

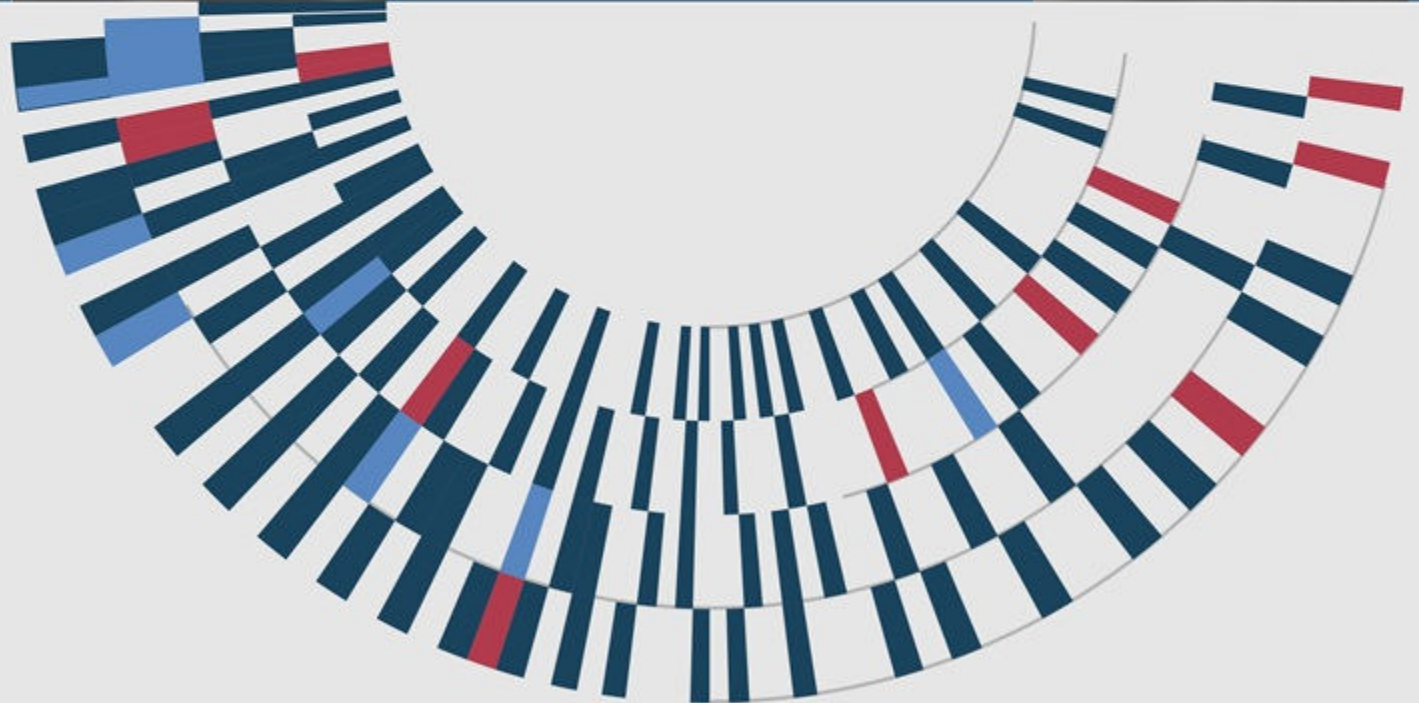
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۴۷ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۱/۳۱

 CHARISMA





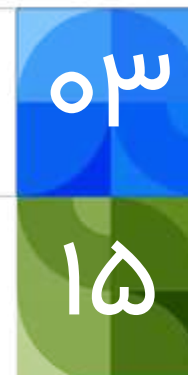
معرفی گزارش:

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

- ۵۴ فلزات آهنی و غیرآهنی
- ۵۵ معادن و محصولات کشاورزی
- ۵۶ پتروشیمی
- ۵۷ انرژی و سایر محصولات

بازار سهام

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

- ۵۸ 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 واړونګۍ منځنۍ بازده و رکود اقتصادي

- ۳۲ برندگان و بازندگان هفته
- ۳۳ بازدهی صنایع
- ۳۴ سبد پیشنهادی



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات آهنی و غیر آهنی

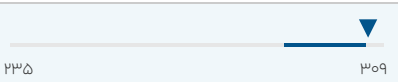
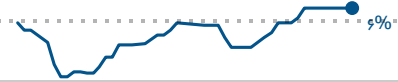
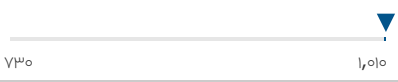
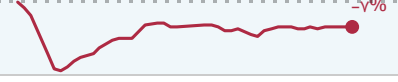
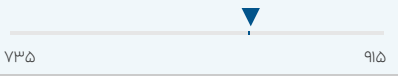
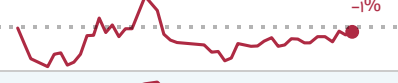
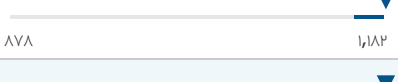
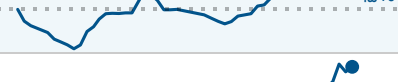
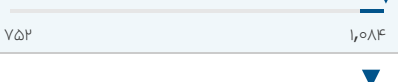
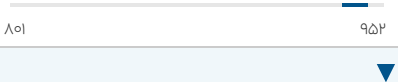
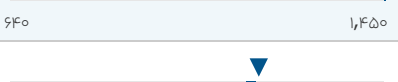
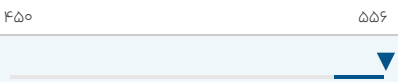
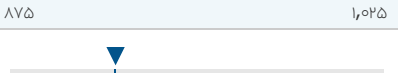
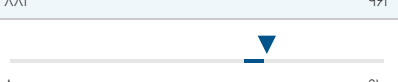
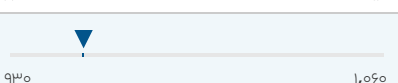
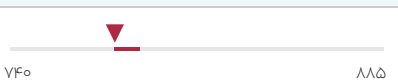
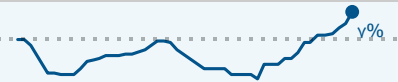
روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	تاثیر در بهای تمام شده	تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
فلزات غیر آهنی			-	فزر	+۱.۹%	۲,۱۳۸۸	دلار/انس	بازار فارکس	طلأ
			بموتو، فباهنر	فملی	+۲.۹%	۹,۷۴۶	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس
			بموتو، فباهنر	فملی	-	۳۹,۸۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)
			فنوال	فایرا	-	۲,۴۵۵	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم
			فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزیزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	+۲.۷%	۲,۸۱۸	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی
			-	فاسمین، فسرب، فروی، فزیزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	+۰.۹%	۲,۱۸۷	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب
فلزات آهنی			کوبیر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	-	۴۷۴	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)
			کوبیر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	-	۵۰۰	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش (منطقه CIS)
			کوبیر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، 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	-	۴۹۳	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب (منطقه CIS)
			-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۲۴,۶۹۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)
			فولای	ذوب، کوبیر	-	۵۸۸	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	-۰.۹%	۵۶۰	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم
			-	فولاد	-۰.۷%	۶۷۰	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			۱۱%		۹۹ ۱۴۳	-	-	-	-	+۸.۵%	۱۱۷	دلار/تن	شمال چین CFR	سنگ آهن
			۸%		۱۱۵ ۱۶۴	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			+۷.۷%	۱۳۴	دلار/تن	شمال چین CFR	گندله سنگ آهن
			۲۰%		۴,۲۷۴ ۵,۱۲۶	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			-	۵,۱۲۶	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	گندله سنگ آهن (گل گهر)
			۱۰%		۱۰۵ ۱۵۳	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			+۸.۲%	۱۲۳	دلار/تن	شمال چین CFR	کنسانتره سنگ آهن
			۱۶%		۳,۲۲۱ ۳,۷۴۹	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا			-	۳,۷۴۹	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی			-۱۳%		۱۹۹ ۲۶۸	-	-	-	-	-۱.۳%	۲۰۲	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
			-۲۷%		۱۵۷ ۲۵۲	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	-۱.۳%	۱۶۸	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
			۷%		۱,۱۹۷ ۱,۷۱۶	-	-	-	-	-۱.۵%	۱,۵۷۷	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
			۵%		۷۲۸ ۹۰۸	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	-	۸۸۸	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام

سنگ آهن و محصولات معدنی

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	
مواد شیمیایی					شاروم، شفارس		شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا		+۵.۵%		۳۰۵		دلار/تن		خلیج فارس FOB		اوره	
					شفارس، شسینا		زاگرس، شخارک، شفن، شیراز		-		۱,۰۱۰		دلار/تن		چین CFR		متانول	
					جم پیلن		جم، شکبیر		-		۸۵۰		دلار/تن		چین CFR		پروپیلن	
					شگویا، شپلی		شصفها، نوری		+۰.۹%		۱,۰۵۵		دلار/تن		جنوب شرق آسیا CFR		پاراژایلین	
					-		شصفها، نوری		+۰.۹%		۱,۰۷۰		دلار/تن		چین CFR		ارتوزایلین	
					شجم، شبصیر		پارس		+۲.۱%		۱,۱۸۲		دلار/تن		چین CFR		استایرن	
					شیران		نوری، بوعلی، شصفها		+۲.۰%		۱,۰۸۴		دلار/تن		چین CFR		بنزن	
					-		بوعلی		+۱.۲%		۹۴۶		دلار/تن		چین CFR		تولوئن	
					شجم		جم، شکبیر، شاراک		-		۱,۴۵۰		دلار/تن		چین CFR		بوتادین	
					شگویا، شپلی		مارون، شاراک		+۰.۶%		۵۲۰		دلار/تن		چین CFR		مونواتیلن گلایکول	
پلیمرها					-		آریا، شکبیر		+۲.۰%		۱,۰۲۵		دلار/تن		خلیج فارس FOB		پلی اتیلن سبک	
					-		مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک		-		۹۲۰		دلار/تن		خلیج فارس FOB		پلی اتیلن سنگین	
					-		جم، شکبیر، شاراک		+۲.۲%		۹۱۵		دلار/تن		خلیج فارس FOB		پلی اتیلن سبک خطی	
					-		جم پیلن، مارون، شاراک		+۰.۷%		۸۷۵		دلار/تن		خلیج فارس FOB		پلی پروپیلن	
					-		شگویا		-		۹۵۵		دلار/تن		جنوب شرق آسیا FOB		PET	
					-		شغدیرو، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام		-۱.۳%		۷۸۰		دلار/تن		جنوب شرق آسیا CFR		PVC	
					-		شبصیر		+۲.۸%		۱,۴۶۰		دلار/تن		جنوب شرق آسیا CFR		ABS	



انرژی، فرآورده‌های نفتی و ارز

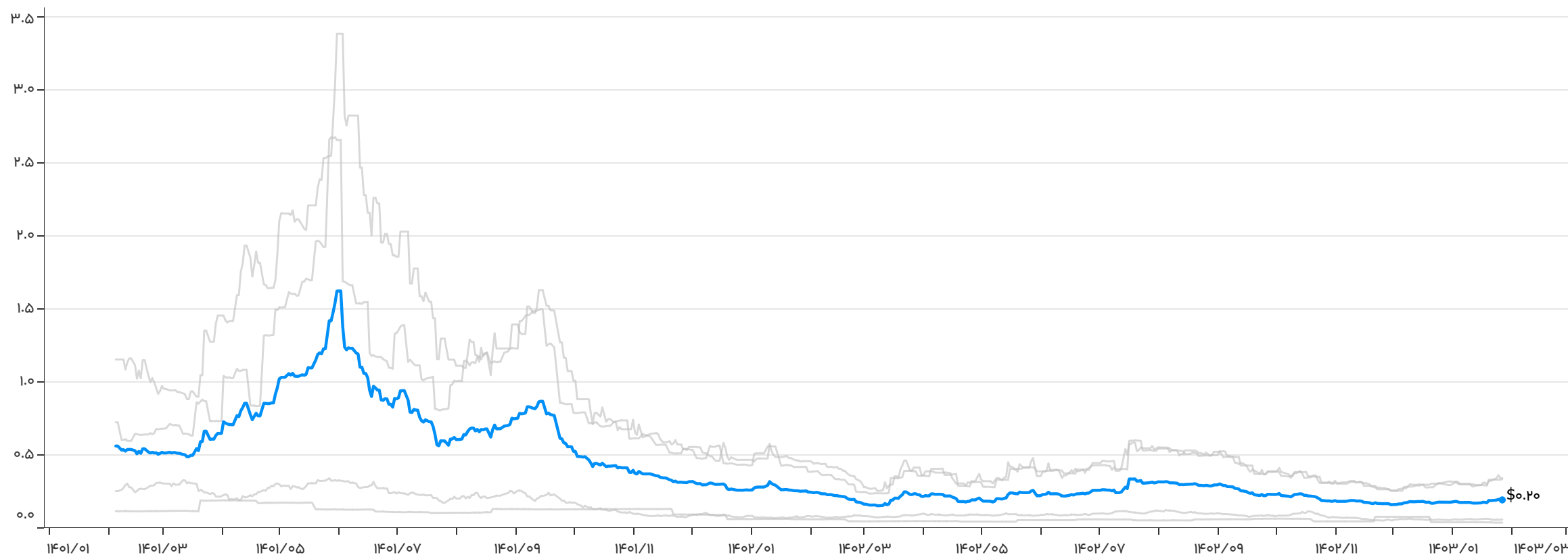
انرژی و فرآورده‌های نفتی	رند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
		۹% ۷۴ - ۹۴		۷۴ - ۹۴	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	-	-	-	۲.۵%-	۸۷	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	نفت برنت
		۹% ۶۹ - ۹۱		۶۹ - ۹۱	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	-	-	-	۲.۳%-	۸۳	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	نفت WTI
		۱۶% ۷۸ - ۱۰۷		۷۸ - ۱۰۷	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	-	-	۳.۶%-	۹۷	دلار/بشکه	خلیج فارس FOB	بنزین
		۱۵% ۷۹ - ۱۲۵		۷۹ - ۱۲۵	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	-	-	۷.۶%-	۹۵	دلار/بشکه	خلیج فارس FOB	گازوئیل
		۱۸% ۳۶۹ - ۵۲۸		۳۶۹ - ۵۲۸	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	-	-	۱.۷%+	۴۷۴	دلار/تن	خلیج فارس FOB	نفت کوره
		۱۰% ۸۱ - ۱۲۴		۸۱ - ۱۲۴	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	-	-	۷.۷%-	۹۴	دلار/بشکه	خلیج فارس FOB	نفت سفید
		۱۱% ۴۵۲ - ۶۵۹		۴۵۲ - ۶۵۹	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	بوعلی، نوری	-	-	۲.۹%-	۶۳۲	دلار/تن	خلیج فارس FOB	نفتا
		۶% ۷۲۰ - ۹۵۰		۷۲۰ - ۹۵۰	شسپا، شرانل، شپهرن، شنف	-	-	-	-	۸۹۵	دلار/تن	امارات متحده CFR عربی	روغن پایه
		۹% ۲۱,۷۹۵ - ۳۳,۵۱۵		۲۱,۷۹۵ - ۳۳,۵۱۵	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	-	-	-	۳۲,۲۵۱	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	روغن پایه (نفت سپاهان)
ارز و ارز دیجیتال		۳۵% ۱۲,۴۵۵ - ۲۱,۶۳۴		۱۲,۴۵۵ - ۲۱,۶۳۴	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	-	-	۱۸,۶۰۶	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	لوب کات (پالایش نفت تهران)
		۲۳%- ۱۷,۱۴۰ - ۱۲,۰۸۶		۱۷,۱۴۰ - ۱۲,۰۸۶	شپاس	-	-	-	-	۱۳,۱۴۶	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	قیر (نفت پاسارگاد)
		۳% ۱۸۸ - ۲۸۷		۱۸۸ - ۲۸۷	ذوب، فروش	-	-	-	۱۴.۰%+	۲۱۴	دلار/تن خیس	استرالیا FOB	زغال سنگ
		۳%- ۱.۰۵ - ۱.۱۲		۱.۰۵ - ۱.۱۲	-	-	-	-	۰.۱%+	۱.۰۷	-	بازار فارکس	یورو به دلار
		۱%- ۱.۳۱ - ۱.۲۱		۱.۲۱ - ۱.۳۱	-	-	-	-	۰.۶%-	۱.۲۴	-	بازار فارکس	پوند به دلار
		۱۱۹% ۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳		۲۵,۷۰۴ - ۶۹,۶۶۳	-	-	-	-	۳.۸%+	۶۴,۲۶۵	دلار	بایننس	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	۰.۰۶	+۴.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن		
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۴	+۰.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن		
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۵	+۱.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن		
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۴	+۰.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن		
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۰	+۱.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن		

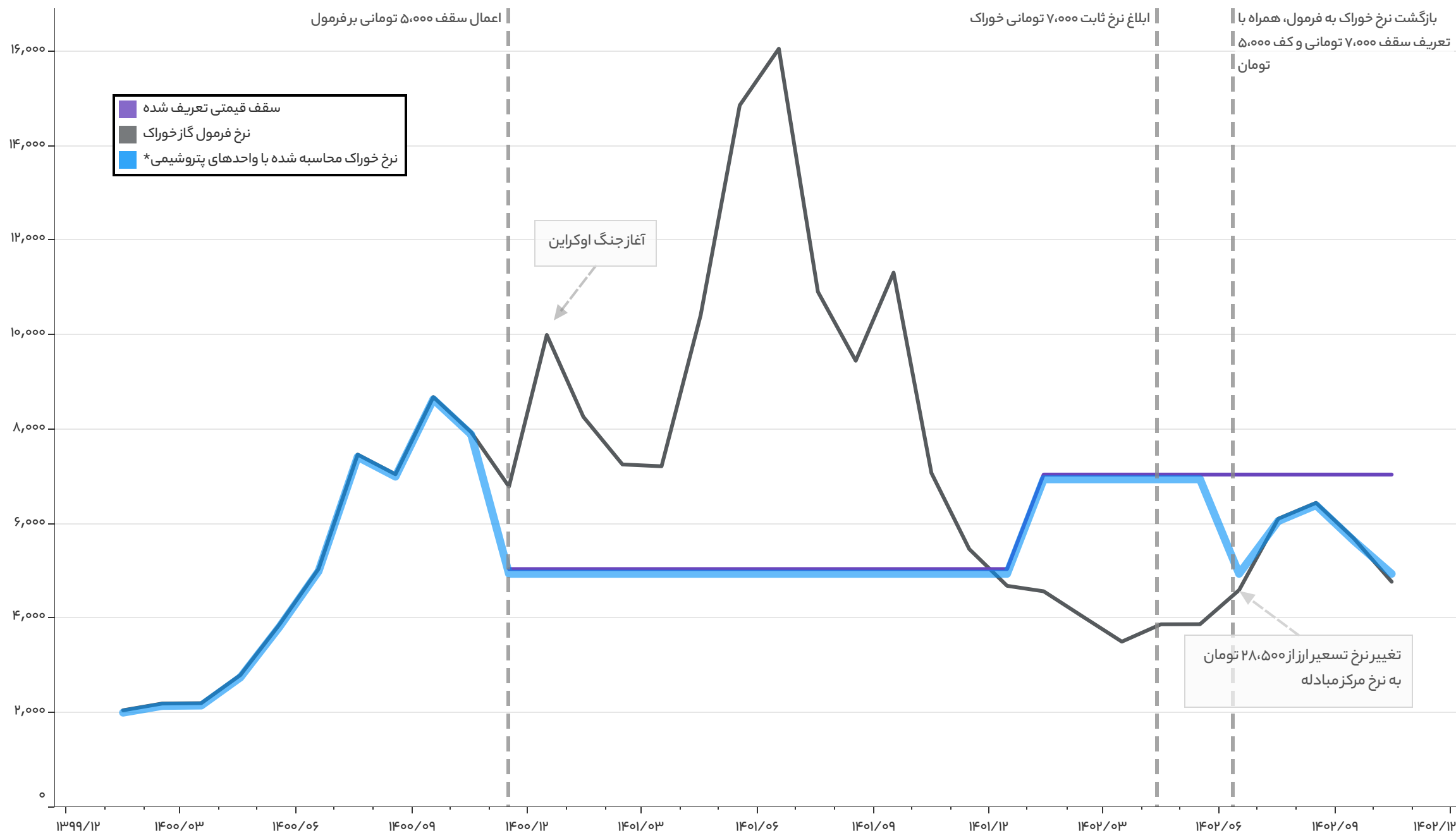
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



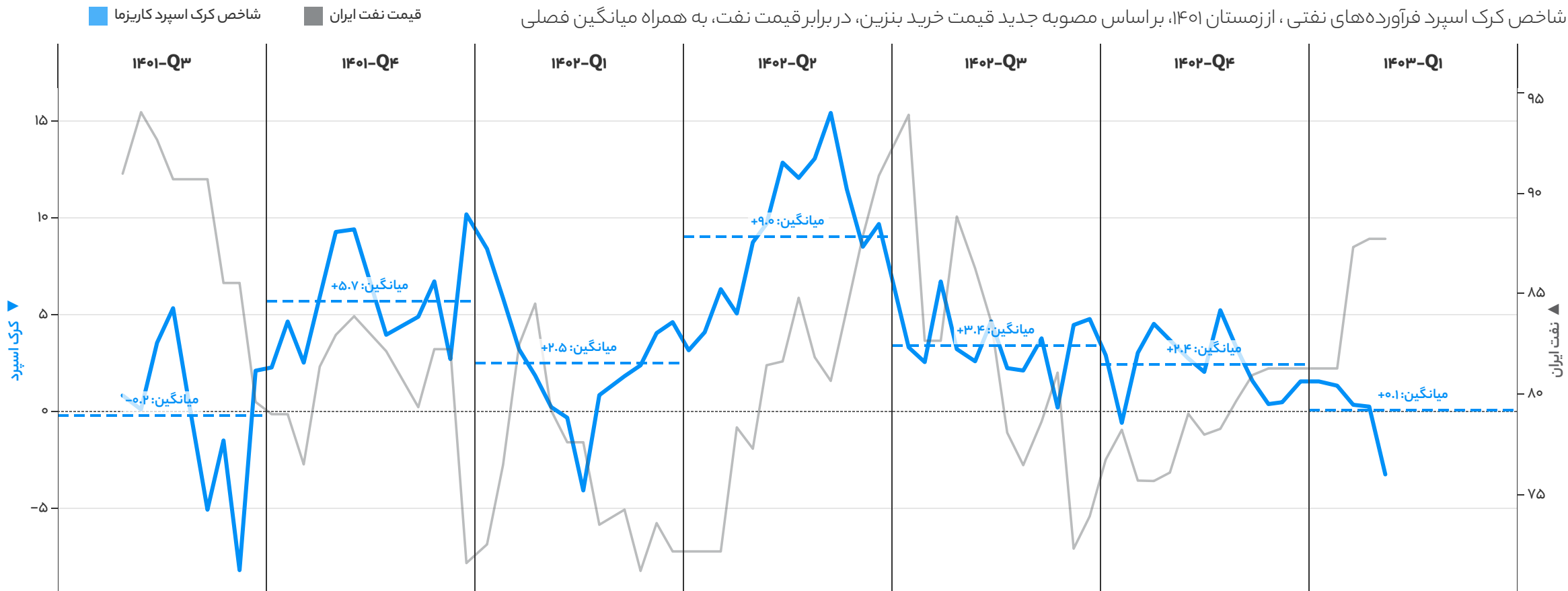
* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بروزرسانی خواهد شد.

- 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.

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) 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	۸۷.۸									
گازوئیل	۹۵.۰	۱۵.۰	۷.۲	▼ ۷.۸	۱۹.۵	۱۳.۷	-۲۹.۷%			
بنزین**	۹۱.۹	۷.۷	۴.۲	▼ ۳.۶	۵.۰	۶.۲	+۲۴.۴%			
نفتا	۷۱.۴	-۱۴.۲	-۱۶.۳	▼ ۲.۲	-۹.۶	-۱۲.۵	-۳۰.۸%			
نفت کوره	۷۴.۷	-۱۴.۳	-۱۳.۰	▲ ۱.۲	-۱۵.۰	-۱۳.۰	+۱۳.۶%			
لوب کات***	۷۰.۶	-۱۷.۱	-۱۷.۱	-	-۸.۶	-۱۴.۴	-۶۷.۹%			
وکیوم باتوم***	۴۶.۲	-۴۱.۶	-۴۱.۶	-	-۳۲.۴	-۳۸.۹	-۱۹.۸%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۰.۳	-۳.۲	▼ ۳.۵	۲.۴	۰.۱	-۹۵.۷%			

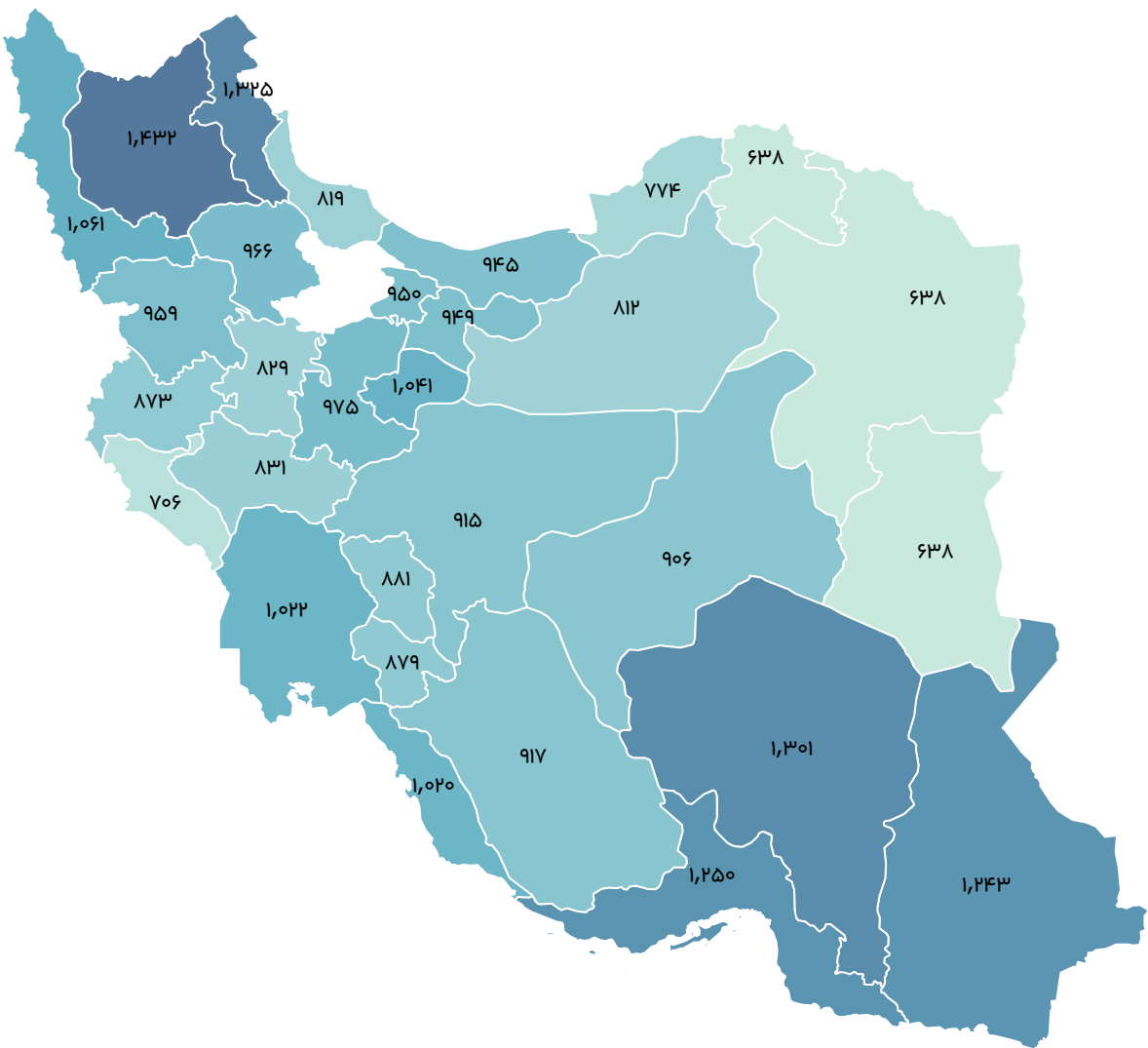
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هریک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هریک از این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

** قیمت بنزین بر اساس فرمول‌های مصوبه جدید، برای ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی (شامل شینا، شیندر، شتران و شیریز) 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 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

منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	سیمان تهران	۹۴۹		
	البرز	سیمان آبیک	۹۵۰		
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۷۵		
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵		
	قم	سیمان نيزار قم	۱,۰۴۱		
	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیماء	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	-
	کردستان	سیمان کردستان	۹۵۹		
شمال	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		
	زنجان	سیمان خمسه	۹۶۶		
شمال شرق	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		

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

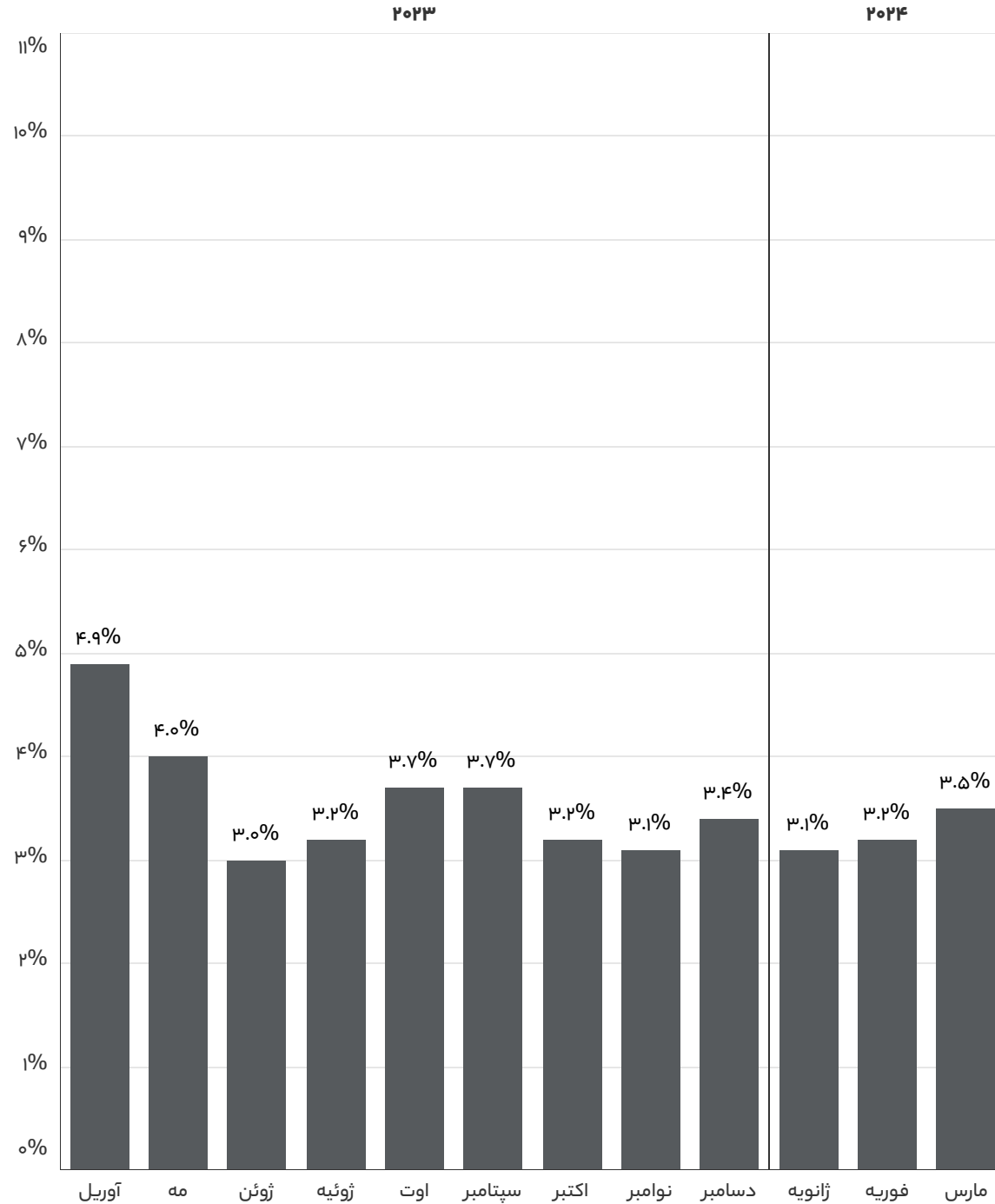
معادن و فلزات

انرژی

- ▲ به گزارش رویترز، قیمت طلا در اولین ساعات معاملاتی در آسیا در روز سه شنبه افزایش یافت. تمایل به خرید این فلز گرانبها به خاطر تشدید تنش های خاورمیانه و علیرغم بالا رفتن ارزش دلار و سود اوراق قرضه خزانه داری آمریکا افزایش یافته است. افزایش بیش از حد انتظار خرده فروشی در آمریکا در ماه مارس احتمال به تاخیر افتادن کاهش نرخ بهره فدرال رزرو را در سال جاری میلادی افزایش داده است. قیمت هراونس طلا امروز با ۰.۱۳ درصد افزایش به ۳۲۲۳۸۶ دلار رسید. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک افزایش ۰.۶۹ درصدی به ۴۰۲۳۹۹ دلار رسیده است.
- ▲ واشنگتن واردات آلومینیوم، مس و نیکل از مبدأ روسیه را ممنوع کرده و به منظور سرکوب تجارت این فلزات در بورس های جهانی با انگلیس هماهنگ کرده است. براساس این گزارش، تصمیم آمریکا بر فلزات تولید شده در روسیه پس از ۱۳ آوریل ۲۰۲۴ تأثیر می گذارد. این در حالی است که بورس های برتر کالا در جهان مانند بورس فلزات لندن (LME) و بورس کالای شیکاگو (CME) تصمیم دارند تجارت این فلزات را ممنوع کنند.
- در دهمین حراج سکه طلا که روز دوشنبه ۲۷ فروردین ماه ۱۴۰۳ برگزار شد از مجموع ۱۳۳۰۲ قطعه ربع سکه ثبت سفارش شده توسط ۴۵۹۹ شرکت کننده، ۴۶۷۵ قطعه با میانگین قیمت ۱۴ میلیون و ۱۱۶ هزار تومان به متقاضیان تخصیص داده شد. همچنین، از مجموع ۵۳۱۶ قطعه نیم سکه ثبت سفارش شده از سوی ۲۲۰۰ شرکت کننده، ۱۰۱۶ قطعه با میانگین قیمت ۲۳ میلیون و ۶۴۴ هزار تومان تخصیص داده شد. در حراج سکه تمام نیز ۳۵۴۴ شرکت کننده، ۱۰ هزار و ۷۶۸ قطعه سکه را ثبت سفارش کردند که ۱۵۲۷ قطعه با میانگین قیمت ۴۱ میلیون و ۶۸ هزار تومان تخصیص داده شد.
- براساس گزارش اوایل پرایس، تقاضای چین برای نفت در سال میلادی گذشته، رکورد دیگری را شکست و امسال هم در بحبوحه سیگنال هایی از سرعت گرفتن فعالیت اقتصادی، قوی مانده است. تقاضای چین برای نفت در سال ۲۰۲۳، به میزان ۱۱.۵ درصد بر مبنای سالانه رشد کرد در حالی که تقاضا برای محصولات نفتی، ۹.۵ درصد افزایش داشت. شرکت ملی نفت چین اوایل امسال پیش بینی کرد تقاضا برای محصولات نفتی در چین، تحت تاثیر پیشرفت «گذار انرژی»، ممکن است تا سال آینده به اوج برسد. تقاضا برای سوخت ها از سال ۲۰۳۰ رو به کاهش خواهد گذاشت. با این حال، سوخت های مشتق شده از نفت همچنان تا سال ۲۰۳۵، پر استفاده خواهند ماند.
- روسیه موفق شده است با سرعت، برخی از پالایشگاه های نفت مهمی که بر اثر حملات پهپادی اوکراین آسیب دیدند را تعمیر کرده و ظرفیت پالایشگاهی غیرفعال را از ۱۴ درصد، به حدود ۱۰ درصد کاهش دهد. اوکراین از ابتدای سال ۲۰۲۴، حملات پهپادی علیه زیرساخت انرژی روسیه را تشدید کرد و برخی از بزرگترین پالایشگاه های نفت این کشور را هدف حمله قرار داد و باعث افزایش قیمت نفت شد. طبق محاسبات رویترز، مجموع ظرفیت پالایش نفت اولیه روسیه که بر اثر حملات پهپادی، غیرفعال شده بود، از ۱۲۳ هزار تن در روز، به ۹۰ هزار و ۵۰۰ تن کاهش یافت.
- با توجه به بخش دوم لایحه بودجه سال ۱۴۰۳، شاهد پیش بینی فروش یک میلیون دلار نفت در روز و تعیین ۴۰۱ میلیارد دلار برای واردات فرآورده های نفتی اصلی (بنزین) هستیم. با توجه به رقم ۱۱.۷ میلیارد دلار رقم سهم دولت از درآمدهای نفتی، به نظر می رسد که قیمت هر بشکه نفت خام حدود ۸۰ دلار در نظر گرفته شده است.

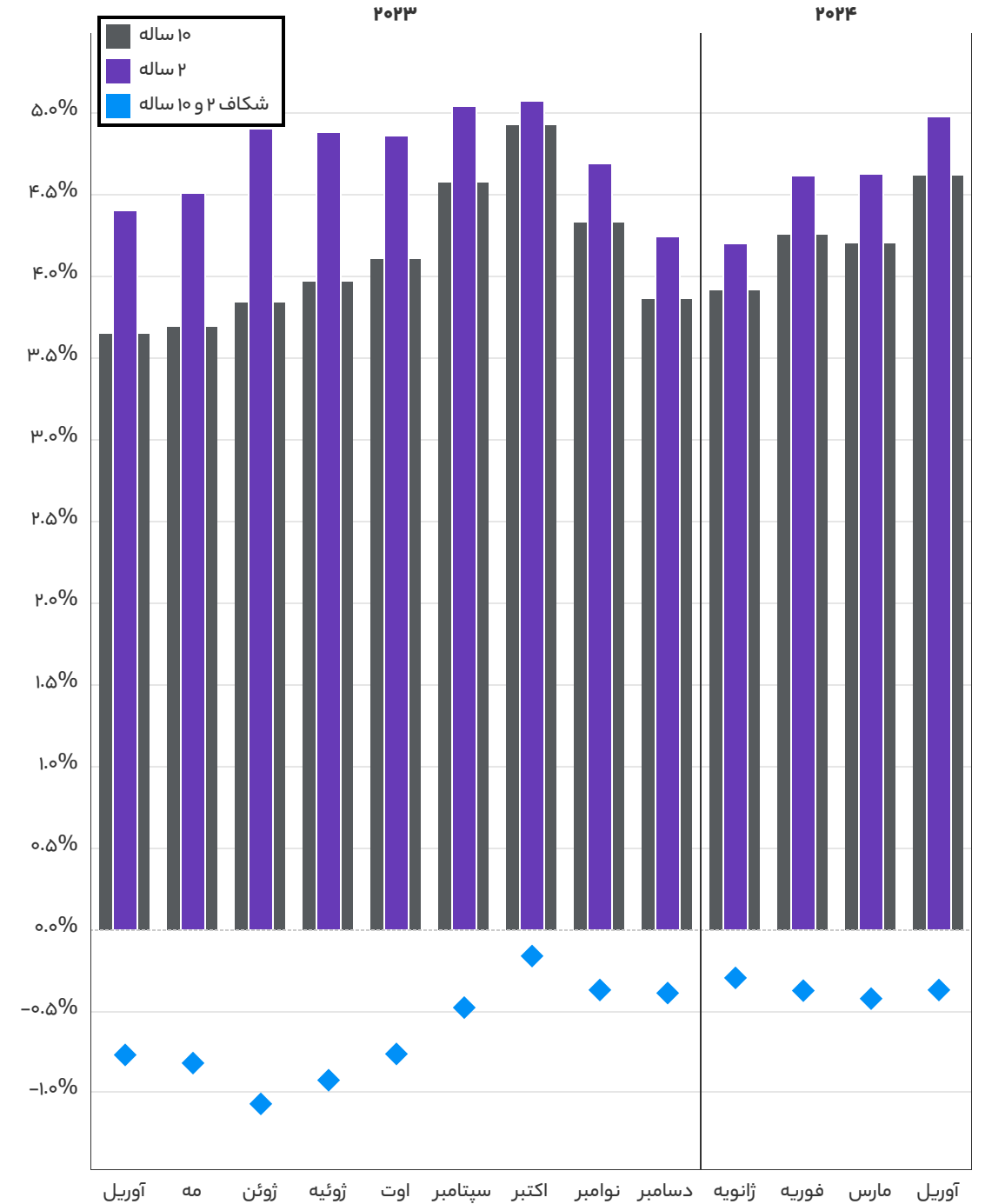
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



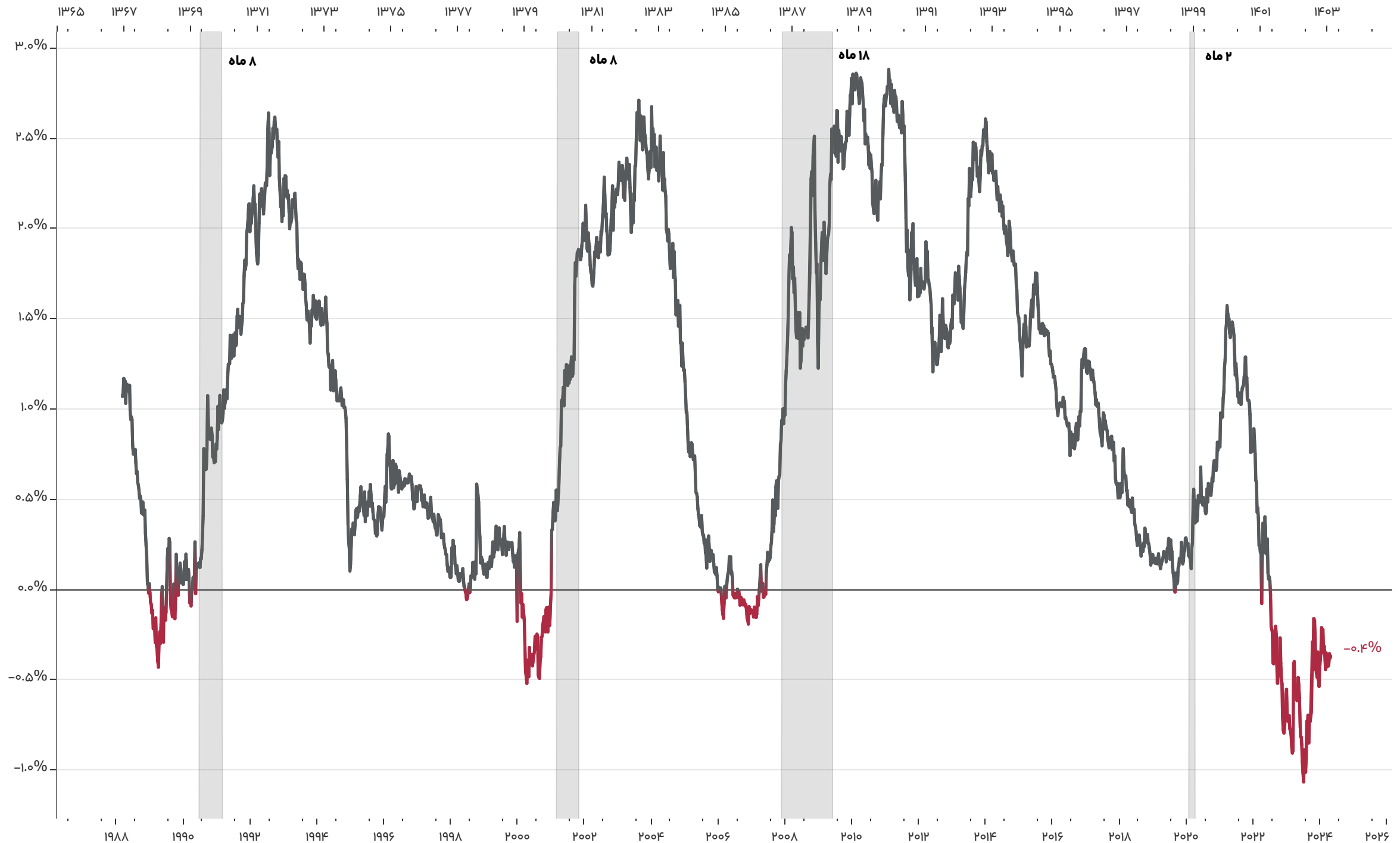
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

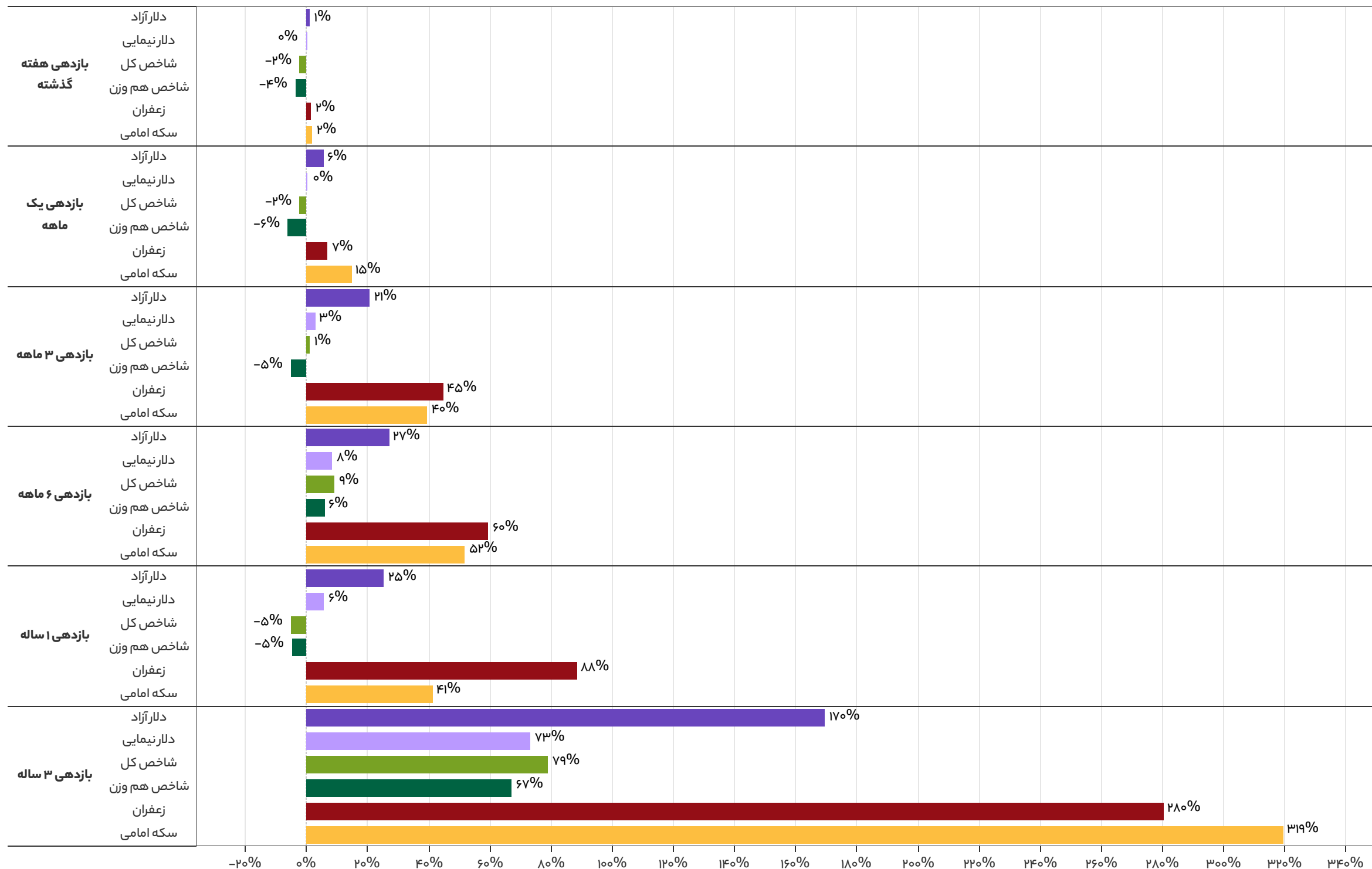
EQUITY MARKET

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
هم وزن ▲ ۳۰.۰%	مسکن ▲ ۱۳.۴%	مسکن ▲ ۴.۰%	زعفران ▲ ۱۲.۳%	زعفران ▲ ۳.۶%	شاخص کل ▲ ۹.۴%	سکه امامی ▲ ۴.۵%	زعفران ▲ ۹.۲%	شاخص کل ▲ ۹.۴%	دلار آزاد ▲ ۸.۸%	زعفران ▲ ۱۵.۹%	سکه امامی ▲ ۱۷.۲%	زعفران ▲ ۷۰.۲%	هم وزن ۳۴%
شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۸%	سکه امامی ▲ ۳.۳%	هم وزن ▲ ۸.۸%	دلار آزاد ▲ ۲.۱%	هم وزن ▲ ۱.۹%	هم وزن ▲ ۸.۲%	سکه امامی ▲ ۸.۸%	دلار آزاد ▲ ۵.۲%	زعفران ▲ ۱۲.۰%	درآمد ثابت ▲ ۲۴.۲%	شاخص کل ۲۸%
دلار آزاد ▲ ۹.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	دلار آزاد ▲ ۰.۰%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	دلار نیمایی ▲ ۲.۲%	زعفران ▲ ۴.۹%	سکه امامی ▲ ۴.۹%	شاخص کل ▲ ۶.۰%	سکه امامی ▲ ۲۳.۲%	سکه امامی ۲۵%
درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۶%	زعفران ▼ ۱.۰%	دلار نیمایی ▼ ۱.۶%	دلار آزاد ▲ ۱.۴%	زعفران ▲ ۱.۳%	مسکن ▲ ۱.۰%	دلار نیمایی ▲ ۰.۴%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ▲ ۲.۲%	مسکن ▲ ۴.۱%	دلار آزاد ▲ ۵.۲%	مسکن ▲ ۲۲.۶%	زعفران ۲۲%
مسکن ▲ ۱.۸%	سکه امامی ▲ ۰.۶%	هم وزن ▼ ۲.۳%	مسکن ▼ ۲.۲%	دلار نیمایی ▲ ۰.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۲%	دلار آزاد ▲ ۰.۱%	زعفران ▲ ۱.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	درآمد ثابت ▲ ۲.۲%	مسکن ▲ ۳.۸%	دلار آزاد ▲ ۱۵.۹%	دلار آزاد ۱۵%
زعفران ▼ ۰.۱%	هم وزن ▲ ۰.۴%	شاخص کل ▼ ۵.۶%	سکه امامی ▼ ۳.۵%	مسکن ▼ ۱.۰%	دلار آزاد ▼ ۰.۴%	شاخص کل ▼ ۴.۲%	سکه امامی ▼ ۰.۱%	سکه امامی ▲ ۰.۸%	مسکن ▲ ۱.۷%	دلار نیمایی ▲ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۳%	دلار نیمایی ▲ ۷.۶%	مسکن ۱۵%
دلار نیمایی ▼ ۲.۱%	دلار آزاد ▲ ۰.۱%	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%	هم وزن ▼ ۰.۹%	هم وزن ▼ ۳.۶%	هم وزن ▲ ۲.۱%	هم وزن ▼ ۲.۴%	دلار نیمایی ۵%
سکه امامی ▼ ۶.۵%	شاخص کل ▼ ۰.۹%	سکه امامی ▼ ۱۱.۱%	شاخص کل ▼ ۸.۸%	هم وزن ▼ ۵.۲%	سکه امامی ▼ ۱.۹%	زعفران ▼ ۴.۷%	شاخص کل ▼ ۰.۶%	مسکن ▼ ۲.۲%	شاخص کل ▼ ۲.۰%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار نیمایی ▲ ۱.۳%	شاخص کل ▼ ۵.۶%	درآمد ثابت 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 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

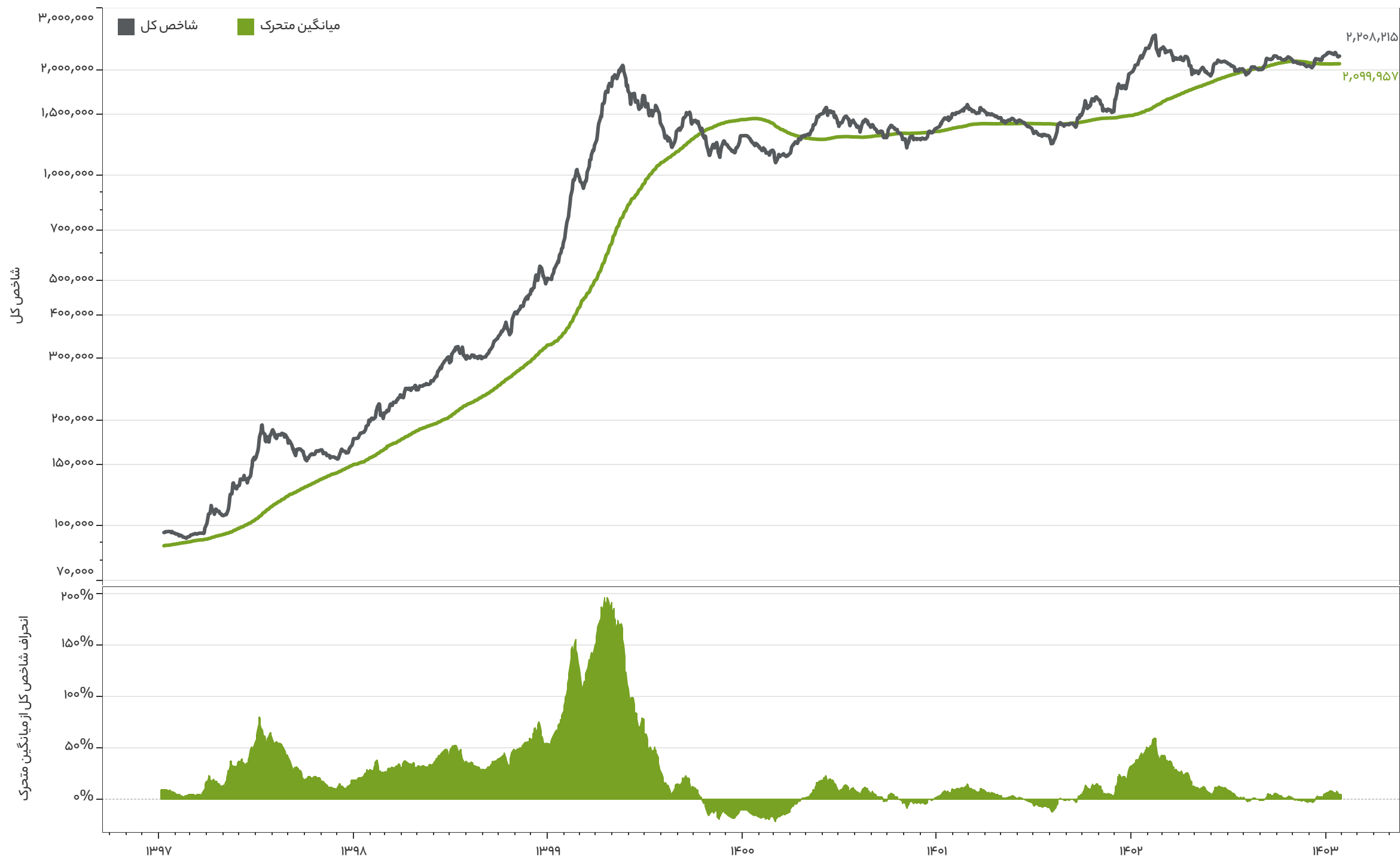
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





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





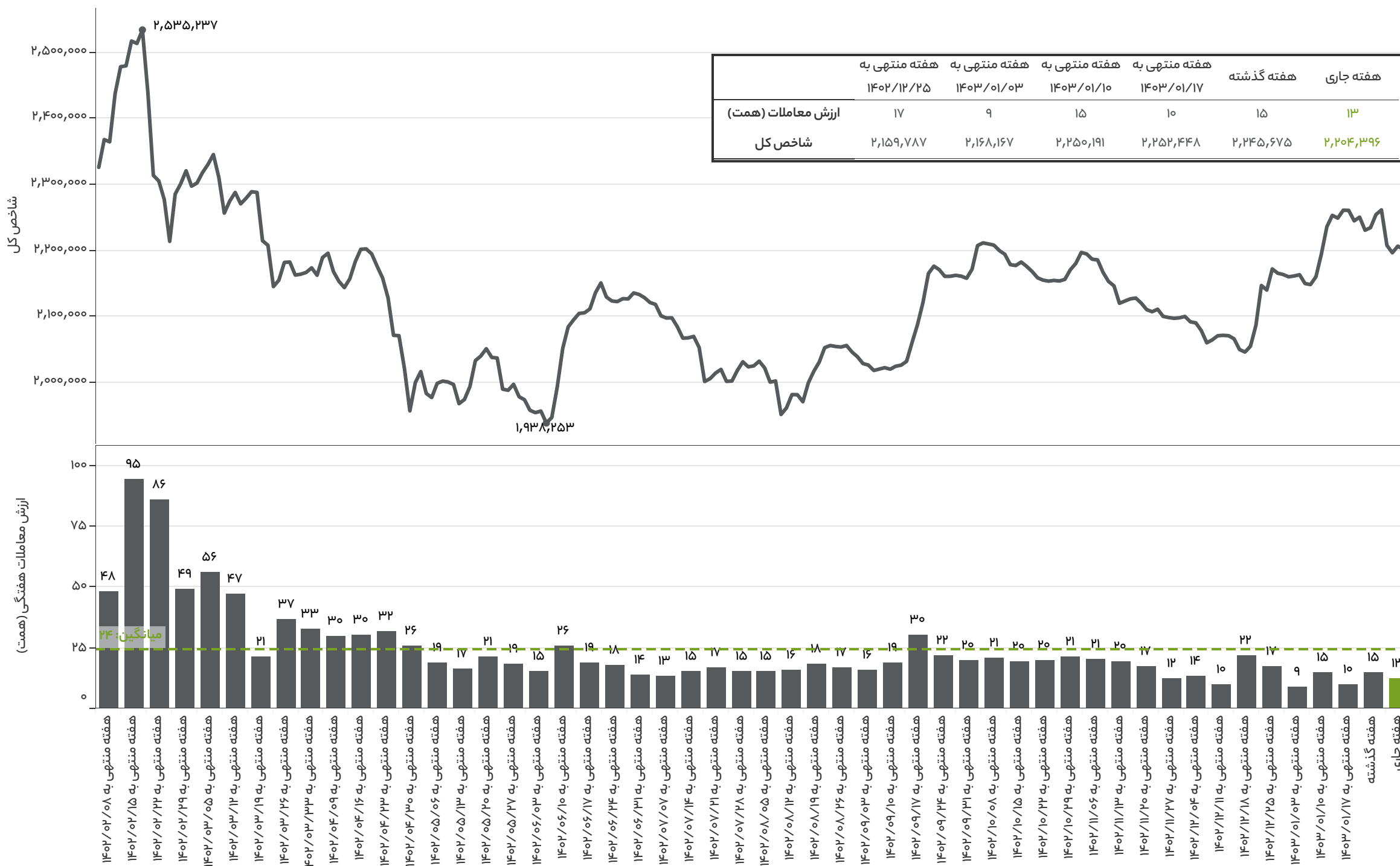
تأثير نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



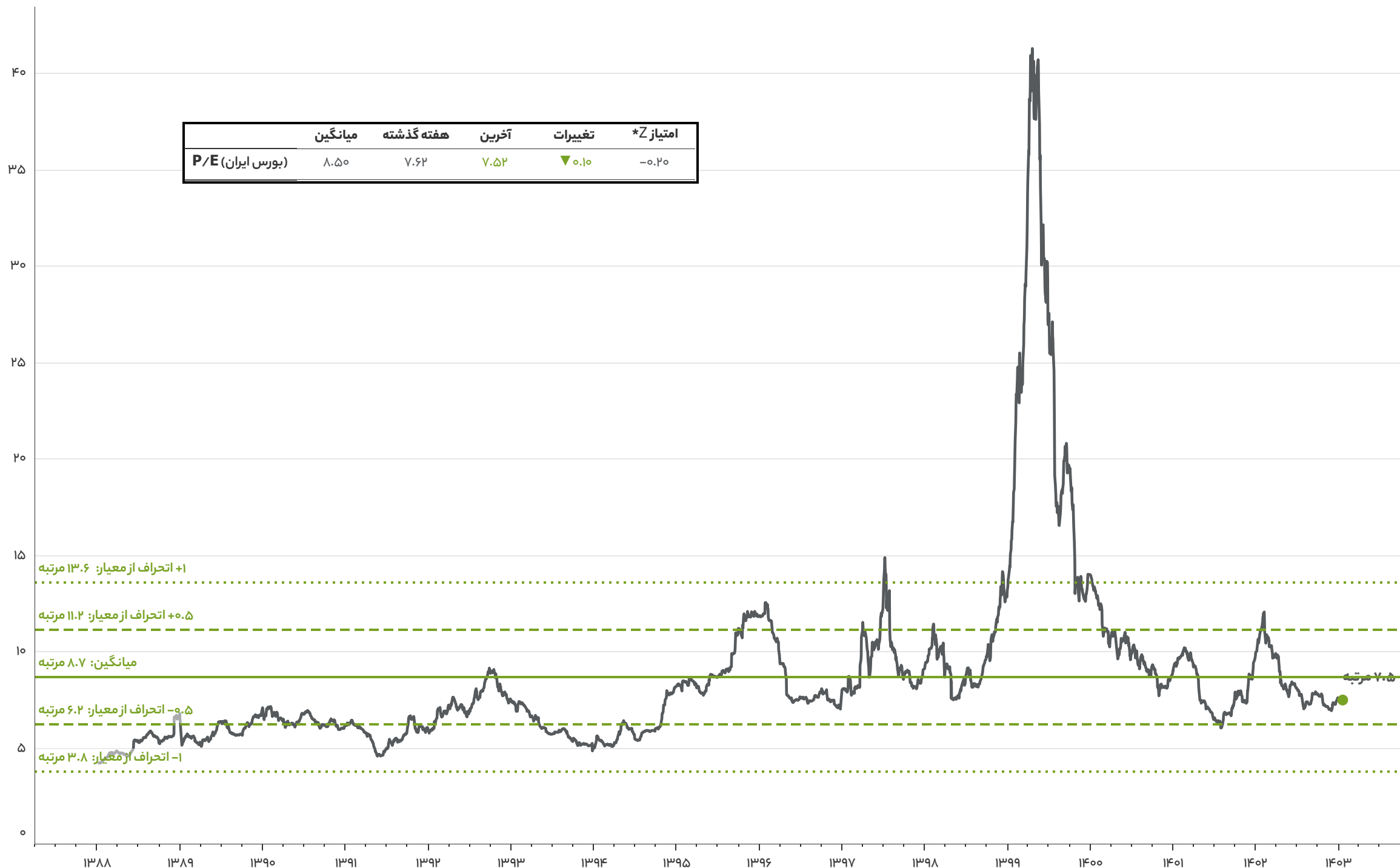
ارزش معاملات هفتگی بازار

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	۷.۵۲	۷.۶۲	۶.۰۷	۱۲.۴۲	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۳۴	۷.۴۰	۵.۶۴	۱۲.۲۲	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۶۹	۹.۰۲	۸.۶۸	۱۴.۴۳	۴۳.۵۱

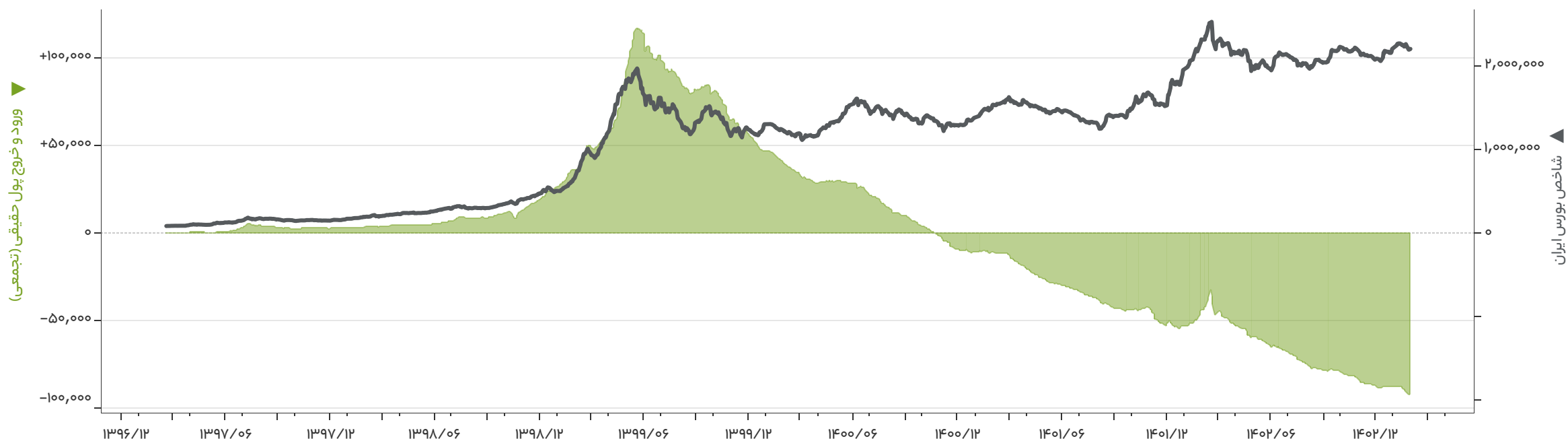


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای	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)	۶۱	۹۹	۱۱۰	۱۲۱	۱۵۵	۱۹۴	۲۱۳	۳۸۷	۶۸۹	۳,۳۰۳	۳,۶۵۸	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۷%	۱.۱%	۱.۲%	۱.۳%	۱.۷%	۲.۲%	۲.۴%	۴.۳%	۷.۷%	۳۶.۷%	۴۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۸.۹	۱۳.۶	۱۱.۶	۱۸.۵	۹.۰	۹.۷	۹.۷	۴.۹	۵.۱	۷.۴	۸.۱	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۸%	۱۵.۱%	۳.۶%	۲.۸%	۷.۷%	۳.۶%	۴.۷%	۳.۲%	۱۲.۹%	۹.۰%	۸.۳%	
نسبت تقسیم سود	۳۹%	۱۰۰%	۴۱%	۵۷%	۷۵%	۳۸%	۵۳%	۳۲%	۶۳%	۶۲%	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)	+۶۸۸%	+۸۵۲%	+۱۱۶%	+۳۲۱%	+۳۷۴%	+۴۱۸%	+۴۰۸%	+۸۵۰%	+۸۴۷%	+۸۵۸%	+۱۰۵۳%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۰%	+۱۳۳%	-۶۵%	+۴%	+۱۲%	-۱۰%	-۱۲%	-۱۵%	+۲۳%	۰%	+۷۷%	
بازده از ابتدای سال	+۲۵۲%	+۵۴%	+۳۹%	+۸۲%	+۸۹%	+۱۰۰%	+۵۱%	+۸۸%	+۱۰۱%	+۷۰%	+۱۰۱%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۵%	۱%	-۵%	-۳%	-۳%	-۴%	-۴%	-۵%	-۴%	-۳%	-۲%	

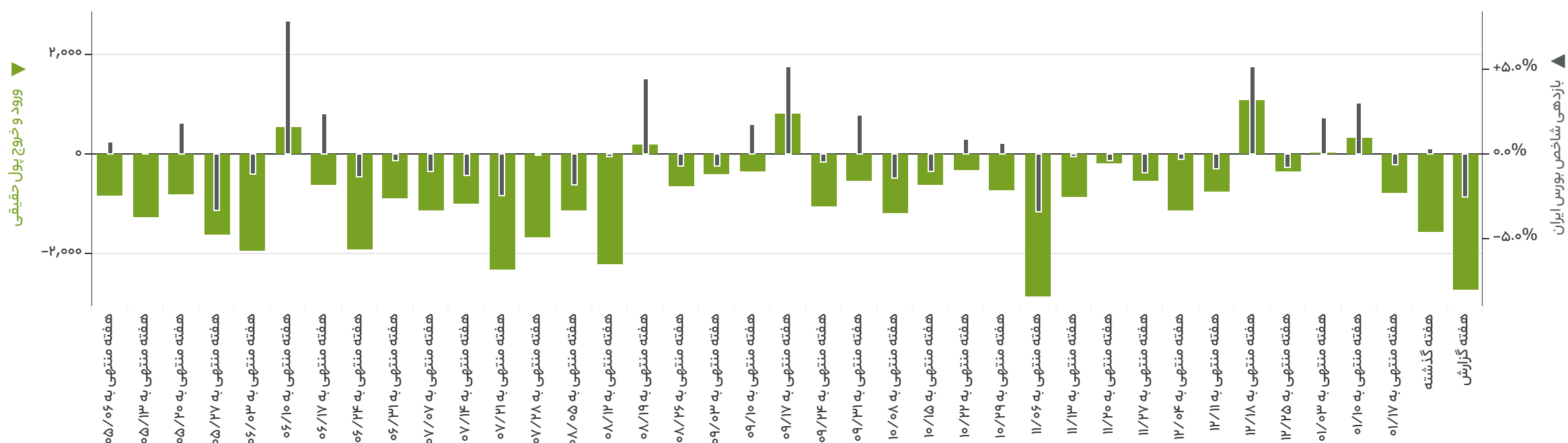
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



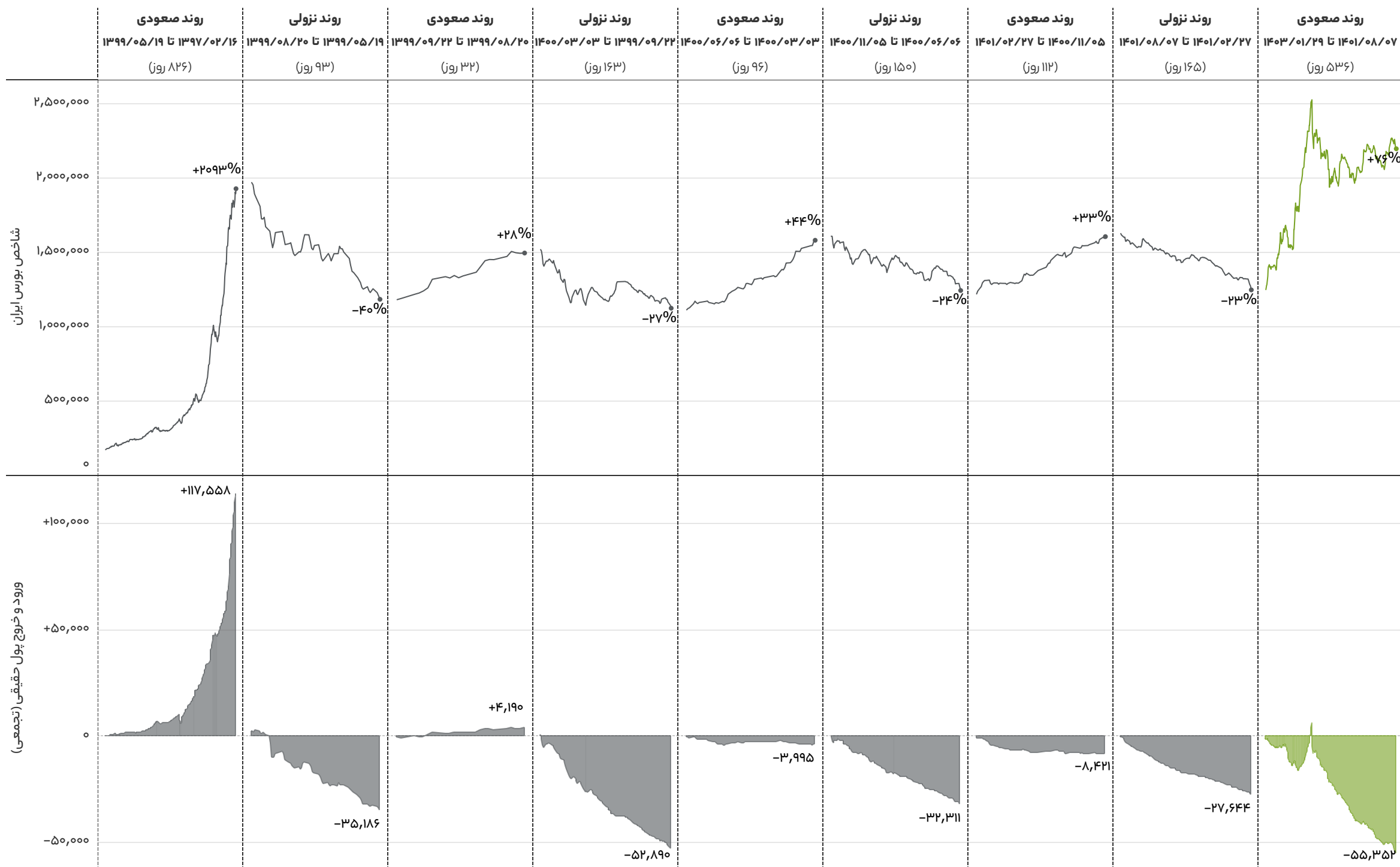
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

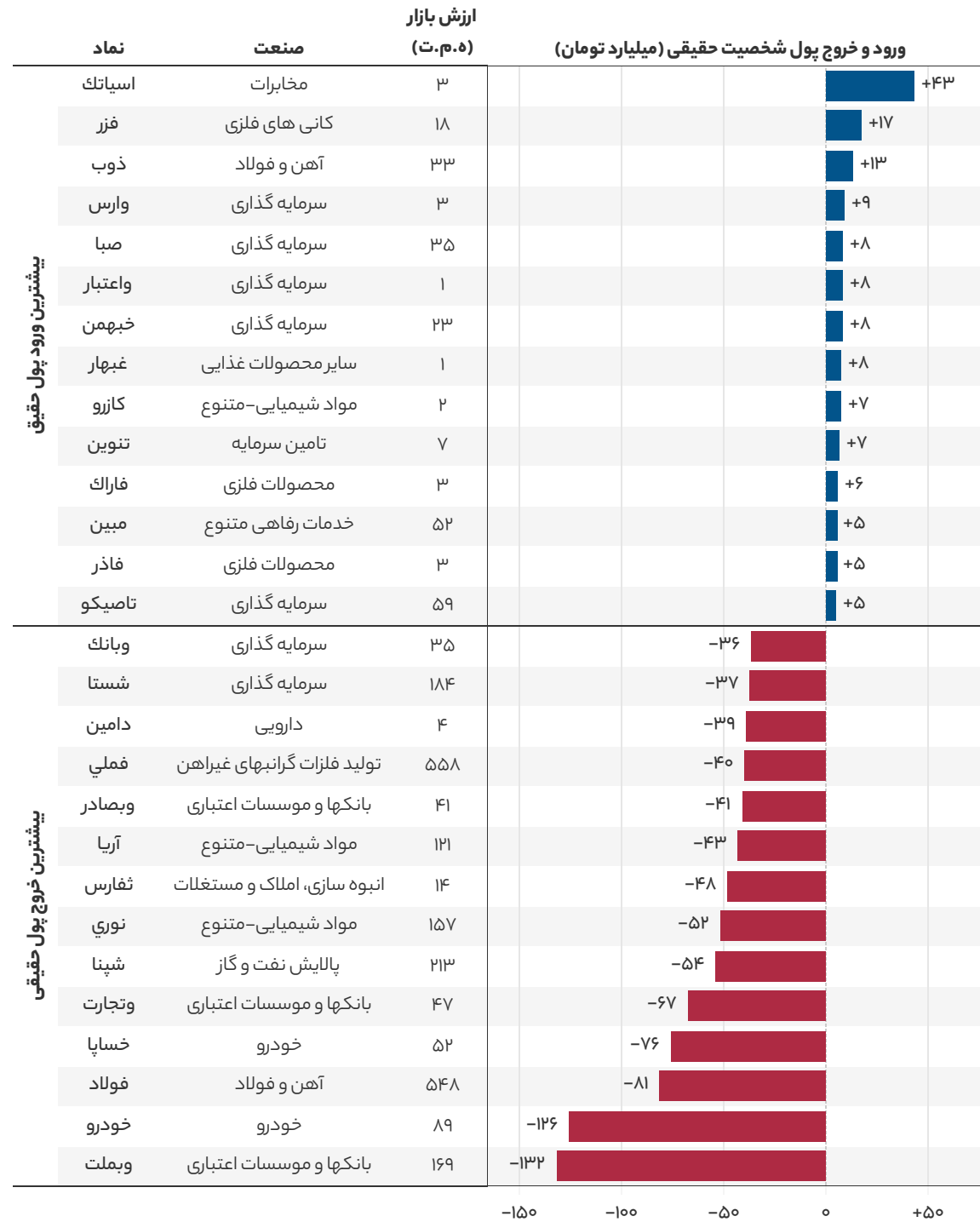
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

ورود و خروج پول حقیقی

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

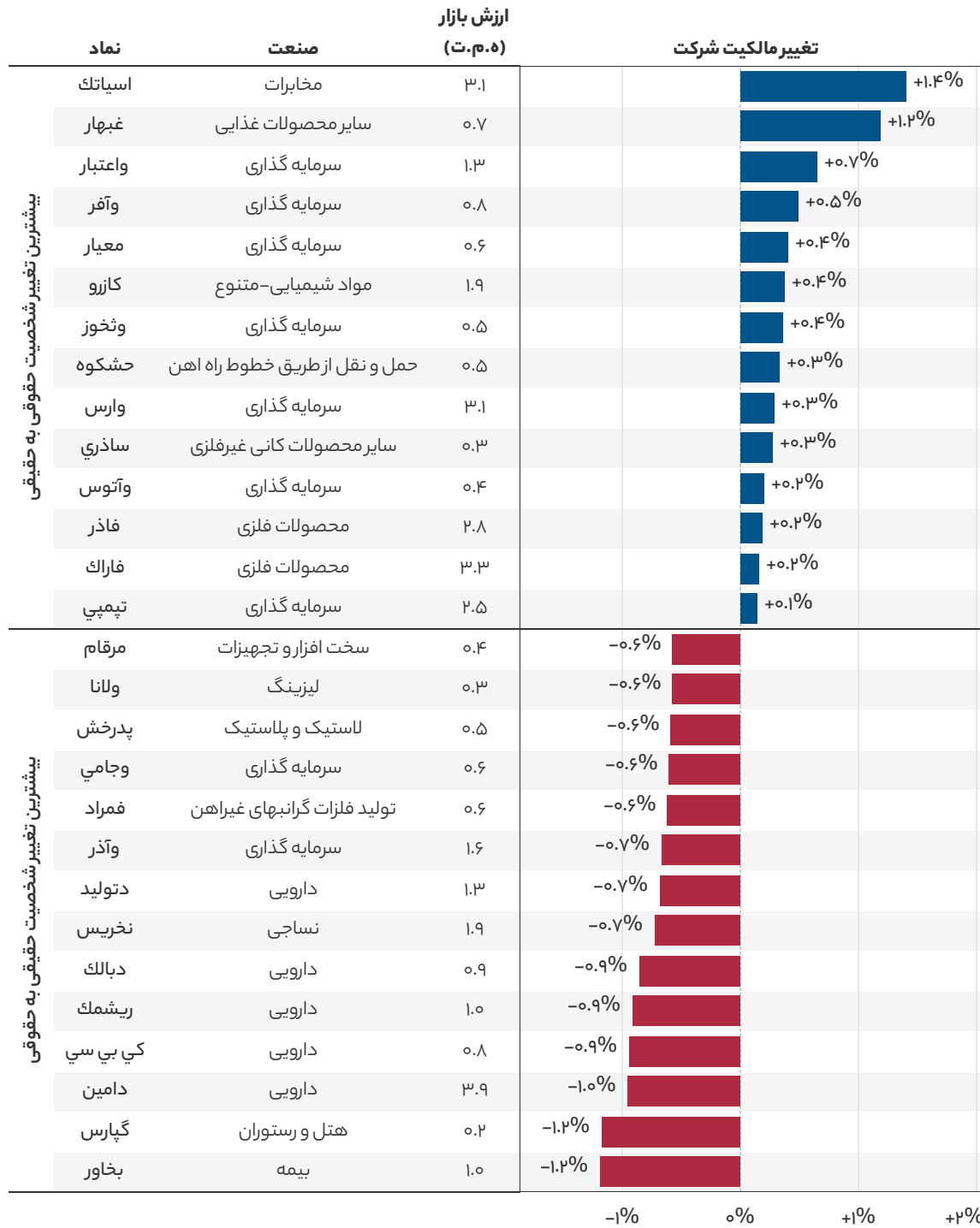


پیشترین ورود پول حقیقی

پیشترین خروج پول حقیقی

تغییر مالکیت شرکت

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

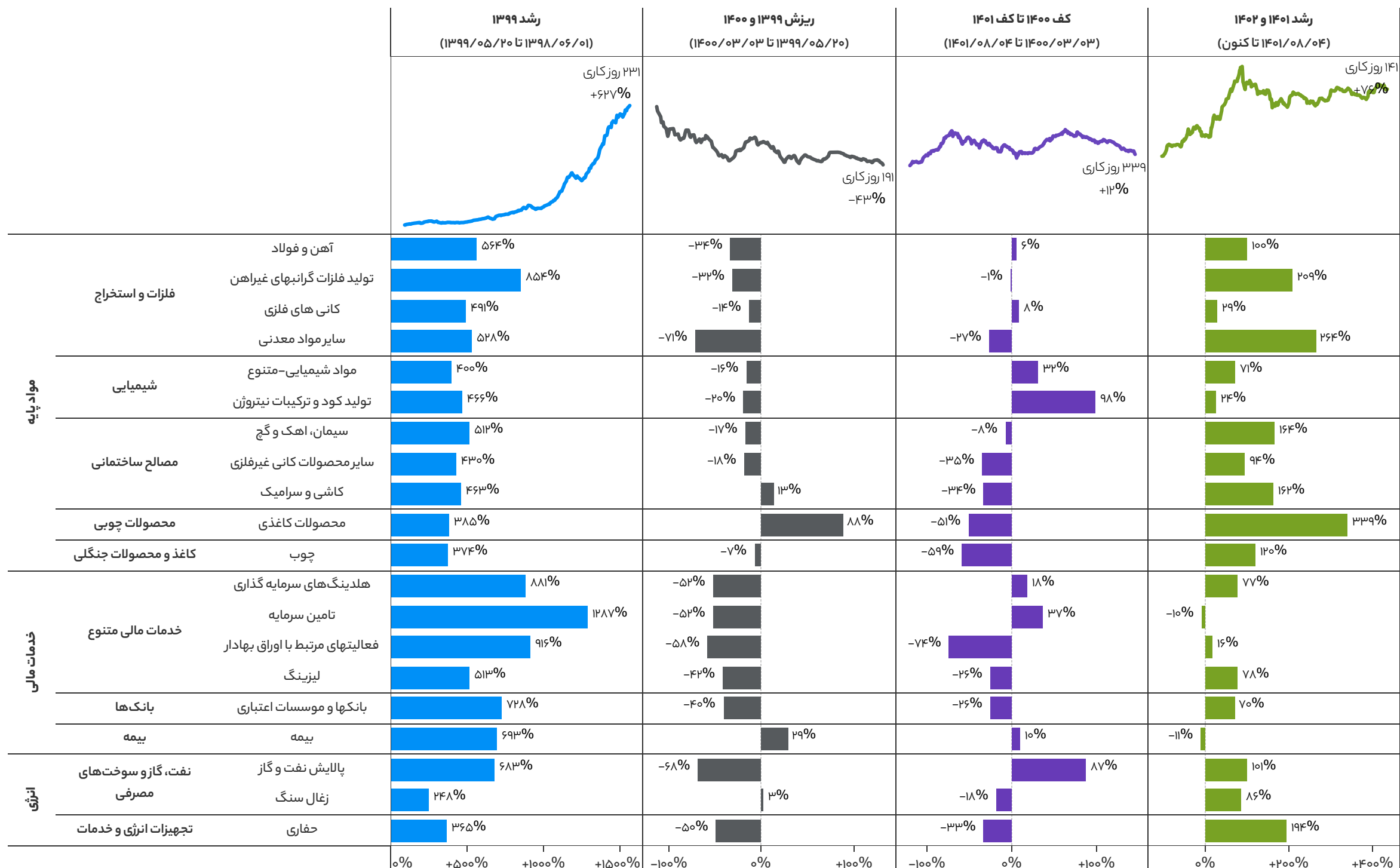


پیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی

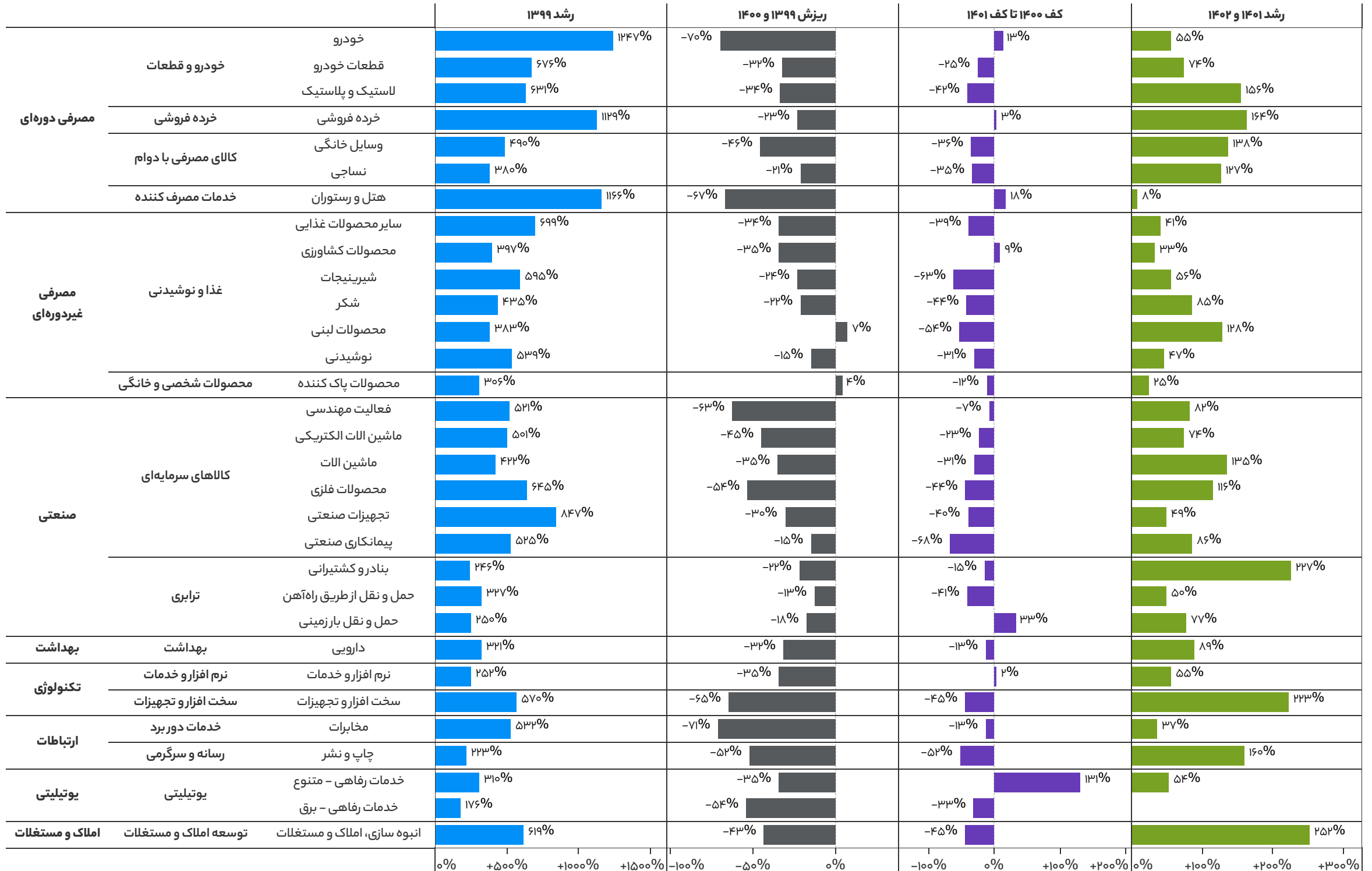
پیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی

بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

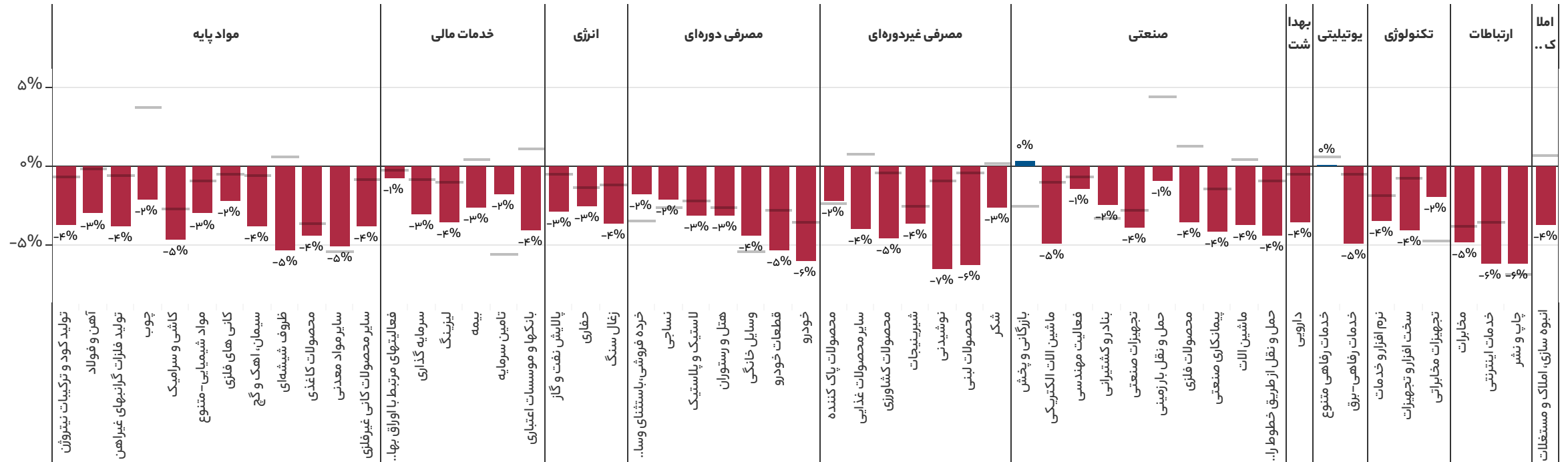
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۸، شاخص بورس ایران، بازدهی صنایع به تفکیک زیرگروه و سکتور، مرتب شده براساس ارزش بازار



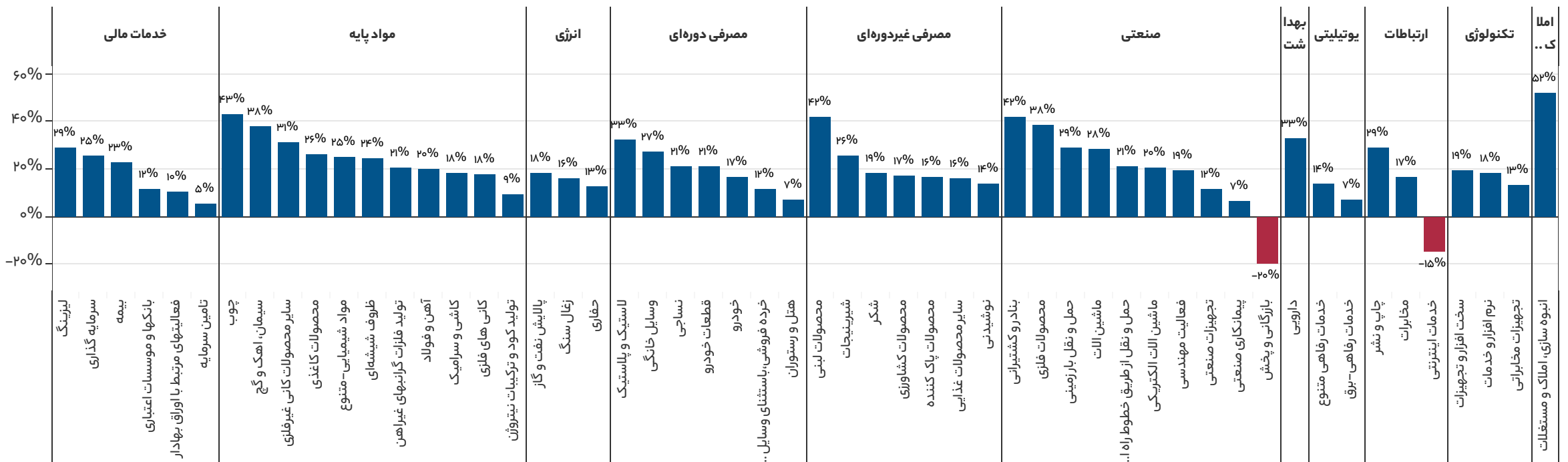
بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازده هفته گذشته با خط‌های خاکستری رنگ نشان داده شده است)

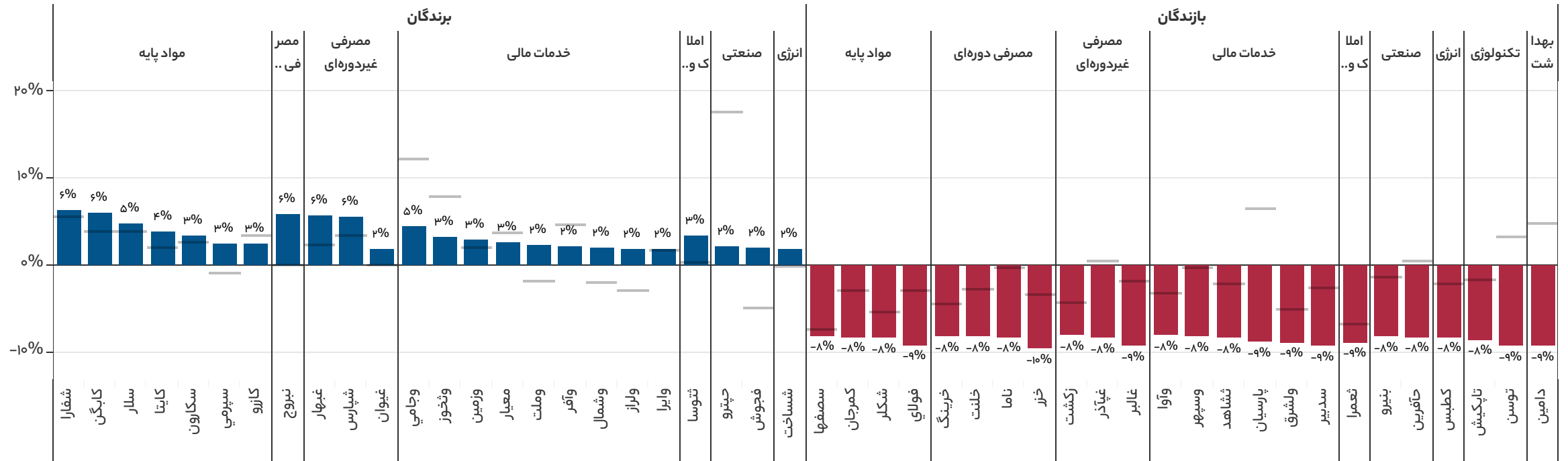


(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده)

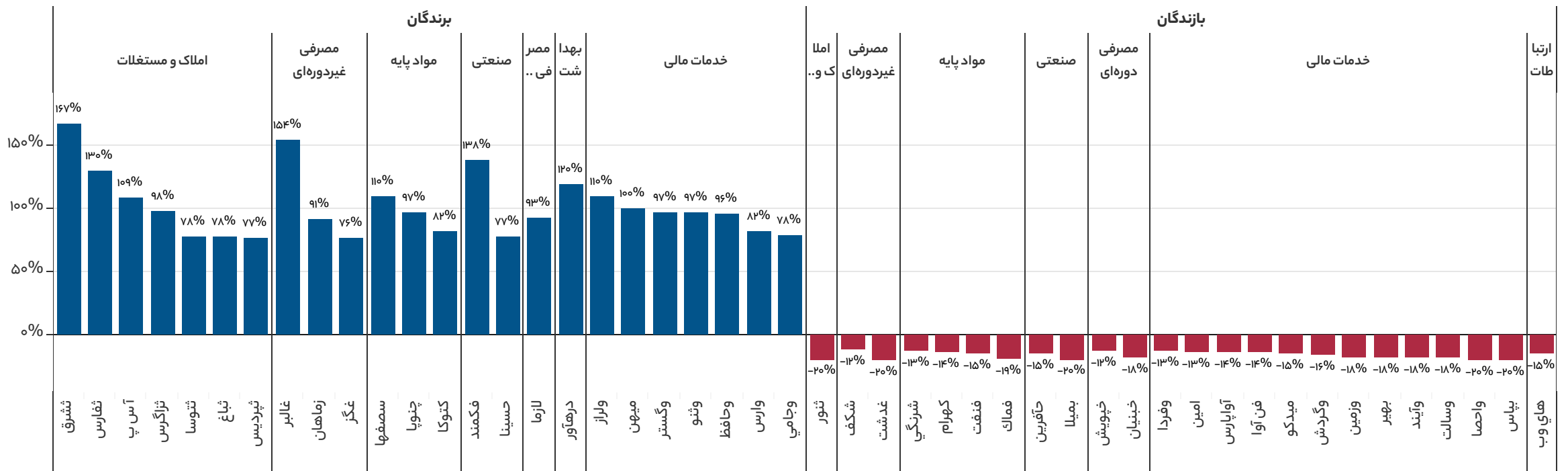


برندگان و بازندگان هفته

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)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

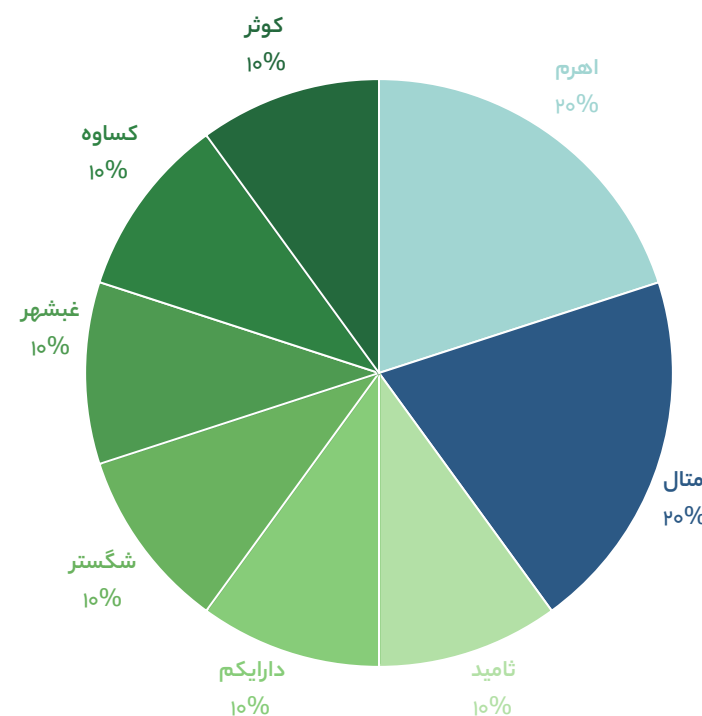


بازده تعدیل شده	بفجر	همراه	کگلر	مبین	ماون	پارس	فملی	فارس	شیراز	میدکو	وامید	شبریز	کگل	جم	بوعلی	پارس	تامیکو	شپدیس	پارسان	کچاد	فخوز	آریا	تاپیکو	وغدیر	وپاسار	وصندوق	ومعادن	نوری	شتران	شستا	شپنا	رمپنا	شبندر	خودرو	خسپا	وتجارت	وبملت	اخابر	حکشتی
بازده هفته گذشته	+0.5%	-0.1%	-0.3%	-0.5%	-0.5%	-0.6%	-1.0%	-1.4%	-1.5%	-1.5%	-1.7%	-1.7%	-1.7%	-1.9%	-2.0%	-2.1%	-2.1%	-2.2%	-2.2%	-2.3%	-2.3%	-2.6%	-2.9%	-2.9%	-2.9%	-3.0%	-3.0%	-3.7%	-3.9%	-4.1%	-4.2%	-4.7%	-4.8%	-5.2%	-5.5%	-5.5%	-5.7%	-6.6%	-7.1%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۱,۹۰۳	نسبت (P/E) و (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۹۰۰	ثامید	میان مدت
۱۰%	۱۵,۹۰۵	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۲۱۰,۰۰۰	دارایکم	
۱۰%	۱,۵۲۶	راه اندازی شرکت در آینده نزدیک و نسبت (P/E) مناسب	۲,۱۵۰	شگستر	
۱۰%	۱,۹۴۶	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۴۰۰	غبشهر	
۱۰%	۱۸,۶۶۰	نسبت (P/E) مناسب	۲۴,۰۰۰	کساوه	
۱۰%	۲,۳۶۶	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا	۳,۳۰۰	کوثر	
۲۰%	۲۱,۷۶۰	دارا بودن پورتهوی متنوع و اهرمی	-	اهرم	بلند مدت
۲۰%	۱۲,۱۳۰	دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد	-	متال	

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

