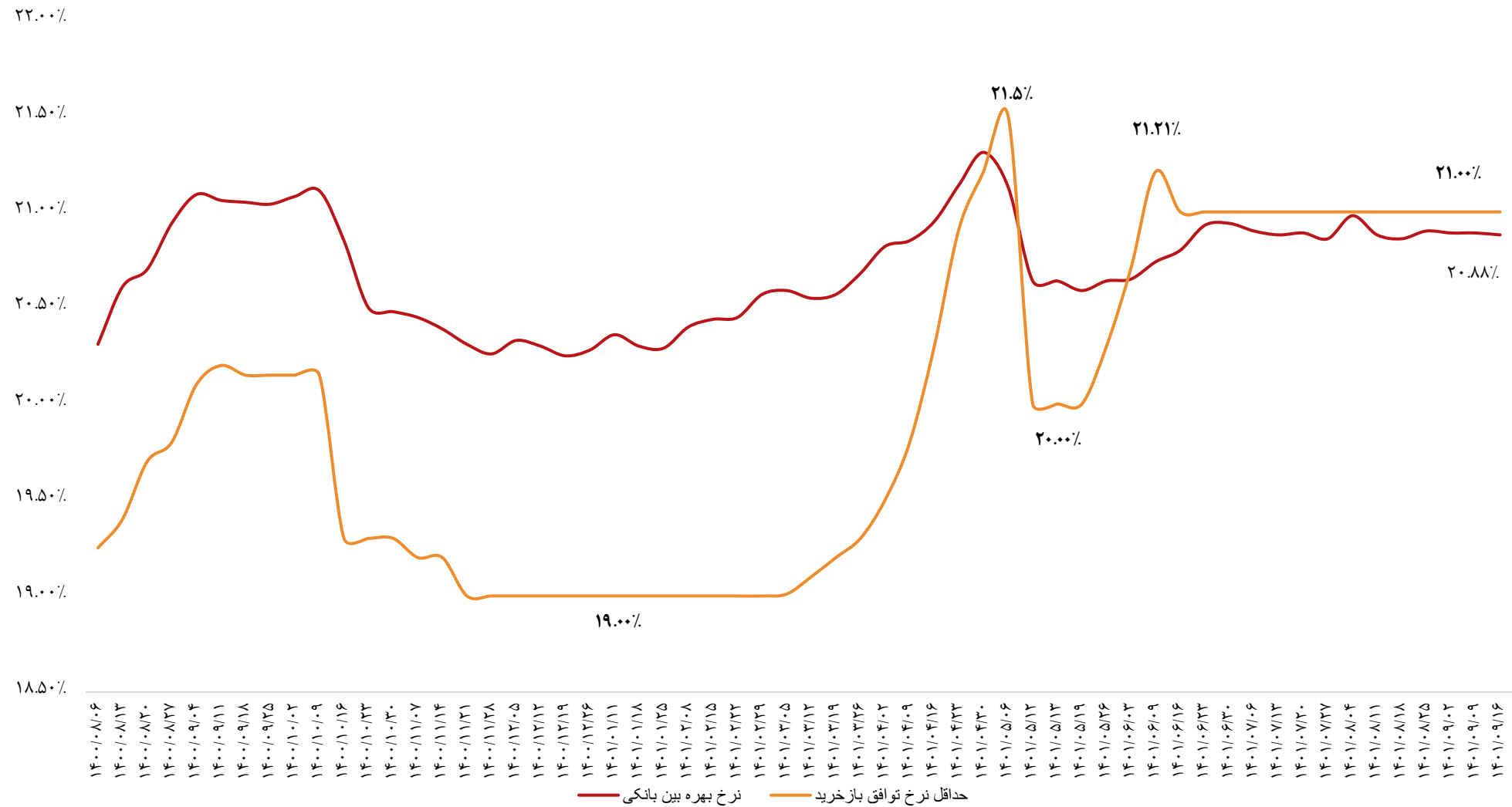


ورود پول (میلیارد تومان)	تاریخ
-۵۴۷.۶	۱۴۰۱/۰۹/۱۲
-۶۴.۸	۱۴۰۱/۰۹/۱۳
-۳۲.۷	۱۴۰۱/۰۹/۱۴
-۱۱۰.۴	۱۴۰۱/۰۹/۱۵
۳۹۳.۳	۱۴۰۱/۰۹/۱۶
-۳۶۲.۲	جمع

ورود پول (میلیارد تومان)	تعداد روز معاملاتی	بازه زمانی
۳,۸۹۰.۱۲	۱۷۱	ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۱۶
-۳۴۶.۴۷	۲۳	ماهینه (۱۴۰۱/۰۸/۱۶ تا ۱۴۰۱/۰۹/۱۶)
-۳۶۲.۲	۵	هفتگی (۱۴۰۱/۰۹/۱۲ تا ۱۴۰۱/۰۹/۱۶)

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته سوم آذرماه ۱۴۰۱ با کاهشی جزئی به ۲۰.۸۸ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	دنا آفرین فدک	گدنا	۲۰.۸
2	نیرو محرکه	خمحرکه	۱۸.۸
3	مهر کام پارس	خمهر	۱۹
4	کاشی سینا	کساوه	۱۸.۵
5	لبنیات کالبر	غالبر	۱۸.۱

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	بانک پاسارگاد	وپاسار	-۱۰.۷
۲	س. مسکن الوند	ثالوند	-۱۰
۳	س. توسعه معادن خاور میانه	میدکو	-۹.۱
۴	کشت و صنعت بهاران خراسان	غبهار	-۸.۴
۵	البرز بالک	دبالک	-۷.۷

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	استخراج سایر معادن	۱۱
۲	محصولات چرمی	۱۰
۳	خودرو و قطعات	۷.۶
۴	کاشی و سرامیک	۶.۵
۵	هتل و رستوران	۵.۴

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	فعالیت‌های فرهنگی و ورزشی	-۴.۸
۲	فنی و مهندسی	-۴.۷
۳	فرآورده های نفتی	-۳.۳
۴	بانکها و موسسات اعتباری	-۳
۵	فلزات اساسی	-۲.۶

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۸,۳۴۰	۳.۴
شاون	۱۸,۵۳۰	۳.۶
شراز	۱۲,۲۴۰	۳.۶
سپاها	۸,۹۷۰	۳.۸
شتران	۳,۲۸۵	۳.۸

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۵۴۳	٪۲۳.۲
وسپهر	۶,۸۶۰	٪۲۸.۷
پترول	۱,۸۱۴	٪۳۰.۸
وملی	۱۳۳,۵۷۰	٪۳۲.۵
وتوشه	۵,۴۹۰	٪۳۹.۱

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۴,۵۷۰
۲	فلزات اساسی	۲,۴۷۲
۳	شیمیایی	۱,۴۴۷
۴	فرآورده های نفتی	۹۷۱
۵	غذایی به جز قند و شکر	۹۲۴

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۲,۹
۲	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۳,۳
۳	چاپ	۳,۴
۴	فعالیت مهندسی، تجزیه و تحلیل	۴,۲
۵	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۷,۳

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
روی	۲,۹۲۳	۳,۲۳۴	۱۰.۶۴
پی وی سی	۷۲۶	۷۹۰	۸.۸۲
اوره (خلیج فارس)	۴۸۳	۵۱۰	۵.۵۹
پلاتین	۹۸۴	۱۰۳۷	۵.۳۹
مس	۸,۰۶۷	۸,۴۸۵	۵.۱۸
آلومینیوم	۲,۳۶۲	۲,۴۷۴	۴.۷۴
سرب	۲,۱۳۴	۲,۲۱۲	۳.۶۶
اونس جهانی طلا	۱,۷۵۵	۱,۷۹۸	۲.۴۵
پروپیلن	۸۷۱	۸۹۰	۲.۱۸
متانول (پلتس)	۳۰۳	۲۹۹	-۱.۳۲
بیلت (فوب ایران)	۴۵۹	۴۴۸	-۲.۴۰
نفت برنت	۸۴	۷۷	-۸.۳۳

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۷۵,۵۰۰,۰۰۰	۱۷۴,۰۴۰,۰۰۰	٪۰.۹
طلای ۱۸ عیار	۱۵,۷۷۳,۰۰۰	۱۵,۹۳۴,۰۰۰	٪۱.۰۲
نرخ دلار نیما	۲۸۰,۲۵۵	۲۸۲,۱۹۵	٪۰.۷

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۹/۲۱	دوشنبه	انتظار تورم مصرف کننده آمریکا - تولید ناخالص داخلی انگلستان
۱۴۰۱/۰۹/۲۲	سه شنبه	نرخ بیکاری انگلستان - نرخ تورم آلمان - نرخ تورم ماهیانه آمریکا
۱۴۰۱/۰۹/۲۳	چهارشنبه	تولیدات صنعتی ژاپن - نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا - تولیدات صنعتی اروپا
۱۴۰۱/۰۹/۲۴	پنج شنبه	شاخص بهای مسکن چین - نرخ بیکاری چین - تولیدات صنعتی آمریکا
۱۴۰۱/۰۹/۲۵	جمعه	شاخص مدیران خرید ژاپن - شاخص قیمت مصرف کننده اروپا - نرخ تورم اروپا

پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری؛ بازار هفته پیش رو با توجه به اخبار مختلف می‌تواند دستخوش چالش‌های بسیاری باشد. با فرارسیدن زمستان، خبرهایی از قطع گاز صنایع پتروشیمی و همچنین کاهش صنایع فولاد و سیمان به گوش می‌رسد که با توجه به ارزش معاملات این صنایع تاثیر منفی قابل توجهی بر بازار خواهد داشت. از طرفی کاهش شدید قیمت نفت موجب کاهش حاشیه سود فرآورده‌های نفتی و کاهش قیمت جهانی محصولات پتروشیمی خواهد شد که با توجه به کامودیتی محور بودن بازار سرمایه، از این مهم تاثیر منفی خواهد پذیرفت. البته افزایش مجدد نرخ دلار طی روزهای اخیر و بدنبال آن افزایش دلار نیمایی می‌تواند تا حدودی تاثیر منفی خبرهای فوق را تعدیل نماید.