

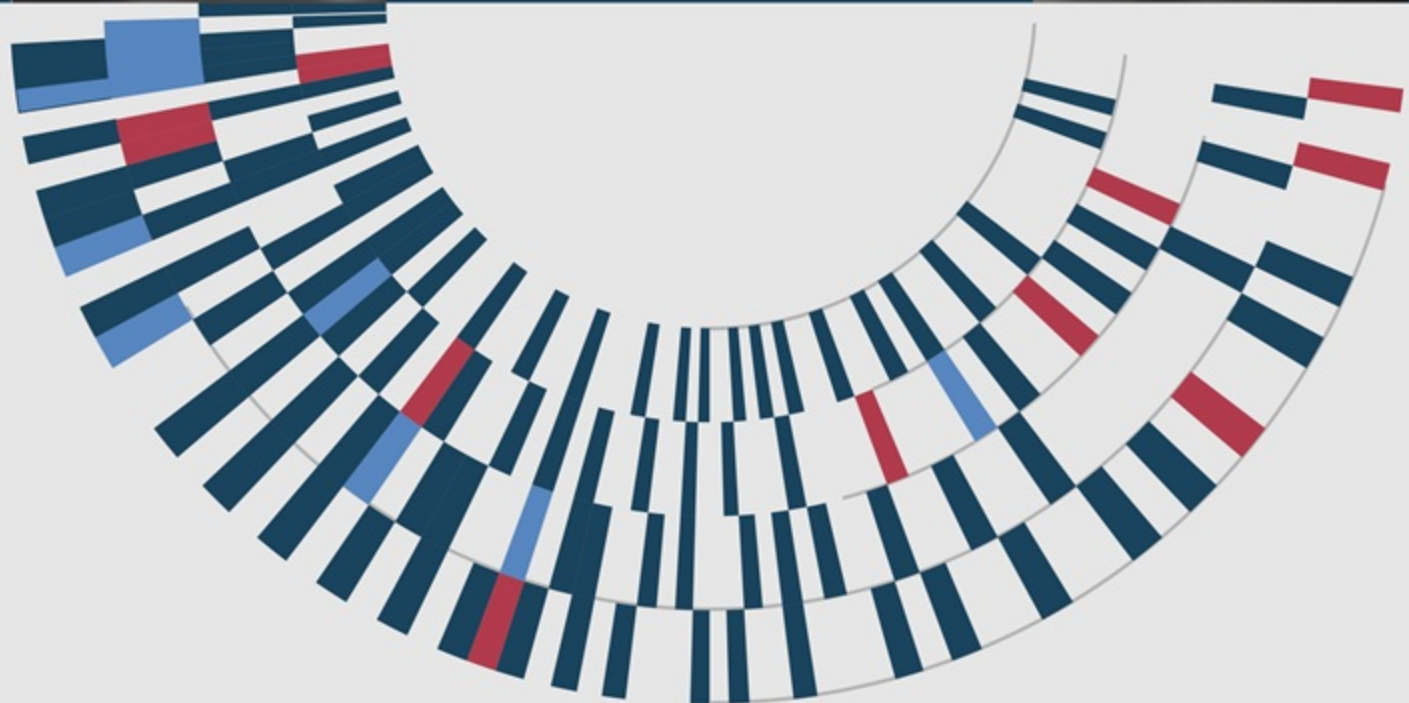


کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۰ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۱۱





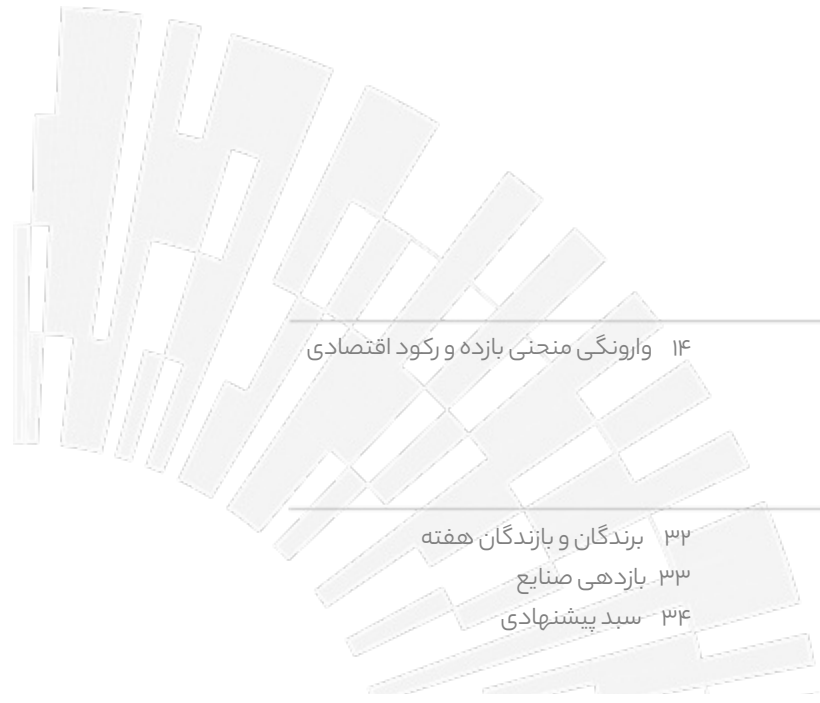
معرفی گزارش:

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

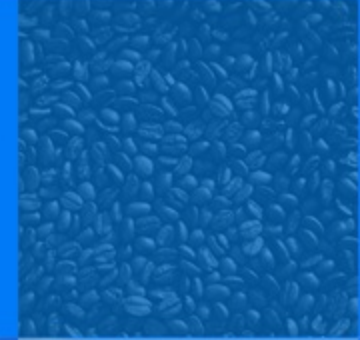
۱۵



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	روند قیمتی ۱۲ ماهه	
فلزات غیر آهنی	طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۲,۰۸۵	+۲.۴%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۰۸۵	
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۵۲۵	-۰.۵%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۹,۰۳۶	
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۶۱,۵۶۶	+۳.۲%	فملی	بموتو، فباهنر	۳۳۳,۵۸۹ - ۴۳۹,۹۱۶	
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۱۵	+۲.۲%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ - ۲,۴۲۴	
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۳۱	+۰.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۲,۹۲۴	
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۳۷	-۳.۰%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۲۹۶	
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۹۶	-۰.۳%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ - ۵۷۲	
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۲	-۰.۴%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۶۲۳	
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۱,۰۸۹	-۱.۱%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق	کوبیر، فوکا، فنورد	۱۷,۹۰۰ - ۲۲,۸۲۱	
	اسلب (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۹۸	-۰.۵%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ - ۵۶۵	
	اسلب (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۵۸	+۰.۹%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۶۷۰	
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۷۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۴۵۵	
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۹۵	-۱.۷%	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۷۴۵	
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۳,۳۱۳	+۴.۳%	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ - ۲۴,۴۵۹	
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۹۳	-۱.۷%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ - ۷۸۰	
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۷۰۸	-۱.۴%	فولاد	-	۶۴۰ - ۸۶۰	



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	
سنگ آهن و محصولات معدنی	سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۱۷	-۹.۸%	-	-	۱۰۱ - ۱۴۳	-۹%
	گندله سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۳۸	-۹.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۱۹ - ۱۶۴	-۱۰%
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۴,۸۸۷	-۰.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۹۹۵ - ۴,۹۲۱	۲۲%
	کنسانتره سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۲۷	-۱۰.۳%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۰۷ - ۱۵۳	-۱۱%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۷۳۲	+۰.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۰۸۵ - ۳,۷۳۲	۲۱%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۰۵	-۲.۶%	-	-	۱۹۹ - ۲۶۸	-۱۸%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۶۷	+۶.۱%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۲۶۳	-۳۱%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۵۲۳	+۱۴.۸%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۱%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۱۱	+۰.۴%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸ - ۹۱۴	-۱۱%



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	۳۰۹	+۱.۸%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شرفارس، شسینا	۲۳۵ - ۳۱۳	-۱%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۰	+۴.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۱,۰۱۰	۳%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۵	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۹۳۵	-۱۵%
پاراژایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۳	-۱.۱%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ - ۱,۱۵۸	۰%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۵	+۰.۵%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۸۰	-۱۲%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۱۴	-۱.۱%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۶۸	۶%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۱۳	-۲.۹%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۴۳	۸%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۸۸۹	-۱.۶%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۰۳	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۳۰۰	+۴.۰%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۳۰۰	۸%
مونواتیلن گلابکول	چین CFR	دلار/تن	۵۴۳	+۰.۶%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	۸%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۸۱	-۷%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۲۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۱,۰۱۱	-۸%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۵	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۸۵	-۷%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۴۷	-۰.۱%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۴۶	-۱۱%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۶۵	+۲.۱%	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۷۵	-۹%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۵	+۰.۶%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۷۴۰ - ۹۰۰	-۱۳%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۵۵	+۲.۷%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۰۵	-۳%

مواد شیمیایی

پلیمرها



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
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۳	+۲.۱%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریزو، شرارز، شاولان	۷۲ - ۹۴	۱%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۰	+۴.۲%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریزو، شرارز، شاولان	۶۶ - ۹۱	۴%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۰	-۲.۳%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	۷۸ - ۱۰۷	۱%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۹	-۱.۵%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	۷۹ - ۱۲۵	۳%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۹۸	+۰.۳%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	۳۵۰ - ۵۲۸	۳%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۸	-۰.۳%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	۸۱ - ۱۲۴	۵%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۴۰	+۲.۳%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریزو، شرارز، لاوان	۴۵۲ - ۶۵۹	۳%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۷۷۰	+۵.۵%	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	۷۲۰ - ۹۵۰	-۱۷%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۸,۸۵۵	+۱۰.۲%	-	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۲۱,۷۹۵ - ۳۳,۵۱۵	-۱۳%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۸,۴۱۳	-	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریزو، شرارز، شاولان	۱۱,۵۷۳ - ۲۱,۶۳۴	۵۹%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۲,۹۴۱	-۳.۳%	-	شپاس	۱۲,۰۸۶ - ۱۷,۱۴۰	-۱۳%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۶۲	-۰.۵%	-	ذوب، فروش	۱۹۶ - ۳۲۱	-۱۹%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۸	+۰.۱%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	۲%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	-۰.۱%	-	-	۱.۲۰ - ۱.۳۱	۵%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۲,۴۵۱	+۲۲.۴%	-	-	۱۹,۹۹۴ - ۶۲,۴۵۱	۲۲%

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	-۲.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۲۶%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۸	+۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ - ۰.۱۰	-۱۴%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۲۸	+۲.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۴۰%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۲۹	+۱۰.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۰.۶۱	-۴۹%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۸	+۴.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۴۱%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

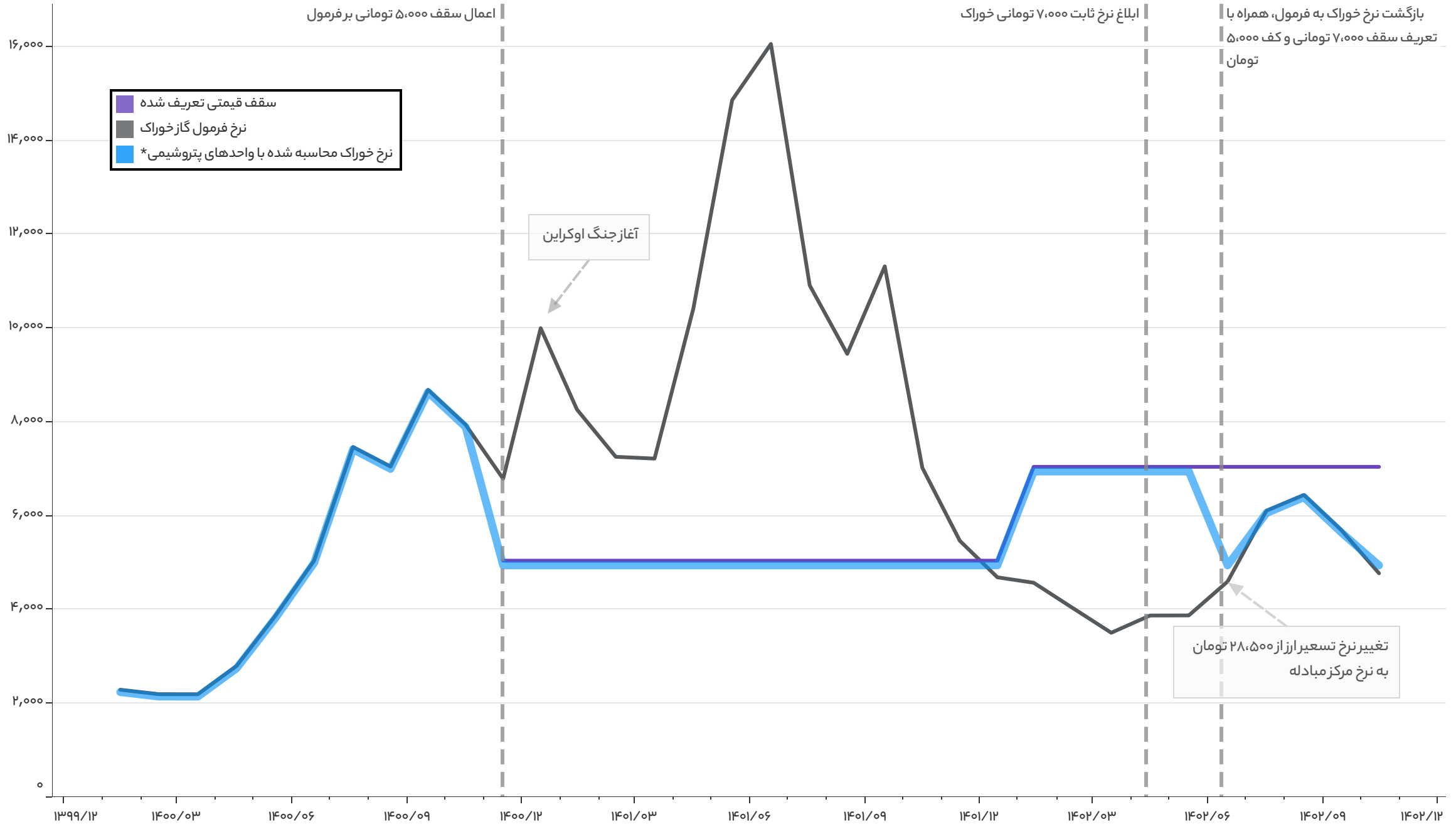
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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

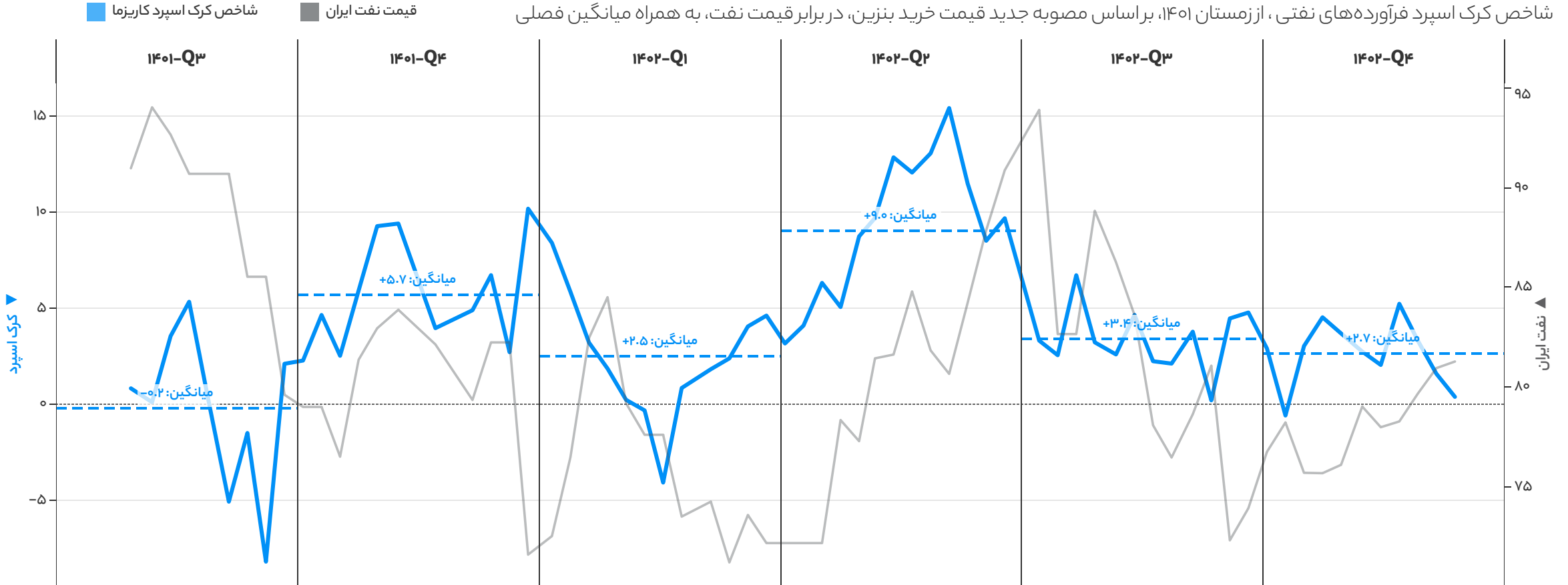


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



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	۸۱.۳								
گازوئیل	۹۸.۸	۱۹.۳	۱۷.۴	▼۱.۸	۲۳.۲	۲۰.۱	-۱۳.۴%		
بنزین**	۸۵.۳	۶.۲	۴.۰	▼۲.۲	۱.۱	۵.۰	+۳۴۵.۴%		
نفتا	۷۲.۴	-۱۰.۲	-۸.۹	▲۱.۳	-۱۲.۳	-۹.۷	+۲۱.۲%		
نفت کوره	۶۲.۷	-۱۸.۴	-۱۸.۶	▼۰.۱	-۱۵.۲	-۱۴.۹	+۲.۰%		
لوب کات***	۷۱.۳	-۹.۷	-۱۰.۰	▼۰.۳	-۲.۹	-۸.۳	-۱۸۵.۳%		
وکیوم باتوم***	۴۵.۷	-۳۵.۲	-۳۵.۶	▼۰.۴	-۲۸.۵	-۳۲.۰	-۱۲.۴%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۱.۶	۰.۴	▼۱.۲	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 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.



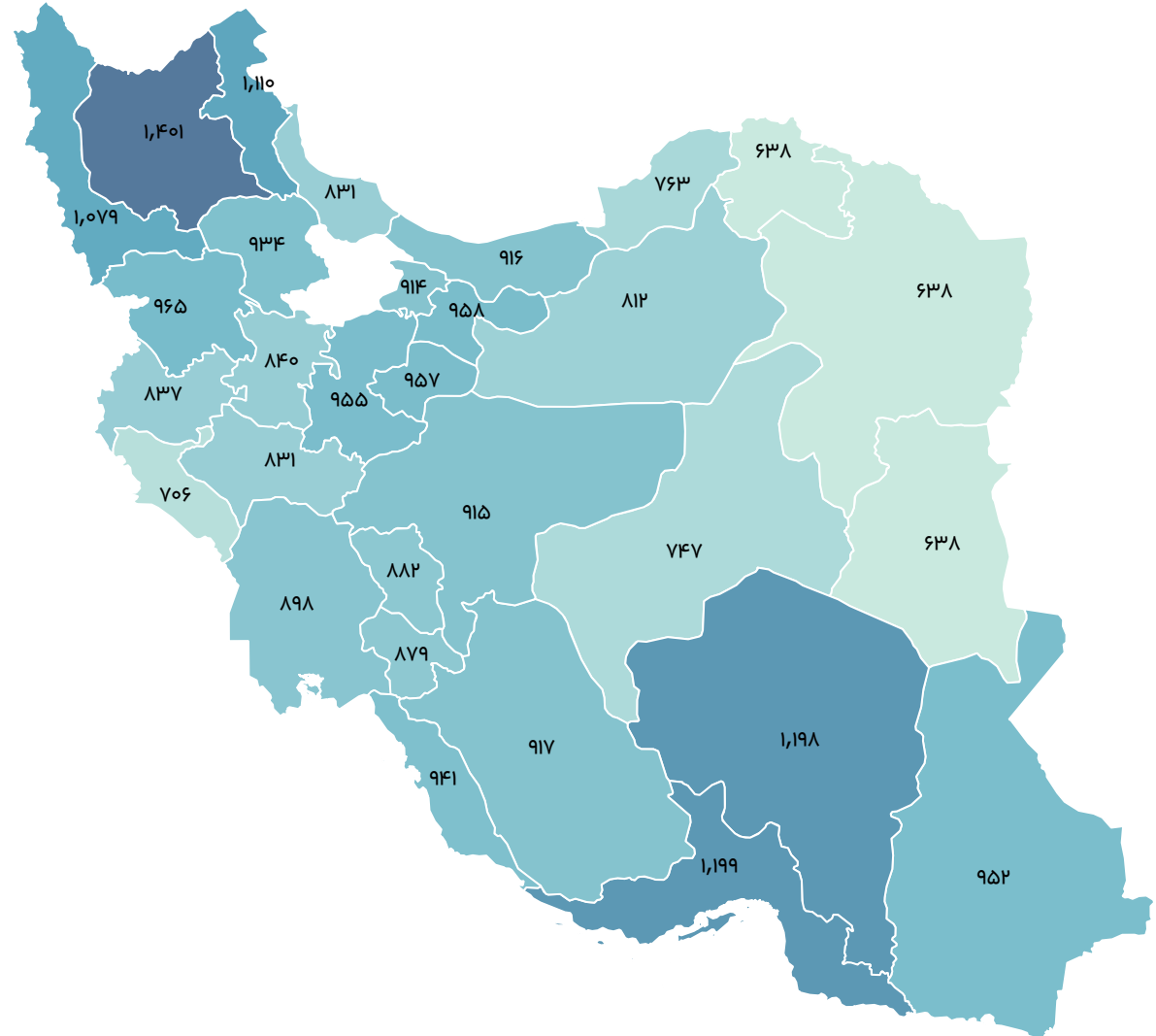
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۹۴۷	۹۵۸	+۱.۲%
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۲۱	۹۵۵	+۳.۷%
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۷۹۹	۷۴۷	-۶.۶%
	قم	سیمان نینزار قم	۱,۰۴۵	۹۵۷	-۸.۴%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
غرب	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۴۰	+۱.۴%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۴۸	۸۹۸	-۵.۳%
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۹۱۷	۸۸۲	-۳.۹%
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۷۰	۸۳۷	-۳.۸%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۸۷۹	-
	لرستان	سیمان دورود	۸۳۱	۸۳۱	-
	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۶۵	+۲.۶%
	مازندران	سیمان مازندران	۹۷۵	۹۱۶	-۶.۰%
شمال	گیلان	سیمان خزر	۹۶۷	۸۳۱	-۱۴.۱%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۶۳	۷۶۳	-
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۱۷۵	۱,۱۹۹	+۲.۰%
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۱۷	-
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۶۳	۹۴۱	-۲.۳%
شمال غرب	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۲۰۸	۱,۱۱۰	-۸.۱%
شمال شرق	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۱۴۴	۱,۴۰۱	+۲۲.۵%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۱,۰۲۴	۱,۰۷۹	+۵.۴%
	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	۱,۱۳۵	۱,۱۹۸	+۵.۶%
شرق	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۱۲۳	۹۵۲	-۱۵.۲%

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



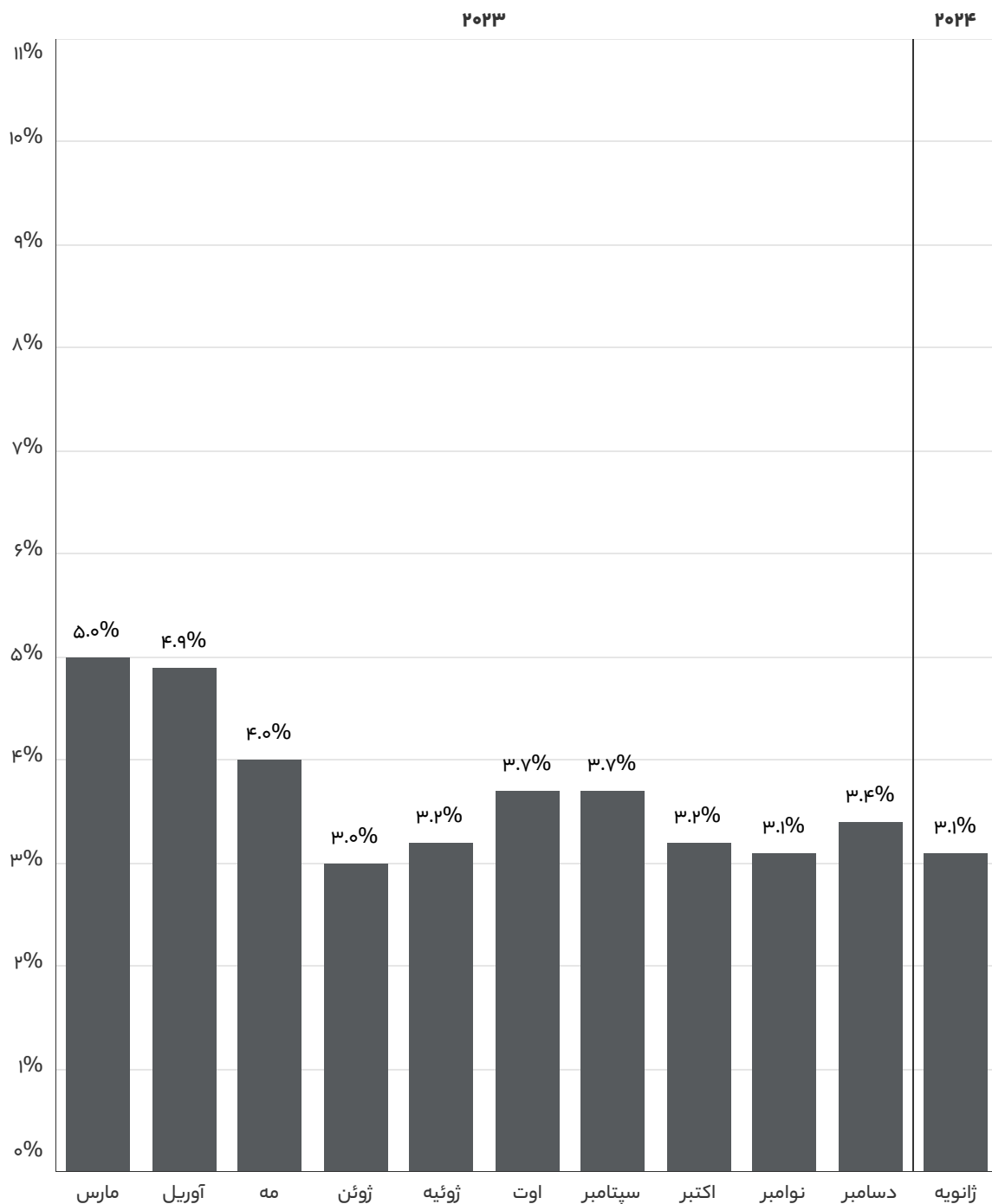
* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ قیمت جهانی طلا طی هفته گذشته روند صعودی داشته و در روزهای شنبه تا پنجشنبه محدوده قیمتی ۲۰۲۴ تا ۲۰۵۱ را طی کرده است. در روز جمعه افزایش ۴۰ دلاری را تجربه کرده و در قیمت ۲۰۸۲ دلار بسته شده است. این افزایش قیمت طلا در روز جمعه شدید بوده و حتی دقایقی با قیمت ۲۰۸۸ دلار نیز معامله شده است.
- آگهی نخستین جلسه حراج سکه طلا در سامانه مرکز مبادله ارز و طلای ایران و همچنین شیوه‌نامه نحوه برگزاری این حراج منتشر شد. به گزارش از مرکز مبادله ارز و طلای ایران، براساس شیوه‌نامه نحوه برگزاری حراج سکه طلا در سامانه مرکز مبادله ایران، اولین جلسه حراج سکه طلا در روز یکشنبه ۱۳ اسفند ماه ۱۴۰۲، برگزار می‌شود. در نخستین جلسه حراج سکه، ربع سکه بهار آزادی ضرب سال ۱۳۸۶ بانک مرکزی است و هر متقاضی مجاز به ثبت سفارش حداکثر ۵ قطعه است.
- مدیریت ارتباطات مرکز مبادله ارز و طلای ایران، دهمین حراج حضوری شمش طلا در مرکز مبادله ارز و طلای ایران روز سه‌شنبه ۸ اسفند ماه ۱۴۰۲ با حضور خریداران و فروشندگان در تالار معاملات طلای مرکز مبادله ایران برگزار شد و حدود یک هزار میلیارد تومان شمش معامله شد. از مجموع عرضه ۳۰۴ قطعه شمش طلای استاندارد یک کیلوگرمی با عیار ۹۹۵ در هزار، ۲۶۸ قطعه شمش طلای استاندارد مورد معامله طرفین قرار گرفت. شمش های طلای استاندارد، در این حراج با میانگین قیمت ۳ میلیارد و ۷۲۱ میلیون تومان معامله شد.
- ▲ سازمان ابتکار داده مشترک (JODI) که اطلاعات گزارش شده از سوی کشورها را جمع‌آوری می‌کند، اعلام کرد تقاضای رو به رشد در آسیا، افت تقاضا در آمریکا و اروپا در ماه‌های پایانی سال ۲۰۲۳ را کاملاً جبران کرد. طبق آمار JODI، تقاضا برای نفت در دسامبر نسبت به نوامبر، ۵۴۱ هزار بشکه در روز افزایش یافت. چین و پس از آن ژاپن و هند، محرکان اصلی رشد تقاضا برای نفت بر مبنای ماه به ماه بودند و کاهش تقاضا در آمریکا، ایتالیا و آلمان را به طور کامل جبران کردند. در بخش سوخت‌ها، تقاضای جهانی برای گاز مایع (ال پی جی) در دسامبر، به بالاترین حد خود رسید و همزمان، تقاضا برای بنزین و دیزل، به میانگین پنج ساله کاهش یافت.
- ▼ موسسه اقتصاد انرژی و تجزیه و تحلیل مالی (IEEFA) در گزارشی اعلام کرد افزایش تاسیسات ظرفیت نیروی تجدیدپذیر و اقدامات برای تقویت بهره‌وری انرژی، باعث کاهش مصرف گاز اروپا به پایین‌ترین رکورد ۱۰ سال اخیر در سال ۲۰۲۳ شد و تقاضای این منطقه برای گاز طبیعی مایع (ال پی جی) ممکن است تا اوایل سال آینده، به اوج برسد. طبق گزارش این موسسه، اقتصادهای بزرگی از جمله آلمان، ایتالیا و انگلیس، بزرگترین محرکان کاهش تقاضای اروپا برای گاز بودند. تقاضای اروپا برای گاز در سال ۲۰۲۲ و ۲۰۲۳ به دلیل بحران انرژی، افزایش سرسام‌آور قیمت پایه بازار گاز و تقاضای صنعت ضعیف‌تر در بنبوه اقتصادهای بحران زده، کاهش یافت.
- ▲ میخائیل میشوستین، نخست وزیر روسیه، ممنوعیت صادرات بنزین را به مدت شش ماه از اول مارس تصویب کرد. روزنامه RBC روز سه‌شنبه به نقل از دو منبع گزارش کرد ممنوعیت موقت صادرات شامل حجم توافق شده صادرات به کشورهای اتحادیه اقتصادی اوراسیا، مغولستان، ازبکستان، آبخازیا و اوستیای جنوبی نمی‌شود. الکساندر نوک، معاون نخست‌وزیر روسیه، پیش از این پیشنهادی برای معرفی این ممنوعیت موقت به نخست‌وزیر ارائه کرده بود. نوک در نامه‌ای به تاریخ ۲۱ فوریه خاطر نشان کرد تقاضای فصلی برای سوخت، به زودی در بازار داخلی افزایش خواهد یافت. بر اساس گزارش رویترز، روسیه در سپتامبر گذشته، به منظور مقابله با قیمت‌های بالای داخلی و کمبود عرضه، ممنوعیت صادرات سوخت را وضع کرد که البته این ممنوعیت شامل بلاروس، قزاقستان، ارمنستان و قرقیزستان نبود. اما تمام محدودیت‌های صادرات تا نوامبر حذف شدند.
- ▲ عراق روز جمعه پالایشگاه شمال خود در بیجی که یکی از مهمترین مجتمع‌های انرژی این کشور است را پس از گذشت یک دهه از تعطیلی آن، بازگشایی کرد. مجتمع پالایشگاه بیجی یکی از قربانیان برجسته هرج و مرج موجود در عراق بود و ماه‌های متوالی به نقطه اصلی نبرد بین نیروهای امنیتی و عناصر داعش تبدیل شد. این پالایشگاه در سال ۲۰۱۴، پس از این که عناصر داعش با تصرف یک سوم خاک کشور عراق، آن را تصرف کردند، بسته شد. بر اساس گزارش رویترز، پالایشگاه بیجی پس از بازگشایی، ظرفیت پالایش ۱۵۰ هزار بشکه در روز را دارد که ظرفیت کل مجتمع پالایشگاه بیجی را به ۲۹۰ هزار بشکه در روز می‌رساند.
- جواد اوجی، وزیر نفت در مراسم پایانی هفدهمین اجلاس کمیسیون مشترک همکاری‌های اقتصادی جمهوری اسلامی ایران و فدراسیون روسیه گفت: ایجاد قطب گازی، تجارت گازی، سوآپ فرآورده‌های نفتی و ارتقای سیستم‌های میان بانکی و مالی از موارد همکاری ایران و روسیه خواهد بود. اوجی با بیان اینکه ایران و روسیه در ۱۱ زمینه مختلف تفاهم‌نامه همکاری و مذاکرات جدی داشتند، گفت: همکاری در حوزه نفت و گاز و تلاش برای اجرایی‌سازی تفاهم‌نامه‌های فی مابین در زمینه‌های مختلف مانند توسعه ۸ میدان نفتی که از سوی شرکت‌های روس در مرحله تفاهم‌نامه، قرارداد و اجرا هستند، انجام شده که برخی از این میدان‌ها هم به بهره‌برداری رسیده‌اند.
- واشنگتن روز جمعه به مناسب دومین سالگرد آغاز حمله نظامی روسیه به اوکراین، تحریم‌هایی را وضع کرد. این تحریم‌ها، گروه نفتکش سوفکامفلوت را هدف گرفته که از سوی واشنگتن متهم شده است که در نقض سقف قیمت گروه هفت برای نفت روسیه مشارکت داشته و همچنین، ۱۴ نفتکش مرتبط با این شرکت هم تحریم شدند. منابع آگاه به رویترز گفتند: پالایشگاه‌های هندی نگران هستند که جدیدترین تحریم‌ها، چالش‌هایی را برای یافتن کشتی برای نفت روسیه، ایجاد کرده و نرخ کرایه را بالا ببرند. در نتیجه، تخفیف برای نفت روسیه که از بازرگانان و شرکت‌های روسی بر مبنای تحویل در مقصد خریداری می‌شوند را کمتر کنند. هند تا قبل از سال ۲۰۲۲، به ندرت نفت روسیه را که هزینه‌های حمل بالایی داشت، خریداری می‌کرد اما پس از ممنوعیت واردات نفت روسیه به اروپا، پالایشگاه‌های هندی اکنون در میان خریداران بزرگ نفت روسیه هستند و از قیمت پایین‌تر آن بهره می‌برند.
- در حالی که ابتدای اسفندماه، متوسط مصرف روزانه بنزین کشور ۱۱۵ میلیون لیتر بود، به گفته وزیر نفت، در روزهای اخیر، این رقم به بیش از ۱۳۲ میلیون لیتر افزایش یافته است. در حالی که در میانه زمستان به سر می‌بریم و در این موقع از سال انتظار ثبت پیک جدید مصرف بنزین وجود ندارد، مصرف روزانه بنزین افزایش عجیب و غریب داشته است. بنا به گفته وزیر نفت، دلیل افزایش عجیب و غریب مصرف روزانه بنزین، اوج‌گیری سفرهای بیرون‌شهری در تعطیلات اخیر بوده است. همچنین غلامرضا کوشکی، رئیس مرکز راهبری گاز کشور، در گفت‌وگویی تلویزیونی اظهار داشت: حجم مصرف گاز در بخش خانگی و تجاری در روز دوشنبه به ۶۶۵ میلیون مترمکعب رسید و رکورد مصرف امسال ثبت شد. وی تصریح کرد: اکنون شبکه گاز بعضی شهرها در استان‌های گلستان، مازندران، گیلان و خراسان رضوی و خراسان شمالی و خراسان جنوبی شرایط بحرانی دارند.



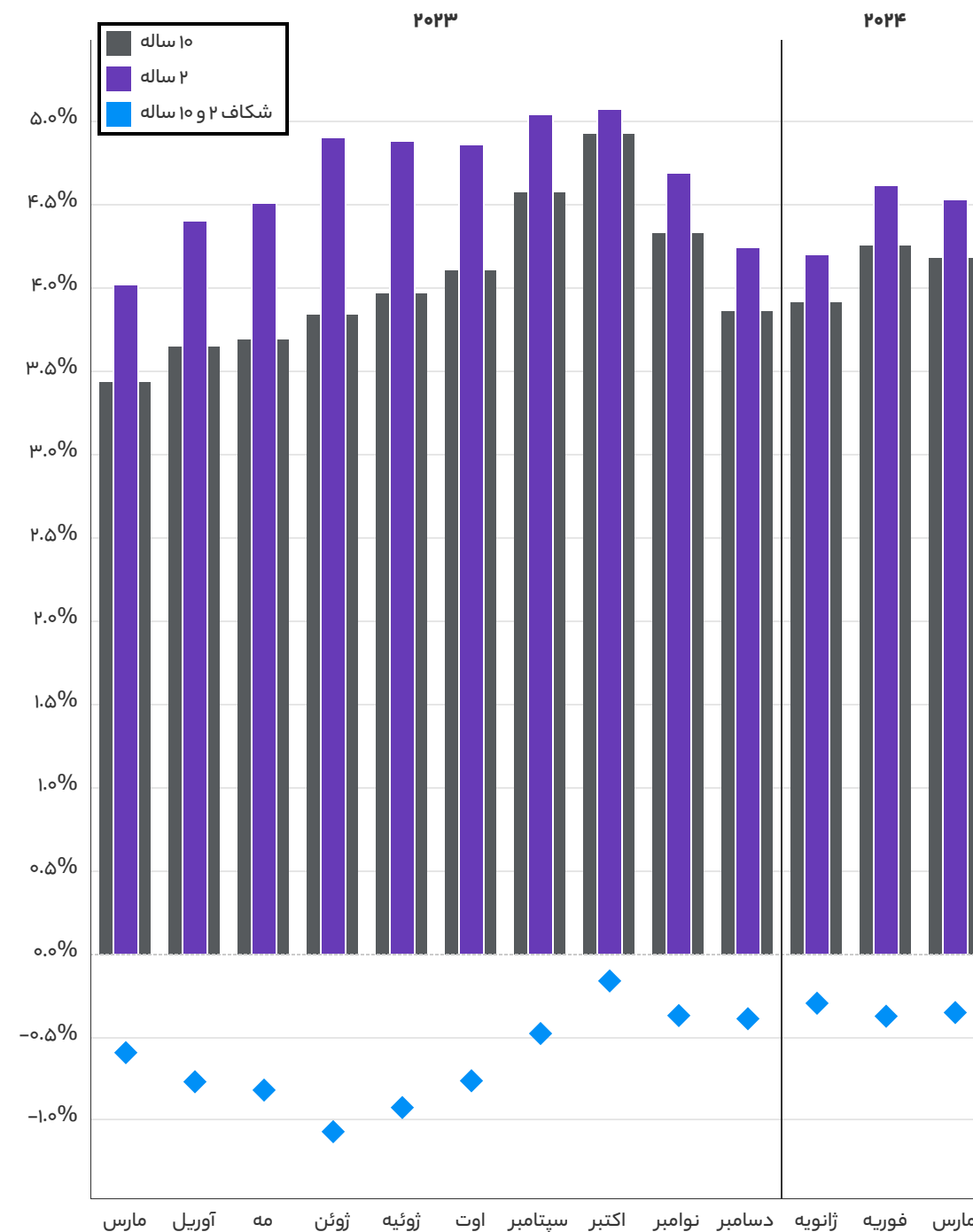
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



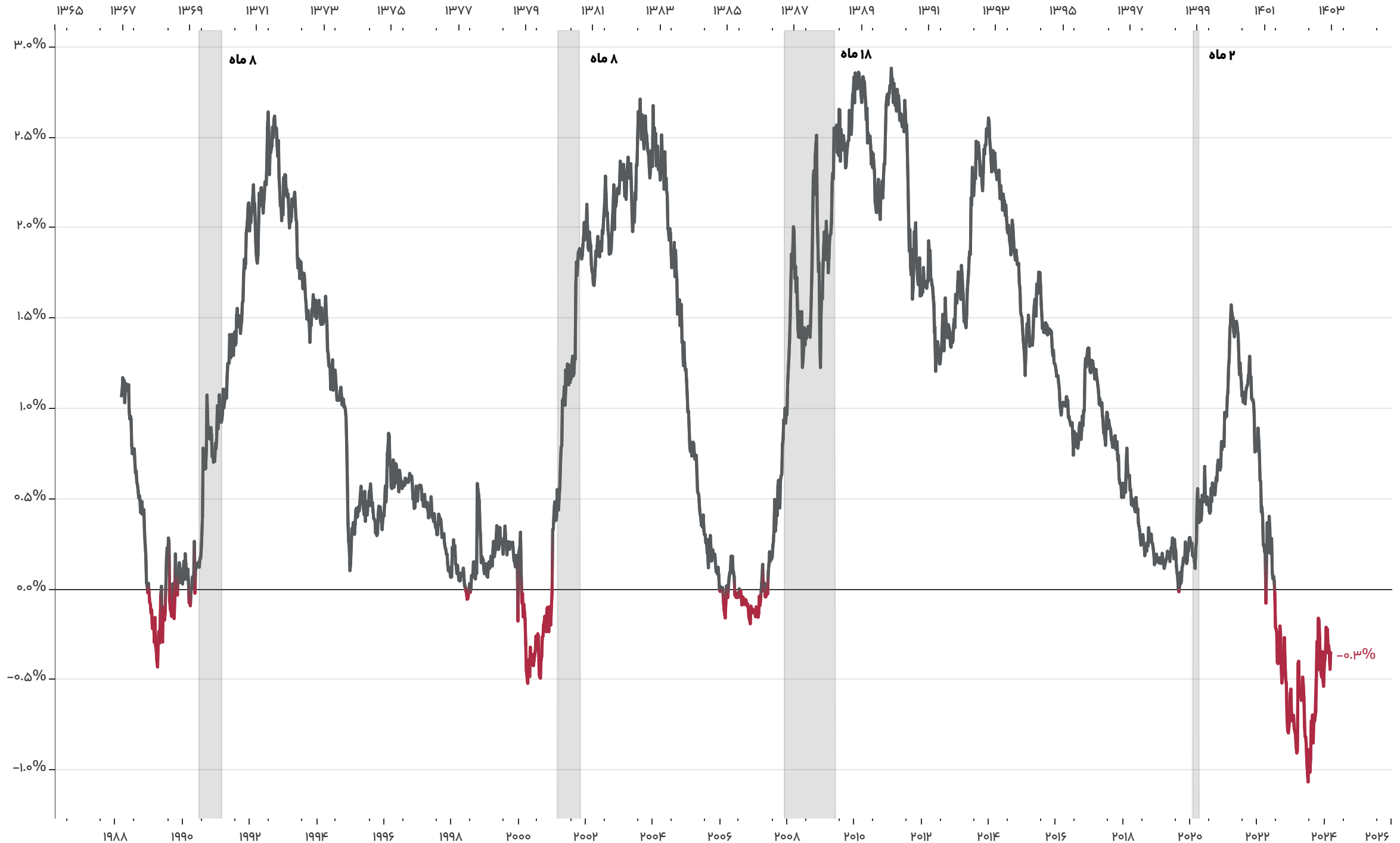
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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



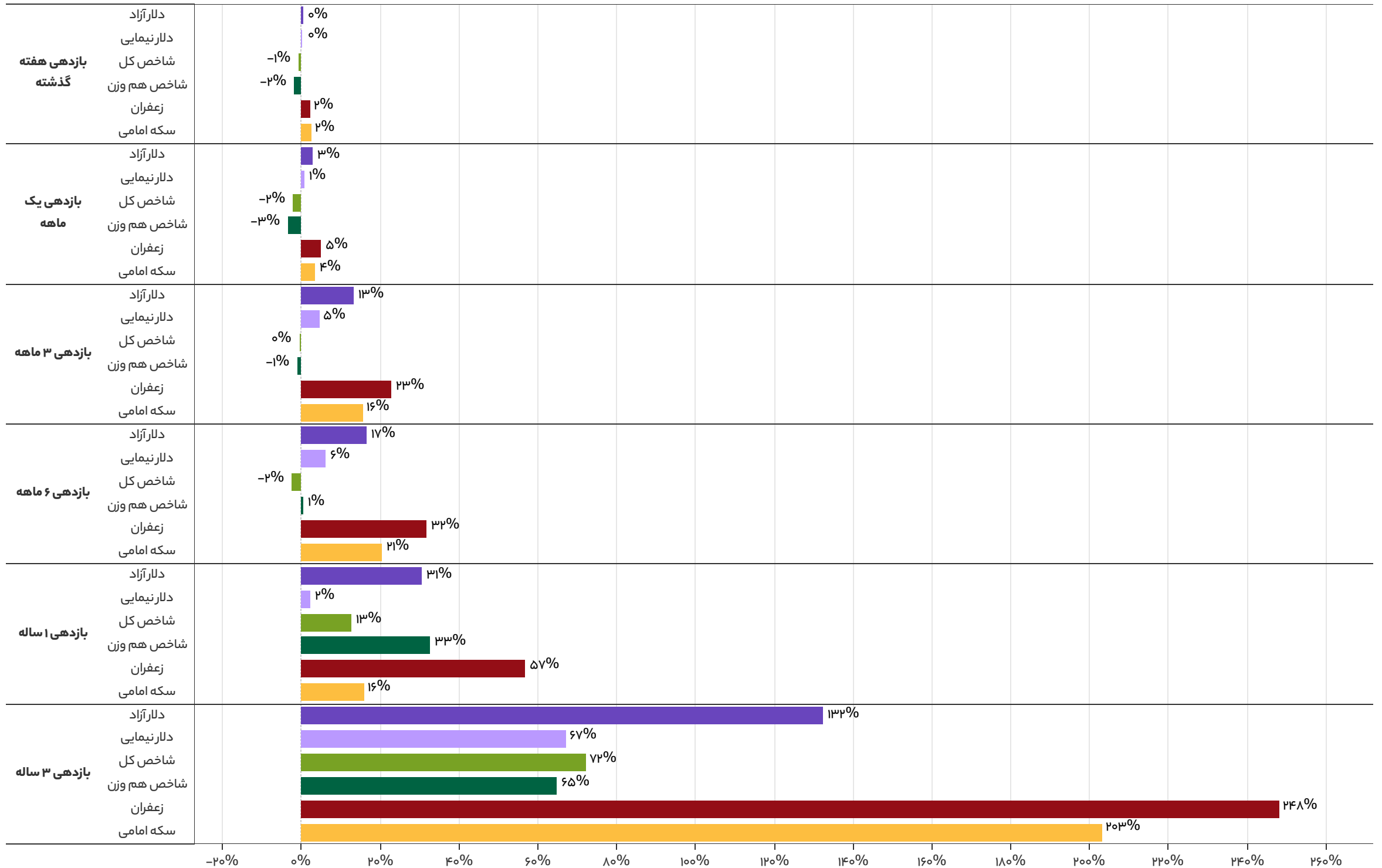
بازار سهام

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 هرماه، 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 کاربرما ذکر گردیده، استفاده شده است.



ارزش دلاری بازار

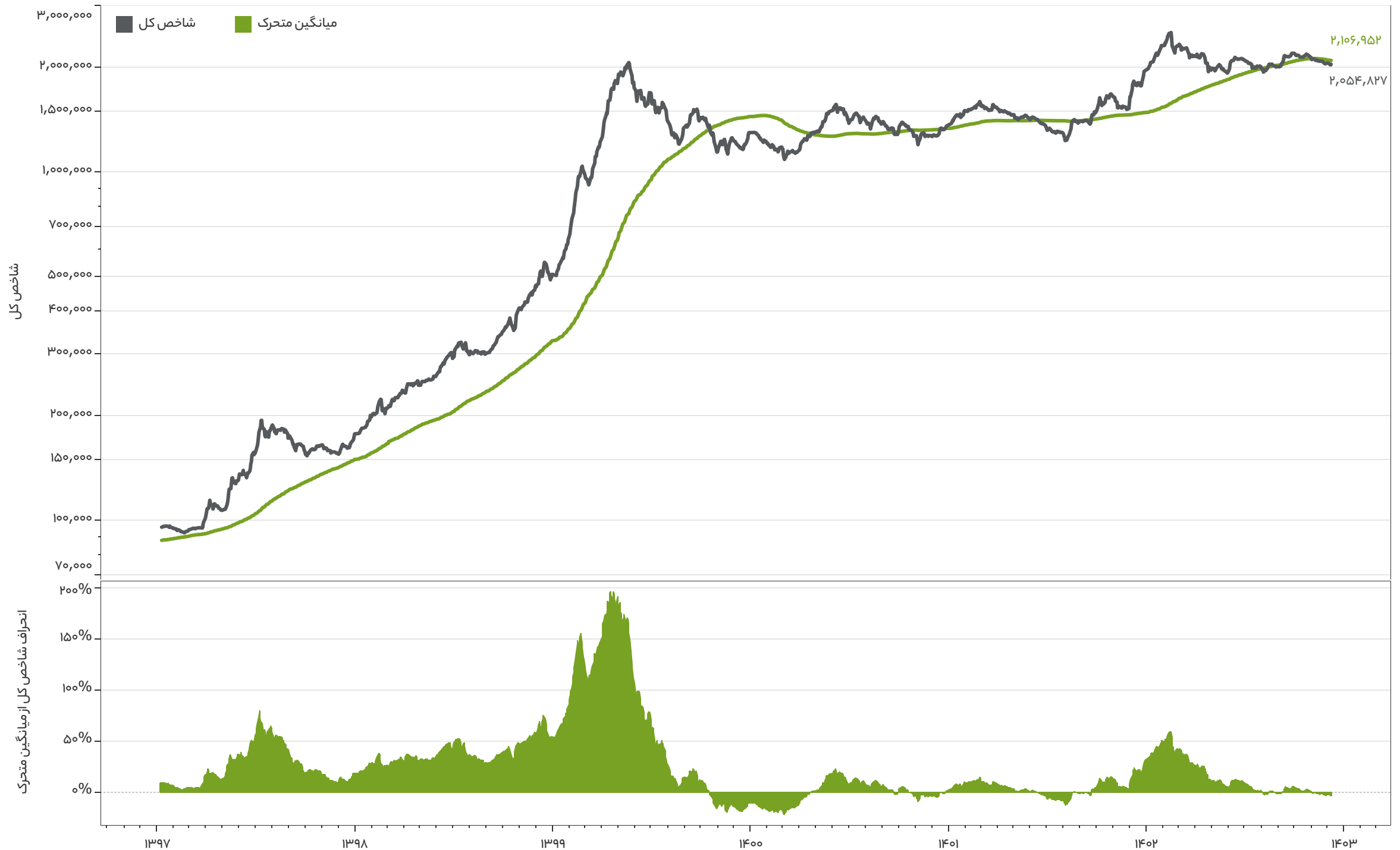
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

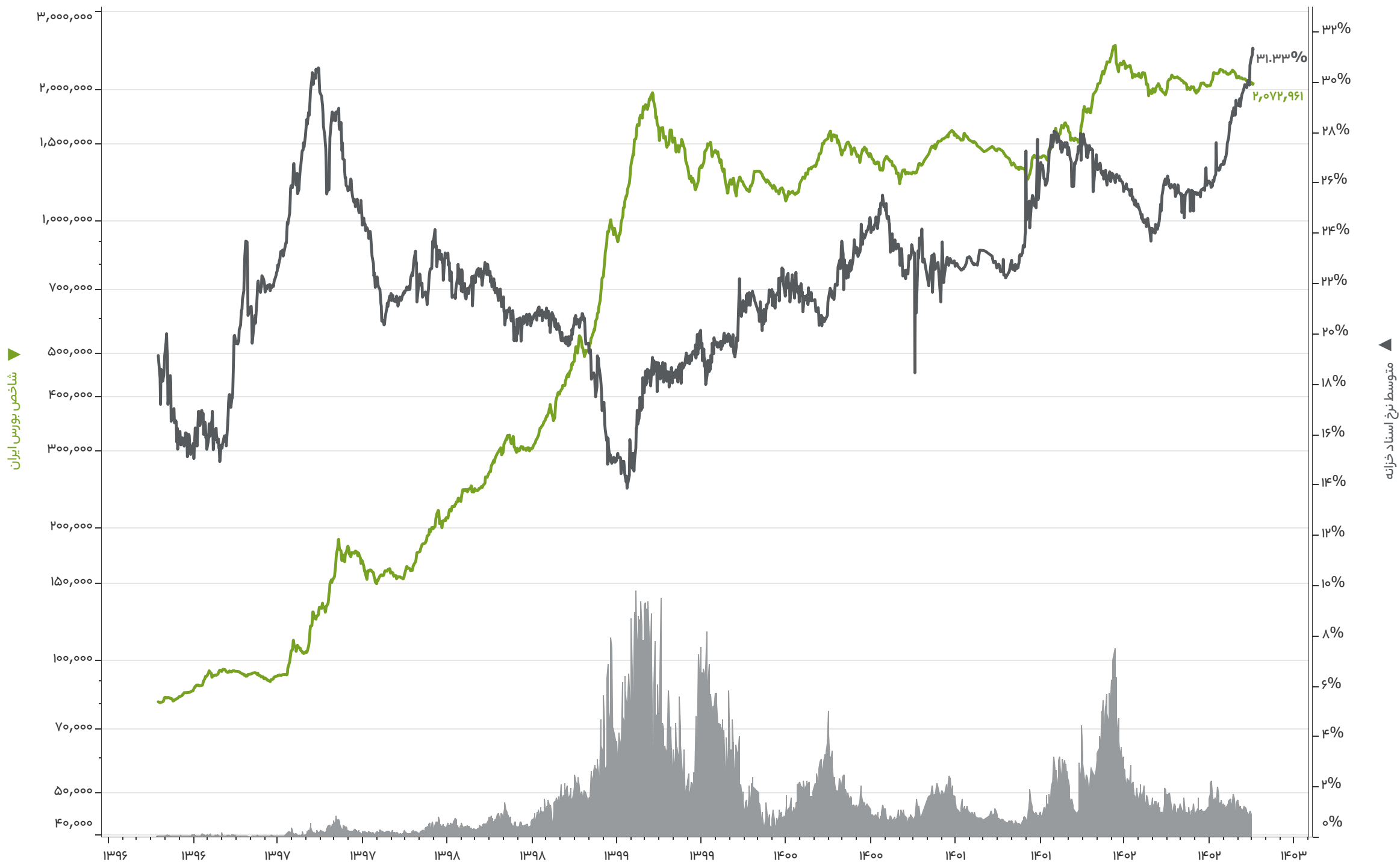
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





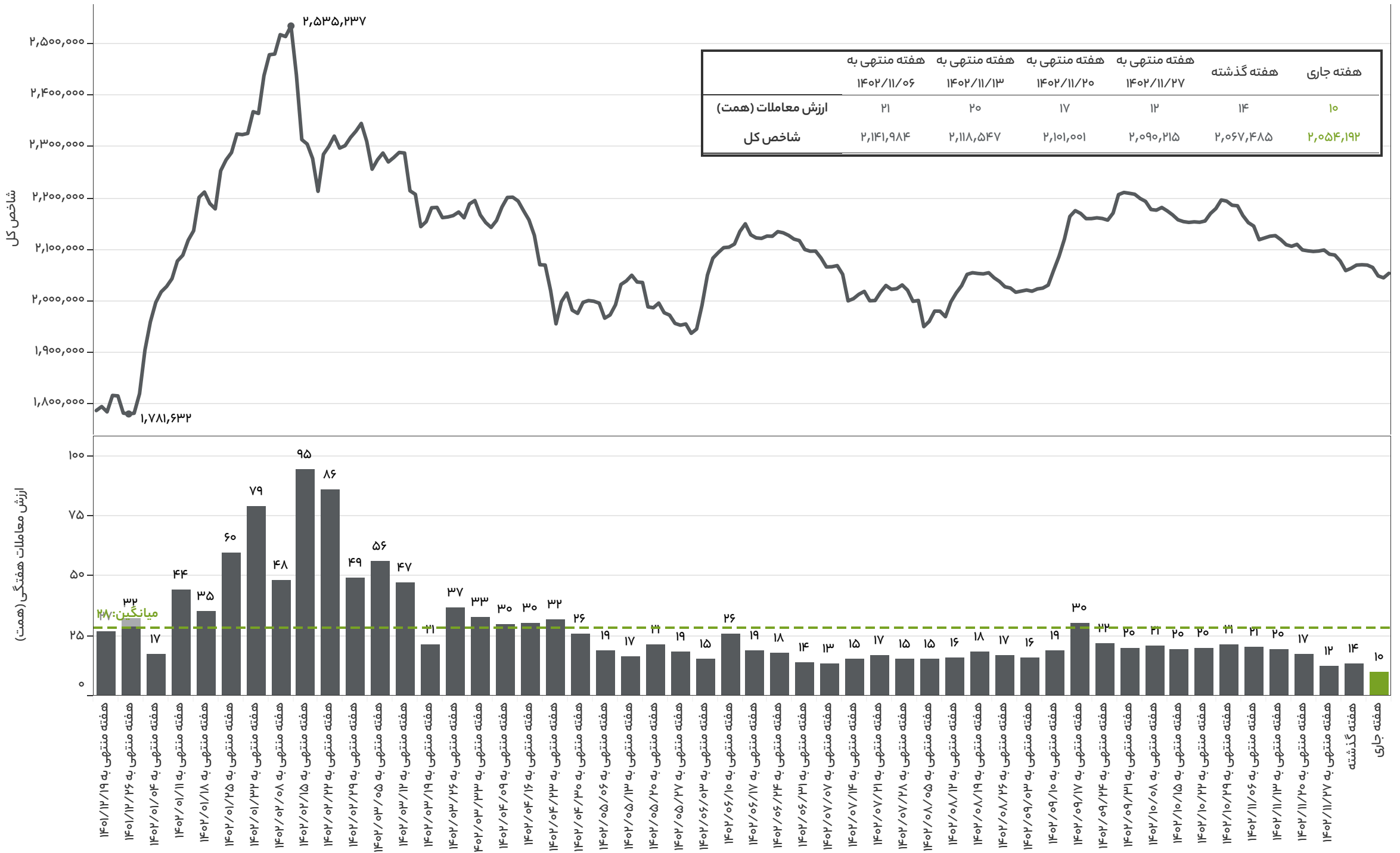
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

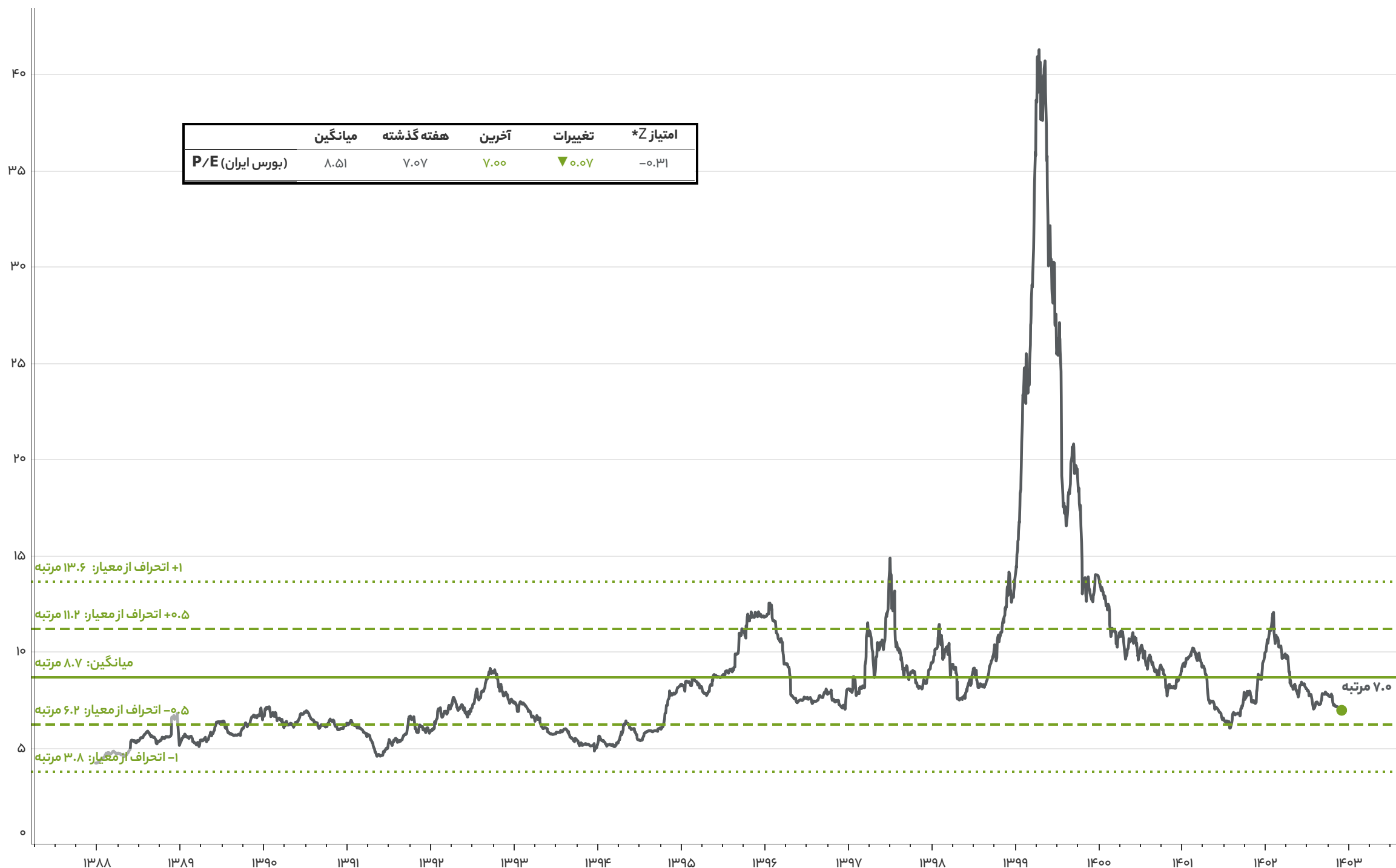
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.



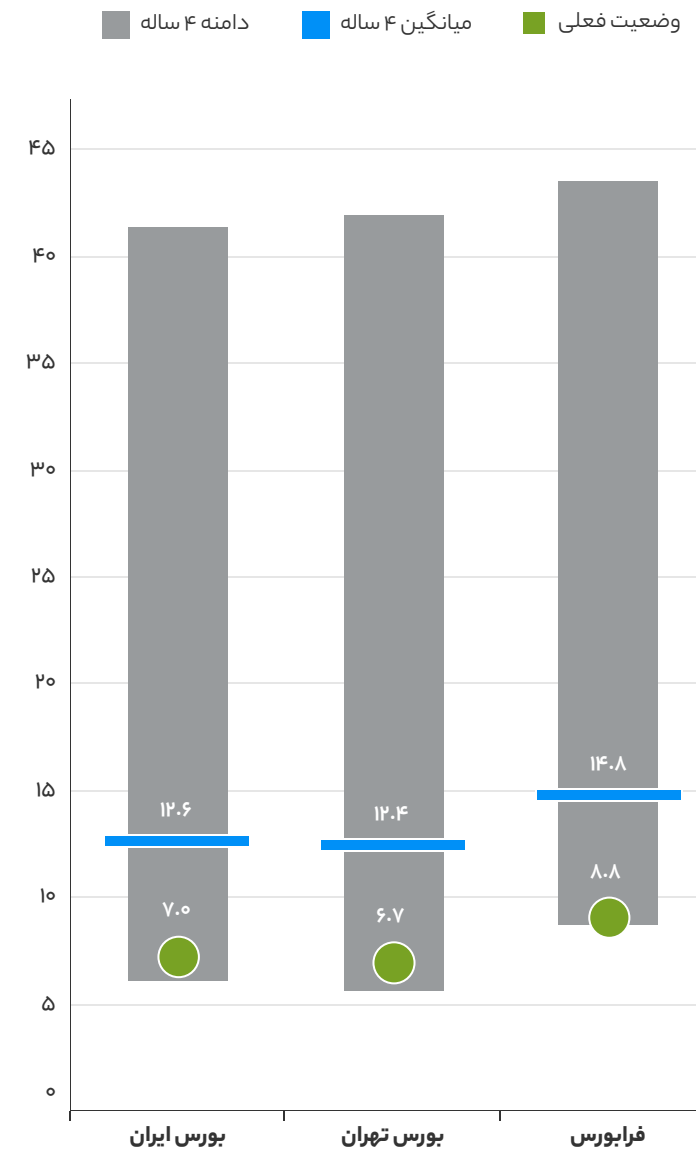
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	کمیته ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۰۰	۷.۰۷	۶.۰۷	۱۲.۶۴	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۷۳	۶.۷۹	۵.۶۴	۱۲.۴۲	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۷۷	۸.۸۹	۸.۷۲	۱۴.۷۹	۴۳.۵۱

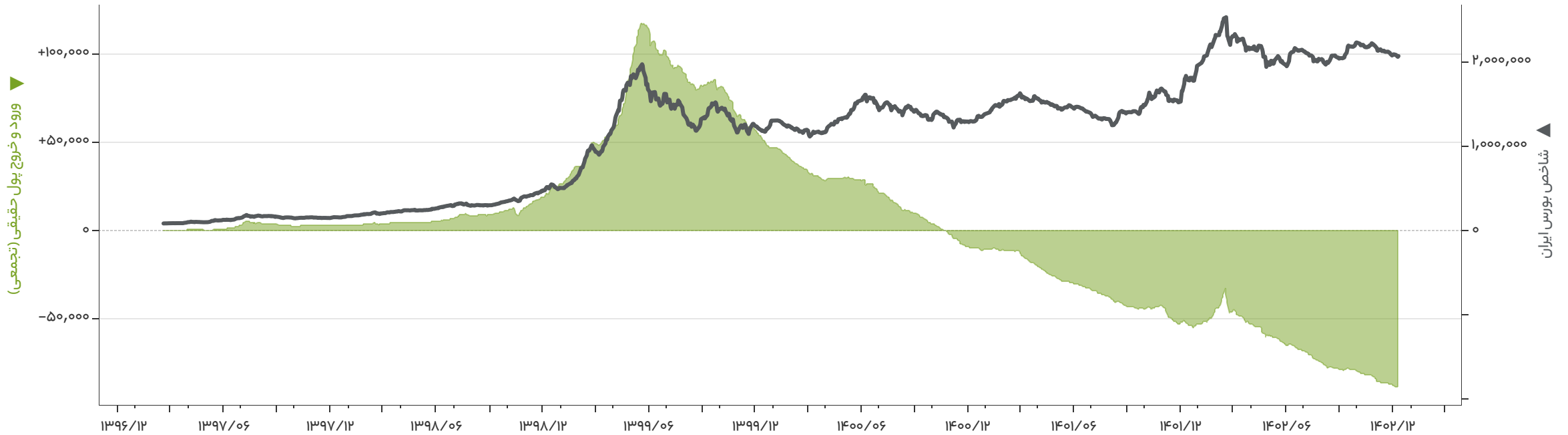


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۲۷۴	۳,۱۲۷	۶۰۵	۳۷۵	۲۳۸	۱۹۰	۱۵۷	۱۱۴	۱۱۳	۸۵	۶۰	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۳۹.۳%	۳۷.۵%	۷.۳%	۴.۵%	۲.۹%	۲.۳%	۱.۹%	۱.۴%	۱.۴%	۱.۰%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۷.۳	۶.۸	۴.۵	۵.۲	۹.۴	۸.۷	۸.۹	۱۱.۴	۱۶.۵	۱۱.۶	۱۵.۳	سودآوری
بازده سود نقدی	۹.۰%	۹.۴%	۱۴.۶%	۲.۵%	۵.۰%	۳.۶%	۷.۱%	۳.۵%	۳.۱%	۱۷.۶%	۲.۸%	
نسبت تقسیم سود	۷۳%	۶۲%	۶۳%	۳۴%	۵۳%	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)	+۹۱۵%	+۸۱۹%	+۷۴۴%	+۸۳۶%	+۴۱۳%	+۴۲۱%	+۳۸۱%	+۱۲۹%	+۲۹۶%	+۷۵۰%	+۶۹۴%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۵۸%	-۴%	+۱۰%	-۱۴%	-۱۰%	-۱۰%	+۱۴%	-۶۳%	-۱%	+۱۰۸%	+۱۰%	
بازده از ابتدای سال	+۷۸%	+۶۲%	+۷۹%	+۸۷%	+۵۰%	+۱۰۲%	+۹۲%	+۴۷%	+۷۲%	+۳۷%	+۲۵۵%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۰%	-۱%	۰%	-۲%	-۳%	-۲%	-۲%	-۴%	-۱%	-۱%	-۳%	

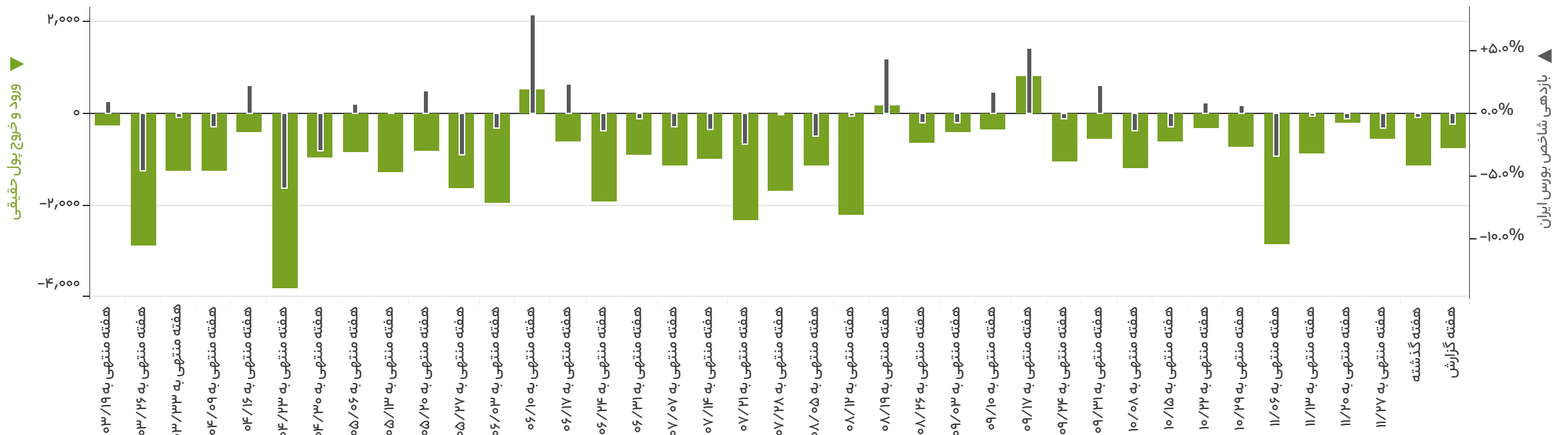
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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

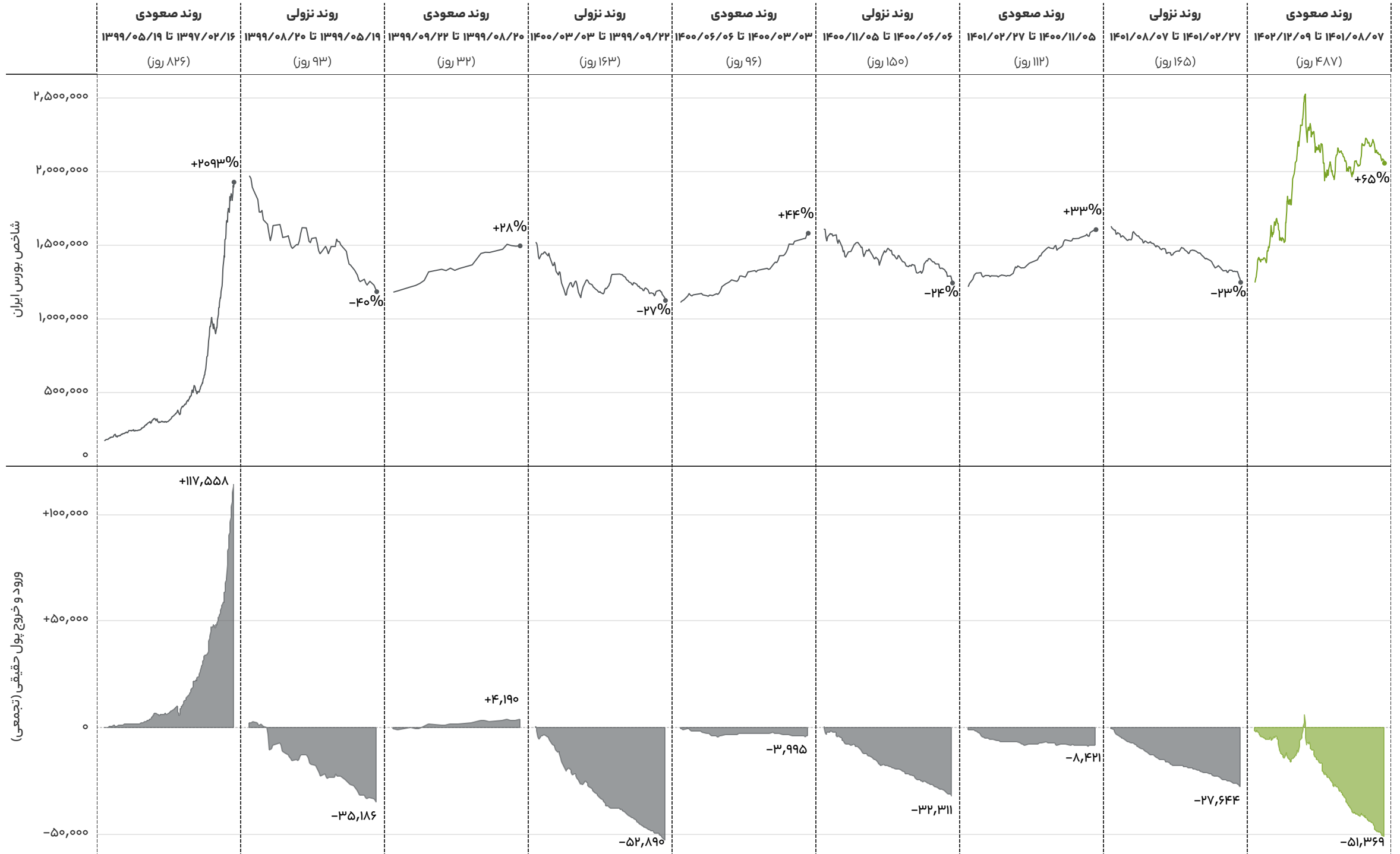
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





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

بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	تغییر مالکیت شرکت	
				تغییر مالکیت شرکت	ارزش بازار
	حشکوه	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰.۵	+۳.۵%	
	زماهان	محصولات کشاورزی	۲.۶	+۱.۱%	
	تپولا	فعالیت مهندسی	۰.۳	+۰.۹%	
	سمگا	سرمایه گذاری	۵.۵	+۰.۸%	
	قیستو	شکر	۱.۶	+۰.۵%	
	سلار	سیمان، اهک و گچ	۱.۰	+۰.۴%	
	کایزد	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱.۳	+۰.۳%	
	وحکمت	بیمه	۱.۳	+۰.۳%	
	اپرداز	نرم افزار و خدمات	۱.۰	+۰.۳%	
	حگردش	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰.۵	+۰.۲%	
	وصنعت	سرمایه گذاری	۴.۰	+۰.۲%	
	کفپارس	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۰.۸	+۰.۲%	
	مرقام	سخت افزار و تجهیزات	۰.۴	+۰.۲%	
	فالوم	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۲.۸	+۰.۲%	
بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقوقی	تقزوی	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۳	-۰.۳%	
	خریخت	قطعات خودرو	۲.۰	-۰.۴%	
	زفجر	محصولات کشاورزی	۱.۹	-۰.۴%	
	گپارس	هتل و رستوران	۰.۲	-۰.۵%	
	وآذر	سرمایه گذاری	۱.۶	-۰.۵%	
	وآرین	سرمایه گذاری	۱.۱	-۰.۵%	
	ومشان	سرمایه گذاری	۰.۴	-۰.۵%	
	زنجان	مواد شیمیایی-متنوع	۱.۵	-۰.۵%	
	کمرجان	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۰.۷	-۰.۵%	
	سبزوا	سیمان، اهک و گچ	۲.۴	-۰.۷%	
	ثعمرا	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲.۳	-۰.۷%	
	ولانا	لیزینگ	۰.۳	-۱.۳%	
	وجامی	سرمایه گذاری	۰.۵	-۱.۸%	
	تمحرکه	ماشین الات	۰.۵	-۱.۹%	

ورود و خروج پول حقیقی

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

بیشترین ورود پول حقیقی	نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
				ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	ارزش بازار
	سمگا	سرمایه گذاری	۵	+۱۴۲	
	ذوب	آهن و فولاد	۳۱	+۳۲	
	زماهان	محصولات کشاورزی	۳	+۲۷	
	حشکوه	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰	+۱۸	
	فزر	کانی های فلزی	۱۲	+۱۸	
	سدشت	سیمان، اهک و گچ	۱۸	+۱۶	
	فولاد	آهن و فولاد	۴۸	+۱۱	
	وصنعت	سرمایه گذاری	۴	+۱۰	
	قیستو	شکر	۲	+۸	
	پترول	سرمایه گذاری	۱۸	+۸	
	پارسیان	بیمه	۶	+۷	
	ملت	بیمه	۷	+۶	
	فسبزار	آهن و فولاد	۱۶	+۶	
	زپارس	محصولات کشاورزی	۵	+۶	
بیشترین خروج پول حقیقی	وشهر	بانکها و موسسات اعتباری	۱۹	-۱۵	
	ثعمرا	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲	-۱۶	
	وبصادر	بانکها و موسسات اعتباری	۳۶	-۱۶	
	خودرو	خودرو	۷۴	-۱۶	
	خگستر	سرمایه گذاری	۱۷	-۱۷	
	سبزوا	سیمان، اهک و گچ	۲	-۱۷	
	وپاسار	بانکها و موسسات اعتباری	۸۴	-۱۸	
	شپدیس	تولید کود و ترکیبات نیتروژن	۸۸	-۱۹	
	فارس	سرمایه گذاری	۵۴۶	-۲۱	
	اخابر	مخابرات	۶۲	-۲۱	
	خساپا	خودرو	۴۴	-۲۵	
	پپاس	بیمه	۷۷	-۲۷	
	شستا	سرمایه گذاری	۱۷۷	-۴۰	
	وبملت	بانکها و موسسات اعتباری	۱۵۶	-۷۹	



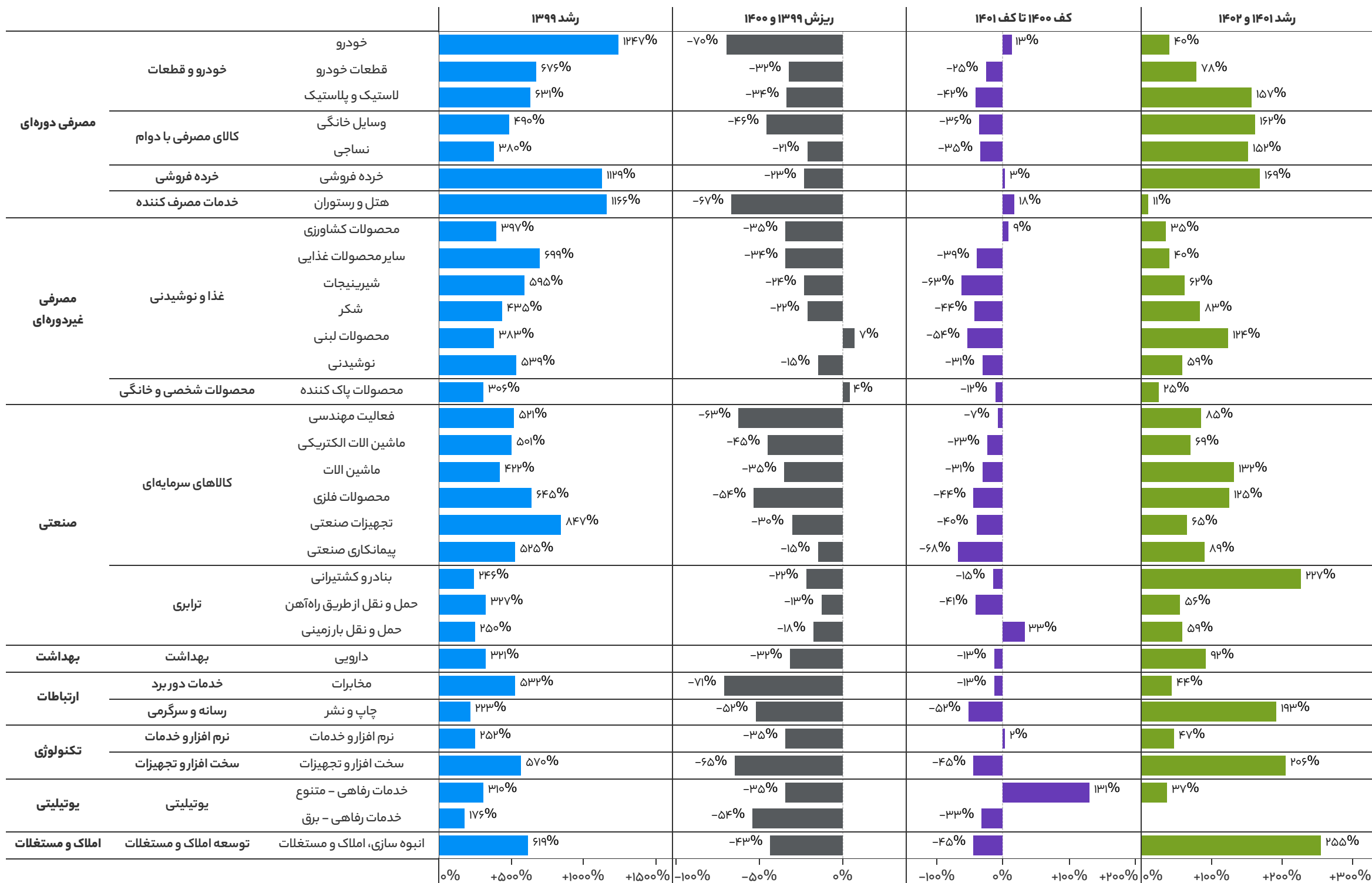
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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 ۱۴۰۲ و ۱۴۰۱ (۱۴۰۱/۰۸/۰۴ تا کنون)
مواد پایه	فلزات و استخراج	آهن و فولاد: ۵۶۴%	-۳۴%	۶%	۸۴%
		کانی های فلزی: ۴۹۱%	-۱۴%	۸%	۲۳%
		تولید فلزات گرانبهای غیراهن: ۸۵۴%	-۳۲%	-۱%	۱۴۹%
		سایر مواد معدنی: ۵۲۸%	-۷۱%	-۲۷%	۲۷۴%
	شیمیایی	مواد شیمیایی-متنوع: ۴۰۰%	-۱۶%	۳۲%	۵۷%
		تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۴۶۶%	-۲۰%	۹۸%	۱۵%
	مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ: ۵۱۲%	-۱۷%	-۸%	۱۶۶%
		سایر محصولات کانی غیرفلزی: ۴۳۰%	-۱۸%	-۳۵%	۱۰۸%
		کاشی و سرامیک: ۴۶۳%	۱۳%	-۳۴%	۱۶۸%
	محصولات چوبی	محصولات کاغذی: ۳۸۵%	۸۸%	-۵۱%	۳۵۳%
کاغذ و محصولات جنگلی	چوب: ۳۷۴%	-۷%	-۵۹%	۱۲۵%	
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	هلدینگ های سرمایه گذاری: ۸۸۱%	-۵۲%	۱۸%	۷۰%
		تامین سرمایه: ۱۲۸۷%	-۵۲%	۳۷%	-۶%
		فعالیت های مرتبط با اوراق بهادار: ۹۱۶%	-۵۸%	-۷۴%	۱۶%
		لیزینگ: ۵۱۳%	-۴۲%	-۲۶%	۸۲%
	بانک ها	بانک ها و موسسات اعتباری: ۷۲۸%	-۴۰%	-۲۶%	۶۰%
بیمه	بیمه: ۶۹۳%	۲۹%	۱۰%	-۱۱%	
انرژی	انرژی	پالایش نفت و گاز: ۶۸۳%	-۶۸%	۸۷%	۷۸%
	مصرفی	زغال سنگ: ۲۴۸%	۳%	-۱۸%	۸۷%
	تجهیزات انرژی و خدمات	حفاری: ۳۶۵%	-۵۰%	-۳۳%	۱۹۱%



بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



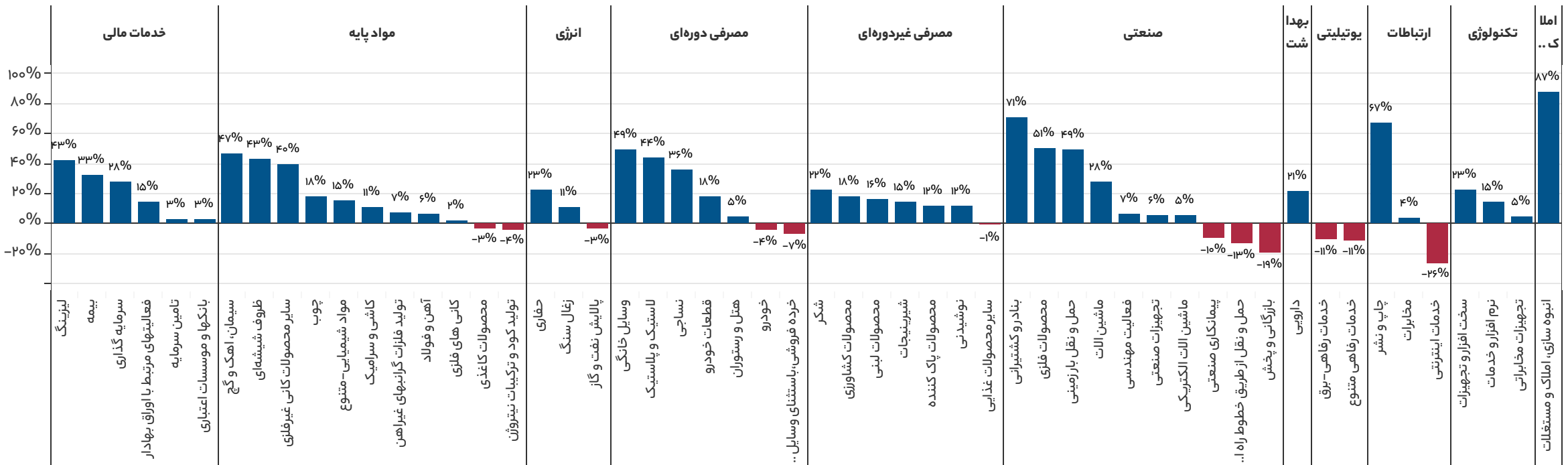
بازدهی صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده، بازدهی هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



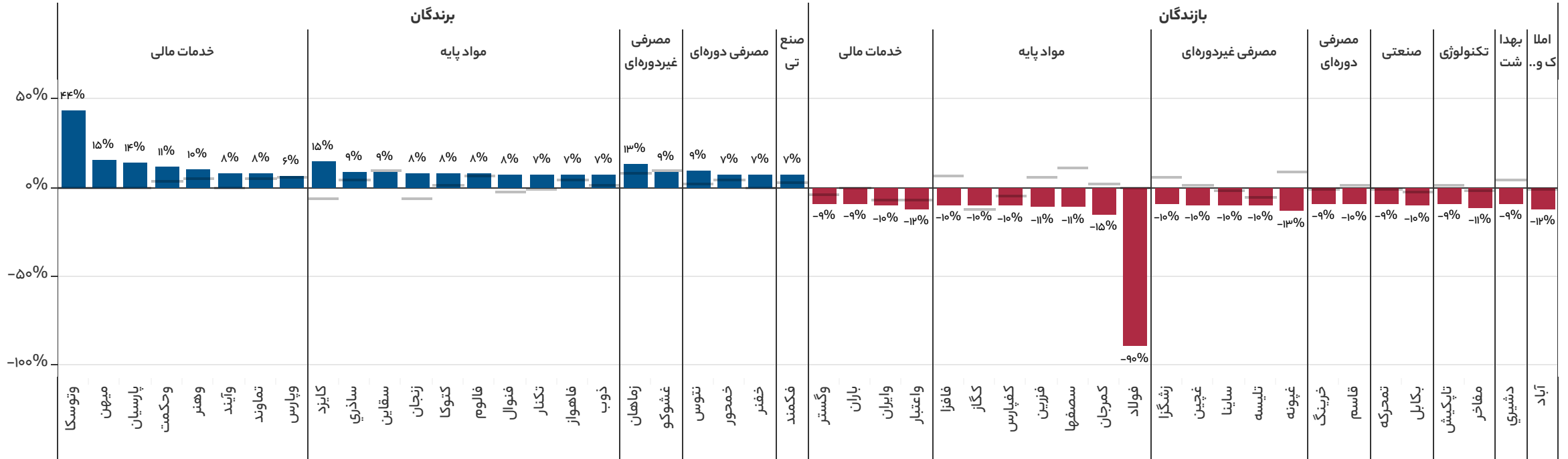
بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

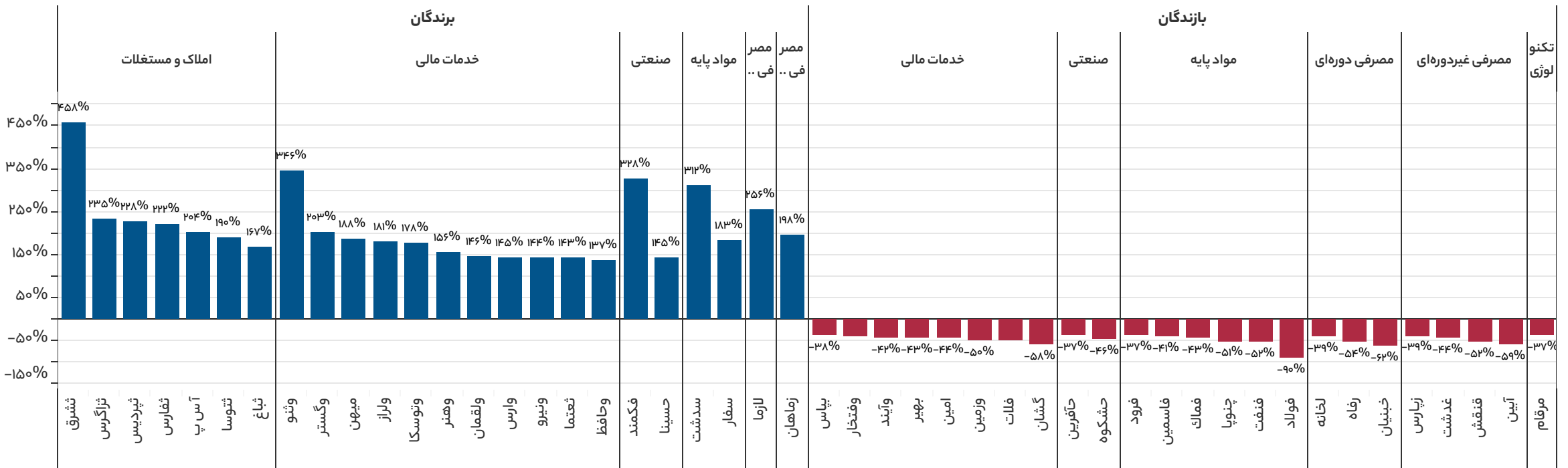




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



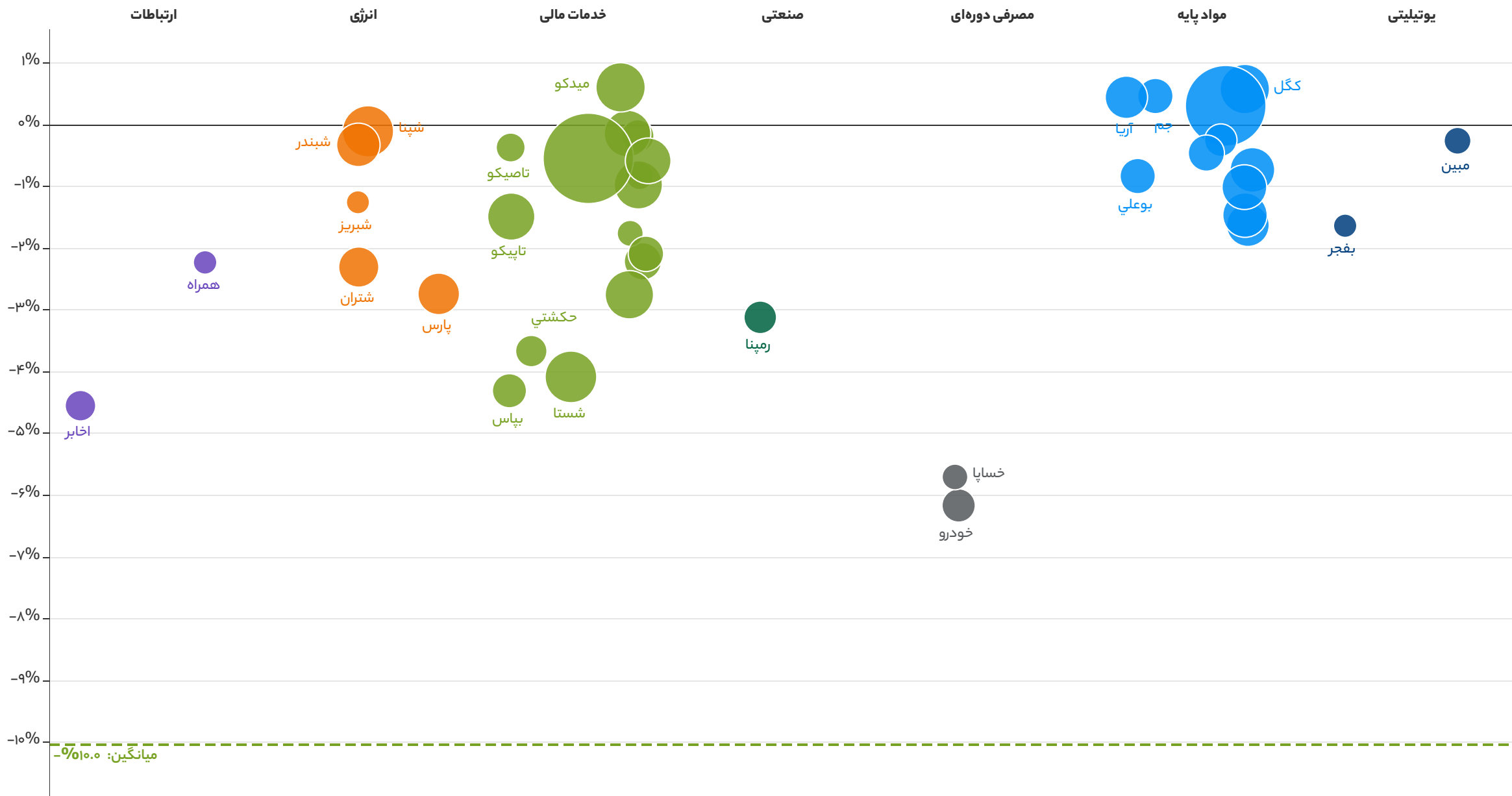
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





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



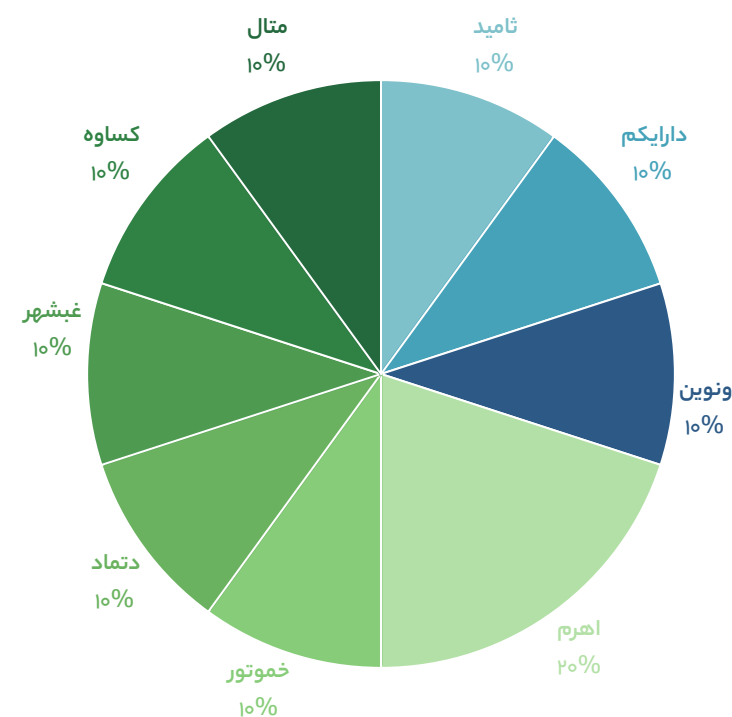
بازدهی تعدیل شده	میدکو	کگل	جم	آریا	فملي	شپنا	وامید	وسندوق	فخوز	مبین	شبندر	تامیکو	شپدیس	فارس	پارسان	نوري	وگدیر	بوعلی	وغدیر	کچاد	شبریز	کگر	تاپیکو	مارون	بفجر	وتجارت	ویاسار	ومعادن	همراه	شتران	پارس	وبملت	رمپنا	حکشتی	شستا	پپاس	اخابر	خساپا	خودرو
بازدهی هفته گذشته	+۰.۶%	+۰.۶%	+۰.۵%	+۰.۵%	+۰.۳%	-۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۲%	-۰.۲%	-۰.۲%	-۰.۳%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۶%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۰.۸%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۲%	-۱.۵%	-۱.۵%	-۱.۶%	-۱.۷%	-۲.۰%	-۲.۲%	-۲.۲%	-۲.۳%	-۲.۷%	-۲.۷%	-۳.۱%	-۳.۷%	-۴.۱%	-۴.۳%	-۴.۵%	-۵.۷%	-۶.۲%



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)	۳,۶۸۵	۱۰%
	دتماد	۷۱,۰۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۵۵,۴۱۰	۱۰%
	غبشهر	۲,۸۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۲۰۷	۱۰%
	کساوه	۲۴,۰۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۱۸,۵۸۰	۱۰%
	متال	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۱۰,۶۷۰	۱۰%
	اهرم	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۱۹,۸۷۰	۲۰%
بلند مدت	ثامید	۲,۹۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۲۶۳	۱۰%
	دارایکم	۲۱۰,۰۰۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۱۵۵,۰۸۰	۱۰%
	ونوین	۴,۱۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۲,۹۴۲	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

