

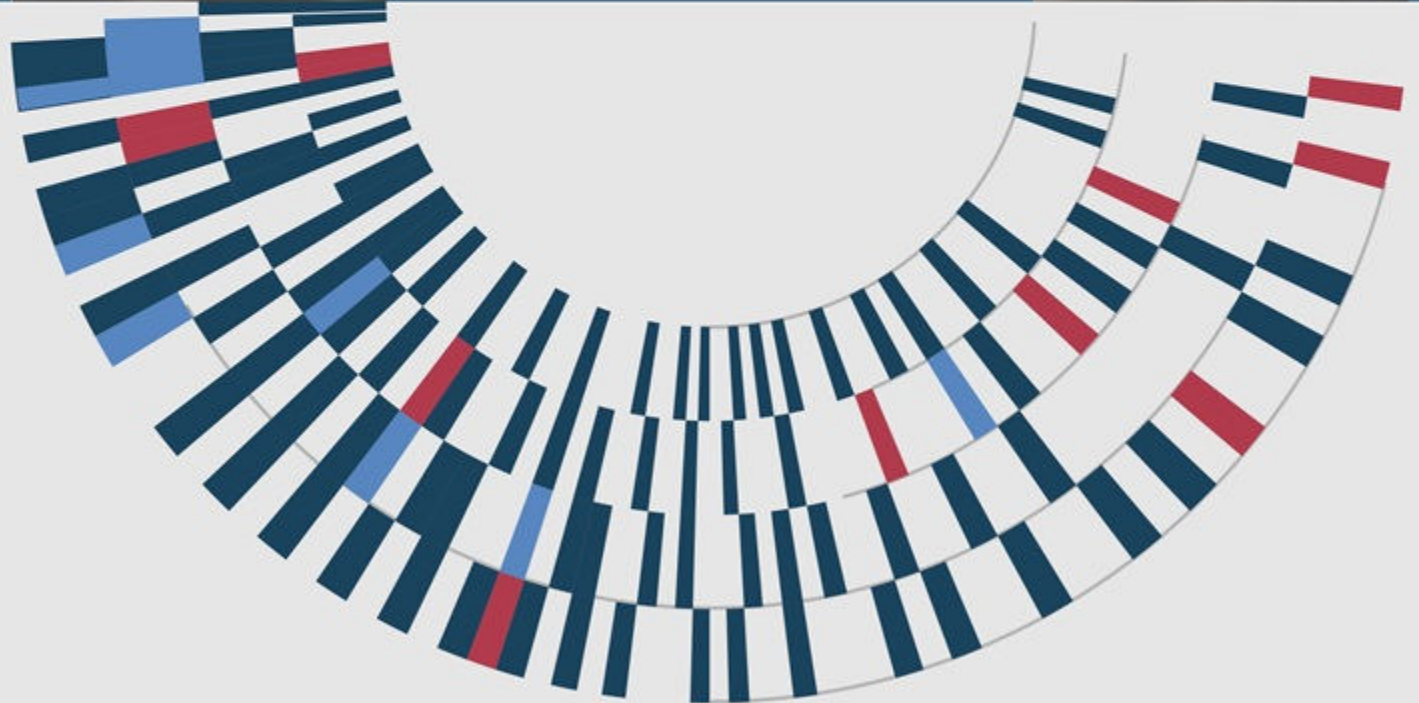
# کاریزماتیک

CHARISMATICK

## گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۷ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۲۰

 CHARISMA





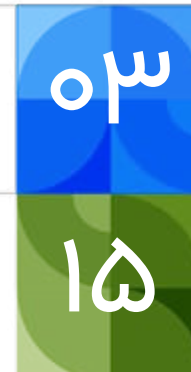
## معرفی گزارش:

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.



## کامودیتی

## بازار سهام

۰۴ فلزات آهنی و غیرآهنی  
۰۵ معادن و محصولات کشاورزی  
۰۶ پتروشیمی  
۰۷ انرژی و سایر محصولات

۱۶ مروری بر بازارهای موازی  
۱۸ بررسی بلندمدت بازار سهام  
۲۰ نرخ بهره و رونق بازار سهام  
۲۱ ارزش معاملات

۰۸ گاز طبیعی  
۱۰ کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی  
۱۱ سیمان  
۱۲ اخبار و معیارهای تاثیرگذار

۲۲ ارزندگی بازار  
۲۴ بازدهی صنایع  
۲۵ ورود و خروج پول  
۲۸ بازدهی صنایع

۱۴ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی

۳۲ برندگان و بازندگان هفته  
۳۳ بازدهی صنایع  
۳۴ سبد پیشنهادی



# کامودیتی

---

COMMODITY

COMMODITY







فلزات آهنی و غیر آهنی

| روند 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                   |
|--------------------|--|-----------------------------------------------|--|------------------------|--------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------------------|------------|---------------|------------------|-------------------------|
| فلزات غیر آهنی     |  |                                               |  | -                      | فزر                                                                      |               | -۰.۶%                    | ۲,۰۲۶      | دلار/انس      | بازار فارکس      | طلا                     |
|                    |  |                                               |  | بموتو، فباهنر          | فملی                                                                     |               | -۳.۴%                    | ۸,۱۸۴      | دلار/تن       | بورس فلزات لندن  | مس                      |
|                    |  |                                               |  | بموتو، فباهنر          | فملی                                                                     |               | +۳.۹%                    | ۳۹۵,۲۴۱    | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | مس (ملي مس ایران)       |
|                    |  |                                               |  | فنوال                  | فایرا                                                                    |               | +۰.۳%                    | ۲,۲۲۱      | دلار/تن       | کامکس            | آلومینیوم               |
|                    |  |                                               |  | فمراد                  | فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما |               | -۶.۴%                    | ۲,۲۹۸      | دلار/تن       | بورس فلزات لندن  | روی                     |
| فلزات آهنی         |  |                                               |  | -                      | فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما                      |               | -۴.۸%                    | ۲,۰۴۵      | دلار/تن       | بورس فلزات لندن  | سرب                     |
|                    |  |                                               |  | کوبر، فوکا، فنورد      | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان                               |               | +۰.۴%                    | ۵۰۰        | دلار/تن       | بنادر ایران FOB  | شمش (ایران)             |
|                    |  |                                               |  | کوبر، فوکا، فنورد      | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان                               |               | -۰.۶%                    | ۵۲۱        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | شمش CIS (منطقه)         |
|                    |  |                                               |  | کوبر، فوکا، فنورد      | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق      |               | -۲.۱%                    | ۲۰,۲۰۲     | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | شمش (فولاد خوزستان)     |
|                    |  |                                               |  | -                      | فولاد، فخوز، هرمز                                                        |               | +۱.۵%                    | ۴۹۵        | دلار/تن       | بنادر ایران FOB  | اسلب (ایران)            |
|                    |  |                                               |  | -                      | فولاد، فخوز، هرمز                                                        |               | -                        | ۵۴۸        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | اسلب CIS (منطقه)        |
|                    |  |                                               |  | -                      | فولاد، فخوز، هرمز                                                        |               | +۲.۶%                    | ۲۲,۷۰۰     | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | اسلب (فولاد هرمزگان)    |
|                    |  |                                               |  | فولای                  | ذوب، کویر                                                                |               | -                        | ۶۱۸        | دلار/تن       | بنادر ترکیه FOB  | میلگرد                  |
|                    |  |                                               |  | فولای                  | ذوب، کویر                                                                |               | -۰.۶%                    | ۲۲,۰۱۵     | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | میلگرد (ذوب آهن اصفهان) |
|                    |  |                                               |  | فجر، فسپا              | فولاد، فوکا، فنورد                                                       |               | +۱.۰%                    | ۶۰۴        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | ورق گرم                 |
|                    |  |                                               |  | -                      | فولاد                                                                    |               | +۲.۹%                    | ۷۱۸        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | ورق سرد                 |

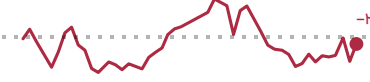
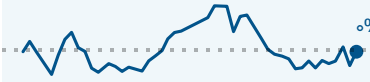
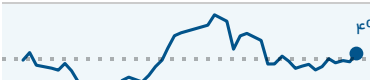
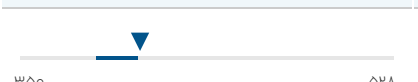
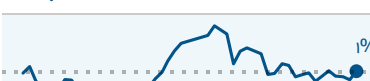
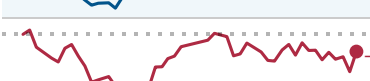
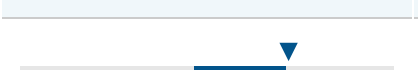
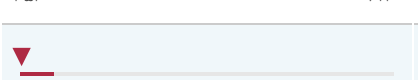
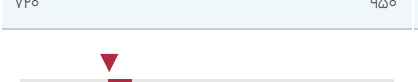


# معادن و محصولات کشاورزی

|                         |  | روند 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                  |
|-------------------------|--|--------------------|------|-----------------------------------------------|---------------|---------------------------------------------------------|------------------------------------|---------------|---|--------------------------|------------|---------------|--------------------|------------------------|
| سنگ آهن و محصولات معدنی |  |                    | ۲٪   |                                               | ۱۴۳ / ۱۰۱     | -                                                       | -                                  | -             | - | -۲.۷%                    | ۱۲۹        | دلار/تن       | شمال چین CFR       | سنگ آهن                |
|                         |  |                    | -۱٪  |                                               | ۱۶۴ / ۱۱۹     | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               |   | -۳.۷%                    | ۱۵۲        | دلار/تن       | شمال چین CFR       | گندله سنگ آهن          |
|                         |  |                    | ۲۴٪  |                                               | ۴,۸۴۳ / ۳,۸۱۵ | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               |   | +۰.۵%                    | ۴,۸۱۸      | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران   | گندله سنگ آهن (گل گهر) |
|                         |  |                    | -۳٪  |                                               | ۱۵۳ / ۱۰۷     | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               |   | -۴.۰%                    | ۱۴۰        | دلار/تن       | شمال چین CFR       | کنسانتره سنگ آهن       |
|                         |  |                    | ۲۲٪  |                                               | ۳,۶۳۶ / ۲,۹۷۷ | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               |   | +۱.۰%                    | ۳,۶۳۶      | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران   | کنسانتره (چادرملو)     |
| محصولات کشاورزی         |  |                    | -۱۵٪ |                                               | ۲۹۰ / ۱۹۹     | -                                                       | -                                  | -             | - | -۰.۷%                    | ۲۲۰        | دلار/تن       | بورس کالای چیکاگو  | گندم آمریکا            |
|                         |  |                    | -۳۴٪ |                                               | ۲۶۸ / ۱۶۹     | غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار                       |                                    | -             | - | -۲.۸%                    | ۱۶۹        | دلار/تن       | بورس کالای چیکاگو  | ذرت آمریکا             |
|                         |  |                    | -۱٪  |                                               | ۱,۷۱۶ / ۱,۱۹۷ | -                                                       | -                                  | -             | - | +۸.۹%                    | ۱,۳۵۸      | دلار/تن       | بورس کالای نیویورک | شکر آمریکا             |
|                         |  |                    | -۱۳٪ |                                               | ۹۶۸ / ۷۲۸     | غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار                       |                                    | -             | - | +۱.۷%                    | ۸۰۵        | دلار/تن       | بورس مالزی         | روغن پالم خام          |



| روند 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             |
|--------------------|--|-----------------------------------------------|--|------------------------|-----------------------------------------|---------------|--|--------------------------|------------|---------|-------------------|-------------------|
| مواد شیمیایی       |  |                                               |  | شاروم، شفارس           | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماش             |               |  |                          |            | دلار/تن | خلیج فارس FOB     | اوره              |
|                    |  |                                               |  | شفارس، شسینا           | زاگرس، شخارک، شفن، شیراز                |               |  | +۱.۷%                    | ۲۹۲        | دلار/تن | چین CFR           | متانول            |
|                    |  |                                               |  | شغدیر، جم پیلن         | مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک           |               |  | -                        | ۹۵۰        | دلار/تن | جنوب شرق آسیا CFR | اتیلن             |
|                    |  |                                               |  | جم پیلن                | جم، شکبیر                               |               |  | -                        | ۸۵۰        | دلار/تن | چین CFR           | پروپیلن           |
|                    |  |                                               |  | شگویا، شپلی            | شصفها، نوری                             |               |  | +۰.۴%                    | ۱,۰۱۷      | دلار/تن | جنوب شرق آسیا CFR | پارازایلن         |
|                    |  |                                               |  | -                      | شصفها، نوری                             |               |  | -۱.۰%                    | ۱,۰۰۵      | دلار/تن | چین CFR           | ارتوزایلن         |
|                    |  |                                               |  | شجم، شبصیر             | پارس                                    |               |  | +۵.۴%                    | ۱,۱۲۵      | دلار/تن | چین CFR           | استایرن           |
|                    |  |                                               |  | شیران                  | نوری، بوعلی، شصفها                      |               |  | +۴.۶%                    | ۱,۰۴۳      | دلار/تن | چین CFR           | بنزن              |
|                    |  |                                               |  | -                      | بوعلی                                   |               |  | +۳.۴%                    | ۸۹۰        | دلار/تن | چین CFR           | تولوئن            |
|                    |  |                                               |  | شجم                    | جم، شکبیر، شاراک                        |               |  | +۳.۴%                    | ۱,۲۰۰      | دلار/تن | چین CFR           | بوتادین           |
| پلیمرها            |  |                                               |  | شگویا، شپلی            | مارون، شاراک                            |               |  | -۲.۲%                    | ۵۴۳        | دلار/تن | چین CFR           | مونواتیلن گلایکول |
|                    |  |                                               |  | -                      | آریا، شکبیر                             |               |  | -۰.۲%                    | ۱,۰۱۸      | دلار/تن | خلیج فارس FOB     | پلی اتیلن سبک     |
|                    |  |                                               |  | -                      | مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک           |               |  | -۰.۴%                    | ۹۳۳        | دلار/تن | خلیج فارس FOB     | پلی اتیلن سنگین   |
|                    |  |                                               |  | -                      | جم، شکبیر، شاراک                        |               |  | -                        | ۹۲۳        | دلار/تن | خلیج فارس FOB     | پلی اتیلن سبک خطی |
|                    |  |                                               |  | -                      | جم پیلن، مارون، شاراک                   |               |  | +۰.۲%                    | ۸۵۳        | دلار/تن | خلیج فارس FOB     | پلی پروپیلن       |
|                    |  |                                               |  | -                      | شگویا                                   |               |  | -                        | ۹۵۵        | دلار/تن | جنوب شرق آسیا FOB | PET               |
|                    |  |                                               |  | -                      | شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام |               |  | -                        | ۷۷۰        | دلار/تن | جنوب شرق آسیا CFR | PVC               |
|                    |  |                                               |  | -                      | شبصیر                                   |               |  | +۱.۶%                    | ۱,۳۰۰      | دلار/تن | جنوب شرق آسیا CFR | ABS               |

| انرژی و فرآورده های نفتی                                                              | روند 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                      |  |
|---------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|---|----------------------------------------|---|----------------------------------------|--------|--------------------------|--------|------------|------|---------------|-------------|-----------------------|--------------|----------------------------|--|
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان |   | -                                      |        | +۰.۱%                    |        | ۸۲         |      | دلار/بشکه     |             | بورس بین المللی اروپا |              | نفت برنت                   |  |
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان |   | -                                      |        | +۰.۱%                    |        | ۷۷         |      | دلار/بشکه     |             | بورس بین المللی اروپا |              | نفت WTI                    |  |
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | -                                      |   | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان |        | +۴.۳%                    |        | ۹۱         |      | دلار/بشکه     |             | خلیج فارس FOB         |              | بنزین                      |  |
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | -                                      |   | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان |        | +۴.۹%                    |        | ۱۰۳        |      | دلار/بشکه     |             | خلیج فارس FOB         |              | گازوئیل                    |  |
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | -                                      |   | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان |        | +۵.۳%                    |        | ۴۰۶        |      | دلار/تن       |             | خلیج فارس FOB         |              | نفت کوره                   |  |
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | -                                      |   | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان |        | +۵.۰%                    |        | ۹۹         |      | دلار/بشکه     |             | خلیج فارس FOB         |              | نفت سفید                   |  |
|                                                                                       |    |                                                                                       |    |   | بوعلی، نوری                            |   | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان |        | +۹.۸%                    |        | ۶۱۰        |      | دلار/تن       |             | خلیج فارس FOB         |              | نفتا                       |  |
|                                                                                       |   |                                                                                       |   |   | -                                      |   | شسپا، شرانل، شبرهن، شنف                |        | -۲.۷%                    |        | ۷۲۰        |      | دلار/تن       |             | امارات متحده CFR عربی |              | روغن پایه                  |  |
|                                                                                       |  |                                                                                       |  |   | -                                      |   | شبرهن، شسپا، شنف، شرانل                |        | -۴.۷%                    |        | ۲۶,۳۷۹     |      | تومان/کیلوگرم |             | بورس کالای ایران      |              | روغن پایه (نفت سپاهان)     |  |
| ارزو ارز دیجیتال                                                                      |  |                                                                                       |  |   | شبرهن، شسپا، شنف، شرانل                |   | شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان |        | -                        |        | ۱۷,۷۱۰     |      | تومان/کیلوگرم |             | بورس کالای ایران      |              | لوب کات (پالایش نفت تهران) |  |
|                                                                                       |  |                                                                                       |  |   | -                                      |   | شپاس                                   |        | +۷.۲%                    |        | ۱۴,۰۳۸     |      | تومان/کیلوگرم |             | بورس کالای ایران      |              | قیر(نفت پاسارگاد)          |  |
|                                                                                       |  |                                                                                       |  |   | ذوب، فروش                              |   | -                                      |        | -۳.۷%                    |        | ۲۶۵        |      | دلار/تن خیس   |             | استرالیا FOB          |              | زغال سنگ                   |  |
|                                                                                       |  |                                                                                       |  |   | -                                      |   | -                                      |        | -۰.۱%                    |        | ۱.۰۸       |      | -             |             | بازار فارکس           |              | یورو به دلار               |  |
|  |                                                                                       |  |                                                                                       | - |                                        | - |                                        | -۰.۱%  |                          | ۱.۲۶   |            | -    |               | بازار فارکس |                       | پوند به دلار |                            |  |
|  |                                                                                       |  |                                                                                       | - |                                        | - |                                        | +۱۰.۶% |                          | ۴۷,۶۰۶ |            | دلار |               | بایانس      |                       | بیتکوین      |                            |  |





| 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 | ۰.۰۷       | -۵.۷%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۰۷ ۰.۱۳                                     | -۲۲%               |
| آلبرتا         | دلار \ مترمکعب | ۰.۰۵       | -                        | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۰۵ ۰.۱۰                                     | -۴۹%               |
| هلند (TTF)     | دلار \ مترمکعب | ۰.۳۱       | -۲.۶%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۲۶ ۱.۵۵                                     | -۴۹%               |
| انگلستان (NBP) | دلار \ مترمکعب | ۰.۲۹       | -۸.۲%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۲۴ ۰.۶۱                                     | -۴۳%               |
| میانگین ۴ هاب  | دلار \ مترمکعب | ۰.۱۸       | -۵.۱%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۱۶ ۰.۵۴                                     | -۴۵%               |

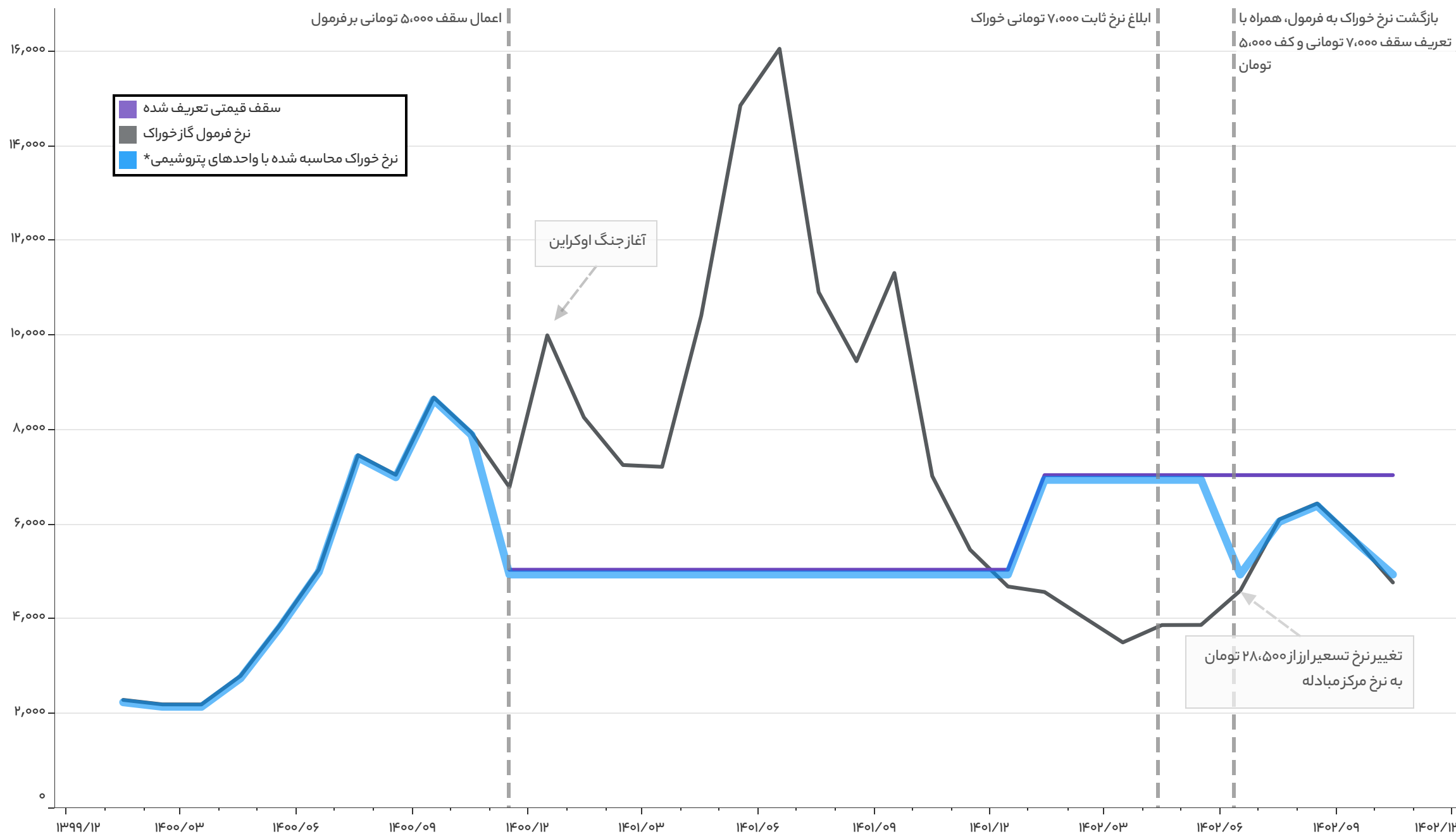
## میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



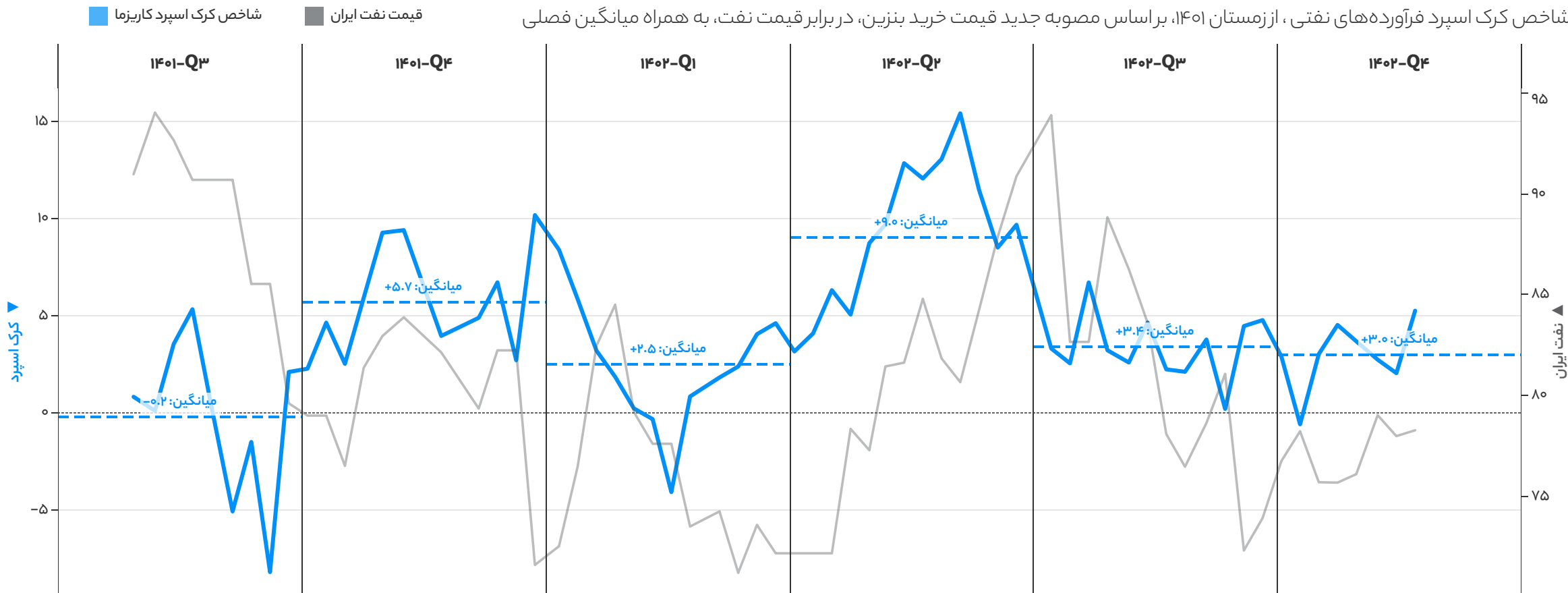
\* نرخ خوراک گاز ابللاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد.

- 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 می گردد.



## 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 | آخرین وضعیت                                                     | میانگین فصل گذشته | میانگین فصل جاری |
| نفت ایران              | ۷۸.۳        |            |                  |              |                               |          |                 |                                                                 |                   |                  |
| گازوئیل                | ۱۰۲.۷       | ۱۹.۸       | ۲۴.۴             | ▲۴.۶         | ۲۳.۲                          | ۲۰.۳     | -۱۲.۵%          |                                                                 |                   |                  |
| بنزین**                | ۸۶.۹        | ۴.۵        | ۸.۶              | ▲۴.۲         | ۱.۱                           | ۴.۶      | +۳۱۵.۵%         |                                                                 |                   |                  |
| نفتا                   | ۶۹.۰        | -۱۵.۲      | -۹.۳             | ▲۵.۹         | -۱۲.۳                         | -۹.۸     | +۲۰.۸%          |                                                                 |                   |                  |
| نفت کوره               | ۶۴.۱        | -۱۷.۲      | -۱۴.۲            | ▲۳.۰         | -۱۵.۲                         | -۱۳.۸    | +۹.۲%           |                                                                 |                   |                  |
| لوب کات***             | ۶۹.۲        | -۸.۹       | -۹.۱             | ▼۰.۳         | -۲.۹                          | -۷.۸     | -۱۶۹.۱%         |                                                                 |                   |                  |
| وکیوم باتوم***         | ۴۷.۸        | -۳۰.۷      | -۳۰.۵            | ▲۰.۲         | -۲۸.۵                         | -۳۱.۰    | -۸.۶%           |                                                                 |                   |                  |
| شاخص کرک اسپرد کاریزما |             | ۲.۱        | ۵.۳              | ▲۳.۲         | ۳.۴                           | ۳.۰      | -۱۲.۶%          |                                                                 |                   |                  |

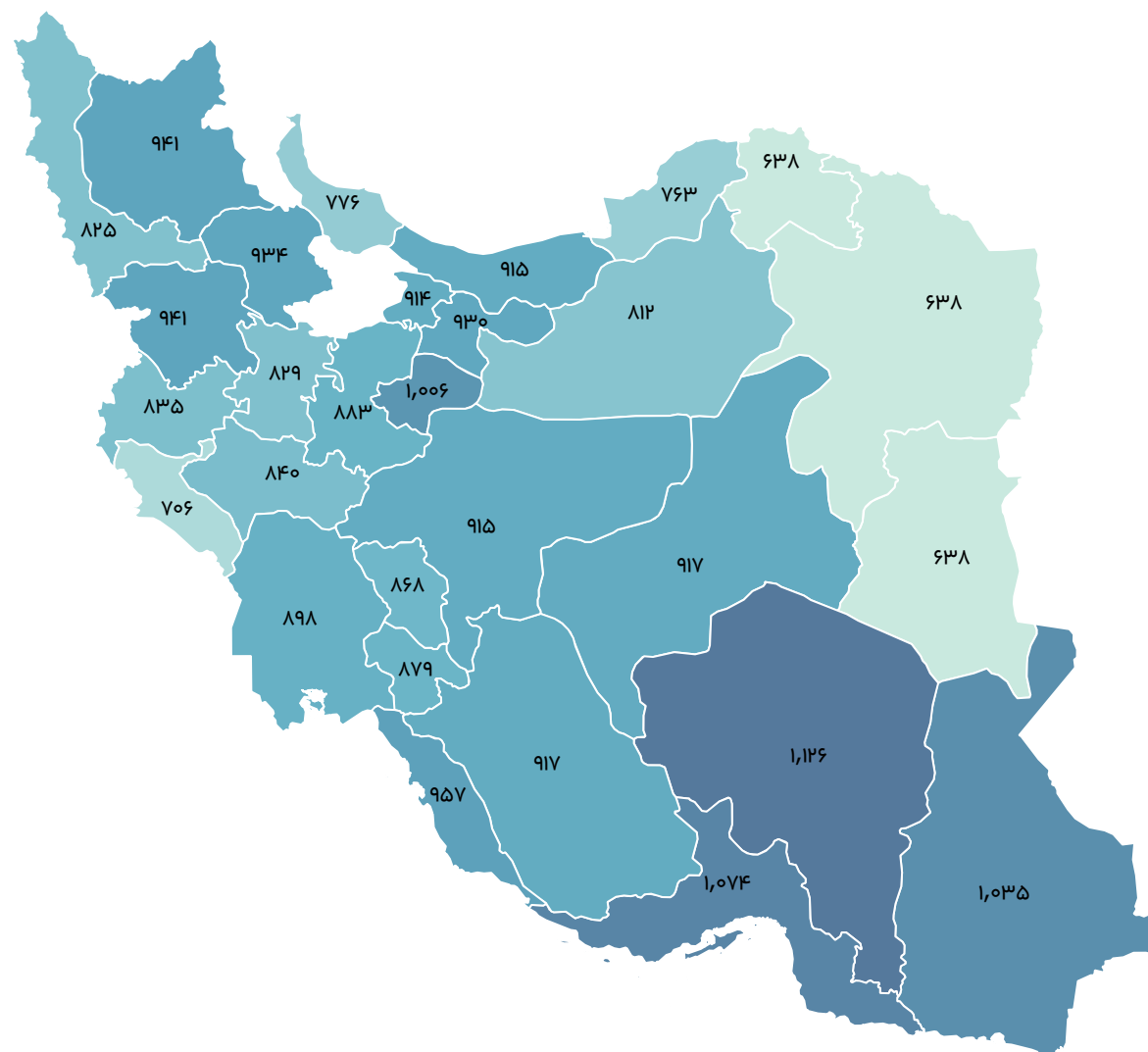
\* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هر یک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هر یک از این پالایشگاه‌ها استفاده شده است.

\*\* قیمت بنزین بر اساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شندر، شتران و شیریز) 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 منطقه‌ای سیمان\* در هفته گزارش

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



## آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

| منطقه    | استان               | شرکت دنبال کننده         | هفته گذشته | هفته گزارش | تغییرات به هفته گذشته |
|----------|---------------------|--------------------------|------------|------------|-----------------------|
| مرکز     | مرکزی               | سیمان ساوه               | ۸۸۳        | ۸۸۳        | -                     |
|          | تهران               | سیمان تهران              | ۹۴۹        | ۹۳۰        | -۲.۱%                 |
|          | البرز               | سیمان آبیک               | ۹۱۴        | ۹۱۴        | -                     |
|          | یزد                 | گروه صنعتی ومعدنی سیما.. | ۸۴۶        | ۹۱۷        | +۸.۴%                 |
|          | قم                  | سیمان نیزار قم           | ۱,۰۳۶      | ۱,۰۰۶      | -۲.۹%                 |
|          | اصفهان              | سیمان سپاهان             | ۹۱۵        | ۹۱۵        | -                     |
|          | سمنان               | سیمان شاهرود             | ۸۱۲        | ۸۱۲        | -                     |
| غرب      | خوزستان             | شرکت سیمان خوزستان       | ۸۹۸        | ۸۹۸        | -                     |
|          | همدان               | سیمان هگمتان             | ۸۲۹        | ۸۲۹        | -                     |
|          | ایلام               | سیمان ایلام              | ۷۱۹        | ۷۰۶        | -۱.۸%                 |
|          | چهارمحال و بختیاری  | صنایع سیمان شهرکرد       | ۸۶۸        | ۸۶۸        | -                     |
|          | کرمانشاه            | صنایع سیمان غرب          | ۸۴۲        | ۸۳۵        | -۰.۸%                 |
|          | کهگیلویه و بویراحمد | سیمان یاسوج              | ۸۷۹        | ۸۷۹        | -                     |
|          | لرستان              | سیمان دورود              | ۸۴۰        | ۸۴۰        | -                     |
| شمال     | کردستان             | سیمان کردستان            | ۹۴۱        | ۹۴۱        | -                     |
|          | مازندران            | سیمان مازندران           | ۹۱۵        | ۹۱۵        | -                     |
|          | گیلان               | سیمان خزر                | ۷۷۳        | ۷۷۶        | +۰.۴%                 |
|          | گلستان              | سیمان پیوند گلستان       | ۷۶۳        | ۷۶۳        | -                     |
| جنوب     | هرمزگان             | سیمان هرمزگان            | ۱,۰۷۷      | ۱,۰۷۴      | -۰.۳%                 |
|          | فارس                | سیمان داراب              | ۹۱۷        | ۹۱۷        | -                     |
|          | بوشهر               | سیمان مند دشتی           | ۹۶۹        | ۹۵۷        | -۱.۳%                 |
| شمال غرب | زنجان               | سیمان خمسه               | ۹۳۴        | ۹۳۴        | -                     |
|          | اردبیل              | سیمان آرتا اردبیل        | ۹۵۰        |            |                       |
|          | آذربایجان شرقی      | کارخانجات سیمان صوفیان   | ۹۴۳        | ۹۴۱        | -۰.۲%                 |
| شمال شرق | آذربایجان غربی      | سیمان ارومیه             | ۸۱۵        | ۸۲۵        | +۱.۲%                 |
|          | خراسان شمالی        | سیمان بجنورد             | ۶۳۸        | ۶۳۸        | -                     |
|          | خراسان رضوی         | سیمان شرق                | ۶۳۸        | ۶۳۸        | -                     |
| جنوب شرق | خراسان جنوبی        | شرکت سیمان قاین          | ۶۳۸        | ۶۳۸        | -                     |
|          | کرمان               | سیمان ممتازان کرمان      | ۹۷۸        | ۱,۱۲۶      | +۱۵.۲%                |
|          | سیستان و بلوچستان   | سیمان خاش                | ۹۷۴        | ۱,۰۳۵      | +۶.۳%                 |

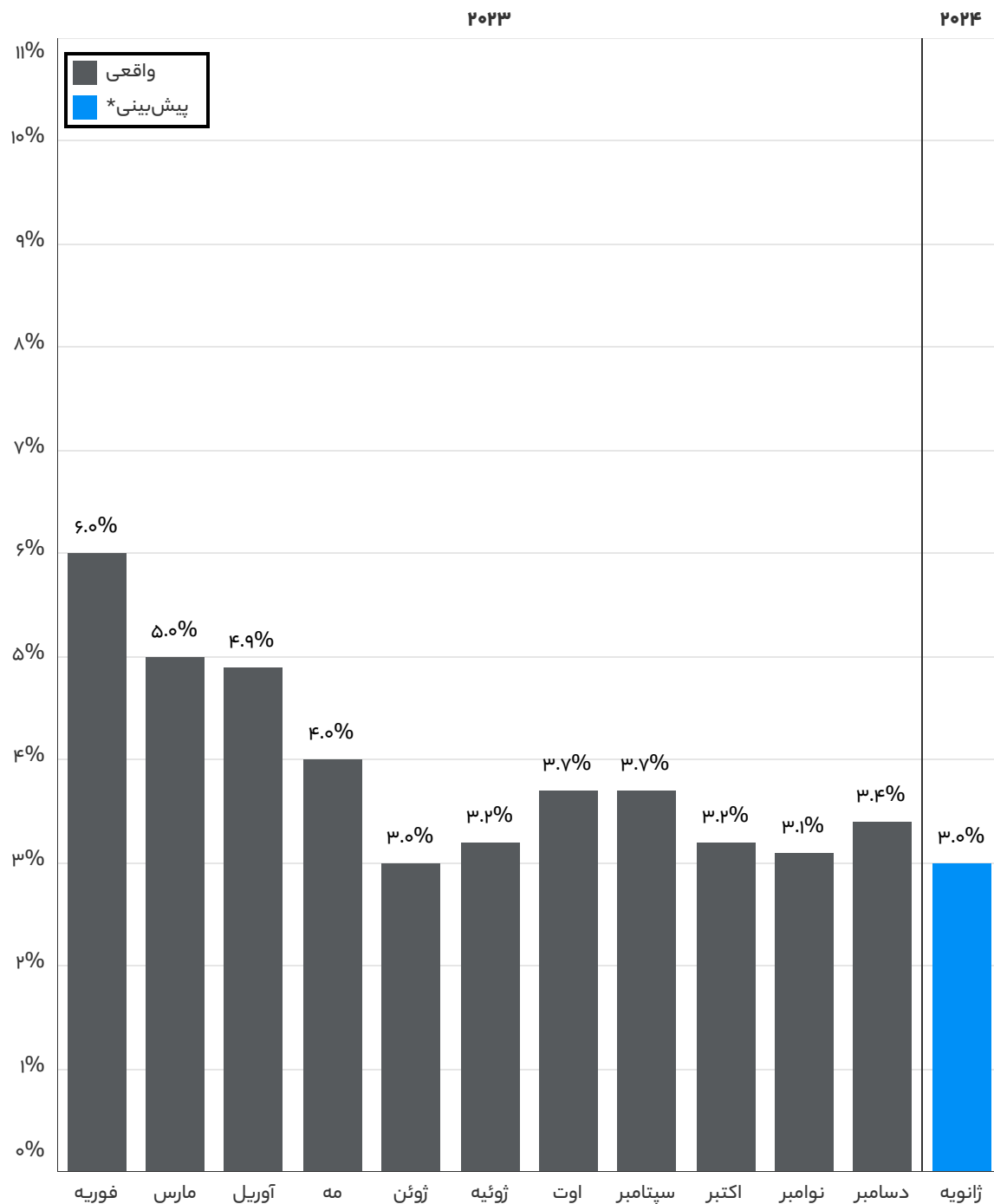
\* قیمت سیمان بر اساس سیمان تب ۲ فله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▼ به گزارش رویترز، عصر روز جمعه ۱۳ بهمن ماه، گزارش بهتر از حد انتظار لیست حقوق بگیران بخش غیرکشاورزی در آمریکا شاخص دلار را به شدت افزایش داد و سود اوراق قرضه خزانه داری این کشور را نیز بالا برد و باعث افت ۲۵ دلاری قیمت جهانی طلا شد. با وجود این که طی هفته های اخیر نوسانات طلا بالا بوده اما در هفته گذشته قیمت طلا نوسانات بالایی را تجربه نکرده و از ۲۰۳۵ تا ۲۰۲۵ در نوسان بوده است.
- بر اساس شیوه نامه نحوه برگزاری حراج حضوری شمش طلای استاندارد در مرکز مبادله ارز و طلای ایران، پنجمین جلسه حراج شمش طلای استاندارد در روز یکشنبه مورخ ۱۵ بهمن ماه ۱۴۰۲، انجام شد که وجه الضمان هر قطعه شمش طلای استاندارد ۳۵۰ میلیون تومان بود. در این جلسه در مجموع ۱۱۲ شمش یک کیلویی عرضه و از این تعداد ۹۴ شمش مورد معامله قرار گرفت. متوسط قیمت شمش در این حراج سه میلیارد و ۵۳۵ میلیون تومان بود. سخنگوی مرکز مبادله ارز و طلا گفت: در کمتر از ۲۰ روز گذشته ۲۰۰ کیلوگرم شمش طلا طی پنج مرحله حراج در مرکز مبادله ایران به فروش رسیده که تاثیر آن در کنترل بازارهای طلا و ارز نمایان شده است.
- احسان خاندوزی وزیر اقتصاد در پاسخ به مطرح شدن ابهاماتی در خصوص مسدود شدن حساب ۴۰۰ طلا فروش در روزهای گذشته گفت: این نکته ای که اشاره شد، محدود کردن ابزارهای کارکسبه و فعالان اقتصادی به شمار می رود که درست نیست، این گونه اقدامات محدودکننده باید آخرین مرحله ای باشد که پس از هشدارها اعمال شود. خاندوزی در خاتمه گفت: درباره آن تعدادی که به هر دلیل و اتهام حسابشان مسدود شده، دستگاه نظارتی تعیین تکلیف کند تا گره از کار آن ها باز شود.
- ▲ به گزارش رویترز، قیمت نفت حدود ۲ درصد در روز جمعه ۱۳ بهمن کاهش یافت و به پایین ترین سطح از ۱۸ ژانویه رسید و یک کاهش قیمت هفتگی را هم پس از انتشار اطلاعات اقتصادی آمریکا تجربه کرد اما در هفته گذشته روند صعودی را تجربه کرد و طی هفته از قیمت ۷۷ دلار تا بیش از ۸۱ دلار معامله شد.
- هیثم الغیس، دبیرکل اوپک که در هفته انرژی هند در گوا صحبت کرد، اعلام کرد تقاضا برای نفت، همچنان به رشد خود ادامه خواهد داد و ضرورت تامین حفظ عرضه وجود دارد. وی افزود: در سطح جهانی، تقاضا برای انرژی از هم اکنون تا سال ۲۰۴۵، به میزان ۲۳ درصد افزایش خواهد یافت. در واقع اگر کشورهای تولیدکننده به دنبال تامین نیازهای جهانی انرژی تا سال ۲۰۴۵ باشند، بازار جهانی نفت ظرف مدت ۲۰ سال آینده به ۱۴ تریلیون دلار سرمایه گذاری نیاز دارد.
- ▲ واردات نفت هند از روسیه در پی تشدید تحریم های غربی، در ژانویه، برای دومین ماه متوالی کاهش یافت و به پایین ترین میزان در یک سال گذشته رسید. داده های اولیه رصد کشتی ها نشان داد هند که سومین واردکننده بزرگ و مصرف کننده بزرگ نفت در جهان است، برای جبران کاهش واردات نفت از روسیه، واردات از عراق را افزایش داد. طبق داده های شرکت مالی LSEG، واردات نفت از روسیه در ژانویه، با ۴.۲ درصد کاهش، به ۱.۳ میلیون بشکه در روز رسید. داده های شرکت تحلیل داده ورتکسا، کاهش ۹ درصدی واردات، به ۱.۲ میلیون بشکه در روز را نشان داد.
- ▼ مصطفی ناظمی، کارشناس انرژی درباره نرخ نامه فرآورده و نفت خام پالایشگاه ها که به تازگی اعلام شده است، گفت: هنوز مشخص نیست که چرا در نرخ نامه های قبلی فوب سنگاپور مدنظر قرار می گرفت. نرخ نامه های سنگاپور با توجه به هزینه های حمل و نقل که در آنجا وجود دارد و همچنین این موضوع که بنزین با کیفیت بالاتری در آنجا عرضه می شود، قابل مقایسه با فرآورده هایی که در ایران و خاورمیانه تولید می شود، نیست. با این کار عملاً یک مشوق نامشخص به پالایشگاه ها می دادیم اما امسال دولت با دید منصفانه تری به نرخ گذاری پرداخته و نرخ هایی که در نزدیک ترین مبداء رسمی کشور وجود دارد، یعنی خلیج فارس مدنظر قرار گرفته است و خرید فرآورده پالایشگاه ها با نرخ فوب سنگاپور فقط در صورت ارتقای کیفیت صورت می گیرد.
- ▲ ولی اله جعفری، مدیر نظارت بر ناشران سازمان بورس و اوراق بهادار در گفت و گو با خبرنگار پایگاه خبری بازار سرمایه ایران (سنا)، گفت: پس از ابلاغ مصوبه مورخ ۲۱ تیر ماه ۱۴۰۲ عوارض صادراتی محصولات خام و نیمه خام و افزایش چند برابری نرخ عوارض و در نتیجه تاثیر کاهنده آن بر سودآوری شرکت ها، این سازمان اقدام به پیگیری از مراجع ذیصلاح مبنی بر بازنگری در مصوبه یاد شده کرد. وی افزود: متعاقب پیگیری های انجام شده، اخیراً کمیسیون اقتصادی دولت و هیات دولت اقدام به بازنگری در نرخ عوارض صادراتی محصولات خام و نیمه خام و کاهش آن کرده است.
- به گزارش انجمن غلات ایران، در این نامه که خطاب به وزیر جهاد کشاورزی ارسال شده، پیشنهاد شده که برای حمایت از تولید داخل و کارخانجات روغن کشی، دانه سویا در فهرست تهاثر نفت قرار گیرد. پیش از این قائم مقام وزیر جهاد کشاورزی در امور تجارت و تنظیم بازار، از انجام موفق ۲ مرحله تهاثر نفت با کالای اساسی خبر داده بود.



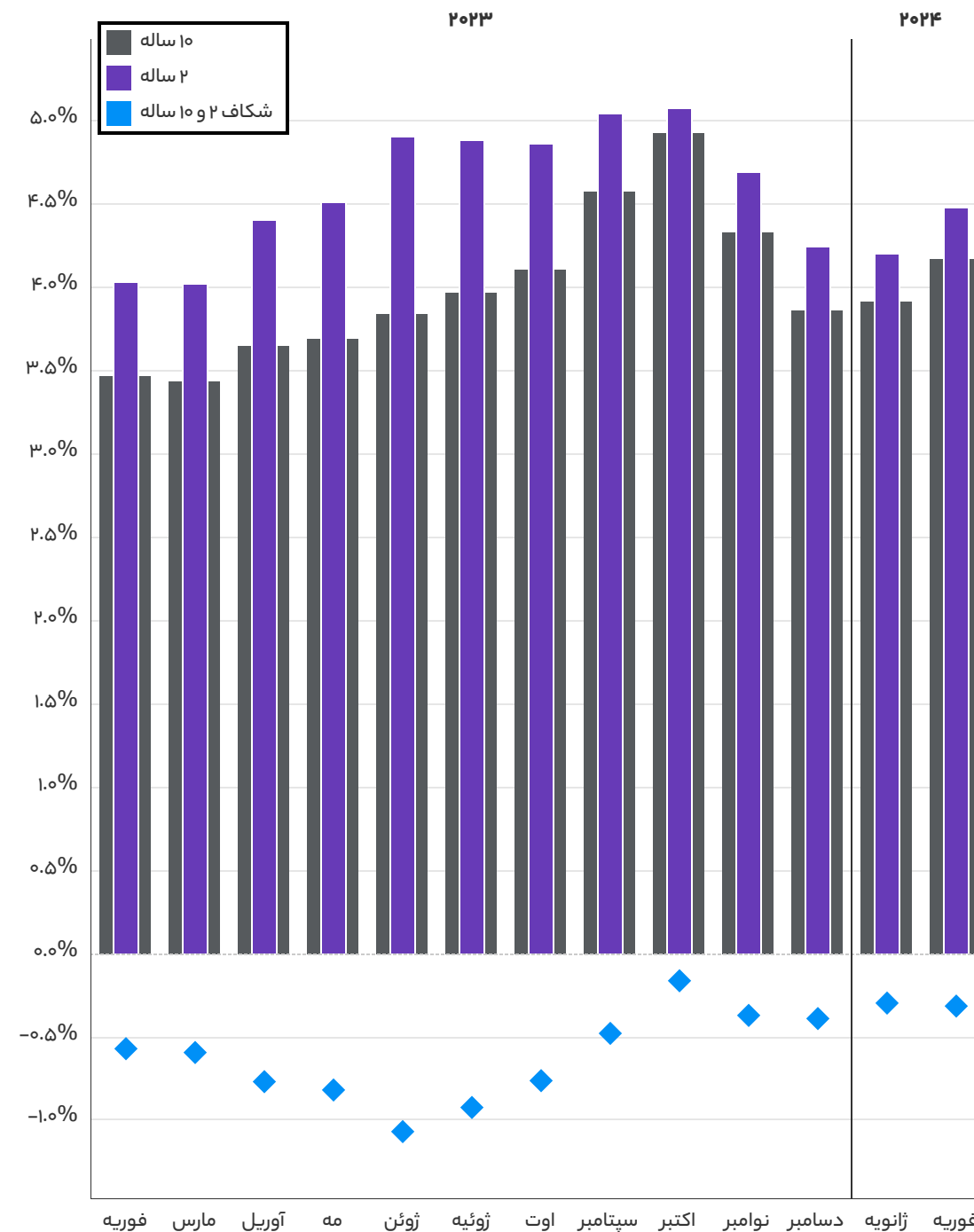
## شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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

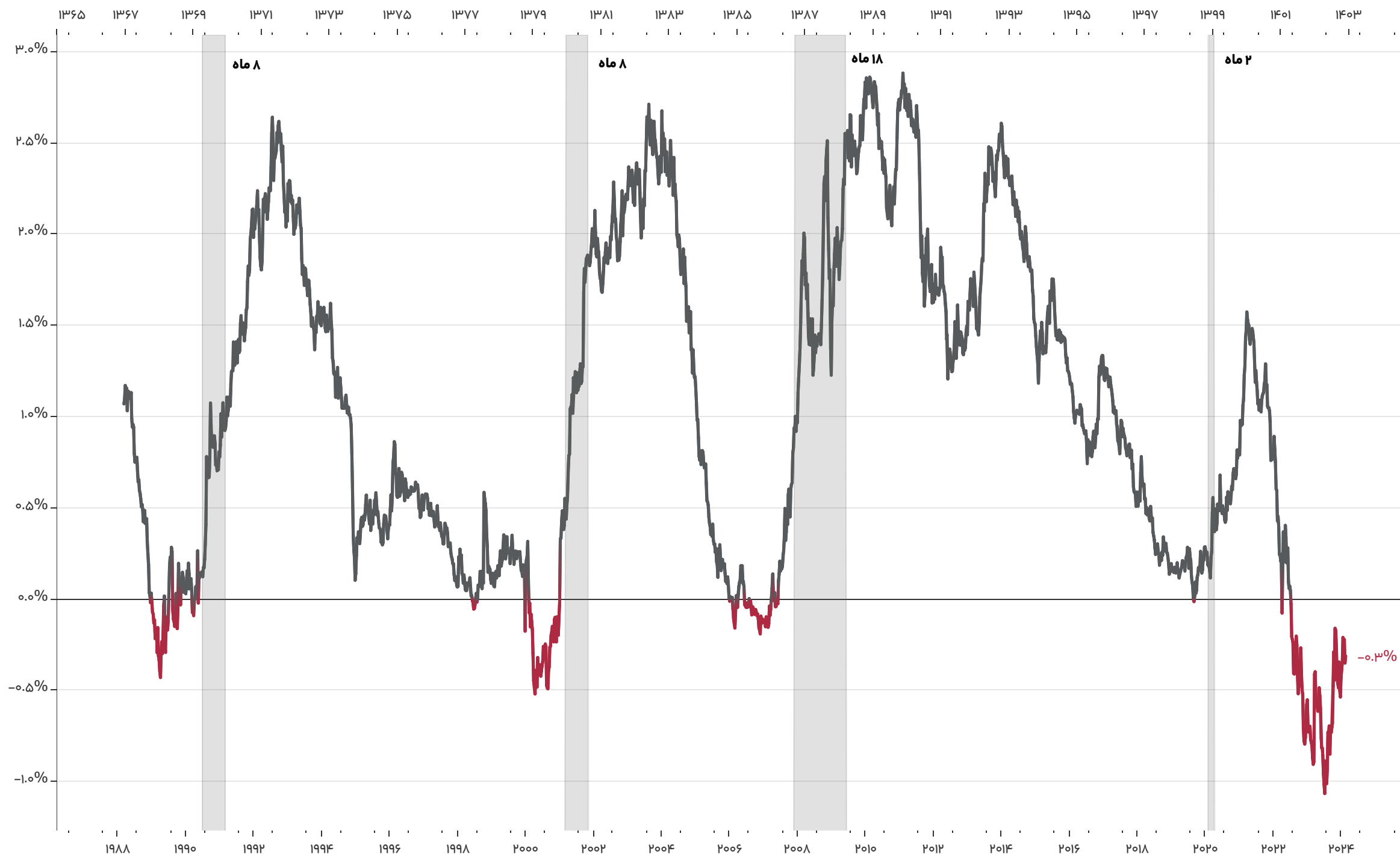






## شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

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

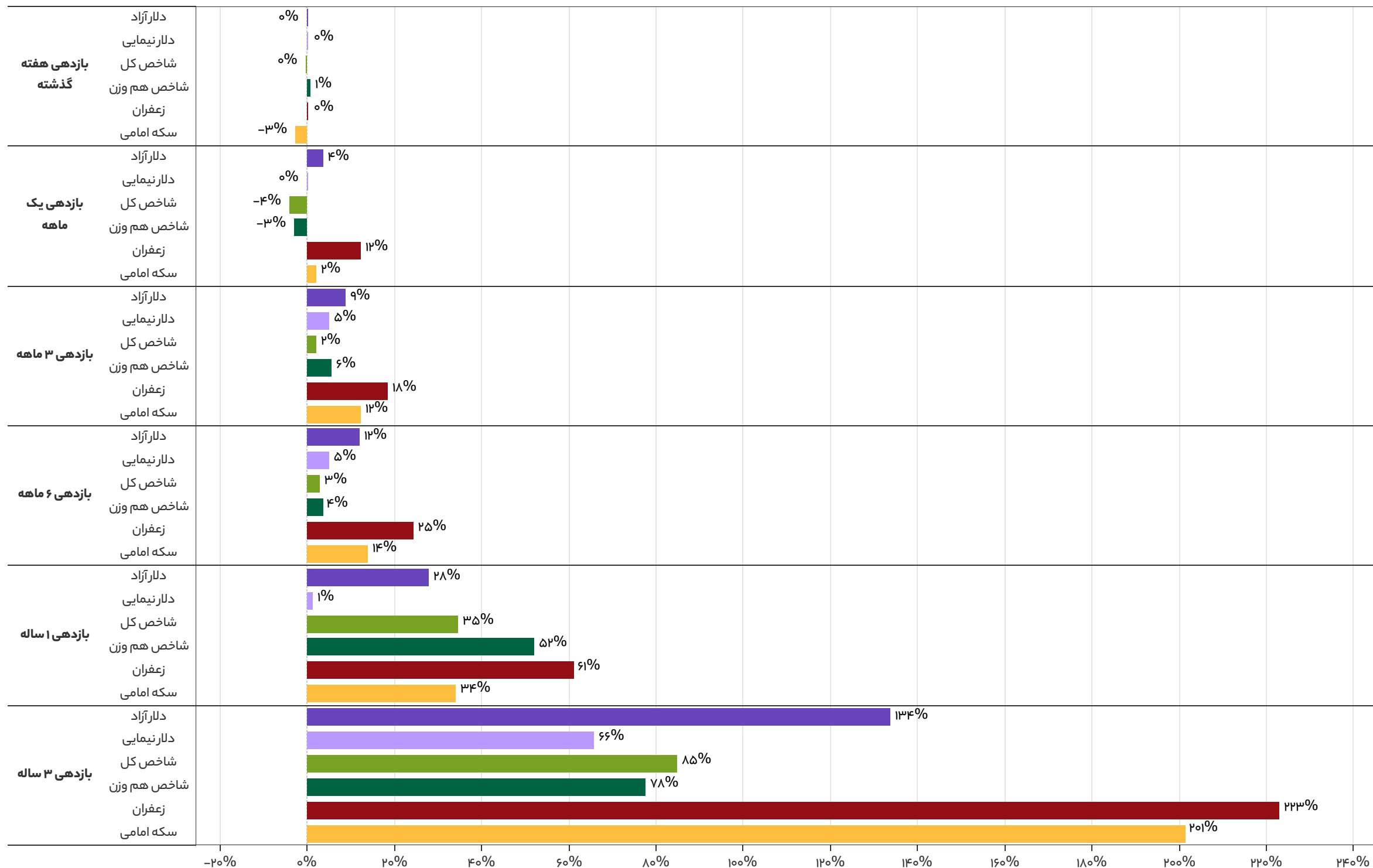
EQUITY MARKET

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           |                       |                       |                       |                       |                       |                       |                       |                       |                       |                       |                       | بازده سال             | نوسان              |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|
| ۱۴۰۱/۱۱                | ۱۴۰۱/۱۲               | ۱۴۰۲/۰۱               | ۱۴۰۲/۰۲               | ۱۴۰۲/۰۳               | ۱۴۰۲/۰۴               | ۱۴۰۲/۰۵               | ۱۴۰۲/۰۶               | ۱۴۰۲/۰۷               | ۱۴۰۲/۰۸               | ۱۴۰۲/۰۹               | ۱۴۰۲/۱۰               | هم وزن<br>▲ ۵۸.۲%     | هم وزن<br>۴۲%      |
| سکه امامی<br>▲ ۱۷.۷%   | شاخص کل<br>▲ ۳۰.۳%    | هم وزن<br>▲ ۲۹.۷%     | مسکن<br>▲ ۱۳.۴%       | مسکن<br>▲ ۴.۰%        | زعفران<br>▲ ۱۲.۳%     | زعفران<br>▲ ۳.۶%      | شاخص کل<br>▲ ۹.۳%     | سکه امامی<br>▲ ۴.۱%   | زعفران<br>▲ ۹.۲%      | شاخص کل<br>▲ ۹.۴%     | دلار آزاد<br>▲ ۸.۸%   | شاخص کل<br>▲ ۴۱.۳%    | شاخص کل<br>۴۰%     |
| دلار آزاد<br>▲ ۱۴.۷%   | هم وزن<br>▲ ۲۴.۳%     | شاخص کل<br>▲ ۱۶.۴%    | دلار نیمایی<br>▲ ۲.۸% | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۸%  | سکه امامی<br>▲ ۳.۳%   | هم وزن<br>▲ ۸.۸%      | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | هم وزن<br>▲ ۱.۹%      | هم وزن<br>▲ ۸.۳%      | سکه امامی<br>▲ ۸.۸%   | سکه امامی<br>▲ ۲۵%    | مسکن<br>۲۱%        |
| زعفران<br>▲ ۱۴.۵%      | مسکن<br>▲ ۱۴.۲%       | دلار آزاد<br>▲ ۳.۷%   | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | دلار نیمایی<br>▼ ۰.۵% | دلار آزاد<br>▲ ۰.۰%   | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | دلار آزاد<br>▲ ۱.۵%   | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | دلار نیمایی<br>▲ ۲.۲% | زعفران<br>▲ ۴.۹%      | زعفران<br>▲ ۳۲.۱%     | مسکن<br>۲۰%        |
| دلار نیمایی<br>▲ ۱۲.۷% | سکه امامی<br>▲ ۹.۷%   | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | زعفران<br>▲ ۱.۶%      | زعفران<br>▼ ۱.۰%      | دلار نیمایی<br>▼ ۱.۷% | دلار آزاد<br>▲ ۱.۴%   | زعفران<br>▲ ۱.۳%      | مسکن<br>▲ ۱.۰%        | دلار نیمایی<br>▲ ۰.۴% | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | دلار نیمایی<br>▲ ۲.۲% | درآمد ثابت<br>▲ ۲۳.۶% | مسکن<br>۲۰%        |
| مسکن<br>▲ ۹.۹%         | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | مسکن<br>▲ ۱.۸%        | دلار آزاد<br>▲ ۰.۸%   | هم وزن<br>▼ ۲.۳%      | مسکن<br>▼ ۲.۲%        | دلار نیمایی<br>▲ ۰.۱% | دلار آزاد<br>▲ ۰.۲%   | دلار نیمایی<br>▼ ۰.۱% | دلار آزاد<br>▲ ۰.۱%   | زعفران<br>▲ ۱.۵%      | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۱%  | دلار آزاد<br>▲ ۹.۶%   | زعفران<br>۲۰%      |
| درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%   | زعفران<br>▲ ۰.۸%      | زعفران<br>▼ ۰.۱%      | سکه امامی<br>▲ ۰.۴%   | شاخص کل<br>▼ ۵.۶%     | سکه امامی<br>▼ ۳.۵%   | مسکن<br>▼ ۱.۰%        | دلار نیمایی<br>▼ ۰.۱% | شاخص کل<br>▼ ۴.۱%     | سکه امامی<br>▼ ۰.۱%   | سکه امامی<br>▲ ۰.۸%   | هم وزن<br>▼ ۰.۹%      | سکه امامی<br>▲ ۹.۲%   | دلار آزاد<br>۱۸%   |
| شاخص کل<br>▼ ۷.۵%      | دلار آزاد<br>▲ ۰.۲%   | سکه امامی<br>▼ ۰.۴%   | هم وزن<br>▼ ۰.۶%      | دلار آزاد<br>▼ ۶.۱%   | هم وزن<br>▼ ۶.۲%      | شاخص کل<br>▼ ۲.۳%     | مسکن<br>▼ ۰.۶%        | هم وزن<br>▼ ۴.۴%      | مسکن<br>▼ ۰.۴%        | دلار آزاد<br>▼ ۰.۸%   | شاخص کل<br>▼ ۲.۰%     | دلار نیمایی<br>▲ ۱.۳% | دلار نیمایی<br>۱۴% |
| هم وزن<br>▼ ۸.۷%       | دلار نیمایی<br>▼ ۲.۰% | دلار نیمایی<br>▼ ۱.۸% | شاخص کل<br>▼ ۱.۰%     | سکه امامی<br>▼ ۱۱.۱%  | شاخص کل<br>▼ ۸.۸%     | هم وزن<br>▼ ۵.۲%      | سکه امامی<br>▼ ۱.۶%   | زعفران<br>▼ ۴.۷%      | شاخص کل<br>▼ ۰.۶%     | مسکن<br>▼ ۲.۲%        | مسکن                  | مسکن                  | درآمد ثابت<br>۰%   |

- بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر 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 سرخیز 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.



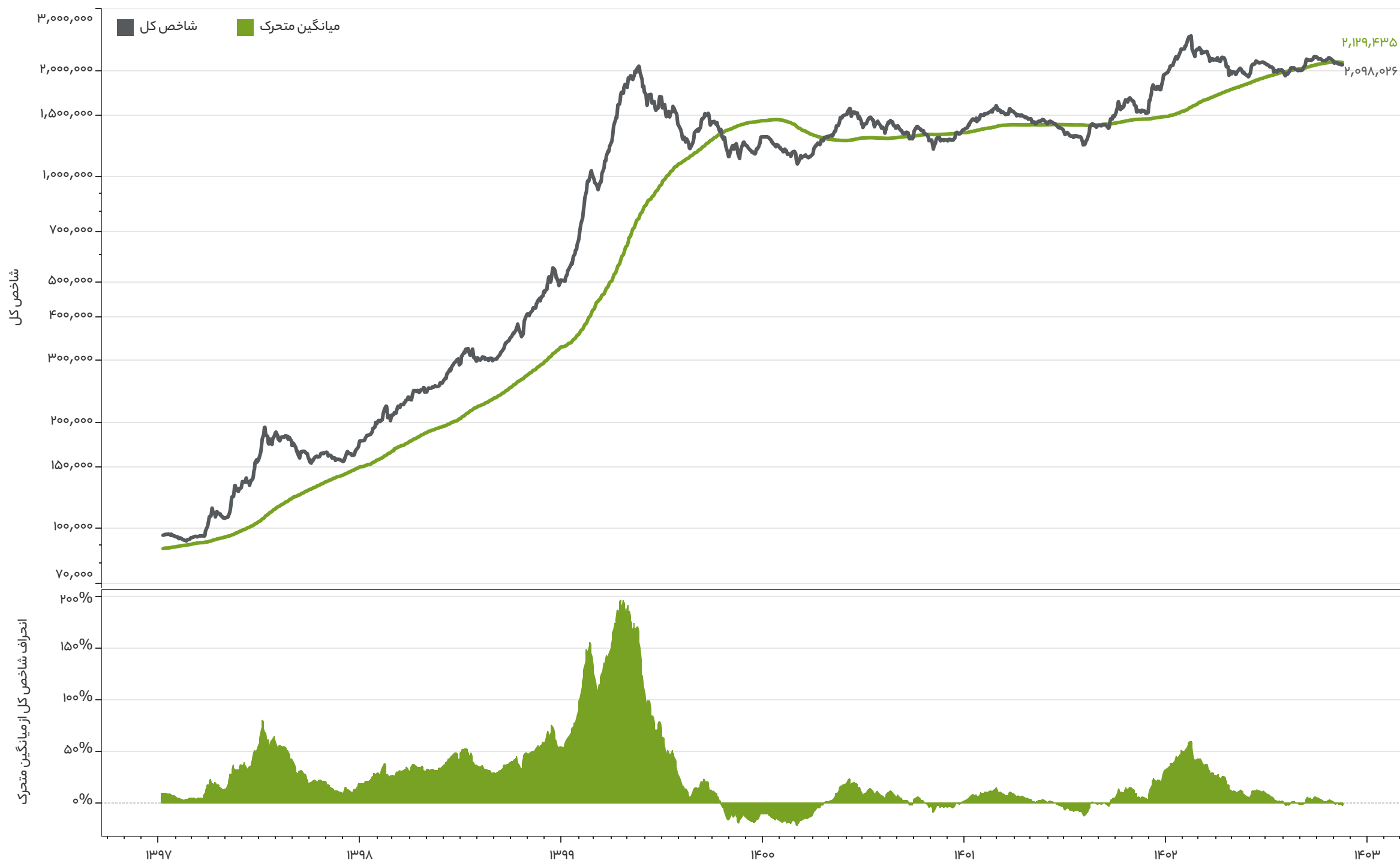
## ارزش دلاری بازار

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

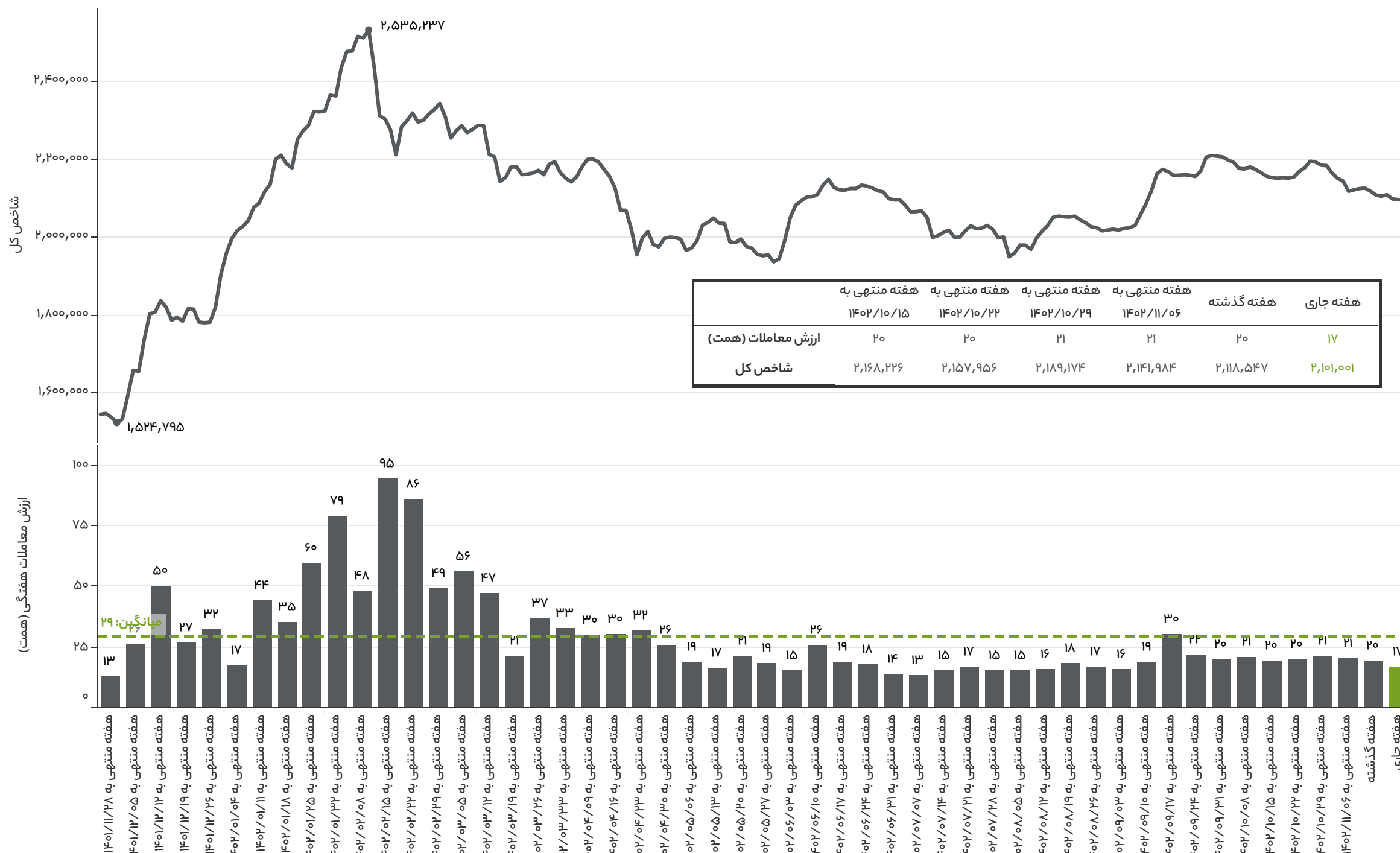
از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس





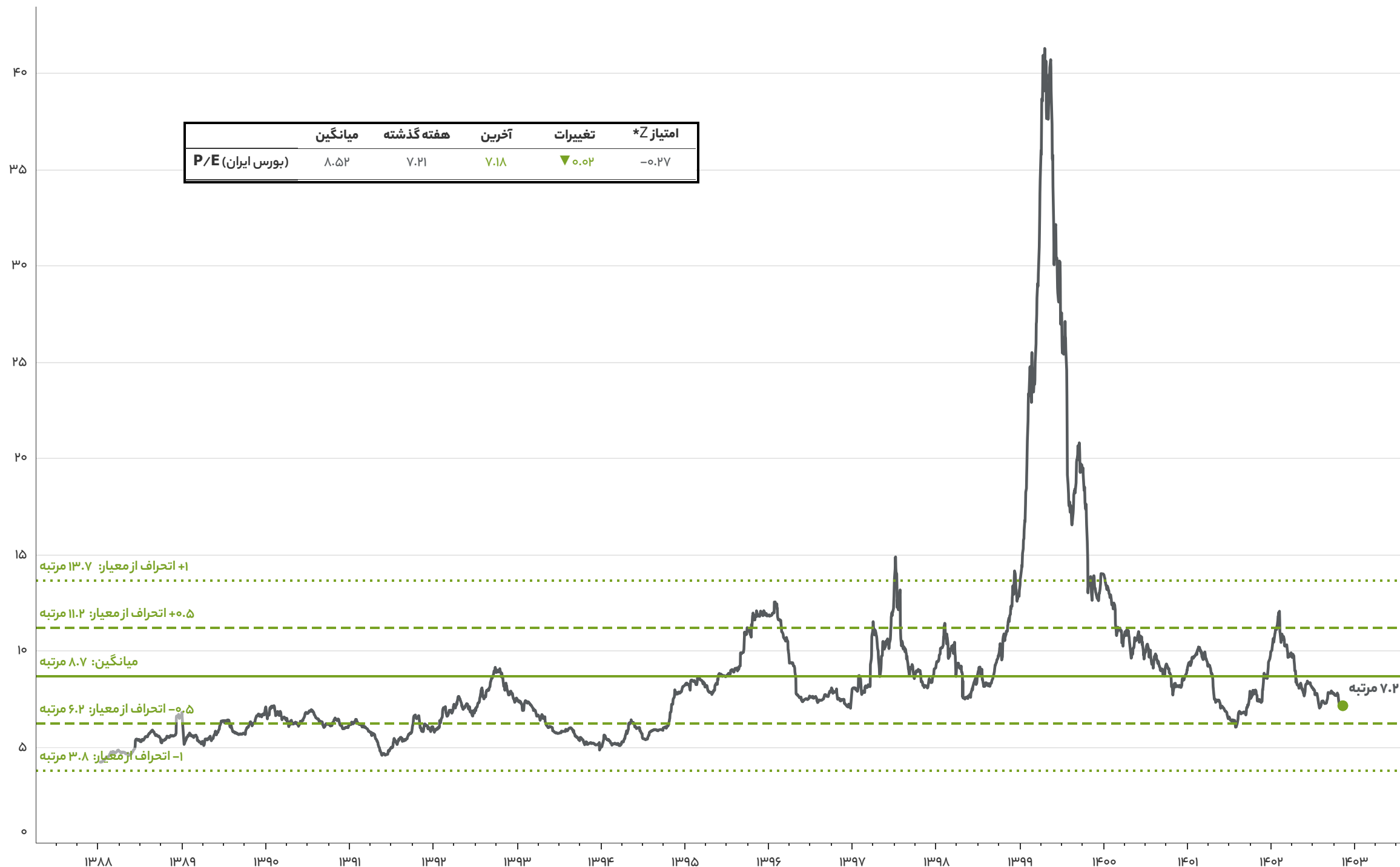
## ارزش معاملات هفتگی بازار

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 | پیشینه ۴ ساله |
|-----------------|------------|------------|--------------|----------------|---------------|
| بورس ایران      | ۷.۱۸       | ۷.۲۱       | ۶.۰۷         | ۱۲.۷۲          | ۴۱.۳۳         |
| بورس تهران      | ۶.۸۹       | ۶.۹۱       | ۵.۶۴         | ۱۲.۵۰          | ۴۱.۹۹         |
| فرابورس         | ۹.۱۳       | ۹.۲۲       | ۹.۰۳         | ۱۴.۹۴          | ۴۳.۵۱         |

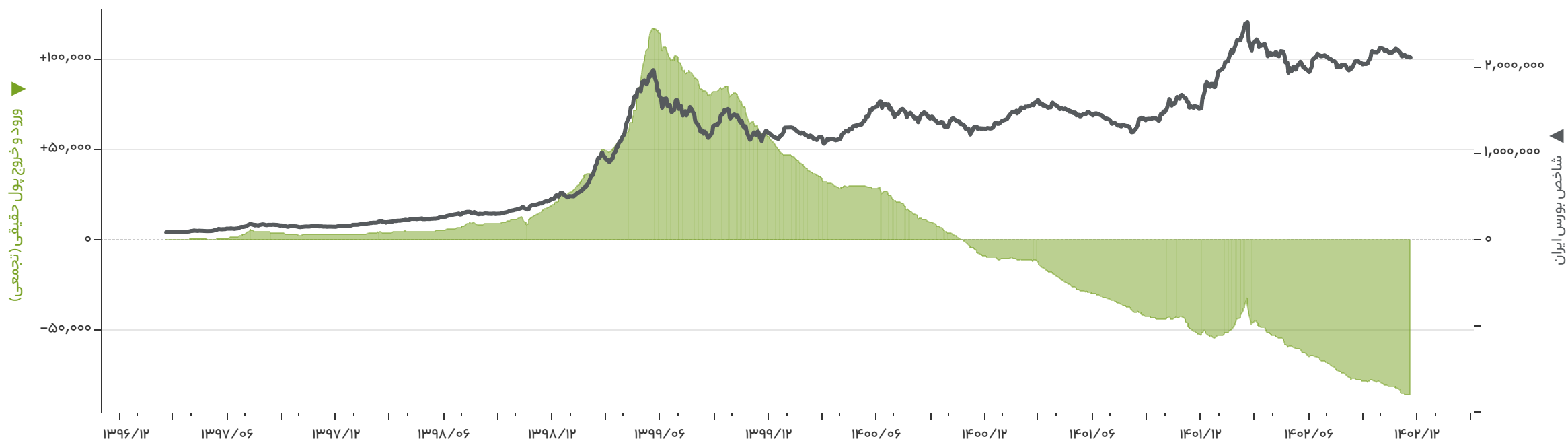


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

|                                         | املاک و مستغلات | یوتیلیتی | تکنولوژی | ارتباطات | بهداشت | صنعتی | غیردوره‌ای مصرفی | مصرفی دوره‌ای | انرژی | خدمات مالی | مواد پایه |                 |
|-----------------------------------------|-----------------|----------|----------|----------|--------|-------|------------------|---------------|-------|------------|-----------|-----------------|
| تعداد سهام                              | ۲۸              | ۱۱       | ۱۹       | ۵        | ۴۰     | ۶۳    | ۸۹               | ۶۶            | ۶     | ۱۹۹        | ۱۸۸       | وزن             |
| ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)         | ۶۶              | ۸۶       | ۱۱۵      | ۱۱۸      | ۱۵۵    | ۱۹۵   | ۲۱۰              | ۳۸۰           | ۵۹۴   | ۳,۲۰۴      | ۳,۲۶۴     |                 |
| سهام هر سکتور از ارزش بازار             | ۰.۸%            | ۱.۰%     | ۱.۴%     | ۱.۴%     | ۱.۹%   | ۲.۳%  | ۲.۵%             | ۴.۵%          | ۷.۱%  | ۳۸.۲%      | ۳۸.۹%     |                 |
| نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر        | ۱۵.۱            | ۱۱.۸     | ۱۷.۵     | ۱۱.۷     | ۸.۹    | ۸.۷   | ۱۰.۰             | ۵.۳           | ۴.۳   | ۷.۰        | ۷.۲       | سودآوری         |
| بازده سود نقدی                          | ۲.۶%            | ۱۷.۵%    | ۲.۸%     | ۳.۴%     | ۷.۱%   | ۳.۸%  | ۴.۵%             | ۲.۳%          | ۱۵.۲% | ۹.۲%       | ۹.۰%      |                 |
| نسبت تقسیم سود                          | ۳۹%             | ۱۰۰%     | ۵۸%      | ۴۱%      | ۷۶%    | ۳۸%   | ۵۳%              | ۳۴%           | ۶۳%   | ۶۲%        | ۷۳%       |                 |
| بتا به شاخص کل                          | ۰.۹             | ۱.۱      | ۰.۷      | ۱.۴      | ۰.۸    | ۱.۲   | ۰.۸              | ۱.۰           | ۱.۱   | ۱.۰        | ۱.۰       | β               |
| بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱) | +۷۸۱%           | +۷۵۹%    | +۲۹۶%    | +۱۴۰%    | +۳۸۱%  | +۴۴۳% | +۴۲۵%            | +۸۶۶%         | +۷۶۲% | +۸۵۳%      | +۹۲۴%     | بازده بلندمدت   |
| بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)         | +۲۳%            | +۱۱۰%    | ۰%       | -۶۲%     | +۱۴%   | -۶%   | -۲%              | -۱۱%          | +۱۲%  | ۰%         | +۶۰%      |                 |
| بازده از ابتدای سال                     | +۲۹۴%           | +۳۹%     | +۷۱%     | +۵۴%     | +۹۲%   | +۱۱۱% | +۵۴%             | +۹۴%          | +۸۳%  | +۶۷%       | +۸۰%      | بازده کوتاه‌مدت |
| بازده هفته گذشته                        | ۴%              | ۰%       | ۰%       | ۵%       | ۱%     | ۲%    | 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



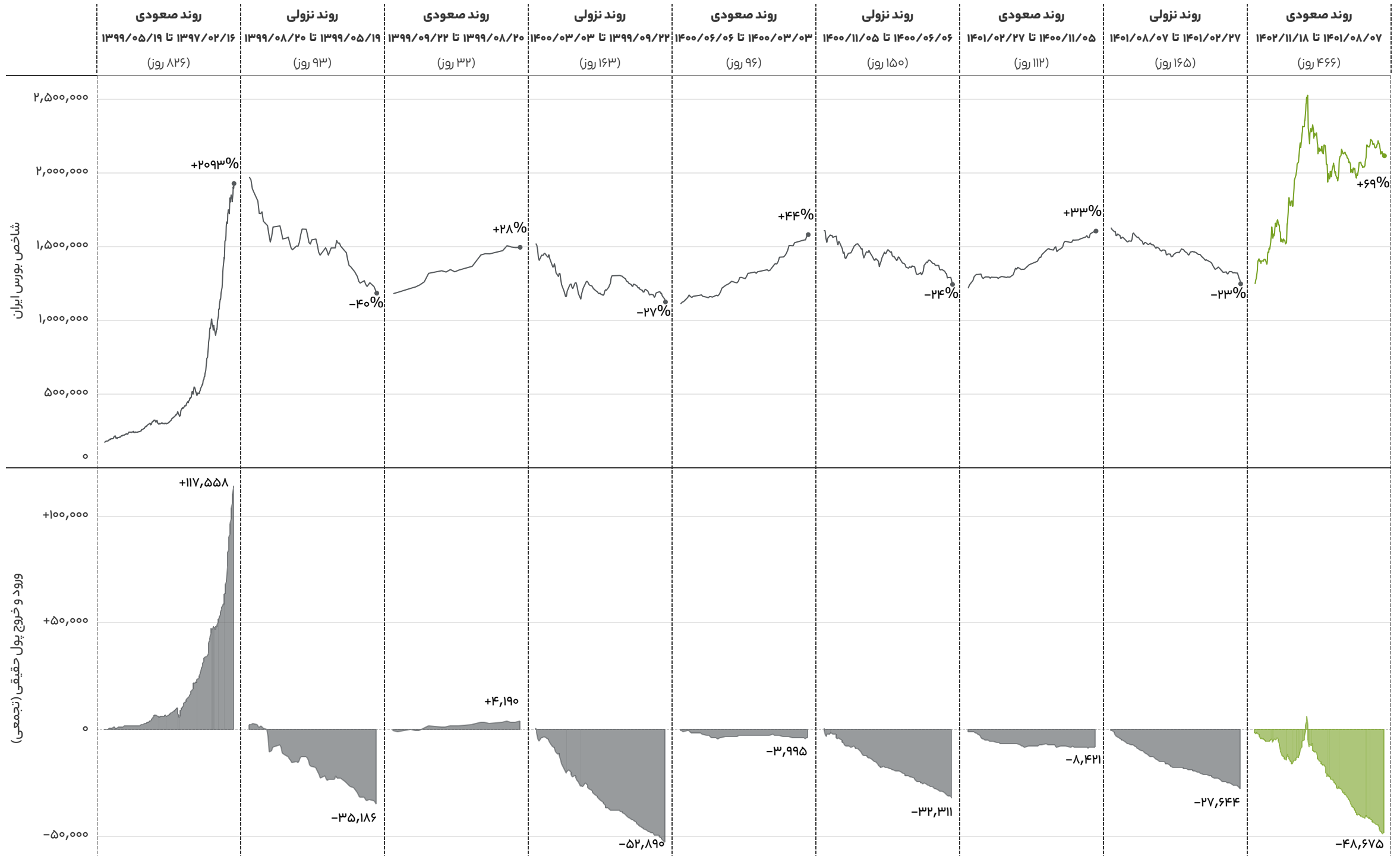
## ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

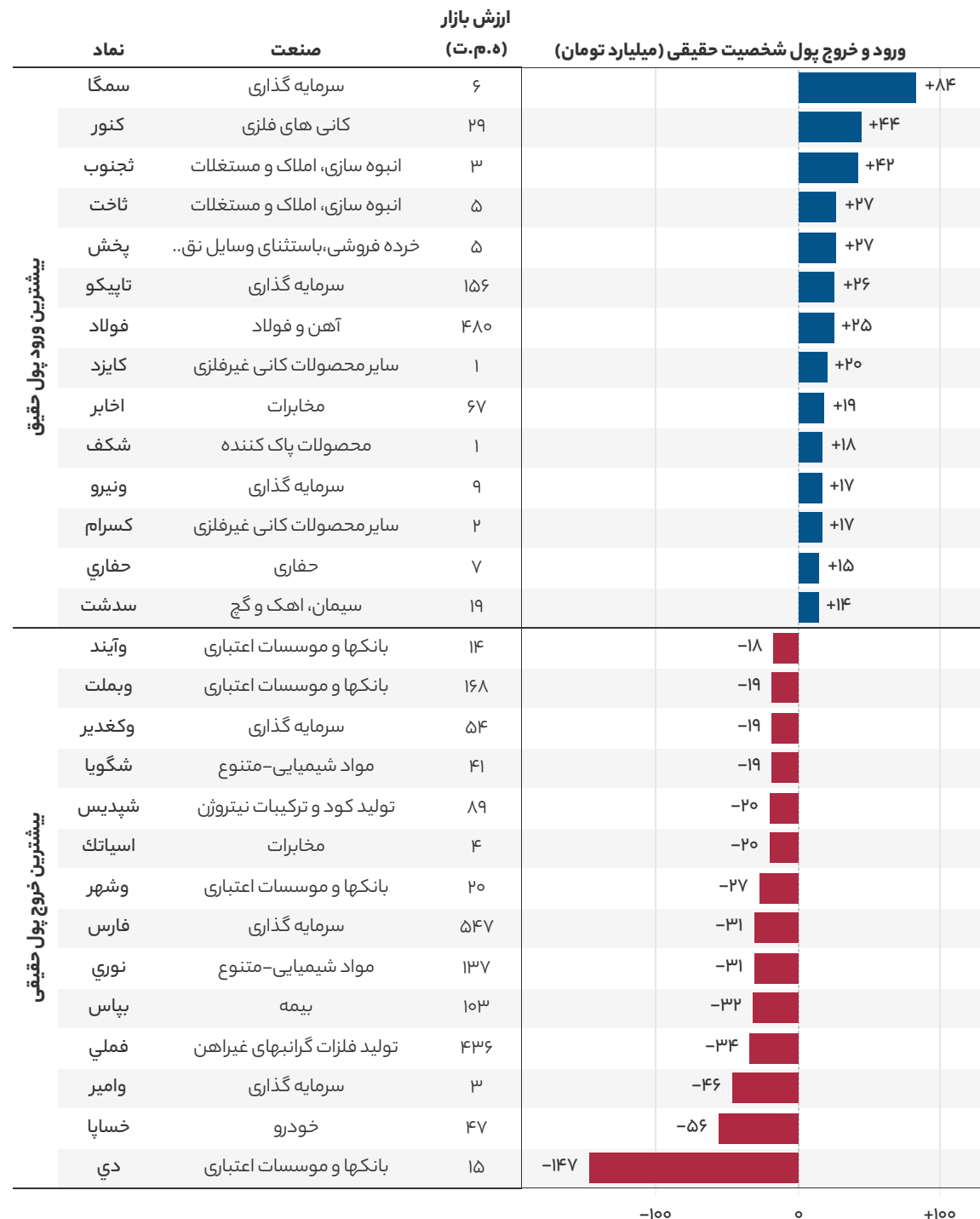
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



# ورود و خروج پول

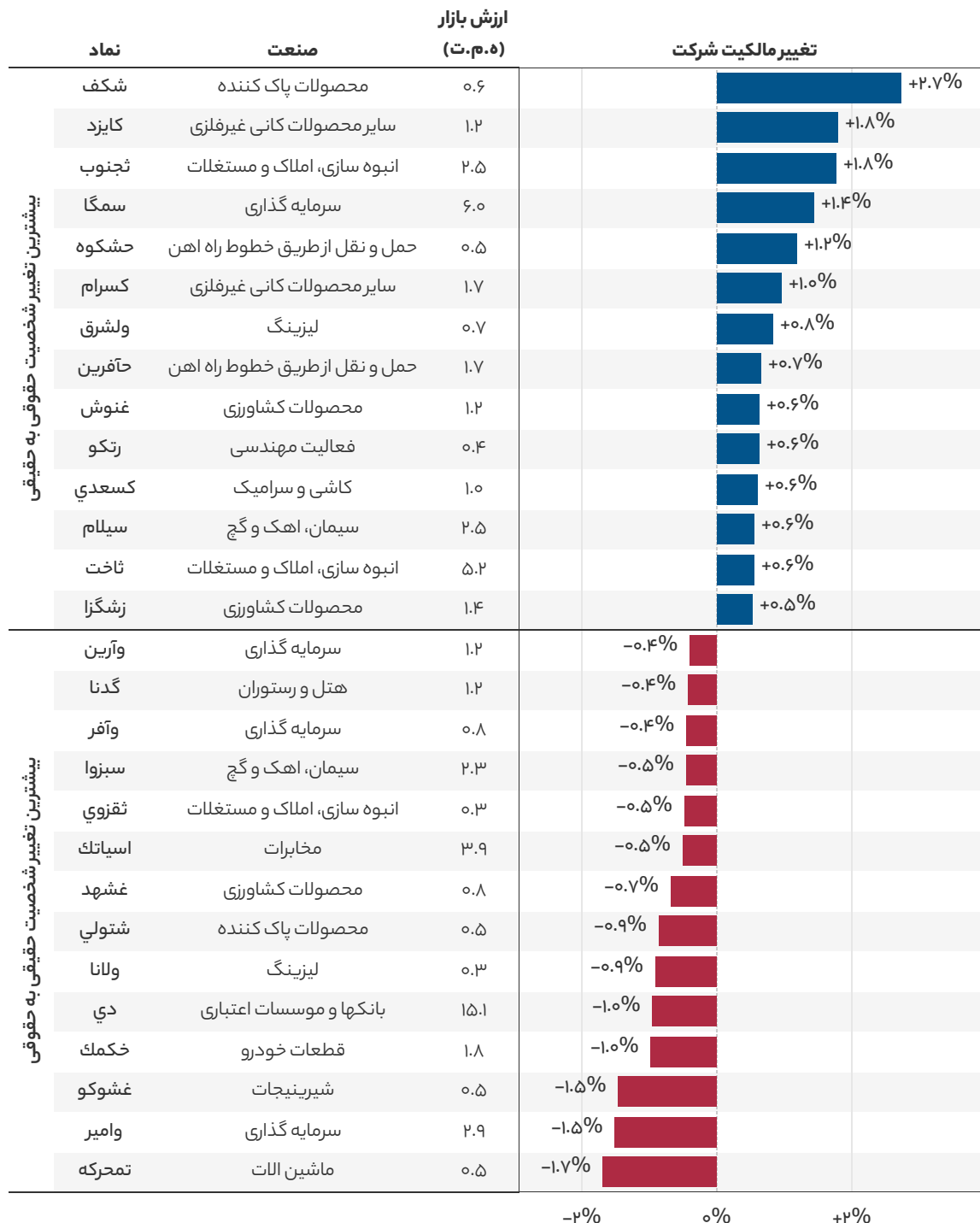
## ورود و خروج پول حقیقی

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



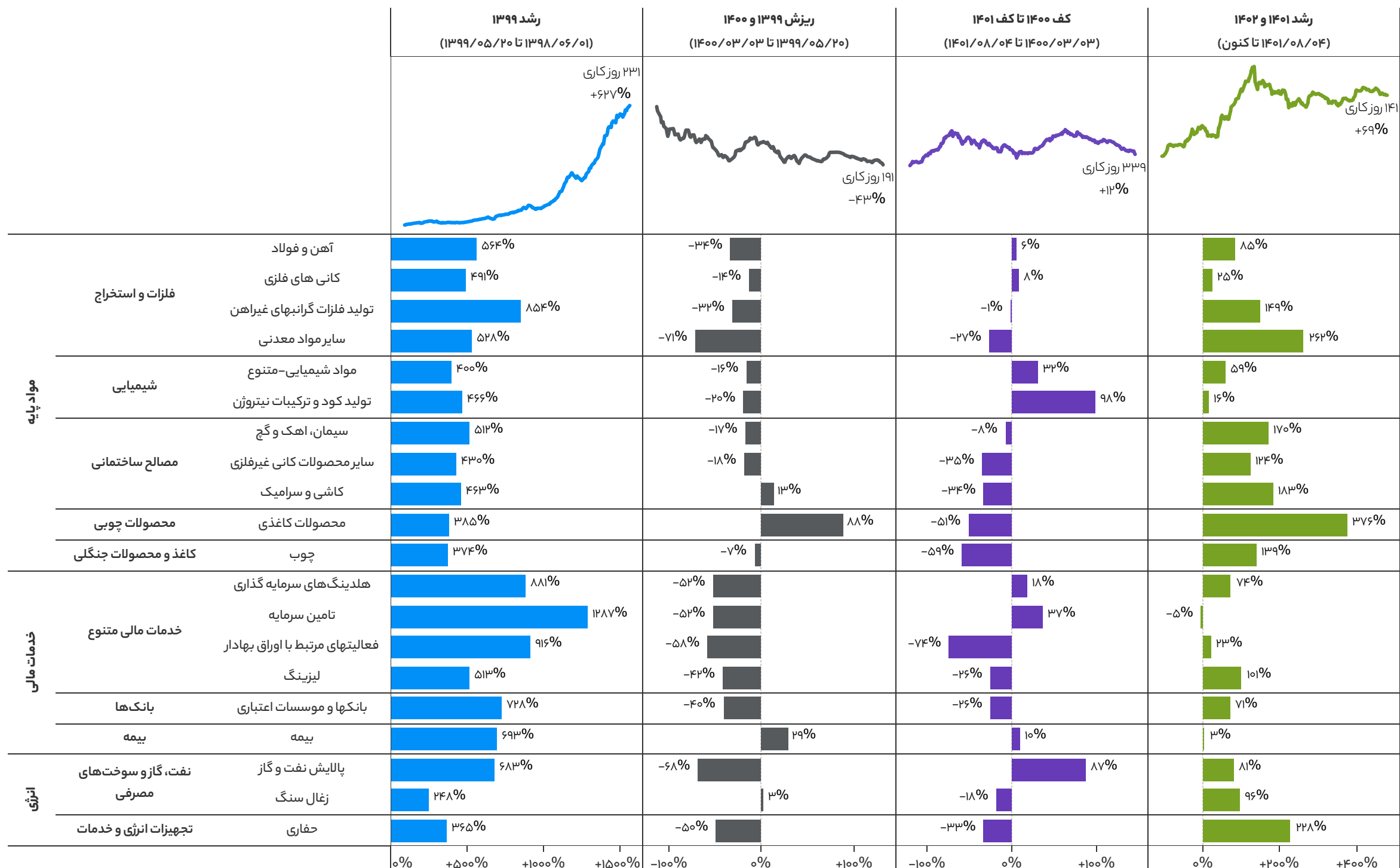
## تغییر مالکیت شرکت

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





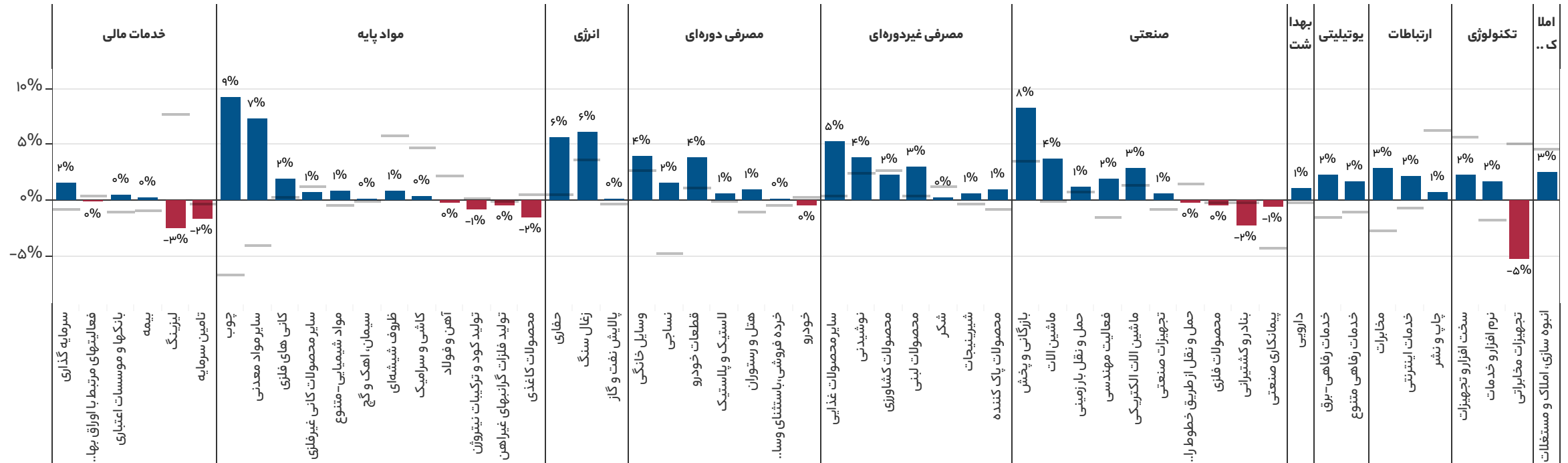
## بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

| رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲       |                           |                     | کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱ |      | ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰ |       | رشد ۱۳۹۹ |  |
|-----------------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------|------------------|-------|----------|--|
| مصرفی دوره‌ای         | خودرو و قطعات             | خودرو               | ۴۷%                | ۱۳%  | -۷۰%             | ۱۲۴۷% |          |  |
|                       |                           | قطعات خودرو         | ۹۴%                | -۲۵% | -۳۲%             | ۶۷۶%  |          |  |
|                       |                           | لاستیک و پلاستیک    | ۱۶۶%               | -۴۲% | -۳۴%             | ۶۳۱%  |          |  |
|                       | کالای مصرفی با دوام       | وسایل خانگی         | ۱۶۳%               | -۳۶% | -۴۶%             | ۴۹۰%  |          |  |
|                       |                           | نساجی               | ۱۷۷%               | -۳۵% | -۲۱%             | ۳۸۰%  |          |  |
|                       | خرده فروشی                | خرده فروشی          | ۱۶۴%               | ۳%   | -۲۳%             | ۱۱۲۹% |          |  |
| مصرفی غیردوره‌ای      | خدمات مصرف کننده          | ۲۲%                 | ۱۸%                | -۶۷% | ۱۱۶۶%            |       |          |  |
|                       | غذا و نوشیدنی             | محصولات کشاورزی     | ۳۶%                | ۹%   | -۳۵%             | ۳۹۷%  |          |  |
|                       |                           | شیرینیجات           | ۶۴%                | -۶۳% | -۲۴%             | ۵۹۵%  |          |  |
|                       |                           | شکر                 | ۸۵%                | -۴۴% | -۲۲%             | ۴۳۵%  |          |  |
|                       |                           | محصولات لبنی        | ۱۳۷%               | -۵۴% | ۷%               | ۳۸۳%  |          |  |
|                       |                           | سایر محصولات غذایی  | ۴۴%                | -۳۹% | -۳۴%             | ۶۹۹%  |          |  |
| نوشیدنی               |                           | ۶۴%                 | -۳۱%               | -۱۵% | ۵۳۹%             |       |          |  |
| صنعتی                 | محصولات شخصی و خانگی      | ۲۶%                 | -۱۲%               | ۴%   | ۳۰۶%             |       |          |  |
|                       | کالاهای سرمایه‌ای         | فعالیت مهندسی       | ۹۶%                | -۷%  | -۶۳%             | ۵۲۱%  |          |  |
|                       |                           | ماشین الات الکتریکی | ۷۸%                | -۲۳% | -۴۵%             | ۵۰۱%  |          |  |
|                       |                           | ماشین الات          | ۱۴۶%               | -۳۱% | -۳۵%             | ۴۲۲%  |          |  |
|                       |                           | محصولات فلزی        | ۱۳۶%               | -۴۴% | -۵۴%             | ۶۴۵%  |          |  |
|                       |                           | تجهیزات صنعتی       | ۶۹%                | -۴۰% | -۳۰%             | ۸۴۷%  |          |  |
| پیمانکاری صنعتی       |                           | ۹۹%                 | -۶۸%               | -۱۵% | ۵۲۵%             |       |          |  |
| ارتباطات              | بنادر و کشتیرانی          | ۲۳۶%                | -۱۵%               | -۲۲% | ۲۴۶%             |       |          |  |
|                       | حمل و نقل از طریق راه‌آهن | ۵۹%                 | -۴۱%               | -۱۳% | ۳۲۷%             |       |          |  |
|                       | حمل و نقل بارزمینی        | ۴۲%                 | ۳۳%                | -۱۸% | ۲۵۰%             |       |          |  |
| تکنولوژی              | بهداشت                    | ۹۲%                 | -۱۳%               | -۳۲% | ۳۲۱%             |       |          |  |
|                       | ارتباطات                  | ۵۲%                 | -۱۳%               | -۷۱% | ۵۳۲%             |       |          |  |
| یوتیلیتی              | رسانه و سرگرمی            | ۱۵۲%                | -۵۲%               | -۵۲% | ۲۲۳%             |       |          |  |
|                       | نرم افزار و خدمات         | ۵۳%                 | ۲%                 | -۳۵% | ۲۵۲%             |       |          |  |
| املاک و مستغلات       | سخت افزار و تجهیزات       | ۱۸۱%                | -۴۵%               | -۶۵% | ۵۷۰%             |       |          |  |
|                       | یوتیلیتی                  | ۳۹%                 | ۱۳۱%               | -۳۵% | ۳۱۰%             |       |          |  |
| مستغلات               | خدمات رفاهی - متنوع       |                     | -۳۳%               | -۵۴% | ۱۷۶%             |       |          |  |
|                       | خدمات رفاهی - برق         |                     |                    |      |                  |       |          |  |
| توسعه املاک و مستغلات |                           | ۲۹۴%                | -۴۵%               | -۴۳% | ۶۱۹%             |       |          |  |
|                       |                           |                     |                    |      |                  |       |          |  |



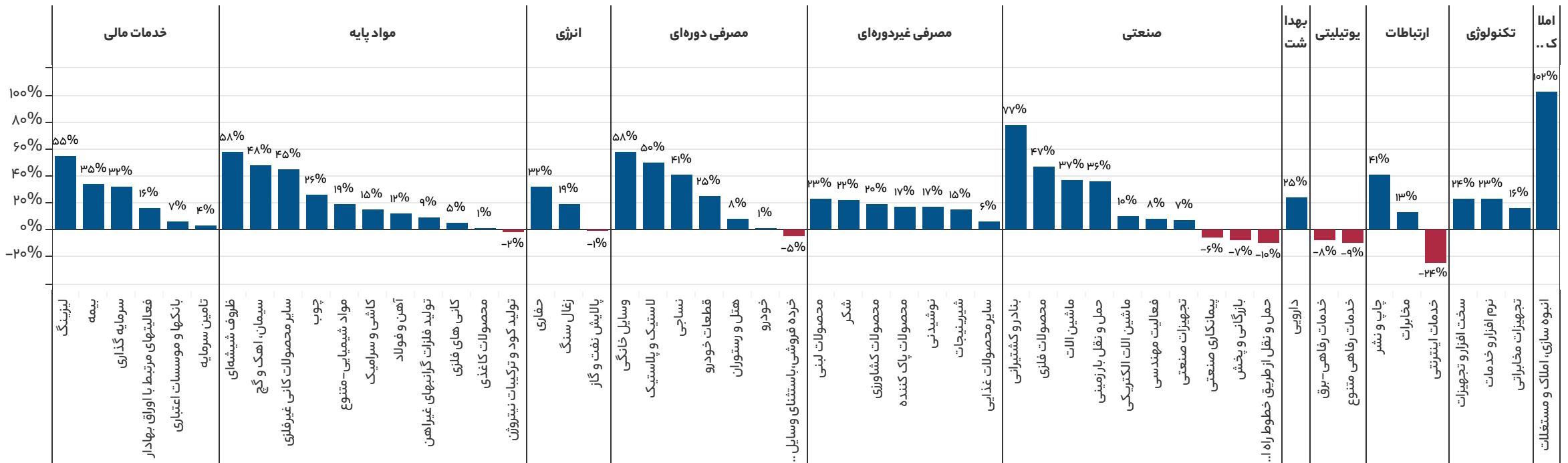
بازده صنايع از ابتداي هفته

(مرتب شده براساس سكتور، بازده تعديل شده، بازده هفته گزارش با نمودار ميله‌اي و بازده هفته گذشته با خط هاي خاكستري رنگ نشان داده شده‌است)



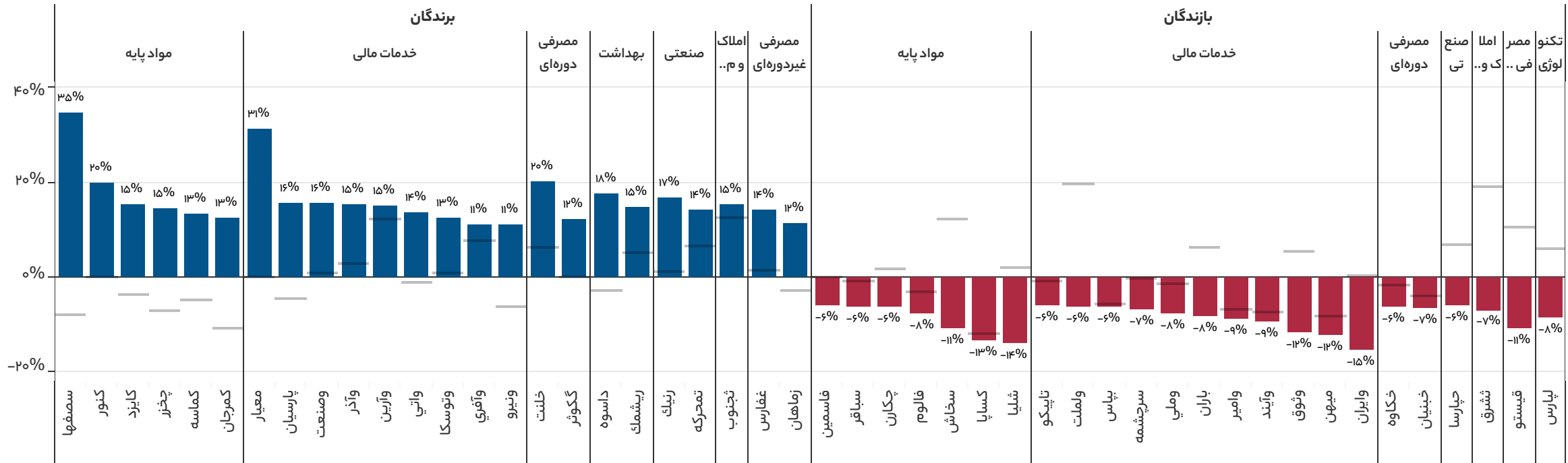
بازده صنايع از ابتداي سال

(مرتب شده براساس سكتور، بازده تعديل شده)



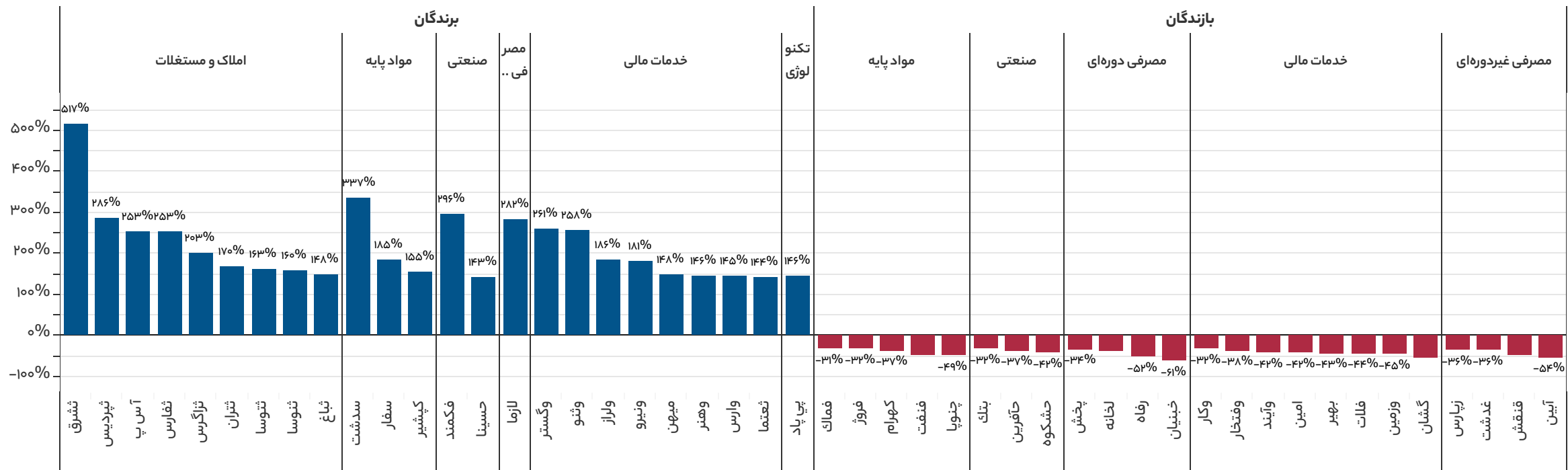
## برندگان و بازندگان هفته

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

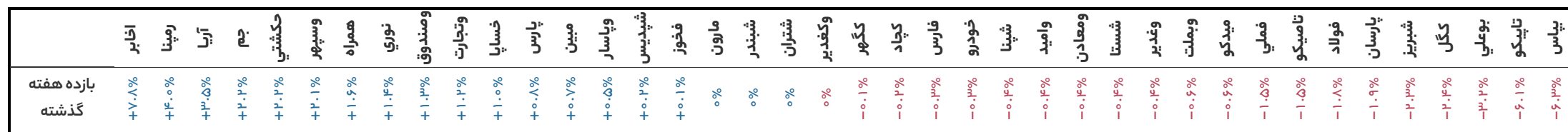


## برندگان و بازندگان سال

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



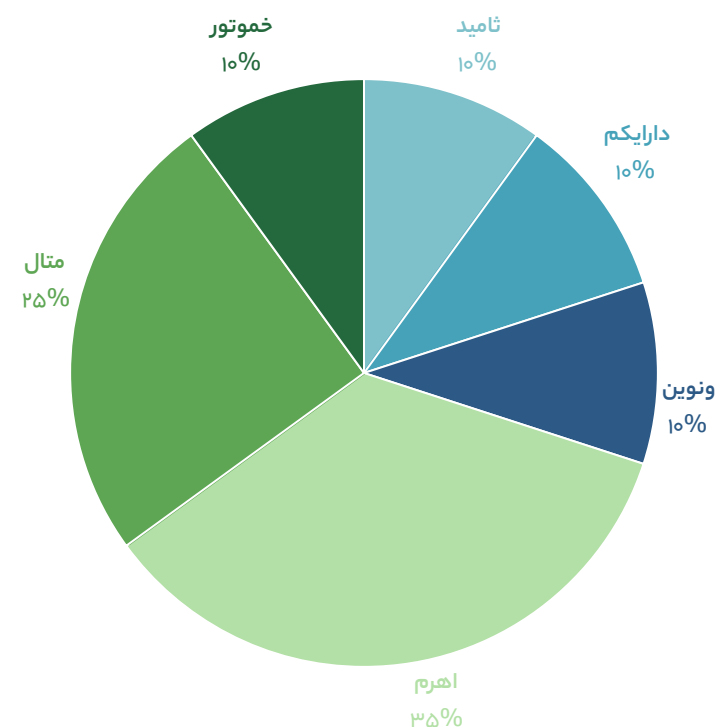
به تفکیک سکتور، بازده تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم





## سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



| وزن پیشنهادی | قیمت سهم | توضیحات                                                            | هدف قیمتی | نماد    | افق زمانی |
|--------------|----------|--------------------------------------------------------------------|-----------|---------|-----------|
| ۱۰%          | ۴,۰۵۲    | افزایش ظرفیت و نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب به صنعت (P/NAV) | ۴,۸۰۰     | خمتور   | میان مدت  |
| ۲۵%          | ۱۰,۸۹۰   | دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد                               | -         | متال    |           |
| ۳۵%          | ۲۱,۳۰۰   | دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد                               | -         | اهرم    |           |
| ۱۰%          | ۲,۳۷۸    | نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت                | ۲,۹۰۰     | تامید   | بلند مدت  |
| ۱۰%          | ۱۶۷,۹۶۰  | پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد     | ۲۱۰,۰۰۰   | دارایکم |           |
| ۱۰%          | ۶,۲۱۰    | نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب                        | ۷,۸۰۰     | ونوین   |           |

## ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

[www.charisma.ir](http://www.charisma.ir)

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

@CharismaHolding

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

[info@ciaco.ir](mailto:info@ciaco.ir)

پست الکترونیکی:

[www.ciaco.ir](http://www.ciaco.ir)

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

@CharismaTickReports

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

