

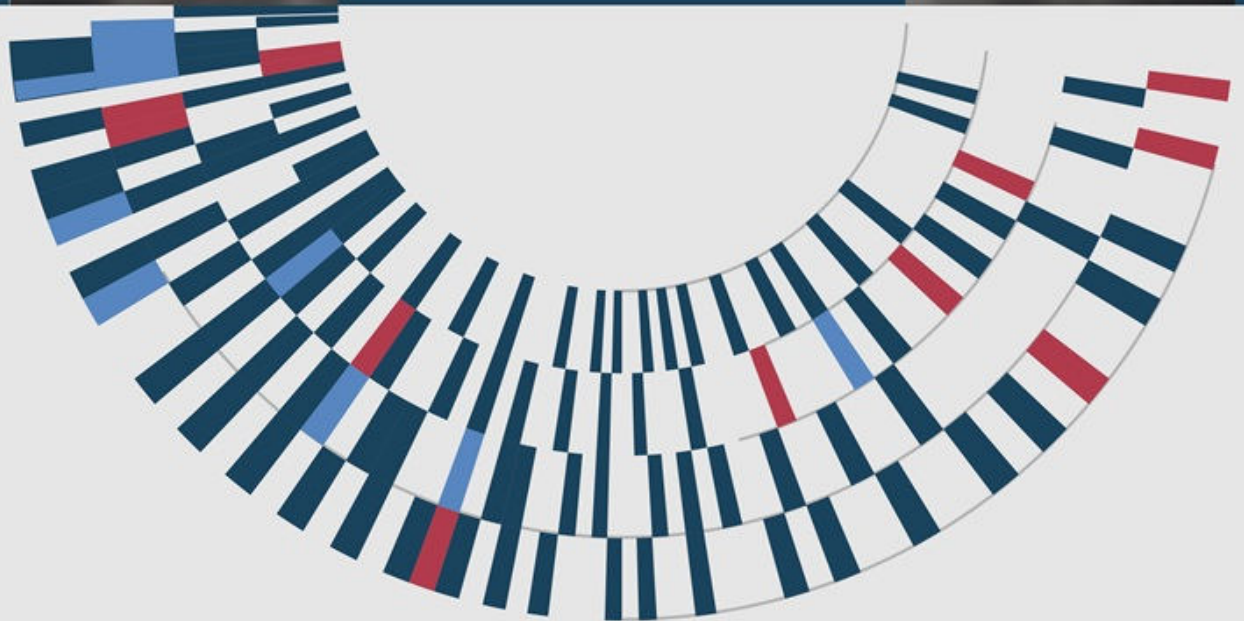
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۱۹

 CHARISMA





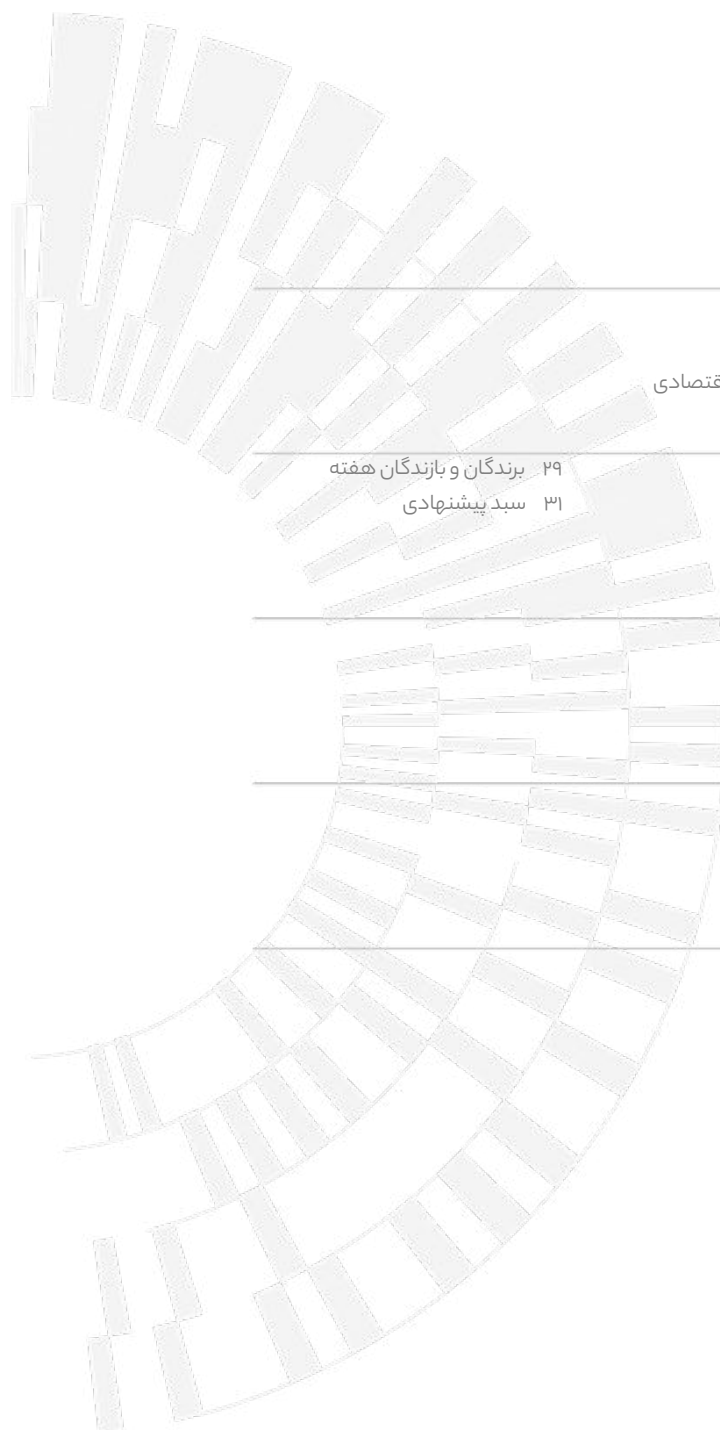
معرفی گزارش:

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 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.



۵۳	کامودیتی	۵۴ فلزات و معادن ۵۵ پتروشیمی ۵۶ انرژی و سایر محصولات ۵۷ گاز طبیعی	۵۸ سیمان ۵۹ اخبار و معیارهای تاثیرگذار ۱۱ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی
۱۲	بازار سهام	۱۳ مروری بر بازارهای موازی ۱۵ بررسی بلندمدت بازار سهام ۱۷ نرخ بهره و رونق بازار سهام ۱۸ ارزش معاملات	۲۹ برندگان و بازندگان هفته ۳۱ سبد پیشنهادی
۳۱	تحلیل تکنیکال	۳۲ شاخص کل (بورس تهران) ۳۳ شاخص کل هم وزن (بورس تهران) ۳۴ شاخص هم وزن به شاخص کل (بورس تهران) ۳۵ نسبت شاخص کل به دلار آزاد	۳۶ دلار آمریکا (بازار آزاد) ۳۷ سکه امامی ۳۸ طلای جهانی ۳۹ نفت برنت
۴۱	اجماع تحلیل گران	۴۲ نسبت قیمت به سود (سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)	

کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY





فلزات و معادن

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	روند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۶۱	۰.۷%	فزر	-	۱,۶۴۳۲,۰۱۷	۷%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۳۳۸	۲.۵%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۱۵۸۹,۳۴۱	-۷%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۴۸	-۰.۴%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۵۰۴	-۱۰%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۳۷۶	۱.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳۳,۶۰۰	-۳۲%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۵۵	-۱.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۸۵۲۲,۲۷۳	-۱%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۸۴۳	۲.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان	۲,۶۸۳۴,۸۴۳	۴۲%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۲۵	۲.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان	۲,۰۹۶۳,۶۲۵	۲۹%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۸	۰.۰%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان	کویر، فوکا، فنورد	۴۸۳۶۲۳	۰%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۲۶۹	۲.۹%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسازان، کطبیس، کپور، کزغال، کشیق	کویر، فوکا، فنورد	۱۲,۳۰۸۲۲,۸۲۱	۴۳%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۵	-۲.۴%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۳%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۰۰	۰.۰%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۱,۶۶۷۲۲,۰۸۰	۲۱%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۳۵	۰.۸%	ذوب، کویر	فولای	۶۲۵۷۵۵	۹%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۳,۷۰۰	۲.۷%	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۰۲۴۲۴,۷۴۷	۴۱%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۸۰	-۲.۹%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۰۷۸۰	-۱۸%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۷۸	-۲.۹%	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	-۱۷%



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
اوره	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۲۹۰	۰.۰%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفارس	۷۷۳ ۲۹۰	-۵۳%
متانول	CFR چین	دلار/تن	۲۴۵	۰.۰%	زاگرس، شخارک، شغن، شیراز	شفارس، شسینا	۳۴۷ ۲۴۵	-۲۹%
اتیلن	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۸۷۰	۰.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۱۱۵۰ ۸۳۹	-۲۴%
پلی اتیلن سبک	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۱۴	-۳.۳%	آریا، شکبیر	-	۱۴۱۳ ۹۱۴	-۳۴%
پلی اتیلن سبک خطی	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۱۸	-۱.۶%	جم، شکبیر، شاراک	-	۱۰۶۶ ۸۶۶	-۱۳%
پلی اتیلن سنگین	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۴۰	-۱.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۱۴۱۵ ۸۴۰	-۳۴%
مونواتیلن گلایکول	CFR چین	دلار/تن	۴۷۰	-۰.۸%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۶۳۵ ۴۳۷	-۲۵%
PET	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۹۸۰	۰.۱%	شگویا	-	۱۰۹۹ ۹۳۴	
پروپیلن	CFR چین	دلار/تن	۷۸۰	-۳.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۱۲۲۸ ۷۸۰	-۳۱%
پلی پروپیلن	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۸۳۴	-۲.۲%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۱۰۳۱ ۸۳۴	-۱۹%
پاراازایلن	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۹۵۴	-۲.۸%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۱۴۰۳ ۹۰۲	-۳۲%
ارتوزایلن	CFR چین	دلار/تن	۱,۰۶۰	-۰.۸%	شصفها، نوری	-	۱,۲۷۵ ۹۷۹	-۱۶%
استایرن	CFR چین	دلار/تن	۹۶۵	-۰.۹%	پارس	شجم، شبصیر	۱,۵۰۵ ۹۴۰	-۳۶%
بنزن	CFR چین	دلار/تن	۸۳۰	-۱.۲%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۱,۳۴۳ ۸۰۲	-۳۸%
تولون	CFR چین	دلار/تن	۷,۰۴۵	-۱.۲%	بوعلی	-	۷,۷۳۹ ۶,۱۲۹	
بوتادین	CFR چین	دلار/تن	۷۸۰	-۵.۹%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۱,۵۶۸ ۷۳۹	-۴۸%
PVC	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۷۶۰	-۲.۴%	شغدیر، ارونند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۱,۲۱۵ ۶۹۹	-۳۷%
ABS	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۱,۲۵۰	۰.۱%	شبصیر	-	۱,۷۹۵ ۱,۲۴۹	-۳۰%



انرژی و سایر محصولات

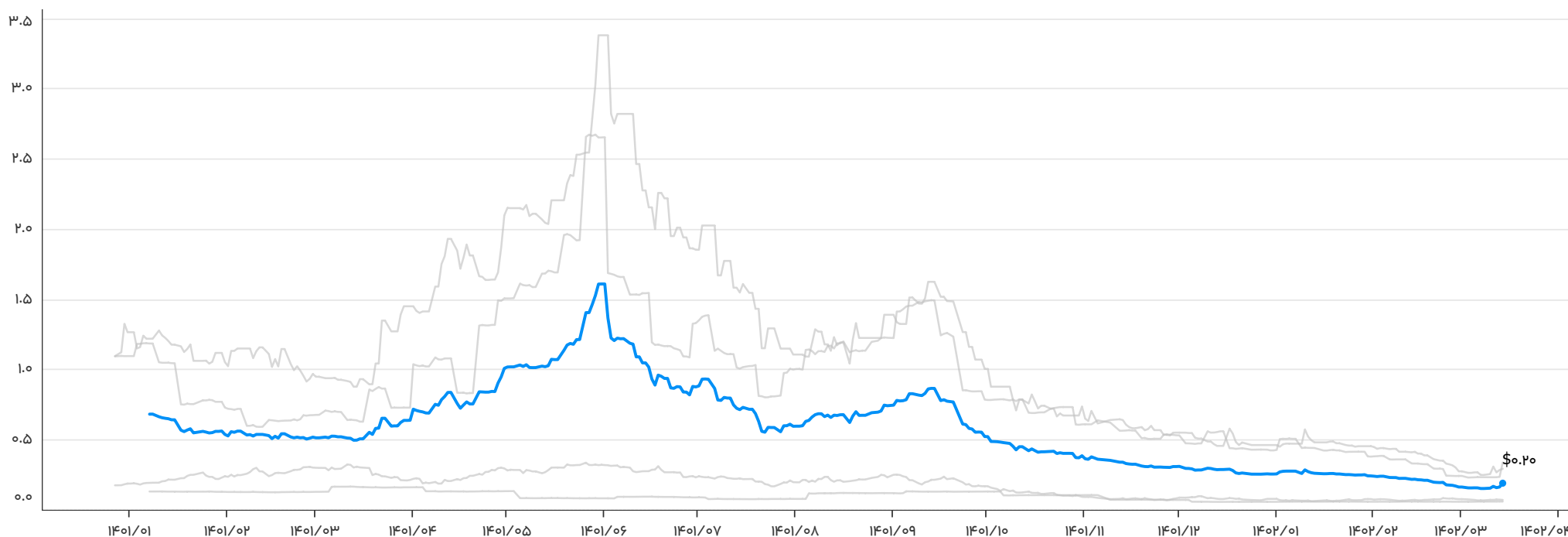
عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
انرژی و فرآورده‌های نفتی	نفت برنت	دلار/بشکه	۷۵	-۲.۷%	-	شپنا، شتران، شیندر، شبریز، شراز، شاوان		
	نفت WTI	دلار/بشکه	۷۰	-۳.۴%	-	شپنا، شتران، شیندر، شبریز، شراز، شاوان		
	نفت کوره	دلار/بشکه	۹۹	-۰.۴%	شپنا، شتران، شیندر، شبریز، شراز، شاوان	-		
	گازوئیل کم سولفور	دلار/بشکه	۹۴	۱.۰%	شپنا، شتران، شیندر، شبریز، شراز، شاوان	-		
	لوب کات - پالایش نفت تهران	تومان/تن	۱۲,۸۷۳	۰.۰%	شپنا، شتران، شیندر، شبریز، شراز، شاوان	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل		
	روغن پایه - نفت سپاهان	تومان/تن	۲۳,۴۲۰	-۱.۱%	شپهرن، شسپا، شنف، شرانل	-		
محصولات کشاورزی	قیر - نفت پاسارگاد	تومان/تن	۱۳,۱۳۱	-۱۱.۹%	شپاس	-		
	ذرت آمریکا	دلار/تن	۲۳۸	۰.۰%	-	غگورش، غیشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		
	روغن پالم خام	دلار/تن	۷۲۸	-۷.۰%	-	غگورش، غیشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		
	شکر آمریکا	دلار/تن	۱,۵۱۳	-۳.۷%	-	-		
ارز و ارز دیجیتال	گندم آمریکا	دلار/تن	۲۳۲	۲.۲%	-	-		
	یورو به دلار	-	۱.۰۷	۰.۱%	-	-		
	پوند به دلار	-	۱.۲۶	۱.۸%	-	-		
	بیتکوین	دلار	۲۶,۴۴۲	-۱.۳%	-	-		



هپ	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
هنری هاب	دلار \مترمکعب	۰.۰۸	۴.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ / ۰.۳۴	-۶۸%
آلبرتا	دلار \مترمکعب	۰.۰۷	۰.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ / ۰.۱۷	-۵۹%
هلند (TTF)	دلار \مترمکعب	۰.۳۰	۹.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ / ۳.۳۹	-۷۸%
انگلستان (NBP)	دلار \مترمکعب	۰.۳۵	۴۲.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ / ۲.۶۸	-۶۰%
میانگین ۴ هاب	دلار \مترمکعب	۰.۲۰	۲۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ / ۱.۶۲	-۷۶%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



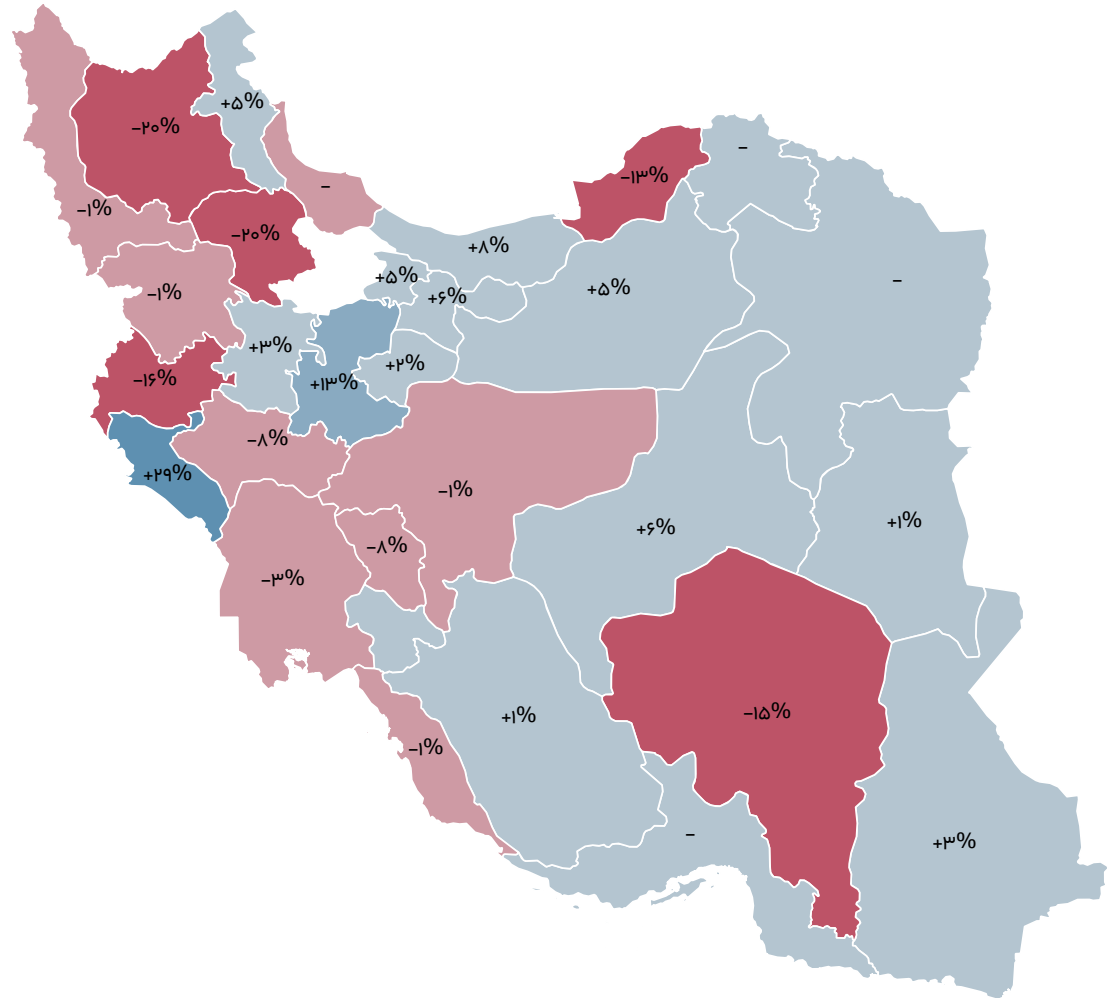
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس حجم معاملات

منطقه	استان	واحد	هفته قبل	هفته گذشته	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	تومان/کیلو	۸۶۳	۹۱۹	+۶%
	مرکزی	تومان/کیلو	۸۲۶	۹۳۶	+۱۳%
	البرز	تومان/کیلو	۸۷۶	۹۲۴	+۵%
	اصفهان	تومان/کیلو	۷۹۷	۷۸۷	-۱%
	سمنان	تومان/کیلو	۶۰۴	۶۳۷	+۵%
	قم	تومان/کیلو	۸۶۹	۸۸۳	+۲%
جنوب	یزد	تومان/کیلو	۶۳۶	۶۷۶	+۶%
	فارس	تومان/کیلو	۹۵۱	۹۶۱	+۱%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۷۵۸	۷۵۸	+۰%
	بوشهر	تومان/کیلو	۹۰۵	۸۹۸	-۱%
غرب	همدان	تومان/کیلو	۸۲۶	۸۵۳	+۳%
	خوزستان	تومان/کیلو	۸۱۷	۷۹۳	-۳%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۸۴۰	۷۷۶	-۸%
	ایلام	تومان/کیلو	۵۵۰	۷۱۰	+۲۹%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۹۰۵	۷۵۷	-۱۶%
	کردستان	تومان/کیلو	۸۶۱	۸۵۱	-۱%
	لرستان	تومان/کیلو	۶۶۷	۶۱۷	-۸%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو		۷۵۸	
شمال	مازندران	تومان/کیلو	۷۵۵	۸۱۶	+۸%
	گیلان	تومان/کیلو	۶۲۲	۶۱۸	+۰%
	گلستان	تومان/کیلو	۷۶۲	۶۶۲	-۱۳%
شمال غرب	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۶۲۰	۶۱۱	-۱%
	اردبیل	تومان/کیلو	۸۱۹	۸۶۲	+۵%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۹۸۴	۷۸۳	-۲۰%
	زنجان	تومان/کیلو	۹۸۲	۷۸۸	-۲۰%
شمال شرق	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۴۶۶	۴۶۶	+۰%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۴۷۴	۴۷۴	+۰%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۴۸۲	۴۸۹	+۱%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۲۴۹	۱,۰۶۷	-۱۵%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۹۱۸	۹۴۵	+۳%

تغییرات قیمت منطقه ای سیمان* در هفته گذشته

تغییرات قیمت هفته گذشته نسبت به هفته قبل، براساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات



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

معادن و فلزات

- موجودی انبارهای فولاد کشور در ماه جاری به حدود ۱۶ میلیون تن رسید که نسبت به موجودی ابتدای سال یعنی ۱۱ میلیون تن، رشد چشم گیری محسوب می شود. از دلایل این افزایش موجودی می توان به افزایش قیمت های جهانی و در نتیجه ی آن کاهش تمایل برای صادرات، و ذخیره سازی محصولات جهت فروش در تابستان (به دلیل کاهش تولید به علت محدودیت های برق) اشاره نمود.
- با رسیدن آمار ضعیف شاخص مدیران خرید (PMI)، همچنان شاهد افزایش احتمال ورود چین به رکود اقتصادی هستیم. تداوم این شرایط باعث تقویت فشار عرضه بر کامودیتی ها شده است، گرچه امید به دخالت دولت چین در اقتصاد سیگنال رشد تقاضا به فولاد را داده و باعث شد تا شاهد تحرکات قابل توجهی در قیمت سنگ آهن طی چند روز گذشته باشیم.
- در اردیبهشت ماه شاهد صادرات ۱.۸۸ میلیون تن سنگ آهن بودیم که در طول تاریخ بی سابقه بوده است. علت این امر محدودیت های برقی صنایع می باشد که واحدهای معدنی را وادار به صادرات و خام فروشی نموده است.

انرژی و فرآورده های نفتی

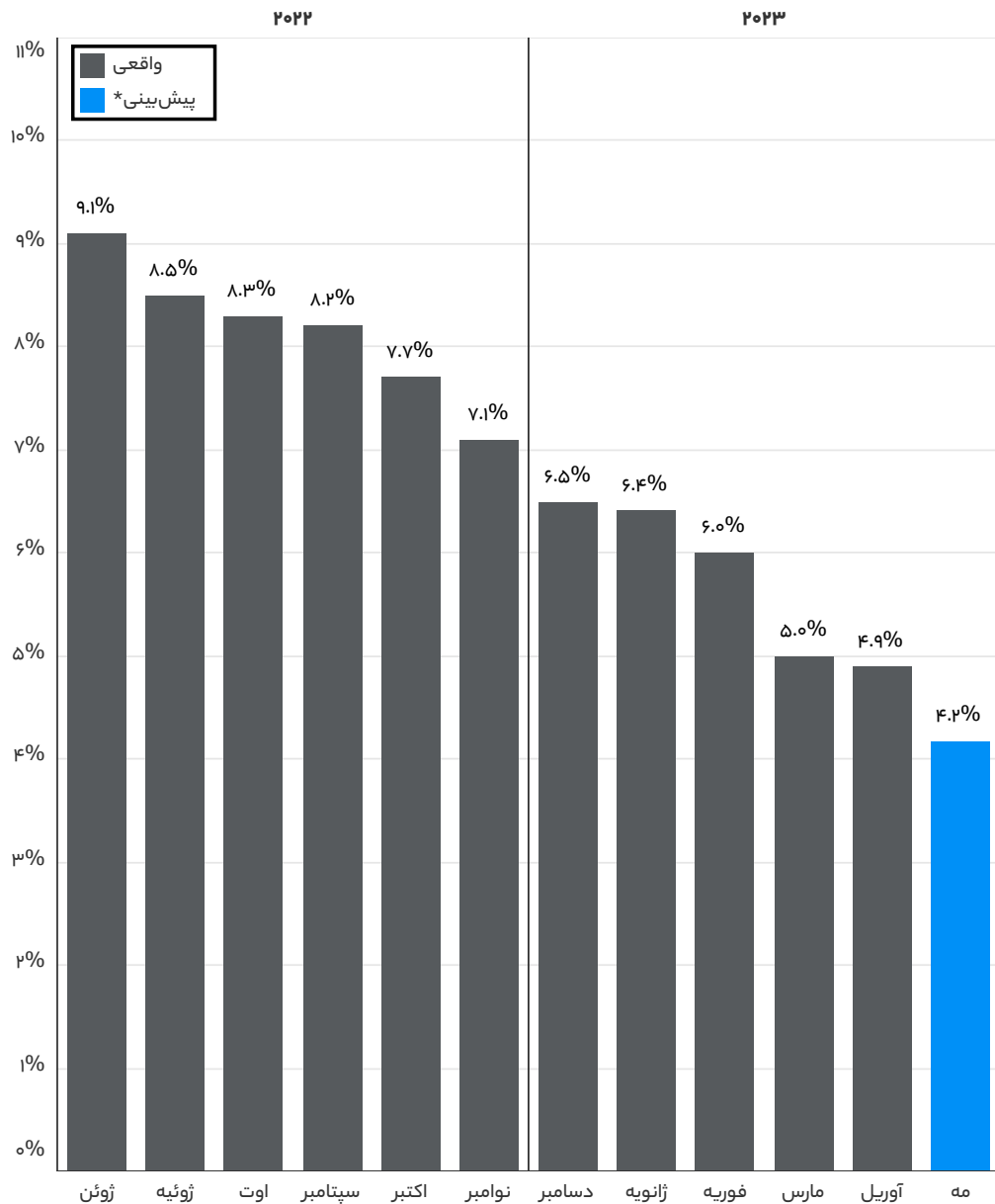
- ابتدای هفته عربستان سعودی با اعلام نمودن کاهش ۱ میلیون بشکه دیگر از تولیدات نفت خود در ماه جاری میلادی، باعث تقویت تقاضا در بازار شد. از این رو تولیدات روزانه نفت عربستان به ۹ میلیون بشکه در روز رسید.
- اقدامات اخیر اوپک در راستای کاهش تولیدات باعث شد تا مجموعاً ۳.۶۶ میلیون بشکه در روز عرضه نفت کاهش یابد که این حجم معادل ۳.۶٪ از تقاضای جهانی می باشد، که در تاریخ بی سابقه بوده است.
- همچنین اقدامات ذکر شده توسط اوپک باعث شد تا بانک UBS برآوردهای خود را بر نفت، به ۹۵ دلار برای نیمه دوم سال میلادی تغییر دهد.
- طلا و نقره تحت تاثیر انتظارات تحلیل گران مبنی بر افزایش ۰.۲۵ درصدی نرخ بهره توسط فدرال رزرو آمریکا، تحت فشار عرضه قرار گرفتند.
- در انتهای هفته افزایش گمانه زنی های تحقق توافق میان ایران و آمریکا باعث شد تا قیمت نفت نزولی شود. تحلیل گران بر این باور هستند که تحقق این توافق می تواند تولیدات نفت را روزانه ۱ میلیون بشکه افزایش دهد.

مواد شیمیایی و پلیمرها

- قیمت متانول طی هفته گذشته مجدد با آمدن آمار جدید مبنی بر کاهش رشد اقتصاد چین کاهش شد. اقتصاد چین در ترمیم آسیب های اقتصادی ناشی از کرونا با چالش روبرو شده است.
- پلی پروپیلن مجدداً طی هفته گذشته کاهش قیمت داشت که علت آن کاهش فعالیت در صنایع پایین دست و به طبع آن کاهش تقاضا می باشد.
- پی وی سی بعد از رسیدن به کف قیمتی ۶ ماهه با افزایش تقاضا روبرو شد. همچنین تولید کنندگان پی وی سی چینی از حاشیه سودهای پایین رنج می برند. در حال حاضر اسپرید پی وی سی و ونیل کلرید حدود ۱۴۰ دلار است که پایین تر از سطح سربه سری ۱۵۰ دلاری می باشد.

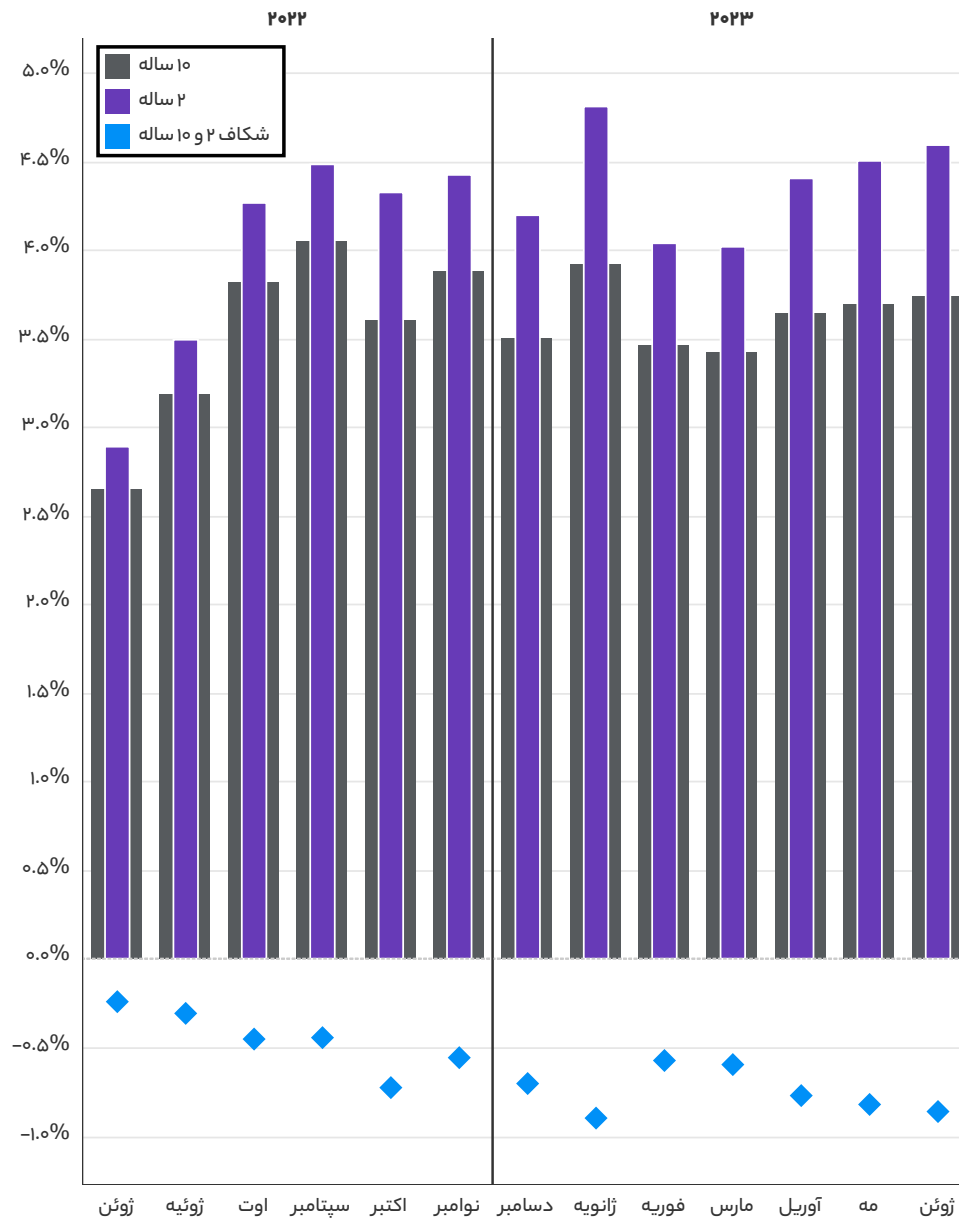
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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

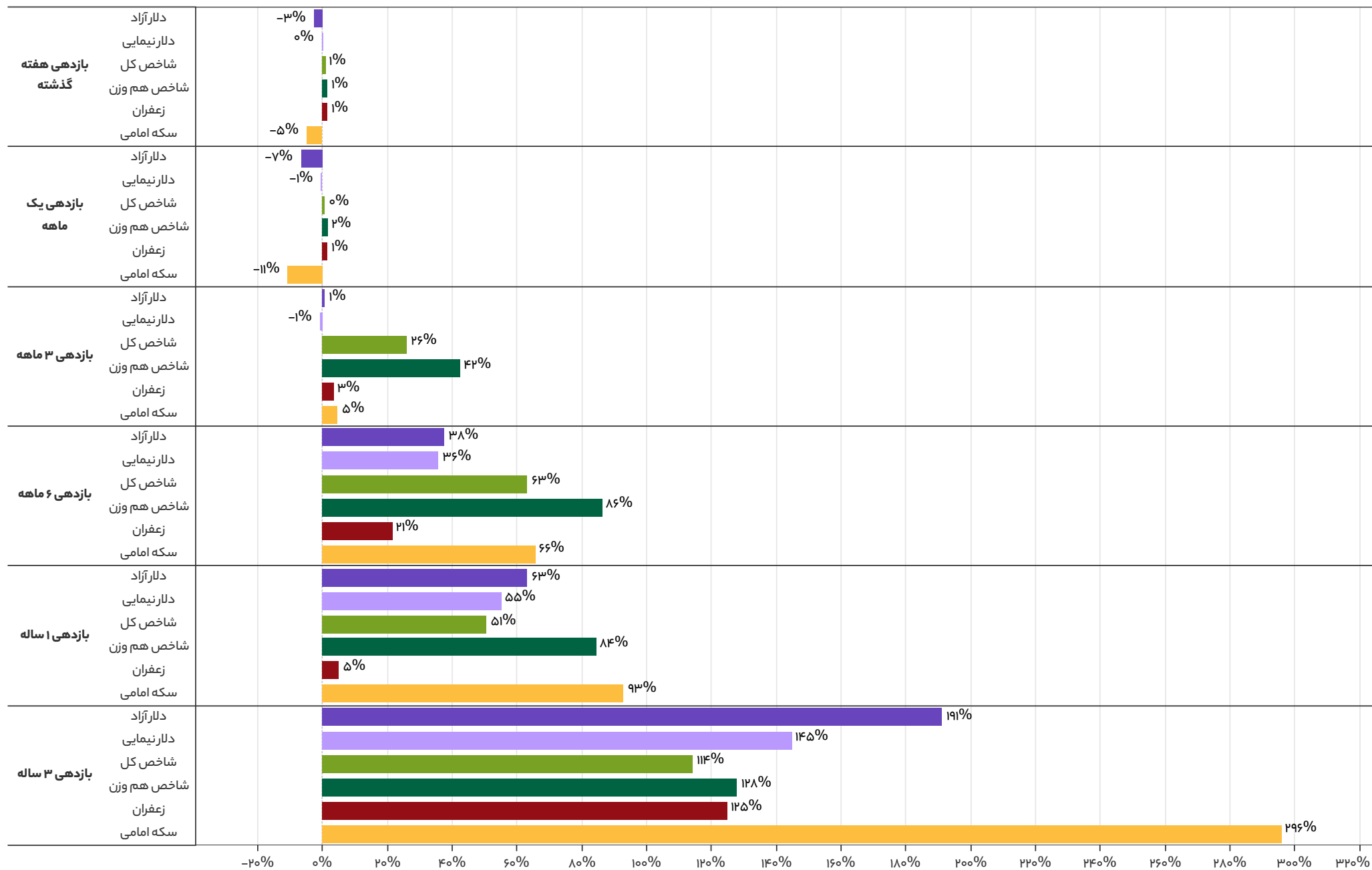
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها 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	سکه امامی
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 ▲ ۲۲.۲%	شاخص کل ▲ ۲۷.۹%	هم وزن ▲ ۳۰.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	هم وزن ۴۳%	سکه امامی ▲ ۱۱۱.۰%
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%	شاخص کل ۳۹%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%
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 ▲ ۱۰.۲%	شاخص کل ▲ ۱۲.۹%	زعفران ▲ ۱۴.۵%	دلار نیمایی ▲ ۱۸.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱۰.۲%	سکه امامی ▲ ۲.۶%	سکه امامی ۳۸%	هم وزن ▲ ۸۲.۵%
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%	زعفران ۲۶%	دلار آزاد ▲ ۶۸.۰%
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%	دلار آزاد ۲۱%	شاخص کل ▲ ۴۸.۲%
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%	دلار نیمایی ۱۹%	مسکن ▲ ۴۵.۳%
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%	مسکن ۸%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%
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%	درآمد ثابت ۱%	زعفران ▲ ۲.۸%

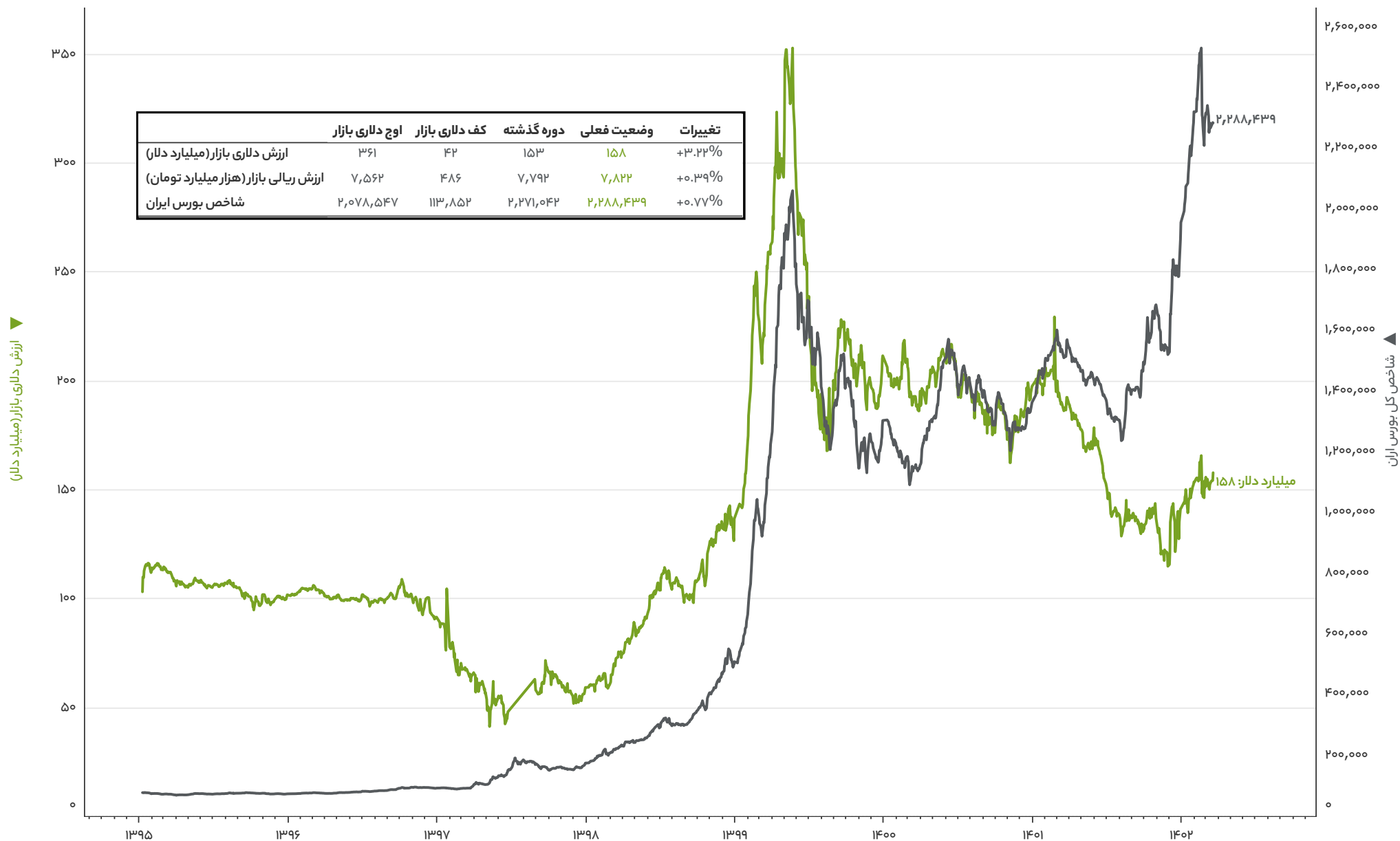
- بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه در هر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

- بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری زعفران سرخیز محاسبه شده است.

- بازده مسکن با استفاده از آماربانک 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 کاریزما ذکر گردیده، استفاده شده است.

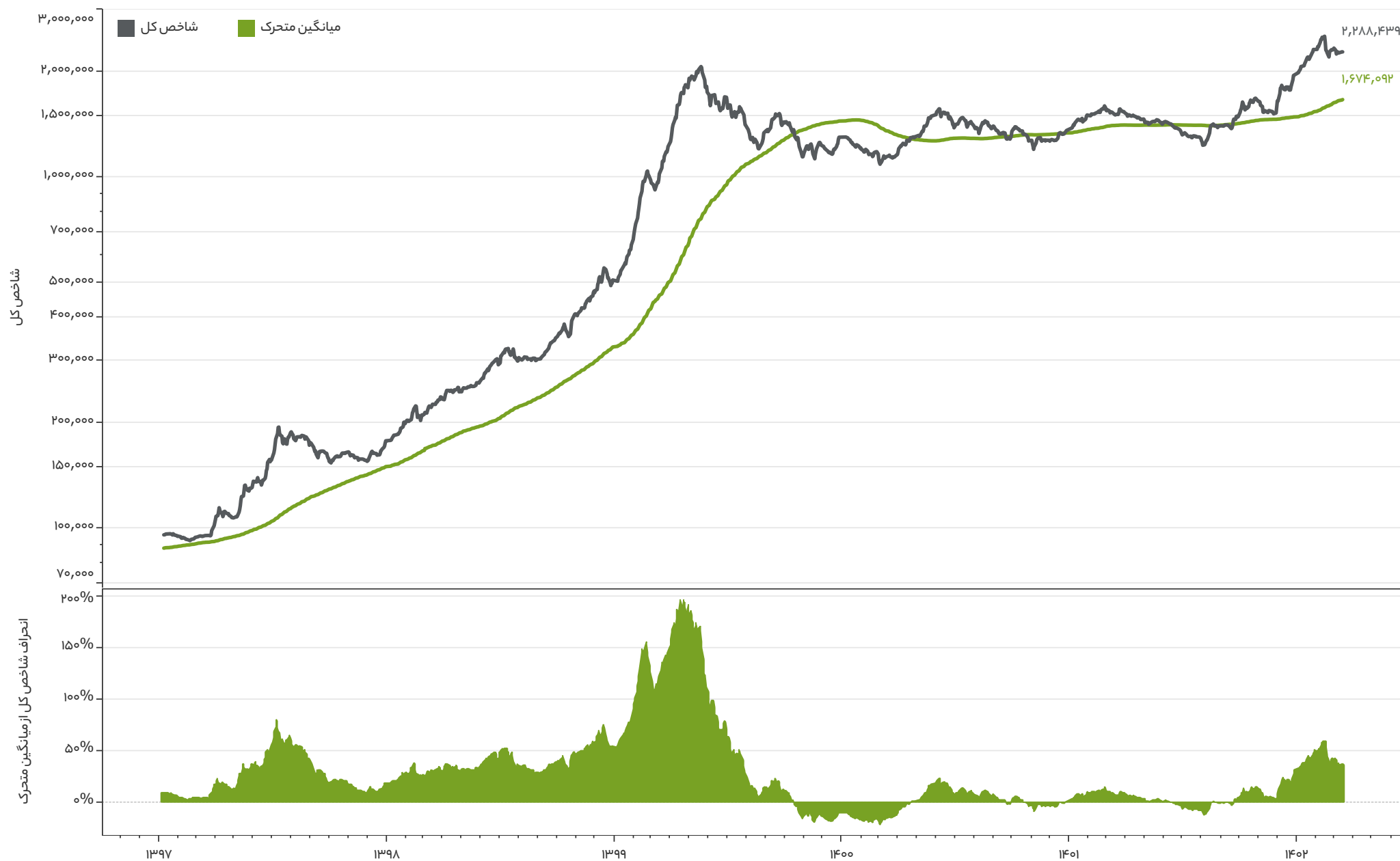
ارزش دلاری بازار

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

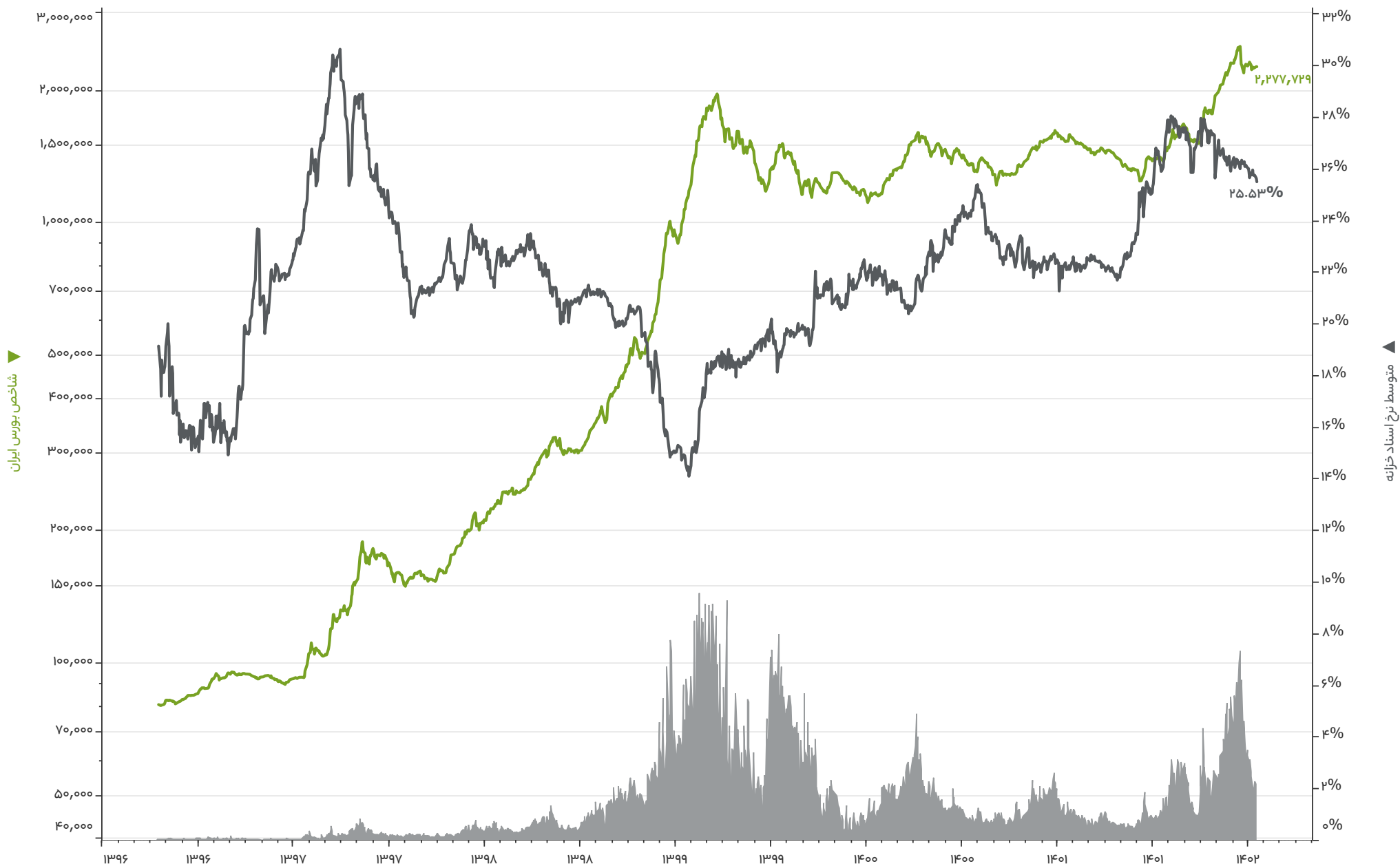
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





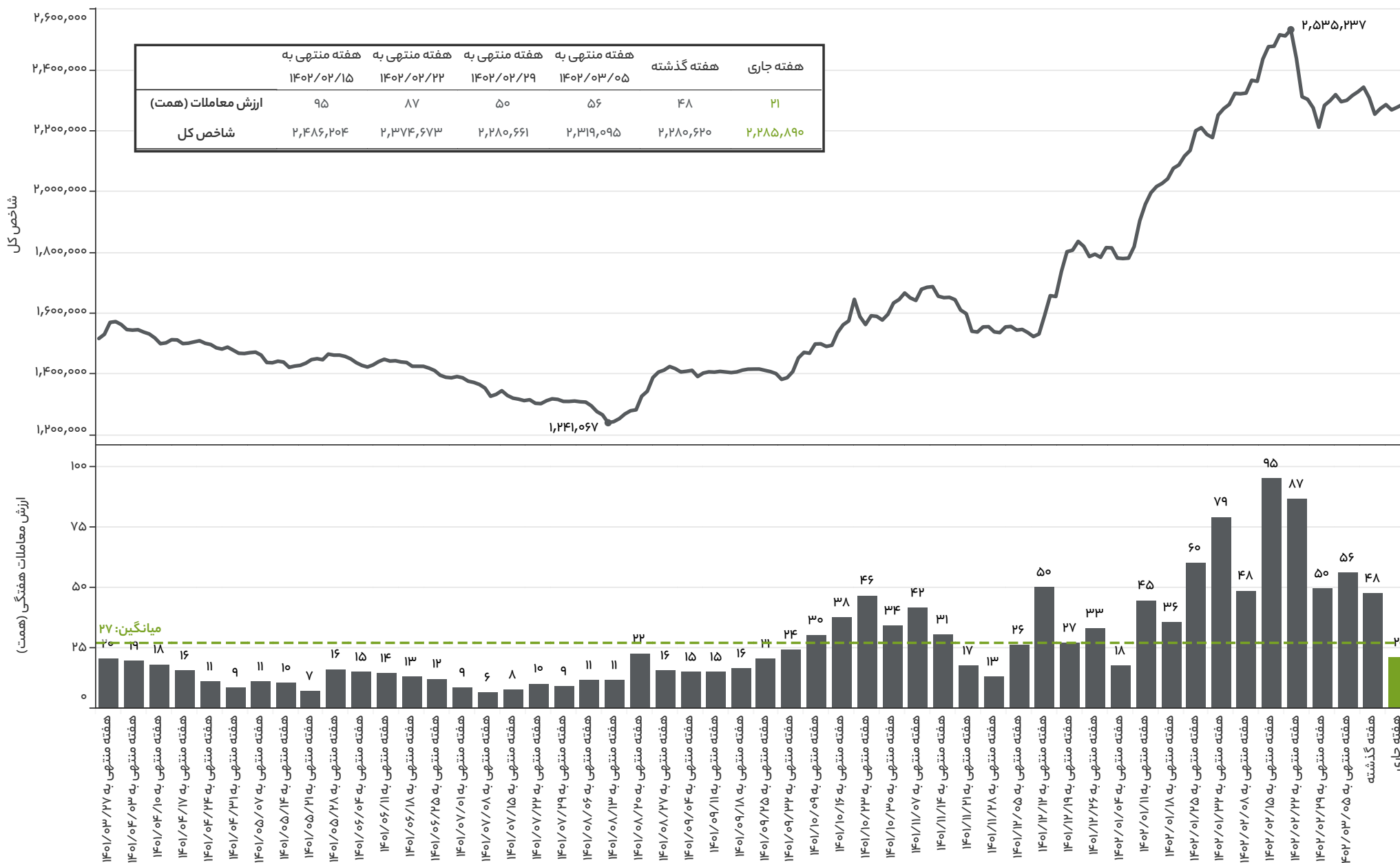
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

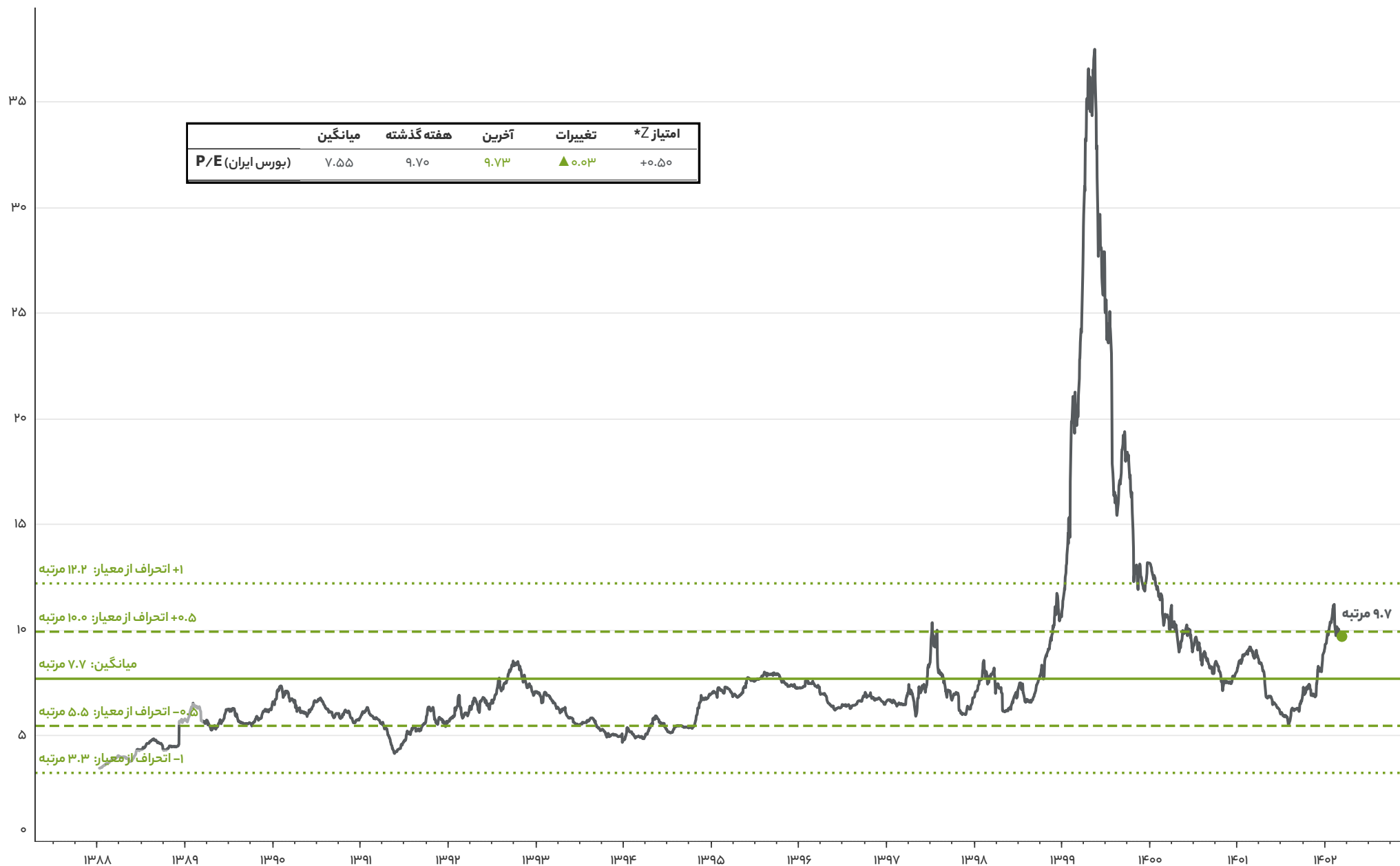
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

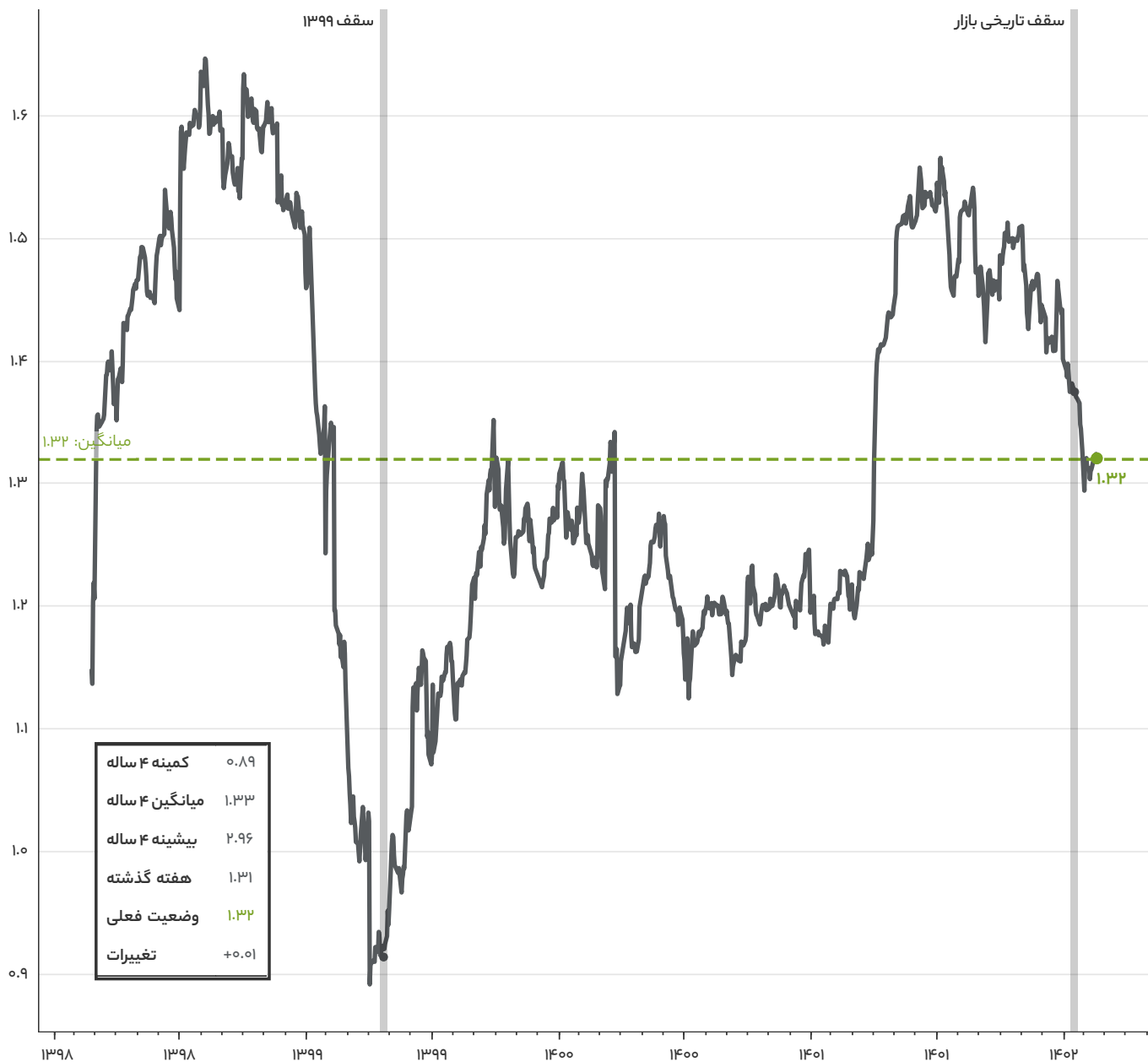
از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*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

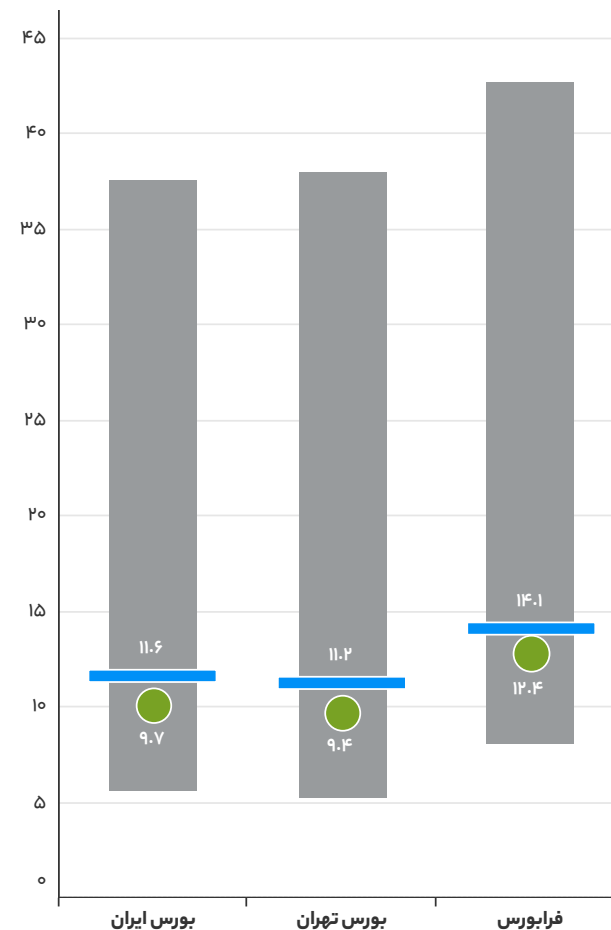
نسبت پی به ای فرابورس به بورس تهران، گذشته نگر، ۴ سال گذشته، بزرگنمایی شده



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته

وضعیت فعلی میانگین ۴ ساله دامنه ۴ ساله



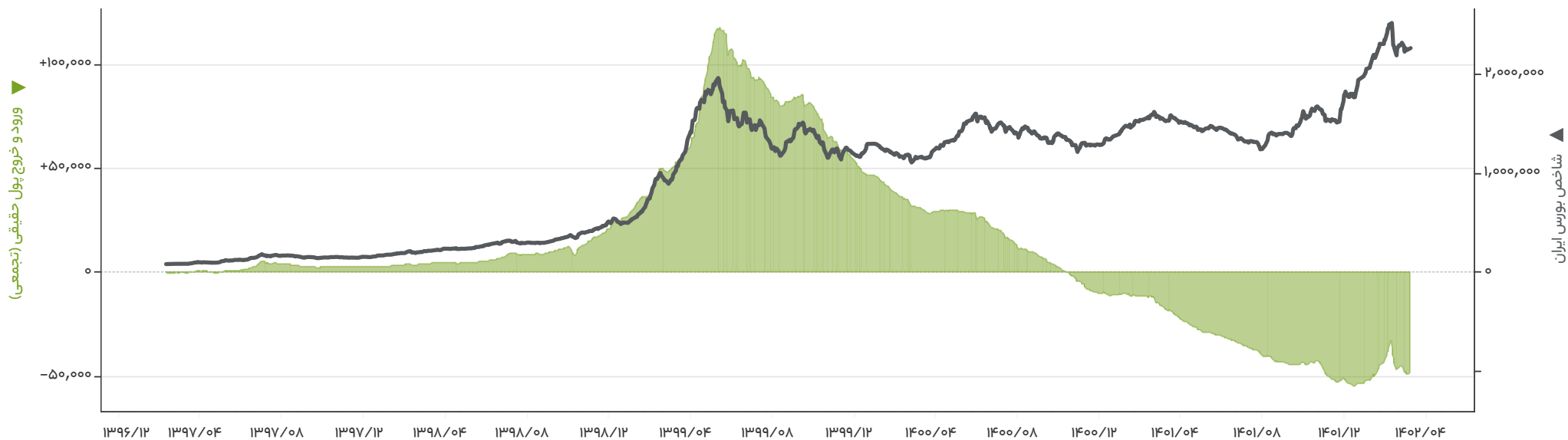
تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	بیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۹.۷۳	۹.۷۰	۵.۵۹	۱۱.۶۰	۳۷.۵۱
بورس تهران	۹.۳۵	۹.۳۳	۵.۲۵	۱۱.۲۳	۳۸.۰۰
فرابورس	۱۲.۳۶	۱۲.۲۶	۸.۰۸	۱۴.۱۱	۴۲.۶۴

بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	خدمات مالی	مواد پایه	انرژی	مصرفی دوره‌ای	مصرفی غیردوره‌ای	صنعتی	یوتیلیتی	بهداشت	ارتباطات	تکنولوژی	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۹۸	۱۸۸	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)	+۹۵۱%	+۹۳۳%	+۷۵۸%	+۱۰۳۴%	+۴۹۹%	+۴۱۸%	+۵۸۱%	+۴۰۳%	+۱۸۷%	+۳۱۷%	+۵۷۴%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۰%	+۶۳%	+۱۱%	-۱%	+۱۱%	-۱۱%	+۸۵%	+۱۹%	-۵۴%	+۸%	-۶%	
بازده از ابتدای سال	+۸۵%	+۷۹%	+۸۲%	+۱۱۸%	+۷۵%	+۱۰۴%	+۷۳%	+۱۰۱%	+۸۴%	+۷۹%	+۲۰۱%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۱%	۰%	-۱%	۳%	۰%	۱%	۰%	۲%	۴%	۲%	۳%	

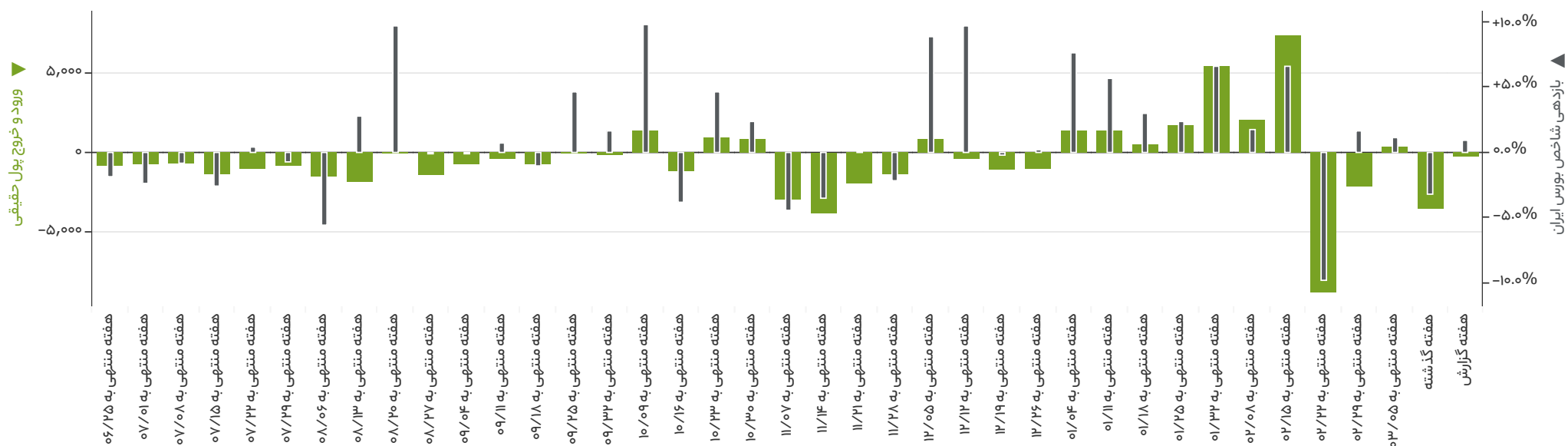
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



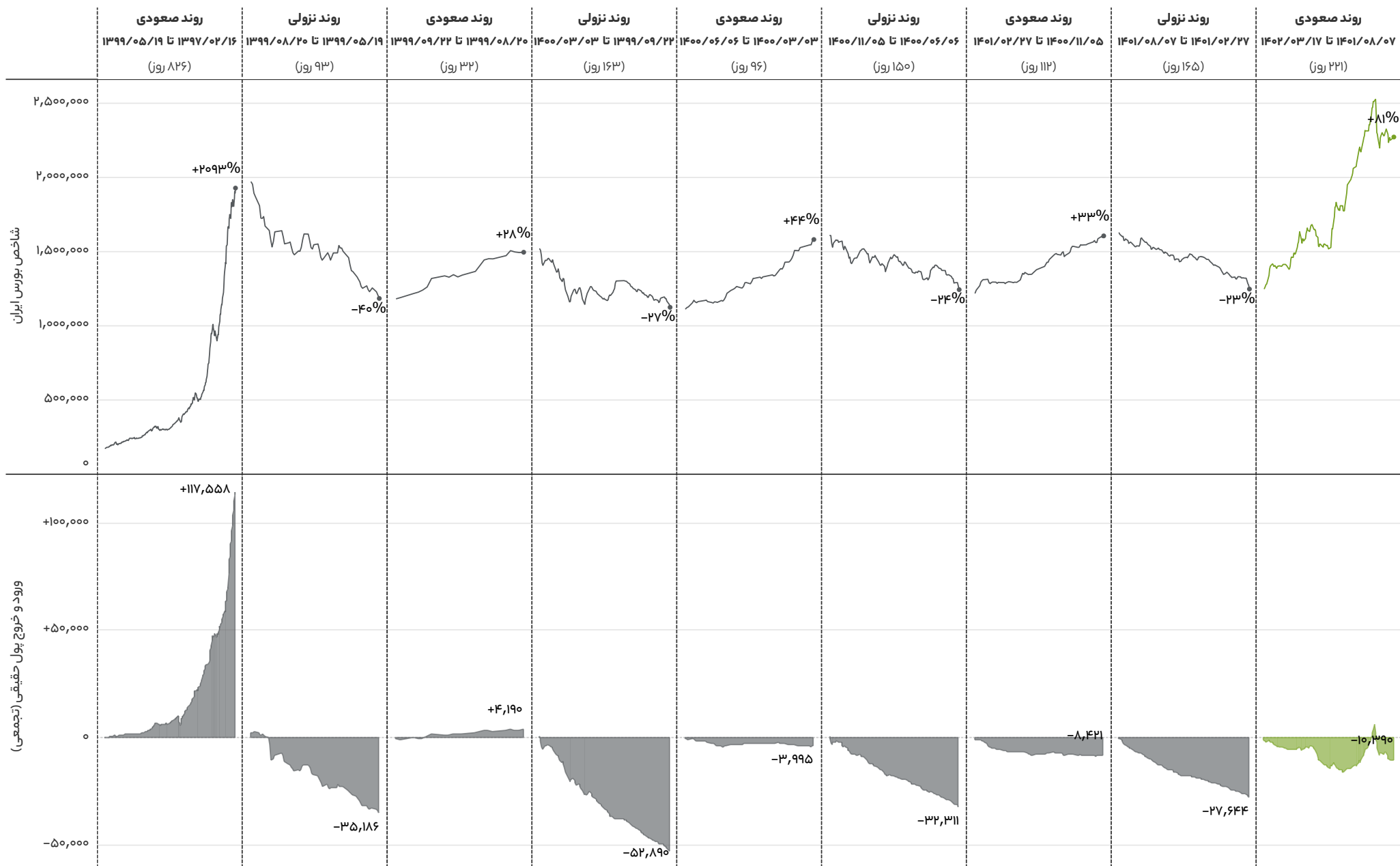
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

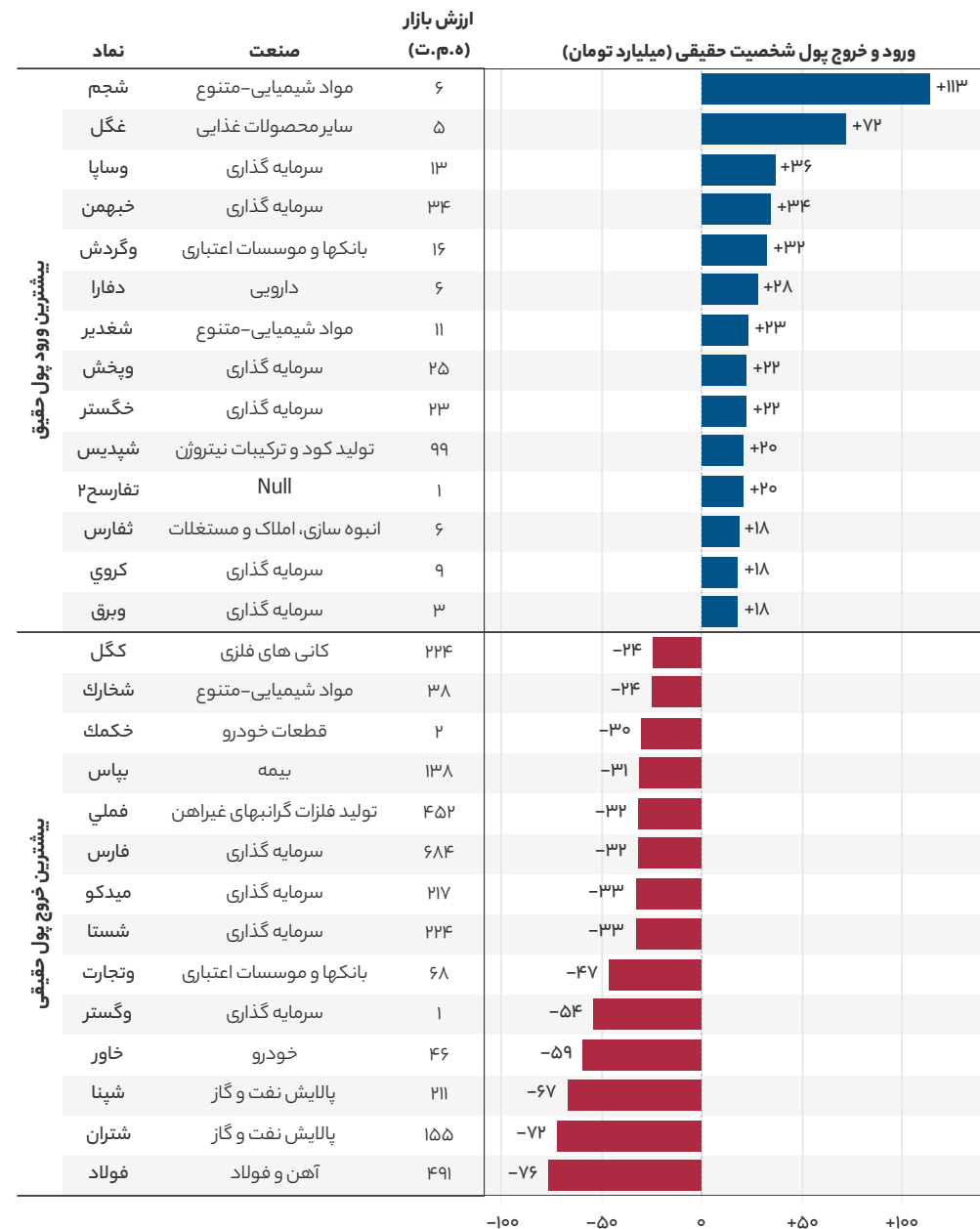
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس





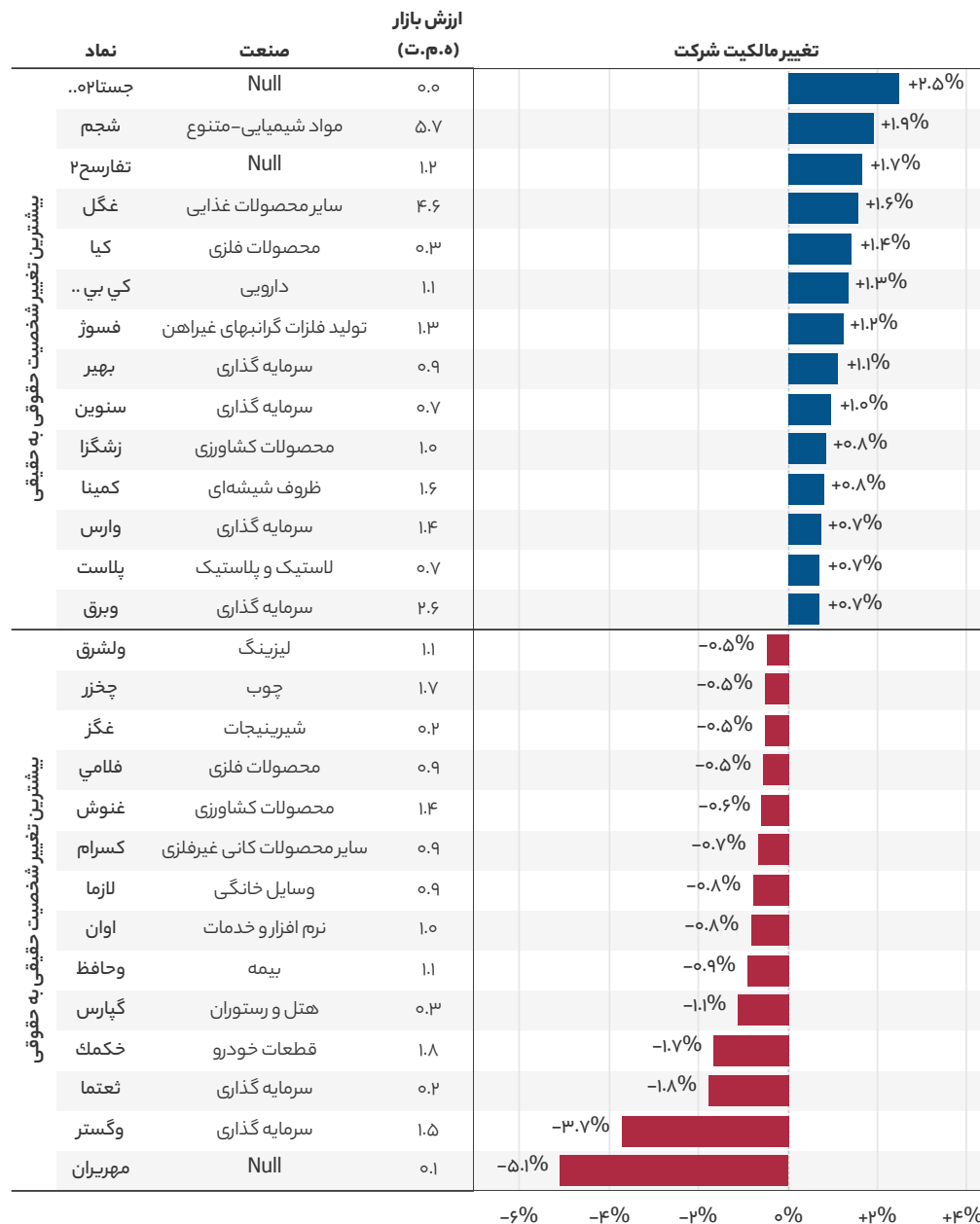
ورود و خروج پول حقیقی

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



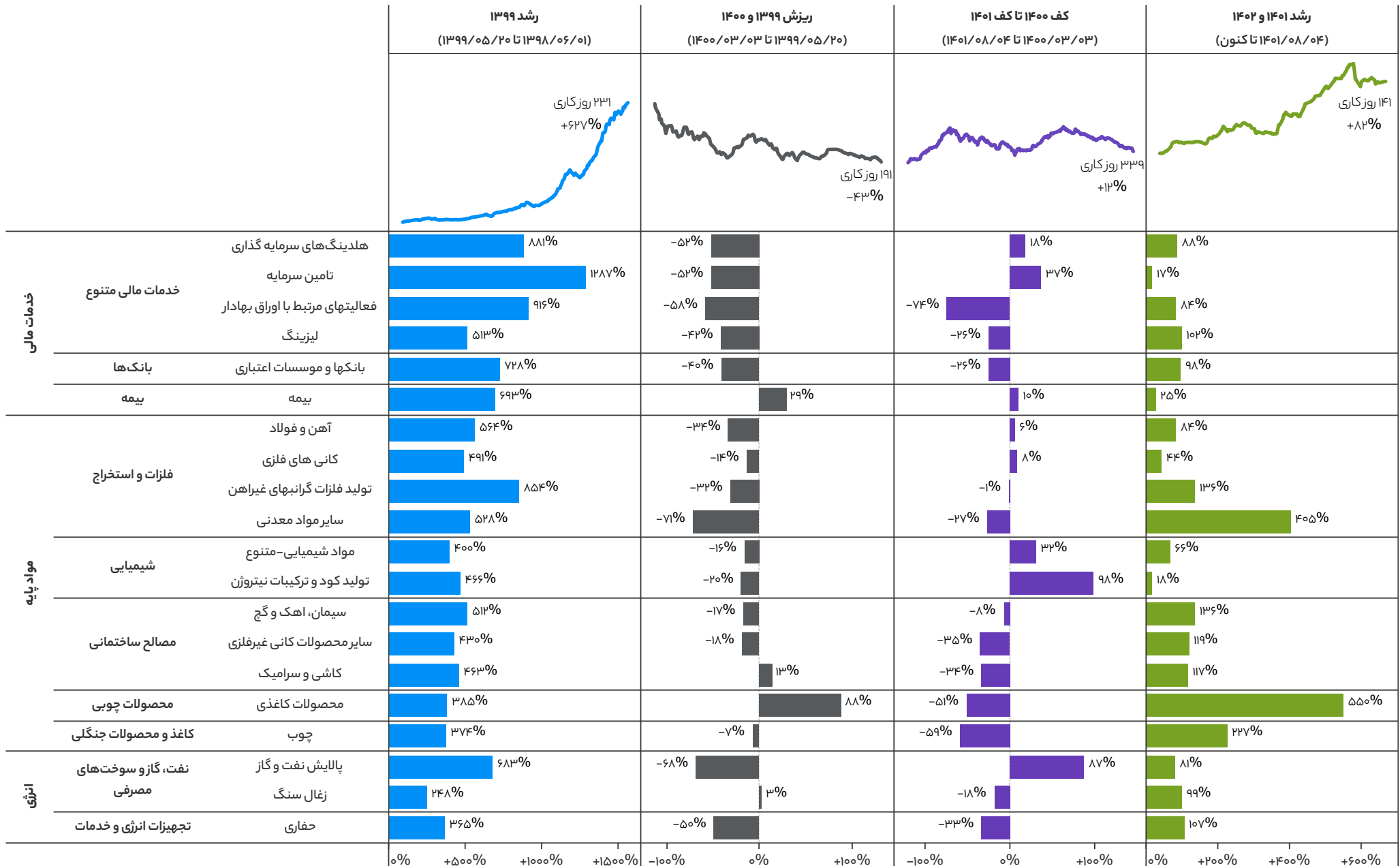
تغییر مالکیت شرکت

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



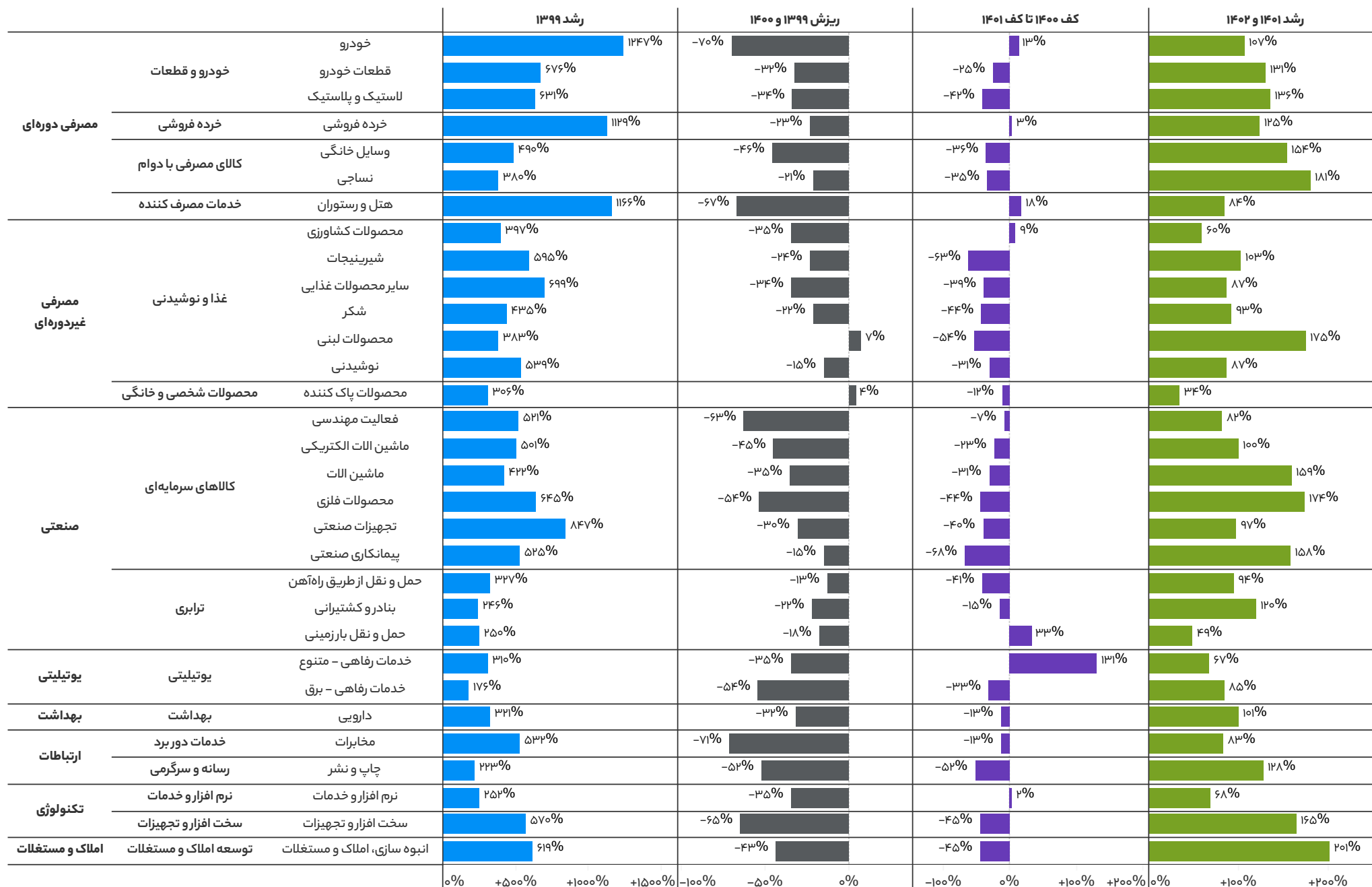
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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





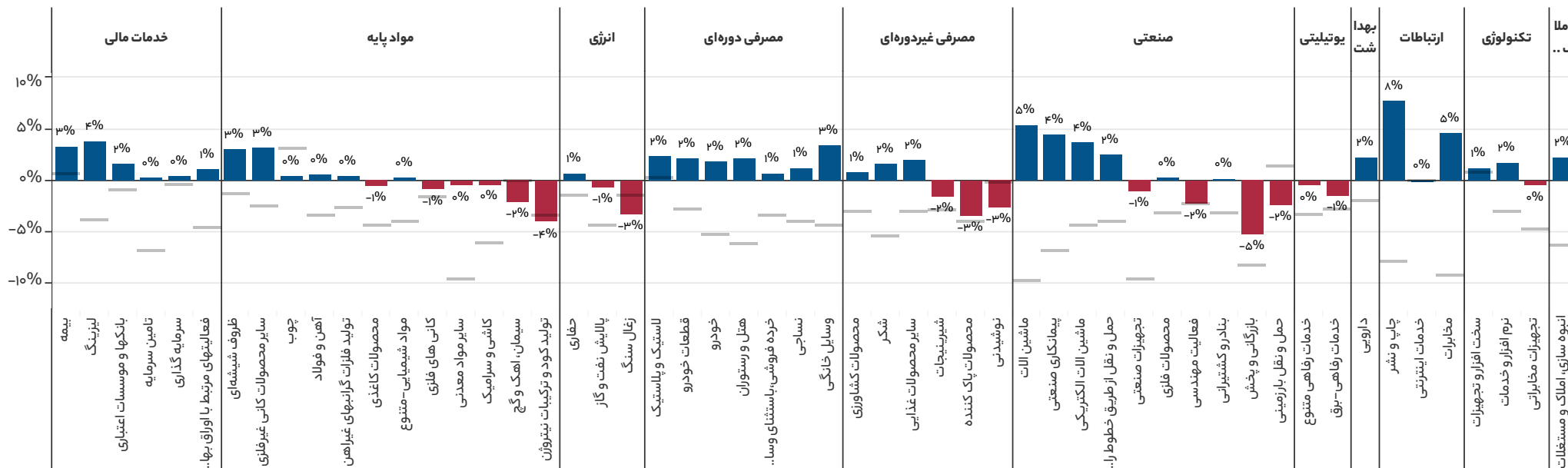
بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)





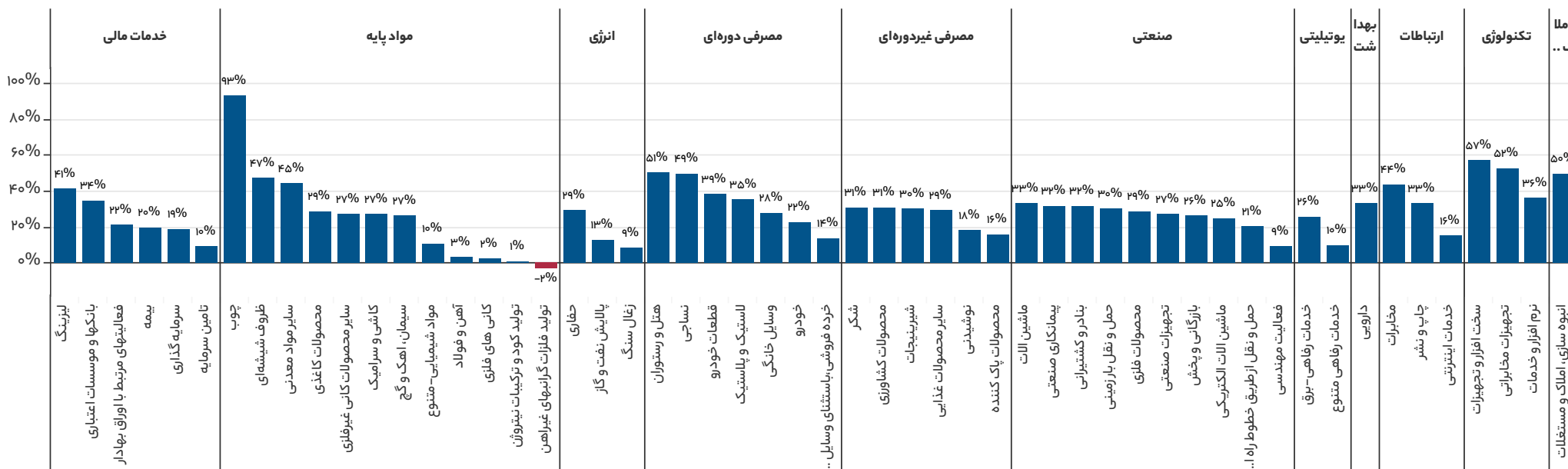
بازده صنایع از ابتدای هفته

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



بازده صنایع از ابتدای هفته

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



بازدهی بزرگ‌ترین ۳۵ شرکت سهامی طی ۲ هفته گذشته

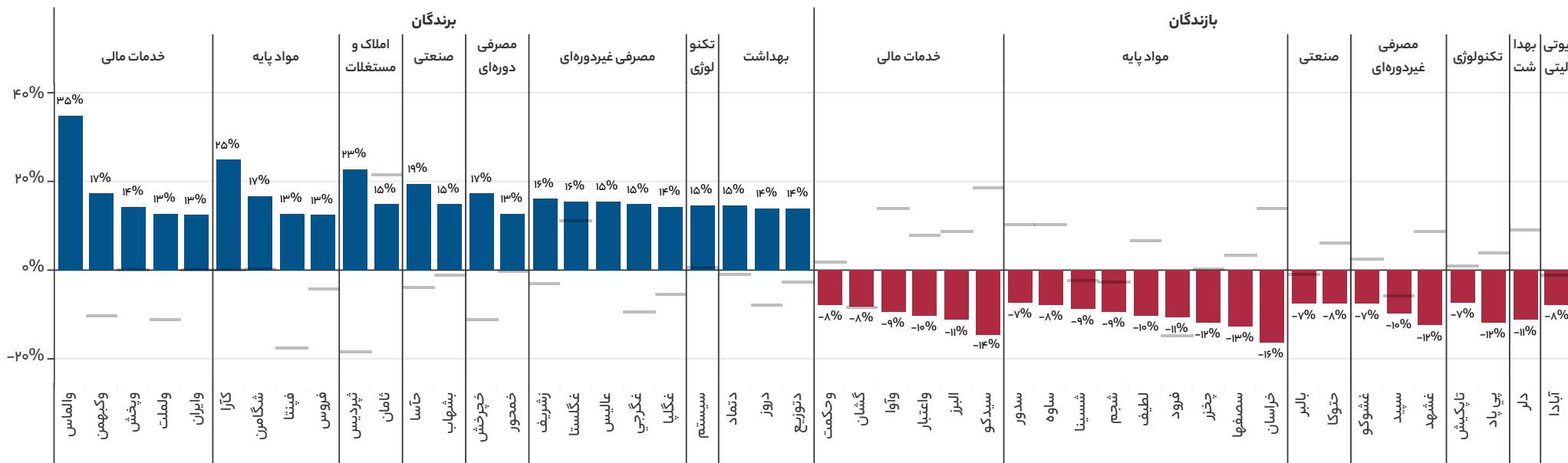
به تفکیک سکتور، بازدهی تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم



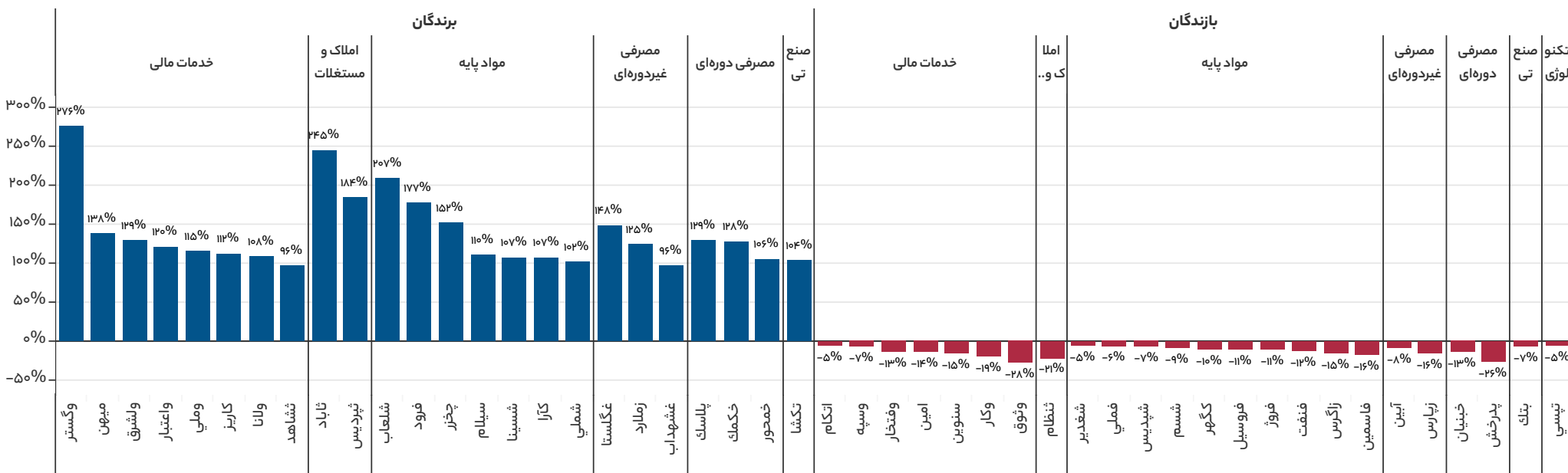
بازدهی هفته گذشته	پاس	اکابر	خودرو	ویجت	تاپیکو	خسپا	پارس	آریا	پارسان	چم	شستا	وغیر	حکشتی	فخوز	فملی	ومعادن	ککهر	نوری	فولاد	ویاسار	فارس	تامیکو	کچاد	شپدیس	مبین	میدکو	وسندوق	شپنا	کگل	شتران	شیندر	مارون	وامید	پوعلی	رمپنا
	+۷.۲٪	+۶.۶٪	+۴.۶٪	+۴.۳٪	+۲.۹٪	+۲.۵٪	+۲.۳٪	+۱.۴٪	+۱.۴٪	+۱.۳٪	+۱.۲٪	+۱.۱٪	+۱.۰٪	+۰.۹٪	+۰.۴٪	+۰.۳٪	+۰.۱٪	+۰.۱٪	۰٪	-۰.۲٪	-۰.۵٪	-۰.۶٪	-۰.۶٪	-۰.۸٪	-۱.۱٪	-۱.۱٪	-۱.۲٪	-۱.۴٪	-۱.۴٪	-۱.۶٪	-۱.۶٪	-۱.۷٪	-۱.۷٪	-۲.۷٪	-۳.۱٪



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



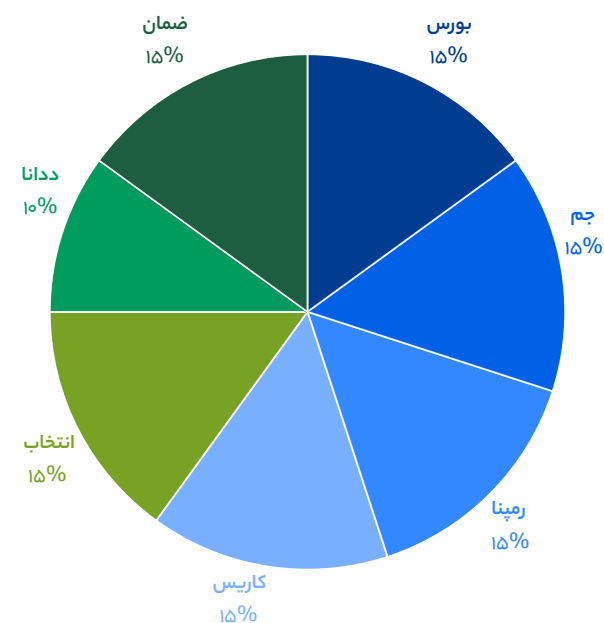
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۵%	۳۴,۶۰۰	انتظار افزایش نرخ و پتانسیل افزایش مقدار تولید و سود زیر مجموعه‌ها	۴۲۰۰۰	انتخاب	میان مدت
۱۵%	۴۸,۱۰۰	پتانسیل افزایش نرخ، پتانسیل بهره‌برداری از طرح سوم در ماه‌های آتی	۶۲۰۰۰	ددانا	
۱۵%	۱۵,۰۹۵	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۶۰,۵۳۰	احتمال افزایش حاشیه سود و بهبود تقاضای محصولات شرکت	۷۸۰۰۰	جم	بلند مدت
۱۵%	۱۴,۵۲۰	ارزش جایگزینی بالای نیروگاهی و احتمال افزایش نرخ برق، وضعیت ارزش مناسب، عرضه اولیه شرکت زیرمجموعه	۱۹۰۰۰	رمپنا	
۱۵%	۸,۰۵۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۹۰۰۰	بورس	
۱۵%	۲۳,۸۴۷	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریزما	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





محدوده کف قبلی شاخص (۲,۲۱۵,۰۰۰ واحد) تعیین کننده مسیر کوتاه مدت شاخص است. در صورت از دست دادن این محدوده انتظار می رود اصلاح تا حوالی ۲,۱۶۵,۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مطابق انتظار بعد از رسیدن به محدوده مقاومتی ۷۷۴۰۰۰ واحد، وارد اصلاح شد و محدوده کف قبلی شاخص هم وزن (۷۳۳۰۰۰ واحد) تعیین کننده مسیر کوتاه مدت است. در صورت از دست دادن این محدوده انتظار می رود اصلاح تا حوالی ۷۰۸۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



این نسبت در محدوده مقاومتی خود می‌باشد. با گذر از این محدوده انتظار می‌رود 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 ۴۹۱۰۰۰ تا ۴۹۷۰۰ تومان محدوده حمایتی مهم برای دلار می‌باشد. در صورت از دست رفتن این محدوده حمایتی انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی ۴۶۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد. در صورت کف‌سازی و تثبیت بالای این محدوده حمایتی، انتظار می‌رود بازگشتی موقت به حوالی ۵۲۵۰۰ تومان داشته باشد.

توضیحات تحلیل



در صورت تثبیت در زیر محدوده ۲۸,۵۰۰,۰۰۰ تا ۲۹,۶۰۰,۰۰۰ تومان، انتظار می‌رود اصلاح قیمتی تا حوالی ۲۶,۰۰۰,۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



رشد انس جهانی طلا از نوامبر ۲۰۲۲ را می‌توان در قالب یک الگو دیامتری که در حال حاضر انتظار می‌رود بعد از تکمیل موج G تا اهداف مشخص شده، 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 (ت.م.ه)	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
شیمیایی	اوره	شیراز	۱۲	۵۰.۸	۳۳,۲۰۰	۳۴%	۷,۶۲۰	۵,۷۱۷	-	-۲۵%	۵.۴	
		خراسان	۱۲	۲۷.۶	۱۵۴,۳۶۰	۷۹%	۲۸,۱۰۴	۱۹,۴۰۴	-	-۳۱%	۸.۰	
		کرمانشا	۱۲	۲۶.۴	۷۴,۹۰۰	۵۱%	۱۳,۱۹۹	۱۰,۲۱۵	-	-۲۳%	۶.۷	
	الفین	شگویا	۱۲	۴۳.۰	۱۷,۹۵۰	۹۱%	۱,۴۴۸	۲,۱۶۴	-	+۴۹%	۷.۷	
		جم پیلن	۱۲	۳۴.۷	۱۷۳,۴۶۰	۱۰۰%	۲۱,۰۹۴	۳۲,۰۱۱	-	+۵۲%	۵.۴	
		شغذیر	۱۲	۱۰.۹	۸۳,۵۰۰	۹۰%	۸,۶۶۰	۱۴,۰۳۳	-	+۶۲%	۵.۴	
		شبصیر	۱۲	۹.۱	۳۶,۵۵۰	۹۰%	۳,۷۶۰	۴,۹۵۲	-	+۳۲%	۶.۷	
		شجم	۶	۵.۷	۸,۷۲۰	۹۱%	۸۷۶	۲,۰۵۶	-	+۱۳۵%	۴.۲	
	آروماتیک	بوعلی	۱۲	۷۵.۲	۵۲,۴۰۰	۹۶%	۵,۴۴۸	۸,۲۲۸	-	+۵۱%	۵.۷	
	متانول	شخارک	۱۲	۳۷.۷	۶۲,۹۰۰	۱۰۰%	۶,۴۱۲	۱۱,۶۸۱	-	+۸۲%	۵.۴	
		شفن	۱۲	۲۴.۵	۷,۹۳۰	۹۹%	۱,۰۲۶	۸۶۲	-	-۱۶%	۸.۰	
	دوده صنعتی	شکرین	۱۲	۳.۳	۵,۱۷۰	۸۷%	۶۳۹	۲,۱۶۴	-	+۲۳۹%	۲.۱	
		شصدف	۱۲	۳.۰	۴۲,۹۵۰	۷۰%	۳,۸۲۳	۱۴,۰۳۳	-	+۲۶۷%	۲.۹	
		شدوص	۱۲	۱.۶	۱۶,۳۷۰	۹۳%	۱,۹۲۷	۲,۷۴۸	-	+۴۳%	۶.۰	
بسته بندی و ظروف	ظروف شیشه ای	کرازپ	۱۲	۵.۲	۱,۷۷۰	۲۷%	۲۲۴	۳۱۸	-	+۴۲%	۵.۴	
		کهمد	۳	۴.۶	۶,۱۹۰	۱۹%	۴۹۷	۶۸۹	۱,۰۶۸	+۳۸%	۹.۰	۶.۱
		کگاز	۱۲	۳.۴	۴۰,۳۰۰	۶۴%	۱,۴۰۰	۴,۱۳۷	-	+۱۹۵%	۹.۵	



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (م.ت)	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
مواد پایه	فلزات و استخراج	فولاد	۱۲	۴۹۱.۲	۶,۱۴۰	۵۹%	۶۸۴	۱,۰۵۳۱	-	+۵۱%	۵.۶	
		فولاد	۱۲	۴۵.۲	۱۸,۸۵۰	۹۱%	۱,۷۲۵	۳,۷۶۶	-	+۱۱۸%	۴.۶	
		کاهه	۱۲	۳۷.۴	۱۱,۷۰۰	۷۸%	۱,۰۵۶	۲,۲۴۴	-	+۱۱۳%	۴.۹	
		ارفع	۱۲	۳۰.۴	۲۵,۳۰۰	۷۱%	۳,۱۱۷	۴,۱۵۶	-	+۳۳%	۶.۱	
	سرب و روی	محصولات فلزی	۱۲	۱۵.۵	۴,۱۵۰	۱۵%	۴۴۱	۶۳۹	-	+۴۵%	۶.۴	
		فنوال	۱۲	۵.۵	۱۶,۳۲۰	۵۴%	۸۷۳	۹۵۴	-	+۹%	۱۶.۶	
		کیمیا	۱۲	۲.۳	۷,۷۰۰	۳۹%	۱,۲۶۵	۱,۶۰۹	-	+۲۷%	۴.۵	
	مصالح ساختمانی	فتوسا	۱۲	۱.۳	۸,۹۹۰	۱۷%	۱,۴۴۳	۲,۲۳۳	-	+۵۵%	۳.۹	
		ساوه	۱۲	۹.۰	۱۳۸,۵۰۰	۹۶%	۱۵,۸۳۸	۲۰,۱۳۴	-	+۲۷%	۶.۹	
		سآبیک	۱۲	۶.۱	۲۰,۵۲۰	۹۰%	۲,۴۹۵	۳,۶۱۸	-	+۴۵%	۵.۷	
		سیمان، اهک و گچ	۹	۵.۱	۳۸,۳۰۰	۱۱۹%	۳,۴۵۴	۴,۶۸۳	۸,۹۹۸	+۳۶%	۸.۲	۴.۳
		ساروم	۱۲	۴.۶	۴۶,۴۵۰	۹۵%	۵,۵۴۳	۶,۹۷۵	-	+۲۶%	۶.۷	
		سصو..	۱۲	۳.۶	۳۲,۷۳۰	۸۶%	۳,۶۸۵	۶,۷۴۷	-	+۸۳%	۴.۹	
		سقایین	۱۲	۱.۹	۷۴,۷۵۰	۹۹%	۵,۹۵۳	۹,۵۰۹	-	+۶۰%	۷.۹	
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	کفرا	۱۲	۲.۳	۱۱,۴۳۰	۱۰%	۶۶۴	۴,۱۳۷	-	+۵۲۳%	۲.۷	

مواد پایه

مصالح ساختمانی

سیمان، اهک و گچ

سایر محصولات کانی غیرفلزی

فلزات و استخراج

فولاد

گروه صنعتی



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

		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%	۲۶,۰۵۰	۴۸.۲	۶	وکغذیر																		
			۱۴۰۲	۶.۳	۱۲.۵	-۳۰%	۳,۶۴۵	۱,۷۶۰	۲,۵۰۲	۴۴%	۲۲,۰۰۰	۱۷.۶	۳	واحیا																		
		تامین سرمایه	۱۴۰۳	۱۲.۷	۱۲.۷	+۲۴%	-	۵۸۲	۴۷۱	۹۹%	۷,۳۷۰	۱۳.۳	۶	امین																		
			۱۴۰۲	۵.۲	۵.۲	+۱۷%	-	۸۸۵	۷۵۸	۱۰۰%	۴,۵۷۰	۱۱.۲	۱۲	تنوین																		
		چند رشته‌ای	۱۴۰۳	۶.۰	۶.۰	+۹%	-	۹۵۱	۸۷۵	۸۴%	۵,۷۱۰	۱۳.۴	۹	وسپه																		
			۱۴۰۲	۲۵.۲%	-	۵۴۸	۱۵۶	۲۵%	۸,۹۴۰	۱۲	بورس	۱۱.۲	۱۲	بورس																		
بهداشت	بهداشت	دارویی	۱۴۰۳	۷.۰	۷.۰	+۱۶%	-	۵,۲۱۱	۴,۴۸۵	۹۴%	۴۰,۷۵۰	۷.۳	۱۲	دتوزیع																		
			۱۴۰۲	۷.۴	۷.۴	+۲۶%	-	۵,۱۳۸	۴,۰۶۳	۹۳%	۳۸,۰۰۰	۶.۱	۱۲	هجرت																		
			۱۴۰۳	۷.۹	۷.۹	+۲۹%	-	۴,۹۱۰	۳,۸۱۲	۹۲%	۴۲,۰۸۰	۵.۹	۱۲	دفرا																		
			۱۴۰۲	۷.۶	۷.۶	+۶%	-	۶,۸۹۱	۶,۵۳۱	۹۸%	۵۸,۵۹۰	۴.۲	۱۲	دتماد																		
			۱۴۰۳	۶.۷	۶.۷	+۱۲%	-	۳,۰۰۰	۲,۶۷۳	۹۵%	۲۲,۶۱۰	۴.۱	۱۲	دابور																		
			۱۴۰۲	۸.۵	۸.۵	+۲۱%	-	۱,۲۷۸	۱,۰۵۴	۵۲%	۱۰,۸۸۰	۳.۹	۱۲	دسبحان																		
			۱۴۰۳	۵.۸	۵.۸	+۳۴%	-	۲,۸۶۵	۲,۱۳۲	۹۸%	۱۸,۷۰۰	۳.۹	۱۲	درازک																		
			۱۴۰۲	۷.۹	۷.۹	-	-	۲,۳۴۴	۲,۳۴۰	۹۷%	۲۰,۸۰۰	۲.۹	۱۲	کاسپین																		
			۱۴۰۳	۸.۲	۸.۲	+۱۵%	-	۱۰,۵۷۹	۹,۲۰۷	۹۴%	۸۶,۶۰۰	۲.۶	۱۲	دکپسول																		
			انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	زغال سنگ	۱۴۰۳	۳.۸	۳.۸	+۱۳۳%	-	۶,۱۵۶	۲,۶۴۷	۱۰۰%	۲۶,۲۵۰	۹.۲	۱۲	کزغال															
۱۴۰۲	۴.۹	۴.۹				+۱۰۹%	-	۴,۱۲۳	۱,۹۷۶	۶۵%	۲۱,۶۲۰	۱.۷	۱۲	کطبس																		
نرم افزار و خدمات	۱۴۰۳	۲۰.۴			۲۰.۴	+۲%	-	۳,۱۶۵	۳,۱۰۷	۹۶%	۶۴,۷۰۰	۴.۵	۱۲	سپیدار																		
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	۱۴۰۳	۱۵.۶	۱۵.۶	+۳۳%	-	۳,۳۸۱	۲,۵۴۷	۹۲%	۵۵,۱۰۰	۱.۹	۱۲	رافزا																			

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (ت.م.ه)	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
مصرفی غیردروای	روغن خوراکی	غکورش	۱۲	۲۰.۱	۱۶,۷۸۰	۸۷%	۲,۰۵۵	۱,۳۶۴	-	-۳۴%	۱۱.۰		
		غیشهر	۹	۱۲.۶	۴,۲۶۱	۳۱%	۳۸۹	۴۲۹	۸۶۱	+۱۰%	۹.۹	۵.۵	
		غمارگ	۹	۱.۸	۱,۹۱۱	۱۰%	-۷۷۲	-۷۸	۱۴۲	+۹۰%	-۲۴.۴	۱۴.۱	
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۷.۵	۱۷,۴۹۰	۷۶%	۱,۶۱۰	۲,۱۵۲	-	+۳۴%	۷.۶		
		غپینو	۱۲	۴.۰	۴,۴۹۵	۶۰%	۴۸۵	۶۶۶	-	+۳۷%	۶.۷		
		غسالم	۱۲	۲.۹	۶,۵۶۰	۵۲%	۶۵۱	۷۸۱	-	+۲۰%	۸.۰		
		غمینو	۱۲	۱.۷	۱۱,۲۰۰	۷۰%	۱,۴۹۴	۱,۷۵۸	-	+۱۸%	۶.۴		
	زراعت و خدمات وابسته	سیمرغ	۹	۳.۸	۲۹,۰۰۰	۲۱%	۳,۹۱۴	۴,۹۵۱	۹,۴۹۶	+۲۶%	۵.۹	۳.۴	
		زفکا	۱۲	۳.۴	۲۲,۹۵۰	۸۹%	۱,۵۴۶	۲,۹۹۲	-	+۹۳%	۷.۲		
		تلیسه	۱۲	۲.۶	۵,۲۹۵	۸۶%	۲۵۲	۴۳۸	-	+۷۴%	۱۱.۶		
		زدشت	۱۲	۲.۶	۳۷,۵۰۰	۷۹%	۲,۱۲۰	۲,۷۶۴	-	+۳۰%	۱۳.۰		
		زقیام	۱۲	۲.۴	۳,۴۹۱	۸۲%	۲۸۸	۵۶۰	-	+۹۴%	۵.۸		
		زملارد	۱۲	۲.۲	۲۷,۴۰۰	۹۸%	۳۲۷	۱,۴۲۶	-	+۳۳۷%	۱۹.۲		
		زگلدشت	۱۲	۲.۰	۲۷,۹۵۰	۹۸%	۹۵۸	۱,۹۳۵	-	+۱۰۲%	۱۴.۰		
		زشریف	۹	۱.۸	۷,۶۱۰	۸۰%	۴۸۱	۶۱۴	۸۷۸	+۲۸%	۱۲.۴	۹.۴	
		زببنا	۱۲	۱.۶	۴,۵۳۰	۶۲%	۴۰۲	۶۷۲	-	+۶۷%	۶.۴		
		زکشت	۱۲	۱.۳	۲۲,۴۵۰	۷۰%	۲,۵۲۹	۲,۸۲۹	-	+۱۲%	۷.۳		
		زمگسا	۱۲	۱.۲	۴۱,۲۹۰	۹۹%	۳,۲۶۴	۴,۳۸۸	-	+۳۴%	۸.۷		
		زشگزا	۱۲	۱.۰	۱۰,۸۳۰	۵۷%	۷۸۲	۱,۹۳۴	-	+۱۴۷%	۵.۴		
	غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۸.۰	۴,۴۶۰	۱۳%	۴۵۱	۵۹۲	-	+۳۱%	۷.۴		
		غمهرا	۱۲	۲.۵	۱۲,۹۰۰	۱۰%	۱,۰۱۰	۱,۷۳۵	-	+۷۲%	۷.۴		
	محصولات لبنی	غگلستا	۱۲	۲.۶	۴۰,۲۰۰	۴۹%	۱,۵۶۲	۲,۱۳۵	-	+۳۷%	۱۸.۸		
		غفارس	۱۲	۱.۸	۱۵,۵۰۰	۴۰%	۱,۰۱۰	۱,۳۶۷	-	+۳۵%	۱۱.۳		
		غگلپا	۱۲	۱.۸	۴۸,۲۰۰	۵۲%	۴,۶۵۰	۴,۹۸۹	-	+۷%	۹.۷		
		غشان	۱۲	۱.۵	۸,۸۲۰	۸۸%	۷۹۵	۷۹۶	-	-	۱۰.۲		
	نوشیدنی	غبهنوش	۱۲	۲.۷	۷۵,۹۰۰	۲۵%	۱,۱۰۳	۵,۳۰۰	-	+۳۸۰%	۱۴.۳		
		غدیس	۱۲	۲.۰	۱۷,۴۰۰	۵۷%	۱,۴۶۶	۱,۸۵۳	-	+۲۶%	۸.۹		

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (م.ت.م.ه)	قیمت	تقسیم سود	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	۱۴۰۲ (میانگین)	۱۴۰۳ (میانگین)	رشد سود ۱۴۰۲ نسبت به ۱۴۰۱	نسبت P/E با سود	
											۱۴۰۲	۱۴۰۳
مصرفی دوره‌ای	کالای مصرفی با دوام	انتخاب	۹	۳۴.۳	۳۴,۳۰۰	۹۰%	۳,۲۲۳	۵,۱۷۷	-	+۶۱%	۶.۶	
			۹	۴.۱	۶,۲۷۰	۵۲%	۲۴۷	۹۱۴	-	+۲۷۱%	۶.۹	
	خودرو و قطعات	لاستیک و پلاستیک	۱۲	۳.۶	۲,۸۰۵	۶۴%	۱۱۲	۱۳۹	-	+۲۴%	۱۹.۷	
			۱۲	۳.۶	۱۷,۵۴۰	۷۲%	۶۱۲	۷۰۲	-	+۱۵%	۲۴.۴	
			۱۲	۲.۹	۱۵,۰۰۰	۱۹%	۱,۳۶۰	۱,۸۳۵	-	+۳۵%	۸.۰	
صنعتی	ترابری	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۱۲	۶.۵	۱۴,۵۴۰	۱۰%	۱,۴۹۹	۲,۲۴۵	-	+۵۰%	۶.۴	
			۱۲	۴.۵	۶,۴۳۰	۵۲%	۴۳۰	۶۸۵	-	+۵۹%	۹.۴	
			۶	۱.۸	۷۳,۰۰۰	۹۰%	۶,۳۱۲	۸,۸۴۹	۱۱,۹۲۳	+۴۰%	۸.۲	۵.۹
	بنادر و کشتیرانی	حسینا	۱۲	۴.۳	۱۷,۱۵۰	۹۶%	۲,۰۱۳	۲,۲۰۴	-	+۹%	۷.۸	

ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

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

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

