

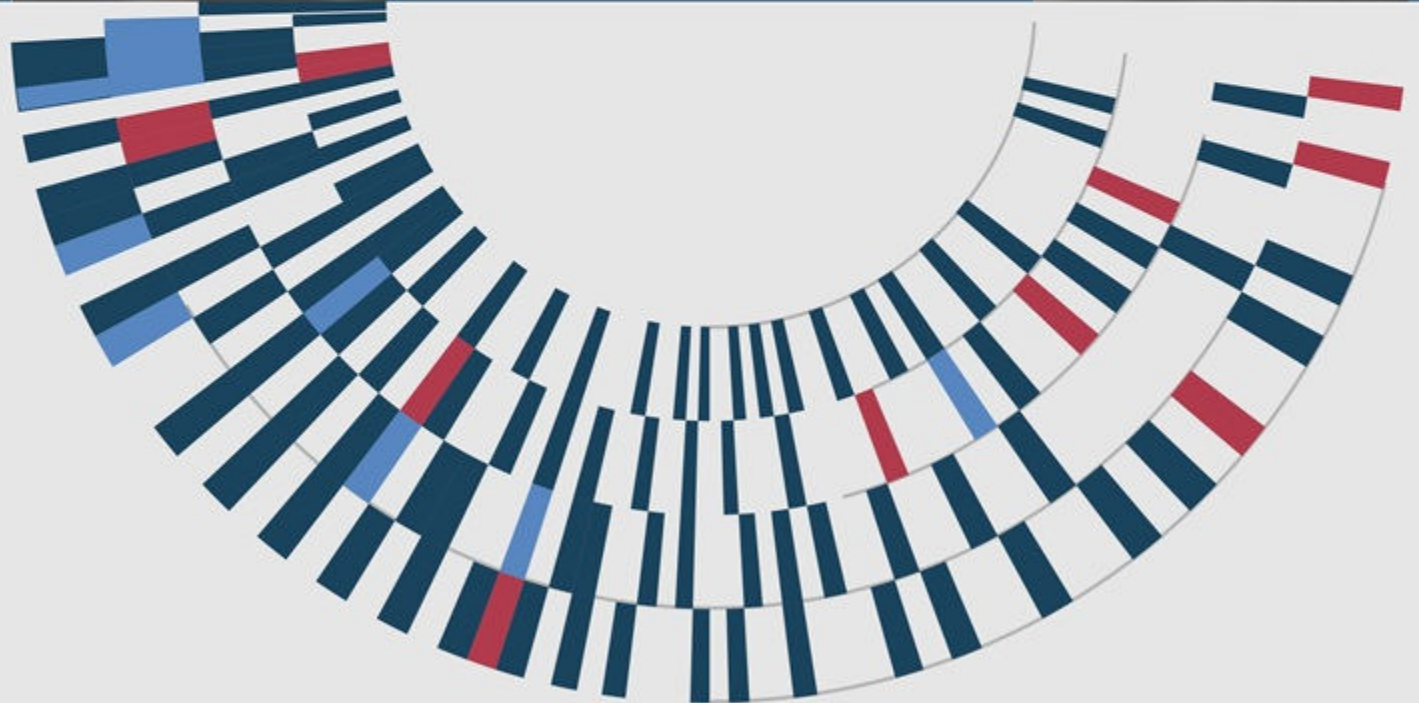
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲۱ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۷/۲۸

 CHARISMA





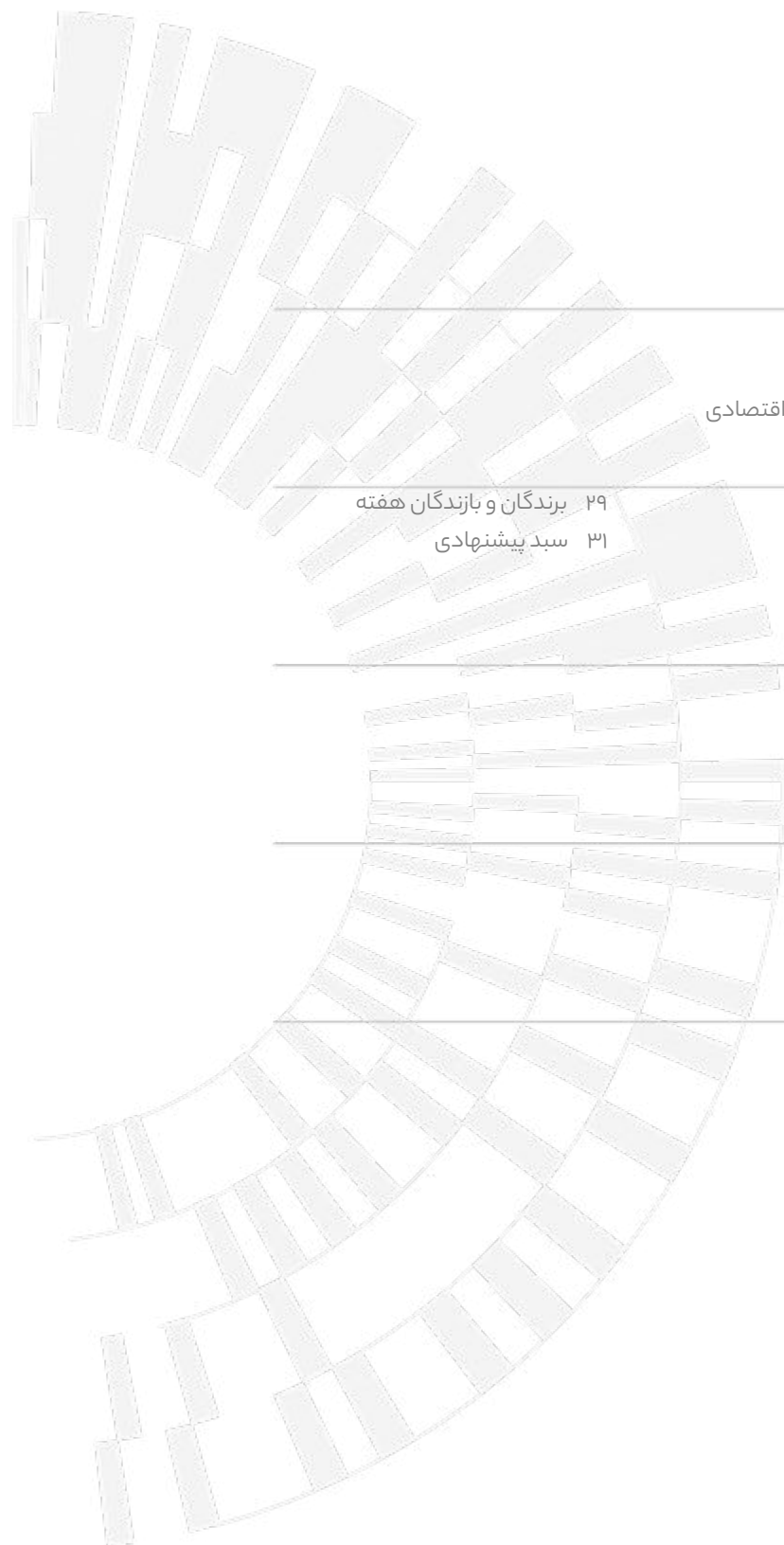
معرفی گزارش:

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	رند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۲۳	۰.۳%-	فزر	-	۱,۶۴۴۲,۰۱۷	۱۷%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۷,۹۴۴	-	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۵۵۸۹,۳۴۱	۵%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۸۶	۰.۲%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۴۲۴	۲%-
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۴۲	۰.۱%-	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۵۳۳,۴۴۴	۱۳%-
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۹۵	۲.۲%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۸۶۵۲,۲۷۳	۱۲%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۷۶	۰.۱%-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۸۳۹۴,۸۴۳	۶۵%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۰۵	۰.۴%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۲۲۹۳,۶۲۵	۶۲%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۷۵	۱.۷%-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱۶۲۳	۹%-
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۹۲	۰.۲%-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۳,۵۱۳۲۲,۸۲۱	۴۵%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۶۰	۲.۱%-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۴%-
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۲,۴۵۳۲۲,۰۸۰	۵۱%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۴۸	۳.۳%-	ذوب، کویر	فولای	۵۴۸۷۵۵	۲۰%-
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۵۲۷	۱.۰%-	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۳۰۰۲۴,۷۴۷	۴۹%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۸۰	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۵۷۸۰	۴%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۶۵	-	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	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	۴۰۹	۰.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۷	-۱.۴%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۵۰	۳.۳%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۷۹	-۰.۸%	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۹	-۱.۷%	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۵	-۱.۲%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۶۱	-۱.۱%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۰	-	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۵	-۱.۰%	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۴	-۰.۷%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۵	-۲.۸%	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۲	۱.۱%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۴۲	۰.۲%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۷,۳۰۰	-۱.۱%	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۰	۱.۰%	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۴۰	-۳.۳%	شغدیر، ارونند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۳۰	-۱.۸%	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

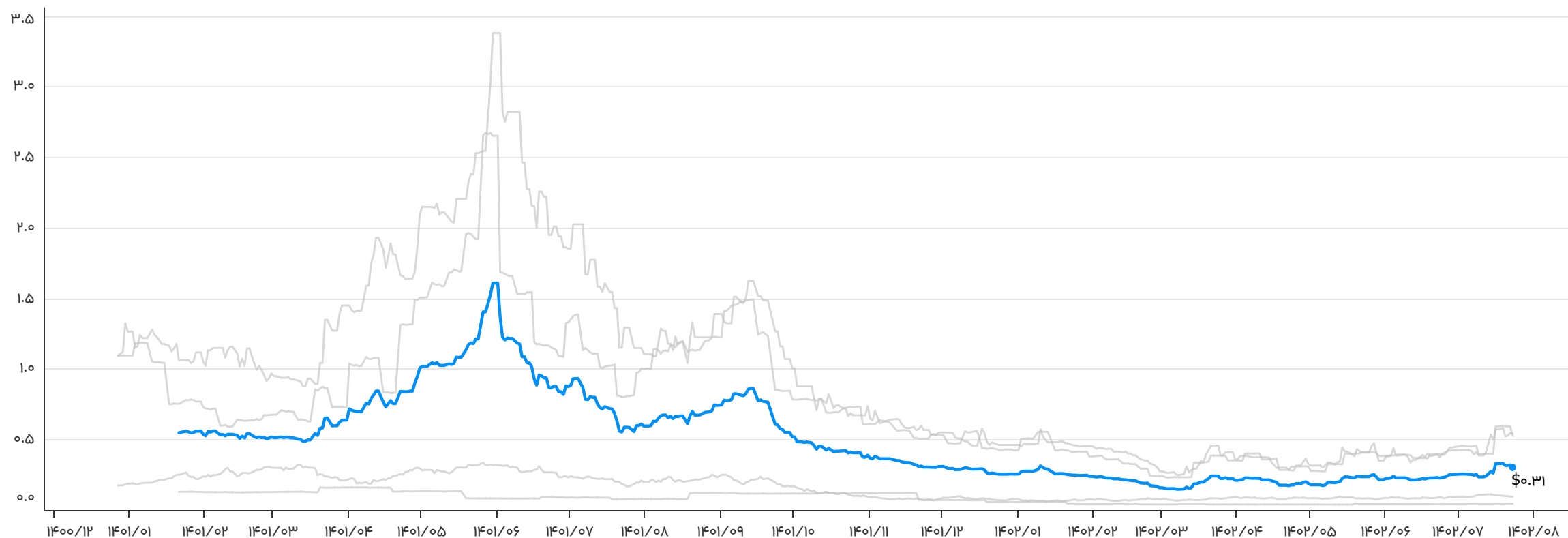
رند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی		۹۹	۷۲	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	–	۱.۴%	۹۲	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت
		۹۳	۶۶	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	–	۰.۵%	۸۸	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI
		۱۶۴	۹۷	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–۱.۴%	۱۳۳	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره
		۱۵۲	۸۹	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–۱.۴%	۱۲۴	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور
		۲۱,۶۳۴	۱۰,۳۰۳	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	–	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	۲۰,۳۰۸	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات – پالایش نفت تهران
		۴۱,۳۶۵	۲۱,۷۹۵	–	–	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۹.۴%	۳۳,۵۱۵	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه – نفت سپاهان
محصولات کشاورزی		۱۷,۱۴۰	۱۰,۴۰۰	–	–	شپاس	–۳.۶%	۱۴,۹۷۰	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر – نفت پاسارگاد
		۲۶۹	۱۸۷	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	–	–	۰.۳%	۱۹۵	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
		۹۶۸	۷۲۸	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	–	–	–۰.۲%	۷۸۳	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام
		۱,۷۱۶	۱,۲۰۵	–	–	–	۴.۸%	۱,۳۸۲	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
ارز و ارز دیجیتال		۳۱۱	۱۹۹	–	–	–	۰.۸%	۲۱۵	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
		۱.۱۲	۱.۰۰	–	–	–	۰.۸%	۱.۰۶	–	بازار فارکس	یورو به دلار
		۱.۳۱	۱.۱۴	–	–	–	۰.۲%	۱.۲۲	–	بازار فارکس	پوند به دلار
ارز و ارز دیجیتال		۳۰,۸۶۹	۱۶,۵۴۹	–	–	–	۱۰.۷%	۲۹,۶۱۷	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	۰.۱۰	-۸.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۴۷%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-۰.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۳۷%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۵	-۵.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۶۳	-۵۲%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۳	-۱۱.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۳۵%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۳۱	-۸.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۸۷	-۴۵%

میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



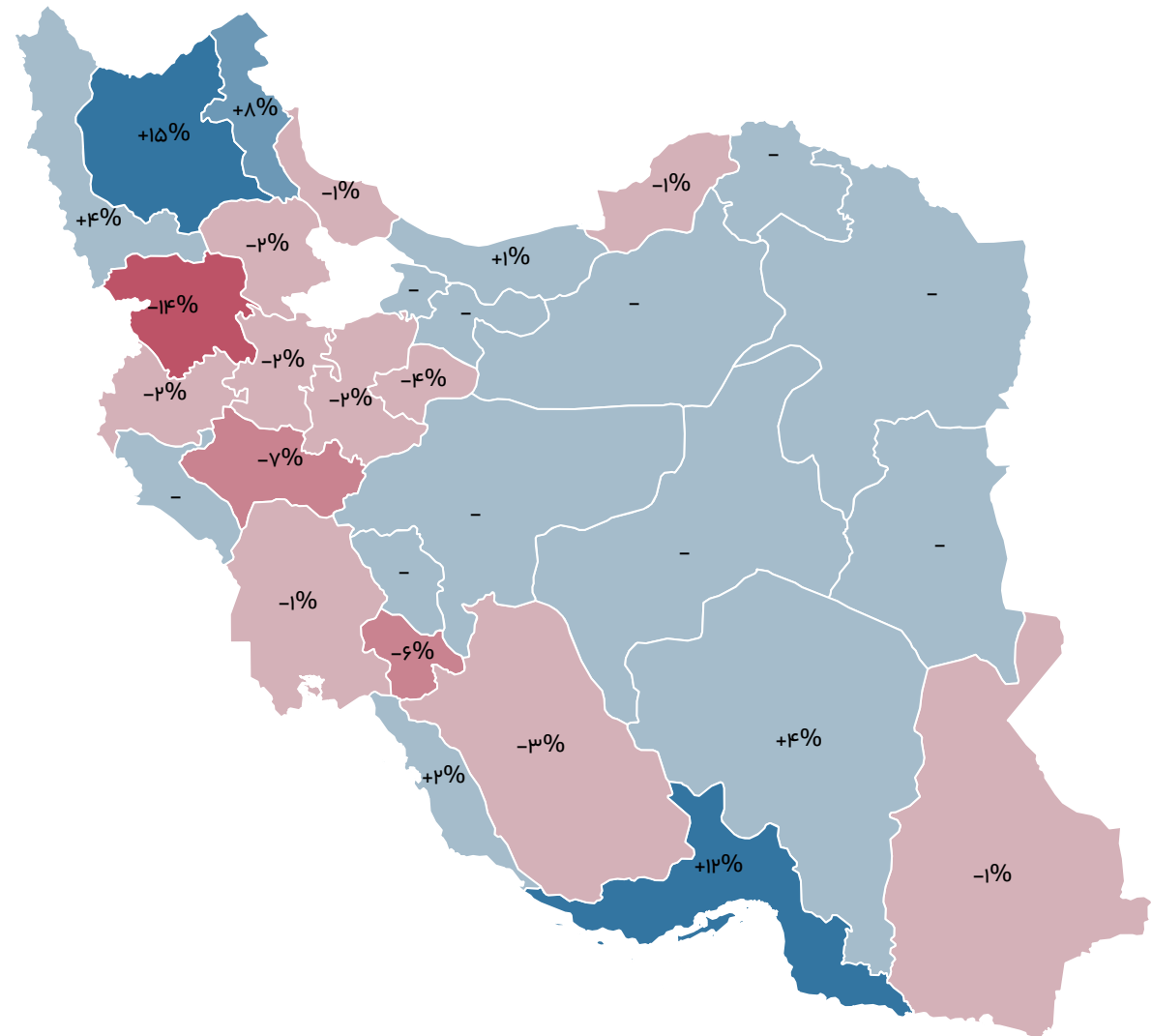
آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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	۹۱۵	۹۱۸	+۰%
	اصفهان	تومان / کیلو	۹۰۸	۹۱۱	+۰%
	مرکزی	تومان / کیلو	۹۷۷	۹۶۰	-۲%
	البرز	تومان / کیلو	۹۱۴	۹۱۴	+۰%
	قم	تومان / کیلو	۹۷۴	۹۳۸	-۴%
	یزد	تومان / کیلو	۷۰۵	۷۰۷	+۰%
	سمنان	تومان / کیلو	۸۱۲	۸۱۲	+۰%
جنوب	فارس	تومان / کیلو	۹۴۱	۹۱۴	-۳%
	هرمزگان	تومان / کیلو	۹۴۲	۱,۰۵۱	+۱۲%
	بوشهر	تومان / کیلو	۱,۰۸۹	۱,۱۰۹	+۲%
غرب	خوزستان	تومان / کیلو	۸۹۲	۸۸۴	-۱%
	همدان	تومان / کیلو	۸۵۷	۸۴۲	-۲%
	ایلام	تومان / کیلو	۷۰۷	۷۰۷	+۰%
	چهارمحال و بختیاری	تومان / کیلو	۸۹۵	۸۹۵	+۰%
	کرمانشاه	تومان / کیلو	۸۸۲	۸۶۱	-۲%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان / کیلو	۹۵۱	۸۹۲	-۶%
	کردستان	تومان / کیلو	۱,۰۸۹	۹۳۹	-۱۴%
	لرستان	تومان / کیلو	۹۰۹	۸۴۱	-۷%
شمال	مازندران	تومان / کیلو	۸۸۲	۸۹۰	+۱%
	گیلان	تومان / کیلو	۶۹۲	۶۸۴	-۱%
	گلستان	تومان / کیلو	۷۴۷	۷۴۰	-۱%
شمال غرب	آذربایجان غربی	تومان / کیلو	۸۵۲	۸۸۲	+۴%
	اردبیل	تومان / کیلو	۱,۰۳۸	۱,۱۱۷	+۸%
	زنجان	تومان / کیلو	۹۱۰	۸۸۸	-۲%
	آذربایجان شرقی	تومان / کیلو	۱,۱۲۴	۱,۲۹۷	+۱۵%
شمال شرق	خراسان رضوی	تومان / کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان شمالی	تومان / کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
	خراسان جنوبی	تومان / کیلو	۶۳۸	۶۳۸	+۰%
جنوب شرق	کرمان	تومان / کیلو	۹۶۴	۹۹۸	+۴%
	سیستان و بلوچستان	تومان / کیلو	۸۰۳	۷۹۵	-۱%

تغییرات قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گذشته

تغییرات قیمت هفته گذشته نسبت به هفته قبل، براساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات



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

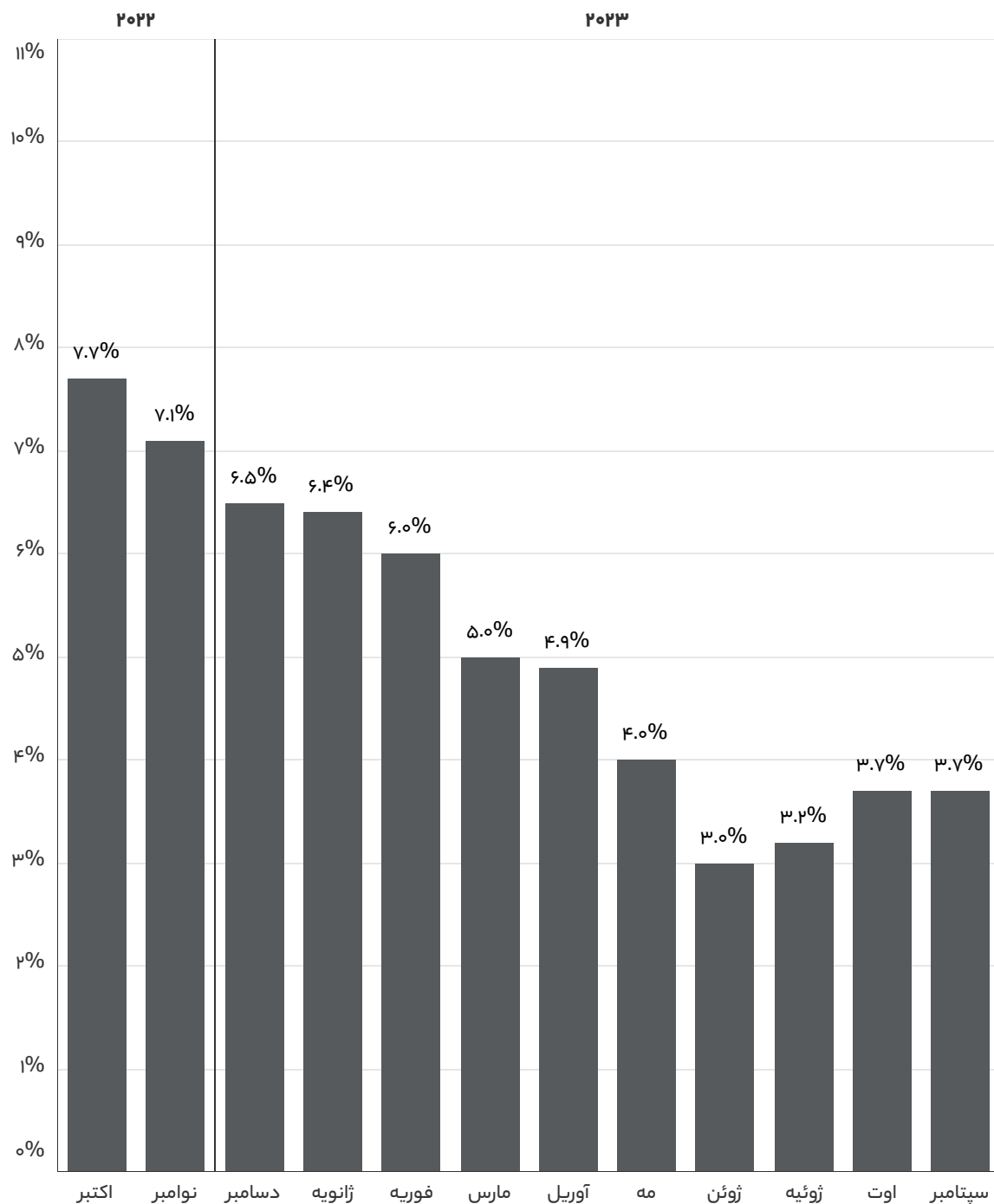
معادن و فزات

انرژی

- ▲ از یک سو، درگیری‌های ژئوپلیتیکی بین اسرائیل و فلسطین تقاضا برای سرمایه‌های ایمن‌تری مانند طلا را افزایش می‌دهد. اما از سوی دیگر، افزایش شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا در ماه سپتامبر، احتمال افزایش دوباره نرخ بهره فدرال رزرو این کشور را بالا برده که می‌تواند ارزش دلار را افزایش داده و تاثیر منفی بر قیمت طلا داشته باشد. در جای دیگری از دنیا، تحولات مثبت در مورد طرح‌های اقتصادی چین می‌تواند تقاضا برای طلا در این کشور را به عنوان بزرگ‌ترین تولیدکننده و مصرف‌کننده این فلز گران بها افزایش دهد. مجموع این عوامل باعث شده است که در ابتدای هفته گذشته، قیمت طلا رشد داشته باشد. به گزارش رویترز، انفجار در بیمارستان غزه ترس از بالا گرفتن درگیری‌ها در منطقه را افزایش داده و قیمت طلا را بیش از یک درصد در روز چهارشنبه بالا برده است.
- ▼ در پی رکود ایجاد شده در بازارهای جهانی بسیاری از فلزات صنعتی، بازدهی خود را برای سرمایه‌گذاران از دست داده که در این میان، به نظر می‌رسد فلز آلومینیوم بیشترین زیان را متوجه سرمایه‌گذاران جهانی خود کرده است. علیرغم کاهش سنگین عرضه آلومینیوم روسیه به بازارهای جهانی طی ماه‌های گذشته که تصور می‌شد بتواند به عنوان فاکتوری مثبت در افزایش قیمت این فلز اساسی عمل نماید؛ اما بروز مشکلات جدی در اقتصاد چین به عنوان بزرگ‌ترین بازار مصرف آلومینیوم جهانی و همچنین شکل‌گیری رکود در اقتصاد ایالات متحده منجر به عدم افزایش قیمت‌ها در بازارهای جهانی شد. نزدیک‌تر شدن قیمت‌ها به کف چند هفته‌ای خود، معمولا نوعی فشار روانی برای خرید بیشتر در بازارهای جهانی ایجاد خواهد کرد که همین موضوع می‌تواند یکی از فاکتورهای مهم در افزایش قیمت آلومینیوم طی سه ماهه پایانی سال جاری و همچنین سه ماهه نخست سال آینده میلادی محسوب شود.
- ✓ مجتبی‌توانگر، عضو ناظر مجلس در شورای عالی بورس و اوراق بهادار، خروج فولاد و سیمان از بورس کالا را منجر به عدم شفافیت، فساد، ناکارآمدی و افزایش قیمت دانست و تاکید کرد: اظهارنظرهای غیرکارشناسی بر بازار سرمایه تاثیر منفی می‌گذارد. وی در نامه‌ای خطاب به رئیس‌جمهور، مخاطرات خروج فولاد و سیمان و دلایل ضرورت باقی ماندن این دو محصول در بورس کالا را عنوان کرد. توانگر در این نامه، به نامشخص بودن روش جایگزین، شبهه در ادعای گران بودن قیمت فولاد و سیمان و تاثیر کم فولاد و سیمان در قیمت تمام‌شده مسکن و کم‌توجهی به دیگر اجزا اشاره کرد و تاکید کرد، در هر حال به نظر می‌رسد پافشاری مسئولان وزارت راه و شهرسازی برای خروج فولاد و سیمان از بورس کالا علاوه بر این که منجر به کاهش قیمت این محصولات و مسکن نمی‌شود، بلکه بازار این دو محصول را درگیر عدم شفافیت، فساد، ناکارآمدی و در نتیجه کاهش تولید و افزایش قیمت می‌سازد.
- ▲ به گزارش رویترز، در ابتدای هفته گذشته، تحریم دو نفتکش حمل‌کننده نفت روسیه و گسترش درگیری‌های خاورمیانه، قیمت نفت را حدود ۵ درصد افزایش داد و نفت برنت در آستانه بیشترین افزایش قیمت هفتگی از ماه فوریه قرار گرفت. آغاز حمله زمینی اسرائیل به نوار غزه، احتمال وسیع‌تر شدن درگیری در خاورمیانه را افزایش داده است. اگرچه درگیری خاورمیانه تاثیر چندانی بر عرضه جهانی نفت و گاز نگذاشته اما سرمایه‌گذاران نگران بالا گرفتن این درگیری‌ها و تاثیر آن بر تولید کشورهای همسایه در خاورمیانه هستند. به گزارش رویترز، قیمت نفت روز دوشنبه، به دلیل امید به کاهش تحریم‌های آمریکا علیه ونزوئلا، بیش از یک درصد کاهش یافت و از کانال ۹۰ دلاری عقب نشینی کرد. اما پس از انفجار بیمارستان غزه، نگرانی در مورد اختلال در عرضه نفت در منطقه افزایش یافت و قیمت نفت را دو درصد بالا برد و به بالاترین حد دو هفته اخیر رساند.
- ▲ به گزارش اوپل پرایس، آمارهای منتشر شده از سوی موسسه ابتکار داده‌های نفتی (جودی) نشان می‌دهد صادرات نفت خام عربستان در ماه اوت تا پایین‌ترین رقم طی ۲۸ ماه گذشته کاهش یافته است. عربستان به عنوان یکی از بزرگ‌ترین تولیدکنندگان اوپک پلاس، هدف کاهش تولید خود را تثبیت بازارهای نفت اعلام کرده است. کاهش تولید و صادرات نفت عربستان، بازارهای نفت را در ماه‌های اخیر با کمبود مواجه کرده و قیمت نفت را در ماه سپتامبر به بالاترین رقم در سال جاری میلادی رساند. از سوی دیگر، کارشناسان می‌گویند معافیت از تحریم‌هایی که آمریکا برای صادرات نفت ونزوئلا در نظر دارد، ضمن افزایش تولید نفت این کشور باعث تغییر جریان صادرات نفت ونزوئلا و دور شدن آن از چین می‌شود. اما عده دیگری از کارشناسان معتقدند بعید است صادرات ونزوئلا، افت عرضه جهانی نفت را جبران کند.
- ▲ براساس داده‌های بورس بین قاره‌ای لندن (ICE)، قیمت‌های آتی گاز طبیعی در اروپای غربی در ابتدای هفته گذشته ۵ درصد افزایش یافت و به بالاترین سطح از اوایل آوریل رسید. تحلیلگران تا حدودی این افزایش را به تنش‌های خاورمیانه نسبت می‌دهند که منجر به تعطیلی یک میدان گازی دریایی که مصر را تامین می‌کند، شده است. آنها همچنین برای بیان علت این افزایش به احتمال خرابکاری در خط لوله دریای بالتیک بین فنلاند و استونی، اعتصابات برنامه‌ریزی شده کارگران در کارخانه‌های صادراتی کلیدی در استرالیا و نزدیک شدن به زمستان در اروپا اشاره کرده‌اند.
- ✓ قطر در دومین قرارداد خود با یک خریدار اروپایی ظرف مدت یک هفته گذشته، موافقت کرده است به مدت ۲۷ سال، به شل در هلند، گاز بفروشد. توافق قطر با شرکت شل، مشابه توافقی است که هفته گذشته با شرکت فرانسوی «توتال انرژی» داشت. هر دو قرارداد، بزرگترین و طولانی‌ترین قراردادهای تامین گازی هستند که قطر با اروپا دارد. قطر که بزرگترین صادرکننده گاز طبیعی مایع (ال‌ان‌جی) در جهان است، پیش از این به قراردادهای فروش بلندمدت به بازار آسیا، متمرکز بود. اما خریداران اتحادیه اروپا، قراردادهایی را برای واردات گاز و جبران از دست دادن عرضه گاز از روسیه پس از تحریم‌های اتحادیه اروپا علیه واردات انرژی روسیه، امضا کرده‌اند.
- ▼ پالایشگاه‌های چینی در پی رشد تقاضای داخلی، فروش بنزین و دیزل به بازارهای خارجی را در سپتامبر محدود کردند. آمار گمرکی چین نشان داد صادرات بنزین در سپتامبر، ۲۱ درصد کاهش یافت و به ۱.۰۹ میلیون تن رسید و محموله‌های دیزل هم با ۶.۴ درصد کاهش، به ۱.۱۸ میلیون تن رسید. صادرات سوخت چین در پی افزایش مصرف داخلی در فصل پرتقاضا و نشانه‌های احیای اقتصادی قوی‌ترین کشور، کاهش پیدا کرده است. تقاضای نفتی آشکار در چین در سپتامبر، ۱۷ درصد نسبت به سپتامبر سال گذشته رشد کرد و به رکورد ۱۵.۲۴ میلیون بشکه در روز رسید.

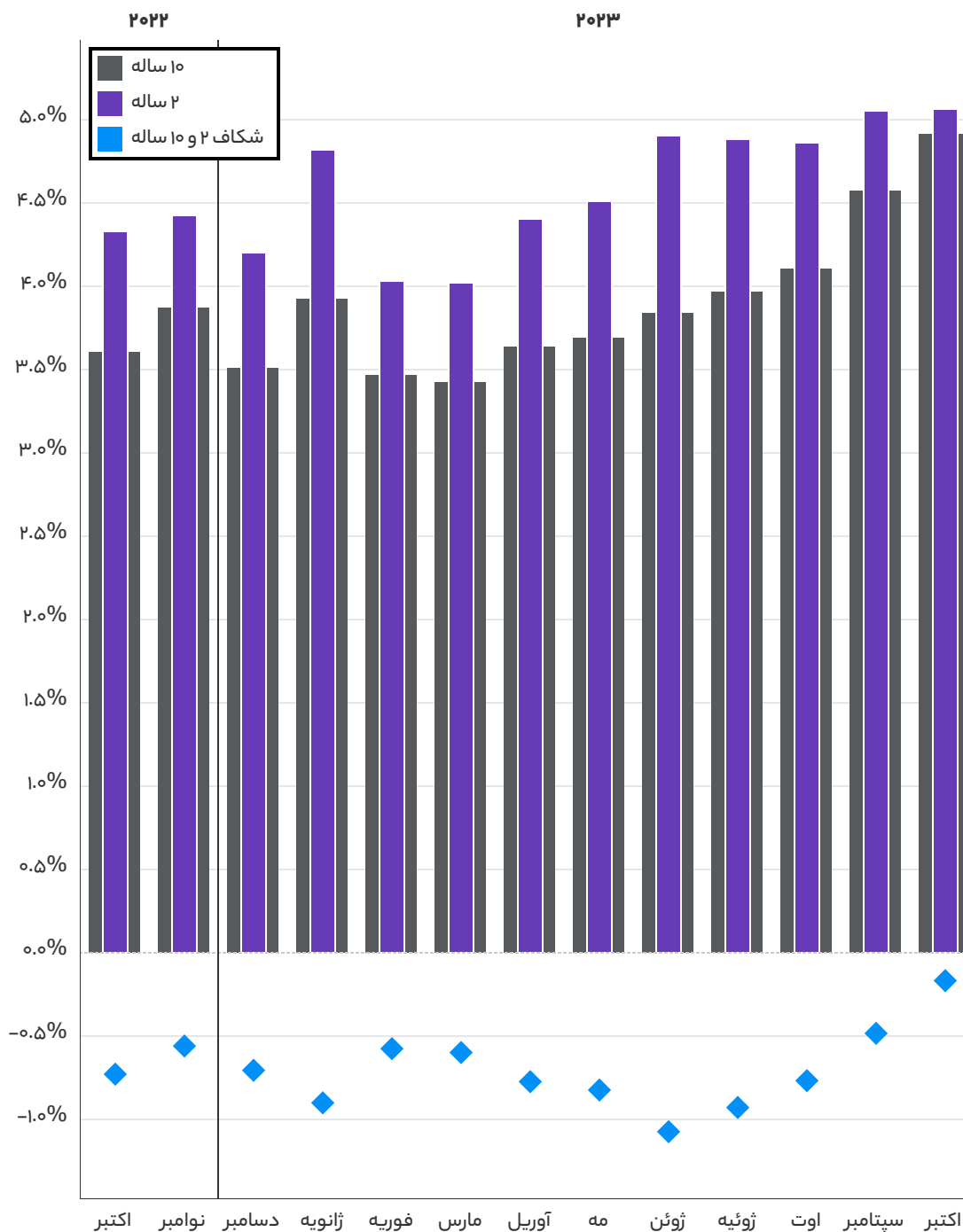
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



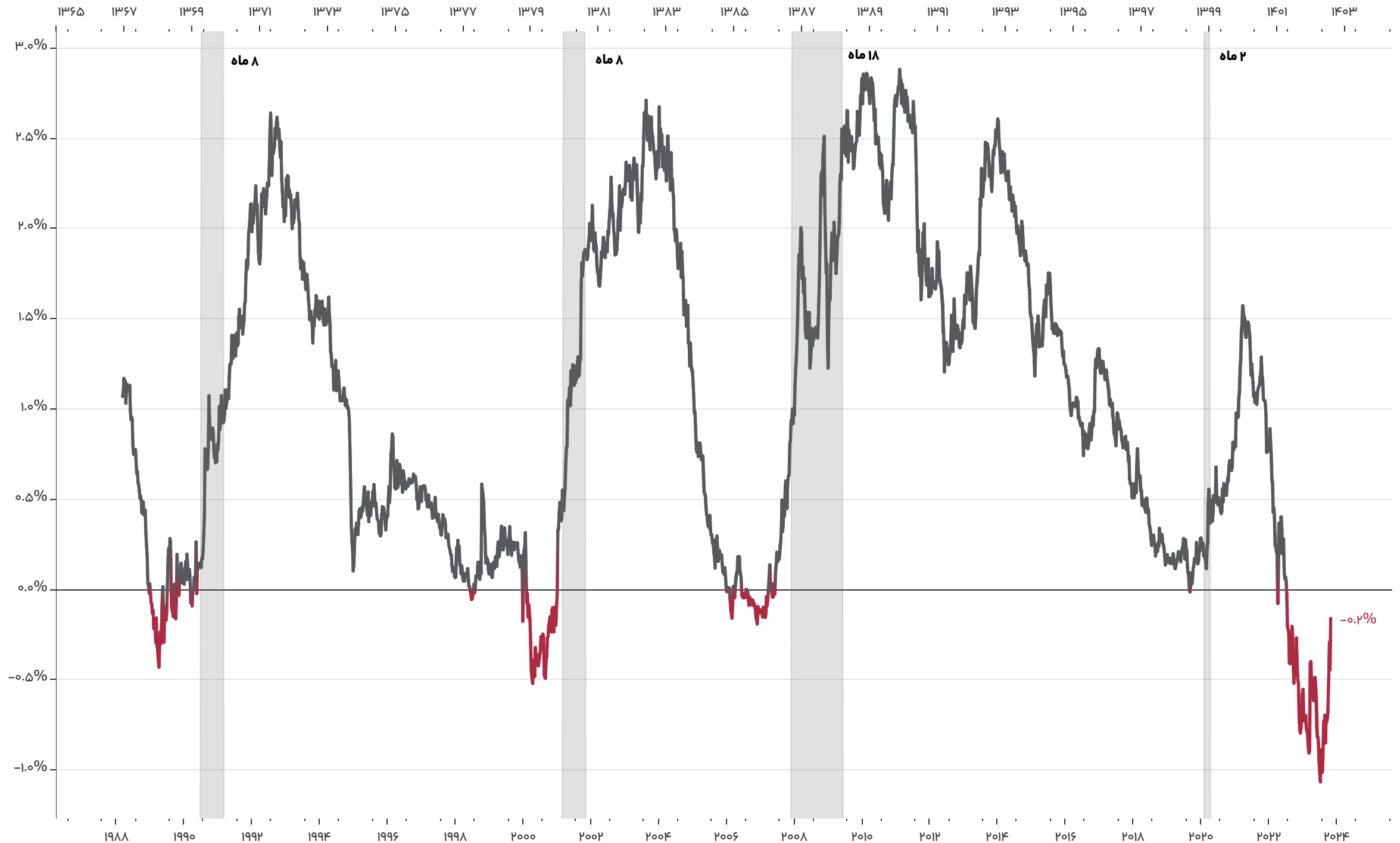
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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



شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



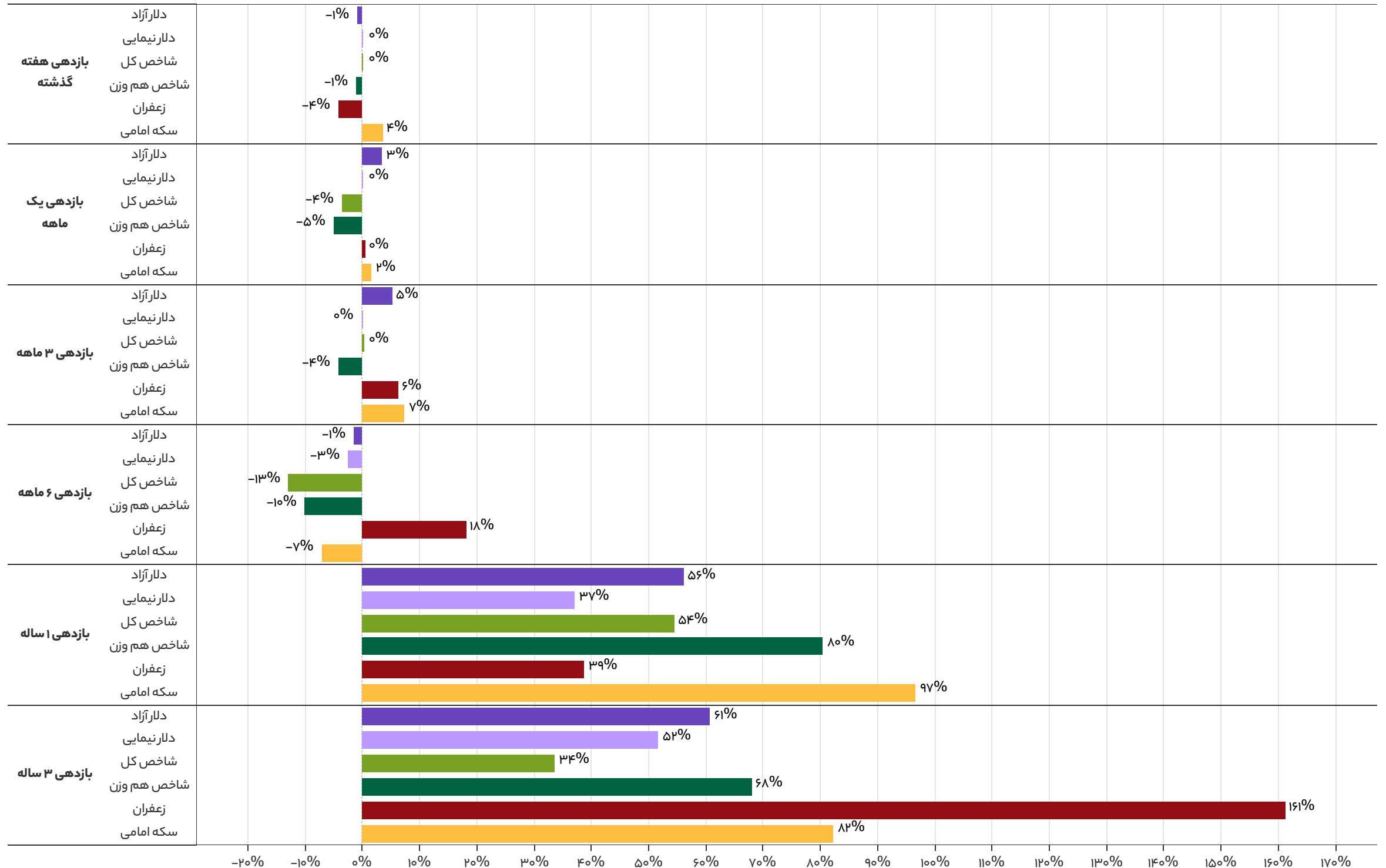
بازار سهام

EQUITY MARKET

EQUITY MARKET



مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها 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 ▲ ۵.۷%	شاخص کل ▼ ۳.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱.۵%	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 ▼ ۵.۶%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار آزاد ▼ ۷.۹%	هم وزن ▼ ۵.۴%	زعفران ▲ ۵.۵%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	مسکن ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	دلار نیمایی ▼ ۵.۷%	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 ▲ ۵.۸%	زعفران ▼ ۵.۱%	هم وزن ▲ ۵.۵%	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 ▲ ۵.۲%	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.

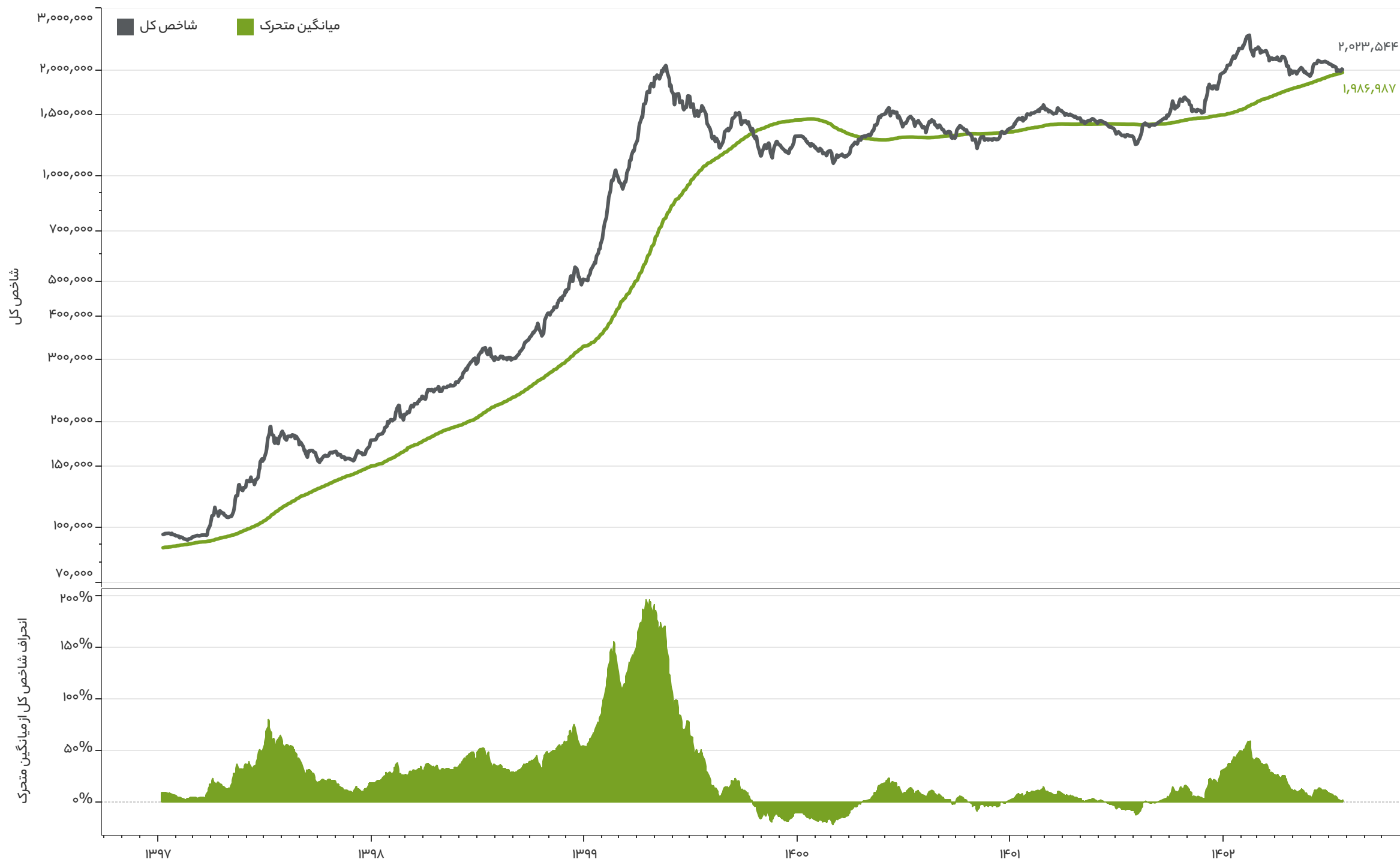
ارزش دلاری بازار

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



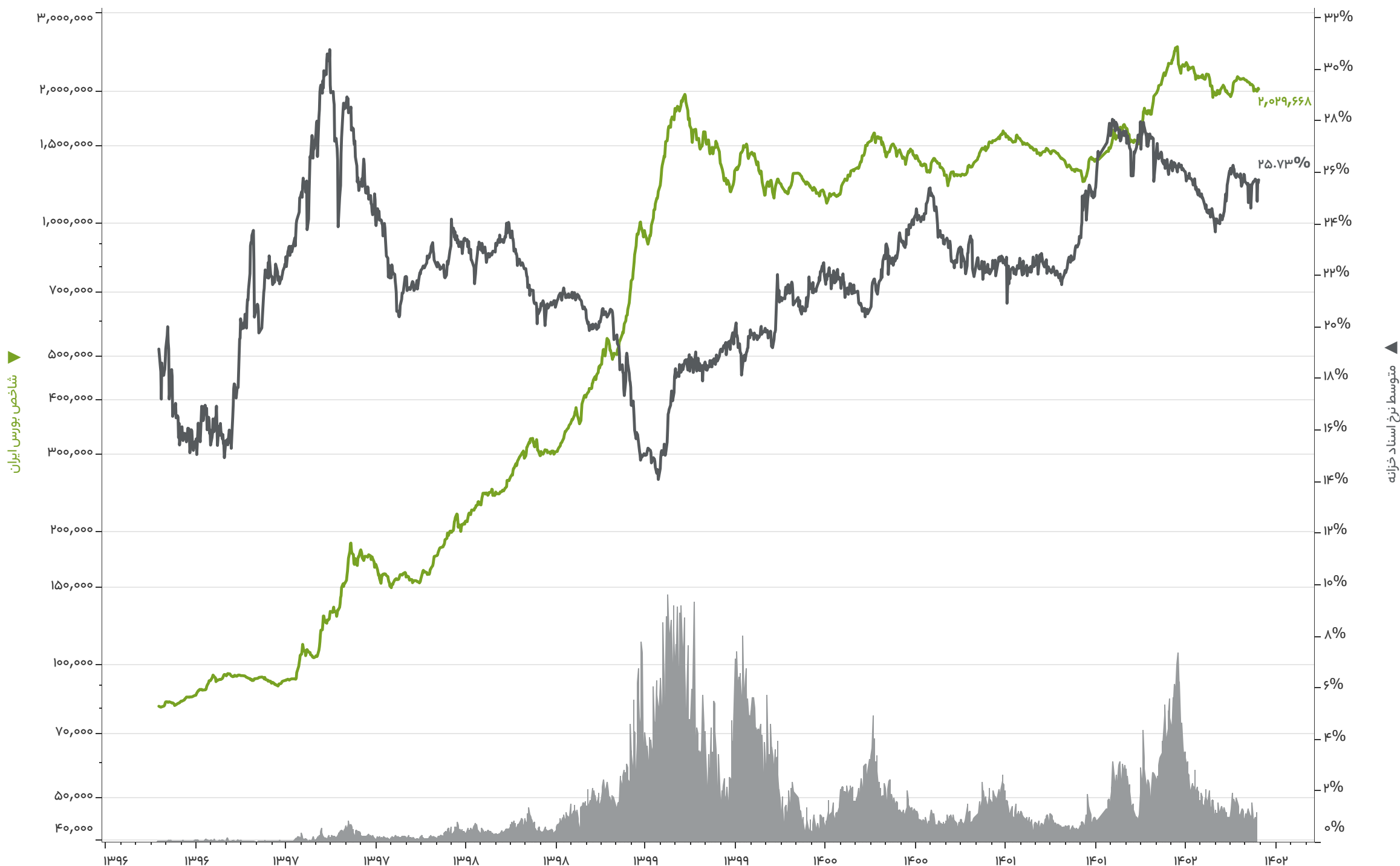
شاخص کل و میانگین متحرک

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



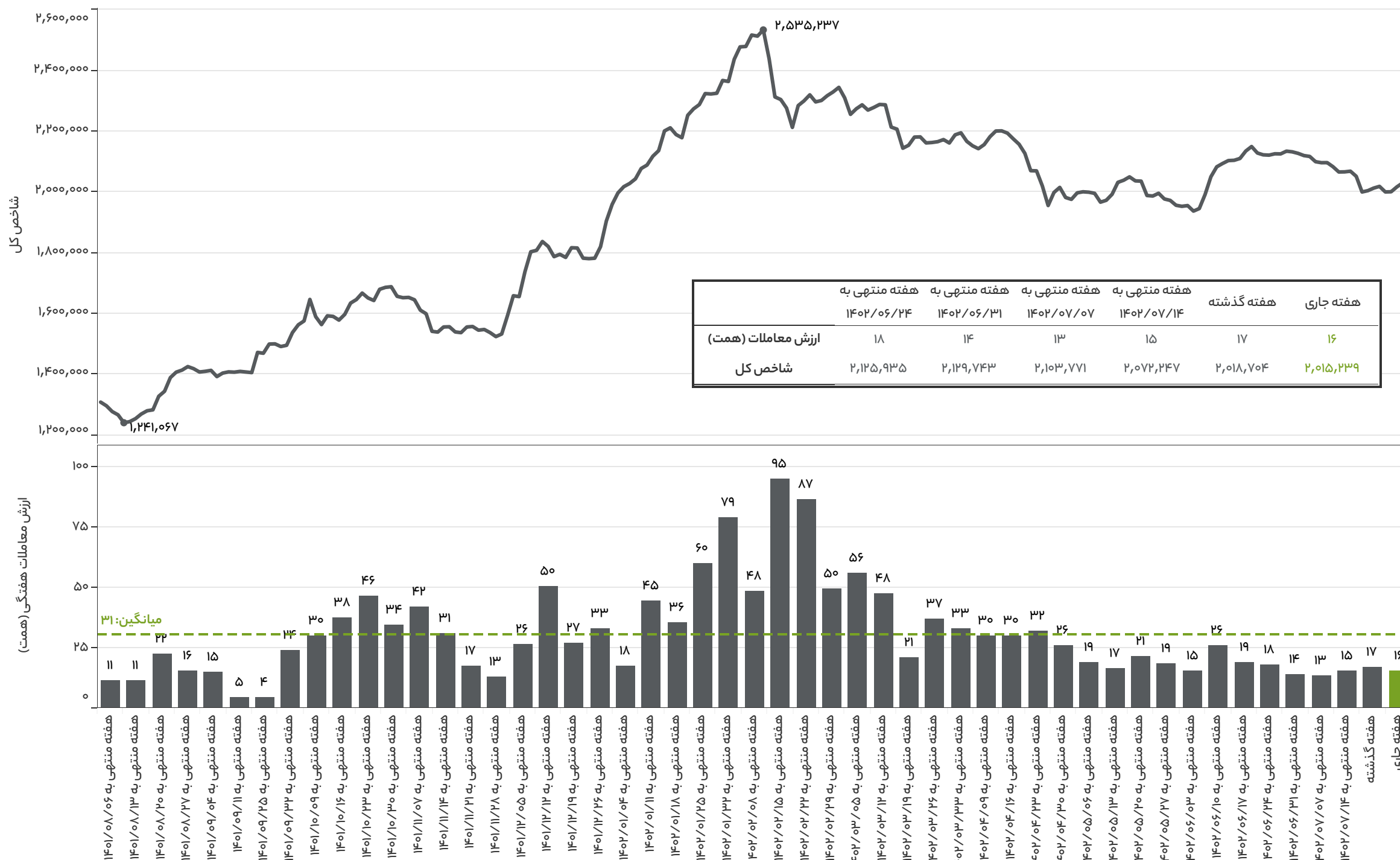
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



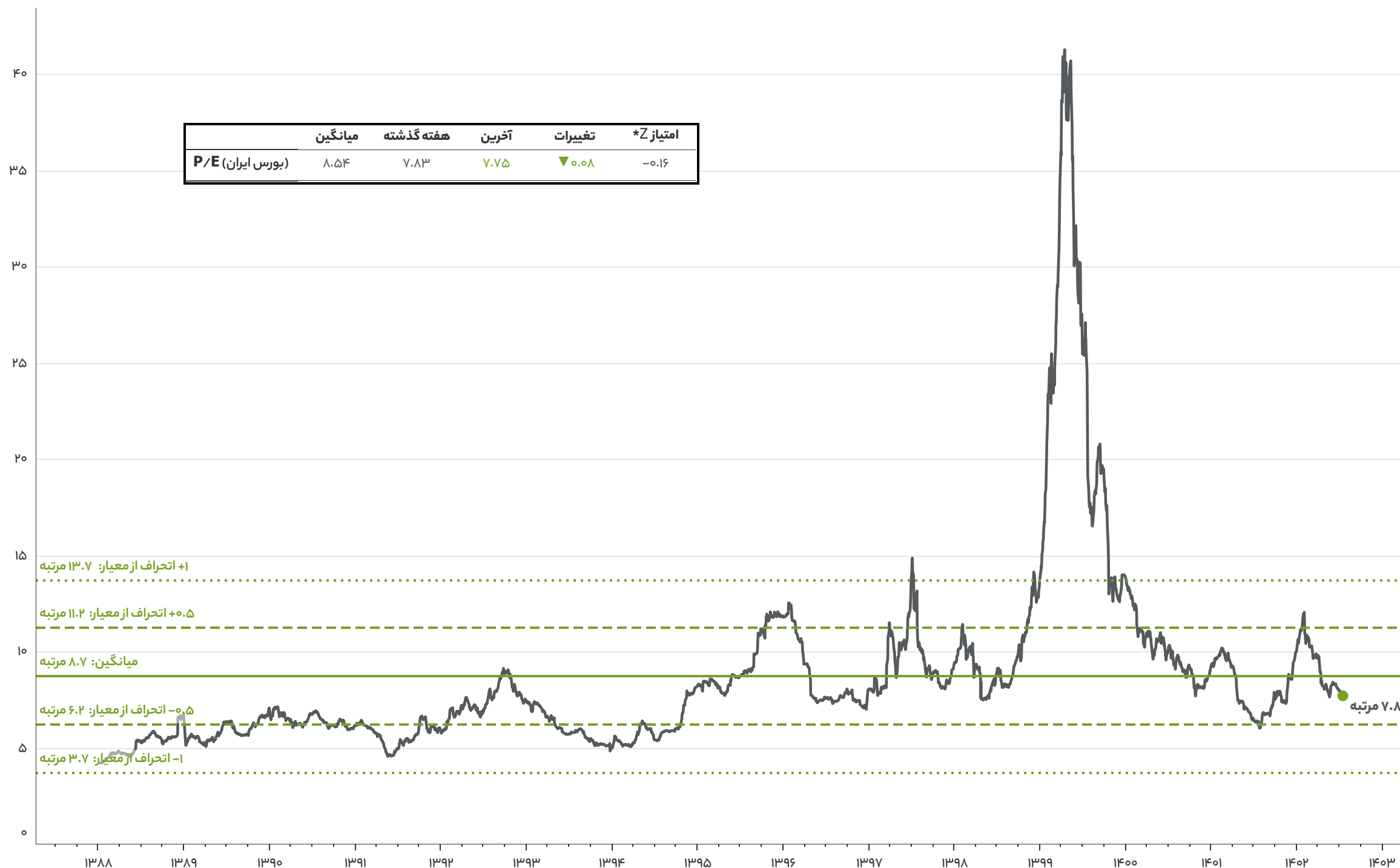
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

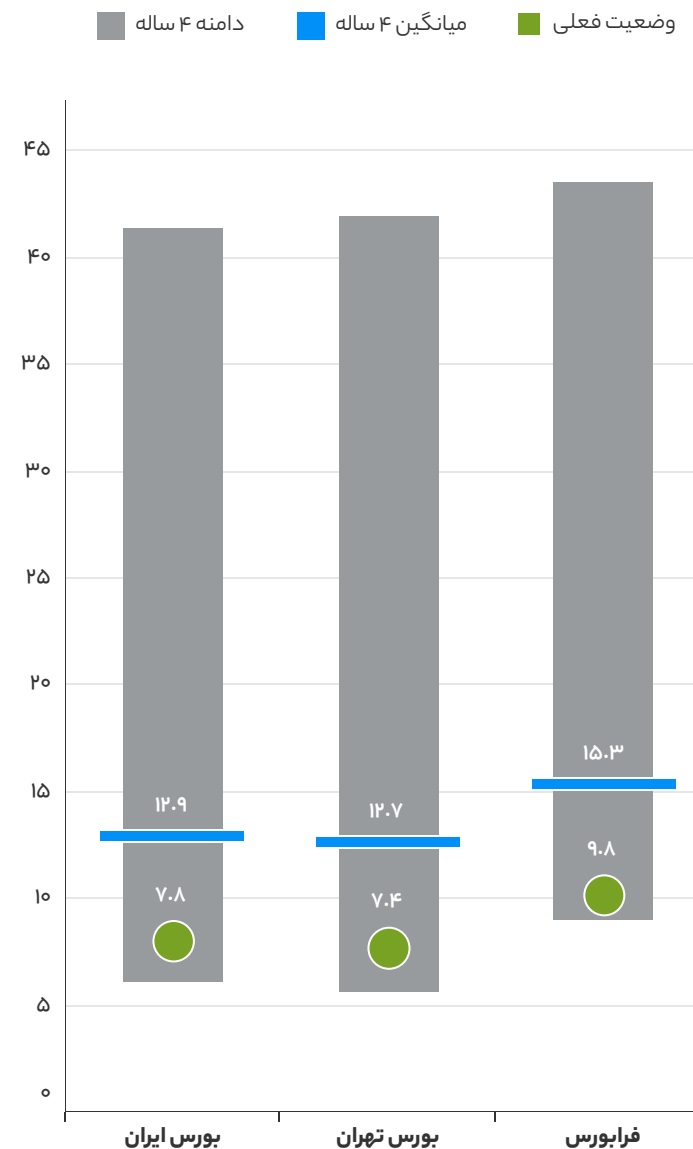
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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
بورس ایران	۷.۷۵	۷.۸۳	۶.۰۷	۱۲.۹۱	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۴۴	۷.۵۰	۵.۶۴	۱۲.۶۶	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۸۳	۱۰.۰۱	۹.۰۳	۱۵.۳۳	۴۳.۵۱

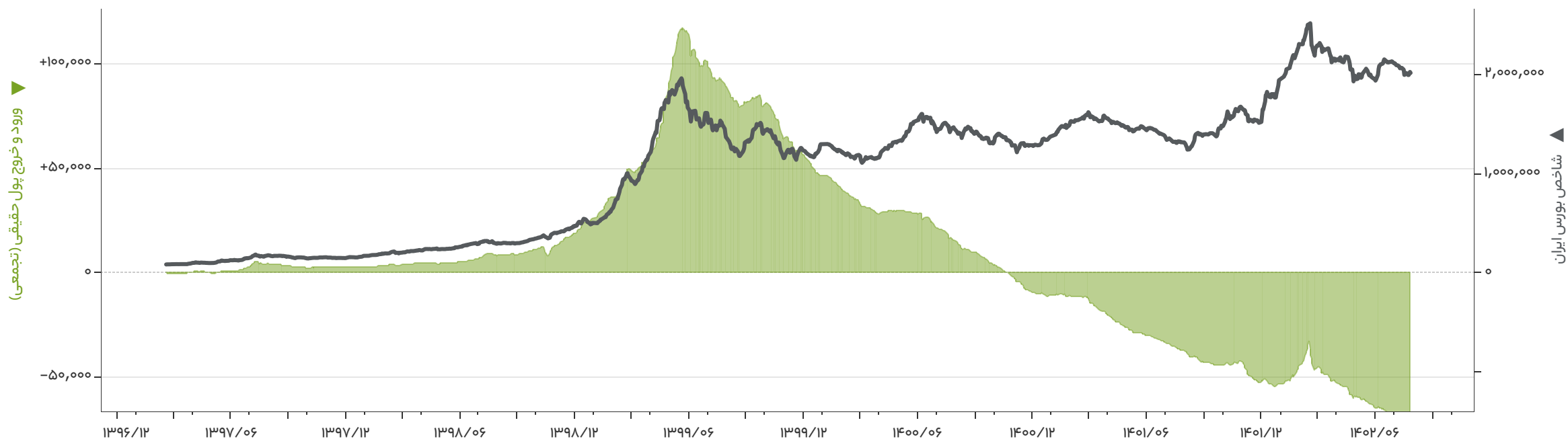


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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	۸۷	۹۷	۱۱۰	۱۵۳	۱۸۰	۲۰۸	۳۵۳	۶۲۷	۲,۹۹۹	۳,۱۳۰	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۱%	۱.۲%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۶%	۴.۴%	۷.۸%	۳۷.۵%	۳۹.۲%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۵	۶.۰	۱۰.۰	۲۱.۵	۹.۰	۱۰.۳	۱۱.۰	۵.۷	۵.۳	۴.۶	۸.۰	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۴%	۱۷.۲%	۴.۰%	۲.۷%	۶.۹%	۴.۸%	۴.۳%	۲.۵%	۱۴.۴%	۷.۹%	۹.۵%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۶%	۳۷%	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%	+۸۱۴%	+۹۷%	+۲۶۴%	+۳۷۴%	+۳۶۳%	+۴۱۶%	+۸۰۷%	+۸۰۴%	+۸۱۱%	+۸۷۰%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۷%	+۱۲۳%	-۶۹%	-۵%	+۱۲%	-۲۰%	-۳%	-۱۸%	+۱۷%	-۴%	+۵۱%	
بازده از ابتدای سال	+۱۶۵%	+۴۷%	+۲۶%	+۵۶%	+۸۹%	+۷۸%	+۵۲%	+۸۰%	+۹۲%	+۵۸%	+۶۹%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۳%	۰%	-۳%	-۱%	۰%	۰%	-۳%	-۲%	۳%	۰%	۰%	

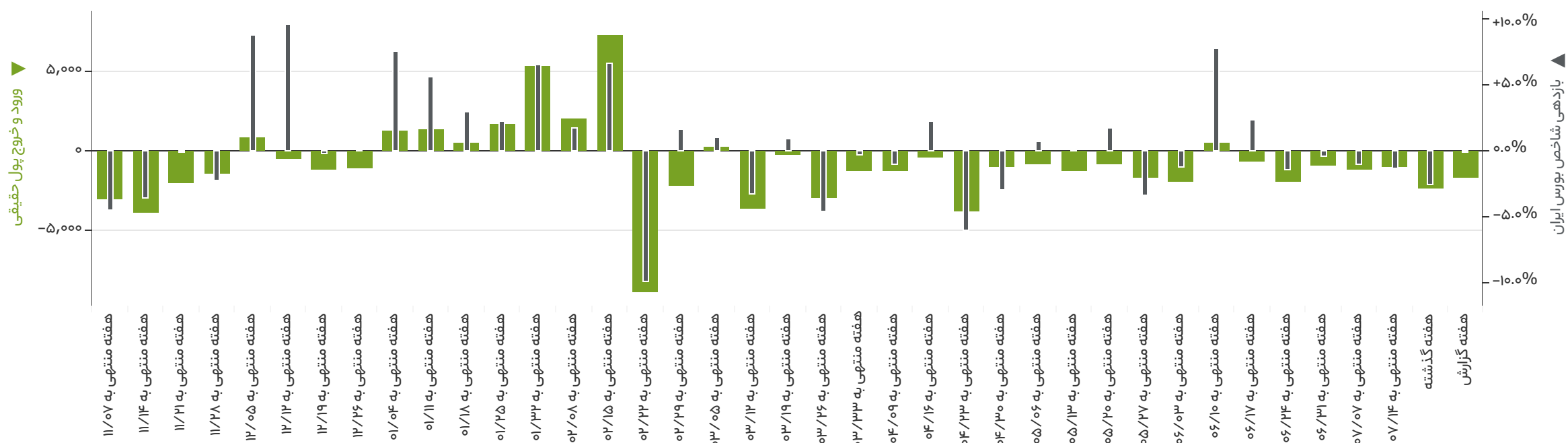
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



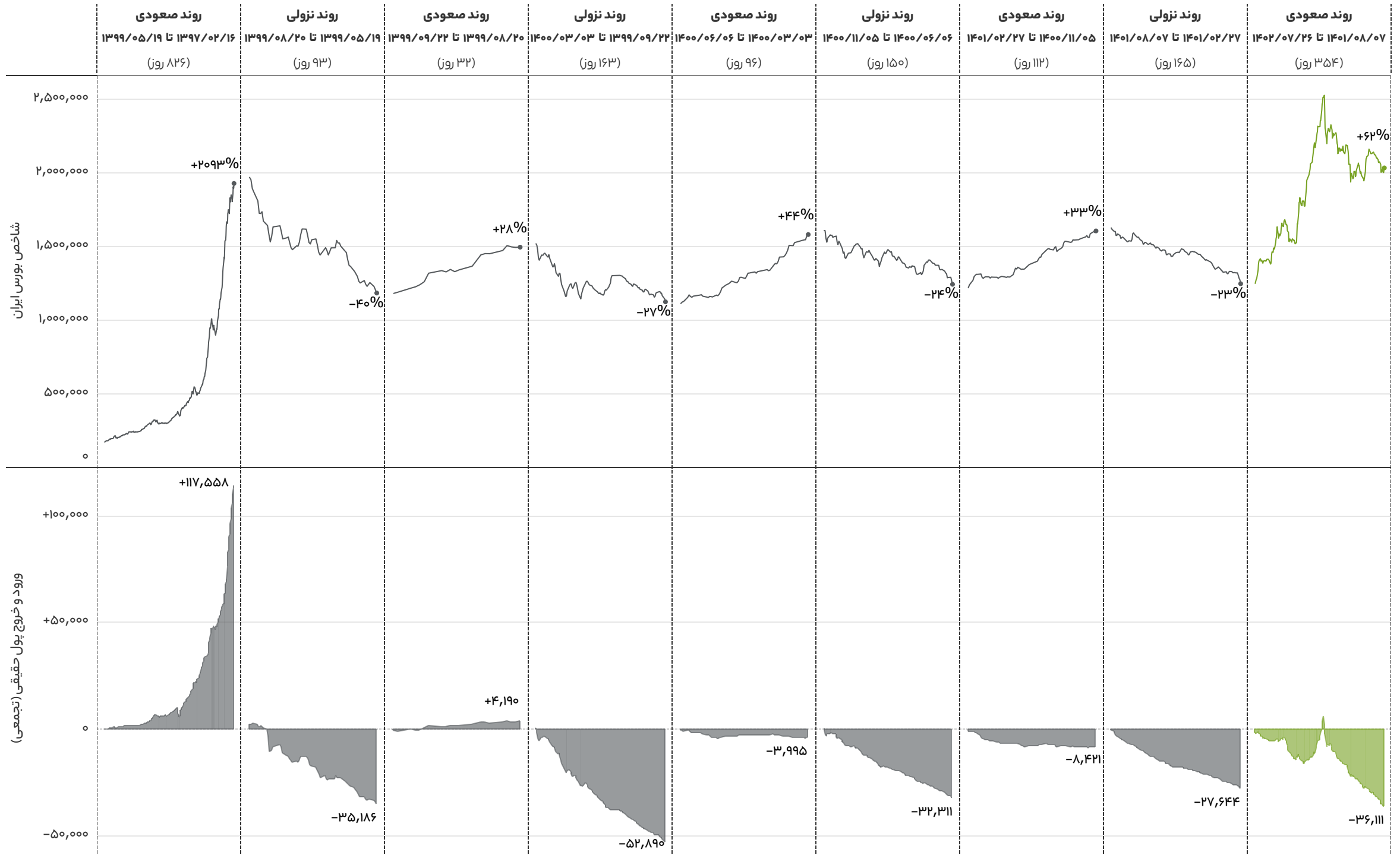
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

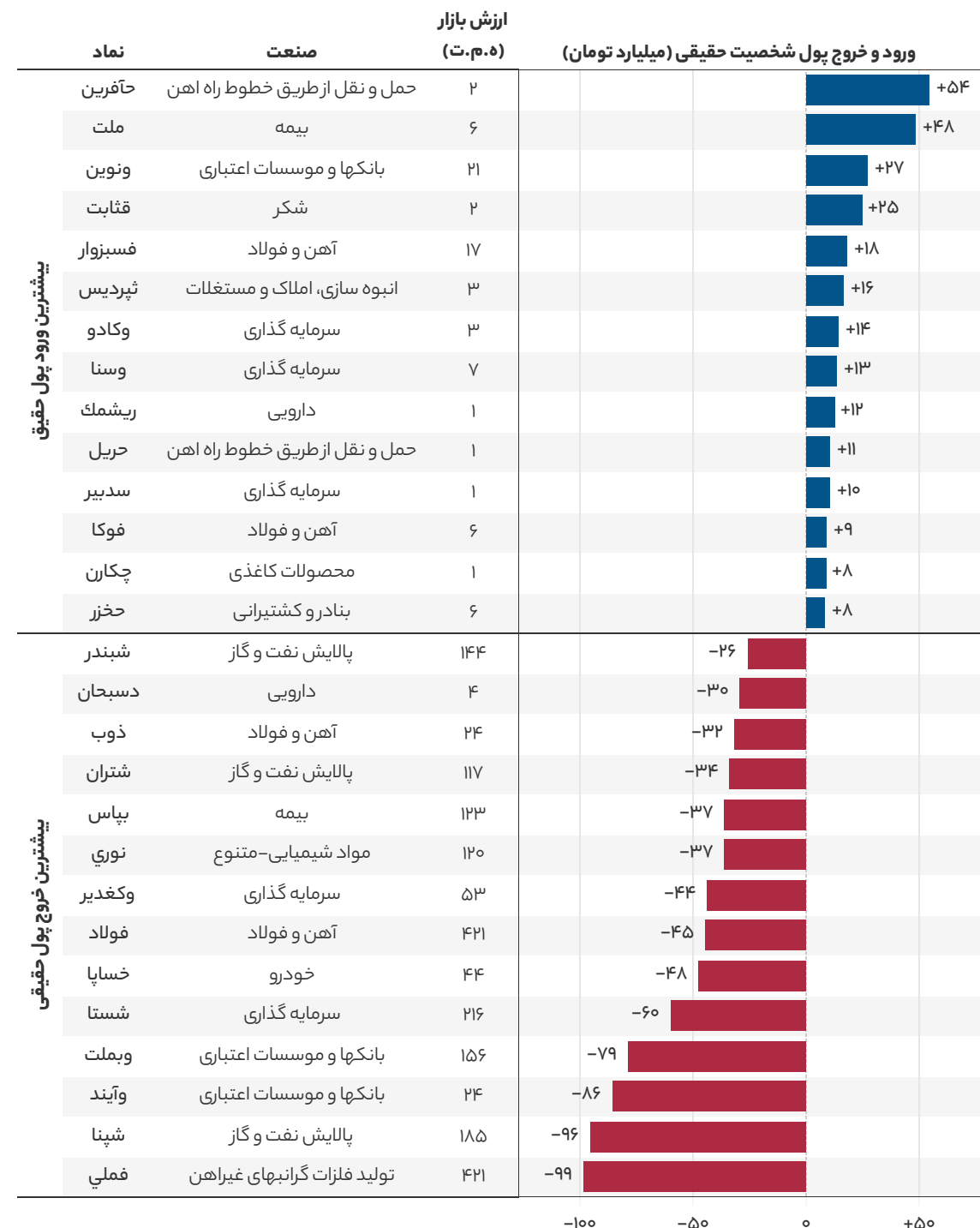




ورود و خروج پول

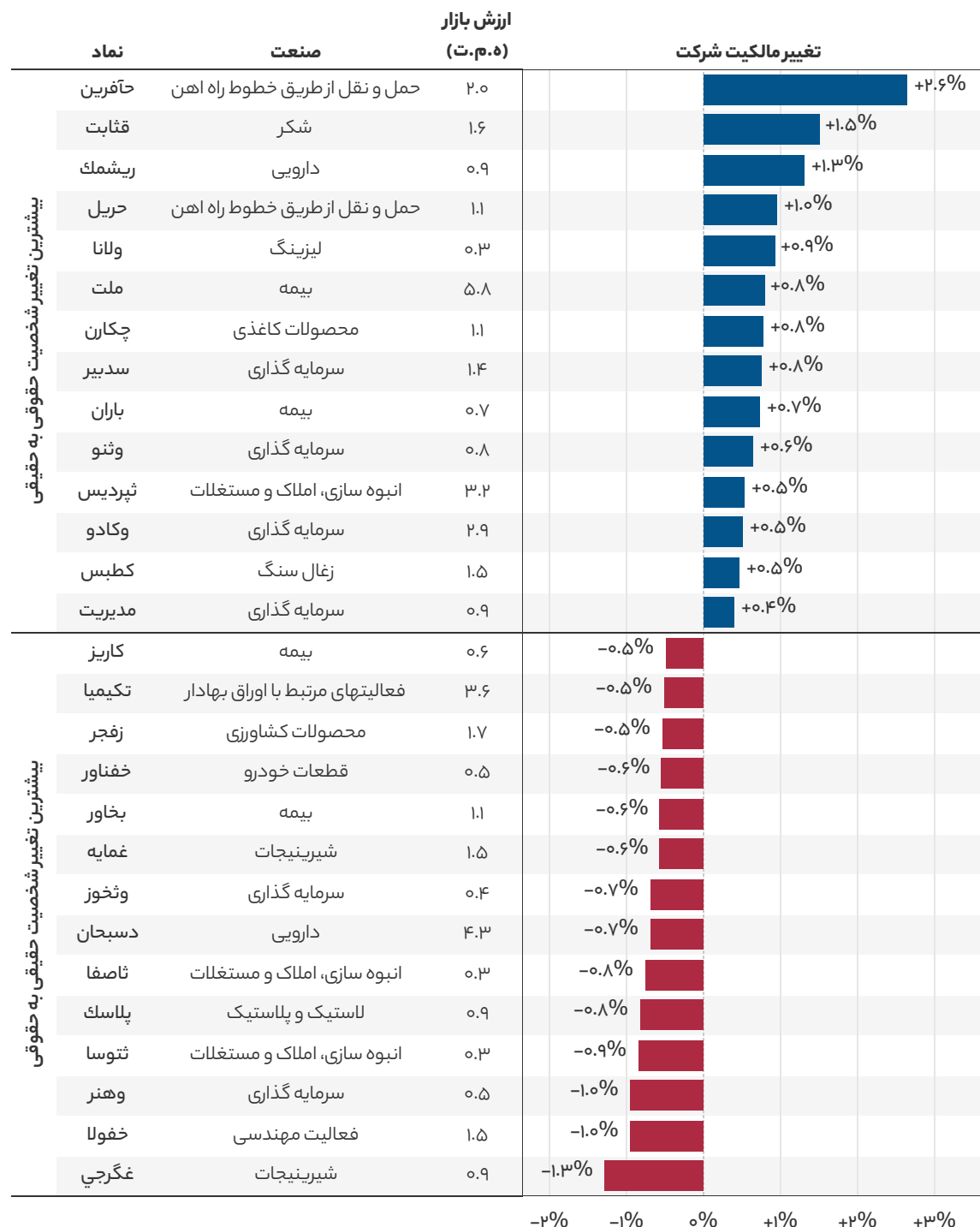
ورود و خروج پول حقیقی

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



تغییر مالکیت شرکت

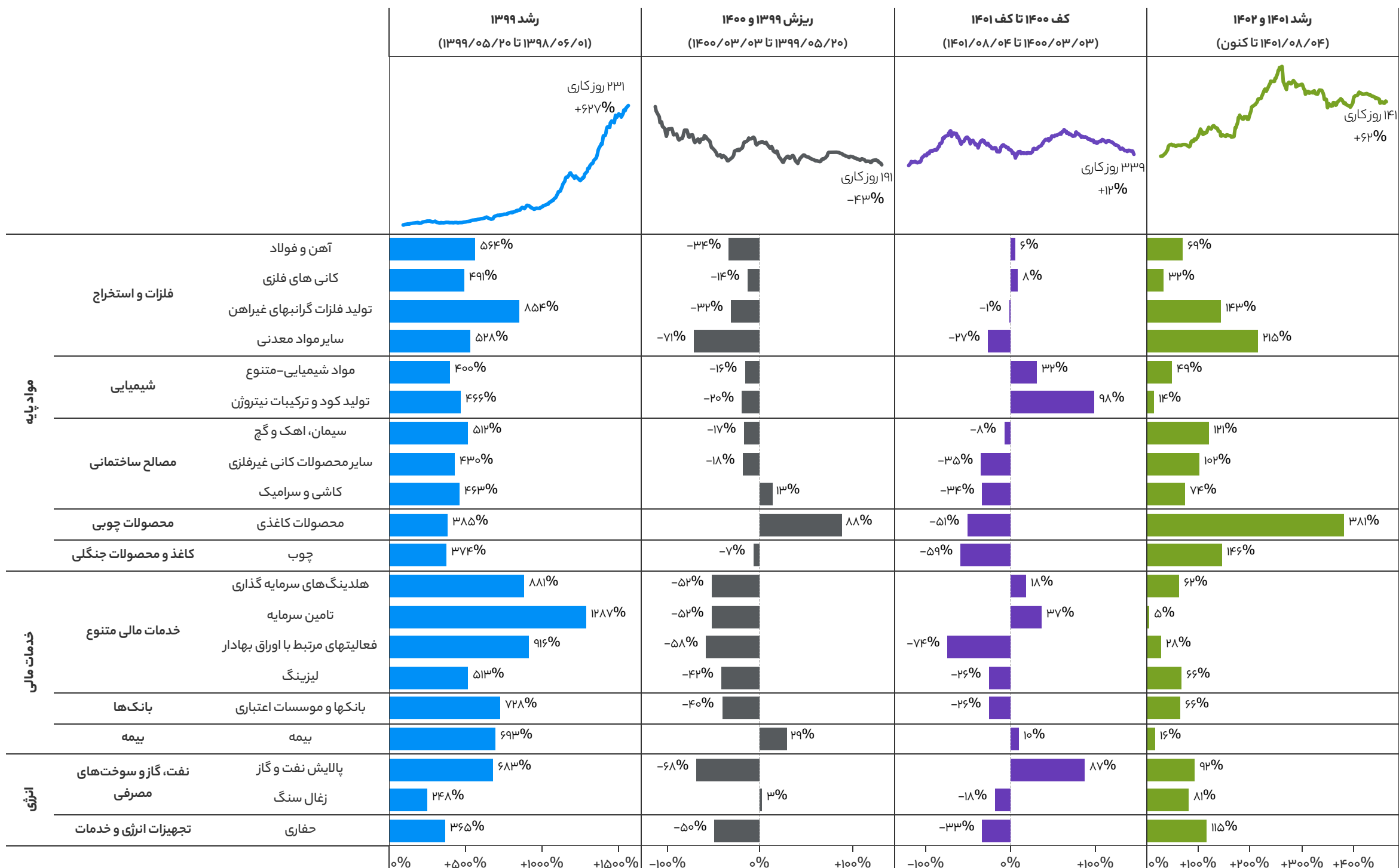
طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبدیل حقوقی به حقیقی، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان



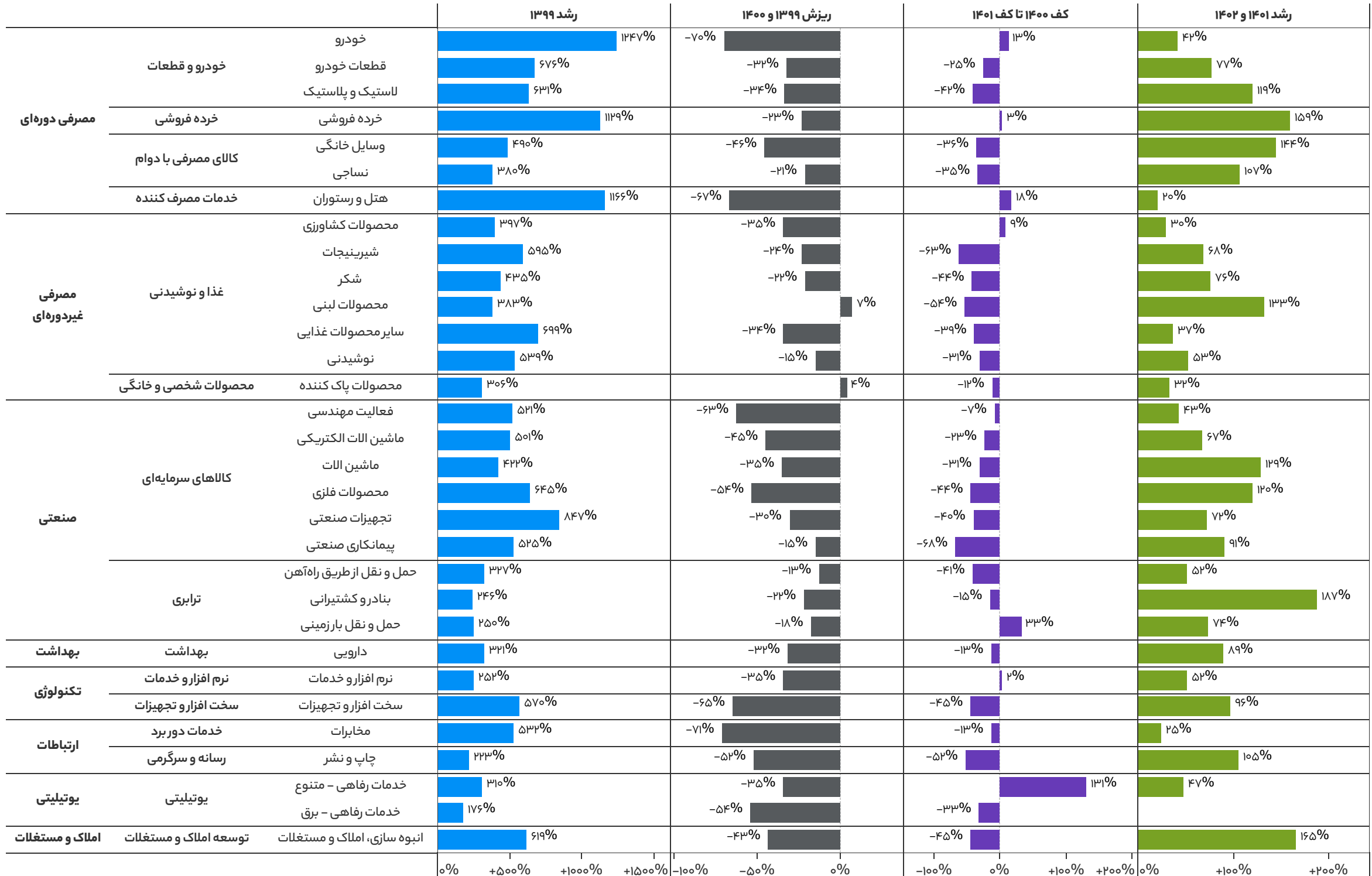


بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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)





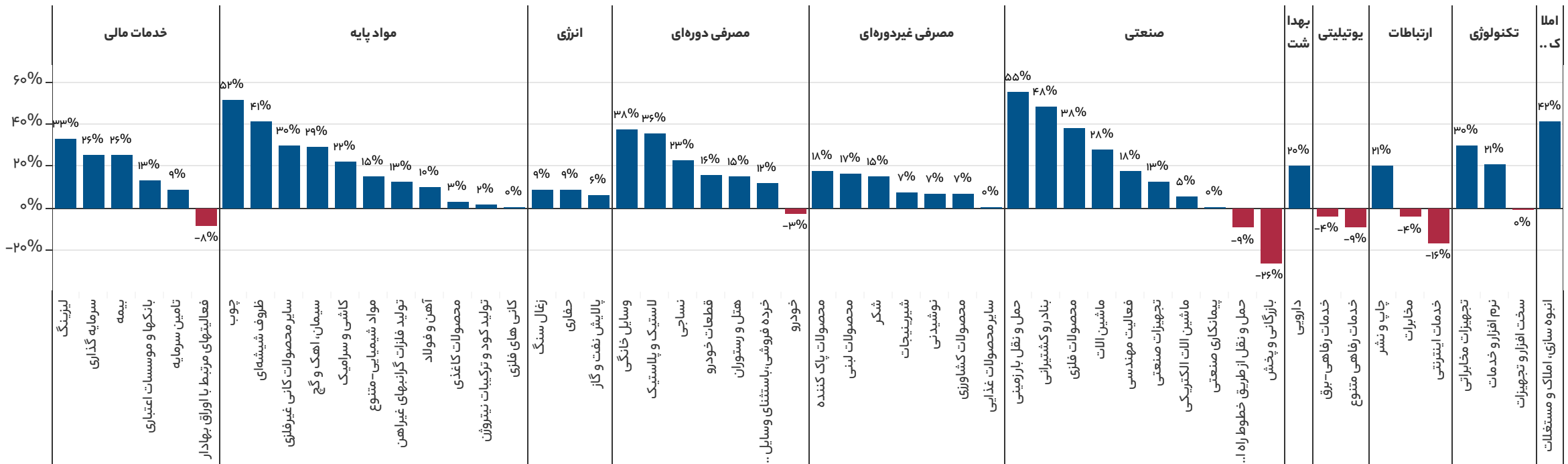
بازده صنایع از ابتدای هفته

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



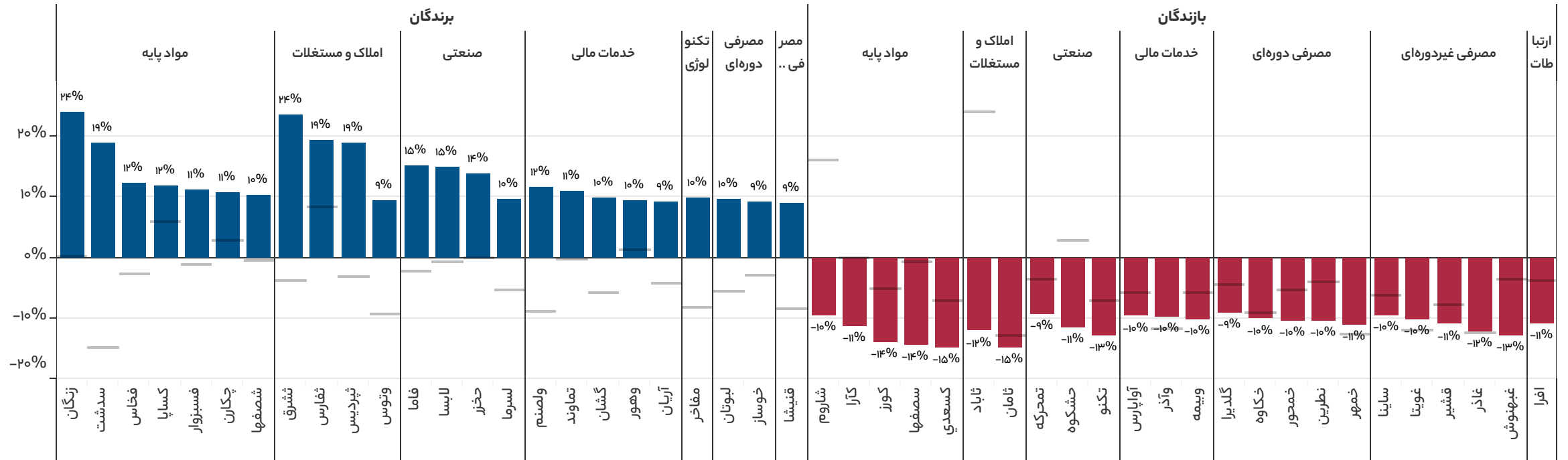
بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)

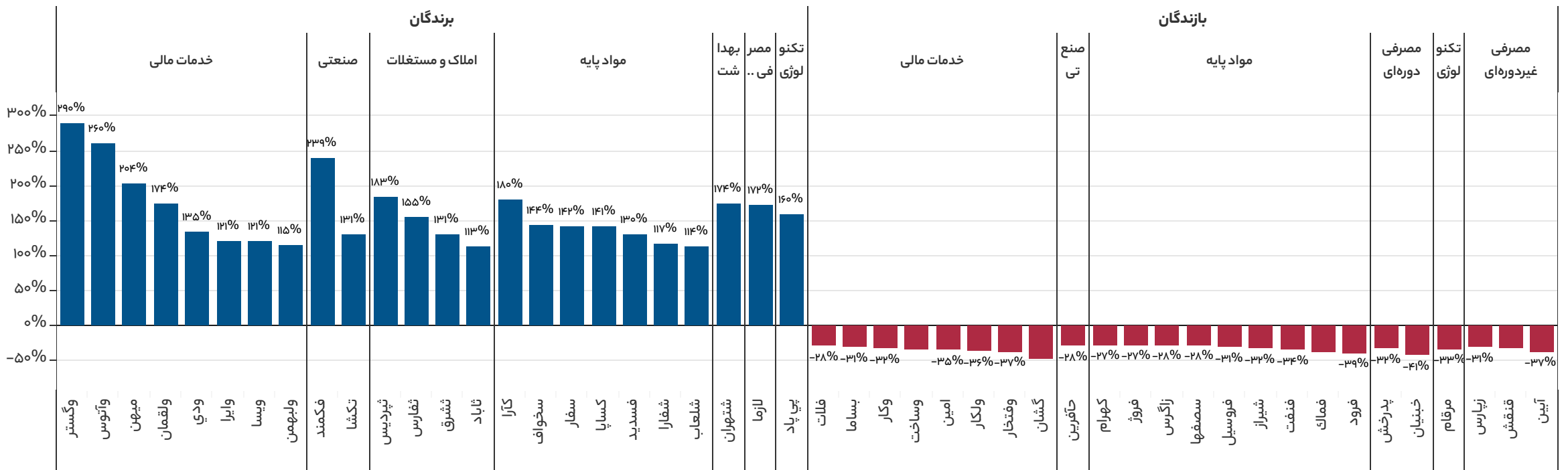




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



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



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

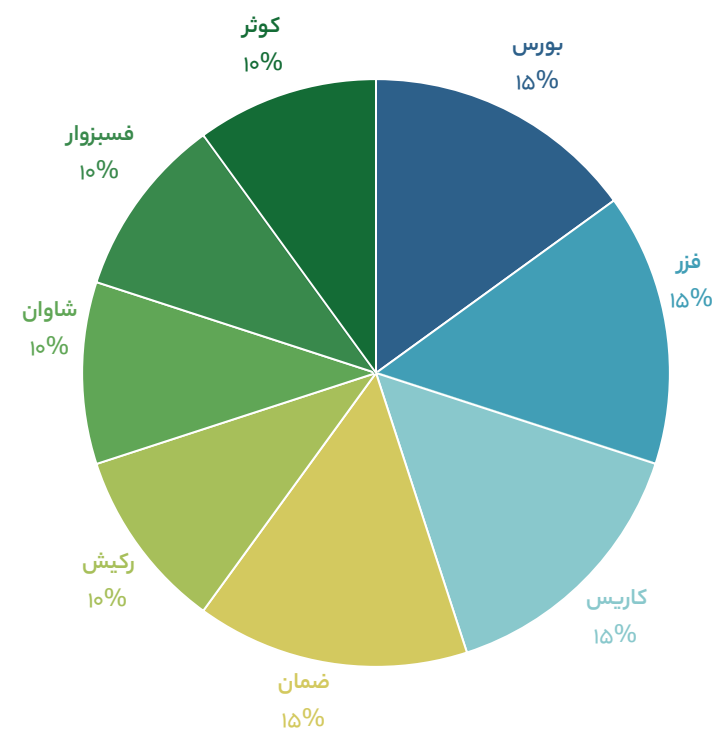


بازدهی هفته گذشته	کچاد	شتراک	شینا	شبندر	پارسان	کگل	شتا	وبملت	پارس	وگتیر	فولاد	شیریز	کهر	مارون	مین	فملی	وسپهر	وامید	حکشتی	تاپیکو	پاس	میدکو	تامیکو	فخوز	وعدیر	بفجر	ومعادن	فارس	وصندوق	خودرو	شپدیس	نوری	ویاسار	وتجارت	آریا	خسپا	بوعلی	جم	رمپنا	اخابر
	+۶.۵%	+۵.۸%	+۴.۶%	+۴.۱%	+۳.۵%	+۲.۸%	+۲.۴%	+۱.۶%	+۰.۸%	+۰.۷%	+۰.۶%	+۰.۵%	+۰.۵%	+۰.۴%	+۰.۴%	+۰.۳%	+۰.۲%	+۰.۱%	۰%	-۰.۲%	-۰.۲%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۰.۹%	-۰.۹%	-۱.۲%	-۱.۳%	-۱.۸%	-۱.۸%	-۲.۵%	-۳.۲%	-۴.۴%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۲,۹۵۳	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۵,۰۰۰	رکیش	میان مدت
۱۰%	۲۱,۵۵۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۴۲,۷۷۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۴۵,۰۰۰	فسبزوار	
۱۰%	۳,۳۱۷	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%	۵,۴۸۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۸,۲۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۲,۹۰۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۴۷,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۱,۱۹۱	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





مهم‌ترین محدوده‌های مقاومتی و حمایتی مشخص شده است.

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی محدوده ۳.۶ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی محدوده مشخص شده ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی محدوده مشخص شده ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مطابق تصویر بعد از اصلاح تا حوالی ۱۹۳۵، به مسیر صعودی خود ادامه دهد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود روندی مطابق شکل 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 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 ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)							
مواد پایه	شیمیایی	الفین	آریا	۱۲	۱۰۸.۵	۷,۸۹۰	۸۰۲	۹۵%	۹۵۶	۱,۲۷۸	+۳۴%	۸.۳	۶.۰	۷.۳	-۰.۲						
			جم	۱۲	۷۸.۶	۴,۳۶۴	۵۶۰	۹۹%	۸۵۳				۵.۱								
			جم پیلن	۱۲	۳۶.۵	۱۸,۲۳۵	۲,۱۰۹	۹۹%	۲,۷۹۰	۳,۳۷۶	+۲۱%	۶.۵	۵.۰	۵.۹	+۰.۹						
			شگویا	۱۲	۳۴.۷	۱,۴۵۰	۱۱۴۳	۹۱%	۲۵۹	۳۱۹	+۲۳%	۵.۶	۴.۲	۵.۹	-۰.۹						
			شکبیر	۱۲	۲۵.۸	۷,۱۸۰	۱,۱۶۸	۸۸%	۱,۶۱۳				۴.۵								
			شاراک	۱۲	۲۴.۱	۲,۹۹۰	۴۱۹	۹۶%	۵۶۷	۷۴۸	+۳۲%	۵.۳	۳.۶	۴.۵	-۱.۱						
			شغدیر	۱۲	۸.۳	۶,۳۸۲	۱,۰۹۶	۹۱%	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۵	۴.۴	۵.۸	-۰.۲						
			شبهصبر	۱۲	۶.۷	۲,۶۶۵	۳۷۶	۸۱%	۳۹۱	۵۲۸	+۳۵%	۶.۸	۴.۹	۶.۰	+۰.۸						
			شجم	۶	۴.۹	۷۴۷	۸۸	۸۵%	۷۵	۱۳۲	+۷۶%	۱۰.۰	۶.۳	۵.۴	-۵.۵						
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۱۹.۹	۱۳,۳۲۰	۱,۳۱۴	۱۰۰%	۱,۷۹۴	۲,۴۵۰	+۳۷%	۷.۴	۵.۲	۵.۹	+۰.۱							
		بوعلی	۱۲	۶۸.۸	۴,۷۹۱	۵۶۳	۹۵%	۷۵۸				۶.۳									
	اوره	شپدیس	۶	۹۷.۲	۱۶,۲۰۰	۴,۲۶۴	۶۳%	۳,۱۰۴	۳,۱۱۲	۰%	۵.۲	۵.۷	۵.۳	+۲.۱							
		شیراز	۱۲	۳۵.۲	۲,۲۹۸	۷۶۱	۲۱%	۴۰۱	۴۶۹	+۱۷%	۵.۷	۵.۰	۵.۴	+۱.۱							
		خراسان	۱۲	۲۶.۷	۱۴,۹۰۰	۲,۸۱۰	۸۳%	۱,۵۶۲	۲,۲۰۲	+۴۱%	۹.۵	۶.۶	۸.۵	+۴.۷							
		کرماشا	۱۲	۲۰.۱	۱,۸۹۴	۴۵۸	۴۸%	۲۵۶	۳۲۸	+۲۸%	۷.۴	۵.۸	۶.۵	+۳.۷							
		شاروم	۱۲	۲.۸	۱,۳۸۵	۵۸	۴۳%	۱۴۵				۹.۶									
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۰.۵	۱۲,۷۲۰	۱,۲۶۵	۷۲%	۱,۲۱۳				۱۰.۵									
		شخارک	۱۲	۲۵.۴	۴,۲۳۰	۶۴۱	۹۹%	۸۰۰	۱,۱۲۴	+۴۰%	۵.۳	۳.۴	۴.۱	-۴.۸							
		شفن	۱۲	۱۷.۱	۵۵۴	۱۰۲	۸۹%	۶۹	۱۱۳	+۶۴%	۸.۰	۴.۸	۶.۸	-۲.۴							
	محصولات شیمیایی	شکلر	۸	۳.۶	۳,۶۲۶	۴۱۹	۷۲%	۶۲۴	۶۶۳	+۶%	۵.۸	۵.۷	۴.۹	+۰.۵							
		شکام	۱۲	۳.۴	۸۵۳	۱۱۵	۱۴%	۱۷۹				۴.۸									
		شمواد	۶	۱.۷	۱۱,۶۴۰	۷۳۹	۲۳%	۱,۸۳۱	۱,۹۳۴	+۶%	۶.۴	۶.۶	۵.۶	-۱.۴							
		شملی	۶	۱.۶	۷۶۴	۴۱		۵۵	۸۵	+۵۴%	۱۳.۹		۱۴.۵								
	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۱	۴۹۳	۶۴	۸۲%	۹۲	۹۶	+۴%	۵.۴	۴.۷	۴.۵	-۲.۴							
شصدف		۱۲	۲.۴	۳,۴۷۵	۳۹۲	۷۳%	۳۵۷	۲۷۱	-۲۴%	۹.۷	۱۲.۸	۱۰.۱	+۰.۸								
شدوص		۱۲	۱.۹	۲,۰۱۲	۱۹۳	۹۳%	۳۲۶	۳۹۸	+۲۲%	۶.۲	۴.۷	۵.۵	-۱.۳								



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	۴۲۰.۸	۵۲۶	۸۵	۵۰%	۱۰۱	۱۲۵	+۲۳%	۵.۲	۴.۱	۴.۹	+۱.۹						
		فخوز	۱۲	۶۱.۴	۳۲۳	۳۵	۴۶%	۸۵	۱۰۲	+۱۹%	۳.۸	۲.۹	۳.۴	-۵.۱						
		فولاد	۱۲	۳۵.۰	۱,۴۶۰	۱۹۹	۷۶%	۳۳۱	۳۸۶	+۱۶%	۴.۴	۳.۳	۳.۵	-۲.۸						
		کاوه	۱۲	۳۳.۶	۱,۰۵۰	۱۰۶	۶۸%	۲۰۲	۲۳۴	+۱۶%	۵.۲	۴.۳	۵.۴	-۱.۱						
		هرمز	۱۲	۳۳.۴	۶۸۱	۱۱۲	۵۱%	۱۶۷	۲۱۰	+۲۶%	۴.۱	۳.۰	۳.۴	-۳.۶						
		ارفع	۱۲	۳۱.۲	۲,۶۰۰	۳۱۲	۸۶%	۴۹۶	۵۹۹	+۲۱%	۵.۲	۴.۰	۵.۳	-۰.۲						
		فخاس	۱۲	۲۹.۴	۱,۲۸۰	۱۰۰	۴۹%	۱۴۳	۲۴۷	+۷۳%	۹.۰	۵.۴	۷.۶	-۳.۳						
		فغدیر	۱۲	۲۸.۹	۸۲۷	۷۲	۸۵%	۱۱۸	۱۵۰	+۲۶%	۷.۰	۵.۳	۷.۴	+۰.۹						
	سنگ آهن	فسبزوار	۹	۱۷.۱	۴,۲۸۲	۳۵۸	۹۰%	۸۰۶	۹۰۵	+۱۲%	۵.۳	۴.۱	۵.۹	+۰.۳						
		کگل	۱۲	۱۹۳.۴	۵۸۶	۴۹	۶۵%	۶۳	۷۱	+۱۳%	۹.۳	۸.۳	۸.۱	-۱.۳						
		کچاد	۱۲	۱۶۰.۵	۵۹۱	۸۴	۷۱%	۱۳۸	۱۶۱	+۱۷%	۴.۳	۳.۳	۳.۴	-۳.۷						
		کگهر	۹	۱۲۴.۸	۴,۹۹۰	۴۶۹	۹۲%	۵۸۳	۶۶۱	+۱۳%	۸.۶	۷.۰	۷.۶	-۱.۶						
	مس	کنور	۱۲	۲۳.۶	۱,۸۵۱	۱۴۷	۹۴%	۲۷۸	۳۶۳	+۳۱%	۶.۷	۴.۶	۵.۵	-۱.۴						
		فملی	۱۲	۴۲۱.۲	۷۰۲	۸۳	۴۵%	۱۰۷	۱۲۹	+۲۱%	۶.۶	۵.۴	۵.۶	+۰.۶						
	محصولات فلزی	فباهر	۱۲	۱۱.۶	۴۷۳	۶۰	۹۵%	۷۸				۶.۰								
		کوبر	۱۲	۱۱.۵	۳۰۸	۴۶	۱۲%	۵۶	۵۷	+۲%	۵.۵	۵.۷	۵.۳	-۱.۹						
		فجر	۱۲	۷.۰	۸۳۲	۱۹	۴۹%	۱۸۲	۲۴۶	+۳۵%	۴.۶	۳.۴	۴.۲	-۴.۲						
		فروز	۱۲	۴.۷	۴,۲۹۰	۵۳۹	۱۰۰%	۹۶۵	۱,۲۷۳	+۳۲%	۴.۴	۲.۹	۳.۶							
		فروس	۱۲	۳.۲	۷۹۵	۹۶	۶۶%	۱۴۷	۱۶۶	+۱۳%	۵.۴	۴.۶	۴.۷	-۰.۳						
		فسپا	۱۲	۲.۹	۷۳۳	۱۲۴	۵۴%	۲۲۷	۲۴۱	+۶%	۳.۲	۲.۷	۲.۷	-۳.۱						
		فروسیل	۱۲	۲.۰	۱,۲۸۰	۱۱۵	۶۴%	۲۴۲	۳۴۰	+۴۱%	۵.۳	۳.۶	۴.۱	-۲۸.۴						
		فرو	۱۲	۲.۰	۳۷۷	۲۳	۸۲%	۸۰			۴.۷									
		فسازان	۱۲	۱.۸	۶۱۳	۷۴	۳۵%	۱۲۴	۱۳۵	+۹%	۴.۹	۴.۵	۴.۸	-۱.۵						
آلومینیوم	فولای	۱۲	۰.۸	۷۱۰	۶۰	۲۱%	۷۵	۷۴	-۱%	۹.۵	۱۰.۱	۹.۱	+۰.۶							
	فایرا	۱۲	۲۹.۲	۷۷۰	۷۳	۳۹%	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۹.۰	۶.۴	۷.۴	+۱.۹							
	فاسمین	۱۲	۱۳.۲	۵۵۰	۱۱۲	۶۴%	۱۱۳	۱۶۷	+۴۷%	۴.۹	۳.۰	۳.۶	-۰.۷							
	فنوال	۱۲	۳.۷	۱,۰۸۹	۱۰۶	۵۱%	۱۰۲	۱۴۱	+۳۸%	۱۰.۷	۸.۰	۸.۷	+۳.۱							
	کیمیا	۱۲	۱.۹	۶۴۴	۱۲۷	۴۰%	۱۱۵	۱۵۳	+۳۳%	۵.۶	۴.۲	۴.۴	-۰.۵							
	فزرین	۱۲	۱.۷	۵۸۱	۹۳	۳۶%	۳۹	۵۷	+۴۶%	۱۴.۹	۱۰.۶	۱۲.۷	+۱.۱							
	فتوسا	۱۲	۱.۱	۷۳۷	۱۴۹	۳۲%	۲۱۴	۳۱۸	+۴۹%	۳.۴	۲.۲	۲.۵	-۲.۹							
	طلا	۹	۱۲.۸	۴,۲۸۰	۹۹۶	۳۱۸%	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۵.۹	۵.۲	۳.۵	-۱.۰							
	سایر کانی های فلزی	کمنگنز	۱۲	۲.۲	۱,۴۸۶	۱۱۴	۶۴%	۲۰۰	۲۴۹	+۲۴%	۷.۴	۵.۹	۶.۳	-۰.۸						
	سایر مواد معدنی	کتوسعه	۹	۲.۰	۱,۸۴۵	۱۱۱	۹۷%	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۰.۶	۸.۲	۷.۷							

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z (آینده نگر ۴ فصله)							
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ (فصله)							
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ	ساوه	۱۲	۸.۴	۱۲,۹۷۰	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۵.۴	۴.۰	۴.۷	+۰.۳							
		ستران	۱۲	۸.۴	۴۹۵	۶۲	۷۶%	۱۰۳				۴.۸									
		سآبیک	۱۲	۶.۴	۲,۱۵۴	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۵.۵	۳.۹	۴.۹	+۰.۹							
		سخوز	۱۲	۵.۸	۴,۱۷۰	۷۱۹	۹۰%	۹۸۷	۱,۲۱۶	+۲۳%	۴.۲	۳.۰	۳.۳	-۱.۵							
		سپاها	۶	۵.۲	۲,۱۱۰	۱۹۷	۷۵%	۳۲۶	۵۶۱	+۷۲%	۶.۵	۴.۰	۳.۶	-۰.۷							
		ساروم	۱۲	۴.۱	۴,۰۸۰	۵۵۴	۹۶%	۷۱۰	۹۹۴	+۴۰%	۵.۷	۳.۸	۵.۰	-۰.۷							
		سشرق	۶	۳.۹	۱,۴۵۱	۱۵۴	۷۲%	۲۴۷	۳۷۴	+۵۲%	۵.۹	۴.۱	۲.۹	-۴.۶							
		سرود	۱۲	۳.۶	۴,۴۸۵	۴۹۶	۹۶%	۶۵۱	۹۵۰	+۴۶%	۶.۹	۴.۴	۶.۴	+۱.۰							
		سصوفی	۱۲	۳.۰	۲,۷۰۰	۳۶۸	۹۰%	۵۳۲	۹۰۷	+۷۱%	۵.۱	۲.۷	۴.۱	-۰.۹							
		سبجنو	۱۲	۲.۷	۶,۹۵۰	۵۷۳	۹۶%	۱,۱۱۵	۱,۴۱۲	+۲۷%	۶.۲	۴.۶	۵.۳	-۱.۵							
		سشمال	۹	۲.۶	۱,۵۳۲	۱۷۰	۸۹%	۲۷۵	۴۱۱	+۴۹%	۵.۶	۳.۲	۴.۲	-۰.۲							
		سبهان	۱۲	۱.۹	۹,۳۰۰	۷۳۶	۹۷%	۱,۵۵۶	۱,۷۸۹	+۱۵%	۶.۰	۴.۸	۵.۹	-۰.۹							
	سخرز	۱۲	۱.۸	۳,۶۵۲	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۶	۵.۵	۵.۹	-۰.۷								
	سشاش	۱۲	۱.۶	۷,۹۵۷	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۹۱	۱,۸۳۶	+۲۳%	۵.۳	۳.۹	۴.۵	-۱.۳								
	کاشی و سرامیک	کحافظ	۱۲	۳.۲	۶۱۸	۸۲	۱۰%	۱۰۱	۱۵۰	+۴۸%	۶.۱	۴.۴	۴.۹	-۱.۰							
		کساوه	۱۲	۳.۱	۵,۷۸۱	۷۴۷	۷۱%	۱,۱۵۰	۱,۶۹۰	+۴۷%	۵.۰	۳.۲	۳.۸	-۲.۷							
		کپارس	۱۰	۱.۷	۱,۰۴۶	۲۴		۱۸۸	۲۵۸	+۳۷%	۵.۶		۴.۳								
		کلوند	۱۲	۱.۷	۴,۱۳۹	۵۰۴	۹۵%	۶۴۶	۹۴۵	+۴۶%	۶.۴	۴.۱	۵.۳	-۰.۵							
		کترام	۱۲	۱.۱	۶۷۳	۵۹	۲۳%	۸۵	۱۱۴	+۳۴%	۷.۹	۶.۳	۶.۰	-۱.۸							
		کصدف	۱۲	۰.۷	۲,۰۷۰	۱۲۸	۱۰%	۱۵۱	۲۴۲	+۶۰%	۱۳.۷	۹.۱	۱۱.۴	+۱.۷							
		کسعدي	۱۲	۰.۶	۶۱۹	۵۱	۸۶%	۹۵	۱۲۳	+۲۹%	۶.۵	۴.۷	۵.۳	-۲.۶							
		شیشه و ظروف شیشه‌ای	کرازى	۱۲	۴.۵	۱۵۴	۱۶	۲۴%	۲۳	۳۲	+۳۹%	۶.۶	۵.۰	۴.۷	-۱.۴						
	کقزوى		۱۲	۳.۸	۲,۶۳۵	۳۵۹	۳۶%	۵۵۷				۴.۷									
	کگاز		۱۲	۲.۹	۳,۴۵۵	۱۱۳	۵۱%	۳۸۱	۴۳۴	+۱۴%	۹.۱	۸.۰	۷.۶	-۳.۸							
فرآورده‌های نسوز	کفرا	۱۲	۱.۹	۹۵۵	۶۶	۹۶%	۷۹	۱۵۴	+۹۴%	۱۲.۱	۶.۲	۸.۱	-۱.۳								
	کاذر	۱۲	۱.۰	۴۸۲	۵۲	۲۶%	۱۲۶	۱۵۰	+۱۹%	۳.۸	۳.۲	۳.۰	-۹.۲								
	کفپارس	۹	۰.۹	۵۷۴	۳۶	۷%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۱.۰	۸.۶	۷.۲	-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		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	۱۸۵۰۲	۸۱۶	۱۷۰	۶۳%	۱۵۱			۵۰۴						
		پالایش گاز	۱۲	۱۲۵۰۲	۲۶۳	۳۱	۸۸%	۳۴	۴۶	+۳۴%	۷۰۷	۵۰۶	۶۰۴	-۰۰۲			
		روانکار	شبه‌رهن	۱۲	۲۹۰۰	۲,۴۲۷	۳۳۸	۸۹%	۳۴۵	۵۲۵	+۵۲%	۷۰۰	۴۰۴	۵۰۸	+۱۰۳		
			شسپا	۱۲	۲۷۰۰	۴۸۳	۷۴	۶۷%	۸۳	۹۹	+۱۹%	۵۰۸	۴۰۵	۴۰۹	+۰۰۴		
			شنفت	۱۲	۱۶۰۵	۸۲۶	۱۰۸	۸۲%	۷۵	۱۰۳	+۳۷%	۱۱۰۰	۸۰۱	۹۰۱	+۰۰۱		
			شرانل	۱۲	۱۵۰۹	۷,۹۶۵	۱,۴۴۱	۸۵%	۹۳۰	۱,۵۶۵	+۶۸%	۸۰۶	۵۰۰	۶۰۸	+۲۰۳		
	زغال سنگ	کزغال	۱۲	۷۰۵	۲,۱۴۰	۲۶۵	۹۹%	۳۷۴	۸۲۷	+۱۲۱%	۵۰۷	۲۰۴	۴۰۳	-۲۰۹			
		کپور	۱۲	۲۰۲	۱,۲۷۸	۱۶۹	۵۹%	۲۴۷	۳۳۵	+۳۶%	۵۰۲	۳۰۶	۴۰۰	-۴۰۴			
		کطبس	۱۲	۱۰۵	۱,۹۱۰	۱۹۳	۶۲%	۳۷۸	۴۷۱	+۲۵%	۵۰۱	۳۰۸	۳۰۹	-۵۰۳			
خدمات مالی	فلزات و معادن	ومعادن	۱۲	۸۵۰۲	۴۴۳	۷۲	۳۸%	۹۷	۱۱۹	+۲۲%	۴۰۵	۳۰۶	۳۰۲	-۵۰۳			
		وکغدير	۶	۵۲۰۷	۱,۳۷۳	۱۳۴	۶۲%	۱۸۳	۲۷۵	+۵۱%	۷۰۵	۵۰۶	۴۰۸				
	سنگ آهن	وامید	۱۰	۱۳۴۰۴	۱,۳۸۶	۱۸۸	۶۸%	۱۷۱	۲۳۸	+۳۹%	۸۰۱	۵۰۵	۸۰۲	+۱۰۱			
		لوتوس	۱۰	۱۲۰۵	۳۵۸	۴۵	۹۶%	۶۷	۸۳	+۲۳%	۵۰۳	۳۰۸	۴۰۳	-۳۰۰			
	تامین سرمایه	تنوین	۱۲	۱۰۰۳	۲۶۷	۴۸	۶۳%	۵۰	۶۱	+۲۳%	۵۰۴	۴۰۱	۴۰۳	-۱۰۱			
		امین	۶	۱۰۰۱	۵۶۰	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲۰۵	۹۰۷	۷۰۷	-۳۰۳			
	دارویی	وپخش	۱۲	۱۵۰۷	۱,۸۷۰	۲۹۸	۹۱%	۳۶۹			۵۰۱						
		شفا	۱۲	۶۰۲	۲,۲۸۲	۲۸۱	۷۱%	۳۲۴			۷۰۰						
	چند رشته‌ای	وسپه	۹	۱۳۰۲	۴۳۳	۶۷	۸۸%	۶۴	۸۱	+۲۶%	۶۰۸	۴۰۸	۷۰۰	+۲۰۶			
		وتوکا	۱۲	۴۰۹	۴۰۲	۳۷	۳۳%	۴۰	۵۲	+۳۱%	۱۰۰۱	۸۰۰	۷۰۶	+۰۰۵			
	سرب و روی	کروی	۱۲	۶۰۴	۶۴۲	۱۵۶	۷۴%	۲۵	۳۵	+۴۴%	۲۶۰۰	۱۸۰۸	۱۷۰۶	+۱۰۷			
	سایر محصولات غذایی	خودکفا	۱۲	۶۰۴	۸۴۹	۱۱۰	۴۵%	۱۷۳	۲۱۳	+۲۳%	۴۰۹	۳۰۷	۳۰۳	-۳۰۸			
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	۱۲	۱۰۵	۷,۲۹۵	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵۰۶	۳۰۵	۴۰۴	-۰۰۸			
	کاغذ و محصولات..	محصولات چوبی	۱۲	۱۰۲	۵,۸۴۰	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۴۰۴	۸۰۱	۱۲۰۰	+۰۰۲			

-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	۳۶.۱	۱,۴۴۳	۶۰	۲۰%	۱۱۱	۱۶۴	+۴۷%	۱۳.۰	۸.۹	۸.۶	+۰.۱						
		ددانا	۱۲	۱۲.۵	۵,۲۰۰	۴۹۵	۷۶%	۷۶۰	۹۴۶	+۲۵%	۶.۸	۵.۳	۵.۷	+۰.۲						
		دارو	۱۲	۷.۹	۳,۰۴۹	۳۳۰	۹۵%	۴۲۳	۴۸۶	+۱۵%	۷.۲	۶.۰	۶.۱	-۰.۱						
		دلر	۱۲	۶.۸	۳,۰۰۰	۳۵۲	۹۶%	۴۷۴	۶۲۵	+۳۲%	۶.۳	۴.۵	۵.۳	-۰.۱						
		دتماد	۱۲	۳.۳	۴,۶۵۸	۶۵۳	۹۶%	۶۷۵	۷۷۰	+۱۴%	۷.۰	۵.۸	۶.۳	-۰.۶						
		دالبر	۱۲	۵.۷	۵۹۷	۷۵	۶۹%	۹۸	۱۱۳	+۱۵%	۶.۱	۵.۲	۵.۲	-۱.۴						
		دیپارس	۱۲	۵.۳	۵,۶۳۰	۸۰۳	۹۸%	۹۳۹	۱,۰۹۹	+۱۷%	۶.۰	۴.۸	۴.۶	-۰.۶						
		دفارا	۱۲	۵.۱	۳,۲۱۷	۴۵۲	۹۹%	۵۱۷	۵۸۳	+۱۳%	۶.۲	۵.۲	۵.۰	-۰.۲						
		کاسپین	۱۲	۲.۵	۱,۸۱۴	۲۳۴	۹۵%	۲۴۹	۳۳۲	+۳۰%	۷.۵	۵.۷	۶.۷	+۰.۴						
		دفرا	۱۲	۵.۰	۳,۵۸۱	۳۹۳	۷۹%	۵۰۱	۶۲۸	+۲۵%	۷.۲	۵.۵	۵.۷	+۱.۰						
		هجرت	۱۲	۴.۶	۲,۸۵۰	۴۰۶	۹۵%	۶۵۷	۷۴۸	+۱۴%	۴.۳	۳.۳	۳.۶	-۲.۱						
		دسبحان	۱۲	۴.۳	۸۰۳	۷۲	۶۳%	۱۰۳	۱۱۳	+۱۰%	۷.۸	۷.۲	۷.۳	-۰.۷						
		دقاضی	۱۲	۴.۱	۲,۴۰۰	۲۷۷	۹۶%	۳۶۶	۴۳۱	+۱۸%	۶.۶	۵.۲	۵.۵	-۰.۵						
		دتوزیع	۱۲	۴.۰	۲,۲۴۵	۴۴۹	۹۴%	۵۱۶	۵۵۳	+۷%	۴.۳	۳.۵	۳.۴	-۲.۳						
		دجابر	۱۲	۳.۸	۱,۶۸۶	۱۷۱	۷۰%	۲۴۲			۷.۰									
		داسوه	۱۲	۳.۳	۴,۴۱۲	۴۸۴	۷۰%	۵۰۸	۶۰۰	+۱۸%	۸.۷	۷.۳	۷.۶	+۰.۲						
		دابور	۱۲	۲.۹	۱,۶۲۳	۲۶۲	۹۵%	۳۱۲	۳۸۳	+۲۳%	۵.۲	۳.۸	۴.۲	-۱.۲						
		درازک	۱۲	۲.۷	۱,۲۷۰	۲۱۳	۱۰۴%	۲۵۹	۲۸۹	+۱۲%	۴.۹	۳.۷	۴.۰	-۶.۱						
		دشیمی	۱۲	۲.۶	۲,۸۵۰	۳۲۱	۹۴%	۴۶۰			۶.۲									
		دکپسول	۱۲	۲.۲	۷,۴۸۰	۹۲۱	۹۲%	۱,۱۳۷	۱,۴۵۷	+۲۸%	۶.۶	۴.۹	۵.۶	+۰.۹						
		درهآور	۱۲	۲.۰	۸,۱۰۰	۹۷۰	۹۳%	۱,۲۴۶			۶.۵									
		درازی	۱۲	۱.۹	۱,۹۳۴	۲۷۳	۶۷%	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۵.۶	۵.۰	۴.۶	-۴.۸						
		دکیمی	۱۲	۱.۹	۳,۳۴۰	۳۵۳	۸۲%	۴۶۸			۷.۱									
		دکوثر	۱۲	۱.۸	۱,۰۷۳	۶۰	۱۱%	۱۱۶	۱۵۵	+۳۳%	۹.۲	۷.۳	۸.۶	+۰.۱						
		دزهرای	۱۲	۱.۷	۵۲۸	۱	۰%	۷۱			۷.۴									
		دشیری	۱۲	۰.۶	۱۱,۳۰۰	۱,۲۱۳	۸۴%	۱,۳۴۲			۸.۴									

-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		-۳	-۲	-۱	۰	+۱	+۲	+۳
مصرفی غیردورهای	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۷.۹	۲,۶۳۰	۲۱۳	۵۵%	۴۶۳				۵.۷									
		سیمرغ	۹	۴.۲	۳,۲۰۰	۳۹۱	۲۴%	۴۸۵	۷۰۰	+۲۴%	۶.۶	۴.۵	۴.۵	-۰.۵							
		زفکا	۱۲	۲.۶	۱,۷۰۰	۱۵۵	۹۱%	۲۵۷				۶.۶									
		تلیسه	۱۲	۱.۸	۳۷۰	۲۵	۹۲%	۳۳				۱۱.۲									
		زگلدشت	۱۲	۱.۸	۲,۵۰۵	۹۶	۹۵%	۱۵۵				۱۶.۲									
		زدشت	۱۲	۱.۷	۲,۵۱۵	۲۱۲	۵۱%	۲۴۵				۱۰.۳									
		زفجر	۱۲	۱.۷	۱,۸۵۷	۱۲۱	۸۰%	۱۶۳				۱۱.۴									
		زملارد	۱۲	۱.۴	۱,۷۵۵	۳۳	۹۴%	۱۰۲				۱۷.۳									
		زبینا	۱۲	۱.۳	۳۶۳	۴۱	۷۹%	۵۱				۷.۲									
		زشریف	۹	۱.۲	۵۰۰	۴۸	۷۶%	۹۰	۸۸	-۳%	۵.۵	۵.۱	۴.۶	-۲.۲							
	زکشت	۱۲	۱.۲	۱,۹۶۱	۱۲۶	۵۳%	۱۱۴				۱۷.۲										
	غذا و نوشیدنی	شیرینیجات	زمگسا	۱۲	۱.۰	۳,۴۱۹	۳۲۶	۹۵%	۴۰۴				۸.۵								
			زشگزا	۱۲	۰.۸	۸۷۱	۸۱	۵۶%	۱۲۴				۷.۰								
			غصینو	۱۲	۱۳.۶	۱,۳۵۷	۱۶۱	۶۰%	۲۱۵	۲۵۶	+۱۹%	۶.۳	۵.۱	۵.۲	-۲.۸						
			غپینو	۱۲	۳.۴	۳۸۰	۴۹	۵۶%	۷۸	۹۷	+۲۴%	۴.۹	۳.۸	۴.۰	-۲.۲						
		غسالم	۱۲	۱.۹	۴۲۷	۶۵	۴۱%	۸۶	۱۰۷	+۲۵%	۵.۰	۴.۱	۳.۹	-۲.۰							
		غمینو	۱۲	۱.۵	۱,۰۰۲	۱۴۹	۴۳%	۱۹۶	۲۵۰	+۲۸%	۵.۱	۳.۹	۴.۲	-۰.۵							
		قند و شکر	قچار	۱۲	۲.۷	۷۷۶	۴۲	۲۱%	۶۲				۱۲.۶								
			قصفها	۱۲	۲.۶	۱۳,۵۷۲	۶۲۲	۹۹%	۱,۱۸۷	۱,۲۰۰	+۱%	۱۱.۴	۱۱.۲	۹.۵	-۲.۰						
			قشهد	۶	۱.۸	۲,۶۱۸	۱۶۹	-۱۸%	۲۵۳				۱۰.۳								
قزوبین			۱۲	۱.۶	۷۴۹	۷۶	۸۴%	۸۰	۹۶	+۱۹%	۹.۳	۷.۷	۶.۹	+۰.۰							
غذای بسته بندی شده	غزر	۱۲	۵.۸	۳۲۵	۴۳	۱۰%	۶۷	۸۰	+۱۹%	۴.۸	۴.۳	۴.۱	-۱۵.۱								
	غمهرا	۱۲	۲.۰	۱,۰۶۲	۱۰۵	۱۶%	۱۶۸	۲۵۶	+۵۲%	۶.۳	۴.۳	۴.۵	-۱.۷								
روغن خوراکی	غبشهر	۹	۷.۳	۲۴۸	۳۹	۳۷%	۴۳	۸۶	+۱۰۱%	۵.۸	۲.۷	۳.۶	-۳.۸								
محصولات لبنی	غفارس	۱۲	۱.۶	۱,۴۰۳	۱۰۱	۱۳%	۱۱۲				۱۲.۶										
	غگلپا	۱۲	۱.۴	۳,۹۲۰	۴۶۵	۷۴%	۵۲۵				۷.۵										
	غگلستا	۱۲	۱.۱	۱,۷۱۱	۱۵۶	۷۰%	۲۰۷				۸.۳										
	غشان	۱۲	۱.۱	۶۲۸	۸۰	۷۱%	۸۴				۷.۴										

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

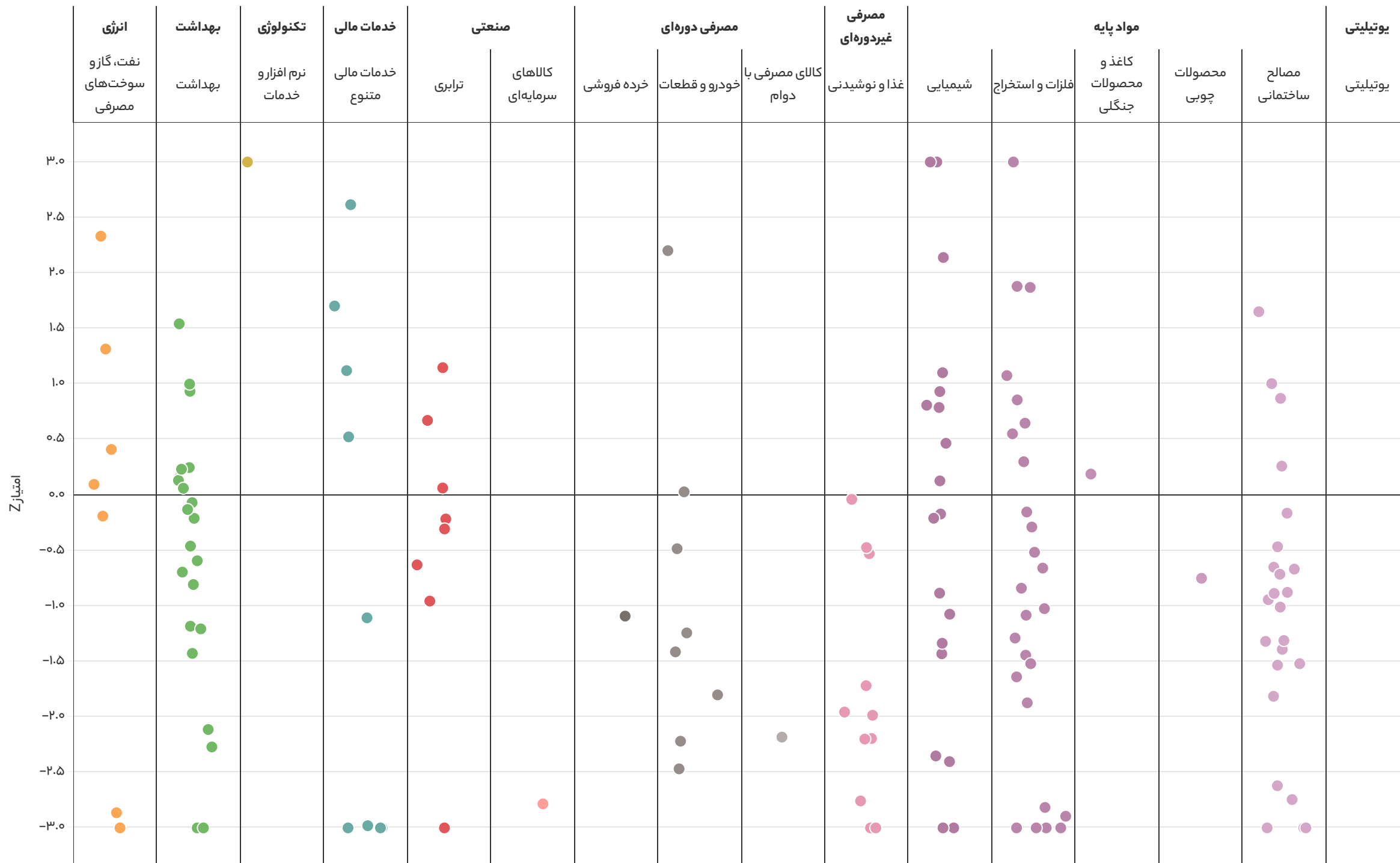
نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

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							
یوتیلیتی	یوتیلیتی و نیروگاهی	مبین	۱۲	۵۰.۴	۲,۴۹۰	۴۲۶	۱۶۱%	۶۳۱				۳.۹								
		بفجر	۱۲	۳۶.۷	۱,۸۸۰	۳۳۰	۱۸۷%	۳۸۹				۴.۸								
مصرفی دورهای	خودرو و قطعات	پکرمان	۱۲	۷.۵	۲,۹۷۹	۱۴۸	۸۷%	۳۰۱	۴۶۴	+۵۴%	۹.۹	۶.۷	۹.۸	-۰.۵						
		پکویر	۹	۴.۵	۶۸۲	۲۵	۷۵%	۷۷	۱۳۱	+۷۰%	۸.۹	۴.۵	۶.۵	-۱.۲						
		پارتا	۱۲	۳.۷	۵۹۹	۴۰	۶۰%	۴۳	۸۲	+۹۲%	۱۴.۰	۷.۶	۸.۹	-۲.۵						
		پاسا	۱۲	۳.۰	۱,۶۰۴	۱۳۶	۴۰%	۱۹۴	۳۰۵	+۵۷%	۸.۳	۵.۶	۷.۲	+۰.۰						
		پتایر	۱۲	۲.۸	۲۱۷	۱۰	۴۱%	۲۳	۲۹	+۲۵%	۹.۵	۷.۸	۸.۳	-۲.۲						
		پیزد	۱۲	۲.۶	۱,۲۹۴	۶۱	۶۷%	۱۰۸	۱۵۵	+۴۳%	۱۲.۰	۸.۶	۱۰.۸	-۱.۴						
		خودرو	۱۲	۱۳.۵	۳۸۷	۵۶	۱۶%	۱۰۸	۱۴۹	+۳۸%	۳.۶	۲.۶	۳.۱	-۱.۸						
		پلاستیک	۱۲	۱.۱	۴,۹۰۰	۶۰۶	۲۹%	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۲۲.۸	۲۳.۵	۱۹.۳	+۲.۲						
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	گل‌دیرا	۱۰	۵.۹	۷۰۱	۴۵	۲۲%	۱۰۶	۱۷۶	+۶۷%	۶.۶	۴.۰	۴.۳						
			لخزر	۱۲	۲.۳	۱,۴۰۰	۱۷۵	۲۹%	۲۴۷	۳۴۲	+۳۹%	۵.۷	۴.۲	۴.۶	-۲.۲					
خرده‌فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۷	۷۳۹	۱۰۳	۴۹%	۱۶۰	۲۱۰	+۳۱%	۴.۶	۳.۳	۳.۷	-۱.۱						
صنعتی	بنادرو کشتیرانی	حتاید	۱۲	۶.۰	۵۰۰	۶۲	۵۲%	۸۸	۱۰۷	+۲۱%	۵.۷	۴.۷	۴.۹	-۰.۲						
		حخر	۱۲	۵.۹	۱,۶۳۸	۲۰۷	۹۶%	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۵.۷	۳.۶	۵.۳	+۰.۱						
		حسینا	۱۲	۵.۱	۲,۰۴۵	۱۹۱	۸۹%	۲۸۸	۳۱۷	+۱۰%	۷.۱	۶.۲	۹.۵	+۰.۷						
	ترابری	حکهر	۱۲	۵.۷	۱,۲۸۱	۱۵۱	۳۸%	۱۹۶	۲۴۵	+۲۵%	۶.۵	۵.۱	۵.۳	+۱.۱						
		توریل	۱۲	۳.۷	۵۳۵	۴۳	۳۸%	۵۲	۶۷	+۲۹%	۱۰.۳	۸.۳	۸.۵	-۱.۰						
		حآفرین	۱۲	۲.۰	۲۶۴	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۴	۵.۸	۵.۱	-۵.۱						
		حپارسا	۶	۱.۶	۶,۲۰۵	۶۳۱	۸۹%	۸۰۱	۱,۱۱۷	+۳۹%	۷.۷	۶.۰	۵.۰	-۰.۳						
		حآسا	۱۲	۱.۵	۸۲۶	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۲.۴	۲۱.۶	۲۰.۶	-۰.۶						
	کالاهای سرمایه‌ای	سیم و کابل	بکابل	۱۲	۳.۶	۳,۵۴۰	۲۵۰	۶۱%	۵۵۷	۷۶۵	+۳۷%	۶.۴	۴.۶	۴.۸						
		محصولات فلزی	چدن	۱۲	۲.۸	۲۵۷	۳۳	۳۱%	۵۹	۵۶	-۵%	۴.۴	۴.۶	۳.۶	-۲.۸					
تولیدی	نرم افزار و خدمات	سیستم	۱۲	۱۸.۳	۱,۸۳۱	۸۳	۸۹%	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۱.۰	۲۶.۳	۲۸.۵	+۵.۶						

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

مقایسه ارزشیابی شرکت‌ها

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



ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

