

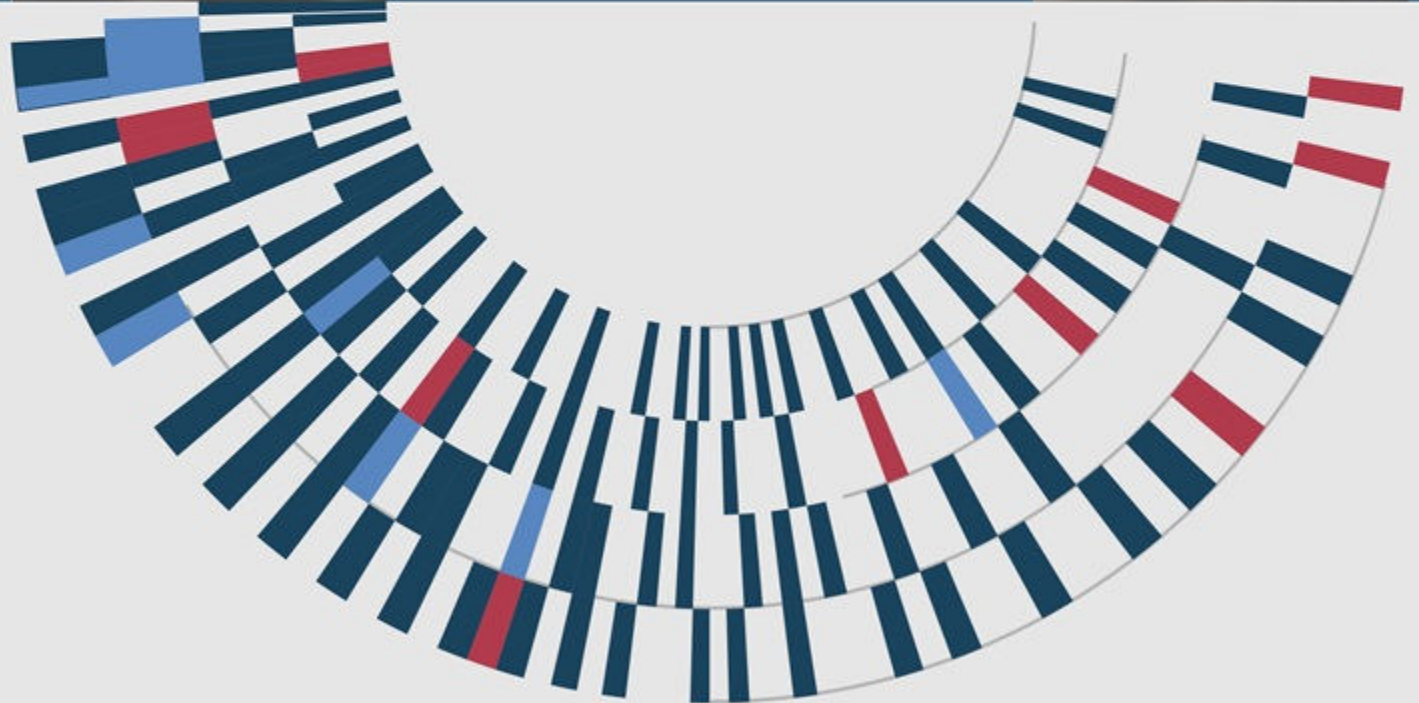
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۱۷ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

 CHARISMA





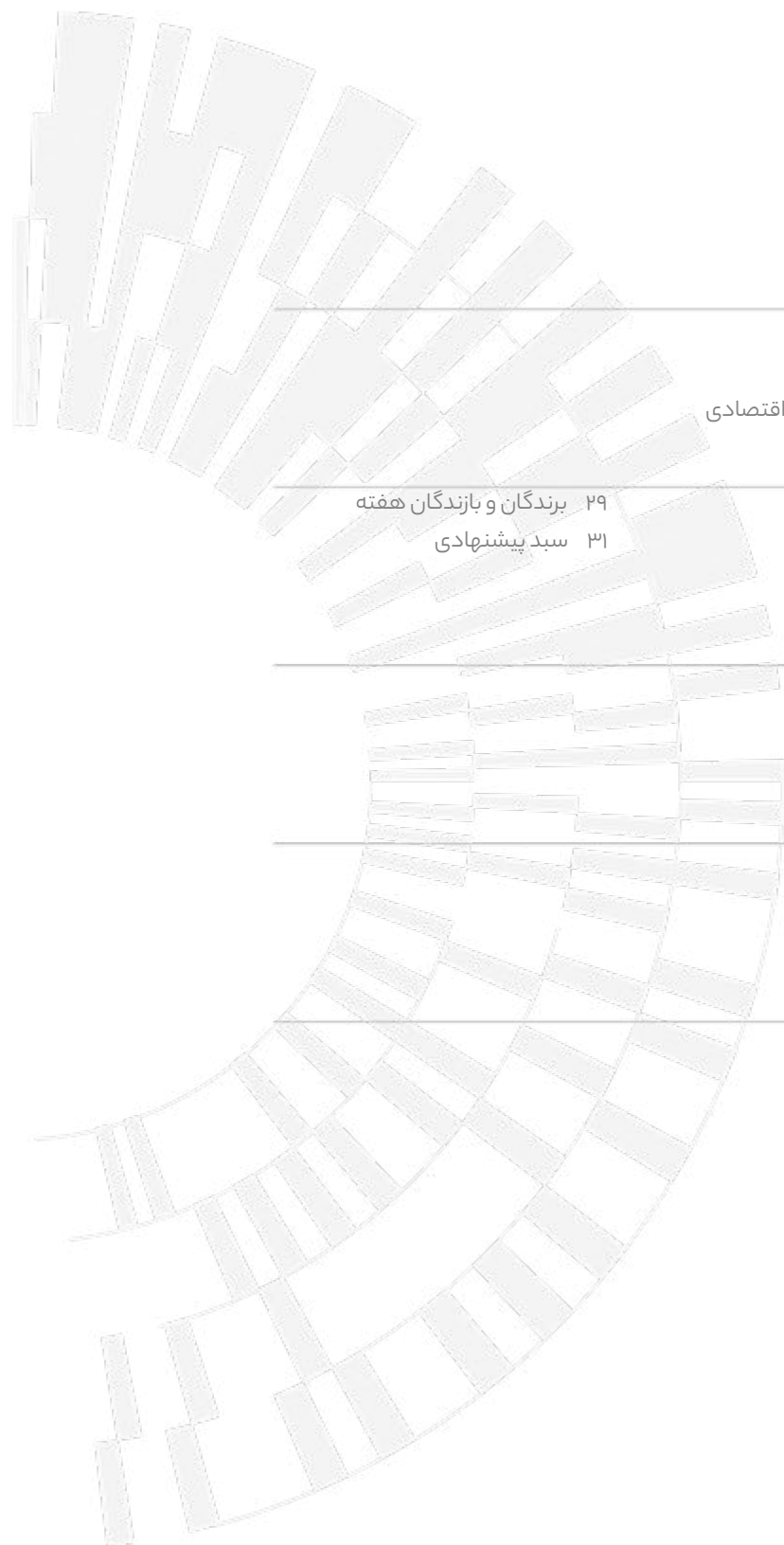
معرفی گزارش:

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 هفته 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 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 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.



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	روند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۲۵	-	فزر	-	۲,۰۱۷ ۱,۶۴۳	۱۷%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۲۰۷	-۲.۴%	فملی	بموتو، فباهنر	۹,۳۴۱ ۷,۴۴۹	۱۰%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۴۰	۱.۹%	فایرا	فنوال	۲,۴۲۴ ۲,۰۷۱	۲%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۵۶	۱.۸%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۳,۴۴۴ ۲,۳۰۳	-۱۵%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۲۰۹	-۲.۴%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۲۷۳ ۱,۸۵۲	۱۹%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۸۶	۰.۳%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۸۴۳ ۲,۶۹۷	۷۴%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۷۴	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۶۲۵ ۲,۱۵۸	۶۲%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۷۳	-۱.۵%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۶۲۳ ۴۳۱	-۷%
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۵۲۷	۱.۹%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۲۲,۸۲۱ ۱۲,۸۸۲	۵۹%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۳	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۶۷۰ ۴۲۰	۷%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۲۲,۰۸۰ ۱۱,۹۰۰	۶۴%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۰	-۰.۹%	ذوب، کویر	فولای	۷۵۵ ۵۵۸	-۱۶%
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۲۱۰	-	ذوب، کویر	فولای	۲۴,۷۴۷ ۱۴,۱۹۰	۵۷%
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	-۱%



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	۳۹۴	-۱.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس	۲۸۵7۰۸	-۴۴%
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۸۷	۰.۷%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا	۲۳۵۳۲۳۰	-۱۰%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۷۰	۰.۶%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰۱۰۰۰	-۱۳%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۹۱	-۰.۲%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱۰۰۹۰	-۱%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۳	-۰.۶%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶۱۰۰۵۸	۹%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۸۱	-۰.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۴۰۱۰۰۱۰	۱۷%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۸۶	-۱.۰%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۳۷۵۳۲	-۷%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۰	-۱.۰%	شگویا	-	۹۳۰۱۰۰۹۹	
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۶۰	۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۴	-۳%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۷۸	۱.۰%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰۹۵۱	-۱%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۱۳۱	-۲.۳%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲۱,۱۵۸	۸%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۴۰	۰.۴%	شصفها، نوری	-	۹۷۹۱,۱۸۵	-۳%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۸۹	-۶.۸%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱,۱۶۸	-۴%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۹۴	-۴.۱%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۱,۰۳۷	۷%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۸,۱۹۰	-۲.۰%	بوعلی	-	۶,۱۲۹۸,۳۵۵	
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰۱,۲۳۹	۶%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۳۵	-۱.۸%	شغدیر، ارونند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۶۹۹۹۱۴	-۸%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۴۰	۰.۸%	شبصیر	-	۱,۲۳۰۱,۴۷۹	-۸%



انرژی و سایر محصولات

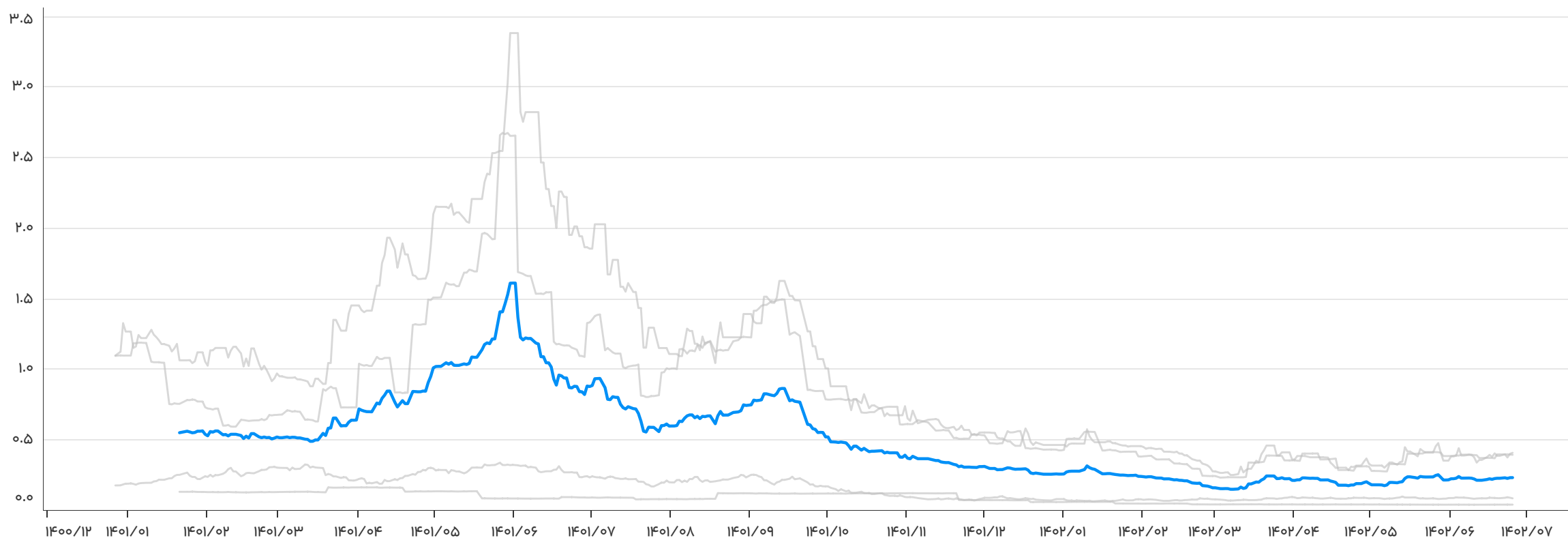
انرژی و فرآورده های نفتی	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره								روند قیمتی ۱۲ ماهه			
	عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده					
انرژی و فرآورده های نفتی	نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۹۴	۰.۵%-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۲	۹۹		۸%	
	نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۹۰	۰.۸%-	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۶	۹۳		۱۴%	
	نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/بشکه	۱۱۴۰	۱.۶%-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۹۷	۱۷۰		۳%	
	گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۱۱۳۲	۰.۴%-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۸۹	۱۷۰		۳%	
	لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۶,۶۲۰	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۰,۳۰۳	۱۶,۶۲۰		۲۶%	
	روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۸,۰۷۷	۰.۵%	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۲۱,۷۹۵	۴۱,۳۶۵		۱۲%	
محصولات کشاورزی	قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۵,۳۶۶	۲.۴%-	شپاس	-	۸,۹۲۹	۱۷,۱۴۰		۴۲%	
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۸۸	۰.۵%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۸۷	۲۷۲		۲۹%-	
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۰۶	۱.۶%-	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸	۹۶۸		۳%-	
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۴۹۸	۵.۲%-	-	-	۱,۲۰۵	۱,۷۱۶		۷%	
ارز و ارز دیجیتال	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۱۳	۴.۱%-	-	-	۲۱۸	۳۳۹		۳۴%-	
	یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۶	۰.۲%-	-	-	۰.۹۷	۱.۱۲		۱۰%	
	پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۲	۱.۲%-	-	-	۱.۰۹	۱.۳۱		۱۳%	
ارز و ارز دیجیتال	بیتکوین	بایننس	دلار	۲۶,۵۲۷	۰.۷%	-	-	۱۶,۵۴۹	۳۰,۸۶۹		۴۰%	



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	۰.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۶۲%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	۰.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۵۱%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۳	۱۰.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۲.۰۳	-۷۷%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۵	۱۱.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۵۹%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۶	۹.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۹۴	-۶۹%

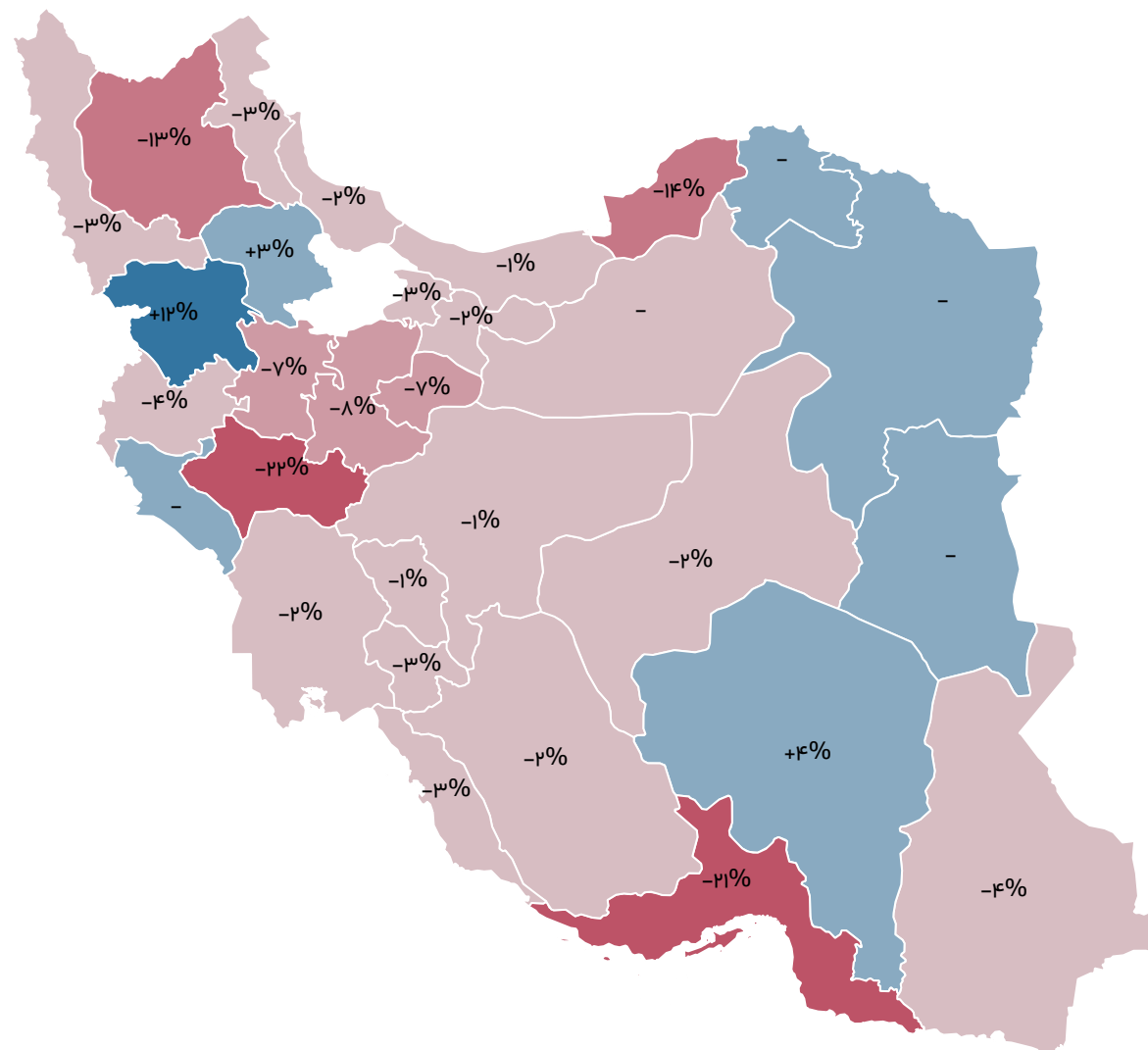
میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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 گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	تومان/کیلو	۹۳۳	۹۱۸	-۲%
	اصفهان	تومان/کیلو	۹۳۲	۹۲۷	-۱%
	البرز	تومان/کیلو	۹۴۰	۹۱۴	-۳%
	مرکزی	تومان/کیلو	۱,۰۶۸	۹۸۵	-۸%
	قم	تومان/کیلو	۱,۰۳۷	۹۶۱	-۷%
	یزد	تومان/کیلو	۷۱۸	۷۰۵	-۲%
جنوب	سمنان	تومان/کیلو	۸۱۵	۸۱۲	+۵%
	فارس	تومان/کیلو	۱,۰۰۱	۹۷۹	-۲%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۱,۱۱۹	۸۷۹	-۲۱%
غرب	بوشهر	تومان/کیلو	۱,۰۱۰	۹۸۳	-۳%
	همدان	تومان/کیلو	۹۶۹	۸۹۶	-۷%
	خوزستان	تومان/کیلو	۹۶۷	۹۴۳	-۲%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۹۰۴	۸۹۵	-۱%
	ایلام	تومان/کیلو	۷۰۶	۷۰۶	+۵%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۸۹۴	۸۶۱	-۴%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۹۶۵	۹۳۵	-۳%
	کردستان	تومان/کیلو	۱,۰۶۵	۱,۱۹۶	+۱۲%
	لرستان	تومان/کیلو	۱,۰۸۵	۸۴۳	-۲۲%
	مازندران	تومان/کیلو	۸۸۴	۸۷۳	-۱%
شمال	گیلان	تومان/کیلو	۷۰۹	۶۹۳	-۲%
	گلستان	تومان/کیلو	۸۶۱	۷۴۱	-۱۴%
شمال غرب	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۸۷۹	۸۵۳	-۳%
	اردبیل	تومان/کیلو	۱,۰۷۵	۱,۰۴۲	-۳%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۱,۰۵۹	۹۱۹	-۱۳%
شمال شرق	زنجان	تومان/کیلو	۹۶۶	۹۹۳	+۳%
	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۵%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۵%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۵%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۰۴۸	۱,۰۹۲	+۴%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۸۱۵	۷۸۲	-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.

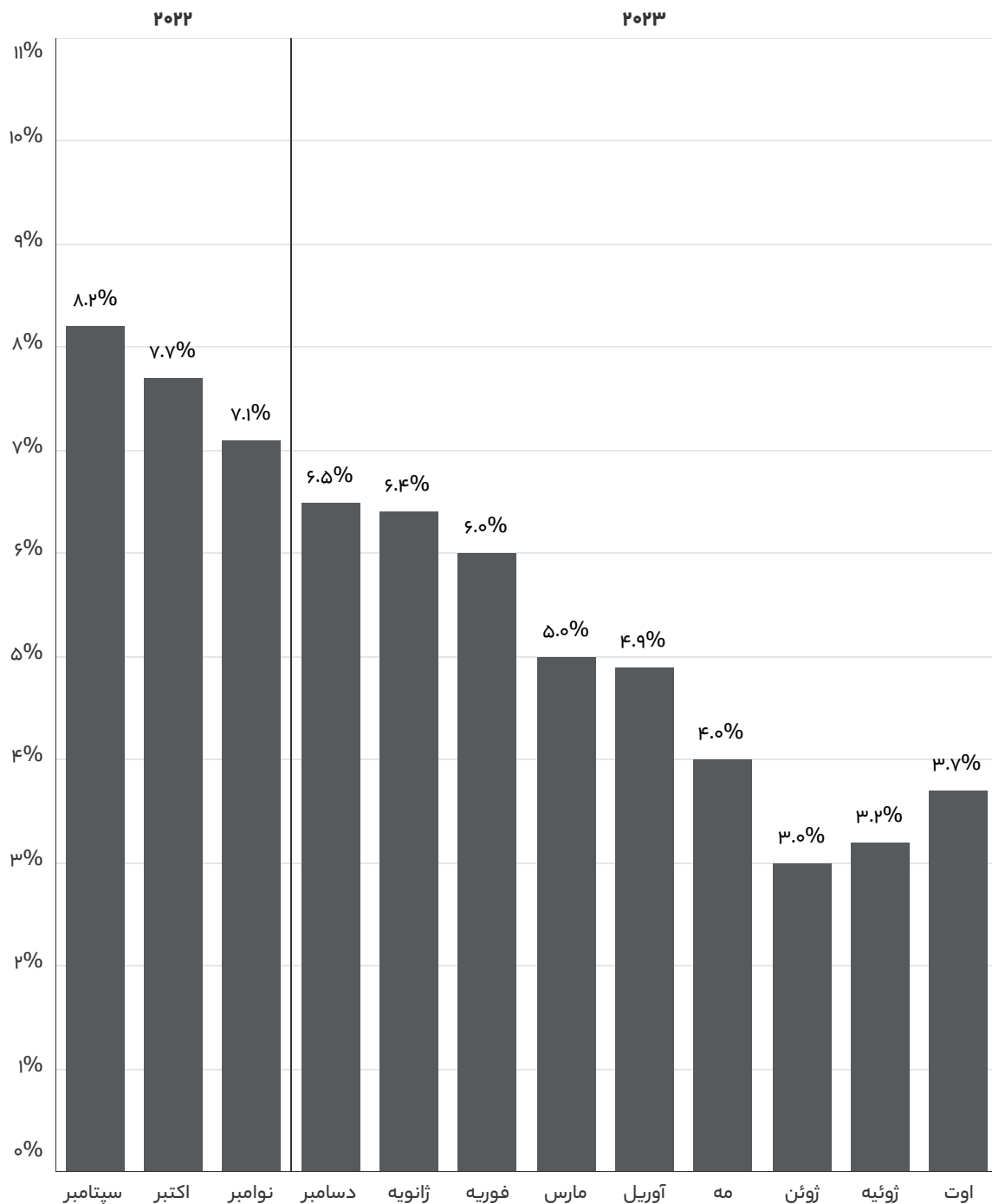
معادن و فلزات

انرژی

- ✓ ارزش دلار آمریکا در برابر رقبای خود پیش از تصمیمات کلیدی سیاست بانک مرکزی ایالات متحده، بریتانیا و ژاپن در هفته کاهش یافت. با کاهش دلار از قله ۶ ماه خود باعث شد تا قیمت طلا به بالاترین حد در دو هفته اخیر برسد. انتظار می‌رود فدرال رزرو هنگام اعلام تصمیم سیاست خود، نرخ‌ها را بدون تغییر نگه دارد. پیش بینی تحلیلگران از سخنرانی پاول، رئیس فدرال رزرو این است که احتمالاً ریسک‌های تورمی از بین نرفته‌اند و آنها در حالت انتظار برای تورم هستند. اگر فدرال رزرو برای کنترل تورم نرخ‌ها را افزایش دهد، طلا جذابیت خود را از دست می‌دهد.
- ▲ در پی انتشار آمارهای مثبت از اقتصاد چین، قیمت سنگ آهن به بیش‌ترین قیمت پنج ماه گذشته خود رسیده است. افزایش میزان وام‌های پرداختی از سوی بانک‌های چینی به مشتریان باعث بهبود شرایط بازار مسکن در این کشور شده است در نتیجه شاهد افزایش قیمت سنگ آهن و آهن آلات در این کشور هستیم. چین خریدار بیش از ۷۰ درصد از فولاد و سنگ آهن تولیدی در جهان است و طی ماه آگوست حدود ۱۰۶ میلیون تن سنگ آهن را وارد این کشور نموده که این رقم بالاترین میزان واردات آهن به چین از ماه اکتبر سال ۲۰۲۰ است. البته خبرها حاکی از تنظیم مقررات کنترل تولید فولاد در چین است مقرراتی که گفته می‌شود برای حصول اطمینان نسبت به عدم تولید مازاد مانند سال گذشته وضع شده‌اند، که میتواند مانعی برای افزایش بیشتر قیمت باشد.
- ▲ به گزارش رویترز، بانک گلدمن ساکس پیش بینی کرده رشد تقاضا برای نفت و کاهش تولید تمديد شده توسط عربستان و روسیه، بازار را به سوی کمبود سوق داده و باعث افزایش قیمت نفت شده است. با توجه به این شرایط اوپک این امکان را دارد تا قیمت نفت برنت را در سال آینده بین ۸۰ تا ۱۰۵ دلار در هر بشکه نگه دارد. نفت برنت و وست تگزاس اینترمدیت هفته گذشته، برای سومین هفته متوالی صعود کرده و به بالاترین حد از نوامبر سال ۲۰۲۲ رسیدند و در مسیر ثبت بزرگترین رشد قیمت سه ماهه از زمان آغاز حمله نظامی روسیه به اوکراین در سه ماهه نخست سال ۲۰۲۲ قرار دارند. این بانک سرمایه‌گذاری همچنین پیش‌بینی قیمت نفت برنت برای باقی سال را از ۹۳ دلار به ۱۰۰ دلار در هر بشکه افزایش داده است.
- ▲ پالایشگاه‌های نفت جهان قادر به تولید دیزل به حد کافی نیستند و شاهد کمبود دیزل هستیم که یک ریسک جدید برای افزایش تورم ایجاد کرده و اقتصادها را از یک سوخت حیاتی برای صنعت برق و حمل و نقل، محروم کرده است. قیمت دیزل در مقایسه با نفت خام با سرعت بیشتری افزایش پیدا کرده و بهای دیزل در آمریکا، به بالای ۱۴۰ دلار و جهش پیدا کرده است. همچنین قیمت معاملات اروپایی این سوخت از تابستان، ۶۰ درصد افزایش پیدا کرده است. اوضاع ممکن است از این هم بدتر شود. عربستان سعودی و روسیه، عرضه گریدهای نفتی را محدود کرده‌اند که بازدهی دیزل بالاتری دارند. عربستان و روسیه در پنجم سپتامبر اعلام کردند محدودیت عرضه اضافی خود را تا پایان سال ۲۰۲۳ ادامه خواهند داد، در حالی که طی مدت مذکور، تقاضا برای دیزل معمولاً افزایش پیدا می‌کند. گرمای شدید نیمکره شمالی در تابستان امسال، بسیاری از پالایشگاه‌ها را وادار کرد با نرخ تولید کندتری، فعالیت کنند.
- ▲ افزایش اخیر قیمت‌ها، اختلاف قیمت معاملات برای تحویل در ماه بعد با ماه‌های آتی را افزایش داده و قیمت ماه بعد، بالاتر از قراردادهای تحویل در ماه‌های آینده شده است. افزایش قیمت نفت برنت هم باعث شده است اختلاف قیمت بیشتری نسبت به شاخص قیمت نفت دوبی پیدا کند. به گفته معامله گران، افزایش اختلاف قیمت نفت برنت با نفت دوبی، نفت برنت را برای پالایشگاه‌های آسیایی گران تر کرده و باعث می‌شود آنها برای خرید، به خاورمیانه رو بیاورند. انتظارات برای تقاضای بالاتر، قیمت معاملات تحویل فوری گریدهای نفتی خاورمیانه مانند نفت عمان و موربان امارات را به بالاترین رکورد چند ماهه رسانده است. بر اساس گزارش رویترز، بانک استرالیایی ANZ پیش بینی کرد کاهش تولید اوپک پلاس در بحبوحه رشد تقاضای جهانی، احتمالاً بازار را در سه ماهه چهارم، با دو میلیون بشکه در روز کمبود عرضه روبرو می‌کند.
- ✓ پالایشگاه‌های چینی در پی افزایش سهمیه صادرات و حاشیه سود فروش، صادرات دیزل را از ابتدای سال میلادی جاری تاکنون، سه برابر افزایش دادند. آمار اداره کل گمرک چین نشان داد صادرات دیزل در فاصله ژانویه تا اوت، ۱۹۷ درصد در مقایسه با هشت ماه نخست سال ۲۰۲۲ رشد کرد. صادرات دیزل چین در ماه اوت نسبت به مدت مشابه سال گذشته، ۵۲ درصد افزایش داشت. افزایش صادرات سوخت به خصوص دیزل از سوی چین، همزمان با رشد حجم پالایش نفت توسط پالایشگاه‌های چینی در اوت، روی داد. آمار هفته گذشته چین نشان داد حاشیه سود بالای صادرات و پیک تقاضای تابستانی، باعث شده است پالایشگاه‌های این کشور، پالایش نفت را به رکورد ۱۵۰۲ میلیون بشکه در روز در اوت افزایش دهند که بالاترین حجم پالایش شده تاکنون بوده است.
- ▲ دولت روسیه در پی ممنوعیت صادرات فرآورده‌های نفتی برای مدتی مشخص به منظور تثبیت قیمت داخلی سوخت است. روسیه قصد دارد با این اقدام باعث اشباع بازار داخلی و در نتیجه کاهش قیمت‌ها برای مصرف کنندگان شود این محدودیت، شامل صادرات بنزین هم خواهد بود که روسیه به مقدار کمتری صادر می‌کند. محدودیت صادراتی روسیه، ممکن است کمبود در بازار دیزل جهانی را نیز تشدید کند. پالایشگاه‌های نفت جهان در بحبوحه محدودیت عرضه نفت عربستان سعودی و روسیه، قادر نیستند به حد کافی از این سوخت را تولید کنند. طبق آمار رسمی، قیمت خرده‌فروشی بنزین و دیزل در روسیه از ابتدای سال ۲۰۲۳ تا ۱۸ سپتامبر، ۹۰۴ درصد افزایش داشته، در حالی که مجموع رشد قیمت‌های مصرف کننده چهار درصد بوده است.
- ▲ عبدالعزيز بن سلمان طی نشستی تخصصی در کنگره جهانی نفت کلگری کانادا، تمديد کاهش داوطلبانه روزانه یک میلیون بشکه‌ای عربستان تا پایان دسامبر ۲۰۲۳ با هدف افزایش قیمت‌ها را رد کرد. وی افزود: تمديد کاهش عرضه داوطلبانه نفت عربستان برای افزایش قیمت نبوده، بلکه این تصمیم متناسب با داده‌های موجود در بازارهای جهانی اتخاذ شده است. وزیر انرژی عربستان همچنین ادامه تردیدها درباره مصرف نفت چین، رکود تولید در اروپا و سیر تورم و نرخ بهره در آمریکا و اروپا را از دیگر دلایل رسیدن به این تصمیم دانست. بن سلمان با رد پیش‌بینی‌ها درباره اینکه بازار نفت کمبود زیادی را در سه ماه چهارم تجربه خواهد کرد، یادآور شد که پیش‌بینی‌های عرضه و تقاضا همیشه قابل اعتماد نیستند. بن سلمان با اشاره به برآوردهای اخیر آژانس بین المللی انرژی درباره شرایط بازارهای انرژی و تقاضا برای سوخت‌های فسیلی گفت: آنها از یک نهاد پیش‌بینی‌کننده و ارزیاب بازارهای انرژی به یک مدافع سیاسی تبدیل شده‌اند.

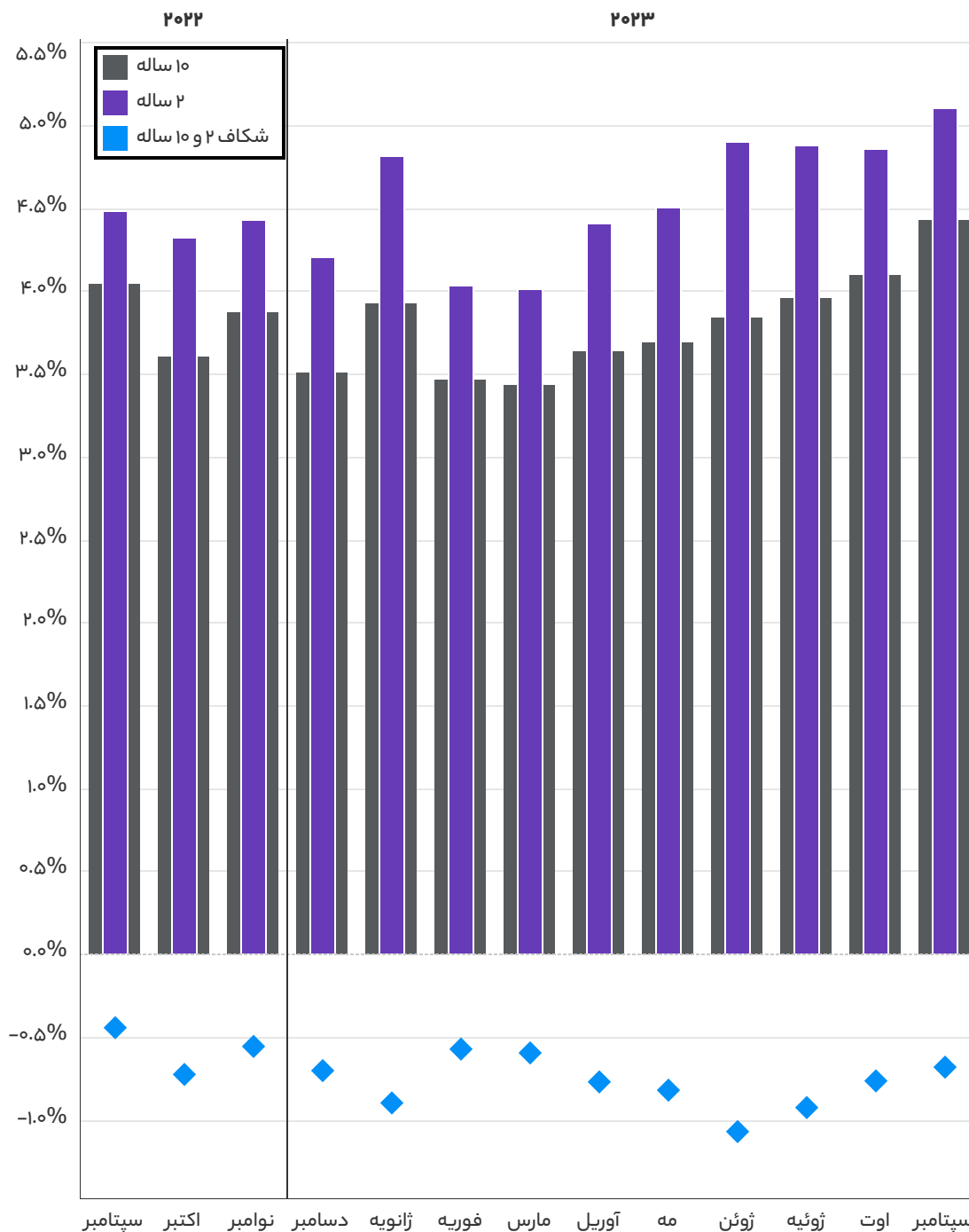
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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

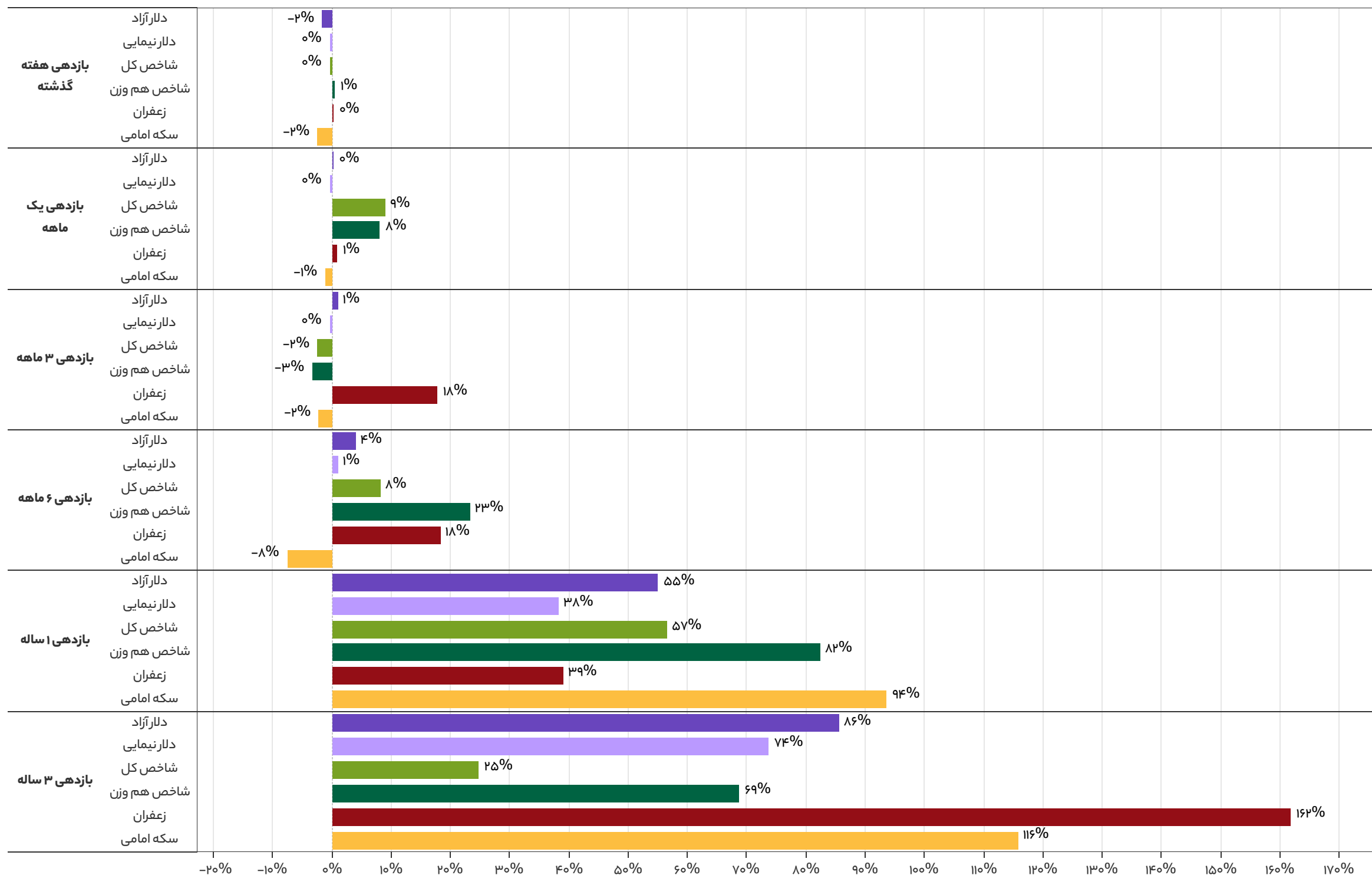
EQUITY MARKET

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												بازده سال	نوسان
۱۴۰۱/۰۳	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	سکه امامی ▲ ۱۱۱.۰%	هم وزن ۴۳%
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%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%	شاخص کل ۳۹%
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 درهر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

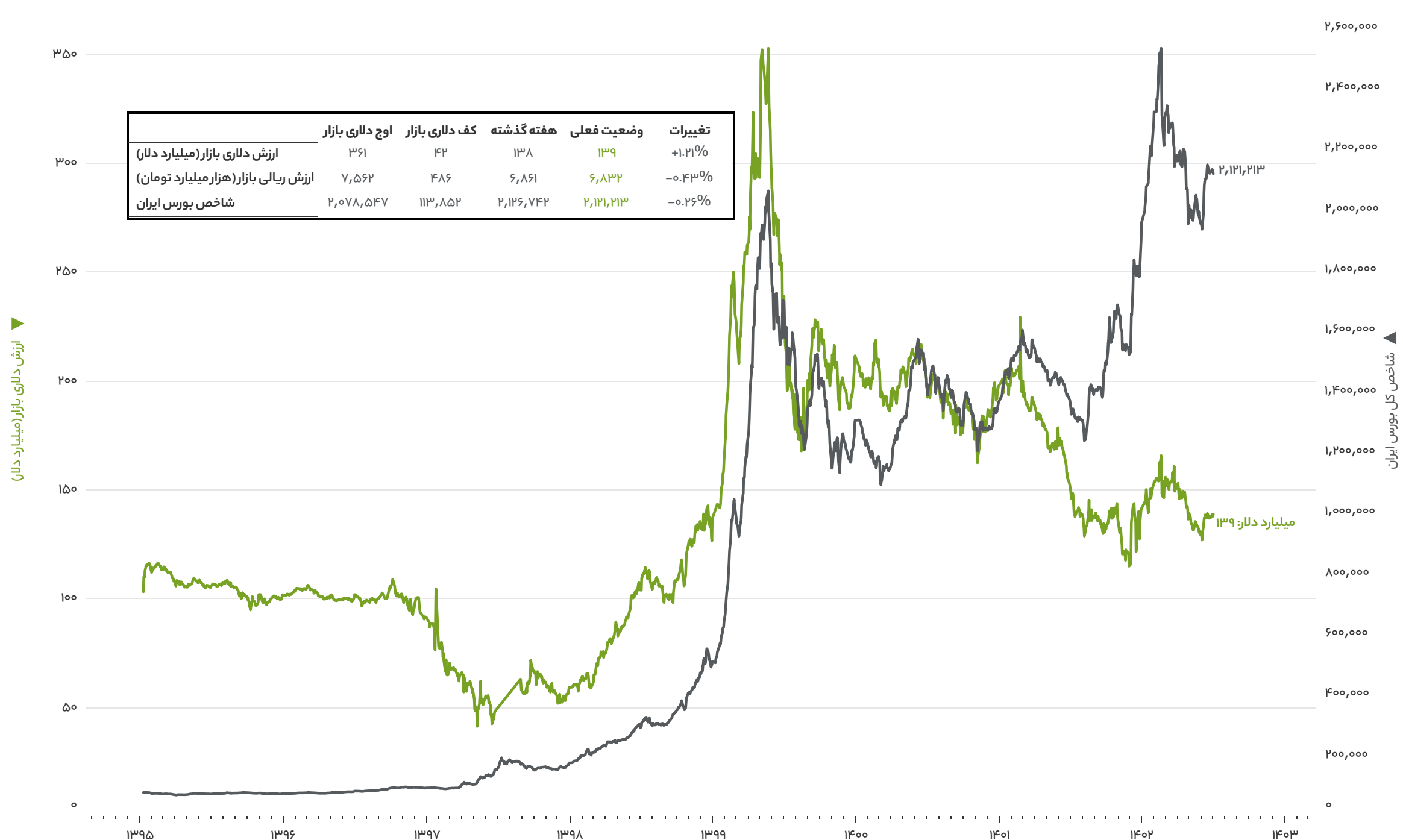
– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری زعفران سحرخیز محاسبه شده است.

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



ارزش دلاری بازار

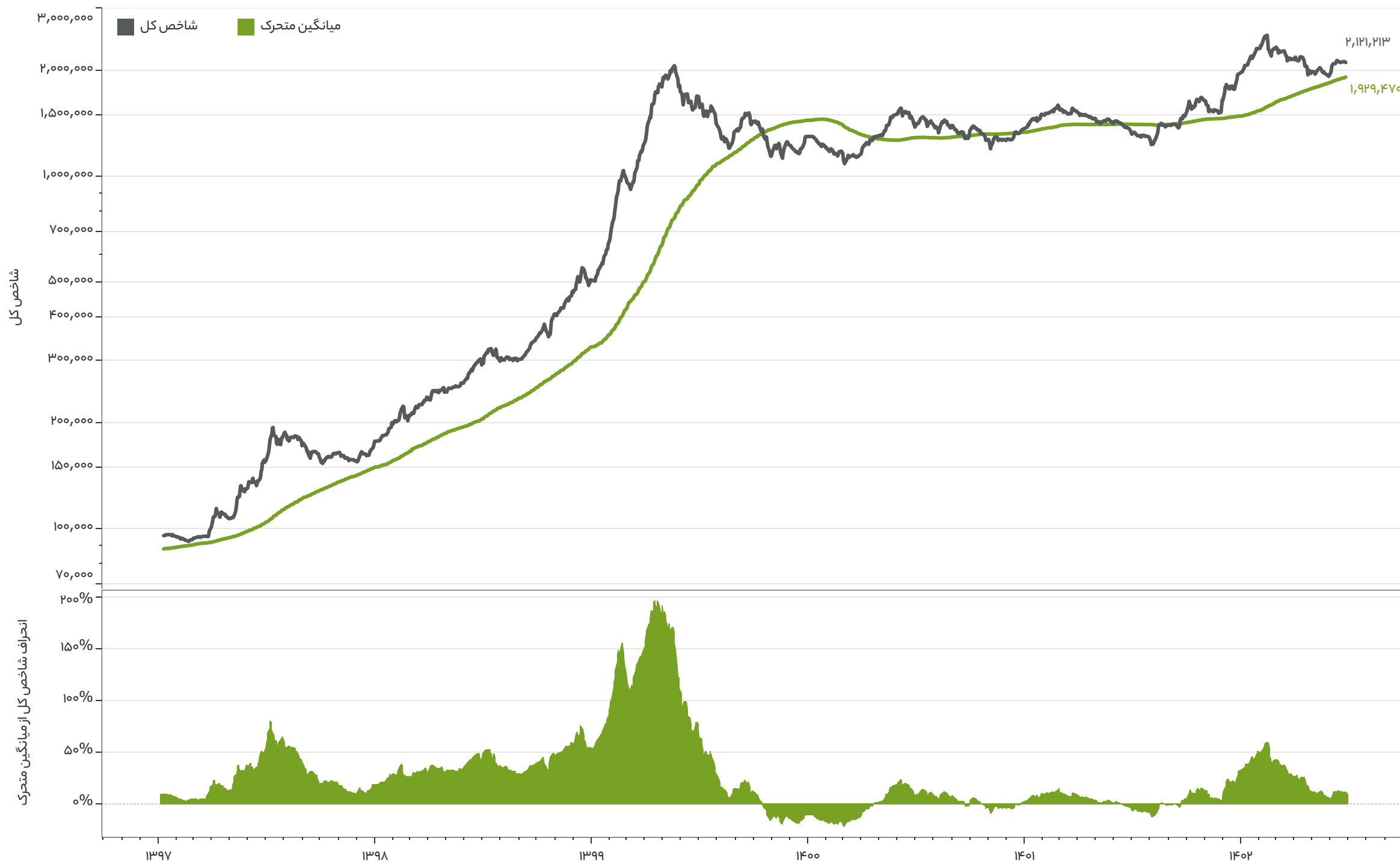
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

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



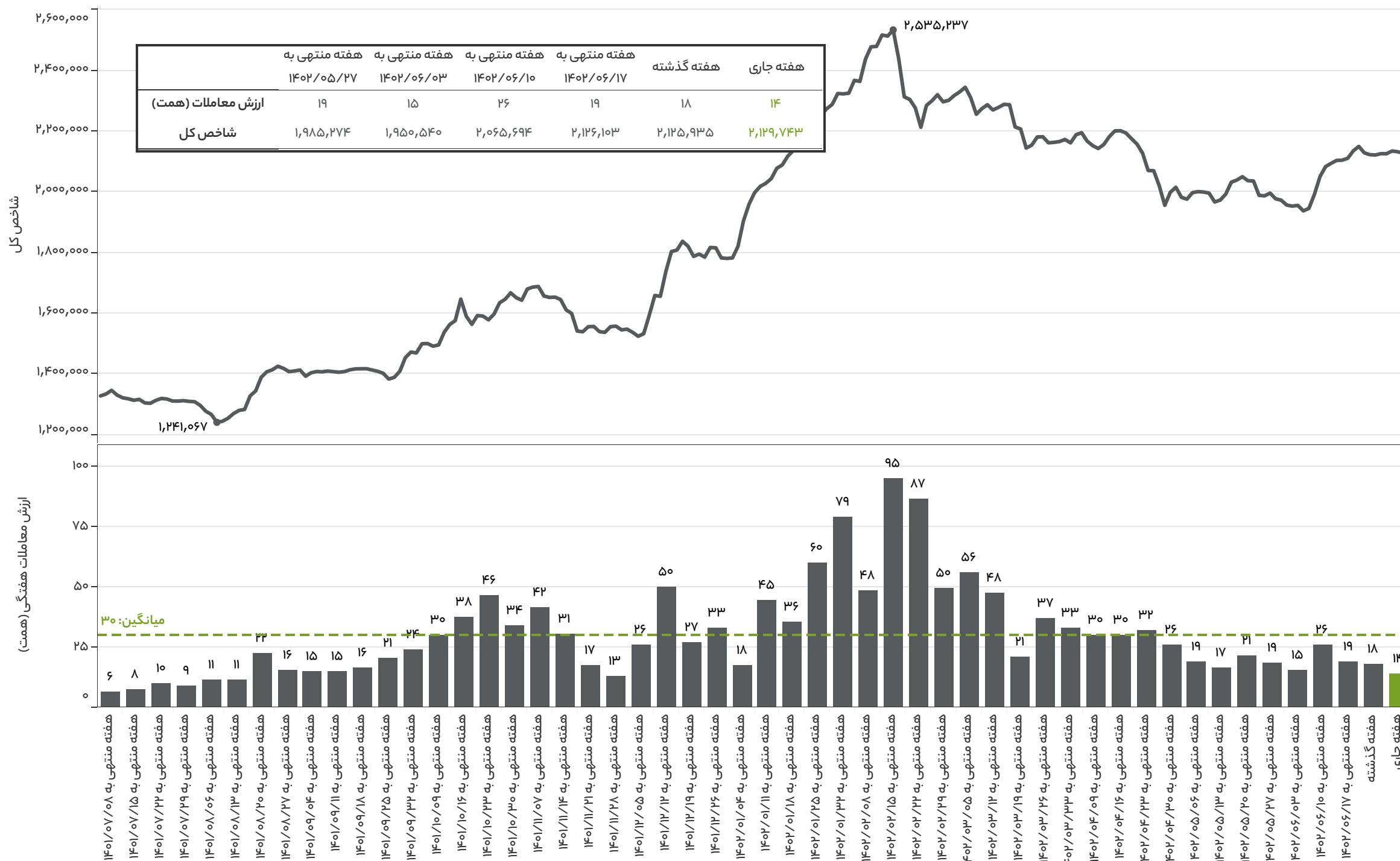
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



ارزش معاملات هفتگی بازار

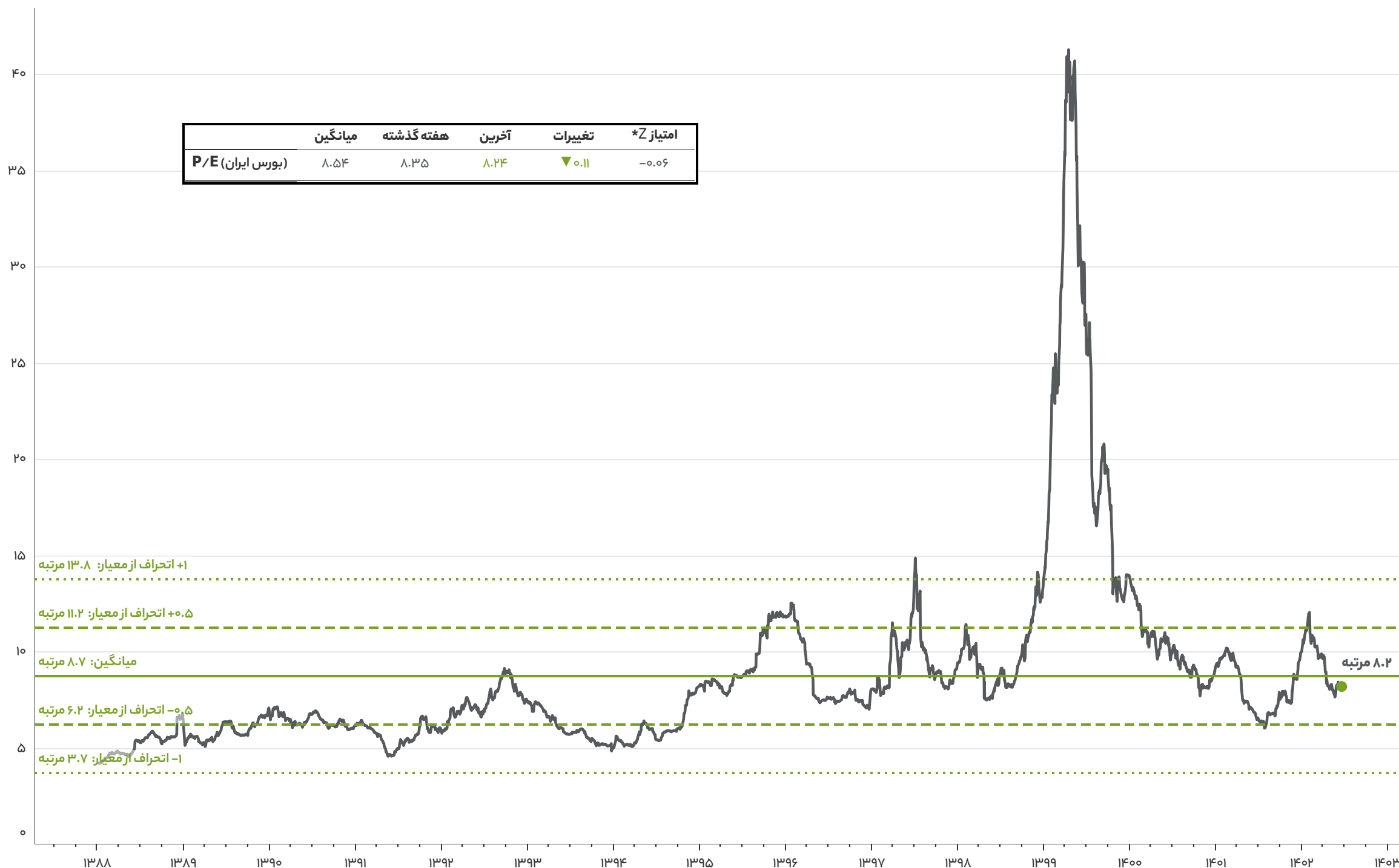
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





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.

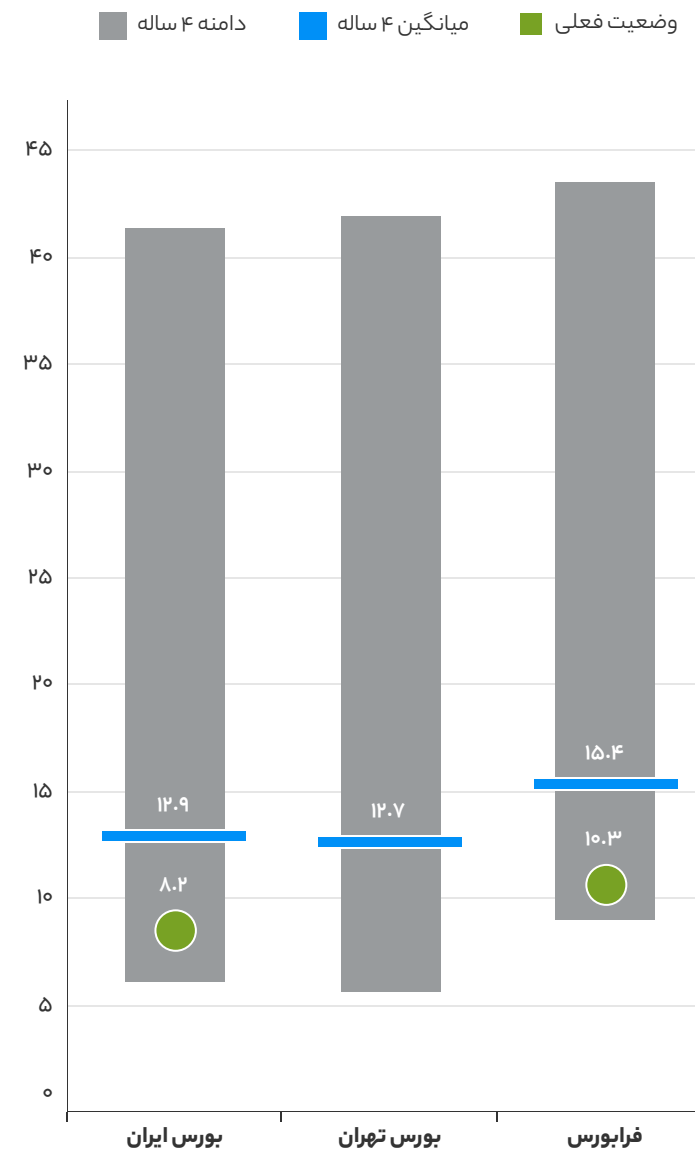
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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
فرابورس	۱۰.۳	۱۵.۴	۱۰.۳	۱۲.۰۷	۱۲.۰۹
بورس تهران	۱۲.۰۷	۱۲.۰۷	۱۲.۰۷	۱۲.۰۷	۱۲.۰۷
بورس ایران	۱۲.۰۹	۱۲.۰۹	۱۲.۰۹	۱۲.۰۹	۱۲.۰۹



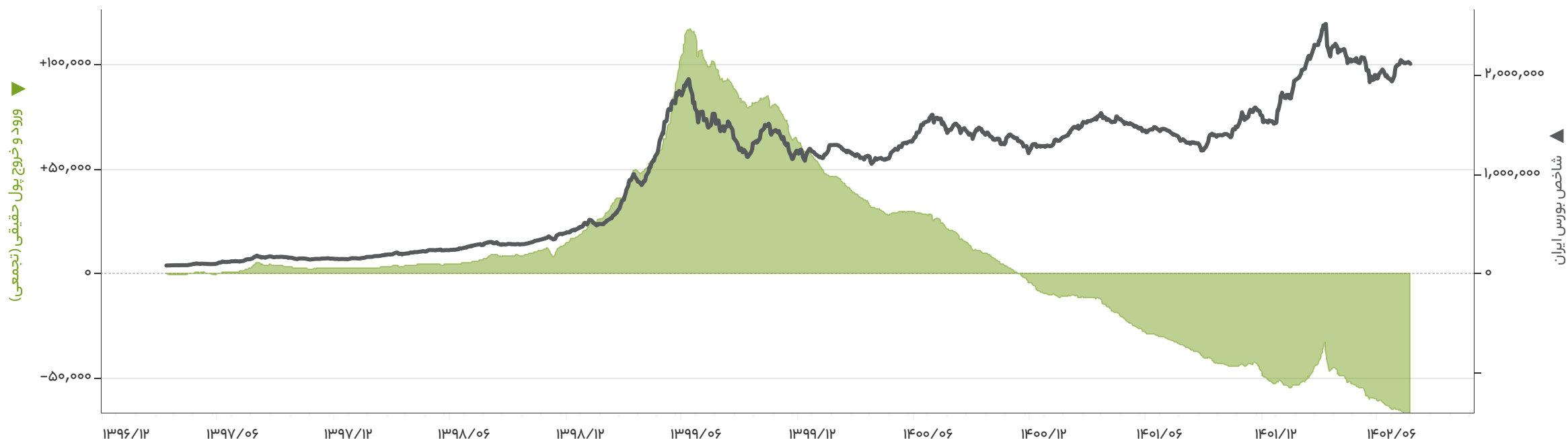
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

بازار سهام

	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	۹۰	۱۱۳	۱۱۶	۱۶۰	۱۹۰	۲۲۱	۳۸۱	۶۷۶	۳,۱۰۸	۳,۲۸۶	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۵%	۱.۱%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۶%	۴.۵%	۸.۱%	۳۷.۱%	۳۹.۲%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۵	۶.۲	۱۱.۶	۲۲.۵	۹.۴	۱۰.۶	۱۱.۹	۵.۹	۵.۸	۷.۶	۸.۵	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۵%	۲۶.۱%	۳.۵%	۲.۶%	۶.۳%	۵.۰%	۴.۴%	۲.۴%	۲۰.۰%	۷.۶%	۱۱.۷%	
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)	+۵۰۱%	+۸۴۴%	+۱۲۹%	+۲۸۵%	+۳۹۵%	+۳۷۵%	+۴۵۱%	+۸۴۸%	+۸۷۴%	+۸۴۰%	+۹۲۵%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۶%	+۱۳۱%	-۶۳%	۰%	+۱۸%	-۱۹%	+۳%	-۱۴%	+۲۶%	-۱%	+۶۰%	
بازده از ابتدای سال	+۱۶۹%	+۵۲%	+۴۷%	+۶۵%	+۹۷%	+۸۵%	+۶۳%	+۹۱%	+۱۰۷%	+۶۳%	+۷۸%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۰%	-۱%	۱%	۱%	۰%	۰%	۰%	-۱%	۰%	-۱%	۰%	

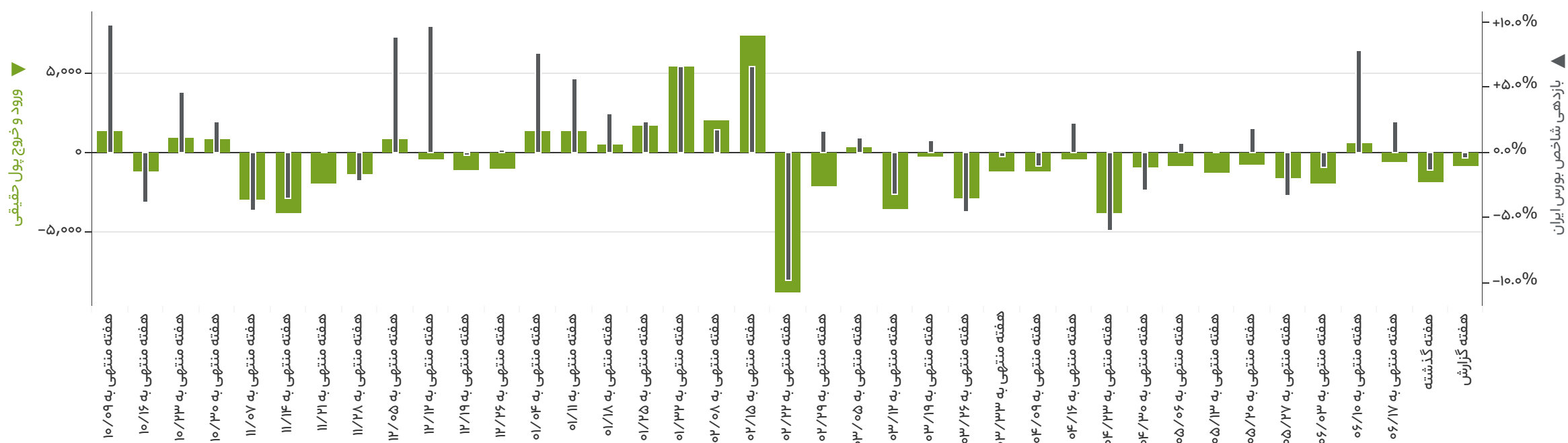
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



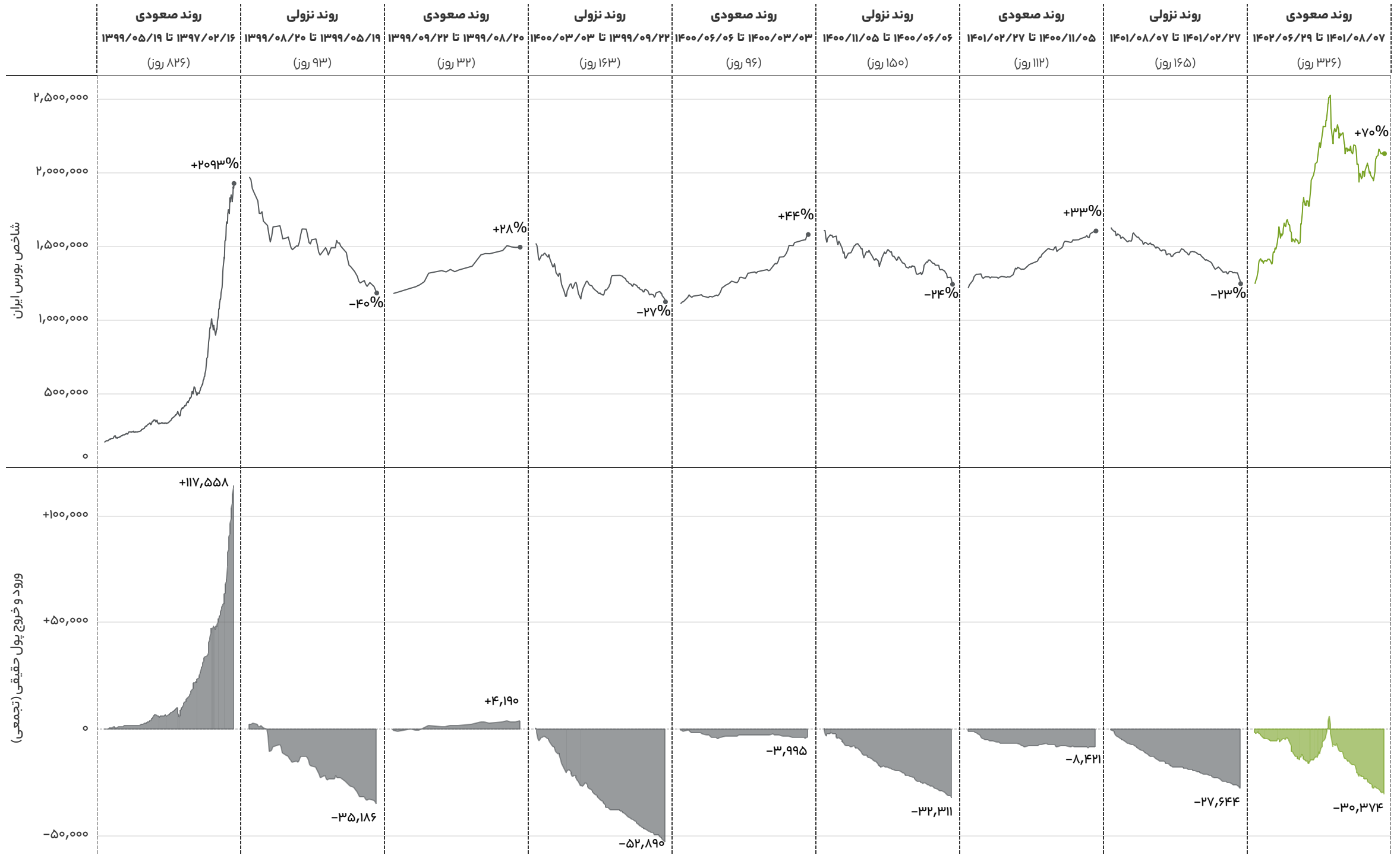
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

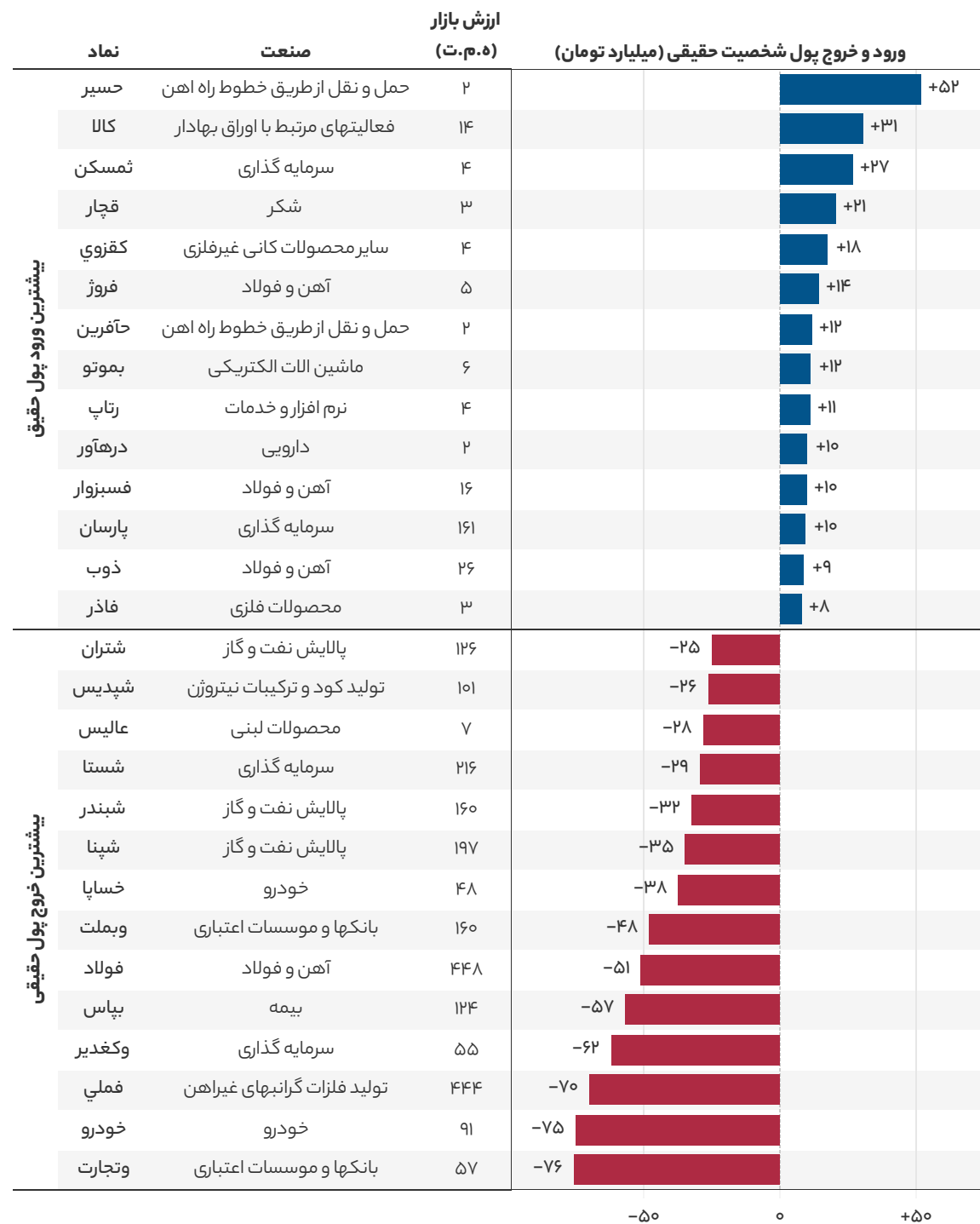




ورود و خروج پول

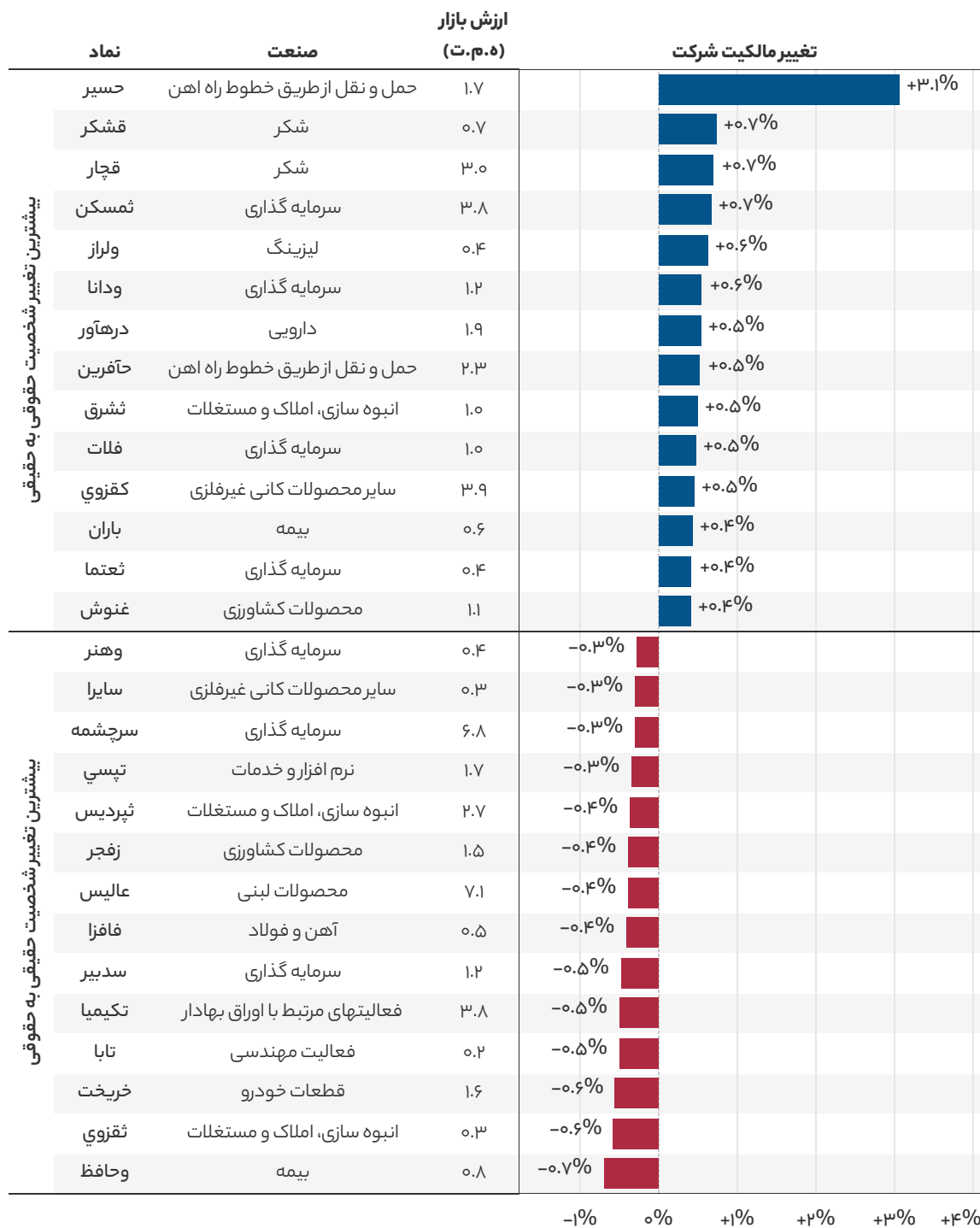
ورود و خروج پول حقیقی

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



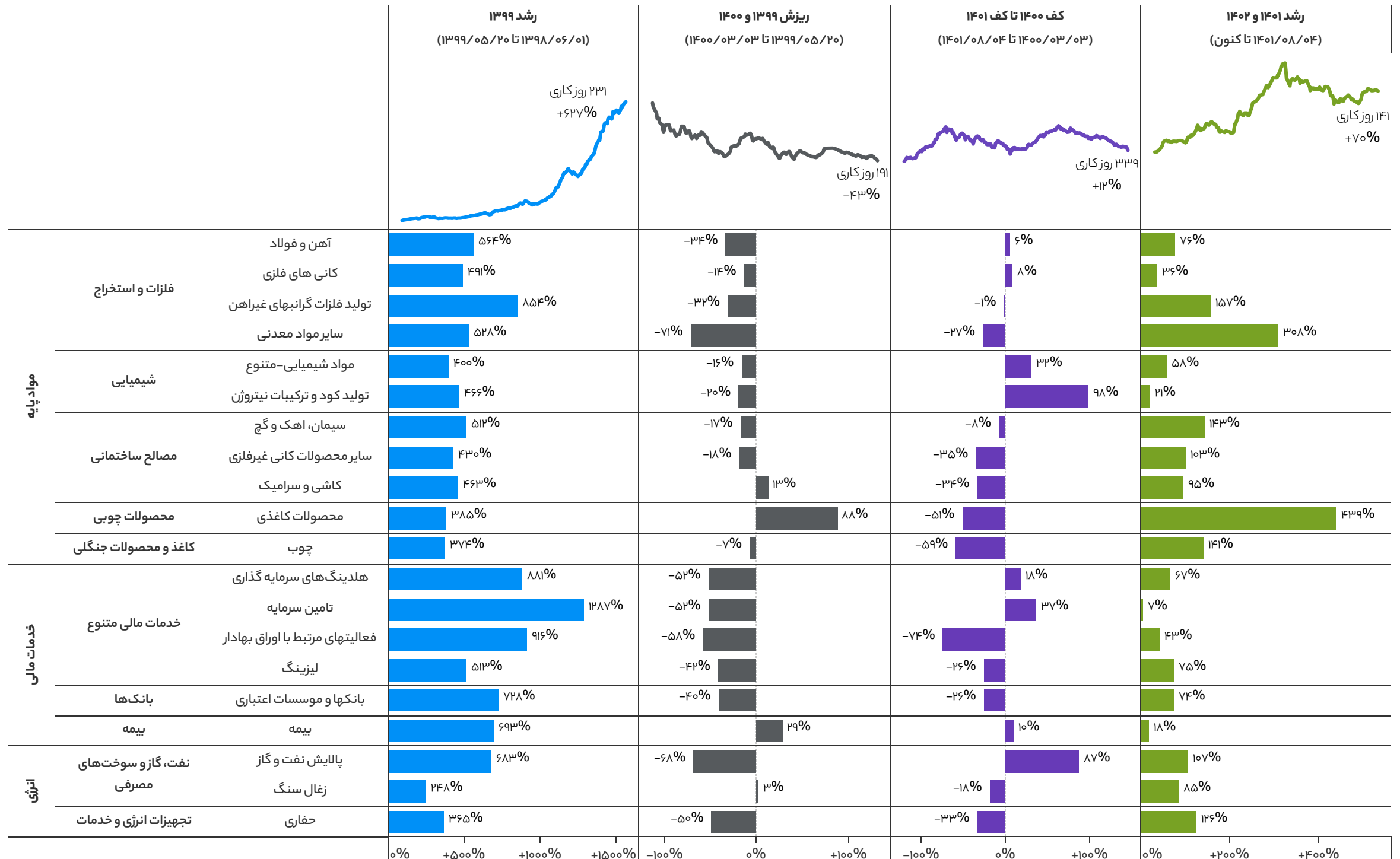
تغییر مالکیت شرکت

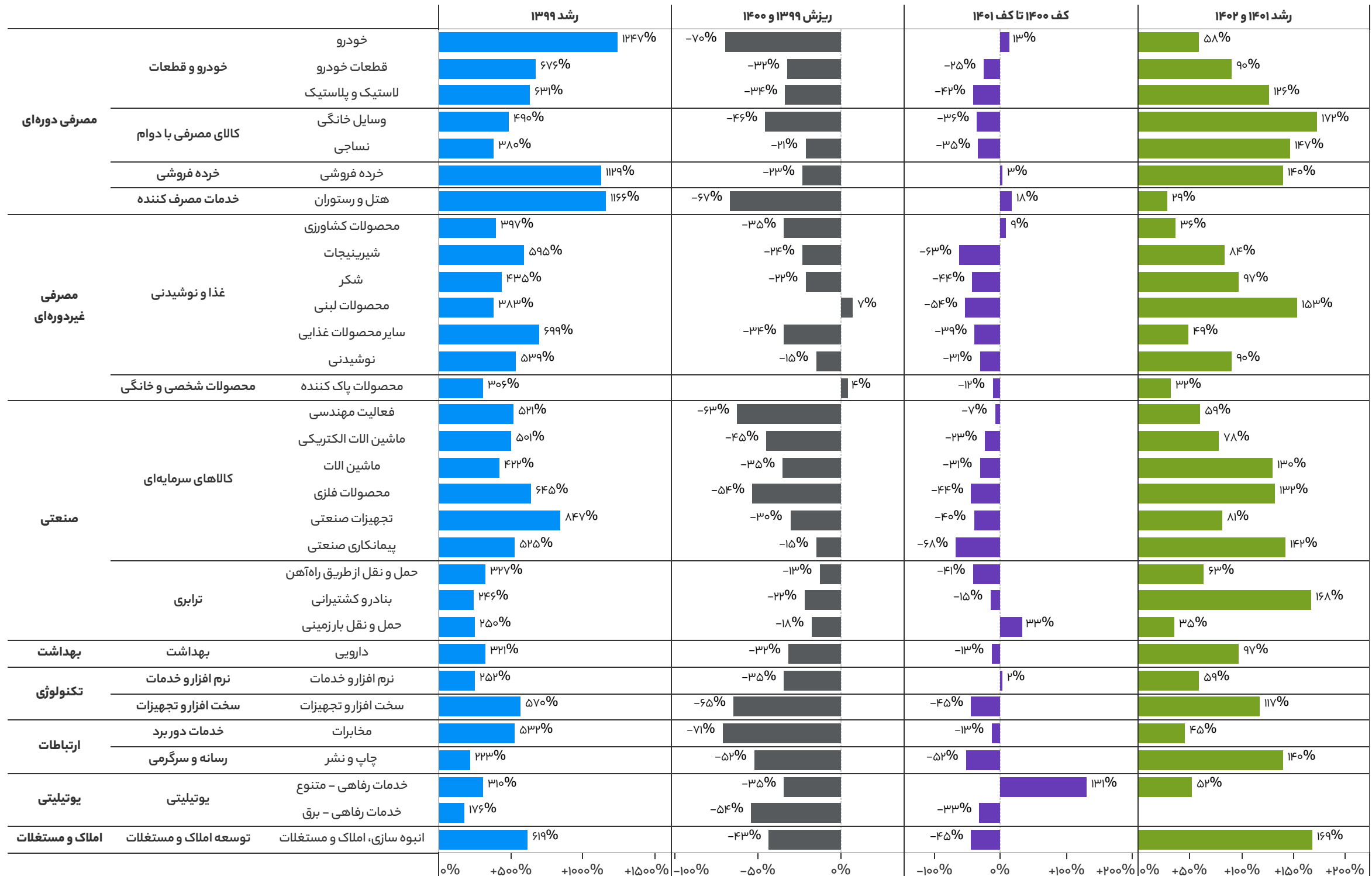
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

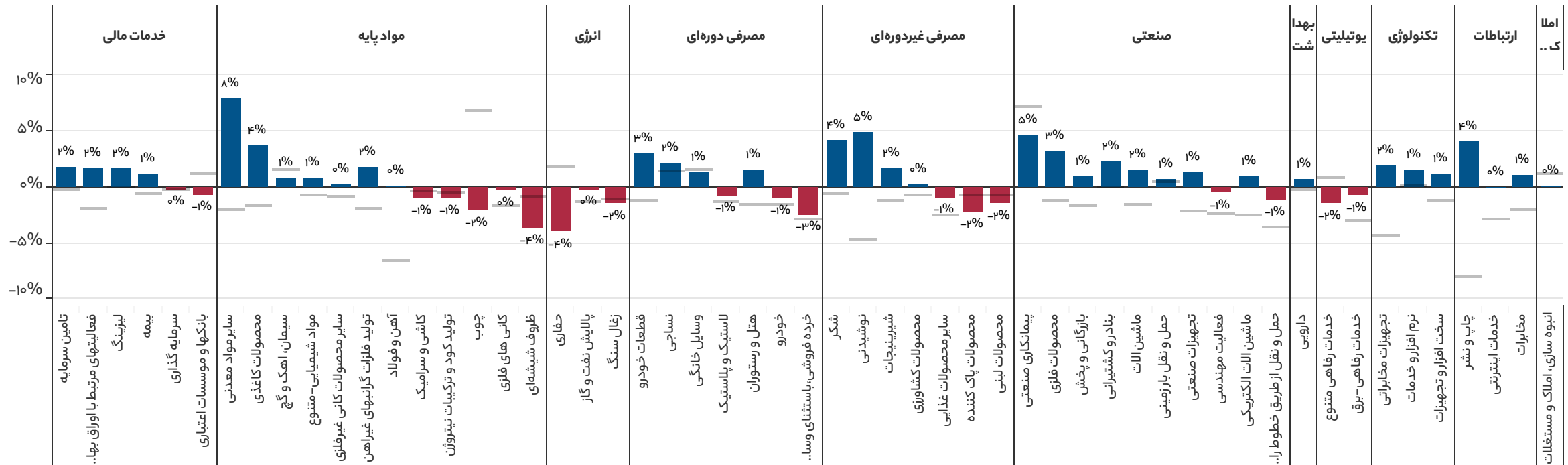
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۸، شاخص بورس ایران، بازدهی صنایع به تفکیک زیرگروه و سکتور، مرتب شده براساس ارزش بازار



بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)


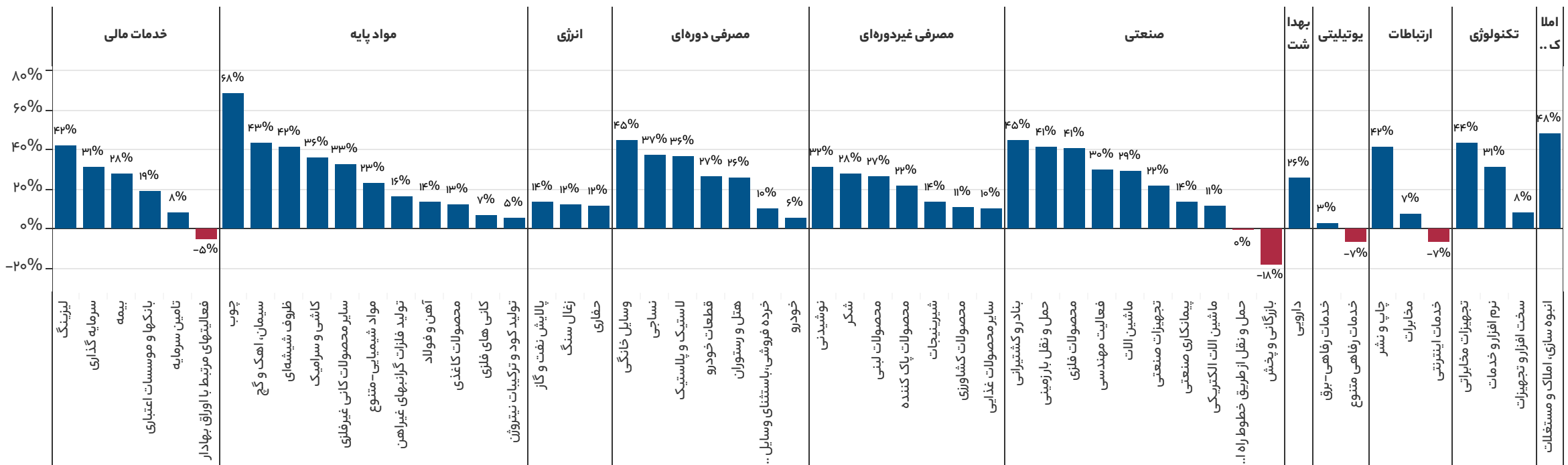
بازده صنایع از ابتدای هفته

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله ای و بازده هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)

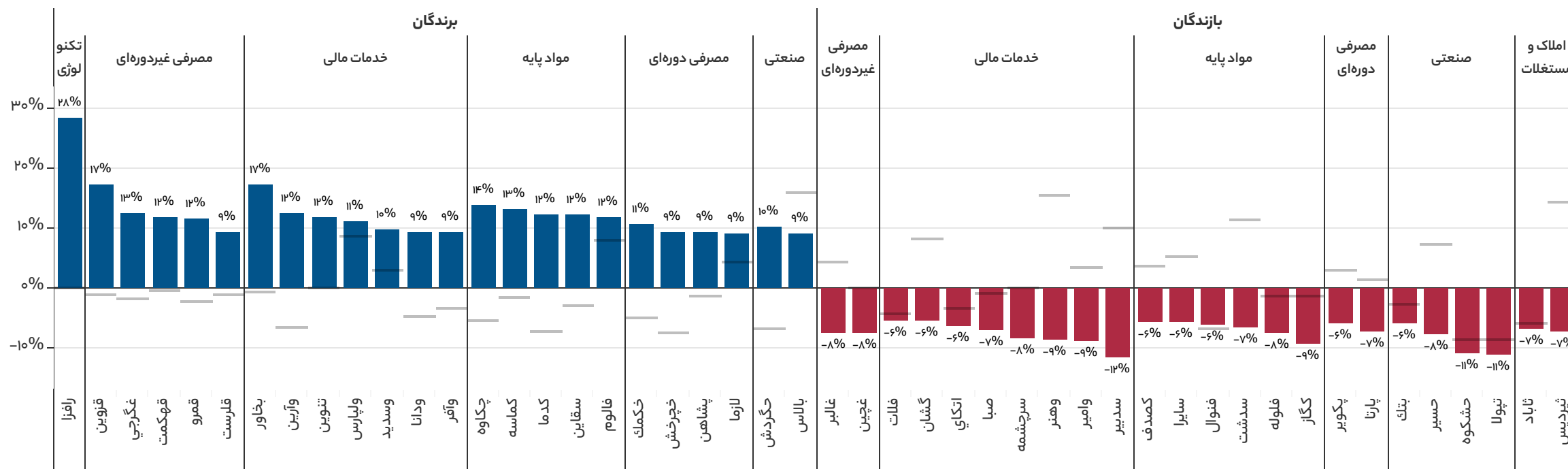




برندگان و بازندگان هفته

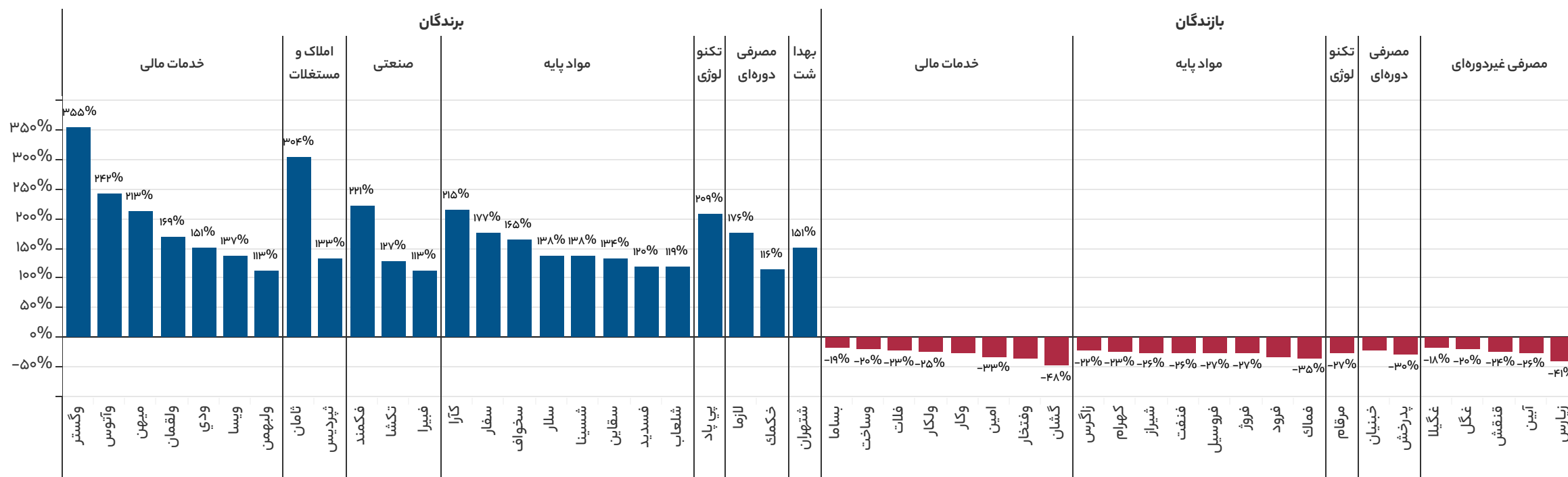
برندگان و بازندگان هفته

(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، بازده تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم

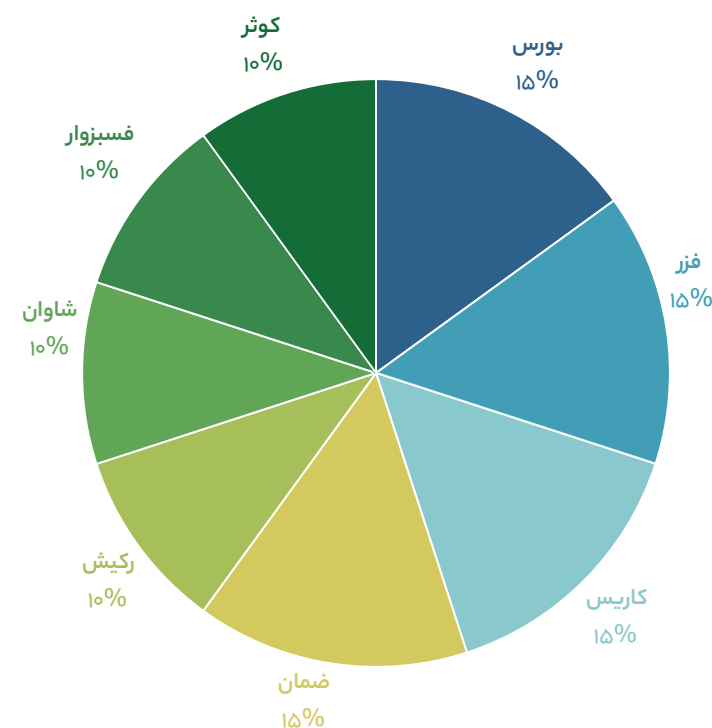


بازده هفته گذشته	شندر	پارسان	ماون	حکشتی	فولاد	اخابر	شینا	تامینکو	بوعلی	میدکو	فارس	شبریز	پپاس	ککهر	وپاسار	نوری	فملی	خودرو	شستا	تاپیکو	فخوز	وغدیر	جم	وامید	وصندوق	شتان	وکغدیر	کچاد	وتجارت	شپدیس	وسپهر	رمینا	شیراز	مین	ومعادن	کگل	خسپا	آریا	ویملت	پارس
	+۲.۳%	+۱.۸%	+۱.۳%	+۱.۱%	+۰.۷%	+۰.۷%	+۰.۷%	+۰.۳%	+۰.۲%	+۰.۲%	+۰.۱%	+۰.۱%	۰%	۰%	۰%	-۰.۳%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۱.۱%	-۱.۳%	-۱.۳%	-۱.۴%	-۱.۴%	-۱.۷%	-۱.۸%	-۱.۹%	-۲.۰%	-۲.۰%	-۲.۳%	-۲.۳%	-۲.۴%	-۲.۴%	-۲.۶%	-۲.۷%	-۲.۸%	-۳.۰%	-۳.۲%	-۴.۱%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۴۷۵	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۵,۰۰۰	رکیش	میان مدت
۱۰%	۲۳,۶۵۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۴۰,۲۵۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۴۵,۰۰۰	فسبزوار	
۱۰%	۵,۳۱۰	رشد سودآتی شرکت ناشی از سرمایه گذاری‌ها و عملیات بیمه‌ای	۵,۸۴۱	کوثر	
۱۵%	۱۵,۰۰۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۶,۰۷۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۸,۲۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۱,۹۵۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۴۷,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۲,۳۲۰	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 ۲،۲۲۰ هزار واحد رشد داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین حمایت در تصویر مشخص شده است. باید دید واکنش نسبت به این حمایت به چه صورت خواهد بود.

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود رشدی تا حوالی ۵.۵ 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 تراکم ایجاد شده 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 شیمیایی	الفین	آریا	۱۲	۱۱۴.۱	۸,۳۰۰	۸۰۲	۹۵%	۹۵۶	۱,۲۷۸	+۳۴%	۸.۷	۶.۴	۷.۸	+۰.۰						
		جم	۱۲	۸۱.۷	۴,۵۴۰	۵۶۰	۹۹%	۸۵۳			۵.۳									
		جم پیلن	۱۲	۳۷.۵	۱۸,۷۳۵	۲,۱۰۹	۹۹%	۲,۷۹۰	۳,۳۷۶	+۲۱%	۶.۷	۵.۳	۶.۲	+۰.۷						
		شگویا	۱۲	۳۵.۹	۱,۵۰۰	۱۴۳	۹۱%	۲۵۹	۳۱۹	+۲۳%	۵.۸	۴.۴	۶.۳	-۰.۴						
		شکبیر	۱۲	۲۶.۲	۷,۲۹۰	۱,۱۶۸	۸۸%	۱,۶۱۳			۴.۵									
		شاراک	۱۲	۲۵.۶	۳,۱۷۶	۴۱۹	۹۶%	۵۶۷	۷۴۸	+۳۲%	۵.۶	۳.۹	۴.۹	-۱.۰						
		شغذیر	۱۲	۸.۸	۶,۷۹۹	۱,۰۹۶	۹۱%	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۹	۴.۸	۶.۲	+۰.۰						
		شبصیر	۱۲	۶.۸	۲,۷۰۰	۳۷۶	۸۱%	۳۹۱	۵۲۸	+۳۵%	۶.۹	۵.۱	۶.۲	+۰.۹						
	شجم	۶	۵.۱	۷۸۰	۸۸	۸۵%	۷۵	۱۳۲	+۷۶%	۱۰.۴	۶.۷	۵.۷	-۵.۳							
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۲۶.۵	۱۴,۰۶۱	۱,۳۱۴	۱۰۰%	۱,۷۹۴	۲,۴۵۰	+۳۷%	۷.۸	۵.۶	۶.۳	-۰.۲						
		یوعلی	۱۲	۷۵.۷	۵,۲۷۸	۵۶۳	۹۵%	۷۵۸			۷.۰									
	اوره	شپدیس	۶	۱۰۱.۴	۱۶,۸۹۸	۴,۲۶۴	۶۳%	۳,۱۰۴	۳,۱۱۲	۰%	۵.۴	۶.۱	۵.۶	+۲.۲						
		شیراز	۱۲	۳۸.۷	۲,۵۲۷	۷۶۱	۲۱%	۴۰۱	۴۶۹	+۱۷%	۶.۳	۵.۶	۶.۱	+۱.۵						
		خراسان	۱۲	۲۷.۳	۱۵,۲۶۹	۲,۸۱۰	۸۳%	۱,۵۶۲	۲,۲۰۲	+۴۱%	۹.۸	۶.۹	۸.۸	+۴.۸						
		کرماشا	۱۲	۲۱.۷	۲,۰۴۷	۴۵۸	۴۸%	۲۵۶	۳۲۸	+۲۸%	۸.۰	۶.۴	۷.۲	+۲.۵						
		شاروم	۱۲	۲.۷	۳,۸۸۵	۱۶۷	۴۳%	۴۱۴			۹.۴									
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۲.۸	۱۳,۶۸۵	۱,۲۶۵	۷۲%	۱,۲۱۳			۱۱.۳									
		شخارک	۱۲	۲۶.۵	۴,۴۱۴	۶۴۱	۹۹%	۸۰۰	۱,۱۲۴	+۴۰%	۵.۵	۳.۶	۴.۴	-۴.۰						
		شفن	۱۲	۱۸.۵	۵۹۹	۱۰۲	۸۹%	۶۹	۱۱۳	+۶۴%	۸.۷	۵.۳	۷.۴	-۱.۶						
	محصولات شیمیایی	شکلر	۸	۳.۹	۳,۹۲۳	۴۱۹	۷۲%	۶۲۴	۶۶۳	+۶%	۶.۳	۵.۴	۵.۸	+۱.۵						
شکام		۱۲	۳.۹	۹۶۷	۱۱۵	۱۴%	۱۷۹			۵.۴										
شمواد		۶	۲.۰	۱۳,۷۴۵	۷۳۹	۲۳%	۱,۸۳۱	۱,۹۳۴	+۶%	۷.۵	۸.۱	۶.۷	+۰.۱							
شملی		۶	۱.۷	۷۹۸	۴۱		۵۵	۸۵	+۵۴%	۱۴.۵		۱۵.۴								
دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۲	۵۰۱	۶۴	۸۲%	۹۲	۹۶	+۴%	۵.۴	۴.۹	۴.۷	-۱.۸							
	شصدف	۱۲	۲.۵	۳,۶۱۵	۳۹۲	۷۳%	۳۵۷	۲۷۱	-۲۴%	۱۰.۱	۱۳.۶	۱۰.۷	+۱.۲							
	شدوص	۱۲	۲.۰	۲,۰۹۹	۱۹۳	۹۳%	۳۲۶	۳۹۸	+۲۲%	۶.۴	۵.۱	۵.۸	-۰.۵							

-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		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)																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																					
مواد پایه فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۴۸.۰	۵۶۰	۸۵	۵۰%	۱۰۱	۱۲۵	+۲۳%	۵.۵	۴.۵	۵.۳	+۱.۴																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																					

-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 (آینده نگر ۴ فصله)								
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله									
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ	ستران	۱۲	۹.۸	۵,۶۱۰	۶۰۰	۷۶%	۱,۰۰۰				۵.۶										
		ساوه	۱۲	۹.۵	۱۴,۶۲۵	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۱	۴.۷	۵.۴	+۰.۸								
		سآبیک	۱۲	۷.۲	۲,۴۲۶	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۶.۲	۴.۶	۵.۶	+۱.۵								
		سخوز	۱۲	۶.۵	۴,۶۴۱	۷۱۹	۹۰%	۹۸۷	۱,۲۱۶	+۲۳%	۴.۷	۳.۵	۳.۷	-۰.۷								
		سپاها	۶	۵.۵	۲,۲۳۰	۱۹۷	۷۵%	۳۲۶	۵۶۱	+۷۲%	۶.۸	۴.۴	۳.۹	-۰.۱								
		ساروم	۱۲	۴.۴	۴,۴۱۷	۵۵۴	۹۶%	۷۱۰	۹۹۴	+۴۰%	۶.۲	۴.۲	۵.۵	+۰.۱								
		سرود	۱۲	۴.۰	۴,۹۷۵	۴۹۶	۹۶%	۶۵۱	۹۵۰	+۴۶%	۷.۶	۵.۱	۷.۲	+۱.۵								
		سشرق	۶	۳.۹	۱,۴۸۸	۱۵۴	۷۲%	۲۴۷	۳۷۴	+۵۲%	۶.۰	۴.۳	۳.۱	-۴.۶								
		سصوفی	۱۲	۳.۲	۲,۹۱۳	۳۶۸	۹۰%	۵۳۲	۹۰۷	+۷۱%	۵.۵	۳.۰	۴.۶	-۰.۴								
		سشمال	۹	۲.۹	۱,۷۰۷	۱۷۰	۸۹%	۲۷۵	۴۱۱	+۴۹%	۶.۲	۳.۷	۴.۷	+۰.۴								
		سبجنو	۱۲	۲.۸	۷,۱۸۳	۵۷۳	۹۶%	۱,۱۱۵	۱,۴۱۲	+۲۷%	۶.۴	۴.۸	۵.۶	-۱.۱								
		سبهان	۱۲	۲.۲	۱۰,۹۰۰	۷۳۶	۹۷%	۱,۵۵۶	۱,۷۸۹	+۱۵%	۷.۰	۵.۹	۷.۰	-۰.۱								
	کاشی و سرامیک	سخرز	۱۲	۲.۱	۴,۲۵۱	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۸.۹	۶.۶	۷.۰	+۰.۱								
		سشاش	۱۲	۱.۶	۸,۲۰۰	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۹۱	۱,۸۳۶	+۲۳%	۵.۵	۴.۲	۴.۷	-۱.۰								
		کحافظ	۱۲	۳.۷	۷۲۰	۸۲	۱۰%	۱۰۱	۱۵۰	+۴۸%	۷.۱	۵.۲	۵.۸	-۰.۱								
		کساوه	۱۲	۳.۳	۶,۲۱۷	۷۴۷	۷۱%	۱,۱۵۰	۱,۶۹۰	+۴۷%	۵.۴	۳.۵	۴.۱	-۲.۴								
		کپارس	۱۰	۱.۸	۱,۱۰۲	۲۴		۱۸۸	۲۵۸	+۳۷%	۵.۸		۴.۶									
		کلوند	۱۲	۱.۷	۴,۲۲۳	۵۰۴	۹۵%	۶۴۶	۹۴۵	+۴۶%	۶.۵	۴.۳	۵.۵	-۰.۱								
		کترام	۱۲	۱.۴	۸۴۳	۵۹	۲۳%	۸۵	۱۱۴	+۳۴%	۹.۹	۸.۰	۷.۷	-۰.۸								
		کسعدی	۱۲	۰.۸	۷۶۲	۵۱	۸۶%	۹۵	۱۲۳	+۲۹%	۸.۰	۶.۱	۶.۷	-۱.۴								
		کصدف	۱۲	۰.۸	۲,۰۹۵	۱۲۸	۱۰%	۱۵۱	۲۴۲	+۶۰%	۱۳.۸	۹.۴	۱۱.۸	+۱.۸								
		شیشه و ظروف شیشه‌ای	کرازلی	۱۲	۴.۶	۱۶۰	۱۶	۲۴%	۲۳	۳۲	+۳۹%	۶.۹	۵.۳	۵.۳	-۰.۶							
			کقزوی	۱۲	۳.۹	۲,۷۵۰	۳۵۹	۳۶%	۵۵۷			۴.۹										
			کگاز	۱۲	۳.۱	۳,۵۹۸	۱۱۳	۵۱%	۳۸۱	۴۳۴	+۱۴%	۹.۵	۸.۵	۸.۰	-۲.۴							
فرآورده‌های نسوز	کفرا	۱۲	۲.۰	۱,۰۰۰	۶۶	۹۶%	۷۹	۱۵۴	+۹۴%	۱۲.۷	۶.۷	۸.۶	-۱.۱									
	کاذر	۱۲	۱.۱	۵۲۹	۵۲	۲۶%	۱۲۶	۱۵۰	+۱۹%	۴.۲	۳.۶	۳.۴	-۷.۸									
	کفپارس	۹	۰.۹	۵۷۳	۳۶	۷%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۰.۹	۸.۷	۷.۳	-۱.۰									

-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)				
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش نفت	۱۲	۱۹۷.۳	۸۶۹	۱۷۰	۶۳%	۱۵۱				۵.۸						
		پالایش گاز	۱۲	۱۳۱.۴	۲۷۶	۳۱	۸۸%	۳۴	۴۶	+۳۴%	۸.۱	۶.۰	۶.۸	+۰.۰				
		روانکار	شبه‌رهن	۱۲	۳۱.۱	۲,۵۹۹	۳۳۸	۸۹%	۳۴۵	۵۲۵	+۵۲%	۷.۵	۴.۹	۶.۳	+۱.۸			
			شسپا	۱۲	۲۸.۱	۵۰۲	۷۴	۶۷%	۸۳	۹۹	+۱۹%	۶.۰	۴.۸	۵.۲	+۰.۹			
			شنفت	۱۲	۱۷.۳	۸۶۶	۱۰۸	۸۲%	۷۵	۱۰۳	+۳۷%	۱۱.۶	۸.۷	۹.۷	+۰.۵			
			شرانل	۱۲	۱۶.۶	۸,۲۷۵	۱,۴۴۱	۸۵%	۹۳۰	۱,۵۶۵	+۶۸%	۸.۹	۵.۴	۷.۲	+۲.۵			
	زغال سنگ	کزغال	۱۲	۷.۷	۲,۲۰۰	۲۶۵	۹۹%	۳۷۴	۸۲۷	+۱۲۱%	۵.۹	۲.۵	۴.۵	-۲.۴				
		کپور	۱۲	۲.۱	۱,۲۳۶	۱۶۹	۵۹%	۲۴۷	۳۳۵	+۳۶%	۵.۰	۳.۶	۳.۹	-۳.۳				
		کطبس	۱۲	۱.۴	۱,۷۳۳	۱۹۳	۶۲%	۳۷۸	۴۷۱	+۲۵%	۴.۶	۳.۵	۳.۶	-۶.۲				
خدمات مالی	فلزات و معادن	ومعادن	۱۲	۹۲.۴	۴۸۰	۷۲	۳۸%	۹۷	۱۱۹	+۲۲%	۴.۹	۴.۰	۳.۵	-۴.۵				
		وکغدير	۶	۵۴.۸	۱,۴۲۹	۱۳۴	۶۲%	۱۸۳	۲۷۵	+۵۱%	۷.۸	۵.۹	۵.۰					
	سنگ آهن	وامید	۱۰	۱۳۳.۴	۱,۳۷۶	۱۸۸	۶۸%	۱۷۱	۲۳۸	+۳۹%	۸.۱	۵.۶	۸.۳	+۱.۳				
		لوتوس	۱۰	۱۲.۹	۳۷۰	۴۵	۹۶%	۶۷	۸۳	+۲۳%	۵.۵	۴.۰	۴.۵	-۲.۵				
	تامین سرمایه	تنوین	۱۲	۱۱.۱	۲۸۸	۴۸	۶۳%	۵۰	۶۱	+۲۳%	۵.۸	۴.۶	۴.۷	-۰.۶				
		امین	۶	۱۰.۴	۵۷۵	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۹	۱۰.۲	۸.۱	-۳.۲				
	دارویی	وپخش	۱۲	۱۶.۰	۱,۹۰۰	۲۹۸	۹۱%	۳۶۹			۵.۱							
		شفا	۱۲	۶.۳	۲,۳۲۰	۲۸۱	۷۱%	۳۲۴			۷.۲							
	چند رشته‌ای	وسپه	۹	۱۳.۴	۴۴۰	۶۷	۸۸%	۶۴	۸۱	+۲۶%	۶.۹	۵.۰	۷.۲	+۳.۱				
		وتوکا	۱۲	۵.۴	۴۴۲	۳۷	۳۳%	۴۰	۵۲	+۳۱%	۱۱.۱	۹.۰	۸.۵	+۰.۷				
	سایر محصولات غذایی	خودکفا	۱۲	۷.۲	۹۶۵	۱۱۰	۴۵%	۱۷۳	۲۱۳	+۲۳%	۵.۶	۴.۳	۳.۸	-۲.۶				
	سرب و روی	کروی	۱۲	۶.۹	۶۸۹	۱۵۶	۷۴%	۲۵	۳۵	+۴۴%	۲۷.۹	۲۰.۶	۱۹.۲	+۲.۱				
مواد پایه	محصولات چوبی	لطیف	۱۲	۱.۶	۷,۸۷۵	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۶.۰	۳.۹	۴.۸	-۰.۳				
	کاغذ و محصولات..	چخزر	۱۲	۱.۴	۶,۸۶۵	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۷.۰	۹.۸	۱۴.۴	+۰.۹				

-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		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z (آینده نگر ۴ فصله)																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	Z	۴	۳	۲	۱	۰	+۱	+۲	+۳	+۴																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																
بهداشت	دارویی	دعبید	۹	۳۹.۷	۱,۵۸۹	۶۰	۲۰%	۱۱۱	۱۶۴	+۴۷%	۱۴.۳	۹.۹	۹.۷	+۰.۵																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																									</

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)	
مصرفی غیردورهای	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۸۰۷	۲,۸۸۹	۲۱۳	۵۵%	۴۶۳				۶۰۲									
		جوین	۴	۵۰۱	۶۸۰	۹۱	۵۳%	۹۷	۹۵	-۲%	۷۰۰	۷۰۹	۶۰۶	+۱۰۰							
		سیمرغ	۹	۳۰۷	۲,۸۱۸	۳۹۱	۲۴%	۴۸۵	۷۰۰	+۴۴%	۵۰۸	۴۰۰	۴۰۰	-۱۰۲							
		زفکا	۱۲	۲۰۴	۱,۶۰۵	۱۵۵	۹۱%	۲۵۷				۶۰۲									
		تلیسه	۱۲	۲۰۰	۴۰۴	۲۵	۹۲%	۳۳				۱۲۰۲									
		زدشت	۱۲	۱۰۸	۲,۶۳۰	۲۱۲	۵۱%	۲۴۵				۱۰۰۷									
		زگلدشت	۱۲	۱۰۷	۲,۳۸۵	۹۶	۹۵%	۱۵۵				۱۵۰۴									
		زفجر	۱۲	۱۰۵	۱,۶۸۲	۱۲۱	۸۰%	۱۶۳				۱۰۰۳									
		زشریف	۹	۱۰۳	۵۵۷	۴۸	۷۶%	۹۰	۸۸	-۳%	۶۰۲	۵۰۹	۵۰۳	-۱۰۴							
		زبینا	۱۲	۱۰۳	۳۶۷	۴۱	۷۹%	۵۱				۷۰۳									
		زملارد	۱۲	۱۰۳	۱,۶۶۰	۳۳	۹۴%	۱۰۲				۱۶۰۳									
		زکشت	۱۲	۱۰۱	۱,۸۵۰	۱۲۶	۵۳%	۱۱۴				۱۶۰۲									
		زمگسا	۱۲	۱۰۱	۳,۶۸۳	۳۲۶	۹۵%	۴۰۴				۹۰۱									
		زشگزا	۱۲	۰۰۸	۸۵۵	۸۱	۵۶%	۱۲۴				۶۰۹									
	غذا و نوشیدنی	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۴۰۶	۱,۴۶۳	۱۶۱	۶۰%	۲۱۵	۲۵۶	+۱۹%	۶۰۸	۵۰۶	۵۰۷	-۱۰۸						
			غپینو	۱۲	۳۰۷	۴۱۷	۴۹	۵۶%	۷۸	۹۷	+۲۴%	۵۰۳	۴۰۳	۴۰۴	-۰۰۹						
			غسالم	۱۲	۲۰۱	۴۷۱	۶۵	۴۱%	۸۶	۱۰۷	+۲۵%	۵۰۵	۴۰۶	۴۰۴	-۱۰۲						
			غمینو	۱۲	۱۰۵	۱,۰۰۰	۱۴۹	۴۳%	۱۹۶	۲۵۰	+۲۸%	۵۰۱	۴۰۰	۴۰۲	-۰۰۳						
	قند و شکر	قپیرا	۴	۳۰۱	۱,۲۴۰	۴۰	۸۷%	۴۸	۱۲۳	+۱۵۶%	۲۵۰۸	۱۱۰۵	۱۰۰۳	-۱۲۰۵							
		قصفا	۱۲	۳۰۰	۱۵,۴۸۵	۶۲۲	۹۹%	۱,۱۸۷	۱,۲۰۰	+۱%	۱۳۰۰	۱۳۰۲	۱۱۰۱	-۰۰۹							
		قچار	۱۲	۳۰۰	۸۵۶	۴۲	۲۱%	۶۲				۱۳۰۹									
		قشهد	۶	۲۰۳	۳,۳۴۷	۱۶۹	-۱۸%	۲۵۳				۱۳۰۲									
		قمرو	۴	۱۰۸	۹۱۵	۷۲	۳۴%	۸۶	۱۰۰	+۱۶%	۱۰۰۷	۱۰۰۶	۶۰۲	-۱۰۰							
		قزوبین	۱۲	۱۰۸	۸۵۰	۷۶	۸۴%	۸۰	۹۶	+۱۹%	۱۰۰۶	۹۰۰	۸۰۰	+۰۰۶							
	غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۶۰۳	۳۵۱	۴۳	۱۰%	۶۷	۸۰	+۱۹%	۵۰۲	۴۰۷	۴۰۵	-۵۰۳							
		غمهرا	۱۲	۲۰۱	۱,۱۱۷	۱۰۵	۱۶%	۱۶۸	۲۵۶	+۵۲%	۶۰۶	۴۰۶	۴۰۸	-۱۰۳							
	روغن خوراکی	غبشهر	۹	۸۰۳	۲۸۳	۳۹	۳۷%	۴۳	۸۶	+۱۰۱%	۶۰۶	۳۰۲	۴۰۲	-۲۰۰							
	محصولات لبنی	غفارس	۱۲	۱۰۹	۱,۶۷۷	۱۰۱	۱۳%	۱۱۲				۱۵۰۰									
		غگلپا	۱۲	۱۰۵	۴,۰۸۵	۴۶۵	۷۴%	۵۲۵				۷۰۸									
		غشان	۱۲	۱۰۲	۷۰۹	۸۰	۷۱%	۸۴				۸۰۴									
		غگلستا	۱۲	۱۰۲	۱,۸۲۹	۱۵۶	۷۰%	۲۰۷				۸۰۹									

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

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

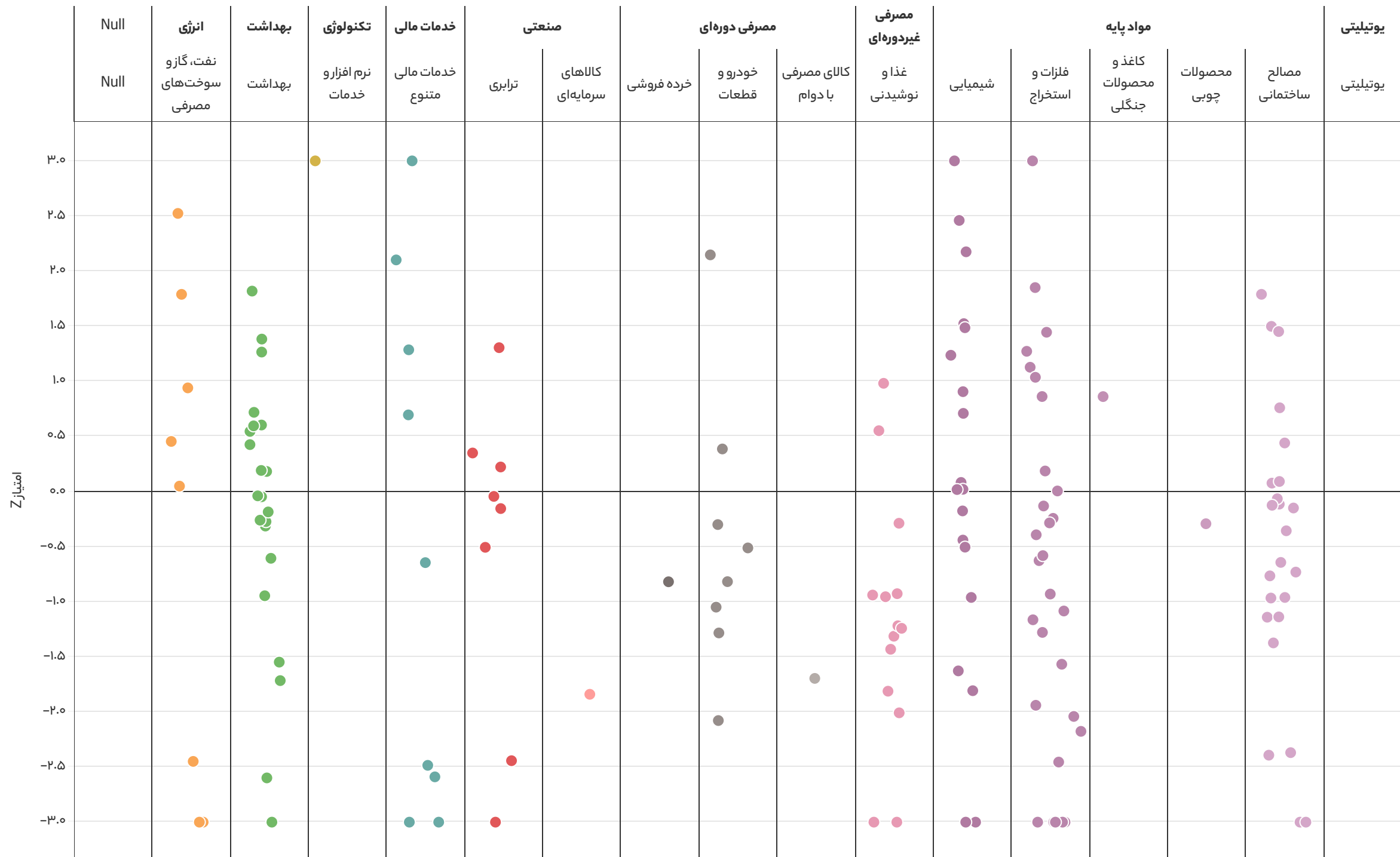
گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z (آینده نگر ۴ فصله)								
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله		-۳	-۲	-۱	۰	+۱	+۲	+۳	
یوتیلیتی	یوتیلیتی و نیروگاهی	مبین	۱۲	۵۲.۱	۲,۵۷۴	۴۲۶	۱۶۱%	۶۳۱				۴.۱										
		بفجر	۱۲	۳۷.۴	۱,۹۱۸	۳۳۰	۱۸۷%	۳۸۹				۴.۹										
مصرفی دورای	خودرو و قطعات	پکرمان	۱۲	۷.۵	۲,۹۷۶	۱۴۸	۸۷%	۳۰۱	۴۶۴	+۵۴%	۹.۹	۶.۸	۱۰.۰	-۰.۳								
		پکویر	۹	۴.۴	۶۷۰	۲۵	۷۵%	۷۷	۱۳۱	+۷۰%	۸.۷	۴.۵	۶.۵	-۰.۸								
		پارتا	۱۲	۴.۰	۶۴۲	۴۰	۶۰%	۴۳	۸۲	+۹۲%	۱۵.۰	۸.۳	۹.۷	-۲.۱								
		پاسا	۱۲	۳.۳	۱,۷۵۴	۱۳۶	۴۰%	۱۹۴	۳۰۵	+۵۷%	۹.۰	۶.۲	۸.۰	+۰.۴								
		پتایر	۱۲	۳.۱	۲۴۲	۱۰	۴۱%	۲۳	۲۹	+۲۵%	۱۰.۶	۸.۹	۹.۴	-۱.۳								
		پیزد	۱۲	۲.۷	۱,۳۰۰	۶۱	۶۷%	۱۰۸	۱۵۵	+۴۳%	۱۲.۰	۸.۸	۱۱.۰	-۱.۰								
		خودرو	۱۲	۱۶.۰	۴۵۶	۵۶	۱۶%	۱۰۸	۱۴۹	+۳۸%	۴.۲	۳.۲	۳.۸	-۰.۵								
	پلاستیک	۱۲	۱.۰	۴,۲۶۰	۶۰۶	۲۹%	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۹.۸	۲۰.۸	۱۷.۱	+۲.۱									
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	گلدیرا	۱۰	۶.۸	۸۱۰	۴۵	۲۲%	۱۰۶	۱۷۶	+۶۷%	۷.۷	۴.۷	۵.۱								
			لخر	۱۲	۲.۴	۱,۴۶۱	۱۷۵	۲۹%	۲۴۷	۳۴۲	+۳۹%	۵.۹	۴.۵	۴.۹	-۱.۷							
خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۸	۷۶۲	۱۰۳	۴۹%	۱۶۰	۲۱۰	+۳۱%	۴.۸	۳.۵	۳.۹	-۰.۸								
صنعتی	بنادرو کشتیرانی	حززر	۱۲	۵.۶	۵,۲۰۰	۶۹۱	۹۶%	۹۶۲	۱,۳۹۱	+۴۵%	۵.۴	۳.۵	۵.۲	+۰.۲								
		حسینا	۱۲	۵.۲	۲,۱۰۰	۱۹۱	۸۹%	۲۸۸	۳۱۷	+۱۰%	۷.۳	۶.۵	۶.۴	+۰.۰								
		حتاید	۱۲	۵.۱	۷۲۴	۱۰۵	۵۲%	۱۵۱	۱۸۲	+۲۱%	۴.۸	۴.۰	۳.۹	-۲.۴								
	ترابری	حکهر	۱۲	۵.۷	۱,۲۸۰	۱۵۱	۳۸%	۱۹۶	۲۴۵	+۲۵%	۶.۵	۵.۲	۵.۴	+۱.۳								
		توریل	۱۲	۴.۰	۵۶۸	۴۳	۳۸%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۰.۹	۹.۰	۹.۱	-۰.۵								
		حآفرین	۱۲	۲.۳	۳۱۰	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۷.۵	۷.۰	۶.۰	-۳.۷								
		حآسا	۱۲	۱.۸	۹۹۹	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۷.۱	۲۶.۷	۲۵.۴	+۰.۳								
	حپارسا	۶	۱.۶	۶,۲۲۵	۶۳۱	۸۹%	۸۰۱	۱,۱۱۷	+۳۹%	۷.۸	۶.۲	۵.۱	-۰.۲									
	کالاهای سرمایه‌ای	سیم و کابل	۱۲	۳.۲	۳,۱۴۰	۲۵۰	۶۱%	۵۵۷	۷۶۵	+۳۷%	۵.۶	۴.۱	۴.۳									
		محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۰	۲۷۳	۳۳	۳۱%	۵۹	۵۶	-۵%	۴.۶	۵.۰	۳.۹	-۱.۸							
تولیدی	نرم افزار و خدمات	سیستم	۱۲	۱۸.۰	۱,۸۰۳	۸۳	۸۹%	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۰.۵	۲۶.۳	۲۸.۶	+۵.۴								

-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

