



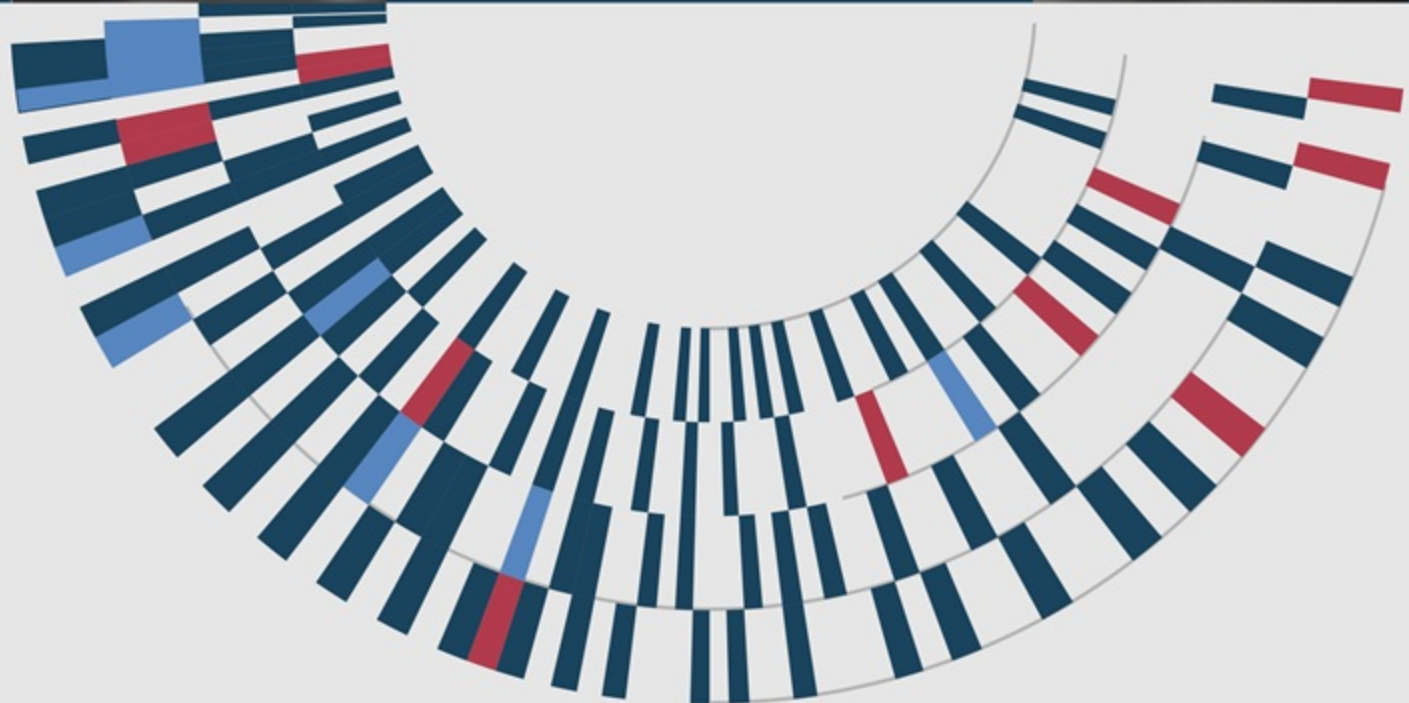
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۹ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۰۴

 CHARISMA





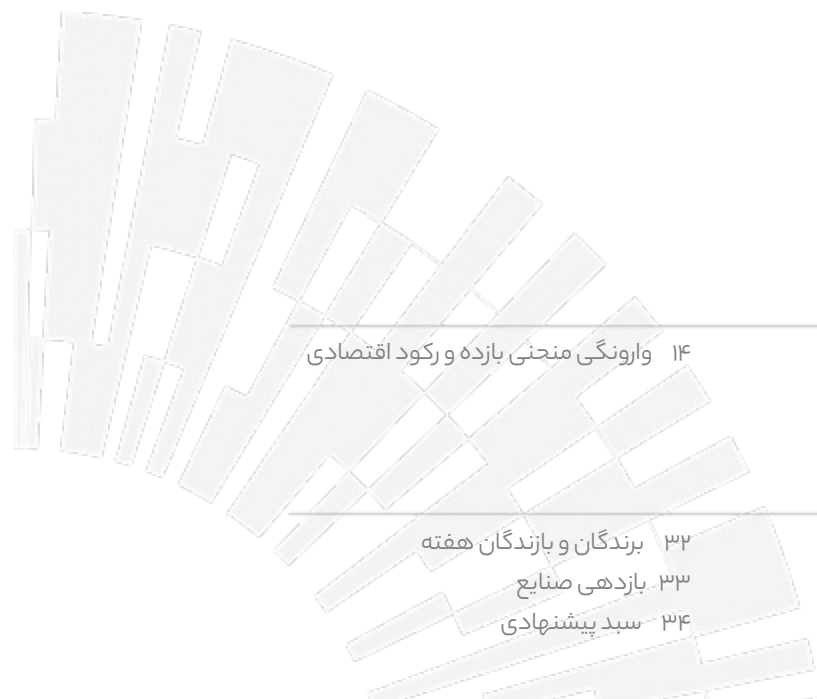
معرفی گزارش:

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 هیچ‌گونه 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.



۱۴ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی

۳۲ برندگان و بازندگان هفته

۳۳ بازدهی صنایع

۳۴ سبد پیشنهادی

۵۸ گاز طبیعی

۱۵ کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی

۱۱ سیمان

۱۲ اخبار و معیارهای تاثیرگذار

۲۲ ارزشگذاری بازار

۲۴ بازدهی صنایع

۲۵ ورود و خروج پول

۲۸ بازدهی صنایع

۵۴ فلزات آهنی و غیرآهنی

۵۵ معادن و محصولات کشاورزی

۵۶ پتروشیمی

۵۷ انرژی و سایر محصولات

۱۶ مروری بر بازارهای موازی

۱۸ بررسی بلندمدت بازار سهام

۲۰ نرخ بهره و رونق بازار سهام

۲۱ ارزش معاملات

کامودیتی

۵۳

بازار سهام

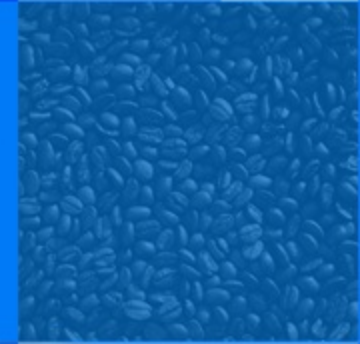
۱۵



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





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	
فلزات غیر آهنی	طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۲,۰۳۷	+۱.۲%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۰۶۹	۱۰%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۵۶۵	+۱.۰%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۹,۰۳۶	-۴%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۵۰,۵۰۹	-۶.۲%	فملی	بموتو، فباهنر	۳۳۳,۵۸۹ - ۴۶۳,۶۶۱	-۲۴%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۶۷	-۱.۸%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ - ۲,۴۲۴	۲%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۱۴	+۱.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۳,۰۴۵	-۲۱%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۰۱	+۱.۶%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۲۹۶	-۱%
	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۹۸	-۰.۵%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ - ۵۷۲	-۱۳%
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۴	-۰.۴%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۶۲۳	-۱۶%
فلزات آهنی	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۱,۳۱۵	-۱.۳%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق	کوبیر، فوکا، فنورد	۱۷,۹۰۰ - ۲۲,۸۲۱	۲%
	اسلب (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۵۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ - ۵۶۵	-۷%
	اسلب (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۵۳	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۶۷۰	-۱۵%
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۷۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۴۵۵	۳%
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۵	-۱.۲%	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۷۵۵	-۲۰%
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۳۶۲	+۱.۶%	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ - ۲۴,۴۵۹	-۱%
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۰۳	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ - ۷۸۰	-۱۷%
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۷۱۸	-	فولاد	-	۶۴۰ - ۸۶۰	-۱۴%



	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		روند قیمتی ۱۲ ماهه
								بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	تغییر قیمت طی دوره	
سنگ آهن و محصولات معدنی	سنگ آهن	CFR چین	دلار/تن	۱۳۰	-	-	-	۱۰۱	۱۴۳	۲%
	گندله سنگ آهن	CFR چین	دلار/تن	۱۵۳	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۱۹	۱۶۴	۱%
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۴,۹۲۱	+۱.۱%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۹۹۵	۴,۹۲۱	۲۲%
	کنسانتره سنگ آهن	CFR چین	دلار/تن	۱۴۱	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۰۷	۱۵۳	۱%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۷۰۶	+۱.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۰۸۵	۳,۷۰۶	۱۸%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۱۱	+۲.۲%	-	-	۱۹۹	۲۶۸	-۱۹%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۵۷	-۴.۰%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷	۲۶۳	-۳۸%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۳۲۷	-۲.۴%	-	-	۱,۱۹۷	۱,۷۱۶	-۱۷%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۰۸	+۰.۶%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸	۹۶۸	-۱۷%



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	روند قیمتی ۱۲ ماهه
اوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن			شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شرفارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۳۰۳	+۳.۸%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شرفارس، شسینا	۲۳۵ - ۳۲۰	-۵%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۷۰	+۲.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۹۸۰	-۱%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۵	-۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۹۴۰	-۱%
پاراژایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۳۴	-۰.۱%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ - ۱,۱۵۸	۰%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۰	+۰.۵%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۸۰	-۱۲%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۲۶	+۰.۲%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۶۸	۱%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۳	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۴۳	۱۵%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۰۳	+۰.۹%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۰۳	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۲۵۰	+۴.۲%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۲۵۰	۴%
مونواتیلن گلابیکول	چین CFR	دلار/تن	۵۴۰	-۰.۶%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	۲%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۸۱	-۶%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۲۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۱,۰۱۱	-۷%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۵	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۸۷	-۷%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۴۸	+۰.۴%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۵۲	-۱۱%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۵	-۱.۰%	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۷۵	-۱۱%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۰	+۱.۳%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ - ۹۱۰	-۱۴%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۲۰	+۱.۵%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۰۵	-۶%

مواد شیمیایی

پلیمرها

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
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۲	-۱.۹%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریزو، شرارز، شاون	۷۲ - ۹۴	-۵%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۷	-۳.۲%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریزو، شرارز، شاون	۶۶ - ۹۱	-۴%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۲	+۰.۵%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	-	۷۸ - ۱۰۷	۰%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۱۰۰	-۱.۲%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	-	۷۹ - ۱۲۵	-۳%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۹۶	-۱.۰%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	-	۳۵۰ - ۵۲۸	-۴%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۹	-۰.۷%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	-	۸۱ - ۱۲۴	-۳%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۲۶	+۱.۲%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	بوعلی، نوری	۴۵۲ - ۶۶۸	-۶%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۷۳۰	+۱.۴%	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	-	۷۲۰ - ۹۵۰	-۱۹%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۶,۱۸۴	-	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	-	۲۱,۷۹۵ - ۴۱,۳۶۵	-۳۷%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۸,۴۱۳	+۰.۶%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، شاون	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۱۱,۵۷۳ - ۲۱,۶۳۴	۵۹%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۳,۳۷۹	-	شپاس	-	۱۲,۰۸۶ - ۱۷,۱۴۰	-۱۰%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۶۳	-۰.۵%	-	ذوب، فروش	۱۹۶ - ۳۲۹	-۲۰%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۸	+۰.۵%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	۲%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	+۰.۶%	-	-	۱.۲۰ - ۱.۳۱	۵%
بیتکوین	بایننس	دلار	۵۱,۰۰۵	-۱.۵%	-	-	۱۹,۹۹۴ - ۵۱,۸۰۴	۱۳۸%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

ارز و 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	۰.۰۶	-۹.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۴۳%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۸	-	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ - ۰.۱۰	-۱۵%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۲۶	-۴.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۵۰%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۲۶	-۳.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۰.۶۱	-۴۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۶	-۳.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۴۵%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

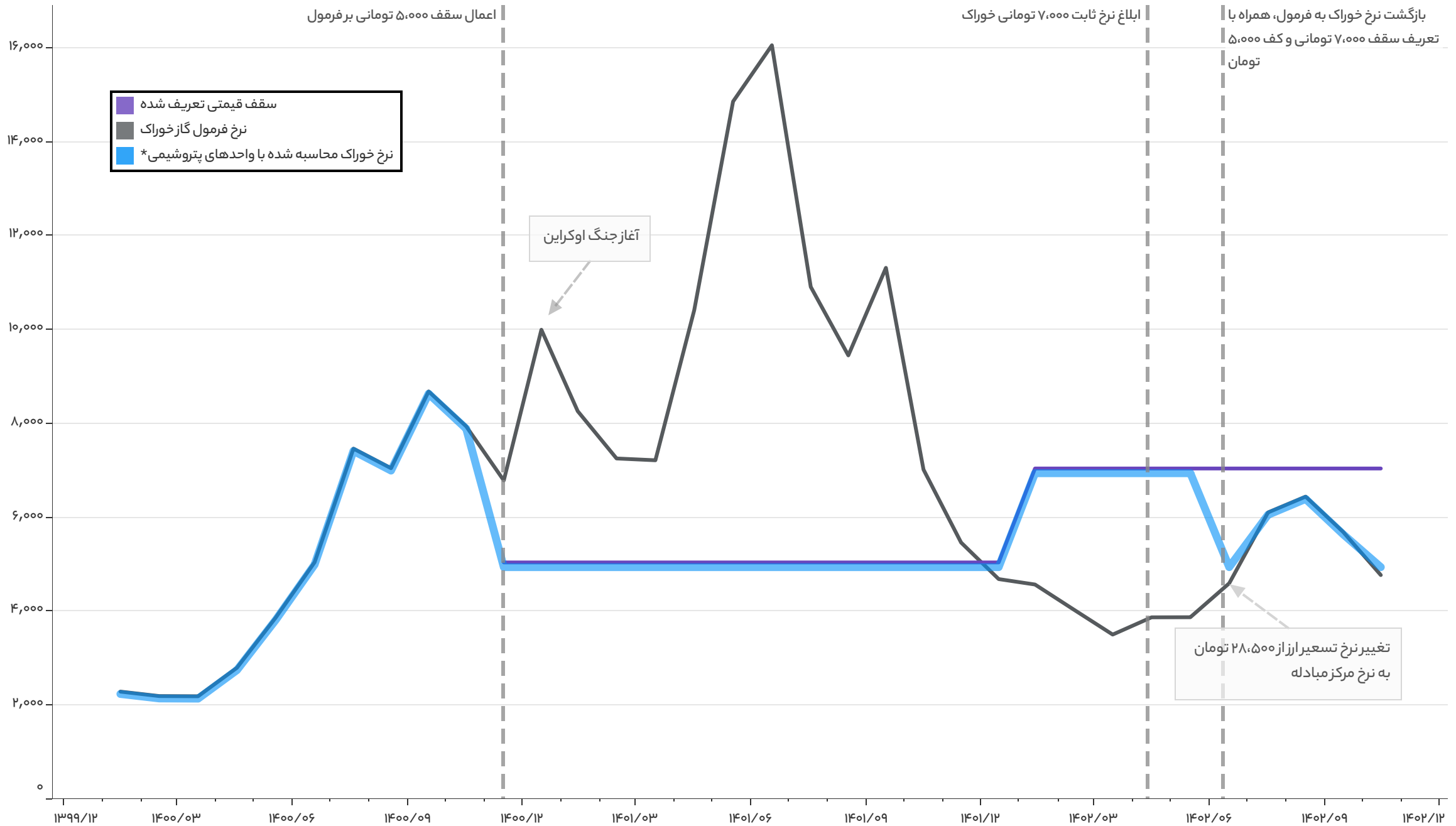
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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

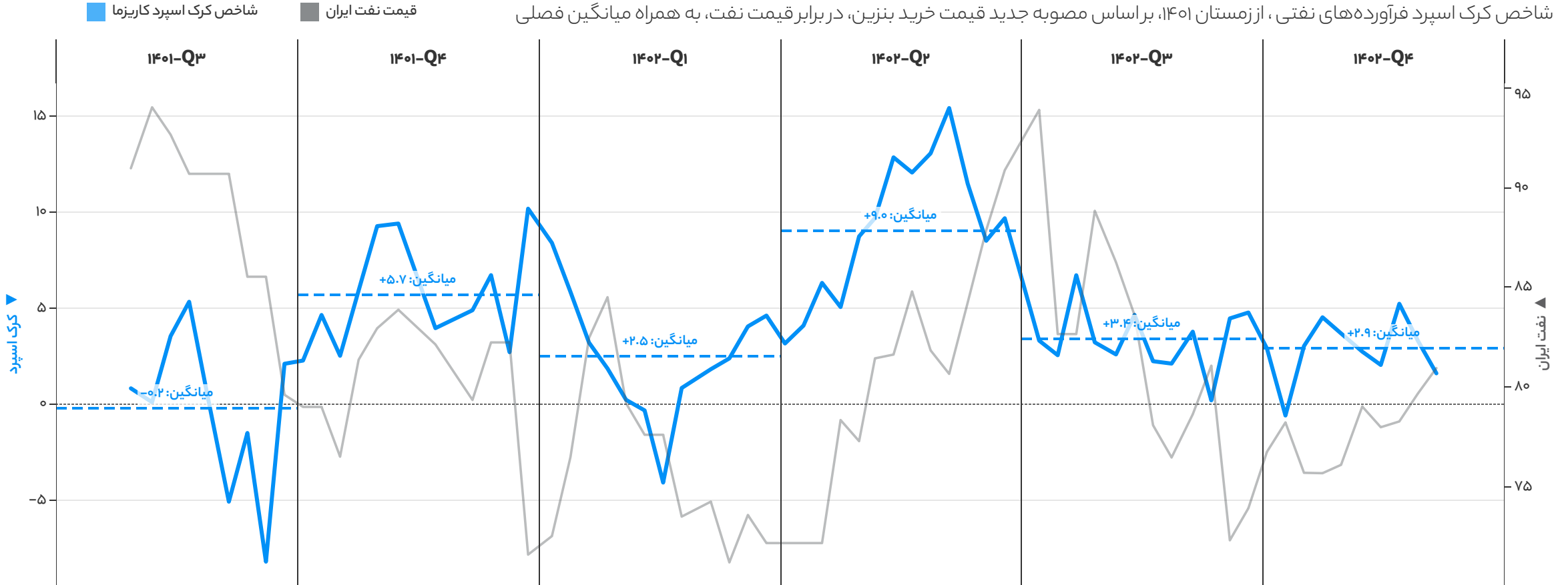


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد. - لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



شاخص کرک اسپرد کاریزما*

شاخص کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی، از زمستان ۱۴۰۱، بر اساس 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	میانگین فصل گذشته	آخرین وضعیت
نفت ایران	۸۱.۰								
گازوئیل	۱۰۰.۲	۲۱.۷	۱۹.۳	▼۲.۵	۲۳.۲	۲۰.۳	-۱۲.۳%		
بنزین**	۸۷.۲	۷.۴	۶.۲	▼۱.۱	۱.۱	۵.۱	+۳۵۴.۰%		
نفتا	۷۰.۸	-۹.۷	-۱۰.۲	▼۰.۴	-۱۲.۳	-۹.۸	+۲۰.۵%		
نفت کوره	۶۲.۵	-۱۶.۵	-۱۸.۴	▼۱.۹	-۱۵.۲	-۱۴.۵	+۴.۴%		
لوب کات***	۷۱.۶	-۸.۵	-۹.۴	▼۰.۹	-۲.۹	-۸.۱	-۱۷۸.۳%		
وکیوم باتوم***	۴۵.۹	-۳۳.۶	-۳۵.۱	▼۱.۵	-۲۸.۵	-۳۱.۷	-۱۱.۰%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۳.۴	۱.۷	▼۱.۷	۳.۴	۲.۹	-۱۵.۶%		

* 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 هر یک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هر یک از این پالایشگاه‌ها استفاده شده است.
 ** قیمت بنزین بر اساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شیندر، شتران و شبریز) و بر اساس نوع بنزین فروخته شده توسط هر یک از این پالایشگاه‌ها حساب گردیده است.
 *** قیمت لوبکات و وکیوم باتوم بر اساس نرخ فروش هر یک از ۴ پالایشگاه ذکر شده در بورس کالا محاسبه گردیده، که این اسپرد نیز بر اساس ارزش بازار هر یک از این پالایشگاه‌ها، به روش موزون میانگین گیری شده است.



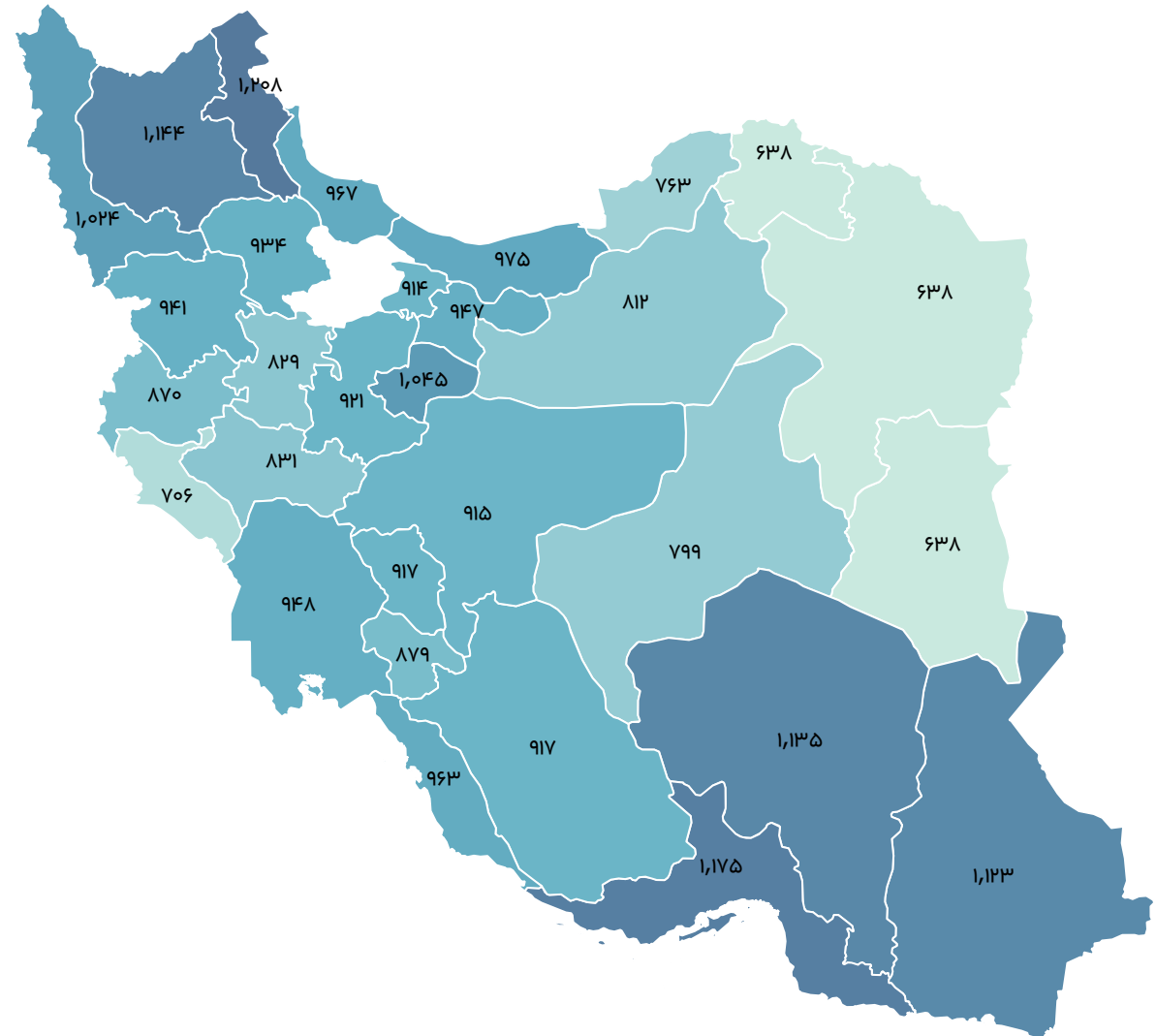
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	تهران	سیمان تهران	۹۳۰	۹۴۷	+۱.۹%
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۹۲۱	+۴.۳%
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۸۰۷	۷۹۹	-۱.۰%
	قم	سیمان نینزار قم	۹۸۱	۱,۰۴۵	+۶.۵%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
غرب	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۹۴۸	+۵.۶%
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۶۸	۹۱۷	+۵.۷%
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۳۵	۸۷۰	+۴.۲%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۸۷۹	-
	لرستان	سیمان دورود	۸۴۰	۸۳۱	-۱.۰%
	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۴۱	-
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۲۰۰	۱,۱۷۵	-۲.۰%
جنوب	فارس	سیمان داراب	۹۲۹	۹۱۷	-۱.۴%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۷۲	۹۶۳	-۰.۹%
شمال	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۷۵	+۶.۶%
	گیلان	سیمان خزر	۷۷۶	۹۶۷	+۲۴.۵%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۶۳	۷۶۳	-
شمال غرب	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۰۴۹	۱,۲۰۸	+۱۵.۱%
شرق	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۴۱	۱,۱۴۴	+۲۱.۷%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۸۴	۱,۰۲۴	+۱۵.۸%
	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	۱,۰۰۸	۱,۱۳۵	+۱۲.۵%
سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۱۱۳	۱,۱۲۳	+۰.۹%	

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



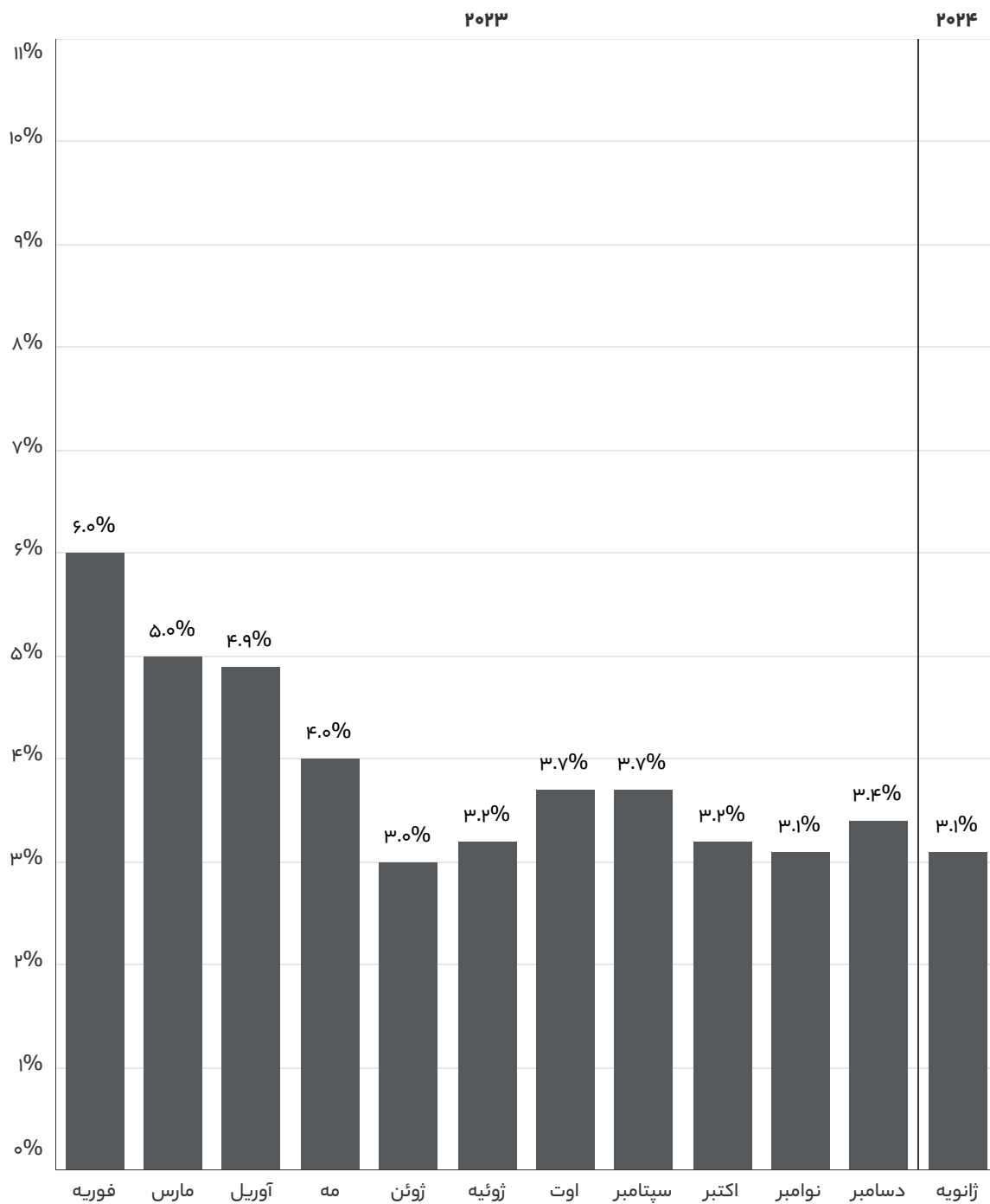
* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ قیمت جهانی طلا طی هفته گذشته را با قیمت ۲۰۱۳ دلار معاملات خود را آغاز کرد و تا روز چهارشنبه تا قیمت ۲۰۲۵ دلار صعود کرد. روز چهارشنبه با اندکی افت قیمت در ۲۰۲۳ دلار بسته شد و در نهایت هفته را با قیمت بیش از ۲۰۳۶ دلار به پایان رساند.
- در هفته گذشته هشتمین و نهمین حراج حضوری شمش طلا در تاریخ ۲۹ بهمن و ۱ اسفند در مرکز مبادلات ارز و طلای ایران برگزار شد. در هر دو حراج ۱۲۴ قطعه شمش طلای استاندارد معامله شد که میانگین قیمت معامله در هشتمین حراج به صورت میانگین ۳ میلیارد و ۶۱۲ میلیون تومان و در هشتمین حراج به صورت میانگین ۳ میلیارد و ۶۱۳ میلیون تومان بود.
- ▼ قیمت نفت در هفته‌های اخیر به کانال ۸۳ دلار وارد شده بود و این سطحی است که در تاریخ ۲۹ ژانویه پس از دو ماه به آن وارد شده بود. به گزارش رویترز، تنش‌های ژئوپلیتیکی در خاورمیانه تاثیر پیش‌بینی آژانس بین‌المللی انرژی در مورد کند شدن رشد تقاضا را خنثی کرده و قیمت نفت را بالا برده است. اما در طی هفته گذشته قیمت نفت تا روز سه‌شنبه روند نزولی را طی کرد و به قیمت ۸۲.۵ دلار رسید. سپس تا روز پنجشنبه روند صعودی شد و به قیمت ۸۳.۵ دلار رسید. اما در نهایت در روز جمعه با قیمت ۸۱.۷ دلار بسته شد.
- ▲ نرخ کشتی‌های VLCC برای حمل نفت از خاورمیانه به چین به دلیل افزایش هزینه‌های بیمه در بحبوحه وضعیت امنیتی دریای سرخ، به ۶۶ هزار و ۶۰۰ دلار در روز رسیده که بالاترین میزان در سه ماه گذشته است. شرکت فراهم‌کننده اطلاعات بازار (فریت و یو) با اشاره به داده‌های کلارکسون اعلام کرد نرخ کشتی‌های VLCC در سه ماهه چهارم سال میلادی گذشته، به طور متوسط، ۲۱ هزار دلار بود. در سه ماهه سوم سال گذشته، نرخ روزانه، ۸۷۰۰ دلار بود. بانک آمریکا اعلام کرده است انتظار دارد برای مارس، نرخ روزانه این کشتی‌ها که قادر به حمل حدود دو میلیون بشکه نفت هستند، بین ۴۰ تا ۵۰ هزار دلار باشد و قیمت‌ها در سه ماهه دوم، به حدود ۳۵ هزار تا ۴۰ هزار دلار کاهش پیدا کند. آخرین باری که هزینه حمل نفت تا این حد افزایش داشت، در سال ۲۰۱۹ تحت تاثیر مسائل ژئوپلیتیکی خاورمیانه و تحریم‌های آمریکا علیه یک شرکت کشتیرانی چینی بود که باعث شد نرخ روزانه کشتی‌های VLCC، از ۲۵ هزار دلار، به مدت ۶ ماه، به بیش از ۱۵۰ هزار دلار افزایش پیدا کند.
- معاون وزیر نفت با بیان اینکه "در حال حاضر تولید و مصرف بنزین کشور سربه‌سر و معادل هم است"، گفت: برای تعیین میزان واردات بنزین باید ببینیم شرایط آینده به چه صورت است. جلیل‌سالاری، مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی در حاشیه مراسم رونمایی از کارخان‌های ساخت داخل سامانه هوشمند سوخت در جمع خبرنگاران اظهار داشت: پیش‌بینی‌های لازم برای تأمین بنزین نروزی صورت گرفته است. وی افزود: با توجه به اینکه تعمیرات اساسی در پالایشگاه‌های کشور پیش‌بینی شده، مثلاً پالایشگاه ستاره خلیج فارس از ابتدای این ماه به مدار بهره‌برداری بازگشته و یکی از واحدهای پالایشگاه ستاره خلیج فارس به صورت کامل تعمیرات اساسی آن انجام شده و شرایط بقیه پالایشگاه‌ها نیز مساعد است که امیدواریم با تولیداتی که در حوزه پالایشگاهی داریم بتوانیم شرایط تأمین بنزین را تثبیت کنیم.
- مدیرعامل شرکت ملی پخش فرآورده‌های نفتی گفت: متوسط مصرف بنزین در مقایسه مدت مشابه سال گذشته ۱۲ تا ۱۳ درصد افزایش داشته است و در حال حاضر تمامی بنزین را از پالایشگاه‌های داخل تحویل می‌گیریم. جعفر سالاری نسب در جمع خبرنگاران با بیان اینکه میزان کنونی مصرف روزانه در حال حاضر ۱۱۵ میلیون لیتر است، اظهار کرد: به خاطر تقارن نوروز با ایام ماه رمضان هنوز مشخص نیست که چه میزان مصرف افزایش پیدا کند. هفته آینده می‌توان در این خصوص نظر داد. میزان ذخایر کافی است و مشکلی نیست. سالاری نسب در پاسخ به سوال ایسنا درباره واردات بنزین گفت: اکنون تمامی بنزین را از پالایشگاه‌های داخل تحویل می‌گیریم و واردات نداریم.



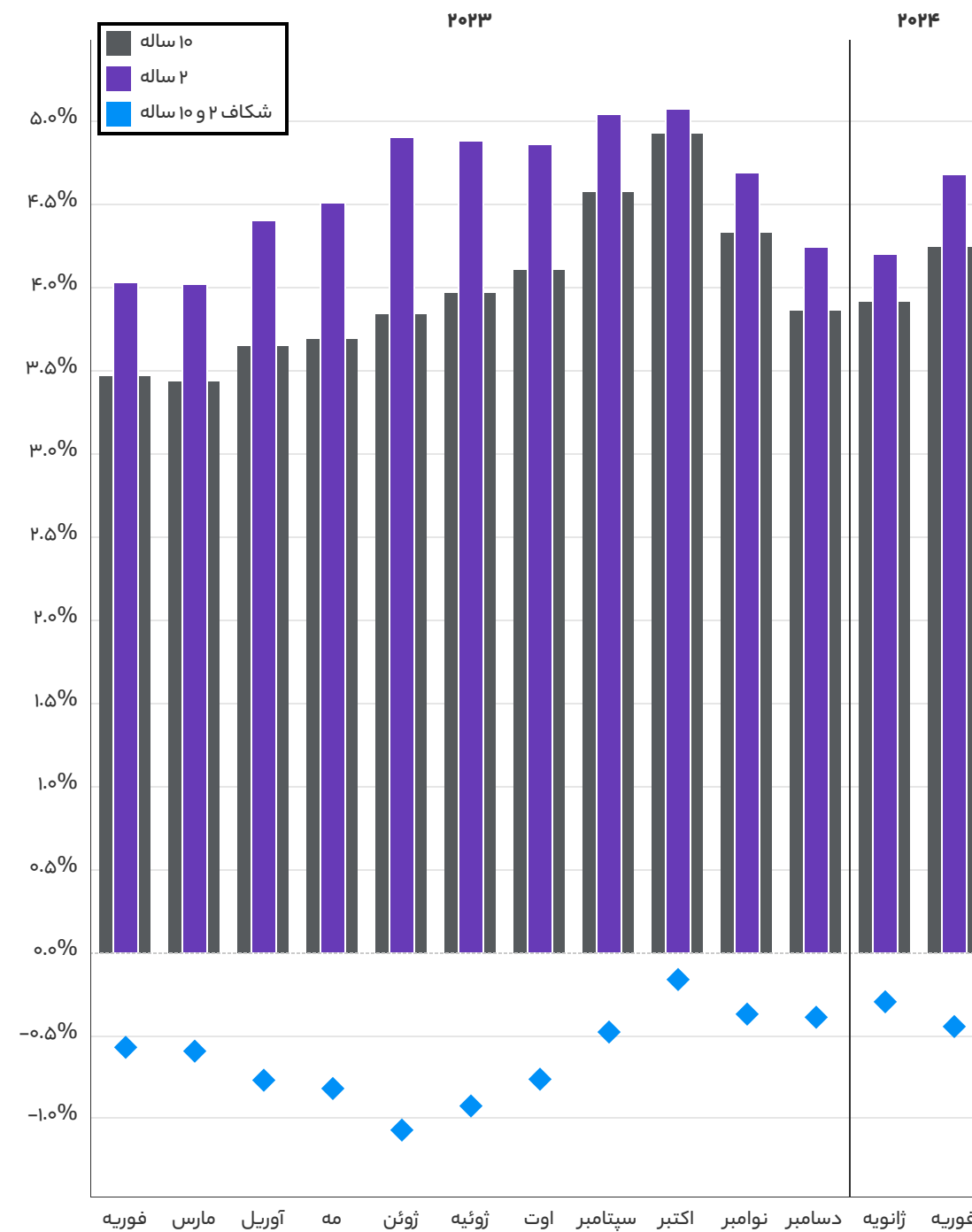
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



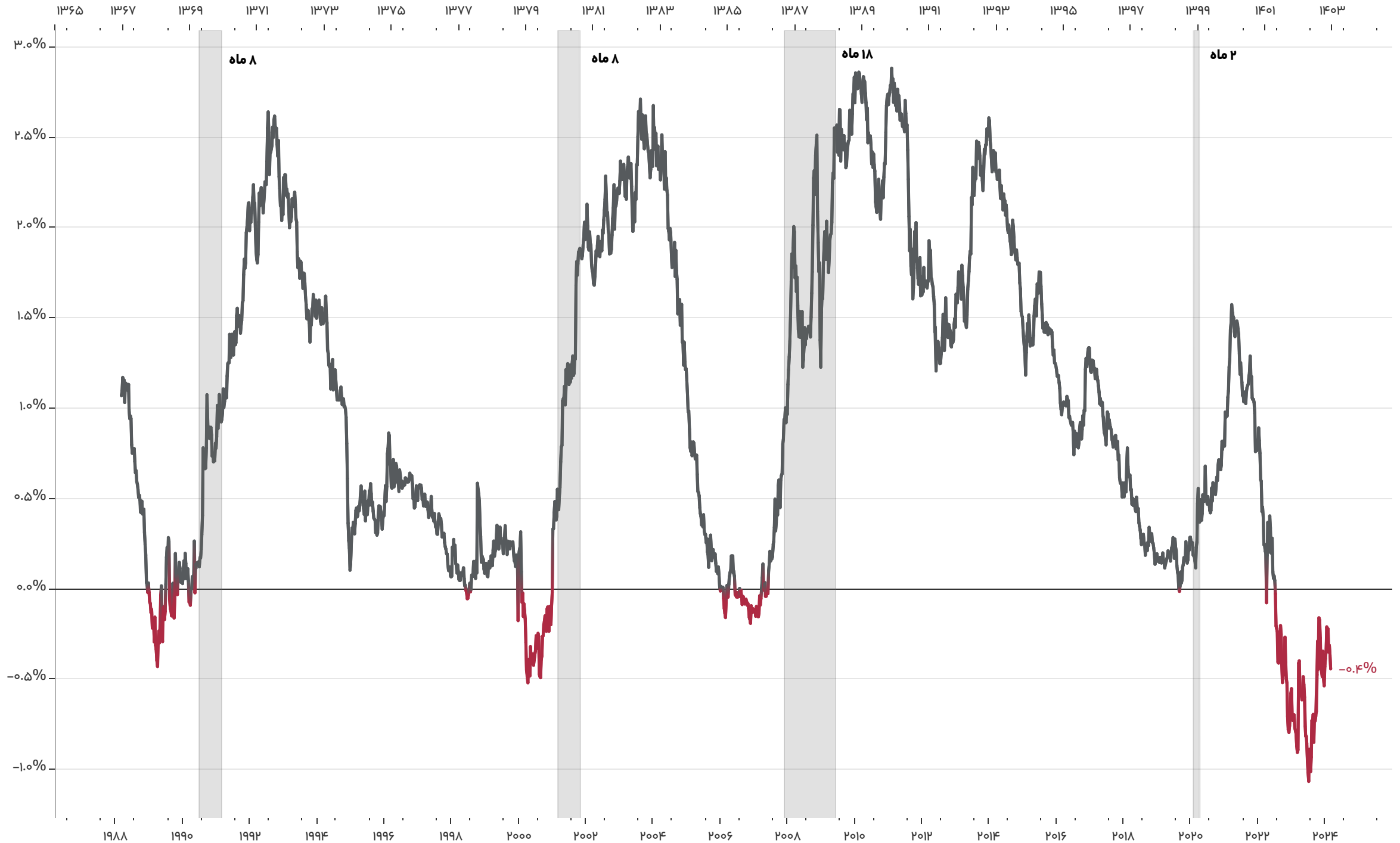
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

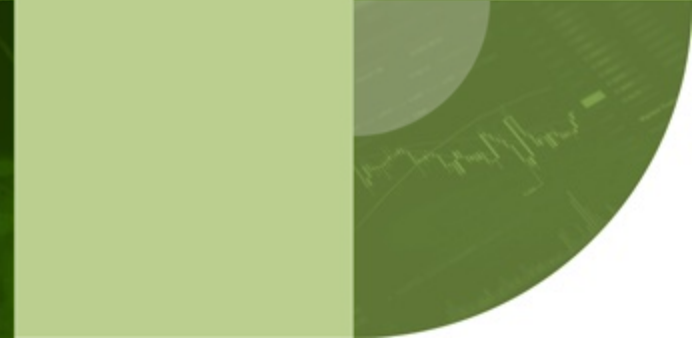
اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



بازار سهام

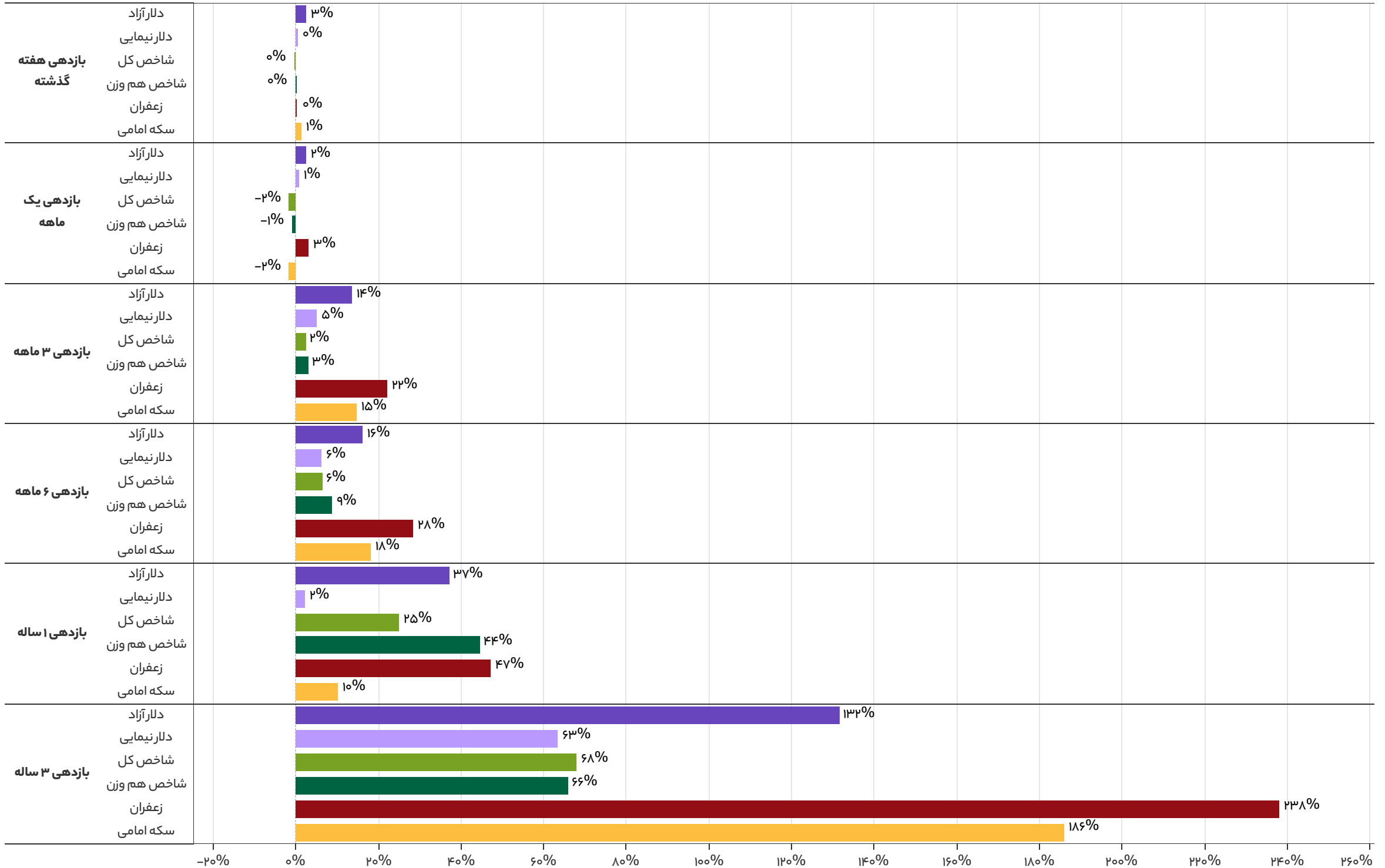
EQUITY MARKET

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 در هر ماه، 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		
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%	هم وزن ▲ ۵۸.۲%	هم وزن ۴۲%
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 ▲ ۸.۲%	سکه امامی ▲ ۸.۸%	شاخص کل ▲ ۴۱.۳%	شاخص کل ۴۰%
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%	زعفران ▲ ۳۲.۱%	سکه امامی ۲۵%
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%	درآمد ثابت ▲ ۲۳.۶%	مسکن ۲۱%
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%	دلار آزاد ▲ ۹.۶%	زعفران ۲۰%
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 در هر 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

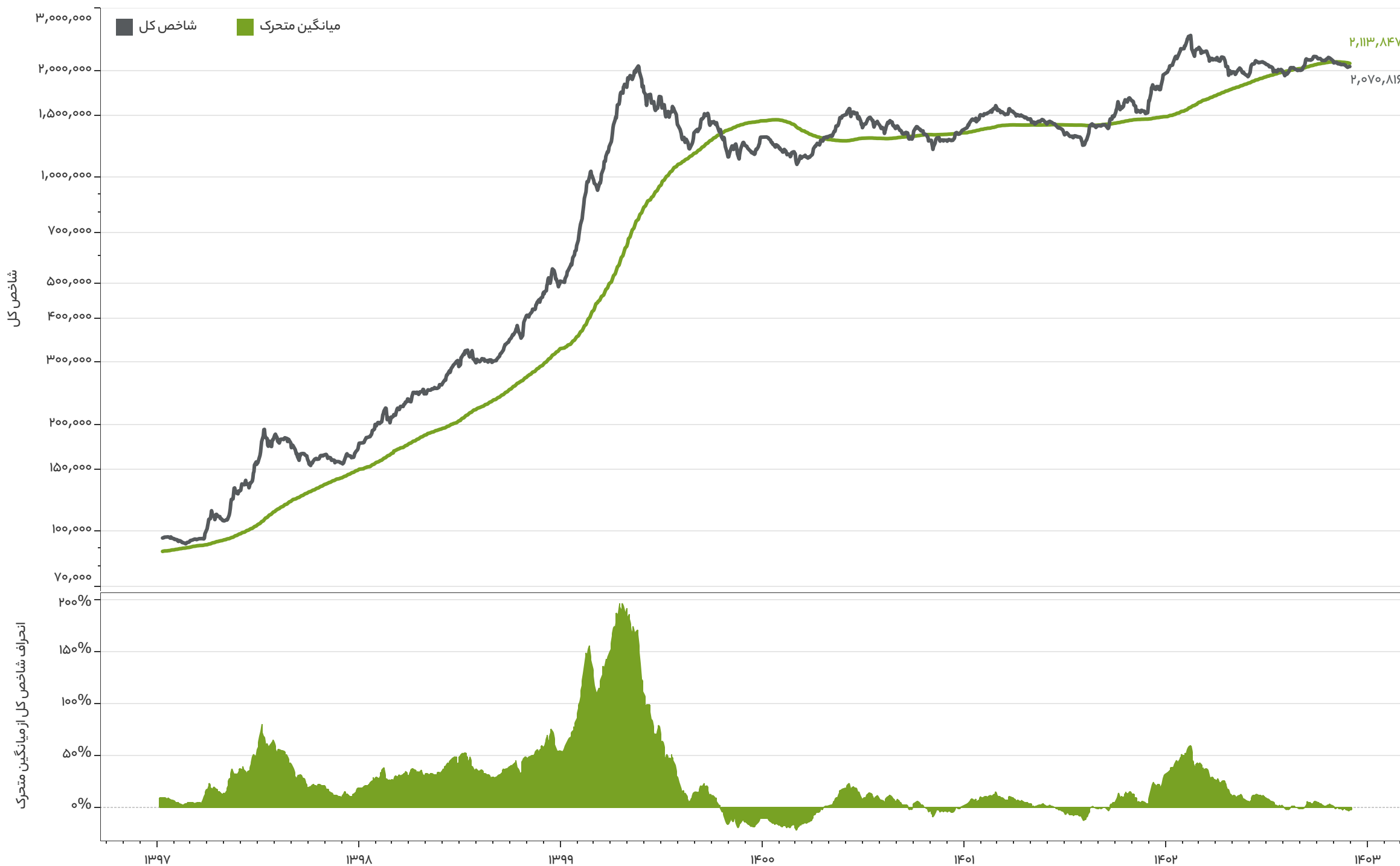
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

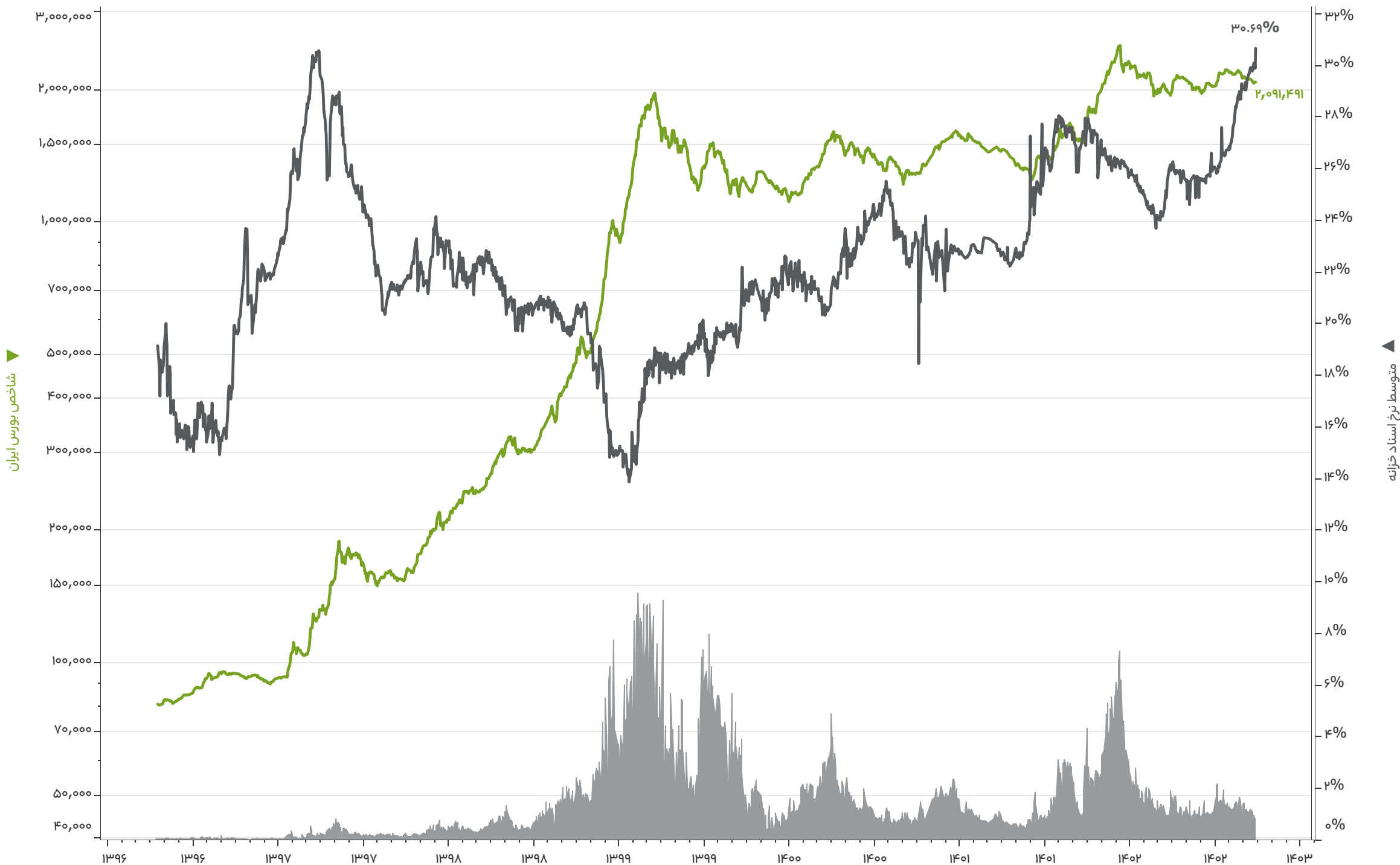
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





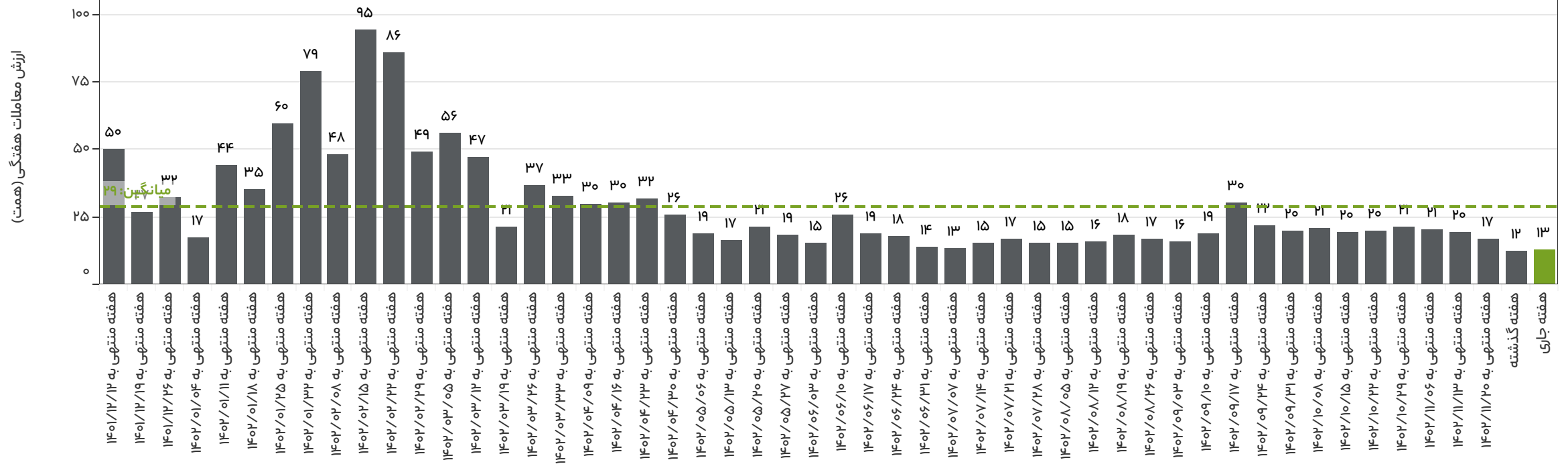
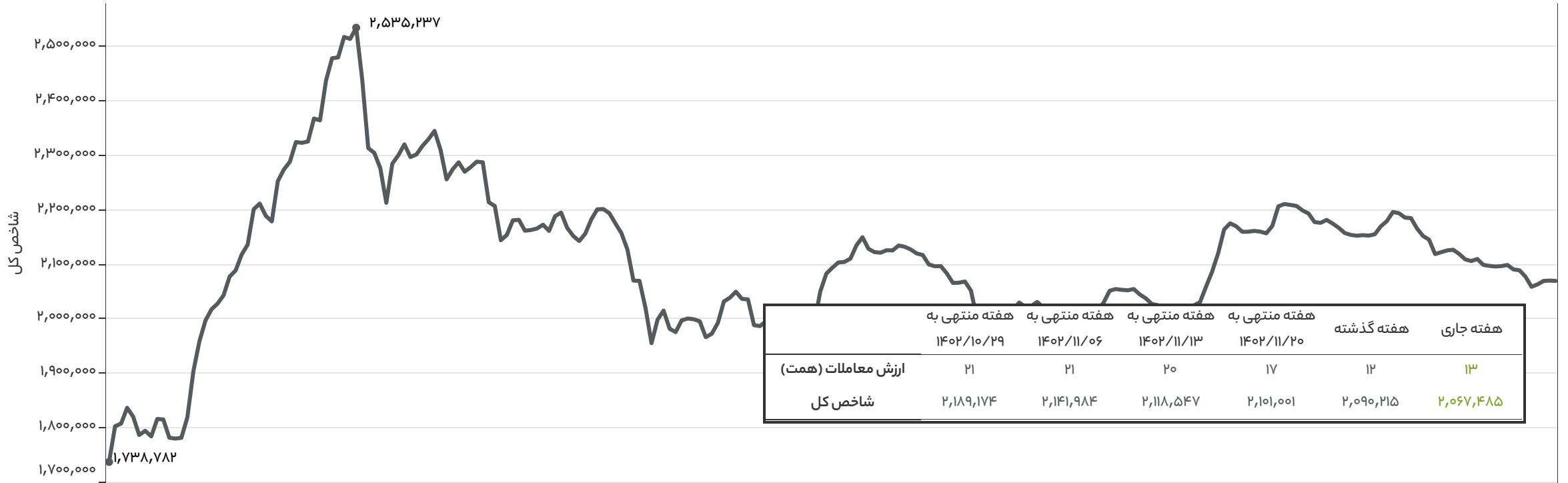
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

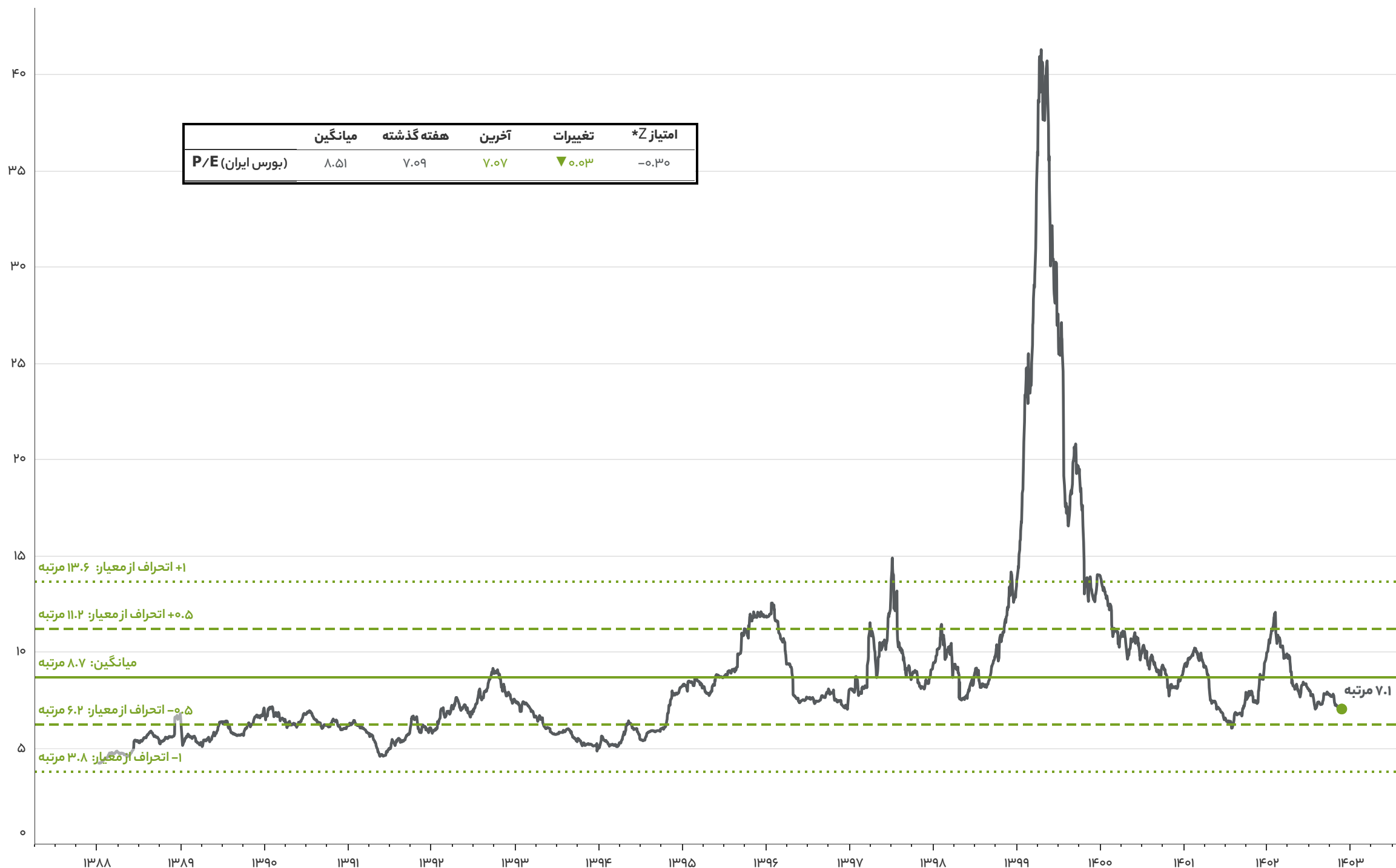
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.



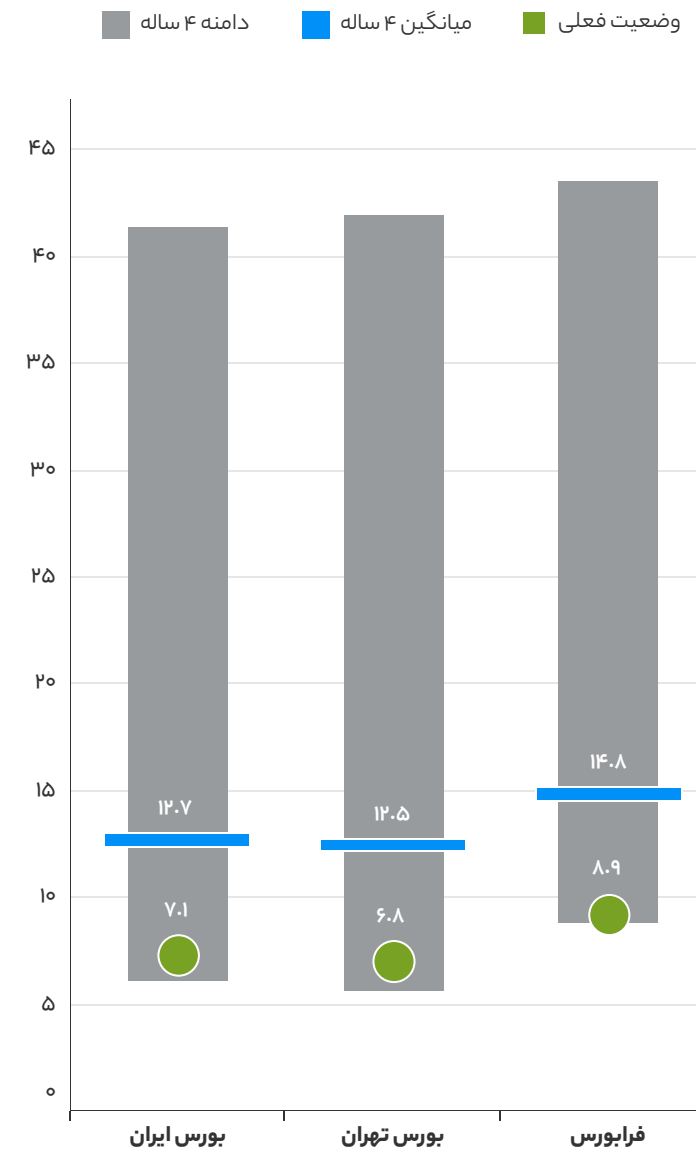
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۰۷	۷.۰۹	۶.۰۷	۱۲.۶۷	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۷۹	۶.۸۲	۵.۶۴	۱۲.۴۵	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۸۹	۸.۹۳	۸.۸۲	۱۴.۸۵	۴۳.۵۱

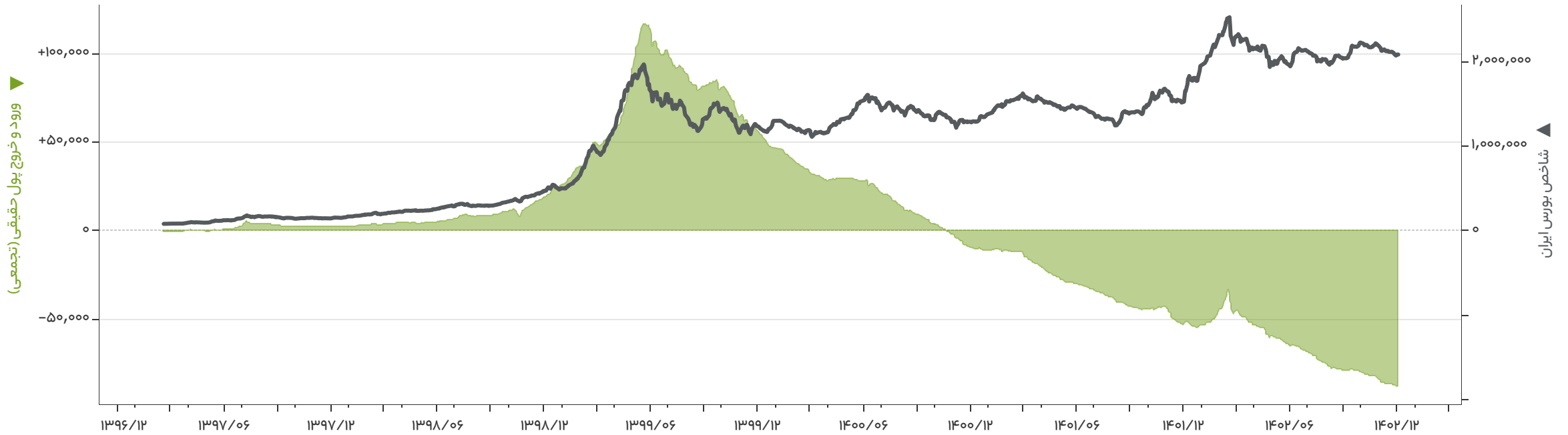


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	مواد پایه	خدمات مالی	انرژی	مصرفی دوره‌ای	مصرفی غیردوره‌ای	صنعتی	بهداشت	ارتباطات	تکنولوژی	یوتیلیتی	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۸۸	۱۹۹	۶	۶۶	۸۹	۶۳	۴۰	۵	۱۹	۱۱	۲۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۳,۲۳۷	۳,۱۲۷	۵۸۳	۳۷۴	۲۴۲	۱۹۱	۱۵۹	۱۱۶	۱۱۴	۸۶	۶۱	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۳۹.۱%	۳۷.۷%	۷.۰%	۴.۵%	۲.۹%	۲.۳%	۱.۹%	۱.۴%	۱.۴%	۱.۰%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته نگر	۷.۲	۶.۸	۴.۳	۵.۱	۹.۵	۸.۶	۹.۰	۱۱.۶	۱۶.۷	۱۱.۷	۱۵.۳	سودآوری
بازده سود نقدی	۹.۱%	۹.۴%	۱۵.۵%	۲.۳%	۵.۰%	۳.۶%	۷.۱%	۳.۴%	۳.۰%	۱۷.۵%	۲.۸%	
نسبت تقسیم سود	۷۳%	۶۲%	۶۳%	۳۴%	۵۴%	۳۷%	۷۶%	۴۱%	۵۷%	۱۰۰%	۳۹%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۱	۱.۰	۰.۹	۱.۲	۰.۸	۱.۴	۰.۷	۱.۱	۰.۹	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۹۱۹%	+۸۳۰%	+۷۴۹%	+۸۵۶%	+۲۲۷%	+۴۳۱%	+۳۹۱%	+۱۳۸%	+۳۰۰%	+۷۵۷%	+۷۱۶%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۵۹%	-۳%	+۱۰%	-۱۳%	-۷%	-۸%	+۱۷%	-۶۲%	۰%	+۱۰۹%	+۱۴%	
بازده از ابتدای سال	+۷۸%	+۶۴%	+۸۰%	+۹۱%	+۵۴%	+۱۰۶%	+۹۶%	+۵۳%	+۷۳%	+۳۸%	+۲۶۴%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۰%	-۱%	۰%	۰%	۱%	۰%	۱%	-۳%	۱%	۰%	-۶%	

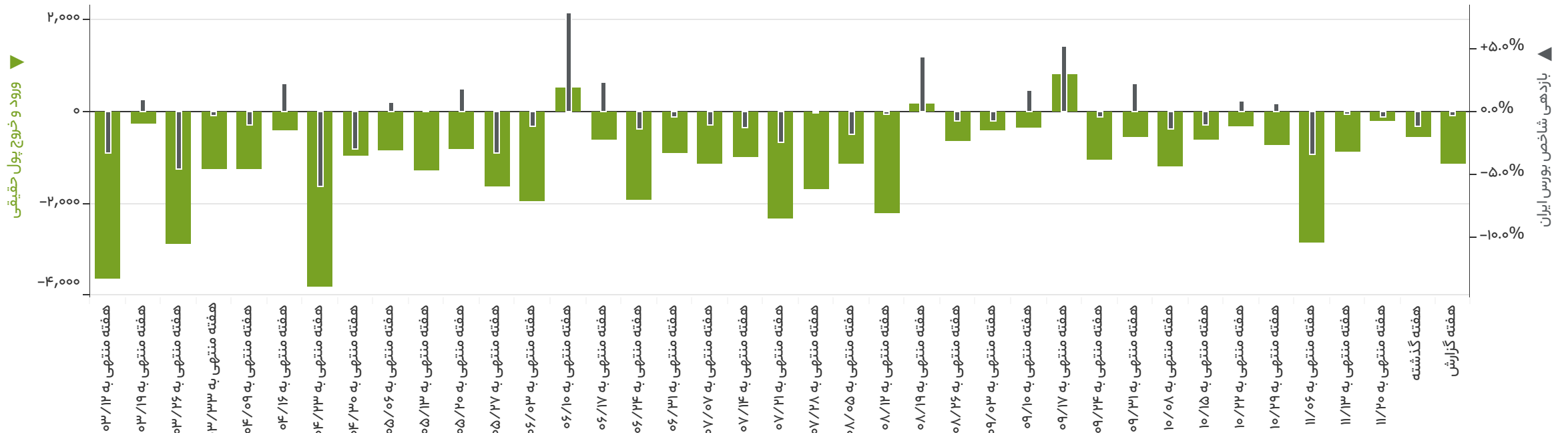
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



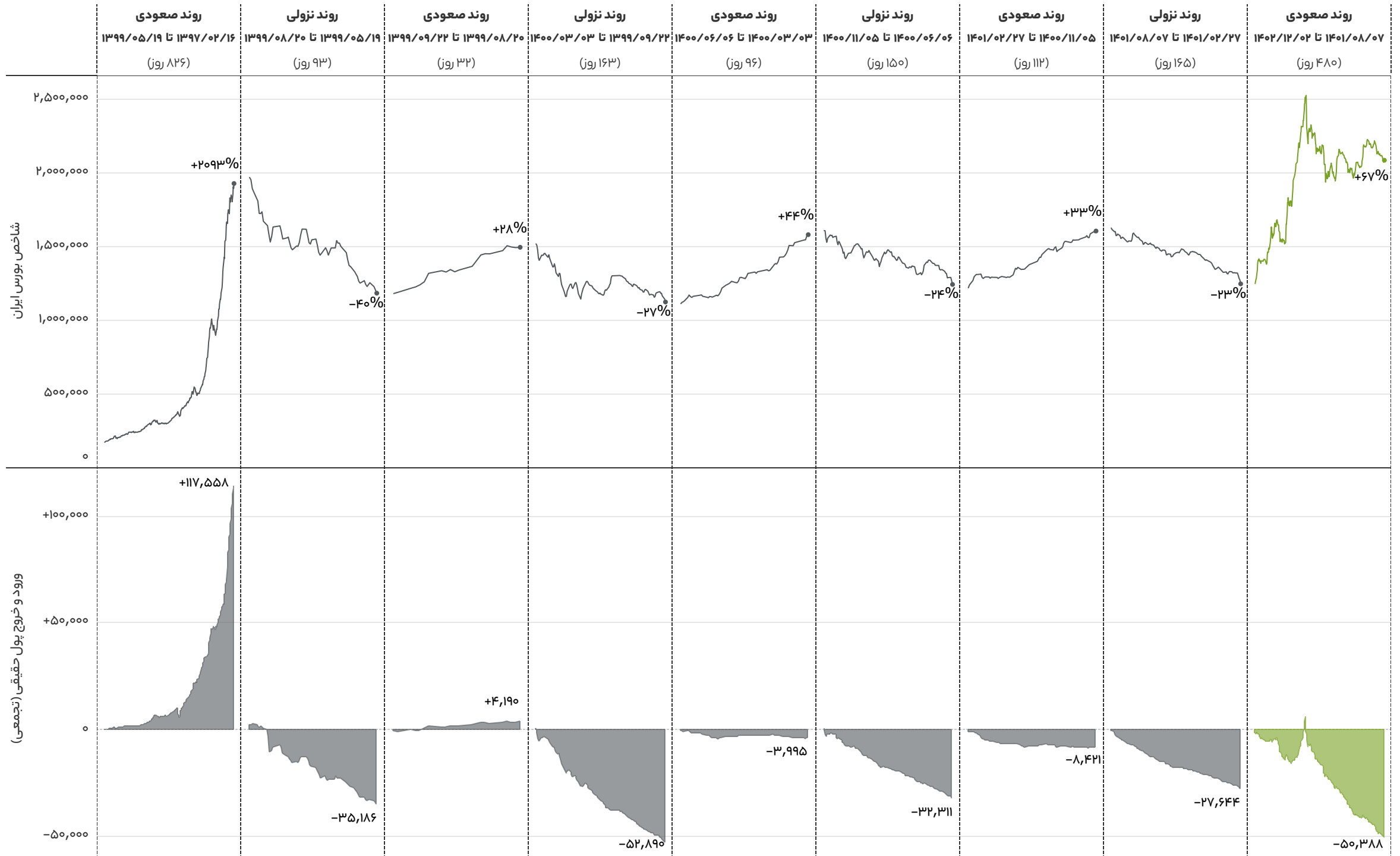
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



تغییر مالکیت شرکت

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

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	تغییر مالکیت شرکت	
			بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	بیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی
حشکوه	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰.۵	+۳.۳%	
حگردش	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰.۵	+۱.۳%	
کسرام	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱.۶	+۱.۲%	
زشگزا	محصولات کشاورزی	۱.۵	+۰.۷%	
چافست	چاپ و نشر	۲.۱	+۰.۷%	
زماهان	محصولات کشاورزی	۲.۳	+۰.۷%	
کلوند	کاشی و سرامیک	۱.۹	+۰.۶%	
سمایه	بانکها و موسسات اعتباری	۲.۸	+۰.۴%	
قیستو	شکر	۱.۷	+۰.۴%	
گکیش	هتل و رستوران	۰.۴	+۰.۴%	
آس پ	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲.۸	+۰.۳%	
سلار	سیمان، اهک و گچ	۱.۰	+۰.۳%	
ولانا	لیزینگ	۰.۳	+۰.۳%	
گلدیرا	وسایل خانگی	۵.۲	+۰.۳%	
کماسه	سایر مواد معدنی	۲.۱	-۰.۴%	
کسرا	کاشی و سرامیک	۲.۶	-۰.۴%	
خکمک	قطعات خودرو	۱.۸	-۰.۵%	
غشهد	محصولات کشاورزی	۰.۸	-۰.۵%	
فجوش	محصولات فلزی	۰.۴	-۰.۶%	
ثعمر	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲.۲	-۰.۶%	
نثران	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱.۹	-۰.۶%	
ولبهم	لیزینگ	۱.۷	-۰.۶%	
خریخت	قطعات خودرو	۱.۹	-۰.۷%	
شزنگ	پالایش نفت و گاز	۰.۳	-۰.۸%	
تمحرکه	ماشین الات	۰.۶	-۰.۸%	
فولای	آهن و فولاد	۰.۸	-۱.۱%	
ومشان	سرمایه گذاری	۰.۴	-۱.۱%	
فکمند	محصولات فلزی	۱.۱	-۱.۶%	

ورود و خروج پول حقیقی

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

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
			بیشترین ورود پول حقیقی	بیشترین خروج پول حقیقی
فولاد	آهن و فولاد	۴۷۴	+۳۷	
وسپه	سرمایه گذاری	۱۵	+۲۵	
کسرام	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۲	+۲۱	
حشکوه	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۱	+۱۷	
چافست	چاپ و نشر	۲	+۱۵	
زماهان	محصولات کشاورزی	۲	+۱۵	
گلدیرا	وسایل خانگی	۵	+۱۳	
خزامیا	خودرو	۱۶	+۱۳	
سمایه	بانکها و موسسات اعتباری	۳	+۱۲	
بوعلی	مواد شیمیایی-متنوع	۸۴	+۱۲	
کلوند	کاشی و سرامیک	۲	+۱۱	
زشگزا	محصولات کشاورزی	۲	+۱۱	
آس پ	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳	+۱۱	
سفارس	سرمایه گذاری	۲۰	+۱۰	
ومعادن	سرمایه گذاری	۹۴	-۱۹	
فارس	سرمایه گذاری	۵۴۹	-۱۹	
فخوز	آهن و فولاد	۷۱	-۲۰	
ونیکي	سرمایه گذاری	۲۶	-۲۱	
وپاسار	بانکها و موسسات اعتباری	۸۵	-۲۶	
شستا	سرمایه گذاری	۱۸۵	-۲۸	
وشهر	بانکها و موسسات اعتباری	۱۹	-۲۹	
ثفارس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۱	-۳۳	
ذوب	آهن و فولاد	۲۹	-۳۶	
خگستر	سرمایه گذاری	۱۷	-۳۷	
اخابر	مخابرات	۶۵	-۴۰	
خسپا	خودرو	۴۷	-۸۴	
وبملت	بانکها و موسسات اعتباری	۱۶۱	-۹۴	
خودرو	خودرو	۷۸	-۱۴۰	

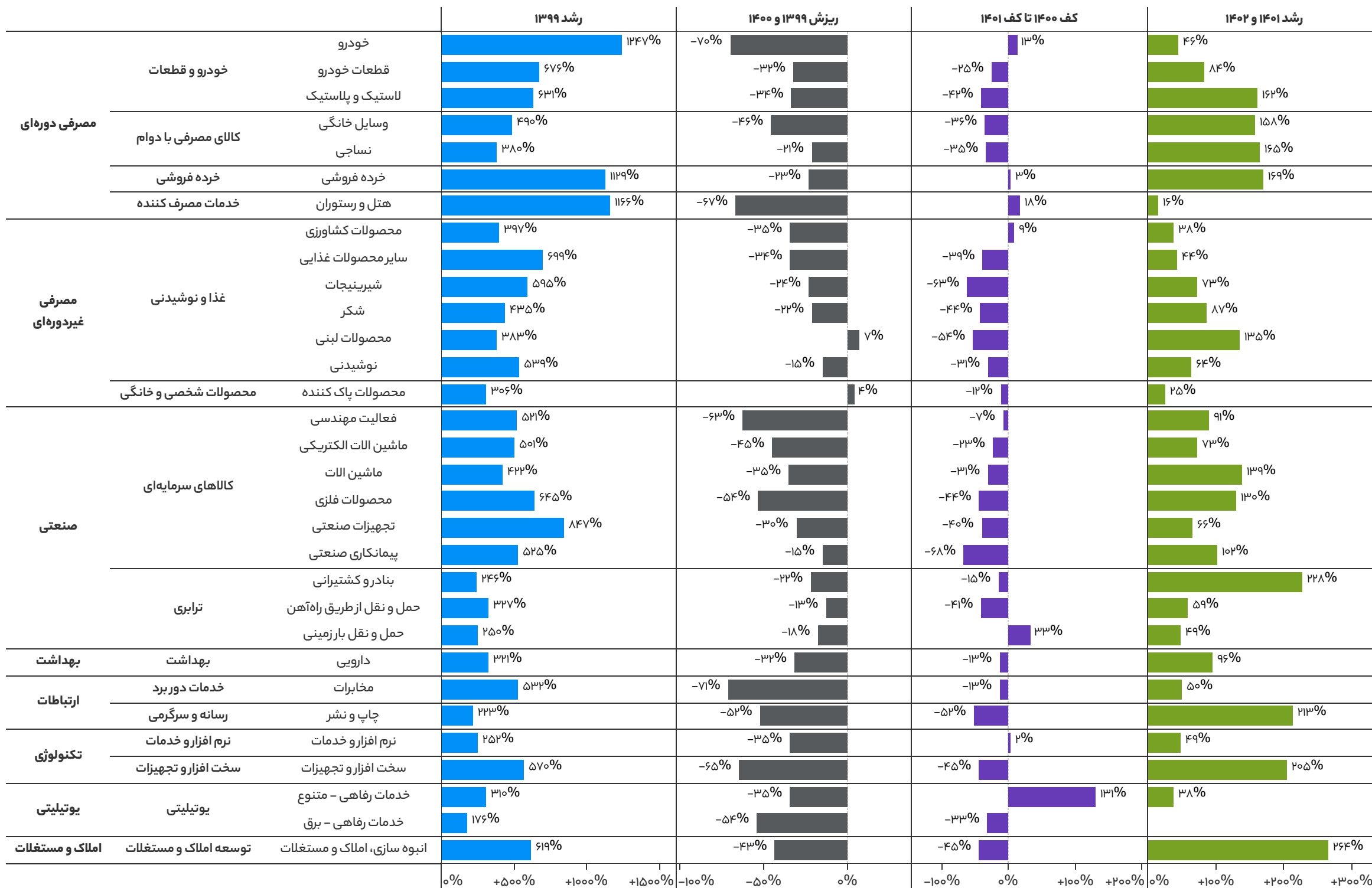
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

		رشد ۱۳۹۹ (۱۳۹۹/۰۵/۲۰ تا ۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	ریش ۱۴۰۰ و ۱۳۹۹ (۱۴۰۰/۰۳/۰۳ تا ۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱ (۱۴۰۱/۰۸/۰۴ تا ۱۴۰۰/۰۳/۰۳)	رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲ (۱۴۰۱/۰۸/۰۴ تا کنون)	
		<p>۲۳۱ روز کاری +۶۲۷%</p>	<p>۱۹۱ روز کاری -۴۳%</p>	<p>۳۳۹ روز کاری +۱۲%</p>	<p>۱۴۱ روز کاری +۶۷%</p>	
مواد پایه	فلزات و استخراج	آهن و فولاد	۵۶۴%	-۳۴%	۶%	۸۳%
		کانی های فلزی	۴۹۱%	-۱۴%	۸%	۲۳%
		تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۸۵۴%	-۳۲%	-۱%	۱۴۹%
		سایر مواد معدنی	۵۲۸%	-۷۱%	-۲۷%	۲۷۳%
	شیمیایی	مواد شیمیایی-متنوع	۴۰۰%	-۱۶%	۳۲%	۵۸%
		تولید کود و ترکیبات نیتروژن	۴۶۶%	-۲۰%	۹۸%	۱۶%
	مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ	۵۱۲%	-۱۷%	-۸%	۱۷۰%
		سایر محصولات کانی غیرفلزی	۴۳۰%	-۱۸%	-۳۵%	۱۱۳%
		کاشی و سرامیک	۴۶۳%	۱۳%	-۳۴%	۱۷۴%
	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	۳۸۵%	۸۸%	-۵۱%	۳۶۱%
کاغذ و محصولات جنگلی	چوب	۳۷۴%	-۷%	-۵۹%	۱۳۸%	
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	هلدینگ های سرمایه گذاری	۸۸۱%	-۵۲%	۱۸%	۷۱%
		تامین سرمایه	۱۲۸۷%	-۵۲%	۳۷%	-۶%
		فعالیت های مرتبط با اوراق بهادار	۹۱۶%	-۵۸%	-۷۴%	۱۹%
		لیزینگ	۵۱۳%	-۴۲%	-۲۶%	۸۹%
بانک ها	بانک ها و موسسات اعتباری	۷۲۸%	-۴۰%	-۲۶%	۶۲%	
بیمه	بیمه	۶۹۳%	۲۹%	۱۰%	-۹%	
انرژی	نفت، گاز و سوخت های مصرفی	پالایش نفت و گاز	۶۸۳%	-۶۸%	۸۷%	۷۹%
		زغال سنگ	۲۴۸%	۳%	-۱۸%	۹۳%
	تجهیزات انرژی و خدمات	حفاری	۳۶۵%	-۵۰%	-۳۳%	۱۹۶%

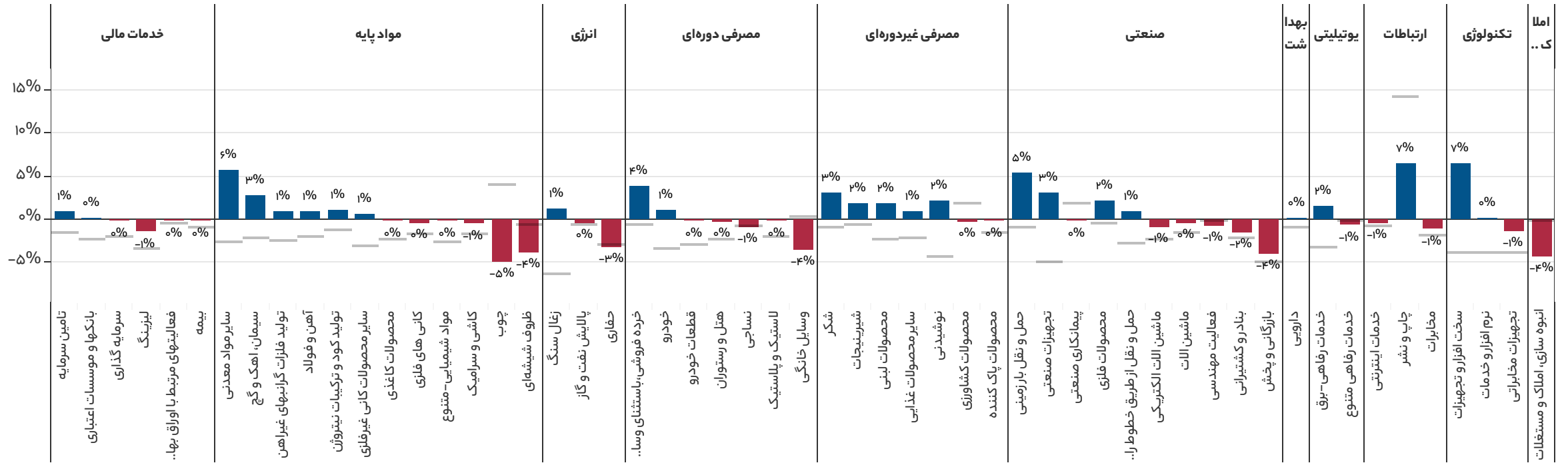


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



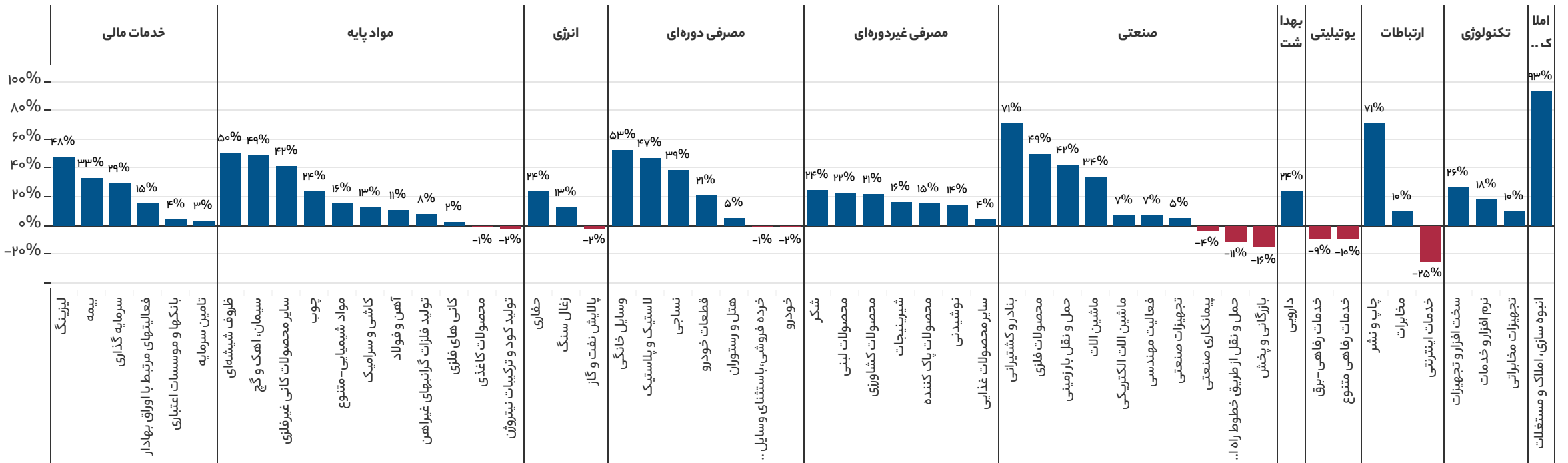
بازدهی صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده براساس سکتور، بازدهی تعدیل شده، بازدهی هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازدهی هفته گذشته با خط‌های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



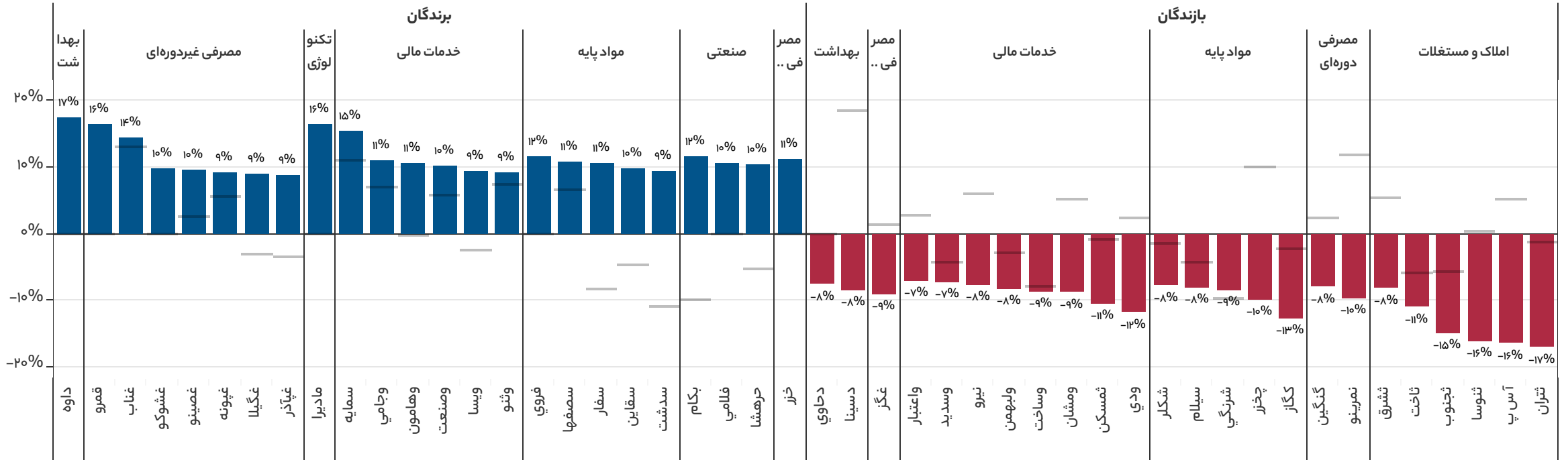
بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

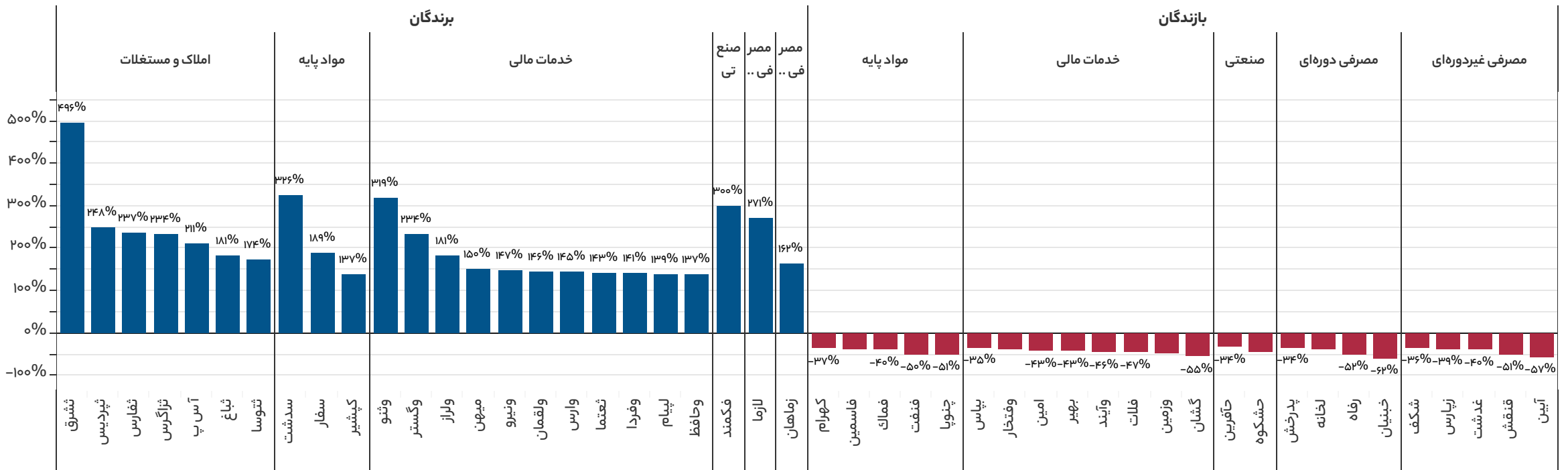




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)

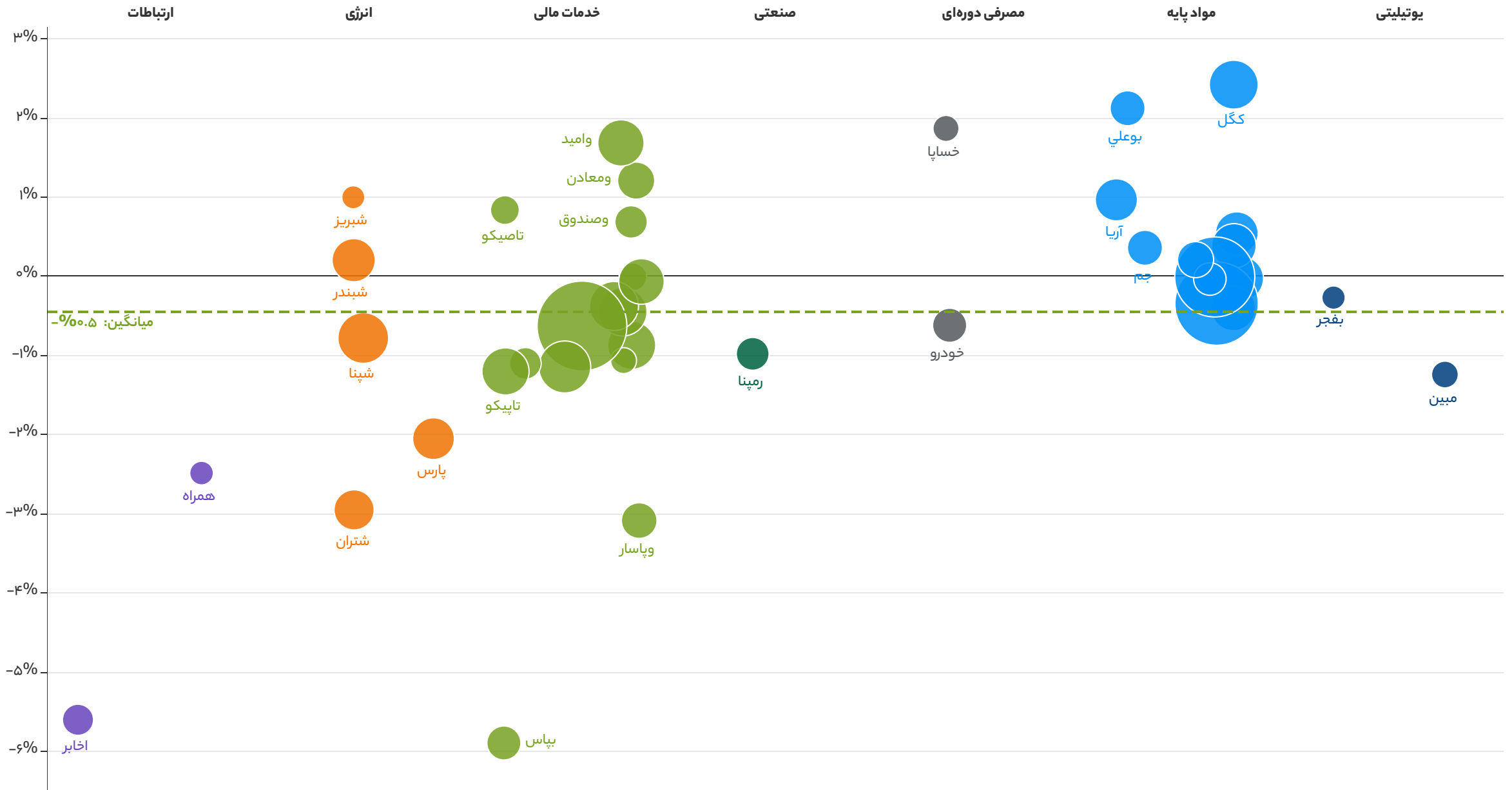


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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



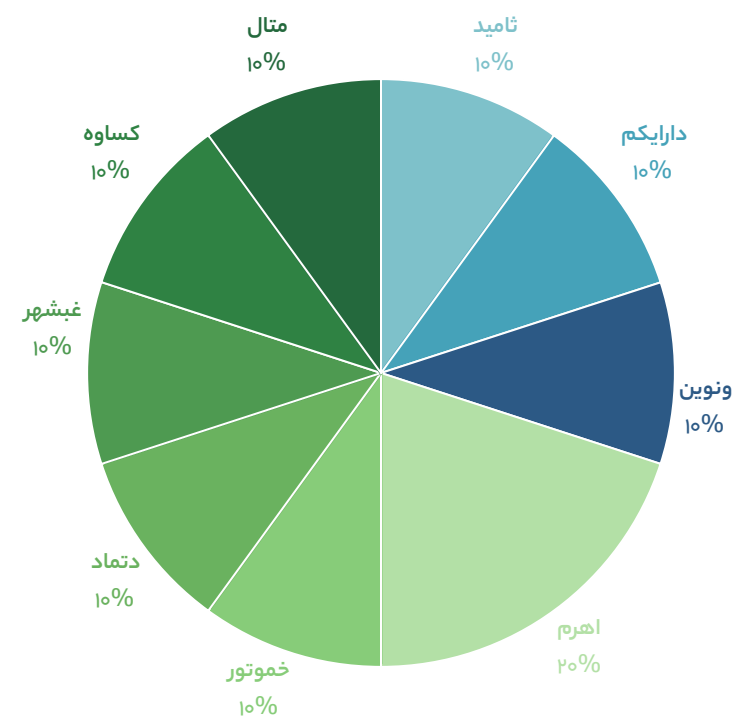
بازدهی هفته گذشته	کگل	بوعلي	خساپا	واميد	ومعادن	شبريز	آريا	تامنيكو	وسندوق	ماون	كگهر	چم	شپديس	شبندر	فعلی	وگفدير	نوري	فخوز	پارسان	بفجر	فولاد	ميدكو	كچاد	وبملت	خودرو	فارس	شپنا	وغدیر	رهمنا	وتجارت	مكشني	شستا	تاپيكو	مبين	پارس	همراه	شتران	وپاسار	اخبار	پياس
	+۲.۴%	+۲.۱%	+۱.۹%	+۱.۷%	+۱.۲%	+۱.۰%	+۱.۰%	+۰.۸%	+۰.۷%	+۰.۶%	+۰.۴%	+۰.۴%	+۰.۲%	+۰.۲%	۰%	۰%	۰%	۰%	-۰.۱%	-۰.۳%	-۰.۳%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۸%	-۰.۹%	-۱.۰%	-۱.۱%	-۱.۱%	-۱.۱%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۲.۰%	-۲.۵%	-۲.۹%	-۳.۱%	-۵.۰%	-۵.۱%	



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

افق زمانی	نماد	هدف قیمتی	توضیحات	قیمت سهم	وزن پیشنهادی
میان مدت	خموتور	۴,۸۰۰	افزایش ظرفیت و نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب به صنعت (P/NAV)	۳,۷۷۴	۱۰%
	دتماد	۷۱,۰۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۵۵,۲۰۰	۱۰%
	غبشهر	۲,۸۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۲۶۸	۱۰%
	کساوه	۲۴,۰۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۱۹,۳۶۰	۱۰%
	متال	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۱۰,۶۲۰	۱۰%
	اهرم	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۲۰,۲۱۰	۲۰%
بلند مدت	ثامید	۲,۹۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۲۲۲	۱۰%
	دارایکم	۲۱۰,۰۰۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۱۶۰,۱۱۰	۱۰%
	ونوین	۷,۸۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۳,۰۸۴	۱۰%



ارتباط با ما

فکس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶
شماره تماس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶
تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: www.charisma.ir
شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: [@CharismaHolding](https://t.me/CharismaHolding)

پست الکترونیکی: info@ciaco.ir
تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما: www.ciaco.ir
شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک: [@CharismaTickReports](https://t.me/CharismaTickReports)
تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، کوچه حکیم اعظم، پلاک ۱۷

