

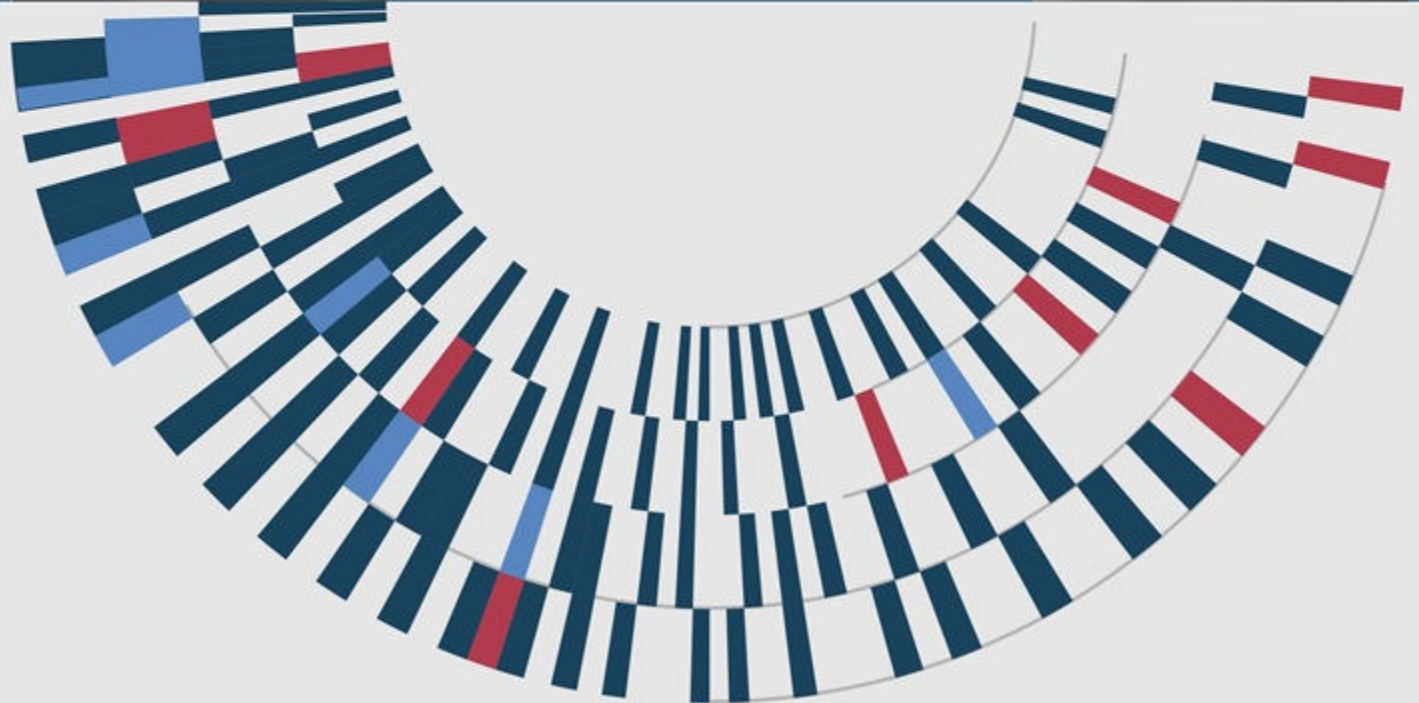
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۱۲ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۲۷

 CHARISMA





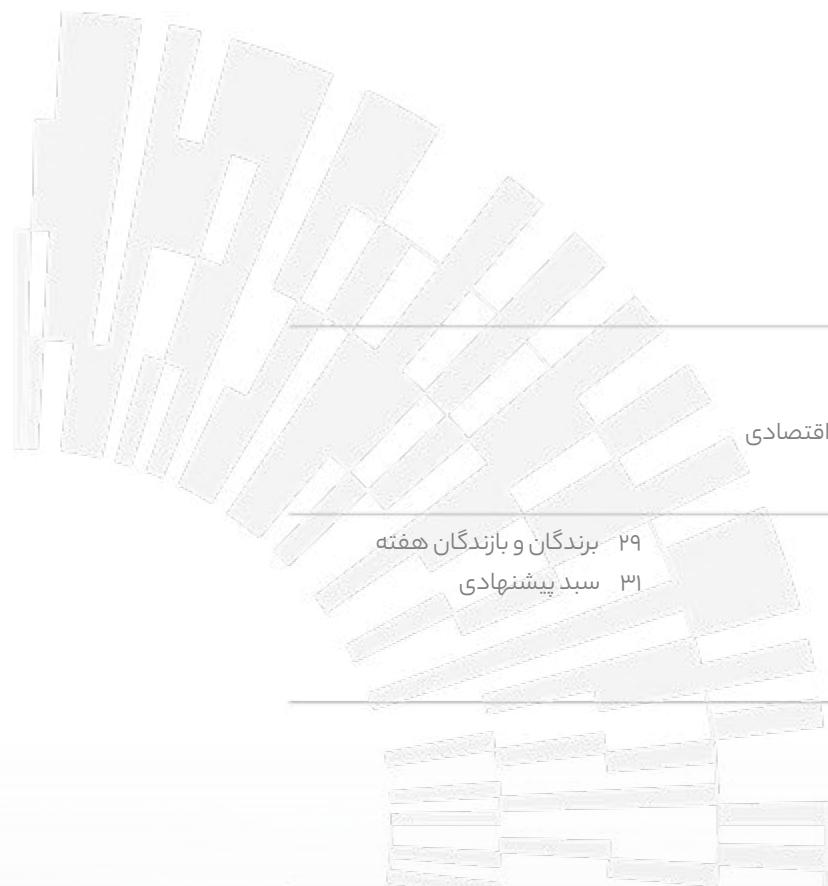
معرفی گزارش:

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 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 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.



۳۰	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 ارزندگی 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	۱,۸۸۹	۱.۳%-	فزر	-	۱,۶۴۳۲,۰۱۷	۹%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۲۷۴	۰.۲%-	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۴۴۹۹,۳۴۱	۲%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۴۴	۰.۶%-	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۵۰۴	۱۴%-
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۳۰۹	۳.۶%-	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳۳,۵۶۲	۳۵%-
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۵۰	۱.۰%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۸۵۲۲,۲۷۳	۹%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۴۹۰	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۶۹۷۴,۸۴۳	۶۰%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۶۴	۰.۶%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۰۹۶۳,۶۲۵	۶۲%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۵۱	۳.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کویر، فوکا، فنورد	۴۳۱۶۲۳	۱۳%-
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۸۵۵	۵.۵%-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کویر، فوکا، فنورد	۱۲,۳۸۴۲۲,۸۲۱	۴۹%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۵۸	۲.۲%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۹%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۹۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۱,۶۶۷۲۲,۰۸۰	۶۲%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۶۵	۱.۳%	ذوب، کویر	فولای	۵۵۸۷۵۵	۱۲%-
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۰۰۹	۰.۴%-	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۰۲۴۲۴,۷۴۷	۵۶%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۶۵	۰.۴%-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۰۷۸۰	۹%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۵	۰.۴%-	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	۲%



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	۳۹۸	۰.۵%-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس	۲۸۵77۳	۳۶%-
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۶۶	۰.۴%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵۳۲۳۵	۱۳%-
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۶۵	۶.۲%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۵۱۶۵۵۵	۷%-
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۹	۲.۲%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱۶۵۹۵	۹%-
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۹	۱.۷%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶۱۶۵۵۸	۵%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۷۱	۱.۳%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۴۵۱۶۵۱۵	۹%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۶۱	۱.۹%-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۳۷۵۳۲	۶%-
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۳۵	۱.۱%-	شگویا	-	۹۳۵۱۶۵۹۹	
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۲۵	۵.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۴	۸%-
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۴۱	۱.۵%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۵۵۹۵۱	۷%-
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۵۴۱	۹.۶%-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۲۱۶۱۵۲	۲%-
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۲۵	-	شصفها، نوری	-	۹۷۹۱۶۱۸۵	۹%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۵۲۵	۵.۵%-	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱۶۱۵۹	۱%-
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۲۲	۵.۱%-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۹۹۸	۲%-
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۸,۵۹۵	۱.۸%	بوعلی	-	۶,۱۲۹۸,۵۹۵	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۸۳۵	۳.۸%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۵۱۶,۲۳۹	۱۵%-
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۸۵	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۶۹۹۹۱۴	۴%-
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۱۵	-	شبصیر	-	۱,۲۴۵۱,۴۷۹	۹%-



انرژی و سایر محصولات

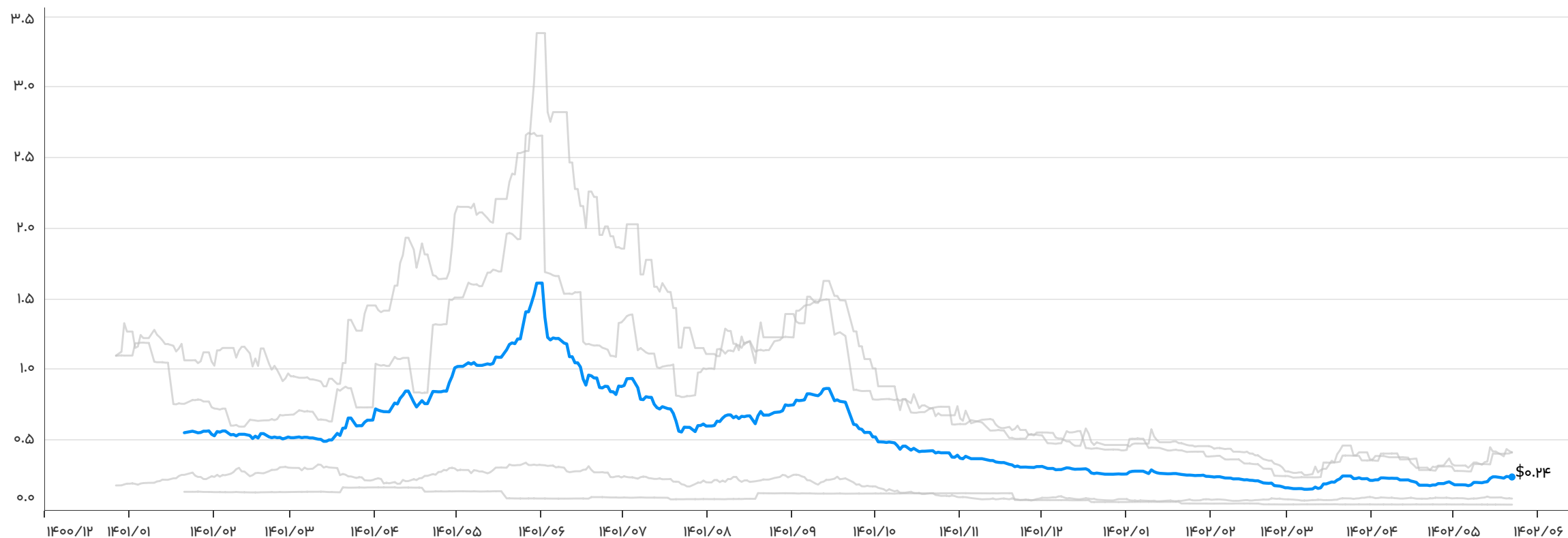
		رند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی	نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/ بشکه	۸۵	۲۰.۱% -	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۲	۱۰۱			
	نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/ بشکه	۸۱	۲۰.۱% -	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۶	۹۳			
	نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/ بشکه	۱۳۳	۱.۶% +	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۹۷	۱۷۰			
	گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/ بشکه	۱۲۴	۱.۱% +	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۸۹	۱۷۰			
	لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/ تن	۱۵,۷۵۱	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۵,۷۵۱	۱۵,۳۵۳					
	روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/ تن	۲۶,۷۴۵	۰.۹% +	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۴۱,۳۶۵	۲۱,۷۹۵					
محصولات کشاورزی	قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/ تن	۱۶,۱۵۳	-	شپاس	-	۱۷,۱۴۰	۸,۸۵۰					
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/ تن	۱۹۴	۱.۱% +	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۲۷۲	۱۹۲					
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/ تن	۸۳۲	۱.۱% +	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۹۶۸	۷۲۸					
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/ تن	۱,۶۴۲	۴.۳% -	-	-	۱,۷۱۶	۱,۲۰۵					
ارز و ارز دیجیتال	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/ تن	۲۲۶	۲.۰% -	-	-	۳۳۹	۲۲۶					
	یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۹	۰.۷% -	-	-	۱.۱۲	۰.۹۷					
	پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	۰.۲% +	-	-	۱.۳۱	۱.۰۹					
	بیتکوین	بایننس	دلار	۲۶,۱۶۸	۱۱.۰% -	-	-	۳۵,۸۶۹	۱۶,۵۴۹					



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	۰.۰۹	-۷.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۳۴	-۷۲%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-۰.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۴۸%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۲	-۱.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۳.۳۹	-۸۴%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۲	۲.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۲.۶۸	-۷۸%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۴	-۰.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۱.۶۲	-۸۰%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



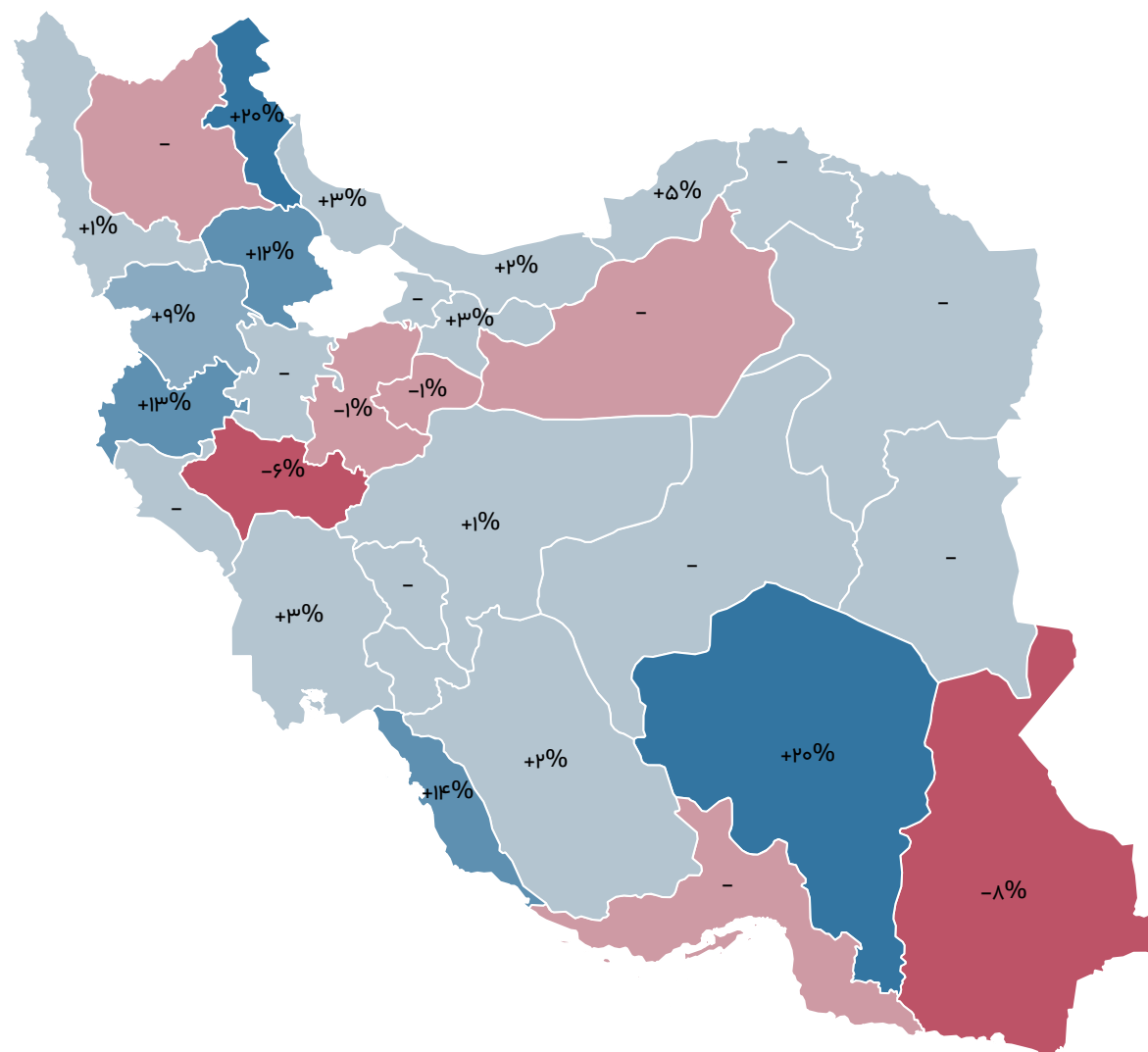
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۹۱۸	۹۴۹	+۳%
	اصفهان	تومان / کیلو	۹۱۹	۹۲۸	+۱%
	مرکزی	تومان / کیلو	۹۳۳	۹۲۱	-۱%
	البرز	تومان / کیلو	۹۱۴	۹۱۴	+۰%
	قم	تومان / کیلو	۹۲۸	۹۱۵	-۱%
	سمنان	تومان / کیلو	۸۱۲	۸۱۲	+۰%
جنوب	یزد	تومان / کیلو	۷۰۵	۷۰۵	+۰%
	فارس	تومان / کیلو	۹۵۱	۹۶۵	+۲%
	هرمزگان	تومان / کیلو	۷۶۸	۷۶۵	+۰%
شمال	بوشهر	تومان / کیلو	۹۴۶	۱,۰۷۴	+۱۴%
	مازندران	تومان / کیلو	۸۸۵	۹۰۳	+۲%
	گیلان	تومان / کیلو	۶۶۵	۶۸۸	+۳%
غرب	گلستان	تومان / کیلو	۶۸۱	۷۱۲	+۵%
	همدان	تومان / کیلو	۸۳۸	۸۴۱	+۰%
	خوزستان	تومان / کیلو	۹۵۳	۹۸۰	+۳%
	ایلام	تومان / کیلو	۷۰۶	۷۰۶	+۰%
	چهارمحال و بختیاری	تومان / کیلو	۸۸۰	۸۸۱	+۰%
	کرمانشاه	تومان / کیلو	۸۰۴	۹۰۶	+۱۳%
	کردستان	تومان / کیلو	۸۹۹	۹۸۵	+۹%
	لرستان	تومان / کیلو	۸۱۶	۷۶۵	-۶%
شمال غرب	کهگیلویه و بویراحمد	تومان / کیلو	۷۹۲		
	آذربایجان غربی	تومان / کیلو	۷۷۱	۷۷۷	+۱%
	اردبیل	تومان / کیلو	۱,۰۴۲	۱,۲۴۷	+۲۰%
شمال شرق	زنجان	تومان / کیلو	۸۹۵	۱,۰۰۱	+۱۲%
	آذربایجان شرقی	تومان / کیلو	۸۷۴	۸۷۴	+۰%
	خراسان رضوی	تومان / کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
جنوب شرق	خراسان جنوبی	تومان / کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان شمالی	تومان / کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	کرمان	تومان / کیلو	۹۵۵	۱,۱۴۸	+۲۰%
	سیستان و بلوچستان	تومان / کیلو	۸۶۹	۷۹۷	-۸%

تغییرات قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گذشته

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

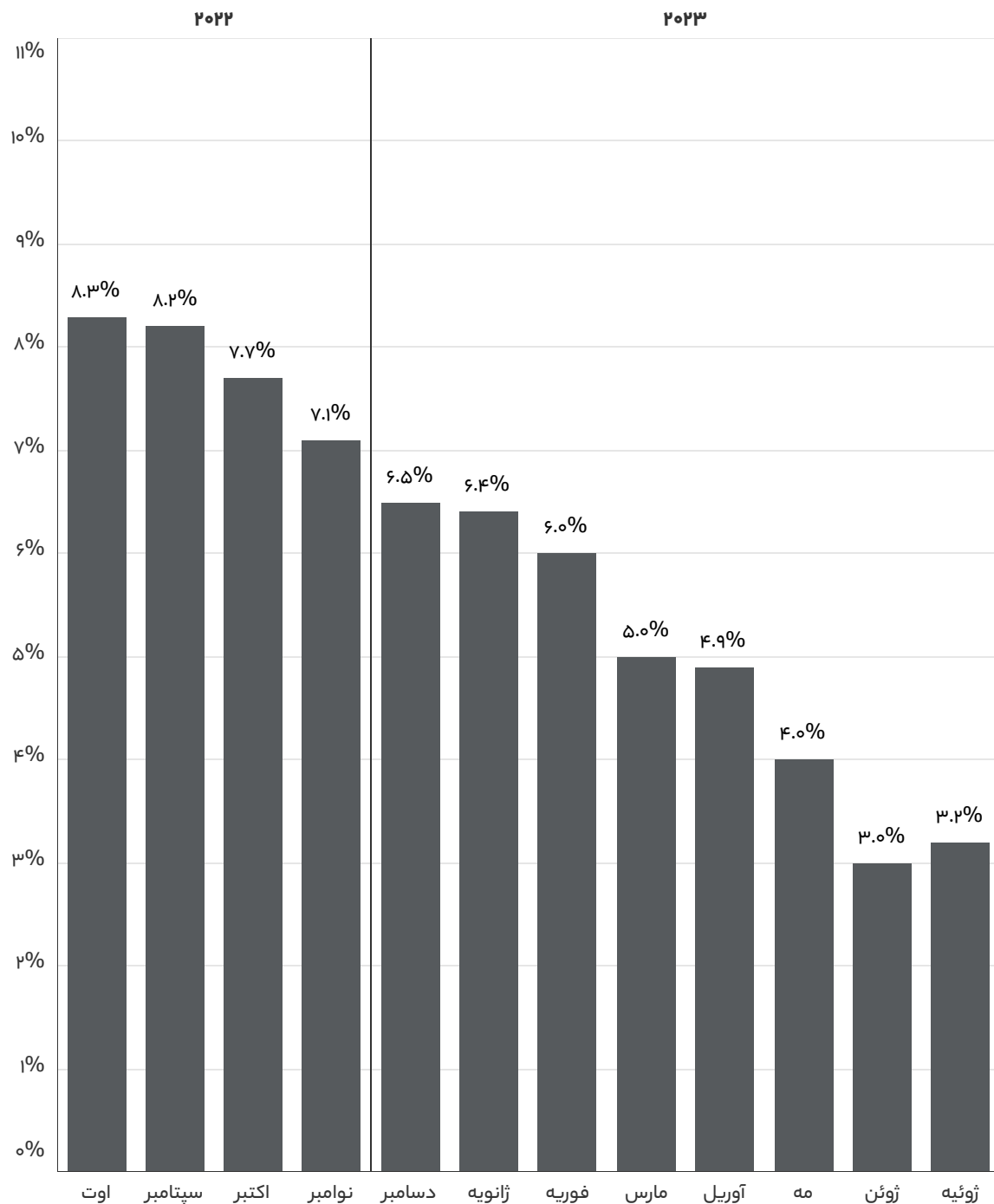


* قیمت سیمان بر اساس سیمان ۲ فله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▼
انتشار اطلاعات اقتصادی آمریکا مبنی بر افزایش قیمت تولید کننده در این کشور در ژوئیه باعث بالا رفتن ارزش دلار و اوراق قرضه خزانه داری آمریکا شد و همچنین باعث کاهش قیمت طلا شده است. طلا در آستانه سومین هفته پیاپی کاهش قیمت قرار دارد. شاخص قیمت تولید کننده در آمریکا کمی بالاتر از حد انتظار بوده که ارزش اوراق قرضه خزانه داری این کشور و همچنین شاخص دلار را کمی بالا برده است. قیمت طلا در روز سه شنبه تا ۱۸۹۵ دلار پایین آمد، یعنی پایین ترین رقم از پایان ماه ژوئیه و همچنین ارزش اوراق قرضه خزانه داری آمریکا به بالاترین رقم طی ۱۰ ماه گذشته رسیده است.
- ▼
تاثیر اطلاعات اقتصادی ضعیف چین به عنوان بزرگترین وارد کننده نفت دنیا، از تاثیر کاهش عرضه نفت و پایین آمدن ذخایر نفت خام آمریکا، بیشتر بوده است و در نتیجه شاهد کاهش قیمت نفت هستیم. خرده فروشی، تولید صنعتی و آمار سرمایه گذاری در چین بسیار فراتر از حد انتظار کاهش یافته و نگرانی در مورد رکود طولانی مدت و عمیق تر اقتصاد را بیشتر کرده است. دورنمای قیمت نفت در سه ماهه پایانی سال جاری میلادی به شرایط اقتصاد کلان در چین بستگی دارد. اما به نظر می رسد عربستان تلاش می کند این دورنما را با کاهش تولید تحت تاثیر قرار دهد. کاهش تولید عربستان و روسیه به عنوان بزرگترین تولید کنندگان ائتلاف اوپک پلاس قیمت نفت را طی ۷ هفته گذشته بالا برده بوده است.
- ▲
براساس داده های بورس بین قاره ای (ICE)، قیمت گاز طبیعی (LNG) در اتحادیه اروپا به بالاترین رقم خود از اواسط ماه ژوئیه رسیده است. قیمت آتی گاز برای تحویل در سپتامبر در هاب گازی هلند (TTF) در روز ۱۸ مرداد ماه به بالاترین حد روزانه خود رسید به طوری که در یک روز شاهد افزایش قیمت ۴۰ درصدی بودیم. این افزایش قیمت به دلیل اعتصاب احتمالی در تاسیسات گاز طبیعی مایع در استرالیا (یکی از سه صادرکننده بزرگ ال ان جی جهان در کنار قطر و ایالات متحده) است. طبق گزارش ها، این اعتصاب می تواند از اوایل هفته آینده میلادی در پنج تاسیسات ال ان جی آغاز شود. تحلیلگران هشدار می دهند اگرچه تاسیسات ذخیره سازی گاز اروپا در حال حاضر حدود ۸۸ درصد پر است اما عدم صادرات ال ان جی از استرالیا باعث کاهش کل عرضه این محصول در جهان و افزایش رقابت برای سوخت می شود و خریداران آسیایی و اروپایی را برای جذب محموله های ال ان جی در مقابل یکدیگر قرار می دهد.
- ▼
تمرکز بانک مرکزی آمریکا بر مهار تورم در بحبوحه اطلاعات اقتصادی قوی تر از حد انتظار این کشور مانع افزایش بیشتر قیمت نفت می شود. وزارت کار آمریکا در روز پنجشنبه اعلام کرد تقاضا برای بیمه بیکاری طی یک هفته گذشته کاهش یافته است. بهبود بازار کار آمریکا، فدرال رزرو را تشویق به ادامه سیاست های سختگیرانه خود می کند. سایر اطلاعات اقتصادی آمریکا مانند میزان خرده فروشی این کشور هم حاکی از ادامه سیاست افزایش نرخ بهره فدرال رزرو برای مدت طولانی تر است. سرمایه گذاران نگرانند بالا ماندن نرخ بهره مانع رشد اقتصاد شود و تقاضا برای کالاها مخصوصاً برای نفت را پایین بیاورد. علاوه بر آن، اطلاعات اخیر اقتصادی چین نشان می دهد از شتاب رشد دومین اقتصاد بزرگ دنیا از سه ماهه دوم سال جاری میلادی کاسته شده است. ذخایر نفت خام آمریکا حدود ۶ میلیون بشکه طی یک هفته گذشته به خاطر صادرات بالا و افزایش فعالیت های پالایشگاهی کاهش یافته است.
- ▲
قیمت بنزین در آمریکا افزایش یافته و به بالاترین حد خود در سال میلادی جاری رسیده است. انجمن اتومبیل آمریکا اعلام کرد که افزایش تقاضا و اختلالات پیش آمده در فعالیت پالایشگاه های نفت، میانگین قیمت خرده فروشی هر گالن بنزین در آمریکا را روز سه شنبه، به ۳.۸ دلار رساند که ۷ درصد بالاتر از یک ماه پیش است. در کالیفرنیا و واشنگتن، قیمت ها به بالای ۵ دلار در هر گالن رسیده اند. ذخایر بنزین هفتگی آمریکا پایین میانگین پنج ساله برای این وقت از سال مانده اند که در صورت مختل شدن تولید پالایشگاهی، زمینه را برای افزایش قیمت ها فراهم می کند.
- ✓
ترکمنستان به روسیه نسبت به تلاش برای گسترش نفوذ خود بر زنجیره تامین گاز طبیعی آسیای مرکزی-چین هشدار داد. این هشدار پس از آن داده شد که مسکو اعلام کرد: کشورهای بیشتری می توانند به اتحادیه گازی، با قزاقستان و ازبکستان ملحق شوند. ترکمنستان، ازبکستان و قزاقستان، همگی از طریق خط لوله ای که از سه کشور عبور می کند، به چین گاز ارسال می کنند. ترکمنستان بزرگترین سهم را در صادرات گاز دارد و دو کشور دیگر با رشد قوی تقاضای داخلی برای گاز روبرو هستند. تنها اقدام عملی که این اتحادیه، تاکنون اعلام کرده است، برنامه معکوس کردن یک خط لوله دیگر بوده که ترکمنستان، ازبکستان و قزاقستان را به روسیه متصل می کند تا شرکت گازپروم روسیه بتواند گاز را به ازبکستان ارسال کند که با کمبود انرژی روبرو شده است.
- ✓
وزارت خارجه روسیه هفته جاری اعلام کرد که اتحادیه گازی ذکر شده می تواند گسترش پیدا کند زیرا کشورهای دیگر هم برای پیوستن به آن، ابراز علاقه کرده اند اما از هیچ کشوری نام نبرد. وزارت خارجه ترکمنستان روز شنبه به این اظهارات واکنش نشان داد و اعلام کرد که هر چند اظهارات روسیه، مبهم بوده است. در بیانیه این وزارتخانه آمده است: طرف ترکمنی، چنین رویکردی را غیرقابل درک و غیرقابل قبول می داند و خارج از کشور، آن را مغایر با قوانین بین المللی و رویه ثابت شده در بخش گاز می داند. براساس گزارش رویترز، روسیه پیش از ساخت خط لوله چینی، خریدار اصلی گاز ترکمنستان بود اما اکنون سهمش از صادرات ترکمنستان، اندک است و معکوس کردن خط لوله بین روسیه و آسیای مرکزی، به چنین صادراتی پایان می دهد.
- ▼
آخرین داده های ائتلاف سازمان های بین المللی بخش انرژی موسوم به "ابتکار مشترک داده های سازمانی" (Joint Organisations Data Initiative) نشان می دهد که صادرات نفت خام عربستان سعودی به پایین ترین سطح خود در تقریباً دو سال گذشته رسیده است. عرضه نفت خام از بزرگترین صادرکننده نفت جهان برای اولین بار در سال جاری میلادی به زیر ۷ میلیون بشکه در روز سقوط کرد چرا که این کشور در ماه مه به همراه چندین تولیدکننده بزرگ دیگر از گروه اوپک پلاس تصمیم به کاهش تولید در مجموع ۱.۶ میلیون بشکه در روز گرفته اند. براساس گزارش "ابتکار مشترک داده های سازمانی"، ذخایر محصولات نفتی عربستان سعودی در ماه ژوئن ۱.۶۴ میلیون بشکه کاهش یافت، در حالی که ذخایر نفت خام این کشور ۱.۴۵ میلیون بشکه افزایش یافت. آژانس بین المللی انرژی (IEA) هفته گذشته اعلام کرد که عرضه نفت از گروه اوپک پلاس با ۱.۲ میلیون بشکه در روز کاهش به ۵۰.۷ میلیون بشکه در روز در ماه ژوئیه رسید و به پایین ترین سطح در نزدیک به دو سال گذشته رسیده است.
- ✓
امارات در ماه گذشته اعلام کرد دنباله روی عربستان در کاهش تولید داوطلبانه نخواهد بود و پایین آمدن تولید عربستان برای متعادل کردن بازارها کافیهست. امارات سومین تولید کننده بزرگ اوپک به حفظ سطح فعلی تولید خود قانع نیست بلکه از اوپک درخواست کرده است تا بتواند تولید خود را ۲۰۰ هزار بشکه در روز در سال آینده میلادی افزایش دهد و به ۳.۲ میلیون بشکه برساند. قیمت نفت از زمان آغاز کاهش تولید داوطلبانه یک میلیون بشکه ای عربستان حدود ۱۵ درصد افزایش یافته است. در واقع تمام بار کاهش تولید بر دوش عربستان است، اما بیشترین سود را امارات می برد. امارات قصد دارد ظرفیت تولید نفت خام خود را تا ۲۰۲۷ به ۵ میلیون بشکه در روز برساند، یعنی بالاتر از سهمیه ۳ میلیون بشکه ای اوپک. اگر عربستان تصمیم بگیرد باز هم تولید خود را از سطح فعلی پایین تر بیاورد امارات شاهد افزایش قابل توجه درآمدهای نفتی خود خواهد بود.
- ✓
داوود منظور رئیس سازمان برنامه در جمع نمایندگان در صحن علنی مجلس با اشاره به منابع بودجه ای به موضوع واگذاری دارایی های سرمایه ای که بخش عمده آن نفتی است پرداخت و توضیح داد: از مجموع درآمدهای نفتی پیش بینی شده برای سال ۱۴۰۲، باید ۲۴۸ هزار میلیارد تومان در ۴ ماهه تحقق می یافت اما تنها ۱۰۵ همت آن محقق شده است. بنابراین دولت توانسته است تنها ۴۲ درصد از منابعی که قرار بود از محل فروش نفت عایدی داشته باشد را وصول کند. به نظر می رسد تبخ تحریم های نفتی همچنان برنده است و این موضوعی است که داوود منظور نیز در اظهارات هفته گذشته خود به آن اشاره کرد. آطور که معاون رئیس جمهور گفت، براساس قانون بودجه ۱۴۰۲، دولت موظف به صادرات روزانه ۱.۴ میلیون بشکه نفت است اما شرایط تحریمی مانع از وصول منابع حاصل از این محل شده است. براین اساس، به نظر می رسد دولتی ها تحریم را اصلی ترین عامل عدم توفیق در فروش و صادرات نفت می دانند.

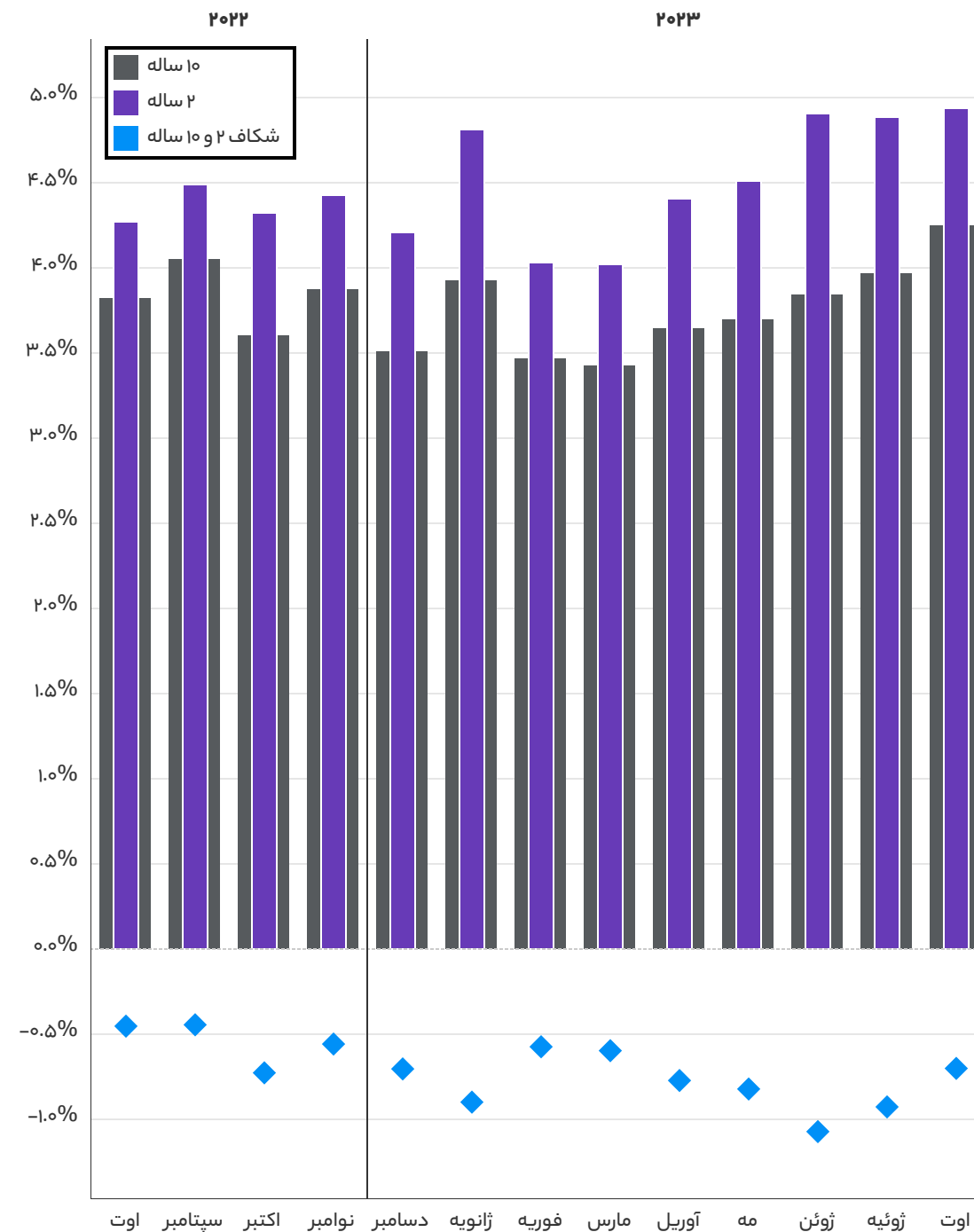
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



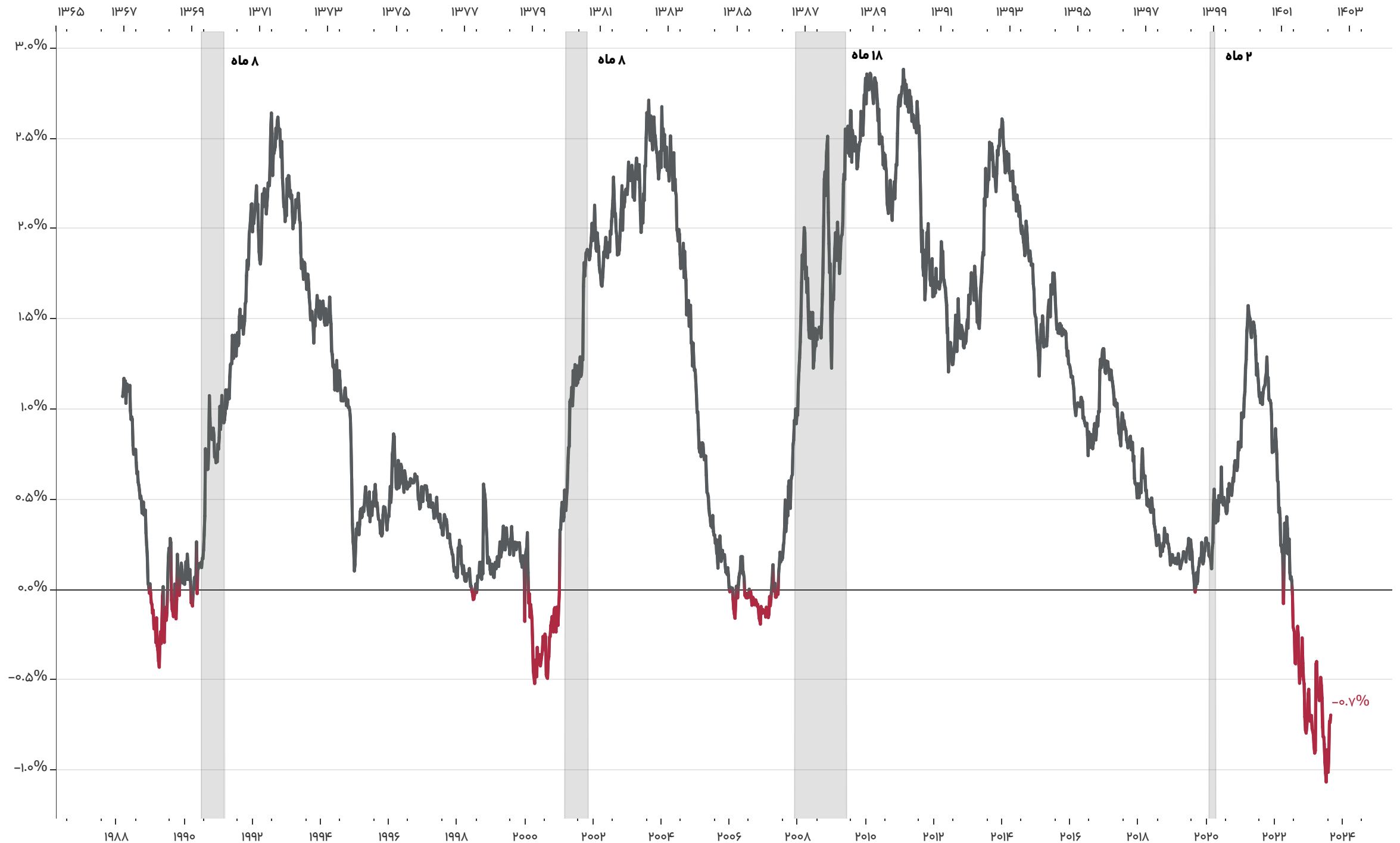
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

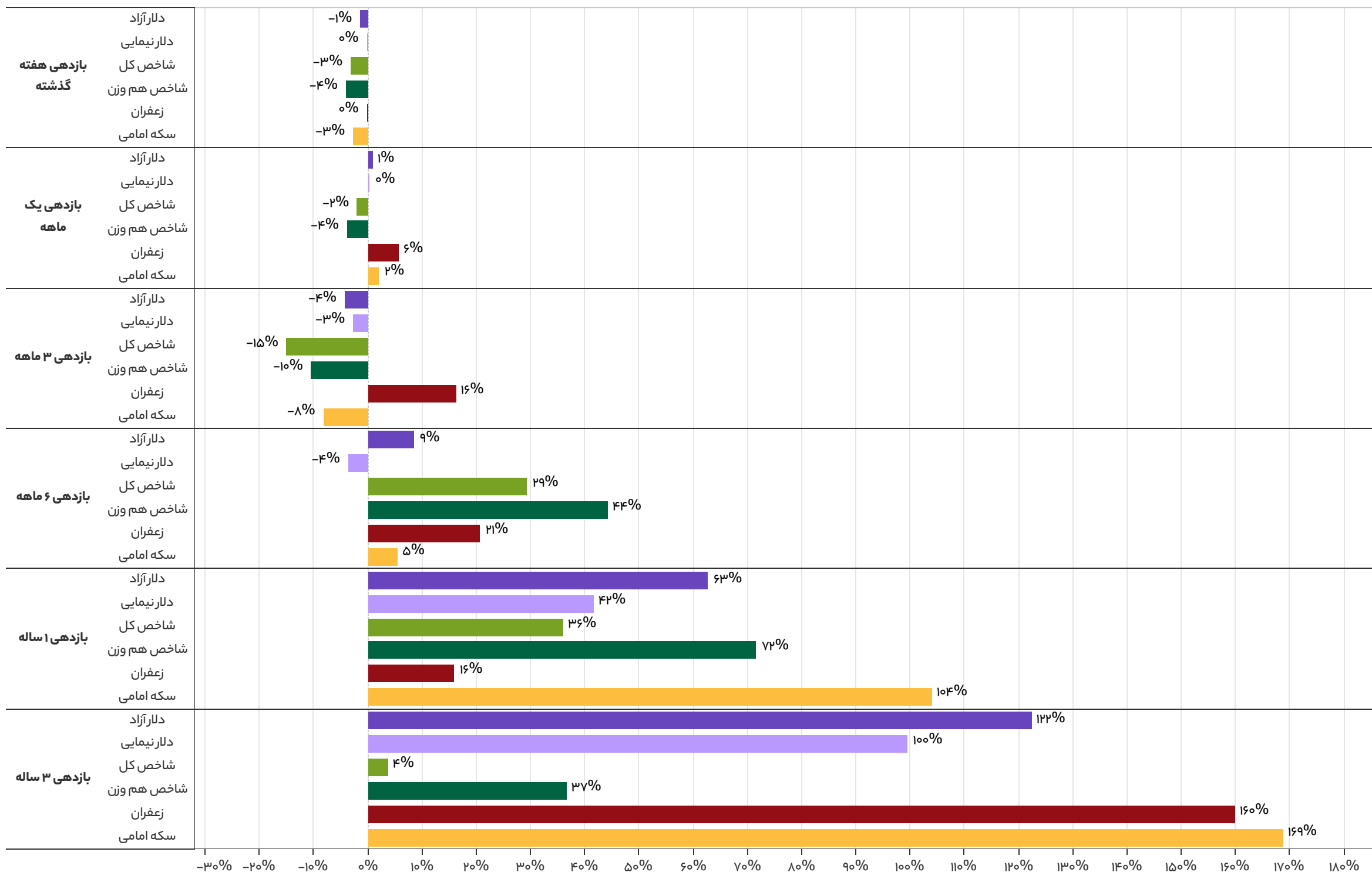
EQUITY MARKET

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 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 ۱۱۱.۰%
سکه امامی ▲ ۱۰.۰%	زعفران ▲ ۹.۶%	مسکن ▲ ۲.۵%	دلار آزاد ▲ ۸.۰%	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 ▲ ۳۰.۰%	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 ▲ ۱۲.۰%	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 ▲ ۶۸.۰%
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 ▲ ۰.۰%	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

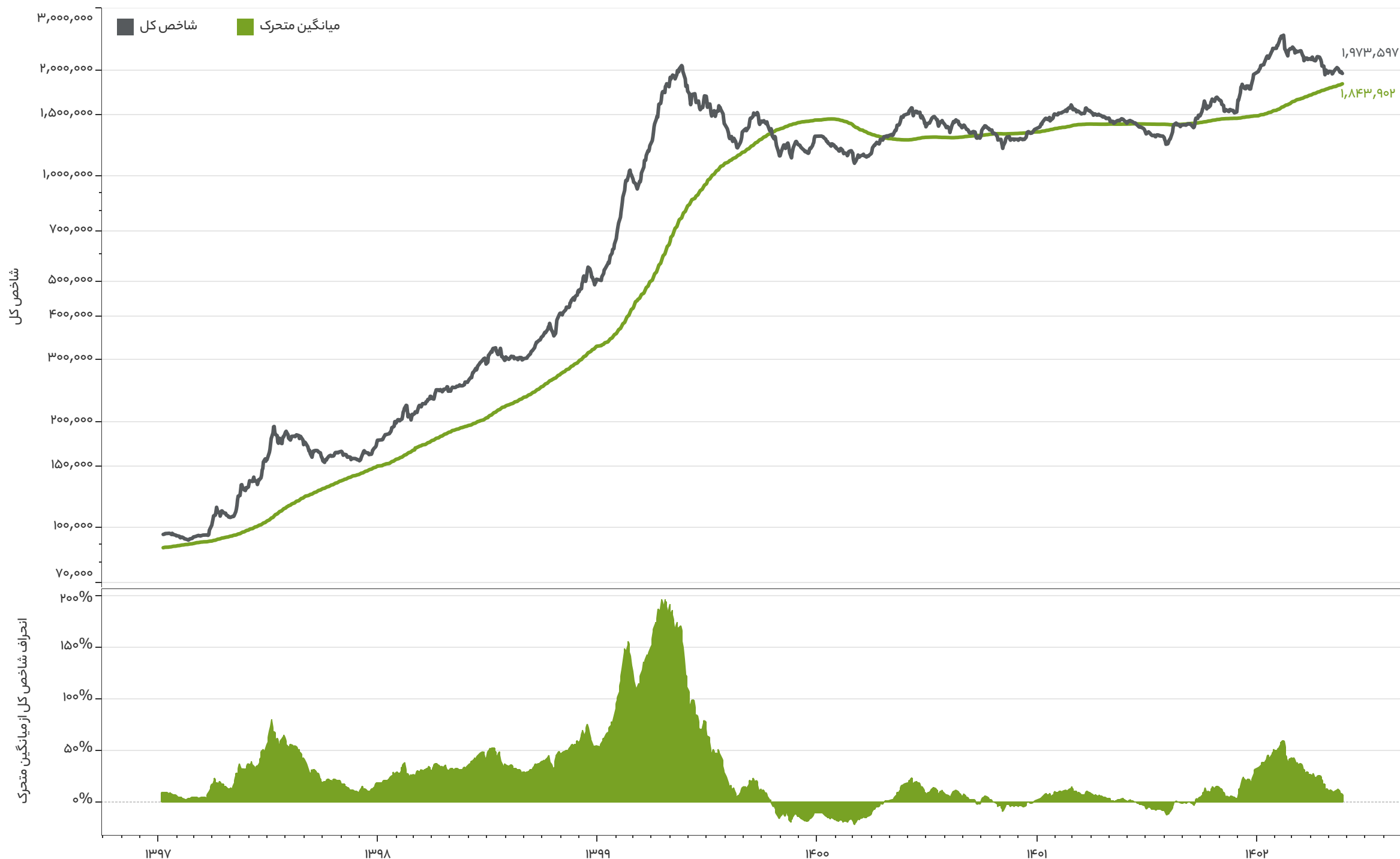
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





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





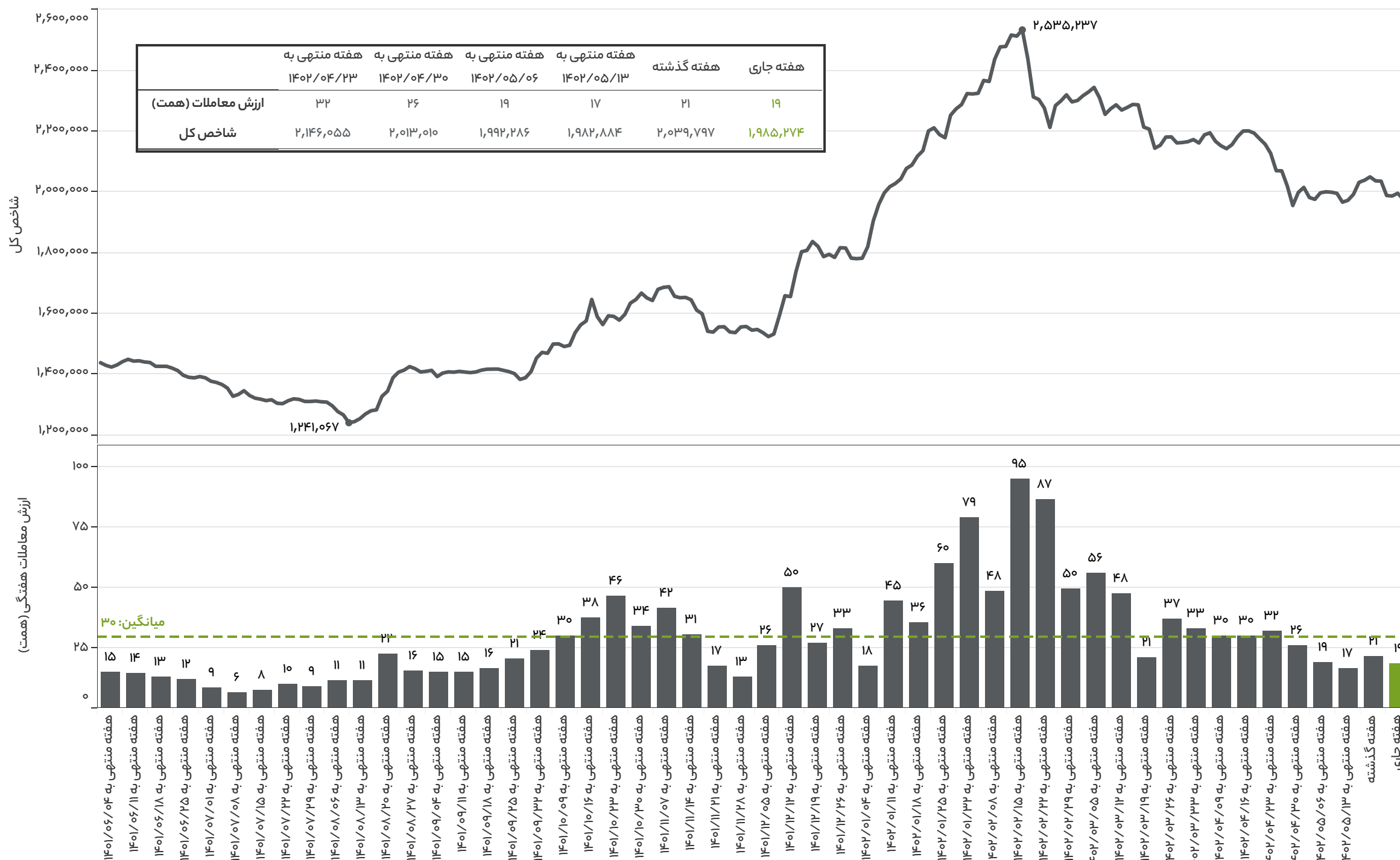
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



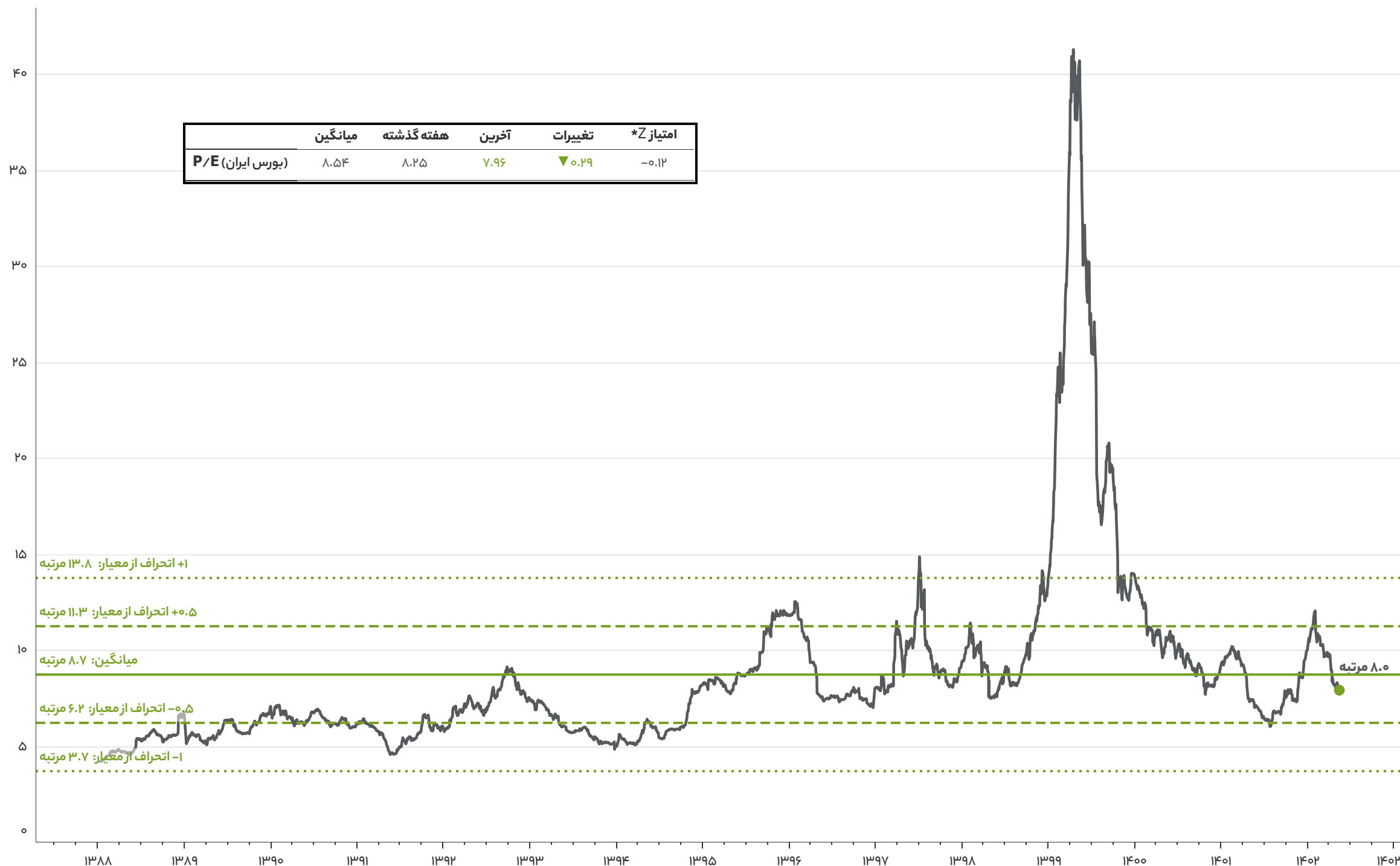
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

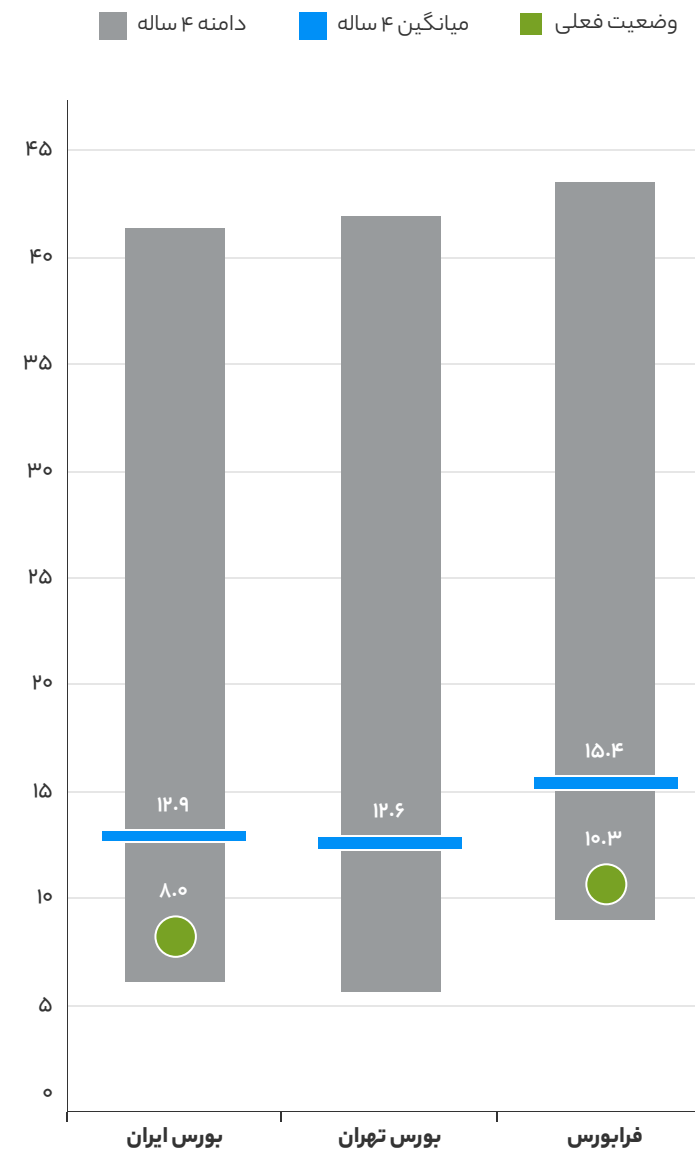
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۷.۹۶	۸.۲۵	۶.۰۷	۱۲.۹۲	۴۱.۳۳
بورس تهران			۵.۶۴	۱۲.۵۹	۴۱.۹۹
فرابورس	۱۰.۳۲	۱۰.۷۴	۹.۰۳	۱۵.۴۱	۴۳.۵۱



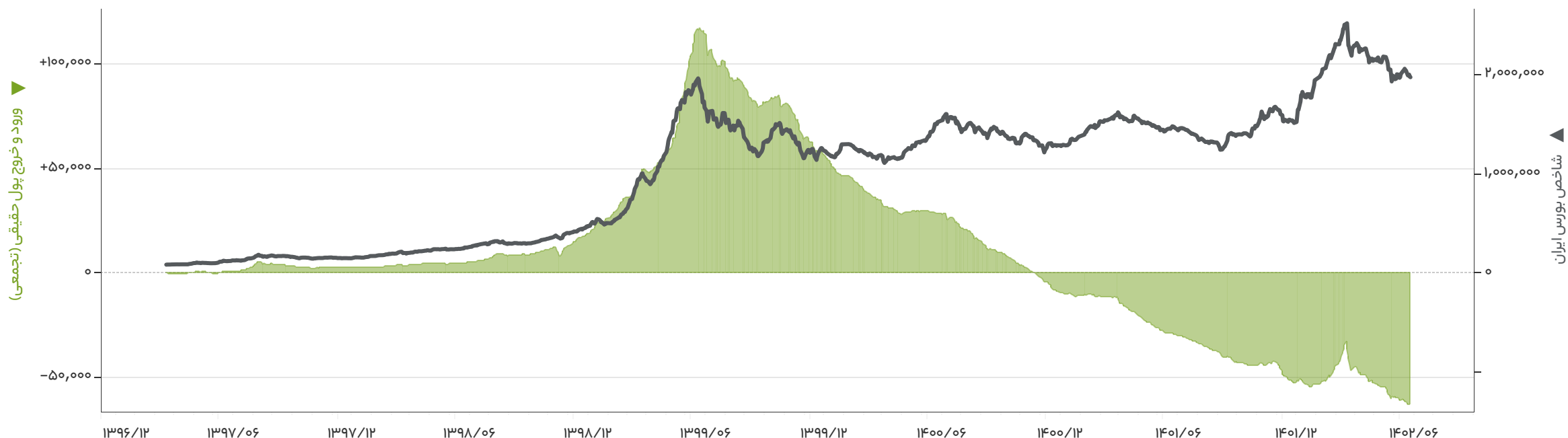
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

بازرسی

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	خدمات مالی	مواد پایه	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۵	۱۹	۴۱	۶۳	۸۹	۶۵	۶	۱۹۹	۱۸۹	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۴۰	۸۷	۱۰۳	۱۱۲	۱۵۵	۱۷۸	۲۰۹	۳۵۰	۵۶۳	۲,۹۵۹	۳,۰۵۸	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۵%	۱.۱%	۱.۳%	۱.۴%	۲.۰%	۲.۳%	۲.۷%	۴.۵%	۷.۲%	۳۷.۹%	۳۹.۱%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۹.۳	۶.۰	۱۰.۷	۲۱.۹	۹.۱	۹.۹	۱۱.۸	۵.۷	۴.۹	۷.۶	۸.۰	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۹%	۱۷.۵%	۳.۸%	۲.۶%	۷.۰%	۳.۵%	۴.۴%	۳.۵%	۱۶.۰%	۷.۴%	۹.۴%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۵%	۳۸%	۵۴%	۳۴%	۶۳%	۵۹%	۷۳%	
بتا به شاخص کل	۰.۷	۱.۰	۱.۲	۰.۷	۰.۸	۱.۱	۰.۸	۱.۰	۱.۲	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۴۴۵%	+۷۳۸%	+۱۱۵%	+۲۷۳%	+۳۸۸%	+۳۵۲%	+۴۲۳%	+۷۹۳%	+۷۱۱%	+۷۹۰%	+۸۵۳%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۲۴%	+۱۰۵%	-۶۶%	-۳%	+۱۶%	-۲۳%	-۲%	-۱۹%	+۵%	-۷%	+۴۹%	
بازده از ابتدای سال	+۱۴۳%	+۳۵%	+۳۸%	+۶۰%	+۹۵%	+۷۶%	+۵۴%	+۷۹%	+۷۲%	+۵۴%	+۶۶%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۹%	-۳%	-۷%	-۲%	-۴%	-۵%	-۵%	-۷%	-۱%	-۳%	-۳%	

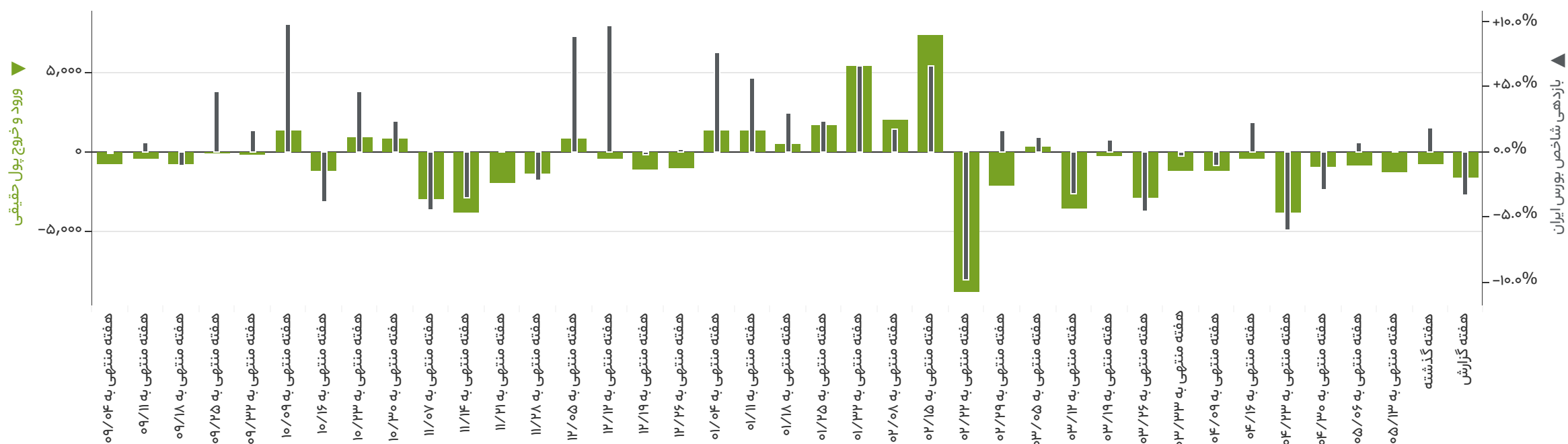
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



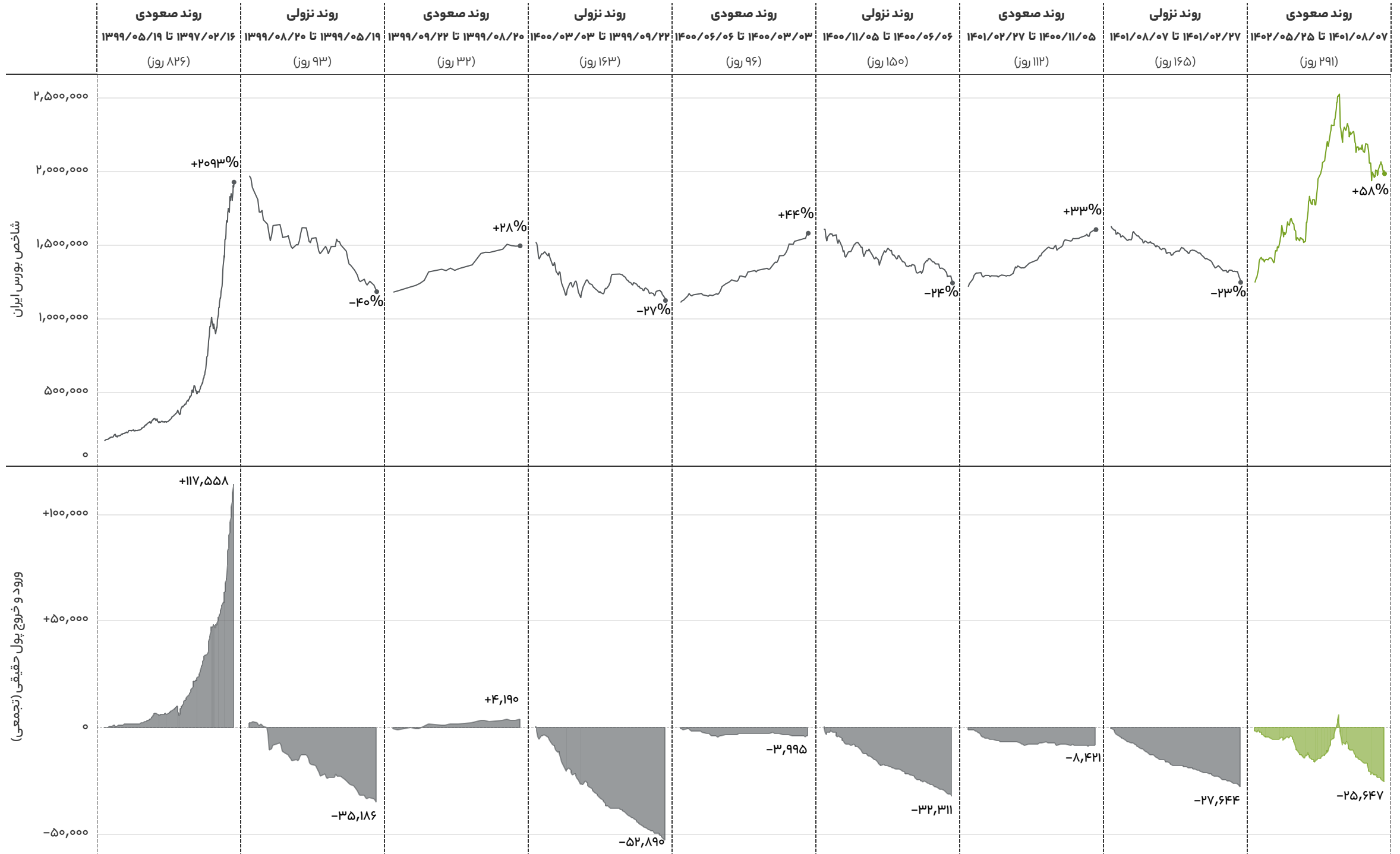
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

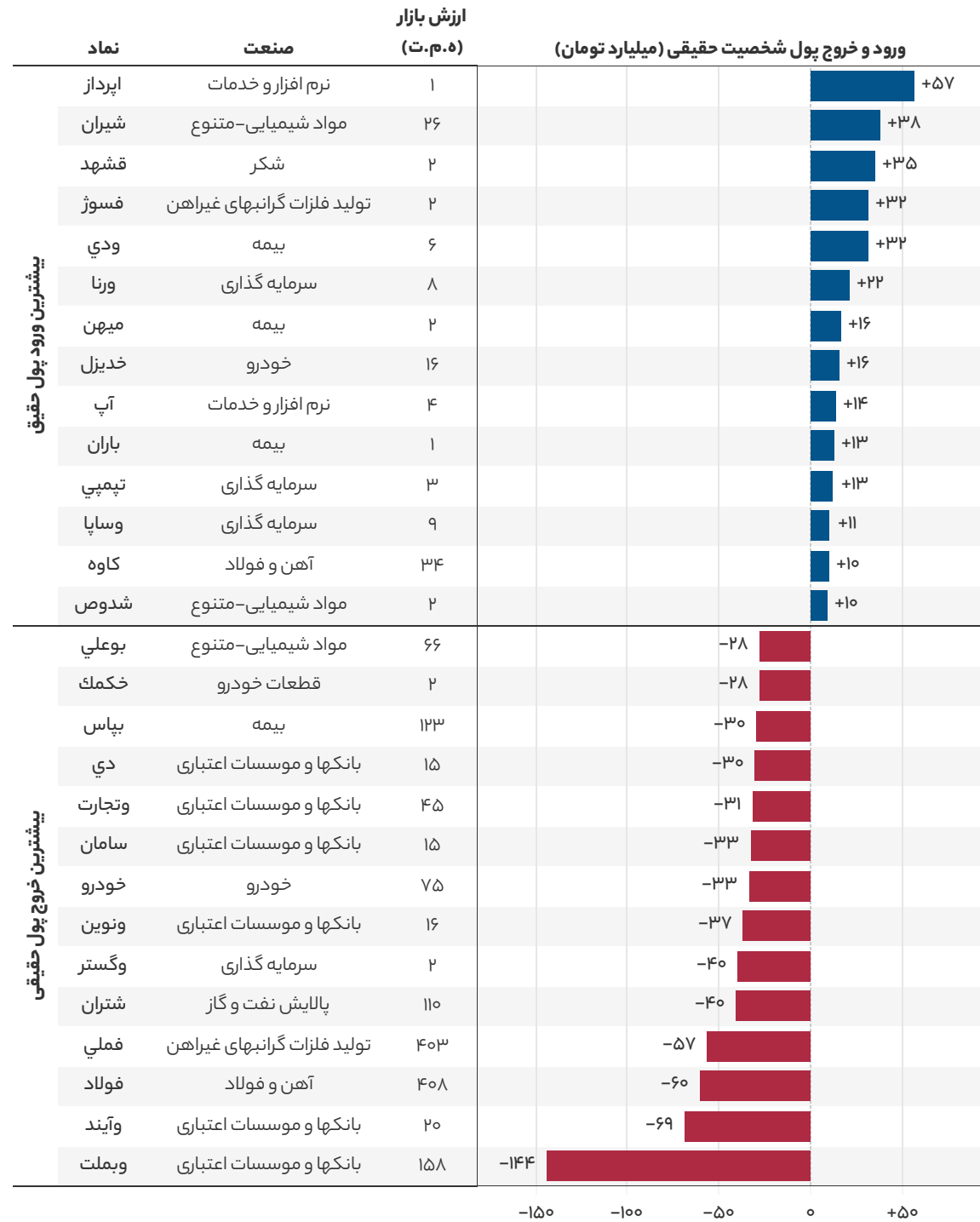
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

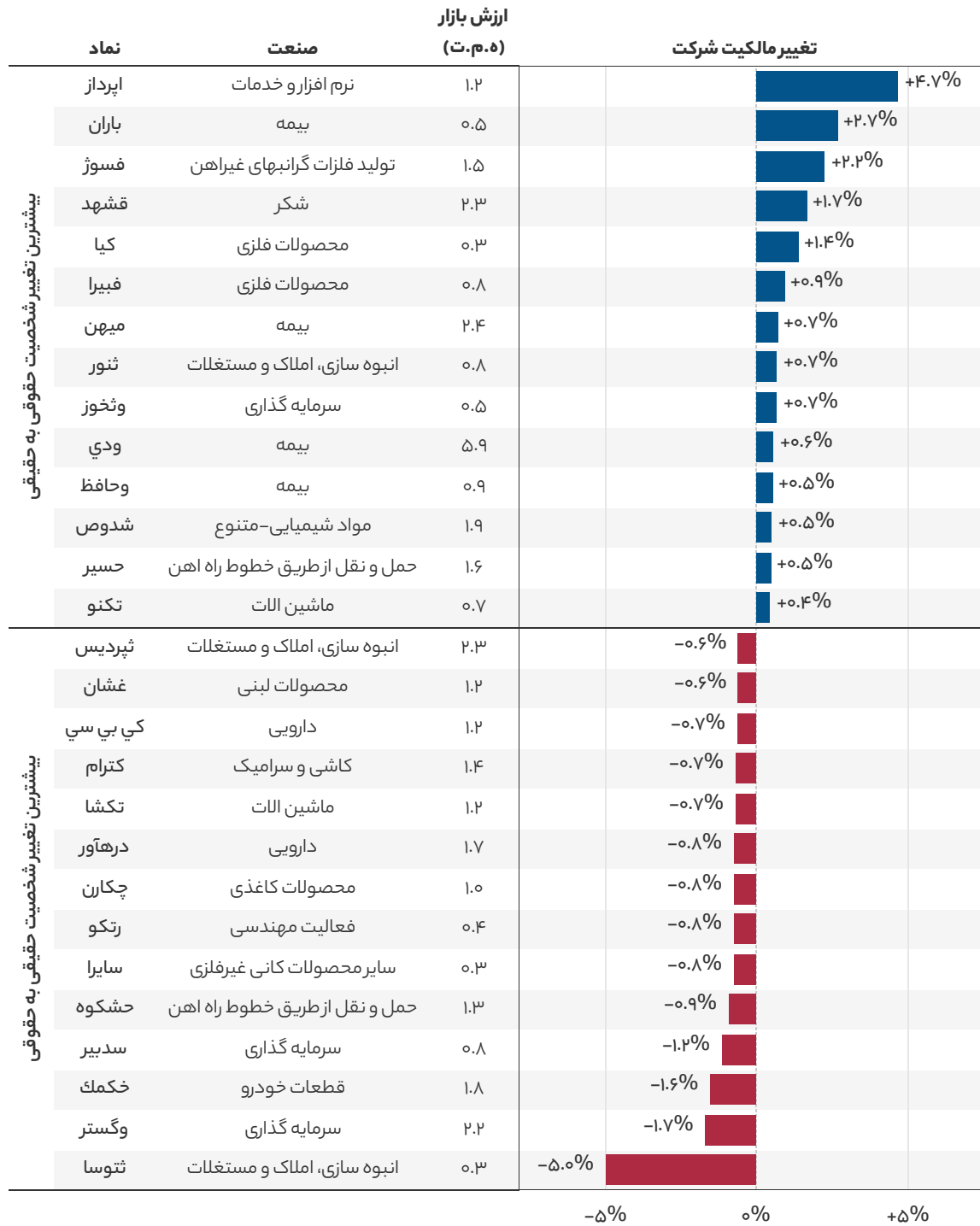
ورود و خروج پول حقیقی

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



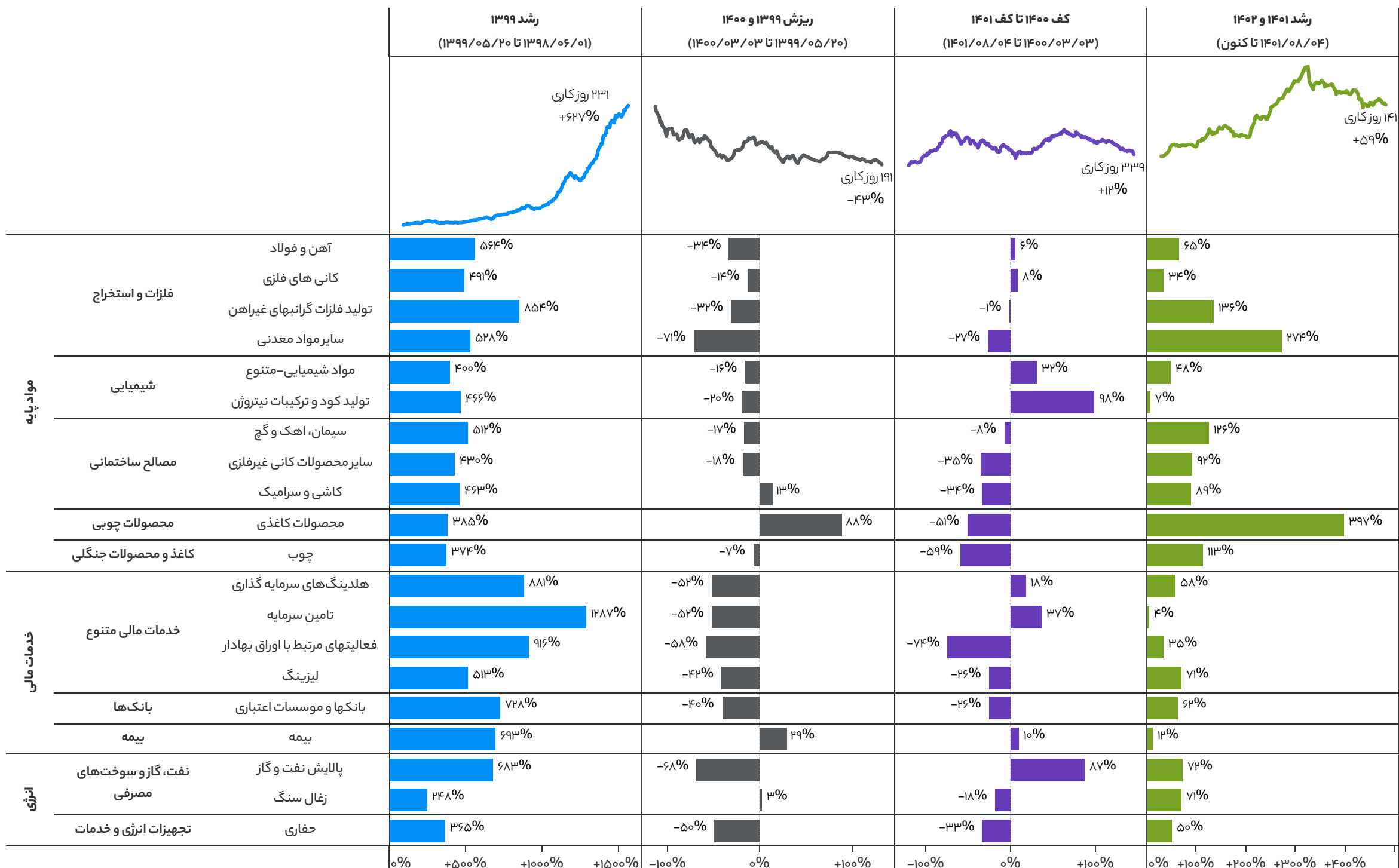
تغییر مالکیت شرکت

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



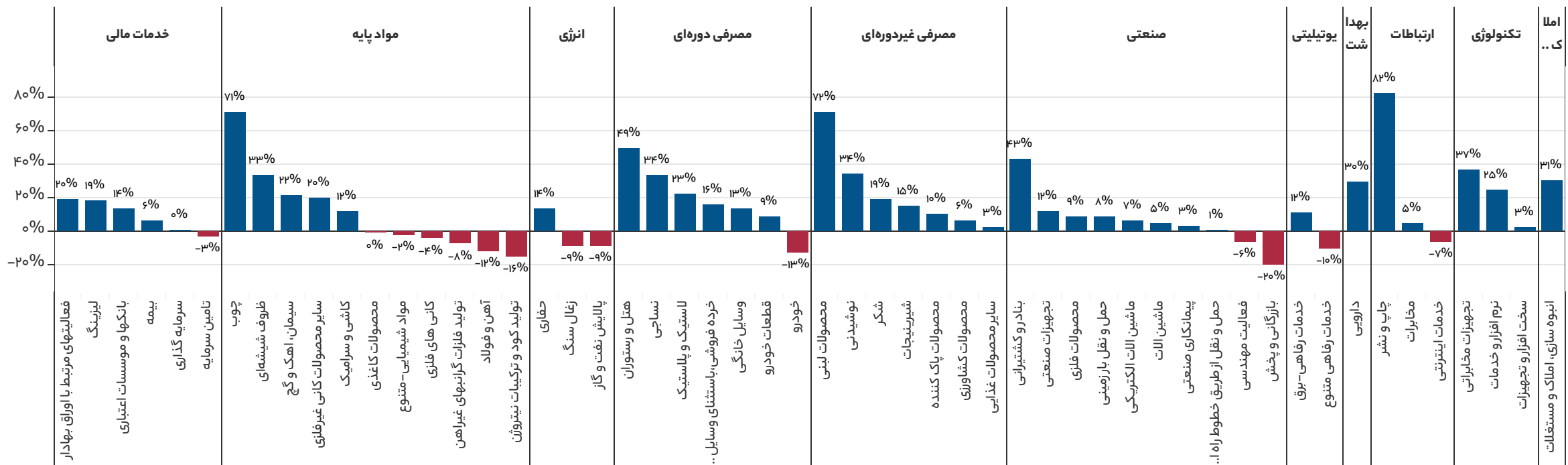
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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



بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲			کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		رشد ۱۳۹۹		
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۴۴%	۱۳%	-۷۰%	۱۲۴۷%			
		قطعات خودرو	۷۱%	-۲۵%	-۳۲%	۶۷۶%			
		لاستیک و پلاستیک	۱۰۹%	-۴۲%	-۳۴%	۶۳۱%			
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۱۶۳%	-۳۶%	-۴۶%	۴۹۰%			
		نساجی	۱۳۲%	-۳۵%	-۲۱%	۳۸۰%			
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۳۸%	۳%	-۲۳%	۱۱۲۹%			
مصرفی غیردوره‌ای	خدمات مصرف کننده	هتل و رستوران	۳۷%	۱۸%	-۶۷%	۱۱۶۶%			
	غذا و نوشیدنی	محصولات کشاورزی	۲۷%	۹%	-۳۵%	۳۹۷%			
		شیرینیجات	۷۲%	-۶۳%	-۲۴%	۵۹۵%			
		محصولات لبنی	۱۴۷%	-۵۴%	۷%	۳۸۳%			
		شکر	۷۵%	-۴۴%	-۲۲%	۴۳۵%			
		سایر محصولات غذایی	۴۶%	-۳۹%	-۳۴%	۶۹۹%			
		نوشیدنی	۹۵%	-۳۱%	-۱۵%	۵۳۹%			
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۲۷%	-۱۲%	۴%	۳۰۶%				
صنعتی	کالاهای سرمایه‌ای	فعالیت مهندسی	۵۴%	-۷%	-۶۳%	۵۲۱%			
		ماشین الات الکتریکی	۶۹%	-۲۳%	-۴۵%	۵۰۱%			
		ماشین الات	۱۱۴%	-۳۱%	-۳۵%	۴۲۲%			
		محصولات فلزی	۱۲۳%	-۴۴%	-۵۴%	۶۴۵%			
		تجهیزات صنعتی	۶۱%	-۴۰%	-۳۰%	۸۴۷%			
		پیمانکاری صنعتی	۸۸%	-۶۸%	-۱۵%	۵۲۵%			
	ترابری	حمل و نقل از طریق راه‌آهن	۶۳%	-۴۱%	-۱۳%	۳۲۷%			
		بنادر و کشتیرانی	۱۵۸%	-۱۵%	-۲۲%	۲۴۶%			
		حمل و نقل بار زمینی	۱۸%	۳۳%	-۱۸%	۲۵۰%			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۹۵%	-۱۳%	-۳۲%	۳۲۱%			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۵۶%	۲%	-۳۵%	۲۵۲%			
		سخت افزار و تجهیزات	۹۱%	-۴۵%	-۶۵%	۵۷۰%			
ارتباطات	خدمات دور برد	مخابرات	۳۴%	-۱۳%	-۷۱%	۵۳۲%			
	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۰۷%	-۵۲%	-۵۲%	۲۲۳%			
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۵%	۱۳۱%	-۳۵%	۳۱۰%			
		خدمات رفاهی - برق		-۳۳%	-۵۴%	۱۷۶%			
املاک و مستغلات		توسعه املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۴۳%	-۴۵%	-۴۳%	۶۱۹%		
				۰%	-۱۰۰%	+۱۵۰۰%	+۱۰۰۰%	+۵۰۰%	۰%





بازدهی بزرگ‌ترین ۳۵ 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

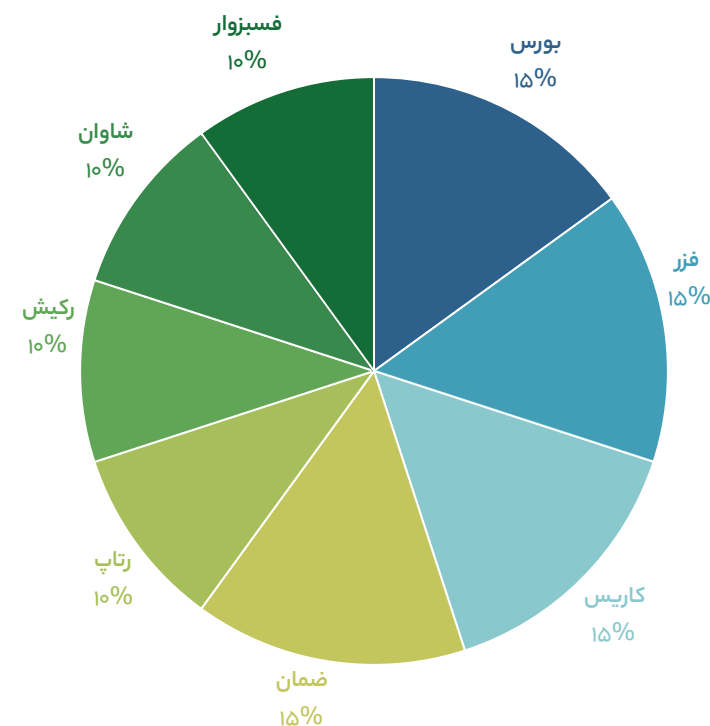


بازده تعدیل شده هفته گذشته	ککهر	تاصیکو	کچاد	وامید	آریا	پارسان	فخوز	تاپیکو	ماون	جم	پاس	شتا	فارس	وبملت	ویندوق	وعدیر	بوعلی	فملی	میدکو	رمینا	شیدیس	ومعادن	خسپا	خودرو	اکابر	حکشی
	+۰.۹%	-۰.۳%	-۰.۸%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۶%	-۱.۷%	-۲.۳%	-۲.۴%	-۲.۴%	-۲.۶%	-۳.۰%	-۳.۰%	-۳.۱%	-۳.۲%	-۳.۲%	-۳.۹%	-۴.۰%	-۵.۲%	-۵.۴%	-۵.۷%	-۶.۱%	-۶.۴%	-۸.۰%	-۷.۹%



سبد پیشنهادی کاریما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۹۹۸	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۵,۲۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۳,۳۷۱	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۳۰۰	رکیش	
۱۰%	۱۸,۳۵۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۳,۸۵۰	شاوان	
۱۰%	۳۵,۸۹۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۴۶,۰۰۰	فسبزوار	
۱۵%	۱۴,۰۰۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵,۵۸۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۷,۲۵۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۳۹,۹۰۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۵۲,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۱,۱۳۲	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود اصلاح شاخص کل تا حوالی ۱,۰۹۲۵,۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد و از این محدوده رشد تا حوالی ۲,۰۱۵۰,۰۰۰ واحد تجربه کند.

توضیحات تحلیل

بورس - 1D - شرکت شاخص

2



انتظار می‌رود اصلاح شاخص هم‌وزن در حوالی ۶۶۵,۰۰۰ واحد خاتمه یابد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح این نسبت تا حوالی ۰.۳۲ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود رشد مقطعی تا حوالی ۴.۸ واحد داشته باشد.

توضیحات تحلیل



باید دید واکنش دلار به کف و سقف تراکم ایجاد شده به چه صورت خواهد بود.

توضیحات تحلیل



باید دید واکنش سکه امامی به کف و سقف تراکم ایجاد شده به چه صورت خواهد بود.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود از حوالی ۱۸۹۰ دلار، رشد مقطعی تا محدوده ۱۹۴۰ دلار تجربه کند.

توضیحات تحلیل



مطابق انتظار، رشد نفت تا حوالی ۸۴ دلار به وقوع پیوست. انتظار می‌رود در جهت تکمیل الگو پیش‌بینی شده، بعد از تکمیل آخرین گام اصلاحی در جهت موج G، وارد مسیر صعودی جدیدی شود.

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

