

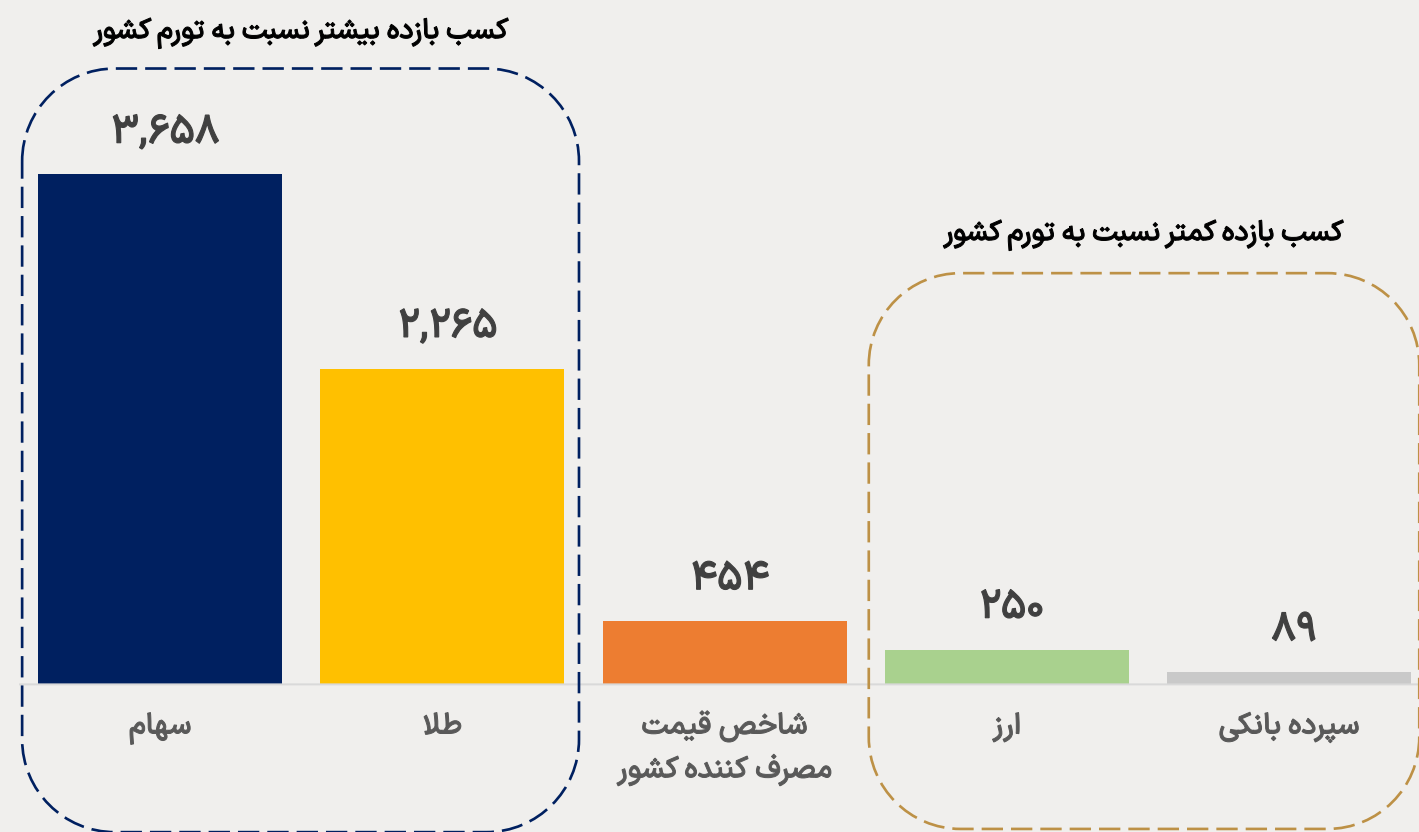
# بررسی بازدهی بازارهای موازی در ایران (۱۴۰۴-۱۳۷۴)

منتهی به پایان تابستان ۱۴۰۴

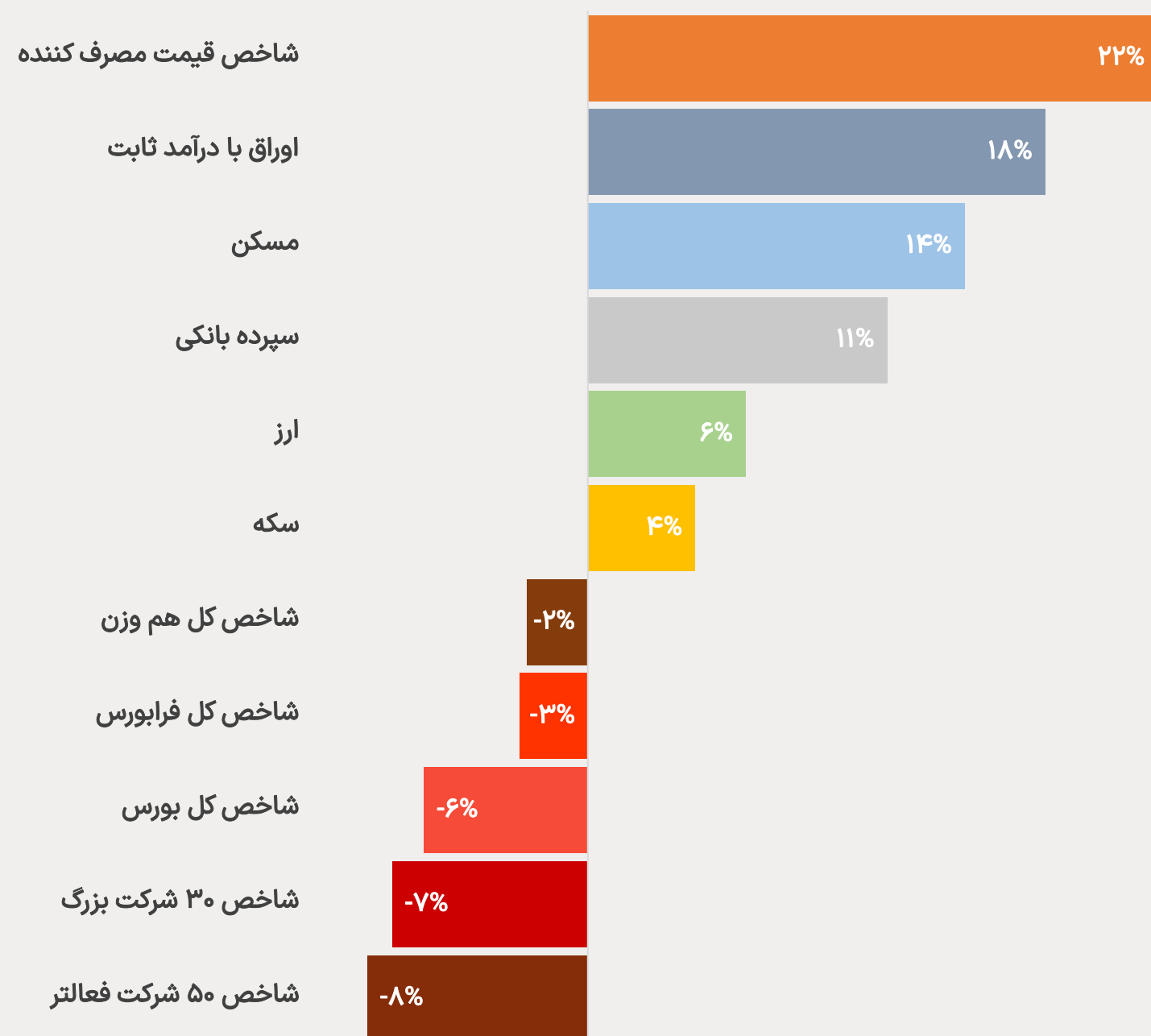


گروه مالی مهرگان تامین پارس  
(سهامی عام)

## بازدهی بازارهای موازی از سال ۱۳۷۴ الی تابستان ۱۴۰۴ (برابر)



## بازدهی بازارهای موازی در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۴ (درصد)



تهیه شده در:

معاونت سرمایه‌گذاری و تامین مالی گروه مالی مهرگان  
مدیریت تحلیل بازار و مطالعات اقتصادی

شماره گزارش: ۱۰۰۹۲-ت/۱۴۰۴ تاریخ انتشار گزارش: مهرماه ۱۴۰۴

## بازدهی ۱۵-۱۰-۵ ساله بازارهای موازی

بازار	ساله ۱۵ (۱۴۰۴-۱۳۸۹)	ساله ۱۰ (۱۴۰۴-۱۳۹۴)	ساله ۵ (۱۴۰۴-۱۳۹۹)
سهام	۲۰۳ برابر	۴۱ برابر	۵ برابر
طلا	۲۸۸ برابر	۱۰۰ برابر	۸.۷ برابر
ارز	۹۵ برابر	۲۹ برابر	۴.۴ برابر
مسکن	۱۹ برابر	۹ برابر	۴.۴ برابر
سپرده بانکی	۱۲ برابر	۵ برابر	۲.۵ برابر
بهترین بازار	طلا	طلا	طلا
بدترین بازار	سپرده بانکی	سپرده بانکی	سپرده بانکی
شاخص قیمت مصرف کننده	۵۱ برابر	۱۶ برابر	۵.۴ برابر

## بازدهی ۱۵-۱۰-۵ ساله سهام منتخب بازار سرمایه

سهام	ساله ۱۵ (۱۴۰۴-۱۳۸۹)	ساله ۱۰ (۱۳۹۴-۱۴۰۴)	ساله ۵ (۱۳۹۹-۱۴۰۴)
فولاد	۳۳۲ برابر	۷۲ برابر	۵.۶ برابر
فملی	۴۰۱ برابر	۱۴۰ برابر	۱۱.۹ برابر
کگل	۱۱۴ برابر	۱۷ برابر	۱.۷ برابر
شپنا	۳۹۹ برابر	۱۴۱ برابر	۱۱ برابر
شیراز	۵۸۶ برابر	۶۴ برابر	۸.۷ برابر
خودرو	۱۴۱ برابر	۲۷ برابر	۵.۹ برابر
انتخاب سهام به عنوان نماینده صنعت، بر مبنای ارزش بازار و تاریخچه معاملات است.			
قیمت سهام بر اساس قیمت تعدیل شده (اعمال سود نقدی و افزایش سرمایه) است.			
شاخص کل بورس	۲۰۳ برابر	۴۱ برابر	۵ برابر

## بازدهی ۳۰ ساله بازارهای موازی

بازار	منبع	ساله ۳۰ (۱۴۰۴-۱۳۷۴)
سهام	شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران بنا بر داده‌های سازمان بورس	۳,۶۵۸ برابر
طلا	سکه امامی بنا بر داده‌های وزارت اقتصاد	۲,۲۶۵ برابر
ارز	قیمت دلار بازار آزاد بنا بر داده‌های وزارت اقتصاد	۲۵۰ برابر
مسکن	شاخص مسکن مرکز آمار ایران (مشکل از اجاره و خدمات نگهداری و تعمیر واحد مسکونی)	-
سپرده بانکی	سود سپرده یک ساله بانک‌های دولتی بنا بر داده‌های بانک مرکزی	۸۹ برابر
بهترین بازار	سهام	
بدترین بازار	سپرده بانکی	
شاخص قیمت مصرف کننده	بنا بر داده‌های بانک مرکزی و مرکز آمار ایران	۴۵۴ برابر

## بازدهی ۲۰ ساله سهام منتخب بازار سرمایه

سهام	توضیحات تکمیلی	ساله ۲۰ (۱۴۰۴-۱۳۸۴)
فولاد	شرکت فولاد مبارکه اصفهان به عنوان نماینده صنعت فولاد در بازار سرمایه (اولین روز معاملاتی: ۱۳۸۵/۱۲/۲۰)	۶۷۵ برابر
فملی	شرکت ملی صنایع مس ایران به عنوان نماینده صنعت مس در بازار سرمایه (اولین روز معاملاتی: ۱۳۸۵/۱۱/۱۵)	۱,۳۶۵ برابر
کگل	شرکت معدنی و صنعتی گل گهر به عنوان نماینده صنعت سنگ آهن در بازار سرمایه (اولین روز معاملاتی: ۱۳۸۲/۰۶/۰۸)	۵۹۷ برابر
شپنا	شرکت پالایش نفت اصفهان به عنوان نماینده صنعت پالایش در بازار سرمایه (اولین روز معاملاتی: ۱۳۸۷/۰۴/۰۹)	۴۶۹ برابر
شیراز	شرکت پتروشیمی شیراز به عنوان نماینده صنعت پتروشیمی در بازار سرمایه (اولین روز معاملاتی: ۱۳۸۴/۰۸/۱۱)	۸۱۴ برابر
خودرو	شرکت ایران خودرو به عنوان نماینده صنعت خودرو در بازار سرمایه (اولین روز معاملاتی: ۱۳۸۰/۰۱/۰۵)	۱۲۸ برابر
انتخاب سهام به عنوان نماینده هر صنعت، بر مبنای ارزش بازار و تاریخچه معاملات است.		
قیمت سهام بر اساس قیمت تعدیل شده (اعمال سود نقدی و افزایش سرمایه) است.		
شاخص کل بورس	بنا بر داده‌های سازمان بورس اوراق بهادار تهران	۳,۶۵۸ برابر

توضیحات تکمیلی:

- به دلیل عدم انتشار رسمی قیمت مسکن در کشور توسط بانک مرکزی، از شاخص مسکن مرکز آمار ایران که بیانگر متوسط اجاره، خدمات نگهداری و تعمیر واحد مسکونی در کشور است، به عنوان نماینده بازار مسکن در گزارش حاضر استفاده شد.
- در جداول فوق، کلیدواژه «سال»، بیانگر متوسط قیمت در سال مورد اشاره و کلیدواژه «سال ۱۴۰۴»، نشانگر متوسط قیمت در شهریورماه سال ۱۴۰۴ (به استثنای شاخص و سهام بازار سرمایه که بر اساس آخرین روز معاملاتی) است.
- در گزارش حاضر، «شاخص قیمت مصرف کننده» بیانگر میانگین وزنی قیمت‌های سبد کالاهای مصرفی و خدماتی خانوارها و درصد تغییرات این شاخص، نشانگر «تورم» است.