

شرکت سرمایه گذاری سایه کستر سرمایه  
متعلق به بانک سرمایه



## گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و دوم منتهی به

۰۶ آبان ماه ۱۴۰۱



# مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

از توقف عرضه های اولیه تا محدودیت فروش و اصلاح عملیات بازارگردانی:

مدیر روابط عمومی سازمان بورس: در پی تصمیمات هیئت مدیره سازمان بورس، تعهدات فروش بازارگردانها طی روزهای آینده محدود شده و عرضه‌های اولیه تا زمان پایداری شرایط بازار، متوقف خواهد شد. همچنین اصلاحیه دستورالعمل بازارگردانی نیز جمع‌بندی شده و به زودی ابلاغ می‌شود.



عرضه ۱۰ درصد سهام شرکت سوژمیران در فرابورس:

تعداد ۶۰ میلیون سهم شرکت "سوژمیران" به روش حراج در بازار اولیه معاملات فرابورس عرضه اولیه شد. در این عرضه که با نماد "فسوژ" انجام شد ۶۵ صندوق به رقابت پرداختند که در نهایت ۳۰ صندوق موفق به خرید سهام این شرکت گردیدند. بیشترین قیمت معامله شده برای سهم مبلغ ۲۰ هزار ریال و کمترین قیمت ۱۳ هزار ۵۵۰ ریال بوده است.



مالیات فروش سهام ۸۰ درصد کاهش می‌یابد:

در جلسه ستاد اقتصادی دولت با حضور رییس سازمان بورس، پیشنهاد کاهش ۸۰ درصدی مالیات فروش سهام از سوی رئیس‌جمهور مورد موافقت قرار گرفت و مقرر شد در دستور کار شورای سران سه قوه قرار گیرد.



وزارت صنعت مجبور به لغو مصوبه محدودیت صادرات محصولات معدنی شد:

معاون وزیر صنعت اعلام کرد نظر به حکم صادره از دیوان عدالت اداری مبنی بر واجد ایراد بودن محدودیت صادرات محصولات صنایع معدنی، صادرات کلیه محصولات صنایع معدنی برای کلیه اشخاص حقیقی و حقوقی واجد شرایط ذیل مقررات جاری صادرات) امکان پذیر است .



## مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

### روسیه از ادامه تحریم علیه ایران و فرصت ۴۰ میلیارد دلاری استقبال کرد :

مدیر صندوق امنیت ملی انرژی روسیه با بیان اینکه اگر ایران تحت تحریم‌ها بماند و تحریم‌ها تشدید شود برای روسیه خبر خوشی است، گفت: ادامه تحریم‌های هسته‌ای ایران از سوی غرب، فرصت بسیار مناسبی به روسیه خواهد داد تا در بخش نفت و گاز ایران سرمایه‌گذاری بزرگی بیش از ۴۰ میلیارد دلار کند.



### مصرف جهانی فولاد کاهش یافت :

به گفته انجمن جهانی فولاد، تقاضای جهانی فولاد امسال کاهش می‌یابد، زیرا بحران انرژی اروپا و کاهش رشد اقتصادی چین مصرف را کاهش داده است. به گزارش فولاد ایران، این گروه در تحقیقی که روز چهارشنبه منتشر شد، گفت تقاضا برای فولاد که به‌طور گسترده به‌عنوان یک فشارسنج اقتصادی در نظر گرفته می‌شود، در سال ۲۰۲۲ تا ۲/۳ درصد کاهش خواهد یافت.



### دو شرکت بورسی و ۵ خودروساز دیگر برای آغاز واردات معرفی شدند :

هفت شرکت پارس خودرو، سایپا، مکث موتور، خودروسازی فردا، آرین موتور پویا، سایپا سیتروئن و کرمان موتور، واردات خودرو را پس از تایید مدارک لازم از سوی نهادهای مربوطه آغاز خواهند کرد. سه مرجع برای تایید نمایندگی رسمی این شرکت‌ها تعیین شده است. شناسه ثبت سفارش برای این شرکت‌ها باز شده و تا سقف مجاز بیست هزار دلاری اجازه ثبت سفارش پیدا کرده‌اند.



### ایران در فهرست سیاه FATF باقی ماند:

اولین جلسه گروه اقدام ویژه مالی FATF با ریاست کشور سنگاپور در پاریس برگزار شد. در این نشست FATF همچنین نام ایران و کره شمالی کماکان در فهرست سیاه باقی ماندند و نیکاراگوئه و پاکستان به دلیل بهبود رژیم مبارزه با پولشویی و تامین مالی تروریسم از تحت نظارت فزاینده خارج شدند.



## مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

قیمت مصوب مرغ ۶۳ هزار تومان شد: معاون بازرگانی وزارت جهاد و کشاورزی گفت: به دلیل افزایش هزینه‌های تولید مرغ و برای استمرار تولید، قیمت مصوب مرغ از ۵۹ هزار و ۸۰۰ تومان به ۶۳ هزار تومان افزایش یافت.



پذیره نویسی تأمین سرمایه کیمیا با استقبال گذاران انجام گردید: علی رستمی مدیرعامل شرکت ملی صنایع مس ایران با اعلام پذیرهنویسی موفق سهام در دست انتشار شرکت تأمین سرمایه کیمیا گفت: استقبال از این پذیرهنویسی، نویدی از روزهای خوب و پربر بار بازار سرمایه تا پایان سال است. شرکت تأمین سرمایه کیمیا طی روز جاری پذیرهنویسی ۸ میلیارد سهم در دست انتشار خود را انجام داد که در اولین روز با استقبال سرمایه‌گذاران، به پایان رسید.



تورم سالانه در پایان مهرماه به ۴۲.۹ درصد رسید: طبق گزارش مرکز آمار، نرخ تورم سالانه مهر برای خانوار به ۴۲.۹ درصد رسید که نسبت به ماه قبل ۰.۸ واحد درصد افزایش نشان می‌دهد. نرخ تورم نقطه‌ای در مهرماه نیز به ۴۸.۶ درصد رسید یعنی خانوارها بطور میانگین ۴۸.۶ درصد بیشتر از مدت مشابه سال قبل برای خرید مجموعه کالا و خدمات یکسان هزینه کردند.





# بورس در هفته ای که گذشت

## شرح وقایع

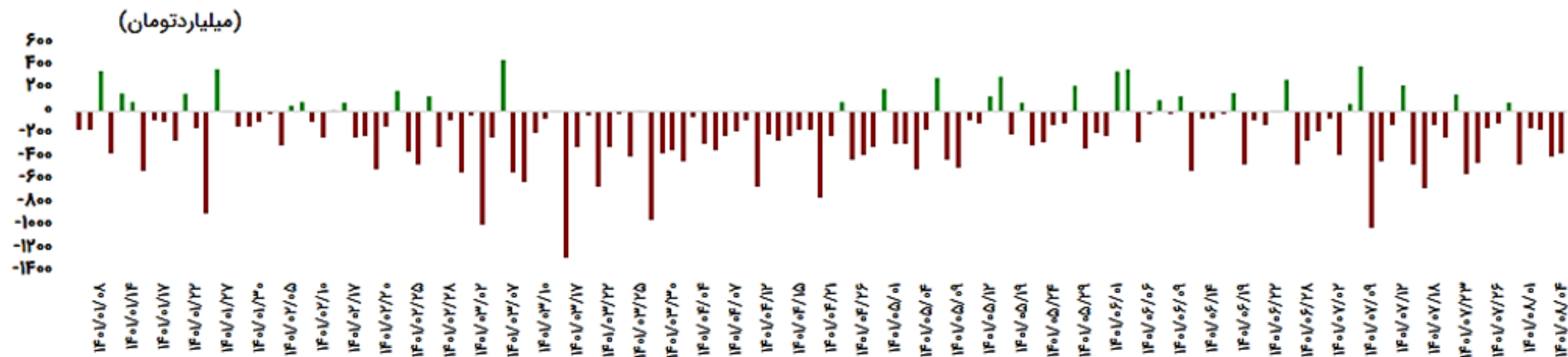
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با  $-۶۹,۰۹۸$  واحد کاهش نسبت به هفته قبل، بر ارتفاع ۱ میلیون و ۲۴۱ هزار واحد قرار گرفت و کاهش  $-۵.۲۷$  درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن با  $-۱۷,۲۳۴$  واحد کاهش در ارتفاع ۳۶۱,۳۶۰ واحدی قرار گرفته و افت  $-۴.۵۵$  درصدی را ثبت نمود. بازار در هفته قبل با یکی از سنگین ترین افت های خود مواجه شد. وضعیت سیاسی مبهم کشور در خصوص تعاملات بین المللی، تنش های سیاسی ادامه دار داخلی، سیاست های پولی دولت و افزایش نرخ بهره بانکی ( بطور غیر رسمی)، عدم توجه و حمایت از بازار سرمایه از سوی تیم اقتصادی دولت همگی عوامل داخلی هستند که موجب عدم اطمینان سرمایه گذاران و در نتیجه خروج سرمایه از بازار گردیده است. در کنار این عوامل کاهش قیمت های جهانی بخصوص در حوزه فلزات و مواد معدنی عامل دیگری برای افت سهام این صنایع در بورس بوده است.

## تغییرات هفتگی شاخص ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۳۱۰,۱۶۵	۱,۲۴۱,۰۶۷	-۶۹,۰۹۸	-۵.۲۷٪
شاخص هم وزن (واحد)	۳۷۸,۵۹۴	۳۶۱,۳۶۰	-۱۷,۲۳۴	-۴.۵۵٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۲۰,۷۹۱	۳,۰۴۰	۳,۰۴۰	۱۷٪

# ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

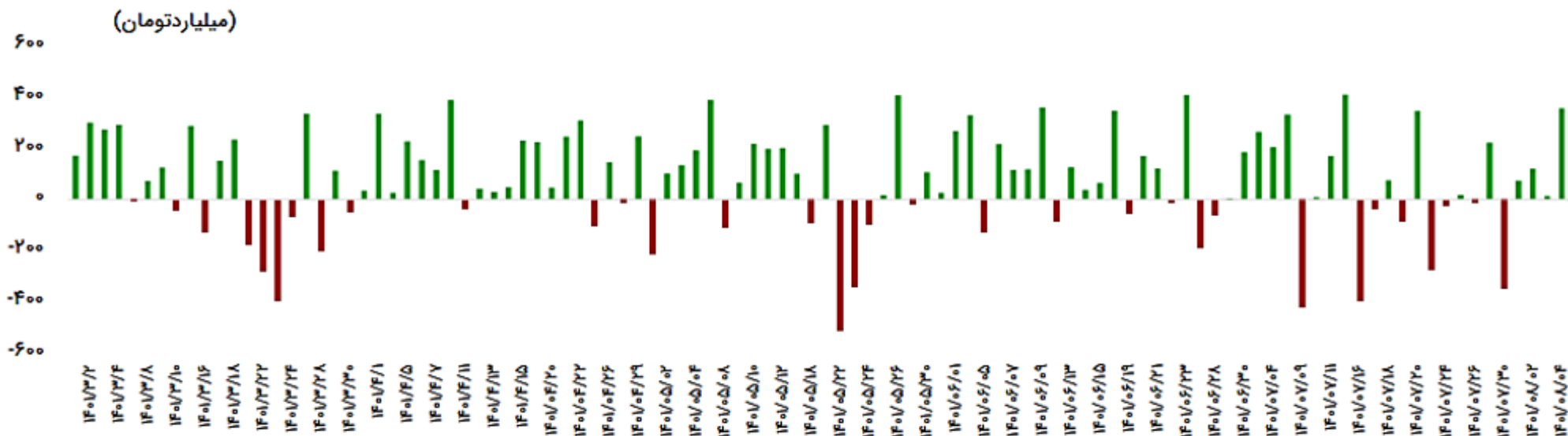
خالص ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۰۴ آبان ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد:



ورود پول (میلیارد تومان)	تاریخ
-۴۶۷	۱۴۰۱/۰۷/۳۰
-۱۴۶	۱۴۰۱/۰۸/۰۱
-۱۵۷	۱۴۰۱/۰۸/۰۲
-۳۹۳	۱۴۰۱/۰۸/۰۳
-۳۷۲	۱۴۰۱/۰۸/۰۴
-۱،۵۳۵	جمع

ورود پول (میلیارد تومان)	تعداد روز معاملاتی	بازه زمانی
-۲۶،۲۹۱	۱۴۱	ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۰۴
-۴،۹۳۱	۲۱	ماهپایانه (۱۴۰۱/۰۷/۰۴ تا ۱۴۰۱/۰۸/۰۴)
-۱،۵۳۵	۵	هفتگی (۱۴۰۱/۰۷/۳۰ تا ۱۴۰۱/۰۸/۰۴)

# ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

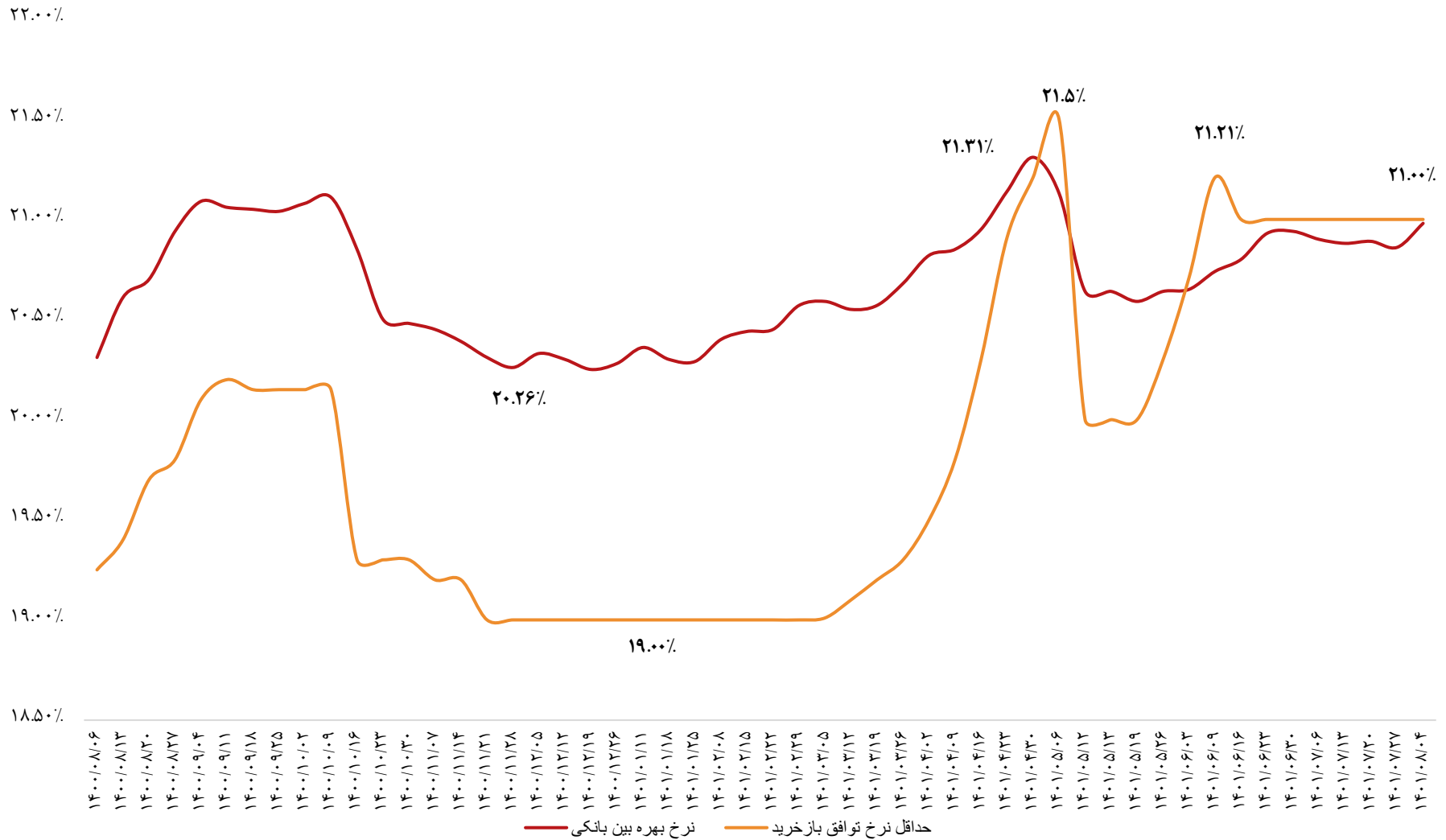


تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۷/۳۰	-۳۴۹.۱۰
۱۴۰۱/۰۸/۰۱	۷۴.۵
۱۴۰۱/۰۸/۰۲	۱۲۰.۲
۱۴۰۱/۰۸/۰۳	۱۳.۹
۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۳۵۶.۴
جمع	۲۱۵.۹

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱۴۱	۶,۱۴۵.۴
ماهیهانه (۱۴۰۱/۰۷/۰۴ تا ۱۴۰۱/۰۸/۰۴)	۲۱	۷۵۵.۷
هفتگی (۱۴۰۱/۰۷/۳۰ تا ۱۴۰۱/۰۸/۰۴)	۵	۲۱۵.۹

# روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می دهد. در هفته اول آبان ماه ۱۴۰۱ با افزایش به ۲۰.۹۸ درصد رسید؛





## ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	س. توسعه آذربایجان	وآذر	۱۹.۹۹
2	شیر پگاه گلپایگان	غگلپا	۱۸.۷۳
3	ورزیران	کورز	۱۵.۸۷
4	لیزینگ ایرانیان	وایران	۱۵.۵۳
5	ناب	غخاب	۱۴.۴۹

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	س. مسکن شمال غرب	ثغرب	-۲۶.۶۸
۲	دنا آفرین فدک	گدنا	-۲۰.۷۰
۳	گروه مپنا	رمپنا	-۱۸.۵۴
۴	صنعتی بهشهر	غبشهر	-۱۶.۴۸
۵	سیمان هرمزگان	سهرمز	-۱۶.۳۱

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	فعالیت های مهندسی، تجزیه و تحلیل	۲.۶۶
۲	محصولات چوبی	۲.۲۲
۳	واسطه‌گری های پولی و مالی	۰.۱۱
۴	----	--
۵	----	--

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	فنی و مهندسی	-۱۷.۴۷
۲	اطلاعات و ارتباطات	-۱۰.۷۵
۳	محصولات کامپیوتری و الکترونیکی	-۹.۶۹
۴	محصولات چرمی	-۸.۴۴
۵	وسایل ارتباطی	-۸.۱۷

کم بازده‌ترین صنایع

## ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۷,۷۸۰	۳.۳
غمینو	۵,۹۱۰	۳.۴
شسپا	۲,۸۲۲	۳.۵
ساوه	۵۳,۹۵۰	۳.۶
شتران	۴,۵۳۱	۳.۶

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۰۶۲	٪۲۰.۳
وملی	۹۳,۴۵۰	٪۲۲.۷
ثمسکن	۲,۴۹۰	٪۲۷.۹
پترول	۱,۶۴۰	٪۲۸.۴
وسپهر	۶,۸۵۰	٪۲۸.۵

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۱,۴۸۱
۲	فلزات اساسی	۱,۳۵۱
۳	فعالیت های کمکی به نهاد های واسط مالی	۱,۱۹۷
۴	فرآورده های نفتی	۱,۰۹۱
۵	شیمیایی	۹۷۴

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۰,۹
۲	سایر حمل و نقل	۱,۱
۳	چاپ	۲,۶
۴	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۶
۵	فعالیت مهندسی، تجزیه و تحلیل	۶,۳

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


## تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
پلاتین	۹۳۳	۹۴۹	۱.۷۱
نفت برنت	۹۳.۵۱	۹۴.۱۲	۰.۶۵
آلومینیوم	۲,۲۲۵	۲,۲۲۴	-۰.۰۴
اونس جهانی طلا	۱,۶۵۴	۱,۶۴۴	-۰.۶۰
مس	۷,۶۴۶	۷,۵۵۸	-۱.۱۵
متانول (پلتس)	۳۲۰	۳۱۱	-۲.۸۱
پروپیلن	۸۹۰	۸۶۰	-۳.۳۷
روی	۲,۹۴۸	۲,۸۲۲	-۴.۲۷
سرب	۱,۹۸۴	۱,۸۸۹	-۴.۷۹
اوره (خلیج فارس)	۶۳۰	۵۷۸	-۸.۲۵
پی‌وی‌سی	۸۳۰	۷۶۰	-۸.۴۳

# اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۴۸,۹۴۰,۰۰۰	۱۵۰,۱۸۰,۰۰۰	٪۰.۸۲
طلای ۱۸ عیار	۱۳,۴۰۶,۰۰۰	۱۳,۶۱۶,۰۰۰	٪۱.۶
نرخ دلار نیما	۲۷۲,۵۳۱	۲۷۳,۵۸۰	٪۰.۴

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۸/۰۹	دوشنبه	تغییرات سالیانه نرخ تورم اروپا- شاخص مدیران خرید تولید چین- نرخ تورم ماهیانه اروپا
۱۴۰۱/۰۸/۱۰	سه شنبه	شاخص مدیران خرید تولید آمریکا
۱۴۰۱/۰۸/۱۱	چهارشنبه	اعلام نرخ بهره فدرال رزرو- اعلام نرخ بیکاری آلمان
۱۴۰۱/۰۸/۱۲	پنج شنبه	شاخص مدیران خرید خدمات چین- اعلام نرخ بهره انگلیس-
۱۴۰۱/۰۸/۱۳	جمعه	شاخص قیمت تولید کننده اروپا- نرخ بیکاری آمریکا- نرخ بیکاری آمریکا

## پیش‌بینی بازار در هفته جاری

در خصوص پیش‌بینی بازار در هفته جاری، بازار با توجه ریزش‌های مداوم قیمت سهام و شاخص بورس ناشی از عوامل مختلف مانند وضعیت سیاسی مبهم کشور در خصوص تعاملات بین‌المللی، تنش‌های سیاسی ادامه‌دار داخلی، سیاست‌های پولی دولت و افزایش نرخ بهره بانکی ( بطور غیر رسمی)، عدم توجه و حمایت از بازار سرمایه از سوی تیم اقتصادی دولت با یک عدم اطمینان و ترس در در نتیجه هیجان فروش روبه‌روست. با توجه به ابلاغ ۱۰ بندی بسته حمایتی، شاید بازار در مجموع در این هفته ریزش چندانی نداشته باشد اما در مقابل رشدی نیز برای آن نمی‌توان متصور بود مگر اینکه حمایت مقطعی نبوده و ادامه‌دار باشد تا شاید با روندی رو به رشد در حجم معاملات و بازگشت نسبی اعتماد سرمایه‌گذاران، بازار به سمت جذب نقدینگی مناسب و رشد سوق داده شود.