

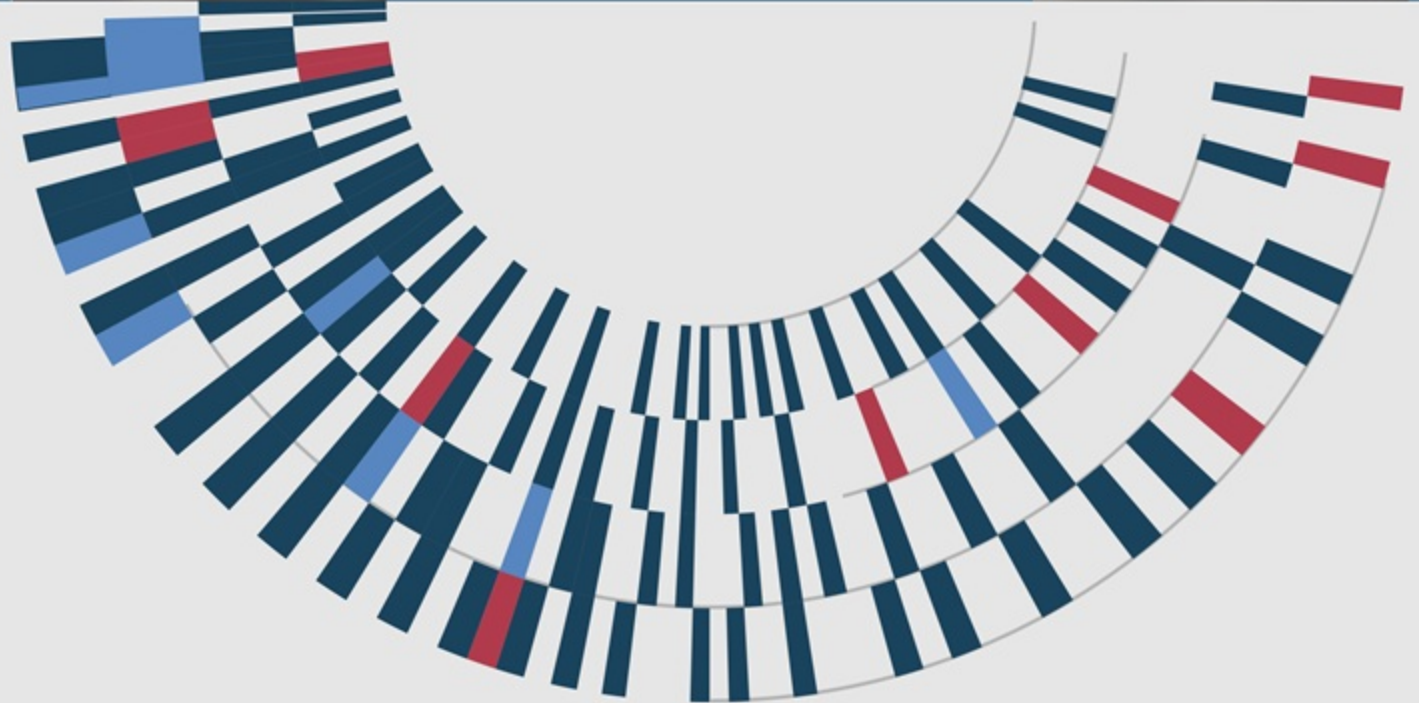
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۶ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۱۳

 CHARISMA





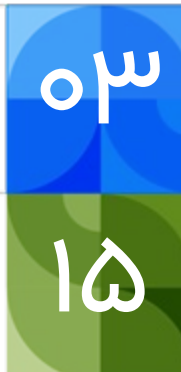
معرفی گزارش:

گزارش کاربزماتیک بازار سرمایه توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاربزم با همکاری شرکت سرمایه‌گذاری کاربزم تهیه شده است. هدف از این گزارش بررسی تحولات بازار سرمایه ایران و متغیرهای موثر بر آن می‌باشد که علاوه بر آن بخش‌های تحلیل سهام، برآورد سود و تحلیل تکنیکال در گزارش پیش رو نیز منظور گردیده است. این گزارش هر هفته در منابع رسمی گروه مالی کاربزم منتشر شده و علاقه‌مندان می‌توانند از آن استفاده نمایند.

سلب مسئولیت:

محتوای این گزارش با رعایت بی‌طرفی، استقلال و دقت و بر اساس نظرات کارشناسان این مجموعه تدارک دیده شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاربزم هیچ گونه تضمینی در مورد نتایج سرمایه‌گذاری بر مبنای این گزارش را ارائه نمی‌دهد. با وجود گردآوری بخش‌های مختلف، این گزارش به تنهایی نمی‌تواند تمامی ملاحظات لازم برای تصمیم‌گیری را فراهم نماید و صرف استفاده از این گزارش نباید مبنای خرید یا فروش هرگونه دارایی قرار گیرد. مدیریت سرمایه هر شخص باید بر اساس سطح ریسک‌پذیری، اهداف مالی، محدودیت‌ها، افق زمانی و سایر ویژگی‌های فردی صورت گیرد و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاربزم در قبال معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش انجام گیرد، مسئولیتی نمی‌پذیرد. گزارش پیش رو بر مبنای اطلاعات و داده‌های موجود در منابع متعددی تهیه شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاربزم در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

کلیه حقوق مادی و معنوی این گزارش متعلق به گروه مالی کاربزم می‌باشد.



کامودیتی

- ۵۴ فلزات آهنی و غیرآهنی
- ۵۵ معادن و محصولات کشاورزی
- ۵۶ پتروشیمی
- ۵۷ انرژی و سایر محصولات

بازار سهام

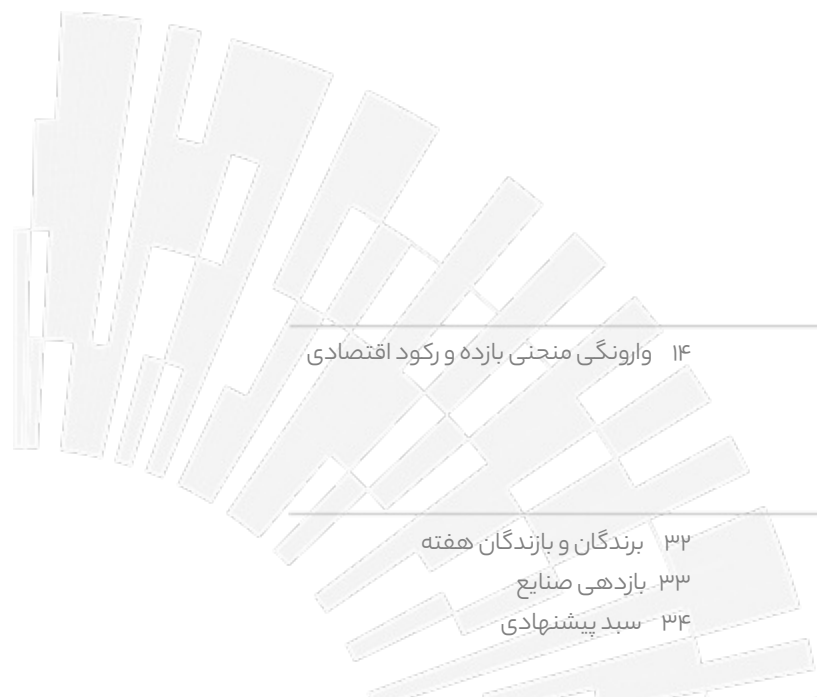
- ۱۶ مروری بر بازارهای موازی
- ۱۸ بررسی بلندمدت بازار سهام
- ۲۰ نرخ بهره و رونق بازار سهام
- ۲۱ ارزش معاملات

- ۵۸ گاز طبیعی
- ۱۰ کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی
- ۱۱ سیمان
- ۱۲ اخبار و معیارهای تاثیرگذار

- ۲۲ ارزندگی بازار
- ۲۴ بازدهی صنایع
- ۲۵ ورود و خروج پول
- ۲۸ بازدهی صنایع

- ۱۴ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی

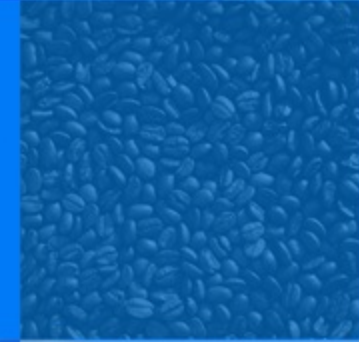
- ۳۲ برندگان و بازندگان هفته
- ۳۳ بازدهی صنایع
- ۳۴ سبد پیشنهادی



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات آهنی و غیر آهنی

روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
فلزات غیر آهنی			-	فزر			۱.۰%+	۲,۰۳۸	دلار/انس	بازار فارکس	طلا
			بموتو، فباهنر	فملی			۰.۷%-	۸,۴۶۸	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس
			بموتو، فباهنر	فملی			-	۳۸۰,۴۲۸	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)
			فنوال	فایرا			۱.۴%-	۲,۲۱۵	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم
			فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما			۵.۱%-	۲,۴۵۴	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی
فلزات آهنی			-	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما			۱.۳%-	۲,۱۴۷	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان			۱.۲%+	۴۹۸	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان			۱.۹%+	۵۲۴	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش CIS (منطقه)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق			۷.۵%+	۲۰,۶۳۷	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	شمش (فولاد خوزستان)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			۰.۵%+	۴۸۸	دلار/تن	بنادر ایران FOB	اسلب (ایران)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			۰.۵%-	۵۴۸	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب CIS (منطقه)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			-	۲۲,۱۳۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)
			فولای	ذوب، کویر			-	۶۱۸	دلار/تن	بنادر ترکیه FOB	میلگرد
			فولای	ذوب، کویر			۰.۶%+	۲۲,۱۴۱	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)
			فجر، فسپا	فولاد، فوکا، فنورد			۰.۸%-	۵۹۸	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم
			-	فولاد			۰.۷%-	۶۹۸	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق سرد



معادن و محصولات کشاورزی

		روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
سنگ آهن و محصولات معدنی			۶%		۱۴۳ ۱۰۱	-	-	-	-	-۲.۷%	۱۳۳	دلار/تن	شمال چین CFR	سنگ آهن
			۴%		۱۶۴ ۱۱۹	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			-۰.۷%	۱۵۸	دلار/تن	شمال چین CFR	گندله سنگ آهن
			۲۶%		۴,۸۴۳ ۳,۸۱۵	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			+۰.۹%	۴,۷۹۵	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	گندله سنگ آهن (گل گهر)
			۳%		۱۵۳ ۱۰۷	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			-۰.۷%	۱۴۶	دلار/تن	شمال چین CFR	کنسانتره سنگ آهن
			۲۱%		۳,۶۲۵ ۲,۹۷۷	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			+۰.۳%	۳,۶۰۱	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی			-۲۴%		۲۹۰ ۱۹۹	-	-	-	-	-	۲۲۱	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
			-۳۵%		۲۶۸ ۱۷۴	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	-۰.۸%	۱۷۴	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
			-۱۴%		۱,۷۱۶ ۱,۱۹۷	-	-	-	-	-۶.۵%	۱,۲۴۸	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
			-۱۳%		۹۶۸ ۷۲۸	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	-۳.۶%	۷۹۱	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام



عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
مواد شیمیایی	خلیج فارس FOB	دلار/تن			شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفارس		
	متانول	دلار/تن	۲۸۷	+۰.۳%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا		
	اتیلن	دلار/تن	۹۵۰	+۴.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
	پروپیلن	دلار/تن	۸۵۰	+۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن		
	پارازایلین	دلار/تن	۱,۰۱۳	-۲.۴%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
	ارتوزایلین	دلار/تن	۱,۰۱۵	-۱.۰%	شصفها، نوری	-		
	استایرن	دلار/تن	۱,۰۶۷	-۰.۹%	پارس	شجم، شبصیر		
	بنزن	دلار/تن	۹۹۷	-۰.۴%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
	تولوئن	دلار/تن	۸۶۱	+۰.۱%	بوعلی	-		
	بوتادین	دلار/تن	۱,۱۶۰	+۴.۵%	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
پلیمرها	مونواتیلن گلایکول	دلار/تن	۵۵۵	-۰.۲%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
	پلی اتیلن سبک	دلار/تن	۱,۰۲۰	+۰.۳%	آریا، شکبیر	-		
	پلی اتیلن سنگین	دلار/تن	۹۳۷	-۱.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
	پلی اتیلن سبک خطی	دلار/تن	۹۲۳	-۰.۹%	جم، شکبیر، شاراک	-		
	پلی پروپیلن	دلار/تن	۸۵۱	-	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
	PET	دلار/تن	۹۵۵	+۱.۱%	شگویا	-		
	PVC	دلار/تن	۷۷۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-		
	ABS	دلار/تن	۱,۲۸۰	-	شبصیر	-		



انرژی، فرآورده‌های نفتی و ارز

عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تأثیر در فروش	تأثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	رند قیمتی ۱۲ ماهه
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۷	-۷.۶%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۷۲۹۴	-۱۱%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۲	-۷.۵%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۶۶۹۱	-۱۵%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۸	-۴.۰%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۷۸۱۰۷	-۵%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۸	-۵.۷%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۷۹۱۲۵	-۴%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۸۶	-۵.۲%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۳۵۰۵۲۸	۶%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۵	-۱.۷%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۸۱۱۲۴	-۸%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۵۵۵	-۶.۸%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	بوعلی، نوری	۴۵۲۶۷۳	-۱۸%
روغن پایه	امارات متحده CFR عربی	دلار/تن	۷۴۵	-۲.۵%	شسپا، شرانل، شپهرن، شنف	-	۷۴۵۹۵۰	-۲۱%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۷,۶۹۲	+۳.۶%	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۲۱,۷۹۵۴۱,۳۶۵	-۳۰%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۷,۷۱۰	-۱.۶%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۱,۳۲۹۲۱,۶۳۴	۵۶%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۳,۱۰۰	-۱.۲%	شپاس	-	۱۲,۰۸۶۱۷,۱۴۰	۲%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۷۵	-۲.۹%	-	ذوب، فروش	۱۹۶۳۴۵	-۲۵%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۸	-۵.۵%	-	-	۱.۰۵۱.۱۲	۱%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۶	-۵.۵%	-	-	۱.۲۰۱.۳۱	۵%
بیتکوین	بایننس	دلار	۴۳,۰۲۶	+۲.۵%	-	-	۱۹,۹۹۴۴۴,۰۳۹	۹۸%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

ارزو ارز دیجیتال



هاب	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
هنری هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۰۷	-۱.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۳	-۱۵%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-۰.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۶۳%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۳	+۲.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۴۶%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	+۴.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۶۱	-۴۵%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۹	+۲.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۴۵%

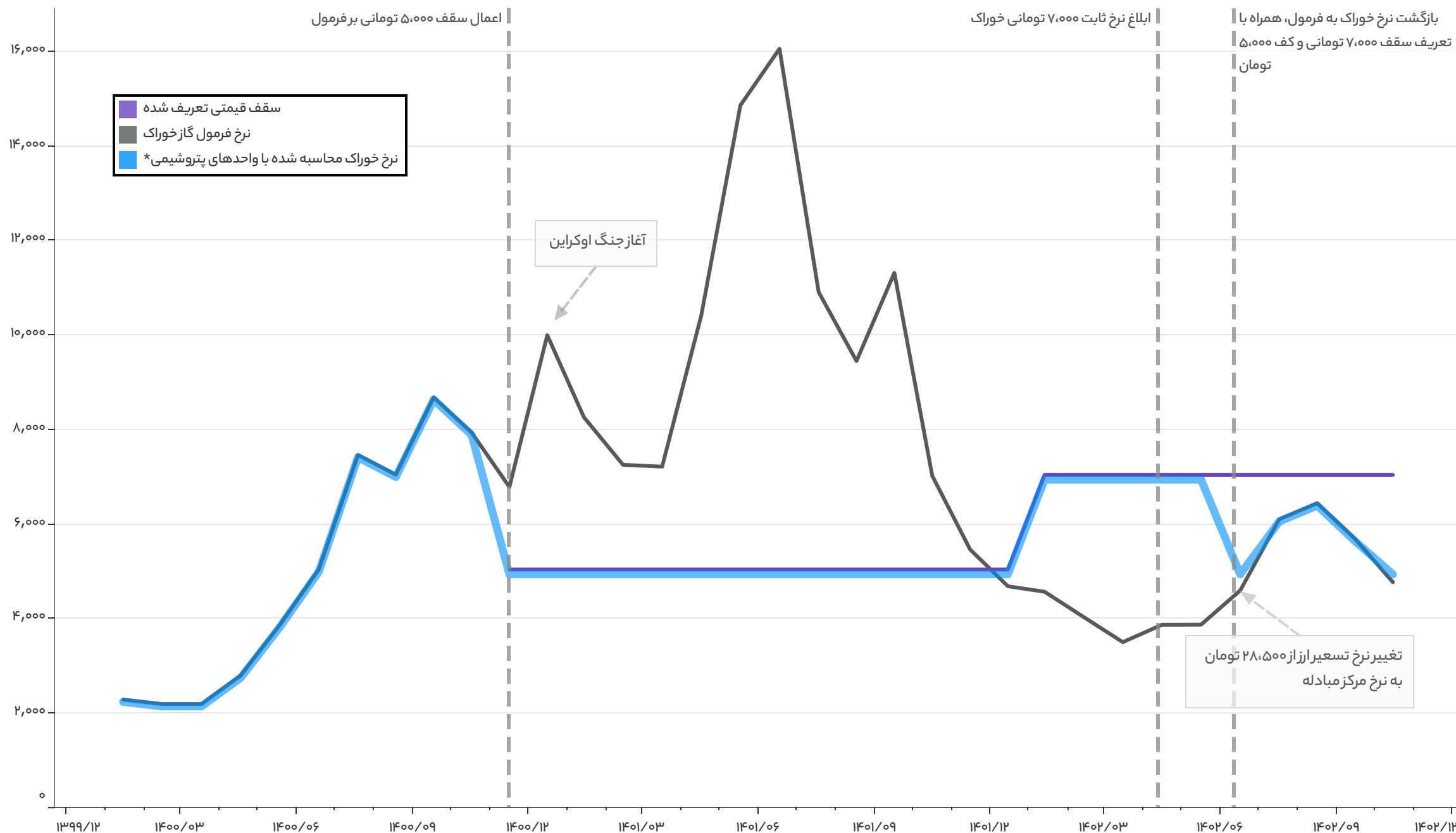
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته



فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

نرخ بدست آمده از فرمول گاز خوراک در برابر نرخ خوراک محاسبه شده با صنایع پتروشیمی با اعمال سقف قیمتی، از ابتدای سال ۱۴۰۰، تومان به ازای هر مترمکعب

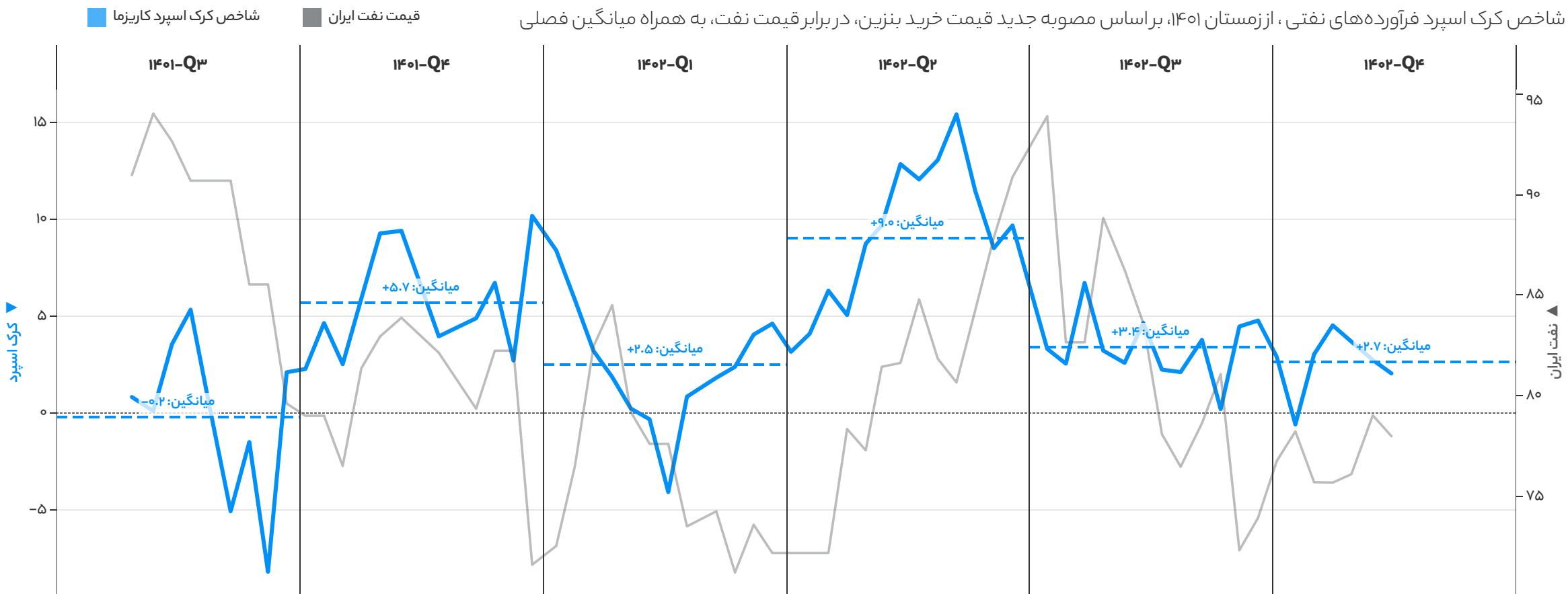


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.



کامودیتی

شاخص کرک اسپرد کاریزما*



فرآورده	قیمت (دلار)	کرک اسپرد (دلار)			میانگین فصلی کرک اسپرد (دلار)			آخرین وضعیت اسپرد (در برابر میانگین فصل جاری و فصل گذشته، دلار)		
	هفته گزارش	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییر (واحد)	فصل گذشته	فصل جاری	رشد میانگین فصل	آخرین وضعیت	میانگین فصل گذشته	میانگین فصل جاری
نفت ایران	۷۸.۰									
گازوئیل	۹۷.۸	۱۹.۵	۱۹.۸	▲ ۰.۳	۲۳.۲	۱۹.۷	-۱۵.۰%			
بنزین**	۸۲.۵	۶.۷	۴.۵	▼ ۲.۲	۱.۱	۴.۱	+۲۶۴.۳%			
نفتا	۶۲.۸	-۱۱.۷	-۱۵.۲	▼ ۳.۵	-۱۲.۳	-۹.۸	+۲۰.۲%			
نفت کوره	۶۰.۸	-۱۴.۹	-۱۷.۲	▼ ۲.۳	-۱۵.۲	-۱۳.۸	+۹.۶%			
لوب کات***	۶۹.۲	-۸.۸	-۸.۹	▼ ۰.۱	-۲.۹	-۷.۶	-۱۶۲.۵%			
وکیوم باتوم***	۴۷.۴	-۳۱.۹	-۳۰.۷	▲ ۱.۲	-۲۸.۵	-۳۱.۰	-۸.۹%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۲.۸	۲.۱	▼ ۰.۷	۳.۴	۲.۷	-۲۲.۲%			

* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هریک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و براساس ارزش بازار هریک از این پالایشگاه‌ها استفاده شده است.

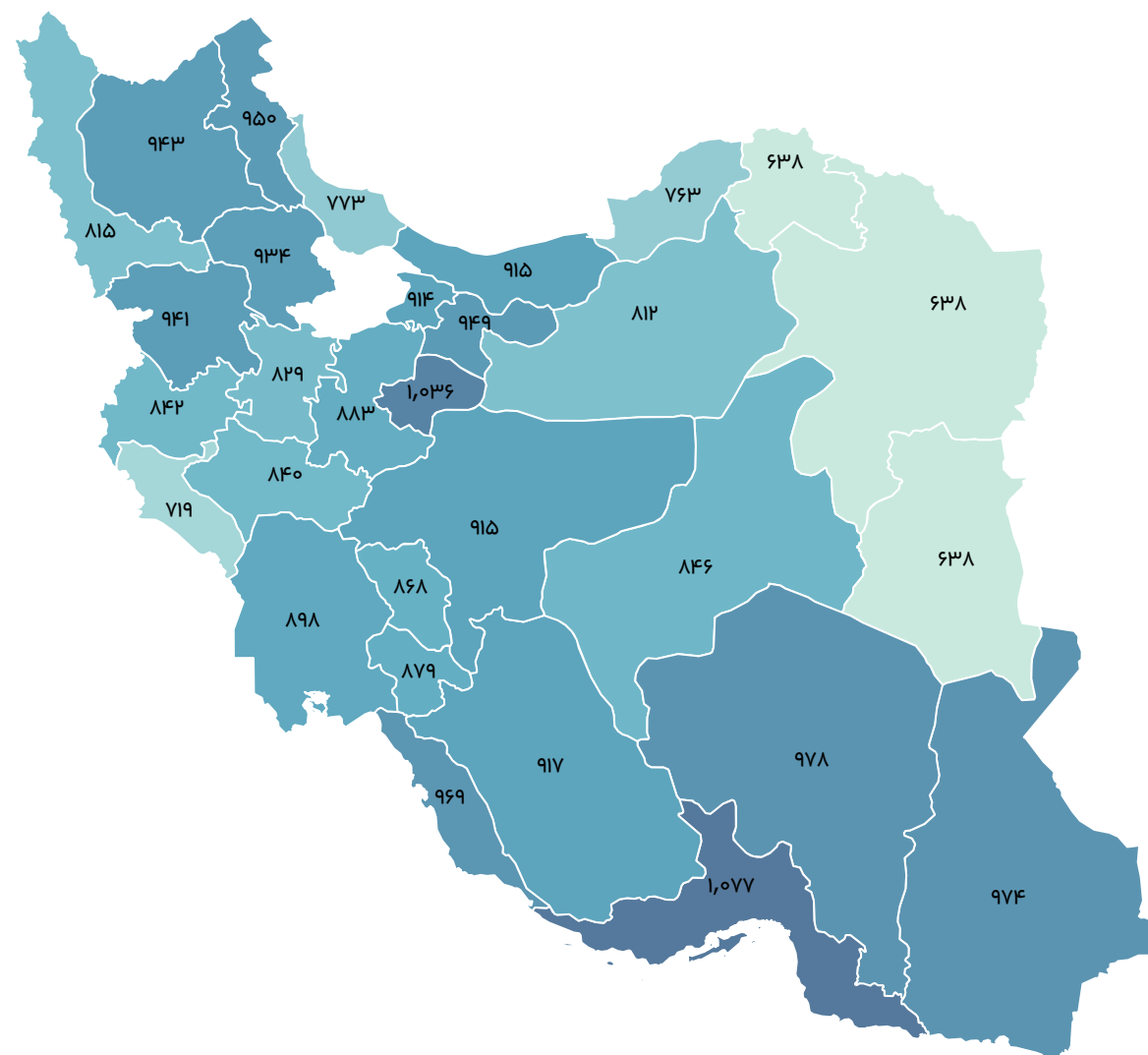
** قیمت بنزین براساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شیندر، شتران و شیریز) و براساس نوع بنزین فروخته شده توسط هریک این پالایشگاه‌ها حساب گردیده است.

*** قیمت لوبکات و وکیوم باتوم براساس نرخ فروش هریک از ۴ پالایشگاه ذکر شده در بورس کالا محاسبه گردیده، که این اسپرد نیز براساس ارزش بازار هریک از این پالایشگاه‌ها، به روش موزون میانگین گیری شده است.

هفته منتهی به: ۱۴۰۲/۱۱/۳۰

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

براساس شرکت دنبال کننده هر استان در جدول روبرو، براساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات، تومان به کیلوگرم



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس حجم معاملات، تومان به کیلوگرم

تغییرات به هفته گذشته	هفته گزارش	هفته گذشته	شرکت دنبال کننده	استان	منطقه
-	۸۸۳	۸۸۳	سیمان ساوه	مرکزی	مرکز
-	۹۱۴	۹۱۴	سیمان آبیک	البرز	
+۰.۳%	۹۴۹	۹۴۶	سیمان تهران	تهران	
-	۹۱۵	۹۱۵	سیمان سپاهان	اصفهان	
+۶.۸%	۸۴۶	۷۹۳	گروه صنعتی ومعدنی سیما..	یزد	
+۴.۰%	۱,۰۳۶	۹۹۶	سیمان نیزاز قم	قم	
-	۸۱۲	۸۱۲	سیمان شاهرود	سمنان	غرب
-	۸۹۸	۸۹۸	شرکت سیمان خوزستان	خوزستان	
-	۸۲۹	۸۲۹	سیمان هگمتان	همدان	
+۱.۸%	۷۱۹	۷۰۶	سیمان ایلام	ایلام	
-	۸۶۸	۸۶۸	صنایع سیمان شهرکرد	چهارمحال و بختیاری	
-۴.۱%	۸۴۲	۸۷۷	صنایع سیمان غرب	کرمانشاه	
-	۸۴۰	۸۴۰	سیمان دورود	لرستان	
-	۸۷۹	۸۷۹	سیمان یاسوج	کهگیلویه و بویراحمد	
-	۹۴۱	۹۴۱	سیمان کردستان	کردستان	شمال
-۲.۲%	۹۱۵	۹۳۵	سیمان مازندران	مازندران	
+۰.۱%	۷۷۳	۷۷۲	سیمان خزر	گیلان	
-	۷۶۳	۷۶۳	سیمان پیوند گلستان	گلستان	
-۰.۹%	۱,۰۷۷	۱,۰۸۷	سیمان هرمزگان	هرمزگان	جنوب
-۸.۹%	۹۱۷	۱,۰۰۶	سیمان داراب	فارس	
-۱.۴%	۹۶۹	۹۸۳	سیمان مند دشتی	بوشهر	
+۰.۹%	۹۵۰	۹۴۲	سیمان آرتا اردبیل	اردبیل	شمال غرب
-	۹۳۴	۹۳۴	سیمان خمسه	زنجان	
-	۹۴۳	۹۴۳	کارخانجات سیمان صوفیان	آذربایجان شرقی	
-۰.۹%	۸۱۵	۸۲۳	سیمان ارومیه	آذربایجان غربی	شمال شرق
-	۶۳۸	۶۳۸	سیمان بجنورد	خراسان شمالی	
-۲.۴%	۶۳۸	۶۵۳	سیمان شرق	خراسان رضوی	
-	۶۳۸	۶۳۸	شرکت سیمان قاین	خراسان جنوبی	جنوب شرق
-۶.۵%	۹۷۸	۱,۰۴۵	سیمان ممتازان کرمان	کرمان	
-۱.۷%	۹۷۴	۹۹۰	سیمان خاش	سیستان و بلوچستان	

* قیمت سیمان بر اساس سیمان ۲ فله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲

به گزارش رویترز، طلا در آخرین روز ماه ژانویه در آستانه اولین کاهش قیمت ماهانه طی ۴ ماه گذشته قرار دارد. انتظار سرمایه‌گذاران از کاهش زود هنگام نرخ بهره پایین آمده و منتظر بیانیه فدرال رزرو آمریکا در این مورد هستند. قیمت طلا طی هفته گذشته روندی صعودی داشته و تا بالای ۲۰۳۵ دلار معامله شد.
- ▲

سومین حراج شمش طلا از ساعت ۱۲ یکشنبه ۸ بهمن ماه و با عرضه ۱۴۵ کیلوگرم شمش طلای یک کیلویی آغاز شد. شمش‌هایی که در این حراج‌ها عرضه می‌شوند، متعلق به بخش خصوصی است که در راستای رفع تعهد ارزی با استفاده از واردات شمش طلا و عرضه در مرکز مبادله ارز و طلای ایران به تولیدکنندگان مصنوعات طلا جهت خرید فروخته می‌شود. از مجموع ۱۱۲ شمش طلای عرضه شده استاندارد یک کیلوگرمی با عیار ۹۹۵ در هزار، ۷۹ شمش طلای استاندارد مورد معامله قرار گرفت. شمش‌های طلای استاندارد، در حراج حضوری روز یکشنبه با میانگین قیمت ۳ میلیارد و ۶۳۵ میلیون تومان مورد معامله قرار گرفت. چهارمین جلسه حراج شمش طلای استاندارد نیز روز چهارشنبه مورخ ۱۱ بهمن ماه ۱۴۰۲، برگزار شد.
- ▲

یکشنبه شب به وقت تهران سه نظامی آمریکایی در حمله شبانه پهبادی به یک پایگاه آمریکایی در اردن کشته و دست‌کم ۲۵ پرسنل نظامی نیز زخمی شدند. تجارت نیوز نوشت: قیمت طلا و سکه دوشنبه به دنبال پرش قیمت دلار به کانال ۵۷ هزار تومانی، در روند افزایشی میلیونی قرار گرفت. روند صعودی قیمت در بازار طلا پس از افزایش ریسک‌های سیاسی رخ داد. قیمت طلا و سکه در شروع سومین روز هفته با افزایش شارپی قیمت دلار همراه شد. رشد قیمت در بازارهای مالی متعاقب افزایش ریسک‌های سیاسی رخ داد و موجب رشد قیمت یک میلیون و ۳۰۰ هزار تومانی سکه امامی شد.
- ▲

همزمان با افزایش گروه‌های دارای امکان خرید شمش طلا از مرکز مبادله، شیوه نامه جدید برگزاری حراج حضوری شمش طلای استاندارد ابلاغ شد. براساس شیوه‌نامه جدید حراج حضوری شمش طلا در مرکز مبادله ارز و طلای ایران، علاوه بر «فروشنندگان عمده شمش طلا دارای پروانه کسب مجاز و معتبر»، «تولیدکنندگان و سازندگان فعال مصنوعات طلا دارای پروانه کسب مجاز و معتبر» و «خرده‌فروشان طلای آب شده دارای پروانه کسب مجاز و معتبر»، «بانک عامل با تأیید بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران» می‌تواند متقاضیان خرید شمش طلای مرکز مبادله ایران باشد.
- ▼

به گزارش رویترز، قیمت نفت در روز دوشنبه به دنبال حمله به نیروهای آمریکایی در اردن و افزایش نگرانی در مورد مختل شدن عرضه نفت خاورمیانه اندکی افزایش یافت. یمن هم حملات خود به کشتی‌ها در دریای سرخ را افزایش داده و به یک نفتکش حامل سوخت متعلق به شرکت ترافیکورا حمله کرده است. اما در ادامه روزهای هفته، قیمت نفت روندی نزولی را طی کرده است.
- ▲

یافته‌های نظرسنجی ماهانه رویترز نشان داد سازمان کشورهای صادرکننده نفت (اوپک) در ژانویه، ۲۶.۳۳ میلیون بشکه در روز نفت تولید کرد که ۴۱۰ هزار بشکه در روز نسبت به دسامبر کاهش داشت. شایان ذکر است که آمار تولید دسامبر شامل تولید آنگولا که اوپک را ترک کرده است، نبود. این کاهش تولید، بزرگترین کاهش ماهانه از ژوئیه محسوب می‌شود. کاهش اخیر تولید، نشان‌دهنده کاهش بیشتر سهم بازار اوپک است که در اواخر سال ۲۰۲۲ به منظور حمایت از بازار و مقابله با افزایش تولید کشورهای غیر اوپک مانند برزیل و آمریکا، محدودیت عرضه را آغاز کرد. بزرگترین کاهش تولید در میان اعضای اوپک در ژانویه مربوط به لیبی بود که از مشارکت در کاهش تولید این گروه معاف است. وقوع ناآرامی‌ها، باعث تعطیلی میدان نفتی شراره شد که یکی از بزرگ‌ترین میدان‌های نفتی این کشور است.
- ▲

به گزارش رویترز، دو منبع اوپک پلاس در روز پنجشنبه و پس از اجلاس وزارتی اعضای این ائتلاف اعلام کردند هیچ تغییری در سیاست تولید این گروه اعمال نشده و اوپک پلاس در ماه مارس در مورد تمدید کاهش تولید فعلی تصمیم‌گیری خواهد کرد. ائتلاف اوپک پلاس در نوامبر سال گذشته میلادی تصمیم گرفت داوطلبانه ۲.۲ میلیون بشکه در روز از تولید خود را در سه ماهه اول سال جاری میلادی کاهش دهد. سردمدار این کاهش تولید عربستان با بیش از یک میلیون بشکه در روز کاهش تولید بوده است. از طرف دیگر، انتظار کاهش نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا در بحبوحه افزایش تنش‌های ژئوپلیتیکی مخصوصاً در دریای سرخ از قیمت نفت حمایت کرده است. قیمت نفت برنت در روز پنجشنبه بیش از ۸۱ دلار در هر بشکه معامله می‌شد.

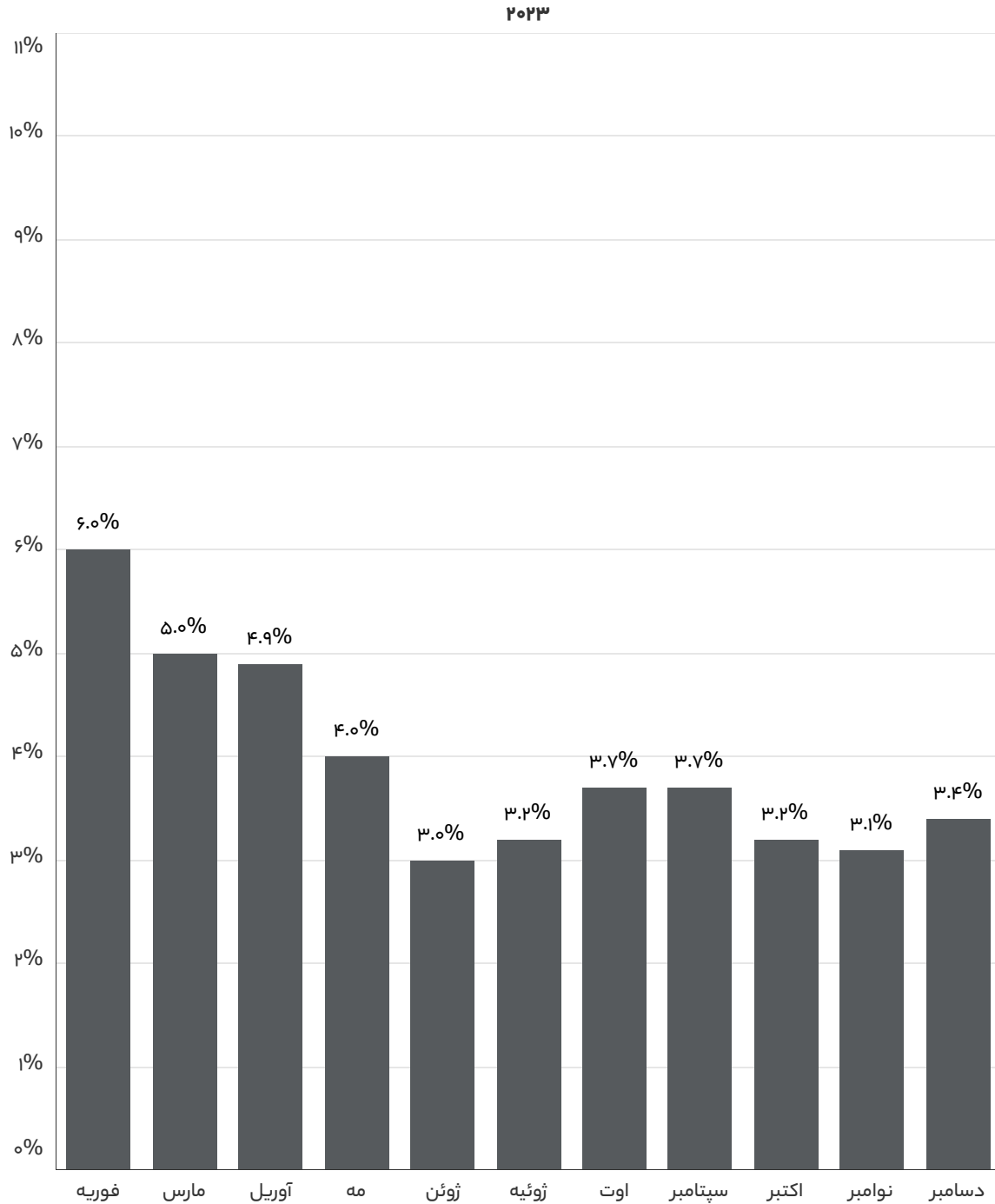
معادن و فلزات

انرژی



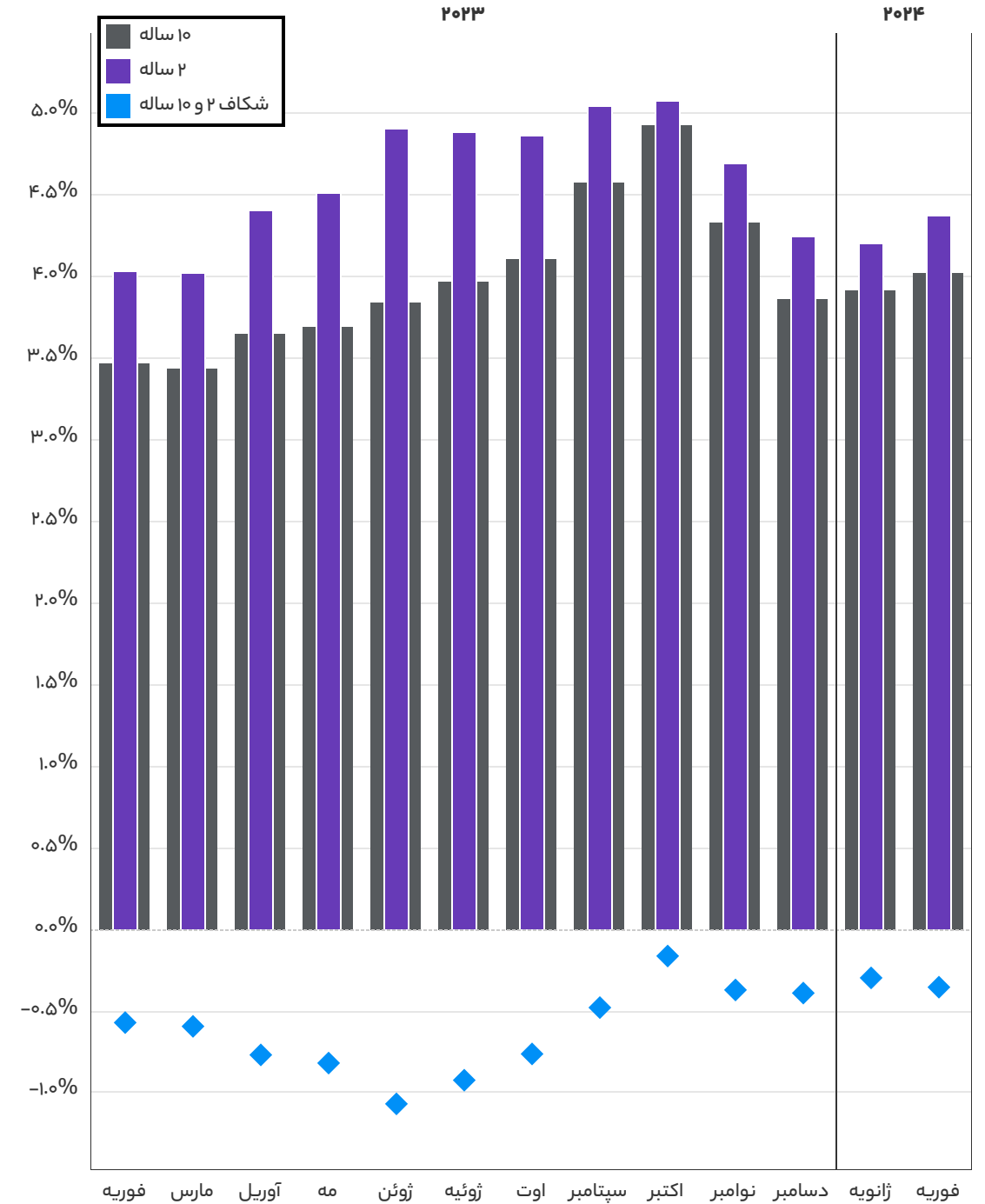
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده





شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



بازار سهام

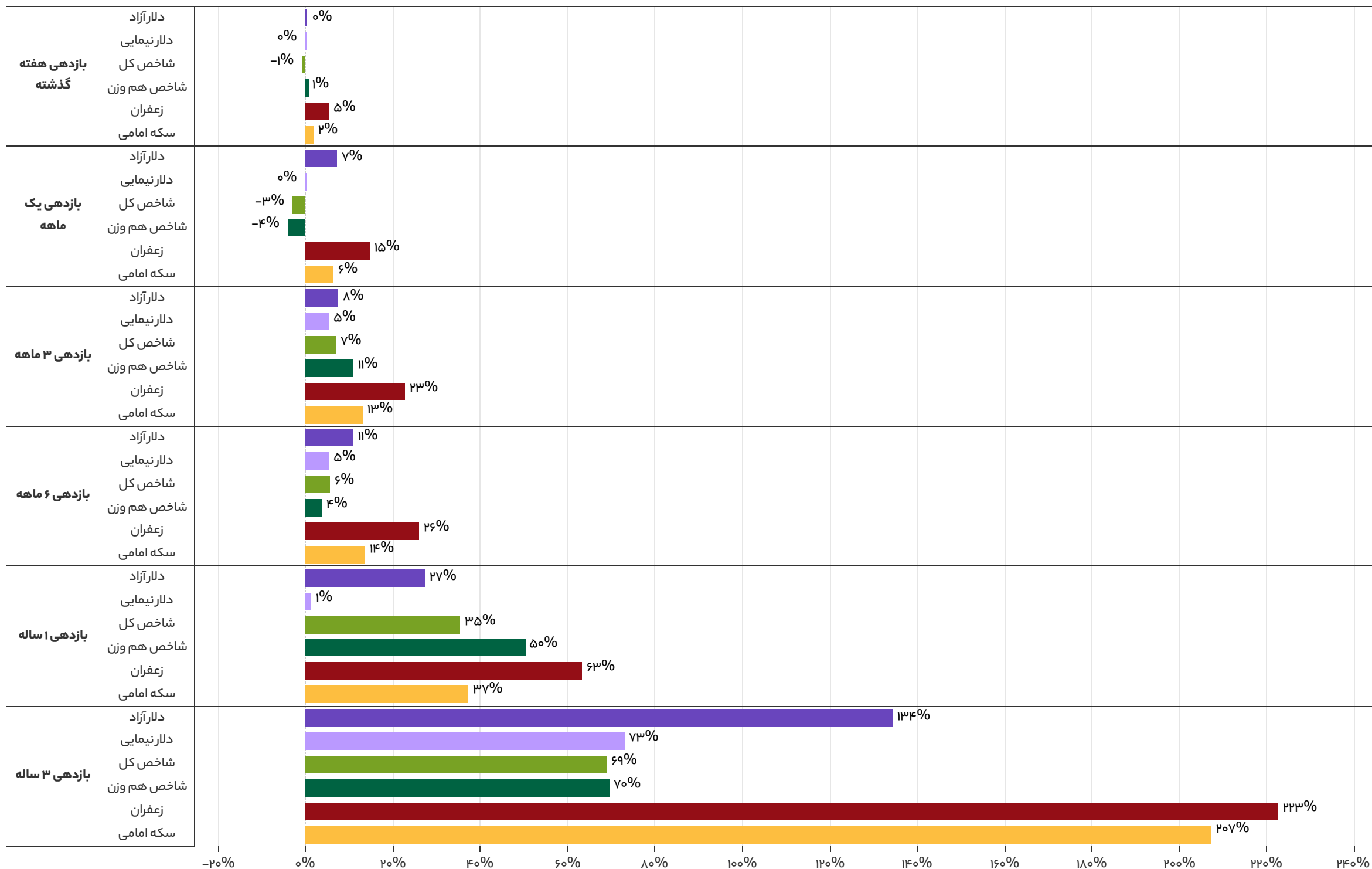
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها در بازه‌های زمانی متفاوت



بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

بازدهی دارایی‌های مختلف، طی یکسال گذشته به صورت ماهانه، مرتب شده براساس بازده درهرماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												بازده سال	نوسان
۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	۱۴۰۲/۰۹	۱۴۰۲/۱۰	هم وزن ۴۲٪	هم وزن ۵۸.۲٪
سکه امامی ▲ ۱۷.۷٪	شاخص کل ▲ ۳۰.۳٪	هم وزن ▲ ۲۹.۷٪	مسکن ▲ ۱۳.۴٪	مسکن ▲ ۴.۰٪	زعفران ▲ ۱۲.۳٪	زعفران ▲ ۳.۶٪	شاخص کل ▲ ۹.۳٪	سکه امامی ▲ ۴.۱٪	زعفران ▲ ۹.۲٪	شاخص کل ▲ ۹.۴٪	دلار آزاد ▲ ۸.۸٪	شاخص کل ▲ ۴۱.۳٪	شاخص کل ۴۰٪
دلار آزاد ▲ ۱۴.۷٪	هم وزن ▲ ۲۴.۳٪	شاخص کل ▲ ۱۶.۴٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۸٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۸٪	سکه امامی ▲ ۳.۳٪	هم وزن ▲ ۸.۸٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	هم وزن ▲ ۱.۹٪	هم وزن ▲ ۸.۳٪	سکه امامی ▲ ۸.۸٪	سکه امامی ▲ ۲۵٪	مسکن ۲۱٪
زعفران ▲ ۱۴.۵٪	مسکن ▲ ۱۴.۲٪	دلار آزاد ▲ ۳.۷٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۵٪	دلار آزاد ▲ ۰.۵٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	دلار آزاد ▲ ۱.۵٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۲٪	زعفران ▲ ۴.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۲۳.۶٪	زعفران ۲۰٪
دلار نیمایی ▲ ۱۲.۷٪	سکه امامی ▲ ۹.۷٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	زعفران ▲ ۱.۶٪	زعفران ▼ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۱.۷٪	دلار آزاد ▲ ۱.۴٪	زعفران ▲ ۱.۳٪	مسکن ▲ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۰.۴٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۲٪	دلار آزاد ▲ ۹.۶٪	دلار آزاد ۱۸٪
مسکن ▲ ۹.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	مسکن ▲ ۱.۸٪	دلار آزاد ▲ ۰.۸٪	هم وزن ▼ ۲.۳٪	مسکن ▼ ۲.۲٪	دلار نیمایی ▲ ۰.۱٪	دلار آزاد ▲ ۰.۲٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۱٪	دلار آزاد ▲ ۰.۱٪	زعفران ▲ ۱.۵٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۱٪	سکه امامی ▲ ۹.۲٪	دلار نیمایی ۱۴٪
درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	زعفران ▲ ۰.۸٪	زعفران ▼ ۰.۱٪	سکه امامی ▲ ۰.۴٪	شاخص کل ▼ ۵.۶٪	سکه امامی ▼ ۳.۵٪	مسکن ▼ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۱٪	شاخص کل ▼ ۴.۱٪	سکه امامی ▼ ۰.۱٪	سکه امامی ▲ ۰.۸٪	هم وزن ▼ ۰.۹٪	سکه امامی ▲ ۹.۲٪	دلار آزاد ۱۸٪
شاخص کل ▼ ۷.۵٪	دلار آزاد ▲ ۰.۲٪	سکه امامی ▼ ۰.۴٪	هم وزن ▼ ۰.۶٪	دلار آزاد ▼ ۶.۱٪	هم وزن ▼ ۶.۲٪	شاخص کل ▼ ۲.۳٪	مسکن ▼ ۰.۶٪	هم وزن ▼ ۴.۴٪	مسکن ▼ ۰.۴٪	دلار آزاد ▼ ۰.۸٪	شاخص کل ▼ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۱.۳٪	دلار نیمایی ۱۴٪
هم وزن ▼ ۸.۷٪	دلار نیمایی ▼ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۱.۸٪	شاخص کل ▼ ۱.۰٪	سکه امامی ▼ ۱۱.۱٪	شاخص کل ▼ ۸.۸٪	هم وزن ▼ ۵.۲٪	سکه امامی ▼ ۱.۶٪	زعفران ▼ ۴.۷٪	شاخص کل ▼ ۰.۶٪	مسکن ▼ ۲.۲٪	مسکن	مسکن	درآمد ثابت ۰٪

– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری سرخیز محاسبه شده است.

– بازده مسکن با استفاده از آمار بانک مرکزی اعلام شده برای میانگین قیمت مسکن در مناطق ۲۲ گانه تهران محاسبه شده و برای ماه‌های اعلام نشده، از برآورد سناریو محتمل مدل‌های آماری و اقتصادی که در گزارش ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما ذکر گردیده، استفاده شده است.

ارزش دلاری بازار

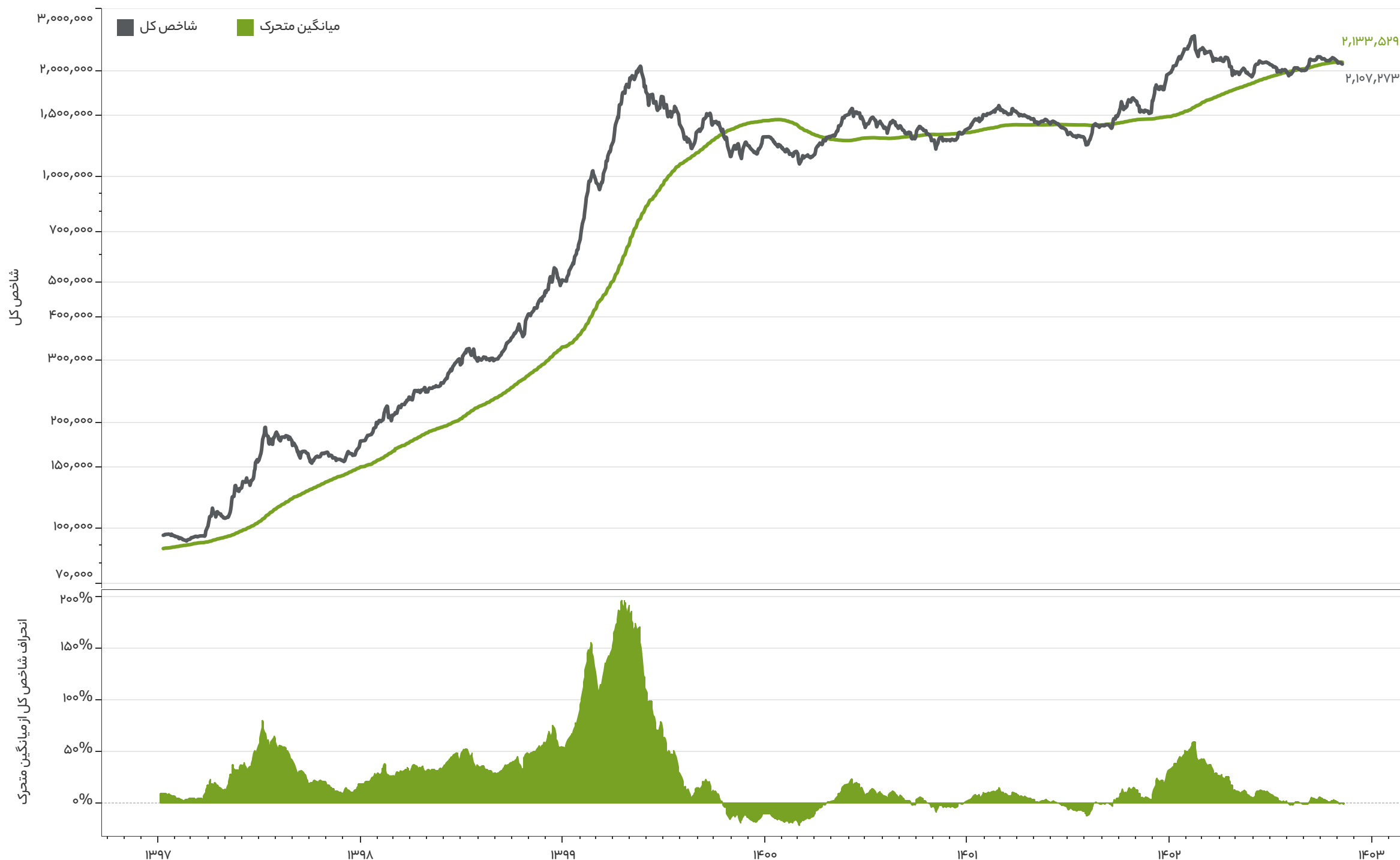
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد



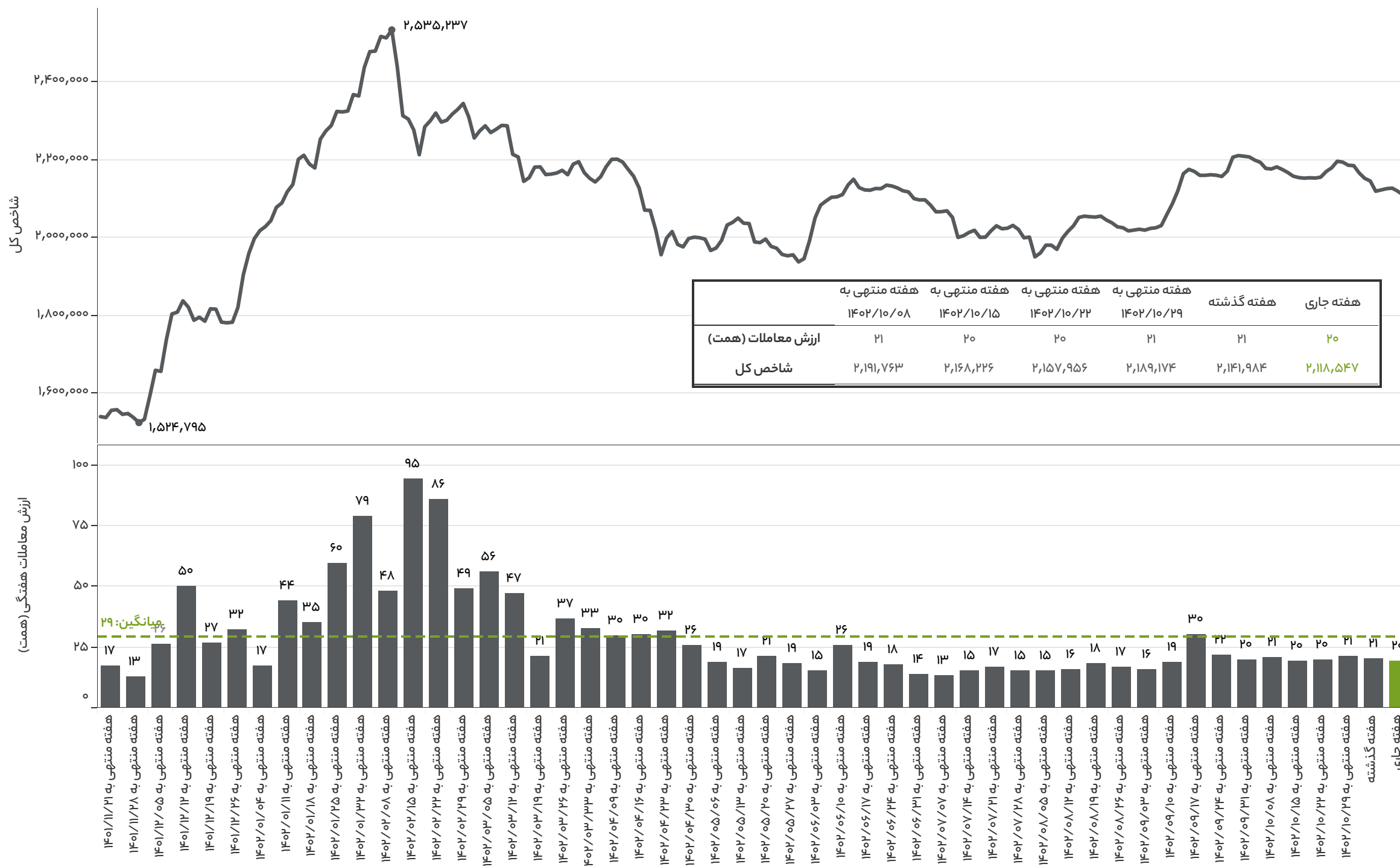
تأثير نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس



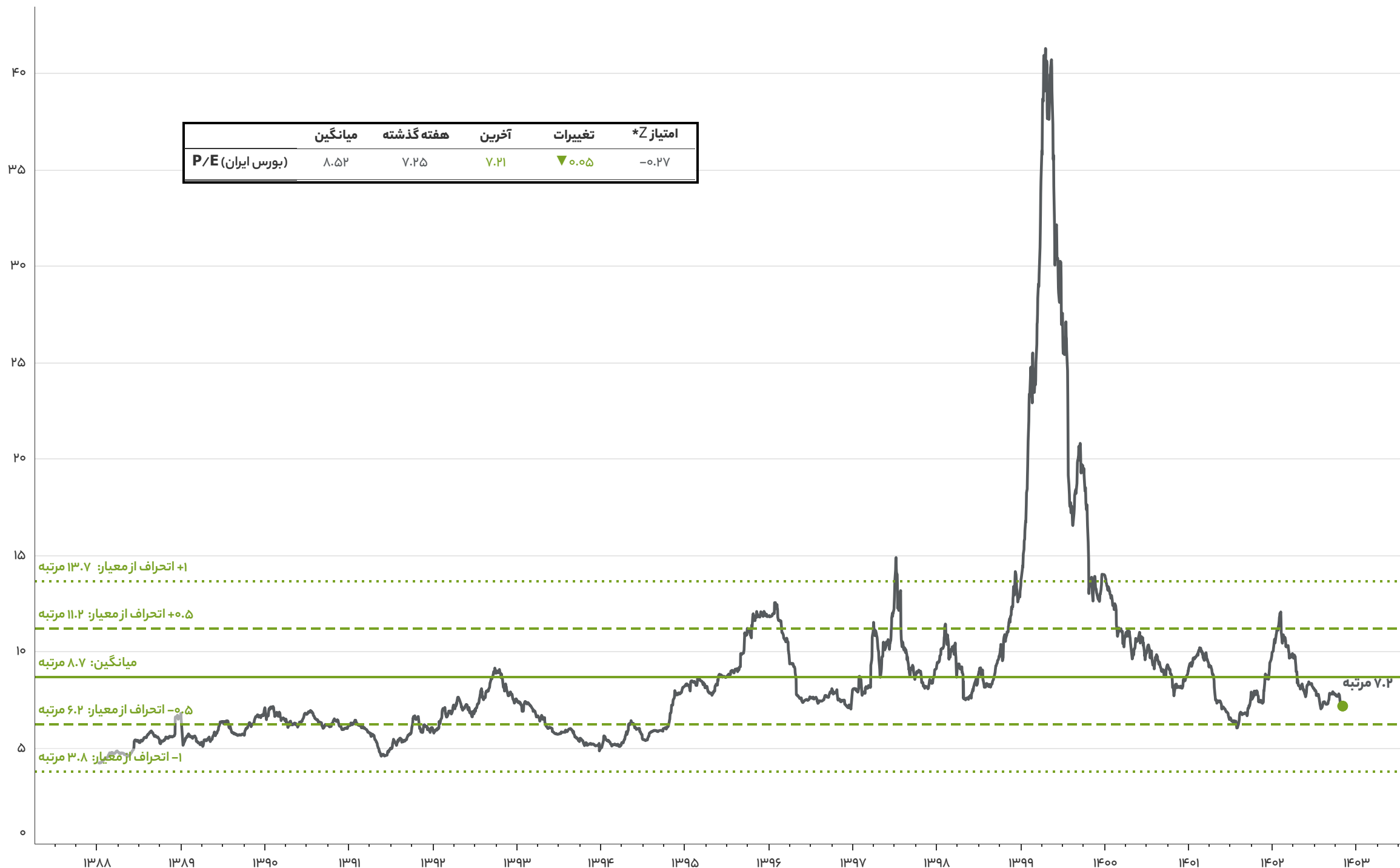
ارزش معاملات هفتگی بازار

ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل



نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*امتیاز Z یا امتیاز استاندارد تفاوت آخرین عدد برای نسبت قیمت به سود را بر حسب انحراف از معیار محاسبه می‌نماید که در اینجا می‌تواند یک معیار برای سنجش گران یا ارزان بودن بازار نسبت به میانگین باشد.



ارزش نسبی فرابورس به بورس

نسبت پی به ای فرابورس به بورس تهران، گذشته نگر، ۴ سال گذشته، بزرگنمایی شده



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	بیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۲۱	۷.۲۵	۶.۰۷	۱۲.۷۵	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۹۱	۶.۹۷	۵.۶۴	۱۲.۵۲	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۲۲	۹.۲۰	۹.۰۳	۱۴.۹۸	۴۳.۵۱

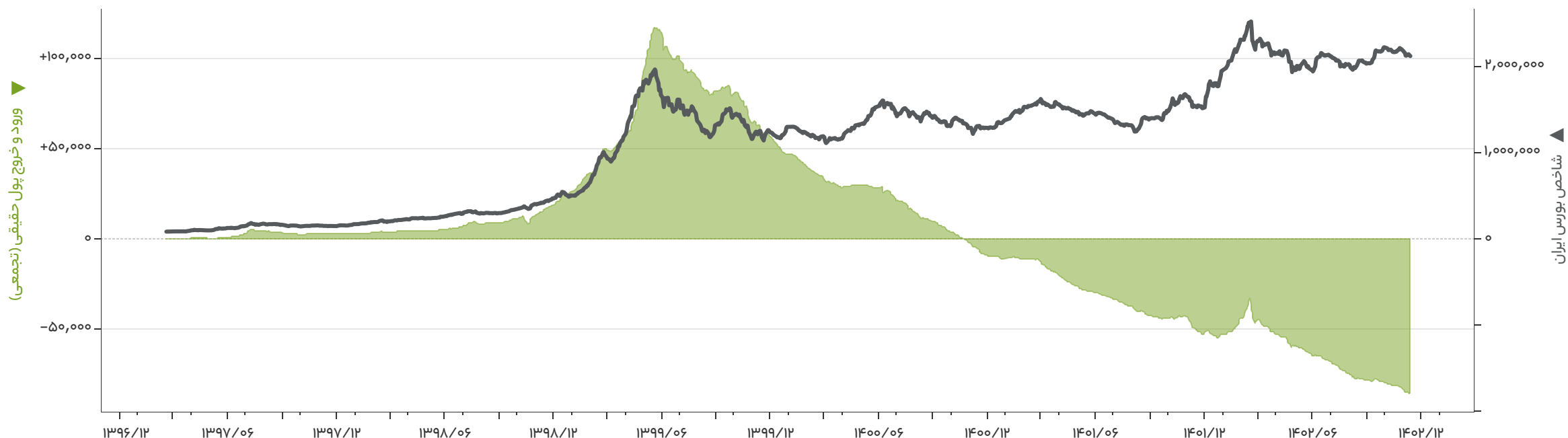


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	تکنولوژی	ارتباطات	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	خدمات مالی	مواد پایه	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۱۹	۵	۴۰	۶۳	۸۹	۶۶	۶	۱۹۹	۱۸۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۶۵	۸۶	۱۱۵	۱۱۸	۱۵۵	۱۹۶	۲۱۰	۳۸۰	۵۹۴	۳,۲۰۹	۳,۲۶۳	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۸%	۱.۰%	۱.۴%	۱.۴%	۱.۸%	۲.۳%	۲.۵%	۴.۵%	۷.۱%	۳۸.۲%	۳۸.۹%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۴.۹	۱۱.۸	۱۸.۰	۱۱.۸	۸.۹	۸.۸	۱۰.۰	۵.۳	۴.۳	۷.۰	۷.۲	سودآوری
بازده سود نقدی	۲.۶%	۱۷.۵%	۲.۸%	۳.۴%	۷.۱%	۳.۸%	۴.۴%	۲.۳%	۱۵.۲%	۹.۲%	۸.۹%	
نسبت تقسیم سود	۳۹%	۱۰۰%	۵۹%	۴۱%	۷۶%	۳۸%	۵۲%	۳۴%	۶۳%	۶۲%	۷۳%	
بتا به شاخص کل	۰.۹	۱.۱	۰.۷	۱.۴	۰.۸	۱.۲	۰.۸	۱.۰	۱.۱	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۷۴۹%	+۷۵۶%	+۲۹۷%	+۱۲۸%	+۳۷۸%	+۴۳۶%	+۴۲۱%	+۸۵۷%	+۷۶۱%	+۸۶۲%	+۹۳۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۸%	+۱۰۹%	۰%	-۶۴%	+۱۴%	-۷%	-۲%	-۱۲%	+۱۲%	+۱%	+۶۱%	
بازده از ابتدای سال	+۲۷۹%	+۳۸%	+۷۱%	+۴۶%	+۹۱%	+۱۰۸%	+۵۳%	+۹۲%	+۸۳%	+۶۹%	+۸۱%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۵%	-۱%	۰%	-۲%	-۱%	-۱%	۰%	۰%	-۱%	۰%	۰%	

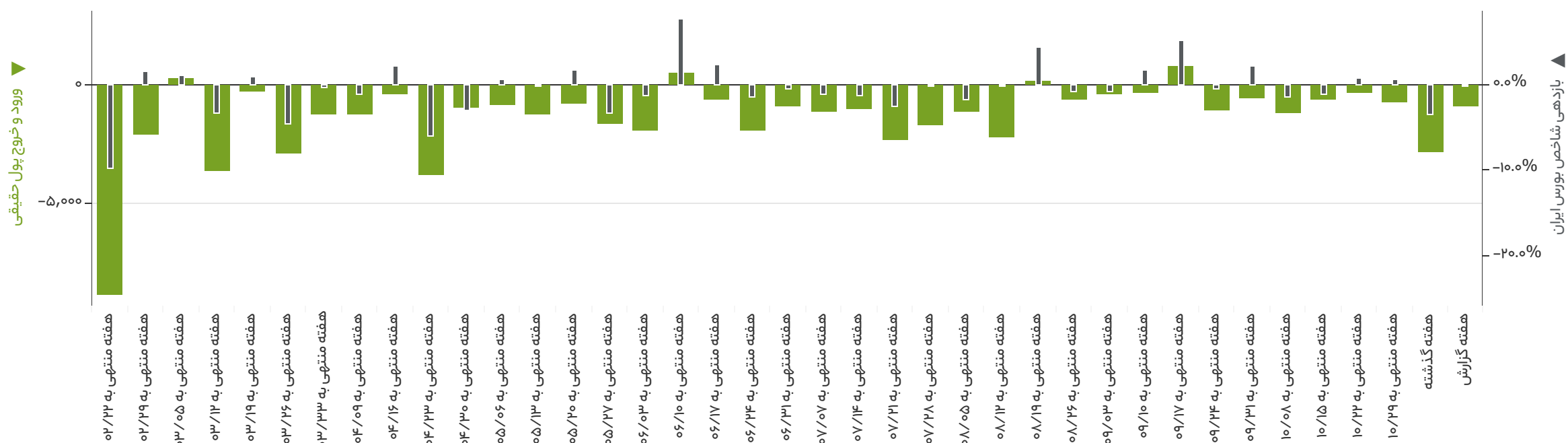
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

از ابتدای روند صعودی ۱۳۹۷/۰۲/۱۶، خالص ورود و خروج پول حقیقی به صورت تجمعی، شاخص بورس ایران



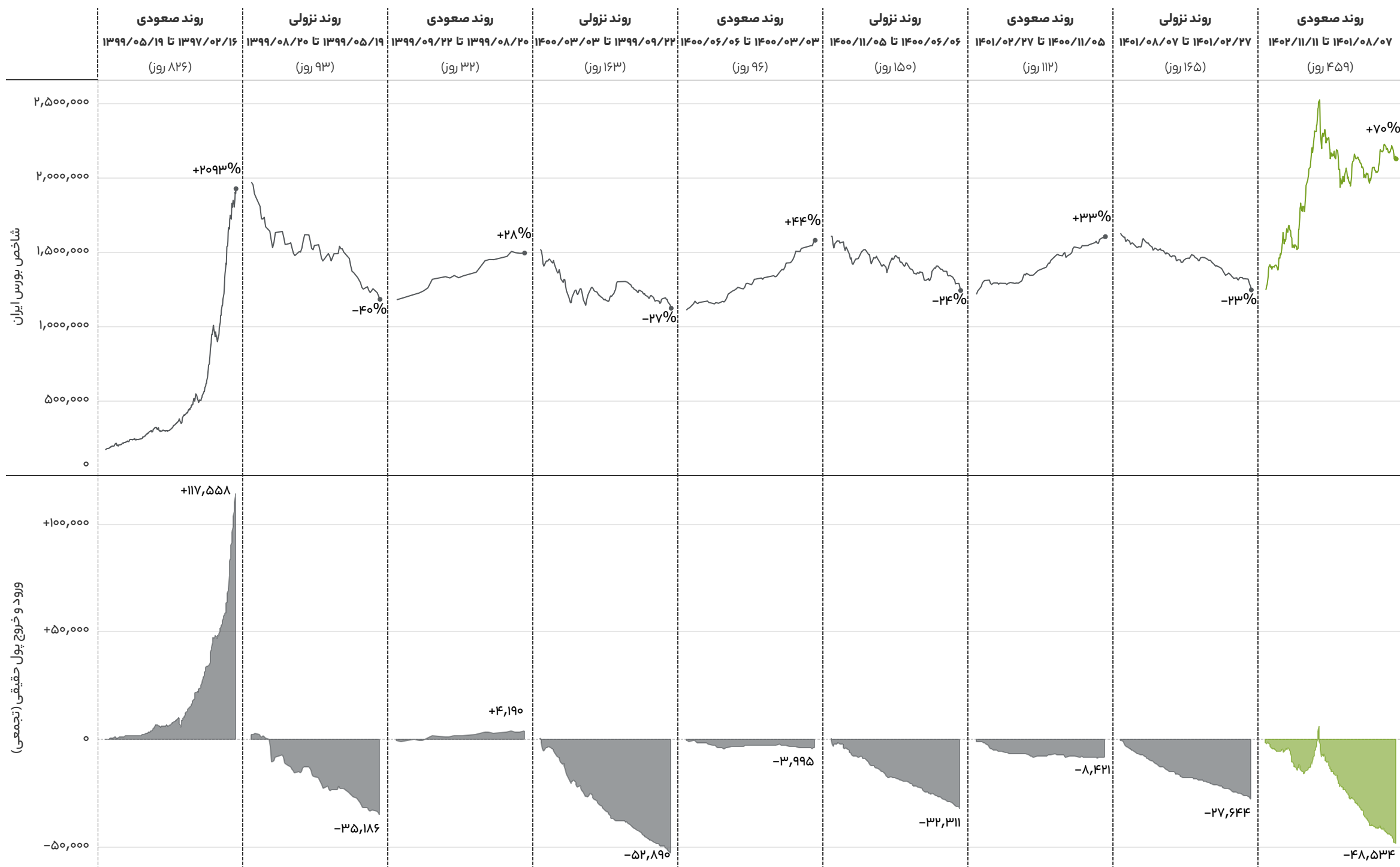
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران



ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس

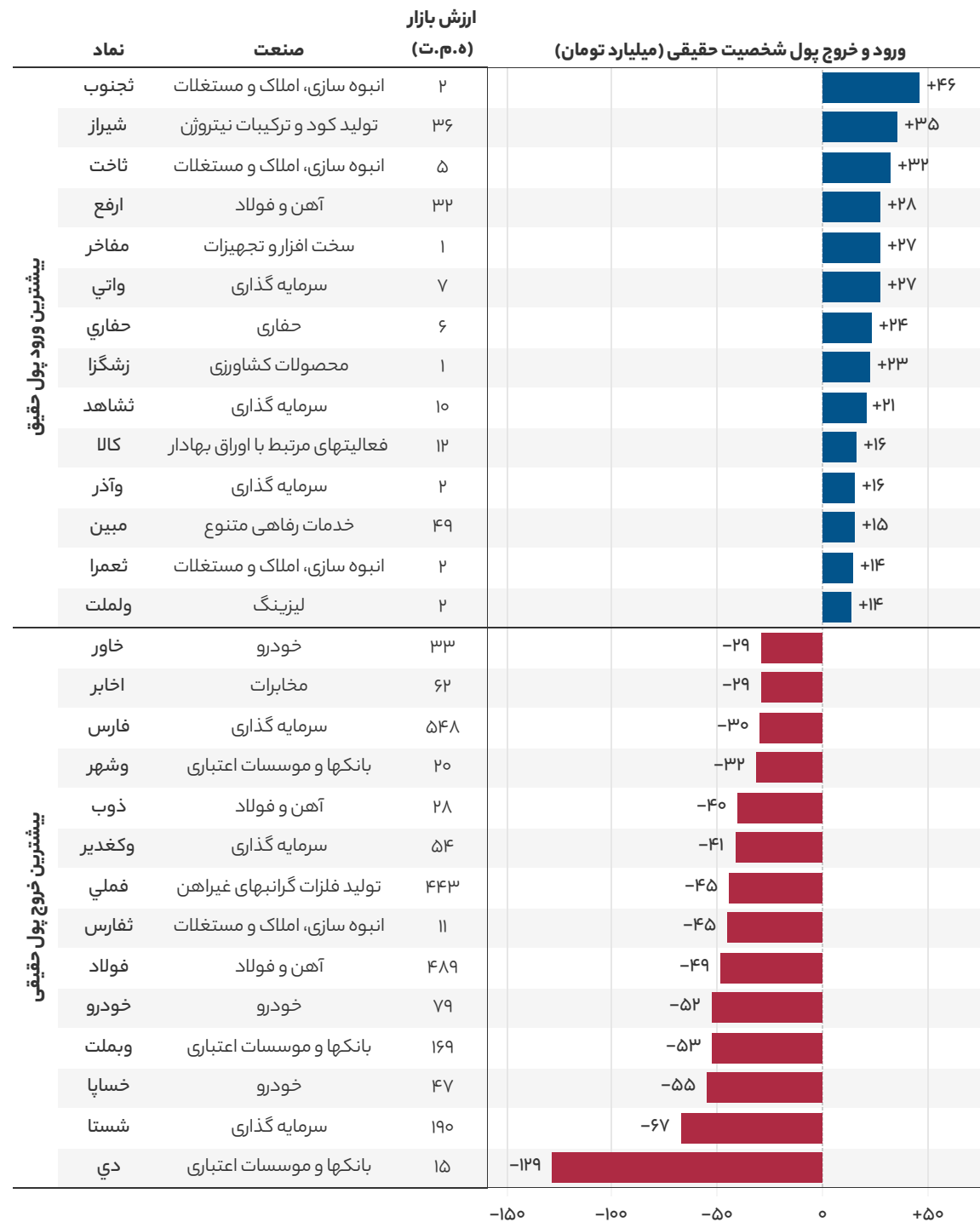




ورود و خروج پول

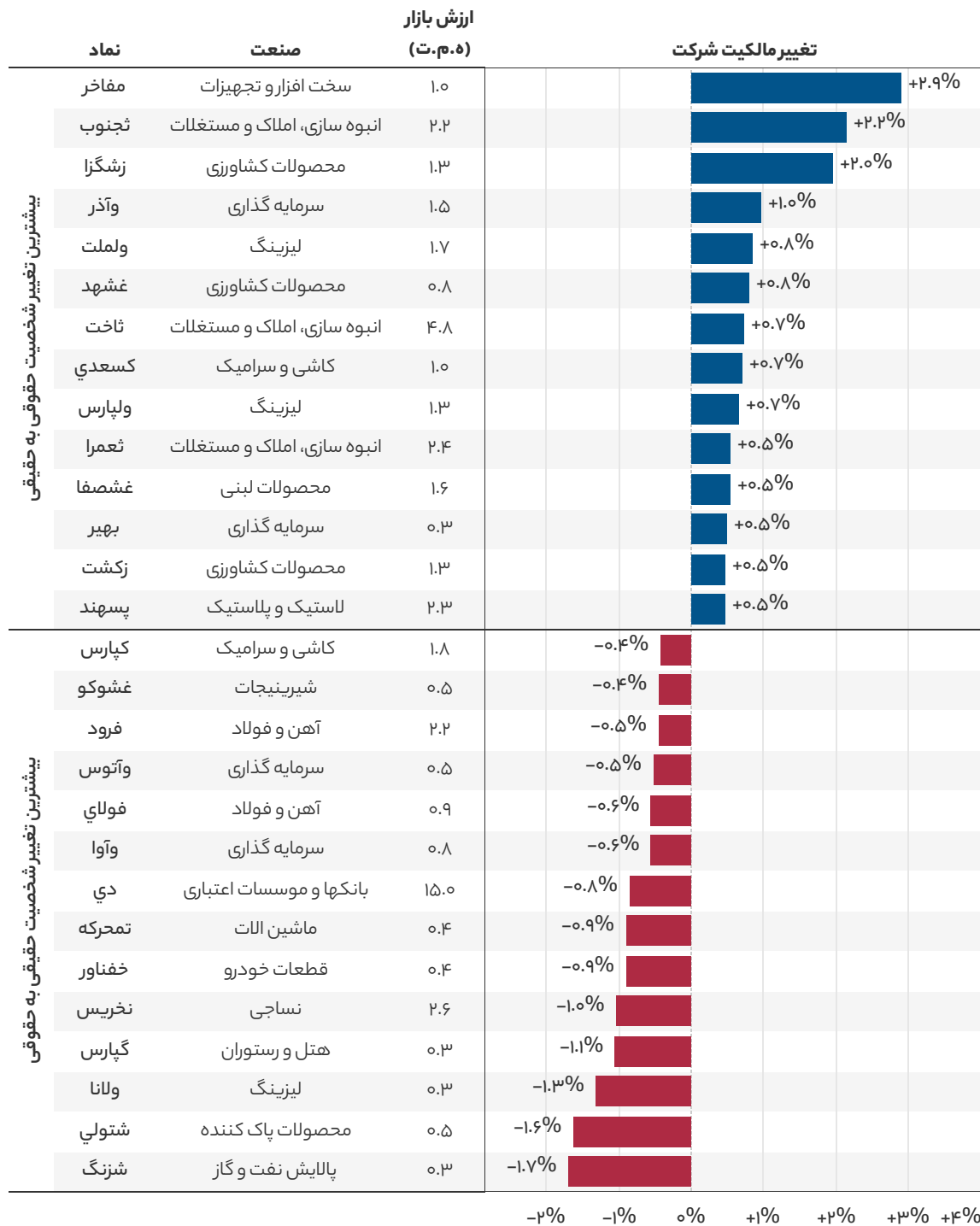
ورود و خروج پول حقیقی

طی دوره گذشته، میلیارد تومان، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان



تغییر مالکیت شرکت

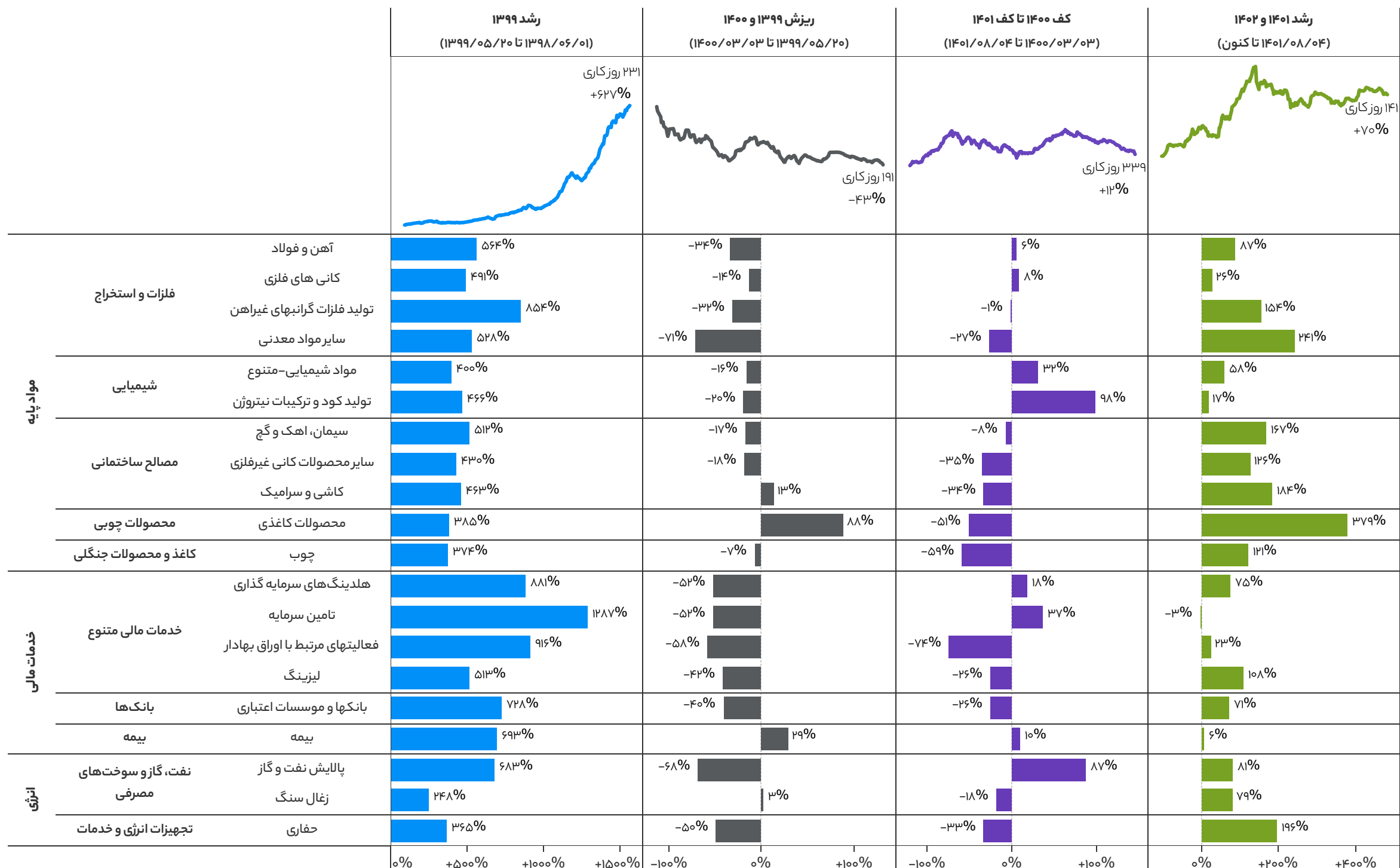
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان





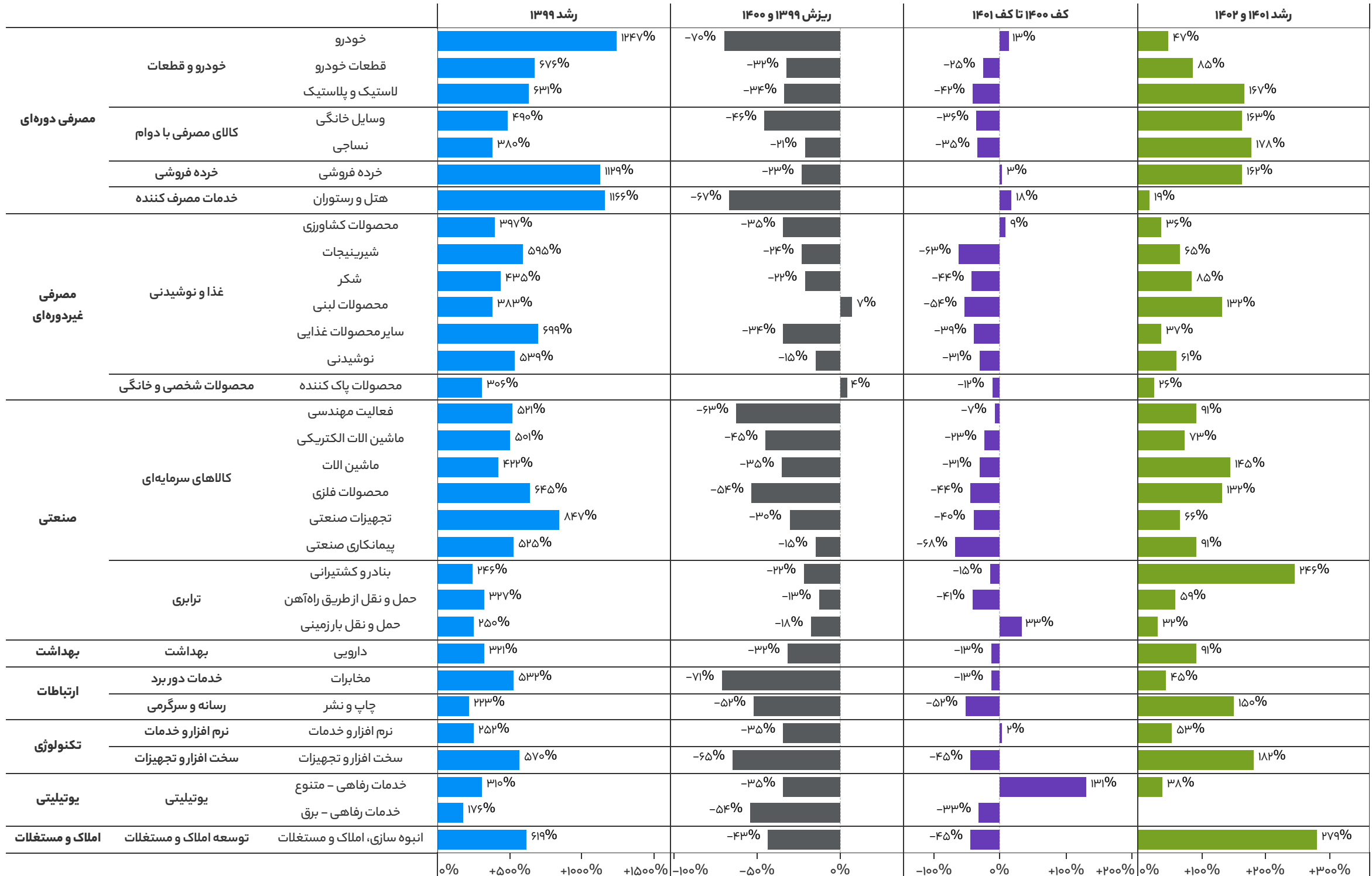
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۸، شاخص بورس ایران، بازدهی صنایع به تفکیک زیرگروه و سکتور، مرتب شده براساس ارزش بازار





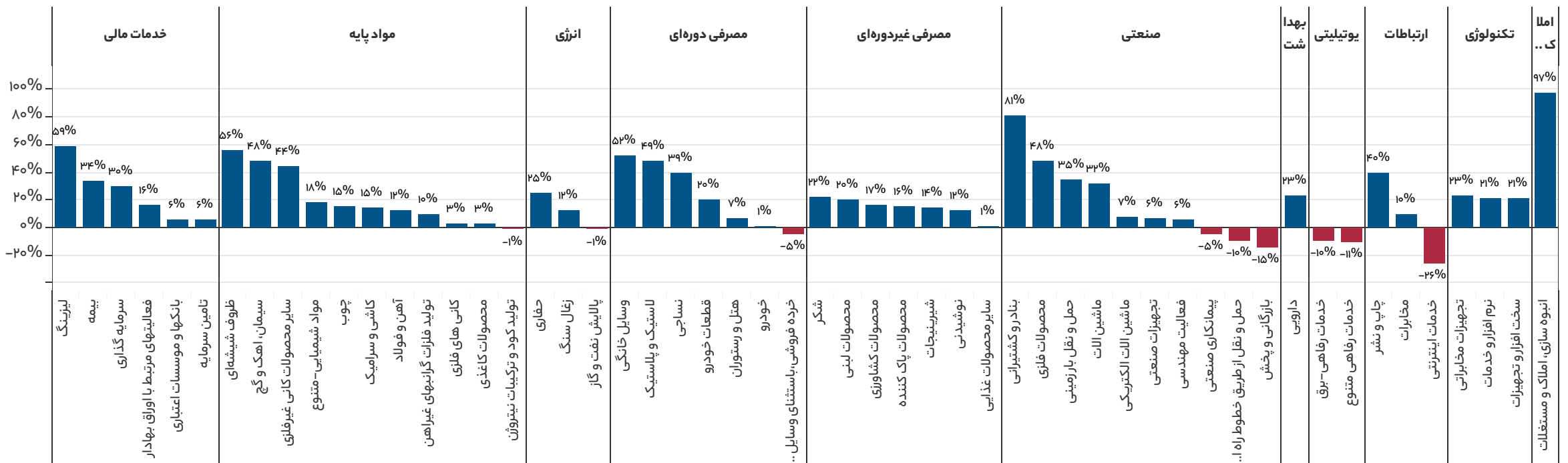
بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازده هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده است)

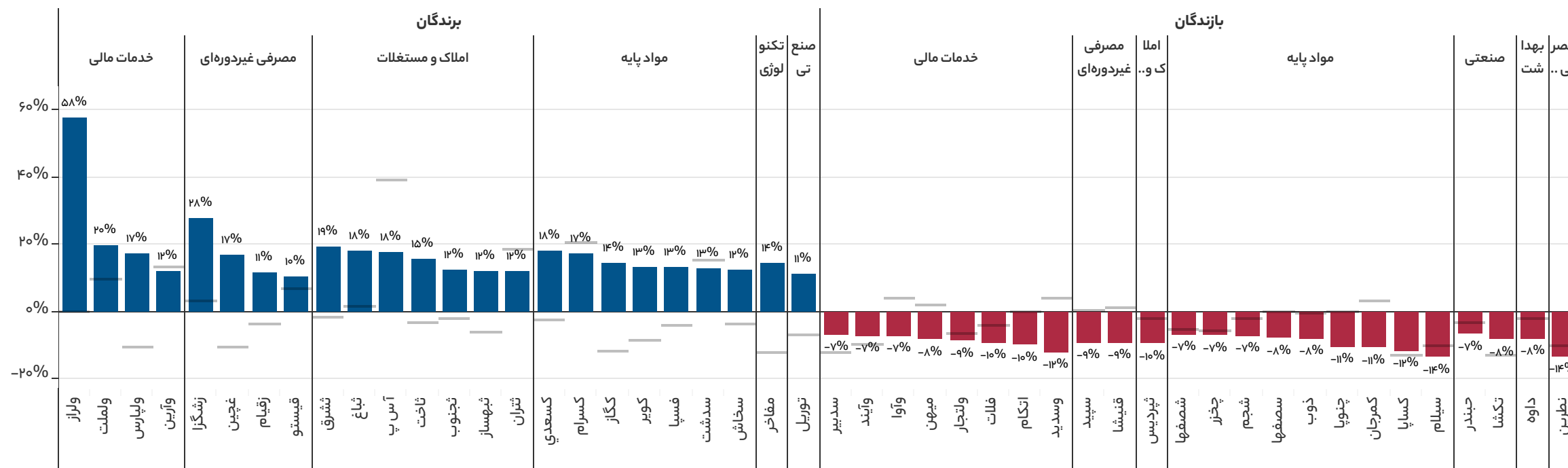


بازده صنایع از ابتدای سال (مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده)

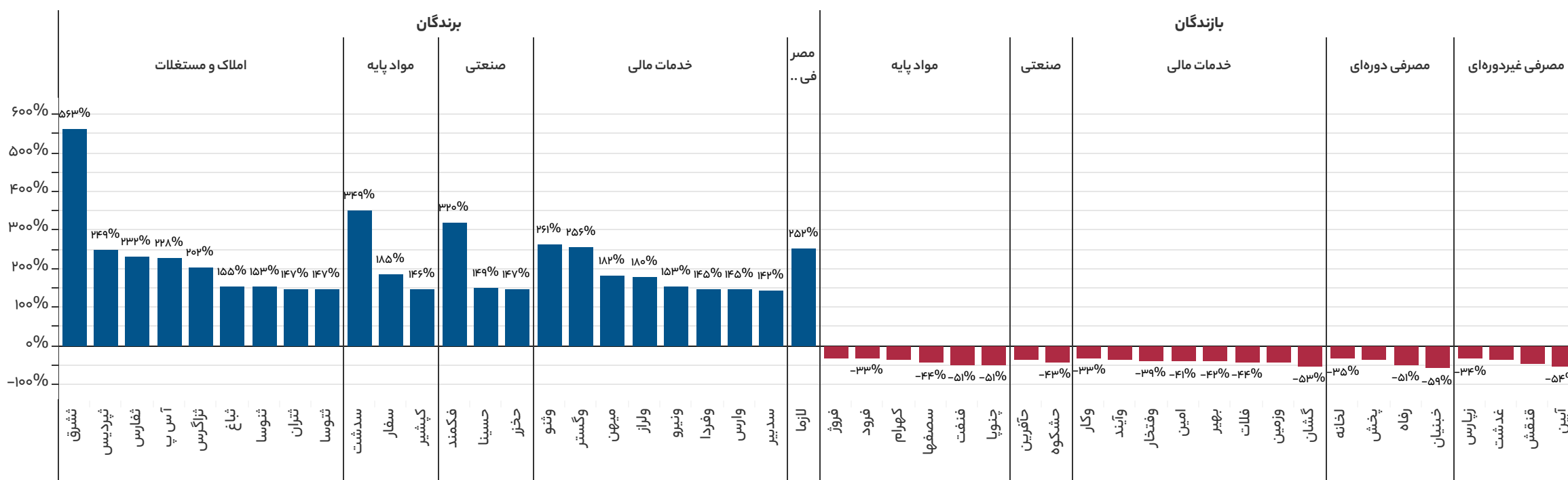


برندگان و بازندگان هفته

برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)

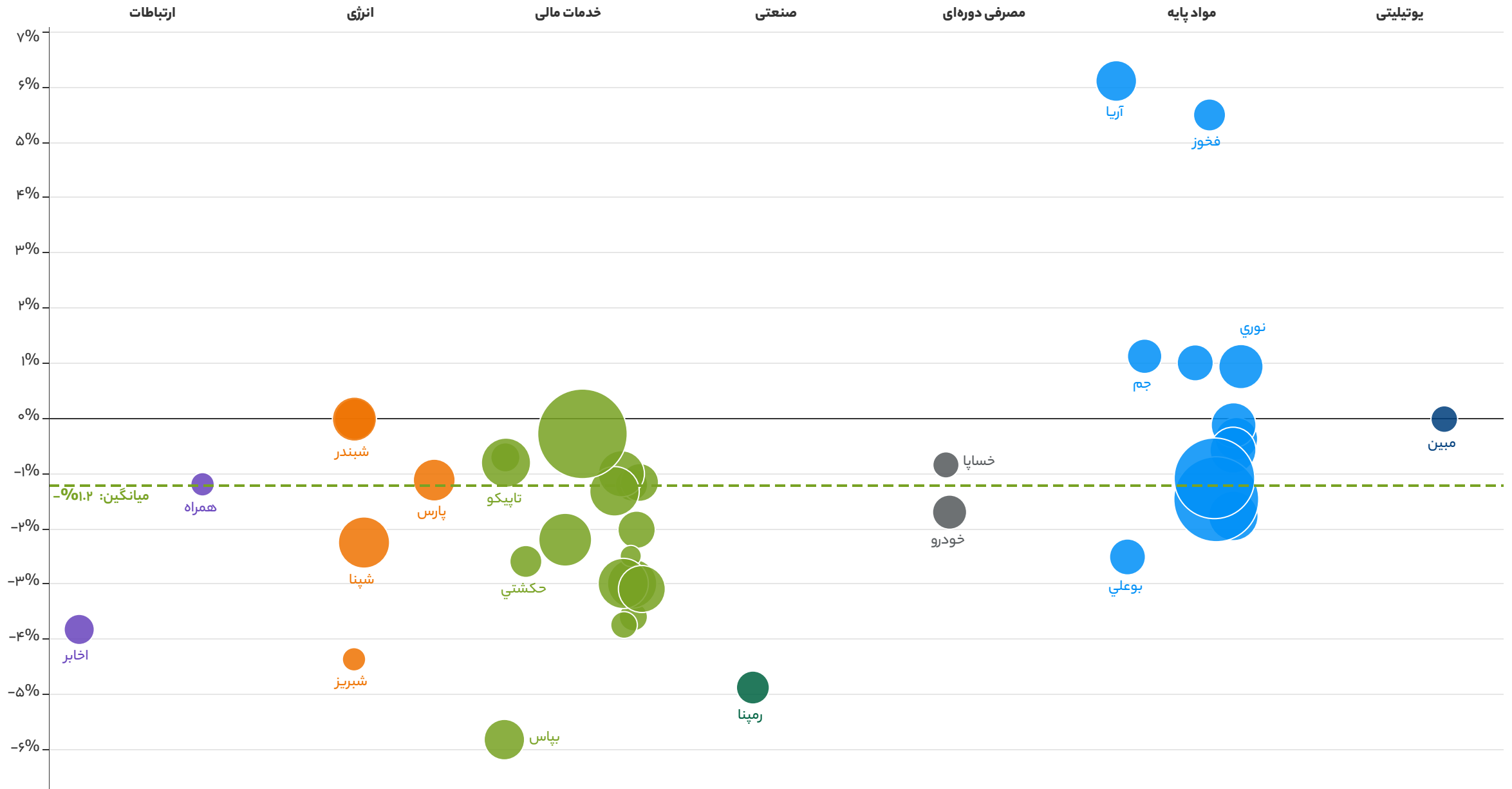


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

به تفکیک سکتور، بازده تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم

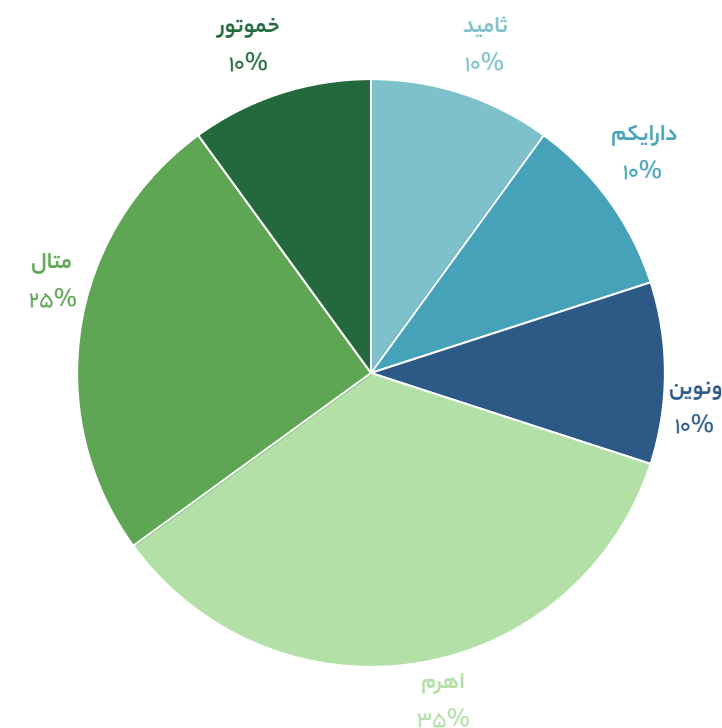


بازده هفته گذشته	آریا	فخوز	جم	شیدیس	نوری	شندر	شتان	مبین	کگهر	فارس	ماون	کچاد	تامیکو	تاپیکو	خسپا	وامید	فملی	پارس	وپاسار	همراه	وصندوق	میدکو	فولاد	خودرو	کگل	ومعادن	شتا	شینا	وسپهر	بوعلی	حکشتی	ویملت	وغدیر	پارسان	وکفدیر	وتجارت	اخابر	شبریز	رمپنا	پپاس
	+۶.۱٪	+۵.۵٪	+۱.۱٪	+۱.۰٪	+۱.۰٪	۰٪	۰٪	۰٪	-۰.۱٪	-۰.۳٪	-۰.۴٪	-۰.۶٪	-۰.۷٪	-۰.۸٪	-۰.۸٪	-۱.۰٪	-۱.۱٪	-۱.۱٪	-۱.۱٪	-۱.۲٪	-۱.۲٪	-۱.۳٪	-۱.۵٪	-۱.۷٪	-۱.۸٪	-۲.۰٪	-۲.۲٪	-۲.۲٪	-۲.۵٪	-۲.۵٪	-۲.۶٪	-۳.۰٪	-۳.۰٪	-۳.۱٪	-۳.۶٪	-۳.۷٪	-۳.۸٪	-۴.۴٪	-۴.۹٪	-۵.۸٪



سبد پيشنهادهي كاريزما

تهيه شده توسط تيم حرفه‌اي سبدگرداني كاريزما



وزن پيشنهادهي	قيمت سهم	توضيحات	هدف قيمتي	نماد	افق زماني
۱۰%	۳,۷۸۸	افزايش ظرفيت و نسبت قيمت به خالص ارزش دارايي مناسب به صنعت (P/NAV)	۴,۸۰۰	خمتور	
۲۵%	۱۰,۹۷۰	دارا بودن پرتفوي متنوع و پتانسيل رشد	-	متال	ميان مدت
۳۵%	۲۱,۱۸۰	دارا بودن پرتفوي متنوع و پتانسيل رشد	-	اھرم	
۱۰%	۲,۲۸۸	نسبت قيمت به خالص ارزش دارايي (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۹۰۰	ثاميد	
۱۰%	۱۶۷,۸۲۰	پايين بودن نسبت قيمت به خالص ارزش دارايي (P/NAV) و پتانسيل رشد	۲۱۰,۰۰۰	دارايكم	بلند مدت
۱۰%	۶,۰۶۰	نسبت قيمت به خالص ارزش دارايي (P/NAV) مناسب	۷,۸۰۰	ونوين	

ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

[@CharismaHolding](https://www.instagram.com/CharismaHolding)

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

[@CharismaTickReports](https://www.instagram.com/CharismaTickReports)

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، کوچه حکیم اعظم، پلاک ۱۷

