



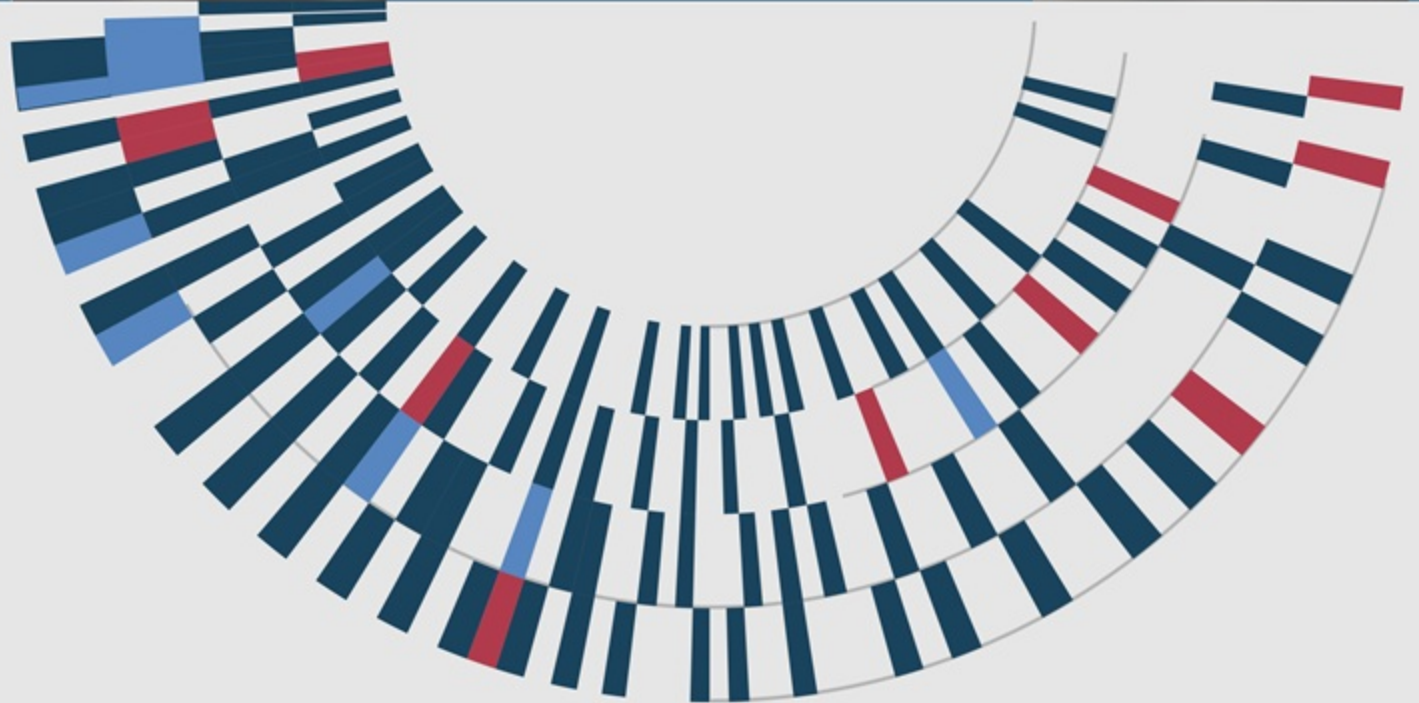
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۵۶ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۰۱

 CHARISMA





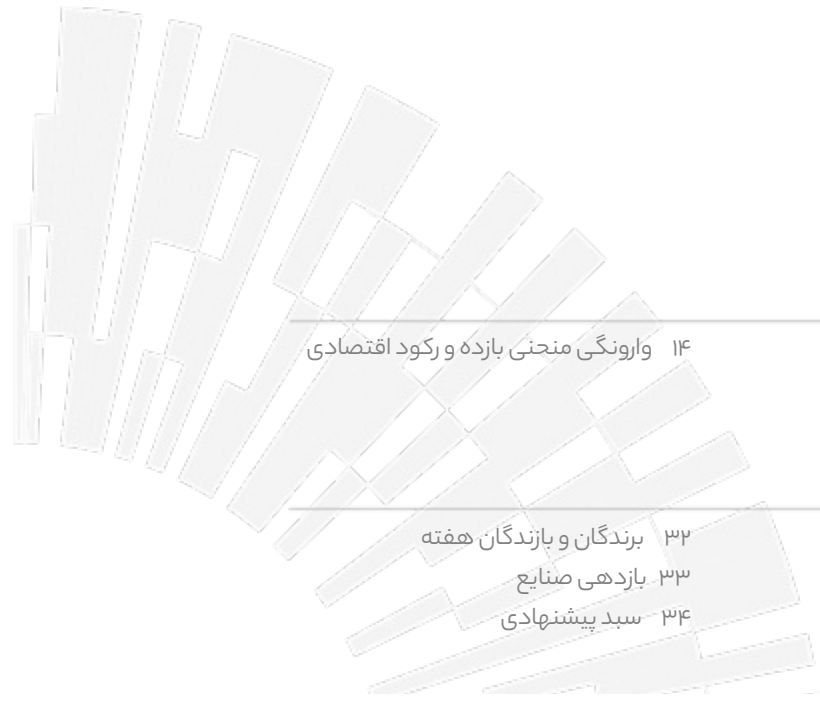
معرفی گزارش:

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	تأثیر در فروش	تأثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	رند قیمتی ۱۲ ماهه	
فلزات غیر آهنی	طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۲,۳۲۱	+۱.۴%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۴۱۵	۲۱%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۹,۶۹۰	-۰.۷%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۱۰,۷۲۴	۱۵%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵۱۰,۰۰۰	-۲.۷%	فملی	بموتو، فباهنر	۳۲۵,۷۰۰ - ۵۳۱,۰۱۲	۴۶%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۴۵۵	-	فایرا	فنوال	۲,۱۰۲ - ۲,۴۵۵	۱۱%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۸۶۱	+۳.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۳,۰۶۶	۲۱%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۸۹	-۰.۳%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۳۰۸	۳%
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۸۰	+۰.۷%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۵۹ - ۵۰۰	-۲%
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۹	-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۵۲۴	-۲%
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۶۵۰	+۸.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، 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	-۳.۰%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۵۵۸	-۳%
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۵۱۸	+۰.۱%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۵۰۰	۱۸%
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۵	-	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۶۲۳	-۸%
	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	۱۱۶	-	-	۹۹ - ۱۴۳	۴%
	گندله سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۳۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	۱۱۵ - ۱۶۴	۵%
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵,۱۹۹	+۱.۳%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	۴,۴۰۰ - ۵,۳۰۵	۷%
	کنسانتره سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۲۳	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	۱۰۵ - ۱۵۳	۴%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۷۶۵	-۰.۸%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	۳,۴۶۹ - ۳,۸۱۰	۴%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۰۷	-۱۰.۲%	-	۱۹۹ - ۲۶۸	-۲۳%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۷۱	-۳.۱%	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۲۳۰	-۲۶%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۴۶۳	+۵.۷%	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۱%
	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	۳۰۴	-	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۷ - ۳۱۲	۲۸%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۴۵	-۰.۵%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۱,۰۱۰	۲۹%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۶۵	+۱.۲%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۴۵ - ۸۶۵	۱۴%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۴۵	-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۹ - ۱,۱۵۸	۹%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۹۰	-	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۴۰	۶%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۲۰۳	-	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۲۰۳	۲۴%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۴	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۸۴	۲۷%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۲۸	-	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۵۲	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۵۰۰	+۹.۵%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۵۰۰	۱۳%
مونواتیلن گلابکول	چین CFR	دلار/تن	۵۳۵	-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۵۶	۱۵%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۵۵	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۵۹	۱۷%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۹۸۵	۳%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۵	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۶۱	۴%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۰۱	-	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۰۱	۱۳%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۹۷۵	۲%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۰۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۷۴۰ - ۸۸۵	۵%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۸۰	-	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۸۰	۱۹%

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	۸۵	+۷.۳%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاوان	۷۴ - ۹۴	۱۵%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۱	+۷.۲%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاوان	۶۹ - ۹۱	۱۶%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۱	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۸۱ - ۱۰۷	-۱%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۹	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۸۵ - ۱۲۵	۵%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۷۳	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۳۸۱ - ۵۲۸	۲۰%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۰	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	-	۸۶ - ۱۲۴	۵%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۰۴	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	بوعلی، نوری	۴۵۲ - ۶۵۹	۳۴%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۸۹۰	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	-	۷۲۰ - ۹۳۰	-۱%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۵,۱۴۴	-۳.۶%	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	-	۲۱,۷۹۵ - ۳۶,۹۴۳	۶۹%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۶۳۰	+۰.۹%	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاوان	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۱۲,۴۵۵ - ۲۲,۶۳۰	۸۲%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۶,۰۷۴	+۶.۵%	شپاس	-	۱۲,۰۸۶ - ۱۶,۵۰۰	۳۳%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۰۸	-	-	ذوب، فروش	۱۸۸ - ۲۸۷	۰%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۷	-۱.۰%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	-۲%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	-۰.۶%	-	-	۱.۲۱ - ۱.۳۱	-۱%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۴,۲۹۷	-۶.۹%	-	-	۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	۱۰۸%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

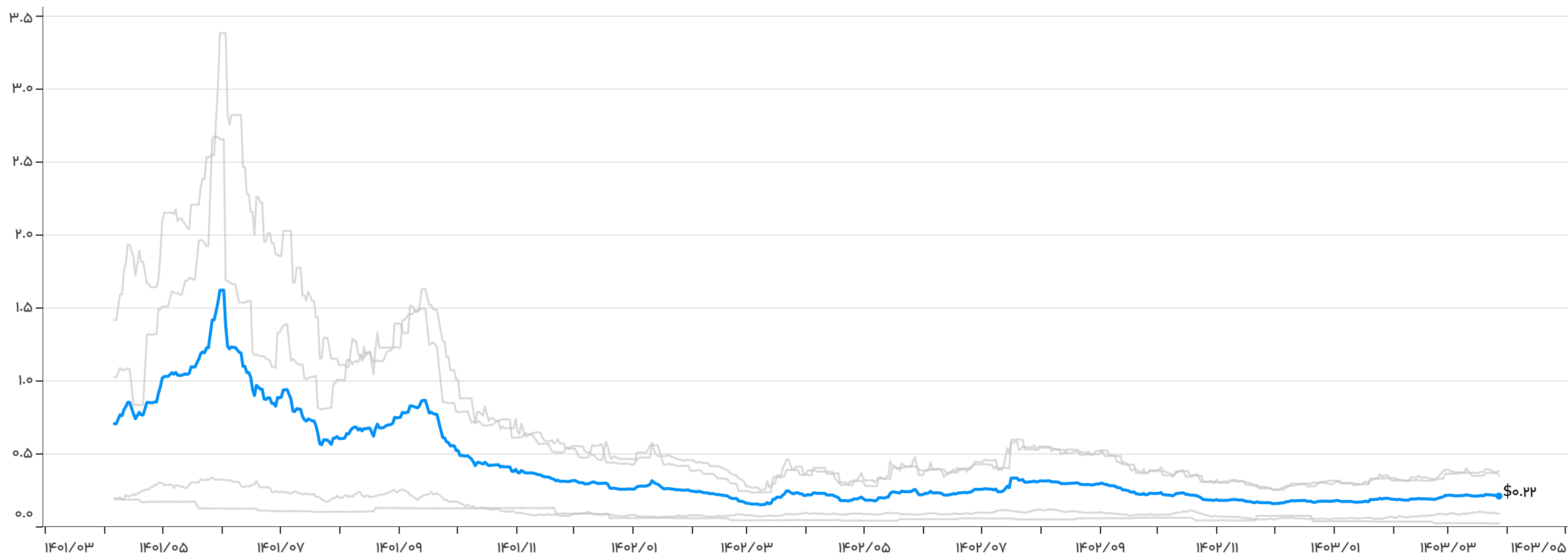
ارز و ارز دیجیتال



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	-۱.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۳%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۳	-	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۳ - ۰.۰۸	-۴۴%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	+۱.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۱%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۵	-۵.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۰.۶۱	-۱۴%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۲	-۱.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۹%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

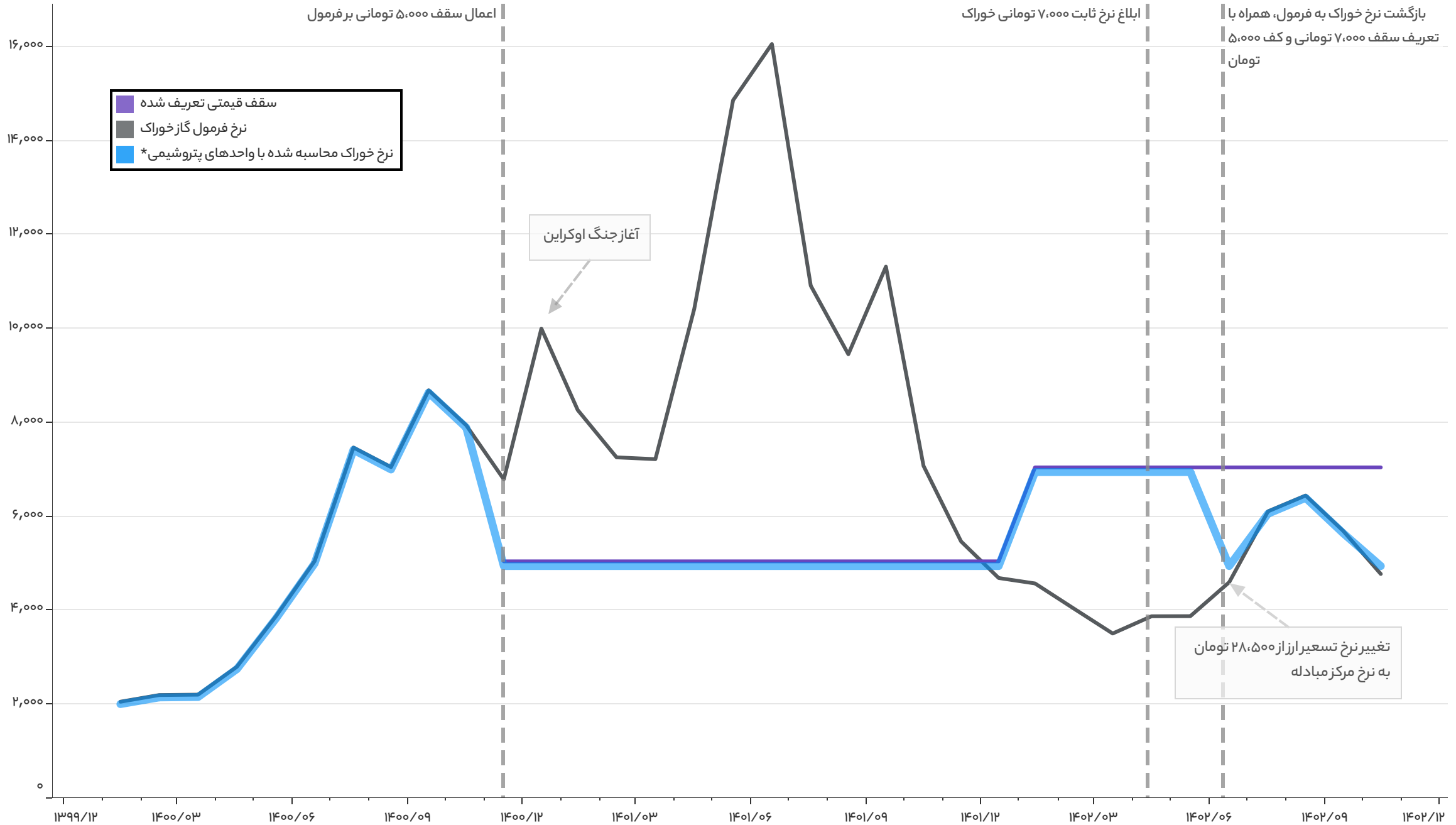
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





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

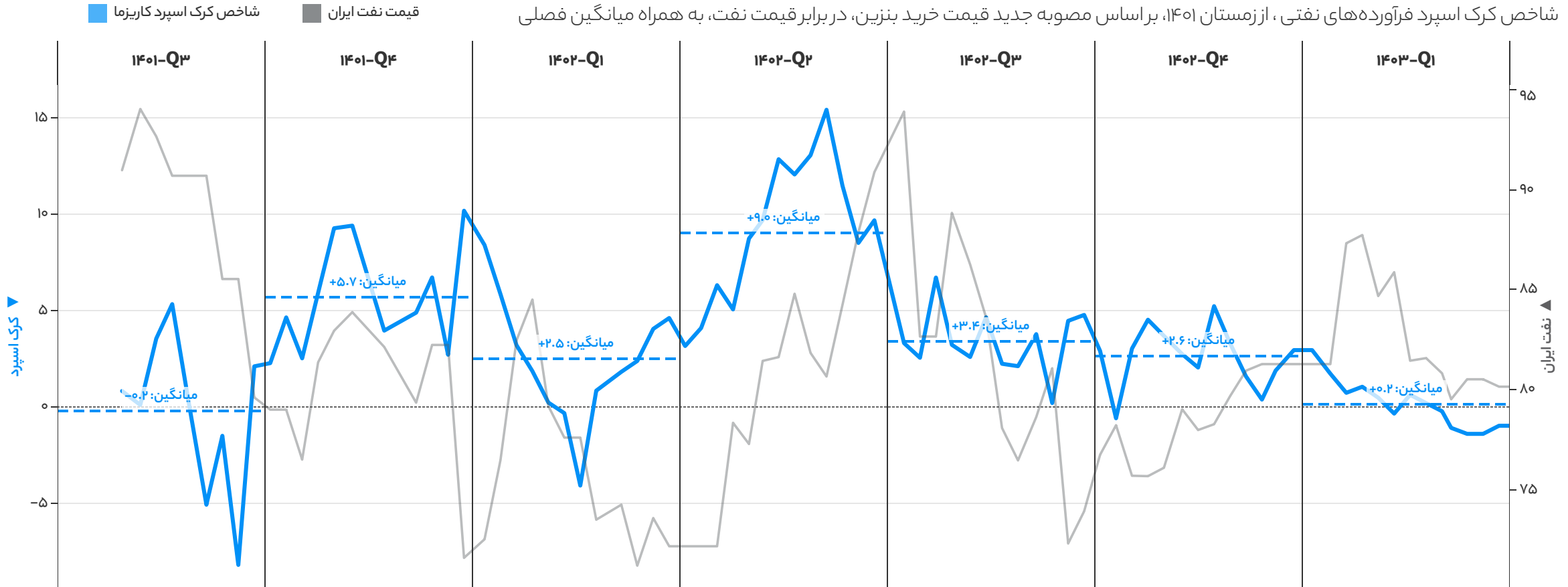


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بر روزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



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	۸۸.۹	۸.۳	۸.۷	▲ ۰.۴	۱۹.۵	۱۰.۹	-۴۴.۲%		
بنزین**	۷۵.۷	-۴.۹	-۴.۵	▲ ۰.۴	۵.۰	۲.۰	-۶۰.۴%		
نفتا	۶۸.۴	-۱۲.۲	-۱۱.۸	▲ ۰.۴	-۹.۶	-۱۲.۲	-۲۷.۵%		
نفت کوره	۷۴.۶	-۵.۹	-۵.۵	▲ ۰.۴	-۱۵.۰	-۸.۶	+۴۲.۷%		
لوب کات***	۸۳.۳	۲.۰	۳.۲	▲ ۱.۱	-۶.۲	-۱.۲	+۷۹.۹%		
وکیوم باتوم***	۵۵.۰	-۲۶.۳	-۲۵.۲	▲ ۱.۱	-۳۰.۸	-۲۹.۹	+۲.۹%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		-۱.۳	-۰.۹	▲ ۰.۴	۲.۶	۰.۲	-۹۴.۱%		

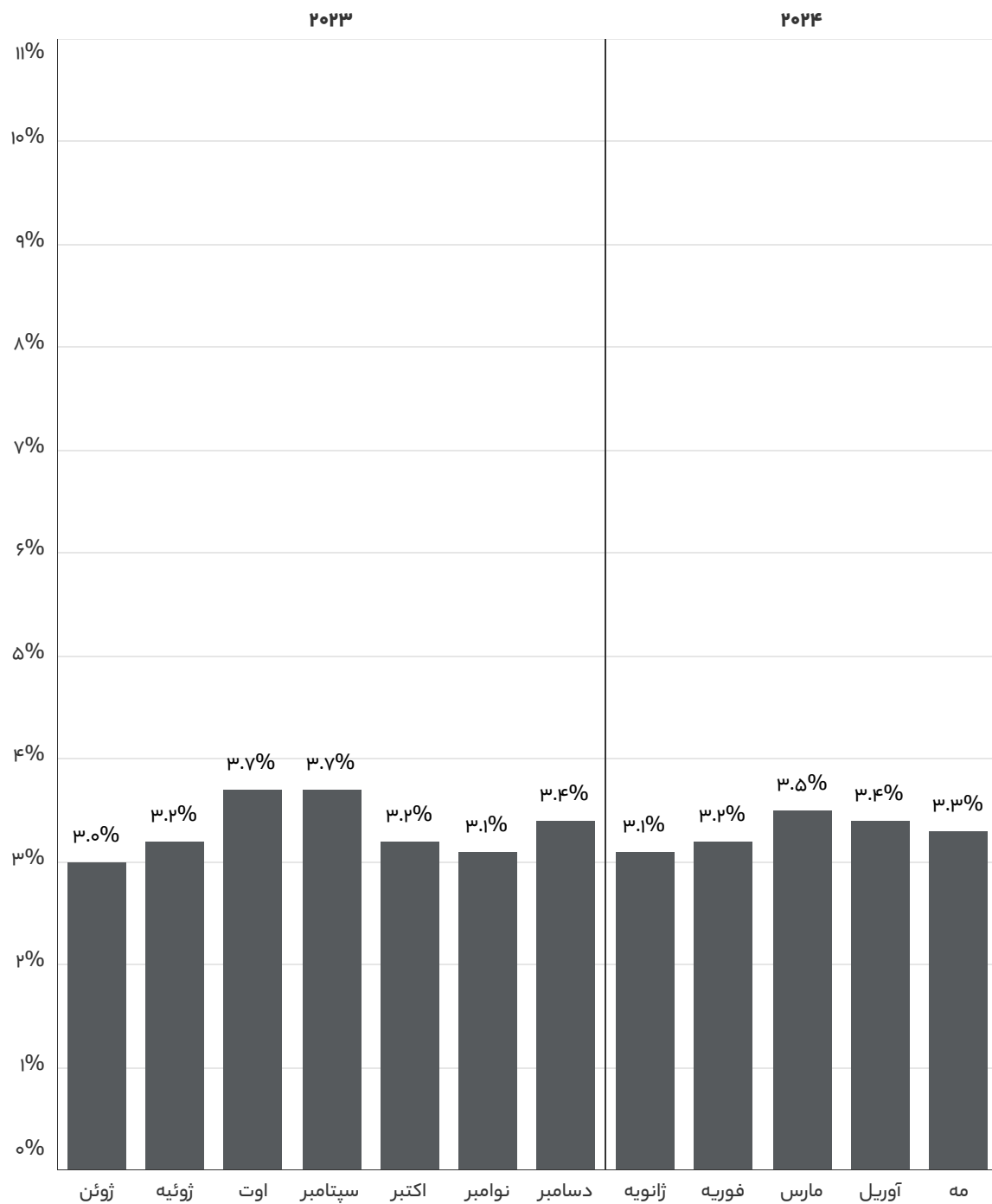
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هر یک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هر یک از این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

- ▲ قیمت جهانی طلا با رشد ۳۰ دلاری طی پنجشنبه و جمعه به بالاترین سطح دو هفته اخیر رسیده و در آستانه دومین افزایش قیمت هفتگی قرار دارد. بالا رفتن تقاضا برای طلا به عنوان یک پشتوانه ایمن در بحبوحه تنش‌ها در خاورمیانه و افزایش احتمال کاهش نرخ بهره فدرال رزرو در سال جاری میلادی از قیمت طلا حمایت کرده است. قیمت هر اونس طلا صبح جمعه ۱ تیر با ۰.۰۹ درصد افزایش به ۲۳۶۲.۲۵ دلار رسید. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک افزایش ۰.۲۶ درصدی به ۲۳۷۵.۱ دلار رسیده است. حملات هوایی جدید به نوار غزه خطر گسترش درگیری در خاورمیانه را افزایش داده است. بازارها حالا منتظر کاهش نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا در ماه سپتامبر هستند که می‌تواند از قیمت طلا حمایت کرده و آن را بالاتر از سطح ۲۳۰۰ دلار نگه دارد.
- ▼ اطلاعات اقتصادی آمریکا که در روز پنجشنبه ۳۱ خرداد منتشر شد نشان داد درخواست برای مزیای بیکاری در این کشور طی هفته گذشته کاهش یافته است. این خبر به همراه گزارش ضعف خرده‌فروشی در این کشور در ماه گذشته احتمال پایین آمدن نرخ بهره در ماه سپتامبر را بالاتر می‌برد. کاهش نرخ بهره هزینه نگهداری طلا به عنوان یک سرمایه غیرسودده را پایین آورده و تمایل برای خرید آن را افزایش می‌دهد. بازار در حال حاضر منتظر گزارش شاخص مدیران خرید در آمریکا است. در میان سایر فلزات گرانبها، قیمت نقره با ۰.۵۶ درصد کاهش به ۴۴۹.۷۵ دلار رسید و پلاتین با یک کاهش ۰.۰۸ درصدی ۹۸۳.۵۳ دلار سنت معامله می‌شود.
- ▲ روز سه‌شنبه ۲۹ خرداد، قیمت نفت به دنبال حمله پهپادی اوکراین به یک پایانه نفتی در بندر بزرگ روسیه، بیش از یک درصد صعود کرد و به بالاترین سطح از ابتدای ماه مه رسید. نگرانی در مورد تشدید درگیری در اروپا و خاورمیانه تاثیر افزایش ذخایر نفت خام را خنثی کرده و باعث بالا رفتن قیمت نفت در اولین ساعات تجارت در روز چهارشنبه شده است. قیمت هر بشکه نفت برنت صبح چهارشنبه به ۸۵.۳۶ دلار رسید. نفت سبک آمریکا نیز ۸۱.۵ دلار معامله می‌شود. در این بین، در خاورمیانه وزیر امور خارجه اسرائیل در مورد یک جنگ تمام عیار قریب‌الوقوع با حزب الله لبنان خبر داده است. تشدید درگیری در منطقه نگرانی در مورد مختل شدن عرضه نفت تولیدکنندگان بزرگ خاورمیانه را افزایش می‌دهد. از طرف دیگر، موسسه نفت آمریکا اعلام کرد ذخایر نفت خام این کشور ۲.۲۶۴ میلیون بشکه در هفته منتهی به ۱۴ ژوئن افزایش یافته که می‌تواند مانع بالا رفتن بیش از حد قیمت نفت شود. تحلیلگران انتظار یک کاهش ۲.۲ میلیون بشکه‌ای را در ذخایر نفت خام آمریکا داشتند.
- ▲ آموس هوکشتاین، مشاور ارشد بایدن گفت: قیمت نفت در حال حاضر برای بسیاری از آمریکایی‌ها بسیار بالاست و باید کمی پایین‌تر بیاید. هوکشتاین در گفتگو با فایننشال تایمز گفت آمریکا در سال آینده میلادی هم به خرید نفت برای ذخایر استراتژیک ادامه می‌دهد تا زمانی که مطمئن شود سطح این ذخایر به اندازه کافی برای حفظ امنیت انرژی کافی است. وزارت انرژی آمریکا که در ۲۰۲۲ و به دنبال حمله روسیه به اوکراین ۱۸۰ میلیون بشکه از ذخایر استراتژیک نفتی را فروخت، از ابتدای سال جاری میلادی ماهانه حدود ۳ میلیون بشکه نفت برای پرکردن این ذخایر خریداری کرده است. این اقدام آمریکا در تلاش برای مهار قیمت بنزین انجام شد که به بیش از ۵ دلار در هر گالن رسیده بود، اما سطح ذخایر نفتی را هم به پایین‌ترین سطح طی ۴۰ سال گذشته رساند.
- معاون وزیر نفت اعلام کرد: در جلسه اخیر هیات دولت، چالش‌های موجود در نرخ خوراک پالایشگاه‌ها برطرف و اصلاح آن به تصویب رسید. هفته گذشته سه اصلاح عمده در دستورالعمل نرخ خوراک پالایشگاه‌ها مورد بحث و تفاهم قرار گرفت که این اصلاحات به اختصار عبارت‌اند از: ۱. زمان اجرای دستورالعمل جدید که قبلاً تاریخ اجرای آن از ابتدای سال در نظر گرفته شده بود به همان تاریخ ابلاغ تغییر یافت؛ بنابراین مقرر شد تا محاسبات مدنظر از ابتدای سال تا ۲۳ بهمن ماه سال گذشته طبق دستورالعمل ۱۴۰۱ انجام شود. ۲. میزان عدم‌النفع شرکت‌های پالایشی ناشی از برنامه تولید ابلاغی از سوی شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی که با توجه به شرایط ویژه کشور و کاهش ناترازی بنزین تدوین شده است و به همین دلیل امکان به‌کارگیری حداکثر ظرفیت تولید محصولات با کیفیت بالاتر را از پالایشگاه‌ها سلب می‌کند، محاسبه و در حساب شرکت‌های پالایشی منظور شود. ۳. همچنین مقرر شد تا تسویه بدهی‌های دولت به پالایشگاه‌ها از محل تخصیص خوراک آنها انجام شود.



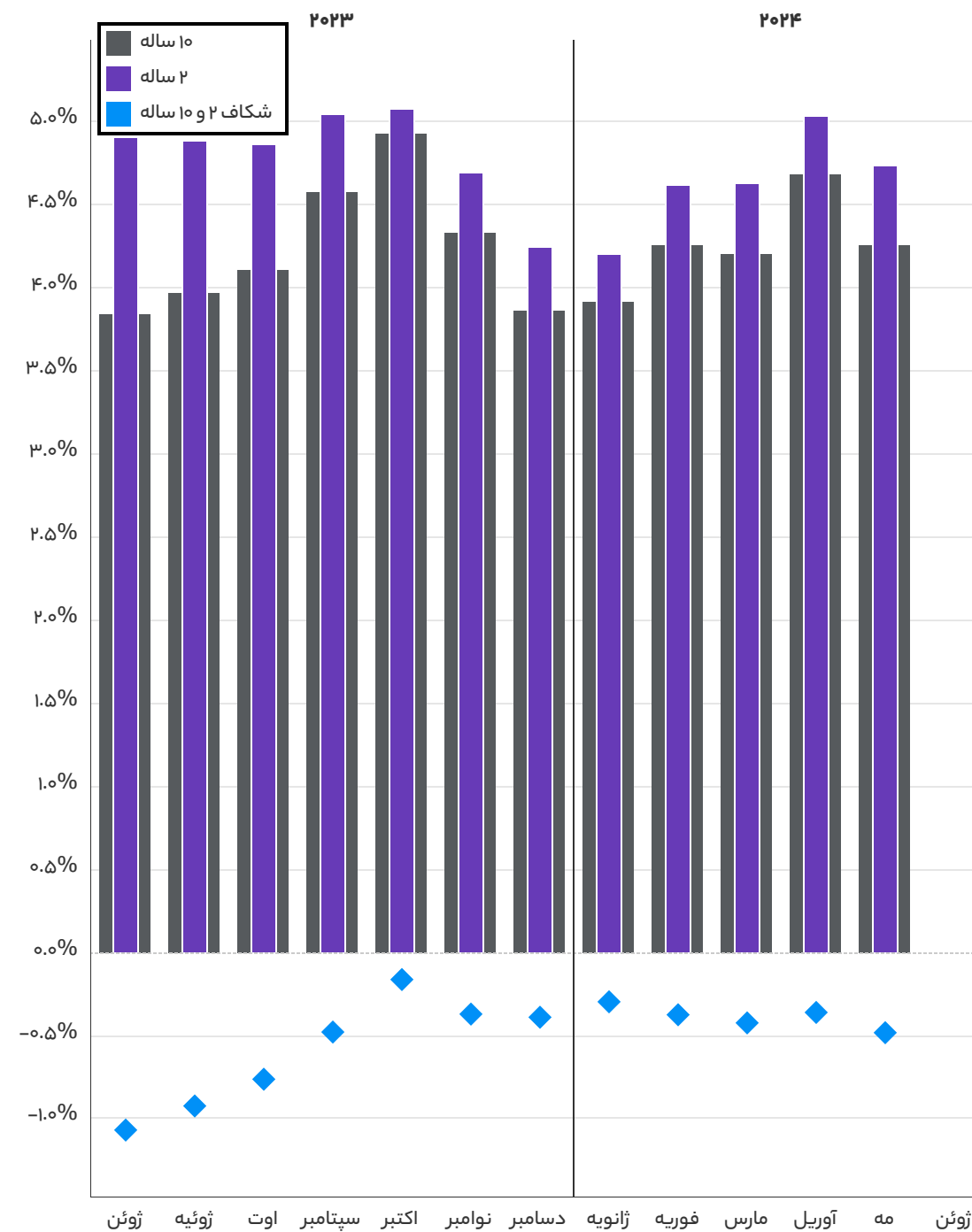
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



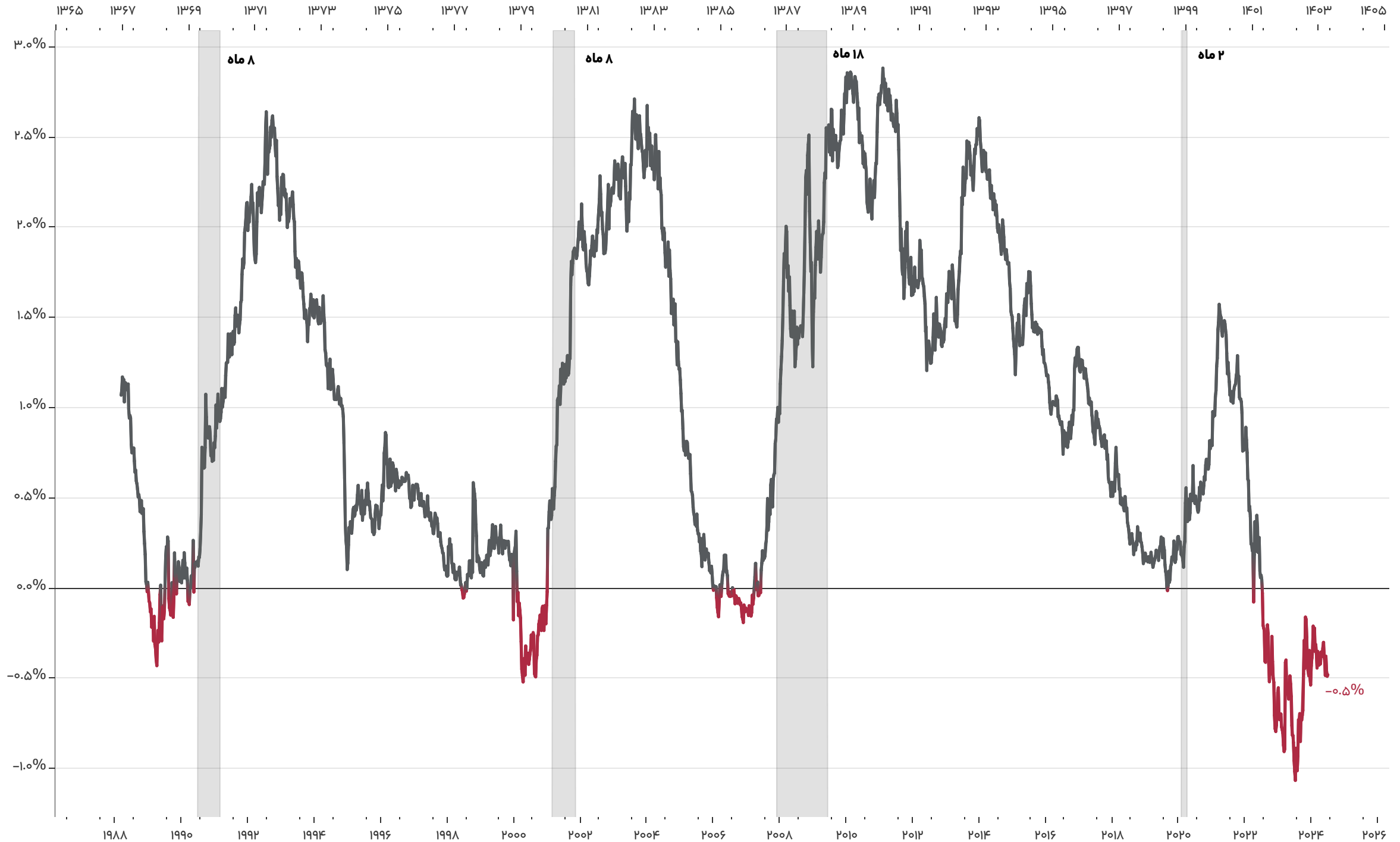
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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



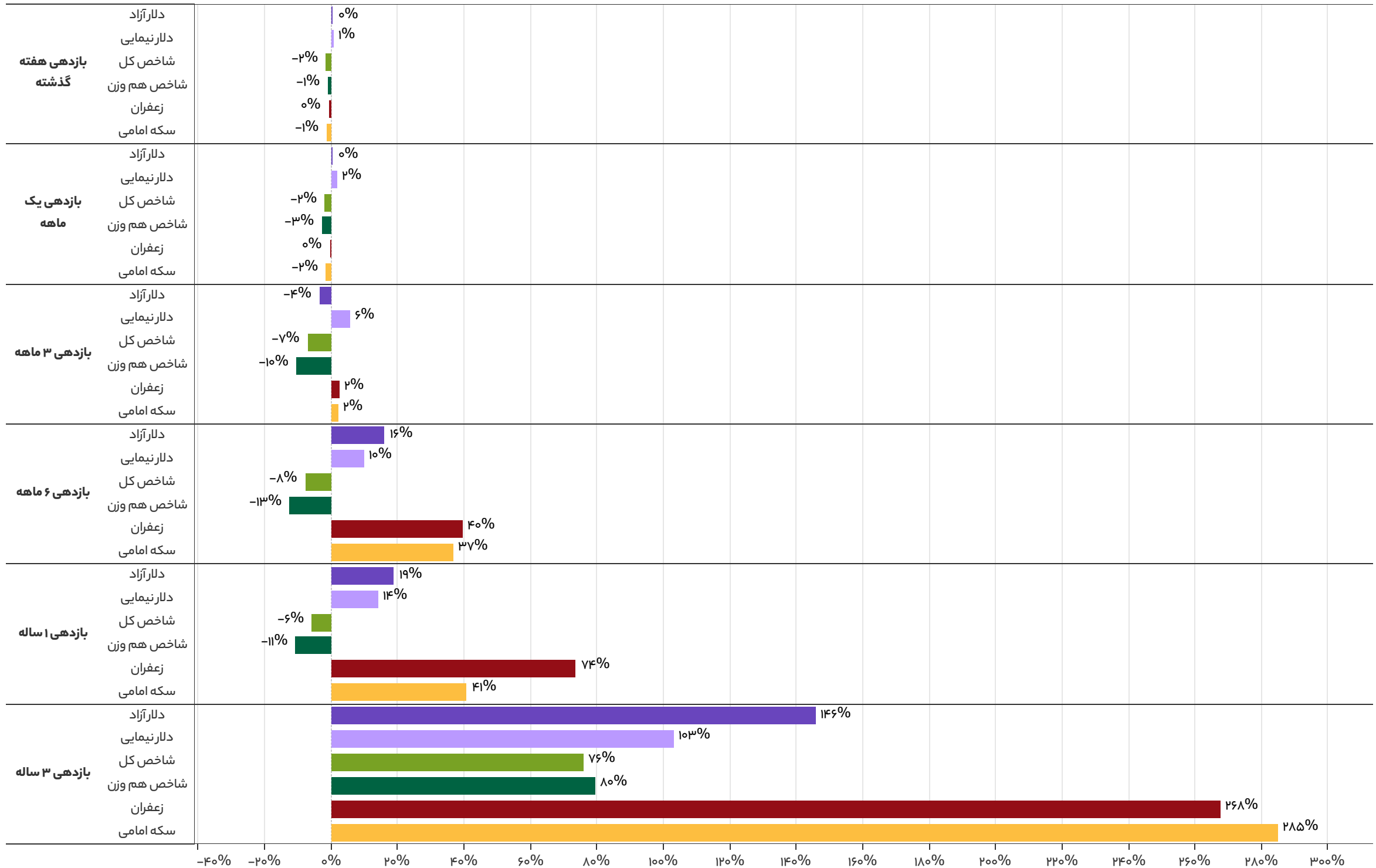
بازار سهام

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

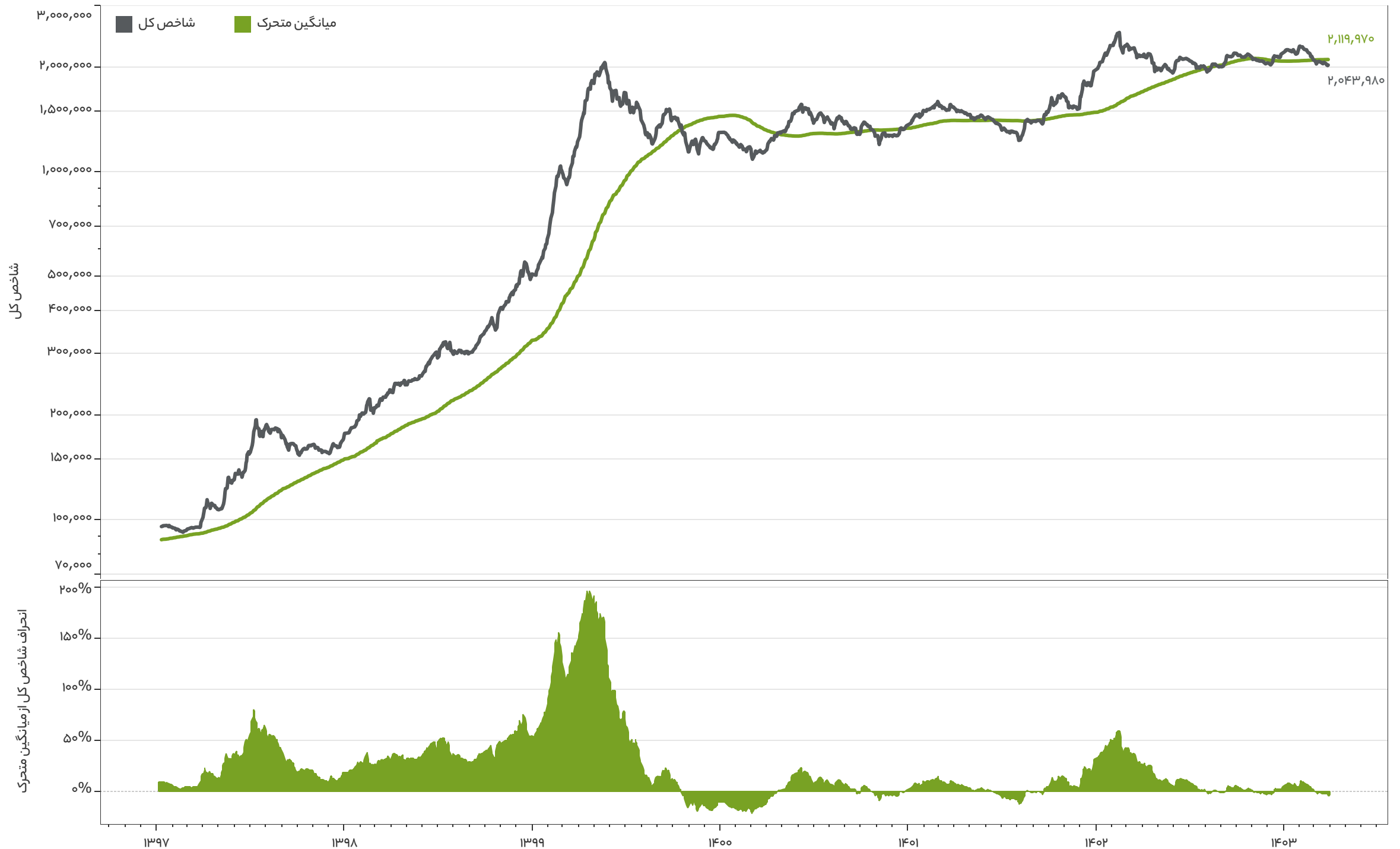
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

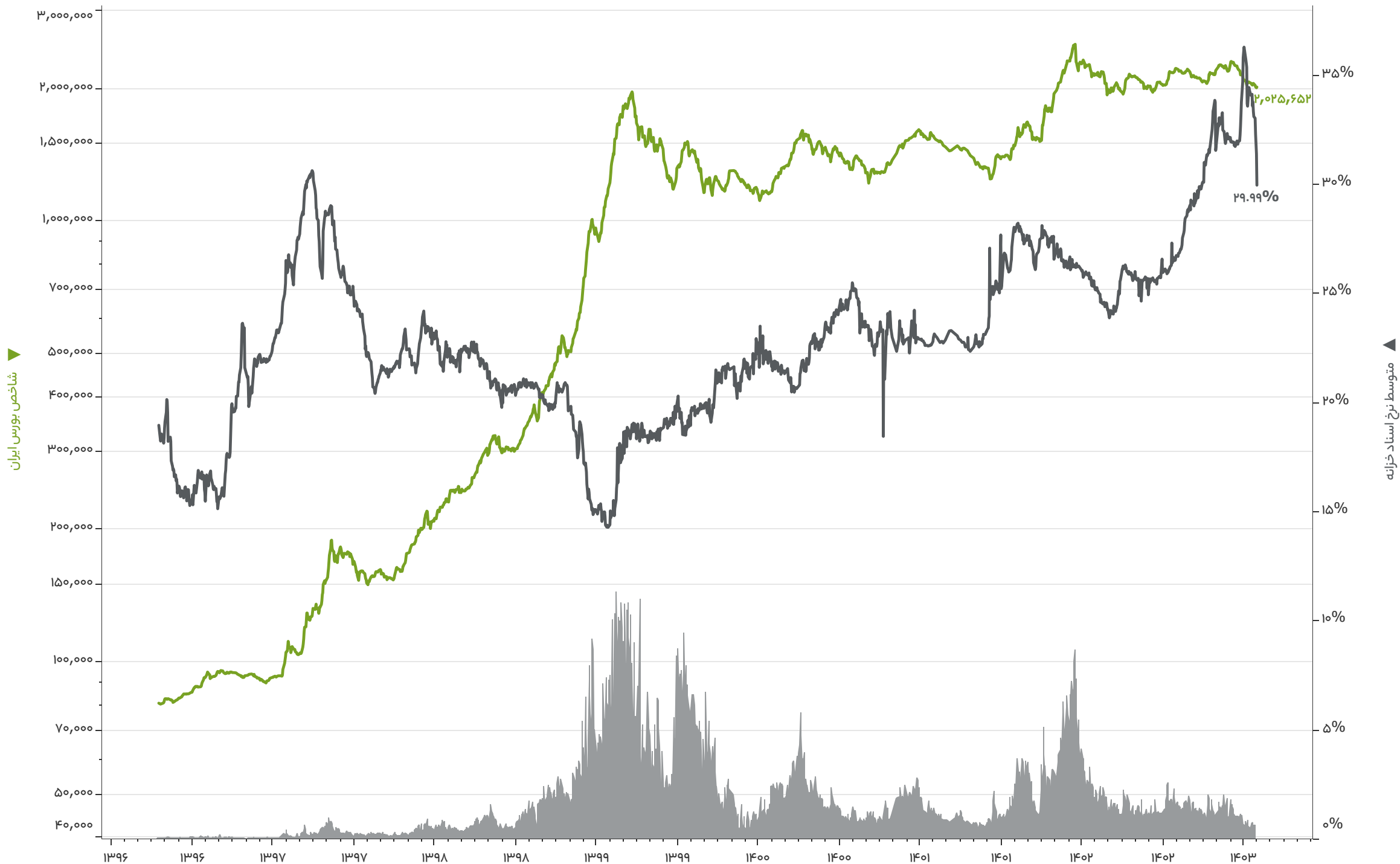
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





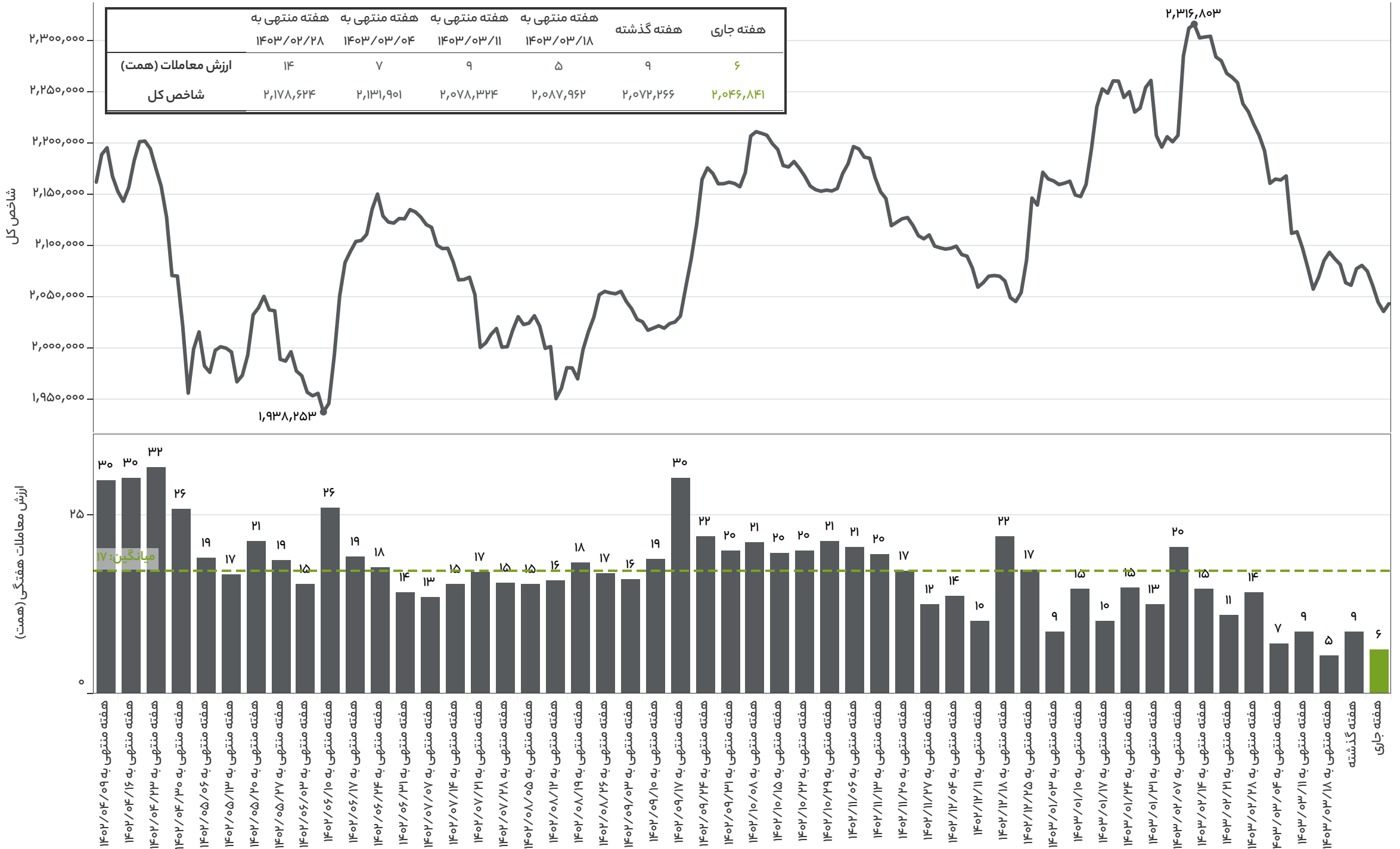
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

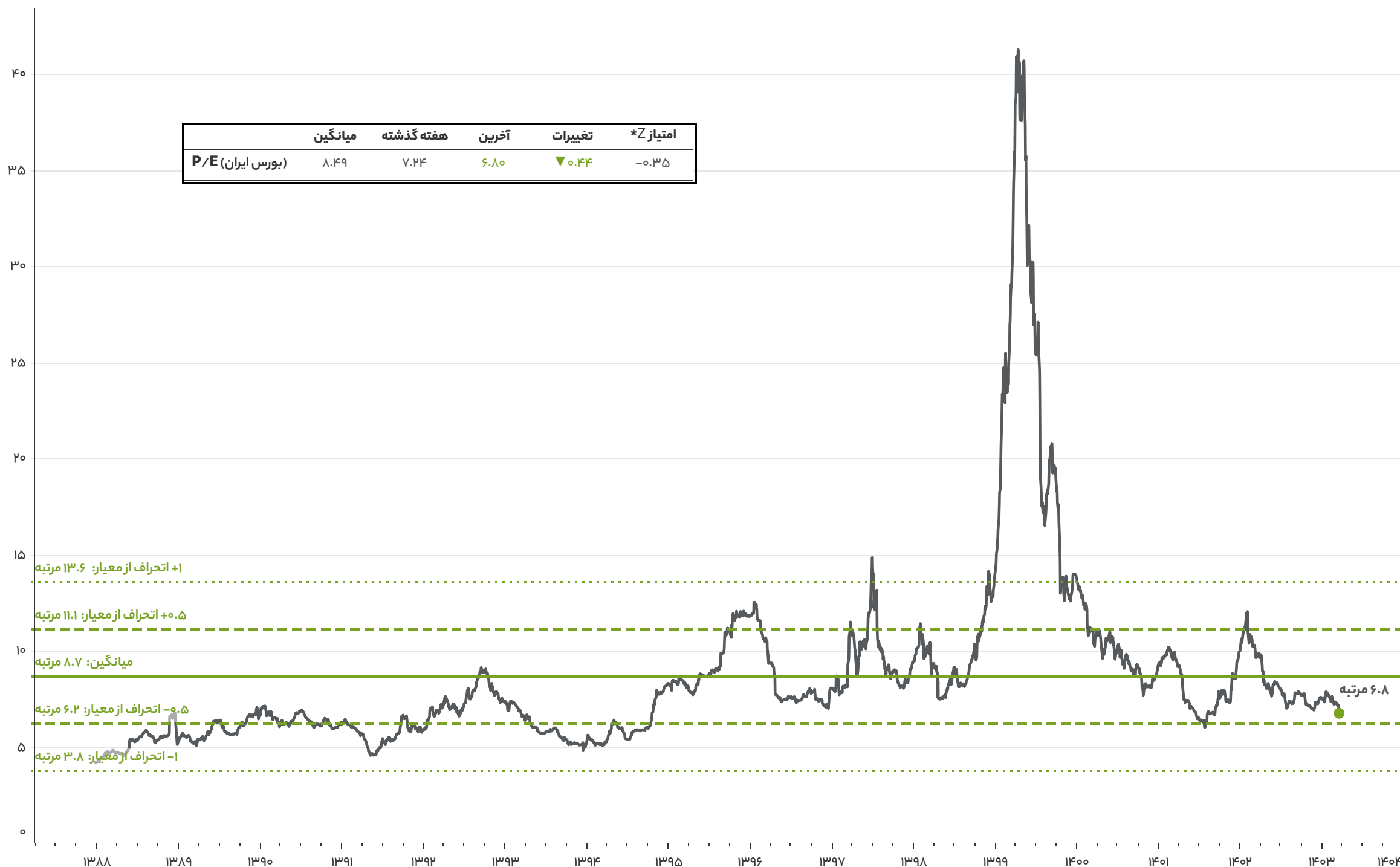
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.



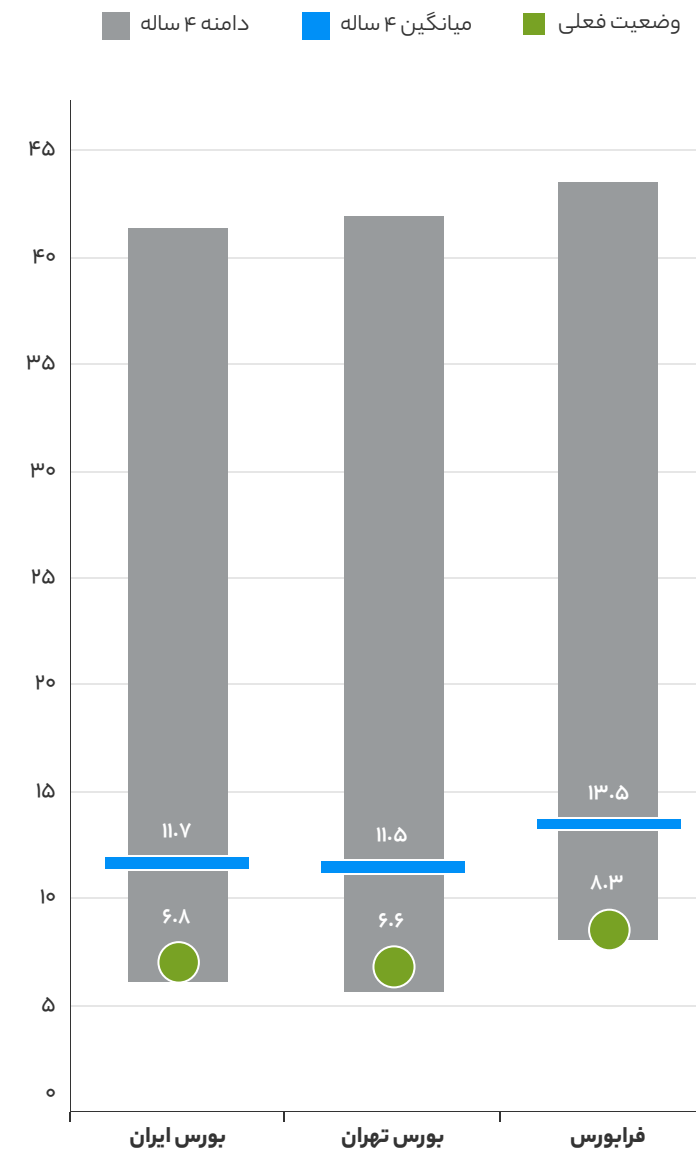
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۶.۸۰	۷.۲۴	۶.۰۷	۱۱.۶۶	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۶۰	۷.۱۰	۵.۶۴	۱۱.۴۷	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۲۶	۸.۱۳	۸.۰۶	۱۳.۴۹	۴۳.۵۱

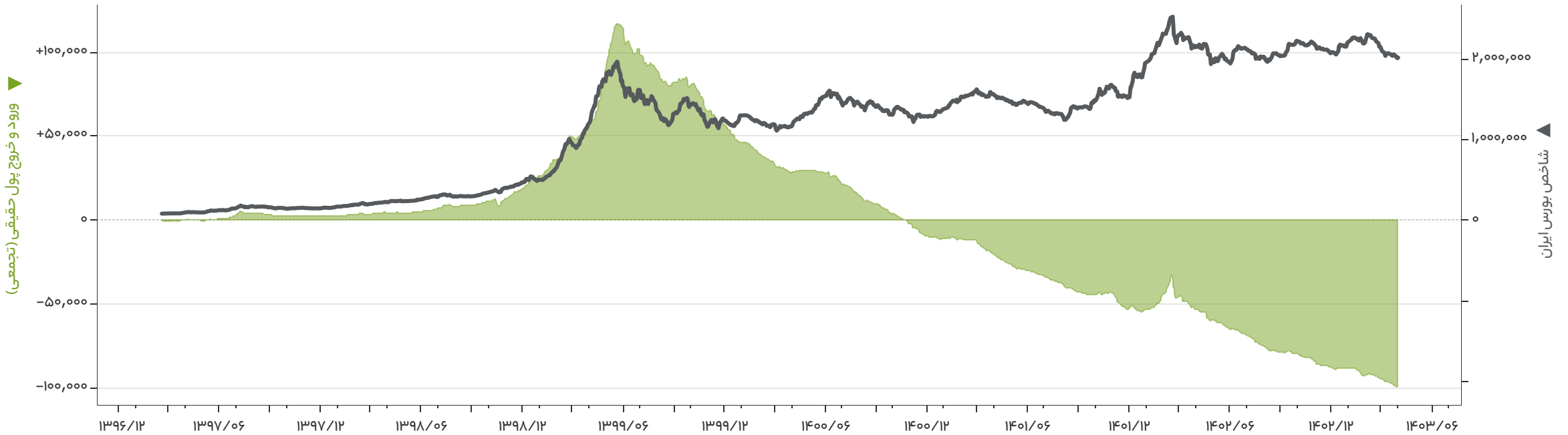


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۲۲۵	۲,۹۱۵	۵۹۰	۳۳۲	۱۸۶	۱۶۵	۱۳۰	۱۱۰	۹۳	۸۹	۵۵	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۴۰.۹%	۳۶.۹%	۷.۵%	۴.۲%	۲.۴%	۲.۱%	۱.۶%	۱.۴%	۱.۲%	۱.۱%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۸.۰	۶.۲	۵.۴	۳.۸	۹.۸	۷.۴	۸.۸	۱۴.۶	۷.۰	۹.۸	۱۷.۰	سودآوری
بازده سود نقدی	۱۰.۳%	۱۱.۵%	۱۵.۷%	۳.۴%	۶.۵%	۴.۵%	۱۴.۰%	۶.۶%	۱۶.۱%	۴.۴%	۵.۳%	
نسبت تقسیم سود	۷۳%	۶۱%	۶۳%	۳۳%	۵۰%	۴۰%	۵۸%	۷۳%	۱۰۰%	۱۱%	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)	+۹۷۱%	+۷۷۸%	+۷۵۹%	+۷۶۷%	+۳۶۳%	+۳۷۷%	+۳۲۵%	+۲۹۳%	+۸۱۲%	+۸۳%	+۶۵۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۶۴%	-۸%	+۱۱%	-۲۲%	-۱۹%	-۱۶%	+۱%	-۲%	+۱۳۳%	-۷۱%	+۴%	
بازده از ابتدای سال	+۸۶%	+۵۶%	+۸۳%	+۷۱%	+۳۶%	+۸۵%	+۶۹%	+۷۰%	+۴۷%	+۱۷%	+۲۳۵%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	-۱%	-۲%	-۳%	۰%	-۱%	-۱%	-۱%	۰%	-۱%	-۱%	

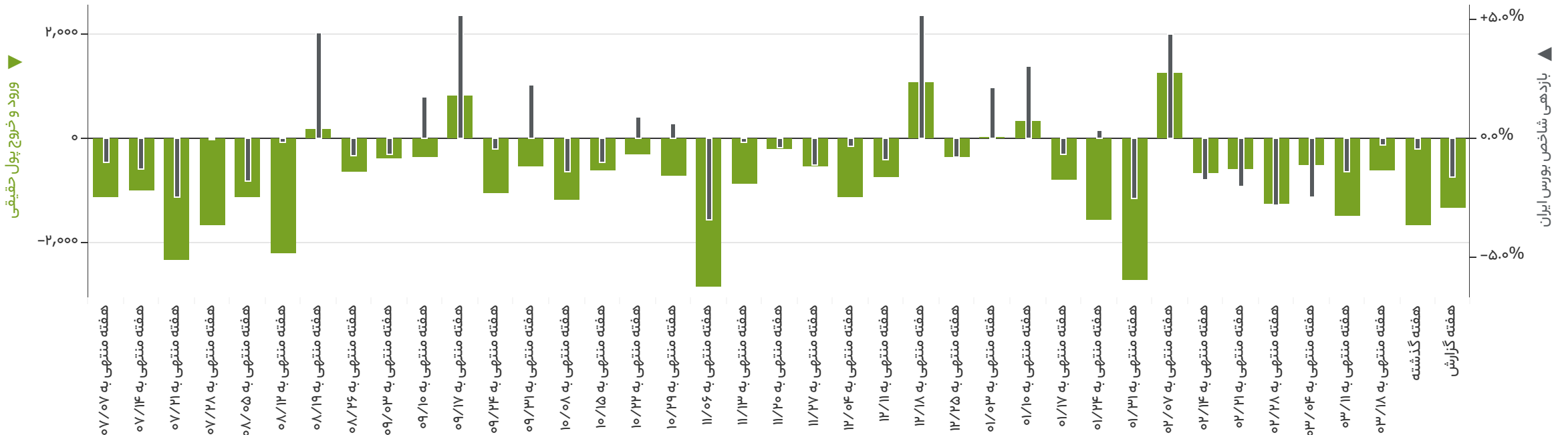
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



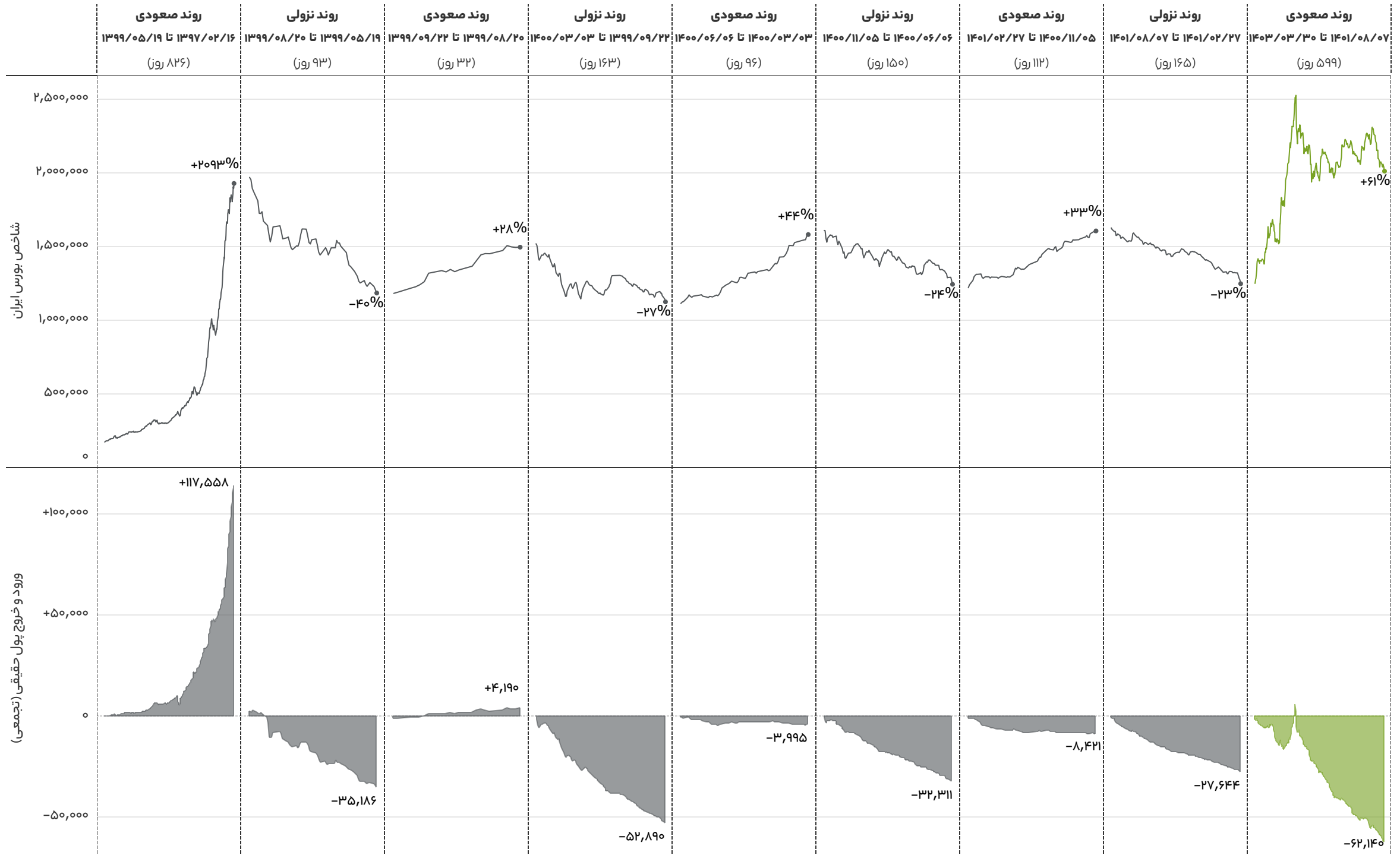
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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	
			تغییر مالکیت شرکت	تغییر مالکیت شرکت
تیمپی	سرمایه گذاری	۲.۳	+۰.۷%	
غپینو	شیرینیجات	۳.۰	+۰.۴%	
شکرین	مواد شیمیایی-متنوع	۴.۸	+۰.۳%	
گدنا	هتل و رستوران	۰.۸	+۰.۳%	
سنوبین	سرمایه گذاری	۰.۷	+۰.۲%	
چنوپا	چوب	۲.۰	+۰.۲%	
حشکوه	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰.۳	+۰.۲%	
کالا	فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار	۹.۱	+۰.۲%	
فسپا	آهن و فولاد	۳.۳	+۰.۱%	
قصفها	شکر	۲.۶	+۰.۱%	
پکرمان	لاستیک و پلاستیک	۱۰.۲	+۰.۱%	
ثباغ	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴.۲	+۰.۱%	
اسیاتک	مخابرات	۳.۰	+۰.۱%	
ختوقا	سرمایه گذاری	۳.۶	+۰.۱%	
کدما	کانی های فلزی	۱.۴	-۰.۴%	
شتوکا	مواد شیمیایی-متنوع	۰.۷	-۰.۴%	
وطوبی	سرمایه گذاری	۰.۷	-۰.۵%	
فسوژ	تولید فلزات گرانبهای غیرآهن	۱.۰	-۰.۵%	
نطربین	نساجی	۰.۹	-۰.۵%	
بکاب	تجهیزات صنعتی	۰.۵	-۰.۵%	
کفپارس	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۰.۶	-۰.۶%	
پلاست	لاستیک و پلاستیک	۰.۹	-۰.۶%	
کترام	کاشی و سرامیک	۱.۰	-۰.۶%	
غدیس	نوشیدنی	۲.۰	-۰.۷%	
ساذری	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۰.۳	-۰.۸%	
دامین	دارویی	۵.۱	-۰.۸%	
غشهد	محصولات کشاورزی	۰.۷	-۰.۸%	
ثپردیس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳.۴	-۱.۴%	

-۲% -۱% ۰% +۱%

ورود و خروج پول حقیقی


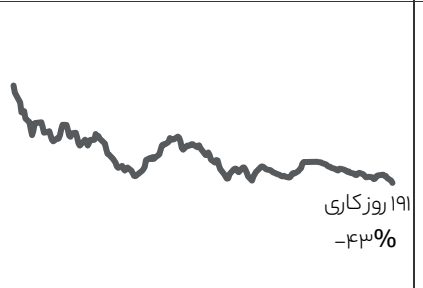
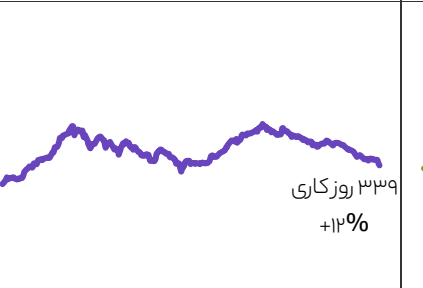

طی دوره گذشته، میلیارد تومان، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
			ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)
وبانک	سرمایه گذاری	۳۵	+۲۹	
تیمپی	سرمایه گذاری	۲	+۱۵	
کالا	فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار	۹	+۱۴	
شکرین	مواد شیمیایی-متنوع	۵	+۱۲	
غپینو	شیرینیجات	۳	+۱۰	
پکرمان	لاستیک و پلاستیک	۱۰	+۱۰	
وبصادر	بانکها و موسسات اعتباری	۳۶	+۸	
کنور	کانی های فلزی	۳۰	+۷	
شپنا	پالایش نفت و گاز	۱۹۴	+۵	
ثباغ	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴	+۴	
فسپا	آهن و فولاد	۳	+۴	
خگستر	سرمایه گذاری	۱۵	+۴	
تاپیکو	سرمایه گذاری	۱۵۳	+۳	
چنوپا	چوب	۲	+۳	
وپارس	بانکها و موسسات اعتباری	۲۷	-۱۵	
ثفارس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۲	-۱۸	
حفاری	حفاری	۵	-۱۹	
شستا	سرمایه گذاری	۱۶۹	-۲۰	
شارک	مواد شیمیایی-متنوع	۲۳	-۲۰	
بوعلی	مواد شیمیایی-متنوع	۸۱	-۲۰	
خاور	خودرو	۲۲	-۳۰	
خودرو	خودرو	۸۴	-۳۴	
فملي	تولید فلزات گرانبهای غیرآهن	۵۳۷	-۴۱	
دامین	دارویی	۵	-۴۱	
خسپا	خودرو	۴۸	-۴۳	
ثپردیس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳	-۴۸	
وتجارت	بانکها و موسسات اعتباری	۵۱	-۵۰	
وبملت	بانکها و موسسات اعتباری	۱۶۱	-۱۰۱	

-۱۰۰ -۵۰ ۰ +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

		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%	۸۴%
		تولید فلزات گرانبه‌های غیراهن: ۸۵۴%	-۳۲%	-۱%	۱۹۷%
		کانی‌های فلزی: ۴۹۱%	-۱۴%	۸%	۲۲%
		سایر مواد معدنی: ۵۲۸%	-۷۱%	-۲۷%	۲۵۳%
	شیمیایی	مواد شیمیایی-متنوع: ۴۰۰%	-۱۶%	۳۲%	۵۴%
		تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۴۶۶%	-۲۰%	۹۸%	۷%
	مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ: ۵۱۲%	-۱۷%	-۸%	۱۳۹%
		سایر محصولات کانی غیرفلزی: ۴۳۰%	-۱۸%	-۳۵%	۶۳%
		کاشی و سرامیک: ۴۶۳%	۱۳%	-۳۴%	۱۳۳%
	محصولات چوبی	محصولات کاغذی: ۳۸۵%	۸۸%	-۵۱%	۲۸۲%
کاغذ و محصولات جنگلی	چوب: ۳۷۴%	-۷%	-۵۹%	۹۴%	
خدمات مالی	هلدینگ‌های سرمایه‌گذاری	۸۸۱%	-۵۲%	۱۸%	۶۲%
	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه: ۱۲۸۷%	-۵۲%	۳۷%	-۱۵%
		فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: ۹۱۶%	-۵۸%	-۷۴%	-۲%
		لیزینگ: ۵۱۳%	-۴۲%	-۲۶%	۶۴%
بانک‌ها	بانک‌ها و موسسات اعتباری: ۷۲۸%	-۴۰%	-۲۶%	۶۲%	
بیمه	بیمه: ۶۹۳%	۲۹%	۱۰%	-۲۲%	
انرژی	پالایش نفت و گاز	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی: ۶۸۳%	-۶۸%	۸۷%	۸۳%
	زغال سنگ	۲۴۸%	۳%	-۱۸%	۵۰%
	تجهیزات انرژی و خدمات	حفاری: ۳۶۵%	-۵۰%	-۳۳%	۱۵۲%

بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

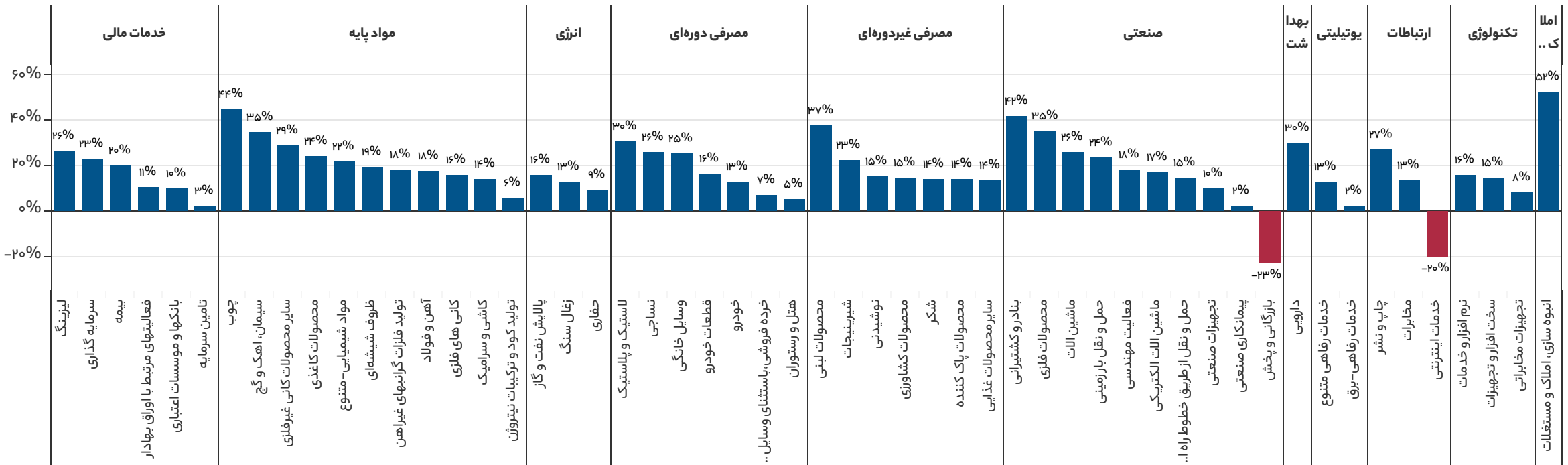
		رشد ۱۳۹۹		ریزش ۱۴۰۰ و ۱۳۹۹		کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲	
مصرفی دوره ای	خودرو و قطعات	خودرو	۱۲۴۷%	-۷۰%		۱۳%		۴۲%	
		قطعات خودرو	۶۷۶%	-۳۲%		-۲۵%	۴۱%		
		لاستیک و پلاستیک	۶۳۱%	-۳۴%		-۴۲%	۱۵۱%		
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۱۲۹%	-۲۳%		۳%	۱۳۹%		
		وسایل خانگی	۴۹۰%	-۴۶%		-۳۶%	۱۰۸%		
	کالای مصرفی با دوام	نساجی	۳۸۰%	-۲۱%		-۳۵%	۱۳۰%		
خدمات مصرف کننده		هتل و رستوران	۱۱۶۶%	-۶۷%		۱۸%	-۱%		
مصرفی غیردوره ای	غذا و نوشیدنی	سایر محصولات غذایی	۶۹۹%	-۳۴%		-۳۹%	۲۹%		
		محصولات کشاورزی	۳۹۷%	-۳۵%		۹%	۲۲%		
		شکر	۴۳۵%	-۲۲%		-۴۴%	۵۶%		
		محصولات لبنی	۳۸۳%	۷%		-۵۴%	۹۸%		
		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%	۵۶%		
		ماشین الات الکتریکی	۵۰۱%	-۴۵%		-۲۳%	۵۷%		
		ماشین الات	۴۲۲%	-۳۵%		-۳۱%	۱۳۶%		
		محصولات فلزی	۶۴۵%	-۵۴%		-۴۴%	۷۸%		
		تجهیزات صنعتی	۸۴۷%	-۳۰%		-۴۰%	۳۳%		
		پیمانکاری صنعتی	۵۲۵%	-۱۵%		-۶۸%	۶۲%		
	ترابری	بنادر و کشتیرانی	۲۴۶%	-۲۲%		-۱۵%	۲۳۵%		
حمل و نقل از طریق راه آهن		۳۲۷%	-۱۳%		-۴۱%	۱۷%			
حمل و نقل بار زمینی		۲۵۰%	-۱۸%		۳۳%	۳۷%			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۳۲۱%	-۳۲%		-۱۳%	۶۹%		
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۲۵۲%	-۳۵%		۲%	۵۱%		
	سخت افزار و تجهیزات	سخت افزار و تجهیزات	۵۷۰%	-۶۵%		-۴۵%	۱۷۵%		
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۱۰%	-۳۵%		۱۳۱%	۴۷%		
		خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%	-۵۴%		-۳۳%			
ارتباطات	خدمات دور برد	مخابرات	۵۳۲%	-۷۱%		-۱۳%	۱۵%		
	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۲۳%	-۵۲%		-۵۲%	۱۴۳%		
املاک و مستغلات	توسعه املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۶۱۹%	-۴۳%		-۴۵%	۲۳۵%		

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)

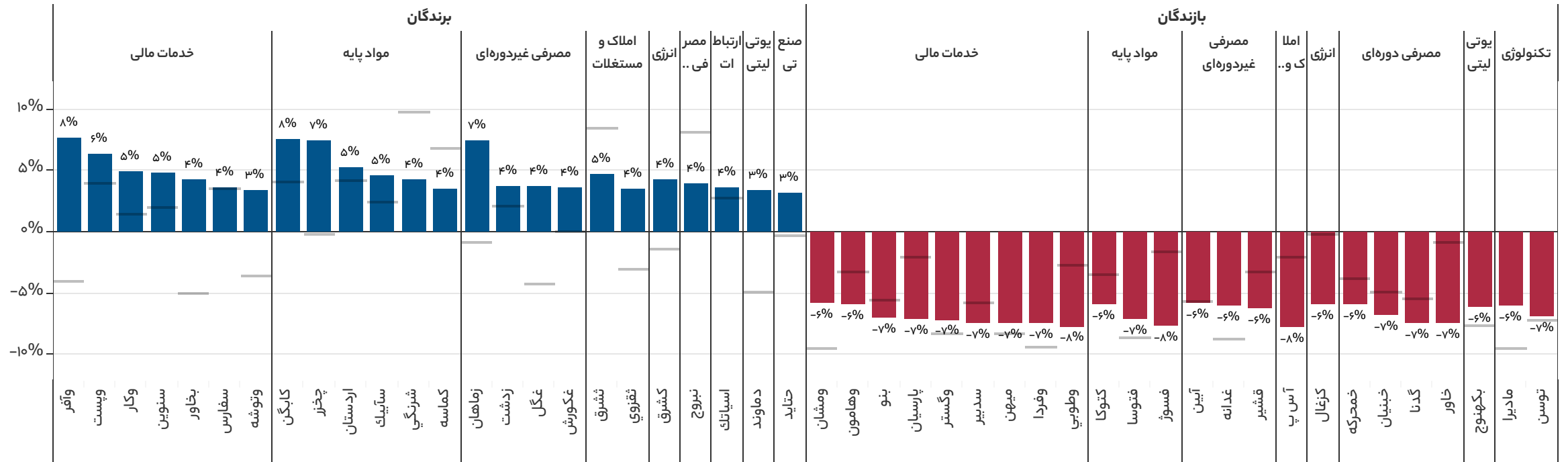

بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

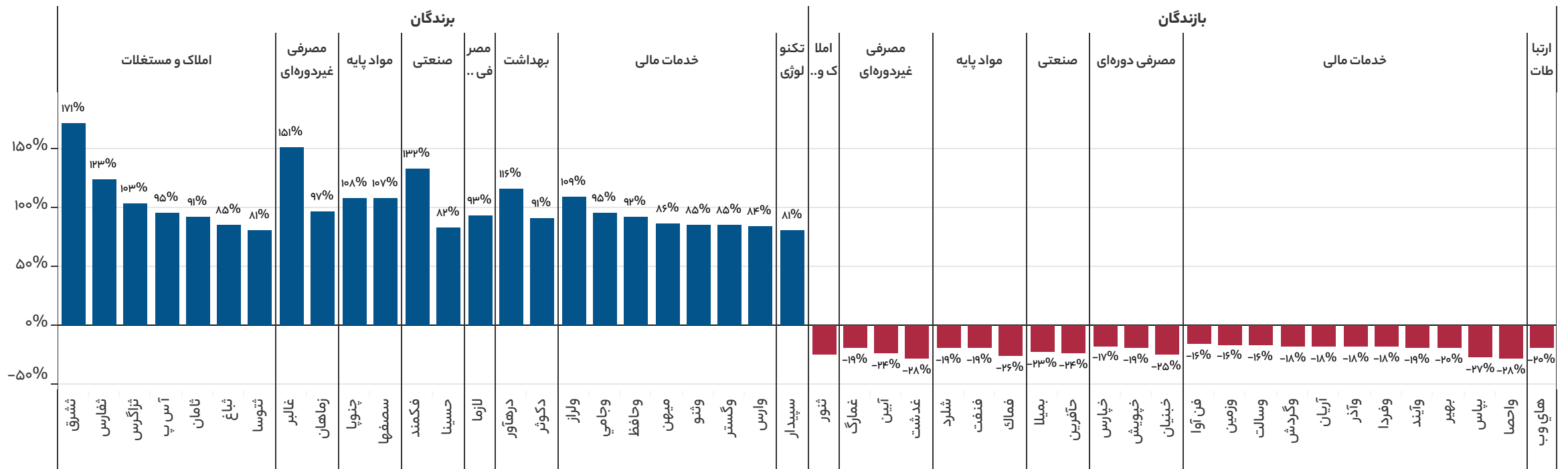




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



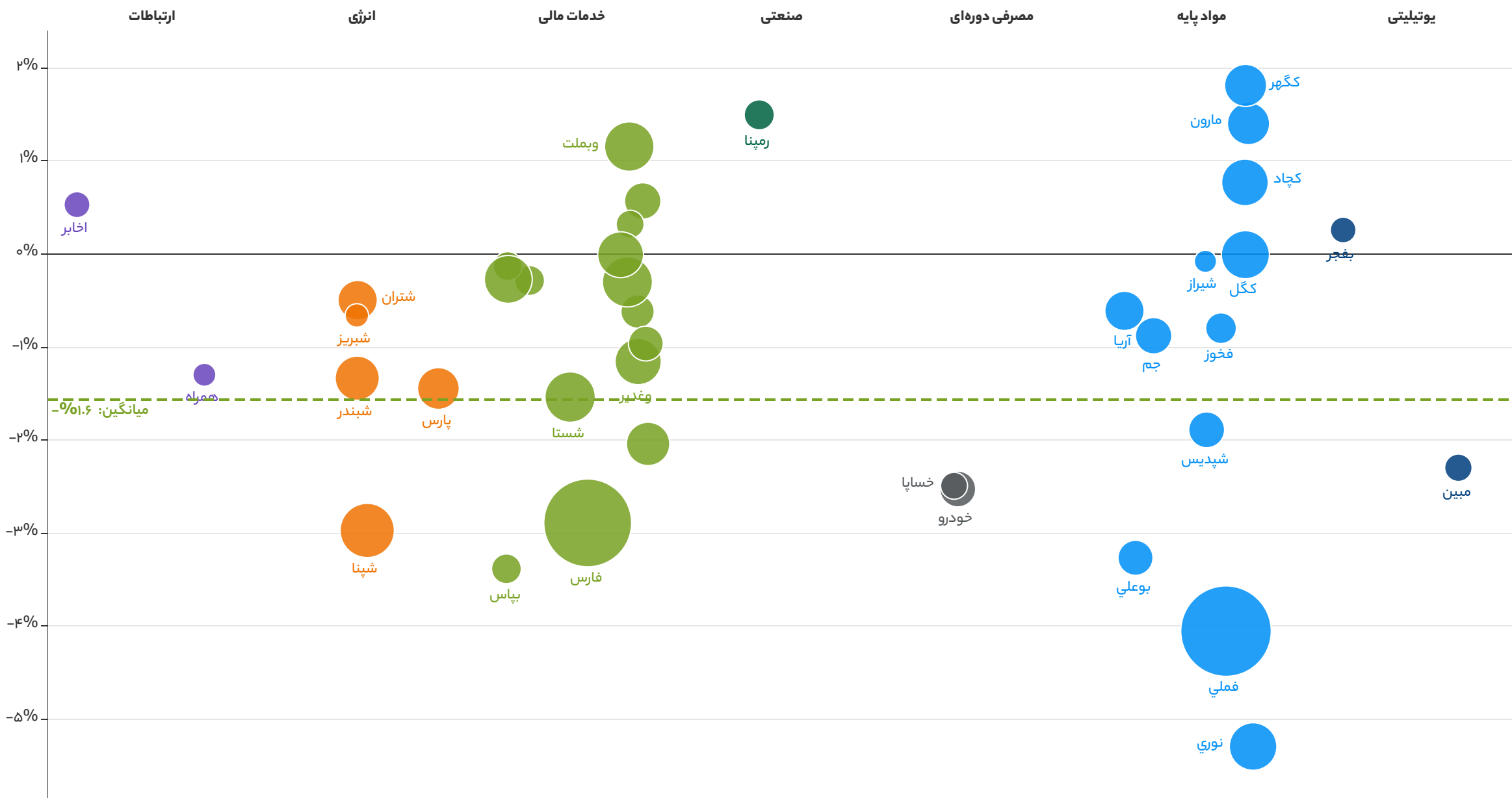
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





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



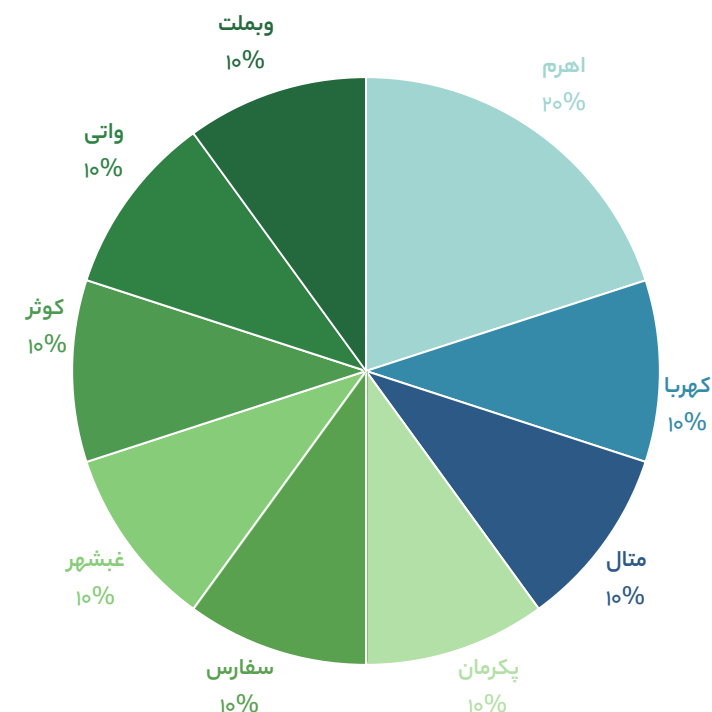
بازدهی هفته گذشته	کگهر	رمپنا	مارون	وبملت	کچاد	ومعادن	اخبر	تجارت	بفجر	کگل	میدکو	شیراز	تاسمیکو	تاپیکو	حکشتی	وامید	شتران	آریا	و صندوق	شبریز	فخور	جم	ویاسار	وغدیر	همراه	شبندر	پارس	شستا	شپدیس	پارسان	مبین	خسپا	خودرو	فارس	شپنا	بوعلی	پاس	فملي	نوري
	+1.8%	+1.5%	+1.4%	+1.2%	+0.8%	+0.6%	+0.5%	+0.3%	+0.3%	0%	0%	-0.1%	-0.1%	-0.3%	-0.3%	-0.3%	-0.5%	-0.6%	-0.6%	-0.7%	-0.8%	-0.9%	-1.0%	-1.0%	-1.3%	-1.4%	-1.5%	-1.9%	-2.0%	-2.3%	-2.5%	-2.5%	-2.9%	-3.0%	-3.3%	-3.4%	-4.0%	-5.3%	



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)	۲۰,۲۱۰	۱۰%
	سفارس	۴۴,۰۰۰	نسبت (P/NAV) مناسب	۳۴,۲۲۰	۱۰%
	غیشهر	۲,۵۰۰	مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸,۵۰۰ (P/E)	۱,۸۸۱	۱۰%
	کوثر	۳,۰۰۰	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۲,۲۶۲	۱۰%
	واتی	۸,۲۰۰	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۶,۲۰۰	۱۰%
	وبملت	۲,۸۰۰	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۲,۲۵۸	۱۰%
بلند مدت	کهریا	---	نسبت ریسک به ریوارد مطلوب و محافظت در برابر نوسانات دلار	۳۳,۹۰۴	۱۰%
	متال	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	۱,۱۰۵	۱۰%
	اهرم	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و اهرمی	۱۹,۶۱۰	۲۰%



ارتباط با ما

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

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

