

شرکت سرمایه گذاری سایه کستر سرمایه
متعلق به بانک سرمایه



گزارش هفتگی بازار سرمایه

هفته چهل و سوم منتهی به بیست و سوم

دی ماه ۱۴۰۱



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

میزبانی بورس کالا از عرضه ۵۰۰ هزار سکه ربع با سهمیه حداکثر پنج قطعه:

بانک مرکزی اعلام کرد: ۵۰۰ هزار ربع سکه از شنبه هفته جاری ۲۴ دی به مدت سه روز کاری در قالب فروش سکه در بورس کالا عرضه خواهد شد و خریداران می‌توانند پنج روز کاری بعد از خرید به خزانه بانک‌های عامل مراجعه کرده و با ارائه اسناد مربوط به بورس به صورت فیزیکی، معادل سکه‌های خریداری‌شده را تحویل بگیرند. تمامی اشخاص حقیقی بیش از ۱۸ سال دارای کد ملی می‌توانند حداقل یک قطعه و حداکثر پنج قطعه سکه ربع را خریداری کنند. متقاضیان در ساز و کار حراج ناپیوسته حضور یافته و قیمت سکه کشف می‌شود.



سه حمایت دولت برای حمایت از بورس در لایحه بودجه ۱۴۰۲:

دولت در لایحه بودجه سال آینده، سه مورد حمایتی از بورس را لحاظ کرد که شامل تزریق تا ۱۵ هزار میلیارد تومان از سهام دولت به صندوق تثبیت، مالیات بر درآمد از سود تقسیم‌نشده شرکت‌های بورسی و فرابورسی در صورت انتقال به حساب سرمایه، صفر درصد خواهد بود. همچنین تمام کالاهایی که در قالب گواهی سپرده کالایی در بورس معامله می‌شود تا قبل از تبدیل به کالای فیزیکی، مشمول مالیات بر ارزش افزوده نخواهند بود و تنها این مالیات یک بار و در زمان تبدیل به کالا دریافت می‌شود.



شرکت‌های سبذگردان مجاز به دریافت اعتبار از کارگزاران شدند:

مرکز تدوین و تطبیق قوانین و مقررات بازار سرمایه اعلام کرد: شرکت‌های سبذگردان طبق مصوبه جدید هیات مدیره سازمان بورس از این پس طبق ضوابط اختصاصی یا مشخص، قادر به دریافت اعتبار برای سبدهای تحت مدیریت بوده و می‌توانند در صورت دریافت اجازه از سرمایه‌گذار سبذ اختصاصی، اقدام به دریافت اعتبار کنند.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

عرضه ۱۰ هزار دستگاه دنا پلاس یکشنبه مورخ ۲۵ دی ماه :

یکشنبه هفته جاری ۱۰ هزار دستگاه دنا پلاس دستی متعلق به ایران خودرو با موعد تحویل ۲۷ اسفند عرضه می‌شود. مهلت ثبت سفارش ساعت ۱۷ شنبه ۲۴ دی ماه، قیمت پایه ۱۸۹.۵ میلیون تومان و میزان پیش دریافت خرید به میزان ۱۰۰ درصد تعیین شده است.



فروژ سه شنبه ۲۷ دی عرضه اولیه خواهد شد:

عرضه اولیه سهام شرکت صنایع فرو آلیاژ ایران در قالب ۱۱۰ میلیون سهم معادل ۱۰ درصد از کل سهام شرکت تحت نماد معاملاتی فروژ انجام خواهد شد. دوره سفارش گیری و عرضه در مرحله اول و دوم در روز سه شنبه ۲۷ دی ماه انجام خواهد شد. حداکثر تعداد سهام قابل خریداری توسط هر کد معاملاتی در مرحله نخست ۲ میلیون و ۷۵۰ هزار سهم بوده و حداکثر تعداد سهام قابل خریداری توسط هر شخص حقیقی و حقوقی در مرحله دوم، ۱۱۰ سهم است. قیمت ارزش گذاری شده برای هر سهم ۳۹ هزار و ۶۸۸ ریال است.



بانک شهر مجوز تأسیس صندوق املاک و مستغلات گرفت

بانک شهر پیرو اقدامات و برنامه‌ها از دریافت مجوز تأسیس صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات از بانک مرکزی خبر داد بر این اساس، "شهر" اعلام کرد: پیرو برنامه‌ها و اقدامات جهت اجرای مفاد ماده ۱۶ و ۱۷ قانون رفع موانع تولید رقابت پذیر و ارتقای نظام مالی و کاهش زیان انباشته بانک به منظور خروج از شمول ماده ۱۴۱ قانون تجارت، مجوز تأسیس صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات توسط بانک شهر طی نامه ۱۴ دی بانک مرکزی اخذ شد.



مهمترین رویدادهای سیاسی و اقتصادی

۵.۴ هزار میلیارد تومان سود سنواتی به حساب ۳۰.۶ میلیون سهامدار واریز شد:

به گزارش پایگاه خبری بورس پرس، تازه‌ترین آمارها نشان می‌دهد از ابتدای سال جاری تا پایان نیمه اول دی ماه از طریق سامانه سجام، بالغ بر ۵.۴ هزار میلیارد تومان سود سنواتی از سوی ۲۷۲ شرکت به ۳۰.۶ میلیون سهامدار واریز شد.



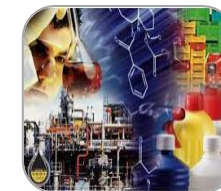
۴۰ هزار خودرو خارجی ثبت سفارش و آماده عرضه در بورس کالا شدند:

سخنگوی وزارت صنعت با بیان اینکه تمام مجوزهای فروش و شماره گذاری خودروهای خارجی انجام شده و هیچ مانعی برای واردات، ترخیص، شماره گذاری و فروش خودرو وجود ندارد، گفت: حدود ۴۰ هزار خودرو وارداتی ثبت سفارش شدند و اولین فروش خودروهای خارجی همین ماه انجام می‌شود.



قیمت پایه جدید محصولات پتروشیمی با کاهش به دلار ۲۸۳,۷۱۸ ریالی:

قیمت پایه محصولات پلیمری و شیمیایی برای معامله در بورس کالا از سوی دفتر توسعه صنایع تکمیلی پتروشیمی به نرخ دلار ۲۸۳,۷۱۸ ریالی اعلام شد.



گرانی هیچ فرآورده نفتی و حامل‌های انرژی در لایحه بودجه ۱۴۰۲ مطرح نیست.

مظفری با اشاره به جزئیات لایحه بودجه ۱۴۰۲ به تسنیم گفت: در لایحه بودجه سال آینده هیچ افزایش قیمتی برای فرآورده‌های نفتی و گازی و حامل‌های انرژی دیده نشده و گفته‌هایی مبنی بر افزایش قیمت بنزین، گازوئیل و گاز در سال آینده اصلاً در دستورکار دولت و مجلس نیست.



بورس در هفته ای که گذشت

شرح وقایع

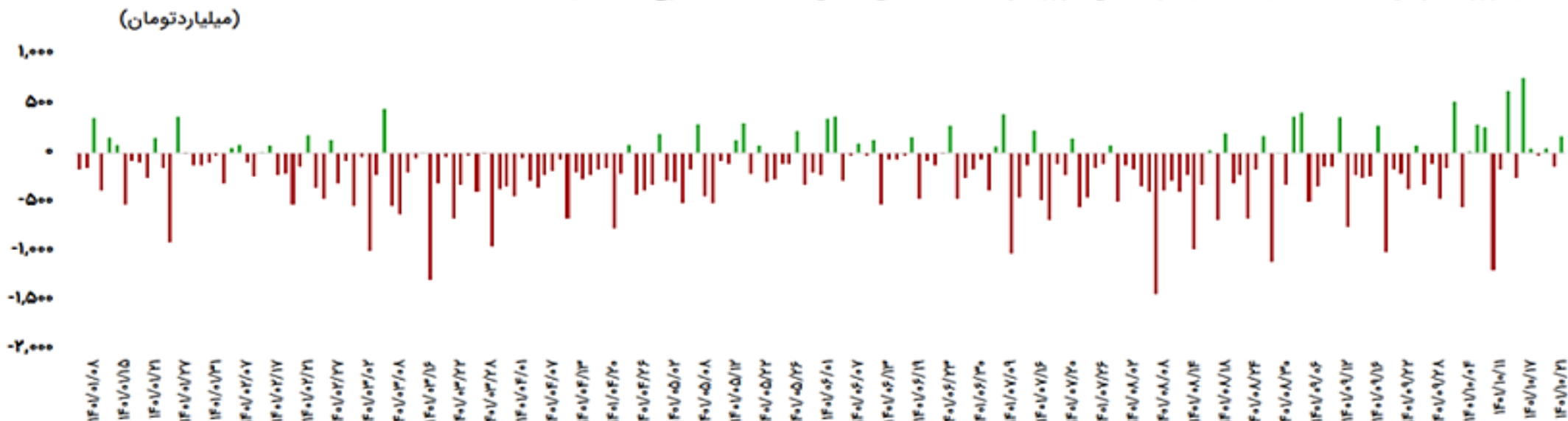
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته گذشته با افزایش ۷۲,۹۶۸ واحد نسبت به هفته قبل، در ارتفاع ۱ میلیون و ۶۵۲ هزار واحد قرار گرفت و افزایش ۴.۶۲ درصدی را ثبت کرد. شاخص کل هم‌وزن هم با افزایش ۳۱,۰۰۶ واحدی در ارتفاع ۵۰۴,۲۰۵ واحدی قرار گرفته و افزایش ۶.۵۵ درصدی را ثبت نمود. انتشار گزارشات میان دوره ای شرکت ها در کنار افزایش قیمت کامودیتی ها در بازار جهانی از عوامل اصلی رشد بازار در هفته قبل بودند. البته تثبیت قیمت دلار بالاتر از ۴۰ هزار تومان و عدم احتمال کاهش آن نیز بر تقویت انگیزه خریداران تاثیرگذار بود.

تغییرات هفتگی شاخص ها

شرح	مقدار ابتدای هفته	مقدار انتهای هفته	تغییرات واحد	درصد تغییرات
شاخص کل (واحد)	۱,۵۷۹,۱۱۹	۱,۶۵۲,۰۸۷	۷۲,۹۶۸	۴.۶۲٪
شاخص هم وزن (واحد)	۴۷۳,۱۹۹	۵۰۴,۲۰۵	۳۱,۰۰۶	۶.۵۵٪
ارزش معاملات خرد میلیارد تومان	۵۰,۷۸۰		۸۷۰۲	۲۰.۶۸٪

ورود و خروج جریان نقد اشخاص حقیقی در بازار سهام

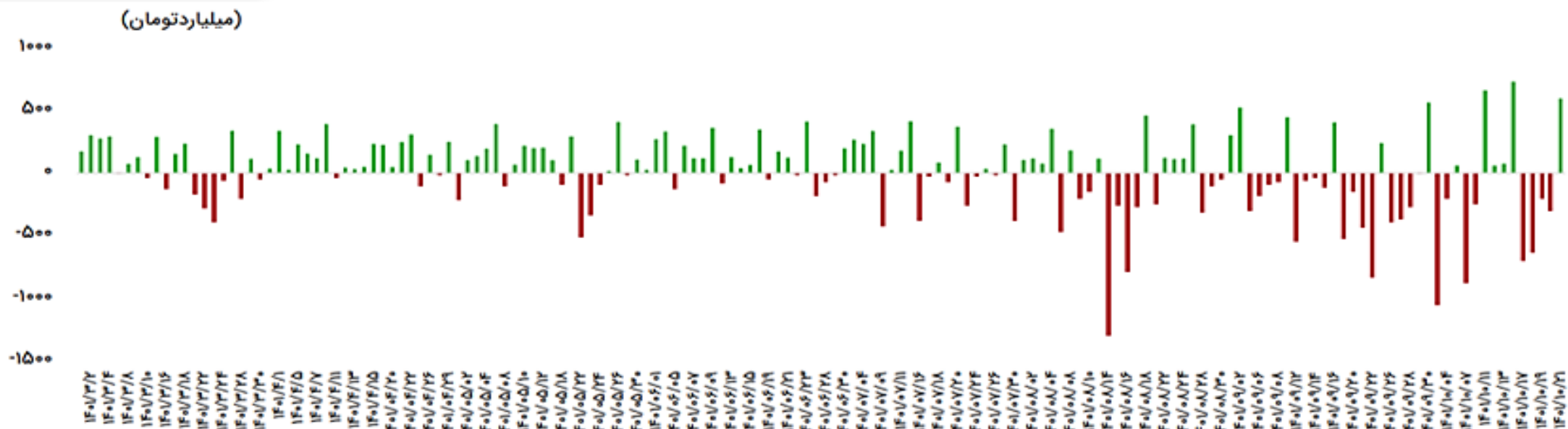
خالص ورود جریان نقد اشخاص حقیقی از ابتدای فروردین ماه تا انتهای ۲۱ دی ماه ۱۴۰۱ به شرح ذیل می باشد :



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۱۰/۱۷	۴۳
۱۴۰۱/۱۰/۱۸	-۲۴
۱۴۰۱/۱۰/۱۹	۴۸
۱۴۰۱/۱۰/۲۰	-۱۴۰
۱۴۰۱/۱۰/۲۱	۱۶۸
جمع	۹۵

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۱۰/۲۱	۱۹۵	-۳۶,۶۸۳
ماه‌بانه (۱۴۰۱/۰۹/۲۱ تا ۱۴۰۱/۱۰/۲۱)	۲۲	-۱,۱۰۹
هفتگی (۱۴۰۱/۱۰/۱۷ تا ۱۴۰۱/۱۰/۲۱)	۵	۹۵

ورود و خروج جریان نقد صندوق های با درآمد ثابت



تاریخ	ورود پول (میلیارد تومان)
۱۴۰۱/۱۰/۱۷	-۷۰۳.۶
۱۴۰۱/۱۰/۱۸	-۶۳۰.۵
۱۴۰۱/۱۰/۱۹	-۲۰۷.۹
۱۴۰۱/۱۰/۲۰	-۳۰۱.۶
۱۴۰۱/۱۰/۲۱	۵۹۳.۷
جمع	-۱,۲۴۹.۹

بازه زمانی	تعداد روز معاملاتی	ورود پول (میلیارد تومان)
ابتدای سال ۱۴۰۱ تا ۱۴۰۱/۱۰/۲۱	۱۹۵	-۳۳۲.۸
ماهانه (۱۴۰۱/۱۰/۲۱ تا ۱۴۰۱/۰۹/۲۱)	۲۲	-۳,۵۶۴.۹
هفتگی (۱۴۰۱/۱۰/۲۱ تا ۱۴۰۱/۱۰/۱۷)	۵	-۱,۲۴۹.۹

ترین های بازار سهام

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
1	شهید قندی	بکام	۳۴.۳
2	شیرپ. پگاه گیلان	غگیلا	۳۳.۸
3	آ.س.پ	آ س پ	۳۰.۲
4	سرمایه گذاری مسکن الوند	ثالوند	۲۸.۲
5	آذراب	فاذر	۲۷.۲

پر بازده‌ترین نمادها

رتبه	شرکت	نماد	بازدهی (درصد)
۱	دنا آفرین فدک	گدنا	-۴۲.۶
۲	بیمه دانا	دانا	-۹.۳
۳	رادیاتور ایران	ختور	-۸.۹
۴	ریل گردش ایرانیان	حگردش	-۸.۸
۵	پتروشیمی پردیس	شپدیس	-۸.۱

کم بازده‌ترین نمادها

رتبه	صنعت	درصد بازدهی
۱	استخراج معدن	۱۷.۹
۲	محصولات کامپیوتری الکترونیکی	۱۳.۲
۳	محصولات کاغذی	۱۲.۴
۴	اطلاعات و ارتباطات	۱۱.۷
۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱۰.۶

پر بازده‌ترین صنایع

رتبه	صنعت	درصد بازدهی با احتساب آورده
۱	محصولات چوبی	-۰.۷
۲	حمل و نقل انبارداری	۴.۹
۳	خودرو و قطعات	۰.۶
۴	کاشی و سرامیک	۰.۹
۵	شیمیایی	۱.۱۹

کم بازده‌ترین صنایع

ترین های بازار سهام

نماد	قیمت (ریال)	P/E
شبندر	۹,۴۹۰	۳.۵
شکبیر	۸۴,۵۰۰	۳.۸
فسبزوا	۲۳,۴۷۰	۳.۸
شپنا	۷,۶۵۰	۳.۹
شاوان	۲۱,۱۰۰	۴

نمادهای با کمترین P/E

نماد	قیمت (ریال)	P/NAV
وخارزم	۴,۳۰۵	%۲۵.۹
وسپهر	۷,۲۹۰	%۲۹.۶
وملی	۱۴۰,۸۸۰	%۳۴.۵
تمسکن	۴,۰۸۳	%۳۷.۲
پترول	۲,۳۵۴	%۳.۷۵

نمادهای با کمترین P/NAV

رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	خودرو و قطعات	۹,۰۲۵
۲	فلزات اساسی	۷,۷۴۲
۳	بانکها و موسسات اعتباری	۴,۸۳۶
۴	شیمیایی	۴,۲۹۳
۵	فرآورده های نفتی	۲,۷۳۷

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


رتبه	صنعت	ارزش معاملات (میلیارد تومان)
۱	سایر حمل و نقل	۱
۲	چاپ	۵.۹
۳	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل	۱۱.۱
۴	فعالیت های فرهنگی و ورزشی	۱۶.۱
۵	سایر واسطه گری های مالی	۱۶.۹

کمترین ارزش معاملات به تفکیک صنایع


تغییرات قیمتی کامودیتی‌ها در بازار جهانی

شرح	ابتدای هفته (دلار)	انتهای هفته (دلار)	درصد تغییرات
روی	۳,۰۳۹	۳,۳۱۷	۹.۱۵
نفت برنت	۷۸	۸۵	۸.۹۷
مس	۸,۶۰۶	۹,۲۳۰	۷.۲۵
اونس جهانی طلا	۱,۸۶۸	۱,۹۱۹	۲.۷۳
بیلت (فوب ایران)	۴۷۸	۴۹۰	۲.۵۱
سرب	۲,۲۷۲	۲,۲۶۸	-۰.۱۸
پلاتین	۱۱۰۶	۱۰۷۵	-۲.۸۰

اهم رویدادهای هفته جاری

تغییرات بازارهای موازی 

شرح	قیمت ابتدای هفته	قیمت انتهای هفته	درصد تغییرات
سکه تمام بهار	۲۰۳,۱۸۰,۰۰۰	۲۱۲,۵۴۰,۰۰۰	٪۴.۶۰
طلای ۱۸ عیار	۱۸,۰۴۹,۰۰۰	۱۹,۰۸۶,۰۰۰	٪۵.۷۴
نرخ دلار نیما	۲۸۵,۰۰۰	۲۸۵,۰۰۰	۰

تقویم اقتصادی 

تاریخ	روز	رویداد
۱۴۰۱/۱۰/۲۶	دوشنبه	شاخص بهای مسکن چین - شاخص قیمت تولید کننده ژاپن
۱۴۰۱/۱۰/۲۷	سه شنبه	نرخ بیکاری چین - نرخ تورم آلمان - نرخ بیکاری انگلستان
۱۴۰۱/۱۰/۲۸	چهارشنبه	نرخ تورم اتحادیه اروپا - شاخص خرید آمریکا - شاخص قیمت تولید کننده آمریکا
۱۴۰۱/۱۰/۲۹	پنج شنبه	نرخ بیکاری استرالیا - پروانه های ساختمانی آمریکا - نرخ بهره ترکیه
۱۴۰۱/۱۰/۳۰	جمعه	شاخص قیمت تولید کننده آلمان - تعداد دکل ها و ایستگاه های نفتی آمریکا

پیش بینی بازار در هفته جاری

درخصوص پیش بینی بازار در هفته جاری؛ بازار در حالی هفته پیش رو را آغاز می کند که با خبرهای مثبت و منفی درگیر خواهد بود. بودجه و افزایش نرخ پتروشیمی ها و نرخ سوخت صنایع بزرگترین ریسک بازار می باشد از طرفی افزایش قیمت جهانی نفت و کامودیتی ها می تواند اثر مثبت بر بازار داشته باشد. همچنین خبرهای تایید نشده ای از توقف عرضه خودرو در بورس کالا به گوش می رسد که با توجه به سیاست های وزارت صمت نمی تواند چندان قابل اتکا و موثر باشد. به نظر هفته آینده بازار سرمایه معاملات متعادلی را دنبال خواهد کرد.