



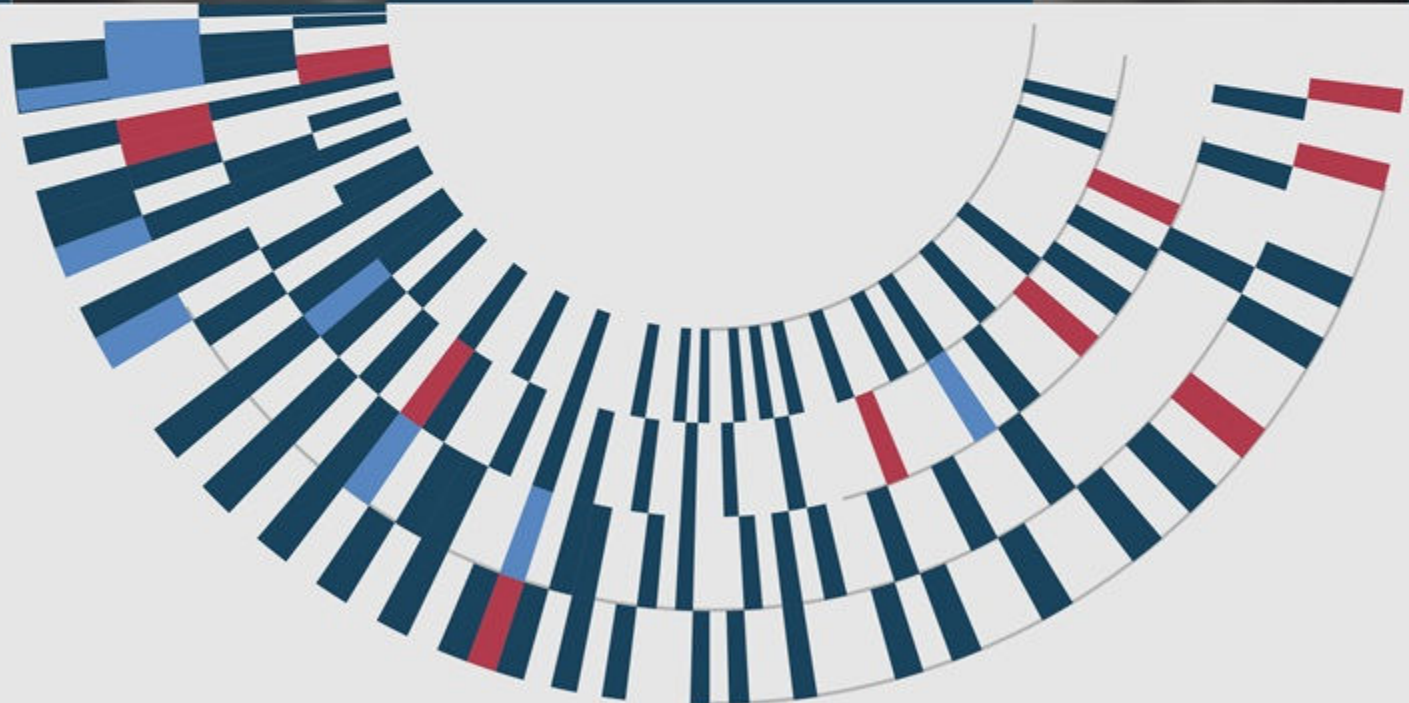
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۸ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۴/۳۰

 CHARISMA





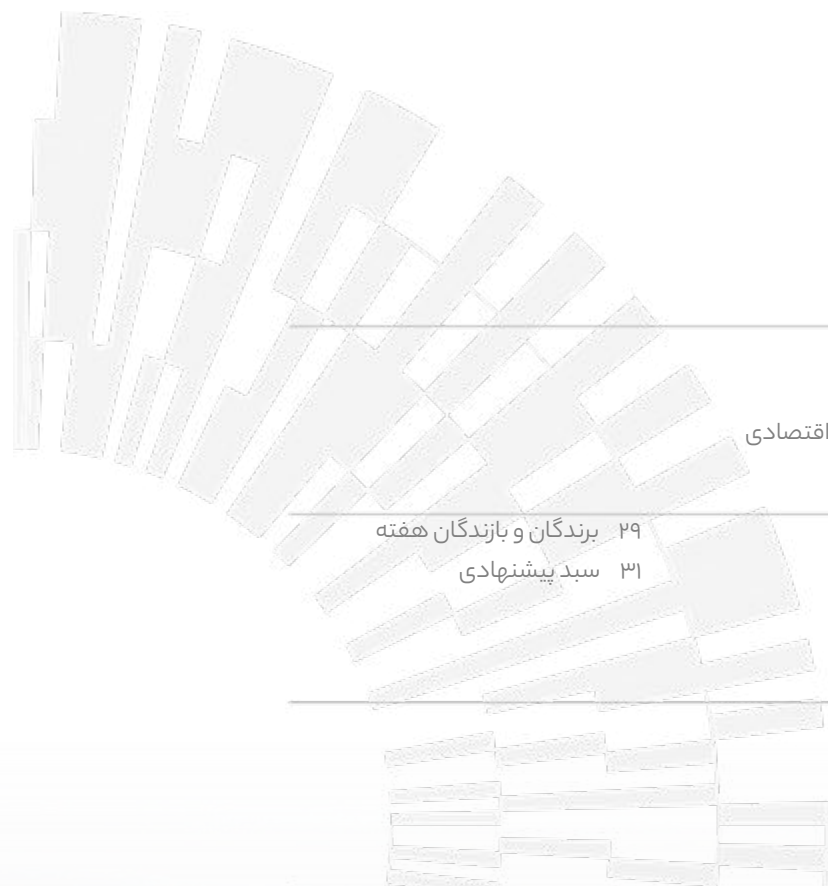
معرفی گزارش:

گزارش کاریزماتیک بازار سرمایه توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما با همکاری شرکت سرمایه‌گذاری کاریزما 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 دو هفته یکبار در منابع رسمی گروه مالی کاریزما 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 کاریزما هیچ گونه 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 کاریزما 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 کاریزما در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

کلیه حقوق مادی و معنوی این گزارش متعلق به گروه مالی کاریزما می‌باشد.



۰۳	کامودیتی	۰۴ فلزات و معادن ۰۵ پتروشیمی ۰۶ انرژی و سایر محصولات ۰۷ گاز طبیعی	۰۸ سیمان ۰۹ اخبار و معیارهای تاثیرگذار ۱۱ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی
۱۲	بازار سهام	۱۳ مروری بر بازارهای موازی ۱۵ بررسی بلندمدت بازار سهام ۱۷ نرخ بهره و رونق بازار سهام ۱۸ ارزش معاملات	۱۹ ارزشگذاری بازار ۲۱ بازدهی صنایع ۲۲ ورود و خروج پول ۲۵ بازدهی صنایع
۳۱	تحلیل تکنیکال	۳۲ شاخص کل (بورس تهران) ۳۳ شاخص کل هم وزن (بورس تهران) ۳۴ شاخص هم وزن به شاخص کل (بورس تهران) ۳۵ نسبت شاخص کل به دلار آزاد	۳۶ دلار آمریکا (بازار آزاد) ۳۷ سکه امامی ۳۸ طلای جهانی ۳۹ نفت برنت



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات و معادن

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
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۶۴	۰.۳%	فزر	-	۱,۶۴۳۲,۰۱۷	۱۱%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۴۴۳	-۲.۶%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۴۴۹۹,۳۴۱	۷%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۹۸	-۲.۸%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۵۰۴	-۹%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۳۸۱	-۲.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳۳,۶۰۰	-۳۱%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۳۹	۰.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۸۵۲۲,۲۷۳	۶%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۵۰۰	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۶۸۳۴,۸۴۳	۶۶%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۲۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۰۹۶۳,۶۲۵	۴۹%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۵۰	-۶.۱%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۵۰۶۱۳	-۱۳%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۹۹	-۴.۳%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۲,۳۰۸۲۲,۸۲۱	۵۹%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۶۳	-۵.۶%	فولاد، فخور، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۱۰%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۹۰۰	-۱.۰%	فولاد، فخور، هرمز	-	۱۱,۶۶۷۲۲,۰۸۰	۴۳%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۵	-۲.۱%	ذوب، کویر	فولای	۵۷۵۷۵۵	-۸%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۸۸۹	-۲.۷%	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۰۲۴۲۴,۷۴۷	۵۳%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۶۸	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۰۷۸۰	-۹%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۵	-۱.۵%	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	-۱۲%



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	رند قیمتی ۱۲ ماهه
اوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۳۴	۰.۵%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۵۳	-۲.۷%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۴۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۷	۱.۸%	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۱	۱.۹%	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۷	۱.۸%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۸۰	-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۰	-	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۷۸۰	۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۱۵	۱.۱%	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۴۵	۰.۱%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۵	-	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۹۸۱	۲.۲%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۸	۲.۸%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۷,۵۴۰	-	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۷۲۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۱۰	۵.۲%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۹۵	۰.۴%	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

		رند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی	نفت برنت		-۱۴%		۷۲	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شرارز، شاولان	-	-	۱.۵%	۸۱	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا		
	نفت WTI		-۱۳%		۶۶	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شرارز، شاولان	-	-	۲.۲%	۷۷	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا		
	نفت کوره		-۱۴%		۹۷	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شرارز، شاولان	-	-	۵.۷%	۱۱۵	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک		
	گازوئیل کم سولفور		-۱۶%		۸۹	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شرارز، شاولان	-	-	۶.۴%	۱۰۸	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا		
	لوب کات - پالایش نفت تهران		-۳%		۱۵,۲۴۷	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	-	-	۱۲,۹۱۰	تومان/تن	بورس کالای ایران	
	روغن پایه - نفت سپاهان		-۱۵%		۴۱,۳۶۵	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۱۳.۳%	۲۸,۸۸۷	تومان/تن	بورس کالای ایران		
محصولات کشاورزی	قیر - نفت پاسارگاد		۴۶%		۱۷,۱۴۰	شپاس	-	-	-	-	۱۳,۵۱۷	تومان/تن	بورس کالای ایران	
	ذرت آمریکا		-۱۳%		۲۷۲	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۴.۴%	۲۱۱	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو		
	روغن پالم خام		-۹%		۹۶۸	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۱.۲%	۸۶۰	دلار/تن	بورس مالزی		
	شکر آمریکا		-۹%		۱,۷۶۹	-	-	-	۶.۰%	۱,۶۲۹	دلار/تن	بورس کالای نیویورک		
ارز و ارز دیجیتال	گندم آمریکا		-۱۰%		۳۳۹	-	-	-	۵.۵%	۲۵۶	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو		
	یورو به دلار		۹%		۱.۱۲	-	-	-	-۰.۳%	۱.۱۱	-	بازار فارکس		
	پوند به دلار		۷%		۱.۳۱	-	-	-	-۱.۶%	۱.۲۹	-	بازار فارکس		
	بیتکوین		۳۱%		۳۵,۸۶۹	-	-	-	-۰.۷%	۲۹,۸۸۱	دلار	بایننس		



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	-۰.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۳۴	-۶۷%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-۰.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۴	-۶۴%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	۳.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۳.۳۹	-۸۵%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	۱۰.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۲.۶۸	-۷۹%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۰	۵.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۱.۶۲	-۸۱%

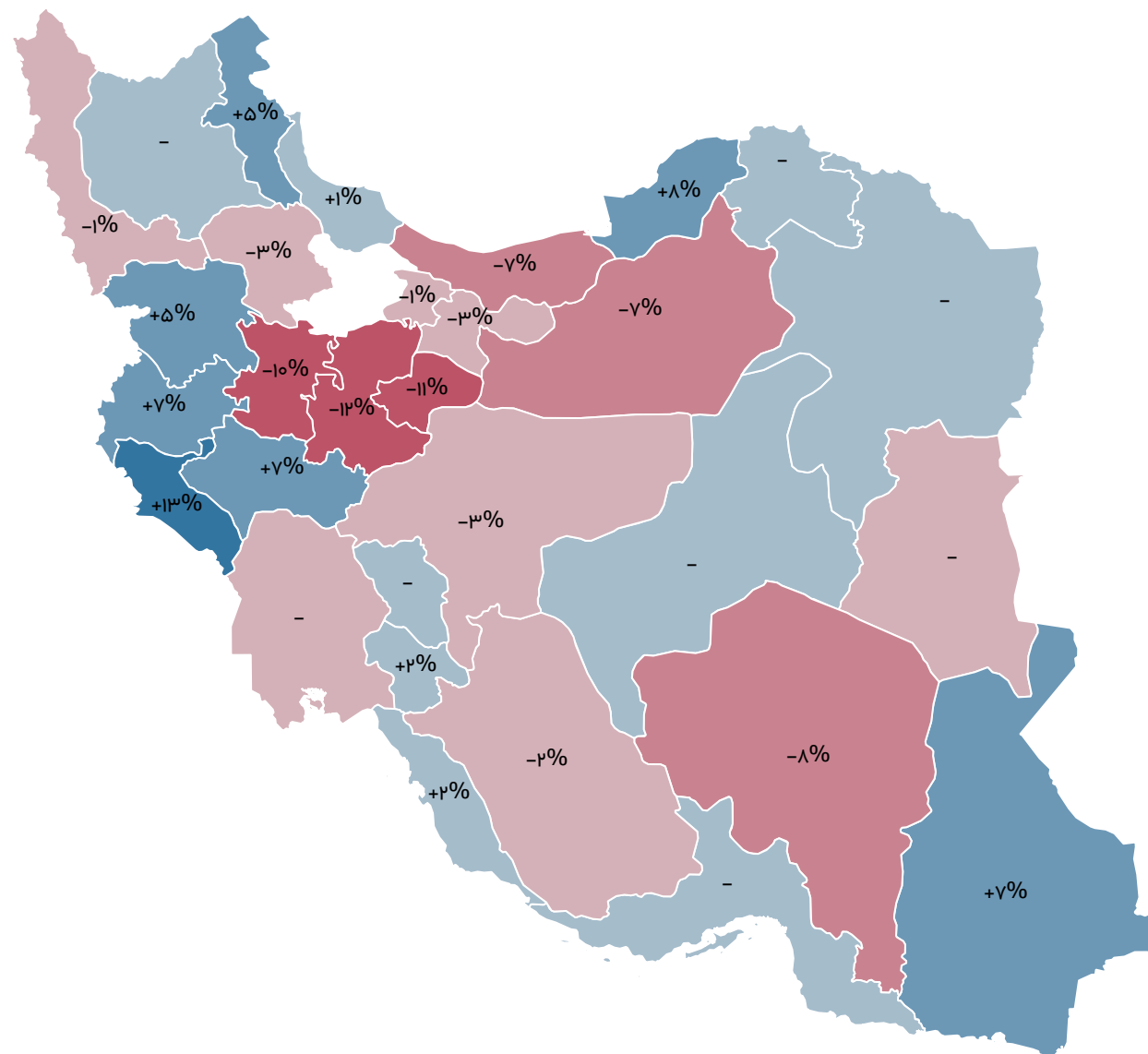
میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

میانگین هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، ۲ سال گذشته



تغییرات قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گذشته

تغییرات قیمت هفته گذشته نسبت به هفته قبل، بر اساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات



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

آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده بر اساس حجم معاملات

منطقه	استان	واحد	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	تومان/کیلو	۱,۰۳۳	۱,۰۰۶	-۳%
	اصفهان	تومان/کیلو	۹۷۱	۹۴۱	-۳%
	البرز	تومان/کیلو	۹۲۵	۹۱۴	-۱%
	مرکزی	تومان/کیلو	۱,۱۰۵	۹۷۴	-۱۳%
	قم	تومان/کیلو	۱,۰۷۹	۹۶۳	-۱۱%
	یزد	تومان/کیلو	۷۰۵	۷۰۵	+۰%
جنوب	سمنان	تومان/کیلو	۹۰۵	۸۳۷	-۷%
	فارس	تومان/کیلو	۹۶۲	۹۴۱	-۲%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۷۵۸	۷۶۰	+۰%
غرب	بوشهر	تومان/کیلو	۸۴۶	۸۵۹	+۲%
	همدان	تومان/کیلو	۹۳۵	۸۳۸	-۱۰%
	خوزستان	تومان/کیلو	۷۶۸	۷۶۶	+۰%
	ایلام	تومان/کیلو	۶۶۸	۷۵۴	+۱۳%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۹۱۶	۹۱۸	+۰%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۷۹۱	۸۴۳	+۷%
	لرستان	تومان/کیلو	۷۱۲	۷۶۴	+۷%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۷۹۲	۸۰۸	+۲%
	کردستان	تومان/کیلو	۹۲۵	۹۷۳	+۵%
	گیلان	تومان/کیلو	۶۳۹	۶۴۸	+۱%
شمال	مازندران	تومان/کیلو	۹۸۲	۹۱۶	-۷%
	گلستان	تومان/کیلو	۶۷۲	۷۲۸	+۸%
	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۷۳۴	۷۲۴	-۱%
شمال غرب	اردبیل	تومان/کیلو	۱,۱۴۲	۱,۲۰۳	+۵%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۸۵۳	۸۵۳	+۰%
	زنجان	تومان/کیلو	۹۸۹	۹۵۹	-۳%
شمال شرق	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۱۳۱	۱,۰۴۲	-۸%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۷۶۷	۸۲۰	+۷%

معادن و فلزات

- در این هفته شاهد رشد قیمت فلزات به ویژه برای ورق، مفتول و محصولات گالوانیزه در بازار چین بودیم. همچنین قیمت سنگ آهن به بالاترین سطح در ۴ ماه گذشته رسیده است. بازار فلزات چین در روند صعودی قرار دارد و به نظر می‌رسد با توجه به شرایط اقتصادی به این روند ادامه دهد.

- قیمت طلا در این هفته هم به روند صعودی خود ادامه داد و به بالاترین رقم طی یک ماه و نیم گذشته رسیده است. اکثر اقتصاددانان ها پیش‌بینی می‌کنند فدرال رزرو نرخ بهره را در اجلاس بیست و ششم تا محدوده ۵.۲۵ و ۵.۵۰ افزایش دهد و بعد این روند متوقف شود. با امید به توقف روند افزایش نرخ بهره فدرال رزرو پیش‌بینی می‌شود قیمت هر انس طلا به سطح ۲۰۰۰ دلار بازگردد.

- کاهش صادرات نفت عربستان به پایین‌ترین رقم طی ۱۹ ماه گذشته رسید و دلیل آن تمایل بسیاری از خریداران آسیایی به نفت ارزان قیمت روسیه بوده است.

- قیمت نفت برنت در این هفته افزایش یافت و به ۸۰ دلار به ازای هر بشکه رسید. تحلیلگران عقیده دارند عوامل مثبت بسیاری در زمینه عرضه و تقاضا برای افزایش قیمت نفت وجود دارد. روسیه با توجه به کاهش داوطلبانه صادرات به میزان ۵۰۰ هزار بشکه در روز در ماه اوت، احتمالاً ۱۶ میلیون بشکه نفت کمتری در سه ماهه سوم سال جاری میلادی صادر خواهد کرد. از طرفی نیز کاهش ذخایر نفتی آمریکا از قیمت آن حمایت می‌کند. آمار موسسه نفت آمریکا نشان می‌دهد ذخایر نفت خام، بنزین و میعانات گازی این کشور کاهش یافته است.

- روند روبه‌رشد بحران ناترازی گاز در کشور و افت تولید پارس جنوبی ادامه دارد. رئیس اتحادیه انجمن‌های انرژی ایران گفت: همین امروز برای حفاری چاه‌های جدید به منظور حفظ و نگهداشت تولید در میدان گازی پارس جنوبی دیر شده و برای اینکار و همین‌طور فشارافزایی میدان، داریم زمان را از دست می‌دهیم. ایران دومین دارنده ذخایر گازی جهان است و میدان گازی پارس جنوبی نقش مهمی در تأمین گاز کشور دارد، به طوری که ۷۰ درصد از گاز کشور از این میدان تأمین می‌شود و ۵۰ درصد برق کشور به وجود میدان پارس جنوبی وابسته است.

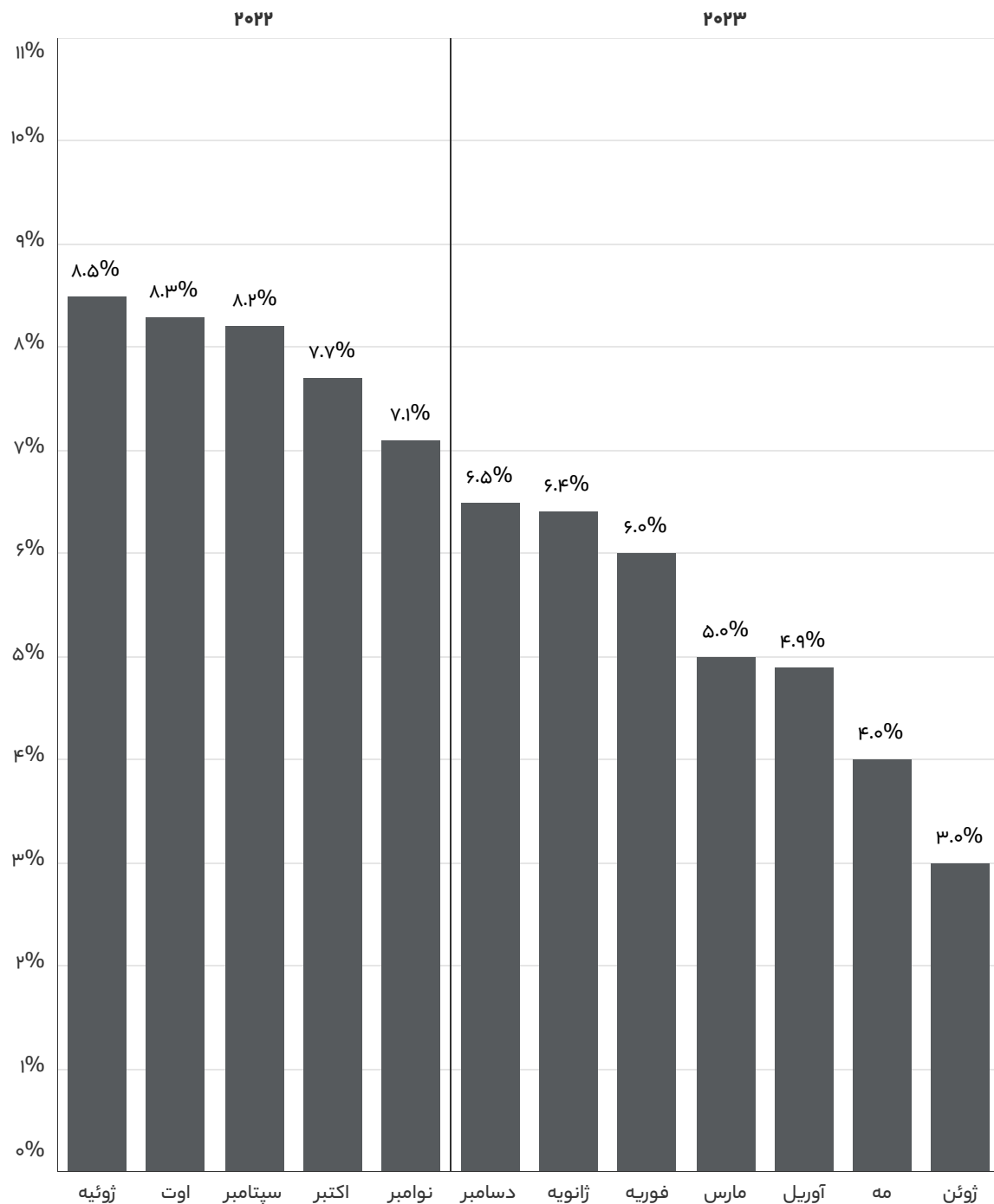
- علی بهادری جهرمی سخنگوی دولت گفت: قصد تغییر نرخ برای خوراک پتروشیمی را نداریم و در واکنش به شایعه گران شدن بنزین گفت: به این شایعات باید خندید و مطابق قانون هدفمندی یارانه‌ها، نرخ منابع انرژی و محل مصارف در زمینه یارانه‌ها مشخص شده است.

- سخنگوی کمیسیون اصل ۹۰ مجلس درباره گزارش این کمیسیون در خصوص ارزیابی اثر فعالیت پتروشیمی‌های متانولی بر منابع بخش عمومی گفت: قیمت فروش گاز به سایر مصارف کشور که بیش از ۹۰٪ مصارف گاز طبیعی را به خود اختصاص می‌دهد، بسیار کمتر از قیمت گاز پتروشیمی است. صنعت پتروشیمی از جمله بخش‌های مهم و تأثیرگذار بر تولید ناخالص ملی است و برای کشورهای دارای ذخایر هیدروکربوری به عنوان صنعت پیشرو شناخته می‌شود. در بین محصولات تولیدی صنعت پتروشیمی ایران، متانول بیشترین سهم حجمی را به خود اختصاص داده است. اهداف اولیه توسعه این صنعت تأمین مواد اولیه برای توسعه صنایع کشور، اشتغال‌زایی، استقلال اقتصادی و خودکفایی از طریق تکمیل زنجیره‌های تولید و صدور محصولات و صیانت از منابع فسیلی کشور است.

انرژی و فراورده‌های نفتی

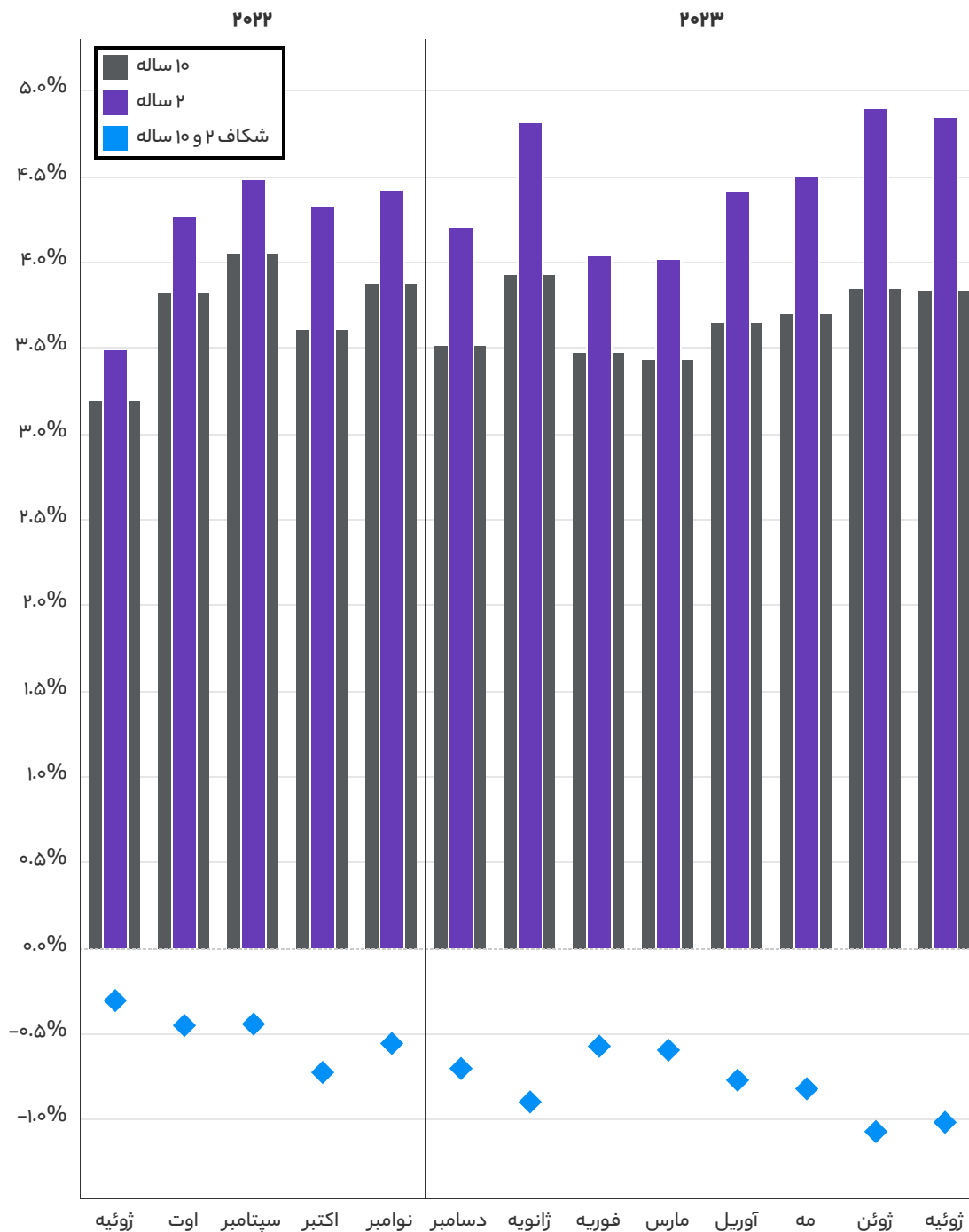
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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

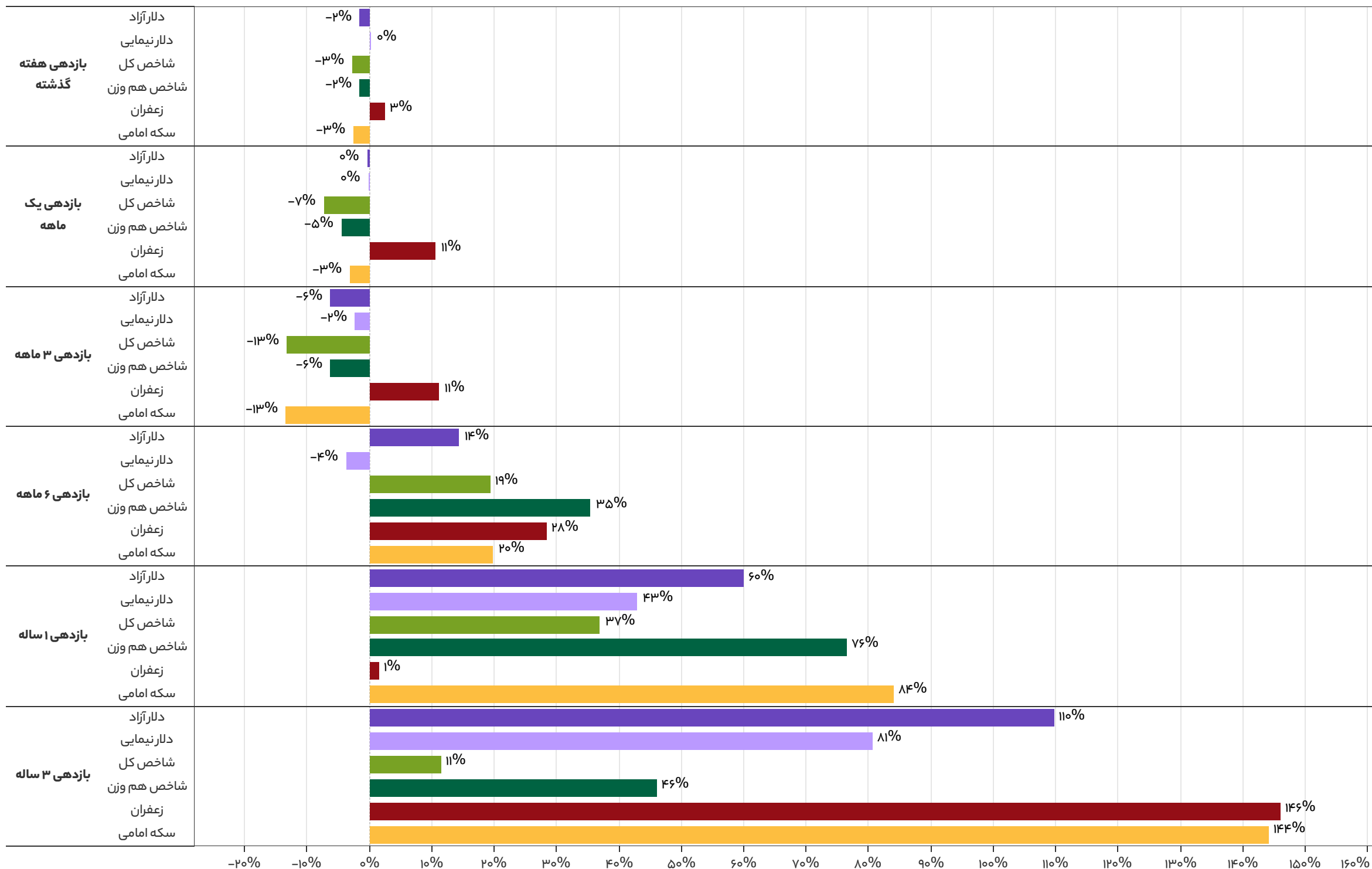
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها طی در بازه‌های زمانی متفاوت



بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

بازدهی دارایی‌های مختلف، طی یکسال گذشته به صورت ماهانه، مرتب شده براساس بازده درهرماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۰۳	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	هم وزن ۴۳%	سکه امامی ۱۱۱.۵%
سکه امامی ▲ ۱۰.۵%	زعفران ▲ ۹.۶%	مسکن ▲ ۲.۵%	دلار آزاد ▲ ۸.۵%	سکه امامی ▲ ۴.۴%	سکه امامی ▲ ۸.۹%	سکه امامی ▲ ۱۴.۷%	سکه امامی ▲ ۲۶.۵%	سکه امامی ▲ ۲۲.۲%	شاخص کل ▲ ۲۷.۹%	هم وزن ▲ ۳۰.۵%	مسکن ▲ ۳.۳%	شاخص کل ۳۹%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%
مسکن ▲ ۸.۴%	مسکن ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۲.۴%	سکه امامی ▲ ۵.۷%	دلار آزاد ▲ ۳.۱%	دلار آزاد ▲ ۸.۲%	دلار آزاد ▲ ۱۲.۵%	هم وزن ▲ ۱۸.۱%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	هم وزن ▲ ۲۲.۸%	شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	سکه امامی ۳۸%	هم وزن ▲ ۸۲.۵%
زعفران ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۴.۶%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	شاخص کل ▲ ۷.۶%	هم وزن ▲ ۱۰.۲%	شاخص کل ▲ ۱۲.۹%	زعفران ▲ ۱۴.۵%	دلار نیمایی ▲ ۱۸.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱۰.۲%	سکه امامی ▲ ۲.۶%	زعفران ۲۶%	دلار آزاد ▲ ۶۸.۵%
دلار آزاد ▲ ۴.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	هم وزن ▼ ۱.۶%	مسکن ▲ ۱.۱%	دلار نیمایی ▲ ۱.۲%	مسکن ▲ ۶.۸%	شاخص کل ▲ ۶.۲%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	مسکن ▲ ۳.۳%	سکه امامی ▲ ۱۶.۶%	دلار آزاد ▲ ۳.۷%	دلار آزاد ▲ ۲.۴%	دلار آزاد ۲۱%	شاخص کل ▲ ۴۸.۲%
درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	دلار آزاد ▲ ۰.۷%	شاخص کل ▼ ۳.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱.۰%	مسکن ▲ ۱.۲%	هم وزن ▲ ۶.۷%	زعفران ▲ ۳.۱%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ۱۹%	مسکن ▲ ۴۵.۳%
دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار آزاد ▼ ۷.۹%	هم وزن ▼ ۰.۴%	زعفران ▲ ۰.۵%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	مسکن ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۶%	مسکن ۸%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%
شاخص کل ▼ ۲.۵%	سکه امامی ▼ ۴.۴%	سکه امامی ▼ ۸.۴%	شاخص کل ▼ ۴.۹%	شاخص کل ▼ ۳.۴%	دلار نیمایی ▲ ۱.۵%	دلار نیمایی ▲ ۲.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱.۳%	شاخص کل ▼ ۹.۲%	زعفران ▲ ۰.۸%	زعفران ▼ ۰.۱%	هم وزن ▲ ۰.۵%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%	مسکن ۸%
هم وزن ▼ ۳.۸%	هم وزن ▼ ۴.۶%	زعفران ▼ ۹.۰%	زعفران ▼ ۱۴.۵%	هم وزن ▼ ۴.۲%	زعفران ▼ ۲.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۰%	هم وزن ▼ ۹.۴%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	سکه امامی ▼ ۶.۳%	شاخص کل ▼ ۲.۰%	زعفران ▲ ۲.۸%	درآمد ثابت ۱%

– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر ماه محاسبه شده و اوراهی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری زعفران 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 کاریزما ذکر گردیده، استفاده شده است.

ارزش دلاری بازار

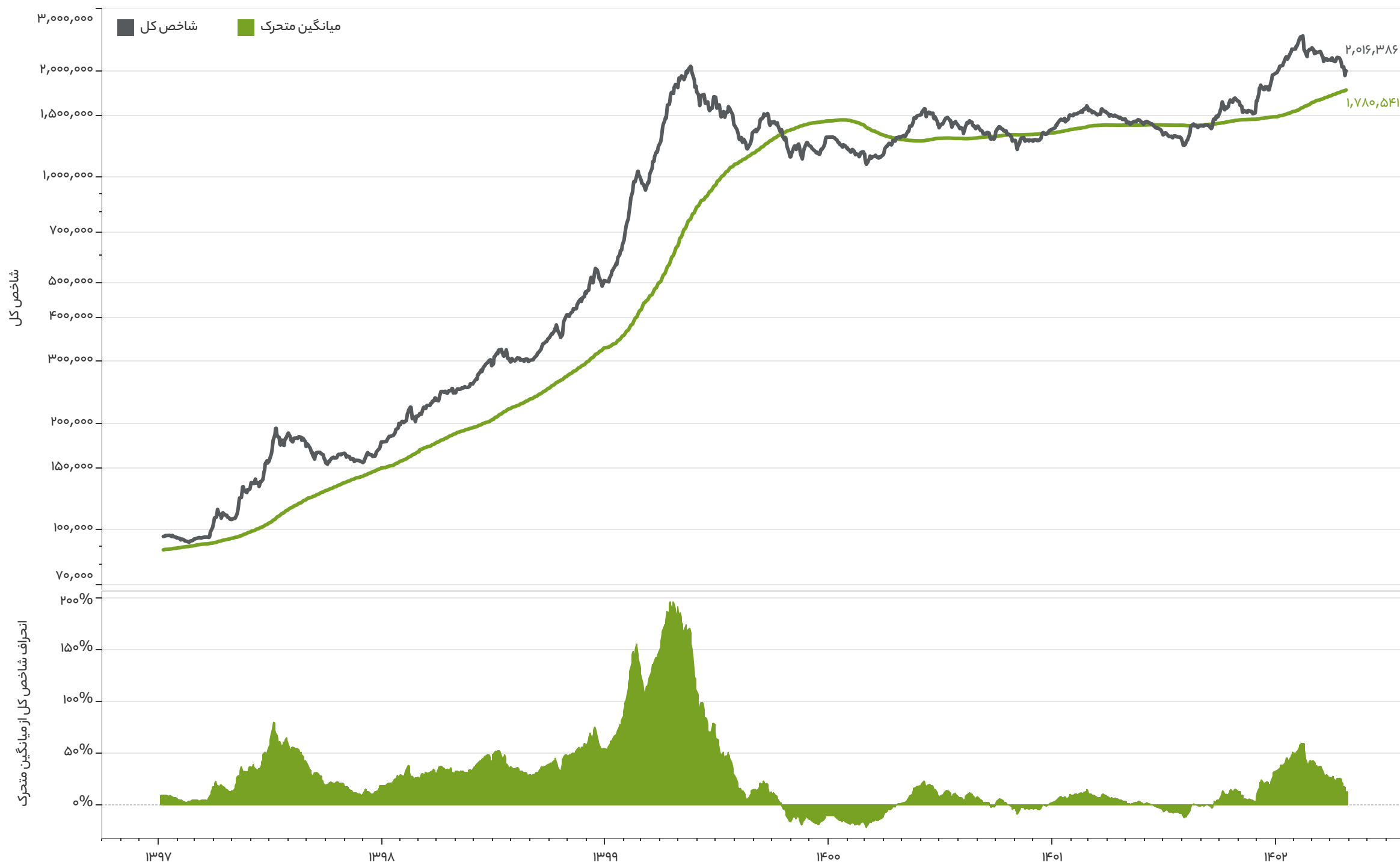
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است

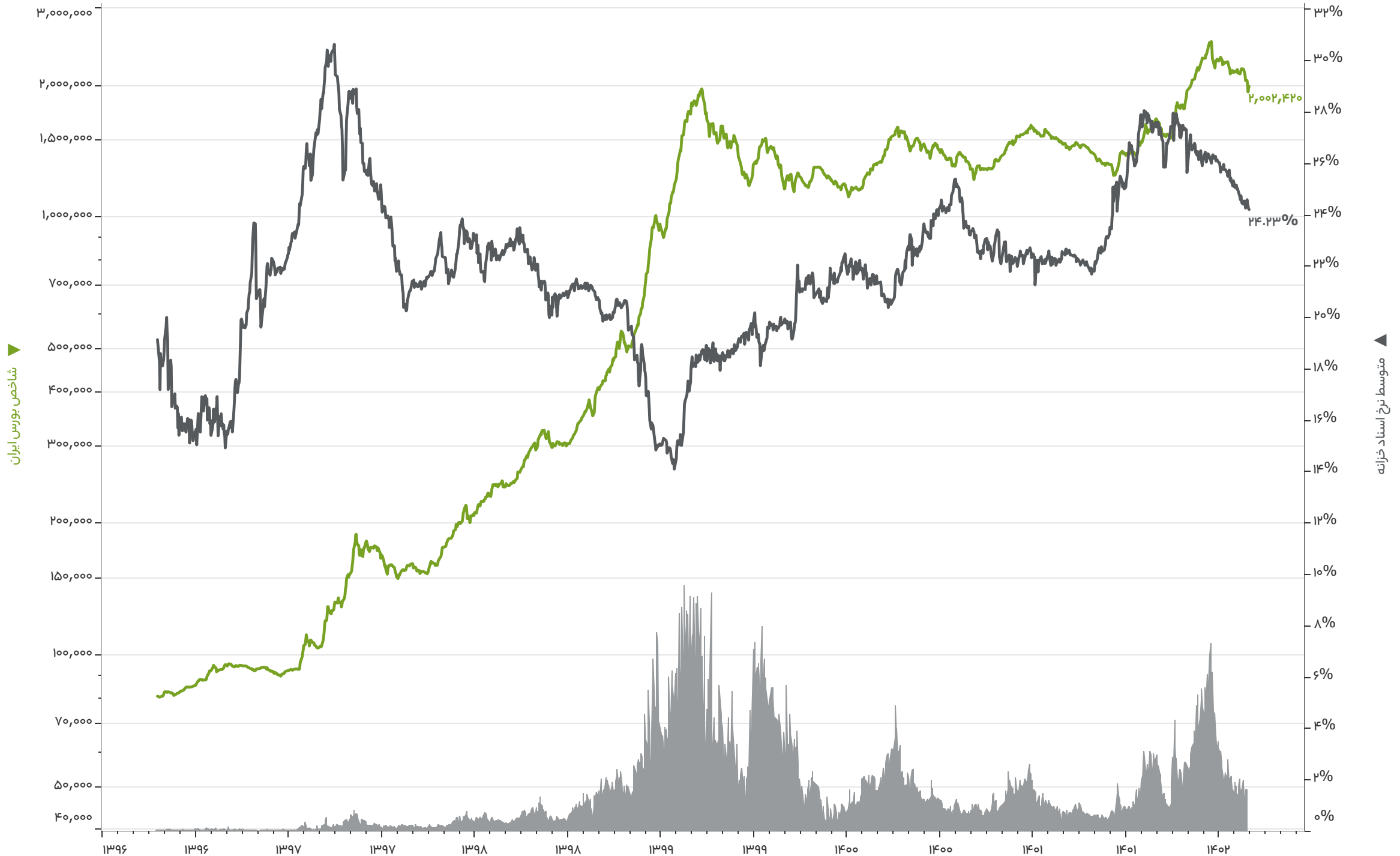




شاخص کل و میانگین متحرک

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

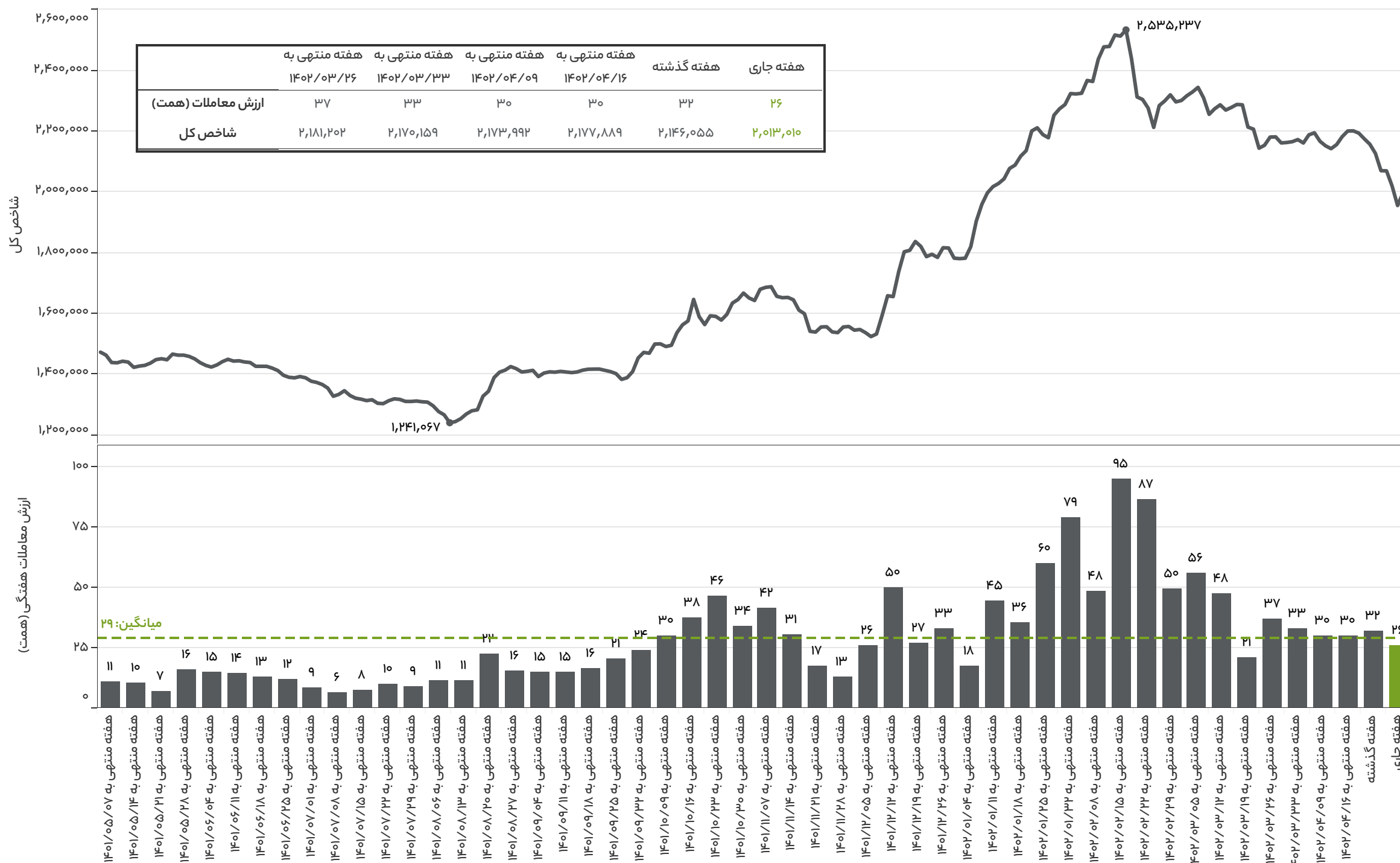






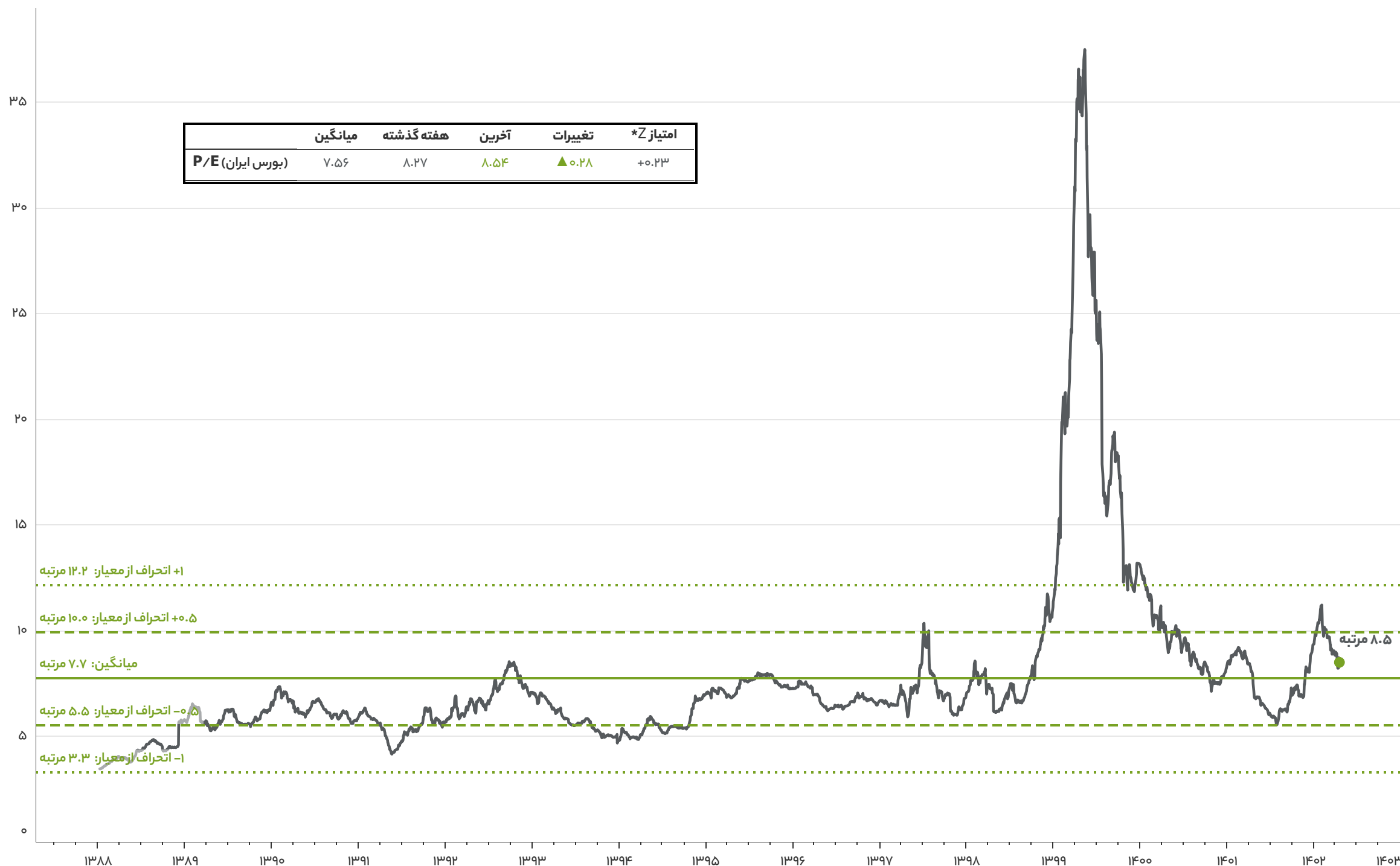
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

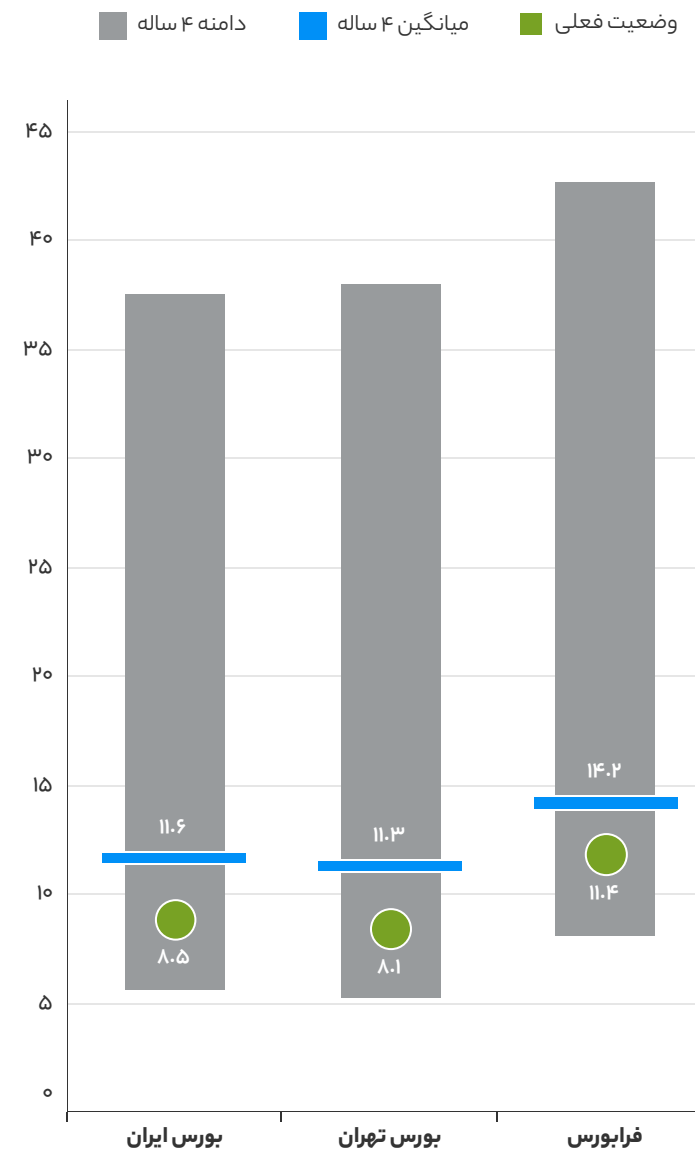
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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
+۰.۲۸	۸.۵۴	۸.۲۷	۵.۵۹	۱۱.۶۵	۳۷.۵۱
+۰.۲۲	۸.۱۳	۷.۹۱	۵.۲۵	۱۱.۲۷	۳۸.۰۰
+۰.۷۱	۱۱.۴۳	۱۰.۷۲	۸.۱۱	۱۴.۱۷	۴۲.۶۴



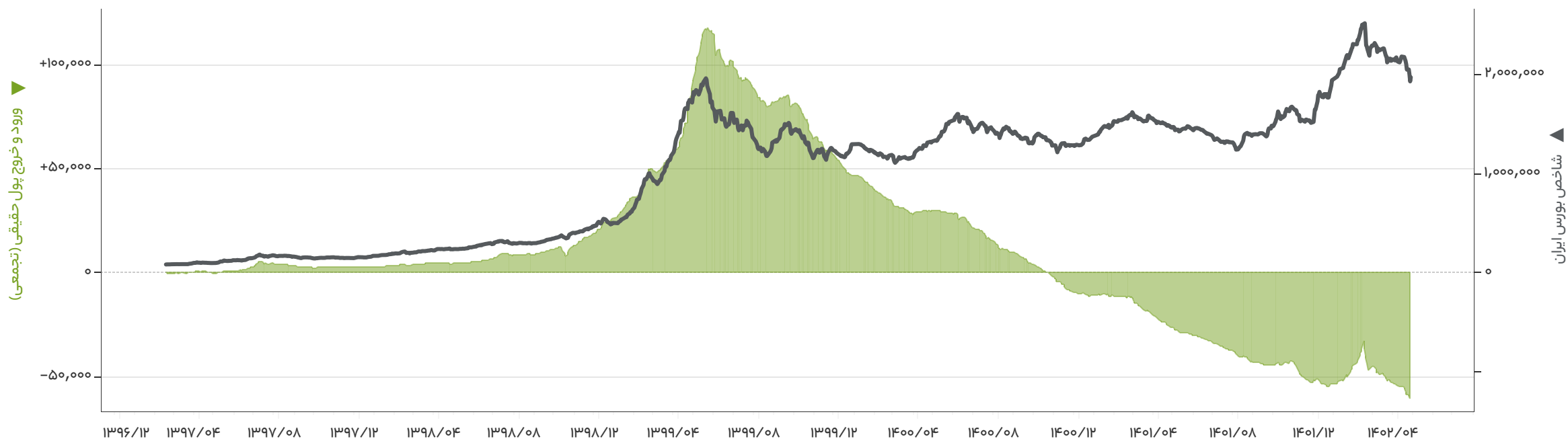
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

بازرسی

	خدمات مالی	مواد پایه	انرژی	مصرفی دوره‌ای	غیردوره‌ای مصرفی	صنعتی	بهداشت	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۹۹	۱۸۹	۶	۶۵	۸۹	۶۳	۴۱	۱۰	۵	۱۹	۲۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۳,۱۴۵	۳,۱۱۶	۶۴۷	۳۰۹	۲۱۳	۱۸۲	۱۶۲	۱۱۴۴	۱۰۹	۱۰۵	۴۳	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۳۸.۵%	۳۸.۱%	۷.۹%	۳.۸%	۲.۶%	۲.۲%	۲.۰%	۱.۸%	۱.۳%	۱.۳%	۰.۵%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۸.۱	۸.۳	۵.۴	۶.۳	۱۲.۶	۱۰.۸	۱۰.۲	۱۵.۰	۱۱.۴	۲۳.۳	۱۰.۳	سودآوری
بازده سود نقدی	۶.۷%	۱۳.۲%	۱۱.۴%	۱.۸%	۴.۲%	۴.۷%	۹.۶%	۲۰.۳%	۶.۴%	۳.۳%	۳.۶%	
نسبت تقسیم سود	۵۸%	۷۴%	۷۵%	۲۸%	۵۶%	۴۰%	۷۶%	۸۲%	۶۰%	۶۰%	۴۵%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۵	۱.۲	۰.۵	۰.۹	۰.۶	۰.۷	۰.۸	۰.۴	۰.۷	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۸۱۰%	+۸۴۲%	+۶۳۴%	+۸۶۹%	+۴۴۷%	+۳۵۶%	+۴۲۴%	+۵۰۱%	+۱۲۵%	+۲۸۳%	+۴۸۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۵%	+۴۷%	-۵%	-۱۴%	+۳%	-۲۲%	+۲۴%	+۶۲%	-۶۴%	+۱%	-۱۹%	
بازده از ابتدای سال	+۵۸%	+۶۴%	+۵۶%	+۸۴%	+۶۰%	+۷۹%	+۱۰۹%	+۵۰%	+۴۴%	+۶۴%	+۱۵۹%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	-۳%	-۵%	-۵%	-۱%	-۵%	۲%	-۳%	-۵%	-۳%	-۳%	

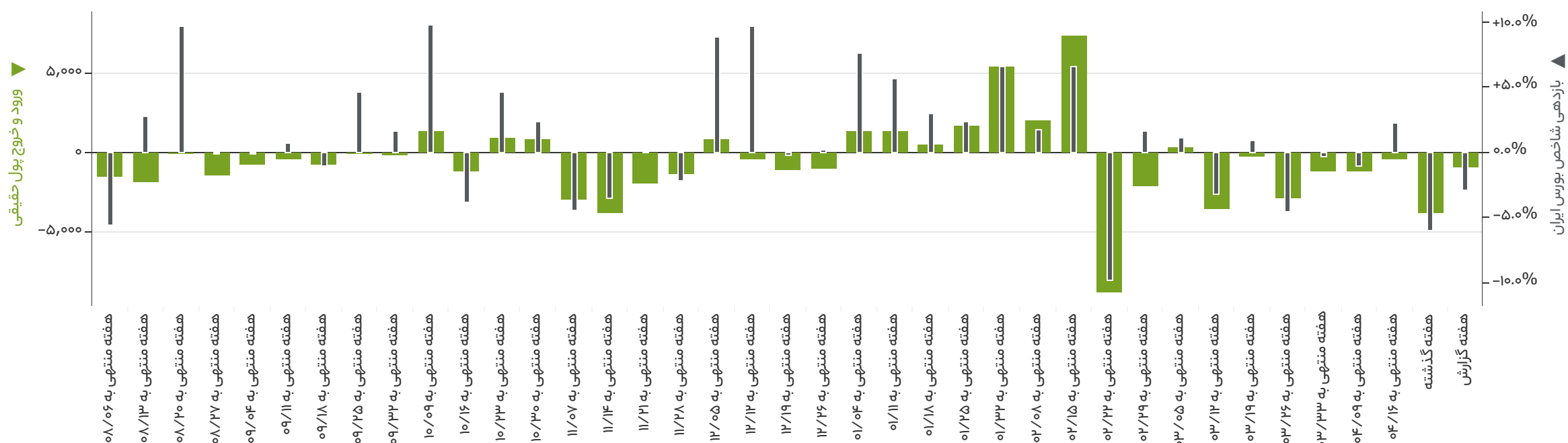
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



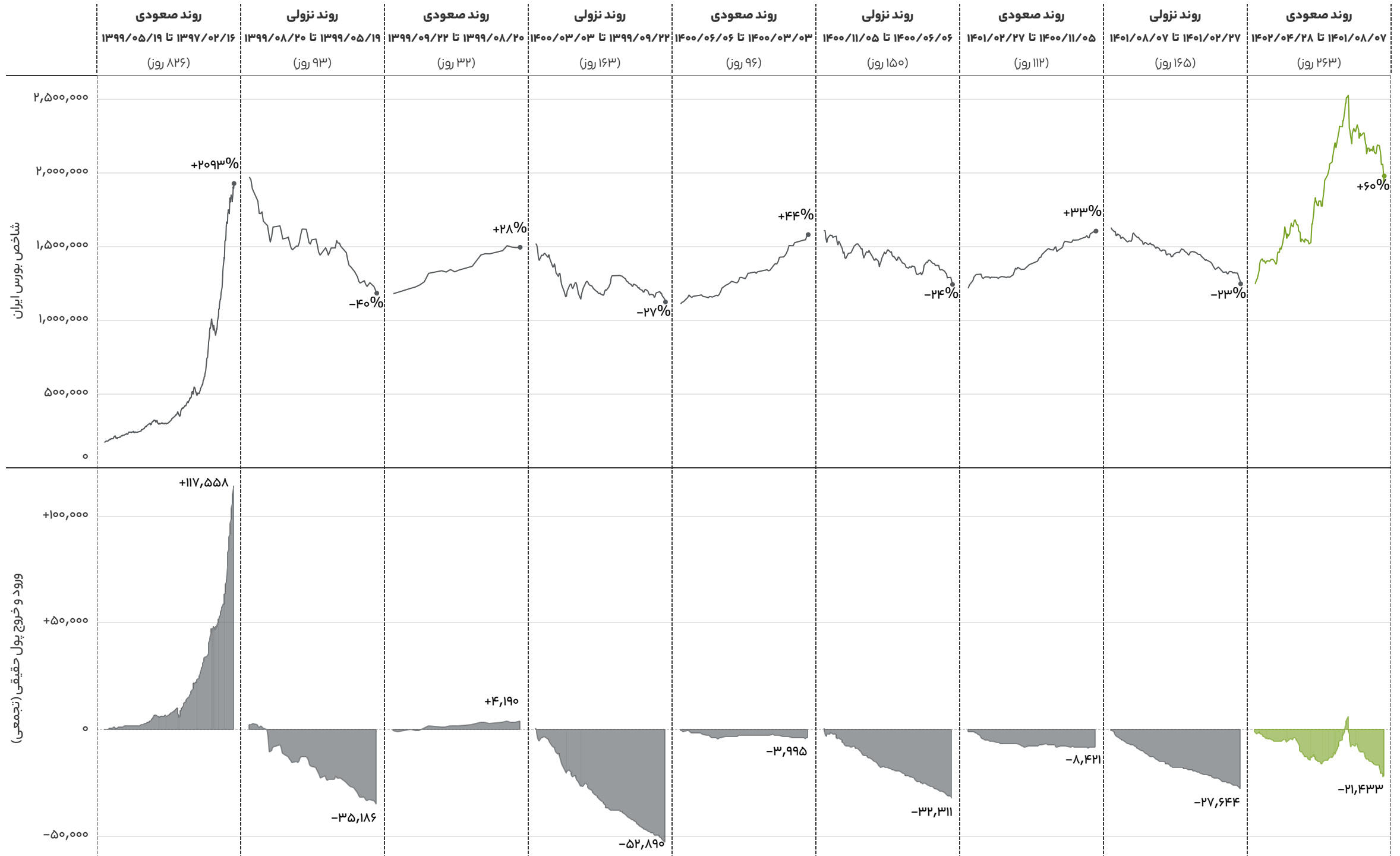
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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

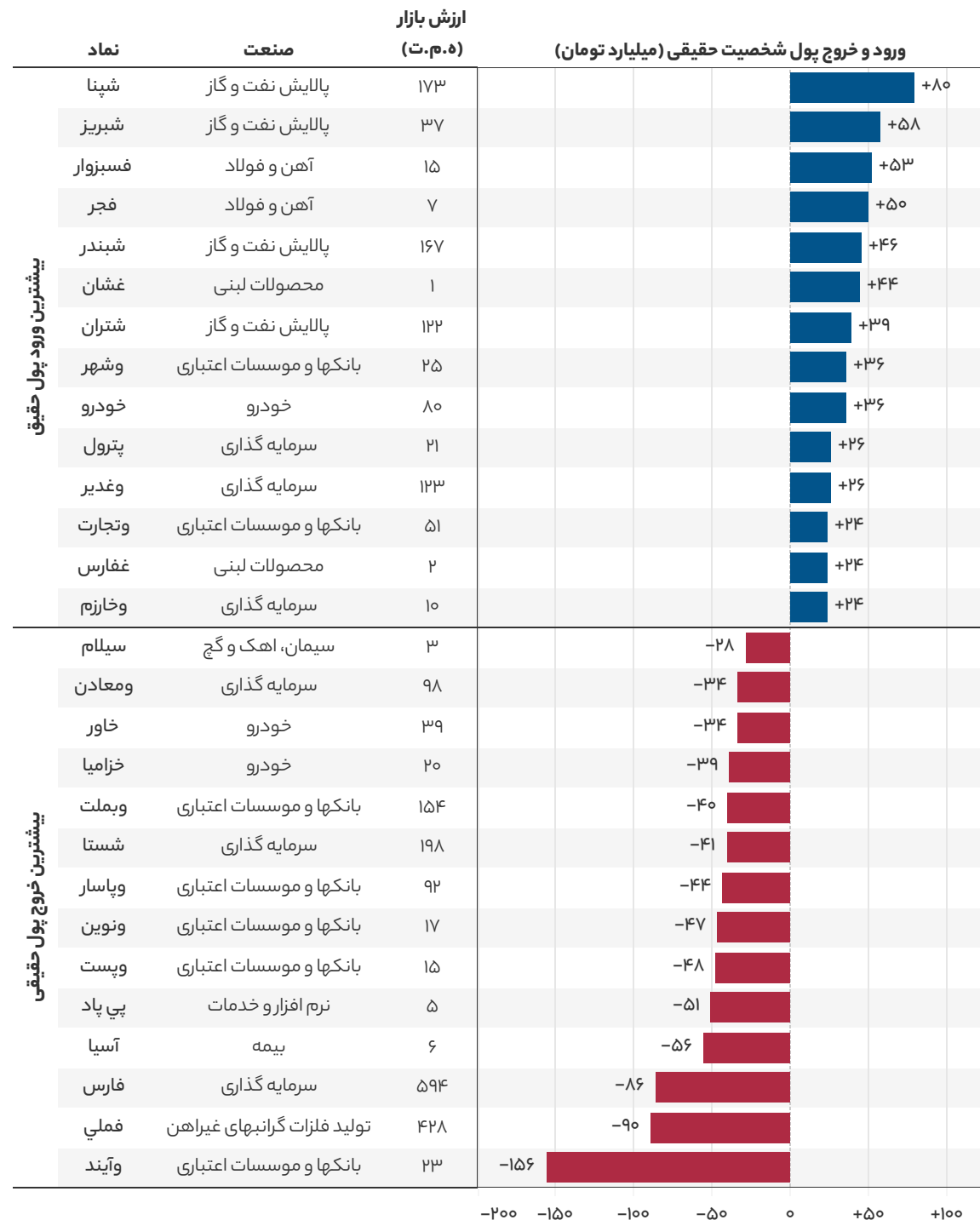




ورود و خروج پول

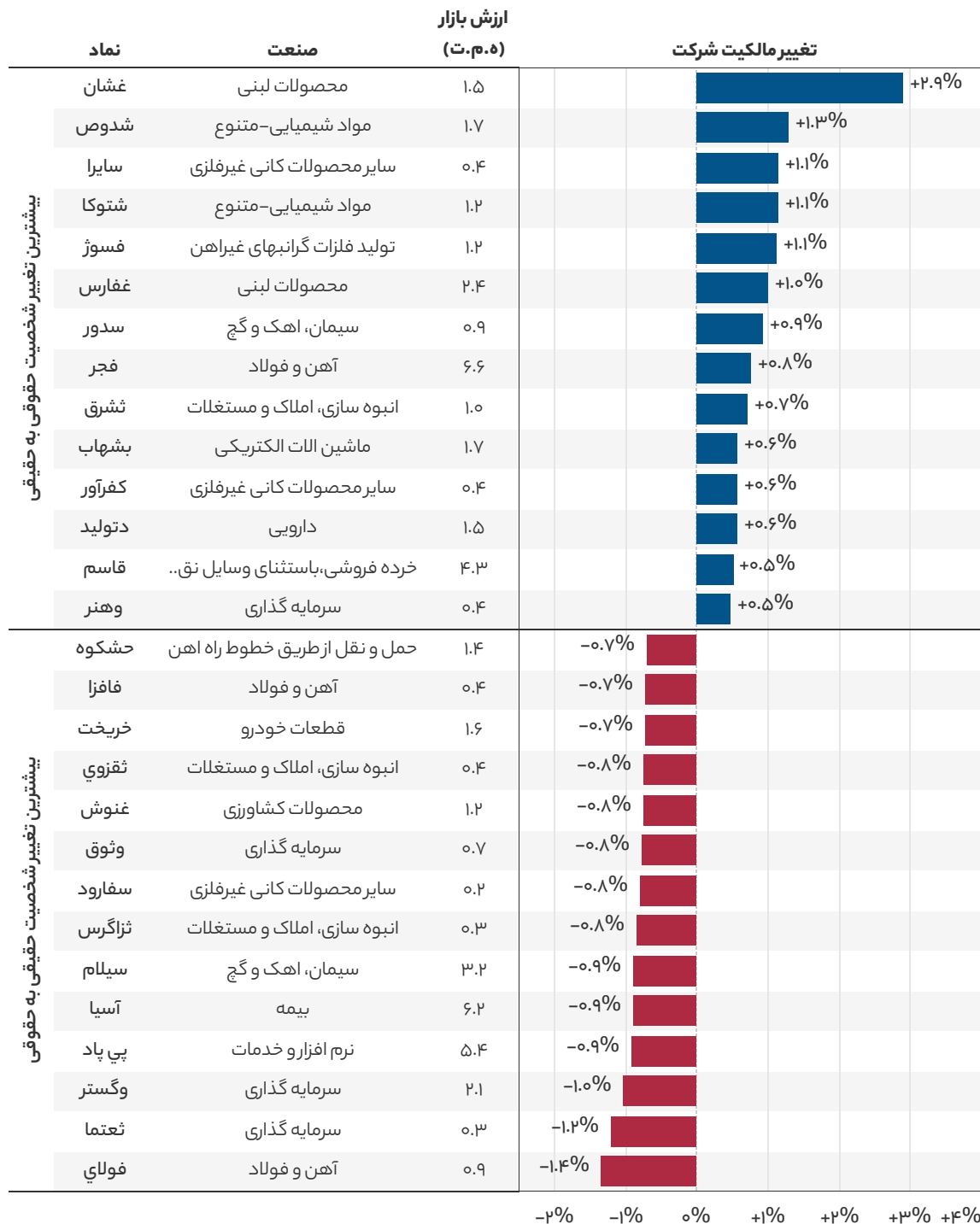
ورود و خروج پول حقيقي

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



تغيير مالکيت شرکت

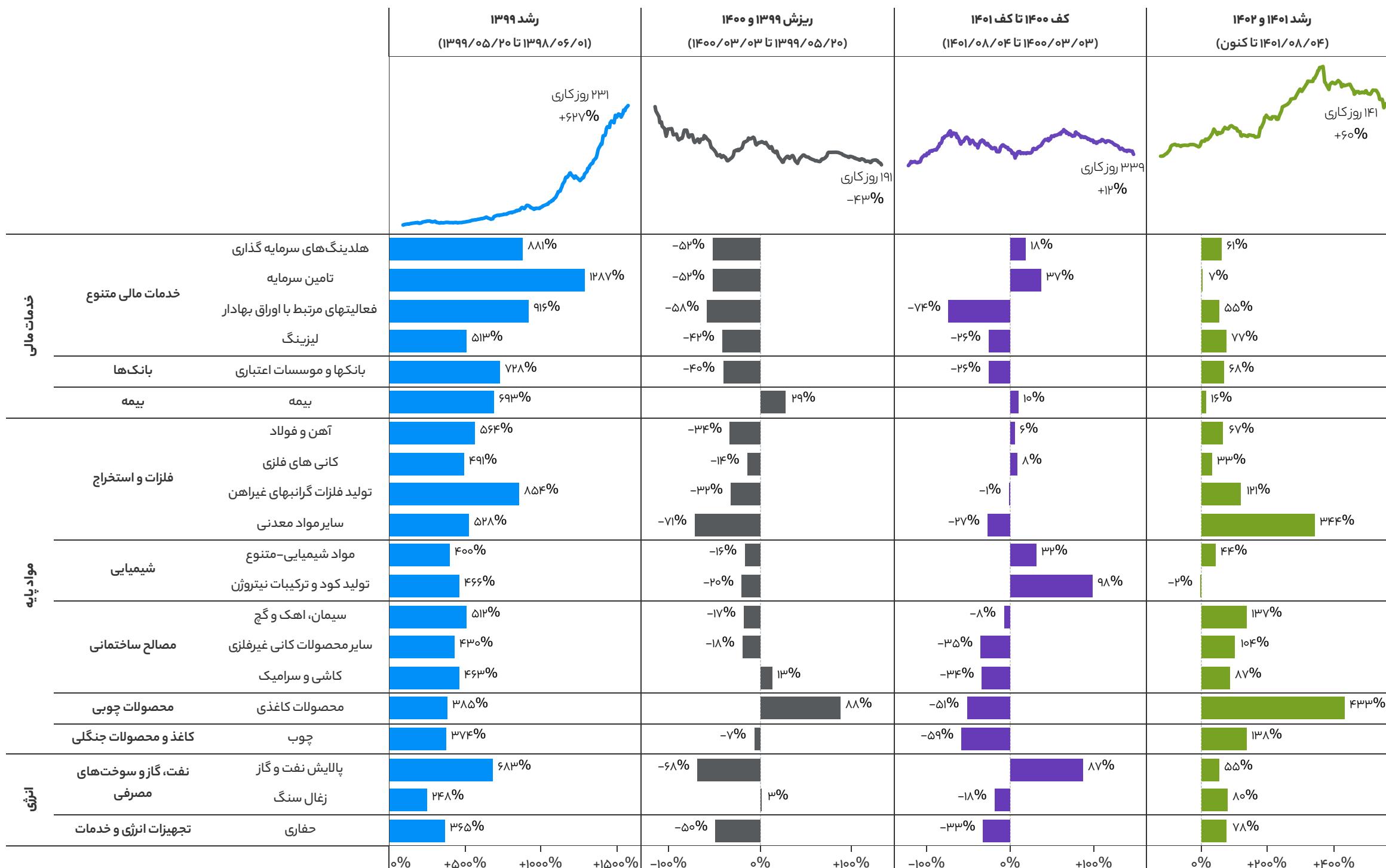
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقيقي، ارزش بازار بر حسب هزار ميليارد تومان





بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

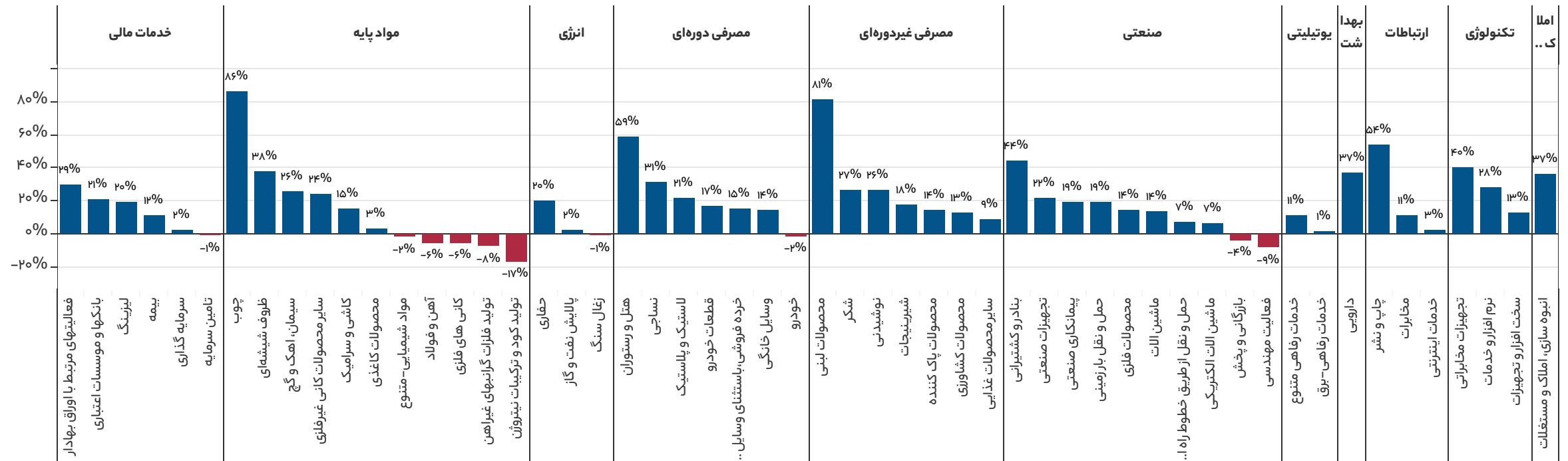
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۸، شاخص بورس ایران، بازدهی صنایع به تفکیک زیرگروه و سکتور، مرتب شده براساس ارزش بازار



بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

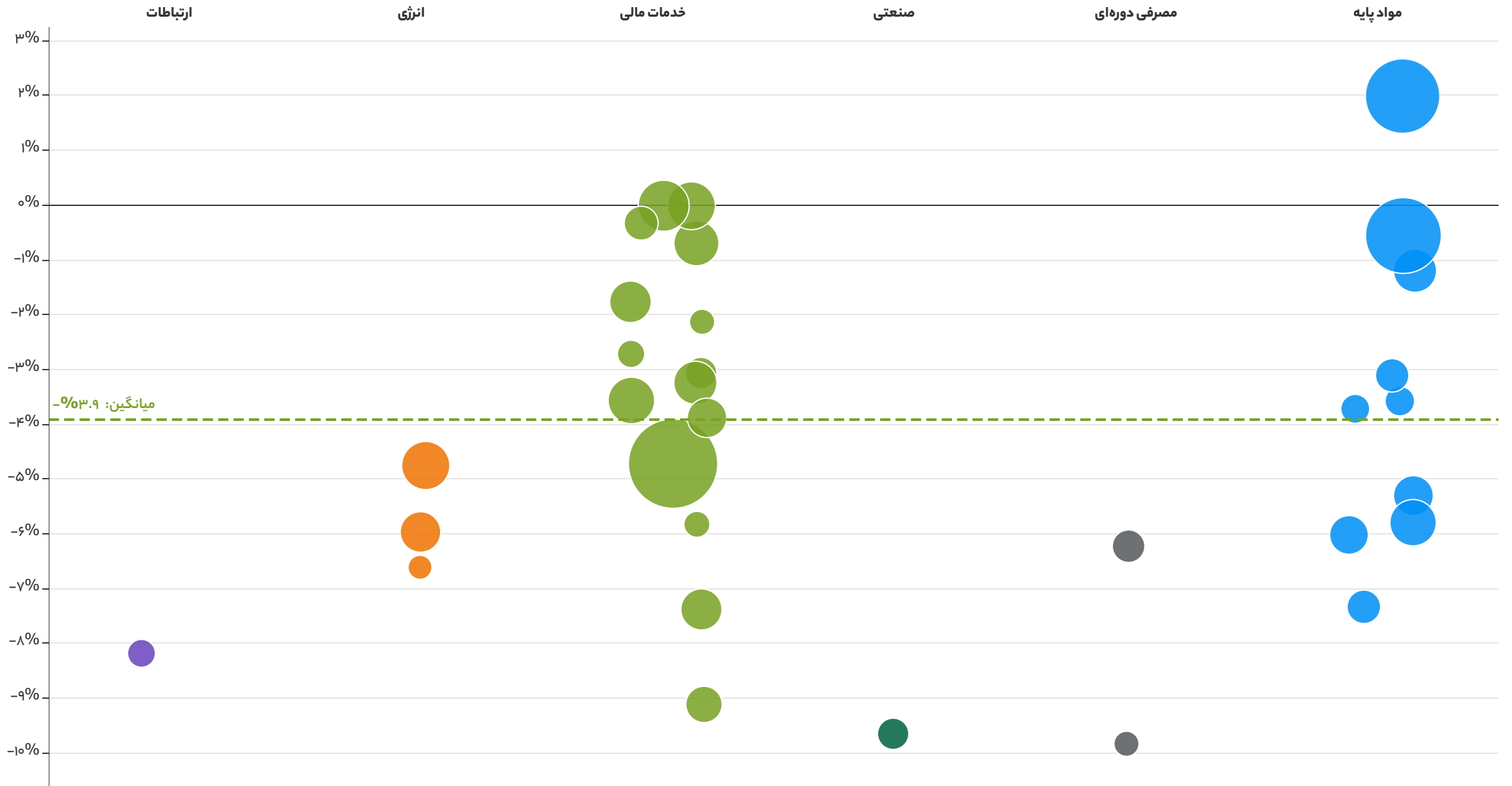
			رشد ۱۳۹۹		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲						
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۱۲۴۷%		-۷۰%		۱۳%		۵۹%						
		قطعات خودرو	۶۷۶%		-۳۲%		-۲۵%		۸۶%						
		لاستیک و پلاستیک	۶۳۱%		-۳۴%		-۴۲%		۱۰۸%						
	خرده فروشی	۱۱۲۹%		-۲۳%		۳%		۱۴۲%							
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۴۹۰%		-۴۶%		-۳۶%		۱۴۱%						
		نساجی	۳۸۰%		-۲۱%		-۳۵%		۱۳۶%						
	خدمات مصرف کننده	هتل و رستوران	۱۱۶۶%		-۶۷%		۱۸%		۵۰%						
مصرفی غیردوره‌ای	غذا و نوشیدنی	محصولات کشاورزی	۳۹۷%		-۳۵%		۹%		۳۹%						
		شیرینیجات	۵۹۵%		-۲۴%		-۶۳%		۷۷%						
		شکر	۴۳۵%		-۲۲%		-۴۴%		۷۸%						
		سایر محصولات غذایی	۶۹۹%		-۳۴%		-۳۹%		۵۶%						
		محصولات لبنی	۳۸۳%	۷%		-۵۴%		۱۶۹%							
		نوشیدنی	۵۳۹%	-۱۵%		-۳۱%		۹۰%							
	محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۳۰۶%		۴%		-۱۲%		۳۲%						
صنعتی	کالاهای سرمایه‌ای	فعالیت مهندسی	۵۲۱%		-۶۳%		-۷%		۵۳%						
		ماشین الات الکتریکی	۵۰۱%		-۴۵%		-۲۳%		۶۸%						
		ماشین الات	۴۲۲%		-۳۵%		-۳۱%		۱۰۸%						
		محصولات فلزی	۶۴۵%		-۵۴%		-۴۴%		۱۳۹%						
		تجهیزات صنعتی	۸۴۷%		-۳۰%		-۴۰%		۷۷%						
		پیمانکاری صنعتی	۵۲۵%	-۱۵%		-۶۸%		۱۰۴%							
	ترابری	حمل و نقل از طریق راه‌آهن	۳۲۷%		-۱۳%		-۴۱%		۷۵%						
		بنادر و کشتیرانی	۲۴۶%		-۲۲%		-۱۵%		۱۴۸%						
		حمل و نقل بار زمینی	۲۵۰%		-۱۸%		۳۳%		۳۰%						
	بهداشت	بهداشت	دارویی	۳۲۱%		-۳۲%		-۱۳%		۱۰۹%					
	یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۱۰%		-۳۵%		۱۳۱%		۴۹%					
			خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%		-۵۴%		-۳۳%		۵۲%					
ارتباطات	خدمات دور برد	مخابرات	۵۳۲%		-۷۱%		-۱۳%		۴۲%						
	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۲۳%		-۵۲%		-۵۲%		۱۷۷%						
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۲۵۲%		-۳۵%		۲%		۶۱%						
	سخت افزار و تجهیزات	سخت افزار و تجهیزات	۵۷۰%		-۶۵%		-۴۵%		۱۰۰%						
املاک و مستغلات	املاک و مستغلات	توسعه املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۶۱۹%		-۴۳%		-۴۵%		۱۵۹%					
			۰%	+۵۰۰%	+۱۰۰۰%	+۱۵۰۰%	-۱۰۰%	-۵۰%	۰%	-۱۰۰%	۰%	+۵۰%	+۱۰۰%	+۱۵۰%	+۲۰۰%

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۳۵ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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



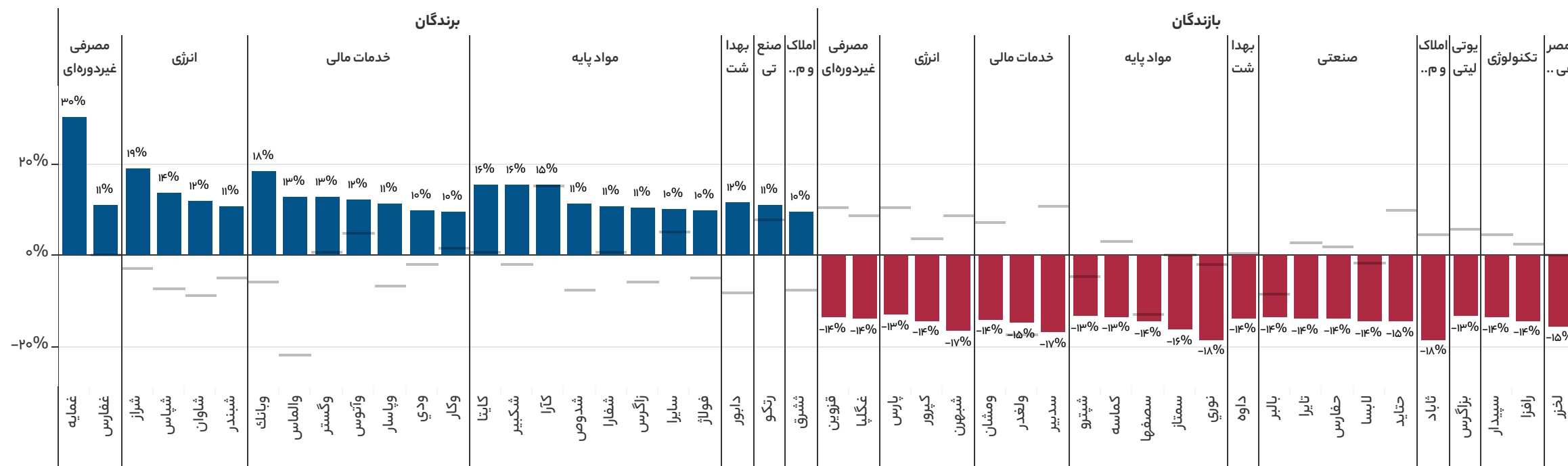
بازدهی تعدیل شده	فملی	شتتا	میدکو	حکشتی	فولاد	وبملت	ماون	پپاس	وسندوق	شپدیس	وامید	تاپیکو	فخوز	بوعلی	پارسان	فارس	شپنا	کگهر	کچاد	وتجارت	شتاران	آریا	خودرو	جم	وغدیر	اخابر	ومعادن	رهمنا	خسپا
بازدهی هفته گذشته	+۲.۰٪	۰٪	۰٪	-۰.۳۳٪	-۰.۵٪	-۰.۷٪	-۱.۲٪	-۱.۸٪	-۳.۱٪	-۳.۱٪	-۳.۲٪	-۳.۶٪	-۳.۶٪	-۳.۷٪	-۳.۹٪	-۴.۷٪	-۴.۷٪	-۵.۳٪	-۵.۸٪	-۵.۸٪	-۶.۰٪	-۶.۰٪	-۶.۲٪	-۷.۳٪	-۷.۴٪	-۸.۲٪	-۹.۱٪	-۹.۶٪	-۹.۸٪



برندگان و بازندگان هفته

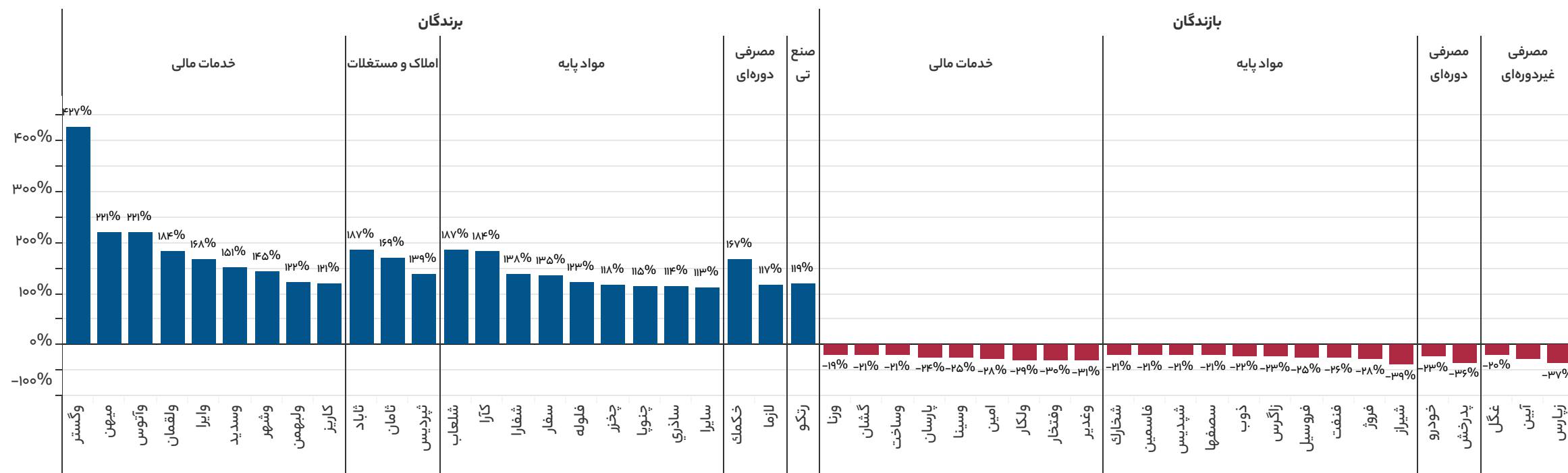
برندگان و بازندگان هفته

(پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



برندگان و بازندگان سال

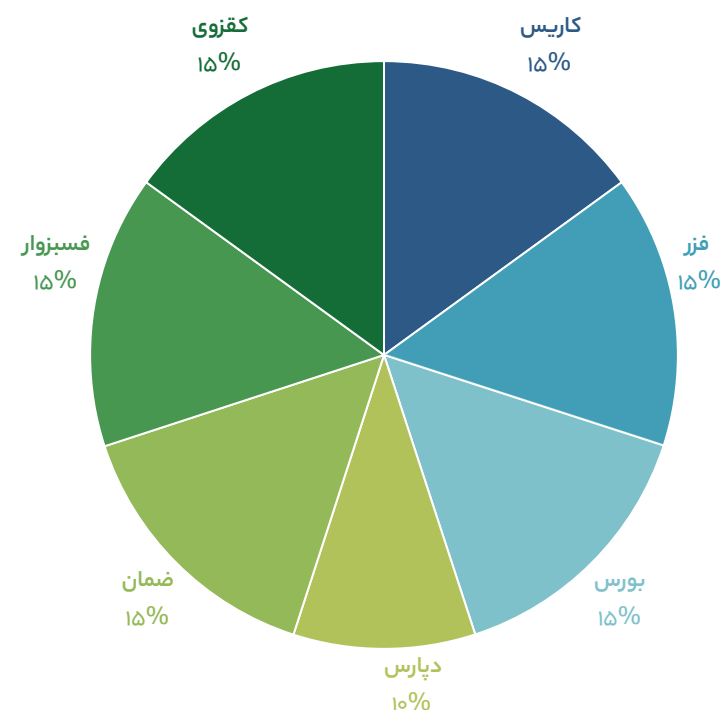
(پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





سبد پیشنهادی کاریما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۶۴,۱۱۰	رشد محسوس سود شرکت زیرمجموعه، ترکیب متنوع محصولات	۸۳,۳۴۳	دپارس	میان مدت
۱۵%	۱۳,۹۵۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۳۶,۷۰۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۴۷,۷۱۰	فسبزوار	
۱۵%	۲۵,۳۵۰	انحصار محصولات و نرخ فروش بالا	۳۲,۹۵۵	کقزوی	
۱۵%	۶,۰۲۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۷,۸۲۶	بورس	بلند مدت
۱۵%	۲۱,۶۲۶	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کریس	
۱۵%	۳۹,۳۵۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۵۱,۱۵۵	فزر	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود شاخص کل تا حوالی ۲,۰۴۰,۰۰۰ واحد رشد مقطعی را تجربه کند.

توضیحات تحلیل

بورس - 1D - شرکت شاخص

2



ساختار اصلاح شاخص هم وزن از ۱۷ اردیبهشت مشابه اصلاح بزرگتر از مرداد ۹۹ تا آبان ۱۴۰۱ است. انتظار می رود مشابه این ساختار رشد مقطعی تا حوالی ۷۶۰,۰۰۰ واحد داشته باشد.

توضیحات تحلیل



این نسبت در محدوده مقاومتی خود می باشد. با گذر از این محدوده انتظار می رود رشد تا حوالی ۰.۳۸ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود رشد مقطعی تا حوالی ۴۰.۸ واحد داشته باشد.

توضیحات تحلیل



محدوده قیمتی ۴۹,۰۰۰ تومان محدوده مقاومتی دلار است. در صورت تثبیت زیر خط روند مشخص شده، انتظار می‌رود اصلاح دلار تا حوالی ۴۷,۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



در حال حاضر مطابق انتظار به حوالی محدوده حمایتی ۲۷ میلیون تومان رسیده است. انتظار می‌رود رشد مقطعی تا حوالی ۲۹ میلیون تومان تجربه کند.

توضیحات تحلیل



مطابق انتظار بعد از رشد مقطعی تا حوالی ۱۹۸۰ دلار، وارد فاز اصلاحی شده است.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود نفت برنت با حفظ محدوده ۷۰ دلار، رشدی تا حوالی ۸۳ دلار تجربه کند. شرط رسیدن به این عدد، گذر از محدوده مقاومتی ۷۹ دلار است.

توضیحات تحلیل

ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

[@CharismaHolding](https://www.instagram.com/CharismaHolding)

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

[@CharismaTickReports](https://www.instagram.com/CharismaTickReports)

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، کوچه حکیم اعظم، پلاک ۱۷

