

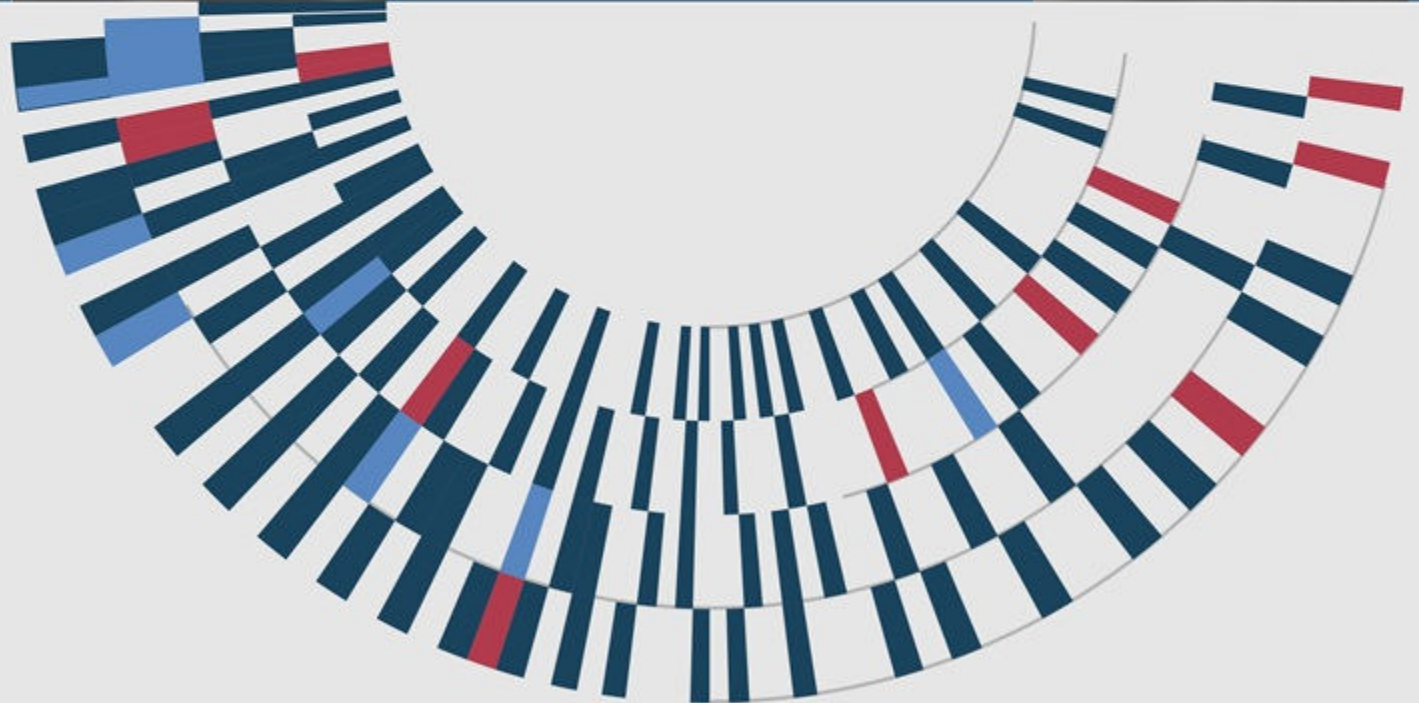
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲۳ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۱۲

 CHARISMA





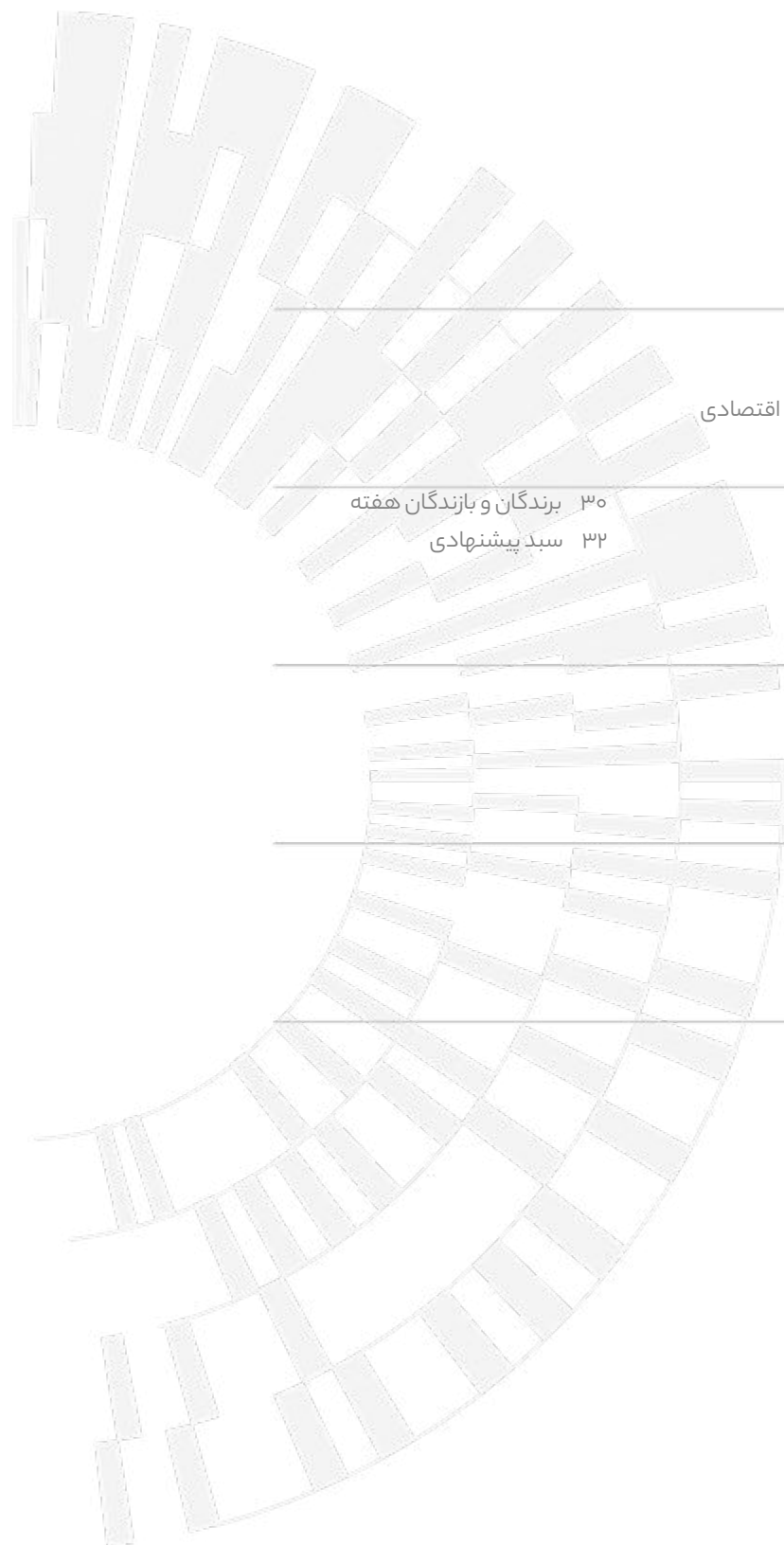
معرفی گزارش:

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	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



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	۱,۹۹۳	۰.۷%-	فزر	-	۱,۷۴۹ ۲,۰۱۷	۱۴%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۱۷۵	۱.۰%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ ۹,۳۴۱	۵%-
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۴۶	۱.۰%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ ۲,۴۲۴	۴%-
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۱۷	۱.۹%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳ ۳,۴۴۴	۱۷%-
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۷۶	۳.۳%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۰۳۵ ۲,۲۷۳	۴%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۸۳۵	۲.۳%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۸۷۳ ۴,۸۴۳	۶۸%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۰۵	-	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۲۵۶ ۳,۶۲۵	۶۰%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۶۵	۱.۱%-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱ ۶۲۳	۵%-
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۰۵۹	۰.۹%-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۳,۷۳۴ ۲۲,۸۲۱	۳۵%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۵۸	۰.۵%-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰ ۶۷۰	۶%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۲,۴۵۳ ۲۲,۰۸۰	۴۹%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۶۰	۲.۶%	ذوب، کویر	فولای	۵۴۶ ۷۵۵	۱۵%-
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۳۵۴	-	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۶۵۰ ۲۴,۷۴۷	۴۶%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۵۵	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۵ ۷۸۰	۵%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۰	-	فولاد	-	۶۱۵ ۸۶۰	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	۳۷۵	۱.۳%-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس	۲۸۵۵۸۸	۳۶%-
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۳	۰.۷%-	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵۳۲۵	۱۵%-
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۴۵	۲.۶%-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰۹۷۹	۸%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۱	۰.۸%-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱,۰۸۰	۱%-
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۷	۰.۴%-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶۱,۰۵۸	۱%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۷	۰.۴%-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۷۰۱,۰۱۰	۷%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۷۰	۰.۹%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۴۴۵۳۲	۶%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	۱.۱%-	شگویا	-	۹۳۰۱,۰۹۹	۱%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۴	۵%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۵	۱.۴%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰۹۵۱	۱%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۹	۲.۷%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲۱,۱۵۸	۲%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۹۵	۲.۰%-	شصفها، نوری	-	۹۷۹۱,۱۷۹	۹%-
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۵	۱.۰%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱,۱۶۸	۸%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۲۷	۰.۹%-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۱,۰۳۷	۷%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۷,۱۵۵	۱.۲%	بوعلی	-	۶,۱۲۹۸,۳۵۵	۵%-
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۶۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰۱,۲۳۹	۴۳%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۶۵	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۶۹۹۹۱۴	۱%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۳۰۵	۰.۸%	شبصیر	-	۱,۲۳۰۱,۴۱۹	۳%-



انرژی و سایر محصولات

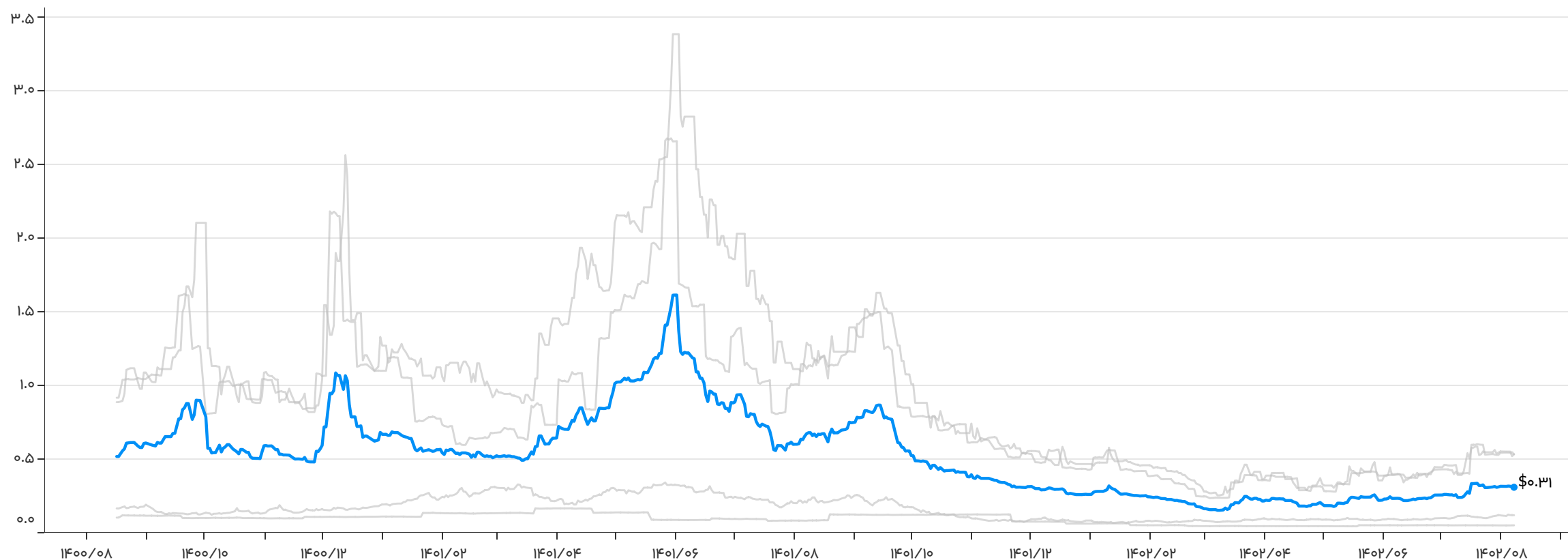
انرژی و فراورده های نفتی	روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته		آخرین قیمت		واحد		مرجع قیمتی		عنوان		
			۹۴۷۲		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-۵.۴%		۸۵		دلار/بشکه		بورس بین المللی اروپا		نفت برنت		
			۹۱۶۶		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-۵.۰%		۸۱		دلار/بشکه		بورس بین المللی اروپا		نفت WTI		
			۱۵۰۹۷		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-۳.۹%		۱۲۳		دلار/بشکه		بورس کالای نیویورک		نفت کوره		
			۱۳۴۸۹		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-۰.۹%		۱۱۸		دلار/بشکه		بورس بین المللی اروپا		گازوئیل کم سولفور		
			۲۱,۶۳۴۱۰,۳۵۳		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		-		۱۹,۳۰۴		تومان/تن		بورس کالای ایران		لوب کات - پالایش نفت تهران		
			۴۱,۳۶۵۲۱,۷۹۵		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		-		۳۱,۸۷۰		تومان/تن		بورس کالای ایران		روغن پایه - نفت سپاهان		
			۱۷,۱۴۰۱۰,۴۰۰		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		شپاس		-		۱۴,۴۷۰		تومان/تن		بورس کالای ایران		قیر- نفت پاسارگاد		
	محصولات کشاورزی			۲۶۹۱۸۷		غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		-۰.۸%		۱۸۸		دلار/تن		بورس کالای چیکاگو		ذرت آمریکا	
				۹۶۸۷۲۸		غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		۲.۰%		۷۹۶		دلار/تن		بورس مالزی		روغن پالم خام	
		۱,۷۱۶۱,۲۰۵		غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		-۴.۷%		۱,۲۸۳		دلار/تن		بورس کالای نیویورک		شکر آمریکا			
		۲۹۹۱۹۹		غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		-۰.۵%		۲۱۰		دلار/تن		بورس کالای چیکاگو		گندم آمریکا			
ارز و ارز دیجیتال			۱.۱۲۱.۰۲		-		-		۱.۵%		۱.۰۷		-		بازار فارکس		یورو به دلار		
			۱.۳۱۱.۱۷		-		-		۲.۲%		۱.۲۴		-		بازار فارکس		پوند به دلار		
			۳۴,۶۲۸۱۶,۵۴۹		-		-		۲.۵%		۳۴,۶۲۸		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	۰.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۴۶%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۵	۱.۵%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۳۷%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۴	-۳.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۶۳	-۵۸%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۴	-۱.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۵۳%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۳۱	-۲.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۸۷	-۵۴%

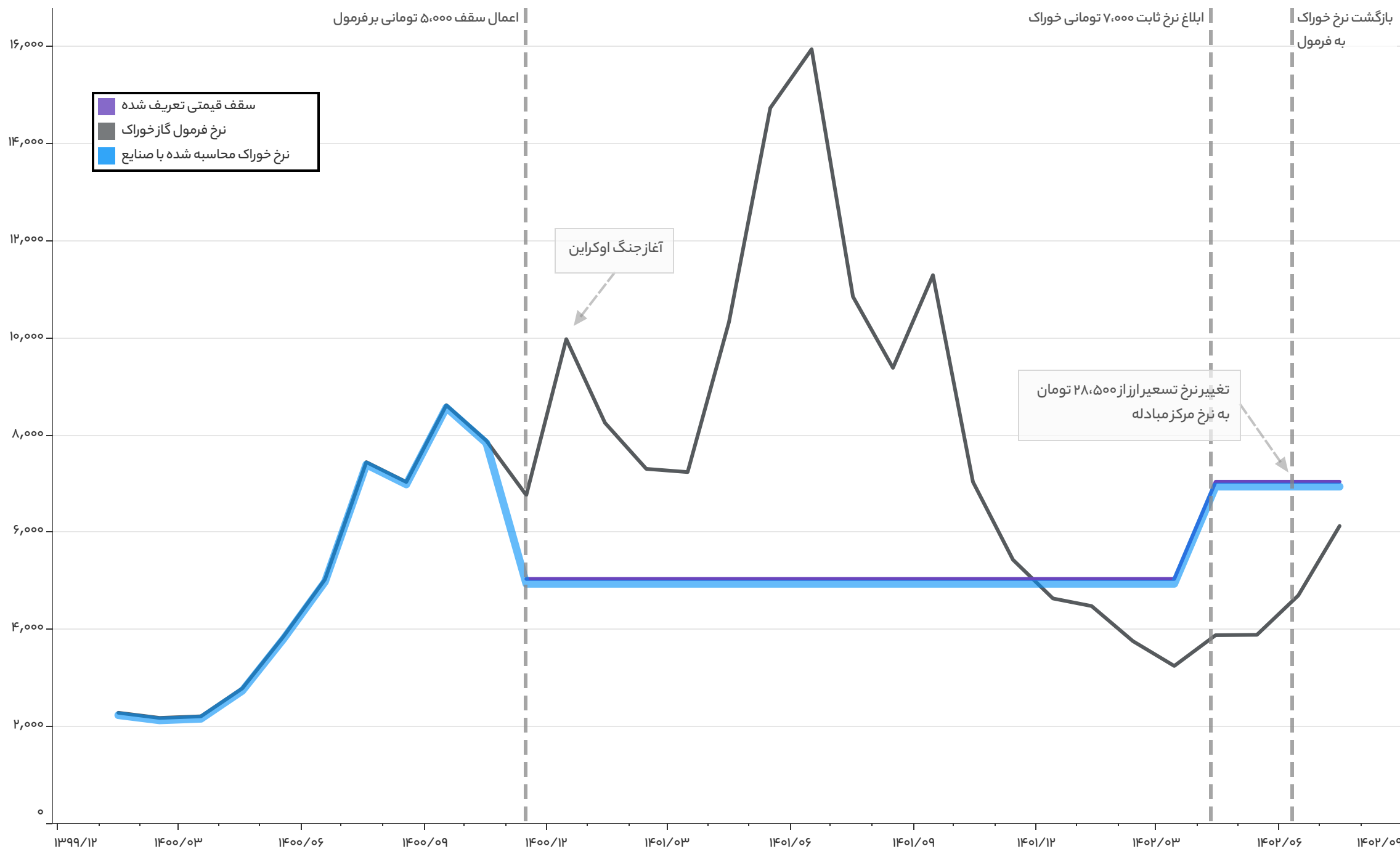
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

میانگین نرخ گاز طبیعی هاب هنری، آلبرتا، TTF هلند و NBP انگلستان، دلار بر متر مکعب، طی ۲ سال گذشته



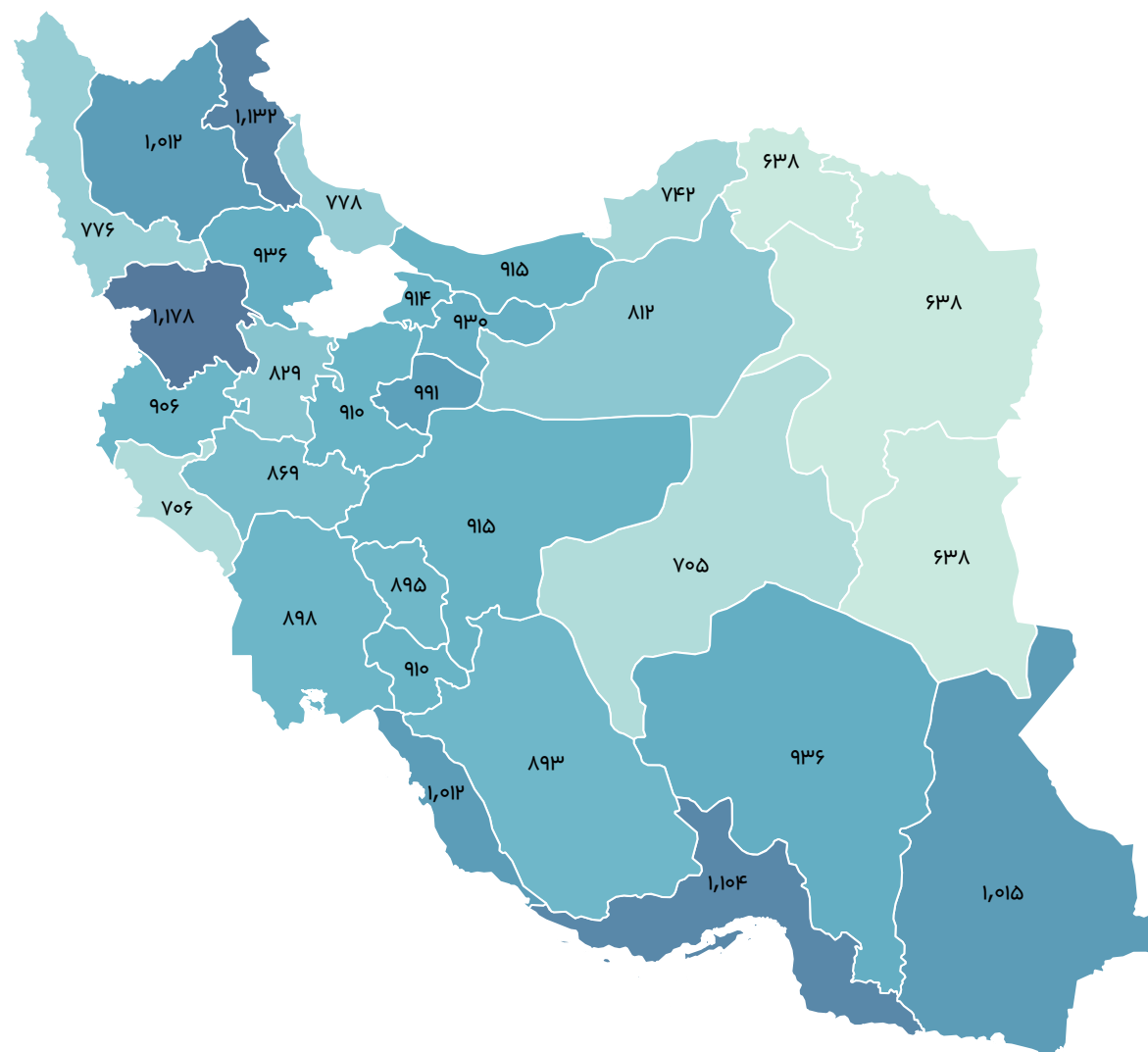
فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

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 به ازای هر مترمکعب



قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

براساس شرکت دنبال کننده هر استان در جدول روبه، براساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات، تومان به کیلوگرم



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده بر اساس حجم معاملات، تومان به کیلوگرم

منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	سیمان تهران	۹۳۰	۹۳۰	-
	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۱۱	۹۱۰	-۰.۲%
	قم	سیمان نیزار قم	۹۳۸	۹۹۱	+۵.۷%
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیما..	۷۰۵	۷۰۵	-
غرب	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۸۹۸	-
	همدان	سیمان هگمتان	۸۳۰	۸۲۹	-۰.۱%
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۹۵	۸۹۵	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۹۰۵	۹۰۶	+۰.۱%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۹۹	۹۱۰	+۱.۲%
	کردستان	سیمان کردستان	۱,۱۲۹	۱,۱۷۸	+۴.۳%
شمال غرب	لرستان	سیمان دورود	۸۸۴	۸۶۹	-۱.۸%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۱۱۴	۱,۱۳۲	+۱.۷%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۲۰	۷۷۶	-۵.۴%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۰۳۸	۱,۰۱۲	-۲.۵%
شمال	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۸	۹۳۶	-۰.۲%
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۳۷	۷۴۲	+۰.۷%
	گیلان	سیمان خزر	۷۳۱	۷۷۸	+۶.۴%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۰۹۲	۱,۱۰۴	+۱.۲%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۱,۰۹۷	۱,۰۱۲	-۷.۸%
	فارس	سیمان داراب	۸۹۳	۸۹۳	-
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۳۸	-
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۳۸	۹۳۶	-۰.۲%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۰۶	۱,۰۱۵	+۱۲.۱%

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

- ▲

به گزارش بلومبرگ، در ابتدای هفته گذشته، قیمت طلا برای اولین بار از ماه مه به بالاتر از ۲۰۰۰ دلار در هر اونس رسیده است. نگرانی در مورد تشدید درگیری‌ها در خاورمیانه تاثیر افزایش اخیر سود اوراق قرضه خزانه‌داری آمریکا را از بین برده است، به طوری که با وجود این که سود اوراق خزانه‌داری آمریکا به بالاترین مقدار خود طی بیش از یک دهه گذشته رسیده است، اما باز هم قیمت طلا در آستانه بزرگترین افزایش قیمت ماهانه از ژوئیه ۲۰۲۰ قرار دارد و قیمت آن حدود ۹ درصد از زمان آغاز حمله حماس به اسرائیل در هفتم اکتبر افزایش یافته که دلیل اصلی آن را می‌توان افزایش تمایل به این فلز گرانبها به عنوان یک پشتوانه ایمن دانست. اما در اواسط هفته قیمت طلا مقداری کاهش پیدا کرد و دوباره تلاش کرد افزایش یابد اما تغییر چندانی نداشت. از نظر تحلیل‌گران، این تحولات نشان می‌دهد بازار دچار نوعی فرسودگی شده است.
- ▲

قیمت هر تن مس تحویل ماه دسامبر در بازار کامکس نیویورک، پس از رسیدن به کف ۱۱ ماه گذشته خود، با بیش از دو درصد افزایش به بالای ۸ هزار دلار رسیده و به نظر می‌رسد در صورت ادامه روند فعلی، همچنان شاهد افزایش قیمت جهانی مس باشیم. افزایش قیمت جهانی مس به دنبال گزارش چین در سپتامبر است که برای دومین ماه متوالی بازدهی بخش صنعت خود را مثبت اعلام کرده است. با این حال هانسن معتقد است که همچنان نگرانی‌هایی در خصوص اقتصاد این کشور مطرح است و همچنین، در سایر نقاط جهان اتفاق چشمگیری رخ نداده که خوشبینی لازم برای ادامه روند افزایش قیمت‌ها را در بازار ایجاد نماید. از سوی دیگر، کارشناسان بازار سرمایه معتقدند که دلیل افزایش قیمت اخیر مس و برخی دیگر از فلزات اساسی بیشتر به دلیل وقفه ایجاد شده در روند افزایشی شاخص دلار بوده که در صورت ادامه روند صعودی شاخص، می‌توان شاهد ریزش مجدد قیمت‌ها بود.
- ▼

در پی اشباع عرضه و کاهش تقاضای بازارهای جهانی برای فلز کبالت، ریزش قیمت این فلز صنعتی، رکوردی جدید بر جای گذاشت. گفته می‌شود با کاهش تقاضا برای خودروهای الکتریکی در چین و اروپا که کبالت نقش مهمی در ساخت و تامین باتری‌های آن‌ها دارد، اکنون قیمت کبالت با ریزشی سنگین مواجه شده است. از سوی دیگر، حرکت صنعت باتری‌سازی به سمت باتری‌های عاری از کبالت نیز تاثیری جدی بر روی بازار این فلز بر جای گذاشته است. از کبالت در ساخت کاتدهای بسیاری از باتری‌های لیتیومی و صنایع پتروشیمی استفاده می‌شود و حال آنکه در صورت کاهش تقاضا برای این نوع باتری‌ها، بازار کبالت نیز آینده مشخصی نخواهد داشت.
- ✓

موسسه آمار ترکیه با ارائه آخرین آمار بخش صنایع این کشور اعلام کرده است که ترکیه در ماه آگوست بیش از ۱.۱۳ میلیون تن سنگ آهن را وارد کرده که به نسبت بازه زمانی مشابه سال قبل، حدود ۷۸.۲ درصد افزایش را نشان می‌دهد. همچنین طی بازه هشت ماهه نخست سال جاری میلادی، ترکیه در مجموع ۵.۳۶ میلیون تن سنگ آهن وارد نموده که این میزان به نسبت هشت ماهه نخست سال گذشته ۲۳ درصد کاهش یافته است. نکته قابل توجه در آمار واردات سنگ آهن ترکیه این است که میزان واردات ترکیه از برزیل در این زمینه افزایشی چشمگیر یافته است. در مقابل، میزان واردات سنگ آهن ترکیه از کشورهای سوئد و روسیه کاهش یافته و این در حالیست که ترکیه طی یک سال گذشته، میزان سنگ آهن وارداتی خود از اوکراین را ۳.۴ درصد افزایش داده است.
- ▲

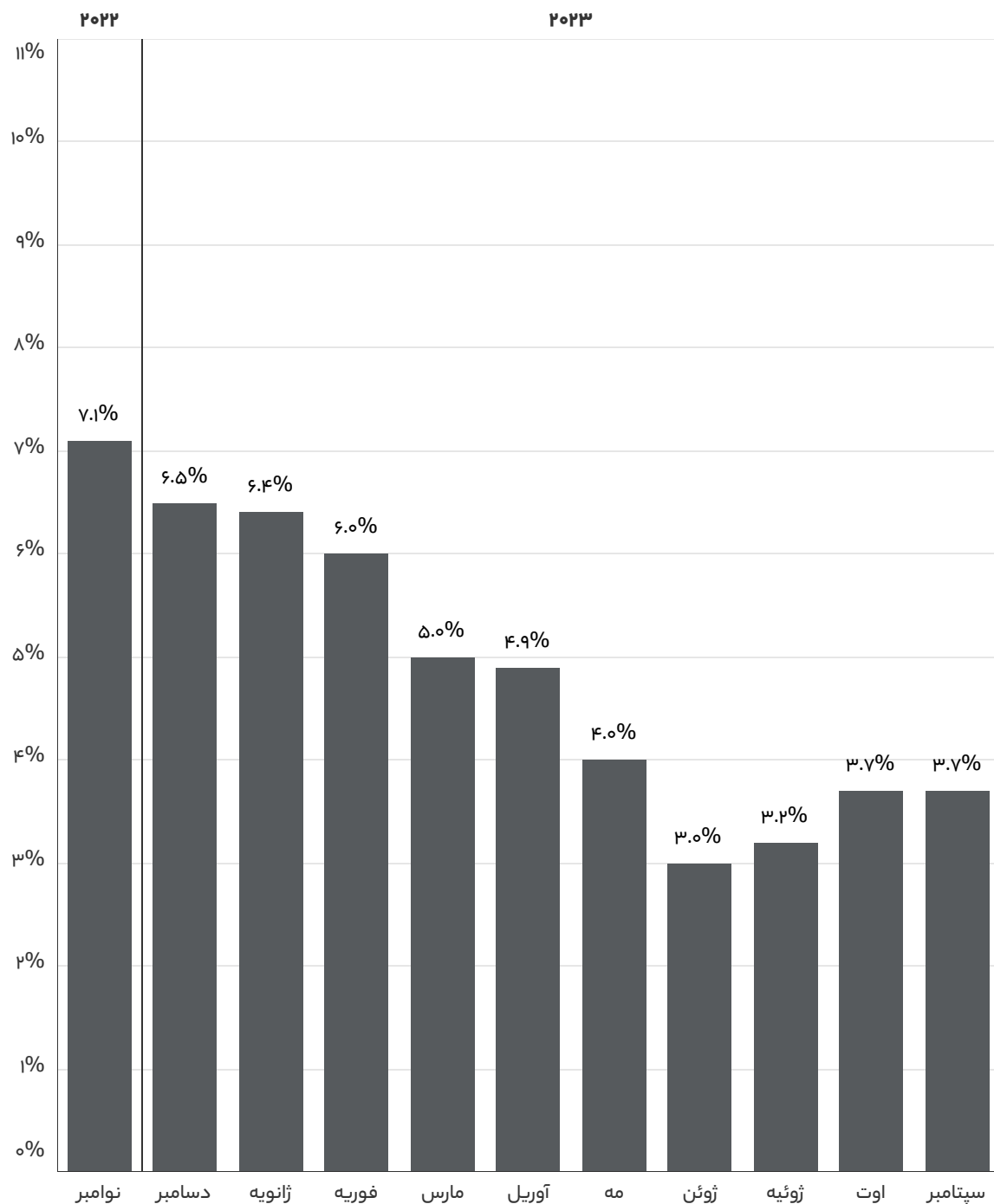
به گزارش رویترز، در هفته‌های اخیر به دلیل نگرانی در مورد تشدید درگیری بین اسرائیل و حماس و احتمال مختل شدن عرضه جهانی نفت، قیمت نفت افزایش پیدا کرده است. به صورت کلی در هفته اخیر قیمت نفت متغیر بوده است و علت آن این است که حمله‌های هوایی و زمینی اسرائیل به نوار غزه همچنان ادامه دارد و حماس آزادی گروگان‌ها در غزه را منوط به آتش بس در این منطقه کرده است. اگرچه تحولات خاورمیانه هنوز تاثیر مستقیمی بر عرضه نفت نگذاشته، اما بسیاری نگرانند صادرات نفت ایران به عنوان یکی از تولیدکنندگان بزرگ منطقه و حامی حماس کاهش پیدا کند. تحلیلگران بانک سرمایه‌گذاری گل‌دمن ساکس هنوز هم پیش‌بینی می‌کنند متوسط قیمت نفت خام برنت در سه ماهه اول ۲۰۲۴ برابر با ۹۵ دلار در هر بشکه باشد اما آن‌ها اعلام کردند کاهش صادرات نفت ایران می‌تواند این رقم را ۵ درصد افزایش دهد.
- ▼

به گزارش رویترز، تولید نفت اوپک با وجود ادامه کاهش تولید عربستان و سایر اعضای اوپک پلاس، در ماه اکتبر برای سومین ماه متوالی افزایش یافت. افزایش تولید این سازمان در ماه اکتبر ناشی از افزایش تولید نیجریه که با سرقت نفت خام و ناامنی در منطقه تولیدکننده نفت خود دست و پنجه نرم می‌کرد و آنگولا بوده است. ایران هم با وجود تحریم‌های آمریکا عرضه خود را در این ماه اندکی افزایش داده است. تولید ۱۰ عضو اوپک پلاس در این گروه که متعهد به توافق کاهش تولید هستند، روزانه ۱۵۰ هزار بشکه افزایش یافته است. از طرف دیگر، عربستان و سایر اعضای حاشیه خلیج فارس به شدت به توافق کاهش تولید پایبند هستند.
- ▼

تولید نفت آمریکا در ماه اوت به بالاترین حد خود رسید و از سطح تولید از پیش از دوران همه‌گیری کرونا، فراتر رفت. جدیدترین داده‌های منتشر شده از سوی اداره اطلاعات انرژی آمریکا نشان داد تولید میدانی نفت آمریکا در ماه اوت، به ۴۰۴.۶ میلیون بشکه یا به طور میانگین، ۱۳۰.۰۵ میلیون بشکه در روز رسید و رکورد قبلی تولید آمریکا در ژوئیه (۴۰۱.۷۳ میلیون بشکه) را شکست. رکورد جدید تولید نفت آمریکا، مدت کوتاهی پس از خرید ۶۰ میلیارد دلاری یک شرکت نفتی پایونیر نچرال ریسورسز توسط شرکت بزرگ آمریکایی اکسون موبیل گزارش می‌شود. اکثر شرکت‌های نفتی در آمریکا انضباط مالی را انتخاب کرده‌اند که منجر به افزایش آهسته و پیوسته تولید شده است. با وجود رکورد بالای تولید که در ماه اوت مشاهده شد، ذخایر نفت خام در آمریکا، حدود سه میلیون بشکه با سطح ذخایر در ابتدای سال ۲۰۲۳، اختلاف دارد.

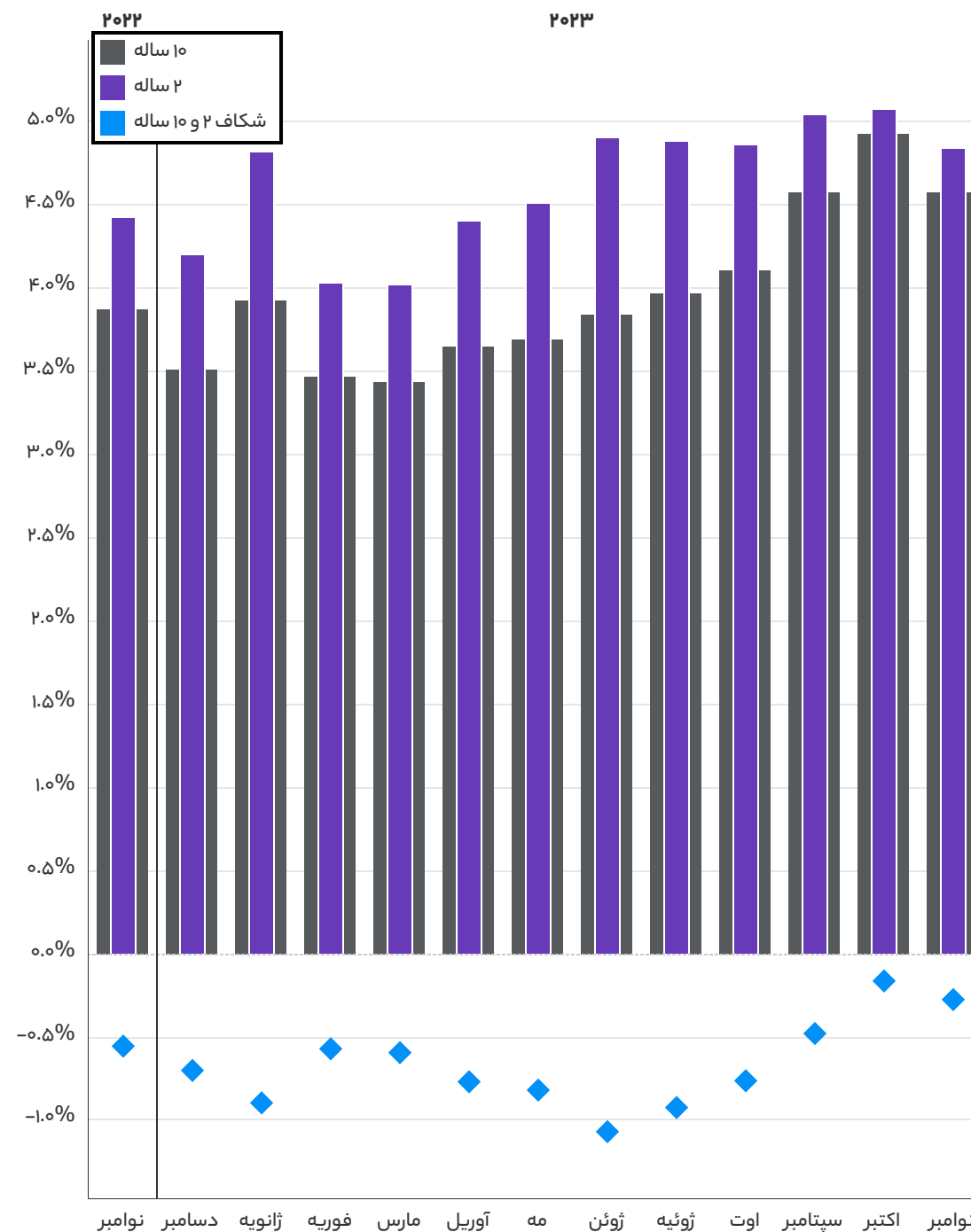
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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

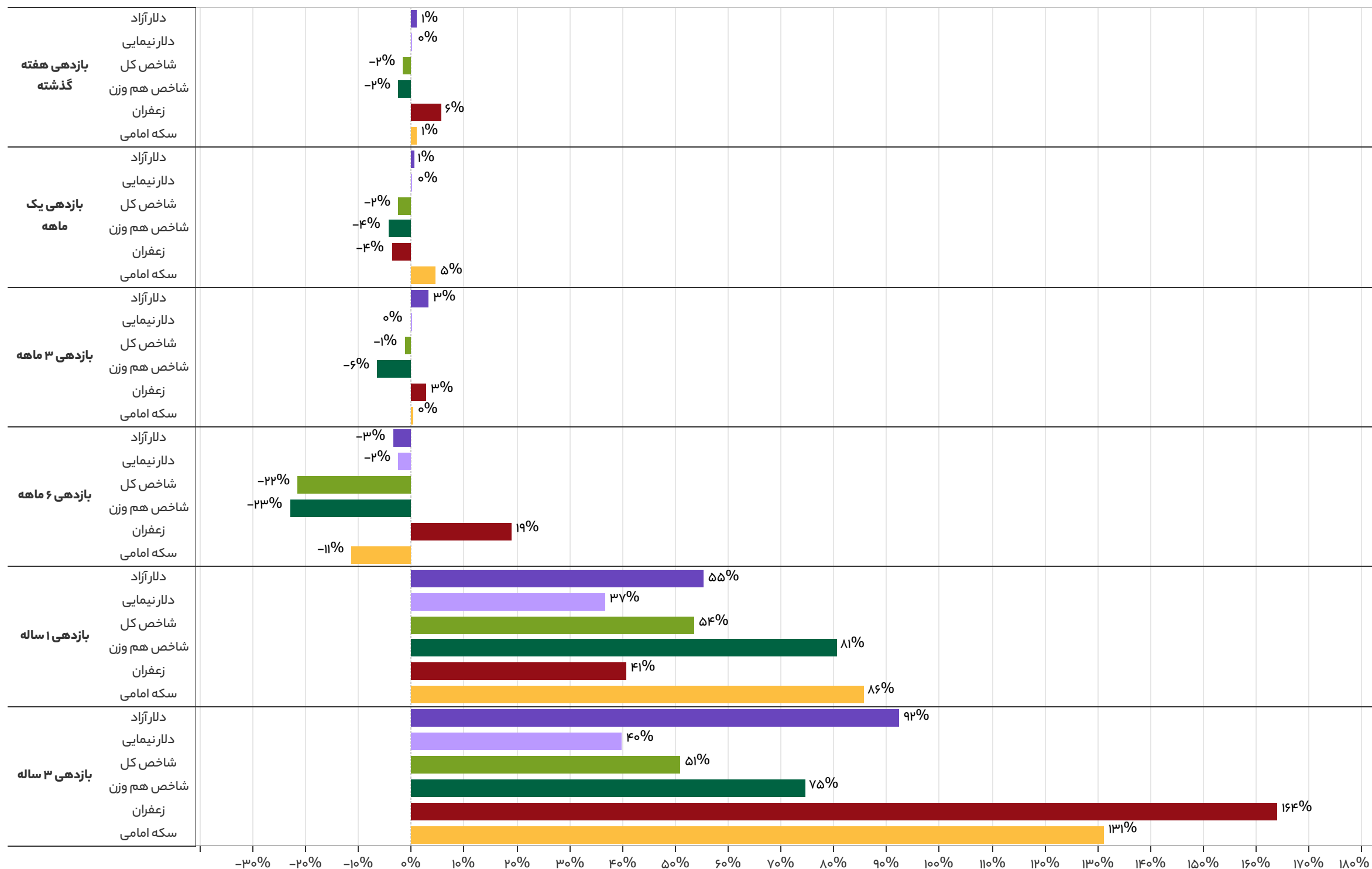
EQUITY MARKET

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
۱۴۰۱/۰۸	۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	هم وزن ۴۴%	زعفران ▲۸۳.۷%
سکه امامی ▲۸.۹%	دلار آزاد ▲۱۲.۰%	دلار آزاد ▲۸.۶%	سکه امامی ▲۱۷.۷%	دلار آزاد ▲۰.۲%	هم وزن ▲۲۹.۷%	دلار آزاد ▲۰.۸%	مسکن ▲۴.۰%	زعفران ▲۱۲.۳%	زعفران ▲۳.۶%	شاخص کل ▲۹.۳%	سکه امامی ▲۳.۱%	شاخص کل ۴۰%	سکه امامی ▲۷۶.۱%
دلار آزاد ▲۸.۲%	شاخص کل ▲۶.۲%	شاخص کل ▲۱۰.۸%	دلار آزاد ▲۱۴.۷%	شاخص کل ▲۳۰.۳%	شاخص کل ▲۱۶.۴%	شاخص کل ▼۱.۰%	درآمد ثابت ▲۱.۹%	درآمد ثابت ▲۱.۸%	سکه امامی ▲۳.۳%	هم وزن ▲۸.۸%	درآمد ثابت ▲۱.۹%	سکه امامی ۳۹%	سکه امامی ▲۷۲.۴%
شاخص کل ▲۷.۶%	هم وزن ▲۱۰.۲%	هم وزن ▲۱۷.۱%	زعفران ▲۱۴.۵%	هم وزن ▲۲۴.۳%	دلار آزاد ▲۳.۷%	هم وزن ▼۰.۶%	دلار نیمایی ▼۰.۵%	دلار آزاد ▲۰.۰%	درآمد ثابت ▲۱.۹%	درآمد ثابت ▲۱.۹%	دلار آزاد ▲۱.۵%	دلار نیمایی ۲۵%	سکه امامی ▲۶۴.۸%
مسکن ▲۶.۸%	زعفران ▲۳.۱%	زعفران ▲۱.۰%	دلار نیمایی ▲۱۲.۷%	زعفران ▲۰.۸%	درآمد ثابت ▲۲.۰%	زعفران ▲۱.۶%	زعفران ▼۱.۰%	دلار نیمایی ▼۱.۷%	دلار آزاد ▲۱.۴%	زعفران ▲۱.۳%	مسکن ▲۱.۰%	دلار نیمایی ۲۱%	سکه امامی ▲۵۳.۴%
هم وزن ▲۶.۷%	مسکن ▲۲.۹%	مسکن ▲۸.۱%	مسکن ▲۹.۹%	مسکن ▲۱۴.۲%	مسکن ▲۱.۸%	مسکن ▲۱۳.۴%	هم وزن ▼۲.۳%	مسکن ▼۲.۲%	دلار نیمایی ▲۰.۱%	دلار آزاد ▲۰.۲%	دلار نیمایی ▼۰.۱%	دلار نیمایی ۱۹%	سکه امامی ▲۴۴.۶%
درآمد ثابت ▲۱.۹%	دلار نیمایی ▲۲.۸%	دلار نیمایی ▲۲۲.۰%	درآمد ثابت ▲۲.۰%	دلار نیمایی ▼۲.۰%	زعفران ▼۰.۱%	دلار نیمایی ▲۲.۸%	شاخص کل ▼۵.۶%	سکه امامی ▼۳.۵%	مسکن ▼۱.۰%	دلار نیمایی ▼۰.۱%	شاخص کل ▼۴.۱%	زعفران ۱۹%	مسکن ۱۹%
دلار نیمایی ▲۱.۴%	درآمد ثابت ▲۲.۰%	درآمد ثابت ▲۲.۱%	شاخص کل ▼۷.۵%	درآمد ثابت ▲۲.۰%	سکه امامی ▼۰.۴%	درآمد ثابت ▲۲.۰%	دلار آزاد ▼۶.۱%	هم وزن ▼۶.۲%	شاخص کل ▼۲.۳%	مسکن ▼۰.۶%	هم وزن ▼۴.۴%	مسکن ۱۹%	درآمد ثابت ۰%
زعفران ▼۲.۳%	سکه امامی ▲۱۴.۷%	سکه امامی ▲۳۱.۳%	هم وزن ▼۸.۷%	سکه امامی ▲۹.۷%	دلار نیمایی ▼۱.۸%	سکه امامی ▲۰.۴%	سکه امامی ▼۱۱.۱%	شاخص کل ▼۸.۸%	هم وزن ▼۵.۲%	سکه امامی ▼۱.۶%	زعفران ▼۴.۷%	درآمد ثابت ▲۲۵.۴%	درآمد ثابت ۰%

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

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

– بازده مسکن با استفاده از 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.

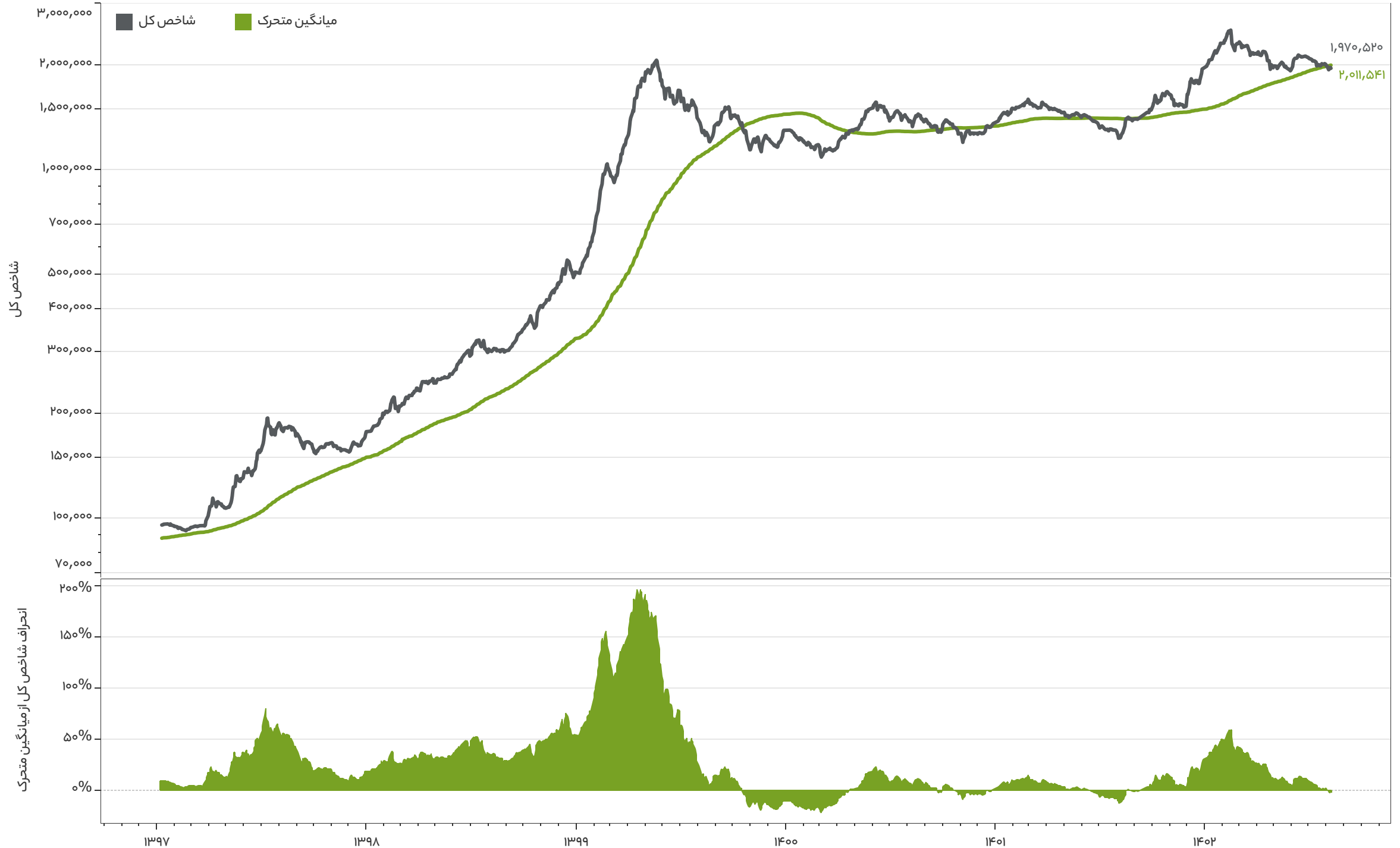
ارزش دلاری بازار

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



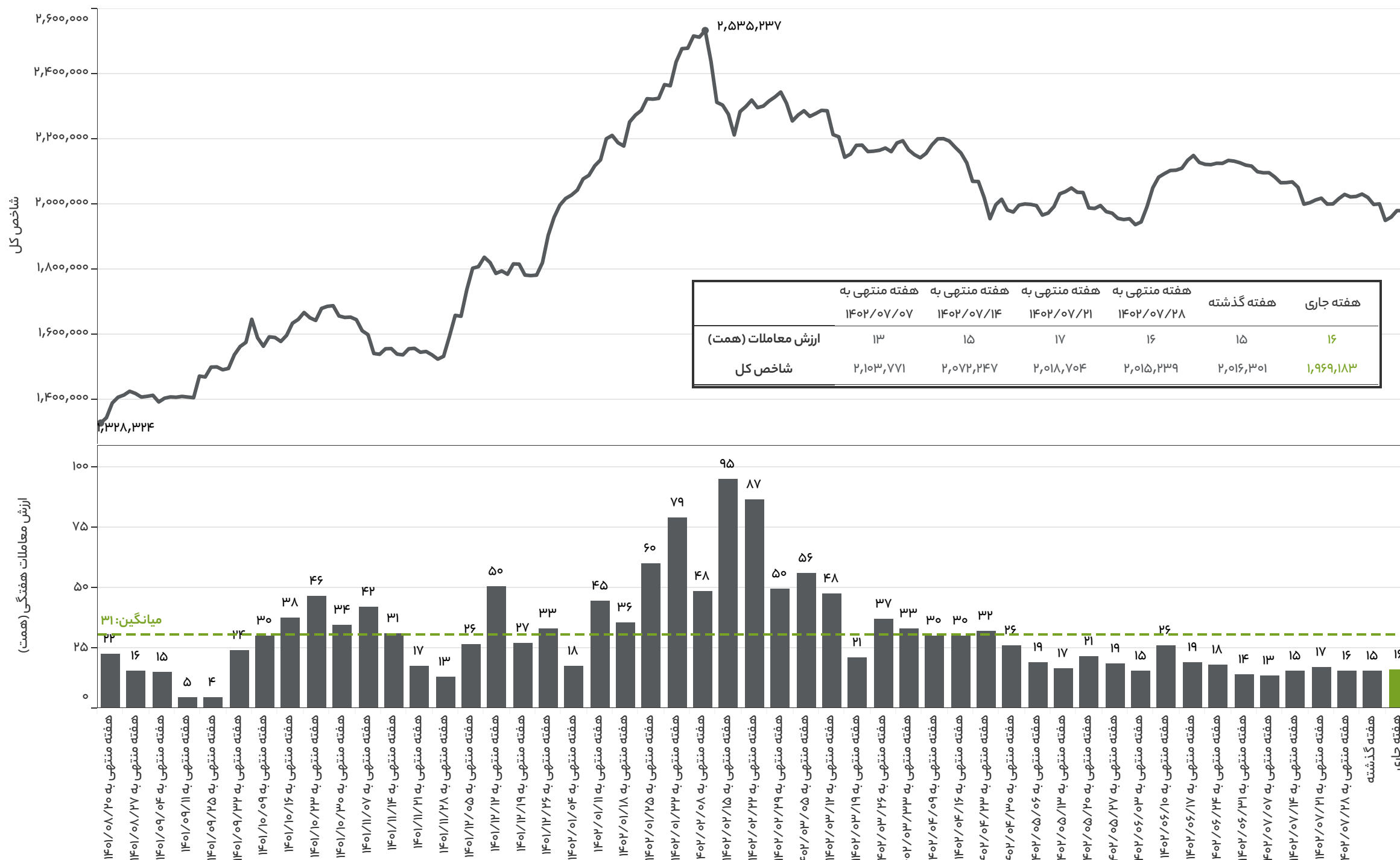
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



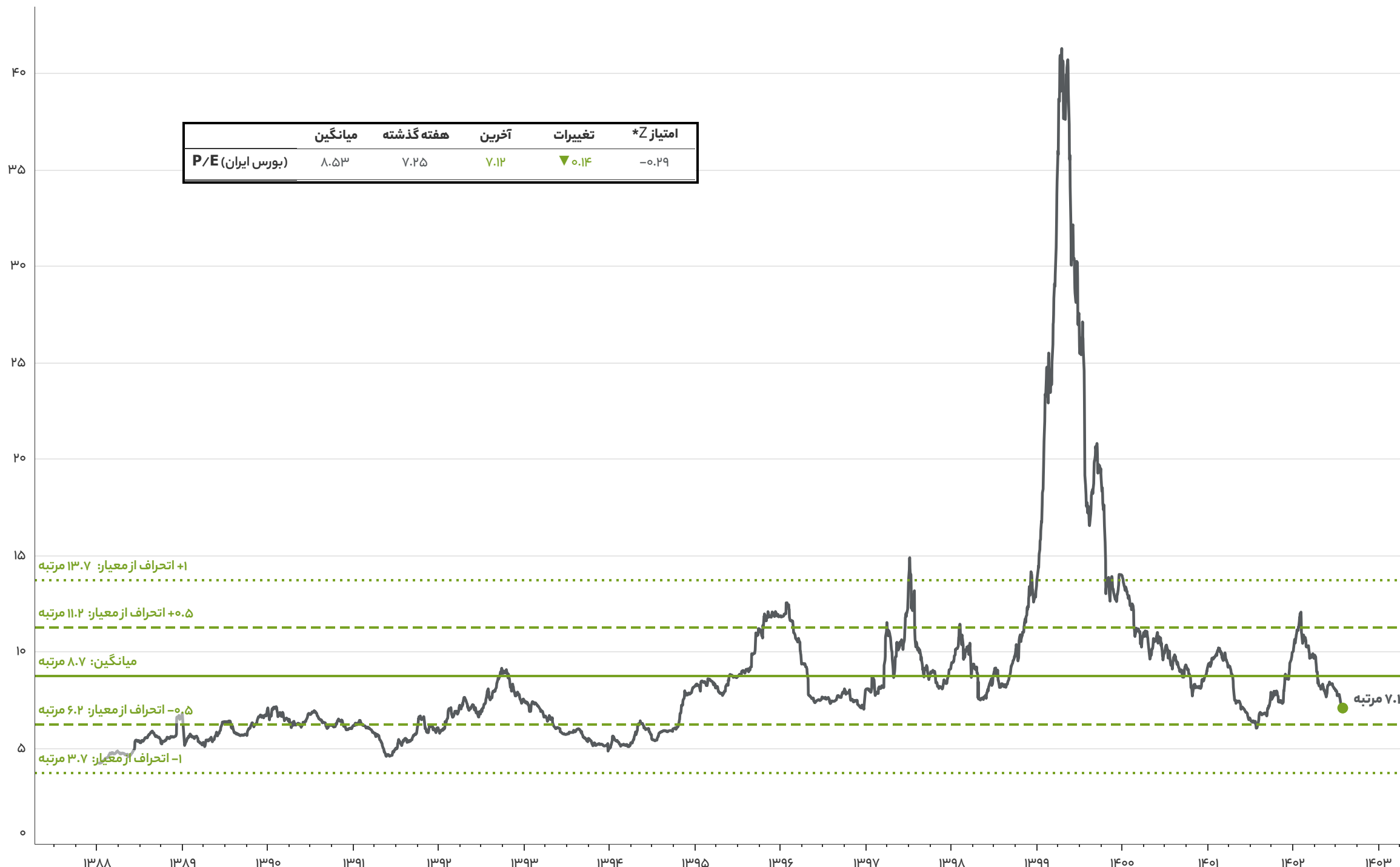
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

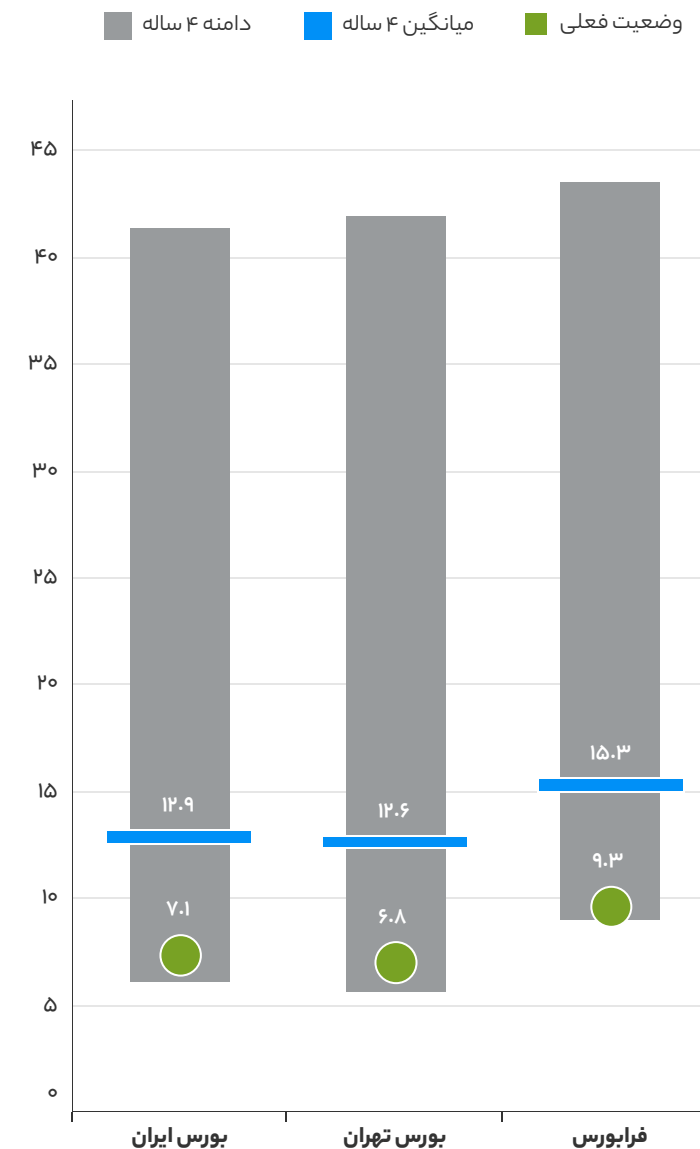
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	۷.۱۲	۷.۲۵	۶.۰۷	۱۲.۸۸	۴۱.۳۳
بورس تهران	۶.۷۹	۶.۹۰	۵.۶۴	۱۲.۶۴	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۳۱	۹.۶۶	۹.۰۳	۱۵.۲۹	۴۳.۵۱



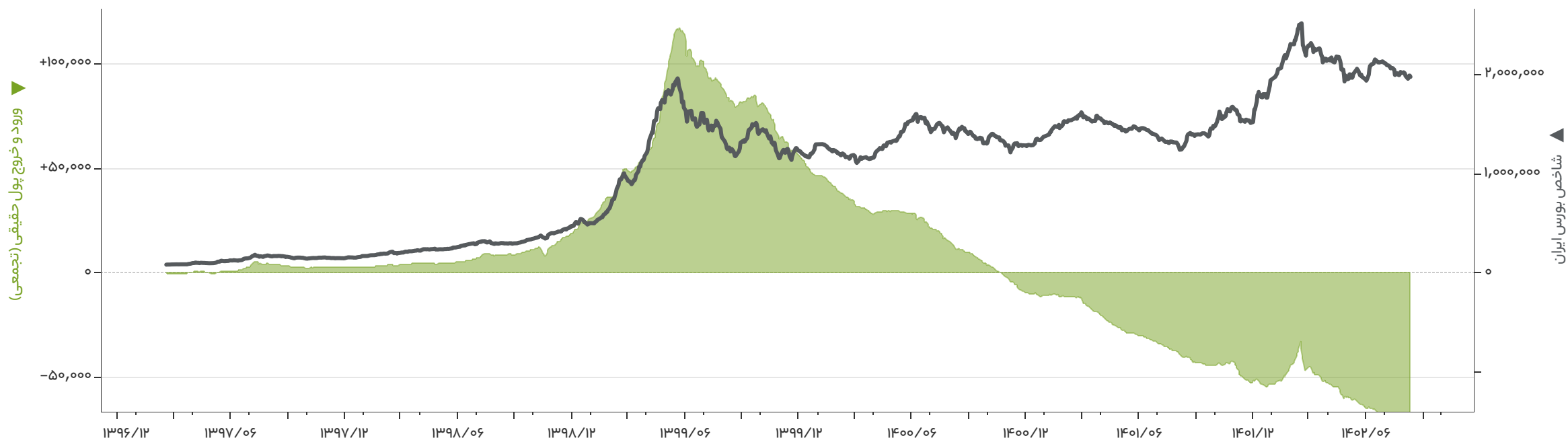
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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	۸۵	۹۷	۱۰۹	۱۴۵	۱۷۰	۱۹۹	۳۲۹	۵۹۷	۳,۰۵۶	۳,۰۶۷	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۱%	۱.۲%	۱.۴%	۱.۸%	۲.۲%	۲.۵%	۴.۲%	۷.۶%	۳۸.۷%	۳۸.۸%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱,۰۹۲.۷	۱۶.۹	۱۱۲.۸	۳,۹۵۷.۸	۱,۶۴۴.۶	۸۹۳.۹	۴,۳۸۴.۵	۴۱۳.۲	۱,۷۲۰.۹	۴,۵۸۱.۴	۳,۲۸۹.۶	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۳%	۱۷.۷%	۳.۹%	۲.۷%	۷.۲%	۵.۱%	۴.۵%	۲.۶%	۱۵.۰%	۱۰.۵%	۹.۷%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۶%	۳۷%	۵۴%	۳۴%	۶۳%	۶۲%	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)	+۴۹۶%	+۷۸۹%	+۹۸%	+۲۶۴%	+۳۵۰%	+۳۶۹%	+۳۹۶%	+۷۵۸%	+۷۶۰%	+۸۰۵%	+۸۵۱%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۷%	+۱۱۷%	-۶۸%	-۶%	+۷%	-۱۹%	-۷%	-۲۲%	+۱۱%	-۵%	+۴۹%	
بازده از ابتدای سال	+۱۶۶%	+۴۳%	+۲۷%	+۵۶%	+۷۹%	+۸۰%	+۴۶%	+۶۹%	+۸۳%	+۵۷%	+۶۶%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۲%	-۲%	۳%	-۱%	-۲%	۴%	-۳%	-۳%	-۲%	۱%	-۱%	



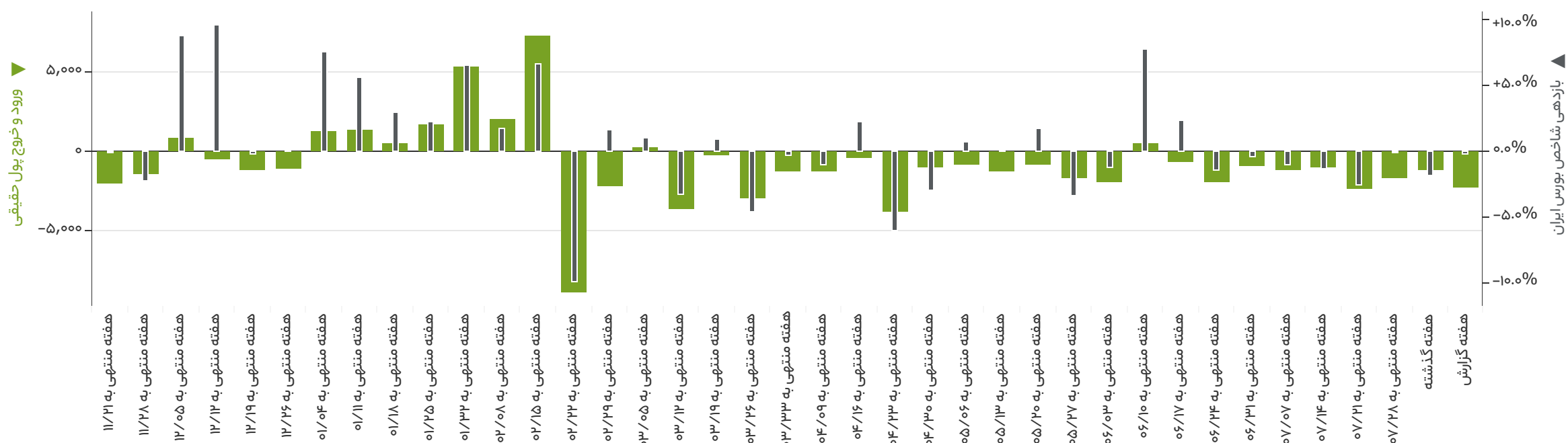
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



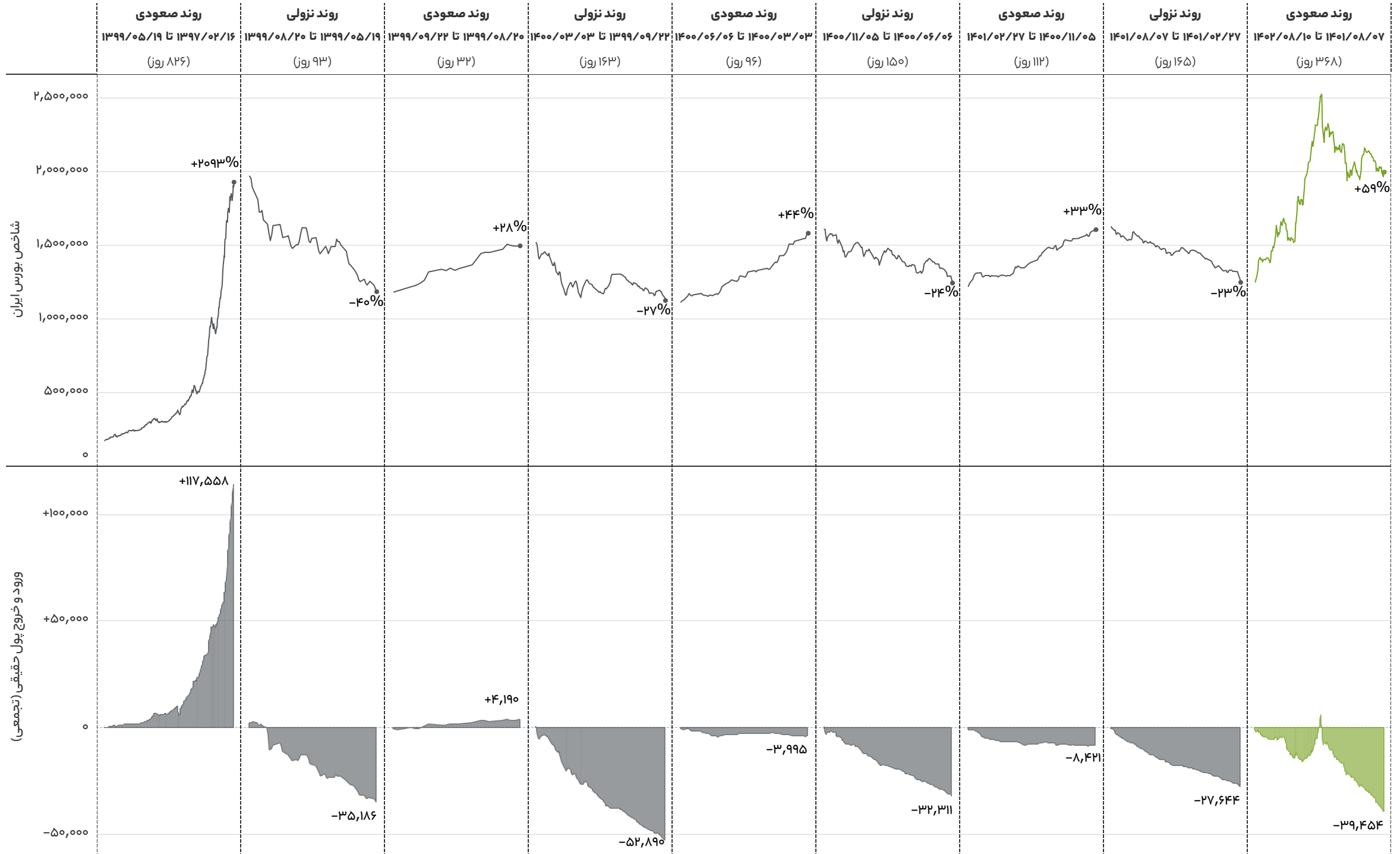
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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

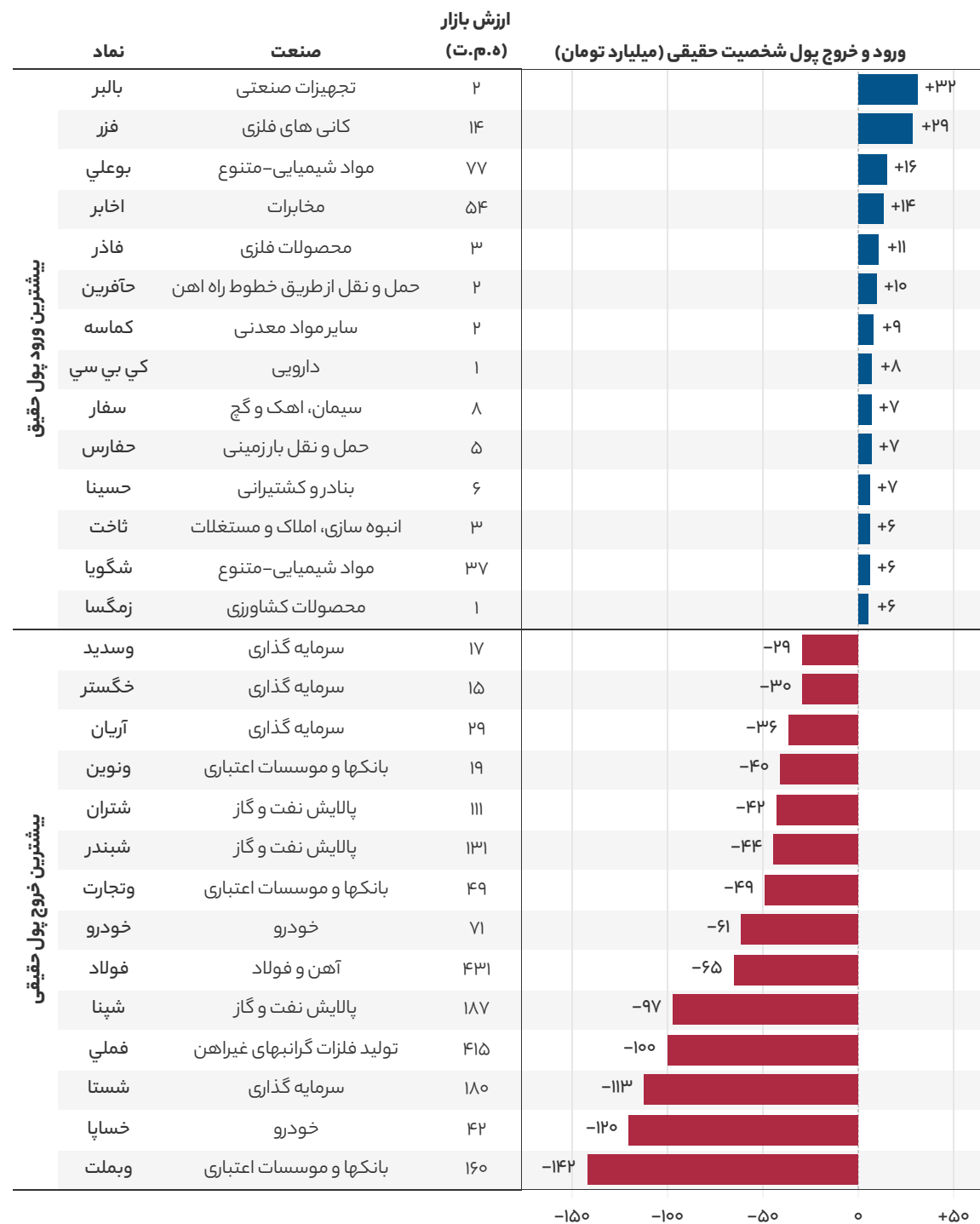




ورود و خروج پول

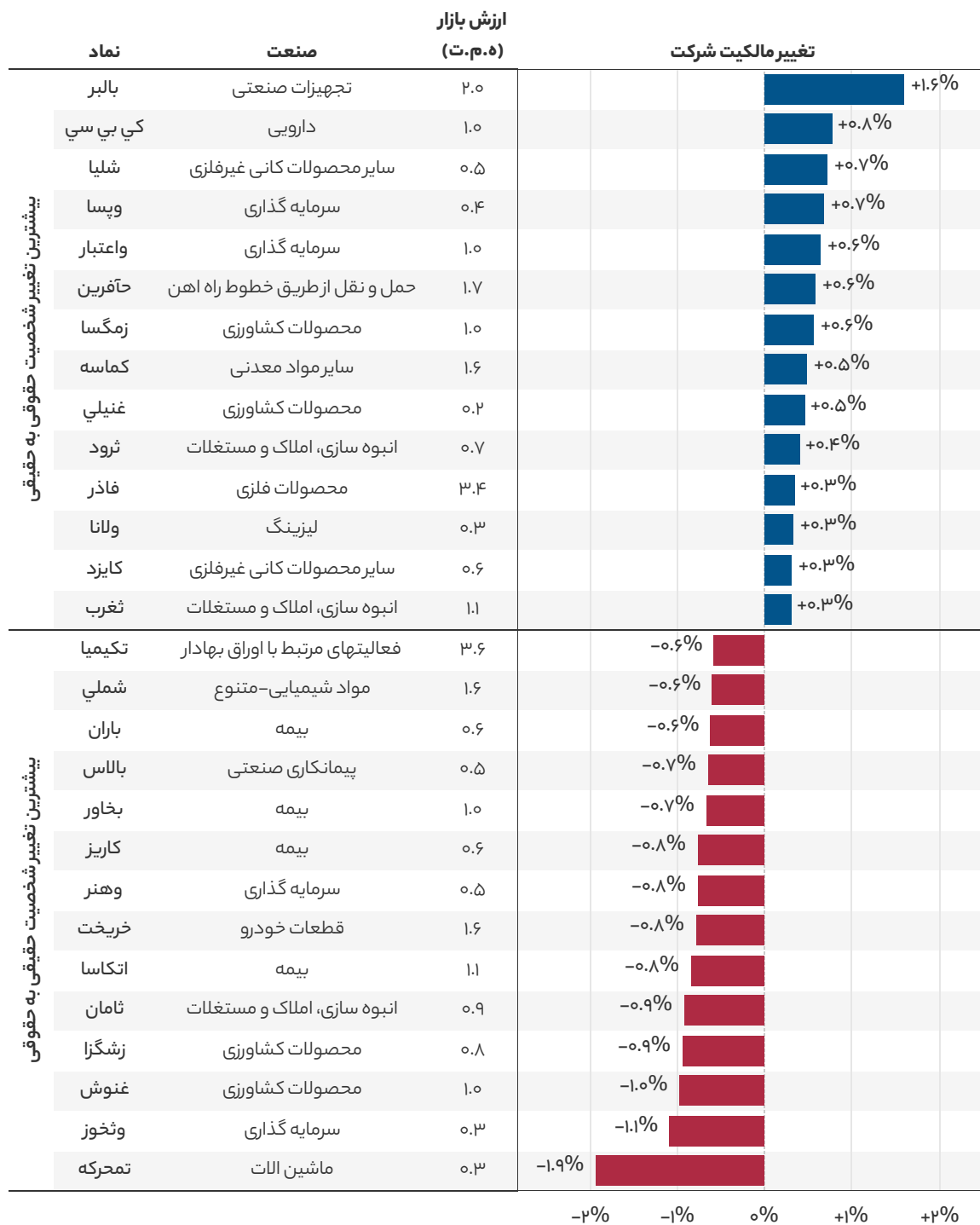
ورود و خروج پول حقیقی

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



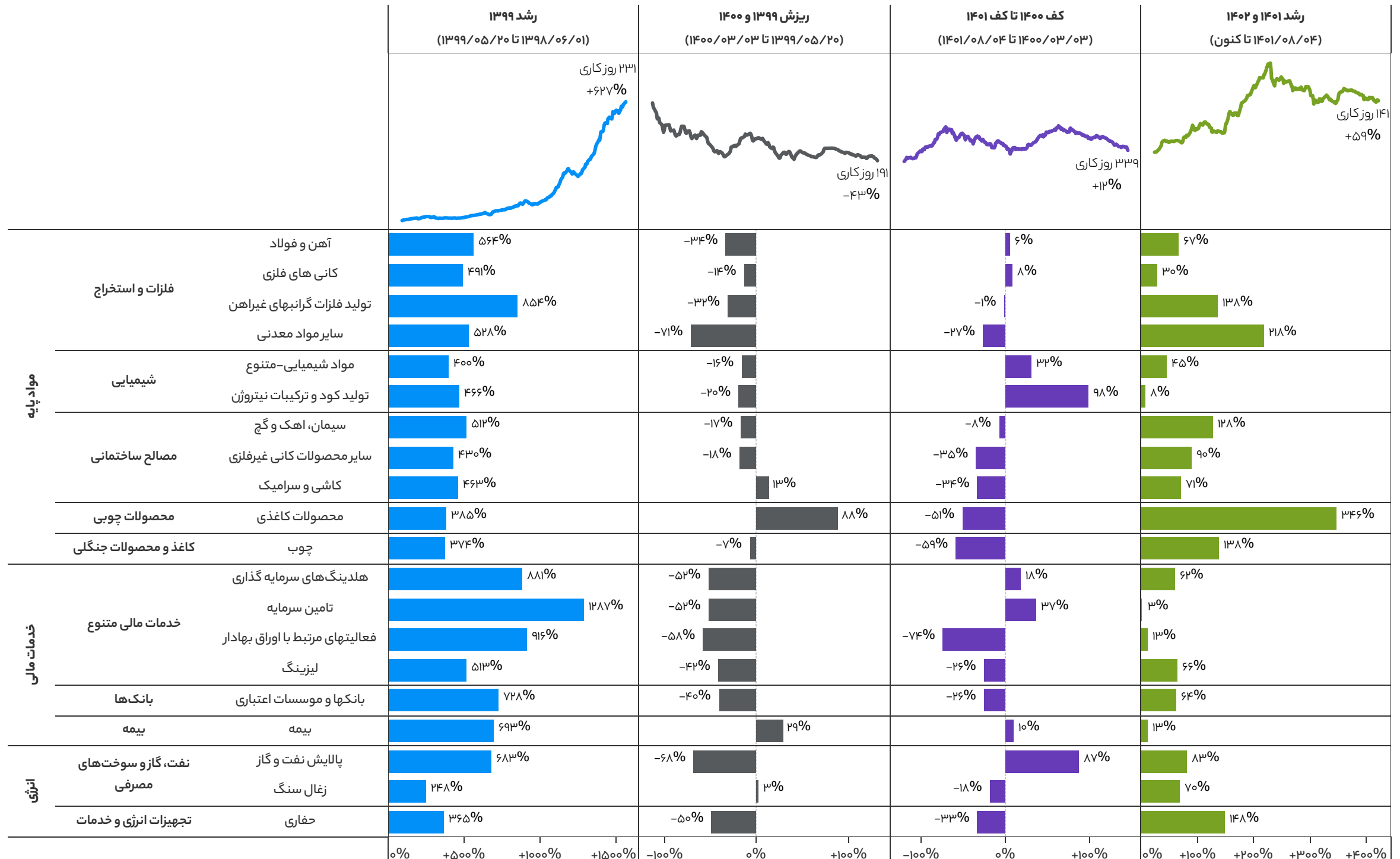
تغییر مالکیت شرکت

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



بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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



بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

			رشد ۱۴۰۱ و ۱۴۰۲	کف ۱۴۰۰ تا کف ۱۴۰۱	ریزش ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰	رشد ۱۳۹۹			
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	خودرو	۳۰%	۱۳%	-۷۰%	۱۲۴۷%	خودرو	قطعات خودرو	۶۷۶%
		لاستیک و پلاستیک	۶۶%	-۲۵%	-۳۲%	۶۳۱%			۶۳۱%
		خرده فروشی	۱۵۴%	۳%	-۲۳%	۱۱۲۹%			۱۱۲۹%
	کالای مصرفی با دوام	وسایل خانگی	۱۲۳%	-۳۶%	-۴۶%	۴۹۰%	کالای مصرفی با دوام	نساجی	۳۸۰%
		خدمات مصرف کننده	۱۲%	۱۸%	-۶۷%	۱۱۶۶%			۱۱۶۶%
مصرفی غیردوره‌ای	غذا و نوشیدنی	محصولات کشاورزی	۲۳%	۹%	-۳۵%	۳۹۷%	غذا و نوشیدنی	محصولات لبنی	۵۹۵%
		شیرینیجات	۵۷%	-۶۳%	-۲۴%	۴۳۵%			۴۳۵%
		شکر	۷۱%	-۴۴%	-۲۲%	۳۸۳%			۳۸۳%
		محصولات لبنی	۱۲۲%	-۵۴%	۷%	۶۹۹%			۶۹۹%
		سایر محصولات غذایی	۲۹%	-۳۹%	-۳۴%	۵۳۹%			۵۳۹%
		نوشیدنی	۵۹%	-۳۱%	-۱۵%	۳۰۶%	محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	۳۰۶%
صنعتی	کالاهای سرمایه‌ای	محصولات پاک کننده	۳۱%	-۱۲%	۴%	۵۲۱%		فعالیت مهندسی	۵۲۱%
		ماشین الات الکتریکی	۶۶%	-۷%	-۶۳%	۵۰۱%			۵۰۱%
		محصولات فلزی	۱۲۱%	-۲۳%	-۴۵%	۶۴۵%			۶۴۵%
		ماشین الات	۱۰۲%	-۴۴%	-۵۴%	۴۲۲%			۴۲۲%
		تجهیزات صنعتی	۶۳%	-۳۱%	-۳۵%	۸۴۷%			۸۴۷%
		پیمانکاری صنعتی	۹۱%	-۴۰%	-۳۰%	۵۲۵%			۵۲۵%
	ترابری	بنادر و کشتیرانی	۱۶۶%	-۱۵%	-۲۲%	۲۴۶%	ترابری	حمل و نقل از طریق راه آهن	۳۲۷%
		حمل و نقل	۴۱%	-۴۱%	-۱۳%	۲۵۰%			۲۵۰%
		حمل و نقل بارزمینی	۶۳%	۳۳%	-۱۸%	۳۲۱%			۳۲۱%
تکنولوژی	ارتباطات	دارویی	۷۹%	-۱۳%	-۳۲%	۲۵۲%	ارتباطات	مخابرات	۵۳۲%
		نرم افزار و خدمات	۴۹%	۲%	-۳۵%	۵۷۰%			۵۷۰%
		سخت افزار و تجهیزات	۱۱۶%	-۴۵%	-۶۵%	۲۲۳%			۲۲۳%
یوتیلیتی	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - متنوع	۴۳%	۱۳۱%	-۳۵%	۳۱۰%	یوتیلیتی	خدمات رفاهی - برق	۱۷۶%
		انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۶۶%	-۴۵%	-۵۴%	۶۱۹%			۶۱۹%
		توسعه املاک و مستغلات							

بازده صنایع از ابتدای هفته

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



بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)

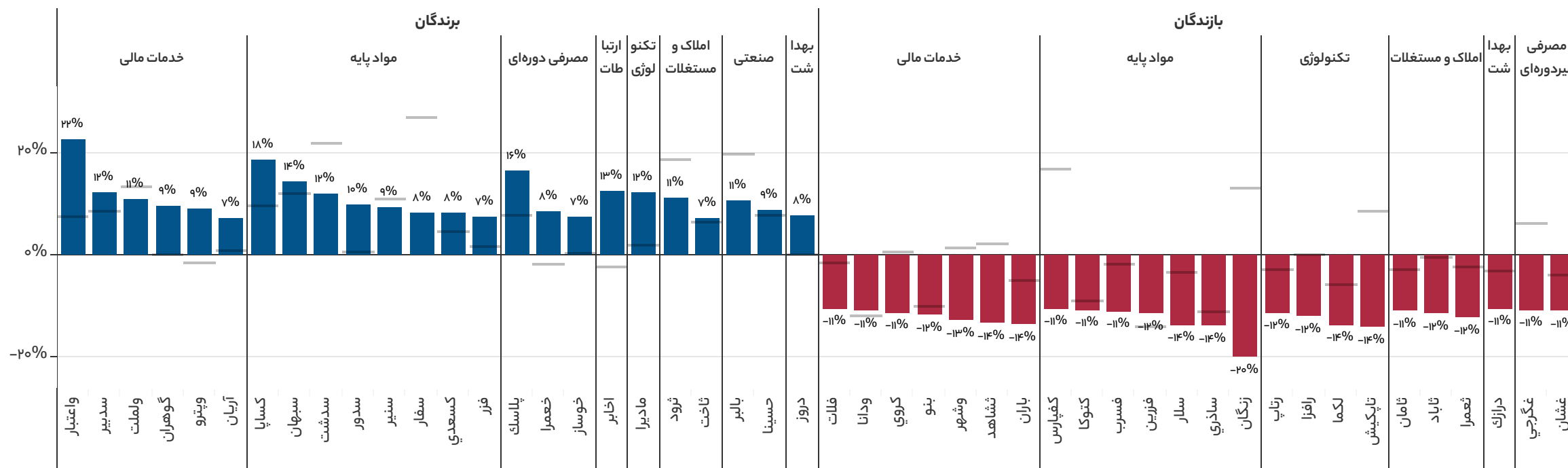




برندگان و بازندگان هفته

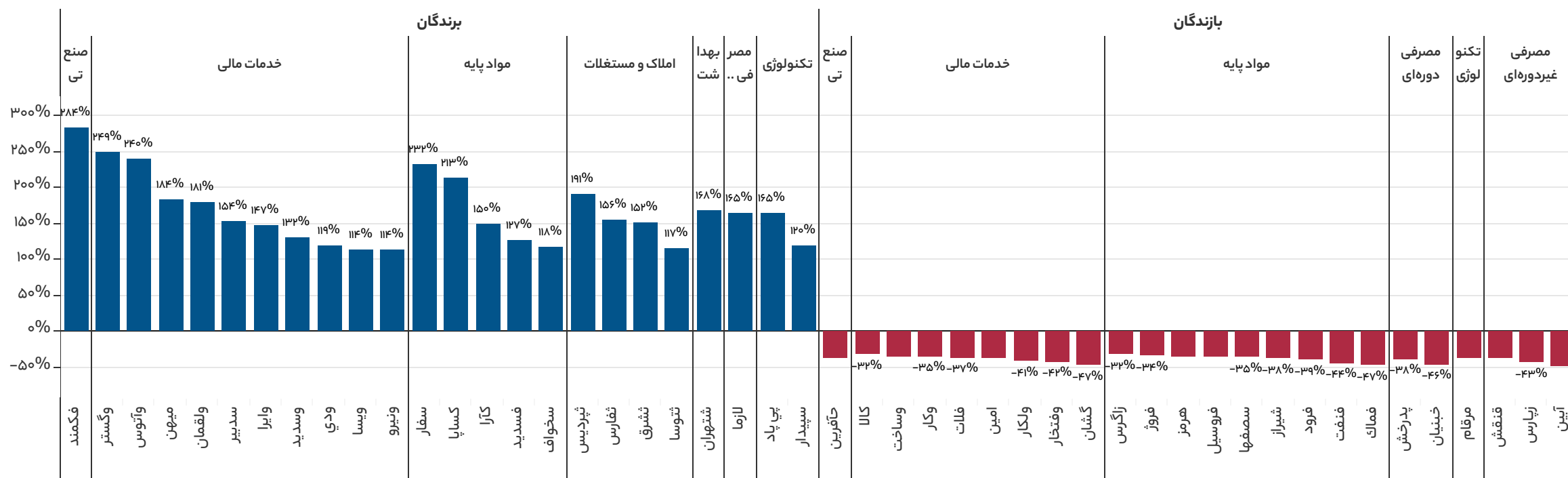
برندگان و بازندگان هفته

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



برندگان و بازندگان سال

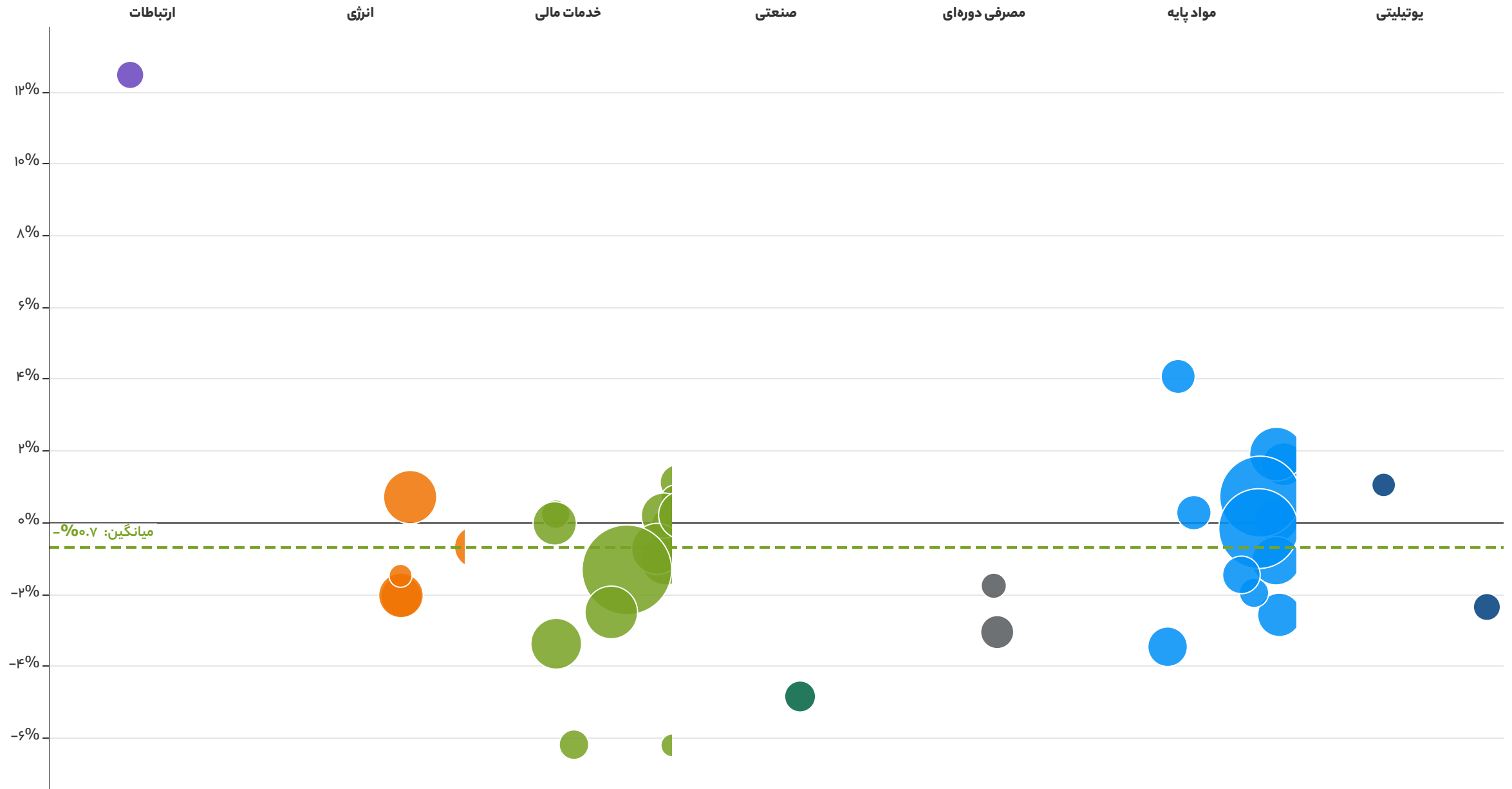
(پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





بازدەهی بزرگترین ٤٠ شرکت سهامي طی هفته گذشته

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

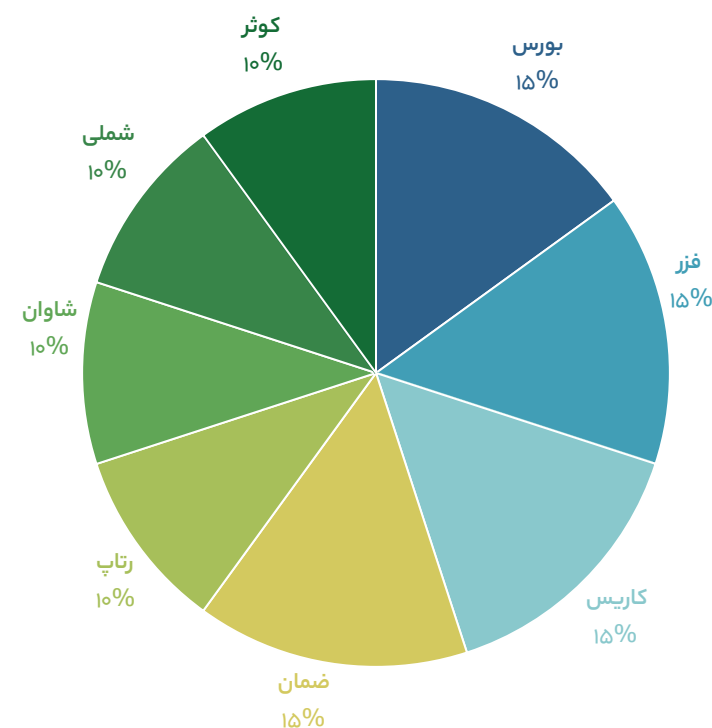


بازده هفته گذشته	اخابر	یوعلي	کگل	نوري	ومعادن	بفجر	فولاد	شپنا	وکفدير	جم	تامنيکو	پارسان	واميد	کگهر	پياس	وپاسار	وسندوق	فملي	وغدير	پارس	ميدکو	وتجارت	ويملت	کچاد	فارس	شپديس	شبريز	خساپا	فخوز	شبندر	شتان	مبين	شتا	مارون	خودرو	تاپيکو	آريا	رمينا	حکشتي	وسپهر
	+١٢.٥%	+٤.١%	+١.٩%	+١.٧%	+١.١%	+١.١%	+٠.٧%	+٠.٧%	+٠.٧%	+٠.٣%	+٠.٣%	+٠.٢%	+٠.٢%	+٠.١%	٠%	٠%	-٠.١%	-٠.١%	-٠.١%	-٠.٧%	-٠.٧%	-٠.٨%	-١.٠%	-١.٠%	-١.٣%	-١.٤%	-١.٥%	-١.٧%	-١.٩%	-٢.٠%	-٢.٠%	-٢.٣%	-٢.٥%	-٢.٥%	-٣.٠%	-٣.٤%	-٣.٤%	-٤.٨%	-٦.٢%	-٦.٢%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۰۴۴	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۱۹,۸۰۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۷,۵۸۰	پتانسیل حذف دلار دولتی، انتظار افزایش سودآوری زیر مجموعه	۹,۸۰۰	شملی	
۱۰%	۳,۰۵۵	رشد سودآتی شرکت ناشی از سرمایه گذاری‌ها و عملیات بیمه‌ای	۴,۱۰۰	کوثر	
۱۵%	۱۴,۸۵۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۴,۸۶۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۷,۰۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۶,۵۰۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۵۰,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۰,۶۳۱	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





مهم‌ترین محدوده مقاومتی شاخص کل در تصویر مشخص شده است. شرط تداوم روند صعودی عبور پر قدرت از این محدوده است.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین محدوده مقاومتی شاخص هم‌وزن در تصویر مشخص شده است. شرط تداوم روند صعودی، عبور پر قدرت از این محدوده است.

توضیحات تحلیل



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

توضیحات تحلیل



این نسبت در محدوده حمایتی معتبری است و انتظار می‌رود از این محدوده صعود موقتی را تجربه کند.

توضیحات تحلیل



محدوده ۵۱,۵۰۰ تومان، محدوده مهم حمایتی است که در صورت از دست رفتن این محدوده انتظار می‌رود روند اصلاحی تا حوالی ۵۰,۰۰۰ تومان را تجربه کند.

توضیحات تحلیل



محدوده ۲۹.۳۵ میلیون تومان، محدوده مهم حمایتی است که در صورت از دست رفتن این محدوده انتظار می‌رود روند اصلاحی تا حوالی ۲۸ میلیون تومان را تجربه کند.

توضیحات تحلیل



محدوده حمایتی مهم مشخص شده است. در صورت از دست رفتن این محدوده اصلاح تا حوالی ۱۹۴۳ ادامه دارد.

توضیحات تحلیل

Brent Oil Futures · 2h · MOEX

1

USD

BLL

100.00

98.00

96.00

94.00

92.00

90.00

88.50

87.00

85.94

85.50

84.00

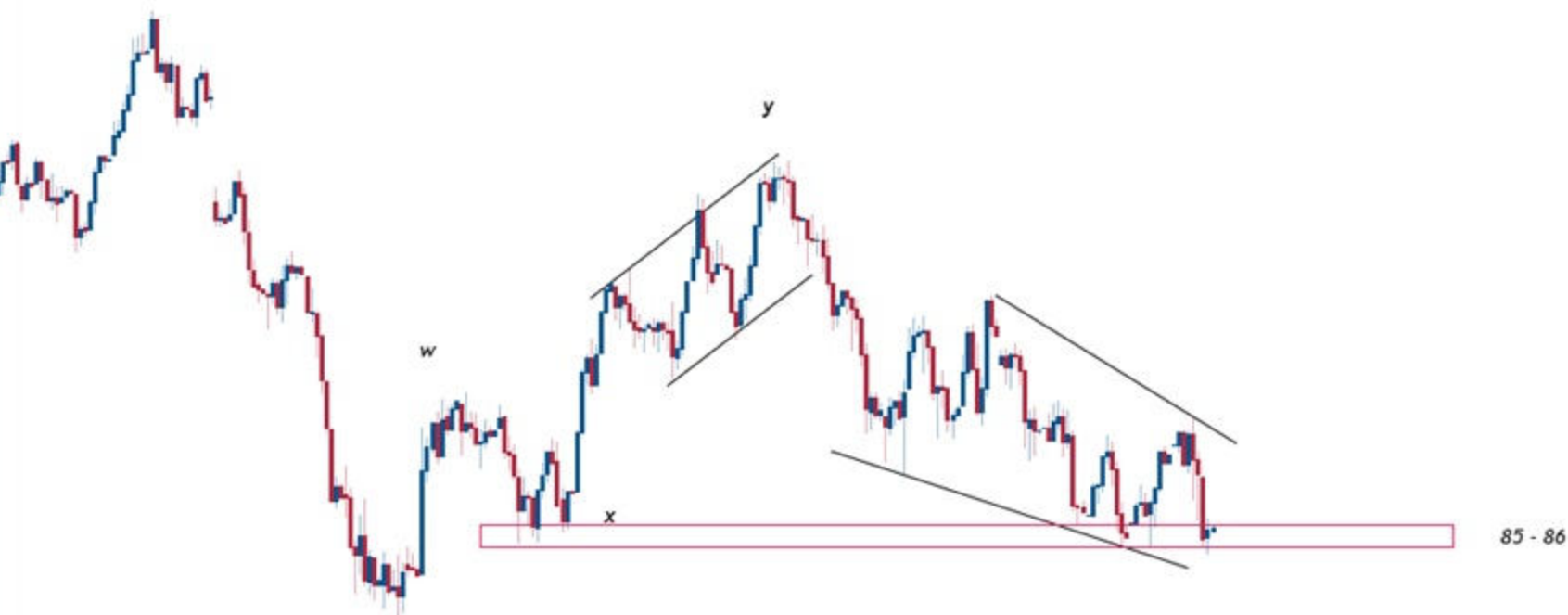
82.50

81.50

80.50

79.50

78.50



TradingView



انتظار می‌رود مدتی در حوالی ۸۵ - ۸۶ دلار در نوسان باشد.

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 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)

		نسبت P/e آینده نگر										امتیاز Z					
		برآورد سود کاریزما		رشد سود		نسبت P/e آینده نگر		با سود		با سود		آینده نگر ۴ فصله		آینده نگر ۴ فصله			
		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	میانگین تقسیم سود	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	قیمت (تومان)	ارزش بازار (همت)	سال مالی	نماد	فعالیت	گروه صنعتی	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله
مواد پایه	الفین	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۷۸%	۱,۳۶۴	۱۵,۳۰۰	۱۲۲.۴	۱۲	مارون	الفین	شیمیایی	-۱.۸	-۱.۸	-۱.۸	-۱.۸	-۱.۸
		۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۹۵%	۸۰۲	۷,۴۴۵	۱۰۲.۴	۱۲	آریا			-۰.۹	-۰.۹	-۰.۹	-۰.۹	-۰.۹
		۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۹۹%	۵۶۰	۴,۳۴۶	۷۸.۲	۱۲	جم			-۳.۶	-۳.۶	-۳.۶	-۳.۶	-۳.۶
		۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۹۱%	۱۴۳	۱,۵۳۰	۳۶.۷	۱۲	شگویا			-۰.۳	-۰.۳	-۰.۳	-۰.۳	-۰.۳
		۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۹۹%	۲,۱۰۹	۱۸,۰۷۰	۳۶.۱	۱۲	جم پیلن			+۱.۲	+۱.۲	+۱.۲	+۱.۲	+۱.۲
		۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۸۸%	۱,۱۶۸	۷,۰۳۵	۲۵.۳	۱۲	شکبیر			-۷.۸	-۷.۸	-۷.۸	-۷.۸	-۷.۸
		۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۹۶%	۴۱۹	۲,۸۵۰	۲۳.۰	۱۲	شاراک			-۱.۳	-۱.۳	-۱.۳	-۱.۳	-۱.۳
		۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۹۱%	۱,۰۹۶	۶,۲۱۲	۸.۱	۱۲	شغذیر			+۰.۱	+۰.۱	+۰.۱	+۰.۱	+۰.۱
		۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۸۱%	۳۷۶	۲,۷۰۰	۶.۸	۱۲	شصبیر			-۰.۷	-۰.۷	-۰.۷	-۰.۷	-۰.۷
		۶۱	۱۳۴	+۱۱۸%	۸۵%	۸۸	۷۳۰	۴.۷	۶	شجعم			-۴.۸	-۴.۸	-۴.۸	-۴.۸	-۴.۸
	آروماتیک	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۱۳,۴۲۱	۱۲۰.۸	۱۲	نوری	آروماتیک	شیمیایی	+۱.۰	+۱.۰	+۱.۰	+۱.۰	+۱.۰
		۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹۵%	۵۶۳	۵,۳۸۷	۷۷.۳	۱۲	بوعلی			+۳.۹	+۳.۹	+۳.۹	+۳.۹	+۳.۹
	اوره	۳,۲۶۲	۲,۷۱۳	-۱۷%	۶۳%	۴,۲۶۴	۱۵,۴۵۹	۹۲.۸	۶	شپدیس	اوره	شیمیایی	+۲.۲	+۲.۲	+۲.۲	+۲.۲	+۲.۲
		۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۲۱%	۷۶۱	۲,۱۰۸	۳۲.۳	۱۲	شیراز			+۱.۳	+۱.۳	+۱.۳	+۱.۳	+۱.۳
		۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۸۳%	۲,۸۱۰	۱۴,۹۴۰	۲۶.۷	۱۲	خراسان			+۳.۳	+۳.۳	+۳.۳	+۳.۳	+۳.۳
		۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۴۸%	۴۵۸	۱,۷۷۰	۱۸.۷	۱۲	کرماشا			+۰.۶	+۰.۶	+۰.۶	+۰.۶	+۰.۶
		۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۷۲%	۱,۲۶۵	۱۱,۹۰۰	۲۸.۶	۱۲	زاگرس			-۲.۸	-۲.۸	-۲.۸	-۲.۸	-۲.۸
	متانول	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۹۹%	۶۴۱	۴,۲۴۰	۲۵.۴	۱۲	شخارک	متانول	شیمیایی	-۱.۷	-۱.۷	-۱.۷	-۱.۷	-۱.۷
		۷۰	۹۰	+۲۸%	۸۹%	۱۰۲	۵۱۱	۱۵.۸	۱۲	شفن			-۲.۰	-۲.۰	-۲.۰	-۲.۰	-۲.۰
	محصولات شیمیایی	۶۲	۷۳	+۱۸%	۷۵%	۵۶	۴۶۶	۲۵.۴	۹	شیران	محصولات شیمیایی	شیمیایی	+۰.۲	+۰.۲	+۰.۲	+۰.۲	+۰.۲
	دوده صنعتی	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۸۲%	۶۴	۵۳۰	۳.۴	۱۲	شکربن	دوده صنعتی	شیمیایی	-۰.۵	-۰.۵	-۰.۵	-۰.۵	-۰.۵
		۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۷۳%	۳۹۲	۳,۷۱۰	۲.۶	۱۲	شصدف			-۱.۱	-۱.۱	-۱.۱	-۱.۱	-۱.۱
		۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۹۳%	۱۹۳	۲,۲۰۸	۲.۱	۱۲	شدوص			+۰.۱	+۰.۱	+۰.۱	+۰.۱	+۰.۱

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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																	
مواد پایه فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۳۱.۲	۵۳۹	۸۵	۵۰%	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۴.۳	۳.۷	۴.۰	+۱.۰																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																	

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z						
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر فصله	آینده نگر ۴ فصله						
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوه	۱۲	۸۰۷	۱۳,۳۸۵	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۵.۶	۴.۲	۵.۰	+۰.۶						
		سفار	۱۲	۷۰۸	۳۳,۴۶۰	۱,۰۳۹	۹۵%	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۳.۹	۱۸.۳	۲۱.۴	+۱.۳						
		سآبیک	۱۲	۶۰۵	۲,۲۱۰	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۵.۷	۴.۰	۵.۴	+۱.۹						
		سخوز	۱۲	۵۰۷	۴,۰۵۰	۷۱۹	۹۰%	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۱	۲.۹	۳.۰	-۱.۵						
		سمازن	۹	۵۰۶	۲,۲۵۸	۲۹۰	۸۱%	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۵.۷	۳.۹	۴.۶	+۱.۰						
		سپاها	۶	۵۰۲	۲,۱۳۰	۱۹۷	۷۵%	۵۰۲	۳۰۸	-۳۹%	۴.۲	۶.۹	۳.۷	-۰.۵						
		ساروم	۱۲	۴۰۰	۳,۹۹۳	۵۵۴	۹۶%	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۰	۳.۳	۴.۳	-۰.۹						
		سهگمت	۱۰	۴۰۰	۵,۴۳۹	۶۴۸	۹۸%	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۵.۴	۲.۹	۳.۷	-۰.۴						
		سفانو	۱۲	۴۰۰	۷,۹۰۱	۱,۱۷۰	۹۷%	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۷	۳.۲	۳.۷	+۰.۴						
		سشرق	۶	۳۰۷	۱,۴۱۳	۱۵۴	۷۲%	۲۴۵	۳۵۹	+۴۷%	۵.۸	۴.۱	۲.۹	-۴.۶						
	کاشی و سرامیک	سرود	۱۲	۳۰۳	۴,۱۳۵	۴۹۶	۹۶%	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۴.۸	۳.۶	۴.۴	+۰.۱						
		سصوفی	۱۲	۳۰۱	۲,۷۹۰	۳۶۸	۹۰%	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۵.۱	۳.۶	۴.۸	+۰.۱						
		سبجنو	۱۲	۲۰۸	۷,۰۹۶	۵۷۳	۹۶%	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۸	۵.۹	۶.۳	+۰.۵						
		سشمال	۹	۲۰۶	۱,۵۵۵	۱۷۰	۸۹%	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۵.۷	۳.۶	۴.۵	+۰.۳						
		سبهان	۱۲	۲۰۴	۱۱,۹۰۵	۷۳۶	۹۷%	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۷	۵.۵	۵.۶	-۰.۲						
		سغرب	۱۲	۲۰۱	۴,۱۷۸	۳۹۰	۹۲%	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۴.۹	۳.۴	۴.۱	-۰.۷						
		سقاین	۱۲	۱۰۸	۴۵۲	۳۷	۹۷%	۴۹	۵۷	+۱۶%	۹.۲	۷.۸	۸.۲	-۰.۳						
		سشاش	۱۲	۱۰۸	۸,۸۹۸	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۲	۴.۱	۴.۶	-۱.۰						
		سخرز	۱۲	۱۰۸	۳,۵۰۰	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۳	۵.۲	۶.۴	-۰.۱						
		کحافظ	۱۲	۳۰۴	۶۶۹	۸۲	۱۰%	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۰	۳.۲	۳.۵	-۲.۸						
فرآورده های نسوز	کساوه	۱۲	۲۰۸	۵,۱۹۷	۷۴۷	۷۱%	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۵.۱	۳.۵	۳.۶	-۱.۹							
	کلوند	۱۲	۱۰۶	۴,۱۰۰	۵۰۴	۹۵%	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۵.۴	۴.۲	۴.۸	-۰.۵							
	کپشیر	۱۲	۱۰۷	۱,۱۵۵	۸۷	۸۸%	۱۹۰	۱۶۷	-۱۲%	۶.۱	۶.۴	۶.۴	+۰.۲							

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
انرژی	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۸۶۰.۸	۸۲۳	۱۷۰	۶۳%	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴۰.۷	۴۰.۷	۵۰.۰	+۱.۵
			شبندر	۱۲	۱۳۱.۳	۹۷۷	۳۰۴	۷۶%	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴۰.۰	۵۰.۷	۳۰.۸	+۱.۶
			شتران	۱۲	۱۱۱.۱	۴۰۴	۱۰۹	۳۱%	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴۰.۱	۴۰.۰	۳۰.۸	+۰.۹
			شبریز	۱۲	۳۴۰.۴	۱,۱۴۸	۳۳۵	۷۶%	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۴۰.۷	۴۰.۵	۴۰.۱	-۰.۴
			شاوان	۱۲	۱۵۰.۹	۱,۹۸۵	۵۵۵	۷۳%	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۳۰.۹	۸۰.۳	۴۰.۴	+۰.۸
	روانکار	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۱۵۰.۶	۲۴۳	۳۱	۸۸%	۳۵	۴۶	+۳۰%	۶۰.۸	۵۰.۰	۴۰.۹	-۲.۶
		شبه‌ر	شبه‌ر	۱۲	۲۷۰.۴	۲,۲۸۹	۳۳۸	۸۹%	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶۰.۱	۶۰.۰	۵۰.۸	+۱.۵
			شسپا	۱۲	۲۵۰.۶	۴۵۸	۷۴	۶۷%	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۴۰.۹	۳۰.۸	۴۰.۳	-۰.۳
			شنفت	۱۲	۱۶۰.۱	۸۰۷	۱۰۸	۸۲%	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۷۰.۶	۷۰.۷	۸۰.۵	+۰.۳
			شرانل	۱۲	۱۵۰.۴	۷,۶۸۰	۱,۴۴۱	۸۵%	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴۰.۶	۴۰.۰	۳۰.۷	-۰.۵
		زغال سنگ	کزغال	۱۲	۷۰.۱	۲,۰۳۰	۲۶۵	۹۹%	۲۶۷	۴۹۶	+۸۶%	۷۰.۶	۳۰.۹	۶۰.۷	-۰.۳
			کپرور	۱۲	۲۰.۰	۱,۱۸۳	۱۶۹	۵۹%	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۵۰.۸	۴۰.۳	۴۰.۵	-۱.۲
			کطبس	۱۲	۱۰۴	۱,۷۶۰	۱۹۳	۶۲%	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۵۰.۹	۵۰.۱	۴۰.۹	-۲.۴
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹۰.۶	۵۳۳	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۱.۹	۹۰.۲	۷۰.۴	-۳.۷
			تنوین	۱۲	۹۰.۳	۲۴۲	۴۸	۶۳%	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴۰.۹	۳۰.۷	۳۰.۷	-۲.۰
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱۰۴	۷,۲۰۰	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵۰.۵	۳۰.۴	۳۰.۹	-۰.۹
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱۰۱	۵,۳۶۰	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۳.۲	۷۰.۴	۸۰.۷	-۰.۷



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	دندان	۱۲	۱۱.۹	۴,۹۵۵	۴۹۵	۷۶%	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۵.۸	۴.۳	۴.۶	+۰.۲	
		دلر	۱۲	۶.۷	۲,۹۷۰	۳۵۲	۹۶%	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۶.۰	۵.۶	۶.۰	+۰.۹	
		دپارس	۱۲	۵.۵	۵,۷۴۵	۸۰۳	۹۸%	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۶.۰	۵.۲	۴.۶	-۰.۱	
		دالبر	۱۲	۵.۳	۵۵۹	۷۵	۶۹%	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۵.۰	۴.۰	۴.۱	-۱.۷	
		دفرا	۱۲	۵.۲	۳,۷۳۰	۳۹۳	۷۹%	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۴	۶.۴	۶.۲	+۱.۵	
		دفارا	۱۲	۴.۹	۳,۰۶۳	۴۵۲	۹۹%	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۵.۵	۴.۷	۴.۲	-۰.۱	
		دقاضی	۱۲	۴.۱	۲,۴۳۰	۲۷۷	۹۶%	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۵	۵.۱	۵.۵	-۰.۲	
		هجرت	۱۲	۴.۰	۲,۵۲۰	۴۰۶	۹۵%	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۴.۶	۳.۷	۴.۰	-۱.۱	
		دتوزیع	۱۲	۳.۶	۲,۰۲۵	۴۴۹	۹۴%	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۶.۱	۴.۶	۴.۵	-۰.۸	
		کاسپین	۱۲	۲.۶	۱,۸۲۵	۲۳۴	۹۵%	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۵.۷	۴.۶	۵.۱	-۰.۴	
		دکپسول	۱۲	۲.۳	۷,۷۰۰	۹۲۱	۹۲%	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۷.۲	۵.۸	۶.۸	+۱.۷	
		درازک	۱۲	۲.۳	۱,۰۹۶	۲۱۳	۱۰۴%	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۴.۹	۳.۴	۳.۱	-۸.۰	
		دراز۱	۱۲	۱.۷	۱,۶۸۰	۲۷۳	۶۷%	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۴.۹	۴.۳	۴.۰	-۸.۵	

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳



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

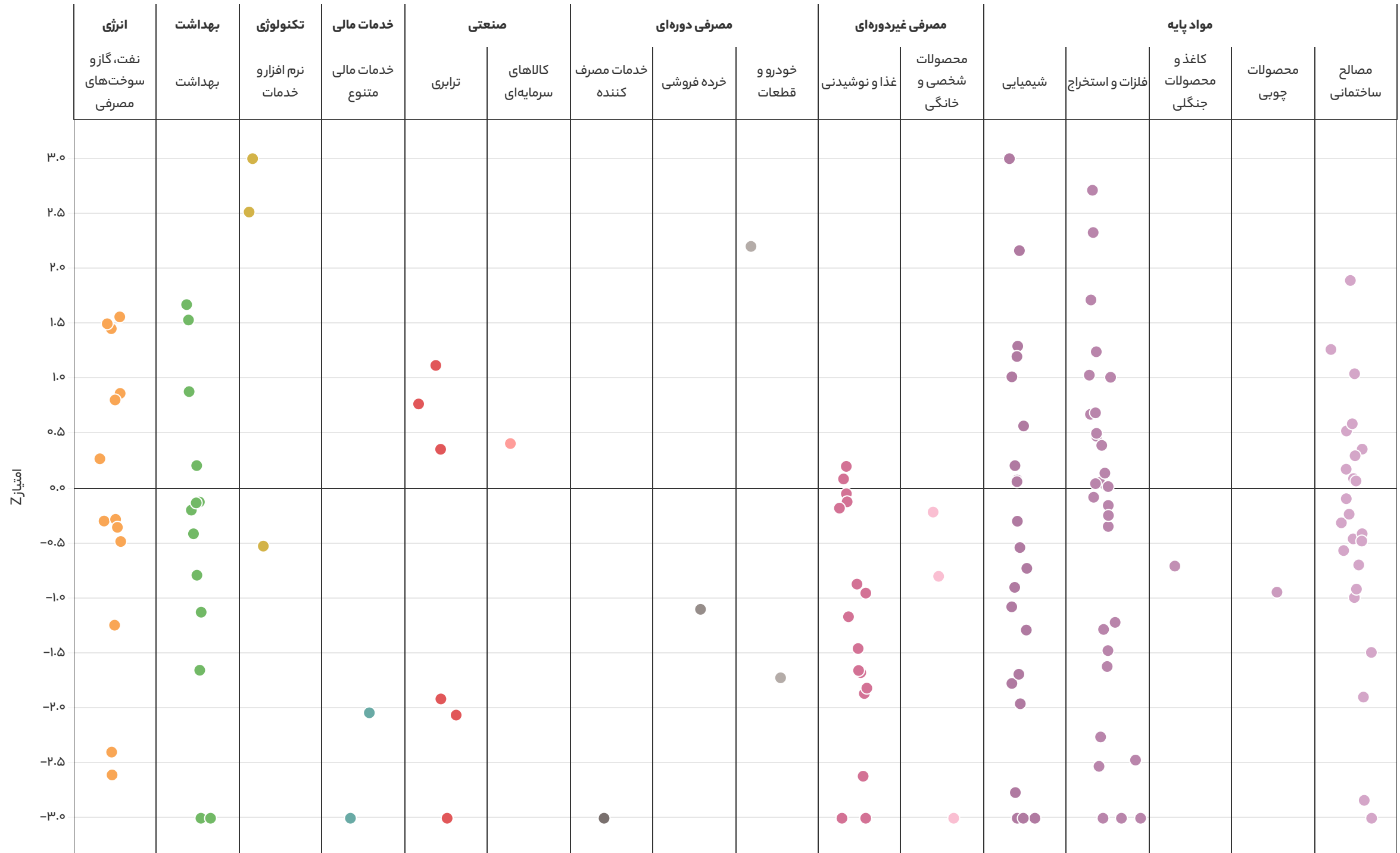
گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z	
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	Z
								۱۴۰۲	۱۴۰۳		۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۳		
مصرفی غیردورهای	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۷.۳	۲,۴۲۶	۲۱۳	۵۵%	۴۹۶	۶۸۹	+۳۹%	۴.۹	۳.۵	۳.۷	-۴.۴	۰.۳
		سیمرغ	۹	۴.۲	۳,۲۴۶	۳۹۱	۲۴%	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۶.۰	۳.۵	۳.۶	-۱.۸	-۰.۳
		زفکا	۱۲	۲.۴	۱,۶۱۹	۱۵۵	۹۱%	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۹.۰	۶.۰	۷.۵	+۰.۲	-۰.۳
		تلیسه	۱۲	۱.۸	۳۶۰	۲۵	۹۲%	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۰.۶	۷.۵	۱۱.۹	-۰.۲	-۰.۳
		زگلدشت	۱۲	۱.۶	۲,۳۰۰	۹۶	۹۵%	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۰.۵	۸.۰	۸.۸	+۰.۱	-۰.۳
		زملارد	۱۲	۱.۴	۱,۷۵۳	۳۳	۹۴%	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۲.۰	۹.۸	۹.۸	-۳.۲	۰.۳
		زشریف	۹	۱.۲	۴۸۹	۴۸	۷۶%	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۶.۲	۴.۰	۴.۵	-۱.۷	-۰.۳
		زشگزا	۱۲	۰.۸	۸۴۸	۸۱	۵۶%	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۷.۸	۴.۶	۷.۲	-۰.۱	-۰.۳
	غذا و نوشیدنی	غصینو	۱۲	۱۲.۶	۱,۲۵۷	۱۶۱	۶۰%	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۵.۶	۳.۸	۳.۹	-۲.۶	-۰.۳
		غپینو	۱۲	۳.۲	۳۵۳	۴۹	۵۶%	۶۷	۹۴	+۳۹%	۵.۳	۳.۷	۳.۸	-۱.۹	-۰.۳
		غسالم	۱۲	۱.۷	۳۸۴	۶۵	۴۱%	۶۵	۸۱	+۲۵%	۵.۹	۴.۹	۴.۲	-۱.۷	-۰.۳
		غمینو	۱۲	۱.۳	۸۳۸	۱۱۹	۴۳%	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۵.۱	۳.۴	۳.۷	-۱.۰	-۰.۳
	محصولات لبنی	غکورش	۱۲	۱۳.۴	۶۷۰	۱۲۶	۵۴%	۸۳	۸۶	+۳%	۸.۱	۷.۸	۷.۵	+۰.۰	-۰.۳
		غگلپا	۱۲	۱.۴	۳,۸۹۰	۴۶۵	۷۴%	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۶.۶	۴.۶	۴.۸	-۰.۹	-۰.۳
		غگلستا	۱۲	۱.۰	۱,۶۱۶	۱۵۶	۷۰%	۲۰۷			۷.۸				-۰.۳
		غشان	۱۲	۰.۹	۵۳۵	۸۰	۷۱%	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۶.۵	۴.۸	۴.۶	-۱.۵	-۰.۳
	Null	غمایه	۱۲	۱.۵	۶,۳۴۰			۶۴۳	۹۵۶	+۴۹%	۹.۹		۷.۶		-۰.۳
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	کیمیاتک	۱۲	۶.۰	۹۹۹	۱۰۲	۶۴%	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۶.۹	۵.۹	۶.۱	-۰.۲	-۰.۳
		قرن	۱۲	۵.۶	۱,۳۹۰	۱۶۵	۶۱%	۲۱۴	۲۹۹	+۴۰%	۶.۵	۴.۶	۴.۹	-۰.۸	-۰.۳
		شپاکسا	۹	۲.۱	۲۲۸	-۲۴	۳۸%	۴۶	۶۱	+۳۲%	۵.۰	۳.۸	۳.۲	-۳.۸	۰.۳

	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)						
صنعتی	ترابری	بنادر و کشتیرانی	حزرق	۱۲	۶.۰	۱,۶۵۵	۲۰۷	۹۶%	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۵.۷	۳.۷	۵.۳	+۰.۴						
			حتایید	۱۲	۵.۶	۴۶۳	۶۲	۵۲%	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۴.۳	۳.۳	۳.۳	-۲.۱						
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	توریرل	۱۲	۳.۵	۵۰۰	۴۳	۳۸%	۶۷	۸۶	+۲۹%	۷.۵	۶.۰	۵.۳	-۱.۹						
			حآقریرن	۱۲	۱.۷	۲۳۱	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۵.۶	۵.۱	۴.۳	-۵.۹						
			حآپارسا	۶	۱.۶	۶,۲۹۵	۶۳۱	۸۹%	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸.۸	۷.۷	۶.۵	+۱.۱						
			حآسا	۱۲	۱.۴	۷۶۹	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۰.۹	۲۰.۱	۳۴.۲	+۰.۸						
		کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۰	۲۷۵	۳۳	۳۱%	۲۶	۳۸	+۴۶%	۱۰.۷	۷.۶	۱۰.۴	+۰.۴					
سیم و کابل	بکابل		۱۲	۲.۹	۲,۸۳۵	۲۵۰	۶۱%	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۴	۵.۲	۴.۶								
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	نرم افزار و خدمات	سیستم	۱۲	۱۸.۱	۱,۸۱۱	۸۳	۸۹%	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۰.۷	۲۶.۰	۳۸.۷	+۴.۰						
			سپیدار	۱۲	۵.۶	۸,۰۶۵	۳۱۱	۷۸%	۲۷۰	۳۳۸	+۲۵%	۲۹.۸	۲۴.۹	۱,۳۳۹.۱	+۲.۵						
			رافزا	۱۲	۱.۳	۱,۲۸۴	۹۱	۸۰%	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۹.۱	۷.۶	۹.۷	-۰.۵						
مصرفی دورهای	خودرو و قطعات	تایرو تیوپ	پکویر	۹	۴.۲	۶۳۶	۲۵	۷۵%	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۷.۴	۳.۰	۴.۰	-۱.۷						
		پلاستیک	پلوه	۱۲	۱.۰	۴,۵۲۰	۶۰۶	۴۳%	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۲۱.۰	۲۱.۷	۲۶.۰	+۲.۲						
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۳	۶۶۵	۱۰۳	۴۹%	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۴.۹	۳.۷	۳.۷	-۱.۱						

-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

