

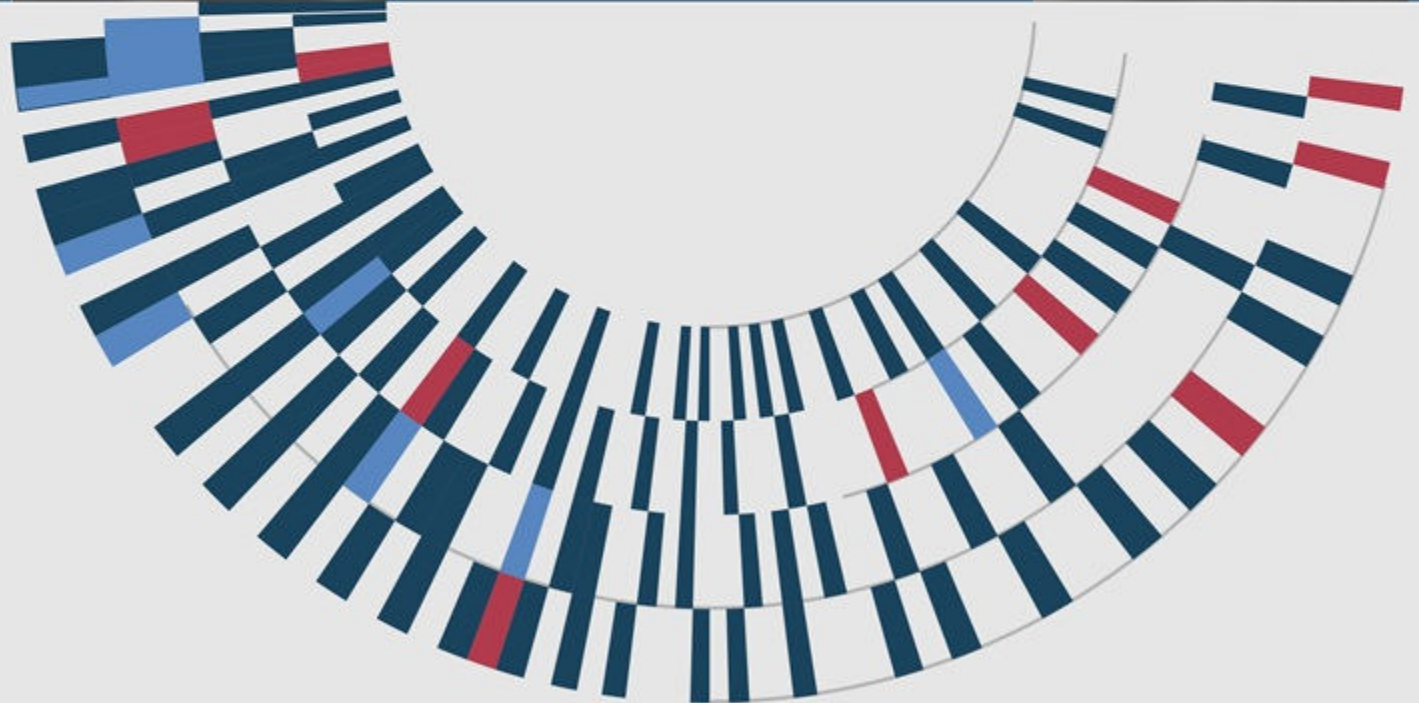
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۱۶ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۲۴

 CHARISMA





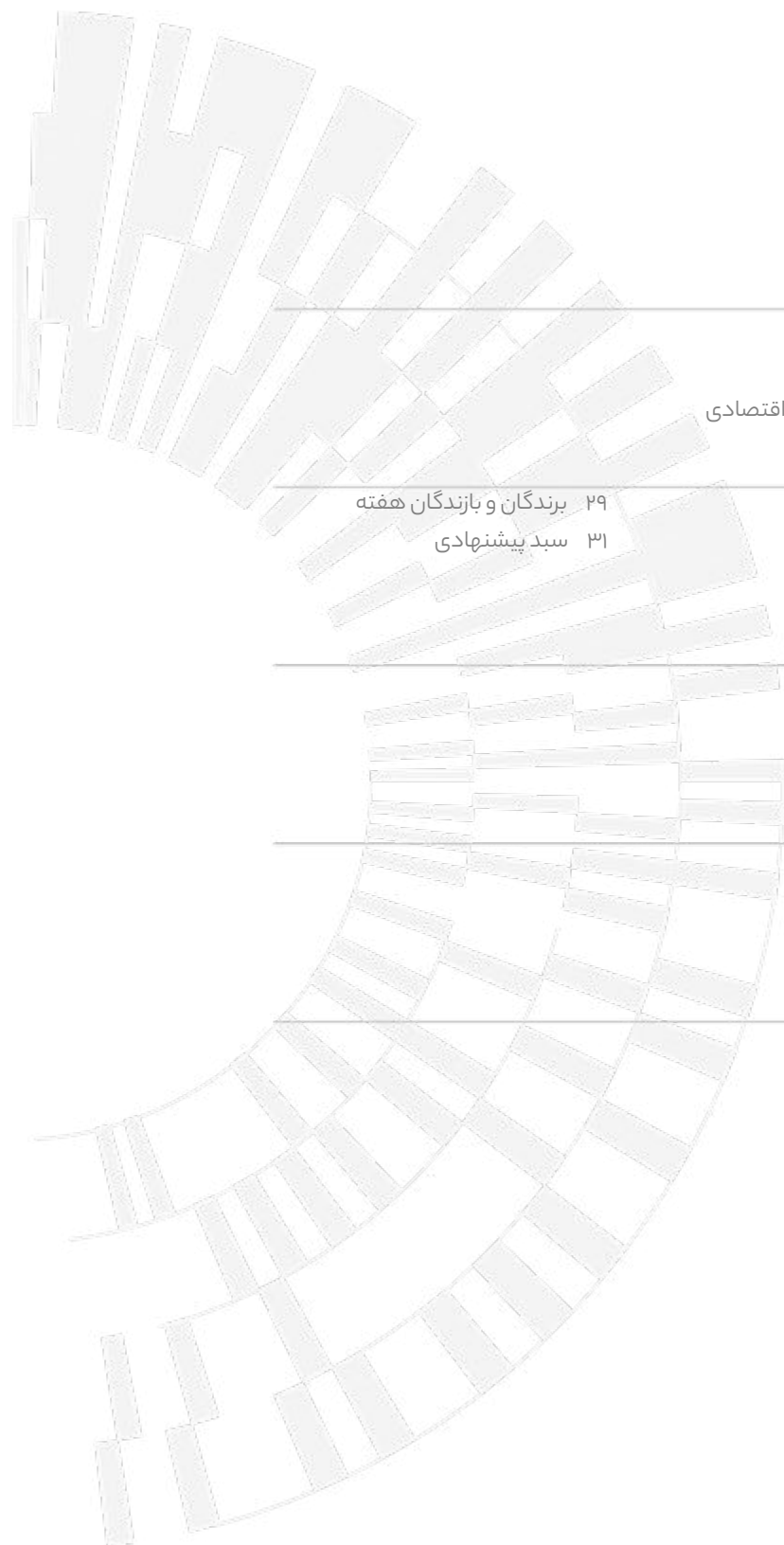
معرفی گزارش:

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 هفته 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	۴۳ 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	رند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۲۴	۰.۳%	فزر	-	۲,۰۱۷ ۱,۶۴۳	۱۷%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۴۱۰	۲.۲%	فملی	بموتو، فباهنر	۹,۳۴۱ ۷,۴۴۹	۱۳%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۹۹	۰.۹%	فایرا	فنوال	۲,۴۲۴ ۲,۰۷۱	۰%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۱۲	۲.۹%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۳,۴۴۴ ۲,۳۰۳	-۱۷%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۲۶۳	۱.۶%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۲۷۳ ۱,۸۵۲	۲۲%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۷۱	-۰.۹%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۸۴۳ ۲,۶۹۷	۷۳%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۷۳	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۶۲۵ ۲,۱۵۸	۶۲%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۸۰	-۴.۰%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۶۲۳ ۴۳۱	-۶%
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۱۳۵	-۴.۹%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۲۲,۸۲۱ ۱۲,۸۸۲	۵۶%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۳	-۱.۵%	فولاد، فخور، هرمز	-	۶۷۰ ۴۲۰	۷%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	۲.۷%	فولاد، فخور، هرمز	-	۲۲,۰۸۰ ۱۱,۹۰۰	۶۴%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۵	-	ذوب، کوپر	فولای	۷۵۵ ۵۵۸	-۱۵%
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۲۰۰	-۰.۳%	ذوب، کوپر	فولای	۲۴,۷۴۷ ۱۴,۱۹۰	۵۶%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۷۰	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۷۸۰ ۵۲۵	۷%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۵۵	-	فولاد	-	۸۶۰ ۶۱۵	-1%

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
اوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۴۰۰	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرمانشا	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۸۵	۳.۳%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۶۵	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۹۳	۱.۲%	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۹	۰.۶%	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۸۵	۰.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۹۱	۲.۷%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۶۰	۲.۱%	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۵	۲.۴%	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۹	۰.۸%	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۱۵۸	۶.۱%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۳۵	۲.۳%	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۶۸	۵.۷%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۷	۳.۷%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۸,۳۵۵	۱.۵%	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۰	۷.۱%	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۵۰	-۱.۲%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۳۰	-۰.۴%	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

	روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته		آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۴.۰%		۹۴	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۴.۳%		۹۱	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۲.۹%		۱۱۴۲	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۳.۰%		۱۳۳	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور
					شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۱۶,۶۲۰	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران
					شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-۶.۶%		۲۷,۹۳۸	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان
محصولات کشاورزی					-		شپاس		۶.۳%		۱۵,۷۴۶	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر - نفت پاسارگاد
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		-۱.۶%		۱۸۷	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		-۱.۳%		۸۱۹	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام
					-		-		۲.۱%		۱,۵۸۰	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
ارز و ارز دیجیتال					-		-		۱.۴%		۲۲۲	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
					-		-		-۰.۳%		۱.۰۷	-	بازار فارکس	یورو به دلار
					-		-		-۰.۶%		۱.۲۴	-	بازار فارکس	پوند به دلار
					-		-		۱.۹%		۲۶,۳۴۲	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	۱.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۸	-۶۶%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	۰.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۵۳%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	۸.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۲.۲۳	-۸۲%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۰	۶.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۶۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۳	۶.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۹۵	-۷۵%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



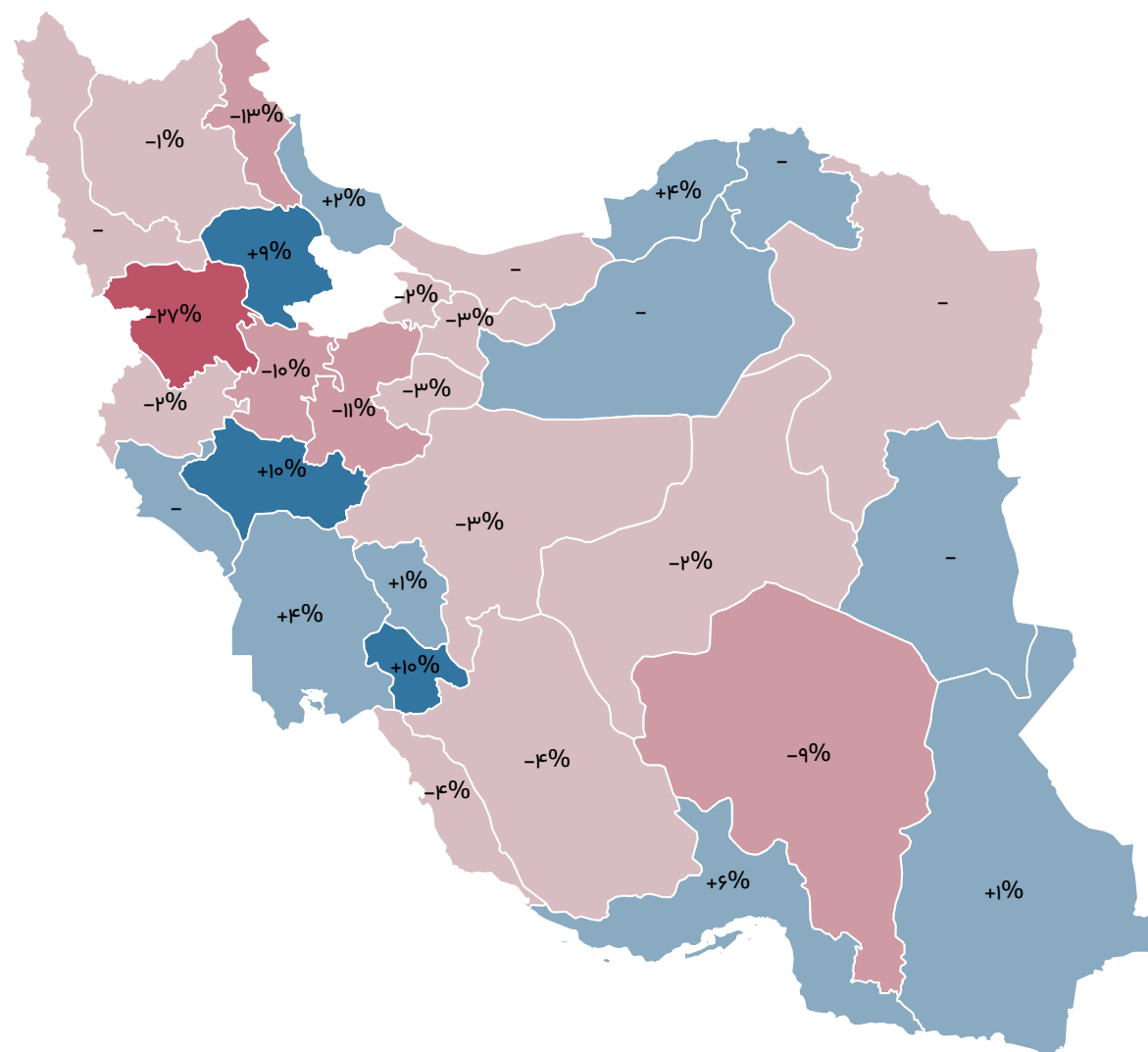
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس حجم معاملات

منطقه	استان	واحد	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	تومان/کیلو	۹۵۷	۹۳۳	-۳%
	اصفهان	تومان/کیلو	۹۶۱	۹۳۲	-۳%
	البرز	تومان/کیلو	۹۵۶	۹۴۰	-۲%
	مرکزی	تومان/کیلو	۱,۲۰۴	۱,۰۶۸	-۱۱%
	قم	تومان/کیلو	۱,۰۶۷	۱,۰۳۷	-۳%
	یزد	تومان/کیلو	۷۲۹	۷۱۸	-۲%
جنوب	سمنان	تومان/کیلو	۸۱۲	۸۱۵	+۰%
	فارس	تومان/کیلو	۱,۰۴۲	۱,۰۰۱	-۴%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۱,۰۵۷	۱,۱۱۹	+۶%
غرب	بوشهر	تومان/کیلو	۱,۰۵۱	۱,۰۱۰	-۴%
	همدان	تومان/کیلو	۱,۰۷۳	۹۶۹	-۱۰%
	خوزستان	تومان/کیلو	۹۳۳	۹۶۷	+۴%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۸۹۵	۹۰۴	+۱%
	ایلام	تومان/کیلو	۷۰۶	۷۰۶	+۰%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۹۱۶	۸۹۴	-۲%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۸۷۶	۹۶۵	+۱۰%
	کردستان	تومان/کیلو	۱,۴۶۴	۱,۰۶۵	-۲۷%
	لرستان	تومان/کیلو	۹۹۱	۱,۰۸۵	+۱۰%
	مازندران	تومان/کیلو	۸۸۶	۸۸۴	+۰%
شمال	گیلان	تومان/کیلو	۶۹۶	۷۰۹	+۲%
	گلستان	تومان/کیلو	۸۲۶	۸۶۱	+۴%
شمال غرب	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۸۸۲	۸۷۹	+۰%
	اردبیل	تومان/کیلو	۱,۲۳۱	۱,۰۷۵	-۱۳%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۱,۰۶۸	۱,۰۵۹	-۱%
شمال شرق	زنجان	تومان/کیلو	۸۸۴	۹۶۶	+۹%
	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۱۴۶	۱,۰۴۸	-۹%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۸۰۳	۸۱۵	+۱%

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 قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (براساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.



به گزارش رویترز، انتشار آمار اقتصادی بهتر از حد انتظار چین روند رشد در این کشور را تقویت کرده و ارزش دلار را در برابر یوان پایین آورده است. بدین ترتیب ارزش طلا در مقایسه با دلار افزایش یافته است. البته احتمال ادامه روند افزایش نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا همچنان سرمایه‌گذاران را وادار می‌کند محتاطانه عمل کنند. قیمت طلا در روز پنجشنبه تا سطح ۱۹۰۰ دلار پایین آمده بود یعنی پایین‌ترین رقم از بیست و سوم ماه اوت. شاخص قیمت تولید کننده آمریکا در ماه گذشته بیشترین افزایش را طی یک سال گذشته تجربه کرده و خرده فروشی هم بیشتر از حد انتظار بوده است که می‌توان آن را نتیجه افزایش قیمت بنزین دانست. همچنین دورنمای طولانی‌تر شدن روند افزایش نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا تمایل برای خرید طلا را پایین آورده است. بانک مرکزی اروپا هم نرخ بهره را تا رکورد ۴ درصد در روز پنجشنبه افزایش داده، اما اعلام کرده این احتمالاً این آخرین افزایش نرخ بهره خواهد بود.



قیمت نفت به دلیل پیش بینی اوپک و آمریکا در مورد کاهش بیشتر عرضه طی ماه‌های آینده، به بالاترین رقم طی ۱۰ ماه گذشته رسیده است. به دنبال افزایش قیمت گازوئیل در آمریکا و نگرانی در مورد عرضه در بازار که ناشی از تمدید کاهش عرضه عربستان و روسیه، قیمت نفت در معاملات بازارهای جهانی افزایش یافت و به بالاترین رقم ۹ ماه گذشته رسیده است. از طرف دیگر، مختل شدن تولید نفت لیبی به خاطر طوفان، عرضه نفت در بازار را در کوتاه مدت محدودتر می‌کند. قزاقستان هم اعلام کرده تولید روزانه خود را به خاطر فصل تعمیرات پایین می‌آورد.



به گزارش رویترز، آژانس بین‌المللی انرژی در گزارش ماهانه خود اعلام کرد، کاهش تولیدی که عربستان و روسیه تا پایان سال ۲۰۲۳ تمدید کردند به معنای کسری قابل توجه بازار در زمستان خواهد بود زیرا این نهاد بین‌المللی تا حد زیادی به برآوردهای خود در مورد رشد تقاضا در سال جاری و سال آینده پایبند مانده است. اوپک و هم‌پیمانانش موسوم به اوپک پلاس، از سال ۲۰۲۲ برای تقویت بازار، محدود کردن عرضه را شروع کردند. پس از اینکه عربستان و روسیه در ماه جاری میلادی، کاهش ۱.۳ میلیون بشکه‌ای خود را تا پایان سال ۲۰۲۳ تمدید کردند، قیمت نفت خام برنت برای اولین بار در سال جاری از ۹۰ دلار در هر بشکه عبور کرد. هم‌آژانس بین‌المللی انرژی و هم اوپک در گزارش ماهانه خود در مورد تقاضا در چین در سال ۲۰۲۳ خوش بین هستند و تقاضا برای نفت در جهان طی امسال و سال آینده را تغییر نداده‌اند. آژانس بین‌المللی انرژی برآورد کرد، تقاضا برای نفت در سال ۲۰۲۳ روزانه ۲.۲ میلیون بشکه افزایش یابد در حالی که برآورد اوپک افزایش ۲.۴۴ میلیون بشکه‌ای در روز بوده است.



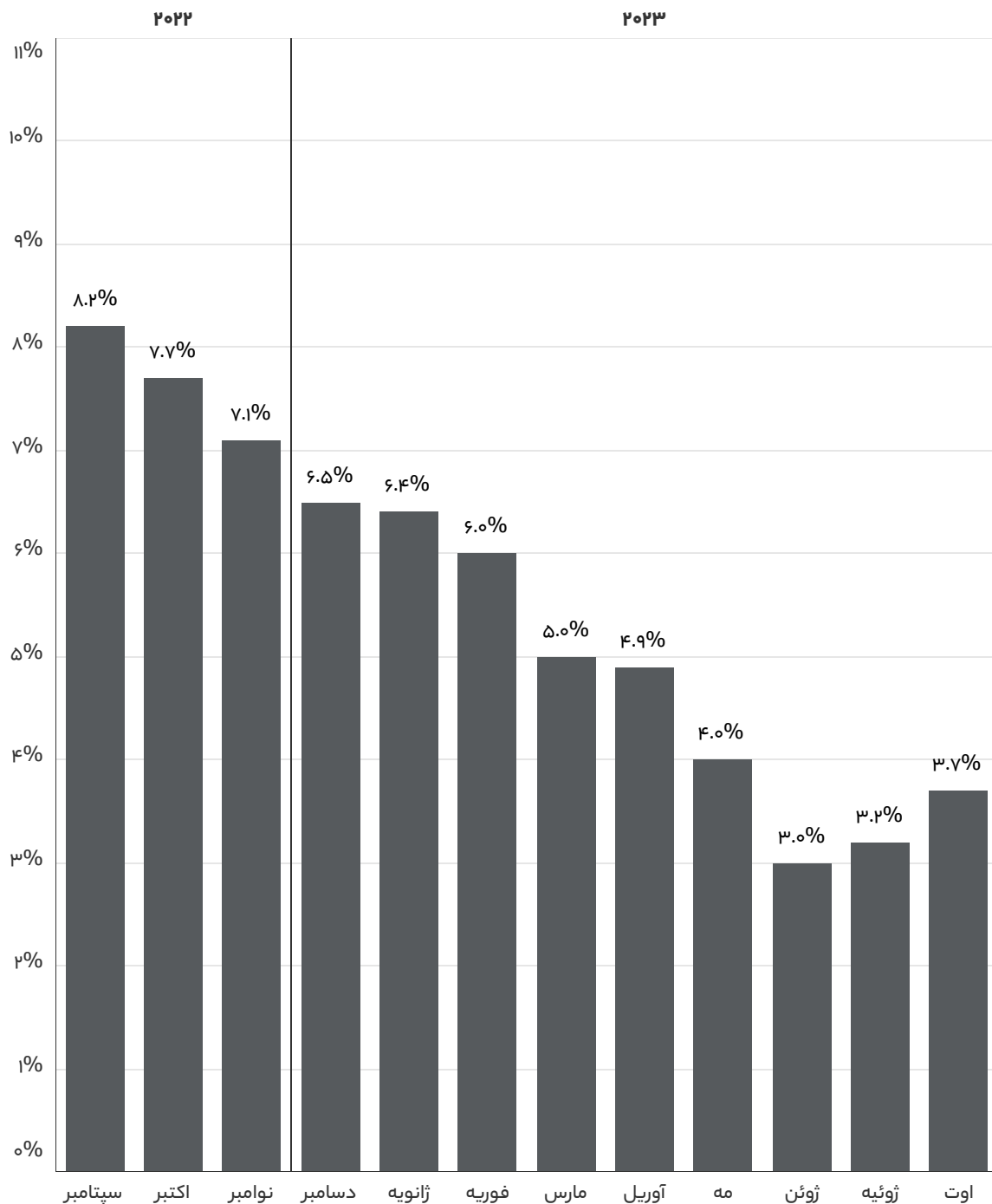
به گزارش اوپل پرایس قیمت بنزین در آمریکا در بالاترین سطح تابستانه طی یک دهه گذشته قرار دارد. این افزایش قیمت در حالی است که فصل تعطیلات تابستانی رو به پایان است و معمولاً قیمت بنزین در این زمان از سال رو به کاهش است. متوسط قیمت بنزین در آمریکا در حال حاضر به ۳.۸۳ دلار در هر گالن رسیده است یعنی بالاتر از ۳.۷۶ دلاری که در تابستان سال گذشته میلادی معامله می‌شد. دلیل اصلی افزایش قیمت بنزین در آمریکا را می‌توان تقاضای بالا و توقف فعالیت برخی از پالایشگاه‌ها دانست. کمبود عرضه نفت در بازار هم قیمت نفت خام را بالا برده است. پالایشگاه دلتا با ظرفیت تولید ۱۸۵ هزار بشکه در روز و پالایشگاه ایروینگ با ظرفیت ۳۲۰ هزار بشکه در روز در سپتامبر و بخشی از ماه اکتبر تعطیل خواهند بود که حدود ۹ درصد از تولید سوخت منطقه را تحت تاثیر قرار می‌دهد. بالا رفتن قیمت بنزین تنها بخشی از چالش‌های مصرف کنندگان انرژی در آمریکا است. گرمای بی‌سابقه هوا در تابستان مصرف برق را هم در این کشور افزایش داده و حالا آن‌ها با افزایش شدید صورتحساب برق خود مواجه هستند.



مدیرعامل شرکت ملی پخش فرآورده‌های نفتی از شکسته شدن رکورد مصرف روزانه بنزین با ثبت رقم مصرف ۱۳۷ میلیون لیتر بنزین، همزمان با افزایش تردهای بین‌شهری در روزهای پایانی تابستان خبر داد. میانگین مصرف بنزین در شهریور امسال ۱۲۲ میلیون لیتر است که در مقایسه با مدت مشابه سال گذشته، حدود ۱۲ درصد و برابر ۱۳ میلیون لیتر در روز افزایش یافته است. مدیرعامل شرکت ملی پخش فرآورده‌های نفتی گفت: تمامی بخش‌ها از کارکنان، پیمانکاران و رانندگان نفتکش‌های جاده‌پیما همگی در وضعیت آماده باش برای عرضه مناسب سوخت در روزهای پایانی تابستان هستند.

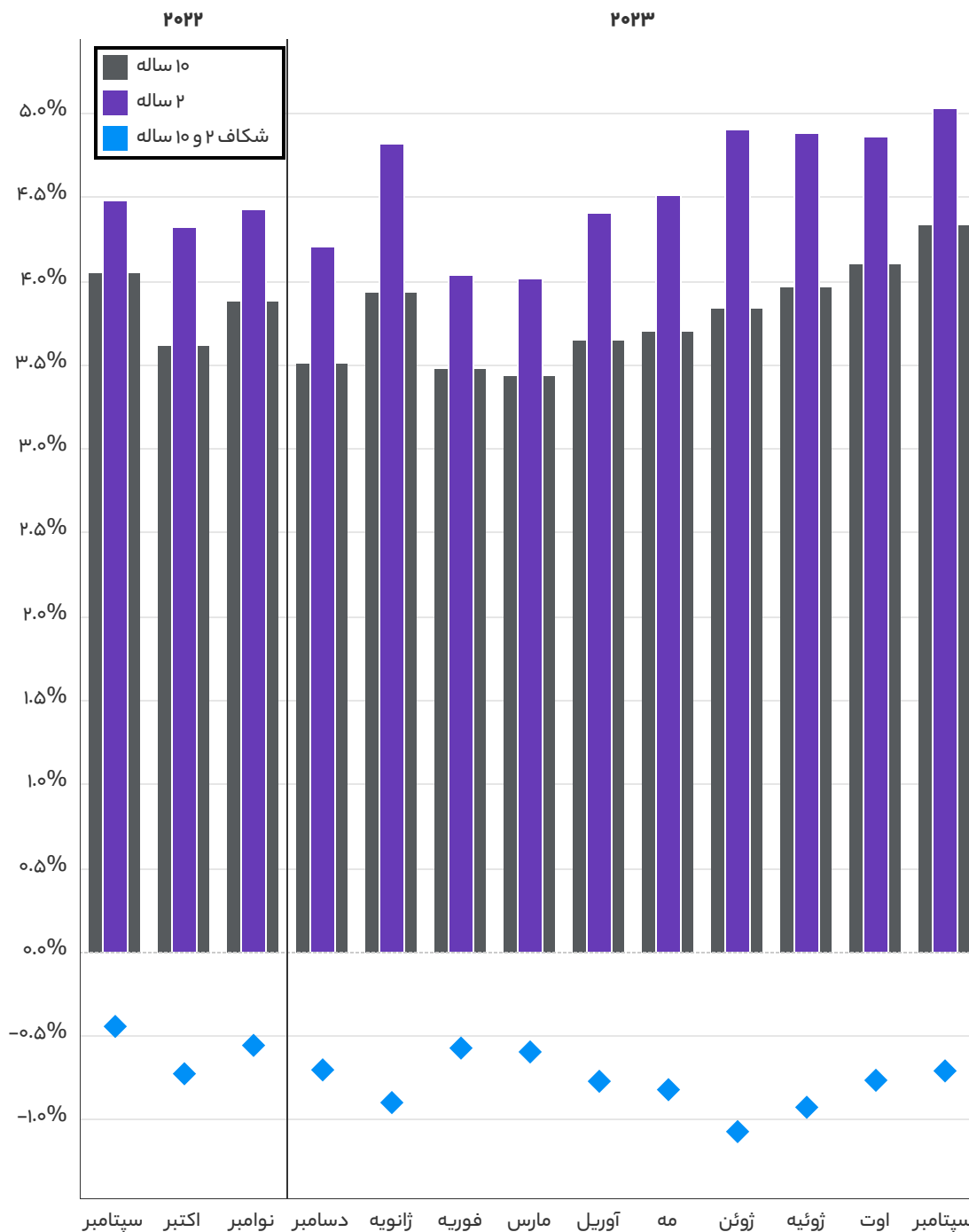
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



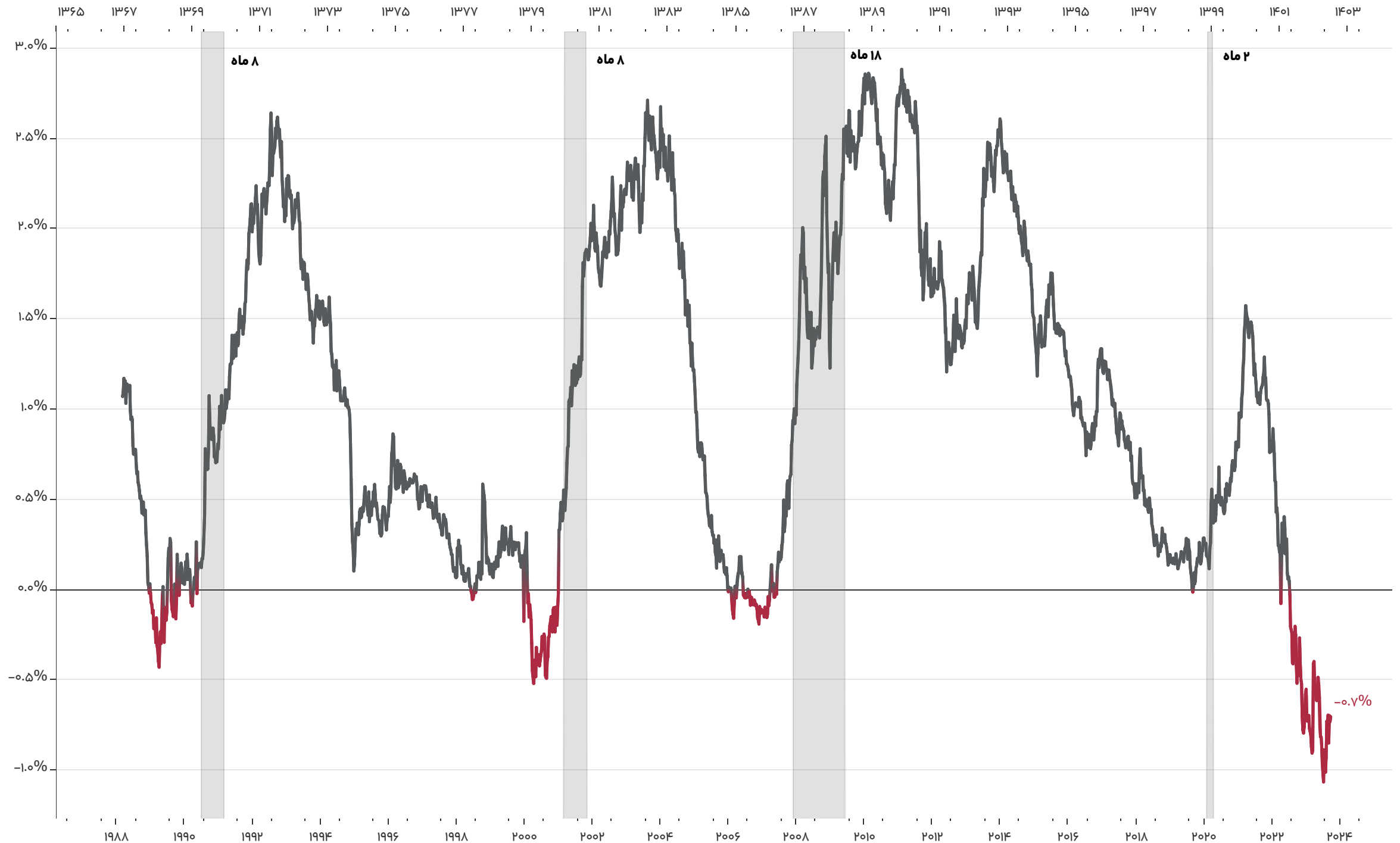
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

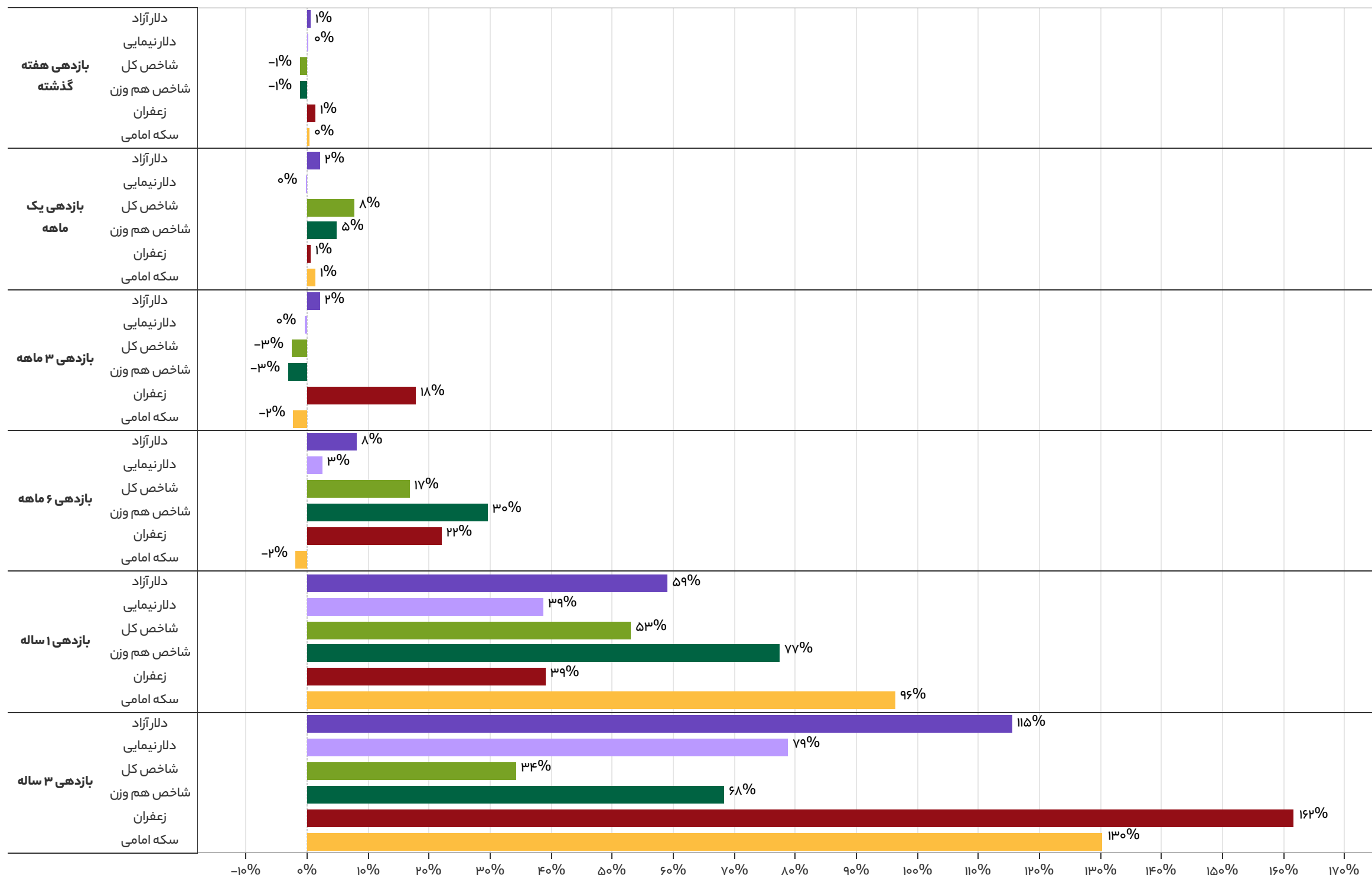
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها 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
۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۳	هم وزن	سکه امامی
مسکن ▲ ۳.۳%	هم وزن ▲ ۳۰.۰%	شاخص کل ▲ ۲۷.۹%	سکه امامی ▲ ۲۲.۲%	سکه امامی ▲ ۲۶.۵%	سکه امامی ▲ ۱۴.۷%	سکه امامی ▲ ۸.۹%	سکه امامی ▲ ۴.۴%	دلار آزاد ▲ ۸.۰%	مسکن ▲ ۲.۵%	زعفران ▲ ۹.۶%	سکه امامی ▲ ۱۰.۰%	هم وزن ۴۳%	سکه امامی ▲ ۱۱۱.۰%
دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	هم وزن ▲ ۲۲.۸%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	هم وزن ▲ ۱۸.۱%	دلار آزاد ▲ ۱۲.۰%	دلار آزاد ▲ ۸.۲%	دلار آزاد ▲ ۳.۱%	سکه امامی ▲ ۵.۷%	دلار نیمایی ▲ ۲.۴%	مسکن ▲ ۵.۸%	مسکن ▲ ۸.۴%	شاخص کل ۳۹%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%
سکه امامی ▲ ۲.۶%	دلار نیمایی ▲ ۱۰.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱۸.۷%	زعفران ▲ ۱۴.۵%	شاخص کل ▲ ۱۲.۹%	هم وزن ▲ ۱۰.۲%	شاخص کل ▲ ۷.۶%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	دلار نیمایی ▲ ۴.۶%	زعفران ▲ ۵.۸%	سکه امامی ۳۸%	هم وزن ▲ ۸۲.۵%
دلار آزاد ▲ ۲.۴%	دلار آزاد ▲ ۳.۷%	سکه امامی ▲ ۱۶.۶%	مسکن ▲ ۳.۳%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	شاخص کل ▲ ۶.۲%	مسکن ▲ ۶.۸%	دلار نیمایی ▲ ۱.۲%	مسکن ▲ ۱.۱%	هم وزن ▼ ۱.۶%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	دلار آزاد ▲ ۴.۸%	زعفران ۲۶%	دلار آزاد ▲ ۶۸.۰%
درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	زعفران ▲ ۳.۱%	هم وزن ▲ ۶.۷%	مسکن ▲ ۱.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱.۰%	شاخص کل ▼ ۳.۲%	دلار آزاد ▲ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	دلار آزاد ۲۱%	شاخص کل ▲ ۴۸.۲%
مسکن ▲ ۴۵.۳%	زعفران ▲ ۱.۶%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ▼ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	مسکن ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	زعفران ▲ ۰.۰%	هم وزن ▼ ۰.۴%	دلار آزاد ▼ ۷.۹%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	دلار نیمایی ۱۹%	مسکن ▲ ۴۵.۳%
مسکن ۸%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%	هم وزن ▲ ۰.۵%	زعفران ▼ ۰.۱%	زعفران ▲ ۰.۸%	شاخص کل ▼ ۹.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱.۳%	دلار نیمایی ▲ ۲.۷%	شاخص کل ▼ ۳.۴%	سکه امامی ▼ ۸.۴%	سکه امامی ▼ ۴.۴%	شاخص کل ▼ ۲.۵%	مسکن ۸%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%
درآمد ثابت ۱%	زعفران ▲ ۲.۸%	شاخص کل ▼ ۲.۰%	سکه امامی ▼ ۶.۳%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	هم وزن ▼ ۹.۴%	زعفران ▲ ۱.۰%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▼ ۲.۳%	زعفران ▼ ۱۴.۵%	هم وزن ▼ ۴.۶%	هم وزن ▼ ۳.۸%	درآمد ثابت ۱%	زعفران ▲ ۲.۸%

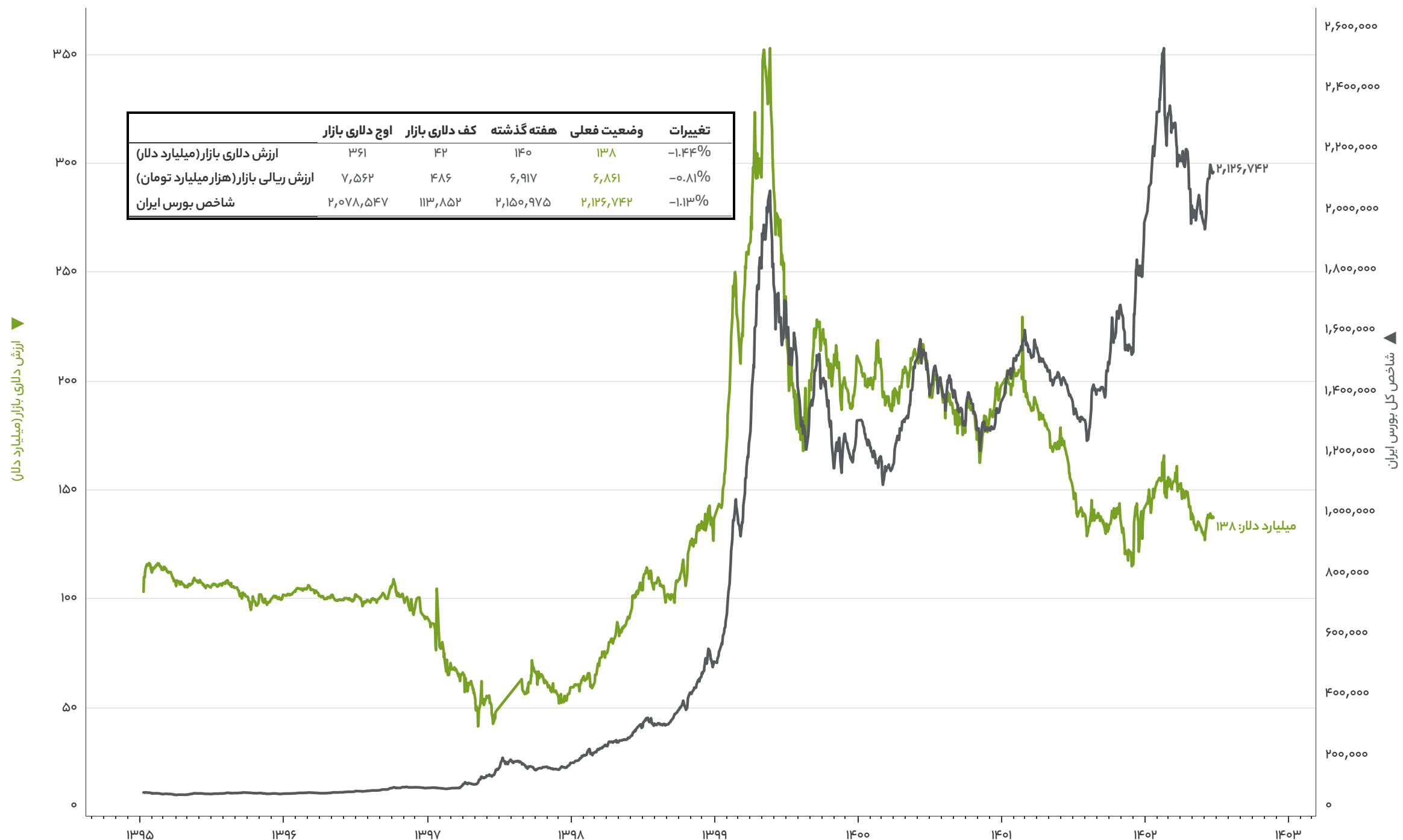
– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر ماه محاسبه شده و اوراهی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

– 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.

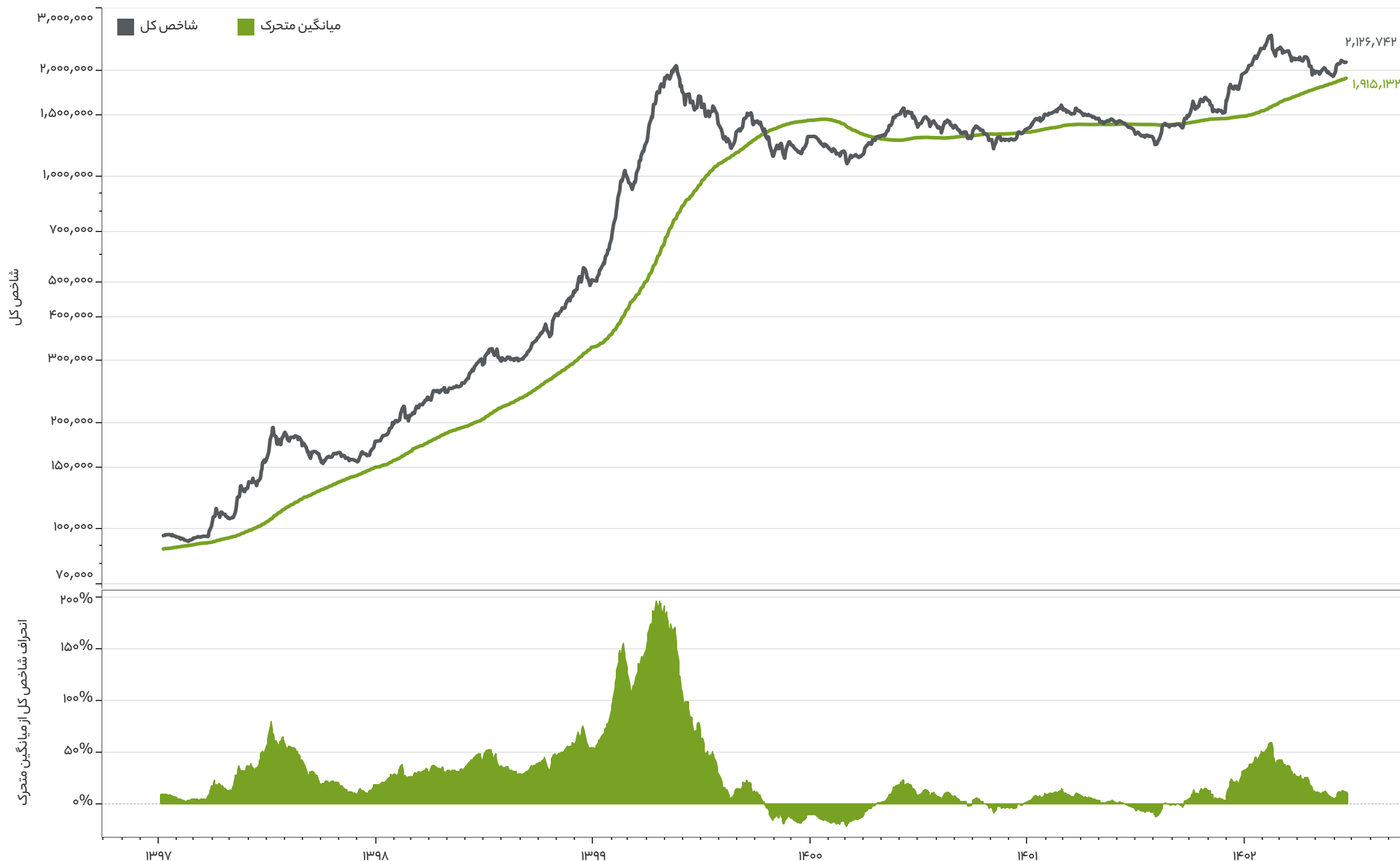
ارزش دلاری بازار

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



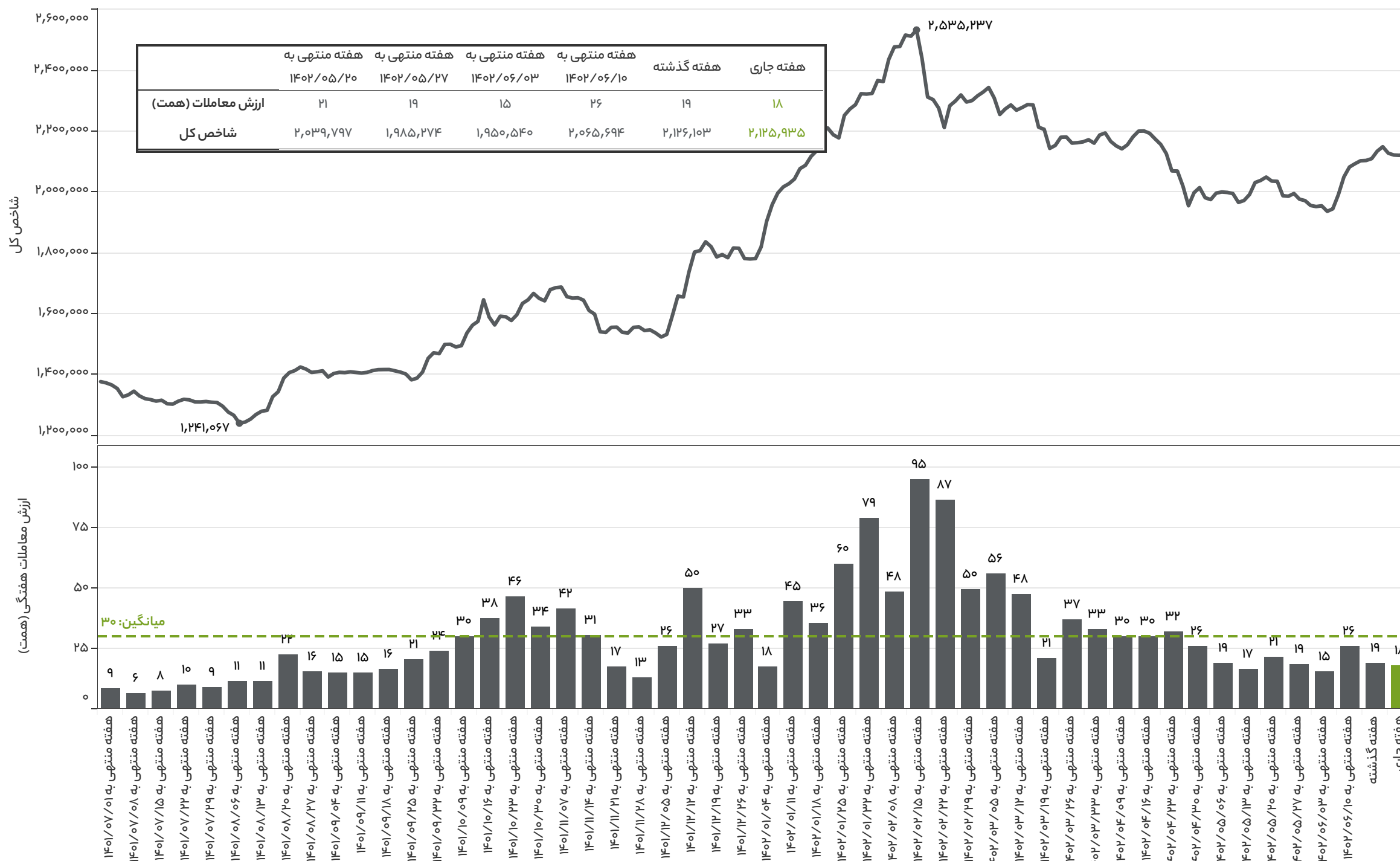
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



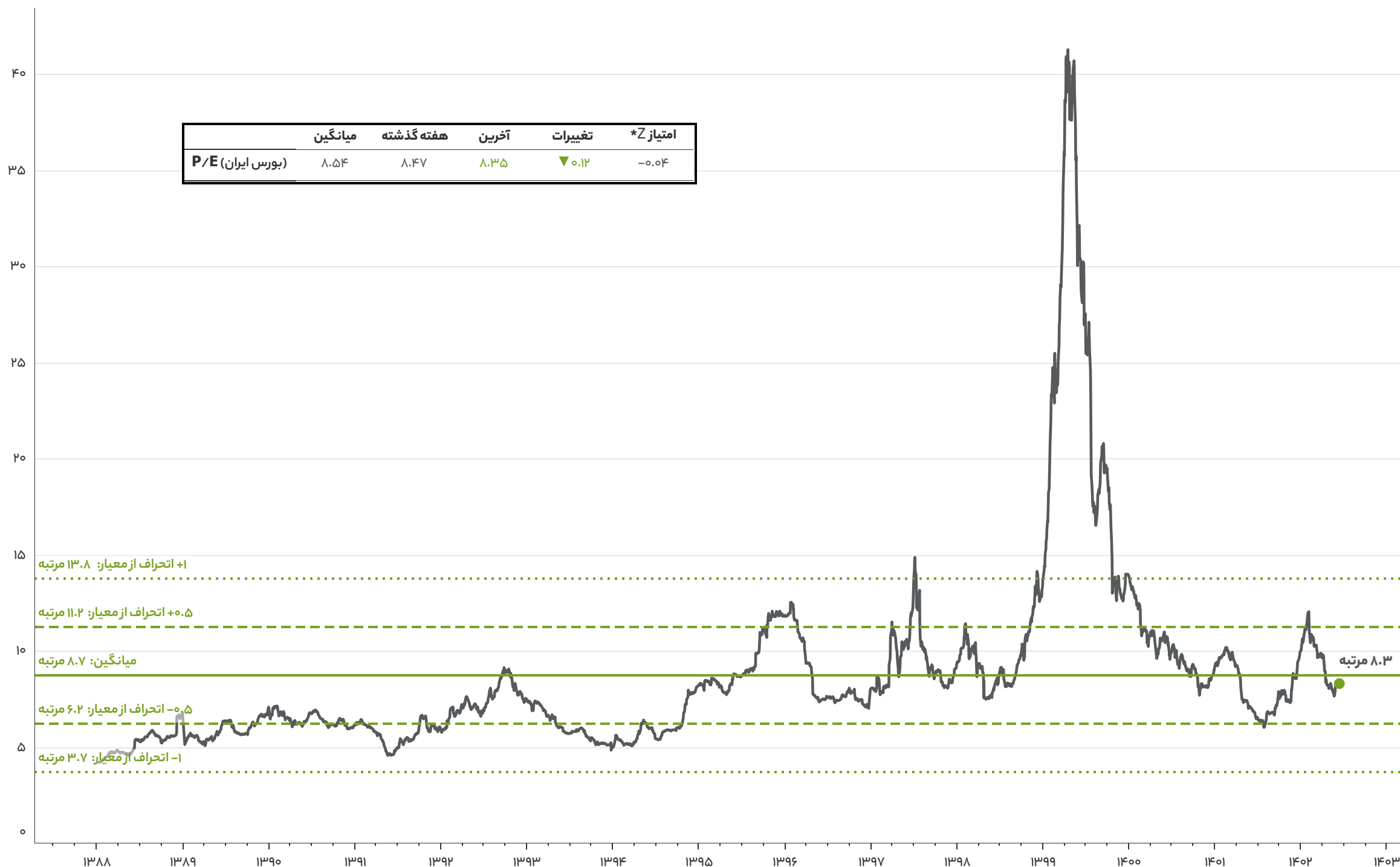
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

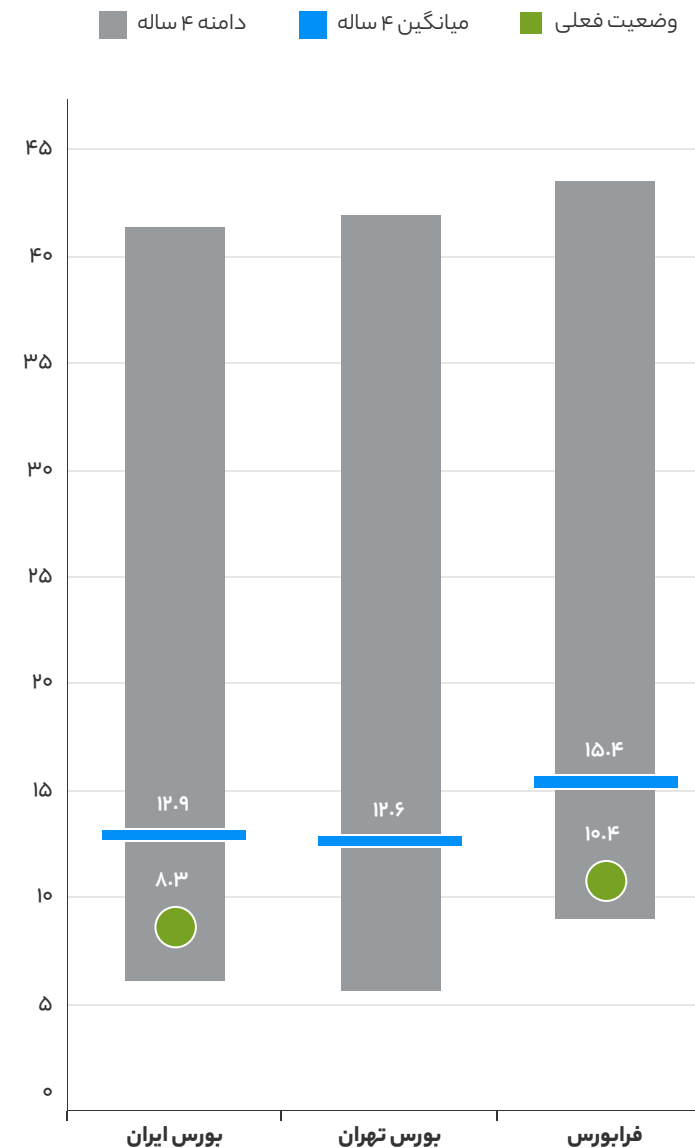
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۸.۳۵	۸.۴۷	۶.۰۷	۱۲.۹۲	۴۱.۳۳
بورس تهران			۵.۶۴	۱۲.۶۴	۴۱.۹۹
فرابورس	۱۵.۴۳	۱۵.۶۰	۹.۰۳	۱۵.۳۸	۴۳.۵۱

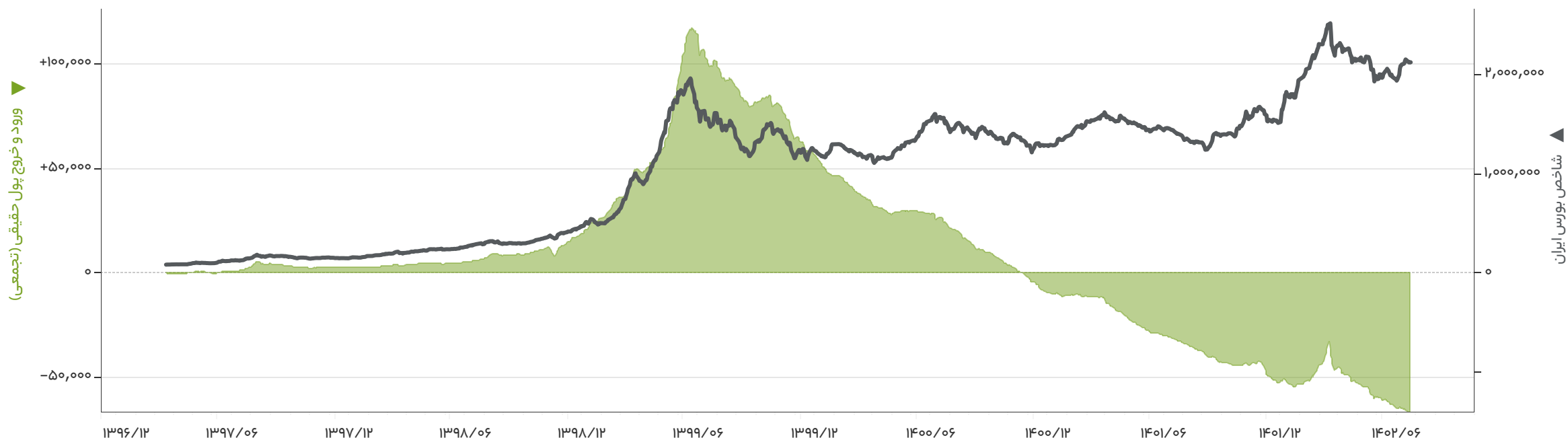


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	خدمات مالی	مواد پایه	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۵	۱۹	۴۱	۶۳	۸۹	۶۵	۶	۱۹۹	۱۸۹	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۴۵	۹۱	۱۱۲	۱۱۵	۱۶۰	۱۹۰	۲۲۱	۳۸۴	۶۷۴	۳,۱۲۴	۳,۳۰۲	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۵%	۱.۱%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۶%	۴.۶%	۸.۰%	۳۷.۱%	۳۹.۲%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۵	۶.۳	۱۱.۶	۲۱.۳	۹.۴	۱۰.۵	۱۲.۲	۵.۸	۵.۹	۷.۸	۸.۵	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۵%	۴۰.۰%	۴.۰%	۲.۶%	۶.۵%	۵.۴%	۴.۶%	۲.۴%	۱۹.۸%	۷.۸%	۱۲.۳%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۵%	۳۶%	۵۴%	۳۳%	۶۳%	۶۰%	۷۲%	
بتا به شاخص کل	۰.۸	۱.۰	۱.۴	۰.۷	۰.۸	۱.۱	۰.۸	۱.۰	۱.۲	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۴۹۹%	+۸۵۸%	+۱۲۷%	+۲۸۳%	+۳۹۵%	+۳۷۳%	+۴۵۰%	+۸۵۳%	+۸۷۱%	+۸۴۵%	+۹۲۸%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۷%	+۱۳۴%	-۶۴%	-۱%	+۱۸%	-۱۹%	+۳%	-۱۴%	+۲۶%	-۱%	+۶۱%	
بازده از ابتدای سال	+۱۶۸%	+۵۴%	+۴۶%	+۶۴%	+۹۷%	+۸۴%	+۶۲%	+۹۲%	+۱۰۶%	+۶۴%	+۷۸%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۱%	۱%	-۳%	۰%	۰%	-۲%	-۱%	-۲%	-۱%	-۲%	-۱%	

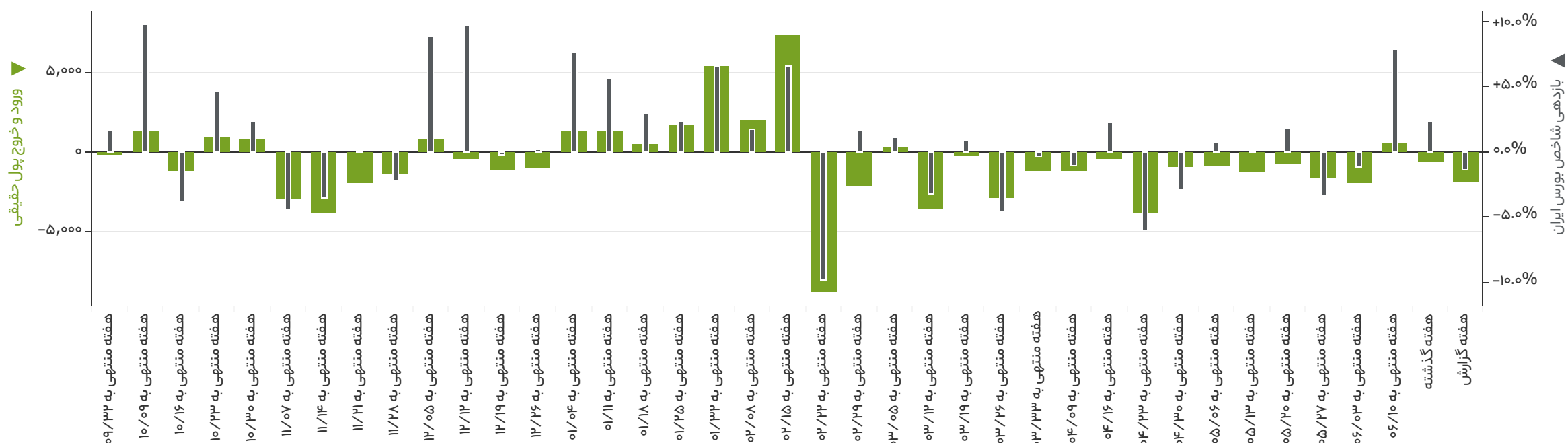
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



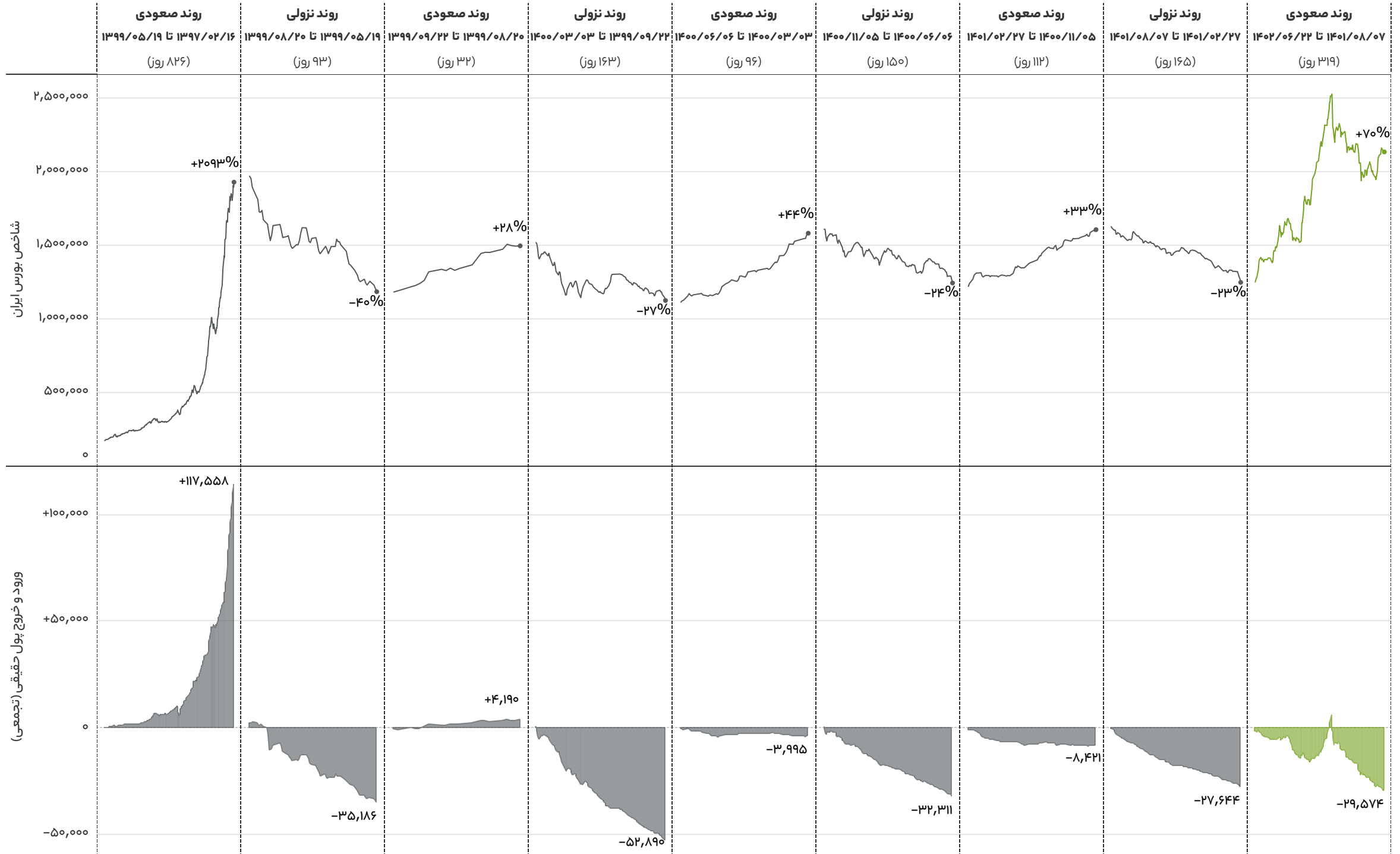
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

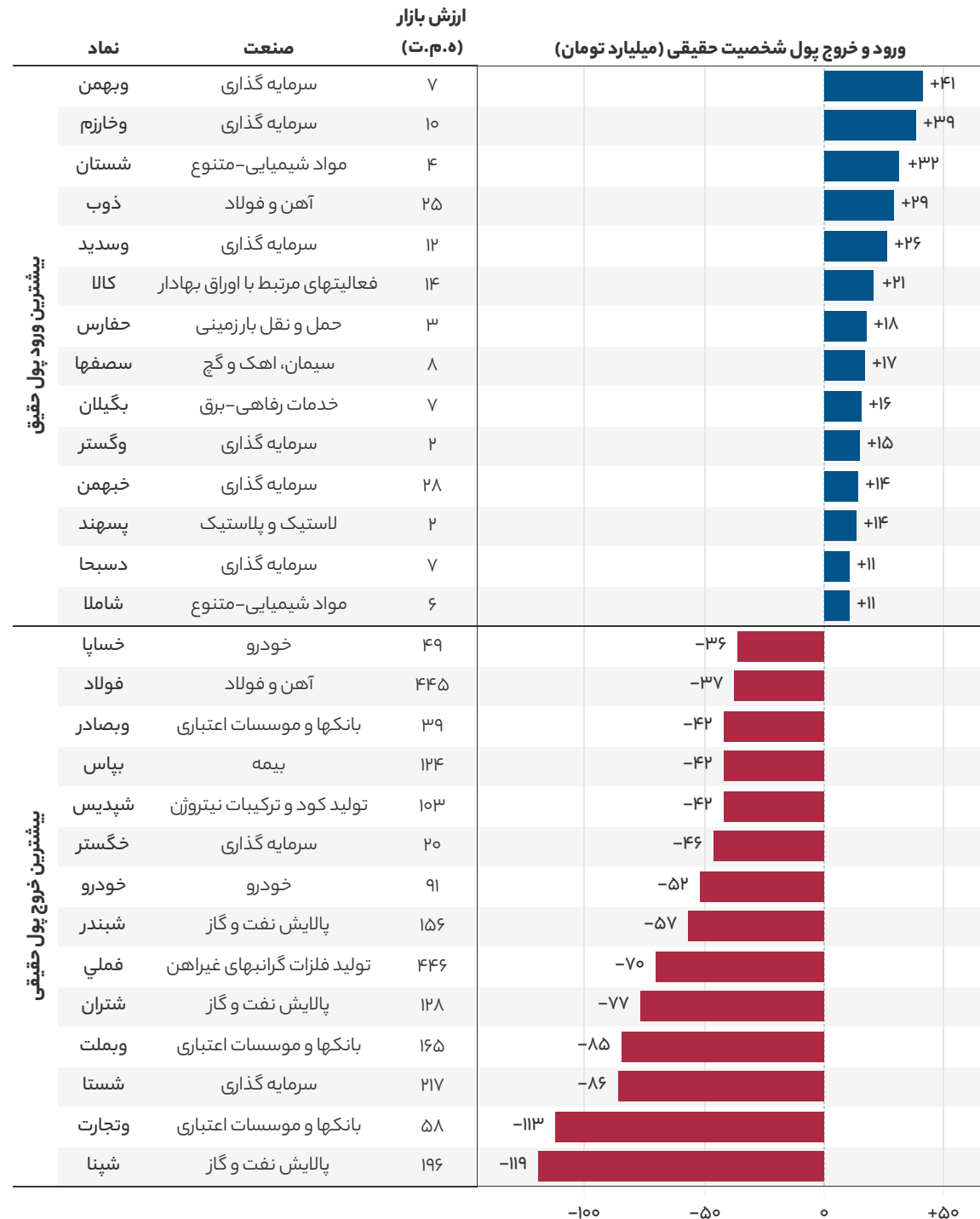
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

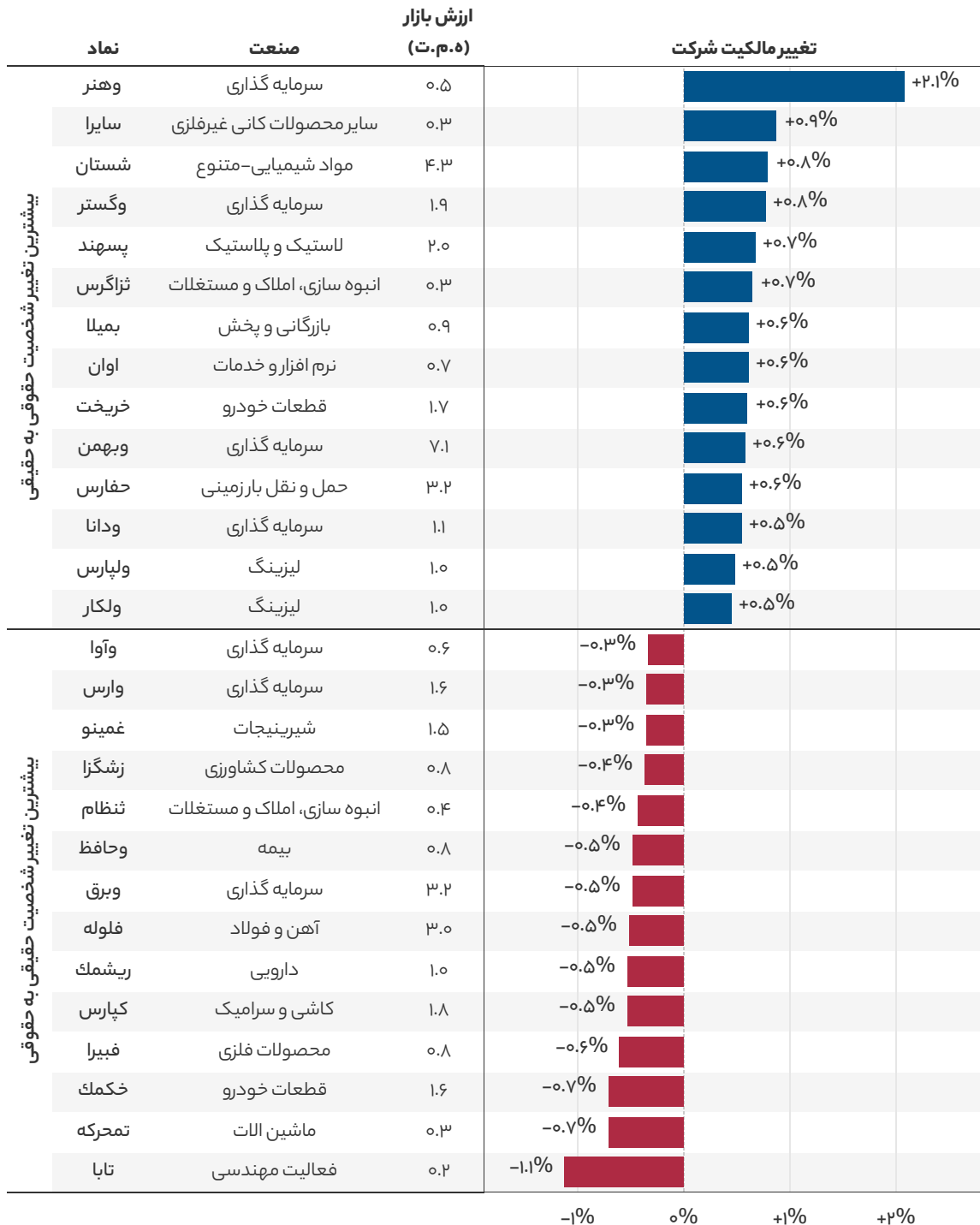
ورود و خروج پول حقیقی

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



تغییر مالکیت شرکت

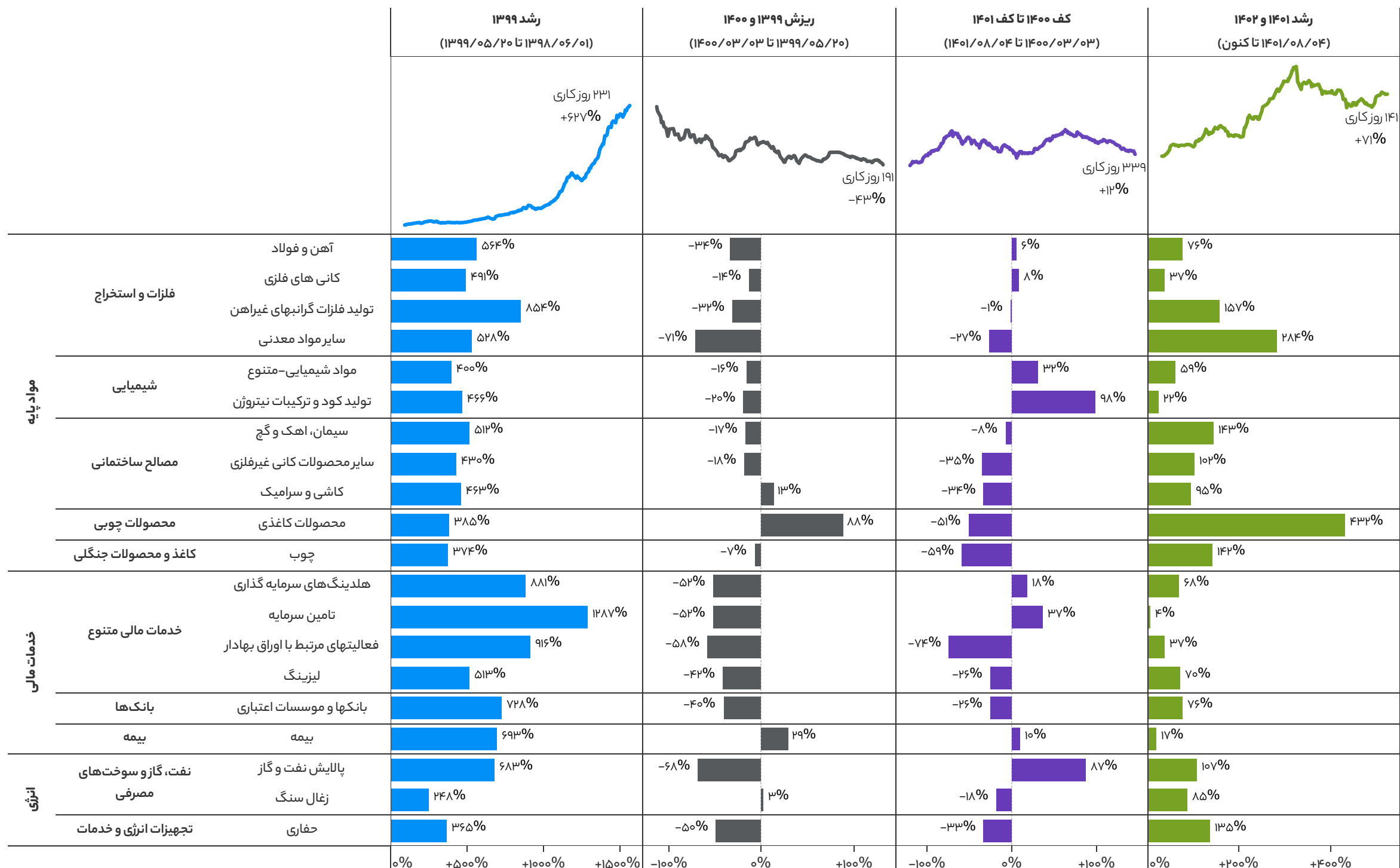
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان



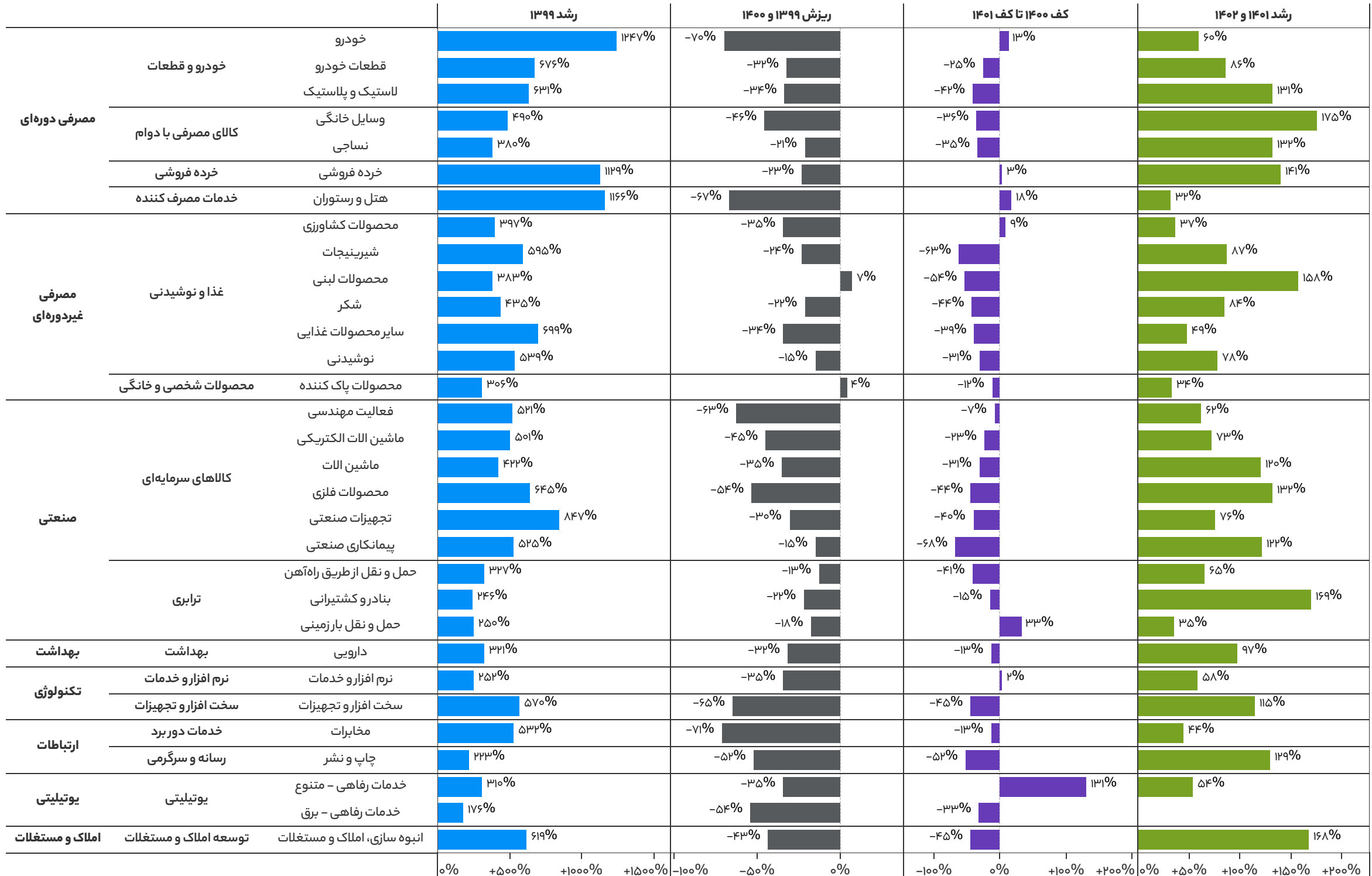


بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

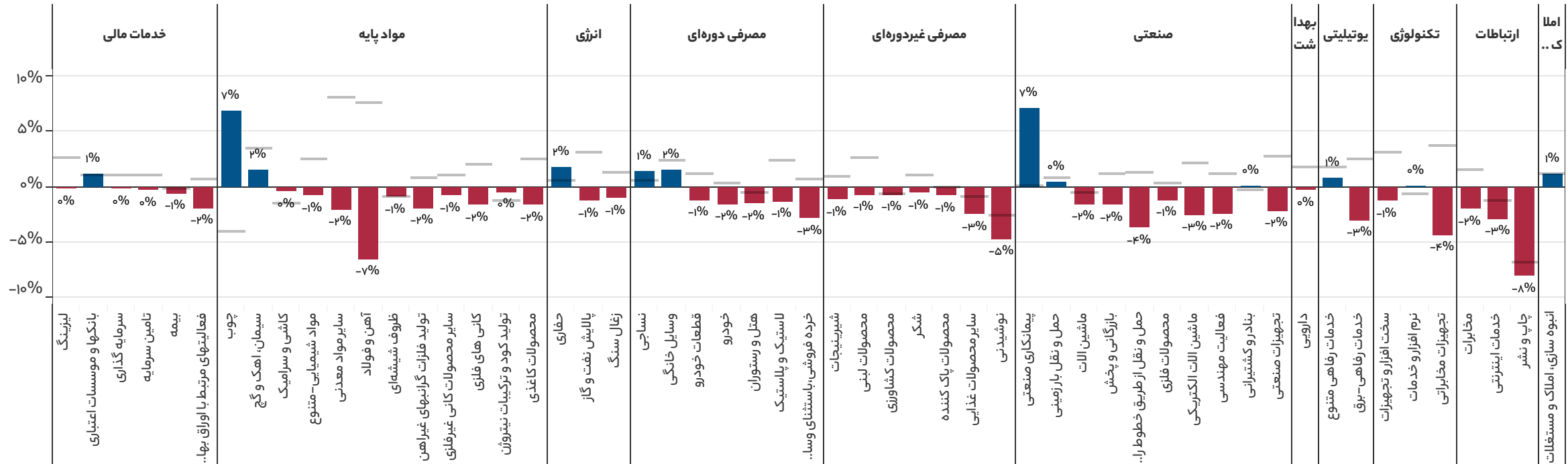


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



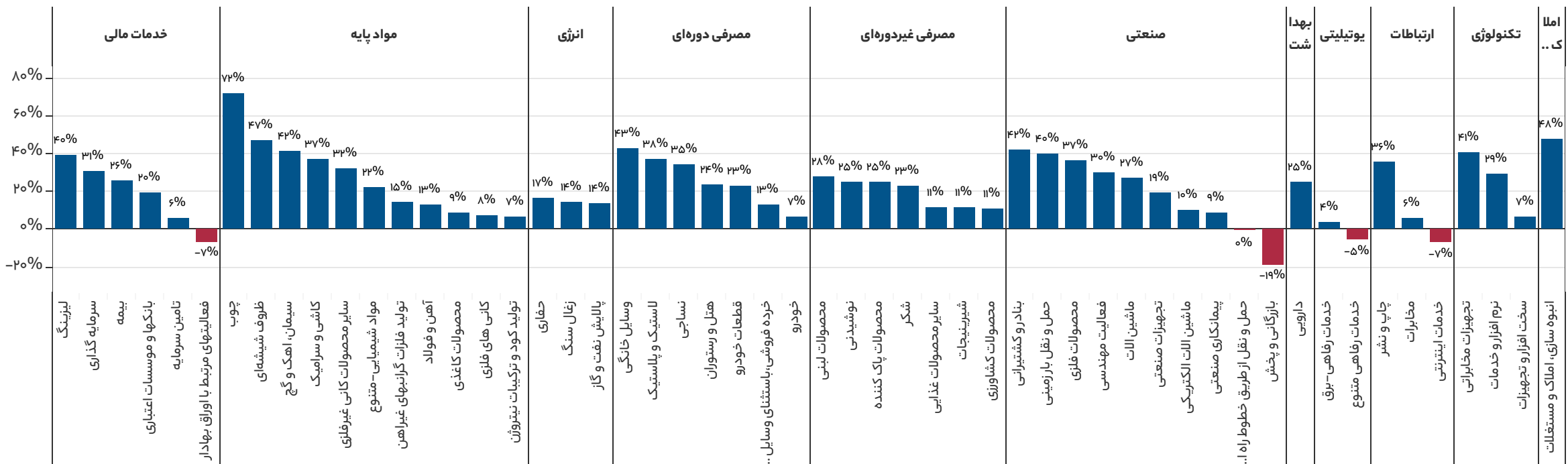
بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازده هفته گذشته با خط‌های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



بازده صنایع از ابتدای سال

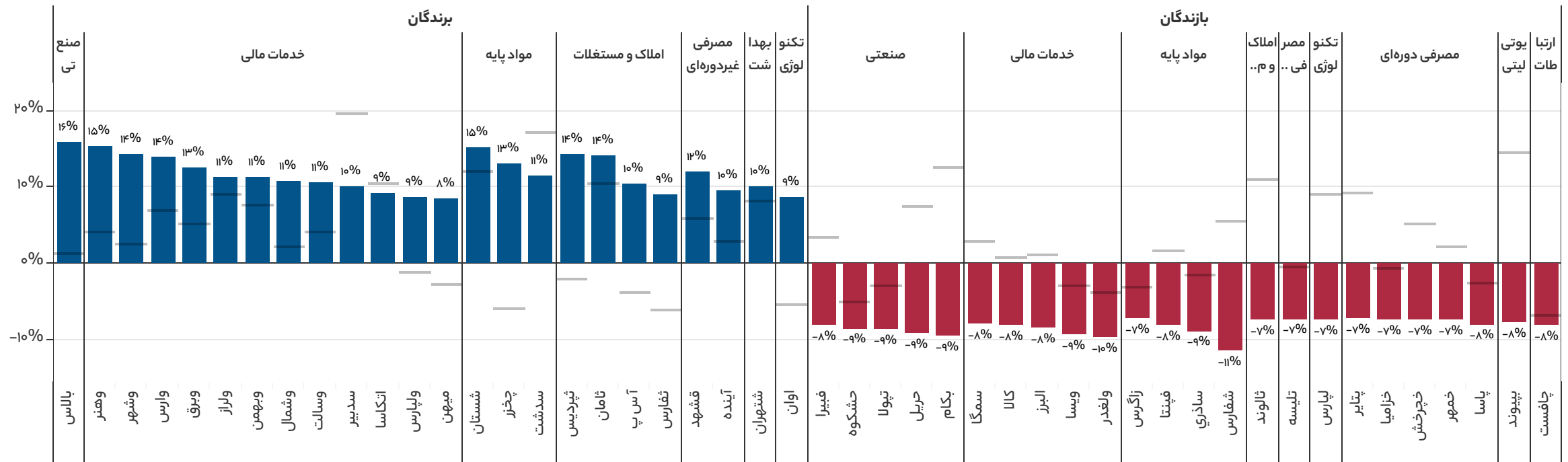
(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده)



برندگان و بازندگان هفته

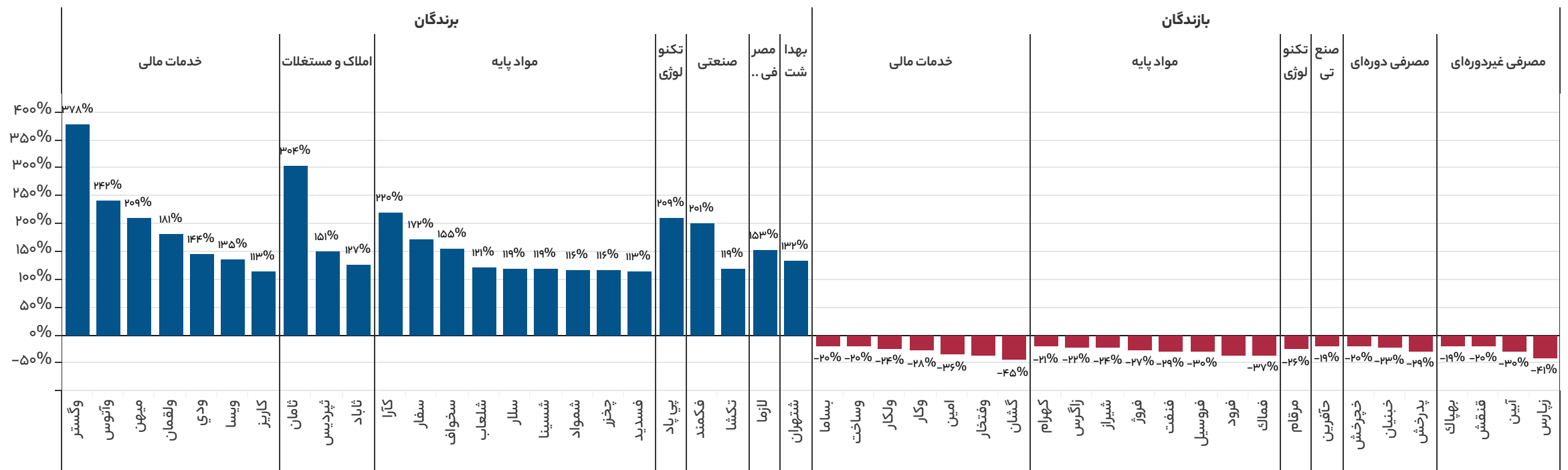
برندگان و بازندگان هفته

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



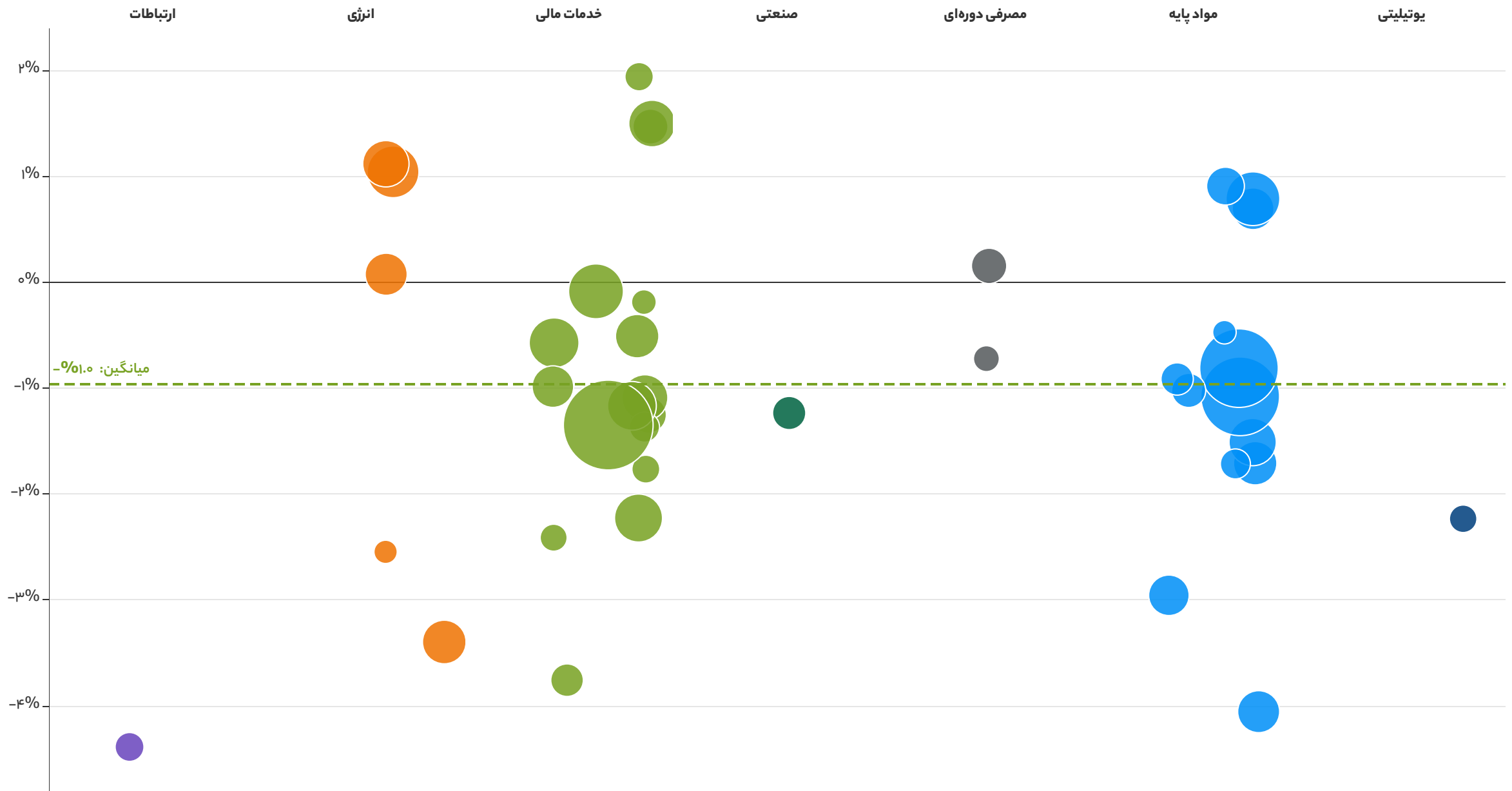
برندگان و بازندگان سال

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



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

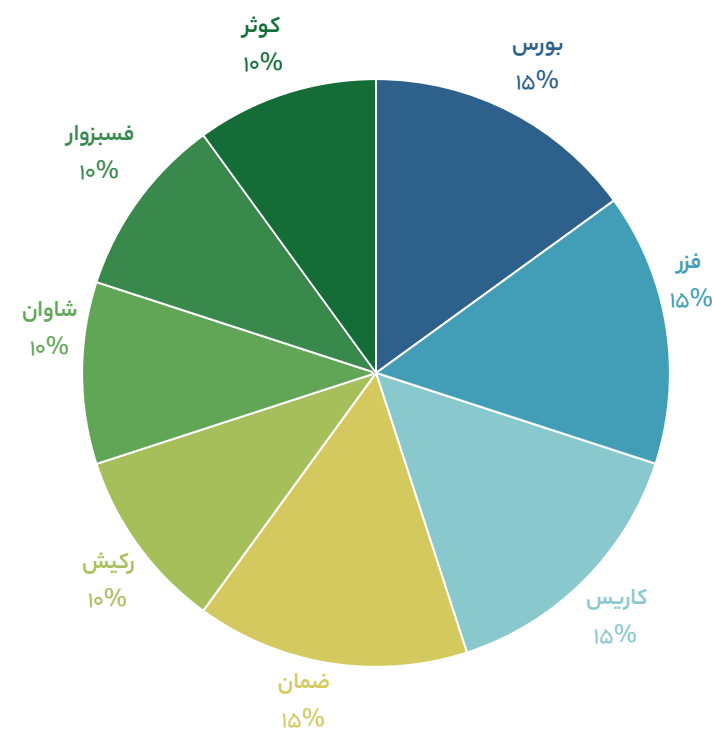


بازدهی هفته گذشته	بفجر	تجارت	پارسان	وپاسار	شبندر	شپنا	شپدیس	کگل	کگهر	خودرو	شتان	شتا	وسپهر	وامید	تاپیکو	خسپا	فملی	بوعلی	پپاس	جم	فولاد	وغدیر	میدکو	رمپنا	ومعادن	فارس	وصندوق	کچاد	مارون	فخوز	وگدیر	وبملت	مین	تامینکو	شبریز	آریا	پارس	حکشتی	نوری	اخابر
+۳.۸%	+۲.۰%	+۱.۵%	+۱.۵%	+۱.۱%	+۱.۱%	+۰.۹%	+۰.۸%	+۰.۷%	+۰.۲%	+۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۲%	-۰.۲%	-۰.۵%	-۰.۶%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۰.۹%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۱%	-۱.۱%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۱.۳%	-۱.۴%	-۱.۵%	-۱.۷%	-۱.۷%	-۱.۸%	-۲.۲%	-۲.۲%	-۲.۴%	-۲.۵%	-۲.۹%	-۳.۴%	-۳.۸%	-۴.۰%	-۴.۴%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۵۷۶	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۵,۰۰۰	رکیش	میان مدت
۱۰%	۲۳,۴۰۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۵,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۳۹,۷۲۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۴۵,۰۰۰	فسبزوار	
۱۰%	۳,۵۹۱	رشد سودآتی شرکت ناشی از سرمایه گذاری‌ها و عملیات بیمه‌ای	۴,۵۰۰	کوثر	
۱۵%	۱۵,۶۶۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵,۹۳۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۸,۲۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۲,۶۰۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۴۷,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۲,۴۸۵	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





مهم‌ترین محدوده حمایتی مشخص شده است. انتظار می‌رود از محدوده مشخص شده تا حوالی ۲۰۲۲۰ هزار واحد رشد داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین مقاومت استاتیک در تصویر مشخص شده‌است. باید دید واکنش نسبت به این مقاومت به چه صورت خواهد بود.

توضیحات تحلیل



BV Bourseview.com

انتظار می‌رود اصلاح این نسبت تا حوالی ۰.۳۲ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود رشد مقطعی تا حوالی ۴.۸ واحد داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مادامی که خط روند مشخص شده در تصویر حفظ شود، مسیر دلار بدون نوسان خواهد بود.

توضیحات تحلیل



باید دید چه واکنشی به محدوده میدلاین کانال قیمتی خواهد داشت.

توضیحات تحلیل



مطابق انتظار رشد مقطعی طلا تا حوالی ۱۹۴۰ دلار اتفاق افتاد. انتظار می‌رود اصلاح تا کف قبلی انجام شود.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود در قالب الگوی مشخص شده، مسیر احتمالی مشخص شده در تصویر را طی کند.

توضیحات تحلیل

اجماع تحلیل‌گران

CONSENSUS ESTIMATES

CONSENSUS ESTIMATES



معرفی بخش

بخش اجماع تحلیل گران کاریزما با تجميع برآوردهای سود تیم تحلیل گری شرکت سبدگردانی کاریزما، به بررسی معیارهای ارزشگذاری سهام برای هر شرکت می‌پردازد.

بخش، سه معیار برای P/E آینده‌نگر گزارش شده که اولین معیار آن با سود سال مالی جاری شرکت محاسبه گردیده است، دومین معیار با استفاده از سود سال مالی آینده و سومین معیار نیز با استفاده از سود برآوردی ۴ فصل پیش رو شرکت محاسبه شده است. شایان ذکر است که تمامی نسبت‌های P/E با سود تقسیمی برآوردی مجمع پیش رو شرکت تعدیل شده‌اند.

همچنین در این بخش معیاری برای سنجش ارزشگذاری نسبی سهام، توسط تیم تحلیل گری کاریزما به نام امتیاز Z نسبت P/E آینده‌نگر ۴ فصله طراحی شده که برای هر شرکت به صورت مجزا تهیه گردیده است. هدف از طراحی این معیار، مقایسه نسبت P/E آینده‌نگر ۴ فصله با نسبت P/E آینده‌نگر تاریخی سهم می‌باشد. امتیاز Z یا امتیاز استاندارد در اینجا عبارت است از تفاوت آخرین نسبت P/E با میانگین تاریخی نسبت P/E که بر حسب انحراف از معیار محاسبه شده است. امتیاز Z پایین نشان دهنده‌ی ارزان بودن نسبی سهم و امتیاز Z بالا نشان دهنده‌ی گران بودن نسبی سهم می‌باشد. همچنین دیتای تاریخی استفاده شده برای محاسبه این معیار، در صورت معامله شدن سهم ۵ سال می‌باشد.

همچنین دسته‌بندی سهم‌های گزارش شده بر اساس سکتور و فعالیت شرکت می‌باشد و ترتیب شرکت‌ها نیز بر اساس ارزش بازار خواهد بود.

بدیهی است که معیار ذکر شده یک روش آماری بوده و بسیاری از عوامل تاثیرگذار بر نسبت P/E را در نظر نمی‌گیرد. همچنین لازم به ذکر است که استفاده از نسبت P/E به تنهایی برای تعیین ارزشگذاری سهام نمی‌تواند روشی قابل اتکایی باشد و بسته به شرایط، سایر روش‌ها نیز باید مدنظر سرمایه‌گذاران و تحلیل گران قرار گیرد.

سلب مسئولیت

تمامی اطلاعات صورت مالی مورد نیاز این بخش نیز از طریق بورس و یو تأمین شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما مسئولیتی در خصوص صحت اطلاعات مزبور بر عهده نخواهد داشت.

جداول یا نمودارهای پیش‌رو به منظور پیشنهاد خرید یا فروش هیچ گونه اوراق بهادار نبوده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در برابر معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش صورت گیرد، هیچ گونه مسئولیتی نمی‌پذیرد.

نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z						
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)						
مواد پایه	الفین	آریا	۱۲	۱۲۱.۳	۸,۸۲۰	۸۰۲	۹۵%	۹۵۶	۱,۲۷۸	+۳۴%	۹.۲	۷.۰	۸.۵	+۰.۴						
		جم	۱۲	۸۳.۶	۴,۶۴۶	۵۶۰	۹۹%	۸۵۳				۵.۴								
		جم پیلن	۱۲	۳۸.۱	۱۹,۰۲۸	۲,۱۰۹	۹۹%	۱,۹۹۳	۲,۴۱۶	+۲۱%	۹.۵	۸.۰	۱۰.۱	+۱.۶						
		شگویا	۱۲	۳۵.۶	۱,۴۸۵	۱۴۳	۹۱%	۲۵۹	۳۱۹	+۲۳%	۵.۷	۴.۵	۶.۳	-۰.۴						
		شکبیر	۱۲	۲۶.۹	۷,۴۶۰	۱,۱۶۸	۸۸%	۱,۶۱۳				۴.۶								
		شاراک	۱۲	۲۶.۹	۳,۳۳۰	۴۱۹	۹۶%	۵۶۷	۷۴۸	+۳۲%	۵.۹	۴.۳	۵.۲	-۰.۸						
		شغذیر	۱۲	۹.۲	۷,۰۴۲	۱,۰۹۶	۹۱%	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۷.۱	۵.۱	۶.۶	+۰.۲						
		شبصیر	۱۲	۷.۳	۲,۹۱۰	۳۷۶	۸۱%	۳۹۱	۵۲۸	+۳۵%	۷.۴	۵.۶	۶.۸	+۱.۳						
		شجم	۶	۵.۳	۸۲۲	۸۸	۸۵%	۷۵	۱۳۲	+۷۶%	۱۱.۰	۷.۲	۶.۱	-۴.۷						
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۳۲.۳	۱۴,۷۰۰	۱,۳۱۴	۱۰۰%	۱,۷۹۴	۲,۴۵۰	+۳۷%	۸.۲	۶.۰	۶.۷	+۰.۰						
		بوعلی	۱۲	۷۶.۲	۵,۳۱۳	۵۶۳	۹۵%	۷۵۸				۷.۰								
	شیمیایی	اوره	شپدیس	۶	۱۰۲.۵	۱۷,۰۸۰	۴,۲۶۴	۶۳%	۲,۹۴۰	۲,۹۳۱	۰%	۵.۸	۶.۷	۶.۵	+۲.۸					
			شیراز	۱۲	۳۹.۸	۲,۶۰۰	۷۶۱	۲۱%	۲۹۱	۳۴۱	+۱۷%									
			خراسان	۱۲	۲۷.۸	۱۵,۵۵۰	۲,۸۱۰	۸۳%	۱,۴۲۲	۱,۹۹۹	+۴۱%	۱۰.۹	۸.۰	۱۰.۴	+۵.۴					
			کرماشا	۱۲	۲۳.۲	۲,۱۸۸	۴۵۸	۴۸%	۲۵۶	۳۲۸	+۲۸%	۸.۵	۷.۰	۷.۸	+۲.۷					
			شاروم	۱۲	۲.۷	۳,۷۹۰	۱۶۷	۴۳%	۴۱۴				۹.۲							
			متانول	زاگرس	۱۲	۳۵.۳	۱۴,۷۰۵	۱,۲۶۵	۷۲%	۱,۲۱۳				۱۲.۱						
	شخارک	۱۲		۲۷.۰	۴,۴۹۲	۶۴۱	۹۹%	۸۰۰	۱,۱۲۴	+۴۰%	۵.۶	۳.۸	۴.۵	-۳.۸						
	شفن	۱۲		۲۰.۱	۶۴۹	۱۰۲	۸۹%	۵۳	۸۷	+۶۴%	۱۲.۳	۷.۸	۱۱.۸	-۰.۵						
	محصولات شیمیایی	شکلر	۸	۴.۱	۴,۱۰۱	۴۱۹	۷۲%	۶۲۴	۶۶۳	+۶%	۶.۶	۵.۸	۶.۲	+۱.۷						
		شکام	۱۲	۳.۹	۹۸۱	۱۱۵	۱۴%	۱۷۹				۵.۵								
		شمواد	۶	۲.۱	۱۴,۴۱۵	۷۳۹	۲۳%	۱,۸۳۱	۱,۹۳۴	+۶%	۷.۹	۸.۶	۷.۱	+۰.۴						
	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۲	۵۰۵	۶۴	۸۲%	۹۲	۹۶	+۴%	۵.۵	۵.۱	۴.۸	-۱.۷						
		شصدف	۱۲	۲.۷	۳,۷۹۵	۳۹۲	۷۳%	۳۵۷	۲۷۱	-۲۴%	۱۰.۶	۱۴.۶	۱۱.۴	+۱.۶						
شدوص		۱۲	۲.۰	۲,۰۶۵	۱۹۳	۹۳%	۲۴۷	۳۰۱	+۲۲%	۸.۴	۶.۹	۸.۴	+۱.۶							

نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر فصله	(آینده نگر ۴ فصله)																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																
مواد پایه فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۴۹.۶	۵۶۲	۸۵	۵۰%	۱۰۱	۱۲۵	+۲۳%	۵.۶	۴.۶	۵.۴	+۱.۵																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																</

نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z				
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ (فصله)				
مصارح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ	ستران	۱۲	۹۰.۸	۵,۶۱۰	۶۰۰	۷۶%	۱,۰۰۰				۵.۶						
		ساوه	۱۲	۹۰.۲	۱۴,۱۵۰	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۵.۹	۴.۶	۵.۴	+۰.۷				
		سآبیک	۱۲	۷۰.۱	۲,۳۸۵	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۶.۱	۴.۶	۵.۶	+۱.۵				
		سخوز	۱۲	۶۰.۵	۴,۶۴۶	۷۱۹	۹۰%	۹۸۷	۱,۲۱۶	+۲۳%	۴.۷	۳.۵	۳.۸	-۰.۶				
		سپاها	۶	۵۰.۵	۲,۲۵۲	۱۹۷	۷۵%	۳۲۶	۵۶۱	+۷۲%	۶.۹	۴.۵	۴.۰	+۰.۰				
		ساروم	۱۲	۴۰.۴	۴,۳۸۵	۵۵۴	۹۶%	۷۱۰	۹۹۴	+۴۰%	۶.۲	۴.۳	۵.۵	+۰.۲				
		سشرق	۶	۴۰.۰	۱,۴۹۵	۱۵۴	۷۲%	۲۴۷	۳۷۴	+۵۲%	۶.۱	۴.۴	۳.۱	-۴.۴				
		سرود	۱۲	۴۰.۰	۴,۸۹۷	۴۹۶	۹۶%	۶۱۱	۸۹۴	+۴۶%	۸.۰	۵.۵	۷.۹	+۱.۷				
		سصوفی	۱۲	۳۰.۲	۲,۹۴۸	۳۶۸	۹۰%	۵۳۲	۹۰۷	+۷۱%	۵.۵	۳.۱	۴.۷	-۰.۲				
		سشمال	۹	۲۰.۹	۱,۷۰۵	۱۷۰	۸۹%	۲۷۵	۴۱۱	+۴۹%	۶.۲	۳.۸	۴.۸	+۰.۵				
		سبجنو	۱۲	۲۰.۸	۷,۲۴۵	۵۷۳	۹۶%	۱,۱۱۵	۱,۴۱۲	+۲۷%	۶.۵	۵.۰	۵.۷	-۰.۹				
		سبهان	۱۲	۲۰.۲	۱۰,۹۳۰	۷۳۶	۹۷%	۱,۵۵۶	۱,۷۸۹	+۱۵%	۷.۰	۶.۰	۷.۲	-۰.۱				
	کاشی و سرامیک	سخرز	۱۲	۲۰.۲	۴,۳۶۰	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۹.۱	۶.۹	۷.۴	+۰.۲				
		سشاش	۱۲	۱۰.۶	۸,۰۳۳	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۹۱	۱,۸۳۶	+۲۳%	۵.۴	۴.۱	۴.۷	-۱.۰				
		کحافظ	۱۲	۳۰.۷	۷۱۷	۸۲	۱۰%	۱۰۱	۱۵۰	+۴۸%	۷.۱	۵.۳	۵.۹	+۰.۰				
		کساوه	۱۲	۳۰.۳	۶,۳۰۵	۷۴۷	۷۱%	۱,۱۵۰	۱,۶۹۰	+۴۷%	۵.۵	۳.۶	۴.۲	-۲.۲				
		کپارس	۱۰	۱۰.۹	۱,۱۴۸	۲۴		۱۸۸	۲۵۸	+۳۷%	۶.۱		۴.۹					
		کلوند	۱۲	۱۰.۷	۴,۲۸۶	۵۰۴	۹۵%	۶۴۶	۹۴۵	+۴۶%	۶.۶	۴.۴	۵.۷	+۰.۰				
		کترام	۱۲	۱۰.۴	۸۰۲	۵۹	۲۳%	۸۵	۱۱۴	+۳۴%	۹.۵	۷.۸	۷.۴	-۰.۹				
		کسعدی	۱۲	۰۰.۸	۷۷۵	۵۱	۸۶%	۹۵	۱۲۳	+۲۹%	۸.۱	۶.۳	۶.۹	-۱.۲				
		کصدف	۱۲	۰۰.۸	۲,۱۴۰	۱۲۸	۱۰%	۱۵۱	۲۴۲	+۶۰%	۱۴.۱	۹.۸	۱۲.۲	+۱.۹				
		شیشه و ظروف شیشه‌ای	کرازی	۱۲	۴۰.۸	۱۶۴	۱۶	۲۴%	۲۳	۳۲	+۳۹%	۷.۱	۵.۵	۵.۵	-۰.۴			
			کقزوی	۱۲	۳۰.۷	۲,۶۰۰	۳۵۹	۳۶%	۵۵۷				۴.۷					
			کگاز	۱۲	۳۰.۴	۴,۰۱۸	۱۱۳	۵۱%	۳۸۱	۴۳۴	+۱۴%	۱۰.۶	۹.۷	۹.۱	-۱.۹			
فرآورده‌های نسوز	کپشیر	۱۲	۲۰.۲	۱,۴۴۱	۸۷	۸۸%	۱۱۷	۱۶۷	+۴۳%	۱۲.۳	۹.۰	۱۳.۳	+۰.۸					
	کفرا	۱۲	۲۰.۰	۹۹۴	۶۶	۹۶%	۷۹	۱۵۴	+۹۴%	۱۲.۶	۶.۷	۸.۷	-۱.۱					
	کاذر	۱۲	۱۰.۱	۵۴۴	۵۲	۲۶%	۱۲۶	۱۵۰	+۱۹%	۴.۳	۳.۸	۳.۶	-۷.۳					
	کفپارس	۹	۰۰.۹	۵۶۵	۳۶	۷%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۰.۸	۸.۸	۷.۴	-۱.۰					



نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z				
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ (فصله)				
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش نفت	۱۲	۱۹۳.۹	۸۵۴	۱۷۰	۶۳%	۶۲			۱۳.۸							
		پالایش گاز	۱۲	۱۴۱.۹	۲۹۸	۳۱	۸۸%	۳۴	۴۶	+۳۴%	۸.۷	۶.۶	۷.۵	+۰.۶				
		روانکار	شبه‌رین	۱۲	۳۱.۰	۲,۵۹۰	۳۳۸	۸۹%	۳۴۵	۵۲۵	+۵۲%	۷.۵	۴.۹	۶.۴	+۱.۸			
			شسپا	۱۲	۲۹.۲	۵۲۲	۷۴	۶۷%	۸۳	۹۹	+۱۹%							
			شنفت	۱۲	۱۷.۵	۸۷۷	۱۰۸	۸۲%	۷۵	۱۰۳	+۳۷%	۱۱.۷	۸.۹	۱۰.۰	+۰.۵			
			شرانل	۱۲	۱۶.۷	۸,۳۵۵	۱,۴۴۱	۸۵%	۹۳۰	۱,۵۶۵	+۶۸%	۹.۰	۵.۵	۷.۴	+۲.۶			
		زغال سنگ	کزغال	۱۲	۷.۹	۲,۲۶۵	۲۶۵	۹۹%	۳۷۴	۸۲۷	+۱۲۱%	۶.۱	۲.۶	۴.۷	-۲.۲			
			کپرور	۱۲	۲.۱	۱,۲۰۵	۱۶۹	۵۹%	۲۴۷	۳۳۵	+۳۶%	۴.۹	۳.۶	۳.۹	-۳.۴			
			کطبس	۱۲	۱.۴	۱,۷۲۵	۱۹۳	۶۲%	۳۷۸	۴۷۱	+۲۵%	۴.۶	۳.۶	۳.۷	-۶.۱			
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	سنگ آهن	۱۰	۱۳۶.۱	۱,۴۰۳	۱۸۸	۶۸%	۱۷۱	۲۳۸	+۳۹%	۸.۲	۵.۸	۸.۶	+۱.۶				
		فلزات و معادن	۱۲	۹۶.۰	۴۹۹	۷۲	۳۸%	۹۷	۱۱۹	+۲۲%	۵.۱	۴.۳	۳.۷	-۳.۹				
		تامین سرمایه	لوتوس	۱۰	۱۳.۲	۳۷۸	۴۵	۹۶%	۶۷	۸۳	+۲۳%	۵.۶	۴.۲	۴.۷	-۲.۰			
			امین	۶	۱۰.۰	۵۵۳	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۴	۱۰.۰	۷.۹	-۳.۴			
			تنوین	۱۲	۹.۹	۴۰۴	۷۶	۶۳%	۷۸	۹۶	+۲۳%	۵.۲	۴.۱	۴.۳	-۱.۱			
		دارویی	وپخش	۱۲	۱۶.۱	۱,۹۱۷	۲۹۸	۹۱%	۳۶۹			۵.۲						
			شفا	۱۲	۶.۰	۲,۲۱۶	۲۸۱	۷۱%	۳۲۴			۶.۸						
		چند رشته‌ای	وسپه	۹	۱۳.۳	۴۳۸	۶۷	۸۸%	۶۴	۸۱	+۲۶%	۶.۹	۵.۰	۷.۳	+۳.۱			
			وتوکا	۱۲	۵.۲	۴۳۰	۳۷	۳۳%	۴۰	۵۲	+۳۱%	۱۰.۸	۸.۹	۸.۴	+۰.۷			
		سایر محصولات غذایی	خودکفا	۱۲	۷.۲	۹۶۲	۱۱۰	۴۵%	۱۷۳	۲۱۳	+۲۳%							
		سرب و روی	کروی	۱۲	۷.۲	۷۱۷	۱۵۶	۷۴%	۲۵	۳۵	+۴۴%	۲۹.۰	۲۱.۹	۲۰.۴	+۲.۱			
		مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۵	۷,۶۳۰	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵.۸	۳.۸	۴.۷	-۰.۳	
کاغذ و محصولات..	محصولات چوبی		چخزر	۱۲	۱.۳	۶,۳۹۰	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۵.۸	۹.۳	۱۳.۶	+۰.۷			

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																							
------------	--------	------	----------	---------------------	-----------------	---------------------	----------------------	--------------------	--	-----------------	--------------------	--	--	----------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--



نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z				
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)				
مصرفی غیردورهای	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۸.۳	۲,۷۵۸	۲۱۳	۵۵%	۴۶۳			۶.۰							
		جوین	۴	۵.۰	۶۷۴	۹۱	۵۳%	۹۷	۹۵	-۲%								
		سیمرغ	۹	۳.۶	۲,۷۸۴	۳۹۱	۲۴%	۴۸۵	۷۰۰	+۴۴%	۵.۷	۴.۰	۴.۰	-۱.۲				
		زفکا	۱۲	۲.۵	۱,۶۵۳	۱۵۵	۹۱%	۲۵۷			۶.۴							
		تلیسه	۱۲	۲.۱	۴۲۳	۲۵	۹۲%	۳۳			۱۲.۸							
		زدشت	۱۲	۲.۰	۲,۸۴۰	۲۱۲	۵۱%	۲۴۵			۱۱.۶							
		زگلدشت	۱۲	۱.۷	۲,۳۸۰	۹۶	۹۵%	۱۵۵			۱۵.۴							
		زشریف	۹	۱.۴	۵۸۰	۴۸	۷۶%	۹۰	۸۸	-۳%	۶.۴	۶.۳	۵.۶	-۱.۲				
		زملارد	۱۲	۱.۳	۱,۶۷۲	۳۳	۹۴%	۱۰۲			۱۶.۴							
		زبینا	۱۲	۱.۳	۳۶۲	۴۱	۷۹%	۵۱			۷.۲							
		زمگسا	۱۲	۱.۲	۳,۹۱۹	۳۲۶	۹۵%	۴۰۴			۹.۷							
		زکشت	۱۲	۱.۱	۱,۹۱۳	۱۲۶	۵۳%	۱۱۴			۱۶.۸							
		زشگزا	۱۲	۰.۸	۸۲۴	۸۱	۵۶%	۱۲۴										
	غذا و نوشیدنی	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۴.۶	۱,۴۵۵	۱۶۱	۶۰%	۲۱۵	۲۵۶	+۱۹%	۶.۸	۵.۷	۵.۸	-۱.۸			
			غپینو	۱۲	۳.۹	۴۳۰	۴۹	۵۶%	۷۸	۹۷	+۲۴%	۵.۵	۴.۶	۴.۷	-۰.۸			
			غسالم	۱۲	۲.۲	۴۹۴	۶۵	۴۱%	۸۶	۱۰۷	+۲۵%	۵.۸	۵.۰	۴.۷	-۱.۰			
			غمینو	۱۲	۱.۵	۱,۰۳۲	۱۴۹	۴۳%	۱۹۶	۲۵۰	+۲۸%	۵.۳	۴.۲	۴.۵	-۰.۱			
	قند و شکر	قپیرا	۴	۳.۱	۱,۲۲۰	۴۰	۸۷%	۴۸	۱۲۳	+۱۵۶%								
		قصفا	۱۲	۲.۹	۱۴,۹۹۰	۶۲۲	۹۹%	۱,۱۸۷	۱,۲۰۰	+۱%	۱۲.۶	۱۳.۰	۱۰.۹	-۱.۰				
		قچار	۱۲	۲.۹	۸۱۶	۴۲	۲۱%	۶۲			۱۳.۲							
		قشهد	۶	۲.۱	۳,۰۸۳	۱۶۹	-۱۸%	۲۵۳			۱۲.۲							
		قمرو	۴	۱.۷	۸۳۹	۷۲	۳۴%	۸۶	۱۰۰	+۱۶%								
		قزوبین	۱۲	۱.۵	۷۳۴	۷۶	۸۴%	۸۰	۹۶	+۱۹%	۹.۱	۷.۸	۷.۰	+۰.۱				
	روغن خوراکی	غبشهر	۹	۸.۷	۲۹۵	۳۹	۳۷%	۴۳	۸۶	+۱۰۱%	۶.۹	۳.۴	۴.۵	-۱.۷				
غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۶.۴	۳۵۷	۴۳	۱۰%	۶۷	۸۰	+۱۹%	۵.۳	۴.۹	۴.۶	-۵.۰					
	غمهرا	۱۲	۲.۲	۱,۱۶۶	۱۰۵	۱۶%	۱۶۸	۲۵۶	+۵۲%	۶.۹	۴.۹	۵.۱	-۱.۱					
محصولات لبنی	غفارس	۱۲	۱.۸	۱,۵۶۰	۱۰۱	۱۳%	۱۱۲			۱۴.۰								
	غگلپا	۱۲	۱.۶	۴,۲۱۵	۴۶۵	۷۴%	۵۲۵			۸.۰								
	غشان	۱۲	۱.۳	۷۶۲	۸۰	۷۱%	۸۴			۹.۰								
	غگلستا	۱۲	۱.۳	۱,۹۸۰	۱۵۶	۷۰%	۲۰۷			۹.۶								

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳



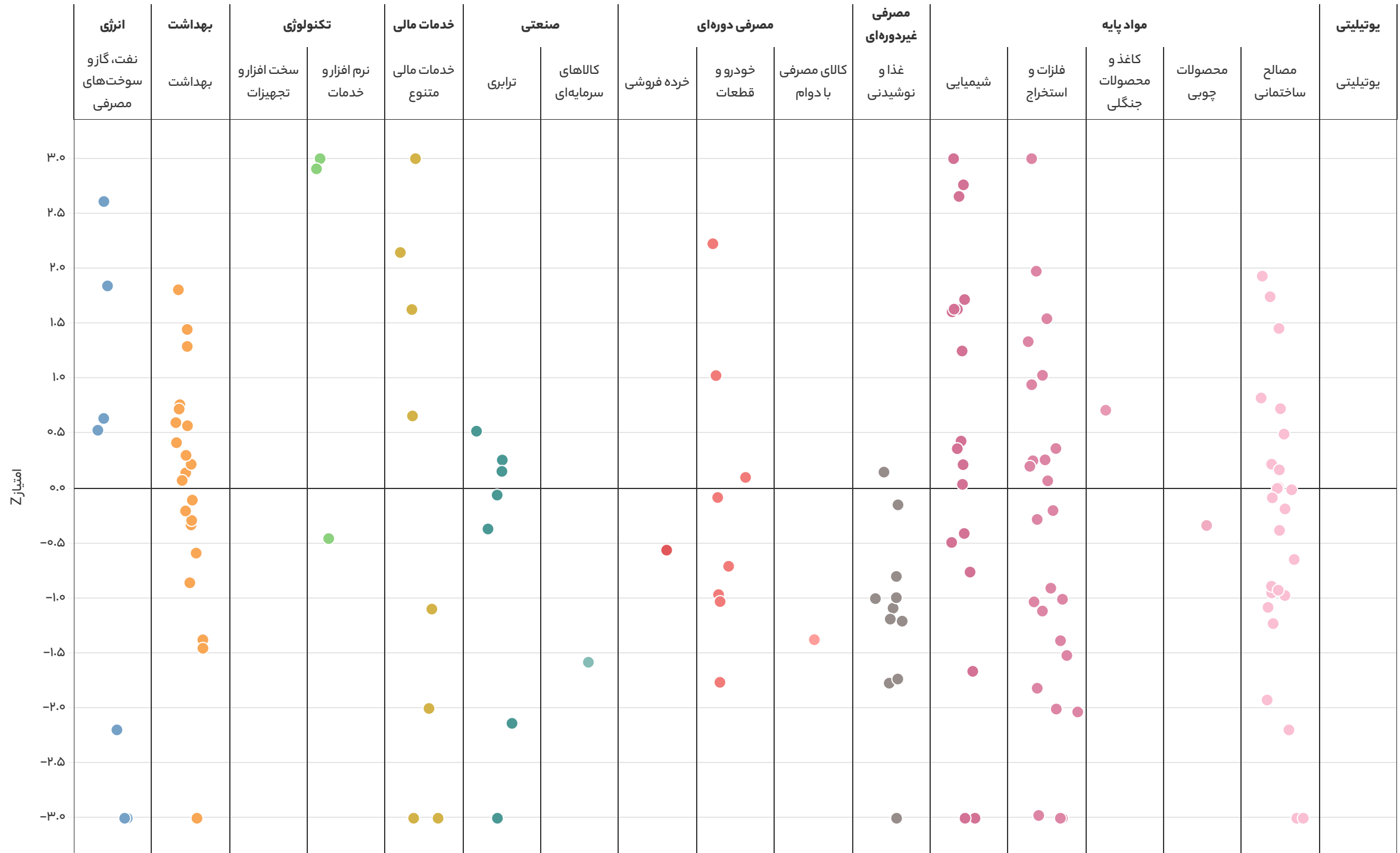
نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z					
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)					
یوتیلیتی	یوتیلیتی و نیروگاهی	مبین	۱۲	۵۴.۶	۲,۶۹۷	۴۲۶	۱۶۱%	۶۳۱			۴.۳								
		بفجر	۱۲	۳۶.۳	۱,۸۶۱	۳۳۰	۱۸۷%	۳۸۹			۴.۸								
مصرفی دورهای	خودرو و قطعات	پکرمان	۱۲	۷.۶	۳,۰۲۰	۱۴۸	۸۷%	۲۷۰	۴۱۷	+۵۴%	۱۱.۲	۷.۸	۱۲.۲	-۰.۱					
		پکویر	۹	۴.۵	۶۹۱	۲۵	۷۵%	۷۷	۱۳۱	+۷۰%	۹.۰	۴.۸	۶.۹	-۰.۷					
		پارتا	۱۲	۴.۲	۶۸۴	۴۰	۶۰%	۴۳	۸۲	+۹۲%	۱۶.۰	۹.۱	۱۰.۵	-۱.۸					
		پاسا	۱۲	۳.۵	۱,۸۴۰	۱۳۶	۴۰%	۱۳۷	۲۱۶	+۵۷%	۱۳.۴	۹.۴	۱۳.۹	+۱.۰					
		پتایر	۱۲	۳.۴	۲۶۲	۱۰	۴۱%	۲۳	۲۹	+۲۵%	۱۱.۵	۹.۸	۱۰.۴	-۱.۰					
		پیزد	۱۲	۲.۷	۱,۳۳۱	۶۱	۶۷%	۱۰۸	۱۵۵	+۴۳%	۱۲.۳	۹.۲	۱۱.۵	-۱.۰					
		خودرو	۱۲	۱۷.۰	۴۸۵	۵۶	۱۶%	۱۰۸	۱۴۹	+۳۸%	۴.۵	۳.۴	۴.۱	+۰.۱					
		پلاستیک	۱۲	۱.۰	۴,۶۰۰	۶۰۶	۲۹%	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۲۱.۴	۲۲.۹	۱۸.۸	+۲.۲					
		خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۴.۱	۸۱۰	۱۰۳	۴۹%	۱۶۰	۲۱۰	+۳۱%	۵.۱	۳.۸	۴.۲	-۰.۶			
		کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	لخرز	۱۲	۲.۵	۱,۵۲۵	۱۷۵	۲۹%	۲۴۷	۳۴۲	+۳۹%	۶.۲	۴.۷	۵.۲	-۱.۴			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	سیستم	۱۲	۱۸.۳	۱,۸۲۵	۸۳	۸۹%	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۰.۹	۲۷.۲	۲۹.۵	+۵.۵					
		سپیدار	۱۲	۵.۳	۷,۵۷۰	۳۱۱	۷۸%	۲۷۰	۳۳۸	+۲۵%	۲۸.۰	۲۴.۲	۷۸.۲	+۲.۹					
		رافزا	۱۲	۱.۵	۴,۴۰۰	۲۶۰	۸۰%	۴۰۲	۴۹۱	+۲۲%	۱۰.۹	۹.۶	۱۱.۸	-۰.۵					
سخت افزار و تجهیزات	سخت افزار و تجهیزات	مادیرا	۱۲	۶.۲	۴۳۹	۲۷	۳۸%	۵۰			۸.۷								
صنعتی	ترابری	بنادرو کشتیرانی	حخرز	۱۲	۵.۷	۵,۲۸۵	۶۹۱	۹۶%	۹۶۲	۱,۳۹۱	+۴۵%	۵.۵	۳.۶	۵.۳	+۰.۳				
			حتاید	۱۲	۵.۲	۷۳۸	۱۰۵	۵۲%	۱۵۱	۱۸۲	+۲۱%	۴.۹	۴.۱	۴.۱	-۲.۱				
			حسینا	۱۲	۵.۱	۲,۰۵۱	۱۹۱	۸۹%	۲۸۸	۳۱۷	+۱۰%	۷.۱	۶.۴	۶.۳	-۰.۱				
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	توریل	۱۲	۴.۱	۵۸۹	۴۳	۳۸%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۱.۳	۹.۵	۹.۷	-۰.۴				
			حآفرین	۱۲	۲.۴	۳۱۷	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۷.۶	۷.۳	۶.۳	-۳.۴				
			حآسا	۱۲	۱.۹	۱,۰۶۸	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۹.۰	۲۹.۱	۲۷.۷	+۰.۵				
			چپارسا	۶	۱.۶	۶,۴۱۵	۶۳۱	۸۹%	۸۰۱	۱,۱۱۷	+۳۹%	۸.۰	۶.۵	۵.۴	+۰.۲				
کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۲	۲۸۹	۳۳	۳۱%	۵۹	۵۶	-۵%	۴.۹	۵.۴	۴.۲	-۱.۶					

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

مقایسه ارزشیابی شرکت‌ها

امتیاز Z نسبت قیمت به سود (P/e) شرکت‌ها، به تفکیک سکتور و گروه صنعتی



ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

