



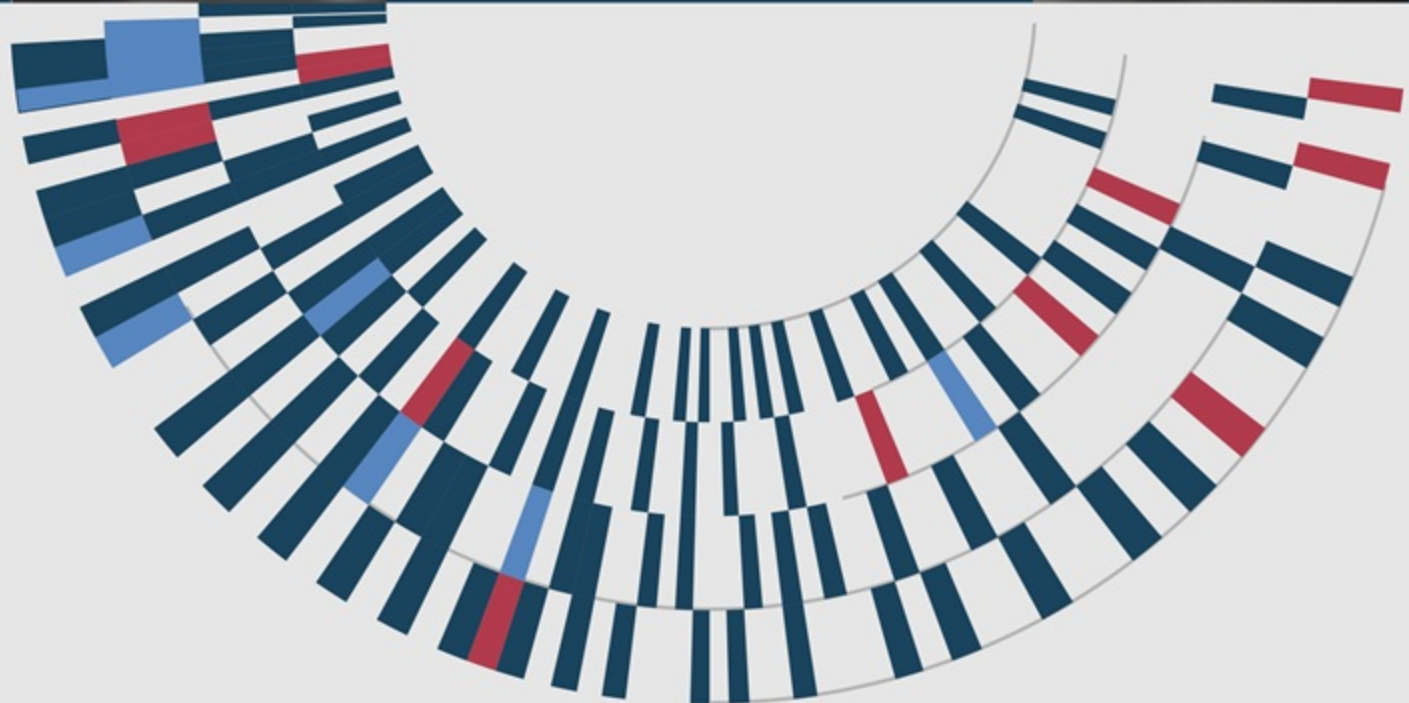
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۵۵ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۲۵

 CHARISMA





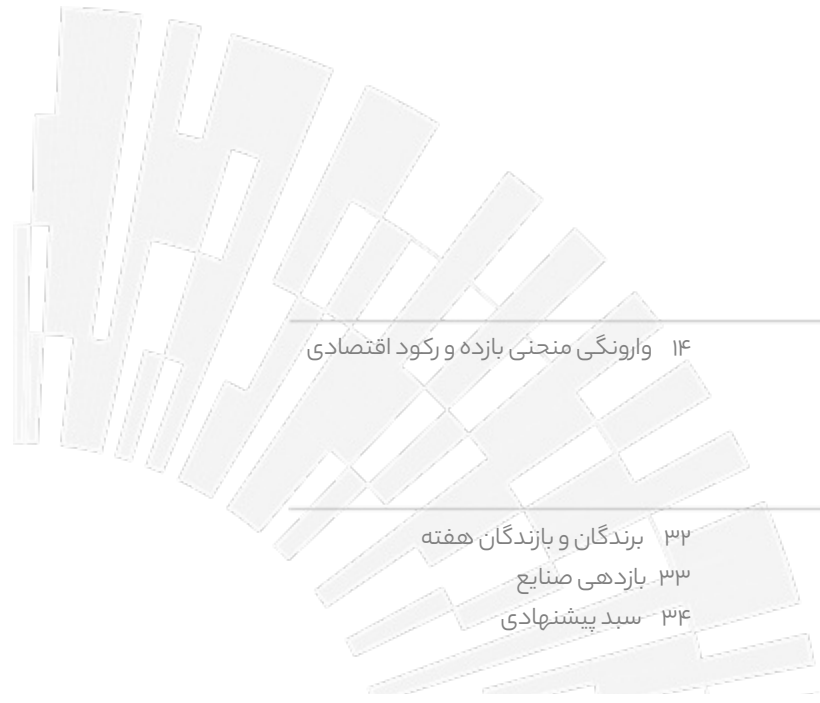
معرفی گزارش:

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

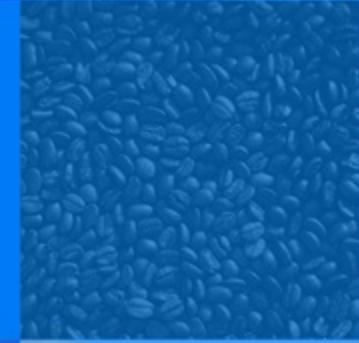
۱۵



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	۲,۳۳۲	+۱.۹%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۴۱۵	۲۱%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۹,۷۸۰	+۰.۲%	فملی	بموتو، فباهتر	۷,۹۴۳ - ۱۰,۷۲۴	۱۶%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵۱۸,۹۳۸	-۱.۰%	فملی	بموتو، فباهتر	۳۲۵,۷۰۰ - ۵۳۱,۰۱۲	۴۹%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۴۵۵	-	فایرا	فنوال	۲,۱۰۲ - ۲,۴۵۵	۱۱%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۷۹۵	+۰.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۳,۰۶۶	۱۸%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۵۷	-۱.۸%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۳۰۸	۱%
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۸۰	+۰.۷%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ - ۵۰۰	-۲%
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۹	-۰.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۵۲۴	-۲%
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۶۵۲	+۸.۲%	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	۴۵۶	+۰.۸%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ - ۵۰۰	-۱%
	اسلب (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۷۵	-۲.۶%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۵۵۸	-۳%
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۵۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۵۰۰	۱۸%
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۸	+۰.۴%	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۶۲۳	-۷%
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۳,۹۵۹	-	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ - ۲۵,۱۱۰	۱%
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۴۸	-۲.۷%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۴۸ - ۶۱۳	-۵%
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۰	-۲.۳%	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	۱۰۶	-۱.۷%	-	-	۹۹ - ۱۴۳	-۴%
	گندله سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۲۶	-۱.۵%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۱۵ - ۱۶۴	-۲%
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵,۱۷۰	+۰.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۴۰۰ - ۵,۳۰۵	۷%
	کنسانتره سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۱۵	-۱.۵%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۰۵ - ۱۵۳	-۳%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۸۱۰	+۰.۴%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۴۶۹ - ۳,۸۱۰	۵%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۲۵	-۲.۳%	-	-	۱۹۹ - ۲۶۸	-۱۶%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۷۷	-۰.۱%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۲۳۰	-۲۳%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۳۹۹	+۱.۱%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۵%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۸۸	-	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۵۷ - ۹۰۸	۱۷%



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	۲۹۶	-۲.۰%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۷ - ۳۱۲	۲۵%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۴۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۱,۰۱۰	۲۹%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۶۰	+۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۴۵ - ۸۶۰	۱۵%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۳۸	+۰.۸%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۹ - ۱,۱۵۸	۸%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۰۰	-	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۴۰	۷%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۵۶	-۰.۶%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۸۲	۲۸%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۴	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۸۴	۳۷%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۲۲	-۲.۴%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۵۲	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۵۰۰	+۶.۴%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۵۰۰	۱۳.۴%
مونواتیلن گلابکول	چین CFR	دلار/تن	۵۲۳	-۰.۴%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	۱۲%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۱۱۷	+۳.۷%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۱۱۷	۲۴%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۹۸۵	۴%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۵	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۶۱	۵%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۰	+۰.۱%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۱۰	۱۴%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۹۷۵	۲%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۱۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۷۴۰ - ۸۸۵	۷%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۶۵	-۰.۳%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۸۰	۱۸%

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	۸۳	+۴.۰%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۴ - ۹۴	۱۱%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۸	+۴.۲%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۹ - ۹۱	۱۳%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۲	+۱.۱%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۸۱ - ۱۰۷	۵%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۲	+۵.۱%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۸۵ - ۱۲۵	۹%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۶۷	+۳.۶%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۳۸۱ - ۵۲۸	۱۸%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۳	+۴.۱%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۸۶ - ۱۲۴	۹%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۱۰	+۴.۹%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	بوعلی، نوری	۴۵۲ - ۶۵۹	۳۵%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۸۸۰	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	-	۷۲۰ - ۹۳۰	-۲%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۳,۶۴۵	-۷.۷%	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	-	۲۱,۷۹۵ - ۳۶,۹۴۳	۵۴%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۶۳۰	+۰.۹%	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، شاولان	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۱۲,۴۵۵ - ۲۲,۶۳۰	۸۲%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۴,۷۵۸	-۲.۳%	شپاس	-	۱۲,۰۸۶ - ۱۶,۵۰۰	۲۲%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۲۳	+۲.۵%	-	ذوب، فروش	۱۸۸ - ۲۸۷	۸%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۷	-۰.۹%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	-۲%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	-۰.۳%	-	-	۱.۲۱ - ۱.۳۱	۰%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۵,۷۰۳	-۴.۹%	-	-	۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	۱۱۳%

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	۰.۱۰	-۱.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	۶%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۳	+۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۳ - ۰.۰۸	-۴۱%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۰	+۴.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۴%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۷	+۵.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۰.۶۱	۴%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۳	+۴.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۲%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

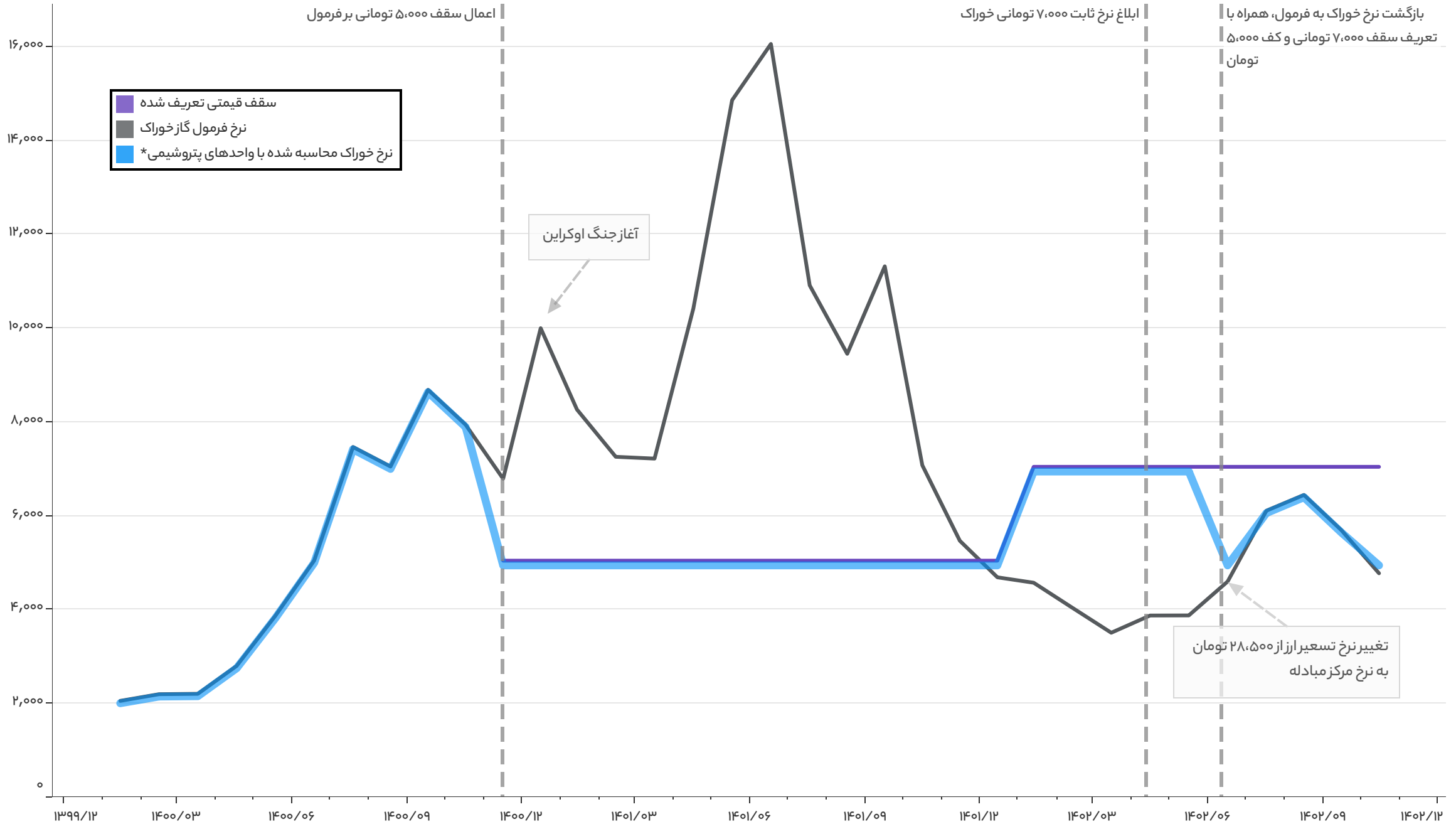
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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

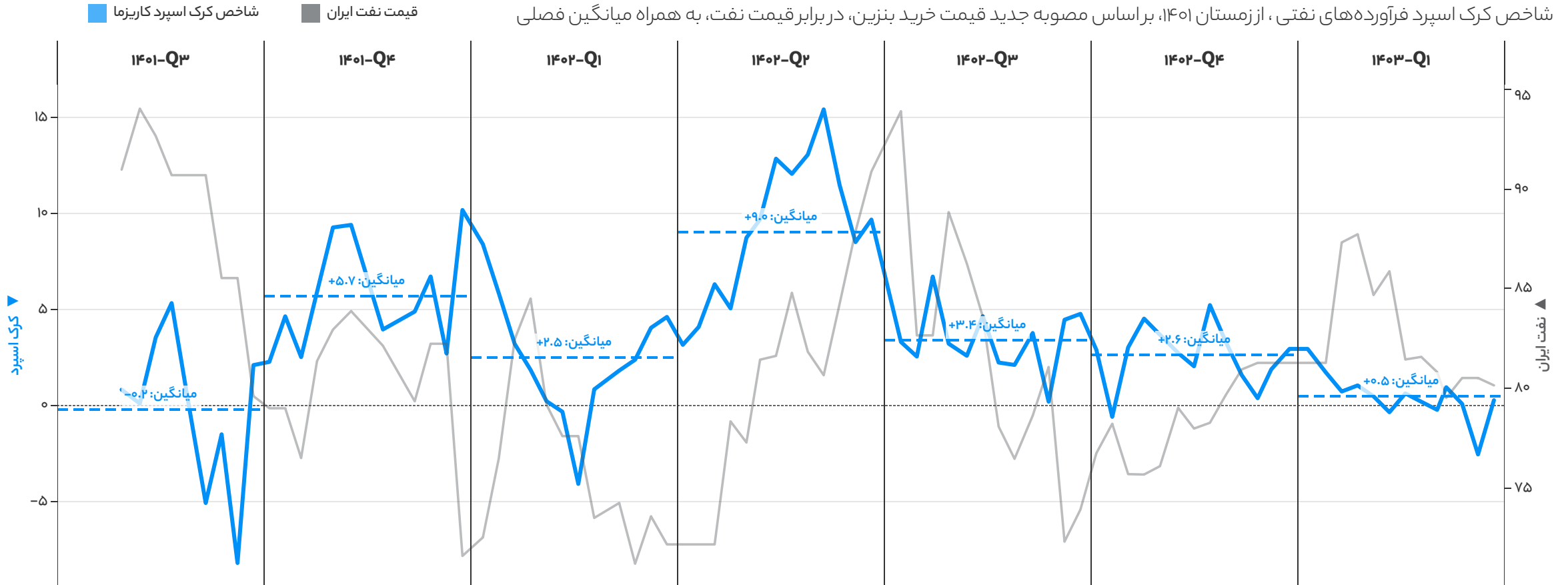


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بر روزرسانی خواهد شد. - لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



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	۸۰.۲								
گازوئیل	۹۲.۳	۷.۳	۱۲.۱	▲۴.۸	۱۹.۵	۱۱.۶	-۴۰.۷%		
بنزین**	۷۶.۳	-۵.۲	-۳.۹	▲۱.۳	۵.۰	۳.۲	-۳۶.۶%		
نفتا	۶۹.۱	-۱۴.۷	-۱۱.۱	▲۳.۶	-۹.۶	-۱۲.۳	-۲۸.۰%		
نفت کوره	۷۳.۷	-۹.۴	-۶.۵	▲۲.۹	-۱۵.۰	-۹.۱	+۳۹.۰%		
لوب کات***	۸۳.۳	۲.۰	۳.۲	▲۱.۱	-۶.۲	-۱.۶	+۷۴.۴%		
وکیوم باتوم***	۵۵.۰	-۲۶.۳	-۲۵.۲	▲۱.۱	-۳۰.۸	-۳۰.۳	+۱.۷%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		-۲.۵	۰.۳	▲۲.۸	۲.۶	۰.۵	-۸۰.۵%		

* 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.

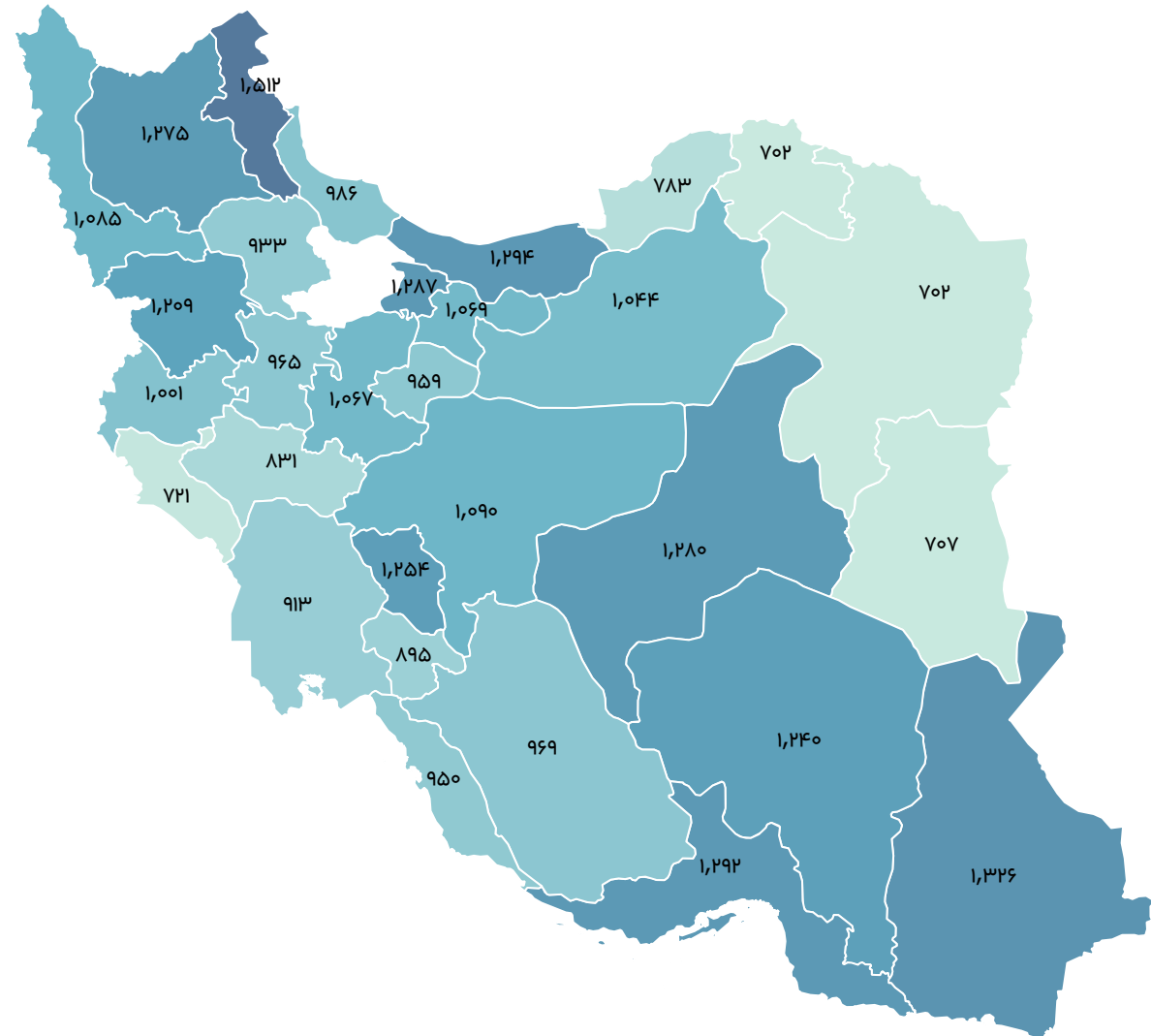
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۱,۰۰۳	۱,۰۶۹	+۶.۶%
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۴۱	۱,۰۶۷	+۱۳.۴%
	البرز	سیمان آبیک	۹۵۰	۱,۲۸۷	+۳۵.۵%
	اصفهان	سیمان سپاهان	۱,۰۱۸	۱,۰۹۰	+۷.۰%
	قم	سیمان نيزار قم	۹۷۳	۹۵۹	-۱.۳%
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیمان..	۸۷۴	۱,۲۸۰	+۴۶.۵%
غرب	سمنان	سیمان شاهرود	۹۹۰	۱,۰۴۴	+۵.۴%
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۹۶۵	+۱۶.۳%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۱۳	۹۱۳	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۹۳۰	۱,۲۵۴	+۳۴.۸%
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۵۶	۱,۰۰۱	+۱۷.۰%
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۲۱	+۲.۱%
	لرستان	سیمان دورود	۸۳۱	۸۳۱	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۹۴	۸۹۵	+۰.۲%
	کردستان	سیمان کردستان	۱,۲۰۳	۱,۲۰۹	+۰.۵%
	مازندران	سیمان مازندران	۱,۰۱۱	۱,۲۹۴	+۲۸.۰%
شمال	گیلان	سیمان خزر	۹۴۷	۹۸۶	+۴.۱%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۸۰	۷۸۳	+۰.۳%
شمال غرب	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۱۷۰	۱,۵۱۲	+۲۹.۳%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۹۵۳	۱,۰۸۵	+۱۳.۸%
شمال شرق	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۰۰۲	۱,۲۷۵	+۲۷.۲%
	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۳	۹۳۳	-
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۷۰	۷۰۲	+۴.۸%
جنوب شرق	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۷۰	۷۰۲	+۴.۸%
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۷۰	۷۰۷	+۵.۵%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۰۶۸	۱,۲۹۲	+۲۱.۰%
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۶۹	+۵.۷%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۴۱	۹۵۰	+۱.۰%
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۵۳	۱,۲۴۰	+۳۰.۲%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۱۵۷	۱,۳۲۶	+۱۴.۶%

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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

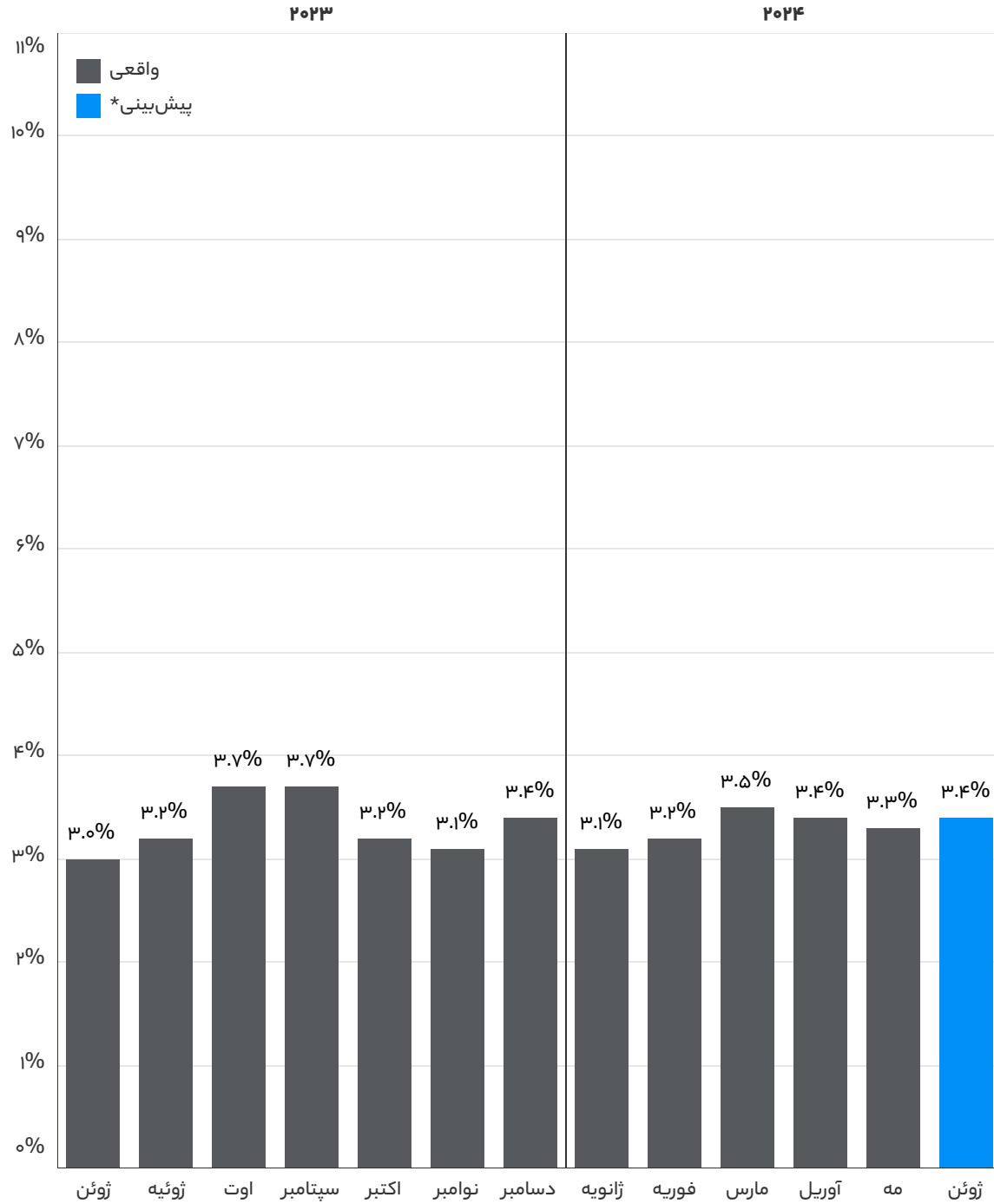


* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▼ کمیته فدرال بازار آزاد (FOMC) بانک مرکزی ایالات متحده، طبق انتظار، نرخ بهره و جوه فدرال را در محدوده ۵.۲۵ تا ۵.۵ درصد ثابت نگه داشت. با این حال، چشم انداز اقتصادی این کمیته اکنون حاکی از تنها یک کاهش ۲۵ واحدی نرخ بهره در سال جاری است. فدرال رزرو با به روزرسانی پیش بینی های اقتصادی خود، میانگین نرخ مورد انتظار برای جوه فدرال در پایان سال ۲۰۲۴ را به ۵.۱ درصد افزایش داد، در حالی که این رقم سه ماه پیش ۴.۶ درصد بود. این تغییر نشان می دهد که بانک مرکزی اکنون تنها یک کاهش نرخ ۲۵ واحدی را در سال جاری در نظر گرفته است، در حالی که پیش از این انتظار ۷۵ کاهش نقطه ای وجود داشت. انتظار برای نرخ جوه فدرال در پایان سال ۲۰۲۵ در حال حاضر ۴.۱ درصد است که نشان دهنده ی کاهش احتمالی ۱۰۰ واحدی در سال آینده است.
- ▼ به گزارش رویترز، قیمت طلا در روز دوشنبه حدود ۸۳ دلار سقوط کرد و به پایین ترین رقم طی یک ماه اخیر رسید. قیمت طلا، دوشنبه پس از انتشار اطلاعات مشاغل آمریکا و گزارش هایی مبنی بر اینکه بانک مرکزی چین خرید طلا را متوقف کرده است، ۳.۵ درصد افت کرد که بیشترین افت خود از نوامبر ۲۰۲۰ را نشان می دهد. قیمت هر اونس طلا در ۱۱ ژوئن با ۰.۳۹ درصد کاهش به ۲۳۰۱.۹۱ دلار رسید. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک کاهش ۰.۳۶ درصدی به ۲۳۱۸.۶۰ دلار رسیده است. تحلیلگران عقیده دارند اطلاعات بسیاری در این هفته منتشر می شود و رویدادهای بسیاری هم در راه است. بنابراین بازار طلا با بی ثباتی بیشتری مواجه خواهد بود.
- دوازدهمین حراج سکه طلا، دوشنبه ۲۱ خرداد ماه ۱۴۰۳ برگزار شد و از مجموع ۱۸،۳۴۶ قطعه ربع سکه ثبت سفارش شده، ۱۴،۸۹۴ قطعه با میانگین قیمت ۱۳ میلیون و ۳۹۴ هزار تومان به متقاضیان تخصیص داده شد. همچنین، از مجموع ۴،۹۱۹ قطعه نیم سکه ثبت سفارش شده، ۴،۱۹۴ قطعه با میانگین قیمت ۲۰ میلیون و ۸۷۳ هزار تومان تخصیص داده شد. در حراج سکه تمام نیز ۱۴،۴۵۲ قطعه سکه ثبت سفارش شد که ۱۱،۸۴۵ قطعه با میانگین قیمت ۳۷ میلیون و ۵۱۸ هزار تومان تخصیص داده شد. تاکنون و در مجموع ۱۲ حراج برگزار شده، جمعاً ۱۷۸،۶۱۰ قطعه انواع سکه طلا به متقاضیان حراج تخصیص داده شده است. سهم ربع سکه از این حجم تخصیص ۱۱۴،۸۸۶ قطعه، نیم سکه ۲۵،۹۶۶ قطعه و تمام سکه ۳۷،۷۵۸ قطعه است.
- ▼ آژانس بین المللی انرژی (IEA) پیش بینی کرد کاهش استفاده از سوخت های فسیلی، بازارهای جهانی نفت را با مازاد عرضه بزرگ در پایان دهه جاری، روبرو می کند. این آژانس مستقر در پاریس، در گزارش میان مدت سالانه خود اعلام کرد مصرف نفت جهان در سال ۲۰۲۹، به ۱۰۵.۶ میلیون بشکه در روز می رسد که حدود چهار درصد بالاتر از سطح مصرف در سال ۲۰۲۳ خواهد بود. در این بین، ظرفیت تولید نفت همچنان افزایش خواهد یافت. ظرفیت تولید نفت، تحت تاثیر افزایش تولید آمریکا، تا پایان دهه جاری، هشت میلیون بشکه در روز بالاتر از میزان تقاضا خواهد بود و بزرگترین مازاد تولید نفت را از زمان اوج قرنطینه کرونا، ایجاد می کند.
- ▲ اوپک در جدیدترین گزارش ماهانه خود، با وجود مصرف کمتر از حد انتظار سوخت در سه ماهه اول، پیش بینی رشد نسبتاً قوی تقاضای جهانی برای نفت در سال ۲۰۲۴ را تغییر نداد. سازمان کشورهای صادرکننده نفت (اوپک)، در گزارش ماهانه بازار نفت که روز سه شنبه منتشر شد، اعلام کرد تقاضای جهان برای نفت، به میزان ۲۰۲۵ میلیون بشکه در روز در سال ۲۰۲۴ و به میزان ۱۰۸۵ میلیون بشکه در روز در سال ۲۰۲۵ رشد خواهد کرد. هر دو پیش بینی، نسبت به ماه گذشته، بدون تغییر ماندند. در این گزارش، اوپک اعلام کرد رشد اقتصادی جهانی در نیمه اول سال ۲۰۲۴ ادامه یافته و تقاضای جهانی برای نفت، به میزان ۲.۳ میلیون بشکه در روز در نیمه دوم، رشد خواهد کرد.
- ▲ به گزارش رویترز، قیمت نفت طی روزهای اخیر به علت افزایش تقاضا در آستانه فصل تعطیلات و سفرها و همچنین خرید توسط آمریکا برای پر کردن ذخایر استراتژیک رشد کرد و از مرز ۸۲ دلار عبور کرد و در بالاترین سطح یک هفته اخیر قرار گرفته است؛ اما بالا رفتن ارزش دلار این افزایش قیمت را محدود کرد. قیمت هر بشکه نفت برنت صبح امروز با ۱۰ سنت (معادل ۰.۱۲ درصد) کاهش به ۸۱.۵۳ دلار رسید. نفت سبک آمریکا هم با ۵ سنت (معادل ۰.۰۶ درصد) کاهش ۷۷.۶۹ دلار معامله می شود. قیمت نفت در روز دوشنبه با ۳ درصد افزایش به بالاترین رقم طی یک هفته گذشته رسید که دلیل آن خوشبینی نسبت به افزایش تقاضا برای سوخت در تابستان علی رغم بالا رفتن ارزش دلار به دنبال احتمال به تعویق افتادن کاهش نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا بود.
- بررسی ها نشان می دهد گاز مصرفی صنایع فعال در بازار سرمایه دست کم با ۶ نرخ متفاوت تحویل داده می شود. در این میان نیروگاه ها، طبق مصوبه مرداد پارسال دولت، گاز را با نرخ ۷۴ تومان به ازای هر متر مکعب دریافت و مصرف می کنند تا این صنعت در بین همه صنایع بورسی ارزان ترین گاز را در اختیار داشته باشد. هزینه گاز صنعت فلزات اساسی هم، ۴،۴۰۰ تومان به ازای هر متر مکعب تخمین زده شده است. به این ترتیب فلزات اساسی، در میان همه صنایع بورسی، گاز را با گران ترین تعرفه دریافت می کند. علاوه بر این ۲ نرخ، گاز ۴ صنعت دیگر بورس با ۴ نرخ متفاوت زیر تحویل می شود: هزینه گاز مصرفی صنعت سیمان به ازای هر متر مکعب ۱،۲۰۰ تومان، صنعت محصولات شیمیایی ۳،۷۰۰ تومان، صنعت استخراج کانی های فلزی ۴،۱۰۰ تومان، صنعت فرآورده های نفتی ۴،۳۰۰ تومان.

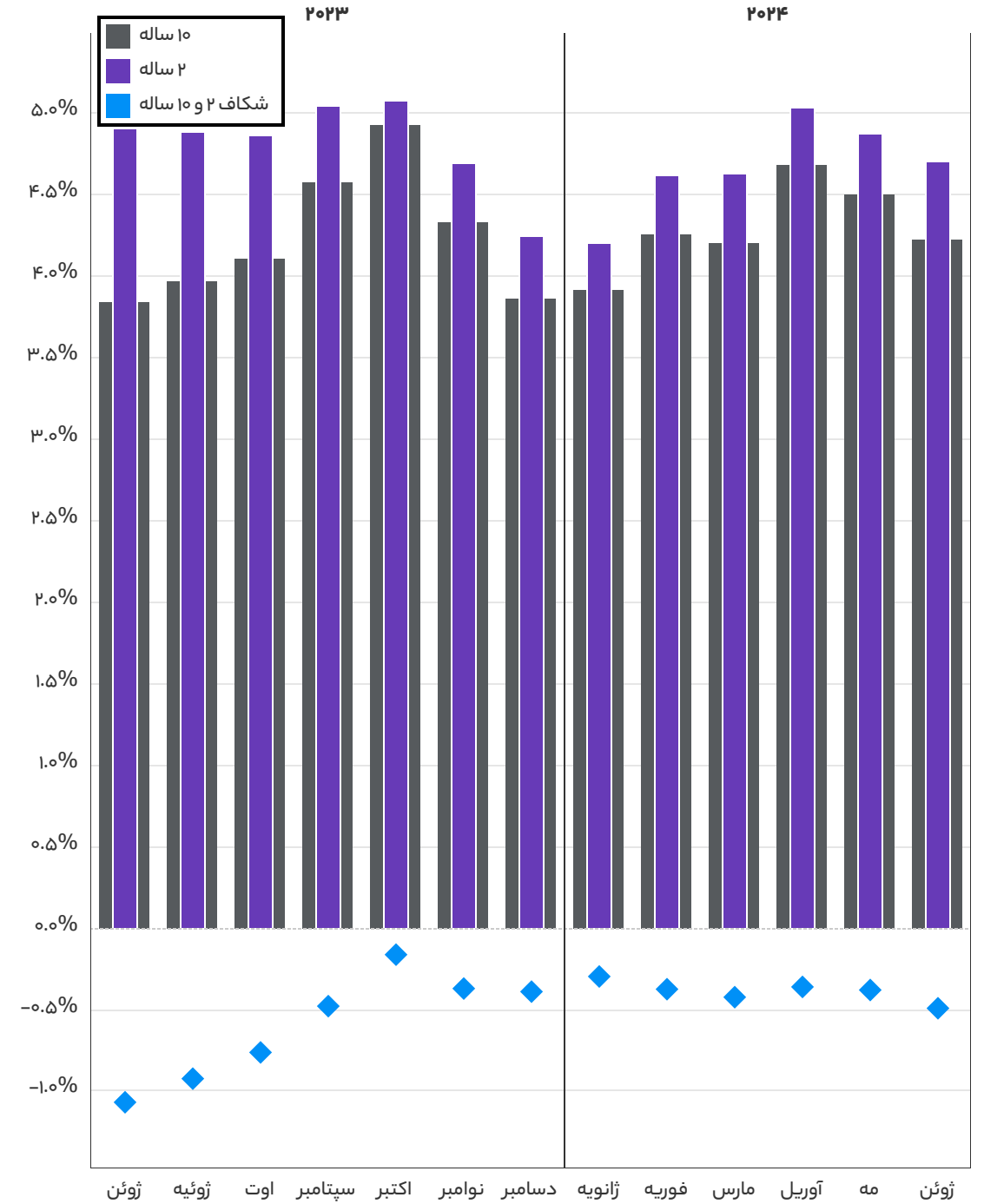
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



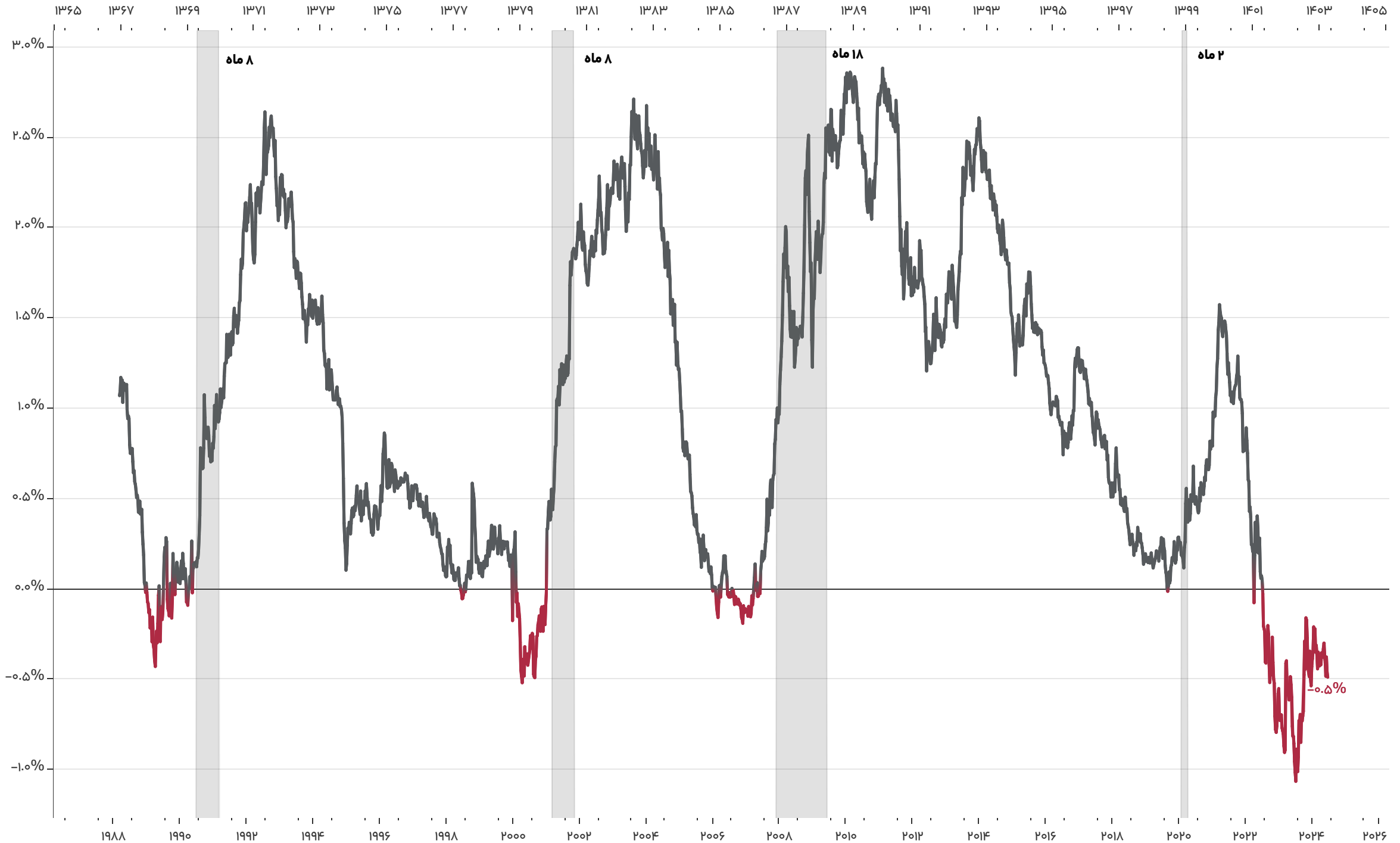
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

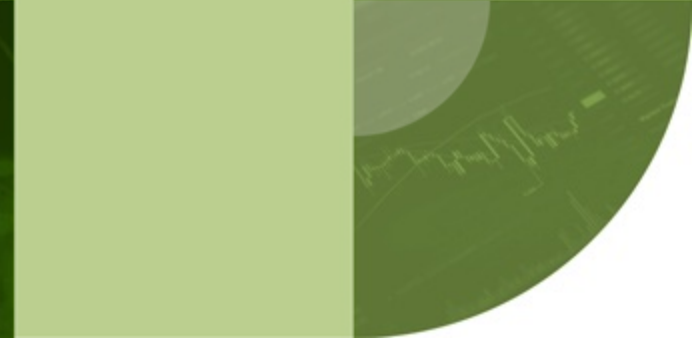
اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



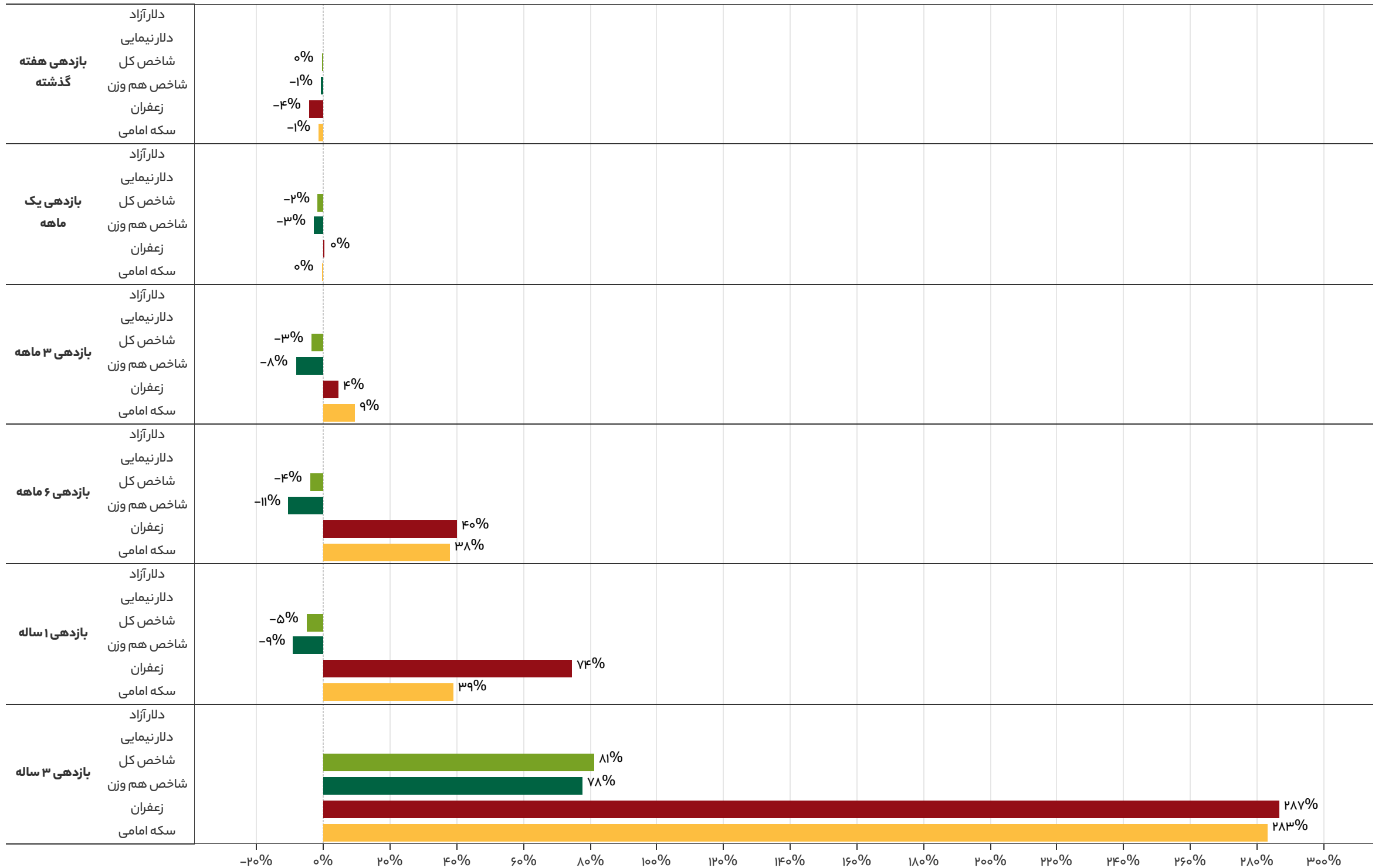
بازار سهام

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

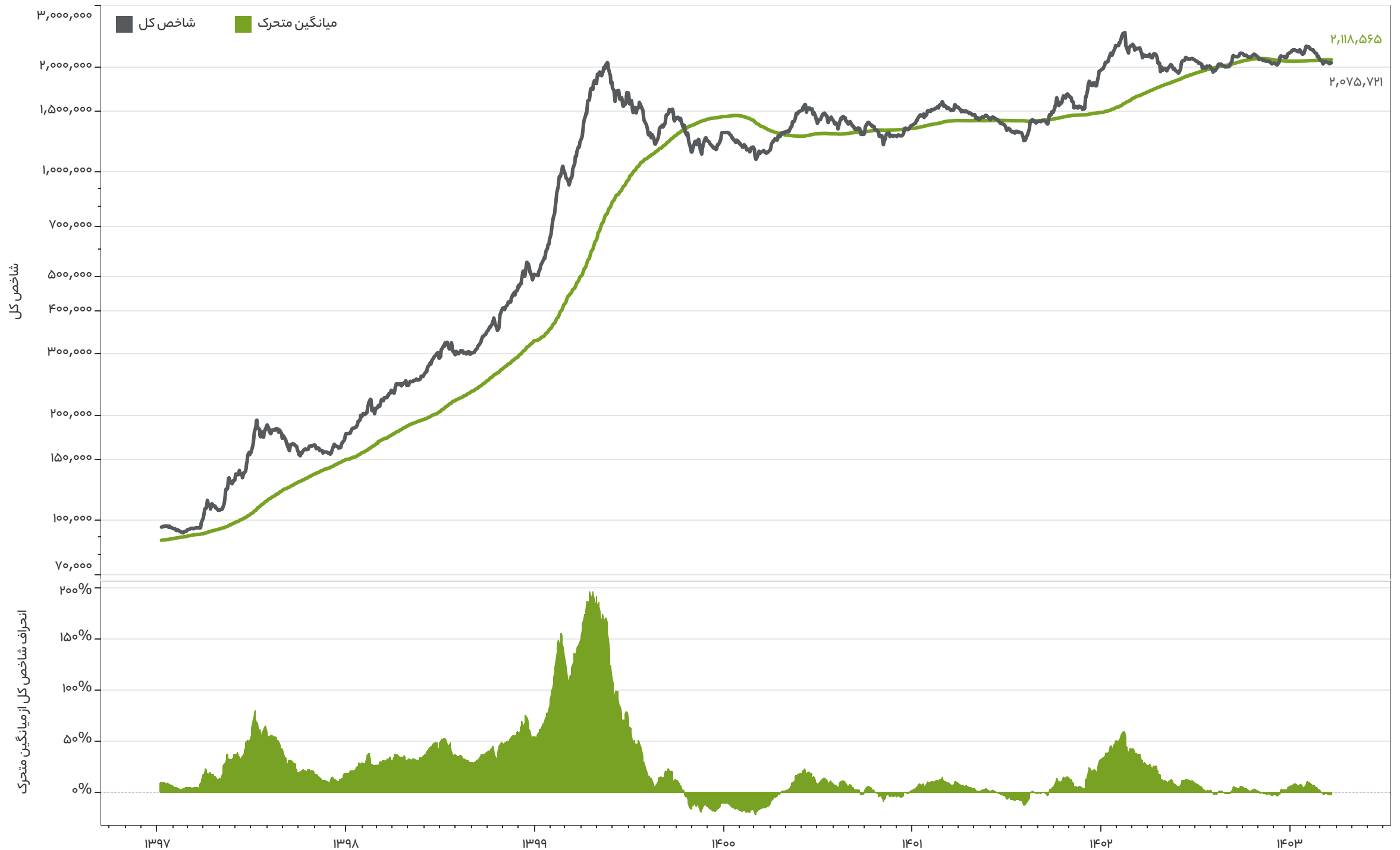
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

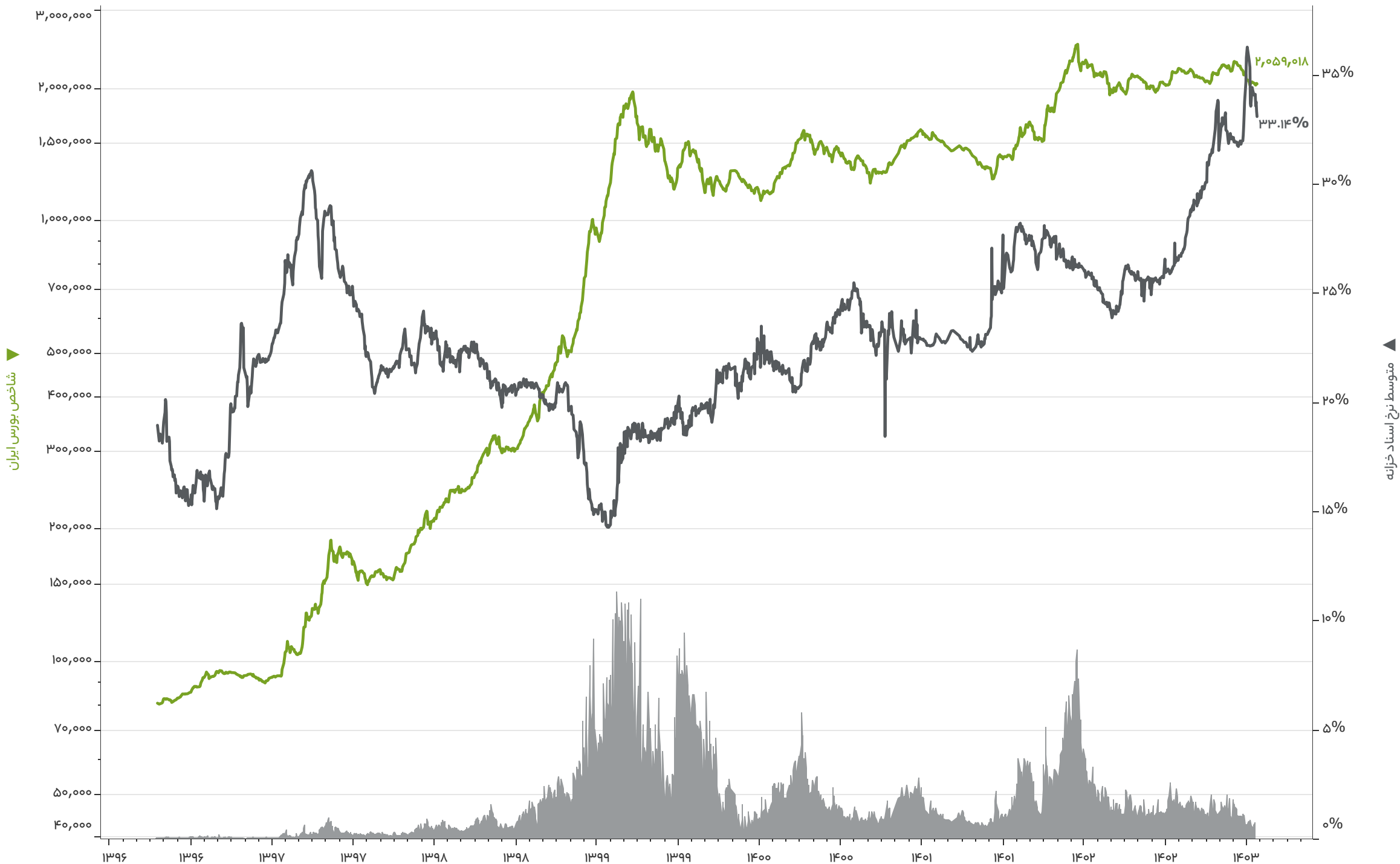
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

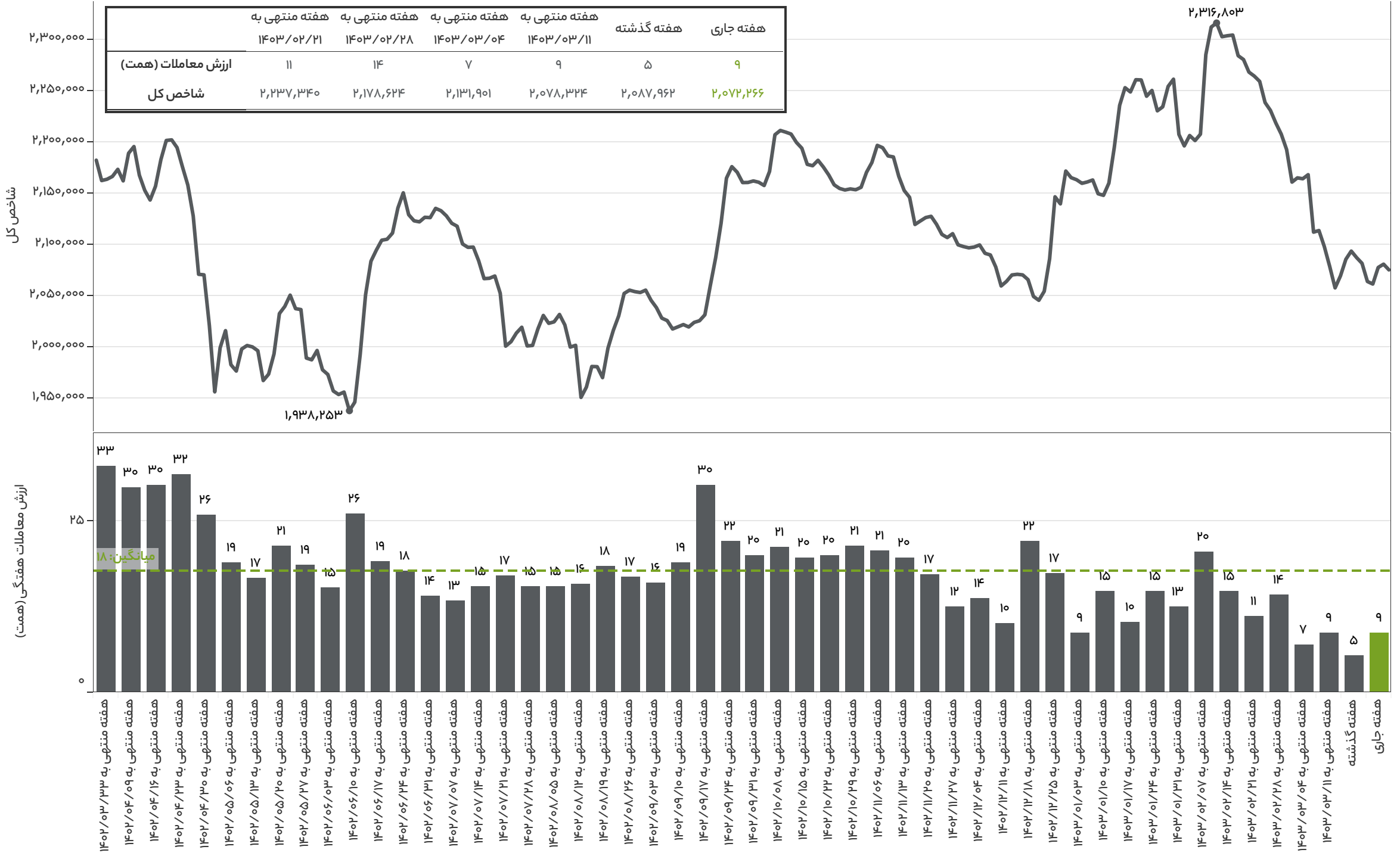
از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس



نرخ اسناد خزانه

ارزش معاملات هفتگی بازار

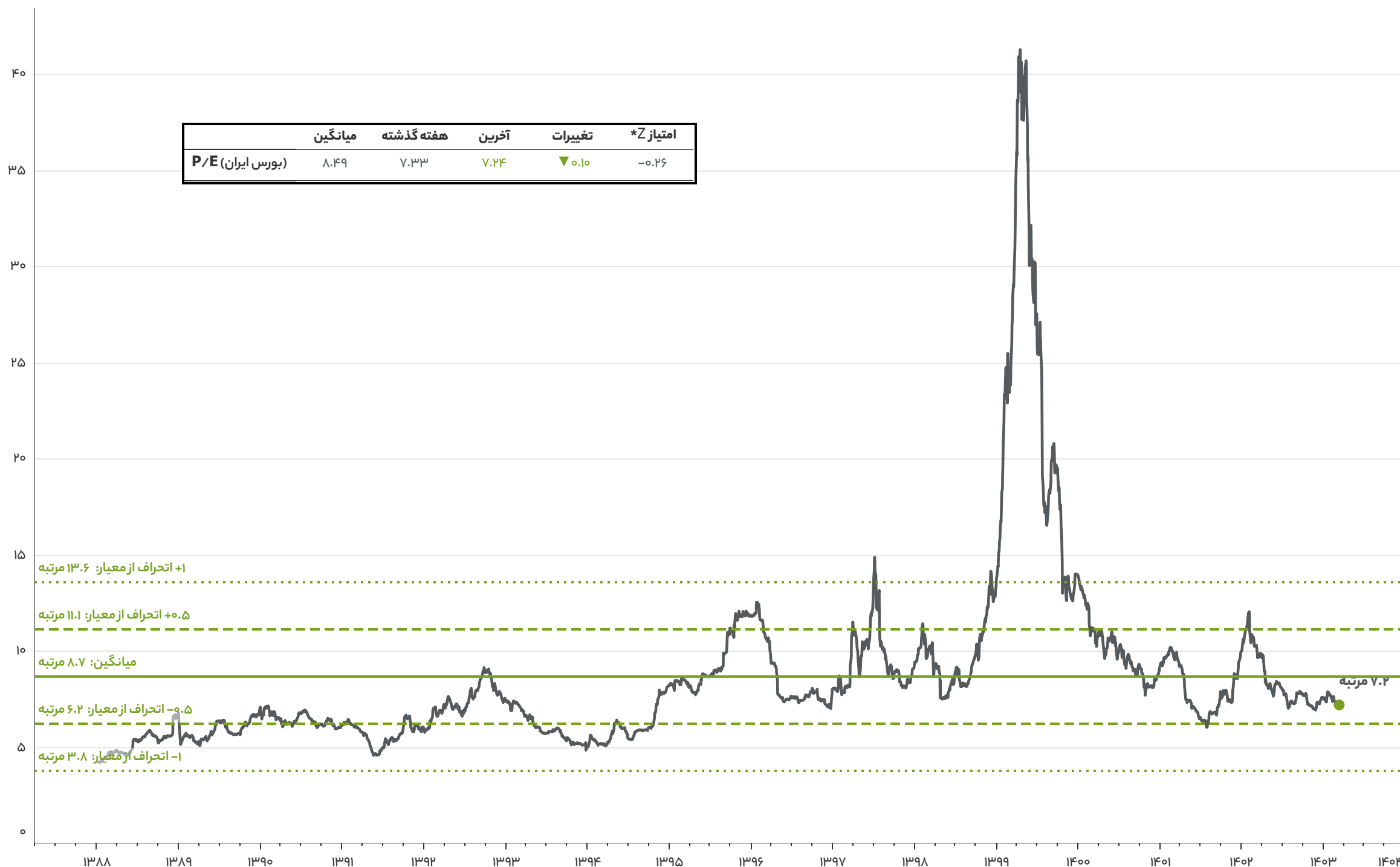
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

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



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



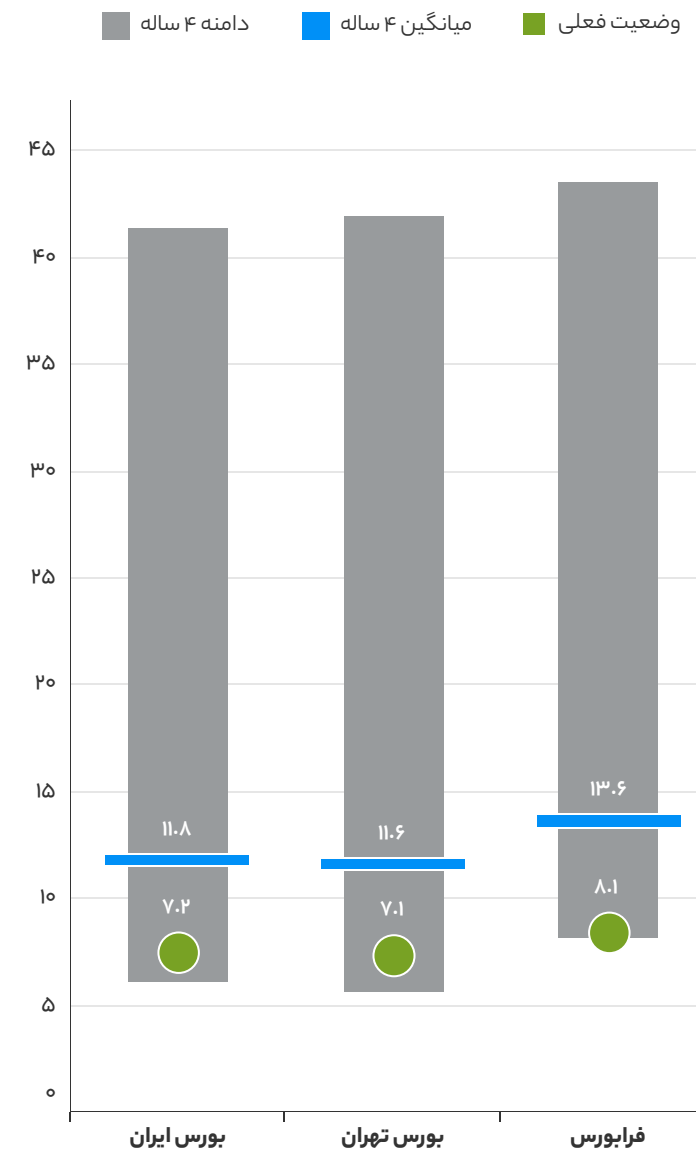
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
-۰.۱۰	۷.۲۴	۷.۳۳	۶.۰۷	۱۱.۷۹	۴۱.۳۳
-۰.۱۰	۷.۱۰	۷.۱۹	۵.۶۴	۱۱.۶۰	۴۱.۹۹
-۰.۰۹	۸.۱۳	۸.۲۲	۸.۱۳	۱۳.۶۲	۴۳.۵۱

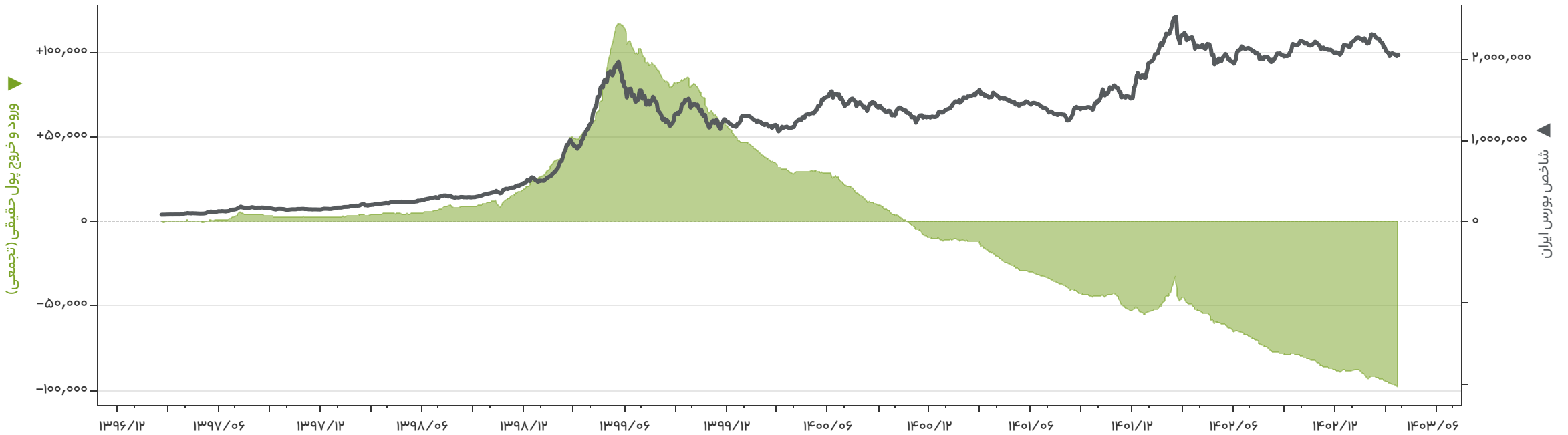


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	مواد پایه	خدمات مالی	انرژی	مصرفی دوره‌ای	مصرفی غیردوره‌ای	صنعتی	بهداشت	تکنولوژی	یوتیلیتی	ارتباطات	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۸۸	۱۹۹	۶	۶۶	۸۹	۶۳	۴۰	۱۹	۱۱	۵	۲۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۳,۲۶۴	۲,۹۳۲	۵۹۶	۳۳۹	۱۸۶	۱۶۶	۱۳۱	۱۱۱	۹۴	۹۰	۵۵	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۴۱.۰%	۳۶.۸%	۷.۵%	۴.۳%	۲.۳%	۲.۱%	۱.۶%	۱.۴%	۱.۲%	۱.۱%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۷.۷	۶.۵	۵.۱	۳.۸	۸.۹	۷.۴	۸.۸	۱۴.۶	۷.۰	۹.۰	۱۷.۸	سودآوری
بازده سود نقدی	۱۰.۵%	۱۱.۳%	۱۵.۳%	۳.۴%	۶.۶%	۴.۵%	۱۳.۸%	۶.۵%	۱۶.۱%	۴.۴%	۵.۳%	
نسبت تقسیم سود	۷۲%	۶۲%	۶۳%	۳۲%	۵۱%	۳۸%	۵۹%	۷۳%	۱۰۰%	۴۱%	۴۲%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۱	۱.۱	۰.۹	۱.۲	۰.۸	۰.۷	۱.۱	۱.۴	۰.۹	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۹۹۹%	+۷۸۷%	+۷۷۲%	+۷۸۸%	+۳۶۵%	+۳۸۰%	+۳۳۱%	+۲۹۸%	+۸۱۶%	+۸۶%	+۶۶۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۶۸%	-۷%	+۱۳%	-۲۱%	-۱۹%	-۱۶%	+۲%	۰%	+۱۲۴%	-۷۰%	+۶%	
بازده از ابتدای سال	+۹۱%	+۵۸%	+۸۶%	+۷۵%	+۳۷%	+۸۶%	+۷۲%	+۷۲%	+۴۸%	+۱۹%	+۲۴۰%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	۰%	۰%	۰%	-۱%	-۲%	-۱%	-۱%	۰%	-۲%	۰%	

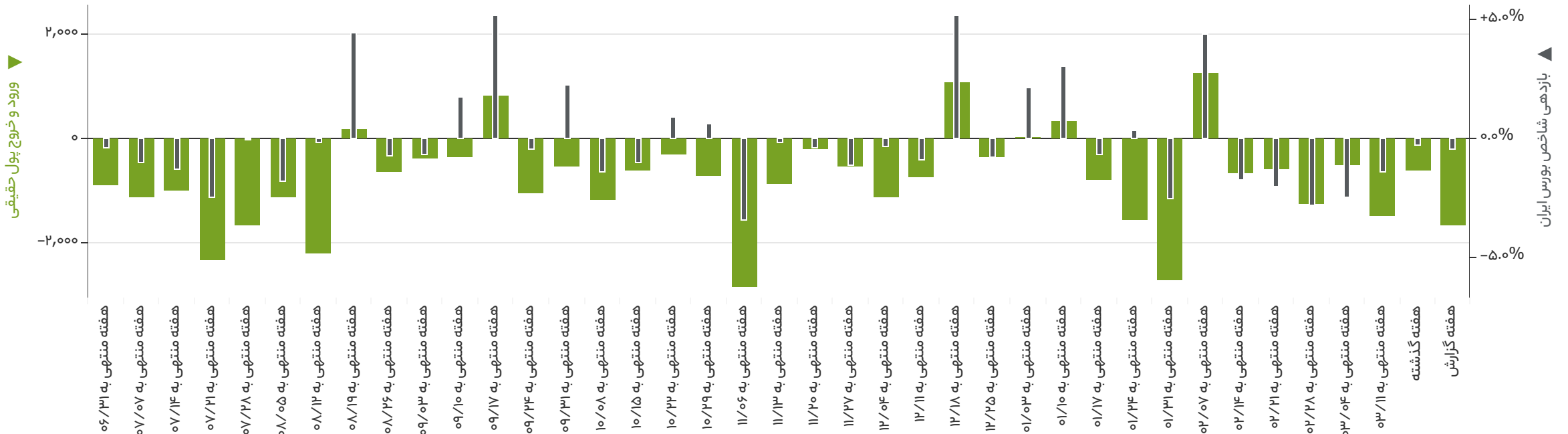
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



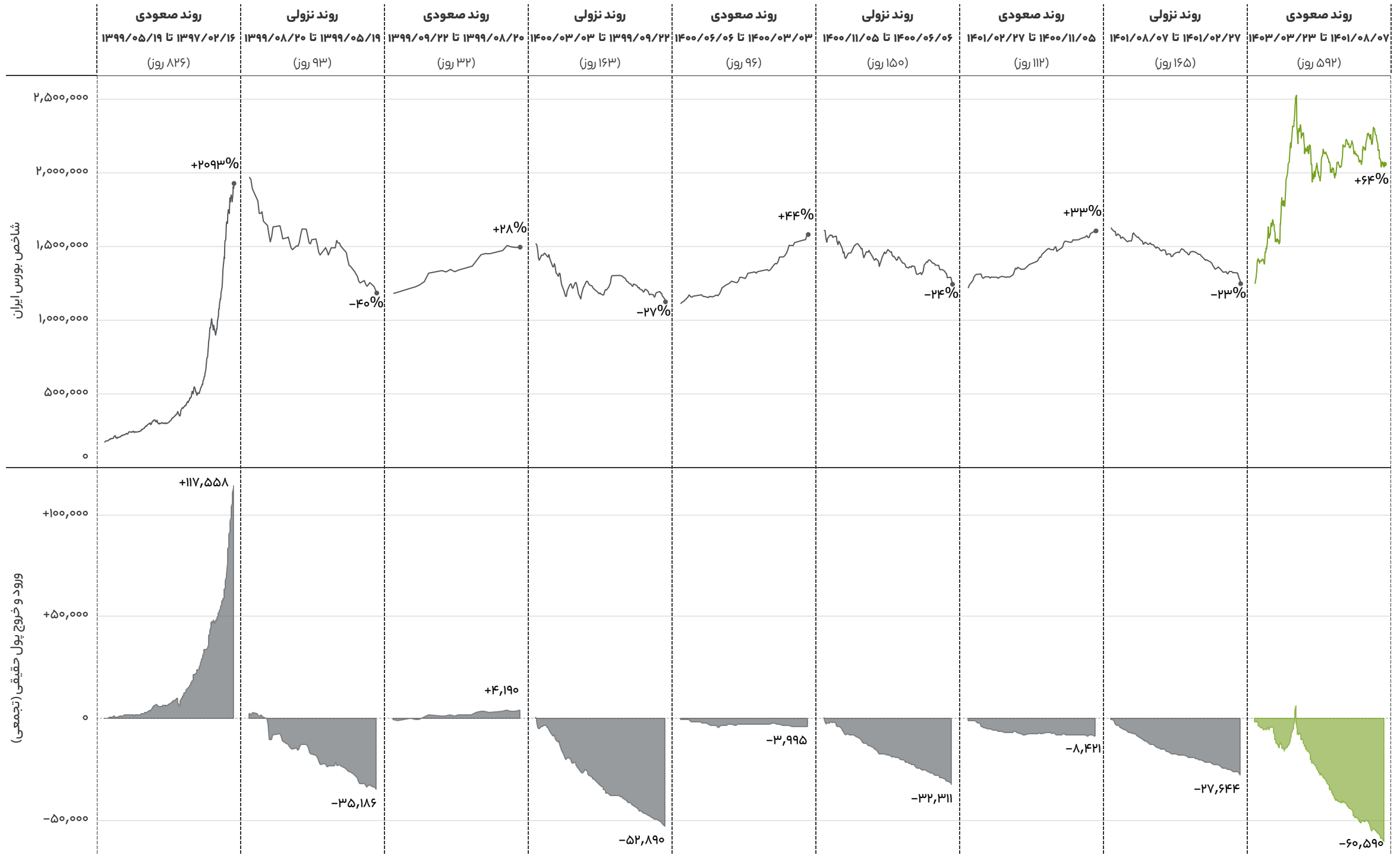
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



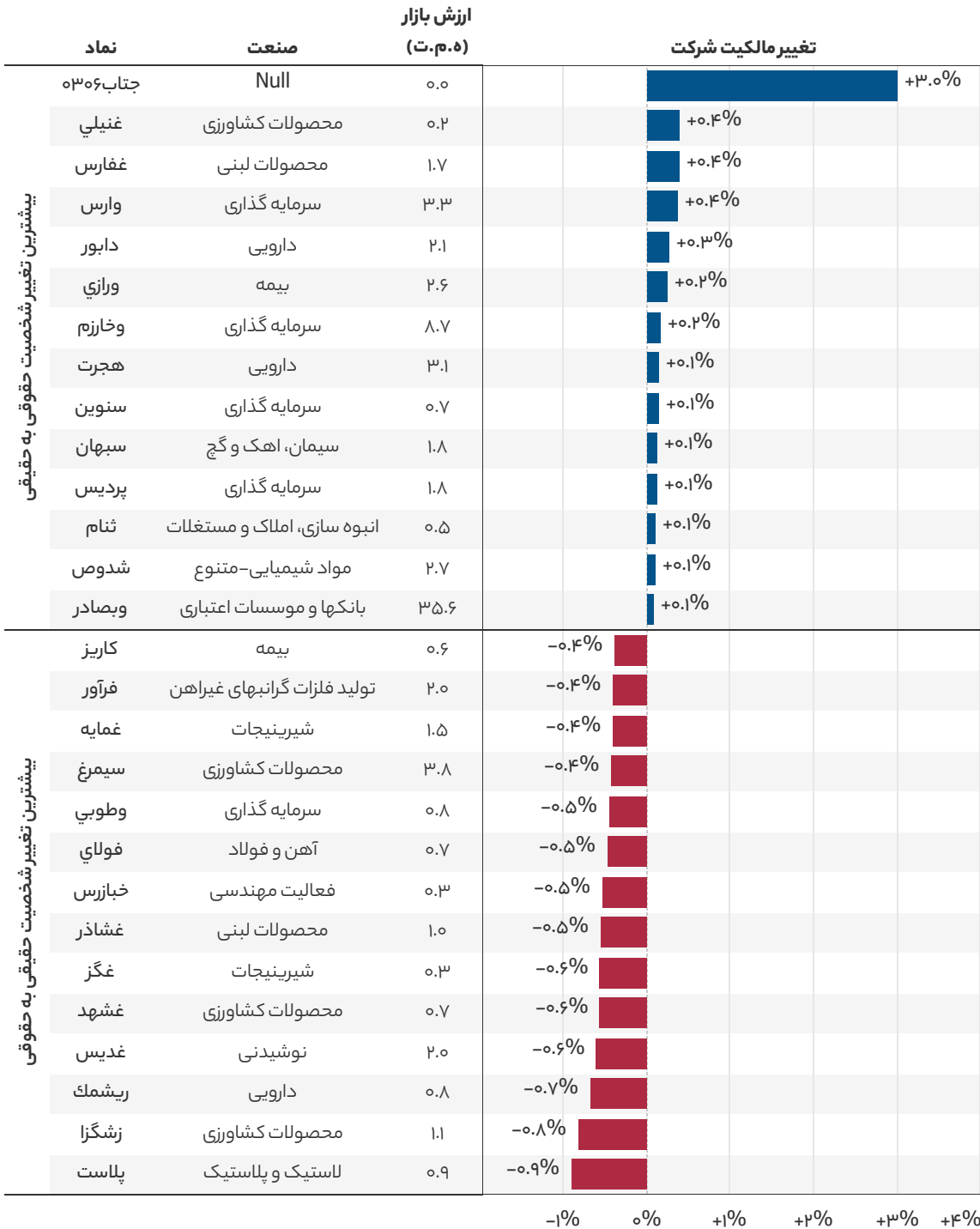
ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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



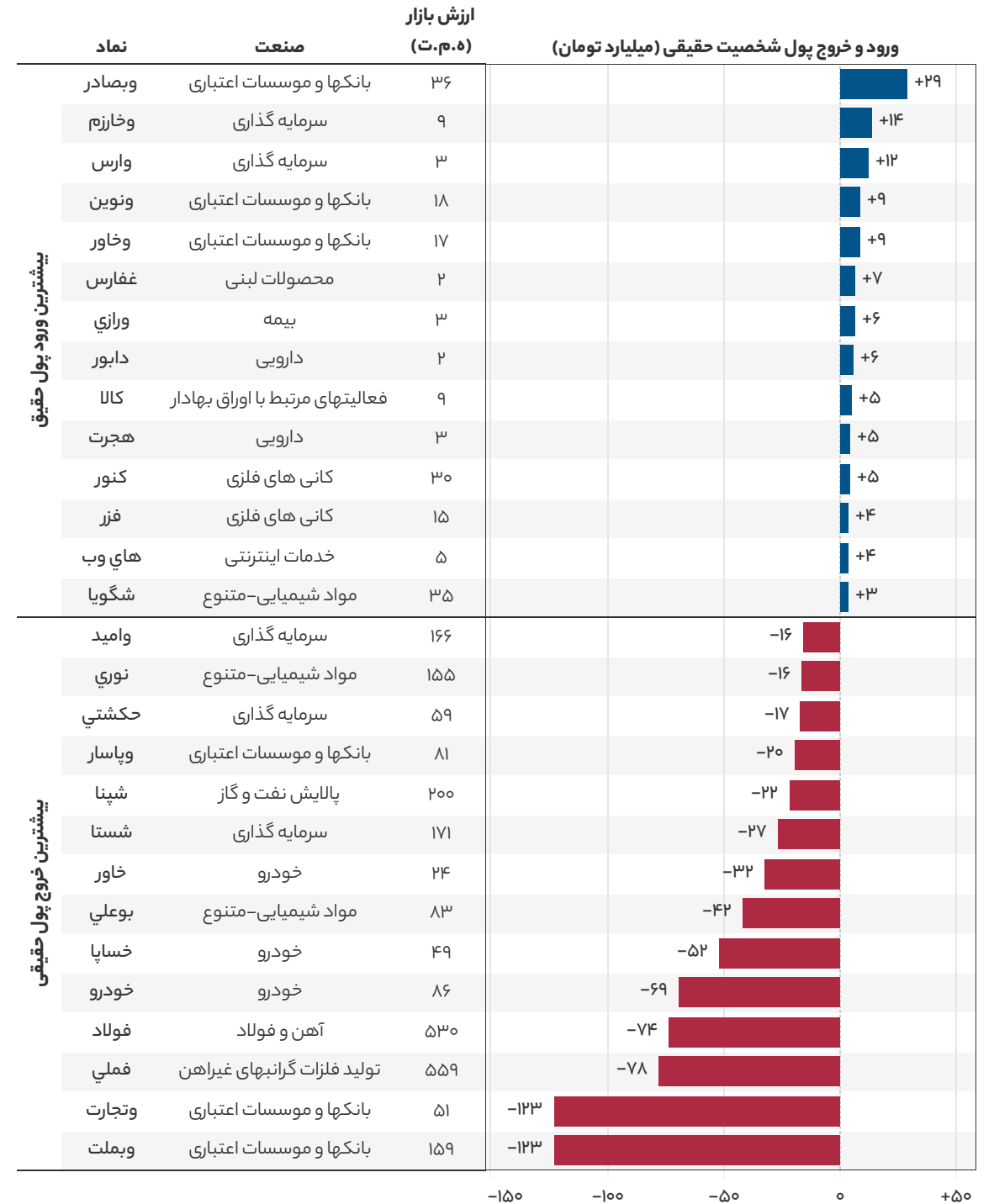
تغییر مالکیت شرکت

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




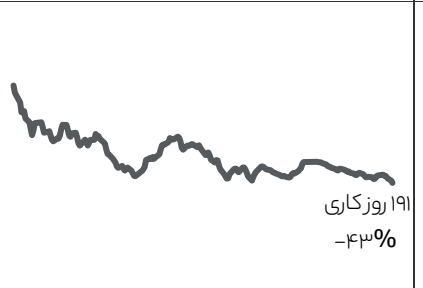
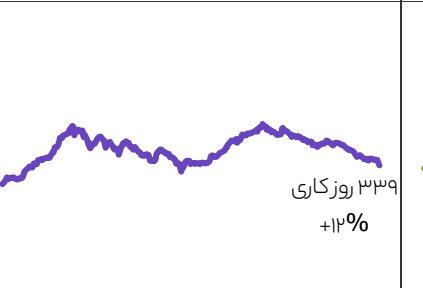
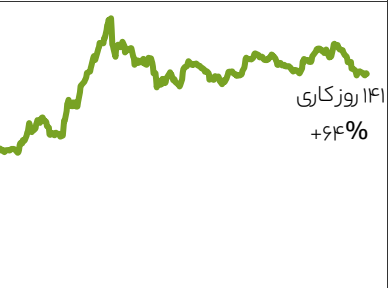
ورود و خروج پول حقیقی

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 ۱۴۰۲ و ۱۴۰۱ (۱۴۰۱/۰۸/۰۴ تا کنون)
					
مواد پایه	فلزات و استخراج	آهن و فولاد: ۵۶۴%	-۳۴%	۶%	۸۹%
		تولید فلزات گرانبهای غیراهن: ۸۵۴%	-۳۲%	-۱%	۲۰۸%
		کانی های فلزی: ۴۹۱%	-۱۴%	۸%	۲۲%
		سایر مواد معدنی: ۵۲۸%	-۷۱%	-۲۷%	۲۴۹%
	شیمیایی	مواد شیمیایی-متنوع: ۴۰۰%	-۱۶%	۳۲%	۵۷%
		تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۴۶۶%	-۲۰%	۹۸%	۱۳%
	مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ: ۵۱۲%	-۱۷%	-۸%	۱۳۸%
		سایر محصولات کانی غیرفلزی: ۴۳۰%	-۱۸%	-۳۵%	۶۷%
		کاشی و سرامیک: ۴۶۳%	۱۳%	-۳۴%	۱۳۵%
	محصولات چوبی	محصولات کاغذی: ۳۸۵%	۸۸%	-۵۱%	۲۹۵%
کاغذ و محصولات جنگلی	چوب: ۳۷۴%	-۷%	-۵۹%	۸۸%	
خدمات مالی	هلدینگ های سرمایه گذاری	۸۸۱%	-۵۲%	۱۸%	۶۴%
	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه: ۱۲۸۷%	-۵۲%	۳۷%	-۱۵%
		فعالیت های مرتبط با اوراق بهادار: ۹۱۶%	-۵۸%	-۷۴%	۱%
		لیزینگ: ۵۱۳%	-۴۲%	-۲۶%	۶۵%
	بانک ها	بانک ها و موسسات اعتباری: ۷۲۸%	-۴۰%	-۲۶%	۶۱%
بیمه	بیمه: ۶۹۳%	۲۹%	۱۰%	-۲۱%	
انرژی	پالایش نفت و گاز	نفت، گاز و سوخت های مصرفی: ۶۸۳%	-۶۸%	۸۷%	۸۶%
	زغال سنگ	۲۴۸%	۳%	-۱۸%	۵۶%
	تجهیزات انرژی و خدمات حفاری	۳۶۵%	-۵۰%	-۳۳%	۱۵۷%

بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

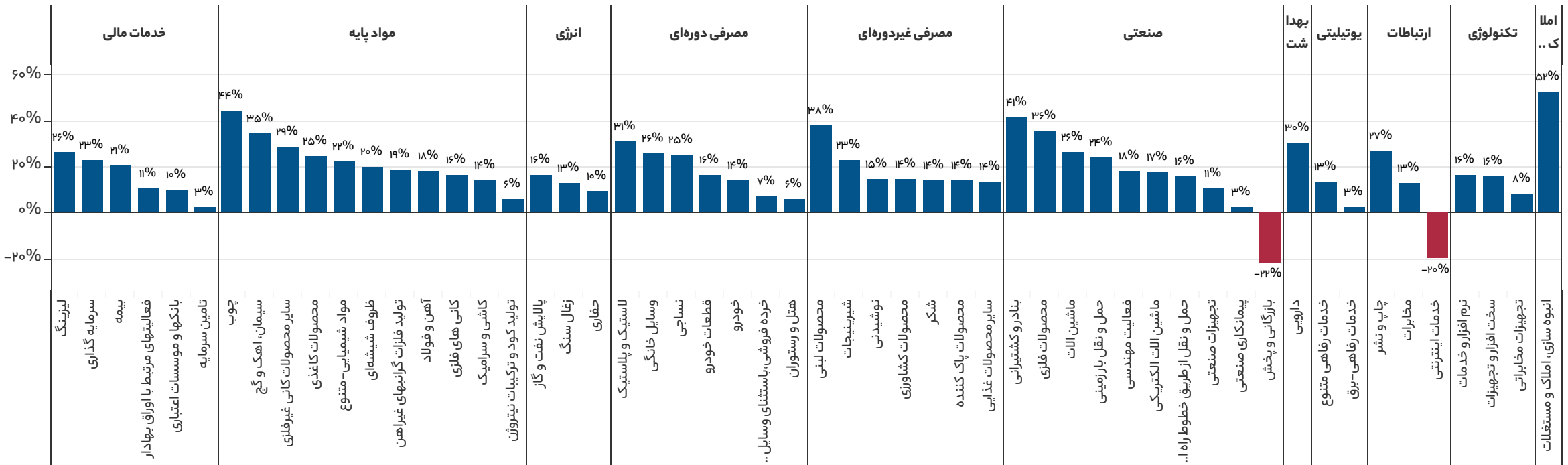
		رشد ۱۳۹۹		ریزش ۱۴۰۰ و ۱۳۹۹		کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲	
مصرفی دوره ای	خودرو و قطعات	خودرو	۱۲۴۷%	-۷۰%		۱۳%		۴۸%	
		قطعات خودرو	۶۷۶%	-۳۲%		-۲۵%	۴۴%		
		لاستیک و پلاستیک	۶۳۱%	-۳۴%		-۴۲%	۱۴۹%		
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۱۲۹%	-۲۳%		۳%	۱۴۰%		
		وسایل خانگی	۴۹۰%	-۴۶%		-۳۶%	۱۲۰%		
	کالای مصرفی با دوام	نساجی	۳۸۰%	-۲۱%		-۳۵%	۱۳۰%		
خدمات مصرف کننده		هتل و رستوران	۱۱۶۶%	-۶۷%		۱۸%	۲%		
مصرفی غیردوره ای	غذا و نوشیدنی	سایر محصولات غذایی	۶۹۹%	-۳۴%		-۳۹%	۳۰%		
		محصولات کشاورزی	۳۹۷%	-۳۵%		۹%	۲۱%		
		شکر	۴۳۵%	-۲۲%		-۴۴%	۵۹%		
		محصولات لبنی	۳۸۳%	۷%		-۵۴%	۱۰۲%		
		شیرینیجات	۵۹۵%	-۲۴%		-۶۳%	۳۴%		
		نوشیدنی	۵۳۹%	-۱۵%		-۳۱%	۴۷%		
	محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۳۰۶%	۴%		-۱۲%	۲۰%		
صنعتی	کالاهای سرمایه ای	فعالیت مهندسی	۵۲۱%	-۶۳%		-۷%	۵۷%		
		ماشین الات الکتریکی	۵۰۱%	-۴۵%		-۲۳%	۶۰%		
		ماشین الات	۴۲۲%	-۳۵%		-۳۱%	۱۴۲%		
		محصولات فلزی	۶۴۵%	-۵۴%		-۴۴%	۸۱%		
		تجهیزات صنعتی	۸۴۷%	-۳۰%		-۴۰%	۳۸%		
		پیمانکاری صنعتی	۵۲۵%	-۱۵%		-۶۸%	۶۳%		
	ترابری	بنادر و کشتیرانی	۲۴۶%	-۲۲%		-۱۵%	۲۲۹%		
حمل و نقل از طریق راه آهن		۳۲۷%	-۱۳%		-۴۱%	۲۲%			
حمل و نقل بار زمینی		۲۵۰%	-۱۸%		۳۳%	۴۰%			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۳۲۱%	-۳۲%		-۱۳%	۷۲%		
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۲۵۲%	-۳۵%		۲%	۵۳%		
	سخت افزار و تجهیزات	سخت افزار و تجهیزات	۵۷۰%	-۶۵%		-۴۵%	۱۸۱%		
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۱۰%	-۳۵%		۱۳۱%	۴۸%		
		خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%	-۵۴%		-۳۳%			
ارتباطات	خدمات دور برد	مخابرات	۵۳۲%	-۷۱%		-۱۳%	۱۷%		
	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۲۳%	-۵۲%		-۵۲%	۱۴۸%		
املاک و مستغلات	توسعه املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۶۱۹%	-۴۳%		-۴۵%	۲۴۰%		

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)

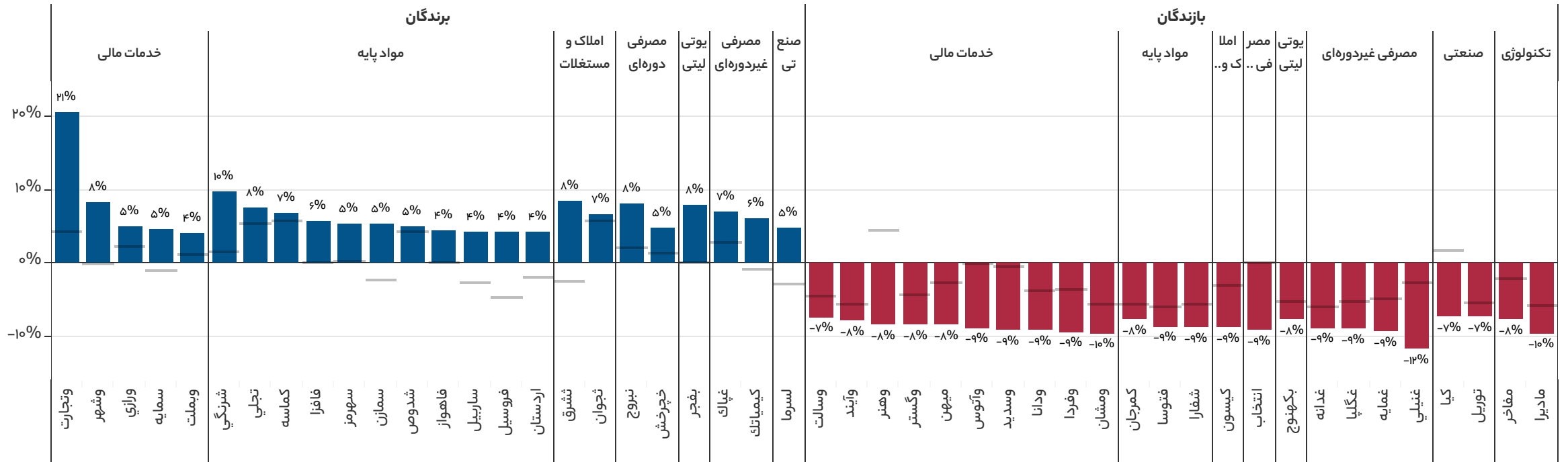

بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

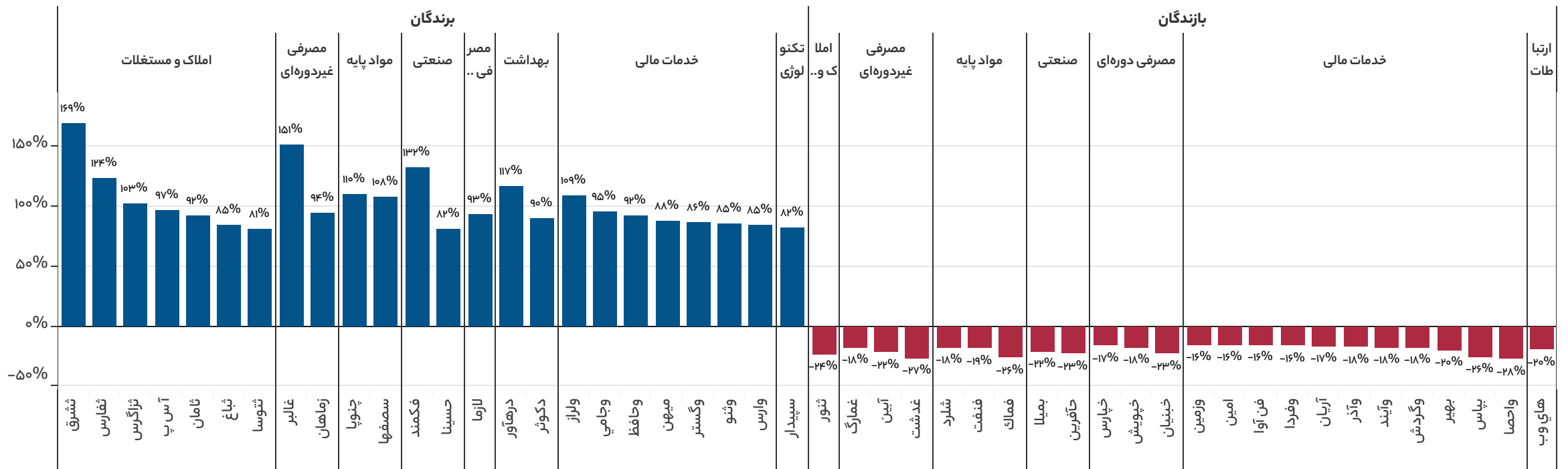




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)

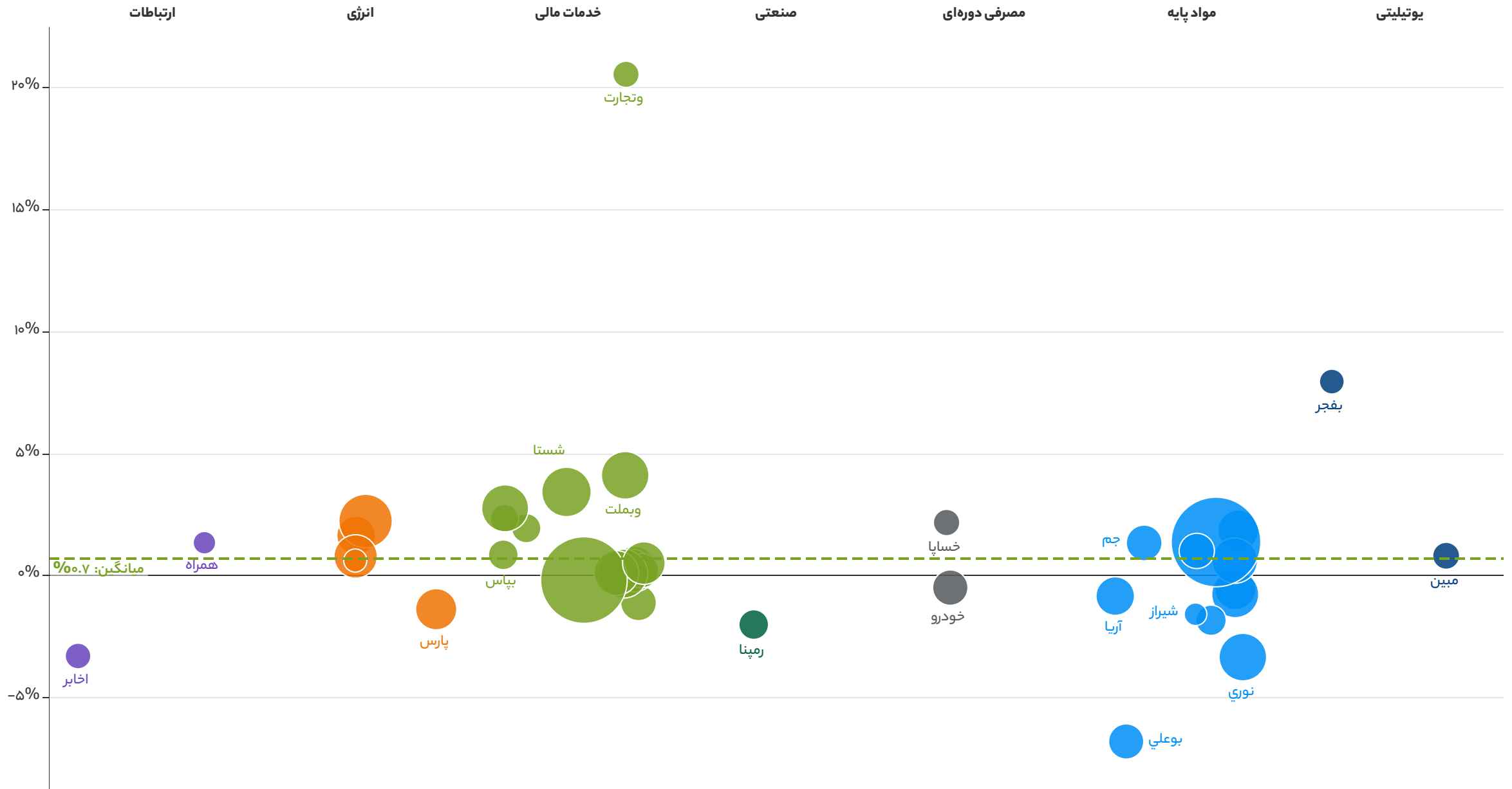


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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



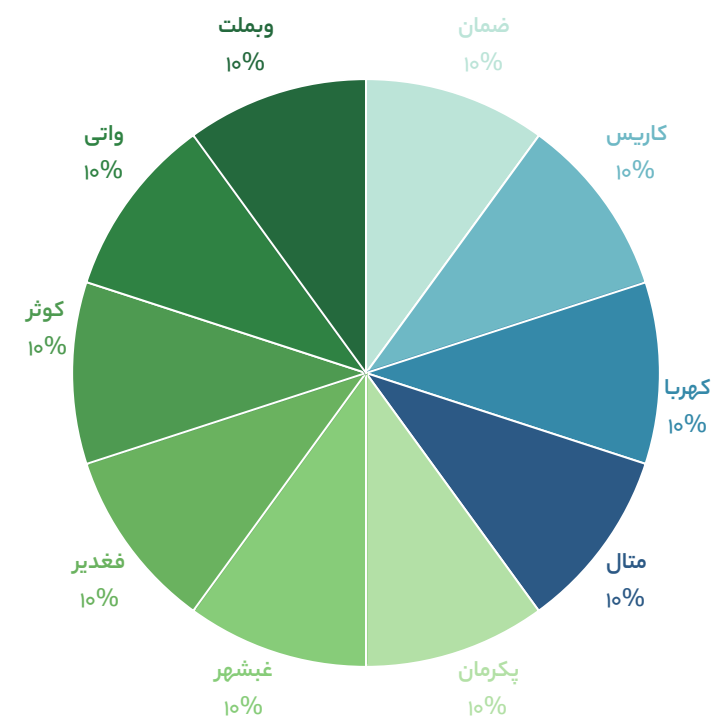
بازدهی هفته گذشته	تجارت	بفجر	وبملت	شستا	تاپیکو	تامیکو	شپنا	خسپا	حکشتی	ماون	شتان	فملي	همراه	جم	شپدیس	پپاس	مبین	شبندر	شبریز	کچاد	پارسان	وسندوق	وغدیر	وپاسار	میدکو	وامید	فارس	خودرو	کگهر	کگل	آریا	ومعادن	پارس	شیراز	فخوز	رمپنا	اخبر	نوری	بوعلی
	+۲۰.۶%	+۸.۰%	+۴.۱%	+۳.۵%	+۲.۸%	+۲.۴%	+۲.۳%	+۲.۲%	+۲.۰%	+۱.۹%	+۱.۷%	+۱.۴%	+۱.۴%	+۱.۴%	+۱.۰%	+۰.۹%	+۰.۹%	+۰.۸%	+۰.۷%	+۰.۷%	+۰.۶%	+۰.۴%	+۰.۳%	+۰.۲%	+۰.۱%	+۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۱.۱%	-۱.۳%	-۱.۵%	-۱.۸%	-۲.۰%	-۳.۳%	-۳.۳%	-۶.۷%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

افق زمانی	نماد	هدف قیمتی	توضیحات	قیمت سهم	وزن پیشنهادی
میان مدت	پکرمان	۲۵,۰۰۰	مناسب و عملکرد خوب در گزارشات ماهانه (P/E)	۱۹,۷۹۰	۱۰%
	غبشهر	۲,۶۰۰	مناسب و پتانسیل حذف ارزش ۲۸,۵۰۰ (P/E)	۱,۸۷۴	۱۰%
	فغدیر	۱۲,۰۰۰	بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب	۷,۸۶۰	۱۰%
	کوثر	۳۲,۱۰۰	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۲,۲۵۲	۱۰%
	واتی	۸,۲۰۰	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۶,۱۱۰	۱۰%
	وبملت	۲,۸۰۰	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۲,۲۵۹	۱۰%
بلند مدت	ضمان	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	۱۵,۹۸۰	۱۰%
	کاریز	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب	۲۱,۵۱۵	۱۰%
	کهربا	---	نسبت ریسک به ریوارد مطلوب و محافظت در برابر نوسانات دلار	۳۳,۶۳۹	۱۰%
	متال	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۱۰,۹۹۰	۱۰%



ارتباط با ما

فکس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶
شماره تماس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶
تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: www.charisma.ir
شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: [@CharismaHolding](https://t.me/CharismaHolding)

پست الکترونیکی: info@ciaco.ir
تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما: www.ciaco.ir
شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک: [@CharismaTickReports](https://t.me/CharismaTickReports)
تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، کوچه حکیم اعظم، پلاک ۱۷

