



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته چهل و دوم منتهی به شانزدهم

دی ماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

شرایط واگذاری ۵۱ درصد سهام استقلال و پرسپولیس تصویب شد:

رئیس سازمان خصوصی از تصویب شرایط واگذاری ۵۱ درصد سهام دو باشگاه استقلال و پرسپولیس بصورت یکجا و یا سه بلوک ۱۷ درصدی همزمان به تشخیص سازمان خصوصی سازی در جلسه هیات عالی واگذاری خبر داد و اعلام کرد: مقرر شده واگذاری با ۲۰ درصد حقه نقدی، یک سال تنفس و اقساط در شش قسط سالانه انجام شود. وی افزود: مبنای قیمت گذاری همان قیمت کارشناسی رسمی دادگستری به اضافه ارزش بلوکی خواهد بود. قیمت پایه بلوک ۱۷ درصدی استقلال و پرسپولیس ۵۰۳ و ۵۱۶ میلیارد تومان و قیمت پایه بلوک ۵۱ درصدی ۱۳۲ و ۱۹۲ هزار میلیارد تومان تعیین شد.



قیمت مسکن از میانگین ۵۰ میلیون تومان گذشت:

مرکز آمار ایران در مورد آخرین وضعیت بازار مسکن تا پایان آذر اعلام کرد: میانگین قیمت هر مترمربع واحد مسکونی در تهران طی آذر به ۵۰.۴ میلیون تومان رسید. در این میان منطقه یک و ۱۸ با متوسط ۱.۱۰۷ و ۶.۲۵ میلیون تومانی، بیشترین و کمترین قیمت را در بین مناطق ۲۲ گانه تهران داشتند. شاخص قیمت هم با رشد ۱.۴ درصدی از ۴.۱۶۷ به ۳.۱۷۴ رسید که نشان از گرانی و تورم ماهانه ۱.۴ درصدی دارد. همچنین تورم نقطه به نقطه قیمت آپارتمان های مسکونی با رشد ۱.۲ درصدی به ۵۲.۱ درصد رسید.



پذیرش نخستین خودروهای وارداتی در بورس کالا/ دنا هم آمد:

در جلسه هیات پذیرش بورس کالای ایران ۱۹ هزار دستگاه از محصولات چانگان از سوی خودروسازی سایپا و ۲ هزار و ۱۴۰ دستگاه از محصولات کیا از سوی شرکت کوشا خودرو نگین، به عنوان نخستین خودروهای وارداتی در بورس کالا پذیرش شدند؛ همچنین محصولات گروه «دنا» از سوی شرکت ایران خودرو برای عرضه در بورس کالا پذیرش شد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

۱۳ هزار و ۲۵۰ دستگاه خودرو در بورس کالا عرضه می‌شود:

بورس کالا این هفته میزبان عرضه ۱۳ هزار و ۲۵۰ دستگاه خودرو سواری و باری خواهد بود به گونه‌ای که روز یکشنبه ۱۸ دی ۴ هزار دستگاه شاهین، ۴ هزار دستگاه پژو ۲۰۷ دستی، ۲ هزار دستگاه پژو ۲۰۷ اتوماتیک و ۲ هزار دستگاه تارا دستی عرضه می‌شود و در روز سه‌شنبه ۲۰ دی، ۵۰۰ دستگاه کارا دو کابین و چهارشنبه ۲۱ دی ۷۵۰ دستگاه فیدلیتی ۷ نفره روی تابلو می‌رود.



برنامه دولت برای حمایت از بورس اعلام شد: تزریق ۱۵ هزار میلیارد تومان به صندوق تثبیت

دولت در لایحه بودجه ۱۴۰۲ برای واگذاری ۱۵ هزار میلیارد تومان از سهام شرکت‌های دولتی برای حمایت از سهامداران خرد در برابر مخاطرات بازار سرمایه به صندوق تثبیت بازار سرمایه، برنامه ریزی کرد. بر این اساس، جهت تقویت بنیه شرکت‌های بازار، بخشی از سودی که به افزایش سرمایه این شرکتها اختصاص پیدا کند با نرخ صفر معافیت مالیاتی محاسبه می‌شود. شرکت‌ها با این اقدام به افزایش سرمایه تشویق و قدرت سرمایه‌گذاری و توسعه فعالیت‌های شرکت‌های بورسی بیش از پیش فراهم می‌شود.



وعده جدید دولت: نرخ ارز کالاهای اساسی تا دو سال آینده ثابت خواهد ماند

محمد مخبر گفت: رئیس‌جمهور روی خوراک و سلامت و مسکن مردم حساسیت خاصی دارد به همین دلیل در وضع موجود ۴ برنامه تدوین شده است. وی افزود: یکی بخش ضربتی است، معیشت مردم مشکل دارد و قیمت کالاهای اساسی و خوراک مردم کم و زیاد می‌شود. تصمیم مطلوبی گرفته شد که برای حداقل دو سال ارز این کالاها را ثابت نگه داشته تا با تنش جدی در قیمت‌ها مواجه نشود.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

تولید شرکت های پتروشیمی با رشد ۷ درصدی به ۴۷ میلیون تن رسید:

بیژن چگنی درباره عملکرد تولید صنعت پتروشیمی گفت: شرکت های پتروشیمی در ۸ ماه سال جاری با ۷۱ درصد ظرفیت اسمی ۴۷ میلیون تن انواع محصول تولید کردند که ۷ درصد نسبت به مدت زمان مشابه سال گذشته افزایش داشت.



افتتاح سپرده با سود بالای ۲۰ درصد ممنوع است:

دبیر شورای هماهنگی بانک‌های دولتی: نرخ سپرده های سالیانه حداکثر ۲۰ درصد است، در صورتیکه بانکی سپرده با سود بالای ۲۰ درصد افتتاح کند تخلف کرده و بازرسان بانک مرکزی قطعاً با بانک متخلف برخورد می کنند.



مالیات ارزش افزوده ۷ کالای روغنی از ۹ درصد به یک درصد کاهش یافت:

نرخ مالیات ارزش افزوده واردات انواع دانه های (روغنی سویا، گلرنگ و کلزا) و روغن خام سویا، آفتابگردان، کلزا و روغن پالم از ۹ درصد به یک درصد کاهش یافت.



برجام ماه ها پیش از دستور کار کاخ سفید خارج شده است:

ند پرایس با بیان اینکه برجام ماه‌ها است از دستور کار کاخ سفید خارج شده، گفت: دولت روی مقابله با همکاری روزافزون امنیتی بین ایران و روسیه تمرکز کرده و اولویت دستور کار این است که هر کاری بتواند حقوق مردم ایران را حفظ و با همکاری روز افزون امنیتی بین ایران و روسیه مقابله کند، انجام شود.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با کاهش **۶۸,۱۹۵** واحد نسبت به هفته قبل، در ارتفاع ۱ میلیون و ۵۷۹ هزار واحد قرار گرفت و کاهش **۴.۱۴** درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن هم با کاهش **۷,۴۸۲** واحدی در ارتفاع ۴۷۳,۱۹۹ واحدی قرار گرفته و کاهش **۱.۵۵** درصدی را ثبت نمود. کاهش ده درصدی قیمت دلار در بازار آزاد در پی تغییر رییس بانک مرکزی و اعلام سیاست نرخ ارز ۲۸ هزار و ۵۰۰ تومانی عامل اصلی ترس و عقب نشینی نسبی بازار سرمایه در هفته گذشته بود البته بایستی اشاره نمود معاملات طی هفته با روند و ارزش مناسبی صورت پذیرفت و مانند قبل موجب رفتار غیرمنطقی معامله‌گران نشد.

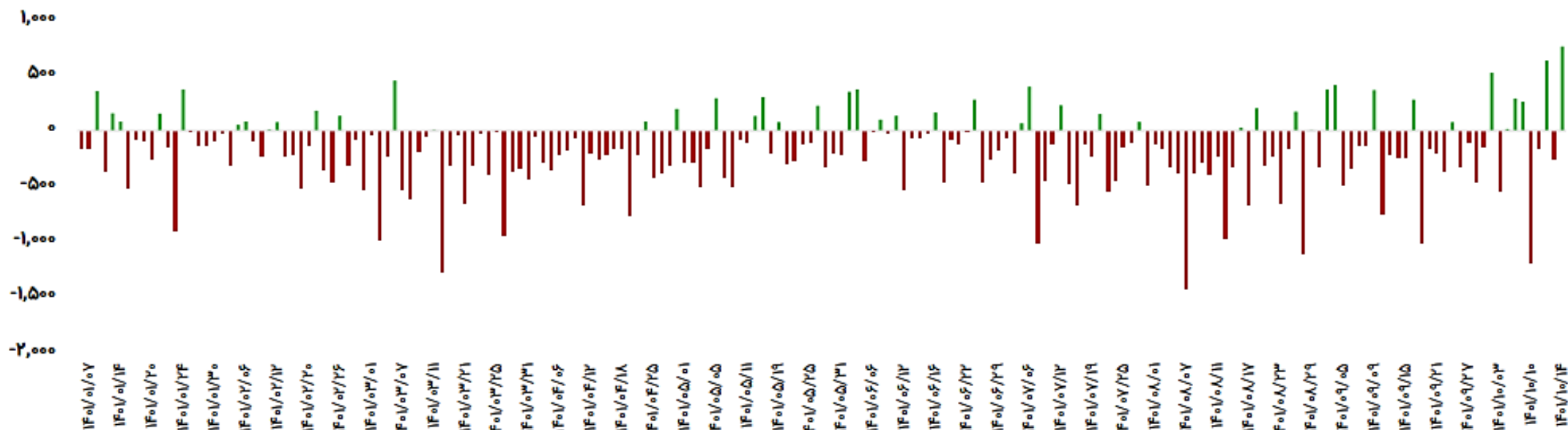
تغییرات هفتگی شاخص‌ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۶۴۷,۳۱۴	۱,۵۷۹,۱۱۹	-۶۸,۱۹۵	-۴.۱۴٪
شاخص هم‌وزن (واحد)	۴۸۰,۶۸۱	۴۷۳,۱۹۹	-۷,۴۸۲	-۱.۵۵٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۴۲,۰۷۸		۸,۹۳۱	۲۶.۹۴٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۱۴۰۱ ماهی ۱۴ به شرح ذیل می باشد :

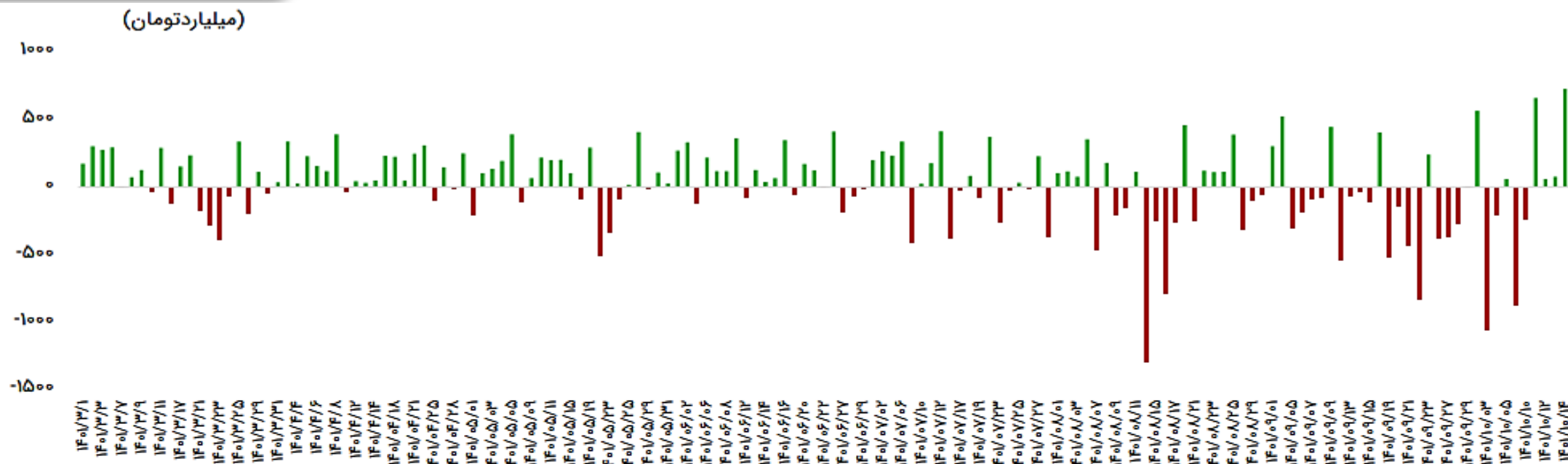
(میلیارد تومان)



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۱۰/۱۰	-۱,۱۹۱
۱۴۰۱/۱۰/۱۱	-۱۶۳
۱۴۰۱/۱۰/۱۲	۶۳۱
۱۴۰۱/۱۰/۱۳	-۲۵۳
۱۴۰۱/۱۰/۱۴	۷۶۰
جمع	-۲۱۶

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۱۰/۱۴	۱۹۰	-۳۶,۷۷۹
ماهینه (۱۴۰۱/۰۹/۱۴ تا ۱۴۰۱/۱۰/۱۴)	۲۲	-۲,۵۸۱
هفتگی (۱۴۰۱/۱۰/۱۰ تا ۱۴۰۱/۱۰/۱۴)	۵	-۲۱۶

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
1401/10/10	-245.1
1401/10/11	658.7
1401/10/12	59.1
1401/10/13	75.8
1401/10/14	725.7
جمع	1,274.2

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال 1401 تا 1401/10/14	190	916.22
ماهیهانه (1401/10/14 تا 1401/09/14)	22	-2,723.7
هفتگی (1401/10/14 تا 1401/10/10)	5	1,274.2

ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	سر. کوثر بهمن	وکبهمن	۳۸.۲
2	درخشان تهران	پدرخش	۲۴.۵
3	گسترش س. ایرانیان	وگستر	۲۲.۳
4	آذراب	فاذر	۲۱.۳
5	رادیاتور ایران	ختور	۲۰.۳

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	بهمن لیزینگ	ولبهمن	-۲۲.۳
۲	سر. توسعه ملی	وبانک	-۱۴.۸
۳	آرتاویل تایر	پارتا	-۱۳.۹
۴	معادن بافق	کبافق	-۱۳.۶
۵	فرآوری مواد معدنی	فرآور	-۱۲.۲

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	خودرو و قطعات	۸.۶
۲	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۸.۴
۳	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل	۸.۲
۴	محصولات چوبی	۶.۶
۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۶.۴

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	چاپ	-۶
۲	محصولات کامپیوتری الکترونیکی	-۳.۹
۳	سایر واسطه‌گری های مالی	-۲.۸
۴	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	-۲.۷
۵	فنی و مهندسی	-۲.۶

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۹,۳۷۰	۳.۵
شپنا	۷,۵۰۰	۳.۸
شکبیر	۸۴,۳۵۰	۳.۸
شاون	۲۱,۰۵۰	۳.۹
دسبحان	۶,۲۴۰	۴

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۴,۱۹۳	٪۲۵.۵
وسپهر	۷,۱۰۰	٪۲۹
وملی	۱۳۸,۹۲۰	٪۳۴.۸
پترول	۲,۲۷۶	٪۳۶.۳
وتوشه	۵,۰۲۰	٪۳۹.۳

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۸,۸۳۱
۲	شیمیایی	۵,۶۹۶
۳	فلزات اساسی	۳,۷۹۲
۴	بانکها و موسسات اعتباری	۲,۹۰۷
۵	فرآورده های نفتی	۲,۴۹۵

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	چاپ	۹
۲	سایر حمل و نقل	۱۰
۳	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل	۱۱
۴	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱۳
۵	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۱۶

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	ابتدای هفته (دلار)	انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
پی وی سی	۸۲۰	۸۸۰	۷.۳۲
مس	۸,۳۷۹	۸,۶۰۶	۲.۷۱
متانول (پلتس)	۳۰۴	۳۱۲	۲.۶۳
بیلت (فوب ایران)	۴۷۸	۴۹۰	۲.۵۱
اونس جهانی طلا	۱,۸۲۱	۱,۸۶۰	۲.۱۴
روی	۲,۹۷۶	۳,۰۳۹	۲.۱۲
پلاتین	۱۰۸۵	۱۱۰۶	۱.۹۴
سرب	۲,۲۷۲	۲,۲۶۸	-۰.۱۸
اوره (خلیج فارس)	۴۷۵	۴۶۳	-۲.۵۳
نفت برنت	۸۶	۷۸	-۹.۳۰
پلی پروپیلن	۹۰۰	۸۹۰	-۱.۱۱

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۲۲۶,۹۵۰,۰۰۰	۲۰۳,۱۸۰,۰۰۰	-۱۰.۴۷٪
طلای ۱۸ عیار	۱۹,۱۵۳,۰۰۰	۱۸,۰۴۹,۰۰۰	-۵.۷۶٪
نرخ دلار نیما	۲۹۳,۹۹۴	۲۸۵,۰۰۰	-۳.۰۵٪

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۱۰/۱۹	دوشنبه	نرخ بیکاری اتحادی اروپا- تورم مصرف کننده آمریکا
۱۴۰۱/۱۰/۲۰	سه شنبه	تغییرات سهام نفت خام آمریکا- نرخ بیکاری کره جنوبی
۱۴۰۱/۱۰/۲۱	چهارشنبه	شاخص خرید آمریکا- شاخص بازپرداخت وام مسکن آمریکا
۱۴۰۱/۱۰/۲۲	پنج شنبه	نرخ تورم سالانه چین- نرخ تورم سالانه آمریکا
۱۴۰۱/۱۰/۲۳	جمعه	موازنه تجاری چین- تغییرات صنعتی سالیانه انگلستان- تعداد دکل های نفتی آمریکا

پیش بینی بازار در هفته جاری

در خصوص پیش بینی بازار در هفته جاری؛ با فروکش کردن هیجانات اولیه کاهش قیمت ارز ناشی از تغییر رئیس بانک مرکزی و تثبیت نرخ ارز در حدود قیمتی ۴۰ هزار تومان به نظر بازار تمایل چندانی به اصلاح قیمتی در نرخ ارز و به تبع آن در بازار سرمایه نخواهد داشت. بازار در این هفته با ریسک عواملی مانند نرخ ارز، حامل های انرژی و نرخ خوراک در بودجه مواجه خواهد بود و از طرفی سیاست بانک مرکزی در خصوص نرخ بهره سپرده های بانکی تا زمان تثبیت آن نیز می تواند موجب احتیاط خریداران باشد. اما با توجه به فضای بازار در اواخر هفته گذشته به نظر می رسد در این هفته شاهد معاملاتی در دامنه مثبت و رشد در ارزش معاملات خواهیم بود.