

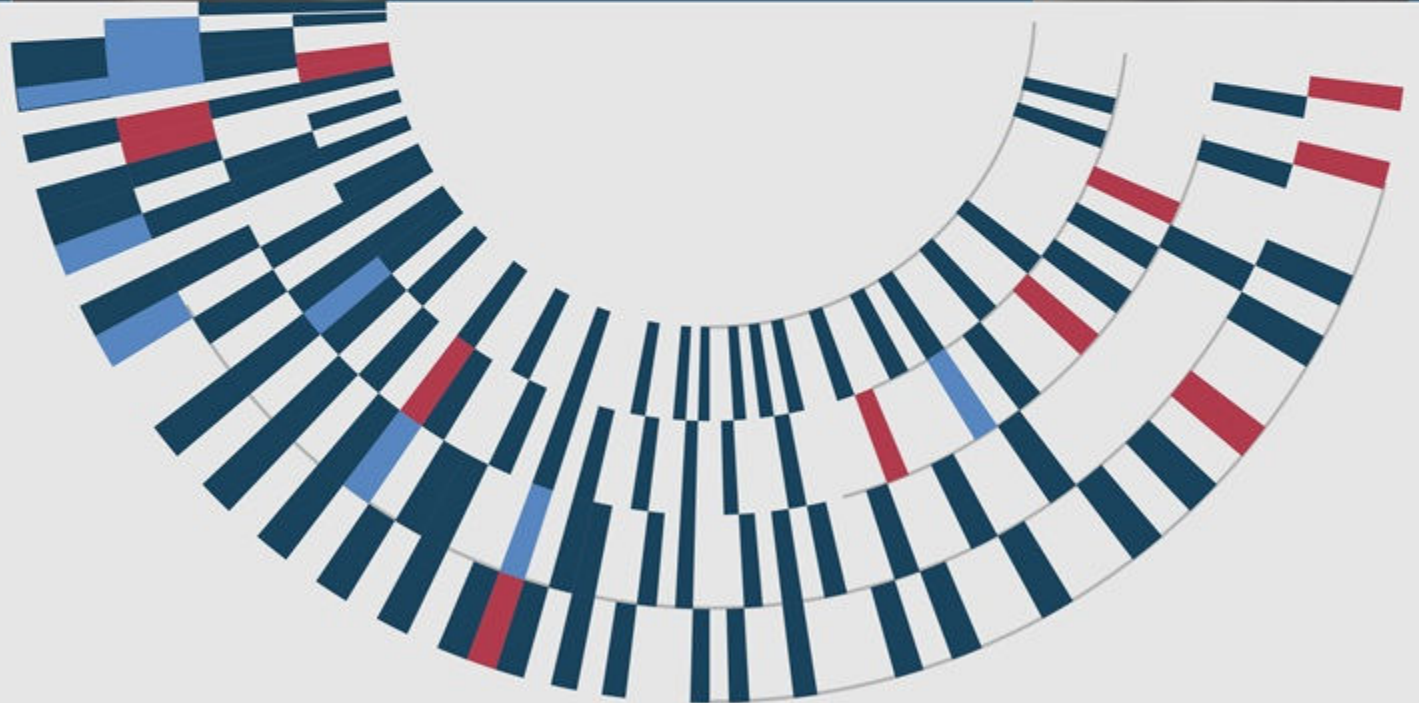
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۴ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۱/۱۰

 CHARISMA





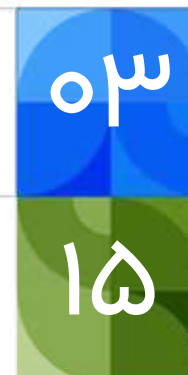
معرفی گزارش:

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

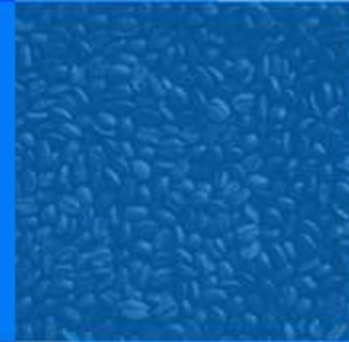
۳۲ برندگان و بازندگان هفته
۳۳ بازدهی صنایع
۳۴ سبد پیشنهادی



کامودیتی

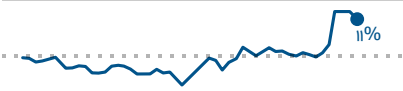
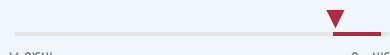
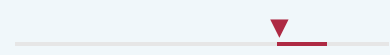
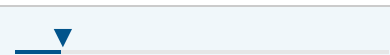
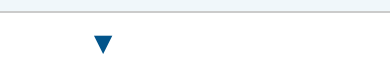
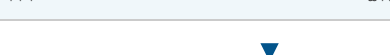
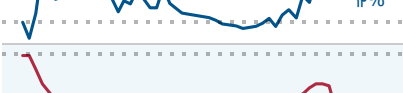
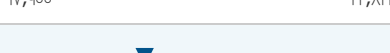
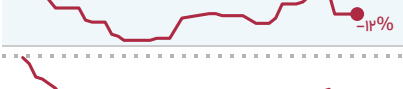
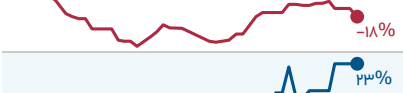
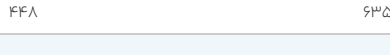
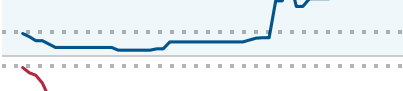
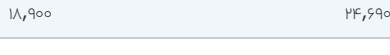
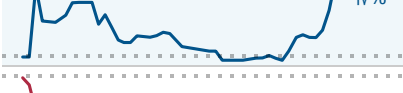
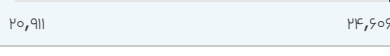
COMMODITY

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			-	فرز		۲,۲۳۳	۱۰۹%-	دلار/انس	بازار فارکس	طلا							
			بموتو، فباهنر	فملی		۸,۸۷۴	۱۰۶%-	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس							
			بموتو، فباهنر	فملی		۳۹۸,۸۰۰	-	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)							
			فنوال	فایرا		۲,۳۱۸	۱۰۸%-	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم							
			فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما		۲,۴۴۱	۱۰۶%-	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی							
			-	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما		۲,۰۵۵	۱۰۷%+	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب							
فلزات آهنی			کوبیر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان		۴۸۰	-	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)							
			کوبیر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان		۵۰۰	۱۰۰%+	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش CIS (منطقه)							
			کوبیر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق		۲۱,۲۲۵	-	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	شمش (فولاد خوزستان)							
			-	فولاد، فخوز، هرمز		۴۷۳	-	دلار/تن	بنادر ایران FOB	اسلب (ایران)							
			-	فولاد، فخوز، هرمز		۵۲۰	۳۰۷%-	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب CIS (منطقه)							
			-	فولاد، فخوز، هرمز		۲۴,۶۹۰	-	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)							
			فولای	ذوب، کوبیر		۵۸۸	۰۰۹%+	دلار/تن	بنادر ترکیه FOB	میلگرد							
			فولای	ذوب، کوبیر		۲۴,۶۰۶	-	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)							
			فجر، فسپا	فولاد، فوکا، فنورد		۵۶۳	۱۰۴%+	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم							
			-	فولاد		۶۷۳	-	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق سرد							

		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	سنگ آهن	۱۴۳	۱۵۱	۱۵%	۱۵۱	-	-	-	۲.۳%-	۱۵۲	دلار/تن	شمال چین CFR	سنگ آهن
	گندله سنگ آهن	۱۶۴	۱۱۹	۱۶%	۱۱۹	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	۳.۵%-	۱۲۵	دلار/تن	شمال چین CFR	گندله سنگ آهن
	گندله سنگ آهن (گل گهر)	۵,۱۲۶	۴,۵۹۱	۲۵%	۴,۵۹۱	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	-	۵,۱۲۶	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	گندله سنگ آهن (گل گهر)
	کنسانتره سنگ آهن	۱۵۳	۱۵۷	۱۸%	۱۵۷	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	۲.۸%-	۱۱۵	دلار/تن	شمال چین CFR	کنسانتره سنگ آهن
	کنسانتره (چادرملو)	۳,۷۴۹	۳,۱۲۸	۲۵%	۳,۱۲۸	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، ذوب، فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، فولاز، ارفع، فسازان	-	۳,۷۴۹	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی	گندم آمریکا	۲۶۸	۱۹۹	۱۷%	۱۹۹	-	-	-	۳.۵%+	۲۵۶	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
	ذرت آمریکا	۲۶۳	۱۵۷	۳۱%-	۱۵۷	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۳.۴%+	۱۷۴	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
	شکر آمریکا	۱,۷۱۶	۱,۱۹۷	۳%-	۱,۱۹۷	-	-	-	۱.۵%-	۱,۵۸۵	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
	روغن پالم خام	۸۸۱	۷۲۸	۷%	۷۲۸	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۵.۵%+	۸۸۱	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، کرماش	شاروم، شفارس		
	چین CFR	دلار/تن	۲۹۴	-۱.۷%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ ۳۵۹	-۱%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ ۱,۰۱۰	۵%
	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ ۹۳۰	-۸%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۶	-۱.۴%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ ۱,۱۵۸	-۸%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۷	+۰.۲%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ ۱,۱۶۱	-۱۰%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۳۳	-۲.۷%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ ۱,۱۶۸	۳%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۲	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ ۱,۰۶۲	۷%
	چین CFR	دلار/تن	۹۱۲	+۱.۰%	بوعلی	-	۸۰۱ ۹۱۲	
	چین CFR	دلار/تن	۱,۴۳۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ ۱,۴۳۰	۰%
پلیمرها	چین CFR	دلار/تن	۵۲۵	-۳.۳%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ ۵۵۶	۳%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۱۰	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ ۱,۰۲۰	-۱%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ ۹۸۵	-۴%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۰۱	-۱.۰%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ ۹۶۲	-۶%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۶	+۰.۷%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ ۹۱۰	-۵%
	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ ۱,۰۷۵	-۱۱%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۹۰	+۰.۶%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ ۸۸۵	-۶%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۸۵	+۰.۴%	شبصیر	-	۱,۲۳۰ ۱,۴۰۵	-۱%



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		روند قیمتی ۱۲ ماهه
نفت برنت	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۷	-۲.۴%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان	۷۴	۹۴	۲%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۳	-۲.۵%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان	۶۹	۹۱	۳%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۵	+۳.۳%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاولان	۷۸	۱۰۷	-۲%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۶	-۱.۱%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاولان	۷۹	۱۲۵	-۱%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۴۵	+۱.۶%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاولان	۳۶۹	۵۲۸	۴%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۶	-۲.۲%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاولان	۸۱	۱۲۴	۱%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۳۶	-۰.۹%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاولان	۴۵۲	۶۵۹	۳%
روغن پایه	امارات متحده CFR عربی	دلار/تن	۸۹۰	+۴.۱%	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنف	۷۲۰	۹۵۰	-۴%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۲,۲۵۱	-	-	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	۲۱,۷۹۵	۳۳,۵۱۵	۱%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۸,۶۰۶	-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان	۱۲,۱۰۵	۲۱,۶۳۴	۲۲%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۳,۱۴۶	-	-	شپاس	۱۲,۰۸۶	۱۷,۱۴۰	-۱۵%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۰۵	-۹.۳%	-	ذوب، فروش	۱۹۶	۲۸۷	-۲۲%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۸	+۰.۲%	-	-	۱.۰۵	۱.۱۲	-۱%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۶	+۰.۳%	-	-	۱.۲۱	۱.۳۱	۲%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۹,۶۶۳	+۵.۶%	-	-	۲۵,۷۰۴	۶۹,۶۶۳	۱۵۰%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

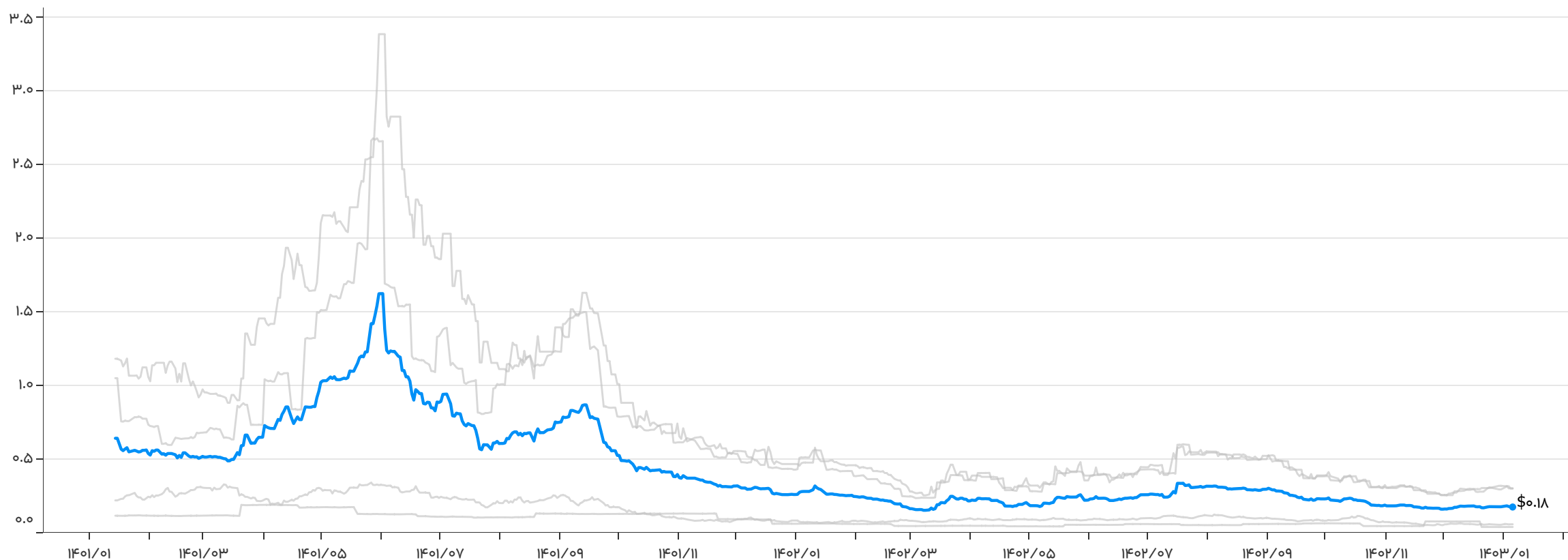
ارزو ارز دیجیتال



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	-۲.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ ۰.۱۳	-۱۷%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۴	+۰.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۴ ۰.۰۸	-۳۵%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۱	-۱.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۴۷%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۰	-۵.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۶۱	-۴۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۸	-۳.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۴۴%

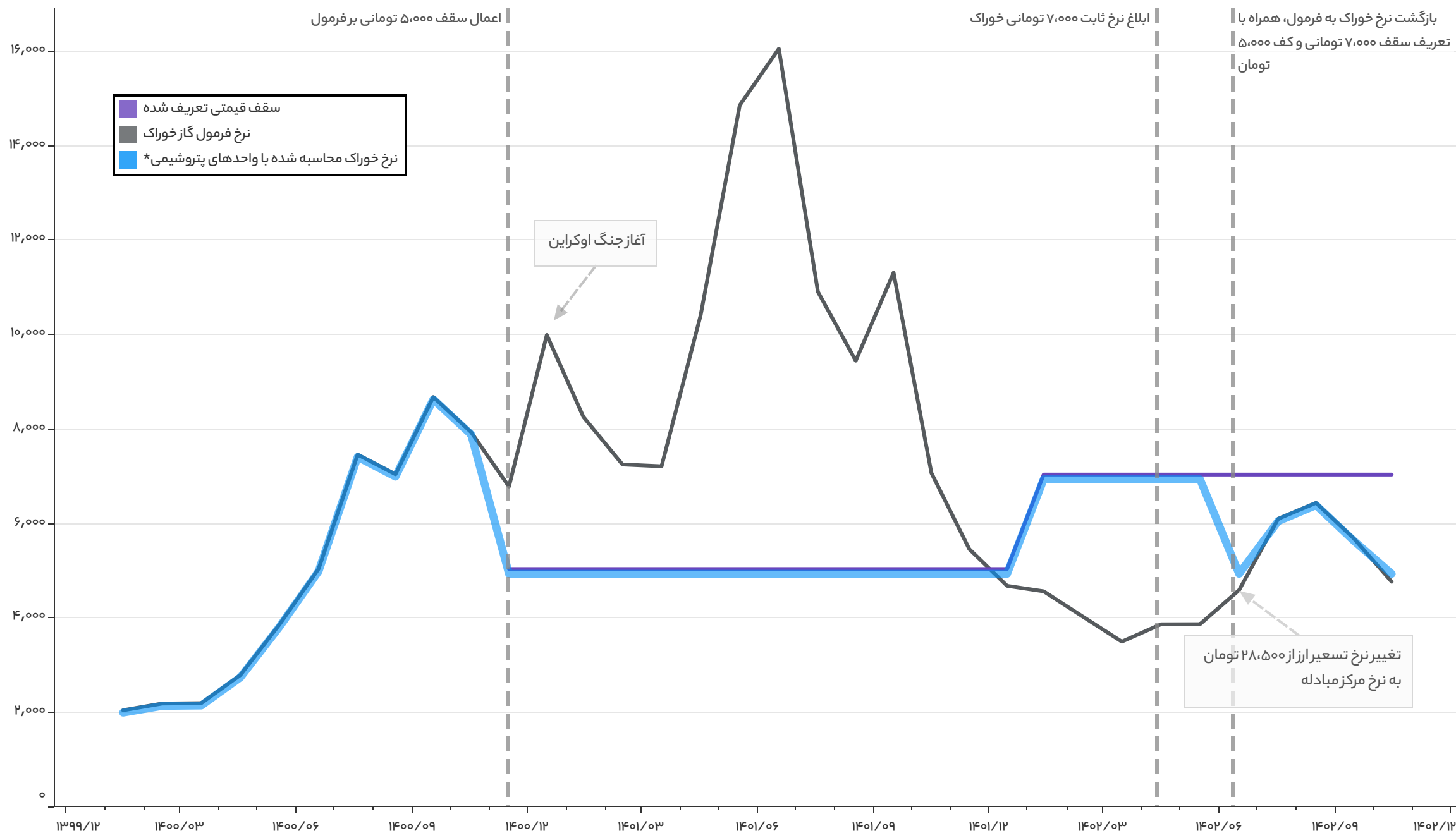
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

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



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

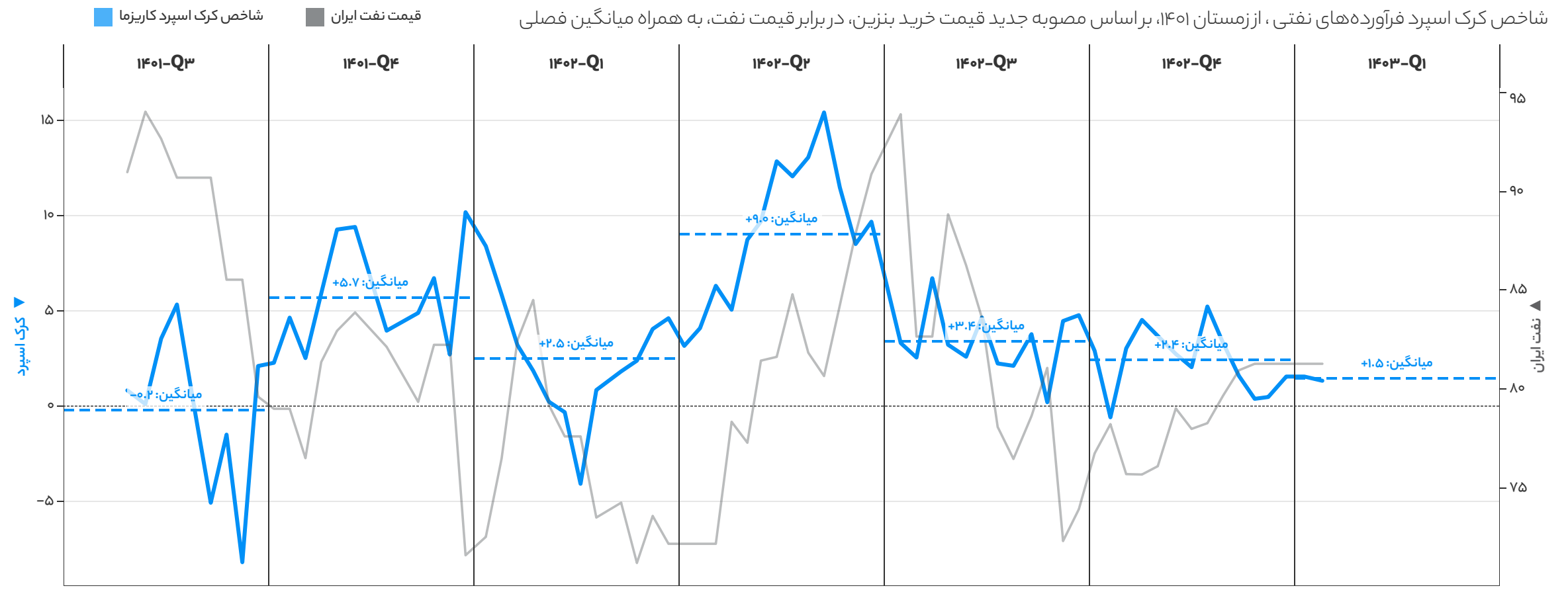
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.



کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی

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	۸۱.۳									
گازوئیل	۹۶.۱	۱۵.۹	۱۴.۸	▼۱.۱	۱۹.۵	۱۵.۳	-۲۱.۵%			
بنزین**	۸۷.۸	۶.۵	۶.۵	-	۵.۰	۶.۵	+۳۰.۰%			
نفتا	۷۱.۹	-۸.۷	-۹.۴	▼۰.۷	-۹.۶	-۹.۱	+۵.۴%			
نفت کوره	۷۰.۱	-۱۲.۳	-۱۱.۲	▲۱.۱	-۱۵.۰	-۱۱.۷	+۲۱.۸%			
لوب کات***	۷۰.۸	-۱۰.۳	-۱۰.۵	▼۰.۲	-۸.۶	-۱۰.۴	-۲۱.۷%			
وکیوم باتوم***	۴۶.۳	-۳۴.۹	-۳۵.۰	▼۰.۱	-۳۲.۴	-۳۵.۰	-۷.۸%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۱.۶	۱.۴	▼۰.۲	۲.۴	۱.۵	-۳۸.۴%			

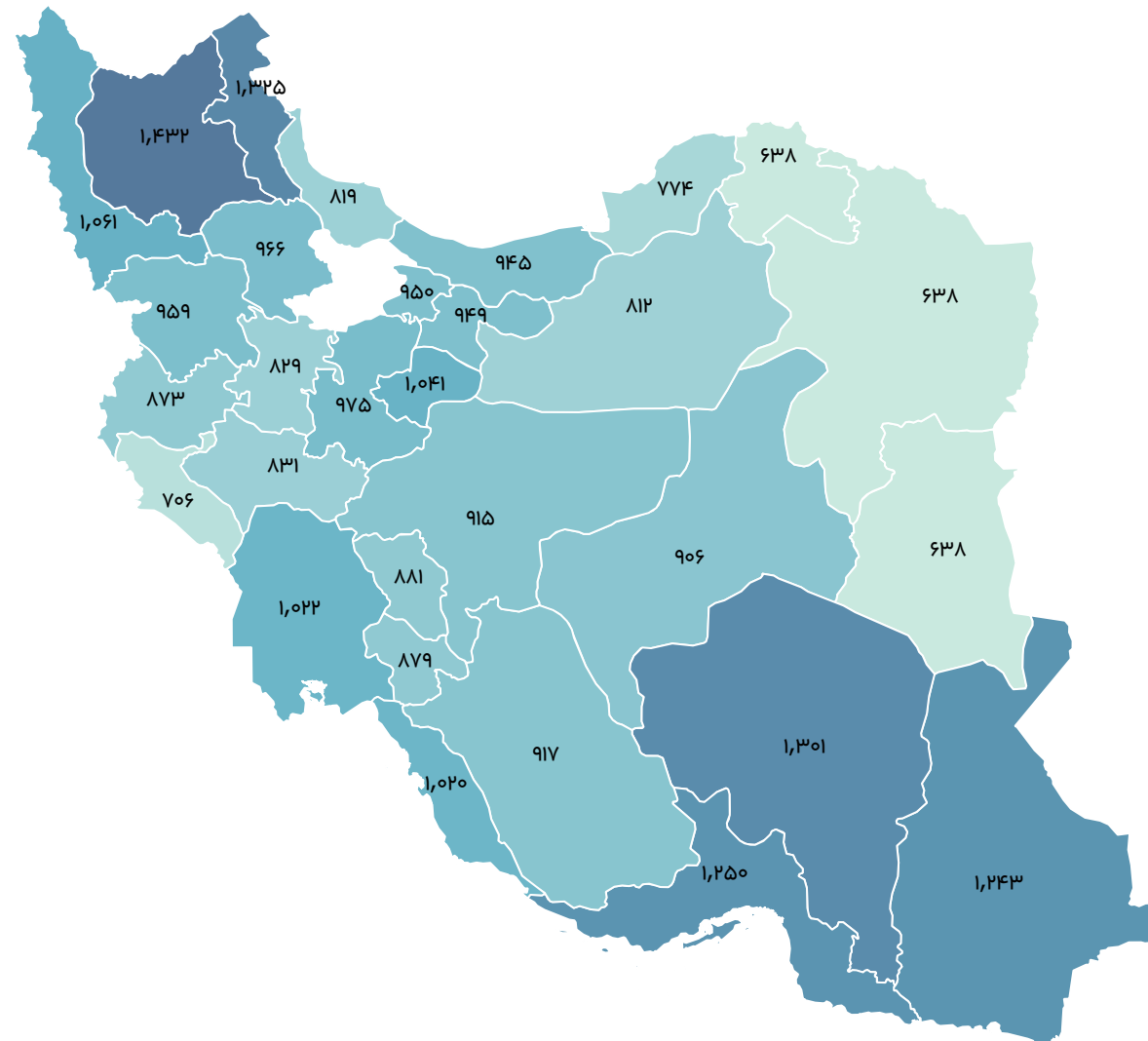
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هریک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هریک از این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

** قیمت بنزین بر اساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شیندر، شتران و شبریز) و بر اساس نوع بنزین فروخته شده توسط هریک این پالایشگاه‌ها حساب گردیده است.

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

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



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

آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

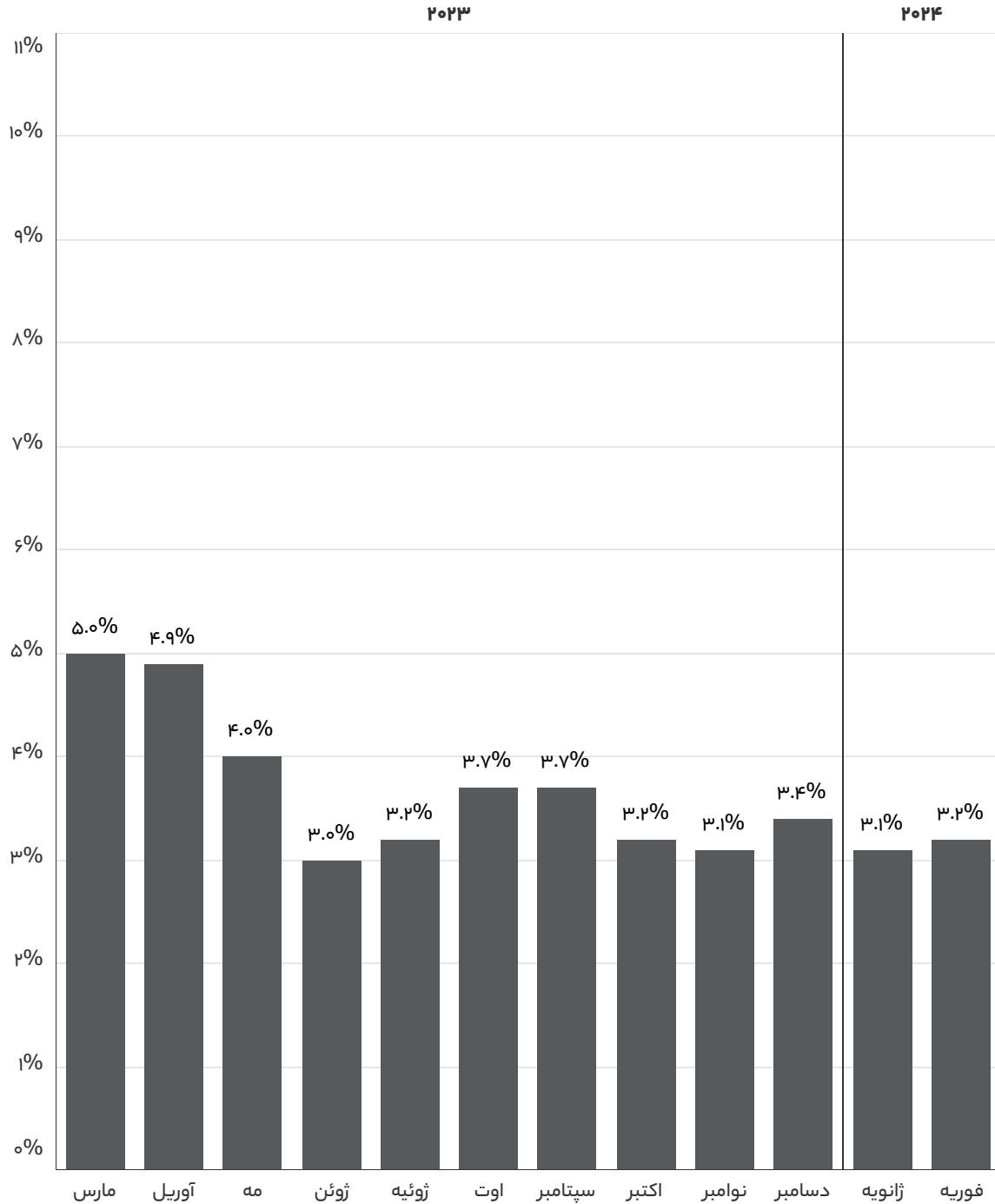
به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس حجم معاملات، تومان به کیلوگرم

منطقه	استان	شرکت دنبال‌کننده	هفته گزارش	هفته گذشته	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	سیمان تهران	۹۴۹		
	البرز	سیمان آتیک	۹۵۰		
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۷۵		
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵		
	قم	سیمان نیزار قم	۱,۰۴۱		
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۹۰۶		
غرب	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹		
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۱,۰۲۲		
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶		
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۸۱		
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۷۳		
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹		
	لرستان	سیمان دورود	۸۳۱	۸۳۱	-
شمال	کردستان	سیمان کردستان	۹۵۹		
	مازندران	سیمان مازندران	۹۴۵		
	گیلان	سیمان خزر	۸۱۹		
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۷۴		
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۲۵۰		
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷		
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۱,۰۲۰		
شمال غرب	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۳۲۵		
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۴۳۲		
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۱,۰۶۱		
شمال شرق	زنجان	سیمان خمسه	۹۶۶		
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸		
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸		
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸		
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۱,۳۰۱		
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۲۴۳		

- ▼ به گزارش رویترز، احتمال آتش‌بس در غزه قیمت نفت را پایین آورده است، اما جنگ اوکراین و کاهش تعداد چاه‌های فعال نفت آمریکا مانع سقوط بیش از حد قیمت آن شده است. قیمت هر بشکه نفت برنت دریای شمال روز جمعه سوم فروردین، با ۳۵ سنت معادل ۰.۴۱ درصد کاهش به ۸۵ دلار و ۴۳ سنت رسید. نفت سبک آمریکا هم با ۴۴ سنت معادل ۰.۵۴ درصد کاهش ۸۰ دلار و ۶۳ سنت پایان یافت. همه چشم‌ها به آتش‌بس غزه دوخته شده است، اگر این اتفاق با موفقیت انجام شود، یمن هم اجازه عبور نفتکش‌ها را از دریای سرخ خواهد داد. آنتونی بلینکن وزیر امور خارجه آمریکا در روز پنجشنبه گفت عقیده دارد مذاکرات قطر به یک قرارداد آتش‌بس در غزه بین رژیم صهیونیستی و حماس می‌انجامد.
- ▼ واردات محصولات انرژی به اتحادیه اروپا در سه ماهه چهارم سال ۲۰۲۳ به ۱۱۱.۳ میلیارد یورو و در مجموع به ۱۸۷.۹ میلیون تن رسید. در مقایسه با سه ماهه مشابه سال ۲۰۲۲، واردات هم از نظر ارزش (منفی ۳۴.۲ درصد) و هم از نظر وزن خالص (منفی ۱۱.۷ درصد) کاهش یافته است. به گزارش اداره آمار کمیسیون اروپا (یورواستات)، در مقایسه سال ۲۰۲۳ با سال ۲۰۲۲، ارزش واردات محصولات انرژی ۳۵ درصد و حجم واردات آن ۹.۴ درصد کاهش یافته است. تغییر در ارزش واردات عمدتاً ناشی از کاهش قیمت‌ها بوده است. در سال ۲۰۲۳، ارزش گاز طبیعی وارداتی نسبت به سال ۲۰۲۲ با کاهش ۵۲.۲ درصدی روبرو شده، در حالی که حجم آن ۱۶.۱ درصد کاهش داشته است. این کاهش ارزش به دلیل افت قیمت گاز طبیعی پس از افزایش شدید قیمت در سال ۲۰۲۲ رخ داد. سال ۲۰۲۲ رشد ۲۰۰.۴ درصدی در ارزش گاز وارداتی به همراه کاهش ۰.۷ درصدی در حجم واردات ثبت شده بود.
- ▲ بر اساس داده‌های کپلر، در ۱۰ روز منتهی به ۱۷ مارس، ۶.۲ میلیون بشکه دیزل روسیه در نفتکش‌ها در دریا ذخیره شده بود که بالاترین سطح دیزل در ذخایر شناور طی سال‌های اخیر است و از سطح اوایل سال ۲۰۲۳ که اتحادیه اروپا واردات دیزل و سایر سوخت‌ها از روسیه را از طریق دریا ممنوع کرد، فراتر رفته است. طبق برآوردهای بلومبرگ، سطح فعلی ذخایر دیزل شناور روسیه، بسیار بالاتر از بهار و تابستان سال ۲۰۲۰ است که شیوع پاندمی کرونا، به تقاضای جهانی سوخت ضربه زد. بلومبرگ به نقل از منابع آگاه گزارش کرد همه پالایشگاه‌های هندی، اکنون حاضر به دریافت نفت روسیه که توسط کشتی‌های شرکت نفتکش سوفکامفلوت (Sovcomflot) حمل شده است نیستند تا مبادا تحریم‌های آمریکا علیه روسیه را نقض کنند. روسیه معمولاً صادرکننده بزرگ سوخت و تامین‌کننده بازارهای بین‌المللی است، اما اختلال در فعالیت پالایشگاه‌های نفت، شرکت‌های نفتی روسیه را مجبور به واردات بنزین از بلاروس کرده است.
- واشنگتن می‌گوید از پروژه خط لوله انتقال گاز ایران-پاکستان حمایت نکرده و درباره خطر تحریم‌ها به دلیل همکاری اسلام‌آباد با تهران هشدار داده است. پیشتر رسانه‌های پاکستانی گزارش داده بودند «مصدق مالک» وزیر نفت پاکستان گفته اسلام‌آباد قصد درخواست از دولت آمریکا برای دریافت معافیت از تحریم‌ها برای پروژه خط لوله گاز پاکستان-ایران را دارد. پایگاه خبری نیشن پاکستان روز دوشنبه نوشت مصدق مالک در گفت‌وگوی غیررسمی با رسانه‌ها گفت: ما به دنبال معافیت از تحریم‌های آمریکا خواهیم بود، زیرا پروژه گازی پاکستان و ایران نمی‌تواند بار تحریم‌ها را تحمل کند. به نوشته روزنامه داون پروژه خط لوله انتقال گاز ایران-پاکستان از مدت‌ها پیش در دستور کار قرار داشته اما چندین سال گرفتار تاخیرهای مکرر و چالش‌ها بر سر تامین بودجه شده است.
- افت جهانی قیمت متانول بسیاری از متانول‌سازها را در حاشیه زیان قرار داده است. آن‌ها نرخ‌های فعلی خوراک را قبول نداشته و خواهان ارائه تخفیف‌های قیمتی هستند. این همان خواسته‌ای است که در شورای کمیسیون اقتصادی دولت چند ماهی است که در دست بررسی است. آنگونه که مرتضی شاهمیرزایی مدیرعامل شرکت صنایع ملی پتروشیمی در روزهای پایانی اسفند اعلام کرده این پیشنهاد در کمیسیون اقتصادی مجلس مورد موافقت قرار گرفته اما فریبز کریمایی قائم می‌گوید که این آیین‌نامه هنوز نهایی نشده است. آیین‌نامه تخفیف‌های پلکانی چیزی جدیدی نیست اما آنگونه که قائم مقام انجمن کارفرمایی صنعت پتروشیمی به بازار می‌گوید در سال‌های گذشته خیلی کاربردی نبوده و به همین دلیل قرار بوده که اصلاحاتی در جز ۴ بند الف ماده یک تنظیم مقررات ماده ۲ آن صورت گیرد.
- جلیل سالاری، مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فراورده‌های نفتی ایران اظهار داشت: بیشترین میزان مصرف بنزین در ایام نوروز امسال به ۲۹ اسفند بازمی‌گردد که ۱۵۲ میلیون لیتر در این روز به مصرف رسید که نسبت به مصرف ۱۴۴ میلیون لیتری بنزین در روز مشابه سال قبل از آن، ۸ میلیون لیتر رشد داشته است. وی افزود: متوسط مصرف بنزین در ایام نوروز امسال تا امروز ۱۱۸.۹ میلیون لیتر در روز بوده که رقم بسیار بالایی است و نسبت به متوسط مصرف بنزین در ایام مشابه سال قبل که رقم ۱۱۵ میلیون لیتر بوده، رشدی ۴.۶ درصدی را نشان می‌دهد. مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فراورده‌های نفتی ایران اذعان داشت: در روز ۲۹ اسفندماه فقط در تهران ۲۱.۵ میلیون لیتر مصرف بنزین داشته ایم.

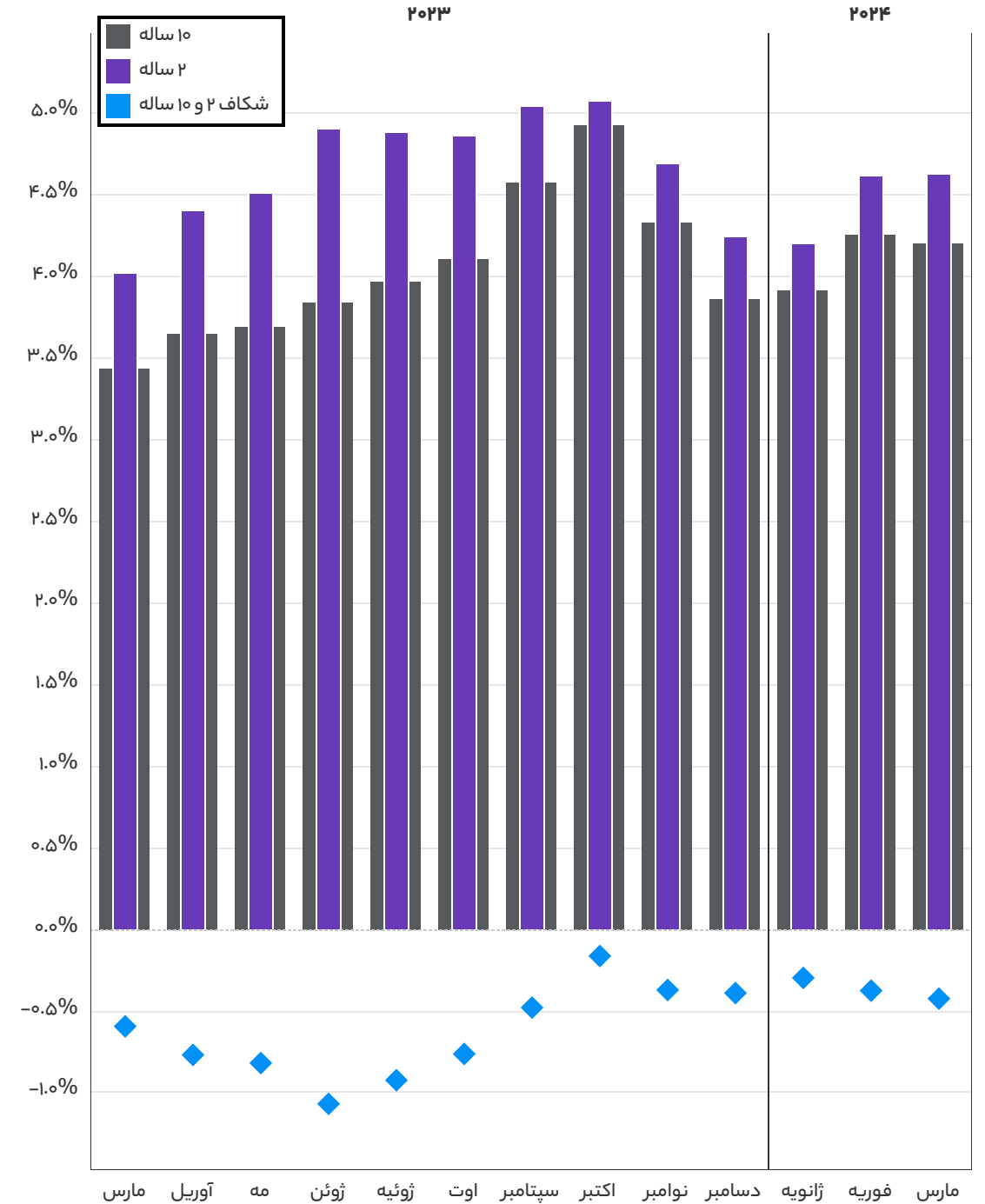
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

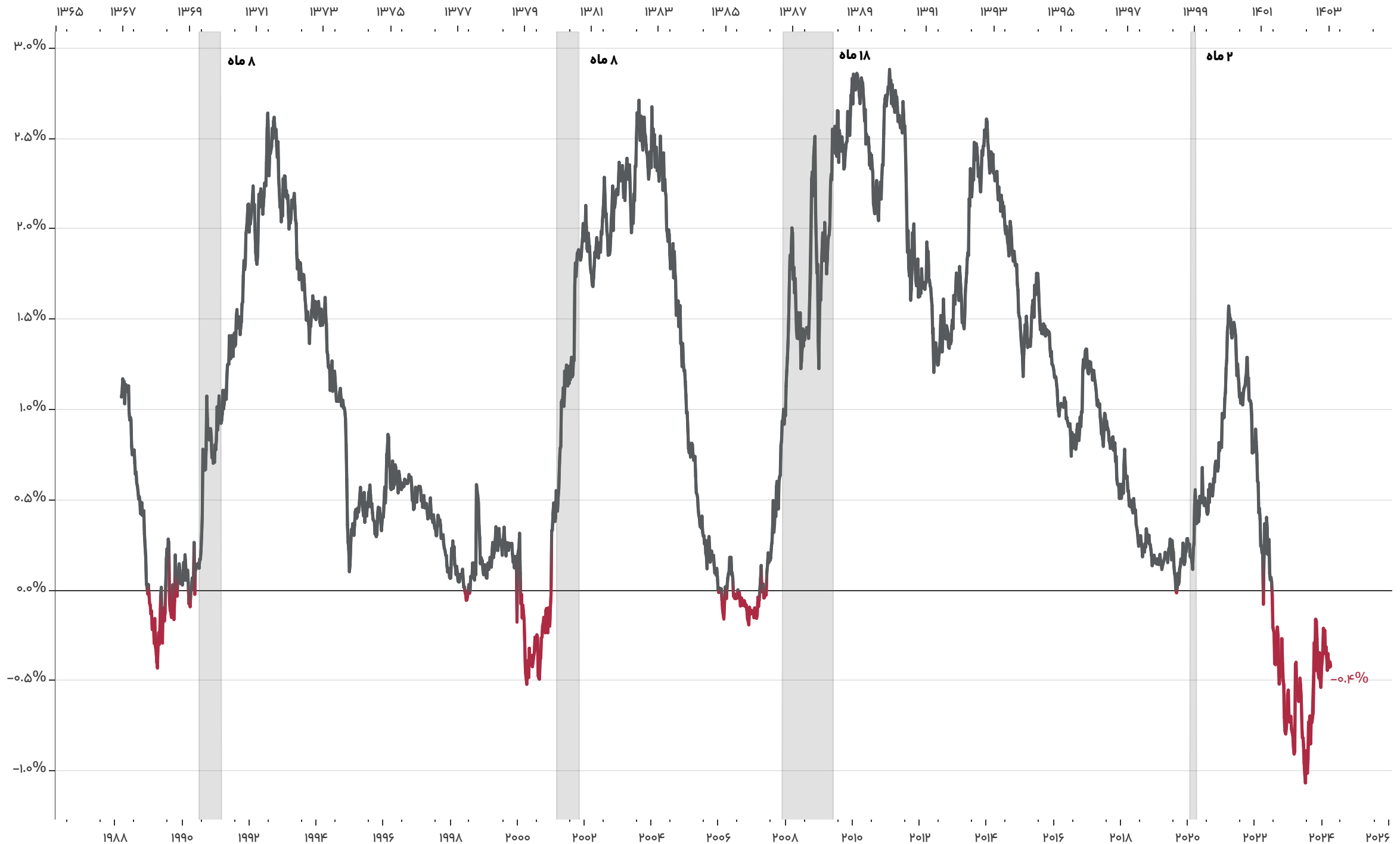
ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده





شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

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



بازار سهام

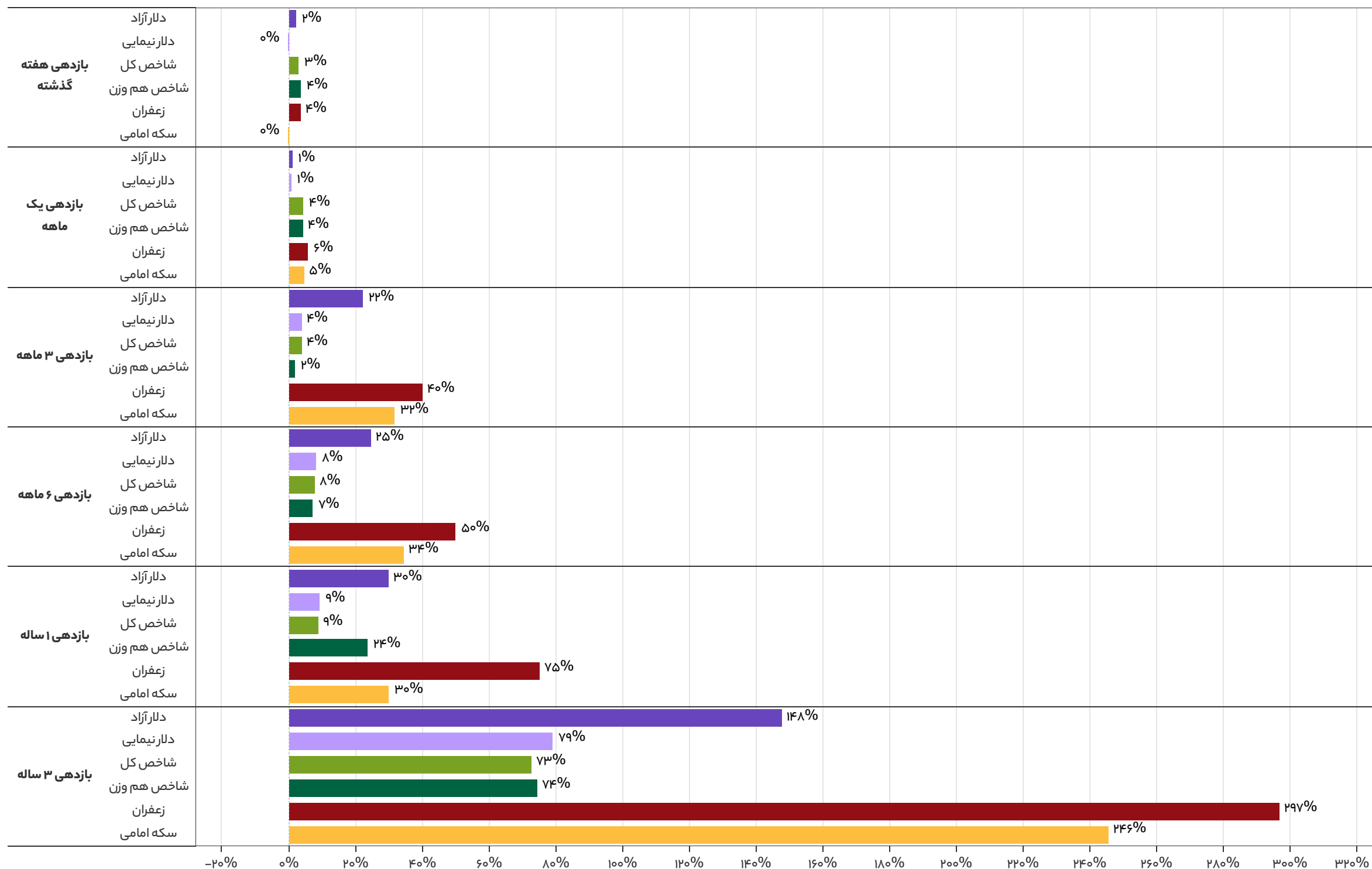
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها در بازه‌های زمانی متفاوت





بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

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

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۱۱	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 ▲ ۴۰.۹٪
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 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 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

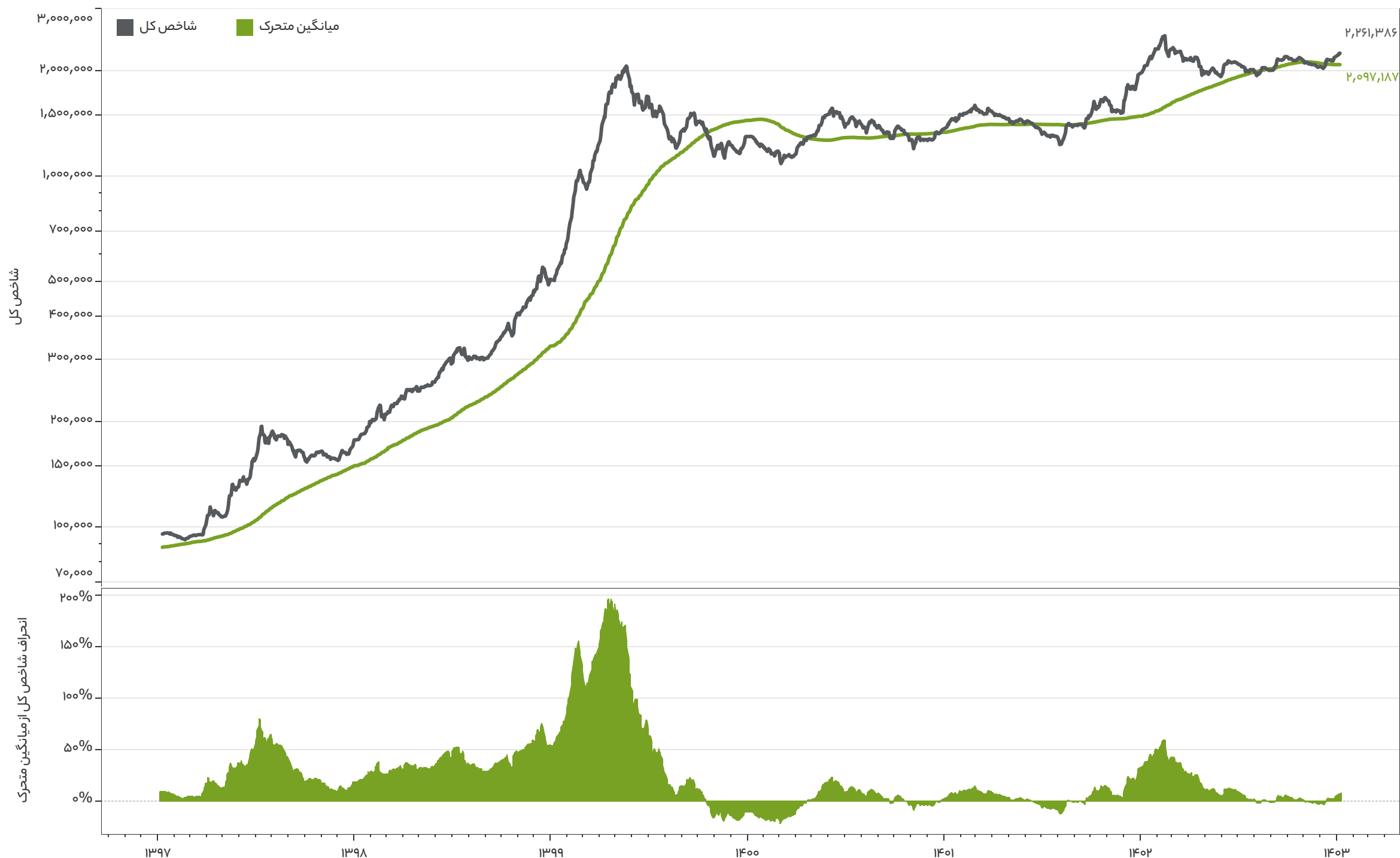
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





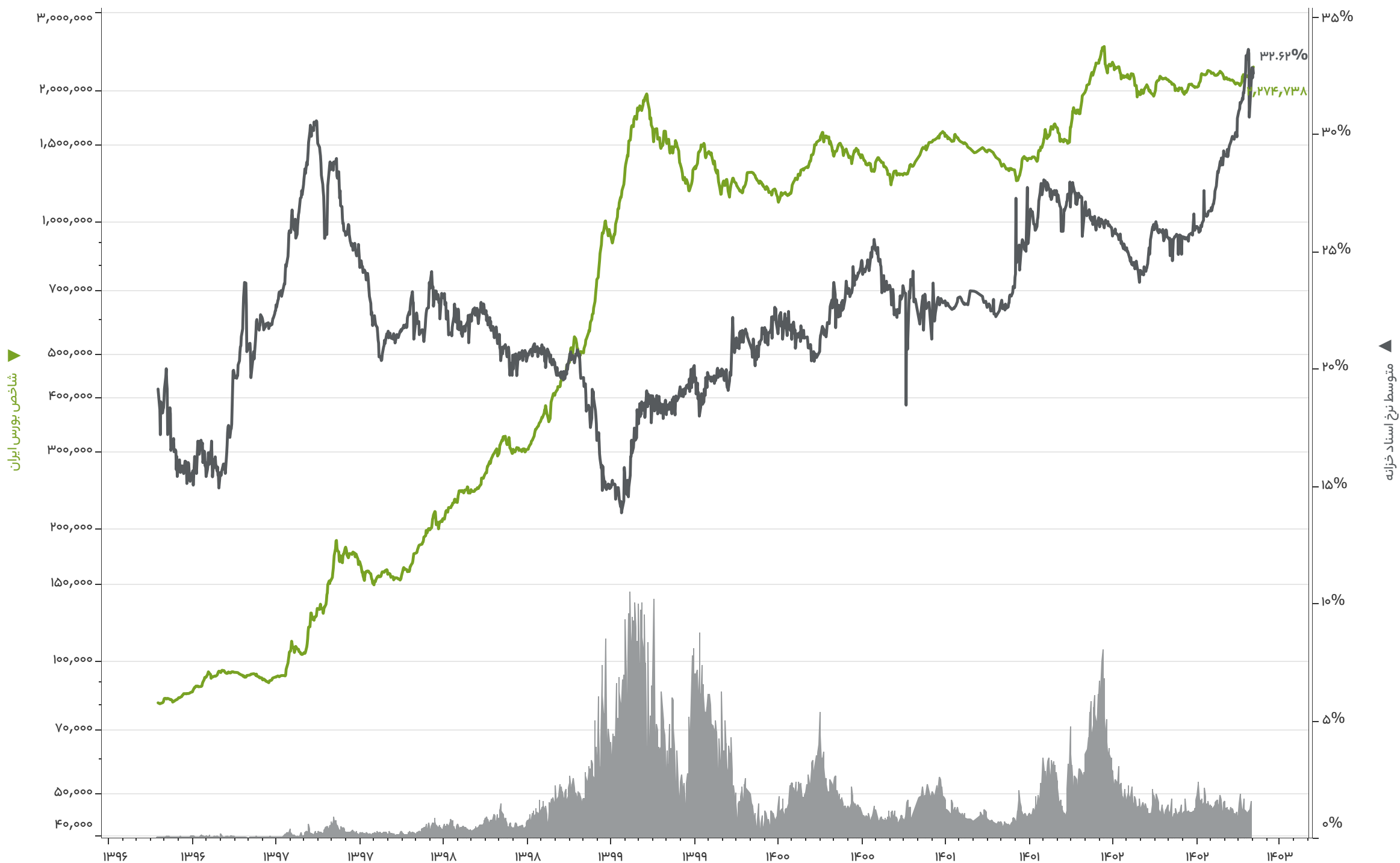
شاخص کل و میانگین متحرک

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



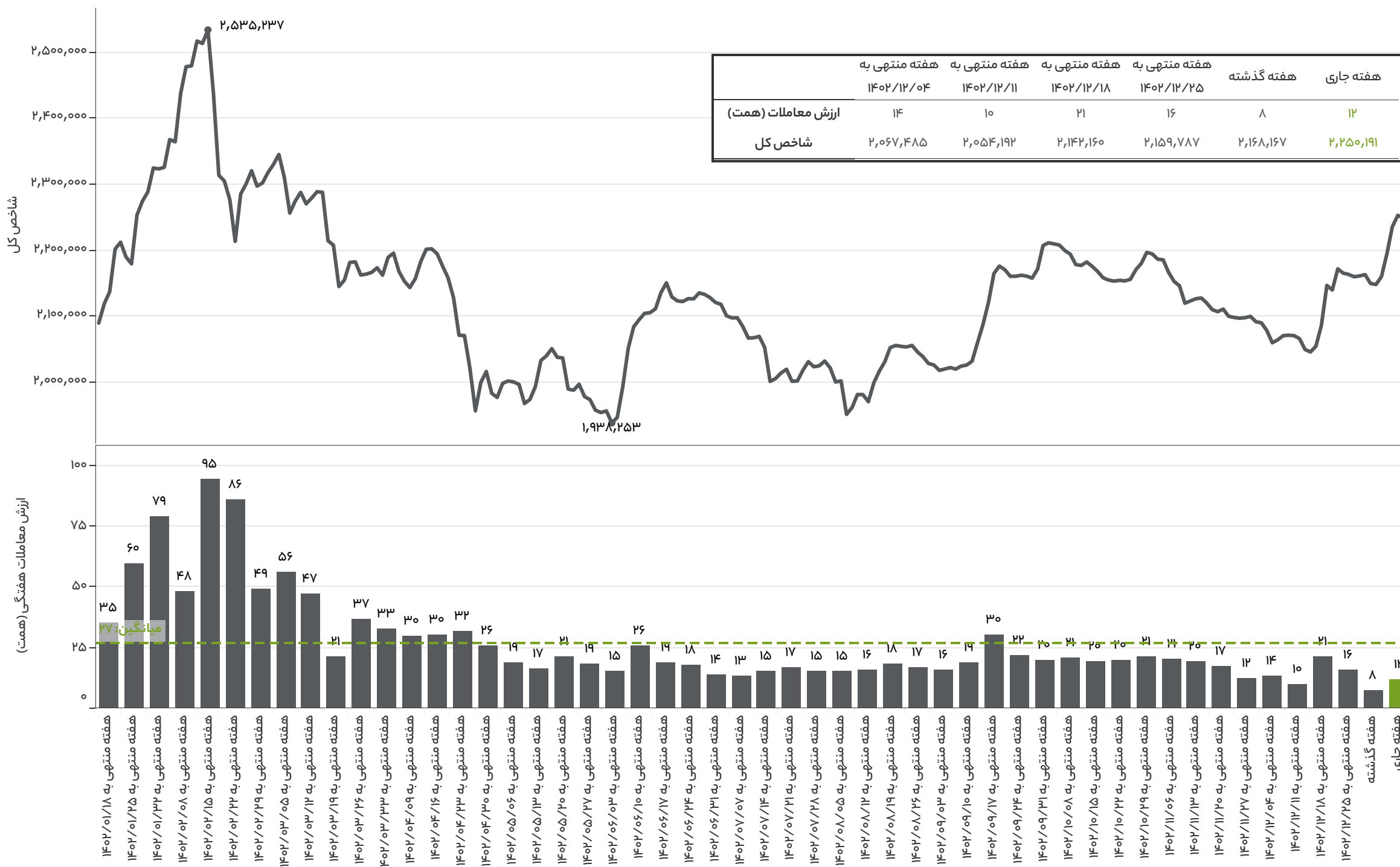
تأثير نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



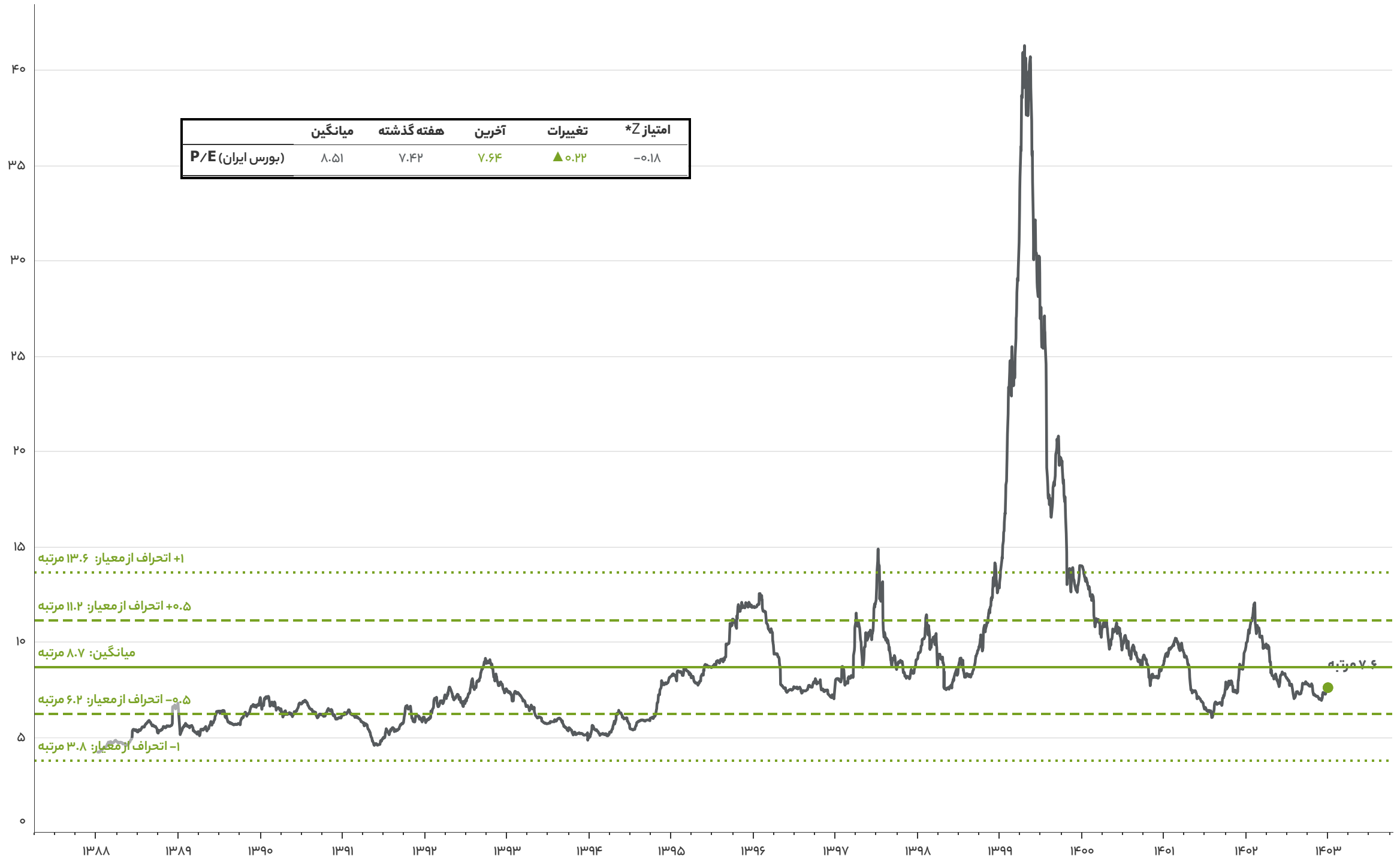
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.



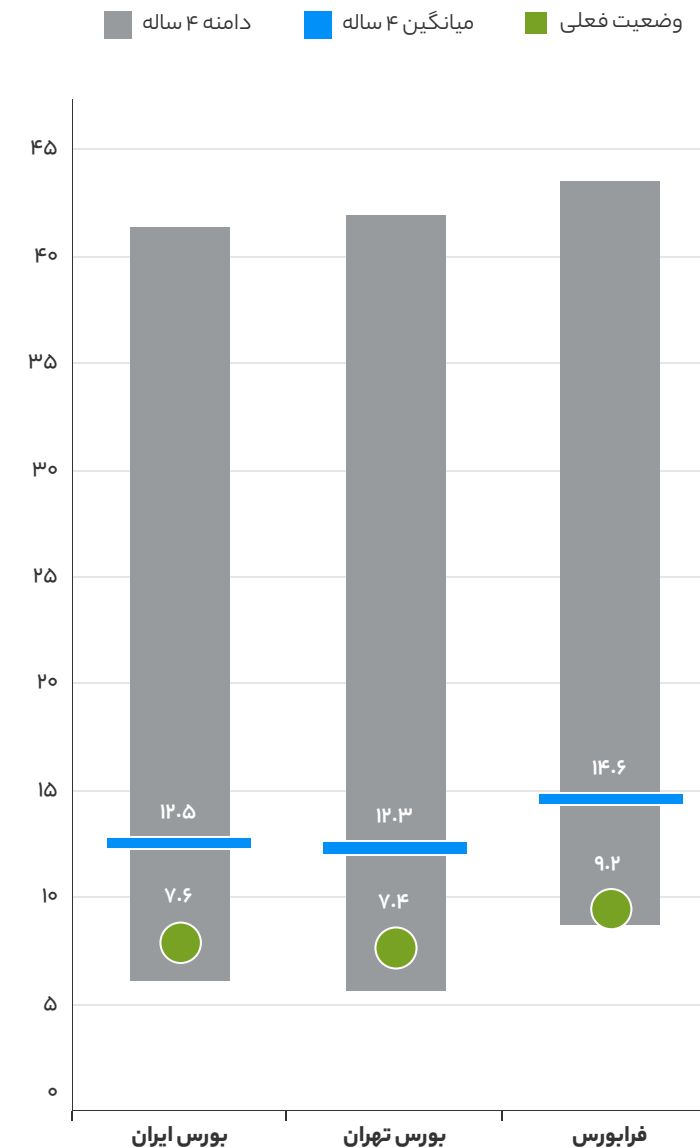
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۷.۶۴	۷.۴۲	۶.۰۷	۱۲.۵۴	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۴۰	۷.۱۸	۵.۶۴	۱۲.۳۳	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۱۶	۸.۹۹	۸.۷۲	۱۴.۶۳	۴۳.۵۱

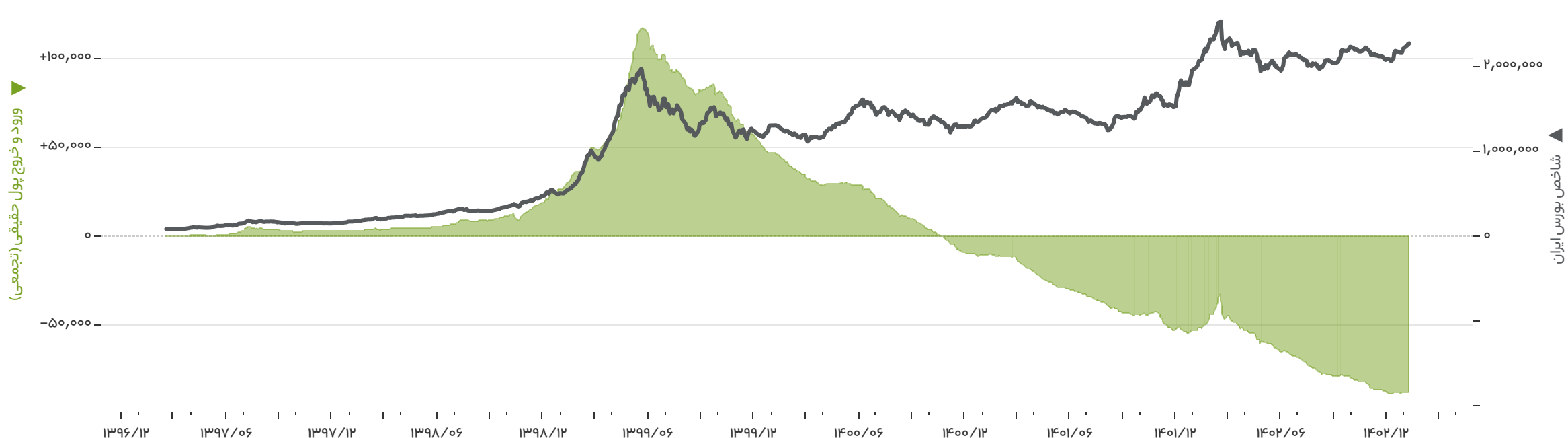


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۶۲	۹۵	۱۱۶	۱۲۳	۱۵۹	۱۹۸	۲۴۷	۴۰۴	۶۷۰	۳,۳۱۵	۳,۵۵۸	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۰.۷%	۱.۱%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۸%	۲.۲%	۲.۸%	۴.۵%	۷.۵%	۳۷.۰%	۳۹.۸%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۵.۵	۱۳.۰	۱۱.۵	۱۷.۸	۹.۰	۸.۹	۹.۷	۴.۹	۴.۹	۷.۰	۷.۸	سودآوری
بازده سود نقدی	۲.۷%	۱۵.۸%	۳.۴%	۲.۶%	۷.۰%	۳.۸%	۴.۷%	۳.۵%	۱۳.۵%	۸.۹%	۸.۳%	
نسبت تقسیم سود	۳۹%	۱۰۰%	۴۱%	۵۷%	۷۴%	۳۷%	۵۲%	۳۳%	۶۳%	۶۱%	۷۲%	
بتا به شاخص کل	۰.۹	۱.۱	۱.۴	۰.۷	۰.۸	۱.۲	۰.۹	۱.۱	۱.۱	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۷۴۲%	+۸۵۴%	+۱۴۲%	+۳۳۸%	+۴۰۰%	+۴۶۴%	+۴۵۴%	+۹۴۵%	+۸۸۶%	+۸۸۶%	+۱۰۴۸%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۷%	+۱۳۳%	-۶۱%	+۹%	+۱۹%	-۲%	-۲%	-۶%	+۲۸%	+۳%	+۷۸%	
بازده از ابتدای سال	+۲۷۶%	+۵۴%	+۵۵%	+۹۰%	+۹۹%	+۱۱۸%	+۶۲%	+۱۰۸%	+۱۱۰%	+۷۵%	+۱۰۰%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۶%	۱%	۷%	۵%	۳%	۴%	۳%	۳%	۲%	۳%	۳%	

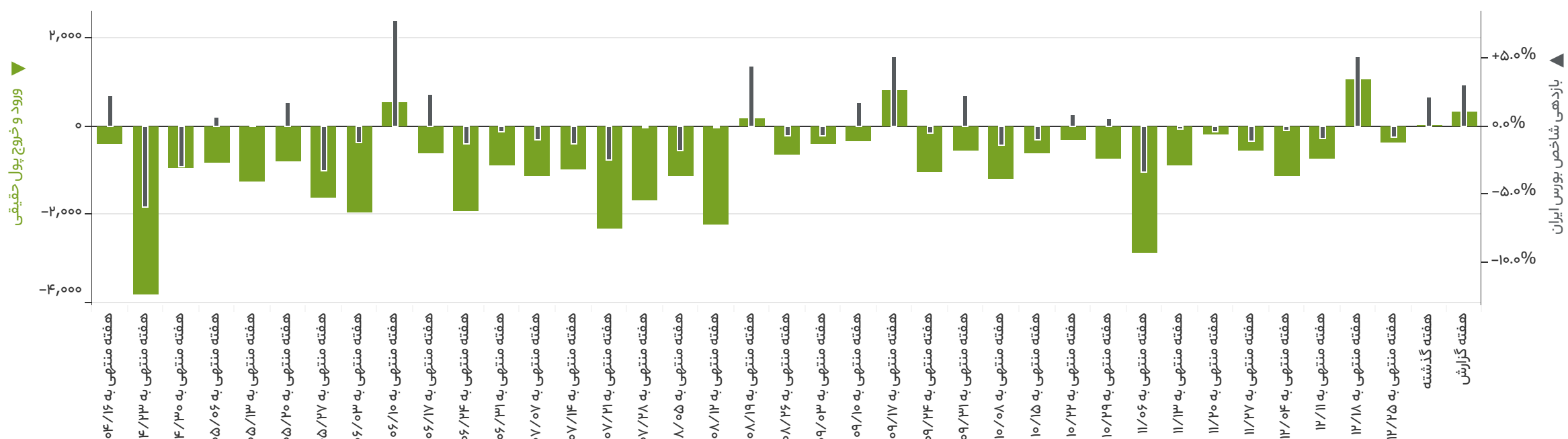
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



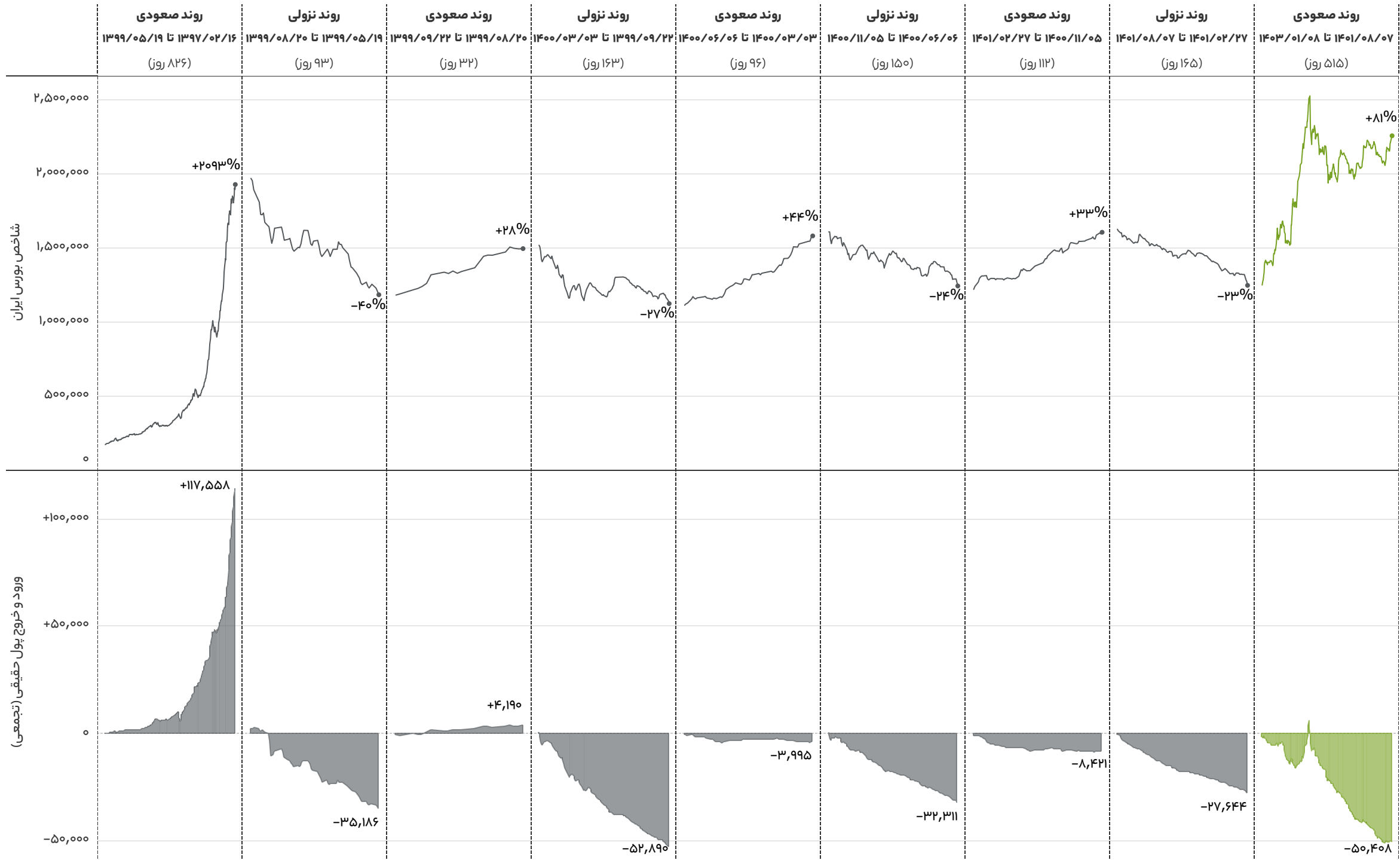
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

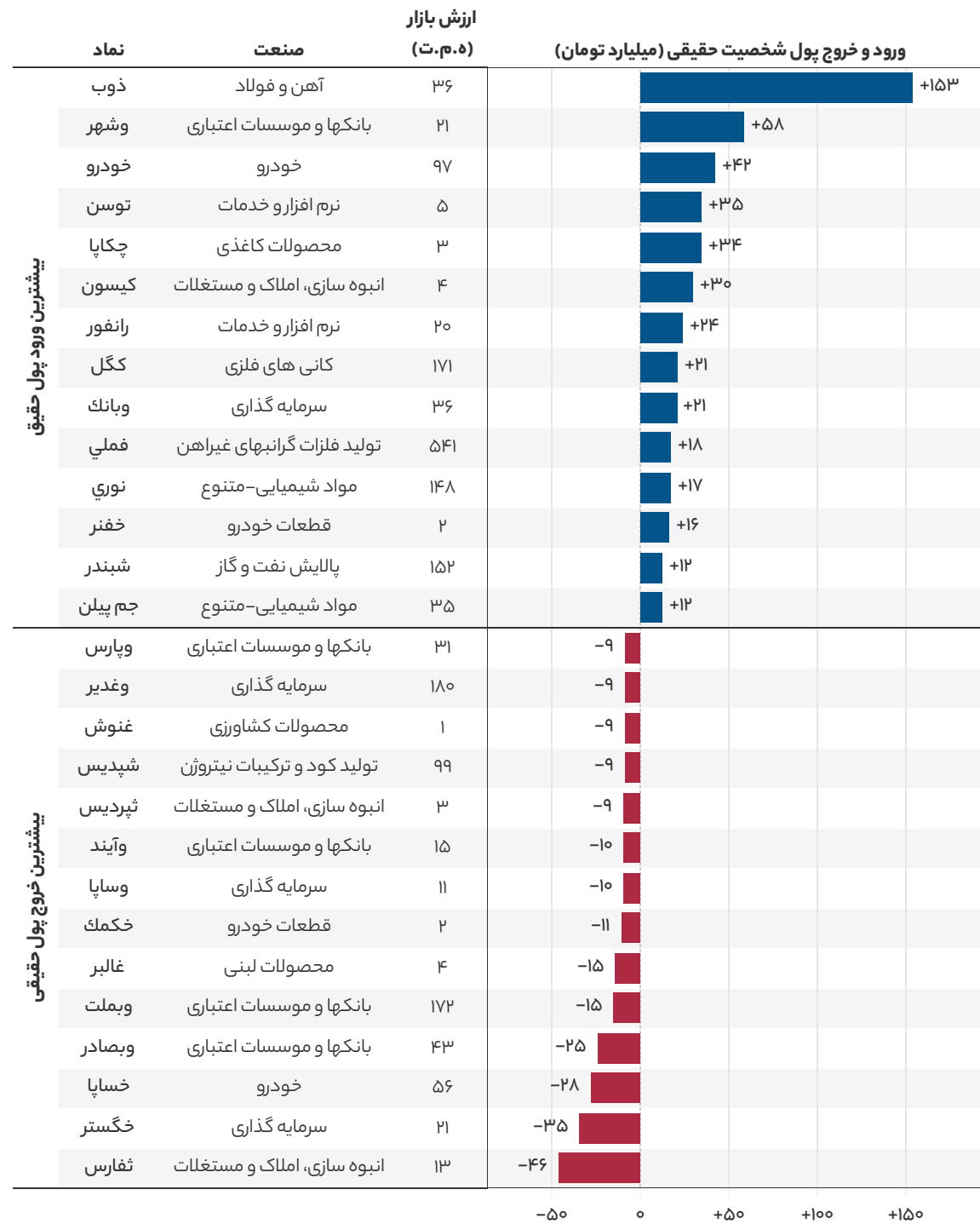
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

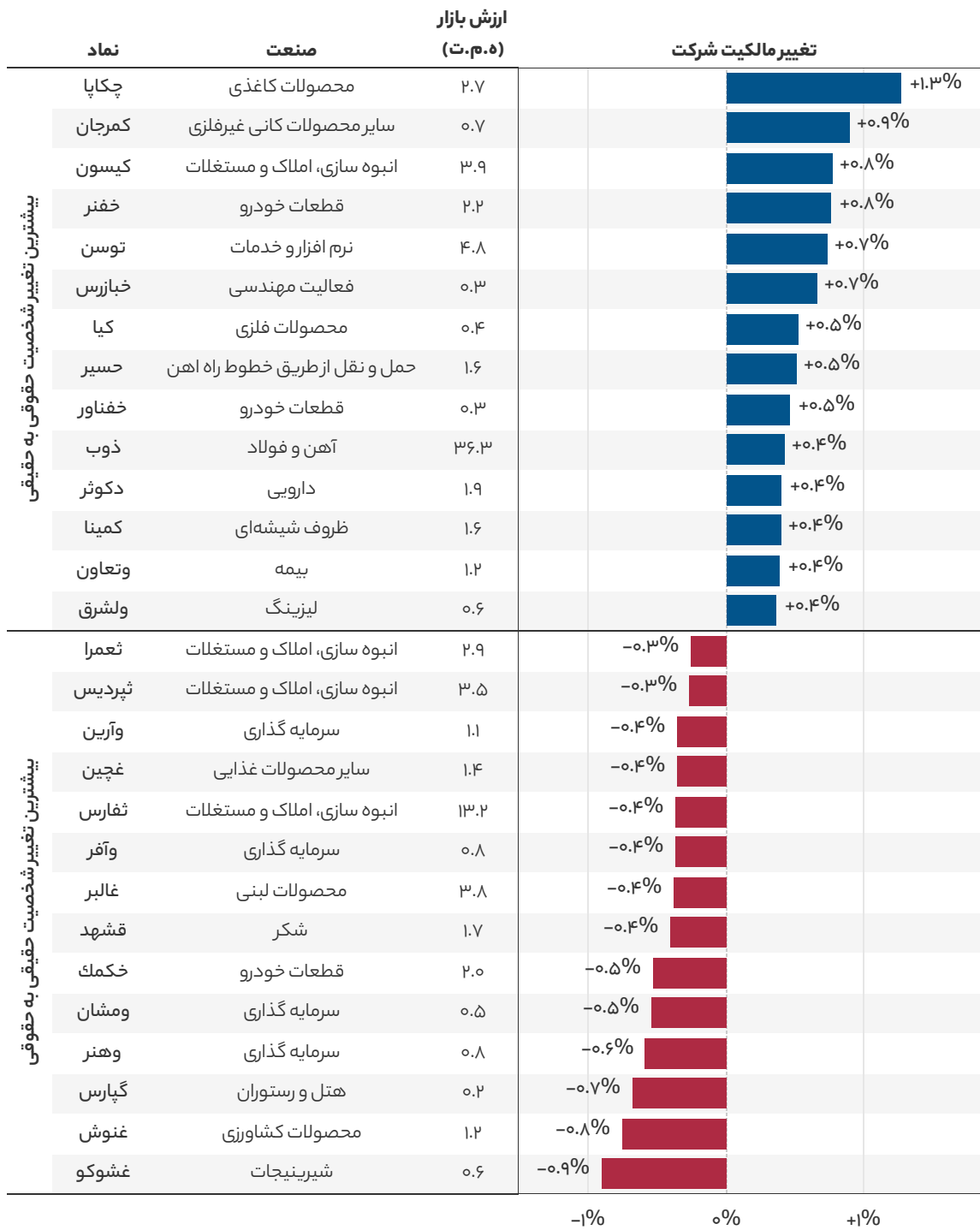
ورود و خروج پول حقیقی

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



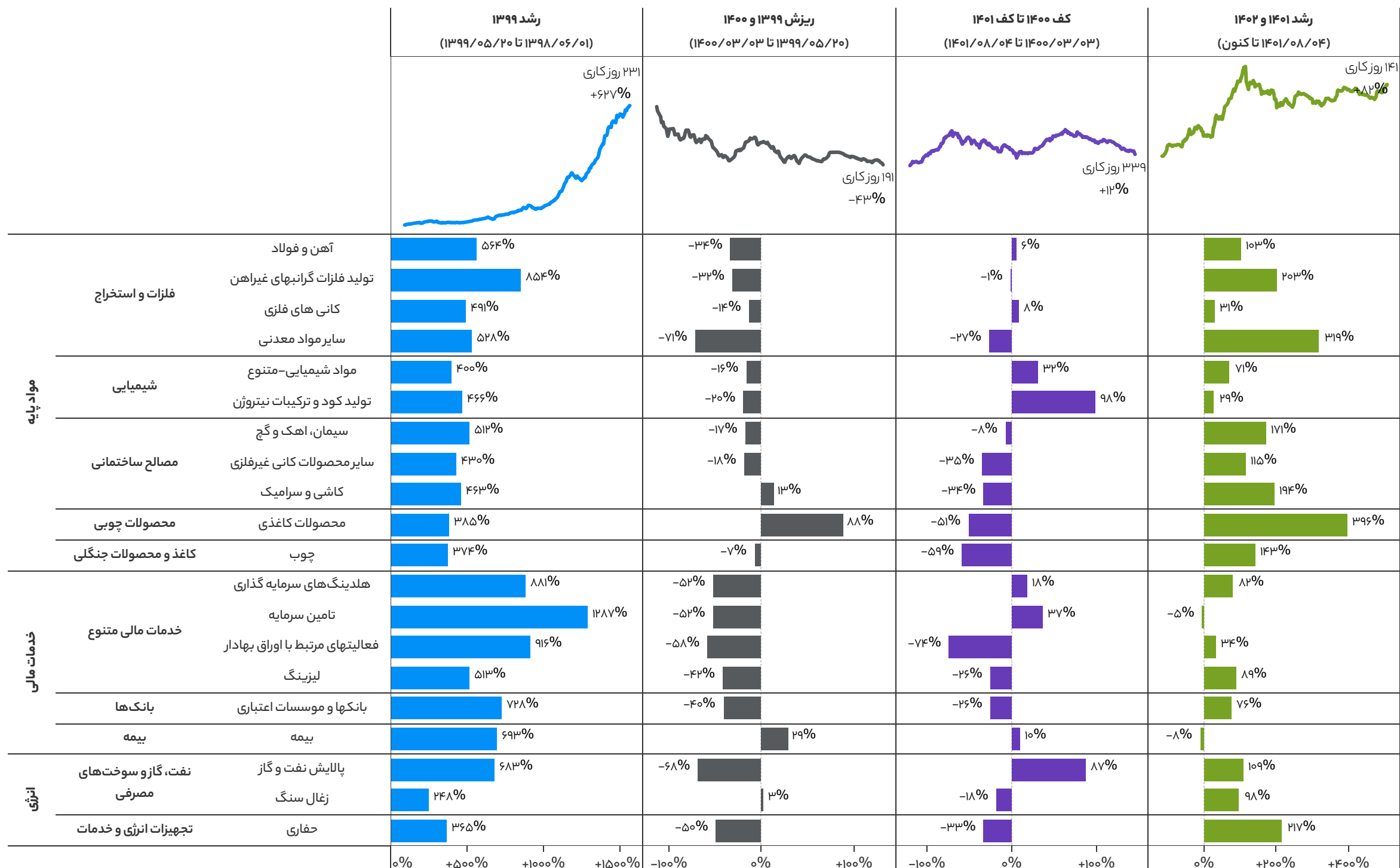
تغییر مالکیت شرکت

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



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

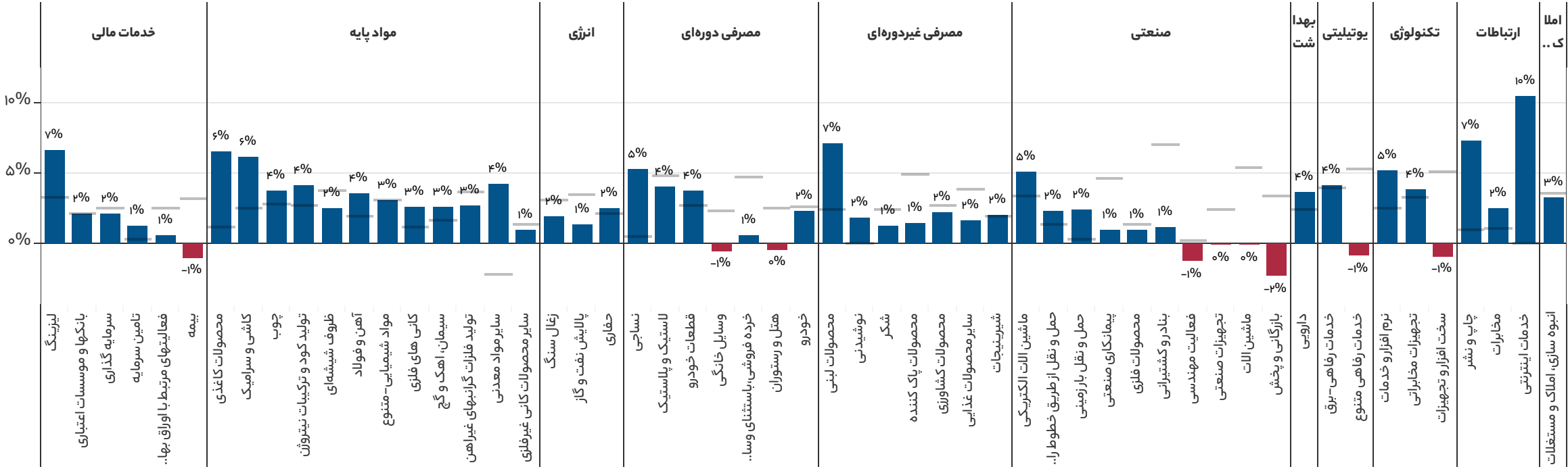


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲			کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		رشد ۱۳۹۹	
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۷۲%	۱۳%	-۷۰%	۱۲۴۷%		
		قطعات خودرو	۹۷%	-۲۵%	-۳۲%	۶۷۶%		
		لاستیک و پلاستیک	۱۸۱%	-۴۲%	-۳۴%	۶۳۱%		
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۷۲%	۳%	-۲۳%	۱۱۲۹%		
		کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۱۷۴%	-۳۶%	-۴۶%	۴۹۰%	
	نساجی		۱۷۰%	-۳۵%	-۲۱%	۳۸۰%		
مصرفی غیردوره‌ای	غذا و نوشیدنی	هتل و رستوران	۱۶%	۱۸%	-۶۷%	۱۱۶۶%		
		محصولات کشاورزی	۴۶%	۹%	-۳۵%	۳۹۷%		
		سایر محصولات غذایی	۵۲%	-۳۹%	-۳۴%	۶۹۹%		
		شیرینیجات	۷۶%	-۶۳%	-۲۴%	۵۹۵%		
		شکر	۹۸%	-۴۴%	-۲۲%	۴۳۵%		
		محصولات لبنی	۱۵۲%	-۵۴%	۷%	۳۸۳%		
صنعتی	کالاهای سرمایه‌ای	نوشیدنی	۶۵%	-۳۱%	-۱۵%	۵۳۹%		
		محصولات پاک کننده	۳۰%	-۱۲%	۴%	۳۰۶%		
		فعالیت مهندسی	۹۸%	-۷%	-۶۳%	۵۲۱%		
		ماشین الات الکتریکی	۹۱%	-۲۳%	-۴۵%	۵۰۱%		
		ماشین الات	۱۵۴%	-۳۱%	-۳۵%	۴۲۲%		
		محصولات فلزی	۱۴۱%	-۴۴%	-۵۴%	۶۴۵%		
ترابری	تجهیزات صنعتی	۷۰%	-۴۰%	-۳۰%	۸۴۷%			
	پیمانکاری صنعتی	۱۰۰%	-۶۸%	-۱۵%	۵۲۵%			
	بنادرو کشتیرانی	۲۵۰%	-۱۵%	-۲۲%	۲۴۶%			
ارتباطات	مخابرات	حمل و نقل از طریق راه‌آهن	۶۹%	-۴۱%	-۱۳%	۳۲۷%		
		حمل و نقل بار زمینی	۷۲%	۳۳%	-۱۸%	۲۵۰%		
		بهداشت	دارویی	۹۹%	-۱۳%	-۳۲%	۳۲۱%	
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۶۱%	۲%	-۳۵%	۲۵۲%		
		سخت افزار و تجهیزات	۲۴۳%	-۴۵%	-۶۵%	۵۷۰%		
یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	خدمات دور برد	۵۳%	-۱۳%	-۷۱%	۵۳۲%		
		چاپ و نشر	۱۸۶%	-۵۲%	-۵۲%	۲۲۳%		
املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	خدمات رفاهی - برق	۵۴%	۱۳۱%	-۳۵%	۳۱۰%		
		توسعه املاک و مستغلات	۲۷۶%	-۳۳%	-۵۴%	۱۷۶%		
املاک و مستغلات		انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۷۶%	-۴۵%	-۴۳%	۶۱۹%		

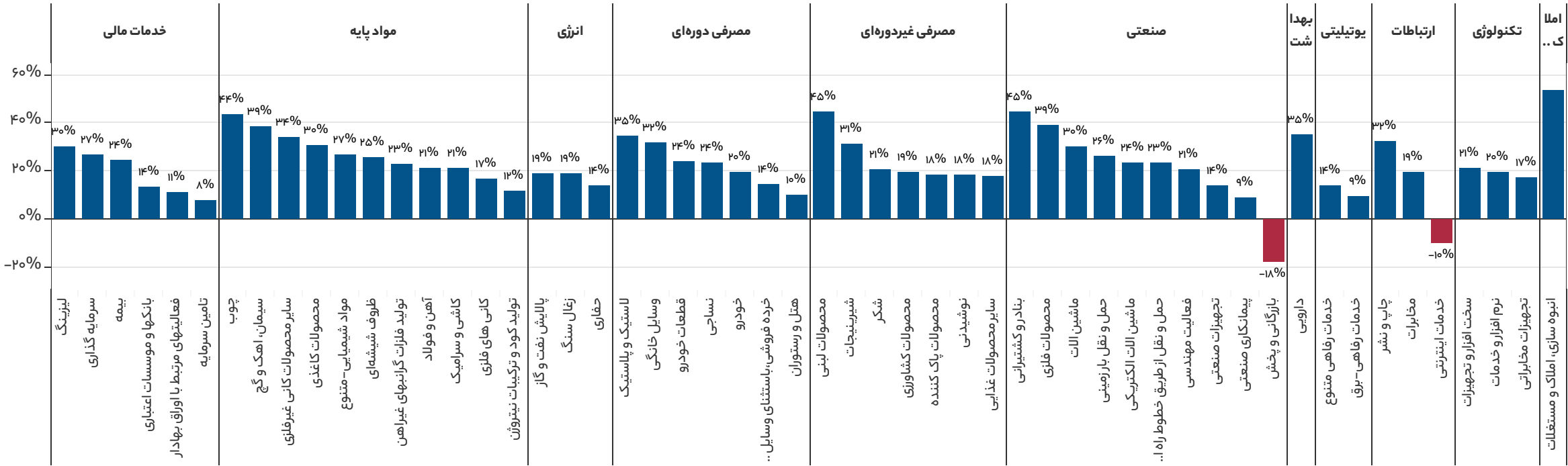
بازده صنایع از ابتدای هفته

(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)



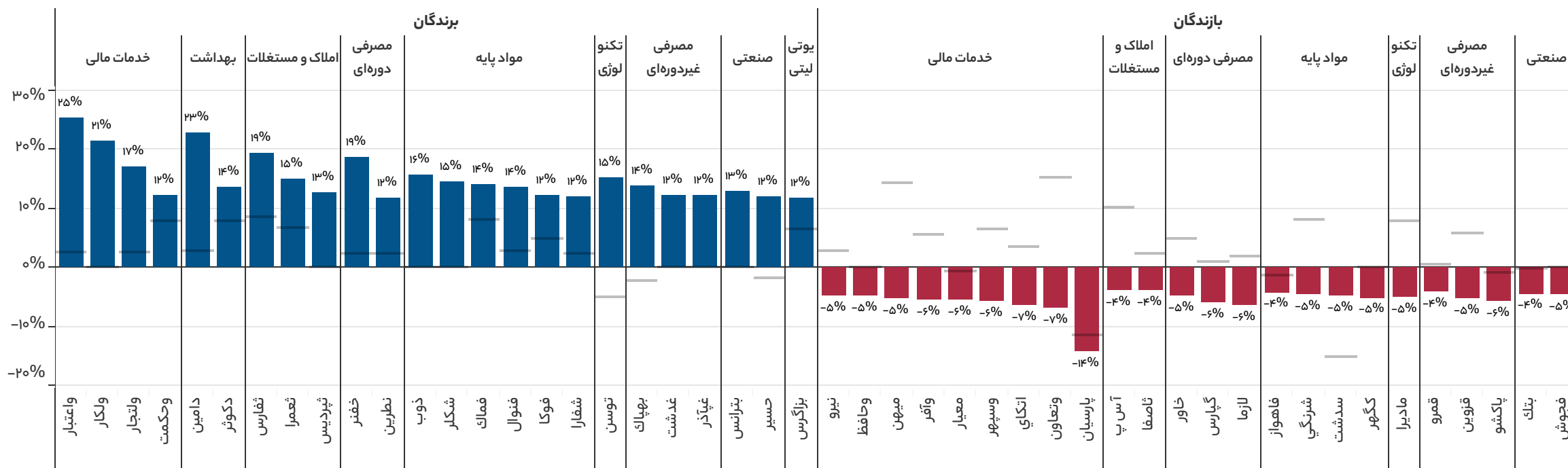
بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)



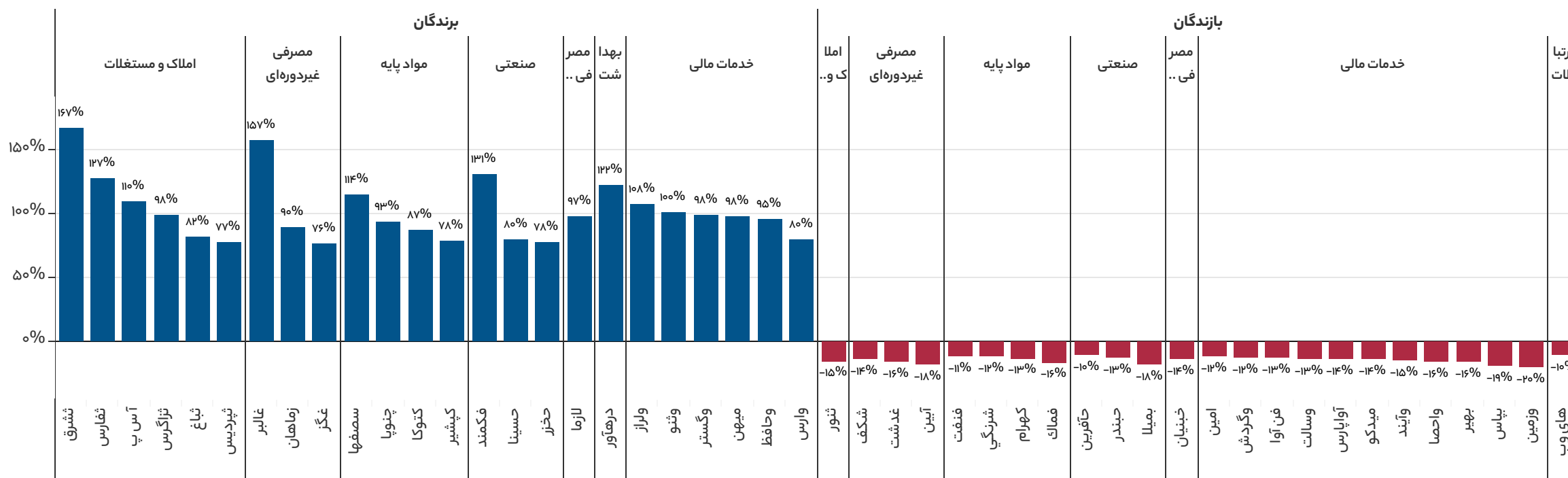
برندگان و بازندگان هفته

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



برندگان و بازندگان سال

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



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

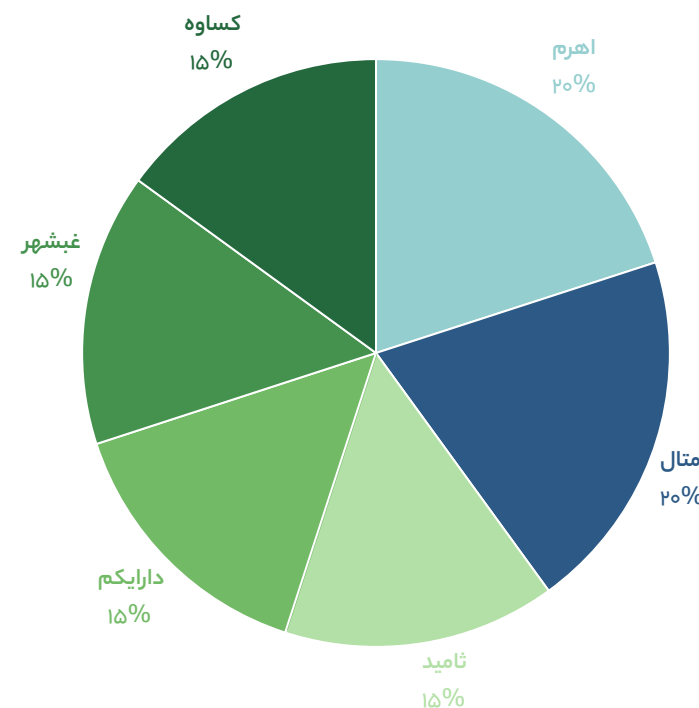


بازدهی	نوری	خسپا	تاصیکو	همراه	آریا	فخوز	شبریز	کچاد	کگل	تاپیکو	فارس	وغدیر	شیراز	مارون	وامید	پارس	حکشتی	جم	شپنا	پارسان	فملی	وصندوق	شستا	وبملت	ومعادن	شبندر	اخابر	بوعلی	رمپنا	شتران	وتجارت	وپاسار	مبین	میدکو	خودرو	بفجر	نیپاس	کگهر
بازدهی هفته گذشته	+۸.۳%	+۷.۰%	+۵.۰%	+۴.۹%	+۴.۳%	+۴.۲%	+۴.۱%	+۴.۰%	+۳.۶%	+۳.۵%	+۳.۲%	+۲.۹%	+۲.۶%	+۲.۵%	+۲.۴%	+۲.۳%	+۲.۱%	+۲.۰%	+۱.۹%	+۱.۹%	+۱.۴%	+۱.۳%	+۱.۰%	+۰.۹%	+۰.۹%	+۰.۹%	۰%	۰%	۰%	۰%	۰%	-۰.۳%	-۰.۵%	-۰.۷%	-۱.۳%	-۱.۳%	-۱.۷%	-۵.۲%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۵%	۲,۳۰۳	نسبت (P/E) و (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۹۰۰	تَامید	میان مدت
۱۵%	۱۷۷,۱۵۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۲۱۰,۰۰۰	دَارایِکَم	
۱۵%	۲,۲۰۰	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۴۰۰	غَبشَهر	
۱۵%	۲۰,۴۶۰	نسبت (P/E) مناسب	۲۴,۰۰۰	کَساوِه	
۲۰%	۲۳,۲۰۰	دارا بودن پرتفوی متنوع و اهرمی	-	اَهرَم	بلند مدت
۲۰%	۱۲,۱۴۰	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	-	مَتال	

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

