

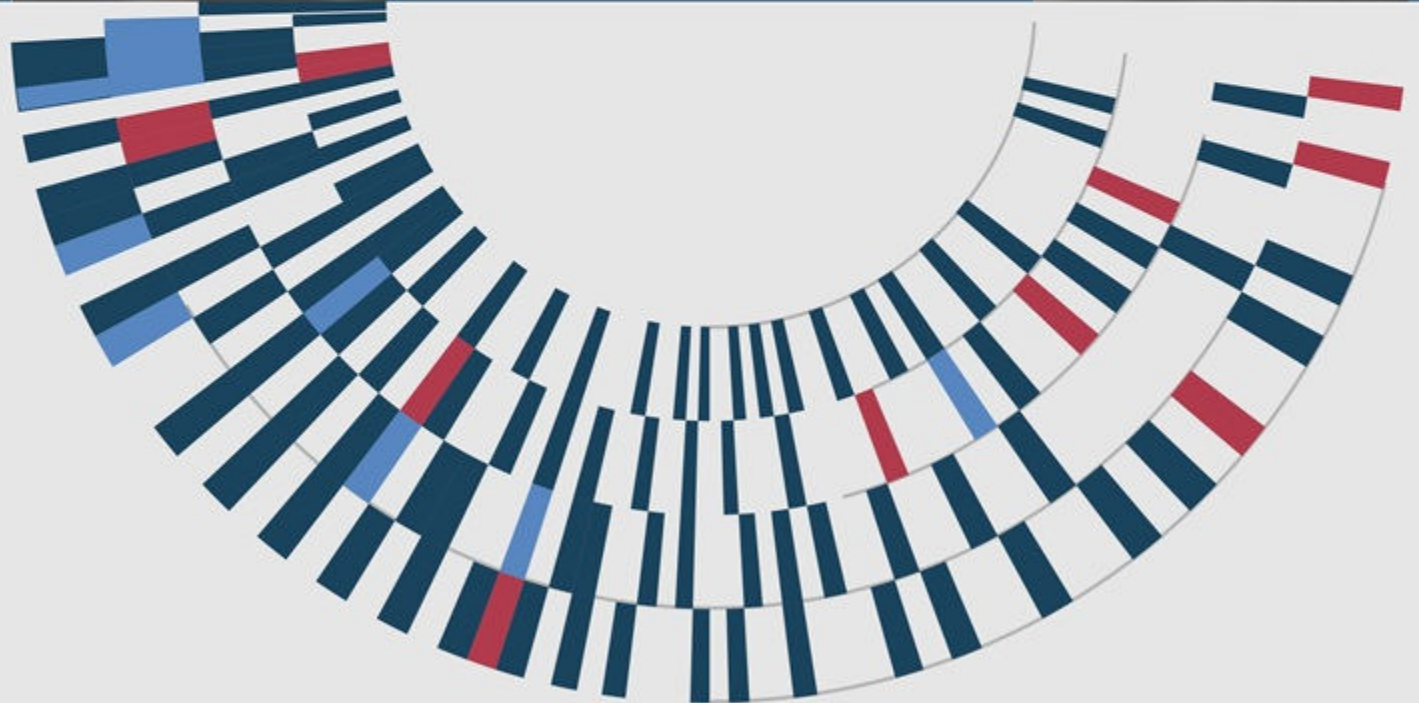
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲۵ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۲۶

 CHARISMA





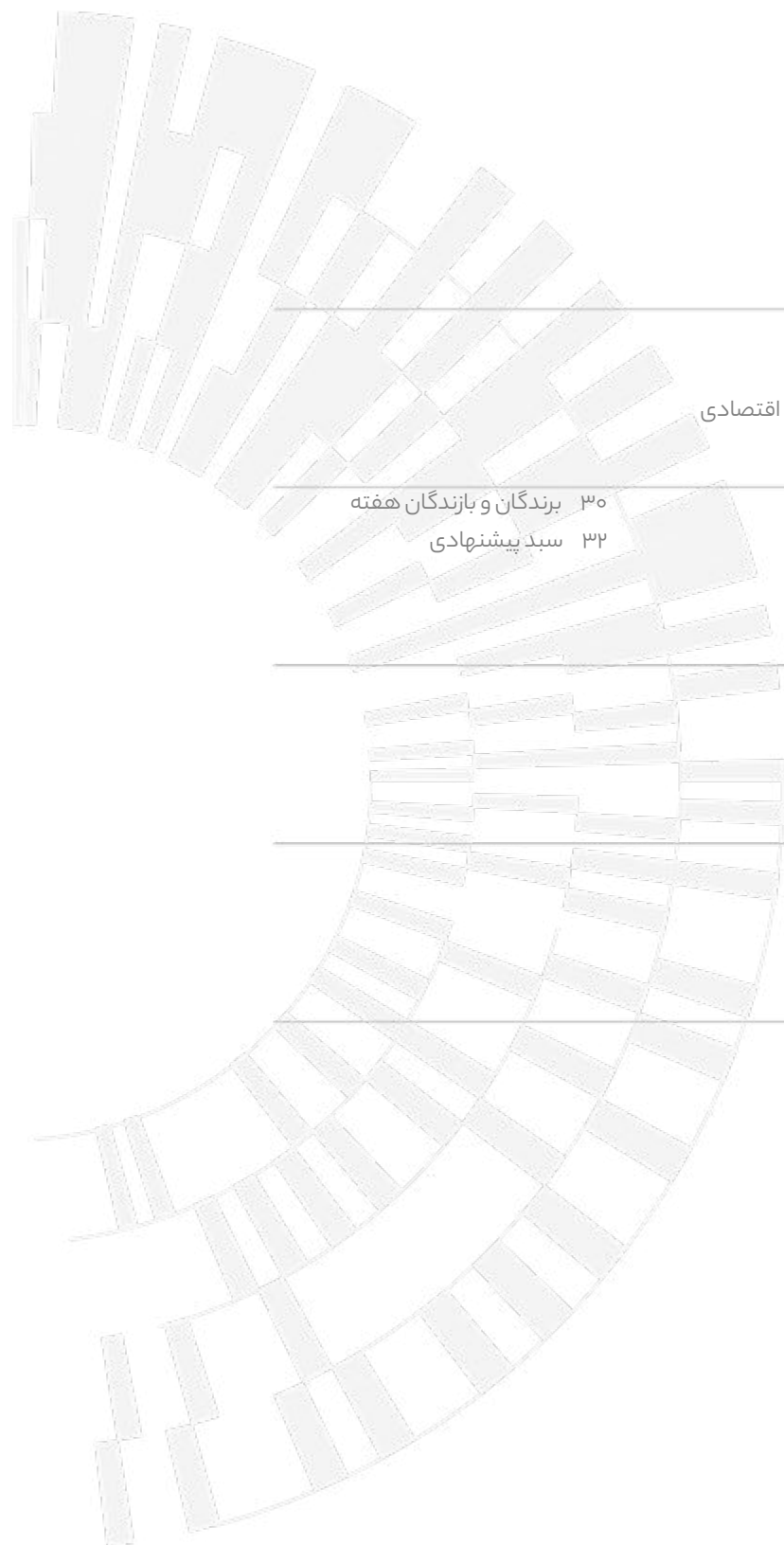
معرفی گزارش:

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





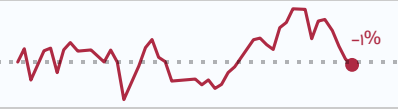
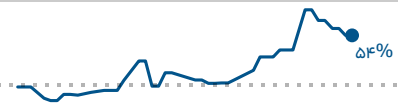
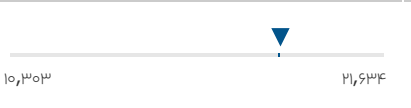
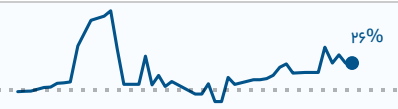
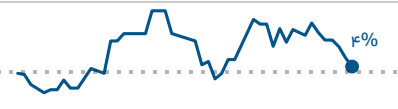
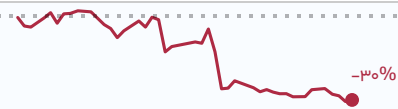
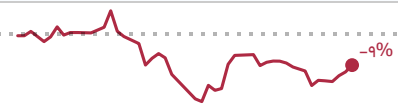
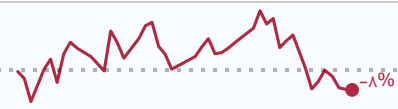
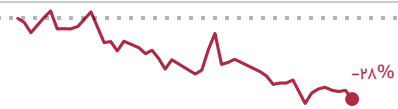
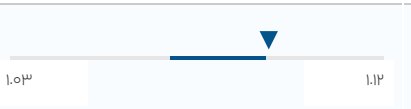
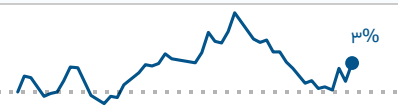
فلزات و معادن

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	۱,۹۸۱	۲.۳%	فزر	-	۱,۷۴۹۲,۰۱۷	۱۱۳%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۳۱۴	۳.۴%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳۹,۳۴۱	۴%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۰۴	-۰.۶%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱۲,۴۲۴	۳%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۶۲	۰.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳۳,۴۴۴	۱۳%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۲۹۶	۵.۴%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۰۳۵۲,۲۹۶	۸%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۷۵۶	۰.۱%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۹۱۰۴,۸۴۳	۶۱%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۶۱۵	۰.۴%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۲۵۶۳,۶۲۵	۶۰%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۹۲	۲.۵%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱۶۲۳	۲%
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۷۶۲	-۰.۳%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۳,۷۳۴۲۲,۸۲۱	۳۳%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۴۶۳	۰.۵%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۲۰۶۷۰	۱۰%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۵۱۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۲,۴۵۳۲۲,۰۸۰	۴۹%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۵۷۰	۰.۹%	ذوب، کویر	فولای	۵۴۶۷۵۵	۱۰%
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۹۱۶	-	ذوب، کویر	فولای	۱۴,۸۰۳۲۴,۷۴۷	۴۱%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۶۰	۰.۹%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۲۵۷۸۰	۷%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۴۵	۰.۸%	فولاد	-	۶۱۵۸۶۰	۴%



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	۳۷۳	۰.۷%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماش	شاروم، شفارس	۲۸۵۸۸	-۳۲%
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۸۵	۱.۱%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، شسینا	۲۳۵۳۲۵	-۶%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۴۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰۹۷۹	۷%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۰	۰.۷%	آریا، شکبیر	-	۸۷۵۱,۰۸۰	-۵%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۹۰	۱.۰%	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۶۶۱,۰۵۸	-۱%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۴۰	۱.۰%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۷۰۱,۰۱۰	۵%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۹۰	۱.۰%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۴۹۵۳۲	۹%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	-	شگویا	-	۹۳۰۱,۰۹۹	-۳%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۵۵	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵۹۹۴	-۲%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۹	۰.۳%	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰۹۵۱	-۱%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۷	۲.۲%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۰۲۱,۱۵۸	۹%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۷۵	-۱.۵%	شصفها، نوری	-	۹۷۵۱,۱۷۹	-۱۰%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۵	۲.۵%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸۱,۱۶۸	۱۳%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۶	۲.۵%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲۱,۰۳۷	۱۴%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۸۳۵	-۱.۸%	بوعلی	-	۶,۱۲۹۸,۳۵۵	-۱%
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۹۸۰	-۵.۸%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰۱,۲۳۹	۲۹%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۶۵	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۶۹۹۹۱۴	۹%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۶۵	-۰.۸%	شبصیر	-	۱,۲۳۰۱,۴۱۹	-۶%

انرژی و سایر محصولات

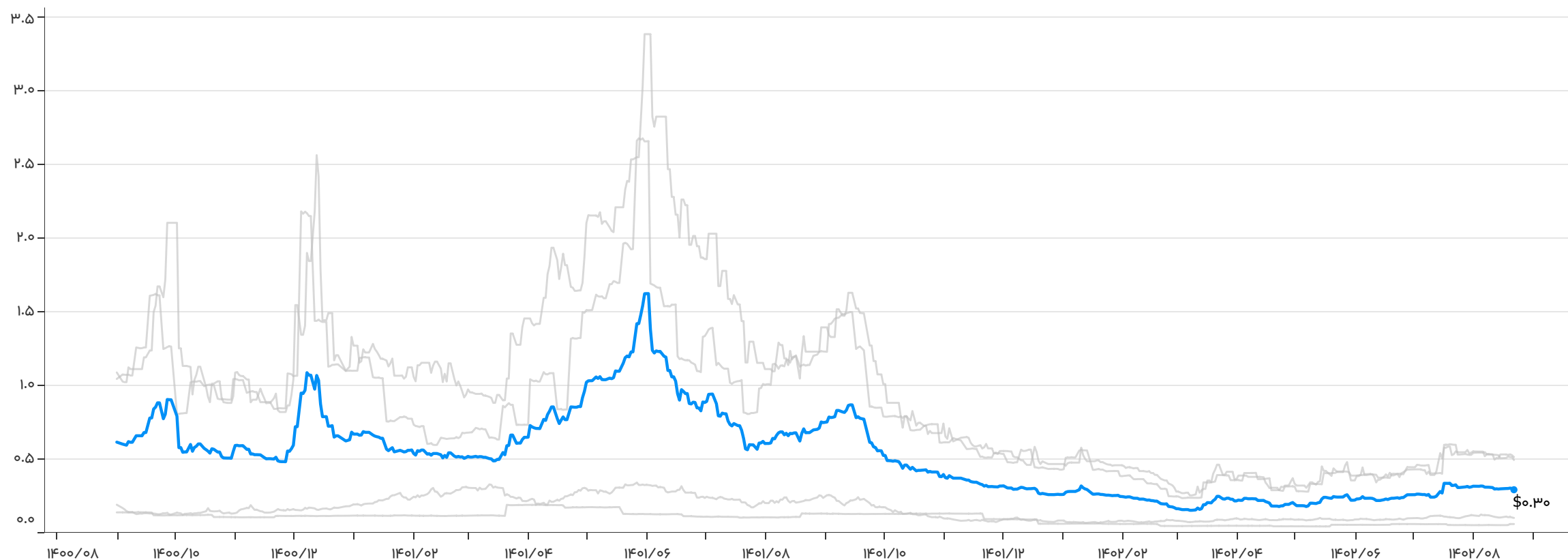
	روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته		آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-۱.۳%		۸۱	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-۲.۰%		۷۶	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۰.۶%		۱۱۶	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		۰.۷%		۱۰۷	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور
					شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		-		۱۸,۴۴۲	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران
					شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		-		-		۳۰,۱۰۳	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان
محصولات کشاورزی					شپاس		-		-۴.۸%		۱۳,۰۰۰	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر - نفت پاسارگاد
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		۰.۹%		۱۸۴	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
					غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		۲.۲%		۸۲۴	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام
					-		-		-۰.۳%		۱,۲۷۱	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
ارز و ارز دیجیتال					-		-		-۴.۱%		۲۰۳	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
					-		-		۲.۰%		۱.۰۹	-	بازار فارکس	یورو به دلار
					-		-		۱.۸%		۱.۲۵	-	بازار فارکس	پوند به دلار
ارز و ارز دیجیتال					-		-		-۱.۹%		۳۶,۴۳۴	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	-۲.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۲۶	-۵۳%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۶	۱۳.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۵۳%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۲	-۳.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۶۳	-۵۸%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۵۰	-۲.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۱.۵۰	-۵۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۳۰	-۲.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۸۷	-۵۷%

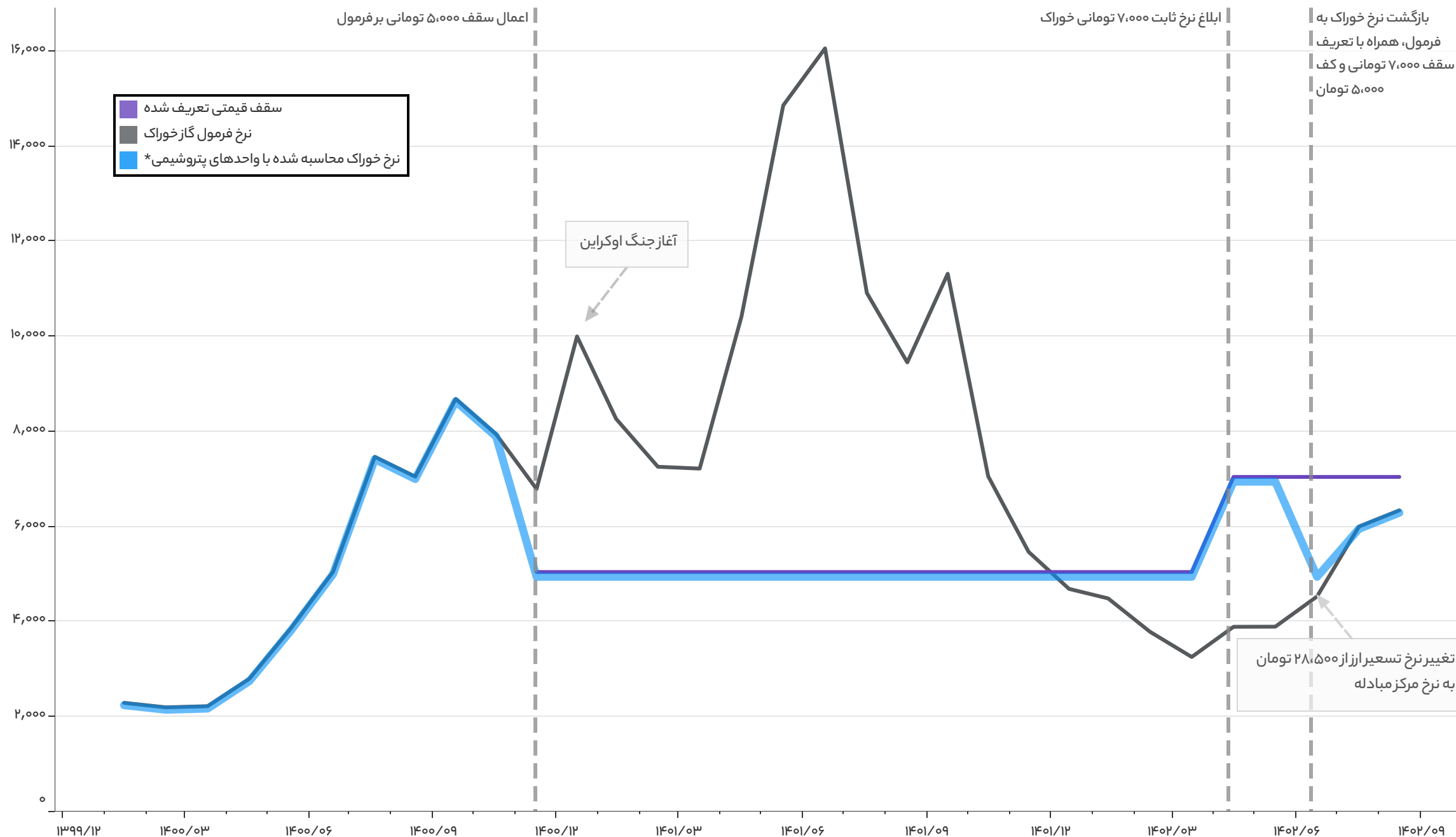
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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

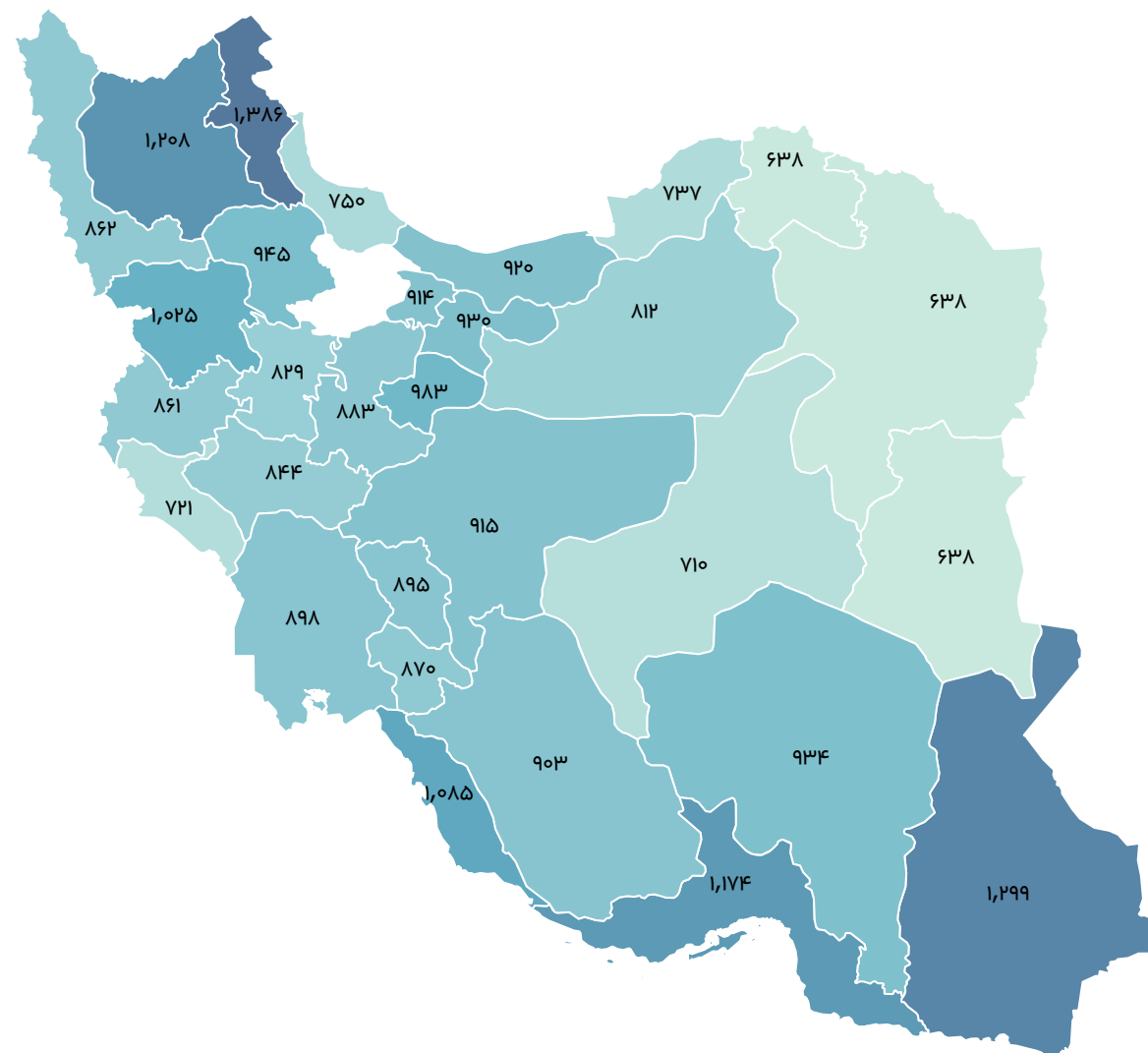


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بر روزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.



قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

براساس شرکت دنبال‌کننده هر استان در جدول روبرو، براساس موقعیت جغرافیایی کارخانجات، تومان به کیلوگرم



* 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.

آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

منطقه	استان	شرکت دنبال‌کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	تهران	سیمان تهران	۹۳۰	۹۳۰	-
	البرز	سیمان آتیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۸۸۳	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	قم	سیمان نيزار قم	۱,۰۳۹	۹۸۳	-۵.۴%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۷۰۹	۷۱۰	+۰.۲%
غرب	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۸۹۸	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۹۵	۸۹۵	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۲۱	+۲.۰%
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۶۱	۸۶۱	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۹۲۶	۸۷۰	-۶.۰%
	کردستان	سیمان کردستان	۱,۱۲۷	۱,۰۲۵	-۹.۱%
شمال غرب	لرستان	سیمان دورود	۸۴۹	۸۴۴	-۰.۶%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۲۶۳	۱,۳۸۶	+۹.۸%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۱۸	۸۶۲	+۵.۳%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۱,۴۲۴	۱,۲۰۸	-۱۵.۱%
شمال	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۴۵	+۱.۲%
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۲۰	+۰.۵%
	گیلان	سیمان خزر	۷۷۳	۷۵۰	-۲.۹%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۳۹	۷۳۷	-۰.۲%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۱۶۱	۱,۱۷۴	+۱.۱%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۱,۰۵۷	۱,۰۸۵	+۲.۶%
	فارس	سیمان داراب	۸۹۳	۹۰۳	+۱.۱%
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۵۴	۶۳۸	-۲.۴%
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۳۸	-
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۳۴	۹۳۴	-
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۱۰۹	۱,۲۹۹	+۱۷.۲%

اخبار و معیارهای تاثیرگذار

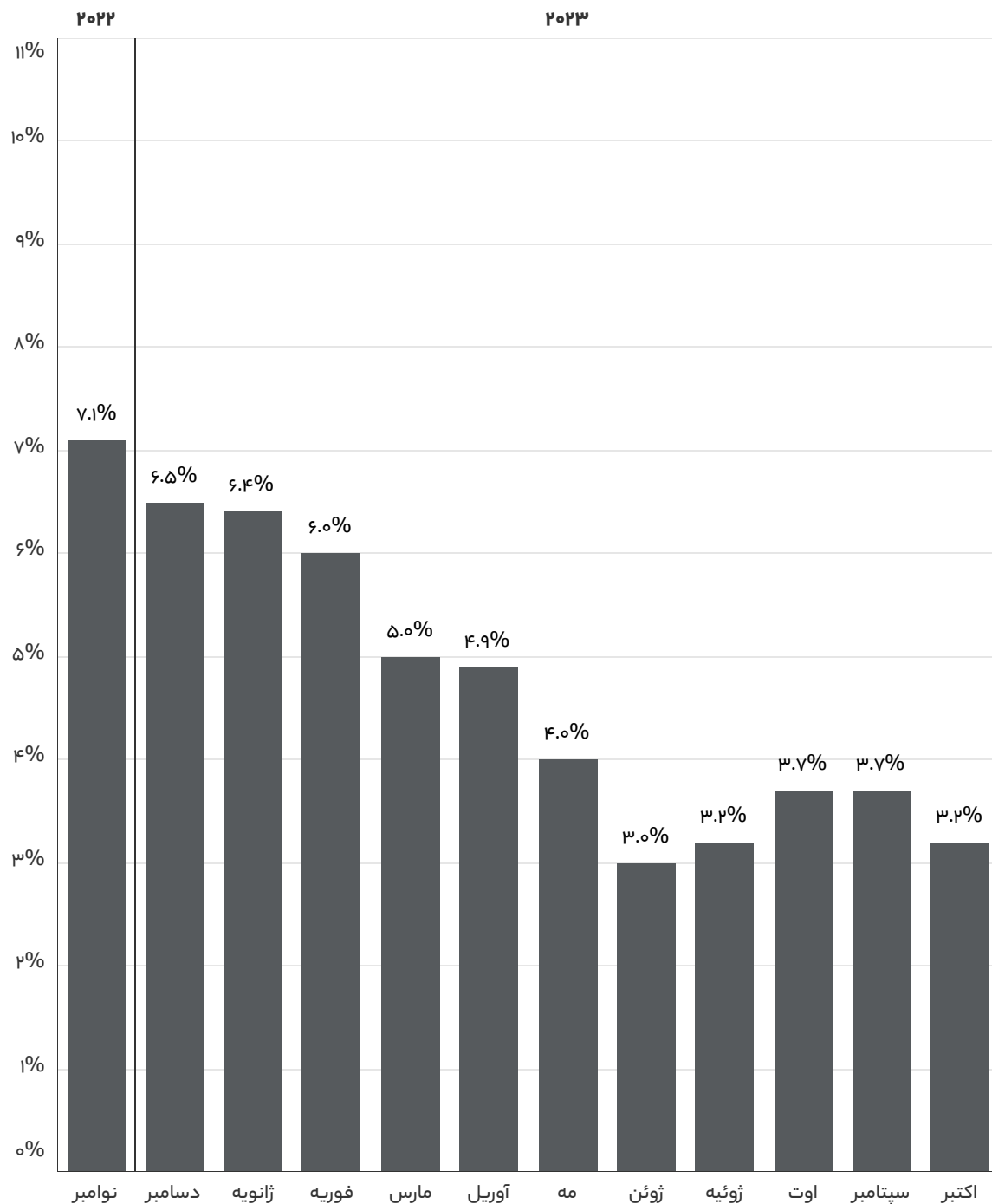
معادن و فزات

انرژی

- ▲ در ابتدای هفته گذشته، کاهش نگرانی در مورد گسترش تنش‌های خاورمیانه تقاضا برای طلا به عنوان یک پشتوانه ایمن را پایین آورده است. قیمت طلا پس از ۱۰ درصد افزایش در ماه اکتبر، به پایین‌ترین رقم طی سه هفته گذشته خود رسیده، اما هنوز در محدوده ۱۹۰۰ دلار قرار دارد. در مقابل، به گزارش رویترز، کاهش ارزش دلار آمریکا و سود اوراق قرضه خزانه‌داری این کشور پس از انتشار گزارش تورم، احتمال توقف روند افزایش نرخ بهره فدرال رزرو را افزایش داده و قیمت طلا را یک درصد در روز سه‌شنبه بالا برد و در نهایت قیمت طلا روز جمعه در پنجمین روز متوالی افزایش یافته و در آستانه اولین افزایش هفتگی طی ۳ هفته گذشته قرار دارد. تحلیلگران عقیده دارند اصلی‌ترین دلیل نزدیک شدن قیمت طلا به ۲۰۰۰ دلار احتمال کاهش نرخ بهره بانک مرکزی آمریکاست. به علاوه جنگ در خاورمیانه همچنان ادامه دارد.
- ▲ بررسی عملکرد بانک‌های مرکزی جهانی به ویژه چین نشان می‌دهد که عدم اطمینان به دلار بیشتر شده و از این رو به متنوع‌سازی سبد ارزش دارایی‌ها روی آورده‌اند و همین موضوع باعث شده تا قیمت طلا در سال جاری به رقم این که بارها از خط روانی ۲۰۰۰ دلار بگذرد اما در بالای کانال ۱۹۰۰ دلاری نوسان داشته باشد. اگرچه چین بزرگترین تولیدکننده طلا در جهان محسوب می‌شود، اما بانک مرکزی این کشور آسیایی بزرگترین خریدار این فلز در ۹ ماهه نخست سال ۲۰۲۳ بوده و به تنهایی حدود ۲۲ درصد از کل خرید طلا توسط بانک مرکزی را در ۹ ماهه اول سال جاری به خود اختصاص داده است. همچنین تلاش برخی کشورها برای کاهش وابستگی به دلار آمریکا به عنوان ارز ذخیره نیز باعث افزایش تقاضا برای طلا از سوی بانک‌های مرکزی شده است.
- ▼ قیمت پالادیوم در این هفته به پایین‌ترین سطح پنج سال اخیر به زیر ۱۰۰۰ دلار در هر اونس رسیده است و به عقب‌نشینی ناشی از انتظارات مازاد به دلیل گسترش سریع خودروهای الکتریکی و خودروسازان که پلاتین ارزان‌تری را برای اتوکاتالیزت‌های خود انتخاب می‌کنند، سرعت بخشیده است. قیمت این فلز که توسط خودروسازان در آگروز موتورها برای کاهش انتشار گازهای گلخانه‌ای استفاده می‌شود، پس از درگیری روسیه و اوکراین، ۷۰ درصد از بالاترین سطح تاریخی ۳۴۴۰ دلار و ۷۶ سنت کاهش یافته است.
- ▼ قیمت نفت در ابتدای هفته گذشته، پس از ۳ هفته کاهش، به دنبال حمایت عراق از کاهش تولید ائتلاف اوپک پلاس در آستانه اجلاس این ائتلاف در دو هفته آینده، افزایش یافت. به گزارش رویترز، قیمت نفت در روز سه‌شنبه به دنبال گزارش اوپک مبنی بر مستحکم بودن ساختار بازار نفت و همچنین بالا رفتن نگرانی در مورد عرضه به دلیل ایجاد محدودیت‌های آمریکا بر صادرات نفت روسیه، بیش از ۱.۵ دلار افزایش یافت و این رشد، قیمت نفت را به بالاترین سطح هفته رساند. قیمت نفت در معاملات روز پنج‌شنبه بازار آسیا، تحت تاثیر سیگنال‌هایی از عرضه بالاتر آمریکا و همزمان نگرانی‌ها نسبت به تقاضای ضعیف برای انرژی، حدود ۵ درصد کاهش یافت و این کاهش قیمت سبب شد قیمت نفت سقوط تا پایین‌ترین رقم طی ۴ ماه گذشته را تجربه کند و در آستانه چهارمین کاهش پیاپی هفتگی قرار گیرد.
- ▲ آژانس بین‌المللی انرژی چشم‌انداز انرژی جهانی ۲۰۲۳ را در ۲۴ اکتبر منتشر کرد. پیام کلیدی این چشم‌انداز این است که تقاضا برای نفت، گاز طبیعی و زغال سنگ قبل از پایان دهه به اوج خود خواهد رسید. بر اساس این گزارش، این تغییر در تراز انرژی در نتیجه شتاب فزاینده سرمایه‌گذاری در انرژی‌های تجدیدپذیر، تعادل مجدد اقتصاد چین و ضریب نفوذ بیشتر خودروهای الکتریکی رخ خواهد داد. این پیش‌بینی در تضاد با دیدگاه صعودی اوپک از رشد تقاضای نفت تا سال ۲۰۴۵ است که در چشم‌انداز جهانی نفت ۲۰۲۳ که در ۹ اکتبر منتشر کرده، اعلام کرده است. علاوه بر این، اوپک در جدیدترین گزارش ماهانه خود اعلام کرد ساختار بازار نفت مستحکم است و عوامل اصلی بازار نفت، قوی مانده و سفته‌بازان، عامل کاهش قیمت‌ها هستند.
- ✓ طی هفته‌های اخیر تقریباً همه گریدهای نفتی که از سوی روسیه فروخته می‌شوند، بالاتر از سقف قیمت ۶۰ دلار در هر بشکه بودند که توسط گروه هفت برای فروش نفت این کشور تعیین شده است. به دنبال این موضوع آمریکا به نفتکش‌های حامل نفت روسیه اولیتما توم داده است. نامه‌های ناگهانی وزارت خزانه‌داری آمریکا به شرکت‌های نفتکش درباره نقض احتمالی مکانیزم سقف قیمت نفت گروه هفت برای تجارت نفت روسیه، شامل هشدار نسبت به عدم رعایت این مقررات بوده است. این نامه‌ها که هفته گذشته توسط اداره کنترل دارایی‌های خارجی وزارت خزانه‌داری ارسال شدند، تغییر لحن نظارتی آمریکا را نشان می‌دهد زیرا واشنگتن و متحدانش، پیش از این رویکرد ملایم برای اجرای مکانیزم سقف قیمت داشتند.
- ✓ با در نظر گرفتن اهمیت گاز مایع در بازار داخلی جمهوری قزاقستان، وزارت نیروی این کشور دستوری را برای ممنوعیت صادرات گاز مایع از طریق جاده و ریلی برای مدت شش ماه صادر کرده است. این وزارتخانه با توجه به رشد سریع جمعیت و نیاز شرکت‌های صنعتی این کشور به این نوع سوخت، این دستور را صادر کرده است که از ۱۴ نوامبر ۲۰۲۳ لازم‌الاجرا است. بر اساس این گزارش در حالی که نیاز قزاقستان به ۱۳۰ تا ۱۴۰ هزار تن در ماه گاز مایع اعلام شده است اما وزارت انرژی قزاقستان قادر به تامین ۱۲۰ تا ۱۳۰ هزار تن یا ۹۰ درصد تقاضا است. الماسادم ساتکالیف، وزیر انرژی قزاقستان اخیراً گفت که این کشور با کمبود جدی گاز مواجه بوده است و این مشکل در آینده نزدیک حل نخواهد شد. با توجه به اینکه قزاقستان صادرکننده اصلی گاز مایع به تاجیکستان است، این امر کشور مقصد را نیز دچار مشکل خواهد کرد.
- ✓ جدیدترین آمار منتشر شده از سوی سازمان توسعه تجارت نشان می‌دهد در شش ماهه نخست امسال مجموع صادرات غیرنفتی شامل پتروشیمی و پایه نفتی، معدن و صنایع معدنی، صنعت و کشاورزی ۶۷ میلیون و ۷۴۴ هزار تن به ارزش ۲۴ میلیارد و ۱۴۴ میلیون دلار بوده است. در مجموع در این مدت نسبت به نیمه نخست سال قبل، وزن صادرات غیرنفتی ۲۹ درصد رشد داشته، اما ارزش آن با افت ۲.۶ درصدی مواجه شده است. بیشترین سهم این صادرات مربوط به پتروشیمی و میعانات گازی است که نزدیک به ۵۲ درصد (به لحاظ ارزشی) کل صادرات غیرنفتی را به خود اختصاص داده است.
- ✓ مدیرعامل شرکت ملی پالایش و پخش فرآورده‌های نفتی ایران از افزایش ظرفیت تولید روزانه ۲ میلیون لیتری بنزین و ۳.۵ میلیون لیتری گازوئیل کشور تا اردیبهشت‌ماه سال ۱۴۰۳ خبر داد. همچنین مدیرعامل شرکت ملی پخش فرآورده‌های نفتی از رشد مصرف بنزین خریدار و گفت: روزانه به طور میانگین ۱۱۵ میلیون لیتر بنزین در کشور سوخت می‌شود که این آمار نسبت به سال گذشته ۱۳ درصد افزایش یافته است. اما باید این را هم اضافه کرد که بنزین به اندازه کافی در انبارهای سوخت موجود است. سخنگوی کمیسیون تلفیق لایحه برنامه نیز گفت: مجلس شورای اسلامی در لایحه برنامه هفتم توسعه، دولت را مکلف به ایجاد تنوع در سبد سوختی کشور کرده و بحث افزایش قیمت بنزین مطرح نیست.
- ✓ رئیس هیئت مدیره انجمن صنعتی CNG گفت: با ورود LPG به سبد سوخت خودروها، صنعت CNG آسیب جدی می‌بیند و این به معنای آن است که به تنها جایگزین و راهکار عملی رفع ناترازی بنزین آسیب می‌زنیم. وی افزود: ورود سوخت‌های جایگزین در سبد سوخت خودروها یکی از راهکارهای موثر رفع ناترازی بنزین است اما باید توجه داشت چه نوع سوختی باید وارد چرخه حمل و نقل کشور شود. در دهه ۷۰ شمسی، سوخت LPG وارد سبد سوخت خودروها شد اما به دلیل ناایمن بودن این نوع سوخت در چرخه حمل و نقل و عدم وجود ظرفیت کافی برای تأمین پایدار آن موجب شد تا این سوخت کنار گذاشته شود. در سند تأمین انرژی در بخش حمل‌ونقل کشور تا افق ۱۴۲۰، LPG از سبد سوخت خودروها در کشور حذف و عرضه LPG را صرفاً برای مصارف عمدتاً پخت‌وپز و گرمایش خانوارهایی که به شبکه گاز طبیعی دسترسی ندارند مورد تأکید قرار گرفته اما مجلس با نادیده گرفتن این سند بالادستی، اصرار بر ورود LPG به سبد سوخت خودروها دارد.

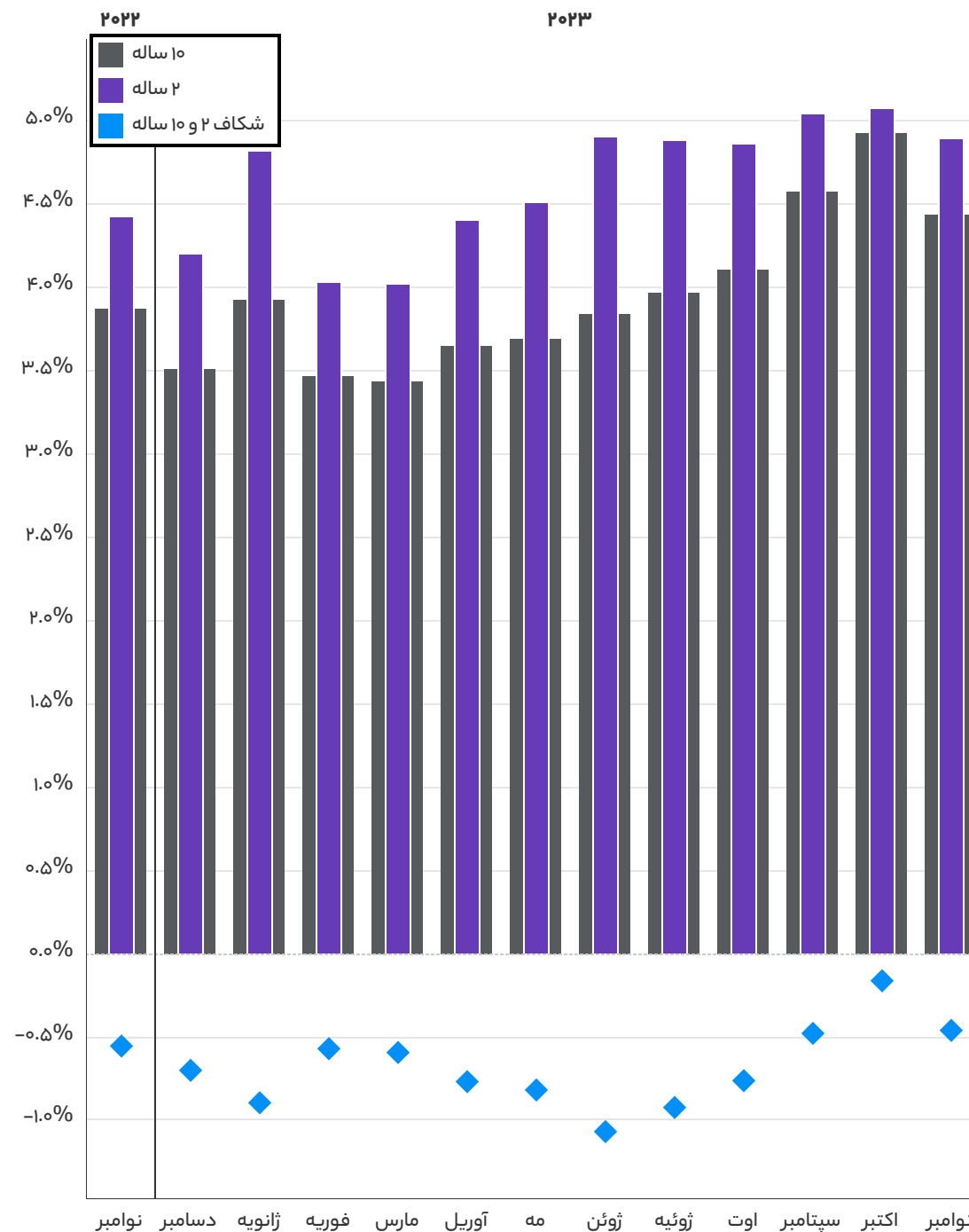
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



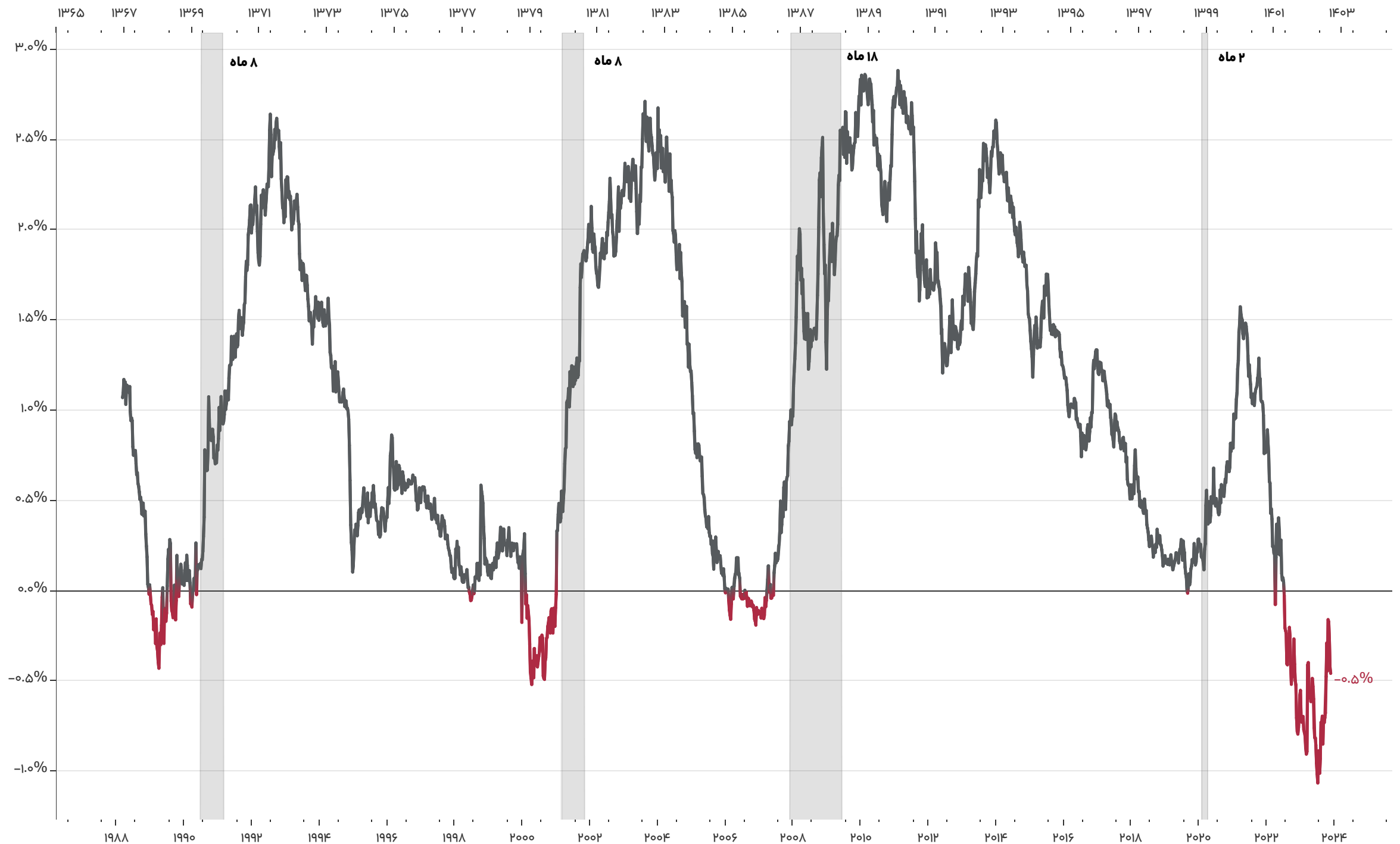
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

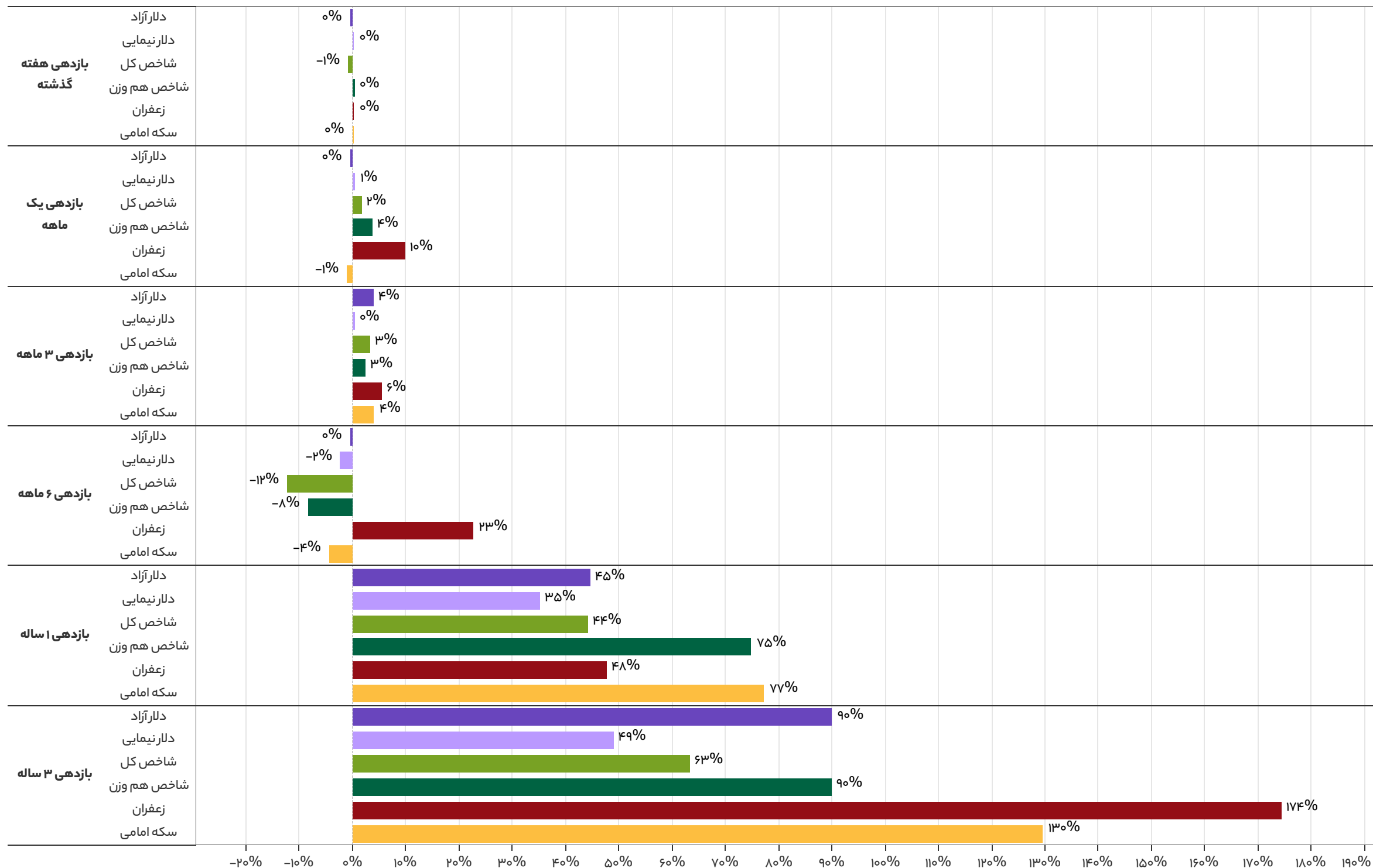
EQUITY MARKET

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 در هر ماه، 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 ▲۷۸.۱%
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%	مسکن ▲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%	مسکن ▲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 ▲۵۳.۴%	دلار نیمایی ۱۹%
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 در هر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

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

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

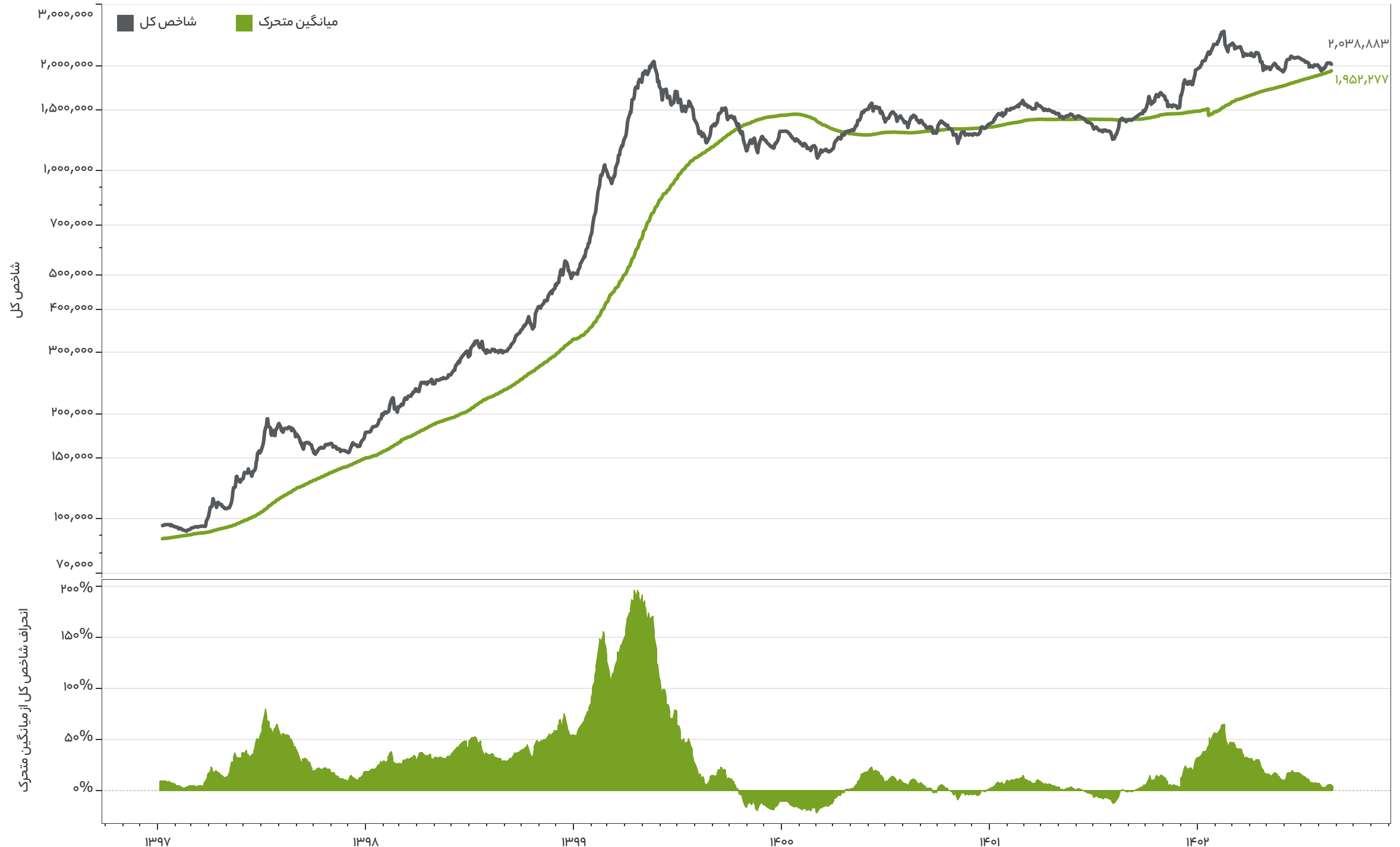
ارزش دلاری بازار

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



شاخص کل و میانگین متحرک

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



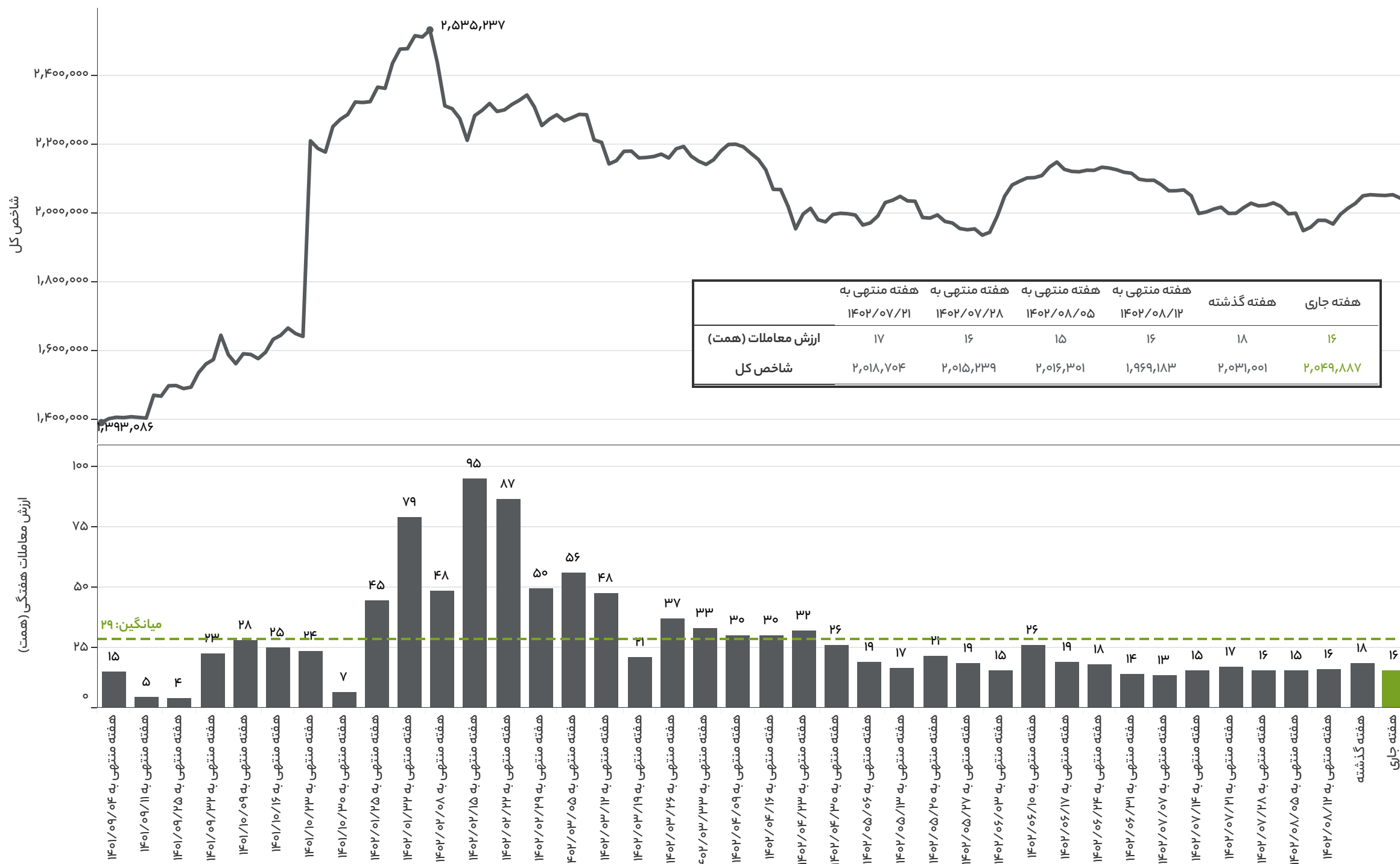
تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



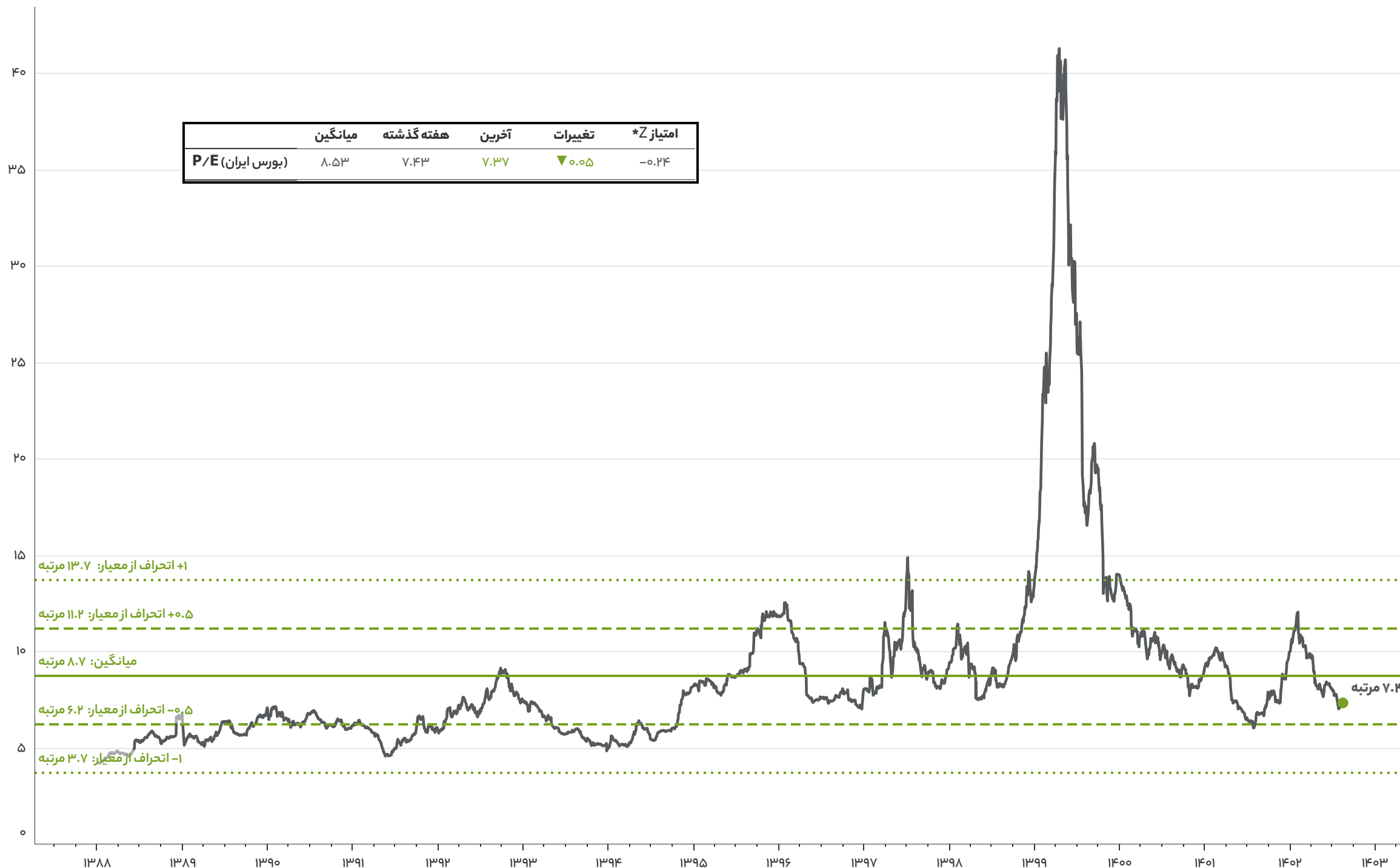
ارزش معاملات هفتگی بازار

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



نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

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



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

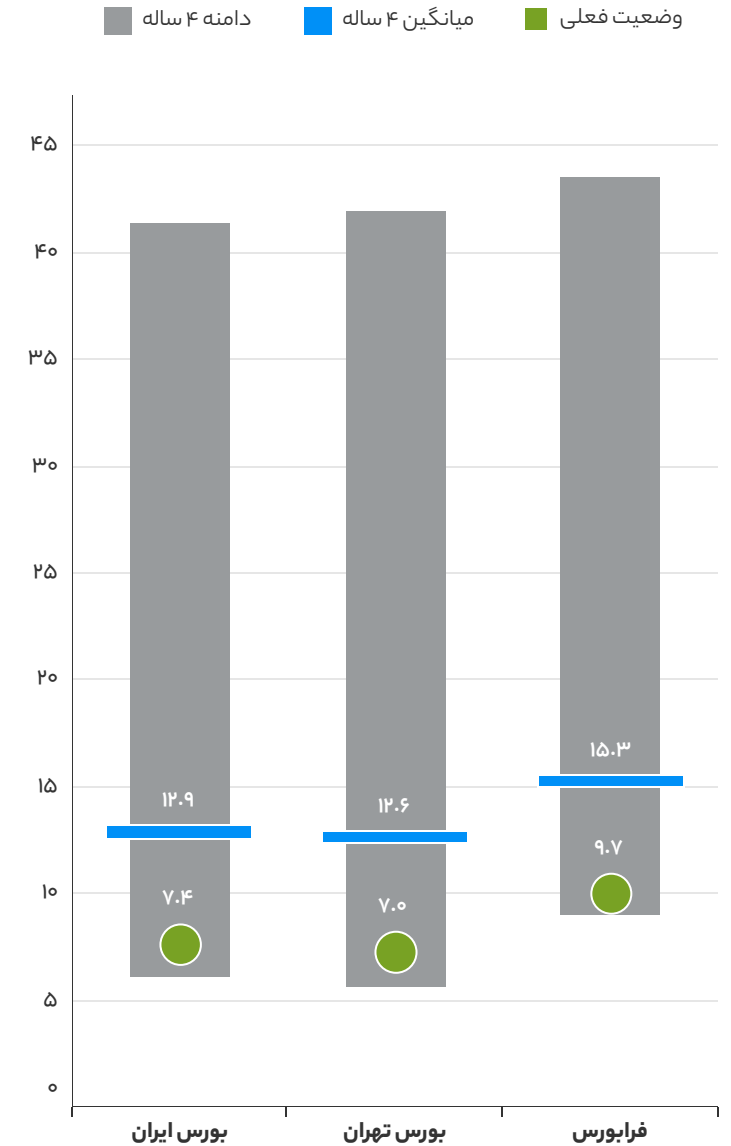
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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



وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	بیشینه ۴ ساله
-۰.۰۵	۷.۳۷	۷.۴۳	۶.۰۷	۱۲.۸۷	۴۱.۳۳
-۰.۰۶	۷.۰۳	۷.۰۹	۵.۶۴	۱۲.۶۳	۴۱.۹۹
+۰.۰۰	۹.۶۷	۹.۶۷	۹.۰۳	۱۵.۲۶	۴۳.۵۱

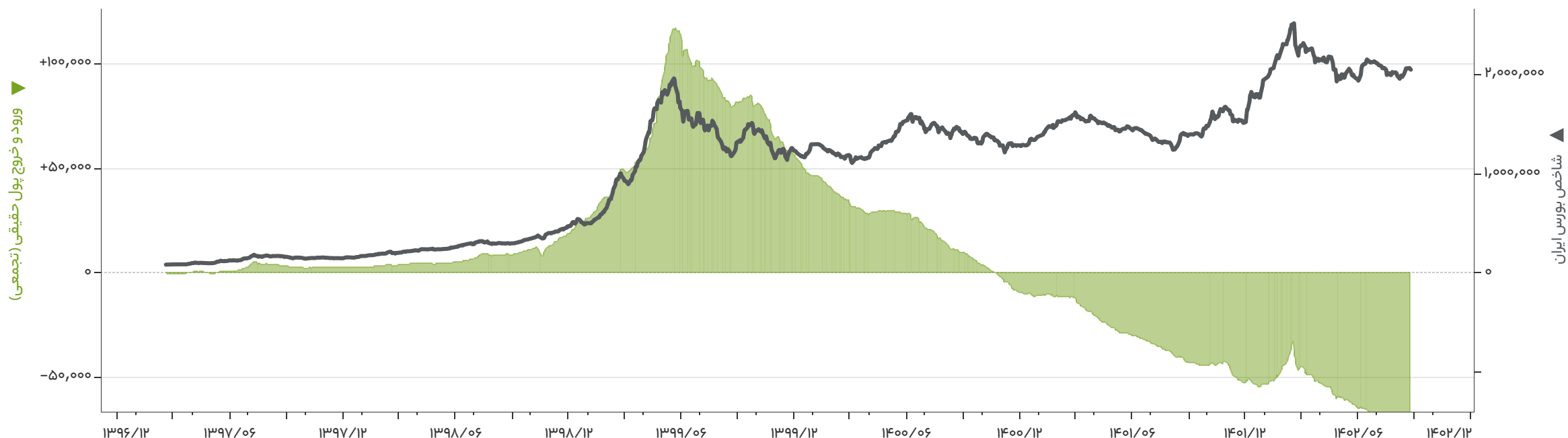
بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	ارتباطات	تکنولوژی	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	مواد پایه	خدمات مالی	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۵	۱۹	۴۱	۶۲	۸۹	۶۵	۶	۱۸۹	۱۹۹	
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۵۱	۸۵	۱۰۵	۱۱۱	۱۵۰	۱۸۳	۲۱۰	۳۶۱	۶۱۴	۳,۱۵۱	۳,۱۶۴	وزن
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۰%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۸%	۲.۲%	۲.۶%	۴.۴%	۷.۵%	۳۸.۵%	۳۸.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۱.۷	۶.۶	۱۱.۳	۱۹.۸	۸.۳	۱۰.۰	۱۰.۸	۵.۲	۴.۹	۷.۵	۷.۰	
بازده سود نقدی	۳.۰%	۱۷.۸%	۳.۷%	۲.۷%	۷.۱%	۴.۴%	۴.۴%	۲.۴%	۱۴.۷%	۹.۴%	۱۰.۰%	سودآوری
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)	+۵۷۶%	+۷۸۶%	+۱۱۵%	+۲۶۹%	+۳۶۳%	+۴۰۳%	+۴۲۳%	+۸۲۱%	+۷۸۶%	+۸۷۷%	+۸۳۶%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	-۶%	+۱۱۶%	-۶۶%	-۵%	+۱۰%	-۱۳%	-۲%	-۱۷%	+۱۵%	+۵۳%	-۲%	
بازده از ابتدای سال	+۲۰۲%	+۴۳%	+۳۷%	+۵۹%	+۸۵%	+۹۳%	+۵۴%	+۸۳%	+۸۸%	+۷۰%	+۶۳%	
بازده هفته گذشته	۵%	۰%	-۳%	۰%	۰%	۰%	۰%	۱%	-۲%	-۱%	۰%	بازده کوتاه‌مدت



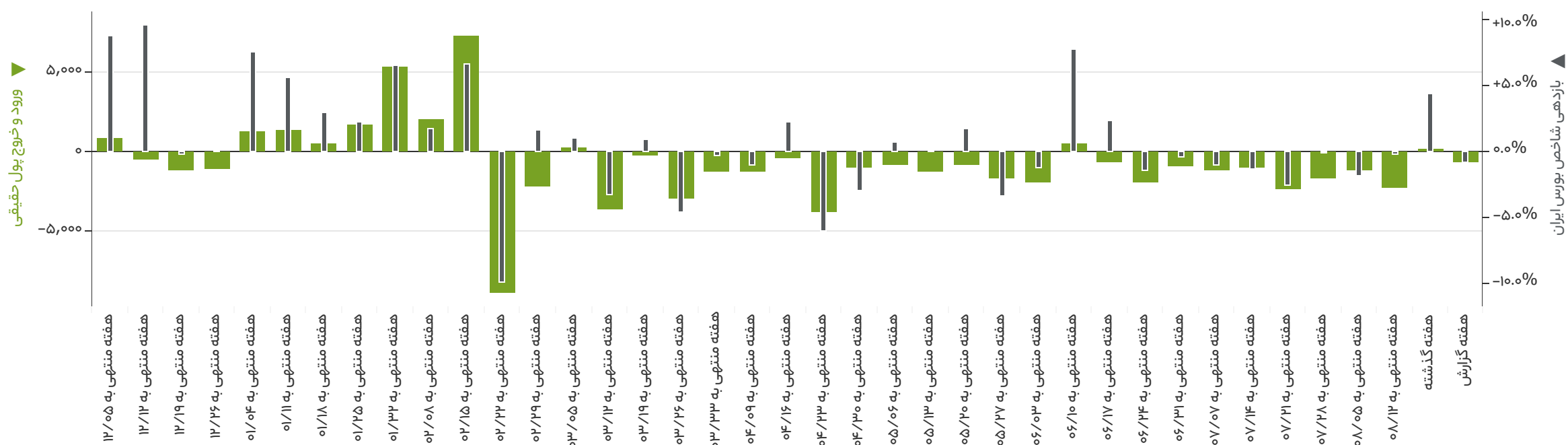
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



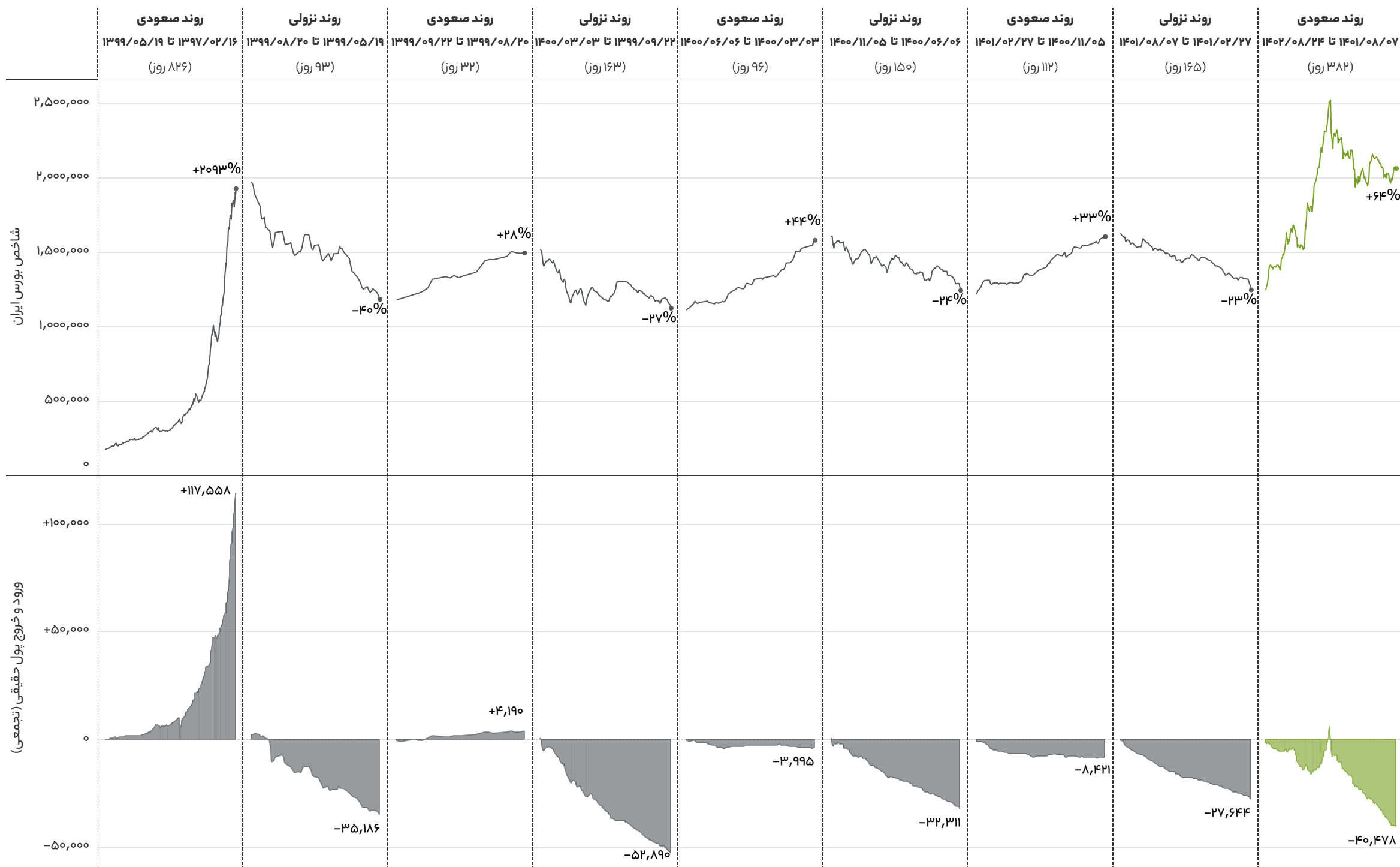
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

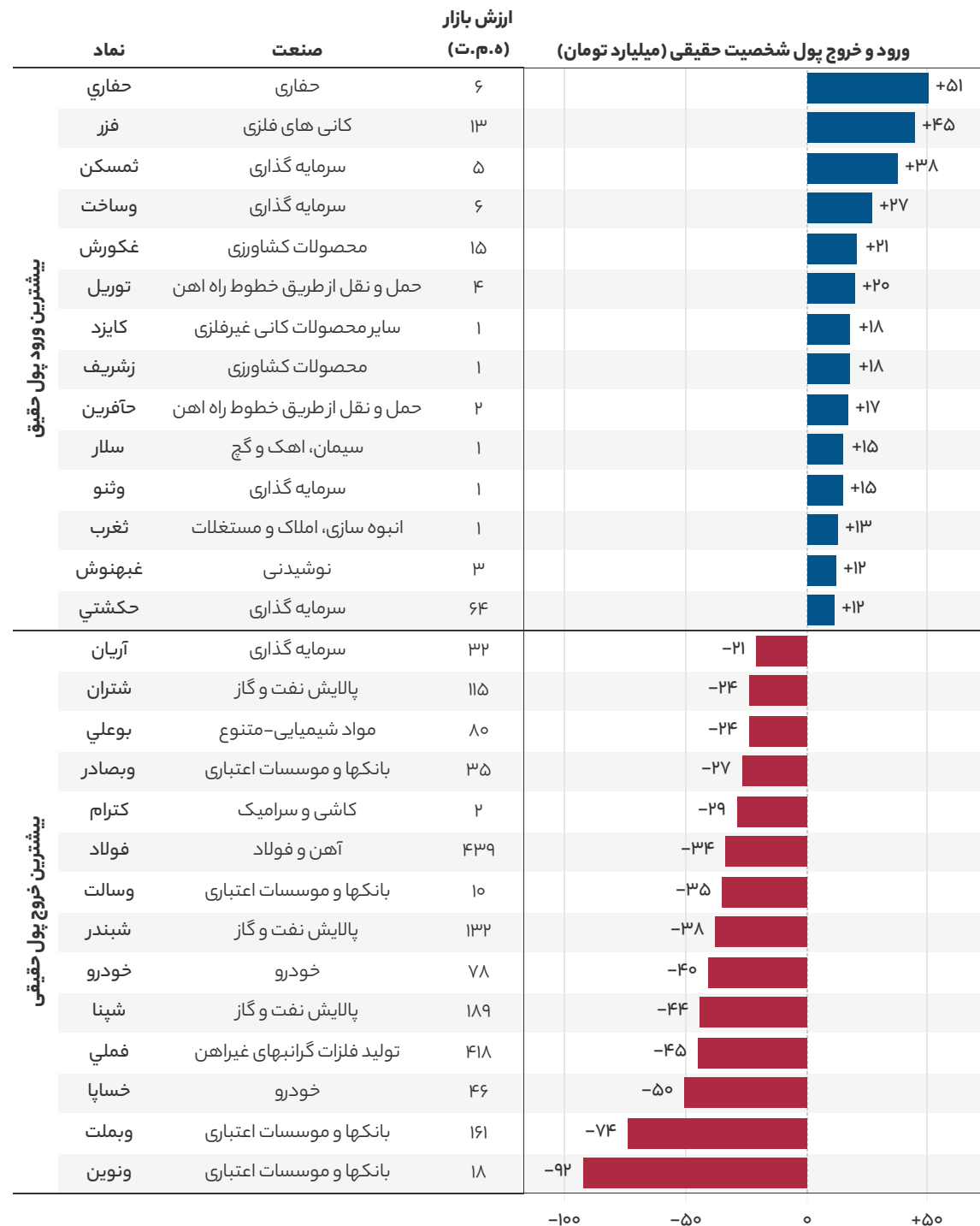
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

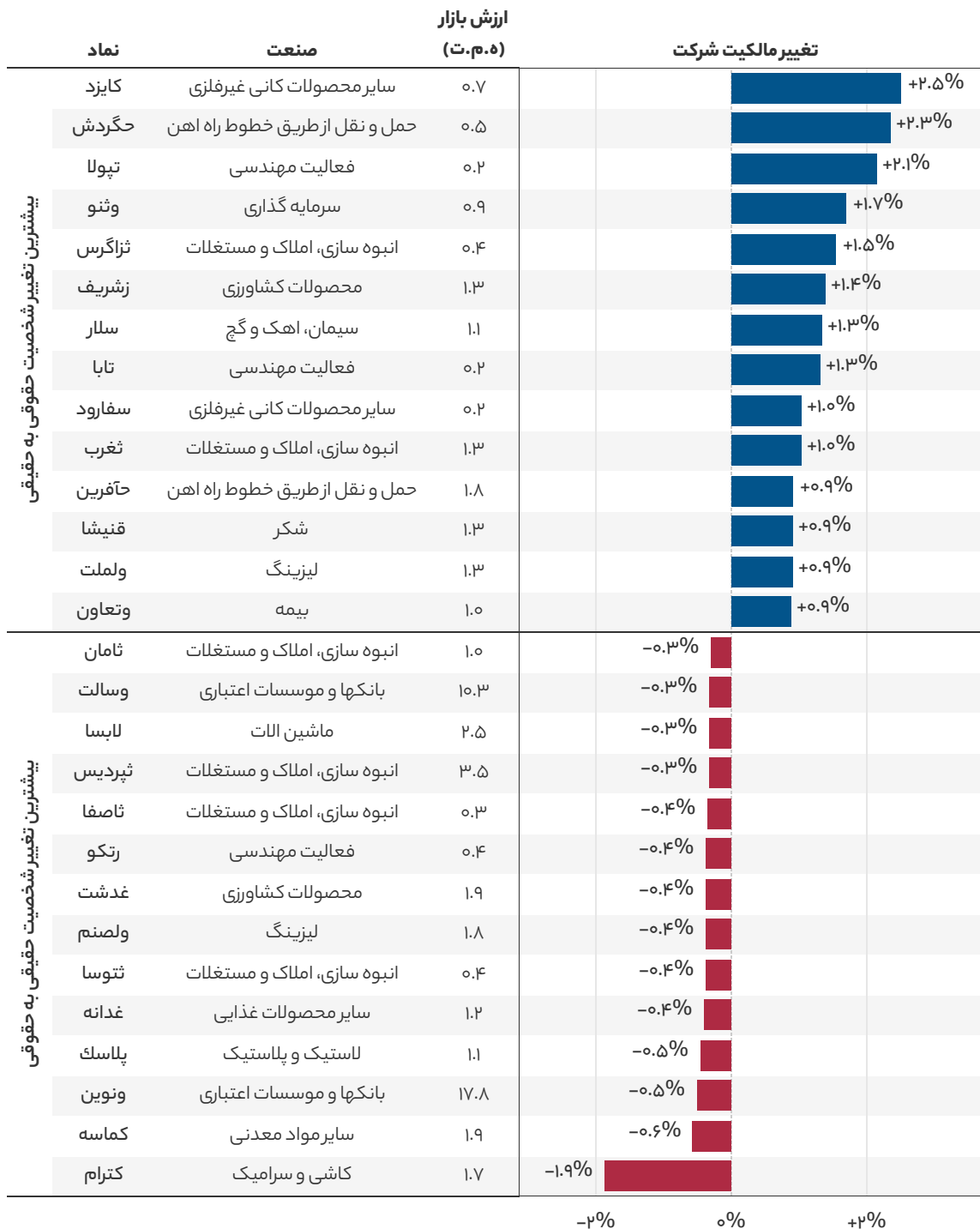
ورود و خروج پول حقیقی

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



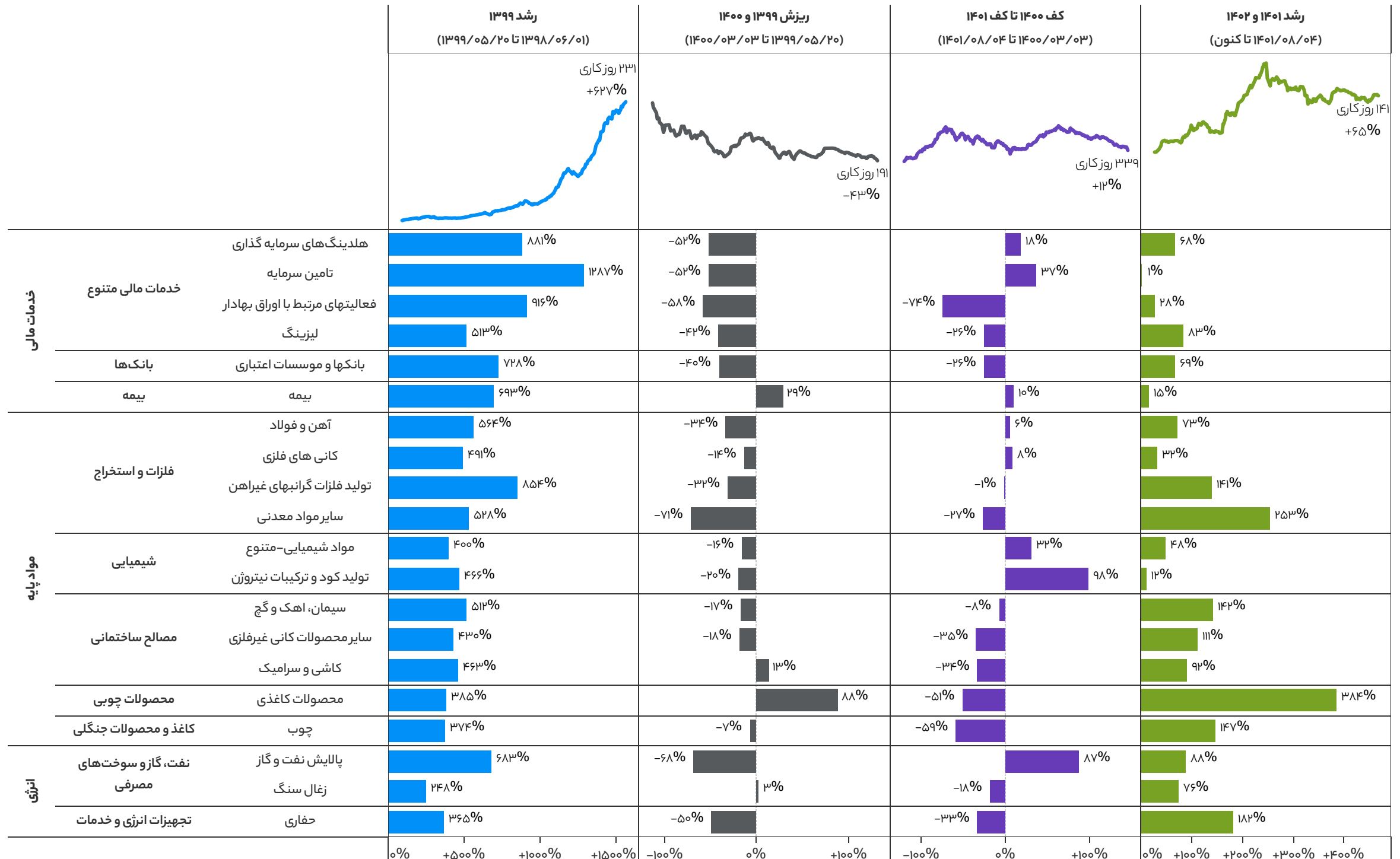
تغییر مالکیت شرکت

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



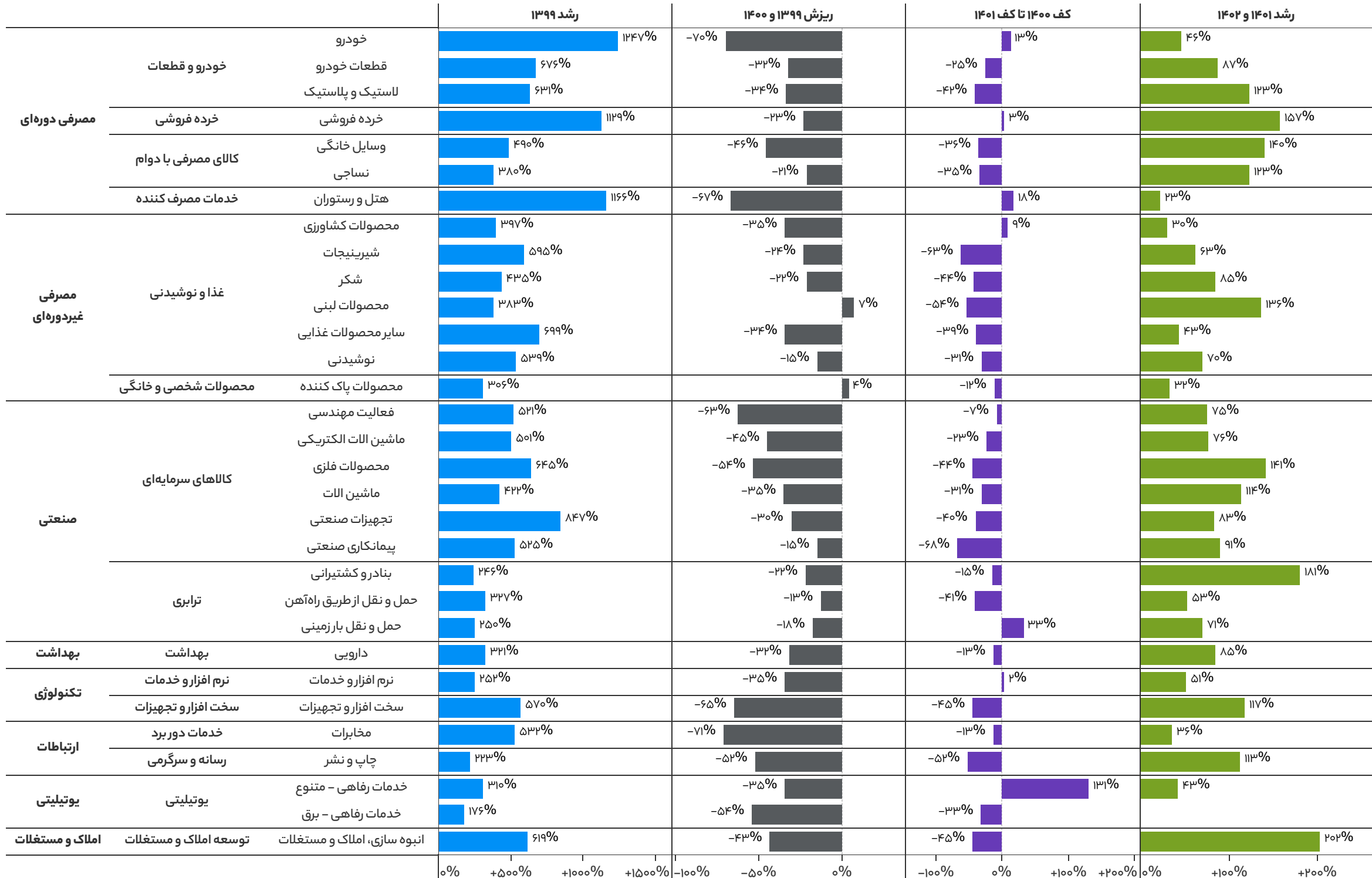
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

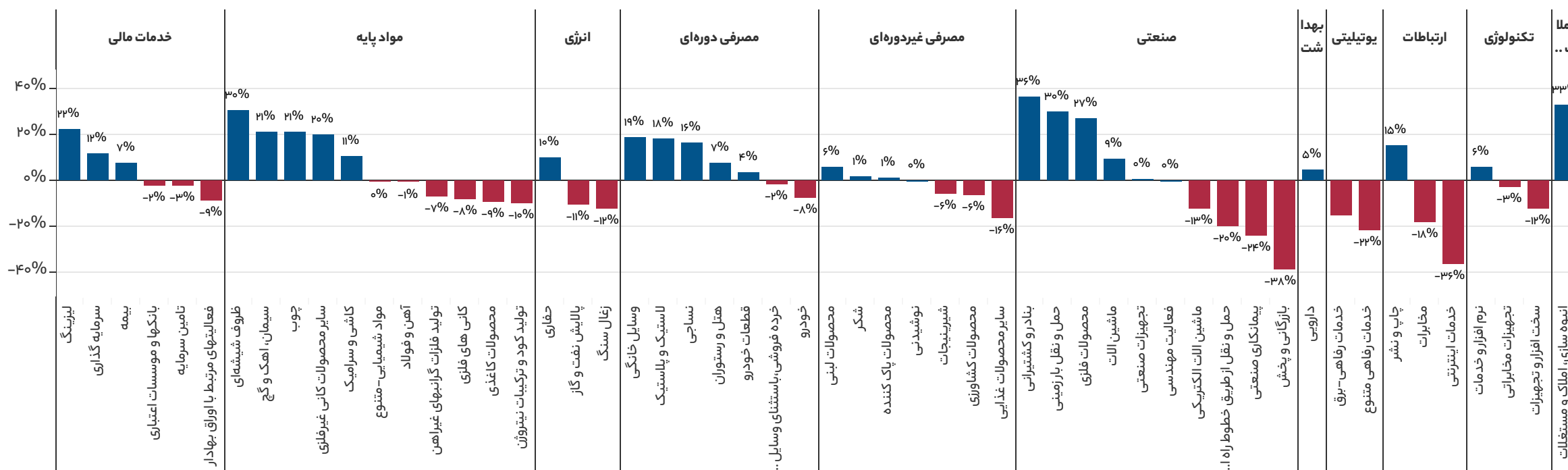




بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



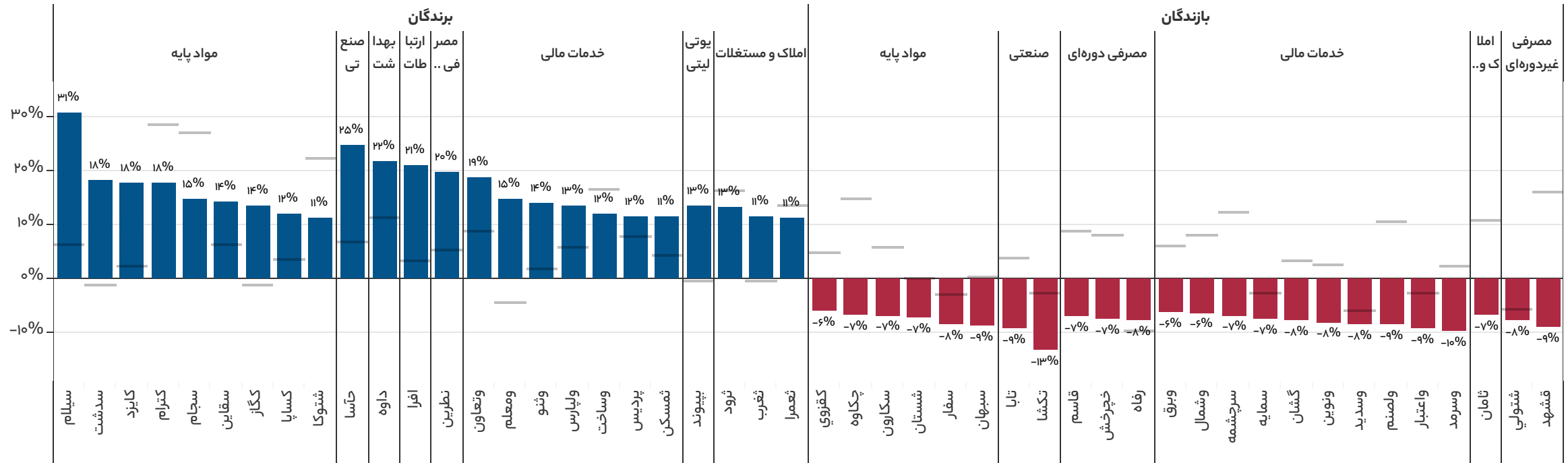
(مرتب شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، بازده هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازده هفته گذشته با خط‌های خاکستری رنگ نشان داده شده است)



برندگان و بازندگان هفته

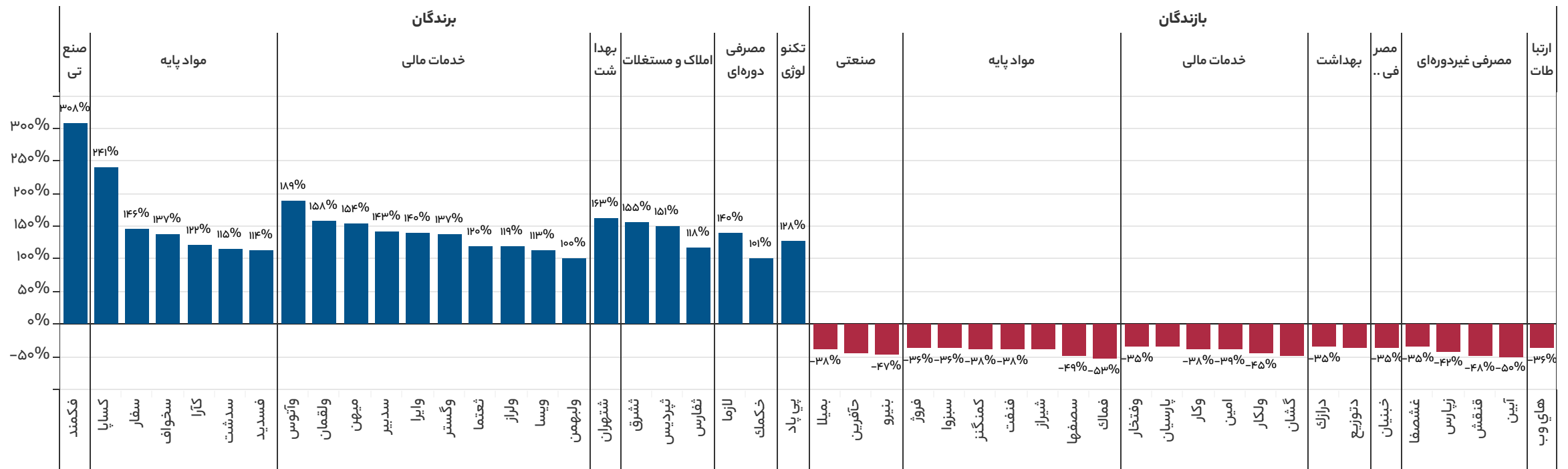
برندگان و بازندگان هفته

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



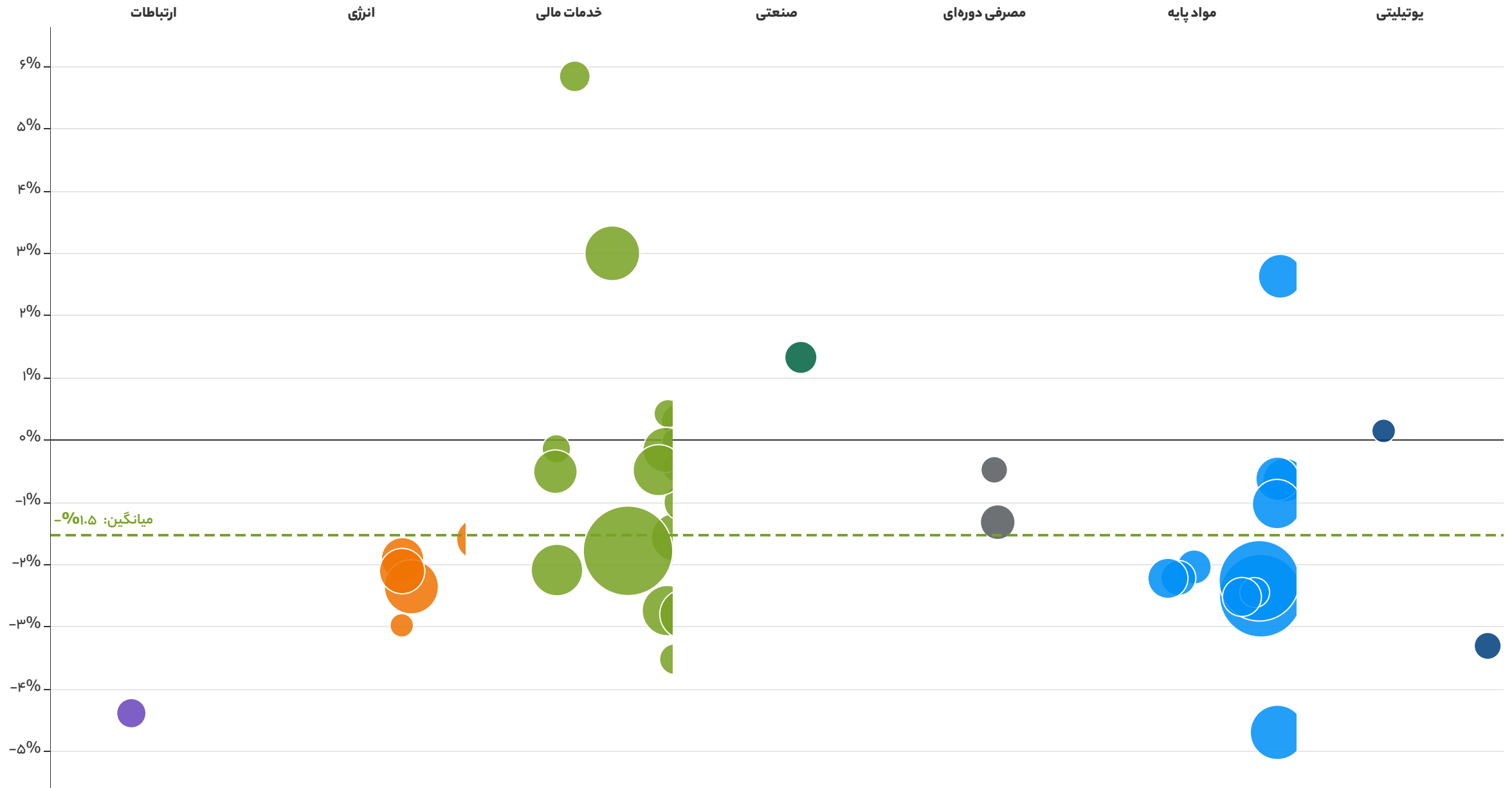
برندگان و بازندگان سال

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



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

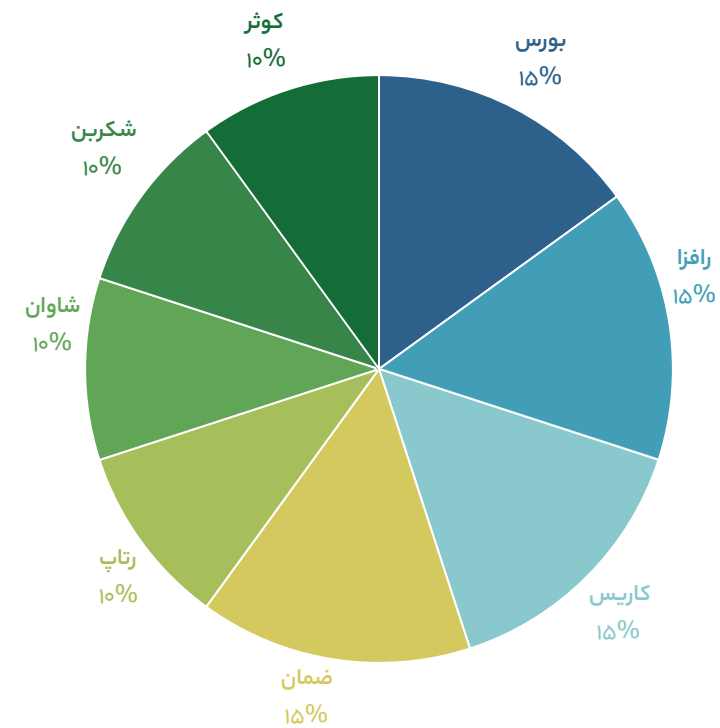
به تفکیک سکتور، بازدهی تعدیل شده، اندازه دایره براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم



کگل	اخابر	وسندوق	مبین	شبریز	پارسان	وبملت	شپدیس	فولاد	فخوز	شپنا	فملی	آریا	بوعلی	شبندر	تاپیکو	جم	شتان	فارس	پارس	وغدیر	خودرو	کچاد	ویپاسار	نوری	ککهر	پپاس	میدکو	خسپا	وکفدیر	وامید	تاضیکو	وسپهر	بفدر	ومعادن	وتجارت	رمینا	مارون	شتتا	حکشتی	بازدهی هفته گذشته
-۴.۷%	-۴.۴%	-۳.۵%	-۳.۳%	-۳.۰%	-۲.۸%	-۲.۷%	-۲.۵%	-۲.۵%	-۲.۴%	-۲.۳%	-۲.۲%	-۲.۲%	-۲.۲%	-۲.۱%	-۲.۱%	-۲.۰%	-۱.۹%	-۱.۸%	-۱.۶%	-۱.۶%	-۱.۳%	-۱.۰%	-۱.۰%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۰.۴%	-۰.۱%	-۰.۱%	۰%	+۰.۲%	+۰.۳%	+۰.۴%	+۱.۳%	+۲.۶%	+۳.۰%	+۵.۹%	بازدهی هفته گذشته

سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۲۳۰	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۲۰,۵۵۰	پتانسیل افزایش سودآوری	۲۶,۰۰۰	شاوان	
۱۰%	۵,۴۵۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و سود مناسب	۷,۰۰۰	شکرین	
۱۰%	۳,۴۲۲	رشد سودآتی شرکت ناشی از سرمایه گذاری‌ها و عملیات بیمه‌ای	۴,۱۰۰	کوثر	
۱۵%	۱۵,۴۹۶	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	
۱۵%	۵,۷۳۰	افزایش ارزش معاملات و رشد حاشیه سود	۷,۰۰۰	بورس	بلند مدت
۱۵%	۱۴,۶۸۰	تغییر فرمول درآمدی و سود مناسب	۱۹,۰۰۰	رافزا	
۱۵%	۲۱,۴۸۹	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	کاریس	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





مهم‌ترین محدوده‌های حمایتی و مقاومتی در تصویر مشخص شده است.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین محدوده مقاومتی شاخص هم‌وزن در تصویر مشخص شده‌است. 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



BV Bourseview.com

باید دید واکنش به محدوده مقاومتی مشخص شده به چه صورت است.

توضیحات تحلیل



باید دید واکنش به محدوده حمایتی مشخص شده به چه صورت است.

توضیحات تحلیل



انظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل

Brent Oil Futures · 4h · MOEX

1

USD

BLL

106.00

104.00

102.00

100.00

98.00

96.00

94.00

92.00

90.00

88.00

86.00

84.00

82.00

80.00

78.00

76.00

74.00

72.00

70.00

68.00

BRZ2023 81.19

TradingView

19

Oct

16

24

Nov

13

21

Dec

11

مطابق انتظار، اصلاح تا حوالی ۷۸ دلار اتفاق افتاد. باید دید واکنش به محدوده مقاومتی ۸۱ دلار به چه صورت است. در صورت گذر از این محدوده انتظار می‌رود رشد تا حوالی ۸۸ 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 نگار گزارش شده که اولین معیار آن با سود سال مالی جاری شرکت محاسبه گردیده است، دومین معیار با استفاده از سود سال مالی آینده و سومین معیار نیز با استفاده از سود برآوردی ۴ فصل پیش رو شرکت محاسبه شده است. شایان ذکر است که تمامی نسبت های P/E با سود تقسیمی برآوردی مجمع پیش رو شرکت تعدیل شده اند.

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

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

بدیهی است که معیار ذکر شده یک روش آماری بوده و بسیاری از عوامل تاثیر گذار بر نسبت P/E را در نظر نمی گیرد. همچنین لازم به ذکر است که استفاده از نسبت P/E به تنهایی برای تعیین ارزشگذاری سهام نمی تواند روشی قابل اتکایی باشد و بسته به شرایط، سایر روش ها نیز باید مدنظر سرمایه گذاران و تحلیل گران قرار گیرد.

سلب مسئولیت

تمامی اطلاعات صورت مالی مورد نیاز این بخش نیز از طریق بورس و یو تأمین شده و شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما مسئولیتی در خصوص صحت اطلاعات مزبور بر عهده نخواهد داشت.

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



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			سود واقعی			برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر				امتیاز Z		ارزان تر ←	نمودار امتیاز Z				گران تر →	
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)	گزارش شده	سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ (فصله)								
مواد پایه شیمیایی	الفین	مارون	۱۲	۱۲۷.۴	+۳%	۱۵,۹۲۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۲	۷.۶	۷.۷	-۱.۷		♦						
		آریا	۱۲	۱۰۳.۵	-۲%	۷,۵۳۰	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۲	۵.۹	۶.۵	-۰.۹			♦					
		جم	۱۲	۷۴.۹	-۲%	۴,۱۵۹	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۵	۴.۰	۴.۴	-۴.۲	♦							
		شگویا	۱۲	۳۶.۹	-۲%	۱,۵۴۰	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۵.۶	۴.۴	۵.۷	-۰.۳				♦				
		جم پیلن	۱۲	۳۶.۴	-۱%	۱۸,۱۷۹	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۴	۴.۷	۵.۸	+۱.۲					♦			
		شکبیر	۱۲	۲۵.۹	-۱%	۷,۲۰۰	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۵	۳.۰	۳.۴	-۷.۷	♦							
		شاراک	۱۲	۲۳.۱	-۱%	۲,۸۵۹	۹۶%	۴۱۹	۱۴۵	۱ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۴.۸	۳.۸	۴.۲	-۱.۳			♦					
		شغذیر	۱۲	۸.۴	-۱%	۶,۴۵۲	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۵	۴.۴	۶.۰	+۰.۱				♦				
		شبصیر	۱۲	۷.۳	+۲%	۲,۹۰۰	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۳	۳.۷	۴.۴	-۰.۴				♦				
		شجم	۶	۵.۳	-	۸۱۷	۸۵%	۸۸	۴۷	۳ Q	۶۱	۱۳۴	+۱۱۸%	۱۳.۳	۶.۸	۶.۴	-۳.۹	♦							
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۲۴.۷	-۱%	۱۳,۸۵۹	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۰	۶.۷	۷.۶	+۱.۱					♦			
		بوعلی	۱۲	۷۹.۷	-۲%	۵,۵۵۱	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۸.۶	۶.۴	۸.۸	+۳.۹						♦		
		اوره	شپدیس	۶	۹۷.۸	-۳%	۱۶,۲۹۴	۶۳%	۴,۲۶۴	۲,۶۴۷	۳ Q	۳,۲۶۲	۲,۷۱۳	-۱۷%	۵.۰	۶.۴	۵.۵	+۲.۳							♦
			شیراز	۱۲	۳۳.۳	-۵%	۲,۱۷۷	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۰	۵.۰	۵.۸	+۱.۳					♦		
			خراسان	۱۲	۲۶.۰	-۲%	۱۴,۵۲۳	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۹.۳	۷.۳	۸.۳	+۳.۲						♦	
			کرماشا	۱۲	۱۸.۶	-۳%	۱,۷۵۷	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۷	۴.۴	۴.۵	+۰.۵					♦		
	متانول	زاگرس	۱۲	۲۹.۵	-۳%	۱۲,۳۰۰	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۲	۶.۳	۶.۴	-۲.۷	♦							
		شخارک	۱۲	۲۷.۸	-۱%	۴,۶۲۶	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۸	۴.۹	۵.۸	-۱.۴			♦					
		شفن	۱۲	۱۷.۰	-۱%	۵۴۸	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۷.۸	۵.۸	۵.۴	-۱.۸			♦					
	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۲۶.۴	-۴%	۴۸۶	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۷.۹	۷.۲	۶.۲	+۰.۱					♦			
دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۳.۵	-۱%	۵۴۴	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۶.۳	۴.۹	۵.۳	-۰.۵				♦					
	شصدف	۱۲	۲.۵	-۲%	۳,۶۳۰	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۹.۳	۵.۹	۷.۳	-۱.۴			♦						
	شدوص	۱۲	۲.۱	-	۲,۲۴۷	۹۳%	۱۹۳	۲۲۳	۲ Q	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۶.۱	۴.۷	۵.۹	+۰.۱					♦				

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی				سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر				امتیاز Z		ارزان تر ←	نمودار امتیاز Z	گران تر →		
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		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	۴۳۹.۲	-۲%	۵۴۹	۵۰%	۸۵	۶۶	۲ Q	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۴.۴	۳.۷	۴.۰	+۱.۰						
		فخوز	۱۲	۵۷.۸	-۲%	۳۰۴	۴۶%	۳۵	۲۷	۲ Q	۶۵	۱۰۹	+۶۸%	۴.۷	۲.۶	۳.۱	-۴.۵						
		فولاز	۱۲	۳۵.۶	-۲%	۱,۴۸۵	۷۶%	۱۹۹	۹۱	۲ Q	۱۷۴	۲۵۰	+۴۴%	۸.۶	۵.۷	۶.۸	+۱.۲						
		هرمز	۱۲	۳۱.۹	-	۶۵۱	۵۱%	۱۱۲	۵۶	۲ Q	۱۱۷	۱۴۱	+۲۱%	۵.۶	۴.۴	۴.۷	-۱.۰						
		ارفع	۱۲	۲۹.۶	-۱%	۲,۴۷۰	۸۶%	۳۱۲	۳۰۹	۲ Q	۵۵۶	۶۴۸	+۱۷%	۴.۴	۳.۳	۴.۱	-۰.۴						
		فخاس	۱۲	۲۶.۸	-۴%	۱,۱۶۵	۴۹%	۱۰۰	۱۳۲	۲ Q	۲۴۲	۲۹۱	+۲۱%	۴.۸	۴.۰	۴.۳	-۱.۸						
	سنگ آهن	کگل	۱۲	۱۸۸.۱	-۵%	۵۷۰	۶۵%	۴۹	۱۲	۲ Q	۵۸	۹۴	+۶۱%	۹.۸	۶.۰	۵.۸	-۲.۷						
		کچاد	۱۲	۱۵۸.۸	-۱%	۵۸۵	۷۱%	۸۴	۳۹	۲ Q	۸۳	۹۹	+۱۹%	۷.۰	۵.۶	۵.۹	+۰.۱						
		کگهر	۹	۱۲۲.۴	-۱%	۴,۸۹۵	۹۲%	۴۶۹	۴۴۴	۳ Q	۵۸۱	۴۸۸	-۱۶%	۸.۴	۱۰.۸	۸.۷	-۰.۱						
		کنور	۱۲	۲۳.۴	-۲%	۱,۸۳۵	۹۴%	۱۴۷	۱۴۴	۲ Q	۲۲۴	۲۸۴	+۲۷%	۸.۲	۵.۹	۷.۹	-۰.۱						
	مس	فملی	۱۲	۴۱۷.۶	-۲%	۶۹۶	۴۵%	۸۳	۵۴	۲ Q	۱۳۴	۱۴۹	+۱۲%	۵.۲	۴.۴	۴.۳	-۰.۲						
	محصولات فلزی	کوبر	۱۲	۱۱.۶	-۱%	۳۱۱	۱۲%	۴۶	۲۰	۲ Q	۴۵	۵۹	+۳۲%	۶.۹	۵.۵	۵.۴	-۱.۱						
		فجر	۱۲	۶.۹	-۱%	۸۱۶	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۴.۱	۳.۷	۴.۳	+۰.۰						
		فروژ	۱۲	۴.۶	-۱%	۴,۱۶۵	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۶.۵	۴.۷	۵.۱							
		فسپا	۱۲	۳.۰	-۲%	۷۵۹	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۲۶	-۱۶%	۵.۰	۵.۷	۴.۹	+۰.۲						
		فروس	۱۲	۲.۹	-۲%	۳۶۲	۶۶%	۴۸	۲۴	۲ Q	۴۹	۶۶	+۳۵%	۷.۴	۵.۳	۵.۹	+۰.۸						
		فروسیل	۱۲	۲.۱	+۴%	۱,۳۰۵	۶۴%	۱۱۵	۵۷	۲ Q	۱۶۷	۲۳۶	+۴۲%	۷.۸	۵.۴	۵.۴	-۱۱.۶						
		فولای	۱۲	۰.۹	+۱%	۷۶۶	۲۱%	۵۹	۴۵	۲ Q	۶۹	۷۶	+۱۰%	۱۱.۱	۱۰.۴	۱۱.۷	+۱.۳						
	آلومینیوم	فایرا	۱۲	۲۸.۷	-۱%	۷۵۶	۳۹%	۷۳	۵۶	۲ Q	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۸.۸	۶.۲	۷.۸	+۲.۲						
	طلا	فرز	۹	۱۳.۴	-۴%	۴,۴۷۵	۳۱۸%	۹۹۶	۶۷	۳ Q	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۶.۱	۶.۳	۳.۲	-۱.۶						
	سرب و روی	فئوال	۱۲	۳.۵	+۶%	۱,۰۲۸	۵۱%	۱۰۶	۶۱	۲ Q	۱۰۲	۱۴۱	+۳۸%	۱۰.۱	۷.۴	۸.۸	+۲.۹						
		کیمیا	۱۲	۱.۶	-	۸۰۱	۴۰%	۱۹۰	۱۷	۲ Q	۹۵	۱۲۱	+۲۸%	۸.۵	۶.۶	۵.۵	+۰.۲						
		فرزین	۱۲	۱.۴	-۲%	۴۶۶	۳۶%	۹۳	۲	۲ Q	۱۱۲	۱۷۰	+۵۱%	۴.۱	۲.۶	۲.۳	-۵.۸						
		فتوسا	۱۲	۱.۱	+۱۱%	۷۵۳	۳۲%	۱۴۹	۳۵	۲ Q	۱۹۵	۲۱۴	+۹%	۳.۹	۳.۳	۲.۷	-۱.۹						
	سایر کانی‌های فلزی	کمنگنز	۱۲	۲.۰	-۶%	۱,۳۶۸	۶۴%	۱۱۴	۷۴	۲ Q	۱۸۴	۲۱۸	+۱۹%	۷.۵	۶.۱	۵.۹	-۱.۸						
	سایر مواد معدنی	کتوسعه	۹	۲.۰	-۲%	۱,۸۷۸	۹۷%	۱۱۱	۱۱۴	۳ Q	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۰.۸	۹.۷	۷.۷							

۳ + ۲ + ۱ ۰ -۱ -۲ -۳



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		ارزان تر ←	نمودار امتیاز Z	گران تر →
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)		۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله			
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، اهک و گچ	ساوه	۱۲	۹.۲	-۵%	۱۴,۰۸۰	۹۵%	۱,۵۸۴	۱,۲۸۲	۲ Q	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۵.۹	۴.۳	۵.۲	+۰.۷			
		سآبیک	۱۲	۷.۴	+۱%	۲,۴۹۹	۹۳%	۲۴۹	۲۴۶	۲ Q	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۶.۴	۴.۵	۶.۰	+۲.۲			
		سفار	۱۲	۶.۹	-۸%	۲۹,۷۶۳	۹۵%	۱,۰۳۹	۸۴۰	۲ Q	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۱.۲	۱۵.۹	۱۸.۷	+۱.۲			
		سخوز	۱۲	۵.۹	-	۴,۲۲۸	۹۰%	۷۱۹	۲۸۴	۲ Q	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۲	۲.۹	۳.۰	-۱.۴			
		سمازن	۹	۵.۷	-۲%	۲,۲۹۸	۸۱%	۲۹۰	۲۹۸	۳ Q	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۵.۸	۴.۷	۴.۴	+۰.۸			
		سپاها	۶	۵.۳	-	۲,۱۸۲	۷۵%	۱۹۷	۲۱۰	۳ Q	۵۰۲	۳۰۸	-۳۹%	۴.۳	۷.۰	۳.۷	-۰.۴			
		ساروم	۱۲	۴.۱	-۱%	۴,۱۴۲	۹۶%	۵۵۴	۴۵۱	۲ Q	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۲	۳.۴	۴.۴	-۰.۸			
		سهگمت	۱۰	۴.۰	-۱%	۵,۵۲۱	۹۸%	۶۴۸	۴۷۲	۲ Q	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۵.۵	۲.۹	۳.۷	-۰.۴			
		سشرق	۶	۴.۰	+۱%	۱,۵۱۵	۷۲%	۱۵۴	۷۵	۳ Q	۲۴۵	۳۵۹	+۴۷%	۶.۲	۴.۴	۳.۱	-۴.۱			
		سفانو	۱۲	۴.۰	-	۷,۹۹۷	۹۷%	۱,۱۷۰	۶۹۵	۲ Q	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۷	۳.۲	۳.۷	+۰.۳			
		سرود	۱۲	۳.۶	+۴%	۴,۴۸۵	۹۶%	۴۹۶	۴۷۲	۲ Q	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۲	۳.۹	۴.۷	+۰.۲			
		سصوفی	۱۲	۳.۲	-	۲,۹۴۲	۹۰%	۳۶۸	۳۳۷	۲ Q	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۵.۴	۳.۷	۴.۹	+۰.۳			
		سبجنو	۱۲	۲.۷	-۱%	۶,۸۳۴	۹۶%	۵۷۳	۵۲۷	۲ Q	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۵	۵.۵	۶.۰	+۰.۳			
		سشمال	۹	۲.۶	-	۱,۵۵۱	۸۹%	۱۷۰	۲۱۸	۳ Q	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۵.۷	۴.۳	۴.۲	+۰.۰			
		سقاین	۱۲	۲.۲	+۱۴%	۵۴۹	۹۷%	۳۷	۲۴	۲ Q	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۱.۲	۹.۵	۹.۸	+۰.۳			
		سبهان	۱۲	۲.۲	-۹%	۱۰,۹۱۰	۹۷%	۷۳۶	۷۴۹	۲ Q	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۱	۴.۹	۵.۱	-۰.۴			
سغرب	۱۲	۲.۱	-۳%	۴,۱۲۱	۹۲%	۳۹۰	۴۱۰	۲ Q	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۴.۸	۳.۳	۳.۹	-۰.۸					
سقاش	۱۲	۱.۹	-	۹,۳۳۰	۹۵%	۱,۱۶۱	۵۷۴	۲ Q	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۶	۴.۳	۴.۸	-۰.۹					
سخزر	۱۲	۱.۸	-۳%	۳,۵۷۹	۹۵%	۳۵۸	۲۶۸	۲ Q	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۵	۵.۳	۶.۴	-۰.۱					
کاشی و سرامیک	کحافظ	۱۲	۳.۵	-۴%	۶۸۴	۱۰%	۸۲	۶۱	۲ Q	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۱	۳.۲	۳.۵	-۲.۸				
	کساوه	۱۲	۲.۹	-۱%	۵,۴۶۲	۷۱%	۷۴۷	۲۹۰	۲ Q	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۵.۴	۳.۶	۳.۷	-۱.۸				
	کلوند	۱۲	۱.۸	-۱%	۴,۴۰۶	۹۵%	۵۰۴	۳۸۱	۲ Q	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۵.۹	۴.۵	۵.۱	-۰.۳				
فرآورده های نسوز	کپشیر	۱۲	۱.۹	+۴%	۱,۲۹۵	۸۸%	۸۷	۱۰۰	۲ Q	۱۹۰	۱۶۷	-۱۲%	۶.۸	۷.۲	۷.۱	+۰.۳				

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	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر				امتیاز Z		ارزان تر ←	نمودار امتیاز Z				گران تر →	
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)		۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله									
انرژی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۸۹.۱	-۲%	۸۳۳	۶۳%	۱۷۰	۱۰۱	۲ Q	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴.۷	۴.۷	۵.۰	+۱.۴						◆		
		شبندر	۱۲	۱۳۲.۱	-۲%	۹۸۳	۷۶%	۳۰۴	۷۷	۲ Q	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴.۰	۵.۶	۳.۸	+۱.۵						◆		
		شتران	۱۲	۱۱۵.۴	-۲%	۴۲۰	۳۱%	۱۰۹	۴۵	۲ Q	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۲	۴.۱	۳.۹	+۱.۰						◆		
		شبریز	۱۲	۳۵.۴	-۳%	۱,۱۷۹	۷۶%	۳۳۵	۹۳	۲ Q	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۴.۸	۴.۵	۴.۱	-۰.۳			◆					
		شاوان	۱۲	۱۶.۴	-	۲,۰۵۵	۷۳%	۵۵۵	۱۸۳	۲ Q	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۰	۸.۵	۴.۵	+۰.۹						◆		
	نفت، گاز و سوخت های مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۱۲.۸	-۲%	۲۳۷	۸۸%	۳۱	۱۰	۲ Q	۳۵	۴۶	+۳۰%	۶.۷	۴.۸	۴.۷	-۳.۰	◆						
		شبهرن	۱۲	۲۷.۶	-۱%	۲,۳۰۹	۸۹%	۳۳۸	۱۷۷	۲ Q	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۲	۵.۹	۵.۸	+۱.۵						◆		
		روانکار	شسپا	۱۲	۲۶.۳	-۳%	۴۷۰	۶۷%	۷۴	۴۵	۲ Q	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۰	۳.۹	۴.۴	-۰.۲				◆			
			شنفت	۱۲	۱۶.۶	+۲%	۸۳۰	۸۲%	۱۰۸	۶۶	۲ Q	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۷.۸	۷.۷	۸.۵	+۰.۳					◆		
			شرانل	۱۲	۱۵.۱	-۱%	۷,۵۳۰	۸۵%	۱,۴۴۱	۵۷۶	۲ Q	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴.۵	۳.۸	۳.۶	-۰.۷				◆			
	زغال سنگ	کپور	۱۲	۲.۰	-۲%	۱,۱۷۶	۵۹%	۱۶۹	۸۳	۲ Q	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۵.۷	۴.۲	۴.۴	-۱.۳			◆					
		کطبس	۱۲	۱.۴	-۵%	۱,۷۲۸	۶۲%	۱۹۳	۱۲۲	۲ Q	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۵.۸	۴.۹	۴.۷	-۲.۷	◆							
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۷	-۱%	۵۳۷	۹۴%	۴۷	۲۷	۳ Q	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۰	۹.۱	۷.۳	-۳.۸	◆						
			تنوین	۱۲	۸.۸	-۳%	۲۲۹	۶۳%	۴۸	۱۷	۲ Q	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴.۶	۳.۴	۳.۴	-۲.۵	◆						
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۵	-	۷,۳۰۰	۹۱%	۸۸۸	۵۰۵	۲ Q	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵.۶	۳.۴	۳.۹	-۱.۰				◆			
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۱	-۴%	۵,۵۸۰	۹۶%	۳۲۲	۱۷۶	۲ Q	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۳.۸	۷.۶	۸.۹	-۰.۶				◆			

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

اجماع تحلیلگران

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران‌تر →	نمودار امتیاز Z	ارزان‌تر ←
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)		۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳		با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده‌نگر ۴ فصله	آینده‌نگر ۴ فصله				
بهداشت	دارویی	ددانا	۱۲	۱۲.۰	-	۵,۰۰۵	۷۶%	۴۹۵	۳۳۹	۲ Q	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۵.۹	۴.۳	۴.۵	+۰.۲				
		دلر	۱۲	۷.۱	-۱%	۳,۱۷۳	۹۶%	۳۵۲	۲۶۴	۲ Q	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۶.۴	۵.۹	۶.۳	+۱.۰				
		دپارس	۱۲	۵.۷	+۲%	۶,۰۲۰	۹۸%	۸۰۳	۲۶۴	۲ Q	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۶.۳	۵.۴	۴.۸	-۰.۱				
		دالبر	۱۲	۵.۴	-۱%	۵۶۷	۶۹%	۷۵	۵۰	۲ Q	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۵.۰	۴.۰	۴.۱	-۱.۷				
		دفرا	۱۲	۵.۱	-۲%	۳,۶۲۹	۷۹%	۳۹۳	۲۰۱	۲ Q	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۲	۶.۱	۵.۹	+۱.۳				
		دفارا	۱۲	۴.۹	-۴%	۳,۰۶۵	۹۹%	۴۵۲	۱۵۲	۲ Q	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۵.۵	۴.۶	۴.۱	-۰.۱				
		هجرت	۱۲	۴.۴	+۴%	۲,۷۶۵	۹۵%	۴۰۶	۲۳۶	۲ Q	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۱	۴.۰	۴.۳	-۰.۸				
		دتوزیع	۱۲	۴.۰	-	۲,۱۹۵	۹۴%	۴۴۹	۱۰۳	۲ Q	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۶.۶	۵.۰	۴.۸	-۰.۵				
		دقاضی	۱۲	۳.۹	+۱%	۲,۲۹۵	۹۶%	۲۷۷	۱۷۷	۲ Q	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۱	۴.۶	۵.۱	-۰.۵				
		کاسپین	۱۲	۲.۶	+۲%	۱,۸۴۰	۹۵%	۲۳۴	۱۵۴	۲ Q	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۵.۸	۴.۶	۵.۰	-۰.۵				
		درازک	۱۲	۲.۵	+۱%	۱,۱۷۸	۱۰۴%	۲۱۳	۲۷	۲ Q	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۲	۳.۶	۳.۳	-۷.۴				
		دکپسول	۱۲	۲.۴	-	۸,۰۲۰	۹۲%	۹۲۱	۶۰۳	۲ Q	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۷.۵	۵.۹	۶.۹	+۱.۷				
		دراز۱	۱۲	۱.۹	+۳%	۱,۸۵۸	۶۷%	۲۷۳	۵۶	۱ Q	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۵.۴	۴.۷	۴.۴	-۶.۳				

صفحه ۱ از ۱۲۹
۱۴۰۲/۰۸/۲۶



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران‌تر →	ارزان‌تر ←	
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)		۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده‌نگر ۴ فصله	آینده‌نگر ۴ (فصله)				
مصرفی غیردوره‌ای	غذا و نوشیدنی	سپید	۱۲	۷.۴	-	۲,۴۶۹	۵۵%	۲۱۳	۲۰۲	۲ Q	۴۹۶	۶۸۹	+۳۹%	۵.۰	۳.۵	۳.۷	-۴.۴				
		سیمرغ	۹	۴.۲	-۱%	۳,۱۹۸	۲۴%	۳۹۱	۳۳۷	۳ Q	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۵.۹	۴.۰	۳.۳	-۲.۴				
		زفکا	۱۲	۲.۴	-۳%	۱,۶۲۵	۹۱%	۱۵۵	۱۰۵	۲ Q	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۹.۰	۵.۹	۷.۴	+۰.۲				
		تلیسه	۱۲	۱.۹	-۲%	۳۷۷	۹۲%	۲۵	۲۹	۲ Q	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۱.۱	۷.۷	۱۲.۳	-۰.۱				
		زگلدشت	۱۲	۱.۶	-۵%	۲,۲۴۵	۹۵%	۹۶	۱۱۰	۲ Q	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۰.۳	۷.۶	۸.۵	+۰.۰				
		زملارد	۱۲	۱.۵	-۲%	۱,۸۲۲	۹۴%	۳۳	۶۳	۲ Q	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۲.۵	۱۰.۰	۱۰.۰	-۳.۱				
		زشریف	۹	۱.۳	+۲%	۵۴۰	۷۶%	۴۸	۵۸	۳ Q	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۶.۸	۵.۲	۴.۶	-۱.۵				
		زشگزا	۱۲	۰.۹	+۱%	۹۱۹	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۸.۴	۴.۹	۷.۷	+۰.۰				
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۲.۹	-۴%	۱,۲۹۰	۶۰%	۱۶۱	۷۴	۲ Q	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۵.۷	۳.۸	۴.۰	-۲.۶				
		غپینو	۱۲	۳.۲	-۲%	۳۵۲	۵۶%	۴۹	۲۵	۲ Q	۶۷	۹۴	+۳۹%	۵.۲	۳.۶	۳.۷	-۱.۹				
		غسالام	۱۲	۱.۹	-	۴۳۲	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۶۵	۸۱	+۲۵%	۶.۶	۵.۴	۴.۷	-۱.۳				
		غمینو	۱۲	۱.۴	+۲%	۹۱۴	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۵.۵	۳.۶	۳.۹	-۰.۷				
	محصولات لبنی	غگورش	۱۲	۱۴.۶	+۵%	۷۳۰	۵۴%	۱۲۶	۴۰	۲ Q	۸۳	۸۶	+۳%	۸.۸	۸.۴	۸.۰	+۰.۱				
		غگلپا	۱۲	۱.۶	-۳%	۴,۲۴۰	۷۴%	۴۶۵	۲۲۳	۲ Q	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۷.۲	۵.۰	۵.۱	-۰.۷				
		غشان	۱۲	۱.۱	+۲%	۶۶۴	۷۱%	۸۰	۲۶	۲ Q	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۸.۱	۵.۹	۵.۶	-۰.۹				
		غگلستا	۱۲	۱.۱	+۱%	۱,۷۴۰	۷۰%	۱۵۶	۴۹	۲ Q	۲۰۷			۸.۴							
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	کیمیاتک	۱۲	۶.۱	-۱%	۱,۰۱۹	۶۴%	۱۰۲	۷۱	۲ Q	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۷.۰	۶.۰	۶.۱	-۰.۲				
		قرن	۱۲	۶.۰	-	۱,۰۰۰	۶۱%	۱۱۰	۶۲	۲ Q	۱۴۳	۲۰۰	+۴۰%	۷.۰	۴.۹	۵.۲	-۰.۷				
		شپاکسا	۹	۲.۲	-۵%	۲۳۵	۳۸%	-۲۴	۲۳	۳ Q	۴۶	۶۱	+۳۲%	۵.۱	۴.۶	۳.۱	-۳.۹				

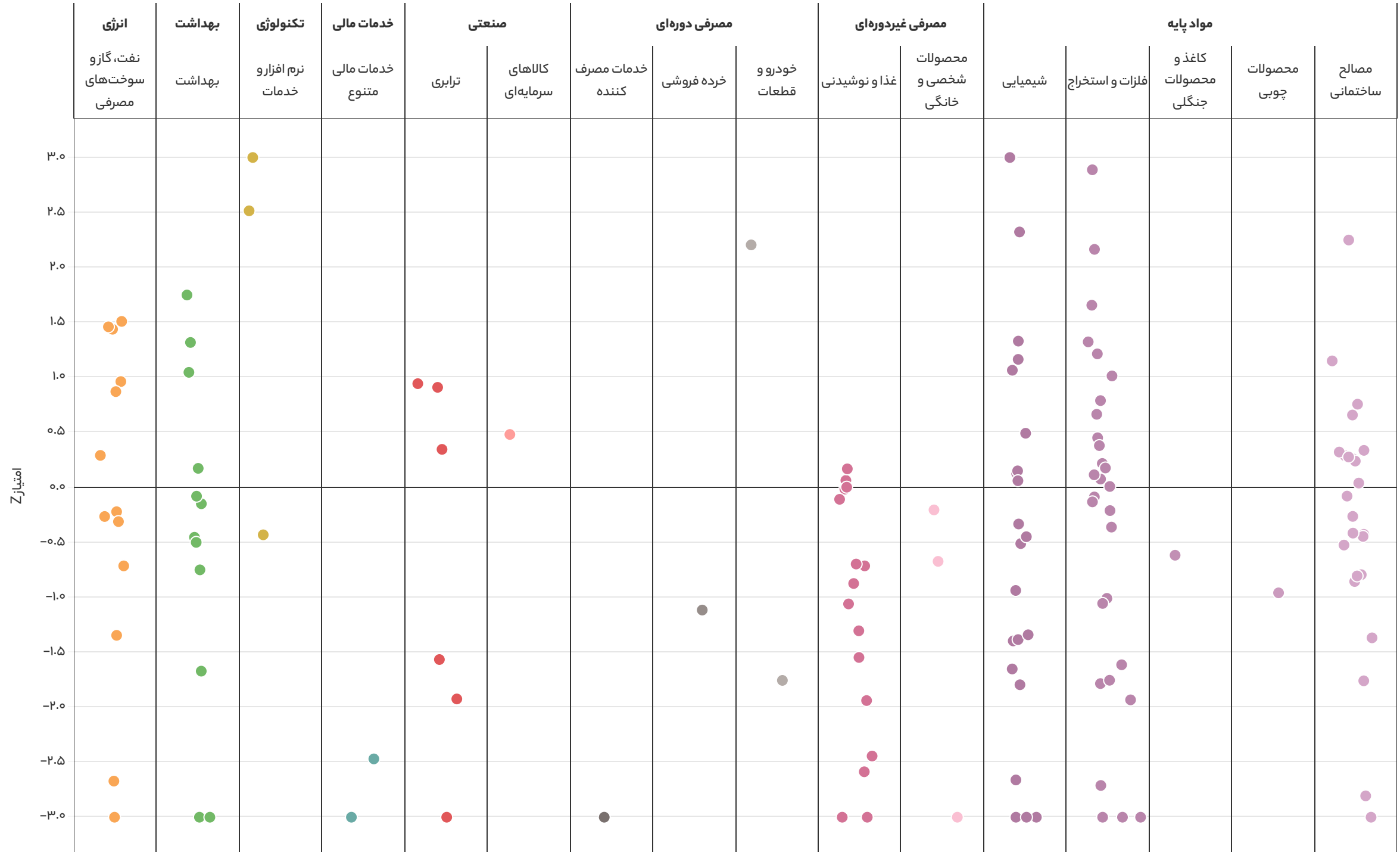
۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		ارزان تر ←	نمودار امتیاز Z	گران تر →
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)		۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	سیستم	۱۲	۱۸.۳	+۱%	۱,۸۳۳	۸۹%	۸۳	۵۰	۲ Q	۵۹	۷۳	+۲۳%	۳۱.۰	۲۵.۸	۳۸.۵	+۴.۰			
		سپیدار	۱۲	۶.۱	-۴%	۸,۷۱۰	۷۸%	۳۱۱	۴۳۴	۲ Q	۲۷۰	۳۳۸	+۲۵%	۳۲.۲	۲۶.۵	۱,۴۲۰.۵	+۲.۵			
		رافزا	۱۲	۱.۴	-۱%	۱,۳۶۸	۸۰%	۹۱	۹۹	۲ Q	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۹.۷	۸.۰	۱۰.۲	-۰.۴			
صنعتی	بنادرو کشتیرانی	حزرج	۱۲	۶.۰	+۱%	۱,۶۶۳	۹۶%	۲۰۷	۱۹۸	۲ Q	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۵.۸	۳.۶	۵.۳	+۰.۳			
		حتاید	۱۲	۵.۸	-۱%	۴۸۳	۵۲%	۶۲	۴۳	۲ Q	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۴.۵	۳.۴	۳.۴	-۱.۹			
	ترابری	توریل	۱۲	۳.۹	+۴%	۵۶۱	۳۸%	۴۳	۱۸	۲ Q	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸.۴	۶.۶	۵.۸	-۱.۶			
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۱۲	۱.۸	-	۲۴۸	۵۲%	۳۱	۱۳	۲ Q	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۰	۵.۴	۴.۵	-۵.۴			
		چپارسا	۶	۱.۵	-۳%	۶,۱۴۰	۸۹%	۶۳۱	۵۱۲	۳ Q	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸.۶	۷.۳	۶.۳	+۰.۹			
کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۳	+۲%	۳۰۳	۳۱%	۳۳	۱۹	۲ Q	۲۶	۳۸	+۴۶%	۱۱.۸	۸.۳	۱۱.۳	+۰.۵			
	سیم و کابل	بکابل	۱۲	۳.۰	-۳%	۲,۸۸۵	۶۱%	۲۵۰	۱۲۷	۲ Q	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۵	۵.۲	۴.۶				
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	پکوبیر	۹	۴.۴	+۱%	۶۷۶	۷۵%	۲۵	۶۳	۳ Q	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۷.۸	۳.۹	۳.۹	-۱.۸			
		پلوله	۱۲	۱.۰	+۲%	۴,۶۳۵	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۲۱.۵	۲۱.۸	۲۶.۲	+۲.۲			
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۴	-۷%	۶۷۴	۴۹%	۱۰۳	۴۷	۲ Q	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۰	۳.۷	۳.۷	-۱.۱		

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

