



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و نهم منتهی به

۲۵ آذرماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

مصوبه جدید هیات دولت درباره شرایط بازگشت ارز شرکت های پتروشیمی و فولادی:

کلیه صادرکنندگان محصولات پتروشیمی، پالایشی، فولادی، فلزات اساسی رنگین و فرآورده‌های نفتی مکلف هستند ۱۰۰ درصد تعهدات ارزی صادراتی را از طریق فروش ارز بصورت حواله در سامانه نیما رفع کنند. بازگشت ارز بصورت اسکناس برای این دسته از صادرکنندگان منوط به تایید بانک مرکزی و رعایت مفاد ماده ۹ این آیین نامه است.



بانک صادرات دست به کار عرضه و فروش سهام ۴ پالایشگاه شد:

بانک صادرات آماده عرضه سهام بلوکی ۴ پالایشگاه بندرعباس، تهران، تبریز و اصفهان شد که در مجموع حدود ۱۲ درصد است. هر چهار بلوک به صورت نقد چهارشنبه ۳۰ آذرماه روانه میز فروش خواهد شد.



۲۰۰۰ هزار دستگاه خودرو تارا در بورس کالا عرضه شد:

بورس کالا چهارشنبه هفته گذشته میزبان عرضه ۲ هزار دستگاه تارا شامل ۸۰۰ دستگاه تارا اتوماتیک و ۱۲۰۰ دستگاه تارا دستی متعلق به شرکت ایران خودرو با موعد تحویل ۲۵ اسفند بود.



تغییر محدوده نوسان قیمت مجاز در معاملات سکه:

مدیریت بازارهای مالی بورس کالاموضوع تغییر نحوه محاسبه محدوده نوسان قیمت مجاز در نمادهای گواهی سپرده کالایی سکه طلا را به کلیه کارگزاران و فعالان بازار سرمایه ابلاغ کرد. از ۲۰ آذرماه محدوده نوسان قیمت مجاز در نمادهای گواهی سپرده کالایی سکه طلا، مثبت و منفی ۵ درصد قیمت پایانی روز قبل خواهد بود.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

وعده معاون وزیر نفت برای جلوگیری از کاهش خوراک شرکت‌های پتروشیمی :

مرتضی شاه میرزایی در نشست تخصصی پتروشیمی با تأکید بر اهمیت تأمین پایدار انرژی و مدیریت تولید، گفت: تلاش می‌شود خوراک شرکت‌های پتروشیمی افزایش یابد تا در فصل سرد دچار محدودیت گاز نشوند. وی افزود: با توجه به توسعه صنعت پتروشیمی و برنامه‌ریزی‌های منسجم می‌توان ضمن کاهش خام‌فروشی، محصولات با ارزش افزوده بالا و افزون بر تأمین نیازهای داخلی، صادر شود.



نقدینگی به مرز ۵.۶ هزار میلیارد تومان رسید:

گزارش بانک مرکزی از آمارهای اقتصادی نشان می‌دهد حجم نقدینگی در مهرماه به ۵.۶ هزار میلیارد رسیده که نسبت به مهر و اسفند سال گذشته ۳۴.۳ و ۱۷.۵ درصد رشد کرده است. ۱.۲ هزار میلیارد تومان از حجم نقدینگی مهرماه مربوط به اسکناس و مسکوک در دست اشخاص و سپرده‌های دیداری است که نسبت به مهر و اسفند سال گذشته ۵۶.۳ و ۲۹.۷ درصد افزایش یافته است.



وعده تصویب طرح مالیات بر عایدی سرمایه:

سخنگوی کمیسیون اقتصادی مجلس ضمن اشاره به نقش طرح مالیات بر عایدی سرمایه در بهبود اوضاع اقتصادی کشور، از تلاش مجلس یازدهم برای تصویب این طرح تا پایان سال ۱۴۰۱ خبر داد. وی درباره طرح مالیات بر عایدی سرمایه گفت: این طرح یکی از طرح‌های زیرساختی و مهم کشور است و به دلیل شفافیتی که ایجاد می‌کند، می‌تواند اوضاع اقتصادی کشور را بهتر کند.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

بازگشت اقبال به معاملات زغال سنگ چین :

بهای زغال سنگ متالورژیک آسیا تحویل چین پس از چند هفته ثبات قیمتی در کانال ۲۹۰ دلاری از اواسط هفته به کانال قیمتی ۳۰۰ دلاری صعود کرد، به نحوی که روز چهارشنبه هفتم دسامبر با نرخ ۳۱۷ دلار به ازای هر تن قیمت خورد. البته ظرف روزهای هشتم و نهم دسامبر از بهای این محصول کاسته شد و پلنتس، پریمیوم آن را در روز نهم دسامبر برابر ۳۱۰ دلار ارزیابی کرد. کاهش محموله‌های زغال در بنادر چین عامل این جهش قیمتی بود.



تصویب دو لایحه مهم در دستور کار مجمع تشخیص برای خروج از فهرست FATF:

رئیس مرکز اطلاعات مالی وزارت اقتصاد: برای اولین بار گزارش مفصل و جامعی درباره اقدامات پیش رو و موثر ایران در حوزه مبارزه با پولشویی و تامین مالی تروریسم به کارگروه منطقه‌ای اوراسیا ارائه شد تا کشورهای دوست و همسو بدانند دلیل تاخیر در عضویت ایران در FATF، برخوردهای دوگانه و غیرفنی و سیاسی این نهاد در گذشته با ایران بوده و این ذهنیت عدم جدیت در مبارزه با پولشویی و تامین مالی تروریسم از پایه و اساس اشتباه است.



اتحادیه اروپا برای وضع تحریم‌های بیشتر علیه ایران اعلام آمادگی کرد:

ارسال پهنپادها به روسیه غیرقابل قبول است و اتحادیه اروپا این موضوع را به شدت محکوم می‌کند. هر گونه کمک خارجی به روسیه در مورد تدارکات نظامی و حمایت از این تجاوز غیرقانونی، غیرقابل قبول است و به همین دلیل افراد ایرانی را در دو مرحله در ارتباط با تامین پهنپادها تحریم کرده و اتحادیه اروپا آماده است تا در صورت ادامه حمایت نظامی ایران از روسیه به این مسیر ادامه دهد.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

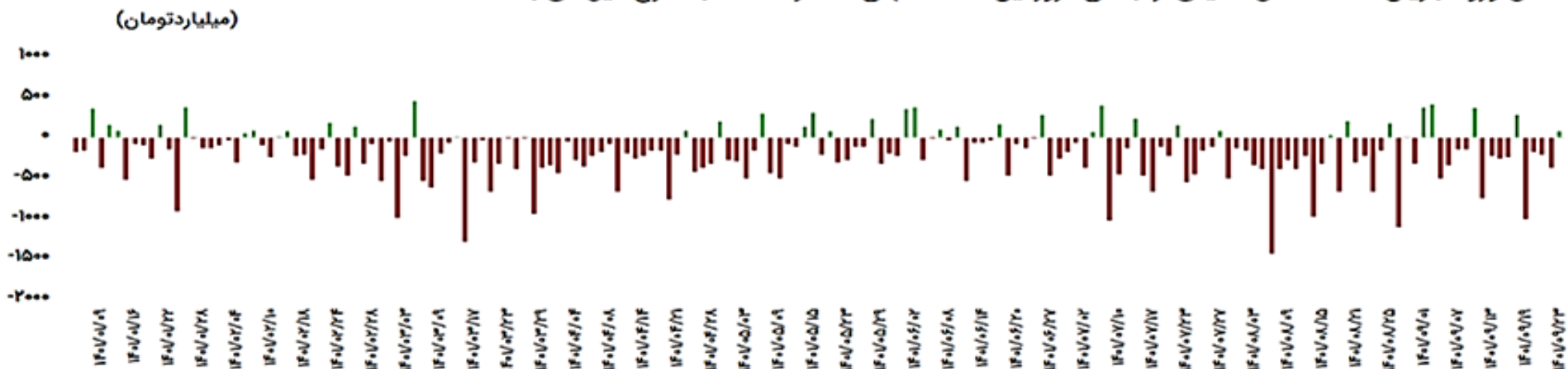
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با **۶۹,۹۳۰** واحد افزایش نسبت به هفته قبل، در ارتفاع ۱ میلیون و ۴۷۲ هزار واحد قرار گرفت و افزایش **۴.۹۸** درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن هم با رشد **۱۶,۶۷۸** واحدی در ارتفاع ۴۳۳,۷۶۳ واحدی قرار گرفته و افزایش **۳.۹۹** درصدی را ثبت نمود. افزایش قیمت‌های جهانی کامودیتی‌ها 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 ۳۶ هزار میلیارد تومان بود که افزایش حجم معاملات نشانگر اقبال سرمایه‌گذاران به بازار سرمایه بود.

تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۴۰۲,۸۰۳	۱,۴۷۲,۷۶۰	۶۹,۹۳۰	٪۴.۹۸
شاخص هم‌وزن (واحد)	۴۱۷,۰۸۵	۴۳۳,۷۶۳	۱۶,۶۷۸	٪۳.۹۹
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان		۳۶,۰۱۴	۸,۱۳۴	٪۲۹.۱۸

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

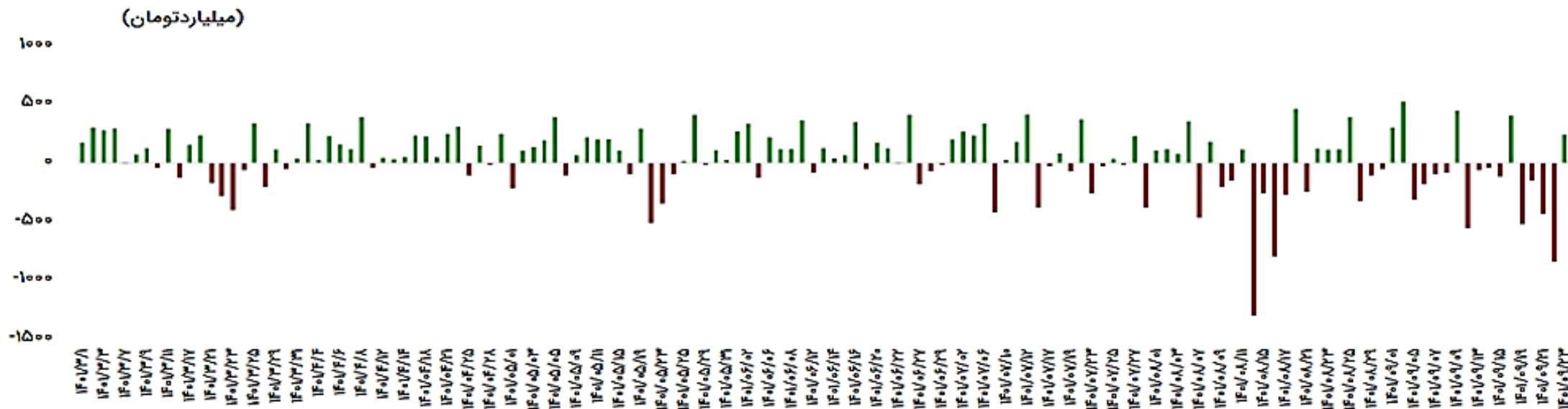
خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۲۳ آذر ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد :



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۹/۱۹	-۱.۰۰۷
۱۴۰۱/۰۹/۲۰	-۱۶۵
۱۴۰۱/۰۹/۲۱	-۲۰۵
۱۴۰۱/۰۹/۲۲	-۳۶۴
۱۴۰۱/۰۹/۲۳	۷۵
جمع	-۱.۶۶۶

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۳	۱۷۶	-۳۶.۰۶۸
ماهیناه (۱۴۰۱/۰۸/۲۳ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۳)	۲۳	-۴.۸۶۱
هفتگی (۱۴۰۱/۰۹/۱۹ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۳)	۵	-۱.۶۶۶

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

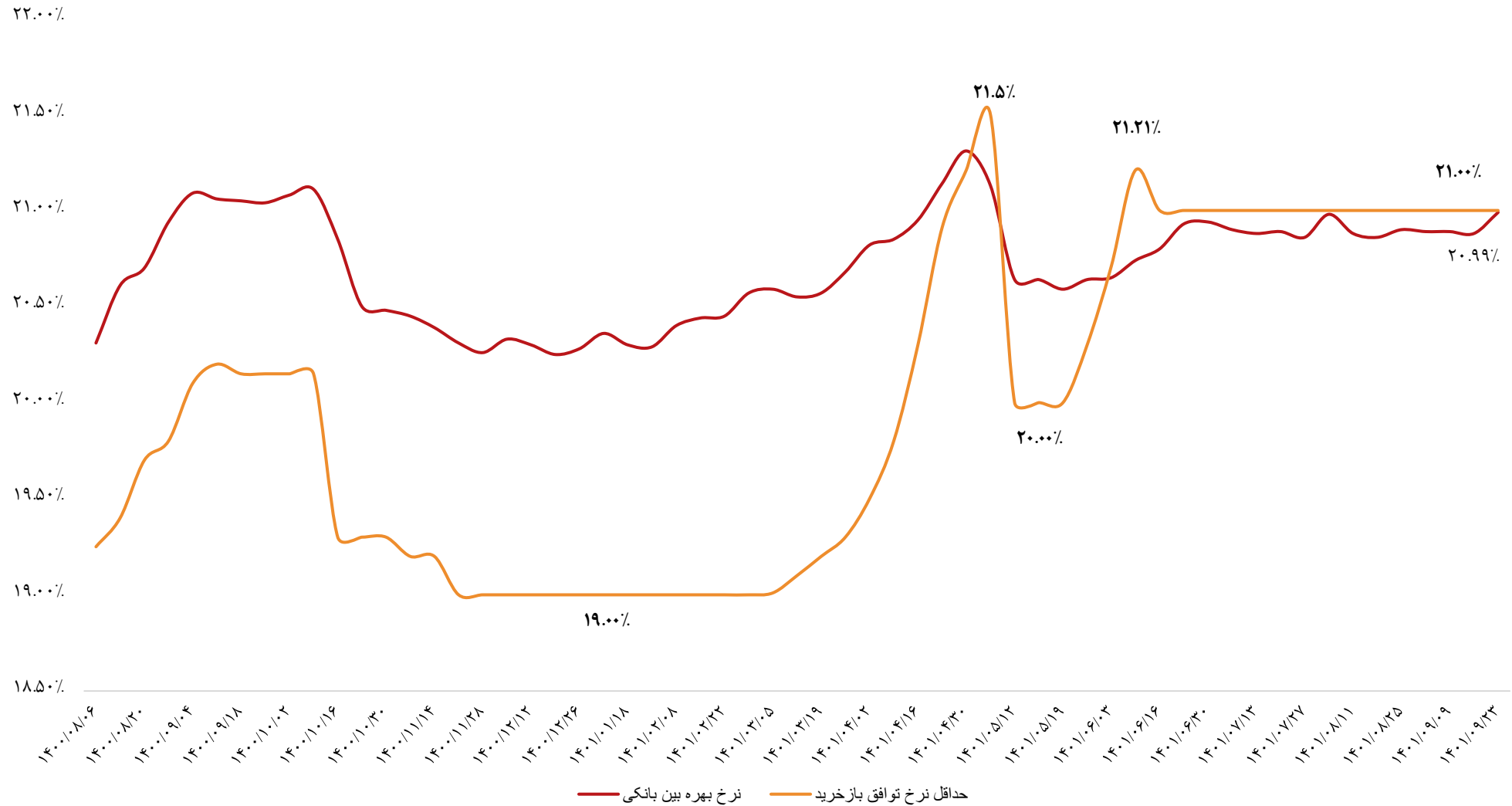


ورود پول (میلیارد تومان)	تاریخ
-۵۱۸.۵	۱۴۰۱/۰۹/۱۹
-۱۴۸.۷	۱۴۰۱/۰۹/۲۰
-۴۳۳.۸	۱۴۰۱/۰۹/۲۱
-۸۳۶.۸	۱۴۰۱/۰۹/۲۲
۲۳۹.۵	۱۴۰۱/۰۹/۲۳
-۱,۶۹۸.۳	جمع

ورود پول (میلیارد تومان)	تعداد روز معاملاتی	بازه زمانی
۲,۲۰۱.۰۲	۱۷۶	ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۳
-۱,۳۰۵.۹۸	۲۳	ماهیهانه (۱۴۰۱/۰۸/۲۳ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۳)
-۱,۶۹۸.۳	۵	هفتگی (۱۴۰۱/۰۹/۱۹ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۳)

روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته چهارم آذرماه ۱۴۰۱ با افزایش به ۲۰.۹۹ درصد رسید؛



ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	شکر شاهرود	قشکر	۲۴.۷
2	دنا آفرین فدک	گدنا	۲۲.۳
3	بهمن لیزینگ	ولبهمن	۲۲
4	پگاه خراسان	غشان	۲۱.۱
5	معادن روی ایران	کروی	۲۱.۱

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	هلدینگ خاورمیانه	میدکو	-۱۱.۶
۲	بیمه پاسارگاد	بپاس	-۱۰.۱
۳	دشت مرغاب	غدشت	-۱۰
۴	کاشی سینا	کساوه	-۸.۳
۵	بانک پاسارگاد	وپاسار	-۷.۹

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	محصولات کامپیوتری الکترونیکی	۱۶
۲	استخراج زغال سنگ	۱۰
۳	فرآورده های نفتی	۹
۴	فلزات اساسی	۸.۸
۵	وسایل ارتباطی	۷.۶

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	بیمه و بازنشستگی	-۵.۹
۲	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	-۰.۸
۳	منسوجات	-۰.۵
۴	محصولات چوبی	۰.۳
۵	سایر واسطه‌گری های مالی	۰.۴

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۹,۰۲۰	۳.۷
شاون	۱۹,۵۵۰	۳.۸
شپنا	۷,۲۵۰	۴
سپاها	۹,۷۰۰	۴
شراز	۱۳,۳۷۰	۴.۱

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۸۳۶	٪۲۴.۷
وسپهر	۶,۸۸۰	٪۲۸.۶
وملی	۱۳۳,۵۷۰	٪۳۲.۵
پترول	۲,۰۶۱	٪۳۴.۱
وتوشه	۵,۶۲۰	٪۳۶.۳

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۴,۳۷۱
۲	فلزات اساسی	۳,۰۸۷
۳	فرآورده های نفتی	۲,۳۳۱
۴	شیمیایی	۲,۲۵۸
۵	بانکها و موسسات اعتباری	۱,۲۴۸

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۲,۱
۲	چاپ	۳,۳
۳	سایر واسطه گری های مالی	۵,۵
۴	فعالیت های هنری, سرگرمی	۵,۶
۵	مهندسی, تجزیه و تحلیل	۶,۹

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
پی وی سی	۷۹۰	۸۲۰	۳.۸۰
نفت برنت	۷۷	۷۹	۲.۶۰
بیلت (فوب ایران)	۴۴۸	۴۵۵	۱.۵۶
پروپیلن	۸۹۰	۹۰۰	۱.۱۲
متانول (پلتس)	۲۹۹	۳۰۲	۱.۰۰
اونس جهانی طلا	۱,۷۹۸	۱,۷۹۴	-۰.۲۲
اوره (خلیج فارس)	۵۱۰	۵۰۳	-۱.۳۷
مس	۸,۴۸۵	۸,۳۰۰	-۲.۱۸
سرب	۲,۲۱۲	۲,۱۵۳	-۲.۶۷
پلاتین	۱۰۳۷	۱۰۰۱	-۳.۴۷
روی	۳,۲۳۴	۳,۰۳۴	-۶.۱۸

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۷۴,۰۴۰,۰۰۰	۱۸۴,۰۲۰,۰۰۰	۵.۷٪
طلای ۱۸ عیار	۱۵,۹۳۴,۰۰۰	۱۶,۹۰۲,۰۰۰	۶.۱٪
نرخ دلار نیما	۲۸۲,۱۹۵	۲۸۹,۱۶۸	۲.۵٪

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۹/۲۸	دوشنبه	تغییرات سالیانه سرمایه گذاری خارجی چین
۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سه شنبه	شاخص قیمت تولیدکننده آلمان - نرخ بهره سالیانه ژاپن
۱۴۰۱/۰۹/۳۰	چهارشنبه	شاخص قیمت تولیدکننده روسیه - تغییرات سالانه تورم کانادا
۱۴۰۱/۰۹/۰۱	پنج شنبه	نرخ تورم سالیانه ژاپن - نرخ رشد تولید ناخالص داخلی انگلستان
۱۴۰۱/۰۹/۰۲	جمعه	شاخص قیمت تولیدکننده فرانسه - تعداد دکل های نفتی آمریکا

پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری؛ بازار هفته پیش رو نگاه مستقیم به روند قیمت دلار خواهد داشت. با توجه به رشد چشمگیر قیمت دلار طی هفته های اخیر و همبستگی بازار سرمایه به نرخ دلار، مسیر حرکتی بازار سهام به سمت جلو شروع شده و با توجه محتمل نبودن اصلاح قیمتی دلار از یک طرف و افزایش قیمت های جهانی کامودیتی از سوی دیگر می توان هفته متعادل و مثبتی را برای بازار سرمایه پیش بینی نمود. البته افزایش حجم معاملات طی روزهای کاری اخیر نیز می تواند علامت مثبتی به روند رو رشد بازار سرمایه باشد.