

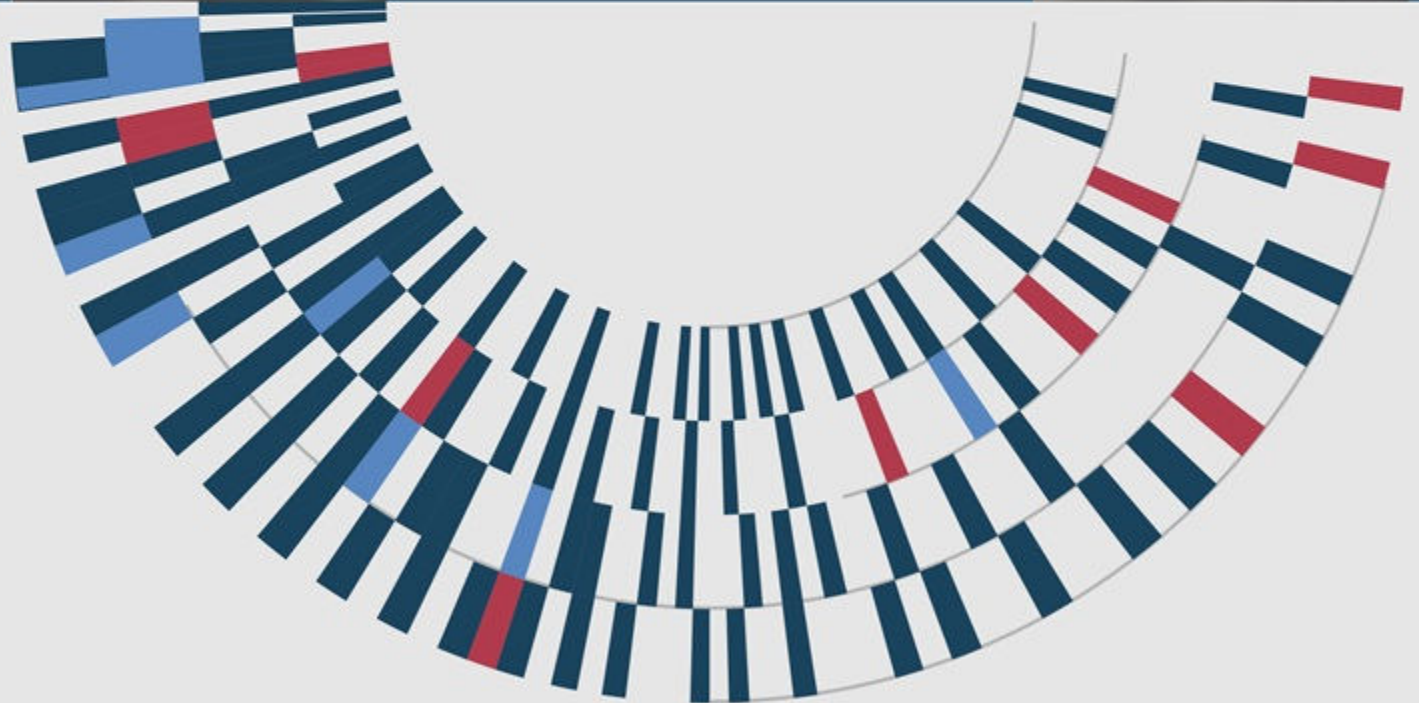
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۵۴ | هفته منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۱۸

 CHARISMA





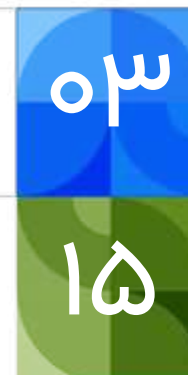
معرفی گزارش:

گزارش کاریزماتیک بازار سرمایه توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما با همکاری شرکت سرمایه‌گذاری کاریزما تهیه شده است. هدف از این گزارش بررسی تحولات بازار سرمایه ایران و متغیرهای موثر بر آن می‌باشد که علاوه بر آن بخش‌های تحلیل سهام، برآورد سود و تحلیل تکنیکال در گزارش پیش رو نیز منظور گردیده است. این گزارش هر هفته در منابع رسمی گروه مالی کاریزما منتشر شده و علاقه‌مندان می‌توانند از آن استفاده نمایند.

سلب مسئولیت:

محتوای این گزارش با رعایت بی‌طرفی، استقلال و دقت و بر اساس نظرات کارشناسان این مجموعه تدارک دیده شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما هیچ گونه تضمینی در مورد نتایج سرمایه‌گذاری بر مبنای این گزارش را ارائه نمی‌دهد. با وجود گردآوری بخش‌های مختلف، این گزارش به تنهایی نمی‌تواند تمامی ملاحظات لازم برای تصمیم‌گیری را فراهم نماید و صرف استفاده از این گزارش نباید مبنای خرید یا فروش هرگونه دارایی قرار گیرد. مدیریت سرمایه هر شخص باید بر اساس سطح ریسک‌پذیری، اهداف مالی، محدودیت‌ها، افق زمانی و سایر ویژگی‌های فردی صورت گیرد و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در قبال معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش انجام گیرد، مسئولیتی نمی‌پذیرد. گزارش پیش رو بر مبنای اطلاعات و داده‌های موجود در منابع متعددی تهیه شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

کلیه حقوق مادی و معنوی این گزارش متعلق به گروه مالی کاریزما می‌باشد.



کامودیتی

بازار سهام

۰۴ فلزات آهنی و غیرآهنی
۰۵ معادن و محصولات کشاورزی
۰۶ پتروشیمی
۰۷ انرژی و سایر محصولات

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

۰۸ گاز طبیعی
۱۰ کرک اسپرد فرآورده‌های نفتی
۱۱ سیمان
۱۲ اخبار و معیارهای تاثیرگذار

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

۱۴ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی

۳۲ برندگان و بازندگان هفته
۳۳ بازدهی صنایع
۳۴ سبد پیشنهادی



کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات آهنی و غیر آهنی

روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
فلزات غیر آهنی			-	فزر			۱۷%	۲,۲۸۹	دلار/انس	بازار فارکس	طلا
			بموتو، فباهنر	فملی			۱۴%	۹,۷۶۰	دلار/تن	بورس فلزات لندن	مس
			بموتو، فباهنر	فملی			۴۳%	۵۲۴,۲۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	مس (ملي مس ایران)
			فنوال	فایرا			۹%	۲,۴۵۵	دلار/تن	کامکس	آلومینیوم
			فمراد	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما			۱۲%	۲,۷۷۵	دلار/تن	بورس فلزات لندن	روی
			-	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما			۳%	۲,۱۹۶	دلار/تن	بورس فلزات لندن	سرب
فلزات آهنی			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان			۳%	۴۷۷	دلار/تن	بنادر ایران FOB	شمش (ایران)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان			۴%	۵۰۰	دلار/تن	دریای سیاه FOB	شمش CIS (منطقه)
			کوبر، فوکا، فنورد	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسازان، کطیس، کپور، کزغال، کشرق			۶%	۲۰,۹۳۶	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	شمش (فولاد خوزستان)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			۳%	۴۵۳	دلار/تن	بنادر ایران FOB	اسلب (ایران)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			۵%	۴۸۸	دلار/تن	دریای سیاه FOB	اسلب CIS (منطقه)
			-	فولاد، فخوز، هرمز			۱۸%	۲۲,۵۰۰	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	اسلب (فولاد هرمزگان)
			فولای	ذوب، کویر			۹%	۵۷۵	دلار/تن	بنادر ترکیه FOB	میلگرد
			فولای	ذوب، کویر			۱%	۲۳,۹۵۹	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	میلگرد (ذوب آهن اصفهان)
			فجر، فسپا	فولاد، فوکا، فنورد			۳%	۵۶۳	دلار/تن	دریای سیاه FOB	ورق گرم
			-	فولاد			۳%	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			-	-	-	-	-۷.۶%	۱۰۸	دلار/تن	CFR شمال چین	سنگ آهن
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	-	-۵.۶%	۱۲۸	دلار/تن	CFR شمال چین	گندله سنگ آهن
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	-	-۰.۲%	۵,۱۳۲	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	گندله سنگ آهن (گل گهر)
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	-	-۶.۳%	۱۱۶	دلار/تن	CFR شمال چین	کنسانتره سنگ آهن
			فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاذ، ارفع، فسانازان	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	-	-	+۱.۰%	۳,۷۹۴	تومان/کیلوگرم	بورس کالای ایران	کنسانتره (چادرملو)
محصولات کشاورزی			-	-	-	-	-۷.۹%	۲۳۰	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
			غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	+۰.۷%	۱۷۷	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
			-	-	-	-	-۱.۹%	۱,۳۸۴	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	۳۰۲	-۳.۲%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۳۱۲ ۲۳۵	۲۹%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۴۵	-۲.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۱۰۵۰ ۷۳۰	۲۹%
	چین CFR	دلار/تن	۸۵۵	+۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۸۶۰ ۷۳۵	۱۶%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۳۰	+۰.۶%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۱,۱۵۸ ۹۵۹	۴%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۰۰	+۱.۴%	شصفها، نوری	-	۱,۱۴۰ ۹۴۰	۷%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۶۳	+۱.۷%	پارس	شجم، شبصیر	۱,۱۸۲ ۸۷۸	۲۷%
	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۴	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۱,۰۸۴ ۷۵۲	۳۴%
	چین CFR	دلار/تن	۹۴۵	+۳.۶%	بوعلی	-	۹۵۲ ۸۰۱	
	چین CFR	دلار/تن	۱,۴۱۰	+۱.۴%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۱,۴۵۰ ۶۴۰	۱۱۷%
پلیمرها	چین CFR	دلار/تن	۵۲۵	-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۵۵۶ ۴۵۰	۱۳%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۷۷	+۲.۵%	آریا، شکبیر	-	۱,۰۷۷ ۸۷۵	۲۰%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۵	+۱.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۹۸۵ ۸۹۵	۴%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۵	+۱.۱%	جم، شکبیر، شاراک	-	۹۶۱ ۸۸۱	۵%
	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۰۹	+۲.۷%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۹۰۹ ۸۰۰	۱۳%
	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۵	-	شگویا	-	۹۷۵ ۹۳۰	-۱%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۱۰	+۳.۸%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۸۸۵ ۷۴۰	۸%
	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۴۷۰	-	شبصیر	-	۱,۴۸۰ ۱,۲۳۰	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	۷۹	-۲.۵%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۷۴۹۴	۴%
نفت WTI	بورس بین‌المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۵	-۲.۶%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۶۹۹۱	۵%
بنزین	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۱	-۷.۳%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۸۱۱۰۷	-۵%
گازوئیل	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۸	-۲.۵%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۸۵۱۲۵	-۱%
نفت کوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۵۱	-۴.۵%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۳۸۱۵۲۸	۱۴%
نفت سفید	خلیج فارس FOB	دلار/بشکه	۸۹	-۱.۴%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۸۶۱۲۴	۵%
نفتا	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۵۸۲	-۳.۱%	-	شپنا، شبندر، شتران، شبریز، شرار، لاوان	۴۵۲۶۵۹	۱۷%
روغن پایه	امارات متحده CFR عربی	دلار/تن	۸۸۵	-۱.۷%	-	شسپا، شرانل، شپهرن، شنف	۷۲۵۹۳۵	-۲%
روغن پایه (نفت سپاهان)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۳۶,۴۵۹	+۰.۶%	-	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	۲۱,۷۹۵۳۶,۹۴۳	۴۲%
لوب کات (پالایش نفت تهران)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۲۲,۴۲۶	-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاوان	۱۲,۴۵۵۲۲,۶۳۵	۸۰%
قیر (نفت پاسارگاد)	بورس کالای ایران	تومان/کیلوگرم	۱۵,۱۰۰	-	-	شپاس	۱۲,۰۸۶۱۶,۵۵۰	۱۳%
زغال سنگ	استرالیا FOB	دلار/تن خیس	۲۱۸	+۹.۷%	-	ذوب، فروش	۱۸۸۲۸۷	۸%
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۸	-۰.۴%	-	-	۱.۰۵۱.۱۲	-۱%
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	-۰.۲%	-	-	۱.۲۱۱.۳۱	-۱%
بیتکوین	بایننس	دلار	۶۹,۰۷۳	+۲.۳%	-	-	۲۵,۷۰۴۶۹,۶۶۳	۱۶۲%

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	۰.۱۰	+۴.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ ۰.۱۳	۱۲%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۳	-۰.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۳ ۰.۰۸	-۴۱%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۸	-	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۱۹%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۵	-۵.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۰.۶۱	-۱۰%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۲	-۱.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۱۴%

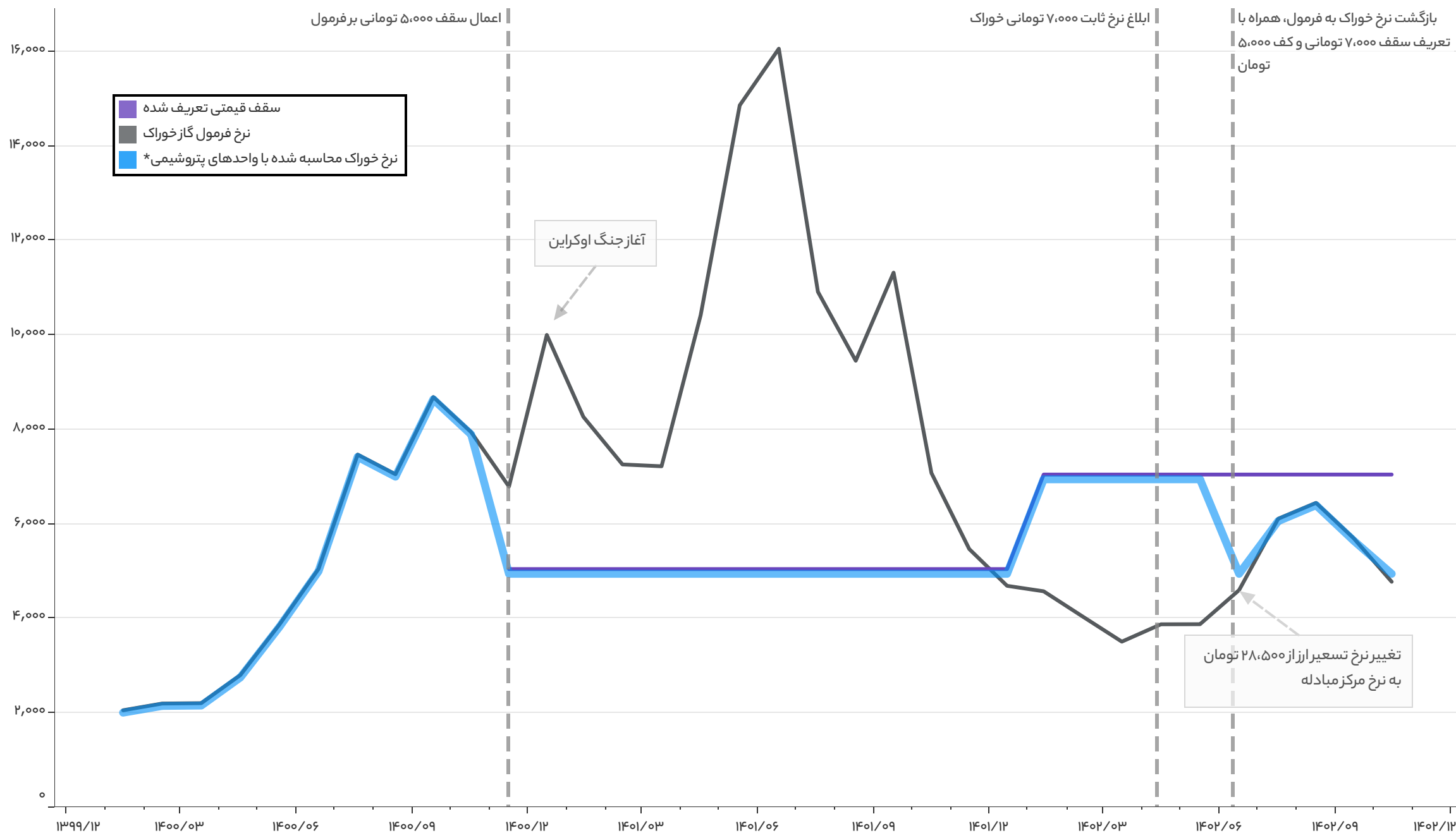
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



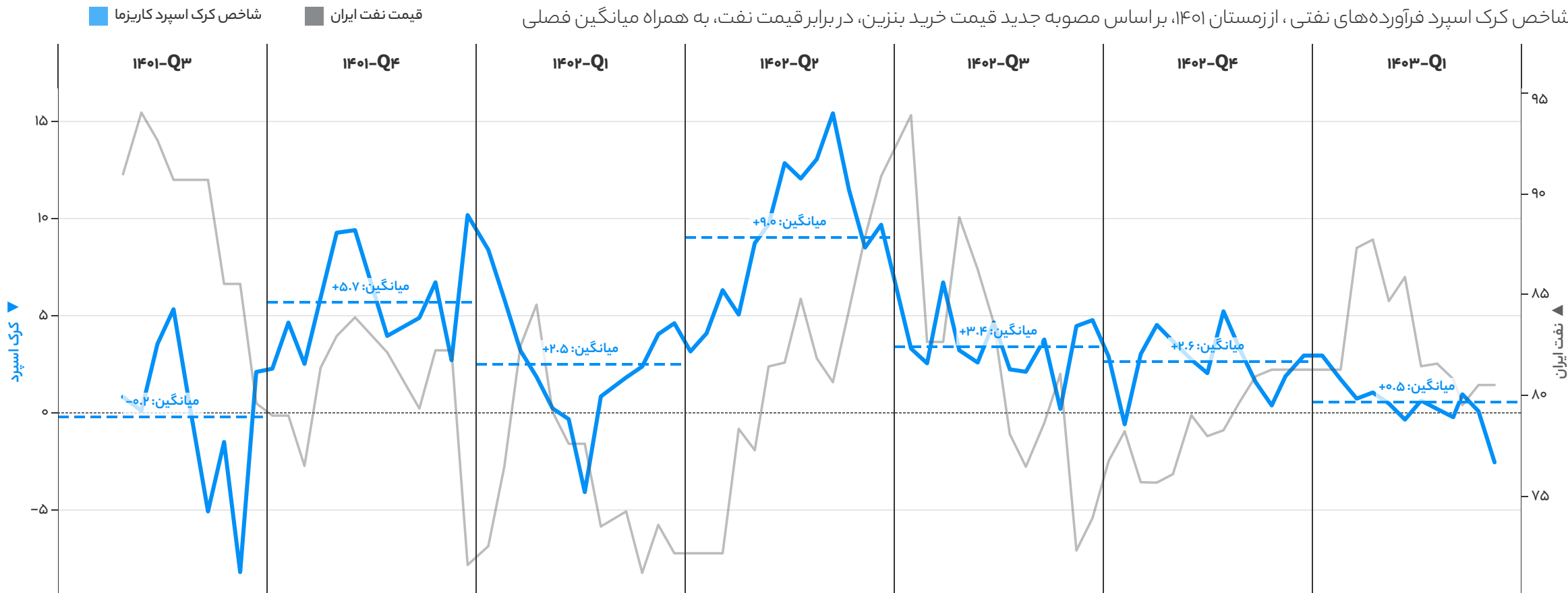
* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقبا بروزرسانی خواهد شد.

- 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	۸۰.۶									
گازوئیل	۸۷.۸	۹.۰	۷.۳	▼۱.۸	۱۹.۵	۱۱.۵	-۴۰.۹%			
بنزین**	۷۵.۴	۱.۵	-۵.۲	▼۶.۶	۵.۰	۳.۸	-۲۴.۹%			
نفتا	۶۵.۸	-۱۲.۶	-۱۴.۷	▼۲.۱	-۹.۶	-۱۲.۴	-۲۹.۰%			
نفت کوره	۷۱.۱	-۶.۵	-۹.۴	▼۳.۰	-۱۵.۰	-۹.۴	+۳۷.۶%			
لوب کات***	۸۲.۶	۲.۰	۲.۰	-	-۶.۲	-۲.۰	+۶۸.۰%			
وکیوم باتوم***	۵۴.۲	-۲۶.۳	-۲۶.۳	-	-۳۰.۸	-۳۰.۷	+۰.۳%			
شاخص کرک اسپرد کاریزما		۰.۱	-۲.۵	▼۲.۶	۲.۶	۰.۵	-۷۹.۹%			

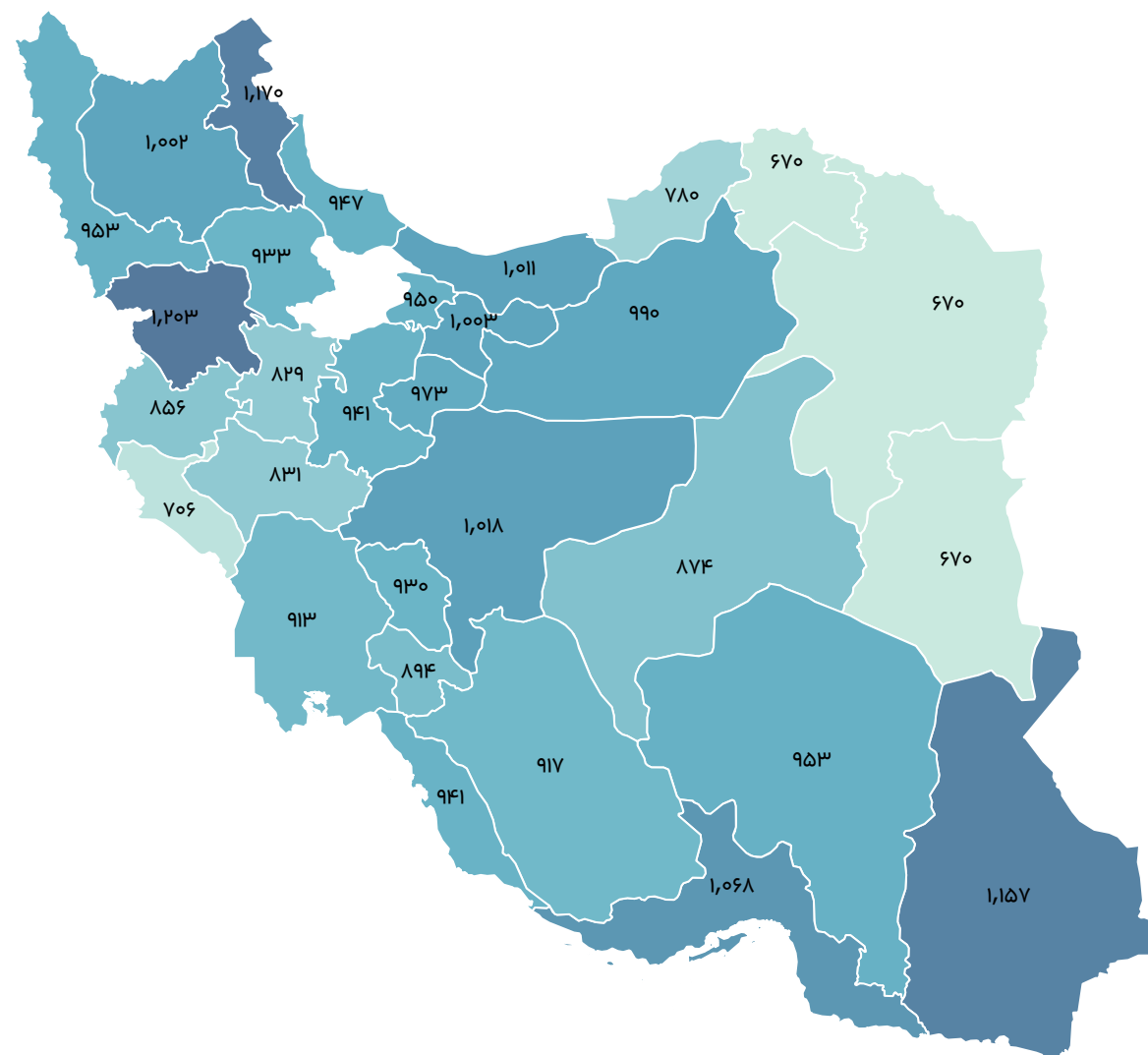
* این شاخص به منظور برآوردی از فروش پالایشگاه‌ها طراحی شده است. در محاسبه این شاخص از اسپرد فرآورده‌های کلیدی استفاده شده و برای انجام محاسبات، از ترکیب تولید هریک از فرآورده‌های نفتی ۴ پالایشگاه بزرگ بورسی استفاده گردیده است. همچنین برای وزن‌دهی، از روش میانگین موزون و بر اساس ارزش بازار هریک از این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

تغییرات به هفته گذشته	هفته گزارش	هفته گذشته	شرکت دنبال کننده	استان	منطقه
+۳.۶%	۱,۰۰۳	۹۶۸	سیمان تهران	تهران	مرکز
+۴.۰%	۹۵۰	۹۱۴	سیمان آبیک	البرز	
+۱.۸%	۹۴۱	۹۲۴	سیمان ساوه	مرکزی	
+۸.۲%	۱,۰۱۸	۹۴۱	سیمان سپاهان	اصفهان	
+۲.۴%	۹۷۳	۹۵۰	سیمان نیزار قم	قم	
-۲۱.۰%	۸۷۴	۱,۱۰۶	گروه صنعتی و معدنی سیما..	یزد	
-۱۲.۶%	۹۹۰	۱,۱۳۲	سیمان شاهرود	سمنان	غرب
-۳.۳%	۸۲۹	۸۵۸	سیمان هگمتان	همدان	
-۲.۱%	۹۱۳	۹۳۳	شرکت سیمان خوزستان	خوزستان	
+۶.۶%	۹۳۰	۸۷۳	صنایع سیمان شهرکرد	چهارمحال و بختیاری	
-۲.۷%	۸۵۶	۸۷۹	صنایع سیمان غرب	کرمانشاه	
-	۷۰۶	۷۰۶	سیمان ایلام	ایلام	
-	۸۳۱	۸۳۱	سیمان دورود	لرستان	
+۱.۶%	۸۹۴	۸۷۹	سیمان یاسوج	کهگیلویه و بویراحمد	
+۲.۱%	۱,۲۰۳	۱,۱۷۸	سیمان کردستان	کردستان	شمال
+۰.۱%	۱,۰۱۱	۱,۰۱۰	سیمان مازندران	مازندران	
+۳.۷%	۹۴۷	۹۱۳	سیمان خزر	گیلان	
+۱.۱%	۷۸۰	۷۷۲	سیمان پیوند گلستان	گلستان	
+۱۰.۳%	۱,۱۷۰	۱,۰۶۱	سیمان آرتا اردبیل	اردبیل	شمال غرب
-۳.۱%	۹۵۳	۹۸۳	سیمان ارومیه	آذربایجان غربی	
-۶.۸%	۱,۰۰۲	۱,۰۷۵	کارخانجات سیمان صوفیان	آذربایجان شرقی	
-	۹۳۳	۹۳۳	سیمان خمسه	زنجان	شمال شرق
+۵.۰%	۶۷۰	۶۳۸	سیمان بجنورد	خراسان شمالی	
+۵.۰%	۶۷۰	۶۳۸	سیمان شرق	خراسان رضوی	
+۵.۰%	۶۷۰	۶۳۸	شرکت سیمان قاین	خراسان جنوبی	جنوب
-۲۰.۲%	۱,۰۶۸	۱,۳۳۹	سیمان هرمزگان	هرمزگان	
-۸.۲%	۹۱۷	۹۹۸	سیمان داراب	فارس	
-۰.۲%	۹۴۱	۹۴۲	سیمان مند دشتی	بوشهر	جنوب شرق
-	۹۵۳	۹۵۳	سیمان ممتازان کرمان	کرمان	
-۰.۷%	۱,۱۵۷	۱,۱۶۶	سیمان خاش	سیستان و بلوچستان	

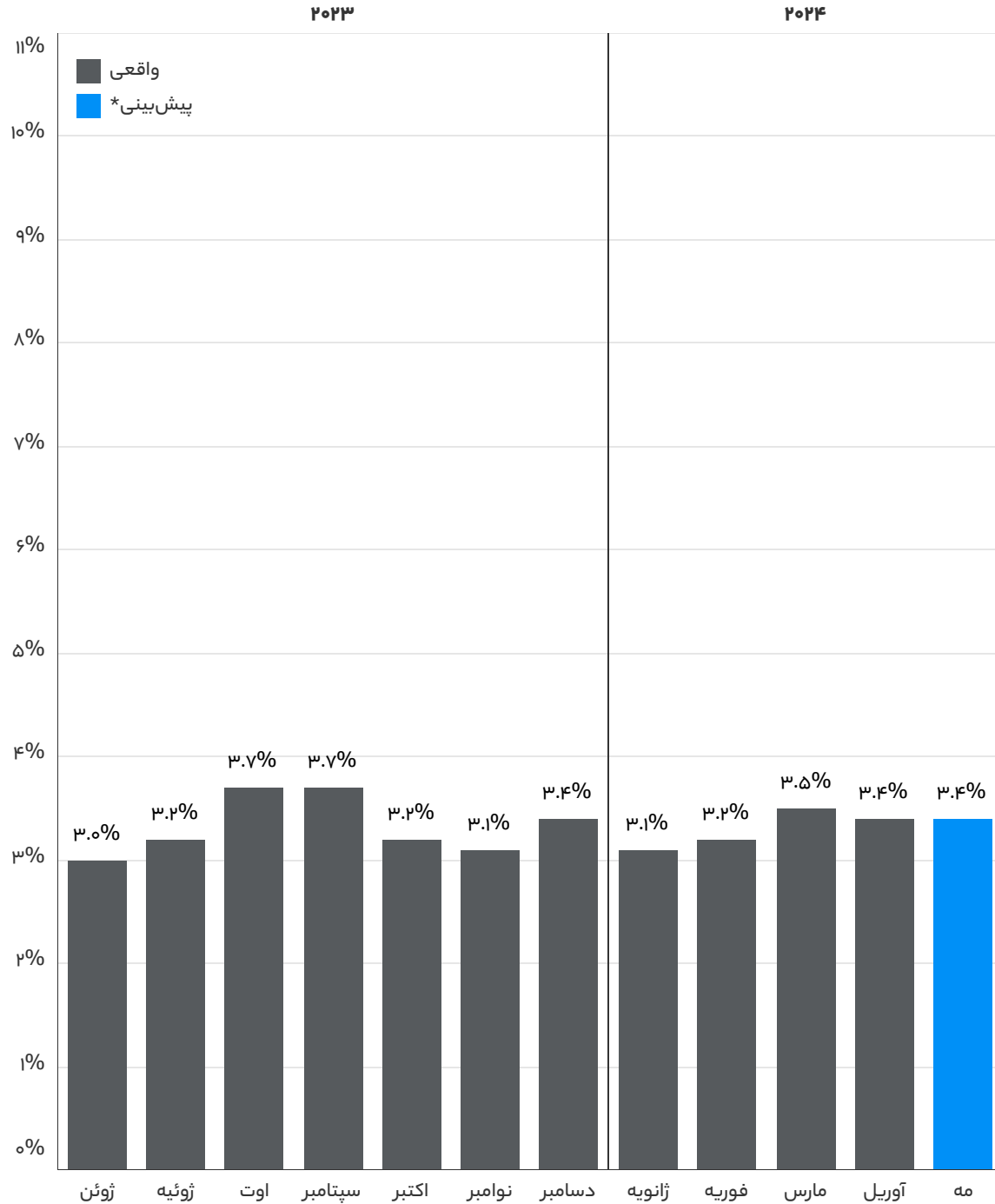
* قیمت سیمان بر اساس سیمان ۲ فله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ با توجه به اینکه سرمایه‌گذاران منتظر داده‌های حقوق و دستمزد غیرکشاورزی ایالات متحده آمریکا بودند تا تعیین شود که آیا نرخ‌های بهره زودتر از حد انتظار در سال جاری کاهش خواهد یافت یا خیر، قیمت طلا روز پنج‌شنبه (۱۴۰۳/۰۳/۱۷) افزایش یافت. بهای هراونس طلا پس از افزایش بیش از یک درصدی در روز چهارشنبه (۱۴۰۳/۰۳/۱۶)، با ۰.۴ درصد افزایش به ۲,۳۶۵.۴ دلار رسید. قیمت طلای آمریکا با ۰.۴ درصد افزایش به ۲,۳۸۴.۵ دلار رسید. شاخص دلار آمریکا ۰.۱ درصد کاهش یافت، در حالی که بازدهی شاخص خزانه‌داری ۱۰ ساله ایالات متحده آمریکا نزدیک به پایین‌ترین سطح دو ماهه خود باقی ماند و طلا را برای سرمایه‌گذاران جذاب‌تر کرد. حقوق و دستمزدهای خصوصی ایالات متحده آمریکا در ماه مه کمتر از حد انتظار افزایش یافت. سرمایه‌گذاران اکنون منتظر داده‌های حقوق و دستمزد غیرکشاورزی هستند که قرار است در روز جمعه منتشر شود تا سلامت اقتصاد ایالات متحده را بسنجند.
- تالارهای بورس کالای ایران در روز شنبه ۱۲ خرداد ماه میزبان دادوستد ۱,۷۰۰,۷۶۵ تن بود. بیشترین حجم معاملات امروز مربوط به سیمان بود و ۹۲۶,۱۶۱ تن از این محصول در تالار سیمان فروخته شد. در تالار محصولات صنعتی و معدنی ۲۹۲,۰۰۰ تن گندله سنگ آهن، ۱۶۹,۲۵۰ تن آهن اسفنجی، ۲۰,۸۵۲ تن میلگرد، ۲۷,۲۰۰ تن شمش بلوم، ۴۰,۸۹۳ تن ورق گرم، ۳۲,۸۵۰ تن ورق سرد خودرو، ۱۳,۷۵۰ ورق گالوانیزه خودرو، ۱۰,۰۰۰ تن ورق سرد و ۲,۴۲۲ تن تیرآهن مورد معامله قرار گرفت. ۲۴,۰۰۰ تن لوب کات، ۶,۶۹۰ تن مواد پلیمری، ۳,۶۲۳ تن مواد شیمیایی، ۱,۰۹۵ تن گوگرد گرانوله، ۹۲۵ تن قیر، ۶۲۰ تن آرگون در تالار پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی به فروش رسید. تالار صادراتی معامله ۵۷,۶۴۷ تن قیر و ۵۰۰ کیلوگرم سبد زعفران را تجربه کرد.
- ▼ چین، بزرگترین تولید و مصرف‌کننده فولاد ضد زنگ جهان، پس از افزایش تولید در ماه مارس، شاهد افزایش تولید در ماه آوریل نیز بود؛ درحالیکه مطابق گذشته تقاضا و قیمت‌ها همچنان تحت فشار باقی ماندند. در ماه آوریل، تولید فولاد ضد زنگ چین به افزایش خود ادامه داد و به بالاترین سطح از سپتامبر در مجموع به ۳.۲۲ میلیون تن رسید که پس از افزایش ۲۴ درصدی در ماه مارس، ۶۴,۱۰۰ تن (معادل ۲ درصد) دیگر افزایش یافت. در همین حین و در ماه آوریل، تقاضا برای فولاد ضد زنگ از صنعت لوازم خانگی چین رشد آهسته‌تری را نشان داد، اما همچنان مثبت باقی ماند که پیش‌بینی می‌شود به تدریج در ماه‌های می و ژوئن این تقاضا کاهش یابد ولی همچنان بالاتر از میانگین پنج ساله باقی بماند. علیرغم کاهش تأثیر قیمت بر روند تولید، حمایت پایه تحت تأثیر سیاست‌های داخلی و نوسانات فصلی، در میان فشارهای عرضه بالا همچنان ادامه دارد.
- ▼ عربستان قیمت رسمی فروش نفت سبک عرب برای تحویل به خریداران آسیایی را کاهش داد. به گزارش رویترز، قیمت رسمی فروش نفت سبک عرب به بازار آسیا برای تحویل در ماه ژوئیه ۵۰ سنت در هر بشکه نسبت به ماه ژوئن کاهش یافته و ۲.۴ دلار در هر بشکه بالاتر از شاخص عمان/دبی به فروش می‌رسد. قیمت فروش سایر درجات نفتی عربستان به خریداران آسیایی هم بین ۴۰ تا ۶۰ سنت در هر بشکه پایین آمده است. این کاهش قیمت نشان می‌دهد عربستان علی‌رغم کاهش جهانی قیمت نفت به دنبال برگزاری اجلاس اوپک پلاس، به جای قیمت بر سهم بازار تمرکز کرده است. اوپک پلاس با اعلام اینکه کاهش تولید داوطلبانه برخی از اعضا به تدریج برداشته خواهد شد، بازار را شگفت زده کرد. البته عربستان قصد دارد کاهش تولید خود را در سال آینده میلادی هم ادامه دهد.
- ▲ اوپک پلاس تصویب کرد کاهش تولید ۳.۶۶ میلیون بشکه‌ای خود را تا پایان ۲۰۲۵ ادامه دهد و کاهش تولید داوطلبانه ۲.۲ میلیون بشکه‌ای برخی از اعضا هم سه ماه دیگر و تا پایان ۲۰۲۴ تمدید شود. به گزارش رویترز، ائتلاف اوپک پلاس در روز یکشنبه تصمیم گرفت طرح کاهش تولید خود را در ۲۰۲۵ هم ادامه دهد. این گروه به دنبال حمایت از بازار نفت در بحبوحه رشد ضعیف تقاضا، نرخ بالای بهره و افزایش تولید نفت آمریکا است. نفت خام برنت در روزهای اخیر حدود ۸۰ دلار در هر بشکه معامله می‌شود، یعنی پایین‌تر از سطحی که بیشتر کشورهای عضو اوپک پلاس برای متعادل کردن بودجه خود نیاز دارند. نگرانی نسبت به رشد آهسته تقاضا در چین به عنوان بزرگترین وارد کننده نفت دنیا و همچنین افزایش ذخایر نفت کشورهای توسعه یافته بر قیمت این کالا تأثیر گذاشته است. سازمان کشورهای صادرکننده نفت و متحدانش در ائتلاف اوپک پلاس تولید خود را از اواخر ۲۰۲۲ پایین آورده‌اند.
- منابع آگاه اعلام کردند شرکت ریلاینس هند، اپراتور بزرگ‌ترین مجتمع پالایشگاهی جهان، قراردادی یک ساله با شرکت دولتی روسنفت روسیه برای پرداخت دست‌کم ۳ میلیون بشکه نفت خریداری‌شده در ماه به روبل امضا کرده است. پس از آنکه ولادیمیر پوتین، رئیس‌جمهوری روسیه، از مسکو و شرکای تجاری این کشور خواست به منظور تسهیل تجارت با وجود تحریم‌های آمریکا و اروپا، جایگزینی برای سیستم مالی غرب پیدا کنند، روش پرداخت به روبل تغییر کرد. قرارداد مدت‌دار با روسنفت همچنین به شرکت ریلاینس کمک می‌کند همزمان با پیش‌بینی‌ها درباره تداوم کاهش تولید تولیدکنندگان نفت سازمان کشورهای صادرکننده نفت (اوپک) و متحدانش (اوپک‌پلاس)، خرید نفت با تخفیف را تضمین کند.



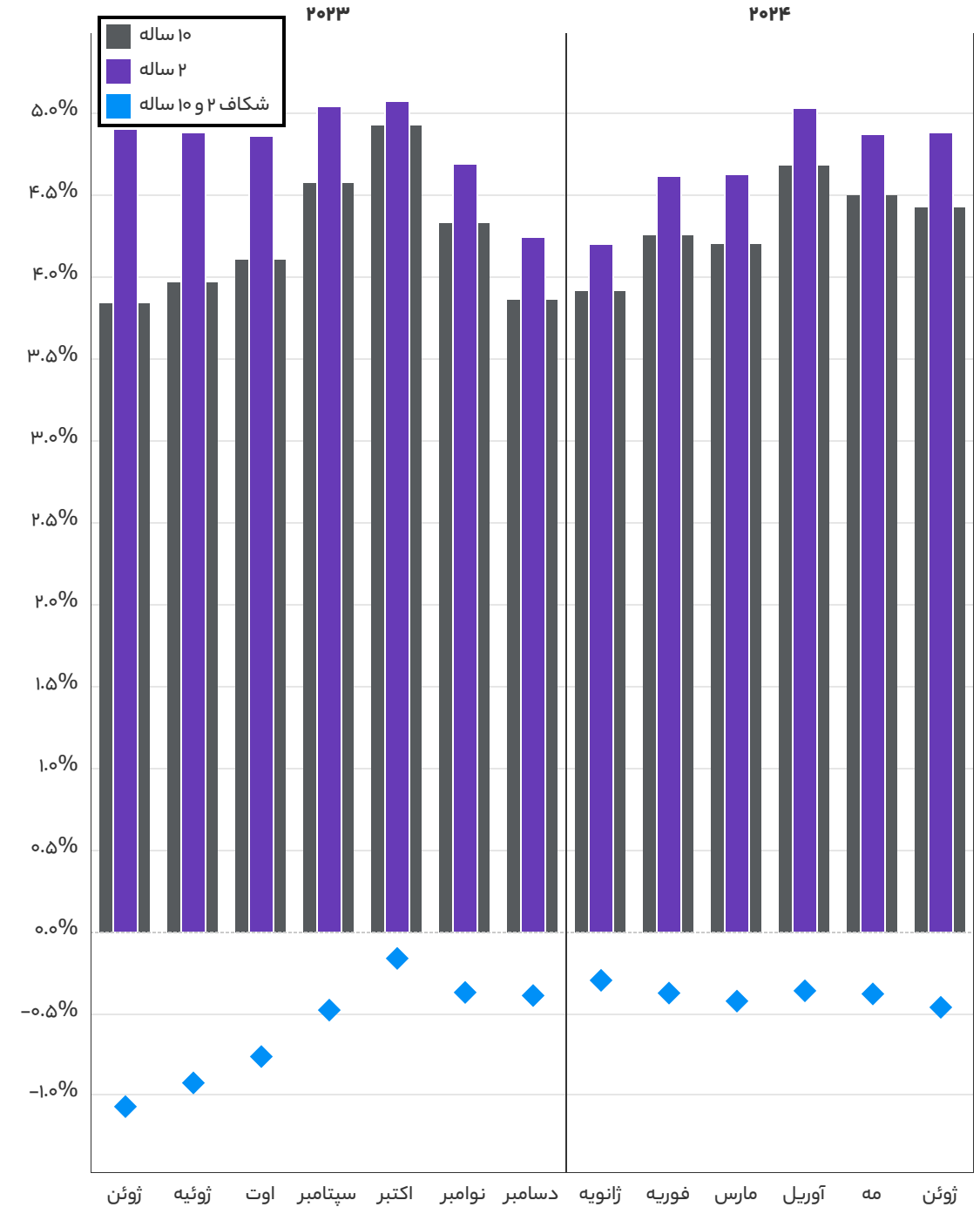
شاخص قیمت مصرف کننده در آمریکا

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

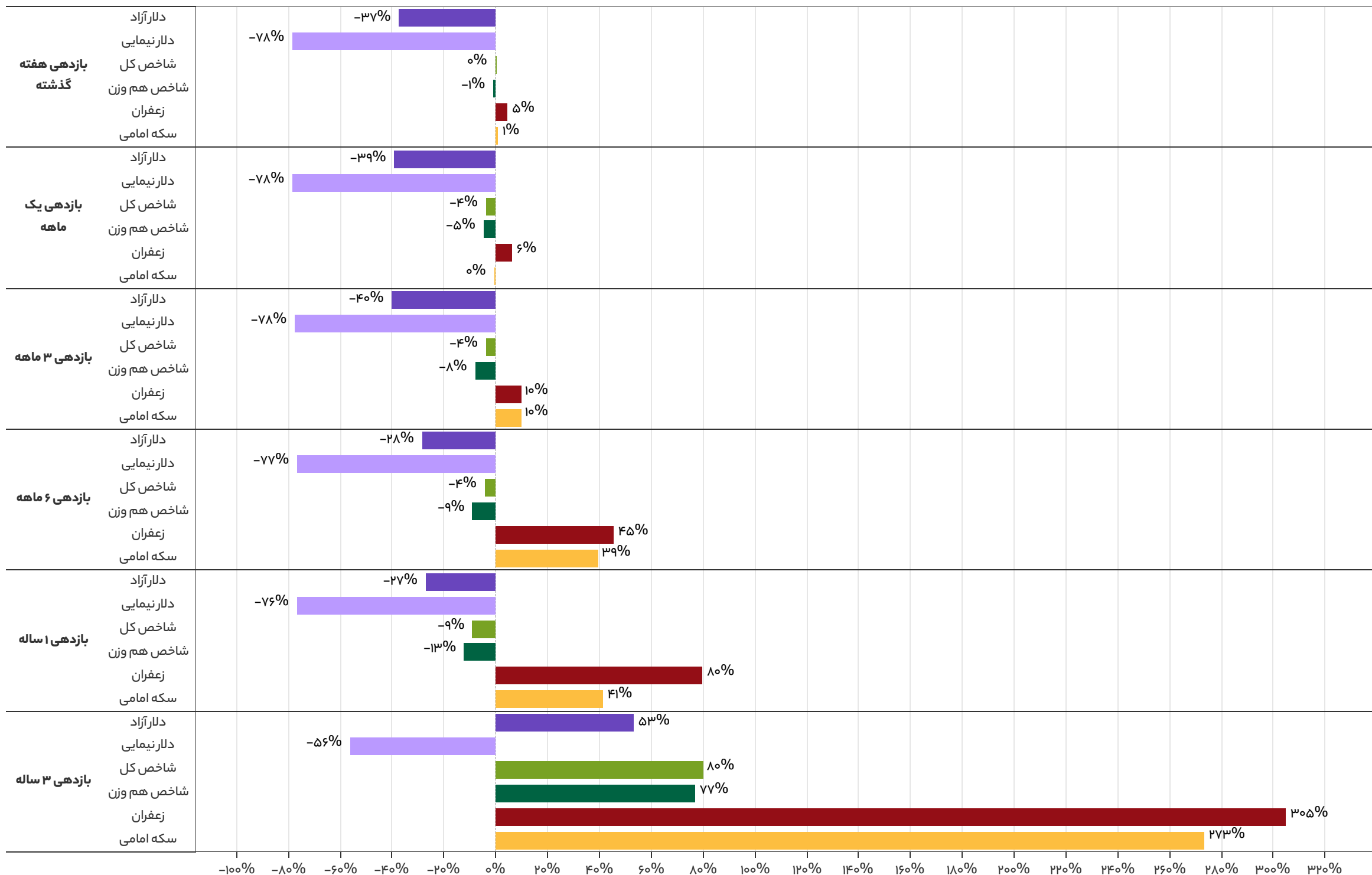
EQUITY MARKET

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%

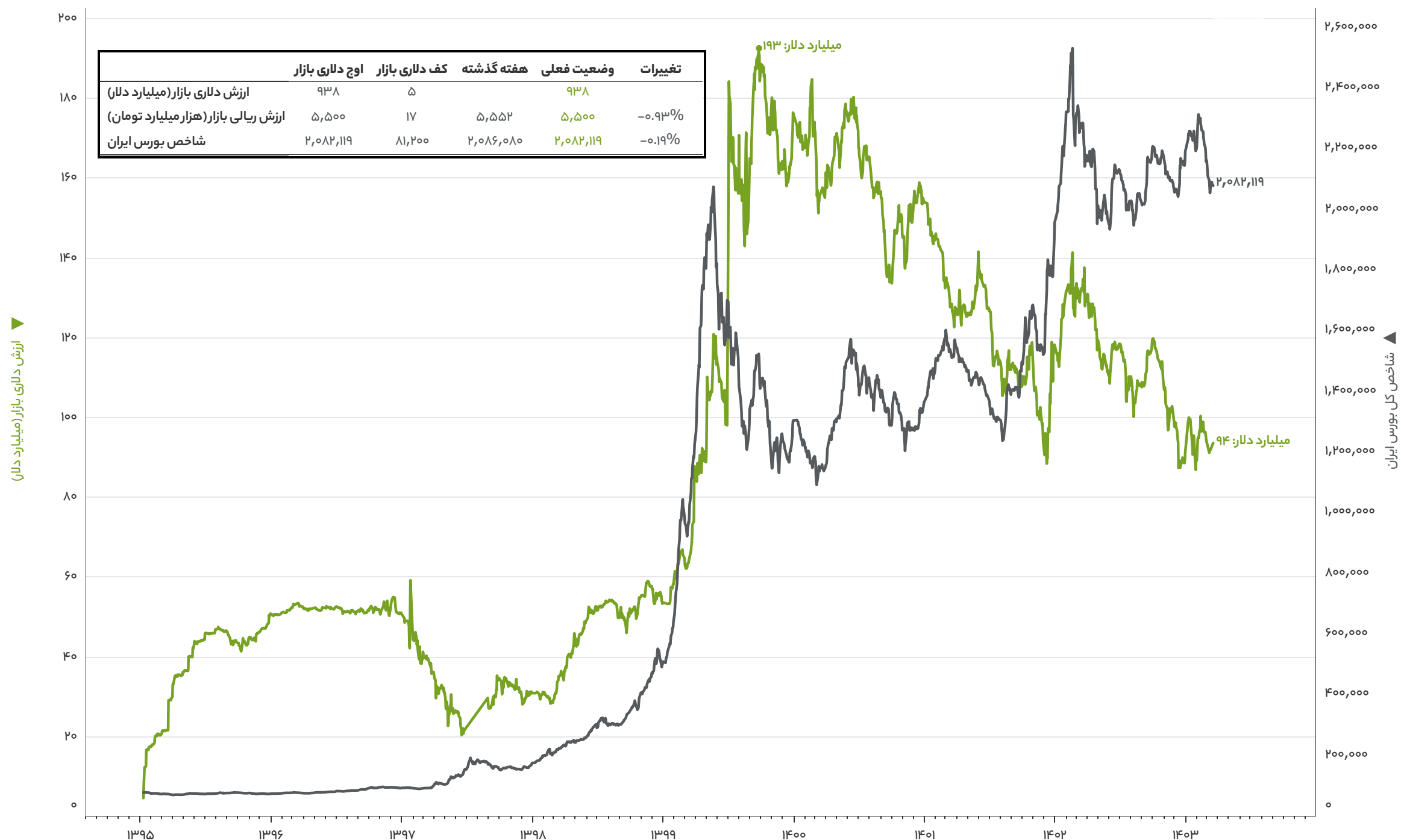
– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

– 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

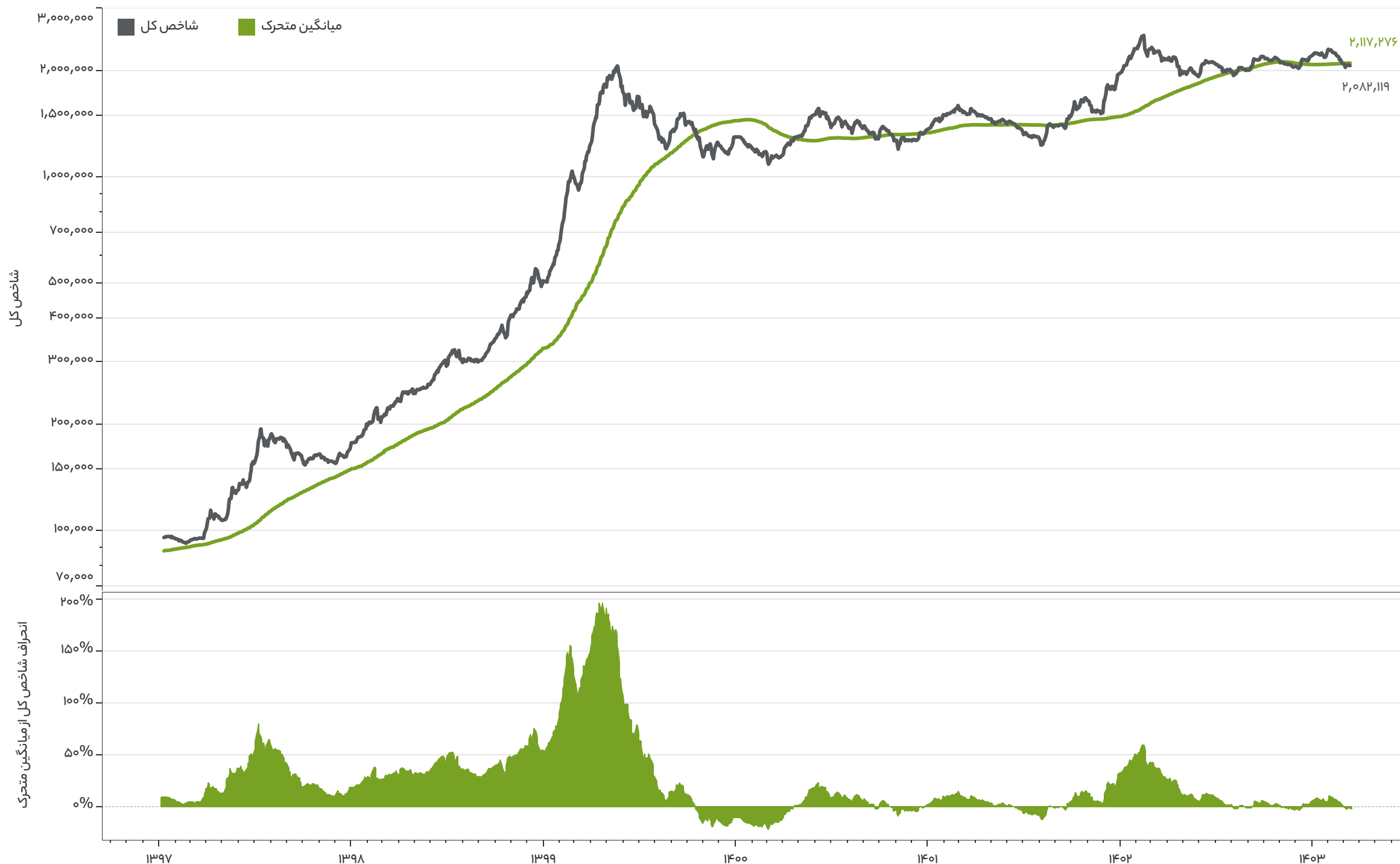
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





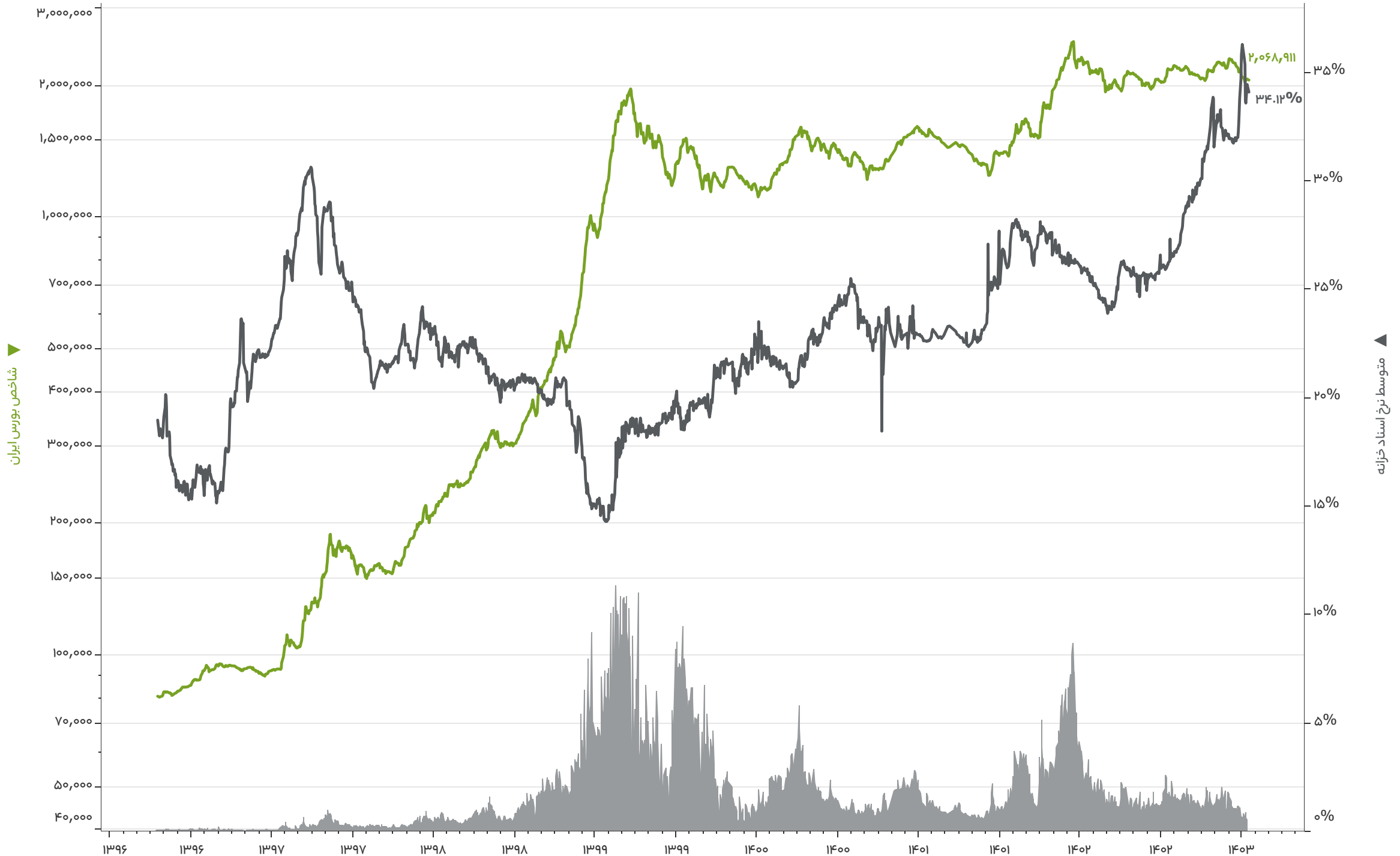
شاخص کل و میانگین متحرک

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



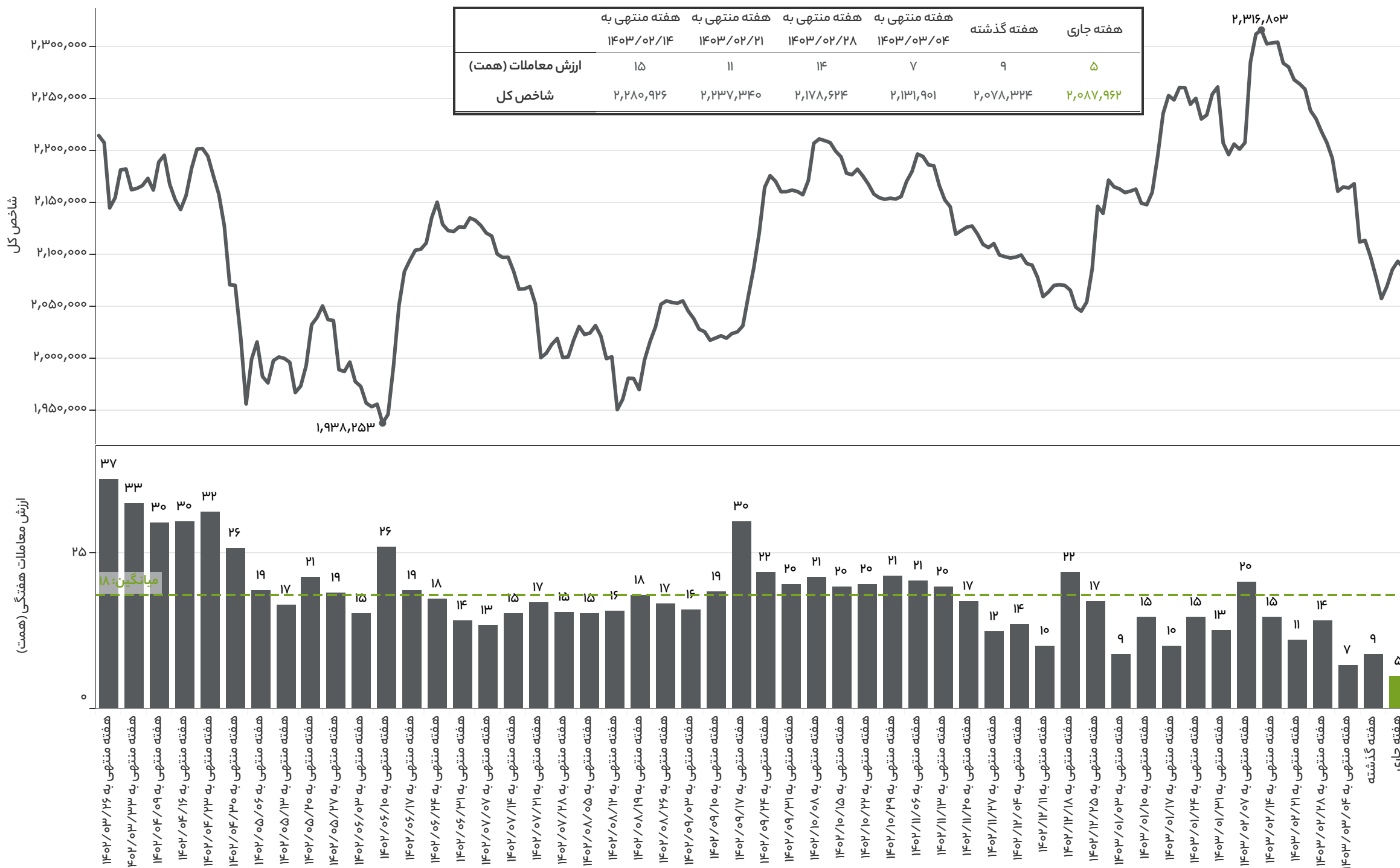
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



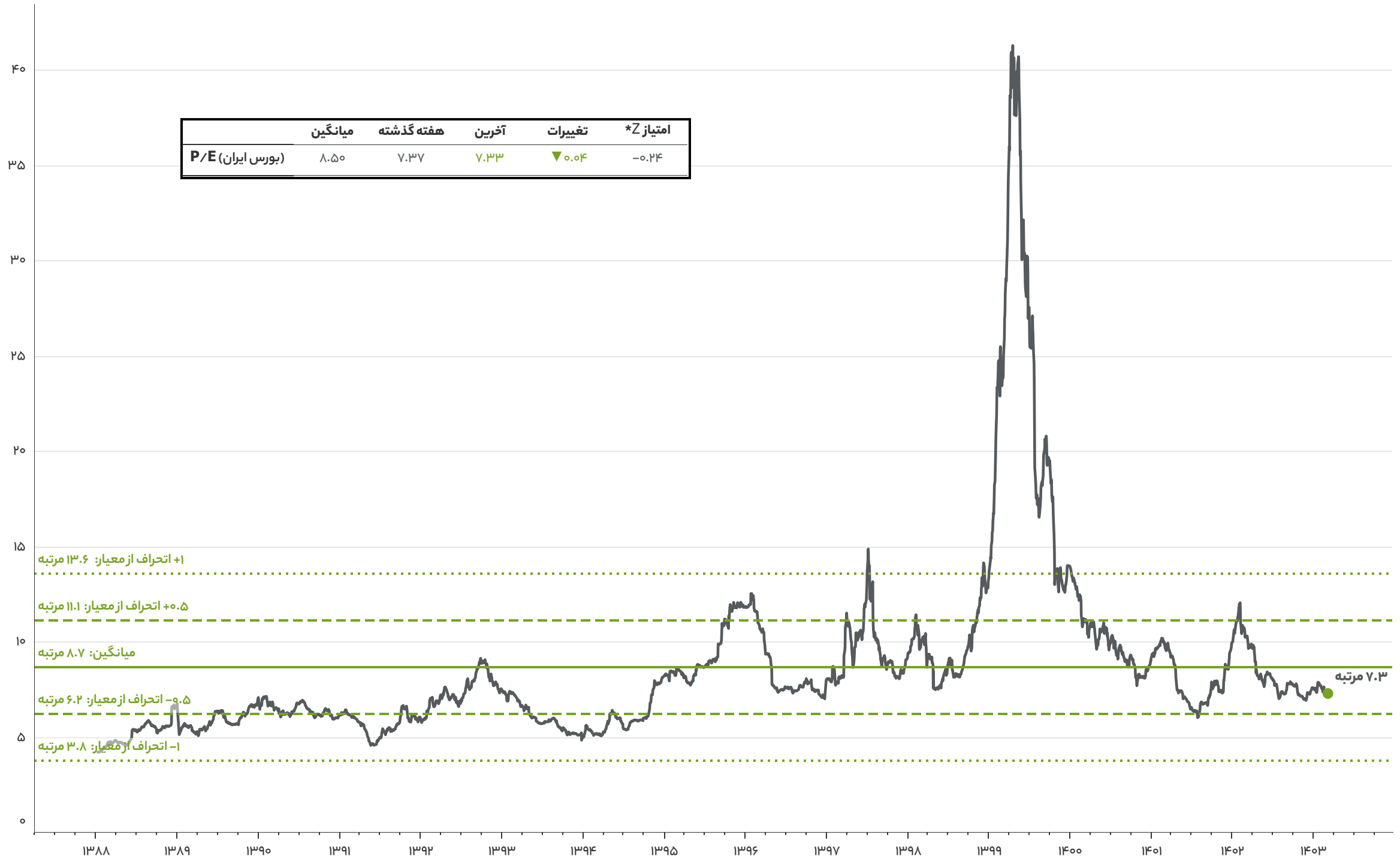
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.



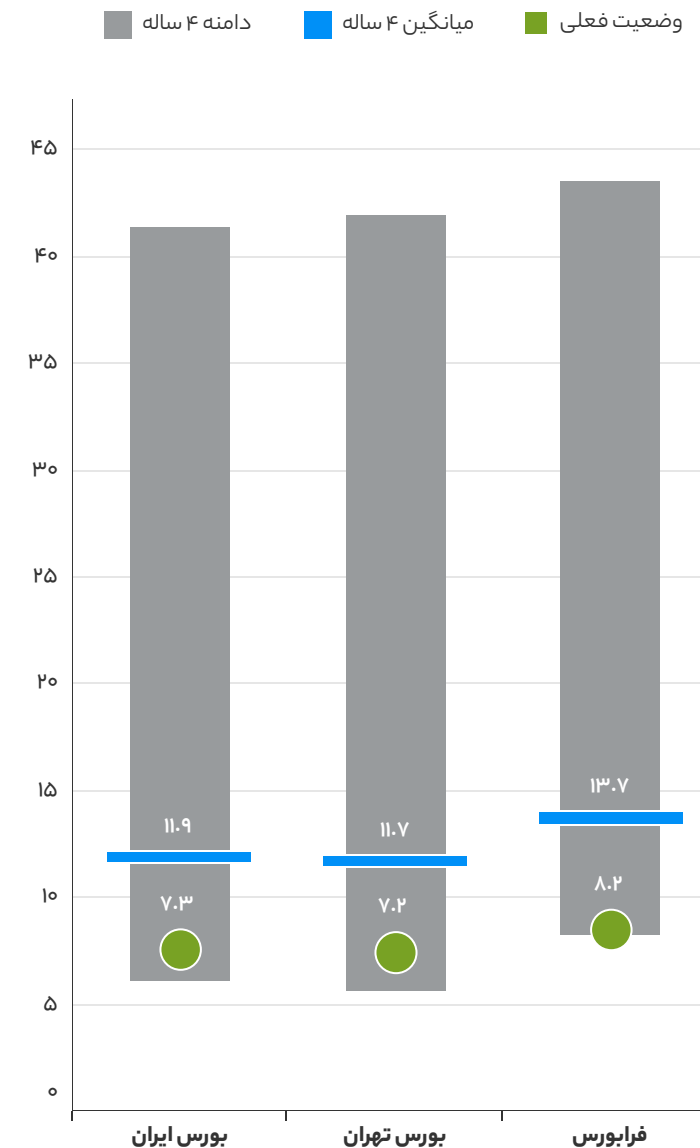
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۷.۳۳	۷.۳۷	۶.۰۷	۱۱.۸۹	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۱۹	۷.۲۳	۵.۶۴	۱۱.۷۰	۴۱.۹۹
فرابورس	۸.۲۲	۸.۲۸	۸.۲۰	۱۳.۷۲	۴۳.۵۱

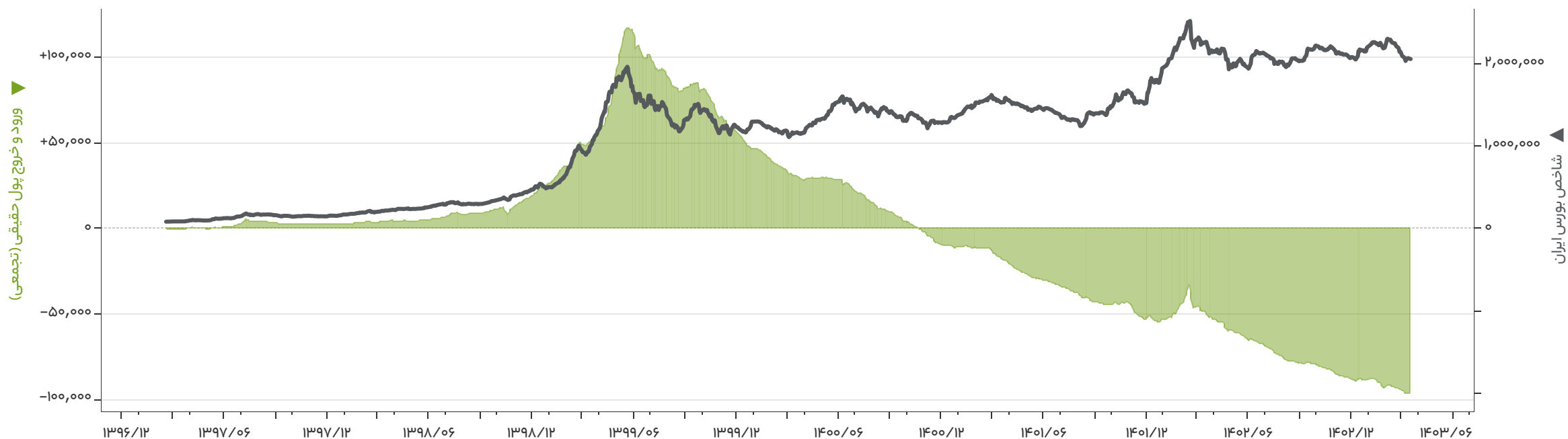


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	ارتباطات	یوتیلیتی	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای	مصرفی دوره‌ای	انرژی	خدمات مالی	مواد پایه	
تعداد سهام	۲۸	۵	۱۱	۱۹	۴۰	۶۳	۸۹	۶۶	۶	۱۹۹	۱۸۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۵۶	۹۱	۹۴	۱۱۱	۱۳۲	۱۶۸	۱۸۷	۳۴۰	۵۹۱	۲,۹۲۸	۳,۲۹۴	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۷%	۱.۱%	۱.۲%	۱.۴%	۱.۷%	۲.۱%	۲.۳%	۴.۲%	۷.۴%	۳۶.۶%	۴۱.۲%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۸.۰	۹.۶	۷.۰	۱۵.۰	۸.۸	۷.۷	۸.۷	۳.۹	۵.۱	۶.۶	۷.۸	سودآوری
بازده سود نقدی	۵.۳%	۴.۳%	۱۶.۴%	۶.۵%	۱۳.۶%	۴.۳%	۵.۹%	۳.۳%	۱۵.۲%	۱۱.۱%	۱۰.۰%	
نسبت تقسیم سود	۴۲%	۴۱%	۱۰۰%	۷۳%	۶۱%	۳۷%	۵۲%	۳۴%	۶۳%	۶۲%	۷۲%	
بتا به شاخص کل	۰.۹	۱.۴	۱.۱	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)	+۶۶۵%	+۹۰%	+۸۱۵%	+۳۰۴%	+۳۳۵%	+۳۸۸%	+۳۷۱%	+۷۹۱%	+۷۷۱%	+۷۸۸%	+۱۰۰۷%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۶%	-۷۰%	+۱۳۴%	+۱%	+۳%	-۱۵%	-۱۸%	-۲۰%	+۱۳%	-۷%	+۶۹%	
بازده از ابتدای سال	+۲۴۲%	+۲۲%	+۴۸%	+۷۵%	+۷۳%	+۸۹%	+۳۹%	+۷۷%	+۸۵%	+۵۷%	+۹۲%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	-۱%	۰%	-۱%	-۱%	-۱%	-۲%	۲%	-۱%	۰%	۰%	

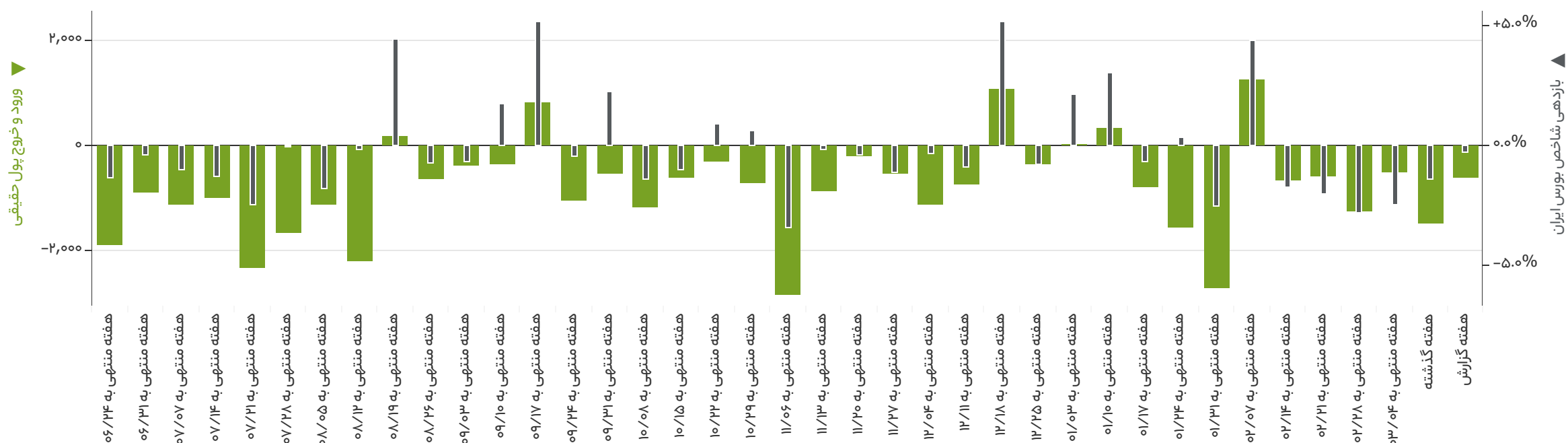
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



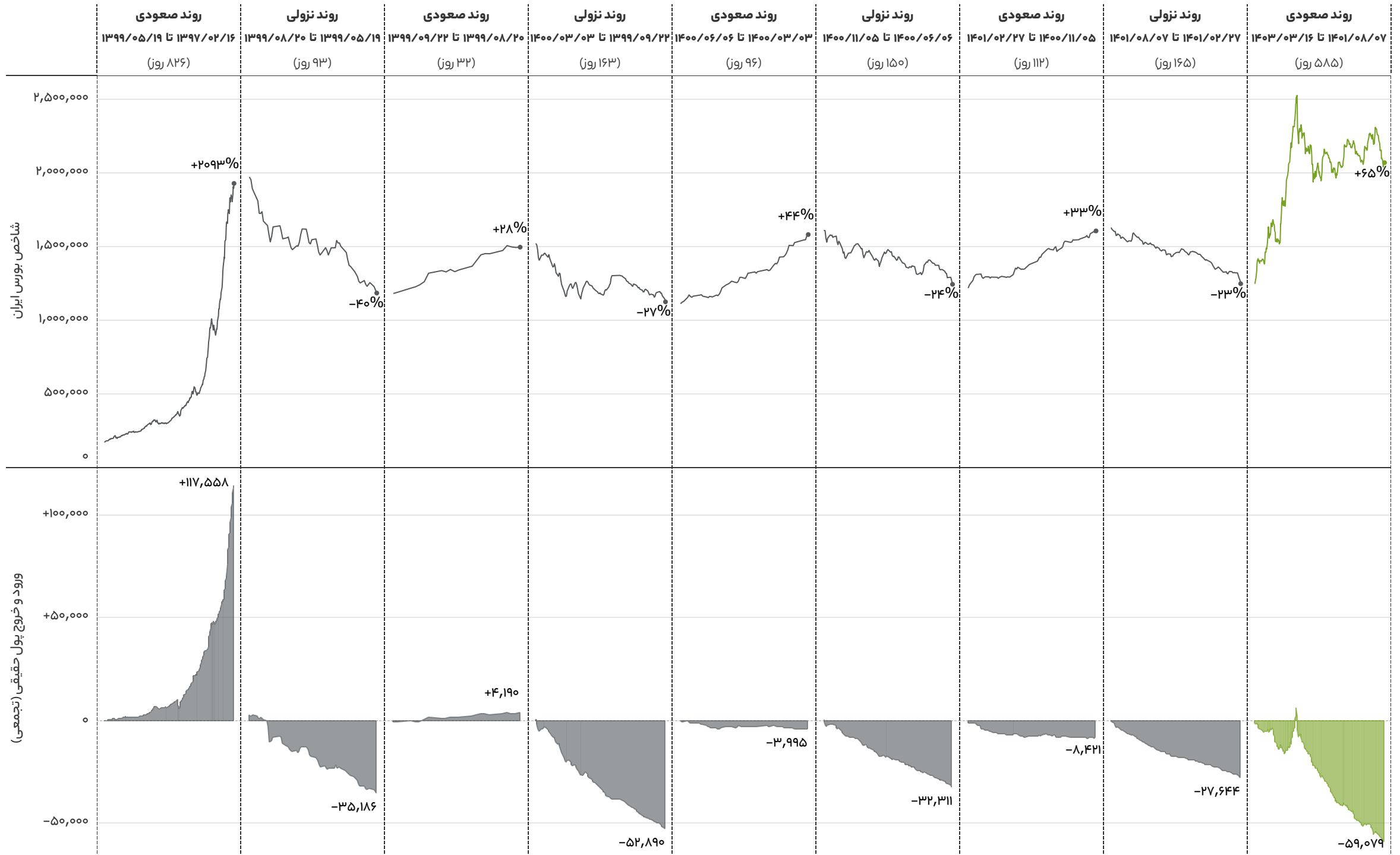
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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

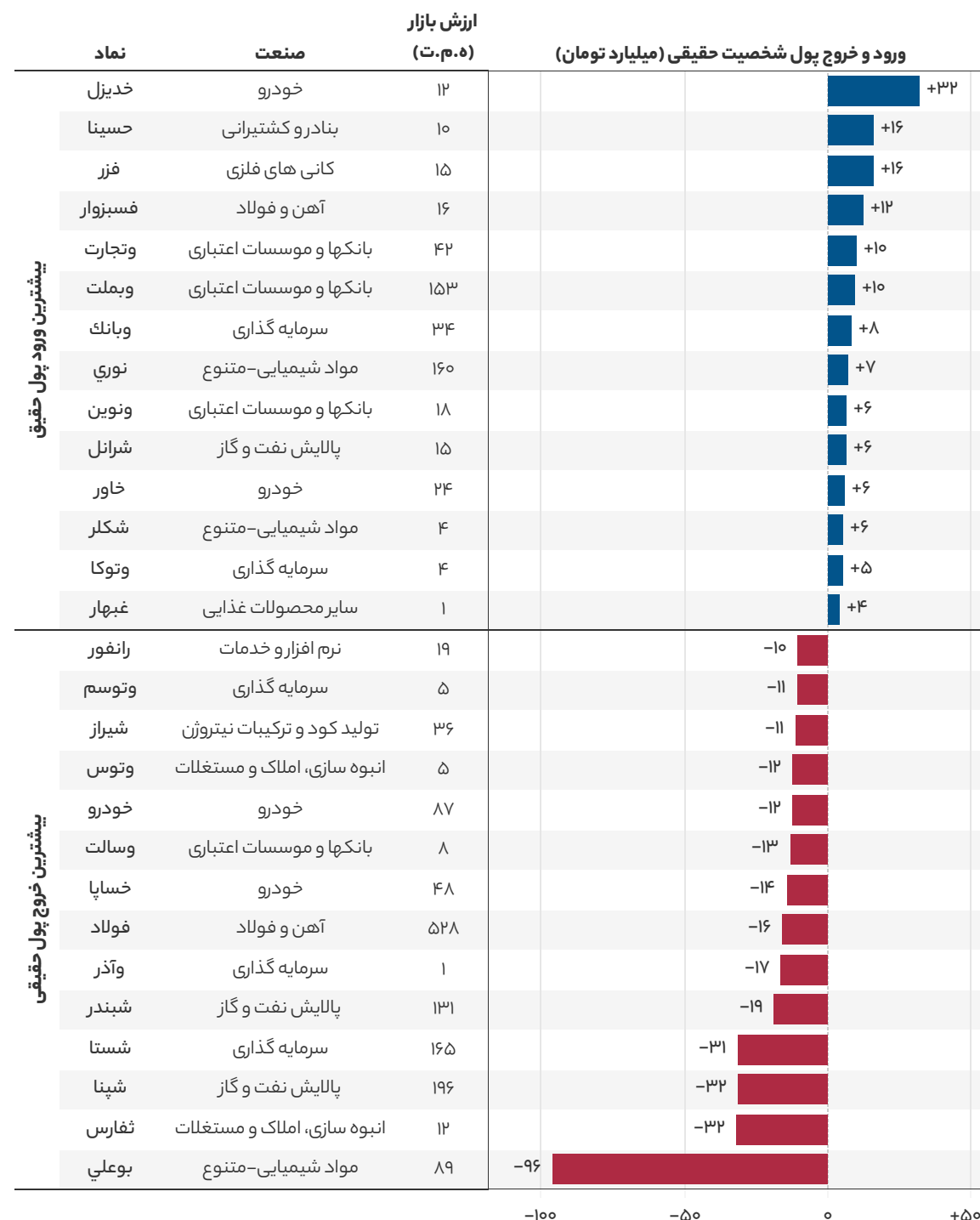




ورود و خروج پول

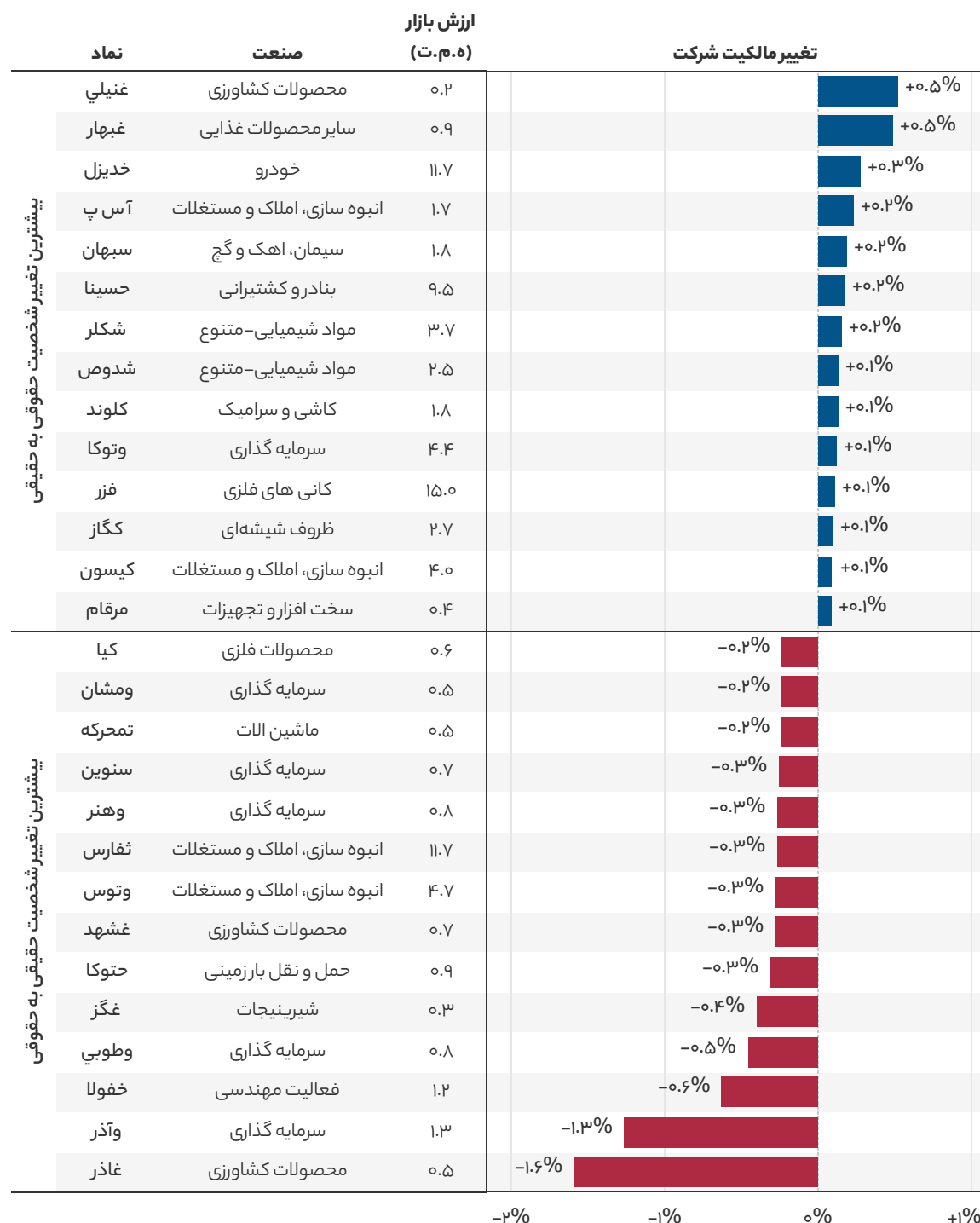
ورود و خروج پول حقیقی

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



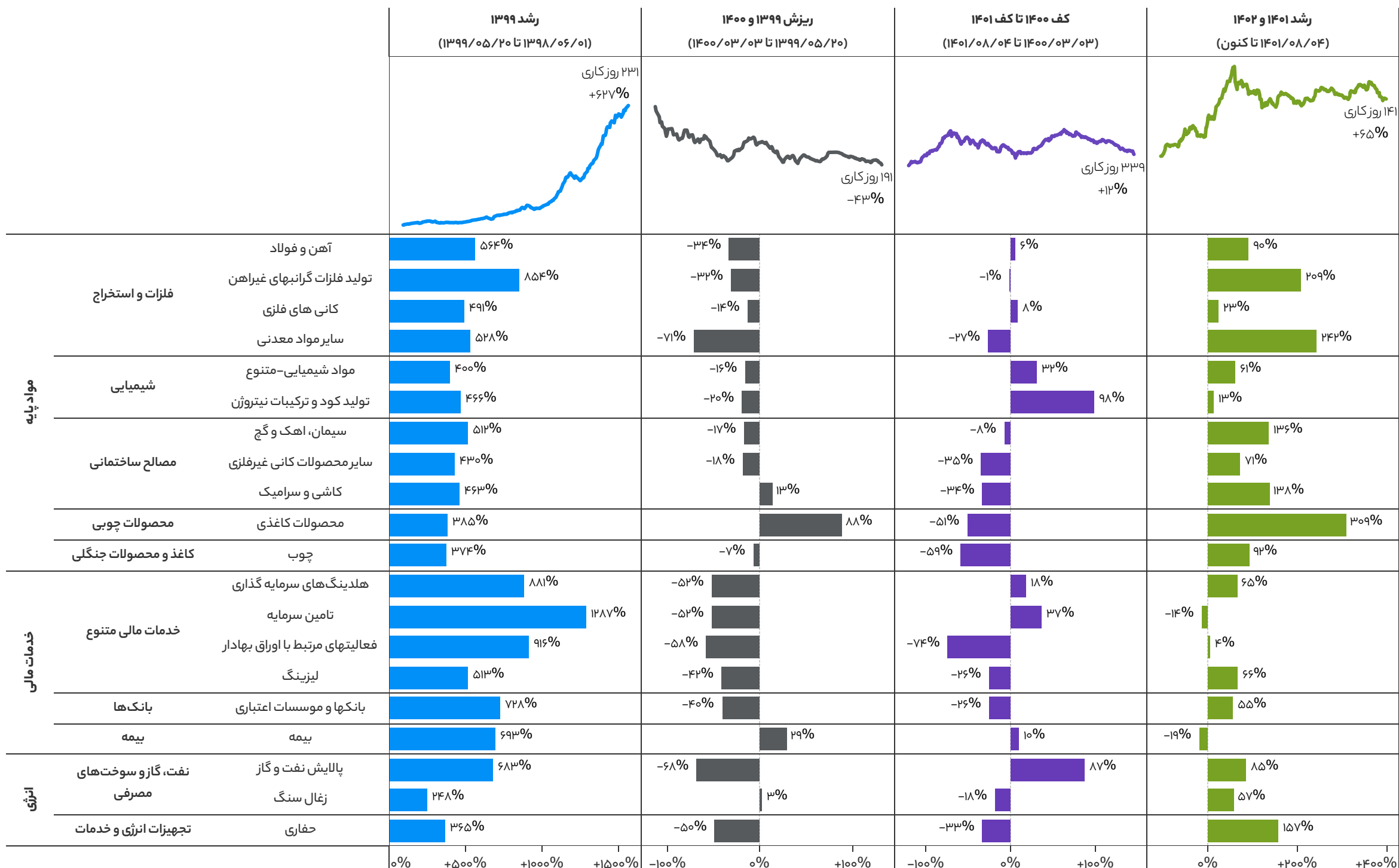
تغییر مالکیت شرکت

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



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

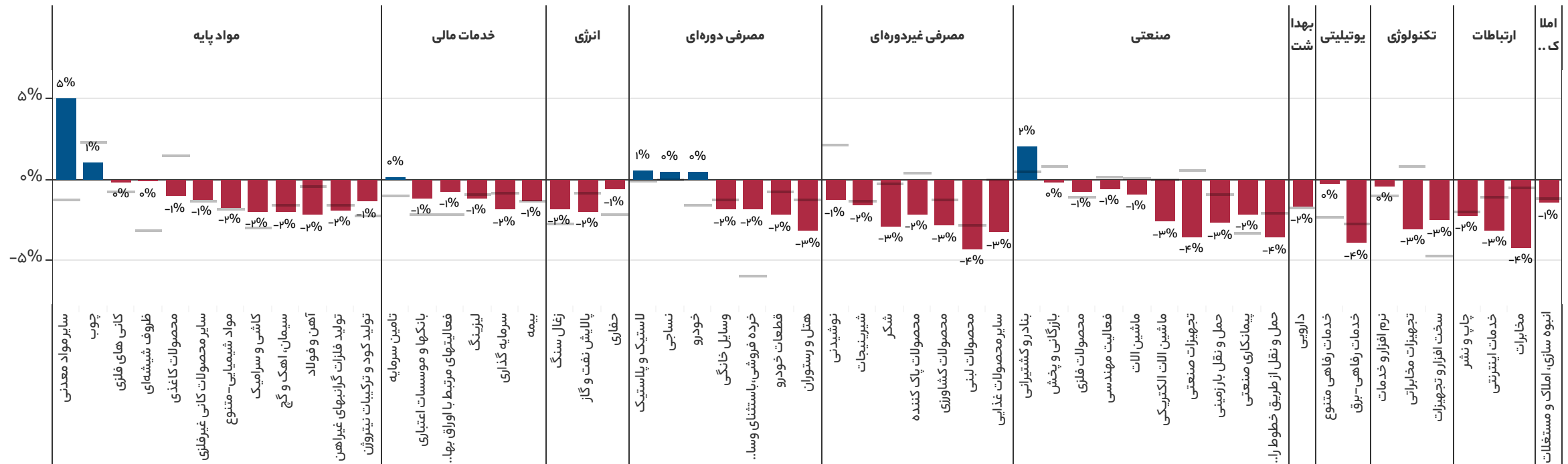


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲			کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		رشد ۱۳۹۹	
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۴۷%	۱۳%		-۷۰%	۱۲۴۷%	
		قطعات خودرو	۴۶%	-۲۵%	-۳۲%	۶۷۶%		
		لاستیک و پلاستیک	۱۴۷%	-۴۲%	-۳۴%	۶۳۱%		
	خرده فروشی	۱۴۰%	۳%	-۲۳%	۱۱۲۹%			
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۱۳۵%	-۳۶%	-۴۶%	۴۹۰%		
		نساجی	۱۳۲%	-۳۵%	-۲۱%	۳۸۰%		
مصرفی غیردوره‌ای	خدمات مصرف کننده	۴%	۱۸%	-۶۷%	۱۱۶۶%			
	غذا و نوشیدنی	سایر محصولات غذایی	۳۲%	-۳۹%	-۳۴%	۶۹۹%		
		محصولات کشاورزی	۲۲%	۹%	-۳۵%	۳۹۷%		
		شکر	۶۳%	-۴۴%	-۲۲%	۴۳۵%		
		شیرینیجات	۳۷%	-۶۳%	-۲۴%	۵۹۵%		
		محصولات لبنی	۱۰۹%	-۵۴%	۷%	۳۸۳%		
نوشیدنی		۴۸%	-۳۱%	-۱۵%	۵۳۹%			
صنعتی	محصولات پاک کننده	۲۰%	-۱۲%	۴%	۳۰۶%			
	کالاهای سرمایه‌ای	فعالیت مهندسی	۶۱%	-۷%	-۶۳%	۵۲۱%		
		ماشین الات الکتریکی	۶۰%	-۲۳%	-۴۵%	۵۰۱%		
		ماشین الات	۱۴۰%	-۳۱%	-۳۵%	۴۲۲%		
		محصولات فلزی	۸۶%	-۴۴%	-۵۴%	۶۴۵%		
		تجهیزات صنعتی	۴۳%	-۴۰%	-۳۰%	۸۴۷%		
پیمانکاری صنعتی		۶۷%	-۶۸%	-۱۵%	۵۲۵%			
ترابری	بنادر و کشتیرانی	۲۳۵%	-۱۵%	-۲۲%	۲۴۶%			
	حمل و نقل از طریق راه آهن	۲۵%	-۴۱%	-۱۳%	۳۲۷%			
	حمل و نقل بار زمینی	۴۶%	۳۳%	-۱۸%	۲۵۰%			
بهداشت	دارویی	۷۳%	-۱۳%	-۳۲%	۳۲۱%			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	۵۳%	۲%	-۳۵%	۲۵۲%			
	سخت افزار و تجهیزات	۱۹۳%	-۴۵%	-۶۵%	۵۷۰%			
یوتیلیتی	یوتیلیتی	۴۸%	۱۳۱%	-۳۵%	۳۱۰%			
			-۳۳%	-۵۴%	۱۷۶%			
ارتباطات	مخابرات	۱۹%	-۱۳%	-۷۱%	۵۳۲%			
	چاپ و نشر	۱۴۹%	-۵۲%	-۵۲%	۲۲۳%			
املاک و مستغلات	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۴۲%	-۴۵%	-۴۳%	۶۱۹%			
		۰%	۰%	۰%	۰%	۰%	۰%	

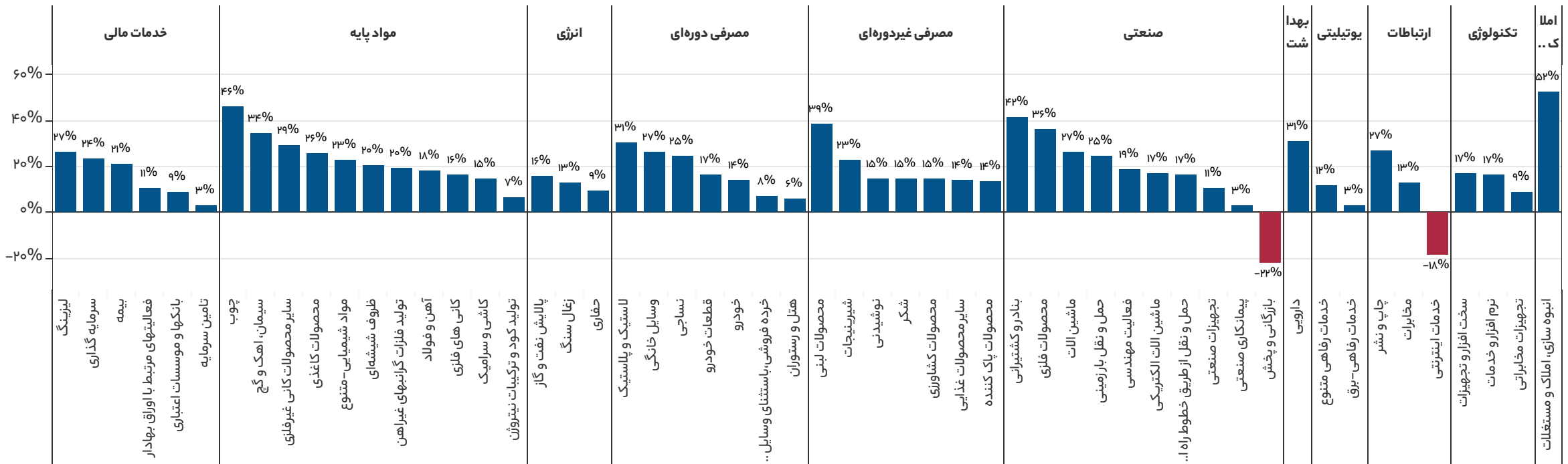
بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده براساس 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

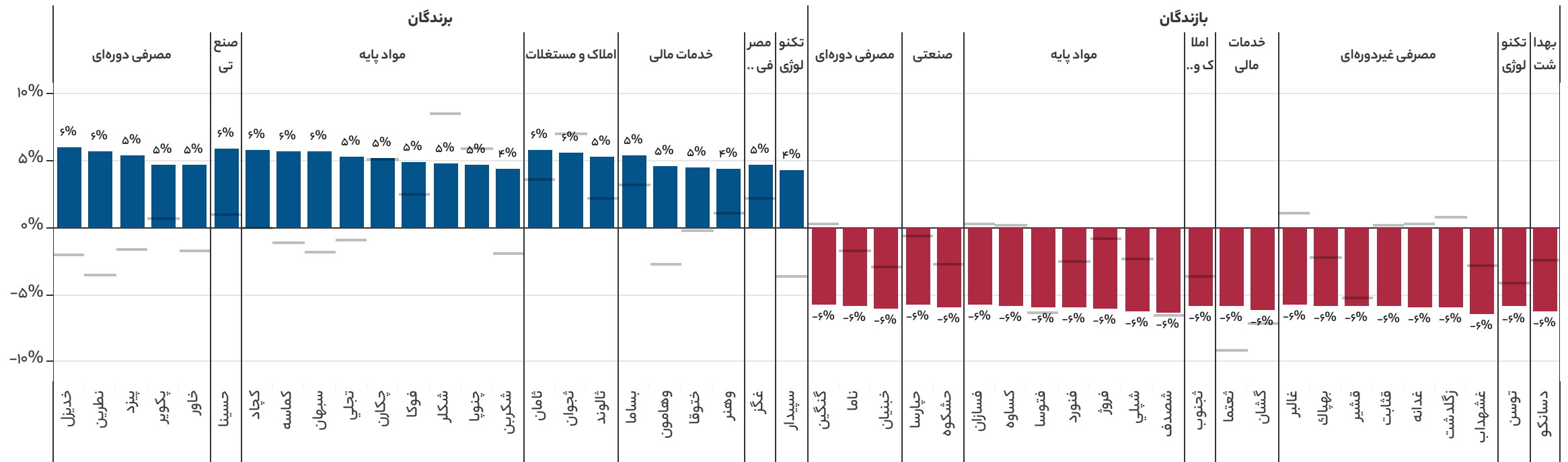
(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)



برندگان و بازندگان هفته

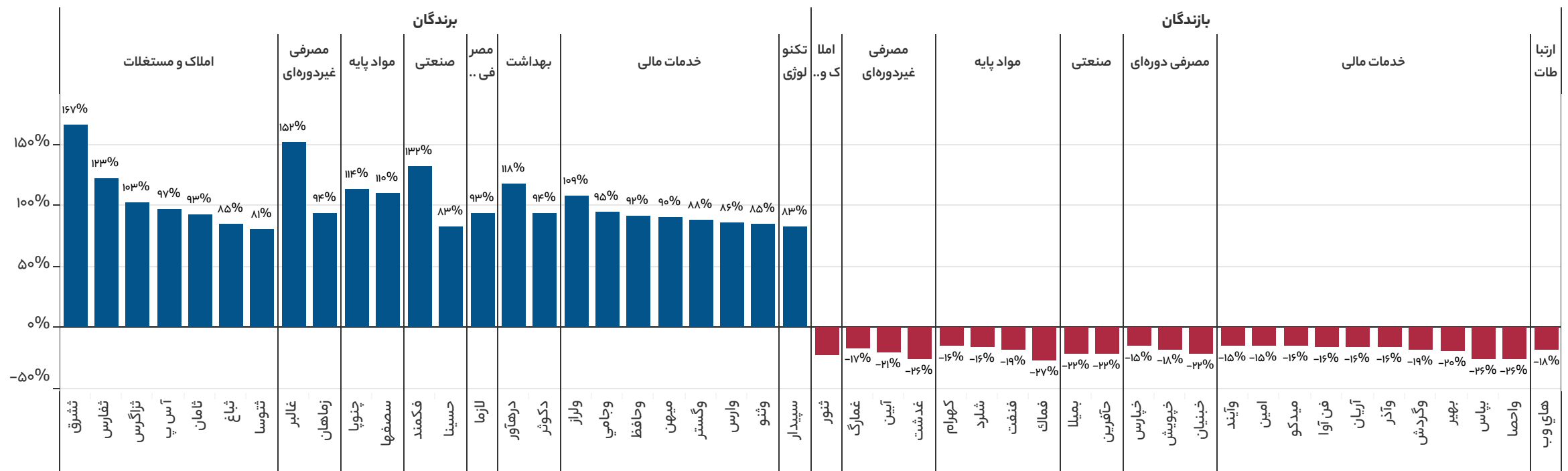
برندگان و بازندگان هفته

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



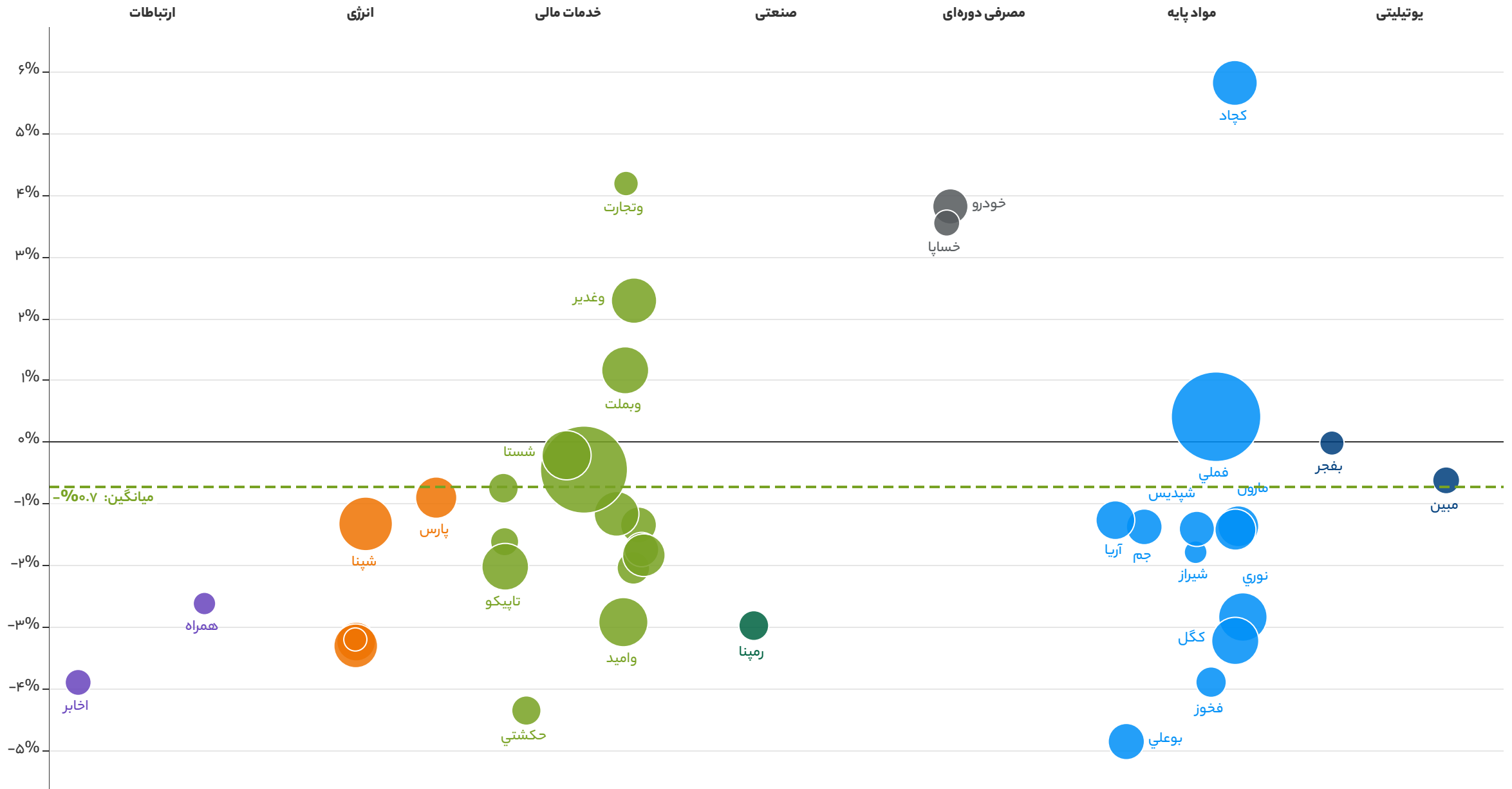
برندگان و بازندگان سال

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



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

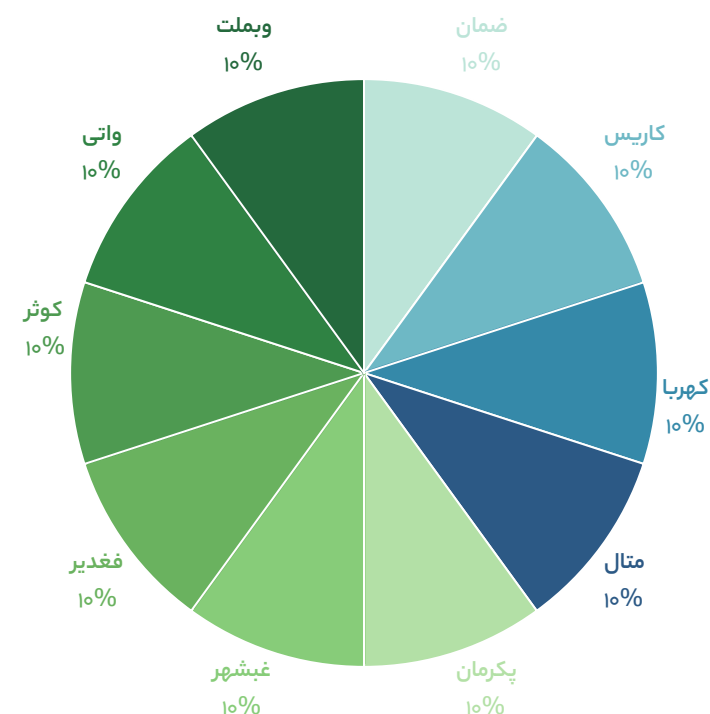


بازدهی	حکشتی	اخابر	فخوز	شبندر	شتان	کگل	شبریز	رمپنا	وامید	نوری	همراه	و صندوق	تاپیکو	پارسان	شیراز	ویاسار	تامپکو	کگهر	شپدیس	جم	ماون	وومعاند	شپنا	آریا	میدکو	پارس	نیاس	مبین	فارس	شتتا	بفجر	فملی	وبملت	وغدیر	خسپا	خودرو	وتجارت	کچاد	بازدهی هفته گذشته
-۴.۸٪	-۴.۳٪	-۳.۹٪	-۳.۹٪	-۳.۳٪	-۳.۲٪	-۳.۲٪	-۳.۲٪	-۳.۰٪	-۲.۹٪	-۲.۸٪	-۲.۶٪	-۲.۰٪	-۲.۰٪	-۱.۸٪	-۱.۸٪	-۱.۷٪	-۱.۶٪	-۱.۴٪	-۱.۴٪	-۱.۴٪	-۱.۳٪	-۱.۳٪	-۱.۳٪	-۱.۲٪	-۱.۱٪	-۰.۹٪	-۰.۷٪	-۰.۶٪	-۰.۴٪	-۰.۲٪	۰٪	+۰.۴٪	+۱.۲٪	+۲.۳٪	+۳.۶٪	+۳.۸٪	+۴.۲٪	+۵.۸٪	بازدهی هفته گذشته



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۱۹,۲۸۰	مناسب و عملکرد خوب در گزارشات ماهانه (P/E)	۲۵,۰۰۰	پکرمان	میان مدت
۱۰%	۱,۹۷۶	مناسب و پتانسیل حذف ارز ۲۸,۵۰۰ (P/E)	۲,۶۰۰	غبشهر	
۱۰%	۸,۹۷۰	بهره‌برداری از طرح‌های شرکت و نسبت (P/E) مناسب	۱۲,۰۰۰	فغدیر	
۱۰%	۲,۲۵۳	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۳۲,۱۰۰	کوثر	
۱۰%	۶,۳۲۰	مناسب و پتانسیل تقسیم سود بالا (P/E)	۸,۲۰۰	واتی	
۱۰%	۲,۱۵۶	رشد تراز عملیاتی و (P/E) مناسب	۲,۸۰۰	وبملت	
۱۰%	۱۵,۹۶۵	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	---	ضمان	بلند مدت
۱۰%	۲۱,۹۱۲	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب	---	کاریز	
۱۰%	۳۴,۷۷۸	نسبت ریسک به ریوارد مطلوب و محافظت در برابر نوسانات دلار	---	کهربا	
۱۰%	۱۱,۱۳۰	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

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

