

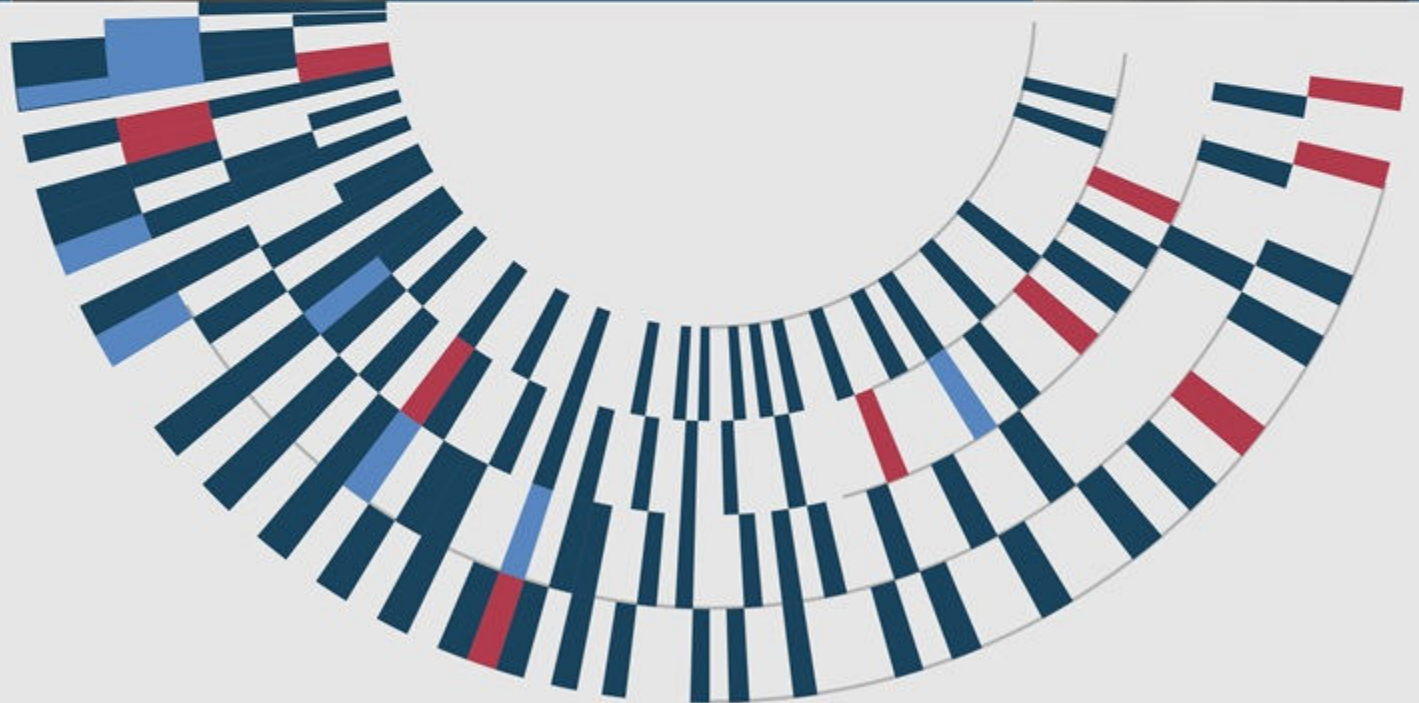
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۶ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۴/۱۶

 CHARISMA





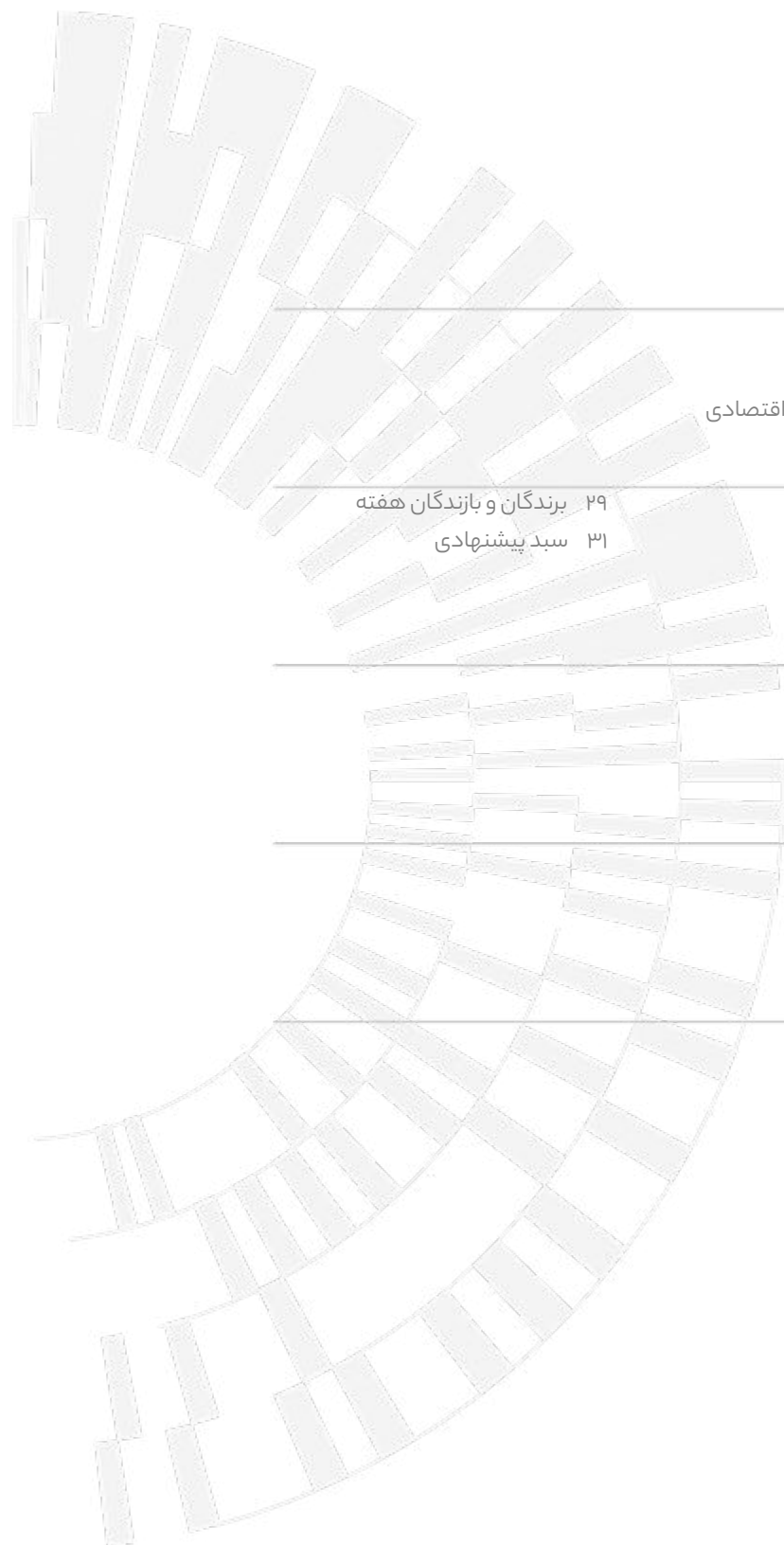
معرفی گزارش:

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	۱۹ ارزندگی 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





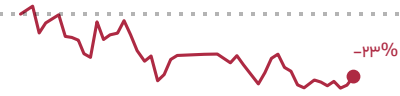
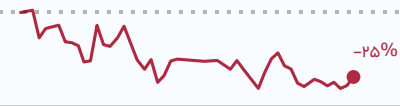
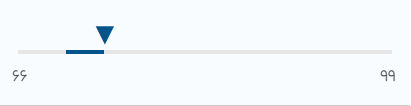
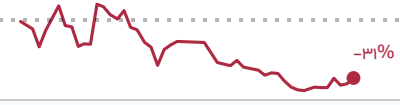
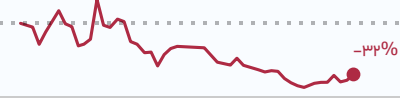
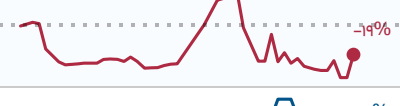
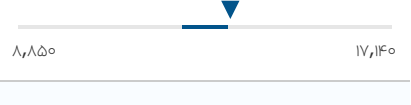
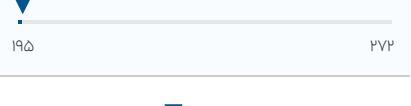
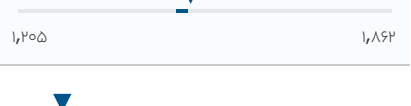
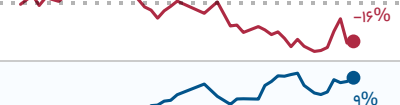
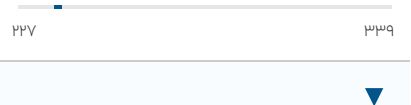
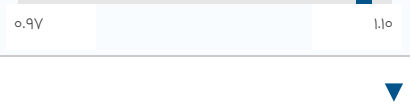
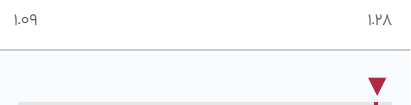
فلزات و معادن

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	۱,۹۲۴	۰.۳%	فزر	-	۱,۶۴۳۲,۰۱۷	۱۳%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۳۶۹	۰.۶%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۱۵۸۹,۳۴۱	۱۷%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۰۲	-۲.۰%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۵۰۴	-۱۱%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۳۵۹	-۱.۵%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳۳,۶۰۰	-۲۰%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۵۶	-۱.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۸۵۲۲,۲۷۳	۵%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۵۰۰	-۷.۱%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۶۸۳۴,۸۴۳	۵۰%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۲۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۰۹۶۳,۶۲۵	۵۳%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۶	-۲.۴%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۸۳۶۲۳	-۱۱%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۵۰۰	-	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۲,۳۰۸۲۲,۸۲۱	۴۲%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۰	-	فولاد، فخور، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۵%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۰۰	-	فولاد، فخور، هرمز	-	۱۱,۶۶۷۲۲,۰۸۰	۳۷%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۸	-۲.۴%	ذوب، کویر	فولای	۶۰۸۷۵۵	-۱۰%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۳,۱۰۴	۲.۰%	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۰۲۴۲۴,۷۴۷	۵۰%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۷۳	-۰.۴%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۰۷۸۰	-۵%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۷۰	-۰.۴%	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	۶%



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	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۲۵	۱.۹%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس	۲۸۵77۳	-۴۶%
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۴۸	-۰.۷%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا	۲۳۵۳۲۳۰	-۲۱%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۵۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدییر، جم پیلن	۷۳۰۱,۰۳۰	-۲۷%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۷۵	-۰.۸%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱,۲۱۶	-۲۸%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۵	-۰.۳%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶۱,۰۳۱	-۱۴%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۹۵	-۰.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۴۰۱,۱۳۸	-۲۱%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۶۰	۲.۲%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۳۷۵۵۰	-۱۶%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۳۵	-	شگویا	-	۹۳۴۱,۰۹۹	
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۷۷۰	۱.۳%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۴	-۱۹%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۰۵	-۰.۹%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰۹۹۱	-۱۹%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۹۰	۲.۴%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲۱,۱۸۲	-۱۶%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۳	۰.۳%	شصفها، نوری	-	۹۷۹۱,۱۸۵	-۹%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۶	۴.۴%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱,۲۶۱	-۲۷%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۷۷۰	۲.۵%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۱,۱۸۹	-۳۵%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۷,۲۱۰	۲.۲%	بوعلی	-	۶,۱۲۹۷,۷۳۹	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۶۸۰	۴.۶%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰۱,۳۷۶	-۵۱%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۷۰	-	شغدییر، ارونند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۶۹۹۱,۰۰۰	-۲۳%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۶۵	۱.۶%	شبصیر	-	۱,۲۴۵۱,۶۴۰	-۲۳%

انرژی و سایر محصولات

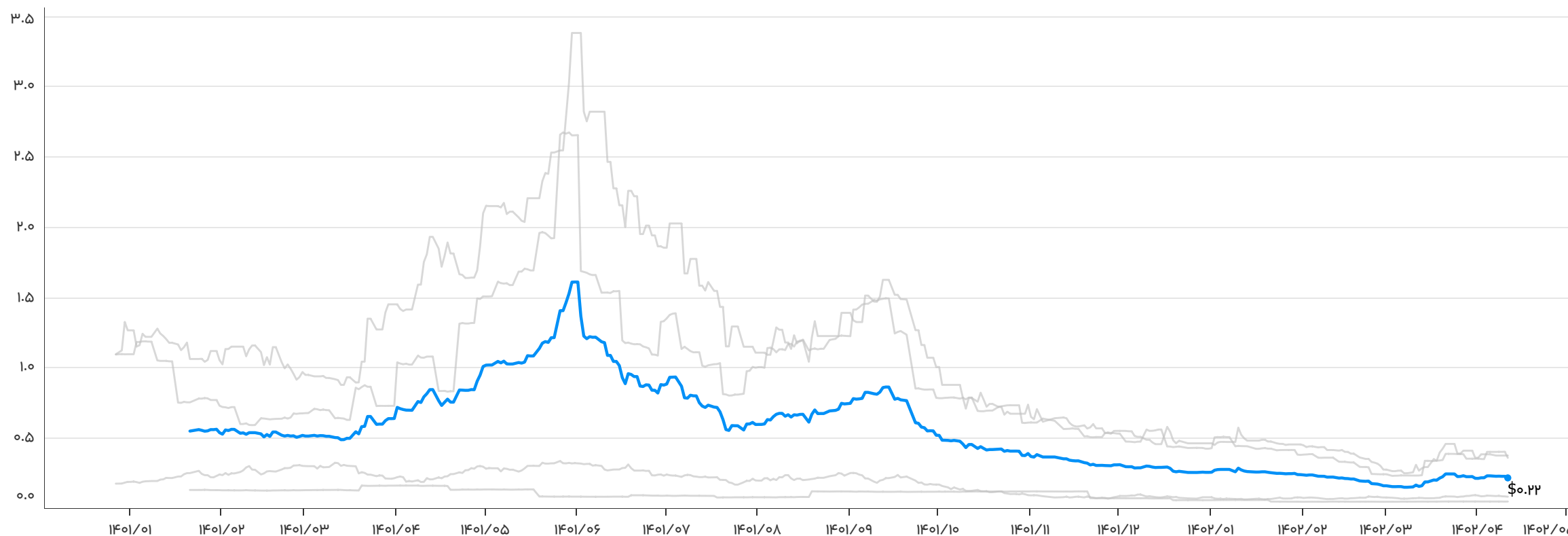
	رند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته		آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۴.۱%		۷۸	دلار/ بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۴.۶%		۷۴	دلار/ بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۴.۸%		۱۰۷	دلار/ بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۵.۶%		۱۰۱	دلار/ بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		-		۱۲,۵۰۴	تومان /تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		۲۳.۹%		۲۷,۰۰۶	تومان /تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان
محصولات کشاورزی					شپاس		-		۸.۳%		۱۳,۵۱۷	تومان /تن	بورس کالای ایران	قیر - نفت پاسارگاد
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		۰.۳%		۱۹۵	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		۸.۴%		۸۲۶	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام
					-		-		۱.۶%		۱,۵۰۵	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
ارز و ارز دیجیتال					-		-		۰.۹%		۲۴۰	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
					-		-		۰.۵%		۱.۱۰	-	بازار فارکس	یورو به دلار
					-		-		۱.۱%		۱.۲۸	-	بازار فارکس	پوند به دلار
					-		-		-۰.۵%		۳۰,۲۳۰	دلار	بایننس	بیتکوین



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	۰.۰۹	-۲.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۳۴	-۶۴%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۶	۰.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۶ ۰.۱۴	-۶۰%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۸	۰.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۳.۳۹	-۷۹%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۷	-۱۰.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۲.۶۸	-۵۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۲	-۴.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۱.۶۲	-۷۱%

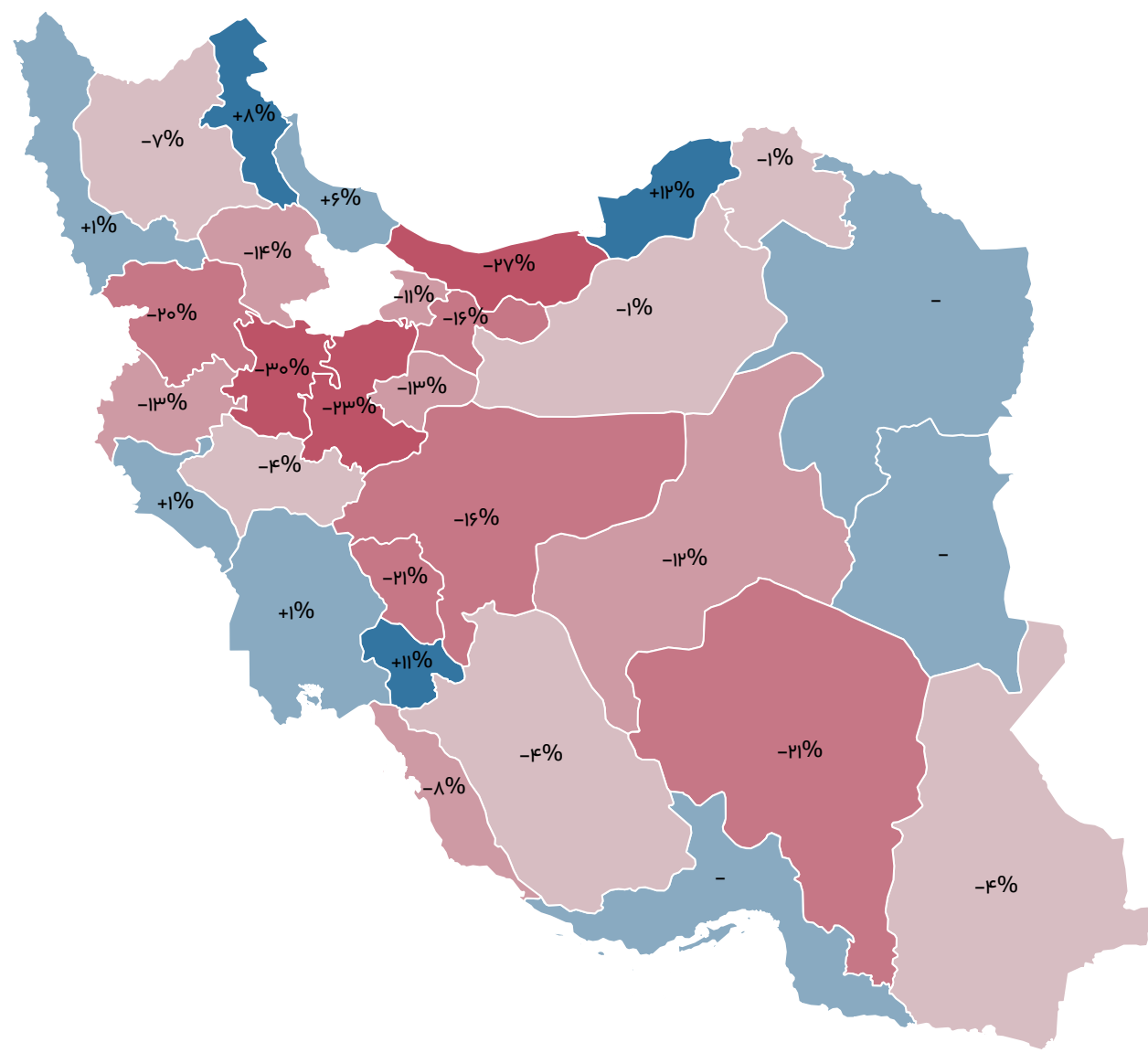
میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



تغییرات قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گذشته

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



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	۱,۲۱۱	۱,۰۱۸	-۱۶%
	اصفهان	تومان/کیلو	۱,۲۱۰	۱,۰۱۳	-۱۶%
	البرز	تومان/کیلو	۱,۱۱۲	۹۸۹	-۱۱%
	مرکزی	تومان/کیلو	۱,۲۹۸	۱,۰۰۱	-۲۳%
	یزد	تومان/کیلو	۸۰۲	۷۰۶	-۱۲%
	سمنان	تومان/کیلو	۹۵۰	۹۴۵	-۱%
جنوب	قم	تومان/کیلو	۱,۱۲۴	۹۷۲	-۱۳%
	فارس	تومان/کیلو	۹۸۵	۹۴۳	-۴%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۷۵۸	۷۵۹	+۰%
غرب	بوشهر	تومان/کیلو	۹۲۹	۸۵۱	-۸%
	همدان	تومان/کیلو	۱,۱۵۶	۸۱۳	-۳۰%
	خوزستان	تومان/کیلو	۷۶۶	۷۷۳	+۱%
	ایلام	تومان/کیلو	۶۶۸	۶۷۸	+۱%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۱,۱۳۷	۸۹۹	-۲۱%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۹۶۸	۸۴۵	-۱۳%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۷۵۸	۸۳۸	+۱۱%
	لرستان	تومان/کیلو	۷۰۲	۶۷۵	-۴%
	کردستان	تومان/کیلو	۱,۰۴۶	۸۳۹	-۲۰%
	گیلان	تومان/کیلو	۶۳۹	۶۸۱	+۶%
شمال	مازندران	تومان/کیلو	۱,۲۷۰	۹۲۸	-۲۷%
	گلستان	تومان/کیلو	۶۹۷	۷۷۹	+۱۲%
	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۶۷۸	۶۸۳	+۱%
شمال غرب	اردبیل	تومان/کیلو	۱,۰۴۸	۱,۱۳۳	+۸%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۹۹۵	۹۲۸	-۷%
	زنجان	تومان/کیلو	۱,۰۰۰	۸۵۹	-۱۴%
شمال شرق	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۶۴۵	۶۳۸	-۱%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۲۱۰	۹۵۶	-۲۱%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۸۰۹	۷۸۱	-۴%

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

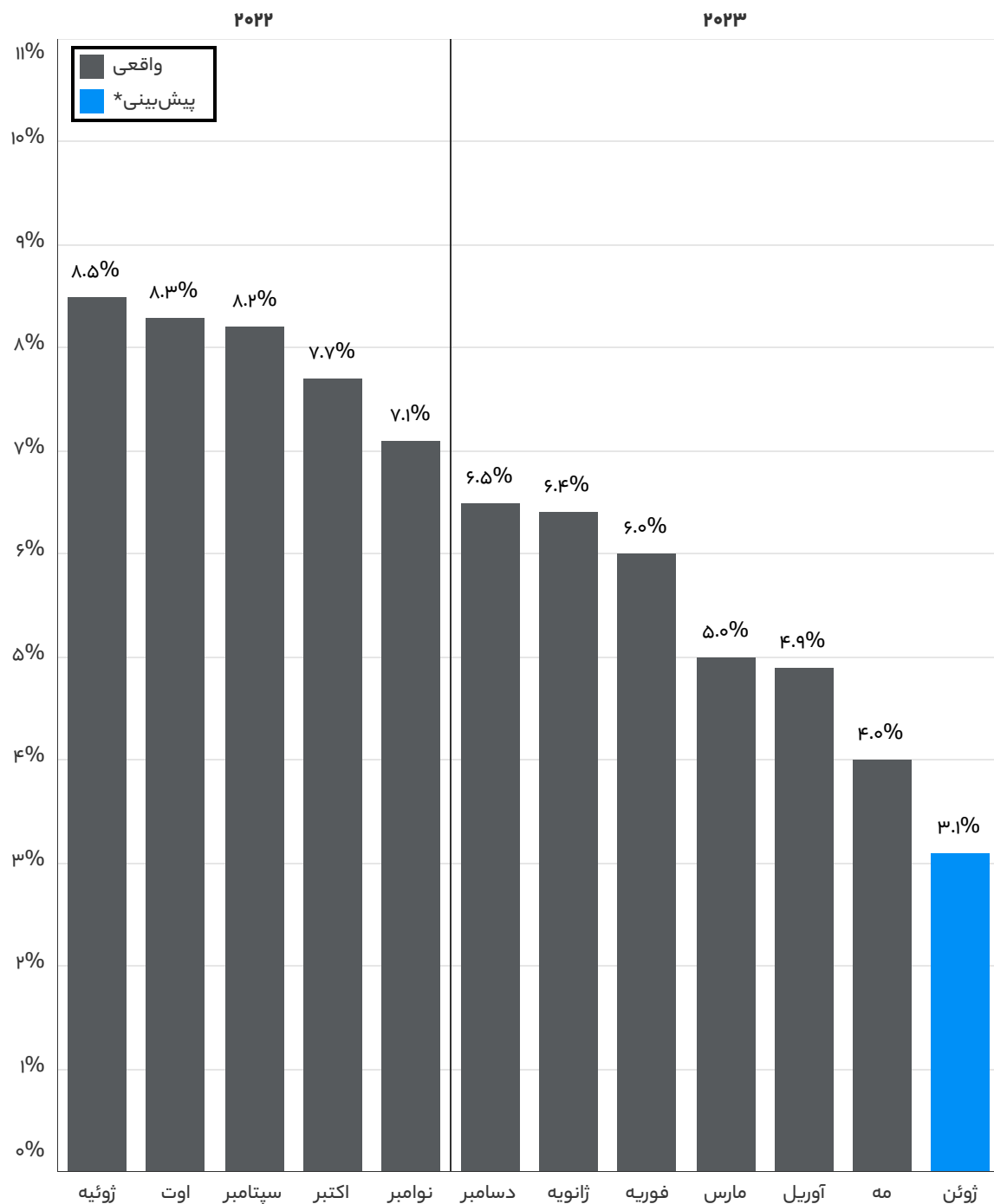
معادن و فزانات

انرژی و فرآورده های نفتی

- با رشد قیمت‌ها و افزایش تقاضای فولاد و همچنین با کاهش ۳۰ تا ۵۰ درصدی تولید آگلومره در چین شاهد رشد ۳۰ یوانی قیمت شمش در هفته گذشته در این کشور بودیم. این عوامل باعث افزایش قیمت رسمی میلگرد و سایر محصولات فولادی کارخانجات بزرگ این کشور شد.
- صادرات صنایع معدنی ایران در خرداد برای دومین ماه متوالی به بیش از ۱ میلیارد دلار رسید. همچنین زنجیره فولاد کشور با ۱.۶۵ میلیارد دلار صادرات افزایش ۷٪ داشته است. گندله آهن با ۲۶۲ میلیون دلار صادرات و حدود ۱۹۰٪ رشد در رتبه دوم قرار دارد البته باید به این نکته توجه داشت که دلیل رشد چشم‌گیر صادرات گندله به کمبود برق و گاز کشور مربوط می‌شود که باعث محدود شدن تقاضای گندله فولادی‌ها شده است.
- قیمت نفت برنت در روز جمعه به مرز ۷۷ دلار افزایش یافته و شاخص‌های نفتی حدود ۲ درصد طی یک هفته گذشته افزایش قیمت داشته‌اند. اما انتظار افزایش بیشتر نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا مانع بالا رفتن بیشتر قیمت نفت می‌شود.
- در پی فروش کمتر نفت روسیه به چین و هند صادرات نفت روسیه به پایین‌ترین میزان در چهار ماه گذشته رسیده است. همچنین عربستان سعودی اعلام کرد کاهش داوطلبانه تولید نفت به میزان یک میلیون بشکه در روز را ادامه خواهد داد.
- به گفته موسسه ریستاد انرژی (Rystad Energy) در حال حاضر ۷۶٪ ظرفیت انبارهای ذخیره‌سازی گاز در اتحادیه اروپا پر هستند و احتمالاً این اتحادیه تلاش خواهد کرد تا پیش از فرا رسیدن فصل زمستان انبارهای گازی خود را به طور کامل پر کند. با افزایش تقاضا شاهد رشد قیمت‌ها هستیم به طوری که از ابتدای ماه گذشته میلادی تاکنون قیمت گاز در اروپا ۳۸ درصد رشد کرده است.
- وزارت خارجه عربستان سعودی مدعی است که مالکیت منابع طبیعی در منطقه مشمول میدان گازی آرش-الدره تنها در مالکیت مشترک عربستان سعودی و کویت است. ذخایر گاز طبیعی این میدان مشترک ۳۶۸ میلیارد متر مکعب و ذخیره نفت آن نیز نزدیک به ۳۱۰ میلیون بشکه برآورد می‌شود. بر اساس مرز، حدود ۴۰ درصد تاسیسات نفتی و گازی موجود میدان آرش-الدوره در آب‌های سرزمینی ایران قرار دارد.
- در جلسه مشترک وزیر نیرو و مدیرعامل شرکت مدیریت شبکه برق ایران با اعضای انجمن صنفی کارفرمایان صنعت سیمان که به میزبانی وزارت نیرو برگزار شد، افزایش ۱۰ درصدی برق تحویلی به صنایع سیمانی به دستور وزیر نیرو تصویب شد.
- مدیرعامل شرکت توانیر گفت: با توجه به وضعیت دمایی حاکم بر کشور سه شنبه این هفته رکورد مصرف برق در کشور طی سال جاری شکسته شد و به ۶۹ هزار ۴۰۰ مگاوات رسید.

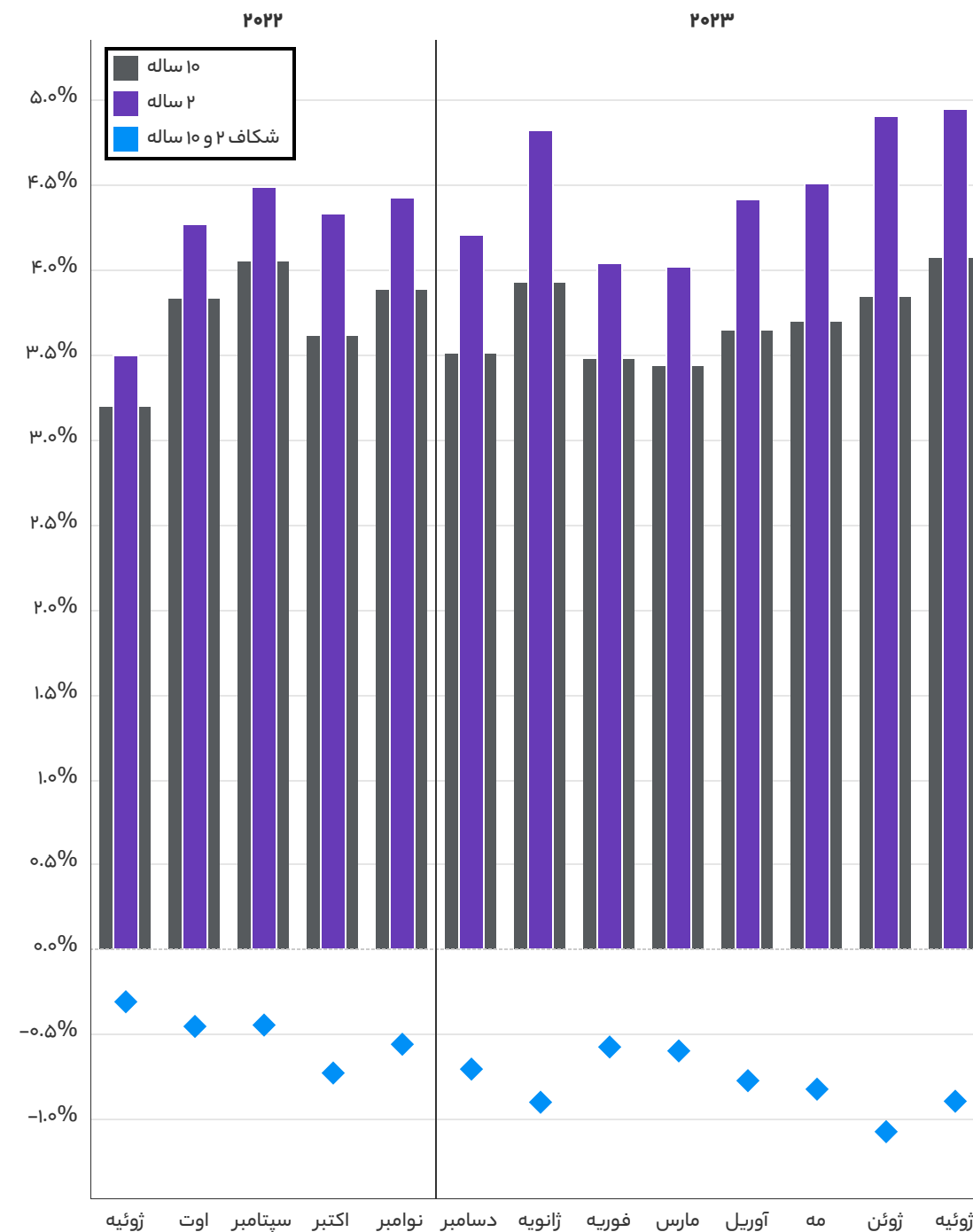
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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



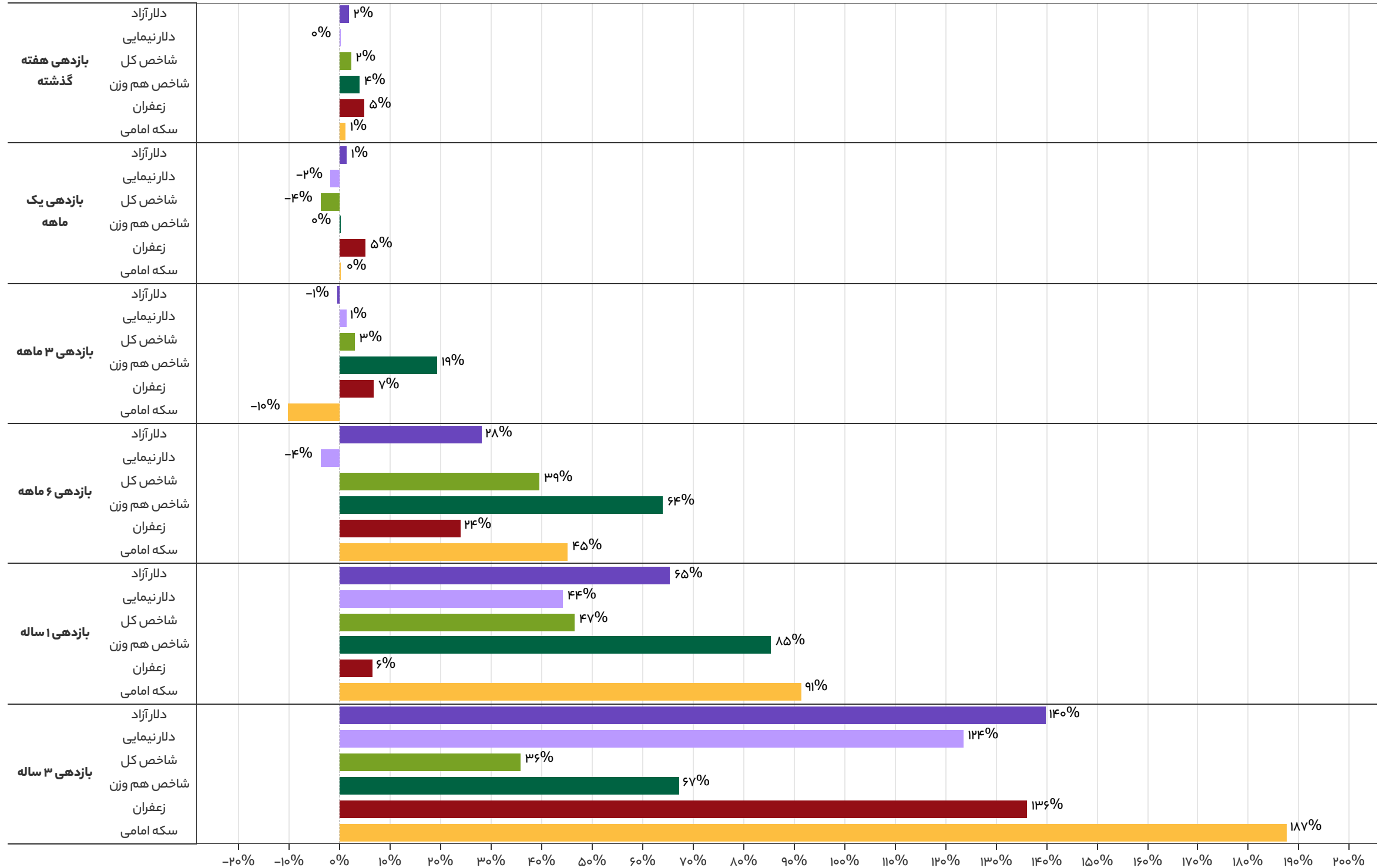
بازار سهام

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 درهرماه، 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 ▲ ۲۰.۸%

– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر ماه محاسبه شده و اوراهی 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 کاریزما ذکر گردیده، استفاده شده است.

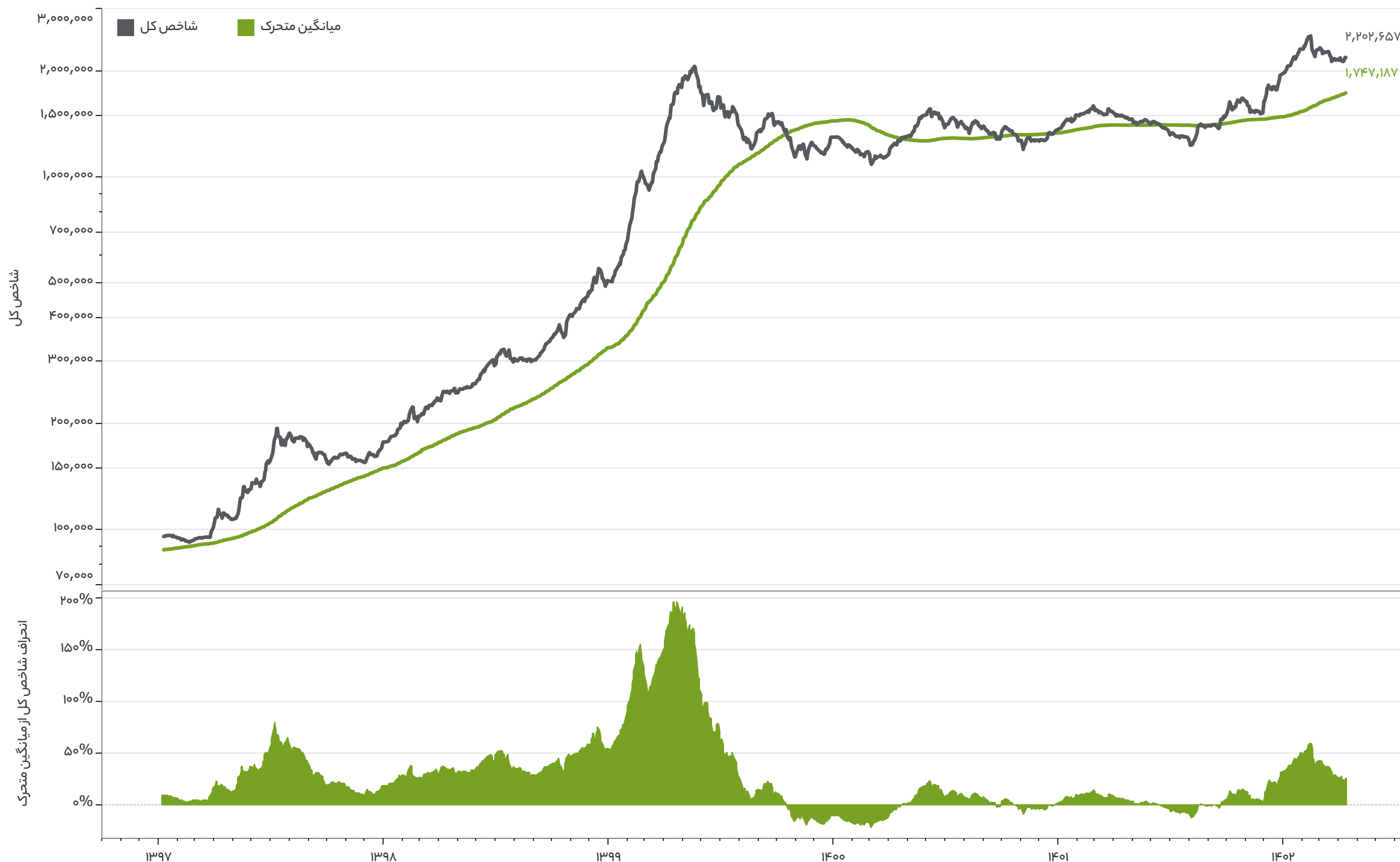
ارزش دلاری بازار

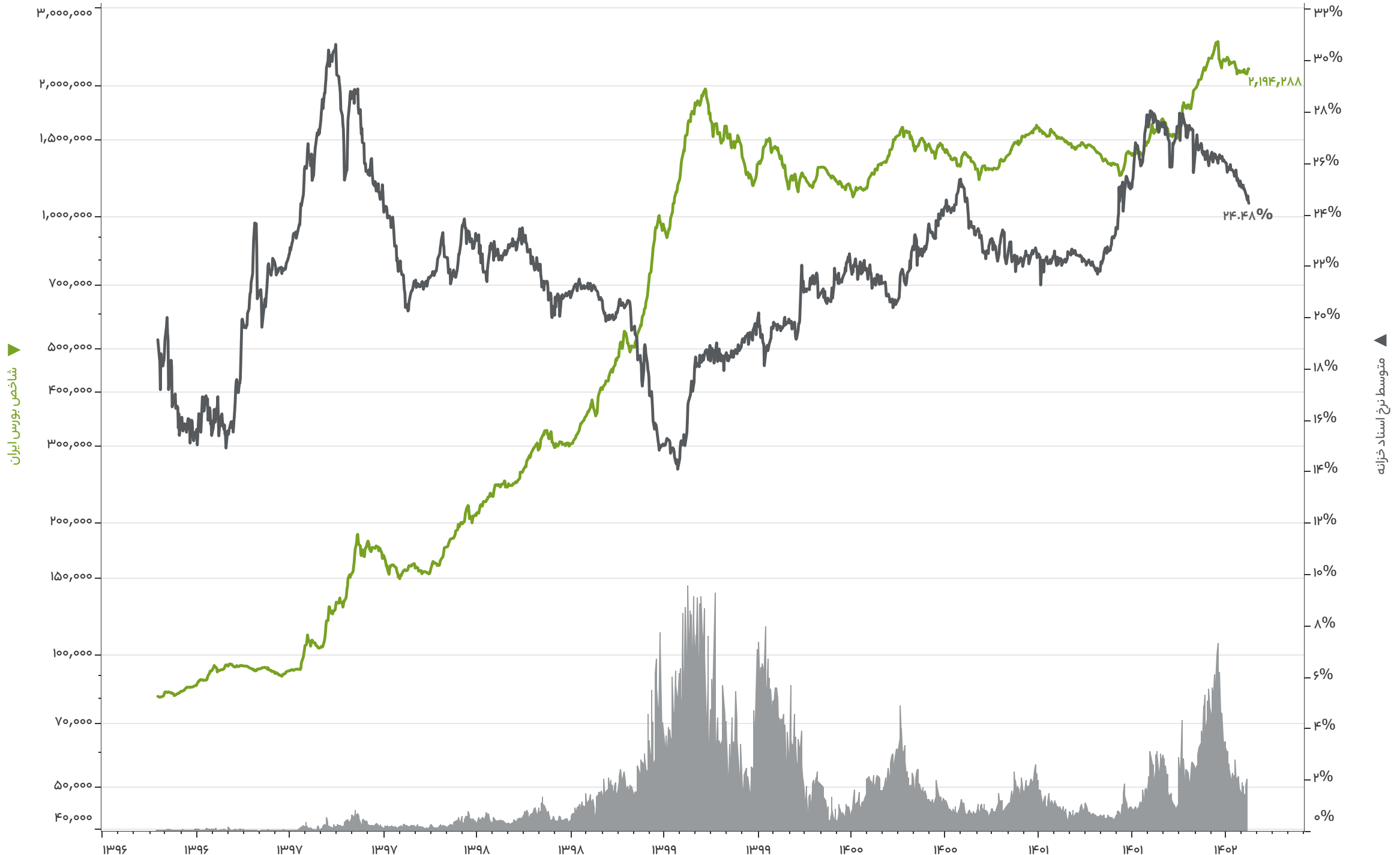
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است



شاخص کل و میانگین متحرک

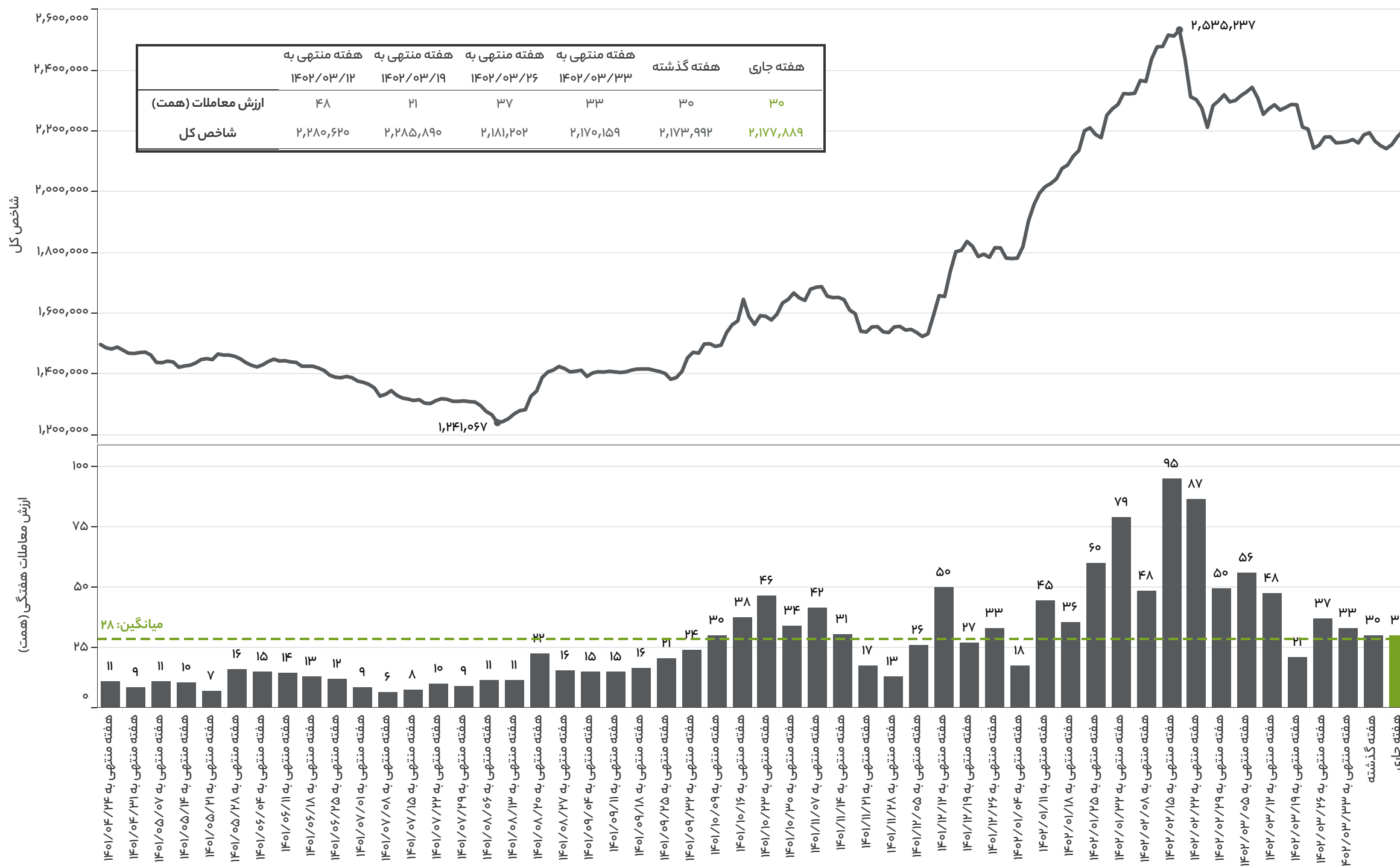
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





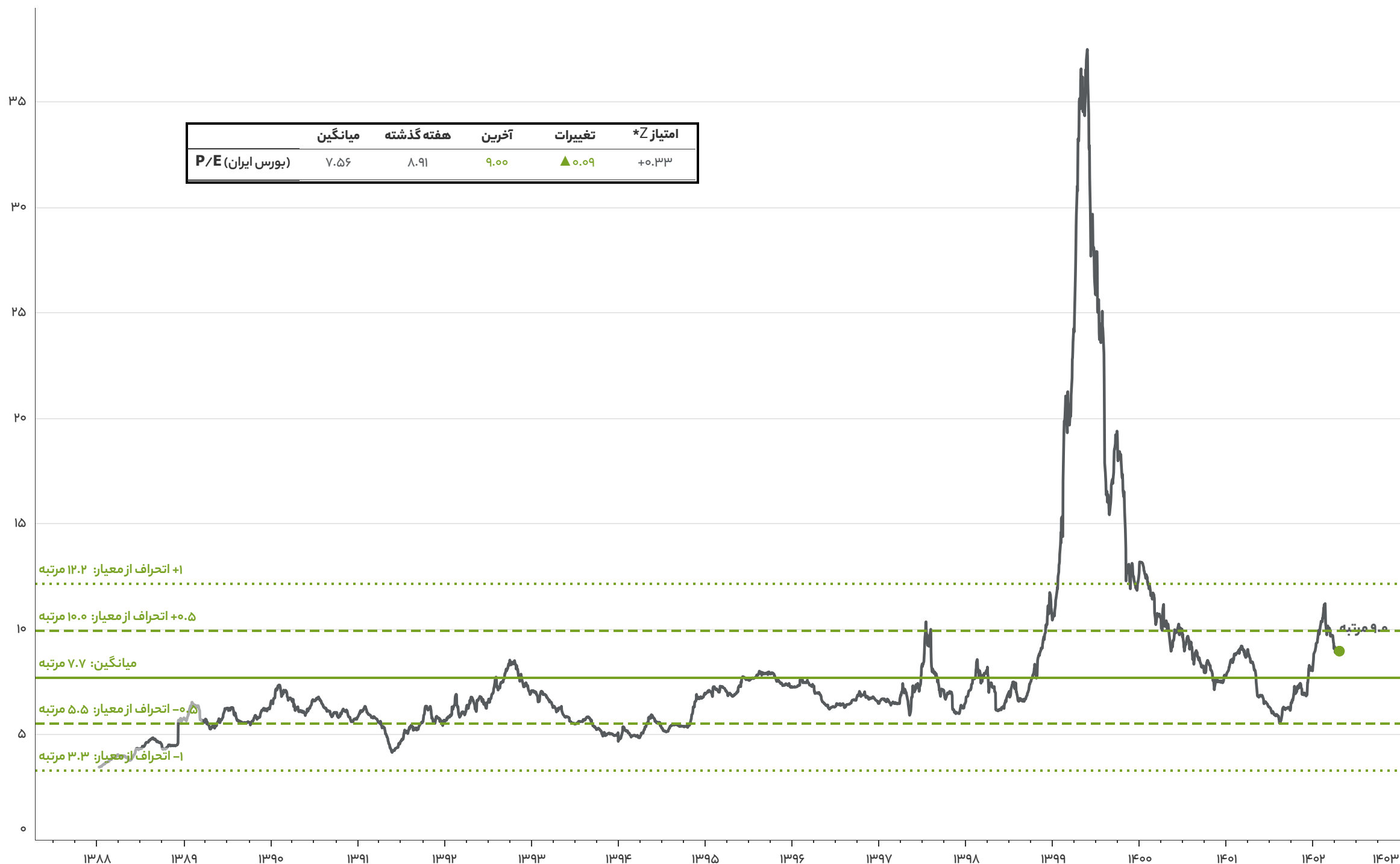
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

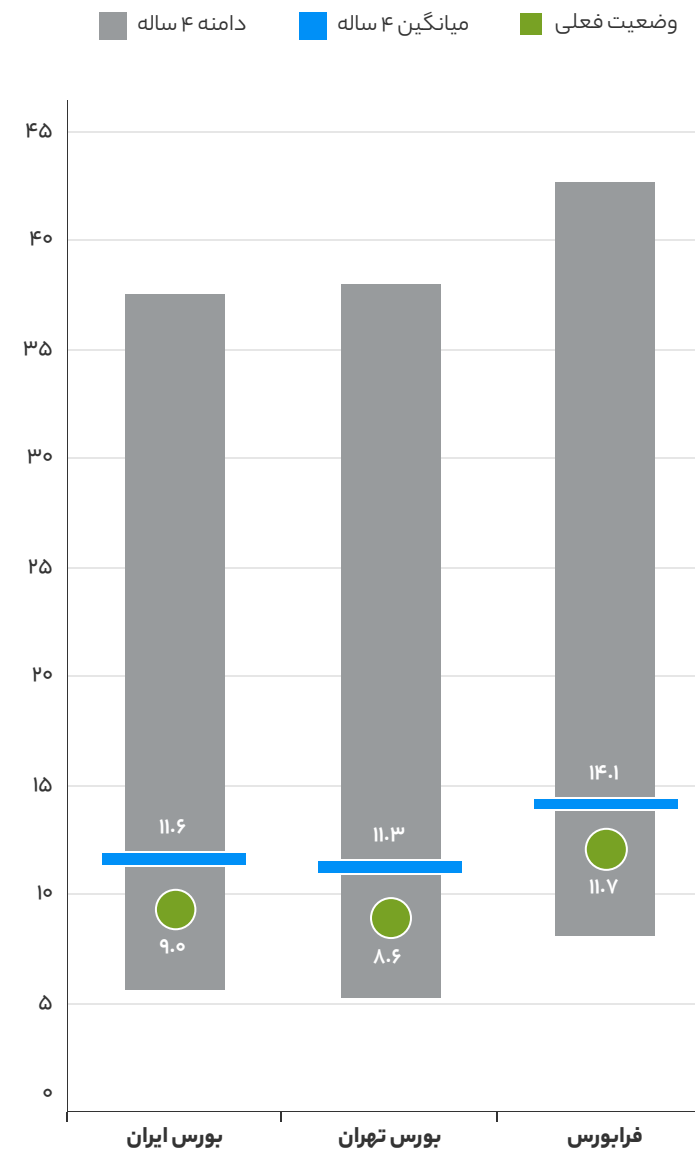
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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



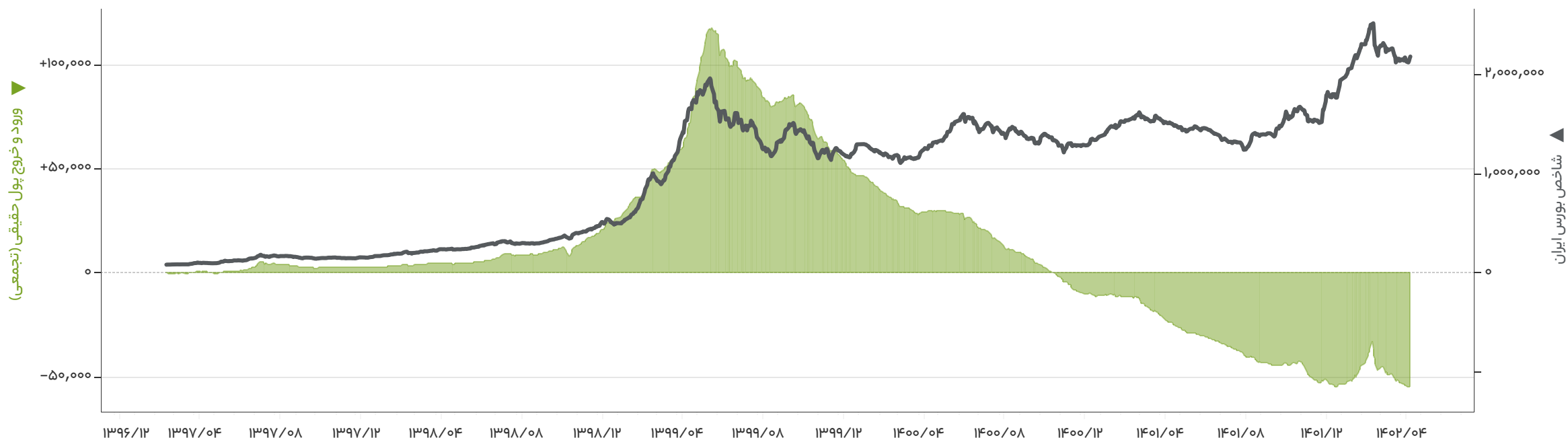
تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	بیشینه ۴ ساله
+۰.۰۹	۹.۰۰	۸.۹۱	۵.۵۹	۱۱.۶۳	۳۷.۵۱
+۰.۰۶	۸.۶۲	۸.۵۶	۵.۲۵	۱۱.۲۶	۳۸.۰۰
+۰.۳۱	۱۱.۶۶	۱۱.۳۵	۸.۰۸	۱۴.۱۵	۴۲.۶۴

بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	تکنولوژی	ارتباطات	یوتیلیتی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	مواد پایه	خدمات مالی	
تعداد سهام	۲۸	۱۹	۵	۱۰	۴۱	۶۳	۸۸	۶۵	۶	۱۸۹	۱۹۸	
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۴۴	۱۰۸	۱۱۴	۱۴۸	۱۶۰	۱۸۸	۲۱۴	۳۱۴	۶۷۹	۳,۱۶۳	۳,۲۱۲	وزن
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۵%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۸%	۱.۹%	۲.۲%	۲.۶%	۳.۸%	۸.۱%	۳۷.۹%	۳۸.۵%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۴	۲۶.۴	۱۱.۹	۱۲.۲	۱۰.۹	۱۱.۹	۱۳.۰	۱۳.۴	۵.۰	۸.۷	۹.۰	سودآوری
بازده سود نقدی	۴.۱%	۲.۵%	۳.۳%	۱۱.۴%	۶.۷%	۳.۴%	۳.۲%	۲.۱%	۱۰.۱%	۹.۱%	۶.۶%	
نسبت تقسیم سود	۴۴%	۶۰%	۵۹%	۸۵%	۷۵%	۴۰%	۵۱%	۲۹%	۶۸%	۷۲%	۵۹%	
بتا به شاخص کل	۰.۷	۰.۴	۰.۸	۰.۷	۰.۶	۰.۹	۰.۵	۱.۲	۱.۵	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۵۸.۵%	+۳۱.۰%	+۱۵.۸%	+۵۵.۸%	+۴۳.۵%	+۴۱.۳%	+۵۰.۲%	+۱۰۰.۱%	+۷۳.۰%	+۹۱.۲%	+۸۹.۸%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۵%	+۸%	-۵۹%	+۷۸%	+۲۷%	-۱۲%	+۱۳%	-۳%	+۷%	+۵۸%	+۵%	
بازده از ابتدای سال	+۲۰.۶%	+۷.۶%	+۶.۵%	+۶.۵%	+۱۱.۳%	+۱۰.۱%	+۷.۶%	+۱۰.۹%	+۷.۶%	+۷.۶%	+۷.۳%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۴%	۱%	۵%	۰%	۸%	۶%	۴%	۵%	۳%	۳%	۲%	

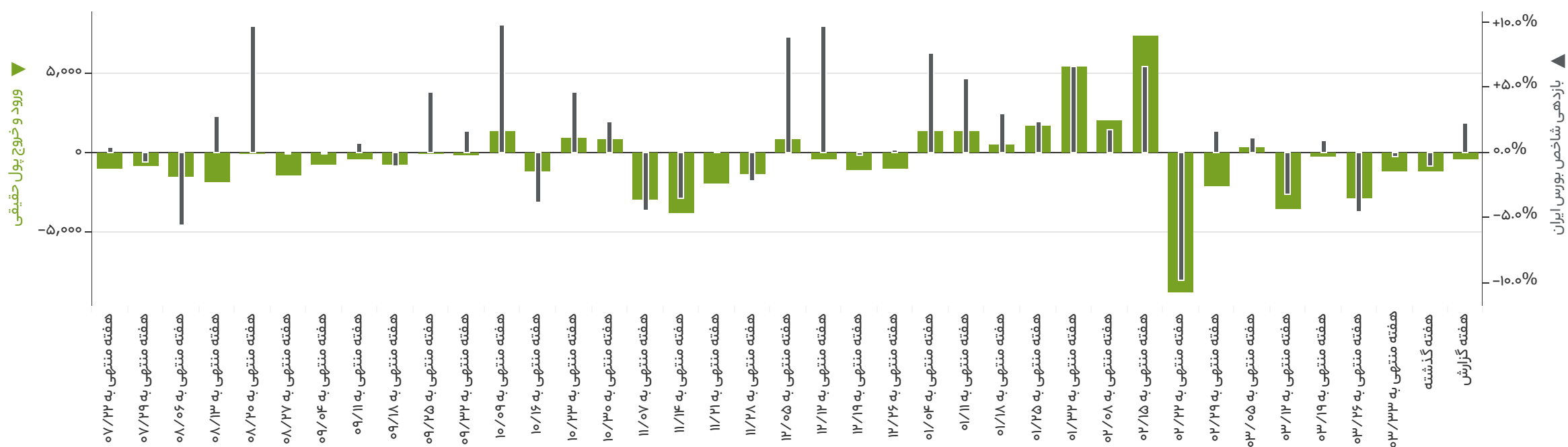
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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

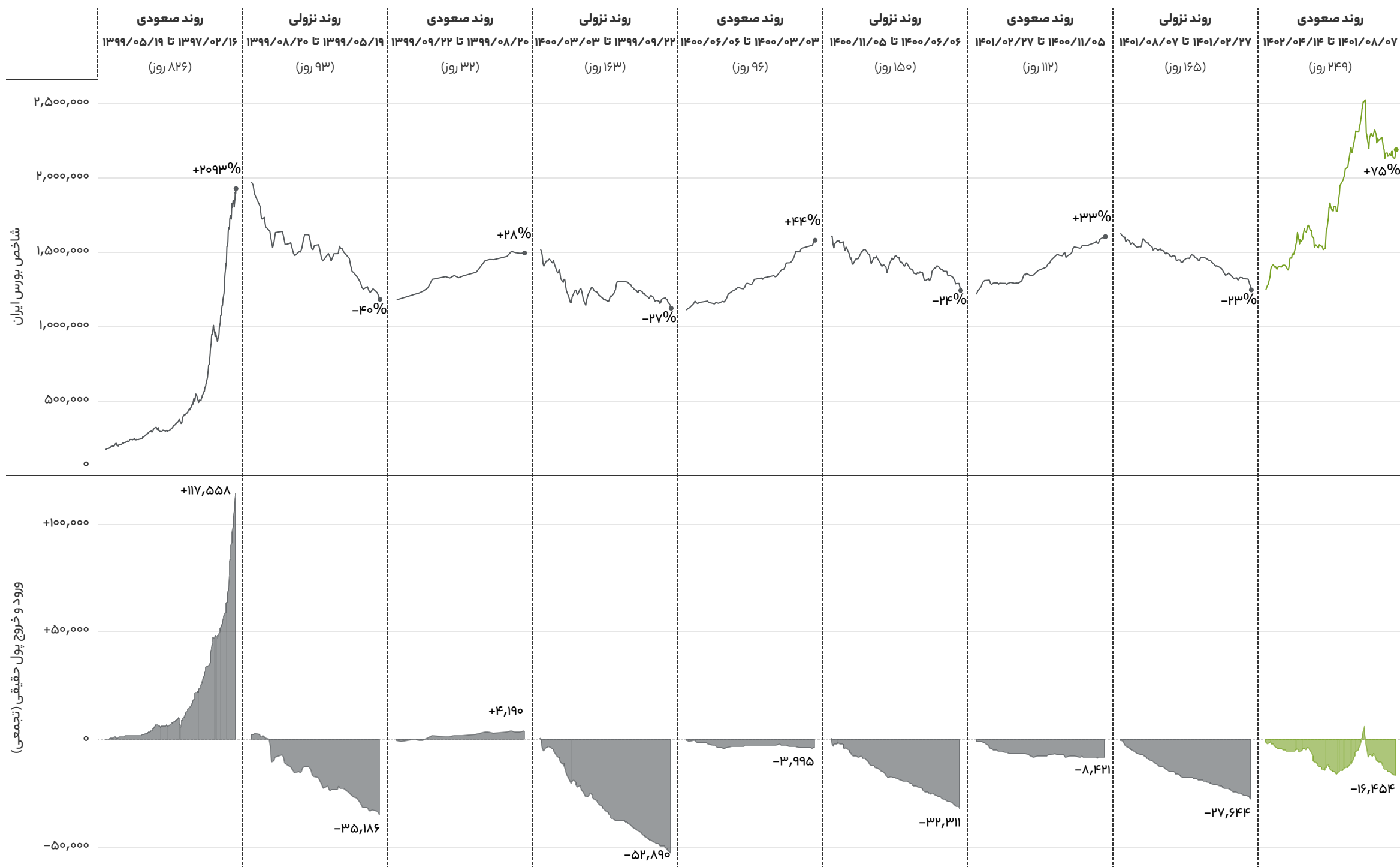
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

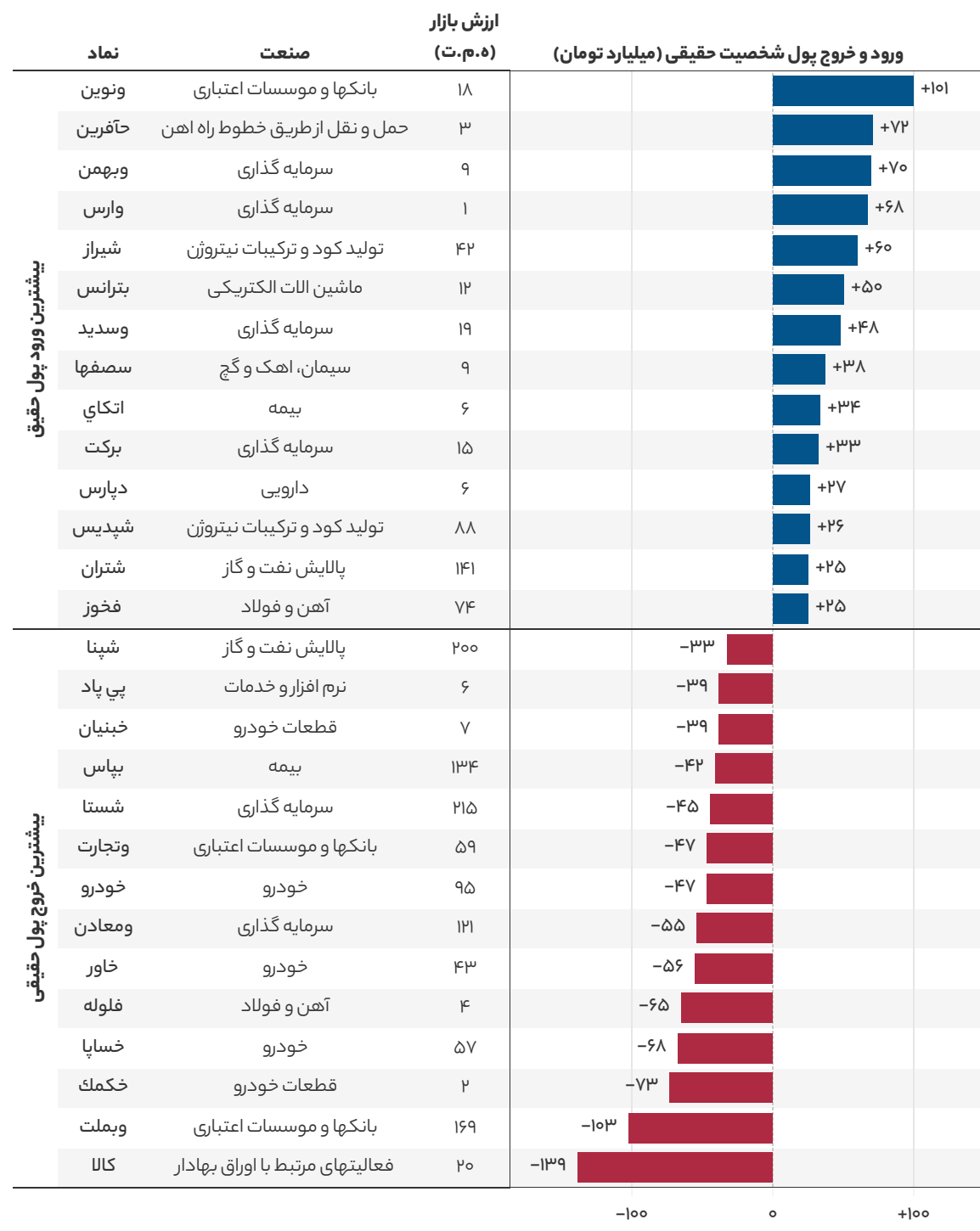
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

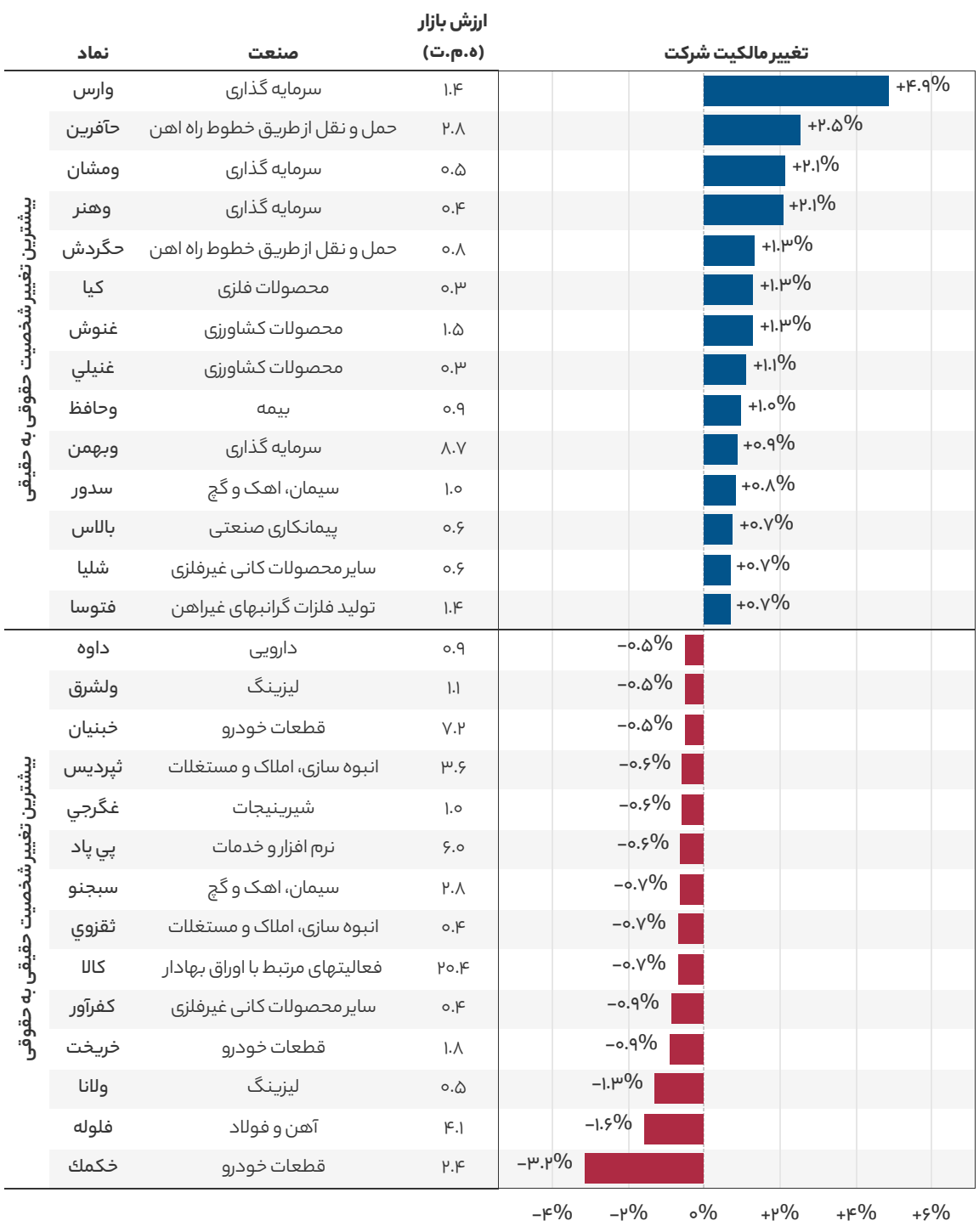
ورود و خروج پول حقیقی

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



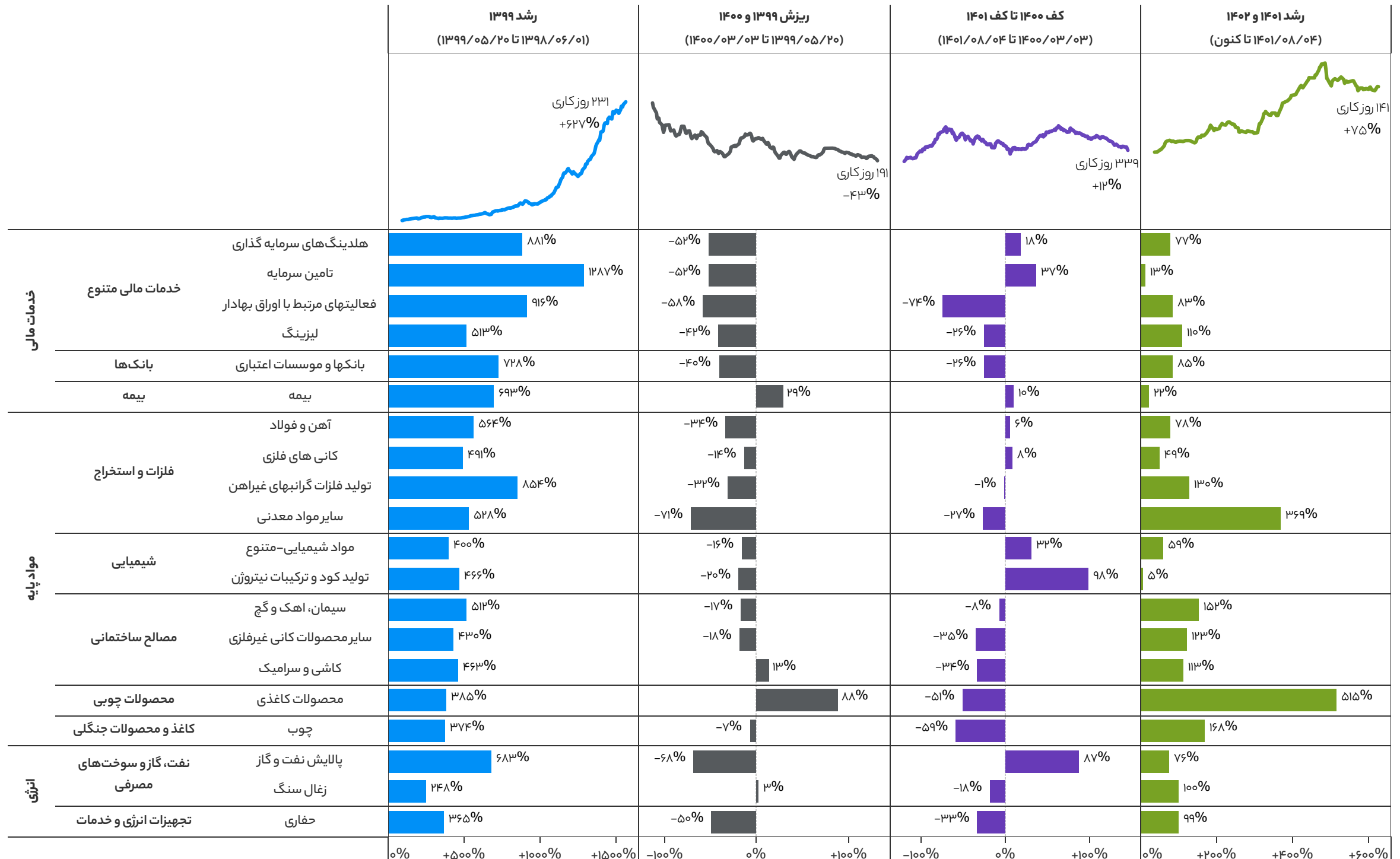
تغییر مالکیت شرکت

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



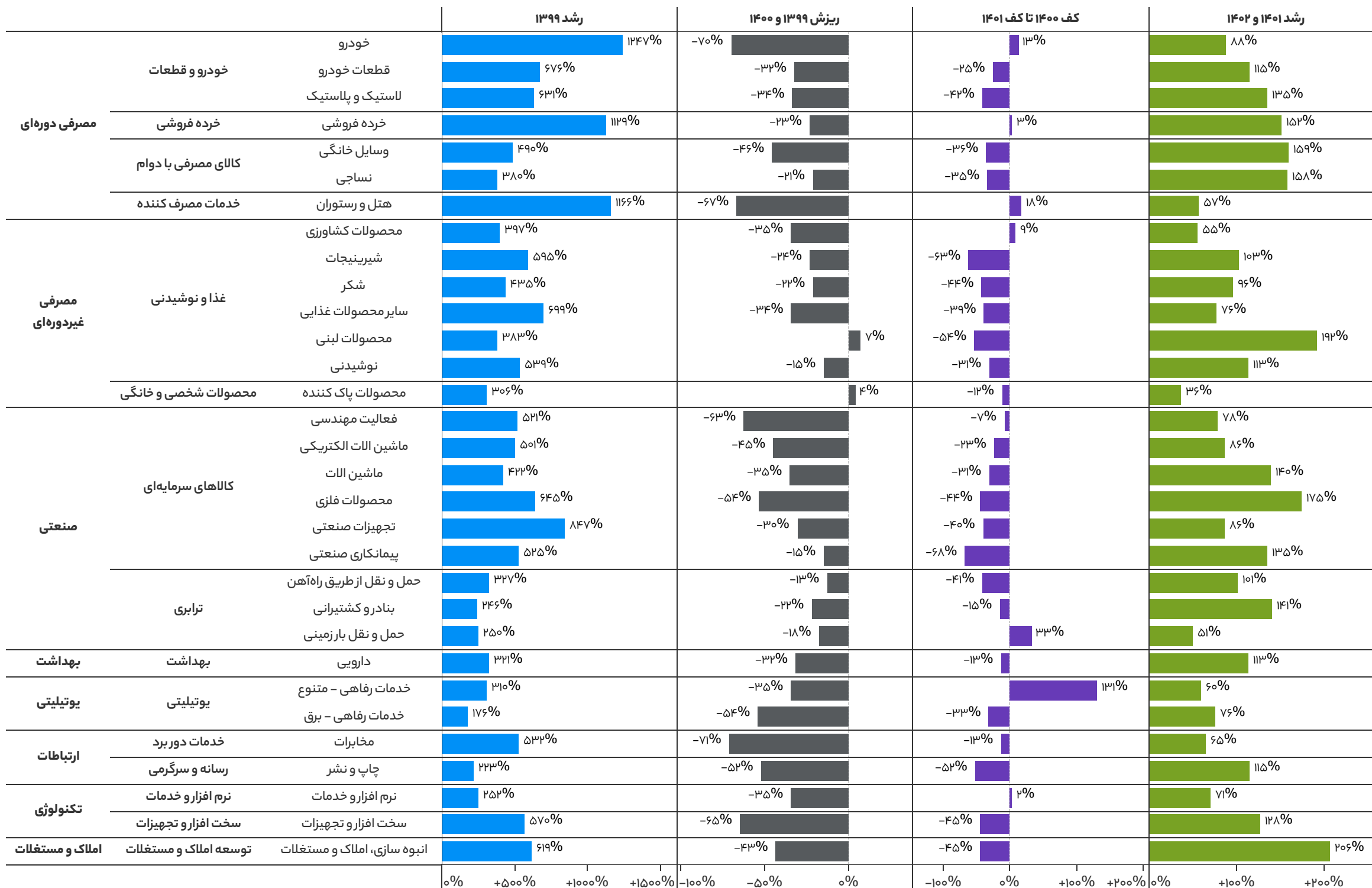
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

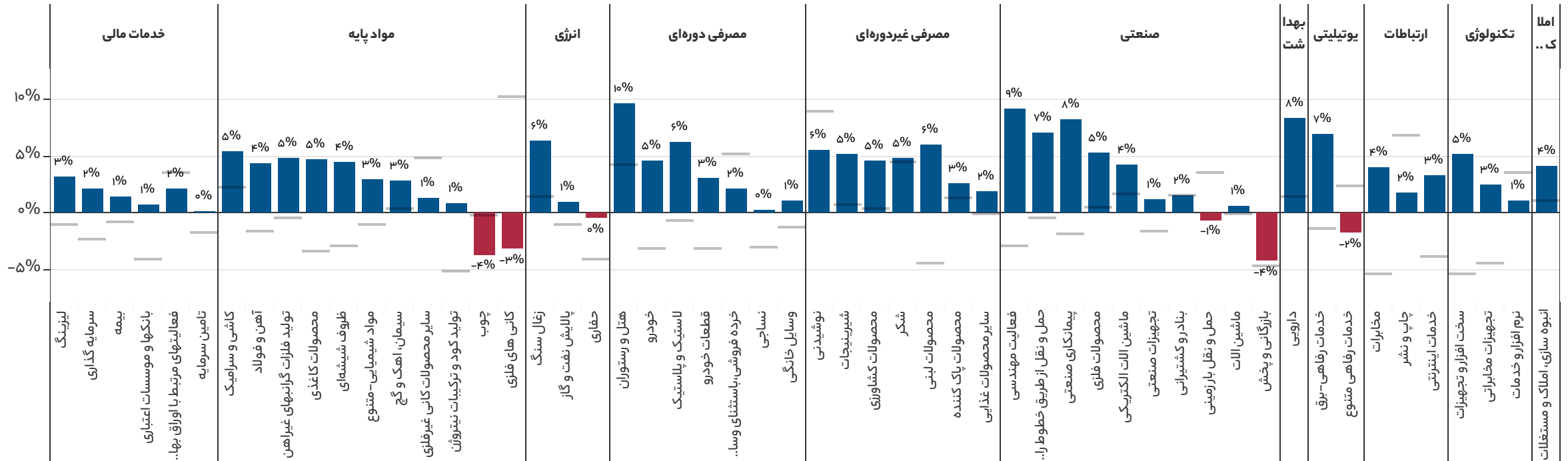




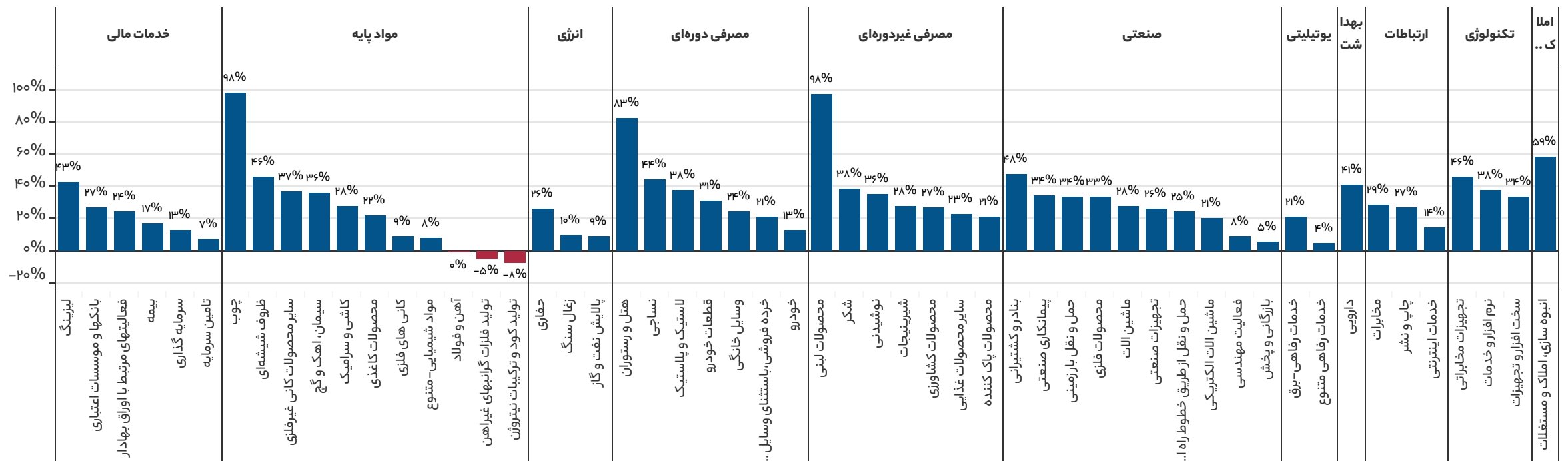
بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



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

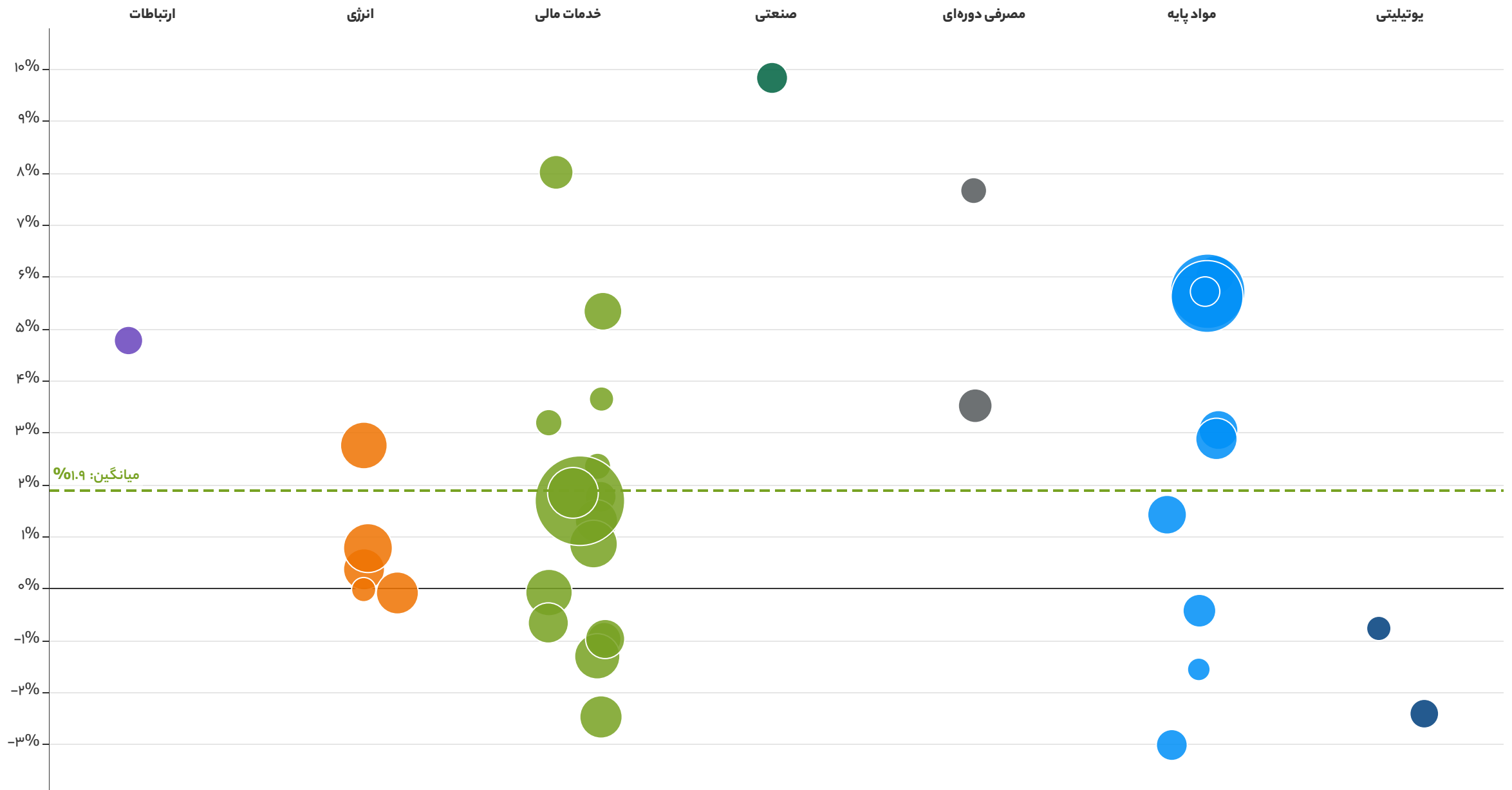


(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده)





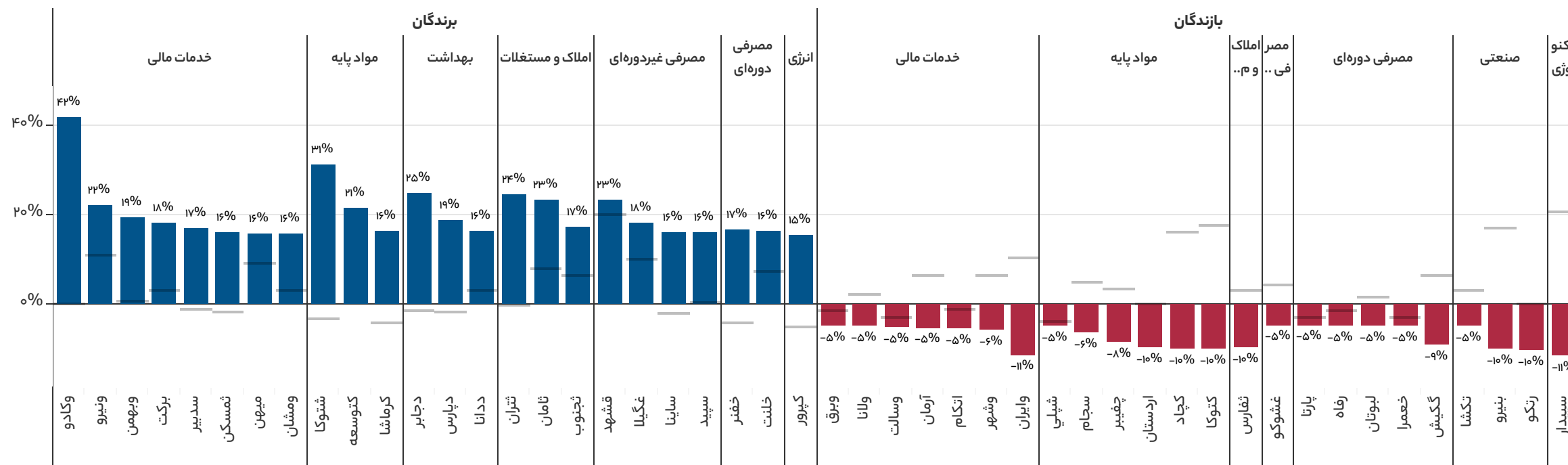
به تفکیک سکتور، بازده تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم



نوع	تغییر درصدی
بوعلی	-۳.۰%
وغدیر	-۲.۵%
مبین	-۲.۴%
ونملت	-۱.۳%
وپاسار	-۱.۰%
پارسان	-۱.۰%
پیاس	-۰.۶%
شیدیس	-۰.۴%
پارس	-۰.۱%
تاپیکو	-۰.۱%
شتران	+۰.۴%
شینا	+۰.۸%
میدکو	+۰.۹%
وامید	+۱.۳%
آریا	+۱.۴%
فارس	+۱.۷%
وسندوق	+۱.۸%
شستا	+۱.۹%
وتجارت	+۲.۴%
شبندر	+۲.۸%
مارون	+۲.۹%
نوری	+۳.۱%
خودرو	+۳.۵%
اخبر	+۴.۸%
ومعادن	+۵.۴%
قملي	+۵.۶%
فخوز	+۵.۷%
فولاد	+۵.۷%
کهر	+۶.۱%
خسپا	+۷.۷%
حکشی	+۸.۰%
رشنا	+۹.۹%
بازده هفته گذشته	

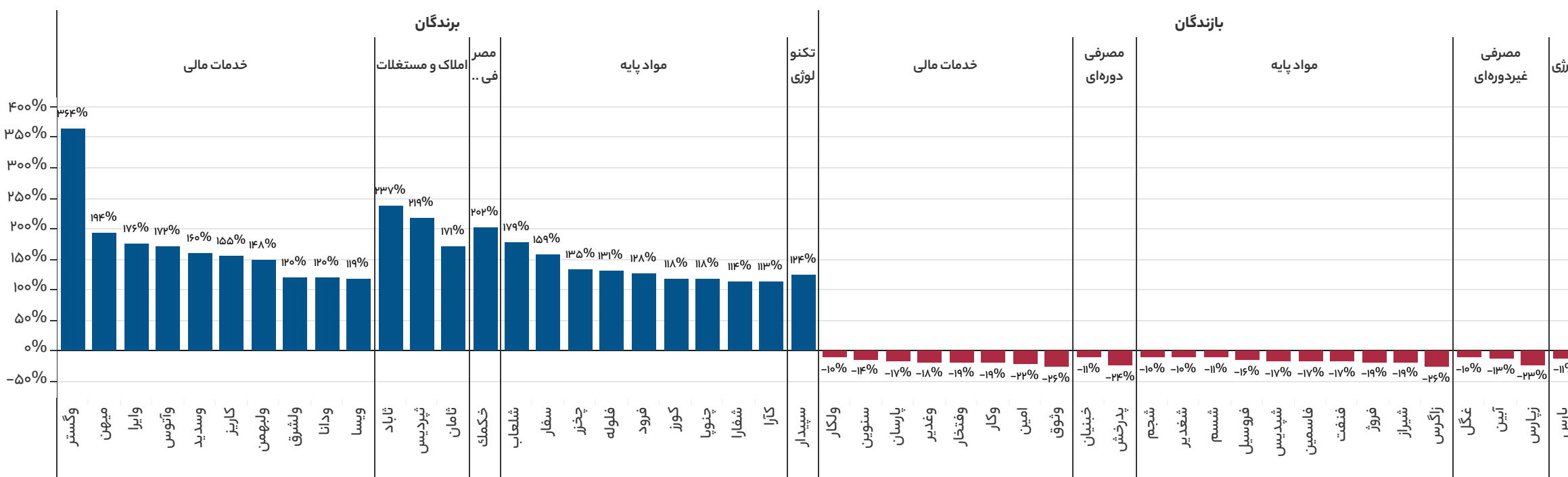
برندگان و بازندگان هفته

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



برندگان و بازندگان سال

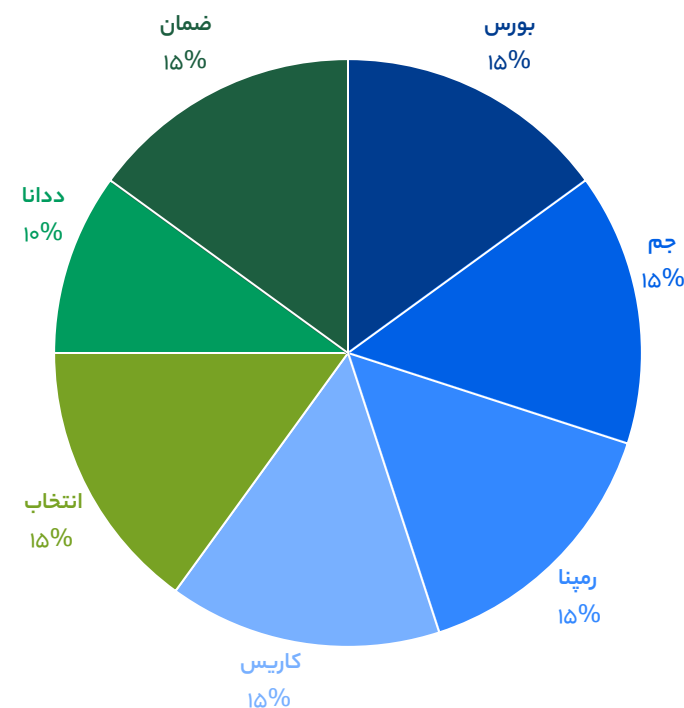
(پیر یازده‌ترین و کم یازده‌ترین نمادها از ابتدای سال)، تفکیک شده بر اساس سکتور، یازده تعدیل شده، همراه با یازده هفته گذشته)





سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۵%	۳۱,۸۰۰	انتظار افزایش نرخ و پتانسیل افزایش مقدار تولید و سود زیر مجموعه‌ها	۴۲۰۰۰	انتخاب	میان مدت
۱۰%	۵۶,۱۰۰	پتانسیل افزایش نرخ، پتانسیل بهره‌برداری از طرح سوم در ماه‌های آتی	۶۲۰۰۰	ددانا	
۱۵%	۱۴,۰۷۴	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵۷,۱۹۰	احتمال افزایش حاشیه سود و بهبود تقاضای محصولات شرکت	۷۸۰۰۰	جم	بلند مدت
۱۵%	۱۴,۲۰۰	ارزش جایگزینی بالای نیروگاهی و احتمال افزایش نرخ برق، وضعیت ارزش مناسب، عرضه اولیه شرکت زیرمجموعه	۱۹۰۰۰	رمپنا	
۱۵%	۷,۶۲۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۹۰۰۰	بورس	
۱۵%	۲۳,۳۷۲	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریز	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS



بورس - 1D - شرکت شاخص

2



محدوده ۲,۱۶۵,۰۰۰ الی ۲,۱۷۵,۰۰۰ واحد، محدوده مهم حمایتی شاخص کل است. در صورت عدم حمایت در این محدوده انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی ۲,۱۰۰,۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



محدوده ۷۵۷،۰۰۰ الی ۷۷۵،۰۰۰ واحد، محدوده حمایتی مهم شاخص هم وزن می باشد. در صورت از دست رفتن این محدوده انتظار می رود اصلاح تا حوالی ۷۲۰،۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد. انتظار می رود اصلاح تا حوالی ۷۰۳،۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



محدوده قیمتی ۵۰،۵۰۰ الی ۵۱،۲۰۰ تومان محدوده مقاومتی دلار است که باید دید واکنش نسبت به این محدوده چطور خواهد بود. همچنین مهم‌ترین حمایت دلار در محدوده ۴۹،۳۰۰ تومان است. در صورت شکستن حمایت مذکور، انتظار می‌رود اصلاح دلار تا اعداد ۴۴،۰۰۰ تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



طلا 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



مواد پایه

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	الفین	شگویا	۱۲	۳۸.۵	۱۶,۰۷۰	۹۱%	۱,۴۴۸	۲,۱۶۴	-	+۴۹%	۶.۸	
		جم پیلن	۱۲	۳۴.۴	۱۷۲,۰۰۰	۱۰۰%	۲۱,۰۹۴	۳۲,۰۱۱	-	+۵۲%	۵.۴	
		شغذیر	۱۲	۹.۰	۶۹,۱۰۰	۹۰%	۸,۶۶۰	۱۴,۰۳۳	-	+۶۲%	۴.۴	
		شبصیر	۱۲	۷.۶	۳۰,۲۰۰	۹۰%	۳,۷۶۰	۴,۹۵۲	-	+۳۲%	۵.۴	
		شجم	۶	۵.۲	۷,۹۷۰	۹۱%	۸۷۶	۲,۰۵۶	-	+۱۳۵%	۳.۹	
	اوره	شیراز	۱۲	۴۲.۲	۲۷,۵۶۰	۳۴%	۷,۶۲۰	۵,۷۱۷	-	-۲۵%	۴.۴	
		خراسان	۱۲	۲۸.۰	۱۵۶,۳۰۰	۷۹%	۲۸,۱۰۴	۱۹,۴۰۴	-	-۳۱%	۸.۱	
		کرماش	۱۲	۲۴.۳	۶۸,۹۴۰	۵۱%	۱۳,۱۹۹	۱۰,۲۱۵	-	-۲۳%	۶.۱	
		آروماتیک	بوعلی	۱۲	۷۲.۹	۵۰,۸۱۰	۹۶%	۵,۴۴۸	۸,۲۲۸	-	+۵۱%	۵.۶
	متانول	شخارک	۱۲	۲۸.۱	۴۶,۹۰۰	۱۰۰%	۶,۴۱۲	۱۱,۶۸۱	-	+۸۲%	۴.۰	
		شفن	۱۲	۱۹.۴	۶,۲۸۰	۹۹%	۱,۰۲۶	۸۶۲	-	-۱۶%	۶.۱	
	دوده صنعتی	شصدف	۱۲	۳.۴	۴۸,۲۰۰	۷۰%	۳,۸۲۳	۱۴,۰۳۳	-	+۲۶۷%	۵.۶	
شکرین		۱۲	۳.۰	۴,۷۴۲	۸۷%	۶۳۹	۲,۱۶۴	-	+۲۳۹%	۷.۷		
شدوص		۱۲	۱.۷	۱۷,۵۰۰	۹۳%	۱,۹۲۷	۲,۷۴۸	-	+۴۳%	۶.۴		
بسته بندی و ظروف	ظروف شیشه ای	کرازی	۱۲	۵.۳	۱,۸۳۳	۲۷%	۲۲۴	۳۱۸	-	+۴۲%	۵.۶	
		کهمدا	۳	۴.۳	۵,۷۵۰	۱۹%	۴۹۷	۶۸۹	۱,۰۶۸	+۳۸%	۸.۳	۵.۶
		کگاز	۱۲	۳.۰	۳۵,۳۵۰	۶۴%	۱,۴۰۰	۴,۱۳۷	-	+۱۹۵%	۸.۳	



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (م.م.ه)	قیمت	تقسیم سود	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	۱۴۰۲ (میانگین)	۱۴۰۳ (میانگین)	رشد سود ۱۴۰۲	نسبت P/E با سود ۱۴۰۲	نسبت P/E با سود ۱۴۰۳
										نسبت به ۱۴۰۱		
فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۷۱.۲	۵,۸۹۰	۵۹%	۶۸۴	۱,۰۳۱	-	+۵۱%	۵.۳	
		فولاد	۱۲	۴۳.۱	۱۷,۹۵۰	۹۱%	۱,۷۲۵	۳,۷۶۶	-	+۱۱۸%	۴.۴	
		کاوه	۱۲	۳۴.۰	۱۰,۶۱۰	۷۸%	۱,۰۵۶	۲,۲۴۴	-	+۱۱۳%	۴.۴	
		ارفع	۱۲	۳۱.۶	۲۶,۳۰۰	۷۱%	۳,۱۱۷	۴,۱۵۶	-	+۳۳%	۶.۳	
	محصولات فلزی	کوبیر	۱۲	۱۵.۲	۴,۰۷۹	۱۵%	۴۴۱	۶۳۹	-	+۴۵%	۶.۳	
	سرب و روی	فنوال	۱۲	۴.۷	۱۳,۸۹۰	۵۴%	۸۷۳	۹۵۴	-	+۹%	۱۴.۱	
		کیمیا	۱۲	۲.۴	۷,۹۲۰	۳۹%	۱,۲۶۵	۱,۶۰۹	-	+۲۷%	۴.۶	
		فتوسا	۱۲	۱.۴	۹,۷۰۰	۱۷%	۱,۴۴۳	۲,۲۳۳	-	+۵۵%	۴.۲	
		مصالح ساختمانی	ساوه	۱۲	۹.۴	۱۴۴,۵۰۰	۹۶%	۱۵,۸۳۸	۲۰,۱۳۴	-	+۲۷%	۷.۲
	سآبیک		۱۲	۶.۹	۲۳,۴۸۰	۹۰%	۲,۴۹۵	۳,۶۱۸	-	+۴۵%	۶.۵	
سیمان، آهک و گچ	ساروج		۹	۵.۰	۳۷,۲۰۰	۱۱۹%	۳,۴۵۴	۴,۶۸۳	۸,۹۹۸	+۳۶%	۷.۹	۴.۱
ساروم	۱۲		۴.۹	۴۹,۲۹۰	۹۵%	۵,۵۴۳	۶,۹۷۵	-	+۲۶%	۷.۱		
سصوفي	۱۲		۳.۴	۳۱,۱۸۰	۸۶%	۳,۶۸۵	۶,۷۴۷	-	+۸۳%	۴.۶		
سقاين	۱۲		۲.۴	۹۵,۸۱۰	۹۹%	۵,۹۵۳	۹,۵۰۹	-	+۶۰%	۱۰.۱		
سایر محصولات کانی غیرفلزی	کفرا	۱۲	۲.۵	۱۲,۴۵۰	۱۰%	۶۶۴	۴,۱۳۷	-	+۵۲۳%	۶.۰		



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 (ت.م.ه)		سال مالی		نماد		فعالیت		گروه صنعتی	
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	فلزات و معادن	۱۴۰۳	۴.۶	۷.۳	+۳۳%	۵,۸۴۹	۳,۶۹۷	۲,۷۷۷	۶۲%	۲۷,۰۵۰	۵۰.۰	۶	وکغذیر															
			۱۴۰۲	۶.۳	-۳۰%	۳,۶۴۵	۱,۷۶۰	۲,۵۰۲	۴۴%	۲۲,۲۵۰	۱۷.۸	۳	واحیا																
		تامین سرمایه	۱۴۰۳	۱۱.۴	+۲۴%	-	۵۸۲	۴۷۱	۹۹%	۶,۶۶۰	۱۲.۰	۶	امین																
			۱۴۰۲	۴.۸	+۱۷%	-	۸۸۵	۷۵۸	۱۰۰%	۴,۲۴۹	۱۰.۴	۱۲	تنوین																
		چند رشته‌ای	۱۴۰۳	۵.۹	+۹%	-	۹۵۱	۸۷۵	۸۴%	۵,۵۹۰	۱۳.۱	۹	وسپه																
			۱۴۰۲	۲۵.۲	+۲۵۲%	-	۵۴۸	۱۵۶	۲۵%	۷,۶۲۰	۱۲	۱۲	بورس																
بهداشت	بهداشت	دارویی	۱۴۰۳	۶.۶	+۱۶%	-	۵,۲۱۱	۴,۴۸۵	۹۴%	۳۸,۳۰۰	۶.۹	۱۲	دتوزیع																
			۱۴۰۲	۸.۱	+۲۶%	-	۵,۱۳۸	۴,۰۶۳	۹۳%	۴۱,۵۰۰	۶.۶	۱۲	هجرت																
			۱۴۰۳	۷.۶	+۲۹%	-	۴,۹۱۰	۳,۸۱۲	۹۲%	۴۰,۵۷۰	۵.۷	۱۲	دفرا																
			۱۴۰۲	۶.۹	+۱۲%	-	۳,۰۰۰	۲,۶۷۳	۹۵%	۲۳,۰۹۰	۴.۲	۱۲	دابور																
			۱۴۰۳	۷.۲	+۶%	-	۶,۸۹۱	۶,۵۳۱	۹۸%	۵۶,۰۰۰	۴.۰	۱۲	دتماد																
			۱۴۰۲	۸.۴	+۲۱%	-	۱,۲۷۸	۱,۰۵۴	۵۲%	۱۰,۷۷۰	۳.۹	۱۲	دسبحان																
			۱۴۰۳	۵.۳	+۳۴%	-	۲,۸۶۵	۲,۱۳۲	۹۸%	۱۷,۳۴۰	۳.۶	۱۲	درازک																
			۱۴۰۲	۸.۱	-	-	۲,۳۴۴	۲,۳۴۰	۹۷%	۲۱,۲۰۰	۳.۰	۱۲	کاسپین																
			۱۴۰۳	۷.۷	+۱۵%	-	۱۰,۵۷۹	۹,۲۰۷	۹۴%	۸۱,۰۵۰	۲.۴	۱۲	دکپسول																
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	روانکار	۱۴۰۳	۵.۳	+۶۱%	-	۱,۷۳۱	۱,۰۷۶	۹۰%	۱۰,۱۵۰	۲۰.۳	۱۲	شنفت																
		زغال سنگ	۱۴۰۳	۳.۴	+۱۳۳%	-	۶,۱۵۶	۲,۶۴۷	۱۰۰%	۲۳,۸۰۰	۸.۳	۱۲	کزغال																
			۱۴۰۲	۵.۰	+۱۰۹%	-	۴,۱۲۳	۱,۹۷۶	۶۵%	۲۱,۷۳۰	۱.۷	۱۲	کطیس																
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	۱۴۰۳	۲۶.۲	+۲%	-	۳,۱۶۵	۳,۱۰۷	۹۶%	۸۳,۰۰۰	۵.۸	۱۲	سپیدار																
		۱۴۰۲	۱۴.۰	+۳۳%	-	۳,۳۸۱	۲,۵۴۷	۹۲%	۴۹,۵۵۰	۱.۷	۱۲	رافزا																	



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 P/E با سود	نسبت P/E با سود
										نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۲	۱۴۰۳
مصرفی غیردورهای	روغن خوراکی	غکورش	۱۲	۲۰.۳	۱۶,۹۱۰	۸۷%	۲,۰۵۵	۱,۳۶۴	-	-۳۴%	۱۱.۱	۵.۴
		غبشهر	۹	۱۲.۳	۴,۱۶۷	۳۱%	۳۸۹	۴۲۹	۸۶۱	+۱۰%	۹.۷	۱۴.۱
		غمارگ	۹	۱.۸	۱,۹۱۱	۱۰%	-۷۷۲	-۷۸	۱۴۲	+۹۰%	-۲۴.۴	
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۵.۵	۱۵,۵۰۰	۷۶%	۱,۶۱۰	۲,۱۵۲	-	+۳۴%	۶.۶	
		غپینو	۱۲	۴.۲	۴,۷۲۰	۶۰%	۴۸۵	۶۶۶	-	+۳۷%	۷.۱	
		غسالم	۱۲	۲.۸	۶,۲۰۰	۵۲%	۶۵۱	۷۸۱	-	+۲۰%	۷.۵	
		غمینو	۱۲	۱.۸	۱۱,۹۴۰	۷۰%	۱,۴۹۴	۱,۷۵۸	-	+۱۸%	۶.۸	
	غذا و نوشیدنی	سیمرخ	۹	۳.۶	۲۸,۰۰۰	۲۱%	۳,۹۱۴	۴,۹۵۱	۹,۴۹۶	+۲۶%	۵.۷	۳.۳
		زفکا	۱۲	۳.۰	۲۰,۱۹۰	۸۹%	۱,۵۴۶	۲,۹۹۲	-	+۹۳%	۶.۳	
		زدشت	۱۲	۲.۳	۳۲,۹۵۰	۷۹%	۲,۱۲۰	۲,۷۶۴	-	+۳۰%	۱۱.۳	
		تلیسه	۱۲	۲.۳	۴,۵۱۰	۸۶%	۲۵۲	۴۳۸	-	+۷۴%	۹.۸	
		زقیام	۱۲	۲.۱	۳,۰۲۰	۸۲%	۲۸۸	۵۶۰	-	+۹۴%	۵.۰	
		زگلدشت	۱۲	۱.۷	۲۴,۵۰۰	۹۸%	۹۵۸	۱,۹۳۵	-	+۱۰۲%	۱۲.۲	
		زملارد	۱۲	۱.۷	۲۰,۹۰۰	۹۸%	۳۲۷	۱,۴۲۶	-	+۳۳۷%	۱۴.۷	
		زشریف	۹	۱.۶	۶,۶۷۰	۸۰%	۴۸۱	۶۱۴	۸۷۸	+۲۸%	۱۰.۹	۸.۲
		زببنا	۱۲	۱.۵	۴,۱۹۸	۶۲%	۴۰۲	۶۷۲	-	+۶۷%	۵.۹	
		زکشت	۱۲	۱.۳	۲۱,۵۰۰	۷۰%	۲,۵۲۹	۲,۸۲۹	-	+۱۲%	۷.۰	
		زمگسا	۱۲	۱.۲	۴۰,۵۰۰	۹۹%	۳,۲۶۴	۴,۳۸۸	-	+۳۴%	۸.۵	
		زشگزا	۱۲	۱.۰	۱۰,۱۶۰	۵۷%	۷۸۲	۱,۹۳۴	-	+۱۴۷%	۵.۰	
	غذای بسته‌بندی شده	غزر	۱۲	۷.۸	۴,۳۴۴	۱۳%	۴۵۱	۵۹۲	-	+۳۱%	۷.۲	
		غمهرا	۱۲	۲.۴	۱۲,۶۷۰	۱۰%	۱,۰۱۰	۱,۷۳۵	-	+۷۲%	۷.۲	
	محصولات لبنی	غگلپا	۱۲	۲.۲	۶۰,۱۵۰	۵۲%	۴,۶۵۰	۴,۹۸۹	-	+۷%	۱۲.۱	
		غفارس	۱۲	۲.۱	۱۸,۴۰۰	۴۰%	۱,۰۱۰	۱,۳۶۷	-	+۳۵%	۱۳.۵	
		غگلستا	۱۲	۱.۷	۲۶,۹۰۰	۴۹%	۱,۵۶۲	۲,۱۳۵	-	+۳۷%	۱۲.۶	
		غشان	۱۲	۱.۶	۹,۰۶۰	۸۸%	۷۹۵	۷۹۶	-	-	۱۰.۵	
	نوشیدنی	غبهنوش	۱۲	۳.۶	۹۹,۰۰۰	۲۵%	۱,۱۰۳	۵,۳۰۰	-	+۳۸۰%	۱۸.۶	
		غدیس	۱۲	۱.۹	۱۶,۳۵۰	۵۷%	۱,۴۶۶	۱,۸۵۳	-	+۲۶%	۸.۴	



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 P/E با سود	نسبت P/E با سود
										نسبت به ۱۴۰۱	۱۴۰۲	۱۴۰۳
مصرفی دوره‌ای	کالای مصرفی با دوام	انتخاب	۹	۳۱۰.۸	۳۱,۸۰۰	۹۰%	۳,۲۲۳	۵,۱۷۷	-	+۶۱%	۶.۱	
			۹	۴۰.۷	۷,۲۵۰	۵۲%	۲۴۷	۹۱۴	-	+۲۷۱%	۷.۹	
	خودرو و قطعات	پتایر	۱۲	۴۰.۱	۳,۱۴۰	۶۴%	۱۱۲	۱۳۹	-	+۲۴%	۲۲.۲	
		پیزد	۱۲	۳۰.۰	۱۴,۹۵۰	۷۲%	۶۱۲	۷۰۲	-	+۱۵%	۲۰.۷	
		پاسا	۱۲	۳۰.۰	۱۵,۸۸۰	۱۹%	۱,۳۶۰	۱,۸۳۵	-	+۳۵%	۸.۵	
صنعتی	ترابری	حکهر	۱۲	۷.۳	۱۶,۳۳۰	۱۰%	۱,۴۹۹	۲,۲۴۵	-	+۵۰%	۷.۲	
		توریل	۱۲	۵.۰	۷,۰۹۰	۵۲%	۴۳۰	۶۸۵	-	+۵۹%	۱۰.۳	
		چپارسا	۶	۱.۸	۷۱,۹۰۰	۹۰%	۶,۳۱۲	۸,۸۴۹	۱۱,۹۲۳	+۴۰%	۸.۱	۵.۸
	بنادر و کشتیرانی	حسینا	۱۲	۴۰.۷	۱۹,۰۱۰	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

