

شرکت سرمایه گذاری سایه کستر سرمایه  
متعلق به بانک سرمایه



## گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته سی و یکم منتهی به

۲۹ مهر ماه ۱۴۰۱



# مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

## شرایط عرضه ۲۰۰ دستگاه شاسی بلند در بورس کالا اعلام شد :

طبق اطلاعیه عرضه بورس کالا، ۲۰۰ دستگاه لاماری ایما متعلق به شرکت آراین پارس موتور ، اول آبان در تابلو عرضه می شود. این خودروها با تحویل ۷۰ روزه، ۱۰ دی با قیمت پایه ۹۸۱ میلیون تومان به دست مشتریان می رسد. هر شخص حقیقی صرفا مجاز به ثبت سفارش یک دستگاه خودرو و صدور سند و شماره گذاری خودرو فقط به اسم شخص خریدار خواهد بود.



## محرك غير منتظره گرانی فولاد:

عرضه اعتباری شمش فولاد در رینگ صنعتی بورس کالای ایران به رقابت قیمتی در رینگ فولاد منجر شده که این امر زمینه گرانی شمش و محصولات فولادی در بازار داخل را فراهم می کند. در شرایطی که بازار صادراتی فولادسازان با فشار جهانی کاهش تقاضا مواجه است، میانگین دلاری نرخ فروش شمش فولاد در بازار فیزیکی بورس کالای ایران ظرف هفته پایانی مهرماه ۵/۵ درصد بالاتر از نرخ فروش صادراتی فوب خلیج فارس قرار گرفت.



## تصمیم اروپا به تحریم ۱۵ مقام و نهاد ایرانی قطعی شد :

جلسه شورای وزیران خارجه اتحادیه اروپا با محور تحریم های جدید ۱۵ نهاد و مقام ایرانی و چند موضوع دیگر برگزار و نام این گروه جدید به فهرست سیاه افزوده شد.



## انصراف آمریکا از ادامه مذاکرات با ایران:

جان کربی هماهنگ کننده ارتباطات راهبردی شورای امنیت ملی آمریکا اعلام کرد: واشنگتن تلاش برای مذاکره با ایران را به دلیل عرضه پهپاد به روسیه کنار گذاشته و فعلا " به جای تمرکز بر روی دیپلماسی ، خواهان پاسخگو کردن ایران به شیوه برخورد با معترضان است. بنابراین بازگشت به برجام بسیار دور به نظر می رسد.



# مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

## رشد رونق اوراق مشتقه در مهرماه:

بازار مشتقه در آخرین هفته از مهر توانست مانند هفته قبل، آمارهای معاملاتی نسبتاً خوبی را ثبت کند. بررسی آمارها نشان می‌دهد که میانگین روزانه سه متغیر اصلی تعیین‌کننده آمارهای معاملاتی مانند ارزش معاملات، حجم معاملات و توان مالی افراد نسبت به ماه‌های گذشته در حال افزایش بوده که بیانگر افزایش رونق در این بازار است.



## پیش بینی صندوق بین المللی پول از تولید ناخالص داخلی :

صندوق بین المللی پول در جدیدترین گزارش میزان تولید ناخالص داخلی ۱۹۲ کشور جهان از جمله ایران در سال ۲۰۲۲ را پیش بینی کرد. براساس این گزارش، انتظار می‌رود تولید ناخالص داخلی ایران بر اساس شاخص قدرت خرید درسال جاری میلادی به حدود ۱.۶ هزار میلیارد دلار برسد که ۱۵۰ میلیارد دلار نسبت به سال گذشته افزایش خواهد یافت و به عنوان بیست و یکمین قدرت بزرگ اقتصادی جهان شناخته شود.



## ۵۴ هزار خودرو لوکس برای دریافت مالیات ۵۰۸ میلیارد تومانی شناسایی شدند:

سازمان امور مالیاتی اعلام کرد: در اجرای تکلیف مقرر در بند ف قانون بودجه سال ۱۴۰۱ پس از ارزیابی آمار و اطلاعات دریافتی از نیروی انتظامی، ۵۴ هزار خودرو گران قیمت و لوکس با ارزش بیش از یک میلیارد تومان شناسایی شده اند که میزان مالیات متعلق به این گروه بالغ بر ۵۰۸ میلیارد تومان است.



## شتران برای خرید بلوک ۱۲ درصدی پتروشیمی خلیج فارس پا پیش گذاشت :

طبق برنامه اعلامی، قرار است ۷ آبان ۵۴ میلیارد و ۷۴۰ میلیون سهم "فارس" به قیمت پایه هر سهم ۱۳۹۷ تومان به صورت ۳۰ درصد نقد و باقی اقساط روانه میز فروش بورس شود. ارزش این بلوک با قیمت پایه اعلامی، افزون بر ۸۲ هزار میلیارد تومان است.



## مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

### زمان راه اندازی قراردادهای اولین صندوق طلا در بورس کالا:

مدیر بازارهای مشتقه و صندوق های کالایی بورس کالا، موضوع راه اندازی قراردادهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس برای تحویل در فروردین سال آینده را به کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه و صندوق های کالایی ابلاغ کرد. بر اساس این گزارش، قراردادهای اولین صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس برای تحویل در فروردین سال ۱۴۰۲ از شنبه ۳۰ مهر راه اندازی شده و تا ۳۰ فروردین سال آینده قابل معامله خواهد بود.



### شورای نگهبان با کاهش حقوق گمرکی مواد اولیه از ۴ به یک درصد موافقت نمود:

هادی طحان نظیف سخنگوی شورای نگهبان درباره لایحه کاهش حقوق گمرکی گفت: این لایحه درباره کاهش نرخ حقوق گمرکی مواد اولیه، واسطه‌ای، اجزاء و قطعات و ماشین‌آلات و تجهیزات به یک درصد بود که شورای نگهبان آن را مغایر با شرع و قانون اساسی نشناخت.



### اتحادیه اروپا متانول و پلی اتیلن را هم به فهرست تحریم های روسیه افزود :

کمیسیون اروپا هشتمین بخش تحریم‌ها بر صادرات روسیه به این منطقه را با تمرکز بر محصولات نهایی فولاد، وسایل نقلیه، پلاستیک ها، ماشین آلات و لوازم و برخی محصولات شیمیایی را اعلام کرد. افزودن متانول به این فهرست اتفاق قابل توجهی بود. زیرا روسیه با صادرات سالانه ۲ میلیون تن از این محصول عمدتاً به اتحادیه اروپا، یکی از عرضه‌کنندگان اصلی آن است.



### پذیره نویسی اولین صندوق املاک و مستغلات با موفقیت انجام شد:

صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات ارزش مسکن پس از دریافت مجوزهای لازم و ثبت نزد مرجع ثبت شرکت‌ها، در تاریخ ۲۶ مهرماه ۱۴۰۱ در فرابورس ایران پذیرهنویسی شد که با وجود مهلت آن تا دهم آبان‌ماه، کل واحدهای عرضه شده آن به ارزش ۳۰۰ میلیارد ریال در نخستین روز از سوی متقاضیان خریداری شد.



# بورس در هفته ای که گذشت

## شرح وقایع

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با **۹,۶۲۴** واحد کاهش نسبت به هفته قبل، بر ارتفاع ۱ میلیون و ۳۱۰ هزار واحد قرار گرفت و کاهش **۰.۷۲-** درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن با **۱,۶۷۶-** واحد کاهش در ارتفاع ۳۷۸,۵۹۴ واحدی قرار گرفته و افت **۰.۴۴-** درصدی را ثبت نمود. بازار همچنان کم رونق و ارزش معاملات بسیار پایین می باشد. افزایش خروج پول حقیقی ها از بازار سرمایه و همچنین از صندوق های درآمد ثابت نشان دهنده حرکت نقدینگی به سمت بازار پول با چانه زنی نرخ بهره بوده که بازار سرمایه را دچار چالش نموده است. از طرفی هرچند تنش های داخلی رو به کاهش می باشد اما سایه تحریم های جدید اتحادیه اروپا و از طرفی اظهار نماینده آمریکا مینی بر بن بست برجام ریسک سیاسی بازار را بالاتر برده است.

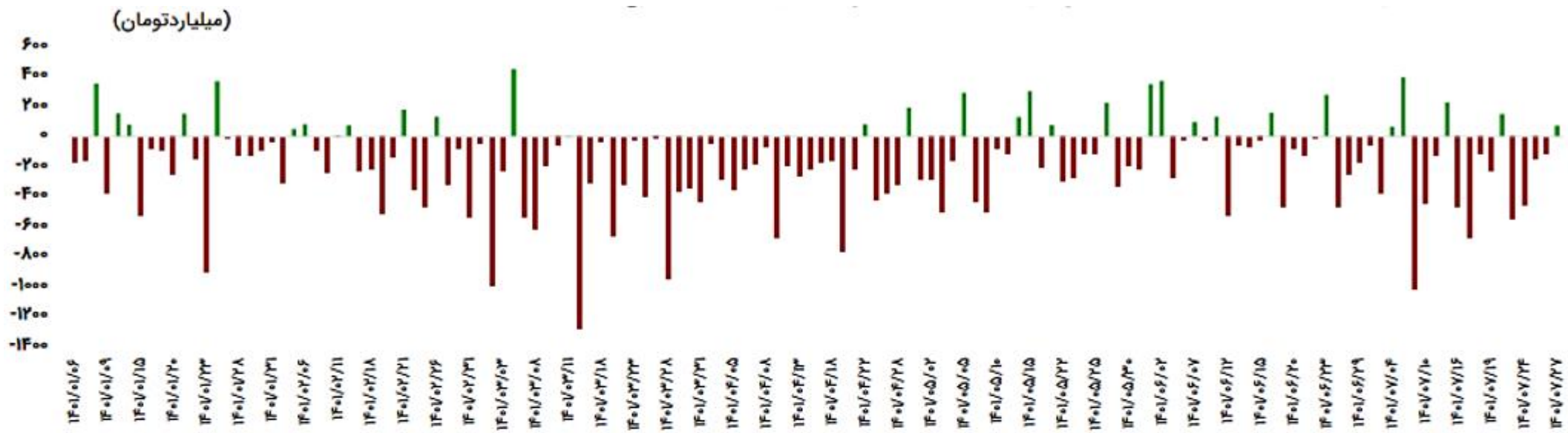
## تغییرات هفتگی شاخص ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۳۱۹,۷۸۹	۱,۳۱۰,۱۶۵	-۹,۶۲۴	-۰.۷۲٪
شاخص هم وزن (واحد)	۳۸۰,۲۷۰	۳۷۸,۵۹۴	-۱,۶۷۶	-۰.۴۴٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۱۷,۷۵۱		-۱,۲۳۶	-۶.۵٪



# ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

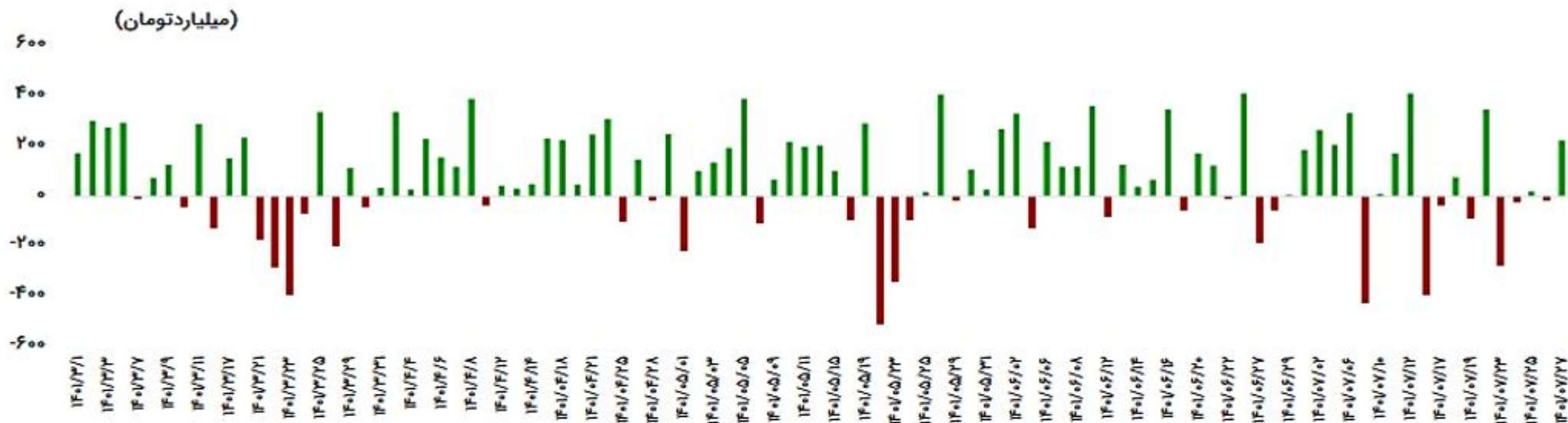
خالص ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۲۷ مهر ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد:



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۰۷/۲۳	-۵۴۹
۱۴۰۱/۰۷/۲۴	-۴۵۳
۱۴۰۱/۰۷/۲۵	-۱۵۱
۱۴۰۱/۰۷/۲۶	-۱۱۰
۱۴۰۱/۰۷/۲۷	۷۳
جمع	-۱,۱۹۰

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۰۷/۲۷	۱۳۶	-۲۴,۷۶۹
ماهانه (۱۴۰۱/۰۶/۲۷ تا ۱۴۰۱/۰۷/۲۷)	۲۱	-۴,۷۳۰
هفتگی (۱۴۰۱/۰۷/۲۳ تا ۱۴۰۱/۰۷/۲۷)	۵	-۱,۱۹۰

# ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت

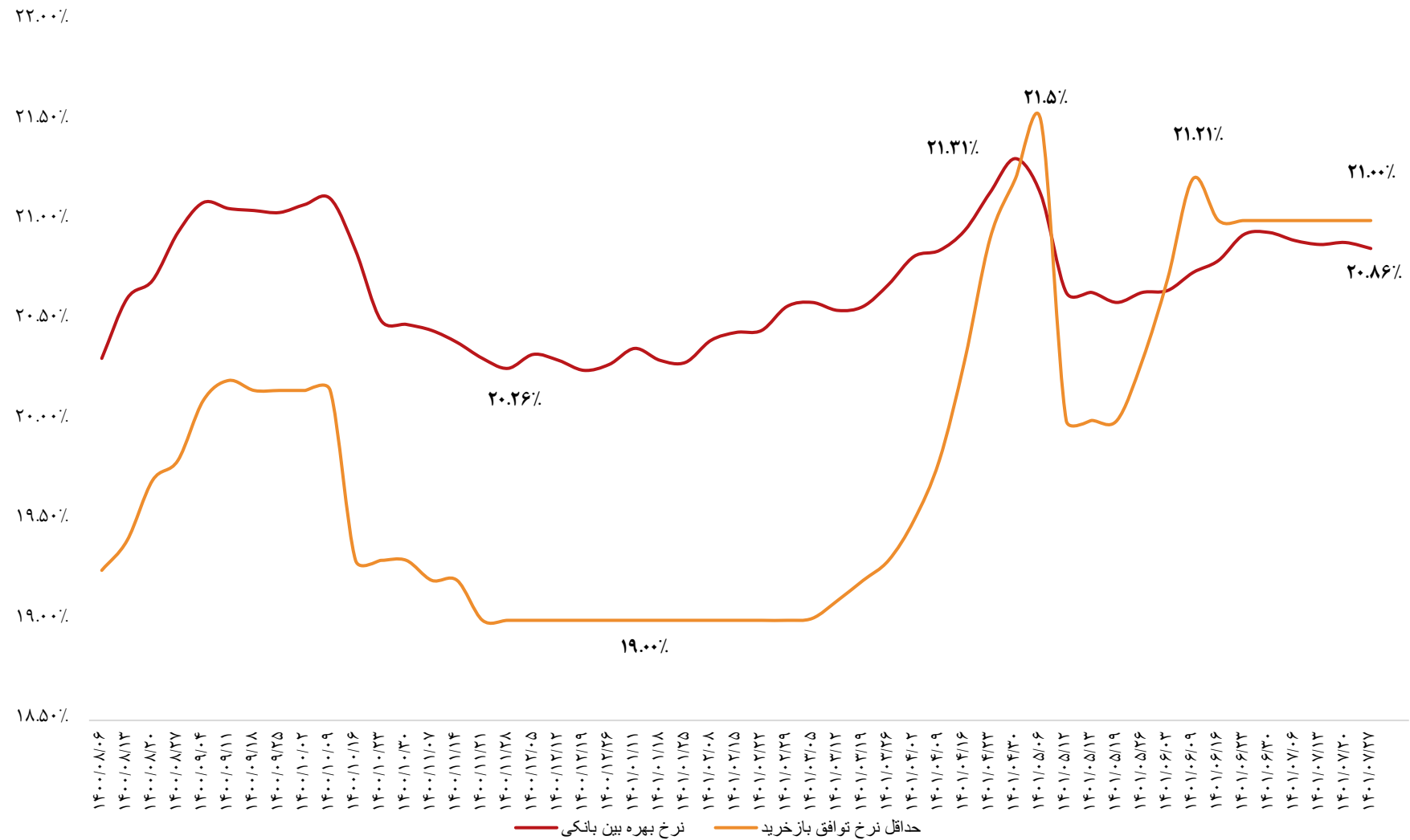


ورود پول (میلیارد تومان)	تاریخ
-274.40	1401/07/23
-23.40	1401/07/24
18.7	1401/07/25
-13.7	1401/07/26
222.2	1401/07/27
-70.6	جمع

ورود پول (میلیارد تومان)	تعداد روز معاملاتی	بازه زمانی
5,928.85	136	ابتدای سال 1401 تا 1401/07/27
749.4	21	ماهیهانه (1401/07/27 تا 1401/06/27)
-70.6	5	هفتگی (1401/07/27 تا 1401/07/23)

# روند نرخ بهره بین بانکی

نمودار ذیل، روند نرخ بهره بین بانکی را نمایش می‌دهد. در هفته چهارم مهر ماه ۱۴۰۱ با کاهش جزئی به ۲۰.۸۶ درصد رسید؛





## ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	مرجان کار	کمرجان	۲۹.۸۲
2	س.توس گستر	وتوس	۲۵.۵۵
3	مبین وان کیش	اوان	۲۳.۰۱
4	دشت مرغاب	غدشت	۱۹.۹۱
5	ورزیران	کورز	۱۵.۸۶

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	لیزینگ ایران و شرق	ولشرق	-۱۷.۹۱
۲	پلاستیک شاهین	پشاهن	-۱۴.۰۰
۳	صنعت روی زنگان	زنگان	-۱۳.۶۸
۴	سایپا دیزل	خکاوه	-۱۱.۳۸
۵	ایران خودرو دیزل	خاور	-۱۱.۰۸

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	پیمانکاری صنعتی	۷.۴۶
۲	سایر واسطه‌گری های مالی	۴.۶۲
۳	چاپ	۴.۶
۴	شیمیایی	۱.۴۶
۵	فرآورده های نفتی	۱.۲۸

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	استخراج زغال سنگ	-۶.۳۸
۲	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	-۵.۲۹
۳	محصولات چوبی	-۵.۰۳
۴	استخراج سایر معادن	-۴.۱۳
۵	خودرو و قطعات	-۳.۶۳

کم بازده‌ترین صنایع

## ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۷,۲۶۰	۳.۶
فزر	۱۸,۷۹۰	۳.۸
کاسپین	۱۰,۵۵۰	۳.۹
شیراز	۶۹,۱۶۰	۳.۹
سصوفی	۱۷,۶۱۰	۳.۹

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۳,۲۷۲	٪۲۱.۶
وملی	۱۰۳,۵۶۰	٪۲۵.۶
ثمسکن	۲,۵۹۵	٪۲۷.۵
وسپهر	۶,۸۵۰	٪۲۹
پترول	۱,۸۴۳	٪۳۱.۱

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۱,۸۹۶
۲	فلزات اساسی	۱,۲۸۸
۳	چندرشته ای صنعتی	۱,۲۸۳
۴	فرآورده های نفتی	۹۱۶
۵	شیمیایی	۸۶۵

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


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

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


## تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	قیمت ابتدای هفته (دلار)	قیمت انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
پلاتین	۸۹۹	۹۳۳	۳.۷۸
نفت برنت	۹۱.۸۱	۹۳.۵۱	۱.۸۵
مس	۷,۵۱۴	۷,۶۴۶	۱.۷۶
روی	۲,۹۱۶	۲,۹۴۸	۱.۱۰
اونس جهانی طلا	۱,۶۴۳	۱,۶۵۴	۰.۶۷
اوره (خلیج فارس)	۶۳۸	۶۳۰	-۱.۲۵
متانول (پلتس)	۳۲۵	۳۲۰	-۱.۵۴
بیلت	۵۳۰	۵۲۰	-۱.۸۹
سرب	۲,۰۳۰	۱,۹۸۴	-۲.۲۷
آلومینیوم	۲,۲۹۵	۲,۲۲۵	-۳.۰۵

# اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۱۵۰,۴۲۰,۰۰۰	۱۴۸,۹۴۰,۰۰۰	-۰.۹۸٪
طلای ۱۸ عیار	۱۳,۶۱۶,۰۰۰	۱۳,۴۰۶,۰۰۰	-۱.۵۴٪
نرخ دلار نیما	۲۷۲,۶۳۰	۲۷۲,۵۳۱	-۰.۰۳٪

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۰۸/۰۲	دوشنبه	شاخص مدیران خرید ژاپن-نرخ رشد ناخالص داخلی چین- شاخص بهای مسکن چین
۱۴۰۱/۰۸/۰۳	سه شنبه	شاخص بهای مسکن آمریکا-شاخص شرایط تجاری آلمان
۱۴۰۱/۰۸/۰۴	چهارشنبه	اعلام نرخ بهره بانک کانادا-گزارش سالیانه عرضه پول اتحادیه اروپا- نرخ تورم سالیانه استرالیا
۱۴۰۱/۰۸/۰۵	پنج شنبه	تغییرات سالانه شاخص قیمت مصرف کننده ژاپن-نرخ بیکاری ژاپن-
۱۴۰۱/۰۸/۰۶	جمعه	شاخص قیمت تولید کننده فرانسه-انتظارات تورم مصرف کننده اتحادیه اروپا

## پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری، بازار این هفته نظاره گر اخباری از جنس متفاوت است. از یک سو انتشار گزارش های مطلوب میان دوره شرکتهای بورسی خصوصا پالایشی ها و همچنین کاهش در تنش های سیاسی داخلی و روند رشدی نرخ دلار نیما می تواند بازار را در مسیر افزایش حجم معاملات سوق دهد ولی از سوی دیگر تحریم اتحادیه اروپا و همچنین اعلام بن بست مذاکرات برجام از سوی نماینده آمریکا می تواند ریسک سیاسی بازار سرمایه را افزایش دهد. بازار نه تمایلی چندانی به افت دارد و نه توان و نقدینگی لازم برای رشد، به نظر این هفته نیز بازار سهام معاملات نوسانی را تجربه نماید.