

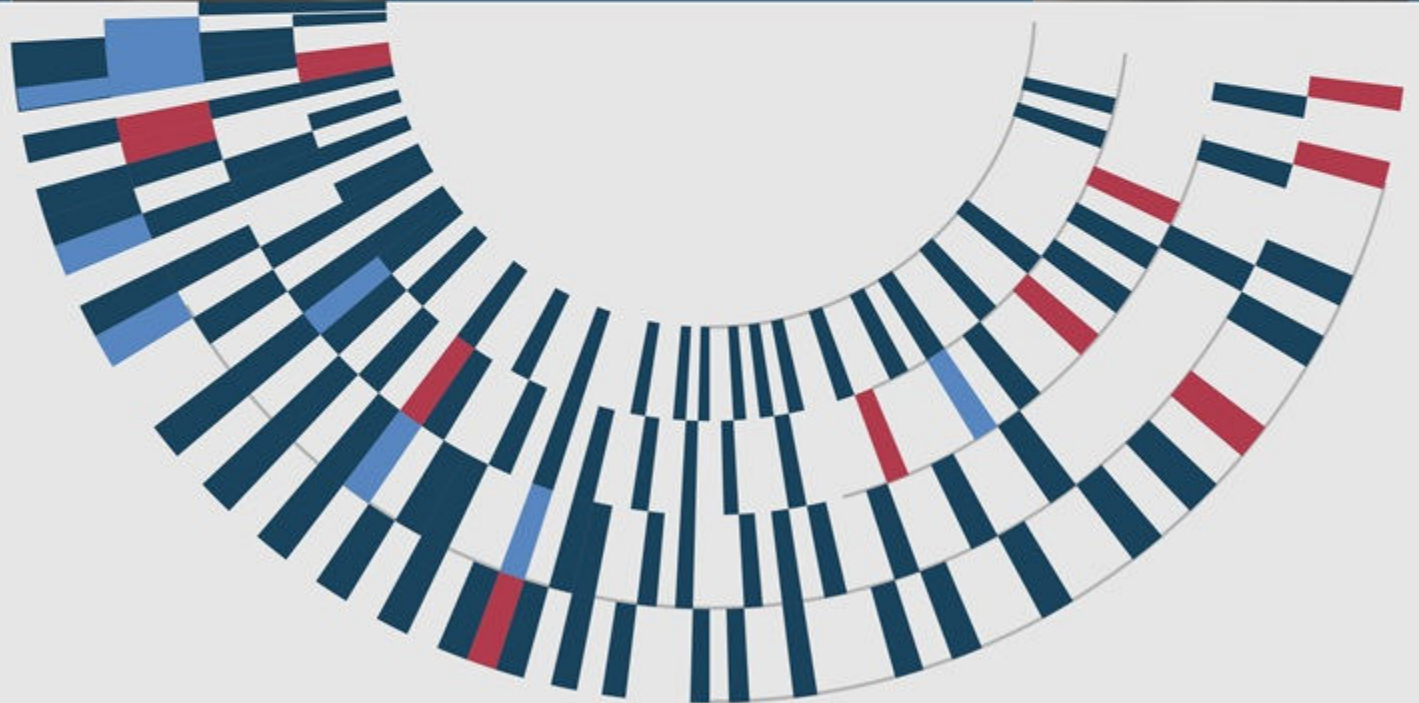
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲۴ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۱۹

 CHARISMA





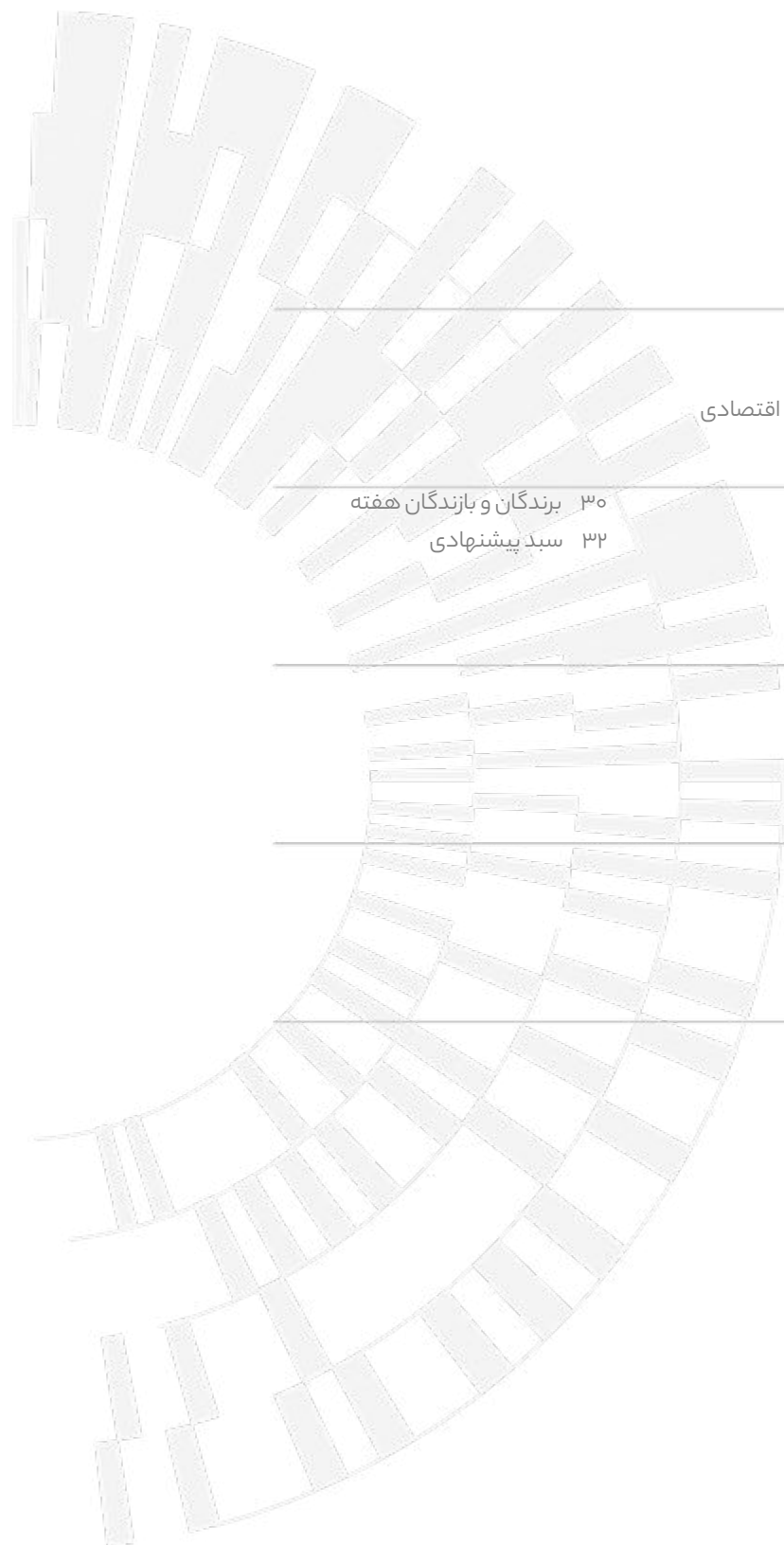
معرفی گزارش:

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.



۳۰	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) ۵۱ ارزشیابی سکتورها بر اساس نسبت قیمت به سود	

کامودیتی

COMMODITY

COMMODITY



فلزات و معادن

عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۱,۹۳۶	۲.۸%+	فزر	-	۱,۷۴۹ ۲,۰۱۷	۱۱%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۰۴۳	۱.۶%+	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ ۹,۳۴۱	۰%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۱۷	۱.۳%+	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ ۲,۴۲۴	۳%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۶۰	۱.۷%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳ ۳,۴۴۴	۱۵%+
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۱۷۸	۰.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۰۳۵ ۲,۲۷۳	۱%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۷۵۱	۱.۷%+	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولار، ارفع، فسازان	۲,۹۱۰ ۴,۸۴۳	۶۱%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۰۰	۰.۱%+	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولار، ارفع، فسازان	۲,۲۵۶ ۳,۶۲۵	۶۰%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۸۰	۳.۲%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولار، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱ ۶۲۳	۱%+
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۸۲۱	۱.۲%+	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولار، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۳,۷۳۴ ۲۲,۸۲۱	۳۵%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۶۰	۰.۵%	فولاد، فخور، هرمز	-	۴۲۰ ۶۷۰	۸%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخور، هرمز	-	۱۲,۴۵۳ ۲۲,۰۸۰	۴۹%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۶۵	۰.۹%	ذوب، کوپر	فولای	۵۴۶ ۷۵۵	۱۳%+
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۹۱۶	۲.۱%+	ذوب، کوپر	فولای	۱۴,۸۰۳ ۲۴,۷۴۷	۴۱%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۵۵	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۵ ۷۸۰	۶%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۰	-	فولاد	-	۶۱۵ ۸۶۰	۳%



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	۳۷۰	۱.۳%-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس	۲۸۵۵۸۸	۳۷%-
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۸۲	۳.۳%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا	۲۳۵۳۲۵	۷%-
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۴۰	۰.۵%-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰۹۷۹	۷%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۳	۰.۸%-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱۰۸۰	۰%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۸۱	۰.۷%-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶۱۰۵۰۸	۲%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	۰.۶%-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۷۰۱۰۱۰	۷%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۸۵	۳.۲%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۴۹۵۳۲	۸%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	-	شگویا	-	۹۳۰۱۰۵۹۹	۳%-
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۵	۱.۸%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۴	۱%-
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۶	۱.۰%-	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰۹۵۱	۱%-
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۹۵	۳.۳%-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲۱۰۵۸	۵%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۹۰	۰.۵%-	شصفها، نوری	-	۹۷۹۱۰۷۹	۹%-
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۲۹	۲.۵%-	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱۰۶۸	۳%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۸۹۳	۳.۷%-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۱۰۳۷	۶%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۹۶۰	۲.۷%-	بوعلی	-	۶,۱۲۹۸,۳۵۵	۷%-
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۰	۱.۹%-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰۱۰,۲۳۹	۳۷%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۶۵	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندرامام	-	۶۹۹۹۱۴	۱%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۷۵	۲.۳%-	شبصیر	-	۱,۲۳۰۱,۴۱۹	۵%-



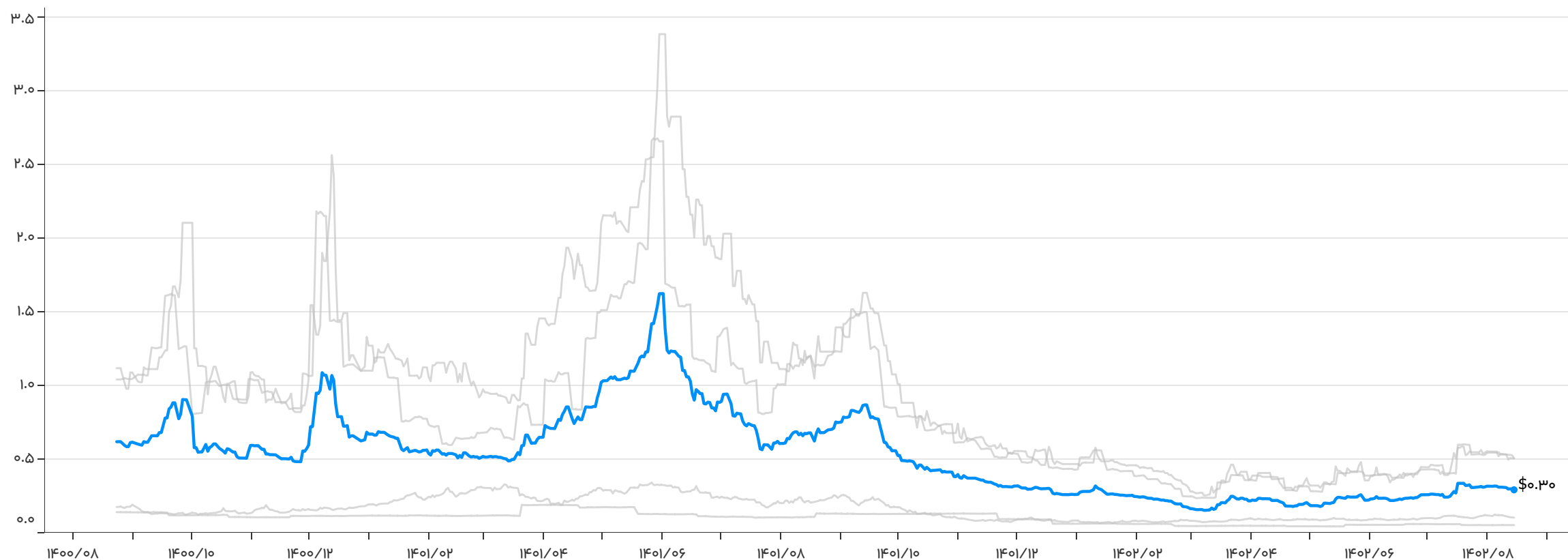
انرژی و سایر محصولات

بازار فارکس																		
تأثیر در بهای تمام شده																		
تأثیر در فروش																		
تغییر نسبت به هفته گذشته																		
آخرین قیمت																		
واحد																		
مرجع قیمتی																		
عنوان																		
انرژی و فراورده های نفتی	روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تأثیر در بهای تمام شده		تأثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته		آخرین قیمت		واحد		مرجع قیمتی		عنوان	
			۹۴ ۷۲		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان		-		-۴.۲%		۸۲		دلار/بشکه		بورس بین المللی اروپا		نفت برنت	
			۹۱ ۶۶		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان		-		-۴.۳%		۷۷		دلار/بشکه		بورس بین المللی اروپا		نفت WTI	
			۱۴۸ ۹۷		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان		-		-۵.۸%		۱۱۶		دلار/بشکه		بورس کالای نیویورک		نفت کوره	
			۱۳۴ ۸۹		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان		-		-۹.۶%		۱۰۶		دلار/بشکه		بورس بین المللی اروپا		گازوئیل کم سولفور	
			۲۱,۶۳۴ ۱۰,۳۵۳		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرار، شاولان		شپهرن، شسپا، شنف، شرانل		-۴.۵%		۱۸,۴۴۲		تومان/تن		بورس کالای ایران		لوب کات - پالایش نفت تهران	
			۴۱,۳۶۵ ۲۱,۷۹۵		شپهرن، شسپا، شنف، شرانل		-		-۵.۵%		۳۰,۱۰۳		تومان/تن		بورس کالای ایران		روغن پایه - نفت سپاهان	
محصولات کشاورزی			۱۷,۱۴۰ ۱۰,۴۰۰		شپاس		-		-۵.۷%		۱۳,۶۴۹		تومان/تن		بورس کالای ایران		قیر - نفت پاسارگاد	
			۲۶۹ ۱۸۳		غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		-۲.۹%		۱۸۳		دلار/تن		بورس کالای چیکاگو		ذرت آمریکا	
			۹۶۸ ۷۲۸		غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		۱.۳%		۸۰۶		دلار/تن		بورس مالزی		روغن پالم خام	
			۱,۷۱۶ ۱,۲۰۵		-		-		-۰.۷%		۱,۲۷۴		دلار/تن		بورس کالای نیویورک		شکر آمریکا	
ارز و ارز دیجیتال			۲۹۵ ۱۹۹		-		-		۰.۶%		۲۱۲		دلار/تن		بورس کالای چیکاگو		گندم آمریکا	
			۱.۱۲ ۱.۰۳		-		-		-۰.۴%		۱.۰۷		-		بازار فارکس		یورو به دلار	
			۱.۳۱ ۱.۱۹		-		-		-۱.۳%		۱.۲۲		-		بازار فارکس		پوند به دلار	
		۳۷,۱۴۵ ۱۶,۵۴۹		-		-		۷.۳%		۳۷,۱۴۵		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	۰.۱۱	-۱۲.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۴۸%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۶	-۱.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۴	-۵۰%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۱	-۵.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۶۳	-۵۸%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۱	-۵.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۵۸%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۳۰	-۵.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۸۷	-۵۷%

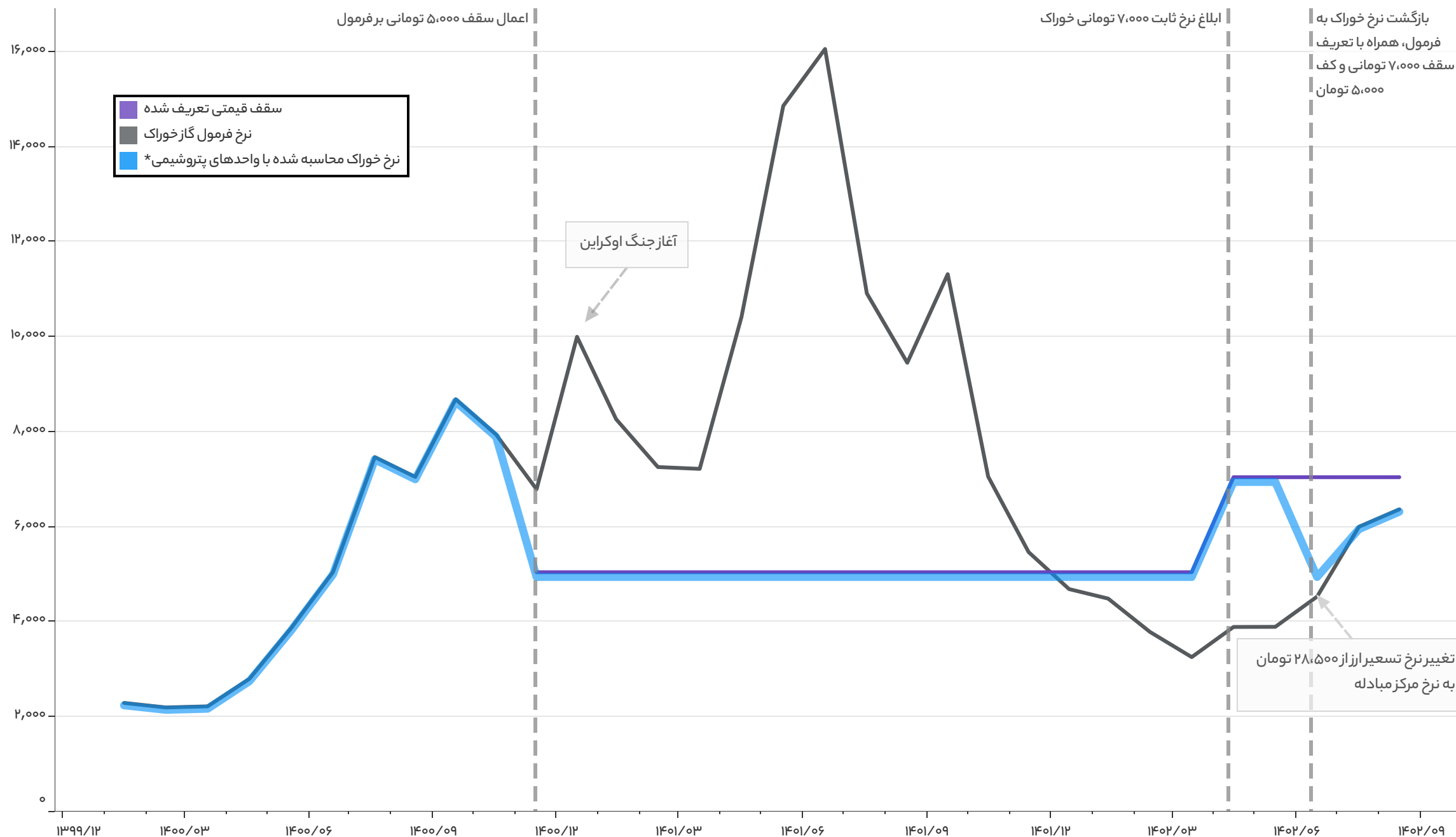
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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

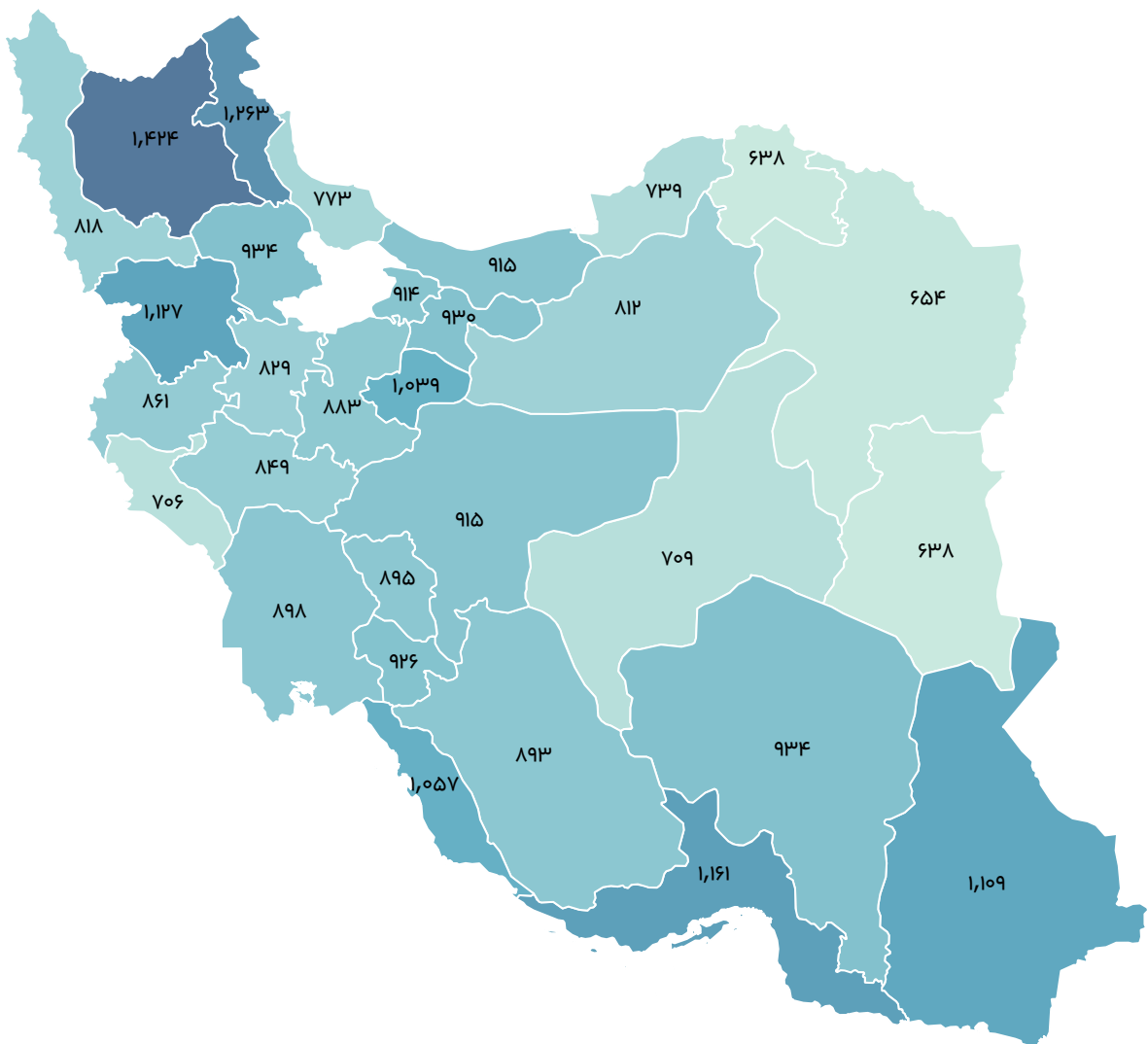
نرخ بدست آمده از فرمول گاز خوراک در برابر نرخ خوراک محاسبه شده با صنایع پتروشیمی با اعمال سقف قیمتی، از ابتدای سال ۱۴۰۰، تومان به ازای هر مترمکعب



* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بر روزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

براساس شرکت دنبال کننده هراستان در جدول روبرو، براساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات، تومان به کیلوگرم



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

به تفکیک استان و منطقه، مرتب شده براساس 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	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	قم	سیمان نیزار قم	۹۹۱	۱,۰۳۹	+۴.۸%
	مرکزی	سیمان ساوه	۹۱۰	۸۸۳	-۳.۰%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۷۰۵	۷۰۹	+۰.۶%
غرب	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۸۹۸	-
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۹۵	۸۹۵	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۹۰۶	۸۶۱	-۵.۰%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۹۱۰	۹۲۶	+۱.۸%
	کردستان	سیمان کردستان	۱,۱۷۸	۱,۱۲۷	-۴.۳%
شمال غرب	لرستان	سیمان دورود	۸۶۹	۸۴۹	-۲.۲%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۱۳۲	۱,۲۶۳	+۱۱.۵%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۷۷۶	۸۱۸	+۵.۵%
شمال	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۰۱۲	۱,۴۲۴	+۴۰.۶%
	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۶	۹۳۴	-۰.۲%
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
جنوب	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۴۲	۷۳۹	-۰.۵%
	گیلان	سیمان خزر	۷۷۸	۷۷۳	-۰.۷%
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۱۰۴	۱,۱۶۱	+۵.۱%
شمال شرق	فارس	سیمان داراب	۸۹۳	۸۹۳	-
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۱,۰۱۲	۱,۰۵۷	+۴.۴%
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
جنوب شرق	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۵۴	+۲.۵%
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۳۸	-
	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۳۶	۹۳۴	-۰.۲%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۰۱۵	۱,۱۰۹	+۹.۲%

* 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 فلزات

در هفته‌های اخیر، ادامه تنش‌های ژئوپلیتیکی در خاورمیانه، تمایل به سرمایه‌گذاری در طلا به عنوان یک پشتوانه ایمن را در کوتاه مدت تقویت کرده بود. اما بالا رفتن نرخ بهره، هزینه نگهداری طلا به عنوان یک سرمایه غیر سودده را افزایش داده و تمایل برای خرید آن را پایین می‌آورد. از ابتدای هفته گذشته، طلا همچنان روند کاهش قیمتی را که از روز جمعه آغاز کرده بود، ادامه داد و از سطح ۲۰۰۰ دلار پایین‌تر آمد که می‌توان آن را نتیجه گزارش بازار کار آمریکا دانست. افزایش نسبی سود اوراق قرضه خزانه‌داری آمریکا ارزش دلار را تا حدی بالا برده و یکی از عوامل اصلی تاثیرگذار بر قیمت طلا بوده است. از سوی دیگر، بالا رفتن احتمال توقف روند افزایش نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا مانع بالا رفتن ارزش دلار شده و می‌تواند تا حدی از طلا حمایت کند.

شرکت مشاوره تحقیقات فلزات ارزشمند «متالز فوکوس» در یادداشت جدیدی اعلام کرد: انتظار دارد تقاضای فزاینده برای تراشه‌های مورد استفاده برای فناوری هوش مصنوعی، از فلزات ارزشمند بکاررفته در این قطعات، حمایت گسترده‌ای فراهم کند. تقاضای صنعتی و فناوری برای فلزات ارزشمند، امسال به دلیل رکود فعالیت اقتصادی جهانی، کم رقم بود. به عنوان مثال، تقاضا برای طلا در بخش فناوری و صنعتی، بر مبنای سال به سال، ۳ درصد در سه ماهه سوم سال ۲۰۲۳ کاهش پیدا کرد. طبق یادداشت «متالز فوکوس»، تقاضای فزاینده برای تحول هوش مصنوعی، می‌تواند این روند را در سال آینده نه تنها برای طلا، بلکه برای نقره، پلاتین و پالادیوم معکوس کند.

قیمت جهانی آهن در پی تصمیم بورس دولتی چین برای محدودسازی تعداد معاملات آتی این فلز با کاهش مواجه شد. این کاهش قیمت در حالی صورت گرفته که بورس فلزات دالیان با انتشار دستورالعملی جدید اعلام کرده است که سقف تعداد قراردادهای آتی آهن را محدود نموده است. این مقررات، منجر به کاهش جذابیت سرمایه‌گذاری بر روی آهن در میان خریداران شده که همین موضوع منجر به ریزش قیمت جهانی سنگ آهن برای روز معاملاتی سه شنبه شده است. با این حال، باید به این نکته توجه داشت که در صورت تغییر سیاست‌های فدرال رزرو آمریکا در خصوص افزایش نرخ بهره بانکی طی روزهای آتی، می‌توان شاهد افزایش قیمت فلزات صنعتی در بازارهای جهانی بود.

به گزارش رویترز، کم شدن نگرانی در مورد گسترش تنش‌ها در خاورمیانه و انتشار اطلاعات بازار اشتغال آمریکا، احتمال توقف روند افزایش نرخ بهره بانک مرکزی آمریکا را بالا برده است. همین امر باعث کاهش قیمت نفت در ابتدای هفته گذشته شد. از سوی دیگر اطلاعات تجاری چین، به عنوان دومین مصرف‌کننده بزرگ دنیا، قرار بود که در روز سه‌شنبه منتشر شود و نگرانی سرمایه‌گذاران در مورد کاهش تقاضا در چین قیمت نفت را در صبح سه‌شنبه به پایین‌ترین سطح یک ماه اخیر خود کاهش داد. به گزارش رویترز در هفته جاری نگرانی بازار در مورد اختلال در عرضه به دنبال ناآرامی‌های خاورمیانه کاهش یافته و تمرکز آن به برهم خوردن تعادل عرضه و تقاضا معطوف شده است. از سوی دیگر، به گزارش رویترز، اوپک با وجود چالش‌های گسترده در مورد تورم و تقاضا، اعلام کرد که نسبت به تقاضا برای نفت در جهان خوش‌بین است. درحالی که وزیر انرژی عربستان سعودی در اظهاراتی، سفته‌بازان را مقصر افت شدید اخیر قیمت نفت خواند.

وزارت انرژی عربستان شامگاه یکشنبه اعلام کرد که این کشور به طور داوطلبانه به کاهش تولید نفت خود به میزان یک میلیون بشکه در روز تا پایان سال ادامه خواهد داد. روسیه نیز ادامه کاهش داوطلبانه عرضه به میزان ۳۰۰ هزار بشکه در روز را تایید کرد. این دو کشور از ژوئیه گذشته کاهش تولید نفت خام خود را آغاز کردند. وزارت انرژی عربستان تاکید کرد که این کاهش داوطلبانه برای تقویت تلاش‌های محتاطانه کشورهای اوپک پلاس با هدف حمایت از ثبات و تعادل بازارهای نفت است. وزارت نفت عربستان طی بیانیه‌ای اعلام کرده است که تجدید نظر در مورد تصمیم فعلی در کاهش تولید و بررسی تمدید کاهش، کاهش بیشتر یا افزایش تولید در ماه آینده انجام خواهد شد. همچنین معاون نخست وزیر روسیه اعلام کرد که روسیه نیز در ماه آینده بررسی خواهد کرد که آیا میزان کاهش صادرات داوطلبانه را بیشتر کند یا تولید را افزایش دهد.

به گزارش رویترز، آرامکو، شرکت دولتی نفت عربستان طی بیانیه‌ای اعلام کرد، قیمت رسمی نفت سبک خود برای فروش به مشتریان آسیایی در ماه دسامبر را نسبت به ماه پیش از آن تغییر نخواهد داد و روند افزایش ۵ ماهه را متوقف می‌کند. همچنین این شرکت قیمت نفت فوق سبک خود برای فروش در ماه دسامبر برای سومین بار افزایش داد که تحت تاثیر قیمت بالای نفت ترش سبک در بازار لحظه‌ای است. از سوی دیگر، پالایشگاه‌های چین تولید خود را کاهش داده‌اند و این کاهش تولید می‌تواند تقاضای نفت خام و صادرات سوخت بزرگ‌ترین واردکننده جهان را کاهش دهد و این شرایط قیمت‌های جهانی نفت خام را محدود خواهد کرد، اما این وضع باعث افزایش قیمت فرآورده‌های نفتی و حاشیه‌های پالایشی در آسیا می‌شود.
- انرژی

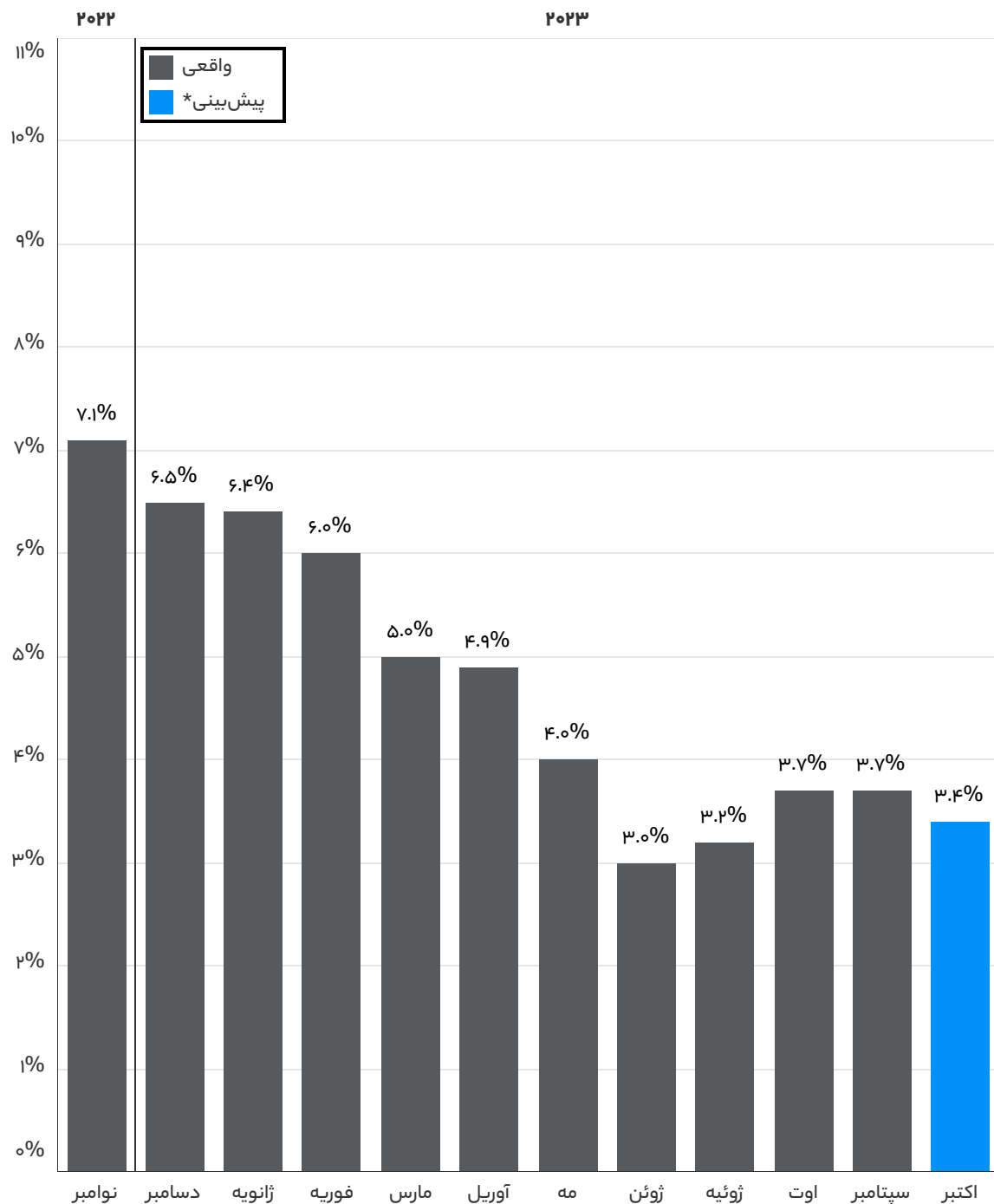
الکساندر نوآک، معاون نخست‌وزیر روسیه در روز شنبه گفت، روسیه هیچ برنامه‌ای برای برداشتن محدودیت‌های صادرات سوخت در آینده نزدیک ندارد و کاهش محدودیت‌های صادراتی تنها زمانی امکان‌پذیر خواهد بود که محموله‌های سوخت (در داخل) جایی برای مصرف نداشته باشند. دولت روسیه در ماه سپتامبر ممنوعیت صادرات سوخت را اعلام کرد و کمی بعد با برداشتن محدودیت‌های مربوط به عرضه گازوئیل انتقالی از طریق خط لوله تا حدی از این محدودیت‌ها کم کرد. این درحالی است که سه منبع صنعتی روز پنجشنبه به رویترز گفتند که دولت روسیه به تولیدکنندگان سوخت این کشور اعلام کرده است برای لغو تمام محدودیت‌های باقی‌مانده در صادرات گازوئیل و بنزین آماده شوند. نیکلای شولگینوف، وزیر انرژی روسیه، روز چهارشنبه گفت: روسیه در حال بررسی لغو ممنوعیت صادرات برخی از انواع بنزین است.

شرکت دولتی سینوپک چین روز یکشنبه اعلام کرد قرارداد ۲۷ ساله جدیدی برای تامین و خرید گاز طبیعی مایع (LNG) با «قطر انرژی» امضا کرده است. بر اساس این قرارداد، ۲ شرکت روی فاز دوم پروژه میدان گازی شمالی (پارس جنوبی بخش قطر) همکاری خواهند کرد که سالانه ۳ میلیون تن ال‌ان‌جی برای سینوپک تامین خواهد کرد. این قرارداد که در نمایشگاه بین‌المللی واردات چین به امضا رسید، سومین قرارداد عرضه بلندمدت میان سینوپک و قطر انرژی، بزرگ‌ترین تامین‌کننده ال‌ان‌جی جهان به شمار می‌رود.

به گزارش رویترز، مجلس نمایندگان آمریکا در روز جمعه لایحه‌ای برای تشدید تحریم‌ها علیه نفت ایران تصویب کرد که این تحریم‌ها شامل بنادرو پالایشگاه‌های خارجی می‌شود که نفت صادراتی ایران را در نقض تحریم‌های آمریکا فرآوری می‌کنند. قانون‌گذاران آمریکا از زمان حمله حماس به رژیم صهیونیستی در هفتم اکتبر، موارد مختلف افزایش فشار بر ایران را مورد بحث گذاشته‌اند. این لایحه قبل از تبدیل شدن به قانون باید به تصویب سنا و امضای رئیس‌جمهور آمریکا برسد. هنوز مشخص نیست این قانون پس از تصویب کامل تا چه حد می‌تواند مؤثر باشد. شایان ذکر است که چین همچنان می‌تواند علی‌رغم تحریم‌های جدید نفت ایران را وارد کند.

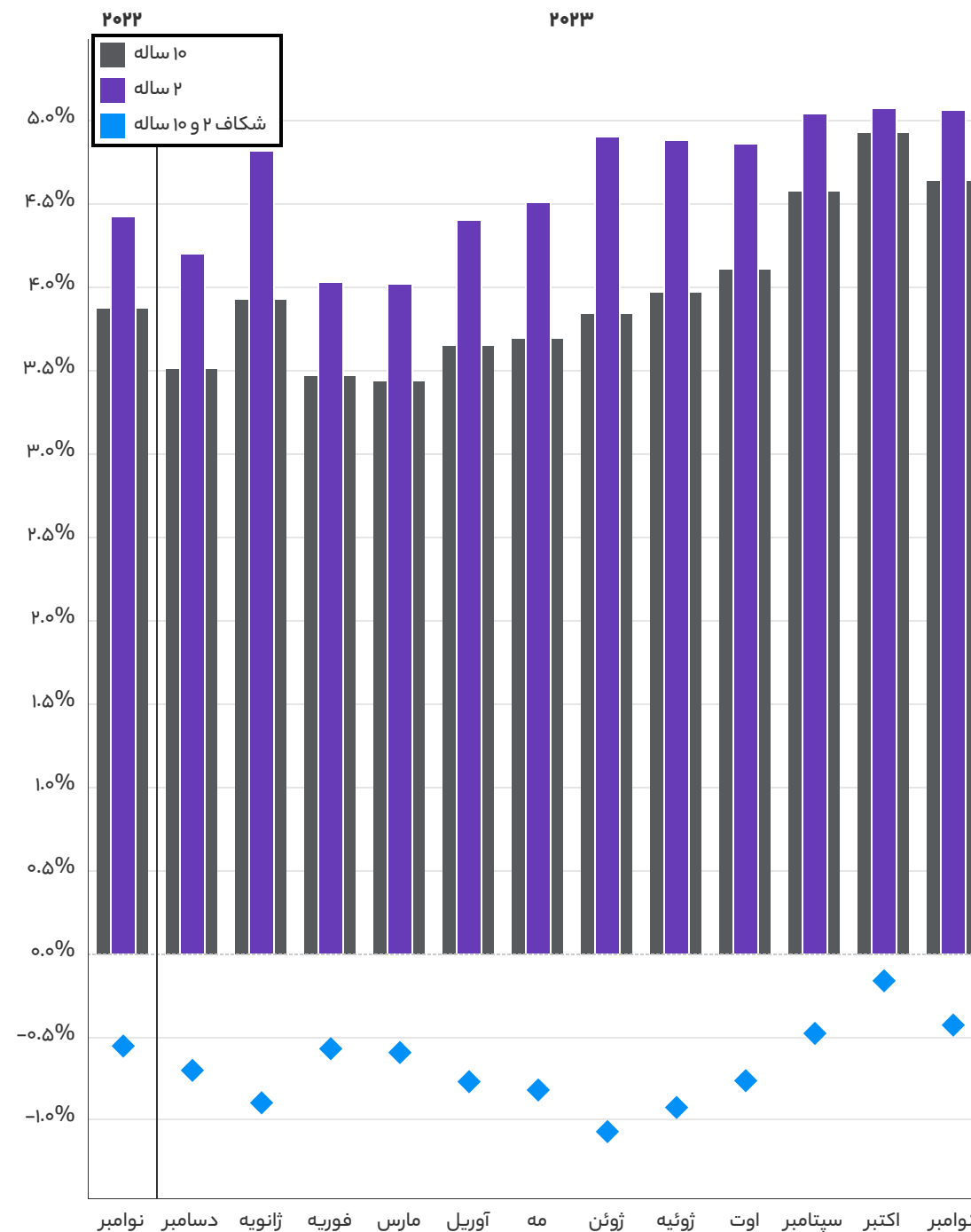
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

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

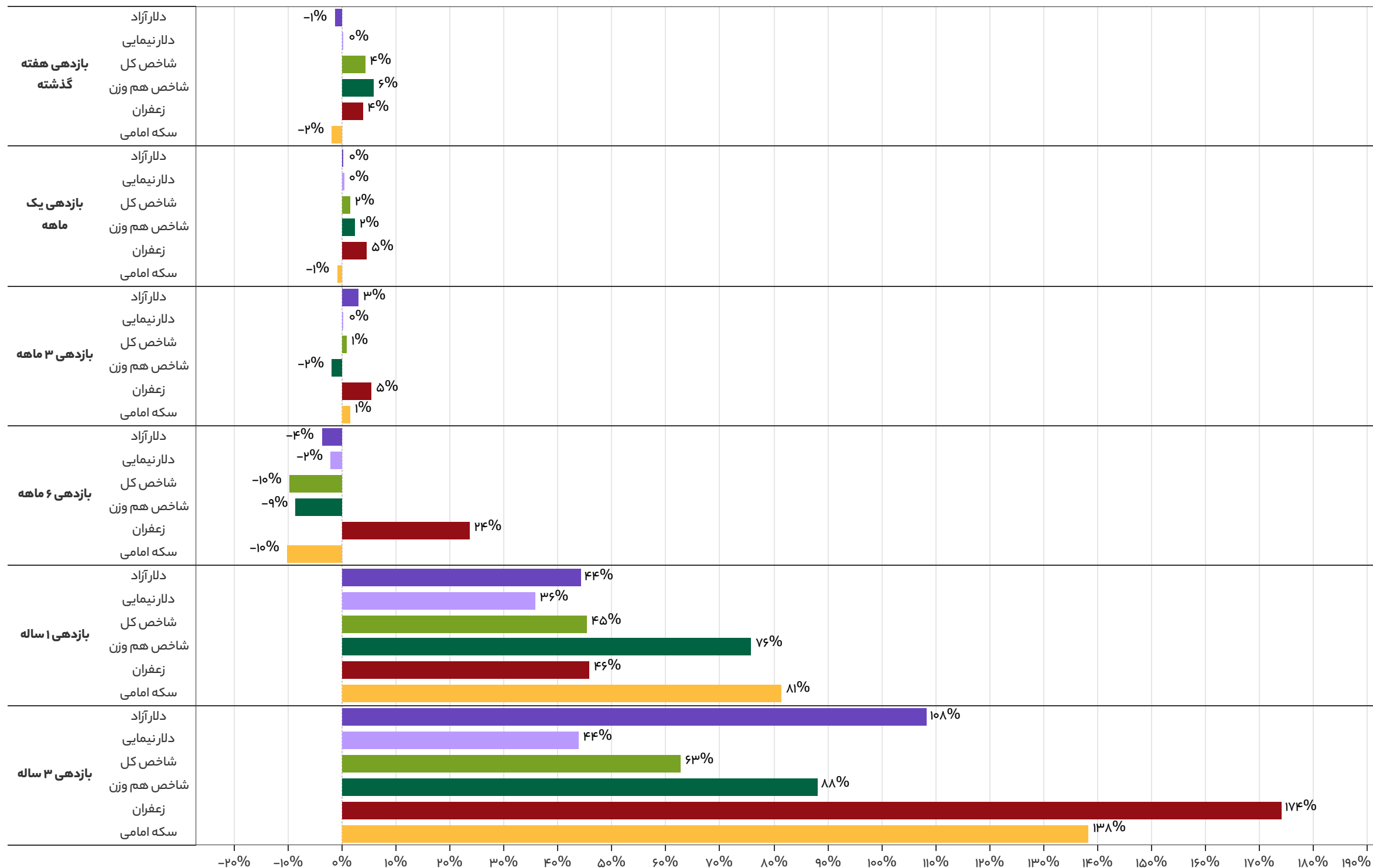
EQUITY MARKET

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%	هم وزن ۷۸.۱%
سکه امامی ▲ ۸.۹%	دلار آزاد ▲ ۱۲.۰%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	سکه امامی ▲ ۱۷.۷%	دلار آزاد ▲ ۵.۲%	هم وزن ▲ ۲۹.۷%	دلار آزاد ▲ ۵.۸%	مسکن ▲ ۴.۰%	زعفران ▲ ۱۲.۳%	زعفران ▲ ۳.۶%	شاخص کل ▲ ۹.۳%	سکه امامی ▲ ۳.۱%	شاخص کل ۴۵%	سکه امامی ▲ ۷۶.۱%
دلار آزاد ▲ ۸.۲%	شاخص کل ▲ ۶.۲%	شاخص کل ▲ ۱۰.۸%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	شاخص کل ▲ ۳۵.۳%	شاخص کل ▲ ۱۶.۴%	شاخص کل ▼ ۱.۵%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۸%	سکه امامی ▲ ۳.۳%	هم وزن ▲ ۸.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	سکه امامی ▲ ۷۶.۱%	سکه امامی ▲ ۷۶.۱%
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 ▼ ۵.۶%	دلار نیمایی ▼ ۵.۵%	دلار آزاد ▲ ۵.۵%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	دلار آزاد ▲ ۱.۵%	سکه امامی ۳۹%	هم وزن ▲ ۷۲.۴%
مسکن ▲ ۶.۸%	زعفران ▲ ۳.۱%	زعفران ▲ ۱.۰%	دلار نیمایی ▲ ۱۲.۷%	زعفران ▲ ۵.۸%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	زعفران ▲ ۱.۶%	زعفران ▼ ۱.۰%	دلار نیمایی ▼ ۱.۷%	دلار آزاد ▲ ۱.۴%	زعفران ▲ ۱.۳%	مسکن ▲ ۱.۰%	دلار نیمایی ۲۵%	مسکن ▲ ۶۴.۸%
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 ▲ ۵.۱%	دلار آزاد ▲ ۵.۲%	دلار نیمایی ▼ ۵.۱%	دلار آزاد ۲۱%	دلار نیمایی ▲ ۵۳.۴%
درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	دلار نیمایی ▲ ۲.۸%	دلار نیمایی ▲ ۲۲.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	دلار نیمایی ▼ ۲.۵%	زعفران ▼ ۵.۱%	دلار نیمایی ▲ ۲.۸%	شاخص کل ▼ ۵.۶%	سکه امامی ▼ ۳.۵%	مسکن ▼ ۱.۵%	دلار نیمایی ▼ ۵.۱%	شاخص کل ▼ ۴.۱%	زعفران ۱۹%	شاخص کل ▲ ۴۴.۶%
دلار نیمایی ▲ ۱.۴%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	شاخص کل ▼ ۷.۵%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	سکه امامی ▼ ۵.۴%	درآمد ثابت ▲ ۲.۵%	دلار آزاد ▼ ۶.۱%	هم وزن ▼ ۶.۲%	شاخص کل ▼ ۲.۳%	مسکن ▼ ۵.۶%	هم وزن ▼ ۴.۴%	مسکن ۱۹%	دلار آزاد ▲ ۴۲.۷%
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 ▲ ۵.۴%	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 ۵%

– 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.

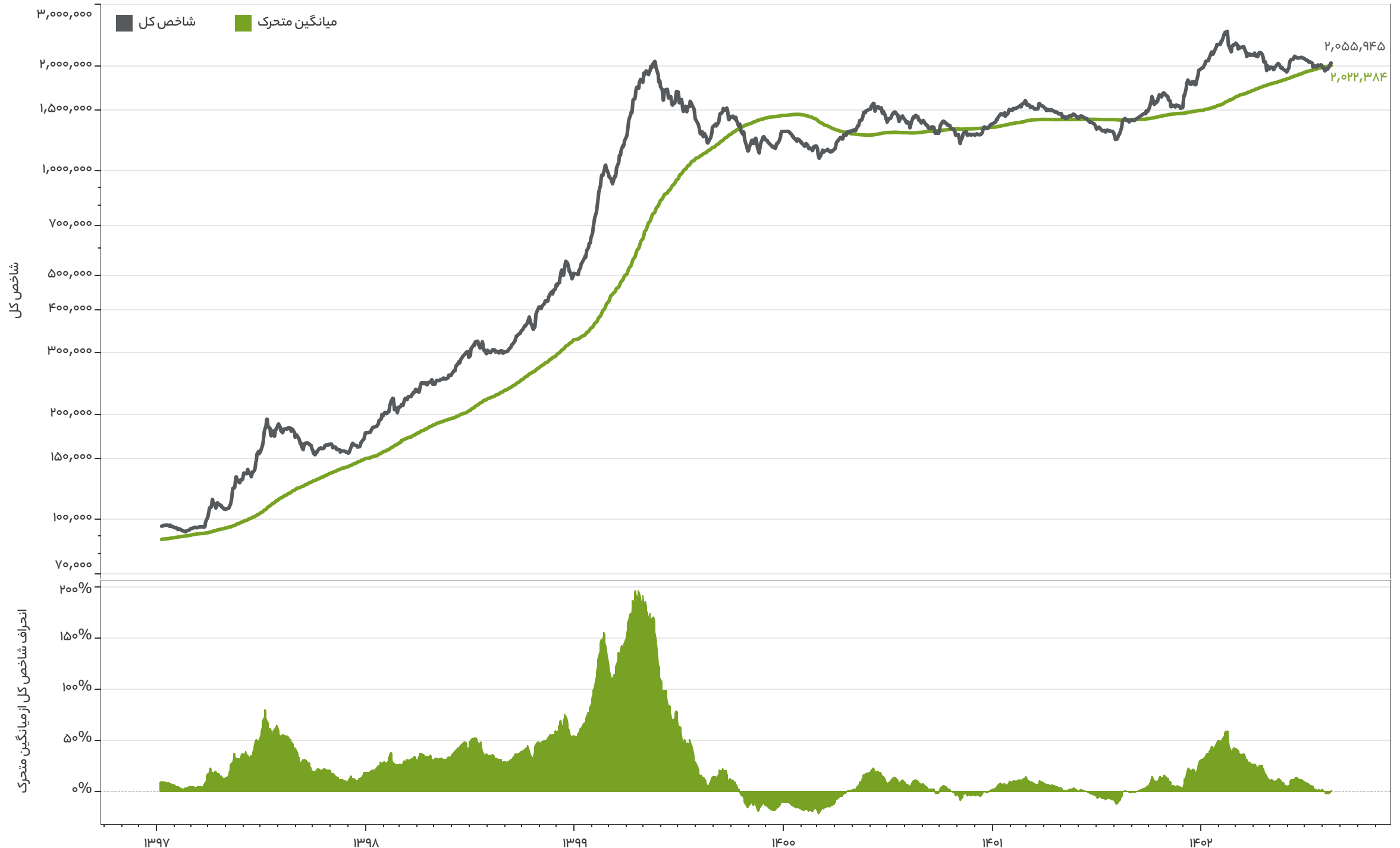
ارزش دلاری بازار

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





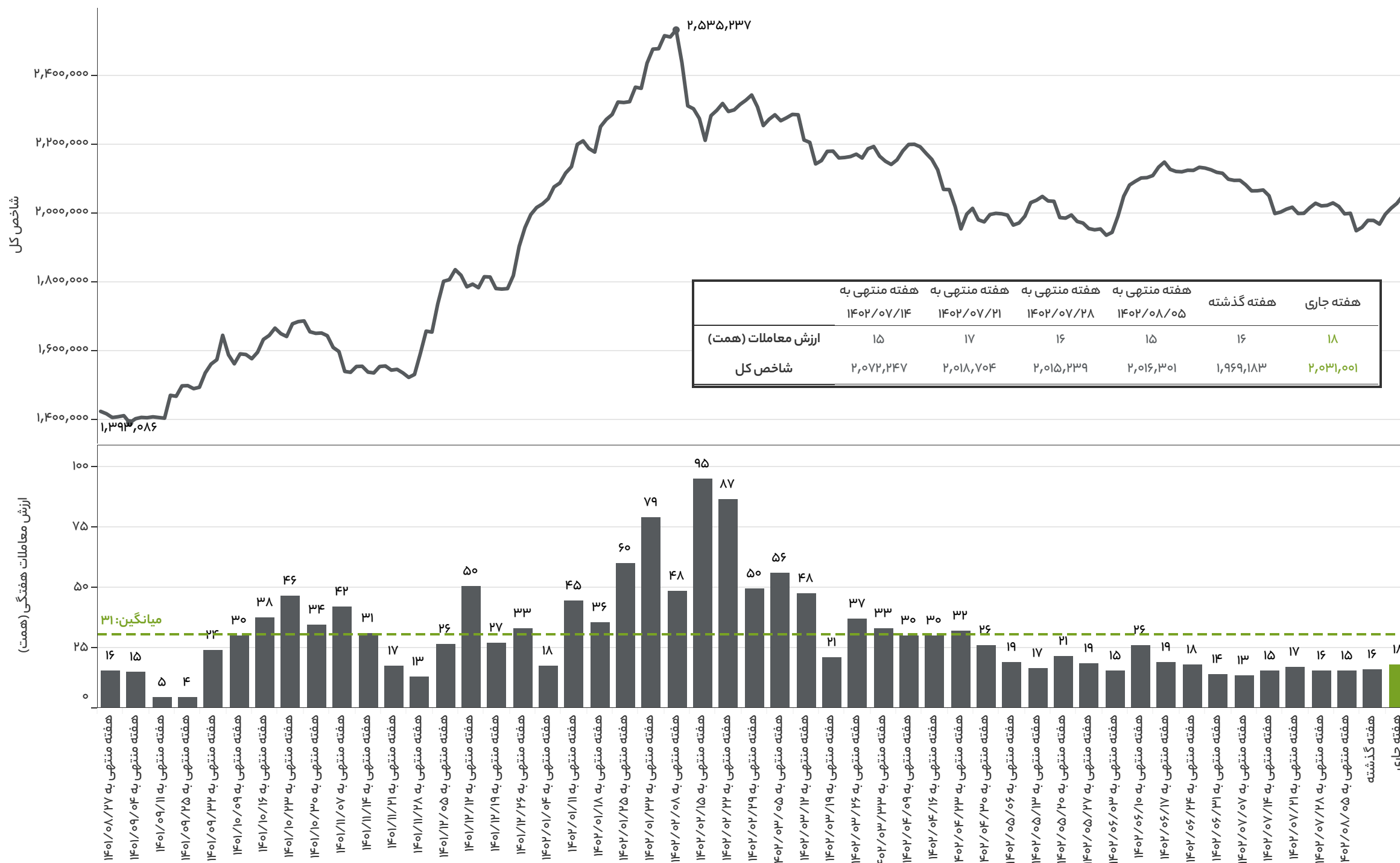
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



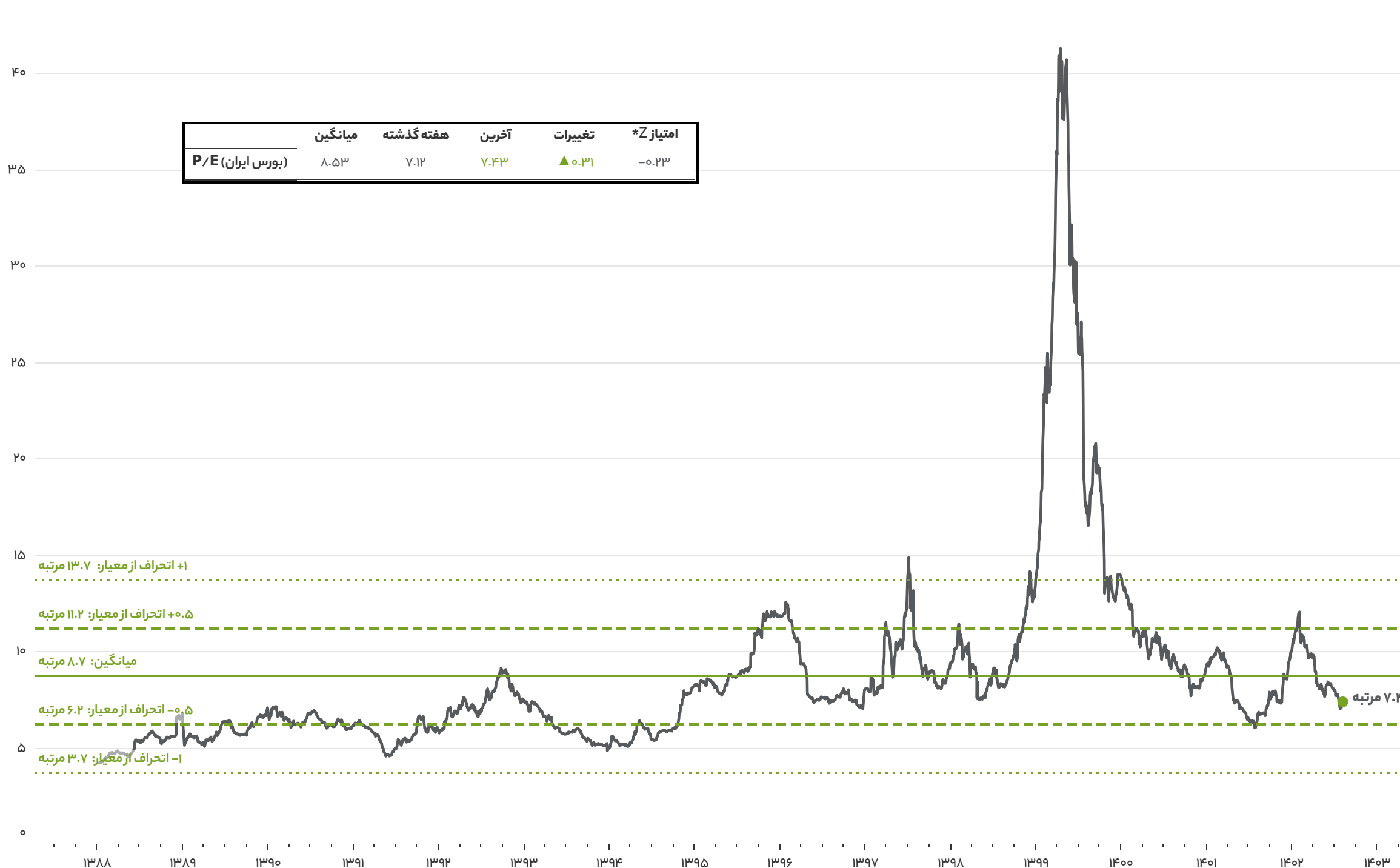
ارزش معاملات هفتگی بازار

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

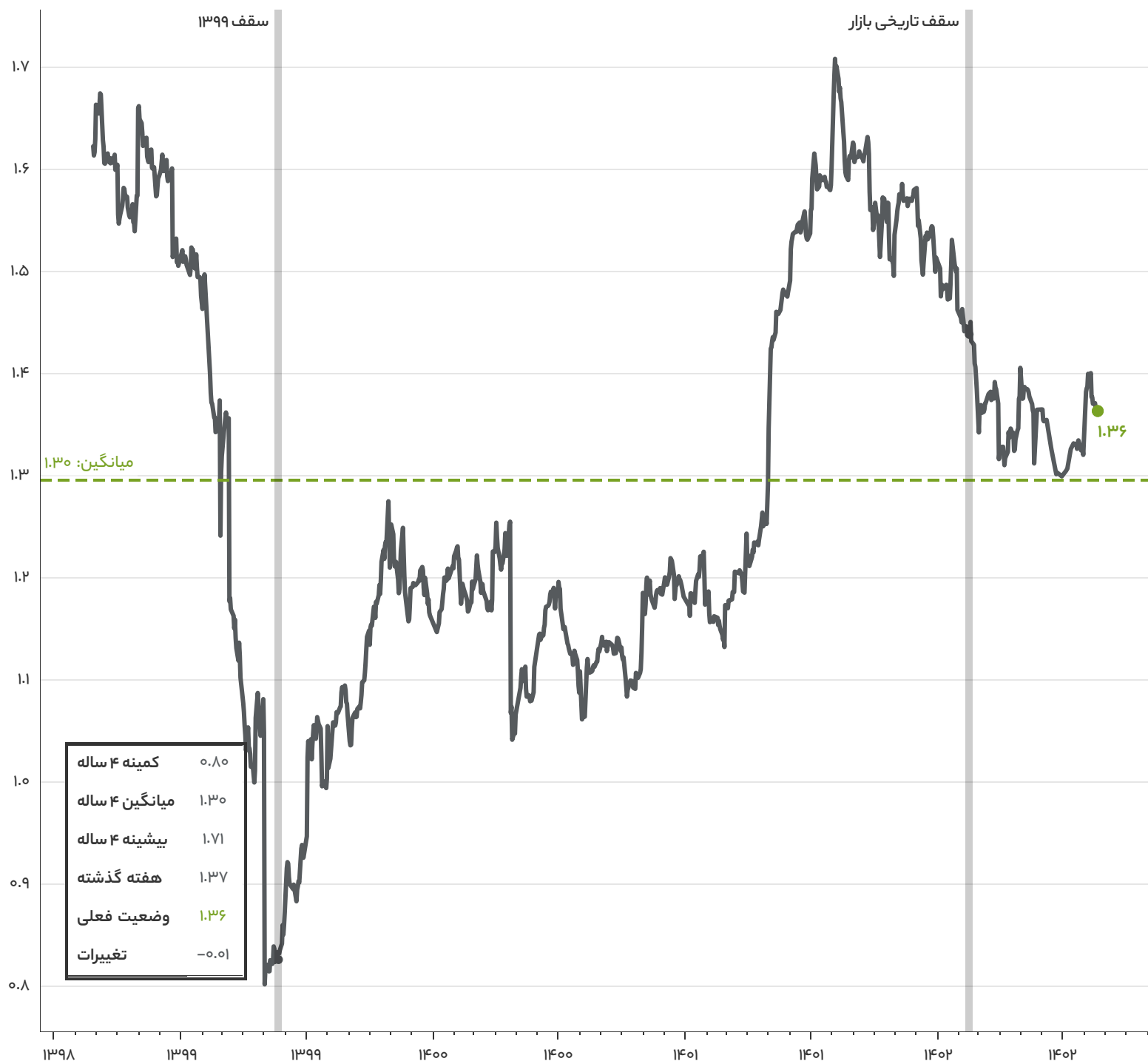
از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران



*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.

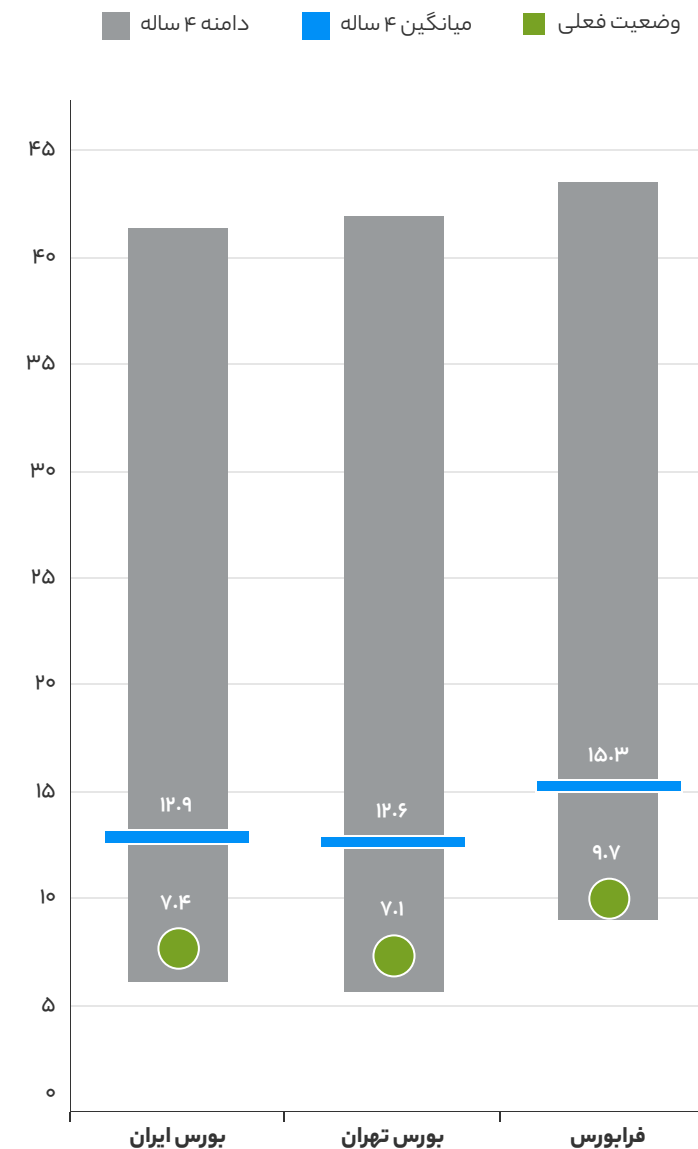
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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
+۰.۳۷	۹.۶۷	۹.۳۱	۹.۰۳	۱۵.۲۸	۴۳.۵۱
+۰.۳۰	۷.۰۹	۶.۷۹	۵.۶۴	۱۲.۶۴	۴۱.۹۹
+۰.۳۱	۷.۴۳	۷.۱۲	۶.۰۷	۱۲.۸۸	۴۱.۳۳



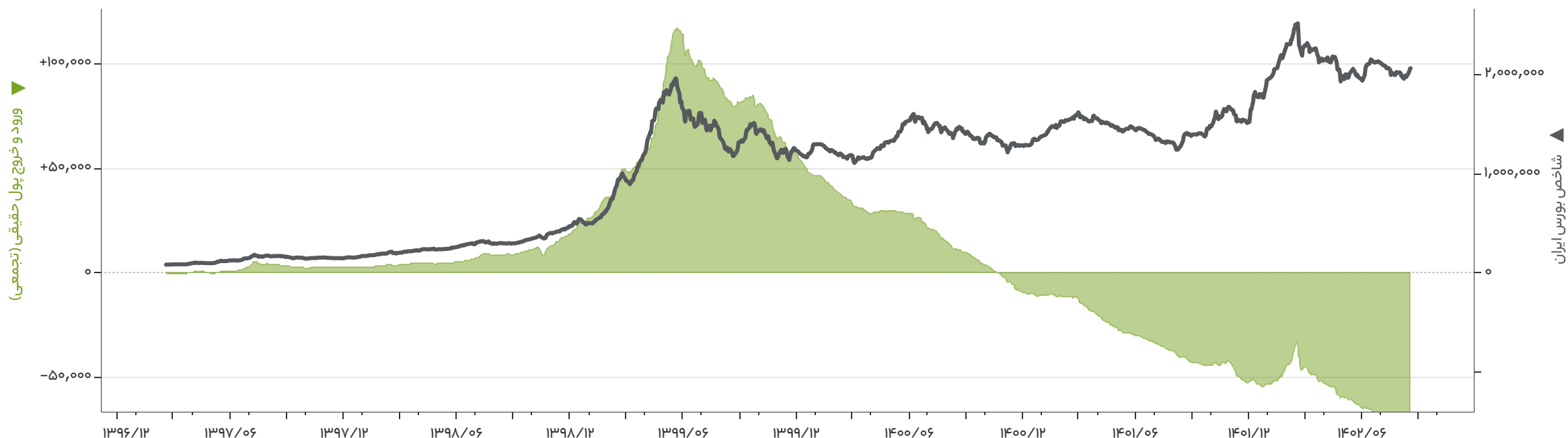
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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)	۴۹	۸۵	۱۰۸	۱۱۱	۱۵۰	۱۸۲	۲۱۰	۳۶۰	۶۲۴	۳,۱۷۹	۳,۱۸۸	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۰%	۱.۳%	۱.۳%	۱.۸%	۲.۲%	۲.۵%	۴.۴%	۷.۶%	۳۸.۶%	۳۸.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۱.۲	۶.۷	۱۱.۶	۱۹.۹	۸.۳	۹.۹	۱۰.۸	۵.۱	۵.۰	۷.۱	۷.۵	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۲%	۱۷.۷%	۳.۶%	۲.۷%	۷.۱%	۴.۸%	۴.۳%	۲.۵%	۱۴.۴%	۱۰.۱%	۹.۳%	
نسبت تقسیم سود	۴۳%	۱۰۰%	۴۱%	۶۰%	۷۶%	۳۷%	۵۴%	۳۳%	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)	+۵۴۶%	+۷۹۰%	+۱۲۰%	+۲۷۰%	+۳۶۴%	+۴۰۲%	+۴۲۲%	+۸۱۷%	+۸۰۱%	+۸۳۹%	+۸۸۹%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۱۰%	+۱۱۷%	-۶۵%	-۵%	+۱۰%	-۱۴%	-۲%	-۱۷%	+۱۷%	-۱%	+۵۴%	
بازده از ابتدای سال	+۱۸۹%	+۴۳%	+۴۱%	+۵۹%	+۸۵%	+۹۳%	+۵۴%	+۸۱%	+۹۱%	+۶۴%	+۷۲%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۸%	۰%	۱۱%	۲%	۳%	۷%	۵%	۱۰%	۵%	۴%	۴%	



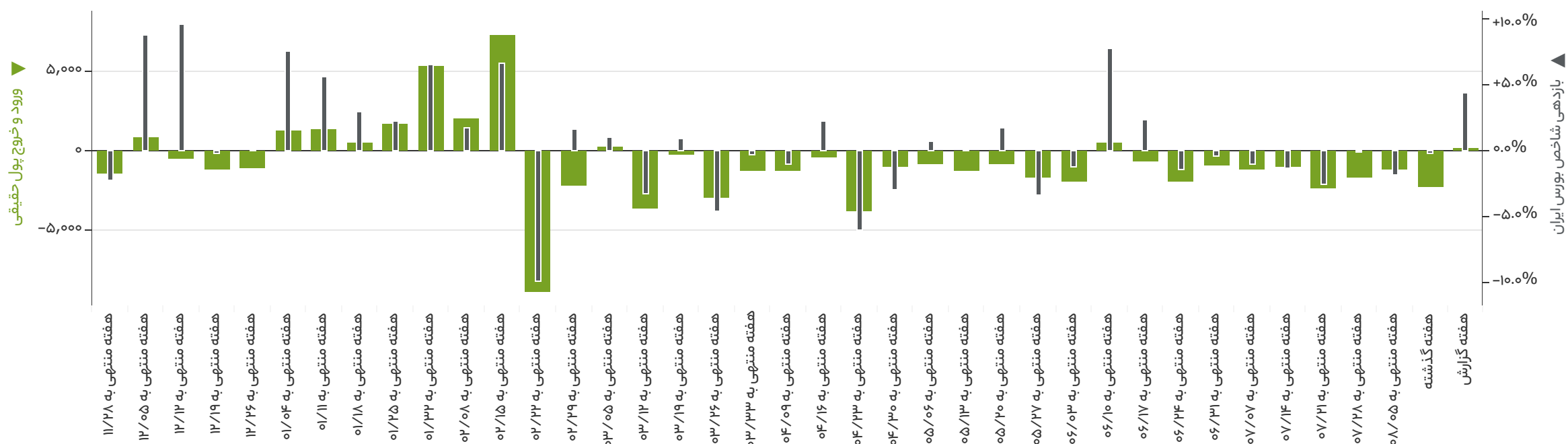
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



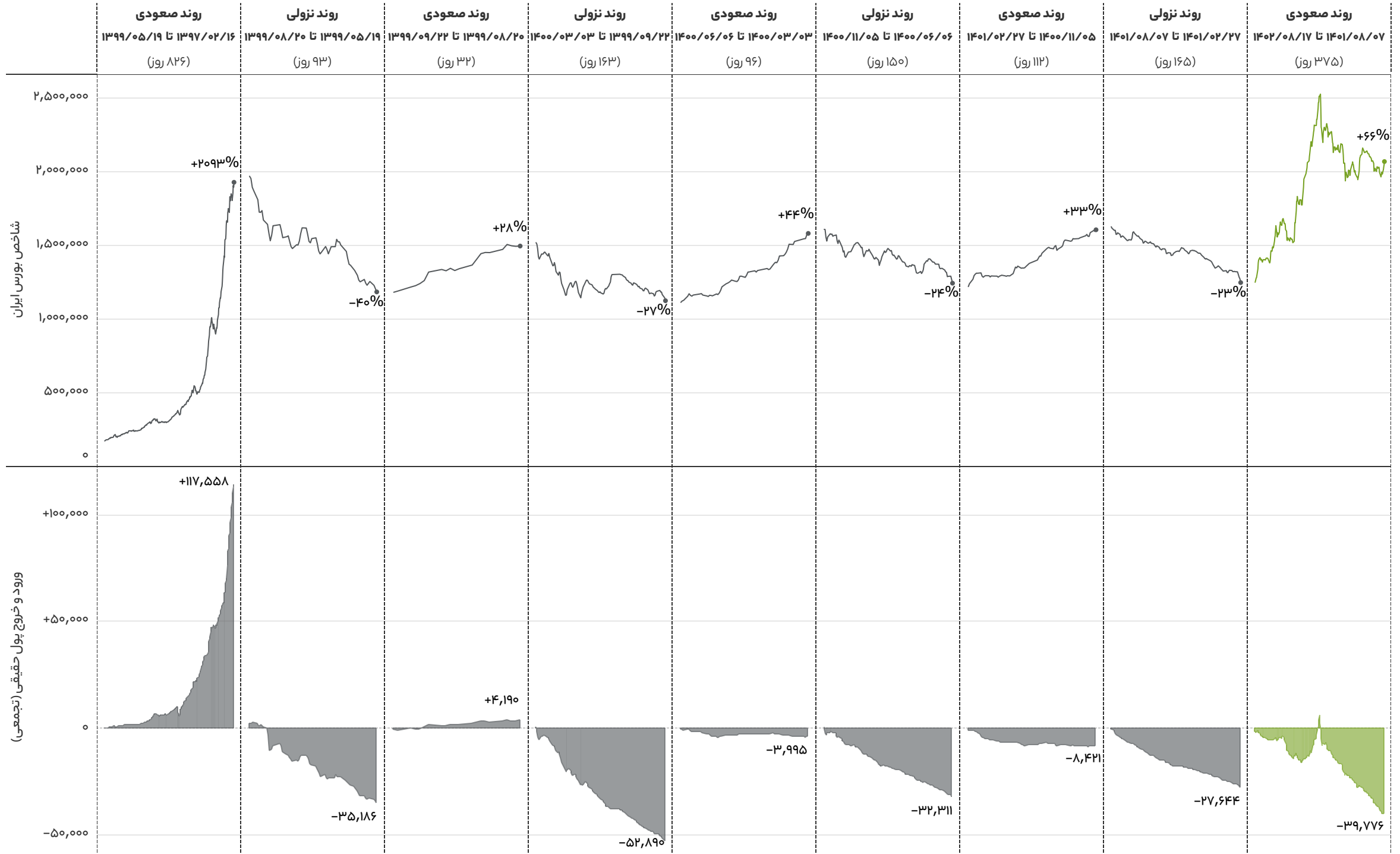
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

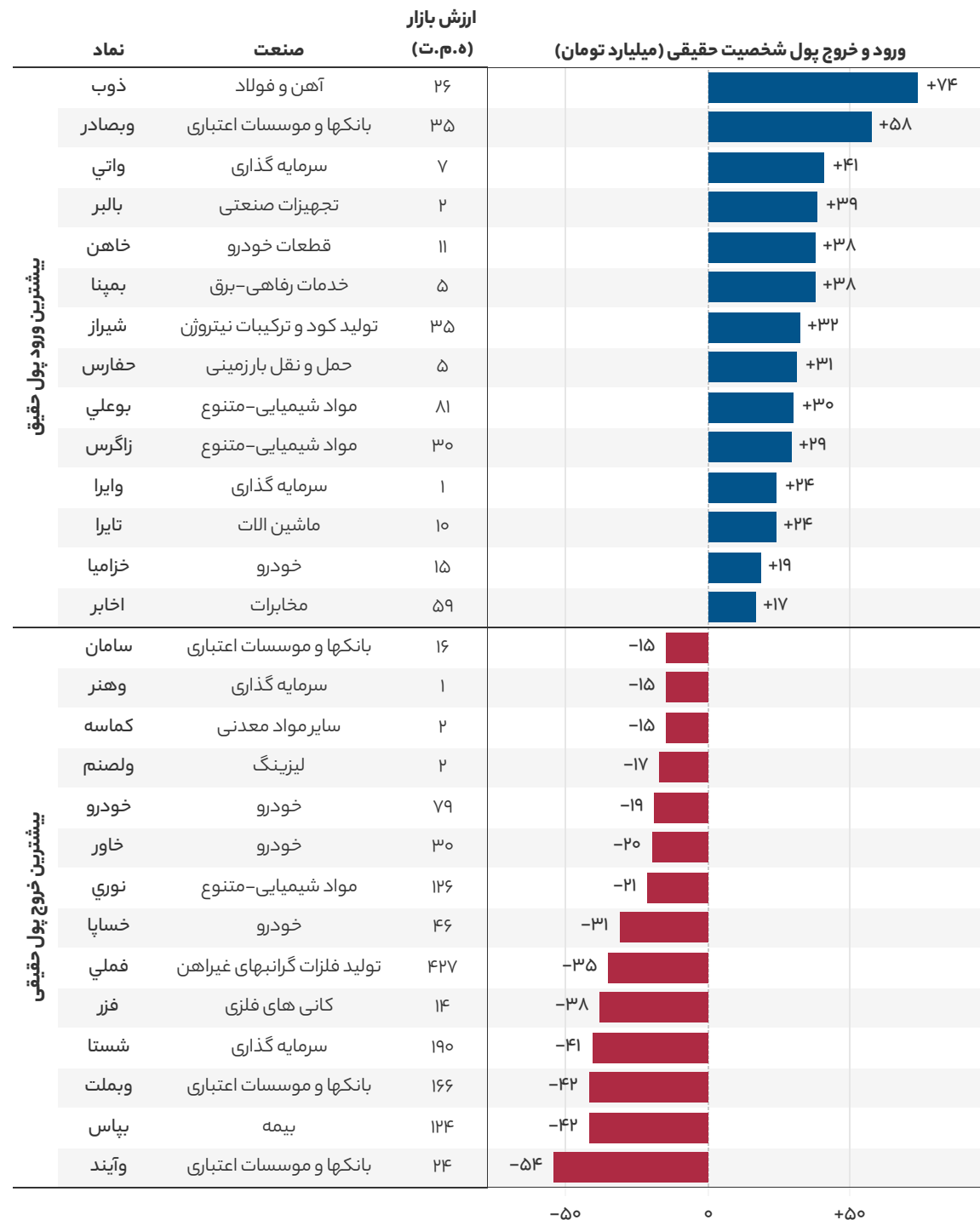
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

ورود و خروج پول حقیقی

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

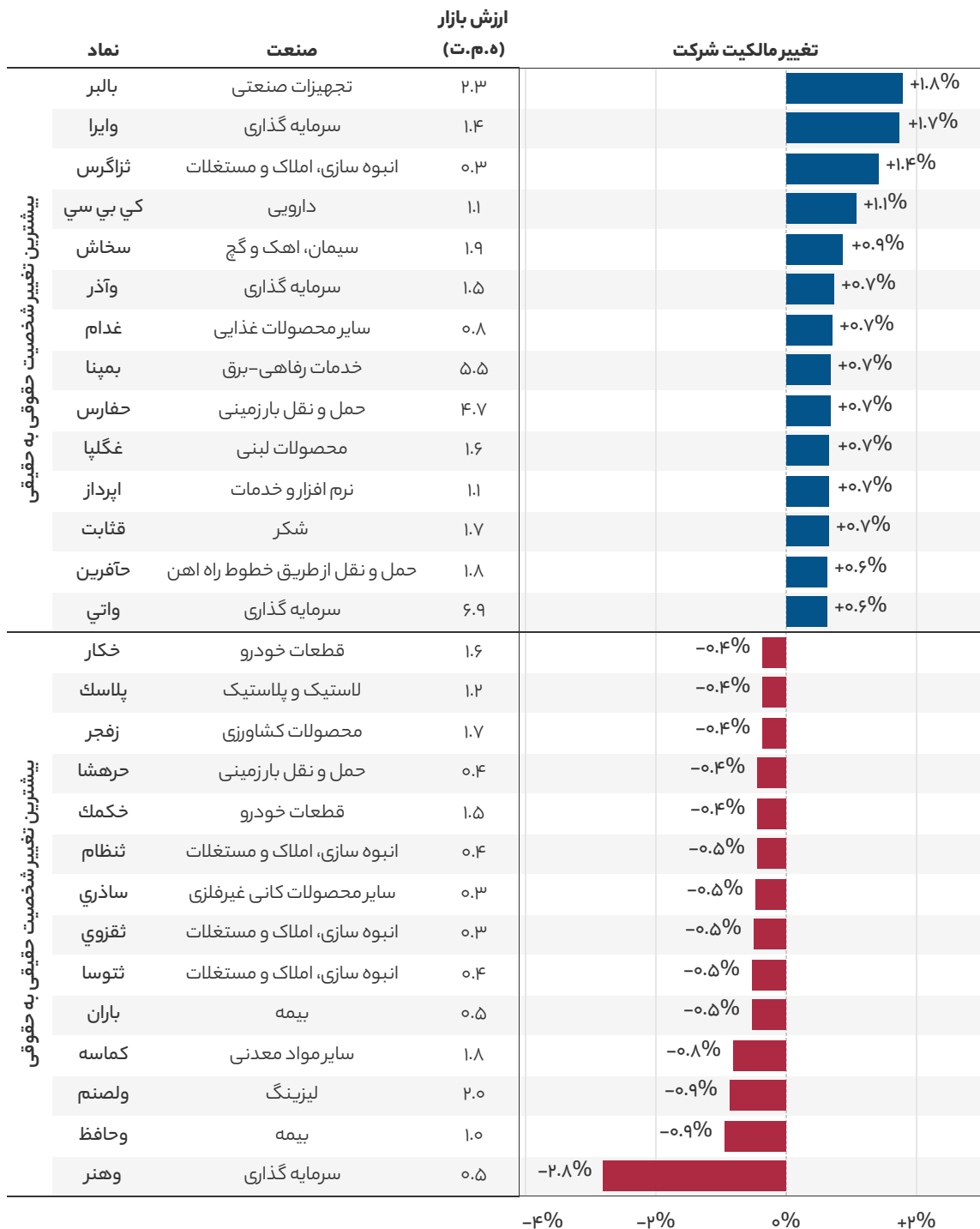


پیشترین خروج پول حقیقی

پیشترین ورود پول حقیقی

تغییر مالکیت شرکت

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

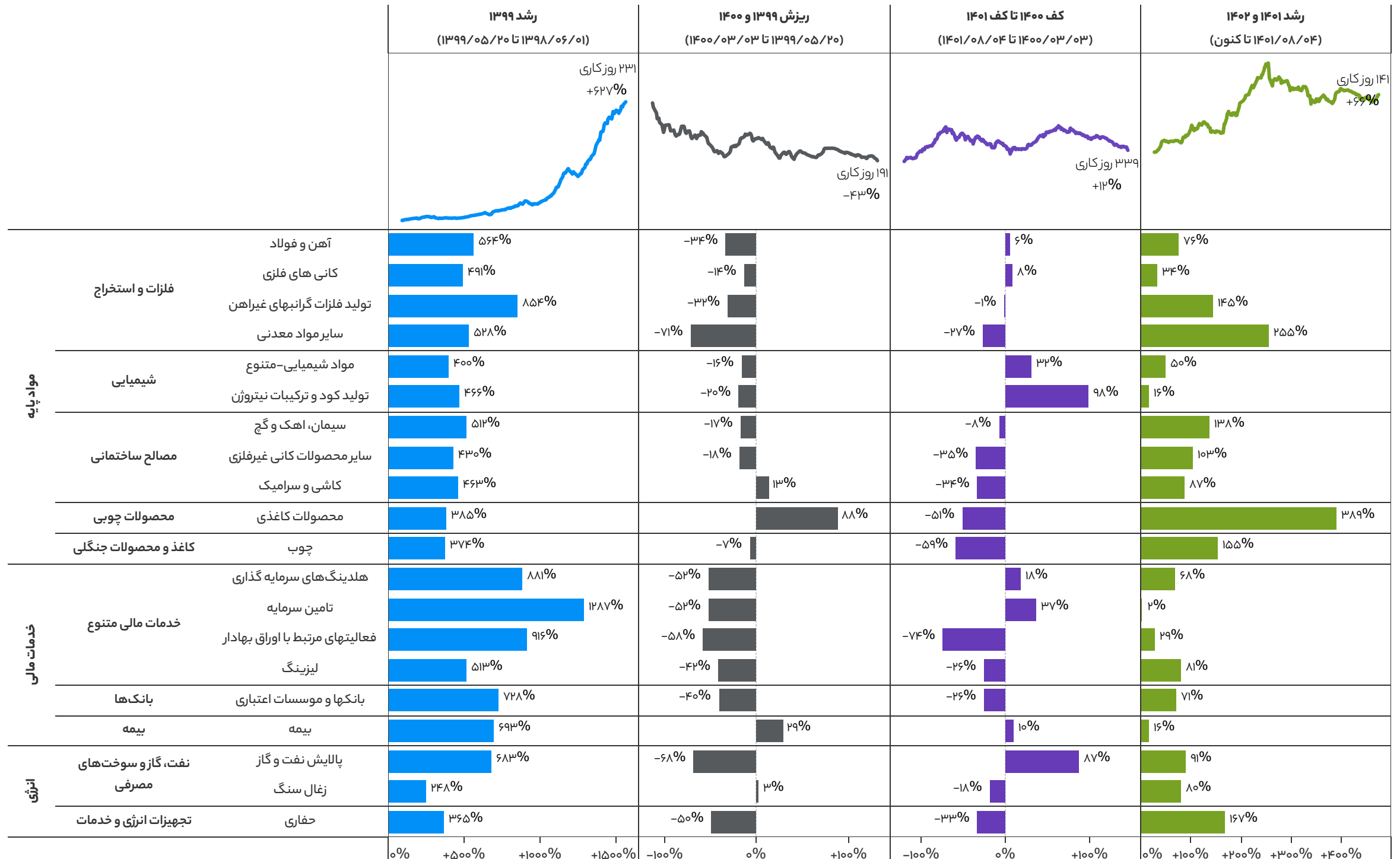


پیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی

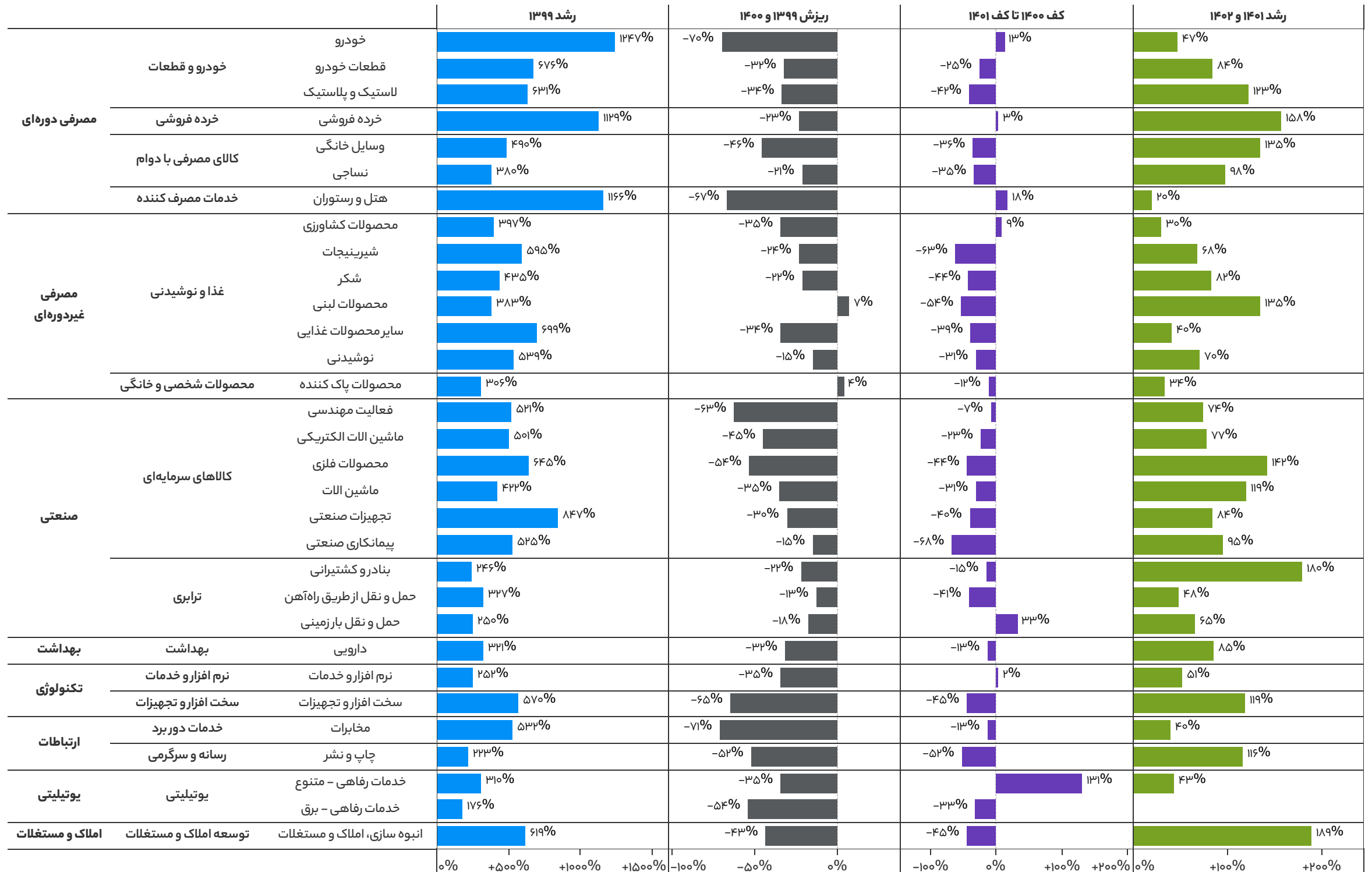
پیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی

بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

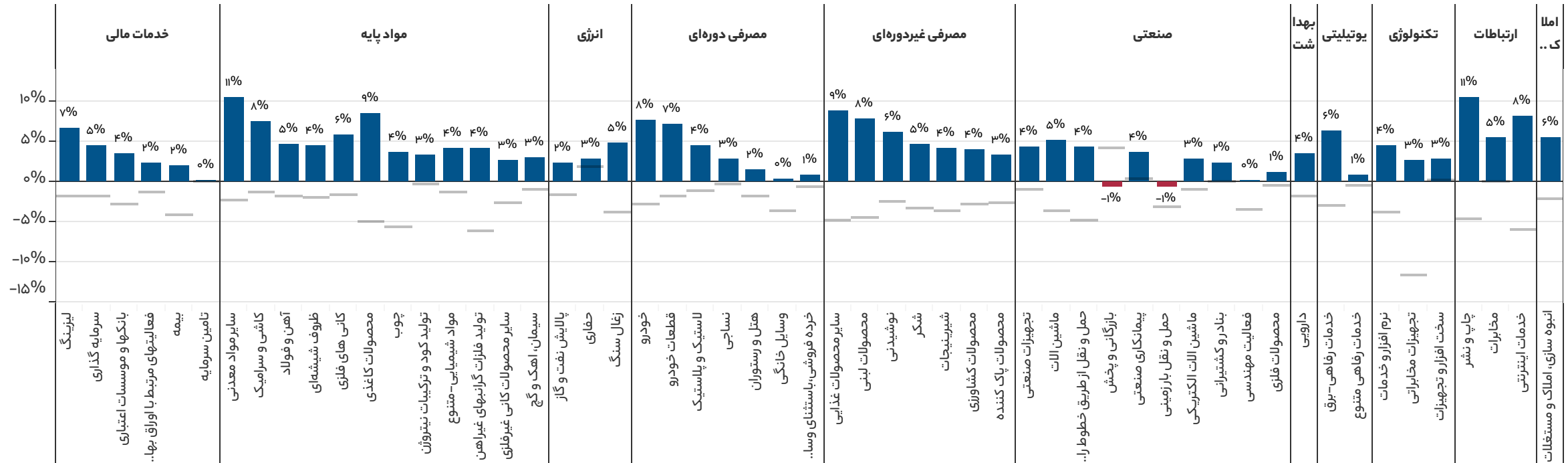


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

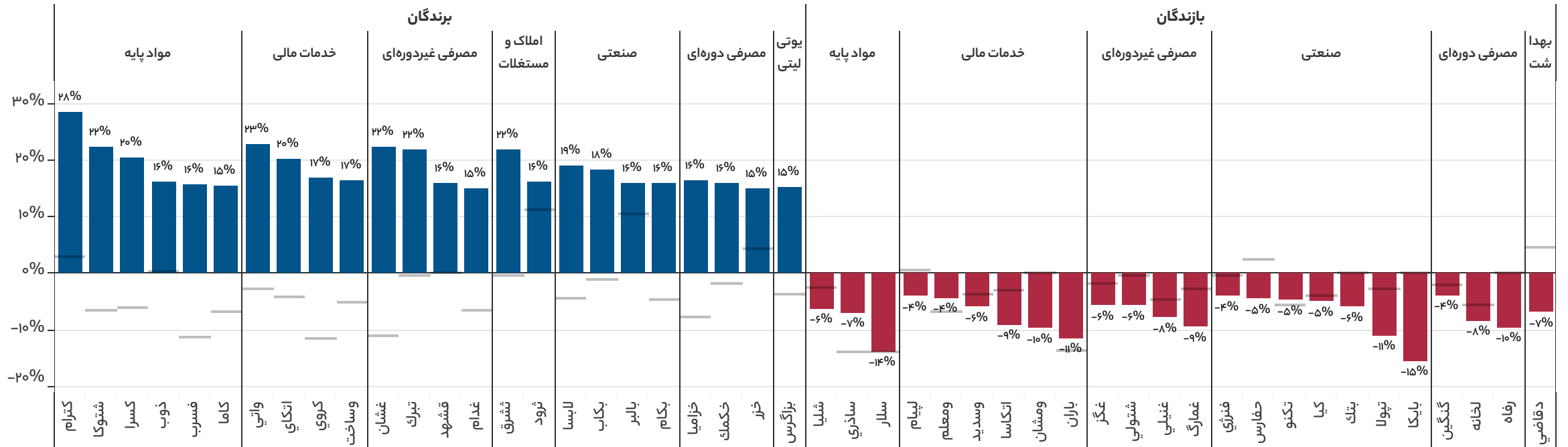


بازده صنایع از ابتدای هفته

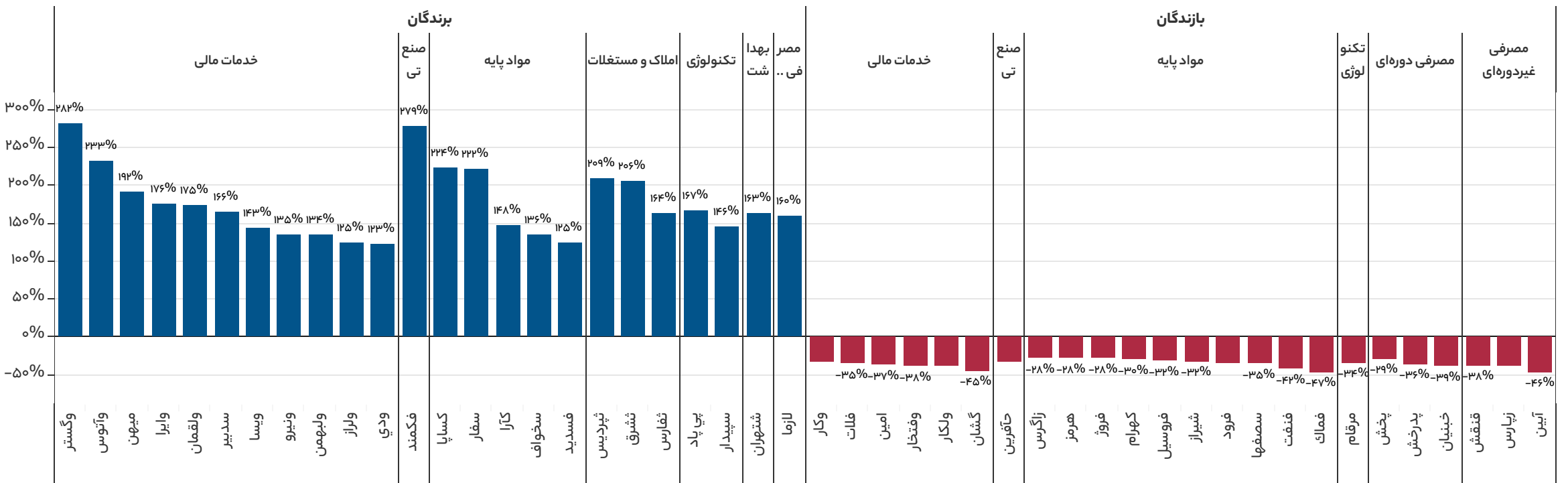
(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله ای و بازده هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



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



برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس 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

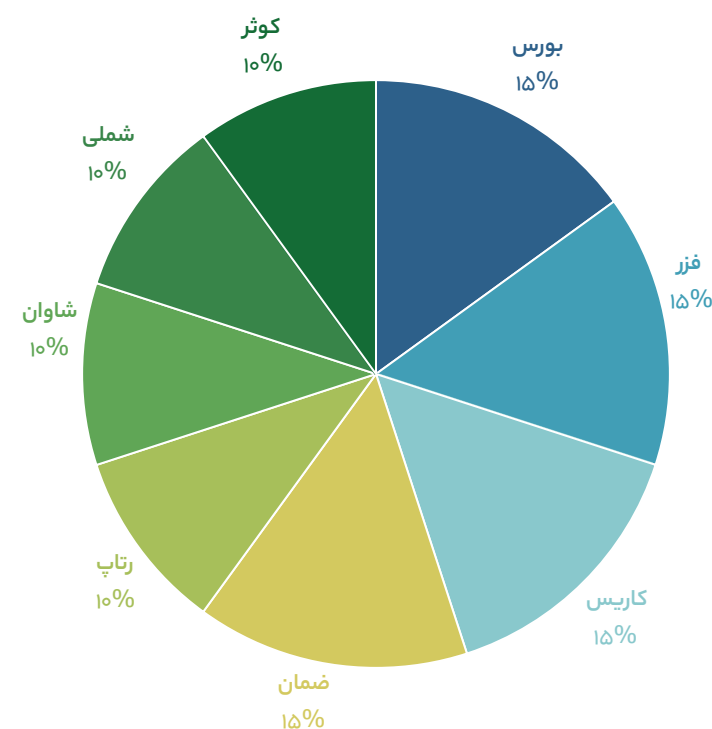


وسپهر	خسپا	خودرو	اخابر	شپدیس	حکشتی	رمپنا	پارسان	فخوز	وغدیر	شتران	شبریز	تاپیکو	شستا	یوعلی	فولاد	وتجارت	نوری	شینا	وپاسار	وکغدیر	آریا	ویملت	کچاد	ومعادن	کگل	فملی	شندیر	مین	مارون	میدکو	پپاس	فارس	تامیکو	وصندوق	وامید	بفجر	کگهر	پارس	جم	
+۱۲.۳%	+۱۰.۱%	+۹.۹%	+۹.۲%	+۸.۱%	+۷.۰%	+۷.۰%	+۶.۵%	+۶.۱%	+۶.۰%	+۵.۹%	+۵.۸%	+۵.۶%	+۵.۵%	+۵.۴%	+۴.۵%	+۴.۳%	+۳.۹%	+۳.۶%	+۳.۵%	+۳.۴%	+۳.۴%	+۳.۳%	+۳.۱%	+۳.۱%	+۲.۹%	+۲.۸%	+۲.۱%	+۱.۴%	+۱.۰%	+۰.۸%	+۰.۷%	+۰.۳%	۰%	-۰.۱%	-۰.۴%	-۰.۷%	-۰.۹%	-۲.۳%		
بازده هفته گذشته																																								



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۳۱۹	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۲۰,۶۵۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۸,۲۰۰	پتانسیل حذف دلار دولتی، انتظار افزایش سودآوری زیر مجموعه	۹,۸۰۰	شملی	
۱۰%	۳,۱۷۴	رشد سودآتی شرکت ناشی از سرمایه گذاری‌ها و عملیات بیمه‌ای	۴,۱۰۰	کوثر	
۱۵%	۱۵,۲۵۰	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵,۷۴۳	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۷,۰۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۴۶,۷۵۰	موجودی بالای انبارهای شرکت و پتانسیل فروش با حاشیه سود بالا	۵۰,۰۰۰	فزر	
۱۵%	۲۱,۷۴۶	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود در صورت افزایش ارزش معاملات، مسیری مطابق تصویر تا حوالی ۲,۱۵۰,۰۰۰ واحد طی کند.

توضیحات تحلیل



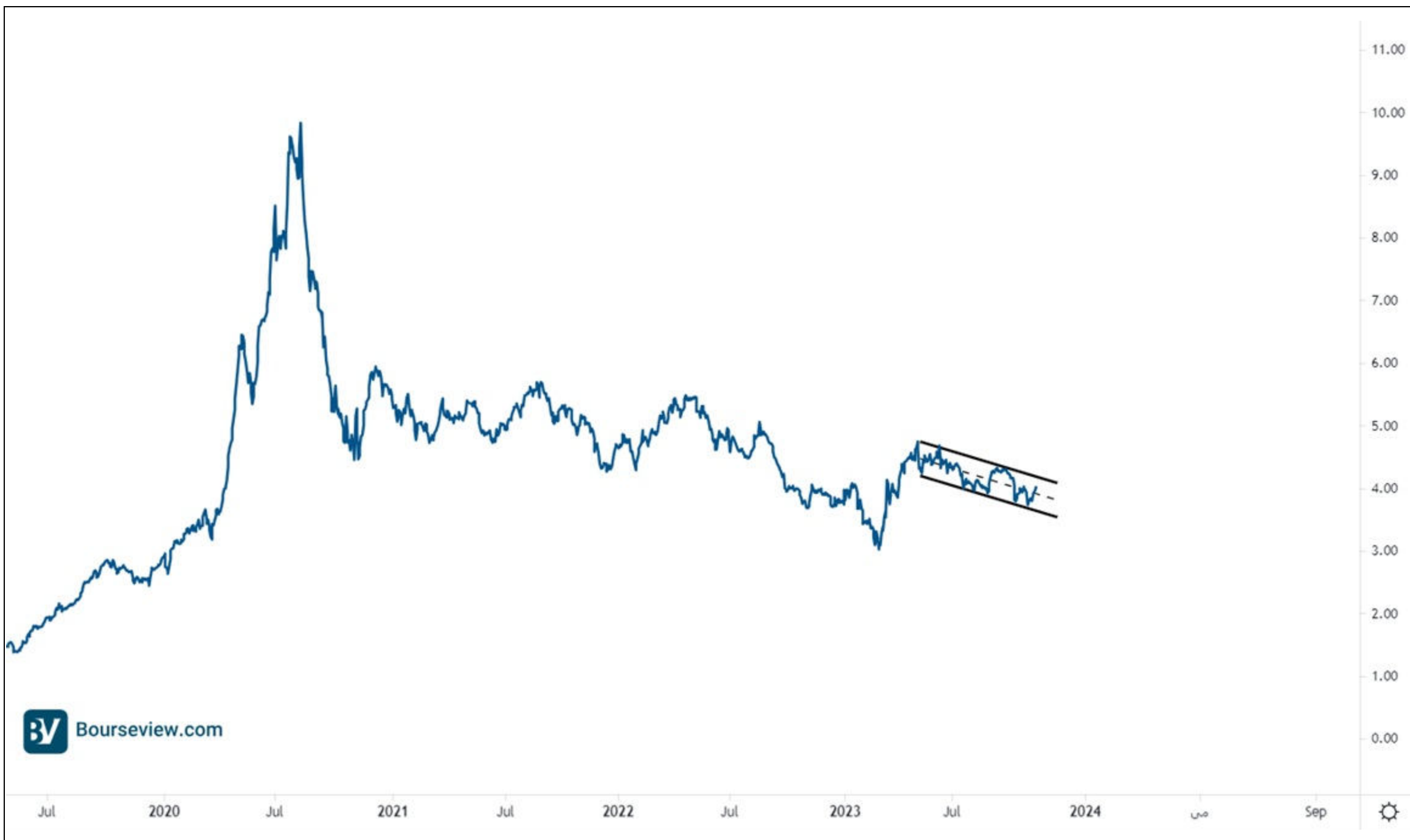
مهم‌ترین محدوده مقاومتی شاخص هم‌وزن در تصویر مشخص شده است. شرط تداوم روند صعودی عبور پرقدرت از این محدوده است.

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 تا سقف کانال ترسیم‌شده را تجربه کند.

توضیحات تحلیل



محدوده ۵۰,۵۰۰ تا ۵۱,۲۰۰ تومان، محدوده مهم حمایتی است. انتظار می‌رود مدتی در این محدوده در نوسان باشد.

توضیحات تحلیل



انظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح مطابق تصویر تا حوالی ۱۹۱۸ دلار ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی ۷۹.۹ دلار ادامه داشته 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 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 فصله)								
مواد پایه	الفین	مارون	۱۲	۱۲۴.۱	۱۵,۵۱۰	۱,۳۶۴	۷۸%	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۳.۹	۷.۴	۷.۵	-۱.۸								
		آریا	۱۲	۱۰۵.۹	۷,۷۰۰	۸۰۲	۹۵%	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۴	۶.۱	۶.۶	-۰.۸								
		جم	۱۲	۷۶.۴	۴,۲۴۵	۵۶۰	۹۹%	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۶	۴.۱	۴.۵	-۴.۰								
		شگویا	۱۲	۳۷.۸	۱,۵۷۹	۱۴۳	۹۱%	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۵.۷	۴.۵	۵.۹	-۰.۳								
		جم پیلن	۱۲	۳۶.۸	۱۸,۴۰۸	۲,۱۰۹	۹۹%	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۵	۴.۸	۵.۹	+۱.۲								
		شکبیر	۱۲	۲۶.۲	۷,۲۷۰	۱,۱۶۸	۸۸%	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۵	۳.۱	۳.۴	-۷.۶								
		شاراک	۱۲	۲۳.۲	۲,۸۸۳	۴۱۹	۹۶%	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۴.۸	۳.۸	۴.۲	-۱.۳								
		شغدیر	۱۲	۸.۵	۶,۵۴۵	۱,۰۹۶	۹۱%	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۶	۴.۵	۶.۰	+۰.۲								
		شبصیر	۱۲	۷.۱	۲,۸۵۵	۳۷۶	۸۱%	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۲	۳.۷	۴.۳	-۰.۵								
		شجم	۶	۵.۳	۸۲۰	۸۸	۸۵%	۶۱	۱۳۴	+۱۱۸%	۱۳.۴	۶.۸	۶.۴	-۳.۹								
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۲۵.۵	۱۳,۹۴۷	۱,۳۱۴	۱۰۰%	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۰	۶.۸	۷.۷	+۱.۱								
		بوعلی	۱۲	۸۱.۵	۵,۶۷۶	۵۶۳	۹۵%	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۸.۸	۶.۶	۹.۰	+۴.۰								
		اوره	شپدیس	۶	۱۰۰.۳	۱۶,۷۱۳	۴,۲۶۴	۶۳%	۳,۲۶۲	۲,۷۱۳	-۱۷%	۵.۱	۶.۶	۵.۷	+۲.۴							
			شیراز	۱۲	۳۵.۱	۲,۲۹۴	۷۶۱	۲۱%	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۳	۵.۳	۶.۱	+۱.۵							
			خراسان	۱۲	۲۶.۶	۱۴,۸۶۴	۲,۸۱۰	۸۳%	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۹.۵	۷.۵	۸.۵	+۳.۳							
			کرماشا	۱۲	۱۹.۲	۱,۸۰۹	۴۵۸	۴۸%	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۹	۴.۶	۴.۶	+۰.۶							
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۰.۵	۱۲,۶۹۰	۱,۲۶۵	۷۲%	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۵	۶.۵	۶.۶	-۲.۴								
		شخارک	۱۲	۲۸.۰	۴,۶۶۹	۶۴۱	۹۹%	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۸	۴.۹	۵.۹	-۱.۳								
		شفن	۱۲	۱۷.۲	۵۵۶	۱۰۲	۸۹%	۷۰	۹۰	+۲۸%	۷.۹	۵.۹	۵.۵	-۱.۸								
	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۲۷.۶	۵۰۷	۵۶	۷۵%	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۲	۷.۵	۶.۵	+۰.۲								
دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۵	۵۴۸	۶۴	۸۲%	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۶.۳	۴.۹	۵.۳	-۰.۵									
	شصدف	۱۲	۲.۶	۳,۶۹۰	۳۹۲	۷۳%	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۹.۴	۶.۰	۷.۴	-۱.۳									
	شدوص	۱۲	۲.۱	۲,۲۵۰	۱۹۳	۹۳%	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۶.۱	۴.۷	۵.۹	+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 فصله	(آینده نگر فصله)																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
مواد پایه فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۵۰.۴	۵۶۳	۸۵	۵۰%	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۴.۵	۳.۸	۴.۱	+۱.۱																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								</

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 مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوه	۱۲	۹.۶	۱۴,۷۸۵	۱,۵۸۴	۹۵%	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۲	۴.۶	۵.۴	+۰.۸						
		سفار	۱۲	۷.۶	۳۲,۴۹۹	۱,۰۳۹	۹۵%	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۳.۲	۱۷.۵	۲۰.۴	+۱.۲						
		سآبیک	۱۲	۷.۳	۲,۴۷۴	۲۴۹	۹۳%	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۶.۳	۴.۵	۵.۹	+۲.۲						
		سخوز	۱۲	۵.۹	۴,۲۱۷	۷۱۹	۹۰%	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۲	۲.۹	۳.۰	-۱.۴						
		سمازن	۹	۵.۸	۲,۳۳۵	۲۹۰	۸۱%	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۵.۹	۴.۸	۴.۴	+۰.۸						
		سپاها	۶	۵.۴	۲,۱۹۰	۱۹۷	۷۵%	۵۰۲	۳۰۸	-۳۹%	۴.۴	۷.۰	۳.۸	-۰.۴						
		ساروم	۱۲	۴.۲	۴,۱۸۰	۵۵۴	۹۶%	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۲	۳.۴	۴.۵	-۰.۸						
		سهگمت	۱۰	۴.۱	۵,۵۶۲	۶۴۸	۹۸%	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۵.۵	۳.۰	۳.۷	-۰.۴						
		سفانو	۱۲	۴.۰	۸,۰۰۰	۱,۱۷۰	۹۷%	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۸	۳.۲	۳.۷	+۰.۳						
		سشرق	۶	۴.۰	۱,۵۰۶	۱۵۴	۷۲%	۲۴۵	۳۵۹	+۴۷%	۶.۲	۴.۴	۳.۱	-۴.۱						
		سرود	۱۲	۳.۵	۴,۳۳۰	۴۹۶	۹۶%	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۰	۳.۷	۴.۵	+۰.۱						
		سصوفی	۱۲	۳.۲	۲,۹۳۲	۳۶۸	۹۰%	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۵.۴	۳.۷	۴.۹	+۰.۲						
		سبجنو	۱۲	۲.۷	۶,۸۹۸	۵۷۳	۹۶%	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۶	۵.۶	۶.۰	+۰.۳						
		سشمال	۹	۲.۶	۱,۵۵۰	۱۷۰	۸۹%	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۵.۷	۴.۳	۴.۲	+۰.۰						
		سبهان	۱۲	۲.۴	۱۱,۹۴۲	۷۳۶	۹۷%	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۷	۵.۴	۵.۵	-۰.۳						
		سغرب	۱۲	۲.۱	۴,۲۵۳	۳۹۰	۹۲%	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۵.۰	۳.۴	۴.۱	-۰.۷						
	سقاین	۱۲	۱.۹	۴۸۰	۳۷	۹۷%	۴۹	۵۷	+۱۶%	۹.۸	۸.۲	۸.۶	-۰.۱							
	سشاش	۱۲	۱.۹	۹,۳۳۵	۱,۱۶۱	۹۵%	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۶	۴.۳	۴.۸	-۰.۹							
	سخرز	۱۲	۱.۹	۳,۷۰۰	۳۵۸	۹۵%	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۷	۵.۵	۶.۶	+۰.۰							
	کاشی و سرامیک	کحافظ	۱۲	۳.۷	۷۱۰	۸۲	۱۰%	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۳	۳.۳	۳.۶	-۲.۵						
کساوه		۱۲	۲.۹	۵,۵۰۰	۷۴۷	۷۱%	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۵.۴	۳.۷	۳.۷	-۱.۷							
کلوند		۱۲	۱.۸	۴,۴۳۰	۵۰۴	۹۵%	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۵.۹	۴.۵	۵.۱	-۰.۲							
فرآورده های نسوز		کپشیر	۱۲	۱.۹	۱,۲۴۸	۸۷	۸۸%	۱۹۰	۱۶۷	-۱۲%	۶.۶	۶.۹	۶.۸	+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	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۹۳.۶	۸۵۳	۱۷۰	۶۳%	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴.۹	۴.۸	۵.۱	+۱.۵
			شبندر	۱۲	۱۳۴.۹	۱,۰۰۴	۳۰۴	۷۶%	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴.۱	۵.۸	۳.۹	+۱.۶
			شتران	۱۲	۱۱۷.۷	۴۲۸	۱۰۹	۳۱%	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۳	۴.۲	۳.۹	+۱.۰
			شبریز	۱۲	۳۶.۵	۱,۲۱۵	۳۳۵	۷۶%	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۵.۰	۴.۷	۴.۳	-۰.۲
			شاوان	۱۲	۱۶.۵	۲,۰۶۰	۵۵۵	۷۳%	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۰	۸.۵	۴.۵	+۰.۹
	روانکار	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۱۴.۶	۲۴۱	۳۱	۸۸%	۳۵	۴۶	+۳۰%	۶.۸	۴.۹	۴.۷	-۲.۹
		شبه‌ر	شبه‌رن	۱۲	۲۸.۰	۲,۳۴۰	۳۳۸	۸۹%	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۲	۶.۰	۵.۹	+۱.۵
			شسپا	۱۲	۲۷.۱	۴۸۳	۷۴	۶۷%	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۱	۴.۰	۴.۵	+۰.۰
			شنفت	۱۲	۱۶.۳	۸۱۶	۱۰۸	۸۲%	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۷.۷	۷.۶	۸.۴	+۰.۳
			شرانل	۱۲	۱۵.۲	۷,۶۰۰	۱,۴۴۱	۸۵%	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴.۵	۳.۹	۳.۶	-۰.۷
		زغال سنگ	کزغال	۱۲	۷.۴	۲,۱۲۰	۲۶۵	۹۹%	۲۶۷	۴۹۶	+۸۶%	۷.۹	۴.۰	۶.۹	-۰.۲
			کپرور	۱۲	۲.۱	۱,۲۰۱	۱۶۹	۵۹%	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۵.۹	۴.۳	۴.۴	-۱.۳
			کطبس	۱۲	۱.۴	۱,۸۱۳	۱۹۳	۶۲%	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۶.۰	۵.۲	۵.۰	-۲.۳
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۸	۵۴۴	۴۷	۹۴%	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۲	۹.۲	۷.۴	-۳.۷
			تنوین	۱۲	۹.۰	۲۳۵	۴۸	۶۳%	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴.۷	۳.۵	۳.۵	-۲.۳
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۵	۷,۲۹۰	۸۸۸	۹۱%	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵.۶	۳.۴	۳.۹	-۱.۰
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۲	۵,۸۰۰	۳۲۲	۹۶%	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۴.۳	۷.۹	۹.۳	-۰.۵

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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		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 فصله)					
بهداشت	دارویی	ددانا	۱۲	۱۲.۰	۵,۰۰۵	۴۹۵	۷۶%	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۵.۹	۴.۳	۴.۵	+۰.۲					
		دلر	۱۲	۷.۲	۳,۱۹۵	۳۵۲	۹۶%	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۶.۵	۵.۹	۶.۴	+۱.۱					
		دپارس	۱۲	۵.۶	۵,۹۱۴	۸۰۳	۹۸%	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۶.۲	۵.۳	۴.۷	-۰.۱					
		دالبر	۱۲	۵.۴	۵۷۰	۷۵	۶۹%	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۵.۱	۴.۰	۴.۲	-۱.۶					
		دفرا	۱۲	۵.۲	۳,۷۰۰	۳۹۳	۷۹%	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۴	۶.۳	۶.۰	+۱.۴					
		دفارا	۱۲	۵.۱	۳,۲۰۶	۴۵۲	۹۹%	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۵.۷	۴.۹	۴.۳	-۰.۱					
		هجرت	۱۲	۴.۲	۲,۶۵۰	۴۰۶	۹۵%	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۴.۹	۳.۸	۴.۱	-۱.۰					
		دتوزیع	۱۲	۳.۹	۲,۱۸۵	۴۴۹	۹۴%	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۶.۶	۵.۰	۴.۸	-۰.۵					
		دقاضی	۱۲	۳.۹	۲,۲۶۵	۲۷۷	۹۶%	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۰	۴.۶	۵.۰	-۰.۵					
		کاسپین	۱۲	۲.۵	۱,۸۰۹	۲۳۴	۹۵%	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۵.۷	۴.۵	۴.۹	-۰.۵					
		درازک	۱۲	۲.۴	۱,۱۶۴	۲۱۳	۱۰۴%	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۲	۳.۶	۳.۳	-۷.۵					
		دکپسول	۱۲	۲.۴	۷,۹۹۵	۹۲۱	۹۲%	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۷.۵	۵.۹	۶.۹	+۱.۷					
درازی	۱۲	۱.۸	۱,۸۰۳	۲۷۳	۶۷%	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۵.۲	۴.۵	۴.۲	-۷.۱							

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

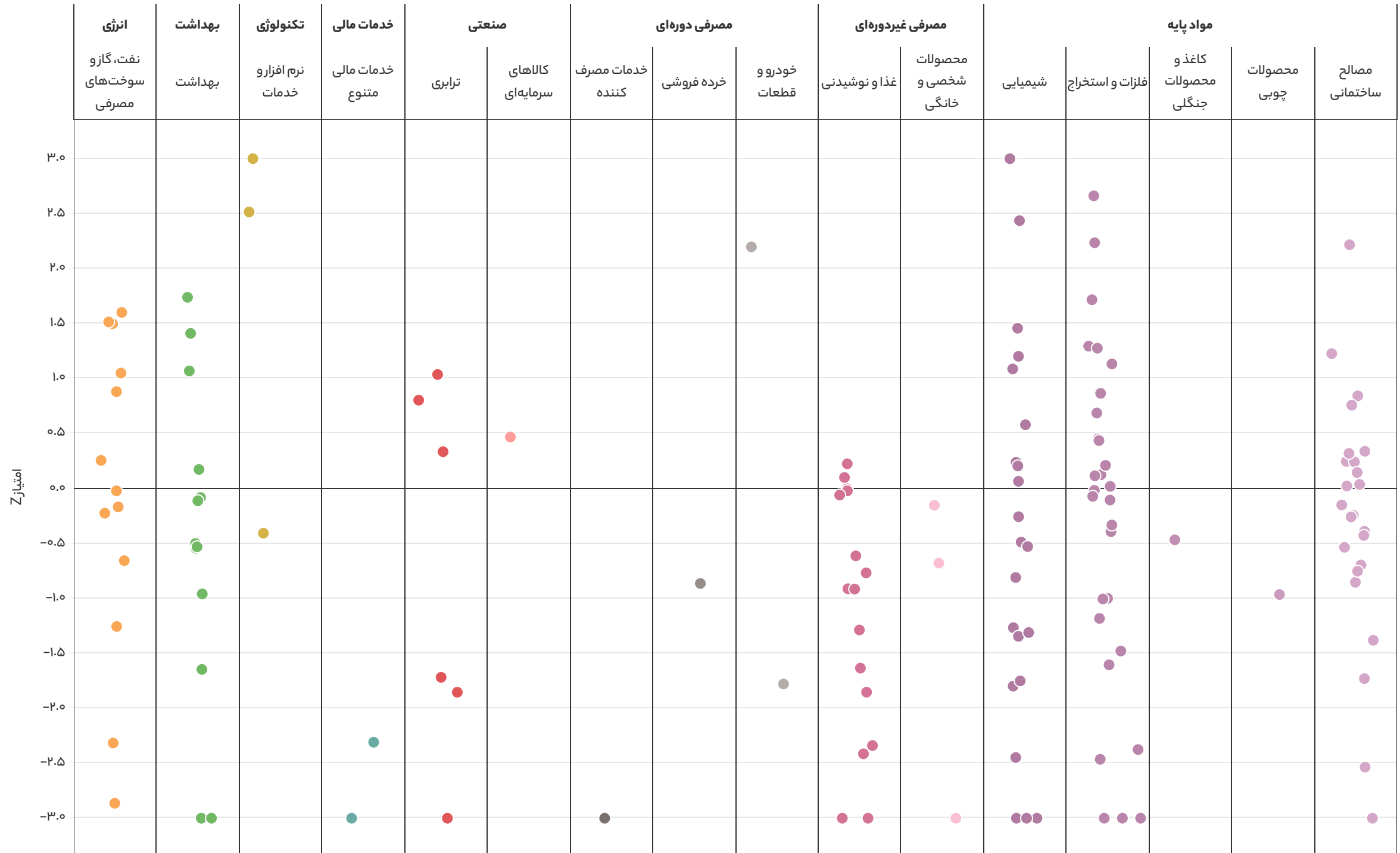
گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	قیمت (تومان)	سود ۱۴۰۱ (واقعی)	میانگین تقسیم سود	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z						
								سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر فصله	آینده نگر ۴ فصله						
مصرفی غیردورهای	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۷.۴	۲,۴۷۷	۲۱۳	۵۵%	۴۹۶	۶۸۹	+۳۹%	۵.۰	۳.۵	۳.۷	-۴.۴	▲					
		سیمرغ	۹	۴.۲	۳,۲۴۶	۳۹۱	۲۴%	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۶.۰	۴.۱	۳.۳	-۲.۳	◆					
		زفکا	۱۲	۲.۵	۱,۶۶۸	۱۵۵	۹۱%	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۹.۲	۶.۱	۷.۶	+۰.۲				◆		
		تلیسه	۱۲	۱.۹	۳۸۵	۲۵	۹۲%	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۱.۳	۷.۹	۱۲.۵	-۰.۱				◆		
		زگلدشت	۱۲	۱.۶	۲,۳۵۵	۹۶	۹۵%	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۰.۸	۸.۰	۸.۹	+۰.۱				◆		
		زملارد	۱۲	۱.۵	۱,۸۵۵	۳۳	۹۴%	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۲.۷	۱۰.۲	۱۰.۲	-۳.۰	▲					
		زشریف	۹	۱.۳	۵۲۸	۴۸	۷۶%	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۶.۷	۵.۱	۴.۵	-۱.۶			◆			
		زشگزا	۱۲	۰.۹	۹۰۸	۸۱	۵۶%	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۸.۳	۴.۸	۷.۶	+۰.۰				◆		
	غذا و نوشیدنی	غصینو	۱۲	۱۳.۵	۱,۳۵۰	۱۶۱	۶۰%	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۶.۰	۴.۰	۴.۱	-۲.۴	◆					
		غپینو	۱۲	۳.۲	۳۶۱	۴۹	۵۶%	۶۷	۹۴	+۳۹%	۵.۴	۳.۷	۳.۸	-۱.۹			◆			
		غسالم	۱۲	۱.۹	۴۳۴	۶۵	۴۱%	۶۵	۸۱	+۲۵%	۶.۷	۵.۵	۴.۷	-۱.۳				◆		
		غمینو	۱۲	۱.۴	۹۰۰	۱۱۹	۴۳%	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۵.۵	۳.۶	۳.۹	-۰.۸				◆		
	محصولات لبنی	غکورش	۱۲	۱۴.۰	۶۹۸	۱۲۶	۵۴%	۸۳	۸۶	+۳%	۸.۴	۸.۰	۷.۷	+۰.۰				◆		
		غگلپا	۱۲	۱.۶	۴,۳۹۰	۴۶۵	۷۴%	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۷.۵	۵.۱	۵.۳	-۰.۶				◆		
		غشان	۱۲	۱.۱	۶۵۴	۸۰	۷۱%	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۷.۹	۵.۸	۵.۵	-۰.۹				◆		
		غگلستا	۱۲	۱.۱	۱,۷۲۹	۱۵۶	۷۰%	۲۰۷			۸.۴									
	محصولات شخصی و خانگی	غمایه	۱۲	۱.۶	۶,۷۰۰				۶۴۳	۹۵۶	+۴۹%	۱۰.۴		۷.۹						
کیمیاتک		۱۲	۶.۲	۱,۰۲۹	۱۰۲	۶۴%	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۷.۱	۶.۰	۶.۲	-۰.۲				◆			
قرن		۱۲	۶.۰	۹۹۷	۱۱۰	۶۱%	۱۴۳	۲۰۰	+۴۰%	۷.۰	۴.۹	۵.۲	-۰.۷				◆			
	شپاکسا	۹	۲.۳	۲۴۹	-۲۴	۳۸%	۴۶	۶۱	+۳۲%	۵.۴	۴.۸	۳.۳	-۳.۷	▲						

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	بنادر و کشتیرانی	حخر	۱۲	۵۰۹	۱,۶۴۰	۲۰۷	۹۶%	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۵۰۷	۳۰۶	۵۰۲	+۰.۳	
		حتاید	۱۲	۵۰۹	۴۸۹	۶۲	۵۲%	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۴۰۵	۳۰۴	۳۰۵	-۱.۹	
	ترابری	توریل	۱۲	۳۰۸	۵۳۷	۴۳	۳۸%	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸۰۱	۶۰۳	۵۰۶	-۱.۷	
		حآفرین	۱۲	۱۰۸	۲۴۹	۳۱	۵۲%	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶۰۰	۵۰۴	۴۰۵	-۵.۴	
		خطوط راه آهن	۶	۱۰۶	۶,۳۰۰	۶۳۱	۸۹%	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸۰۸	۷۰۶	۶۰۴	+۱.۰	
		حآسا	۱۲	۱۰۵	۸۲۱	۳۲	۲۲%	۳۷	۴۱	+۱۱%	۲۲.۳	۲۱.۱	۳۵.۸	+۰.۸	
		محصولات فلزی	۱۲	۳۰۳	۲۹۹	۳۳	۳۱%	۲۶	۳۸	+۴۶%	۱۱.۶	۸۰۱	۱۱.۱	+۰.۵	
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	سیم و کابل	۱۲	۳۰۱	۲,۹۸۵	۲۵۰	۶۱%	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶۰۷	۵۰۳	۴۰۸		
		سیستم	۱۲	۱۸۰۲	۱,۸۱۸	۸۳	۸۹%	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۰۰.۸	۲۵۰.۶	۳۸۰.۱	+۴.۰	
		سپیدار	۱۲	۶۰۳	۹,۰۳۵	۳۱۱	۷۸%	۲۷۰	۳۳۸	+۲۵%	۳۳.۴	۲۷۰.۵	۱,۴۷۳.۶	+۲.۵	
	نرم افزار و خدمات	رافزا	۱۲	۱۰۴	۱,۳۸۵	۹۱	۸۰%	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۹۰۸	۸۰۱	۱۰۰.۳	-۰.۴	
مصرفی دورای	خودرو و قطعات	پکیور	۹	۴۰۴	۶۷۱	۲۵	۷۵%	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۷۰۸	۳۰۸	۳۰۹	-۱.۸	
		پلولة	۱۲	۱۰۰	۴,۵۶۰	۶۰۶	۴۳%	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۲۱.۲	۲۱.۵	۲۵.۸	+۲.۲	
	خردف فروشف	قاسم	۱۲	۳۰۶	۷۲۴	۱۰۳	۴۹%	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵۰۴	۴۰۰	۴۰۰	-۰.۹	

-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 سرمایه گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

