

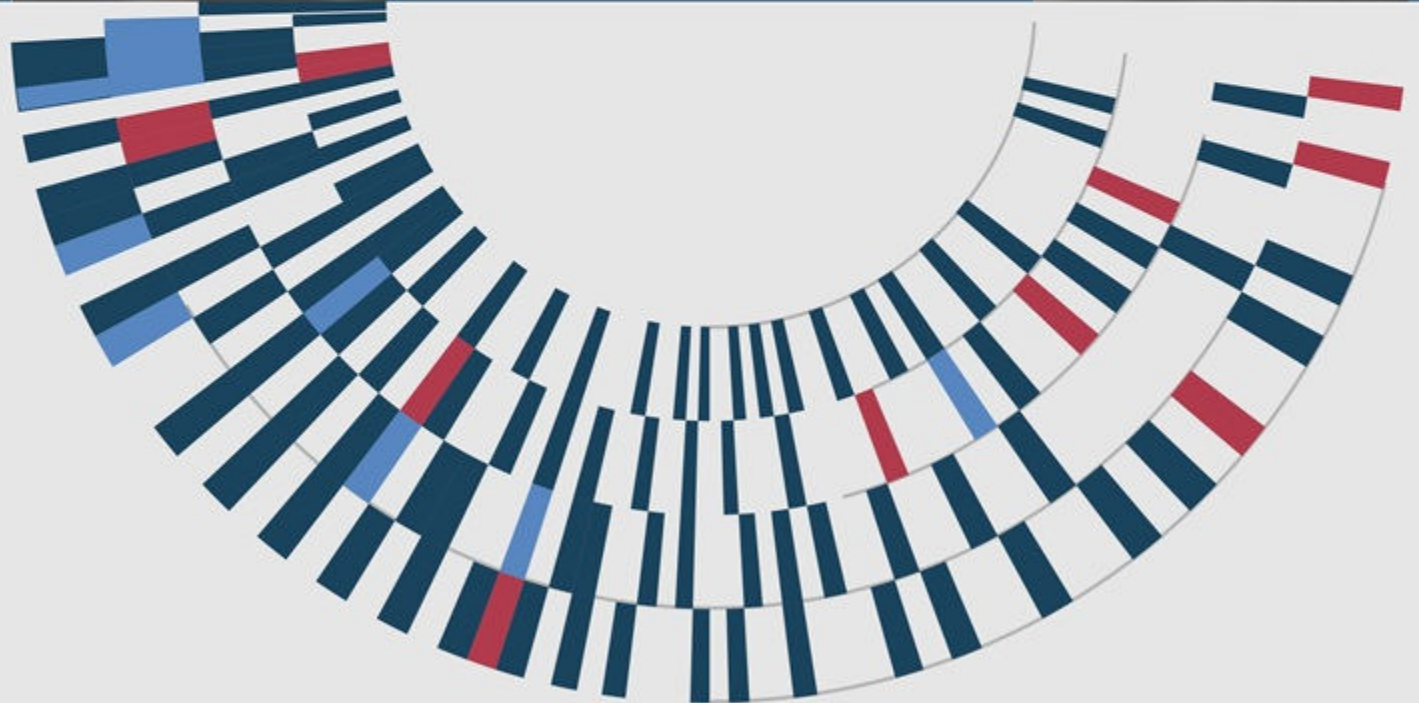
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۵۱ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۲۸

 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.



۱۴ واړونګی منځنۍ بازده و رکود اقتصادي

۵۸ ګاز طبيعي
۱۵ کرک اسپرډ فرآورده‌های نفتي
۱۱ سيمان
۱۲ اخبار و معيارهای تأثيرگذار

۳۲ برندگان و بازندگان هفته
۳۳ بازدهی صنایع
۳۴ سبد پیشنهادی

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

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

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

کامودیتی

بازار سهام

۳۵

۱۵



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		+۲.۲%	۲,۴۱۵	دلار/انس	بازار فارکس	طلا
			بموتو، فباهنر	فملی		+۶.۷%	۱۰,۷۲۴	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس
			بموتو، فباهنر	فملی		-	۵۱۵,۵۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)
			فنوال	فایرا		-	۲,۴۵۵	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم
			فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما		+۳.۳%	۳,۰۴۵	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی
			-	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما		+۳.۲%	۲,۳۰۷	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب
فلزات آهنی			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان		-۰.۵%	۴۷۷	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان		+۱.۰%	۵۰۵	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش CIS (منطقه)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق		+۱.۰%	۲۱,۸۱۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	شمش (فولاد خورستان)
			-	فولاد، فخوز، هرمز		-۲.۷%	۴۵۳	دلار/تن	بنادر ایران FOB	اسلب (ایران)
			-	فولاد، فخوز، هرمز		-	۴۹۰	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب CIS (منطقه)
			-	فولاد، فخوز، هرمز		-۳.۷%	۲۳,۶۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)
			فولای	ذوب، کویر		-	۵۸۵	دلار/تن	بنادر ترکیه FOB	میلگرد
			فولای	ذوب، کویر		+۲.۴%	۲۴,۶۷۸	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)
			فجر، فسپا	فولاد، فوکا، فنورد		-	۵۶۳	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم
			-	فولاد		-	۶۵۵	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق سرد



معادن و محصولات کشاورزی

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
سنگ آهن و محصولات معدنی				-	-	+۰.۶%	۱۱۷	دلار/تن	CFR شمال چین	سنگ آهن
				فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	+۰.۴%	۱۳۶	دلار/تن	CFR شمال چین	گندله سنگ آهن
				فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-۰.۴%	۵,۲۸۵	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	گندله سنگ آهن (گل گهر)
				فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	+۰.۴%	۱۲۴	دلار/تن	CFR شمال چین	کنسانتره سنگ آهن
				فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	+۱.۰%	۳,۶۹۸	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی				-	-	-۱.۷%	۲۳۹	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
				غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-۳.۴%	۱۷۸	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
				-	-	+۲.۹%	۱,۵۰۰	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
				غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۸۸۸	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، شفارس		
	چین CFR	دلار/تن	۳۱۲	+۳.۱%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ ۳۱۲	۲۰%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۶۵	-۱.۵%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ ۱,۰۱۰	۰%
	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ ۸۷۰	۰%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۴	+۱.۴%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ ۱,۱۵۸	۴%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۸۵	+۲.۴%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ ۱,۱۴۰	۱%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۴۴	-۰.۱%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ ۱,۱۸۲	۱۷%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۴	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ ۱,۰۸۴	۳%
	چین CFR	دلار/تن	۹۱۲	-۰.۳%	بوعلی	-	۸۰۱ ۹۵۲	
	چین CFR	دلار/تن	۱,۳۹۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ ۱,۴۵۰	۶۲%
پلیمرها	چین CFR	دلار/تن	۵۲۵	+۴.۰%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ ۵۵۶	۴%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۵۱	+۰.۲%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ ۱,۰۵۱	۹%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۵	+۰.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ ۹۸۵	-۲%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۵	+۰.۴%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ ۹۶۱	-۱%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۵	-۰.۶%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ ۸۹۰	۱%
	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۳۰ ۱,۰۰۰	-۵%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۷۴۰ ۸۸۵	-۲%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۷۰	-	شبصیر	-	۱,۲۳۰ ۱,۴۸۰	۱۲%



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	۸۴	۱.۳%+	-	شیپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۷۴	۹۴	۹%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۸۰	۲.۲%+	-	شیپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۶۹	۹۱	۱۰%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۷	۰.۳%+	شیپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۸۰	۱۰۷	۶%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۰	۳.۸%-	شیپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۸۰	۱۲۵	۸%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۷۰	۲.۰%-	شیپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۳۷۳	۵۲۸	۲۱%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۹۱	۱.۴%-	شیپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	-	۸۱	۱۲۴	۷%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۶۰۰	۱.۶%-	شیپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	بوعلی، نوری	۴۵۲	۶۵۹	۱۱%
روغن پایه	امارات متحده CFR عربی	دلار/تن	۸۹۵	۰.۶%-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنف	-	۷۲۰	۹۴۰	۵%-
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۶,۲۸۳	۱.۳%-	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۲۱,۷۹۵	۳۶,۹۴۳	۳۰%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۲۶۹	-	شیپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۲,۴۵۵	۲۲,۲۶۹	۳%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۴,۰۰۰	-	شپاس	-	۱۲,۰۸۶	۱۶,۴۹۹	۶%-
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۱۹۸	۴.۶%-	-	ذوب، فروش	۱۸۸	۲۸۷	۱%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۹	۱.۲%+	-	-	۱.۰۵	۱.۱۲	۱%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	۱.۷%+	-	-	۱.۲۱	۱.۳۱	۳%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۶,۹۲۰	۱۰.۳%+	-	-	۲۵,۷۰۴	۶۹,۶۶۳	۱۵۰%

انرژی و فرآورده‌های نفتی

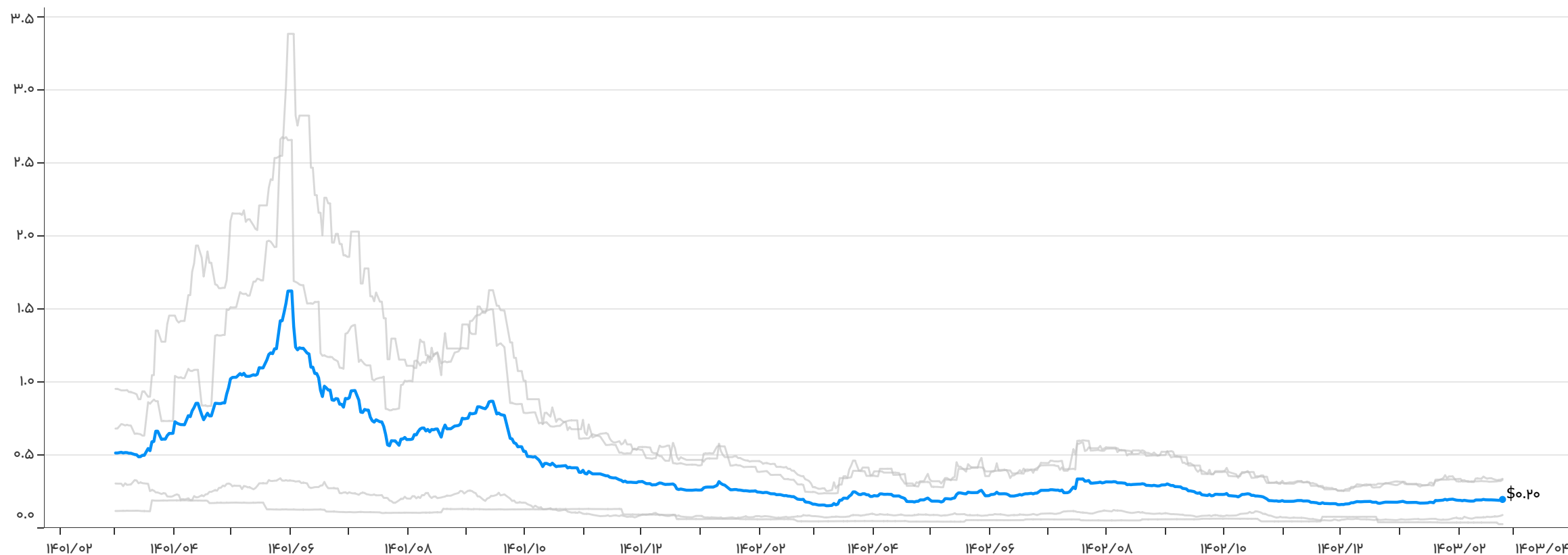
ارزو ارز دیجیتال



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	۰.۰۹	+۱۱.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ ۰.۱۳	۹%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۳	-۲۶.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۳ ۰.۰۸	-۳۸%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۴	+۱.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	۲۰%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۳	+۳.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۶۱	۳۳%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۰	+۲.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	۱۹%

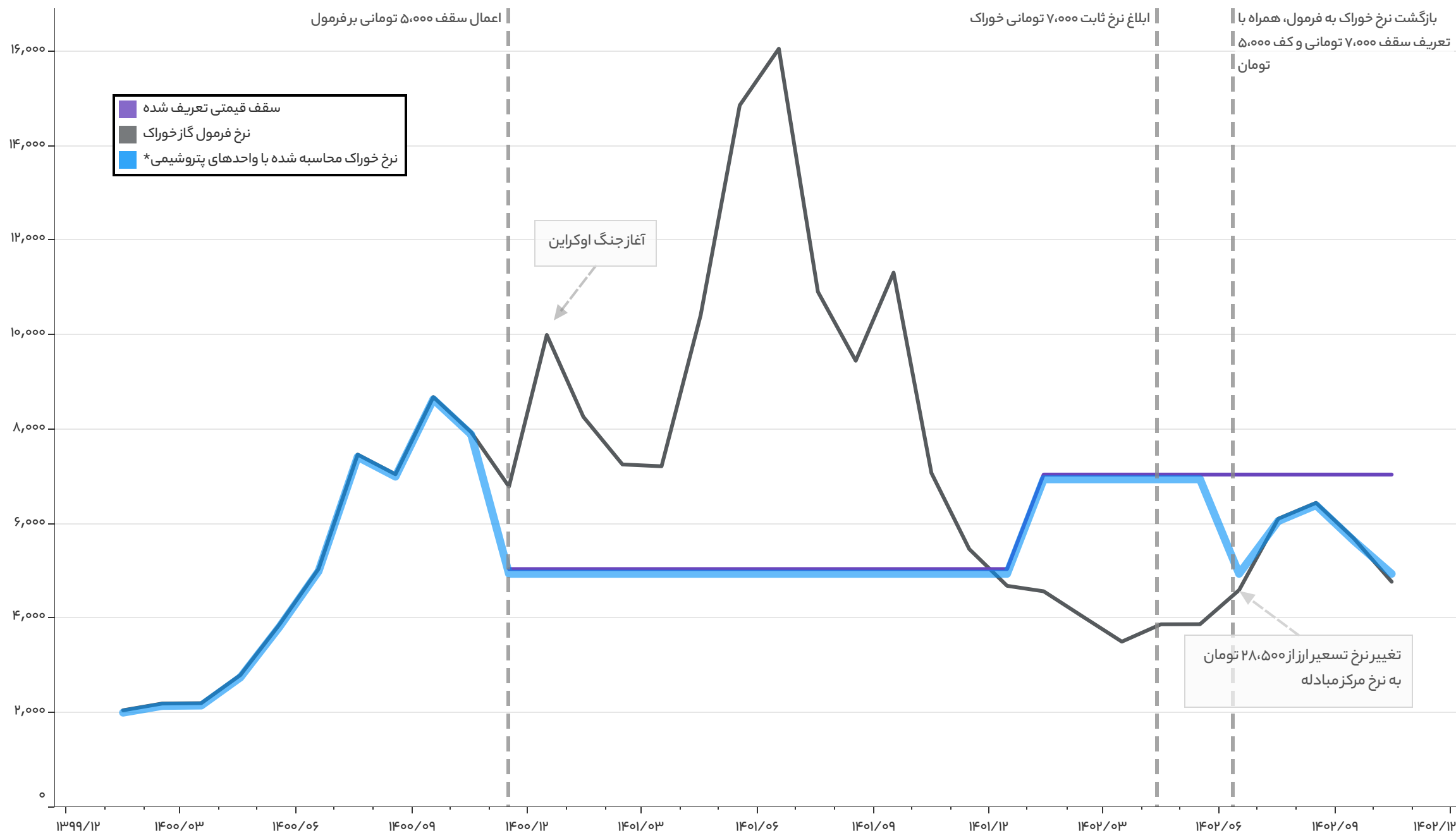
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



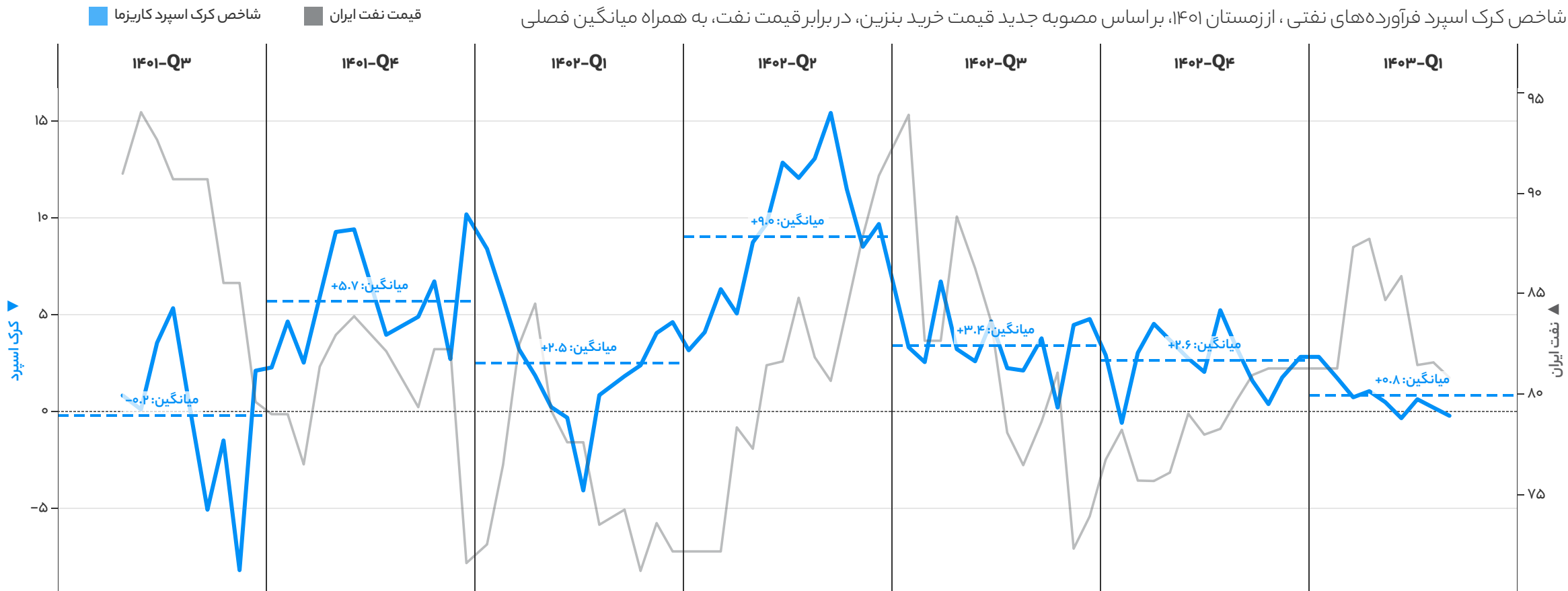
* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بروزرسانی خواهد شد.

- 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	۸۰.۹									
گازوئیل	۸۹.۶	۱۱.۵	۸.۷	▼۲.۸	۱۹.۵	۱۲.۵	-۳۶.۱%			
بنزین**	۸۲.۰	۰.۲	۱.۲	▲۱.۰	۵.۰	۵.۲	+۲.۹%			
نفتا	۶۷.۹	-۱۲.۶	-۱۲.۹	▼۰.۳	-۹.۶	-۱۲.۱	-۲۶.۷%			
نفت کوره	۷۴.۱	-۶.۰	-۶.۸	▼۰.۸	-۱۵.۰	-۱۰.۱	+۳۲.۶%			
لوب کات***	۸۲.۰	۰.۴	۱.۲	▲۰.۸	-۶.۴	-۳.۵	+۴۵.۰%			
وکیوم باتوم***	۵۴.۰	-۳۳.۳	-۲۶.۸	▲۶.۵	-۳۱.۰	-۳۲.۴	-۴.۶%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۰.۳	-۰.۲	▼۰.۴	۲.۶	۰.۸	-۶۷.۹%			

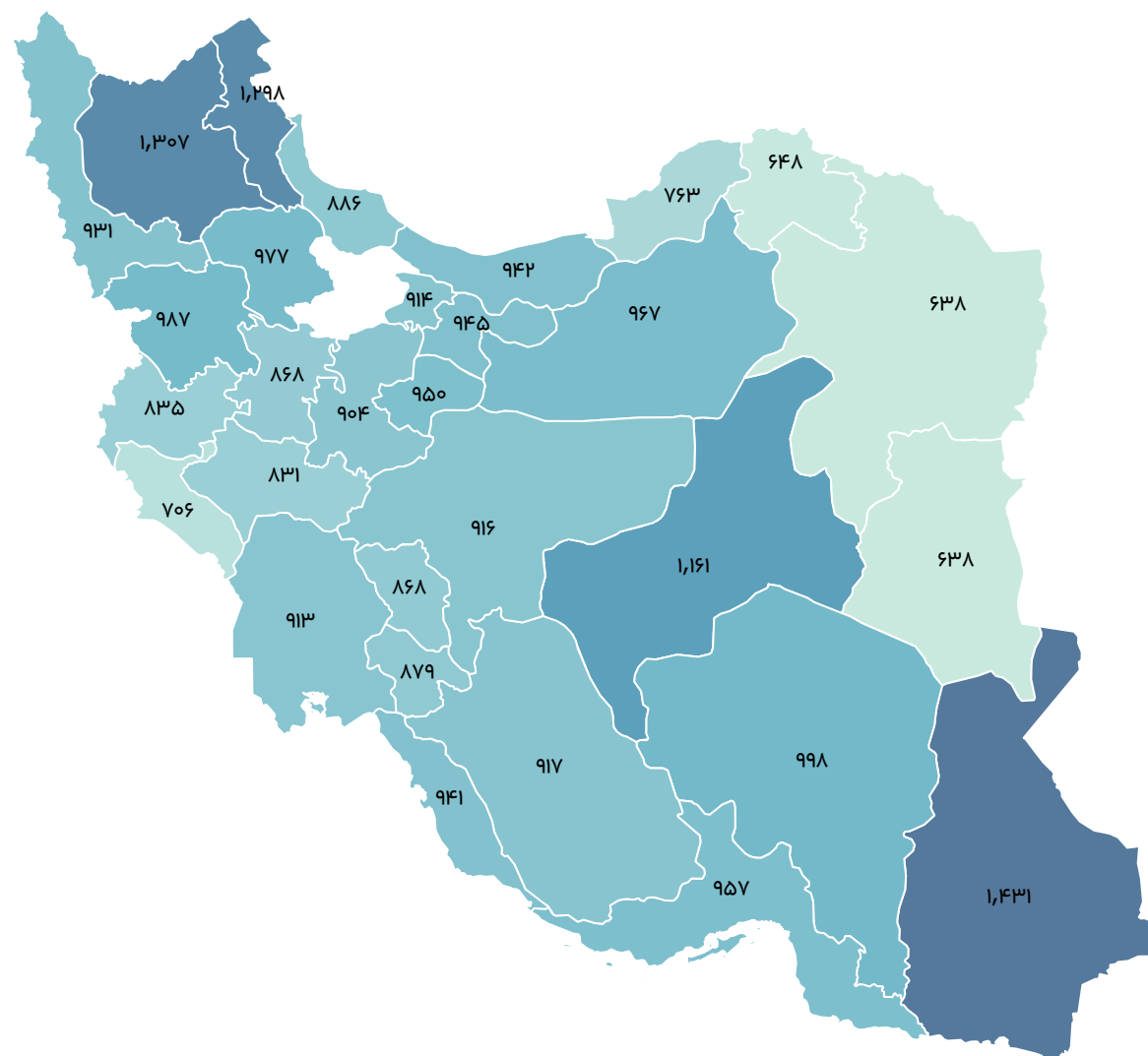
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هریک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و براساس ارزش بازار هریک از این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

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

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

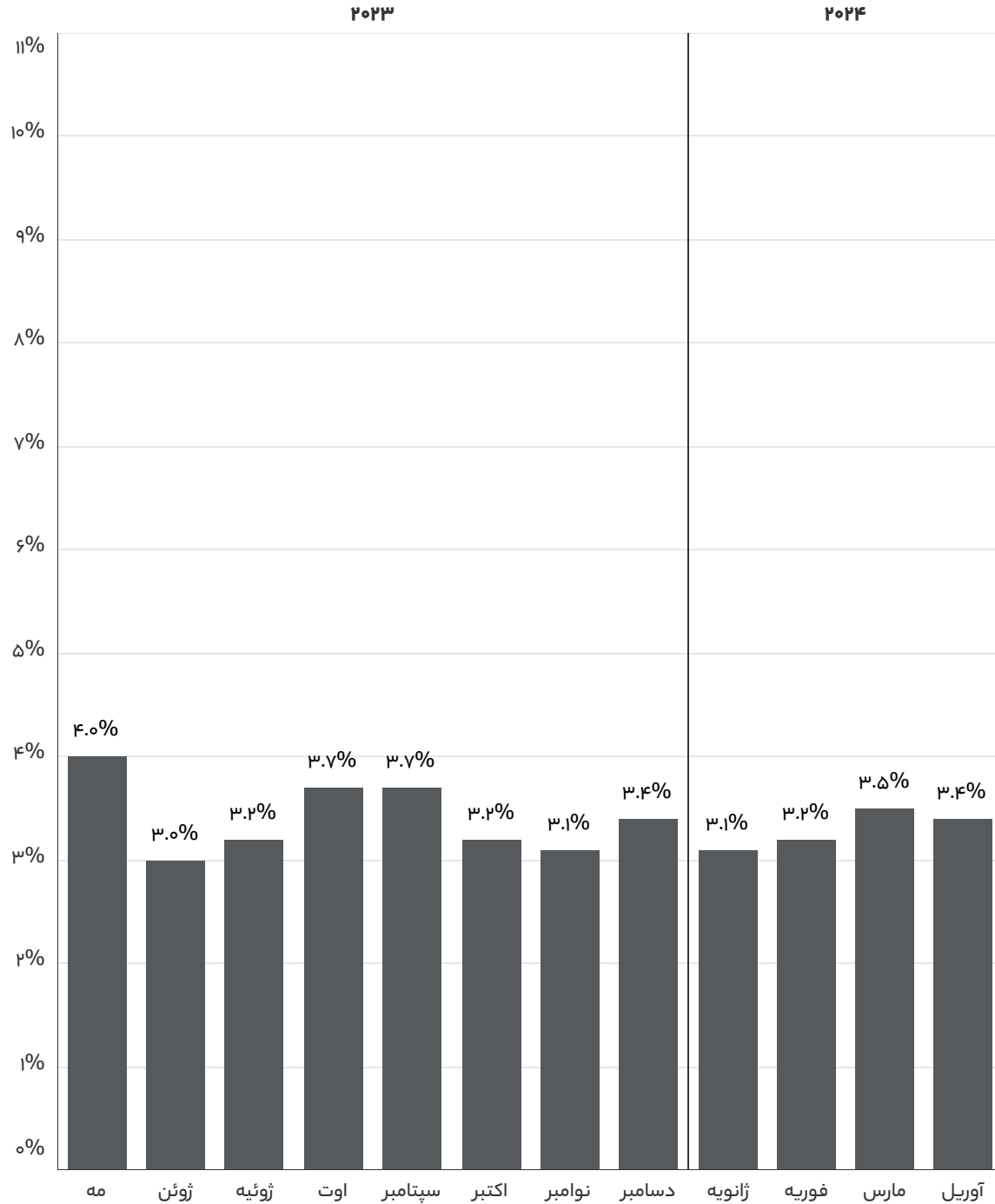
منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	سیمان تهران	۹۳۰	۹۴۵	+۱.۷%
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۹۵	۹۰۴	+۱.۰%
	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۶	+۰.۱%
	قم	سیمان نیزار قم	۹۵۰	۹۵۰	-
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۷۶۲	۱,۱۶۱	+۵۲.۴%
غرب	سمنان	سیمان شاهرود	۱,۰۱۲	۹۶۷	-۴.۴%
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۶۸	+۴.۷%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۱۳	۹۱۳	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۳۹	۸۳۵	-۰.۴%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۶۸	۸۶۸	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۸۳	۸۷۹	-۰.۴%
	لرستان	سیمان دورود		۸۳۱	
شمال	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۸۷	+۵.۰%
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۴۲	+۲.۹%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۸۰۱	۷۶۳	-۴.۷%
	گیلان	سیمان خزر	۱,۰۷۷	۸۸۶	-۱۷.۷%
شمال غرب	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۴۵۶	۱,۲۹۸	-۱۰.۹%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۱,۱۲۳	۹۳۱	-۱۷.۰%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۴۳۱	۱,۳۰۷	-۸.۷%
	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۳	۹۷۷	+۴.۷%
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۴۸	+۱.۶%
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۴۰	۶۳۸	-۰.۳%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۹۵۴	۹۵۷	+۰.۳%
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۱۷	-
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۴۱	۹۴۱	-
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۵۴	۹۹۸	+۴.۶%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۰۷۴	۱,۴۳۱	+۳۳.۲%

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

- ▲ به گزارش رویترز، روز جمعه (۱۷ می) قیمت هر اونس طلا با ۱.۵ درصد افزایش به ۸۳۲۴۱۲ دلار رسید و به رکورد ۲۹۲۴۳۱۰ دلار در ۱۲ آوریل نزدیک شد. قیمت طلا در معاملات آتی با ۱.۳ درصد افزایش به ۲۴۱۷.۴۰ دلار رسید. قیمت جهانی طلا به دلیل اقدامات محرک چین، دومین افزایش هفتگی متوالی خود را تجربه کرد. همچنین به همراه طلا، قیمت نقره نیز به دلیل امیدواری‌های جدید برای کاهش نرخ بهره آمریکا از سد ۳۰ دلار عبور کرده و به بالاترین حد در ۱۱ سال گذشته رسیده است.
- ▲ دولت آمریکا روز سه‌شنبه به بهانه محافظت از کارگران و کسب و کارهای آمریکایی تعرفه‌های شدیدی را برای واردات از چین وضع کرد. این تعرفه‌ها بر ۱۸ میلیارد دلار کالاهای وارداتی چین از جمله فولاد و آلومینیوم، تراشه‌ها، باتری‌ها، مواد معدنی حیاتی، سلول‌های خورشیدی و جرثقیل‌ها تأثیر خواهد گذاشت. این اقدام شامل چهار برابر کردن عوارض خودروهایی الکتریکی و رساندن تعرفه آن بیش از ۱۰۰ درصد بود. دولت آمریکا همچنین عوارض جدیدی بر تراشه‌های کامپیوتری، سلول‌های خورشیدی و باتری‌های لیتیوم بون وضع کرد.
- با فروش حدود نیم تن طلا در حراج بیست و پنجم، رکورد جدیدی در معاملات شمش طلای مرکز مبادله ایران ثبت شد. در بیست و پنجمین جلسه حراج شمش طلا که روز ۲۳ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ در مرکز مبادله ایران برگزار شد، ۴۶۸ کیلو گرم شمش طلای استاندارد با عیار ۹۹۵ در هزار معامله شد. از مجموع ۶۷۰ کیلوگرم شمش طلای عرضه‌شده در حراج‌های عمده و خرد تالار معاملات طلای این مرکز، ۴۶۸ کیلوگرم با میانگین قیمت چهار میلیارد و ۴۳۳ میلیون تومان به ازای هر شمش طلای استاندارد معامله شد. گفتنی است، در مجموع ۲۵ جلسه حراج حضوری مرکز مبادله ایران، حدود چهار تن شمش طلا مورد معامله قرار گرفته است. حراج بعدی نیز بناست روز سه‌شنبه ۲۵ اردیبهشت ماه در مرکز مبادله برگزار شود.
- ▼ طبق گزارش ماهانه اوپک از بازار نفت که در روز سه‌شنبه منتشر شد، کل تولید نفت ۱۲ عضو این گروه در ماه آوریل به طور متوسط برابر با ۲۶.۵۸ میلیون بشکه در روز (۴۸ هزار بشکه در روز پایین‌تر از ماه مارس) بوده است. اجلاس حساس ائتلاف اوپک پلاس دو هفته دیگر برگزار می‌شود تا در مورد سطح تولید این ائتلاف پس از ماه ژوئن تصمیم‌گیری شود. تولید نفت ایران، که از قرارداد کاهش تولید معاف شده، افزایش یافته است. همچنین تولید در نیجریه، عراق و ونزوئلا که آن‌ها هم معاف از سهمیه تولید اوپک پلاس بوده‌اند، کاهش یافته است. طبق این گزارش اوپک، تولید نفت اعضای غیر عضو اوپک در ائتلاف اوپک پلاس ۱۹۸ هزار بشکه در روز در آوریل کاهش یافته و به ۱۴.۴۴ میلیون بشکه در روز رسیده است.
- ▼ به گزارش رویترز، اظهارات مقامات بانک مرکزی آمریکا در مورد ادامه نرخ بالای بهره قیمت نفت را حدود دو دلار در هر بشکه پایین آورد. این سیاست پولی، تقاضا از سوی بزرگترین مصرف‌کنندگان نفت خام را کاهش می‌دهد. قیمت هر بشکه نفت برنت که صبح روز جمعه تا رقم ۸۴.۴۷ دلار نیز رسیده بود در پایان روز به ۷۹۸۲۰ دلار رسید. نفت سبک آمریکا هم از نرخ حدود ۸۰ دلاری صبح جمعه نهایتاً در پایان روز به ۲۶۷۸۰ دلار افت کرد. نفت برنت ۰.۲ درصد از ارزش خود را طی یک هفته گذشته از دست داده و نفت آمریکا ۰.۲ درصد افزایش قیمت داشته است.
- ▲ در تاریخ ۲۷ فروردین ۱۴۰۳ مجلس نمایندگان آمریکا لایحه‌ای با عنوان «قانون تحریم‌های انرژی ایران و چین ۲۰۲۳» را با ۳۸۳ رأی موافق در مقابل ۱۱ رأی مخالف برای تحریم بیشتر فروش نفت تصویب کرد. هدف این قانون جلوگیری از فروش نفت ایران به چین است. این لایحه در پی اصلاح «بخش ۱۲۴۵ (d) قانون اختیارات دفاع ملی (NDAA) برای سال مالی ۲۰۱۲» و اضافه‌کردن بندی به این بخش از قانون است. این قانون برای اجرا شدن نیاز به تصویب سنا نیز دارد و باید فرآیندی طولانی را طی کند. به خصوص که لوابی‌ی شبیه این لایحه در پیچ و تاب کنگره آمریکا زیاد است و تا تصویب شدن فاصله دارد.
- معاونت نظارت بر بورس‌ها و ناشران سازمان بورس، جزئیات نرخ گاز خوراک پتروشیمی‌ها بر حسب چهارهاب منطقه‌ای در اسفند ماه ۱۴۰۲ را اعلام کرد. بر اساس مصوبه هیئت دولت، نرخ پایه خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تا پایان برنامه هفتم توسعه ایران بر اساس ابلاغیه ۲۶ دی ماه ۱۳۹۴ وزارت نفت تعیین می‌شود.

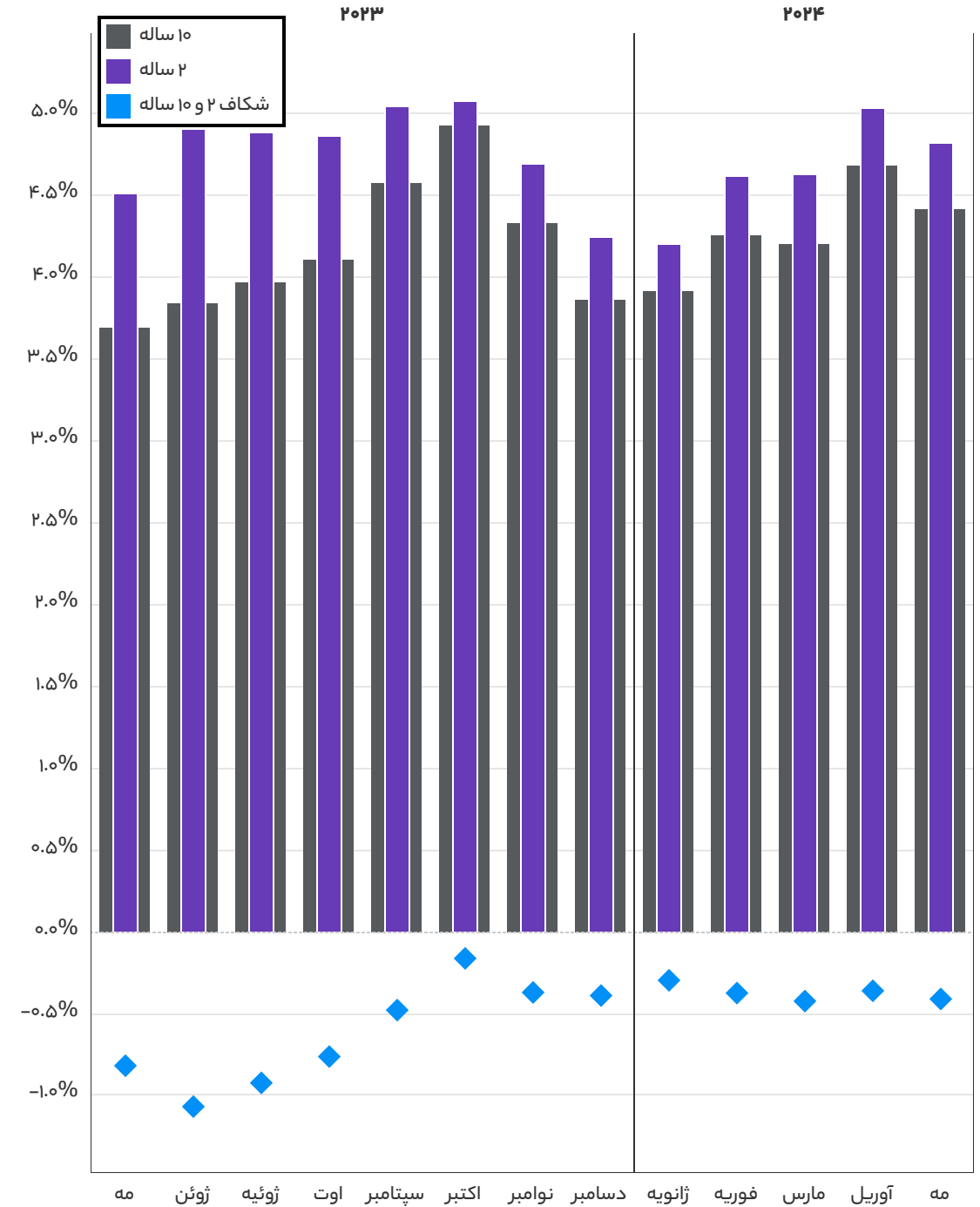
شاخص قیمت مصرف کننده در آمریکا

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

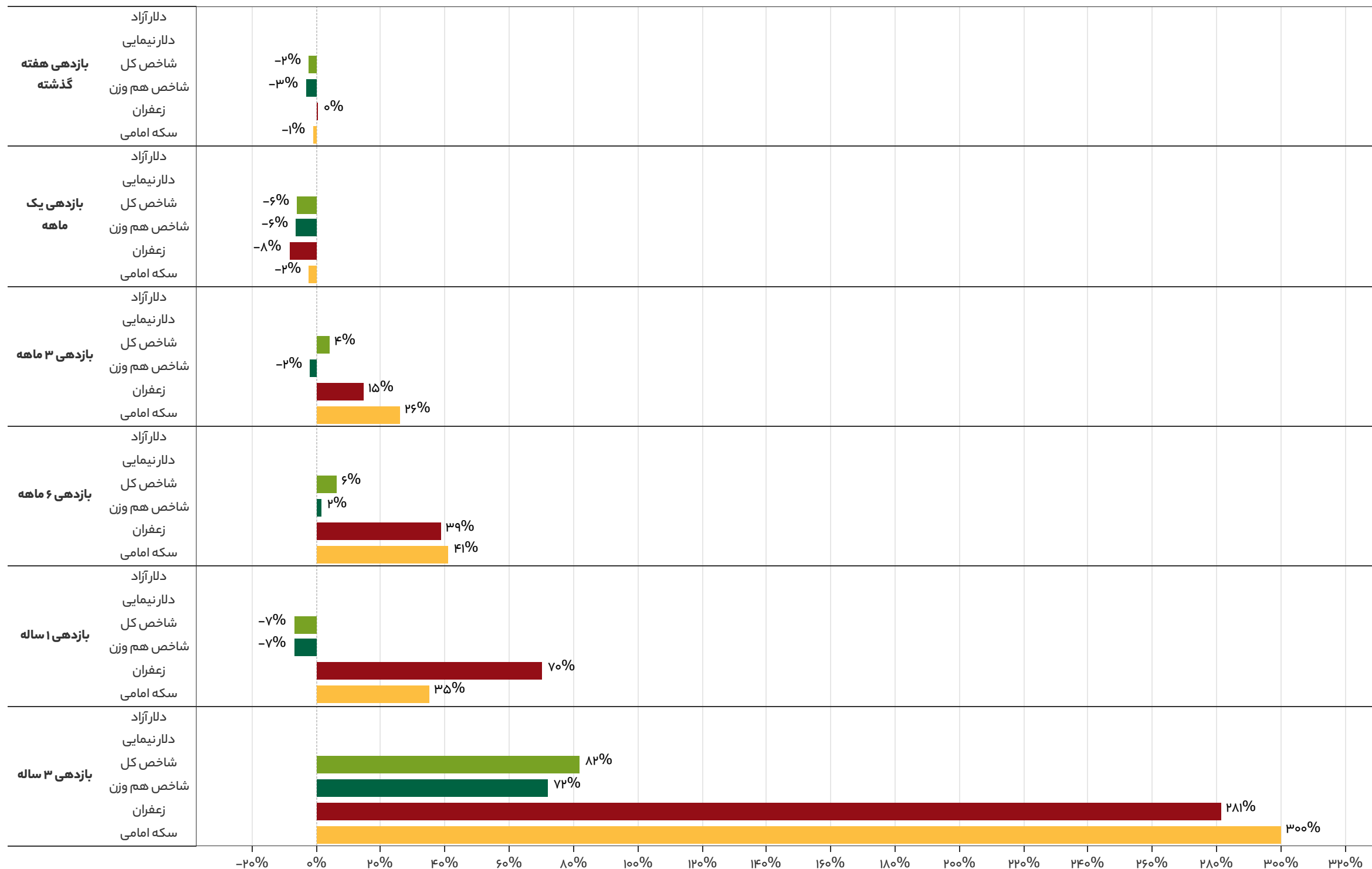
EQUITY MARKET

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 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

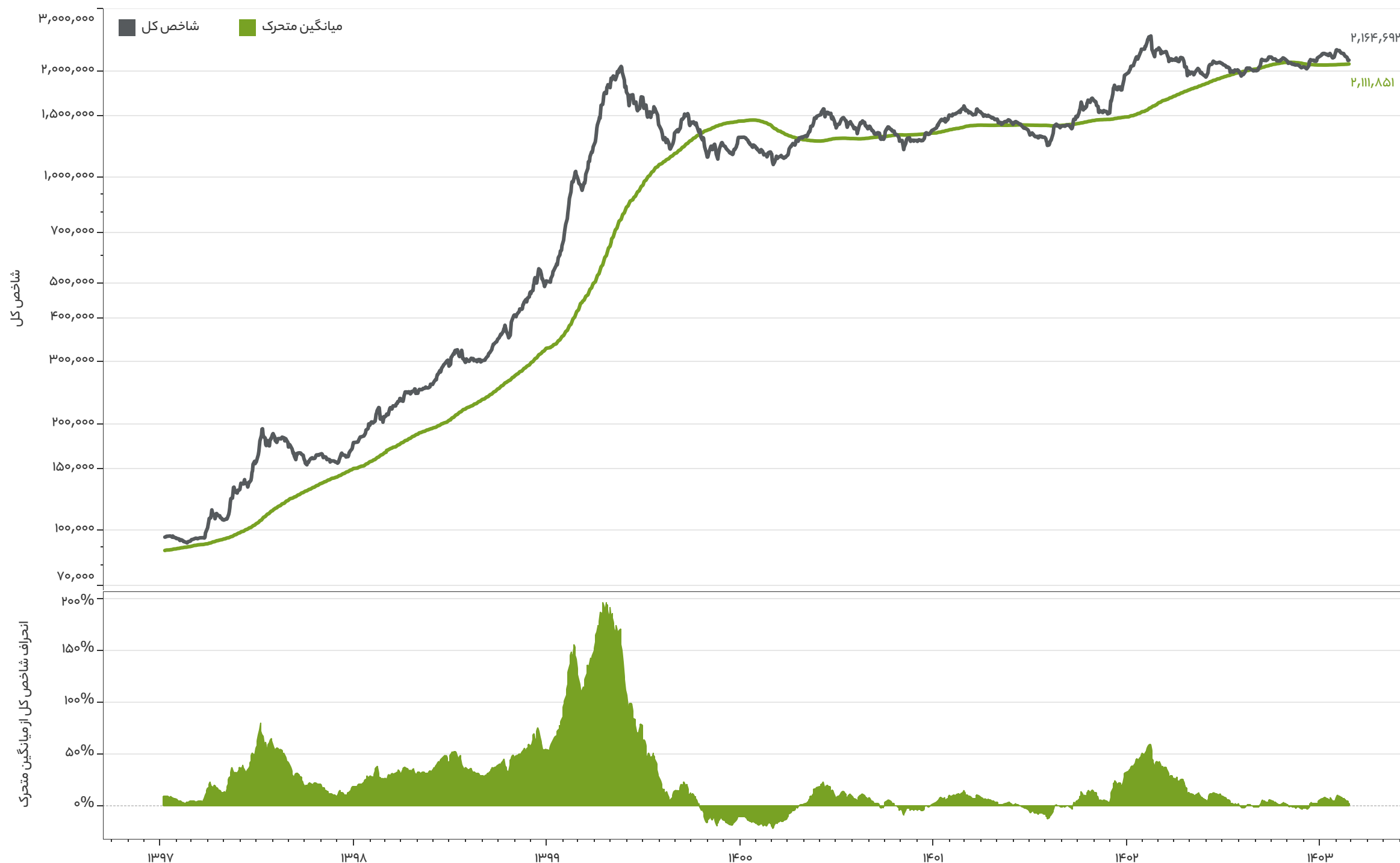
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

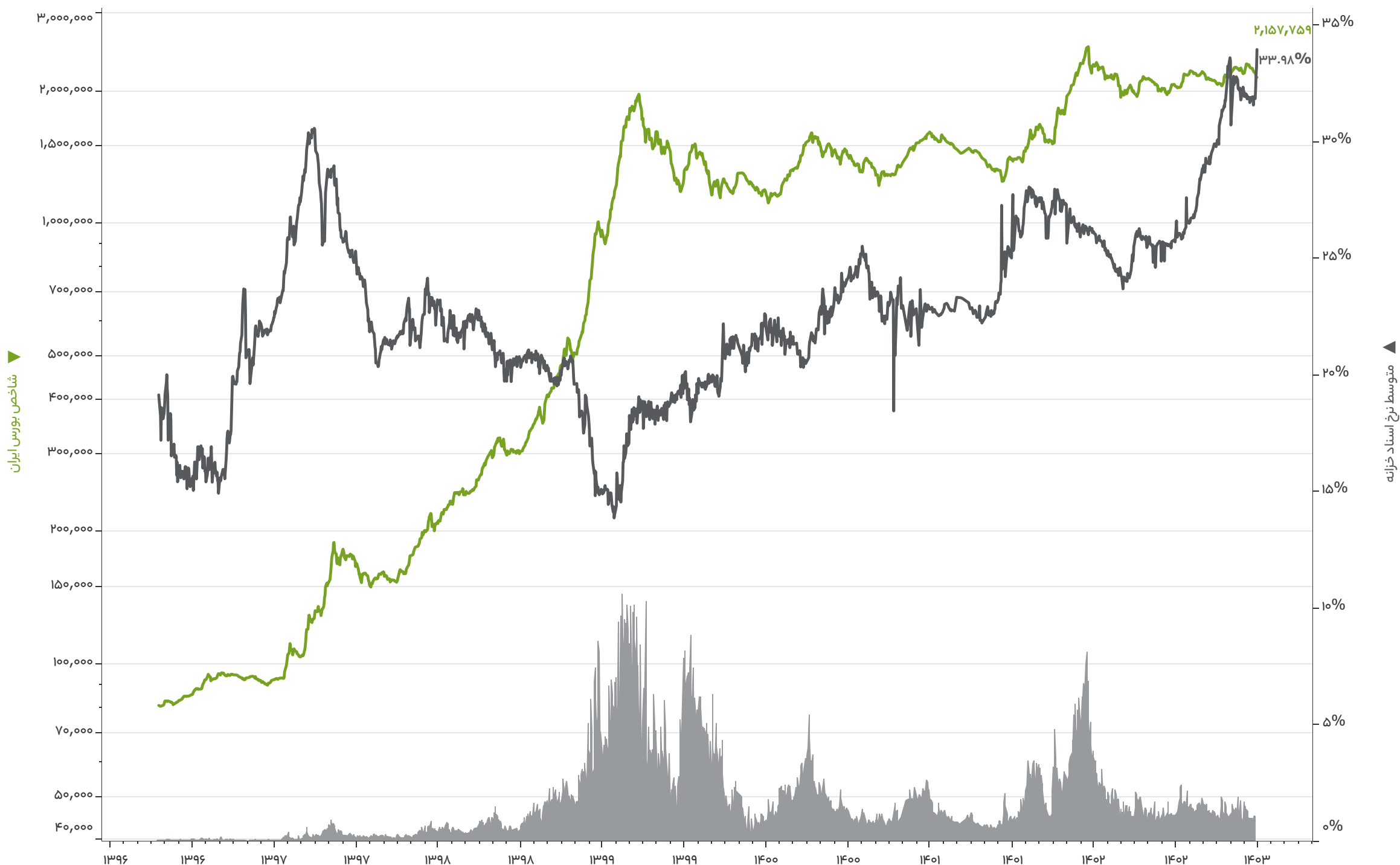
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



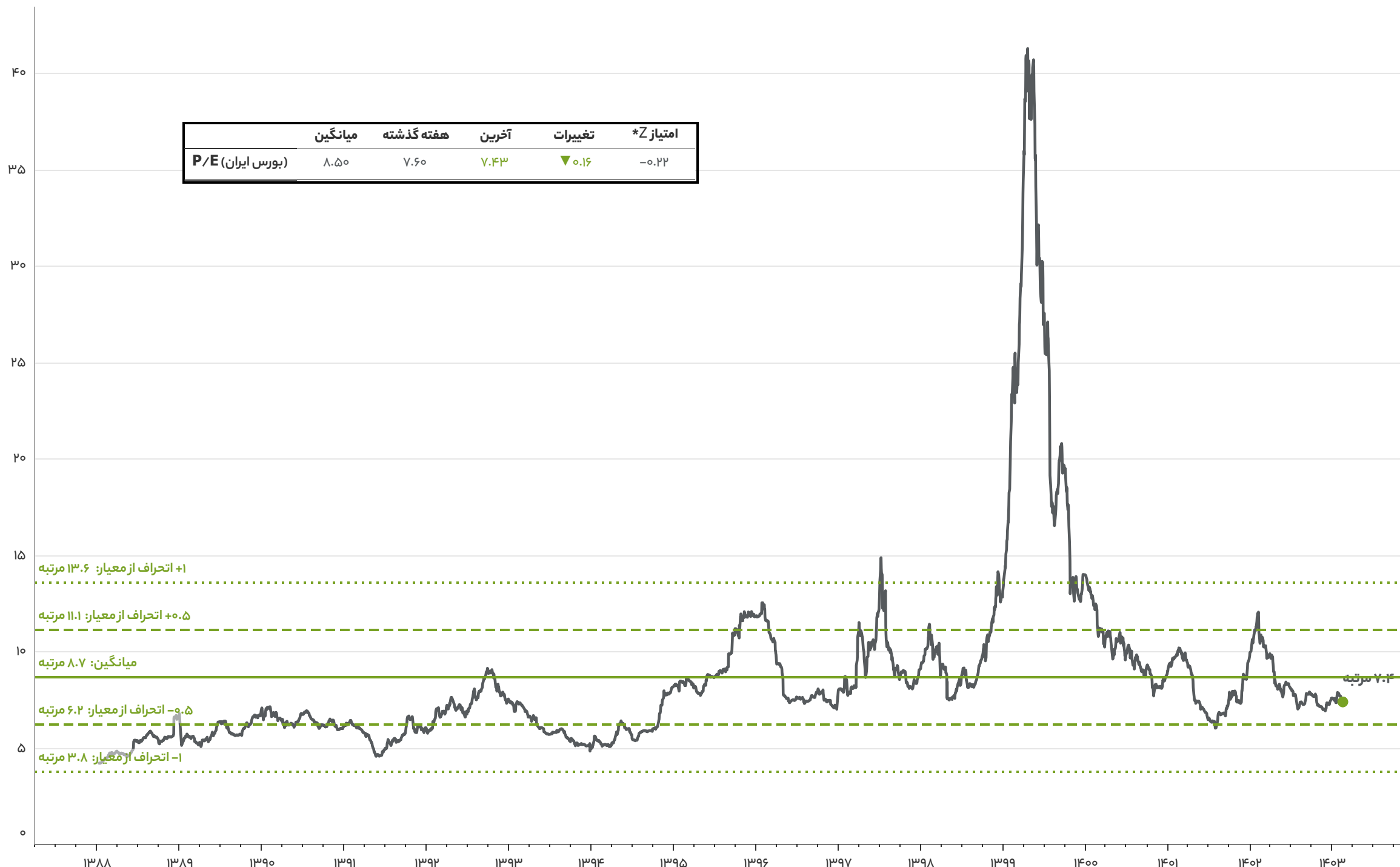
ارزش معاملات هفتگی بازار

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



نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

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



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



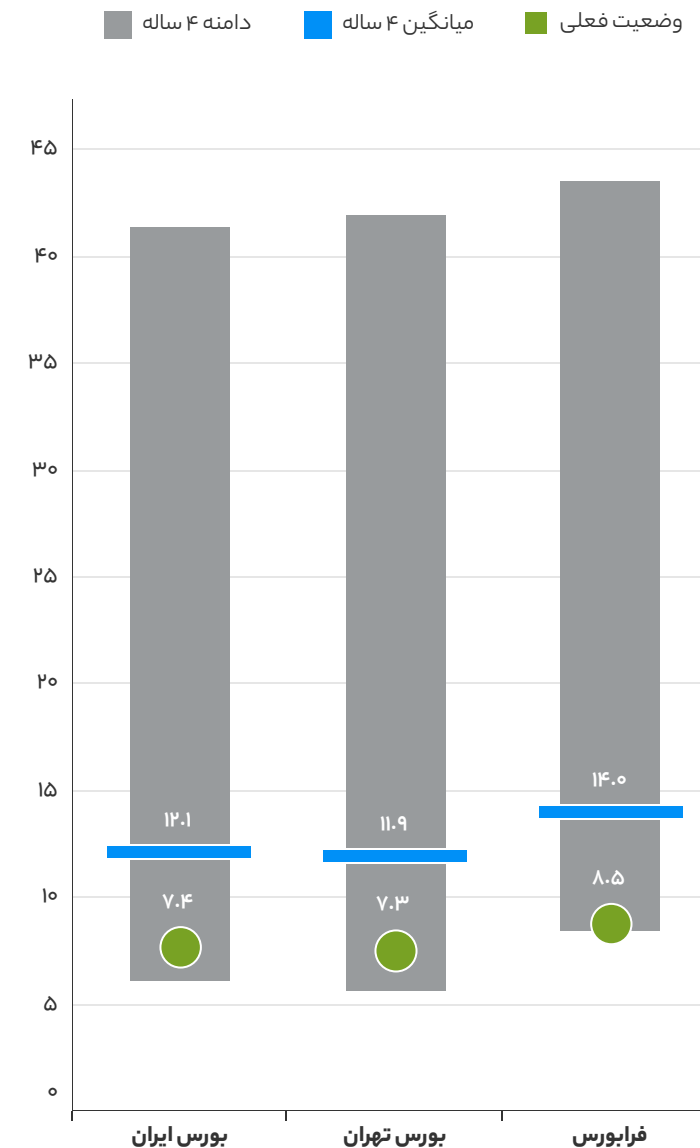
ارزش نسبی فرابورس به بورس

نسبت پی به ای فرابورس به بورس تهران، گذشته نگر، ۴ سال گذشته، بزرگنمایی شده



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۴۳	۷.۶۰	۶.۰۷	۱۲.۱۱	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۲۷	۷.۴۴	۵.۶۴	۱۱.۹۲	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۴۸	۸.۵۶	۸.۴۴	۱۳.۹۹	۴۳.۵۱

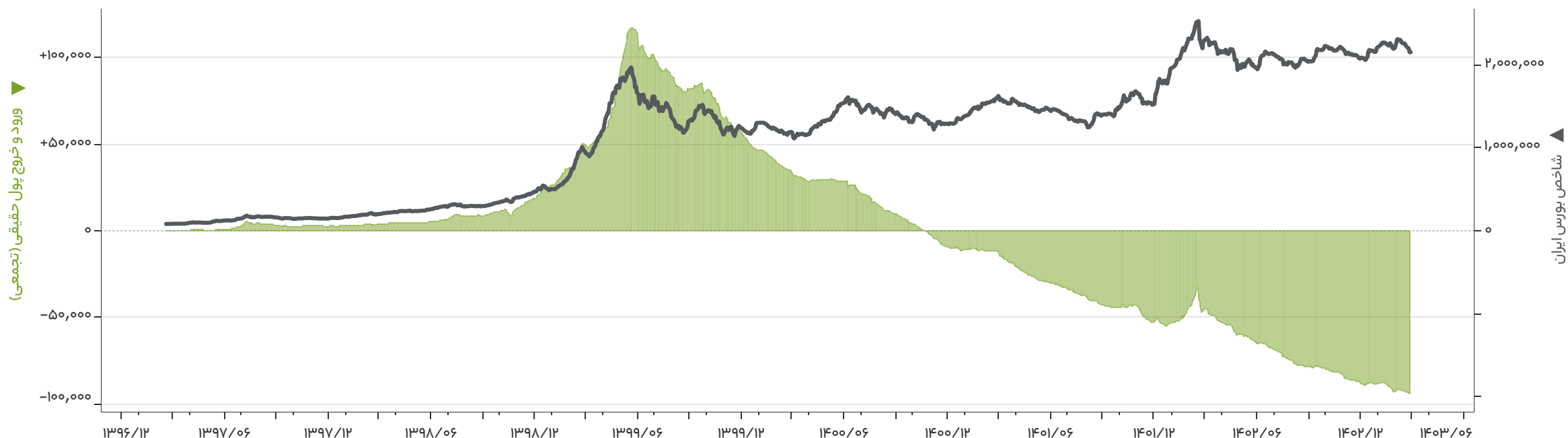


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۶۰	۹۳	۹۵	۱۱۸	۱۴۱	۱۷۴	۱۹۸	۳۴۱	۶۲۱	۳,۰۲۰	۳,۳۸۸	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۷%	۱.۱%	۱.۲%	۱.۴%	۱.۷%	۲.۱%	۲.۴%	۴.۱%	۷.۵%	۳۶.۶%	۴۱.۱%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۴.۴	۶.۹	۱۰.۱	۱۶.۷	۹.۱	۸.۶	۸.۷	۴.۵	۵.۲	۷.۱	۷.۸	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۸%	۱۶.۱%	۴.۰%	۳.۳%	۱۰.۴%	۳.۹%	۵.۰%	۲.۸%	۱۴.۴%	۹.۵%	۹.۲%	
نسبت تقسیم سود	۳۷%	۱۰۰%	۴۱%	۵۵%	۶۶%	۳۹%	۵۱%	۳۳%	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)	+۷۲۷%	+۸۳۳%	+۱۰۲%	+۳۲۵%	+۳۶۲%	+۴۰۸%	+۴۰۲%	+۸۱۵%	+۸۱۶%	+۸۳۱%	+۱۰۳۶%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۵%	+۱۲۸%	-۶۸%	+۵%	+۱۰%	-۱۱%	-۱۳%	-۱۷%	+۱۹%	-۳%	+۷۵%	
بازده از ابتدای سال	+۲۶۹%	+۵۱%	+۳۰%	+۸۴%	+۸۴%	+۹۶%	+۴۹%	+۸۱%	+۹۵%	+۶۵%	+۹۷%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۳%	-۴%	-۵%	-۲%	-۲%	-۵%	-۴%	-۶%	-۳%	-۳%	-۲%	

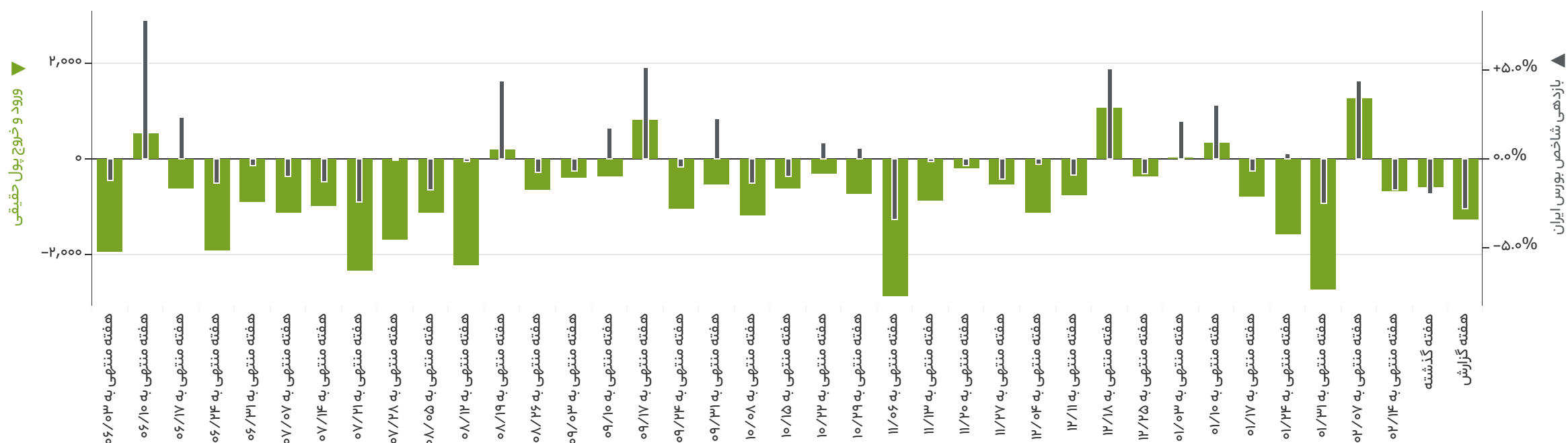
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



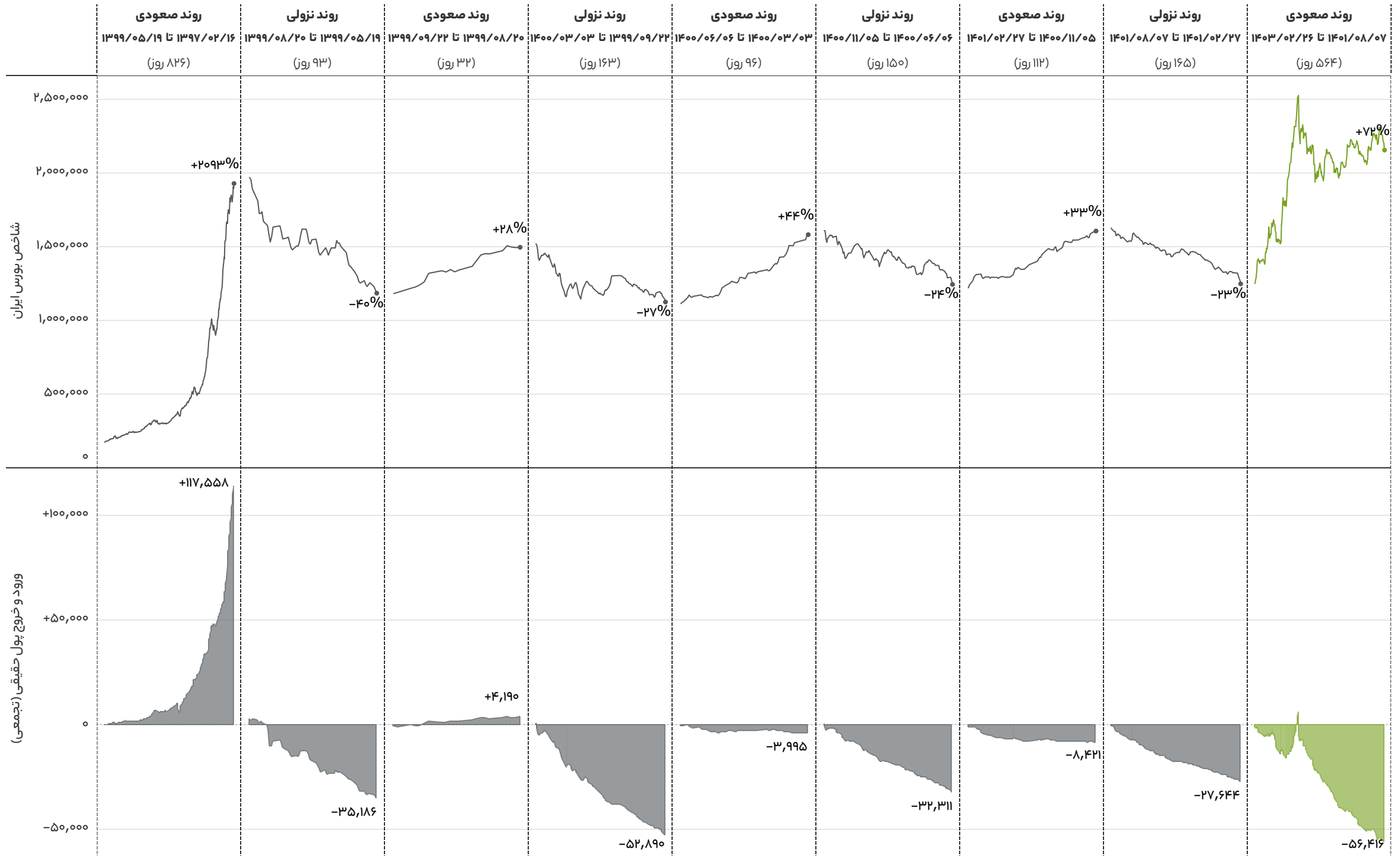
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

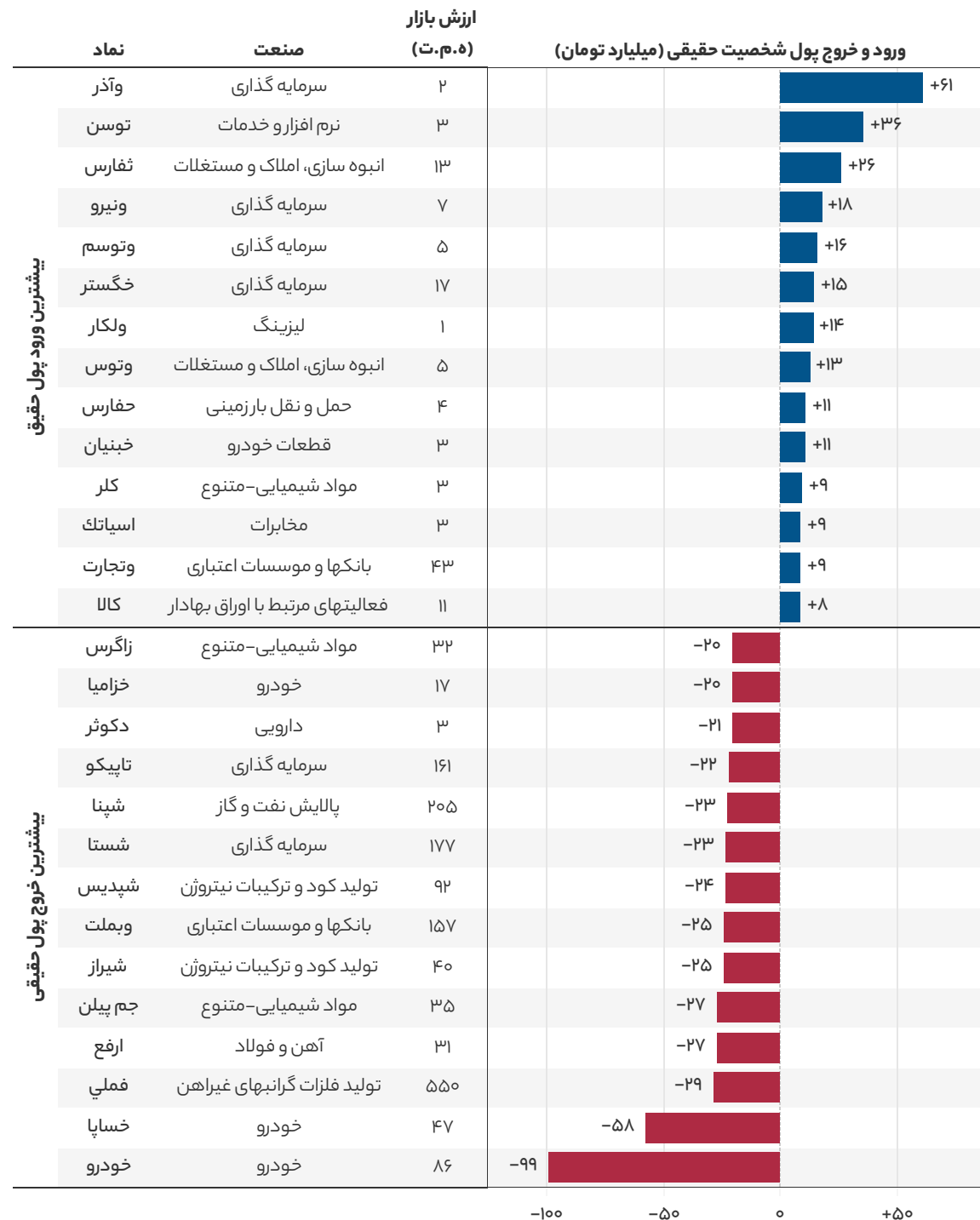
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

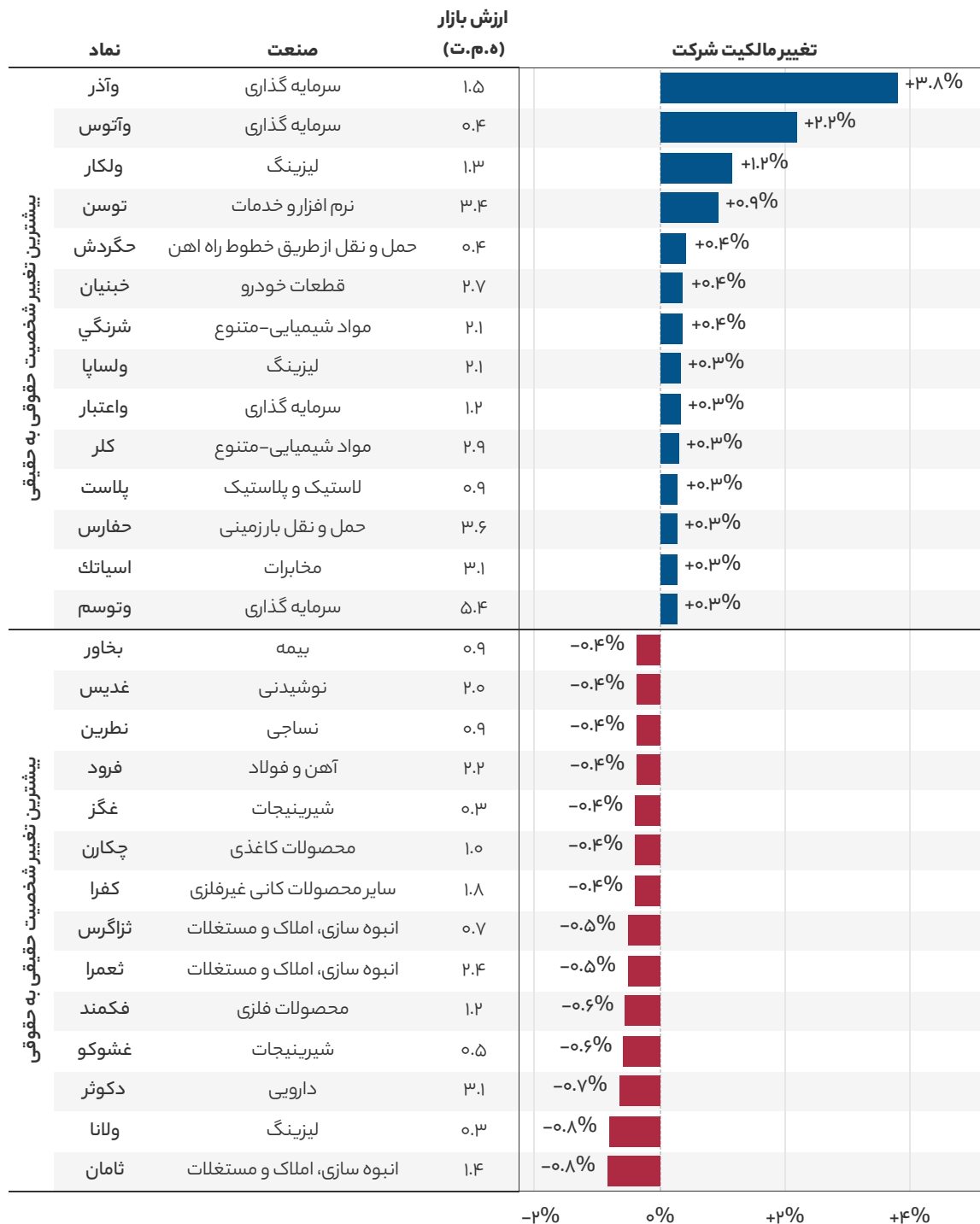
ورود و خروج پول حقیقی

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



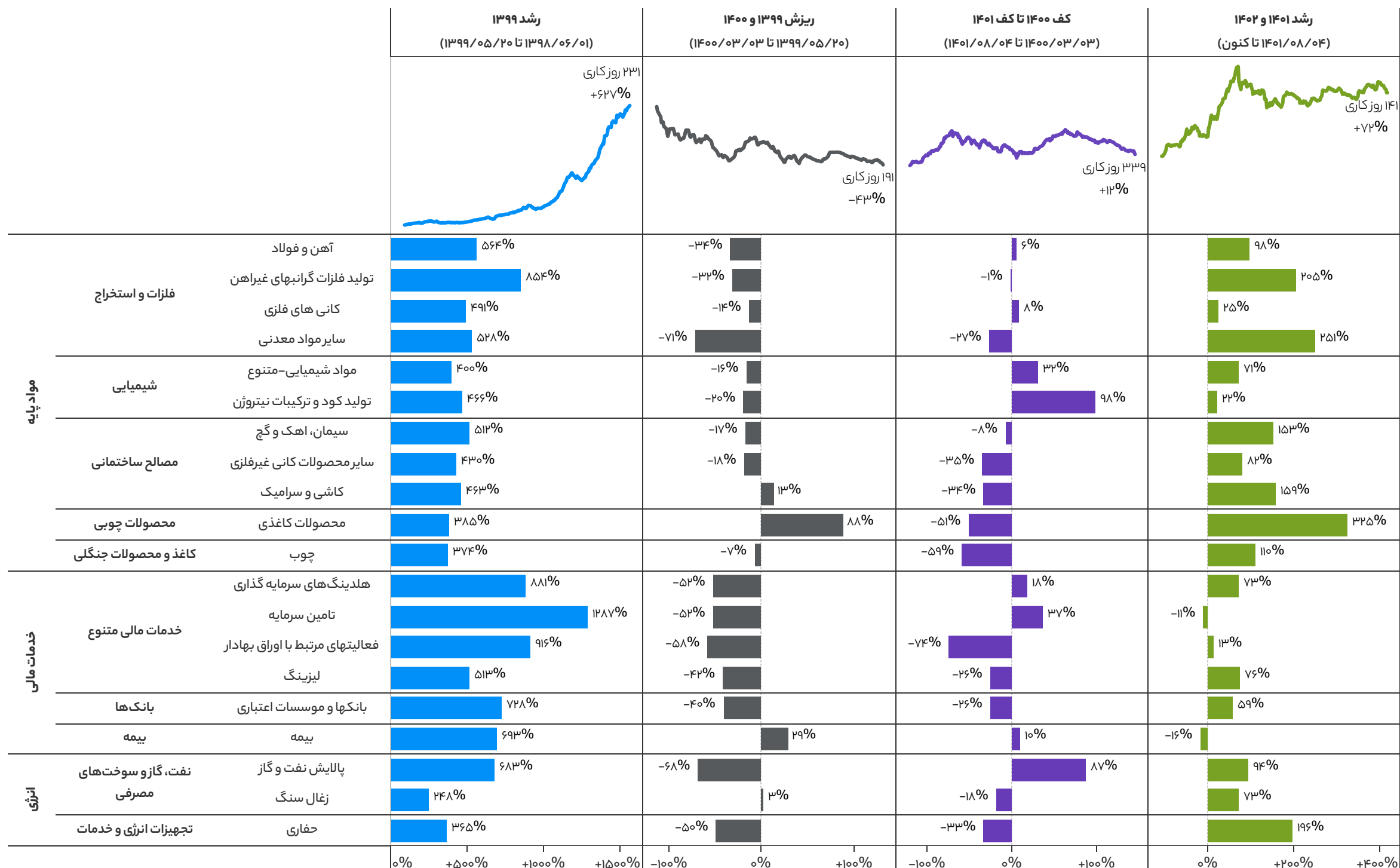
تغییر مالکیت شرکت

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

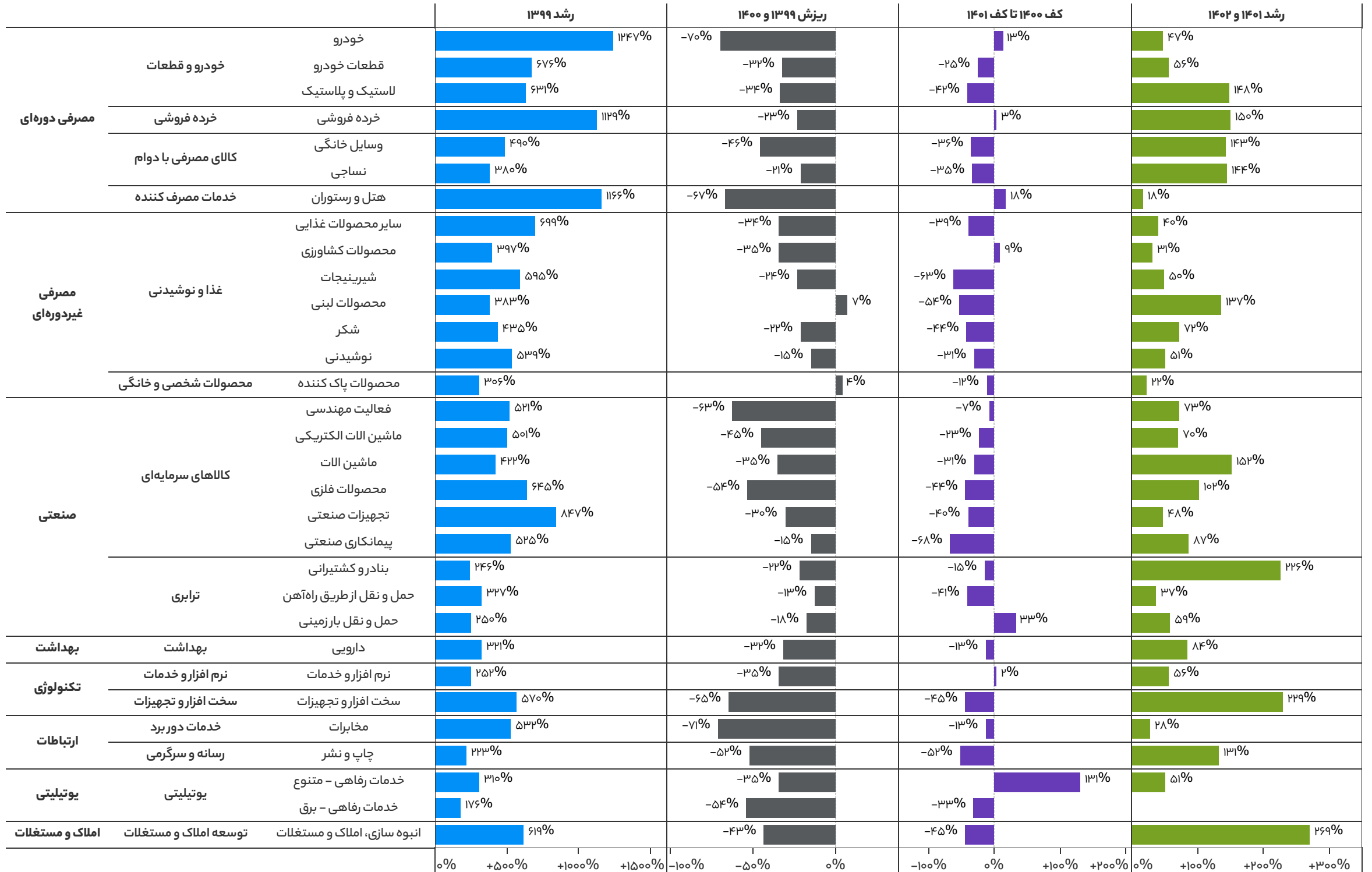


بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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)



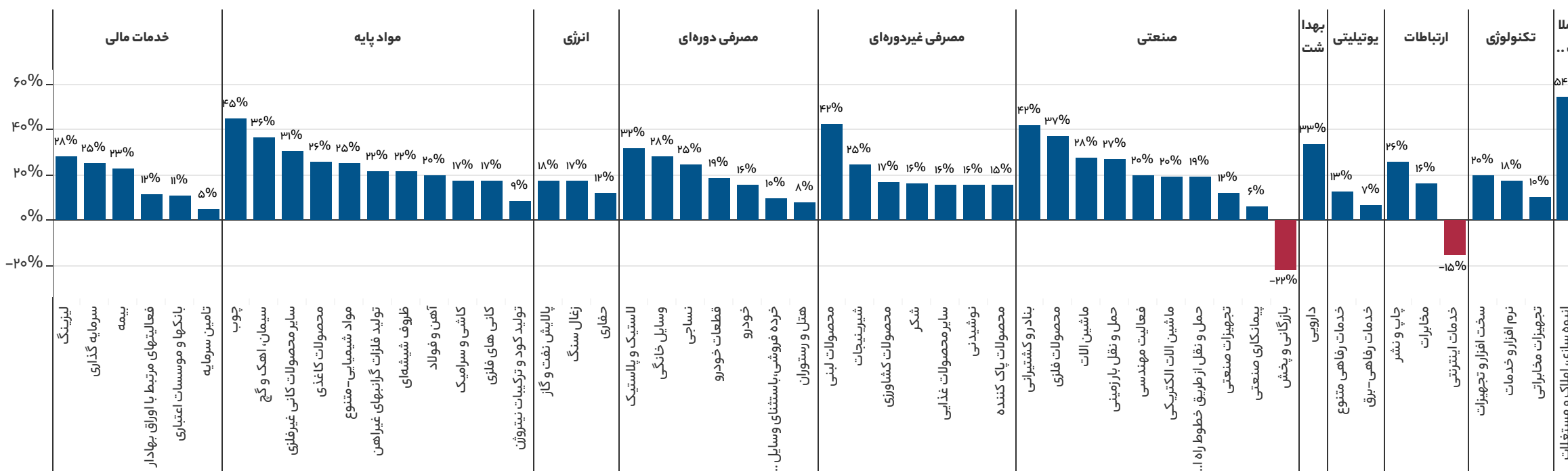
بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله ای و بازده هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



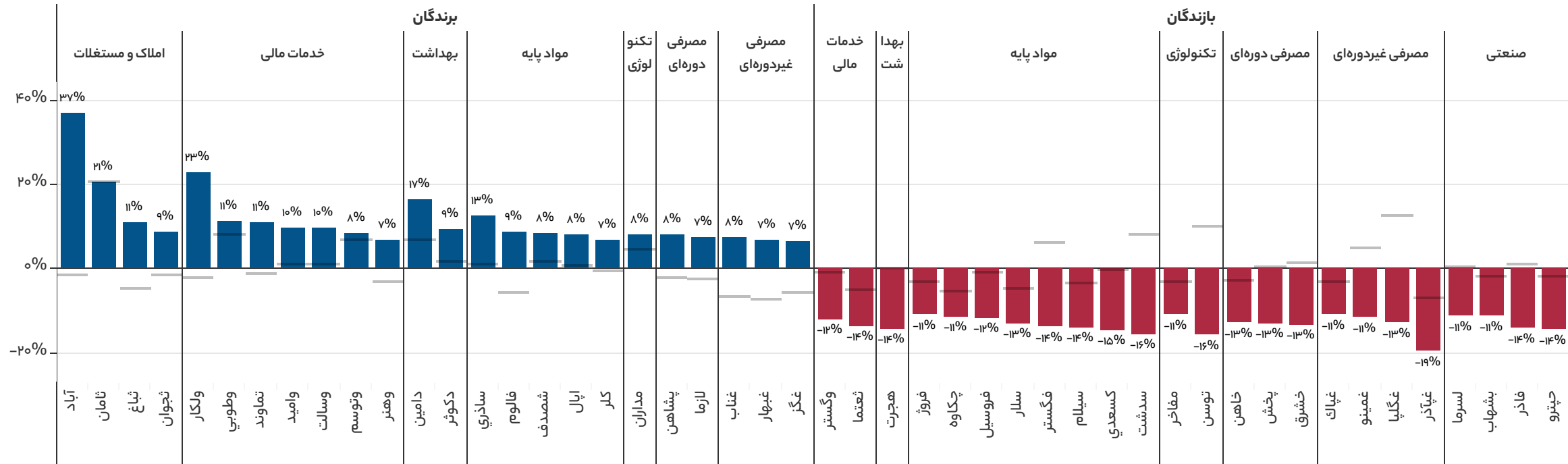
بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده)



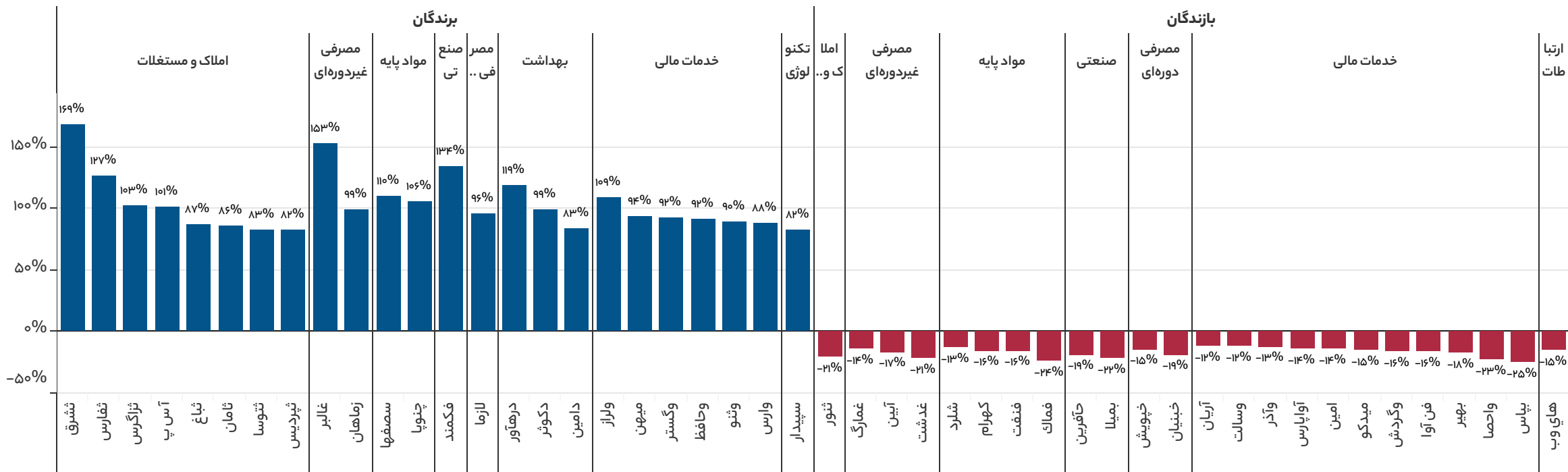
برندگان و بازندگان هفته

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

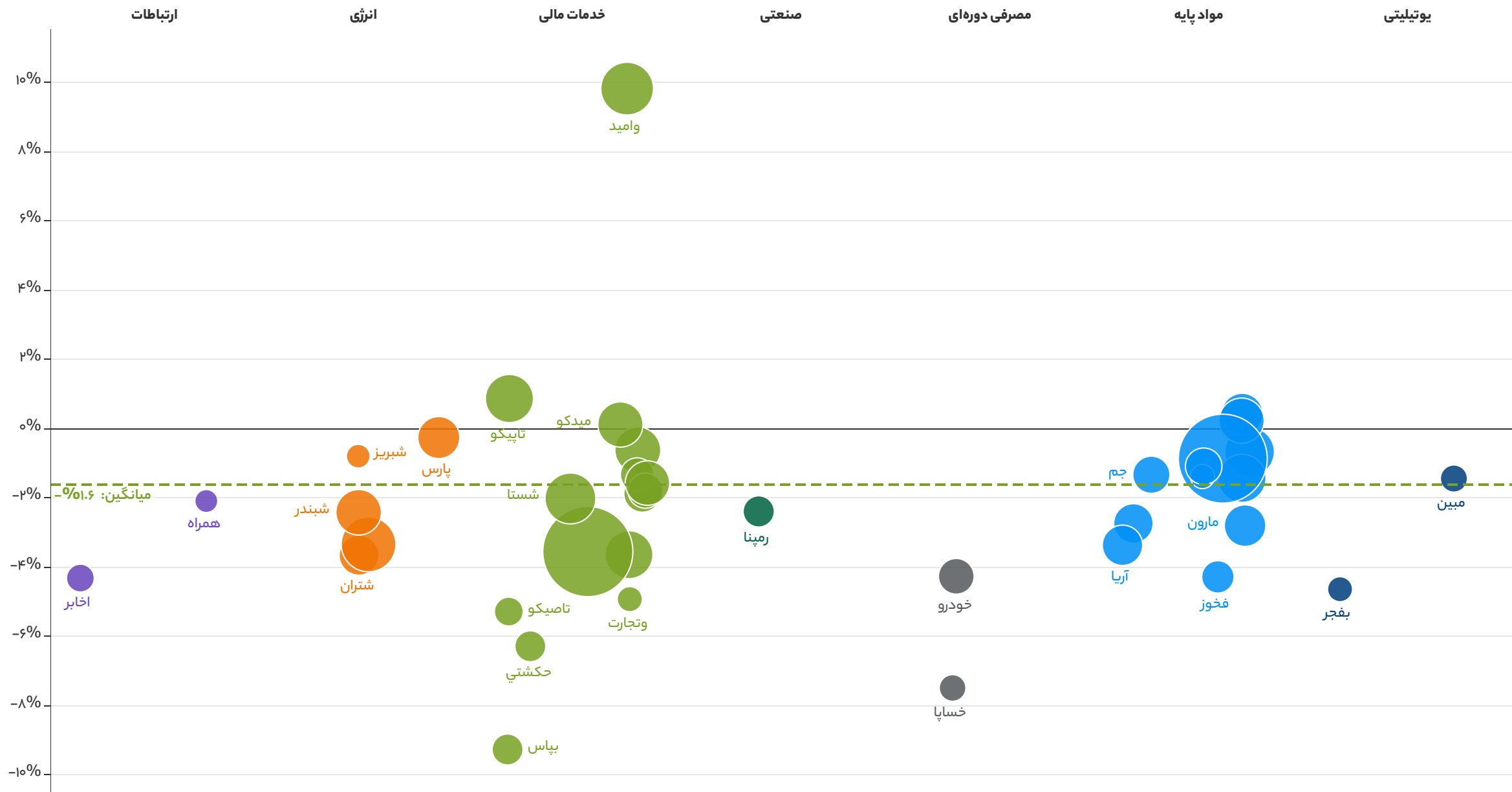


برندگان و بازندگان سال

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



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

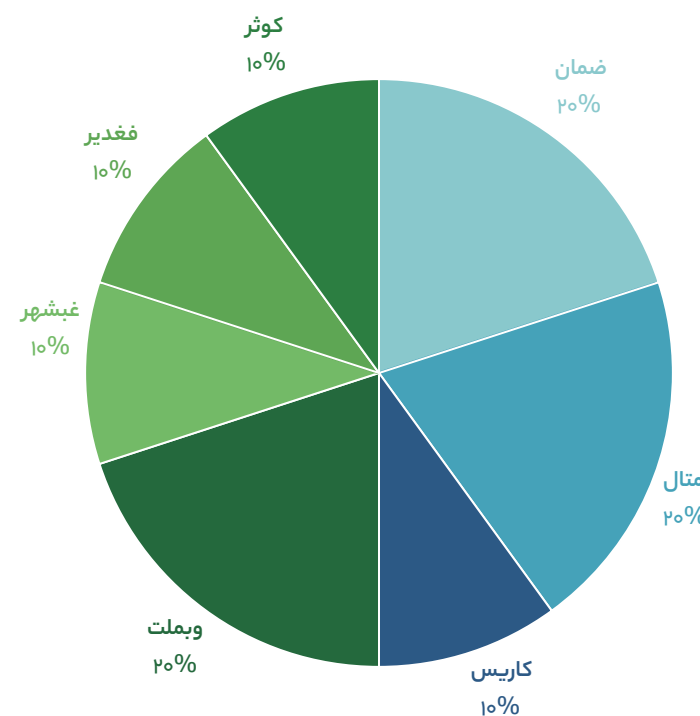


پاس	-۹.۲%
خسپا	-۷.۵%
حکشتي	-۶.۳%
تامیکو	-۵.۳%
وتجارت	-۴.۹%
بجبر	-۴.۶%
اخابر	-۴.۳%
فخور	-۴.۳%
خودرو	-۴.۲%
شتران	-۳.۶%
ویملت	-۳.۶%
فارس	-۳.۵%
آریا	-۳.۳%
شپنا	-۳.۳%
مارون	-۲.۸%
یوعلي	-۲.۷%
شبنر	-۲.۴%
رینا	-۲.۴%
همراه	-۲.۱%
شتا	-۲.۰%
ومعادن	-۱.۹%
وپاسار	-۱.۸%
پارسان	-۱.۵%
مبین	-۱.۴%
کگل	-۱.۴%
شیراز	-۱.۴%
چم	-۱.۳%
ومصندوق	-۱.۳%
شپیس	-۱.۱%
فملی	-۰.۸%
شبریز	-۰.۸%
نوري	-۰.۶%
وغیر	-۰.۶%
پارس	-۰.۲%
میدگو	+۰.۱%
کچاد	+۰.۳%
کگر	+۰.۴%
تاپیکو	+۰.۹%
وامید	+۰.۸%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۲,۰۴۷	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰	۲,۶۰۰	غبشهر	میان مدت
۱۰%	۹,۳۵۰	بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب	۱۲,۰۰۰	فغدیر	
۱۰%	۲,۴۴۰	نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا	۳,۳۰۰	کوثر	
۲۰%	۲,۱۹۵	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۳,۲۰۰	وبملت	
۱۰%	۲۲,۹۱۹	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب	-	کاریز	بلند مدت
۲۰%	۱۶,۳۹۷	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	ضمان	
۲۰%	۱۱,۷۴۰	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

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

@CharismaTickReports

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

