

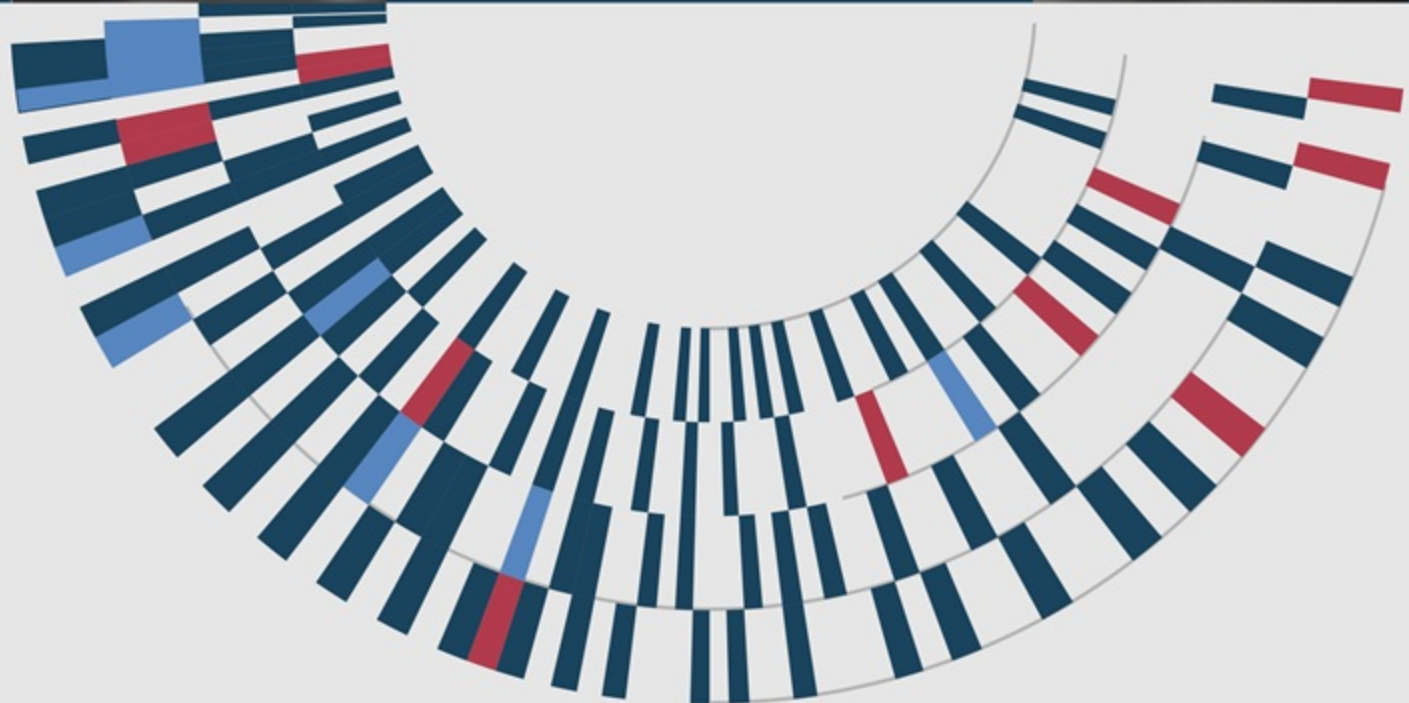


کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۴ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۱/۱۰





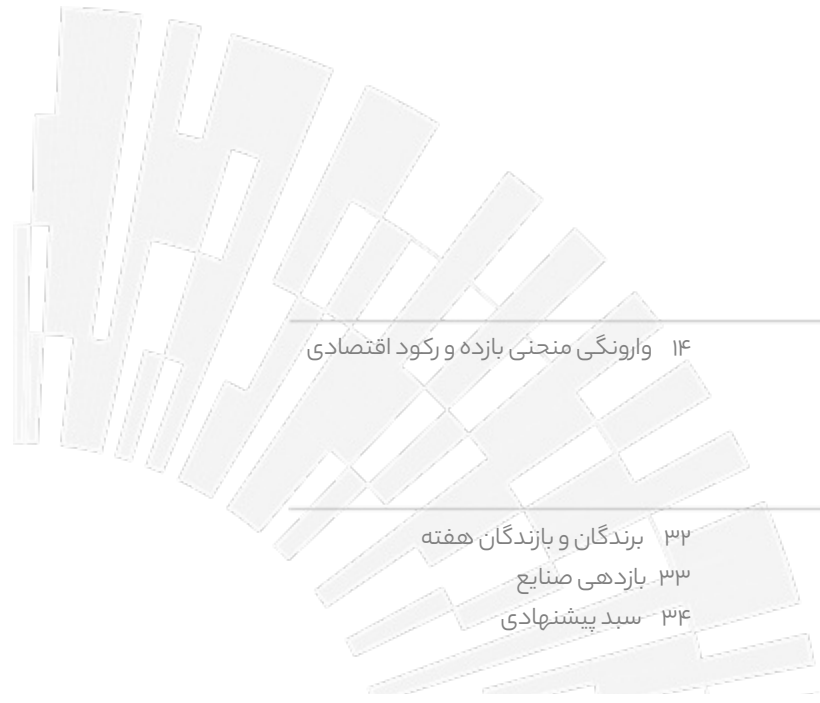
معرفی گزارش:

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

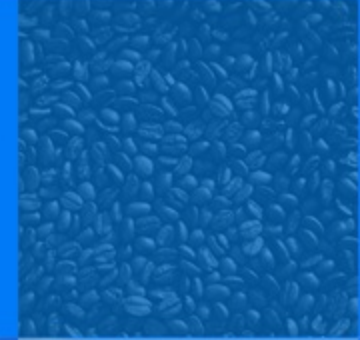
۱۵



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 | ۲,۲۳۳ | -۱.۹% | فزر | - | ۱,۸۳۰ - ۲,۲۷۷ | ۱۱% |
| | مس | بورس فلزات لندن | دلار/تن | ۸,۸۷۴ | -۱.۶% | فملی | بموتو، فباهتر | ۷,۹۴۳ - ۹,۰۳۶ | ۰% |
| | مس (ملي مس ایران) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۳۹۸,۸۰۰ | - | فملی | بموتو، فباهتر | ۳۳۳,۵۸۹ - ۴۳۹,۹۱۶ | -۹% |
| | آلومینیوم | کامکس | دلار/تن | ۲,۳۱۸ | -۱.۸% | فایرا | فنوال | ۲,۱۰۲ - ۲,۴۱۰ | -۱% |
| | روی | بورس فلزات لندن | دلار/تن | ۲,۴۴۱ | -۱.۶% | فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما | فمراد | ۲,۲۹۸ - ۲,۸۴۷ | ۱۳% |
| | سرب | بورس فلزات لندن | دلار/تن | ۲,۰۵۵ | +۱.۷% | فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما | - | ۲,۰۲۱ - ۲,۲۹۶ | ۹% |
| فلزات آهنی | شمش (ایران) | بنادر ایران FOB | دلار/تن | ۴۸۰ | - | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان | کوبیر، فوکا، فنورد | ۴۵۹ - ۵۵۲ | ۱۳% |
| | شمش CIS (منطقه) | دریای سیاه FOB | دلار/تن | ۵۰۰ | +۱.۰% | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان | کوبیر، فوکا، فنورد | ۴۳۱ - ۵۷۱ | -۱۳% |
| | شمش (فولاد خوزستان) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۲۱,۲۲۵ | - | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق | کوبیر، فوکا، فنورد | ۱۷,۹۰۰ - ۲۲,۸۲۱ | ۱۳% |
| | اسلب (ایران) | بنادر ایران FOB | دلار/تن | ۴۷۳ | - | فولاد، فخوز، هرمز | - | ۴۴۰ - ۵۳۵ | ۱۳% |
| | اسلب (منطقه CIS) | دریای سیاه FOB | دلار/تن | ۵۲۰ | -۳.۷% | فولاد، فخوز، هرمز | - | ۴۴۸ - ۶۳۵ | -۱۸% |
| | اسلب (فولاد هرمزگان) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۲۴,۶۹۰ | - | فولاد، فخوز، هرمز | - | ۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۶۹۰ | ۲۳% |
| | میلگرد | بنادر ترکیه FOB | دلار/تن | ۵۸۸ | +۰.۹% | ذوب، کوبیر | فولای | ۵۴۶ - ۶۹۵ | -۱۵% |
| | میلگرد (ذوب آهن اصفهان) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۲۴,۶۰۶ | - | ذوب، کوبیر | فولای | ۲۰,۹۱۱ - ۲۴,۶۰۶ | ۱۷% |
| | ورق گرم | دریای سیاه FOB | دلار/تن | ۵۶۳ | +۱.۴% | فولاد، فوکا، فنورد | فجر، فسپا | ۵۵۵ - ۷۲۰ | ۲۳% |
| | ورق سرد | دریای سیاه FOB | دلار/تن | ۶۷۳ | - | فولاد | - | ۶۴۰ - ۸۰۰ | -۱۶% |



| 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 | ۱۰۲ | -۲.۳% | - | - | ۱۰۱ - ۱۴۳ | -۱۵% |
| | گندله سنگ آهن | شمال چین CFR | دلار/تن | ۱۲۰ | -۳.۵% | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا | فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان | ۱۱۹ - ۱۶۴ | -۱۶% |
| | گندله سنگ آهن (گل گهر) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۵,۱۲۶ | - | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا | فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان | ۴,۵۹۱ - ۵,۱۲۶ | ۲۵% |
| | کنسانتره سنگ آهن | شمال چین CFR | دلار/تن | ۱۱۰ | -۲.۸% | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا | فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان | ۱۰۷ - ۱۵۳ | -۱۸% |
| | کنسانتره (چادرملو) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۳,۷۴۹ | - | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا | فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان | ۳,۱۲۸ - ۳,۷۴۹ | ۲۰% |
| محصولات کشاورزی | گندم آمریکا | بورس کالای چیکاگو | دلار/تن | ۲۵۶ | +۳.۰% | - | - | ۱۹۹ - ۲۶۸ | -۱۷% |
| | ذرت آمریکا | بورس کالای چیکاگو | دلار/تن | ۱۷۴ | +۳.۴% | - | غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار | ۱۵۷ - ۲۶۳ | -۳۱% |
| | شکر آمریکا | بورس کالای نیویورک | دلار/تن | ۱,۵۸۵ | -۱.۵% | - | - | ۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶ | -۳% |
| | روغن پالم خام | بورس مالزی | دلار/تن | ۸۸۱ | +۰.۵% | - | غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار | ۷۲۸ - ۸۸۱ | ۷% |



| 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 | ۲۹۴ | -۱.۷% | زاگرس، شخارک، شفن، شیراز | شرفارس، شسینا | ۲۳۵ - ۳۵۹ | -۱% |
| اتیلن | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۱,۰۱۰ | - | مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک | شغدیر، جم پیلن | ۷۳۰ - ۱,۰۱۰ | ۵% |
| پروپیلن | چین CFR | دلار/تن | ۸۵۰ | - | جم، شکبیر | جم پیلن | ۷۳۵ - ۹۳۰ | -۸% |
| پارازایلین | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۱,۰۲۶ | -۱.۴% | شصفها، نوری | شگویا، شپلی | ۹۵۴ - ۱,۱۵۸ | -۸% |
| ارتوزایلین | چین CFR | دلار/تن | ۱,۰۴۷ | +۰.۲% | شصفها، نوری | - | ۹۴۰ - ۱,۱۶۱ | -۱۰% |
| استایرن | چین CFR | دلار/تن | ۱,۱۳۳ | -۲.۷% | پارس | شجم، شبصیر | ۸۷۸ - ۱,۱۶۸ | ۳% |
| بنزن | چین CFR | دلار/تن | ۱,۰۶۲ | - | نوری، بوعلی، شصفها | شیران | ۷۵۲ - ۱,۰۶۲ | ۷% |
| تولوئن | چین CFR | دلار/تن | ۹۱۲ | +۱.۰% | بوعلی | - | ۸۰۱ - ۹۱۲ | |
| بوتادین | چین CFR | دلار/تن | ۱,۴۳۰ | - | جم، شکبیر، شاراک | شجم | ۶۴۰ - ۱,۴۳۰ | ۰% |
| مونواتیلن گلابیکول | چین CFR | دلار/تن | ۵۲۵ | -۳.۳% | مارون، شاراک | شگویا، شپلی | ۴۵۰ - ۵۵۶ | ۳% |
| پلی اتیلن سبک | خلیج فارس FOB | دلار/تن | ۱,۰۱۰ | - | آریا، شکبیر | - | ۸۷۵ - ۱,۰۲۰ | -۱% |
| پلی اتیلن سنگین | خلیج فارس FOB | دلار/تن | ۹۳۰ | - | مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک | - | ۸۹۵ - ۹۸۵ | -۳% |
| پلی اتیلن سبک خطی | خلیج فارس FOB | دلار/تن | ۹۰۱ | -۱.۰% | جم، شکبیر، شاراک | - | ۸۸۱ - ۹۶۲ | -۶% |
| پلی پروپیلن | خلیج فارس FOB | دلار/تن | ۸۵۶ | +۰.۷% | جم پیلن، مارون، شاراک | - | ۸۰۰ - ۹۱۰ | -۵% |
| PET | جنوب شرق آسیا FOB | دلار/تن | ۹۵۵ | - | شگویا | - | ۹۳۰ - ۱,۰۷۵ | -۱۱% |
| PVC | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۷۹۰ | +۰.۶% | شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام | - | ۷۴۰ - ۸۸۵ | -۶% |
| ABS | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۱,۳۸۵ | +۰.۴% | شبصیر | - | ۱,۲۳۰ - ۱,۴۰۵ | -۱% |

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 | ۸۷ | -۲.۴% | - | شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرار، شاولان | ۷۴ - ۹۴ | ۲% |
| نفت WTI | بورس بین‌المللی اروپا | دلار/بشکه | ۸۳ | -۲.۵% | - | شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرار، شاولان | ۶۹ - ۹۱ | ۳% |
| بنزین | خلیج فارس FOB | دلار/بشکه | ۹۵ | +۳.۳% | - | شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | ۷۸ - ۱۰۷ | -۲% |
| گازوئیل | خلیج فارس FOB | دلار/بشکه | ۹۶ | -۱.۱% | - | شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | ۷۹ - ۱۲۵ | -۱% |
| نفت کوره | خلیج فارس FOB | دلار/تن | ۴۴۵ | +۱.۶% | - | شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | ۳۶۹ - ۵۲۸ | ۴% |
| نفت سفید | خلیج فارس FOB | دلار/بشکه | ۹۶ | -۲.۲% | - | شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | ۸۱ - ۱۲۴ | ۱% |
| نفتا | خلیج فارس FOB | دلار/تن | ۶۳۶ | -۰.۹% | - | شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | ۴۵۲ - ۶۵۹ | ۲% |
| روغن پایه | امارات متحده عربی CFR | دلار/تن | ۸۹۰ | +۴.۱% | - | شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت | ۷۲۰ - ۹۵۰ | -۴% |
| روغن پایه (نفت سپاهان) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۳۲,۲۵۱ | - | - | شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل | ۲۱,۷۹۵ - ۳۳,۵۱۵ | ۱% |
| لوب کات (پالایش نفت تهران) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۱۸,۶۰۶ | - | - | شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرار، شاولان | ۱۲,۱۰۵ - ۲۱,۶۳۴ | ۲۲% |
| قیر (نفت پاسارگاد) | بورس کالای ایران | تومان/کیلوگرم | ۱۳,۱۴۶ | - | - | شپاس | ۱۲,۰۸۶ - ۱۷,۱۴۰ | -۱۵% |
| زغال سنگ | استرالیا FOB | دلار/تن خیس | ۲۰۵ | -۹.۳% | - | ذوب، فروش | ۱۹۶ - ۲۸۷ | -۳۲% |
| یورو به دلار | بازار فارکس | - | ۱.۰۸ | +۰.۲% | - | - | ۱.۰۵ - ۱.۱۲ | -۱% |
| پوند به دلار | بازار فارکس | - | ۱.۲۶ | +۰.۳% | - | - | ۱.۲۱ - ۱.۳۱ | ۲% |
| بیتکوین | بایننس | دلار | ۶۹,۶۶۳ | +۵.۶% | - | - | ۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳ | ۱۵۰% |

انرژی و فرآورده‌های نفتی

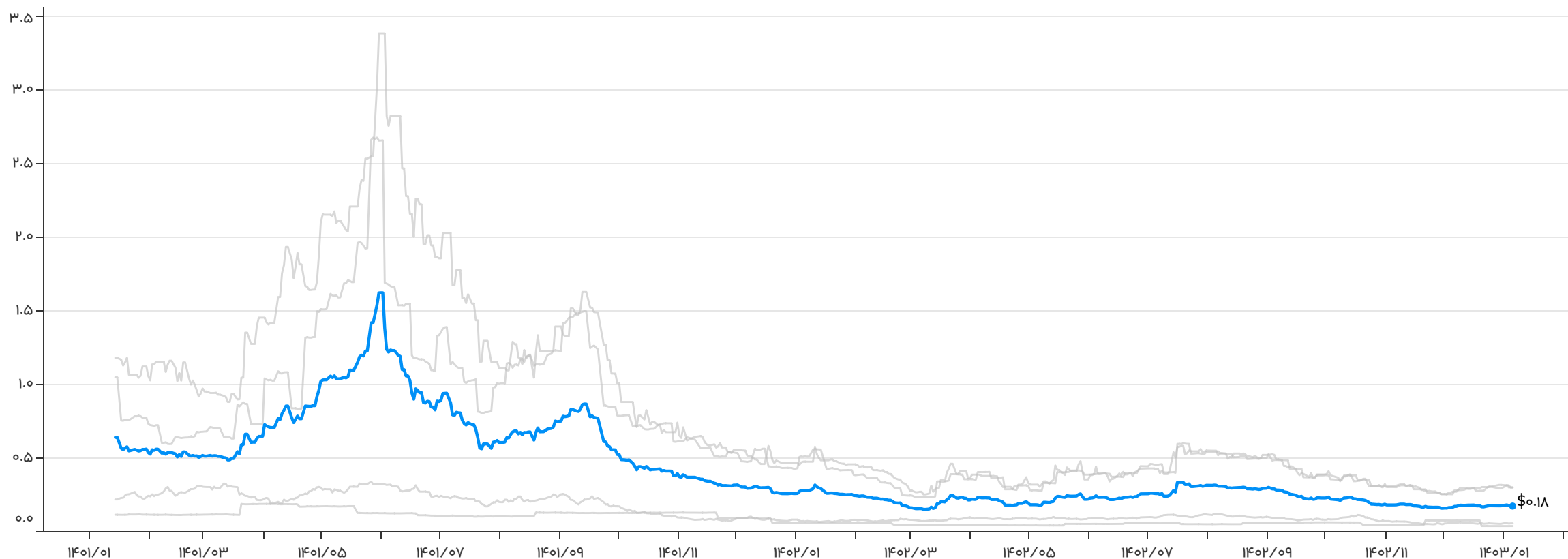
ارز و ارز دیجیتال



| 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 | -۲.۹% | - | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۰۶ - ۰.۱۳ | -۱۷% |
| آلبرتا | دلار \ مترمکعب | ۰.۰۴ | +۰.۳% | - | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۰۴ - ۰.۰۸ | -۳۵% |
| هلند (TTF) | دلار \ مترمکعب | ۰.۳۱ | -۱.۶% | - | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۲۶ - ۱.۵۵ | -۴۷% |
| انگلستان (NBP) | دلار \ مترمکعب | ۰.۳۰ | -۵.۳% | - | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۲۴ - ۰.۶۱ | -۴۶% |
| میانگین ۴ هاب | دلار \ مترمکعب | ۰.۱۸ | -۳.۲% | - | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۱۶ - ۰.۵۴ | -۴۴% |

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

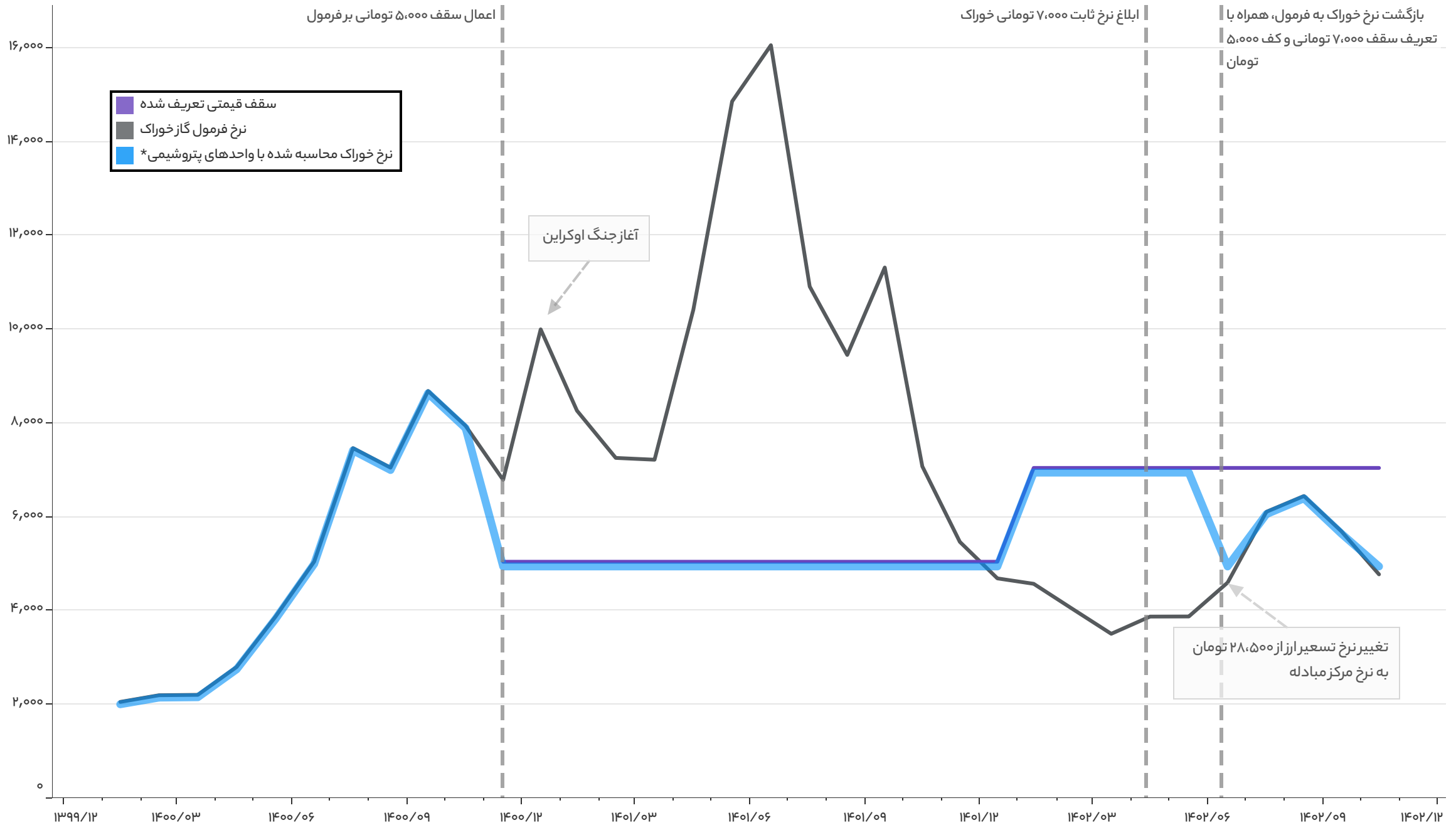
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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

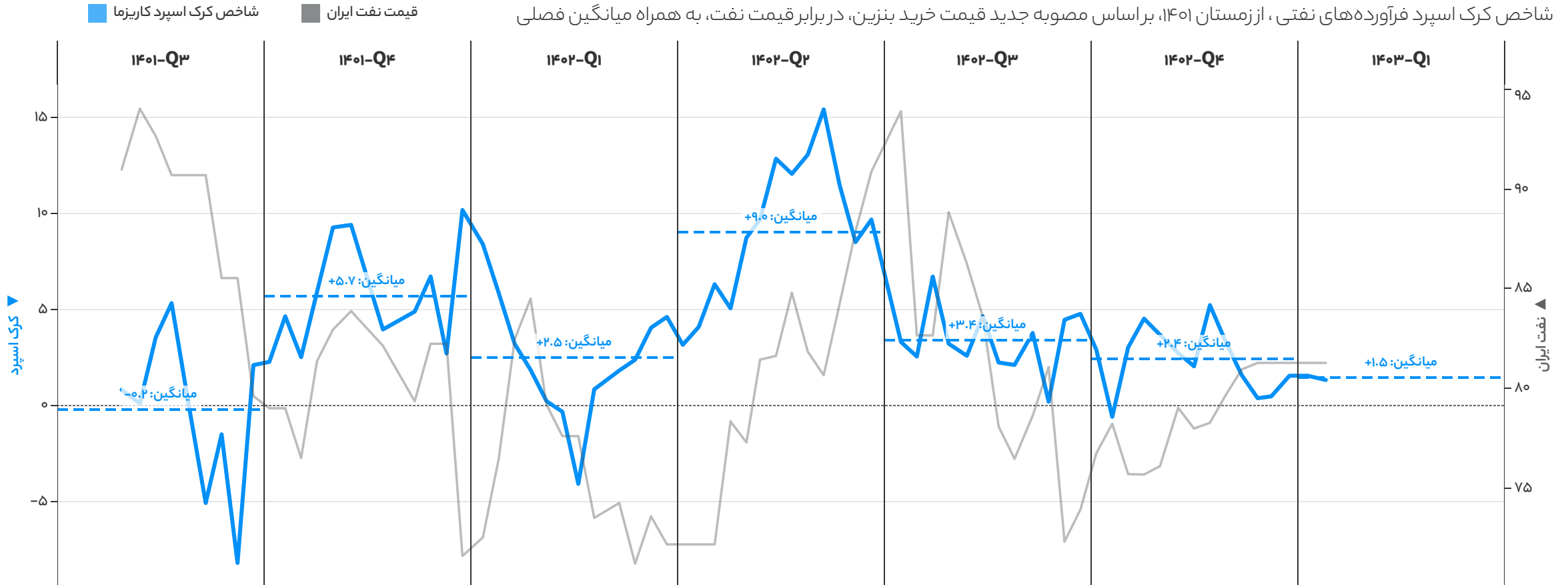


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد. - لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



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 | ۹۶.۱ | ۱۵.۹ | ۱۴.۸ | ▼۱.۱ | ۱۹.۵ | ۱۵.۳ | -۲۱.۵% | | |
| بنزین** | ۸۷.۸ | ۶.۵ | ۶.۵ | - | ۵.۰ | ۶.۵ | +۳۰.۰% | | |
| نفتا | ۷۱.۹ | -۸.۷ | -۹.۴ | ▼۰.۷ | -۹.۶ | -۹.۱ | +۵.۴% | | |
| نفت کوره | ۷۰.۱ | -۱۲.۳ | -۱۱.۲ | ▲۱.۱ | -۱۵.۰ | -۱۱.۷ | +۲۱.۸% | | |
| لوب کات*** | ۷۰.۸ | -۱۰.۳ | -۱۰.۵ | ▼۰.۲ | -۸.۶ | -۱۰.۴ | -۲۱.۷% | | |
| وکیوم باتوم*** | ۴۶.۳ | -۳۴.۹ | -۳۵.۰ | ▼۰.۱ | -۳۲.۴ | -۳۵.۰ | -۷.۸% | | |
| شاخص کرک اسپرد کاریزما | | ۱.۶ | ۱.۴ | ▼۰.۲ | ۲.۴ | ۱.۵ | -۳۸.۴% | | |

* 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.

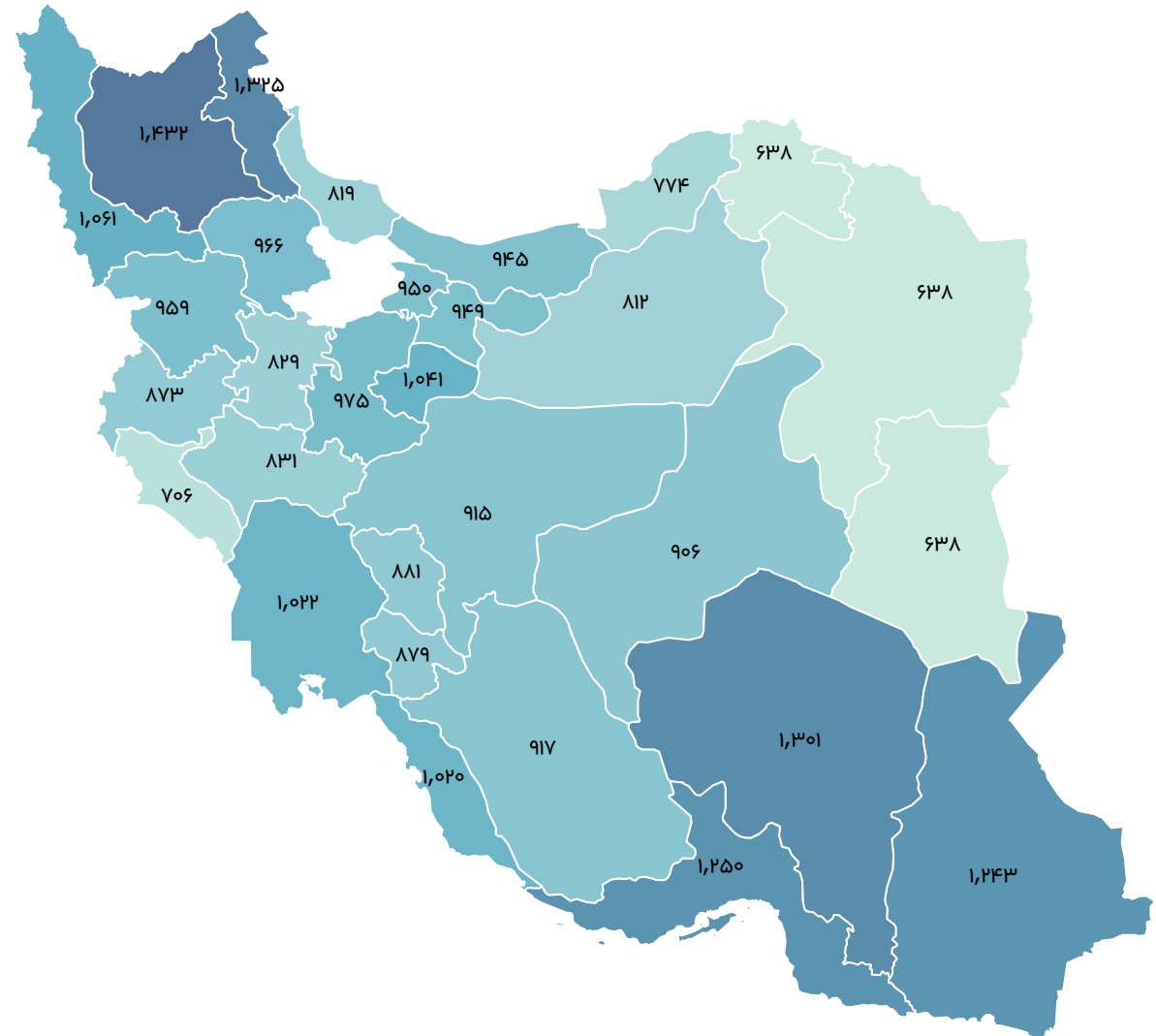
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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 | تهران | سیمان تهران | ۹۴۹ | | |
| | البرز | سیمان آپیک | ۹۵۰ | | |
| | مرکزی | سیمان ساوه | ۹۷۵ | | |
| | سمنان | سیمان شاهرود | ۸۱۲ | ۸۱۲ | - |
| | اصفهان | سیمان سپاهان | ۹۱۵ | | |
| | قم | سیمان نیزار قم | ۱,۰۴۱ | | |
| غرب | یزد | گروه صنعتی و معدنی سیما.. | ۹۰۶ | | |
| | همدان | سیمان هگمتان | ۸۲۹ | | |
| | خوزستان | شرکت سیمان خوزستان | ۱,۰۲۲ | | |
| | ایلام | سیمان ایلام | ۷۰۶ | | |
| | چهارمحال و بختیاری | صنایع سیمان شهرکرد | ۸۸۱ | | |
| | کرمانشاه | صنایع سیمان غرب | ۸۷۳ | | |
| | کهگیلویه و بویراحمد | سیمان یاسوج | ۸۷۹ | | |
| | لرستان | سیمان دورود | ۸۳۱ | ۸۳۱ | - |
| | کردستان | سیمان کردستان | ۹۵۹ | | |
| | مازندران | سیمان مازندران | ۹۴۵ | | |
| شمال | گیلان | سیمان خزر | ۸۱۹ | | |
| | گلستان | سیمان پیوند گلستان | ۷۷۴ | | |
| جنوب | هرمزگان | سیمان هرمزگان | ۱,۲۵۰ | | |
| | فارس | سیمان داراب | ۹۱۷ | | |
| شمال غرب | بوشهر | سیمان مند دشتی | ۱,۰۲۰ | | |
| | اردبیل | سیمان آرتا اردبیل | ۱,۳۲۵ | | |
| شمال غرب | آذربایجان شرقی | کارخانجات سیمان صوفیان | ۱,۴۳۲ | | |
| | آذربایجان غربی | سیمان ارومیه | ۱,۰۶۱ | | |
| | زنجان | سیمان خمسه | ۹۶۶ | | |
| شمال شرق | خراسان شمالی | سیمان بجنورد | ۶۳۸ | | |
| | خراسان رضوی | سیمان شرق | ۶۳۸ | | |
| | خراسان جنوبی | شرکت سیمان قاین | ۶۳۸ | | |
| جنوب شرق | کرمان | سیمان ممتازان کرمان | ۱,۳۰۱ | | |
| | سیستان و بلوچستان | سیمان خاش | ۱,۲۴۳ | | |

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



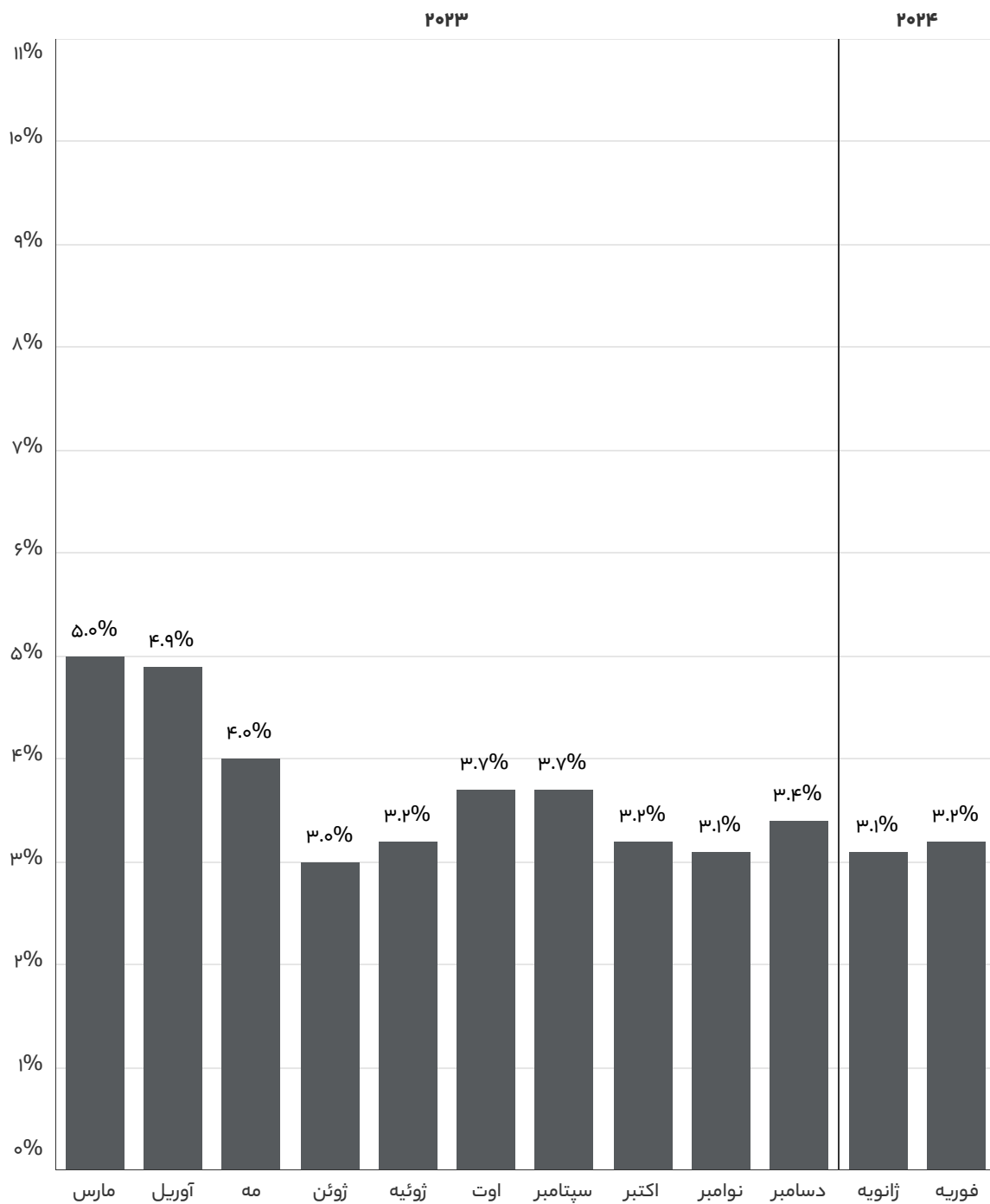
* قیمت سیمان بر اساس سیمان تیپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▼ به گزارش رویترز، احتمال آتش‌بس در غزه قیمت نفت را پایین آورده است، اما جنگ اوکراین و کاهش تعداد چاه‌های فعال نفت آمریکا مانع سقوط بیش از حد قیمت آن شده است. قیمت هر بشکه نفت برنت دریای شمال روز جمعه سوم فروردین، با ۳۵ سنت معادل ۰.۴۱ درصد کاهش به ۸۵ دلار و ۴۳ سنت رسید. نفت سبک آمریکا هم با ۴۴ سنت معادل ۰.۵۴ درصد کاهش ۸۰ دلار و ۶۳ سنت پایان یافت. همه چشم‌ها به آتش‌بس غزه دوخته شده است، اگر این اتفاق با موفقیت انجام شود، یمن هم اجازه عبور نفتکش‌ها را از دریای سرخ خواهد داد. آنتونی بلینکن وزیر امور خارجه آمریکا در روز پنجشنبه گفت عقیده دارد مذاکرات قطر به یک قرارداد آتش‌بس در غزه بین رژیم صهیونیستی و حماس می‌انجامد.
- ▼ واردات محصولات انرژی به اتحادیه اروپا در سه ماهه چهارم سال ۲۰۲۳ به ۱۱۱.۳ میلیارد یورو و در مجموع به ۱۸۷.۹ میلیون تن رسید. در مقایسه با سه ماهه مشابه سال ۲۰۲۲، واردات هم از نظر ارزش (منفی ۳۴.۲ درصد) و هم از نظر وزن خالص (منفی ۱۱.۷ درصد) کاهش یافته است. به گزارش اداره آمار کمیسیون اروپا (یورواستات)، در مقایسه سال ۲۰۲۳ با سال ۲۰۲۲، ارزش واردات محصولات انرژی ۳۵ درصد و حجم واردات آن ۹.۴ درصد کاهش یافته است. تغییر در ارزش واردات عمدتاً ناشی از کاهش قیمت‌ها بوده است. در سال ۲۰۲۳، ارزش گاز طبیعی وارداتی نسبت به سال ۲۰۲۲ با کاهش ۵۲.۲ درصدی روبرو شده، در حالی که حجم آن ۱۶.۱ درصد کاهش داشته است. این کاهش ارزش به دلیل افت قیمت گاز طبیعی پس از افزایش شدید قیمت در سال ۲۰۲۲ رخ داد. سال ۲۰۲۲ رشد ۲۰۰.۴ درصدی در ارزش گاز وارداتی به همراه کاهش ۰.۷ درصدی در حجم واردات ثبت شده بود.
- ▲ بر اساس داده‌های کپلر، در ۱۰ روز منتهی به ۱۷ مارس، ۶.۲ میلیون بشکه دیزل روسیه در نفتکش‌ها در دریا ذخیره شده بود که بالاترین سطح دیزل در ذخایر شناور طی سال‌های اخیر است و از سطح اوایل سال ۲۰۲۳ که اتحادیه اروپا واردات دیزل و سایر سوخت‌ها از روسیه را از طریق دریا ممنوع کرد، فراتر رفته است. طبق برآوردهای بلومبرگ، سطح فعلی ذخایر دیزل شناور روسیه، بسیار بالاتر از بهار و تابستان سال ۲۰۲۰ است که شیوع پاندمی کرونا، به تقاضای جهانی سوخت ضربه زد. بلومبرگ به نقل از منابع آگاه گزارش کرد همه پالایشگاه‌های هندی، اکنون حاضر به دریافت نفت روسیه که توسط کشتی‌های شرکت نفتکش سوفکامفلوت (Sovcomflot) حمل شده است نیستند تا مبادا تحریم‌های آمریکا علیه روسیه را نقض کنند. روسیه معمولاً صادرکننده بزرگ سوخت و تامین‌کننده بازارهای بین‌المللی است، اما اختلال در فعالیت پالایشگاه‌های نفت، شرکت‌های نفتی روسیه را مجبور به واردات بنزین از بلاروس کرده است.
- واشنگتن می‌گوید از پروژه خط لوله انتقال گاز ایران-پاکستان حمایت نکرده و درباره خطر تحریم‌ها به دلیل همکاری اسلام‌آباد با تهران هشدار داده است. بیشتر رسانه‌های پاکستانی گزارش داده بودند «مصدق مالک» وزیر نفت پاکستان گفته اسلام‌آباد قصد درخواست از دولت آمریکا برای دریافت معافیت از تحریم‌ها برای پروژه خط لوله گاز پاکستان-ایران را دارد. پایگاه خبری نیشن پاکستان روز دوشنبه نوشت مصدق مالک در گفت‌وگوی غیررسمی با رسانه‌ها گفت: ما به دنبال معافیت از تحریم‌های آمریکا خواهیم بود، زیرا پروژه گازی پاکستان و ایران نمی‌تواند بار تحریم‌ها را تحمل کند. به نوشته روزنامه داوون پروژه خط لوله انتقال گاز ایران-پاکستان از مدت‌ها پیش در دستور کار قرار داشته اما چندین سال گرفتار تاخیرهای مکرر و چالش‌ها بر سر تامین بودجه شده است.
- افت جهانی قیمت متانول بسیاری از متانول‌سازها را در حاشیه زیان قرار داده است. آن‌ها نرخ‌های فعلی خوراک را قبول نداشته و خواهان ارائه تخفیف‌های قیمتی هستند. این همان خواسته‌ای است که در شورای کمیسیون اقتصادی دولت چند ماهی است که درست بررسی است. آنگونه که مرتضی شاهمیرزایی مدیرعامل شرکت صنایع ملی پتروشیمی در روزهای پایانی اسفند اعلام کرده این پیشنهاد در کمیسیون اقتصادی مجلس مورد موافقت قرار گرفته اما فریبز کریمایی قائم می‌گوید که این آیین‌نامه هنوز نهایی نشده است. آیین‌نامه تخفیف‌های پلکانی چیزی جدیدی نیست اما آنگونه که قائم مقام انجمن کارفرمایی صنعت پتروشیمی به بازار می‌گوید در سال‌های گذشته خیلی کاربردی نبوده و به همین دلیل قرار بوده اصلاحاتی در جز ۴ بند الف ماده یک تنظیم مقررات ماده ۲ آن صورت گیرد.
- جلیل سالاری، مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی ایران اظهار داشت: بیشترین میزان مصرف بنزین در ایام نوروز امسال به ۲۹ اسفند بازمی‌گردد که ۱۵۲ میلیون لیتر در این روز به مصرف رسید که نسبت به مصرف ۱۴۴ میلیون لیتری بنزین در روز مشابه سال قبل از آن، ۸ میلیون لیتر رشد داشته است. وی افزود: متوسط مصرف بنزین در ایام نوروز امسال تا امروز ۱۱۸.۹ میلیون لیتر در روز بوده که رقم بسیار بالایی است و نسبت به متوسط مصرف بنزین در ایام مشابه سال قبل که رقم ۱۱۵ میلیون لیتر بوده، رشدی ۴.۶ درصدی را نشان می‌دهد. مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی ایران اذعان داشت: در روز ۲۹ اسفندماه فقط در تهران ۲۱.۵ میلیون لیتر مصرف بنزین داشته ایم.



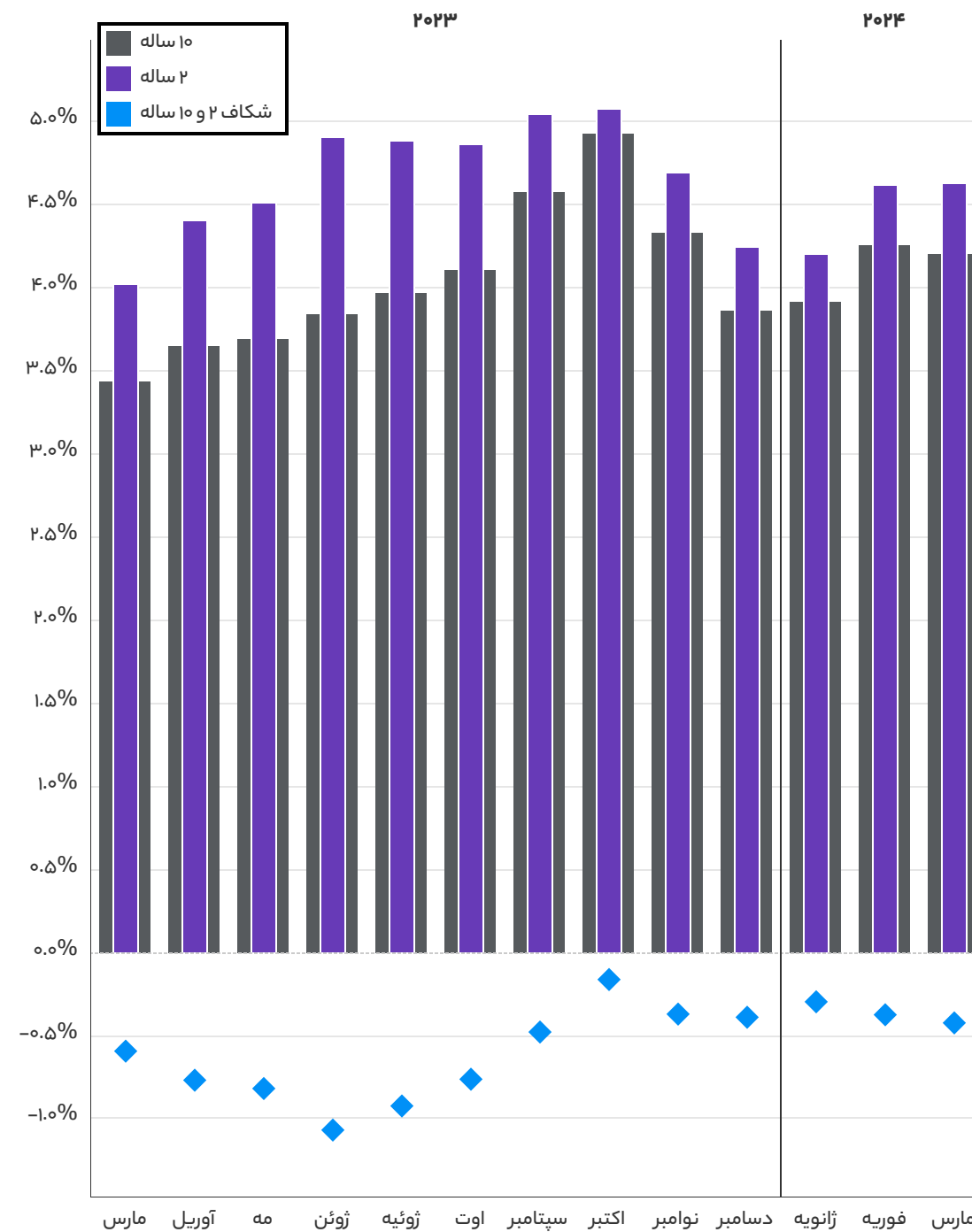
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



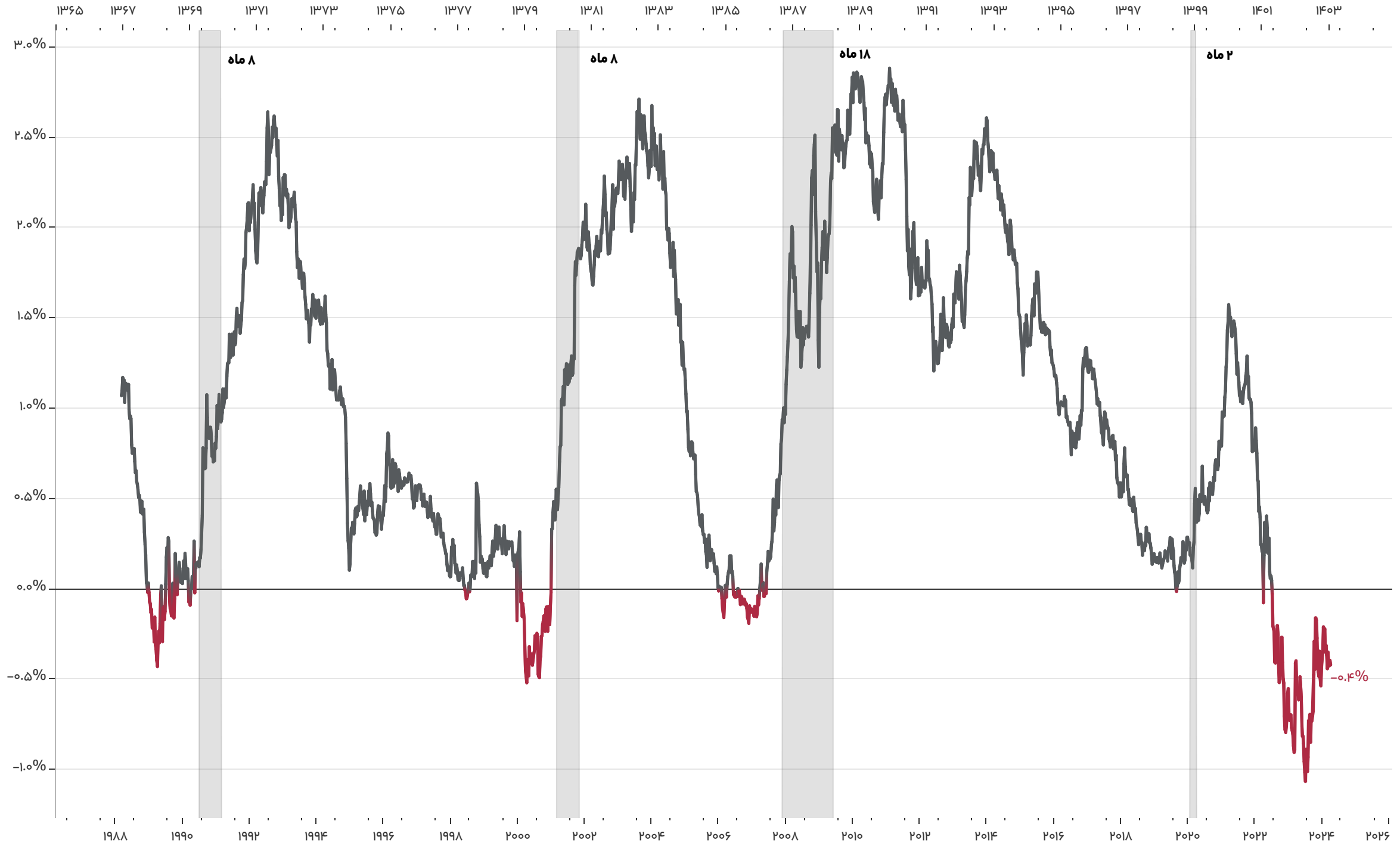
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

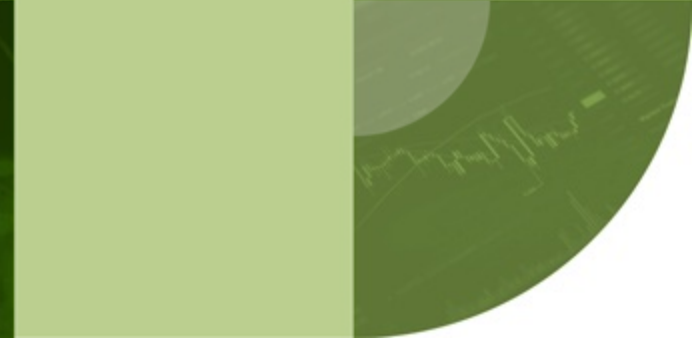
اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



بازار سهام

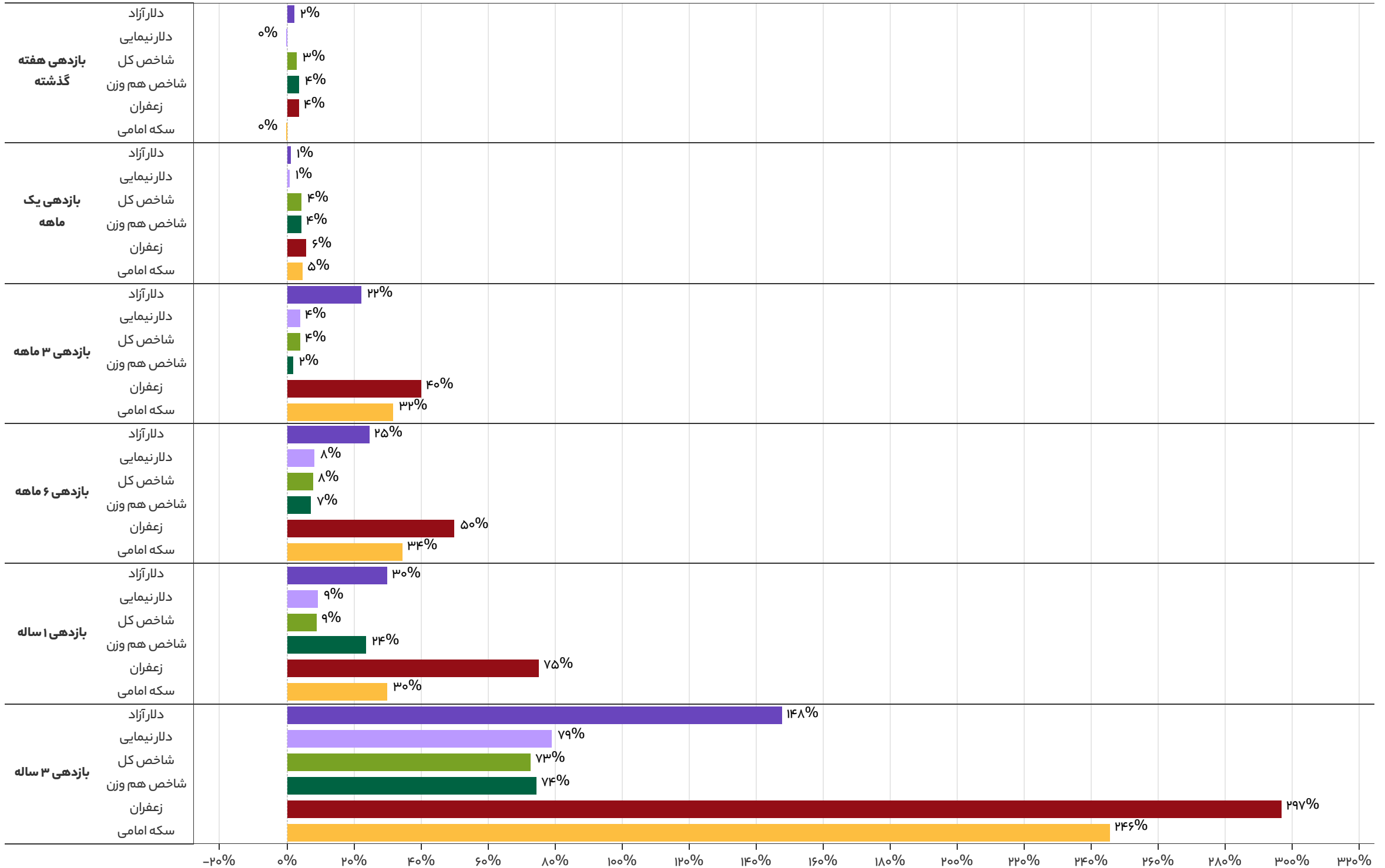
EQUITY MARKET

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

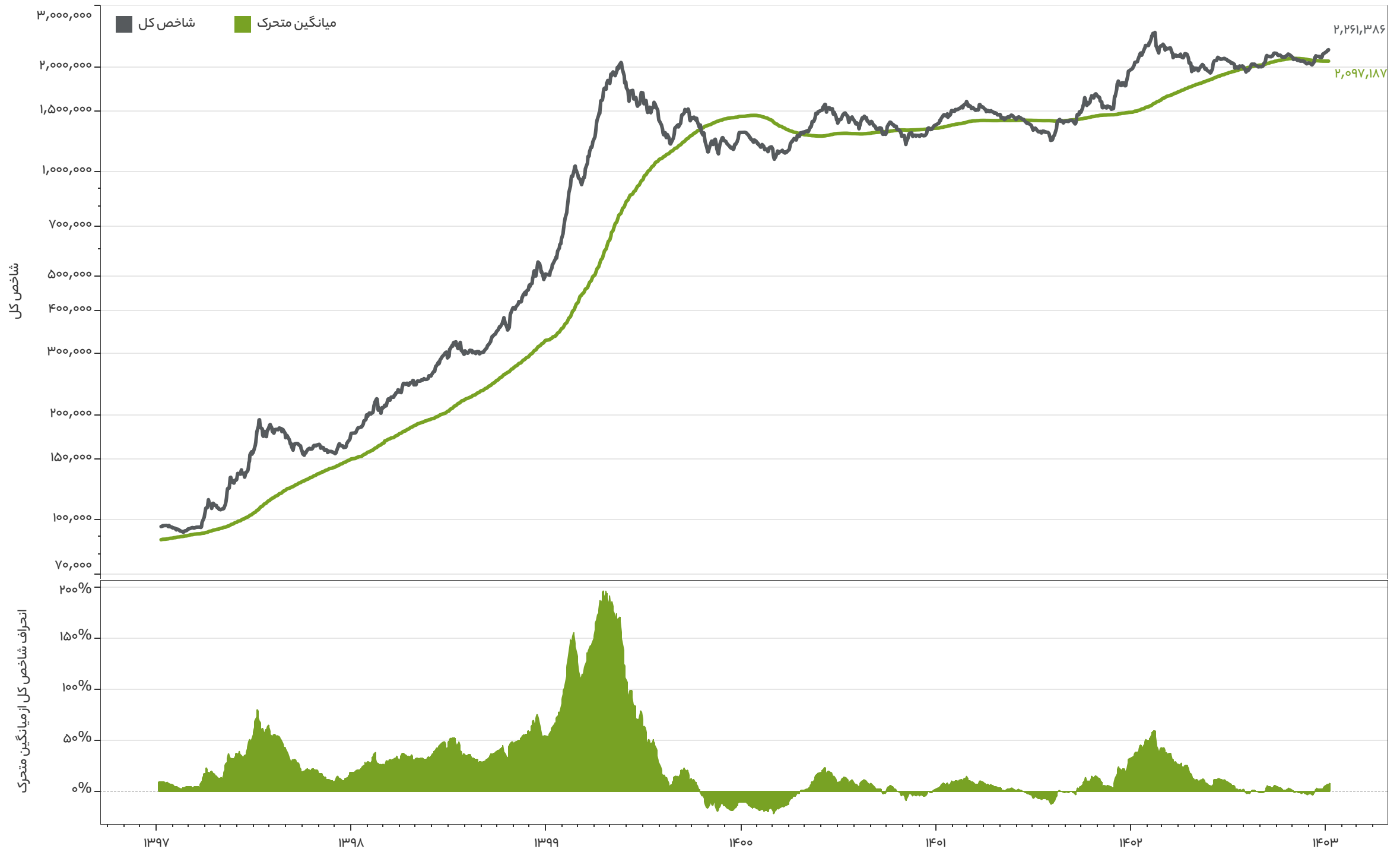
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

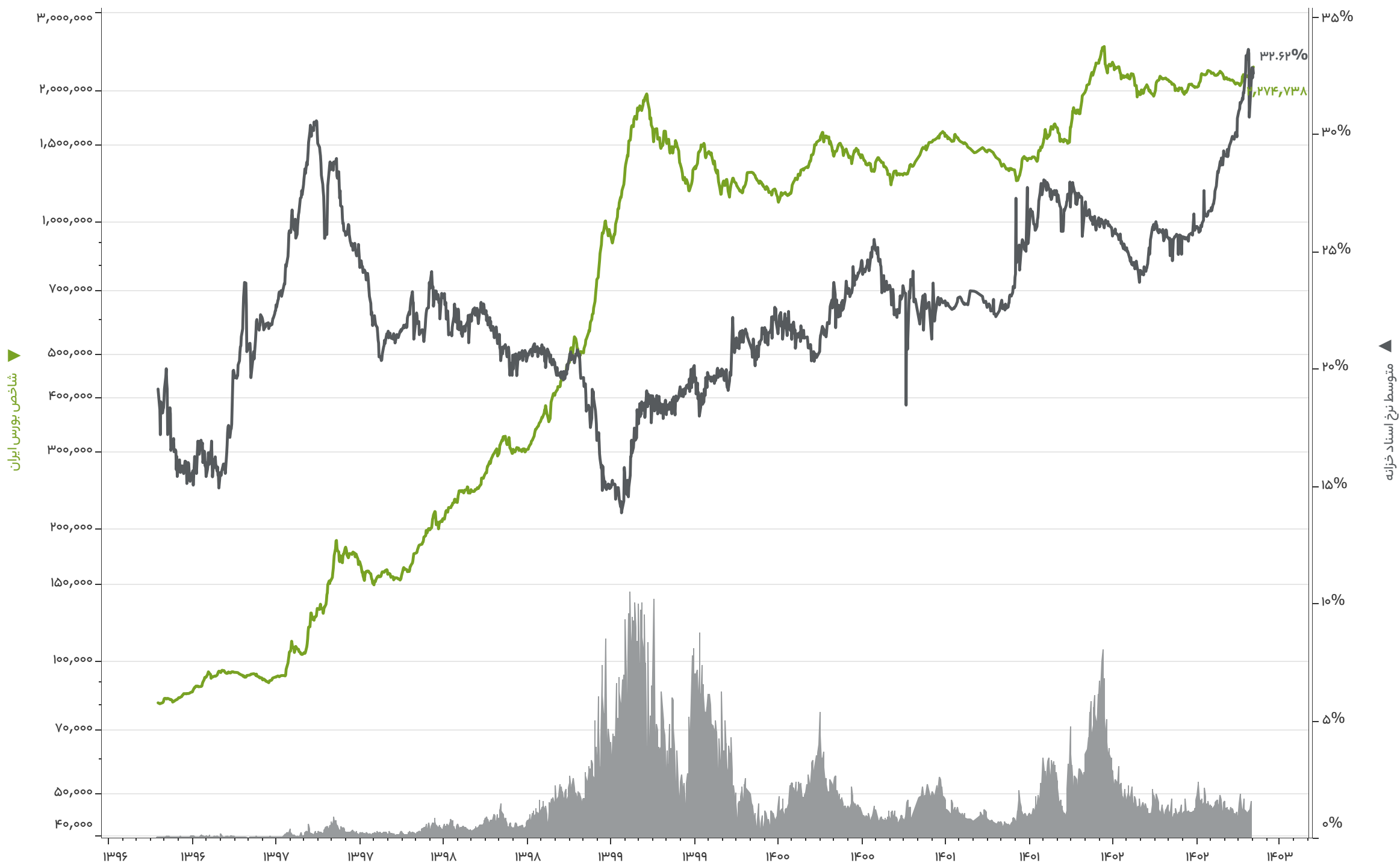
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





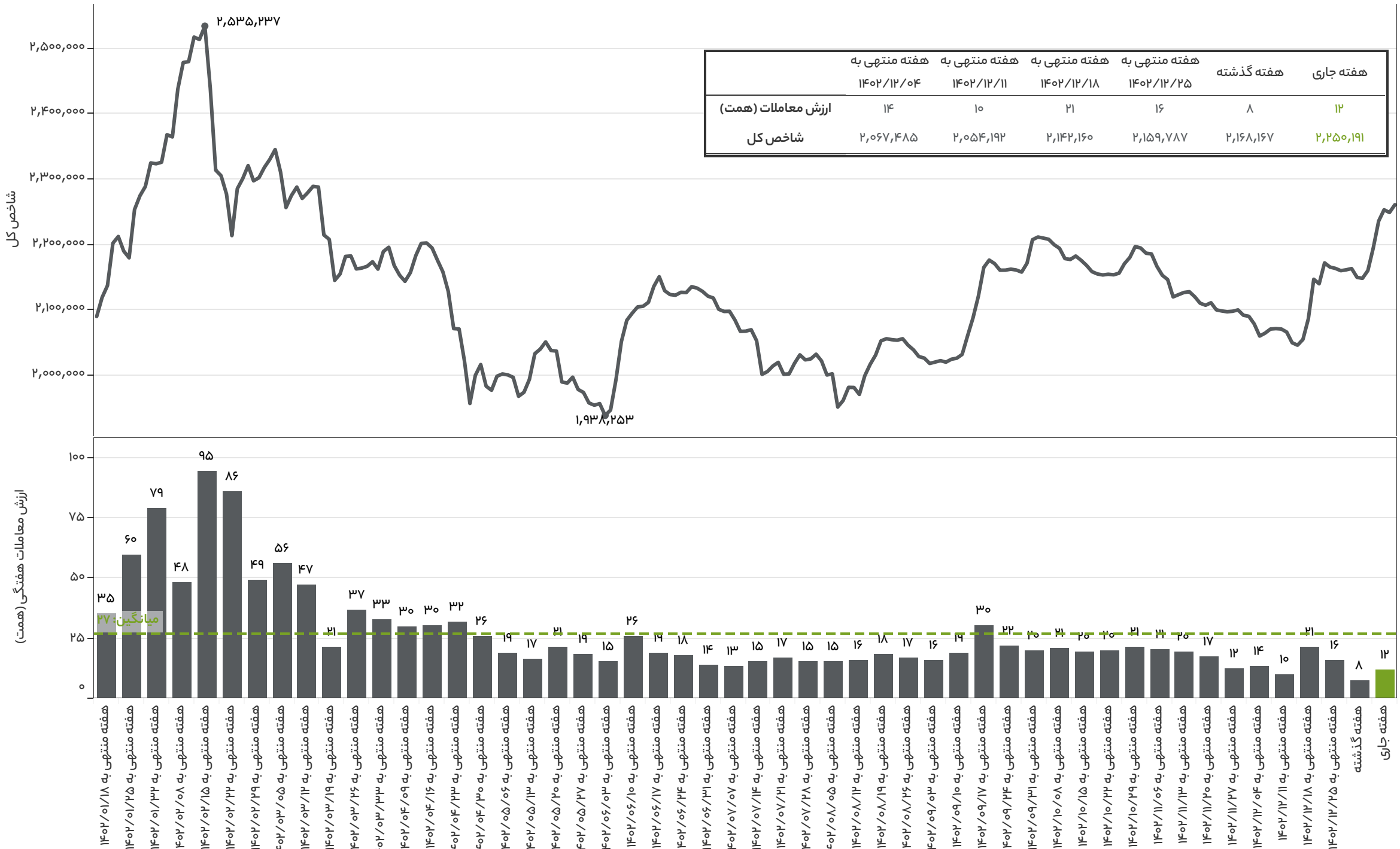
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



ارزش معاملات هفتگی بازار

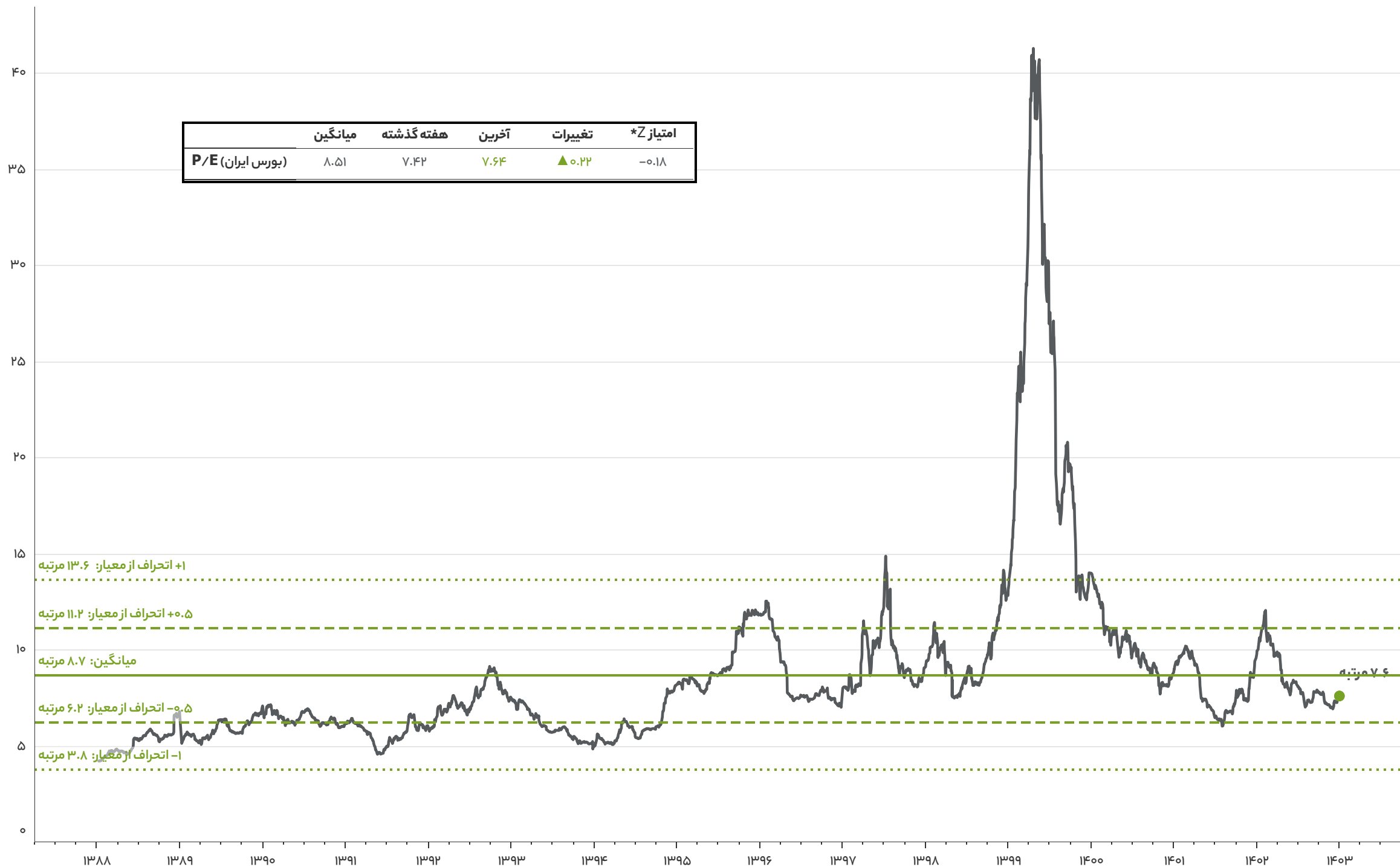
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.



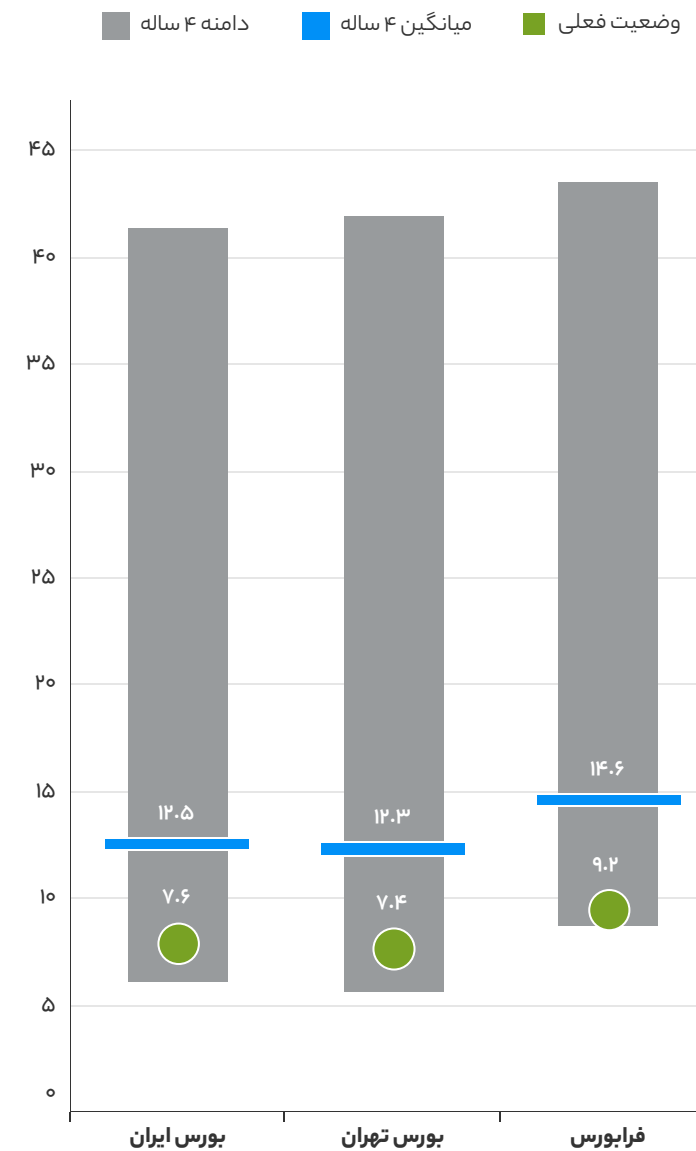
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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 |
|-----------------|------------|------------|--------------|----------------|---------------|
| +۰.۲۲ | ۷.۶۴ | ۷.۴۲ | ۶.۰۷ | ۱۲.۵۴ | ۴۱.۳۳ |
| +۰.۲۲ | ۷.۴۰ | ۷.۱۸ | ۵.۶۴ | ۱۲.۳۳ | ۴۱.۹۹ |
| +۰.۱۷ | ۹.۱۶ | ۸.۹۹ | ۸.۷۲ | ۱۴.۶۳ | ۴۳.۵۱ |

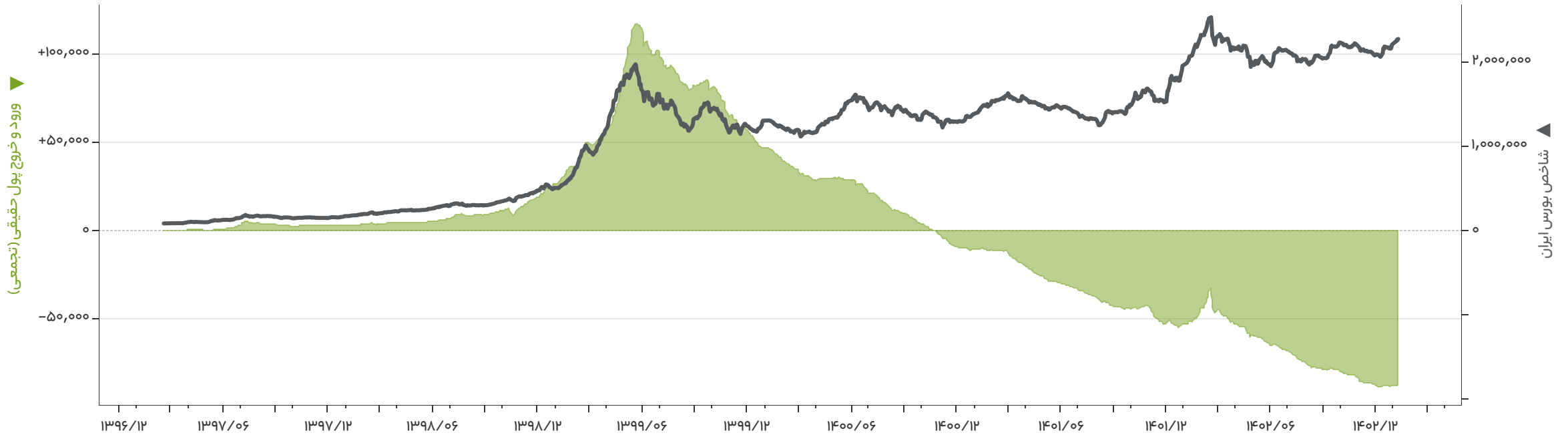


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

| | مواد پایه | خدمات مالی | انرژی | مصرفی دوره‌ای | مصرفی غیردوره‌ای | صنعتی | بهداشت | تکنولوژی | ارتباطات | یوتیلیتی | املاک و مستغلات | |
|---|-----------|------------|-------|---------------|------------------|-------|--------|----------|----------|----------|-----------------|-----------------|
| تعداد سهام | ۱۸۸ | ۱۹۹ | ۶ | ۶۶ | ۸۹ | ۶۳ | ۴۰ | ۱۹ | ۵ | ۱۱ | ۲۸ | وزن |
| ارزش بازار (هزار میلیارد تومان) | ۳,۵۵۸ | ۳,۳۱۵ | ۶۷۰ | ۴۰۴ | ۲۴۷ | ۱۹۸ | ۱۵۹ | ۱۲۳ | ۱۱۶ | ۹۵ | ۶۲ | |
| سهام هر سکتور از ارزش بازار | ۳۹.۸% | ۳۷.۰% | ۷.۵% | ۴.۵% | ۲.۸% | ۲.۲% | ۱.۸% | ۱.۴% | ۱.۳% | ۱.۱% | ۰.۷% | |
| نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر | ۷.۸ | ۷.۰ | ۴.۹ | ۴.۹ | ۹.۷ | ۸.۹ | ۹.۰ | ۱۷.۸ | ۱۱.۵ | ۱۳.۰ | ۱۵.۵ | سودآوری |
| بازده سود نقدی | ۸.۳% | ۸.۹% | ۱۳.۵% | ۳.۵% | ۴.۷% | ۳.۸% | ۷.۰% | ۲.۶% | ۳.۴% | ۱۵.۸% | ۲.۷% | |
| نسبت تقسیم سود | ۷۲% | ۶۱% | ۶۳% | ۳۳% | ۵۲% | ۳۷% | ۷۴% | ۵۷% | ۴۱% | ۱۰۰% | ۳۹% | |
| بتا به شاخص کل | ۱.۰ | ۱.۰ | ۱.۱ | ۱.۱ | ۰.۹ | ۱.۲ | ۰.۸ | ۰.۷ | ۱.۴ | ۱.۱ | ۰.۹ | β |
| بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱) | +۱۰۴۸% | +۸۸۶% | +۸۸۶% | +۹۴۵% | +۴۵۴% | +۴۶۴% | +۴۰۰% | +۳۳۸% | +۱۴۲% | +۸۵۴% | +۷۴۲% | بازده بلندمدت |
| بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰) | +۷۸% | +۳% | +۲۸% | -۶% | -۲% | -۲% | +۱۹% | +۹% | -۶۱% | +۱۳۳% | +۱۷% | |
| بازده از ابتدای سال | +۱۰۰% | +۷۵% | +۱۱۰% | +۱۰۸% | +۶۲% | +۱۱۸% | +۹۹% | +۹۰% | +۵۵% | +۵۴% | +۲۷۶% | بازده کوتاه‌مدت |
| بازده هفته گذشته | ۳% | ۳% | ۲% | ۳% | ۳% | ۴% | ۳% | ۵% | ۷% | ۱% | ۶% | |

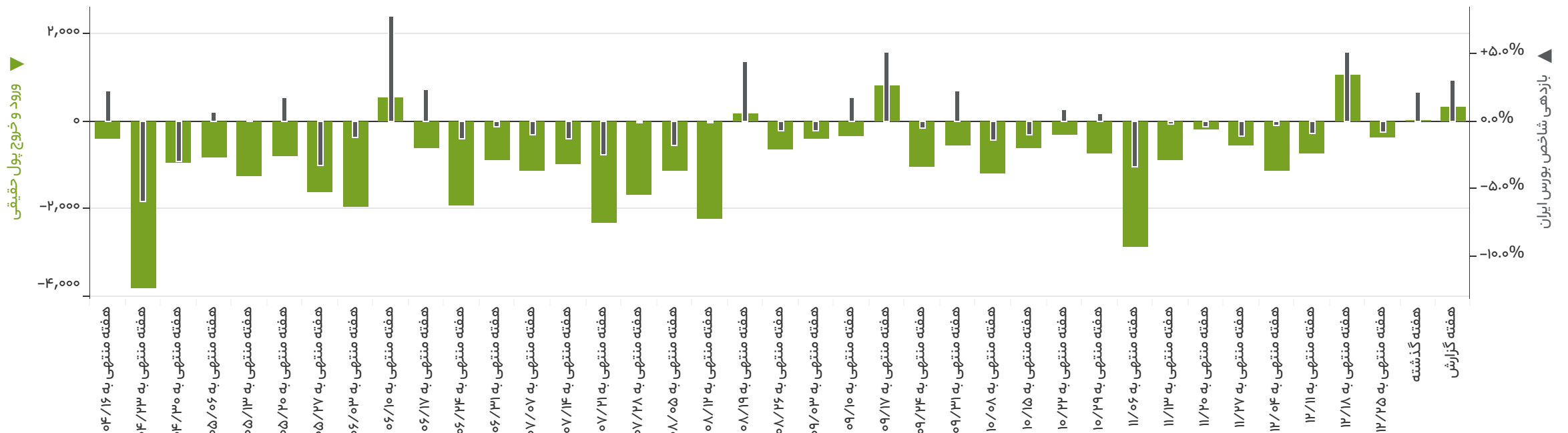
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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

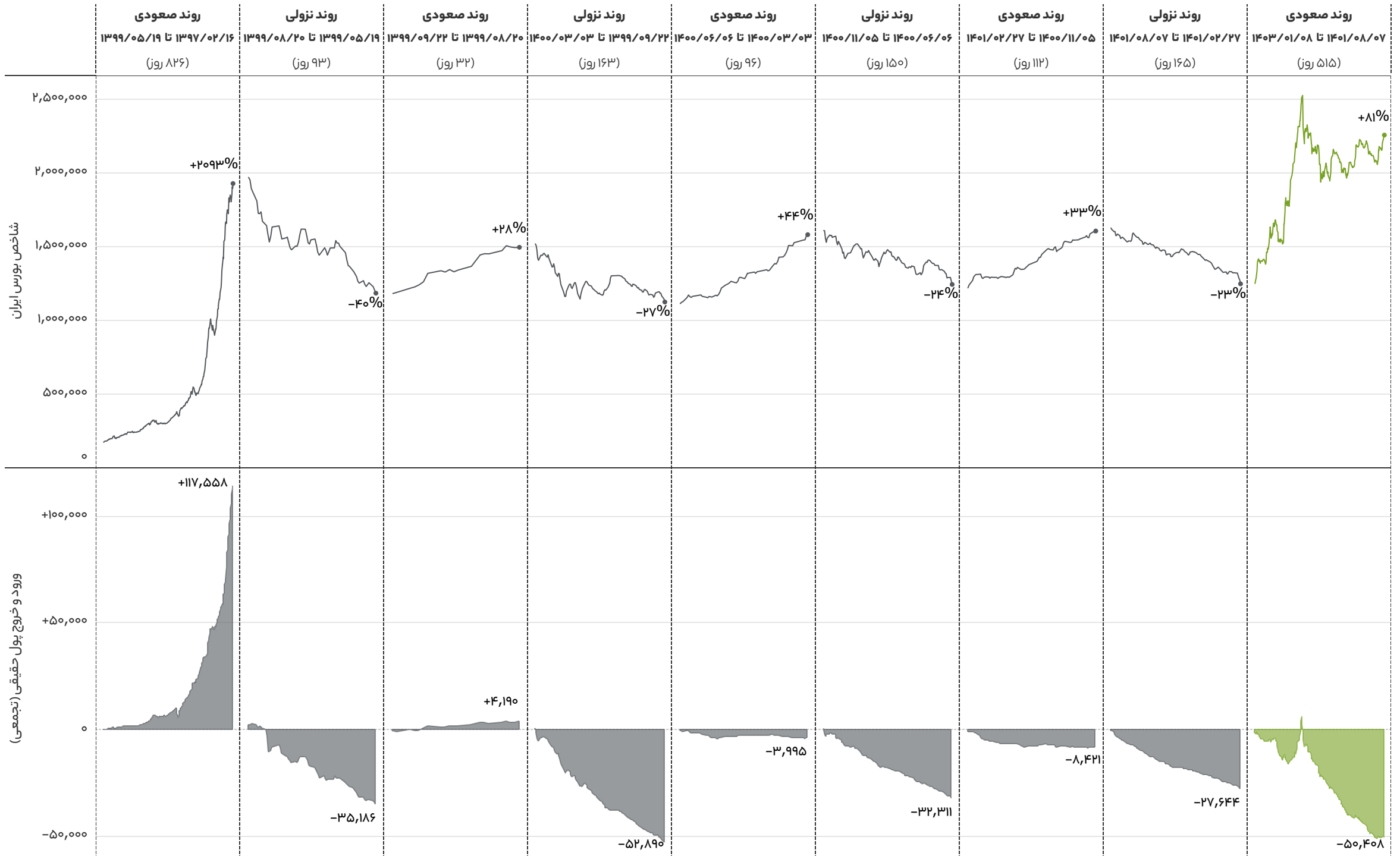
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

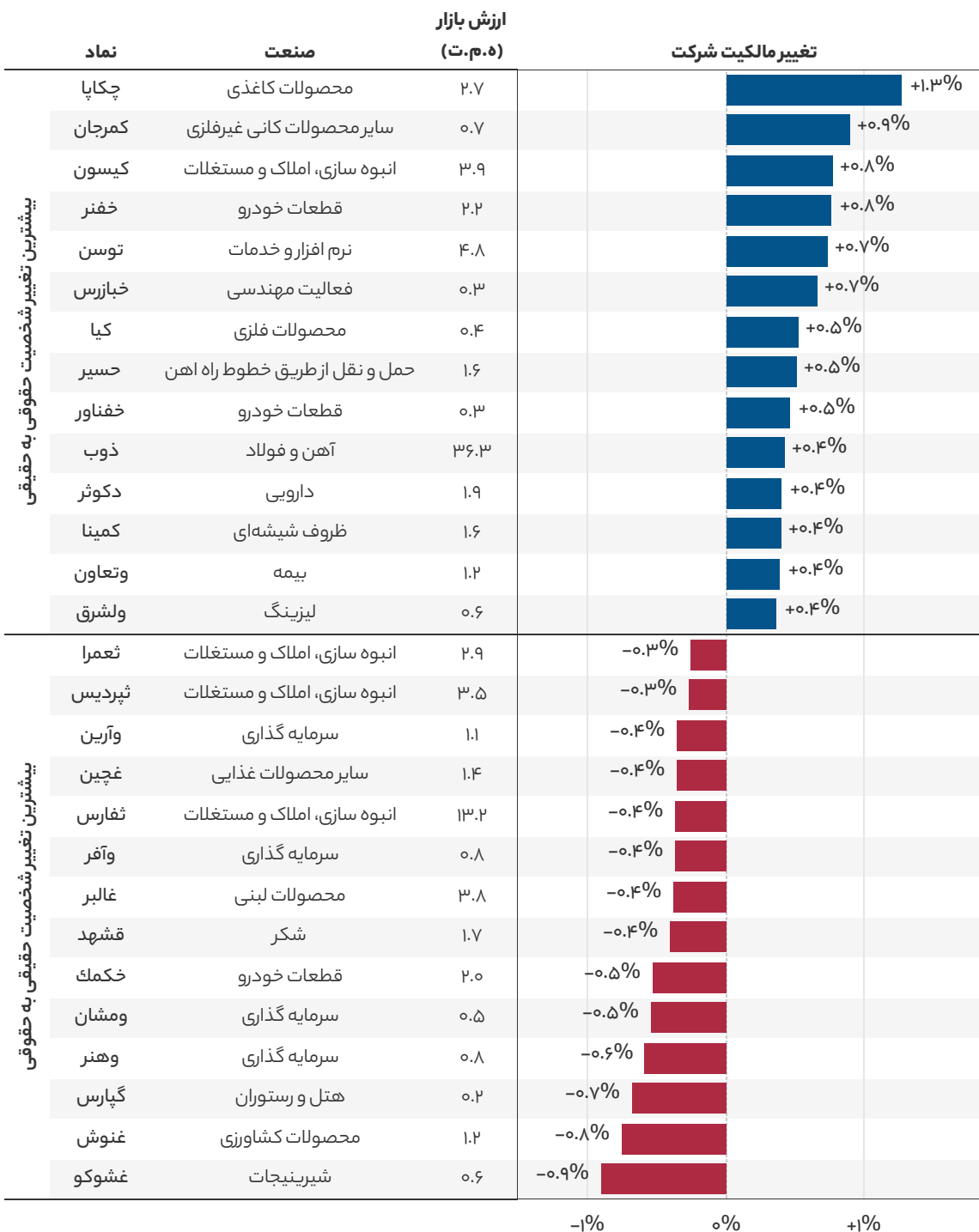
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس





تغییر مالکیت شرکت

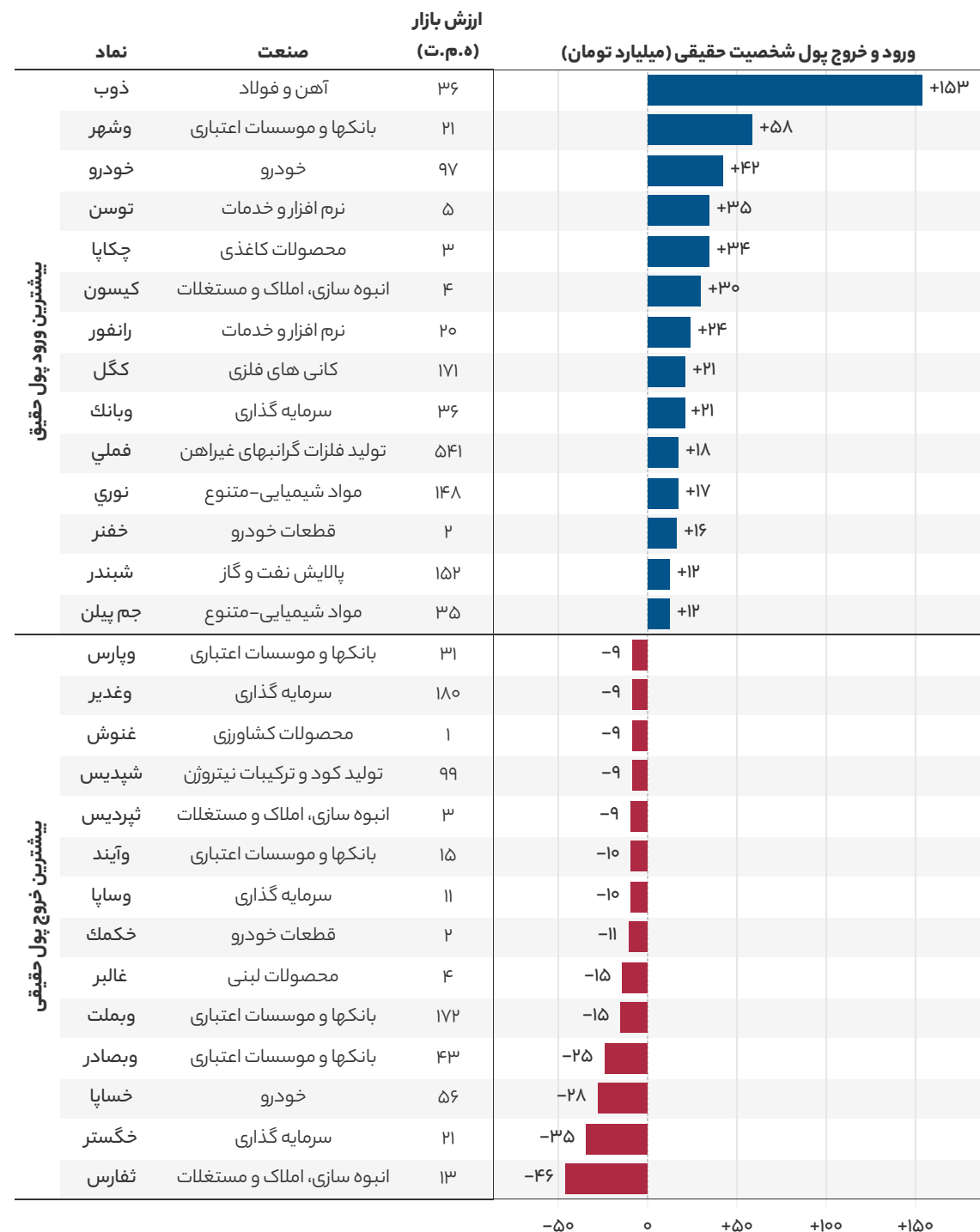
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان



-۱% ۰% +۱%

ورود و خروج پول حقیقی

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



-۵۰ ۰ +۵۰ +۱۰۰ +۱۵۰

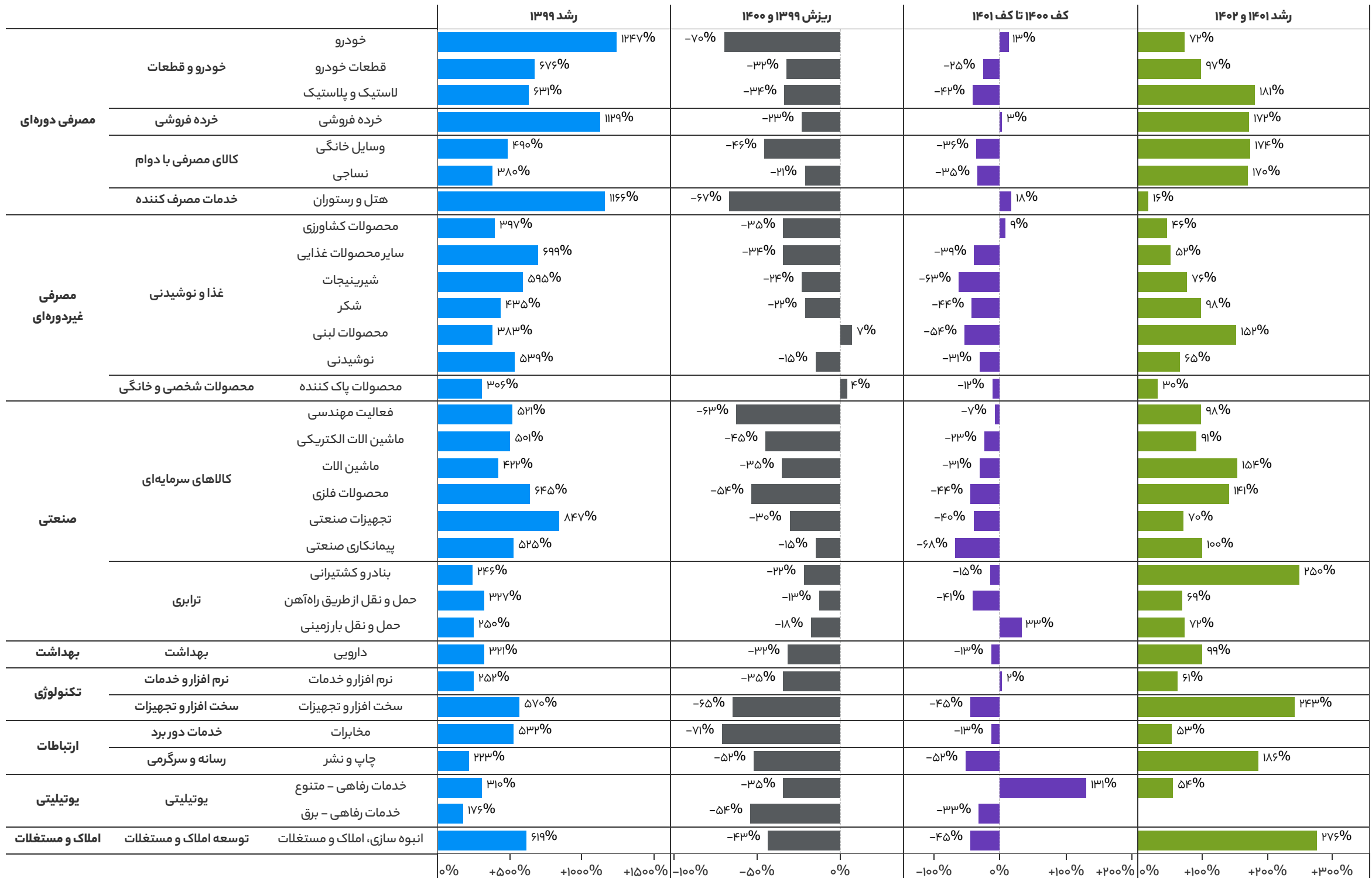
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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 ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰ (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) |
|----------------------|-----------------------|--|---|--|---|
| | | | | | |
| مواد پایه | فلزات و استخراج | آهن و فولاد: ۵۶۴% | -۳۴% | ۶% | ۱۰۳% |
| | | تولید فلزات گرانبه‌های غیراهن: ۸۵۴% | -۳۲% | -۱% | ۲۰۳% |
| | | کانی‌های فلزی: ۴۹۱% | -۱۴% | ۸% | ۳۱% |
| | | سایر مواد معدنی: ۵۲۸% | -۷۱% | -۲۷% | ۳۱۹% |
| | شیمیایی | مواد شیمیایی-متنوع: ۴۰۰% | -۱۶% | ۳۲% | ۷۱% |
| | | تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۴۶۶% | -۲۰% | ۹۸% | ۲۹% |
| | مصالح ساختمانی | سیمان، اهک و گچ: ۵۱۲% | -۱۷% | -۸% | ۱۷۱% |
| | | سایر محصولات کانی غیرفلزی: ۴۳۰% | -۱۸% | -۳۵% | ۱۱۵% |
| | | کاشی و سرامیک: ۴۶۳% | ۱۳% | -۳۴% | ۱۹۴% |
| | محصولات چوبی | محصولات کاغذی: ۳۸۵% | ۸۸% | -۵۱% | ۳۹۶% |
| کاغذ و محصولات جنگلی | چوب: ۳۷۴% | -۷% | -۵۹% | ۱۴۳% | |
| خدمات مالی | خدمات مالی متنوع | هلدینگ‌های سرمایه‌گذاری: ۸۸۱% | -۵۲% | ۱۸% | ۸۲% |
| | | تامین سرمایه: ۱۲۸۷% | -۵۲% | ۳۷% | -۵% |
| | | فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: ۹۱۶% | -۵۸% | -۷۴% | ۳۴% |
| | | لیزینگ: ۵۱۳% | -۴۲% | -۲۶% | ۸۹% |
| | بانک‌ها | بانک‌ها و موسسات اعتباری: ۷۲۸% | -۴۰% | -۲۶% | ۷۶% |
| بیمه | بیمه: ۶۹۳% | ۲۹% | ۱۰% | -۸% | |
| انرژی | پالایش نفت و گاز | نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی: ۶۸۳% | -۶۸% | ۸۷% | ۱۰۹% |
| | زغال سنگ | زغال سنگ: ۲۴۸% | ۳% | -۱۸% | ۹۸% |
| | تجهیزات انرژی و خدمات | حفاری: ۳۶۵% | -۵۰% | -۳۳% | ۲۱۷% |

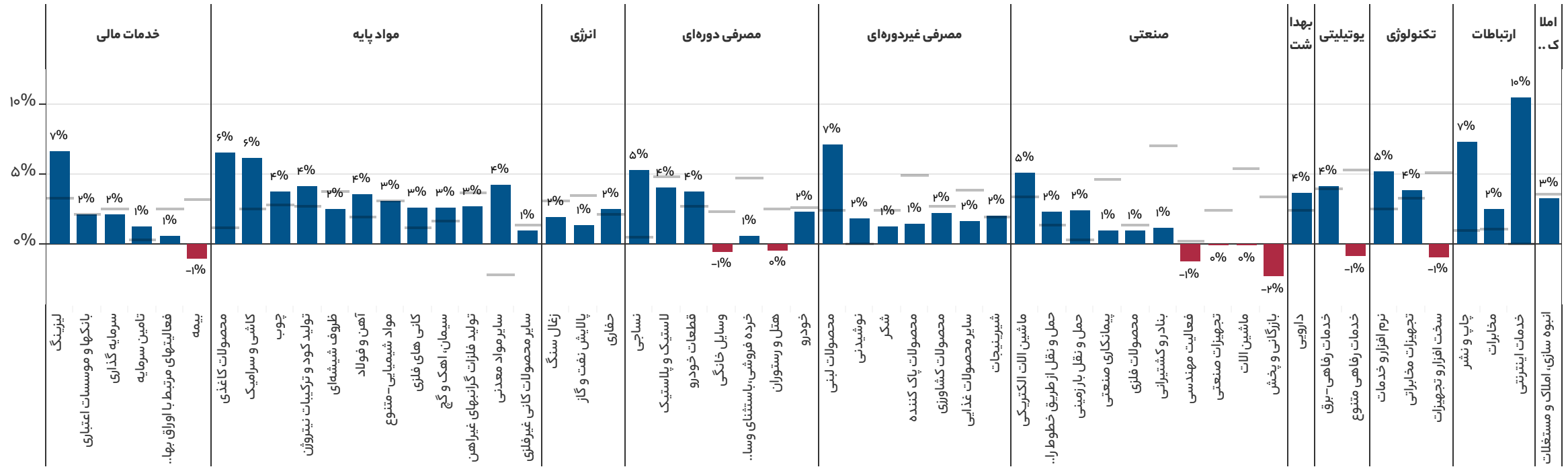


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



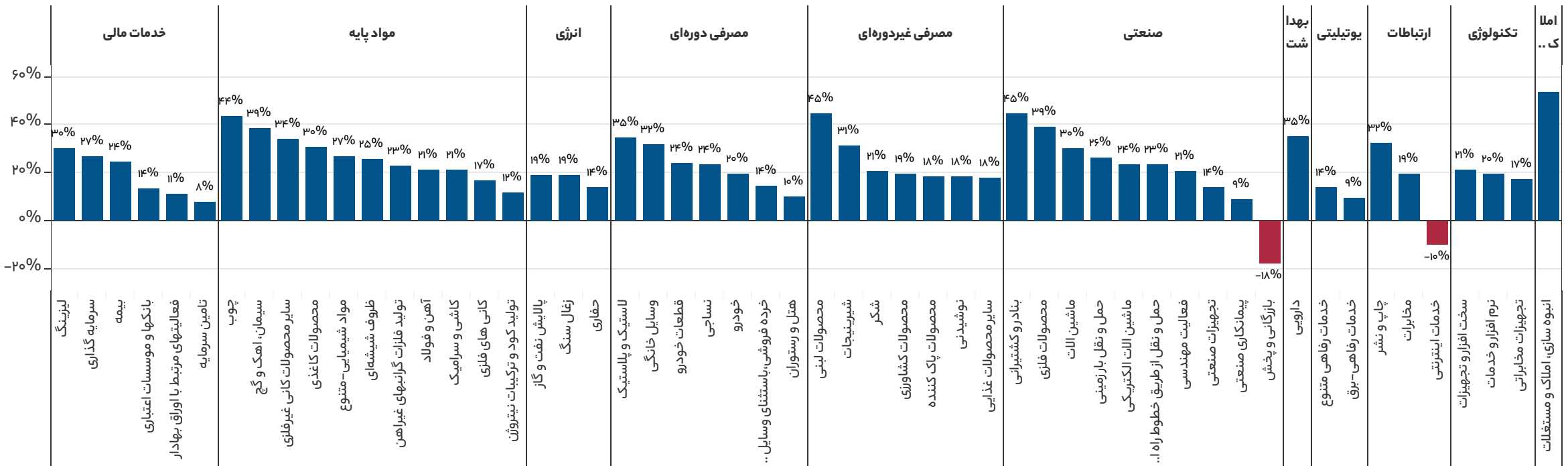
بازدهی صنایع از ابتدای هفته

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



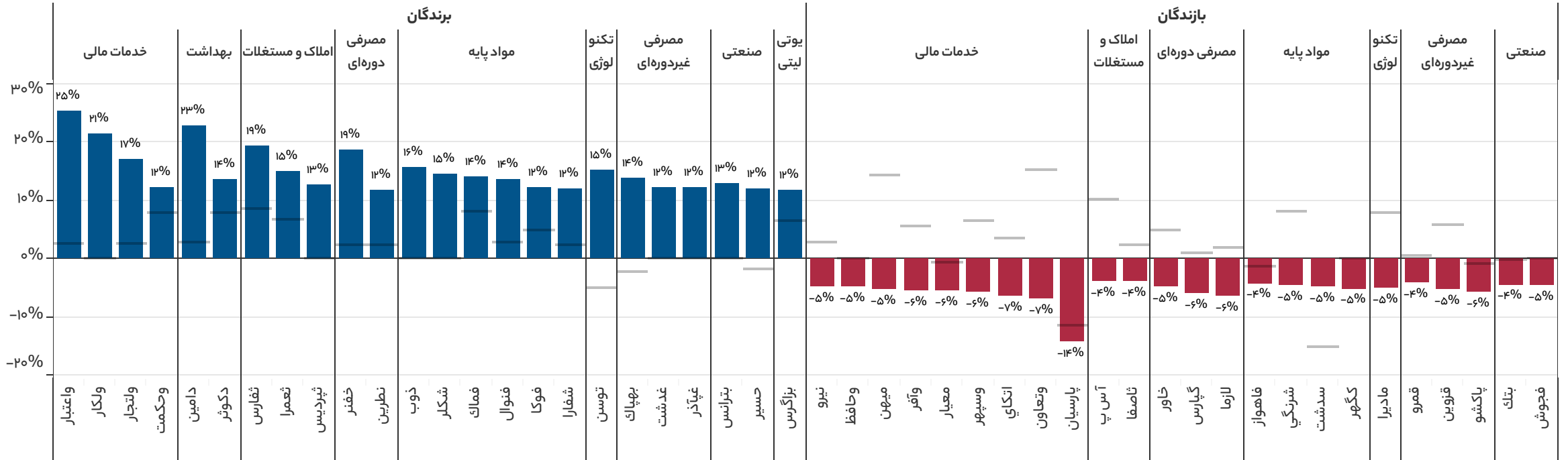
بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

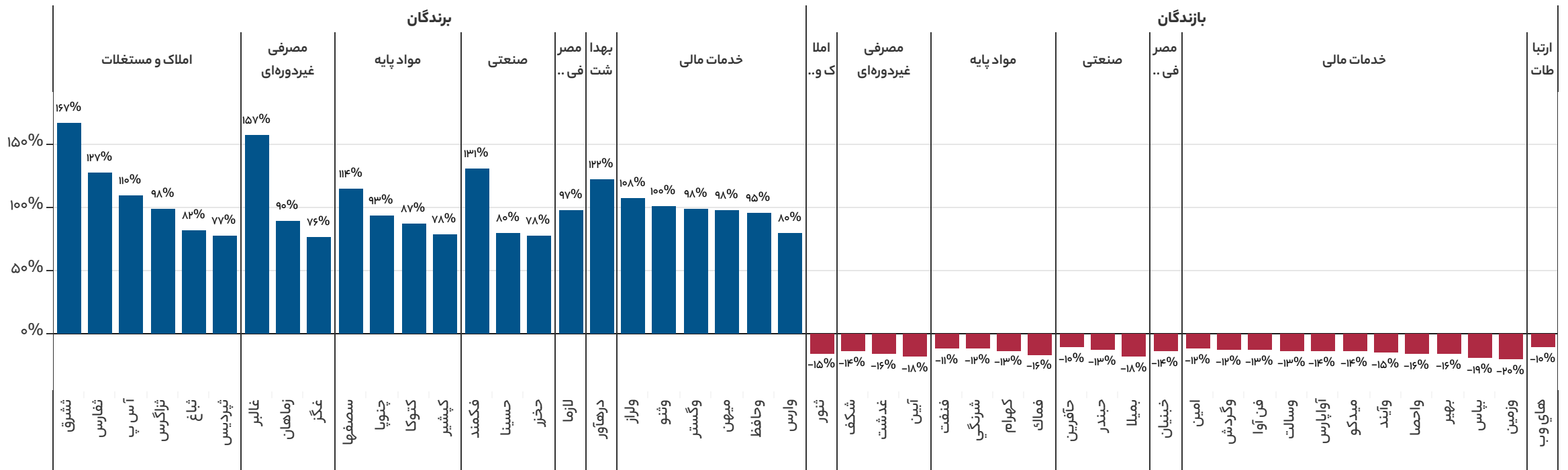




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)

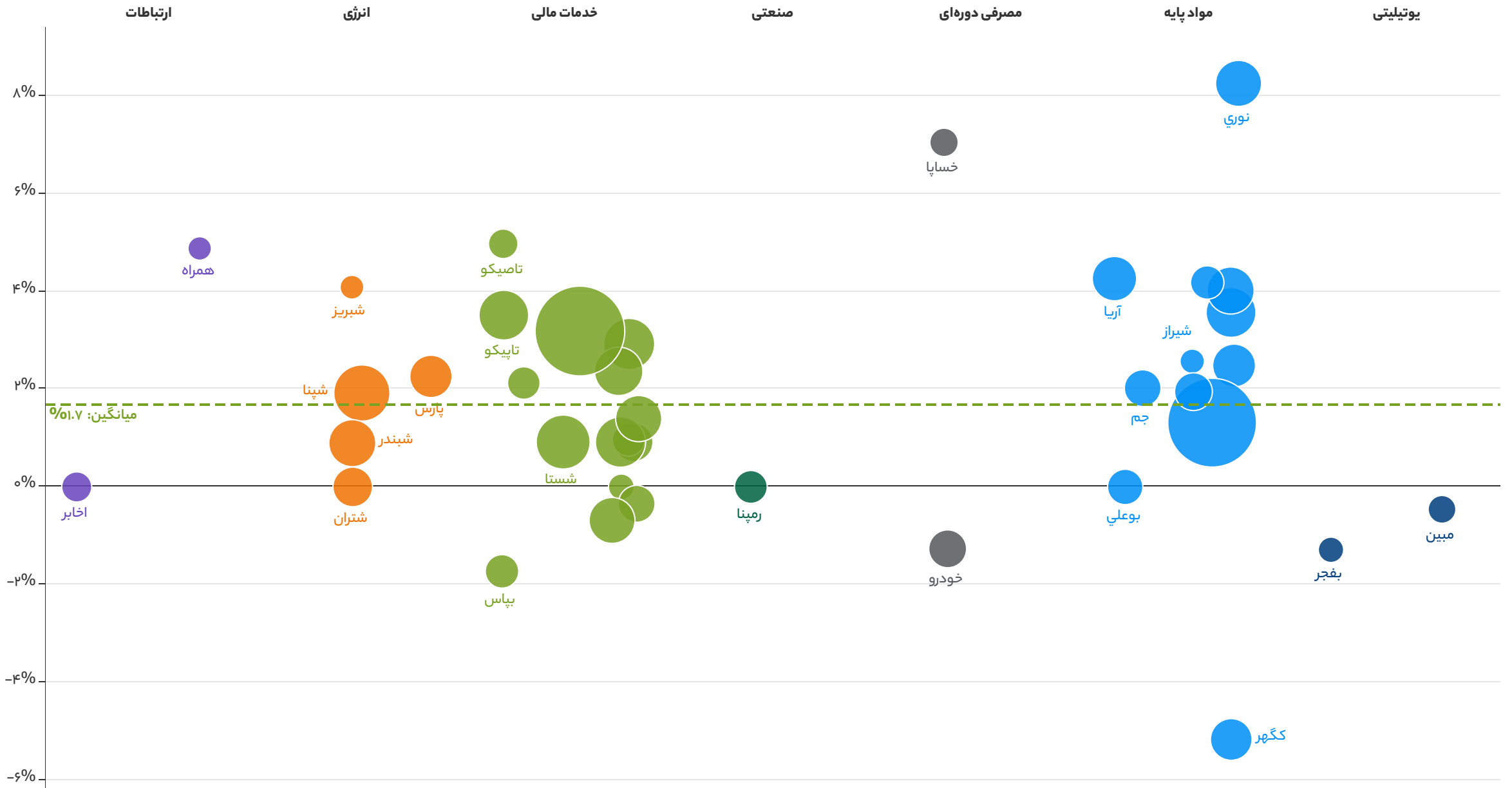


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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



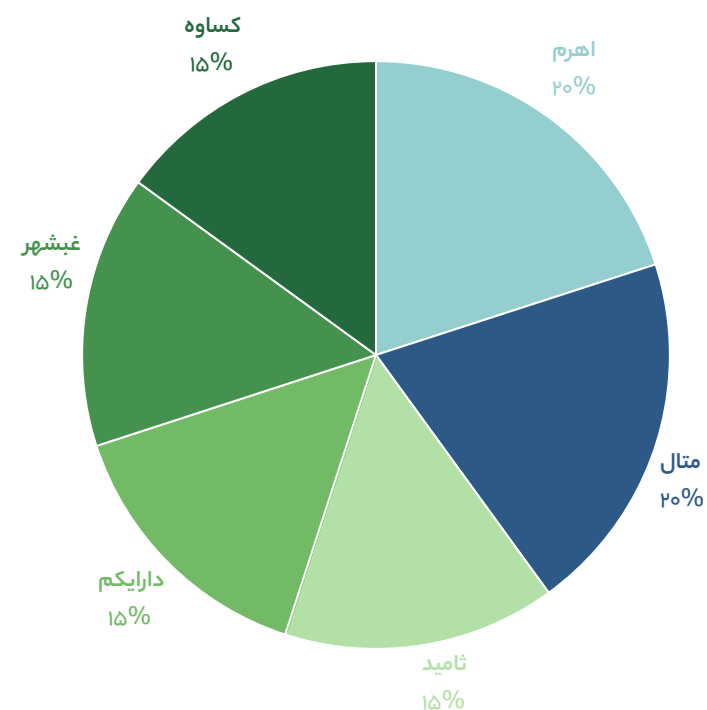
| بازده هفته گذشته | نوری | خسپا | تاصیکو | همراه | آریا | فخوز | شبریز | کچاد | کگل | تاپیکو | فارس | وغدیر | شیراز | ماون | وامید | پارس | حکشتی | جم | شپدیس | شینا | پارسان | فملی | وسندوق | شستا | وبملت | ومعادن | شبندر | اخابر | بوعلی | رمپنا | شتران | وتجارت | وپاسار | مبین | میدکو | خودرو | بفجر | بپاس | کگهر |
|------------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| | +۸.۳% | +۷.۰% | +۵.۰% | +۴.۹% | +۴.۳% | +۴.۲% | +۴.۱% | +۴.۰% | +۳.۶% | +۳.۵% | +۳.۲% | +۲.۹% | +۲.۶% | +۲.۵% | +۲.۴% | +۲.۳% | +۲.۱% | +۲.۰% | +۱.۹% | +۱.۹% | +۱.۴% | +۱.۳% | +۱.۰% | +۰.۹% | +۰.۹% | +۰.۹% | +۰.۹% | ۰% | ۰% | ۰% | ۰% | -۰.۳% | -۰.۵% | -۰.۷% | -۱.۳% | -۱.۳% | -۱.۷% | -۵.۲% | |



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

| وزن پیشنهادی | قیمت سهم | توضیحات | هدف قیمتی | نماد | افق زمانی |
|--------------|----------|---|-----------|---------|-----------|
| ۱۵% | ۲,۳۰۳ | نسبت (P/E) و (P/NAV) مناسب در صنعت | ۲,۹۰۰ | ثامید | میان مدت |
| ۱۵% | ۱۷۷,۱۵۰ | نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب | ۲۱۰,۰۰۰ | دارایکم | |
| ۱۵% | ۲,۲۰۰ | نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارزش ۲۸۵۰۰ | ۲,۴۰۰ | غیشهر | |
| ۱۵% | ۲۰,۴۶۰ | نسبت (P/E) مناسب | ۲۴,۰۰۰ | کساوه | |
| ۲۰% | ۲۳,۲۰۰ | دارا بودن پرتفوی متنوع و اهرمی | - | اهرم | بلند مدت |
| ۲۰% | ۱۲,۱۴۰ | دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد | - | متال | |



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

