

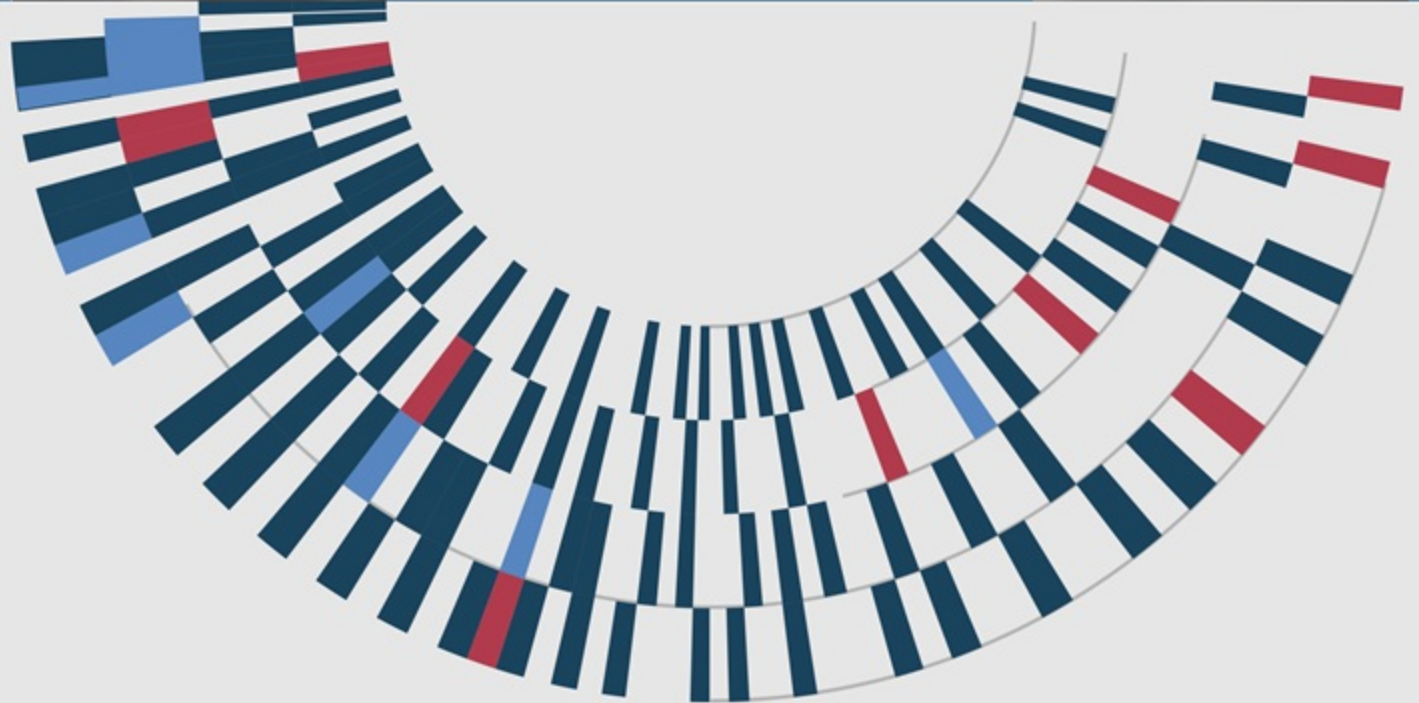
کاریزما تیک

CHARISMATICK

## گزارش بازار سرمایه

شماره ۵۲ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۰۴

 CHARISMA





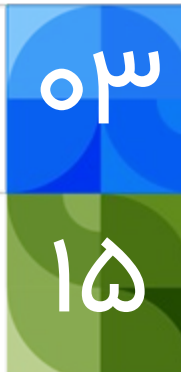
## معرفی گزارش:

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

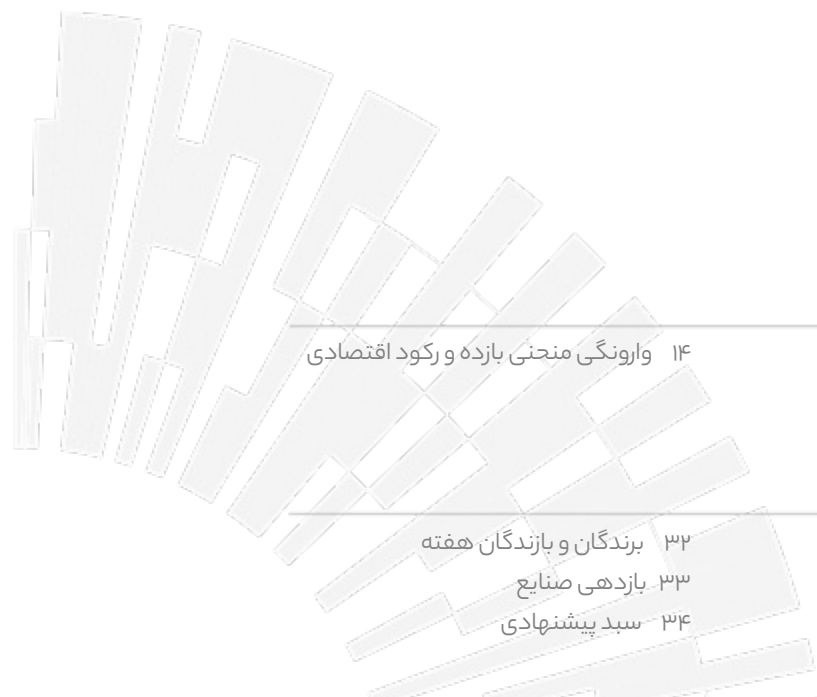
- ۱۶ مروری بر بازارهای موازی
- ۱۸ بررسی بلندمدت بازار سهام
- ۲۰ نرخ بهره و رونق بازار سهام
- ۲۱ ارزش معاملات

- 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 وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی

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

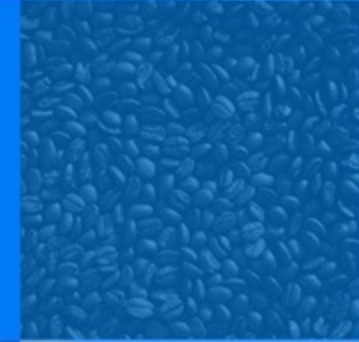


# کامودیتی

---

COMMODITY

COMMODITY





# فلزات آهنی و غیر آهنی

| روند قیمتی ۱۲ ماهه |  | بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره |                   | تاثیر در بهای تمام شده                                                   |  | تاثیر در فروش                                                            | تغییر نسبت به هفته گذشته | آخرین قیمت | واحد          | مرجع قیمتی       | عنوان                   |
|--------------------|--|-----------------------------------------------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------|--|--------------------------------------------------------------------------|--------------------------|------------|---------------|------------------|-------------------------|
| فلزات غیر آهنی     |  |                                               | -                 | -                                                                        |  | فزر                                                                      | ۳.۳%-                    | ۲,۳۳۵      | دلار/انس      | بازار فارکس      | طلا                     |
|                    |  |                                               | بموتو، فباهنر     | فملی                                                                     |  | فملی                                                                     | ۳.۵%-                    | ۱۰,۳۴۹     | دلار/تن       | بورس فلزات لندن  | مس                      |
|                    |  |                                               | بموتو، فباهنر     | فملی                                                                     |  | فملی                                                                     | ۱.۶%+                    | ۵۲۳,۹۰۰    | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | مس (ملی مس ایران)       |
|                    |  |                                               | فنوال             | فایرا                                                                    |  | فایرا                                                                    | -                        | ۲,۴۵۵      | دلار/تن       | کامکس            | آلومینیوم               |
|                    |  |                                               | فمراد             | فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما |  | فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما | ۰.۷%+                    | ۳,۰۶۶      | دلار/تن       | بورس فلزات لندن  | روی                     |
|                    |  |                                               | -                 | فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما                      |  | فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما                      | -                        | ۲,۳۰۸      | دلار/تن       | بورس فلزات لندن  | سرب                     |
| فلزات آهنی         |  |                                               | کوبر، فوکا، فنورد | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان                               |  | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان                               | -                        | ۴۷۷        | دلار/تن       | بنادر ایران FOB  | شمش (ایران)             |
|                    |  |                                               | کوبر، فوکا، فنورد | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان                               |  | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان                               | ۱.۰%-                    | ۵۰۰        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | شمش CIS (منطقه)         |
|                    |  |                                               | کوبر، فوکا، فنورد | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق      |  | فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق      | ۱.۹%-                    | ۲۱,۳۹۶     | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | شمش (فولاد خوزستان)     |
|                    |  |                                               | -                 | فولاد، فخوز، هرمز                                                        |  | فولاد، فخوز، هرمز                                                        | -                        | ۴۵۳        | دلار/تن       | بنادر ایران FOB  | اسلب (ایران)            |
|                    |  |                                               | -                 | فولاد، فخوز، هرمز                                                        |  | فولاد، فخوز، هرمز                                                        | ۰.۱%-                    | ۴۹۰        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | اسلب CIS (منطقه)        |
|                    |  |                                               | -                 | فولاد، فخوز، هرمز                                                        |  | فولاد، فخوز، هرمز                                                        | -                        | ۲۳,۶۰۰     | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | اسلب (فولاد هرمزگان)    |
|                    |  |                                               | فولای             | ذوب، کویر                                                                |  | ذوب، کویر                                                                | ۱.۷%-                    | ۵۷۵        | دلار/تن       | بنادر ترکیه FOB  | میلگرد                  |
|                    |  |                                               | فولای             | ذوب، کویر                                                                |  | ذوب، کویر                                                                | -                        | ۲۴,۶۷۸     | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران | میلگرد (ذوب آهن اصفهان) |
|                    |  |                                               | فجر، فسپا         | فولاد، فوکا، فنورد                                                       |  | فولاد، فوکا، فنورد                                                       | -                        | ۵۶۳        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | ورق گرم                 |
|                    |  |                                               | -                 | فولاد                                                                    |  | فولاد                                                                    | -                        | ۶۵۵        | دلار/تن       | دریای سیاه FOB   | ورق سرد                 |



# معادن و محصولات کشاورزی

|                         |                        | روند قیمتی ۱۲ ماهه |  | بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره |       | تأثیر در بهای تمام شده                                  |                                    | تأثیر در فروش | تغییر نسبت به هفته گذشته | آخرین قیمت | واحد          | مرجع قیمتی         | عنوان |
|-------------------------|------------------------|--------------------|--|-----------------------------------------------|-------|---------------------------------------------------------|------------------------------------|---------------|--------------------------|------------|---------------|--------------------|-------|
| سنگ آهن و محصولات معدنی | سنگ آهن                | ۱۳%                |  | ۱۴۳                                           | ۹۹    | –                                                       | –                                  | –             | +۲.۳%                    | ۱۲۰        | دلار/تن       | شمال چین CFR       |       |
|                         | گندله سنگ آهن          | ۱۲%                |  | ۱۶۴                                           | ۱۱۵   | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               | +۱.۷%                    | ۱۳۸        | دلار/تن       | شمال چین CFR       |       |
|                         | گندله سنگ آهن (گل گهر) | ۹%                 |  | ۵,۳۰۵                                         | ۴,۴۰۰ | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               | –۱.۵%                    | ۵,۲۰۷      | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران   |       |
|                         | کنسانتره سنگ آهن       | ۱۴%                |  | ۱۵۳                                           | ۱۰۵   | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               | +۱.۹%                    | ۱۲۶        | دلار/تن       | شمال چین CFR       |       |
|                         | کنسانتره (چادرملو)     | ۴%                 |  | ۳,۷۸۷                                         | ۳,۴۶۹ | فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان | کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا |               | +۰.۹%                    | ۳,۷۳۳      | تومان/کیلوگرم | بورس کالای ایران   |       |
| محصولات کشاورزی         | گندم آمریکا            | ۱۳%                |  | ۲۶۸                                           | ۱۹۹   | –                                                       | –                                  | –             | +۸.۱%                    | ۲۵۸        | دلار/تن       | بورس کالای چیکاگو  |       |
|                         | ذرت آمریکا             | –۲۴%               |  | ۲۵۲                                           | ۱۵۷   | غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار                       | –                                  | –             | +۲.۷%                    | ۱۸۳        | دلار/تن       | بورس کالای چیکاگو  |       |
|                         | شکر آمریکا             | ۵%                 |  | ۱,۷۱۶                                         | ۱,۱۹۷ | –                                                       | –                                  | –             | –۳.۱%                    | ۱,۴۵۳      | دلار/تن       | بورس کالای نیویورک |       |
|                         | روغن پالم خام          | ۲۱%                |  | ۹۰۸                                           | ۷۲۸   | غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار                       | –                                  | –             | –                        | ۸۸۸        | دلار/تن       | بورس مالزی         |       |

| 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 | ۳۰۰        | -۳.۸%                    | زاگرس، شخارک، شفن، شیراز                | شفارس، شسینا           | ۲۳۵ ۳۱۲                                       | ۲۲%               |
|              | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۹۵۵        | -۱.۰%                    | مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک           | شغدیر، جم پیلن         | ۷۳۰ ۱،۰۱۰                                     | ۱۰%               |
|              | چین CFR           | دلار/تن | ۸۵۰        | -                        | جم، شکبیر                               | جم پیلن                | ۷۳۵ ۸۶۰                                       | ۹%                |
|              | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۱،۰۳۸      | +۱.۴%                    | شصفها، نوری                             | شگویا، شپلی            | ۹۵۴ ۱،۱۵۸                                     | ۹%                |
|              | چین CFR           | دلار/تن | ۱،۰۹۰      | +۰.۵%                    | شصفها، نوری                             | -                      | ۹۴۰ ۱،۱۴۰                                     | ۳%                |
|              | چین CFR           | دلار/تن | ۱،۱۶۹      | +۲.۱%                    | پارس                                    | شجم، شبصیر             | ۸۷۸ ۱،۱۸۲                                     | ۲۱%               |
|              | چین CFR           | دلار/تن | ۱،۰۵۴      | -                        | نوری، بوعلی، شصفها                      | شیران                  | ۷۵۲ ۱،۰۸۴                                     | ۲۷%               |
|              | چین CFR           | دلار/تن | ۹۱۷        | +۰.۵%                    | بوعلی                                   | -                      | ۸۰۱ ۹۵۲                                       |                   |
|              | چین CFR           | دلار/تن | ۱،۳۷۰      | -۱.۴%                    | جم، شکبیر، شاراک                        | شجم                    | ۶۴۰ ۱،۴۵۰                                     | ۷۶%               |
| پلیمرها      | چین CFR           | دلار/تن | ۵۲۷        | +۰.۴%                    | مارون، شاراک                            | شگویا، شپلی            | ۴۵۰ ۵۵۶                                       | ۱۳%               |
|              | خلیج فارس FOB     | دلار/تن | ۱،۰۵۹      | +۰.۷%                    | آریا، شکبیر                             | -                      | ۸۷۵ ۱،۰۵۹                                     | ۱۶%               |
|              | خلیج فارس FOB     | دلار/تن | ۹۴۹        | +۰.۴%                    | مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک           | -                      | ۸۹۵ ۹۸۵                                       | ۱%                |
|              | خلیج فارس FOB     | دلار/تن | ۹۳۹        | +۰.۴%                    | جم، شکبیر، شاراک                        | -                      | ۸۸۱ ۹۶۱                                       | ۲%                |
|              | خلیج فارس FOB     | دلار/تن | ۸۹۰        | +۰.۶%                    | جم پیلن، مارون، شاراک                   | -                      | ۸۰۰ ۸۹۰                                       | ۳%                |
|              | جنوب شرق آسیا FOB | دلار/تن | ۹۵۵        | -                        | شگویا                                   | -                      | ۹۳۰ ۹۸۰                                       | -۳%               |
|              | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۷۹۰        | +۱.۳%                    | شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام | -                      | ۷۴۰ ۸۸۵                                       | ۴%                |
|              | جنوب شرق آسیا CFR | دلار/تن | ۱،۴۸۰      | +۰.۷%                    | شبصیر                                   | -                      | ۱،۲۳۰ ۱،۴۸۰                                   | ۱۸%               |



# انرژی، فرآورده‌های نفتی و ارز

| عنوان                      | مرجع قیمتی            | واحد          | آخرین قیمت | تغییر نسبت به هفته گذشته | تأثیر در فروش                          | تأثیر در بهای تمام شده                 | بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره | رند قیمتی ۱۲ ماهه                     |
|----------------------------|-----------------------|---------------|------------|--------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|-----------------------------------------------|---------------------------------------|
|                            |                       |               |            |                          |                                        |                                        |                                               |                                       |
| نفت برنت                   | بورس بین‌المللی اروپا | دلار/بشکه     | ۸۲         | -۲.۱%                    | -                                      | شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان | <div><div></div><div>۷۴۹۴</div></div>         | <div><div></div><div>۸%</div></div>   |
| نفت WTI                    | بورس بین‌المللی اروپا | دلار/بشکه     | ۷۸         | -۲.۷%                    | -                                      | شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان | <div><div></div><div>۶۹۹۱</div></div>         | <div><div></div><div>۸%</div></div>   |
| بنزین                      | خلیج فارس FOB         | دلار/بشکه     | ۸۴         | -۴.۲%                    | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | -                                      | <div><div></div><div>۸۰۱۰۷</div></div>        | <div><div></div><div>۴%</div></div>   |
| گازوئیل                    | خلیج فارس FOB         | دلار/بشکه     | ۸۶         | -۴.۰%                    | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | -                                      | <div><div></div><div>۸۰۱۲۵</div></div>        | <div><div></div><div>۷%</div></div>   |
| نفت کوره                   | خلیج فارس FOB         | دلار/تن       | ۴۶۴        | -۱.۲%                    | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | -                                      | <div><div></div><div>۳۷۳۵۲۸</div></div>       | <div><div></div><div>۲۴%</div></div>  |
| نفت سفید                   | خلیج فارس FOB         | دلار/بشکه     | ۸۸         | -۲.۶%                    | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | -                                      | <div><div></div><div>۸۱۱۲۴</div></div>        | <div><div></div><div>۸%</div></div>   |
| نفتا                       | خلیج فارس FOB         | دلار/تن       | ۵۸۳        | -۳.۰%                    | شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان | بوعلی، نوری                            | <div><div></div><div>۴۵۲۶۵۹</div></div>       | <div><div></div><div>۱۳%</div></div>  |
| روغن پایه                  | امارات متحده CFR عربی | دلار/تن       | ۸۹۵        | -                        | شسپا، شرانل، شپهرن، شنف                | -                                      | <div><div></div><div>۷۲۰۹۳۰</div></div>       | <div><div></div><div>-۳%</div></div>  |
| روغن پایه (نفت سپاهان)     | بورس کالای ایران      | تومان/کیلوگرم | ۳۴,۶۷۷     | -۴.۴%                    | شپهرن، شسپا، شنف، شرانل                | -                                      | <div><div></div><div>۲۱,۷۹۵۳۶,۹۴۳</div></div> | <div><div></div><div>۴۸%</div></div>  |
| لوب کات (پالایش نفت تهران) | بورس کالای ایران      | تومان/کیلوگرم | ۲۲,۲۶۹     | -                        | شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان | شپهرن، شسپا، شنف، شرانل                | <div><div></div><div>۱۲,۴۵۵۲۲,۲۶۹</div></div> | <div><div></div><div>۷۳%</div></div>  |
| قیر (نفت پاسارگاد)         | بورس کالای ایران      | تومان/کیلوگرم | ۱۶,۵۰۰     | +۱۷.۹%                   | شپاس                                   | -                                      | <div><div></div><div>۱۲,۰۸۶۱۶,۵۰۰</div></div> | <div><div></div><div>۱۱%</div></div>  |
| زغال سنگ                   | استرالیا FOB          | دلار/تن خیس   | ۲۰۴        | +۲.۹%                    | -                                      | ذوب، فروش                              | <div><div></div><div>۱۸۸۲۸۷</div></div>       | <div><div></div><div>۲%</div></div>   |
| یورو به دلار               | بازار فارکس           | -             | ۱.۰۸       | -۰.۲%                    | -                                      | -                                      | <div><div></div><div>۱.۰۵۱.۱۲</div></div>     | <div><div></div><div>۱%</div></div>   |
| پوند به دلار               | بازار فارکس           | -             | ۱.۲۷       | +۰.۳%                    | -                                      | -                                      | <div><div></div><div>۱.۲۱۱.۳۱</div></div>     | <div><div></div><div>۲%</div></div>   |
| بیتکوین                    | بایننس                | دلار          | ۶۸,۹۲۱     | +۳.۰%                    | -                                      | -                                      | <div><div></div><div>۲۵,۷۰۴۶۹,۶۶۳</div></div> | <div><div></div><div>۱۵۳%</div></div> |

انرژی و فرآورده‌های نفتی

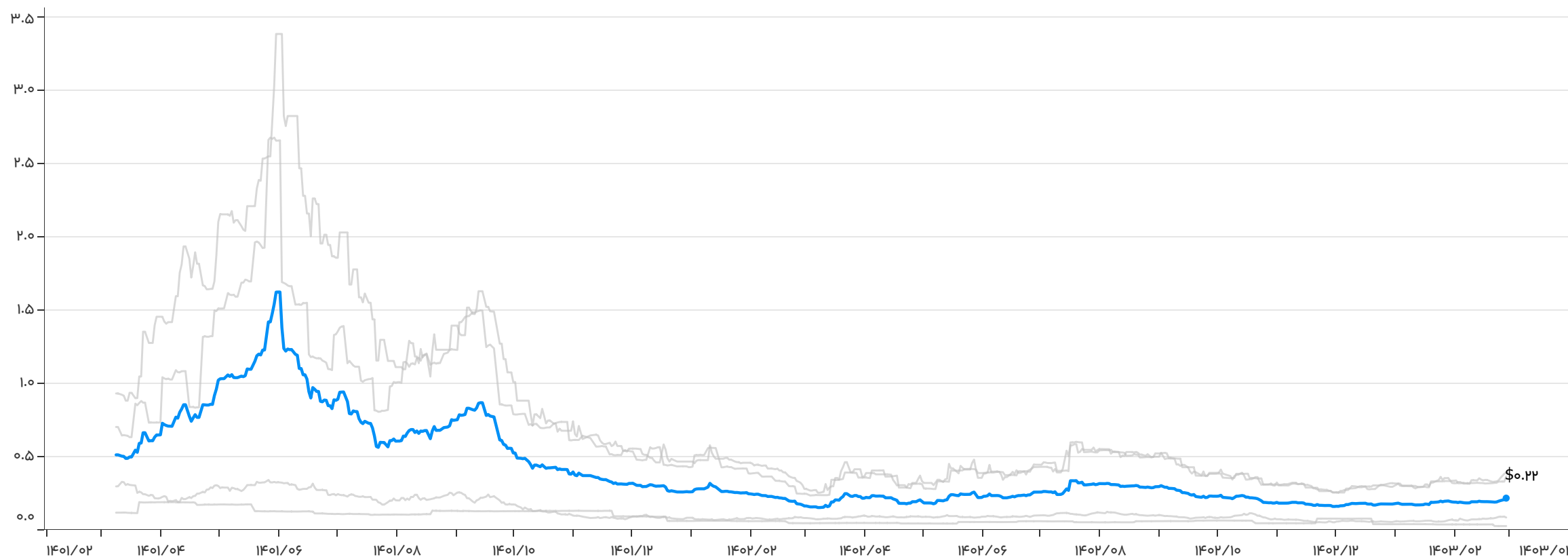
ارز و ارز دیجیتال



| 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       | -۵.۹%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۰۶ ۰.۱۳                                     | ۱۶%                |
| آلبرتا         | دلار \ مترمکعب | ۰.۰۳       | +۰.۵%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۰۳ ۰.۰۸                                     | -۳۹%               |
| هلند (TTF)     | دلار \ مترمکعب | ۰.۴۰       | +۲.۴%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۲۶ ۱.۵۵                                     | ۵۴%                |
| انگلستان (NBP) | دلار \ مترمکعب | ۰.۳۷       | +۱۰.۵%                   | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۲۴ ۰.۶۱                                     | ۵۲%                |
| میانگین ۴ هاب  | دلار \ مترمکعب | ۰.۲۲       | +۴.۶%                    | -             | شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن | ۰.۱۶ ۰.۵۴                                     | ۴۱%                |

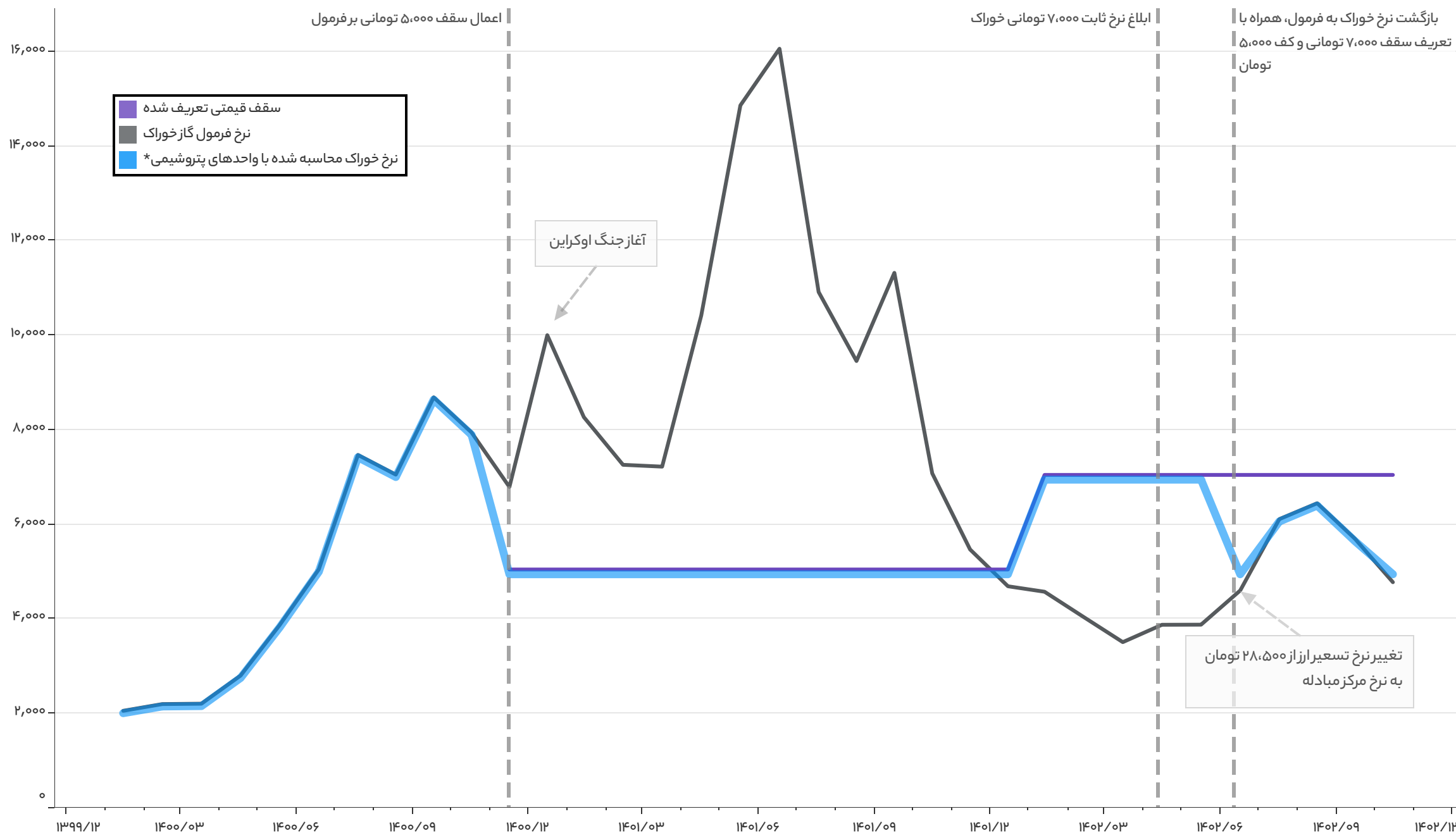
## میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



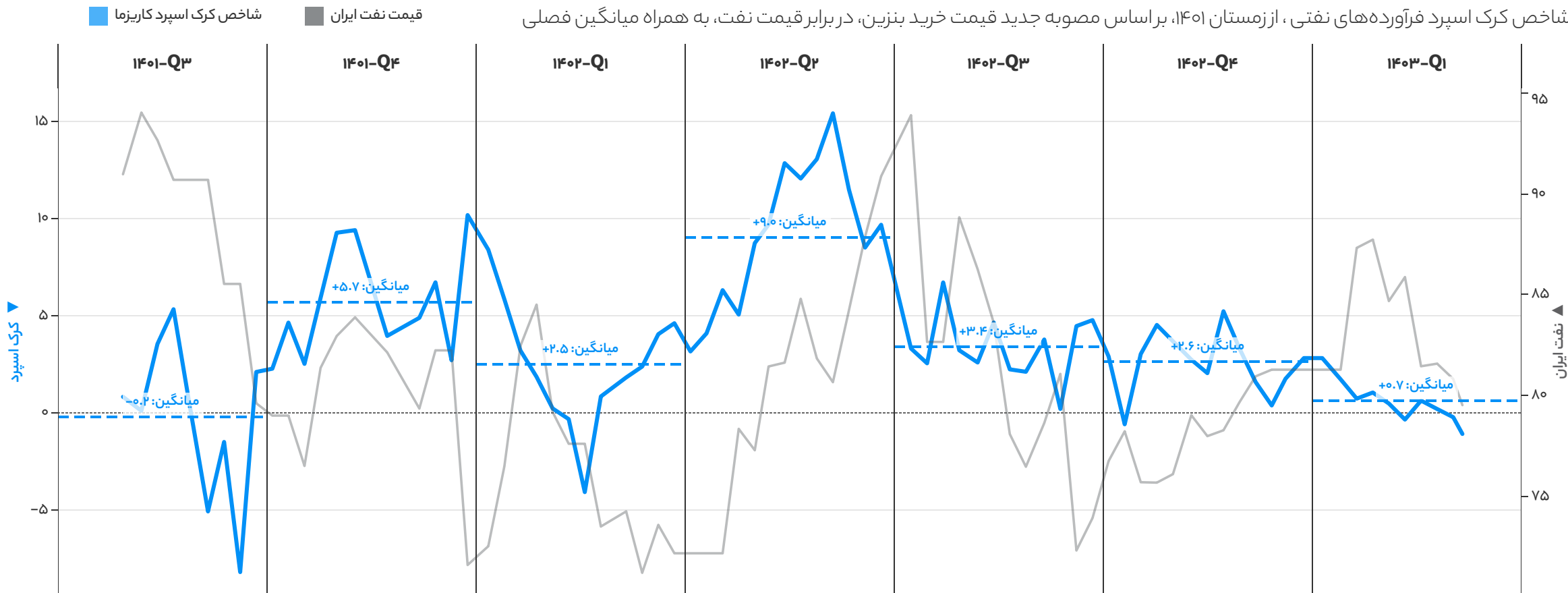
\* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد.

- 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.



## 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              | ۷۹.۶        |            |                  |              |                               |          |                 |                                                                 |                   |                  |
| گازوئیل                | ۸۶.۰        | ۸.۷        | ۶.۴              | ▼ ۲.۳        | ۱۹.۵                          | ۱۱.۹     | -۳۹.۳%          |                                                                 |                   |                  |
| بنزین**                | ۷۹.۷        | ۱.۲        | ۰.۲              | ▼ ۱.۰        | ۵.۰                           | ۴.۷      | -۷.۰%           |                                                                 |                   |                  |
| نفتا                   | ۶۵.۹        | -۱۲.۹      | -۱۳.۶            | ▼ ۰.۷        | -۹.۶                          | -۱۲.۳    | -۲۸.۳%          |                                                                 |                   |                  |
| نفت کوره               | ۷۳.۲        | -۶.۸       | -۶.۴             | ▲ ۰.۴        | -۱۵.۰                         | -۹.۷     | +۳۵.۱%          |                                                                 |                   |                  |
| لوب کات***             | ۸۲.۰        | ۱.۲        | ۲.۵              | ▲ ۱.۳        | -۶.۴                          | -۲.۹     | +۵۴.۴%          |                                                                 |                   |                  |
| وکیوم باتوم***         | ۵۴.۰        | -۲۶.۸      | -۲۵.۵            | ▲ ۱.۳        | -۳۱.۰                         | -۳۱.۷    | -۲.۴%           |                                                                 |                   |                  |
| شاخص کرک اسپرد کاریزما |             | -۰.۲       | -۱.۰             | ▼ ۰.۹        | ۲.۶                           | ۰.۷      | -۷۵.۰%          |                                                                 |                   |                  |

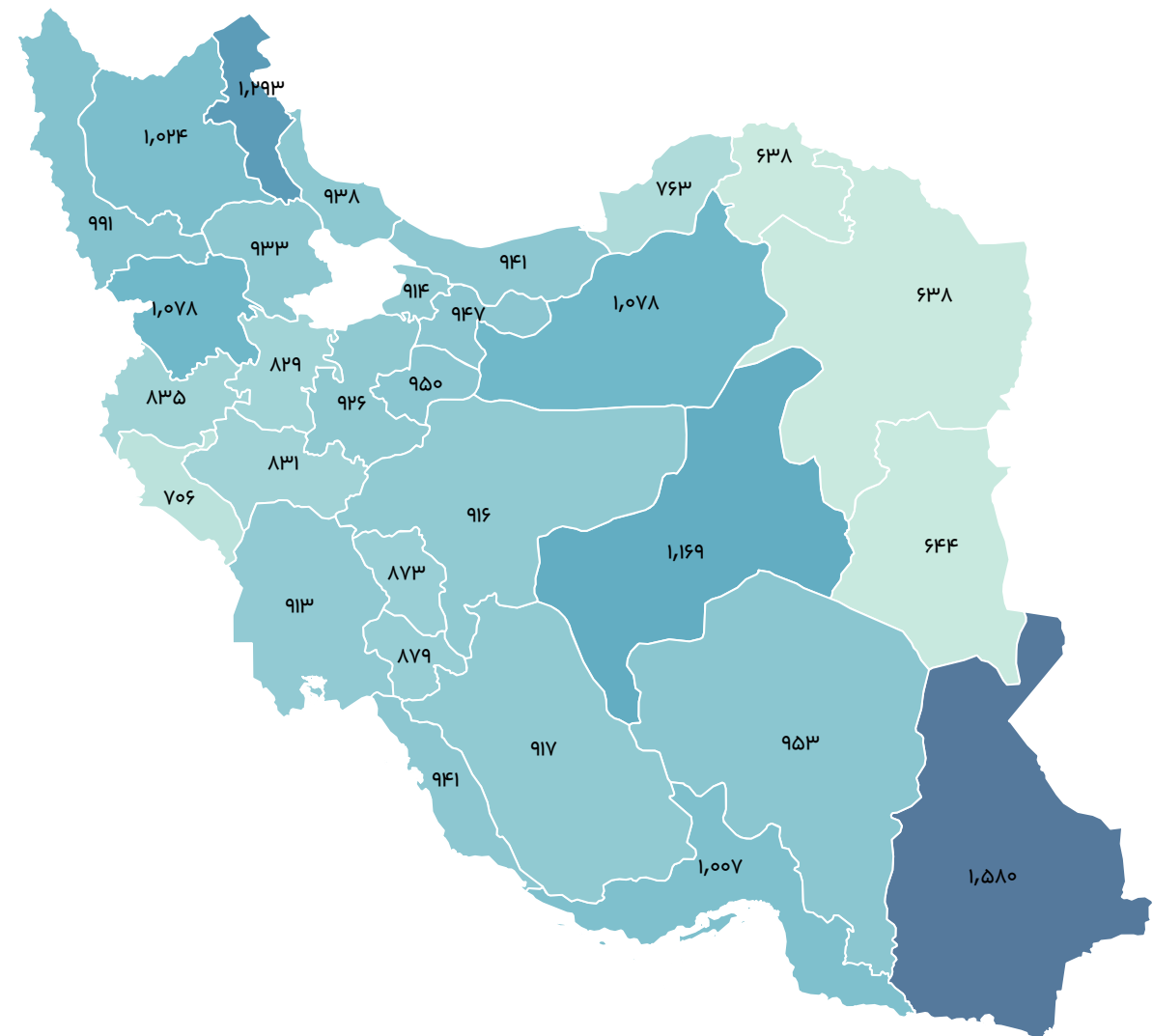
\* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هر یک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هر یک از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

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

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

## قیمت منطقه‌ای سیمان\* در هفته گزارش

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

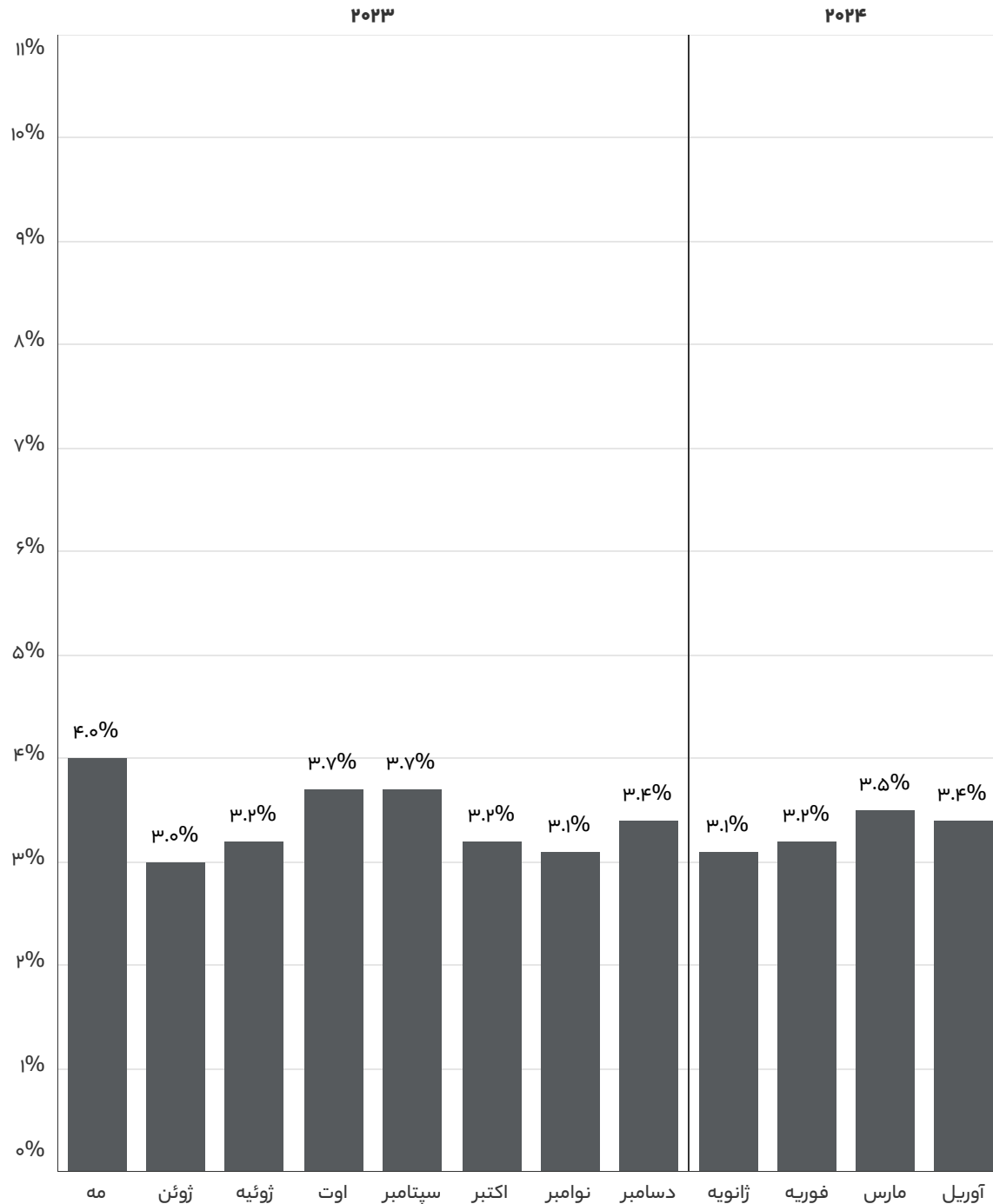
| منطقه    | استان               | شرکت دنبال‌کننده          | هفته گذشته | هفته گزارش | تغییرات به هفته گذشته |
|----------|---------------------|---------------------------|------------|------------|-----------------------|
| مرکز     | تهران               | سیمان تهران               | ۹۴۵        | ۹۴۷        | +۰.۳%                 |
|          | مرکزی               | سیمان ساوه                | ۹۰۴        | ۹۲۶        | +۲.۴%                 |
|          | البرز               | سیمان آبیک                | ۹۱۴        | ۹۱۴        | -                     |
|          | اصفهان              | سیمان سپاهان              | ۹۱۶        | ۹۱۶        | -                     |
|          | قم                  | سیمان نيزار قم            | ۹۵۰        | ۹۵۰        | -                     |
|          | یزد                 | گروه صنعتی و معدنی سیما.. | ۱,۱۶۱      | ۱,۱۶۹      | +۰.۷%                 |
|          | سمنان               | سیمان شاهرود              | ۹۶۷        | ۱,۰۷۸      | +۱۱.۵%                |
| غرب      | همدان               | سیمان هگمتان              | ۸۶۸        | ۸۲۹        | -۴.۵%                 |
|          | خوزستان             | شرکت سیمان خوزستان        | ۹۱۳        | ۹۱۳        | -                     |
|          | چهارمحال و بختیاری  | صنایع سیمان شهرکرد        | ۸۶۸        | ۸۷۳        | +۰.۶%                 |
|          | کرمانشاه            | صنایع سیمان غرب           | ۸۳۵        | ۸۳۵        | -                     |
|          | ایلام               | سیمان ایلام               | ۷۰۶        | ۷۰۶        | -                     |
|          | کهگیلویه و بویراحمد | سیمان یاسوج               | ۸۷۹        | ۸۷۹        | -                     |
|          | لرستان              | سیمان دورود               | ۸۳۱        | ۸۳۱        | -                     |
| شمال     | کردستان             | سیمان کردستان             | ۹۸۷        | ۱,۰۷۸      | +۹.۲%                 |
|          | مازندران            | سیمان مازندران            | ۹۴۲        | ۹۴۱        | -۰.۱%                 |
|          | گلستان              | سیمان پیوند گلستان        | ۷۶۳        | ۷۶۳        | -                     |
|          | گیلان               | سیمان خزر                 | ۸۸۶        | ۹۳۸        | +۵.۸%                 |
| شمال غرب | اردبیل              | سیمان آرتا اردبیل         | ۱,۲۹۸      | ۱,۲۹۳      | -۰.۴%                 |
|          | آذربایجان غربی      | سیمان ارومیه              | ۹۳۱        | ۹۹۱        | +۶.۴%                 |
|          | آذربایجان شرقی      | کارخانجات سیمان صوفیان    | ۱,۳۰۷      | ۱,۰۲۴      | -۲۱.۷%                |
| شمال شرق | زنجان               | سیمان خمسه                | ۹۷۷        | ۹۳۳        | -۴.۵%                 |
|          | خراسان شمالی        | سیمان بجنورد              | ۶۴۸        | ۶۳۸        | -۱.۵%                 |
|          | خراسان رضوی         | سیمان شرق                 | ۶۳۸        | ۶۳۸        | -                     |
|          | خراسان جنوبی        | شرکت سیمان قاین           | ۶۳۸        | ۶۴۴        | +۱.۰%                 |
| جنوب     | هرمزگان             | سیمان هرمزگان             | ۹۵۷        | ۱,۰۰۷      | +۵.۳%                 |
|          | فارس                | سیمان داراب               | ۹۱۷        | ۹۱۷        | -                     |
|          | بوشهر               | سیمان مند دشتی            | ۹۴۱        | ۹۴۱        | -                     |
| جنوب شرق | کرمان               | سیمان ممتازان کرمان       | ۹۹۸        | ۹۵۳        | -۴.۵%                 |
|          | سیستان و بلوچستان   | سیمان خاش                 | ۱,۴۳۱      | ۱,۵۸۰      | +۱۰.۵%                |

- ▲ به گزارش رویترز، قیمت طلا در روز دوشنبه به دنبال افزایش احتمال کاهش زود هنگام نرخ بهره فدرال رزرو رکورد شکنی کرد. قیمت هر اونس طلا صبح دوشنبه با ۱.۰۳ درصد افزایش به ۲۲۴۴۰ دلار رسید. قیمت معاملات آتی طلا در بازار کامکس نیویورک هم با یک افزایش ۱.۴۸ درصدی به ۲۲۴۵۳ دلار رسیده است. تحلیل‌گران عقیده دارند دلیل اصلی افزایش قیمت طلا ضعف دلار و بالا رفتن امید به کاهش زود هنگام نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا است. کاهش ارزش دلار خرید طلا را برای دارندگان سایر ارزهای دنیا ارزان تر می‌کند. از طلا همواره به عنوان یک پشتوانه ایمن در زمان تورم بالا یاد می‌شود، اما افزایش نرخ بهره هزینه نگهداری این فلز گران بها به عنوان یک سرمایه غیر سودده را بالا برده و تمایل برای خرید آن را کاهش می‌دهد.
  
- ▲ علاوه بر عوامل بنیادی عرضه و تقاضا، فلزات تحت تاثیر کاهش اخیر دلار آمریکا قرار گرفته اند و این امر باعث شده است که خرید کالاهای برای دارندگان ارزهای دیگر هزینه کمتری داشته باشد و حتی در مقابل نااطمینانی های اقتصاد جهانی که عمدتاً ناشی از بدهی‌های سنگین آمریکا و ترس از کاهش بیش تر اعتبار دلار است به خرید فلزات گران بها روی آورده‌اند. پس از رکورد افزایش اخیر قیمت طلا و مس، نقره به این کاروان پیوست تا رکورد بی سابقه‌ای در بیش از یک دهه گذشته را در بحبوحه انتظارات برای افزایش بیشتر در دوره آتی ثبت کند. نقره از ابتدای سال جاری از افزایش طلا پیشی گرفته است و این فلز سفید را در میان فلزات اصلی با افزایش ۳۲.۹۷ درصد بهترین عملکرد در سال جاری قرار داده است
  
- ▼ به گزارش رویترز، قیمت نفت برای سومین روز پیاپی در روز چهارشنبه کاهش یافته است. انتظار می‌رود فدرال رزرو آمریکا نرخ بهره را به خاطر ادامه تورم بالا برای مدت طولانی‌تری در همین سطح نگه دارد که بر مصرف سوخت در بزرگترین مصرف‌کننده نفت دنیا تاثیر می‌گذارد. قیمت هر بشکه نفت برنت روز چهارشنبه با ۶۳ سنت معادل ۰.۷۶ درصد کاهش به ۲۵۸۲ دلار رسید. نفت سبک آمریکا هم با ۵۴ سنت معادل ۰.۶۸ درصد کاهش ۲۶۷۹ دلار معامله می‌شود. قیمت نفت حدود یک درصد در روز سه‌شنبه کاهش یافته بود. سیاست‌گذاران فدرال رزرو آمریکا در روز سه‌شنبه اعلام کردند بانک مرکزی این کشور باید چند ماه دیگر منتظر باشد تا از روند نزولی تورم تا هدف دو درصد بانک مرکزی مطمئن شود و بعد نرخ بهره را پایین بیاورد. نرخ بالای بهره رشد اقتصاد را کند کرده و تقاضا برای نفت را کاهش می‌دهد.
  
- روسیه در آوریل برای دوازدهمین ماه متوالی، بزرگترین صادرکننده نفت به چین ماند و حجم صادراتش، ۳۰ درصد نسبت به مدت مشابه سال گذشته افزایش یافت. آمار اداره کل گمرک چین نشان داد واردات نفت خام از روسیه به چین که شامل واردات از طریق خط لوله و دریا است، ۹.۲۶ میلیون تن معادل ۲.۲۵ میلیون بشکه در روز بود. این رقم در مقایسه با واردات ۲.۵۵ میلیون بشکه در روز و رکورد واردات ۲.۵۶ میلیون بشکه در روز در ژوئن، کمتر بود. طبق گزارش ماهانه آژانس بین‌المللی انرژی، روسیه در آوریل، عرضه نفت خود را به میزان ۱۵۰ هزار بشکه در روز کاهش داد و به ۹.۳ میلیون بشکه در روز رساند که همچنان ۲۰۰ هزار بشکه در روز بالاتر از سهمیه تولید توافق شده با اوپک پلاس بوده است.
  
- مجید عشقی، رئیس سازمان بورس و اوراق بهادار در نامه‌ای به جواد اوجی وزیر نفت خواستار اصلاح دستورالعمل قیمت‌گذاری خوراک نفت و فرآورده‌های شرکت‌های پالایشی شد. وی در متن این نامه به کاهش سودآوری شرکت‌های پالایشی در نسبت‌های مالی ۱۴۰۲ نسبت به ۱۴۰۱ و انباشت مطالبات از شرکت ملی پخش و فرآورده‌های نفتی اشاره کرده است.



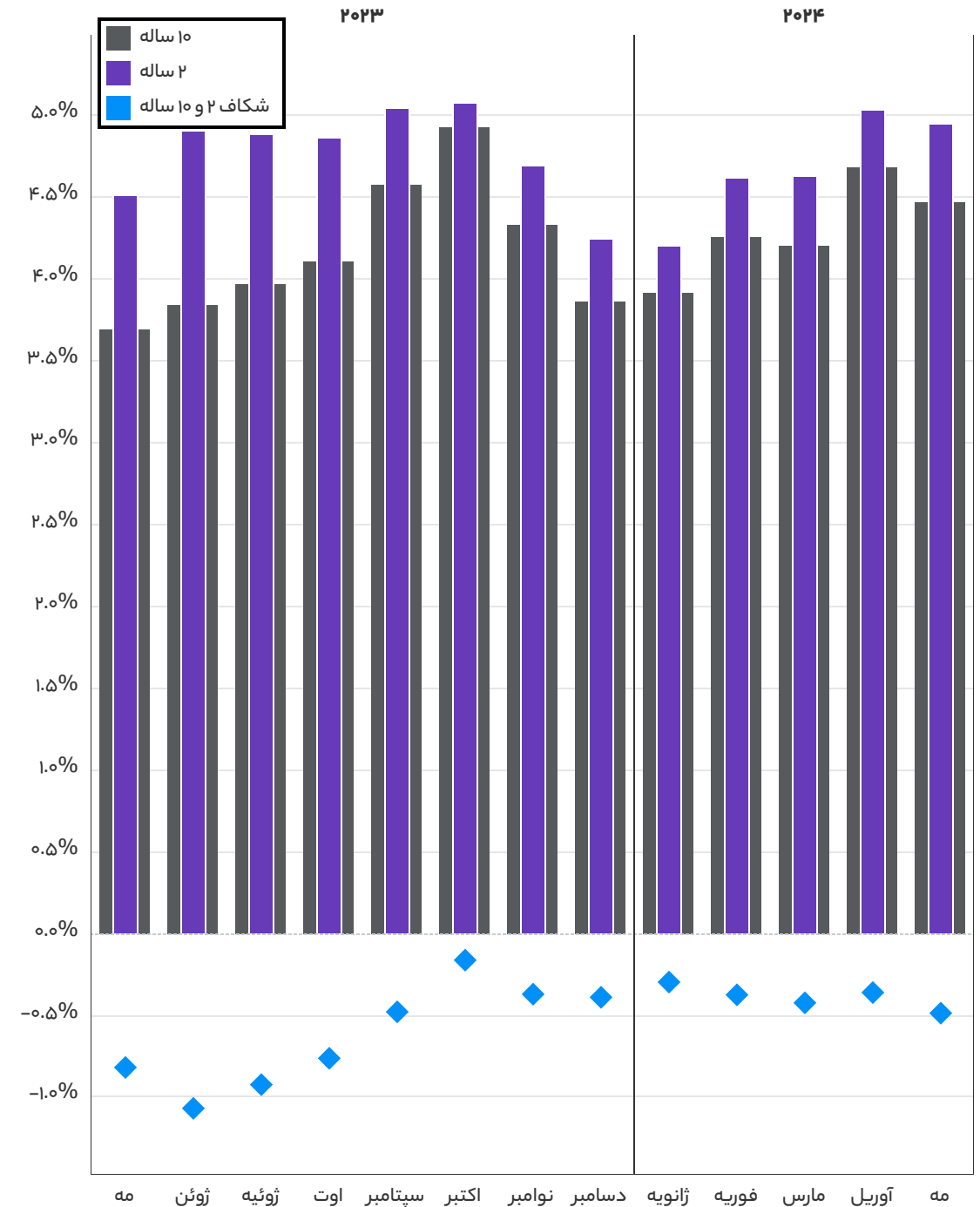
## شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



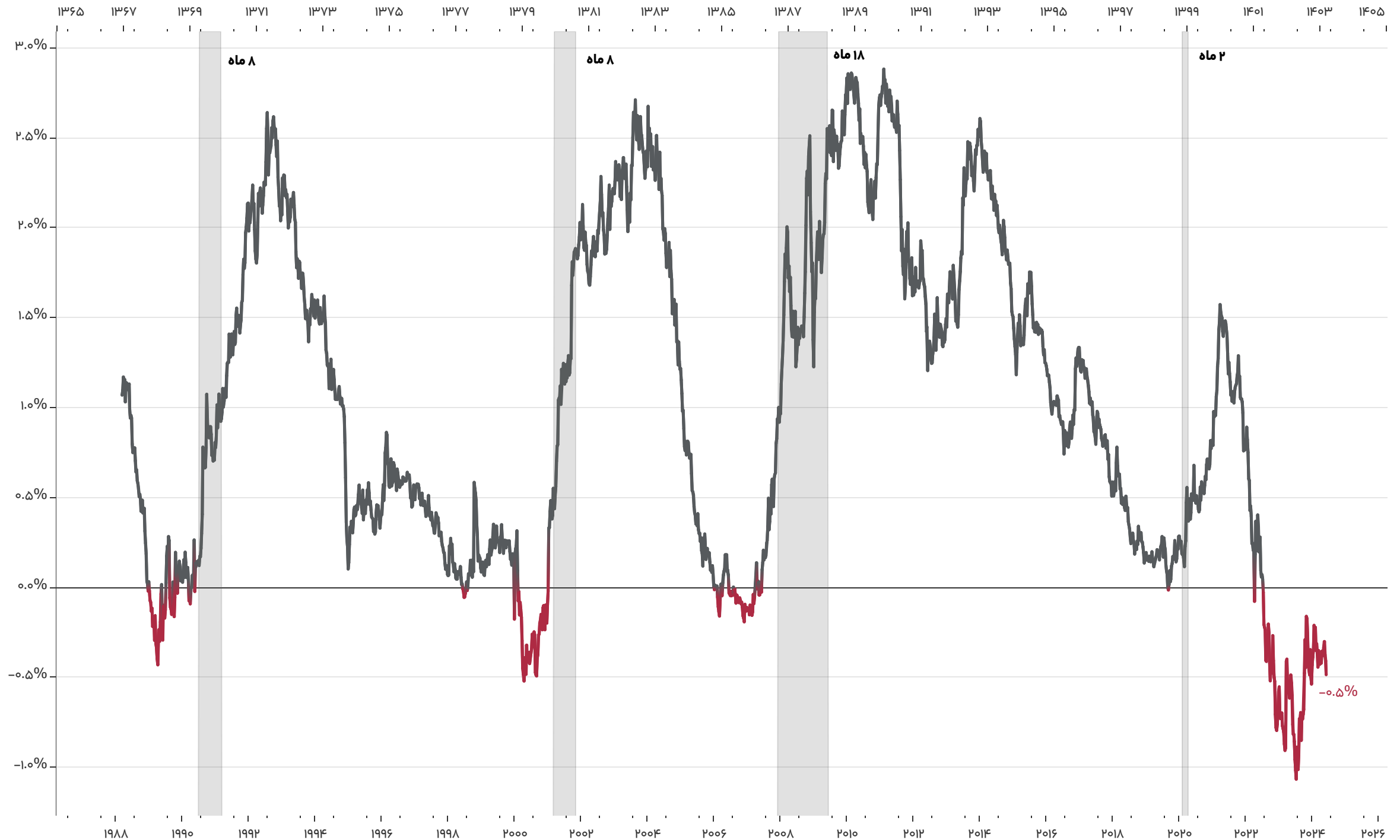
## وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

---

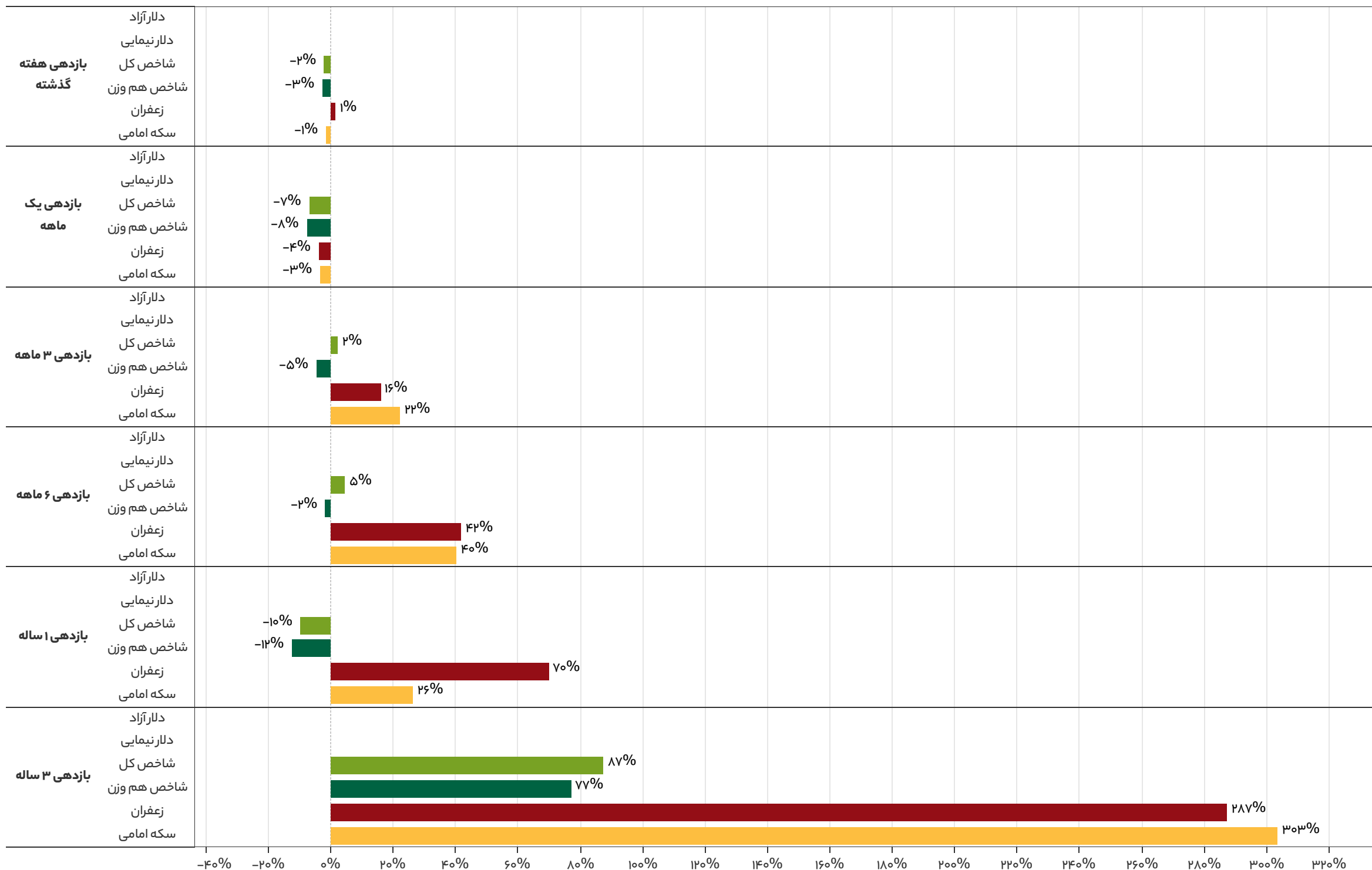
EQUITY MARKET

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<br>▲ ۳۰.۰%     | مسکن<br>▲ ۱۳.۴%       | مسکن<br>▲ ۴.۰%        | زعفران<br>▲ ۱۲.۳%     | زعفران<br>▲ ۳.۶%      | شاخص کل<br>▲ ۹.۴%     | سکه امامی<br>▲ ۴.۵%   | زعفران<br>▲ ۹.۲%      | شاخص کل<br>▲ ۹.۴%     | دلار آزاد<br>▲ ۸.۸%   | زعفران<br>▲ ۱۵.۹%     | سکه امامی<br>▲ ۱۷.۲%  | زعفران<br>▲ ۷۰.۲%     | هم وزن<br>۳۴%     |
| شاخص کل<br>▲ ۱۸.۶%    | دلار نیمایی<br>▲ ۲.۹% | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۸%  | سکه امامی<br>▲ ۳.۳%   | هم وزن<br>▲ ۸.۸%      | دلار آزاد<br>▲ ۲.۱%   | هم وزن<br>▲ ۱.۹%      | هم وزن<br>▲ ۸.۲%      | سکه امامی<br>▲ ۸.۸%   | دلار آزاد<br>▲ ۵.۲%   | زعفران<br>▲ ۱۲.۰%     | درآمد ثابت<br>▲ ۲۴.۲% | شاخص کل<br>۲۸%    |
| دلار آزاد<br>▲ ۹.۵%   | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | دلار نیمایی<br>▼ ۰.۶% | دلار آزاد<br>▲ ۰.۰%   | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | درآمد ثابت<br>▲ ۱.۹%  | دلار نیمایی<br>▲ ۲.۲% | زعفران<br>▲ ۴.۹%      | سکه امامی<br>▲ ۴.۹%   | شاخص کل<br>▲ ۶.۰%     | سکه امامی<br>▲ ۲۳.۲%  | سکه امامی<br>۲۵%  |
| درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | زعفران<br>▲ ۱.۶%      | زعفران<br>▼ ۱.۰%      | دلار نیمایی<br>▼ ۱.۶% | دلار آزاد<br>▲ ۱.۴%   | زعفران<br>▲ ۱.۳%      | مسکن<br>▲ ۱.۰%        | دلار نیمایی<br>▲ ۰.۴% | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۰%  | دلار نیمایی<br>▲ ۲.۲% | مسکن<br>▲ ۴.۱%        | دلار آزاد<br>▲ ۵.۲%   | مسکن<br>▲ ۲۲.۶%       | زعفران<br>۲۲%     |
| مسکن<br>▲ ۱.۸%        | سکه امامی<br>▲ ۰.۶%   | هم وزن<br>▼ ۲.۳%      | مسکن<br>▼ ۲.۲%        | دلار نیمایی<br>▲ ۰.۱% | دلار نیمایی<br>▼ ۰.۱% | دلار نیمایی<br>▼ ۰.۲% | دلار آزاد<br>▲ ۰.۱%   | زعفران<br>▲ ۱.۵%      | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۱%  | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۲%  | مسکن<br>▲ ۳.۸%        | دلار آزاد<br>▲ ۱۵.۹%  | دلار آزاد<br>۱۵%  |
| زعفران<br>▼ ۰.۱%      | هم وزن<br>▲ ۰.۴%      | شاخص کل<br>▼ ۵.۶%     | سکه امامی<br>▼ ۳.۵%   | مسکن<br>▼ ۱.۰%        | دلار آزاد<br>▼ ۰.۴%   | شاخص کل<br>▼ ۴.۲%     | سکه امامی<br>▼ ۰.۱%   | سکه امامی<br>▲ ۰.۸%   | مسکن<br>▲ ۱.۷%        | دلار نیمایی<br>▲ ۰.۷% | درآمد ثابت<br>▲ ۲.۳%  | دلار نیمایی<br>▲ ۷.۶% | مسکن<br>۱۵%       |
| دلار نیمایی<br>▼ ۲.۱% | دلار آزاد<br>▲ ۰.۱%   | دلار آزاد<br>▼ ۶.۱%   | هم وزن<br>▼ ۶.۲%      | شاخص کل<br>▼ ۲.۳%     | مسکن<br>▼ ۰.۶%        | هم وزن<br>▼ ۴.۴%      | مسکن<br>▼ ۰.۴%        | دلار آزاد<br>▼ ۰.۸%   | هم وزن<br>▼ ۰.۹%      | هم وزن<br>▼ ۳.۶%      | هم وزن<br>▲ ۲.۱%      | هم وزن<br>▼ ۲.۴%      | دلار نیمایی<br>۵% |
| سکه امامی<br>▼ ۶.۵%   | شاخص کل<br>▼ ۰.۹%     | سکه امامی<br>▼ ۱۱.۱%  | شاخص کل<br>▼ ۸.۸%     | هم وزن<br>▼ ۵.۲%      | سکه امامی<br>▼ ۱.۹%   | زعفران<br>▼ ۴.۷%      | شاخص کل<br>▼ ۰.۶%     | مسکن<br>▼ ۲.۲%        | شاخص کل<br>▼ ۲.۰%     | شاخص کل<br>▼ ۴.۴%     | دلار نیمایی<br>▲ ۱.۳% | شاخص کل<br>▼ ۵.۶%     | درآمد ثابت<br>۰%  |

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

– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری 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 کاربیزما ذکر گردیده، استفاده شده است.

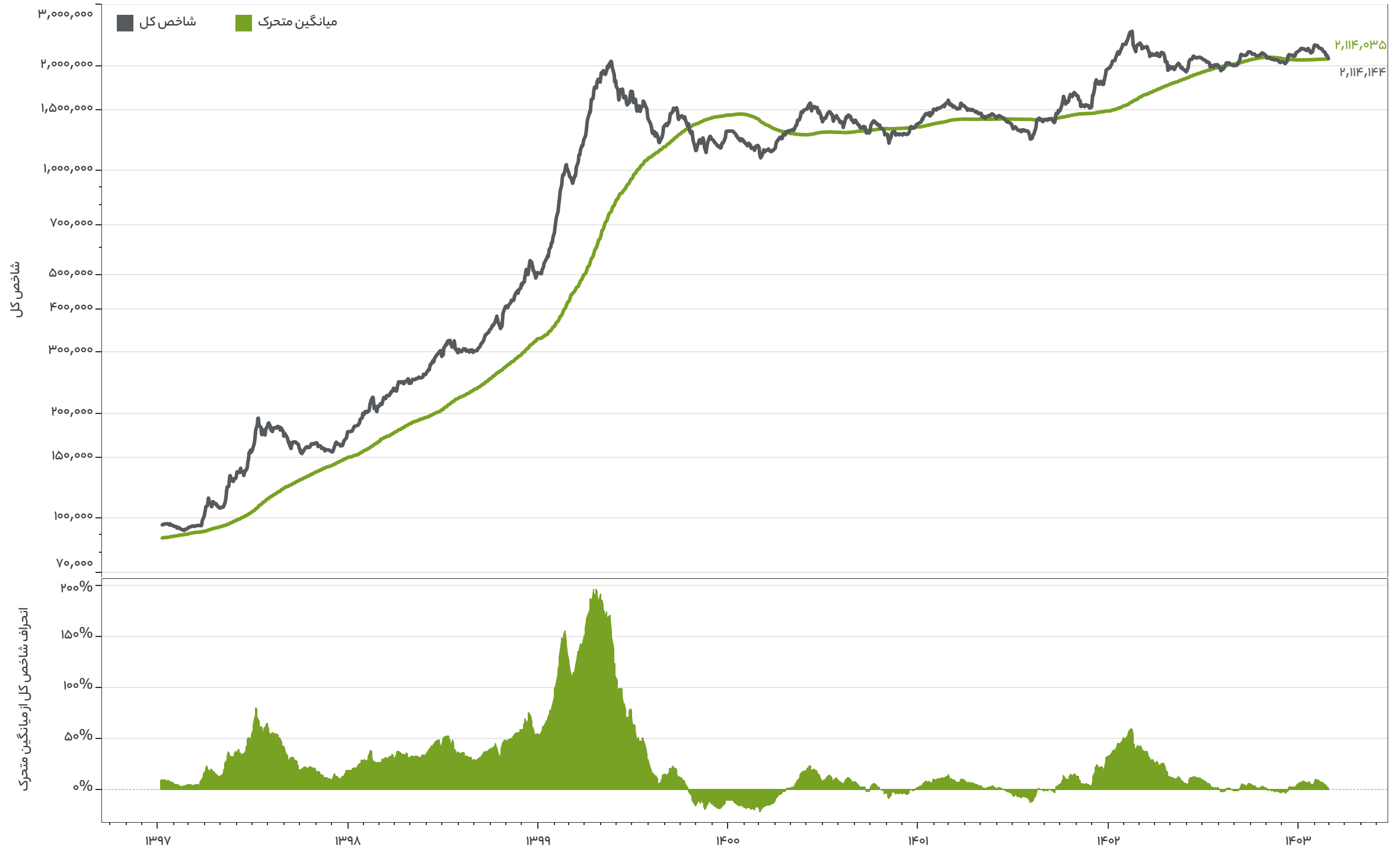
## ارزش دلاری بازار

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





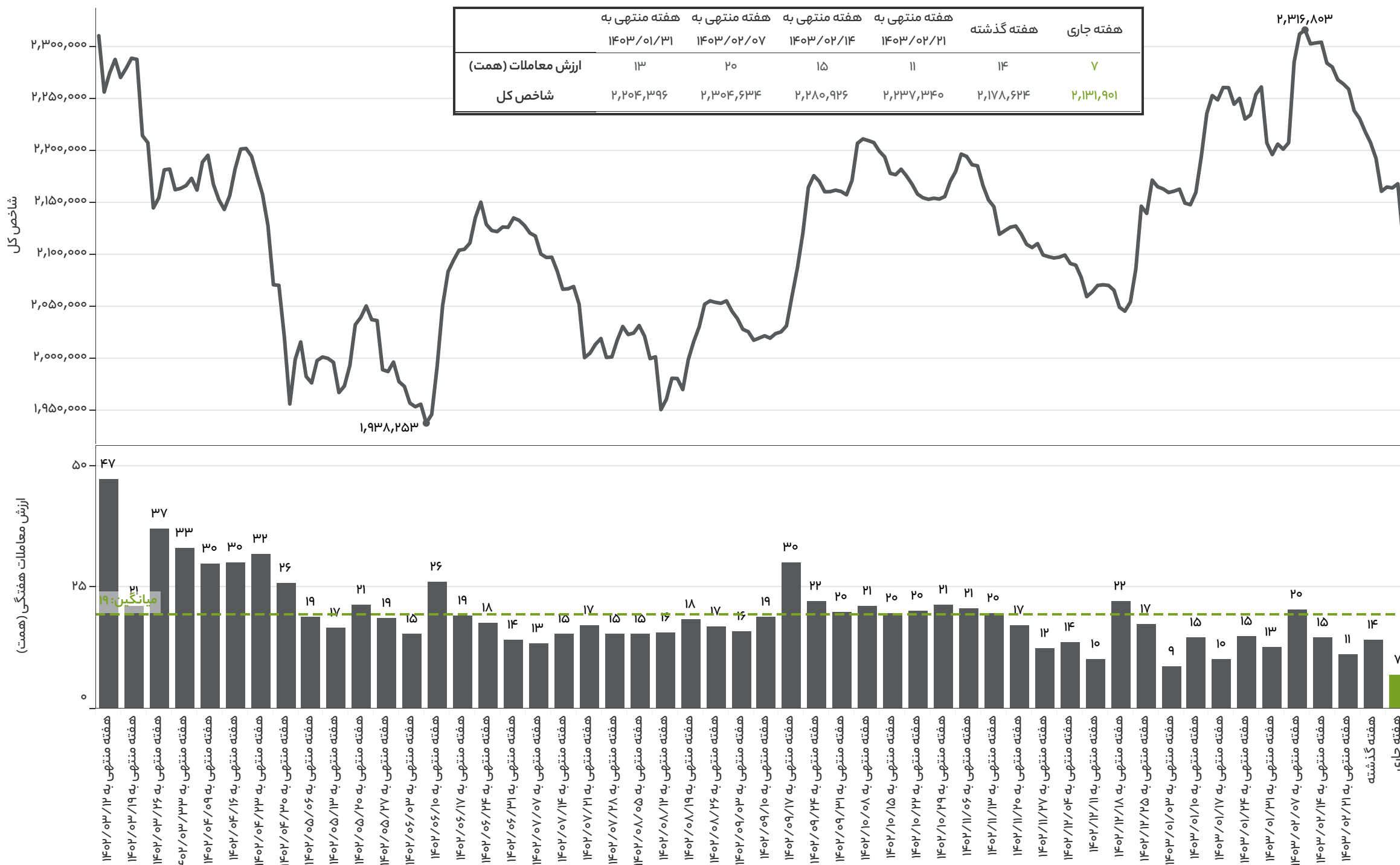
## تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

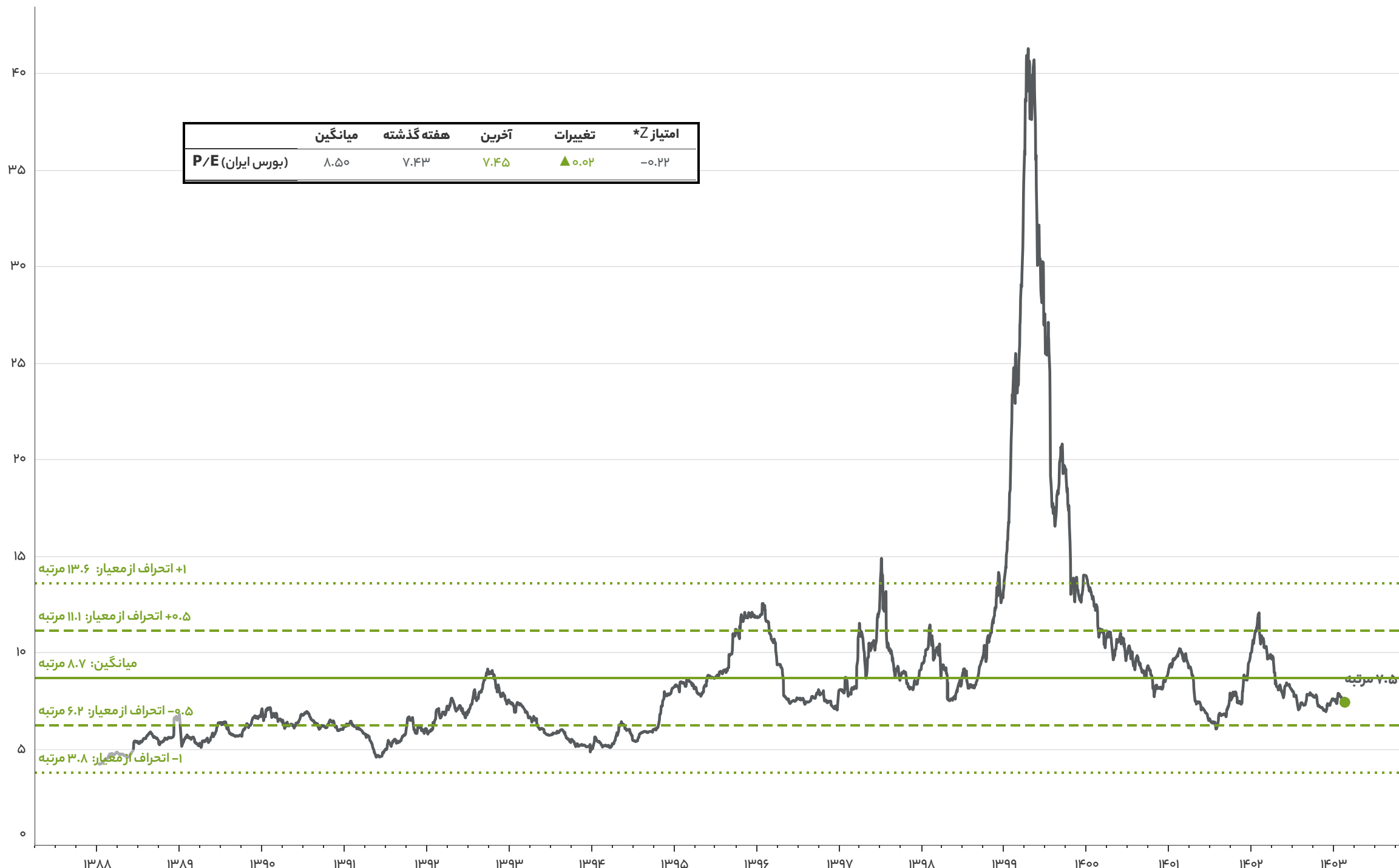
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





## 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.



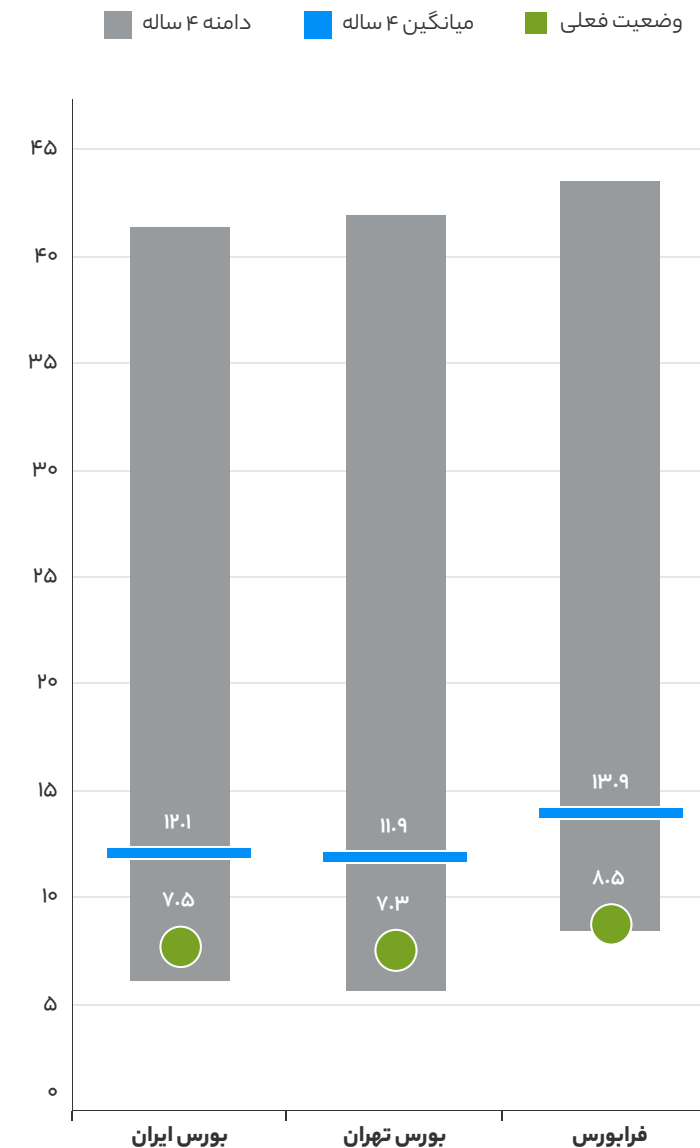
## ارزش نسبی فرابورس به بورس

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      | ۷.۴۵       | ۷.۴۳       | ۶.۰۷         | ۱۲.۰۶          | ۴۱.۳۳         |
| بورس تهران      | ۷.۳۰       | ۷.۲۷       | ۵.۶۴         | ۱۱.۸۷          | ۴۱.۹۹         |
| فرابورس         | ۸.۴۷       | ۸.۴۸       | ۸.۴۴         | ۱۳.۹۲          | ۴۳.۵۱         |

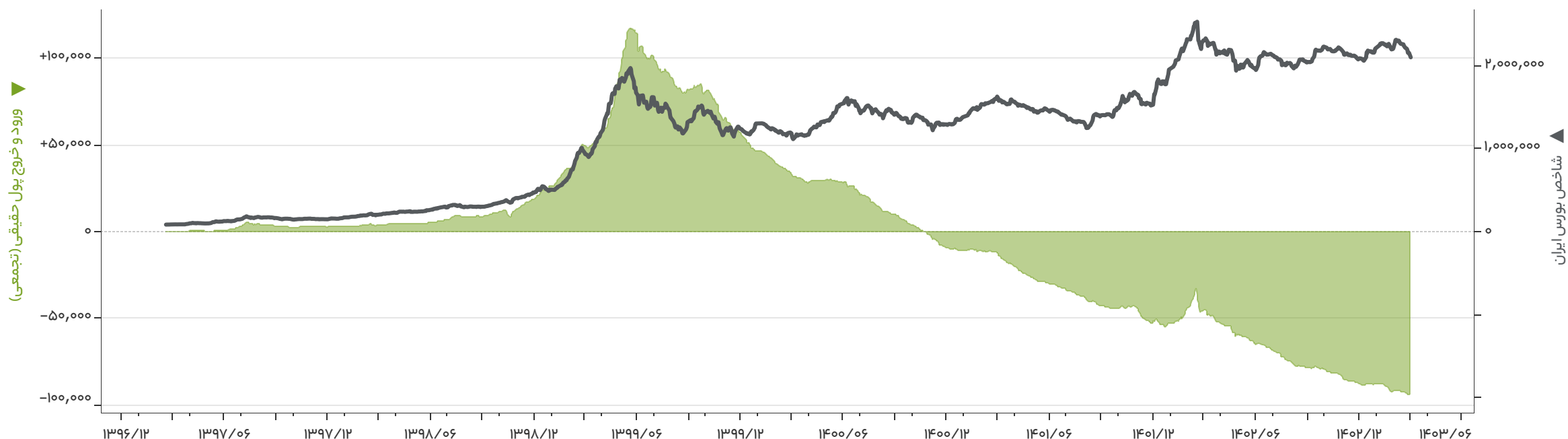


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

|                                         | 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)         | ۵۸              | ۹۳       | ۹۴       | ۱۱۷      | ۱۳۹    | ۱۷۳   | ۱۹۷              | ۳۴۰           | ۶۱۷   | ۲,۹۸۳      | ۳,۳۶۱     |                 |
| سهام هر سکتور از ارزش بازار             | ۰.۷%            | ۱.۱%     | ۱.۲%     | ۱.۴%     | ۱.۷%   | ۲.۱%  | ۲.۴%             | ۴.۲%          | ۷.۶%  | ۳۶.۵%      | ۴۱.۱%     |                 |
| نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر        | ۱۴.۴            | ۶.۹      | ۱۰.۰     | ۱۶.۶     | ۹.۲    | ۷.۹   | ۸.۸              | ۴.۵           | ۵.۱   | ۶.۸        | ۷.۹       | سودآوری         |
| بازده سود نقدی                          | ۵.۰%            | ۱۶.۱%    | ۴.۲%     | ۳.۵%     | ۱۱.۰%  | ۴.۰%  | ۵.۰%             | ۲.۸%          | ۱۴.۴% | ۱۰.۵%      | ۹.۳%      |                 |
| نسبت تقسیم سود                          | ۴۲%             | ۱۰۰%     | ۴۱%      | ۵۹%      | ۶۷%    | ۳۹%   | ۵۱%              | 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) | +۷۰۳%           | +۸۳۱%    | +۹۴%     | +۳۲۰%    | +۳۴۶%  | +۳۹۲% | +۳۸۶%            | +۷۹۵%         | +۸۱۰% | +۸۰۳%      | +۱۰۱۴%    | بازده بلندمدت   |
| بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)         | +۱۲%            | +۱۲۷%    | -۶۹%     | +۴%      | +۶%    | -۱۴%  | -۱۶%             | -۱۹%          | +۱۸%  | -۵%        | +۷۱%      |                 |
| بازده از ابتدای سال                     | +۲۵۹%           | +۵۰%     | +۲۴%     | +۸۲%     | +۷۸%   | +۹۰%  | +۴۴%             | +۷۷%          | +۹۴%  | +۶۰%       | +۹۴%      | بازده کوتاه‌مدت |
| بازده هفته گذشته                        | -۳%             | ۰%       | -۴%      | -۱%      | -۳%    | -۳%   | -۳%              | -۲%           | -۱%   | -۳%        | -۲%       |                 |

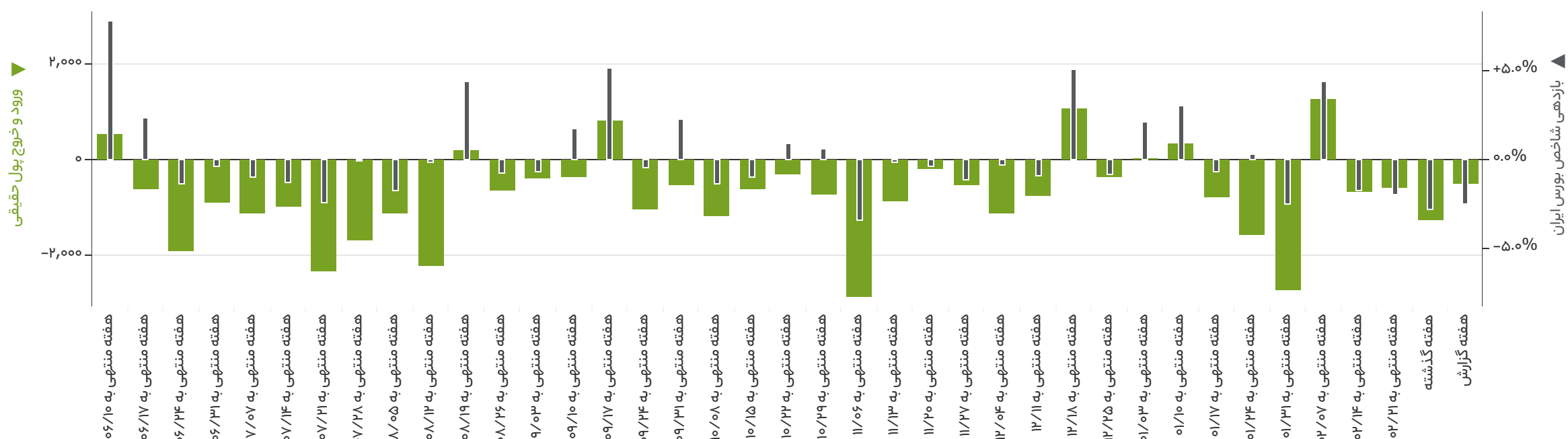
## ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



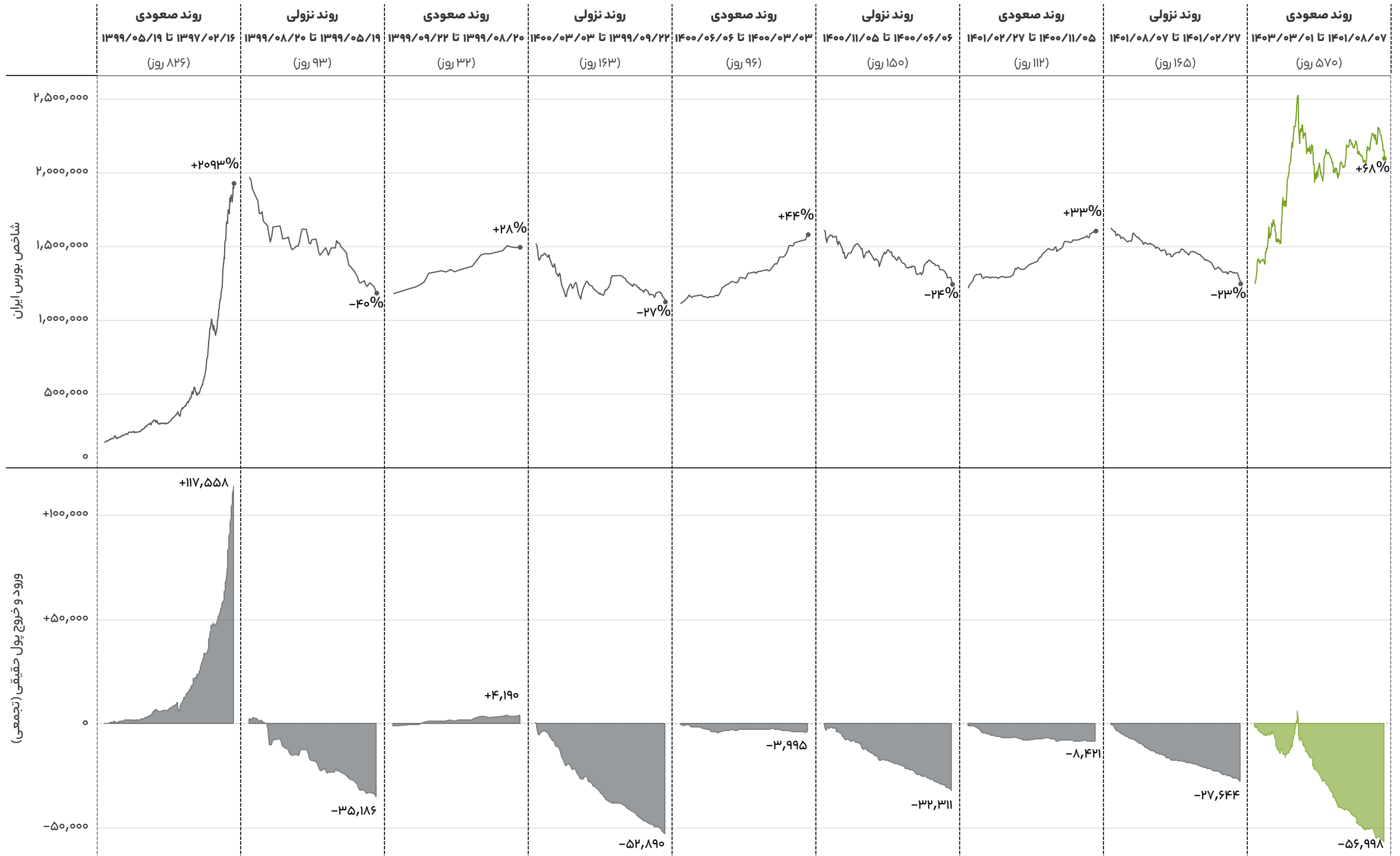
## ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

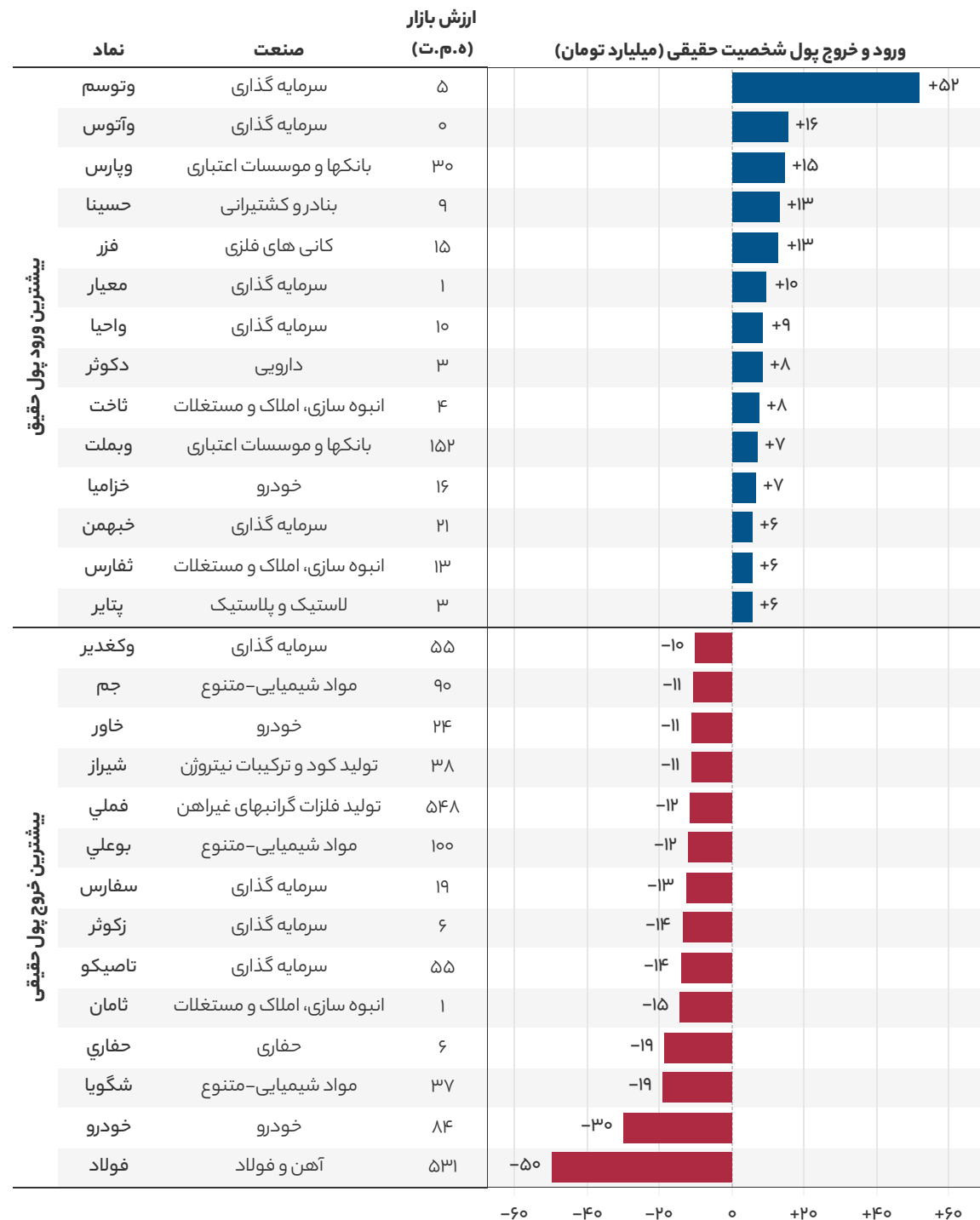




## ورود و خروج پول

## ورود و خروج پول حقیقی

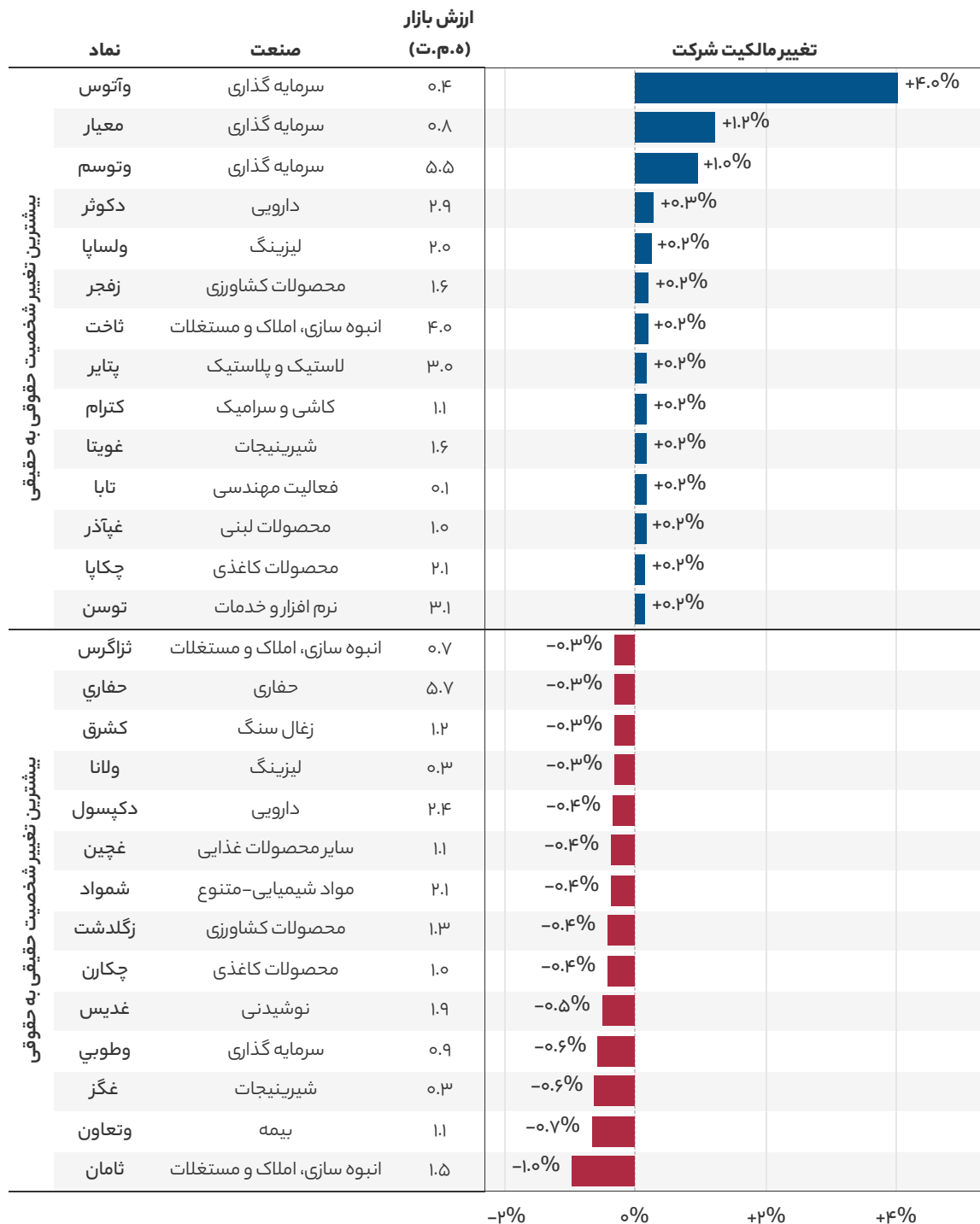
طی دوره گذشته، میلیارد تومان، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان



پیشترین خروج پول حقیقی

## تغییر مالکیت شرکت

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



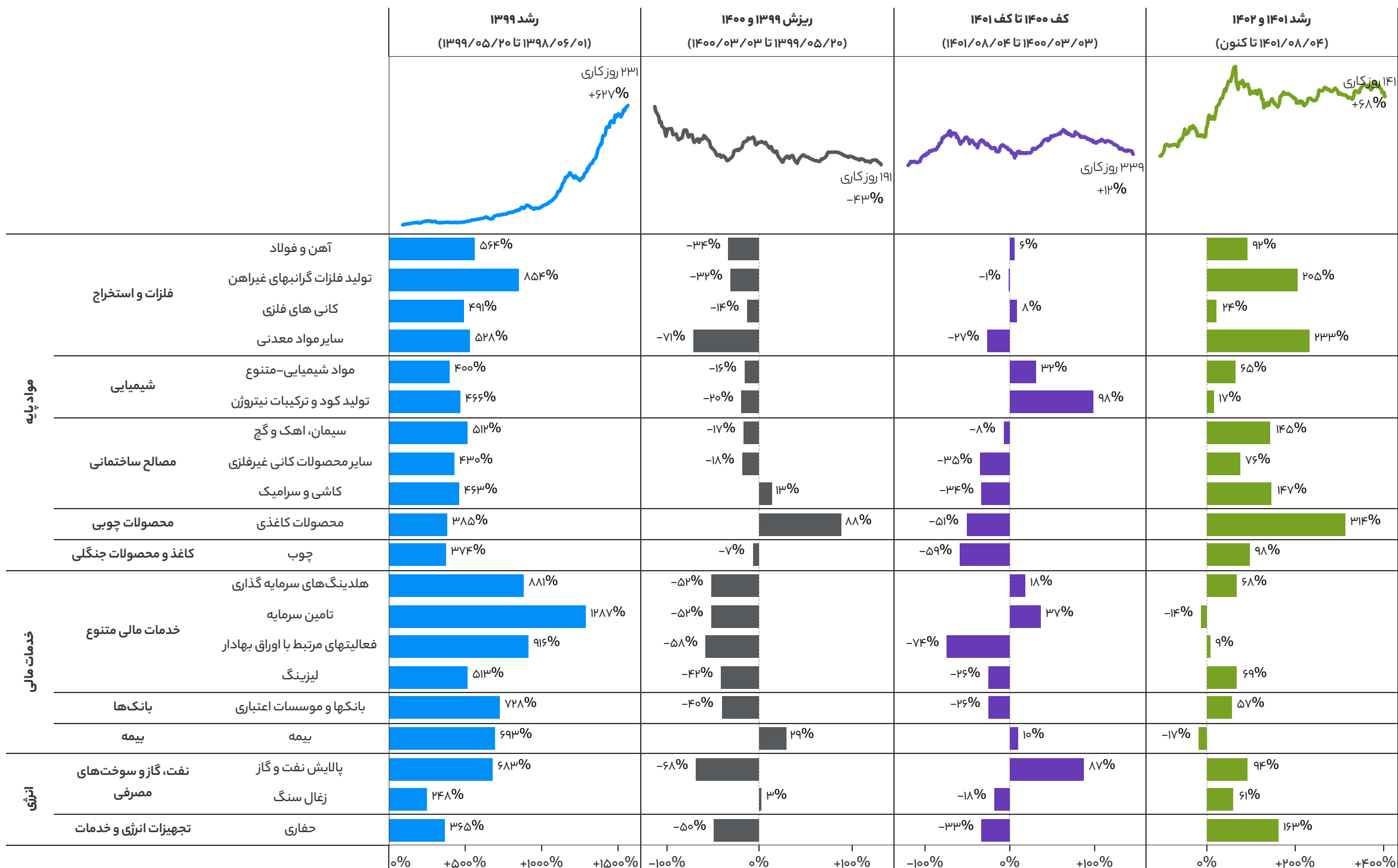
پیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی

پیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی

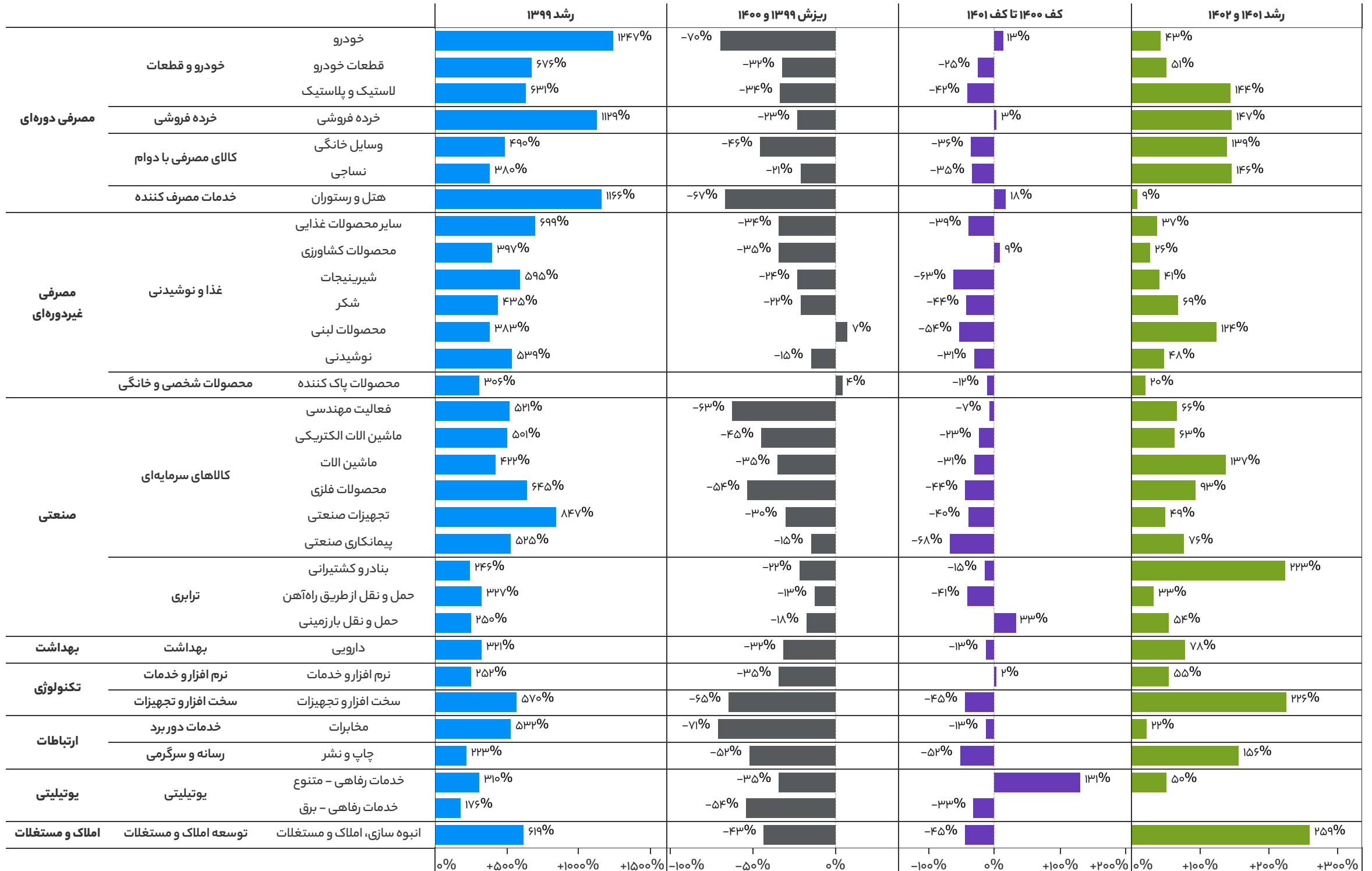


## بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

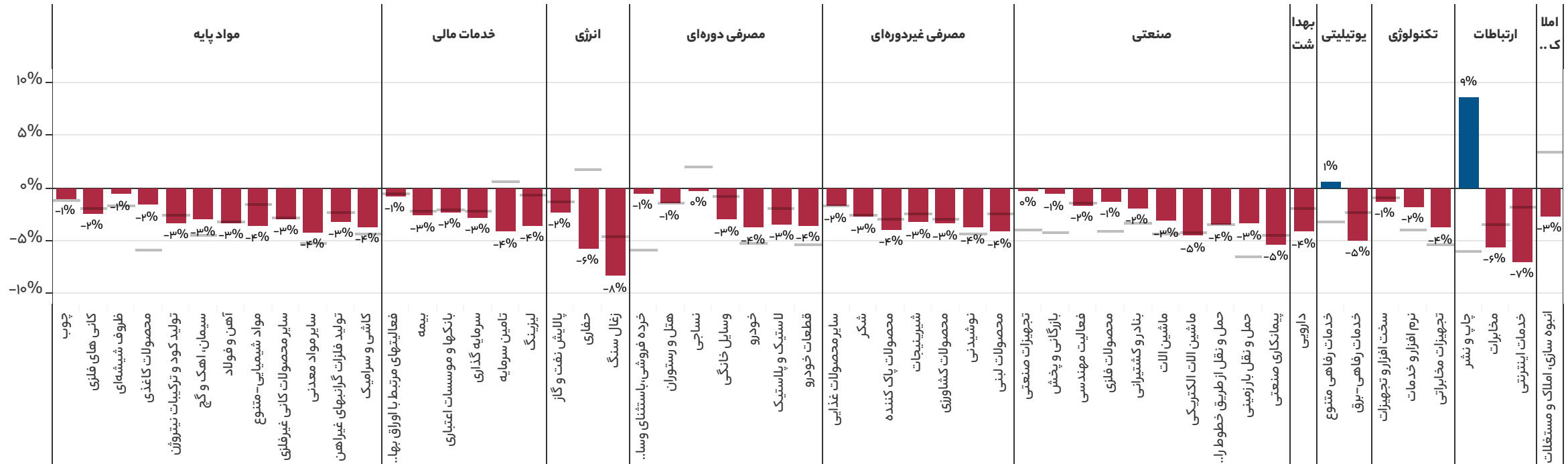


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



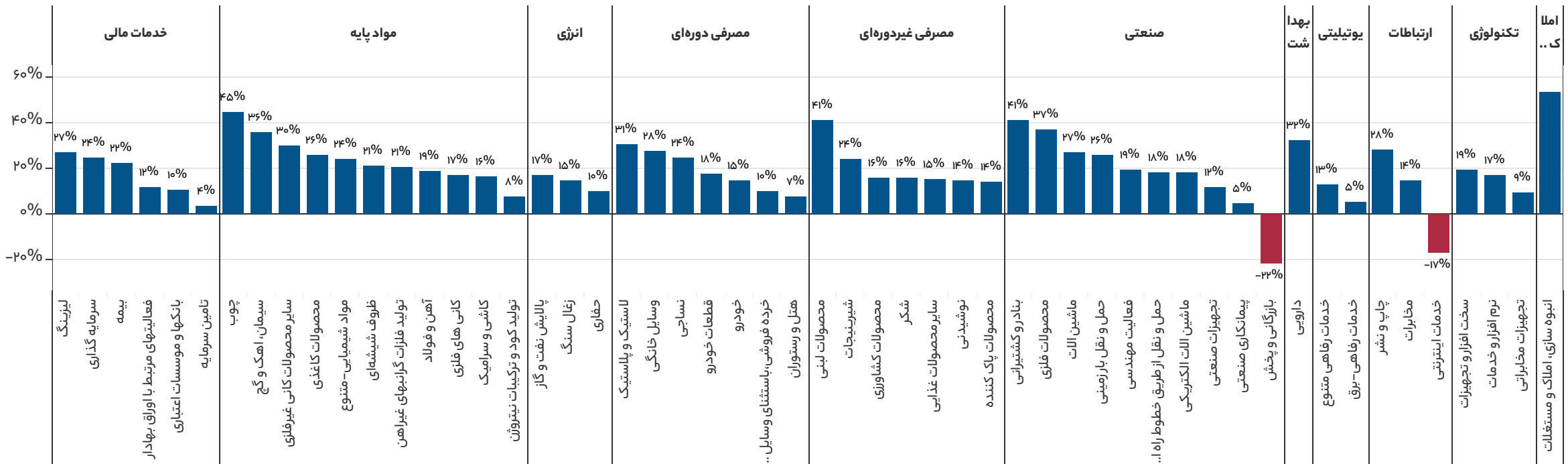
## بازده صنايع از ابتدای هفته

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



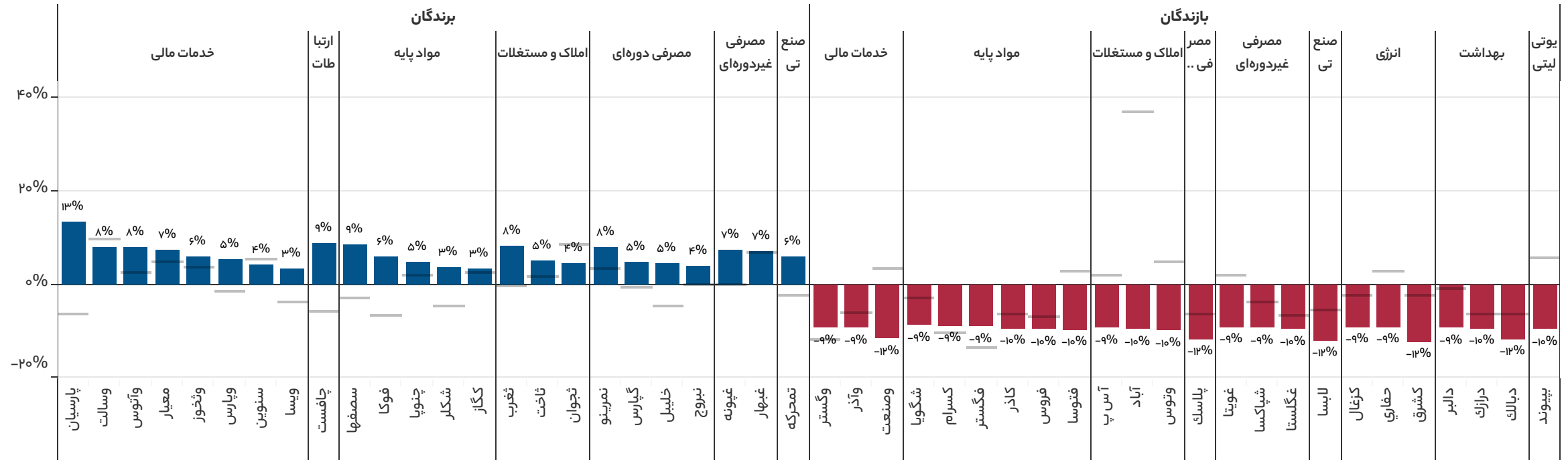
## بازده صنايع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سكتور، بازده تعديل شده)

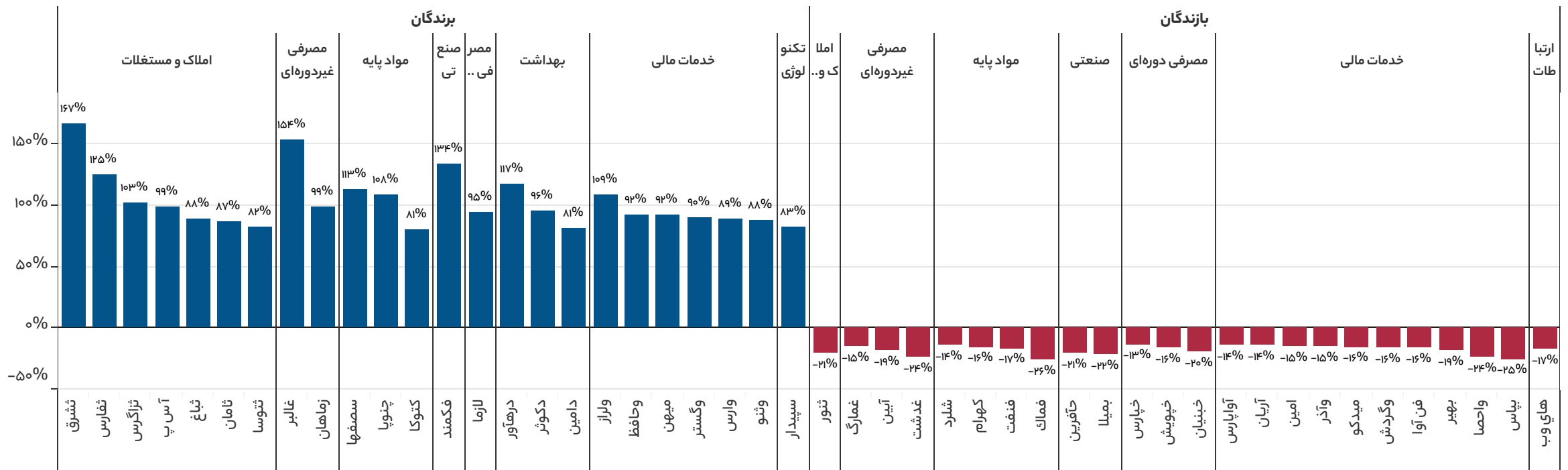




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



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



# 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

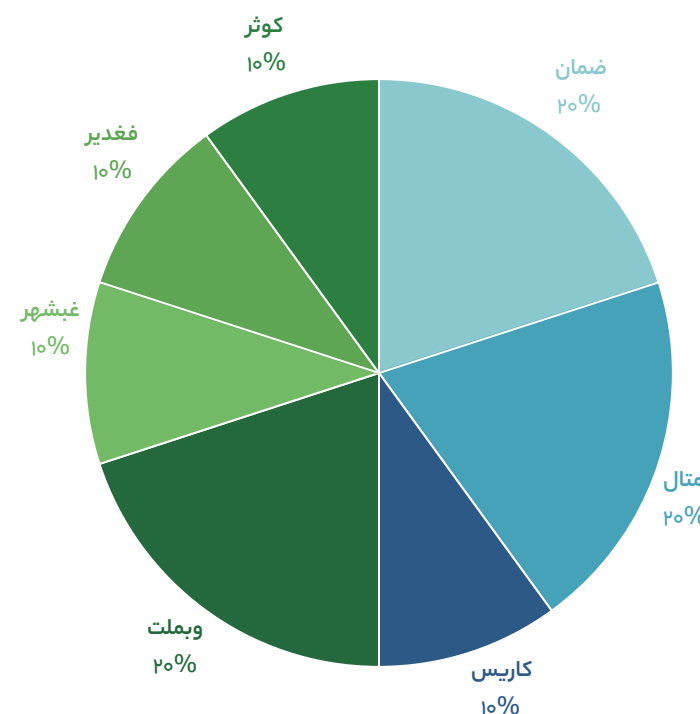


| بازدهی تعدیل شده | مبین | وامید | فملی | بفجر | کگهر | مارون | شتران | پاس  | شپنا | میدکو | وپاسار | تامیکو | خسپا | حکشتی | ومعادن | کگل  | وغدیر | خودرو | پارس | همراه | وبملت | شبریز | شبندر | وشندوق | شپدیس | کچاد | رمپنا | تاپیکو | نوری | شیراز | جم   | شستا | وتجارت | فخوز | فارس | پارسان | بوعلی | آریا | اخابر |
|------------------|------|-------|------|------|------|-------|-------|------|------|-------|--------|--------|------|-------|--------|------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|------|-------|--------|------|-------|------|------|--------|------|------|--------|-------|------|-------|
|                  | ۲.۰% | ۰%    | ۰.۳% | ۰.۶% | ۰.۸% | ۱.۰%  | ۱.۱%  | ۱.۵% | ۱.۸% | ۱.۹%  | ۲.۰%   | ۲.۱%   | ۲.۱% | ۲.۲%  | ۲.۲%   | ۲.۴% | ۲.۵%  | ۲.۵%  | ۲.۸% | ۳.۰%  | ۳.۳%  | ۳.۳%  | ۳.۳%  | ۳.۵%   | ۴.۰%  | ۴.۱% | ۴.۳%  | ۴.۴%   | ۴.۸% | ۴.۸%  | ۴.۹% | ۵.۱% | ۵.۲%   | ۵.۳% | ۵.۸% | ۶.۷%   | ۶.۷%  | ۸.۱% |       |



## سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



| وزن پیشنهادی | قیمت سهم | توضیحات                                        | هدف قیمتی | نماد  | افق زمانی |
|--------------|----------|------------------------------------------------|-----------|-------|-----------|
| ۱۰%          | ۱,۹۹۷    | نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸۵۰۰       | ۲,۶۰۰     | غبشهر | میان مدت  |
| ۱۰%          | ۹,۲۱۰    | بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب | ۱۲,۰۰۰    | فغدیر |           |
| ۱۰%          | ۲,۳۲۲    | نسبت (P/E) مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا      | ۳,۳۰۰     | کوثر  |           |
| ۲۰%          | ۲,۱۴۵    | رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب                 | ۳,۲۰۰     | وبملت |           |
| ۱۰%          | ۲۲,۲۵۷   | دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب                 | -         | کاریز | بلند مدت  |
| ۲۰%          | ۱۶,۲۸۹   | دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین   | -         | ضمان  |           |
| ۲۰%          | ۱۱,۳۱۰   | دارا بودن پرتفوی متنوع و پتانسیل رشد           | -         | متال  |           |

## ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

[www.charisma.ir](http://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](mailto:info@ciaco.ir)

پست الکترونیکی:

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

تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما:

[@CharismaTickReports](https://www.instagram.com/CharismaTickReports)

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

