

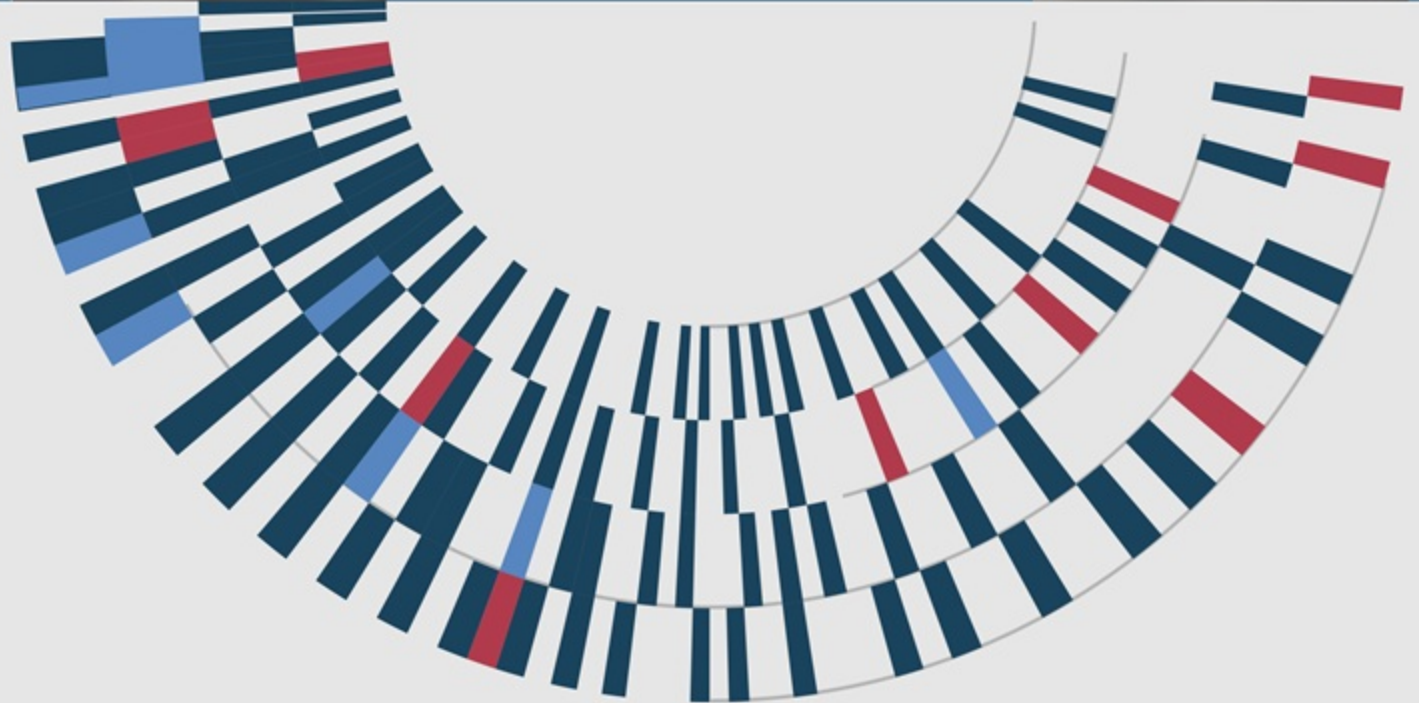
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۷ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۲۰

 CHARISMA





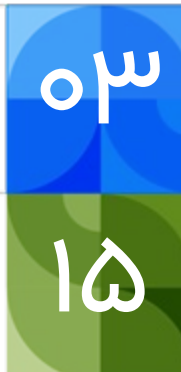
معرفی گزارش:

گزارش کاریزماتیک بازار سرمایه توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما با همکاری شرکت سرمایه‌گذاری کاریزما 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 کاریزما 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 کاریزما 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 کاریزما 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 کاریزما در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

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



کامودیتی

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

بازار سهام

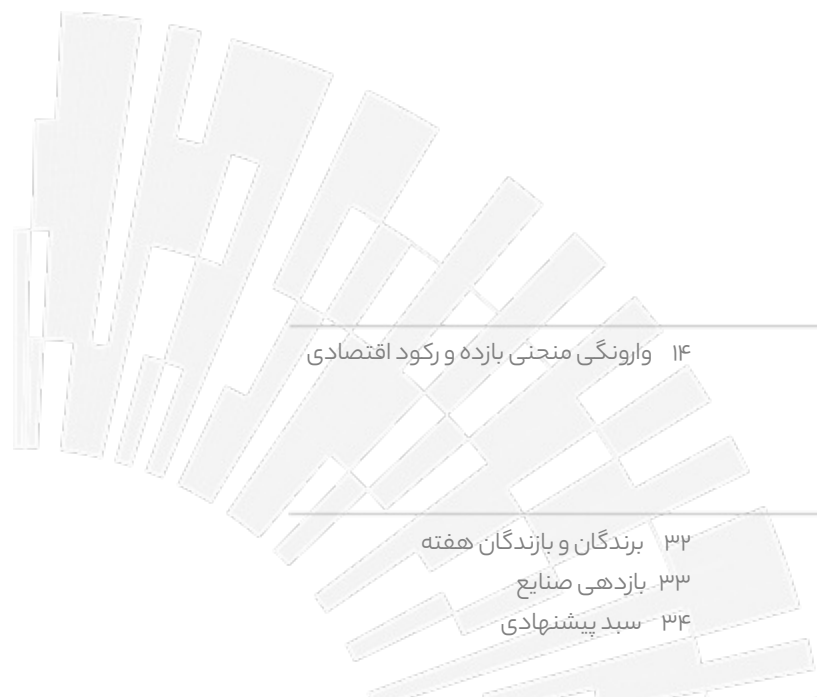
- ۱۶ مروری بر بازارهای موازی
- ۱۸ بررسی بلندمدت بازار سهام
- ۲۰ نرخ بهره و رونق بازار سهام
- ۲۱ ارزش معاملات

- 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

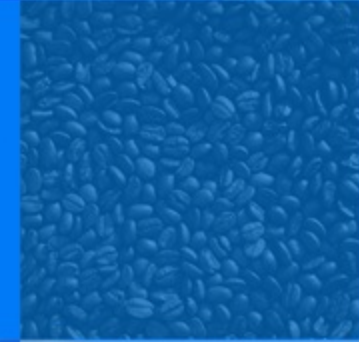
- ۳۲ برندگان و بازندگان هفته
- ۳۳ بازدهی صنایع
- ۳۴ سبد پیشنهادی



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				-	فرز		-۰.۶%	۲,۰۲۶	دلار/انس	بازار فارکس	طلا
				بموتو، فباهنر	فملی		-۳.۴%	۸,۱۸۴	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس
				بموتو، فباهنر	فملی		+۳.۹%	۳۹۵,۲۴۱	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)
				فنوال	فایرا		+۰.۳%	۲,۲۲۱	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم
				فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما		-۶.۴%	۲,۲۹۸	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی
فلزات آهنی				-	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما		-۴.۸%	۲,۰۴۵	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب
				کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان		+۰.۴%	۵۰۰	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)
				کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان		-۰.۶%	۵۲۱	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش CIS (منطقه)
				کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق		-۲.۱%	۲۰,۲۰۲	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	شمش (فولاد خوزستان)
				-	فولاد، فخوز، هرمز		+۱.۵%	۴۹۵	دلار/تن	بنادر ایران FOB	اسلب (ایران)
				-	فولاد، فخوز، هرمز		-	۵۴۸	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب CIS (منطقه)
				-	فولاد، فخوز، هرمز		+۲.۶%	۲۲,۷۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)
				فولای	ذوب، کویر		-	۶۱۸	دلار/تن	بنادر ترکیه FOB	میلگرد
				فولای	ذوب، کویر		-۰.۶%	۲۲,۰۱۵	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)
				فجر، فسپا	فولاد، فوکا، فنورد		+۱.۰%	۶۰۴	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم
				-	فولاد		+۲.۹%	۷۱۸	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			۲%		۱۴۳ ۱۰۱	-	-	-	-	-۲.۷%	۱۲۹	دلار/تن	شمال چین CFR	سنگ آهن
			-۱%		۱۶۴ ۱۱۹	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			-۳.۷%	۱۵۲	دلار/تن	شمال چین CFR	گندله سنگ آهن
			۲۴%		۳,۸۱۵ ۴,۸۴۳	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			+۰.۵%	۴,۸۱۸	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			-۴.۰%	۱۴۰	دلار/تن	شمال چین CFR	کنسانتره سنگ آهن
			۲۲%		۲,۹۷۷ ۳,۶۳۶	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			+۱.۰%	۳,۶۳۶	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی			-۱۵%		۲۹۰ ۱۹۹	-	-	-	-	-۰.۷%	۲۲۰	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
			-۳۴%		۲۶۸ ۱۶۹	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-	-	-۲.۸%	۱۶۹	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
			-۱%		۱,۷۱۶ ۱,۱۹۷	-	-	-	-	+۸.۹%	۱,۳۵۸	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
			-۱۳%		۷۲۸ ۹۶۸	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-	-	+۱.۷%	۸۰۵	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	اوره	دلار/تن			شپدیس، خراسان، شیراز، کرماش	شاروم، شفارس		
	متانول	دلار/تن	۲۹۲	+۱.۷%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵۳۲۶	-۱۵%
	اتیلن	دلار/تن	۹۵۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰۹۸۰	-۲%
	پروپیلن	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۵	-۱۱%
	پارازایلن	دلار/تن	۱,۰۱۷	+۰.۴%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴۱,۱۵۸	۰%
	ارتوزایلن	دلار/تن	۱,۰۰۵	-۱.۰%	شصفها، نوری	-	۹۴۰۱,۱۸۰	-۱۴%
	استایرن	دلار/تن	۱,۱۲۵	+۵.۴%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱,۱۶۸	۱%
	بنزن	دلار/تن	۱,۰۴۳	+۴.۶%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۱,۰۴۳	۹%
	تولوئن	دلار/تن	۸۹۰	+۳.۴%	بوعلی	-	۸۰۱۸۹۰	
	بوتادین	دلار/تن	۱,۲۰۰	+۳.۴%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰۱,۲۴۰	-۳%
پلیمرها	مونواتیلن گلایکول	دلار/تن	۵۴۳	-۲.۲%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰۵۵۶	۳%
	پلی اتیلن سبک	دلار/تن	۱,۰۱۸	-۰.۲%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱,۰۸۱	-۵%
	پلی اتیلن سنگین	دلار/تن	۹۳۳	-۰.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵۱,۰۱۱	-۶%
	پلی اتیلن سبک خطی	دلار/تن	۹۲۳	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱۱,۰۰۹	-۶%
	پلی پروپیلن	دلار/تن	۸۵۳	+۰.۲%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰۹۵۲	-۸%
	PET	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰۱,۱۰۰	-۱۱%
	PVC	دلار/تن	۷۷۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰۹۱۵	-۱۵%
	ABS	دلار/تن	۱,۳۰۰	+۱.۶%	شبصیر	-	۱,۲۳۰۱,۴۲۰	-۷%



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	-۵.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۳	-۲۲%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۰	-۴۹%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۱	-۲.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۴۹%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۲۹	-۸.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۶۱	-۴۳%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۸	-۵.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۴۵%

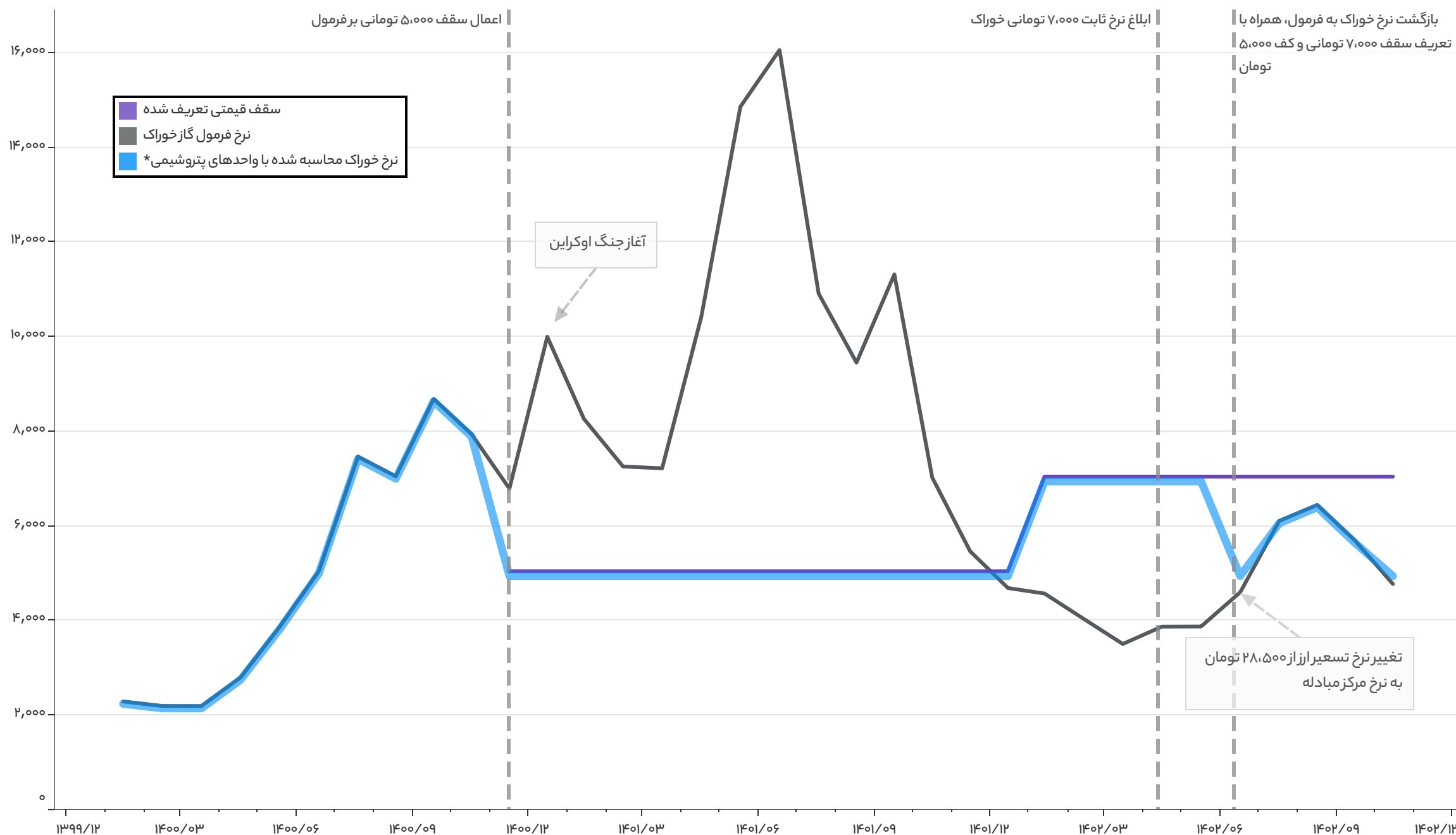
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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

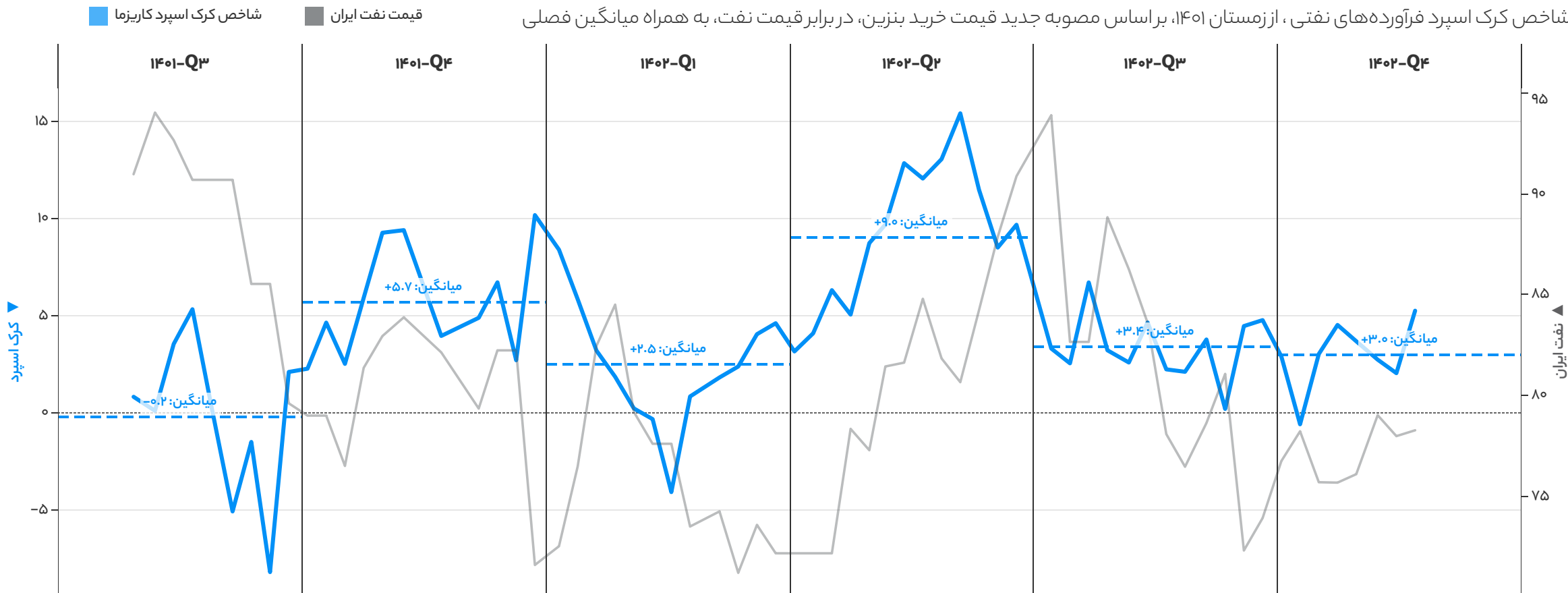


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بروز رسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.



شاخص کرک اسپرد کاریزما*

شاخص کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی، از زمستان ۱۴۰۱، براساس مصوبه جدید قیمت خرید بنزین، در برابر قیمت نفت، به همراه میانگین فصلی



فرآورده	قیمت (دلار) هفته گزارش	کرک اسپرد (دلار)			میانگین فصلی کرک اسپرد (دلار)			آخرین وضعیت اسپرد (در برابر میانگین فصل جاری و فصل گذشته، دلار)		
		هفته گذشته	هفته گزارش	تغییر (واحد)	فصل گذشته	فصل جاری	رشد میانگین فصل	آخرین وضعیت	میانگین فصل گذشته	میانگین فصل جاری
نفت ایران	۷۸.۳									
گازوئیل	۱۰۲.۷	۱۹.۸	۲۴.۴	▲۴.۶	۲۳.۲	۲۰.۳	-۱۲.۵%			
بنزین**	۸۶.۹	۴.۵	۸.۶	▲۴.۲	۱.۱	۴.۶	+۳۱۵.۵%			
نفتا	۶۹.۰	-۱۵.۲	-۹.۳	▲۵.۹	-۱۲.۳	-۹.۸	+۲۰.۸%			
نفت کوره	۶۴.۱	-۱۷.۲	-۱۴.۲	▲۳.۰	-۱۵.۲	-۱۳.۸	+۹.۲%			
لوب کات***	۶۹.۲	-۸.۹	-۹.۱	▼۰.۳	-۲.۹	-۷.۸	-۱۶۹.۱%			
وکیوم باتوم***	۴۷.۸	-۳۰.۷	-۳۰.۵	▲۰.۲	-۲۸.۵	-۳۱.۰	-۸.۶%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۲.۱	۵.۳	▲۳.۲	۳.۴	۳.۰	-۱۲.۶%			

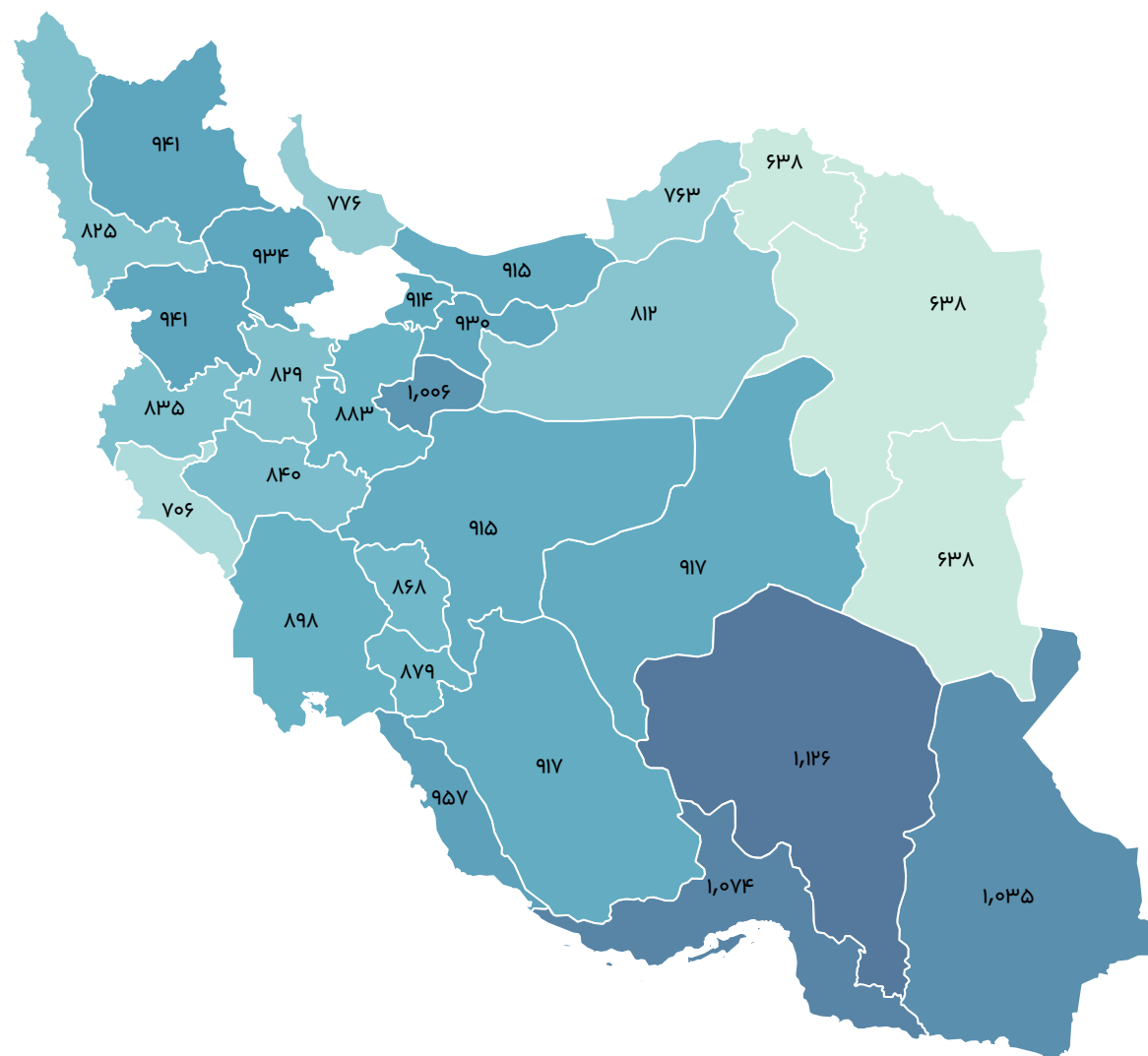
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هریک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن دهی، از روش میانگین موزون و براساس ارزش بازار هریک از این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

** قیمت بنزین براساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شندر، 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.

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

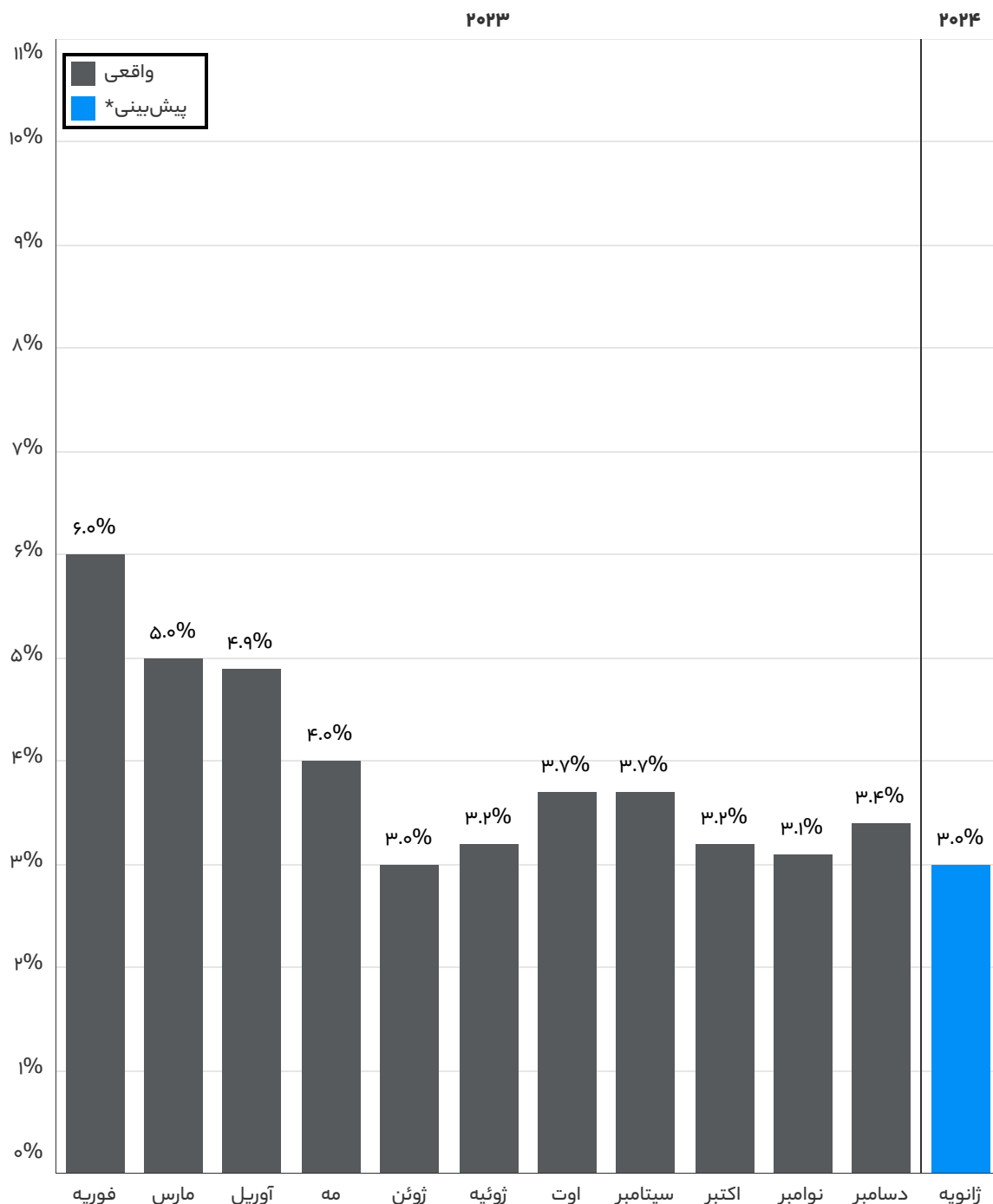
منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۸۸۳	-
	تهران	سیمان تهران	۹۴۹	۹۳۰	-۲.۱%
	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیما..	۸۴۶	۹۱۷	+۸.۴%
	قم	سیمان نیزار قم	۱,۰۳۶	۱,۰۰۶	-۲.۹%
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
غرب	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۸۹۸	-
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۱۹	۷۰۶	-۱.۸%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۶۸	۸۶۸	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۴۲	۸۳۵	-۰.۸%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۸۷۹	-
	لرستان	سیمان دورود	۸۴۰	۸۴۰	-
شمال	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۴۱	-
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
	گیلان	سیمان خزر	۷۷۳	۷۷۶	+۰.۴%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۶۳	۷۶۳	-
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۰۷۷	۱,۰۷۴	-۰.۳%
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۱۷	-
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۶۹	۹۵۷	-۱.۳%
شمال غرب	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۹۵۰		
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۴۳	۹۴۱	-۰.۲%
شمال شرق	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۱۵	۸۲۵	+۱.۲%
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
جنوب شرق	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۳۸	-
	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۷۸	۱,۱۲۶	+۱۵.۲%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۷۴	۱,۰۳۵	+۶.۳%

* قیمت سیمان بر اساس سیمان تیپ 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، عصر روز جمعه ۱۳ بهمن ماه، گزارش بهتر از حد انتظار لیست حقوق بگیران بخش غیرکشاورزی در آمریکا شاخص دلار را به شدت افزایش داد و سود اوراق قرضه خزانه داری این کشور را نیز بالا برد و باعث افت ۲۵ دلاری قیمت جهانی طلا شد. با وجود این که طی هفته های اخیر نوسانات طلا بالا بوده اما در هفته گذشته قیمت طلا نوسانات بالایی را تجربه نکرده و از ۲۰۳۵ تا ۲۰۲۵ در نوسان بوده است.
- بر اساس شیوه نامه نحوه برگزاری حراج حضوری شمش طلای استاندارد در مرکز مبادله ارز و طلای ایران، پنجمین جلسه حراج شمش طلای استاندارد در روز یکشنبه مورخ ۱۵ بهمن ماه ۱۴۰۲، انجام شد که وجه الضمان هر قطعه شمش طلای استاندارد ۳۵۰ میلیون تومان بود. در این جلسه در مجموع ۱۱۲ شمش یک کیلویی عرضه و از این تعداد ۹۴ شمش مورد معامله قرار گرفت. متوسط قیمت شمش در این حراج سه میلیارد و ۵۳۵ میلیون تومان بود. سخنگوی مرکز مبادله ارز و طلا گفت: در کمتر از ۲۰ روز گذشته ۲۰۰ کیلوگرم شمش طلا طی پنج مرحله حراج در مرکز مبادله ایران به فروش رسیده که تاثیر آن در کنترل بازارهای طلا و ارز نمایان شده است.
- احسان خاندوزی وزیر اقتصاد در پاسخ به مطرح شدن ابهاماتی در خصوص مسدود شدن حساب ۴۰۰ طلا فروش در روزهای گذشته گفت: این نکته ای که اشاره شد، محدود کردن ابزارهای کارکسبه و فعالان اقتصادی به شمار می رود که درست نیست، این گونه اقدامات محدودکننده باید آخرین مرحله ای باشد که پس از هشدارها اعمال شود. خاندوزی در خاتمه گفت: درباره آن تعدادی که به هر دلیل و اتهام حسابشان مسدود شده، دستگاه نظارتی تعیین تکلیف کند تا گره از کار آن ها باز شود.
- ▲ به گزارش رویترز، قیمت نفت حدود ۲ درصد در روز جمعه ۱۳ بهمن کاهش یافت و به پایین ترین سطح از ۱۸ ژانویه رسید و یک کاهش قیمت هفتگی را هم پس از انتشار اطلاعات اقتصادی آمریکا تجربه کرد اما در هفته گذشته روند صعودی را تجربه کرد و طی هفته از قیمت ۷۷ دلار تا بیش از ۸۱ دلار معامله شد.
- هیثم الغیس، دبیرکل اوپک که در هفته انرژی هند در گوا صحبت کرد، اعلام کرد تقاضا برای نفت، همچنان به رشد خود ادامه خواهد داد و ضرورت تامین حفظ عرضه وجود دارد. وی افزود: در سطح جهانی، تقاضا برای انرژی از هم اکنون تا سال ۲۰۴۵، به میزان ۲۳ درصد افزایش خواهد یافت. در واقع اگر کشورهای تولیدکننده به دنبال تامین نیازهای جهانی انرژی تا سال ۲۰۴۵ باشند، بازار جهانی نفت ظرف مدت ۲۰ سال آینده به ۱۴ تریلیون دلار سرمایه گذاری نیاز دارد.
- ▲ واردات نفت هند از روسیه در پی تشدید تحریم های غربی، در ژانویه، برای دومین ماه متوالی کاهش یافت و به پایین ترین میزان در یک سال گذشته رسید. داده های اولیه رصد کشتی ها نشان داد هند که سومین واردکننده بزرگ و مصرف کننده بزرگ نفت در جهان است، برای جبران کاهش واردات نفت از روسیه، واردات از عراق را افزایش داد. طبق داده های شرکت مالی LSEG، واردات نفت از روسیه در ژانویه، با ۴.۲ درصد کاهش، به ۱.۳ میلیون بشکه در روز رسید. داده های شرکت تحلیل داده ورتکسا، کاهش ۹ درصدی واردات، به ۱.۲ میلیون بشکه در روز را نشان داد.
- ▼ مصطفی ناظمی، کارشناس انرژی درباره نرخ نامه فرآورده و نفت خام پالایشگاه ها که به تازگی اعلام شده است، گفت: هنوز مشخص نیست که چرا در نرخ نامه های قبلی فوب سنگاپور مدنظر قرار می گرفت. نرخ نامه های سنگاپور با توجه به هزینه های حمل و نقل که در آنجا وجود دارد و همچنین این موضوع که بنزین با کیفیت بالاتری در آنجا عرضه می شود، قابل مقایسه با فرآورده هایی که در ایران و خاورمیانه تولید می شود، نیست. با این کار عملاً یک مشوق نامشخص به پالایشگاه ها می دادیم اما امسال دولت با دید منصفانه تری به نرخ گذاری پرداخته و نرخ هایی که در نزدیک ترین مبداء رسمی کشور وجود دارد، یعنی خلیج فارس مدنظر قرار گرفته است و خرید فرآورده پالایشگاه ها با نرخ فوب سنگاپور فقط در صورت ارتقای کیفیت صورت می گیرد.
- ▲ ولی اله جعفری، مدیر نظارت بر ناشران سازمان بورس و اوراق بهادار در گفت و گو با خبرنگار پایگاه خبری بازار سرمایه ایران (سنا)، گفت: پس از ابلاغ مصوبه مورخ ۲۱ تیر ماه ۱۴۰۲ عوارض صادراتی محصولات خام و نیمه خام و افزایش چند برابری نرخ عوارض و در نتیجه تاثیر کاهنده آن بر سودآوری شرکت ها، این سازمان اقدام به پیگیری از مراجع ذیصلاح مبنی بر بازنگری در مصوبه یاد شده کرد. وی افزود: متعاقب پیگیری های انجام شده، اخیراً کمیسیون اقتصادی دولت و هیات دولت اقدام به بازنگری در نرخ عوارض صادراتی محصولات خام و نیمه خام و کاهش آن کرده است.
- به گزارش انجمن غلات ایران، در این نامه که خطاب به وزیر جهاد کشاورزی ارسال شده، پیشنهاد شده که برای حمایت از تولید داخل و کارخانجات روغن کشی، دانه سویا در فهرست تهاثر نفت قرار گیرد. پیش از این قائم مقام وزیر جهاد کشاورزی در امور تجارت و تنظیم بازار، از انجام موفق ۲ مرحله تهاثر نفت با کالای اساسی خبر داده بود.

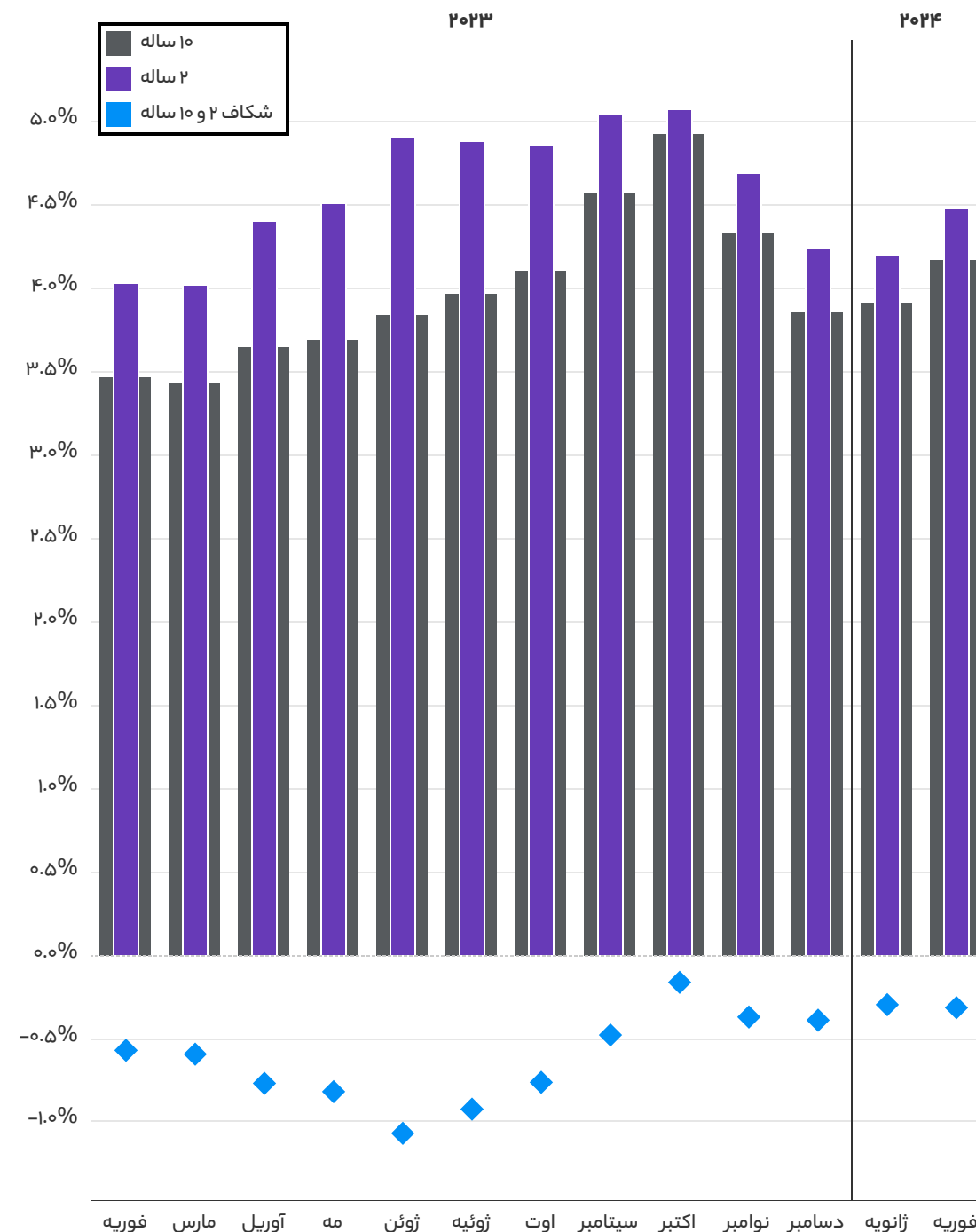
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

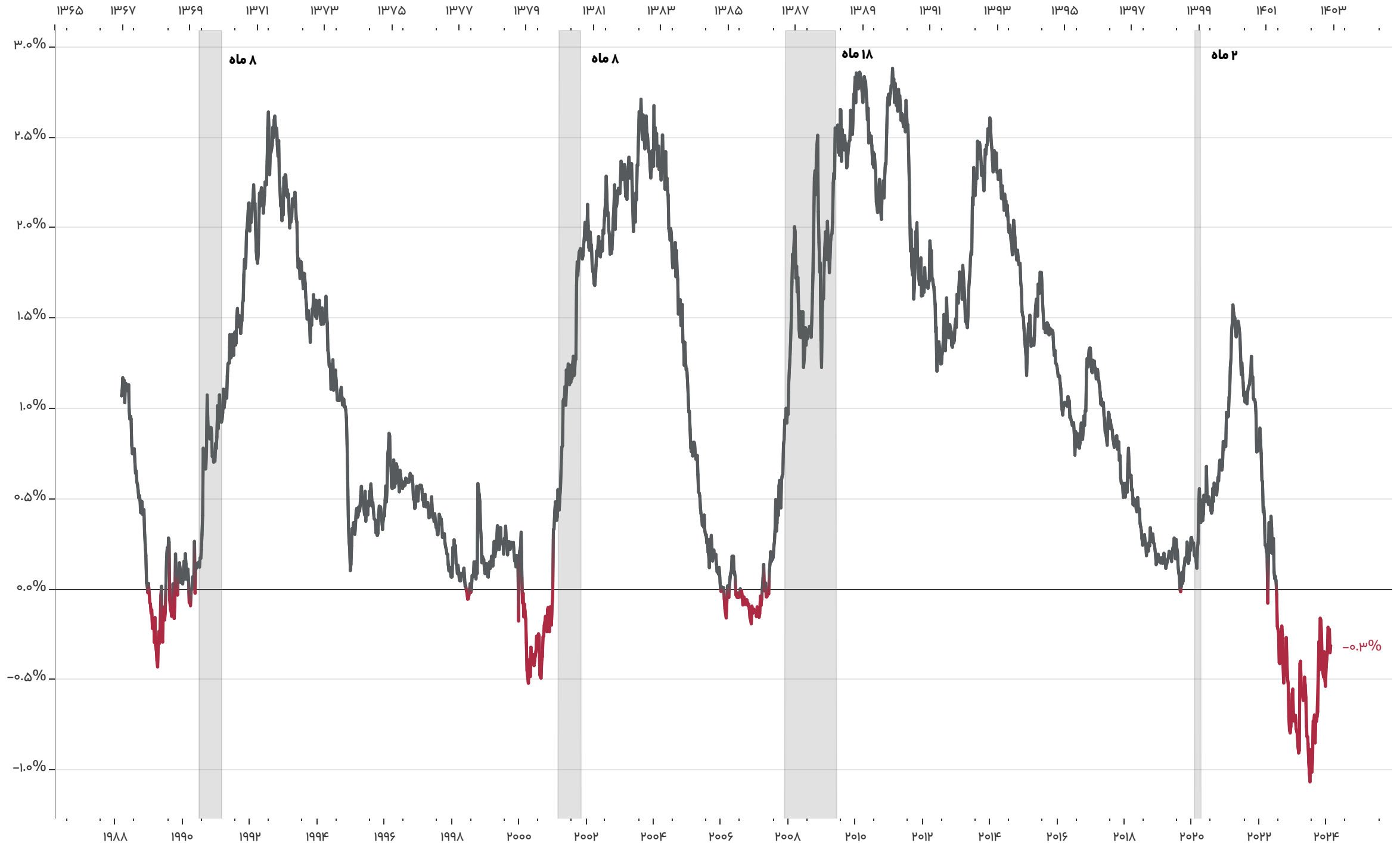
ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده





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

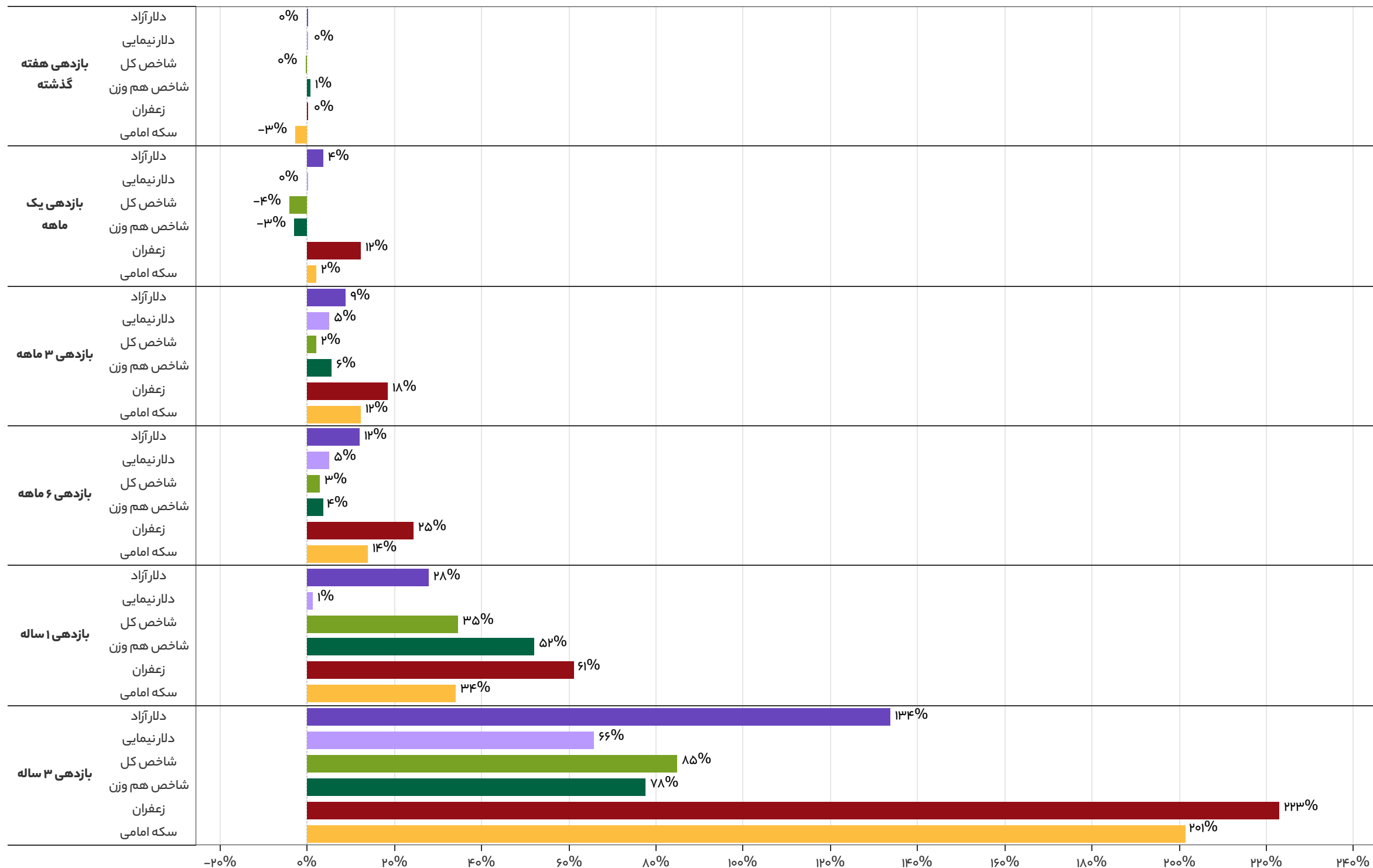
EQUITY MARKET

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 ▲ ۵۸.۲%	هم وزن ۴۲%
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 ▲ ۰.۰%	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 سحرخیز 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 کاربریما ذکر گردیده، استفاده شده است.



ارزش دلاری بازار

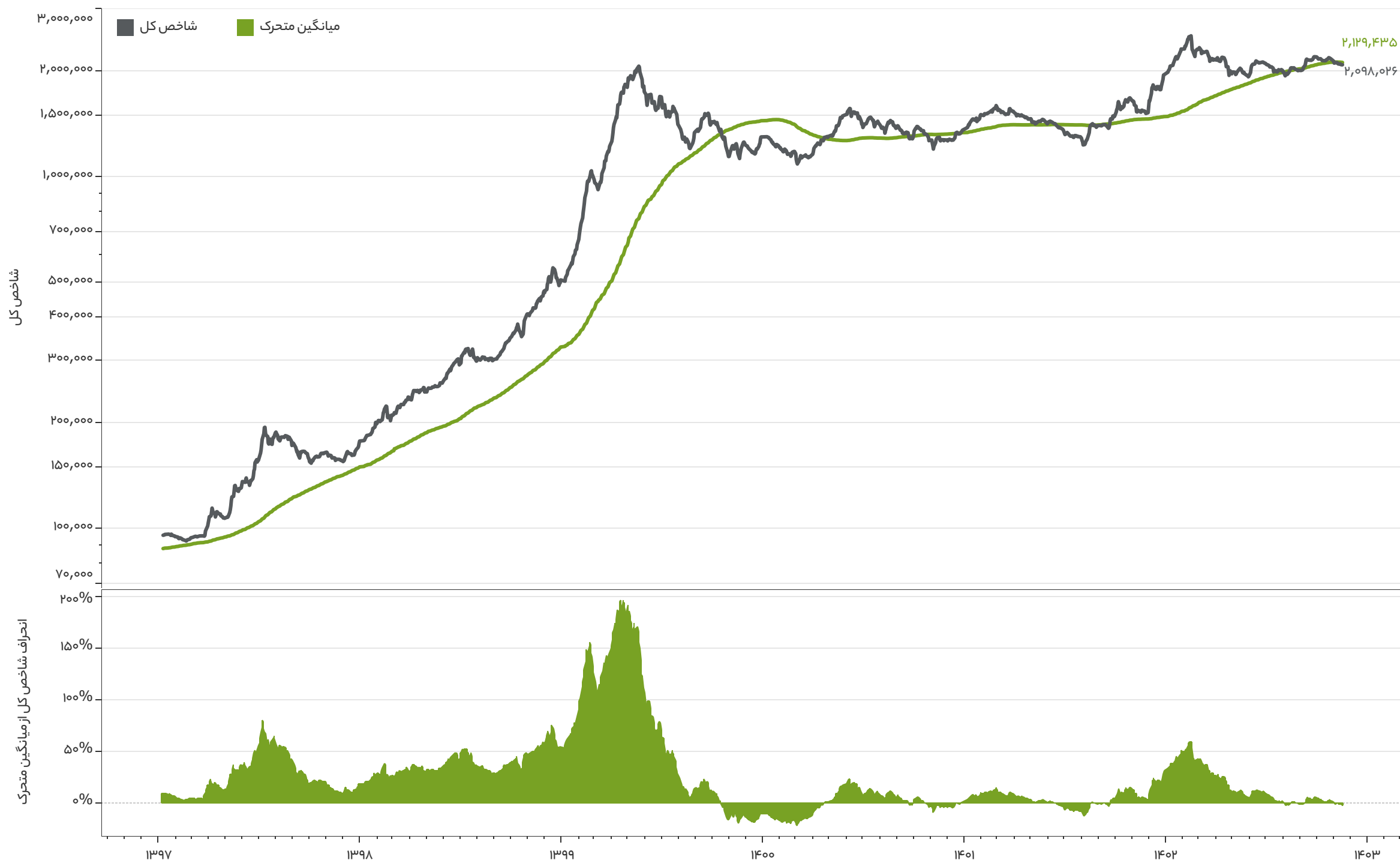
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





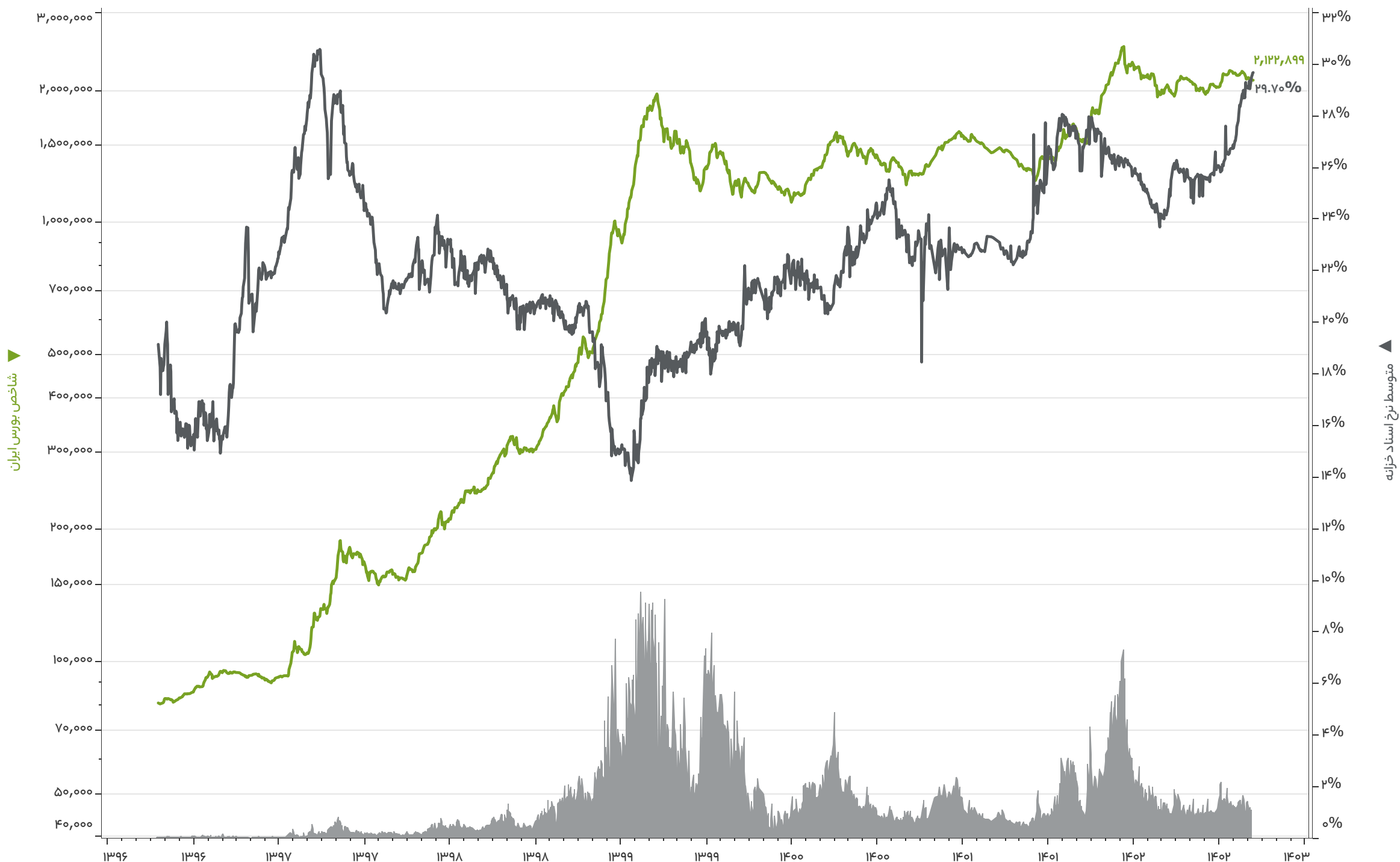
شاخص کل و میانگین متحرک

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



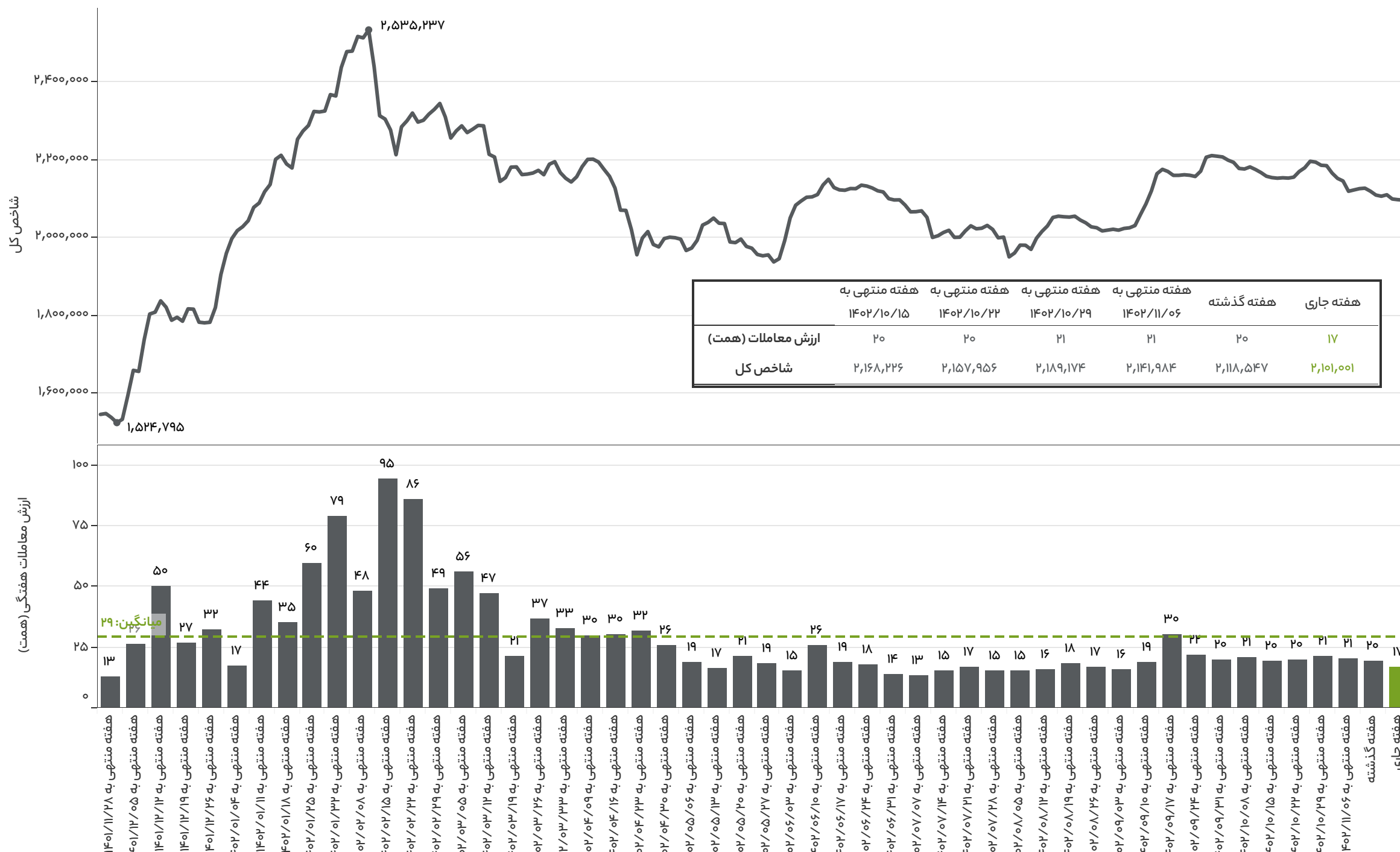
تأثير نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

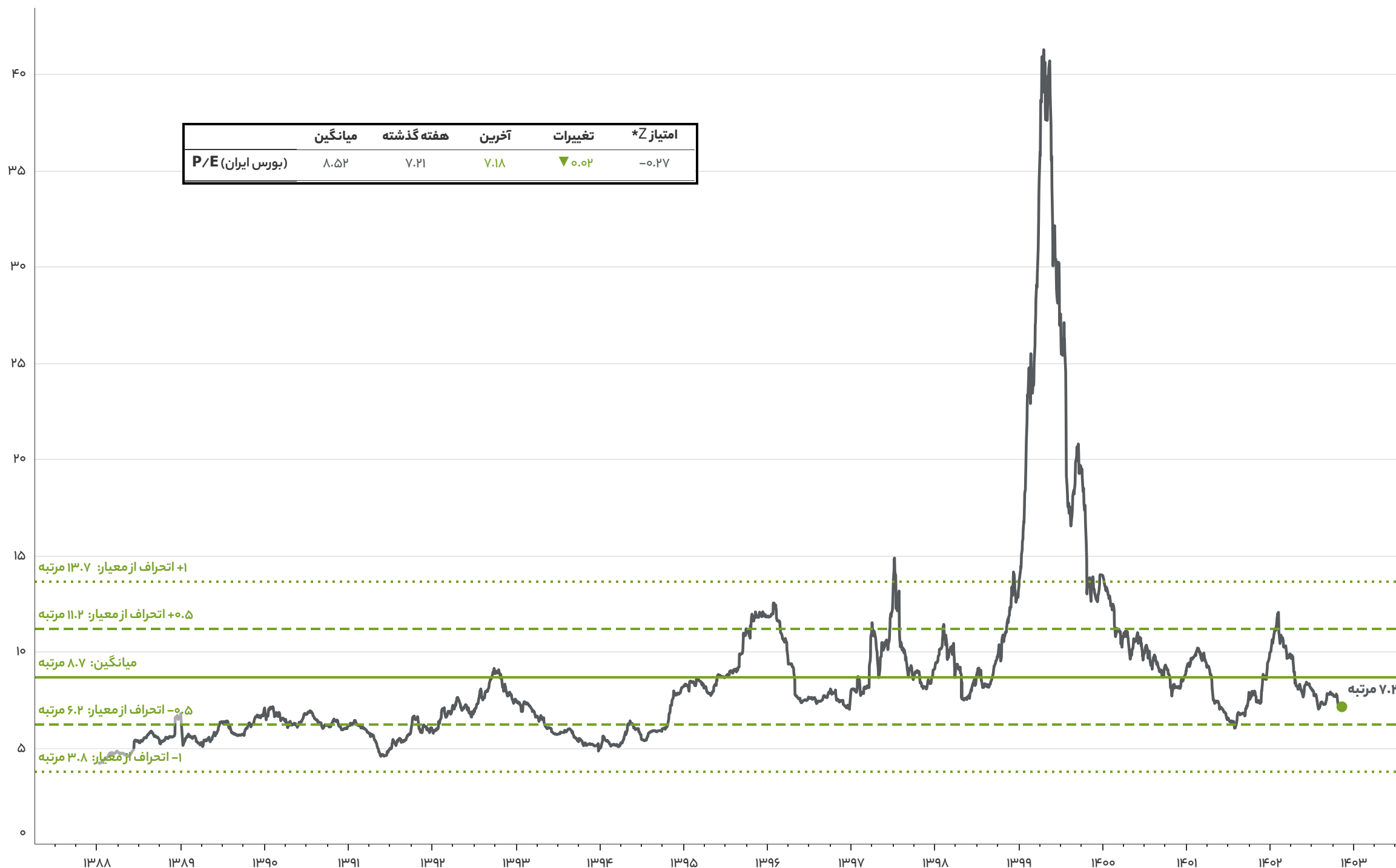


ارزش معاملات هفتگی بازار

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



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	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۱۸	۷.۲۱	۶.۵۷	۱۲.۷۲	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۸۹	۶.۹۱	۵.۶۴	۱۲.۵۰	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۱۳	۹.۲۲	۹.۰۳	۱۴.۹۴	۴۳.۵۱



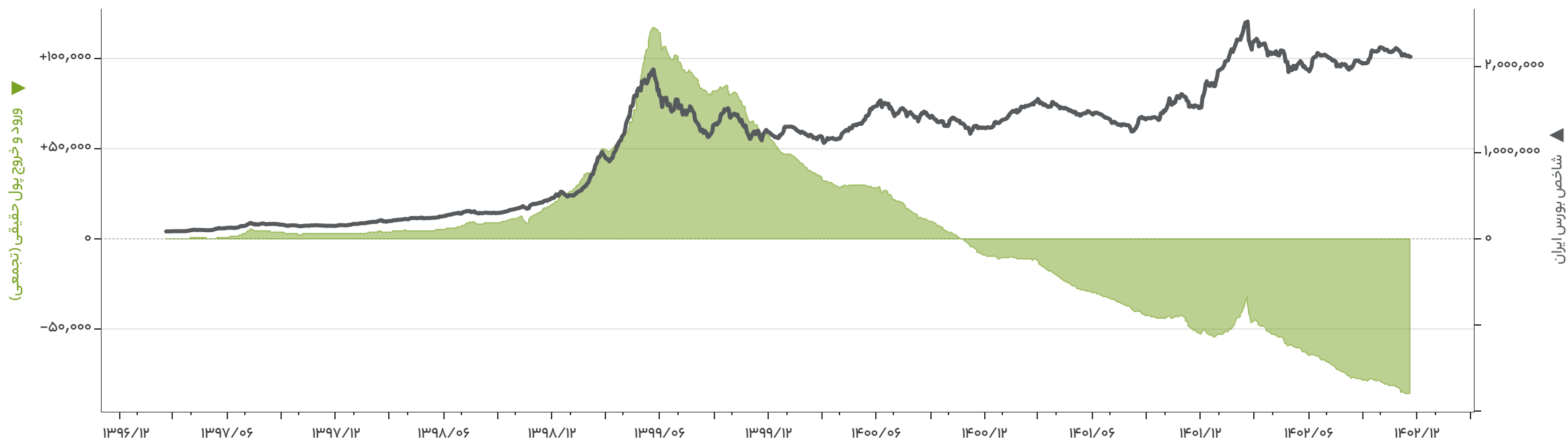
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

بازار سهام

	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)	۶۶	۸۶	۱۱۵	۱۱۸	۱۵۵	۱۹۵	۲۱۰	۳۸۰	۵۹۴	۳,۲۰۴	۳,۲۶۴	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۸%	۱.۰%	۱.۴%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۵%	۴.۵%	۷.۱%	۳۸.۲%	۳۸.۹%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۵.۱	۱۱.۸	۱۷.۵	۱۱.۷	۸.۹	۸.۷	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%	۴.۵%	۲.۳%	۱۵.۲%	۹.۲%	۹.۰%	
نسبت تقسیم سود	۳۹%	۱۰۰%	۵۸%	۴۱%	۷۶%	۳۸%	۵۳%	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)	+۷۸۱%	+۷۵۹%	+۲۹۶%	+۱۴۰%	+۳۸۱%	+۴۴۳%	+۴۲۵%	+۸۶۶%	+۷۶۲%	+۸۵۳%	+۹۲۴%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۲۳%	+۱۱۰%	۰%	-۶۲%	+۱۴%	-۶%	-۲%	-۱۱%	+۱۲%	۰%	+۶۰%	
بازده از ابتدای سال	+۲۹۴%	+۳۹%	+۷۱%	+۵۴%	+۹۲%	+۱۱۱%	+۵۴%	+۹۴%	+۸۳%	+۶۷%	+۸۰%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۴%	۰%	۰%	۵%	۱%	۲%	۱%	۱%	۰%	-۱%	-۱%	

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



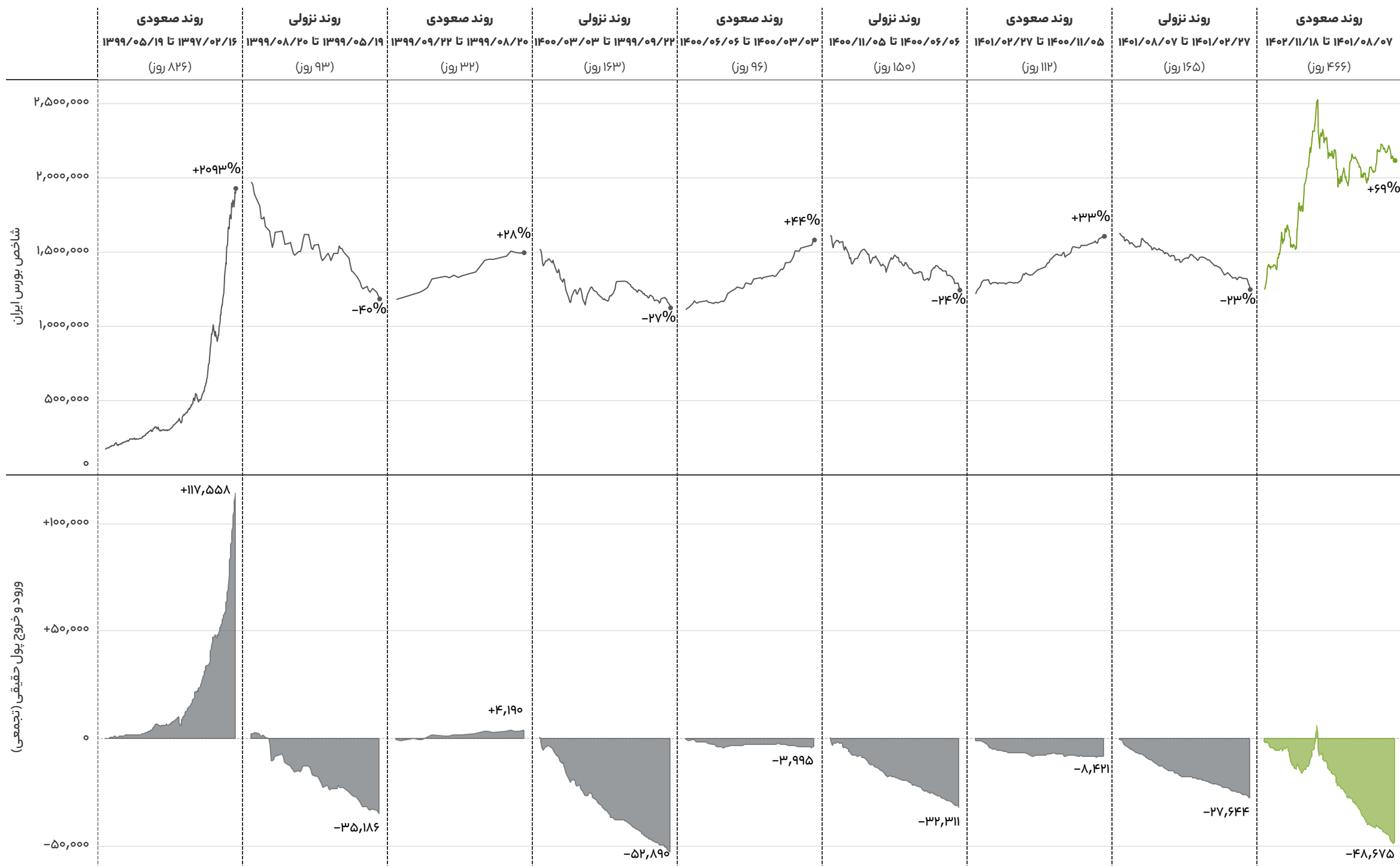
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

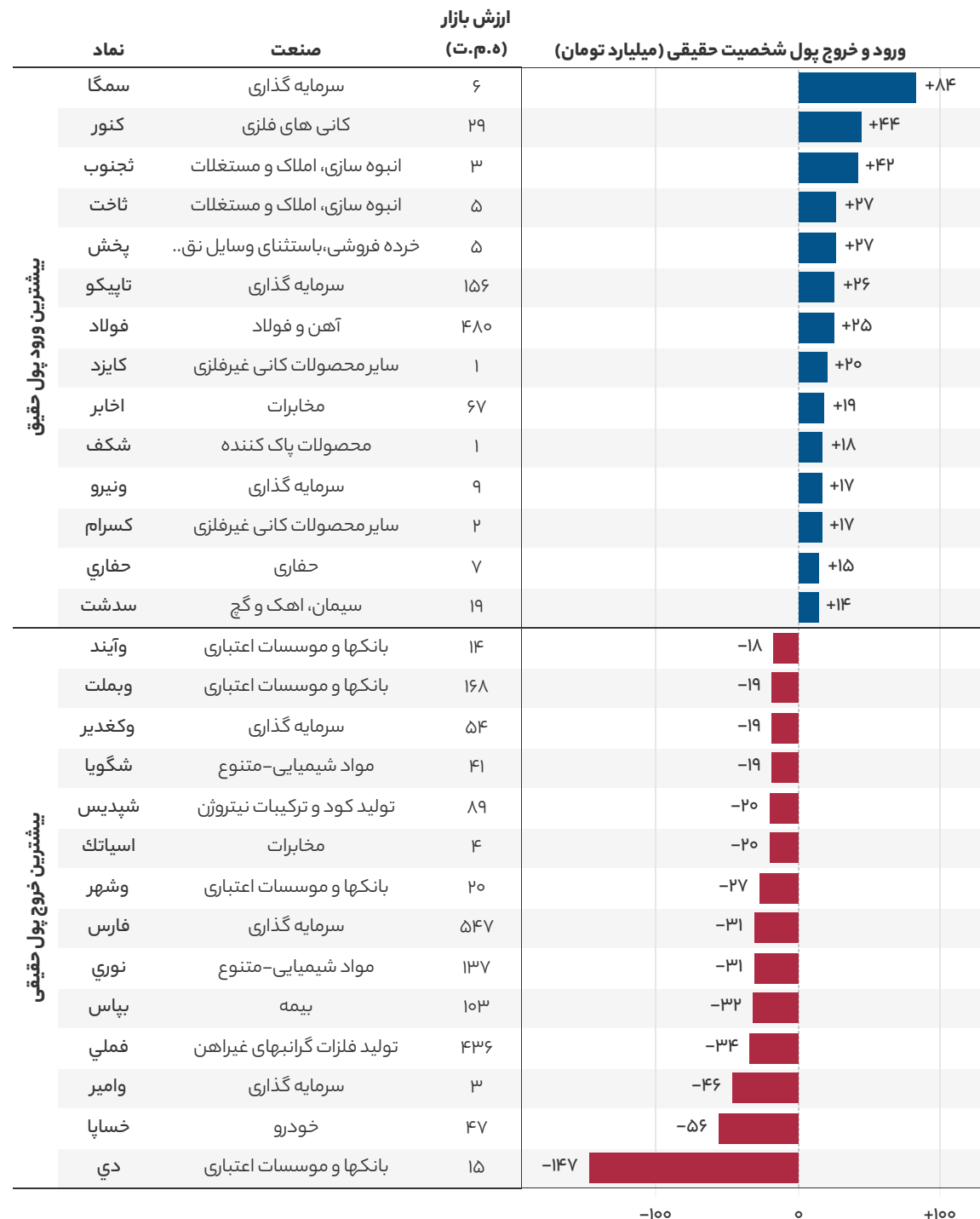
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

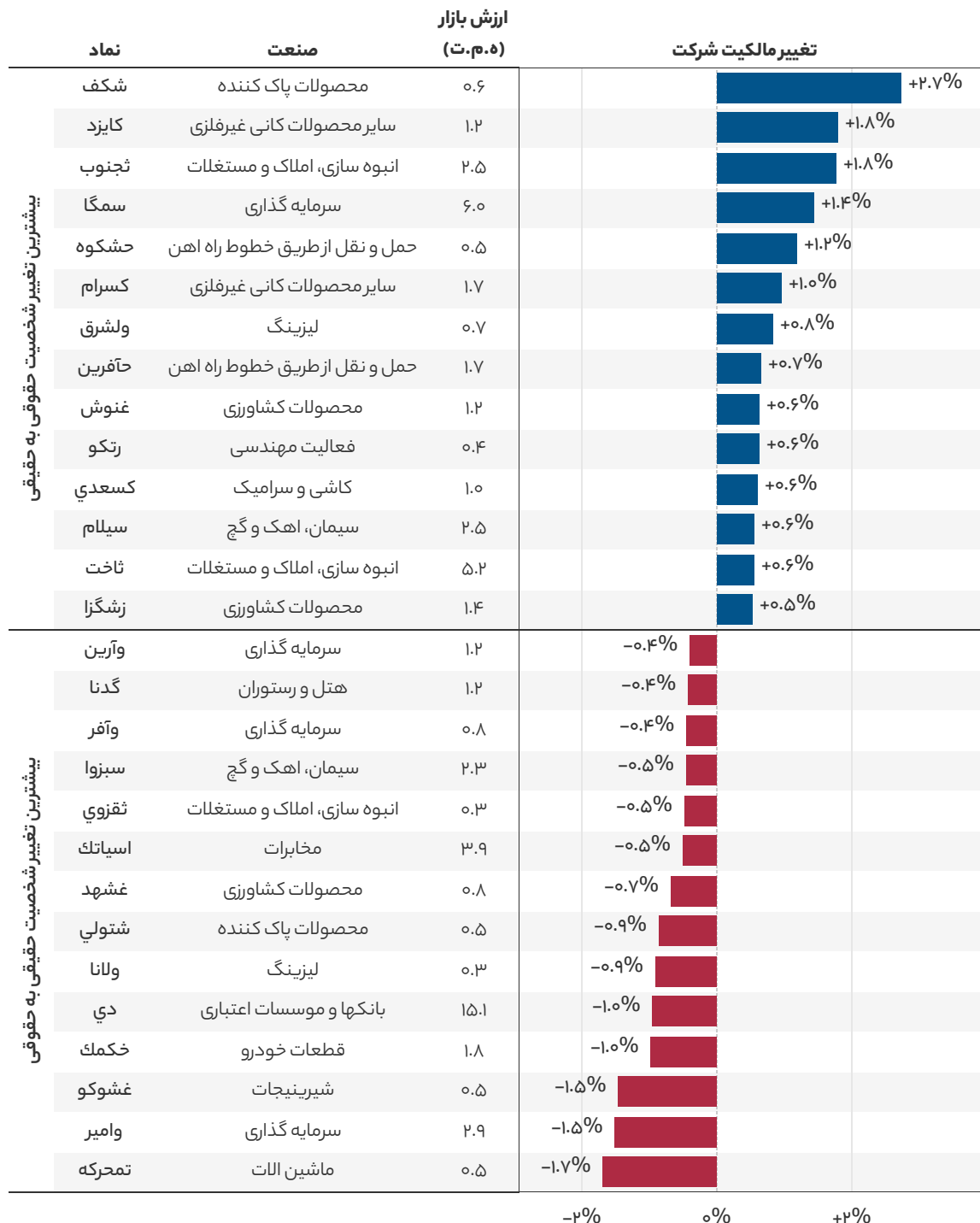
ورود و خروج پول حقیقی

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



تغییر مالکیت شرکت

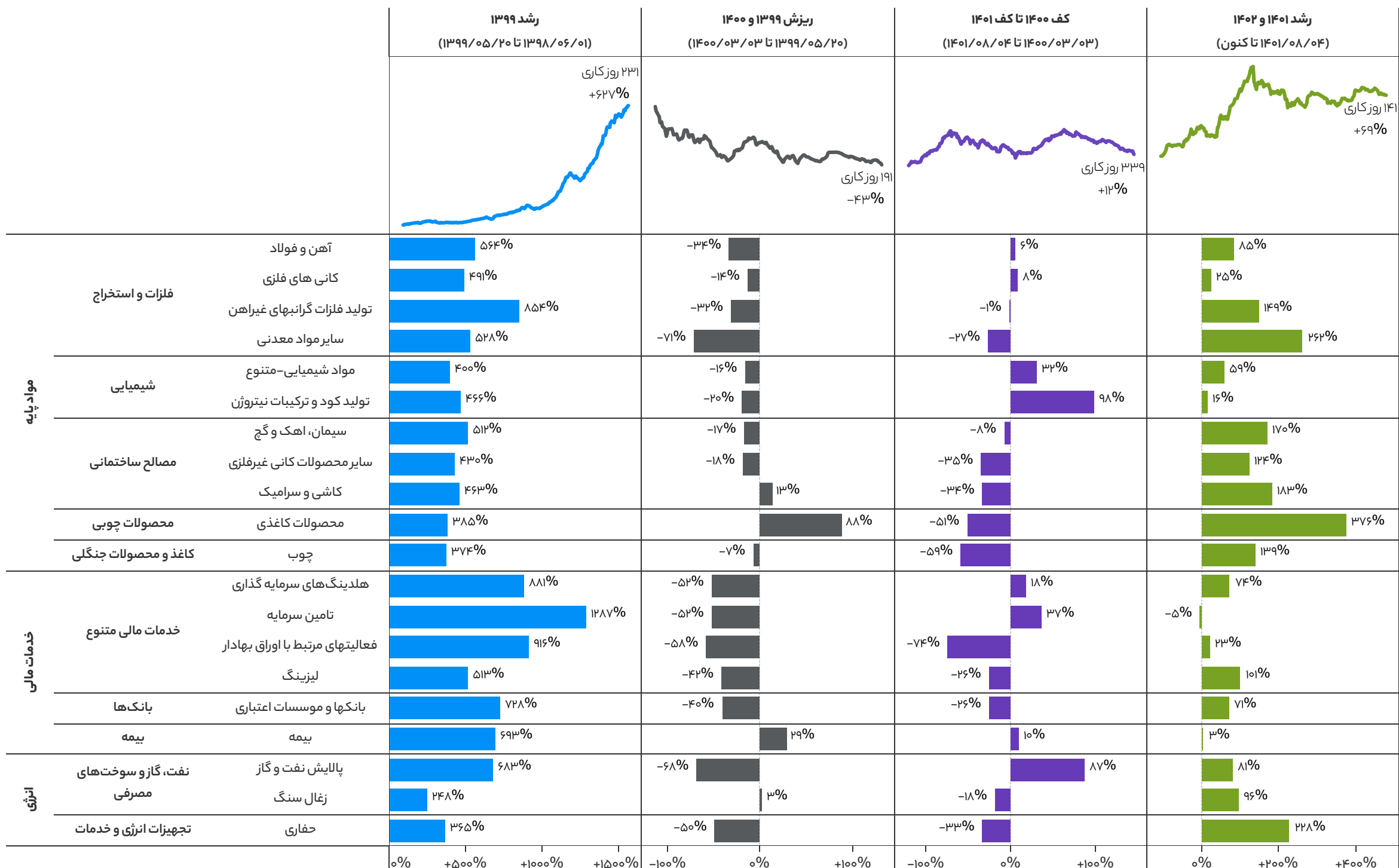
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان





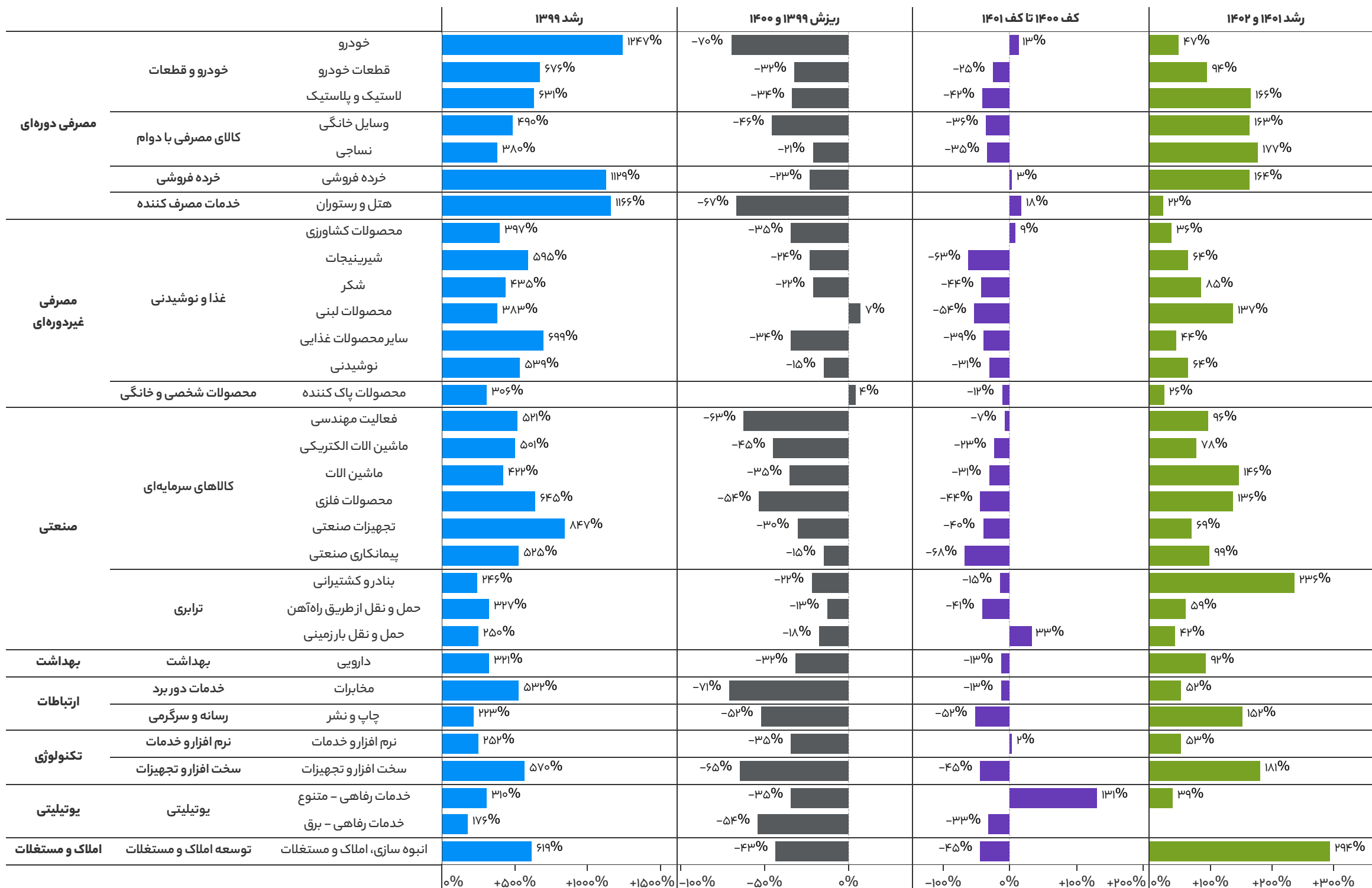
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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



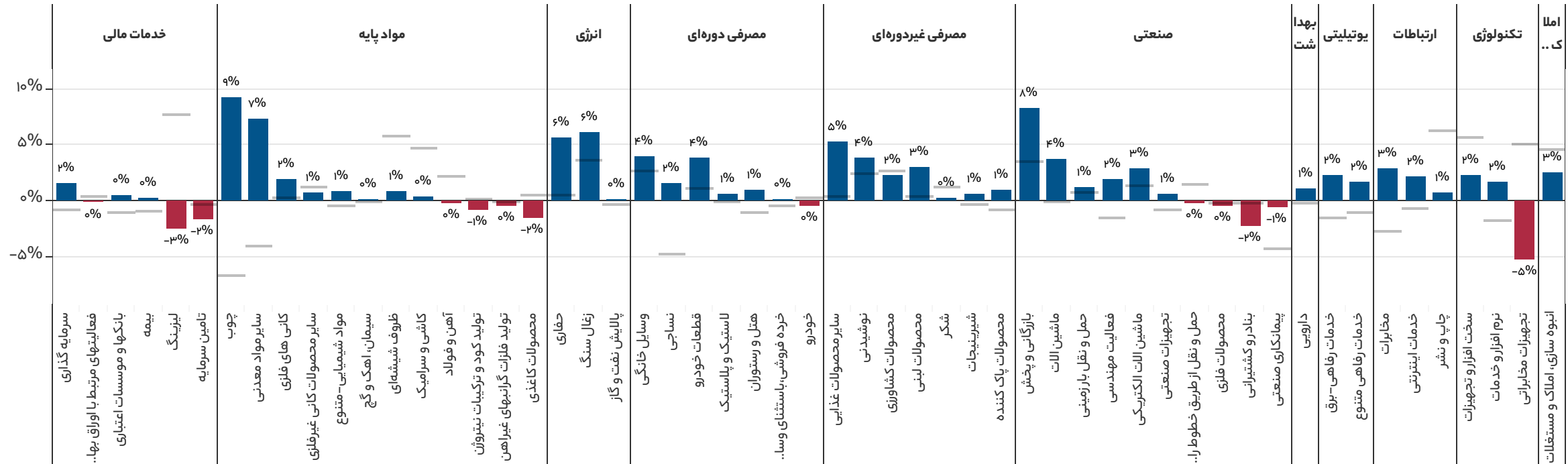


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



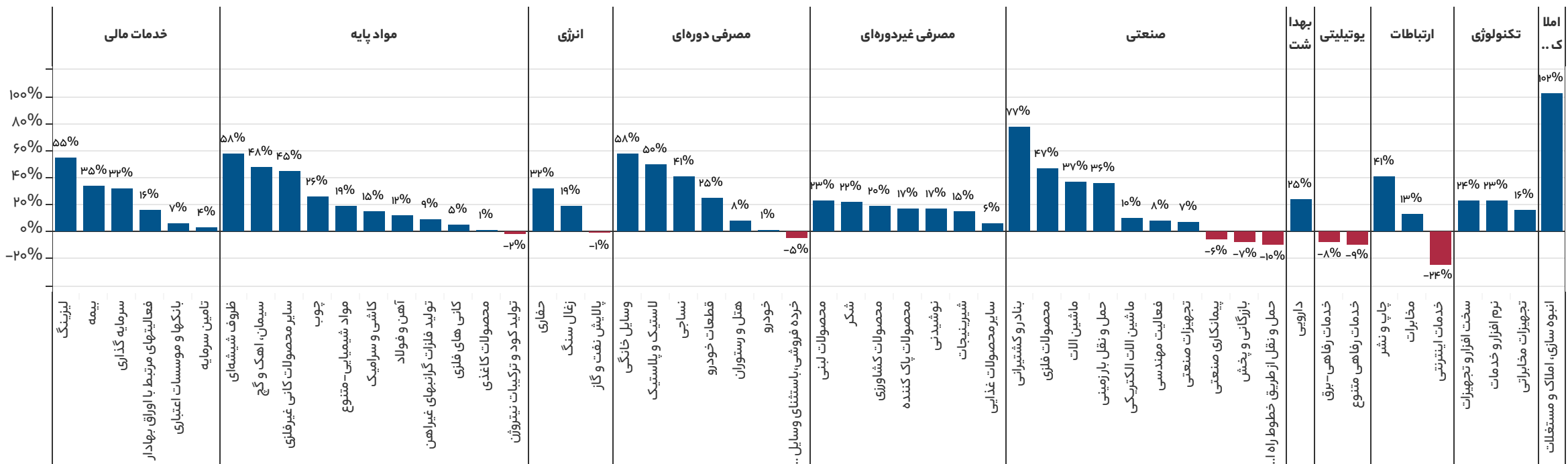
بازده صنایع از ابتدای هفته

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



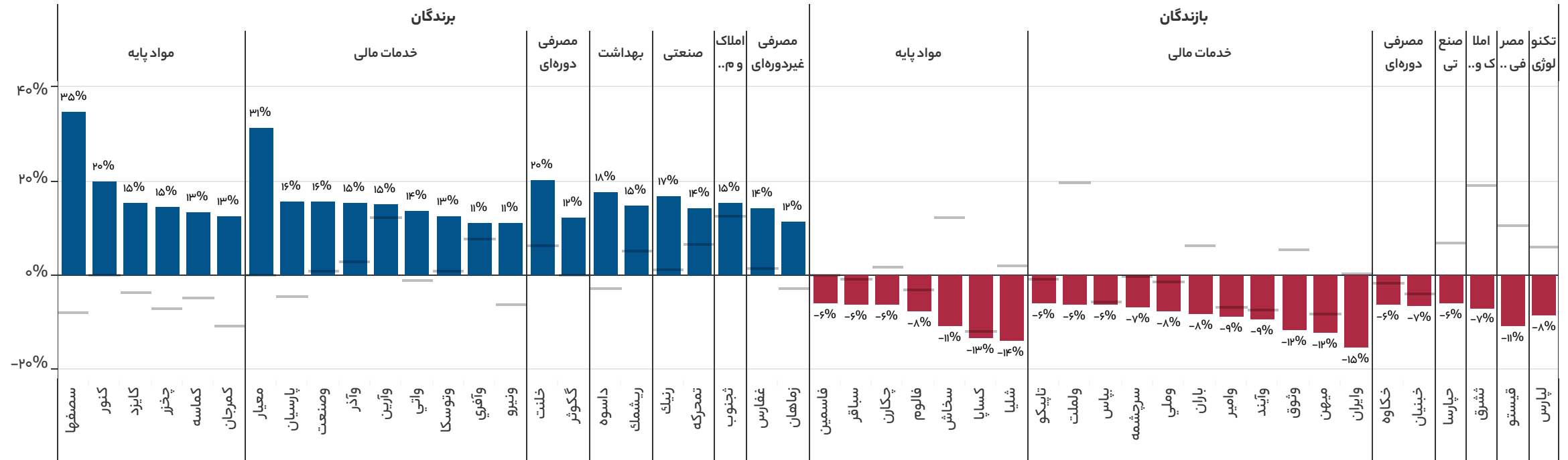
بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده)

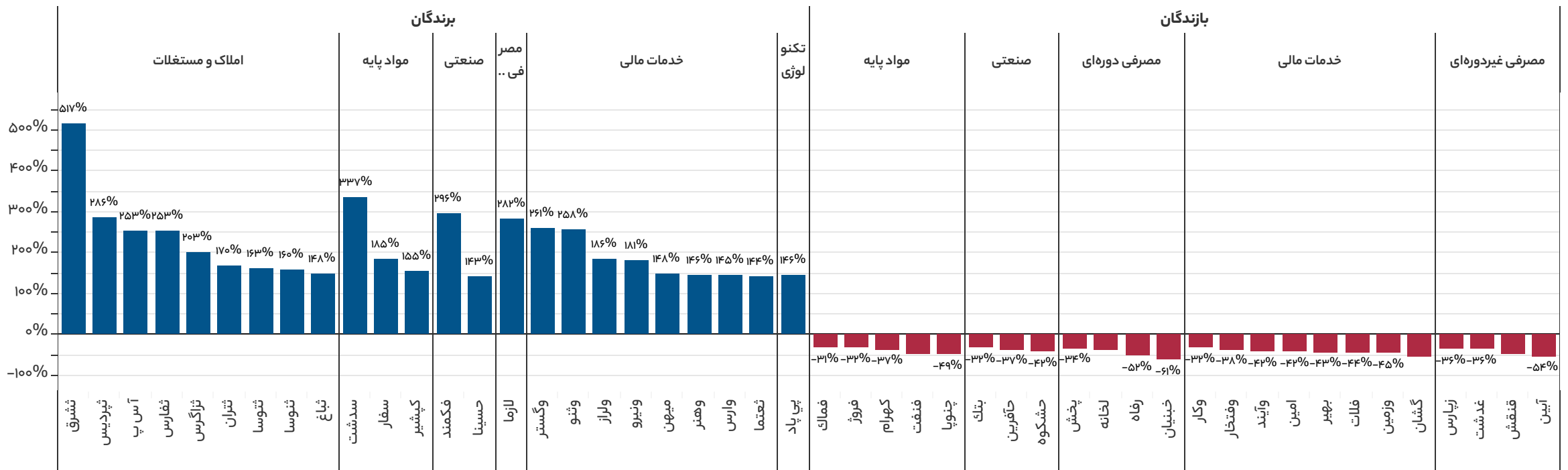


برندگان و بازندگان هفته

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

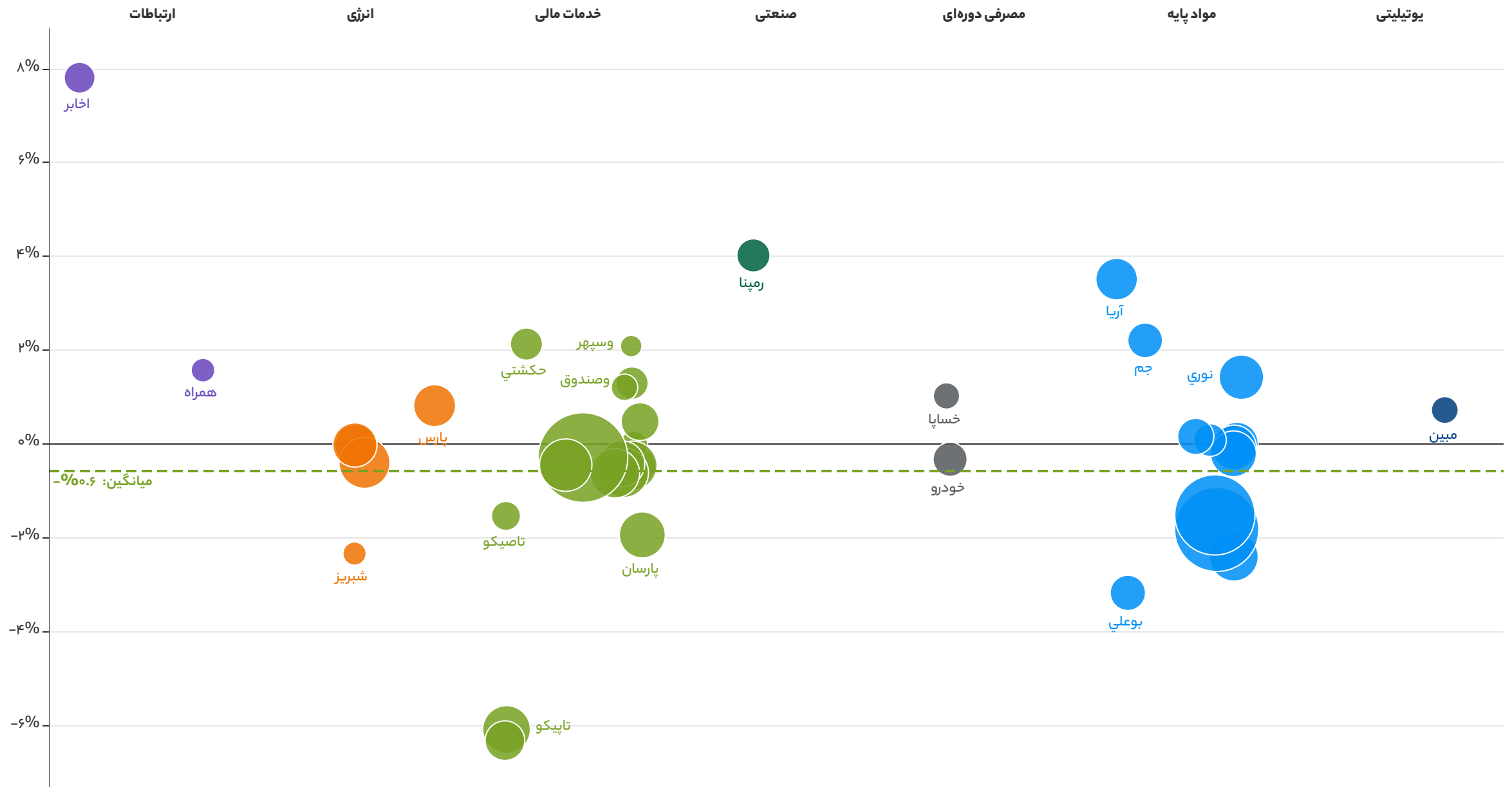


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

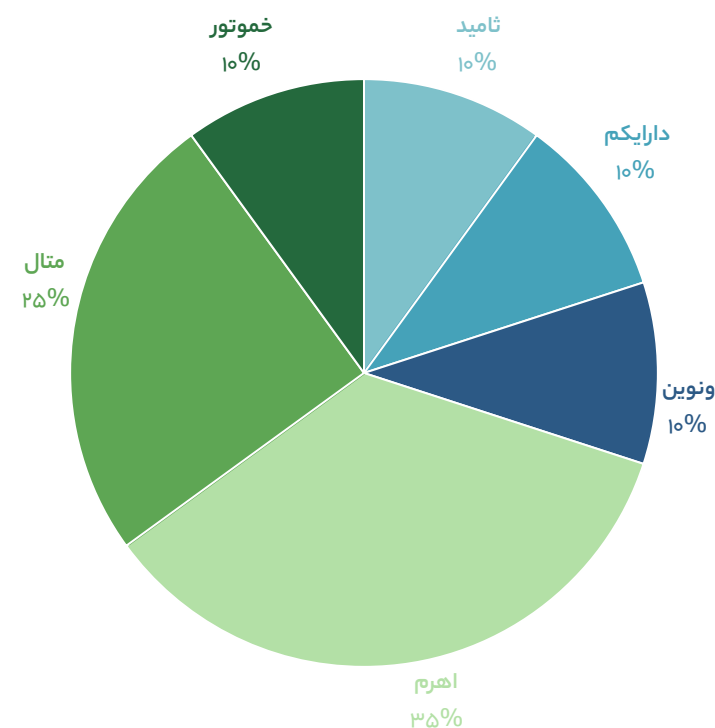


پایاس	تاپیکو	بوعلی	کگل	شبریز	پارسان	فولاد	تامیکو	فملی	میدکو	وبملت	وغدیر	شستا	ومعادن	وامید	شپنا	خودرو	فارس	کچاد	کگهر	وگدیر	شتران	شبنر	مارون	فخوز	شپدیس	وپاسار	مین	پارس	خسپا	تجارت	وصندوق	نوری	همراه	وسپهر	حکشتی	آریا	رمینا	آخابر	
-۶.۳%	-۶.۱%	-۳.۲%	-۲.۴%	-۲.۳%	-۱.۹%	-۱.۸%	-۱.۵%	-۱.۵%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۳%	-۰.۳%	-۰.۲%	-۰.۱%	۰%	۰%	۰%	۰%	+۰.۱%	+۰.۲%	+۰.۵%	+۰.۷%	+۰.۸%	+۱.۰%	+۱.۲%	+۱.۳%	+۱.۴%	+۱.۶%	+۲.۱%	+۲.۲%	+۲.۲%	+۳.۵%	+۴.۰%	+۷.۸%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۴,۰۵۲	افزایش ظرفیت و نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب به صنعت (P/NAV)	۴,۸۰۰	خمتور	میان مدت
۲۵%	۱۰,۸۹۰	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	-	ماتال	
۳۵%	۲۱,۳۰۰	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	-	اهرم	
۱۰%	۲,۳۷۸	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۹۰۰	تامید	بلند مدت
۱۰%	۱۶۷,۹۶۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۲۱۰,۰۰۰	دارایکم	
۱۰%	۶,۲۱۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۷,۸۰۰	ونوین	

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 سرمایه گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

