

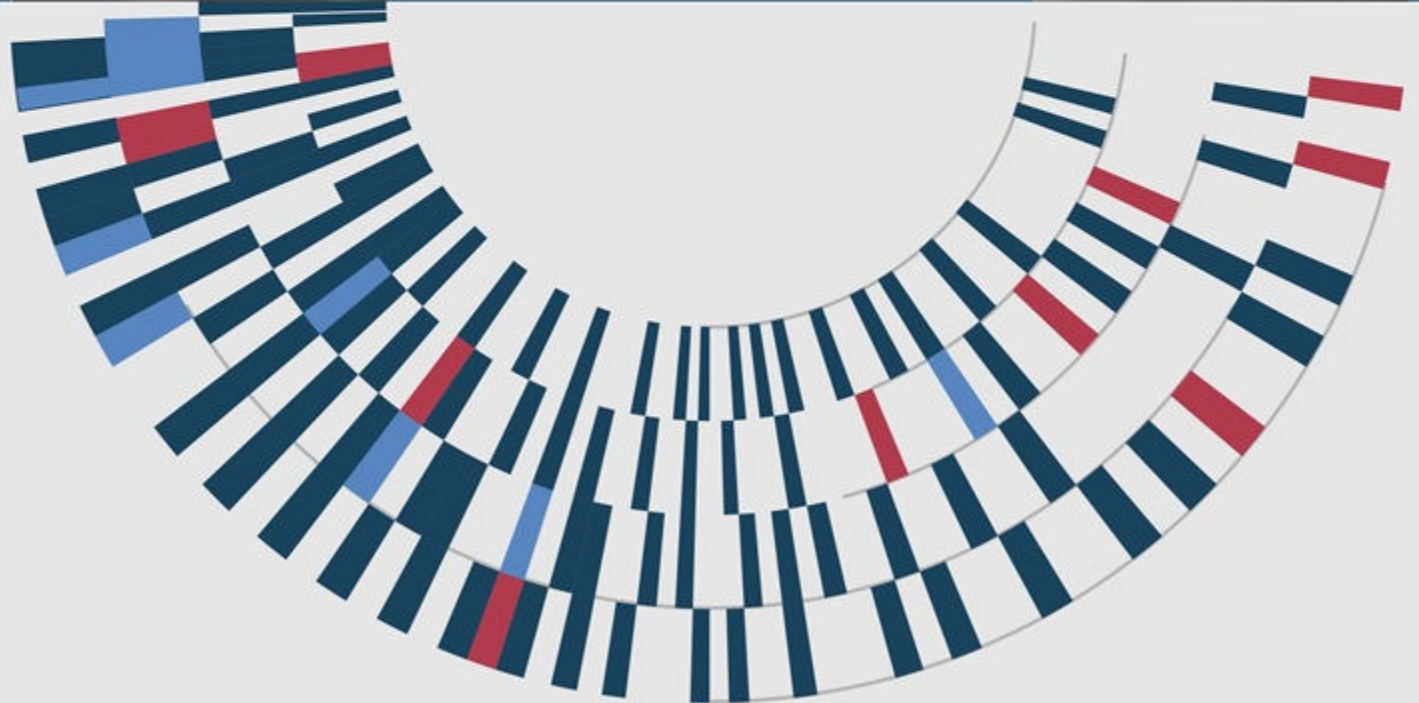
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۱۹ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۷/۱۴

 CHARISMA





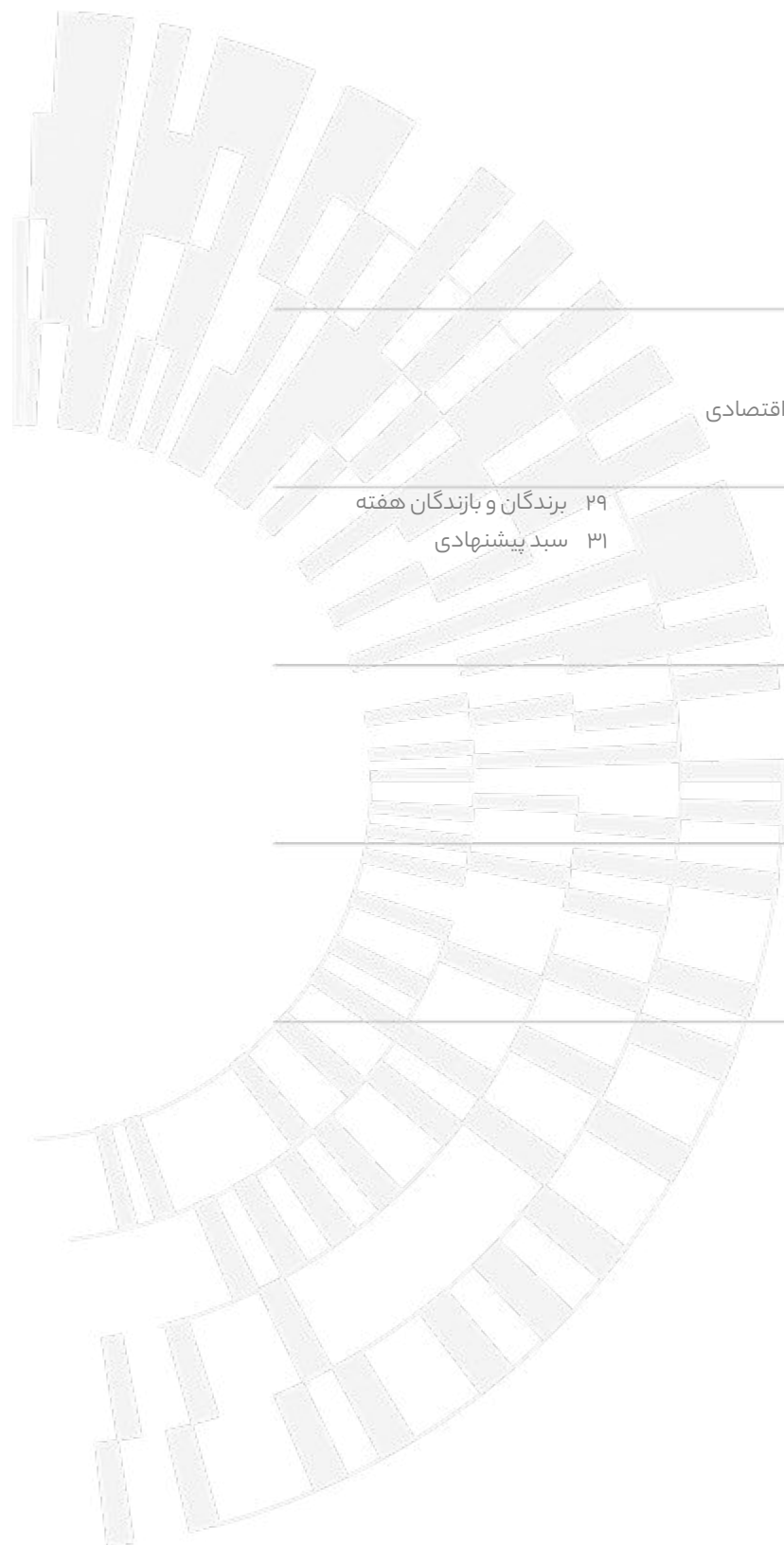
معرفی گزارش:

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



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	۱,۸۳۰	-۱.۱%	فزر	-	۱,۶۴۳ ۲,۰۱۷	۱۱%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۰۴۴	-۲.۹%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۵۱۵ ۹,۳۴۱	۷%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۴۴	-۴.۷%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ ۲,۴۲۴	-۳%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۹۹	-۶.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳ ۳,۴۴۴	۱۴%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۴۳	-۱.۸%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۸۶۵ ۲,۲۷۳	۵%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۸۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۷۲۸ ۴,۸۴۳	۷۲%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۷۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۲۲۹ ۳,۶۲۵	۵۰%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۸۵	۱.۳%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱ ۶۲۳	-۸%
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۸۱۴	۱.۵%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۳,۰۹۵ ۲۲,۸۲۱	۵۱%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۲	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰ ۶۷۰	۲%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۲,۴۵۳ ۲۲,۰۸۰	۵۳%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۸	-	ذوب، کوپر	فولای	۵۵۸ ۷۵۵	۱۷%
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۵۰۰	-۰.۳%	ذوب، کوپر	فولای	۱۴,۳۰۰ ۲۴,۷۴۷	۵۰%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۸۰	۱.۸%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۵ ۷۸۰	۶%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۶۵	۱.۵%	فولاد	-	۶۱۵ ۸۶۰	۰%



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	۴۱۱	۲.۳%-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۹	-	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۰۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۹۱	-	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۱	۰.۲%-	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۸۱	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۶۹	-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۷۵	۳.۷%	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۶۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۶	۰.۹%-	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۴۸	۶.۲%-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۲۰	۱.۸%-	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۵	۳.۱%-	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۴۰	۴.۷%-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۷,۶۵۰	۵.۲%-	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۱۵	-	شغدیر، ارونند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۶۰	-	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

رند قیمتی ۱۲ ماهه												بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-	-	۸۵	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت									
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-	-	۸۳	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI									
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-	-	۱۲۲	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره									
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-	-	۱۱۷	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور									
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-	-	۲۱,۶۳۴	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران									
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-	-	۲۸,۰۷۷	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان									
				شپاس		-	شپاس	۱۶,۲۳۱	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر - نفت پاسارگاد										
محصولات کشاورزی					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-	-	۱۹۴	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا									
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-	-	۷۷۰	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام									
					-		-	-	۱,۲۷۶	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا									
					-		-	-	۲۰۹	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا									
ارز و ارز دیجیتال					-		-	-	۱.۰۶	-	بازار فارکس	یورو به دلار									
					-		-	-	۱.۲۲	-	بازار فارکس	پوند به دلار									
					-		-	-	۲۷,۹۷۹	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	۰.۱۲	۱۳.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۴۹%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-۰.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۵۱%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۰	-۸.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۶۳	-۷۵%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۱	-۱۲.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۶۴%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۴	-۷.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۸۷	-۶۸%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



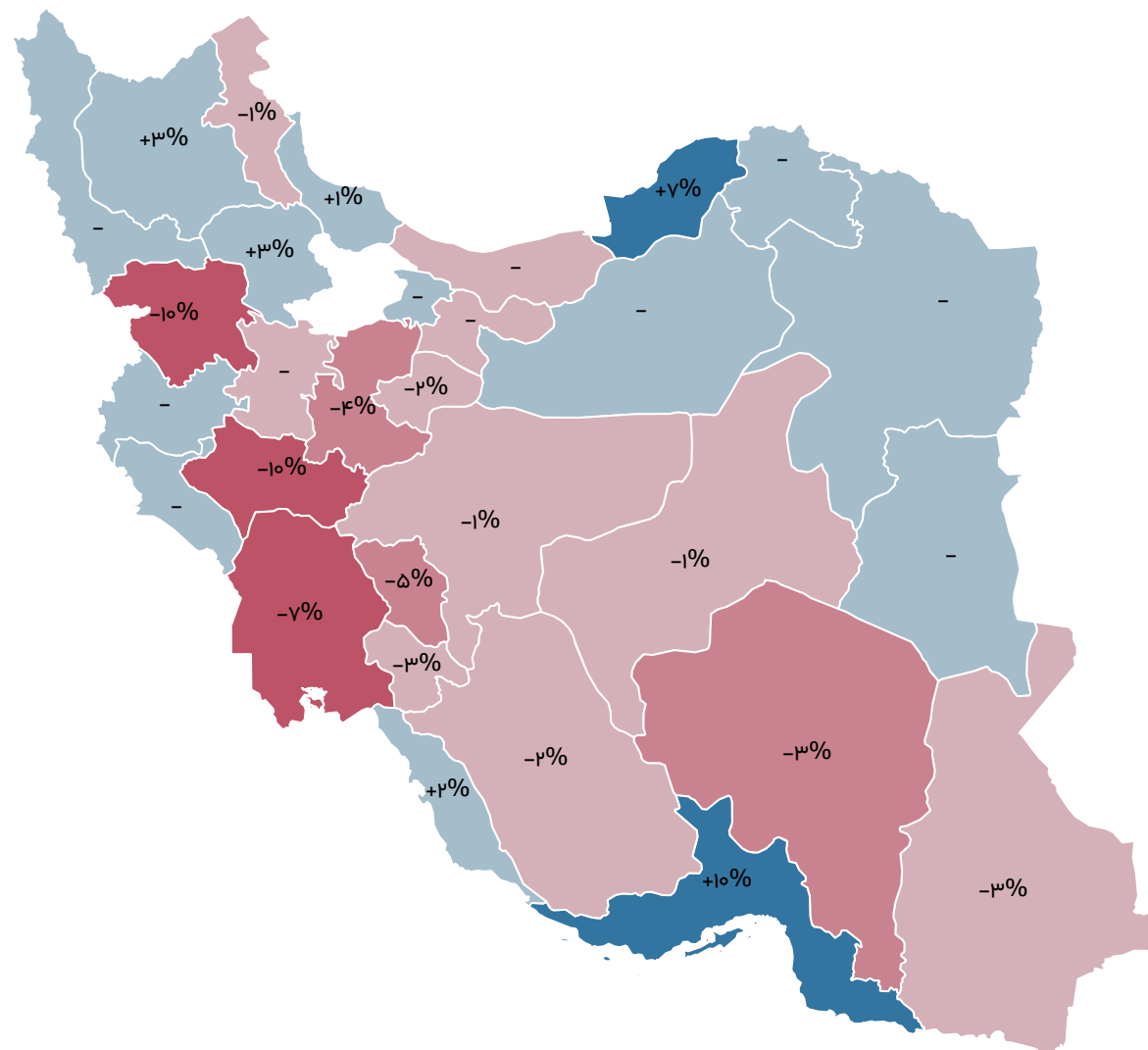
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۹۲۰	۹۲۰	+۰%
	اصفهان	تومان/کیلو	۹۲۷	۹۱۶	-۱%
	مرکزی	تومان/کیلو	۱,۰۲۵	۹۸۷	-۴%
	البرز	تومان/کیلو	۹۱۴	۹۱۴	+۰%
	قم	تومان/کیلو	۱,۰۱۹	۹۹۷	-۲%
	یزد	تومان/کیلو	۷۱۳	۷۰۵	-۱%
جنوب	سمنان	تومان/کیلو	۸۱۲	۸۱۲	+۰%
	فارس	تومان/کیلو	۹۶۳	۹۴۵	-۲%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۸۷۷	۹۶۱	+۱۰%
غرب	بوشهر	تومان/کیلو	۱,۰۰۳	۱,۰۱۹	+۲%
	همدان	تومان/کیلو	۸۹۶	۸۹۲	+۰%
	خوزستان	تومان/کیلو	۹۵۷	۸۸۹	-۷%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۹۳۸	۸۹۵	-۵%
	ایلام	تومان/کیلو	۷۰۶	۷۰۶	+۰%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۸۶۱	۸۶۱	+۰%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۹۶۸	۹۴۴	-۳%
	کردستان	تومان/کیلو	۱,۲۱۲	۱,۰۹۱	-۱۰%
	لرستان	تومان/کیلو	۹۳۳	۸۴۰	-۱۰%
	مازندران	تومان/کیلو	۸۸۷	۸۸۷	+۰%
شمال	گیلان	تومان/کیلو	۶۸۳	۶۸۸	+۱%
	گلستان	تومان/کیلو	۷۴۶	۷۹۶	+۷%
شمال غرب	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۸۶۸	۸۷۰	+۰%
	اردبیل	تومان/کیلو	۱,۰۵۳	۱,۰۳۸	-۱%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۹۹۲	۱,۰۲۱	+۳%
شمال شرق	زنجان	تومان/کیلو	۹۱۷	۹۴۳	+۳%
	خراسان رضوی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۴۰	+۰%
	خراسان شمالی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان جنوبی	تومان/کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
جنوب شرق	کرمان	تومان/کیلو	۱,۰۵۹	۱,۰۲۳	-۳%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۷۹۰	۷۷۰	-۳%

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.

معادن و فزرات

انرژی

- ▼

قیمت طلا به علت چشم انداز بالا ماندن نرخ بهره برای مدت بیشتر در آستانه انتشار نرخ تورم آمریکا، در نزدیکی کمترین رقم ۶ ماه گذشته در نوسان بود و در روزهای اخیر با رسیدن به رقم ۱۸۱۲ به پایین ترین سطح ۷ ماه اخیر رسیده بود. چراکه هرچه نرخ بهره بالاتر باشد، هزینه های نگهداری طلا که دارایی بدون بهره است نیز افزایش می یابد. همچنین قیمت طلا در روز جمعه با رسیدن به نقطه حمایت تکنیکالی و پس از ۹ روز نزول، افزایش یافت و از قعر ۷ ماهه فاصله گرفت. اگرچه داده های قوی مشاغل در ایالات متحده، نگرانی ها را نسبت به یک افزایش دیگر نرخ بهره در آمریکا افزایش داد و طلا را در مسیر دومین افت هفتگی خود نگه داشت.
- ▼

به گزارش ماینینگ، با گسترش افزایش سطح انبارها و ادامه نگرانی های تقاضا در بحبوحه کندی تولید صنعتی جهانی، کنتانگو مس در بازارهای جهانی به شدیدترین میزان خود از ۱۹۹۴ میلادی به این سو رسید. ساختاری که به عنوان کنتانگو شناخته می شود، نشان دهنده عرضه زیاد و فوری کالا است. از سوی دیگر، در حالی که گروه گلدمن ساکس میزان ذخایر پایین را پشتیبان قیمت مس می بیند، شرکت توسعه اطلاعات پکن، یک اندیشکده تحت حمایت دولت، هفته گذشته اعلام کرد که چرخه نزولی مس ممکن است تا سال ۲۰۲۵ ادامه یابد، زیرا تولیدات صنعتی در حال تضعیف است.
- ✓

در پی اخبار منتشر شده در خصوص حذف سیمان و فولاد از بورس کالا در هفته های اخیر، رئیس سازمان بورس گفت: فعلاً موضوع خروج فولاد و سیمان از بورس کالا منتفی شده است، البته که عده ای انتقاداتی به برخی از فرآیندها دارند و توصیه کرده ایم در جلسات کارشناسی اگر ایرادی به عرضه ها مطرح است، مورد بررسی قرار گرفته و برطرف شود.
- ▲

قیمت نفت در سه ماهه سوم ۲۰۲۳ حدود ۳۰ درصد رشد داشت زیرا کاهش تولید اوپک، عرضه نفت در جهان را کاهش داده بود. قیمت نفت در معاملات روز چهارشنبه بازار آسیا در آستانه نشست کمیته نظارتی اوپک پلاس، تحت تاثیر نگرانی ها نسبت به تاثیر منفی نرخ های بهره بالا روی تقاضا، با ریزش پنج دلاری مواجه شد اما در معاملات صبح پنج شنبه بازار آسیا، تحت تاثیر عدم تغییر سیاست محدودیت عرضه اوپک پلاس، بخشی از ضرر روز گذشته را جبران کرد و افزایش یافت اما دورنمای مبهم تقاضا، رشد قیمت را محدود نگه داشت. همچنین عربستان سعودی اعلام کرد به کاهش تولید خود تا پایان سال ۲۰۲۳ ادامه می دهد و همزمان روسیه هم محدودیت صادرات نفت خود را تا پایان دسامبر، حفظ خواهد کرد. این در حالی است که رابرت یاوگر، استراتژیست بازار انرژی در بانک میزوهو، گفت، نرخ بهره بالاتر در جهان ممکن است اقتصاد جهانی را در سال ۲۰۲۴ وارد رکود کند و تقاضای نفت را کاهش دهد.
- ✓

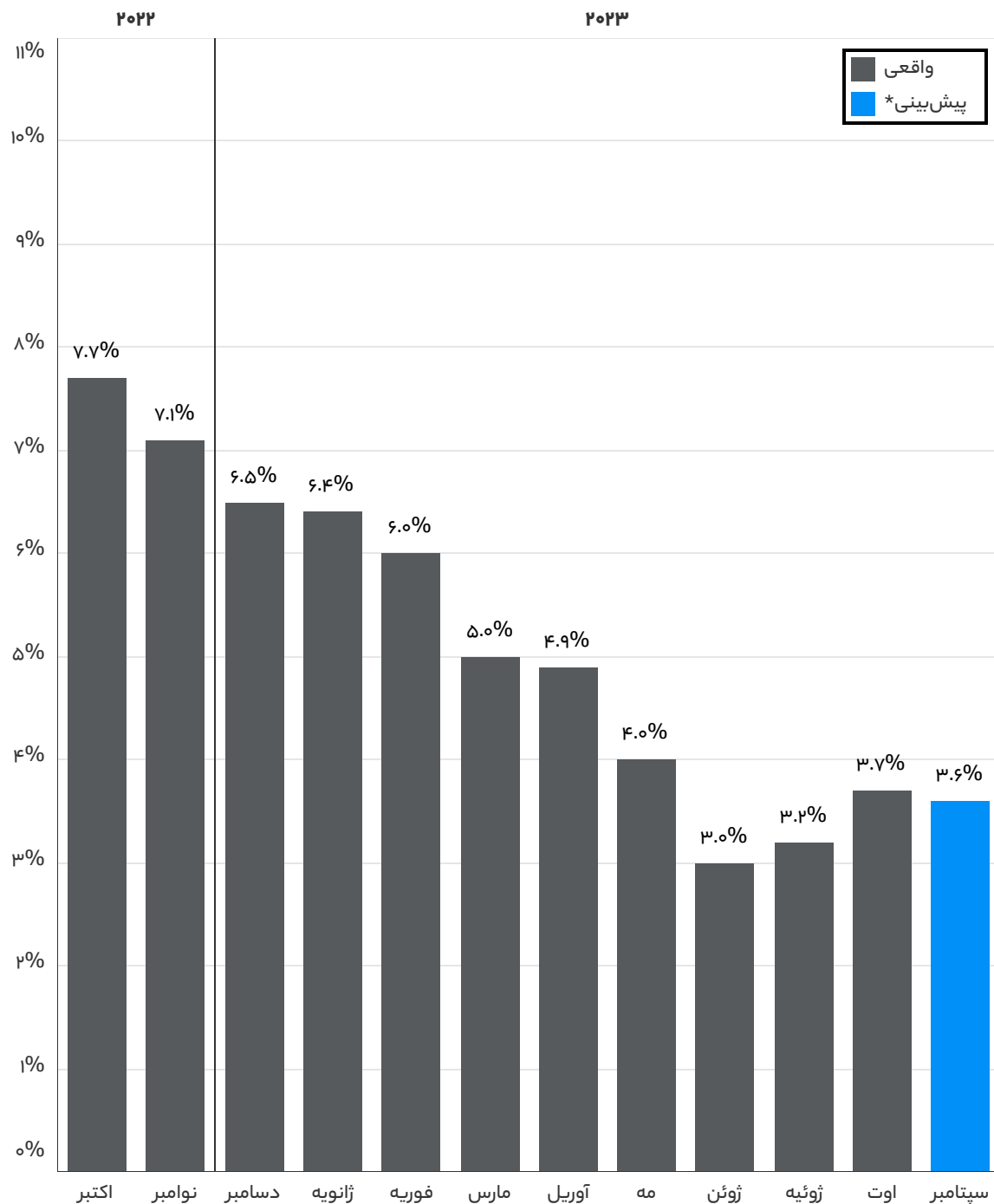
روسیه با هدف کنترل قیمت سوخت در بازار داخلی، در سپتامبر، صادرات سوخت از بنادر غربی را ممنوع اعلام کرد اما اندکی بعد ممنوعیت صادرات دیزل کم کیفیت را حذف کرد. اکنون به نظر می رسد روسیه به ممنوعیت صادرات دیزل در اکتبر عمل کرده و بازرگاری این سوخت در بنادر این کشور در دریای سیاه و دریای بالتیک برای ماه میلادی آینده، تقریباً به صفر رسیده است. دولت روسیه روز جمعه ممنوعیت صادرات گازوئیل خط لوله از طریق بنادر را لغو کرد و بخش عمده ای از محدودیت هایی را که در ۲۱ سپتامبر اعمال کرده بود، برداشت اما محدودیت صادرات بنزین همچنان پابرجاست. البته محدودیت های صادرات گازوئیل راه آهن به استثنای صادرات به برخی از کشورهای شوروی سابق نیز همچنان پابرجاست. روسیه گفته است که صادرات بنزین را پس از تثبیت بازار داخلی خود از سر گرفته خواهد شد، اما تاکنون برای این موضوع چارچوب زمانی ارائه نکرده است.
- ✓

خریداران بزرگ انرژی روسیه، دو کشور ترکیه و برزیل هستند. ترکیه برای تامین نیازهای خود، کاملاً وابسته به واردات است. بنابراین در برابر افزایش هزینه های جهانی به دنبال جنگ اوکراین آسیب پذیر شده است. تقاضای داخلی هم از زمان همه گیری کرونا افزایش یافته است. افزایش قیمت جهانی انرژی در سال جاری میلادی و کاهش ارزش لیر ترکیه هم قیمت های داخلی را بالا برده است. این موارد باعث شده است که قیمت برق و گاز در ترکیه حدود ۲۰ درصد برای خانواده ها و حدود ۵۰ درصد برای صنایع از اول سپتامبر افزایش پیدا کند. از سرگیری صادرات دیزل روسیه بیشترین تأثیر را بر ترکیه و برزیل، دو خریدار بزرگ روسیه در سال جاری، خواهد داشت.
- ✓

مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده های نفتی با اشاره به طرح شایعه هایی درباره واردات روزانه ۳۰ میلیون لیتر بنزین در فضای مجازی، این اخبار را بی اساس و دروغ خواند و گفت: واردات این مقدار بنزین به بیش از ۶ میلیارد لیتر ظرفیت ذخیره سازی نیاز دارد که کل مخازن ذخیره سازی ما به این مقدار نمی رسد. همچنین این موضوع در حالی است که ما روزانه ۱۱۷ میلیون لیتر بنزین نیز در داخل کشور تولید می کنیم.

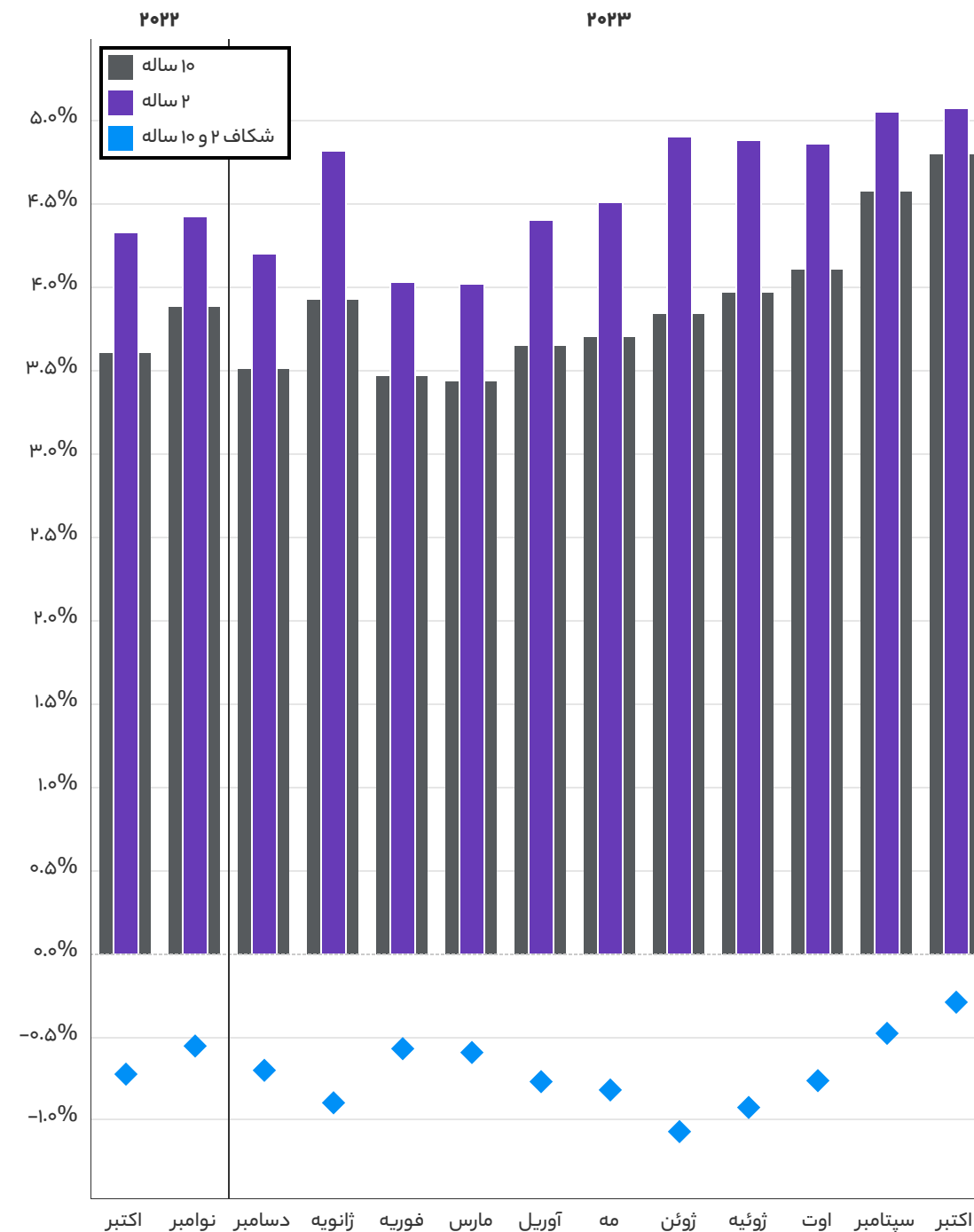
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



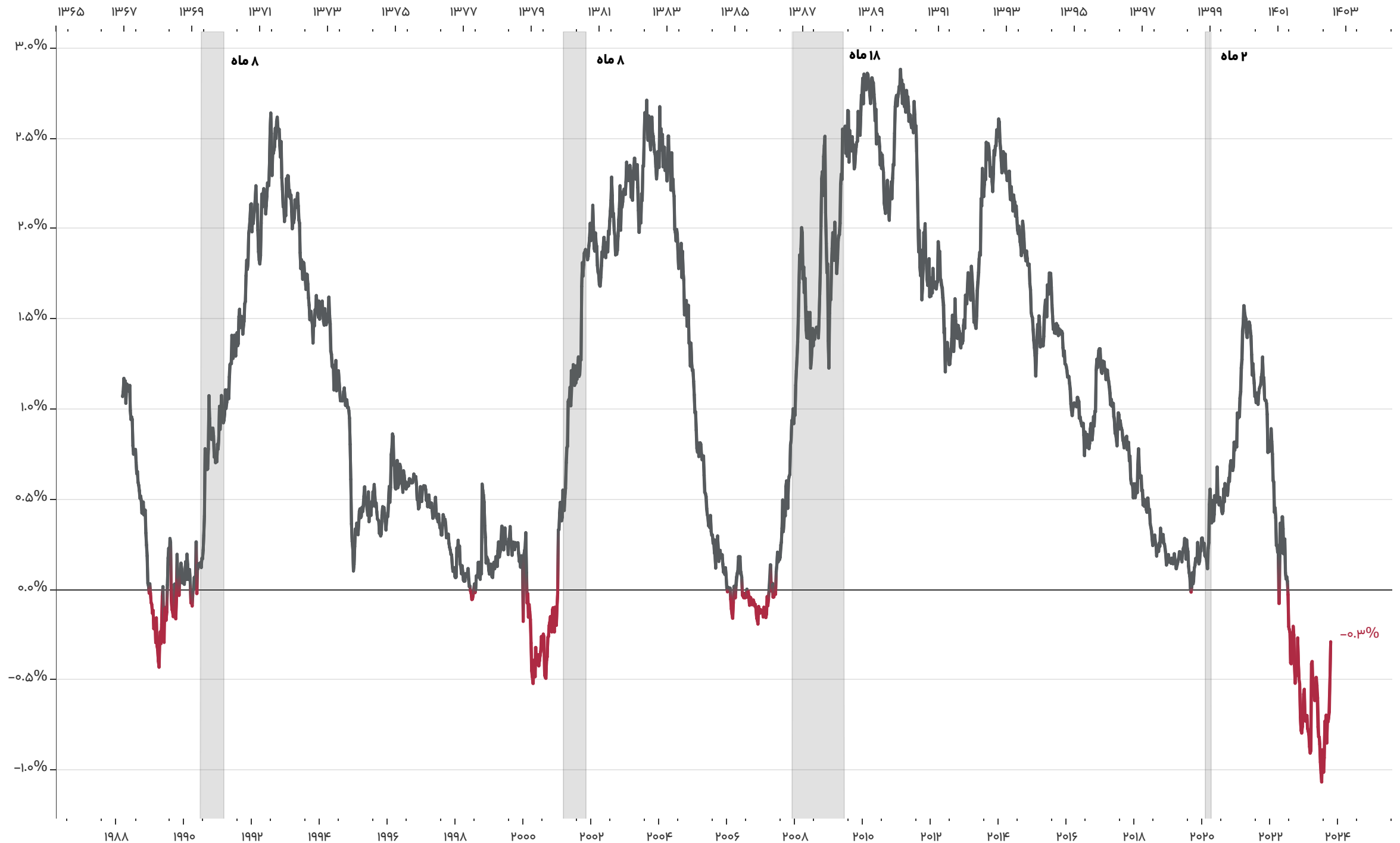
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

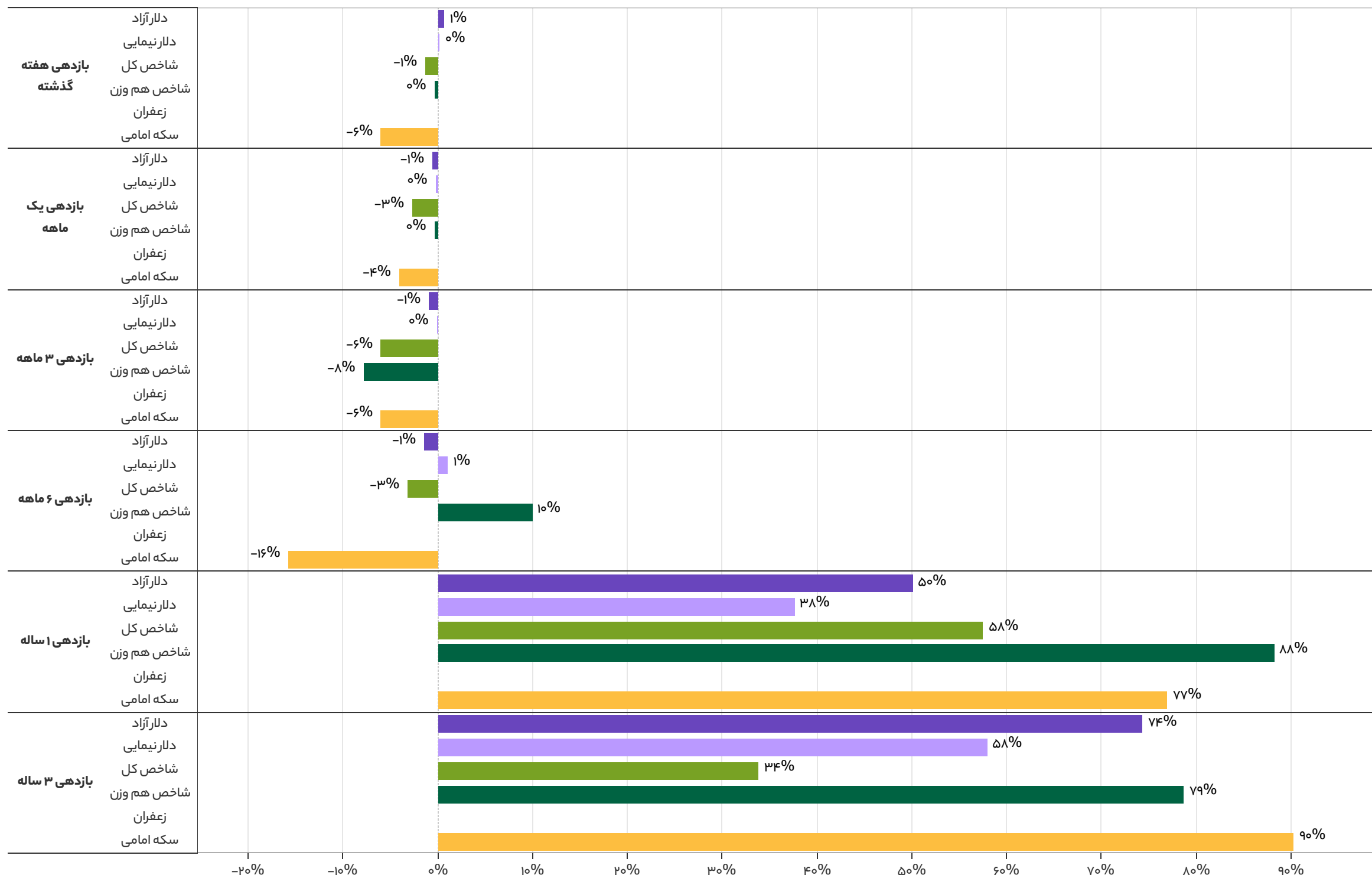
EQUITY MARKET

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 در هر ماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۰۳	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	هم وزن ۴۳%	سکه امامی ۱۱۱.۵%
سکه امامی ▲ ۱۰.۵%	زعفران ▲ ۹.۶%	مسکن ▲ ۲.۵%	دلار آزاد ▲ ۸.۵%	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 ▲ ۳۰.۵%	مسکن ▲ ۳.۳%	شاخص کل ۳۹%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%
مسکن ▲ ۸.۴%	مسکن ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۲.۴%	سکه امامی ▲ ۵.۷%	دلار آزاد ▲ ۳.۱%	دلار آزاد ▲ ۸.۲%	دلار آزاد ▲ ۱۲.۵%	هم وزن ▲ ۱۸.۱%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	هم وزن ▲ ۲۲.۸%	شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	سکه امامی ۳۸%	هم وزن ▲ ۸۲.۵%
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%	زعفران ۲۶%	دلار آزاد ▲ ۶۸.۵%
دلار آزاد ▲ ۴.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	هم وزن ▼ ۱.۶%	مسکن ▲ ۱.۱%	دلار نیمایی ▲ ۱.۲%	مسکن ▲ ۶.۸%	شاخص کل ▲ ۶.۲%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	مسکن ▲ ۳.۳%	سکه امامی ▲ ۱۶.۶%	دلار آزاد ▲ ۳.۷%	دلار آزاد ▲ ۲.۴%	دلار آزاد ۲۱%	شاخص کل ▲ ۴۸.۲%
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 ▲ ۲.۵%	مسکن ▲ ۳.۳%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	دلار نیمایی ۱۹%	مسکن ▲ ۴۵.۳%
دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار آزاد ▼ ۷.۹%	هم وزن ▼ ۰.۴%	زعفران ▲ ۰.۵%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	مسکن ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	زعفران ▲ ۱.۶%	مسکن ۸%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%
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 ▼ ۹.۵%	زعفران ▼ ۱۴.۵%	هم وزن ▼ ۴.۲%	زعفران ▼ ۲.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	زعفران ▲ ۱.۵%	هم وزن ▼ ۹.۴%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	سکه امامی ▼ ۶.۳%	شاخص کل ▼ ۲.۵%	زعفران ▲ ۲.۸%	درآمد ثابت ۱%

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

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

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



ارزش دلاری بازار

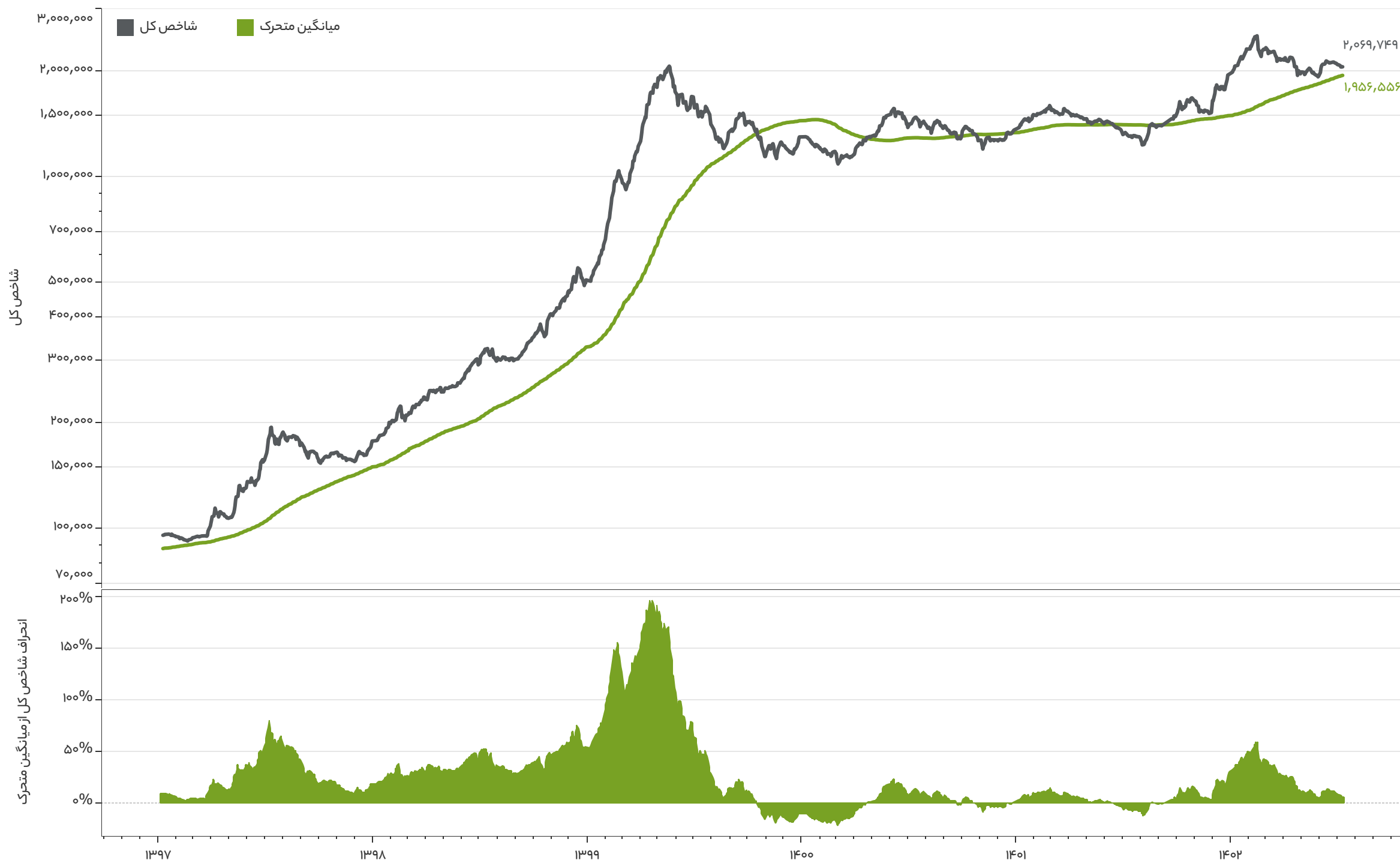
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





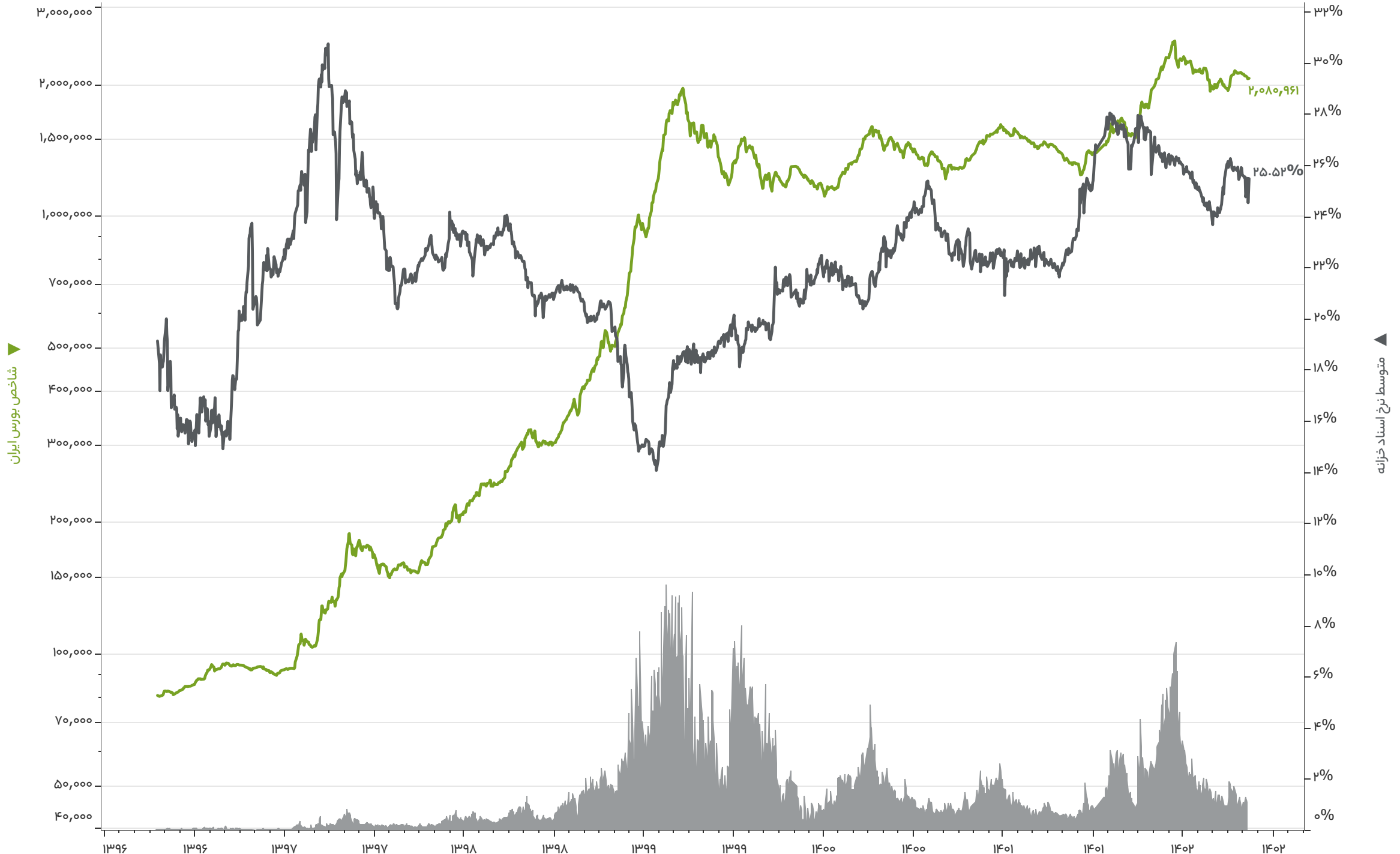
شاخص کل و میانگین متحرک

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



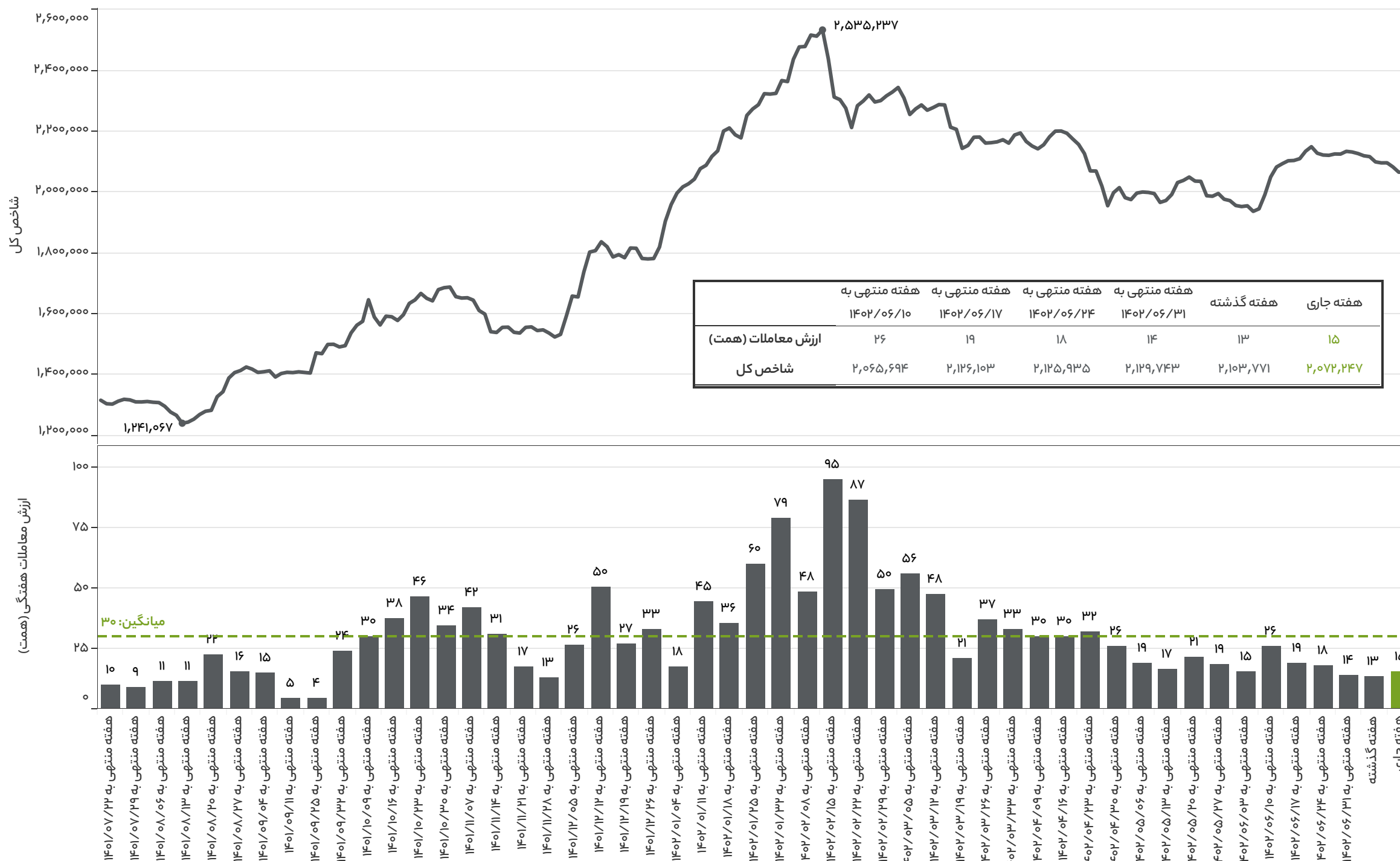
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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

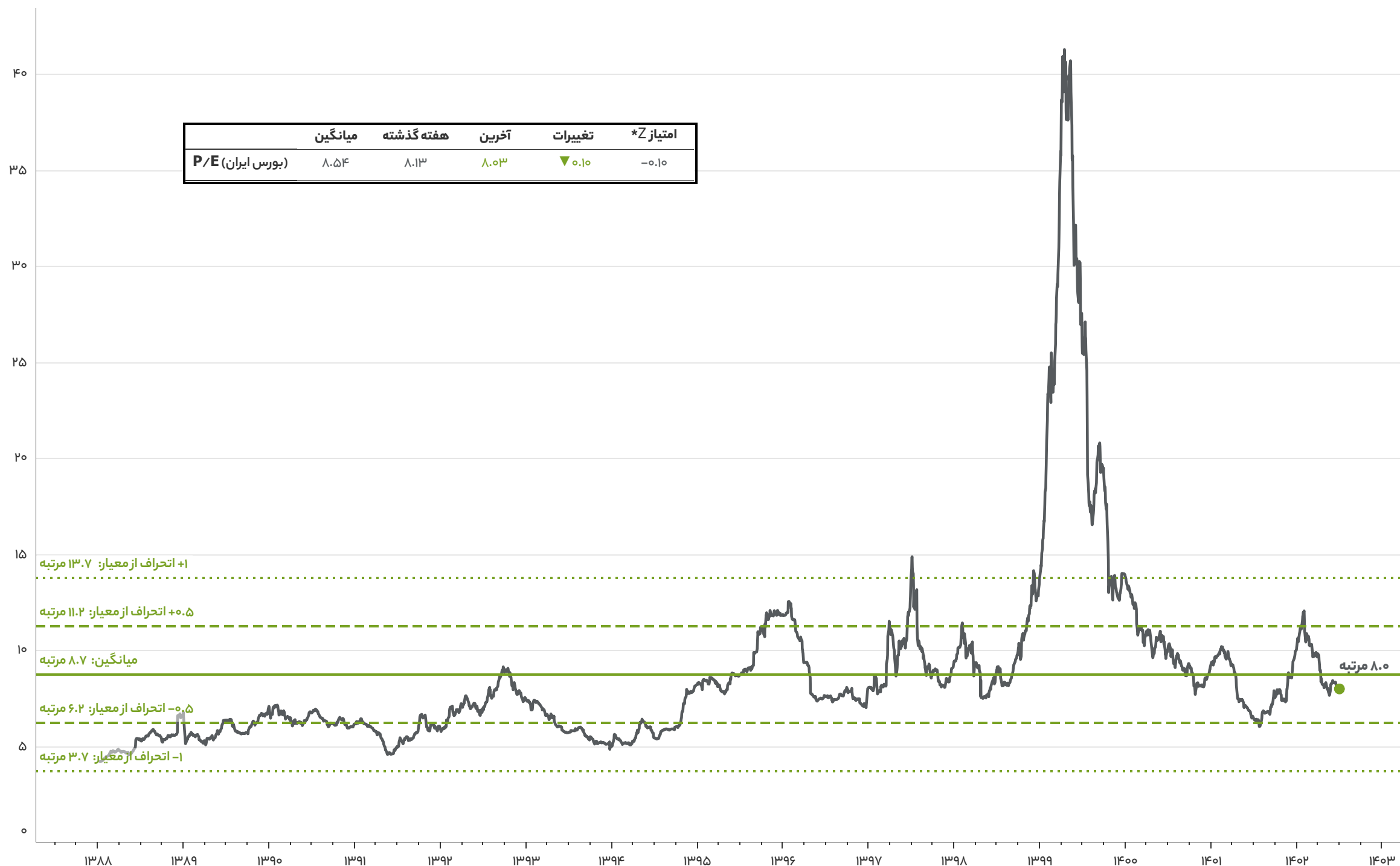
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

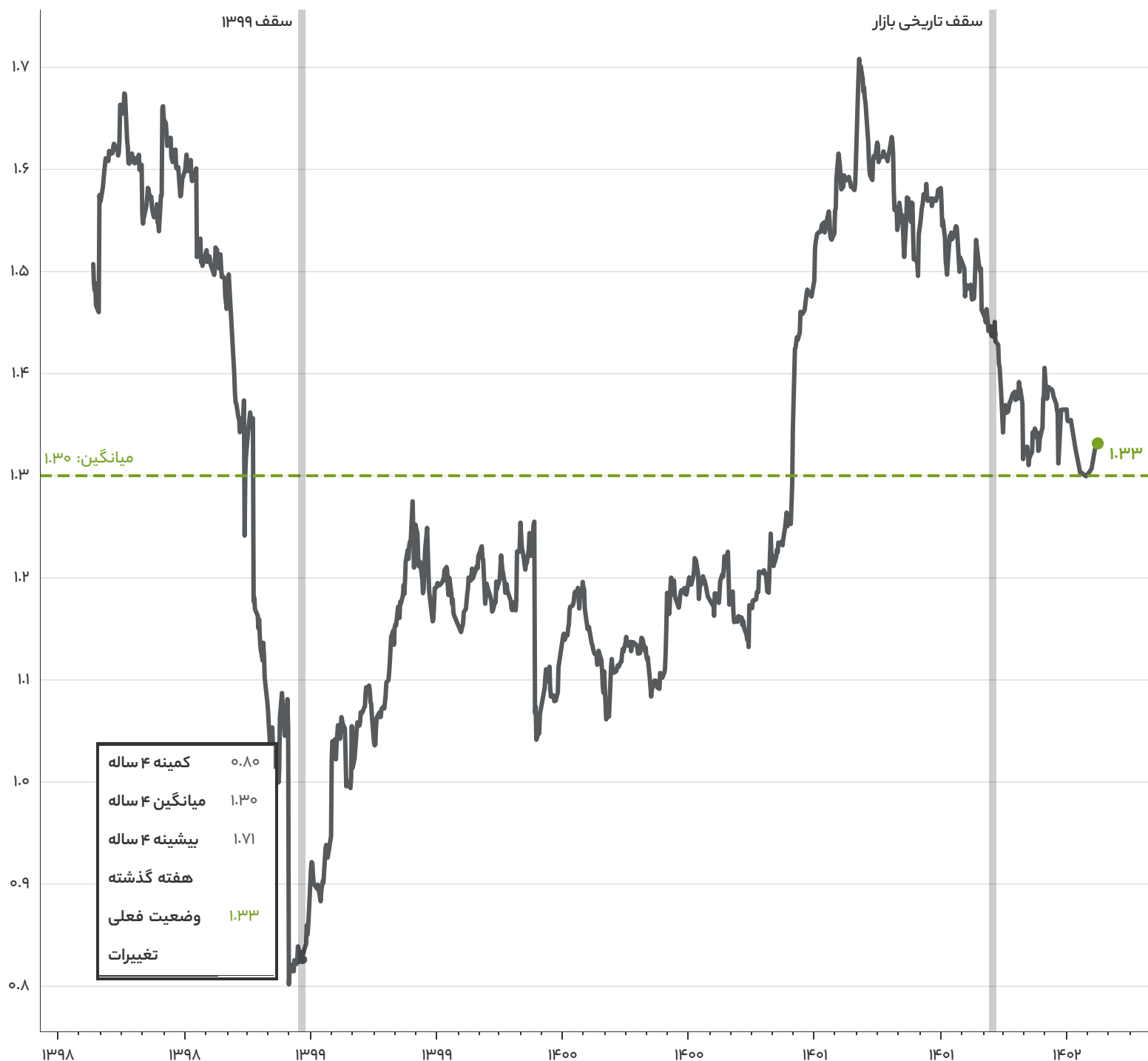
از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*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



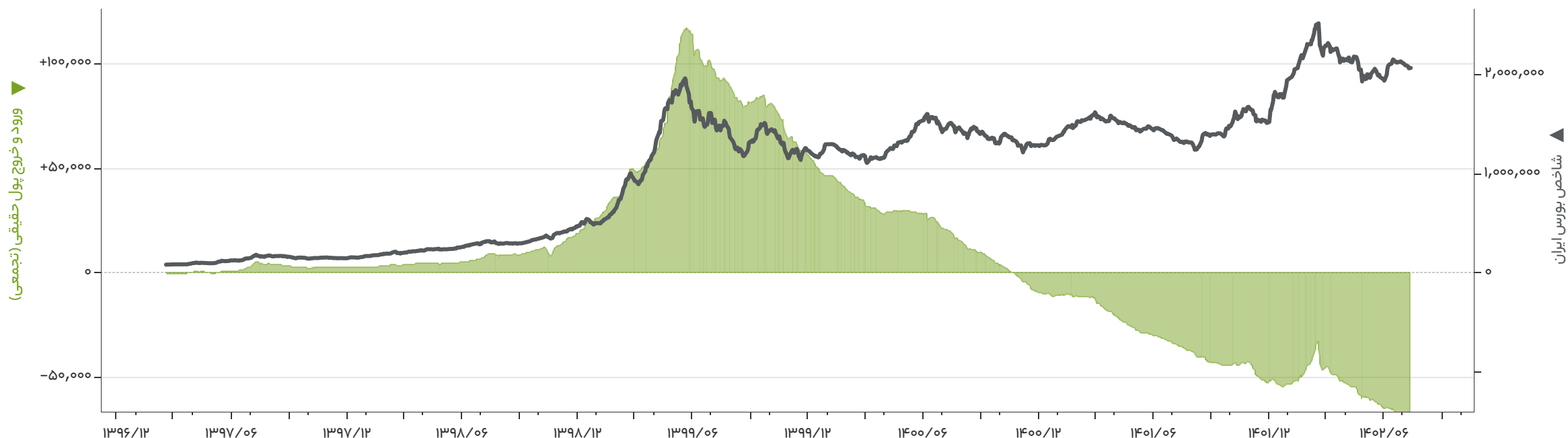
تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	بیشینه ۴ ساله
۰.۱۰-	۸.۰۳	۸.۱۳	۶.۰۷	۱۲.۹۲	۴۱.۳۳
	۷.۶۹		۵.۶۴	۱۲.۶۸	۴۱.۹۹
۰.۰۷-	۱۰.۲۵	۱۰.۳۲	۹.۰۳	۱۵.۳۶	۴۳.۵۱

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	۶۲	۸۹	۶۵	۶	۱۹۹	۱۸۹	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۴۵	۸۸	۱۰۸	۱۱۴	۱۵۷	۱۸۹	۲۲۲	۳۷۶	۶۴۰	۳,۰۷۶	۳,۱۷۶	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۵%	۱.۱%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۷%	۴.۶%	۷.۸%	۳۷.۶%	۳۸.۸%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۳	۶.۱	۱۱.۲	۲۲.۱	۹.۲	۱۰.۸	۱۱.۹	۶.۰	۵.۵	۷.۵	۸.۲	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۵%	۱۷.۰%	۳.۶%	۲.۶%	۶.۵%	۴.۶%	۴.۱%	۲.۳%	۱۴.۲%	۷.۷%	۹.۴%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۵%	۳۶%	۵۴%	۳۳%	۶۳%	۶۱%	۷۲%	
بتا به شاخص کل	۰.۸	۱.۰	۱.۳	۰.۶	۰.۷	۱.۰	۰.۸	۱.۰	۱.۲	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۴۹۳%	+۸۲۵%	+۱۲۰%	+۲۷۸%	+۳۸۵%	+۳۷۷%	+۴۵۲%	+۸۴۰%	+۸۲۴%	+۸۳۱%	+۸۸۷%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۸%	+۱۲۶%	-۶۵%	-۲%	+۱۵%	-۱۸%	+۳%	-۱۵%	+۲۰%	-۲%	+۵۴%	
بازده از ابتدای سال	+۱۶۵%	+۴۹%	+۴۱%	+۶۳%	+۹۳%	+۸۴%	+۶۳%	+۸۹%	+۹۶%	+۶۲%	+۷۱%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	-۱%	-۲%	-۱%	-۱%	۰%	۱%	-۱%	-۳%	-۱%	-۲%	

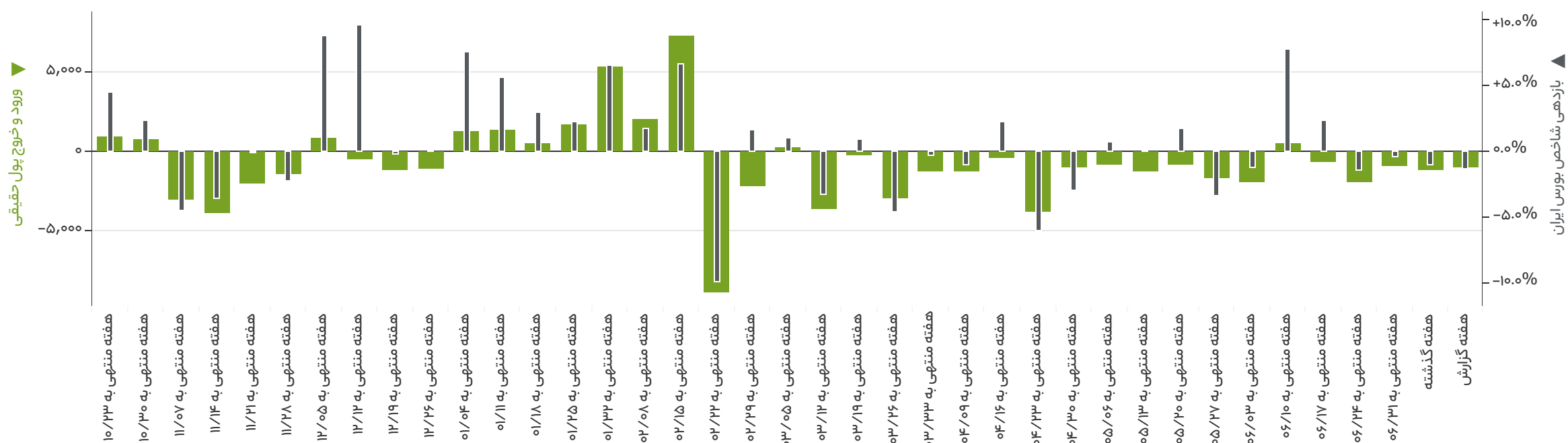
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



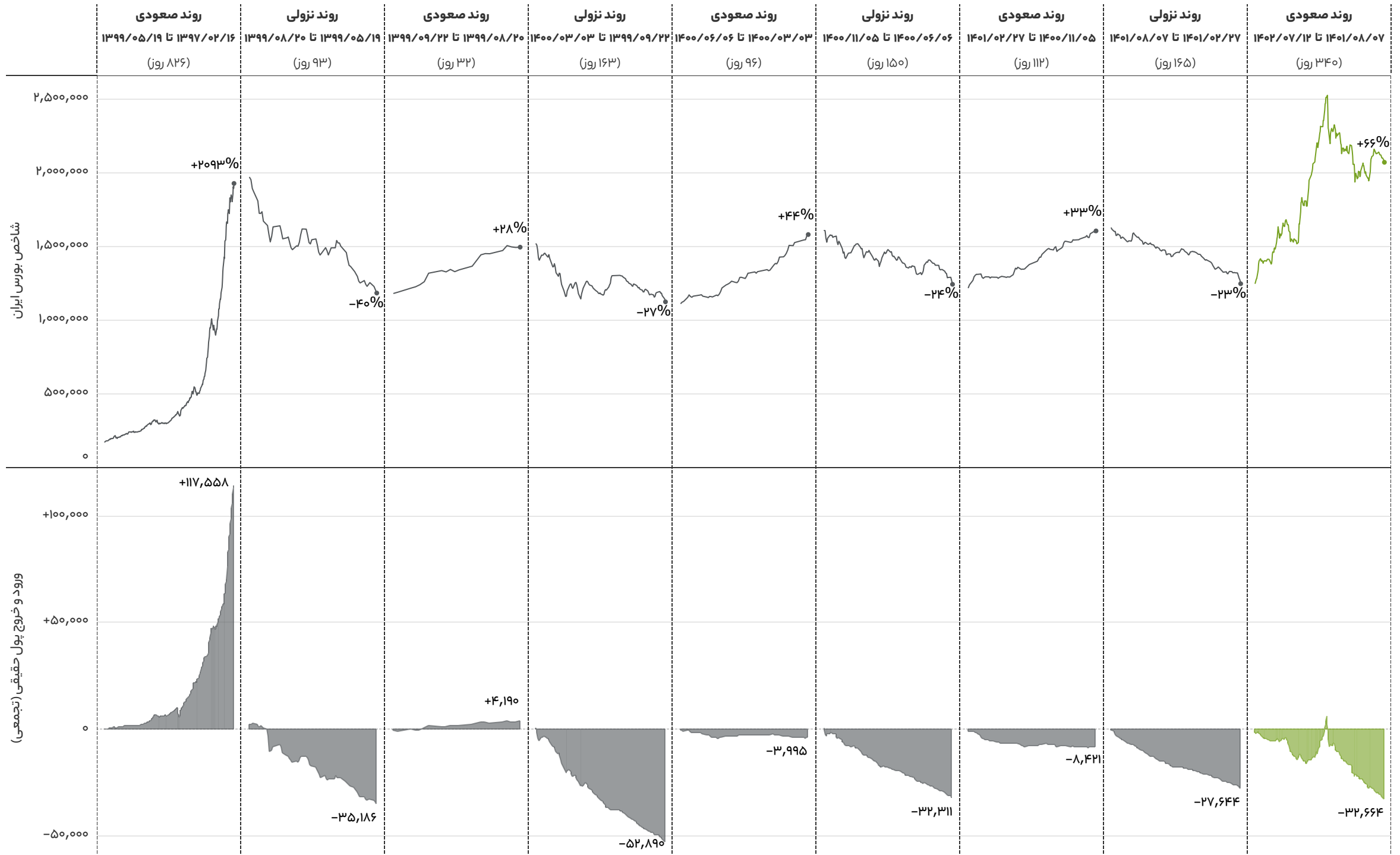
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



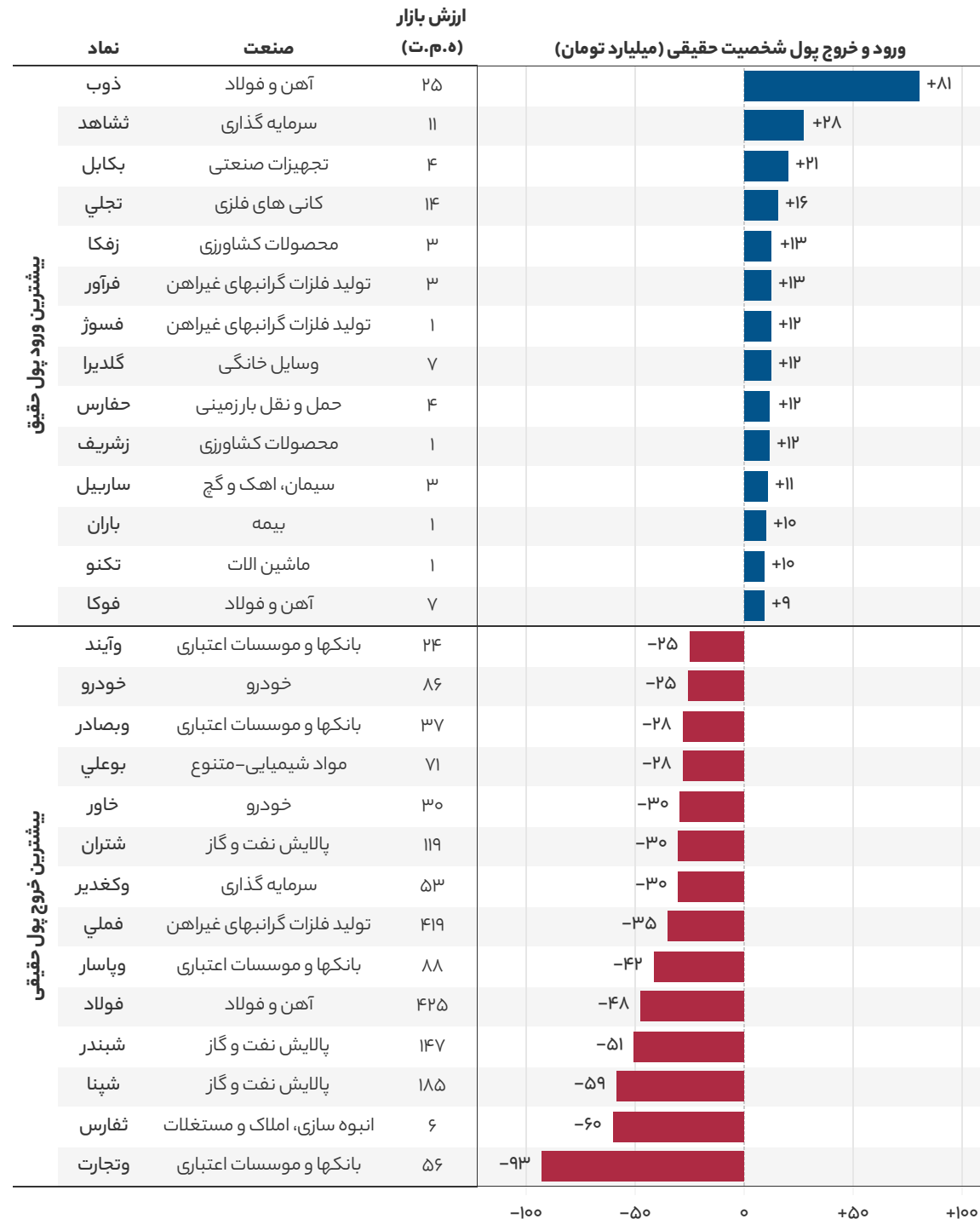
ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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



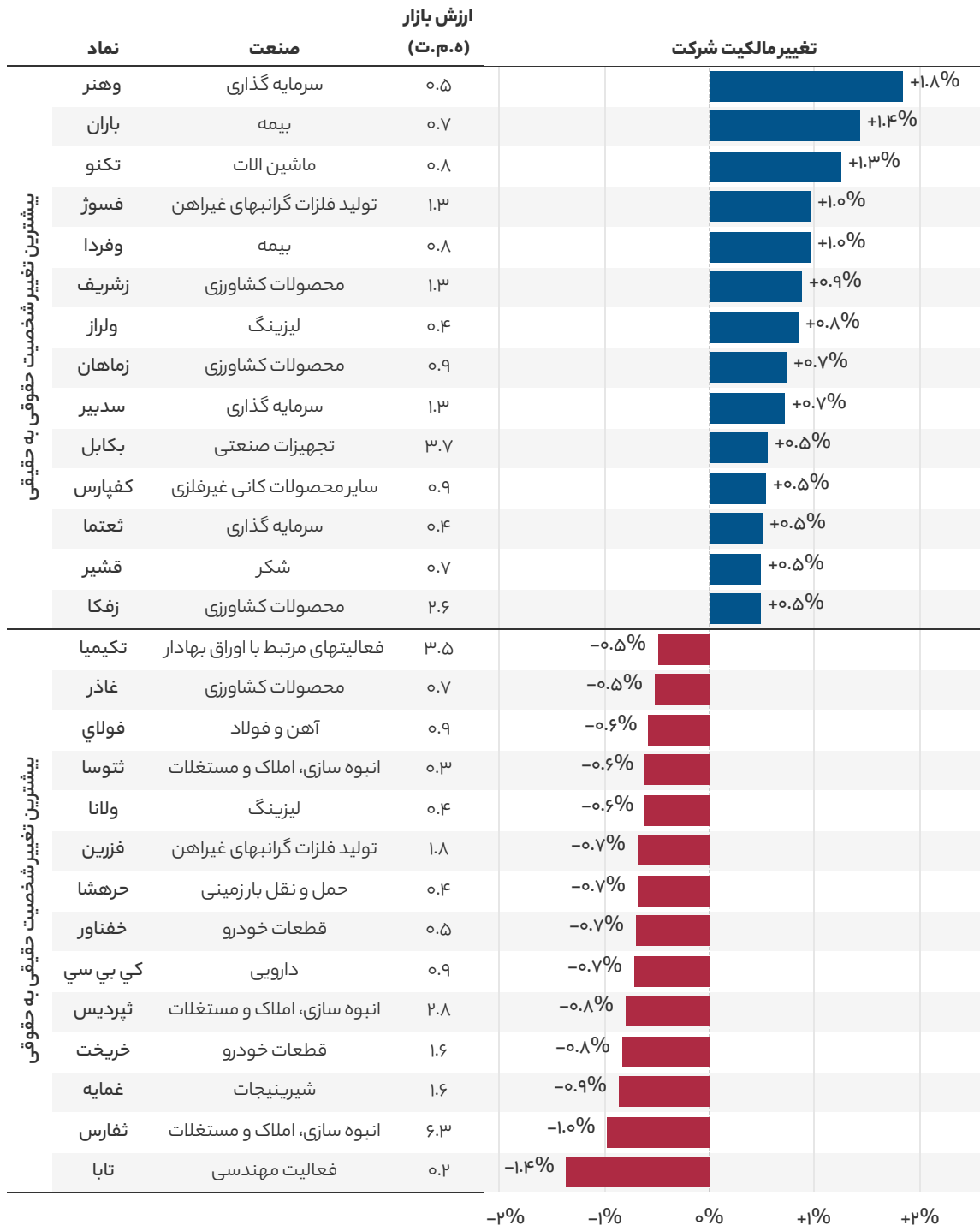
ورود و خروج پول حقیقی

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



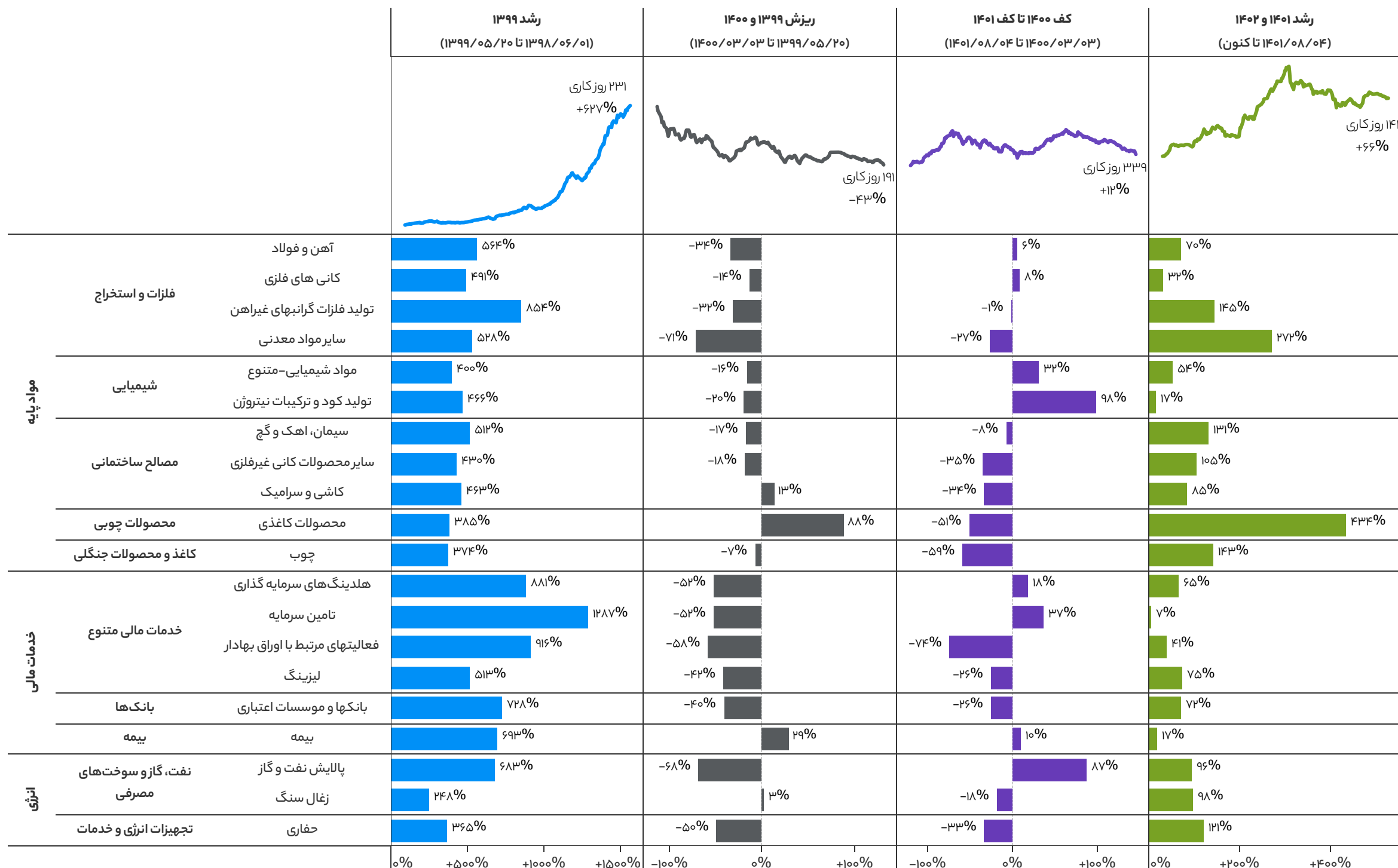
تغییر مالکیت شرکت

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



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

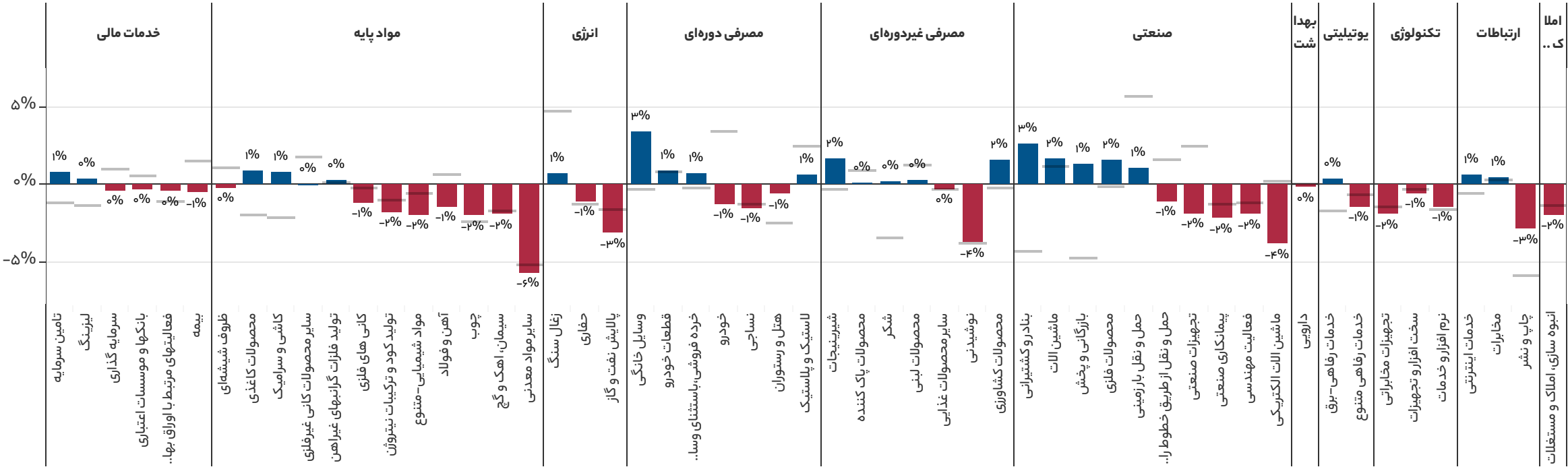


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲			کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱		ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰		رشد ۱۳۹۹	
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۵۴%	۱۳%	-۷۰%	۱۲۴۷%		
		قطعات خودرو	۹۴%	-۲۵%	-۳۲%	۶۷۶%		
		لاستیک و پلاستیک	۱۳۴%	-۴۲%	-۳۴%	۶۳۱%		
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۱۶۵%	-۳۶%	-۴۶%	۴۹۰%		
		نساجی	۱۲۹%	-۳۵%	-۲۱%	۳۸۰%		
	خرده فروشی	خرده فروشی	۱۴۱%	۳%	-۲۳%	۱۱۲۹%		
مصرفی غیردوره‌ای	غذا و نوشیدنی	هتل و رستوران	۲۲%	۱۸%	-۶۷%	۱۱۶۶%		
		محصولات کشاورزی	۳۷%	۹%	-۳۵%	۳۹۷%		
		شیرینیجات	۸۹%	-۶۳%	-۲۴%	۵۹۵%		
		محصولات لبنی	۱۵۶%	-۵۴%	۷%	۳۸۳%		
		شکر	۸۹%	-۴۴%	-۲۲%	۴۳۵%		
		سایر محصولات غذایی	۴۹%	-۳۹%	-۳۴%	۶۹۹%		
صنعتی	کالاهای سرمایه‌ای	نوشیدنی	۷۷%	-۳۱%	-۱۵%	۵۳۹%		
		محصولات پاک کننده	۳۴%	-۱۲%	۴%	۳۰۶%		
		فعالیت مهندسی	۵۶%	-۷%	-۶۳%	۵۲۱%		
		ماشین الات الکتریکی	۷۳%	-۲۳%	-۴۵%	۵۰۱%		
		ماشین الات	۱۳۱%	-۳۱%	-۳۵%	۴۲۲%		
		محصولات فلزی	۱۳۴%	-۴۴%	-۵۴%	۶۴۵%		
ترابری	تجهیزات صنعتی	۸۷%	-۴۰%	-۳۰%	۸۴۷%			
	پیمانکاری صنعتی	۱۱۶%	-۶۸%	-۱۵%	۵۲۵%			
	حمل و نقل از طریق راه‌آهن	۶۶%	-۴۱%	-۱۳%	۳۲۷%			
ارتباطات	بنادر و کشتیرانی	۱۶۸%	-۱۵%	-۲۲%	۲۴۶%			
	حمل و نقل بار زمینی	۶۳%	۳۳%	-۱۸%	۲۵۰%			
	دارویی	۹۳%	-۱۳%	-۳۲%	۳۲۱%			
تکنولوژی	بهداشت	۵۶%	۲%	-۳۵%	۲۵۲%			
	نرم افزار و خدمات	۱۱۴%	-۴۵%	-۶۵%	۵۷۰%			
یوتیلیتی	سخت افزار و تجهیزات	۴۰%	-۱۳%	-۷۱%	۵۳۲%			
	مخابرات	۱۱۸%	-۵۲%	-۵۲%	۲۲۳%			
املاک و مستغلات	چاپ و نشر	۴۹%	۱۳۱%	-۳۵%	۳۱۰%			
	رسانه و سرگرمی		-۳۳%	-۵۴%	۱۷۶%			
انبوه سازی، املاک و مستغلات		۱۶۵%	-۴۵%	-۴۳%	۶۱۹%			
توسعه املاک و مستغلات								
املاک و مستغلات								

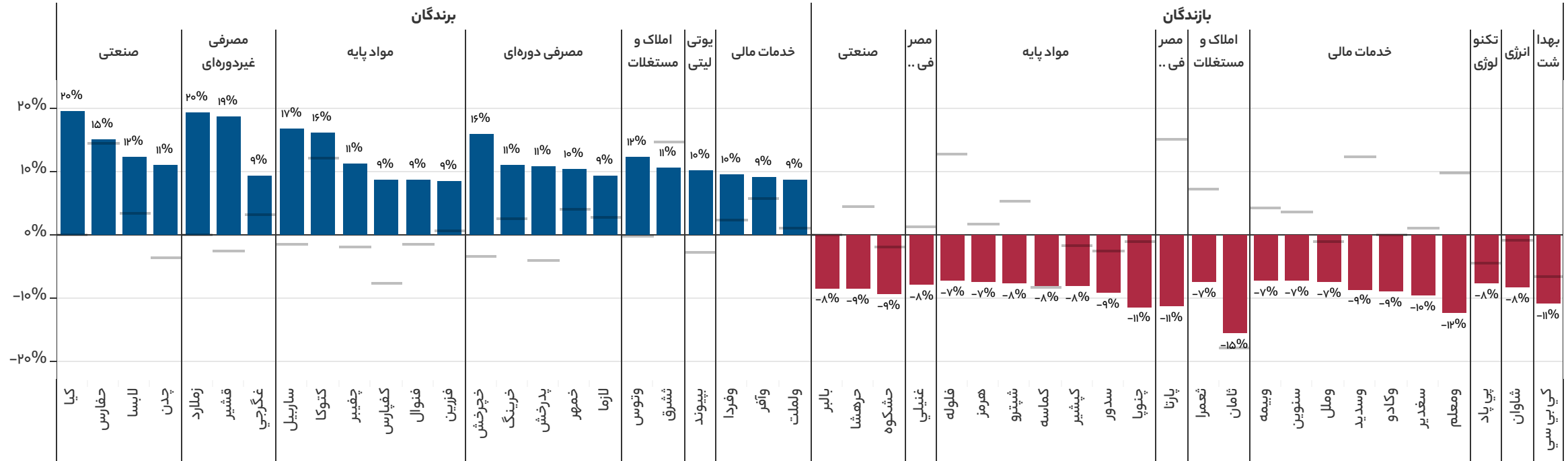
بازده صنایع از ابتدای هفته

(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)



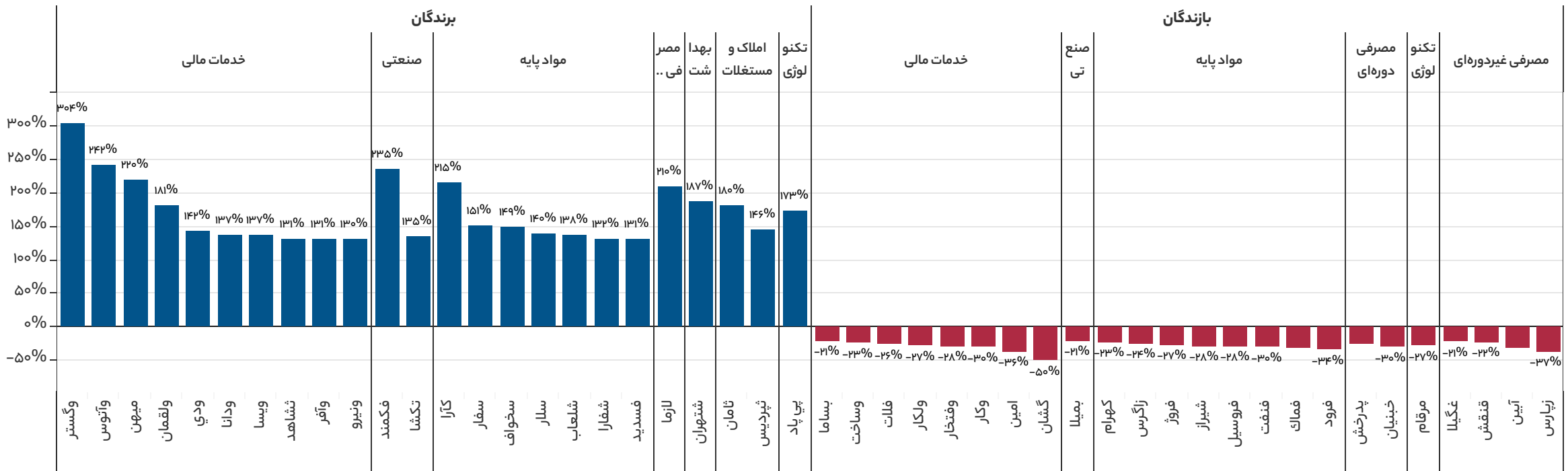
برندگان و بازندگان هفته

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



برندگان و بازندگان سال

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



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

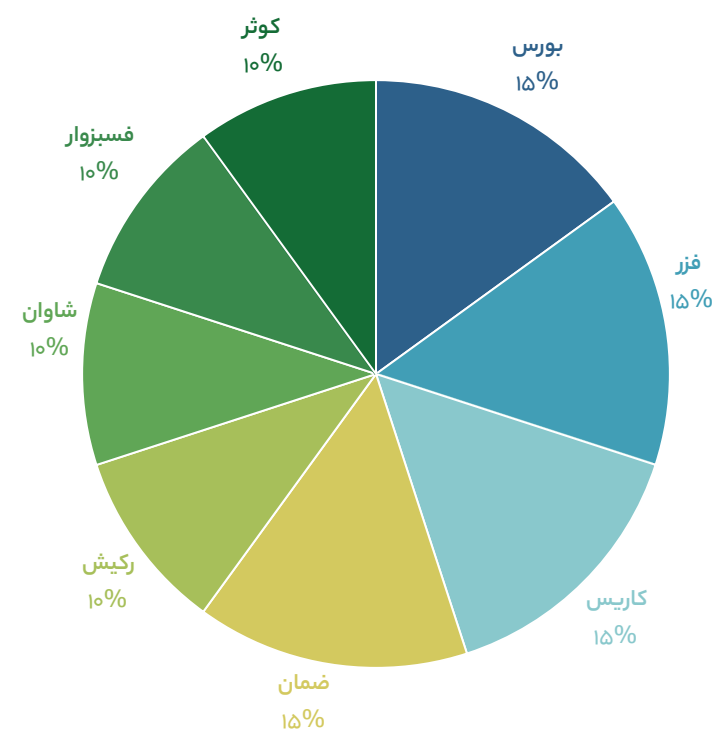


شبندر	۵۰.۲%
بوعلی	۴۰.۳%
وسهر	۳۱.۷%
فولاد	۳۱.۶%
شیراز	۳۰.۶%
شیریز	۳۰.۴%
شپنا	۳۰.۲%
فملی	۳۱.۱%
پارسان	۲۰.۷%
وتجارت	۲۰.۷%
شتارن	۲۰.۷%
رمپنا	۲۰.۴%
اخابر	۲۰.۳%
کچاد	۲۰.۳%
کگل	۲۰.۲%
شیدیس	۲۰.۰%
وگدیر	۱۰.۹%
جم	۱۰.۸%
تاپکو	۱۰.۸%
فخور	۱۰.۵%
مبین	۱۰.۵%
وبملت	۱۰.۴%
آریا	۱۰.۱%
ومعادن	۱۰.۱%
پارس	۱۰.۹%
میدکو	۱۰.۶%
مارون	۱۰.۴%
ککهر	۱۰.۴%
شتتا	۱۰.۴%
وامید	۱۰.۳%
ویپاسار	۱۰.۲%
بیپاس	۱۰.۲%
فارس	۱۰.۲%
تامیگو	۱۰.۱%
خساپا	۱۰.۱%
نوری	۱۰.۱%
خودرو	۱۰.۲%
ومصنوق	۱۰.۳%
وغدیر	۱۰.۳%
حکستی	۱۰.۶%
بازده هفته گذشته	



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۳۶۰	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۵,۰۰۰	رکیش	میان مدت
۱۰%	۲۱,۶۵۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۳۸,۸۸۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۴۵,۰۰۰	فسبزوار	
۱۰%	۳,۴۳۰	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%	۵,۸۹۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۸,۲۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۱,۱۵۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۴۷,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۱,۸۷۵	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





با تداوم ریزش‌های اخیر انتظار می‌رود ریزش تا حوالی محدوده مشخص شده ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین محدوده‌های حمایتی در تصویر مشخص شده‌است.

توضیحات تحلیل



BV Bourseview.com

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



با قدرت از محدوده تراکمی ایجاد شده خارج شده است. مهم‌ترین محدوده‌های مقاومتی در تصویر مشخص شده است.

توضیحات تحلیل



از کف کانال ترسیم شده بازگشت و انتظار می رود رشدی تا حوالی سقف کانال داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مطابق پیش‌بینی اصلاح تا محدوده‌های ذکرشده انجام شد. انتظار می‌رود رشد تا حوالی ۱۸۷۵ تجربه کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی ۸۹ دلار تجربه 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 می پردازد.

بخش، سه معیار برای P/E آینده نگار 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 نسبت های P/E با سود تقسیمی برآوردی مجمع پیش رو شرکت تعدیل شده اند.

همچنین در این بخش معیاری برای سنجش ارزشگذاری نسبی سهام، توسط تیم تحلیل گری کاریزما به نام امتیاز Z نسبت P/E آینده نگار ۴ فصله طراحی شده که برای هر شرکت به صورت مجزا تهیه گردیده است. هدف از طراحی این معیار، مقایسه نسبت P/E آینده نگار ۴ فصله با نسبت P/E آینده نگار تاریخی سهم می باشد. 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 دهنده ی ارزان بودن نسبی سهم و امتیاز Z بالا نشان دهنده ی گران بودن نسبی سهم می باشد. همچنین دیتای تاریخی استفاده شده برای محاسبه این معیار، در صورت معامله شدن سهم ۵ سال می باشد.

همچنین دسته بندی سهم های گزارش شده بر اساس سکتور و فعالیت شرکت می باشد و ترتیب شرکت ها نیز بر اساس ارزش بازار خواهد بود.

بدیهی است که معیار ذکر شده یک روش آماری بوده و بسیاری از عوامل تاثیر گذار بر نسبت P/E را در نظر نمی گیرد. همچنین لازم به ذکر است که استفاده از نسبت P/E به تنهایی برای تعیین ارزشگذاری سهام نمی تواند روشی قابل اتکایی باشد و بسته به شرایط، سایر روش ها نیز باید مدنظر سرمایه گذاران 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 سرمایه گذاری کاریزما مسئولیتی در خصوص صحت اطلاعات مزبور بر عهده نخواهد داشت.

جداول یا نمودارهای پیش رو به منظور پیشنهاد خرید یا فروش هیچ گونه اوراق بهادار نبوده و شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما در برابر معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش صورت گیرد، هیچ گونه مسئولیتی نمی پذیرد.

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 فصله	(آینده نگر فصله)						
مواد پایه شیمیایی	الفین	آریا	۱۲	۱۱۱.۷	۸,۱۲۰	۸۰۲	۹۵%	۹۵۶	۱,۲۷۸	+۳۴%	۸.۵	۶.۳	۷.۷	+۰.۰						
		جم	۱۲	۸۰.۴	۴,۴۶۴	۵۶۰	۹۹%	۸۵۳				۵.۲								
		جم پیلن	۱۲	۳۷.۲	۱۸,۵۹۵	۲,۱۰۹	۹۹%	۲,۷۹۰	۳,۳۷۶	+۲۱%	۶.۷	۵.۳	۶.۱	+۱.۰						
		شگویا	۱۲	۳۴.۵	۱,۴۳۹	۱۴۳	۹۱%	۲۵۹	۳۱۹	+۲۳%	۵.۶	۴.۲	۶.۰	-۰.۸						
		شکبیر	۱۲	۲۶.۲	۷,۲۷۰	۱,۱۶۸	۸۸%	۱,۶۱۳				۴.۵								
		شاراک	۱۲	۲۴.۶	۳,۰۴۹	۴۱۹	۹۶%	۵۶۷	۷۴۸	+۳۲%	۵.۴	۳.۸	۴.۷	-۱.۰						
		شغذیر	۱۲	۸.۶	۶,۵۹۵	۱,۰۹۶	۹۱%	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۷	۴.۷	۶.۱	+۰.۰						
		شعبصیر	۱۲	۷.۰	۲,۷۸۰	۳۷۶	۸۱%	۳۹۱	۵۲۸	+۳۵%	۷.۱	۵.۲	۶.۴	+۱.۰						
		شجم	۶	۵.۲	۸۰۱	۸۸	۸۵%	۷۵	۱۳۲	+۷۶%	۱۰.۷	۶.۹	۵.۹	-۴.۷						
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۲۴.۵	۱۳,۸۳۸	۱,۳۱۴	۱۰۰%	۱,۷۹۴	۲,۴۵۰	+۳۷%	۷.۷	۵.۵	۶.۲	+۰.۳						
		بوعلی	۱۲	۷۱.۴	۴,۹۷۳	۵۶۳	۹۵%	۷۵۸				۶.۶								
	اوره	شپدیس	۶	۹۷.۷	۱۶,۲۷۵	۴,۲۶۴	۶۳%	۳,۱۰۴	۳,۱۱۲	۰%	۵.۲	۵.۹	۵.۴	+۲.۲						
		شیراز	۱۲	۳۷.۲	۲,۴۳۴	۷۶۱	۲۱%	۴۰۱	۴۶۹	+۱۷%	۶.۱	۵.۴	۵.۸	+۱.۳						
		خراسان	۱۲	۲۷.۲	۱۵,۱۷۰	۲,۸۱۰	۸۳%	۱,۵۶۲	۲,۲۰۲	+۴۱%	۹.۷	۶.۹	۸.۸	+۴.۸						
		کرماشا	۱۲	۲۰.۸	۱,۹۶۸	۴۵۸	۴۸%	۲۵۶	۳۲۸	+۲۸%	۷.۷	۶.۱	۶.۹	+۳.۹						
		شاروم	۱۲	۲.۶	۳,۷۷۵	۱۶۷	۴۳%	۴۱۴				۹.۱								
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۱.۹	۱۳,۲۸۰	۱,۲۶۵	۷۲%	۱,۲۱۳				۱۰.۹								
		شخارک	۱۲	۲۶.۰	۴,۳۲۸	۶۴۱	۹۹%	۸۰۰	۱,۱۲۴	+۴۰%	۵.۴	۳.۶	۴.۳	-۴.۵						
		شفن	۱۲	۱۸.۵	۵۹۷	۱۰۲	۸۹%	۶۹	۱۱۳	+۶۴%	۸.۷	۵.۳	۷.۴	-۲.۰						
	محصولات شیمیایی	شکلر	۸	۴.۰	۳,۹۶۵	۴۱۹	۷۲%	۶۲۴	۶۶۳	+۶%	۶.۴	۵.۵	۵.۹	+۱.۳						
		شکام	۱۲	۳.۶	۸۹۴	۱۱۵	۱۴%	۱۷۹				۵.۰								
		شمواد	۶	۱.۹	۱۲,۹۳۰	۷۳۹	۲۳%	۱,۸۳۱	۱,۹۳۴	+۶%	۷.۱	۷.۵	۶.۳	-۰.۶						
		شملی	۶	۱.۶	۷۶۷	۴۱		۵۵	۸۵	+۵۴%	۱۴.۰		۱۴.۸							
	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۲	۵۰۵	۶۴	۸۲%	۹۲	۹۶	+۴%	۵.۵	۵.۰	۴.۷	-۲.۱						
شصدف		۱۲	۲.۵	۳,۶۰۵	۳۹۲	۷۳%	۳۵۷	۲۷۱	-۲۴%	۱۰.۱	۱۳.۶	۱۰.۷	+۱.۱							
شدوص		۱۲	۲.۰	۲,۰۵۴	۱۹۳	۹۳%	۳۲۶	۳۹۸	+۲۲%	۶.۳	۴.۹	۵.۷	-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		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر فصله	(آینده نگر فصله)
								۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۳	۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۳	۱۴۰۳
فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۲۴۰.۸	۵۳۱	۸۵	۵۰%	۱۰۱	۱۲۵	+۲۳%	۵.۲	۴.۲	۵.۰	+۲.۰
		فخوز	۱۲	۶۱.۷	۳۲۵	۳۵	۴۶%	۸۵	۱۰۲	+۱۹%	۳.۸	۲.۹	۳.۵	-۴.۹
		فولاد	۱۲	۳۵.۶	۱,۴۸۳	۱۹۹	۷۶%	۳۳۱	۳۸۶	+۱۶%	۴.۵	۳.۵	۳.۶	-۲.۵
		هرمز	۱۲	۳۵.۵	۷۲۴	۱۱۲	۵۱%	۱۶۷	۲۱۰	+۲۶%	۴.۳	۳.۳	۳.۷	-۲.۹
		کاوه	۱۲	۳۴.۸	۱,۰۸۷	۱۰۶	۶۸%	۲۰۲	۲۳۴	+۱۶%	۵.۴	۴.۵	۵.۷	-۰.۹
		ارفع	۱۲	۳۱.۲	۲,۶۰۰	۳۱۲	۸۶%	۴۹۶	۵۹۹	+۲۱%	۵.۲	۴.۱	۵.۴	-۰.۱
		فغدیر	۱۲	۲۹.۲	۸۳۳	۷۲	۸۵%	۱۱۸	۱۵۰	+۲۶%	۷.۰	۵.۴	۷.۶	+۱.۰
		فخاس	۱۲	۲۶.۹	۱,۱۷۰	۱۰۰	۴۹%	۱۴۳	۲۴۷	+۷۳%	۸.۲	۵.۰	۷.۱	-۴.۱
	سنگ آهن	فسبزوار	۹	۱۵.۶	۳,۸۸۸	۳۵۸	۹۰%	۸۰۶	۹۰۵	+۱۲%	۴.۸	۳.۷	۴.۶	-۱.۲
		کگل	۱۲	۱۹۱.۷	۵۸۱	۴۹	۶۵%	۶۳	۷۱	+۱۳%	۹.۲	۸.۴	۸.۲	-۱.۳
		کچاد	۱۲	۱۵۲.۹	۵۶۳	۸۴	۷۱%	۱۳۸	۱۶۱	+۱۷%	۴.۱	۳.۲	۳.۳	-۴.۰
	مس	کگهر	۹	۱۲۴.۴	۴,۹۷۵	۴۶۹	۹۲%	۵۸۳	۶۶۱	+۱۳%	۸.۵	۷.۱	۷.۶	-۱.۸
		کنور	۱۲	۲۴.۱	۱,۸۹۰	۱۴۷	۹۴%	۲۷۸	۳۶۳	+۳۱%	۶.۸	۴.۸	۵.۷	-۱.۳
مواد پایه	فلزات و استخراج	فملی	۱۲	۴۱۸.۸	۶۹۸	۸۳	۴۵%	۱۰۷	۱۲۹	+۲۱%	۶.۵	۵.۵	۵.۷	+۰.۷
		فباهنر	۱۲	۱۱.۷	۴۷۸	۶۰	۹۵%	۷۸			۶.۱			
		کوبر	۱۲	۱۳.۷	۳۶۷	۴۶	۱۲%	۵۶	۵۷	+۲%	۶.۶	۶.۹	۶.۴	-۱.۱
	محصولات فلزی	فجر	۱۲	۷.۰	۸۲۴	۱۹	۴۹%	۱۸۲	۲۴۶	+۳۵%	۴.۵	۳.۴	۴.۲	-۴.۱
		فروژ	۱۲	۴.۸	۴,۳۲۵	۵۳۹	۱۰۰%	۹۶۵	۱,۲۷۳	+۳۲%	۴.۵	۳.۰	۳.۷	
		فروس	۱۲	۳.۱	۷۸۵	۹۶	۶۶%	۱۴۷	۱۶۶	+۱۳%	۵.۳	۴.۶	۴.۷	-۰.۳
		فسپا	۱۲	۳.۰	۷۶۸	۱۲۴	۵۴%	۲۲۷	۲۴۱	+۶%	۳.۴	۳.۰	۲.۹	-۲.۷
		فروند	۱۲	۲.۲	۴۰۷	۲۳	۸۲%	۸۰			۵.۱			
		فروسیل	۱۲	۲.۱	۱,۳۲۵	۱۱۵	۶۴%	۲۴۲	۳۴۰	+۴۱%	۵.۵	۳.۸	۴.۳	-۲۶.۳
		فسازان	۱۲	۲.۰	۶۶۹	۷۴	۳۵%	۱۲۴	۱۳۵	+۹%	۵.۴	۵.۱	۵.۳	-۱.۳
		فولای	۱۲	۰.۹	۷۹۵	۶۰	۱۸%	۷۵	۷۴	-۱%	۱۰.۶	۱۱.۵	۱۰.۴	+۱.۲
	سرب و روی	آلومینیوم	۱۲	۲۹.۴	۷۷۴	۷۳	۳۹%	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۹.۰	۶.۵	۷.۶	+۲.۰
		فاسمین	۱۲	۱۳.۹	۵۷۸	۱۱۲	۶۴%	۱۱۳	۱۶۷	+۴۷%	۵.۱	۳.۲	۳.۹	+۰.۰
		فنوال	۱۲	۳.۹	۱,۱۵۳	۱۰۶	۵۱%	۱۰۲	۱۴۱	+۳۸%	۱۱.۳	۸.۶	۹.۴	+۳.۴
		کیمیا	۱۲	۱.۹	۶۴۴	۱۲۷	۴۰%	۱۱۵	۱۵۳	+۳۳%	۵.۶	۴.۳	۴.۴	-۰.۵
		فزرین	۱۲	۱.۸	۵۹۸	۹۳	۳۶%	۳۹	۵۷	+۴۶%	۱۵.۳	۱۱.۲	۱۳.۳	+۱.۲
		فتوسا	۱۲	۱.۱	۷۷۲	۱۴۹	۳۲%	۲۱۴	۳۱۸	+۴۹%	۳.۶	۲.۴	۲.۷	-۲.۶
سایر	طلا	فزر	۹	۱۲.۴	۴,۱۳۰	۹۹۶	۳۱۸%	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۵.۷	۵.۱	۳.۵	-۱.۱
	سایر کانی‌های فلزی	کمنگنز	۱۲	۲.۵	۱,۶۸۵	۱۱۴	۶۴%	۲۰۰	۲۴۹	+۲۴%	۸.۴	۶.۹	۷.۳	+۰.۲
سایر مواد معدنی		کتوسعه	۹	۲.۳	۲,۱۷۰	۱۱۱	۹۷%	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۲.۵	۹.۹	۹.۲	

-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	آینده نگر ۴ (فصله)				
مواد پایه	سیمان، اهک و گچ	ستران	۱۲	۹۰۱	۵۳۷	۶۲	۷۶%	۱۰۳			۵۰۲							
		ساوه	۱۲	۸۰۵	۱۳,۰۹۰	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۵۰۵	۴۰۱	۴۰۹	+۰.۳				
		سآبیک	۱۲	۶۰۴	۲,۱۷۵	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۵۰۶	۴۰۰	۵۰۰	+۱.۰				
		سخوز	۱۲	۶۰۲	۴,۴۳۴	۷۱۹	۹۰%	۹۸۷	۱,۲۱۶	+۲۳%	۴۰۵	۳۰۳	۳۰۵	-۱.۱				
		سپاها	۶	۵۰۱	۲,۱۰۰	۱۹۷	۷۵%	۳۲۶	۵۶۱	+۷۲%	۶۰۴	۴۰۱	۳۰۶	-۰.۶				
		ساروم	۱۲	۴۰۳	۴,۲۹۲	۵۵۴	۹۶%	۷۱۰	۹۹۴	+۴۰%	۶۰۰	۴۰۱	۵۰۳	-۰.۲				
		سرود	۱۲	۳۰۸	۴,۷۳۰	۴۹۶	۹۶%	۶۵۱	۹۵۰	+۴۶%	۷۰۳	۴۰۸	۶۰۸	+۱.۲				
		سشرق	۶	۳۰۷	۱,۳۹۲	۱۵۴	۷۲%	۲۴۷	۳۷۴	+۵۲%	۵۰۶	۴۰۰	۲۰۹	-۴.۸				
		سصوفی	۱۲	۳۰۱	۲,۷۷۸	۳۶۸	۹۰%	۵۳۲	۹۰۷	+۷۱%	۵۰۲	۲۰۹	۴۰۳	-۰.۶				
		سبجنو	۱۲	۳۰۰	۷,۶۱۵	۵۷۳	۹۶%	۱,۱۱۵	۱,۴۱۲	+۲۷%	۶۰۸	۵۰۲	۵۰۹	-۰.۷				
		سشمال	۹	۲۰۷	۱,۶۱۵	۱۷۰	۸۹%	۲۷۵	۴۱۱	+۴۹%	۵۰۹	۳۰۵	۴۰۵	+۰.۱				
		سبهان	۱۲	۲۰۱	۱۰,۴۲۶	۷۳۶	۹۷%	۱,۵۵۶	۱,۷۸۹	+۱۵%	۶۰۷	۵۰۶	۶۰۷	-۰.۶				
	مصالح ساختمانی	سخرز	۱۲	۲۰۰	۳,۹۹۶	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۸۰۳	۶۰۲	۶۰۶	-۰.۳				
		سشاش	۱۲	۱۰۸	۸,۸۰۸	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۹۱	۱,۸۳۶	+۲۳%	۵۰۹	۴۰۵	۵۰۱	-۰.۸				
		کحافظ	۱۲	۳۰۵	۶۷۳	۸۲	۱۰%	۱۰۱	۱۵۰	+۴۸%	۶۰۶	۴۰۸	۵۰۵	-۰.۴				
		کساوه	۱۲	۳۰۱	۵,۸۴۱	۷۴۷	۷۱%	۱,۱۵۰	۱,۶۹۰	+۴۷%	۵۰۱	۳۰۳	۳۰۹	-۲.۶				
		کپارس	۱۰	۱۰۸	۱,۰۸۴	۲۴		۱۸۸	۲۵۸	+۳۷%	۵۰۸		۴۰۵					
		کلوند	۱۲	۱۰۷	۴,۲۵۰	۵۰۴	۹۵%	۶۴۶	۹۴۵	+۴۶%	۶۰۶	۴۰۳	۵۰۵	-۰.۳				
		کترام	۱۲	۱۰۳	۷۶۹	۵۹	۲۳%	۸۵	۱۱۴	+۳۴%	۹۰۱	۷۰۳	۷۰۰	-۱.۲				
		کصدف	۱۲	۰۰۸	۲,۳۰۵	۱۲۸	۱۰%	۱۵۱	۲۴۲	+۶۰%	۱۵۰۲	۱۰۰۳	۱۲۰۹	+۲.۱				
		کسعدي	۱۲	۰۰۸	۷۸۲	۵۱	۸۶%	۹۵	۱۲۳	+۲۹%	۸۰۲	۶۰۳	۶۰۹	-۱.۴				
		شیشه و ظروف شیشه‌ای	کرازى	۱۲	۴۰۷	۱۶۳	۱۶	۲۴%	۲۳	۳۲	+۳۹%	۷۰۰	۵۰۴	۵۰۴	-۰.۷			
			کقزوى	۱۲	۳۰۸	۲,۶۴۵	۳۵۹	۳۶%	۵۵۷			۴۰۷						
			کگاز	۱۲	۲۰۹	۳,۳۸۸	۱۱۳	۵۱%	۳۸۱	۴۳۴	+۱۴%	۸۰۹	۸۰۰	۷۰۵	-۳.۸			
فرآورده‌های نسوز	کفرا	۱۲	۲۰۰	۱,۰۰۷	۶۶	۹۶%	۷۹	۱۵۴	+۹۴%	۱۲۰۷	۶۰۷	۸۰۷	-۱.۰					
	کاذر	۱۲	۱۰۰	۵۱۵	۵۲	۲۶%	۱۲۶	۱۵۰	+۱۹%	۴۰۱	۳۰۵	۳۰۳	-۸.۲					
	کفپارس	۹	۰۰۹	۵۷۷	۳۶	۷%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۱۰۰	۸۰۸	۷۰۴	-۰.۸					

-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)
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۸۴.۸	۸۱۴	۱۷۰	۶۳%	۱۵۱			۵.۴			
		پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۲۷.۹	۲۶۹	۳۱	۸۸%	۳۴	۴۶	+۳۴%	۷.۹	۵.۸	۶.۶	+۰.۱
		روانکار	شبه‌هرن	۱۲	۳۰.۰	۲,۵۱۰	۳۳۸	۸۹%	۳۴۵	۵۲۵	+۵۲%	۷.۳	۴.۷	۶.۱	+۱.۵
			شسپا	۱۲	۲۷.۷	۴۹۴	۷۴	۶۷%	۸۳	۹۹	+۱۹%	۵.۹	۴.۷	۵.۱	+۰.۷
			شنفت	۱۲	۱۶.۹	۸۴۵	۱۰۸	۸۲%	۷۵	۱۰۳	+۳۷%	۱۱.۳	۸.۴	۹.۵	+۰.۲
			شرانل	۱۲	۱۶.۰	۸,۰۲۰	۱,۴۴۱	۸۵%	۹۳۰	۱,۵۶۵	+۶۸%	۸.۶	۵.۲	۷.۰	+۲.۴
	زغال سنگ	کزغال		۱۲	۸.۰	۲,۲۹۰	۲۶۵	۹۹%	۳۷۴	۸۲۷	+۱۲۱%	۶.۱	۲.۶	۴.۷	-۲.۴
		کپور		۱۲	۲.۳	۱,۳۳۵	۱۶۹	۵۹%	۲۴۷	۳۳۵	+۳۶%	۵.۴	۳.۹	۴.۲	-۳.۸
		کطبس		۱۲	۱.۵	۱,۹۷۰	۱۹۳	۶۲%	۳۷۸	۴۷۱	+۲۵%	۵.۲	۴.۱	۴.۱	-۴.۸
		فلزات و معادن	ومعادن	۱۲	۸۸.۷	۴۶۱	۷۲	۳۸%	۹۷	۱۱۹	+۲۲%	۴.۷	۳.۸	۳.۴	-۴.۶
خدمات مالی	سنگ آهن	وکغدير		۶	۵۲.۹	۱,۳۸۰	۱۳۴	۶۲%	۱۸۳	۲۷۵	+۵۱%	۷.۵	۵.۷	۴.۹	
		وامید		۱۰	۱۳۴.۴	۱,۳۸۶	۱۸۸	۶۸%	۱۷۱	۲۳۸	+۳۹%	۸.۱	۵.۶	۸.۴	+۱.۳
		لوتوس		۱۰	۱۲.۶	۳۶۰	۴۵	۹۶%	۶۷	۸۳	+۲۳%	۵.۴	۳.۹	۴.۴	-۲.۷
		تامین سرمایه	تنوین	۱۲	۱۰.۷	۲۷۹	۴۸	۶۳%	۵۰	۶۱	+۲۳%	۵.۶	۴.۴	۴.۶	-۰.۸
	دارویی	امین		۶	۹.۸	۵۴۷	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۲	۹.۷	۷.۷	-۳.۴
		وپخش		۱۲	۱۵.۸	۱,۸۸۳	۲۹۸	۹۱%	۳۶۹			۵.۱			
		شفا		۱۲	۶.۱	۲,۲۴۷	۲۸۱	۷۱%	۳۲۴			۶.۹			
	چند رشته‌ای	وسپه		۹	۱۳.۴	۴۴۰	۶۷	۸۸%	۶۴	۸۱	+۲۶%	۶.۹	۵.۰	۷.۲	+۲.۸
		وتوکا		۱۲	۵.۲	۴۲۸	۳۷	۳۳%	۴۰	۵۲	+۳۱%	۱۰.۸	۸.۷	۸.۲	+۰.۹
	سرب و روی	کروی		۱۲	۶.۸	۶۸۰	۱۵۶	۷۴%	۲۵	۳۵	+۴۴%	۲۷.۵	۲۰.۳	۱۹.۰	+۱.۸
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۵	۷,۵۷۵	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵.۸	۳.۷	۴.۶	-۰.۶
	کاغذ و محصولات..	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۳	۶,۵۲۵	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۶.۱	۹.۳	۱۳.۷	+۰.۶

+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		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)						
بهداشت	دارویی	دعبید	۹	۳۷.۷	۱,۵۰۷	۶۰	۲۰%	۱۱۱	۱۶۴	+۴۷%	۱۳.۵	۹.۴	۹.۲	+۰.۳						
		ددانا	۱۲	۱۲.۸	۵,۳۳۰	۴۹۵	۷۶%	۷۶۰	۹۴۶	+۲۵%	۷.۰	۵.۵	۶.۰	+۰.۵						
		دارو	۱۲	۷.۸	۲,۹۸۱	۳۳۰	۹۵%	۴۲۳	۴۸۶	+۱۵%	۷.۰	۵.۹	۶.۰	-۰.۲						
		دتماد	۱۲	۳.۴	۴,۸۰۱	۶۵۳	۹۶%	۶۷۵	۷۷۰	+۱۴%	۷.۲	۶.۱	۶.۶	-۰.۳						
		دلر	۱۲	۶.۹	۳,۰۴۵	۳۵۲	۹۶%	۴۷۴	۶۲۵	+۳۲%	۶.۴	۴.۶	۵.۵	+۰.۱						
		دالبر	۱۲	۵.۷	۵۹۸	۷۵	۶۹%	۹۸	۱۱۳	+۱۵%	۶.۱	۵.۳	۵.۳	-۱.۳						
		کاسپین	۱۲	۲.۸	۱,۹۸۲	۲۳۴	۹۵%	۲۴۹	۳۳۲	+۳۰%	۸.۲	۶.۵	۷.۵	+۰.۹						
		دیپارس	۱۲	۵.۵	۵,۷۸۹	۸۰۳	۹۸%	۹۳۹	۱,۰۹۹	+۱۷%	۶.۲	۵.۰	۴.۸	-۰.۵						
		دفارا	۱۲	۵.۴	۳,۳۴۹	۴۵۲	۹۹%	۵۱۷	۵۸۳	+۱۳%	۶.۵	۵.۵	۵.۳	-۰.۱						
		دفرا	۱۲	۵.۱	۳,۶۲۰	۳۹۳	۷۹%	۵۰۱	۶۲۸	+۲۵%	۷.۲	۵.۷	۵.۸	+۱.۲						
		هجرت	۱۲	۴.۵	۲,۸۱۰	۴۰۶	۹۵%	۶۵۷	۷۴۸	+۱۴%	۴.۳	۳.۳	۳.۶	-۲.۱						
		دتوزیع	۱۲	۴.۳	۲,۴۰۰	۴۴۹	۹۴%	۵۱۶	۵۵۳	+۷%	۴.۶	۳.۹	۳.۷	-۱.۸						
		دقاضی	۱۲	۴.۱	۲,۴۳۰	۲۷۷	۹۶%	۳۶۶	۴۳۱	+۱۸%	۶.۶	۵.۴	۵.۷	-۰.۴						
		دجابر	۱۲	۳.۹	۱,۷۴۰	۱۷۱	۷۰%	۲۴۲			۷.۲									
		دسبحان	۱۲	۳.۹	۷۳۱	۷۲	۶۳%	۱۰۳	۱۱۳	+۱۰%	۷.۱	۶.۶	۶.۸	-۰.۹						
		داسوه	۱۲	۳.۳	۴,۴۱۰	۴۸۴	۷۰%	۵۰۸	۶۰۰	+۱۸%	۸.۷	۷.۵	۷.۷	+۰.۳						
		دابور	۱۲	۳.۰	۱,۶۸۷	۲۶۲	۹۵%	۳۱۲	۳۸۳	+۲۳%	۵.۴	۴.۱	۴.۵	-۰.۸						
		درازک	۱۲	۲.۹	۱,۳۶۷	۲۱۳	۱۰۴%	۲۵۹	۲۸۹	+۱۲%	۵.۳	۴.۲	۴.۴	-۵.۱						
		دشیمی	۱۲	۲.۸	۳,۰۸۷	۳۲۱	۹۴%	۴۶۰			۶.۷									
		دکپسول	۱۲	۲.۳	۷,۶۸۰	۹۲۱	۹۲%	۱,۱۳۷	۱,۴۵۷	+۲۸%	۶.۸	۵.۱	۵.۹	+۱.۱						
		دراز	۱۲	۲.۱	۲,۱۱۰	۲۷۳	۶۷%	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۶.۱	۵.۶	۵.۱	-۲.۴						
		درهآور	۱۲	۲.۰	۸,۱۹۰	۹۷۰	۹۳%	۱,۲۴۶			۶.۶									
		دکوثر	۱۲	۲.۰	۱,۱۷۰	۶۰	۱۱%	۱۱۶	۱۵۵	+۳۳%	۱۰.۱	۸.۲	۹.۶	+۰.۲						
		دکیمی	۱۲	۱.۹	۳,۳۲۵	۳۵۳	۸۲%	۴۶۸			۷.۱									
		دزهرای	۱۲	۱.۹	۵۸۳	۱	۰%	۷۱			۸.۲									
		دشیری	۱۲	۰.۶	۱۱,۷۲۰	۱,۲۱۳	۸۴%	۱,۳۴۲			۸.۷									

-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		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	۸.۲	۲,۷۲۹	۲۱۳	۵۵%	۴۶۳				۵.۹									
		جوین	۴	۴.۹	۶۶۱	۹۱	۵۳%	۹۷	۹۵	-۲%	۶.۸	۷.۷	۶.۴	+۰.۹							
		سیمرغ	۹	۴.۲	۳,۲۰۳	۳۹۱	۲۴%	۴۸۵	۷۰۰	+۴۴%	۶.۶	۴.۵	۴.۵	-۰.۴							
		زفکا	۱۲	۲.۶	۱,۷۲۵	۱۵۵	۹۱%	۲۵۷				۶.۷									
		تلیسه	۱۲	۲.۰	۴۰۷	۲۵	۹۲%	۳۳				۱۲.۳									
		زدشت	۱۲	۱.۹	۲,۷۳۰	۲۱۲	۵۱%	۲۴۵				۱۱.۱									
		زگلدشت	۱۲	۱.۷	۲,۴۳۵	۹۶	۹۵%	۱۵۵				۱۵.۷									
		زفجر	۱۲	۱.۶	۱,۸۱۶	۱۲۱	۸۰%	۱۶۳				۱۱.۱									
		زملارد	۱۲	۱.۶	۱,۹۸۵	۳۳	۹۴%	۱۰۲				۱۹.۵									
		زبینا	۱۲	۱.۴	۳۸۵	۴۱	۷۹%	۵۱				۷.۶									
		زشریف	۹	۱.۳	۵۴۰	۴۸	۷۶%	۹۰	۸۸	-۳%	۶.۰	۵.۷	۵.۱	-۱.۸							
		زکشت	۱۲	۱.۱	۱,۹۱۲	۱۲۶	۵۳%	۱۱۴				۱۶.۸									
		زمگسا	۱۲	۱.۱	۳,۶۰۰	۳۲۶	۹۵%	۴۰۴				۸.۹									
		زشگزا	۱۲	۰.۸	۸۶۴	۸۱	۵۶%	۱۲۴				۷.۰									
	غذا و نوشیدنی	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۵.۳	۱,۵۳۳	۱۶۱	۶۰%	۲۱۵	۲۵۶	+۱۹%	۷.۱	۵.۹	۶.۰	-۲.۲						
			غپینو	۱۲	۳.۷	۴۱۲	۴۹	۵۶%	۷۸	۹۷	+۲۴%	۵.۳	۴.۳	۴.۴	-۱.۹						
			غسالم	۱۲	۲.۱	۴۶۳	۶۵	۴۱%	۸۶	۱۰۷	+۲۵%	۵.۴	۴.۶	۴.۳	-۱.۶						
			غمینو	۱۲	۱.۶	۱,۰۶۸	۱۴۹	۴۳%	۱۹۶	۲۵۰	+۲۸%	۵.۵	۴.۳	۴.۵	-۰.۳						
	قند و شکر	قپیرا	۴	۳.۱	۱,۲۲۹	۴۰	۸۷%	۴۸	۱۲۳	+۱۵۶%	۲۵.۶	۱۱.۴	۱۰.۲	-۱۲.۳							
		قچار	۱۲	۳.۰	۸۵۹	۴۲	۲۱%	۶۲				۱۳.۹									
		قصفها	۱۲	۲.۹	۱۴,۸۰۰	۶۲۲	۹۹%	۱,۱۸۷	۱,۲۰۰	+۱%	۱۲.۵	۱۲.۶	۱۰.۶	-۱.۴							
		قشهد	۶	۲.۱	۳,۰۶۰	۱۶۹	-۱۸%	۲۵۳				۱۲.۱									
		قمرو	۴	۱.۸	۸۹۰	۷۲	۳۴%	۸۶	۱۰۰	+۱۶%	۱۰.۴	۱۰.۳	۶.۰	-۰.۹							
		قزوبین	۱۲	۱.۶	۷۷۱	۷۶	۸۴%	۸۰	۹۶	+۱۹%	۹.۶	۸.۱	۷.۳	+۰.۱							
	غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۶.۵	۳۶۰	۴۳	۱۰%	۶۷	۸۰	+۱۹%	۵.۳	۴.۸	۴.۶	-۱۲.۸							
		غمهرا	۱۲	۲.۰	۱,۰۷۳	۱۰۵	۱۶%	۱۶۸	۲۵۶	+۵۲%	۶.۴	۴.۴	۴.۶	-۱.۶							
	روغن خوراکی	غبشهر	۹	۸.۱	۲۷۳	۳۹	۳۷%	۴۳	۸۶	+۱۰۱%	۶.۴	۳.۱	۴.۱	-۳.۱							
	محصولات لبنی	غفارس	۱۲	۲.۰	۱,۷۱۵	۱۰۱	۱۳%	۱۱۲				۱۵.۳									
		غگلپا	۱۲	۱.۵	۴,۰۱۰	۴۶۵	۷۴%	۵۲۵				۷.۶									
		غشان	۱۲	۱.۳	۷۲۸	۸۰	۷۱%	۸۴				۸.۶									
		غگلستا	۱۲	۱.۲	۱,۸۸۲	۱۵۶	۷۰%	۲۰۷				۹.۱									

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

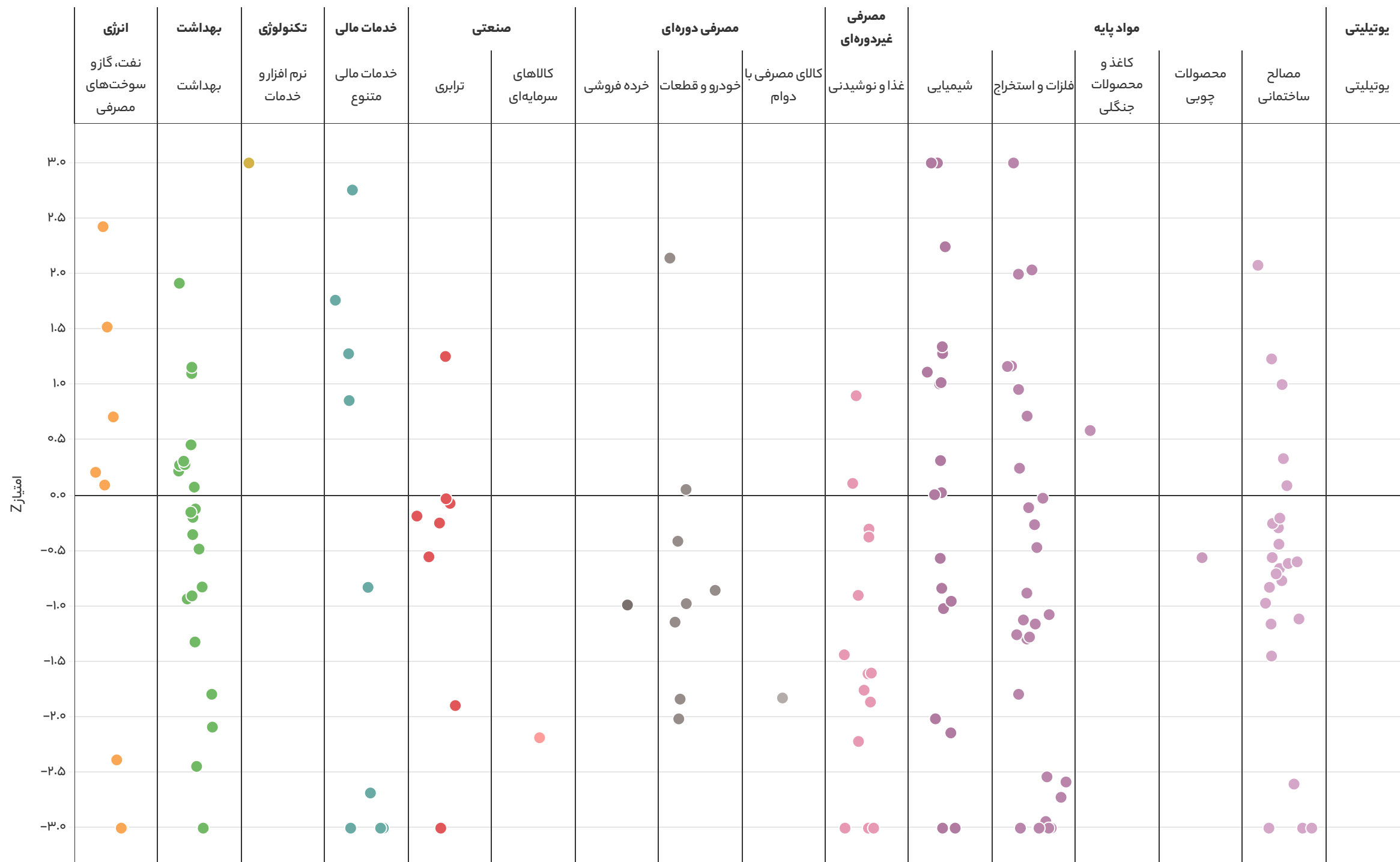
نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

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						
یوتیلیتی	یوتیلیتی و نیروگاهی	مبین	۱۲	۵۰.۶	۲,۵۰۰	۴۲۶	۱۶۱%	۶۳۱			۴.۰								
		بفجر	۱۲	۳۶.۹	۱,۸۹۴	۳۳۰	۱۸۷%	۳۸۹			۴.۹								
مصرفی دورای	خودرو و قطعات	پکرمان	۱۲	۷.۸	۳,۱۰۰	۱۴۸	۸۷%	۳۰۱	۴۶۴	+۵۴%	۱۰.۳	۷.۱	۱۰.۴	-۰.۴					
		پکویر	۹	۴.۹	۷۴۲	۲۵	۷۵%	۷۷	۱۳۱	+۷۰%	۹.۷	۵.۱	۷.۲	-۱.۰					
		پارتا	۱۲	۴.۱	۶۵۷	۴۰	۶۰%	۴۳	۸۲	+۹۲%	۱۵.۴	۸.۵	۱۰.۰	-۲.۰					
		پتایر	۱۲	۳.۱	۲۳۹	۱۰	۴۱%	۲۳	۲۹	+۲۵%	۱۰.۵	۸.۸	۹.۳	-۱.۸					
		پاسا	۱۲	۳.۰	۱,۶۰۰	۱۳۶	۴۰%	۱۹۴	۳۰۵	+۵۷%	۸.۲	۵.۷	۷.۳	+۰.۱					
		پیزد	۱۲	۲.۹	۱,۴۴۰	۶۱	۶۷%	۱۰۸	۱۵۵	+۴۳%	۱۳.۳	۹.۸	۱۲.۲	-۱.۱					
		خودرو	۱۲	۱۴.۹	۴۲۶	۵۶	۱۶%	۱۰۸	۱۴۹	+۳۸%	۴.۰	۳.۰	۳.۵	-۰.۹					
		پلاستیک	۱۲	۱.۰	۴,۴۹۰	۶۰۶	۲۹%	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۲۰.۹	۲۱.۹	۱۸.۰	+۲.۱					
	کالای مصرفی با دوام	گل‌دیرا	۱۰	۶.۷	۸۰۷	۴۵	۲۲%	۱۰۶	۱۷۶	+۶۷%	۷.۶	۴.۷	۵.۱						
		لخر	۱۲	۲.۴	۱,۴۶۶	۱۷۵	۲۹%	۲۴۷	۳۴۲	+۳۹%	۵.۹	۴.۵	۴.۹	-۱.۸					
صنعتی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۷	۷۴۹	۱۰۳	۴۹%	۱۶۰	۲۱۰	+۳۱%	۴.۷	۳.۴	۳.۸	-۱.۰					
		حتاید	۱۲	۵.۵	۴۵۵	۶۲	۵۲%	۸۸	۱۰۷	+۲۱%	۵.۲	۴.۳	۴.۲	-۱.۹					
	بنادرو کشتیرانی	حسینا	۱۲	۵.۳	۲,۱۰۶	۱۹۱	۸۹%	۲۸۸	۳۱۷	+۱۰%	۷.۳	۶.۵	۶.۴	-۰.۲					
		حززر	۱۲	۵.۲	۴,۸۰۰	۶۹۱	۹۶%	۹۶۲	۱,۳۹۱	+۴۵%	۵.۰	۳.۲	۴.۸	-۰.۱					
		حکهر	۱۲	۵.۷	۱,۲۷۳	۱۵۱	۳۸%	۱۹۶	۲۴۵	+۲۵%	۶.۵	۵.۲	۵.۴	+۱.۳					
	ترابری	توریل	۱۲	۴.۳	۶۱۰	۴۳	۳۸%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۱.۷	۹.۷	۹.۸	-۰.۶					
		حآفرین	۱۲	۲.۳	۳۱۵	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۷.۶	۷.۱	۶.۱	-۳.۲					
		حآسا	۱۲	۱.۸	۹۷۵	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۶.۵	۲۶.۰	۲۴.۸	-۰.۲					
		حپارسا	۶	۱.۶	۶,۳۸۰	۶۳۱	۸۹%	۸۰۱	۱,۱۱۷	+۳۹%	۸.۰	۶.۴	۵.۳	+۰.۰					
		سیم و کابل	۱۲	۳.۷	۳,۶۶۰	۲۵۰	۶۱%	۵۵۷	۷۶۵	+۳۷%	۶.۶	۴.۹	۵.۰						
تکلیف	نرم افزار و خدمات	سیستم	۱۲	۱۸.۰	۱,۸۰۰	۸۳	۸۹%	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۰.۵	۲۶.۳	۲۸.۶	+۵.۶					
	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۲	۲۹۲	۳۳	۳۱%	۵۹	۵۶	-۵%	۵.۰	۵.۴	۴.۲	-۲.۲					

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

اجماع تحلیگران

دفعه منتهی به: ۱۴۰۷/۰۷/۱۴



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 سرمایه گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

