

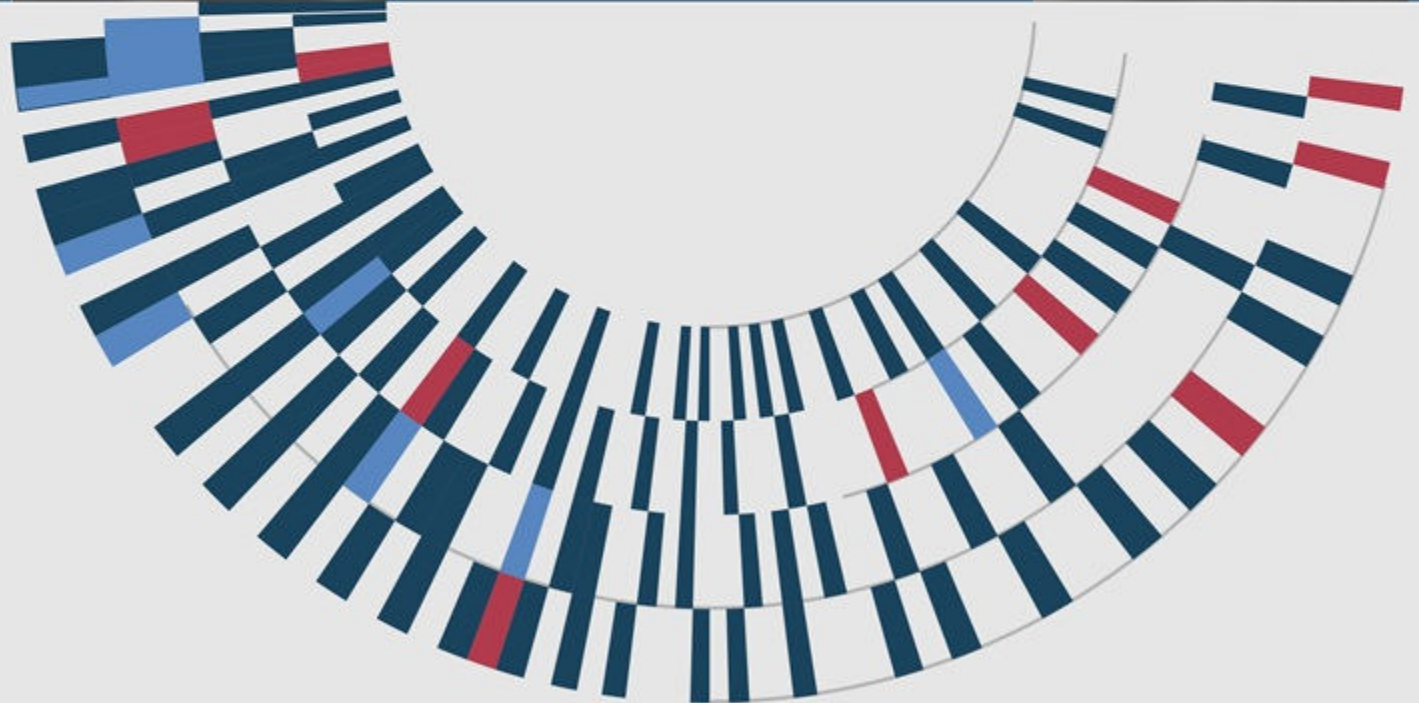
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲۲ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۰۵

 CHARISMA





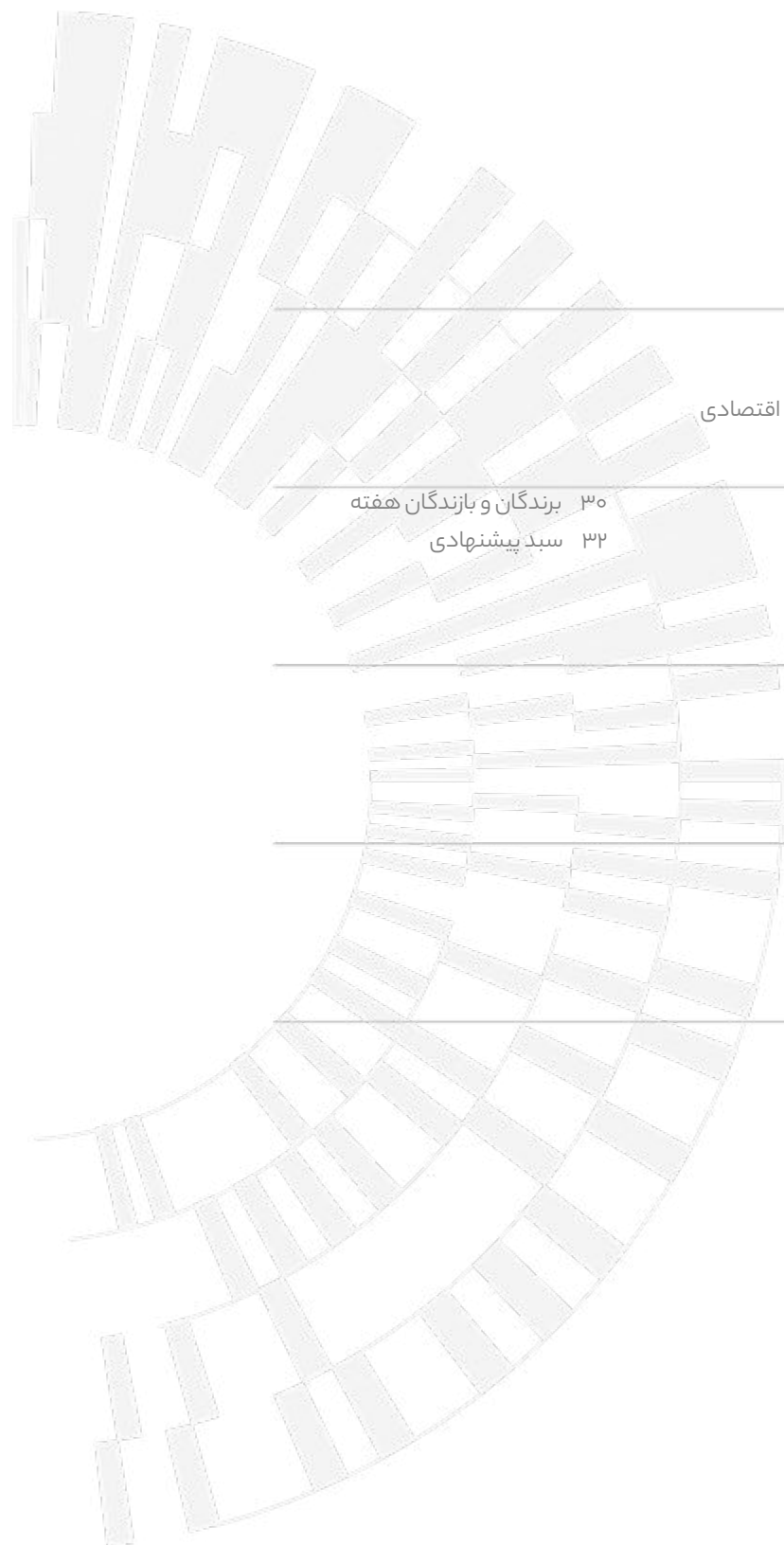
معرفی گزارش:

گزارش کاریزماتیک بازار سرمایه توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما با همکاری شرکت سرمایه‌گذاری کاریزما تهیه شده است. هدف از این گزارش بررسی تحولات بازار سرمایه ایران و متغیرهای موثر بر آن می‌باشد که علاوه بر آن بخش‌های تحلیل سهام، برآورد سود و تحلیل تکنیکال در گزارش پیش رو نیز منظور گردیده است. این گزارش هر هفته در منابع رسمی گروه مالی کاریزما منتشر شده و علاقه‌مندان می‌توانند از آن استفاده نمایند.

سلب مسئولیت:

محتوای این گزارش با رعایت بی‌طرفی، استقلال و دقت و بر اساس نظرات کارشناسان این مجموعه تدارک دیده شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما هیچ گونه تضمینی در مورد نتایج سرمایه‌گذاری بر مبنای این گزارش را ارائه نمی‌دهد. با وجود گردآوری بخش‌های مختلف، این گزارش به تنهایی نمی‌تواند تمامی ملاحظات لازم برای تصمیم‌گیری را فراهم نماید و صرف استفاده از این گزارش نباید مبنای خرید یا فروش هرگونه دارایی قرار گیرد. مدیریت سرمایه هر شخص باید بر اساس سطح ریسک‌پذیری، اهداف مالی، محدودیت‌ها، افق زمانی و سایر ویژگی‌های فردی صورت گیرد و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در قبال معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش انجام گیرد، مسئولیتی نمی‌پذیرد. گزارش پیش رو بر مبنای اطلاعات و داده‌های موجود در منابع متعددی تهیه شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

کلیه حقوق مادی و معنوی این گزارش متعلق به گروه مالی کاریزما می‌باشد.



۵۳	کامودیتی	۵۴ فلزات و معادن ۵۵ پتروشیمی ۵۶ انرژی و سایر محصولات ۵۷ گاز طبیعی	۵۹ سیمان ۱۰ اخبار و معیارهای تاثیرگذار ۱۲ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی
۱۲	بازار سهام	۱۴ مروری بر بازارهای موازی ۱۶ بررسی بلندمدت بازار سهام ۱۸ نرخ بهره و رونق بازار سهام ۱۹ ارزش معاملات	۲۰ ارزشگذاری بازار ۲۲ بازدهی صنایع ۲۳ ورود و خروج پول ۲۶ بازدهی صنایع
۳۱	تحلیل تکنیکال	۳۳ شاخص کل (بورس تهران) ۳۴ شاخص کل هم وزن (بورس تهران) ۳۵ شاخص هم وزن به شاخص کل (بورس تهران) ۳۶ نسبت شاخص کل به دلار آزاد	۳۷ دلار آمریکا (بازار آزاد) ۳۸ سکه امامی ۳۹ طلای جهانی ۴۰ نفت برنت
۴۱	اجماع تحلیل گران	۴۴ 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	۲,۰۰۶	۱.۴%	فزر	-	۲,۰۱۷۱,۶۸۱	۱۹%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۰۹۶	۱.۹%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳۹,۳۴۱	۰%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۲۳	۱.۷%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۴۲۴	-۶%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۶۹	۱.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳۳,۴۴۴	۱۵%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۰۷	۰.۶%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۱,۹۸۹۲,۲۷۳	۶%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۷۲۵	۱.۰%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۸۷۳۴,۸۴۳	۶۴%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۰۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۲۵۶۳,۶۲۵	۵۳%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۷۰	-۱.۱%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱۶۲۳	-۴%
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۲۲۵	-۱.۹%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۳,۷۳۴۲۲,۸۲۱	۴۰%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۶۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۳%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۲,۴۵۳۲۲,۰۸۰	۴۹%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۴۶	-۰.۳%	ذوب، کویر	فولای	۵۴۶۷۵۵	-۱۸%
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۳۵۴	-۰.۸%	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۳۰۰۲۴,۷۴۷	۴۹%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۵۵	-۴.۳%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۵۷۸۰	۵%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۰	-۳.۸%	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	۲%



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	۳۸۰	۷.۱%-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماش	شاروم، شفارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۵	۰.۷%-	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۷۰	۲.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۹	۱.۰%-	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۹۱	۳.۰%-	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۱	۲.۵%-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۶۶	۱.۱%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۵۰	-	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۰	۱.۲%-	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۳	۰.۲%-	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۰۲	۲.۱%-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۱۵	۱.۹%-	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۵	۰.۳%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۳۵	۰.۷%-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۷,۰۷۰	۳.۲%-	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۶۵	۳.۴%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۹۵	۲.۶%-	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

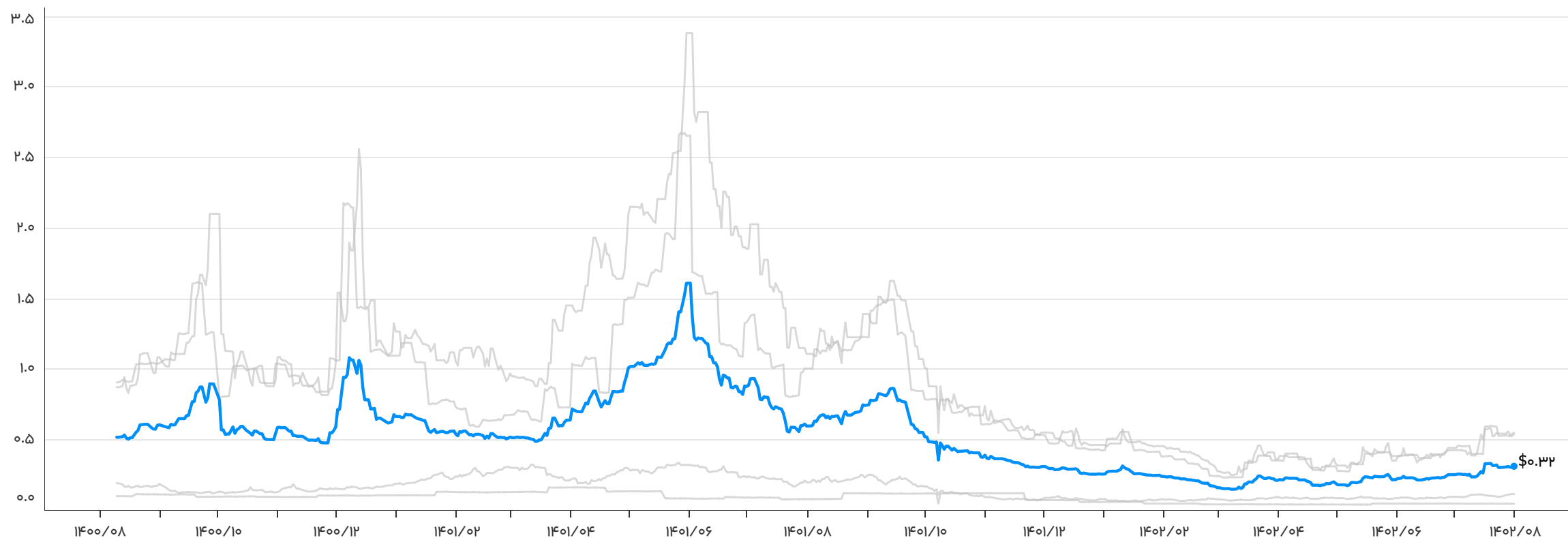
انرژی و فرآورده های نفتی	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره								روند قیمتی ۱۲ ماهه			
	عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده					
انرژی و فرآورده های نفتی	نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/ بشکه	۹۰	-۲.۴%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۲	۹۹		-۹%	
	نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/ بشکه	۸۵	-۳.۴%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۶	۹۳		-۸%	
	نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/ بشکه	۱۲۸	-۳.۹%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۹۷	۱۶۴		-۲۲%	
	گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/ بشکه	۱۱۹	-۳.۹%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۸۹	۱۴۹		-۲۰%	
	لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/ تن	۱۹,۳۰۴	-۴.۹%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	۱۰,۳۰۳	۲۱,۶۳۴		۷۶%	
	روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/ تن	۳۰,۱۰۳	-۱۰.۲%	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	۲۱,۷۹۵	۴۱,۳۶۵		۱۸%	
محصولات کشاورزی	قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/ تن	۱۴,۹۶۵	-	شپاس	-	۱۰,۴۰۰	۱۷,۱۴۰		۴۴%	
	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/ تن	۱۹۰	-۲.۸%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۸۷	۲۶۹		-۲۹%	
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/ تن	۷۸۱	-۰.۳%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸	۹۶۸		-۱۵%	
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/ تن	۱,۳۴۷	-۲.۵%	-	-	۱,۲۰۵	۱,۷۱۶		-۱۶%	
ارز و ارز دیجیتال	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/ تن	۲۱۲	-۱.۵%	-	-	۱۹۹	۳۱۱		-۳۲%	
	یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۶	-۰.۳%	-	-	۱.۰۰	۱.۱۲		۶%	
	پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۱	-۰.۳%	-	-	۱.۱۴	۱.۳۱		۷%	
ارز و ارز دیجیتال	بیتکوین	بایننس	دلار	۳۳,۷۷۳	۱۴.۰%	-	-	۱۶,۵۴۹	۳۳,۷۷۳		۶۰%	



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	۱۸.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۴۰%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	-۱.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۳۸%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۶	۱.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۶۳	-۵۰%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۵	۲.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۴۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۳۲	۲.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۸۷	-۴۷%

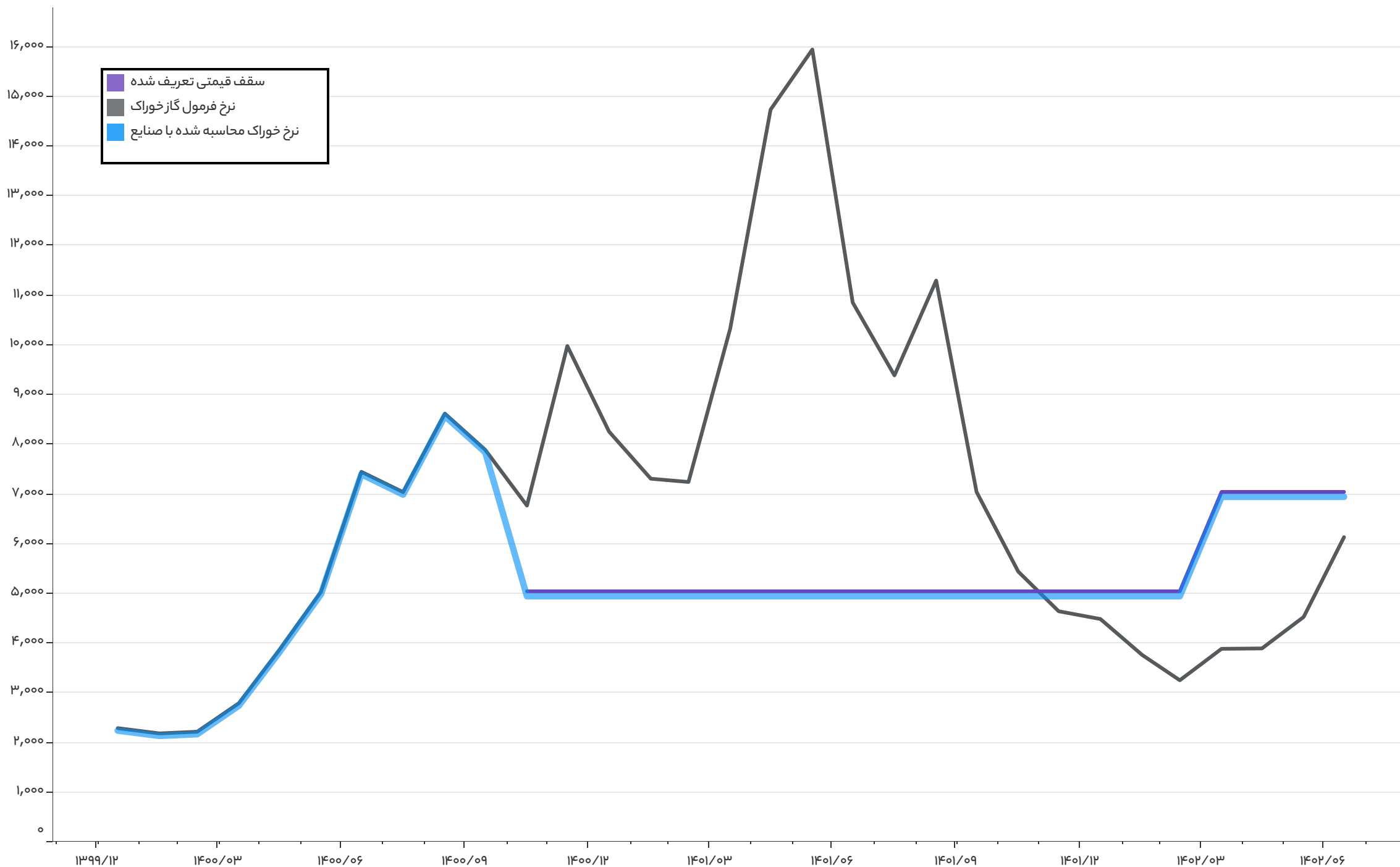
میانگین ۴ هاب گاز طبیعی

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



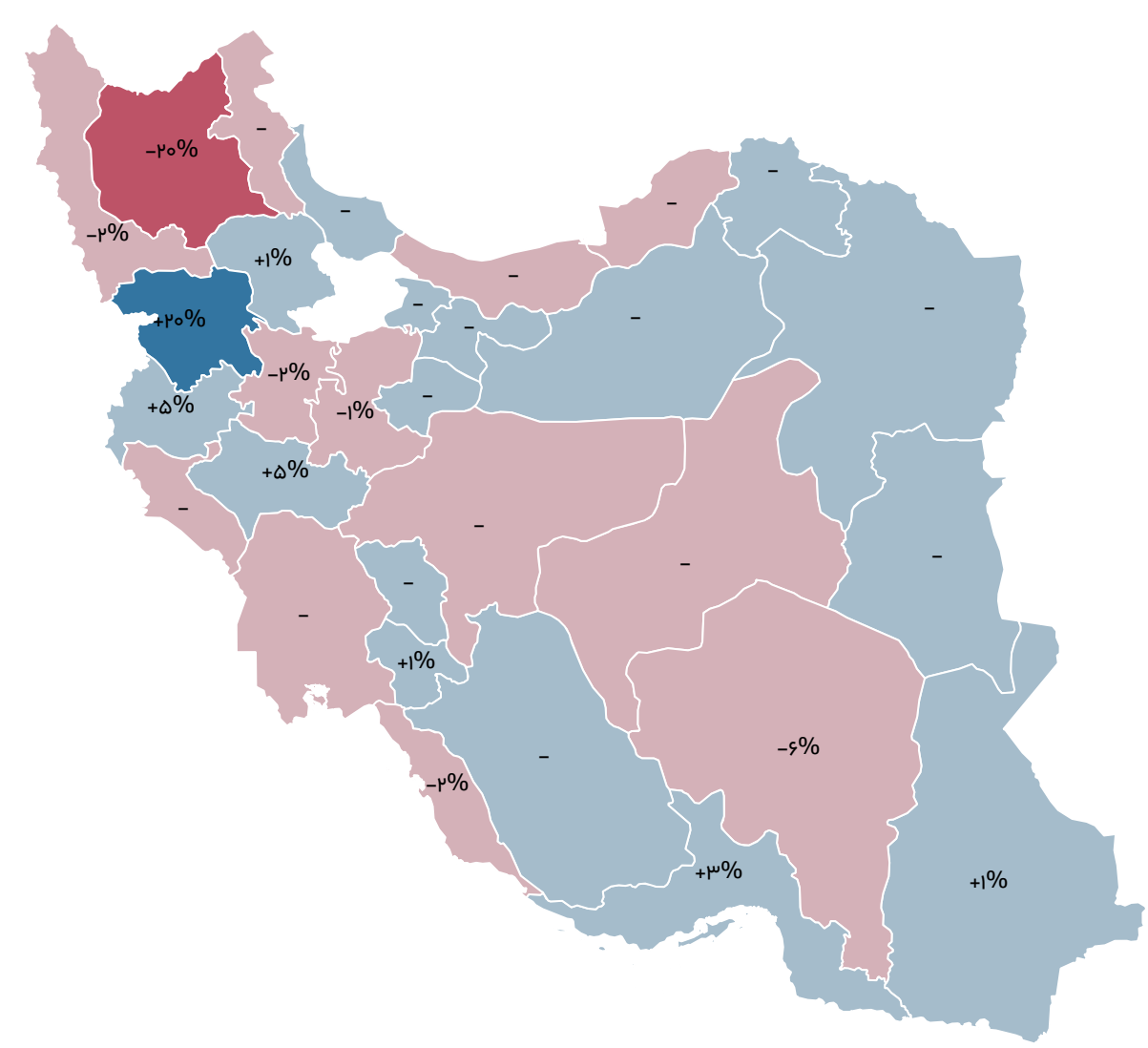
فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

نرخ بدست آمده از فرمول گاز خوراک در برابر نرخ خوراک محاسبه شده با صنایع پتروشیمی با اعمال سقف قیمتی، از ابتدای سال ۱۴۰۰، تومان



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	۹۱۸	۹۲۱	+۰%
	البرز	تومان/کیلو	۹۱۴	۹۱۴	+۰%
	اصفهان	تومان/کیلو	۹۱۱	۹۰۹	+۰%
	مرکزی	تومان/کیلو	۹۶۰	۹۵۲	-۱%
	قم	تومان/کیلو	۹۳۸	۹۳۸	+۰%
	سمنان	تومان/کیلو	۸۱۲	۸۱۲	+۰%
	یزد	تومان/کیلو	۷۰۷	۷۰۵	+۰%
جنوب	فارس	تومان/کیلو	۹۱۴	۹۱۷	+۰%
	هرمزگان	تومان/کیلو	۱,۰۵۱	۱,۰۷۷	+۳%
	بوشهر	تومان/کیلو	۱,۱۰۹	۱,۰۹۰	-۲%
غرب	خوزستان	تومان/کیلو	۸۸۴	۸۸۳	+۰%
	همدان	تومان/کیلو	۸۴۲	۸۲۸	-۲%
	ایلام	تومان/کیلو	۷۰۷	۷۰۶	+۰%
	چهارمحال و بختیاری	تومان/کیلو	۸۹۵	۸۹۵	+۰%
	کرمانشاه	تومان/کیلو	۸۶۱	۹۰۵	+۵%
	کهگیلویه و بویراحمد	تومان/کیلو	۸۹۲	۸۹۹	+۱%
	کردستان	تومان/کیلو	۹۳۹	۱,۱۲۹	+۲۰%
	لرستان	تومان/کیلو	۸۴۱	۸۸۴	+۵%
	آذربایجان غربی	تومان/کیلو	۸۸۲	۸۶۳	-۲%
	اردبیل	تومان/کیلو	۱,۱۱۷	۱,۱۱۴	+۰%
شمال غرب	زنجان	تومان/کیلو	۸۸۸	۹۰۱	+۱%
	آذربایجان شرقی	تومان/کیلو	۱,۲۹۷	۱,۰۳۸	-۲۰%
	مازندران	تومان/کیلو	۸۹۰	۸۸۸	+۰%
شمال	گیلان	تومان/کیلو	۶۸۴	۶۸۴	+۰%
	گلستان	تومان/کیلو	۷۴۰	۷۳۷	+۰%
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	۹۹۸	۹۳۸	-۶%
	سیستان و بلوچستان	تومان/کیلو	۷۹۵	۸۰۴	+۱%

* 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.

اخبار و معیارهای تاثیرگذار

معادن و فزانات

▲ طلای جهانی در روز شنبه، برای اولین بار از ماه آگوست، در حالی که سرمایه‌گذاران منتظر سخنرانی جروم پاول، رئیس فدرال رزرو آمریکا بودند، به دلیل تشدید ناآرامی‌های خاورمیانه و افزایش تقاضا برای این دارایی امن، نزدیک به بالاترین حد خود، یعنی ۲۰۰۰ دلار، در ۲۰ ماه گذشته رسید. طلا که اغلب به عنوان ذخیره ایمن ارزش در زمان عدم اطمینان سیاسی و مالی مورد استفاده قرار می‌گیرد، از زمان سقوط به پایین‌ترین سطح هفت ماهه در اکتبر، بیش از ۱۳۰ دلار یا نزدیک به ۸ درصد افزایش یافته است. طبق گزارش رویترز، نرخ‌های بهره بالاتر، هزینه فرصت طلای بدون بازده به قیمت دلار را افزایش می‌دهد.

▼ قیمت نفت پس از این که دومین رشد هفتگی متوالی را به ثبت رساند، در روز دوشنبه بیش از یک دلار کاهش را تجربه کرد. به گزارش رویترز، افزایش تلاش‌های دیپلماتیک برای آرام کردن تنش‌های خاورمیانه باعث این کاهش قیمت شده است. البته همچنان نگرانی در مورد گسترش این درگیری در منطقه نفت‌خیز خاورمیانه و کمبود عرضه ادامه دارد. همچنین رویترز بخشی از علت این کاهش قیمت را آزاد کردن دو گروگان آمریکایی توسط حماس دانست. این اقدام حماس تا حدی حساسیت را از روی بازار برداشت و امید به خروج از این بحران را افزایش داد.

▲ آژانس بین‌المللی انرژی در جدیدترین گزارش سالانه دورنمای انرژی جهان، اعلام کرد انتظار دارد تقاضا برای گاز در همه سناریوهای پیش‌بینی این آژانس، تا سال ۲۰۳۰ به اوج خود برسد و پس از آن، فضای اندکی برای رشد تجارت ال‌ان‌جی یا گاز خط لوله‌ای وجود داشته باشد. در گزارش آژانس بین‌المللی انرژی آمده است: فرصت‌های بسیار محدودی برای روسیه به منظور یافتن بازارهای بیشتر وجود دارد. در نتیجه، حتی با وجود تلاش‌های روسیه برای یافتن بازار در آسیا، همچنان این کشور در آینده با دشواری‌های بزرگی مواجه خواهد بود. در حالی که شرکت گازپروم روسیه اوایل ماه میلادی جاری، اعلام کرد صادرات گاز از طریق خط لوله به چین در آینده نزدیک، به سطح مشابه صادرات این شرکت به اروپای غربی خواهد رسید.

✓ شرکت انی ایتالیا یک قرارداد ۲۷ ساله برای خرید گاز طبیعی مایع (ال‌ان‌جی) با شرکت «قطر انرژی» امضا کرد. این سومین قرارداد انرژی است که شرکت «قطر انرژی» پس از قرارداد با توتال انرژی فرانسه و شل، امضا می‌کند. همزمان با آماده شدن اروپا برای دومین زمستان بدون واردات گاز روسیه، شرکت‌های انرژی بزرگ اروپایی، بعضی از طولانی‌مدت‌ترین و بزرگترین قراردادهای خرید ال‌ان‌جی را منعقد می‌کنند. پس از حمله نظامی روسیه به اوکراین که بازارهای انرژی را ملتهب کرد، کشورهای اروپایی، امنیت تامین انرژی را نسبت به اهداف انرژی سبز در اولویت قرار دادند و در نتیجه، قراردادهای بلندمدت خرید ال‌ان‌جی از قطر، جذاب‌تر شده اند. قطر که با آمریکا و استرالیا بر سر جایگاه بزرگترین صادرکننده ال‌ان‌جی جهان رقابت دارد، ده‌ها میلیارد دلار برای افزایش تولید به میزان ۶۴ درصد تا سال ۲۰۲۷، سرمایه‌گذاری کرده و به دنبال یافتن مشتری است.

✓ بیست و دومین نشست شورای نخست‌وزیران کشورهای عضو پیمان شانگهای، پنج‌شنبه چهارم آبان‌ماه در بیشکک قرقیزستان برگزار شد. معاون اول رئیس‌جمهوری به همراه تعدادی از همراهان، افزون بر حضور در برنامه‌های اصلی این نشست در حاشیه آن نشست‌هایی دوجانبه نیز با اعضای حاضر پیرامون همکاری‌های متقابل داشت که دیدار با نخست‌وزیران روسیه، قرقیزستان، تاجیکستان و وزیر امور خارجه پاکستان از جمله آنهاست. در این نشست، قرقیزستان خواهان تأمین فرآورده‌های نفتی مورد نیاز به‌ویژه بنزین، نفت‌گاز، سوخت‌جت، نفت سفید و قیر از سوی ایران شد. همچنین قرقیزستان در این دیدار خواستار مشارکت ایران به‌ویژه وزارت نفت برای مدرن‌سازی، تعمیرات اساسی و بازسازی یکی از پالایشگاه‌های این کشور شد.

✓ به گزارش اینترفاکس، معاون «ترکمن گاز» در حاشیه کنفرانس بین‌المللی گاز و نفت در ترکمنستان اعلام کرد: این کشور در نظر دارد که طی سواب گازی که با ایران به توافق رسیده است سالانه ۹ میلیارد مترمکعب گاز به عراق صادر کند. در این گزارش آمده است که ترکمنستان در حال حاضر به آذربایجان از طریق ایران گاز سواپ می‌کند که مقامات نفتی ایران اعلام کرده‌اند که گازی که ایران از ترکمنستان دریافت می‌کند طبق قرارداد ۴۰۵ میلیون متر مکعب در روز بوده که اکنون به ۸ میلیون متر مکعب در روز افزایش یافته است. سفیر ایران در ترکمنستان هم در ماه دسامبر اعلام کرد که حتی ظرفیت ارسال ۲۰ میلیون متر مکعب گاز از ترکمنستان به ایران وجود دارد.

✓ داود منظور رئیس سازمان برنامه و بودجه در حاشیه جلسه هیئت دولت در جمع خبرنگاران درباره ناترازی در رقم بودجه سال جاری اظهار داشت: در پیش‌بینی در قانون بودجه و کمیسیون‌های مجلس در سال گذشته، قیمت نفت ۸۵ دلار فرض شده است که در خیلی از ماه‌های سال این رقم اتفاق نمی‌افتد و میزان صادرات هم بالاتر از ظرفیت قابل تحقق در نظر گرفته شده است لذا در بخش فروش نفت عدم تحقق داشتیم. همچنین وی افزود: ناترازی در بخش درآمدهای نفتی ۴۰ درصد بیش برآورد داشت و با ابزارهایی که در اختیار داریم، از جمله ابزار تخصیص، به دنبال رفع ناترازی هستیم.

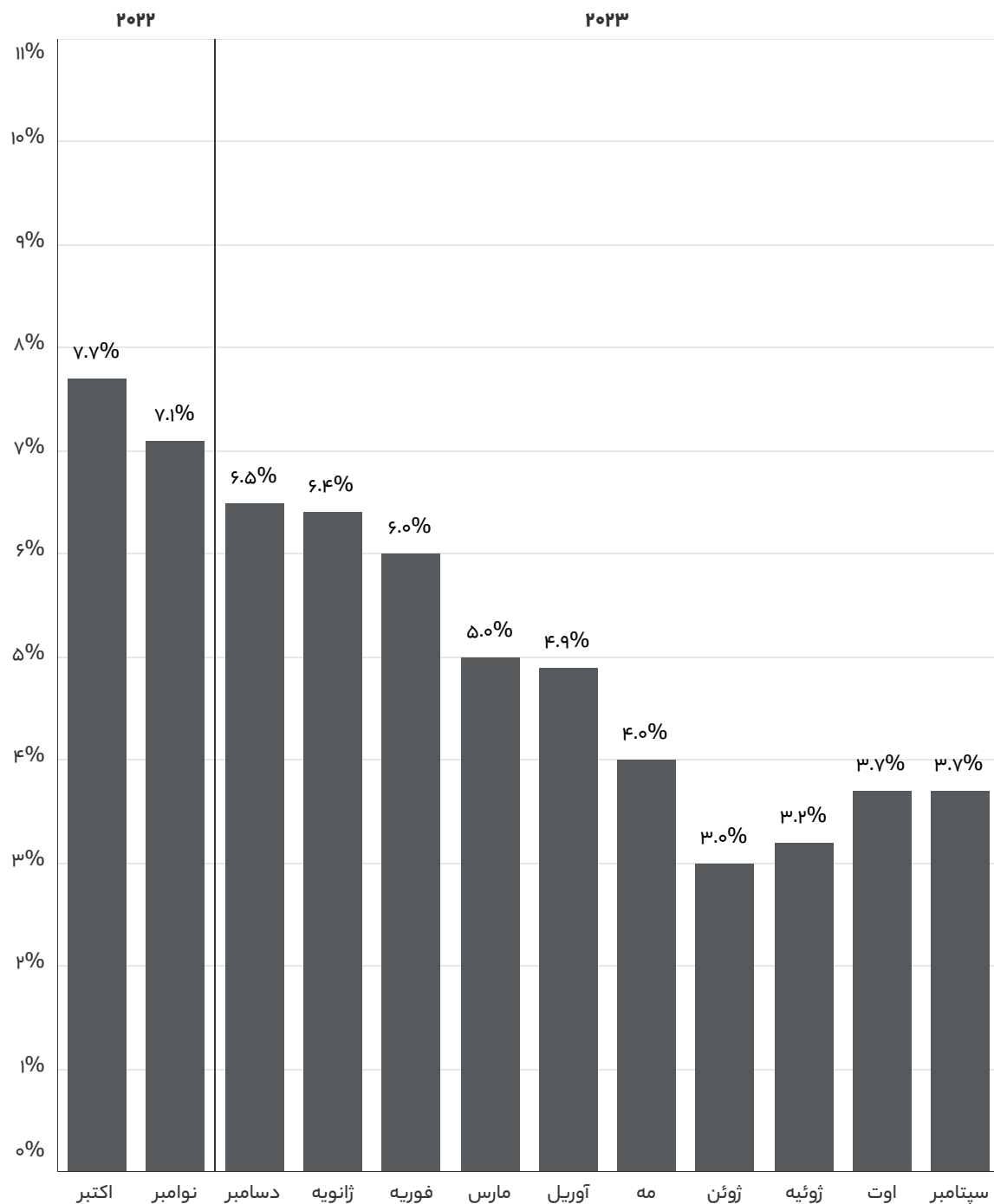
✓ مدیر هماهنگی امور گازرسانی شرکت ملی گاز ایران با بیان اینکه امسال هم شاهد ناترازی بین تولید و مصرف گاز هستیم، گفت: این مشکل همچنان وجود خواهد داشت. مسلم رحمانی، مدیر هماهنگی امور گازرسانی شرکت ملی گاز ایران در نشست هم‌اندیشی مدیران ارشد ستادی، مدیران عامل و مدیران بهره‌برداری شرکت‌های گاز استانی کشور، افزود: سال ۱۴۰۱ زمستان بسیار سختی را برای کارکنان شرکت گاز داشتیم، اما با اقدامات وزارت نفت و همراهی و همدلی مردم توانست عملیات اجرای کنترل تولید، انتقال و مصرف را با موفقیت انجام دهد. رحمانی عنوان کرد که به دلیل ناترازی بین تولید و مصرف در زمستان ۱۴۰۲ نیز لازم است که مصرف بهینه و مدیریت مصرف توسط مردم رعایت شود.

✓ مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی از سر به سر شدن تولید و مصرف بنزین خبر داد. جلیل سالاری، مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی در جمع خبرنگاران، اظهار داشت: متوسط مصرف بنزین در سال جاری به ۱۱۶ میلیون لیتر در روز رسیده که امیدواریم روند کاهشی مصرف ادامه داشته باشد. وی ادامه داد: میزان تولید فعلی بنزین به طور متوسط ۱۱۵ میلیون لیتر در روز است و در شرایط سربه‌سری تولید و مصرف بنزین هستیم.

انرژی

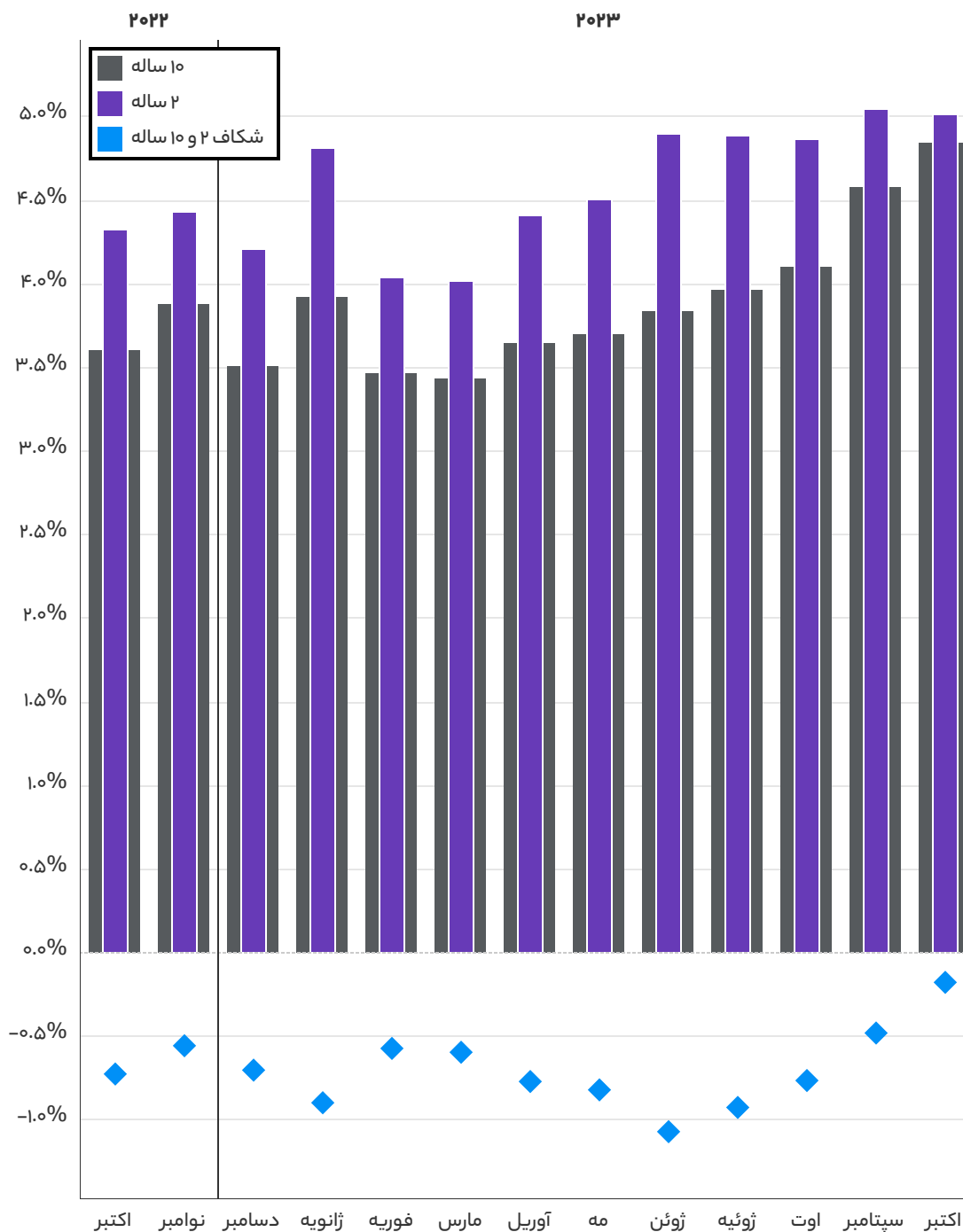
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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



شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

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



بازار سهام

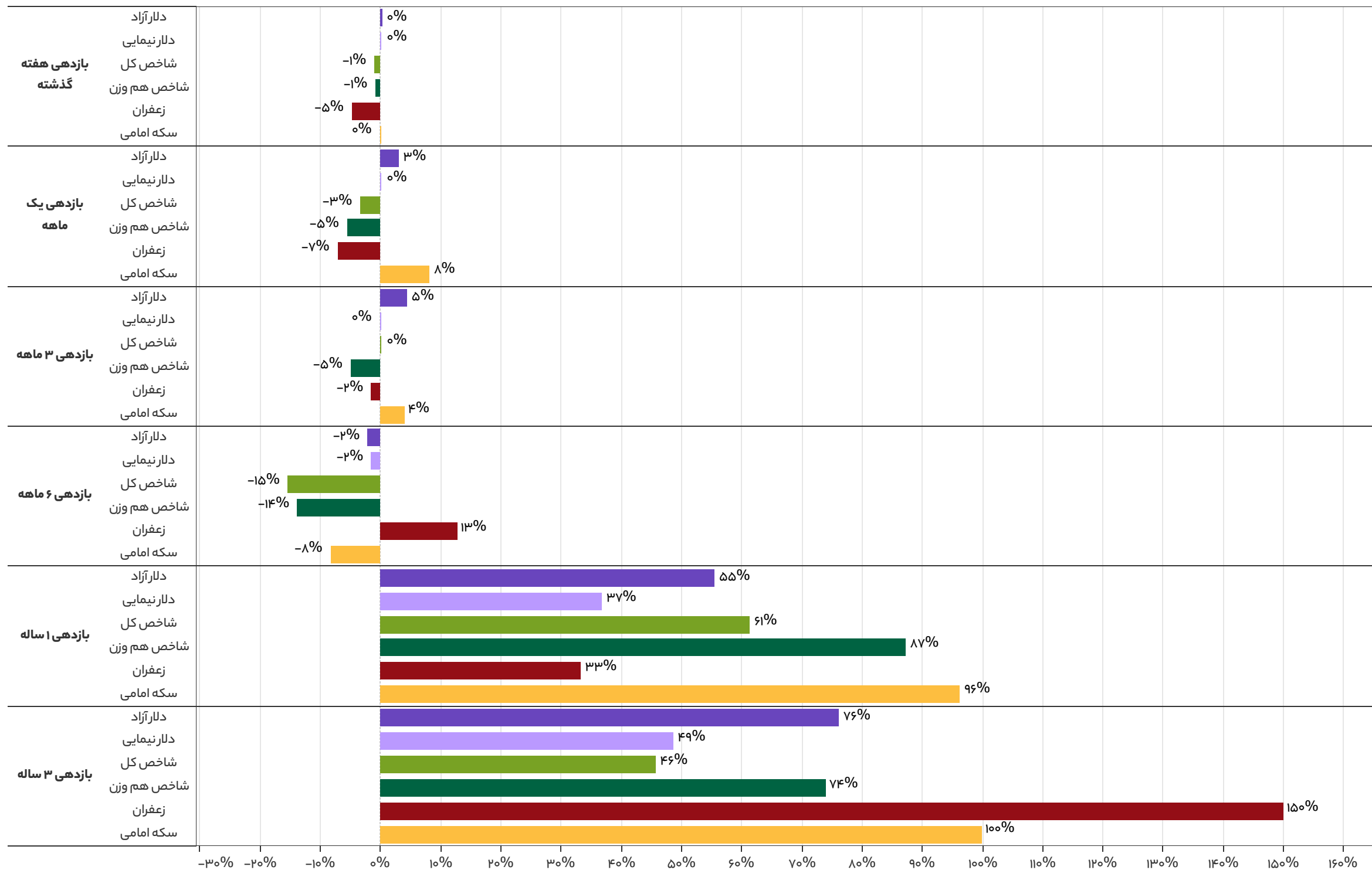
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها در بازه‌های زمانی متفاوت





بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

بازدهی دارایی‌های مختلف، طی یکسال گذشته به صورت ماهانه، مرتب شده براساس بازده درهرماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۰۳	۱۴۰۱/۰۴	۱۴۰۱/۰۵	۱۴۰۱/۰۶	۱۴۰۱/۰۷	۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	هم وزن	سکه امامی
سکه امامی ▲ ۱۰.۰%	زعفران ▲ ۹.۶%	مسکن ▲ ۲.۵%	دلار آزاد ▲ ۸.۰%	سکه امامی ▲ ۴.۴%	سکه امامی ▲ ۸.۹%	سکه امامی ▲ ۱۴.۷%	سکه امامی ▲ ۲۶.۵%	سکه امامی ▲ ۲۲.۲%	شاخص کل ▲ ۲۷.۹%	هم وزن ▲ ۳۰.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	هم وزن ۴۳%	سکه امامی ▲ ۱۱۱.۰%
مسکن ▲ ۸.۴%	مسکن ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۲.۴%	سکه امامی ▲ ۵.۷%	دلار آزاد ▲ ۳.۱%	دلار آزاد ▲ ۸.۲%	دلار آزاد ▲ ۱۲.۰%	هم وزن ▲ ۱۸.۱%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	هم وزن ▲ ۲۲.۸%	شاخص کل ▲ ۱۸.۶%	دلار نیمایی ▲ ۲.۹%	شاخص کل ۳۹%	دلار نیمایی ▲ ۸۴.۸%
زعفران ▲ ۵.۸%	دلار نیمایی ▲ ۴.۶%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	شاخص کل ▲ ۷.۶%	هم وزن ▲ ۱۰.۲%	شاخص کل ▲ ۱۲.۹%	زعفران ▲ ۱۴.۵%	دلار نیمایی ▲ ۱۸.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱۰.۲%	سکه امامی ▲ ۲.۶%	سکه امامی ۳۸%	هم وزن ▲ ۸۲.۵%
دلار آزاد ▲ ۴.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	هم وزن ▼ ۱.۶%	مسکن ▲ ۱.۱%	دلار نیمایی ▲ ۱.۲%	مسکن ▲ ۶.۸%	شاخص کل ▲ ۶.۲%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	مسکن ▲ ۳.۳%	سکه امامی ▲ ۱۶.۶%	دلار آزاد ▲ ۳.۷%	دلار آزاد ▲ ۲.۴%	زعفران ۲۶%	دلار آزاد ▲ ۶۸.۰%
درآمد ثابت ▲ ۱.۷%	دلار آزاد ▲ ۰.۷%	شاخص کل ▼ ۳.۲%	دلار نیمایی ▲ ۱.۰%	مسکن ▲ ۱.۲%	هم وزن ▲ ۶.۷%	زعفران ▲ ۳.۱%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	مسکن ▲ ۳.۳%	مسکن ▲ ۳.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار آزاد ۲۱%	شاخص کل ▲ ۴۸.۲%
دلار نیمایی ▼ ۰.۶%	شاخص کل ▼ ۴.۴%	دلار آزاد ▼ ۷.۹%	هم وزن ▼ ۰.۴%	زعفران ▲ ۰.۰%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	مسکن ▲ ۲.۹%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	دلار نیمایی ▼ ۰.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۶%	دلار نیمایی ۱۹%	مسکن ▲ ۴۵.۳%
شاخص کل ▼ ۲.۵%	سکه امامی ▼ ۴.۴%	سکه امامی ▼ ۸.۴%	شاخص کل ▼ ۴.۹%	شاخص کل ▼ ۳.۴%	دلار نیمایی ▲ ۱.۵%	دلار نیمایی ▲ ۲.۷%	دلار نیمایی ▲ ۱.۳%	شاخص کل ▼ ۹.۲%	زعفران ▲ ۰.۸%	زعفران ▼ ۰.۱%	هم وزن ▲ ۰.۵%	مسکن ۸%	درآمد ثابت ▲ ۳۷.۶%
هم وزن ▼ ۳.۸%	هم وزن ▼ ۴.۶%	زعفران ▼ ۹.۰%	زعفران ▼ ۱۴.۵%	هم وزن ▼ ۴.۲%	زعفران ▼ ۲.۳%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۰%	هم وزن ▼ ۹.۴%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	سکه امامی ▼ ۶.۳%	شاخص کل ▼ ۲.۰%	درآمد ثابت ۱%	زعفران ▲ ۲.۸%

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

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

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

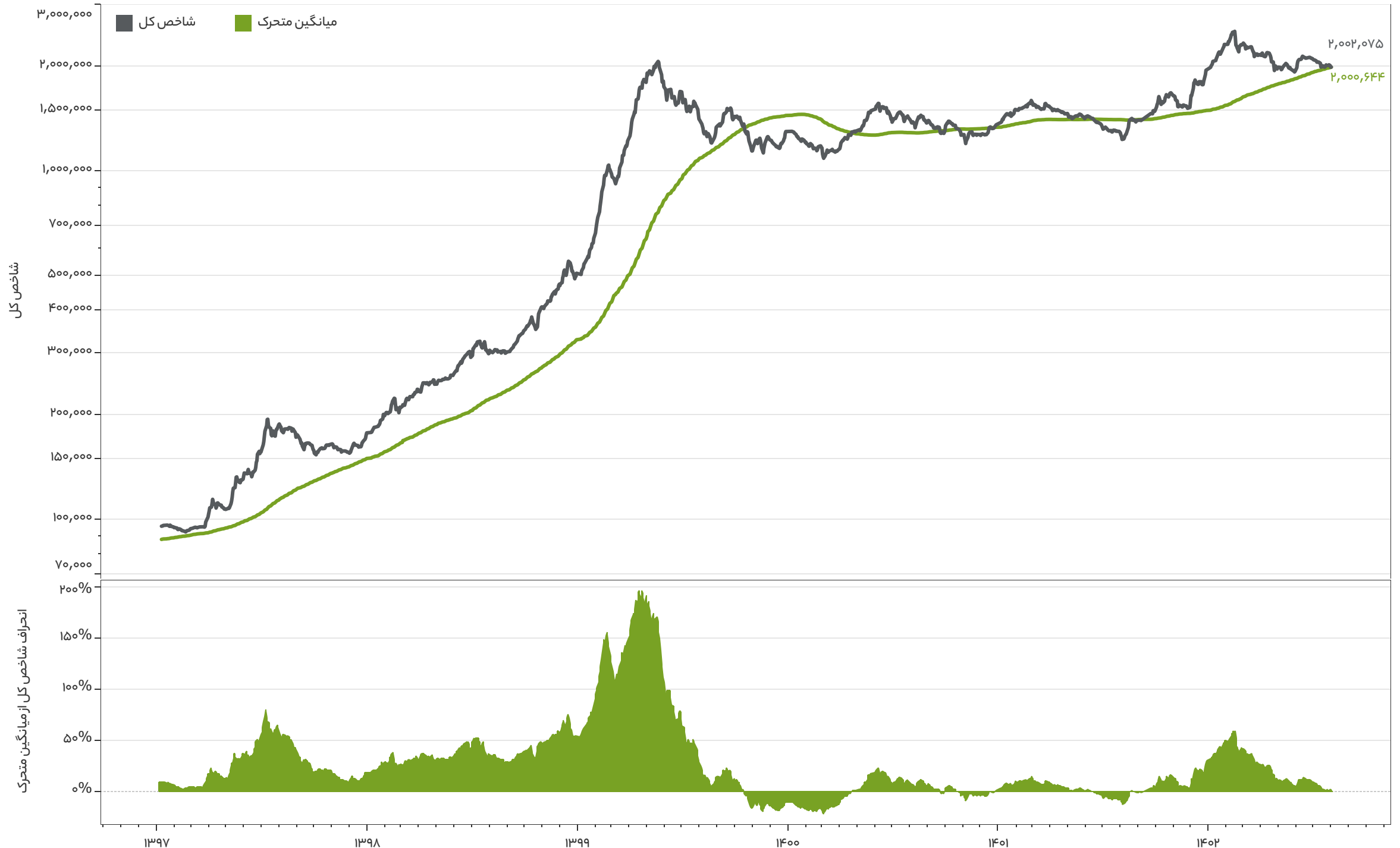
ارزش دلاری بازار

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



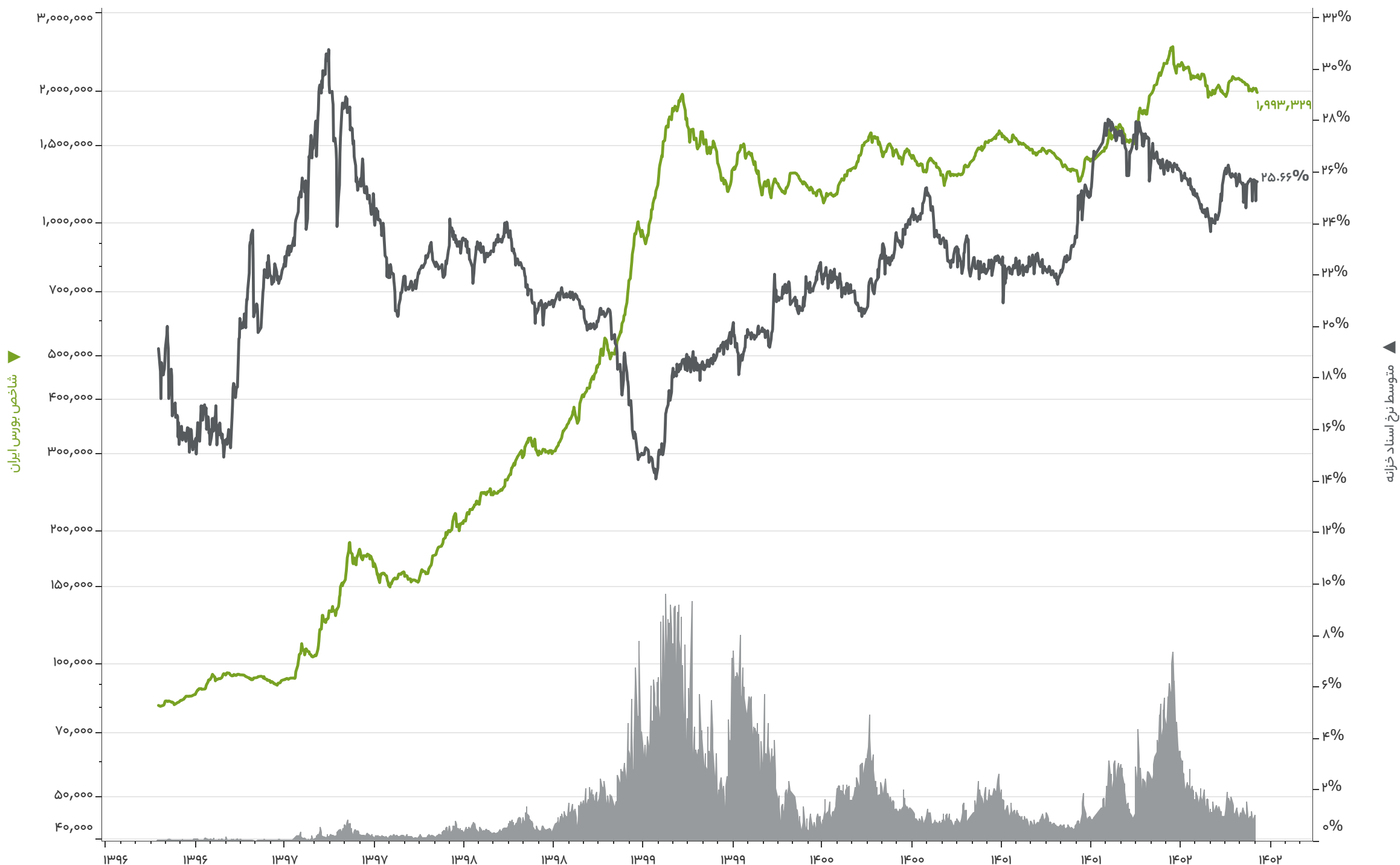
شاخص کل و میانگین متحرک

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



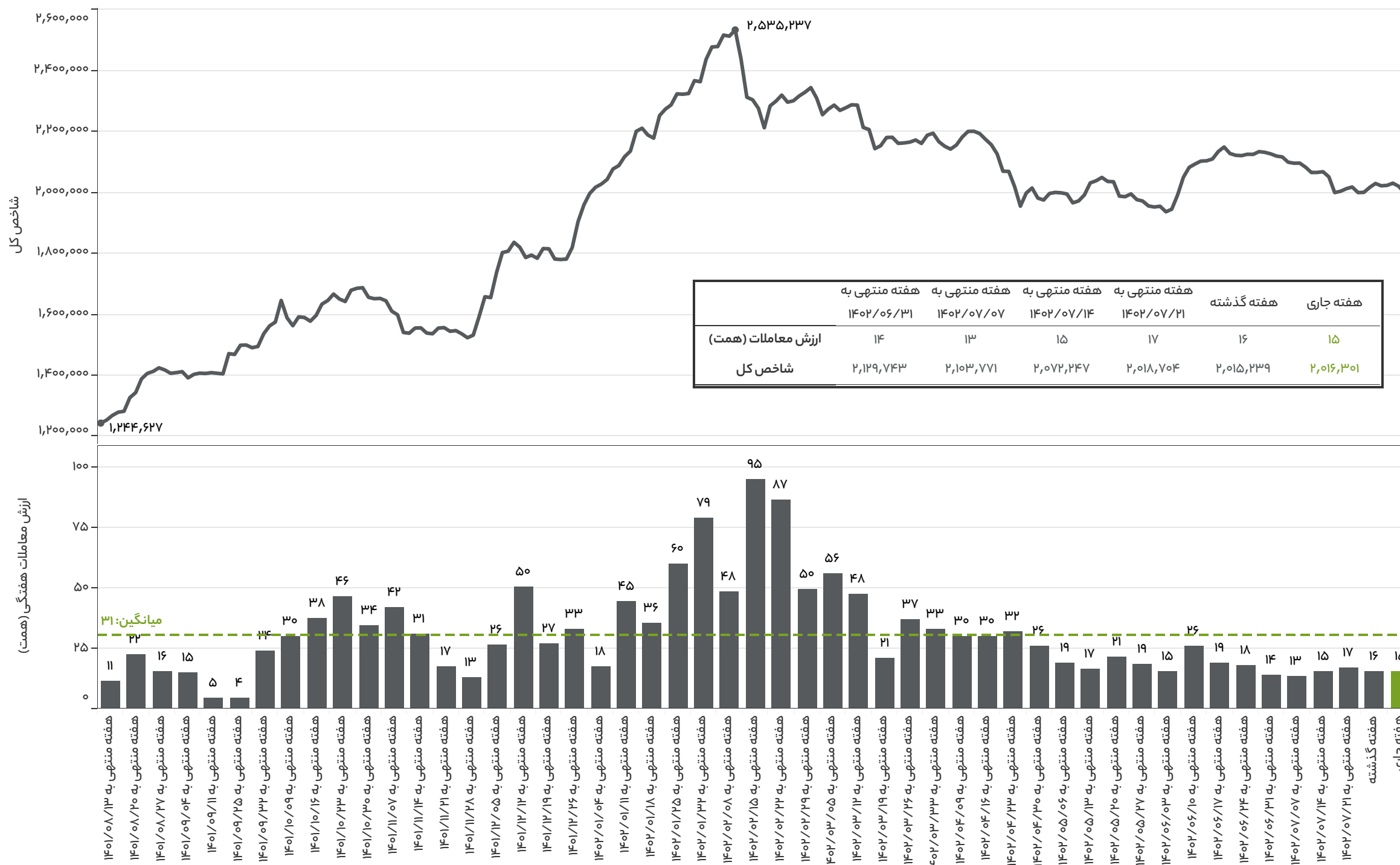
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



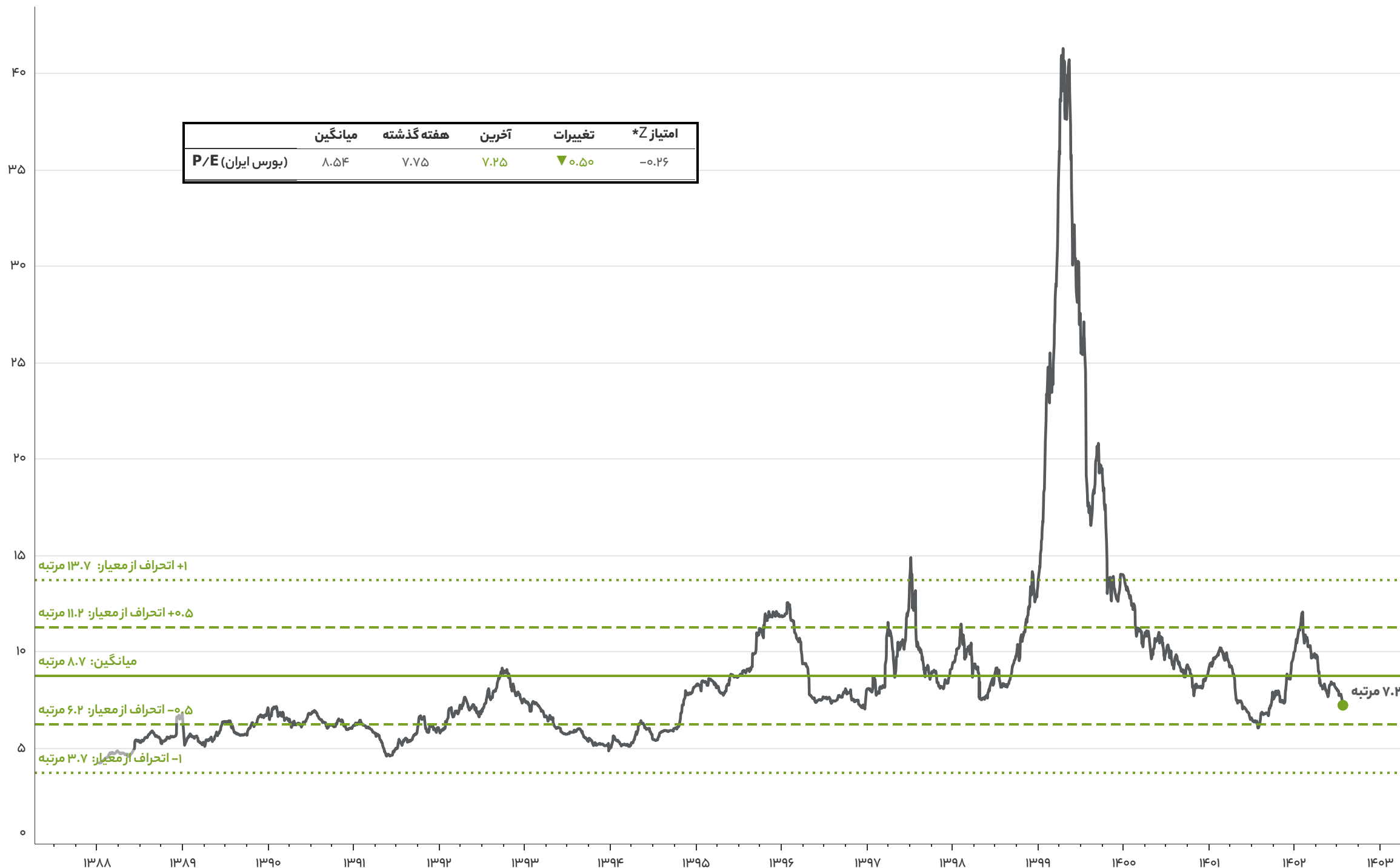
ارزش معاملات هفتگی بازار

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



نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

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



*امتیاز Z یا امتیاز استاندارد تفاوت آخرین عدد برای نسبت قیمت به سود را بر حسب انحراف از معیار محاسبه می‌نماید که در اینجا می‌تواند یک معیار برای سنجش گران یا ارزان بودن بازار نسبت به میانگین باشد.

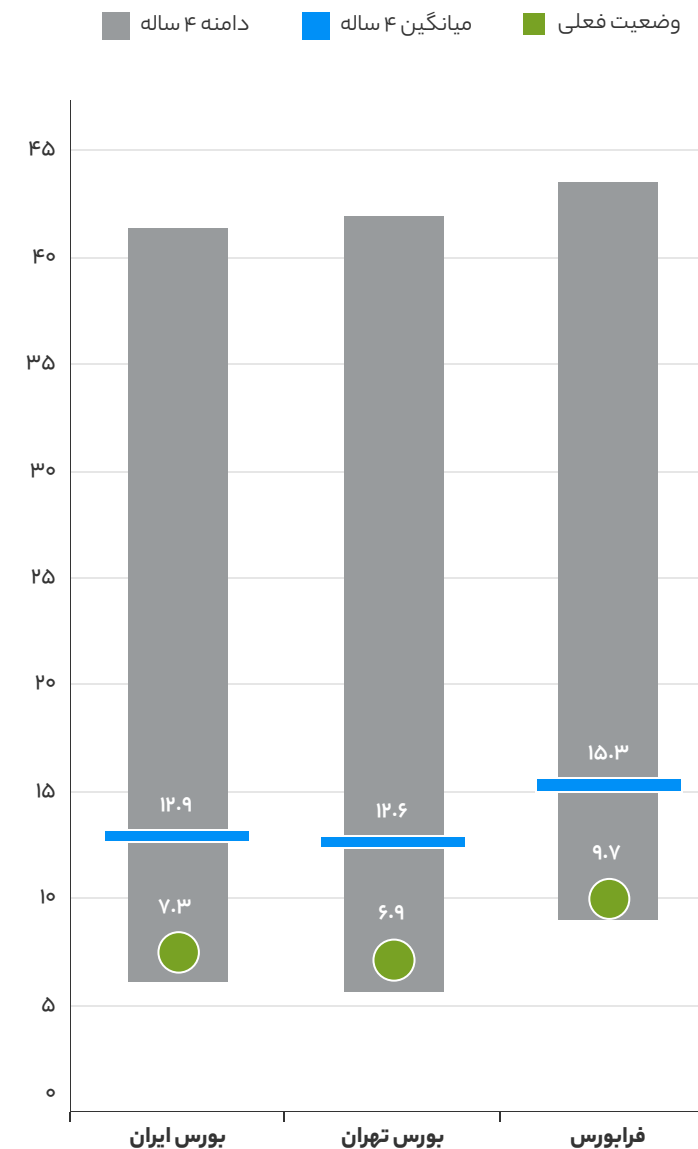
ارزش نسبی فرابورس به بورس

نسبت پی به ای فرابورس به بورس تهران، گذشته نگر، ۴ سال گذشته، بزرگنمایی شده



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۲۵	۷.۷۵	۶.۰۷	۱۲.۸۹	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۹۰	۷.۴۴	۵.۶۴	۱۲.۶۵	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۶۶	۹.۸۳	۹.۰۳	۱۵.۳۱	۴۳.۵۱

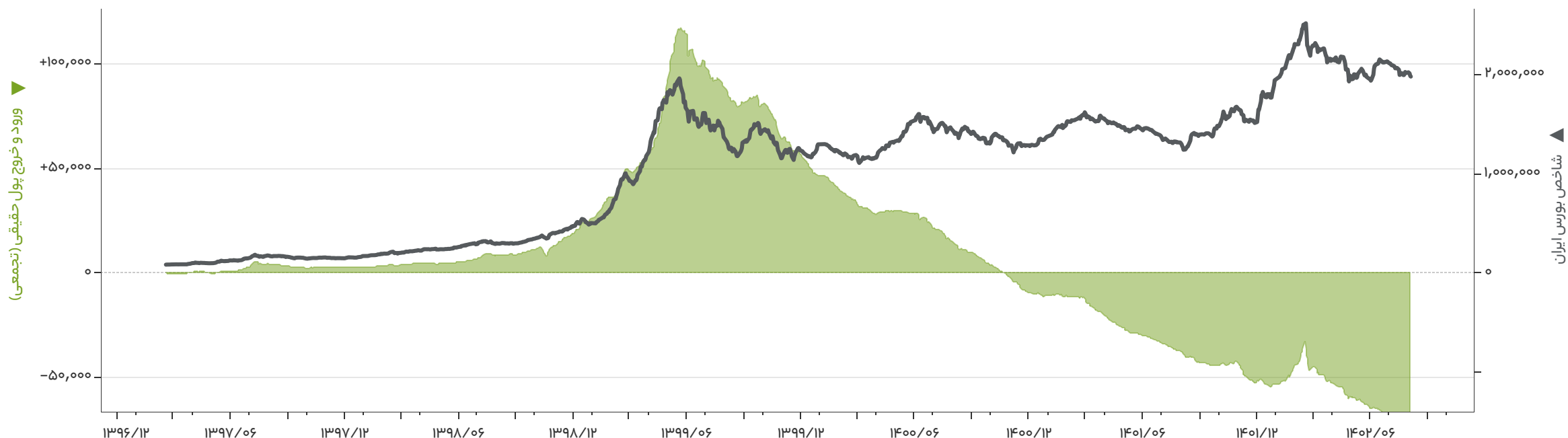
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای	مصرفی دوره‌ای	انرژی	مواد پایه	خدمات مالی	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۵	۱۹	۳۱	۶۲	۸۹	۶۵	۶	۱۸۹	۱۹۹	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۴۶	۸۷	۹۴	۱۱۱	۱۴۸	۱۷۷	۲۰۶	۳۴۱	۶۱۰	۳,۰۹۶	۳,۱۰۴	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۱%	۱.۲%	۱.۴%	۱.۸%	۲.۲%	۲.۶%	۴.۳%	۷.۶%	۳۸.۶%	۳۸.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۰.۳	۶.۸	۱۰.۰	۱۹.۷	۸.۲	۹.۶	۱۰.۵	۵.۰	۴.۸	۷.۳	۶.۹	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۵%	۱۷.۳%	۴.۲%	۲.۷%	۷.۲%	۵.۰%	۴.۵%	۲.۶%	۱۵.۰%	۹.۷%	۹.۷%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۶%	۳۷%	۵۴%	۳۳%	۶۳%	۷۲%	۶۲%	
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)	+۵۰۸%	+۸۰۷%	+۹۲%	+۲۶۸%	+۳۵۹%	+۳۵۷%	+۴۱۰%	+۷۷۹%	+۷۸۰%	+۸۶۰%	+۷۹۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۵%	+۱۲۲%	-۶۹%	-۵%	+۹%	-۲۱%	-۴%	-۲۱%	+۱۴%	+۵۰%	-۷%	
بازده از ابتدای سال	+۱۷۱%	+۴۶%	+۲۳%	+۵۸%	+۸۳%	+۷۶%	+۵۰%	+۷۴%	+۸۷%	+۶۷%	+۵۵%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۲%	-۱%	-۲%	۱%	-۳%	-۲%	-۱%	-۳%	-۳%	-۱%	-۲%	



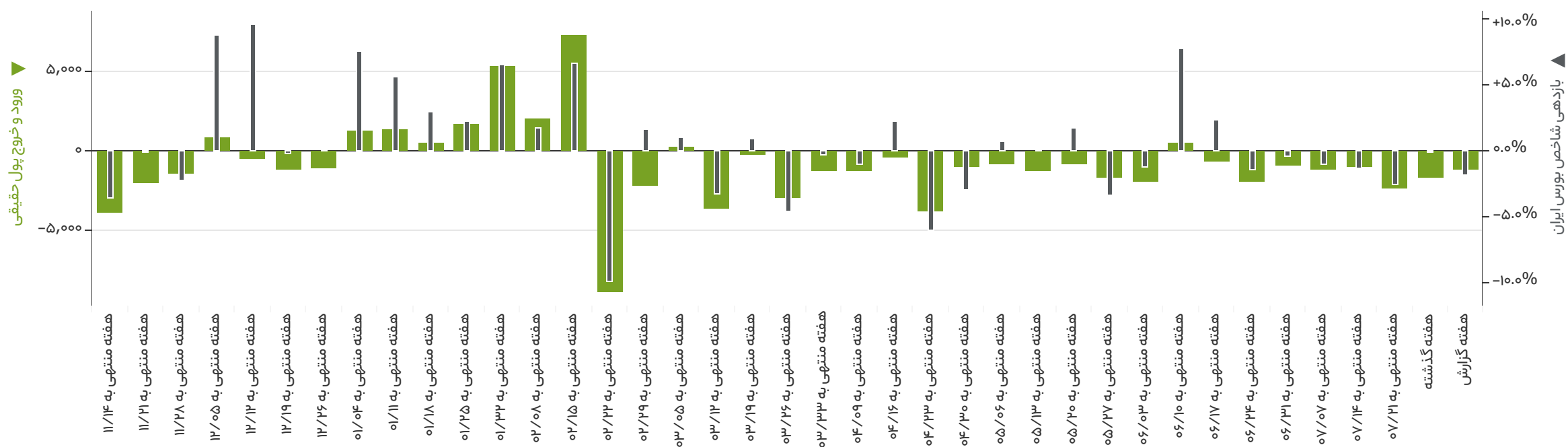
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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

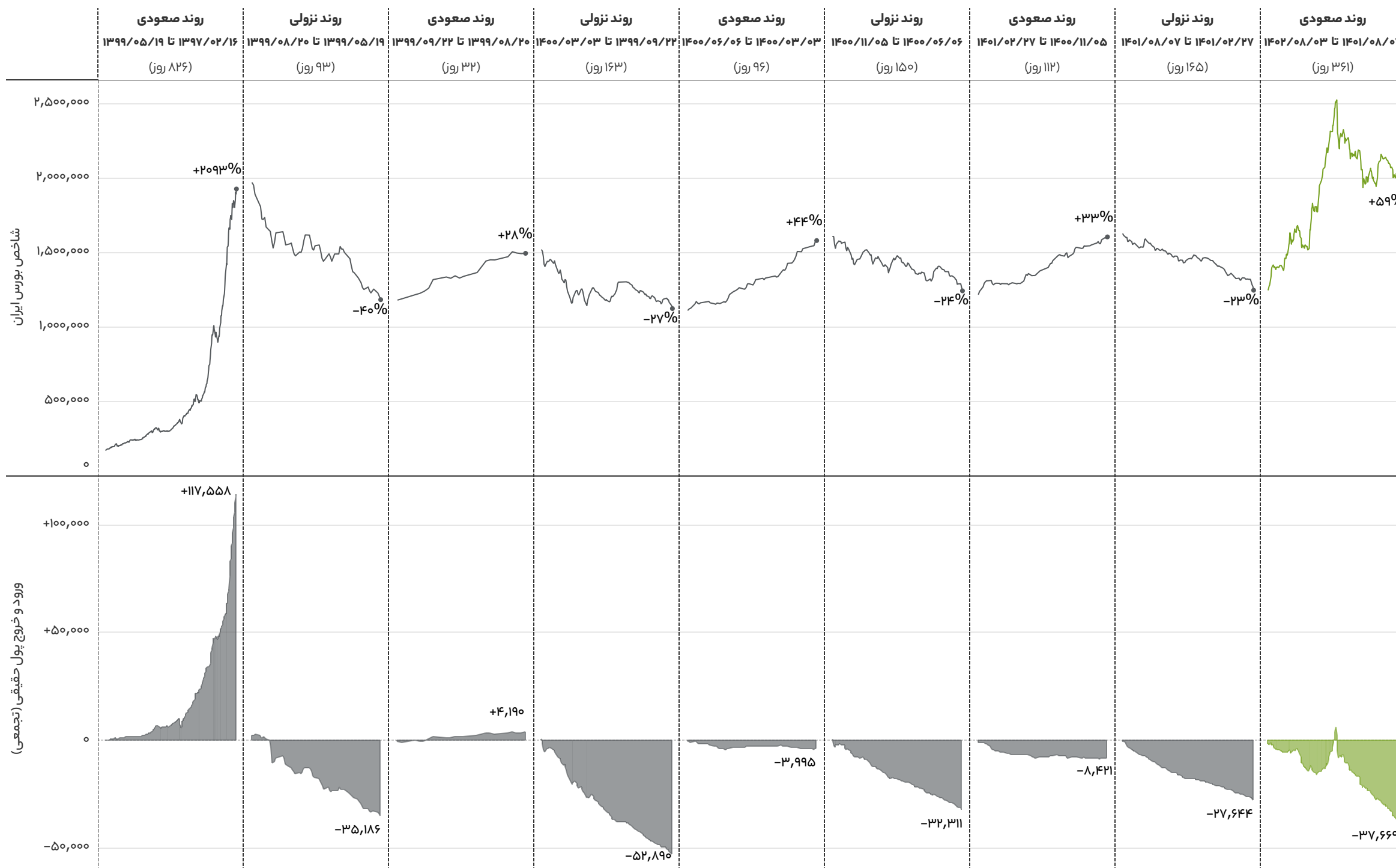
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





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 یول حقیقی

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

ارزش بازار			ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
نماد	صنعت	(م.م.ت)		
بیشترین ورود پول حقیقی	حفاری	۵		+۸۳
	سرمایه گذاری	۹		+۳۴
	سرمایه گذاری	۴		+۳۰
	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱		+۲۸
	بنادرو کشتیرانی	۵		+۲۰
	سرمایه گذاری	۱۸		+۱۶
	سیمان، اهک و گچ	۷		+۱۵
	محصولات فلزی	۳		+۱۴
	سرمایه گذاری	۱۶		+۱۳
	خودرو	۷۴		+۱۲
	محصولات کشاورزی	۱		+۱۲
	دارویی	۱		+۱۱
دارویی	۲		+۱۱	
سیمان، اهک و گچ	۲		+۱۱	
بیشترین خروج پول حقیقی	محصولات کشاورزی	۷	-۲۳	
	تجهیزات صنعتی	۳	-۲۵	
	پالایش نفت و گاز	۱۱۳	-۳۳	
	خودرو	۲۸	-۳۵	
	بیمه	۱۲۳	-۳۶	
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۰	-۳۷	
	خودرو	۴۳	-۴۱	
	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۸	-۴۳	
	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۴۱۶	-۵۰	
	پالایش نفت و گاز	۱۸۵	-۵۰	
	آهن و فولاد	۴۲۸	-۵۵	
	سرمایه گذاری	۱۸۵	-۵۶	
	بانکها و موسسات اعتباری	۱۶۲	-۶۲	
	پالایش نفت و گاز	۱۳۴	-۸۰	

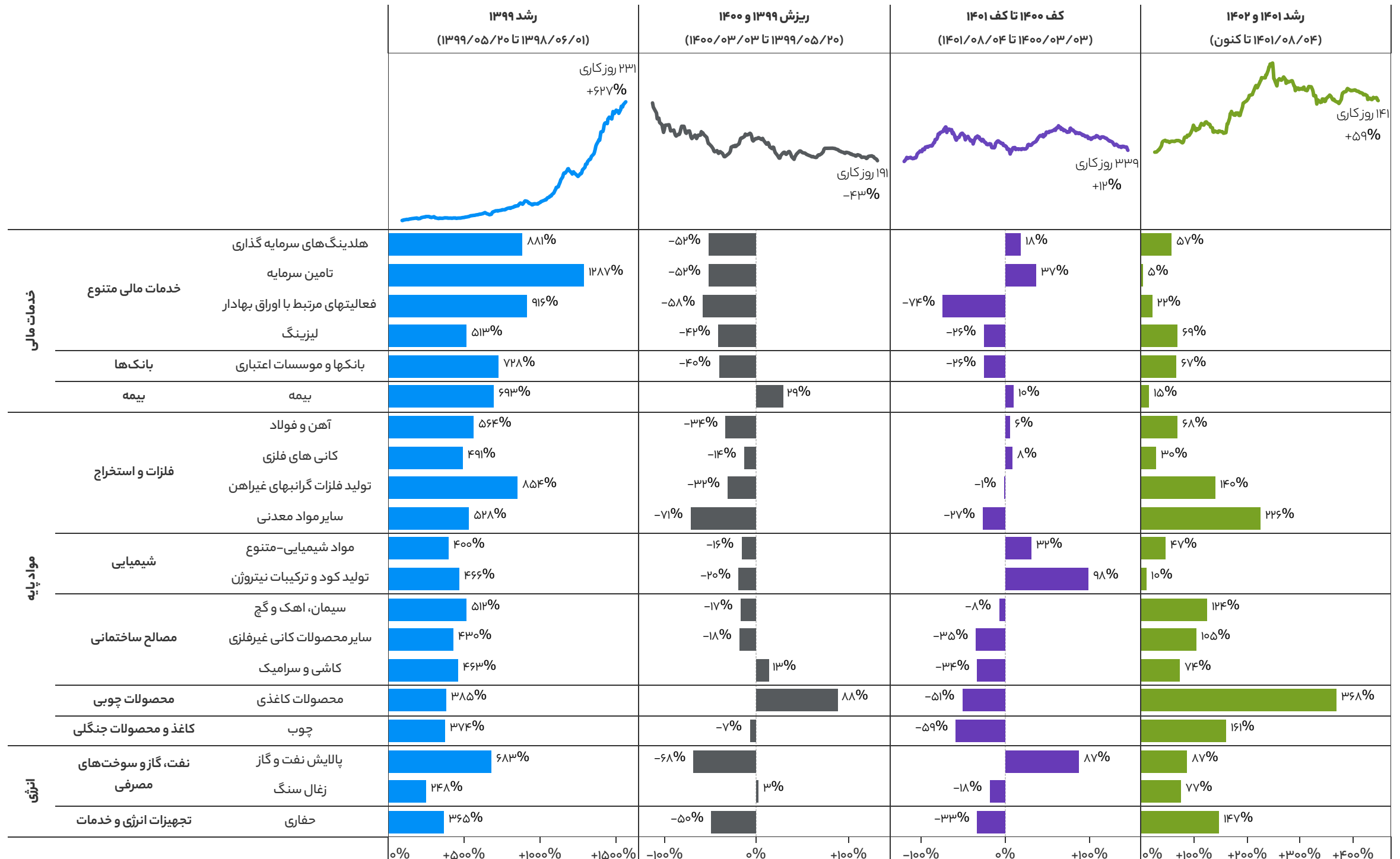
تغییر مالکیت شرکت

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

ارزش بازار			تغییر مالکیت شرکت					
نماد	صنعت	(م.م.ت)						
بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	تامان	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱.۱					+۲.۴%
	حفاري	حفاری	۵.۳					+۱.۶%
	کي بي سي	دارویی	۱.۵					+۱.۳%
	وپسا	سرمایه گذاری	۵.۵					+۱.۱%
	ثرد	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۵.۶					+۱.۱%
	زملارد	محصولات کشاورزی	۱.۵					+۰.۸%
	زشگزا	محصولات کشاورزی	۵.۸					+۰.۷%
	وتوصا	سرمایه گذاری	۴.۴					+۰.۷%
	لپيام	سرمایه گذاری	۵.۹					+۰.۶%
	شرق	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱.۷					+۰.۶%
	قنیشا	شکر	۱.۲					+۰.۶%
	زنگان	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۵.۹					+۰.۶%
بیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی	حپترو	حمل و نقل بارزمینی	۱.۵					+۰.۶%
	سبهان	سیمان، اهنک و گچ	۲.۱					+۰.۵%
	ودانا	سرمایه گذاری	۱.۱	-۰.۴%				
	ولشرق	لیزینگ	۵.۸	-۰.۴%				
	شلعاب	مواد شیمیایی-متنوع	۱.۵	-۰.۴%				
	کرازي	ظروف شیشه‌ای	۴.۶	-۰.۴%				
	ولبهم	لیزینگ	۲.۵	-۰.۵%				
	ولتجار	لیزینگ	۵.۸	-۰.۵%				
	وحافظ	بیمه	۱.۱	-۰.۵%				
	وتوس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳.۶	-۰.۵%				
	ثمسکن	سرمایه گذاری	۴.۱	-۰.۵%				
	معیار	سرمایه گذاری	۵.۶	-۰.۵%				
	ثفارس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۸.۲	-۰.۵%				
	غمابه	شیرینیجات	۱.۵	-۰.۵%				
	بکابل	تجهیزات صنعتی	۳.۲	-۰.۷%				
غنوش	محصولات کشاورزی	۱.۱	-۱.۱%					
			-۱%	۰%	+۱%	+۲%	+۳%	

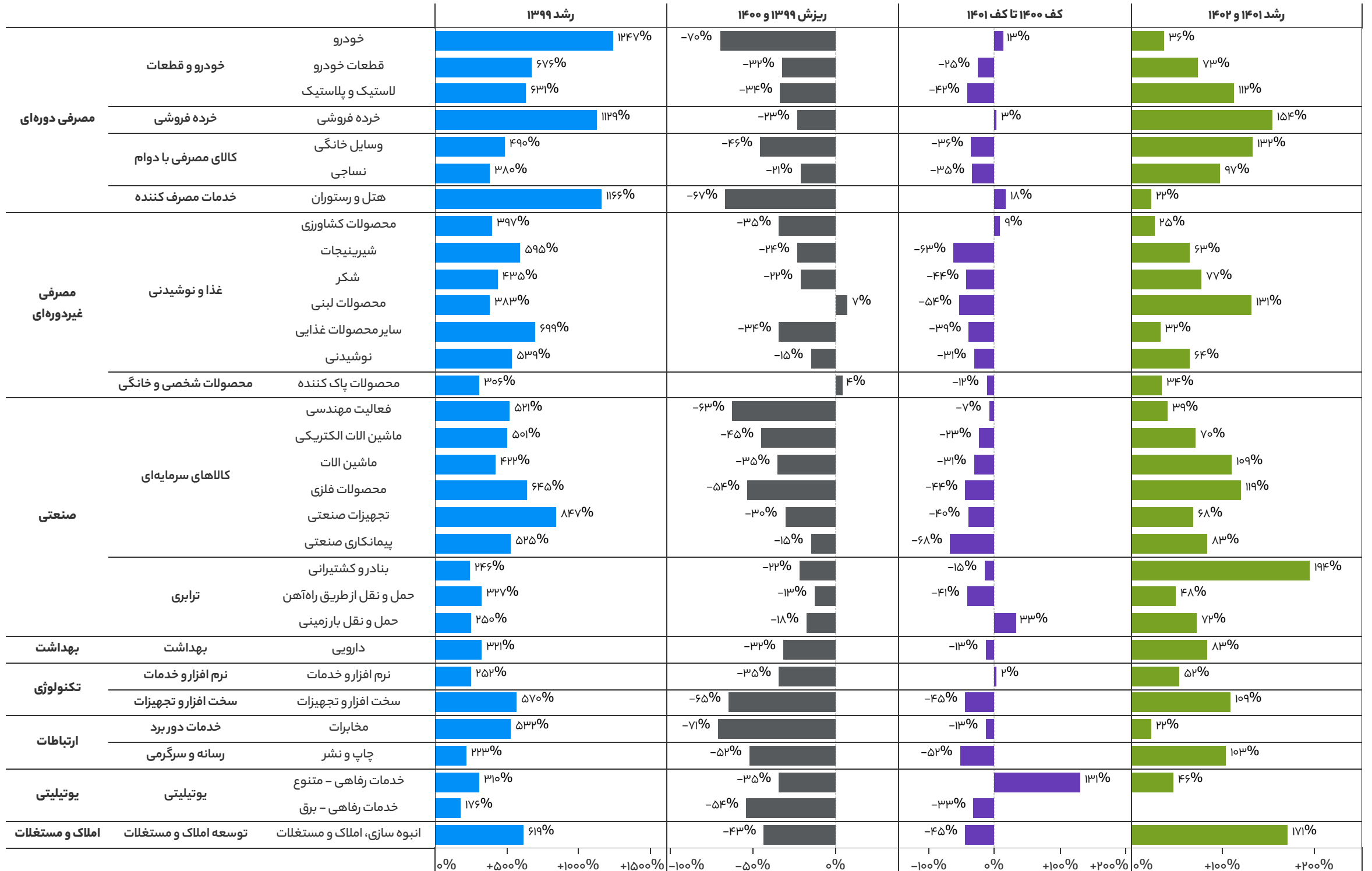
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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)



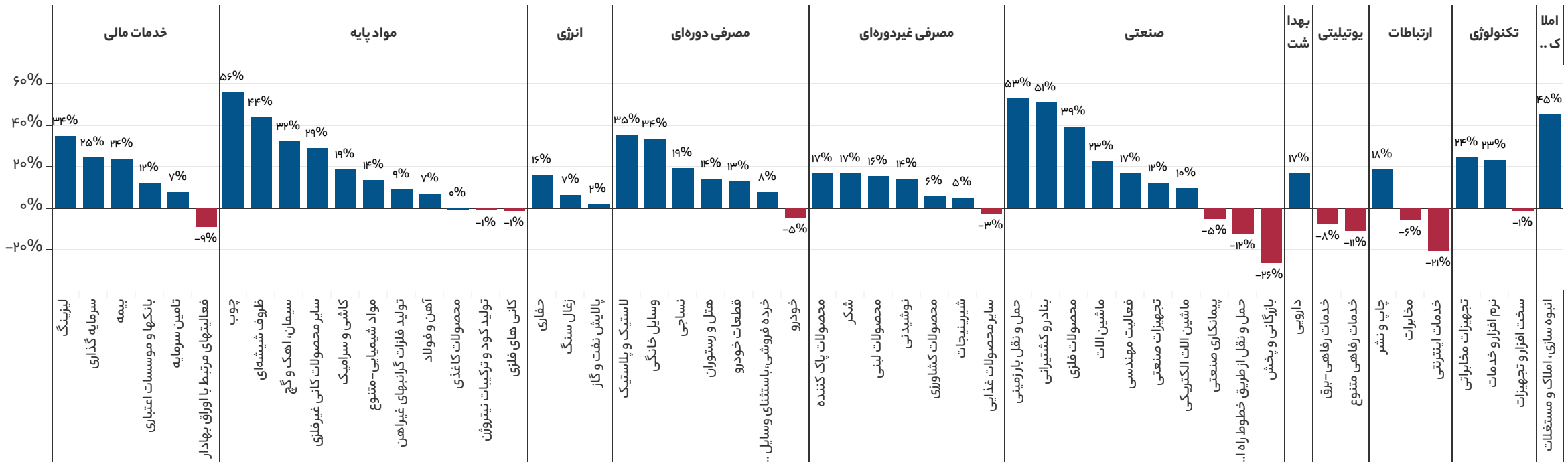
بازده صنایع از ابتدای هفته

(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)



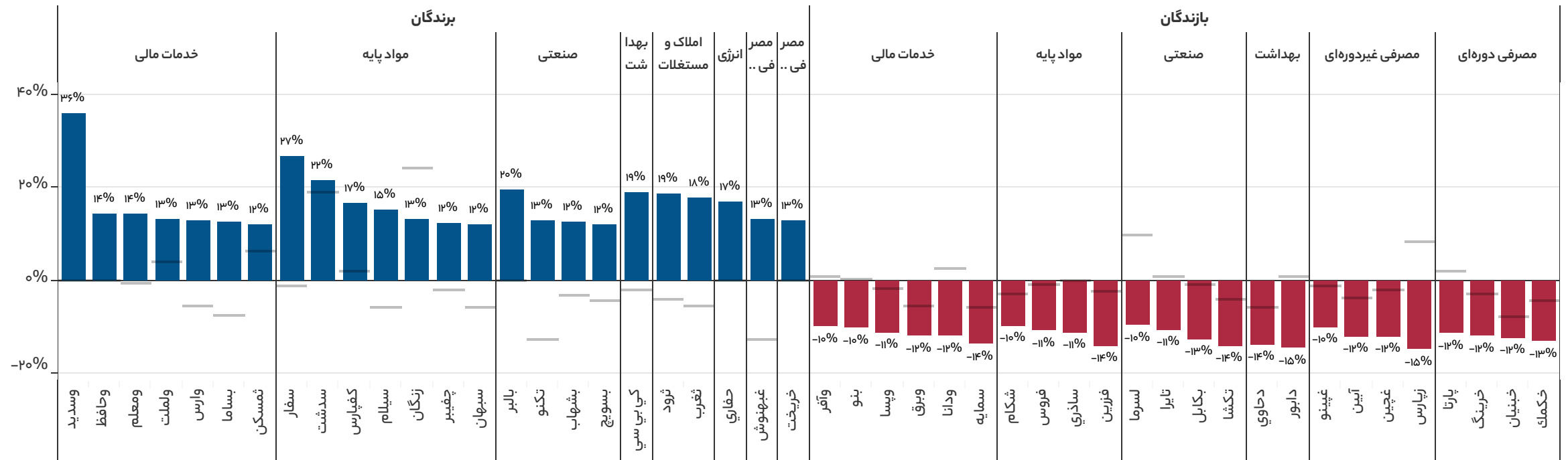
بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)

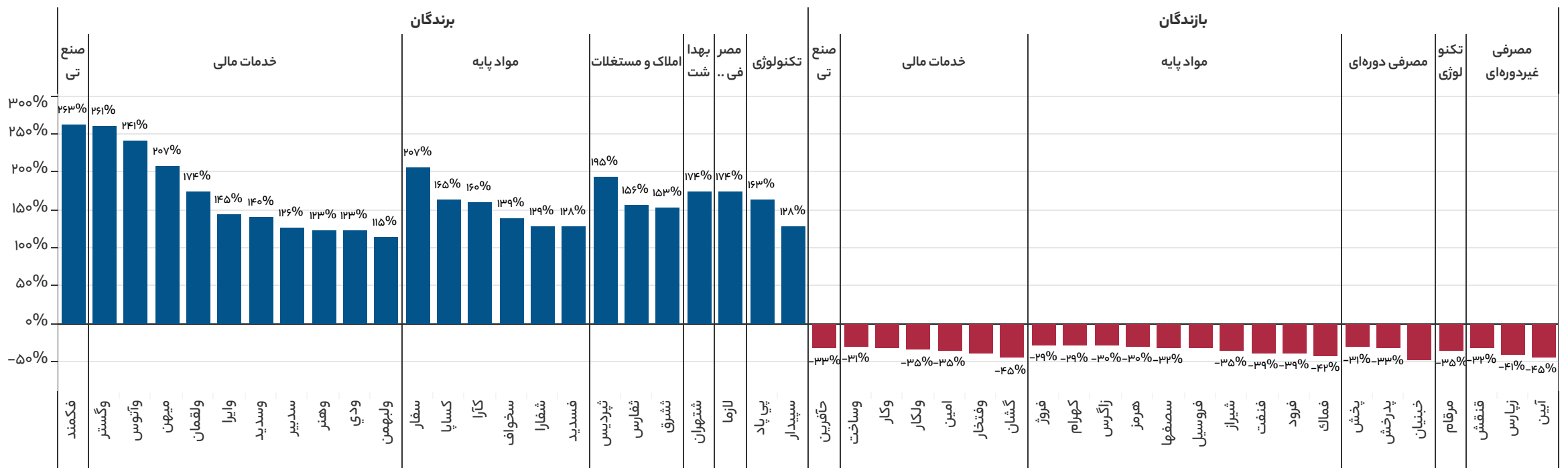


برندگان و بازندگان هفته

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)



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

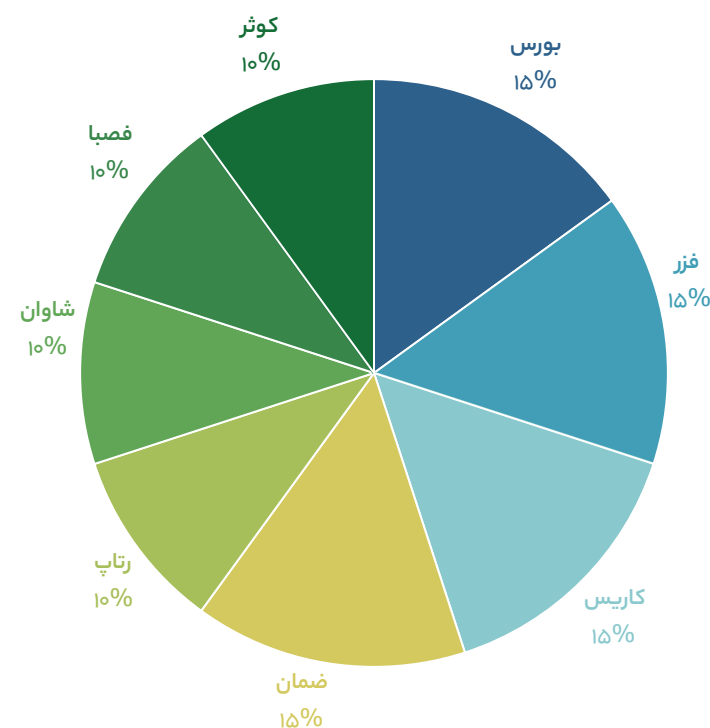


حکشتی	فخوز	پارس	شبنر	خودرو	ماون	وسپهر	وگتدیر	مبین	شتاران	ومعادن	شپدیس	کگل	خسپا	اخابر	آریا	وغدیر	کچاد	رمپنا	وتجارت	فملی	تاصیکو	وامید	تایکو	پارسان	بقر	نوری	شبریز	جم	کهر	ومندوق	شستا	میدکو	پپاس	فارس	شینا	وپاسار	فولاد	وبملت	یوعلی	
-۸۵.۰%	-۷.۲%	-۷.۰%	-۶.۸%	-۶.۲%	-۵.۰%	-۴.۵%	-۳.۸%	-۳.۴%	-۳.۴%	-۳.۳%	-۳.۲%	-۲.۹%	-۲.۵%	-۲.۴%	-۲.۳%	-۲.۲%	-۲.۲%	-۲.۱%	-۱.۵%	-۱.۳%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۰.۹%	-۰.۹%	-۰.۷%	-۰.۷%	-۰.۷%	-۰.۵%	-۰.۳%	-۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۱%	+۰.۱%	+۰.۳%	+۱.۰%	+۳.۸%	+۸.۰%
بازده هفته گذشته																																								



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۴۶۳	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۵,۰۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۲۰,۵۰۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۴,۸۵۰	وضعیت مناسب بنیادی و پتانسیل سودآوری بالا	۶,۳۰۰	فصبیا	
۱۰%	۳,۳۱۰	رشد سودآتی شرکت ناشی از سرمایه گذاری‌ها و عملیات بیمه‌ای	۴,۵۰۰	کوثر	
۱۵%	۱۵,۰۰۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵,۲۲۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۸,۲۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۳,۲۵۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۴۷,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۰,۹۶۴	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریز	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود بعد از رشد موقت از محدوده حمایتی مشخص شده، ریزش تا حوالی محدوده مشخص شده ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



 Bourseview.com

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

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود در صورت حفظ محدوده کف کانال ترسیم‌شده، رشد تا حوالی سقف کانال ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



با حفظ محدوده حمایتی ۵۱۰۰ تومان و گذر از محدوده میانی کانال رسم شده، انتظار می‌رود رشد تا حوالی ۵۴ هزار تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود با حفظ محدوده ۲۸ میلیون تومان، رشد تا حوالی ۳۵ میلیون تومان ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مطابق تصویر بعد از اصلاح تا حوالی ۱۹۵۰، به مسیر صعودی خود ادامه دهد.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین محدوده‌های حمایتی و مقاومتی مشخص شده است.

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 نگر 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 نگر ۴ فصله طراحی شده که برای هر شرکت به صورت مجزا تهیه گردیده است. هدف از طراحی این معیار، مقایسه نسبت P/E آینده نگر ۴ فصله با نسبت P/E آینده نگر 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.

لازم به ذکر است که آخرین آپدیت برآوردها توسط تحلیلگری شرکت سبدگردانی کاریزما، مهر ماه ۱۴۰۲ می باشد.

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 ویدئو 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		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر فصله	آینده نگر ۴ فصله	Z
								۱۴۰۲	۱۴۰۳		۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۲		
مواد پایه	الفین	مارون	۱۲	۱۳۲.۳	۱۶,۵۳۵	۱,۳۶۴	۷۸%	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۸	۸.۱	۸.۱	-۱.۴	
		آریا	۱۲	۱۰۸.۵	۷,۸۹۰	۸۰۲	۹۵%	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۶	۶.۳	۶.۹	-۰.۶	
		جم	۱۲	۷۸.۶	۴,۳۶۴	۵۶۰	۹۹%	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۸	۴.۳	۴.۷	-۳.۶	
		جم پیلن	۱۲	۳۶.۵	۱۸,۲۳۵	۲,۱۰۹	۹۹%	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۴	۴.۹	۵.۹	+۱.۲	
		شگویا	۱۲	۳۴.۷	۱,۴۵۰	۱۴۳	۹۱%	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۵.۲	۴.۲	۵.۵	-۰.۵	
		شکبیر	۱۲	۲۵.۸	۷,۱۸۰	۱,۱۶۸	۸۸%	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۵	۳.۱	۳.۴	-۷.۵	
		شاراک	۱۲	۲۴.۱	۲,۹۹۰	۴۱۹	۹۶%	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۰	۴.۱	۴.۴	-۱.۱	
		شغدير	۱۲	۸.۳	۶,۳۸۲	۱,۰۹۶	۹۱%	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۵	۴.۴	۶.۰	+۰.۲	
		شصبير	۱۲	۶.۷	۲,۶۶۵	۳۷۶	۸۱%	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۴.۹	۳.۵	۴.۱	-۰.۸	
		شجم	۶	۴.۹	۷۴۷	۸۸	۸۵%	۶۱	۱۳۴	+۱۱۸%	۱۲.۲	۶.۳	۶.۰	-۴.۵	
مواد پایه	اوره	شپديس	۶	۹۷.۲	۱۶,۲۰۰	۴,۲۶۴	۶۳%	۳,۲۶۲	۲,۷۱۳	-۱۷%	۵.۰	۶.۵	۵.۶	+۲.۴	
		شيراز	۱۲	۳۵.۲	۲,۲۹۸	۷۶۱	۲۱%	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۳	۵.۴	۶.۲	+۱.۵	
		خراسان	۱۲	۲۶.۷	۱۴,۹۰۰	۲,۸۱۰	۸۳%	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۹.۵	۷.۷	۸.۷	+۳.۳	
		کرماشا	۱۲	۲۰.۱	۱,۸۹۴	۴۵۸	۴۸%	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۶.۲	۴.۹	۴.۹	+۰.۸	
مواد پایه	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۱۹.۹	۱۳,۳۲۰	۱,۳۱۴	۱۰۰%	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۷.۷	۶.۵	۷.۵	+۱.۰	
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۰.۵	۱۲,۷۲۰	۱,۲۶۵	۷۲%	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۵	۶.۶	۶.۸	-۲.۳	
		شخارک	۱۲	۲۵.۴	۴,۲۳۰	۶۴۱	۹۹%	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۱	۴.۵	۵.۴	-۱.۷	
	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۲۶.۱	۴۷۹	۵۶	۷۵%	۶۲	۷۳	+۱۸%	۷.۸	۶.۰	۶.۶	+۰.۳	
مواد پایه	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۱	۴۹۳	۶۴	۸۲%	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۵.۷	۴.۴	۴.۹	-۰.۸	
		شصدف	۱۲	۲.۴	۳,۴۷۵	۳۹۲	۷۳%	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۸.۹	۵.۸	۷.۱	-۱.۶	
		شدوص	۱۲	۱.۹	۲,۰۱۲	۱۹۳	۹۳%	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۵.۵	۴.۲	۵.۴	-۰.۳	



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%	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۴.۲	۳.۶	۳.۹	+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							
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر فصله	آینده نگر ۴ فصله						
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوه	۱۲	۸۰۴	۱۲,۹۷۰	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۵۰۴	۴۰۰	۴۰۸	+۰.۵						
		سآبیک	۱۲	۶۰۴	۲,۱۵۴	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۵۰.۵	۳۰.۹	۵۰.۲	+۱.۸						
		سرخوز	۱۲	۵۰۸	۴,۱۷۰	۷۱۹	۹۰%	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴۰.۲	۳۰.۰	۳۰.۰	-۱.۳						
		سمازن	۹	۵۰۸	۲,۳۵۰	۲۹۰	۸۱%	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۶۰.۰	۴۰.۱	۴۰.۸	+۱.۲						
		سفار	۱۲	۵۰۷	۲۴,۴۰۱	۱,۰۳۹	۹۵%	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۱۷.۴	۱۳.۲	۱۵.۶	+۱.۰						
		سفانو	۱۲	۴۰۴	۸,۸۷۹	۱,۱۷۰	۹۷%	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۵۰.۳	۳۰.۷	۴۰.۱	+۰.۸						
		سهگمت	۱۰	۴۰.۲	۵,۶۹۶	۶۴۸	۹۸%	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۵۰.۶	۳۰.۱	۳۰.۹	-۰.۲						
		ساروم	۱۲	۴۰.۱	۴,۰۸۰	۵۵۴	۹۶%	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵۰.۱	۳۰.۴	۴۰.۴	-۰.۸						
		سرود	۱۲	۳۰.۶	۴,۴۸۵	۴۹۶	۹۶%	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵۰.۲	۳۰.۹	۴۰.۸	+۰.۳						
		سصوفی	۱۲	۳۰.۰	۲,۷۰۰	۳۶۸	۹۰%	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۵۰.۰	۳۰.۴	۴۰.۶	-۰.۱						
		سبجنو	۱۲	۲۰.۷	۶,۹۵۰	۵۷۳	۹۶%	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶۰.۶	۵۰.۸	۶۰.۲	+۰.۴						
		سشمال	۹	۲۰.۶	۱,۵۳۲	۱۷۰	۸۹%	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۵۰.۶	۳۰.۶	۴۰.۵	+۰.۲						
		سقاین	۱۲	۲۰.۱	۵۳۷	۳۷	۹۷%	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۱.۰	۹.۴	۹.۸	+۰.۳						
		سغرب	۱۲	۲۰.۰	۳,۹۷۴	۳۹۰	۹۲%	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۴۰.۶	۳۰.۲	۳۰.۹	-۰.۹						
		سبهان	۱۲	۱۰.۹	۹,۳۰۰	۷۳۶	۹۷%	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۵۰.۲	۴۰.۱	۴۰.۴	-۰.۷						
		سرخزر	۱۲	۱۰.۸	۳,۶۵۲	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷۰.۶	۵۰.۵	۶۰.۶	+۰.۰						
	سشاش	۱۲	۱۰.۶	۷,۹۵۷	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۵۰.۶	۳۰.۶	۴۰.۲	-۱.۵							
	کاشی و سرامیک	کحافظ	۱۲	۳۰.۲	۶۱۸	۸۲	۱۰%	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۴۰.۶	۲۰.۹	۳۰.۲	-۳.۵						
		کساوه	۱۲	۳۰.۱	۵,۷۸۱	۷۴۷	۷۱%	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۵۰.۷	۳۰.۹	۴۰.۰	-۱.۵						
		کلوند	۱۲	۱۰.۷	۴,۱۳۹	۵۰۴	۹۵%	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۵۰.۵	۴۰.۲	۴۰.۹	-۰.۴						
فرآورده های نسوز		کپشیر	۱۲	۱۰.۸	۱,۲۲۷	۸۷	۸۸%	۱۹۰	۱۶۷	-۱۲%	۶۰.۴	۶۰.۹	۶۰.۸	+۰.۲						

-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		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	پالایش نفت	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۸۵۰۲	۸۱۶	۱۷۰	۶۳%	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴۰۶	۴۰۷	۴۰۹	+۱.۴
			شبندر	۱۲	۱۴۳۰۷	۱,۰۷۰	۳۰۴	۷۶%	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴۰۴	۶۰۴	۴۰۲	+۱.۹
			شتران	۱۲	۱۱۷۰۴	۴۲۷	۱۰۹	۳۱%	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴۰۳	۴۰۲	۴۰۰	+۱.۱
			شبریز	۱۲	۳۵۰۳	۱,۱۷۵	۳۳۵	۷۶%	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۴۰۸	۴۰۶	۴۰۲	-۰.۲
			شاوان	۱۲	۱۷۰۲	۲,۱۵۰	۵۵۵	۷۳%	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴۰۲	۹۰۱	۴۰۸	+۱.۱
	نفت، گاز و سوخت های مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۲۵۰۲	۲۶۳	۳۱	۸۸%	۳۵	۴۶	+۳۰%	۷۰۴	۵۰۵	۵۰۳	-۱.۹
			شبهرن	۱۲	۲۹۰۰	۲,۴۲۷	۳۳۸	۸۹%	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶۰۵	۶۰۴	۶۰۲	+۱.۷
		روانکار	شسپا	۱۲	۲۷۰۰	۴۸۳	۷۴	۶۷%	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵۰۱	۴۰۱	۴۰۶	+۰.۱
			شنفت	۱۲	۱۶۰۵	۸۲۶	۱۰۸	۸۲%	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۷۰۸	۷۰۹	۸۰۷	+۰.۳
			شرانل	۱۲	۱۵۰۹	۷,۹۶۵	۱,۴۴۱	۸۵%	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴۰۷	۴۰۲	۳۰۹	-۰.۳
	زغال سنگ	زغال سنگ	کپرور	۱۲	۲۰۲	۱,۲۷۸	۱۶۹	۵۹%	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۶۰۲	۴۰۶	۴۰۸	-۰.۹
			کطبس	۱۲	۱۰۵	۱,۹۱۰	۱۹۳	۶۲%	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۶۰۴	۵۰۶	۵۰۳	-۱.۸
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	تنوین	۱۲	۱۰۰۳	۲۶۷	۴۸	۶۳%	۵۰	۶۱	+۲۳%	۵۰۴	۴۰۱	۴۰۱	-۱.۵
			امین	۶	۱۰۰۱	۵۶۰	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲۰۵	۹۰۷	۷۰۷	-۳.۳
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱۰۵	۷,۲۹۵	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵۰۶	۳۰۵	۴۰۰	-۰.۹
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱۰۲	۵,۸۴۰	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۴۰۴	۸۰۱	۹۰۵	-۰.۴

-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	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	Z
								۱۴۰۲	۱۴۰۳		۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۳		
بهداشت	دارویی	ددانا	۱۲	۱۲.۵	۵,۲۰۰	۴۹۵	۷۶%	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۶.۱	۴.۶	۴.۸	+۰.۴	
		دلر	۱۲	۶.۸	۳,۰۰۰	۳۵۲	۹۶%	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۶.۱	۵.۶	۶.۱	+۰.۹	
		دالبر	۱۲	۵.۷	۵۹۷	۷۵	۶۹%	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۵.۳	۴.۳	۴.۴	-۱.۴	
		دپارس	۱۲	۵.۳	۵,۶۳۰	۸۰۳	۹۸%	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۵.۹	۵.۱	۴.۵	-۰.۲	
		دفارا	۱۲	۵.۱	۳,۲۱۷	۴۵۲	۹۹%	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۵.۷	۵.۰	۴.۴	-۰.۱	
		دفرا	۱۲	۵.۰	۳,۵۸۱	۳۹۳	۷۹%	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۲	۶.۲	۶.۰	+۱.۳	
		هجرت	۱۲	۴.۶	۲,۸۵۰	۴۰۶	۹۵%	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۲	۴.۳	۴.۵	-۰.۵	
		دقاضی	۱۲	۴.۱	۲,۴۰۰	۲۷۷	۹۶%	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۴	۵.۰	۵.۴	-۰.۲	
		دتوزیع	۱۲	۴.۰	۲,۲۴۵	۴۴۹	۹۴%	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۶.۸	۵.۲	۵.۰	-۰.۳	
		کاسپین	۱۲	۲.۵	۱,۸۱۴	۲۳۴	۹۵%	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۵.۷	۴.۶	۵.۰	-۰.۴	
		دکپسول	۱۲	۲.۲	۷,۴۸۰	۹۲۱	۹۲%	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۷.۰	۵.۶	۶.۶	+۱.۶	



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z	
											با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳						
مصرفی غیردورهای	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۳۰۶	۱,۳۵۷	۱۶۱	۶۰%	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۶۰	۴۰	۴۰	-۲.۳	◆
		غپینو	۱۲	۳۰۴	۳۸۰	۴۹	۵۶%	۶۷	۹۴	+۳۹%	۵۰	۴۰	۴۰	-۱.۶	◆
		غسالم	۱۲	۱۰۹	۴۲۷	۶۵	۴۱%	۶۵	۸۱	+۲۵%	۶۰	۵۰	۴۰	-۱.۳	◆
		غمینو	۱۲	۱۰۵	۱,۰۰۲	۱۴۹	۴۳%	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۶۰	۴۰	۴۰	-۰.۴	◆
	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۷۰۹	۲,۶۳۰	۲۱۳	۵۵%	۴۹۶	۶۸۹	+۳۹%	۵۰	۳۰	۴۰	-۳.۷	▶
		سیمرغ	۹	۴۰	۳,۲۰۰	۳۹۱	۲۴%	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۵۰	۳۰	۳۰	-۱.۹	◆
		زفکا	۱۲	۲۰۶	۱,۷۰۰	۱۵۵	۹۱%	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۹۰	۶۰	۷۰	+۰.۳	◆
		زگلدشت	۱۲	۱۰۸	۲,۵۰۵	۹۶	۹۵%	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۱۰	۸۰	۹۰	+۰.۳	◆
		زملارد	۱۲	۱۰۴	۱,۷۵۵	۳۳	۹۴%	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۲۰	۹۰	۹۰	-۳.۲	▶
		زشریف	۹	۱۰	۵۰۰	۴۸	۷۶%	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۶۰	۴۰	۴۰	-۱.۶	◆
		غکورش	۱۲	۱۴۰۷	۷۳۳	۱۲۶	۵۴%	۸۳	۸۶	+۳%	۸۰	۸۰	۸۰	+۰.۱	◆
	محصولات لبنی	غگلپا	۱۲	۱۰۴	۳,۹۲۰	۴۶۵	۷۴%	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۶۰	۴۰	۴۰	-۰.۹	◆
		غشان	۱۲	۱۰۱	۶۲۸	۸۰	۷۱%	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۷۰	۵۰	۵۰	-۱.۰	◆
	محصولات شخصی و خانگی	کیمیاتک	۱۲	۶۰	۹۹۹	۱۰۲	۶۴%	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۶۰	۵۰	۶۰	-۰.۲	◆
		قرن	۱۲	۵۰۸	۱,۴۵۳	۱۶۵	۶۱%	۲۱۴	۲۹۹	+۴۰%	۶۰	۴۰	۵۰	-۰.۷	◆
		شپاکسا	۹	۲۰۳	۲۵۱	-۲۴	۳۸%	۴۶	۶۱	+۳۲%	۵۰	۴۰	۳۰	-۳.۴	▶

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

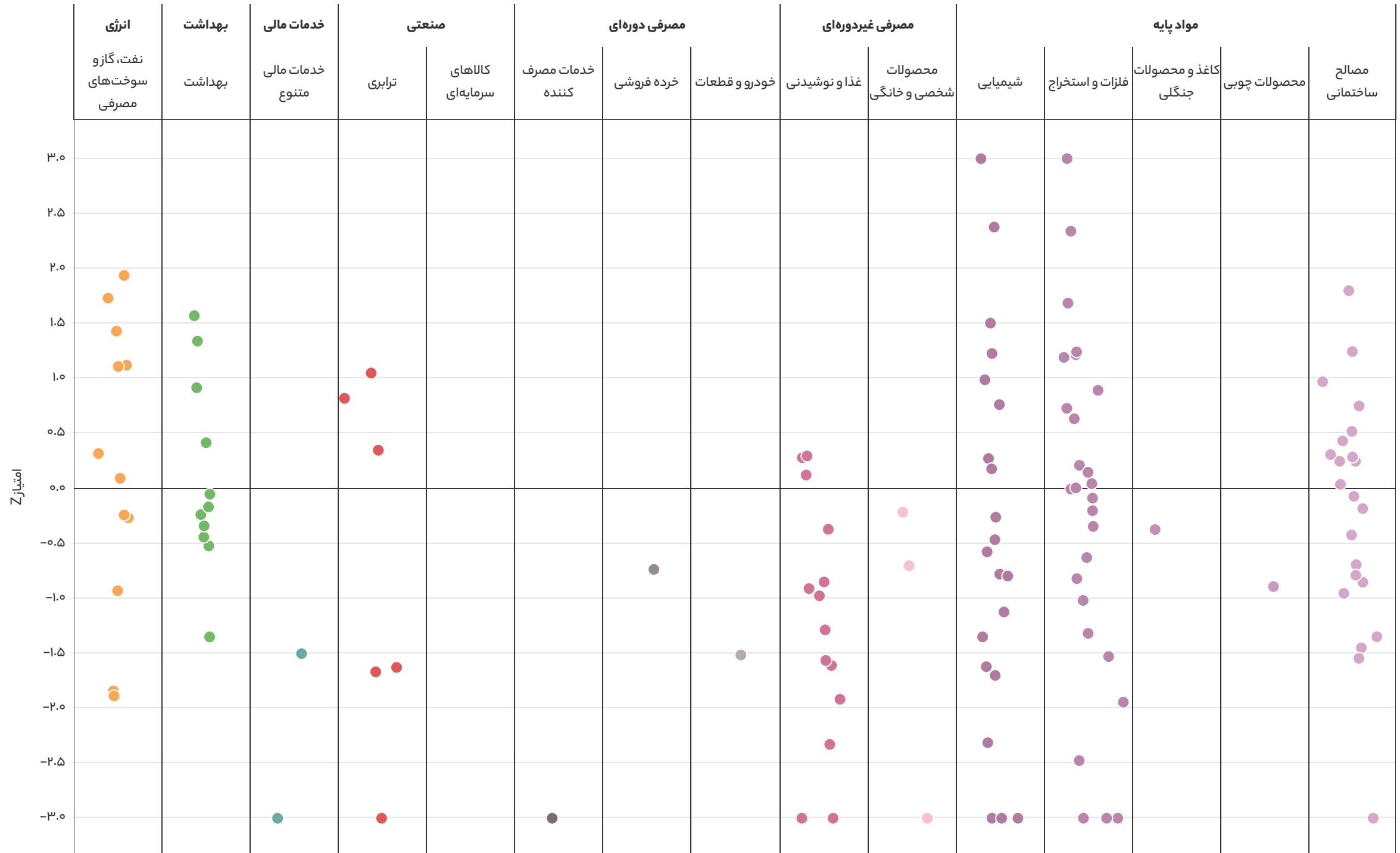
نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

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	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)	
								۱۴۰۲	۱۴۰۳		۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۳		
صنعتی	بنادرو کشتیرانی	حتاید	۱۲	۶.۰	۵۰۰	۶۲	۵۲%	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۴.۶	۳.۶	۳.۶	-۱.۶	
		حززر	۱۲	۵.۹	۱,۶۳۸	۲۰۷	۹۶%	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۵.۷	۳.۶	۵.۳	+۰.۳	
	ترابری	توریل	۱۲	۳.۷	۵۳۵	۴۳	۳۸%	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸.۰	۶.۴	۵.۶	-۱.۷	
		حآفرین	۱۲	۲.۰	۲۶۴	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۴	۵.۸	۴.۹	-۴.۷	
		خطوط راه اهن	۶	۱.۶	۶,۲۰۵	۶۳۱	۸۹%	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸.۷	۷.۶	۶.۴	+۱.۰	
		حآسا	۱۲	۱.۵	۸۲۶	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۲.۴	۲۱.۶	۳۶.۷	+۰.۸	
مصرفی دوره‌ای	کالاهای سرمایه‌ای	سیم و کابل	۱۲	۳.۶	۳,۵۴۰	۲۵۰	۶۱%	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۸.۰	۶.۵	۵.۸		
	خودرو و قطعات	پکویلر	۹	۴.۵	۶۸۲	۲۵	۷۵%	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۷.۹	۳.۳	۴.۳	-۱.۵	
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	۱۲	۳.۷	۷۳۹	۱۰۳	۴۹%	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۵	۴.۲	۴.۱	-۰.۷	

-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

