

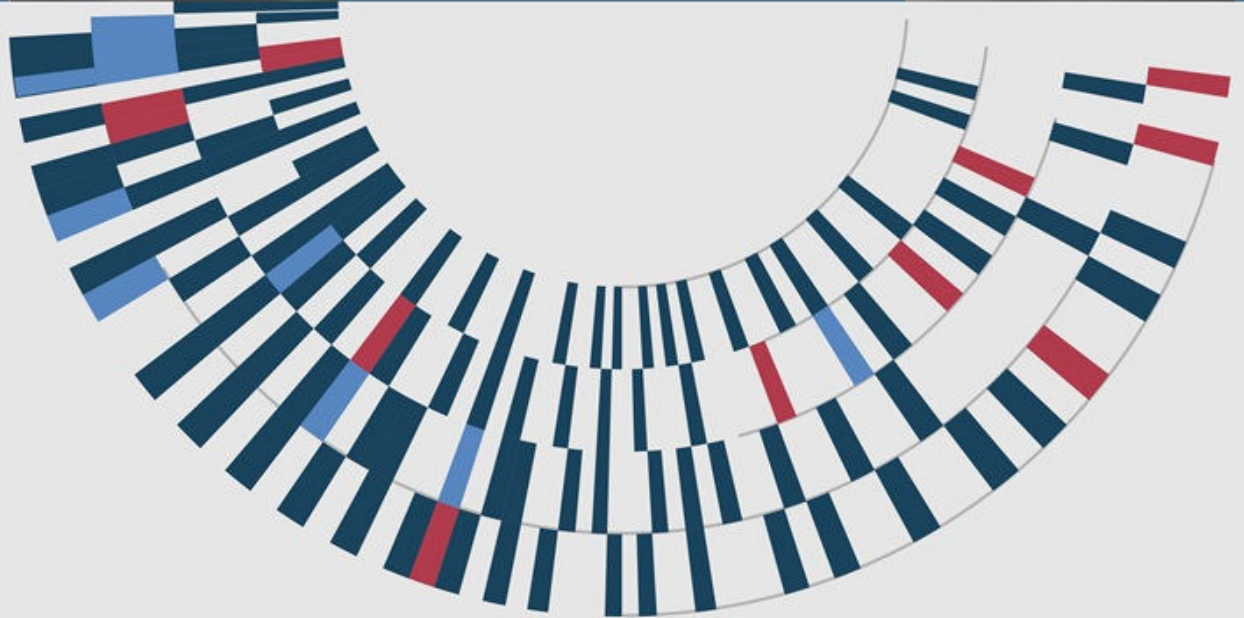
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۲۶

 CHARISMA





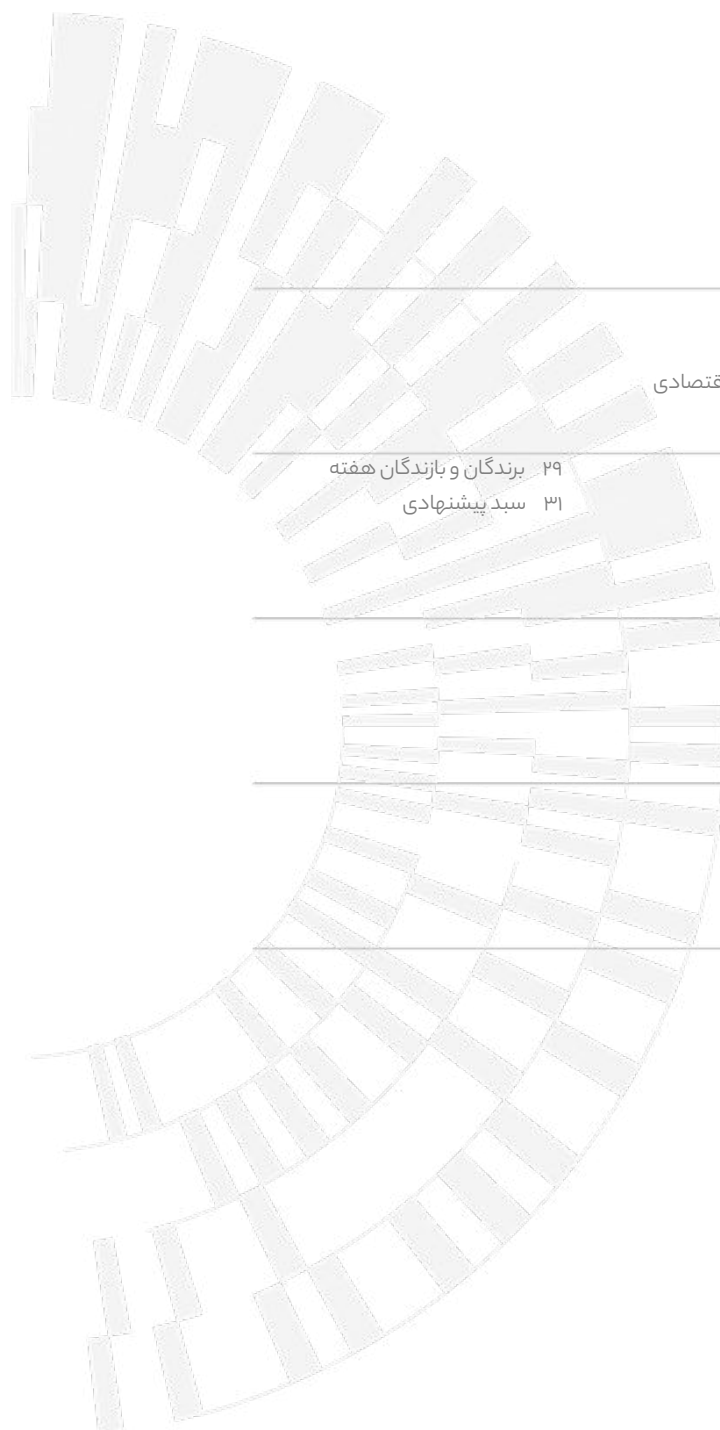
معرفی گزارش:

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 براساس 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 براساس 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 برعهده 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 ۱۹ ارزشگذاری بازار ۲۱ بازدهی صنایع ۲۲ ورود و خروج پول ۲۵ بازدهی صنایع
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





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	۱,۹۵۷	۰.۴%	فزر	-	۲,۰۱۷ ۱,۹۶۳	۷%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۵۸۱	۴.۰%	فملی	بموتو، فباهنر	۹,۳۴۱ ۷,۱۵۸	۴%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۶۰	-۰.۱%	فایرا	فنوال	۲,۵۰۴ ۲,۰۷۱	-۷%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۷۴	۷.۴%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۳,۶۰۰ ۲,۳۰۳	-۲۶%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۳۴	۴.۹%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۲۷۳ ۱,۸۵۲	۱۵%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۸۴۳	۱.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	۴,۸۴۳ ۲,۶۸۳	۴۱%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۲۵	۱.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	۳,۶۲۵ ۲,۰۹۶	۲۹%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۲۰	۰.۸%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان	کویر، فوکا، فنورد	۶۲۳ ۴۸۳	۴%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۲۷۵	۱.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولارژ، ارفع، فسانازان، کطبس، کپور، کزغال، کشیق	کویر، فوکا، فنورد	۲۲,۸۲۱ ۱۲,۳۰۸	۴۸%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۰	-۵.۸%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۶۷۰ ۴۲۰	-۱۳%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۰۰	۰.۰%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۲۲,۰۸۰ ۱۱,۶۶۷	۲۱%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۳۵	۱.۶%	ذوب، کویر	فولای	۷۵۵ ۶۲۵	۳%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۳,۷۰۰	۰.۱%	ذوب، کویر	فولای	۲۴,۷۴۷ ۱۴,۰۲۴	۴۶%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۷۵	-۰.۹%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۷۸۰ ۵۲۰	-۱۸%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۷۳	-۰.۷%	فولاد	-	۸۶۰ ۶۱۵	-۱۷%



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	روند قیمتی ۱۲ ماهه
اوره	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۲۸۶	-۱.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفارس	۲۸۶ ۷۷۳	-۵۴%
متانول	CFR چین	دلار/تن	۲۳۵	-۴.۱%	زاگرس، شخارک، شغن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ ۳۳۴	-۳۰%
اتیلن	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۷۳۰	-۱۶.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ ۱,۱۴۰	-۳۶%
پلی اتیلن سبک	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۰۰	-۱.۵%	آریا، شکبیر	-	۹۰۰ ۱,۴۱۳	-۳۶%
پلی اتیلن سبک خطی	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۰۰	-۲.۰%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶ ۱,۰۶۶	-۱۶%
پلی اتیلن سنگین	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۲۰	-۲.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۴۰ ۱,۲۴۷	-۲۶%
مونواتیلن گلاپکول	CFR چین	دلار/تن	۴۶۵	-۱.۱%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۳۷ ۶۳۵	-۲۷%
PET	FOB جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۹۶۰	-۲.۰%	شگویا	-	۹۳۴ ۱,۰۹۹	-۱۳%
پروپیلن	CFR چین	دلار/تن	۷۳۵	-۵.۸%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ ۱,۰۳۰	-۲۹%
پلی پروپیلن	FOB خلیج فارس	دلار/تن	۹۰۸	۸.۹%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۱۰ ۱,۰۲۵	-۱۱%
پاراازایلن	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۹۹۴	۴.۲%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲ ۱,۲۹۰	-۲۳%
ارتوزایلن	CFR چین	دلار/تن	۱,۰۲۹	-۲.۹%	شصفها، نوری	-	۹۷۹ ۱,۲۷۵	-۱۹%
استایرن	CFR چین	دلار/تن	۹۱۵	-۵.۲%	پارس	شجم، شبصیر	۹۱۵ ۱,۳۹۷	-۳۵%
بنزن	CFR چین	دلار/تن	۷۸۵	-۵.۵%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۸۵ ۱,۳۴۰	-۴۱%
تولوئن	CFR چین	دلار/تن	۷,۱۳۰	۱.۲%	بوعلی	-	۶,۱۲۹ ۷,۷۳۹	-۸%
بوتادین	CFR چین	دلار/تن	۶۵۰	-۱۶.۷%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۵۰ ۱,۵۶۸	-۵۹%
PVC	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۷۵۰	-۱.۳%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۶۹۹ ۱,۱۸۵	-۳۷%
ABS	CFR جنوب شرق آسیا	دلار/تن	۱,۲۴۵	-۰.۴%	شبصیر	-	۱,۲۴۵ ۱,۲۷۹	-۳%



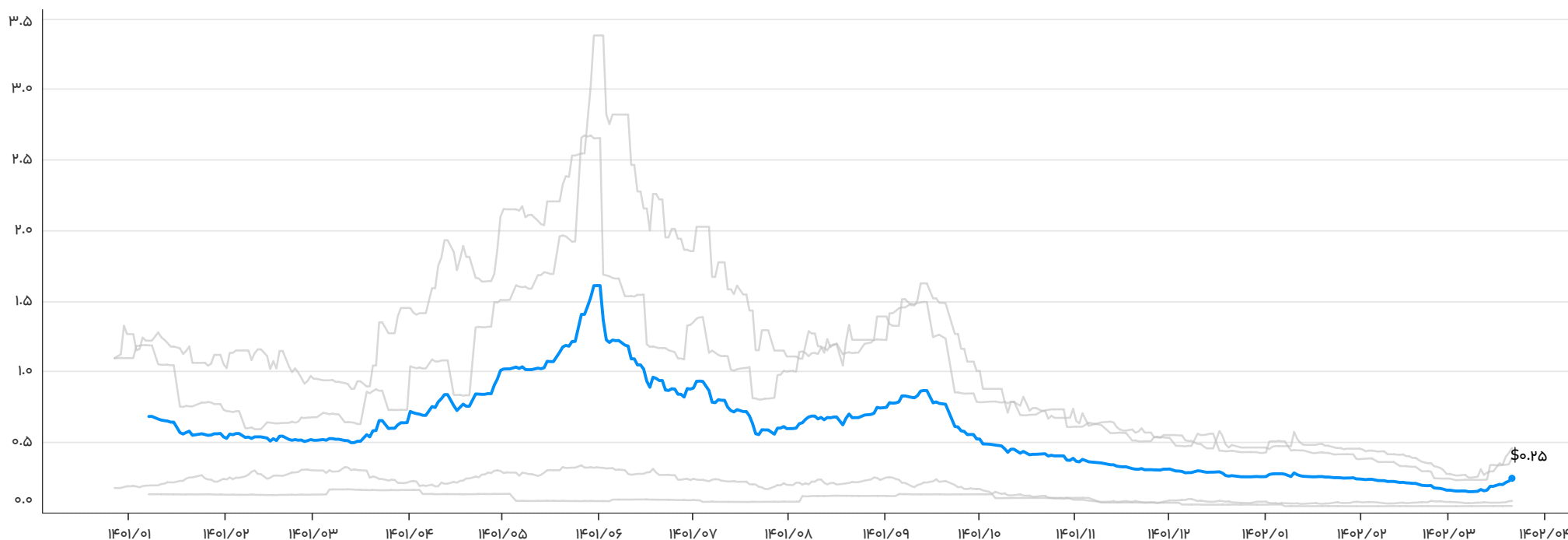
انرژی و سایر محصولات

انرژی و فرآورده‌های نفتی	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	
		-۳۲%		۷۲	۱۱۳	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	-	-	۰.۳%	۷۷	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	نفت برنت					
		-۳۳%		۶۶	۱۰۸	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	-	-	-۰.۳%	۷۲	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	نفت WTI					
		-۴۱%		۹۷	۱۸۳	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	-	-	۸.۵%	۱۰۷	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره					
		-۴۳%		۸۹	۱۷۴	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	-	-	۶.۸%	۱۰۰	دلار/بشکه	بورس بین‌المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور					
		-۲۸%		۱۰,۳۰۳	۱۷,۲۵۹	شپنا، شتران، شبندر، شبیریز، شراز، شاوان	شبه‌رن، شسیا، شنف، شرانل	-	-۳.۲%	۱۲,۴۵۵	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران					
		-۲۵%		۲۳,۴۲۰	۴۱,۳۶۵	شبه‌رن، شسیا، شنف، شرانل	-	-	۹.۵%	۲۵,۶۳۶	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان					
		۱۵%		۸,۸۵۰	۱۷,۱۴۰	شپاس	-	-	-۱۰.۲%	۱۳,۳۷۸	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر- نفت پاسارگاد					
	محصولات کشاورزی		-۱۵%		۲۳۰	۲۹۶	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۵.۱%	۲۵۲	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا				
			-۳۸%		۷۲۸	۱,۲۵۷	غگورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	۴.۹%	۷۷۱	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام				
		-۳۱%		۱,۲۰۵	۲,۲۶۰	-	-	-	۶.۹%	۱,۵۵۹	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا					
		-۲۶%		۲۲۷	۳۴۰	-	-	-	۱۰.۷%	۲۵۲	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا					
ارز و ارز دیجیتال		۵%		۰.۹۷	۱.۱۰	-	-	-	۲.۲%	۱.۰۹	-	بازار فارکس	یورو به دلار					
		۸%		۱.۰۹	۱.۲۸	-	-	-	۳.۰%	۱.۲۸	-	بازار فارکس	پوند به دلار					
		۲۵%		۱۶,۵۴۹	۳۰,۳۳۵	-	-	-	-۳.۴%	۲۶,۳۳۰	دلار	بایننس	بیتکوین					

هَاب	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
هنری هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۰۹	۱۳.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ - ۰.۳۴	-۵۸%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۶	۱.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۷	-۶۶%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۷	۵۹.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۳.۳۹	-۶۸%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۰	۶۲.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۲.۶۸	-۴۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۵	۴۹.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۱.۶۲	-۶۱%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



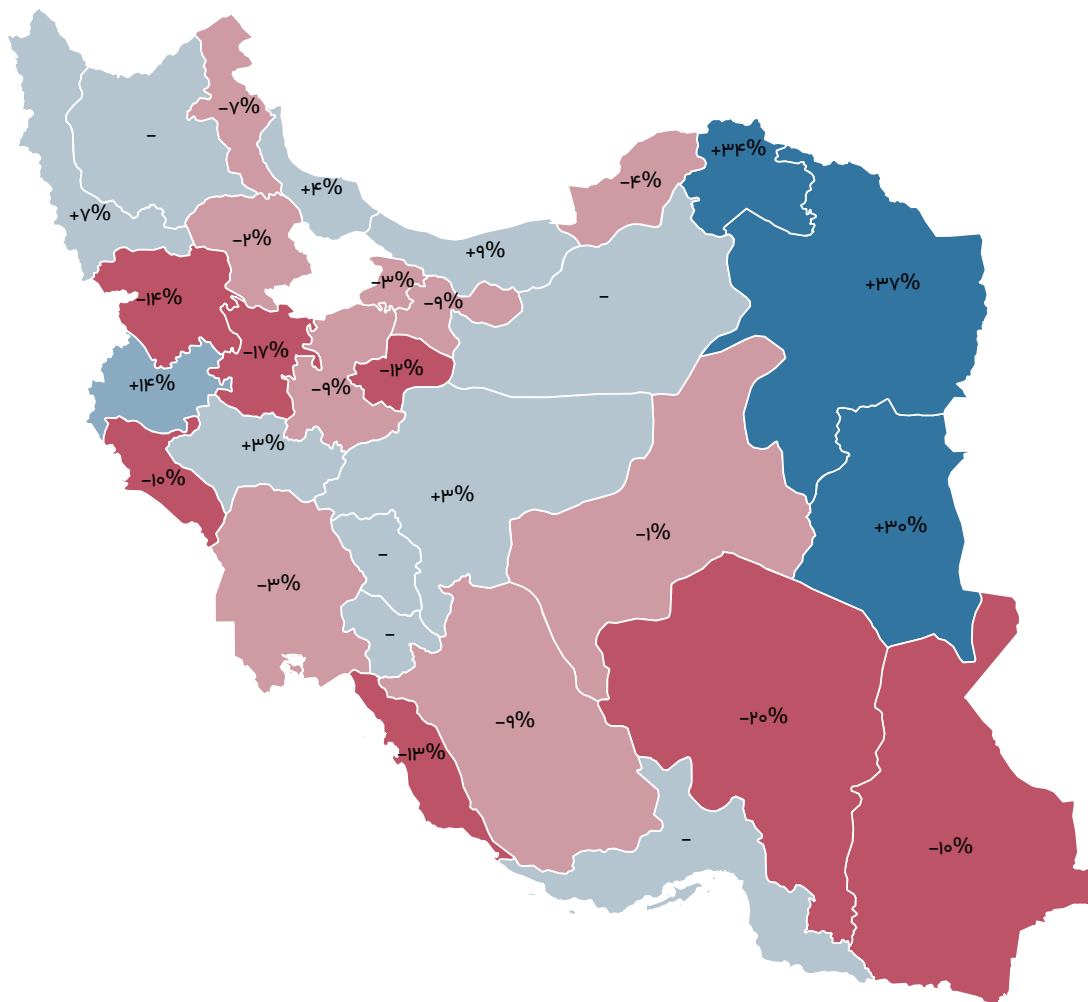
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۹۱۹	۸۳۶	-۹%
	مرکزی	تومان/کیلو	۹۳۶	۸۴۹	-۹%
	اصفهان	تومان/کیلو	۷۸۷	۸۰۷	+۳%
	البرز	تومان/کیلو	۹۲۴	۸۹۳	-۳%
	سمنان	تومان/کیلو	۶۳۷	۶۳۸	+۰%
	قم	تومان/کیلو	۸۸۳	۷۷۶	-۱۲%
غرب	یزد	تومان/کیلو	۶۷۶	۶۷۲	-۱%
	همدان	تومان/کیلو	۸۵۳	۷۱۰	-۱۷%
	خوزستان	تومان/کیلو	۷۹۳	۷۶۹	-۳%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۷۷۶	۷۷۶	+۰%
	ایلام	تومان/کیلو	۷۱۰	۶۳۸	-۱۰%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۷۵۷	۸۶۶	+۱۴%
	لرستان	تومان/کیلو	۶۱۷	۶۳۸	+۳%
	کردستان	تومان/کیلو	۸۵۱	۷۳۵	-۱۴%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۷۵۸	۷۵۹	+۰%
جنوب	فارس	تومان/کیلو	۹۶۱	۸۷۳	-۹%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۷۵۸	۷۵۸	+۰%
	بوشهر	تومان/کیلو	۸۹۸	۷۸۵	-۱۳%
شمال	مازندران	تومان/کیلو	۸۱۶	۸۸۸	+۹%
	گیلان	تومان/کیلو	۶۱۸	۶۴۱	+۴%
	گلستان	تومان/کیلو	۶۶۲	۶۳۸	-۴%
شمال غرب	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۶۱۱	۶۵۶	+۷%
	اردبیل	تومان/کیلو	۸۶۲	۷۹۹	-۷%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۷۸۳	۷۸۳	+۰%
	زنجان	تومان/کیلو	۷۸۸	۷۷۱	-۲%
شمال شرق	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۴۶۶	۶۳۸	+۳۷%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۴۸۹	۶۳۸	+۳۰%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۴۷۴	۶۳۸	+۳۴%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۰۶۷	۸۵۹	-۲۰%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۹۴۵	۸۴۹	-۱۰%

تغییرات قیمت منطقه‌ای 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.

- در روزهای اخیر بازار فولاد چین شاهد بهبود در سمت تقاضا و کاهش در سمت عرضه بوده که باعث شده تا شرایط کاهشی اخیر در روند قیمت‌ها کمی تعدیل شود. از سوی دیگر، موجودی انبارهای میلگرد چین در کمترین سطح ۴ سال اخیر قرار گرفته و موجب بازگشت نسبی قیمت‌ها گردیده است. با این حال کاهش قیمت‌ها همچنان محتمل است.
- بانک مرکزی چین نرخ بهره بانکی را کاهش داد و باعث خروج پول از منابع بانکی در نتیجه باعث کاهش منابع در اختیار بانک‌ها برای اعطای وام به صنایع شد که عامل ایجاد رکود در بازار محصولات فولادی است. بهای بیلت تانگشان نیز با ۳۰ یوان افت نسبت به روز گذشته به ۳۵۱۰ یوان به تن رسید.
- بهای محصولات زنجیره فولاد در معاملات اخیر بازار فیوچرز چین رشد داشته که دلیل این موضوع هم عمدتاً به افزایش ۱۲ درصدی نقدینگی بازار چین در ماه می باز می‌گردد که نشانه رونق بازارها می‌باشد. از سوی دیگر، استان شانشی ۵ کوره بلند را برای انجام تعمیرات اساسی از مدار خارج کرد که باعث کاهش بیشتر عرضه می‌شود.
- انبارهای مس دنیا در کمترین سطح ۵ ماه اخیر خود قرار دارند، روند تغییر موجودی انبارهای مس بورس کالای شانگهای، بازار فلزات لندن و بورس کامکس آمریکا در ۵ ماه اخیر سال کاهش پیدا کرده‌اند.
- تولید نفت ونزویلا در ماه مه به حدود ۸۳۸ هزار بشکه در روز رسید که نسبت به ماه گذشته حدود ۲٪ افزایش داشته است.
- تداوم روند صعودی قیمت کامودیتی‌ها در ماه ژوئن ۲۰۲۳ باعث رشد ۱۴٪ نفت شد همچنین شاخص ترکیبی بلومبرگ کامودیتی نیز طی ماه ژوئن افزایش ۳.۵٪ داشته و در اوج ۳ هفته گذشته قرار دارد.
- مصر قرارداد ۱۰ میلیارد دلاری با شرکت توسعه دهند انرژی سبز امارات متحده عربی برای ایجاد یک مزرعه بادی امضا نمود که یک از بزرگ‌ترین نیروگاه‌های برنامه‌ریزی شده در دنیا خواهد بود.
- قیمت بنزین در آسیا شرقی با تقویت تقاضا در استرالیا، هند و ویتنام افزایش یافت.
- تولید کنندگان پی‌وی سی همچنان در ناحیه حاشیه سود منفی به سر می‌برند. اسپرید سرب‌به‌سری پی‌وی سی حدود ۱۵۰ دلار می‌باشد.
- در آخرین روزهای هفته گذشته با کاهش نرخ بهره در چین شاهد بازیابی بخشی از ریزش قیمت بنزن در بازار آسیای شرقی بودیم.
- تقاضا برای پلی اتیلن‌ها طی هفته گذشته ضعیف بود و مجدداً شاهد افت قیمت در هفته جاری بودیم.

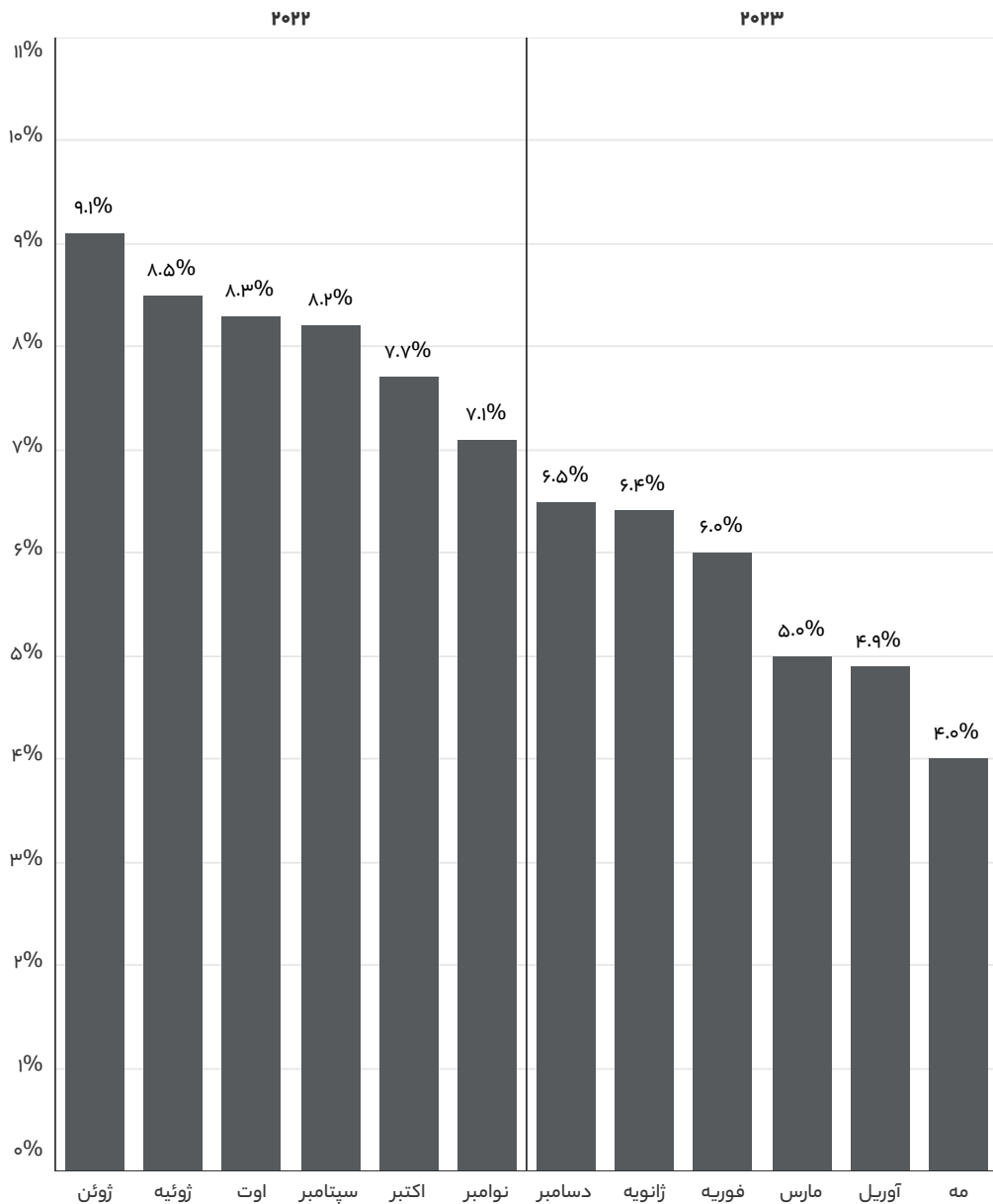
معادن و فلزات

انرژی و فرآورده‌های نفتی

مواد شیمیایی و پلیمرها

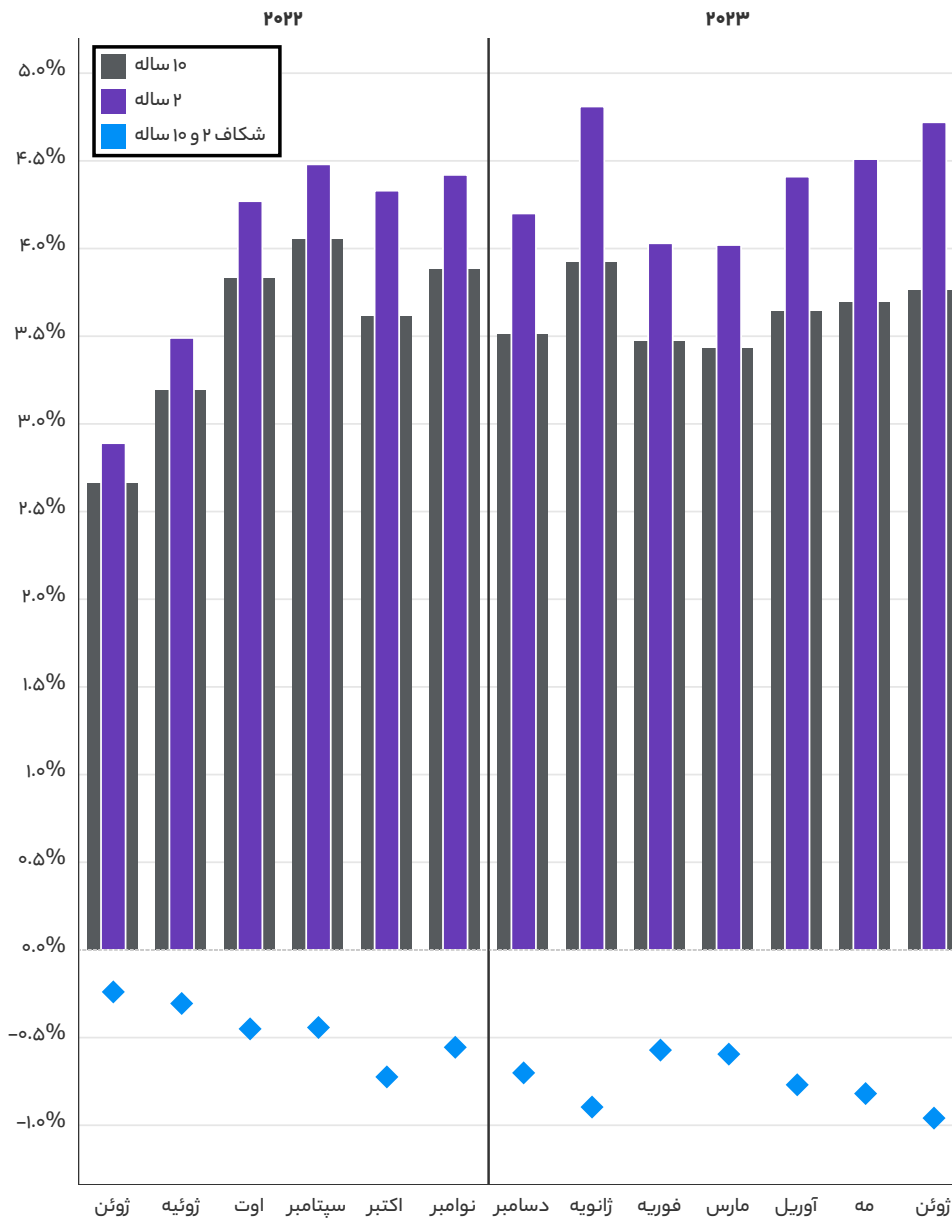
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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



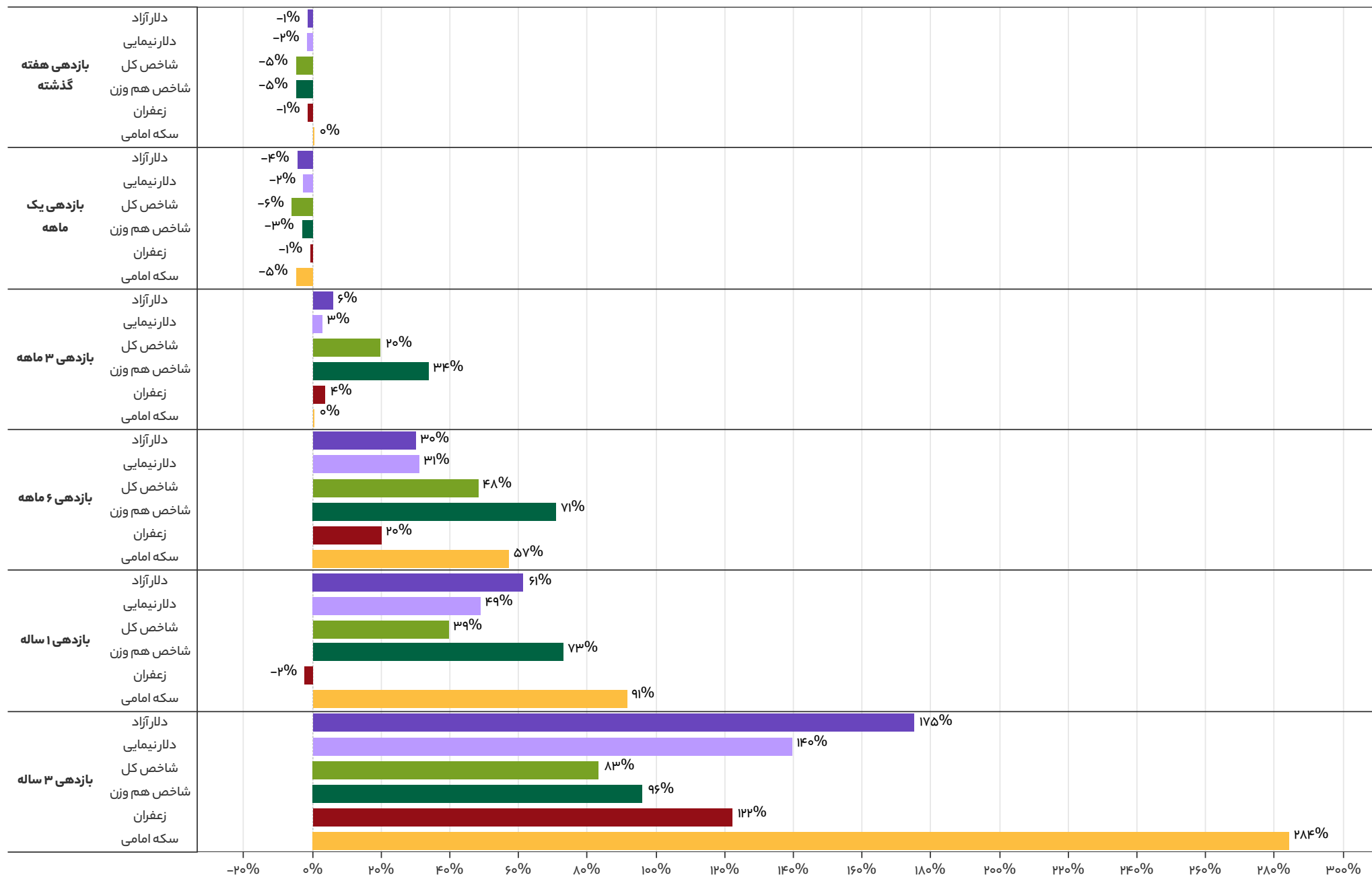
بازار سهام

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 ▲ ۱۱.۰%
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 سحرخیز 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

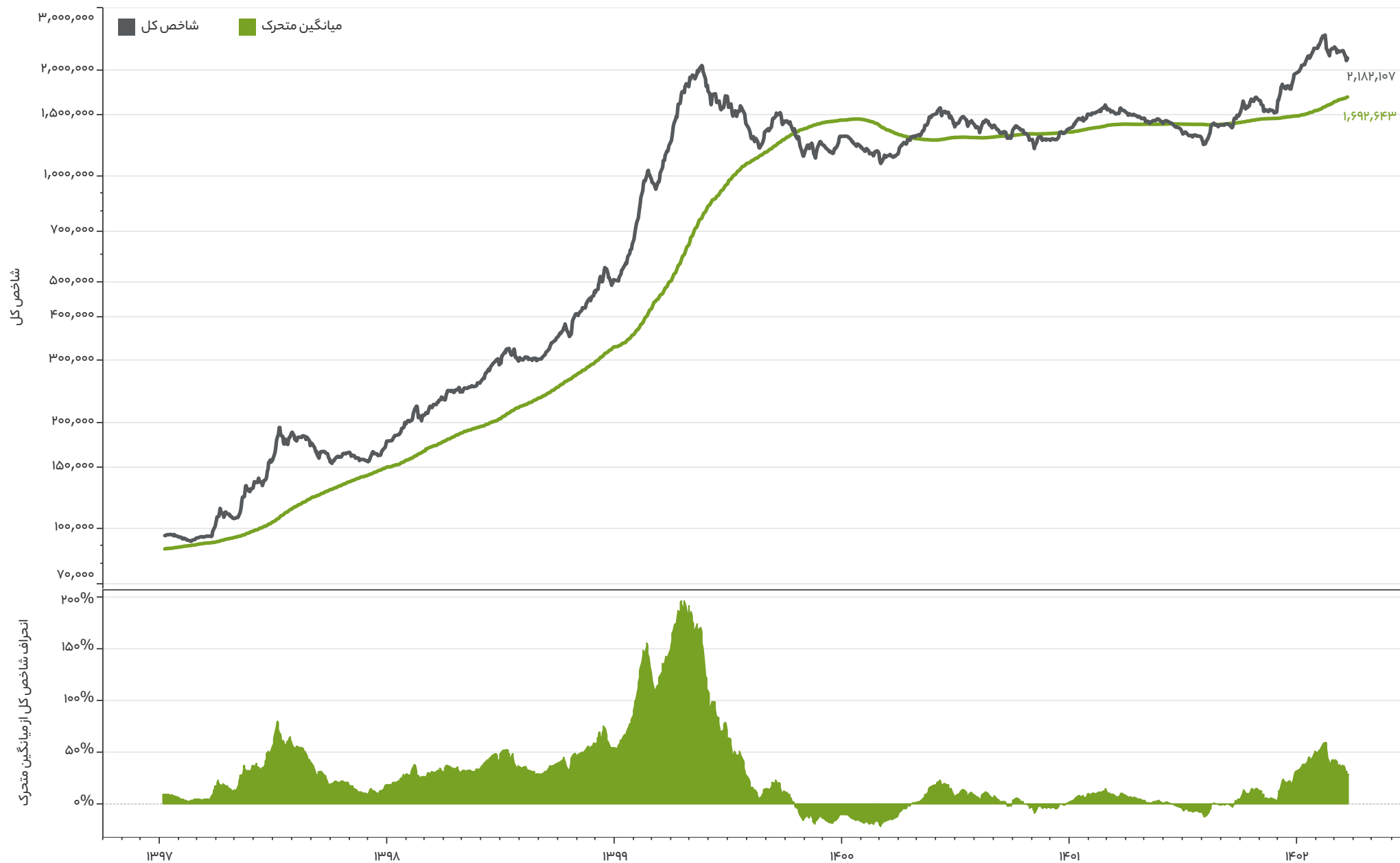
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





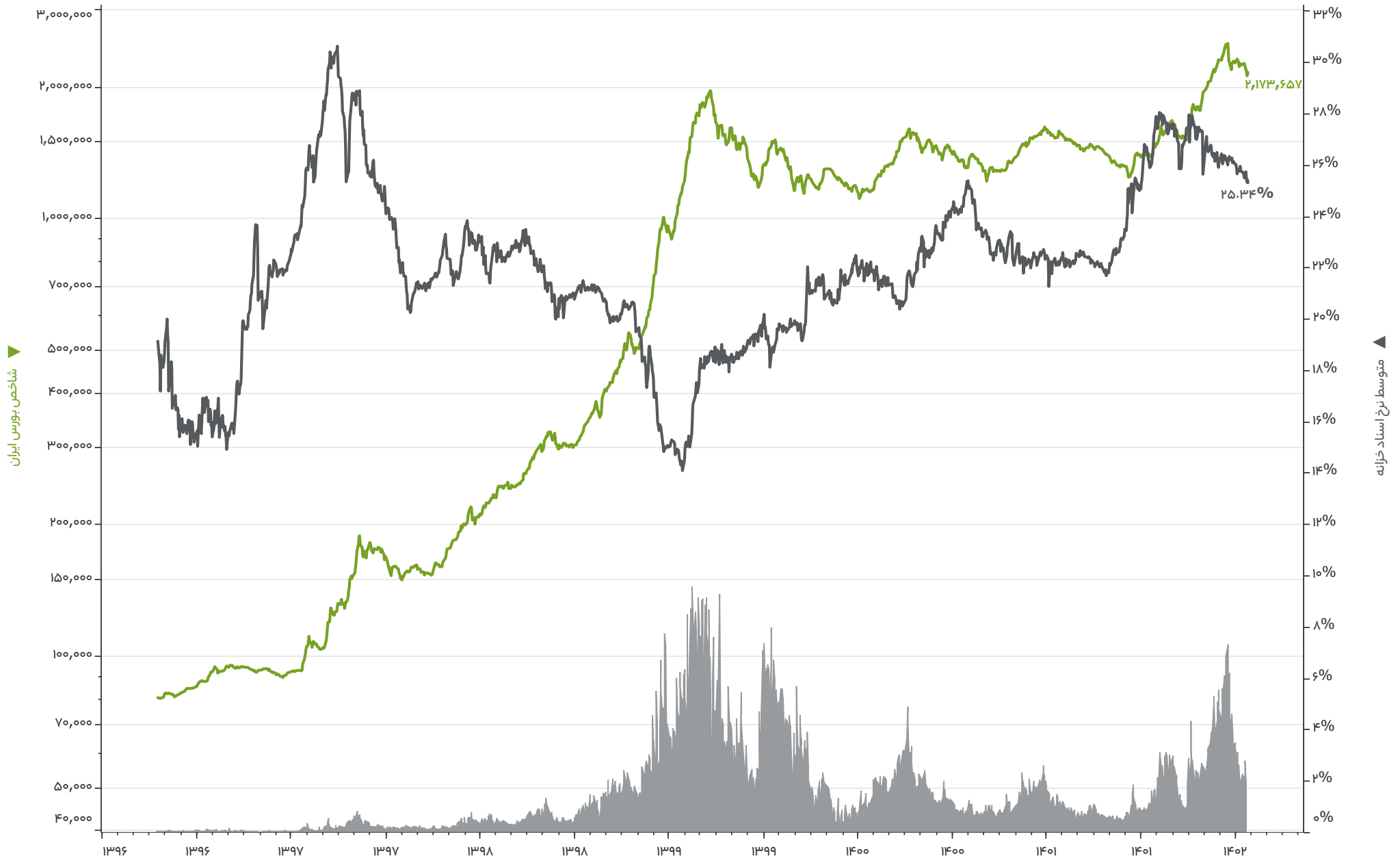
شاخص کل و میانگین متحرک

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



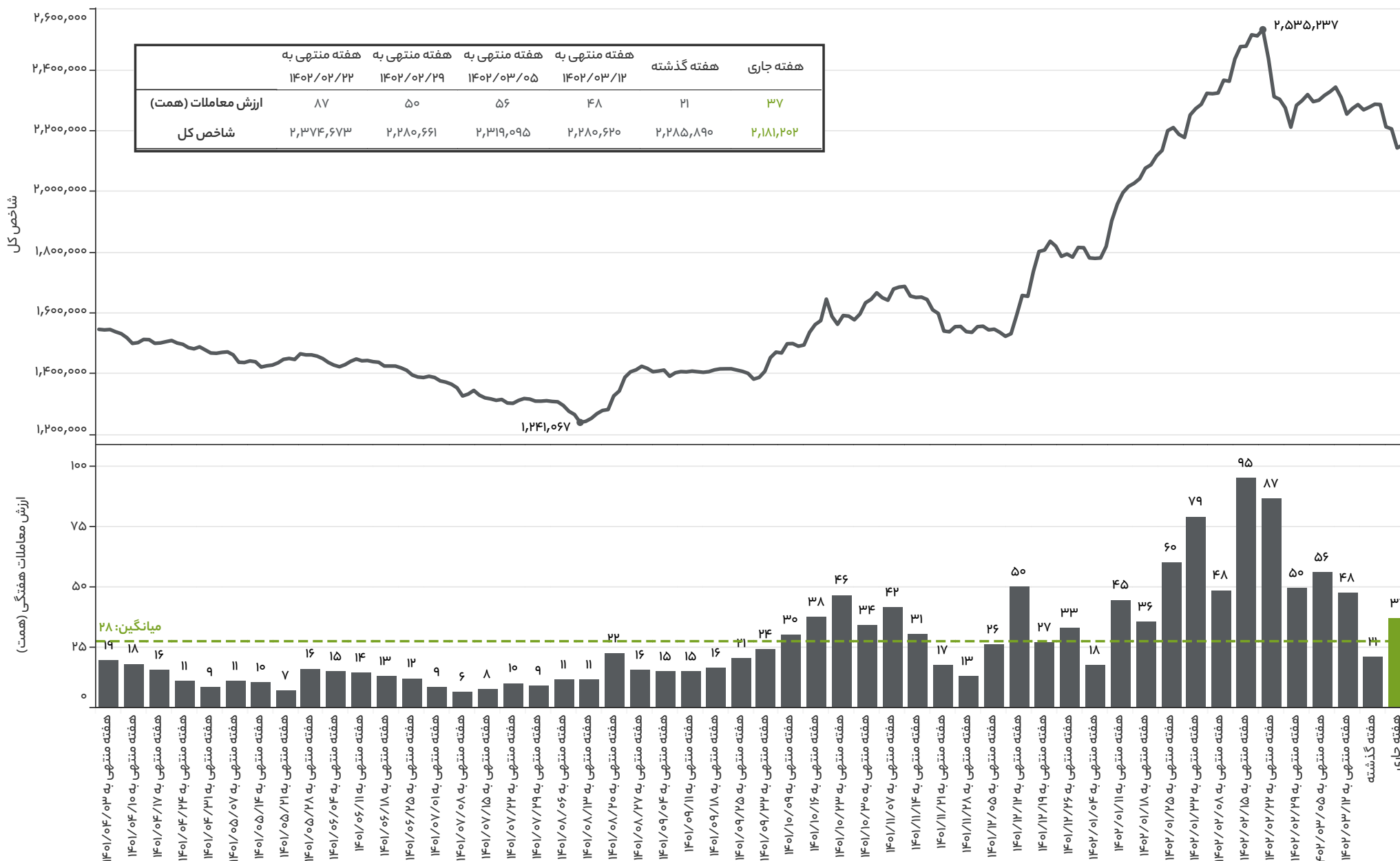
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



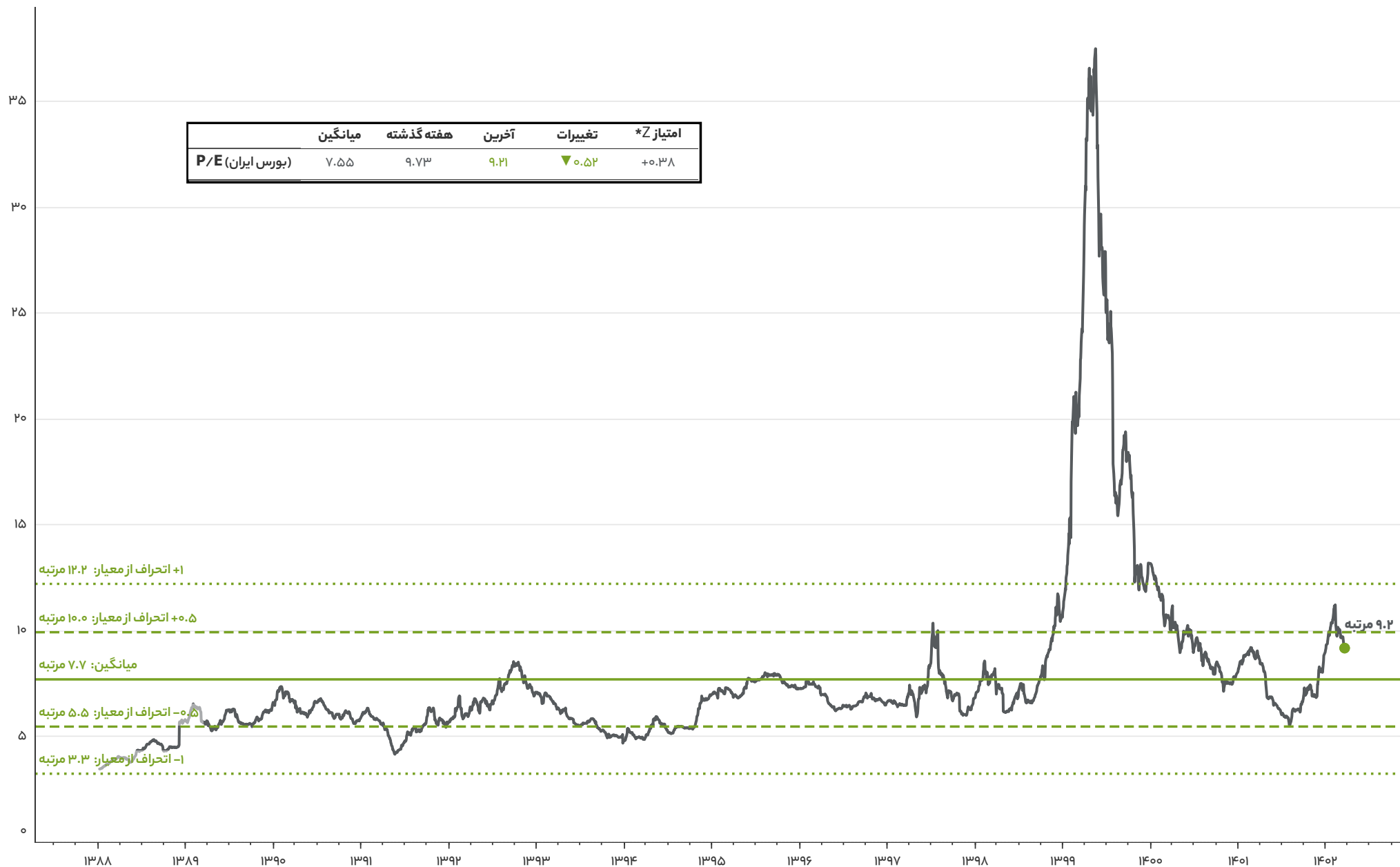
ارزش معاملات هفتگی بازار

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

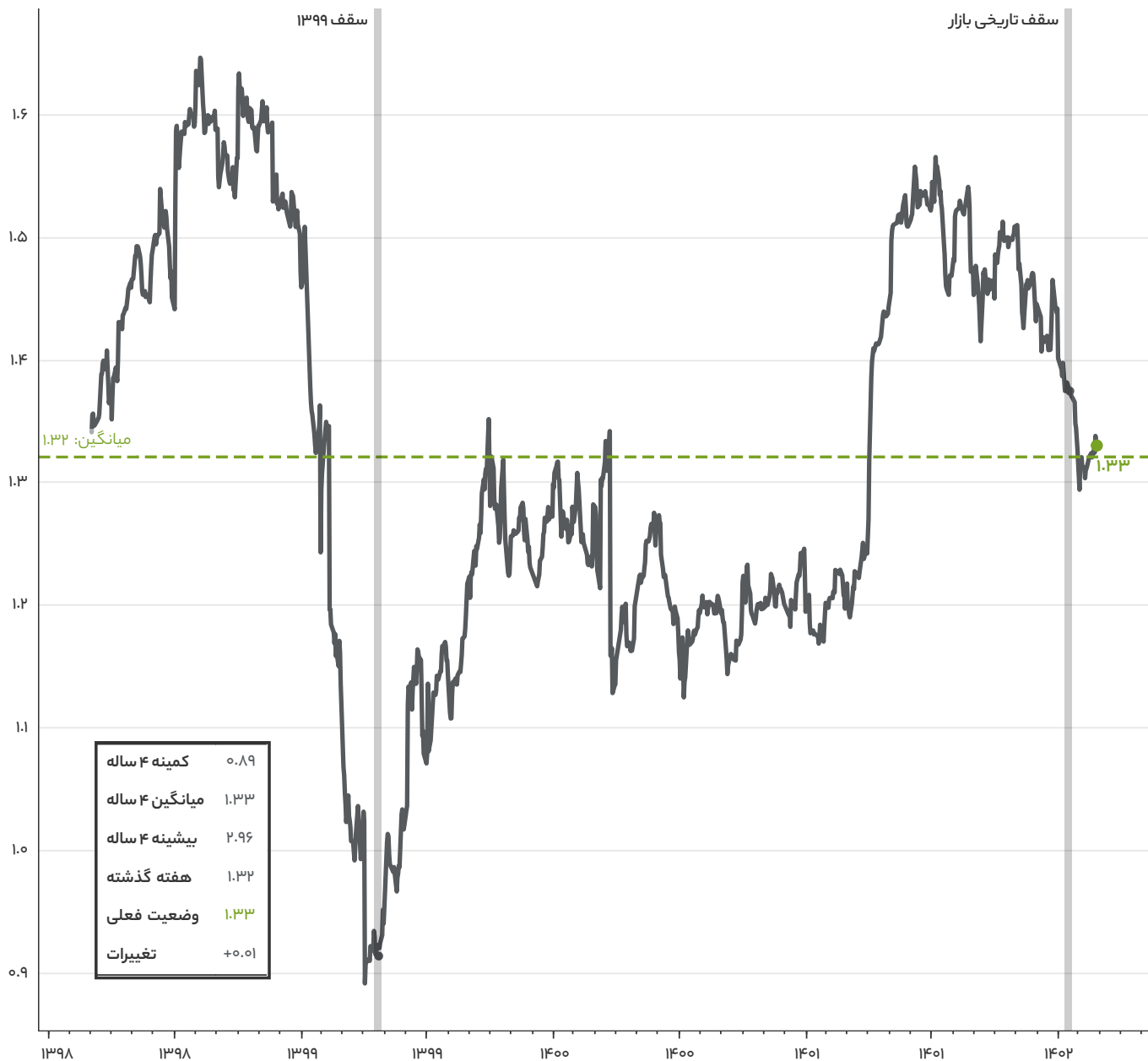
از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*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.

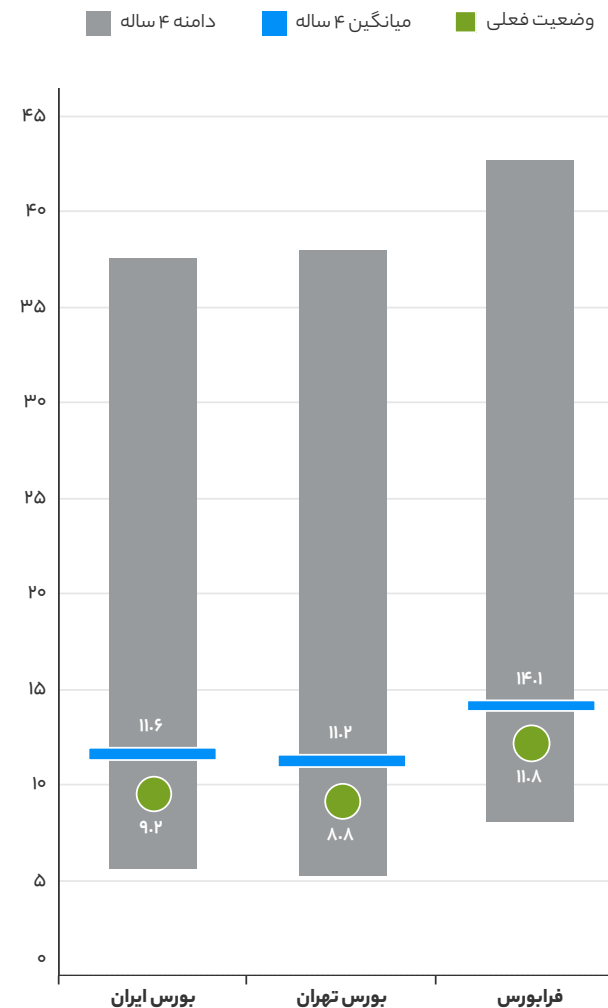
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
فرابورس	۱۱.۷۷	۱۲.۳۶	۸.۰۸	۱۴.۱۲	۴۲.۶۴
بورس تهران	۸.۸۴	۹.۳۵	۵.۲۵	۱۱.۲۳	۳۸.۰۰
بورس ایران	۹.۲۱	۹.۷۳	۵.۵۹	۱۱.۶۱	۳۷.۵۱

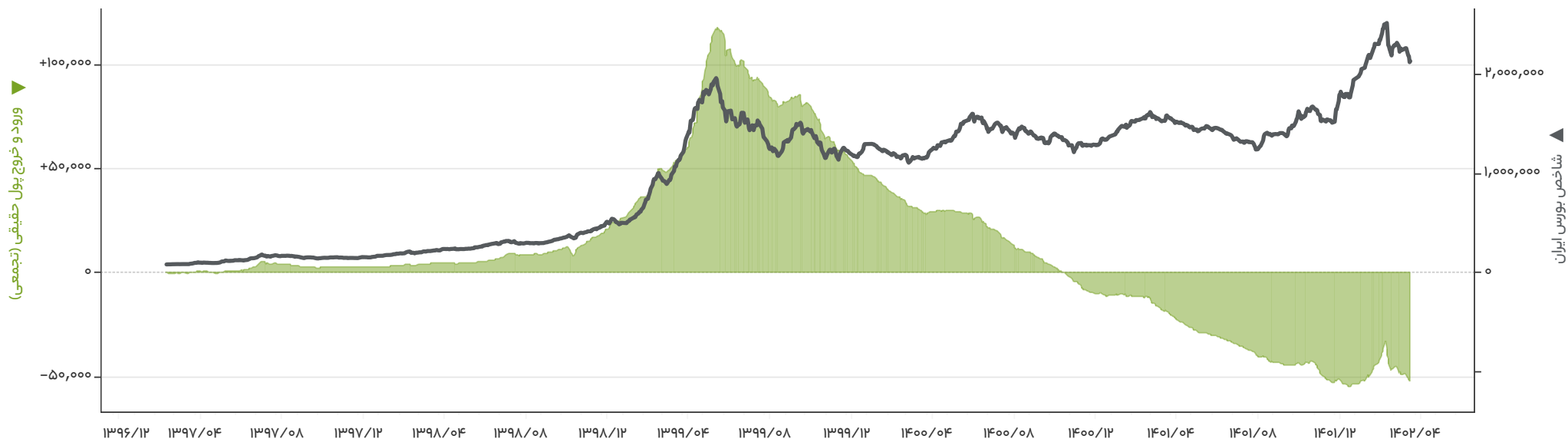


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۵۵۱	۳,۳۹۳	۷۴۵	۳۴۳	۲۲۵	۲۰۲	۱۶۵	۱۵۳	۱۳۲	۱۰۹	۵۰	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۳۹.۲%	۳۷.۴%	۸.۲%	۳.۸%	۲.۵%	۲.۲%	۱.۸%	۱.۷%	۱.۵%	۱.۲%	۰.۶%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۲	۹.۹	۵.۵	۷.۷	۱۴.۶	۱۴.۹	۱۹.۵	۱۰.۵	۱۳.۷	۲۶.۵	۱۴.۲	سودآوری
بازده سود نقدی	۵.۶%	۹.۶%	۷.۷%	۱.۲%	۳.۳%	۲.۷%	۱۳.۸%	۱۰.۲%	۵.۳%	۴.۱%	۳.۵%	
نسبت تقسیم سود	۵۷%	۷۲%	۷۰%	۳۰%	۴۶%	۳۹%	۸۵%	۷۶%	۵۹%	۶۲%	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)	+۹۰۷%	+۸۸۵%	+۷۰۴%	+۹۷۰%	+۴۷۱%	+۴۰۰%	+۵۵۲%	+۳۸۸%	+۱۷۷%	+۳۰۰%	+۵۵۹%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۶%	+۵۵%	+۴%	-۶%	+۷%	-۱۴%	+۷۶%	+۱۶%	-۵۶%	+۴%	-۸%	
بازده از ابتدای سال	+۷۶%	+۷۱%	+۷۱%	+۱۰۶%	+۶۷%	+۹۶%	+۶۳%	+۹۴%	+۷۷%	+۷۲%	+۱۹۴%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۴%	-۴%	-۶%	-۶%	-۵%	-۴%	-۵%	-۳%	-۳%	-۳%	-۲%	

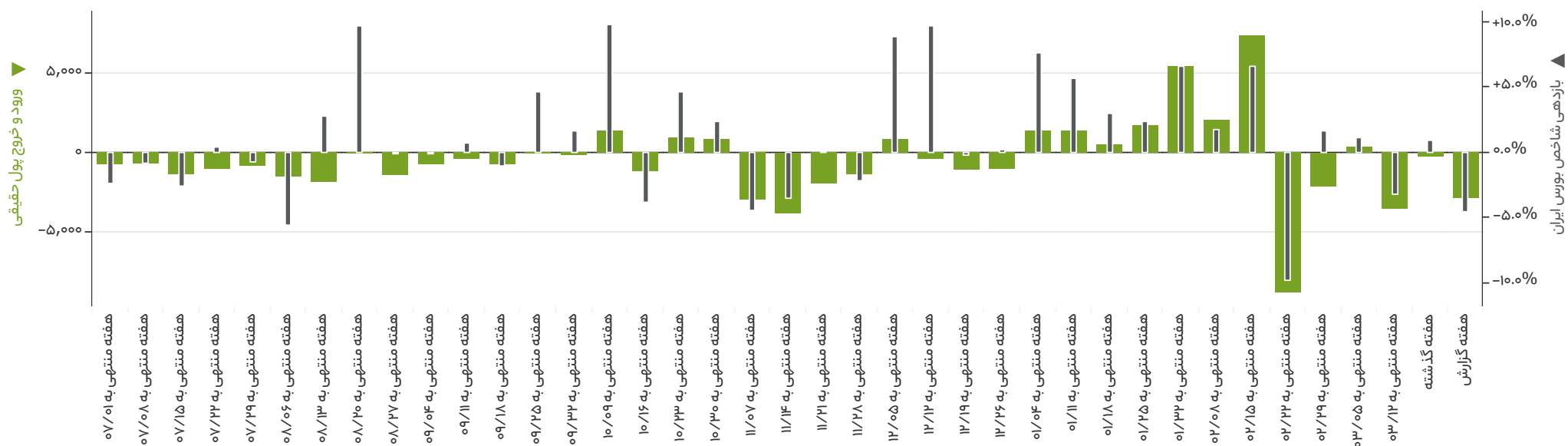
ورود و خروج یول به صورت تجمعی

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



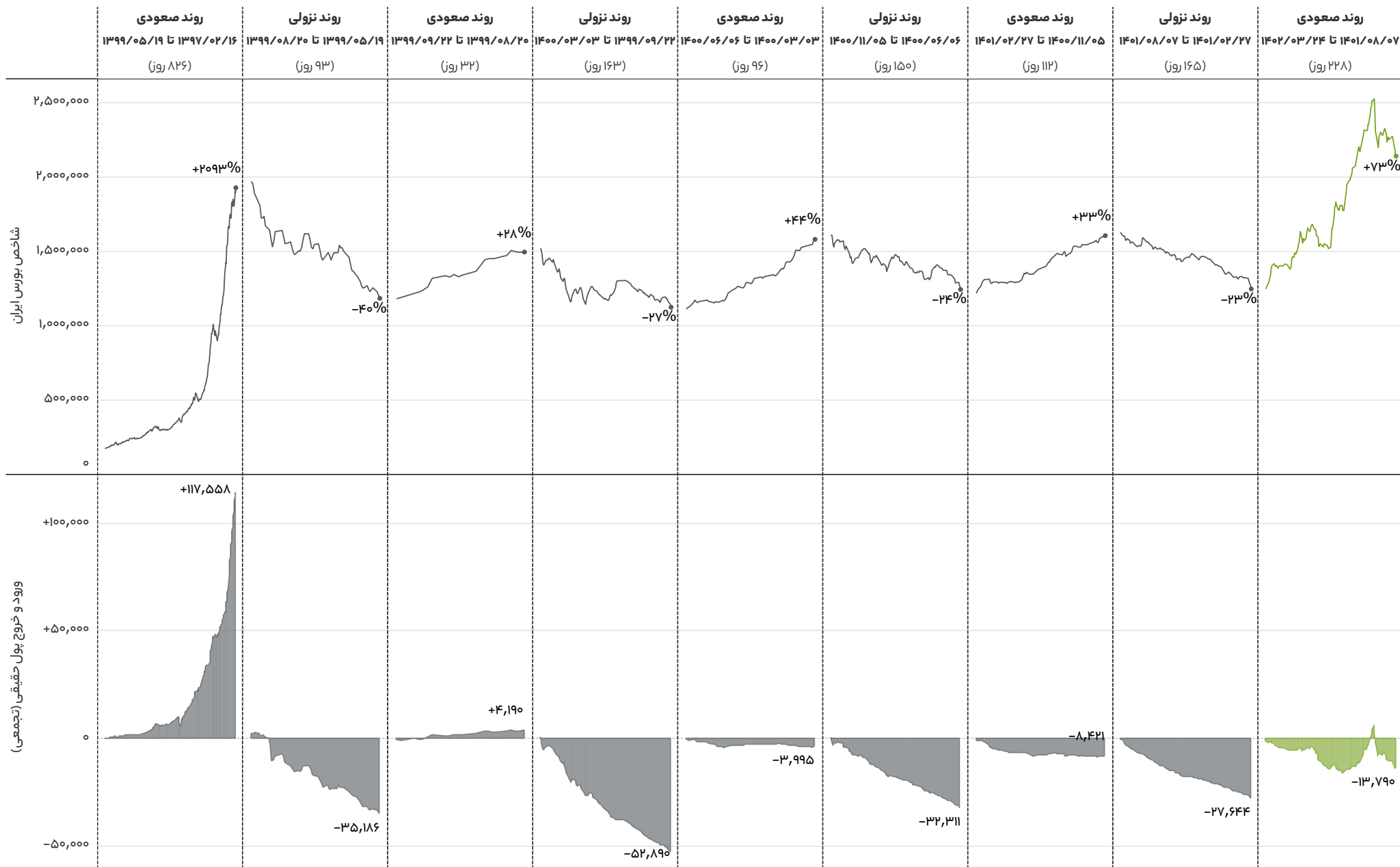
ورود و خروج یول حقیقی در مدت اخیر

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

ارزش بازار			رود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)			
نماد	صنعت	(م.م.ت)				
ونوین	بانکها و موسسات اعتباری	۱۶				+۲۰۶
ثمسکن	سرمایه گذاری	۵				+۱۳۱
فزر	کانی های فلزی	۱۱				+۷۲
وسدید	سرمایه گذاری	۱۶				+۶۲
ثفارس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۷				+۴۳
ثشاهد	سرمایه گذاری	۸				+۲۸
قیستو	شکر	۲				+۲۸
فسوز	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۱				+۲۶
حفاری	حفاری	۶				+۲۴
فاذر	محصولات فلزی	۴				+۲۳
غپونه	سایر محصولات غذایی	۲				+۲۰
های وب	خدمات اینترنتی	۱۰				+۱۹
کهمدا	ظروف شیشه ای	۴				+۱۸
سامان	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸				+۱۷
پی پاد	نرم افزار و خدمات	۶			-۶۰	
میدکو	سرمایه گذاری	۱۹۹			-۶۲	
فارس	سرمایه گذاری	۶۸۲			-۶۳	
وبصادر	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵			-۶۶	
خودرو	خودرو	۱۰۱			-۸۵	
خاور	خودرو	۴۳			-۸۸	
فولاد	آهن و فولاد	۴۶۴			-۹۱	
حکشتی	سرمایه گذاری	۹۷			-۱۰۱	
فملی	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۴۲۱			-۱۱۷	
شستا	سرمایه گذاری	۲۱۱			-۱۱۸	
وتجارت	بانکها و موسسات اعتباری	۶۵			-۱۱۸	
شتران	پالایش نفت و گاز	۱۴۴			-۱۴۲	
شپنا	پالایش نفت و گاز	۱۹۴			-۱۵۵	
وبملت	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸۶			-۳۲۶	

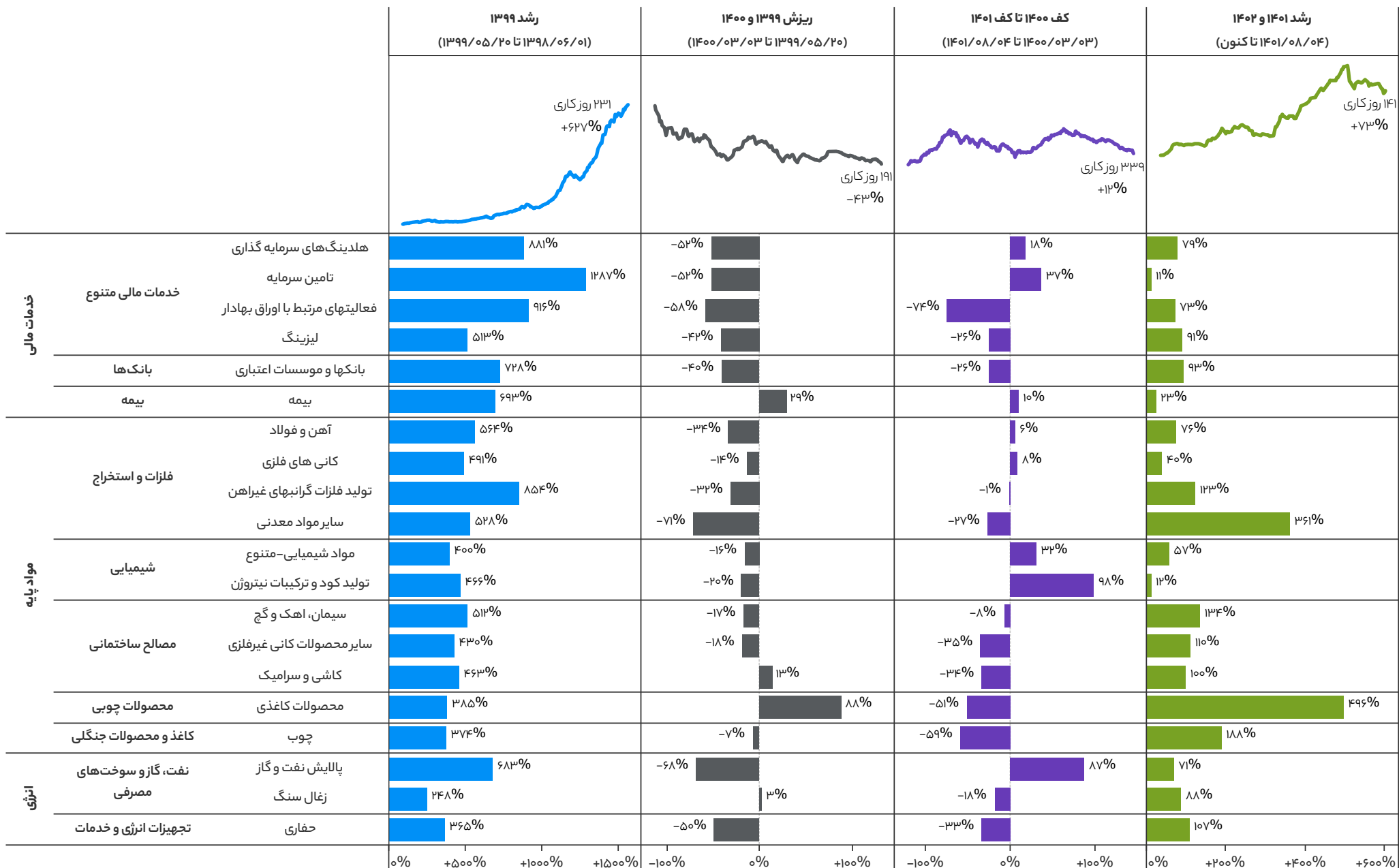
تغییر مالکیت شرکت

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

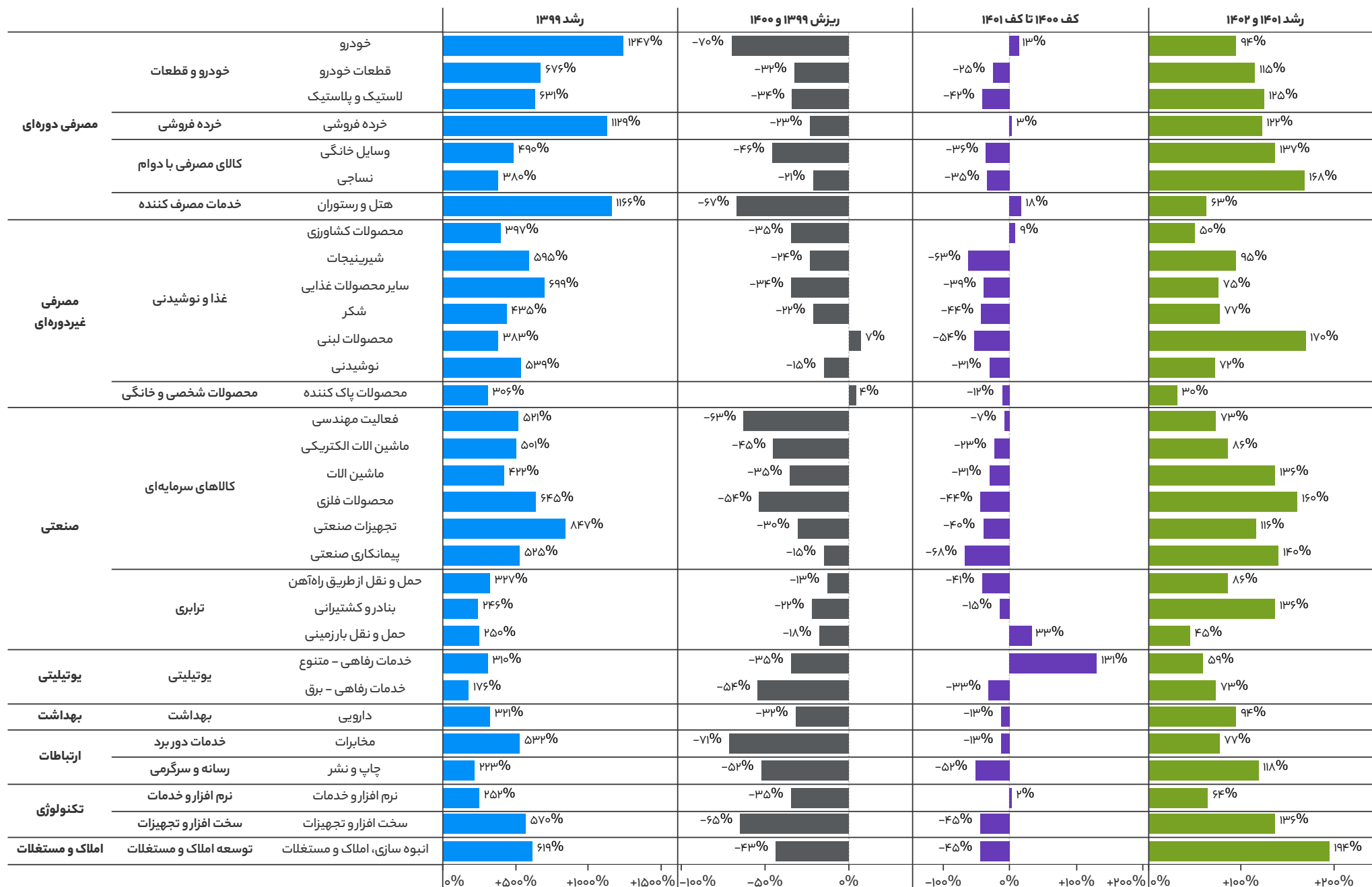
تغییر مالکیت شرکت		ارزش بازار (م.م.ه)	صنعت	نماد
۲.۷%+		۵.۲	سرمایه گذاری	ثمسکن
۲.۵%+		۱.۳	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	فسوژ
۱.۶%+		۰.۴	فعالیت مهندسی	تپولا
۱.۶%+		۱.۸	شکر	قیستو
۱.۳%+		۱۶.۰	بانکها و موسسات اعتباری	ونوین
۱.۳%+		۱.۶	سایر محصولات غذایی	غپونه
۱.۱%+		۱.۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات	ثتران
۱.۰%+		۰.۶	سرمایه گذاری	ولقمان
۱.۰%+		۱.۳	سرمایه گذاری	وارس
۰.۷%+		۷.۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	ثفارس
۰.۷%+		۱.۷	بیمه	ومعلم
۰.۶%+		۱۱.۲	کانی های فلزی	فزر
۰.۶%+		۲.۱	تجهیزات صنعتی	بالبر
۰.۶%+		۰.۲	سایر محصولات کانی غیرفلزی	سفارود
۱.۰%-		۱.۷	بیمه	میهن
۱.۱%-		۳.۳	آهن و فولاد	فلوله
۱.۱%-		۵.۶	نرم افزار و خدمات	پی پاد
۱.۱%-		۰.۲	سرمایه گذاری	ثعثما
۱.۲%-		۲.۵	سرمایه گذاری	وبرق
۱.۲%-		۰.۱	Null	مهریران
۱.۳%-		۰.۹	نرم افزار و خدمات	اوان
۱.۳%-		۰.۴	قطعات خودرو	خفناور
۱.۴%-		۲.۹	قطعات خودرو	خنصیر
۱.۸%-		۰.۷	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	حگدرش
۱.۹%-		۱.۸	محصولات کشاورزی	زملارد
۲.۰%-		۱.۰	بیمه	وحافظ
۲.۲%-		۱.۴	محصولات کشاورزی	غنوش
۲.۳%-		۰.۳	هتل و رستوران	گپارس
۴%+	۲%+	۰%	۲%-	

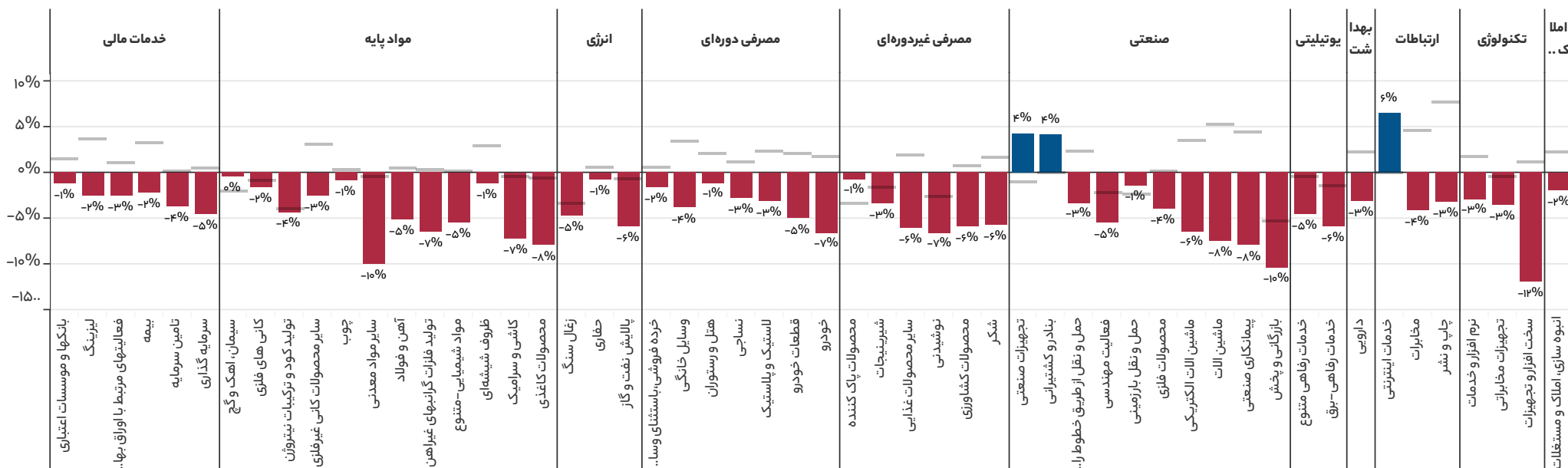
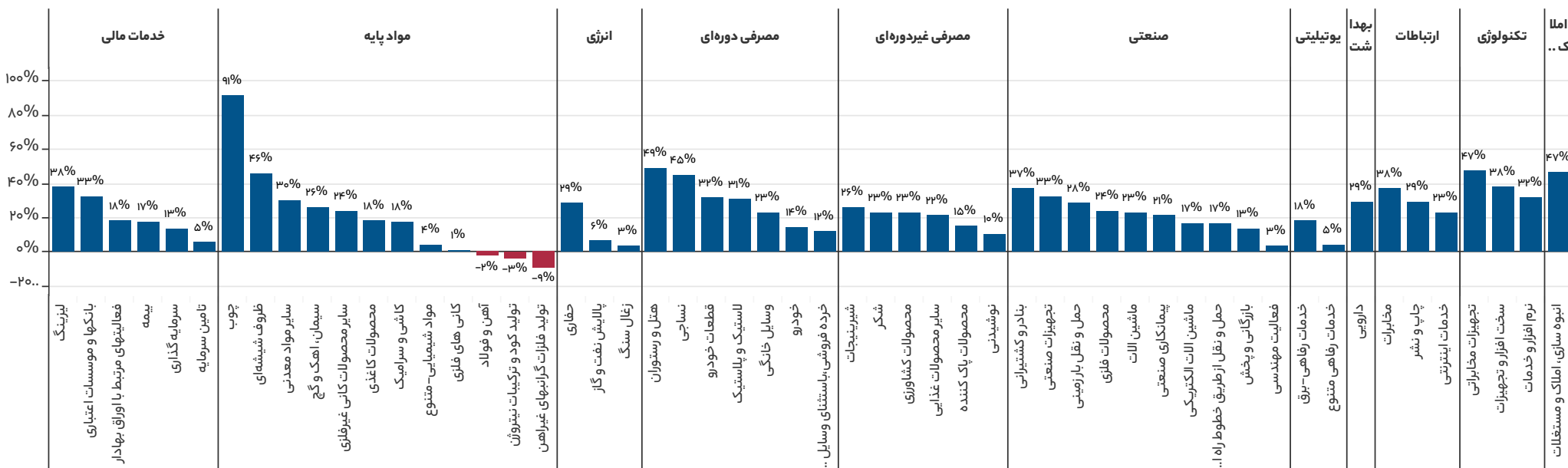
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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)

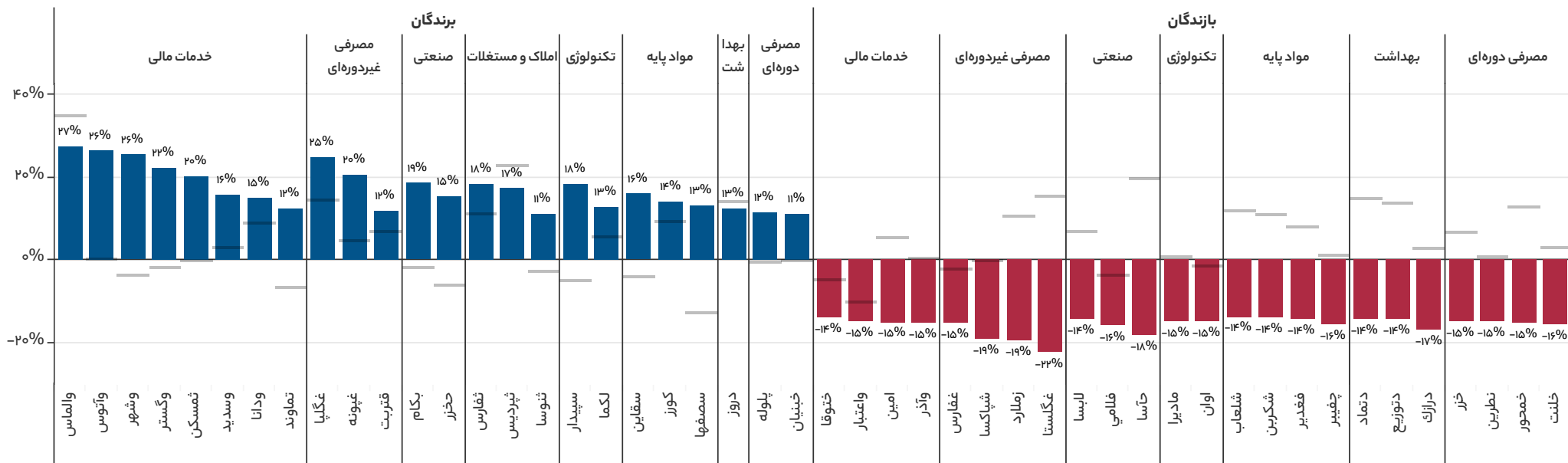
بازدهی بزرگ‌ترین ۳۵ شرکت سهامی طی ۲ هفته گذشته

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

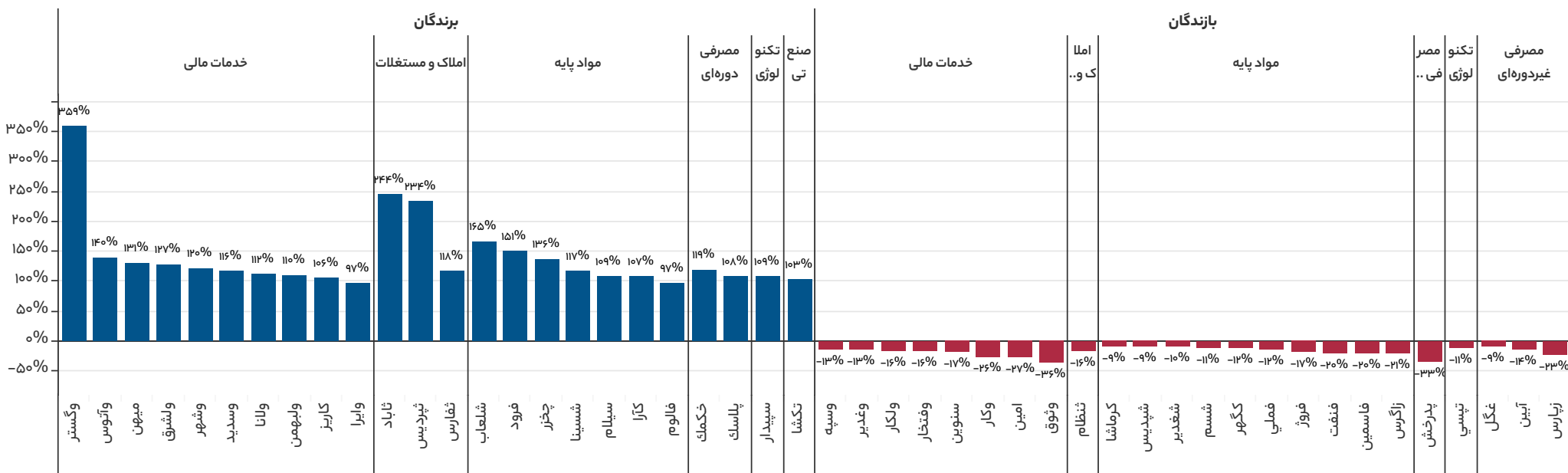


بازدهی هفته گذشته	ویپاسار	پپاس	فارس	ویملت	کگل	کگهر	کچاد	فخوز	اخابر	شیدیس	مارون	وسندوق	شبندر	وتجارت	ومعادن	پارس	یوعی	جم	مبین	فولاد	وامید	آریا	شستا	نوری	رمپنا	خودرو	قمی	شتران	حکشتی	تاپیکو	شپنا	میدکو	پارسان	وغدیر	خسپا
	+۴.۱٪	۰٪	-۰.۳۳٪	-۰.۴۴٪	-۰.۶٪	-۱.۳۳٪	-۱.۷٪	-۲.۳۳٪	-۲.۸٪	-۳.۰٪	-۳.۴٪	-۳.۷٪	-۴.۴٪	-۴.۴٪	-۴.۵٪	-۴.۷٪	-۴.۸٪	-۵.۱٪	-۵.۳٪	-۵.۵٪	-۵.۷٪	-۵.۸٪	-۵.۹٪	-۵.۹٪	-۶.۰٪	-۶.۵٪	-۶.۹٪	-۶.۹٪	-۷.۷٪	-۷.۷٪	-۸.۱٪	-۸.۱٪	-۸.۹٪	-۹.۲٪	-۹.۷٪

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



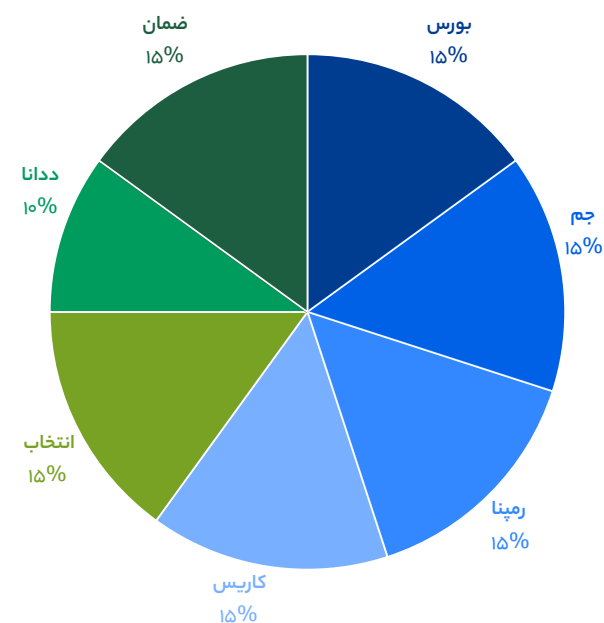
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



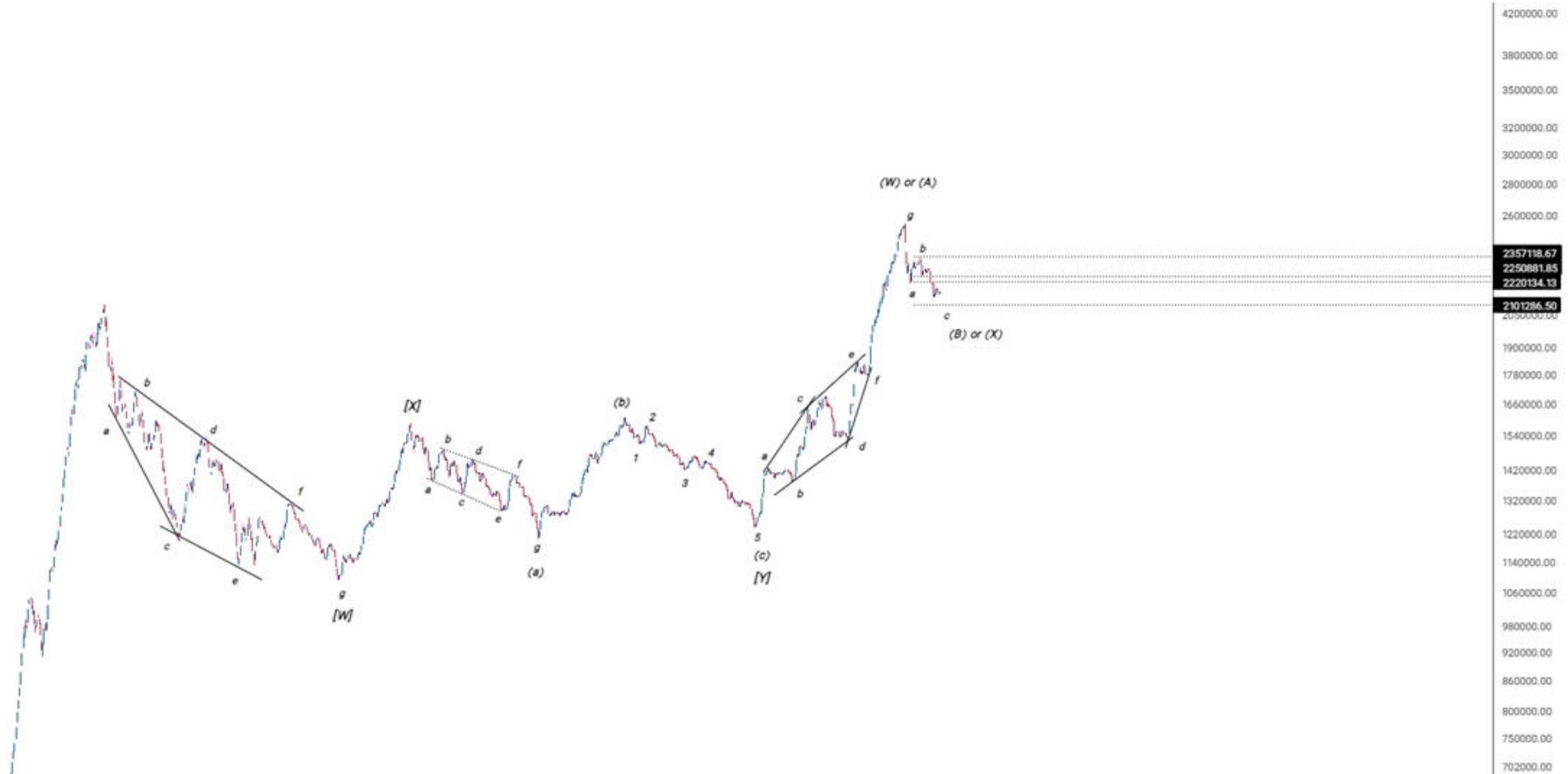
وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۵%	۳۳,۳۰۰	انتظار افزایش نرخ و پتانسیل افزایش مقدار تولید و سود زیر مجموعه‌ها	۴۲۰۰۰	انتخاب	
۱۰%	۴۶,۴۰۰	پتانسیل افزایش نرخ، پتانسیل بهره‌برداری از طرح سوم در ماه‌های آتی	۶۲۰۰۰	ددانا	میان مدت
۱۵%	۱۴,۱۲۵	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵۸,۶۵۰	احتمال افزایش حاشیه سود و بهبود تقاضای محصولات شرکت	۷۸۰۰۰	جم	
۱۵%	۱۳,۷۳۰	ارزش جایگزینی بالای نیروگاهی و احتمال افزایش نرخ برق، وضعیت ارزش مناسب، عرضه اولیه شرکت زیرمجموعه	۱۹۰۰۰	رمپنا	بلند مدت
۱۵%	۷,۵۰۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۹۰۰۰	بورس	
۱۵%	۲۲,۹۳۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریزما	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

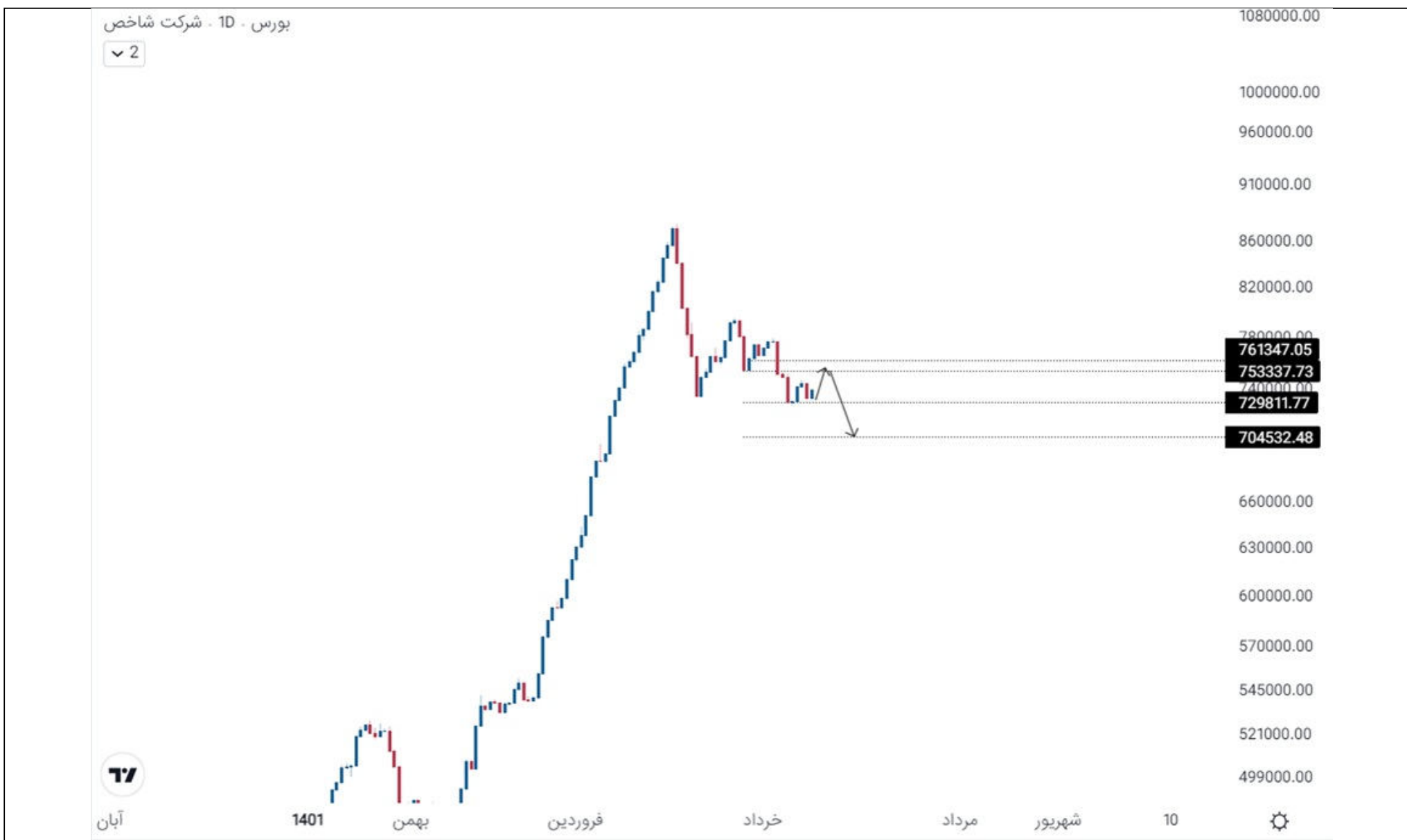
TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود اصلاح شاخص کل تا حوالی ۲,۱۰۰ هزار واحد ادامه داشته باشد. مهم‌ترین محدوده مقاومتی حوالی ۲,۲۲۰ الی ۲,۲۵۰ هزار واحد می‌باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح شاخص هم‌وزن تا حوالی ۷۰۴ هزار واحد ادامه داشته باشد. مهم‌ترین محدوده مقاومتی حوالی ۷۵۳ الی ۷۶۱ هزار واحد می‌باشد.

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



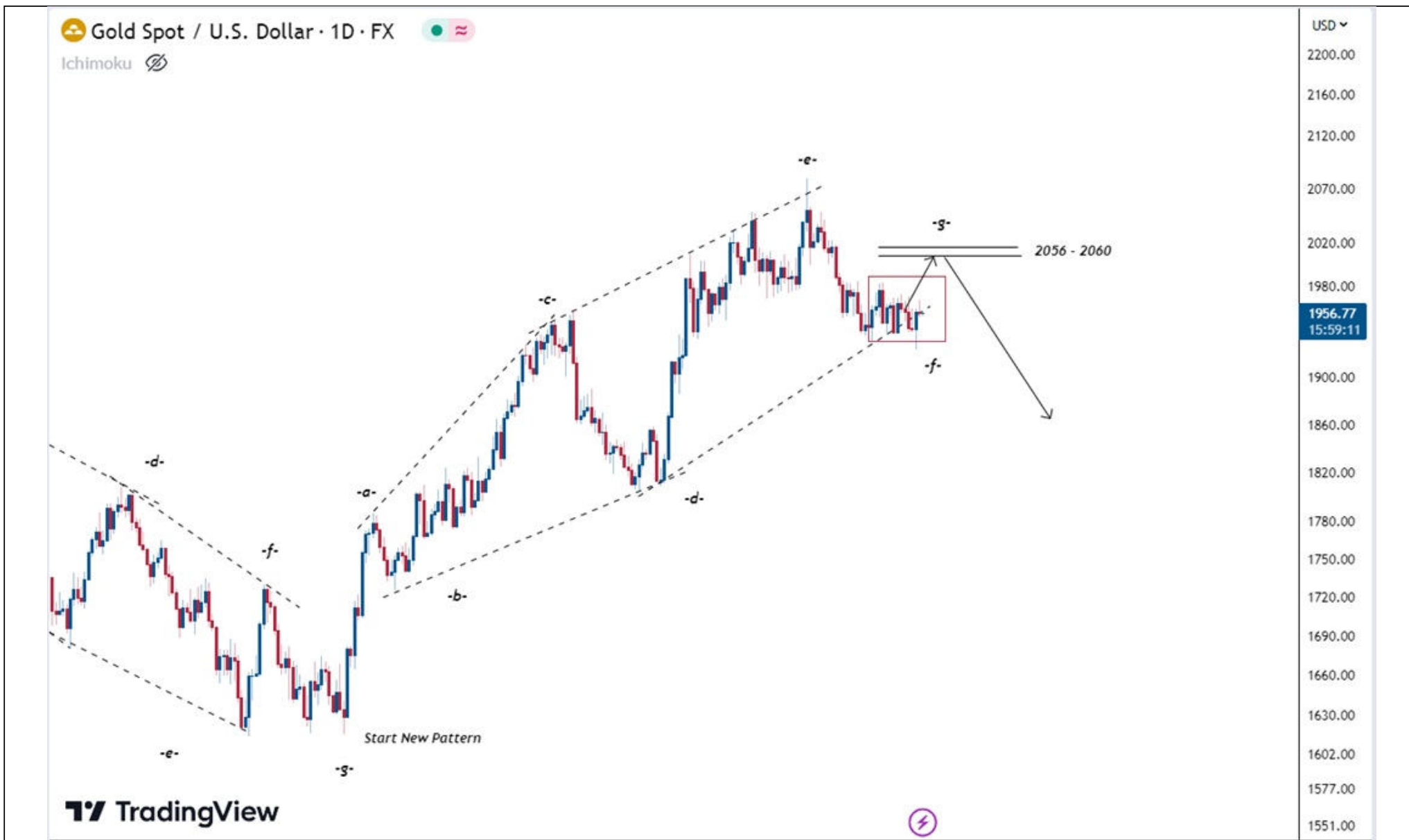
محدوده ۴۹,۱۰۰ تا ۴۹,۷۰۰ تومان محدوده حمایتی مهم برای دلار بود که با از دست رفتن این محدوده تبدیل به ناحیه مقاومتی مهمی شده است. انتظار می‌رود اصلاح دلار تا حوالی ۴۷ هزار تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح سکه تا حوالی ۲۵ میلیون تومان ادامه داشته باشد. مهم‌ترین محدوده مقاومتی حوالی ۲۹,۵۰۰ هزار الی ۲۹,۷۰۰ هزار تومان می‌باشد.

توضیحات تحلیل



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 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 ۱۴۰۳ و 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 به ۱۴۰۱	نسبت P/E با سود ۱۴۰۲	نسبت P/E با سود ۱۴۰۳
											۱۴۰۲	۱۴۰۳
شیمیایی	اوره	شیراز	۱۲	۴۷.۴	۳۵,۹۸۰	۳۴%	۷,۶۲۰	۵,۷۱۷	-	-۲۵%	۵.۰	
		خراسان	۱۲	۲۵.۹	۱۴۴,۸۰۰	۷۹%	۲۸,۱۰۴	۱۹,۴۰۴	-	-۳۱%	۷.۵	
		کرمانشا	۱۲	۲۵.۰	۷۰,۷۲۰	۵۱%	۱۳,۱۹۹	۱۰,۲۱۵	-	-۲۳%	۶.۳	
	الفین	شگویا	۱۲	۳۷.۴	۱۵,۶۲۰	۹۱%	۱,۴۴۸	۲,۱۶۴	-	+۴۹%	۶.۶	
		جم پیلن	۱۲	۳۳.۶	۱۶۸,۰۰۰	۱۰۰%	۲۱,۰۹۴	۳۲,۰۱۱	-	+۵۲%	۵.۲	
		شغذیر	۱۲	۱۰.۳	۷۸,۸۷۰	۹۰%	۸,۶۶۰	۱۴,۰۳۳	-	+۶۲%	۵.۱	
		شبصیر	۱۲	۷.۷	۳۰,۸۰۰	۹۰%	۳,۷۶۰	۴,۹۵۲	-	+۳۲%	۵.۶	
		شجم	۶	۵.۳	۸,۰۹۰	۹۱%	۸۷۶	۲,۰۵۶	-	+۱۳۵%	۳.۹	
	آروماتیک	بوعلی	۱۲	۷۱.۵	۴۹,۸۶۰	۹۶%	۵,۴۴۸	۸,۲۲۸	-	+۵۱%	۵.۴	
	متانول	شخارک	۱۲	۳۳.۳	۵۵,۴۸۰	۱۰۰%	۶,۴۱۲	۱۱,۶۸۱	-	+۸۲%	۴.۷	
		شغن	۱۲	۲۲.۴	۷,۲۳۰	۹۹%	۱,۰۲۶	۸۶۲	-	-۱۶%	۷.۲	
	دوده صنعتی	شصدف	۱۲	۲.۹	۴۱,۸۵۰	۷۰%	۳,۸۲۳	۱۴,۰۳۳	-	+۲۶۷%	۲.۸	
		شکرین	۱۲	۲.۸	۴,۳۷۰	۸۷%	۶۳۹	۲,۱۶۴	-	+۲۳۹%	۱.۸	
		شدوص	۱۲	۱.۵	۱۵,۴۵۰	۹۳%	۱,۹۲۷	۲,۷۴۸	-	+۴۳%	۵.۶	
بسته‌بندی و ظروف	ظروف شیشه‌ای	کرازپ	۱۲	۵.۲	۱,۷۷۰	۲۷%	۲۲۴	۳۱۸	-	+۴۲%	۵.۴	
		کهمد	۳	۴.۲	۵,۶۴۰	۱۹%	۴۹۷	۶۸۹	۱,۰۶۸	+۳۸%	۸.۲	۵.۵
		کگاز	۱۲	۳.۴	۴۰,۵۵۰	۶۴%	۱,۴۰۰	۴,۱۳۷	-	+۱۹۵%	۹.۶	



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	۴۶۴.۰	۵,۸۰۰	۵۹%	۶۸۴	۱,۰۵۳۱	-	+۵۱%	۵.۲	
		فولاد	۱۲	۴۴.۴	۱۸,۵۲۰	۹۱%	۱,۷۲۵	۳,۷۶۶	-	+۱۱۸%	۴.۵	
		کاهه	۱۲	۳۶.۷	۱۱,۴۶۰	۷۸%	۱,۰۵۶	۲,۲۴۴	-	+۱۱۳%	۴.۷	
		ارفع	۱۲	۲۹.۷	۲۴,۷۵۰	۷۱%	۳,۱۱۷	۴,۱۵۶	-	+۳۳%	۶.۰	
	سرب و روی	محصولات فلزی	۱۲	۱۴.۳	۳,۸۵۰	۱۵%	۴۴۱	۶۳۹	-	+۴۵%	۵.۹	
		فنوال	۱۲	۵.۰	۱۴,۸۷۰	۵۴%	۸۷۳	۹۵۴	-	+۹%	۱۵.۱	
		کیمیا	۱۲	۱.۹	۶,۴۴۰	۳۹%	۱,۲۶۵	۱,۶۰۹	-	+۲۷%	۳.۷	
	مصالح ساختمانی	فتوسا	۱۲	۱.۳	۹,۱۸۰	۱۷%	۱,۴۴۳	۲,۲۳۳	-	+۵۵%	۴.۰	
		ساوه	۱۲	۹.۰	۱۳۸,۲۰۰	۹۶%	۱۵,۸۳۸	۲۰,۱۳۴	-	+۲۷%	۶.۹	
		سآبیک	۱۲	۵.۸	۱۹,۷۵۰	۹۰%	۲,۴۹۵	۳,۶۱۸	-	+۴۵%	۵.۵	
		سیمان، اهک و گچ	۹	۵.۰	۳۷,۶۰۰	۱۱۹%	۳,۴۵۴	۴,۶۸۳	۸,۹۹۸	+۳۶%	۸.۰	۴.۲
		ساروم	۱۲	۴.۵	۴۴,۶۱۰	۹۵%	۵,۵۴۳	۶,۹۷۵	-	+۲۶%	۶.۴	
		سصو..	۱۲	۳.۳	۳۰,۳۱۰	۸۶%	۳,۶۸۵	۶,۷۴۷	-	+۸۳%	۴.۵	
		سقایین	۱۲	۲.۲	۸۷,۵۳۰	۹۹%	۵,۹۵۳	۹,۵۰۹	-	+۶۰%	۹.۲	
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	کفرا	۱۲	۲.۳	۱۱,۶۳۰	۱۰%	۶۶۴	۴,۱۳۷	-	+۵۲۳%	۲.۸	

		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%	۲۵,۹۱۰	۴۷.۹	۶	وکغذیر			
			۱۴۰۲	۵.۸	۱۱.۵	-۳۰%	۳,۶۴۵	۱,۷۶۰	۲,۵۰۲	۴۴%	۲۰,۳۰۰	۱۶.۲	۳	واحیا			
		تامین سرمایه	۱۴۰۳	۱۰.۸	۱۰.۸	+۲۴%	-	۵۸۲	۴۷۱	۹۹%	۶,۲۶۰	۱۱.۳	۶	امین			
			۱۴۰۲	۴.۹	۴.۹	+۱۷%	-	۸۸۵	۷۵۸	۱۰۰%	۴,۳۷۰	۱۰.۷	۱۲	تنوین			
		چند رشته‌ای	۱۴۰۳	۵.۶	۵.۶	+۹%	-	۹۵۱	۸۷۵	۸۴%	۵,۳۳۰	۱۲.۵	۹	وسپه			
			۱۴۰۲	۲۵.۲	۲۵.۲	+۲۵۲%	-	۵۴۸	۱۵۶	۲۵%	۸,۹۴۰	۱۲	۱۲	بورس			
بهداشت	بهداشت	دارویی	۱۴۰۳	۵.۸	۵.۸	+۱۶%	-	۵,۲۱۱	۴,۴۸۵	۹۴%	۳۴,۳۵۰	۶.۲	۱۲	دتوزیع			
			۱۴۰۲	۸.۰	۸.۰	+۲۹%	-	۴,۹۱۰	۳,۸۱۲	۹۳%	۴۲,۷۶۰	۶.۰	۱۲	دفرا			
			۱۴۰۳	۷.۲	۷.۲	+۲۶%	-	۵,۱۳۸	۴,۰۶۳	۹۳%	۳۶,۸۰۰	۵.۹	۱۲	هجرت			
			۱۴۰۲	۶.۴	۶.۴	+۱۲%	-	۳,۰۰۰	۲,۶۷۳	۹۵%	۲۱,۷۵۰	۳.۹	۱۲	دابور			
			۱۴۰۳	۷.۹	۷.۹	+۲۱%	-	۱,۲۷۸	۱,۰۵۴	۵۲%	۱۰,۱۵۰	۳.۷	۱۲	دسیحان			
			۱۴۰۲	۶.۳	۶.۳	+۶%	-	۶,۸۹۱	۶,۵۳۱	۹۸%	۴۹,۴۰۰	۳.۵	۱۲	دتماد			
			۱۴۰۳	۴.۷	۴.۷	+۳۴%	-	۲,۸۶۵	۲,۱۳۲	۹۸%	۱۵,۵۷۰	۳.۳	۱۲	درازک			
			۱۴۰۲	۷.۷	۷.۷	-	-	۲,۳۴۴	۲,۳۴۰	۹۷%	۲۰,۲۰۰	۲.۸	۱۲	کاسپین			
			۱۴۰۳	۷.۶	۷.۶	+۱۵%	-	۱۰,۵۷۹	۹,۲۰۷	۹۴%	۸۰,۵۰۰	۲.۴	۱۲	دکپسول			
			۱۴۰۲	۵.۳	۵.۳	+۶۱%	-	۱,۷۳۱	۱,۰۷۶	۹۰%	۱۰,۱۰۰	۲۰.۲	۱۲	شنفت			
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	زغال سنگ	۱۴۰۳	۳.۶	۳.۶	+۱۳۳%	-	۶,۱۵۶	۲,۶۴۷	۱۰۰%	۲۵,۰۵۰	۸.۸	۱۲	کزغال			
			۱۴۰۲	۴.۵	۴.۵	+۱۰۹%	-	۴,۱۲۳	۱,۹۷۶	۶۵%	۱۹,۹۳۰	۱.۶	۱۲	کطبس			
			۱۴۰۳	۲۴.۴	۲۴.۴	+۲%	-	۳,۱۶۵	۳,۱۰۷	۹۶%	۷۷,۱۰۰	۵.۴	۱۲	سپیدار			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۱۴۰۳	۱۴.۱	۱۴.۱	+۳۳%	-	۳,۳۸۱	۲,۵۴۷	۹۲%	۴۹,۹۰۰	۱.۷	۱۲	رافزا			
			۱۴۰۲	۲۴.۴	۲۴.۴	+۲%	-	۳,۱۶۵	۳,۱۰۷	۹۶%	۷۷,۱۰۰	۵.۴	۱۲	سپیدار			

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
صنعتی	روغن خوراکی	غکورش	۱۲	۱۹.۳	۱۶,۱۰۰	۸۷%	۲,۰۵۵	۱,۳۶۴	-	-۳۴%	۱۰.۵		
		غیشهر	۹	۱۱.۷	۳,۹۷۳	۳۱%	۳۸۹	۴۲۹	۸۶۱	+۱۰%	۹.۳	۵.۱	
		غمارگ	۹	۱.۸	۱,۹۳۹	۱۰%	-۷۷۲	-۷۸	۱۴۲	+۹۰%	-۲۴.۸	۱۴.۳	
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۶.۰	۱۶,۰۰۰	۷۶%	۱,۶۱۰	۲,۱۵۲	-	+۳۴%	۶.۹		
		غپینو	۱۲	۳.۷	۴,۱۱۰	۶۰%	۴۸۵	۶۶۶	-	+۳۷%	۶.۲		
		غسالم	۱۲	۲.۷	۶,۰۸۰	۵۲%	۶۵۱	۷۸۱	-	+۲۰%	۷.۴		
		غمینو	۱۲	۱.۷	۱۱,۳۰۰	۷۰%	۱,۴۹۴	۱,۷۵۸	-	+۱۸%	۶.۴		
	زراعت و خدمات وابسته	سیمرغ	۹	۳.۴	۲۶,۳۷۰	۲۱%	۳,۹۱۴	۴,۹۵۱	۹,۴۹۶	+۲۶%	۵.۳	۳.۱	
		زفکا	۱۲	۳.۱	۲۰,۶۵۰	۸۹%	۱,۵۴۶	۲,۹۹۲	-	+۹۳%	۶.۵		
		تلیسه	۱۲	۲.۳	۴,۶۴۰	۸۶%	۲۵۲	۴۳۸	-	+۷۴%	۱۰.۱		
		زدشت	۱۲	۲.۳	۳۳,۳۵۰	۷۹%	۲,۱۲۰	۲,۷۶۴	-	+۳۰%	۱۱.۵		
		زقیام	۱۲	۲.۲	۳,۱۴۶	۸۲%	۲۸۸	۵۶۰	-	+۹۴%	۵.۲		
		زگلدشت	۱۲	۱.۸	۲۵,۸۵۰	۹۸%	۹۵۸	۱,۹۳۵	-	+۱۰۲%	۱۲.۹		
		زملارد	۱۲	۱.۸	۲۲,۰۰۰	۹۸%	۳۲۷	۱,۴۲۶	-	+۳۳۷%	۱۵.۴		
		زشریف	۹	۱.۶	۶,۶۶۰	۸۰%	۴۸۱	۶۱۴	۸۷۸	+۲۸%	۱۰.۸	۸.۱	
		زببنا	۱۲	۱.۶	۴,۲۸۰	۶۲%	۴۰۲	۶۷۲	-	+۶۷%	۶.۰		
		زکشت	۱۲	۱.۳	۲۱,۱۰۰	۷۰%	۲,۵۲۹	۲,۸۲۹	-	+۱۲%	۶.۸		
		زمگسا	۱۲	۱.۲	۳۹,۱۰۰	۹۹%	۳,۲۶۴	۴,۳۸۸	-	+۳۴%	۸.۲		
		زشگزا	۱۲	۰.۹	۹,۶۹۰	۵۷%	۷۸۲	۱,۹۳۴	-	+۱۴۷%	۴.۸		
	غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۷.۴	۴,۱۰۱	۱۳%	۴۵۱	۵۹۲	-	+۳۱%	۶.۸		
		غمهرا	۱۲	۲.۳	۱۲,۳۴۰	۱۰%	۱,۰۱۰	۱,۷۳۵	-	+۷۲%	۷.۱		
	محصولات لبنی	غگلپا	۱۲	۲.۲	۶۰,۷۰۰	۵۲%	۴,۶۵۰	۴,۹۸۹	-	+۷%	۱۲.۲		
		غگلستا	۱۲	۲.۰	۳۱,۰۵۰	۴۹%	۱,۵۶۲	۲,۱۳۵	-	+۳۷%	۱۴.۵		
		غفارس	۱۲	۱.۵	۱۳,۰۹۰	۴۰%	۱,۰۱۰	۱,۳۶۷	-	+۳۵%	۹.۶		
		غشان	۱۲	۱.۴	۸,۳۹۰	۸۸%	۷۹۵	۷۹۶	-	-	۹.۷		
	نوشیدنی	غبهنوش	۱۲	۲.۷	۷۴,۰۳۰	۲۵%	۱,۱۰۳	۵,۳۰۰	-	+۳۸۰%	۱۳.۹		
		غدیس	۱۲	۱.۸	۱۵,۳۰۰	۵۷%	۱,۴۶۶	۱,۸۵۳	-	+۲۶%	۷.۸		



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	
											۱۴۰۲	۱۴۰۳
مصرفی دوره‌ای	کالای مصرفی با دوام	انتخاب	۹	۳۳.۰	۳۳,۰۰۰	۹۰%	۳,۲۲۳	۵,۱۷۷	-	+۶۱%	۶.۴	
			پکوپر	۹	۴.۳	۶,۵۸۰	۵۲%	۲۴۷	۹۱۴	+۲۷۱%	۷.۲	
	خودرو و قطعات	لاستیک و پلاستیک	۱۲	۳.۷	۲,۸۴۶	۶۴%	۱۱۲	۱۳۹	-	+۲۴%	۲۰.۰	
			پیزد	۱۲	۳.۴	۱۶,۴۸۰	۷۲%	۶۱۲	۷۰۲	+۱۵%	۲۲.۹	
			پاسا	۱۲	۲.۷	۱۴,۳۰۰	۱۹%	۱,۳۶۰	۱,۸۳۵	+۳۵%	۷.۷	
صنعتی	ترابری	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۱۲	۶.۳	۱۴,۲۸۰	۱۰%	۱,۴۹۹	۲,۲۴۵	-	+۵۰%	۶.۳	
			توریل	۱۲	۴.۵	۶,۴۶۰	۵۲%	۴۳۰	۶۸۵	+۵۹%	۹.۴	
			چارسا	۶	۱.۸	۷۳,۸۵۰	۹۰%	۶,۳۱۲	۸,۸۴۹	+۴۰%	۸.۳	۶.۰
	بنادرو کشتیرانی	حسینا	۱۲	۴.۷	۱۸,۹۳۰	۹۶%	۲,۰۱۳	۲,۲۰۴	-	+۹%	۸.۶	

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

