

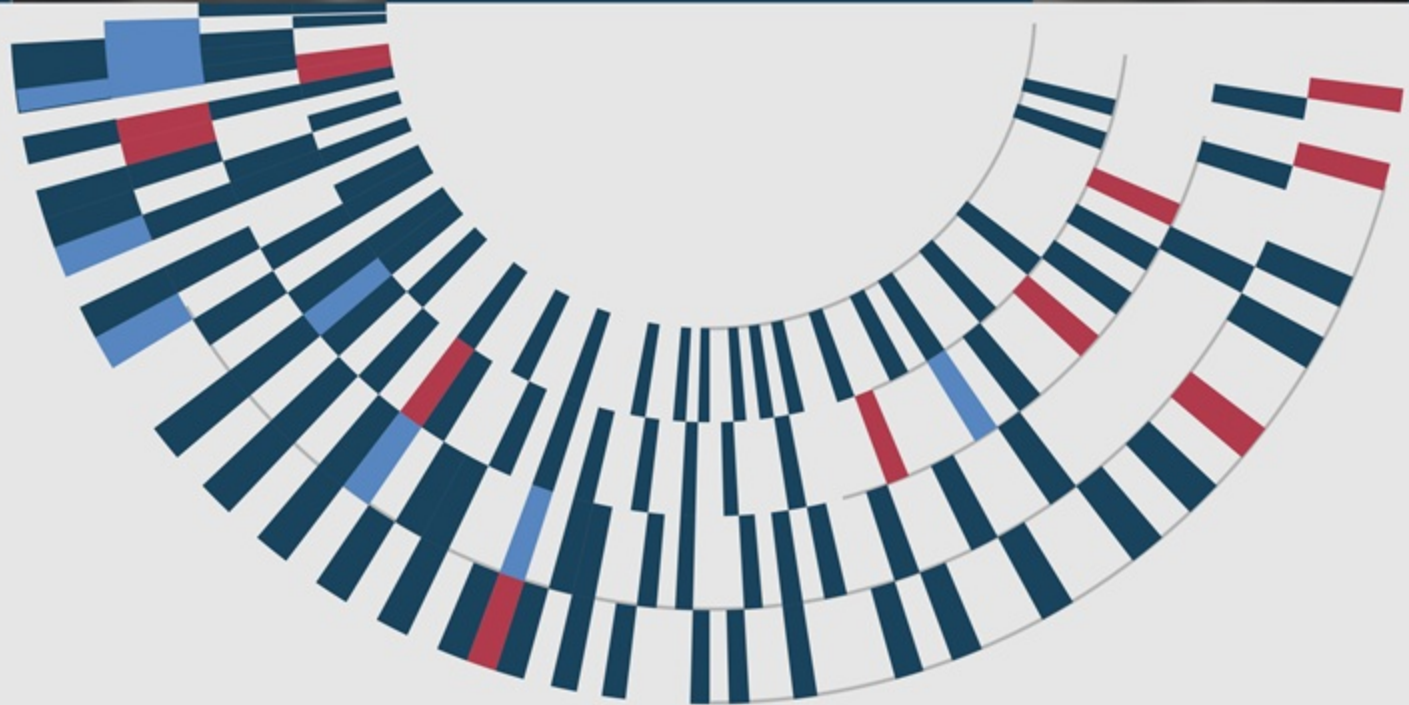


# کاریزماتیک

CHARISMATICK

## گزارش بازار سرمایه

شماره ۵۰ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۲۱





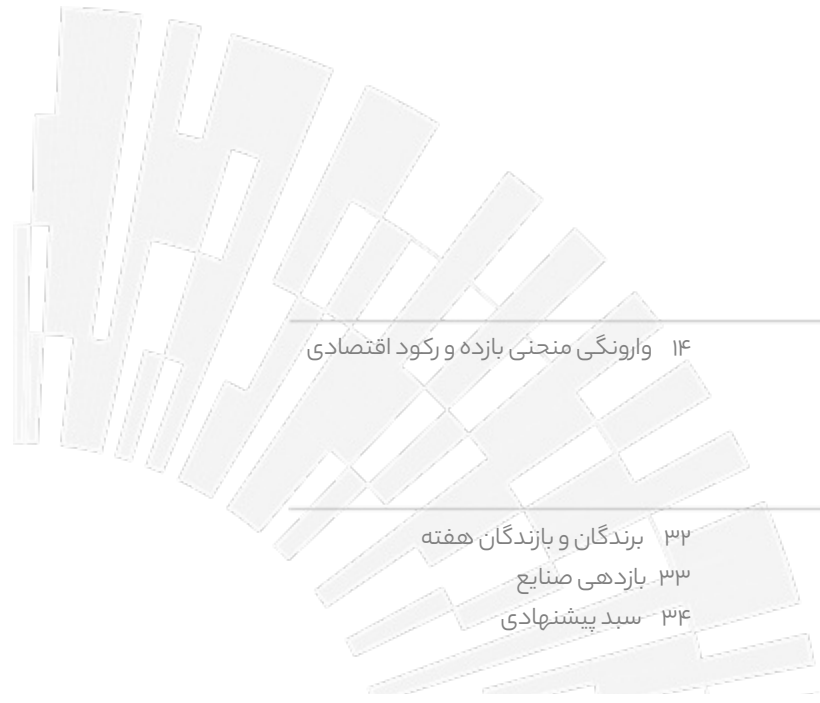
## معرفی گزارش:

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

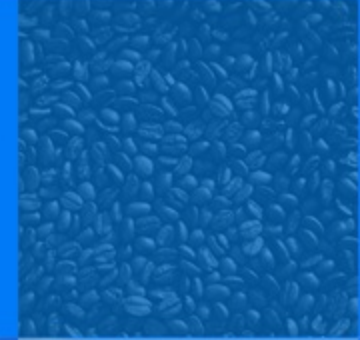
۱۵



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	۲,۳۶۴	+۲.۷%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۳۸۸	۲۱%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۱۰,۰۵۱	+۱.۲%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۱۰,۰۵۱	۲۴%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵۱۵,۵۰۰	-۲.۶%	فملی	بموتو، فباهنر	۳۲۵,۷۰۰ - ۵۲۹,۲۳۷	۴۱%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۴۵۵	-	فایرا	فنوال	۲,۱۰۲ - ۲,۴۵۵	۹%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۹۴۷	+۱.۲%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۲,۹۴۷	۲۶%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۲۳۶	+۰.۶%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۲۹۶	۸%
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۷۹	+۱.۱%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ - ۵۰۰	-۳%
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۰	-۰.۸%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۵۲۴	-۴%
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۱,۵۹۱	-۵.۰%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق	کوبیر، فوکا، فنورد	۱۸,۳۷۴ - ۲۳,۴۷۲	۴%
	اسلب (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۶۵	-۱.۶%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ - ۵۰۰	-۳%
	اسلب (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۰	+۰.۲%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۵۶۰	-۷%
	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	-	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۶۳۵	-۷%
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۴,۱۰۰	-۲.۰%	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ - ۲۵,۱۱۰	۴%
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۶۳	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ - ۶۱۳	-۶%
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۵۵	+۰.۴%	فولاد	-	۶۴۰ - ۷۱۸	-۶%



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	۱۱۶	-۰.۷%	-	-	۹۹ - ۱۴۳	۱۵%
	گندله سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۳۵	-۰.۴%	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	۵,۳۰۵	+۰.۹%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۴۰۰ - ۵,۳۰۵	۱۳%
	کنسانتره سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۲۴	-۰.۶%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۰۵ - ۱۵۳	۱۳%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۶۶۲	-۰.۵%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۳۸۲ - ۳,۷۸۷	۲۳%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۴۳	+۰.۲%	-	-	۱۹۹ - ۲۶۸	-۷%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۸۴	+۱.۸%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۲۵۲	-۲۳%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۴۵۸	-۱.۹%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۷%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۸۸	-	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸ - ۹۰۸	۱۳%



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	۳۰۳	+۲.۵%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ - ۳۰۹	۱۷%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۸۰	-۲.۰%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۱,۰۱۰	۸%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۸۸۰	۶%
پارازایلین	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۰	-۱.۲%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ - ۱,۱۵۸	۲%
ارتوزایلین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۰	-	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۴۰	-۱%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۴۵	-۰.۱%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۸۲	۷%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۴	-۲.۲%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۸۴	۳%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۵	+۰.۵%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۵۲	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۳۹۰	-۱.۴%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۴۵۰	۲%
مونواتیلن گلابکول	چین CFR	دلار/تن	۵۰۵	-۱.۴%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	۰%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۴۹	+۱.۱%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۴۹	۹%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۱	+۰.۹%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۹۸۵	-۲%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	+۰.۹%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۶۱	-۱%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۹۰	+۰.۸%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۸۹۰	۴%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۲۰	-۵%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ - ۸۸۵	-۲%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۷۰	-۰.۷%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۸۰	۱۲%

مواد شیمیایی

پلیمرها



عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تأثیر در فروش	تأثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۳	-۰.۱%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۴ - ۹۴	۷%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۸	+۰.۳%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۹ - ۹۱	۸%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۷	-۳.۸%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۷۹ - ۱۰۷	۵%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۳	+۱.۶%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۸۰ - ۱۲۵	۱۳%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۷۹	+۱.۳%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۳۷۳ - ۵۲۸	۲۴%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۲	+۲.۱%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۸۱ - ۱۲۴	۹%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۱۰	-۱.۲%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۴۵۲ - ۶۵۹	۱۳%
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	۳۶,۷۷۸	-۰.۴%	-	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۲۱,۷۹۵ - ۳۶,۹۴۳	۵۵%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۲۶۹	+۲.۱%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، شاولان	۱۲,۴۵۵ - ۲۲,۲۶۹	۷۳%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۴,۰۰۰	-	-	شپاس	۱۲,۰۸۶ - ۱۶,۴۹۹	-۶%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۰۸	+۱.۶%	-	ذوب، فروش	۱۸۸ - ۲۸۷	۶%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۷	+۰.۵%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	۰%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۵	-	-	-	۱.۲۱ - ۱.۳۱	۱%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۰,۶۶۸	-۳.۴%	-	-	۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	۱۲۷%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

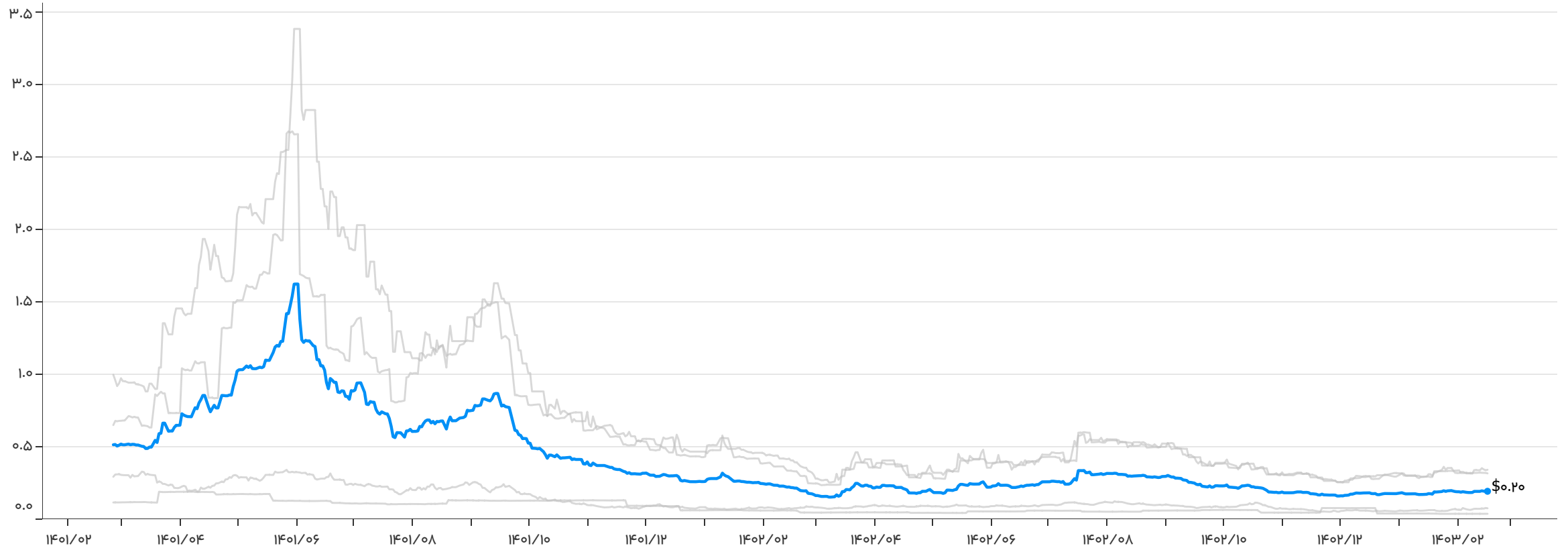
ارز و ارز دیجیتال



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	۰.۰۸	+۵.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۴%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۴	-	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۴ - ۰.۰۸	-۱۷%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۵	+۱.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۵%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	-۱.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۰.۶۱	۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۰	+۰.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۲%

### میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

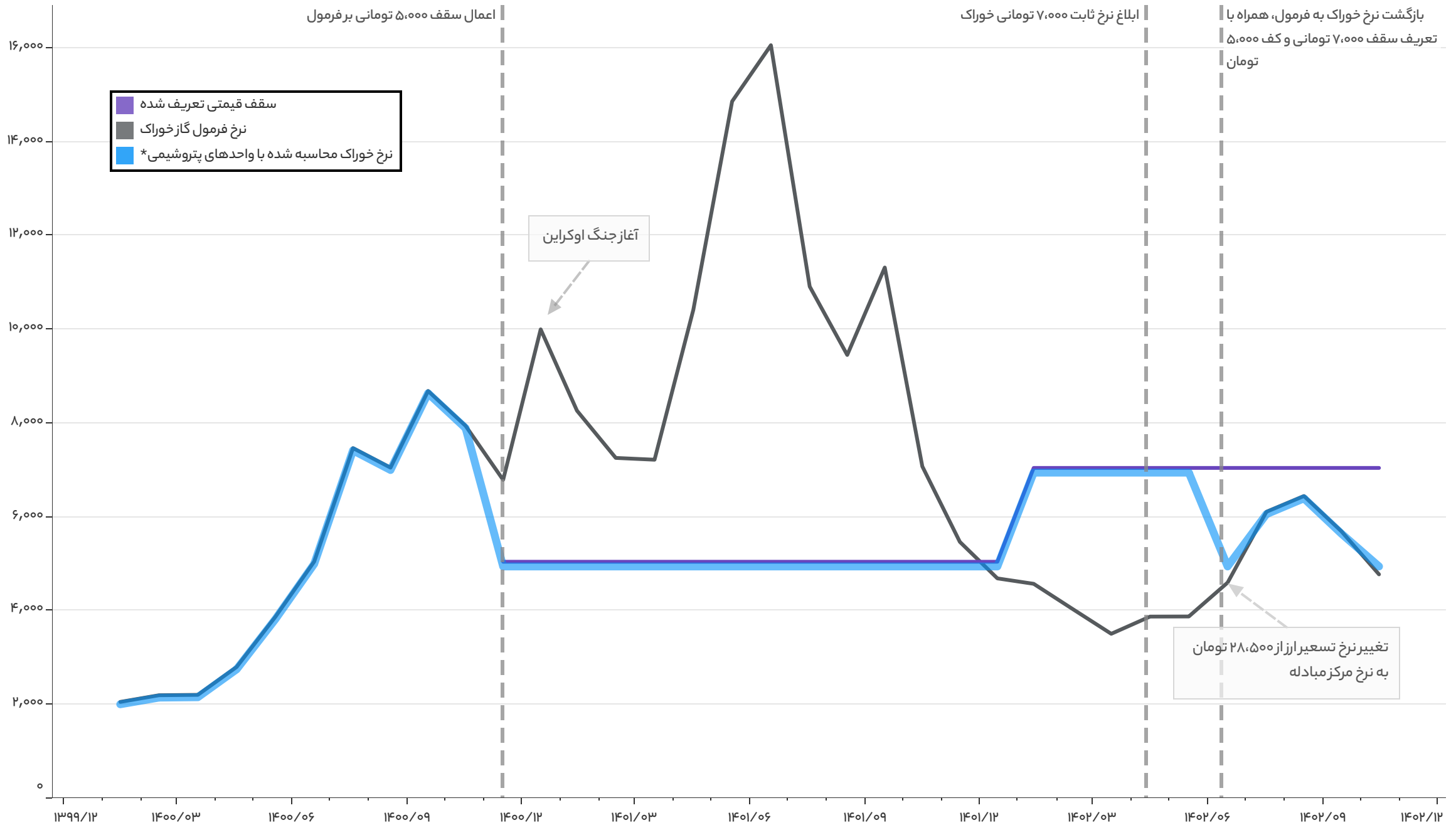
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





## 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

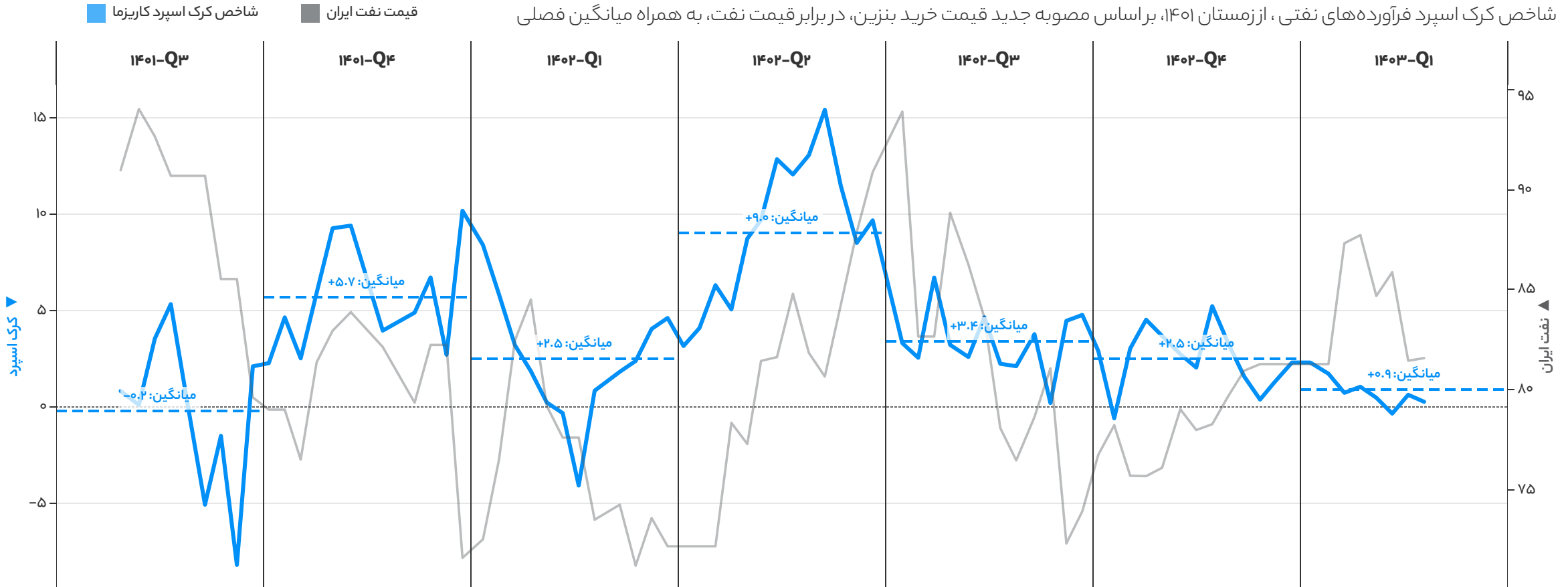


\* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد. - لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



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)		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	۸۱.۶								
گازوئیل	۹۳.۱	۱۰.۲	۱۱.۵	▲۱.۴	۱۹.۵	۱۲.۹	-۳۳.۷%		
بنزین**	۸۱.۸	۵.۳	۰.۲	▼۵.۱	۵.۰	۵.۷	+۱۲.۹%		
نفتا	۶۹.۰	-۱۱.۶	-۱۲.۶	▼۱.۰	-۹.۶	-۱۲.۰	-۲۵.۷%		
نفت کوره	۷۵.۶	-۶.۸	-۶.۰	▲۰.۹	-۱۵.۰	-۱۰.۵	+۲۹.۸%		
لوب کات***	۸۲.۸	-۰.۳	۱.۲	▲۱.۵	-۶.۴	-۴.۰	+۳۷.۵%		
وکیوم باتوم***	۴۸.۸	-۳۲.۷	-۳۲.۸	▼۰.۱	-۳۱.۹	-۳۳.۸	-۵.۹%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۰.۷	۰.۳	▼۰.۴	۲.۵	۰.۹	-۶۴.۲%		

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

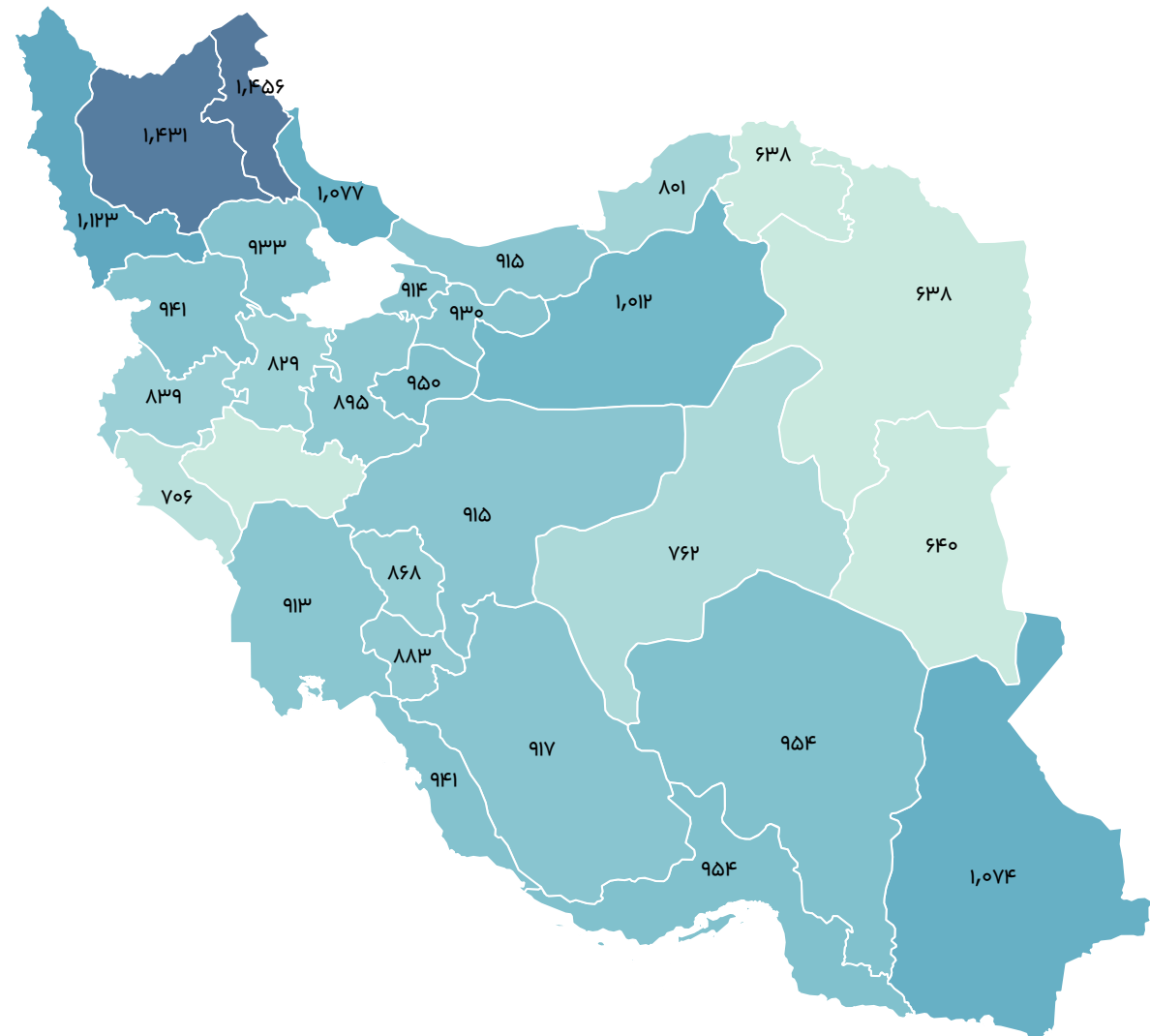
## آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس حجم معاملات، تومان به کیلوگرم

منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	سیمان تهران	۹۳۷	۹۳۰	-۰.۸%
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۱۶	۸۹۵	-۲.۲%
	البرز	سیمان آبیگ	۹۱۴	۹۱۴	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	قم	سیمان نيزار قم	۹۵۰	۹۵۰	-
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیمان..	۷۹۲	۷۶۲	-۳.۸%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۷۳	۱,۰۱۲	+۱۵.۸%
غرب	همدان	سیمان هگمتان	۸۴۶	۸۲۹	-۲.۱%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۱۳	۹۱۳	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۷۰	۸۳۹	-۳.۶%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۶۸	۸۶۸	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۸۸۳	+۰.۴%
	لرستان	سیمان دورود	۸۳۱		
	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۴۱	-
شمال	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۷	۹۱۵	-۰.۲%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۸۱۸	۸۰۱	-۲.۰%
	گیلان	سیمان خزر	۱,۰۲۳	۱,۰۷۷	+۵.۳%
شمال غرب	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۳۴۴	۱,۴۵۶	+۸.۴%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۱,۱۲۷	۱,۱۲۳	-۰.۴%
شمال شرق	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۲۷۸	۱,۴۳۱	+۱۱.۹%
	زنجان	سیمان خمسه	۱,۰۱۹	۹۳۳	-۸.۴%
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
جنوب	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۴۳	۶۴۰	-۰.۵%
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۹۵۴	۹۵۴	-
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۱۷	-
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۴۱	۹۴۱	-
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۱,۰۳۵	۹۵۴	-۷.۸%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۵۴	۱,۰۷۴	+۱۲.۶%

## 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 تپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (براساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

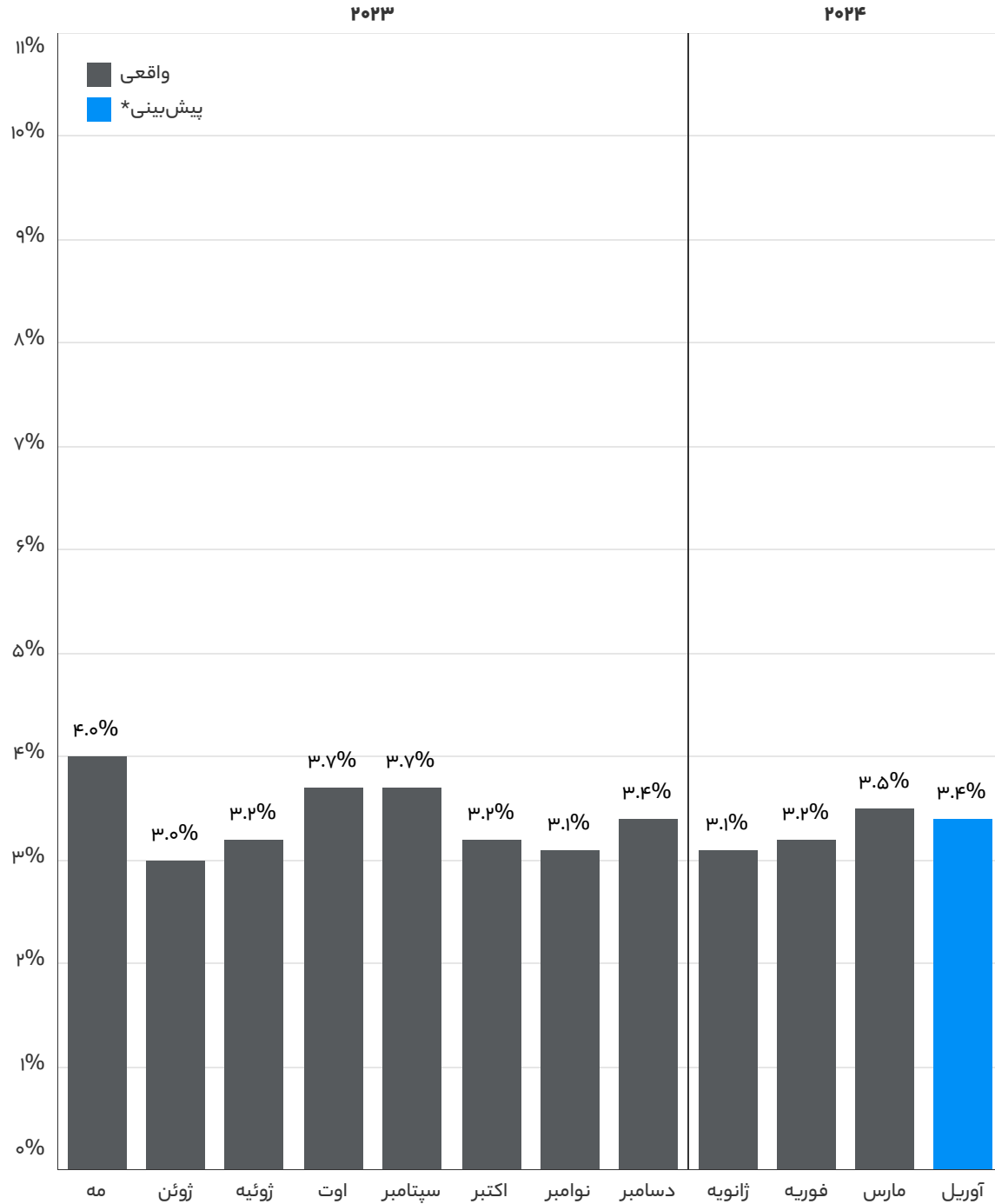
## معادن و فلزات

## انرژی

- ▼ قیمت انس طلا طی دو هفته اخیر بیش از ۱۰۰ دلار کاهش یافته است. طلا در معاملات روز جمعه ۱۴ اردیبهشت نیز به دنبال انتشار اطلاعات اقتصادی آمریکا، کاهش یافت. قیمت هر اونس طلا روز جمعه با ۰.۰۹ درصد کاهش به ۲۳۰۱.۷۴ دلار رسید. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک کاهش ۰.۰۴ درصدی به ۲۳۰۸.۶۰ دلار رسیده است. بالا ماندن نرخ بهره هزینه نگهداری طلا به عنوان یک سرمایه غیرسودده را افزایش داده و تمایل برای خرید آن را پایین می‌آورد. در میان سایر فلزات گران‌بها، قیمت نقره با ۰.۵۲ درصد کاهش به ۲۶.۶۹ دلار رسید و پلاتین با یک افزایش ۰.۲۸ درصدی، ۹۵۷.۴۴ دلار معامله می‌شود.
- در بیست و چهارمین جلسه حراج شمش طلا که روز ۱۸ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ در مرکز مبادله ایران برگزار شد، ۳۱۹ کیلو گرم شمش طلای استاندارد با عیار ۹۹۵ در هزار معامله شد. از مجموع ۴۱۰ کیلوگرم شمش طلای عرضه شده در حراج های عمده و خرد تالار معاملات طلای این مرکز، ۳۱۹ کیلوگرم با میانگین قیمت چهار میلیارد و ۴۴۳ میلیون تومان به ازای هر شمش طلای استاندارد معامله شد. گفتنی است، در مجموع ۲۴ جلسه حراج حضوری مرکز مبادله ایران، حدود ۳.۵ تن شمش طلا مورد معامله قرار گرفته است.
- یک تولیدکننده سیمان اعلام کرد: ارزان فروشی سیمان صادراتی باعث شد بعد از عراق، کشور امارات عربی متحده نیز واردات سیمان و کلینکر از ایران را به استناد قوانین ضد دامپینگ با گذاشتن تعرفه گمرکی ۶۷ درصدی عملاً ممنوع نماید. ابراهیم غلامزاده با ابراز اینکه "متأسفانه با سیاست‌گذاری‌های اشتباه در بازار صادراتی عراق باعث از دست رفتن این بازار بزرگ شده‌ایم."، گفت: در زمان حاضر علاوه بر کشور امارات، سایر کشورهای عربی حوزه خلیج فارس همچون کویت و عمان نیز در صدد اعمال محدودیت به استناد قوانین ضد دامپینگ هستند.
- ▲ به گزارش رویترز، به دنبال نشانه‌های بهبود اقتصاد چین و بی‌نتیجه ماندن مذاکرات برای آتش‌بس بین اسرائیل و حماس قیمت نفت به روند افزایشی خود ادامه داد. قیمت هر بشکه نفت برنت روز جمعه ۲۱ اردیبهشت با ۴۸ سنت معادل ۰.۵۷ درصد افزایش به ۸۴.۳۶ دلار رسید. نفت سبک آمریکا هم با ۵۲ سنت معادل ۰.۶۶ درصد افزایش ۷۹.۷۸ دلار معامله می‌شود. انتشار اطلاعات مربوط به افزایش واردات نفت خام چین در ماه آوریل و همچنین بالا رفتن احتمال کاهش نرخ بهره فدرال رزرو به دنبال ضعف بازار اشتغال آمریکا، قیمت نفت را به بالاترین رقم طی ده روز گذشته رسانده 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 می‌تواند به تامین نفت ارزان قیمت‌تر برای کارخانه‌ها و واحدهای تولیدی این کشور انجامیده و در نتیجه، قیمت تمام شده محصولات صادراتی نیز کاهش خواهد یافت. چنین موضوعی می‌تواند منجر به تصاحب بیشتر بازارهای جهانی توسط شرکت‌های 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 می‌شود که دانش فنی و توانمندی تولید آن را داریم. اوجی از امضای تفاهم‌نامه با شرکت‌های تولید متانول برای تولید بنزین خبر داد و گفت: در خصوص تولید بنزین در مجتمع‌های پتروشیمی، به ویژه پتروشیمی‌هایی که متانول تولید می‌کنند، با شرکت‌های ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی و صنایع پتروشیمی برنامه‌ریزی‌هایی شده و تفاهم‌نامه‌ای با شرکت‌های تولید متانول امضا شده است تا با تولید بنزین از متانول، به رفع ناترازی بنزین کمک کنند.
- مدیرعامل شرکت ملی نفت گفت: ۲.۵ میلیارد بشکه معادل نفت خام، مجموع ذخایر جدید اکتشافی در دولت سیزدهم بوده است، حدود ۸ مخزن نفتی و گازی کشف جدید ما بوده و یک کشف بسیار مهم هم اخیراً داشتیم که به زودی از طرف وزیر نفت اعلام خواهد شد. وی افزود: ما در گذشته نفت تولید می‌کردیم ولی نمی‌فروختیم، اما امروز هم تولید می‌کنیم و هم می‌فروشیم و در سال گذشته ۳۵ میلیارد دلار درآمد صادرات نفتی داشتیم.
- عضو کمیسیون انرژی مجلس شورای اسلامی گفت: امسال حدود پنج میلیارد دلار برای واردات بنزین و گازوئیل پیش بینی شده که بخش زیادی از درآمدهای کشور را از بودجه عمومی کشور به خود اختصاص می‌دهد. مالک شریعتی در حاشیه نمایشگاه نفت در جمع خبرنگاران با اشاره به سیستم ناعادلانه توزیع بنزین در کشور، گفت: این مساله موجب افزایش قاچاق در کشور شده است یعنی بنزین ۳۰ تا ۴۰ هزار تومانی را وارد می‌کنیم و با قیمت ۱۵۰۰ و ۳۰۰۰ هزار تومان عرضه می‌کنیم که در مرزهای شرقی کشور قاچاق می‌شود که کمترین آمار رسمی که توسط دستگاه‌های ناظر اعلام شده بیانگر قاچاق روزانه پنج میلیون لیتر بنزین و ۱۰ میلیون لیتر گازوئیل است.

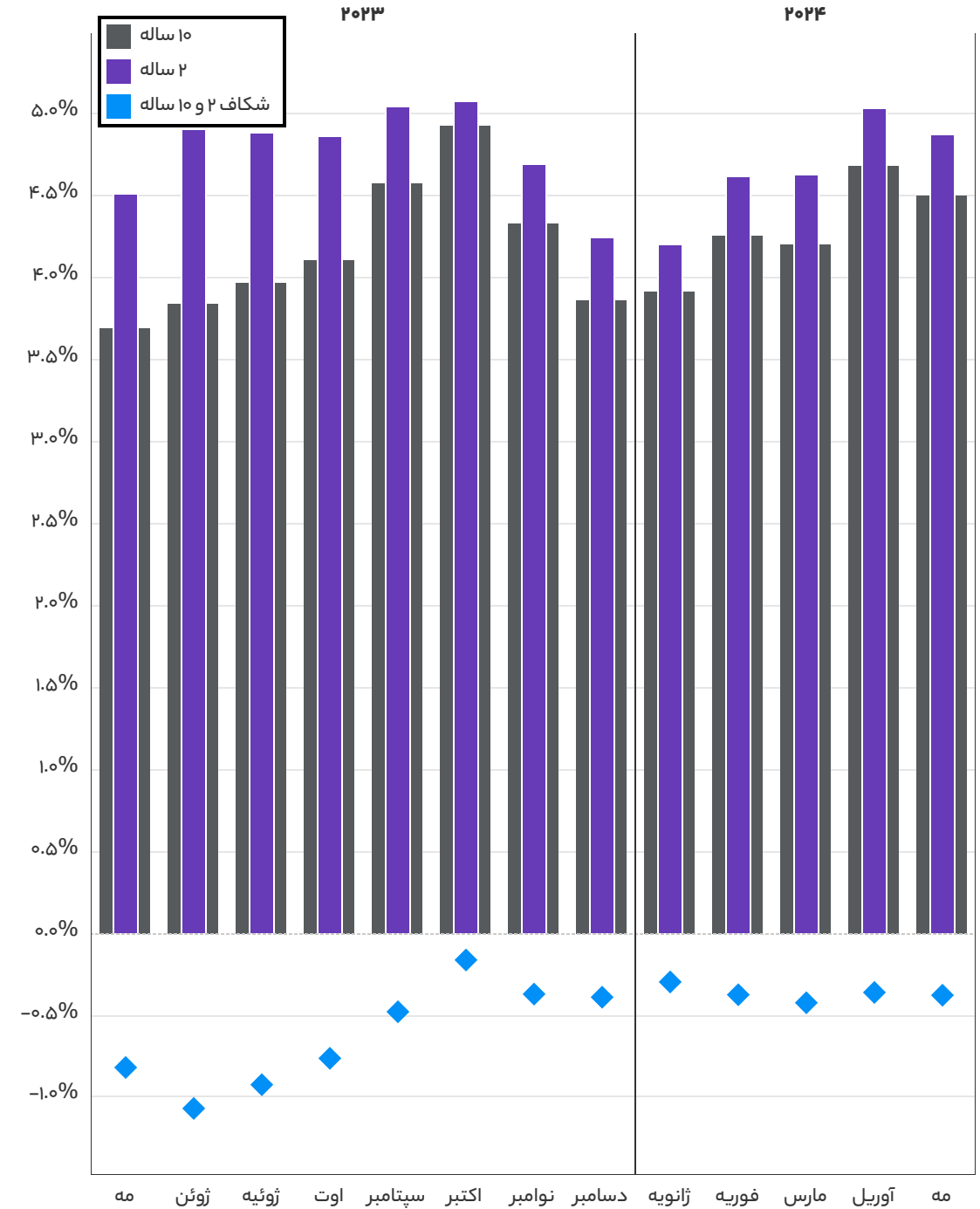
## شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



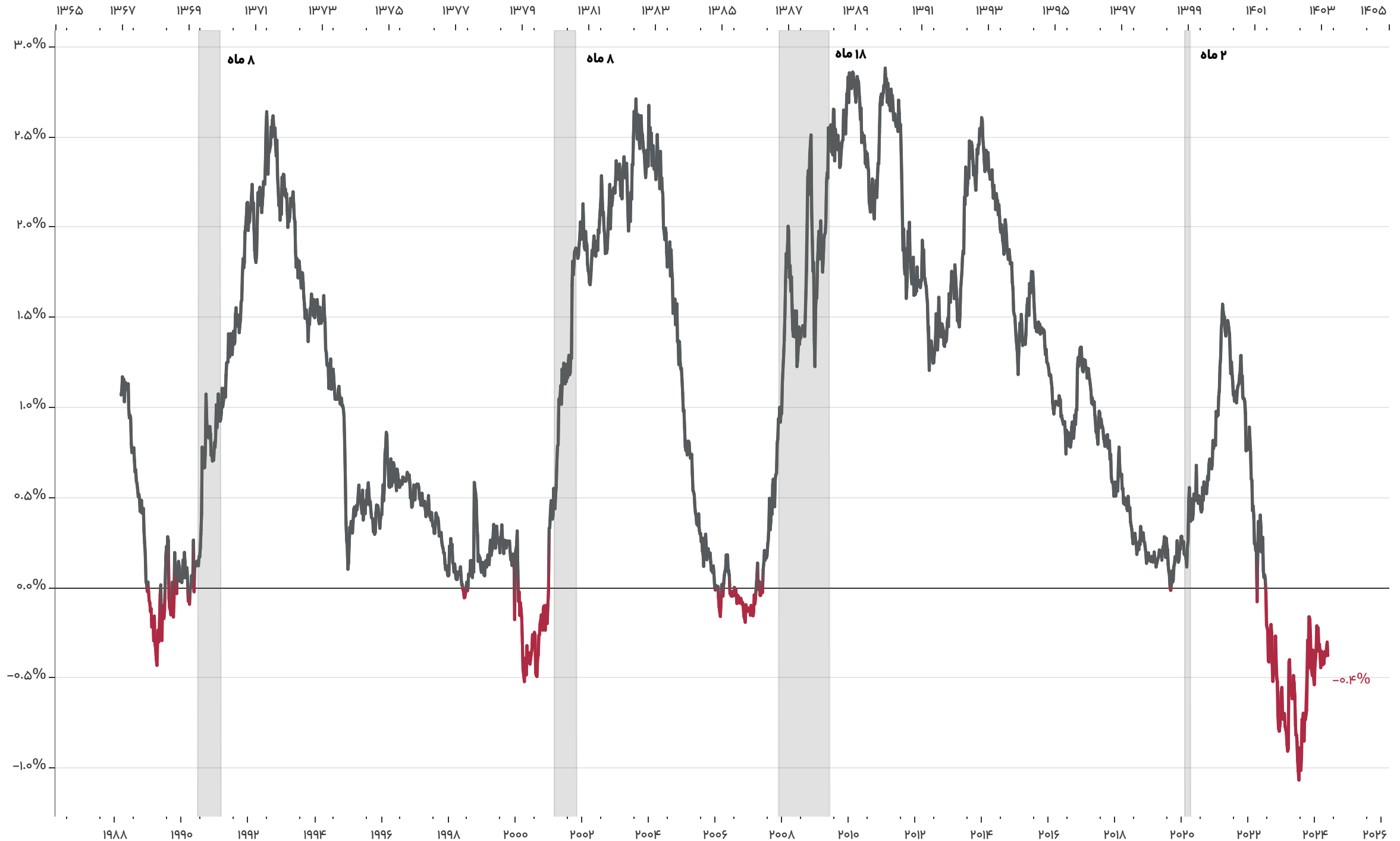
## وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

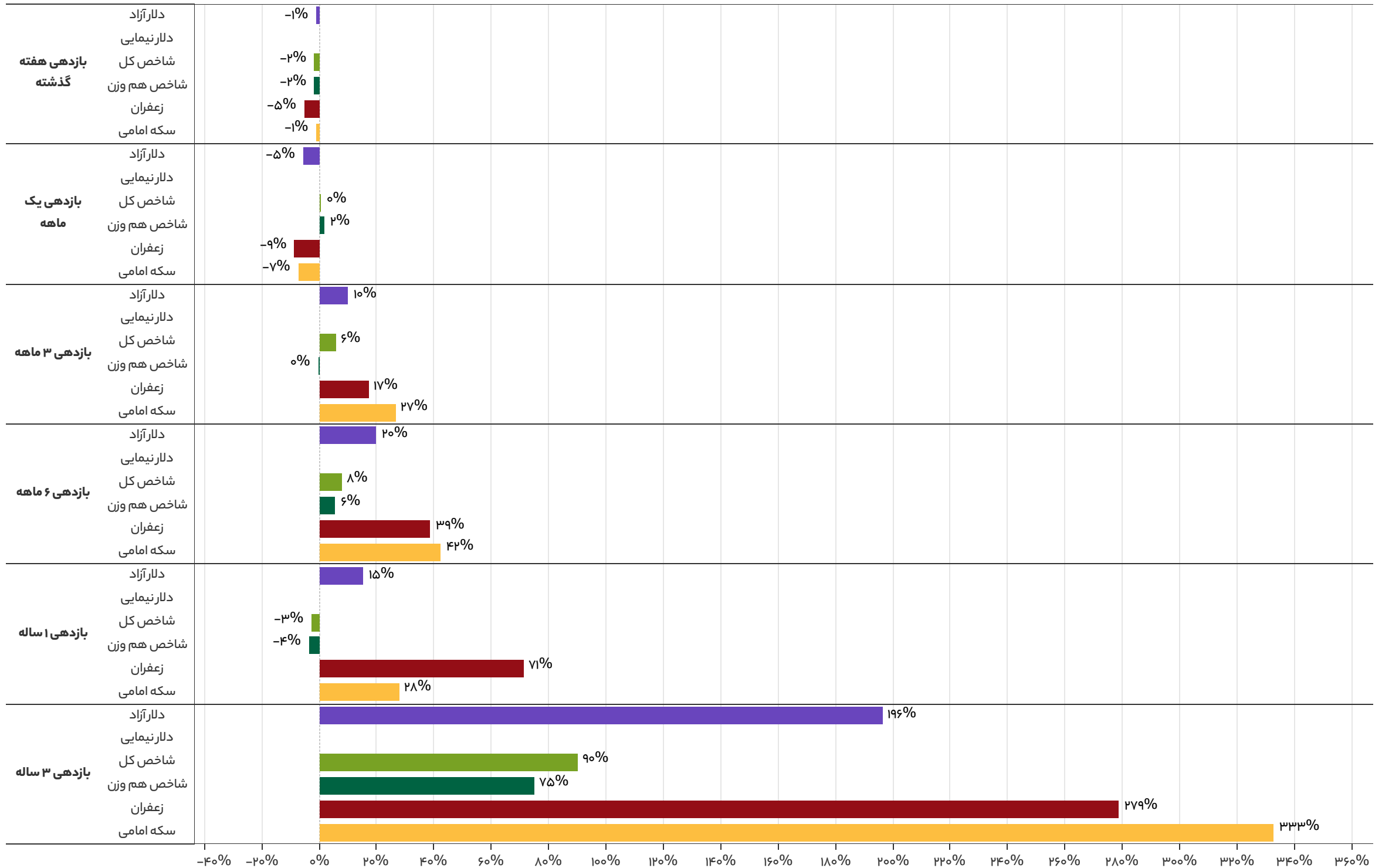
EQUITY MARKET

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

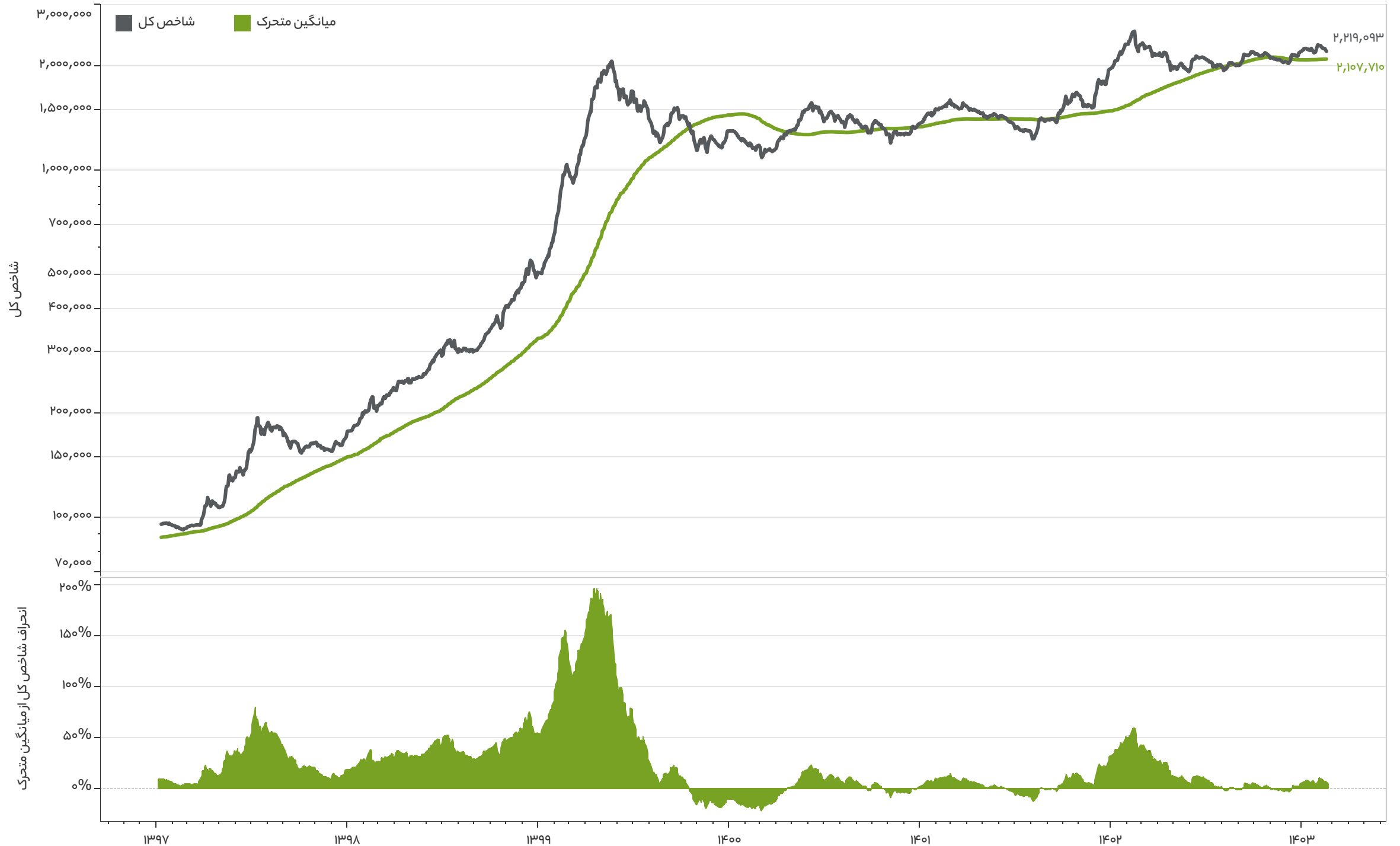
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





## شاخص کل و میانگین متحرک

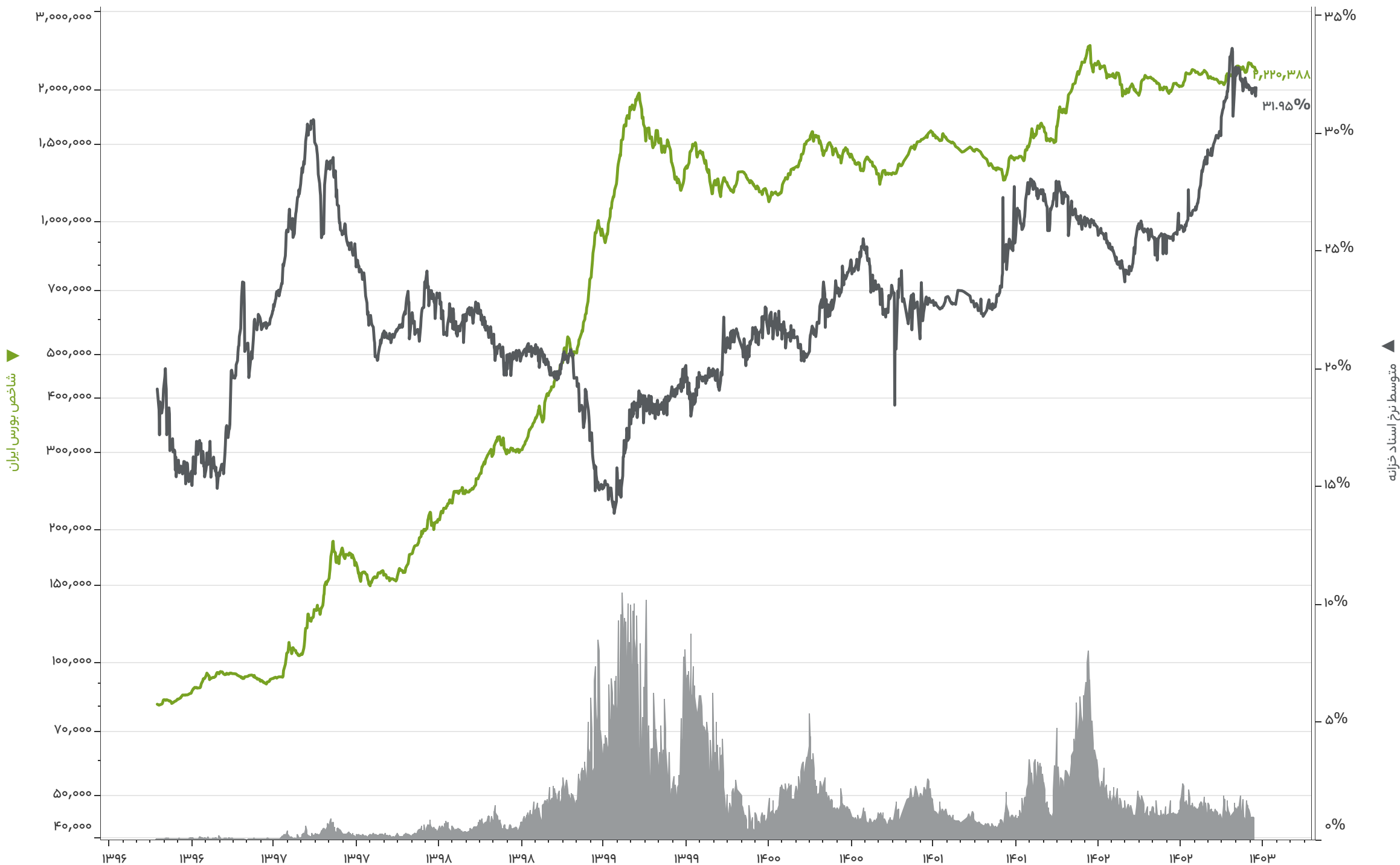
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





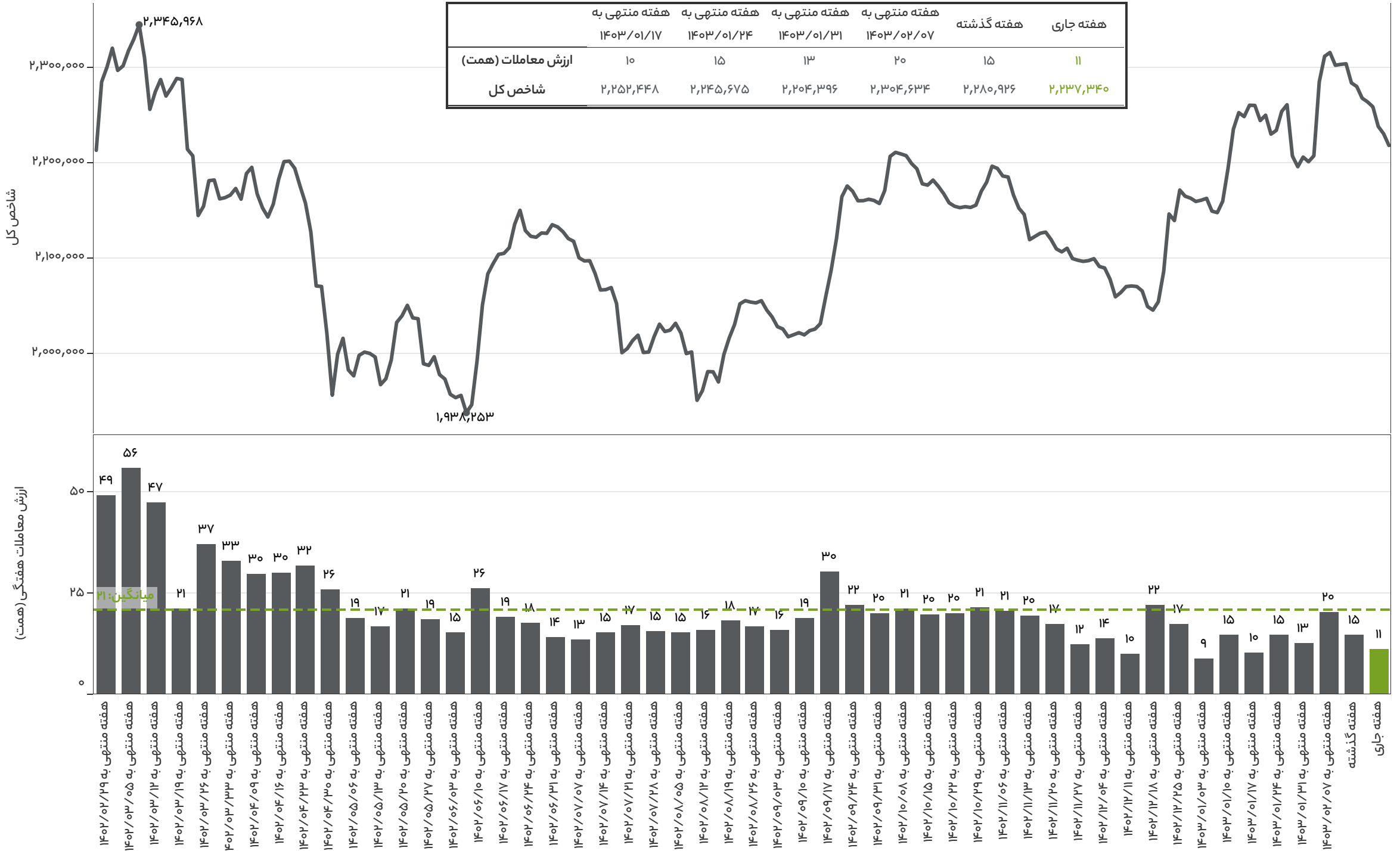
## تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

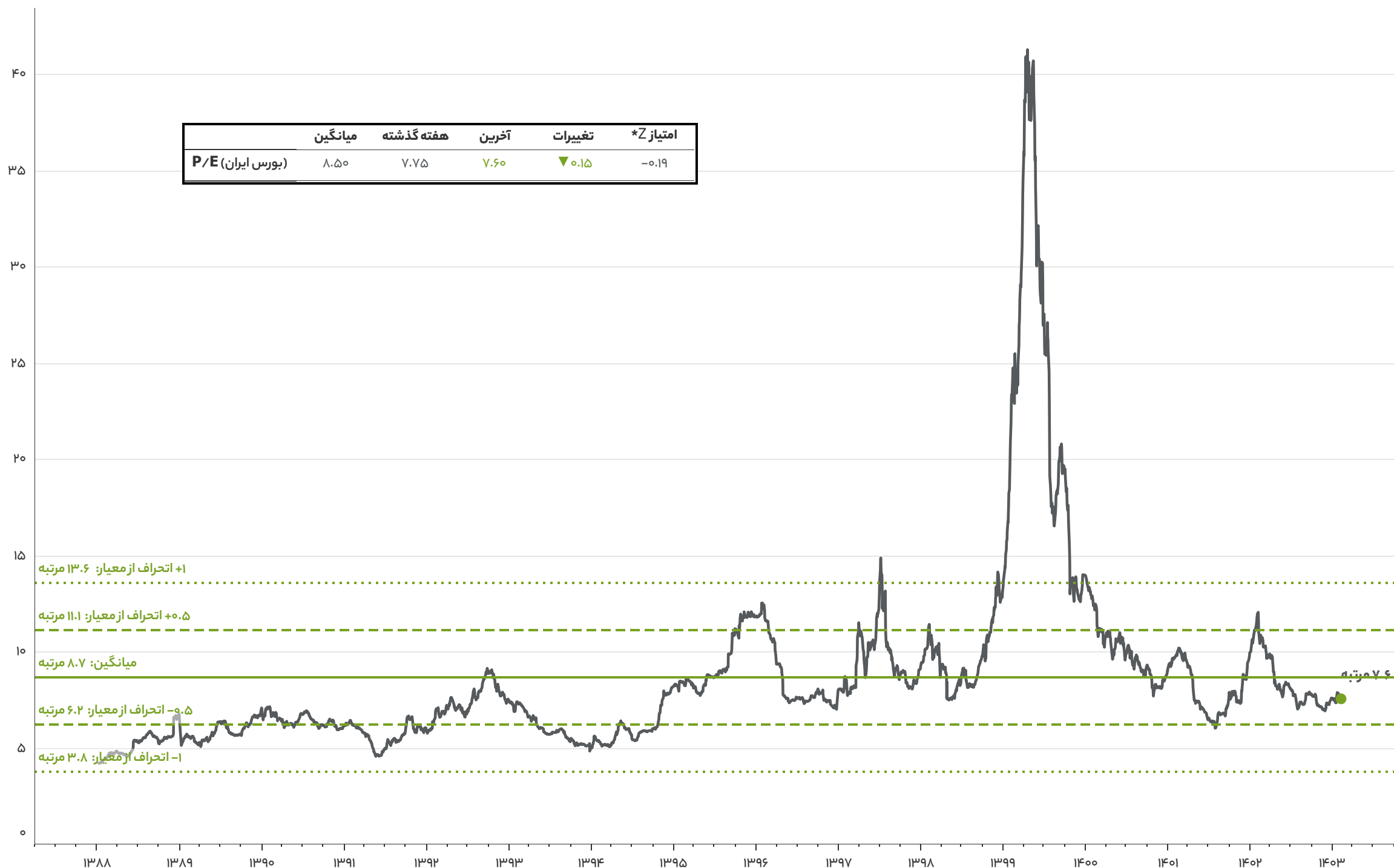
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





## 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.



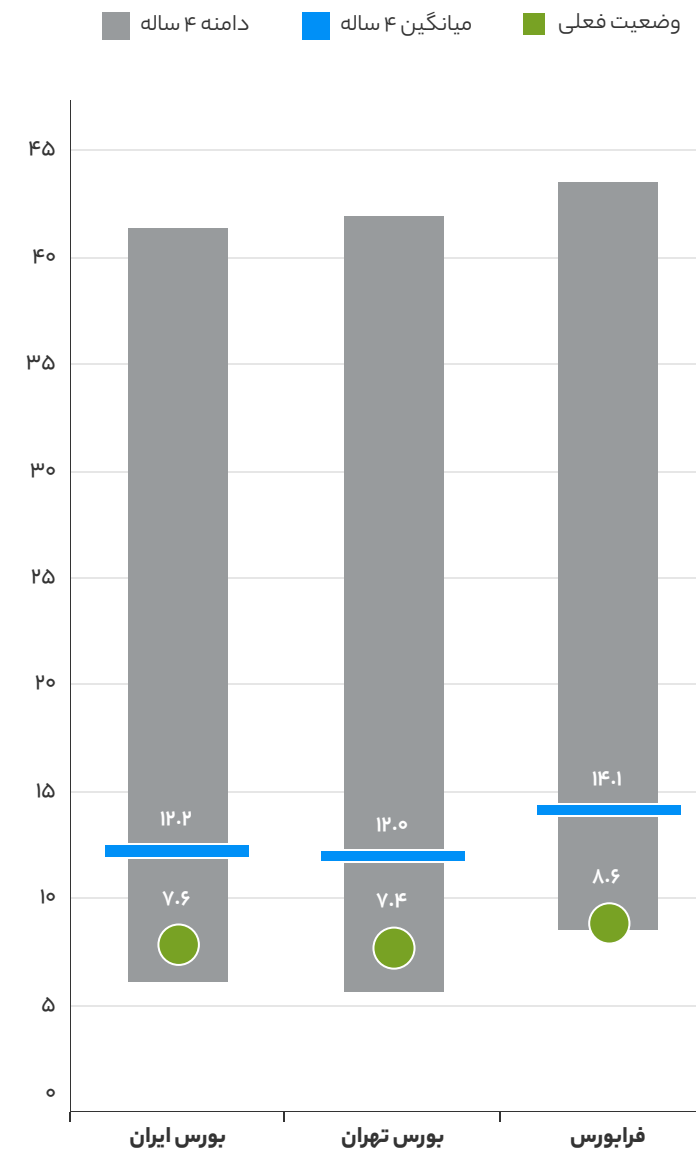
## ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۷.۶۰	۷.۷۵	۶.۰۷	۱۲.۲۰	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۴۴	۷.۶۰	۵.۶۴	۱۲.۰۱	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۵۶	۸.۷۱	۸.۵۶	۱۴.۱۱	۴۳.۵۱

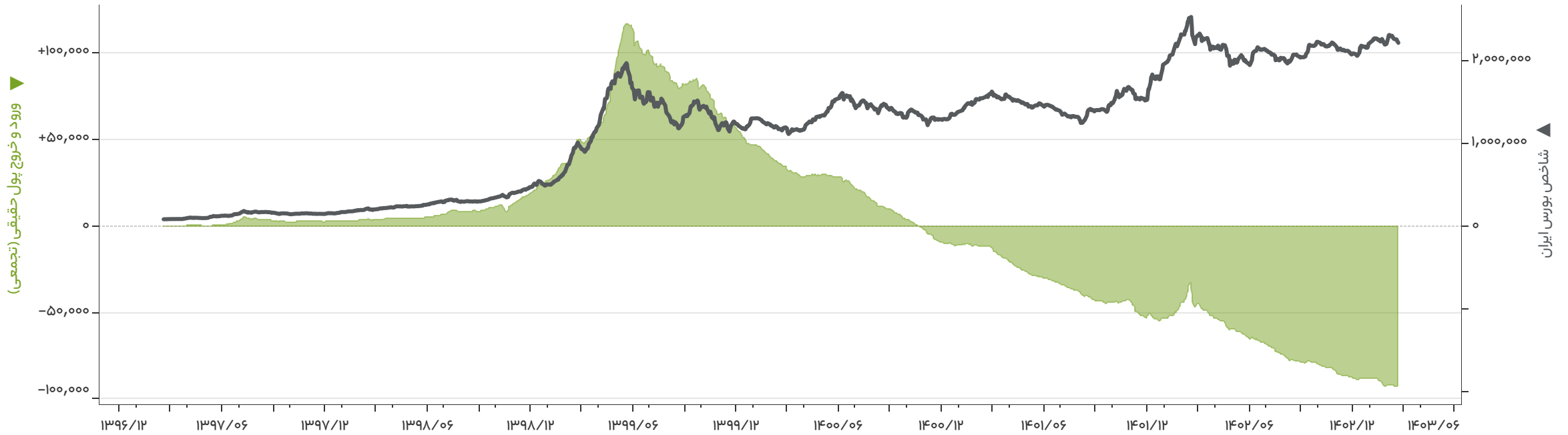


## بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۵۶۱	۳,۲۰۹	۶۵۳	۳۷۴	۲۱۳	۱۹۰	۱۵۰	۱۲۲	۱۰۴	۹۷	۶۰	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۴۰.۸%	۳۶.۷%	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	۷.۸	۷.۳	۴.۸	۴.۵	۹.۵	۹.۶	۸.۹	۱۸.۰	۱۰.۹	۱۳.۳	۱۹.۲	سودآوری
بازده سود نقدی	۸.۸%	۹.۳%	۱۳.۸%	۳.۴%	۴.۸%	۳.۷%	۹.۱%	۲.۸%	۳.۸%	۱۵.۵%	۳.۹%	
نسبت تقسیم سود	۷۲%	۶۱%	۶۳%	۳۳%	۵۱%	۳۹%	۶۹%	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)	+۱۰۶۰%	+۸۵۸%	+۸۴۷%	+۸۶۳%	+۴۲۴%	+۴۳۳%	+۳۷۲%	+۳۲۹%	+۱۱۲%	+۸۷%	+۷۰۳%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۷۹%	۰%	+۲۳%	-۱۳%	-۹%	-۷%	+۱۲%	+۷%	-۶۶%	+۱۳۷%	+۱۳%	
بازده از ابتدای سال	+۱۰۲%	+۶۹%	+۱۰۱%	+۹۱%	+۵۶%	+۱۰۶%	+۸۸%	+۸۶%	+۳۶%	+۵۶%	+۲۵۹%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	-۲%	-۳%	-۳%	-۲%	-۲%	-۱%	-۱%	-۲%	-۲%	-۳%	

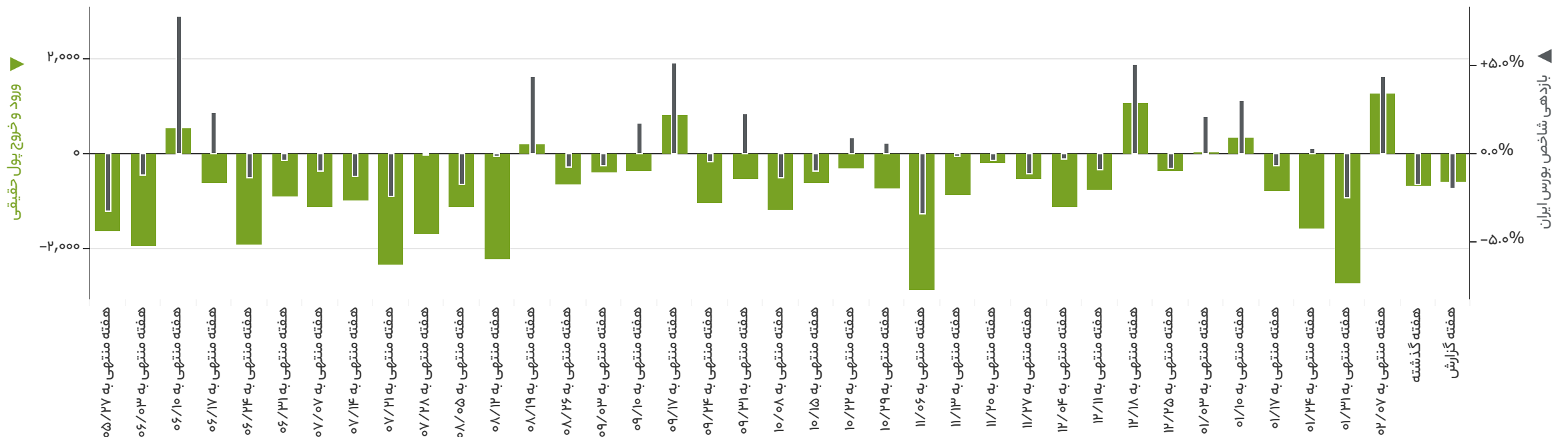
## ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



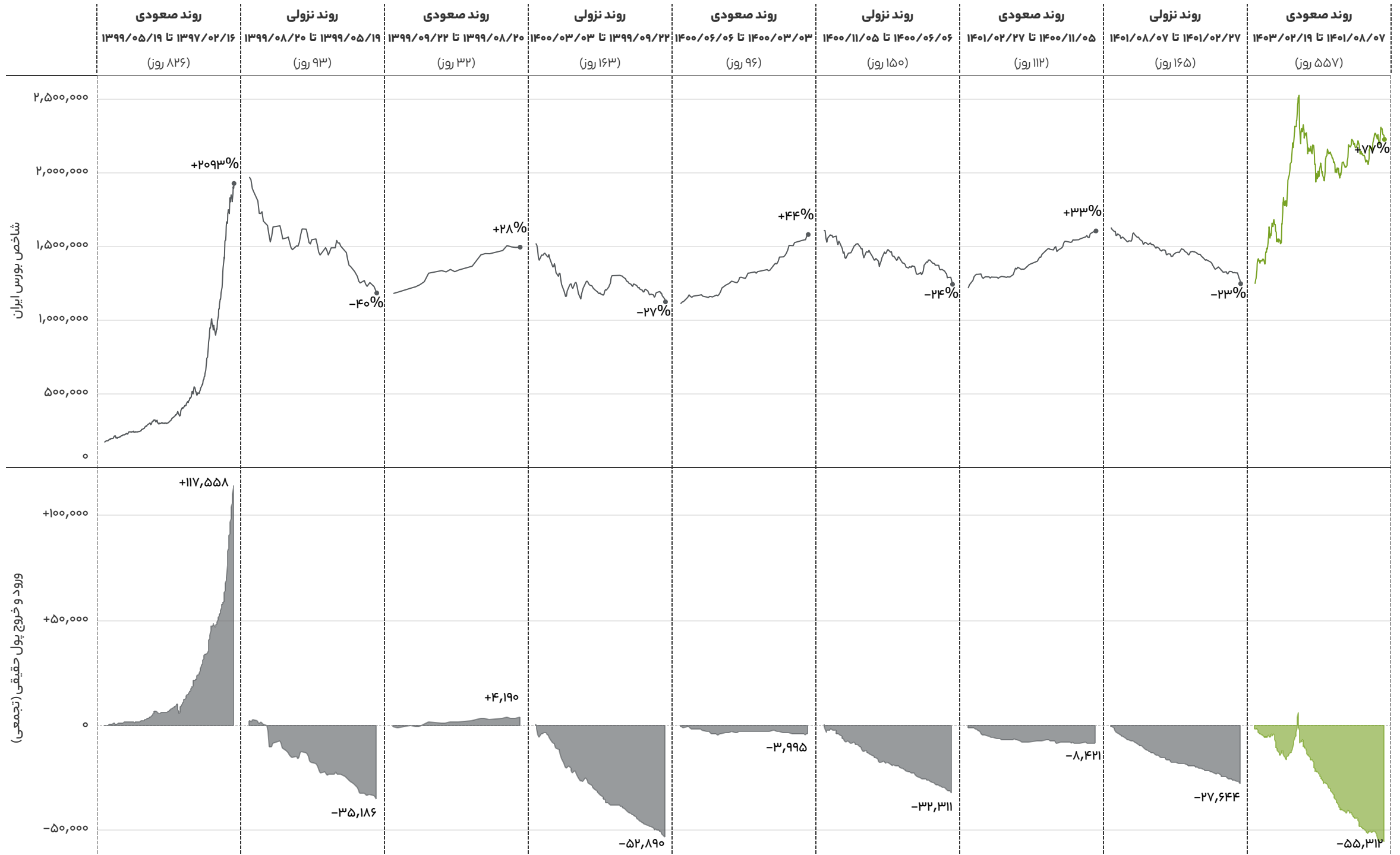
## ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



## ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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



## تغییر مالکیت شرکت

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

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	تغییر مالکیت شرکت	
			بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	بیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی
توسن	نرم افزار و خدمات	۴.۰	+۲.۹%	
کاذر	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱.۲	+۱.۷%	
وتوس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴.۸	+۱.۶%	
درازک	دارویی	۲.۳	+۰.۷%	
غفارس	محصولات لبنی	۲.۲	+۰.۶%	
کترام	کاشی و سرامیک	۱.۱	+۰.۴%	
وطوبی	سرمایه گذاری	۰.۸	+۰.۴%	
خاهن	قطعات خودرو	۷.۶	+۰.۴%	
خبنيان	قطعات خودرو	۳.۰	+۰.۴%	
حفارس	حمل و نقل بارزمینی	۳.۸	+۰.۴%	
خکمک	قطعات خودرو	۱.۷	+۰.۳%	
غبشهر	محصولات کشاورزی	۷.۶	+۰.۳%	
غگلیا	محصولات لبنی	۱.۹	+۰.۳%	
شرنگی	مواد شیمیایی-متنوع	۲.۱	+۰.۳%	
لسرما	ماشین الات	۰.۸	-۰.۳%	
سدور	سیمان، اهنک و گچ	۰.۹	-۰.۳%	
داوه	دارویی	۱.۰	-۰.۳%	
واتوس	سرمایه گذاری	۰.۴	-۰.۳%	
ولتجار	لیزینگ	۱.۲	-۰.۴%	
غالبر	محصولات لبنی	۳.۲	-۰.۴%	
ثپردیس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴.۰	-۰.۵%	
کماسه	سایر مواد معدنی	۲.۱	-۰.۵%	
دکوثر	دارویی	۲.۸	-۰.۵%	
ولانا	لیزینگ	۰.۳	-۰.۶%	
ثامان	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱.۲	-۰.۶%	
فولای	آهن و فولاد	۰.۸	-۰.۷%	
فکمند	محصولات فلزی	۱.۳	-۱.۰%	
وجامی	سرمایه گذاری	۰.۶	-۱.۶%	

## ورود و خروج پول حقیقی

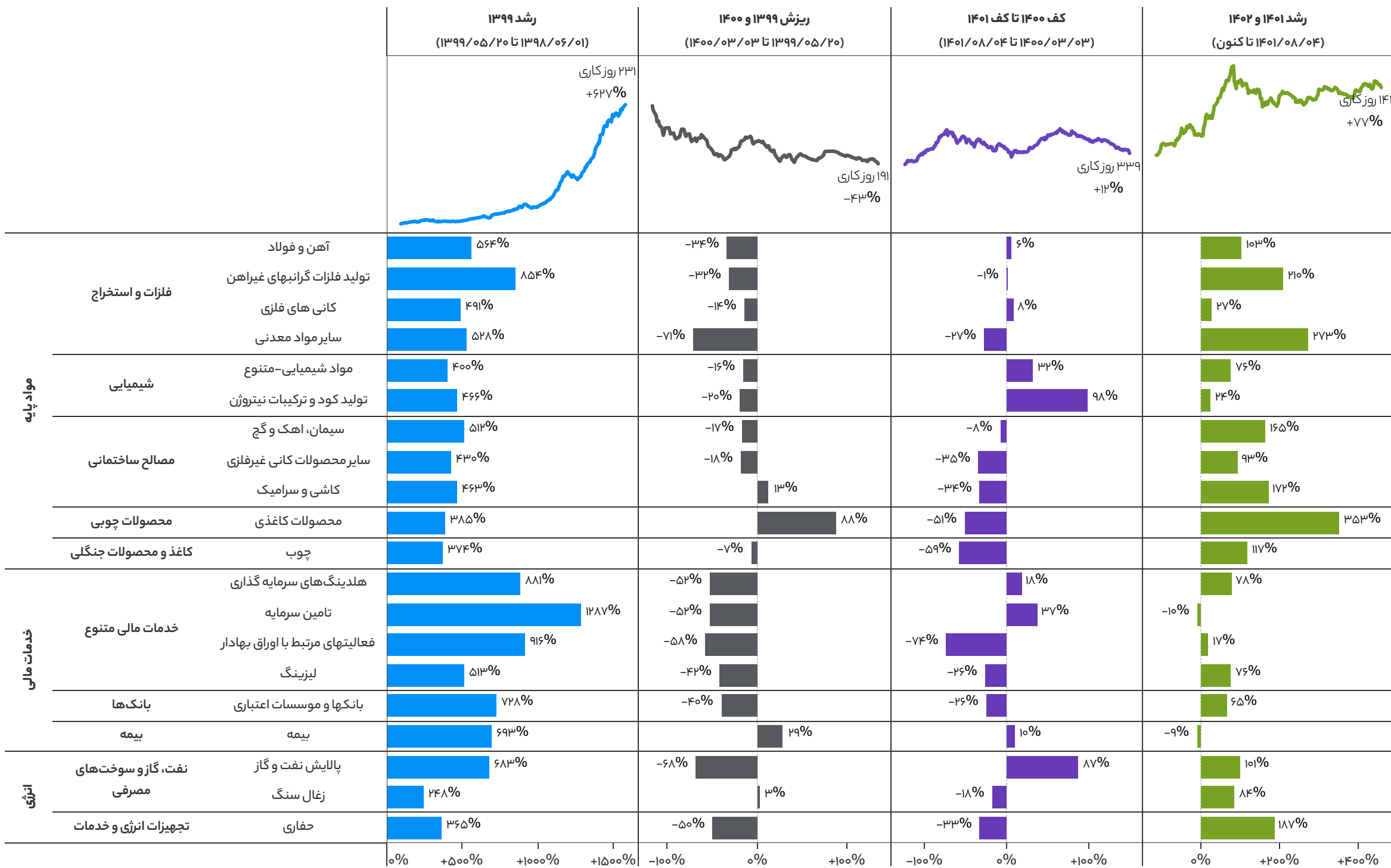
طی دوره گذشته، میلیارد تومان، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
			بیشترین ورود پول حقیقی	بیشترین خروج پول حقیقی
توسن	نرم افزار و خدمات	۴	+۱۱۲	
وتوس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۵	+۶۹	
خاهن	قطعات خودرو	۸	+۳۲	
ثفارس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۲	+۲۷	
غبشهر	محصولات کشاورزی	۸	+۲۶	
کاذر	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱	+۲۰	
درازک	دارویی	۲	+۱۶	
حفارس	حمل و نقل بارزمینی	۴	+۱۴	
غفارس	محصولات لبنی	۲	+۱۳	
برکت	سرمایه گذاری	۹	+۱۲	
خبنيان	قطعات خودرو	۳	+۱۱	
دامین	دارویی	۵	+۹	
سکارون	سیمان، اهنک و گچ	۳	+۸	
جم پیلن	مواد شیمیایی-متنوع	۳۹	+۷	
تاصیکو	سرمایه گذاری	۵۹	-۱۵	
دکوثر	دارویی	۳	-۱۶	
آریا	مواد شیمیایی-متنوع	۱۱۵	-۱۶	
وپارس	بانکها و موسسات اعتباری	۲۹	-۱۸	
بوعلی	مواد شیمیایی-متنوع	۱۱۰	-۱۹	
ثپردیس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴	-۲۰	
فباهنر	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۱۲	-۲۱	
سامان	بانکها و موسسات اعتباری	۱۴	-۲۲	
نوری	مواد شیمیایی-متنوع	۱۷۰	-۲۵	
شستا	سرمایه گذاری	۱۸۰	-۲۶	
فملی	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۵۵۵	-۲۸	
شپنا	پالایش نفت و گاز	۲۱۲	-۲۹	
خودرو	خودرو	۹۰	-۴۸	
خسپا	خودرو	۵۱	-۵۰	

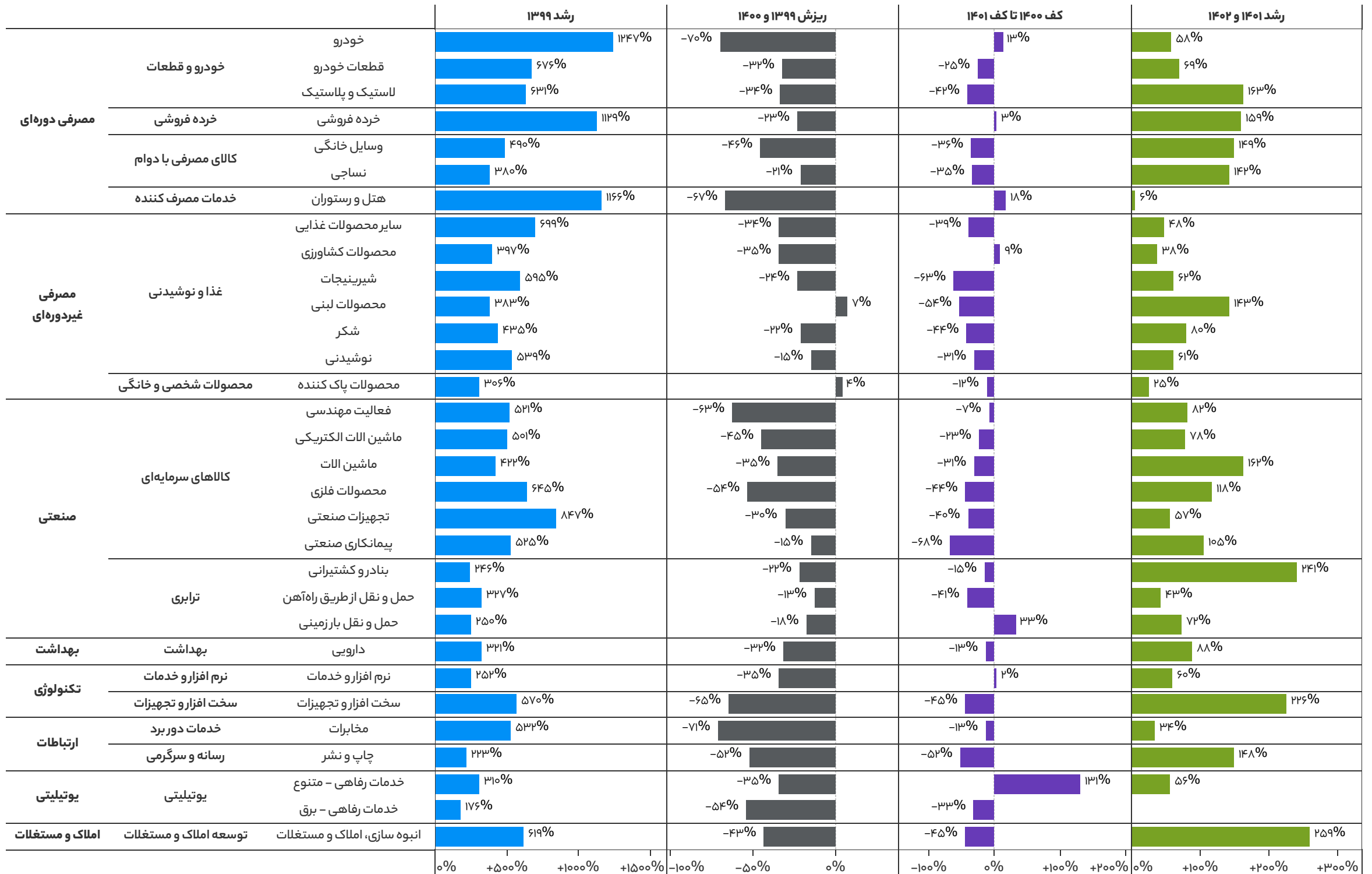


## بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

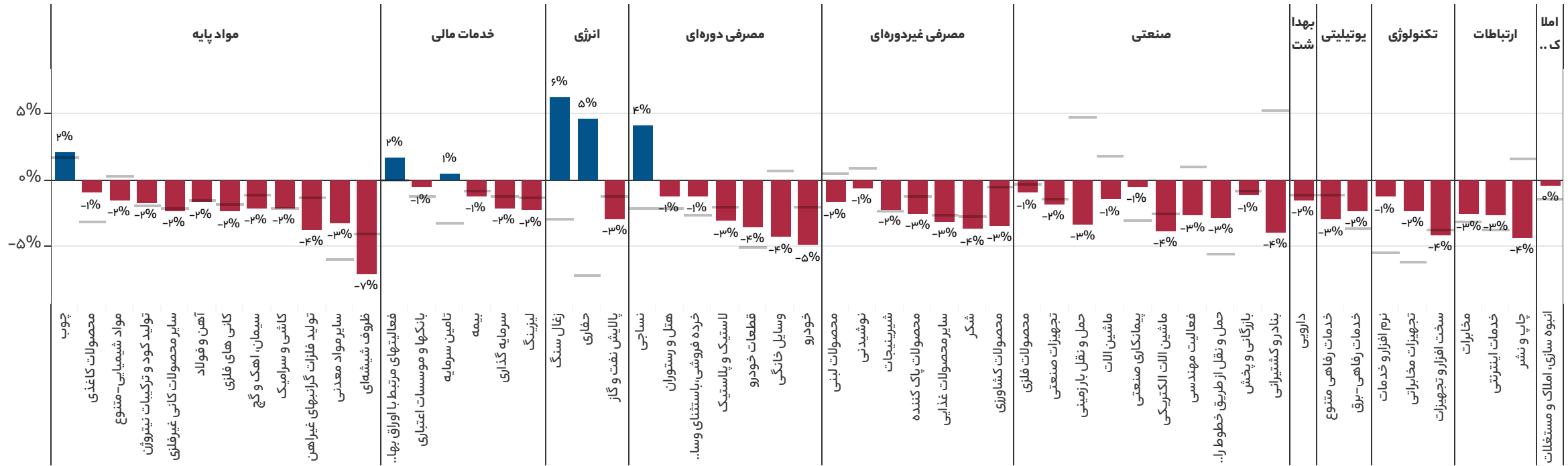


## بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

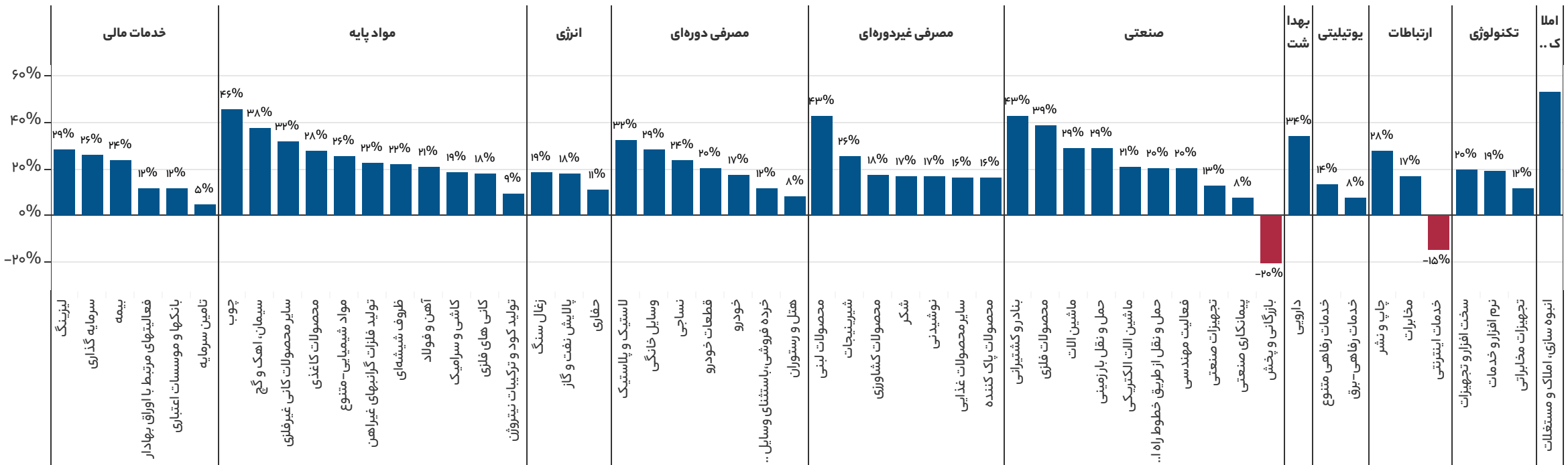


**بازدهی صنایع از ابتدای هفته**

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

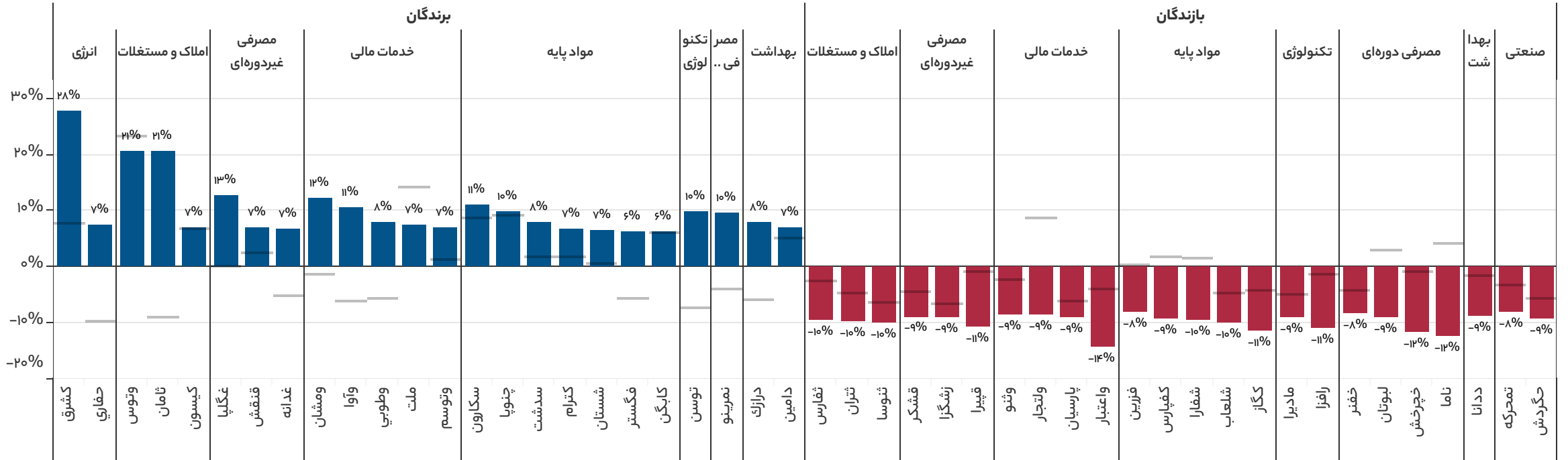

**بازدهی صنایع از ابتدای سال**

(مرتب شده براساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

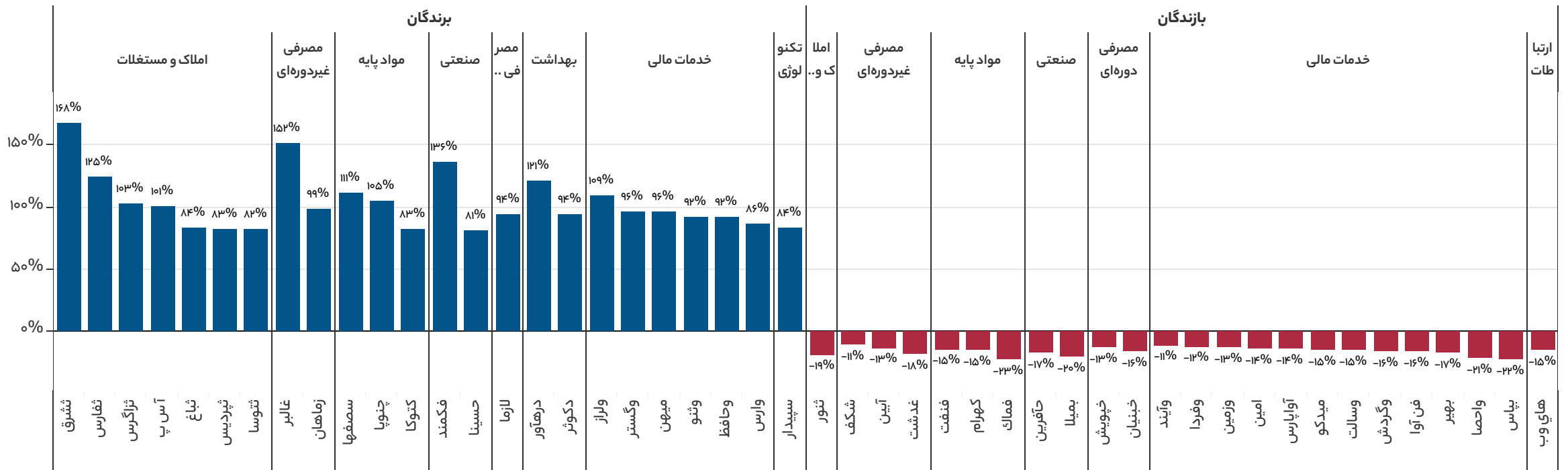




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



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





## بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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



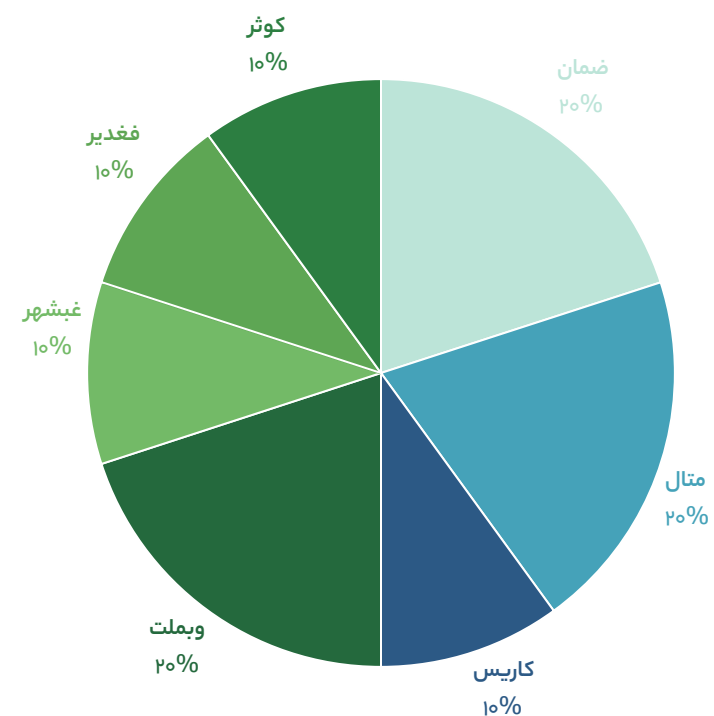
بازده هفته گذشته	وامید	حکشتی	نوری	جم	همراه	مارون	میدکو	شستا	کگهر	بفجر	پارس	پارسان	شپدیس	شبریز	تاپیکو	کگل	وپاسار	وصندوق	وغدیر	ومعادن	بوعلی	فخوز	آریا	شپنا	کچاد	فارس	ویملت	پپاس	وتجارت	اخابر	شتران	مبین	خودرو	شیراز	رمپنا	قملي	شبندر	تامیکو	خسپا
+۱.۰%	+۰.۹%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۱%	-۱.۴%	-۱.۸%	-۱.۹%	-۲.۰%	-۲.۰%	-۲.۱%	-۲.۳%	-۲.۴%	-۲.۶%	-۲.۶%	-۲.۶%	-۲.۹%	-۳.۰%	-۳.۰%	-۳.۳%	-۳.۴%	-۳.۴%	-۳.۵%	-۳.۷%	-۳.۷%	-۳.۸%	-۳.۸%	-۴.۱%	-۴.۴%	-۴.۵%	-۴.۸%	-۴.۹%	-۵.۲%	-۵.۵%	-۶.۶%	-۶.۸%		



## سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۲,۱۹۰	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۶۰۰	غیشهر	میان مدت
۱۰%	۹,۳۸۰	بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب	۱۲,۰۰۰	فغدیر	
۱۰%	۲,۴۶۴	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا	۳,۳۰۰	کوثر	
۲۰%	۲,۲۹۶	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۳,۲۰۰	وبملت	
۱۰%	۲۳,۷۳۰	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب	-	کاریس	بلند مدت
۲۰%	۱۶,۸۵۲	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	ضمان	
۲۰%	۱۱,۹۶۰	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](http://www.charisma.ir)  
شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: [@CharismaHolding](https://t.me/CharismaHolding)

پست الکترونیکی: [info@ciaco.ir](mailto:info@ciaco.ir)  
تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما: [www.ciaco.ir](http://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

