

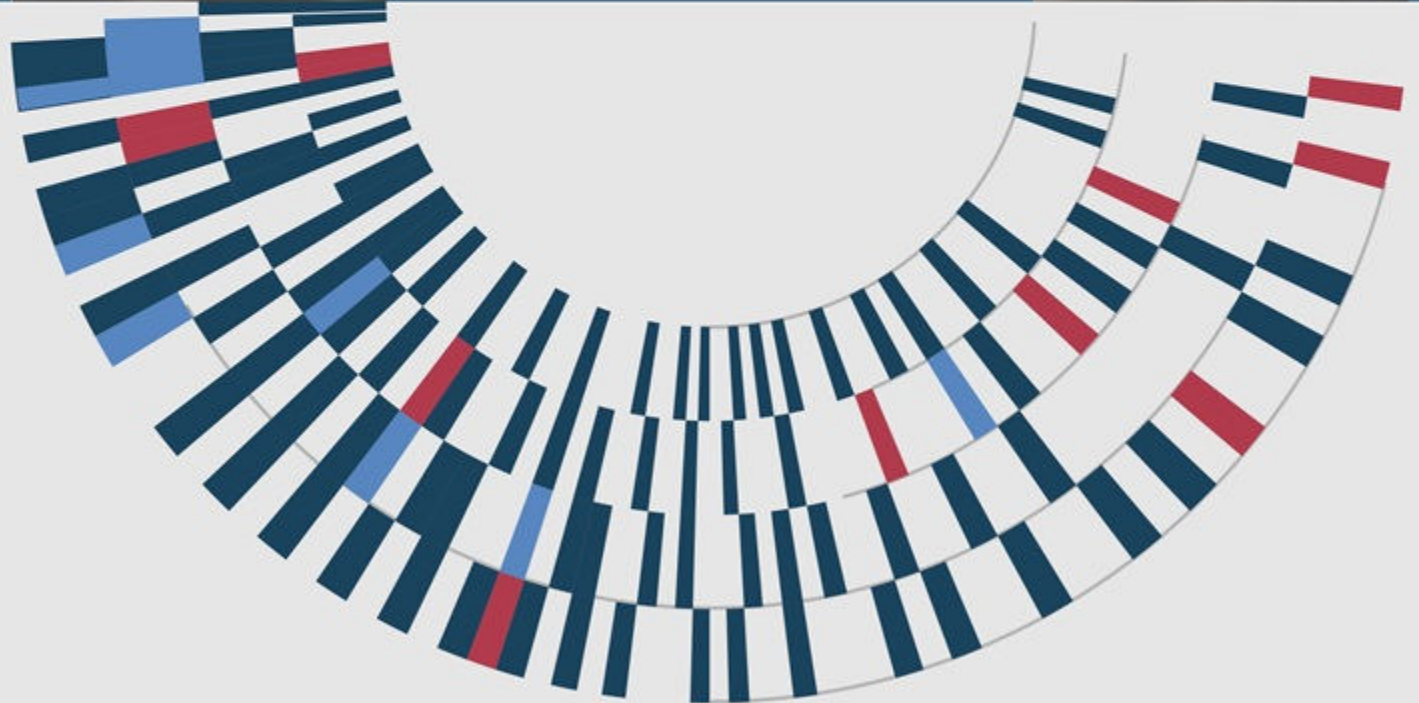
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۱ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۱۸

 CHARISMA





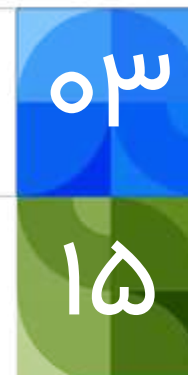
معرفی گزارش:

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 هفته 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.



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

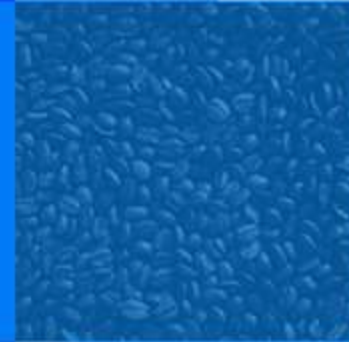
۳۲ برندگان و بازندگان هفته
۳۳ بازدهی صنایع
۳۴ سبد پیشنهادی



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY



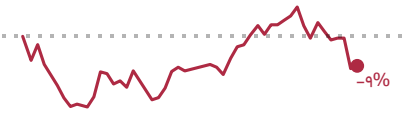
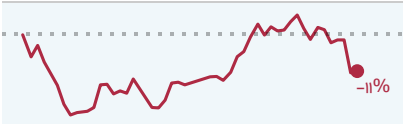
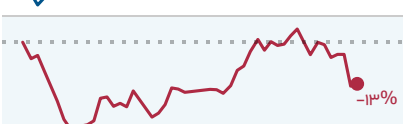
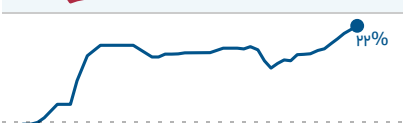
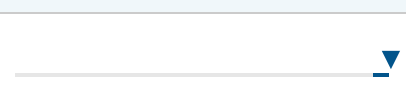
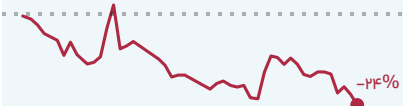
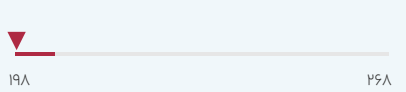
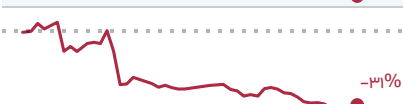
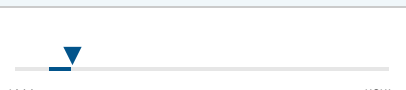
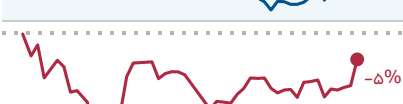
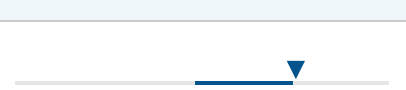


فلزات آهنی و غیر آهنی

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			-	فلز			+۴.۴%	۲,۱۷۷	دلار/انس	بازار فارکس	طلا
			بموتو، فباهنر	فملی			+۰.۵%	۸,۵۷۱	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس
			بموتو، فباهنر	فملی			+۱۵.۹%	۴۱۹,۰۵۵	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)
			فنوال	فایرا			+۰.۱%	۲,۲۱۷	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم
			فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما			+۳.۸%	۲,۵۲۴	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی
فلزات آهنی			-	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما			+۳.۲%	۲,۱۰۳	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان			-۳.۲%	۴۸۰	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان			-۳.۹%	۴۹۲	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش CIS (منطقه)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق			+۱.۸%	۲۱,۴۷۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	شمش (فولاد خوزستان)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			-۵.۰%	۴۷۳	دلار/تن	بنادر ایران FOB	اسلب (ایران)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			-۳.۱%	۵۴۰	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب CIS (منطقه)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			-	۲۲,۷۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)
			فولای	ذوب، کویر			-۱.۱%	۵۸۹	دلار/تن	بنادر ترکیه FOB	میلگرد
			فولای	ذوب، کویر			+۴.۶%	۲۴,۳۹۴	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)
			فجر، فسپا	فولاد، فوکا، فنورد			-	۵۹۳	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم
			-	فولاد			-	۷۰۸	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			-	-	-	۱۱۹	+۱.۰%	۱۱۹	دلار/تن	CFR چین	سنگ آهن
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	۱۳۹	+۰.۵%	۱۳۹	دلار/تن	CFR چین	گندله سنگ آهن
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	۵,۱۳۱	+۵.۰%	۵,۱۳۱	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	گندله سنگ آهن (گل گهر)
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	۱۲۸	+۰.۹%	۱۲۸	دلار/تن	CFR چین	کنسانتره سنگ آهن
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	۳,۷۵۸	+۰.۷%	۳,۷۵۸	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی			-	-	-	۱۹۸	-۳.۷%	۱۹۸	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
			غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۱۷۳	+۳.۷%	۱۷۳	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
			-	-	-	۱,۴۷۳	-۳.۳%	۱,۴۷۳	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
			غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۸۵۶	+۵.۶%	۸۵۶	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام

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
مواد شیمیایی	خلیج فارس FOB	دلار/تن			شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفقارس		
	چین CFR	دلار/تن	۳۰۲	-۲.۱%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ ۳۱۱	-۳%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ ۱,۰۱۰	۴%
	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	+۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ ۹۳۰	-۶%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۰۱	-۲.۲%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ ۱,۱۵۸	-۴%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۵	-	شصفها، نوری	-	۹۴۰ ۱,۱۶۱	-۹%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۴۱	+۲.۴%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ ۱,۱۶۸	۱۰%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۰	+۲.۷%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ ۱,۰۴۳	۱۲%
	چین CFR	دلار/تن	۸۹۵	+۰.۷%	بوعلی	-	۸۰۱ ۹۰۳	
	چین CFR	دلار/تن	۱,۳۶۰	+۴.۶%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ ۱,۳۶۰	۱۸%
پلیمرها	چین CFR	دلار/تن	۵۳۷	-۱.۱%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ ۵۵۶	۷%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ ۱,۰۸۱	-۷%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	+۰.۶%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ ۱,۰۱۱	-۸%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۳	-۰.۲%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ ۹۸۵	-۷%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۰	+۰.۴%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ ۹۲۸	-۸%
	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۶۰	-۰.۵%	شگویا	-	۹۳۰ ۱,۰۷۵	-۱۰%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۵	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ ۸۸۵	-۹%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۶۵	+۰.۷%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ ۱,۴۰۵	-۳%



انرژی، فرآورده‌های نفتی و ارز

عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تأثیر در فروش	تأثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		رند قیمتی ۱۲ ماهه
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۲	-۱.۸%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۷۲	۹۴	۱۳%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۸	-۲.۴%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۶۶	۹۱	۱۸%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۰	+۰.۴%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۷۸	۱۰۷	۵%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۱۰۰	+۱.۴%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۷۹	۱۲۵	۶%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۲۸	+۷.۵%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۳۵۰	۵۲۸	۲۲%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۱۰۰	+۱.۳%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۸۱	۱۲۴	۸%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۶۱	+۳.۲%	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	بوعلی، نوری	۴۵۲	۶۶۱	۱۶%
روغن پایه	امارات متحده CFR عربی	دلار/تن	۸۱۰	+۵.۲%	شسپا، شرانل، شپهرن، شنف	-	۷۲۰	۹۵۰	-۱۳%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۲,۲۵۱	+۱۱.۸%	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۲۱,۷۹۵	۳۳,۵۱۵	۲۶%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۸,۴۱۳	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۲,۱۰۵	۲۱,۶۳۴	۴۴%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۳,۱۱۹	+۱.۴%	شپاس	-	۱۲,۰۸۶	۱۷,۱۴۰	-۱۵%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۵۷	-۱.۹%	-	ذوب، فروش	۱۹۶	۳۱۵	-۱۸%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۹	+۰.۹%	-	-	۱.۰۵	۱.۱۲	۳%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۹	+۱.۶%	-	-	۱.۲۱	۱.۳۱	۵%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۹,۲۴۹	+۱۰.۹%	-	-	۲۵,۷۰۴	۶۹,۲۴۹	۱۵۱%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

ارزو ارز دیجیتال

هاب	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
هنری هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۰۶	+۰.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ ۰.۱۳	-۲۹%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۸	+۰.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۰۸	۲۴%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۰	-۲.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۳۷%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۰	+۴.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۶۱	-۳۲%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۹	+۱.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۳۱%

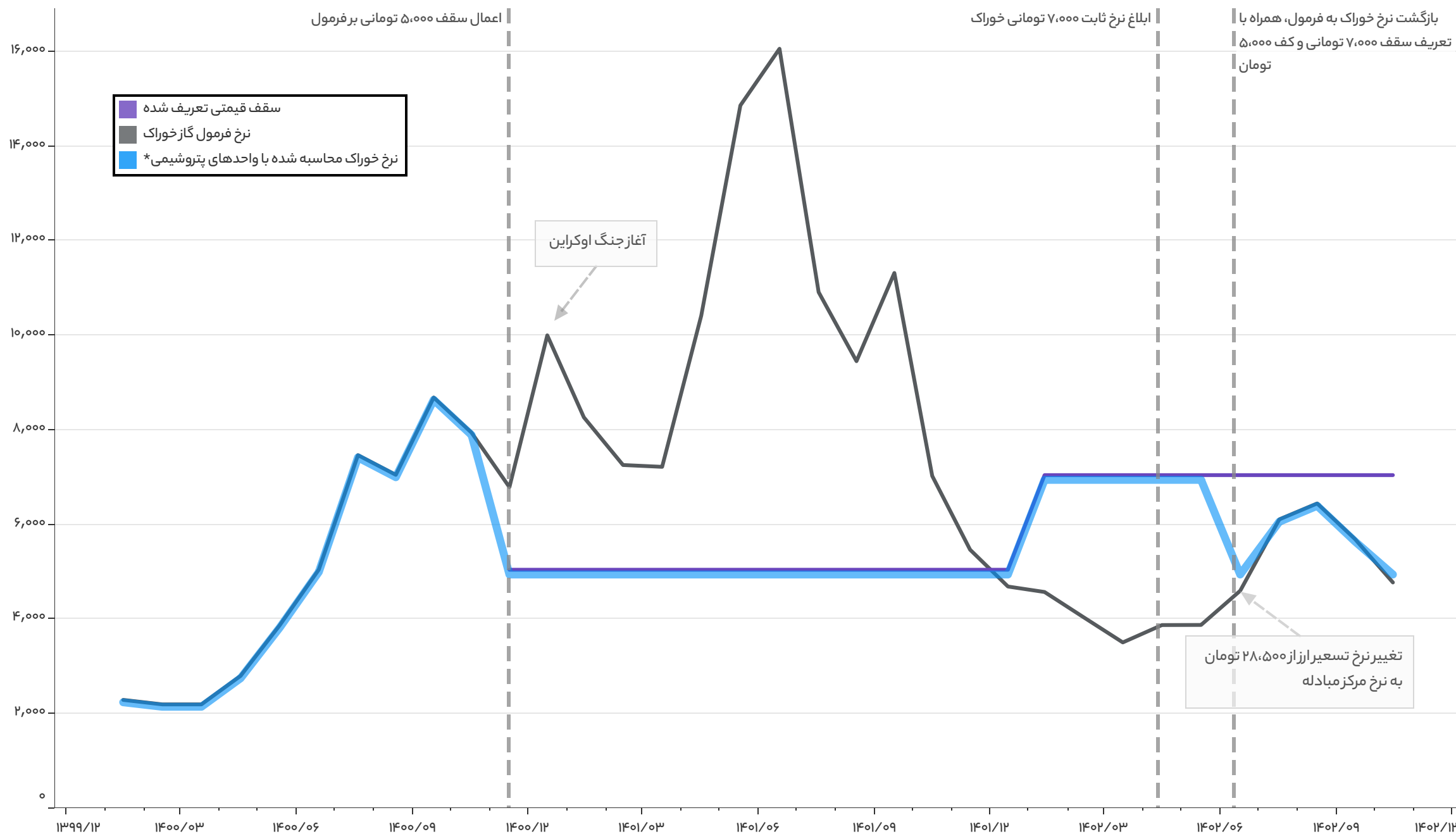
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

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



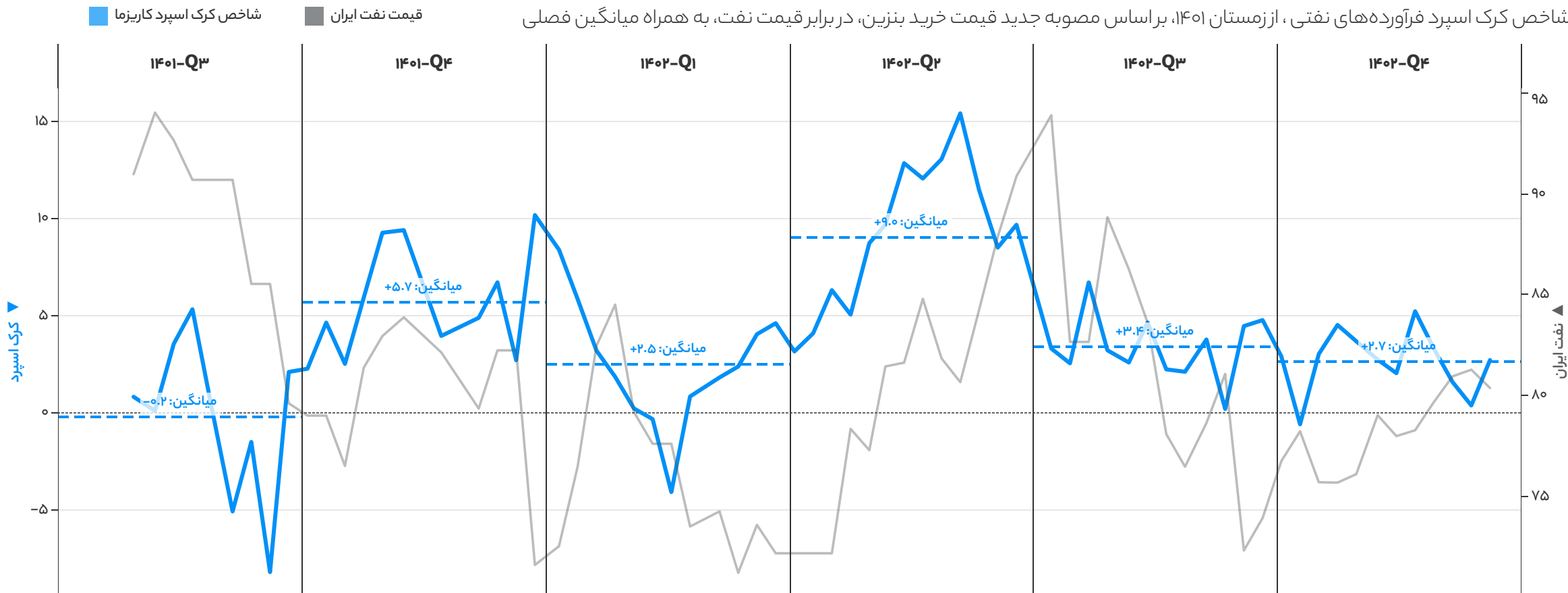
* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بروزرسانی خواهد شد.

- 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، براساس مصوبه جدید قیمت خرید بنزین، در برابر قیمت نفت، به همراه میانگین فصلی



فرآورده	قیمت (دلار) هفته گزارش	کرک اسپرد (دلار)			میانگین فصلی کرک اسپرد (دلار)			آخرین وضعیت اسپرد (در برابر میانگین فصل جاری و فصل گذشته، دلار)		
		هفته گذشته	هفته گزارش	تغییر (واحد)	فصل گذشته	فصل جاری	رشد میانگین فصل	آخرین وضعیت	میانگین فصل گذشته	میانگین فصل جاری
نفت ایران	۸۰.۴									
گازوئیل	۱۰۰.۱	۱۷.۴	۱۹.۷	▲ ۲.۳	۲۳.۲	۲۰.۰	-۱۳.۵%			
بنزین**	۸۵.۷	۴.۰	۵.۳	▲ ۱.۳	۱.۱	۵.۰	+۳۴۸.۰%			
نفتا	۷۴.۷	-۸.۹	-۵.۷	▲ ۳.۲	-۱۲.۳	-۹.۴	+۲۳.۹%			
نفت کوره	۶۷.۵	-۱۸.۶	-۱۲.۹	▲ ۵.۶	-۱۵.۲	-۱۴.۷	+۳.۱%			
لوب کات***	۷۱.۳	-۱۰.۰	-۹.۱	▲ ۰.۹	-۲.۹	-۸.۳	-۱۸۷.۷%			
وکیوم باتوم***	۴۵.۷	-۳۵.۶	-۳۴.۷	▲ ۰.۹	-۲۸.۵	-۳۲.۲	-۱۳.۱%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۰.۴	۲.۸	▲ ۲.۳	۳.۴	۲.۷	-۲۱.۹%			

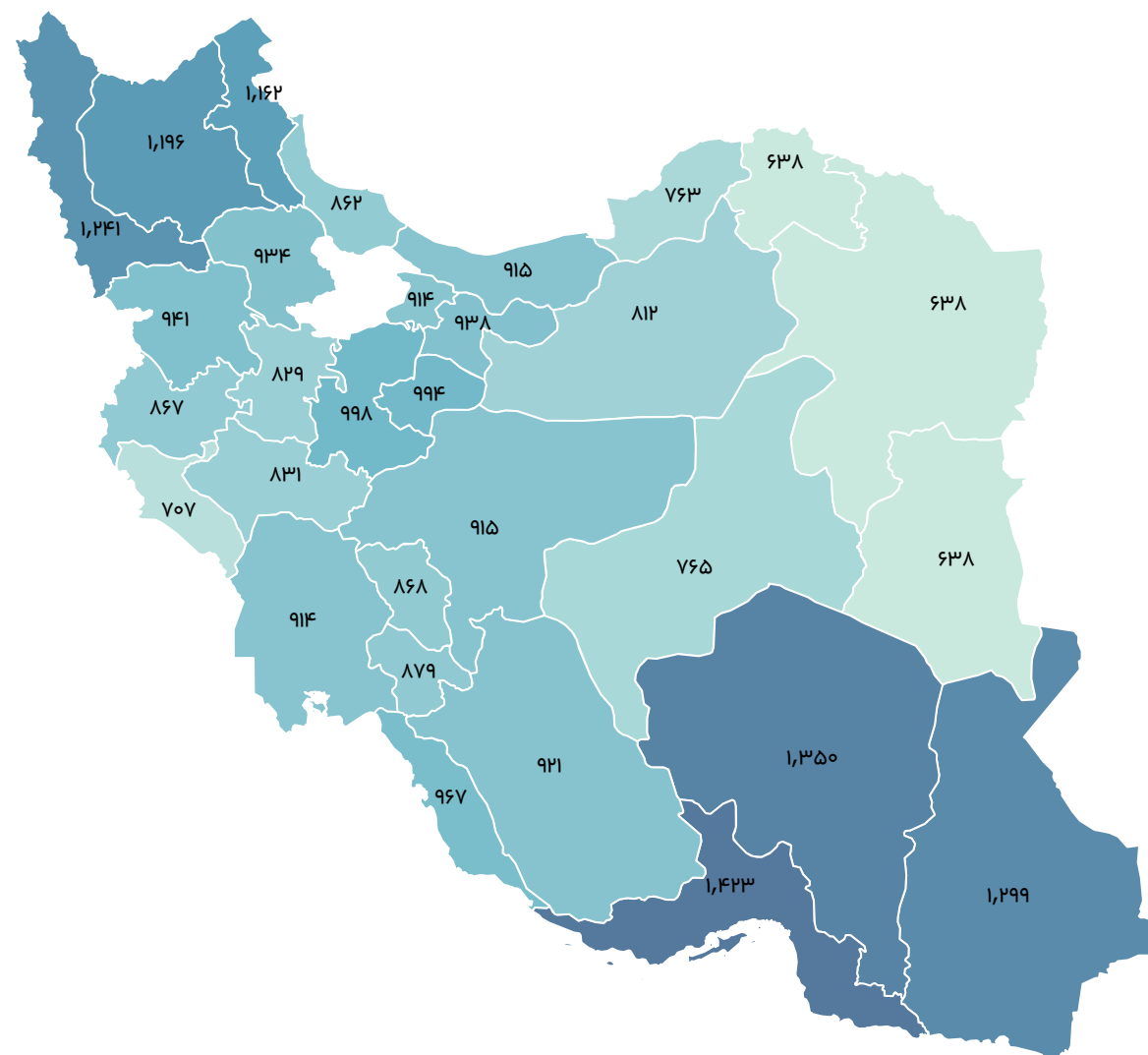
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هر یک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و براساس ارزش بازار هر یک از این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

** قیمت بنزین براساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شیندر، شتران و شیریز) و براساس نوع بنزین فروخته شده توسط هر یک این پالایشگاه‌ها حساب گردیده است.

*** قیمت لوبکات و وکیوم باتوم براساس نرخ فروش هر یک از ۴ پالایشگاه ذکر شده در بورس کالا محاسبه گردیده، که این اسپرد نیز براساس ارزش بازار هر یک از این پالایشگاه‌ها، به روش موزون میانگین گیری شده است.

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

تغییرات به هفته گذشته	هفته گزارش	هفته گذشته	شرکت دنبال کننده	استان	منطقه
-	۹۱۴	۹۱۴	سیمان آبیگ	البرز	مرکز
-۲.۱%	۹۳۸	۹۵۸	سیمان تهران	تهران	
+۴.۴%	۹۹۸	۹۵۵	سیمان ساوه	مرکزی	
-	۸۱۲	۸۱۲	سیمان شاهرود	سمنان	
+۳.۹%	۹۹۴	۹۵۷	سیمان نیزاز قم	قم	
+۲.۵%	۷۶۵	۷۴۷	گروه صنعتی و معدنی سیما..	یزد	
-	۹۱۵	۹۱۵	سیمان سپاهان	اصفهان	غرب
-۱.۴%	۸۲۹	۸۴۰	سیمان هگمتان	همدان	
+۱.۸%	۹۱۴	۸۹۸	شرکت سیمان خوزستان	خوزستان	
-۱.۵%	۸۶۸	۸۸۲	صنایع سیمان شهرکرد	چهارمحال و بختیاری	
+۰.۲%	۷۰۷	۷۰۶	سیمان ایلام	ایلام	
+۳.۶%	۸۶۷	۸۳۷	صنایع سیمان غرب	کرمانشاه	
-	۸۳۱	۸۳۱	سیمان دورود	لرستان	
-	۸۷۹	۸۷۹	سیمان یاسوج	کهگیلویه و بویراحمد	
-۲.۵%	۹۴۱	۹۶۵	سیمان کردستان	کردستان	شمال
-۰.۱%	۹۱۵	۹۱۶	سیمان مازندران	مازندران	
+۳.۸%	۸۶۲	۸۳۱	سیمان خزر	گیلان	
-	۷۶۳	۷۶۳	سیمان پیوند گلستان	گلستان	
+۱۸.۷%	۱,۴۲۳	۱,۱۹۹	سیمان هرمزگان	هرمزگان	جنوب
+۰.۵%	۹۲۱	۹۱۷	سیمان داراب	فارس	
+۲.۸%	۹۶۷	۹۴۱	سیمان مند دشتی	بوشهر	
+۴.۷%	۱,۱۶۲	۱,۱۱۰	سیمان آرتا اردبیل	اردبیل	شمال غرب
-	۹۳۴	۹۳۴	سیمان خمسه	زنجان	
-۱۴.۶%	۱,۱۹۶	۱,۴۰۱	کارخانجات سیمان صوفیان	آذربایجان شرقی	
+۱۵.۰%	۱,۲۴۱	۱,۰۷۹	سیمان ارومیه	آذربایجان غربی	
-	۶۳۸	۶۳۸	سیمان بجنورد	خراسان شمالی	شمال شرق
-	۶۳۸	۶۳۸	سیمان شرق	خراسان رضوی	
-	۶۳۸	۶۳۸	شرکت سیمان قاین	خراسان جنوبی	
+۱۲.۶%	۱,۳۵۰	۱,۱۹۸	سیمان ممتازان کرمان	کرمان	جنوب
+۳۶.۴%	۱,۲۹۹	۹۵۲	سیمان خاش	سیستان و بلوچستان	شرق

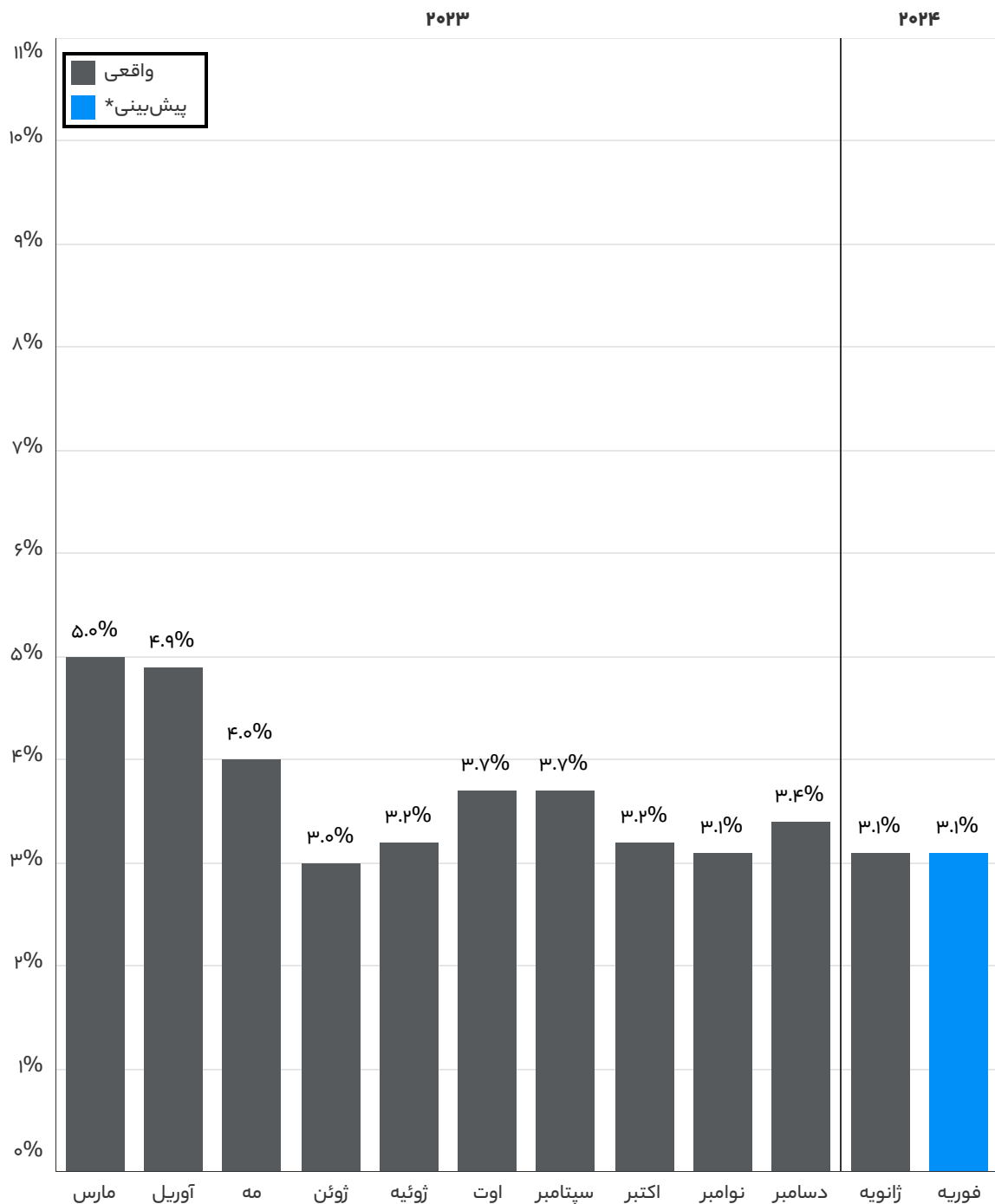
* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ فله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ به گزارش رویترز، طلا در ادامه رکوردشکنی‌های روزهای اخیر، روز پنج‌شنبه با رسیدن به رقم ۲۱۶۵ به بالاترین رکورد تاریخ خود رسید. اظهارات جروم پاول رئیس فدرال رزرو آمریکا در مورد کاهش نرخ بهره تا اواسط سال جاری میلادی، از قیمت این فلز گرانبها حمایت کرده‌ است. قیمت هر اونس طلا امروز با ۰.۰۹ درصد کاهش به ۲۱۵۷ دلار و ۹۸ سنت رسید. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک کاهش ۰.۰۲ درصدی به ۲۱۶۴ دلار و ۷۰ سنت رسیده است. قیمت طلا طی یک هفته گذشته بیش از ۳.۵ درصد افزایش یافته و در آستانه بیشترین افزایش هفتگی از اواسط اکتبر یعنی آغاز تشدید تنش‌های خاورمیانه قرار دارد. به علاوه، طلا سومین افزایش قیمت پیاپی هفتگی را تجربه می‌کند. تحلیلگران عقیده دارند بزرگترین عامل افزایش قیمت طلا انتظار کاهش زود هنگام نرخ بهره بانک مرکزی آمریکاست.
- دومین حراج سکه طلای مرکز مبادله ایران چهارشنبه ۱۶ اسفندماه برگزار و از مجموع ۷۲ هزار و ۵۹۶ سکه ثبت سفارش شده، ۱۰ هزار و ۵ قطعه ربع سکه با میانگین قیمت ۱۲ میلیون و ۵۸۸ هزار تومان به متقاضیان تخصیص داده شد. طبق اعلام مرکز مبادله ارز و طلای ایران، در بین متقاضیان، افرادی بالاتر و افرادی پایین‌تر از این قیمت پیشنهادهایی اعلام کرده و به آن‌ها تخصیص داده شده است.
- با فروش ۲۰۳ قطعه شمش طلا در دوازدهمین حراج حضوری شمش، در مجموع تا کنون ۱۲۶۰ کیلو طلا در مرکز مبادله ارز و طلای ایران به فروش رسیده است. تالار معاملات طلای مرکز مبادله در دوازدهمین حراج حضوری شمش طلا، شاهد خرید ۲۰۳ قطعه شمش طلای استاندارد یک کیلوگرمی با عیار ۹۹۵ در هزار از سوی فعالان صنعت طلای کشور بود. شمش‌های طلای استاندارد، در حراج دوازدهم با میانگین قیمت ۴ میلیارد و ۷۲ میلیون تومان معامله شد. که نسبت به قیمت فروش شمش طلا در حراج قبلی ۸۰ میلیون تومان افزایش یافته است.
- بهمن قاسمی، مدیرعامل آریان فولاد در یک نشست خبری در مورد وضعیت صادرات محصولات فولادی و لزوم عرضه ارز حاصله با نرخ نیما، اظهار داشت: در حال حاضر نوسانات نرخ ارز مشکلات زیادی برای تولیدکنندگان ایجاد کرده و پیش‌بینی مشخصی از نرخ ارز نداریم. وی در ادامه با بیان اینکه سال گذشته قیمت هر کیلو میلگرد ۳۱ هزار تومان بود، افزود: این رقم طی ۲۰ روز گذشته در بورس کالا کاهش یافته و به ۲۶ هزار و ۵۰۰ تومان رسیده در حالی که قیمت مواد اولیه تغییری نداشته و هزینه تولید ۳۰ تا ۴۰ درصد افزایش داشته است.
- محمدرضا مهدیار اسماعیلی رییس هیات عامل صندوق ملی مسکن از بزرگ‌ترین خرید حوزه فولاد در بورس کالا برای نهضت ملی مسکن خبر داد و افزود: وزارت راه و شهرسازی با همکاری وزارت صمت و وزارت اقتصاد و امور دارایی، ۹۰ هزار تن کالا، شامل چهار نوع میل‌گرد پرمصرف مورد نیاز برای اجرای طرح نهضت ملی مسکن، به مبلغ حدود ۲ هزار میلیارد تومان خریداری کرد.
- ▲ پایانه نفتی دورتیول ترکیه که سال گذشته حجم بالایی از نفت مسکو را دریافت کرده بود، در بحبوحه تشدید فشار تحریم‌ها از سوی آمریکا، دیگر واردات نفت روسیه را نمی‌پذیرد. پس از اعمال تحریم‌های غرب علیه مسکو بر سر جنگ در اوکراین، ترکیه از سال ۲۰۲۲ به یکی از بزرگ‌ترین واردکنندگان نفت خام و سوخت روسیه تبدیل شد. روسیه با تغییر مسیر تجارت نفت خود از اروپا و آمریکا به آسیا، ترکیه و آفریقا، به این تحریم‌ها واکنش نشان داد. شرکت گلوبال ترمینال سرویس (GTS) که پایانه نفتی دورتیول را در استان هاتای ترکیه اداره می‌کند، اعلام کرد به مشتریانش گفته است هیچ محصولی از روسیه را نخواهد پذیرفت.
- حیان عبدالغنی وزیر نفت عراق گفت: عراق مبالغ مربوط به واردات گاز از ایران را به خاطر تحریم‌ها پرداخت نمی‌کند و مبلغ حاصل از این واردات به ده میلیارد یورو رسیده است. عبدالغنی تصریح کرد: ما روزانه بیش از شانزده هزار متر مکعب بنزین وارد می‌کردیم که با دستاورد حاصل شده در پالایشگاه کربلا و تکمیل واحدهای معوقه در پالایشگاه‌های جنوب، واردات به پنج هزار متر مکعب کاهش یافت. وزیر نفت عراق در پایان اظهار داشت: پس از سال ۲۰۲۵ میلادی انتظار داریم واردات فرآورده‌های نفتی به دلیل خودکفایی کشور متوقف شود. اکنون عراق سالانه ۵ میلیارد دلار واردات فرآورده‌های نفتی دارد.
- در حالی که به ایام پایانی سال و نوروز نزدیک می‌شویم، پیش‌بینی ثبت رکوردهای عجیب مصرف بنزین تا ۱۵۰ میلیون لیتر در روز می‌شود و این به معنای ۱.۵ برابر شدن ظرفیت تأمین و عرضه بنزین نسبت به روزهای عادی سال است. متوسط مصرف روزانه بنزین در سال جاری ۱۱۶ میلیون لیتر بوده، در حالی که ظرفیت تولید بنزین پالایشگاهی در حدود ۱۰۶ میلیون لیتر در روز است. به عبارتی اگر روزانه با سقف ظرفیت بنزین، به تولید بپردازیم، بازهم ۱۰ میلیون لیتر در روز ناترازی و کسری بنزین داریم که این کسری با تولیدات پتروشیمی و واردات بنزین جبران می‌شود.



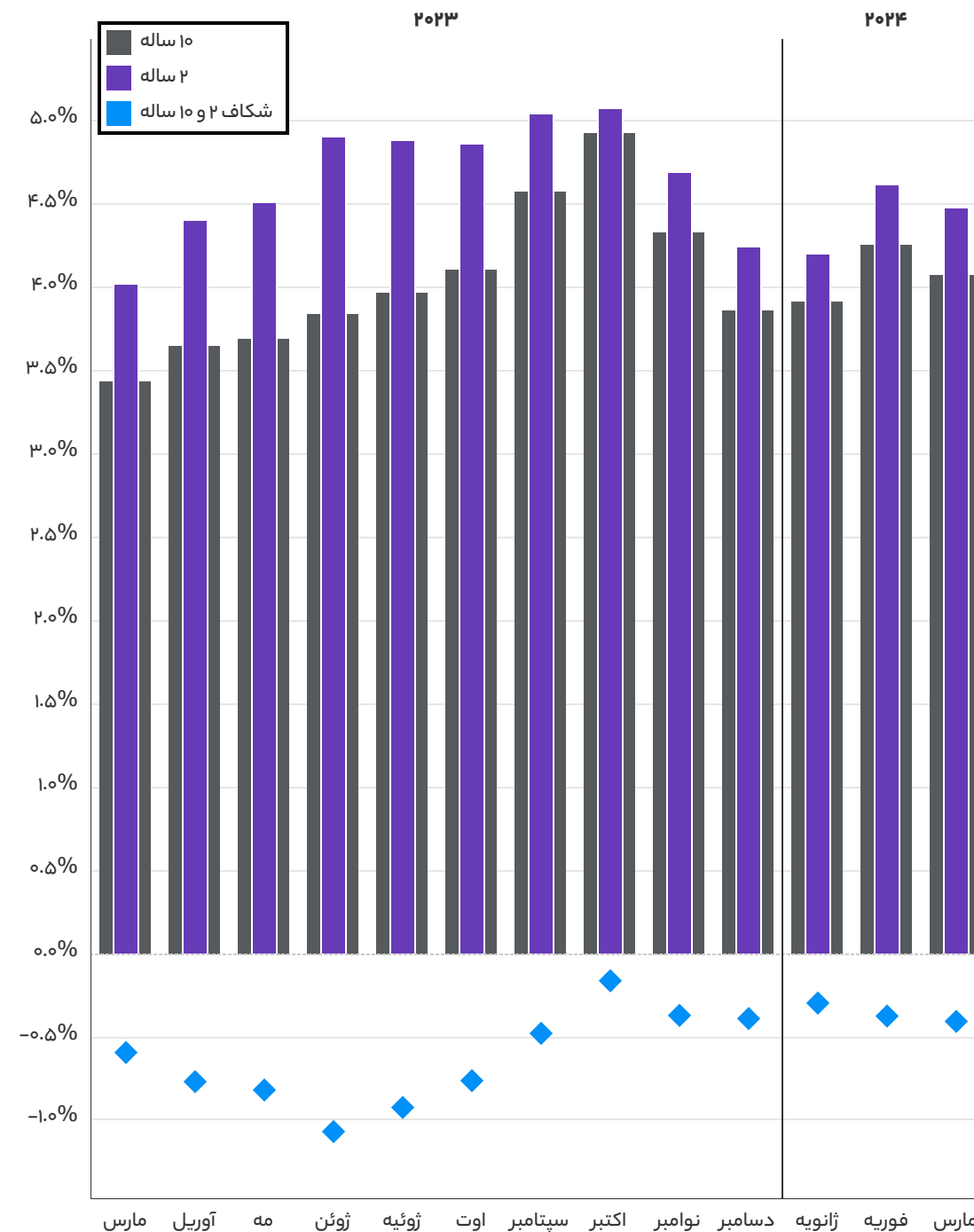
شاخص قیمت مصرف کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده



شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

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



بازار سهام

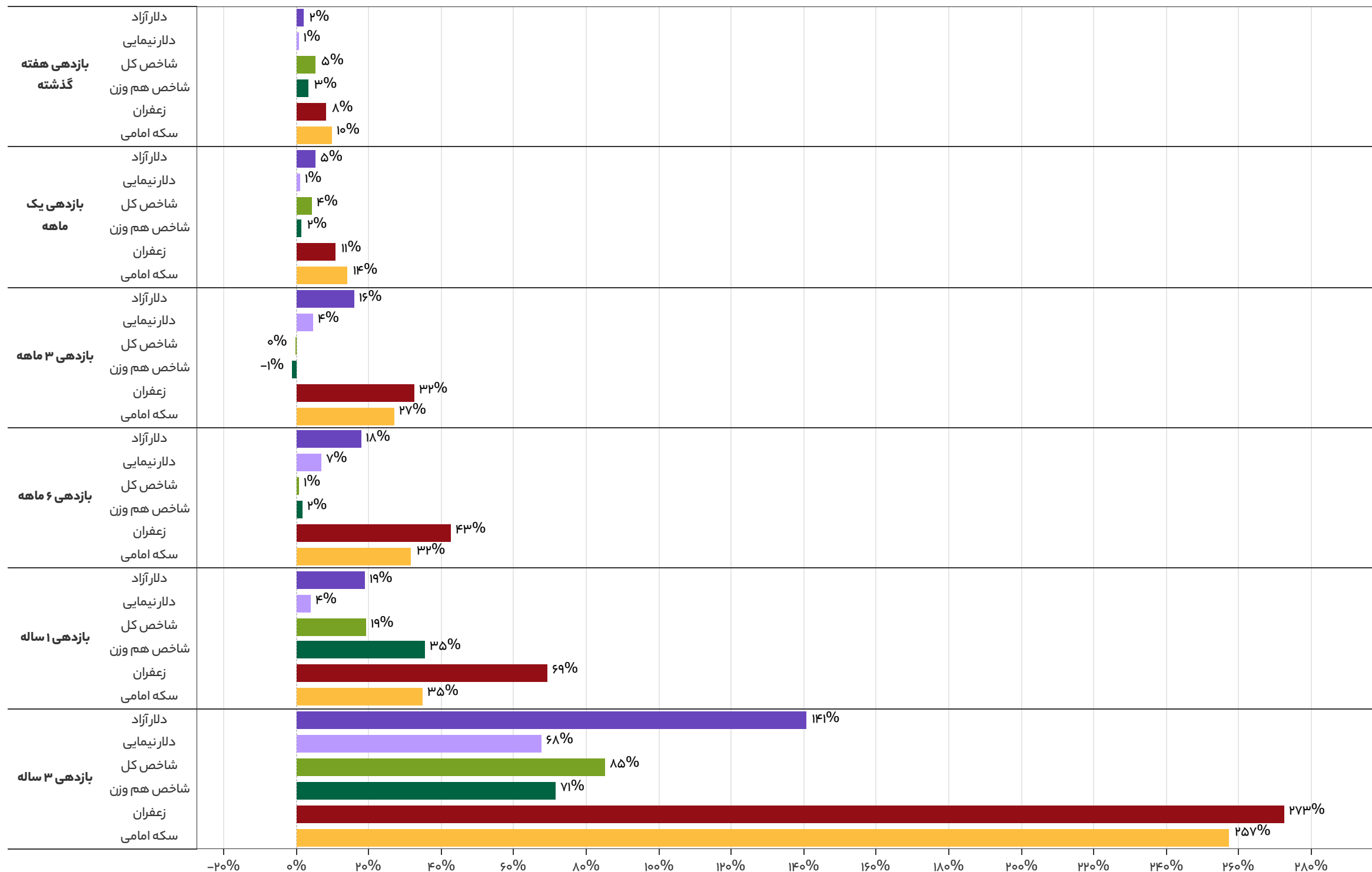
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها در بازه‌های زمانی متفاوت



بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

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

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
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 ۴۲٪	هم وزن ۵۸.۲٪
سکه امامی ▲ ۱۷.۷٪	شاخص کل ▲ ۳۰.۳٪	هم وزن ▲ ۲۹.۷٪	مسکن ▲ ۱۳.۴٪	مسکن ▲ ۴.۰٪	زعفران ▲ ۱۲.۳٪	زعفران ▲ ۳.۶٪	شاخص کل ▲ ۹.۳٪	سکه امامی ▲ ۴.۱٪	زعفران ▲ ۹.۲٪	شاخص کل ▲ ۹.۴٪	دلار آزاد ▲ ۸.۸٪	شاخص کل ۴۰٪	شاخص کل ▲ ۴۱.۳٪
دلار آزاد ▲ ۱۴.۷٪	هم وزن ▲ ۲۴.۳٪	شاخص کل ▲ ۱۶.۴٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۸٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۸٪	سکه امامی ▲ ۳.۳٪	هم وزن ▲ ۸.۸٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	هم وزن ▲ ۱.۹٪	هم وزن ▲ ۸.۳٪	سکه امامی ▲ ۸.۸٪	سکه امامی ۲۵٪	سکه امامی ▲ ۴.۹٪
زعفران ▲ ۱۴.۵٪	مسکن ▲ ۱۴.۲٪	دلار آزاد ▲ ۳.۷٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۵٪	دلار آزاد ▲ ۰.۵٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	دلار آزاد ▲ ۱.۵٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۲٪	زعفران ▲ ۴.۹٪	مسکن ۲۱٪	درآمد ثابت ▲ ۲۳.۶٪
دلار نیمایی ▲ ۱۲.۷٪	سکه امامی ▲ ۹.۷٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	زعفران ▲ ۱.۶٪	زعفران ▼ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۱.۷٪	دلار آزاد ▲ ۱.۴٪	زعفران ▲ ۱.۳٪	مسکن ▲ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۰.۴٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۲٪	زعفران ۲۰٪	دلار آزاد ▲ ۹.۶٪
مسکن ▲ ۹.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	مسکن ▲ ۱.۸٪	دلار آزاد ▲ ۰.۸٪	هم وزن ▼ ۲.۳٪	مسکن ▼ ۲.۲٪	دلار نیمایی ▲ ۰.۱٪	دلار آزاد ▲ ۰.۲٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۱٪	دلار آزاد ▲ ۰.۱٪	زعفران ▲ ۱.۵٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۱٪	زعفران ۱۸٪	سکه امامی ▲ ۹.۲٪
درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	زعفران ▲ ۰.۸٪	زعفران ▼ ۰.۱٪	سکه امامی ▲ ۰.۴٪	شاخص کل ▼ ۵.۶٪	سکه امامی ▼ ۳.۵٪	مسکن ▼ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۱٪	شاخص کل ▼ ۴.۱٪	سکه امامی ▼ ۰.۱٪	سکه امامی ▲ ۰.۸٪	هم وزن ▼ ۰.۹٪	دلار آزاد ۱۴٪	دلار نیمایی ▲ ۱.۳٪
شاخص کل ▼ ۷.۵٪	دلار آزاد ▲ ۰.۲٪	سکه امامی ▼ ۰.۴٪	هم وزن ▼ ۰.۶٪	دلار آزاد ▼ ۶.۱٪	هم وزن ▼ ۶.۲٪	شاخص کل ▼ ۲.۳٪	مسکن ▼ ۰.۶٪	هم وزن ▼ ۴.۴٪	مسکن ▼ ۰.۴٪	دلار آزاد ▼ ۰.۸٪	شاخص کل ▼ ۲.۰٪	درآمد ثابت ۰٪	مسکن
هم وزن ▼ ۸.۷٪	دلار نیمایی ▼ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۱.۸٪	شاخص کل ▼ ۱.۰٪	سکه امامی ▼ ۱۱.۱٪	شاخص کل ▼ ۸.۸٪	هم وزن ▼ ۵.۲٪	سکه امامی ▼ ۱.۶٪	زعفران ▼ ۴.۷٪	شاخص کل ▼ ۰.۶٪	مسکن ▼ ۲.۲٪	مسکن		

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

– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری سحرخیز محاسبه شده است.

– بازده مسکن با استفاده از آمار بانک مرکزی اعلام شده برای میانگین قیمت مسکن در مناطق ۲۲ گانه تهران محاسبه شده و برای ماه‌های اعلام نشده، از برآورد سناریو محتمل مدل‌های آماری و اقتصادی که در گزارش ماهنامه دیدگاه بازار کاربریما ذکر گردیده، استفاده شده است.



ارزش دلاری بازار

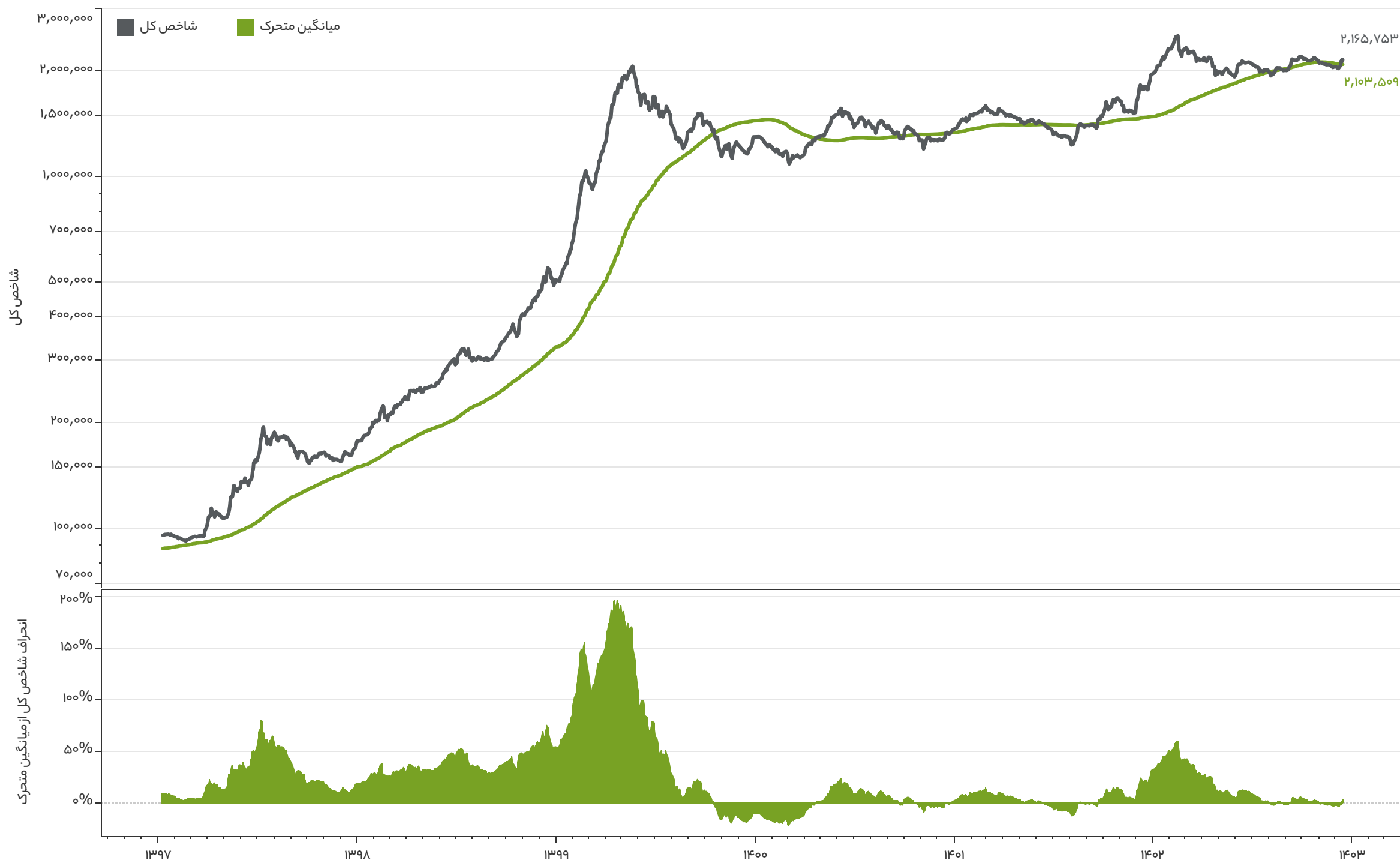
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

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





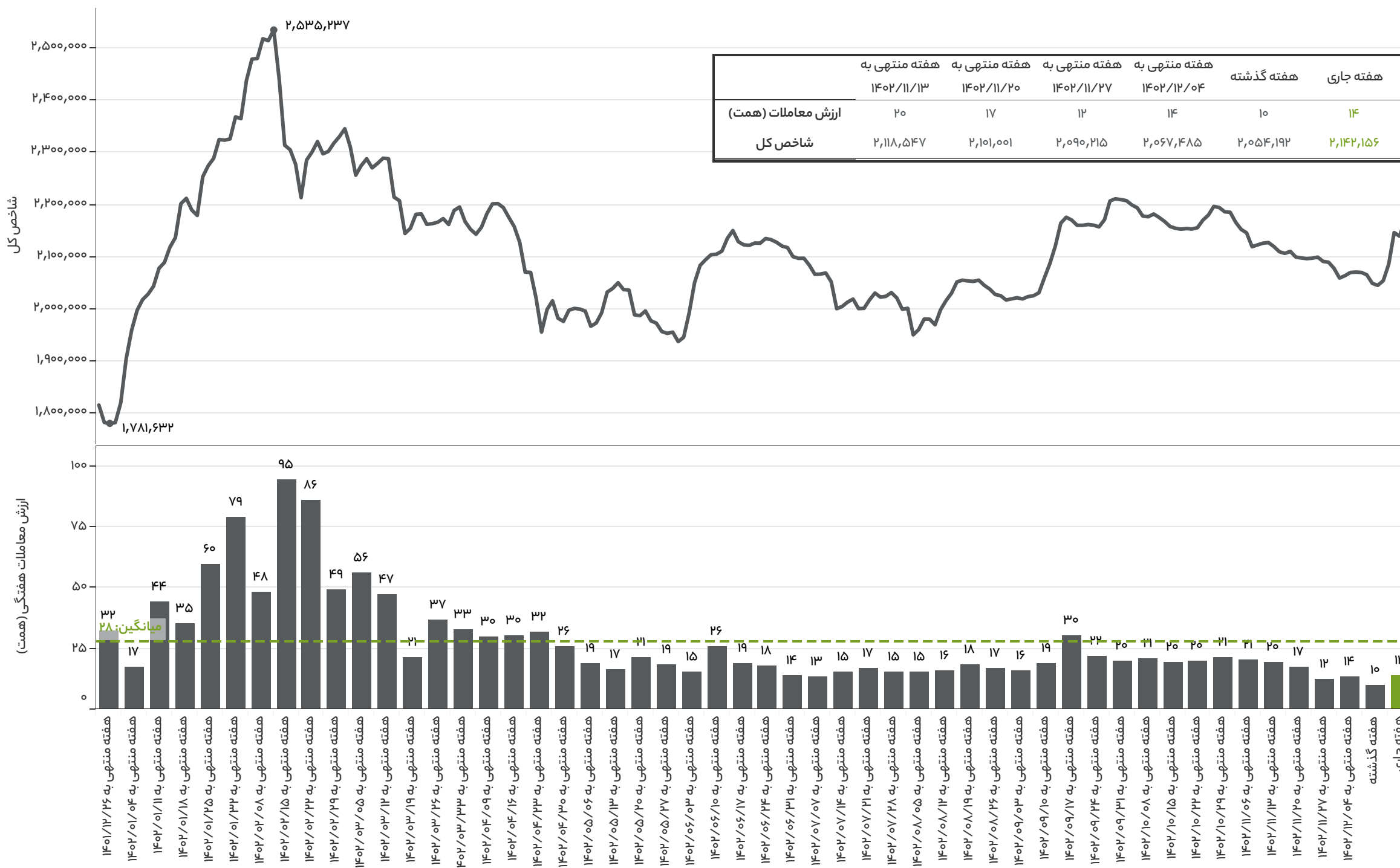
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



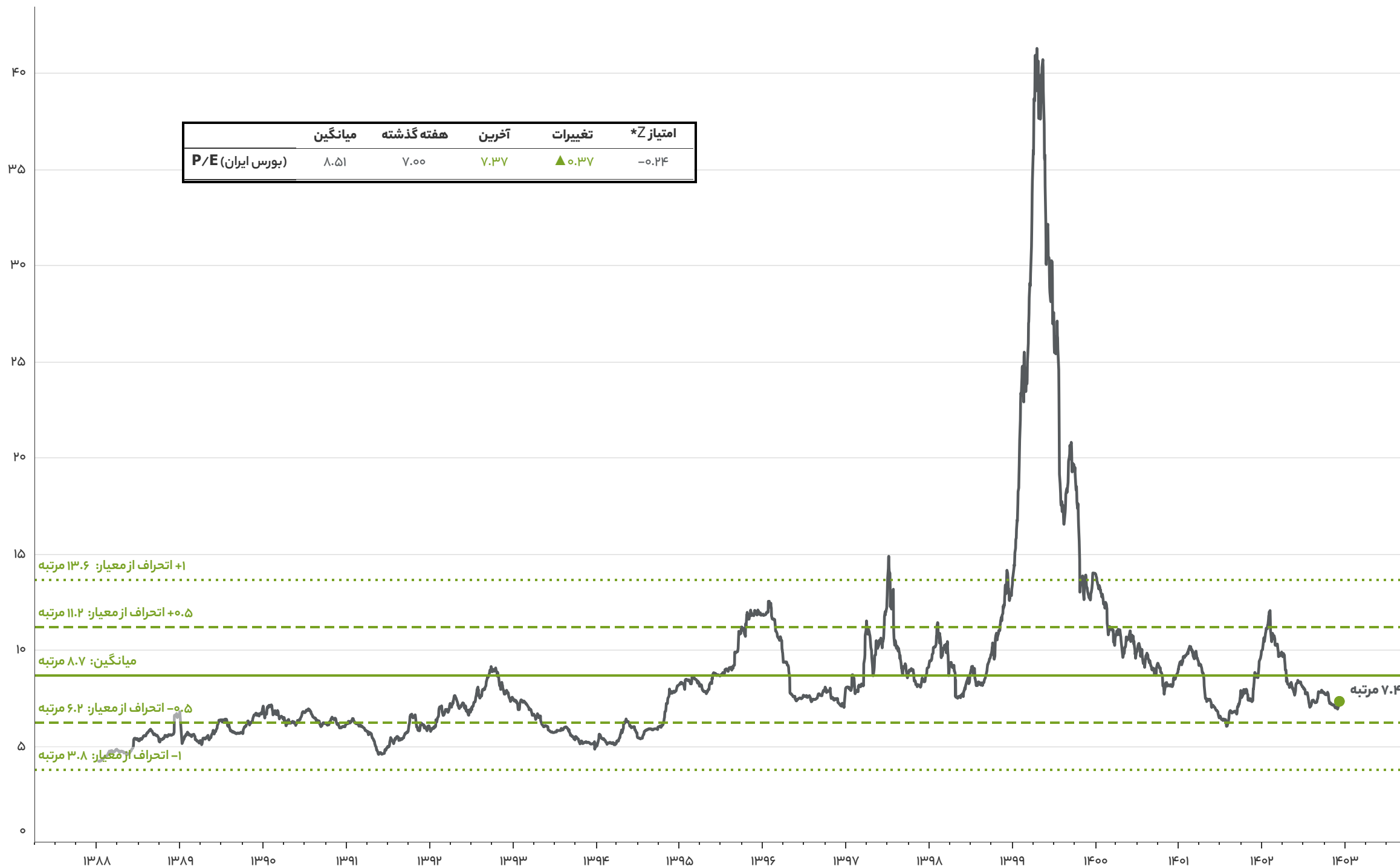
ارزش معاملات هفتگی بازار

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



نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*امتیاز Z یا امتیاز استاندارد تفاوت آخرین عدد برای نسبت قیمت به سود را بر حسب انحراف از معیار محاسبه می‌نماید که در اینجا می‌تواند یک معیار برای سنجش گران یا ارزان بودن بازار نسبت به میانگین باشد.

ارزش نسبی فرا بورس 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
+۰.۳۷	۷.۳۷	۷.۰۰	۶.۰۷	۱۲.۶۱	۴۱.۳۳
+۰.۳۹	۷.۱۳	۶.۷۳	۵.۶۴	۱۲.۳۹	۴۱.۹۹
+۰.۱۶	۸.۹۴	۸.۷۷	۸.۷۲	۱۴.۷۴	۴۳.۵۱

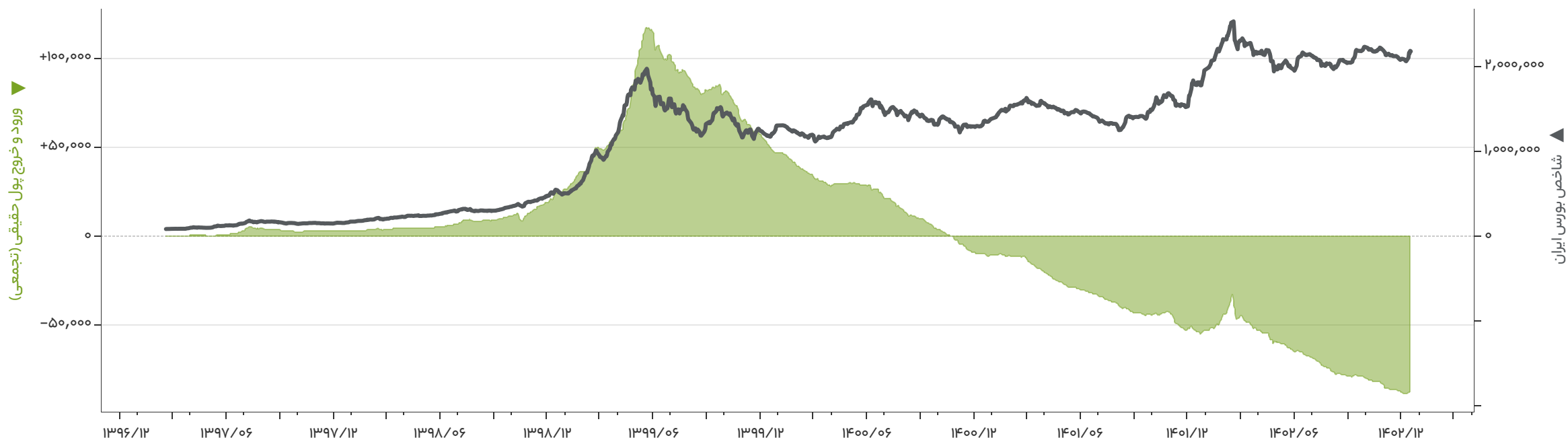


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	خدمات مالی	مواد پایه	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۵	۱۹	۴۰	۶۳	۸۹	۶۶	۶	۱۹۹	۱۸۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۵۹	۹۵	۱۱۲	۱۱۳	۱۵۷	۱۹۵	۲۴۱	۳۹۳	۶۵۵	۳,۲۲۸	۳,۳۹۱	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۷%	۱.۱%	۱.۳%	۱.۳%	۱.۸%	۲.۳%	۲.۸%	۴.۶%	۷.۶%	۳۷.۴%	۳۹.۳%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۴.۶	۱۲.۹	۱۱.۱	۱۶.۴	۸.۹	۸.۸	۹.۴	۴.۹	۴.۸	۷.۰	۷.۵	سودآوری
بازده سود نقدی	۲.۹%	۱۶.۰%	۳.۵%	۲.۷%	۷.۲%	۳.۸%	۴.۸%	۳.۴%	۱۳.۸%	۹.۱%	۸.۸%	
نسبت تقسیم سود	۳۹%	۱۰۰%	۴۱%	۵۷%	۷۴%	۳۷%	۵۳%	۳۳%	۶۳%	۶۲%	۷۳%	
بتا به شاخص کل	۰.۹	۱.۱	۱.۴	۰.۷	۰.۸	۱.۲	۰.۹	۱.۰	۱.۱	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۶۸۸%	+۷۹۹%	+۱۳۱%	+۲۹۷%	+۳۸۹%	+۴۳۸%	+۴۲۷%	+۸۸۰%	+۸۶۶%	+۸۵۷%	+۹۷۲%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۰%	+۱۱۹%	-۶۳%	-۱%	+۱۶%	-۷%	-۷%	-۱۱%	+۲۵%	۰%	+۶۷%	
بازده از ابتدای سال	+۲۵۲%	+۴۵%	+۴۸%	+۷۲%	+۹۵%	+۱۰۸%	+۵۴%	+۹۶%	+۱۰۵%	+۶۹%	+۸۷%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	۶%	۱%	۰%	۲%	۳%	۳%	۸%	۱۵%	۴%	۵%	

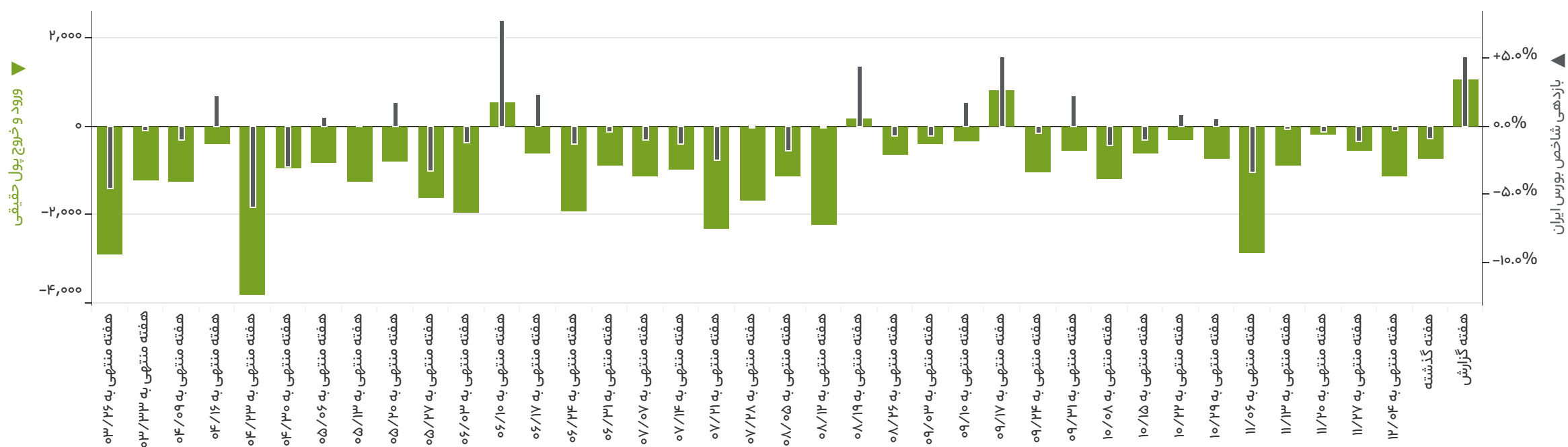
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



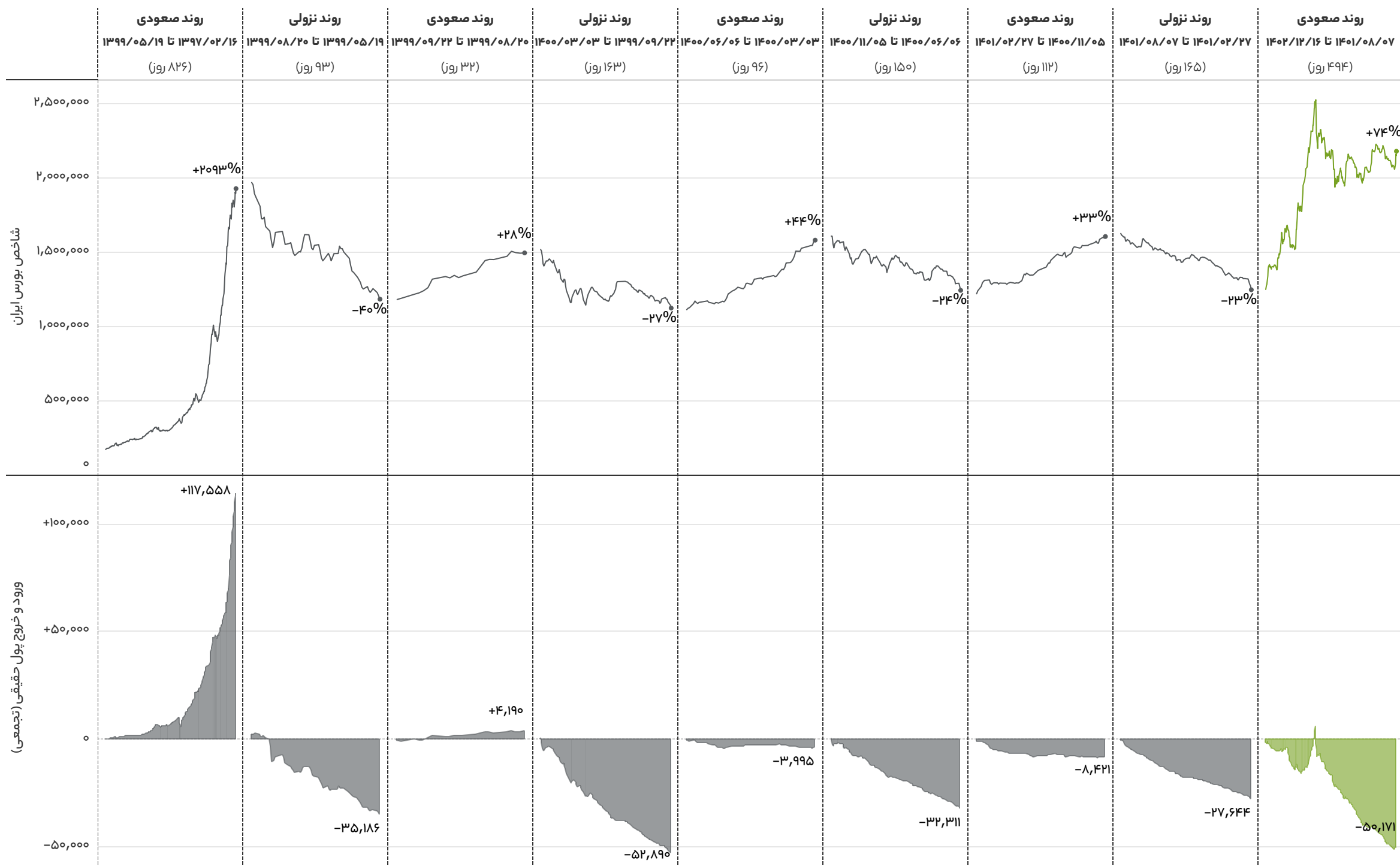
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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 مدت 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 یول حقیقی

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

ارزش بازار			ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)					
نماد	صنعت	(م.م.ت)						
بیشترین ورود پول حقیقی	شبندر	پالایش نفت و گاز	۱۵۰				۱۱۷+	
	وبملت	بانکها و موسسات اعتباری	۱۶۰				۹۲+	
	ویپارس	بانکها و موسسات اعتباری	۳۷				۶۷+	
	خودرو	خودرو	۸۸				۴۳+	
	ولشرف	لیرینگ	۱				۴۲+	
	تراجرس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱				۳۰+	
	کگل	کانی های فلزی	۱۶۵				۲۵+	
	کترام	کاشی و سرامیک	۱				۲۲+	
	وبشهر	سرمایه گذاری	۱۱				۲۱+	
	خکمک	قطعات خودرو	۲				۱۸+	
	فخاس	آهن و فولاد	۳۲				۱۸+	
	فاراک	محصولات فلزی	۴				۱۷+	
	کالا	فعالیت های مرتبط با اوراق بهادار	۱۲				۱۷+	
	بوعلي	مواد شیمیایی-متنوع	۸۶				۱۵+	
بیشترین خروج پول حقیقی	دابور	دارویی	۲			-۷		
	وسپهر	سرمایه گذاری	۳۲			-۷		
	غشوکو	شیرینیجات	۱			-۸		
	فجر	آهن و فولاد	۷			-۸		
	فارس	سرمایه گذاری	۵۵۷			-۸		
	وخابر	بانکها و موسسات اعتباری	۱۷			-۹		
	وشهر	بانکها و موسسات اعتباری	۱۹			-۱۰		
	دي	بانکها و موسسات اعتباری	۱۵			-۱۰		
	ثاغت	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴			-۱۵		
	وپاسار	بانکها و موسسات اعتباری	۹۱			-۱۹		
	خابر	خودرو	۳۳			-۲۰		
	وساپا	سرمایه گذاری	۱۰			-۲۳		
	خسابا	خودرو	۵۰			-۳۶		
	خگستر	سرمایه گذاری	۲۰	-۸۳				
			-۱۰۰	-۵۰	۰	+۵۰	+۱۰۰	+۱۵۰

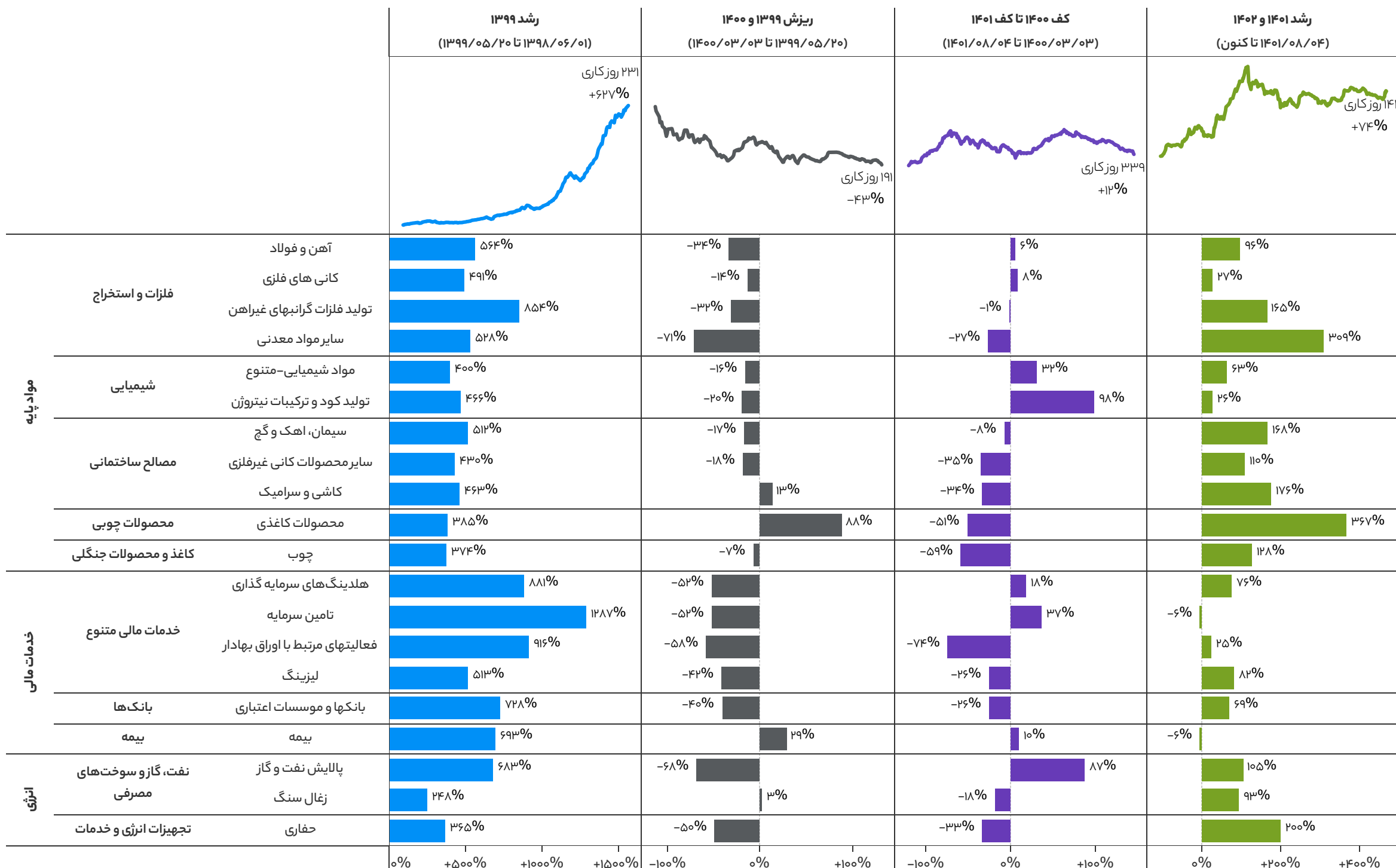
تغییر مالکیت شرکت

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

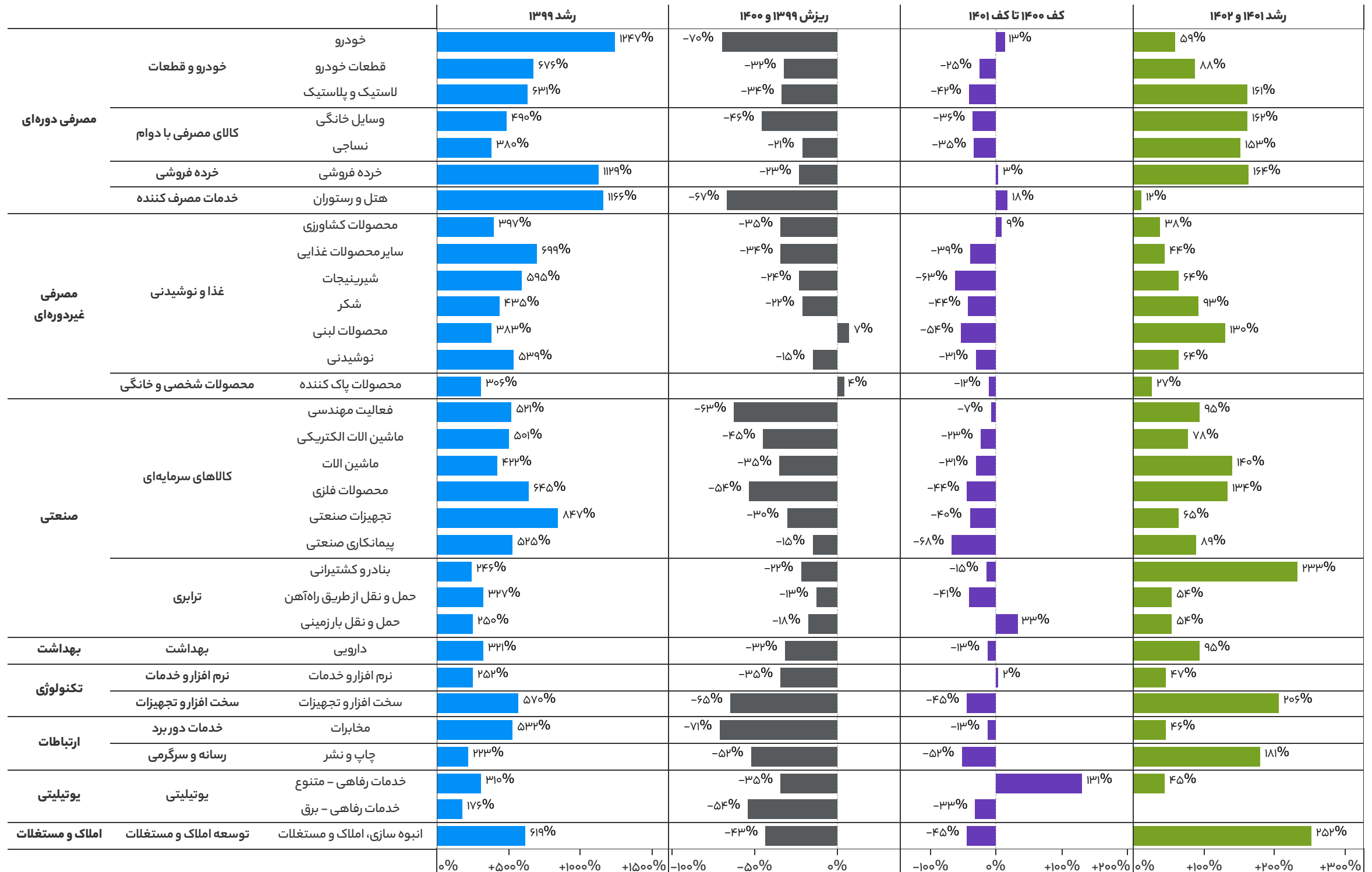
ارزش بازار			تغییر مالکیت شرکت						
نماد	صنعت	(م.ت)							
بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	ولشرق	لیزینگ	۰.۶						+۶.۸%
	تراگرس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۷						+۴.۶%
	کیا	محصولات فلزی	۰.۴						+۲.۲%
	کترام	کاشی و سرامیک	۱.۱						+۱.۹%
	اوان	نرم افزار و خدمات	۰.۶						+۱.۶%
	خکمک	قطعات خودرو	۲.۰						+۰.۹%
	غمارگ	محصولات کشاورزی	۱.۳						+۰.۶%
	وپسا	سرمایه گذاری	۰.۴						+۰.۶%
	فاراک	محصولات فلزی	۳.۶						+۰.۵%
	شپلی	مواد شیمیایی-متنوع	۲.۹						+۰.۵%
	زماهان	محصولات کشاورزی	۲.۷						+۰.۴%
	تتران	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱.۸						+۰.۴%
وحکمت	بیمه	۱.۱						+۰.۴%	
	تکنار	کانی های فلزی	۰.۴						+۰.۳%
بیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی	حپترو	حمل و نقل بارزمینی	۱.۳	-۰.۳%					
	ناخت	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴.۳	-۰.۴%					
	غپآذر	محصولات لبنی	۱.۵	-۰.۴%					
	خگستر	سرمایه گذاری	۱۹.۸	-۰.۴%					
	ولانا	لیزینگ	۰.۳	-۰.۴%					
	زمگسا	محصولات کشاورزی	۱.۲	-۰.۵%					
	غچین	سایر محصولات غذایی	۱.۲	-۰.۵%					
	ثاصفا	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۳	-۰.۵%					
	آواپارس	بیمه	۰.۹	-۰.۵%					
	وآفر	سرمایه گذاری	۰.۸	-۰.۶%					
	ثقزوی	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۳	-۰.۸%					
	گپارس	هتل و رستوران	۰.۲	-۰.۸%					
	وجامی	سرمایه گذاری	۰.۶	-۱.۱%					
	غشوکو	شیرینیجات	۰.۶	-۱.۲%					
			-۲%	۰%	+۲%	+۴%	+۶%	+۸%	

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

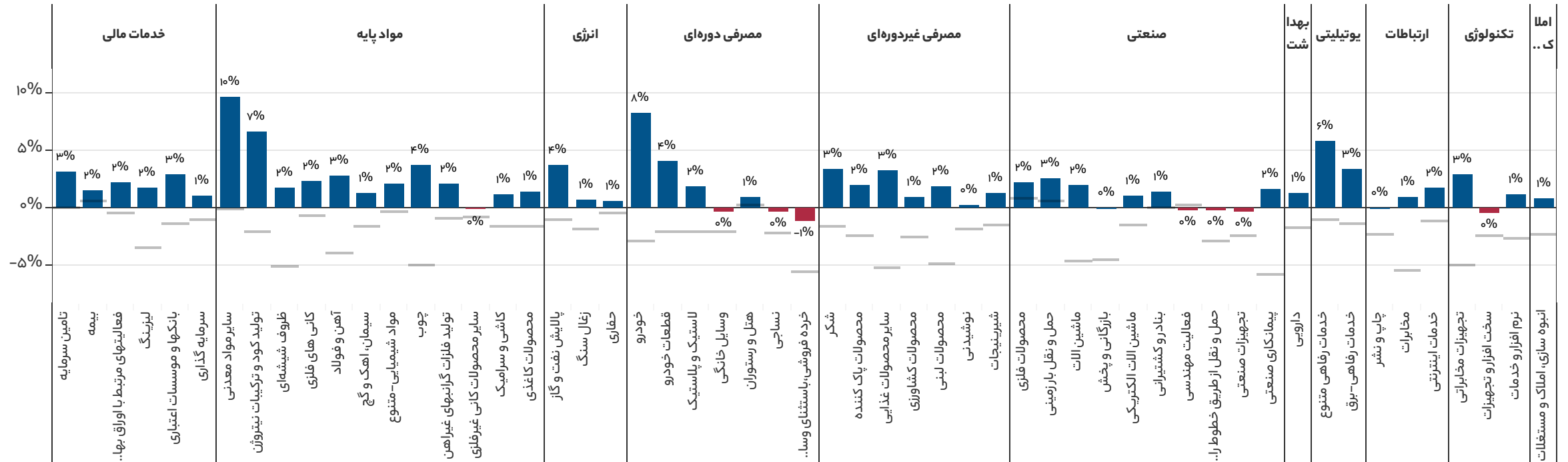


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



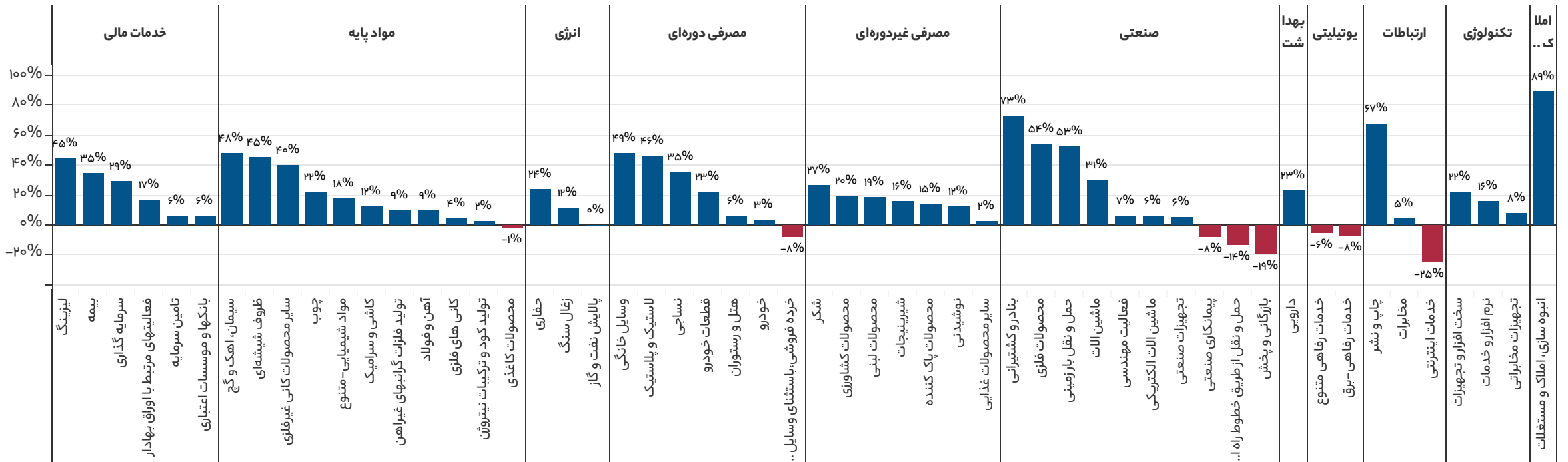
بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازده هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده‌است)



بازده صنایع از ابتدای سال

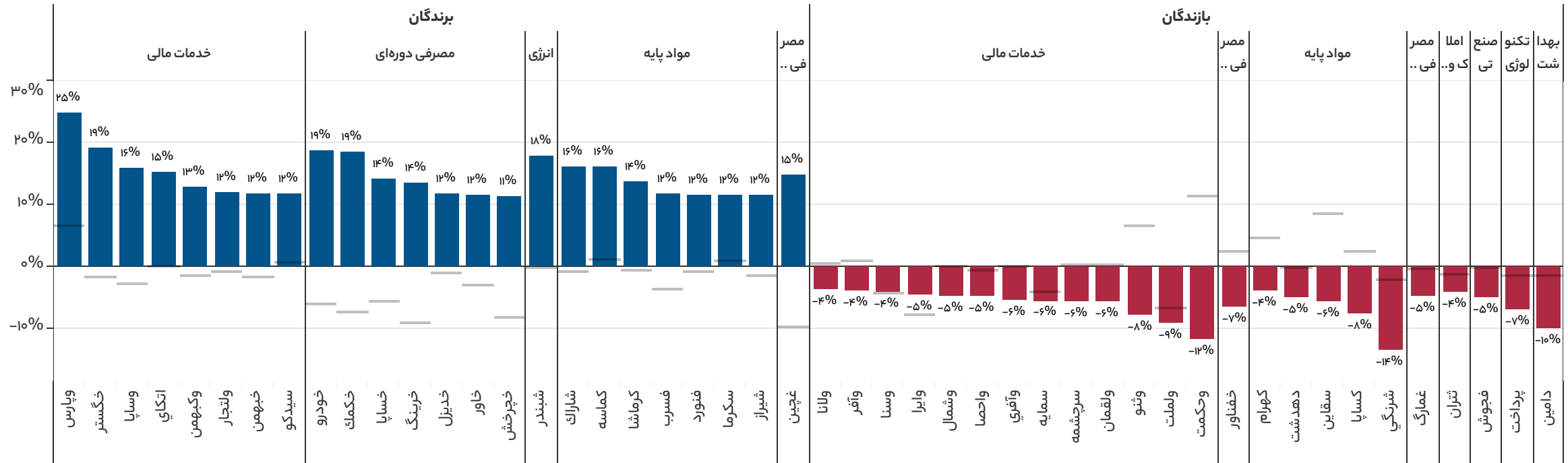
(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)



برندگان و بازندگان هفته

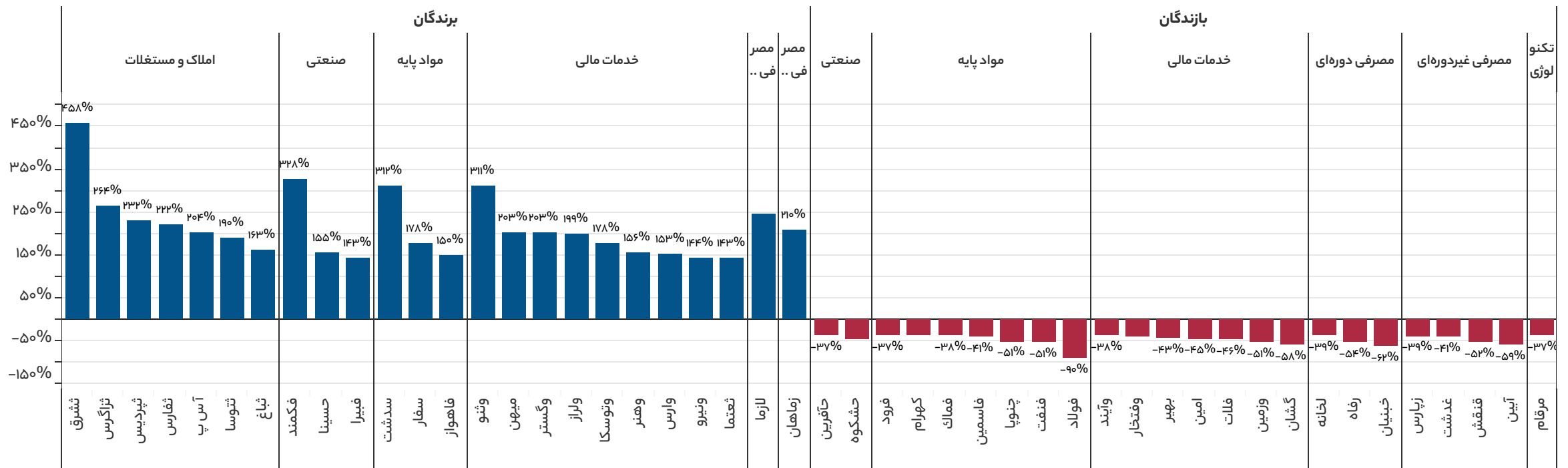
برندگان و بازندگان هفته

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

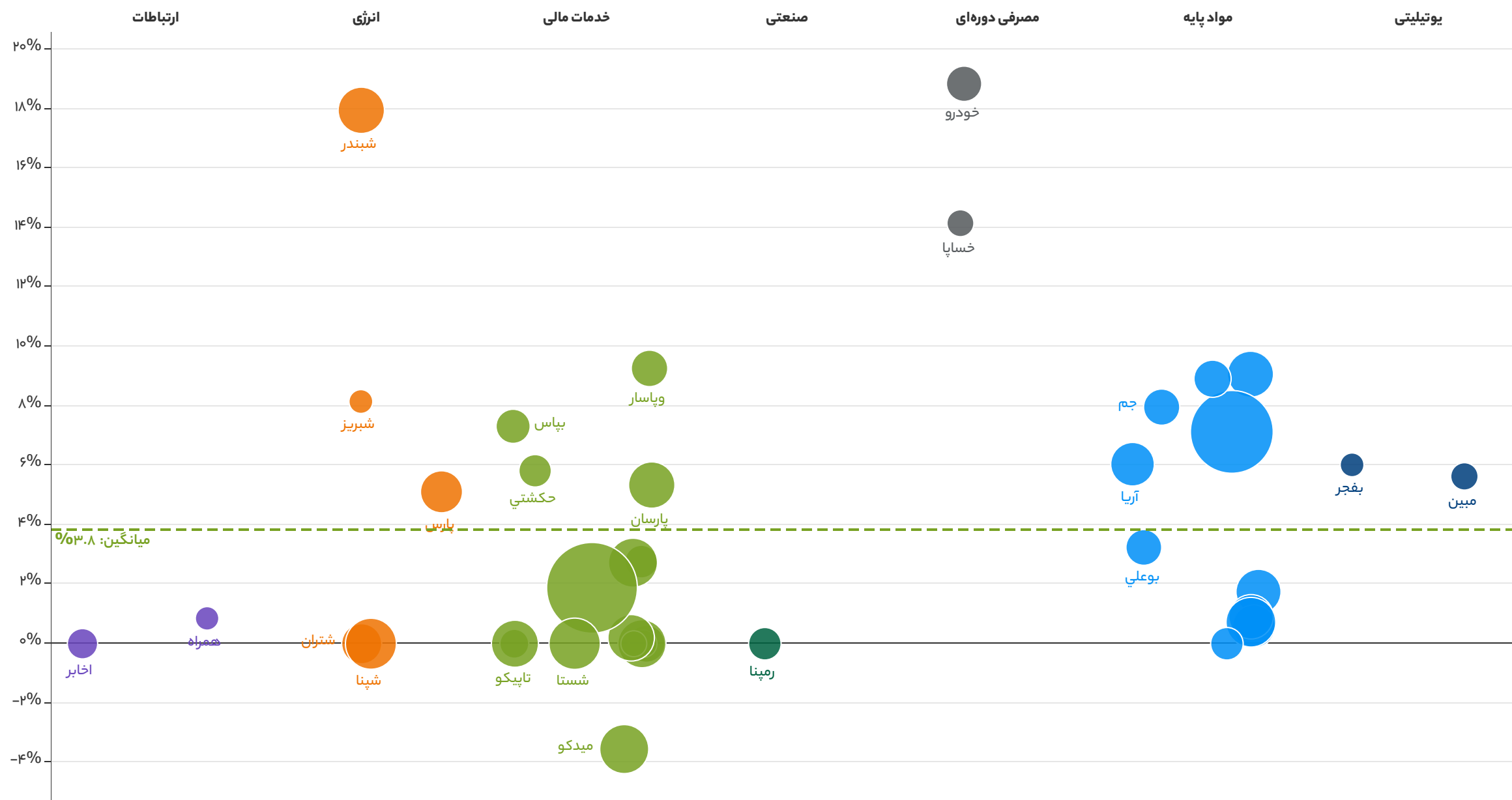


برندگان و بازندگان سال

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



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

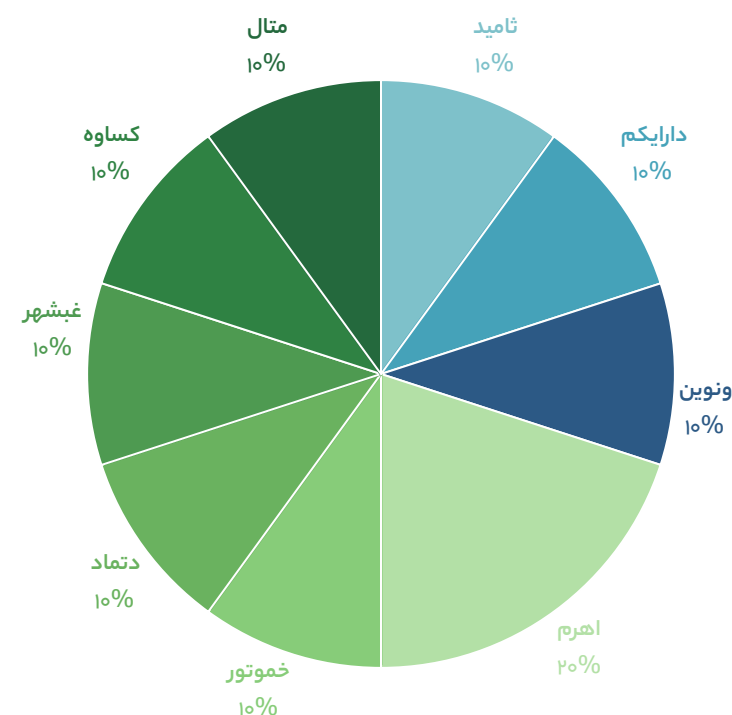


میدکه	۳۸٪	ومعدان	۰٪	وگندبر	۰٪	وغدیر	۰٪	وتجارت	۰٪	فخوز	۰٪	شستا	۰٪	شتان	۰٪	شپنا	۰٪	رمپنا	۰٪	تاپیکو	۰٪	تاخبر	۰٪	وامید	۰۰.۲٪	مارون	۰۰.۶٪	کگل	۰۰.۷٪	همراه	۰۰.۹٪	کگهر	۰۰.۹٪	نوری	۰۱.۷٪	فارس	۰۱.۹٪	ویملت	۰۲.۷٪	وسندوق	۰۲.۸٪	بوعلی	۰۳.۲٪	پارس	۰۵.۱٪	پارسان	۰۵.۳٪	مبین	۰۵.۶٪	کشتی	۰۵.۸٪	بقر	۰۶.۰٪	آریا	۰۶.۰٪	فعلی	۰۷.۱٪	پپاس	۰۷.۳٪	جم	۰۸.۰٪	شیریز	۰۸.۲٪	شپیدیس	۰۸.۹٪	کچاد	۰۹.۱٪	ویپاسار	۰۹.۲٪	خسپا	۱۴.۲٪	شبندر	۱۸.۰٪	خودرو	۱۸.۸٪	بازده هفته گذشته
-------	-----	--------	----	--------	----	-------	----	--------	----	------	----	------	----	------	----	------	----	-------	----	--------	----	-------	----	-------	-------	-------	-------	-----	-------	-------	-------	------	-------	------	-------	------	-------	-------	-------	--------	-------	-------	-------	------	-------	--------	-------	------	-------	------	-------	-----	-------	------	-------	------	-------	------	-------	----	-------	-------	-------	--------	-------	------	-------	---------	-------	------	-------	-------	-------	-------	-------	------------------



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
10%	4,085	افزایش ظرفیت و نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب به صنعت (P/NAV)	4,800	خموتور	میان مدت
10%	60,780	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب و پتانسیل حذف ارز 28500	71,000	دتماد	
10%	1,860	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب و پتانسیل حذف ارز 28500	2,400	غیشهر	
10%	18,970	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب (P/NAV)	24,000	کساوه	
10%	11,500	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	-	متال	
20%	21,910	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	-	اهرم	
10%	2,289	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب در صنعت (P/NAV)	2,900	تامید	بلند مدت
10%	168,480	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	210,000	دارایکم	
10%	2,968	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی مناسب (P/NAV)	3,800	ونوین	

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

