

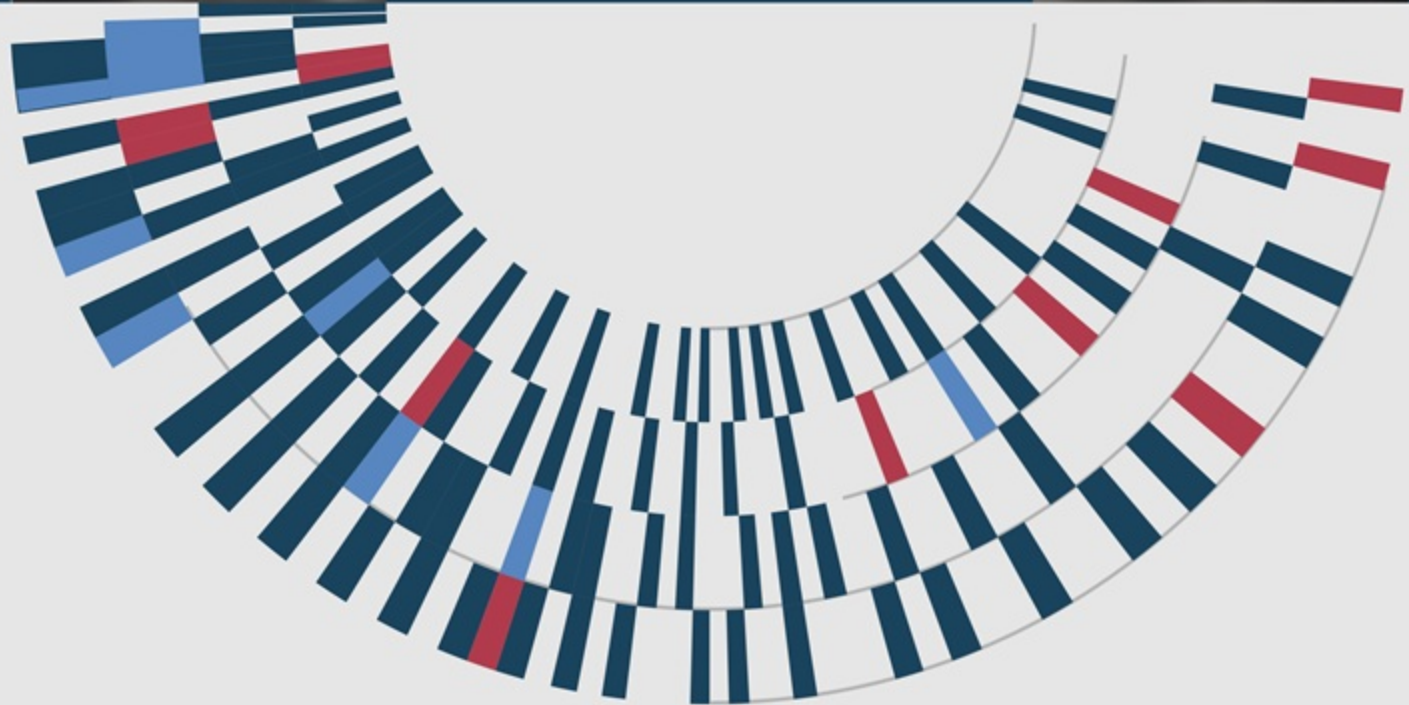


کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۹ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۱۴





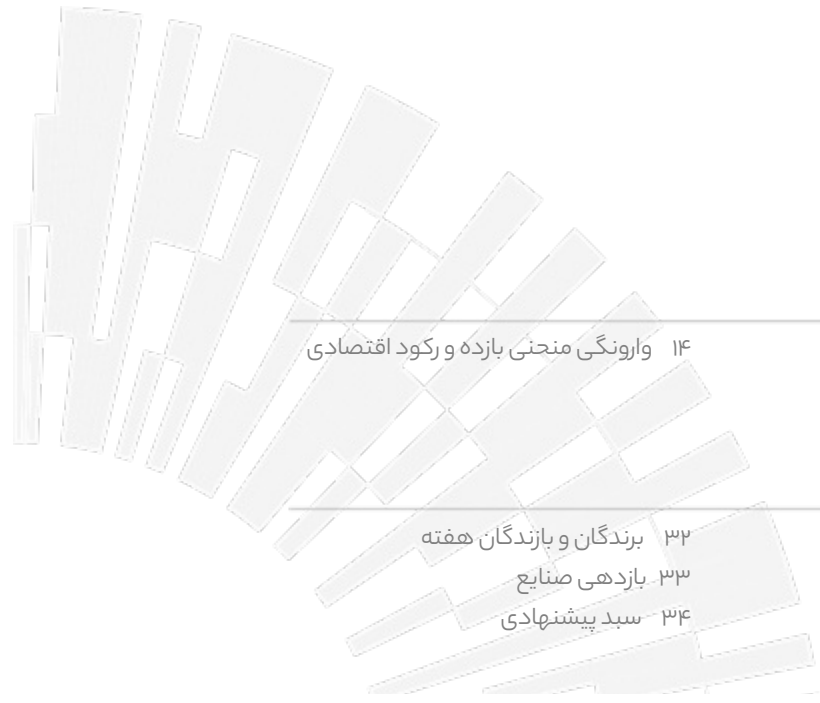
معرفی گزارش:

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

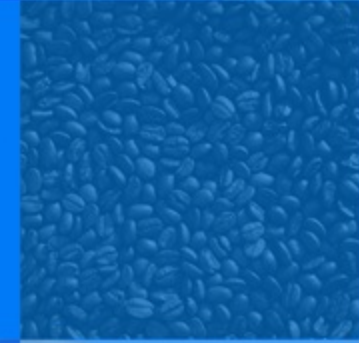
۱۵



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر 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	۲,۲۹۱	-۲.۰%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۳۸۸	۱۴%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۹,۹۸۷	+۰.۱%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۹,۹۸۷	۲۱%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵۲۹,۲۰۰	-	فملی	بموتو، فباهنر	۳۲۵,۷۰۰ - ۵۲۹,۲۳۷	۳۹%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۴۵۵	-	فایرا	فنوال	۲,۱۰۲ - ۲,۴۵۵	۱۰%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۹۰۸	+۱.۹%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۲,۹۰۸	۱۴%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۲۲۲	+۰.۵%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۲۹۶	۷%
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۷۴	+۰.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ - ۵۰۰	۱%
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۴	-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۵۲۴	-۴%
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۷۱۷	-۳.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق	کوبیر، فوکا، فنورد	۱۸,۳۷۴ - ۲۳,۴۷۲	۱۱%
	اسلب (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۷۳	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ - ۵۰۰	-۲%
	اسلب CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۸۹	-۲.۹%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۵۶۰	-۱۳%
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۴,۵۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۵۰۰	۲۸%
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۸۵	-۰.۴%	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۶۳۵	-۴%
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۴,۸۸۳	-	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ - ۲۵,۱۱۰	۹%
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۶۳	+۰.۴%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ - ۶۱۳	-۵%
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۵۳	-۲.۶%	فولاد	-	۶۴۰ - ۷۱۸	-۵%



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	-۱.۲%	-	-	۹۹ - ۱۴۳	۱۴%
	گندله سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۳۶	+۰.۲%	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	۵,۲۵۷	-۰.۲%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۴۰۰ - ۵,۲۶۹	۱۷%
	کنسانتره سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۲۴	+۰.۵%	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	۳,۶۸۰	+۱.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۳۸۲ - ۳,۷۸۷	۹%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۲۲	+۰.۱%	-	-	۱۹۹ - ۲۶۸	-۵%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۷۶	+۱.۶%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۲۵۲	-۲۳%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۵۶۱	-۲.۹%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	۱۰%
	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	۲۹۵	+۱.۰%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ - ۳۰۹	۱۱%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۰۰	-۱.۰%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۱,۰۱۰	۹%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۸۸۰	-۳%
پاراژایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۲	-۱.۵%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ - ۱,۱۵۸	۵%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۰	-۰.۹%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۴۰	-۱%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۴۶	-۲.۱%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۸۲	۱۴%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۷۸	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۸۴	۵%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۰	-۳.۹%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۵۲	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۴۱۰	-۱.۴%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۴۵۰	۵۷%
مونواتیلن گلابکول	چین CFR	دلار/تن	۵۱۲	+۰.۴%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	-۲%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۳۸	+۱.۲%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۳۸	۷%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۳	+۰.۹%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۹۸۵	-۴%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۲۳	+۰.۸%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۶۱	-۳%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۳	+۰.۹%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۸۹۰	-۱%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۲۰	-۶%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۷۴۰ - ۸۸۵	-۳%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۸۰	-	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۸۰	۱۰%

مواد شیمیایی

پلیمرها

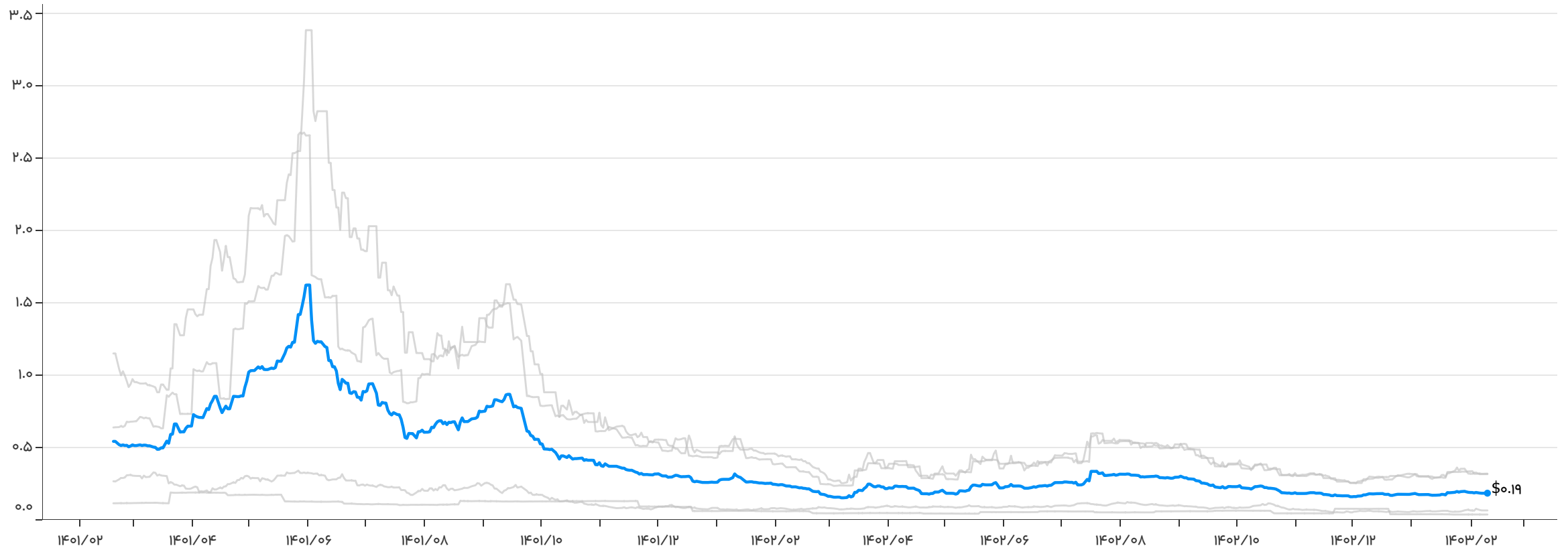


عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تأثیر در فروش	تأثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۶	-۳.۷%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرار، شاولان	۷۴ - ۹۴	۱۶%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۲	-۲.۵%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرار، شاولان	۶۹ - ۹۱	۱۶%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۰	-۵.۹%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۷۹ - ۱۰۷	۱۵%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۲	-۴.۶%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۸۰ - ۱۲۵	۱۳%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۷۳	-۲.۱%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۳۷۳ - ۵۲۸	۲۱%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۰	-۵.۴%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۸۱ - ۱۲۴	۷%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۱۸	-۴.۸%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۴۵۲ - ۶۵۹	۱۶%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۹۰۰	-	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	۷۲۰ - ۹۴۰	-۴%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۶,۹۴۳	+۰.۹%	-	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۲۱,۷۹۵ - ۳۶,۹۴۳	۵۲%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۱,۸۲۲	-	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرار، شاولان	۱۲,۴۵۵ - ۲۱,۸۲۲	۶۹%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۳,۱۲۳	-	-	شپاس	۱۲,۰۸۶ - ۱۶,۴۹۹	-۱۵%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۰۵	-۳.۴%	-	ذوب، فروش	۱۸۸ - ۲۸۷	-۶%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۷	-۰.۲%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	-۲%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۵	-	-	-	۱.۲۱ - ۱.۳۱	۰%
بیتکوین	بایننس	دلار	۵۹,۵۸۴	-۶.۹%	-	-	۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	۱۲۶%

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	-۳.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۱۳%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۴	-۰.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۴ - ۰.۰۸	-۳۶%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	+۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۲۴%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	-۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۰.۶۱	-۴%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۹	-۰.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۱۷%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

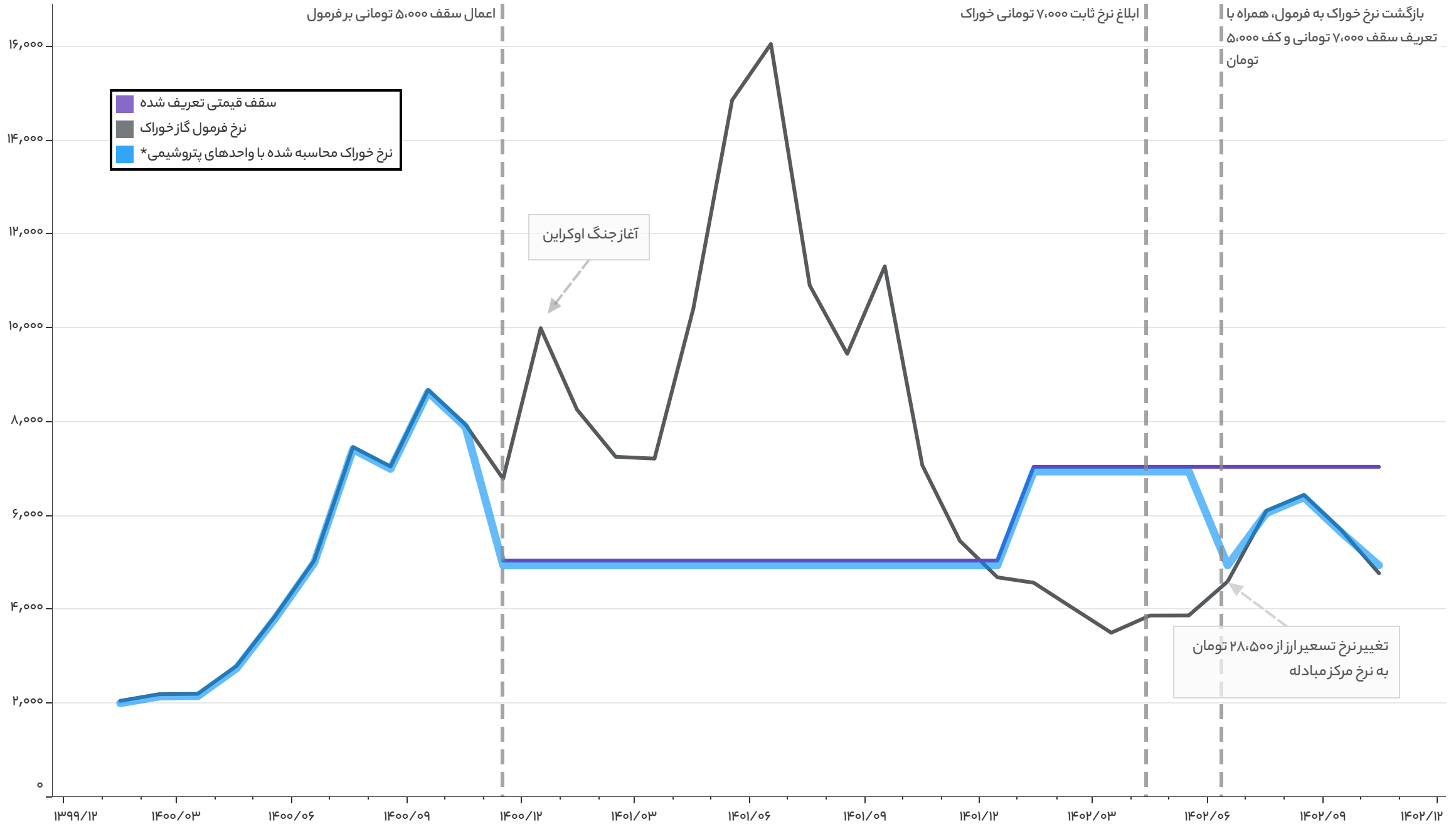
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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



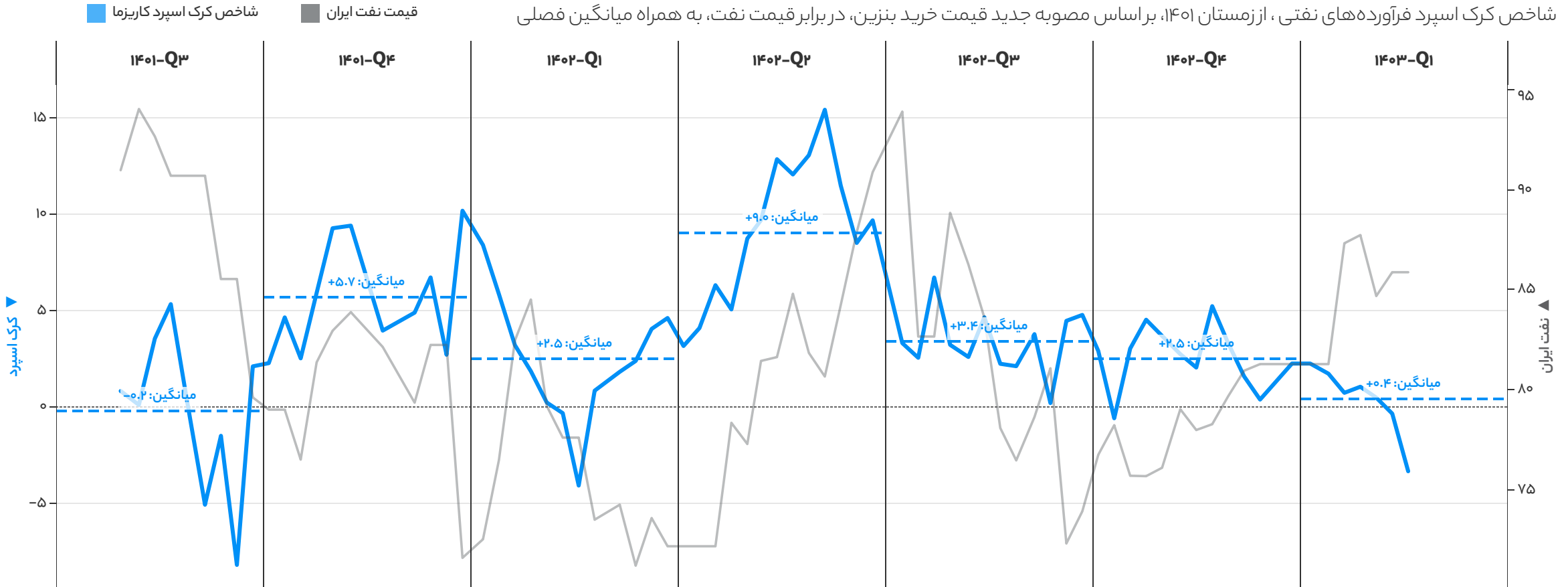
* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهرو آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد. - لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



کامودیتی

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	۹۱.۶	۱۰.۲	۵.۷	▼۴.۴	۱۹.۵	۱۲.۵	-۳۵.۹%		
بنزین**	۸۶.۸	۵.۶	۰.۹	▼۴.۷	۵.۰	۵.۸	+۱۵.۹%		
نفتا	۶۹.۹	-۱۲.۵	-۱۶.۰	▼۳.۵	-۹.۶	-۱۲.۶	-۳۱.۵%		
نفت کوره	۷۴.۶	-۹.۷	-۱۱.۳	▼۱.۶	-۱۵.۰	-۱۱.۸	+۲۱.۲%		
لوب کات***	۸۱.۶	-۴.۳	-۴.۳	-	-۶.۷	-۵.۶	+۱۶.۵%		
وکیوم باتوم***	۴۹.۰	-۳۶.۹	-۳۶.۹	-	-۳۱.۹	-۳۴.۵	-۸.۲%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		-۰.۳	-۳.۳	▼۳.۰	۲.۵	۰.۴	-۸۳.۴%		

* 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.



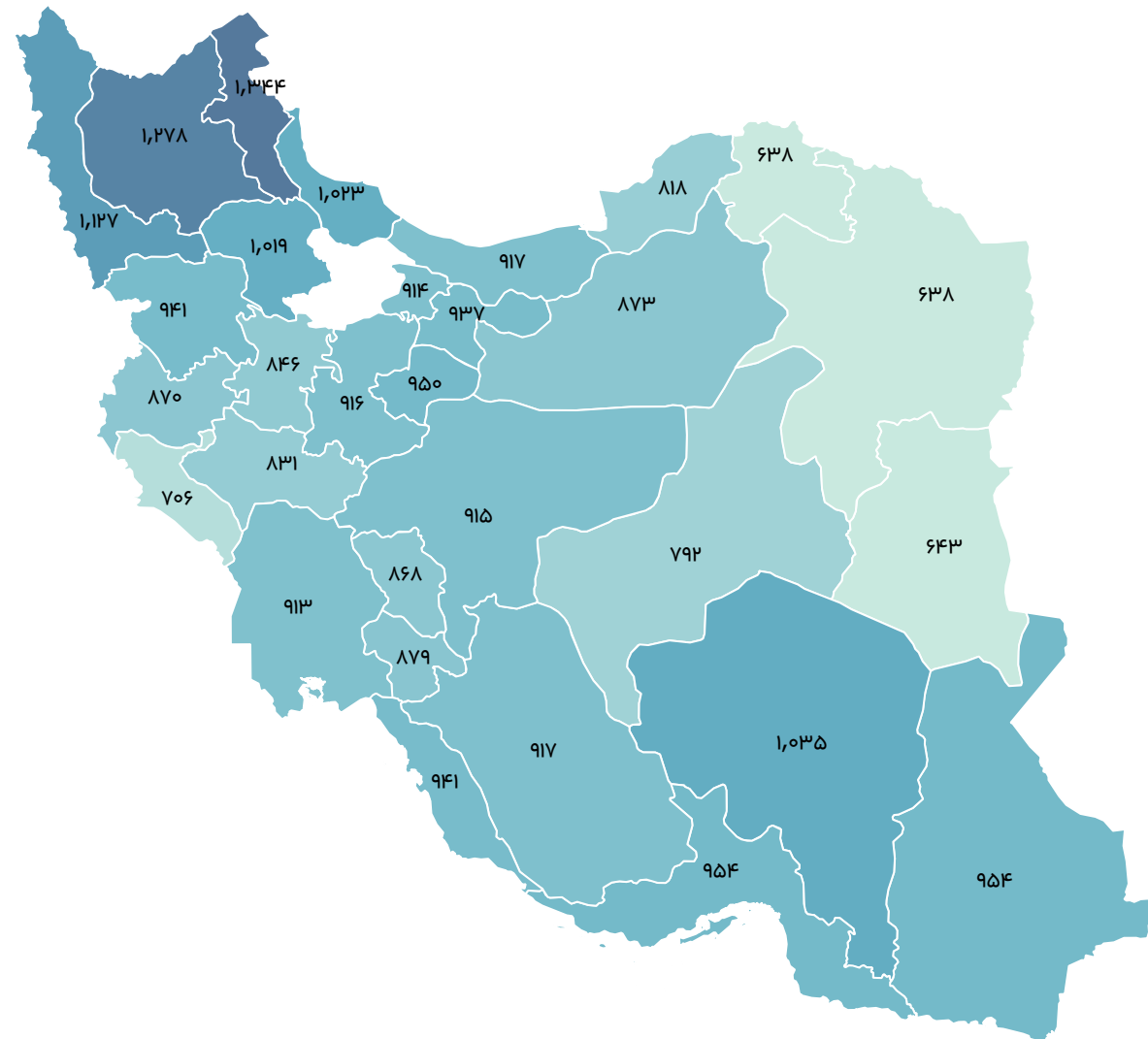
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۹۳۰	۹۳۷	+۰.۸%
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۲۹	۹۱۶	-۱.۴%
	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	قم	سیمان نیزاز قم	۹۵۰	۹۵۰	-
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیمان..	۷۶۲	۷۹۲	+۳.۹%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۷۳	+۷.۶%
غرب	همدان	سیمان هگمتان	۸۷۰	۸۴۶	-۲.۸%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۱۳	۹۱۳	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۳۵	۸۷۰	+۴.۲%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۶۸	۸۶۸	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۸۷۹	-
	لرستان	سیمان دورود	۸۳۱	۸۳۱	-
	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۴۱	-
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۷	+۰.۲%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۸۰۷	۸۱۸	+۱.۳%
شمال	گیلان	سیمان خزر	۹۶۵	۱,۰۲۳	+۶.۰%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۱۴۵	۱,۳۴۴	+۱۷.۳%
شمال غرب	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۱,۰۰۳	۱,۱۲۷	+۱۲.۳%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۲۲۵	۱,۲۷۸	+۴.۳%
	زنجان	سیمان خمسه	۹۲۵	۱,۰۱۹	+۱۰.۲%
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۴۳	+۰.۸%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۹۶۲	۹۵۴	-۰.۸%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۴۱	۹۴۱	-
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۱۷	-
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۱,۰۵۴	۱,۰۳۵	-۱.۸%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۶۲	۹۵۴	-۰.۸%

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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

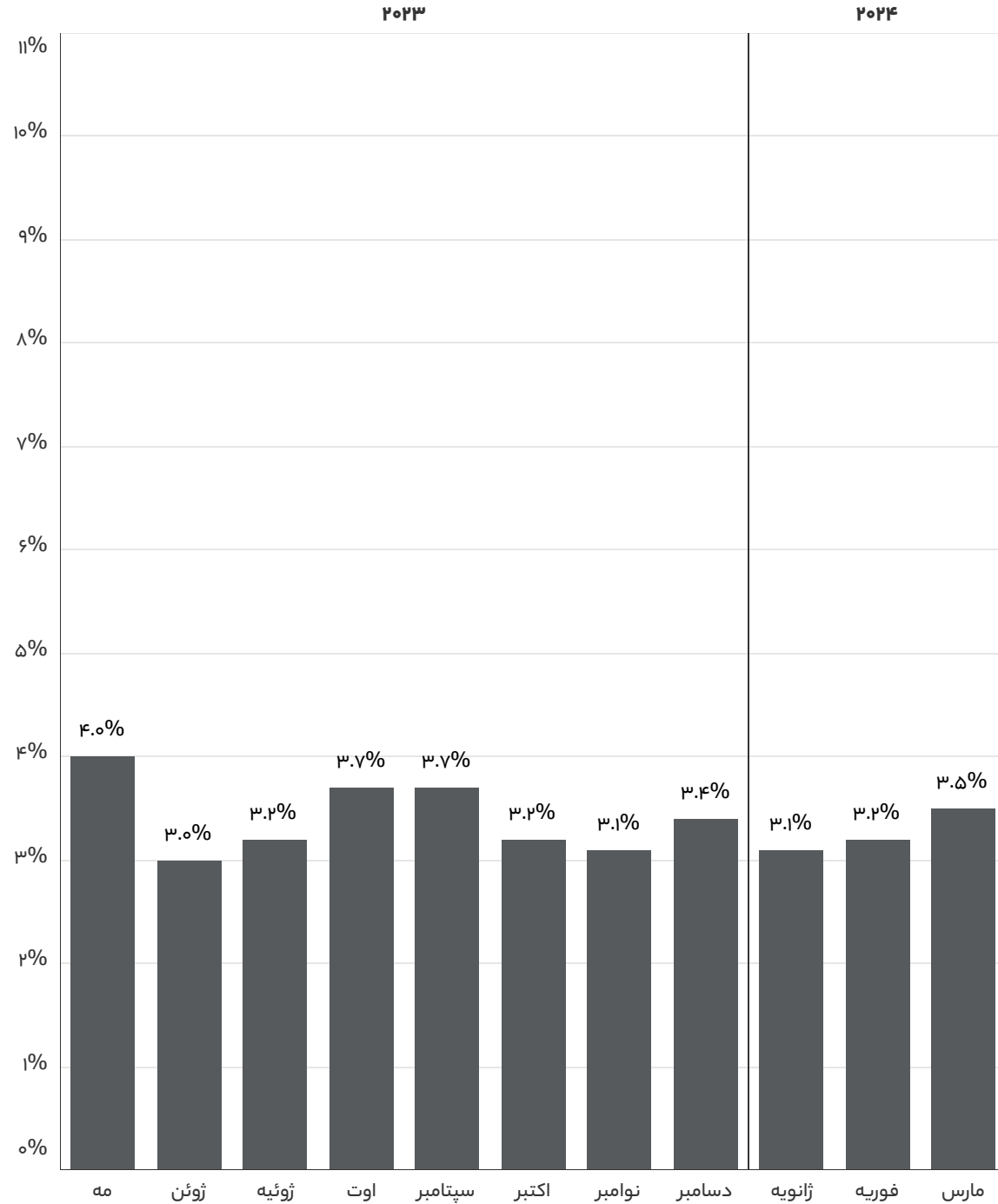


* قیمت سیمان بر اساس سیمان تیپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ در حالی که بسیاری از فلزات بازار به ویژه مس و در برخی مقاطع زمانی، آهن، رشد چشم گیری برای سرمایه گذاران خود به ارمغان آوردند، آلومینیوم در سه ماهه آخر سال گذشته میلادی تقریباً سرمایه گذاران خود را ناامید کرد. با این حال، پویایی بازار و تغییرات کلیدی در شرایط فاندمنتال آن منجر به آغاز روند رو به رشد این فلز اساسی در بازار از اواخر ماه فوریه سال جاری شد. قیمت آلومینیوم تنها طی بازه زمانی یک ماهه گذشته با ۱۶.۲۵ درصد رشد مواجه شده که می توان آن را به رشد قیمت طلا در دوران بروز بحران های جهانی قیاس کرد. بر اساس آخرین داده های موسسه بین المللی آلومینیوم (IAI) تولید آلومینیوم از ماه مارس سال جاری با رشد ۳.۵ درصد سالانه، در سطح جهانی، به رقم ۱۹۵۹۰۰ تن در هر روز رسیده است.
- مهدی ضیغمی رئیس سازمان توسعه تجارت در نشست خبری ششمین نمایشگاه توانمندی های صادراتی ایران در پاسخ به سوال درباره اقداماتی که برای نقل و انتقال پول به دیگر کشورها در شرایط تحریم انجام شده اظهار داشت: علاوه بر مبادله با پول های ملی با سایر کشورها در سال گذشته ۱.۸ میلیارد طلا به کشور وارد و رفع تعهد ارزی انجام شده است. وی افزود: برخی از منابع بلوکه شده ایران نیز آزاد شده است و برای تامین منابع اولیه در اختیار صنایع قرار گرفته است.
- میزان اکتشافات نفت و گاز در سطح جهان طی سال ۲۰۲۳ به پایین ترین رکورد تاریخی خود رسید. بنابر اعلام مجمع کشورهای صادرکننده گاز (GECF)، در حالی که طی سال گذشته میلادی، تنها ۵ میلیارد بشکه منابع جدید نفتی در اقصی نقاط جهان اکتشاف شد که در همین بازه زمانی، هزینه عملیات اکتشاف به بالای دو برابر صعود کرده است. به گفته کارشناسان اوپک، افزایش بسیار زیاد هزینه اکتشاف فیلدهای جدید نفتی، عامل اصلی کاهش سرمایه گذاری در بخش نفت و گاز بوده است. به گفته GECF، در حالی که هزینه اکتشاف هر بشکه نفت در سال ۲۰۲۲ حدود ۲۰.۶۰ دلار ارزیابی شده بود، این رقم برای سال ۲۰۲۳ به بالای ۵.۳۰ دلار هر بشکه افزایش یافته است.
- نشریه دولتی شینهوا چین روز ۸ مارس، از کشف یک میدان نفتی عظیم در دریای جنوبی چین توسط شرکت ملی نفت چین (CNOOC) خبر داد. به گفته «لی چن» کارشناس ارشد بازار نفت چین، کشف ذخایر جدید نفتی می تواند به تامین نفت ارزان قیمت تر برای کارخانه ها و واحدهای تولیدی این کشور انجامیده و در نتیجه، قیمت تمام شده محصولات صادراتی نیز کاهش خواهد یافت. چنین موضوعی می تواند منجر به تصاحب بیشتر بازارهای جهانی توسط شرکت های چینی شده و رقبای غربی آنها بیش از وضعیت فعلی تحت فشار قرار خواهند گرفت.
- وزیر نفت از برنامه جدید وزارت نفت برای تولید بنزین از متانول به منظور کمک به رفع ناترازی بنزین خبر داد و گفت: بخشی از تولید متانول کشور به سمت تولید بنزین و ارزش افزوده سوق داده می شود که دانش فنی و توانمندی تولید آن را داریم. اوجی از امضای تفاهم نامه با شرکت های تولید متانول برای تولید بنزین خبر داد و گفت: در خصوص تولید بنزین در مجتمع های پتروشیمی، به ویژه پتروشیمی هایی که متانول تولید می کنند، با شرکت های ملی پالایش و پخش فرآورده های نفتی و صنایع پتروشیمی برنامه ریزی هایی شده و تفاهم نامه ای با شرکت های تولید متانول امضا شده است تا با تولید بنزین از متانول، به رفع ناترازی بنزین کمک کنند.

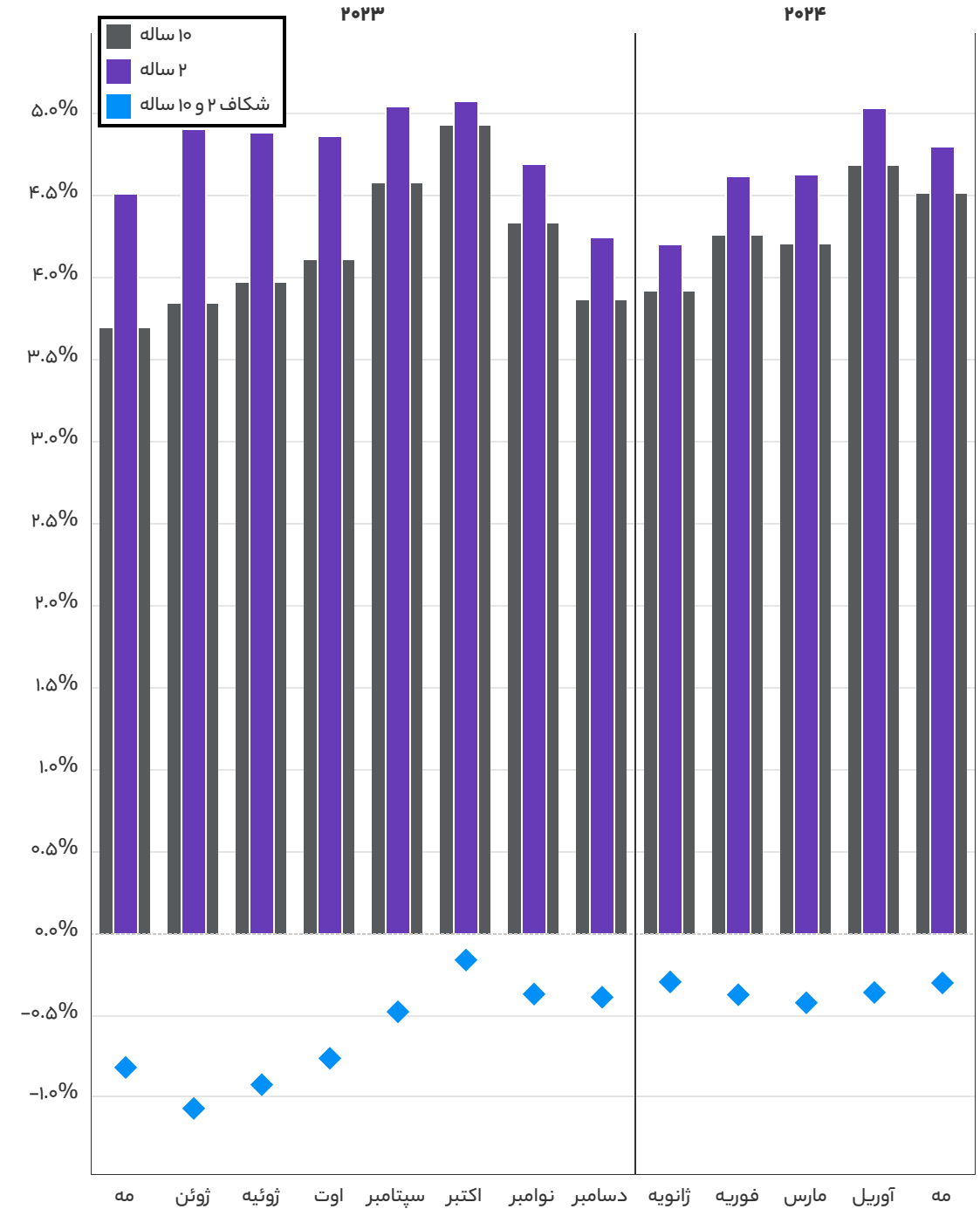
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



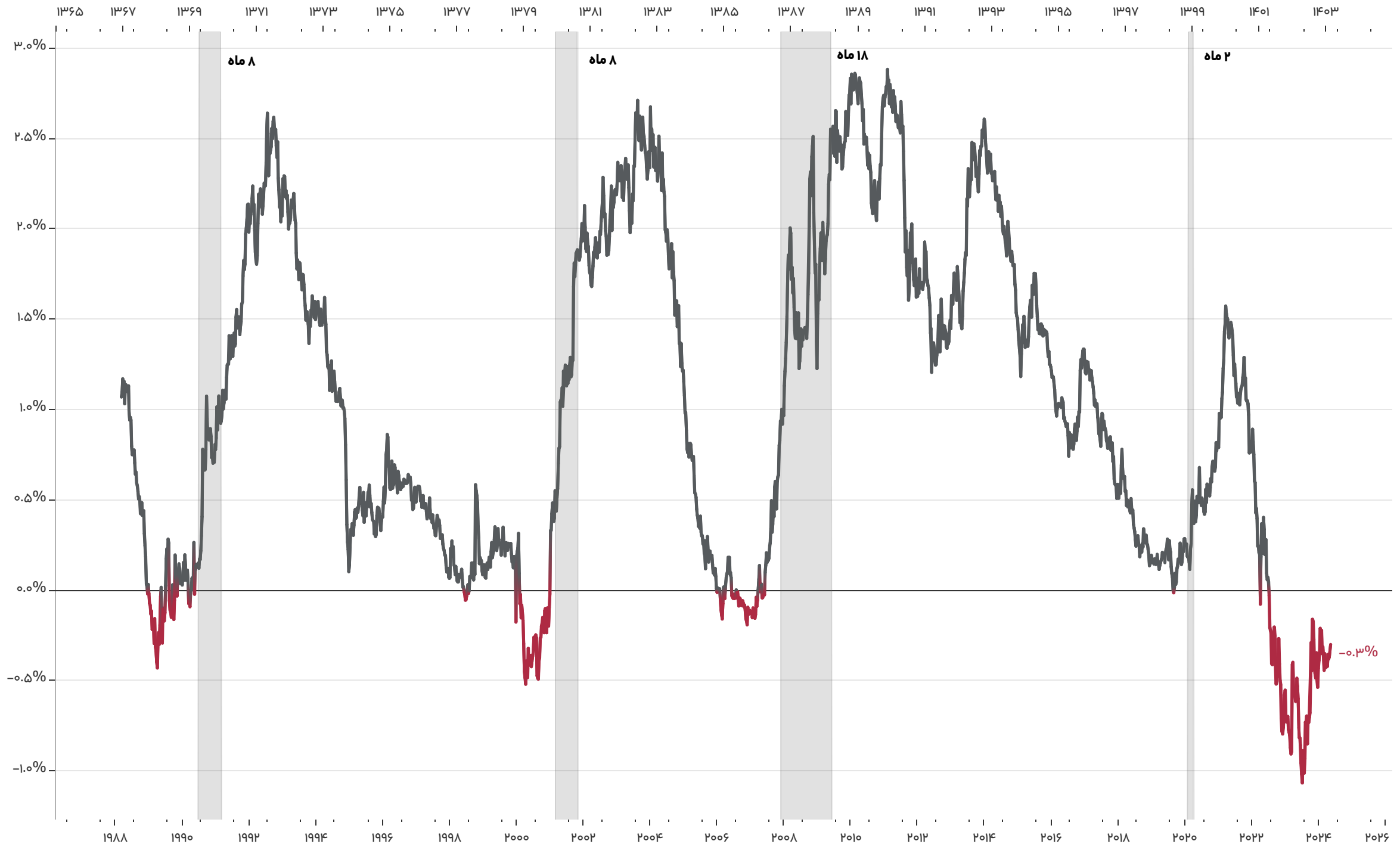
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

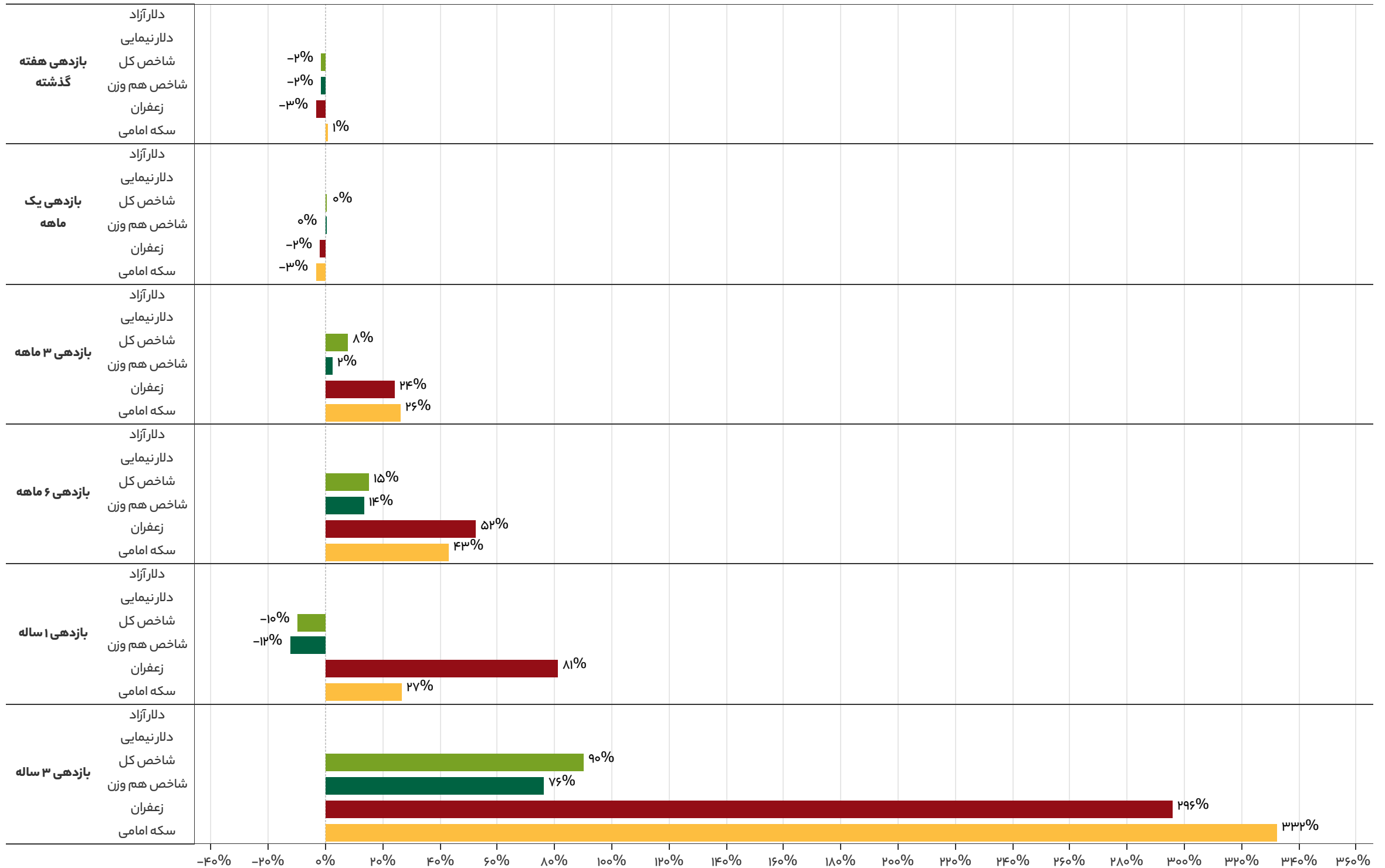
EQUITY MARKET

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



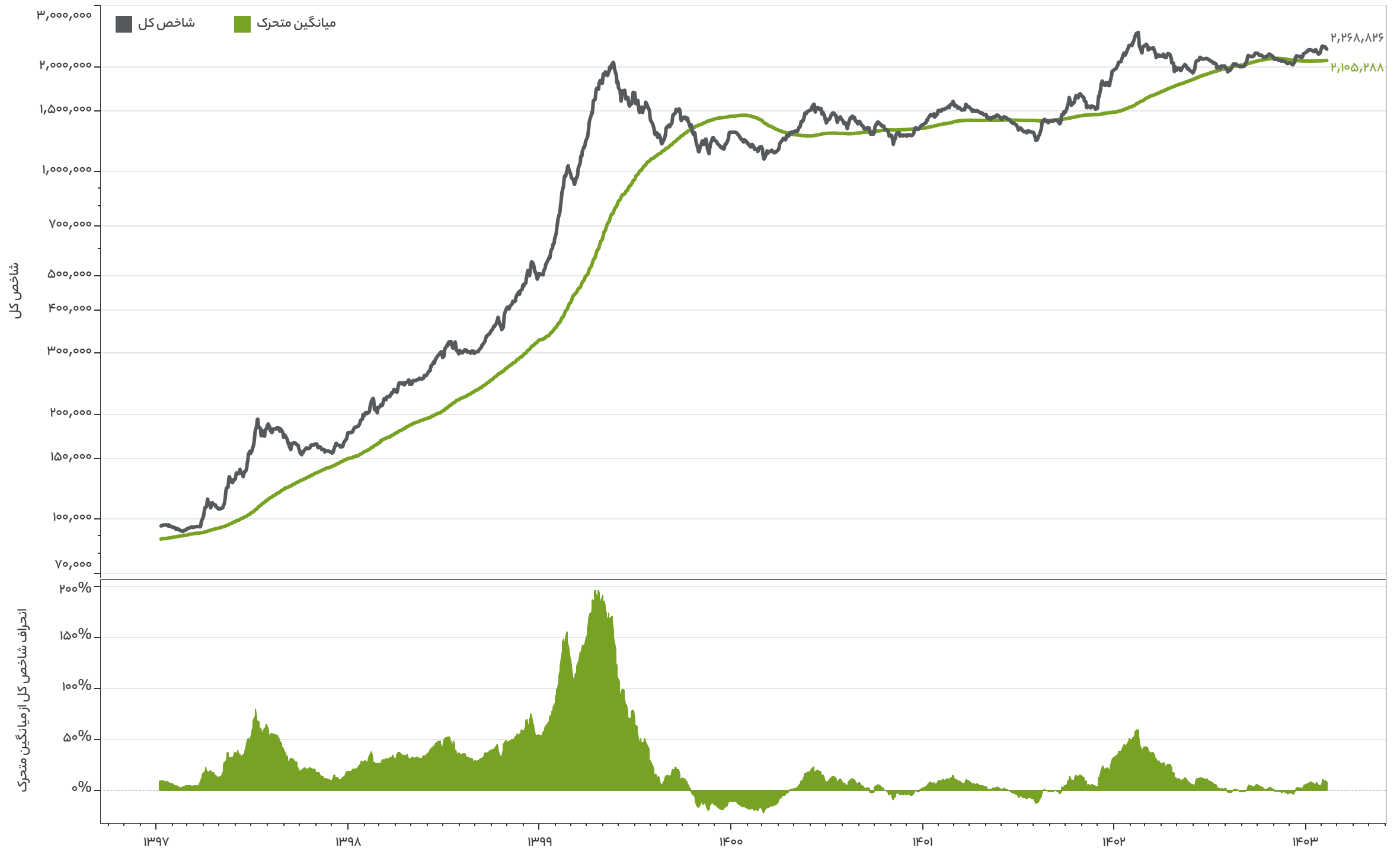
ارزش دلاری بازار (میلیارد دلار)

شاخص کل بورس ایران

بازار سهام

شاخص کل و میانگین متحرک

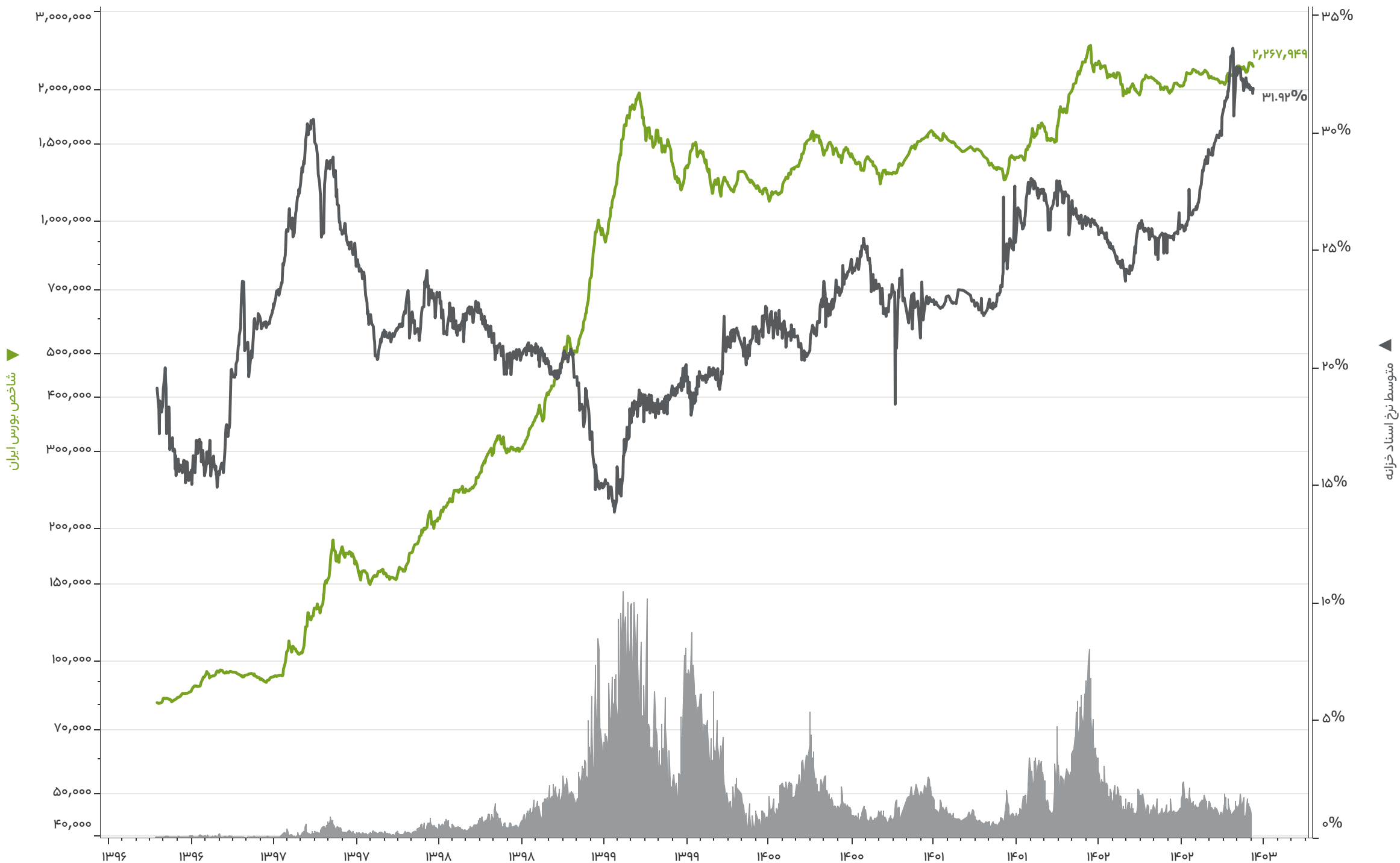
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





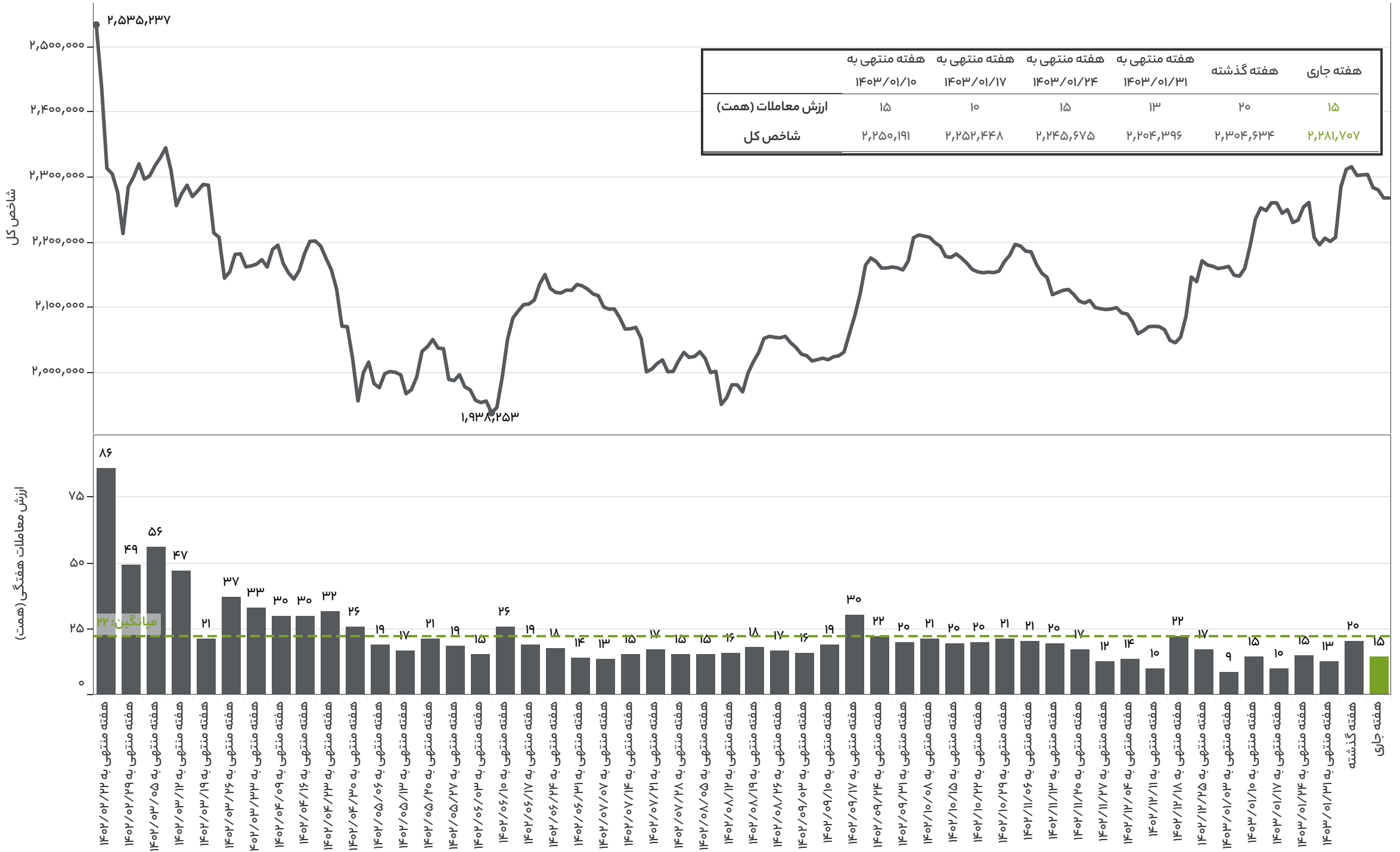
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



ارزش معاملات هفتگی بازار

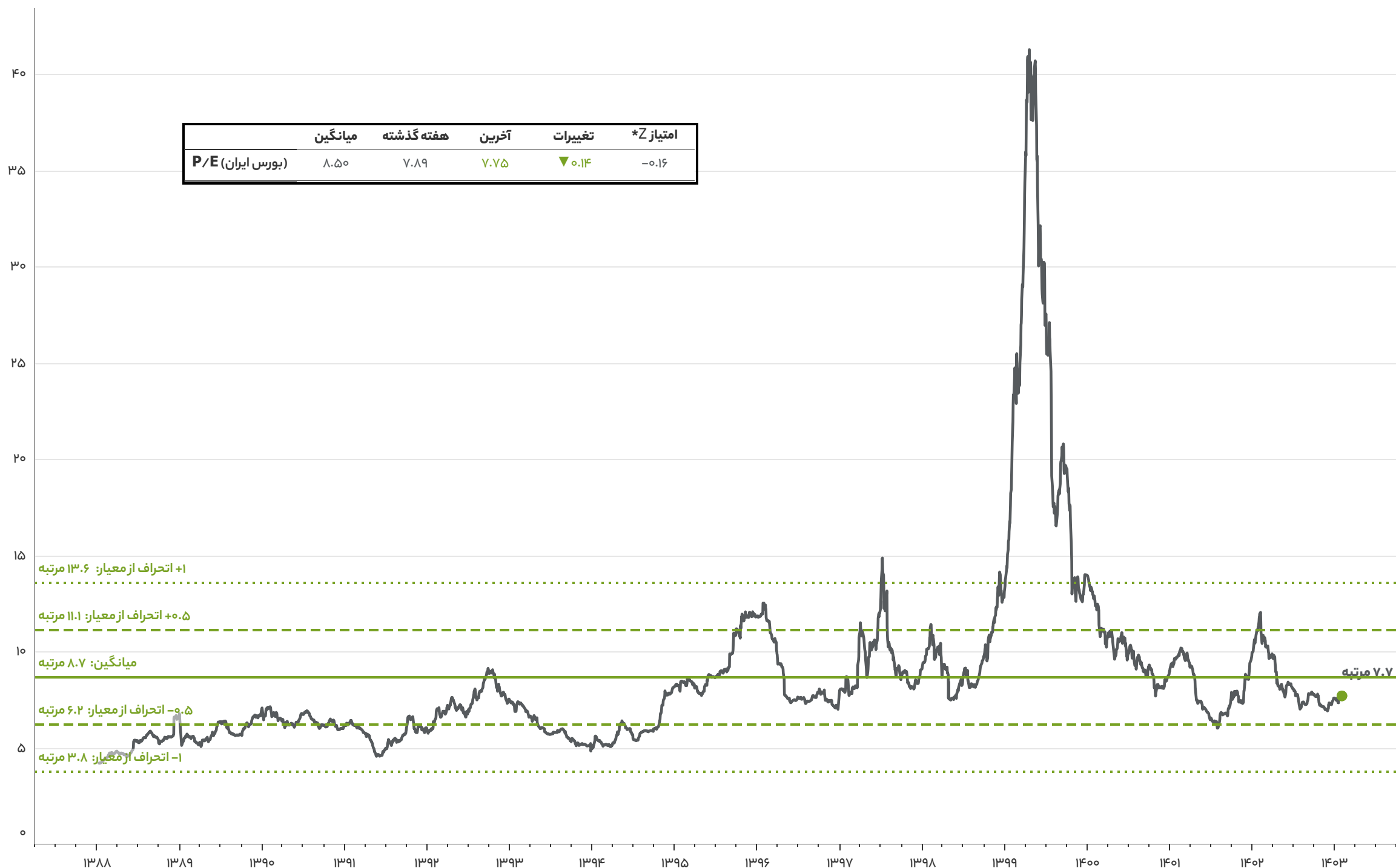
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*امتیاز Z یا امتیاز استاندارد تفاوت آخرین عدد برای نسبت قیمت به سود را بر حسب انحراف از معیار محاسبه می‌نماید که در اینجا می‌تواند یک معیار برای سنجش گران یا ارزان بودن بازار نسبت به میانگین باشد.



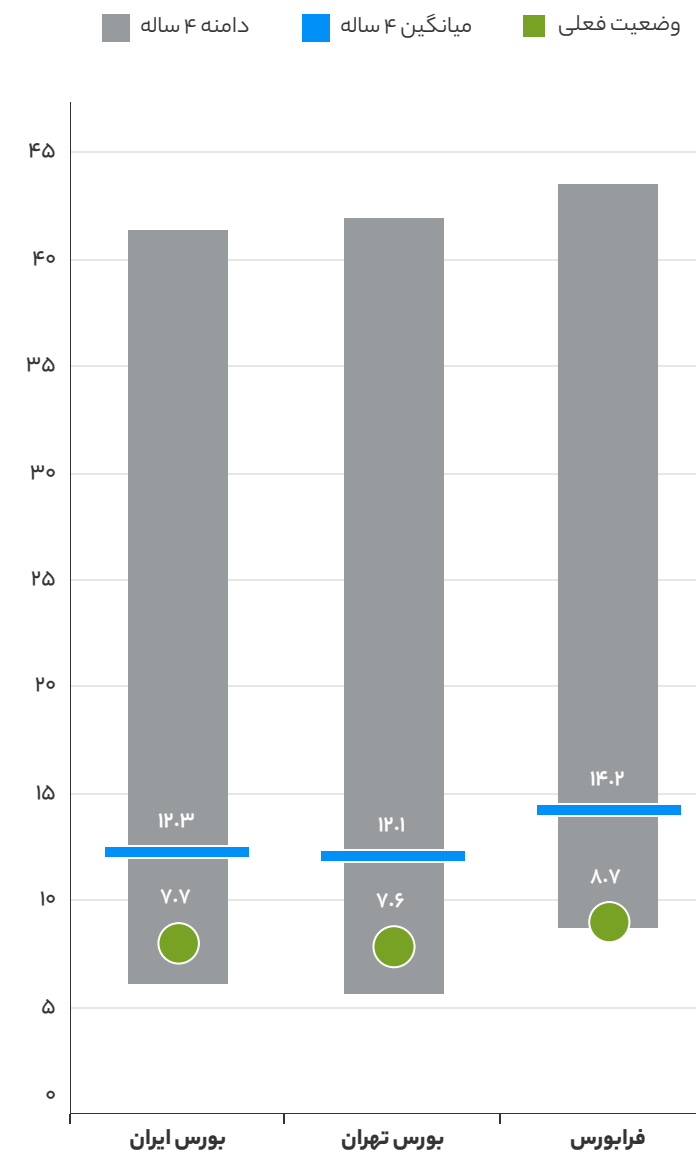
ارزش نسبی فرابورس به بورس

نسبت پی به ای فرابورس به بورس تهران، گذشته نگر، ۴ سال گذشته، بزرگنمایی شده



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۷۵	۷.۸۹	۶.۰۷	۱۲.۲۸	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۶۰	۷.۷۳	۵.۶۴	۱۲.۰۹	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۷۱	۸.۸۵	۸.۶۸	۱۴.۲۲	۴۳.۵۱

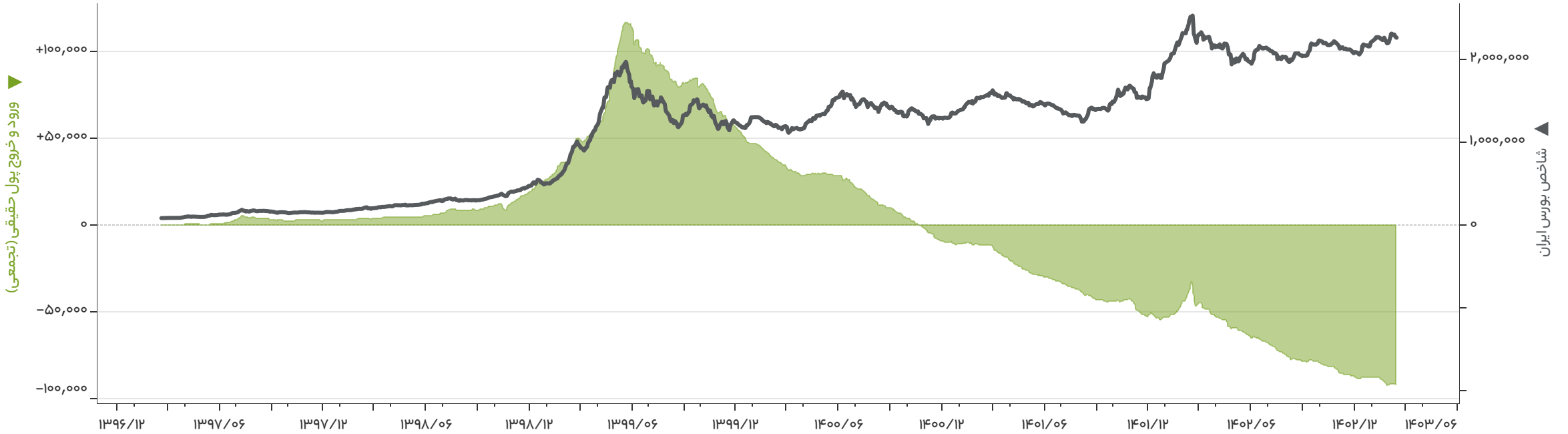


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۶۳۲	۳,۲۵۵	۶۷۰	۳۸۶	۲۱۸	۱۹۴	۱۵۴	۱۲۲	۱۰۶	۹۹	۶۲	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۴۰.۸%	۳۶.۶%	۷.۵%	۴.۳%	۲.۴%	۲.۲%	۱.۷%	۱.۴%	۱.۲%	۱.۱%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۸.۰	۷.۴	۴.۹	۴.۸	۹.۶	۹.۷	۹.۱	۱۷.۶	۱۱.۲	۱۳.۵	۱۴.۴	سودآوری
بازده سود نقدی	۸.۵%	۹.۲%	۱۳.۴%	۳.۳%	۴.۷%	۳.۶%	۷.۸%	۲.۸%	۳.۷%	۱۵.۲%	۳.۸%	
نسبت تقسیم سود	۷۲%	۶۱%	۶۳%	۳۲%	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	۰.۷	۱.۴	۱.۱	۰.۹	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۱۰۹۴%	+۸۷۳%	+۸۷۵%	+۸۹۱%	+۴۳۴%	+۴۴۷%	+۳۷۹%	+۳۳۷%	+۱۱۶%	+۸۸۸%	+۷۲۵%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۸۴%	+۲%	+۲۶%	-۱۱%	-۸%	-۵%	+۱۴%	+۸%	-۶۶%	+۱۴۱%	+۱۵%	
بازده از ابتدای سال	+۱۰۸%	+۷۲%	+۱۰۷%	+۹۶%	+۵۹%	+۱۱۱%	+۹۱%	+۸۹%	+۳۸%	+۵۹%	+۲۶۹%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	-۱%	-۳%	-۲%	-۱%	-۲%	-۲%	-۲%	-۴%	-۲%	-۲%	

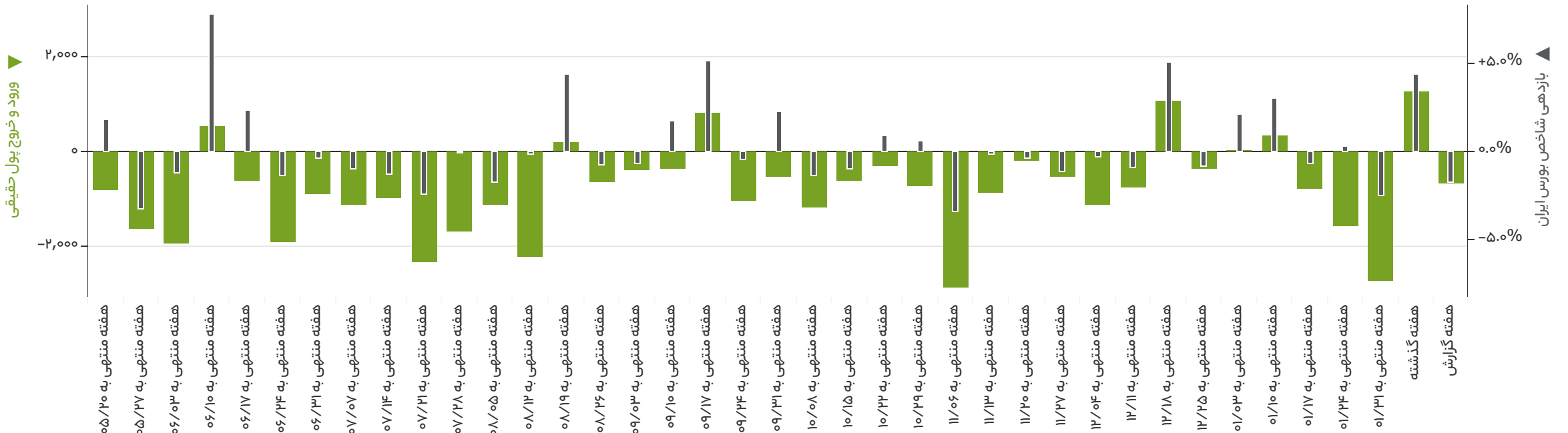
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

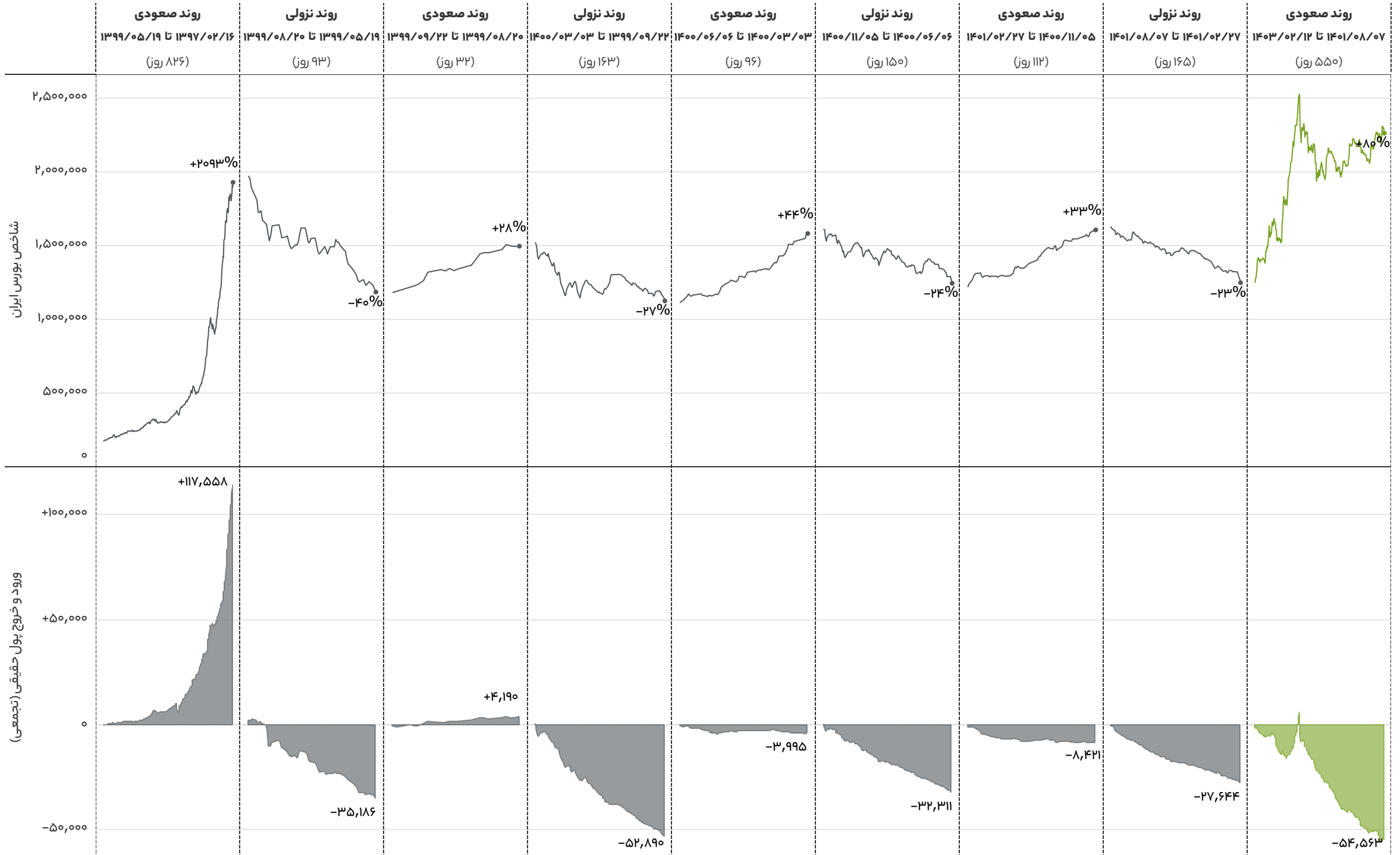
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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





ورود و خروج پول حقیقی

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

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
			بیشترین ورود پول حقیقی	بیشترین خروج پول حقیقی
حسینا	بنادر و کشتیرانی	۱۰	+۳۲	-۱۳
دعبید	دارویی	۳۶	+۲۵	-۱۳
توسن	نرم افزار و خدمات	۴	+۲۳	-۱۴
واعتبار	سرمایه گذاری	۲	+۲۳	-۱۴
فروژ	آهن و فولاد	۴	+۱۶	-۱۴
شرنگی	مواد شیمیایی-متنوع	۲	+۱۵	-۱۴
ثپردیس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴	+۱۴	-۱۴
غمایه	شیرینیجات	۲	+۱۴	-۱۵
اتکام	بیمه	۴	+۱۲	-۱۴
شمواد	مواد شیمیایی-متنوع	۲	+۱۲	-۱۵
نوری	مواد شیمیایی-متنوع	۱۷۱	+۱۱	-۱۶
غفارس	محصولات لبنی	۲	+۱۱	-۱۹
خزامیا	خودرو	۱۸	+۱۰	-۲۱
آسیا	بیمه	۵	+۱۰	-۶۰
وکار	بانکها و موسسات اعتباری	۱۳	-۱۳	-۸۲
شبریز	پالایش نفت و گاز	۴۰	-۱۳	
پارسان	سرمایه گذاری	۱۴۱	-۱۴	
وپارس	بانکها و موسسات اعتباری	۳۰	-۱۴	
شپدیس	تولید کود و ترکیبات نیتروژن	۹۵	-۱۴	
وبصادر	بانکها و موسسات اعتباری	۴۰	-۱۴	
وغدیر	سرمایه گذاری	۱۵۰	-۱۵	
زکوثر	سرمایه گذاری	۷	-۱۵	
ورنا	سرمایه گذاری	۹	-۱۵	
شبندر	پالایش نفت و گاز	۱۵۴	-۱۶	
زاگرس	مواد شیمیایی-متنوع	۳۳	-۱۹	
آریا	مواد شیمیایی-متنوع	۱۱۹	-۲۱	
فولاد	آهن و فولاد	۵۶۳	-۶۰	
خودرو	خودرو	۹۵	-۸۲	

تغییر مالکیت شرکت

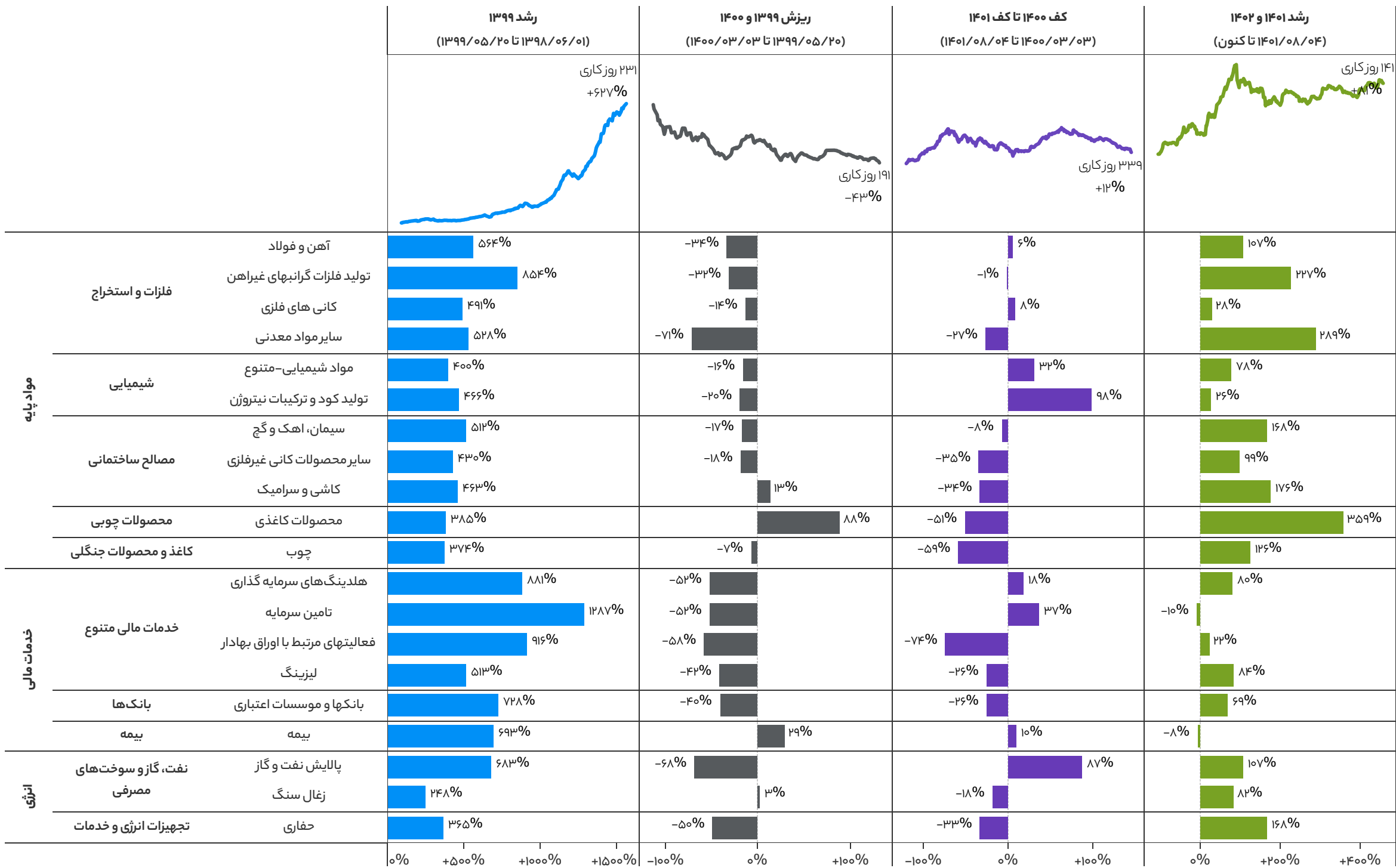
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	تغییر مالکیت شرکت	
			بیشترین تغییر مالکیت حقوقی به حقیقی	بیشترین تغییر مالکیت حقیقی به حقوقی
وهنر	سرمایه گذاری	۰.۷	+۱.۵%	-۰.۲%
واعتبار	سرمایه گذاری	۱.۶	+۱.۳%	-۰.۲%
فگستر	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۰.۹	+۰.۸%	-۰.۲%
غمایه	شیرینیجات	۱.۷	+۰.۸%	-۰.۳%
شرنگی	مواد شیمیایی-متنوع	۲.۲	+۰.۷%	-۰.۳%
شمواد	مواد شیمیایی-متنوع	۲.۰	+۰.۶%	-۰.۳%
توسن	نرم افزار و خدمات	۳.۶	+۰.۶%	-۰.۳%
غفارس	محصولات لبنی	۲.۱	+۰.۵%	-۰.۳%
معیار	سرمایه گذاری	۰.۷	+۰.۵%	-۰.۳%
زشریف	محصولات کشاورزی	۱.۵	+۰.۴%	-۰.۳%
فروژ	آهن و فولاد	۴.۱	+۰.۴%	-۰.۴%
ثپردیس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳.۹	+۰.۴%	-۰.۴%
حسینا	بنادر و کشتیرانی	۹.۷	+۰.۴%	-۰.۵%
میهن	بیمه	۲.۲	+۰.۳%	-۰.۵%
توریل	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۳.۹	-۰.۲%	-۰.۵%
لطیف	محصولات کاغذی	۱.۶	-۰.۲%	-۰.۵%
زکوثر	سرمایه گذاری	۶.۵	-۰.۲%	-۰.۴%
غشهد	محصولات کشاورزی	۰.۸	-۰.۳%	-۰.۴%
غالبر	محصولات لبنی	۳.۴	-۰.۳%	-۰.۴%
والماس	سرمایه گذاری	۱.۳	-۰.۳%	-۰.۴%
فسازان	آهن و فولاد	۱.۹	-۰.۳%	-۰.۴%
فولای	آهن و فولاد	۰.۷	-۰.۳%	-۰.۴%
غشصفا	محصولات لبنی	۱.۷	-۰.۴%	-۰.۵%
خبندان	قطعات خودرو	۳.۱	-۰.۴%	-۰.۵%
کماسه	سایر مواد معدنی	۲.۲	-۰.۵%	-۰.۶%
غدیس	نوشیدنی	۲.۱	-۰.۵%	
لسرما	ماشین الات	۰.۸	-۰.۵%	
وآذر	سرمایه گذاری	۱.۶	-۰.۶%	



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

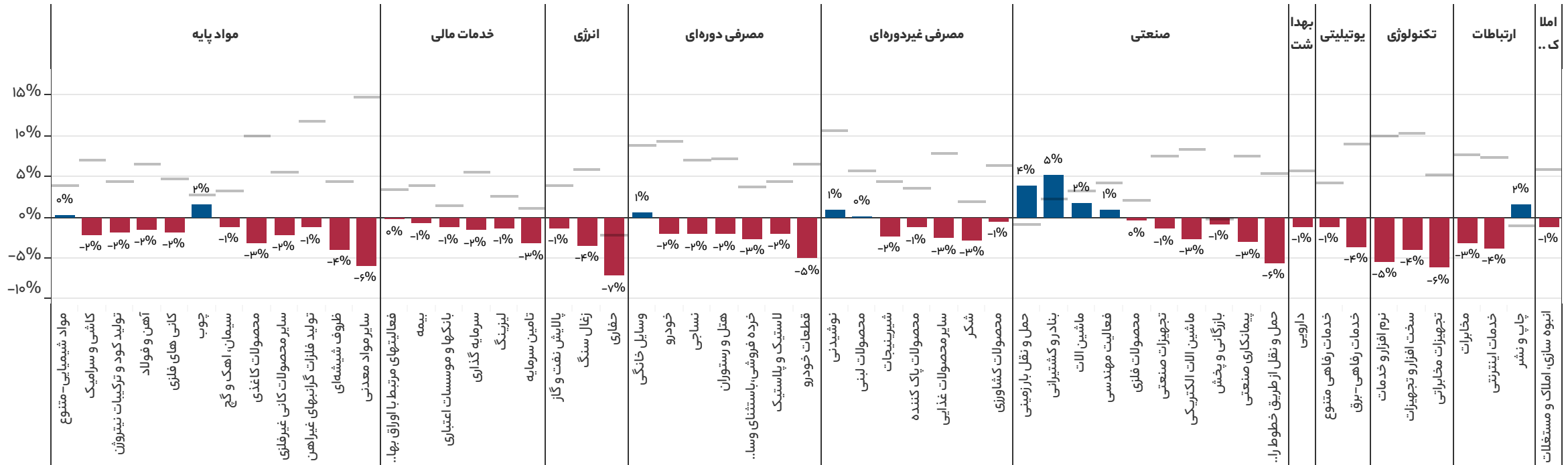


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

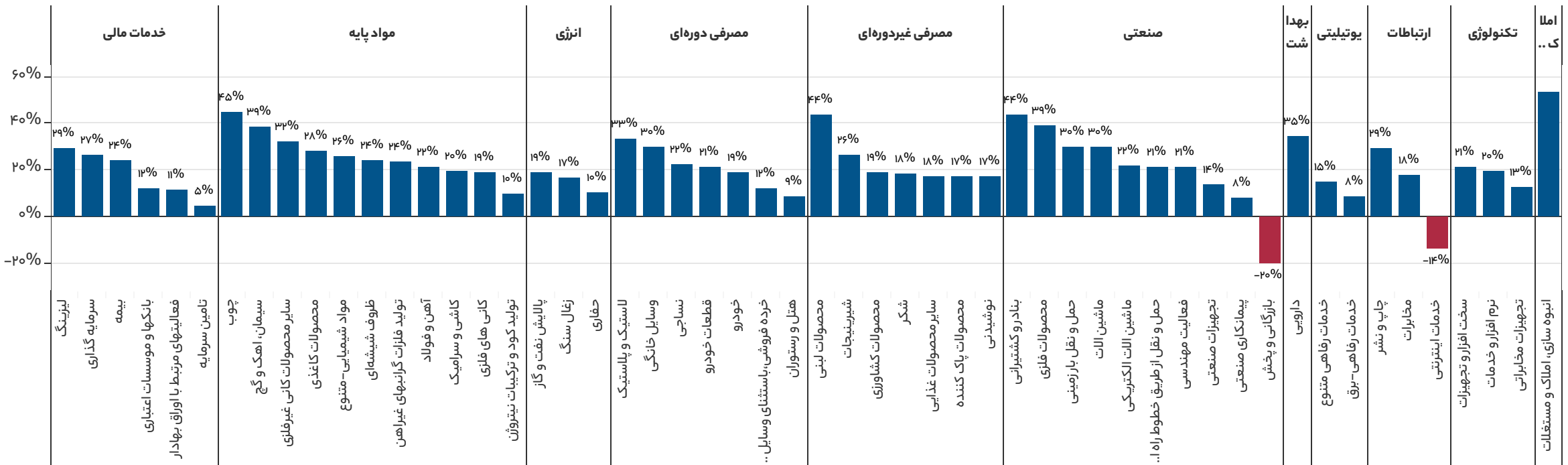
		رشد ۱۳۹۹		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲	
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۱۲۴۷%	-۷۰%		۱۳%		۶۵%	
		قطعات خودرو	۶۷۶%	-۳۲%		-۲۵%	۷۵%		
		لاستیک و پلاستیک	۶۳۱%	-۳۴%		-۴۲%	۱۷۱%		
	خرده‌فروشی	خرده‌فروشی	۱۱۲۹%	-۲۳%		۳%	۱۶۴%		
		کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۴۹۰%	-۴۶%		-۳۶%	۱۵۳%	
		نساجی	۳۸۰%	-۲۱%		-۳۵%	۱۳۵%		
مصرفی غیردوره‌ای	خدمات مصرف کننده	هتل و رستوران	۱۱۶۶%	-۶۷%		۱۸%	۱۰%		
		سایر محصولات غذایی	۶۹۹%	-۳۴%		-۳۹%	۵۲%		
	غذا و نوشیدنی	محصولات کشاورزی	۳۹۷%	-۳۵%		۹%	۴۲%		
		شیرینیجات	۵۹۵%	-۲۴%		-۶۳%	۶۵%		
		شکر	۴۳۵%	-۲۲%		-۴۴%	۸۸%		
		محصولات لبنی	۳۸۳%	۷%		-۵۴%	۱۴۳%		
	نوشیدنی	۵۳۹%	-۱۵%		-۳۱%	۵۸%			
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۳۰۶%	۴%		-۱۲%	۲۶%			
صنعتی	کالاهای سرمایه‌ای	فعالیت مهندسی	۵۲۱%	-۶۳%		-۷%	۸۷%		
		ماشین الات الکتریکی	۵۰۱%	-۴۵%		-۲۳%	۸۳%		
		ماشین الات	۴۲۲%	-۳۵%		-۳۱%	۱۶۱%		
		محصولات فلزی	۶۴۵%	-۵۴%		-۴۴%	۱۲۴%		
		تجهیزات صنعتی	۸۴۷%	-۳۰%		-۴۰%	۶۰%		
		پیمانکاری صنعتی	۵۲۵%	-۱۵%		-۶۸%	۱۰۰%		
تزابری	بنادر و کشتیرانی	۲۴۶%	-۲۲%		-۱۵%	۲۵۲%			
	حمل و نقل از طریق راه آهن	۳۲۷%	-۱۳%		-۴۱%	۴۵%			
	حمل و نقل بار زمینی	۲۵۰%	-۱۸%		۳۳%	۷۹%			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۳۲۱%	-۳۲%		-۱۳%	۹۱%		
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۲۵۲%	-۳۵%		۲%	۶۰%		
		سخت افزار و تجهیزات	۵۷۰%	-۶۵%		-۴۵%	۲۴۳%		
ارتباطات	خدمات دور برد	مخابرات	۵۳۲%	-۷۱%		-۱۳%	۳۶%		
	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۲۳%	-۵۲%		-۵۲%	۱۶۰%		
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۱۰%	-۳۵%		۱۳۱%	۵۹%		
		خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%	-۵۴%		-۳۳%			
املاک و مستغلات	توسعه املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۶۱۹%	-۴۳%		-۴۵%	۲۶۹%		

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)

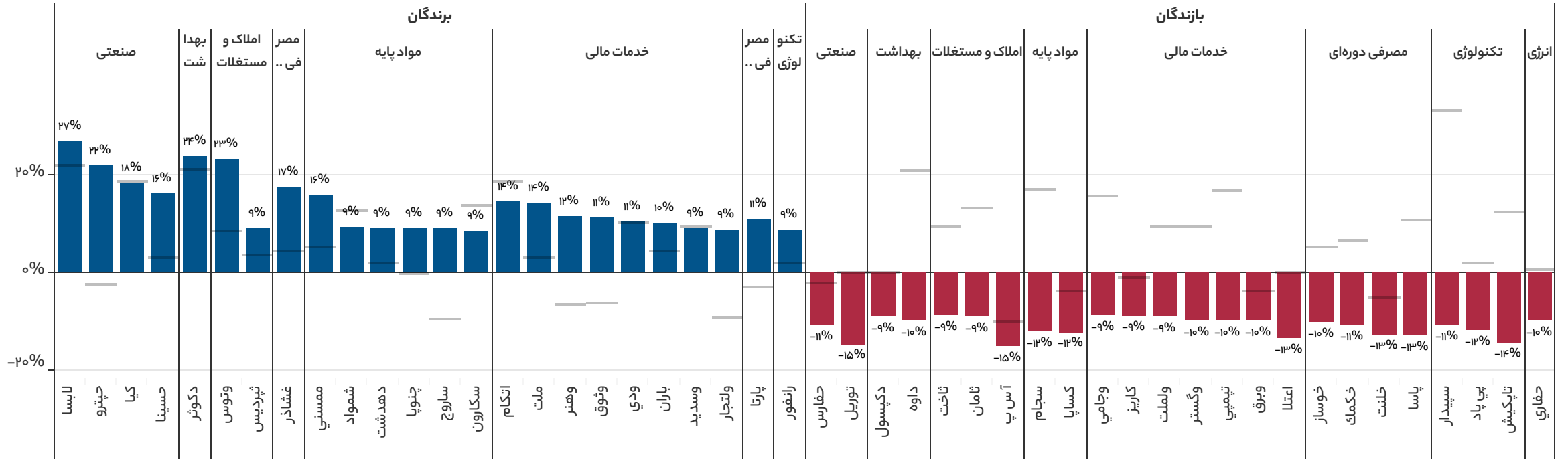

بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

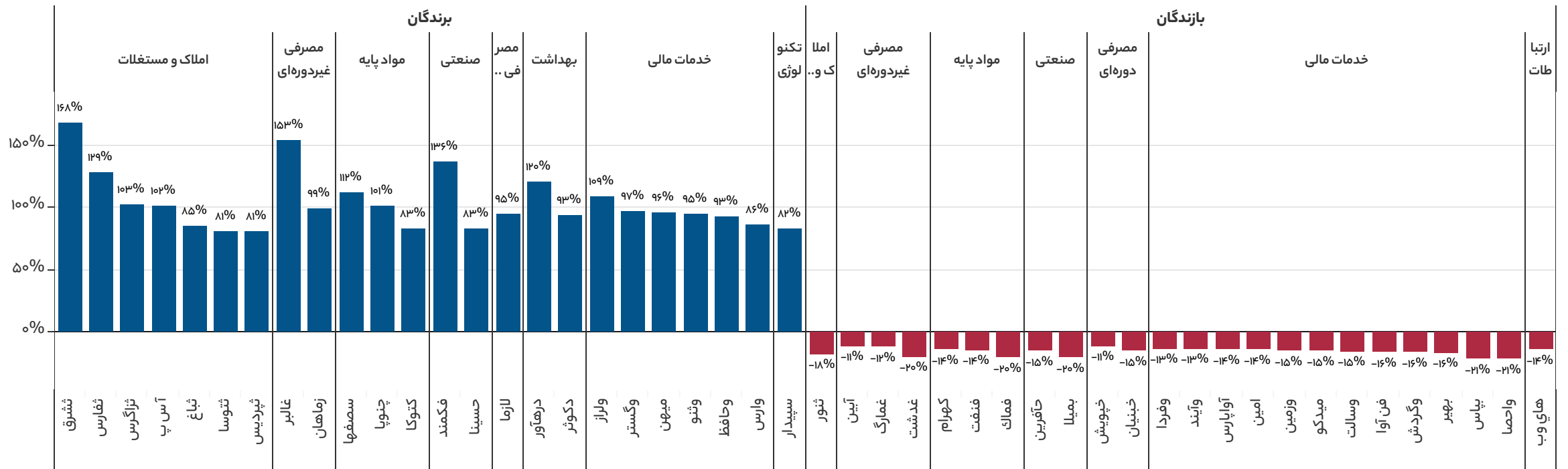




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)

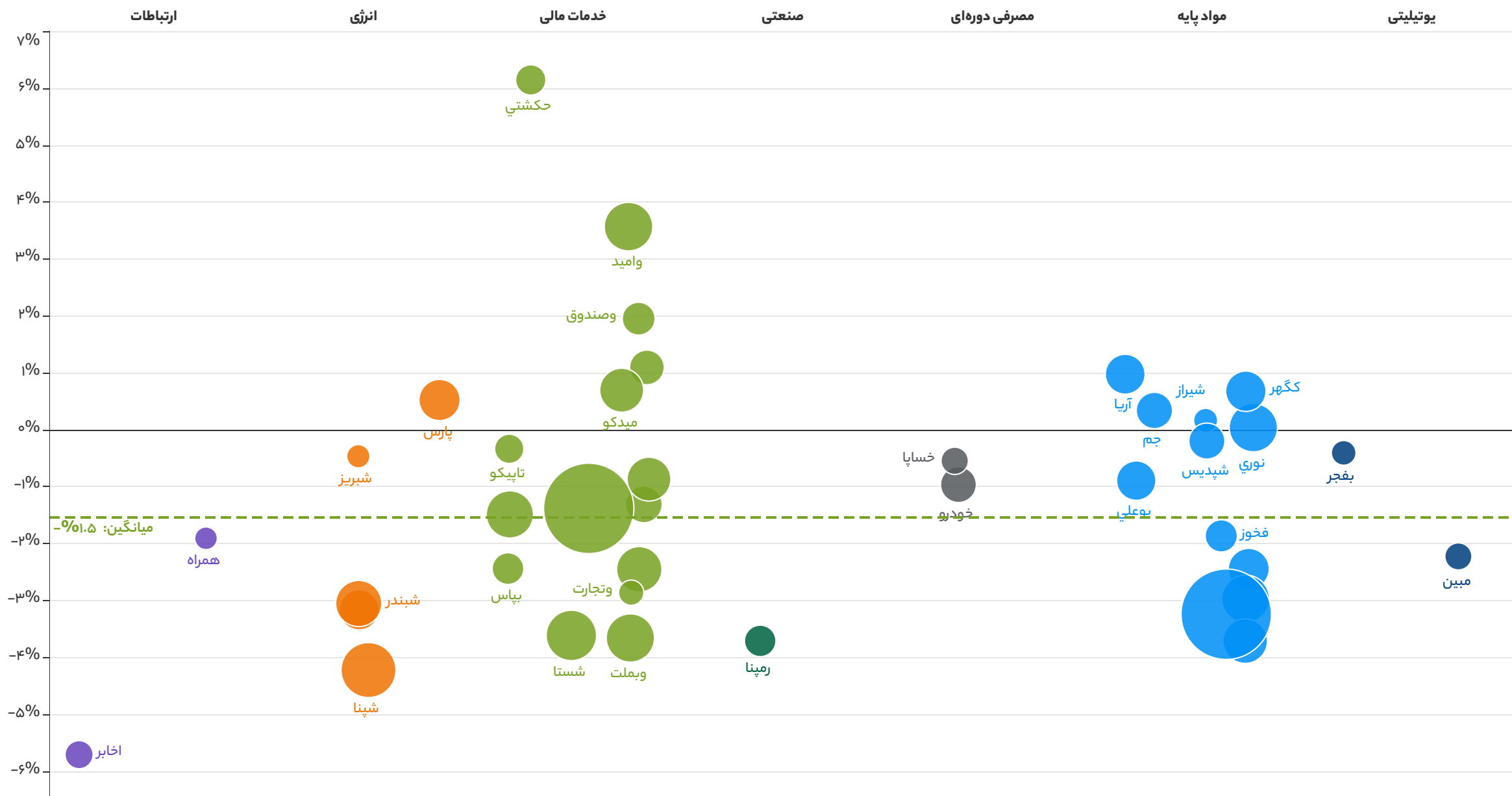


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



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



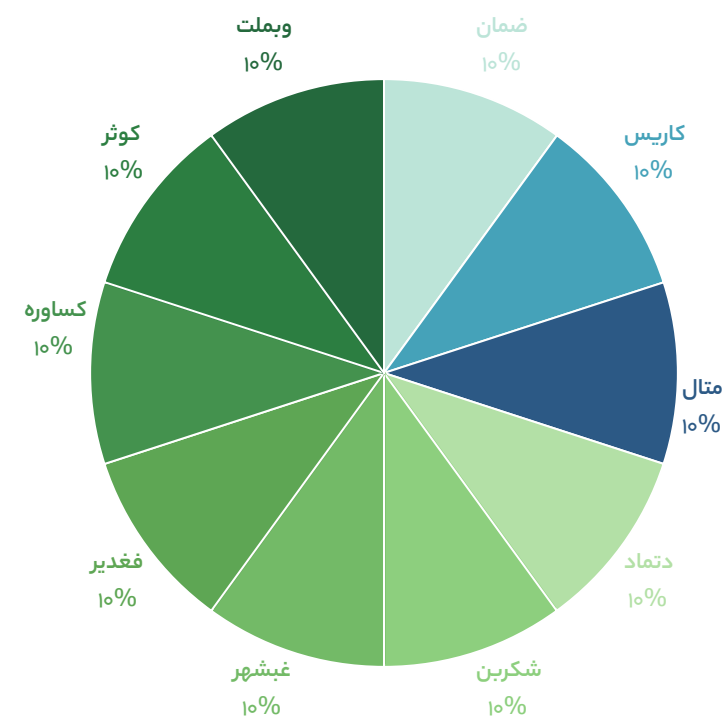
بازدهی تعدیل شده	حکشتی	وامید	وصندوق	وپاسار	آریا	میدکو	کگهر	پارس	چم	شیراز	نوری	شپدیس	تامیکو	بفجر	شبریز	خسپا	پارسان	بوعلی	خودرو	ومعادن	فارس	تاپیکو	فخوز	همراه	مبین	پاس	ماون	وغدیر	وتجارت	کگل	شبندر	شتران	فلمی	شستا	وبملت	رمپنا	کچاد	شپنا	اخابر
+۶.۲%	+۳.۶%	+۲.۰%	+۱.۱%	+۱.۰%	+۰.۷%	+۰.۷%	+۰.۵%	+۰.۴%	+۰.۲%	+۰.۲%	+۰.۱%	-۰.۲%	-۰.۳%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۰.۹%	-۰.۹%	-۰.۹%	-۱.۳%	-۱.۴%	-۱.۵%	-۱.۸%	-۱.۹%	-۲.۲%	-۲.۴%	-۲.۴%	-۲.۸%	-۳.۰%	-۳.۰%	-۳.۱%	-۳.۲%	-۳.۶%	-۳.۶%	-۳.۷%	-۳.۷%	-۴.۲%	-۵.۷%	



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۶۰,۲۵۰	نسبت (P/E) مناسب در صنعت	۷۸,۰۰۰	دتماد	میان مدت
۱۰%	۷,۷۲۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و پتانسیل تقسیم سود بالا	۱۰,۰۰۰	شکرین	
۱۰%	۲,۱۸۷	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۴۰۰	غبشهر	
۱۰%	۹,۴۰۰	بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب	۱۲,۰۰۰	فغدیر	
۱۰%	۱۹,۸۷۰	نسبت (P/E) مناسب	۲۴,۰۰۰	کساوره	
۱۰%	۲,۵۳۳	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا	۳,۳۰۰	کوثر	
۱۰%	۲,۳۷۲	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۳,۲۰۰	وبملت	
۱۰%	۱۶,۹۴۸	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	ضمان	
۱۰%	۲۴,۲۸۲	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب	-	کاریس	
۱۰%	۱۲,۴۰۰	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

