



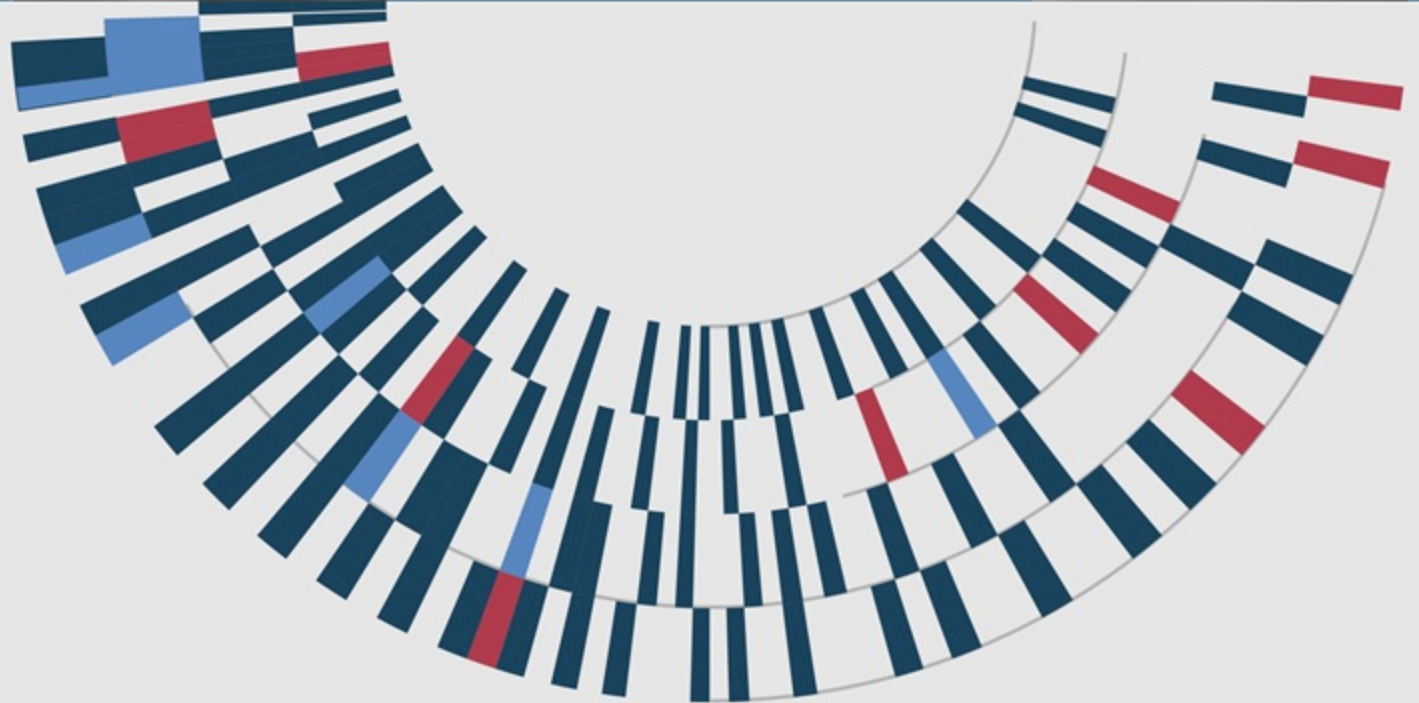
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۶۰ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۲۹

 CHARISMA





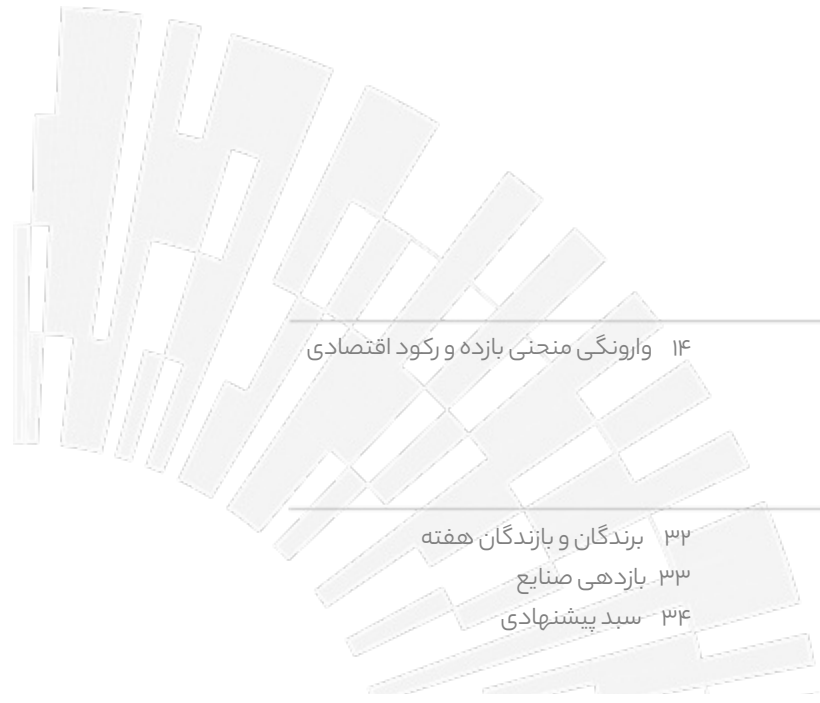
معرفی گزارش:

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

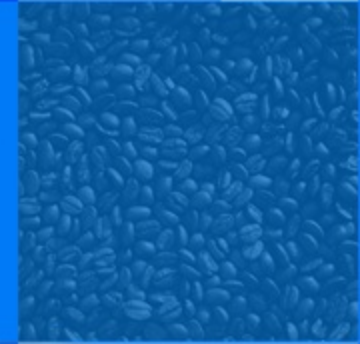
۱۵



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	روند قیمتی ۱۲ ماهه	
فلزات غیر آهنی	طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۲,۳۹۹	-۰.۵%	فزر	-	۱,۸۳۰ - ۲,۴۱۵	۲۴%
	مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۹,۲۹۸	-۵.۹%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۱۰,۷۲۴	۹%
	مس (ملي مس ایران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵۱۵,۲۰۰	+۰.۹%	فملی	بموتو، فباهنر	۳۲۵,۷۰۰ - ۵۳۱,۰۱۲	۴۷%
	آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۴۵۵	-	فایرا	فنوال	۲,۱۲۷ - ۲,۴۵۵	۱۰%
	روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۷۸۰	-۵.۸%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۲۹۸ - ۳,۰۶۶	۱%
	سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۲۶	-۴.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۳۰۸	-۱%
فلزات آهنی	شمش (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۷۵	-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۶۰ - ۵۰۰	۳%
	شمش CIS (منطقه)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۶	+۰.۴%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوبیر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۵۲۴	۱۵%
	شمش (فولاد خوزستان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۷۶۷	+۱.۰%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق	کوبیر، فوکا، فنورد	۱۸,۳۷۴ - ۲۳,۴۷۲	۱۳%
	اسلب (ایران)	بنادر ایران FOB	دلار/تن	۴۵۵	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۰ - ۵۰۰	۰%
	اسلب (منطقه CIS)	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۷۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۵۵۸	۲%
	اسلب (فولاد هرمزگان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۶۱۳	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۸,۹۰۰ - ۲۴,۵۰۰	۲۰%
	میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۸	-	ذوب، کوبیر	فولای	۵۴۶ - ۶۲۰	۲%
	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۶,۱۸۴	+۲.۷%	ذوب، کوبیر	فولای	۲۰,۹۱۱ - ۲۶,۱۸۴	۲۰%
	ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۴۵	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۴۵ - ۶۱۳	-۳%
	ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۳۸	-	فولاد	-	۶۳۸ - ۷۱۸	-۱%



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	-۰.۳%	-	-	۹۹ - ۱۴۳	۱%
	گندله سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۲۶	+۰.۸%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۱۵ - ۱۶۴	۳%
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۵,۱۸۶	-۰.۱%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۴۰۰ - ۵,۳۰۶	۱۸%
	کنسانتره سنگ آهن	شمال چین CFR	دلار/تن	۱۱۵	+۱.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۱۰۵ - ۱۵۳	۲%
	کنسانتره (چادرملو)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳,۷۶۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۴۶۹ - ۳,۸۱۰	۶%
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۰۰	-۱.۱%	-	-	۱۹۹ - ۲۵۸	-۱۴%
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۶۰	+۰.۵%	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۵۷ - ۱۹۶	-۱۸%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۴۳۰	-۲.۳%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۱۳%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۸۸	-	-	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۷۰ - ۹۰۸	۴%



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، شرفارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۸۷	-۲.۴%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شرفارس، شسینا	۲۶۵ - ۳۱۲	۸%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۲۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۸۱۰ - ۱,۰۱۰	۱۴%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۷۵	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۸۰۵ - ۸۷۵	۹%
پاراژایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۰۷	-۱.۷%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۷۱ - ۱,۱۵۸	-۴%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۰	-۰.۹%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۴۰	-۳%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۲۹	-۱.۱%	پارس	شجم، شبصیر	۹۸۷ - ۱,۲۰۳	۱۱%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۲۰	-۱.۸%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۸۷۲ - ۱,۰۸۴	۱۱%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۹	-۰.۲%	بوعلی	-	۸۰۱ - ۹۵۲	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۵۶۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۷۵۰ - ۱,۵۸۰	۱۰.۸%
مونواتیلن گلابیکول	چین CFR	دلار/تن	۵۴۵	-۲.۵%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۶۱ - ۵۵۹	۱۶%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۱۳۱	-۰.۴%	آریا، شکبیر	-	۹۳۹ - ۱,۱۳۵	۱۹%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۰	-۱.۵%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۹۲۰ - ۹۸۵	-۲%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۱	-۰.۸%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۹۶۱	۰%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۹۴	-۰.۷%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۲۶ - ۹۰۲	۸%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۹۷۵	۲%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۲۵	-۱.۲%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ - ۸۸۵	-۱%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۶۵	-	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	-۲.۷%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۶ - ۹۴	-۴%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۹	-۴.۳%	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۱ - ۹۱	-۵%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۹	-۱.۶%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۸۱ - ۱۰۷	-۶%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۳	-۱.۴%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۸۶ - ۱۲۵	-۱۸%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۷۸	-۲.۲%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۳۸۱ - ۵۲۸	-۹%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۴	-۱.۶%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۸۸ - ۱۲۴	-۱۵%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۴۹	+۰.۵%	-	شیپنا، شیندر، شتران، شبریز، شرارز، لاوان	۵۵۵ - ۶۵۹	۹%
روغن پایه	امارات متحده عربی CFR	دلار/تن	۸۱۰	-۱.۲%	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنفت	۷۲۰ - ۹۳۰	-۶%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۲,۹۱۸	-	-	شپهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۲۶,۱۸۴ - ۳۶,۹۴۳	۲۴%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۳,۱۹۹	-	-	شیپنا، شتران، شیندر، شبریز، شرارز، شاولان	۱۴,۰۸۳ - ۲۳,۱۹۹	۶۵%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۶,۰۷۴	-	-	شپاس	۱۲,۳۷۶ - ۱۶,۵۰۰	۳۳%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۰۰	-۶.۷%	-	ذوب، فروش	۱۸۸ - ۲۸۷	-۸%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۹	-۰.۲%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۰	-۱%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۹	-۰.۶%	-	-	۱.۲۱ - ۱.۳۰	۱%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۶,۹۵۳	+۱۶.۸%	-	-	۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	۱۳۱%

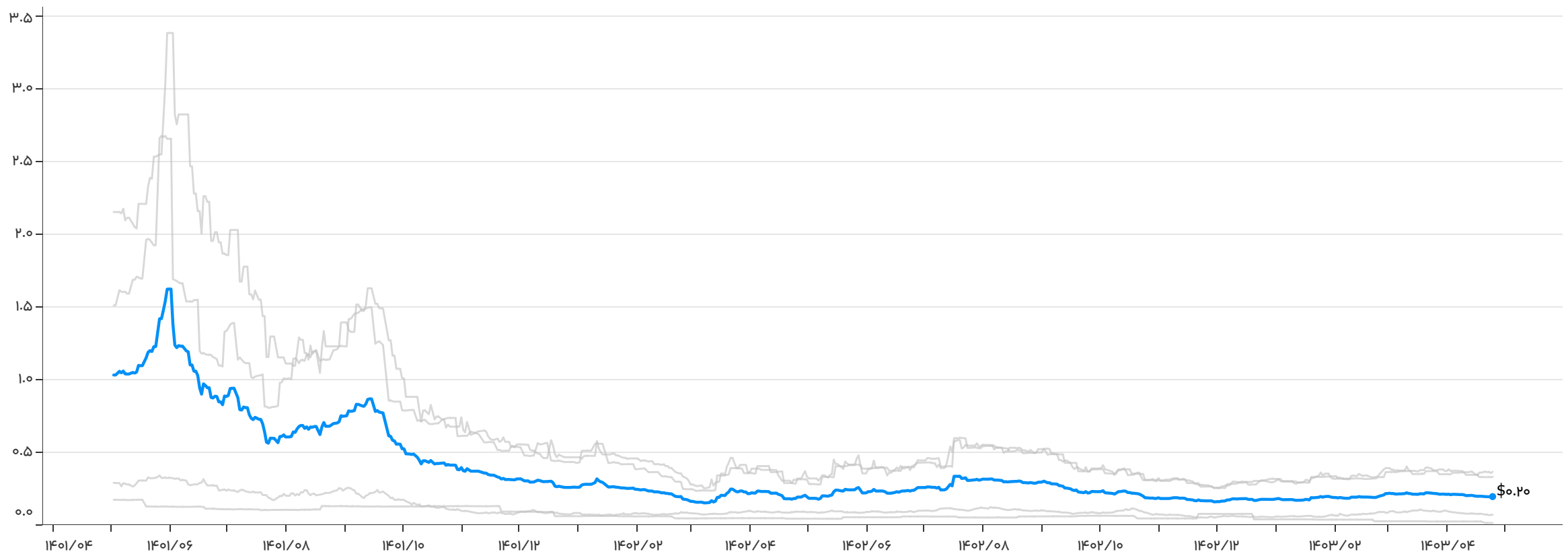
انرژی و فرآورده‌های نفتی

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	+۱.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۳	-۲۰%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۲	-۰.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۲ - ۰.۰۸	-۶۱%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۷	+۲.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	۱۴%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۴	+۰.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۰.۶۱	۱۷%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۰	+۱.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	۶%

میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

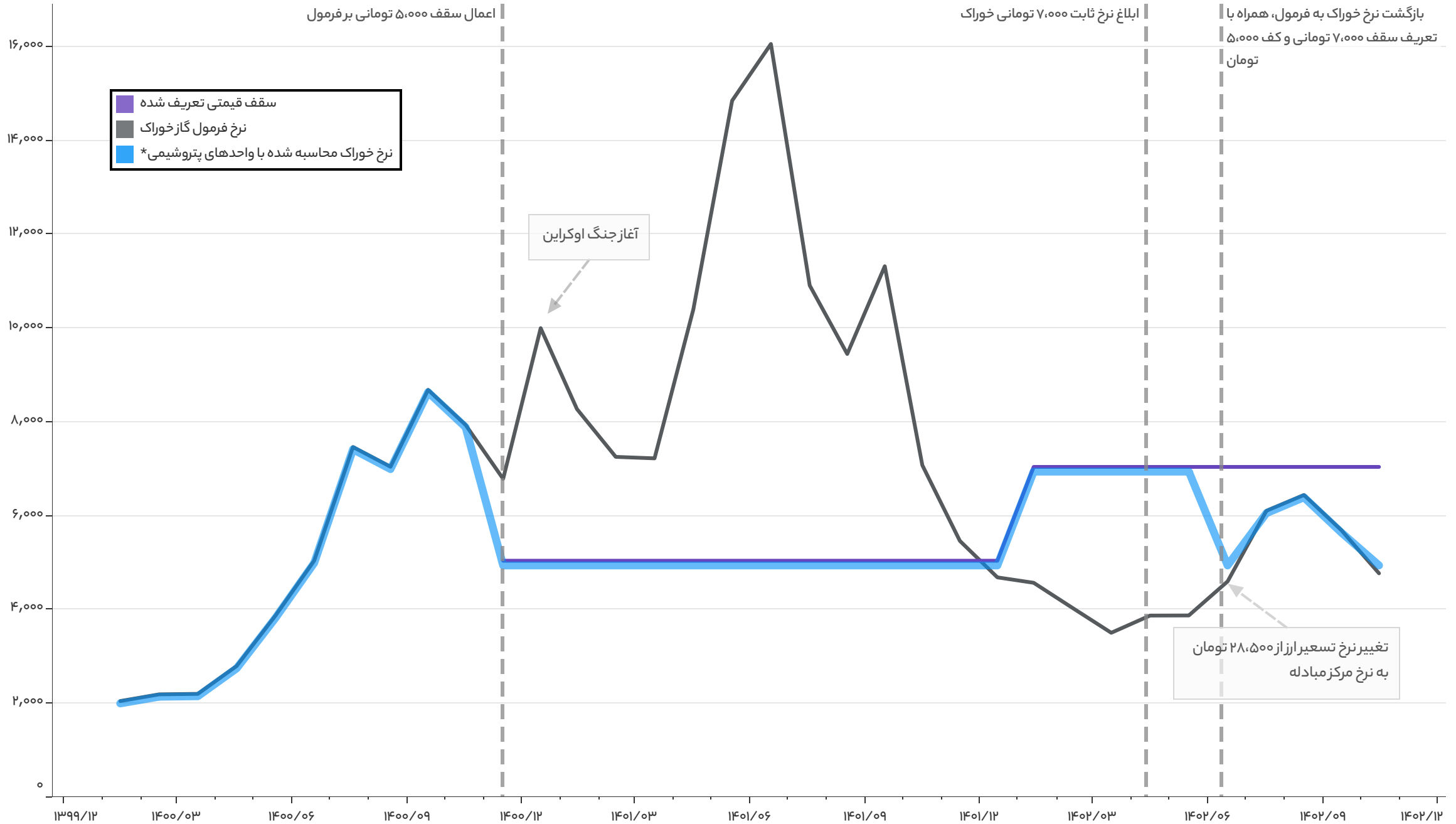
میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته





فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

نرخ بدست آمده از فرمول گاز خوراک در برابر نرخ خوراک محاسبه شده با صنایع پتروشیمی با اعمال سقف قیمتی، از ابتدای سال ۱۴۰۰، تومان به ازای هر مترمکعب

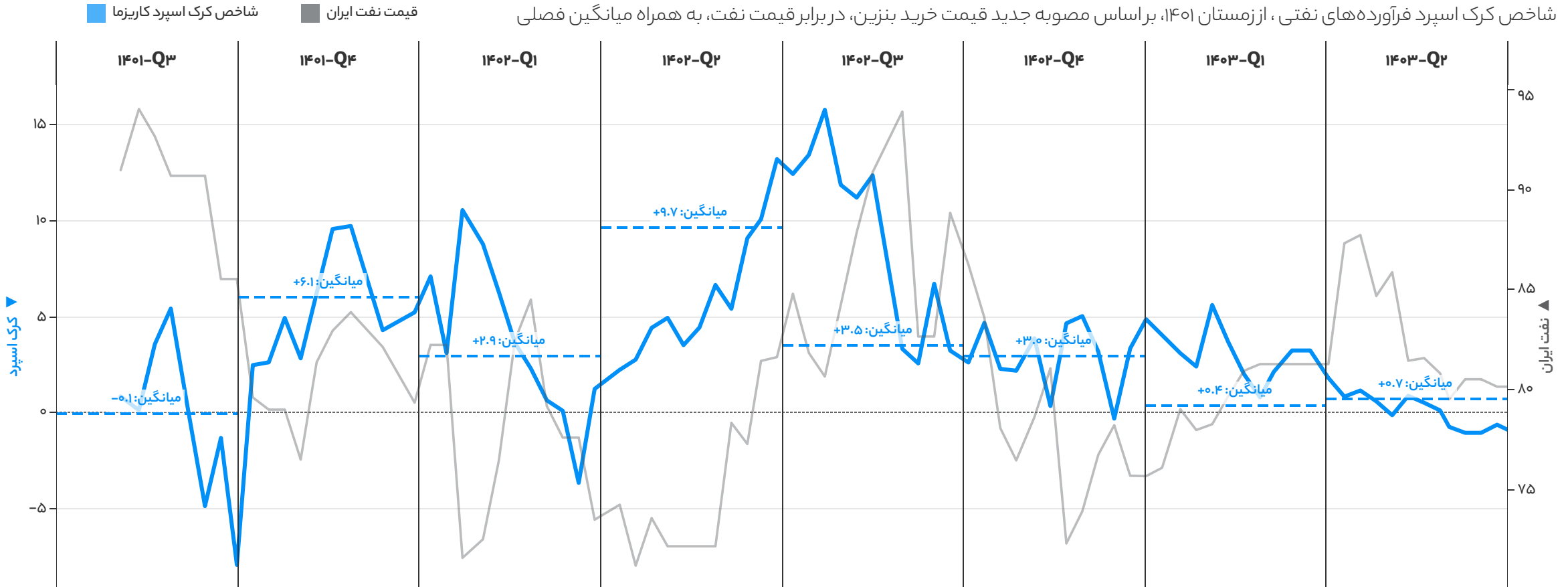


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا برورسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می‌گردد.



شاخص کرک اسپرد کاریزما*

شاخص کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی، از زمستان ۱۴۰۱، براساس مصوبه جدید قیمت خرید بنزین، در برابر قیمت نفت، به همراه میانگین فصلی



فرآورده	قیمت (دلار) هفته گزارش	کرک اسپرد (دلار)			میانگین فصلی کرک اسپرد (دلار)			آخرین وضعیت اسپرد (در برابر میانگین فصل جاری و فصل گذشته، دلار)	
		هفته گذشته	هفته گزارش	تغییر (واحد)	فصل گذشته	فصل جاری	رشد میانگین فصل	میانگین فصل گذشته	آخرین وضعیت
نفت ایران	۸۲.۸								
گازوئیل	۹۲.۶	۱۰.۹	۹.۸	▼۱.۱	۱۰.۹	۱۱.۵	+۵.۶%		
بنزین**	۸۴.۱	۲.۵	۱.۴	▼۱.۲	۲.۰	۱.۲	-۳۹.۴%		
نفتا	۷۳.۴	-۱۰.۰	-۹.۴	▲۰.۶	-۱۲.۲	-۹.۵	+۲۲.۱%		
نفت کوره	۷۵.۳	-۶.۰	-۷.۴	▼۱.۵	-۸.۶	-۶.۴	+۲۵.۱%		
لوب کات***	۸۳.۵	۰.۴	۰.۷	▲۰.۳	۱.۱	-۱.۸	-۲۶۳.۷%		
وکیوم باتوم***	۵۵.۳	-۲۷.۷	-۲۷.۴	▲۰.۳	-۲۸.۴	-۲۹.۰	-۲.۱%		
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۱.۰	۰.۱	▼۰.۹	۰.۴	۰.۷	+۹۸.۵%		

* 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 براساس ارزش بازار هر یک از این پالایشگاه‌ها استفاده شده است.
 ** قیمت بنزین براساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شیندر، شتران و شبریز) و براساس نوع بنزین فروخته شده توسط هر یک از این پالایشگاه‌ها حساب گردیده است.
 *** قیمت لوبکات و وکیوم باتوم براساس نرخ فروش هر یک از ۴ پالایشگاه ذکر شده در بورس کالا محاسبه گردیده، که این اسپرد نیز براساس ارزش بازار هر یک از این پالایشگاه‌ها، به روش موزون میانگین گیری شده است.



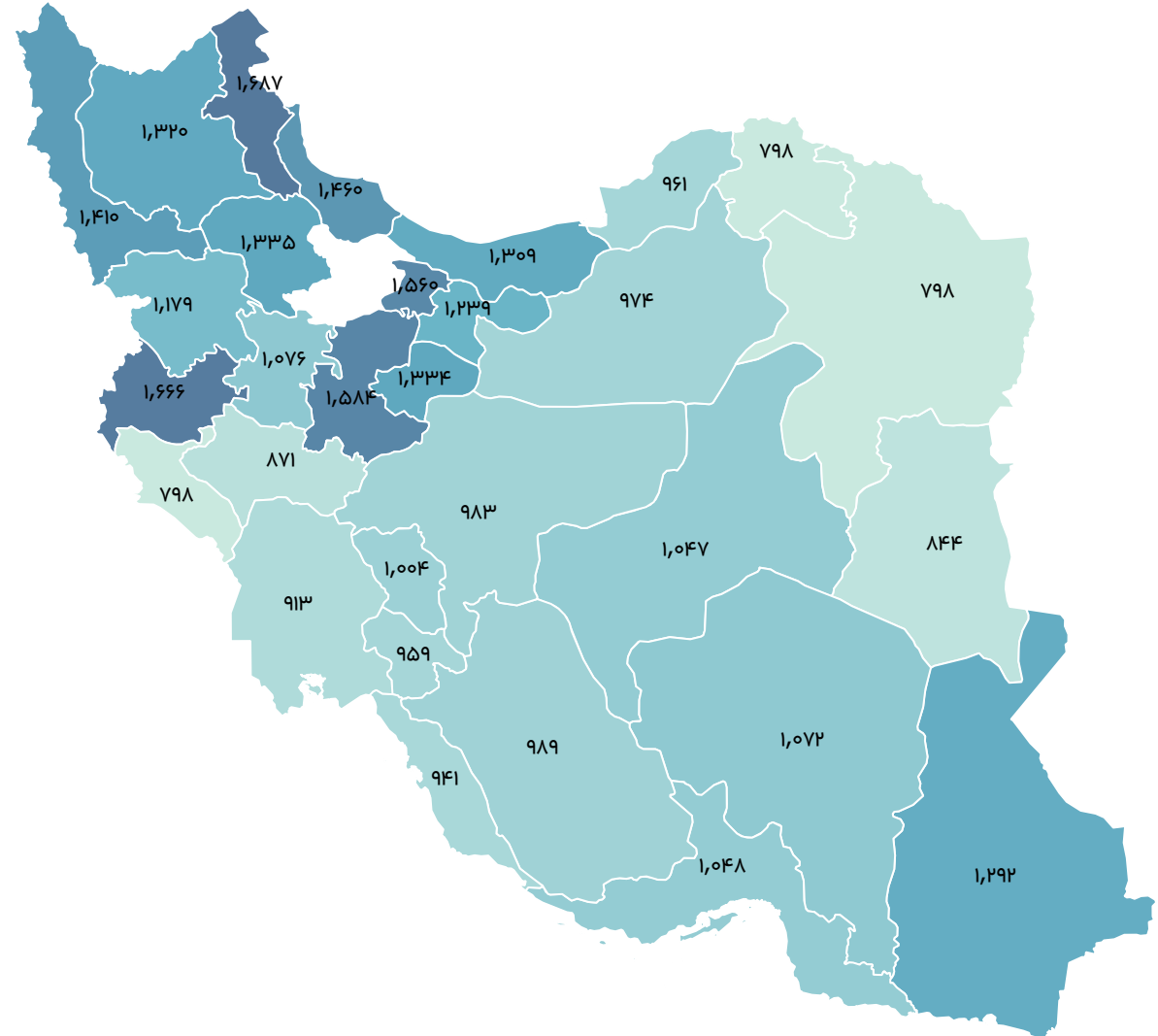
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۱,۳۵۰	۱,۲۳۹	-۸.۲%
	البرز	سیمان آبیگ	۱,۴۴۶	۱,۵۶۰	+۷.۹%
	قم	سیمان نیزار قم	۱,۳۷۹	۱,۳۳۴	-۳.۳%
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۸۳	۹۸۳	-
	مرکزی	سیمان ساوه	۱,۳۰۰	۱,۵۸۴	+۲۱.۸%
	سمنان	سیمان شاهرود	۹۷۴	۹۷۴	-
غرب	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیما..	۱,۱۸۰	۱,۰۴۷	-۱۱.۳%
	همدان	سیمان هگمتان	۱,۳۱۷	۱,۰۷۶	-۱۸.۴%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۱۳	۹۱۳	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۹۸	۷۹۸	-۰.۱%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۱,۰۰۴	۱,۰۰۴	-
	لرستان	سیمان دورود	۹۷۶	۸۷۱	-۱۰.۷%
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۱,۳۷۴	۱,۶۶۶	+۲۱.۳%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۱,۲۹۶	۹۵۹	-۲۶.۰%
	کردستان	سیمان کردستان	۱,۲۶۱	۱,۱۷۹	-۶.۵%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۴۰۲	۱,۶۸۷	+۲۰.۳%
شمال غرب	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۱,۴۳۶	۱,۴۱۰	-۱.۸%
جنوب	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۳۶۹	۱,۳۲۰	-۳.۶%
	زنجان	سیمان خمسه	۱,۲۵۵	۱,۳۳۵	+۶.۴%
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۰۴۸	۱,۰۴۸	-
شمال	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۴۱	۹۴۱	-
	فارس	سیمان داراب	۹۹۱	۹۸۹	-۰.۲%
شمال شرق	مازندران	سیمان مازندران	۱,۱۸۲	۱,۳۰۹	+۱۰.۷%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۸۰۵	۹۶۱	+۱۹.۳%
	گیلان	سیمان خزر	۱,۳۵۸	۱,۴۶۰	+۷.۵%
جنوب شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۷۹۸	۷۹۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۷۹۸	۷۹۸	-
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۹۲۰	۸۴۴	-۸.۲%
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۱,۰۳۷	۱,۰۷۲	+۳.۴%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۲۷۹	۱,۲۹۲	+۱.۰%

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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

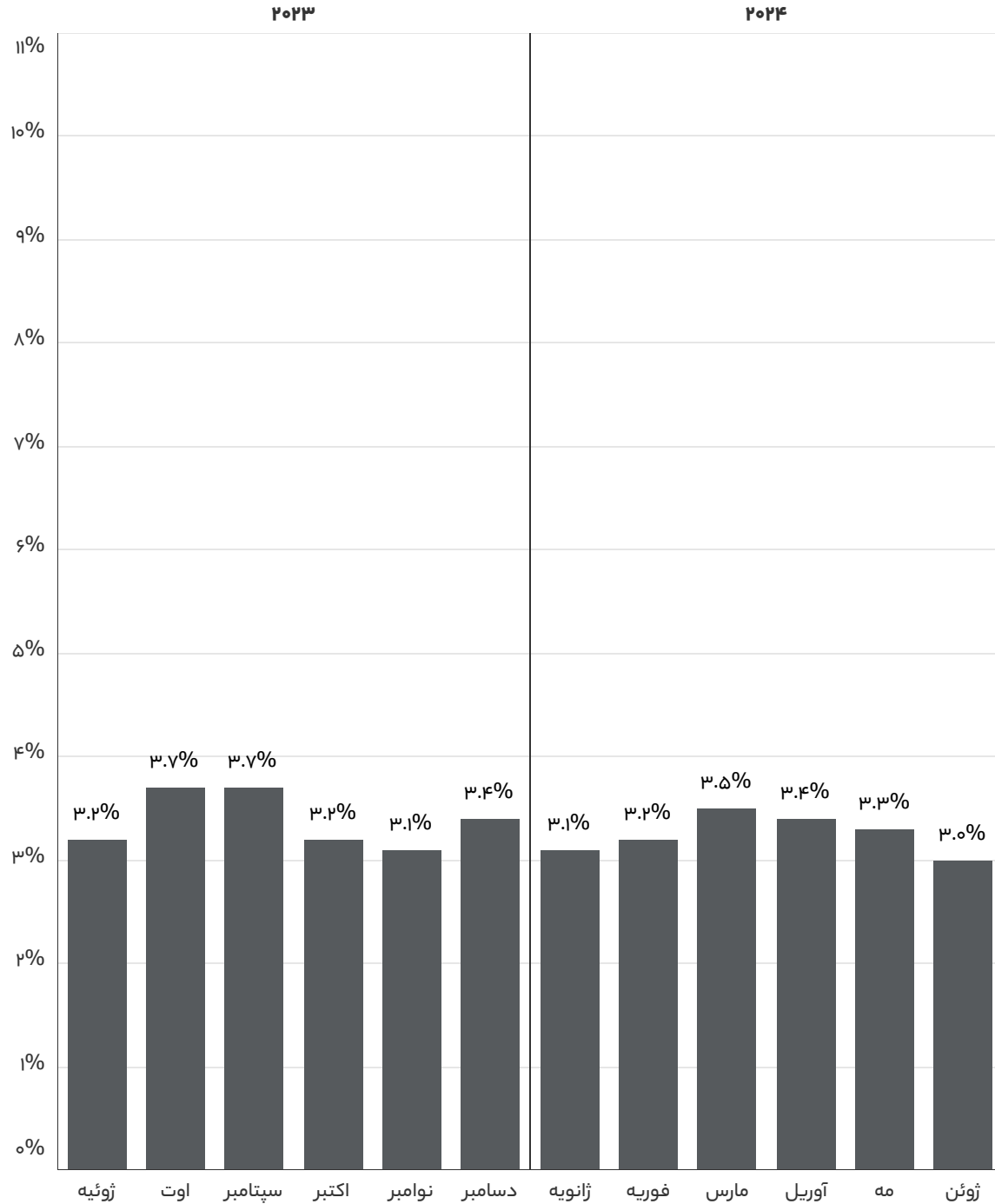


* قیمت سیمان براساس سیمان تپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (براساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ قیمت انس طلا صبح روز چهارشنبه ۲۷ مرداد با رسیدن به رقم ۲۴۸۲ دلار به یک رکورد تاریخی جدید رسید. در این راستا سود اوراق قرضه خزانه داری آمریکا هم افزایش یافته و بازارها آماده کاهش نرخ بهره بانک‌های مرکزی دنیا هستند. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک افزایش ۰.۳۸ درصدی به ۲۴۷۷.۲ دلار رسیده است. اظهارات دونالد ترامپ در مورد تایوان باعث سقوط بازار بورس این کشور شده است. ترامپ در مصاحبه‌ای با بلومبرگ حمایت آمریکا از تایوان را زیر سوال برد و گفت این کشور باید برای حمایت آمریکا هزینه بپردازد. ارزش دلار تایوان تا پایین‌ترین سطح طی دو هفته گذشته کاهش یافته و یوان چین روی ۷.۲۶ دلار ثابت مانده است.
- ▲ جروم پاول رئیس فدرال رزرو آمریکا در آخرین سخنرانی خود از کاهش تورم خبر داد و گفت به نظر می‌رسد قیمت‌های مصرف‌کننده تحت کنترل درآمد است. بدین ترتیب انتظار می‌رود نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا برای اولین بار در ماه سپتامبر کاهش یافته و بعد دو بار دیگر هم تا پایان سال جاری میلادی پایین بیاید. سود اوراق قرضه ۱۰ ساله خزانه داری آمریکا روی ۴.۷۵ درصد ثابت مانده و اوراق قرضه ۲ ساله در حدود ۴.۴۴۵ قرار دارد. بازار اوراق قرضه در استرالیا، ژاپن و کره جنوبی هم رشد داشته‌اند. پایین آمدن نرخ بهره هزینه نگهداری طلا به عنوان یک سرمایه غیر سودده را کاهش داده و تمایل برای خرید آن را افزایش می‌دهد. قیمت جهانی طلا طی ماه جاری میلادی بیش از ۱۵۰ دلار افزایش یافته و از ۲۴۸۰ دلار عبور کرده است. تحلیلگران عقیده دارند با وجود اینکه پیش‌بینی می‌شود طلا در ماه‌های آینده با بی‌ثباتی‌های مواجه شود، اما این بی‌ثباتی‌ها تاثیر مثبتی خواهند داشت و می‌تواند قیمت طلا را تا بیش از ۲۵۰۰ دلار تا پایان سال جاری میلادی افزایش دهند.
- به گزارش رویترز در ۱۸ جولای، در حالی که سرمایه‌گذاران با سیگنال‌های متفاوت در مورد تقاضای نفت و نگرانی‌ها در مورد کندی رشد اقتصادی در ایالات متحده با افزایش انتظارات از فدرال رزرو برای کاهش قریب‌الوقوع نرخ‌های بهره، دست و پنجه نرم می‌کردند، قیمت نفت ثابت ماند. معاملات آتی برنت با ۳ سنت افزایش به ۸۵.۱۱ دلار در هر بشکه رسید، در حالی که نفت خام وست تگزاس اینترمدیت آمریکا (WTI) با ۳ سنت کاهش به ۸۲.۸۲ دلار در هر بشکه رسید. هر دو معیار در جلسه معاملاتی قبلی صعودی بودند.
- به گزارش پایگاه اطلاع رسانی اتاق بازرگانی ایران سال گذشته میلادی، علاوه بر مصرف کلی انرژی، مصرف جهانی نفت هم به نقطه عطف تاریخی بیش از ۱۰۰ میلیون بشکه در روز رسید که این افزایش ناشی از تقاضای بالا برای بنزین، گازوئیل و نفت سفید پس از همه‌گیری بود. در سال گذشته، آمریکا با ثبت رکورد جدید و پیشی گرفتن از عربستان سعودی و روسیه، برتری خود را به عنوان بزرگ‌ترین تولیدکننده نفت جهان افزایش داد. چین هم از نظر ظرفیت پالایش نفت از آمریکا پیشی گرفت و به ۱۸.۵ میلیون بشکه در روز رسید. براساس این آمار، سوخت‌های فسیلی ۸۱ درصد از ترکیب انرژی جهانی را تشکیل می‌دهند. با وجود تلاش‌های گسترده برای کربن‌زدایی اقتصاد، سوخت‌های فسیلی همچنان بیش از ۸۰ درصد از ترکیب انرژی جهان را در سال ۲۰۲۳ تشکیل داده‌اند. زغال سنگ مسئول ۳۲ درصد از انرژی مصرف‌شده در سراسر جهان بود، پس از آن گاز طبیعی با ۲۶ درصد و سپس نفت با ۲۳ درصد سهم در رتبه‌های بعدی قرار گرفته‌اند.
- رئیس هیئت مدیره چای سریلانکا گفت این کشور ۵۵ میلیون دلار از ۲۵۰.۹ میلیون دلار بدهی خود بابت خرید سوخت از ایران را از طریق صادرات چای پرداخت کرده است. وی گفت سریلانکا طبق یادداشت تفاهمی که با ایران دارد بازپرداخت بدهی سوخت خود را از ماه اوت سال گذشته میلادی از طریق صادرات چای آغاز کرده است. وی اضافه کرد کشورش در چهار ماه ابتدایی سال جاری میلادی ۴.۱ میلیون کیلوگرم چای به ایران صادر کرده که سه برابر بیشتر از چای صادر شده به ایران طی همین دوره در ۲۰۲۳ است. در دسامبر ۲۰۲۱ اعلام شد ایران موافقت کرده چای سیلان سریلانکا را در عوض ۲۵۱ میلیون دلار بدهی نفتی این کشور قبول کند.

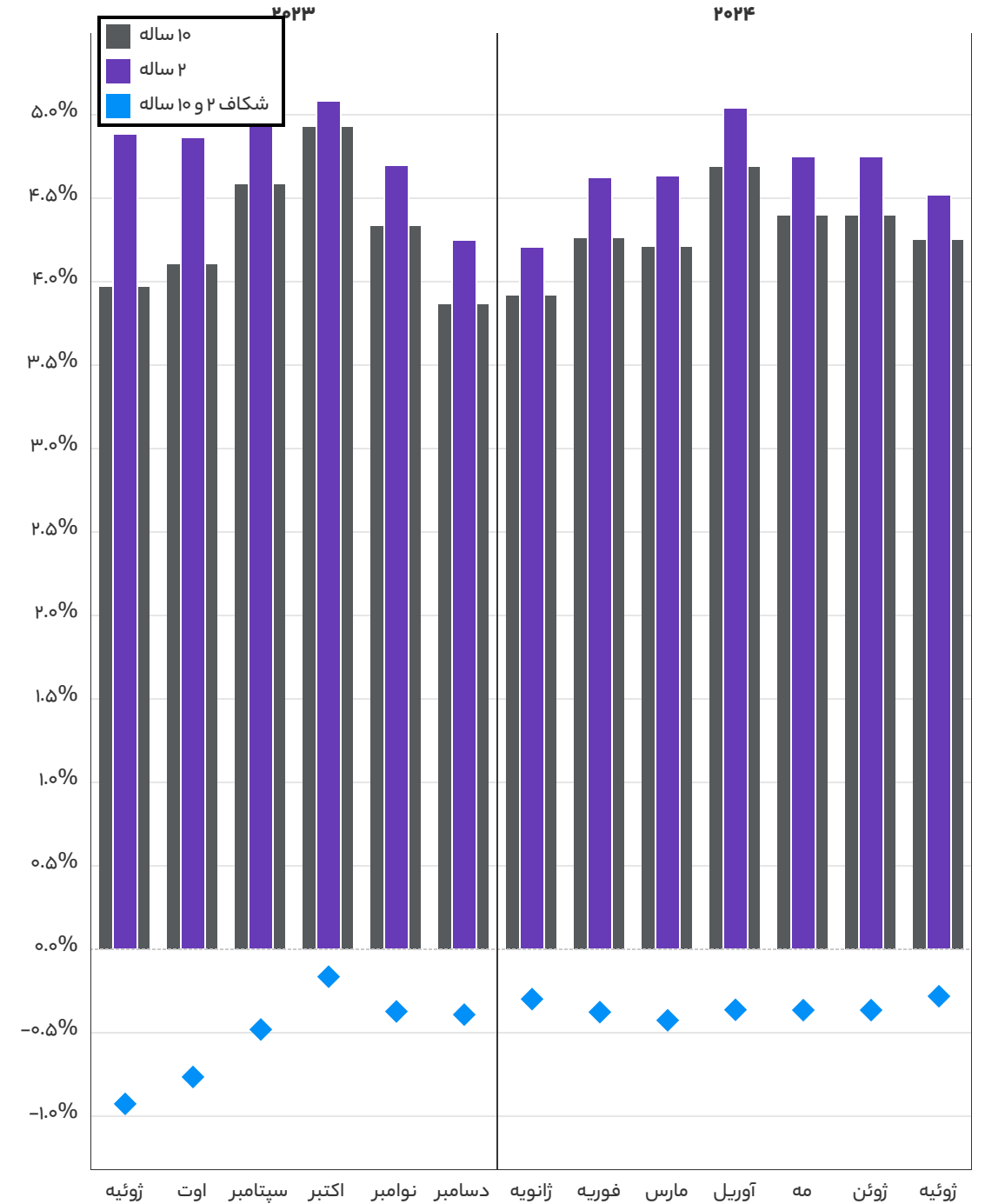
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



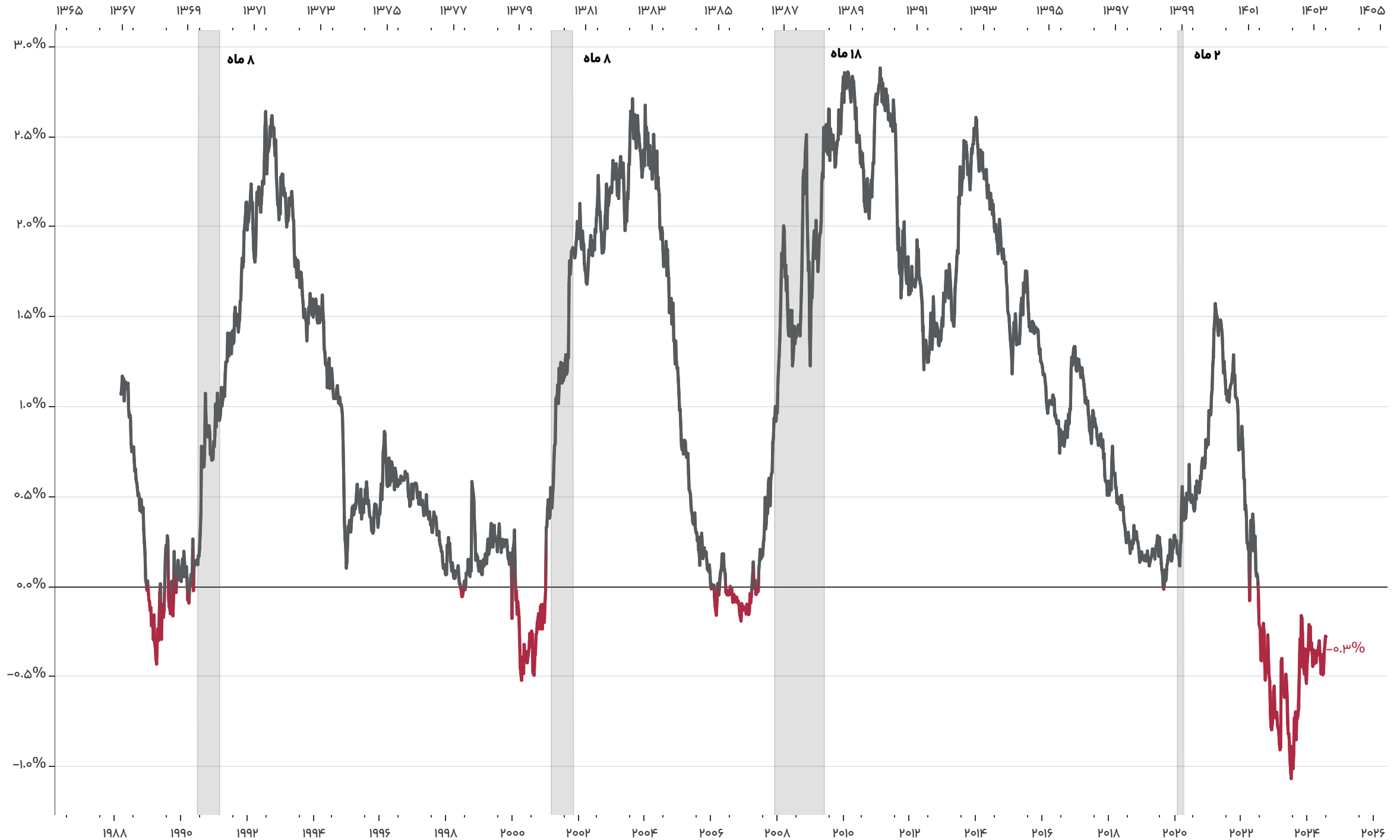
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

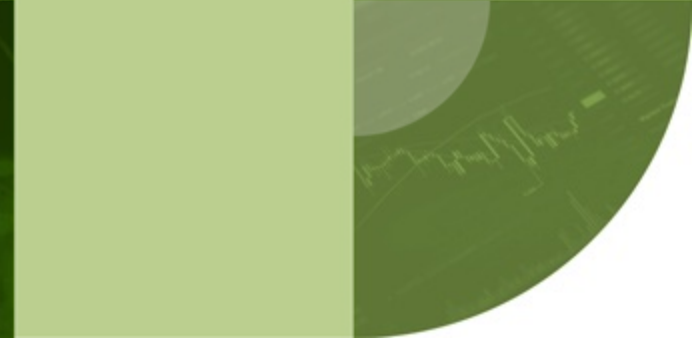
اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



بازار سهام

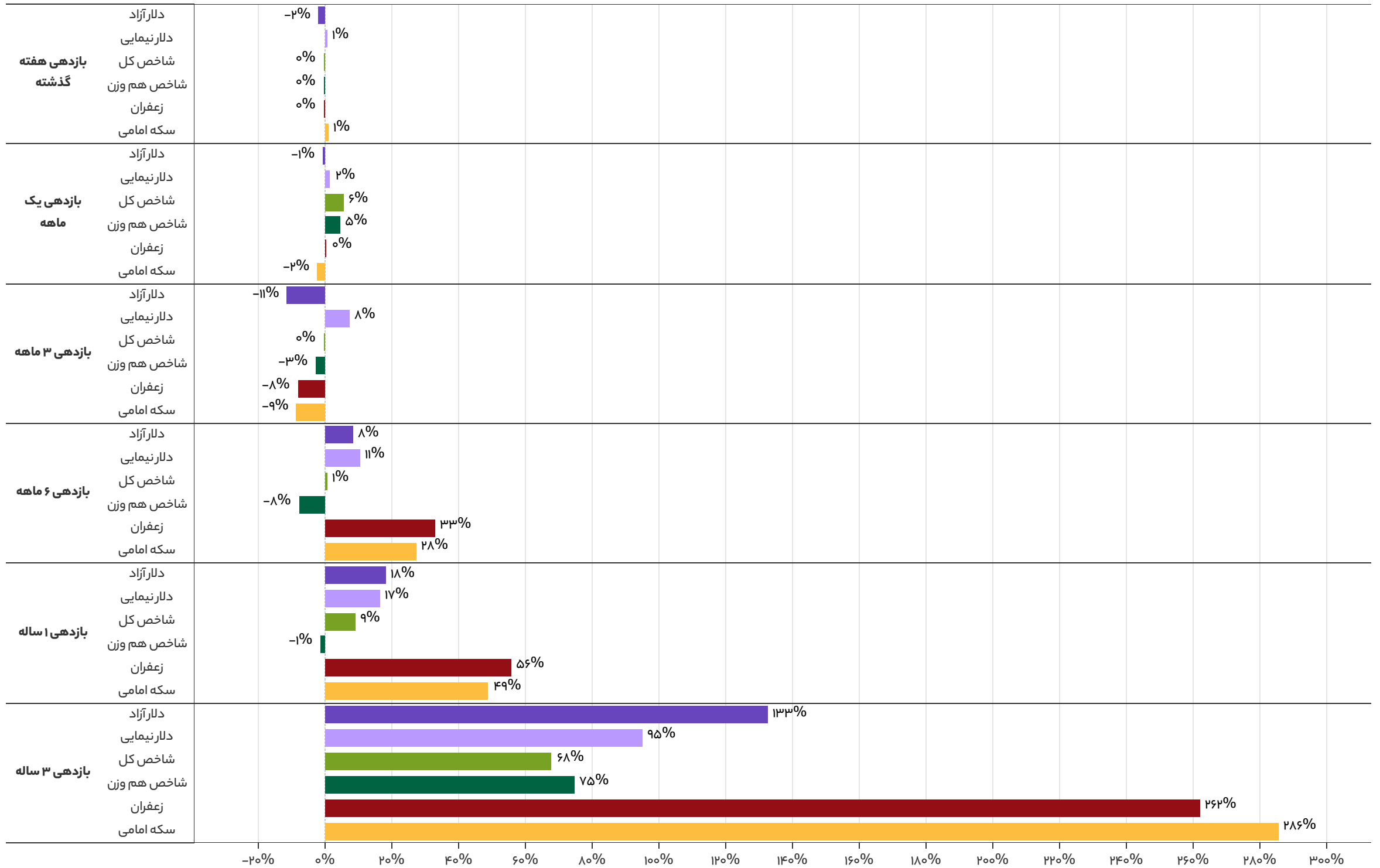
EQUITY MARKET

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

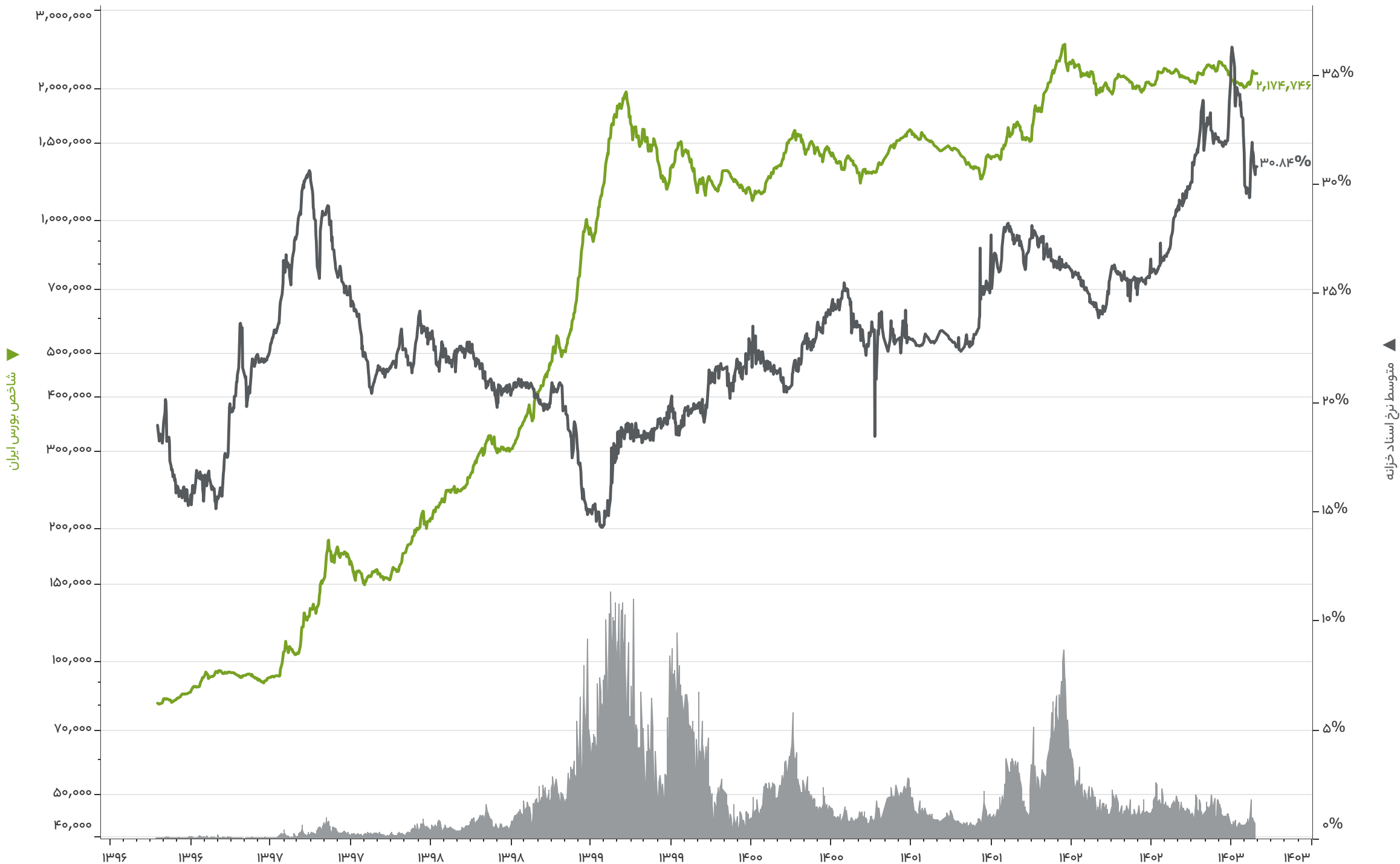
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





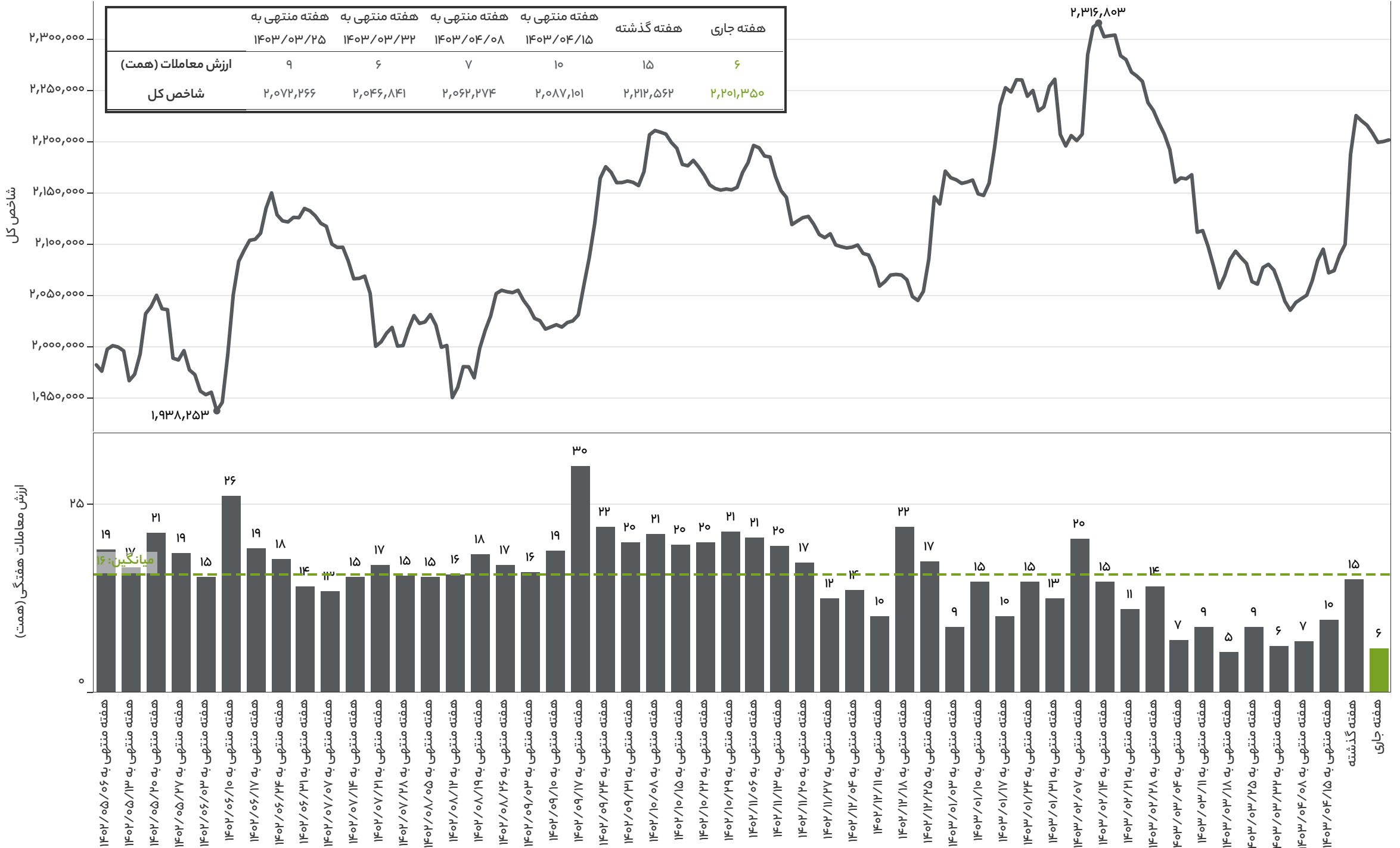
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

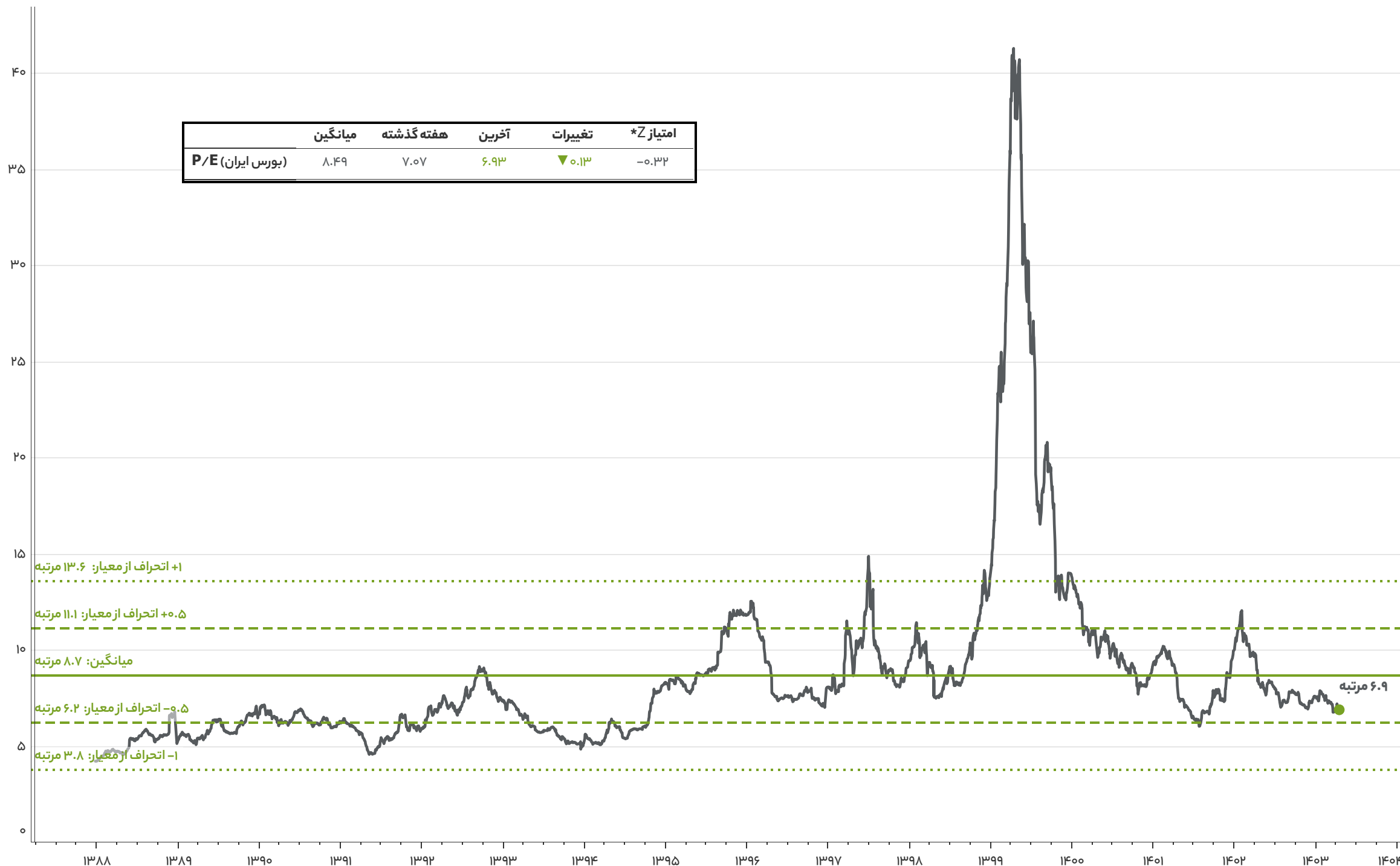
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.



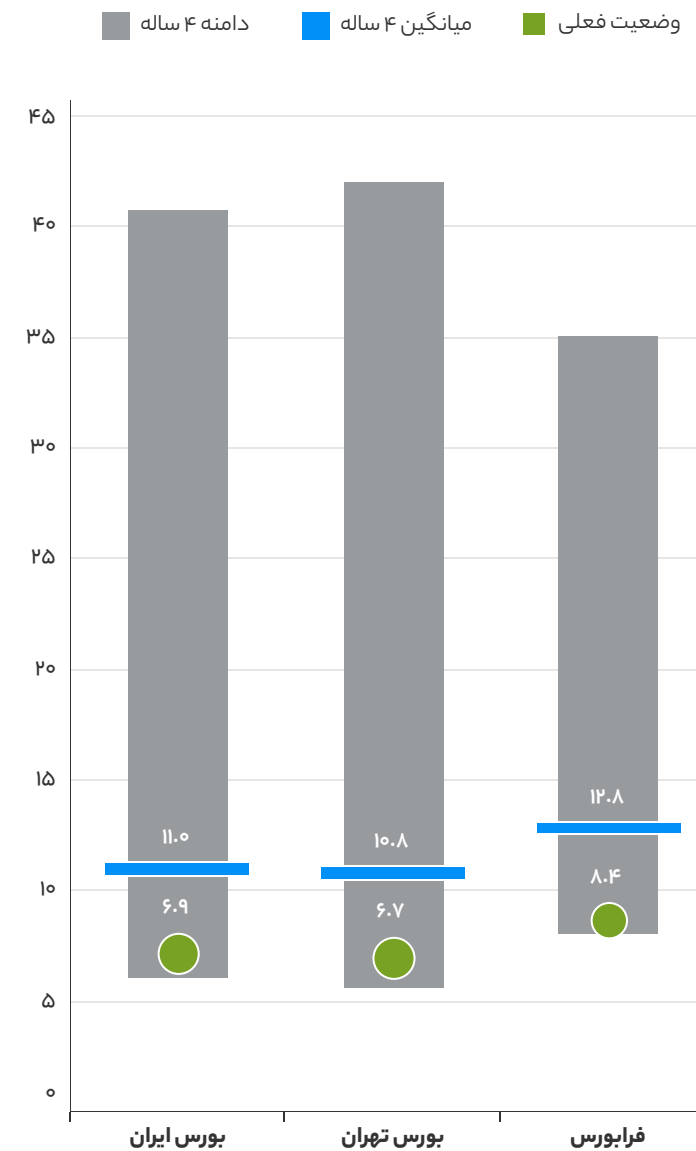
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	بیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۶.۹۳	۷.۰۷	۶.۰۷	۱۱.۰۰	۴۰.۷۵
بورس تهران	۶.۷۴	۶.۸۸	۵.۶۴	۱۰.۷۹	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۳۸	۸.۴۳	۸.۰۶	۱۲.۸۴	۳۵.۰۳

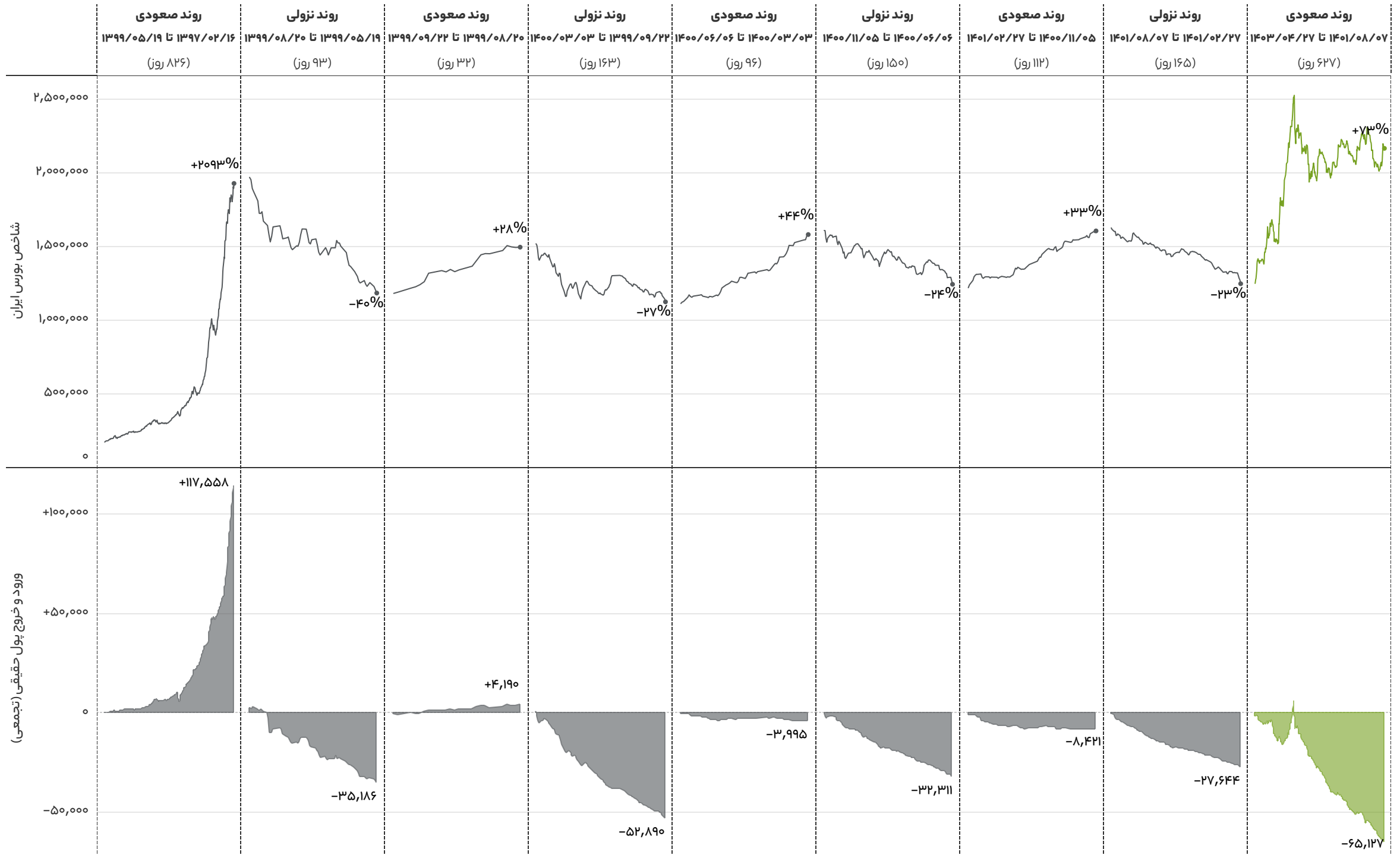


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۳۳۶	۳,۱۰۱	۶۰۰	۳۴۶	۱۹۸	۱۷۹	۱۳۵	۱۱۰	۹۹	۹۲	۵۹	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۴۰.۴%	۳۷.۶%	۷.۳%	۴.۲%	۲.۴%	۲.۲%	۱.۶%	۱.۳%	۱.۲%	۱.۱%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۸.۷	۶.۵	۵.۰	۴.۳	۸.۳	۸.۳	۸.۹	۱۴.۳	۴.۷	۷.۸	۱۷.۸	سودآوری
بازده سود نقدی	۹.۴%	۱۰.۰%	۱۳.۶%	۶.۳%	۵.۱%	۴.۵%	۷.۳%	۵.۳%	۱۵.۲%	۴.۳%	۳.۰%	
نسبت تقسیم سود	۷۲%	۶۱%	۶۸%	۳۸%	۴۴%	۳۶%	۶۰%	۷۴%	۱۰۰%	۱۲%	۴۲%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۱	۱.۰	۰.۹	۱.۲	۰.۸	۰.۷	۱.۱	۱.۴	۰.۹	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۱۰۸۰%	+۸۴۹%	+۸۲۱%	+۸۳۹%	+۴۰۰%	+۴۳۷%	+۳۴۷%	+۲۹۳%	+۸۷۶%	+۸۸%	+۶۹۳%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۷۹%	-۱%	+۱۹%	-۱۵%	-۱۳%	-۵%	+۶%	۰%	+۱۳۸%	-۷۰%	+۱۰%	
بازده از ابتدای سال	+۱۰۴%	+۶۹%	+۹۶%	+۸۶%	+۴۷%	+۱۰۶%	+۷۸%	+۷۰%	+۵۷%	+۲۱%	+۲۵۴%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۰%	۰%	۰%	-۱%	۰%	۰%	-۲%	-۱%	۲%	-۱%	۲%	

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

بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	ارزش بازار (ت.م.ه)		تغییر مالکیت شرکت
	صنعت	نماد	
	۰.۶	سرمایه گذاری	وآفر +۱.۰%
	۰.۴	شیرینیجات	غشوکو +۰.۹%
	۱.۱	سرمایه گذاری	وآذر +۰.۶%
	۰.۹	دارویی	دیران +۰.۵%
	۱.۹	سیمان، آهک و گچ	سغرب +۰.۳%
	۱.۴	محصولات لبنی	غگلپا +۰.۳%
	۲.۷	نرم افزار و خدمات	توسن +۰.۳%
	۱.۹	نوشیدنی	غبهنوش +۰.۲%
	۳.۲	انبوه سازی، املاک و مستغلات	ثپردیس +۰.۲%
	۱.۱	سایر محصولات کانی غیرفلزی	کسرام +۰.۲%
	۳.۹	قطعات خودرو	خمحور +۰.۲%
	۰.۵	لیزینگ	ولشرق +۰.۲%
	۱۷.۵	پالایش نفت و گاز	شاون +۰.۲%
	۰.۵	آهن و فولاد	فافزا +۰.۲%
بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقوقی	۲.۶	دارویی	دکپسول -۰.۲%
	۲.۳	محصولات کشاورزی	زفکا -۰.۲%
	۵.۰	دارویی	دامین -۰.۲%
	۲.۱	آهن و فولاد	فروید -۰.۲%
	۲.۷	قطعات خودرو	ختراک -۰.۲%
	۲.۱	نوشیدنی	غدیس -۰.۲%
	۲.۲	سایر مواد معدنی	کماسه -۰.۲%
	۱.۰	کاشی و سرامیک	کترام -۰.۲%
	۰.۹	بیمه	نوبین -۰.۳%
	۰.۶	سرمایه گذاری	فلات -۰.۳%
	۱.۰	نساجی	نطربین -۰.۳%
	۱.۱	محصولات کشاورزی	غنوش -۰.۴%
	۰.۷	آهن و فولاد	فولای -۰.۴%
۴.۴	حمل و نقل بارزمینی	حفارس -۰.۴%	

ورود و خروج پول حقیقی

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

بیشترین ورود پول حقیقی	ارزش بازار (ت.م.ه)		ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)
	صنعت	نماد	
	۱۸	پالایش نفت و گاز	شاون +۲۹
	۱۱۰	پالایش نفت و گاز	شتران +۲۷
	۱۷۶	سرمایه گذاری	تاپیکو +۱۶
	۵۶۱	آهن و فولاد	فولاد +۱۲
	۲۰۹	پالایش نفت و گاز	شپنا +۱۱
	۱۶	کانی های فلزی	فزر +۹
	۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات	ثپردیس +۸
	۳	نرم افزار و خدمات	توسن +۷
	۱۰	سرمایه گذاری	واحیا +۷
	۴	قطعات خودرو	خمحور +۷
	۷	سرمایه گذاری	وپترو +۷
	۱	سرمایه گذاری	وآفر +۷
	۲	سیمان، آهک و گچ	سغرب +۷
	۱	سرمایه گذاری	وآذر +۶
بیشترین خروج پول حقیقی	۹	بیمه	کوثر -۱۱
	۴۸	بانکها و موسسات اعتباری	وتجارت -۱۴
	۸۱	بانکها و موسسات اعتباری	ویاسار -۱۵
	۲۱	خودرو	خاور -۱۸
	۷۵	سرمایه گذاری	حکشتی -۲۰
	۱۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	ثفارس -۲۰
	۴	حمل و نقل بارزمینی	حفارس -۲۰
	۱۹۵	سرمایه گذاری	شستا -۲۱
	۸۵	خودرو	خودرو -۲۳
	۴۸	خودرو	خسپا -۲۹
	۲۵	بانکها و موسسات اعتباری	وشهر -۳۶
	۱۰۷	تولید کود و ترکیبات نیتروژن	شپدیس -۳۷
	۱۵۶	بانکها و موسسات اعتباری	وبملت -۵۰
۵۹۷	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	فملی -۵۶	

بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

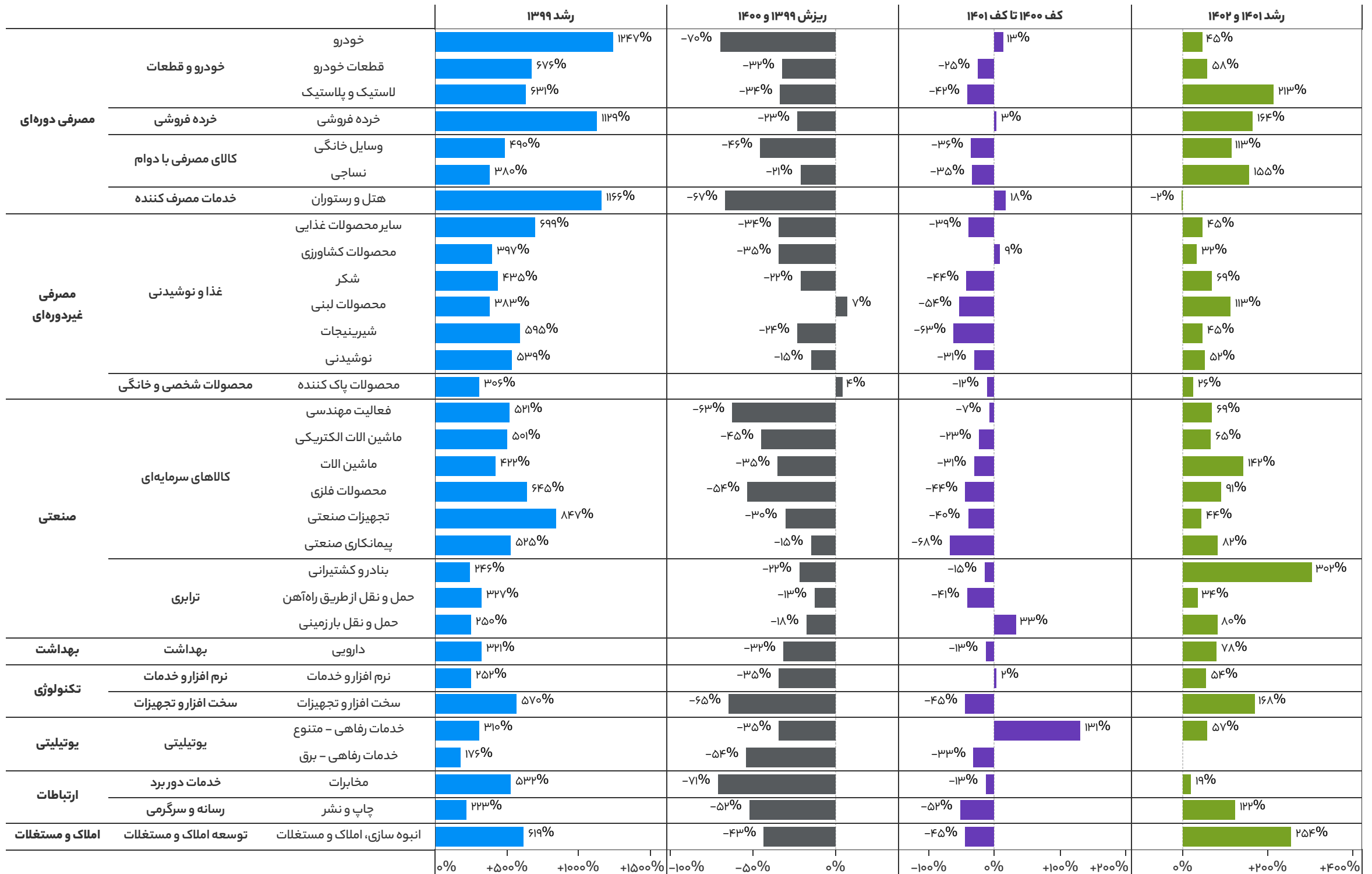
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۸، شاخص بورس ایران، بازدهی صنایع به تفکیک زیرگروه و سکتور، مرتب شده براساس ارزش بازار

		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%	۹۹%
		تولید فلزات گرانبه‌های غیر آهن: ۸۵۴%	-۳۲%	-۱%	۲۳۰%
		کانی های فلزی: ۴۹۱%	-۱۴%	۸%	۲۳%
		سایر مواد معدنی: ۵۲۸%	-۷۱%	-۲۷%	۲۷۰%
	شیمیایی	مواد شیمیایی-متنوع: ۴۰۰%	-۱۶%	۳۲%	۶۲%
		تولید کود و ترکیبات نیتروژن: ۴۶۶%	-۲۰%	۹۸%	۳۳%
	مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ: ۵۱۲%	-۱۷%	-۸%	۱۶۳%
		سایر محصولات کانی غیر فلزی: ۴۳۰%	-۱۸%	-۳۵%	۷۹%
		کاشی و سرامیک: ۴۶۳%	۱۳%	-۳۴%	۱۶۶%
		محصولات چوبی: ۳۸۵%	۸۸%	-۵۱%	۲۹۳%
	کاغذ و محصولات جنگلی: ۳۷۴%	-۷%	-۵۹%	۸۸%	
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	هلدینگ‌های سرمایه گذاری: ۸۸۱%	-۵۲%	۱۸%	۷۸%
		تامین سرمایه: ۱۲۸۷%	-۵۲%	۳۷%	-۱۱%
		فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار: ۹۱۶%	-۵۸%	-۷۴%	۱۳%
		لیزینگ: ۵۱۳%	-۴۲%	-۲۶%	۶۳%
	بانک‌ها	بانک‌ها و موسسات اعتباری: ۷۲۸%	-۴۰%	-۲۶%	۶۲%
بیمه	بیمه: ۶۹۳%	۲۹%	۱۰%	-۲۴%	
انرژی	انرژی	پالایش نفت و گاز: ۶۸۳%	-۶۸%	۸۷%	۹۶%
	مصرفی	زغال سنگ: ۲۴۸%	۳%	-۱۸%	۵۵%
	تجهیزات انرژی و خدمات	حفاری: ۳۶۵%	-۵۰%	-۳۳%	۱۸۱%

بازدهی بازار

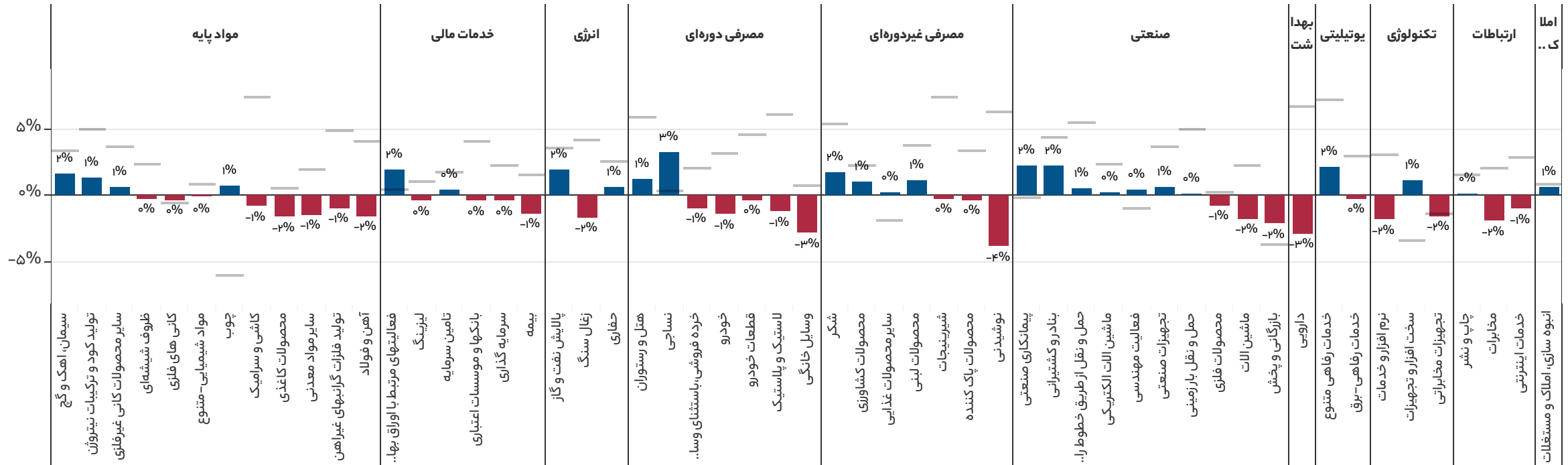


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

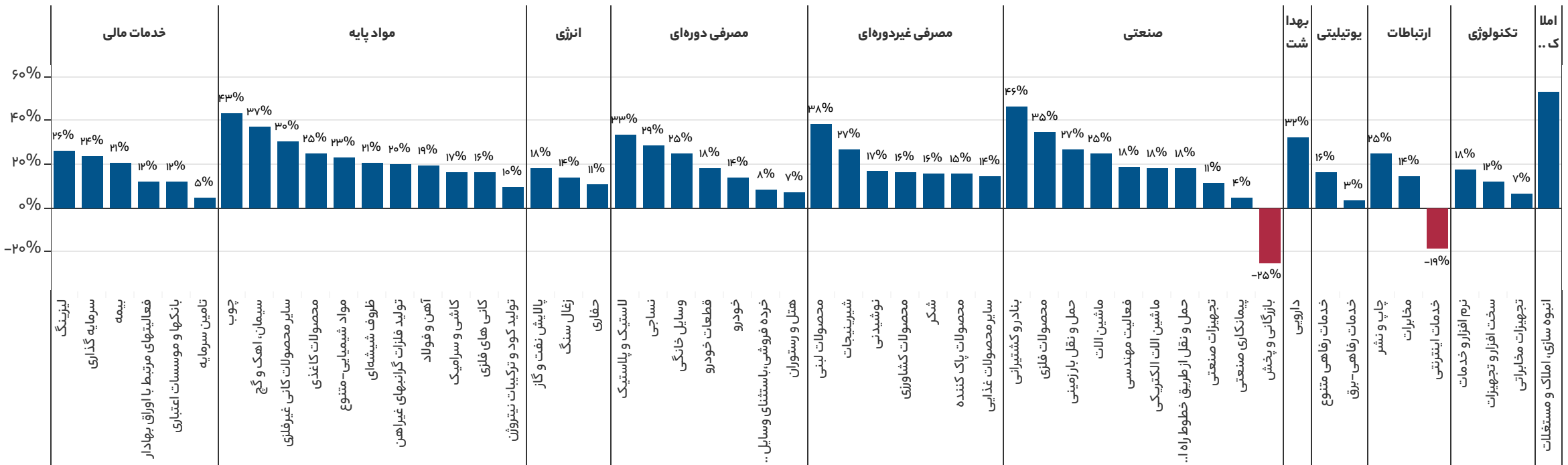


بازدهی صنایع از ابتدای هفته

(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)

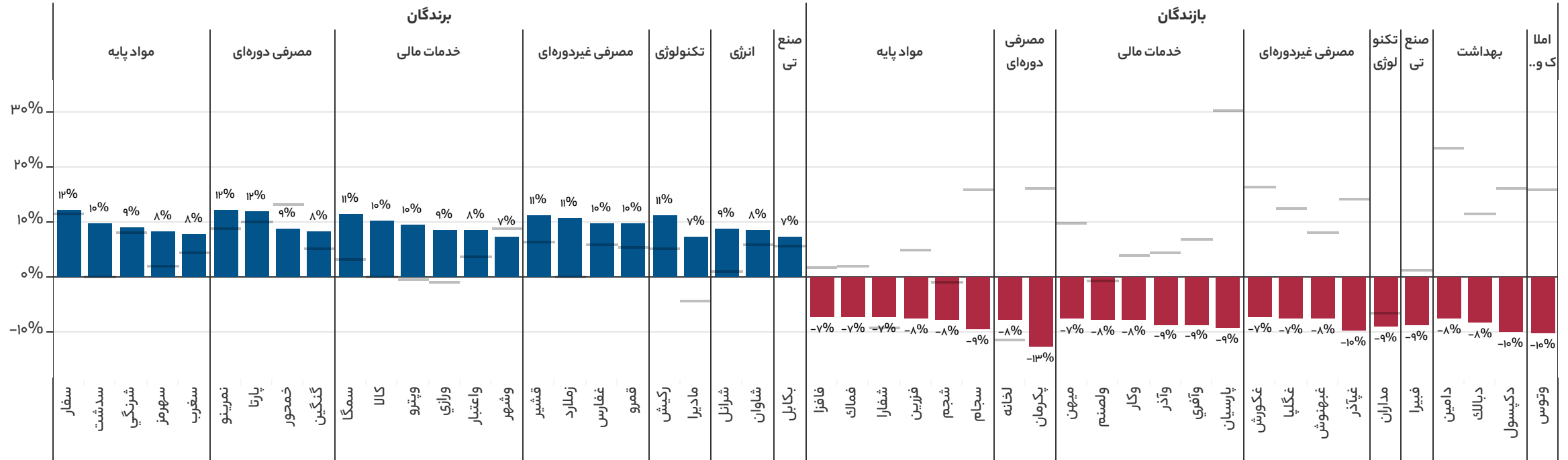

بازدهی صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

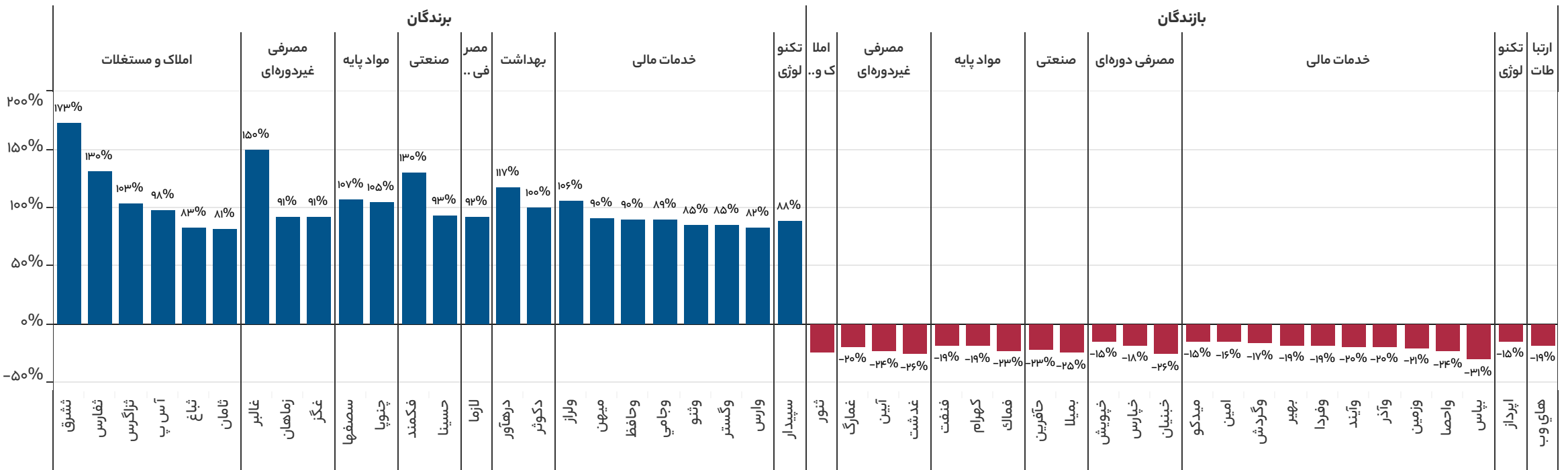




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



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



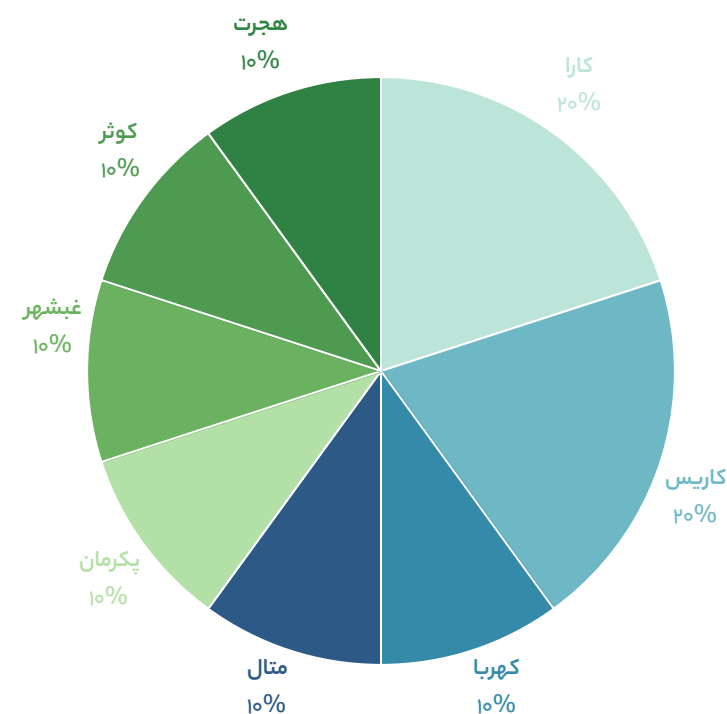
بازده هفته گذشته	شیراز	تاپیکو	وپاسار	مبین	وامید	شبریز	میدکو	پارسان	بفجر	شتران	نوری	شپدیس	وصندوق	آریا	تامیکو	پارس	مارون	چم	پپاس	بوعلی	وغدیر	وگدیر	شندر	شپنا	حکشتی	شستا	فملی	کگل	اخابر	وبملت	فارس	وتجارت	ومعادن	کگهر	رمپنا	خودرو	خسپا	فخوز	کچاد
	+۴.۵%	+۳.۵%	+۳.۱%	+۲.۷%	+۲.۱%	+۲.۰%	+۲.۰%	+۱.۹%	+۱.۹%	+۱.۸%	+۱.۸%	+۱.۴%	+۱.۳%	+۱.۲%	+۱.۲%	+۰.۹%	+۰.۷%	+۰.۶%	+۰.۵%	+۰.۴%	+۰.۲%	+۰.۱%	۰%	-۰.۲%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۰.۶%	-۰.۷%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۰.۹%	-۱.۳%	-۱.۵%	-۱.۷%	-۱.۸%	-۲.۱%	-۳.۱%	-۵.۱%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

افق زمانی	نماد	هدف قیمتی	توضیحات	قیمت سهم	وزن پیشنهادی
میان مدت	پکرمان	۳,۳۰۰	مناسب و عملکرد خوب در گزارشات ماهانه (P/E)	۲۴,۹۶۰	۱۰%
	غیشهر	۳,۶۰۰	مناسب و پتانسیل حذف ارزش ۲۸,۵۰۰ (P/E)	۲,۲۱۸	۱۰%
	کوثر	۳,۳۰۰	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۲,۵۴۲	۱۰%
	هجرت	۲۹,۰۰۰	مناسب و پتانسیل حذف ارزش ۲۸,۵۰۰ (P/E)	۲۱,۹۰۰	۱۰%
بلند مدت	کهربا	---	نسبت ریسک به ریوارد مطلوب و محافظت در برابر نوسانات دلار	۳۴,۵۵۷	۱۰%
	متال	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	۱۱,۶۰۰	۱۰%
	کارا	---	دارا بودن پرتفوی بدون ریسک و مناسب	۱۸,۹۶۳	۲۰%
	کاریس	---	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب	۲۳,۹۷۳	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

