

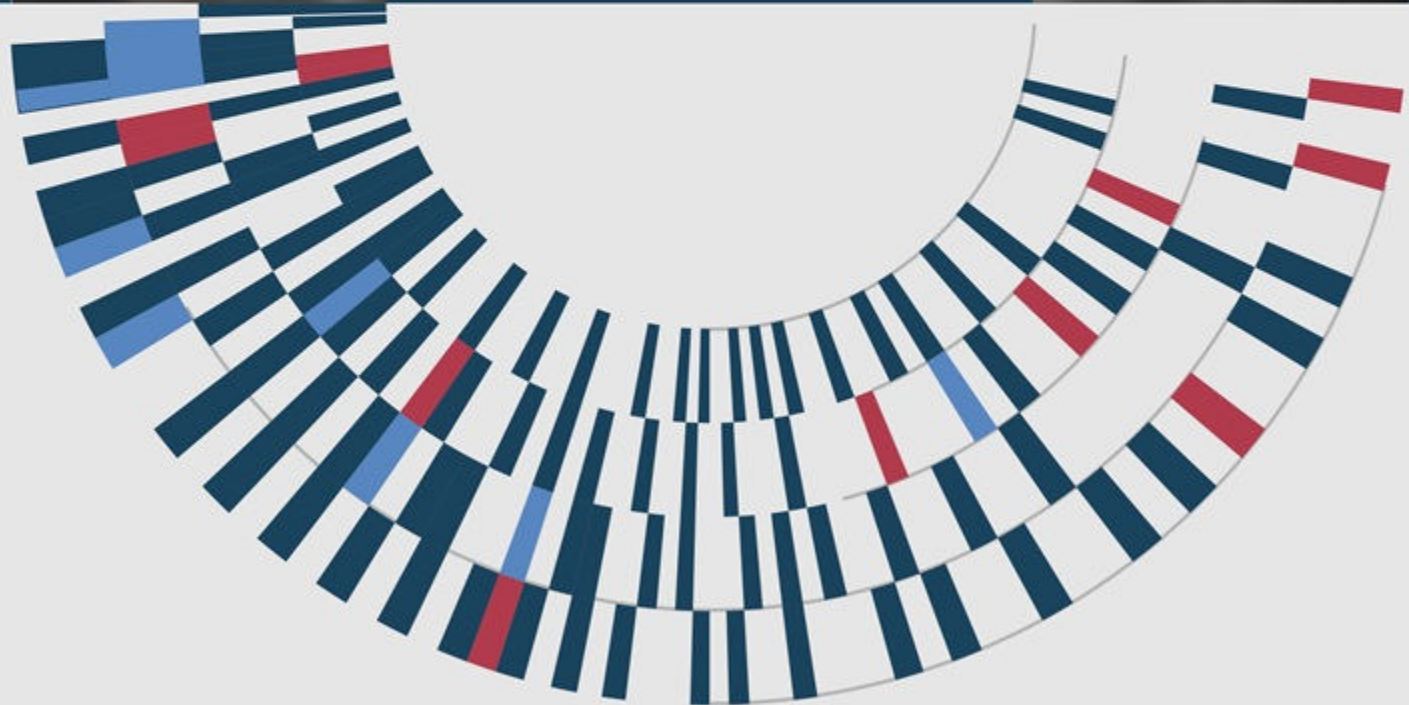


کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۵ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۴/۰۹





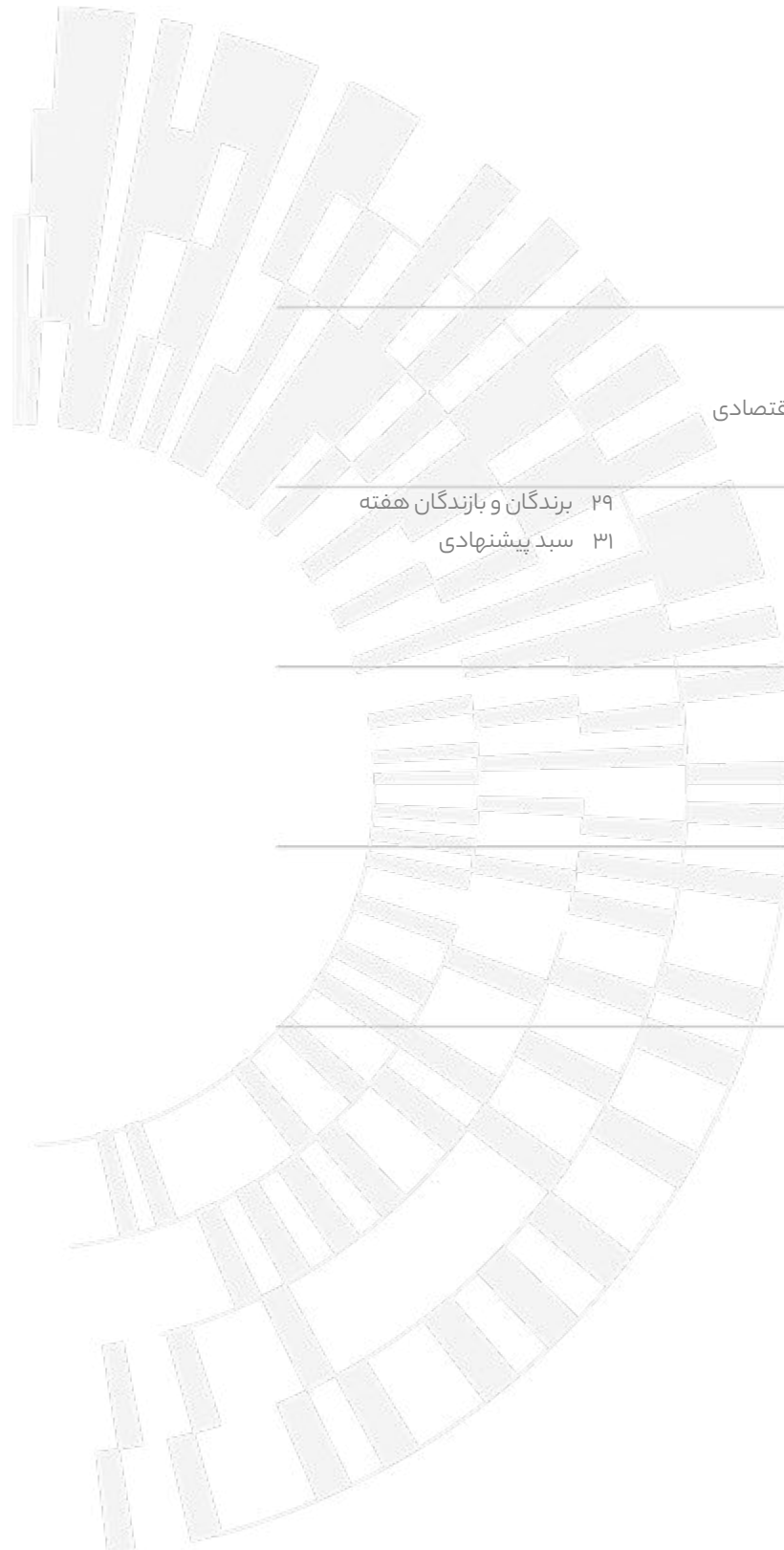
معرفی گزارش:

گزارش کاربزماتیک بازار سرمایه توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاربزم با همکاری شرکت سرمایه‌گذاری کاربزم 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 کاربزم 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 کاربزم هیچ‌گونه 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 کاربزم 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 کاربزم در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

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



<p>۰۳</p>	<p>کامودیتی</p>	<p>۰۴ فلزات و معادن ۰۵ پتروشیمی ۰۶ انرژی و سایر محصولات ۰۷ گاز طبیعی</p>	<p>۰۸ سیمان ۰۹ اخبار و معیارهای تاثیرگذار ۱۱ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی</p>
<p>۱۲</p>	<p>بازار سهام</p>	<p>۱۳ مروری بر بازارهای موازی ۱۵ بررسی بلندمدت بازار سهام ۱۷ نرخ بهره و رونق بازار سهام ۱۸ ارزش معاملات</p>	<p>۲۹ برندگان و بازندگان هفته ۳۱ سبد پیشنهادی</p>
<p>۳۱</p>	<p>تحلیل تکنیکال</p>	<p>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</p>	<p>۳۶ دلار آمریکا (بازار آزاد) ۳۷ سکه امامی ۳۸ طلای جهانی ۳۹ نفت برنت</p>
<p>۴۱</p>	<p>اجماع تحلیل گران</p>	<p>۴۲ نسبت قیمت به سود (سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)</p>	

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	رند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۱۸	-۰.۱%	فزر	-	۱,۶۴۳ - ۲,۰۱۷	۱۰%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۳۱۷	-۱.۲%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۱۵۸ - ۹,۳۴۱	۷%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۴۵	-۲.۶%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ - ۲,۵۰۴	۱۲%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۳۹۴	۱.۳%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمرداد	۲,۳۰۳ - ۳,۶۰۰	۲۲%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۹۲	-۱.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۱,۸۵۲ - ۲,۲۷۳	۶%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۸۴۳	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۶۸۳ - ۴,۸۴۳	۶۷%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۲۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۰۹۶ - ۳,۶۲۵	۲۴%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۸	-۰.۲%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کویر، فوکا، فنورد	۴۸۳ - ۶۲۳	۹%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۵۰۰	-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کویر، فوکا، فنورد	۱۲,۳۰۸ - ۲۲,۸۲۱	۴۴%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰ - ۶۷۰	۵%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۰۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۱,۶۶۷ - ۲۲,۰۸۰	۳۷%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۲۳	-	ذوب، کویر	فولای	۶۲۳ - ۷۵۵	۷%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۶۵۰	-۴.۴%	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۰۲۴ - ۲۴,۷۴۷	۴۷%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۷۵	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۰ - ۷۸۰	۳%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۷۳	-	فولاد	-	۶۱۵ - ۸۶۰	۴%

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	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۱۹	۱۱.۹%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشاه	شاروم، شفارس	۲۸۵ / ۷۷۳	-۴۶%
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۵۰	۵.۵%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵ / ۳۳۰	-۲۱%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۵۰	۲.۷%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ / ۱,۰۵۰	-۲۹%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۲	-۲.۰%	آریا، شکبیر	-	۸۸۲ / ۱,۲۴۷	-۲۹%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۸	-۱.۳%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶ / ۱,۰۳۹	-۱۵%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۹۶	-۲.۶%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۴۰ / ۱,۱۳۸	-۱۷%
مونواتیلن گلاکول	چین CFR	دلار/تن	۴۵۰	-۳.۲%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۳۷ / ۵۵۰	-۱۷%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۳۵	-	شگویا	-	۹۳۴ / ۱,۰۹۹	
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۷۶۰	۲.۰%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ / ۹۹۴	-۲۱%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۱۲	۱.۵%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ / ۹۹۱	-۱۸%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۶۷	۰.۹%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲ / ۱,۲۱۰	-۲۰%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۰	-	شصفها، نوری	-	۹۷۹ / ۱,۱۸۵	-۱۳%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۸۷۸	-۲.۵%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ / ۱,۳۰۷	-۳۳%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۷۵۲	-۲.۵%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ / ۱,۲۵۰	-۴۰%
تولون	چین CFR	دلار/تن	۷,۰۵۵	-۰.۴%	بوعلی	-	۶,۱۲۹ / ۷,۷۳۹	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۶۵۰	۱.۶%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ / ۱,۴۵۸	-۵۵%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۷۰	۱.۳%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۶۹۹ / ۱,۰۵۰	-۲۷%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۴۵	-	شبصیر	-	۱,۲۴۵ / ۱,۶۹۰	-۲۶%



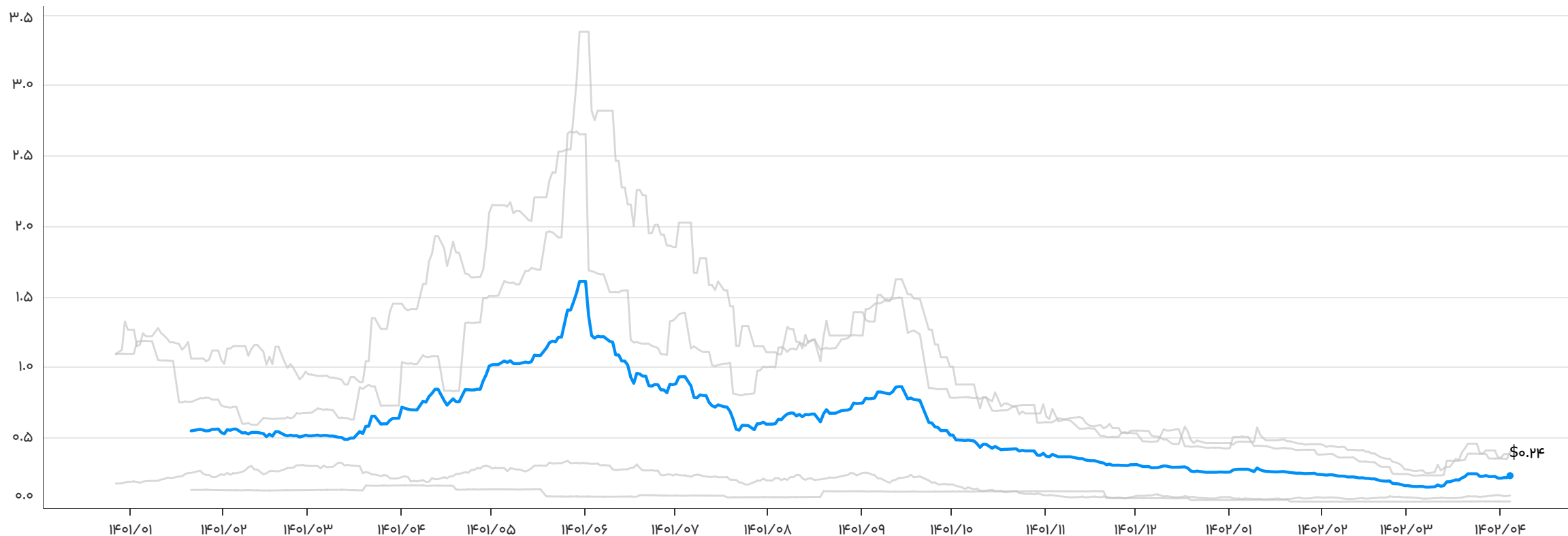
عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه	
انرژی و فرآورده های نفتی	نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۵	۱.۵%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۲ / ۱۰۷	-۳۰%
	نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۰	۱.۶%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۶ / ۱۰۵	-۳۳%
	نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/بشکه	۱۰۲	۱.۱%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۹۷ / ۱۷۰	-۳۴%
	گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۹۶	۱.۶%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۸۹ / ۱۷۰	-۳۸%
	لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۲,۵۰۴	۰.۴%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۱۰,۳۰۳ / ۱۶,۸۹۵	-۲۶%
	روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۷۹۵	-	شبهرن، شسپا، شنفت، شرانل	-	۲۱,۷۹۵ / ۴۱,۳۶۵	-۳۴%
	قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۲,۴۸۰	۳.۳%	شپاس	-	۸,۸۵۰ / ۱۷,۱۴۰	۷%
محصولات کشاورزی	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۹۵	-۱۵.۳%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۹۵ / ۲۷۲	-۲۲%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۷۶۲	۰.۶%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸ / ۹۶۸	-۲۰%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۴۸۱	۰.۴%	-	-	۱,۲۰۵ / ۲,۰۰۷	-۲۶%
	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۳۷	-۱۱.۵%	-	-	۲۲۷ / ۳۳۹	-۲۸%
ارز و ارز دیجیتال	یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۹	۰.۲%	-	-	۰.۹۷ / ۱.۱۰	۰%
	پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	-۰.۲%	-	-	۱.۰۹ / ۱.۲۸	۰%
	بیتکوین	بایننس	دلار	۳۰,۳۸۶	-۱.۶%	-	-	۱۶,۵۴۹ / ۳۰,۸۶۹	۰%



هاب	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
هنری هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۱۰	۳.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ - ۰.۳۴	-۵۴%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۶	۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ - ۰.۱۷	-۶۶%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	۰.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۳.۳۹	-۸۰%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۱	۱۴.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۲.۶۸	-۶۲%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۴	۶.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۱.۶۲	-۷۲%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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





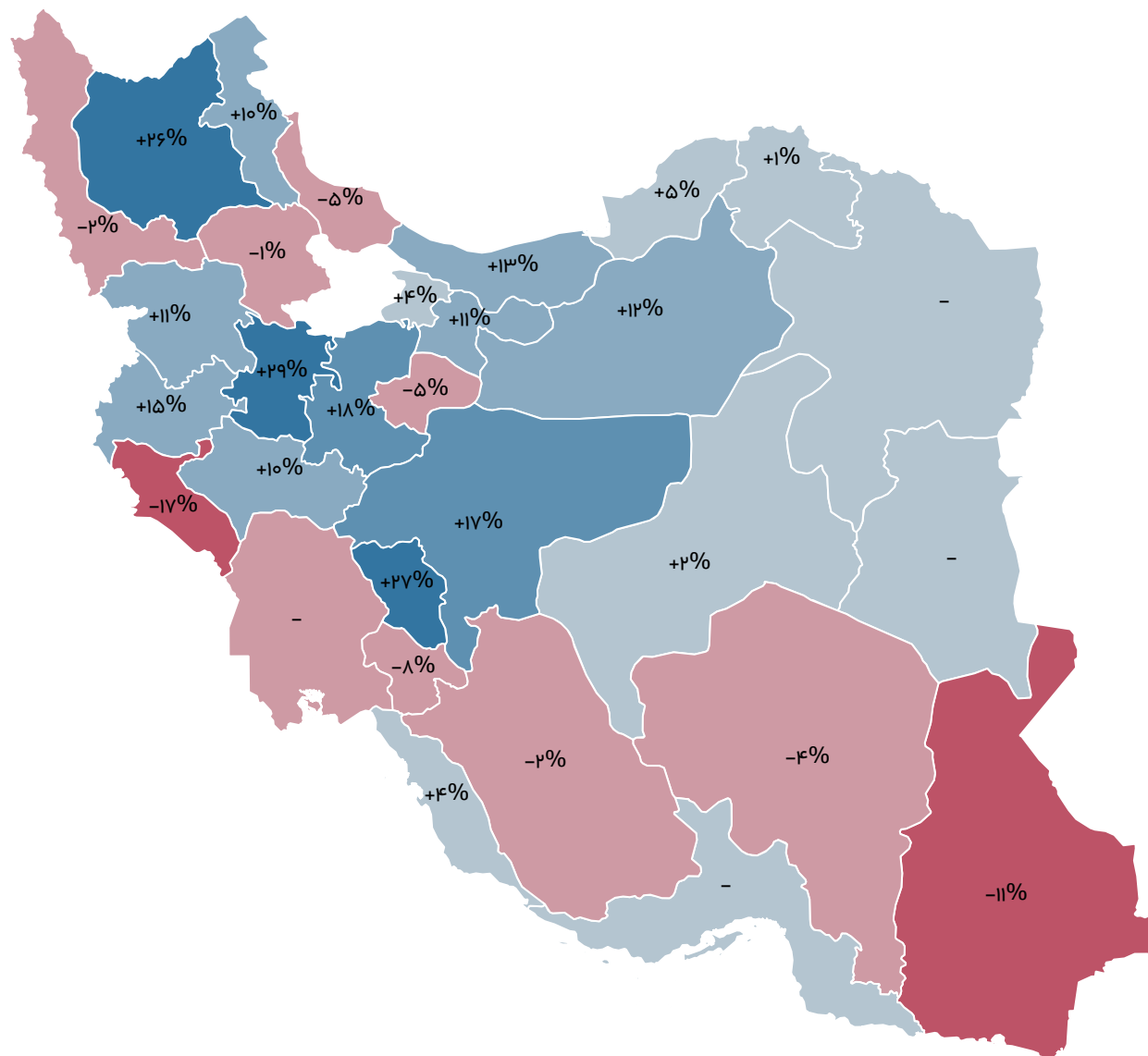
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده بر اساس حجم معاملات

منطقه	استان	واحد	هفته قبل	هفته گذشته	تغییرات به هفته گذشته	
مرکز	تهران	تومان/کیلو	۱,۰۸۷	۱,۲۱۱	+۱۱%	
	اصفهان	تومان/کیلو	۱,۰۳۰	۱,۲۱۰	+۱۷%	
	مرکزی	تومان/کیلو	۱,۱۰۲	۱,۲۹۸	+۱۸%	
	البرز	تومان/کیلو	۱,۰۶۸	۱,۱۱۲	+۴%	
	سمنان	تومان/کیلو	۸۵۰	۹۵۰	+۱۲%	
	یزد	تومان/کیلو	۷۸۵	۸۰۲	+۲%	
	قم	تومان/کیلو	۱,۱۸۸	۱,۱۲۴	-۵%	
غرب	همدان	تومان/کیلو	۸۹۸	۱,۱۵۶	+۲۹%	
	خوزستان	تومان/کیلو	۷۶۶	۷۶۶	+۰%	
	ایلام	تومان/کیلو	۸۰۸	۶۶۸	-۱۷%	
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۸۹۸	۱,۱۳۷	+۲۷%	
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۸۴۰	۹۶۸	+۱۵%	
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۸۲۲	۷۵۸	-۸%	
	لرستان	تومان/کیلو	۶۳۸	۷۰۲	+۱۰%	
	کردستان	تومان/کیلو	۹۴۵	۱,۰۴۶	+۱۱%	
	جنوب	فارس	تومان/کیلو	۱,۰۰۸	۹۸۵	-۲%
		هرمزگان	تومان/کیلو	۷۵۸	۷۵۸	+۰%
بوشهر		تومان/کیلو	۸۹۰	۹۲۹	+۴%	
شمال	گیلان	تومان/کیلو	۶۷۵	۶۳۹	-۵%	
	مازندران	تومان/کیلو	۱,۱۲۸	۱,۲۷۰	+۱۳%	
شمال غرب	گلستان	تومان/کیلو	۶۶۴	۶۹۷	+۵%	
	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۶۹۵	۶۷۸	-۲%	
	اردبیل	تومان/کیلو	۹۵۷	۱,۰۴۸	+۱۰%	
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۷۸۷	۹۹۵	+۲۶%	
شمال شرق	زنجان	تومان/کیلو	۱,۰۱۴	۱,۰۰۰	-۱%	
	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%	
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%	
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۴۵	+۱%	
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۲۶۴	۱,۲۱۰	-۴%	
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۹۰۹	۸۰۹	-۱۱%	

تغییرات قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گذشته

تغییرات قیمت هفته گذشته نسبت به هفته قبل، بر اساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات



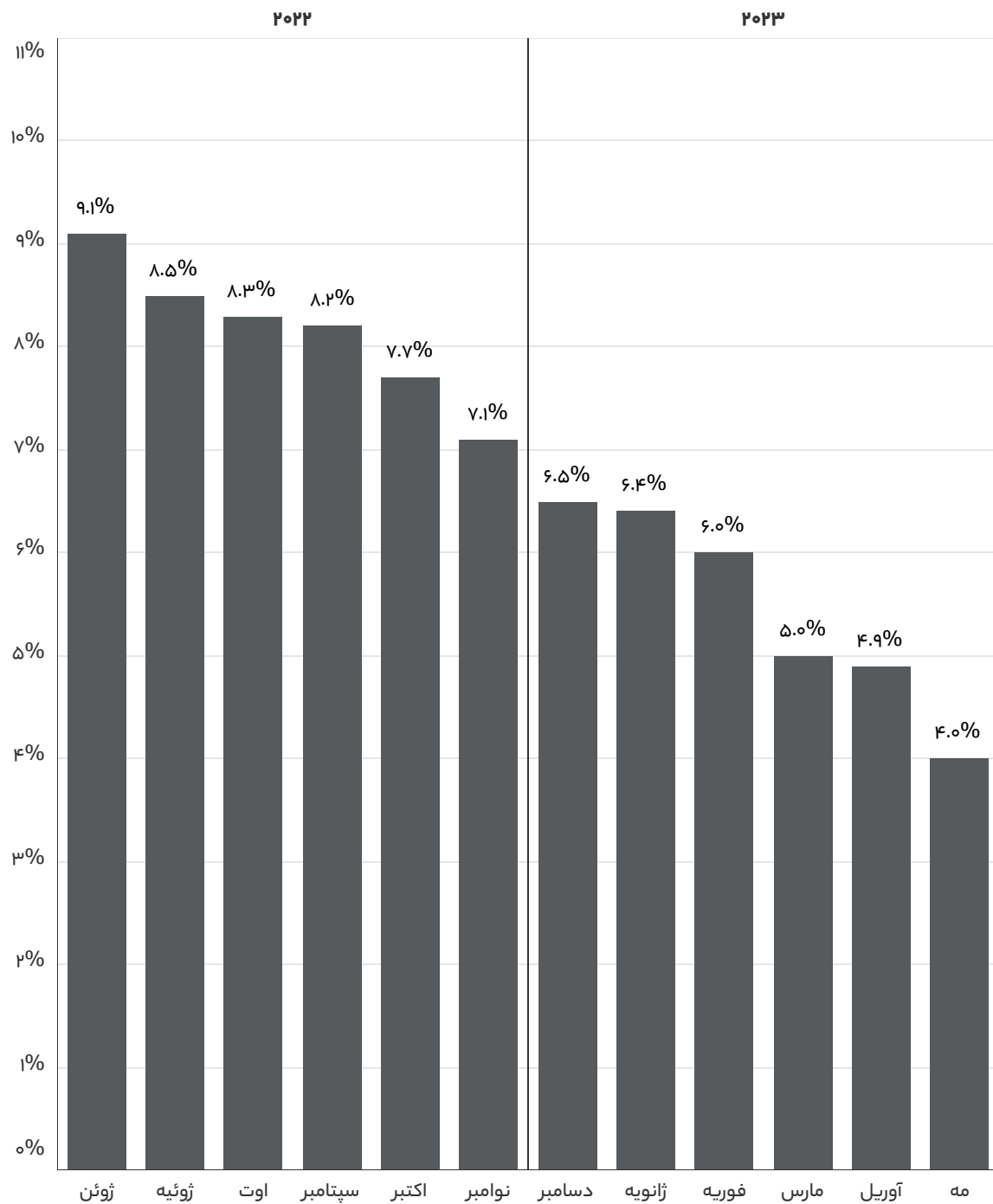
* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- همچنین اعلام کرد که رشد اقتصادی چین در نیمه دوم سال جاری بیش از نیمه ابتدایی خواهد بود تا این کشور به رشد هدف گذاری شده ۵ درصدی خود در سال ۲۰۲۳ برسد.
- در نتیجه رشد سودآوری تولید بیلت در چین شاهد افزایش تولید فولادسازان چین هستیم این روند موجب شد تا تولید روزانه واحدهای فولادسازی به ۲۰۹۸ میلیون تن برسد.
- بازار عمده اسلب ایران همچنان زیر فشار عرضه روسیه بوده و شاهد محدودیت تقاضا است. اما وضعیت قیمت های بیلت صادراتی با رشد مصرف میلگرد در منطقه بهتر از اسلب می باشد و این موضوع بر سودآوری و رقابت پذیری واحدهای عمده بیلت کشور اثرگذار است.
- طی هفته گذشته با افزایش نسبی قیمت محصولات فولادی و همچنین کاهش قیمت مواد اولیه، شاهد افزایش سودآوری کارخانجات فولاد چین بودیم. در اثر این تغییر طی ۲ هفته گذشته شاهد افزایش تولید فولاد بودیم تا بخشی از کاهش تولید اتفاق که طی چند ماه گذشته اتفاق افتاده بود، جبران گردد.
- موجودی انبارهای بیلت تانگشان در ماه می کمترین میزان از دسامبر ۲۰۲۲ را ثبت نمود. با این حال ممکن است با افزایش سودآوری تولیدکنندگان فولاد چین شاهد تغییر روند در ماه های آتی و رشد موجودی انبارهای بیلت در چین باشیم.
- تولید و صادرات نفت خام ایران در ماه می رشد قابل توجهی داشته و به بالاترین سطح تولید از سال ۲۰۱۸ رسیده است. همچنین با شروع مذاکرات ایران و آمریکا احتمال برداشته شدن تحریم ها برای صادرات نفت را افزایش داده که می تواند باعث کاهش قیمت نفت در بازارهای جهانی شود.
- با توجه به شورش آخر هفته گروه واگنر و ابهامات ناشی از این اقدام و تاثیر آن بر عرضه نفت باعث شد قیمت نفت با افزایش جزئی رو به رو شود.
- مجلس در بودجه ۱۴۰۲ درآمد فروش گاز طبیعی را با ۵۵٪ افزایش تعدیل کرده و آن را به عدد ۲۷۳ همت رسانده است که مبنای پرداخت یارانه خانواده ها می باشد و در نتیجه تحقق آن یک الزام است.
- شرکت اردمیر، بزرگترین تولیدکننده فولاد در ترکیه، در پی سرمایه گذاری در نیروگاه های خورشیدی است. این شرکت اعلام کرده که قصد دارد تا ۴.۹ میلیارد لیر (حدود ۱۸۹ میلیون دلار) در نصب و راه اندازی این نیروگاه بزرگ در استان تونجلی سرمایه گذاری کند. این پروژه توان تولید سالانه ۳۸۷،۹۷۸ مگاوات ساعت برق را خواهد داشت.



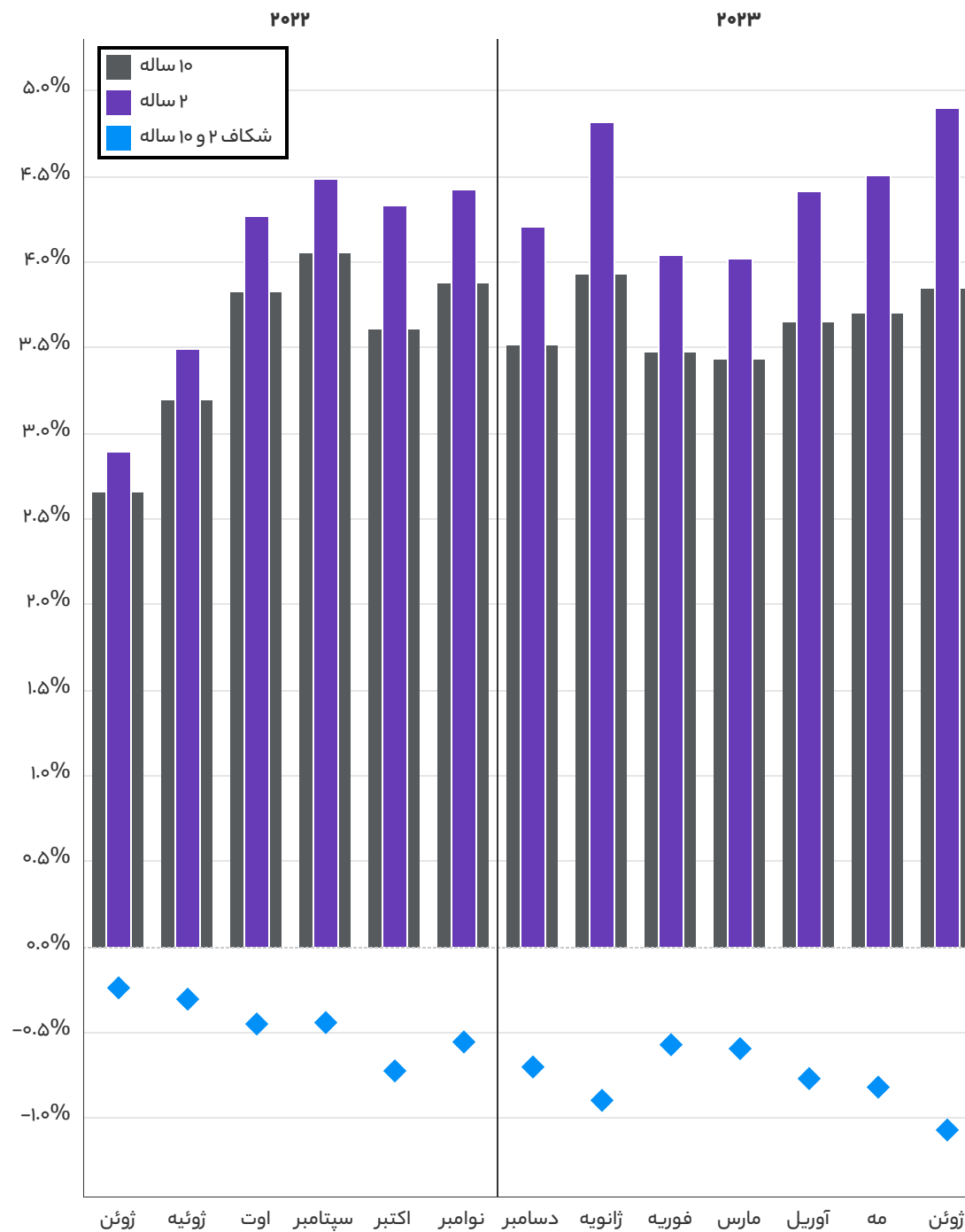
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

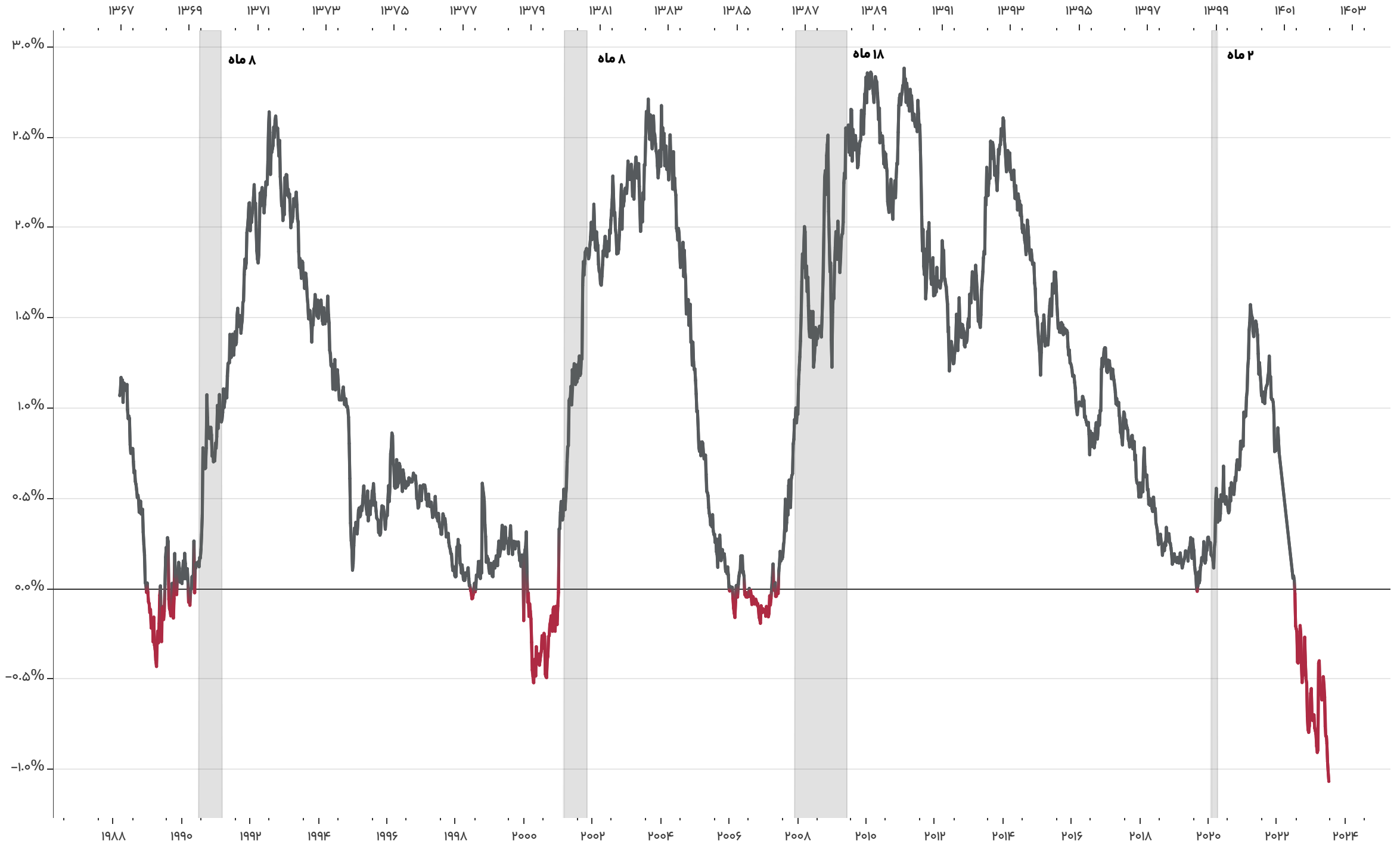
ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده





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

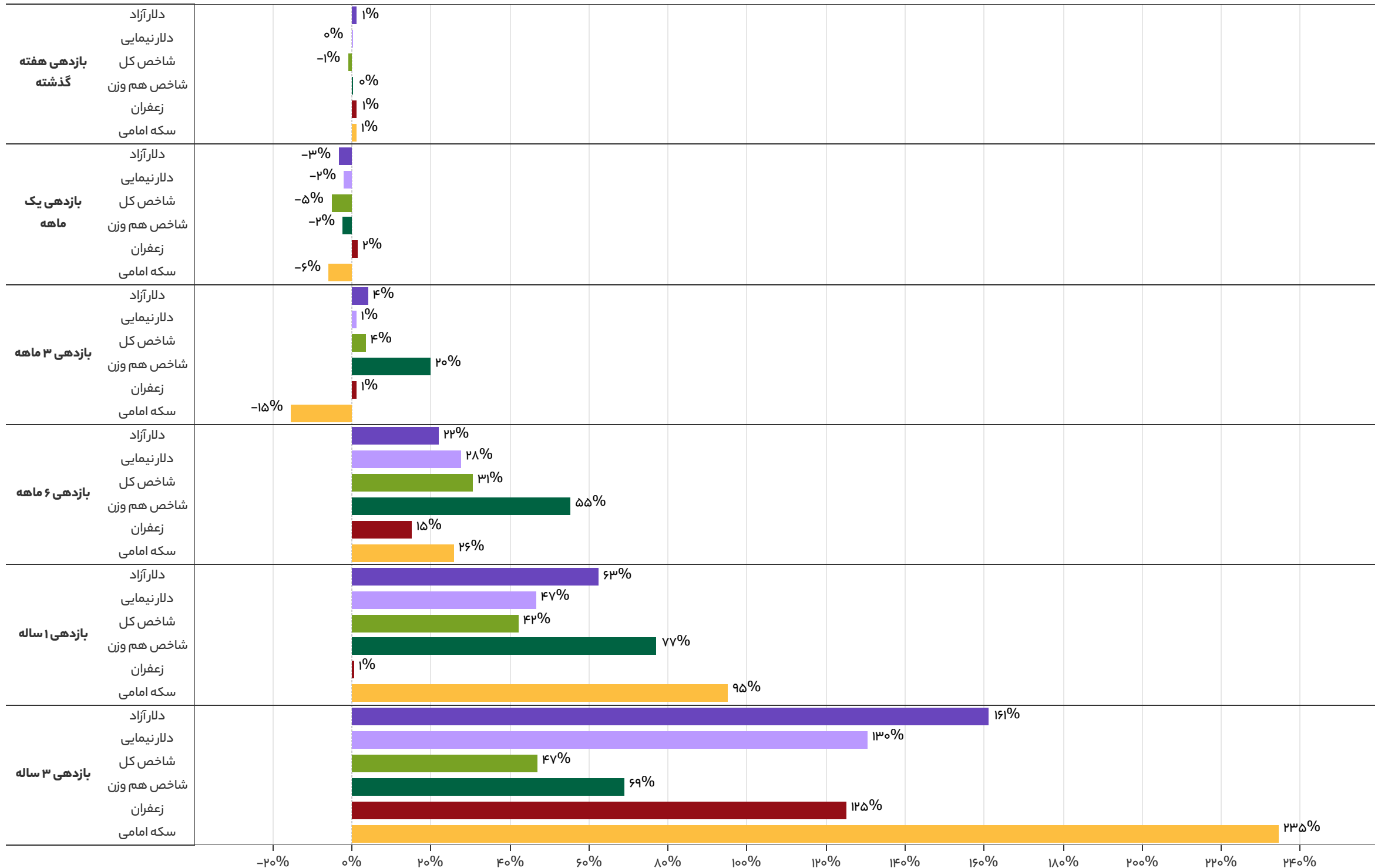
EQUITY MARKET

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	
۱۴۰۱/۰۳	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	بازده سال	نوسان
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%	سکه امامی ▲ ۱۱۱.۰%	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 ▲ ۱۰.۲%	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%

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.

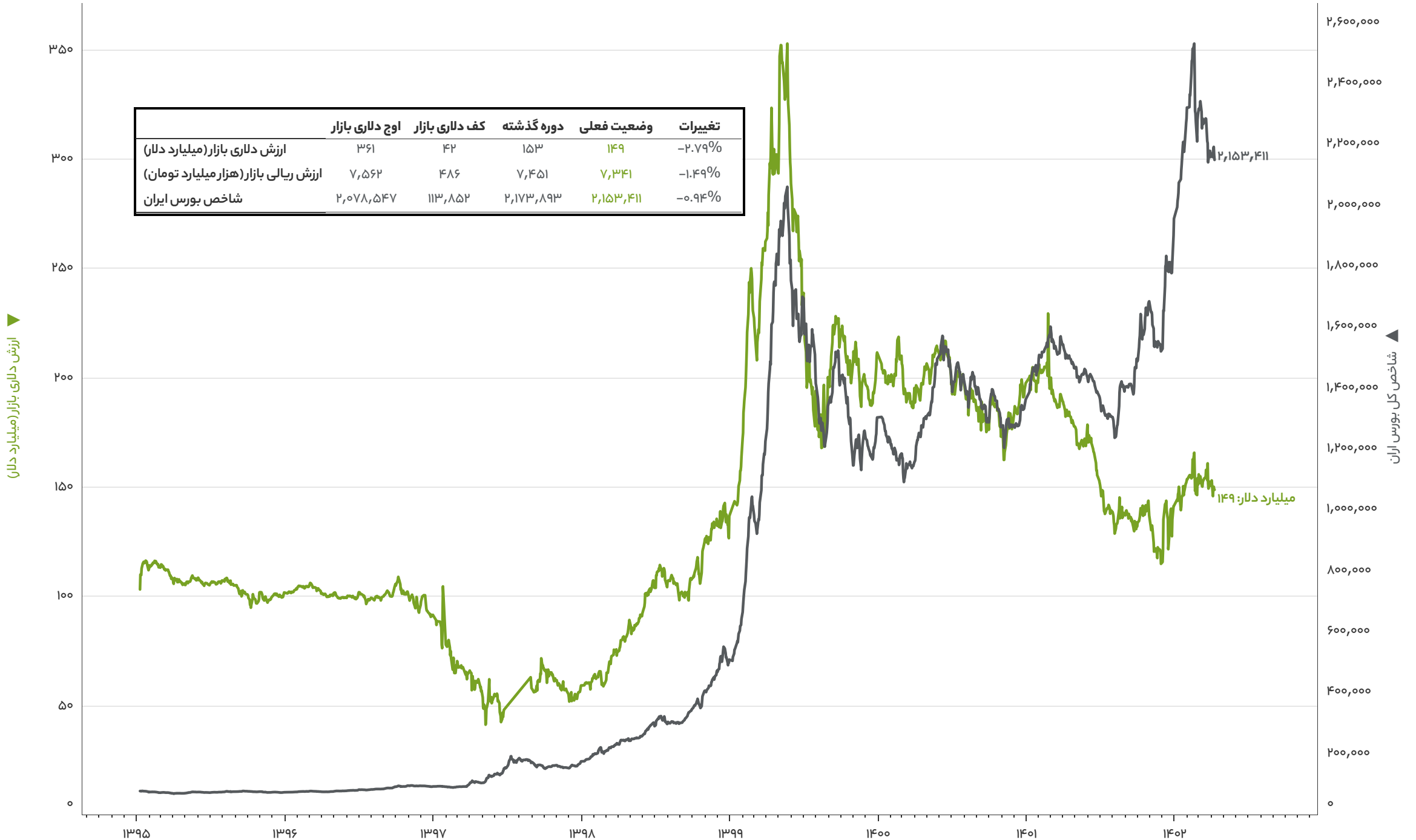
بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری زعفران سحرخیز محاسبه شده است.

بازده مسکن با استفاده از آمار بانک مرکزی اعلام شده برای میانگین قیمت مسکن در مناطق ۲۲ گانه تهران محاسبه شده و برای ماه‌های اعلام نشده، از برآورد سناریو محتمل مدل‌های آماری و اقتصادی که در گزارش ماهنامه دیدگاه بازار کاربریما ذکر گردیده، استفاده شده است.



ارزش دلاری بازار

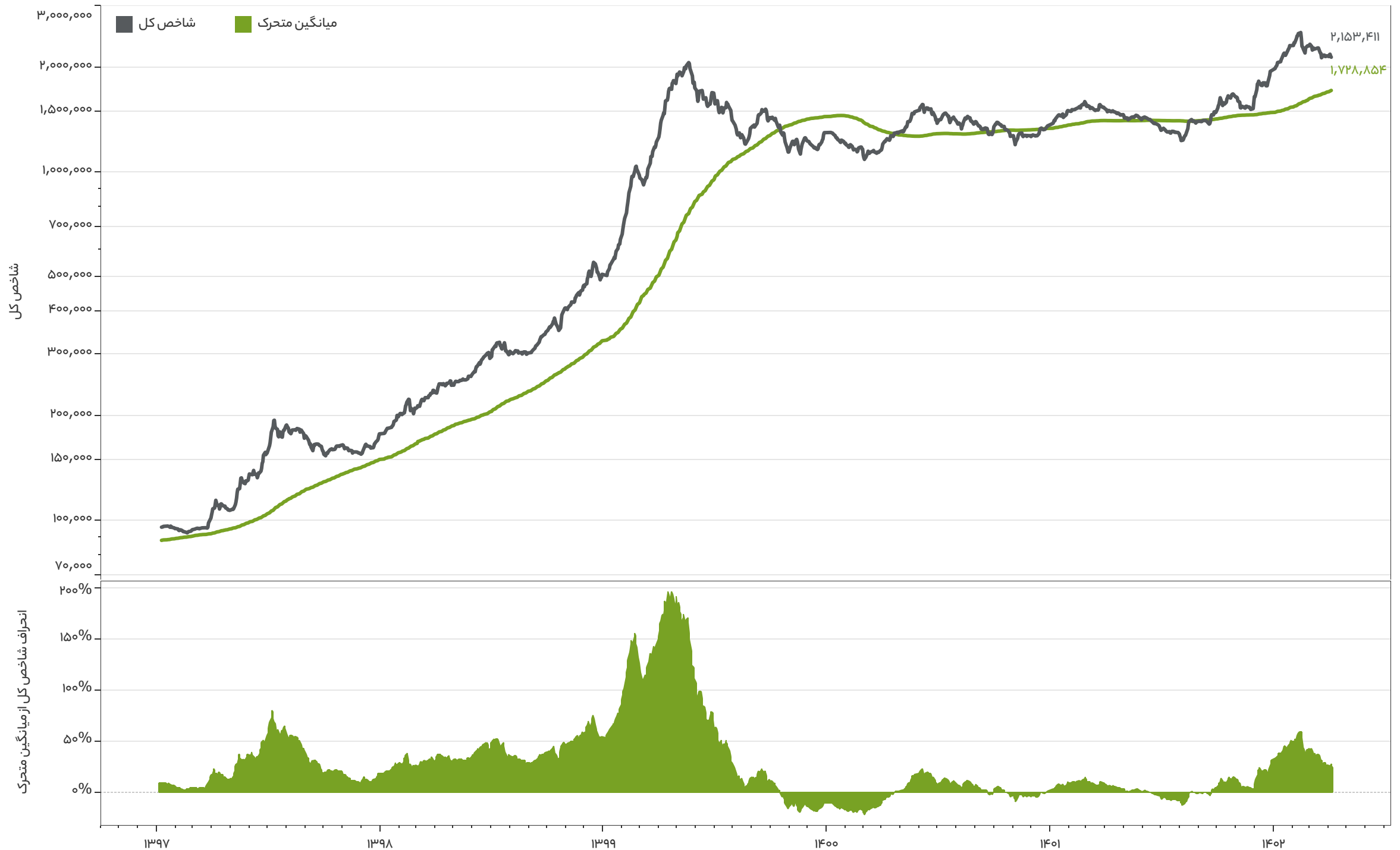
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

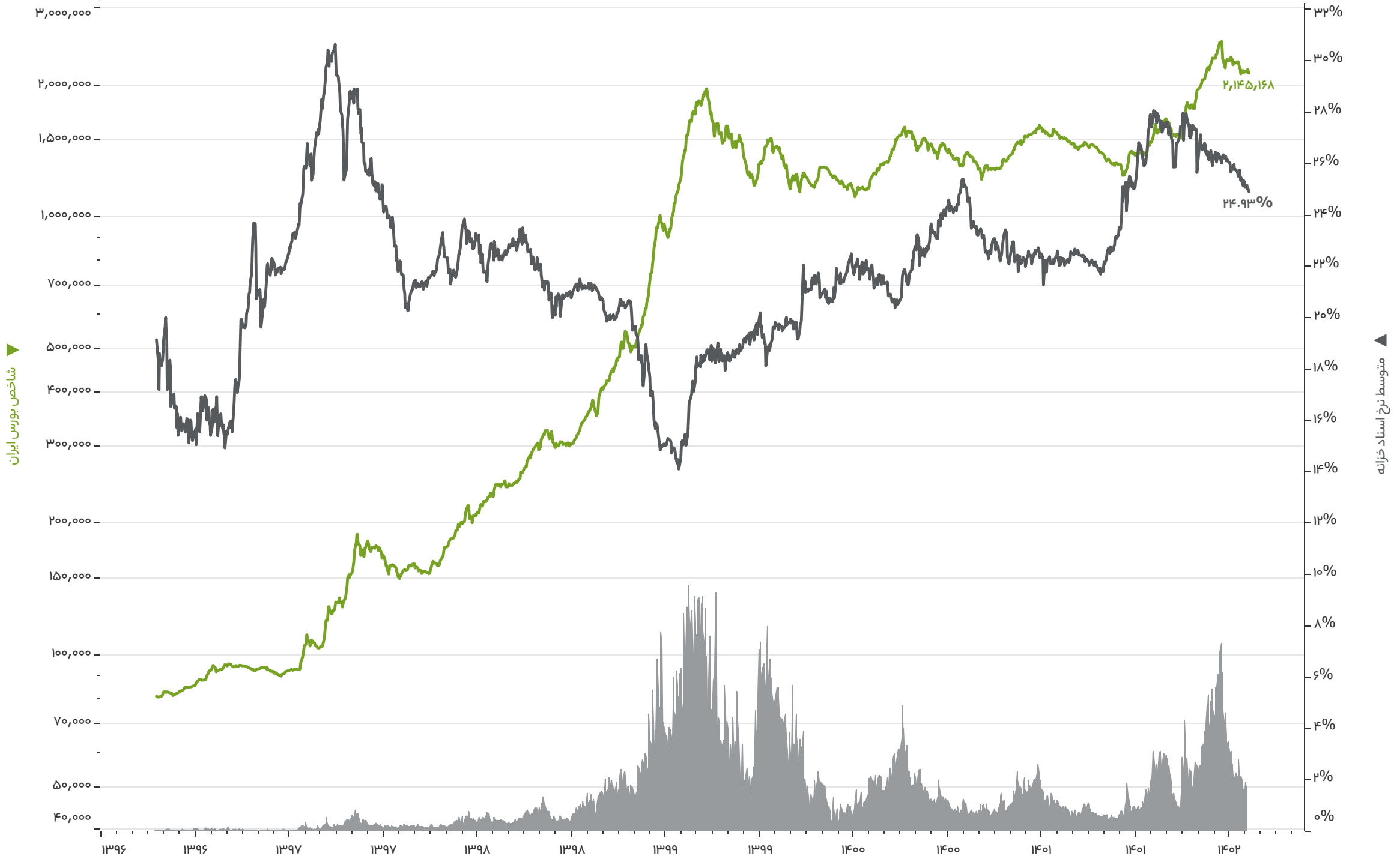
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





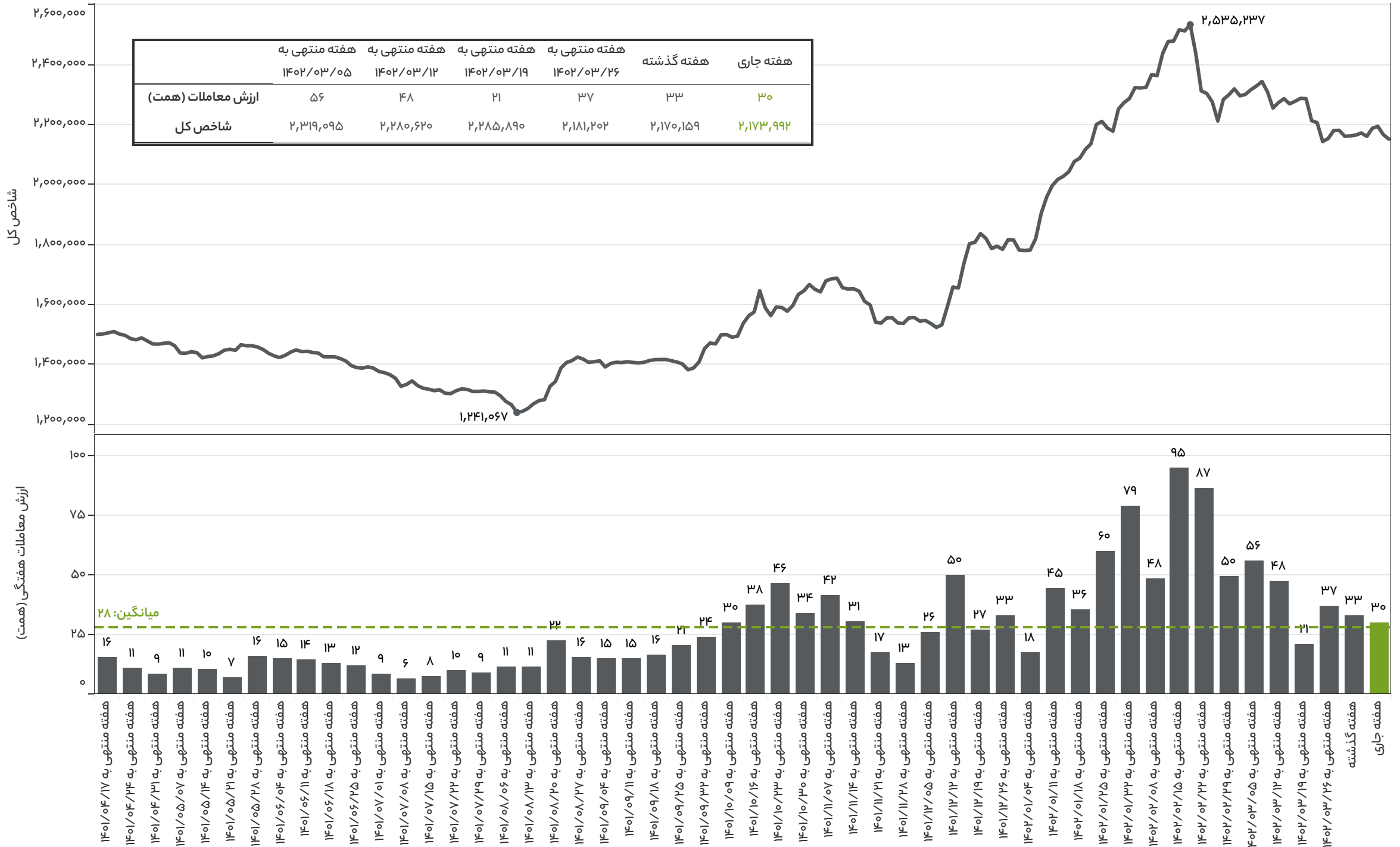
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



ارزش معاملات هفتگی بازار

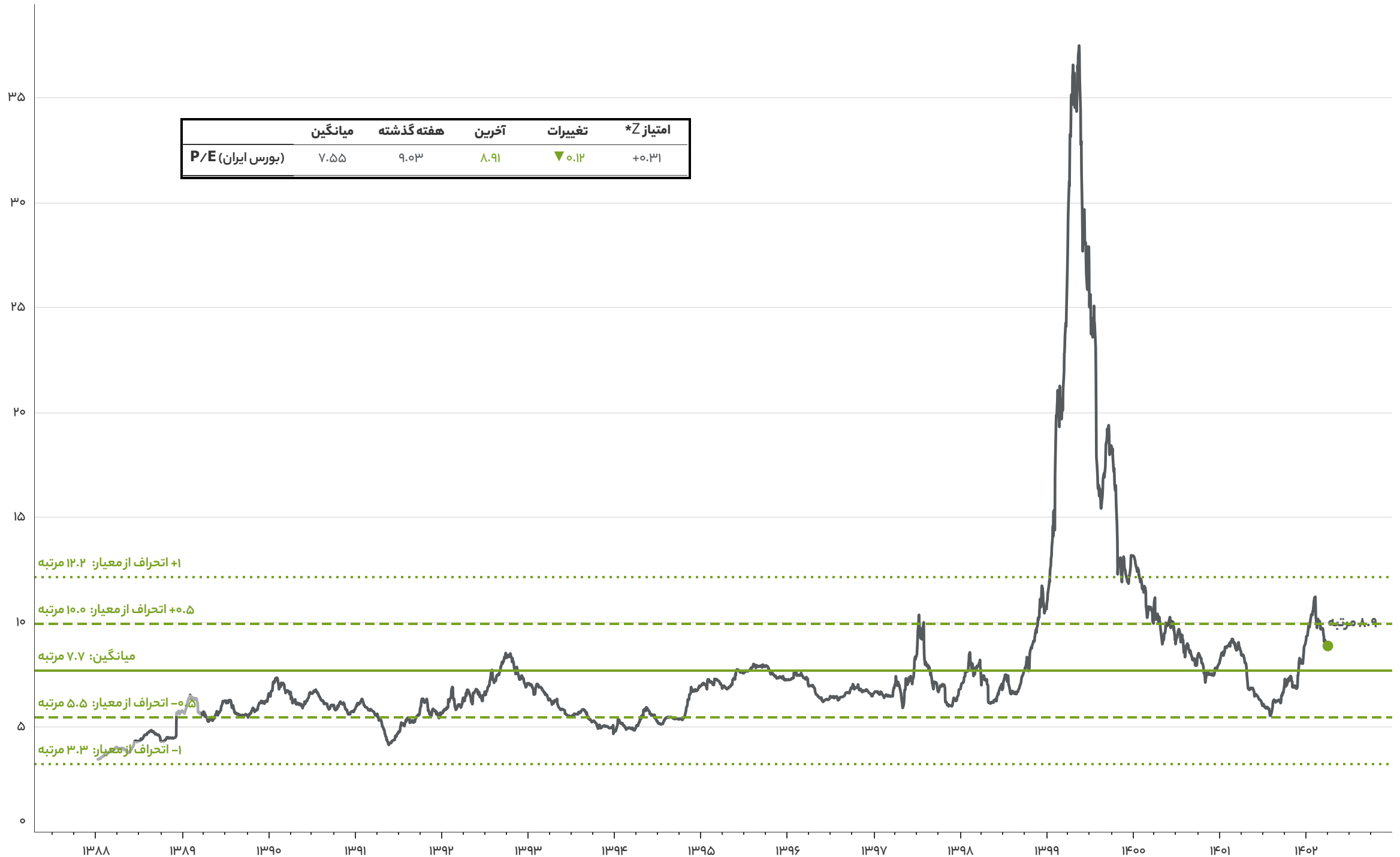
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.



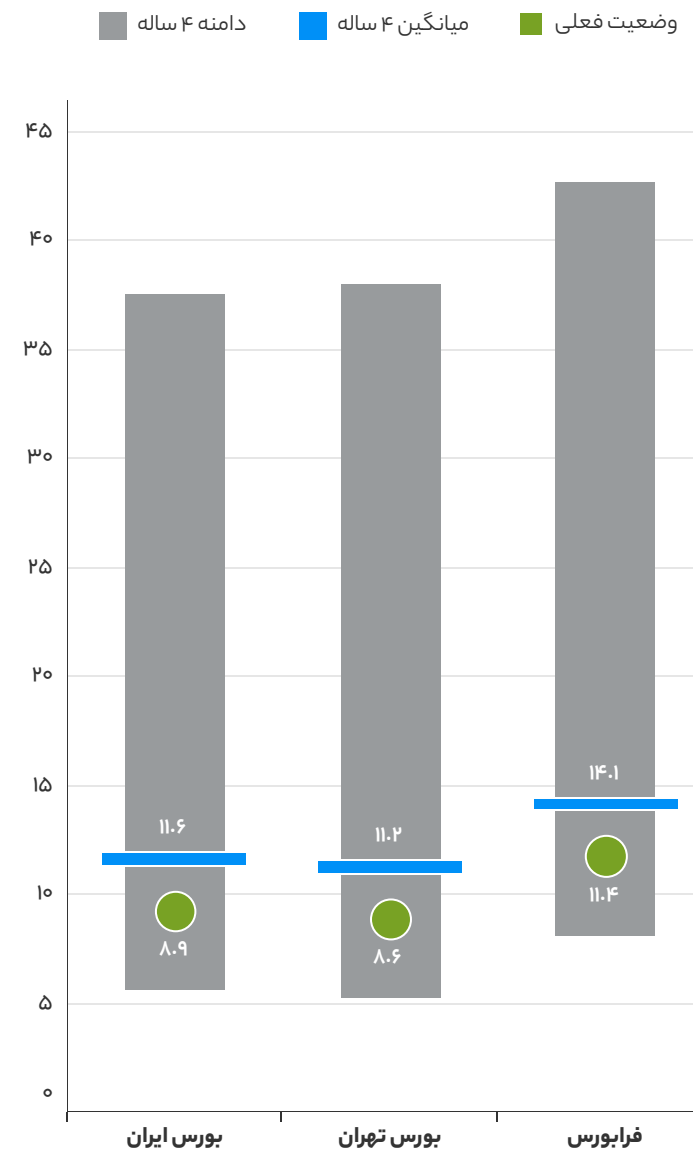
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	بیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۸.۹۱	۹.۰۳	۵.۵۹	۱۱.۶۲	۳۷.۵۱
بورس تهران	۸.۵۶	۸.۶۶	۵.۲۵	۱۱.۲۵	۳۸.۰۰
فرابورس	۱۱.۳۵	۱۱.۵۷	۸.۰۸	۱۴.۱۴	۴۲.۶۴

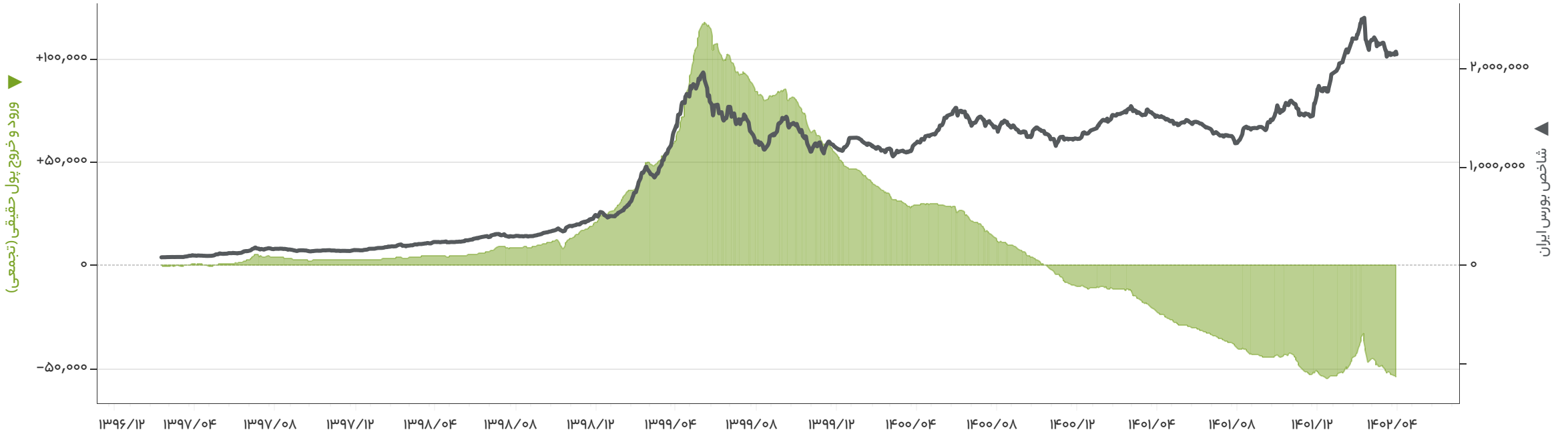
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۳,۵۰۶	۳,۴۰۱	۷۵۲	۳۵۲	۲۳۵	۲۰۱	۱۷۰	۱۶۰	۱۲۵	۱۱۴	۵۱	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۳۸.۷%	۳۷.۵%	۸.۳%	۳.۹%	۲.۶%	۲.۲%	۱.۹%	۱.۸%	۱.۴%	۱.۳%	۰.۶%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۹.۹	۹.۸	۵.۶	۱۴.۴	۱۴.۱	۱۴.۴	۱۳.۵	۱۰.۹	۱۳.۰	۲۷.۸	۱۲.۴	سودآوری
بازده سود نقدی	۵.۸%	۱۰.۶%	۷.۹%	۱.۲%	۳.۲%	۳.۶%	۱۳.۵%	۹.۲%	۵.۶%	۳.۹%	۳.۰%	
نسبت تقسیم سود	۵۷%	۷۲%	۷۰%	۳۰%	۴۷%	۴۰%	۸۳%	۷۶%	۵۸%	۶۱%	۴۴%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۵	۱.۲	۰.۵	۰.۹	۰.۷	۰.۶	۰.۸	۰.۴	۰.۷	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۸۷۵%	+۸۸۵%	+۷۱۶%	+۹۴۲%	+۴۷۳%	+۳۹۰%	+۵۶۱%	+۳۹۲%	+۱۵۰%	+۳۰۴%	+۵۶۶%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۲%	+۵۵%	+۶%	-۸%	+۷%	-۱۶%	+۷۹%	+۱۷%	-۶۰%	+۶%	-۷%	
بازده از ابتدای سال	+۷۱%	+۷۲%	+۷۳%	+۹۹%	+۶۸%	+۹۳%	+۶۵%	+۹۶%	+۶۰%	+۷۳%	+۱۹۸%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	۰%	-۲%	-۲%	۱%	-۲%	۳%	۱%	-۵%	۳%	۰%	



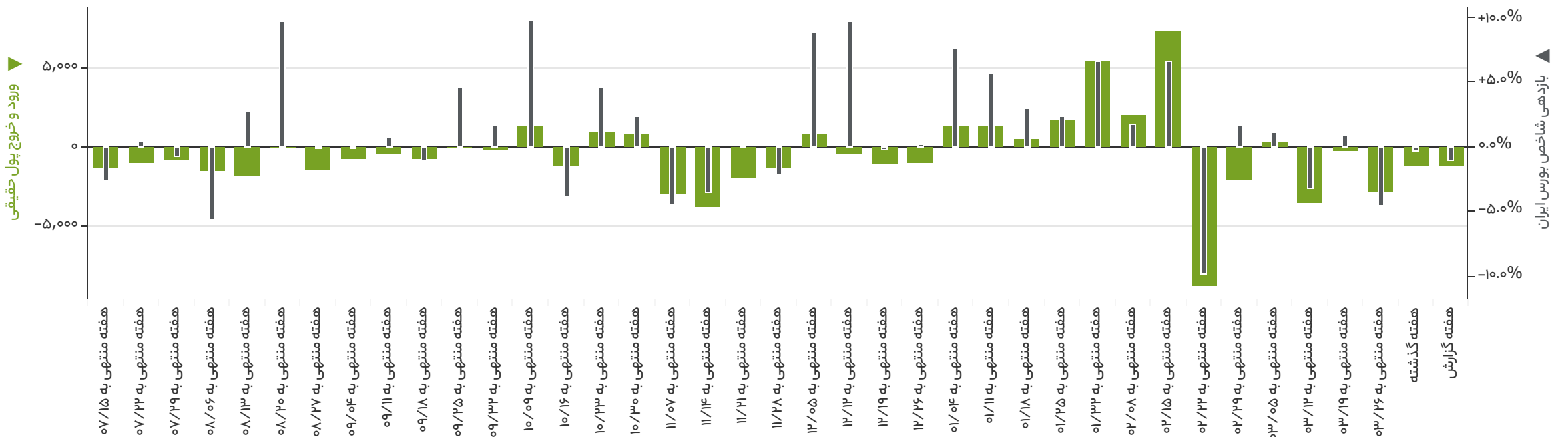
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

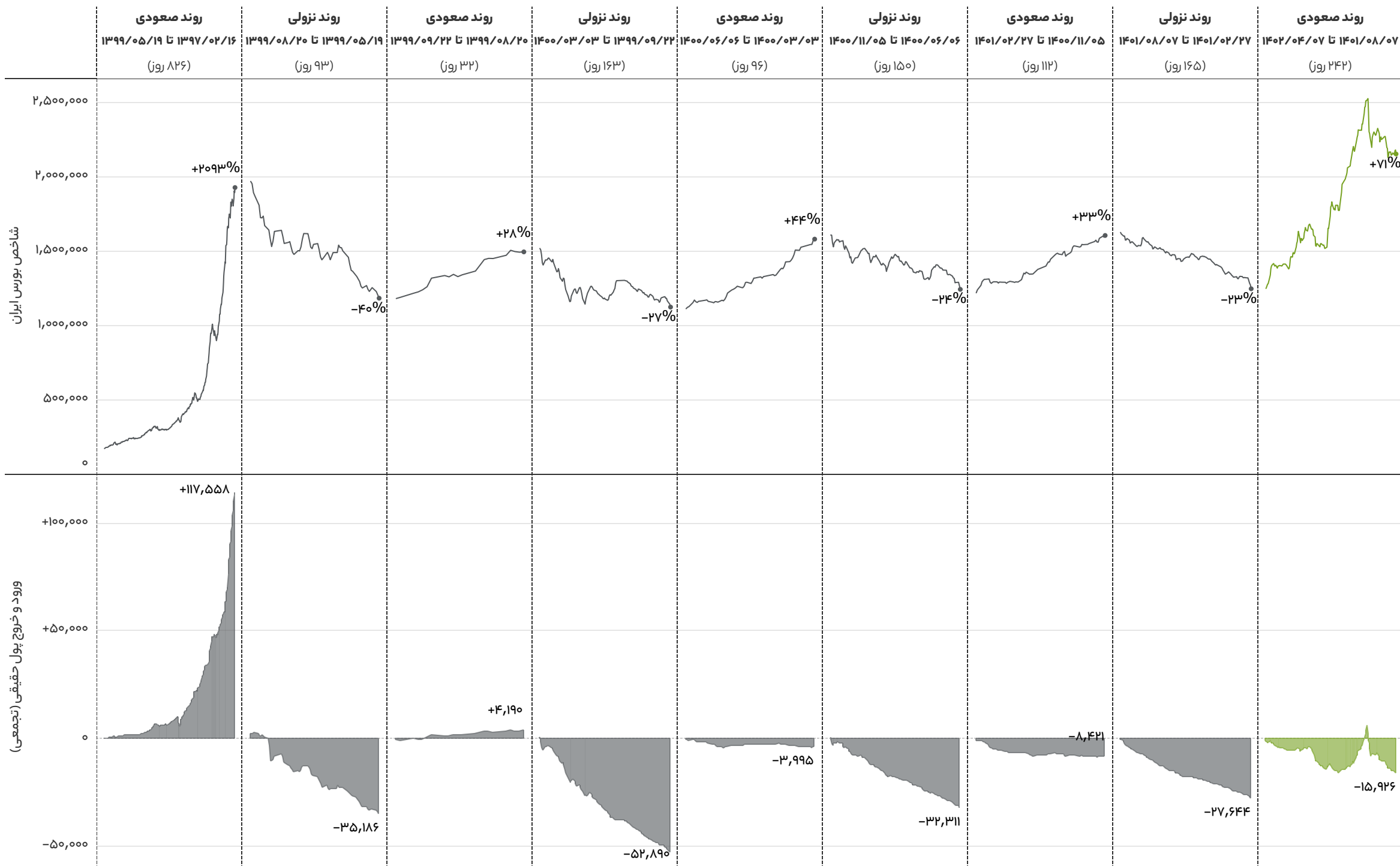
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

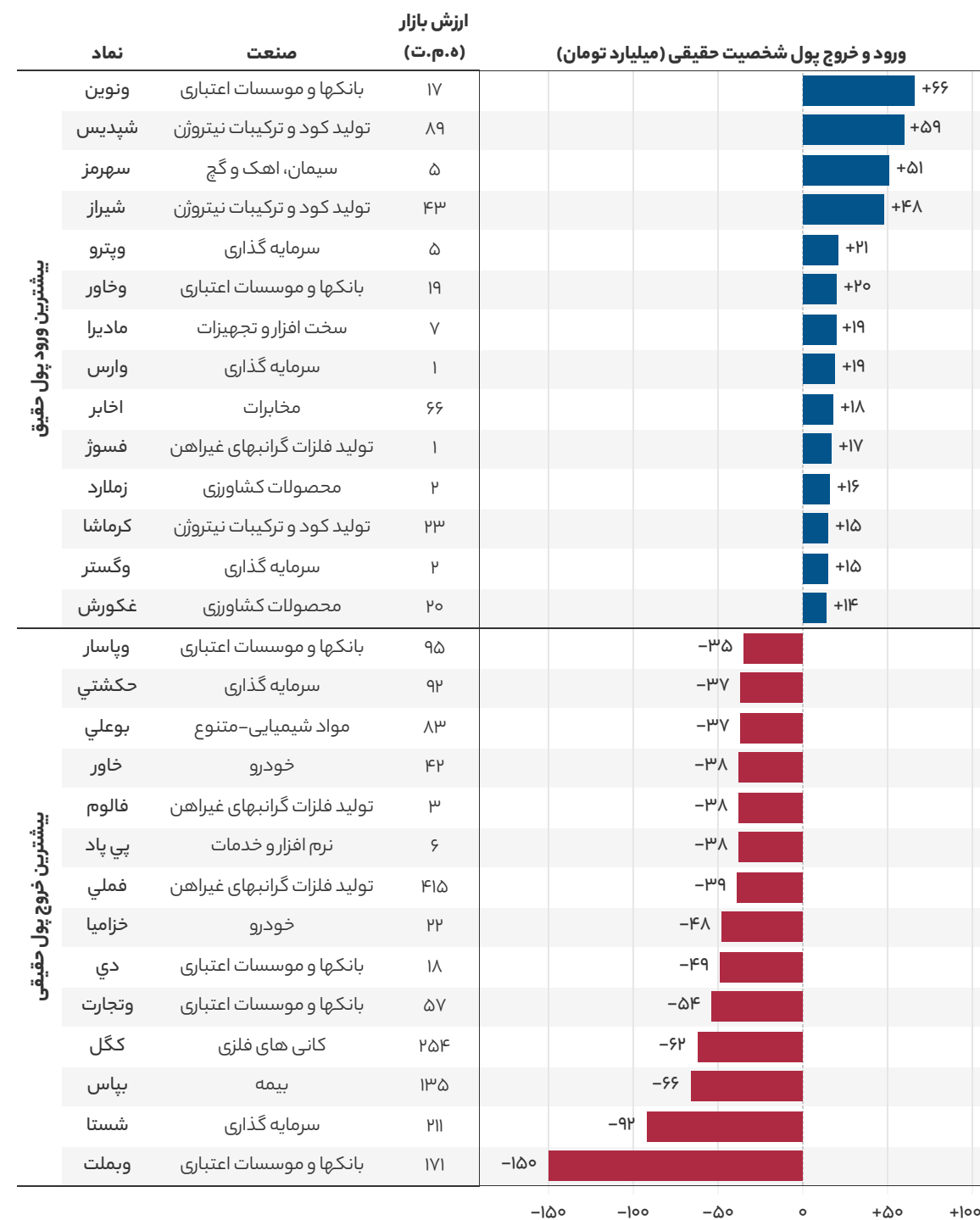
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس





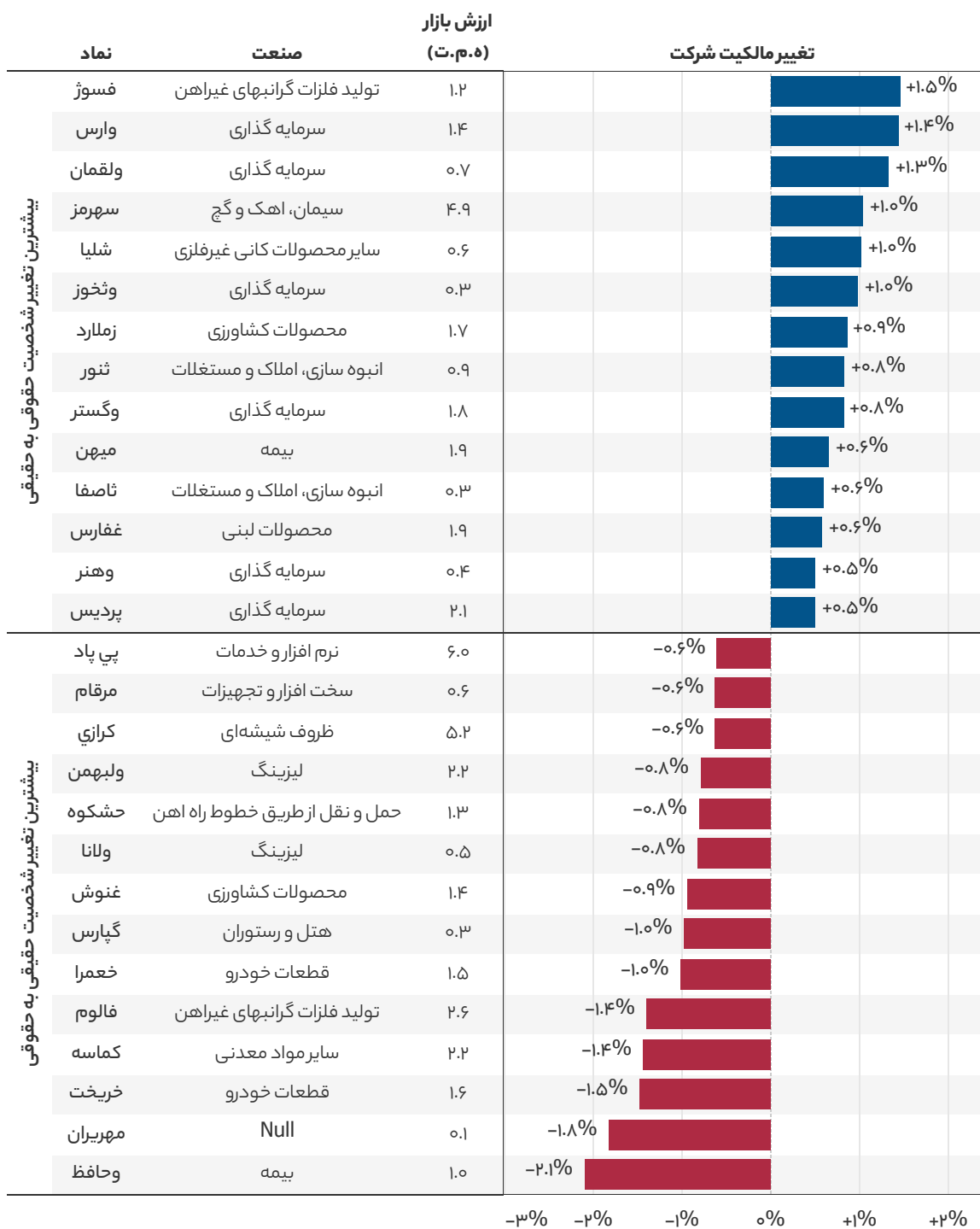
ورود و خروج پول حقیقی

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



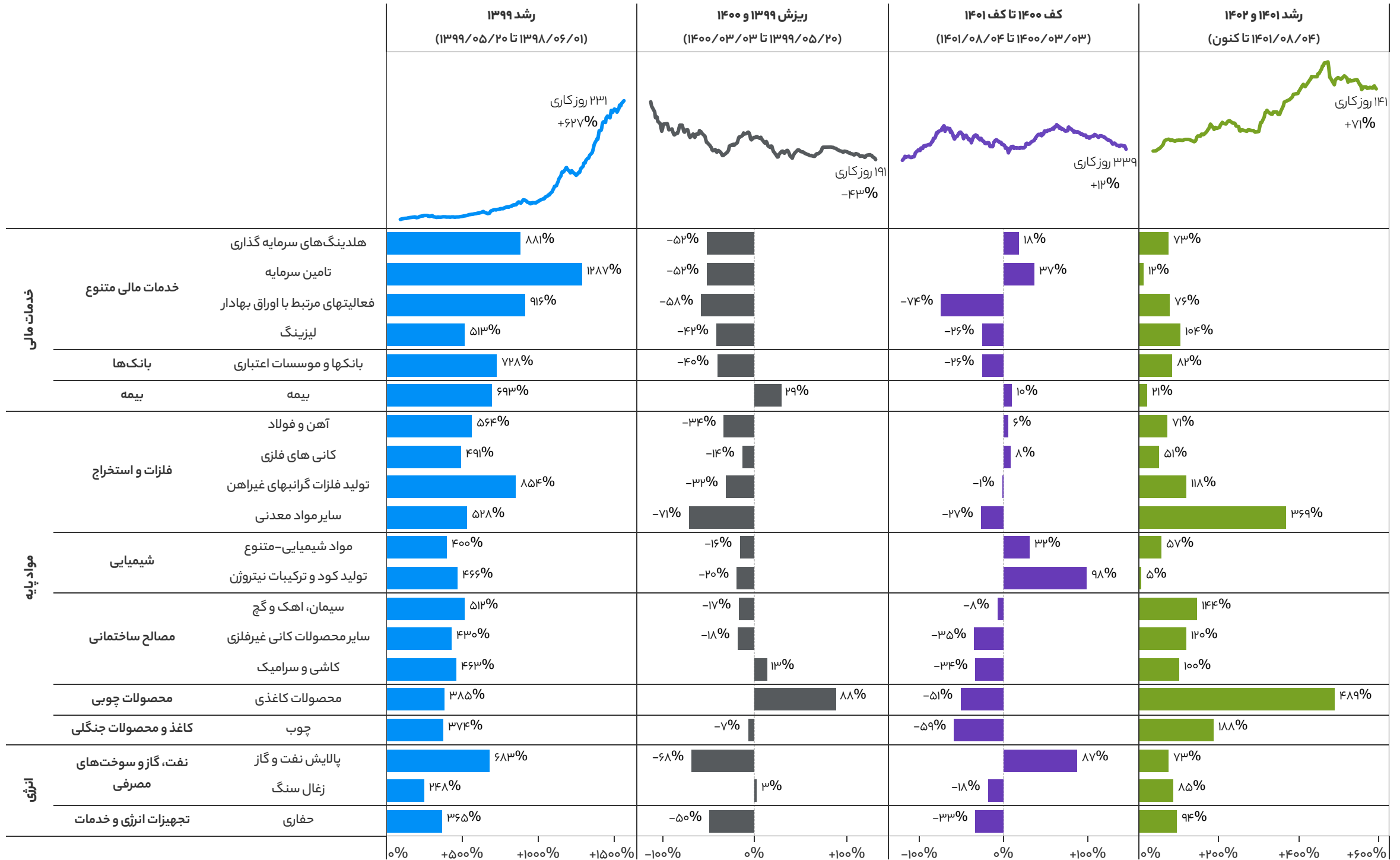
تغییر مالکیت شرکت

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



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

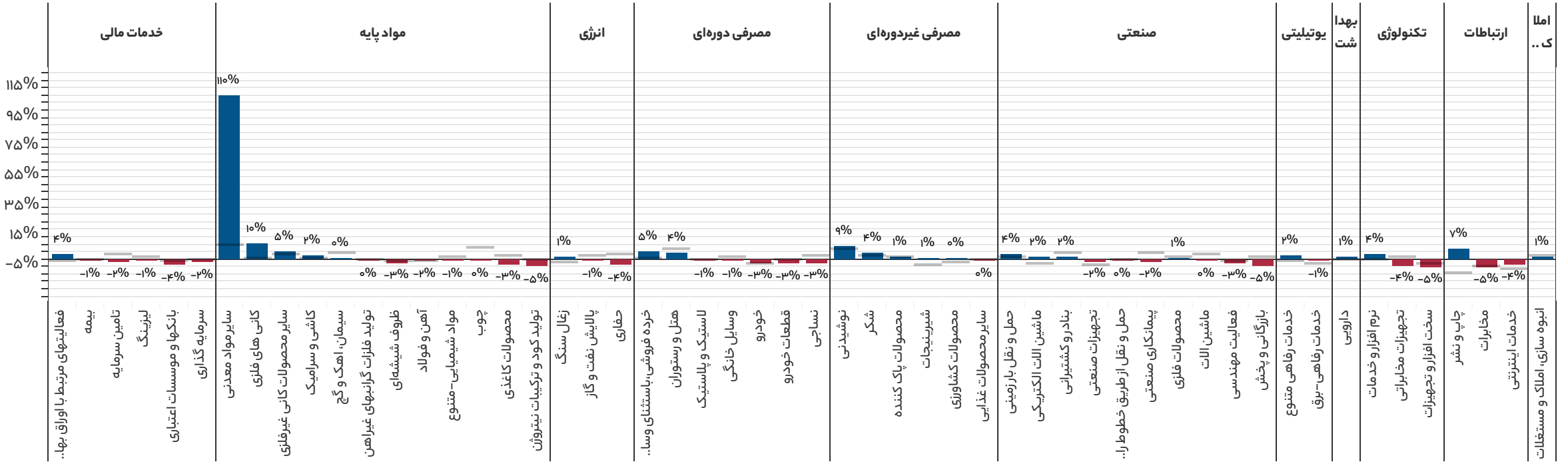
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۸، شاخص بورس ایران، بازدهی صنایع به تفکیک زیرگروه و سکتور، مرتب شده براساس ارزش بازار



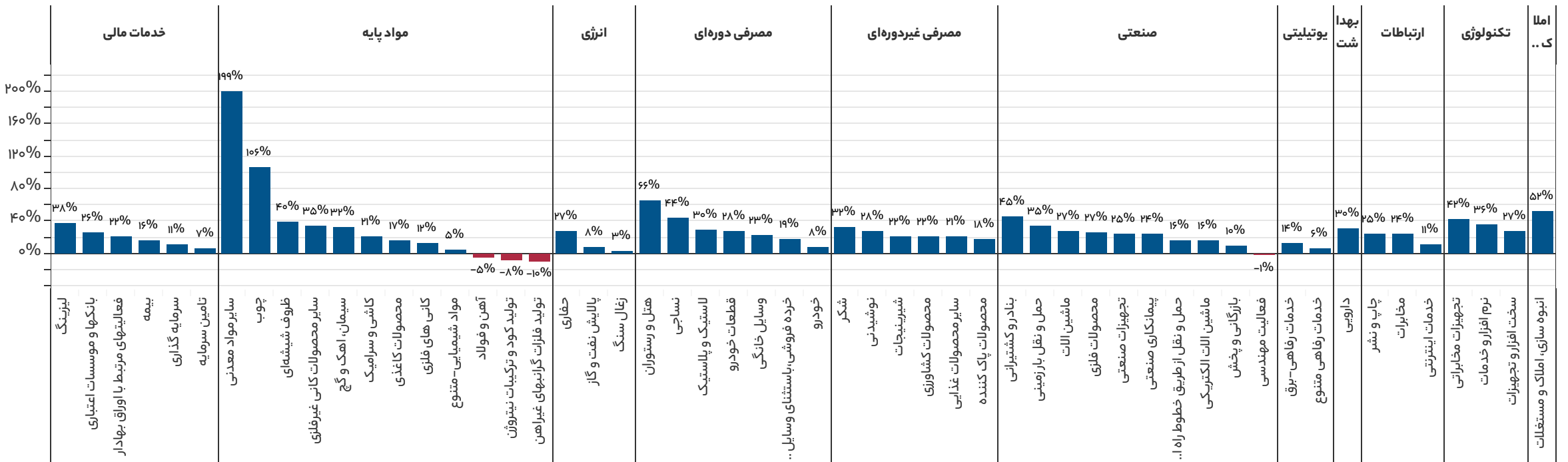
بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

		رشد ۱۳۹۹		ریزش ۱۴۰۰ و ۱۳۹۹		کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲	
مصرفی دوره ای	خودرو و قطعات	خودرو	۱۲۴۷%	-۷۰%		۱۳%		۸۰%	
		قطعات خودرو	۶۷۶%	-۳۲%		-۲۵%	۱۰۵%		
		لاستیک و پلاستیک	۶۳۱%	-۳۴%		-۴۲%	۱۲۰%		
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۱۲۹%	-۲۳%		۳%	۱۳۸%		
		وسایل خانگی	۴۹۰%	-۴۶%		-۳۶%	۱۵۴%		
	کالای مصرفی با دوام	نساجی	۳۸۰%	-۲۱%		-۳۵%	۱۶۰%		
خدمات مصرف کننده	هتل و رستوران	۱۱۶۶%	-۶۷%		۱۸%	۵۲%			
مصرفی غیردوره ای	غذا و نوشیدنی	محصولات کشاورزی	۳۹۷%	-۳۵%		۹%	۴۹%		
		شیرینیجات	۵۹۵%	-۲۴%		-۶۳%	۸۶%		
		شکر	۴۳۵%	-۲۲%		-۴۴%	۸۷%		
		سایر محصولات غذایی	۶۹۹%	-۳۴%		-۳۹%	۷۲%		
		محصولات لبنی	۳۸۳%	۷%		-۵۴%	۱۷۲%		
	نوشیدنی	۵۳۹%	-۱۵%		-۳۱%	۱۰۳%			
	محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۳۰۶%	۴%		-۱۲%	۳۲%		
صنعتی	کالاهای سرمایه ای	فعالیت مهندسی	۵۲۱%	-۶۳%		-۷%	۶۴%		
		ماشین الات الکتریکی	۵۰۱%	-۴۵%		-۲۳%	۸۳%		
		ماشین الات	۴۲۲%	-۳۵%		-۳۱%	۱۴۰%		
		محصولات فلزی	۶۴۵%	-۵۴%		-۴۴%	۱۶۲%		
		تجهیزات صنعتی	۸۴۷%	-۳۰%		-۴۰%	۹۱%		
		پیمانکاری صنعتی	۵۲۵%	-۱۵%		-۶۸%	۱۲۸%		
	ترابری	حمل و نقل از طریق راه آهن	۳۲۷%	-۱۳%		-۴۱%	۸۹%		
بنادر و کشتیرانی		۲۴۶%	-۲۲%		-۱۵%	۱۳۸%			
حمل و نقل بار زمینی		۲۵۰%	-۱۸%		۳۳%	۵۲%			
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۳۱۰%	-۳۵%		۱۳۱%	۶۵%		
		خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%	-۵۴%		-۳۳%	۶۶%		
بهداشت	بهداشت	دارویی	۳۲۱%	-۳۲%		-۱۳%	۹۶%		
		خدمات دور برد	مخابرات	۵۳۲%	-۷۱%		-۱۳%	۶۰%	
ارتباطات	رسانه و سرگرمی	چاپ و نشر	۲۲۳%	-۵۲%		-۵۲%	۱۱۰%		
		نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۲۵۲%	-۳۵%		۲%	۶۹%	
تکنولوژی	سخت افزار و تجهیزات	سخت افزار و تجهیزات	۵۷۰%	-۶۵%		-۴۵%	۱۱۴%		
		انبوه سازی، املاک و مستغلات	توسعه املاک و مستغلات	۶۱۹%	-۴۳%		-۴۵%	۱۹۸%	

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



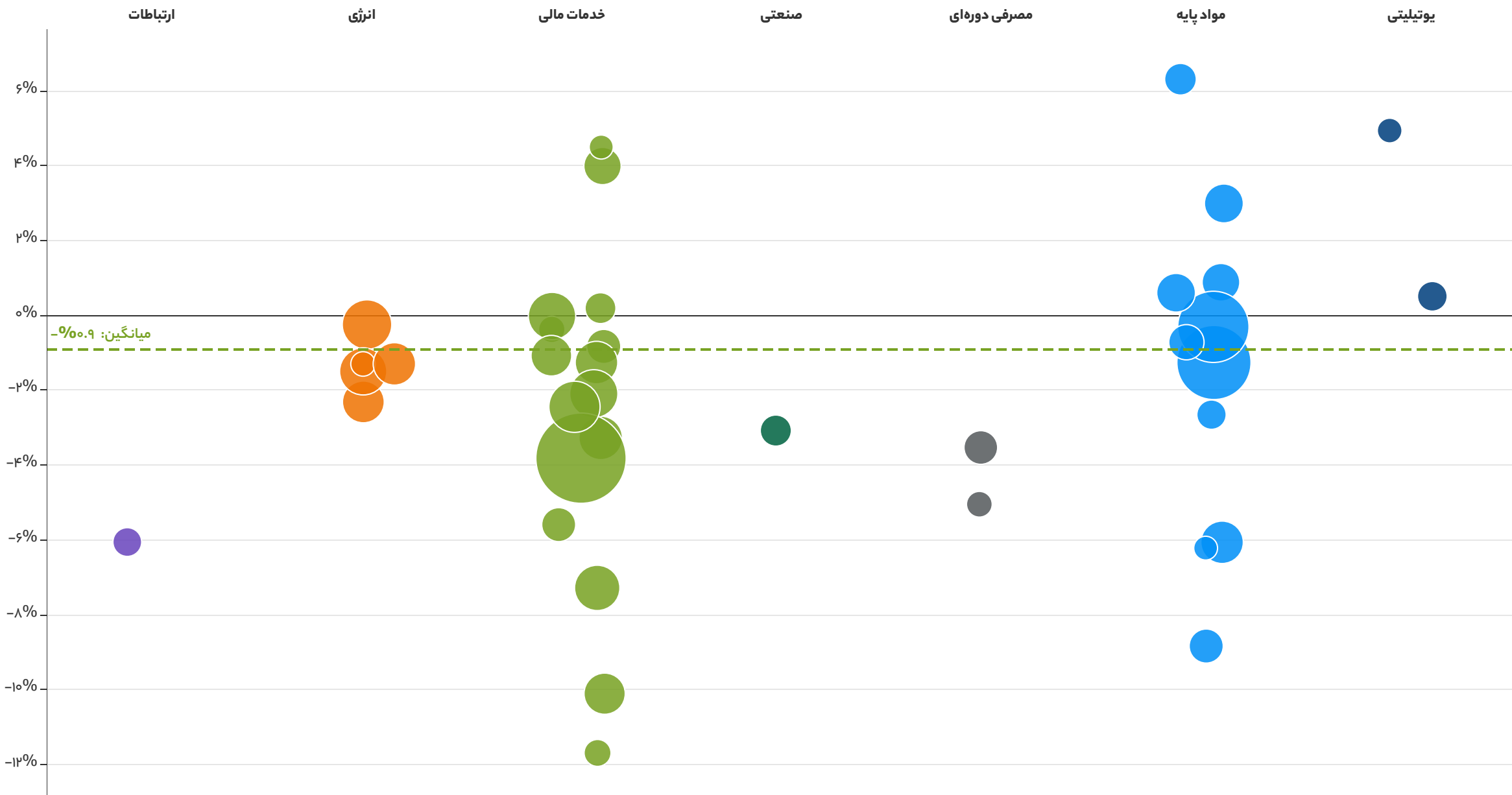
بازده صنایع از ابتدای سال (مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)





بازدهی بزرگترین ۳۵ شرکت سهامی طی ۲ هفته گذشته

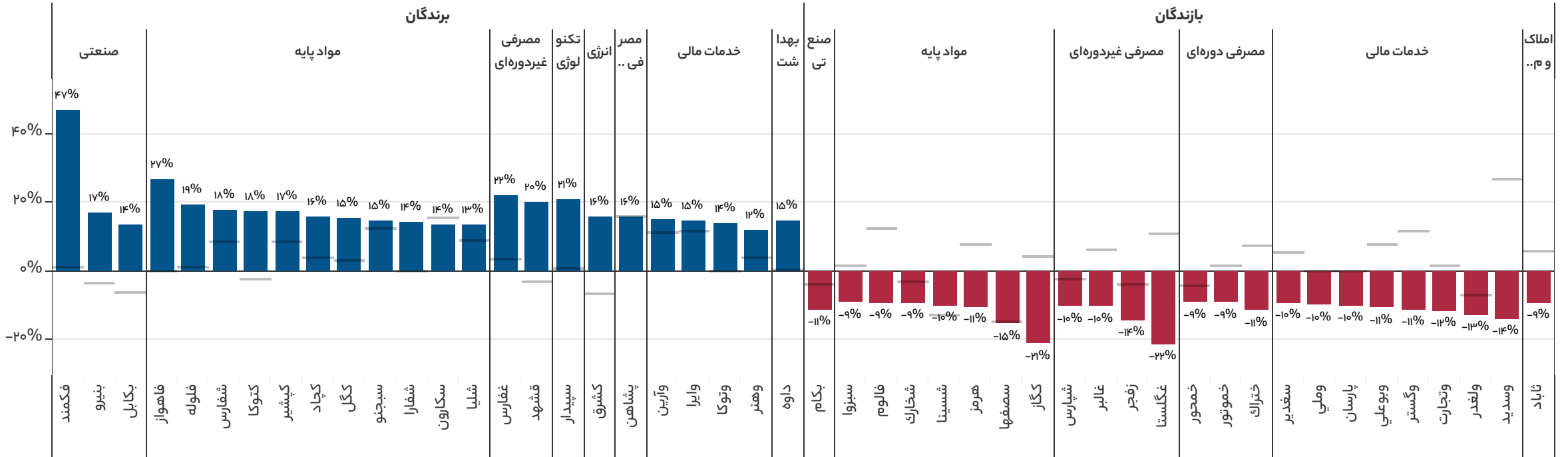
به تفکیک سکتور، بازده تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم



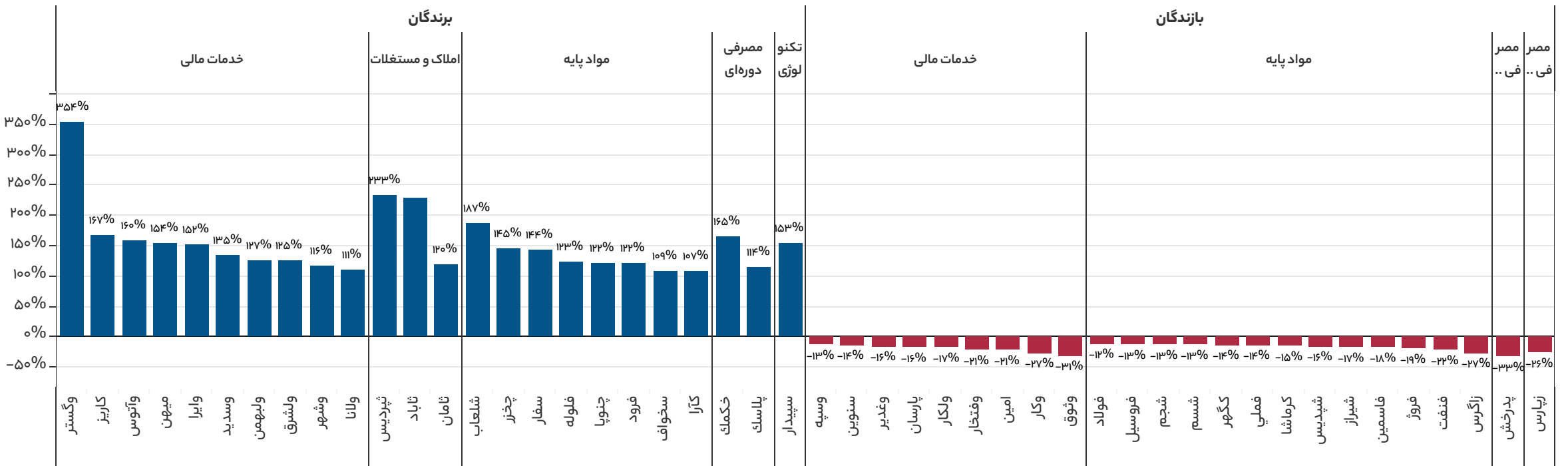
بازده هفته گذشته	بوعلی	ومعادن	نوری	کگهر	آریا	مبین	وسندوق	تاپیکو	شپنا	فملي	جم	وپاسار	پپاس	فولاد	وامید	پارس	شبندر	میدکو	شتران	شستا	فخوز	رمپنا	وغدیر	خودرو	فارس	خسپا	حکشتي	اکابر	ماون	وبملت	شپدیس	پارسان	وتجارت
	+۶.۳%	+۴.۰%	+۳.۰%	+۰.۹%	+۰.۶%	+۰.۵%	+۰.۲%	۰%	-۰.۲%	-۰.۳%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۱.۱%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۱.۳%	-۱.۵%	-۲.۱%	-۲.۳%	-۲.۴%	-۲.۶%	-۳.۱%	-۳.۳%	-۳.۵%	-۳.۸%	-۵.۰%	-۵.۶%	-۶.۰%	-۶.۰%	-۷.۳%	-۸.۸%	-۱۰.۱%	-۱۱.۷%



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



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

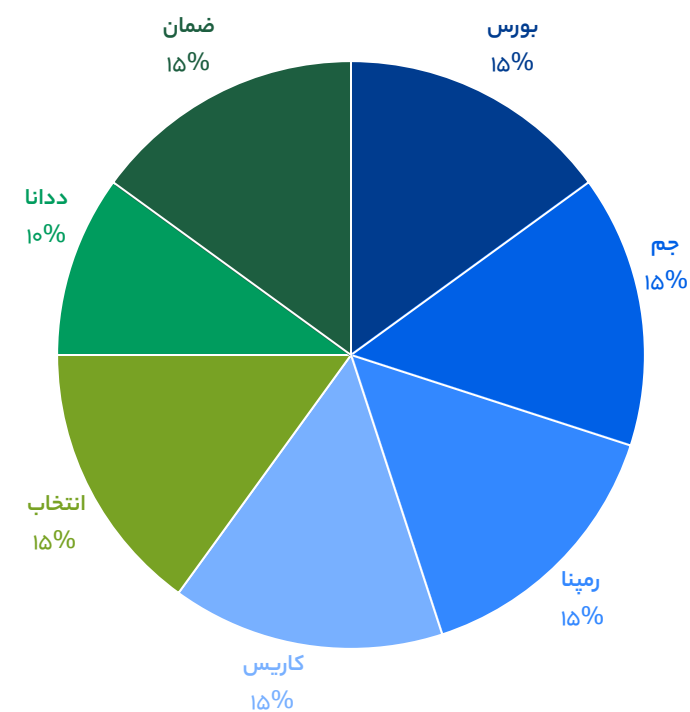




سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

افق زمانی	نماد	هدف قیمتی	توضیحات	قیمت سهم	وزن پیشنهادی
میان مدت	انتخاب	۴۲۰۰۰	انتظار افزایش نرخ و پتانسیل افزایش مقدار تولید و سود زیر مجموعه‌ها	۳۱,۴۵۰	۱۵%
	ددانا	۶۲۰۰۰	پتانسیل افزایش نرخ، پتانسیل بهره‌برداری از طرح سوم در ماه‌های آتی	۴۷,۳۰۰	۱۰%
	ضمان	-	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	۱۳,۹۴۲	۱۵%
بلند مدت	جم	۷۸۰۰۰	احتمال افزایش حاشیه سود و بهبود تقاضای محصولات شرکت	۵۶,۸۲۰	۱۵%
	رمپنا	۱۹۰۰۰	ارزش جایگزینی بالای نیروگاهی و احتمال افزایش نرخ برق، وضعیت ارزش مناسب، عرضه اولیه شرکت زیرمجموعه	۱۳,۰۶۰	۱۵%
	بورس	۹۰۰۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۷,۳۸۰	۱۵%
	کاریس	-	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	۲۲,۷۸۵	۱۵%



تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS

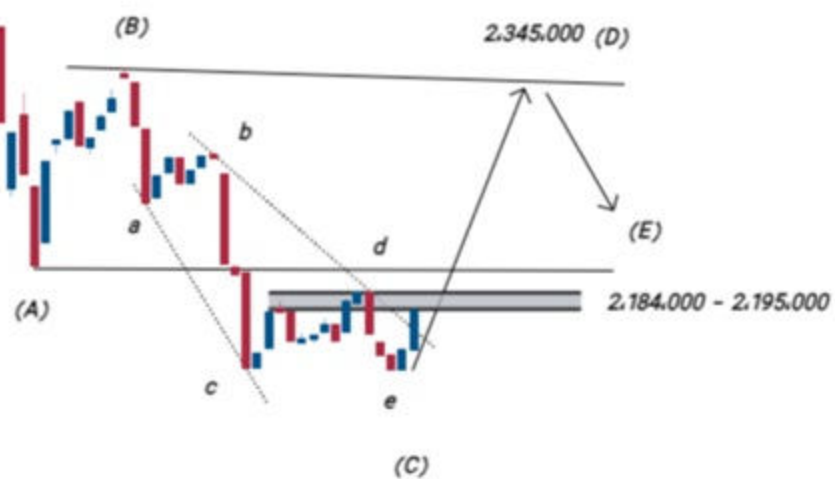




بورس - 1D - شرکت شاخص

2

17



انتظار می‌رود با عبور از محدوده مقاومتی ۲,۱۸۴,۰۰۰ الی ۲,۱۹۵,۰۰۰ واحد، مسیر صعودی شاخص کل تا حوالی ۲,۳۴۵,۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود رشد شاخص هم‌وزن تا حوالی ۷۹۰,۰۰۰ 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



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.



محدوده قیمتی ۵۰،۷۰۰ الی ۵۱،۲۰۰ تومان محدوده مقاومتی دلار است که باید دید واکنش نسبت به این محدوده چطور خواهد بود. با عبور از این محدوده مقاومتی انتظار می‌رود رشد دلار تا حوالی ۵۵،۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد

توضیحات تحلیل



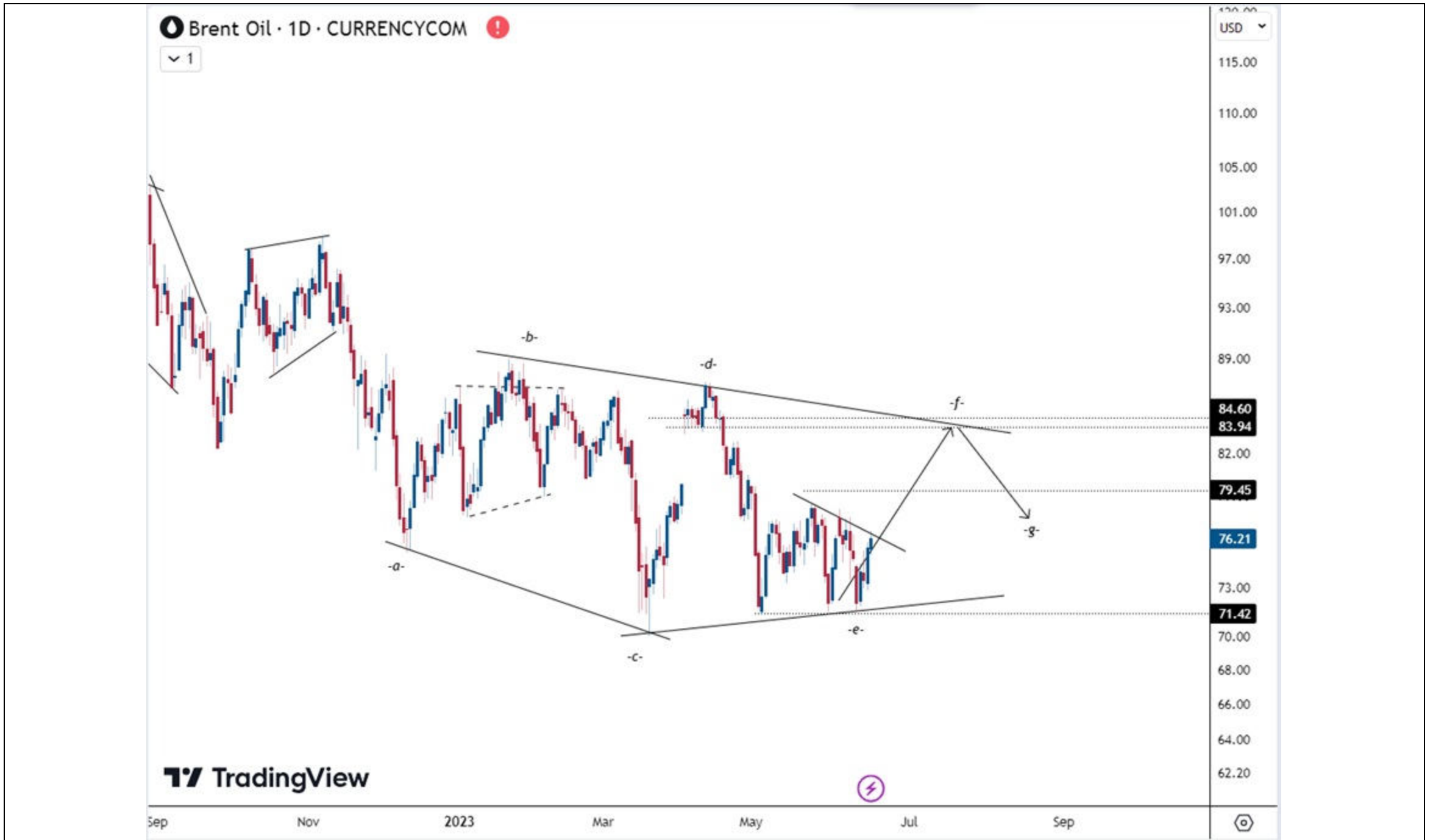
محدوده قیمتی ۲۹،۵۰۰،۰۰۰ الی ۳۰،۰۰۰،۰۰۰ تومان محدوده مقاومتی مهم سکه است.

توضیحات تحلیل



طلای جهانی در محدوده حمایت داینامیک کوتاه مدت خود قرار دارد. انتظار می رود بعد از رشد موقت تا حوالی ۱۹۸۰ دلار، 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





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

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 P/E با سود	
										نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۲	۱۴۰۳	
فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۶۴.۰	۵,۸۰۰	۵۹%	۶۸۴	۱,۰۳۱	-	+۵۱%	۵.۲		
		فولاد	۱۲	۴۴.۴	۱۸,۵۲۰	۹۱%	۱,۷۲۵	۳,۷۶۶	-	+۱۱۸%	۴.۵		
		کاوہ	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		
	محصولات فلزی	کوپر	۱۲	۱۴.۳	۳,۸۵۰	۱۵%	۴۴۱	۶۳۹	-	+۴۵%	۵.۹		
	مواد پایه	سرب و روی	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	
فتوسا			۱۲	۱.۳	۹,۱۸۰	۱۷%	۱,۴۴۳	۲,۲۳۳	-	+۵۵%	۴.۰		
مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوہ	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		
		ساروج	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		
		سسو..	۱۲	۳.۳	۳۰,۳۱۰	۸۶%	۳,۶۸۵	۶,۷۴۷	-	+۸۳%	۴.۵		
		سفاین	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			



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 P/E با سود	
										نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۲	۱۴۰۳	
خدمات مالی	فلزات و معادن	وگتدیر	۶	۴۷.۹	۲۵,۹۱۰	۶۲%	۲,۷۷۷	۳,۶۹۷	۵,۸۴۹	+۳۳%	۷.۰	۴.۴	
		واحیا	۳	۱۶.۲	۲۰,۳۰۰	۴۴%	۲,۵۰۲	۱,۷۶۰	۳,۶۴۵	-۳۰%	۱۱.۵	۵.۸	
	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۱۱.۳	۶,۲۶۰	۹۹%	۴۷۱	۵۸۲	-	+۲۴%	۱۰.۸	
		تتوین	۱۲	۱۰.۷	۴,۳۷۰	۱۰۰%	۷۵۸	۸۸۵	-	+۱۷%	۴.۹		
	چند رشته‌ای	وسپه	۹	۱۲.۵	۵,۳۳۰	۸۴%	۸۷۵	۹۵۱	-	+۹%	۵.۶		
	فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار	بورس	۱۲		۸,۹۴۰	۲۵%	۱۵۶	۵۴۸	-	+۲۵۲%			
بهداشت	بهداشت	دارویی	دتوزیع	۱۲	۶.۲	۳۴,۳۵۰	۹۴%	۴,۴۸۵	۵,۲۱۱	-	+۱۶%	۵.۸	
			دفرا	۱۲	۶.۰	۴۲,۷۶۰	۹۲%	۳,۸۱۲	۴,۹۱۰	-	+۲۹%	۸.۰	
			هجرت	۱۲	۵.۹	۳۶,۸۰۰	۹۳%	۴,۰۶۳	۵,۱۳۸	-	+۲۶%	۷.۲	
			دابور	۱۲	۳.۹	۲۱,۷۵۰	۹۵%	۲,۶۷۳	۳,۰۰۰	-	+۱۲%	۶.۴	
			دسبحان	۱۲	۳.۷	۱۰,۱۵۰	۵۲%	۱,۰۵۴	۱,۲۷۸	-	+۲۱%	۷.۹	
			دتماد	۱۲	۳.۵	۴۹,۴۰۰	۹۸%	۶,۵۳۱	۶,۸۹۱	-	+۶%	۶.۳	
			درازک	۱۲	۳.۳	۱۵,۵۷۰	۹۸%	۲,۱۳۲	۲,۸۶۵	-	+۳۴%	۴.۷	
			کاسپین	۱۲	۲.۸	۲۰,۲۰۰	۹۷%	۲,۳۴۰	۲,۳۴۴	-	-	۷.۷	
			دکپسول	۱۲	۲.۴	۸۰,۵۰۰	۹۴%	۹,۲۰۷	۱۰,۵۷۹	-	+۱۵%	۷.۶	
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	روانکار	۱۲	۲۰.۲	۱۰,۱۰۰	۹۰%	۱,۰۷۶	۱,۷۳۱	-	+۶۱%	۵.۳		
		زغال سنگ	کزغال	۱۲	۸.۸	۲۵,۰۵۰	۱۰۰%	۲,۶۴۷	۶,۱۵۶	-	+۱۳۳%	۳.۶	
			کطیس	۱۲	۱.۶	۱۹,۹۳۰	۶۵%	۱,۹۷۶	۴,۱۳۳	-	+۱۰۹%	۴.۵	
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	سپیدار	۱۲	۵.۴	۷۷,۱۰۰	۹۶%	۳,۱۰۷	۳,۱۶۵	-	+۲%	۲۴.۴		
		رافزا	۱۲	۱.۷	۴۹,۹۰۰	۹۲%	۲,۵۴۷	۳,۳۸۱	-	+۳۳%	۱۴.۱		



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 P/E با سود
										نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۲	۱۴۰۳
روغن خوراکی	غکورش		۱۲	۱۹.۳	۱۶,۱۰۰	۸۷%	۲,۰۵۵	۱,۳۶۴	-	-۳۴%	۱۰.۵	
	غبشهر		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	
غذا و نوشیدنی	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 بسته‌بندی شده	غزر		۱۲	۷.۴	۴,۱۰۱	۱۳%	۴۵۱	۵۹۲	-	+۳۱%
غمهرا			۱۲	۲.۳	۱۲,۳۴۰	۱۰%	۱,۰۱۰	۱,۷۳۵	-	+۷۲%	۷.۱	
محصولات لبنی	غگلیا		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	

مصروفی غیردوره‌ای



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 P/E با سود
										نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۲	۱۴۰۳
مصرفی دوره‌ای	کالای مصرفی با دوام	انتخاب	۹	۳۳.۰	۳۳,۰۰۰	۹۰%	۳,۲۲۳	۵,۱۷۷	-	+۶۱%	۶.۴	
		پکویر	۹	۴.۳	۶,۵۸۰	۵۲%	۲۴۷	۹۱۴	-	+۲۷۱%	۷.۲	
	خودرو و قطعات	پتایر	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	حگهر	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	
	بنادرو کشتیرانی	چپارسا	۶	۱.۸	۷۳,۸۵۰	۹۰%	۶,۳۱۲	۸,۸۴۹	۱۱,۹۲۳	+۴۰%	۸.۳	۶.۰
		حسینا	۱۲	۴.۷	۱۸,۹۳۰	۹۶%	۲,۰۱۳	۲,۲۰۴	-	+۹%	۸.۶	

ارتباط با ما

فکس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶
شماره تماس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶
تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: www.charisma.ir
شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: [@CharismaHolding](https://t.me/CharismaHolding)

پست الکترونیکی: info@ciaco.ir
تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما: www.ciaco.ir
شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک: [@CharismaTickReports](https://t.me/CharismaTickReports)
تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، کوچه حکیم اعظم، پلاک ۱۷

