

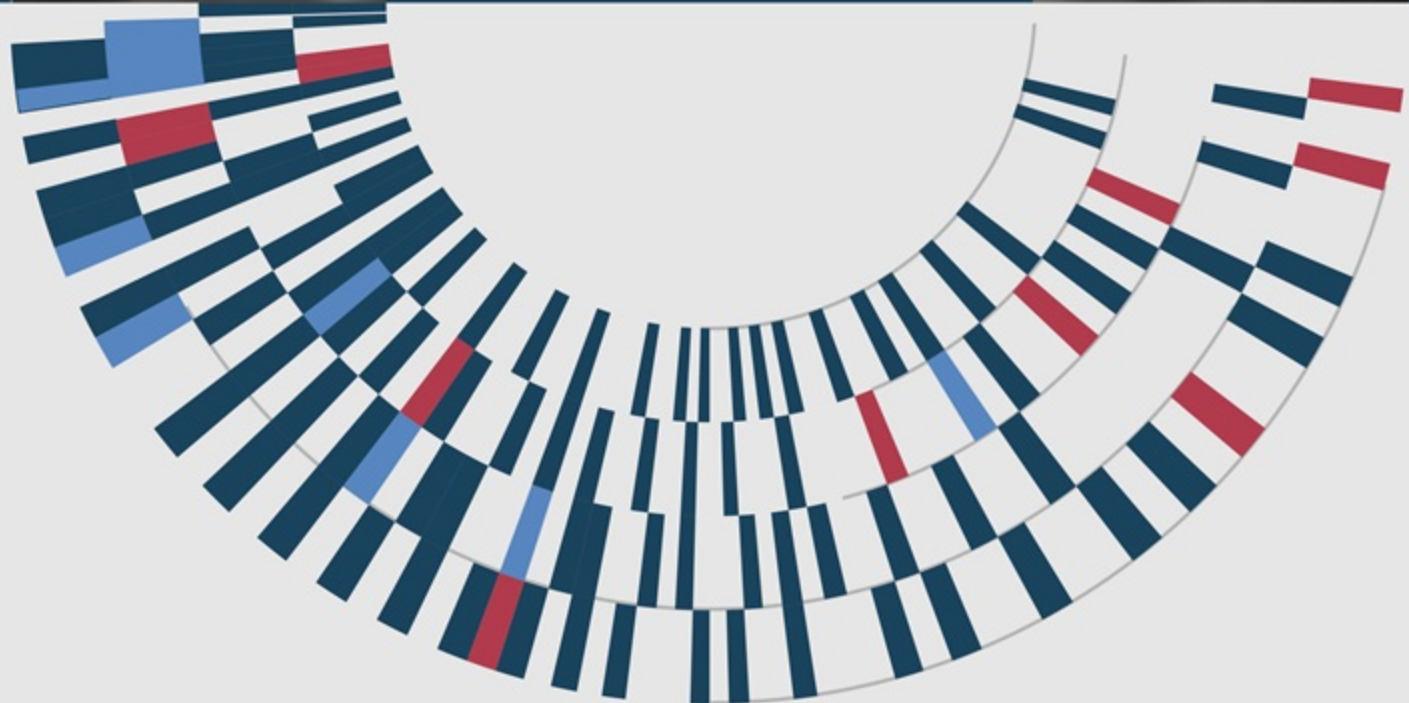


کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۸ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۰۷





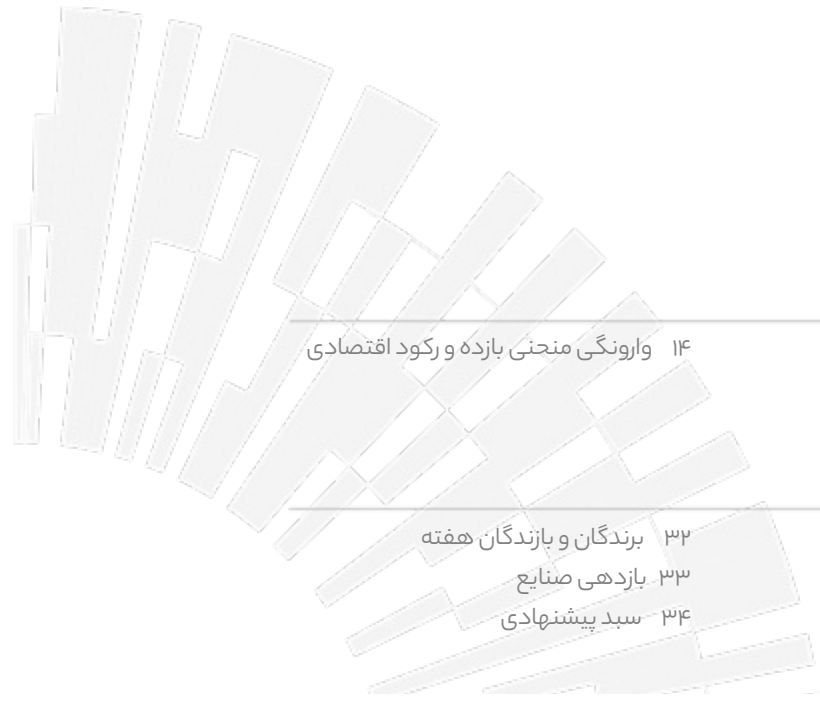
معرفی گزارش:

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

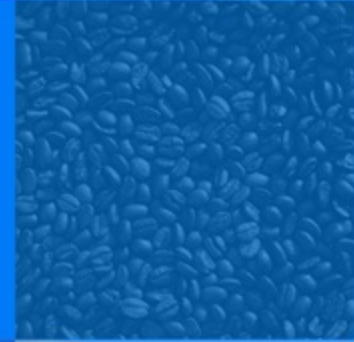
۱۵



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات غیر آهنی	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	۲,۳۳۹	-۲.۱%	فزر	-	۱,۸۳۰ / ۲,۳۸۸	۱۶%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۹,۹۷۶	+۰.۹%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ / ۹,۹۷۶	۱۶%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵۲۹,۲۰۰	-	فملی	بموتو، فباهنر	۳۲۵,۷۰۰ / ۵۲۹,۲۳۷	۳۴%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۴۵۵	-	فایرا	فنوال	۲,۱۰۲ / ۲,۴۵۵	۶%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۸۵۵	-	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ / ۲,۸۵۶	۷%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۲۱۰	-۰.۳%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ / ۲,۲۹۶	۵%
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۷۳	-۰.۱%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ / ۵۰۰	-۲%
	شمش (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۴	+۰.۸%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ / ۵۳۸	-۶%
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۳,۴۷۲	+۰.۹%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق	کوبیر، فوکا، فنورد	۱۸,۳۷۴ / ۲۳,۴۷۲	۱۰%
	اسلب (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۷۳	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ / ۵۰۰	-۲%
	اسلب (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۴	+۲.۲%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ / ۵۶۰	-۱۰%
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۴,۵۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ / ۲۴,۵۰۰	۲۸%
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۸۸	-	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ / ۶۵۵	-۱۰%
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۴,۸۸۳	+۰.۶%	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ / ۲۵,۱۱۰	۲%
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۶۰	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ / ۶۳۰	-۱۱%
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۷۰	-	فولاد	-	۶۴۰ / ۷۲۵	-۸%



	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	CFR چین	دلار/تن	۱۱۹	+۱.۳%	-	-	۹۹ - ۱۴۳	۱۷%
	گندله سنگ آهن	CFR چین	دلار/تن	۱۳۵	+۰.۹%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۱۵ - ۱۶۴	۱۳%
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵,۲۶۹	+۱.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۲۷۴ - ۵,۲۶۹	۲۳%
	کنسانتره سنگ آهن	CFR چین	دلار/تن	۱۲۴	+۰.۸%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۰۵ - ۱۵۳	۱۵%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۶۴۴	-۰.۵%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۲۲۱ - ۳,۷۸۷	۱۳%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۲۲	+۹.۶%	-	-	۱۹۹ - ۲۶۸	-۸%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۷۳	+۱.۵%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۲۵۲	-۲۶%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۶۰۸	+۲.۰%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	۱۶%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۸۸	-	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸ - ۹۰۸	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، شفارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۹۲	-۴.۳%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ - ۳۰۹	۷%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۱,۰۱۰	۱۰%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۹۰۰	-۶%
پاراژایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۳۸	-۱.۶%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ - ۱,۱۵۸	۲%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۷۰	-	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۴۰	-۲%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۷۱	-۰.۹%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۸۲	۱۵%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۷۸	-۰.۶%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۸۴	۲۲%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۴۷	+۰.۱%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۵۲	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۴۳۰	-۱.۴%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۴۵۰	۴۷%
مونواتیلن گلابکول	چین CFR	دلار/تن	۵۱۰	-۱.۹%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	۲%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۲۵	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۲۵	۸%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۲۴	+۰.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۹۸۵	-۵%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۵	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۶۱	-۴%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۷۵	-	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۱۰	-۳%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۶۰	-۱۰%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ - ۸۸۵	-۳%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۸۰	+۱.۴%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۸۰	۸%

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	۸۹	+۲.۵%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۴ - ۹۴	۱۹%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۴	+۰.۵%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۹ - ۹۱	۱۷%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۶	-۰.۵%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۷۸ - ۱۰۷	۲۳%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۶	+۱.۲%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۷۹ - ۱۲۵	۲۱%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۸۳	+۲.۰%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۳۶۹ - ۵۲۸	۳۱%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۵	+۰.۹%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۸۱ - ۱۲۴	۱۴%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۴۹	+۲.۷%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۴۵۲ - ۶۵۹	۲۳%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۹۰۰	+۰.۶%	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	۷۲۰ - ۹۴۰	-۴%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۶,۶۲۱	+۲.۱%	-	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۲۱,۷۹۵ - ۳۶,۶۲۱	۴۰%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۱,۸۲۲	+۴.۷%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۱۲,۴۵۵ - ۲۱,۸۲۲	۵۸%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۳,۱۲۳	-	-	شپاس	۱۲,۰۸۶ - ۱۶,۴۹۹	-۱۵%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۱۲	-۰.۹%	-	ذوب، فروش	۱۸۸ - ۲۸۷	-۱%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۷	+۰.۴%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	-۳%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۵	+۱.۰%	-	-	۱.۲۱ - ۱.۳۱	۰%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۴,۰۲۵	-۰.۴%	-	-	۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	۱۱۷%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

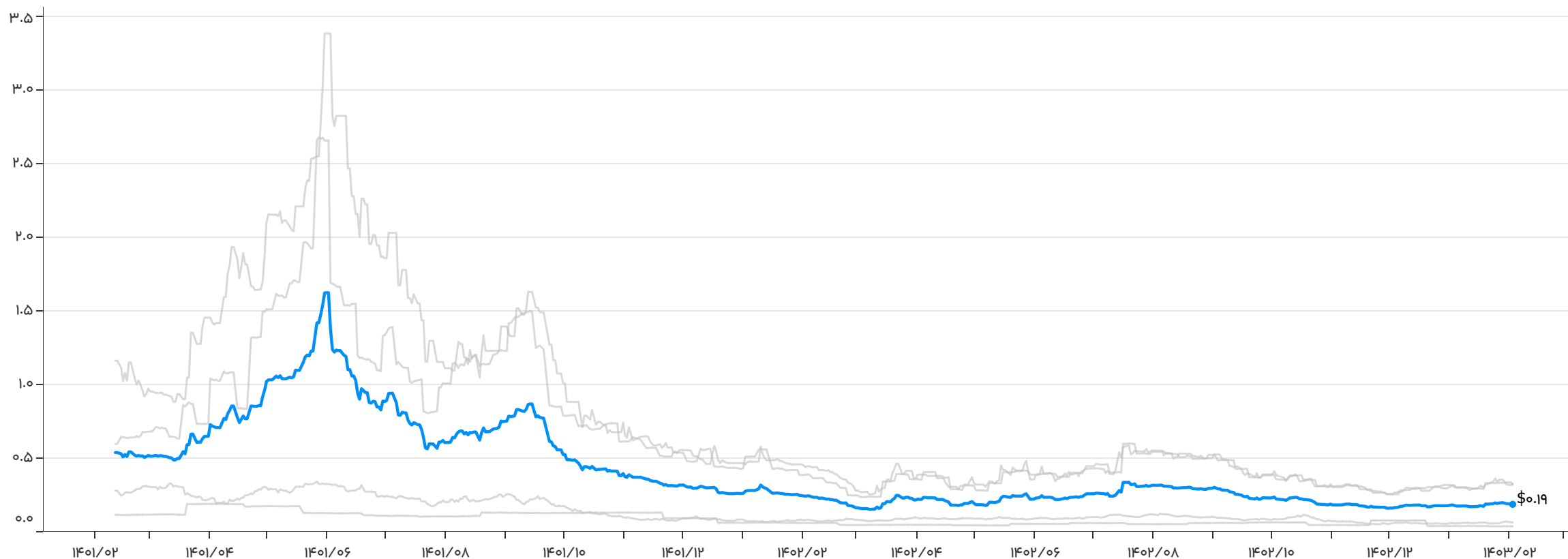
ارز و ارز دیجیتال



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	۰.۰۷	-۷.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۱۴%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۴	+۰.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۴ - ۰.۰۸	-۳۵%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۳	-۲.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۲۵%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	-۴.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۰.۶۱	-۱۴%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۹	-۳.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۲۵%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

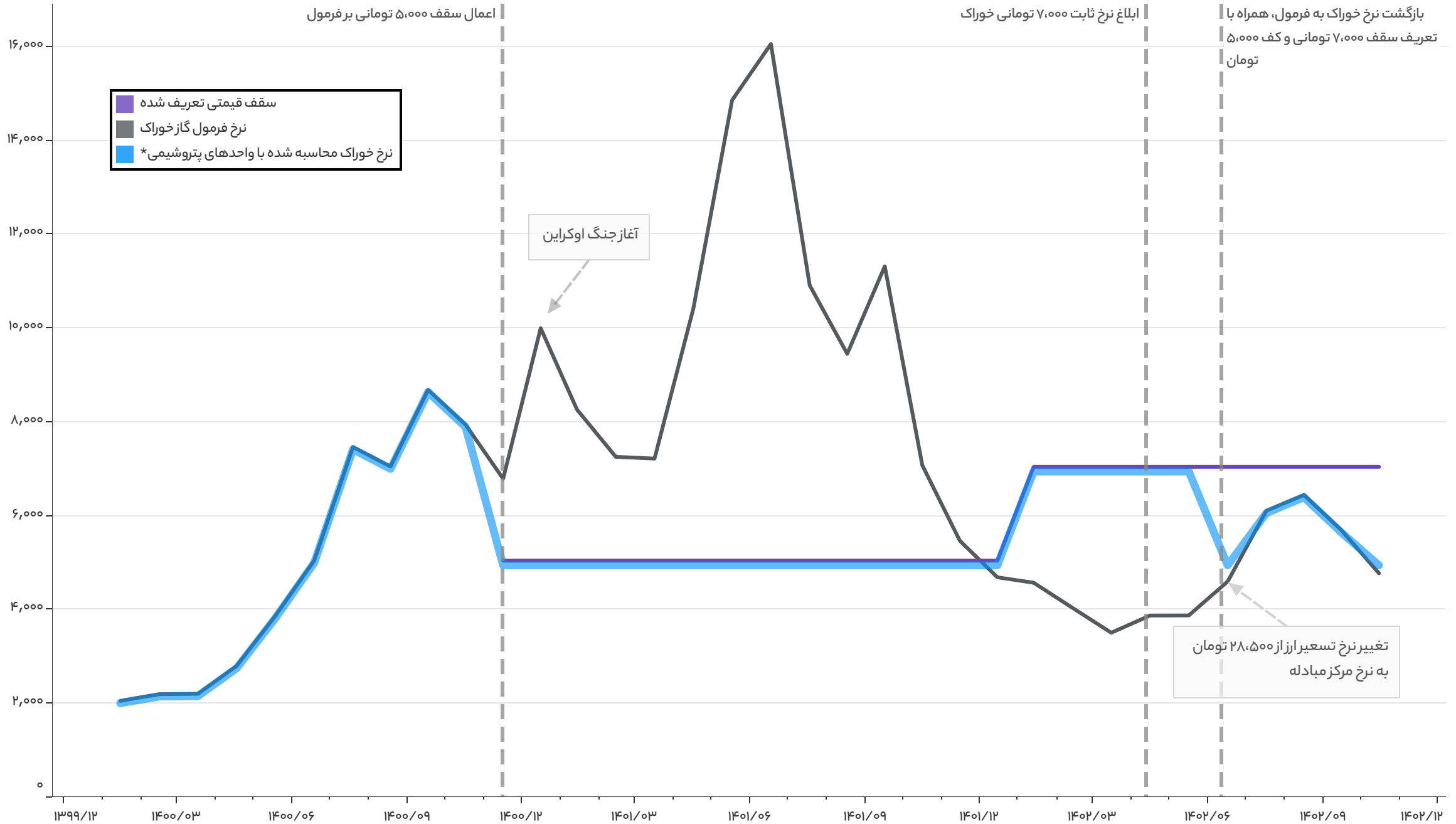
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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

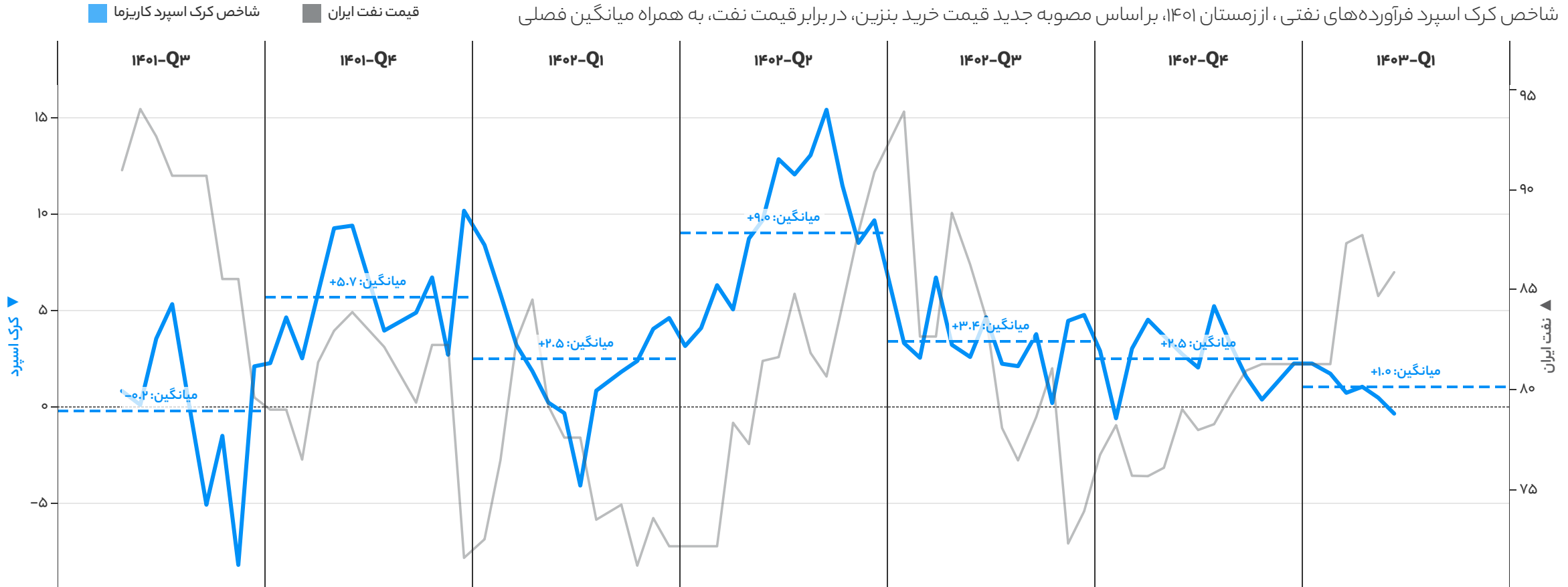


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا برورسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



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)		کرک اسپرد (دلار)		میانگین فصلی کرک اسپرد (دلار)			آخرین وضعیت اسپرد (در برابر میانگین فصل جاری و فصل گذشته، دلار)	
	هفته گزارش	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییر (واحد)	فصل گذشته	فصل جاری	رشد میانگین فصل	میانگین فصل گذشته	آخرین وضعیت
نفت ایران	۸۵.۹								
گازوئیل	۹۶.۱	۱۰.۲	۱۰.۲	▼۰.۱	۱۹.۵	۱۳.۶	-۳۰.۲%		
بنزین**	۹۱.۵	۷.۲	۵.۶	▼۱.۶	۵.۰	۶.۶	+۳۲.۳%		
نفتا	۷۳.۴	-۱۳.۳	-۱۲.۵	▲۰.۷	-۹.۶	-۱۲.۰	-۲۵.۵%		
نفت کوره	۷۶.۲	-۱۰.۰	-۹.۷	▲۰.۳	-۱۵.۰	-۱۱.۹	+۲۰.۶%		
لوب کات***	۸۱.۶	-۵.۶	-۴.۳	▲۱.۳	-۶.۷	-۵.۸	+۱۳.۴%		
وکیوم باتوم***	۴۹.۰	-۳۰.۴	-۳۶.۹	▼۶.۴	-۳۱.۹	-۳۴.۱	-۶.۹%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۰.۵	-۰.۳	▼۰.۸	۲.۵	۱.۰	-۵۹.۱%		

* 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 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.

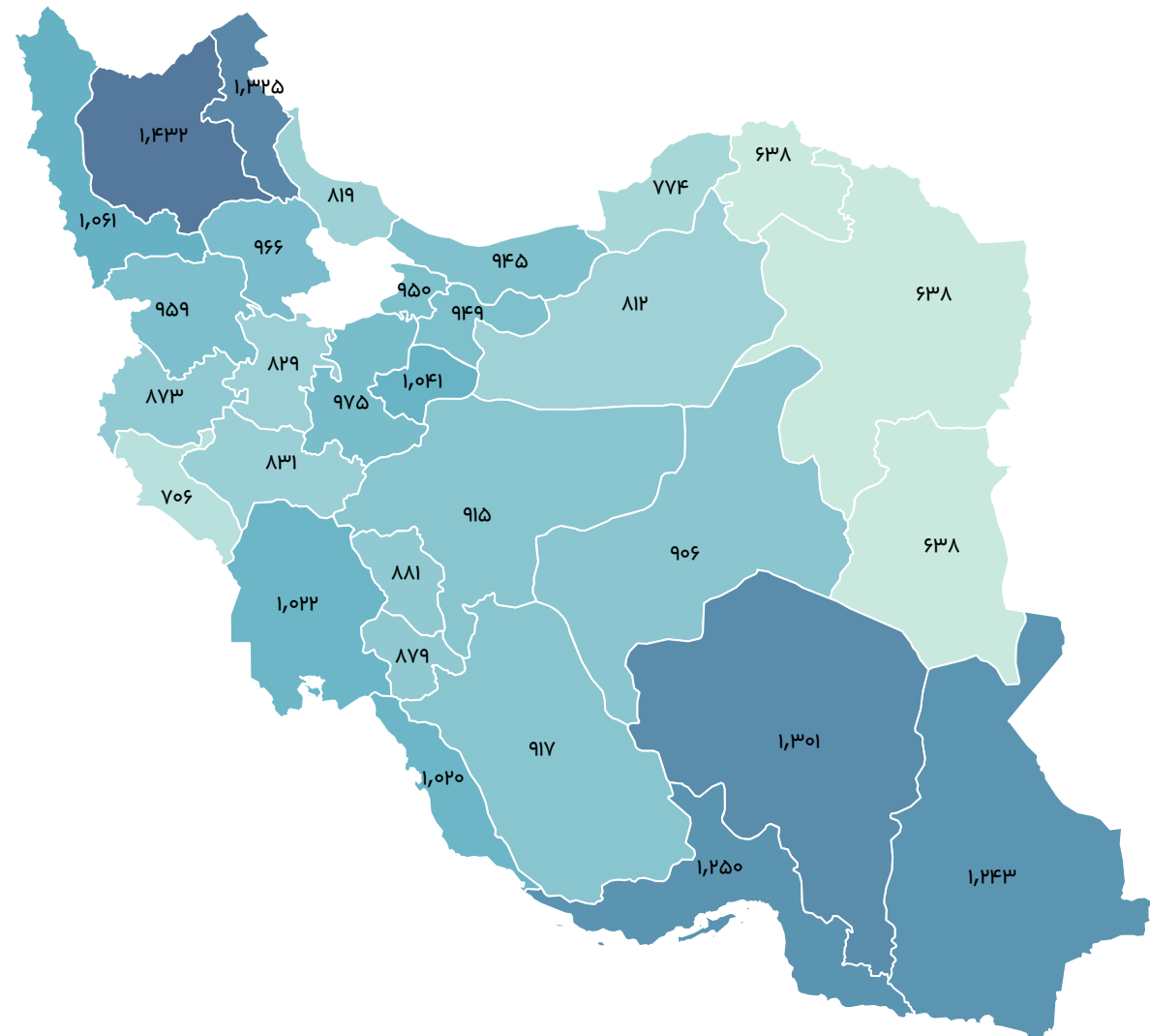
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس 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 آبیگ	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

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



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

▼ طلای جهانی در معامله صبح سه‌شنبه به کانال ۲۲۰۰ دلاری ریزش کرد و به پایین‌ترین سطح از ۵ آوریل رسیده است. به گزارش رویترز، قیمت طلا روز دوشنبه بیش از ۲ درصد کاهش داشت و به پایین‌ترین رقم طی یک هفته گذشته رسیده بود. نگرانی در مورد درگیری‌های خاورمیانه آرام‌تر شده و باعث شده تمایل سرمایه‌گذاران به خرید طلا به عنوان یک پشتوانه ایمن در برابر سرمایه‌های مخاطره آمیزتر مانند سهام کاهش یابد.

- طبق اعلام مرکز مبادله ارز و طلای ایران، در نوزدهمین حراج شمش طلای استاندارد، مجموعاً ۳۹۵ قطعه شمش طلای استاندارد یک کیلوگرمی با عیار ۹۹۵ از سوی صادرکنندگان عرضه و تالار معاملات شاهد معامله ۱۷۵ قطعه شمش طلای استاندارد بود. گفتنی است؛ میانگین قیمت شمش‌های طلای معامله شده در این حراج که در دو عرضه عمده و خرد صورت گرفت، چهار میلیارد و ۸۲۰ میلیون تومان بود. شایان ذکر است؛ طی ۱۹ جلسه حراج حضوری شمش طلای استاندارد در مرکز مبادله ایران مجموعاً ۲۶۳۶ کیلوگرم (قطعه) شمش طلا مورد معامله قرار گرفته است.

▼ به گزارش رویترز، قیمت نفت در اولین ساعات معاملات هفته در روز دوشنبه به زیر ۸۷ دلار کاهش یافته است، که پایین‌ترین سطح از ۲۸ ماه مارس است. پس از کاهش ریسک تشدید تنش‌های خاورمیانه حالا تمرکز معامله‌گران به ساختار بازار نفت بازگشته است. نفت سبک آمریکا هم ۸۱.۲۹ دلار معامله می‌شود. تحلیلگران عقیده دارند نگرانی‌های اقتصادی دوباره به عامل تاثیرگذار بر بازار نفت خام تبدیل شده است و قیمت نفت تحت فشار افزایش ذخایر نفت خام آمریکا و سیاست‌های فدرال رزرو قرار گرفته که ارزش دلار را بالا برده است. اداره اطلاعات انرژی آمریکا اعلام کرد ذخایر نفت خام این کشور ۲۰۷ میلیون بشکه افزایش یافته است. این رقم تقریباً دو برابر انتظار تحلیلگران برای ۱۰۴ میلیون بشکه افزایش بوده است.

- صندوق بین‌المللی پول در چشم‌انداز اقتصادی منطقه‌ای خود اعلام کرد ریاض برای متعادل کردن بودجه خود به میانگین قیمت نفت ۹۶.۲ دلار برای هر بشکه و نگه داشتن رقم تولید نفت خام در سطح روزانه ۹ میلیون و ۳۰۰ هزار بشکه در سال ۲۰۲۴ میلادی نیاز دارد. بر اساس این گزارش، عربستان امسال به قیمت نفت بالاتر از آنچه پیش‌تر تصور می‌شد نیاز خواهد داشت، زیرا خود از پیشگامان برنامه کاهش عرضه نفت ائتلاف تولیدکنندگان عضو سازمان کشورهای صادرکننده نفت (اوپک) و غیراوپک (اوپک پلاس) است.

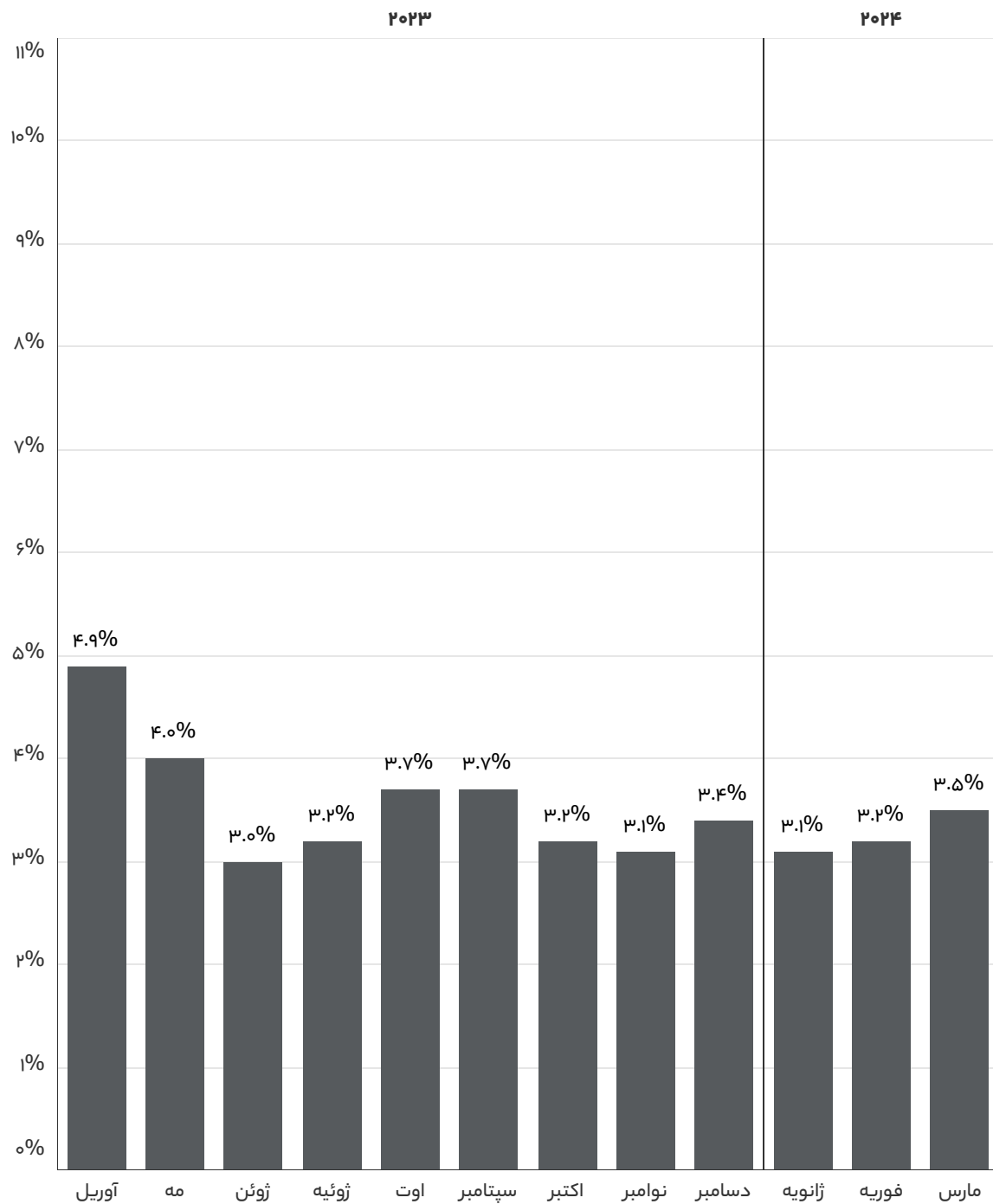
- بر اساس داده‌های اداره کل گمرک چین، این کشور از ماه ژانویه تا مارس سال جاری میلادی ۲۸.۵۲۸ میلیون تن نفت از روسیه وارد کرده که ۱۲.۸۵ درصد نسبت به مدت مشابه سال گذشته افزایش داشته است. روسیه همچنان بزرگترین تأمین‌کننده نفت چین است و پس از آن عربستان سعودی (با ۱۹.۸ میلیون تن) و عراق (با ۱۵.۶ میلیون تن) در رتبه‌های بعدی فهرست بزرگترین صادرکنندگان نفت به چین قرار دارند. از نظر ارزش، صادرات نفت روسیه به چین در سه ماهه اول سال جاری میلادی با ۱۷.۹ درصد افزایش به ۱۳.۸۵۸ میلیارد دلار رسیده است.

- روزنامه انگلیسی فایننشال تایمز طی گزارشی نوشت؛ صادرات نفت ایران به بالاترین رقم در شش سال گذشته رسیده و فروش سالانه نفت این کشور به ۳۵ میلیارد دلار رسیده است. اطلاعات شرکت داده ورتکسا نشان می‌دهد، تهران در سه ماه اول سال جاری میلادی به طور متوسط ۱.۵۶ میلیون بشکه در روز نفت فروخته است، که بالاترین رقم از سه ماهه سوم سال ۲۰۱۸ است. موفقیت ایران در صادرات نفت خام خود نشان‌دهنده مشکلاتی است که ایالات متحده و اتحادیه اروپا برای محدود کردن ایران در بازار نفت با آن مواجه هستند.



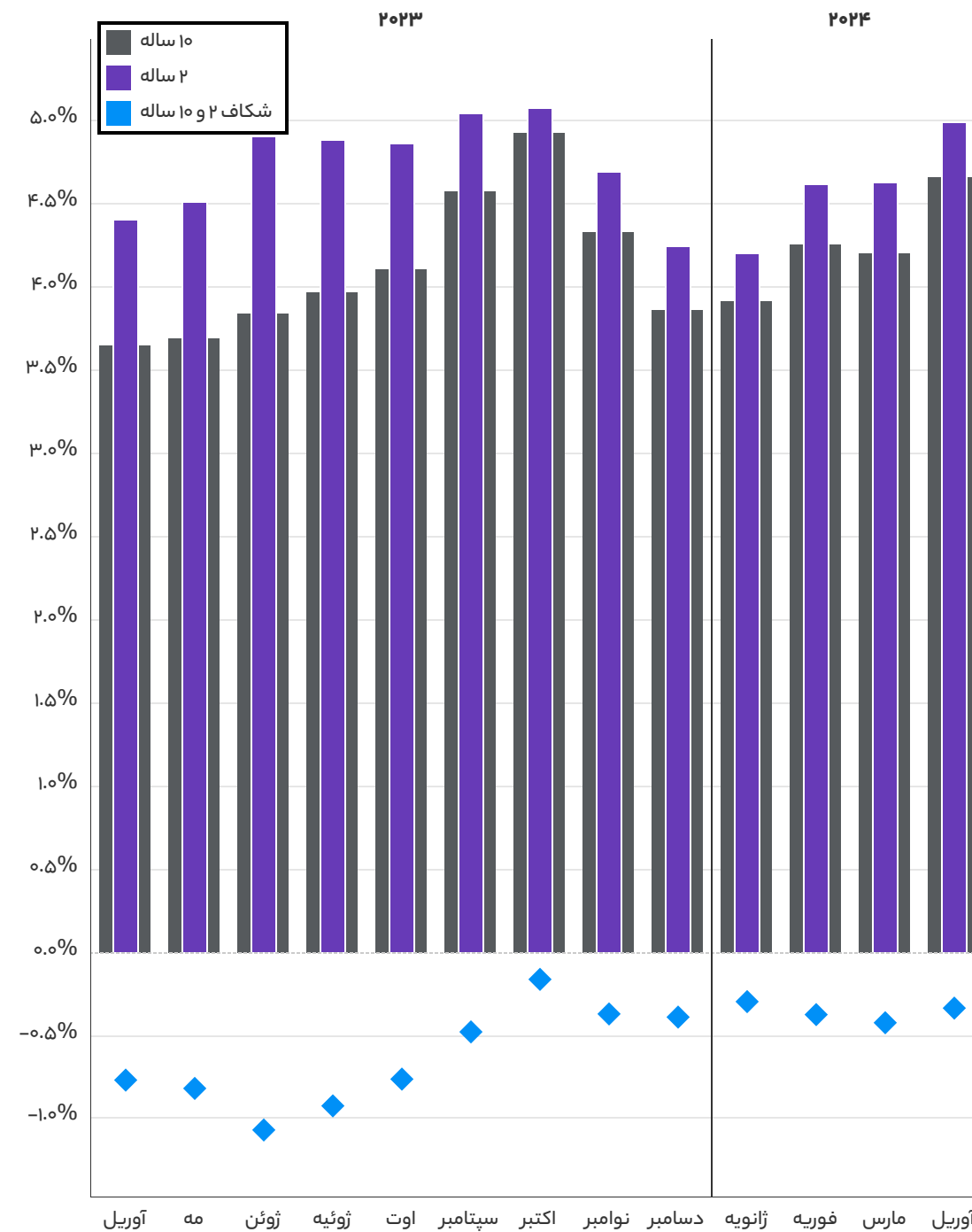
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



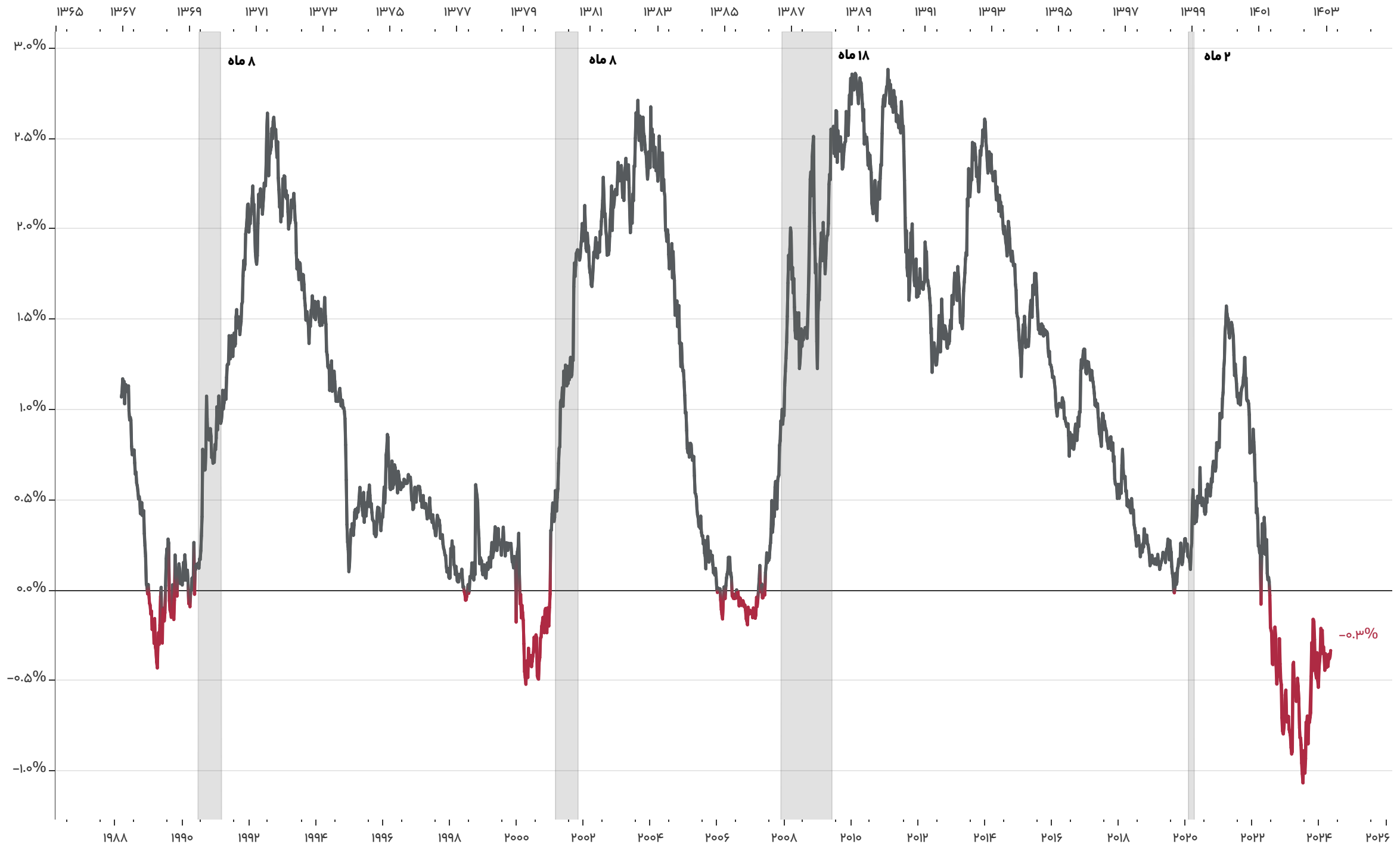
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

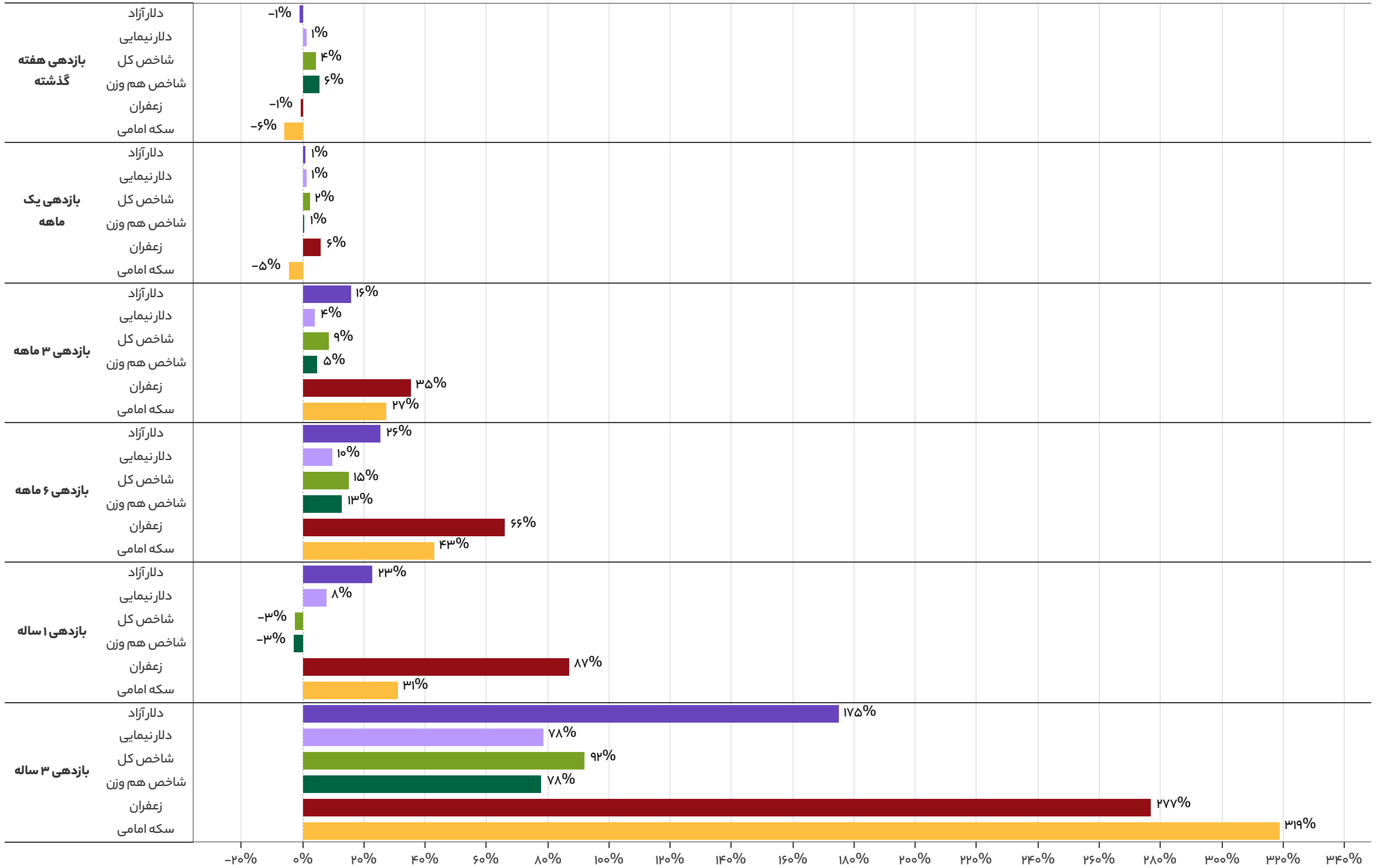
EQUITY MARKET

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
۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	۱۴۰۲/۰۹	۱۴۰۲/۱۰	۱۴۰۲/۱۱	۱۴۰۲/۱۲	بازده سال	نوسان
هم وزن ▲ ۳۰.۰%	مسکن ▲ ۱۳.۴%	مسکن ▲ ۴.۰%	زعفران ▲ ۱۲.۳%	زعفران ▲ ۳.۶%	شاخص کل ▲ ۹.۴%	سکه امامی ▲ ۲۰.۵%	زعفران ▲ ۹.۲%	شاخص کل ▲ ۹.۴%	دلار آزاد ▲ ۸.۸%	زعفران ▲ ۱۵.۹%	سکه امامی ▲ ۱۷.۲%	زعفران ▲ ۷۰.۲%	هم وزن ۳۴%
شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۸%	سکه امامی ▲ ۳.۳%	هم وزن ▲ ۸.۸%	دلار آزاد ▲ ۲.۱%	هم وزن ▲ ۱.۹%	هم وزن ▲ ۸.۲%	سکه امامی ▲ ۸.۸%	دلار آزاد ▲ ۵.۲%	زعفران ▲ ۱۲.۰%	درآمد ثابت ▲ ۲۴.۲%	شاخص کل ۲۸%
دلار آزاد ▲ ۹.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	دلار آزاد ▲ ۰.۰%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	دلار نیمایی ▲ ۲.۲%	زعفران ▲ ۴.۹%	سکه امامی ▲ ۴.۹%	شاخص کل ▲ ۶.۰%	سکه امامی ▲ ۲۳.۲%	سکه امامی ۲۵%
درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۶%	زعفران ▼ ۱.۰%	دلار نیمایی ▼ ۱.۶%	دلار آزاد ▲ ۱.۴%	زعفران ▲ ۱.۳%	مسکن ▲ ۱.۰%	دلار نیمایی ▲ ۰.۴%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ▲ ۲.۲%	مسکن ▲ ۴.۱%	دلار آزاد ▲ ۵.۲%	مسکن ▲ ۲۲.۶%	زعفران ۲۲%
مسکن ▲ ۱.۸%	سکه امامی ▲ ۰.۶%	هم وزن ▼ ۲.۳%	مسکن ▼ ۲.۲%	دلار نیمایی ▲ ۰.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۲%	دلار آزاد ▲ ۰.۱%	زعفران ▲ ۱.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	درآمد ثابت ▲ ۲.۲%	مسکن ▲ ۳.۸%	دلار آزاد ▲ ۱۵.۹%	دلار آزاد ۱۵%
زعفران ▼ ۰.۱%	هم وزن ▲ ۰.۴%	شاخص کل ▼ ۵.۶%	سکه امامی ▼ ۳.۵%	مسکن ▼ ۱.۰%	دلار آزاد ▼ ۰.۴%	شاخص کل ▼ ۴.۲%	سکه امامی ▼ ۰.۱%	سکه امامی ▲ ۰.۸%	مسکن ▲ ۱.۷%	دلار نیمایی ▲ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۳%	دلار نیمایی ▲ ۷.۶%	مسکن ۱۵%
دلار نیمایی ▼ ۲.۱%	دلار آزاد ▲ ۰.۱%	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%	هم وزن ▼ ۰.۹%	هم وزن ▼ ۳.۶%	هم وزن ▲ ۲.۱%	هم وزن ▼ ۲.۴%	دلار نیمایی ۵%
سکه امامی ▼ ۶.۵%	شاخص کل ▼ ۰.۹%	سکه امامی ▼ ۱۱.۱%	شاخص کل ▼ ۸.۸%	هم وزن ▼ ۵.۲%	سکه امامی ▼ ۱.۹%	زعفران ▼ ۴.۷%	شاخص کل ▼ ۰.۶%	مسکن ▼ ۲.۲%	شاخص کل ▼ ۲.۰%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار نیمایی ▲ ۱.۳%	شاخص کل ▼ ۵.۶%	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



ارزش دلاری بازار (میلیارد دلار)

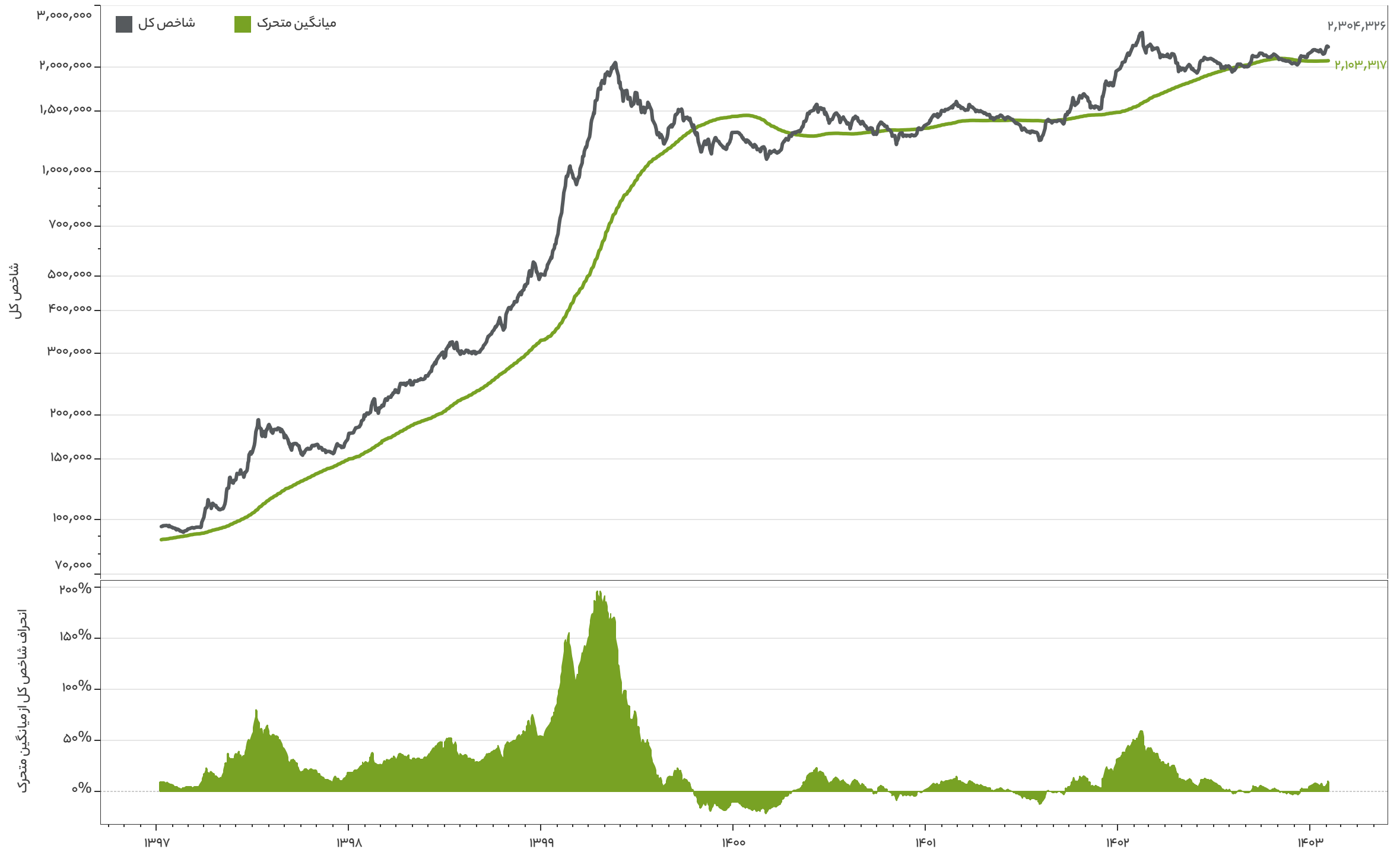
شاخص کل بورس ایران

ماهنامه آریانا



شاخص کل و میانگین متحرک

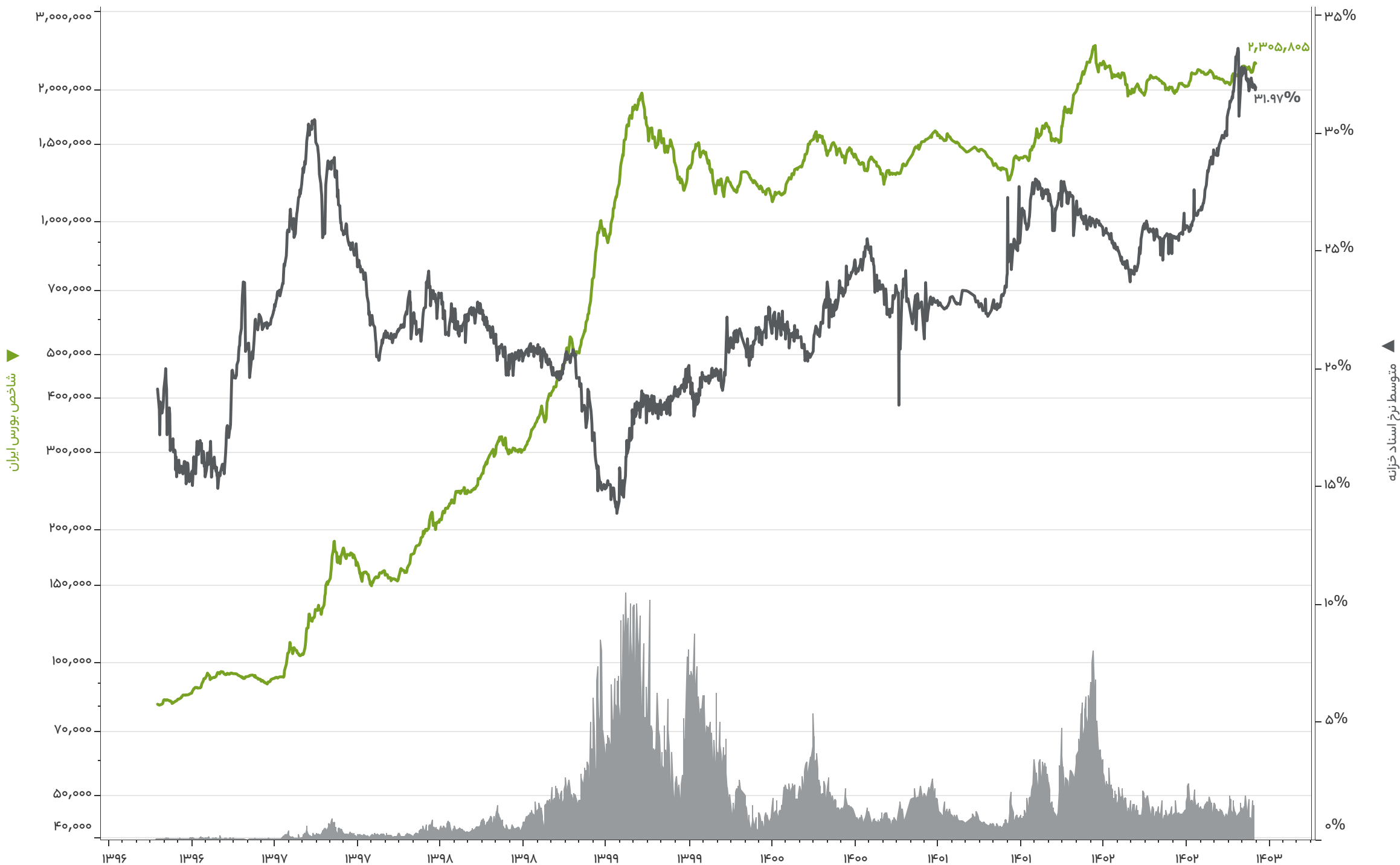
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





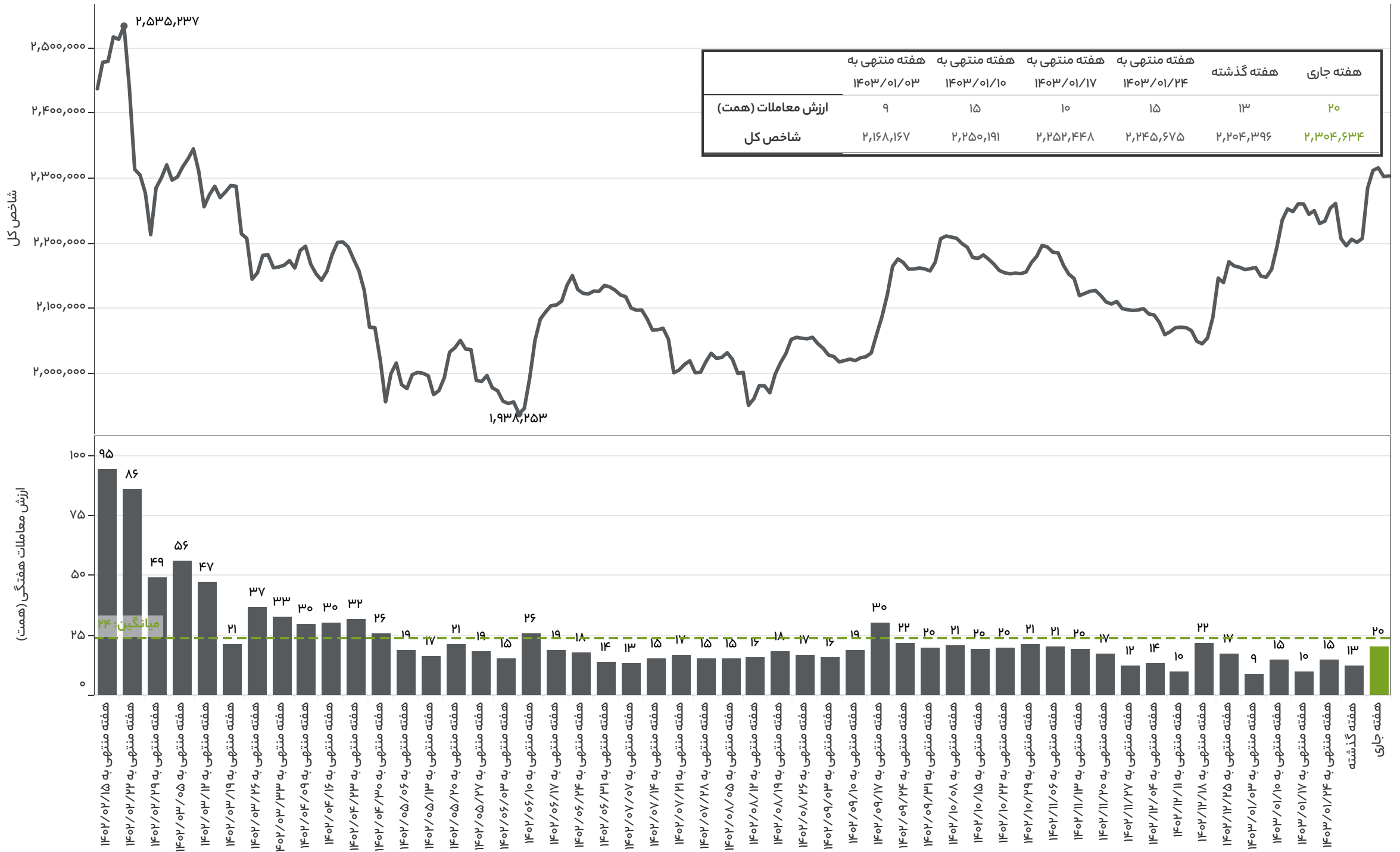
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



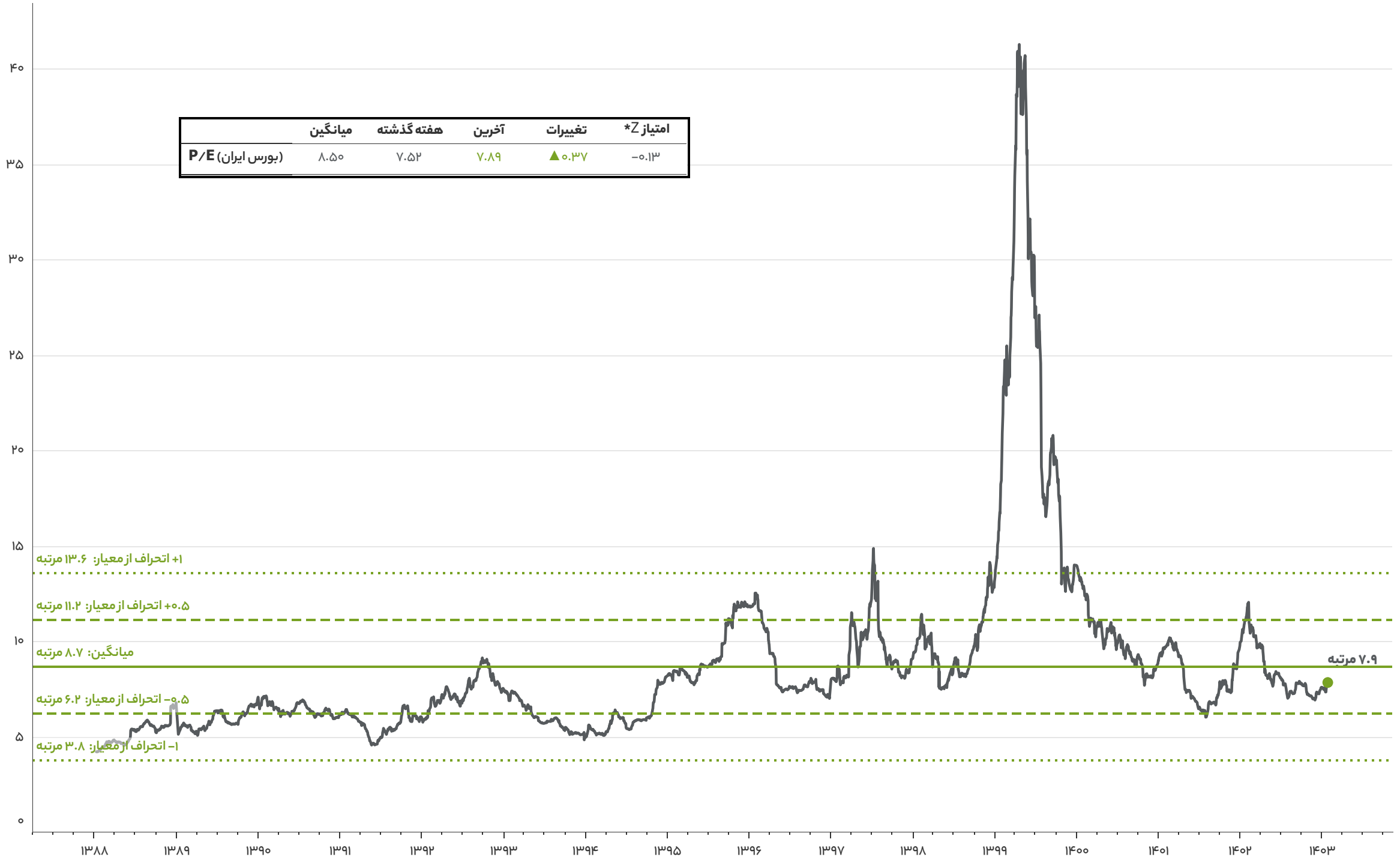
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.



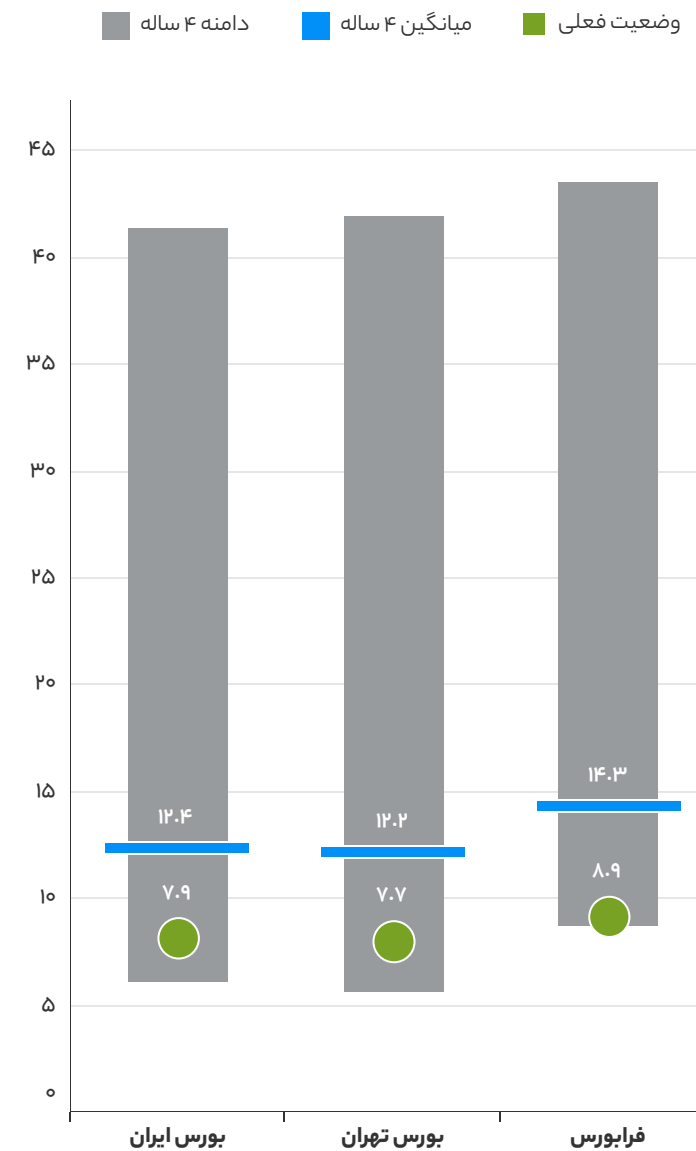
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۷.۸۹	۷.۵۲	۶.۰۷	۱۲.۳۶	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۷۳	۷.۳۴	۵.۶۴	۱۲.۱۶	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۸۵	۸.۶۹	۸.۶۸	۱۴.۳۴	۴۳.۵۱

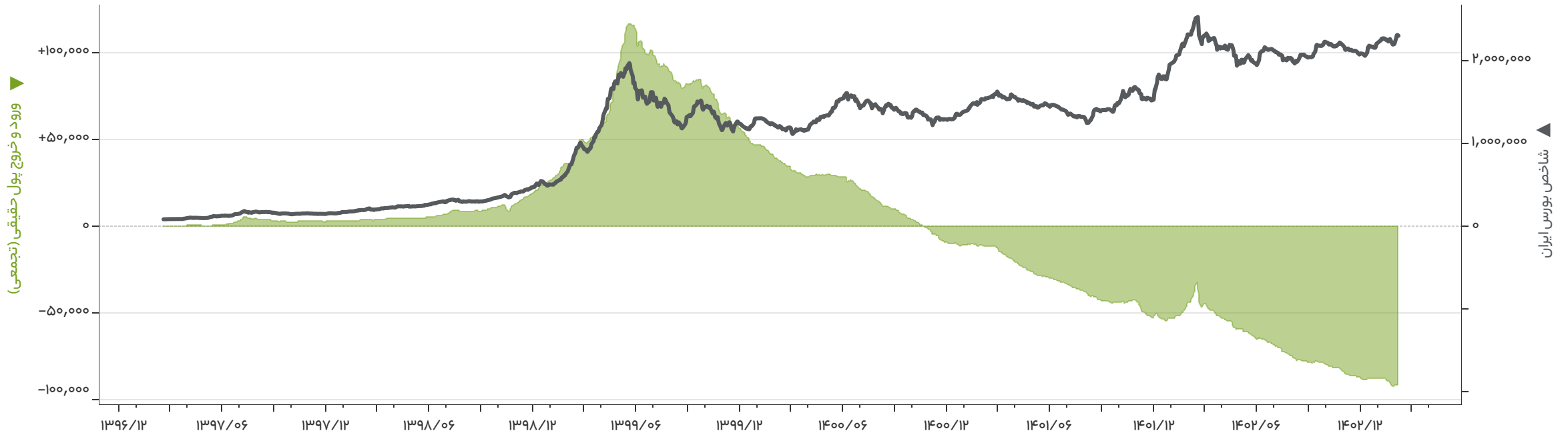


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۷۱۶	۳,۲۹۹	۶۸۹	۳۹۳	۲۲۰	۲۰۰	۱۵۶	۱۲۵	۱۱۰	۱۰۰	۶۲	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۴۱.۰%	۳۶.۴%	۷.۶%	۴.۳%	۲.۴%	۲.۲%	۱.۷%	۱.۴%	۱.۲%	۱.۱%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۸.۱	۷.۶	۵.۱	۴.۹	۹.۸	۱۰.۱	۹.۲	۱۹.۰	۱۱.۶	۱۳.۷	۱۹.۱	سودآوری
بازده سود نقدی	۸.۳%	۹.۰%	۱۳.۰%	۳.۲%	۴.۶%	۳.۵%	۷.۷%	۲.۷%	۳.۶%	۱۴.۹%	۳.۷%	
نسبت تقسیم سود	۷۲%	۶۱%	۶۳%	۳۳%	۵۱%	۳۸%	۷۴%	۵۷%	۴۱%	۱۰۰%	۳۷%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۱	۱.۱	۰.۹	۱.۲	۰.۸	۰.۸	۱.۴	۱.۱	۰.۹	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۱۱۲۳%	+۸۸۵%	+۹۰۵%	+۹۰۷%	+۴۴۱%	+۴۵۲%	+۳۸۷%	+۳۵۰%	+۱۲۵%	+۹۰۳%	+۷۴۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۸۷%	+۳%	+۳۰%	-۱۰%	-۷%	-۴%	+۱۶%	+۱۱%	-۶۴%	+۱۴۵%	+۱۷%	
بازده از ابتدای سال	+۱۱۳%	+۷۴%	+۱۱۴%	+۱۰۰%	+۶۱%	+۱۱۳%	+۹۴%	+۹۵%	+۴۴%	+۶۲%	+۲۷۶%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۵%	۳%	۶%	۷%	۶%	۷%	۳%	۶%	۴%	۵%	۷%	

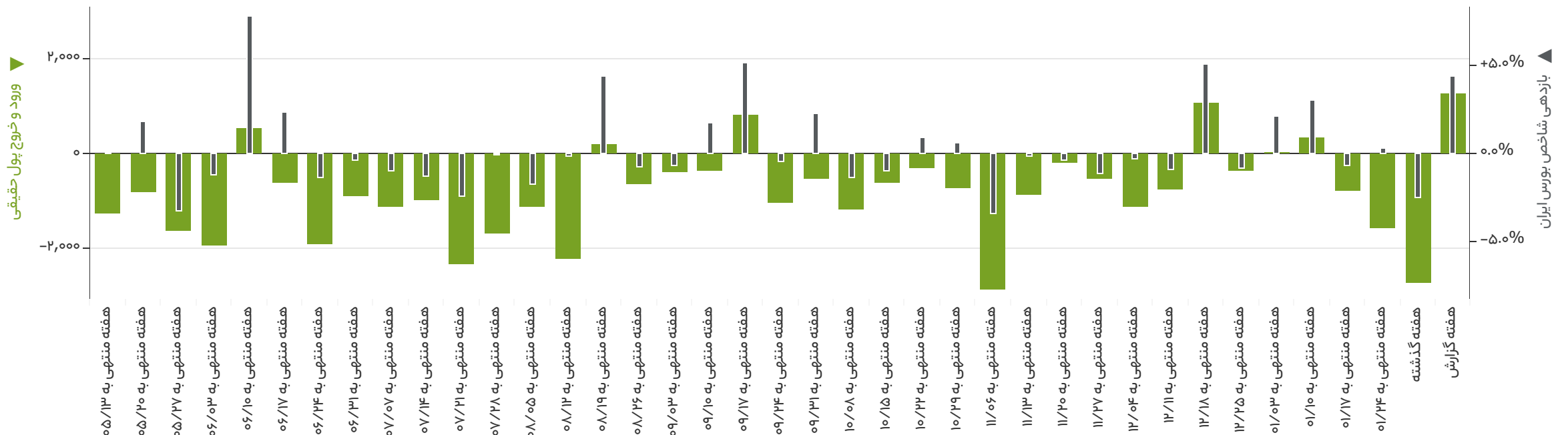
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



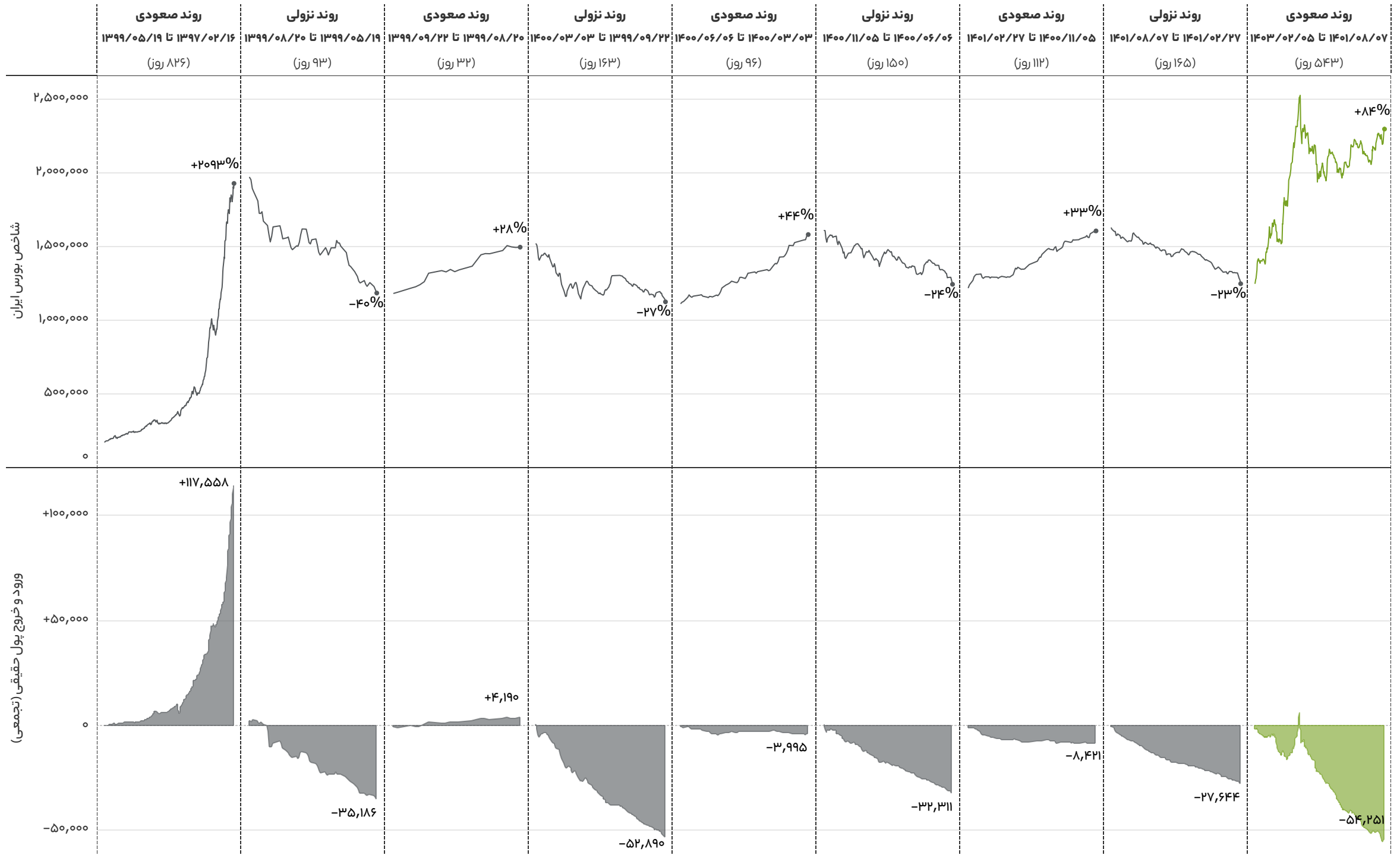
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



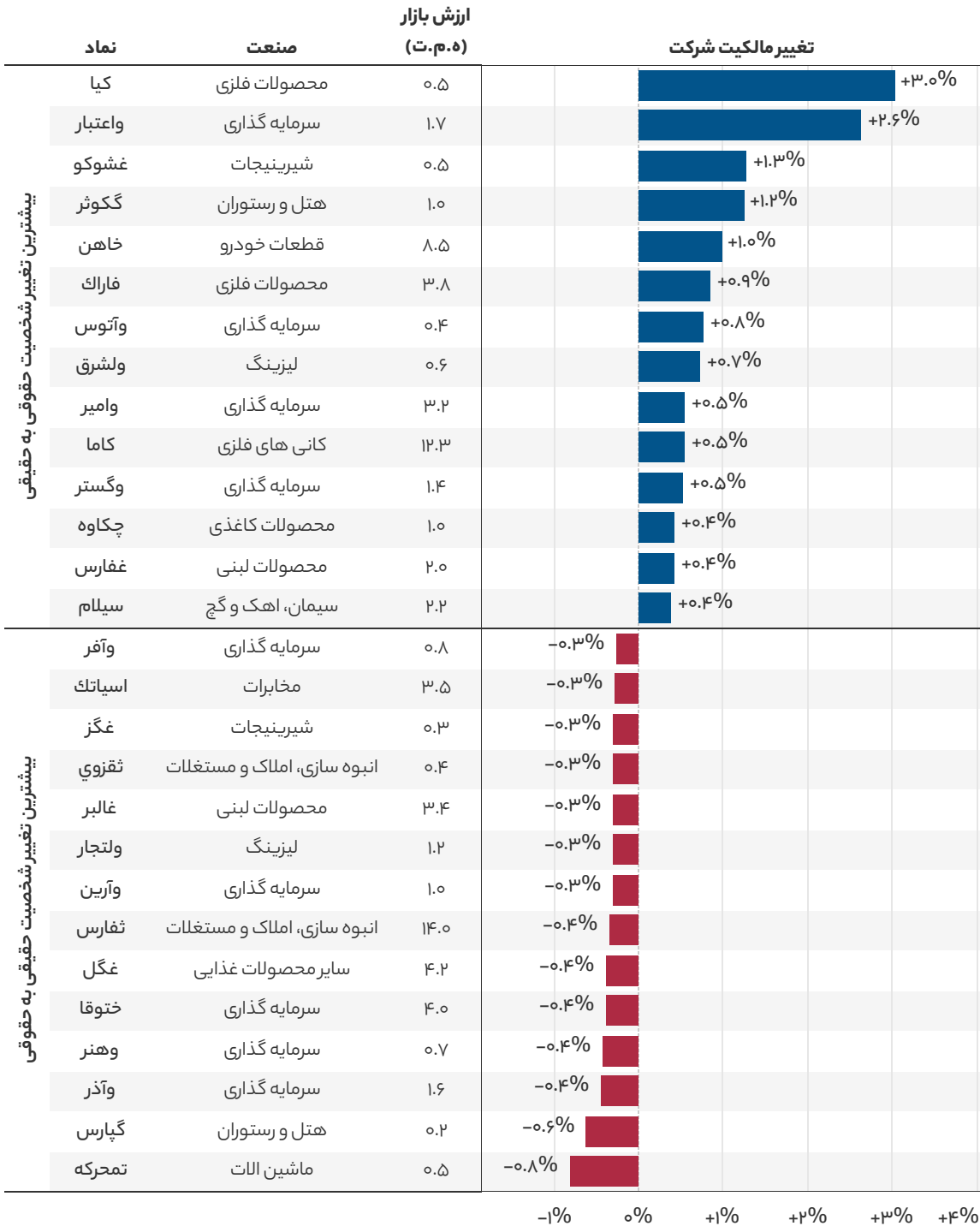
ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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



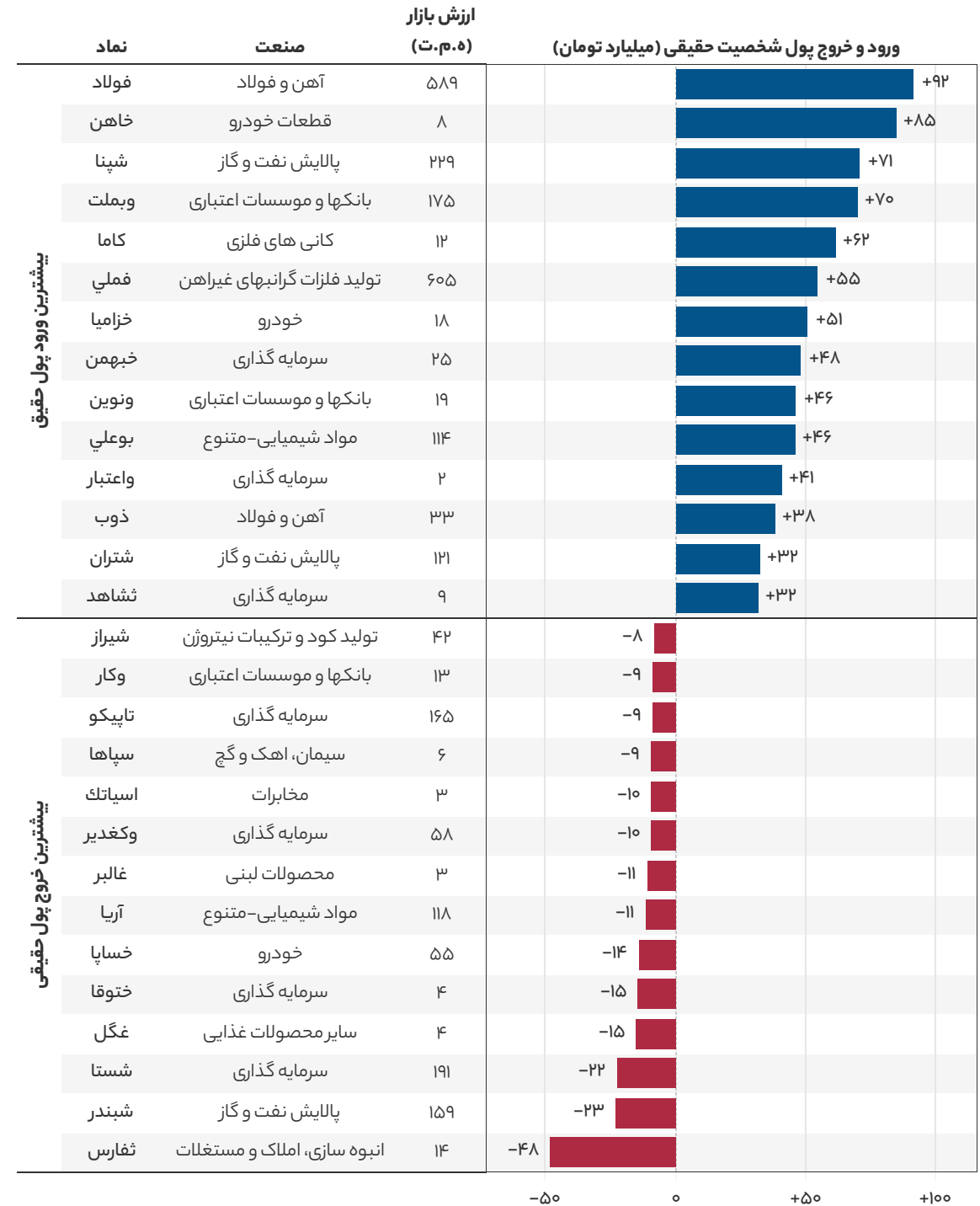
تغییر مالکیت شرکت

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



ورود و خروج پول حقیقی

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



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

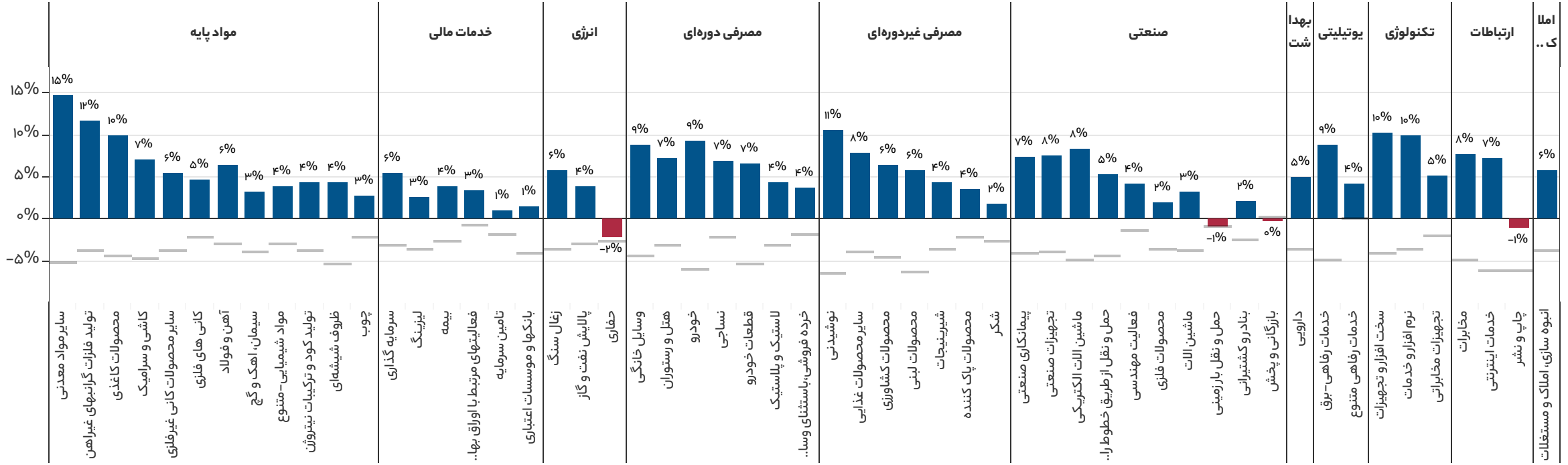
		رشد ۱۳۹۹ (۱۳۹۹/۰۵/۲۰ تا ۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	ریش ۱۴۰۰ و ۱۳۹۹ (۱۴۰۰/۰۳/۰۳ تا ۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱ (۱۴۰۱/۰۸/۰۴ تا ۱۴۰۰/۰۳/۰۳)	رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲ (۱۴۰۱/۰۸/۰۴ تا کنون)	
مواد پایه	فلزات و استخراج	<ul style="list-style-type: none"> آهن و فولاد: ۵۶۴% تولید فلزات گرانبه‌های غیر آهن: ۸۵۴% کانی های فلزی: ۴۹۱% سایر مواد معدنی: ۵۲۸% 	<ul style="list-style-type: none"> آهن و فولاد: -۳۴% تولید فلزات گرانبه‌های غیر آهن: -۳۲% کانی های فلزی: -۱۴% سایر مواد معدنی: -۷۱% 	<ul style="list-style-type: none"> آهن و فولاد: ۶% تولید فلزات گرانبه‌های غیر آهن: -۱% کانی های فلزی: ۸% سایر مواد معدنی: -۲۷% 	<ul style="list-style-type: none"> آهن و فولاد: ۱۱۲% تولید فلزات گرانبه‌های غیر آهن: ۲۳۶% کانی های فلزی: ۳۱% سایر مواد معدنی: ۳۰۵% 	
	شیمیایی	<ul style="list-style-type: none"> مواد شیمیایی-متنوع: ۴۰۰% تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۴۶۶% 	<ul style="list-style-type: none"> مواد شیمیایی-متنوع: -۱۶% تولید کود و ترکیبات نیتروژن: -۲۰% 	<ul style="list-style-type: none"> مواد شیمیایی-متنوع: ۳۲% تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۹۸% 	<ul style="list-style-type: none"> مواد شیمیایی-متنوع: ۷۸% تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۲۷% 	
	مصالح ساختمانی	<ul style="list-style-type: none"> سیمان، اهک و گچ: ۵۱۲% سایر محصولات کانی غیر فلزی: ۴۳۰% کاشی و سرامیک: ۴۶۳% 	<ul style="list-style-type: none"> سیمان، اهک و گچ: -۱۷% سایر محصولات کانی غیر فلزی: -۱۸% کاشی و سرامیک: ۱۳% 	<ul style="list-style-type: none"> سیمان، اهک و گچ: -۸% سایر محصولات کانی غیر فلزی: -۳۵% کاشی و سرامیک: -۳۴% 	<ul style="list-style-type: none"> سیمان، اهک و گچ: ۱۷۲% سایر محصولات کانی غیر فلزی: ۱۰۷% کاشی و سرامیک: ۱۸۰% 	
	محصولات چوبی	<ul style="list-style-type: none"> محصولات کاغذی: ۳۸۵% 	<ul style="list-style-type: none"> محصولات کاغذی: ۸۸% 	<ul style="list-style-type: none"> محصولات کاغذی: -۵۱% 	<ul style="list-style-type: none"> محصولات کاغذی: ۳۷۸% 	
	کاغذ و محصولات جنگلی	<ul style="list-style-type: none"> چوب: ۳۷۴% 	<ul style="list-style-type: none"> چوب: -۷% 	<ul style="list-style-type: none"> چوب: -۵۹% 	<ul style="list-style-type: none"> چوب: ۱۳۲% 	
	خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	<ul style="list-style-type: none"> هلدینگ‌های سرمایه گذاری: ۸۸۱% تامین سرمایه: ۱۲۸۷% فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: ۹۱۶% لیزینگ: ۵۱۳% 	<ul style="list-style-type: none"> هلدینگ‌های سرمایه گذاری: -۵۲% تامین سرمایه: -۵۲% فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: -۵۸% لیزینگ: -۴۲% 	<ul style="list-style-type: none"> هلدینگ‌های سرمایه گذاری: ۱۸% تامین سرمایه: ۳۷% فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: -۷۴% لیزینگ: -۲۶% 	<ul style="list-style-type: none"> هلدینگ‌های سرمایه گذاری: ۸۲% تامین سرمایه: -۸% فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: ۲۸% لیزینگ: ۸۷%
		بانک‌ها	<ul style="list-style-type: none"> بانک‌ها و موسسات اعتباری: ۷۲۸% 	<ul style="list-style-type: none"> بانک‌ها و موسسات اعتباری: -۴۰% 	<ul style="list-style-type: none"> بانک‌ها و موسسات اعتباری: -۲۶% 	<ul style="list-style-type: none"> بانک‌ها و موسسات اعتباری: ۷۴%
		بیمه	<ul style="list-style-type: none"> بیمه: ۶۹۳% 	<ul style="list-style-type: none"> بیمه: ۲۹% 	<ul style="list-style-type: none"> بیمه: ۱۰% 	<ul style="list-style-type: none"> بیمه: -۸%
		انرژی	<ul style="list-style-type: none"> پالایش نفت و گاز: ۶۸۳% مصرفی: ۲۴۸% تجهیزات انرژی و خدمات: ۳۶۵% 	<ul style="list-style-type: none"> پالایش نفت و گاز: -۶۸% مصرفی: ۳% تجهیزات انرژی و خدمات: -۵۰% 	<ul style="list-style-type: none"> پالایش نفت و گاز: ۸۷% مصرفی: -۱۸% تجهیزات انرژی و خدمات: -۳۳% 	<ul style="list-style-type: none"> پالایش نفت و گاز: ۱۱۳% مصرفی: ۹۴% تجهیزات انرژی و خدمات: ۱۹۶%

بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

		رشد ۱۳۹۹		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲	
مصرفی دوره ای	خودرو و قطعات	خودرو	۱۲۴۷%	-۷۰%		۱۳%		۶۷%	
		قطعات خودرو	۶۷۶%	-۳۲%		-۲۵%	۸۶%		
		لاستیک و پلاستیک	۶۳۱%	-۳۴%		-۴۲%	۱۶۸%		
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۱۲۹%	-۲۳%		۳%	۱۶۷%		
		کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۴۹۰%	-۴۶%		-۳۶%	۱۵۴%	
		نساجی	۳۸۰%	-۲۱%		-۳۵%	۱۴۸%		
مصرفی غیر دوره ای	خدمات مصرف کننده	هتل و رستوران	۱۱۶۶%	-۶۷%		۱۸%	۱۱%		
		سایر محصولات غذایی	۶۹۹%	-۳۴%		-۳۹%	۵۵%		
	غذا و نوشیدنی	محصولات کشاورزی	۳۹۷%	-۳۵%		۹%	۴۳%		
		شیرینیجات	۵۹۵%	-۲۴%		-۶۳%	۶۷%		
		شکر	۴۳۵%	-۲۲%		-۴۴%	۹۳%		
		محصولات لبنی	۳۸۳%	۷%		-۵۴%	۱۴۴%		
	نوشیدنی	۵۳۹%	-۱۵%		-۳۱%	۵۹%			
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۳۰۶%	۴%		-۱۲%	۲۷%			
صنعتی	کالاهای سرمایه ای	فعالیت مهندسی	۵۲۱%	-۶۳%		-۷%	۹۵%		
		ماشین الات الکتریکی	۵۰۱%	-۴۵%		-۲۳%	۹۱%		
		ماشین الات	۴۲۲%	-۳۵%		-۳۱%	۱۵۳%		
		محصولات فلزی	۶۴۵%	-۵۴%		-۴۴%	۱۳۲%		
		تجهیزات صنعتی	۸۴۷%	-۳۰%		-۴۰%	۶۶%		
		پیمانکاری صنعتی	۵۲۵%	-۱۵%		-۶۸%	۱۰۳%		
تزابری	بنادر و کشتیرانی	۲۴۶%	-۲۲%		-۱۵%	۲۳۶%			
	حمل و نقل از طریق راه آهن	۳۲۷%	-۱۳%		-۴۱%	۵۷%			
	حمل و نقل بار زمینی	۲۵۰%	-۱۸%		۳۳%	۷۷%			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۳۲۱%	-۳۲%		-۱۳%	۹۴%		
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۲۵۲%	-۳۵%		۲%	۶۲%		
		سخت افزار و تجهیزات	۵۷۰%	-۶۵%		-۴۵%	۲۵۹%		
ارتباطات	خدمات دور برد	مخابرات	۵۳۲%	-۷۱%		-۱۳%	۴۳%		
	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۲۳%	-۵۲%		-۵۲%	۱۵۷%		
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۱۰%	-۳۵%		۱۳۱%	۶۲%		
		خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%	-۵۴%		-۳۳%			
املاک و مستغلات	توسعه املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۶۱۹%	-۴۳%		-۴۵%	۲۷۶%		

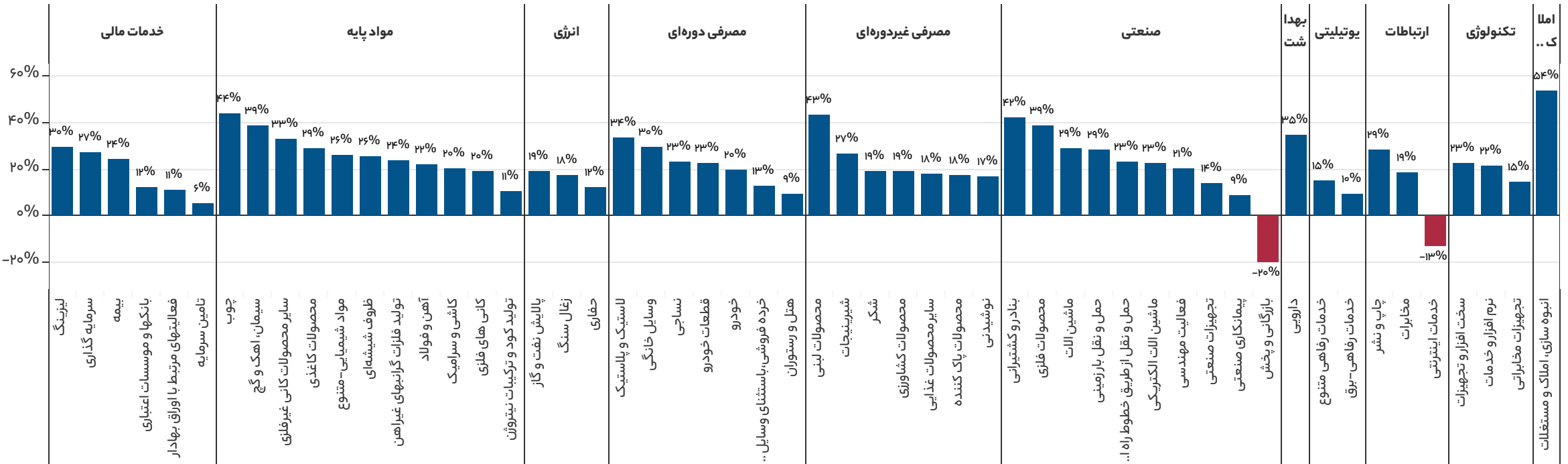
بازدهی صنایع از ابتدای هفته

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



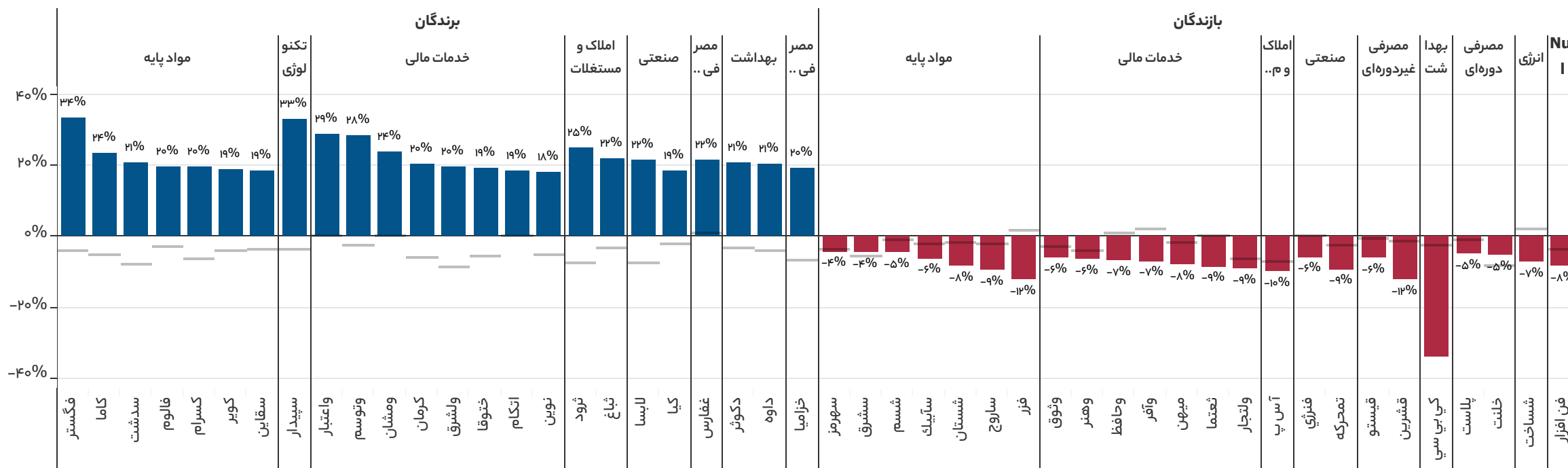
بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

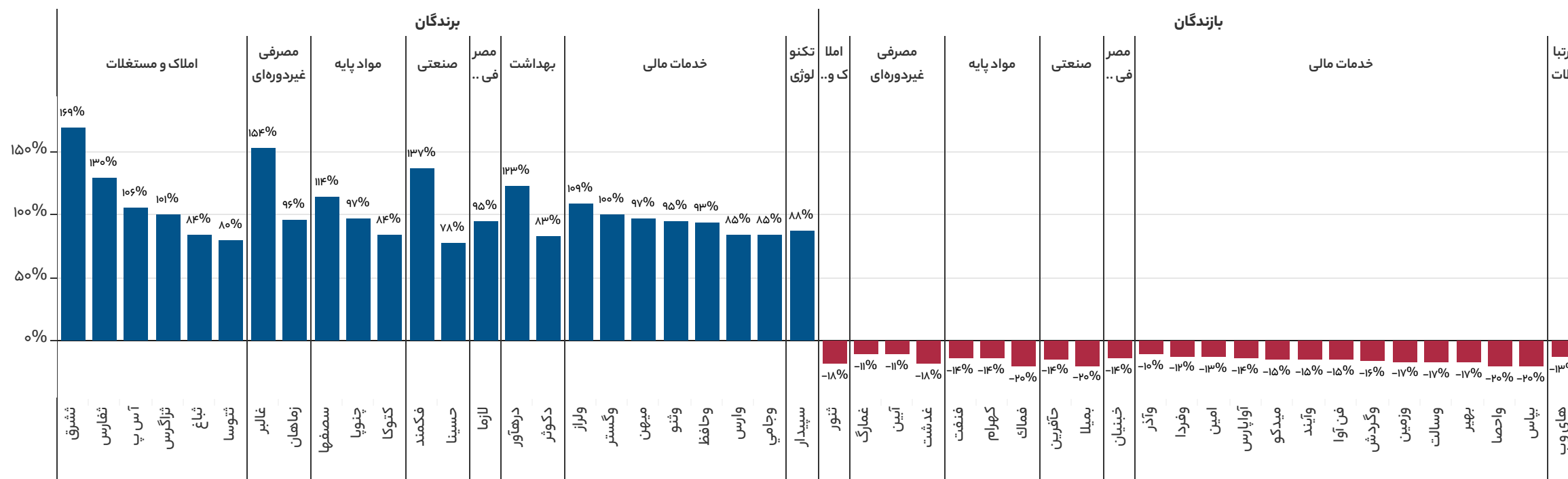




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)

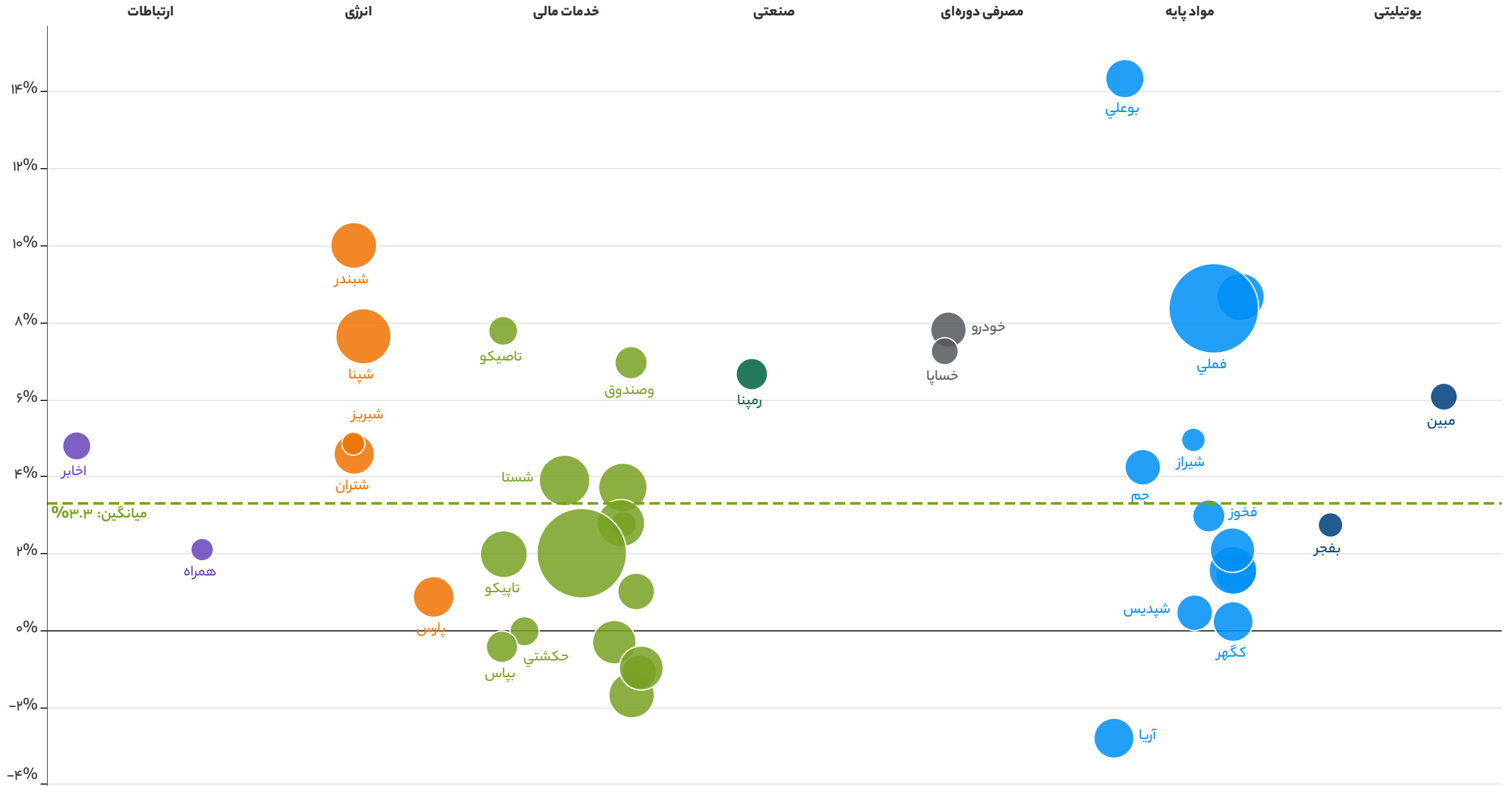


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



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



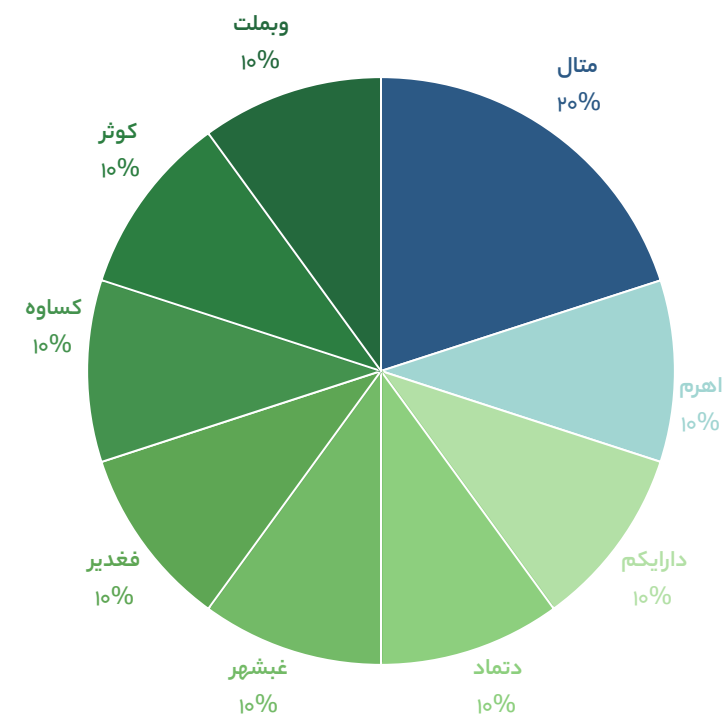
بازدهی	بوعلی	شبندر	نوری	فملی	خودرو	تاصیکو	شپنا	خسپا	وصندوق	رمپنا	مبین	شیراز	شبریز	اخابر	شتران	چم	شستا	وبملت	فخوز	وامید	وتجارت	بفجر	همراه	کچاد	فارس	تاپیکو	کگل	ماون	ومعادن	پارس	شپدیس	کگهر	حکشتی	میدکو	پاس	پارسان	وپاسار	وغدیر	آریا
بازده هفته گذشته	+۱۴.۴%	+۱۰.۰%	+۸.۷%	+۸.۴%	+۷.۸%	+۷.۸%	+۷.۷%	+۷.۳%	+۷.۰%	+۶.۷%	+۶.۱%	+۵.۰%	+۴.۹%	+۴.۸%	+۴.۶%	+۴.۳%	+۳.۹%	+۳.۷%	+۳.۰%	+۲.۸%	+۲.۸%	+۲.۸%	+۲.۸%	+۲.۱%	+۲.۰%	+۲.۰%	+۱.۶%	+۱.۵%	+۱.۰%	+۰.۹%	+۰.۵%	+۰.۳%	۰%	-۰.۳%	-۰.۴%	-۱.۰%	-۱.۱%	-۱.۰۷%	-۲.۰۸%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

افق زمانی	نماد	هدف قیمتی	توضیحات	قیمت سهم	وزن پیشنهادی
میان مدت	دارایکم	۲۱۰,۰۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۱۷۰,۱۷۰	۱۰%
	دتماد	۷۸,۰۰۰	نسبت (P/E) مناسب در صنعت	۶۱,۱۶۰	۱۰%
	غبشهر	۲,۴۰۰	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارزش ۲۸۵۰۰	۲,۱۳۵	۱۰%
	فغدیر	۱۲,۰۰۰	بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب	۹,۲۳۰	۱۰%
	کساوه	۲۴,۰۰۰	نسبت (P/E) مناسب	۱۹,۹۹۰	۱۰%
	کوثر	۳,۳۰۰	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا	۲,۵۷۸	۱۰%
	وبملت	۳,۲۰۰	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۲,۴۷۹	۱۰%
بلند مدت	اهرم	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و اهرمی	۲۳,۷۵۰	۱۰%
	متال	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۱۲,۶۶۰	۲۰%



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

