

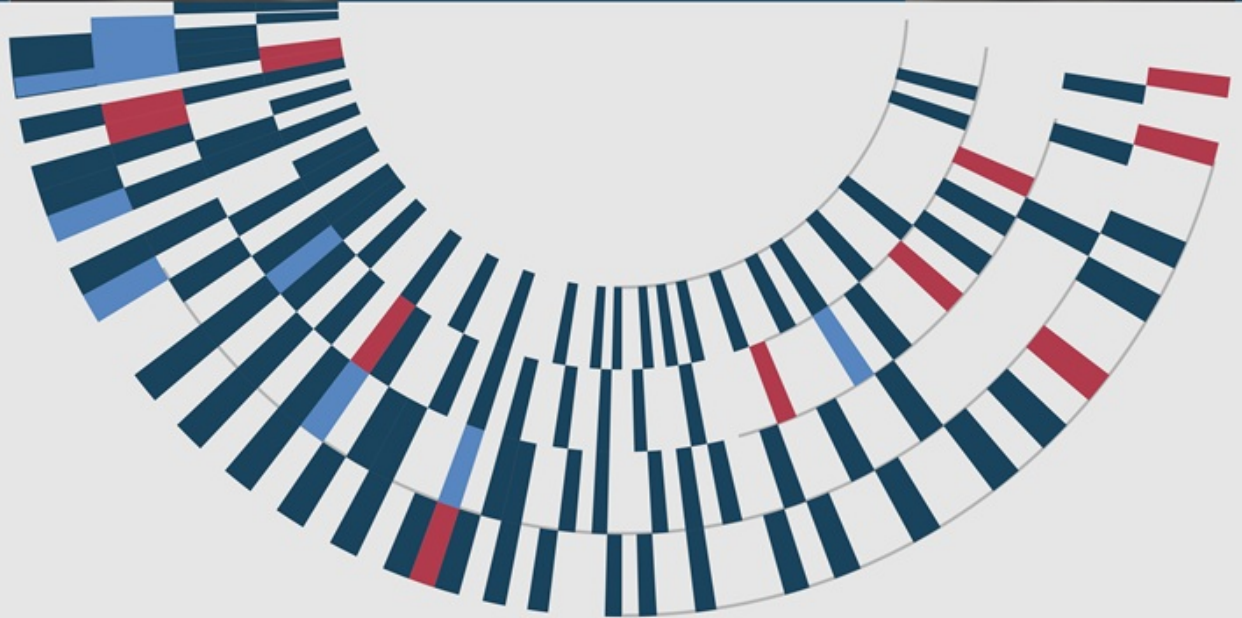
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۱ | دوره منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۱۲

 CHARISMA





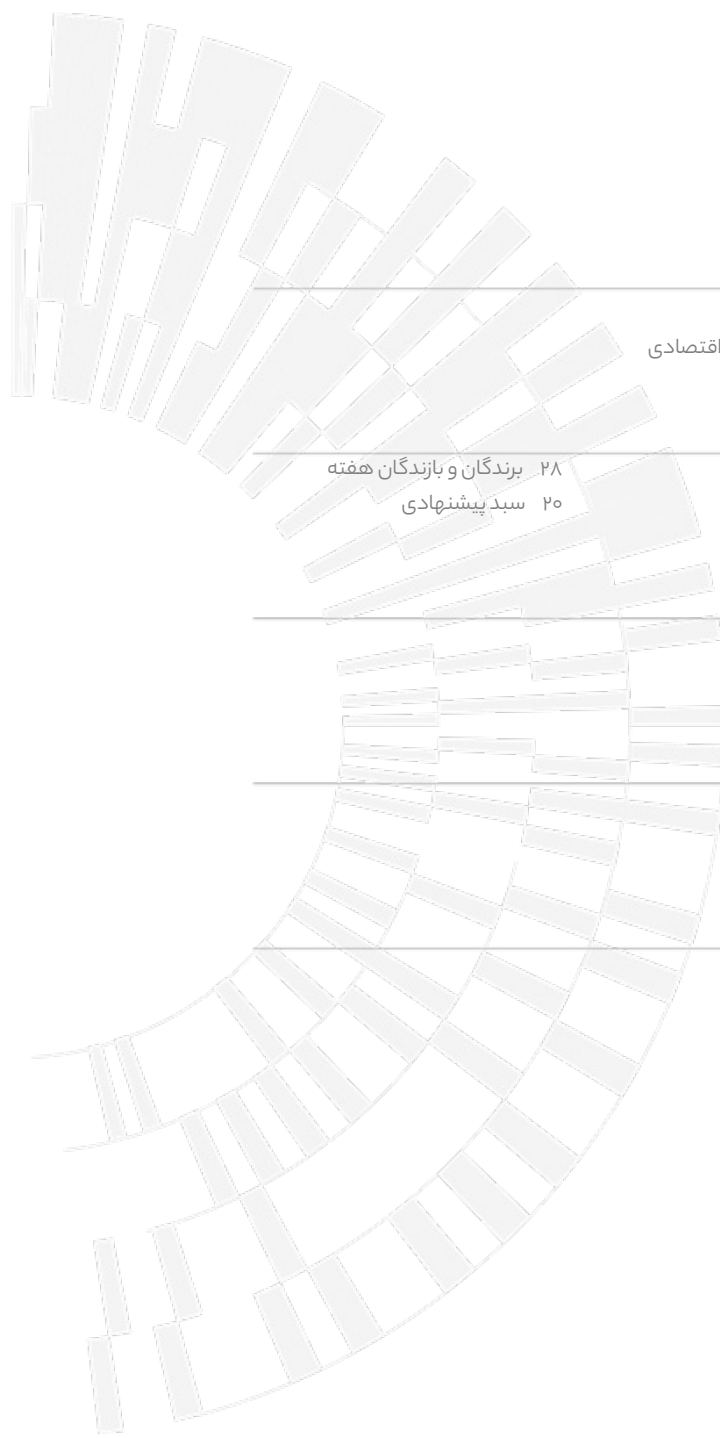
معرفی گزارش:

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 دو هفته یکبار 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 هر گونه 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.



۵۴	کامودیتی	۵۴ فلزات و معادن ۵۵ پتروشیمی ۵۶ انرژی و سایر محصولات ۵۷ گاز طبیعی	۵۸ اخبار و معیارهای تاثیرگذار ۱۰ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی
۱۲	بازار سهام	۱۲ مروری بر بازارهای موازی ۱۴ بررسی بلندمدت بازار سهام ۱۶ نرخ بهره و رونق بازار سهام ۱۷ ارزش معاملات	۱۸ ارزندگی بازار ۲۰ بازدهی صنایع ۲۱ ورود و خروج پول ۲۴ بازدهی صنایع
۳۱	تحلیل تکنیکال	۳۱ شاخص کل (بورس تهران) ۳۲ شاخص کل هم وزن (بورس تهران) ۳۳ شاخص هم وزن به شاخص کل (بورس تهران) ۳۴ نسبت شاخص کل به دلار آزاد	۳۵ دلار آمریکا (بازار آزاد) ۳۶ سکه امامی ۳۷ طلای جهانی ۳۸ نفت برنت
۴۱	اجماع تحلیل گران	۴۱ نسبت قیمت به سود (سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)	۲۸ برندگان و بازندگان هفته ۲۰ سبد پیشنهادی

کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات و معادن

عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به دوره گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۴۹	-۳.۱%	فزر	-		
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۲۴۸	۰.۱%	فملی	بموتو، فباهنر		
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۶۲	۱.۰%	فایرا	فنوال		
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۳۰۳	-۹.۸%	فاسمین، فسرب، فروی، فزور، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد		
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۳۵	-۱.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-		
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۷۹۵	۶.۹%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان		
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۸۹	۶.۱%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان		
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۶	-۳.۴%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد		
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۰۱۳	۷.۹%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشیق	کوپر، فوکا، فنورد		
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۲۰	-۷.۱%	فولاد، فخوز، هرمز	-		
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۰۰	۰.۰%	فولاد، فخوز، هرمز	-		
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۲۵	-۴.۶%	ذوب، کویر	فولای		
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۳,۶۸۲	۴.۲%	ذوب، کویر	فولای		
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۸۰	-۲.۵%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا		
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۷۸	-۱.۸%	فولاد	-		



عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به دوره گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	رند قیمتی ۱۲ ماهه
اوره	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۲۹۰	-۸.۷%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفارس		
متانول	CFR چین	دلار/تن	۲۴۵	-۷.۲%	زاگرس، شخارک، شغن، شیراز	شفارس، شسینا		
اتیلن	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۸۷۰	-۵.۳%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۱۴	-۵.۹%	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۱۸	-۳.۳%	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۴۰	-۳.۰%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلیکول	CFR چین	دلار/تن	۴۷۰	-۹.۴%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۹۸۰	-۳.۸%	شگویا	-		
پروپیلن	CFR چین	دلار/تن	۷۸۰	-۱۱.۳%	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۸۳۴	-۶.۲%	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پاراازایلن	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۹۵۴	-۲.۳%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	CFR چین	دلار/تن	۱,۰۶۰	-۱.۳%	شصفها، نوری	-		
استایرن	CFR چین	دلار/تن	۹۶۵	-۴.۲%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	CFR چین	دلار/تن	۸۳۰	-۳.۸%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	CFR چین	دلار/تن	۷,۰۴۵	۳.۰%	بوعلی	-		
بوتادین	CFR چین	دلار/تن	۷۸۰	-۱۳.۲%	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۷۶۰	-۵.۵%	شغدیر، ارونه، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-		
ABS	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۱,۲۵۰	-۷.۰%	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

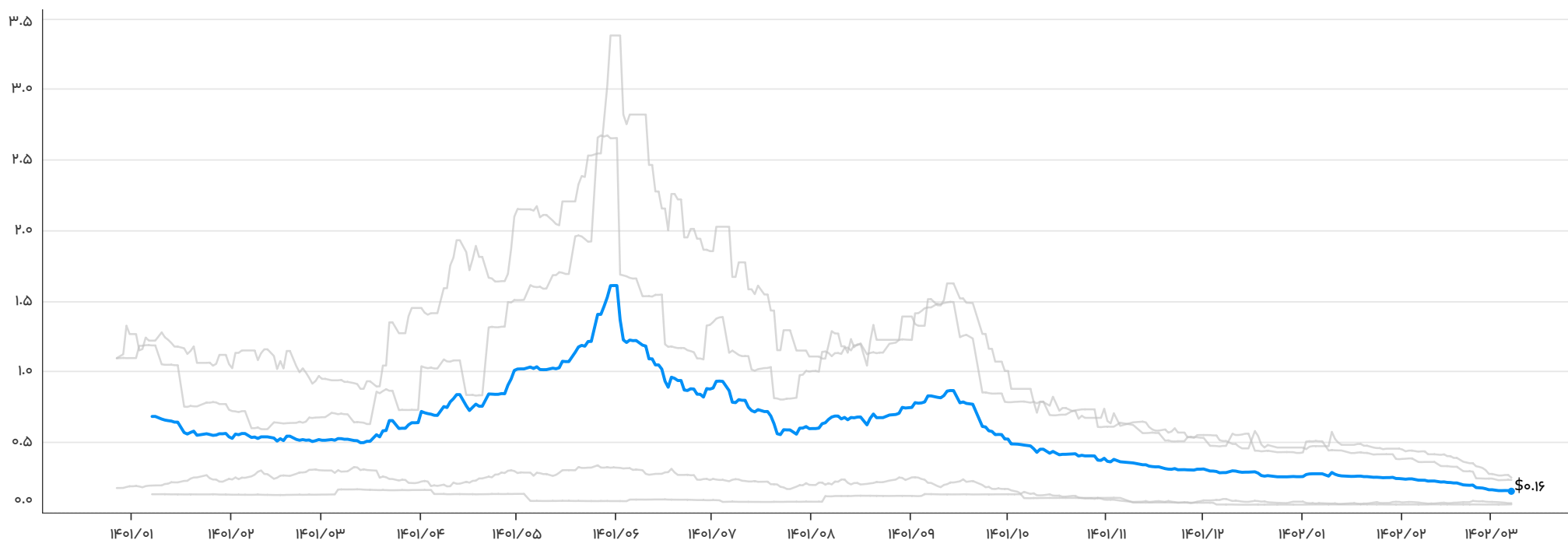
روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به دوره گذشته		آخرین قیمت		واحد		مرجع قیمتی		عنوان	
		۱۲۲	۱۰۷	-۳۷%	شیپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	-	۷۲	۷۶	۲.۸%	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	نفت برنت					
		۱۱۱	۱۰۱	-۴۰%	شیپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	-	۶۶	۷۲	۲.۶%	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	نفت WTI					
		۱۸۴	۱۴۶	-۴۶%	-	شیپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	۹۷	۹۹	۲.۶%	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره					
		۱۷۴	۱۴۶	-۴۶%	-	شیپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	۸۹	۹۴	۵.۲%	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور					
		۱۷,۲۵۹	۱۵,۳۵۳	-۲۵%	شبه‌رن، شسپا، شنتف، شرانل	شیپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	۱۵,۳۵۳	۱۲,۸۷۳	-۰.۱%	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران					
		۴۱,۳۶۵	۳۹,۴۲۰	-۲۲%	-	شبه‌رن، شسپا، شنتف، شرانل	۳۹,۴۲۰	۲۳,۴۲۰	-۳.۹%	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان					
		۱۷,۱۴۰	۸,۸۵۰	-۳۴%	-	شپاس	۸,۸۵۰	۱۴,۹۰۰	-۳.۶%	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر- نفت پاسارگاد					
		۳۵۹	۲۳۵	-۲۱%	غکورش، غیشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	۲۳۵	۲۳۹	۴.۲%	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا					
		۱,۳۶۰	۷۳۵	-۴۶%	غکورش، غیشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	۷۳۵	۷۳۵	-۸.۴%	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام					
		۲,۴۱۹	۱,۲۰۵	-۴۰%	-	-	۱,۲۰۵	۱,۴۵۹	۳.۰%	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا					
		۳۹۴	۲۲۷	-۴۲%	-	-	۲۲۷	۲۲۸	-۲.۳%	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا					
		۱.۱۰	۰.۹۷	-۱۲%	-	-	۰.۹۷	۱.۰۷	-۱.۳%	-	بازار فارکس	یورو به دلار					
		۱.۲۶	۱.۰۹	-۱۳%	-	-	۱.۰۹	۱.۲۵	۰.۰%	-	بازار فارکس	پوند به دلار					
		۳۰,۳۳۵	۱۶,۵۴۹	-۴۶%	-	-	۱۶,۵۴۹	۲۷,۲۴۴	۳.۲%	دلار	بایننس	بیتکوین					



هَاب	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به دوره 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	۰.۰۸	-۱۱.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۳۴	-۷۵%
آلبرتا	دلار \مترمکعب	۰.۰۷	۱.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۷	-۶۰%
هلند (TTF)	دلار \مترمکعب	۰.۲۶	-۱۷.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۳.۳۹	-۷۳%
انگلستان (NBP)	دلار \مترمکعب	۰.۲۴	-۳.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۲.۶۸	-۶۲%
میانگین ۴ هاب	دلار \مترمکعب	۰.۱۶	-۹.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۱.۶۲	-۶۹%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

میانگین هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، ۲ سال گذشته





معادن و فزانات

– دولت و مجلس همچنان در تلاش برای تصویب نهایی جداسازی بخش بازرگانی از صمت در مجلس هستند. از آنجایی که نمایندگان مجلس علاقه‌مند رقابتی شدن بازار و پذیرش شدن محصولات بیشتری در بورس کالا و بورس انرژی هستند، بخش زیادی از شرکت‌های تولیدی تحت تاثیر قرار خواهند گرفت.

– شاخص قیمت فولاد صادراتی ایران طی ۱۵ روز گذشته صعودی بوده با وجود کاهش قیمت فولاد در دنیا اکنون شاخص قیمت فولاد صادراتی ایران بالاتر از قیمت های صادراتی هند و قیمت داخلی تانگشان چین است.

– با توجه به مقایسه قیمت‌های کامودیتی CIS و شرق آسیا ، قیمت‌های فوب ایران در قیمت مطلوبی قرار دارد و ریشه آن بهبود در قیمت‌های کشورهای منطقه می‌باشد.

– با افزایش صادرات اسلب روسیه و تقاضای محدود، بازار اسلب جهانی تحت فشار عرضه قرار گرفته است.

– با توجه به افزایش نشانه‌های کند شدن اقتصاد چین و افزایش احتمال ورود به رکود اقتصادی، دولت چین در تلاش برای تحریک تقاضا می‌باشد.

– طی هفته گذشته با کاهش موجودی فولاد در چین، شاهد رشد قیمت سنگ آهن در بورس کالای دالیان بودیم.

– معاون نخست وزیر روسیه و مذاکره کننده اصلی اوپک پلاس گفت که او انتظار ندارد که این گروه در جلسه بعدی خود که در ۴ ژوئن برگزار می‌شود تصمیم جدیدی بگیرد. این اعلامیه بعد از اینکه روسیه به طور داوطلبانه ۵۰۰ هزار بشکه در روز از تولیدات خود کاست، صورت گرفت. هر چند که این کاهش تولید تحت فشار تحریم‌های جدید اروپا و تعریف سقف‌های قیمتی جدید برای نفت روسیه انجام گرفت.

– پالایشگاه گرینفیلد الزور سبز کویت در شرف بهره‌برداری است. بیشتر تولیدات این پالایشگاه برای صادرات در نظر گرفته شده است. انتظار می‌رود این اقدام بر صادرات نفت خام کویت تأثیر بگذارد. این پالایشگاه ظرفیت تولید ۶۱۵ هزار بشکه در روز را دارد و همچنین می‌تواند از نفت خام سنگین کویت استفاده کند. کویت در حال کار بر روی افزایش ظرفیت تولید نفت خام خود به ۴ میلیون بشکه در روز است.

– تعداد کل دکل های حفاری نفت و گاز در ماه می ۲۰۲۳ در مقایسه با اوج خود در دسامبر ۲۰۲۲ حدود ۷ درصد کاهش داشت.

چین با چالش های بزرگی در گذار از توسعه اقتصادی با استفاده از صنایع انرژی-بر (مسیر توسعه متمرکز بر انرژی) روبرو است، این استراتژی که برای توسعه اقتصادی استفاده می‌شود، با توجه به اینکه نیاز زیادی به مصرف انرژی دارد، معمولاً با نادیده گرفتن محیط زیست به مصرف بالایی از سوخت‌های فسیلی ناپاک مثل زغال سنگ و نفت کوره روی می‌آورد. با توجه به اینکه تولید سیمان و فولاد انتشار گاز کربن فراوانی به همراه دارند، صنعت ساخت و توسعه مسکن که یکی از صنایع کلیدی چین می‌باشد را با مشکلات فراوانی روبرو کرده است.

انرژی و فرآورده‌های نفتی

مواد شیمیایی و پلیمرها

– با وجود سطح قابل توجهی از تقاضا در بازار پلی پروپیلن در جنوب آسیا، عرضه سنگین تامین کنندگان چینی قیمت‌ها را تحت فشار شدیدی قرار داده است.

– کاهش تقاضای پلی اتیلن ترفتالات در بازارهای آسیایی، صادرات این محصول را تحت تاثیر قرار داده و از طرفی کاهش مصرف کالا در بازارهای داخلی نیز باعث افزایش موجودی این محصول و فشار بر قیمت‌های فروشندگان شده است.

– تقاضا در بازارهای الیاف و نخ پلی استر ضعیف باقی مانده است. موجودی انبارها نیز با کاهش تقاضا رو به افزایش است.

معادن و فزانات

انرژی و فرآورده‌های نفتی

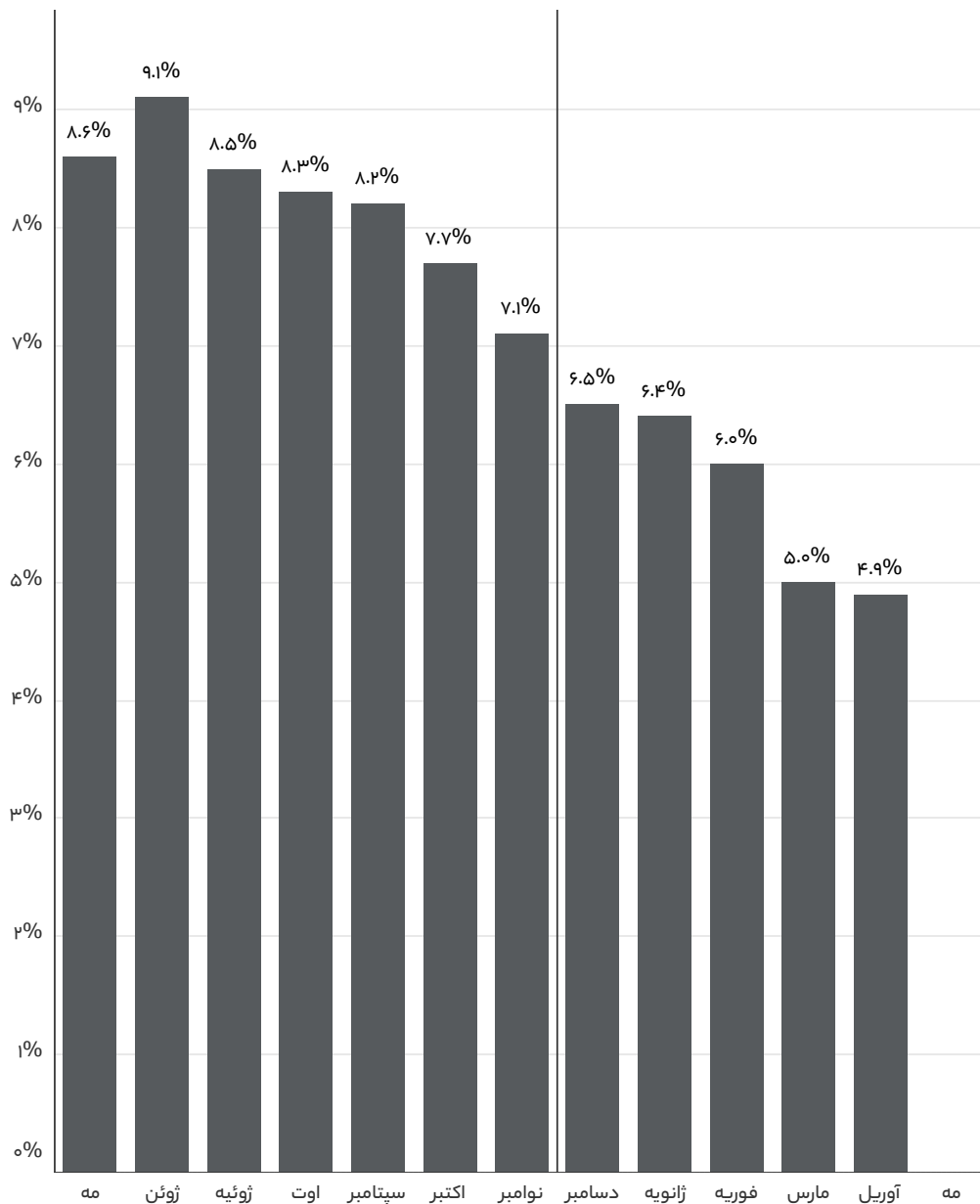
مواد شیمیایی و پلیمرها

شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته

۲۰۲۲

۲۰۲۳

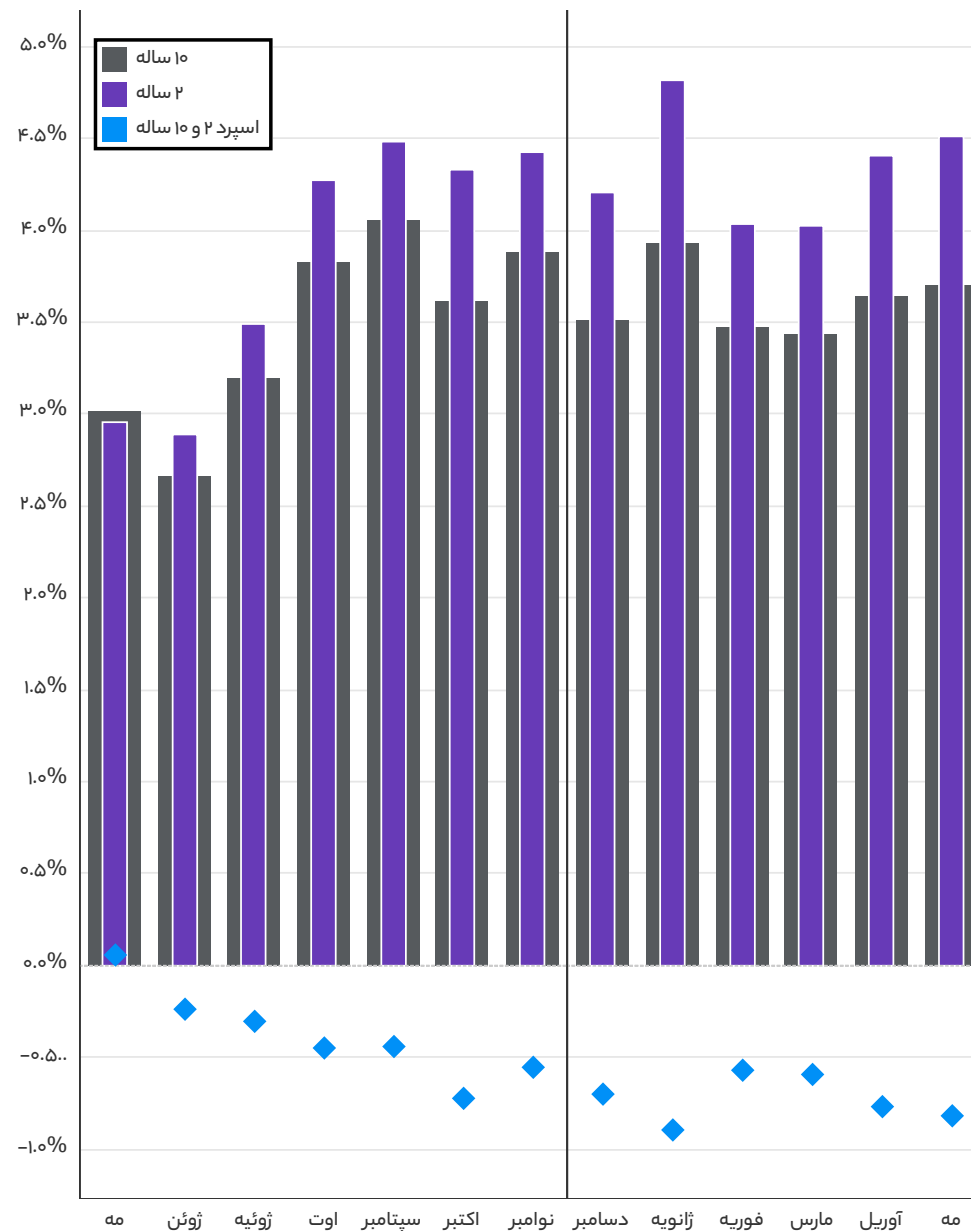


وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده

۲۰۲۲

۲۰۲۳





شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

شکاف 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

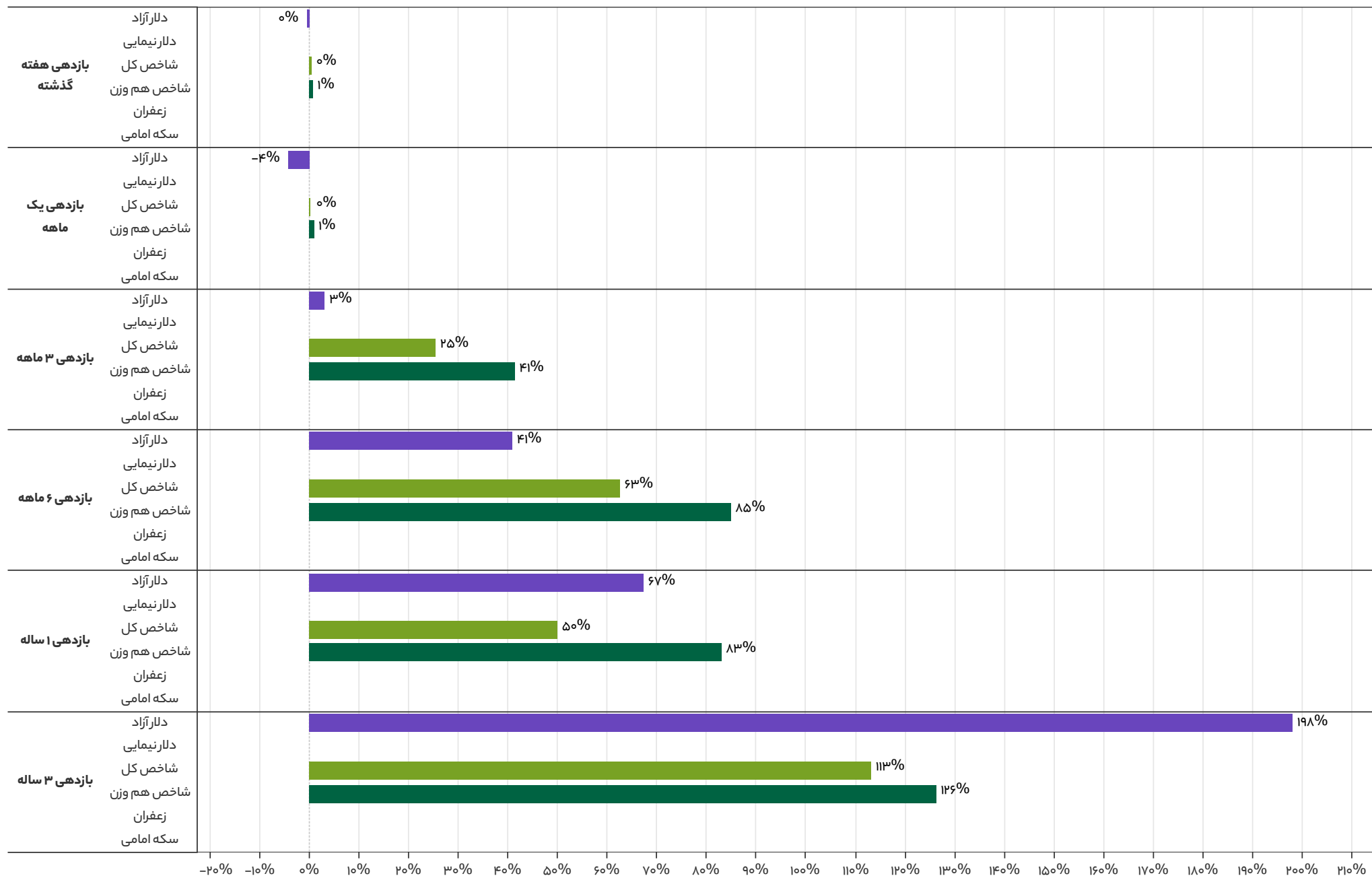
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها طی در بازه‌های زمانی متفاوت





بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

بازدهی دارایی‌های مختلف، طی یکسال گذشته به صورت ماهانه، مرتب شده براساس بازده در هر ماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۰۳	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	هم وزن	هم وزن
سکه امامی ▲ ۱۰.۰%	زعفران ▲ ۹.۶%	مسکن ▲ ۲.۵%	دلار آزاد ▲ ۸.۰%	سکه امامی ▲ ۴.۴%	سکه امامی ▲ ۸.۹%	سکه امامی ▲ ۱۴.۷%	سکه امامی ▲ ۲۶.۵%	سکه امامی ▲ ۲۲.۳%	شاخص کل ▲ ۲۷.۹%	هم وزن ▲ ۳۰.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	سکه امامی ▲ ۱۱.۰%	هم وزن ۴۳%
مسکن ▲ ۸.۴%	مسکن ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۲.۴%	سکه امامی ▲ ۵.۷%	دلار آزاد ▲ ۳.۱%	دلار آزاد ▲ ۸.۲%	دلار آزاد ▲ ۱۲.۰%	هم وزن ▲ ۱۸.۱%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	هم وزن ▲ ۲۲.۸%	شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%	شاخص کل ۳۹%
زعفران ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۴.۶%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	شاخص کل ▲ ۷.۶%	هم وزن ▲ ۱۰.۳%	شاخص کل ▲ ۱۲.۹%	زعفران ▲ ۱۴.۵%	دلار نیمایی ▲ ۱۸.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱۰.۲%	سکه امامی ▲ ۲.۶%	هم وزن ▲ ۸۲.۵%	سکه امامی ۳۸%
دلار آزاد ▲ ۴.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	هم وزن ▼ ۱.۶%	مسکن ▲ ۱.۱%	دلار نیمایی ▲ ۱.۲%	مسکن ▲ ۶.۸%	شاخص کل ▲ ۶.۲%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	مسکن ▲ ۳.۳%	سکه امامی ▲ ۱۶.۶%	دلار آزاد ▲ ۳.۷%	دلار آزاد ▲ ۲.۴%	دلار آزاد ▲ ۶۸.۰%	زعفران ۲۶%
درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	دلار آزاد ▲ ۰.۷%	شاخص کل ▼ ۳.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱.۰%	مسکن ▲ ۱.۲%	هم وزن ▲ ۶.۷%	زعفران ▲ ۳.۱%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	شاخص کل ▲ ۴۸.۲%	دلار آزاد ۲۱%
دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار آزاد ▼ ۷.۹%	هم وزن ▼ ۰.۴%	زعفران ▲ ۰.۰%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	مسکن ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۶%	مسکن ▲ ۴۵.۳%	دلار نیمایی ۱۹%
شاخص کل ▼ ۲.۵%	سکه امامی ▼ ۴.۴%	سکه امامی ▼ ۸.۴%	شاخص کل ▼ ۴.۹%	شاخص کل ▼ ۳.۴%	دلار نیمایی ▲ ۱.۵%	دلار نیمایی ▲ ۲.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱.۳%	شاخص کل ▼ ۹.۲%	زعفران ▲ ۰.۸%	زعفران ▼ ۰.۱%	هم وزن ▲ ۰.۵%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%	مسکن ۸%
هم وزن ▼ ۳.۸%	هم وزن ▼ ۴.۶%	زعفران ▼ ۹.۰%	زعفران ▼ ۱۴.۵%	هم وزن ▼ ۴.۲%	زعفران ▼ ۲.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۰%	هم وزن ▼ ۹.۴%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	سکه امامی ▼ ۶.۳%	شاخص کل ▼ ۲.۰%	زعفران ▲ ۲.۸%	درآمد ثابت ۱%

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

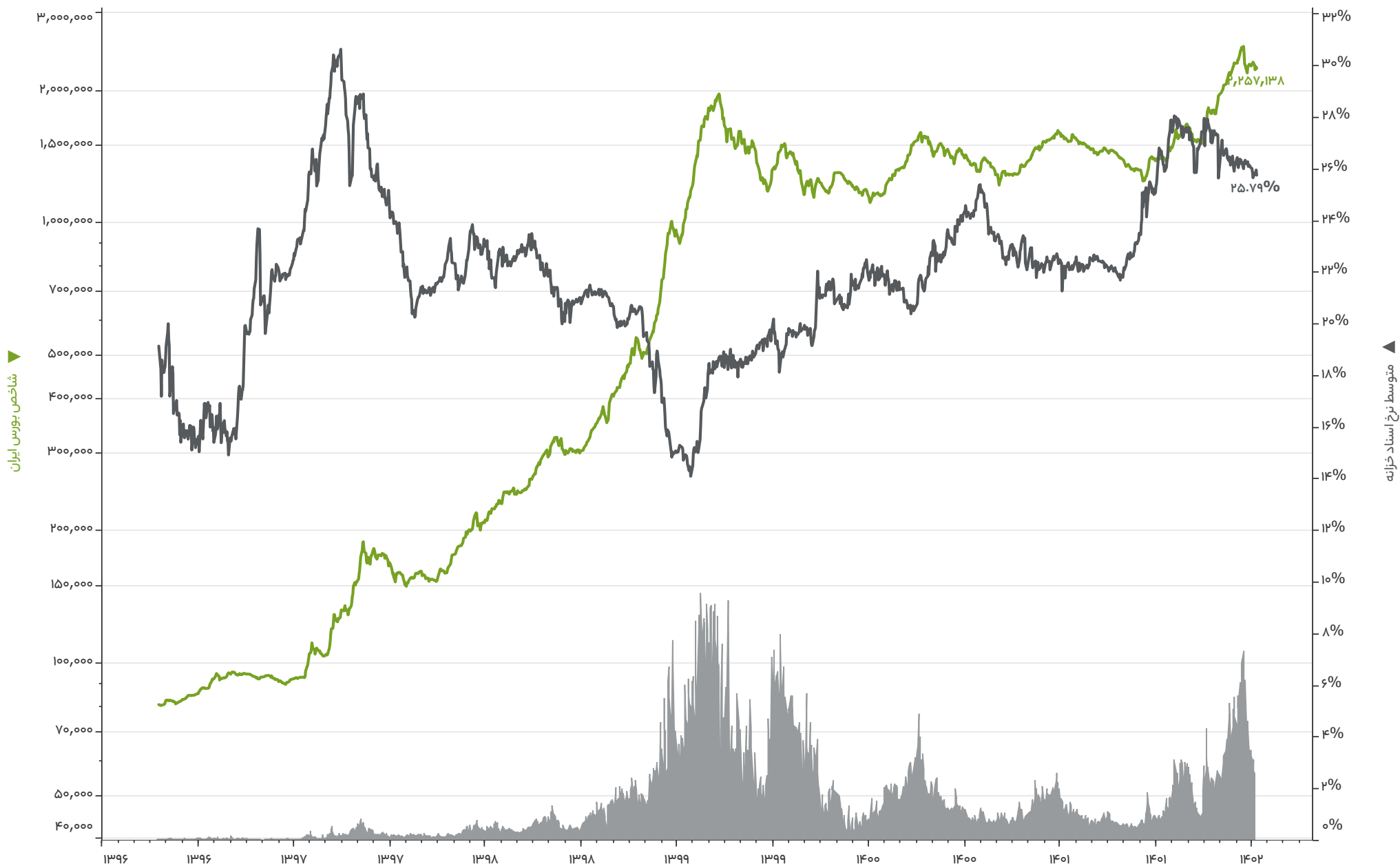
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





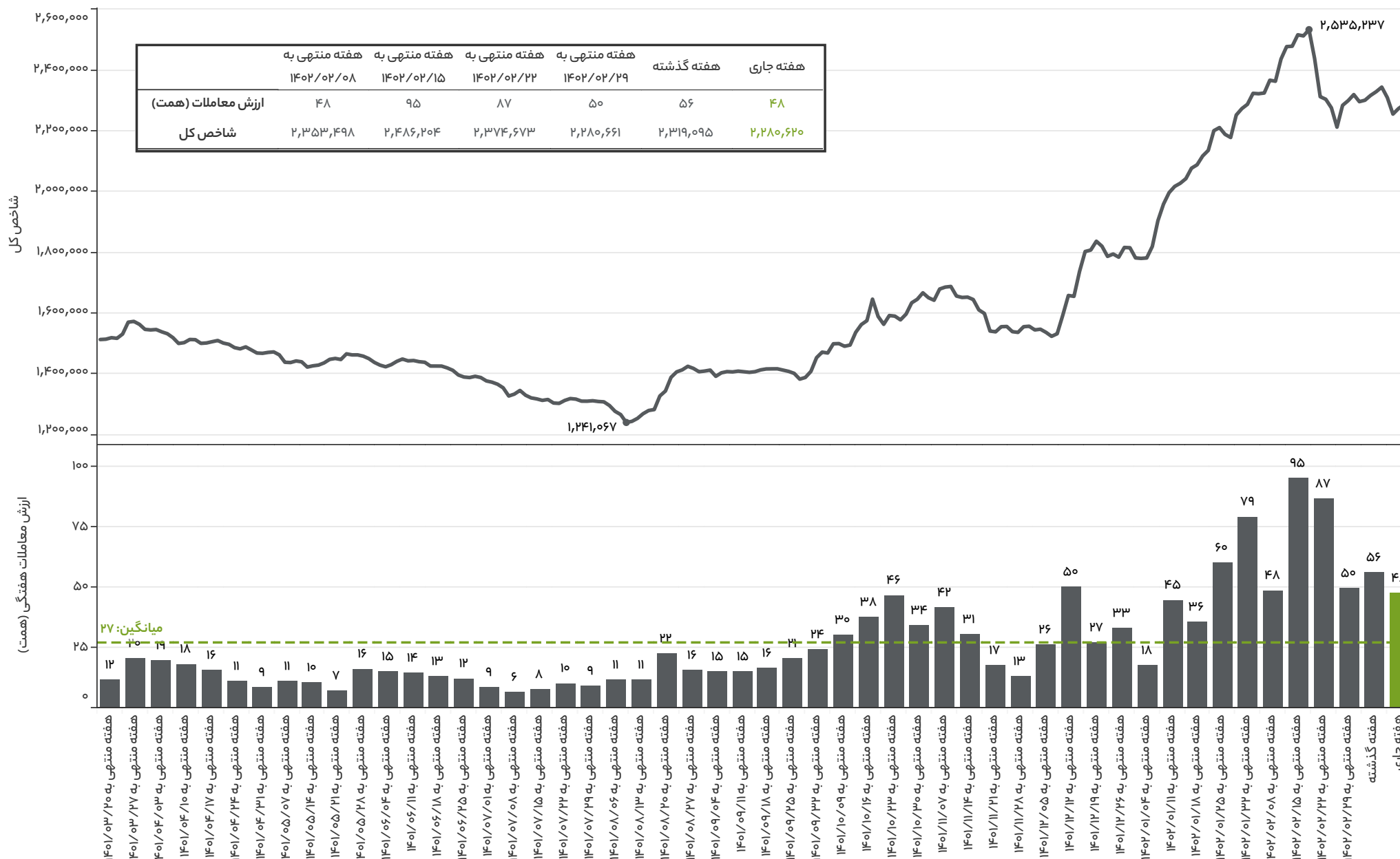
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



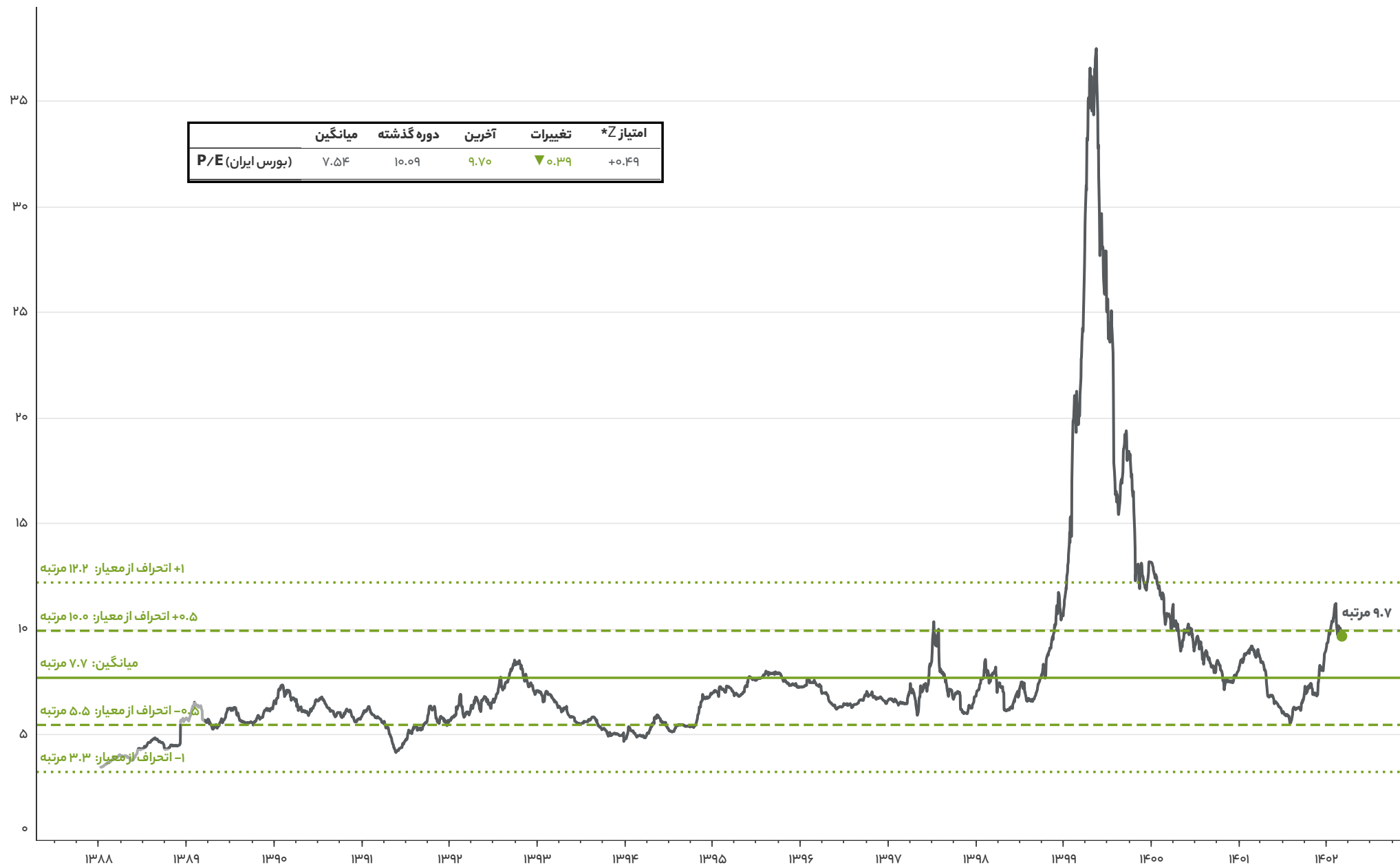
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

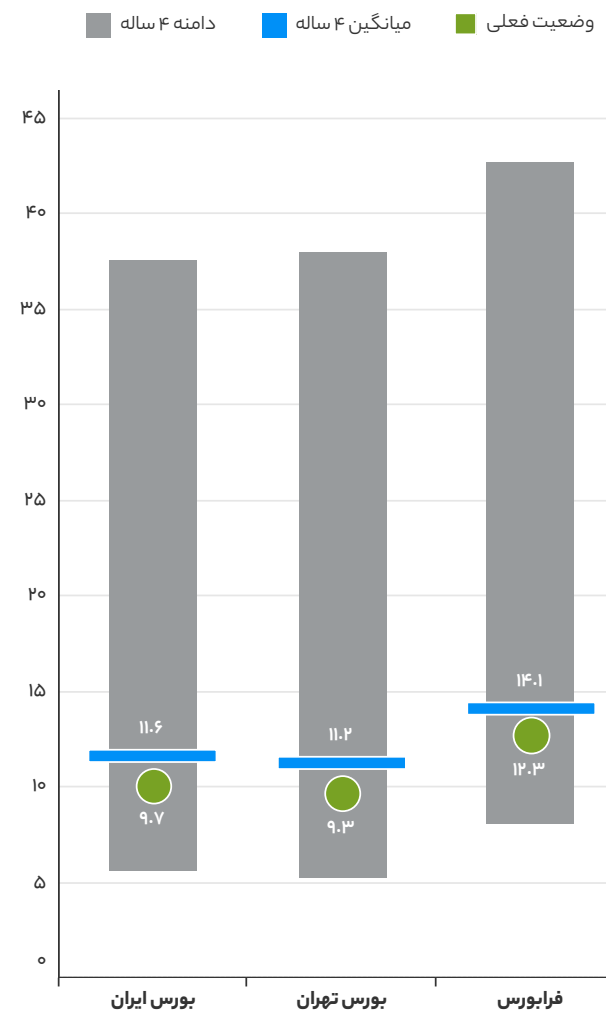
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	دوره گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۹.۷۰	۱۰.۰۹	۵.۵۹	۱۱.۵۹	۳۷.۵۱
بورس تهران	۹.۳۳	۹.۷۱	۵.۲۵	۱۱.۲۲	۳۸.۰۰
فرابورس	۱۲.۲۶	۱۲.۷۵	۸.۰۸	۱۴.۰۹	۴۲.۶۴

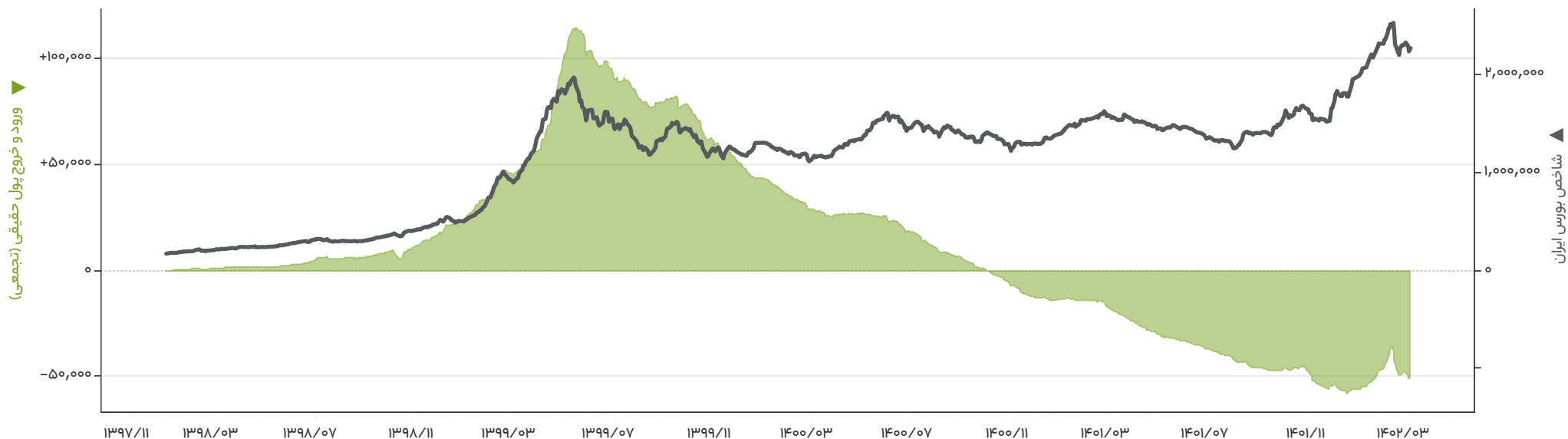


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	خدمات مالی	مواد پایه	انرژی	مصرفی دوره‌ای	مصرفی غیردوره‌ای	صنعتی	یوتیلیتی	بهداشت	ارتباطات	تکنولوژی	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۹۸	۱۸۹	۶	۶۴	۸۸	۶۳	۱۰	۴۱	۵	۱۹	۲۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۳,۷۰۲	۳,۵۷۹	۷۸۹	۳۶۴	۲۴۲	۲۱۴	۱۷۹	۱۵۹	۱۱۳۹	۱۱۱۳	۵۰	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۳۸.۸%	۳۷.۶%	۸.۳%	۳.۸%	۲.۵%	۲.۲%	۱.۹%	۱.۷%	۱.۵%	۱.۲%	۰.۵%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۷	۱۰.۸	۶.۴	۱۵.۴	۱۵.۷	۱۶.۴	۱۴.۹	۱۱.۵	۷.۲	۲۸.۷	۱۲.۷	سودآوری
بازده سود نقدی	۵.۵%	۸.۲%	۸.۵%	۱.۰%	۲.۰%	۲.۲%	۱۲.۸%	۵.۷%	۲.۶%	۲.۱%	۳.۵%	
نسبت تقسیم سود	۵۷%	۷۲%	۷۰%	۲۲%	۴۳%	۳۶%	۸۶%	۷۳%	۵۱%	۵۹%	۴۴%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۵	۱.۳	۰.۵	۰.۹	۰.۸	۰.۶	۰.۸	۰.۴	۰.۶	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۹۳۷%	+۹۲۹%	+۷۶۶%	+۹۹۷%	+۴۹۶%	+۴۱۳%	+۵۸۲%	+۳۹۴%	+۱۷۵%	+۳۰۸%	+۵۵۳%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۹%	+۶۲%	+۱۲%	-۴%	+۱۱%	-۱۲%	+۸۵%	+۱۷%	-۵۶%	+۵%	-۹%	
بازده از ابتدای سال	+۸۲%	+۷۸%	+۸۴%	+۱۱۱%	+۷۴%	+۱۰۲%	+۷۳%	+۹۷%	+۷۶%	+۷۵%	+۱۹۲%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲۵%	-۴۷%	-۱۲%	-۲۱%	-۲۵%	-۴۴%	-۶%	-۴%	-۱۵%	۰%	-۹%	

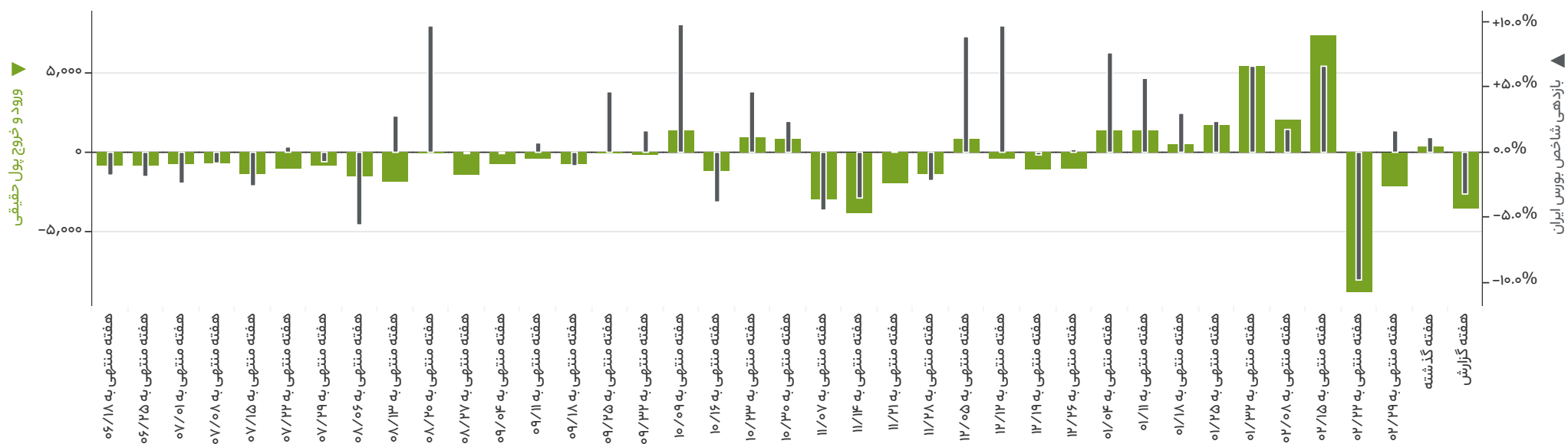
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



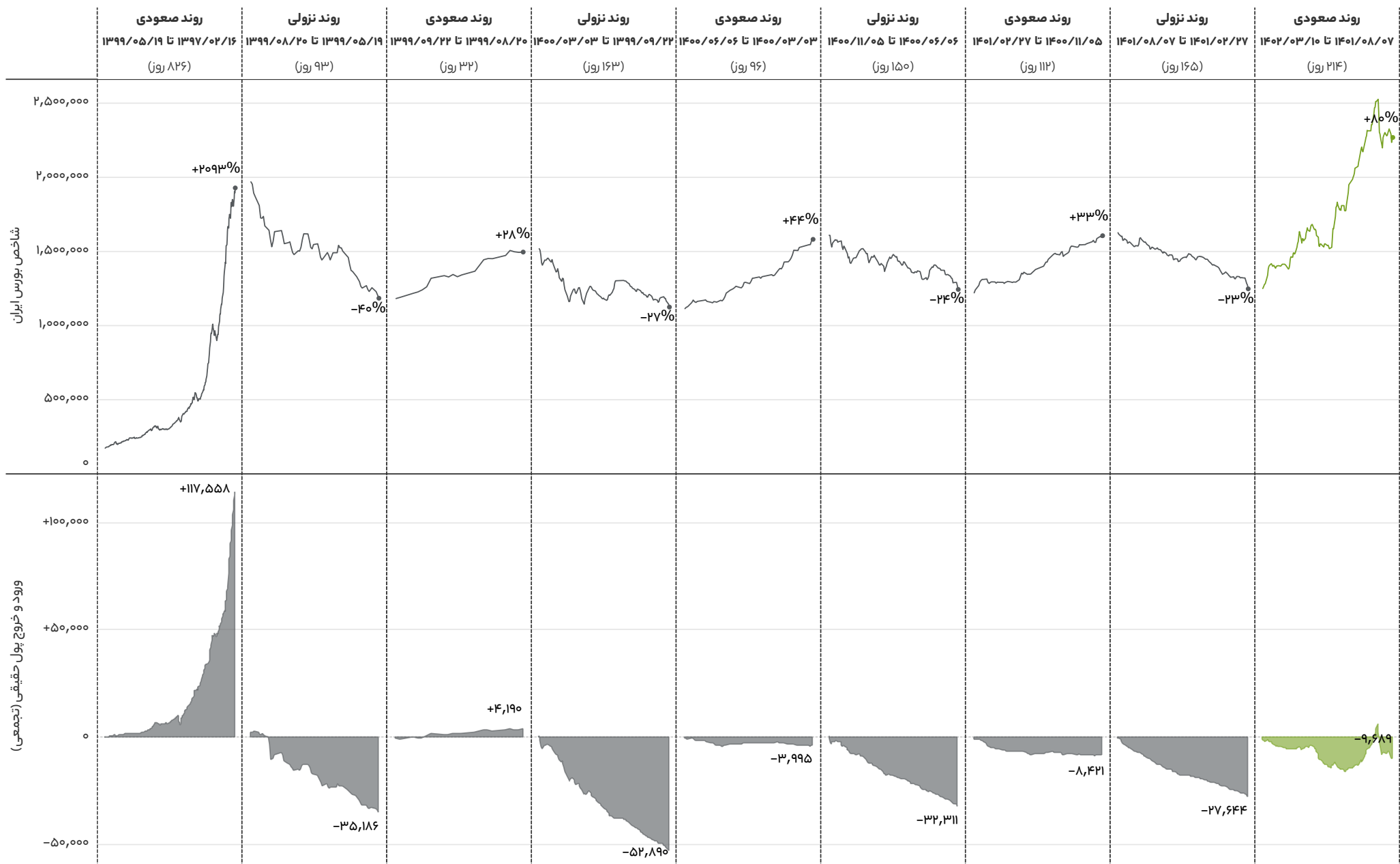
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

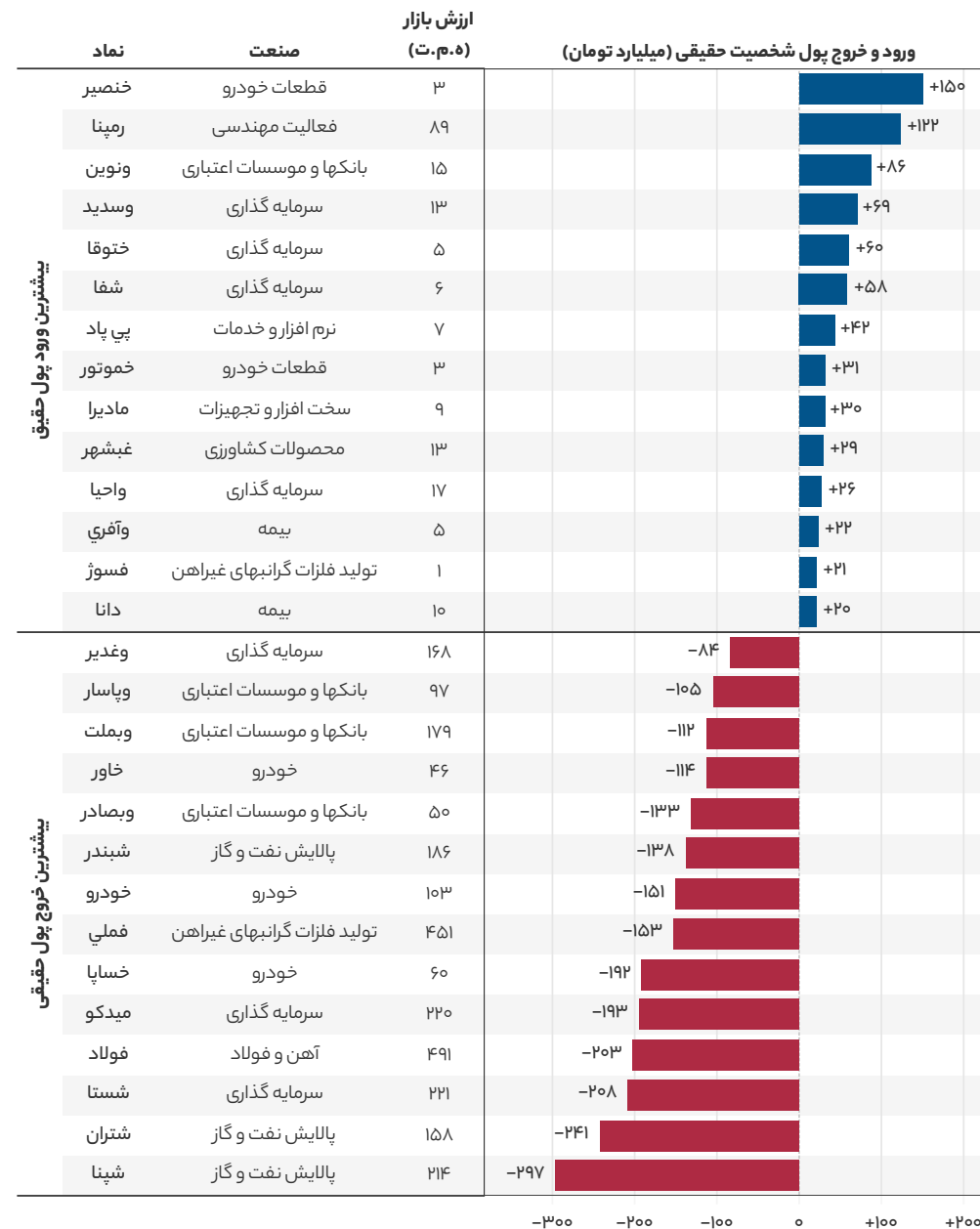
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس





ورود و خروج پول حقیقی

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

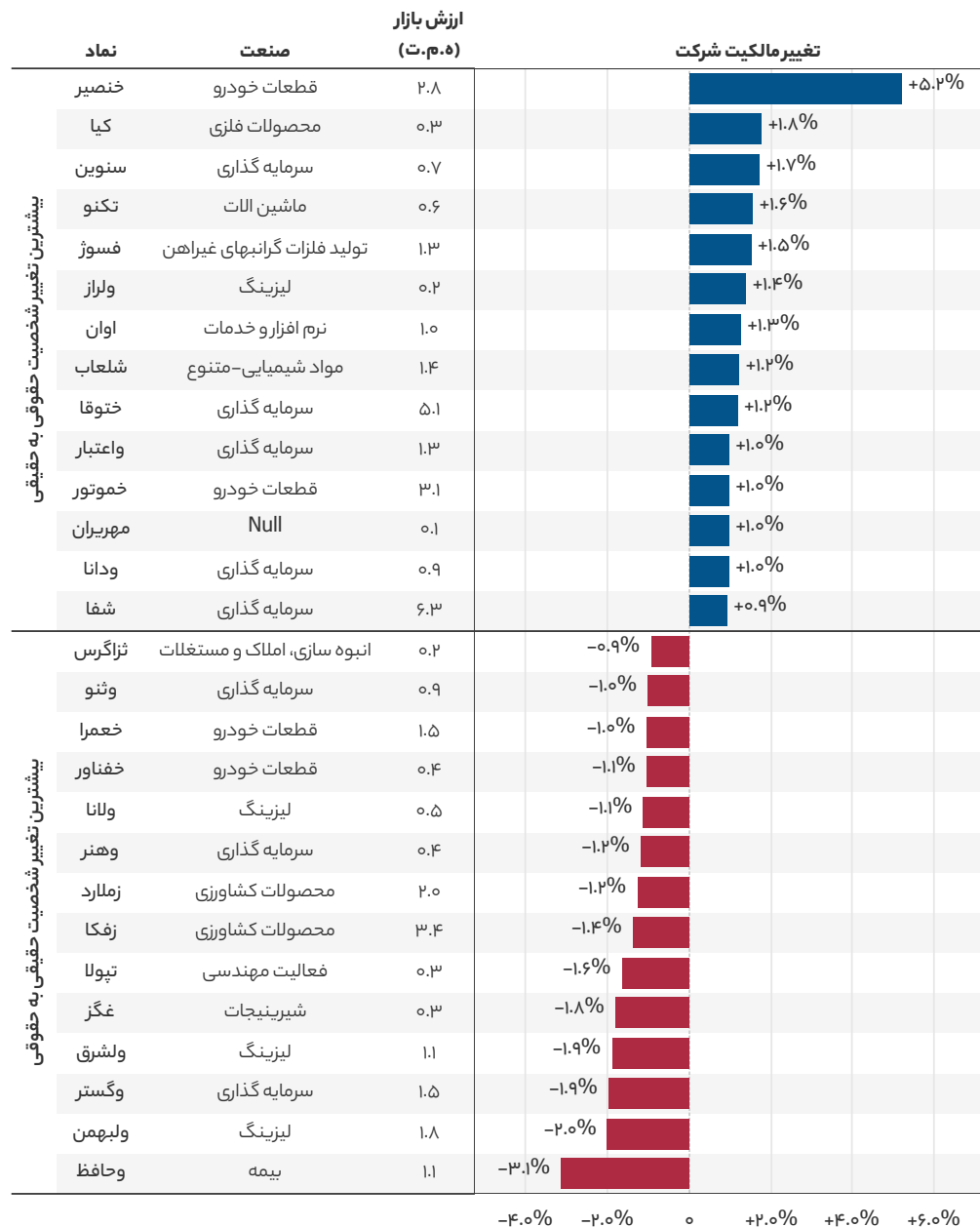


پیشترین ورود پول حقیقی

پیشترین خروج پول حقیقی

تغییر مالکیت شرکت

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

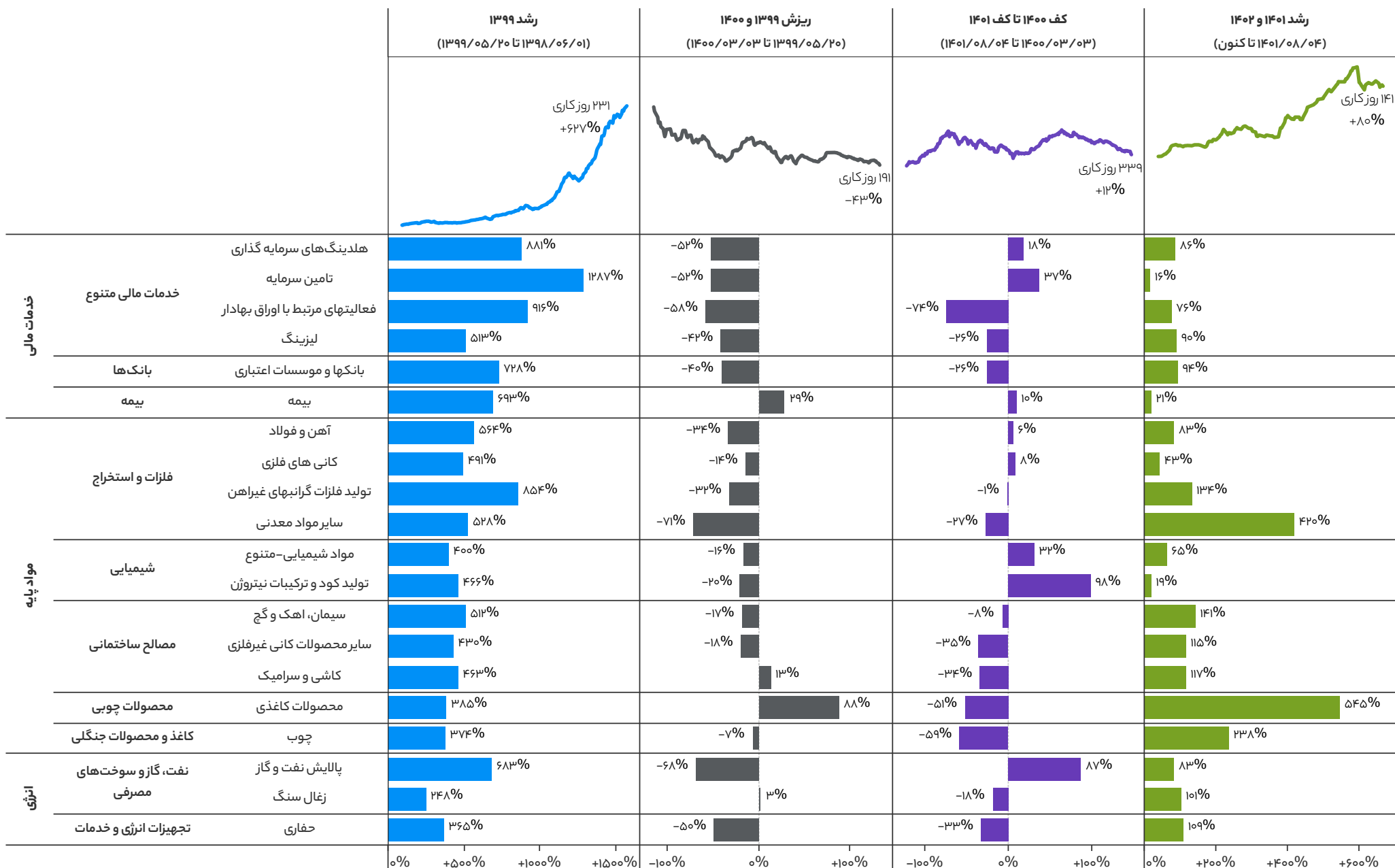


پیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی

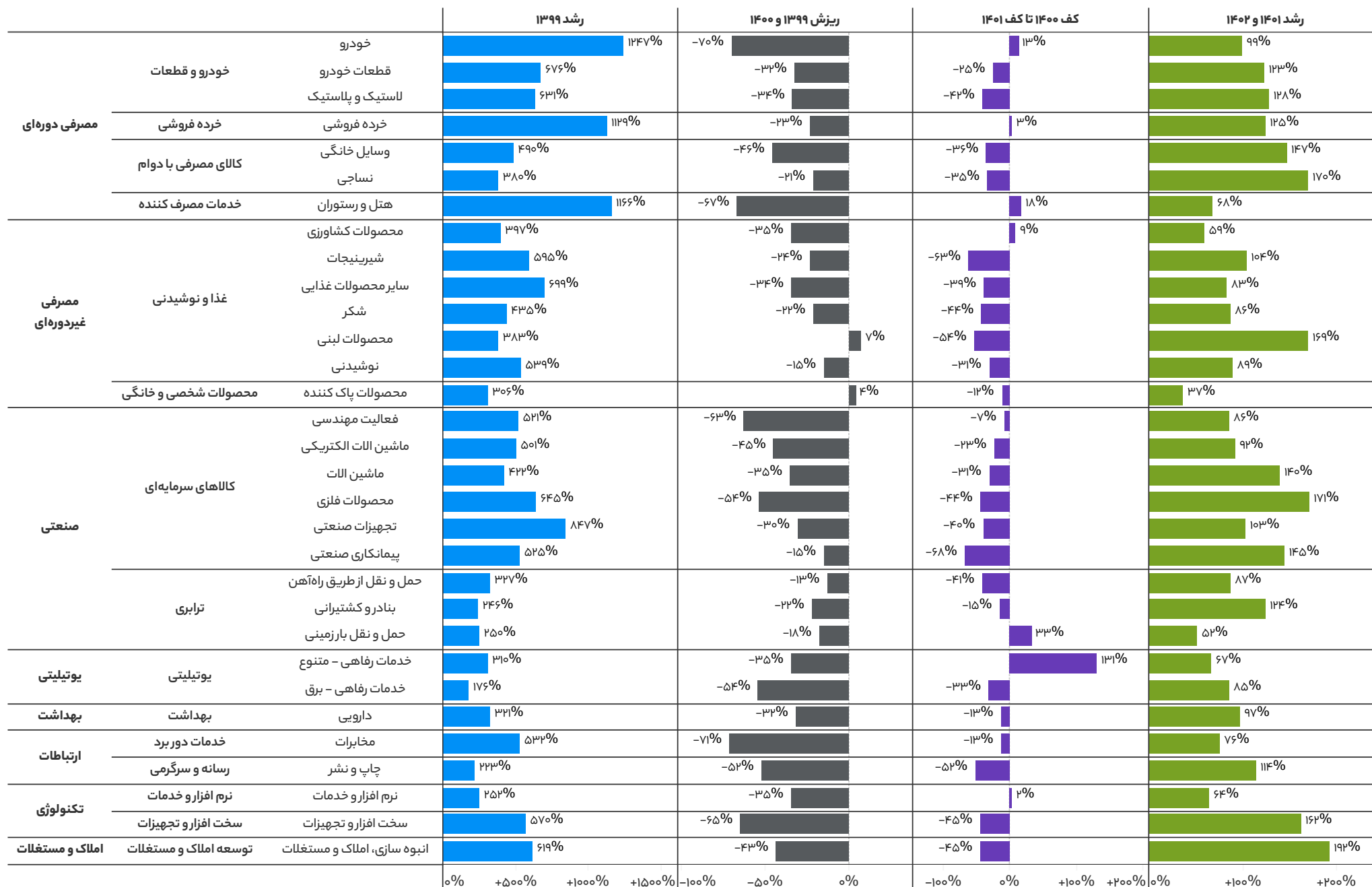
پیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی

بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

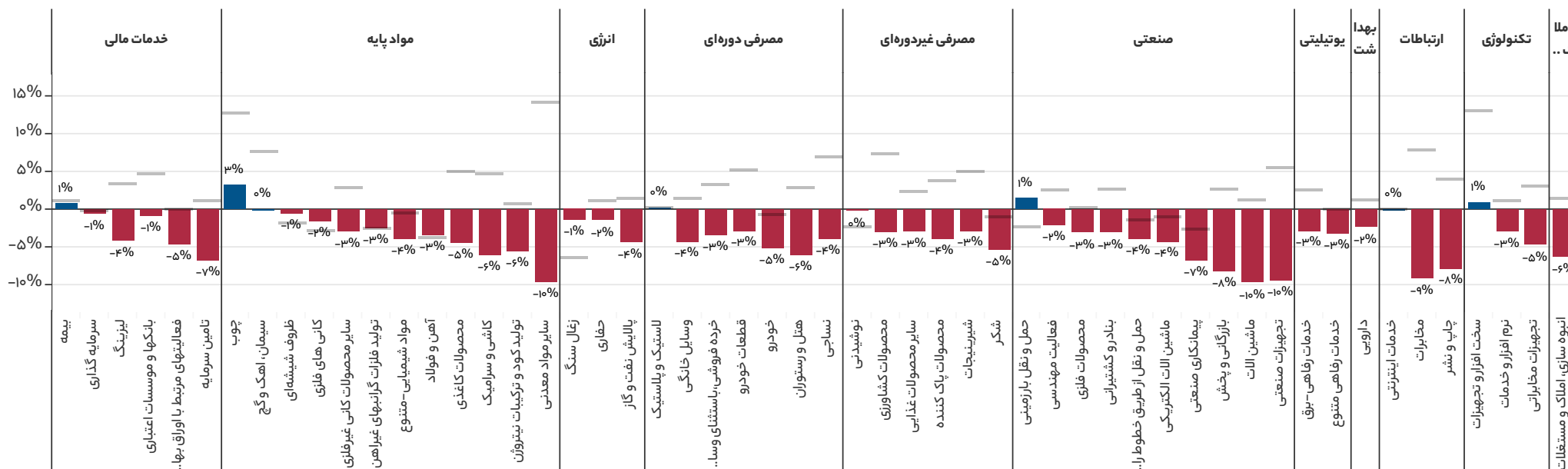


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



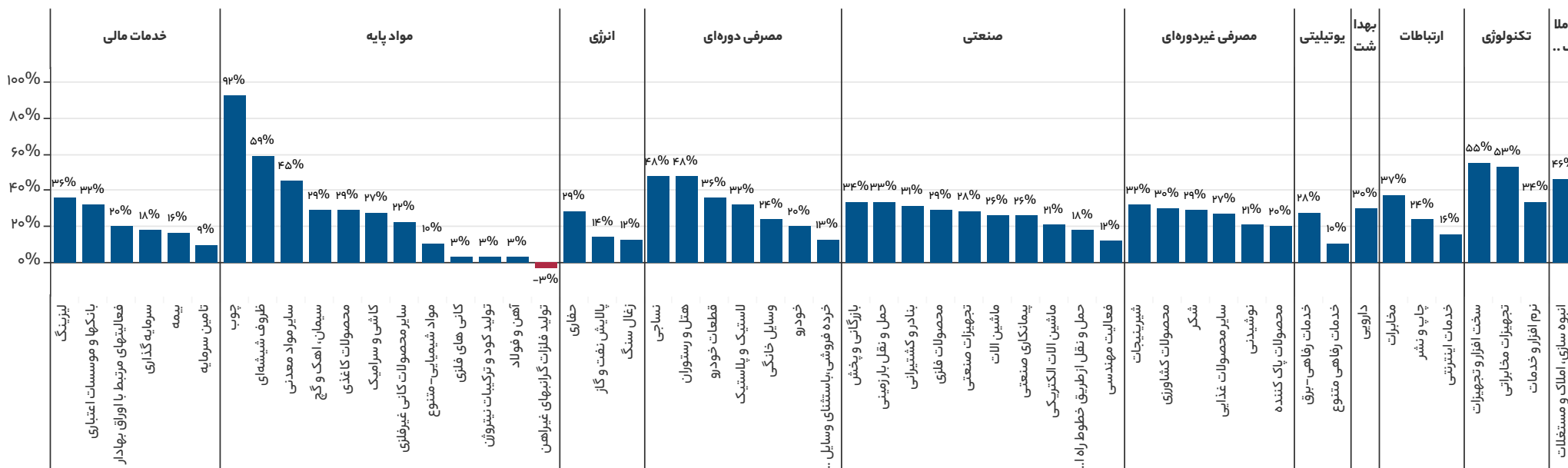
بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۳۵ شرکت سهامی طی ۲ هفته گذشته

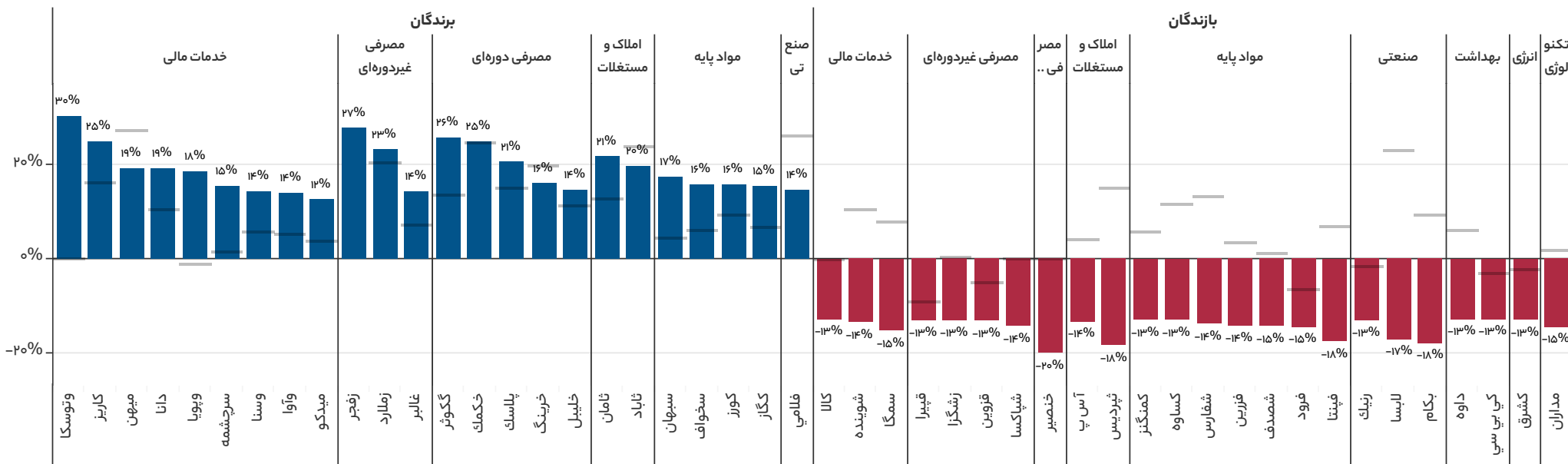
به تفکیک سکتور، بازدهی تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم



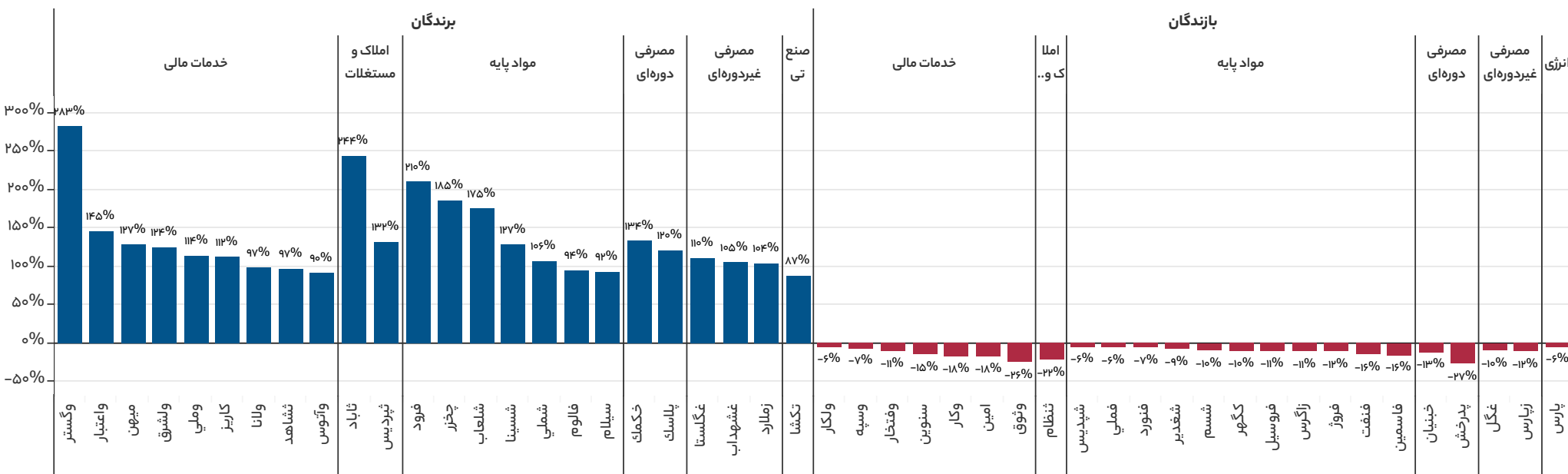
میدکو	فارس	حکشتی	وبملت	مارون	کگل	پاس	ویپاسار	کهر	چم	رمینا	فملی	وامید	کچاد	فولاد	یوعلی	پارس	تامسکو	وغیر	شتتا	شپنا	آریا	مبین	فخوز	پارسان	شبنر	شتران	وسندوق	تاپیکو	خودرو	خسپا	شپدیس	نوری	ومعدان	اخابر
بازده هفته گذشته	+ ۱۲.۵%	+۵.۰%	+ ۱.۹%	+ ۱.۶%	+ ۱.۴%	+۰.۹%	۰%	-۰.۳%	- ۱.۰%	- ۱.۷%	-۲.۱%	-۲.۳%	-۲.۵%	-۳.۰%	-۳.۳%	-۳.۴%	-۳.۴%	-۳.۵%	-۴.۰%	-۴.۲%	-۴.۳%	-۴.۳%	-۴.۴%	-۴.۶%	-۵.۰%	-۵.۰%	-۵.۴%	-۶.۵%	-۶.۶%	-۷.۳%	-۷.۵%	-۷.۷%	- ۱۲.۴%	

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)



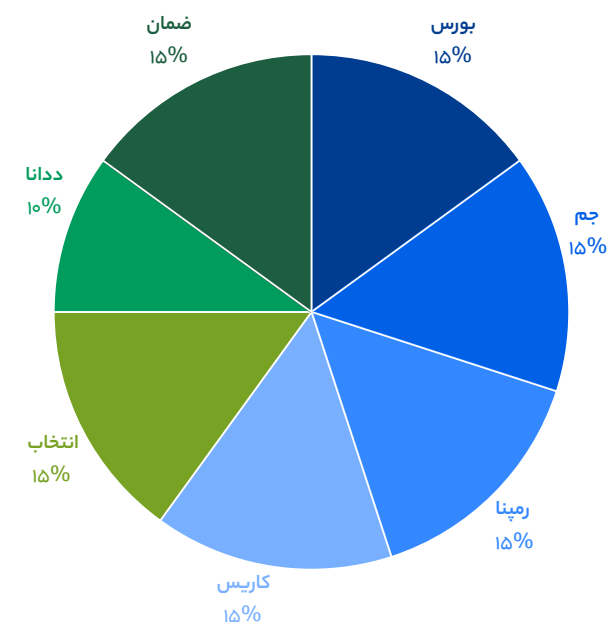
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۵%	۳۲,۹۰۰	انتظار افزایش نرخ و پتانسیل افزایش مقدار تولید و سود زیر مجموعه‌ها	۴۲۰۰۰	انتخاب	میان مدت
۱۰%	۴۸,۲۵۰	پتانسیل افزایش نرخ، پتانسیل بهره‌برداری از طرح سوم در ماه‌های آتی	۶۲۰۰۰	ددانا	
۱۵%	۱۴,۸۵۵	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۶۰,۵۹۰	احتمال افزایش حاشیه سود و بهبود تقاضای محصولات شرکت	۷۸۰۰۰	جم	بلند مدت
۱۵%	۱۴,۹۲۰	ارزش جایگزینی بالای نیروگاهی و احتمال افزایش نرخ برق، وضعیت ارزش مناسب، عرضه اولیه شرکت زیرمجموعه	۱۹۰۰۰	رمپنا	
۱۵%	۷,۶۱۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۹۰۰۰	بورس	
۱۵%	۲۳,۵۵۶	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	



تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





محدوده کف قبلی شاخص (۲۲۱۹۰۰۰ واحد) تعیین کننده مسیر کوتاه مدت شاخص است. در صورت از دست دادن این محدوده انتظار می رود اصلاح تا حوالی ۲۱۶۵۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود نفت برنت با حفظ محدوده ۷۰ دلار، رشدی تا حوالی ۸۳ دلار تجربه کند. شرط رسیدن به این عدد، گذر از محدوده مقاومتی ۷۹ دلار است.

توضیحات تحلیل



این نسبت در محدوده مقاومتی خود می باشد. با گذر از این محدوده انتظار می رود رشد تا حوالی ۰.۳۸ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



بعد از گذر از محدوده مقاومتی ۴.۲۲ واحد، انتظار می‌رود پس از مدتی نوسان در این محدوده به سمت ۵ واحد حرکت کند.

توضیحات تحلیل



محدوده ۵۲۷۰۰ تومان مقاومت مهم دلار می باشد. در صورت عدم گذر از این قیمت، انتظار می رود اصلاح دلار تا محدوده های زیر ۵۰۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد. محدوده ۴۹۶۰۰ تومان نیز مهم ترین محدوده حمایتی می باشد.

توضیحات تحلیل



در نمای میان مدت، بعد از واکنش به سقف کانال وارد اصلاح شده است. در حال حاضر محدوده ۲۹۵۰۰۰۰۰ تومان مهم ترین محدوده حمایتی سکه است که در صورت از دست داد این حمایت انتظار می رود اصلاح تا حوالی ۲۷۰۰۰۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل

Gold Spot / U.S. Dollar · 1D · FX

Ichimoku



رشد انس جهانی طلا از نوامبر ۲۰۲۲ را می‌توان در قالب یک الگو دیامتریک در نظر گرفت که در حال حاضر انتظار می‌رود بعد از تکمیل موج G، وارد فاز اصلاحی شود.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود نفت برنت با حفظ محدوده ۷۰ دلار، رشدی تا حوالی ۸۳ دلار تجربه کند. شرط رسیدن به این عدد، گذر از محدوده مقاومتی ۷۹ دلار است.

توضیحات تحلیل

اجماع تحلیل‌گران

CONSENSUS ESTIMATES

CONSENSUS ESTIMATES





نسبت قیمت به سود (P/E) سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (م.ت.ه)	قیمت	تقسیم سود	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	۱۴۰۲ (میانگین)	۱۴۰۳ (میانگین)	رشد سود ۱۴۰۲ نسبت به ۱۴۰۱	نسبت P/E با سود	نسبت P/E با سود
											۱۴۰۲	۱۴۰۳
شیمیایی	اوره	شیراز	۱۲	۵۴.۷	۳۵,۷۴۰	۳۴%	۷,۶۲۰	۵,۷۱۷	-	-۲۵%	۵.۸	
		کرمانشا	۱۲	۲۹.۶	۸۳,۹۷۰	۵۱%	۱۳,۱۹۹	۱۰,۲۱۵	-	-۲۳%	۷.۶	
		خراسان	۱۲	۲۶.۸	۱۴۹,۶۰۰	۷۹%	۲۸,۱۰۴	۱۹,۴۰۴	-	-۳۱%	۷.۷	
	الفین	شگویا	۱۲	۴۱.۲	۱۷,۲۰۰	۹۱%	۱,۴۴۸	۲,۱۶۴	-	+۴۹%	۷.۴	
		جم پیلن	۱۲	۴۱.۲	۲۰۵,۷۸۰	۱۰۰%	۲۱,۰۹۴	۳۲,۰۱۱	-	+۵۲%	۶.۴	
		شغذیر	۱۲	۱۲.۵	۹۶,۰۷۰	۹۰%	۸,۶۶۰	۱۴,۰۳۳	-	+۶۲%	۶.۳	
		شبصیر	۱۲	۹.۲	۳۶,۹۵۰	۹۰%	۳,۷۶۰	۴,۹۵۲	-	+۳۲%	۶.۸	
		شجم	۶	۶.۷	۱۰,۳۴۰	۹۱%	۸۷۶	۲,۰۵۶	-	+۱۳۵%	۵.۰	
	آروماتیک	بوعلی	۱۲	۷۸.۵	۵۴,۷۰۰	۹۶%	۵,۴۴۸	۸,۲۲۸	-	+۵۱%	۶.۰	
	متانول	شخارک	۱۲	۳۵.۰	۵۸,۲۹۰	۱۰۰%	۶,۴۱۲	۱۱,۶۸۱	-	+۸۲%	۵.۰	
		شغن	۱۲	۲۶.۴	۸,۵۳۰	۹۹%	۱,۰۲۶	۸۶۲	-	-۱۶%	۸.۷	
	دوده صنعتی	شکرین	۱۲	۳.۵	۵,۴۲۶	۸۷%	۶۳۹	۲,۱۶۴	-	+۲۳۹%	۲.۳	
		شصدف	۱۲	۳.۱	۴۴,۸۵۰	۷۰%	۳,۸۲۳	۱۴,۰۳۳	-	+۲۶۷%	۳.۰	
		شدوص	۱۲	۱.۷	۱۸,۱۲۰	۹۳%	۱,۹۲۷	۲,۷۴۸	-	+۴۳%	۶.۶	
بسته بندی و ظروف	ظروف شیشه ای	کرازپ	۱۲	۵.۵	۱,۸۸۷	۲۷%	۲۲۴	۳۱۸	-	+۴۲%	۵.۷	
		کهمد	۳	۴.۴	۵,۹۲۰	۱۹%	۴۹۷	۶۸۹	۱,۰۶۸	+۳۸%	۸.۶	۵.۸
		کگاز	۱۲	۲.۲	۲۶,۲۸۰	۶۴%	۱,۴۰۰	۴,۱۳۷	-	+۱۹۵%	۶.۱	

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (م.م.ت)	قیمت	تقسیم سود	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	۱۴۰۲ (میانگین)	۱۴۰۳ (میانگین)	رشد سود ۱۴۰۲ نسبت به ۱۴۰۱	نسبت P/E با سود ۱۴۰۲	نسبت P/E با سود ۱۴۰۳
مواد پایه	فلزات و استخراج	فولاد	۱۲	۵۱۰.۴	۶,۳۸۰	۵۹%	۶۸۴	۱,۰۳۱	-	+۵۱%	۵.۸	
		فولاد	۱۲	۴۱.۶	۱۷,۳۲۰	۹۱%	۱,۷۲۵	۳,۷۶۶	-	+۱۱۸%	۴.۲	
		کاهه	۱۲	۳۷.۶	۱۱,۷۴۰	۷۸%	۱,۰۵۶	۲,۲۴۴	-	+۱۱۳%	۴.۹	
		ارفع	۱۲	۳۰.۸	۲۵,۷۰۰	۷۱%	۳,۱۱۷	۴,۱۵۶	-	+۳۳%	۶.۲	
	محصولات فلزی	کوبیر	۱۲	۱۴.۷	۳,۹۵۲	۱۵%	۴۴۱	۶۳۹	-	+۴۵%	۶.۱	
		فنوال	۱۲	۴.۱	۱۲,۱۱۰	۵۴%	۸۷۳	۹۵۴	-	+۹%	۱۲.۲	
		سرب و روی	۱۲	۲.۳	۷,۷۰۰	۳۹%	۱,۲۶۵	۱,۶۰۹	-	+۲۷%	۴.۵	
	مصالح ساختمانی	فتوسا	۱۲	۱.۲	۸,۱۲۰	۱۷%	۱,۴۴۳	۲,۲۳۳	-	+۵۵%	۳.۵	
		ساوه	۱۲	۷.۸	۱۲۰,۴۰۰	۹۶%	۱۵,۸۳۸	۲۰,۱۳۴	-	+۲۷%	۶.۰	
		ستایک	۱۲	۶.۰	۲۰,۱۱۰	۹۰%	۲,۴۹۵	۳,۶۱۸	-	+۴۵%	۵.۶	
		سیمان، اهک و گچ	۹	۴.۷	۳۵,۴۰۰	۱۱۹%	۳,۴۵۴	۴,۶۸۳	۸,۹۹۸	+۳۶%	۷.۶	۳.۹
		ساروم	۱۲	۴.۶	۴۵,۹۲۰	۹۵%	۵,۵۴۳	۶,۹۷۵	-	+۲۶%	۶.۶	
		سصو..	۱۲	۳.۹	۳۵,۴۸۰	۸۶%	۳,۶۸۵	۶,۷۴۷	-	+۸۳%	۵.۳	
		سقاین	۱۲	۱.۶	۶۴,۵۳۰	۹۹%	۵,۹۵۳	۹,۵۰۹	-	+۶۰%	۶.۸	
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	کفرا	۱۲	۲.۶	۱۲,۷۶۰	۱۰%	۶۶۴	۴,۱۳۷	-	+۵۲۳%	۳.۱	



		نسبت P/E با سود		نسبت P/E با سود	رشد سود ۱۴۰۲		نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۳ (میانگین)	۱۴۰۲ (میانگین)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	تقسیم سود	قیمت	ارزش بازار (م.ت)	سال مالی	نماد	فعالیت	گروه صنعتی
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	فلزات و معادن	۱۴۰۳	۴.۴	۷.۰	۳۳٪+	۵,۸۴۹	۳,۶۹۷	۲,۷۷۷	۶۲٪	۲۶,۵۴۰	۴۸.۲	۶	وکغذیر			
			۱۴۰۲	۶.۴	۱۲.۷	۳۰٪-	۳,۶۴۵	۱,۷۶۰	۲,۵۰۲	۴۴٪	۲۲,۳۵۰	۱۷.۹	۳	واحیا			
		تامین سرمایه	۱۴۰۳	۱۴.۹	۱۴.۹	۲۴٪+	-	۵۸۲	۴۷۱	۹۹٪	۸,۷۰۰	۱۵.۷	۶	امین			
			۱۴۰۲	۵.۱	۵.۱	۱۷٪+	-	۸۸۵	۷۵۸	۱۰۰٪	۴,۵۰۰	۱۱.۰	۱۲	تنوین			
		چند رشته‌ای	۱۴۰۳	۷.۱	۷.۱	۹٪+	-	۹۵۱	۸۷۵	۸۴٪	۶,۷۹۰	۱۵.۹	۹	وسپه			
			۱۴۰۲	۲۵۲٪+	۲۵۲٪+	۲۵۲٪+	-	۵۴۸	۱۵۶	۲۵٪	۸,۹۴۰		۱۲	بورس			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۱۴۰۳	۶.۷	۶.۷	۱۶٪+	-	۵,۲۱۱	۴,۴۸۵	۹۴٪	۳۹,۱۵۰	۷.۰	۱۲	دتوزیع			
			۱۴۰۲	۶.۸	۶.۸	۲۶٪+	-	۵,۱۳۸	۴,۰۶۳	۹۳٪	۳۵,۰۰۰	۵.۶	۱۲	هجرت			
			۱۴۰۳	۶.۰	۶.۰	۲۹٪+	-	۴,۹۱۰	۳,۸۱۲	۹۲٪	۳۲,۹۷۰	۴.۶	۱۲	دفرا			
			۱۴۰۲	۶.۵	۶.۵	۱۲٪+	-	۳,۰۰۰	۲,۶۷۳	۹۵٪	۲۲,۰۳۰	۴.۰	۱۲	دابور			
			۱۴۰۳	۵.۶	۵.۶	۳۴٪+	-	۲,۸۶۵	۲,۱۳۲	۹۸٪	۱۸,۰۵۰	۳.۸	۱۲	درازک			
			۱۴۰۲	۶.۶	۶.۶	۶٪+	-	۶,۸۹۱	۶,۵۳۱	۹۸٪	۵۱,۷۰۰	۳.۷	۱۲	دتماد			
			۱۴۰۳	۶.۹	۶.۹	۲۱٪+	-	۱,۲۷۸	۱,۰۵۴	۵۲٪	۸,۸۱۰	۳.۲	۱۲	دسیحان			
			۱۴۰۲	۶.۹	۶.۹	-	-	۲,۳۴۴	۲,۳۴۰	۹۷٪	۱۸,۴۴۰	۲.۶	۱۲	کاسپین			
			۱۴۰۳	۷.۲	۷.۲	۱۵٪+	-	۱۰,۵۷۹	۹,۲۰۷	۹۴٪	۷۶,۵۵۰	۲.۳	۱۲	دکپسول			
			۱۴۰۲	۵.۱	۵.۱	۶۱٪+	-	۱,۷۳۱	۱,۰۷۶	۹۰٪	۹,۸۱۰	۱۹.۶	۱۲	شنفت			
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	زغال سنگ	۱۴۰۳	۴.۸	۴.۸	۱۳۳٪+	-	۶,۱۵۶	۲,۶۴۷	۱۰۰٪	۳۲,۰۰۰	۱۱.۲	۱۲	کزغال			
			۱۴۰۲	۵.۳	۵.۳	۱۰۹٪+	-	۴,۱۲۳	۱,۹۷۶	۶۵٪	۲۳,۳۰۰	۱.۸	۱۲	کطبس			
			۱۴۰۳	۱۵.۳	۱۵.۳	۲٪+	-	۳,۱۶۵	۳,۱۰۷	۹۶٪	۴۸,۴۵۰	۳.۴	۱۲	سپیدار			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۱۴۰۳	۱۴.۹	۱۴.۹	۳۳٪+	-	۳,۳۸۱	۲,۵۴۷	۹۲٪	۵۲,۶۰۰	۱.۸	۱۲	رافزا			
			۱۴۰۲														

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (م.ت)	قیمت	تقسیم سود	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	۱۴۰۲ (میانگین)	۱۴۰۳ (میانگین)	رشد سود ۱۴۰۲		نسبت P/E با سود	
										نسبت به ۱۴۰۱	نسبت به ۱۴۰۲	نسبت به ۱۴۰۱	نسبت به ۱۴۰۲
غذا و نوشیدنی	روغن خوراکی	غکورش	۱۲	۱۷.۷	۱۴,۷۲۰	۸۷%	۲,۰۵۵	۱,۳۶۴	-	-۳۴%	۹.۵		
		غیشهر	۹	۱۰.۶	۳,۵۸۰	۳۱%	۳۸۹	۴۲۹	۸۶۱	+۱۰%	۸.۴	۴.۶	
		غمارگ	۹	۱.۸	۱,۹۱۱	۱۰%	-۷۷۲	-۷۸	۱۴۲	+۹۰%	-۲۴.۴	۱۴.۱	
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۵.۶	۱۵,۵۵۰	۷۶%	۱,۶۱۰	۲,۱۵۲	-	+۳۴%	۶.۷		
		غپینو	۱۲	۴.۳	۴,۷۹۳	۶۰%	۴۸۵	۶۶۶	-	+۳۷%	۷.۲		
		غسالم	۱۲	۲.۷	۵,۹۷۰	۵۲%	۶۵۱	۷۸۱	-	+۲۰%	۷.۲		
		غمینو	۱۲	۱.۸	۱۱,۷۶۰	۷۰%	۱,۴۹۴	۱,۷۵۸	-	+۱۸%	۶.۷		
	زراعت و خدمات وابسته	سیمرغ	۹	۴.۱	۳۱,۷۱۰	۲۱%	۳,۹۱۴	۴,۹۵۱	۹,۴۹۶	+۲۶%	۶.۴	۳.۷	
		زدشت	۱۲	۲.۸	۴۰,۴۵۰	۷۹%	۲,۱۲۰	۲,۷۶۴	-	+۳۰%	۱۴.۰		
		تلیسه	۱۲	۲.۸	۵,۵۸۴	۸۶%	۲۵۲	۴۳۸	-	+۷۴%	۱۲.۳		
		زفکا	۱۲	۲.۶	۱۷,۲۴۰	۸۹%	۱,۵۴۶	۲,۹۹۲	-	+۹۳%	۵.۳		
		زقیام	۱۲	۲.۳	۳,۲۹۹	۸۲%	۲۸۸	۵۶۰	-	+۹۴%	۵.۵		
		زبینا	۱۲	۱.۷	۴,۷۲۳	۶۲%	۴۰۲	۶۷۲	-	+۶۷%	۶.۷		
		زگلدشت	۱۲	۱.۶	۲۲,۵۰۰	۹۸%	۹۵۸	۱,۹۳۵	-	+۱۰۲%	۱۱.۲		
		زشریف	۹	۱.۵	۶,۱۹۰	۸۰%	۴۸۱	۶۱۴	۸۷۸	+۲۸%	۱۰.۱	۷.۵	
		زملارد	۱۲	۱.۲	۱۵,۴۵۰	۹۸%	۳۲۷	۱,۴۲۶	-	+۳۳۷%	۱۰.۸		
		زمگسا	۱۲	۱.۲	۴۰,۱۶۰	۹۹%	۳,۲۶۴	۴,۳۸۸	-	+۳۴%	۸.۴		
		زشگزا	۱۲	۰.۹	۹,۵۲۰	۵۷%	۷۸۲	۱,۹۳۴	-	+۱۴۷%	۴.۷		
		زکشت	۱۲	۰.۰	۰	۷۰%	۲,۵۲۹	۲,۸۲۹	-	+۱۲%	-۰.۶		
	غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۸.۵	۴,۷۰۱	۱۳%	۴۵۱	۵۹۲	-	+۳۱%	۷.۸		
		غمهرا	۱۲	۲.۴	۱۲,۶۰۰	۱۰%	۱,۰۱۰	۱,۷۳۵	-	+۷۲%	۷.۲		
	محصولات لبنی	غشان	۱۲	۱.۵	۸,۷۸۰	۸۸%	۷۹۵	۷۹۶	-	-	۱۰.۲		
		غگلپا	۱۲	۱.۵	۴۰,۱۰۰	۵۲%	۴,۶۵۰	۴,۹۸۹	-	+۷%	۸.۰		
		غفارس	۱۲	۱.۵	۱۲,۷۵۰	۴۰%	۱,۰۱۰	۱,۳۶۷	-	+۳۵%	۹.۳		
		غگلستا	۱۲	۱.۵	۲۳,۱۰۰	۴۹%	۱,۵۶۲	۲,۱۳۵	-	+۳۷%	۱۰.۸		
	نوشیدنی	غبهوش	۱۲	۲.۵	۷۰,۴۰۰	۲۵%	۱,۱۰۳	۵,۳۰۰	-	+۳۸۰%	۱۳.۲		
		غدیس	۱۲	۲.۴	۲۰,۴۲۰	۵۷%	۱,۴۶۶	۱,۸۵۳	-	+۲۶%	۱۰.۶		



نسبت قیمت به سود (P/E) سال مالی ۱۴۰۳ و ۱۴۰۲

		نسبت P/E با سود		نسبت P/E با سود		رشد سود ۱۴۰۲		نسبت به ۱۴۰۱		۱۴۰۳ (میانگین)		۱۴۰۲ (میانگین)		سود ۱۴۰۱ (واقعی)		تقسیم سود		قیمت		ارزش بازار (ت.م.ه)		سال مالی		نماد		فعالیت		گروه صنعتی		
صنعتی	ترابری		۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
		۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر													
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲	۱۲	حکهر												
			۶.۲	۹.۷	۷.۵	۵.۳	۱۱,۹۲۳	۸,۸۴۹	۶,۳۱۲	۶,۶۷۰	۴۳۰	۶۸۵	۱,۴۹۹	۱۰%	۱۴,۰۶۰	۶.۲														

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

