

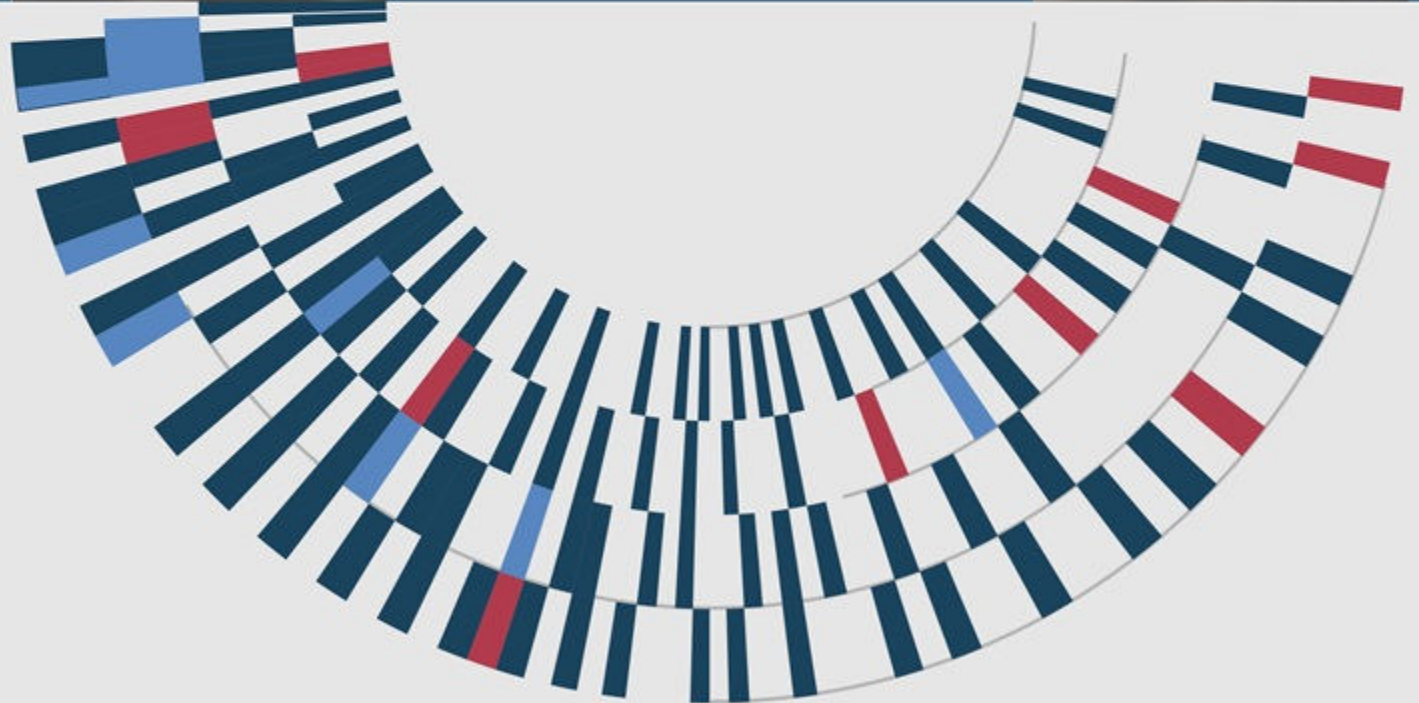
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۲۹ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۲۴

 CHARISMA





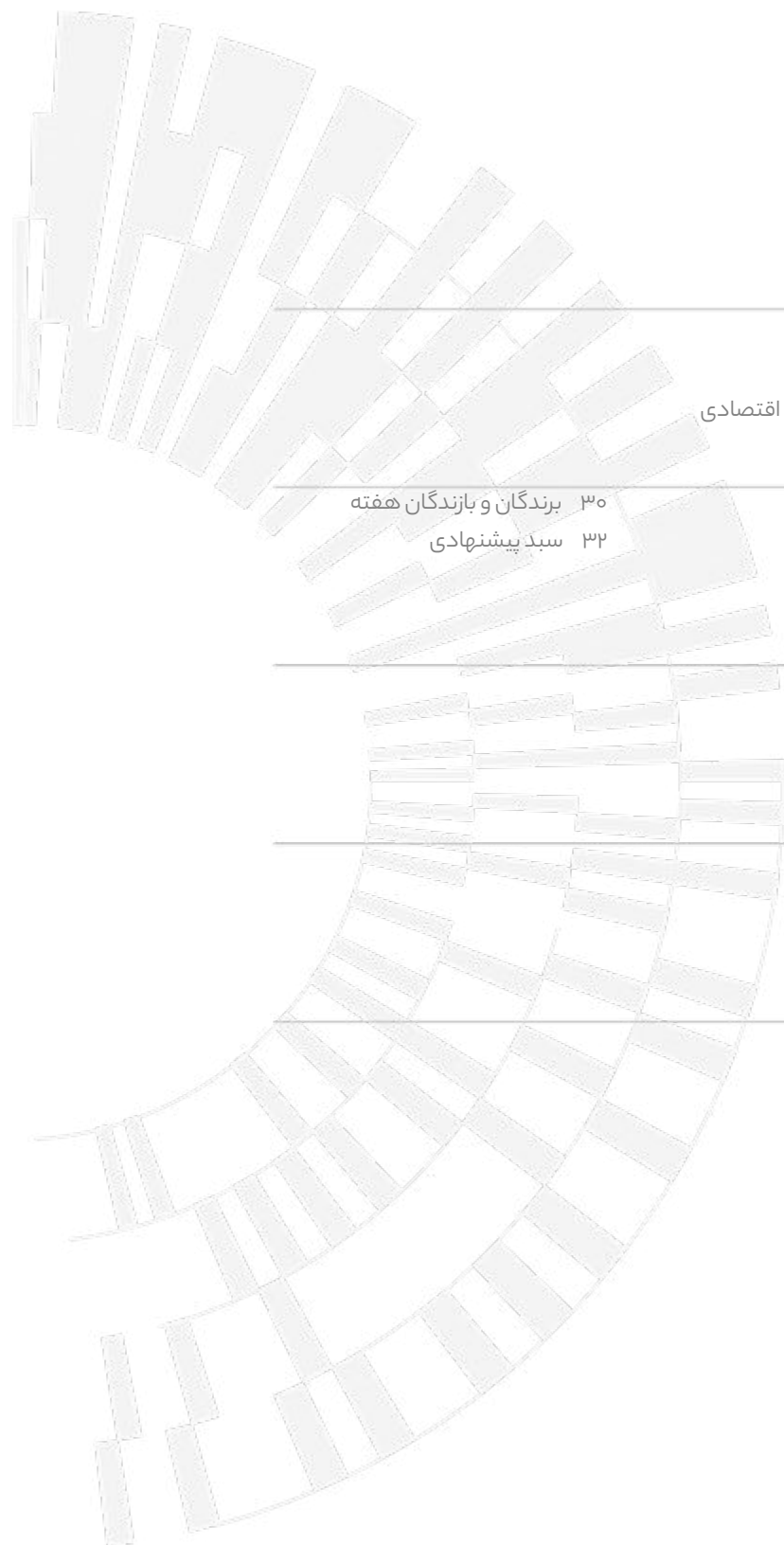
معرفی گزارش:

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	رند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۲,۰۲۰	۰.۵%-	فزر	-	۱,۷۹۷ ۲,۰۶۹	۱۳%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۵۳۰	۱.۱%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ ۹,۳۴۱	۲%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۳۴	۵.۱%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ ۲,۴۲۴	۱%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۴۸۳	۳.۹%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳ ۳,۴۴۴	-۱۷%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۷۰	۲.۳%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۰۲۴ ۲,۲۹۶	-۷%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۳۷	۱.۸%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۰۲۲ ۴,۸۴۳	۵۳%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۰۰	۰.۹%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۳۷۲ ۳,۶۲۵	۴۸%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۴	۲.۰%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۴۳۱ ۶۲۳	۰%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۶۶۹	۱.۶%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۱۵,۶۹۰ ۲۲,۸۲۱	۱۹%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۲۰	۶.۷%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ ۶۷۰	۱۴%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۷۸۶	۱.۴%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۳,۳۸۴ ۲۲,۰۸۰	۴۸%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۲۰	۰.۸%	ذوب، کویر	فولای	۵۴۶ ۷۵۵	-۵%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۰۱۷	۰.۷%-	ذوب، کویر	فولای	۱۶,۴۰۰ ۲۴,۷۴۷	۲۸%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۰۰	۱.۷%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ ۷۸۰	۲%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۹۰	۱.۵%	فولاد	-	۶۴۰ ۸۶۰	۰%

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	۳۲۲	-۲.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۶	-۴.۸%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۵۰	-۴.۵%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۱	۰.۴%	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۱	-	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۴۹۰	۱.۷%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۳۵	-	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۰	-	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۵۷	۰.۷%	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۹۷۹	۰.۸%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۴۰	-	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۹۹۸	-۰.۴%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۸۸۳	۱.۳%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۵۸۰	-۱.۳%	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	-۲.۱%	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۸۵	۱.۳%	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۴۵	-۱.۶%	شبصیر	-		



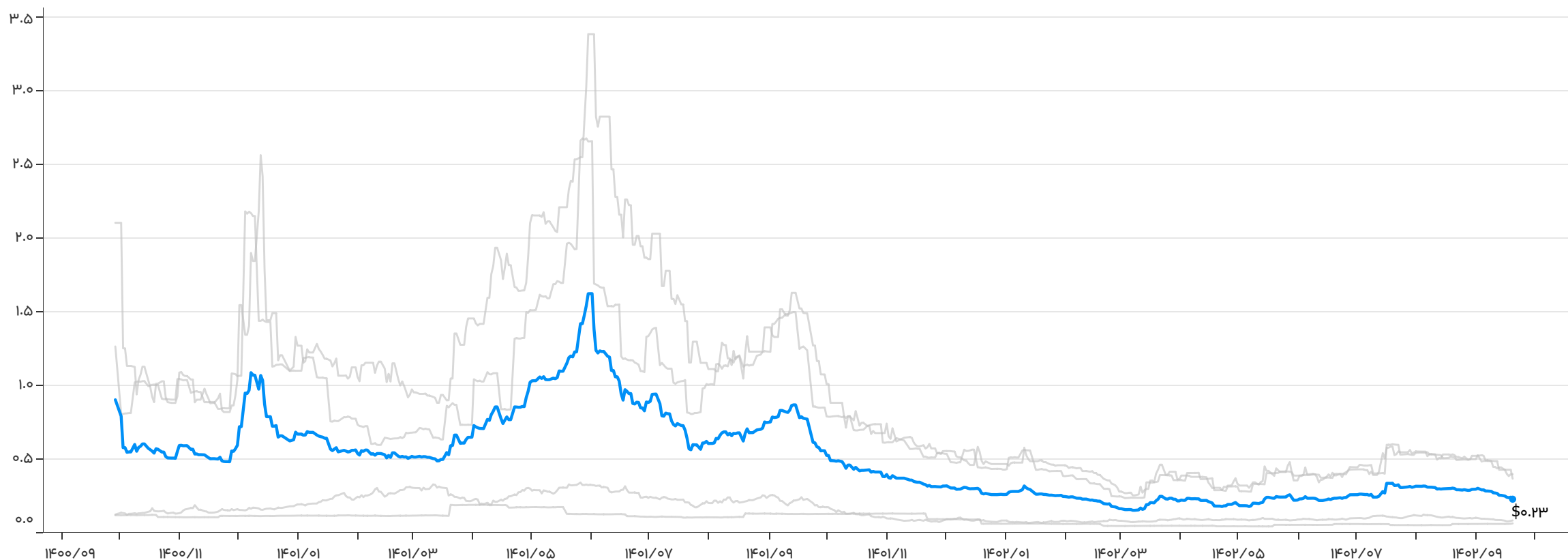
انرژی و سایر محصولات

رند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فراورده های نفتی				شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	–	۱.۱%	۷۷	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت
				شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	–	۰.۴%	۷۲	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI
				–	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	۱.۶%	۱۱۰	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره
				–	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	–۱.۰%	۱۰۲	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور
				شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	–	۳.۰%	۱۸,۱۵۹	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات – پالایش نفت تهران
				–	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	–	۰.۸%	۲۸,۴۶۵	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه – نفت سپاهان
محصولات کشاورزی				–	شپاس	–	–۲.۹%	۱۲,۸۰۷	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر – نفت پاسارگاد
				غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	–	–	–۰.۹%	۱۹۰	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
				غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	–	–	–۰.۹%	۷۹۹	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام
				–	–	–	۳.۷%	۱,۲۴۱	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
ارز و ارز دیجیتال				–	–	–	–۲.۵%	۲۲۷	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
				–	–	–	–	۱.۰۸	–	بازار فارکس	یورو به دلار
				–	–	–	–	۱.۲۶	–	بازار فارکس	پوند به دلار
				–	–	–	–۴.۲%	۴۲,۱۶۸	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	۰.۰۹	۳.۳%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۸	-۵۵%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۷	۴.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۴۹%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۴۰	۰.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۶۳%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۷	-۱۴.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۸۵	-۵۶%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۳	-۵.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۶	-۵۹%

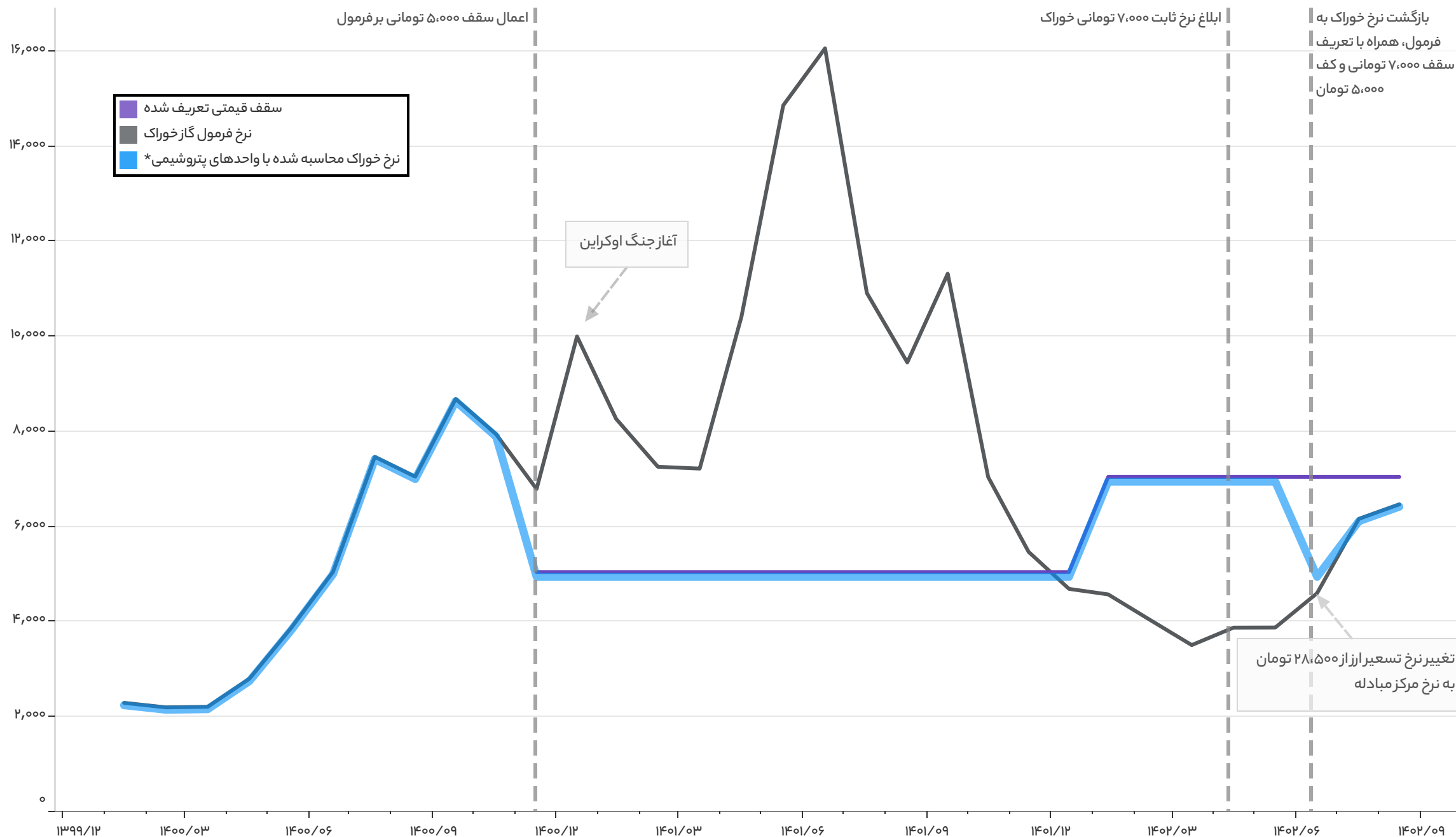
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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

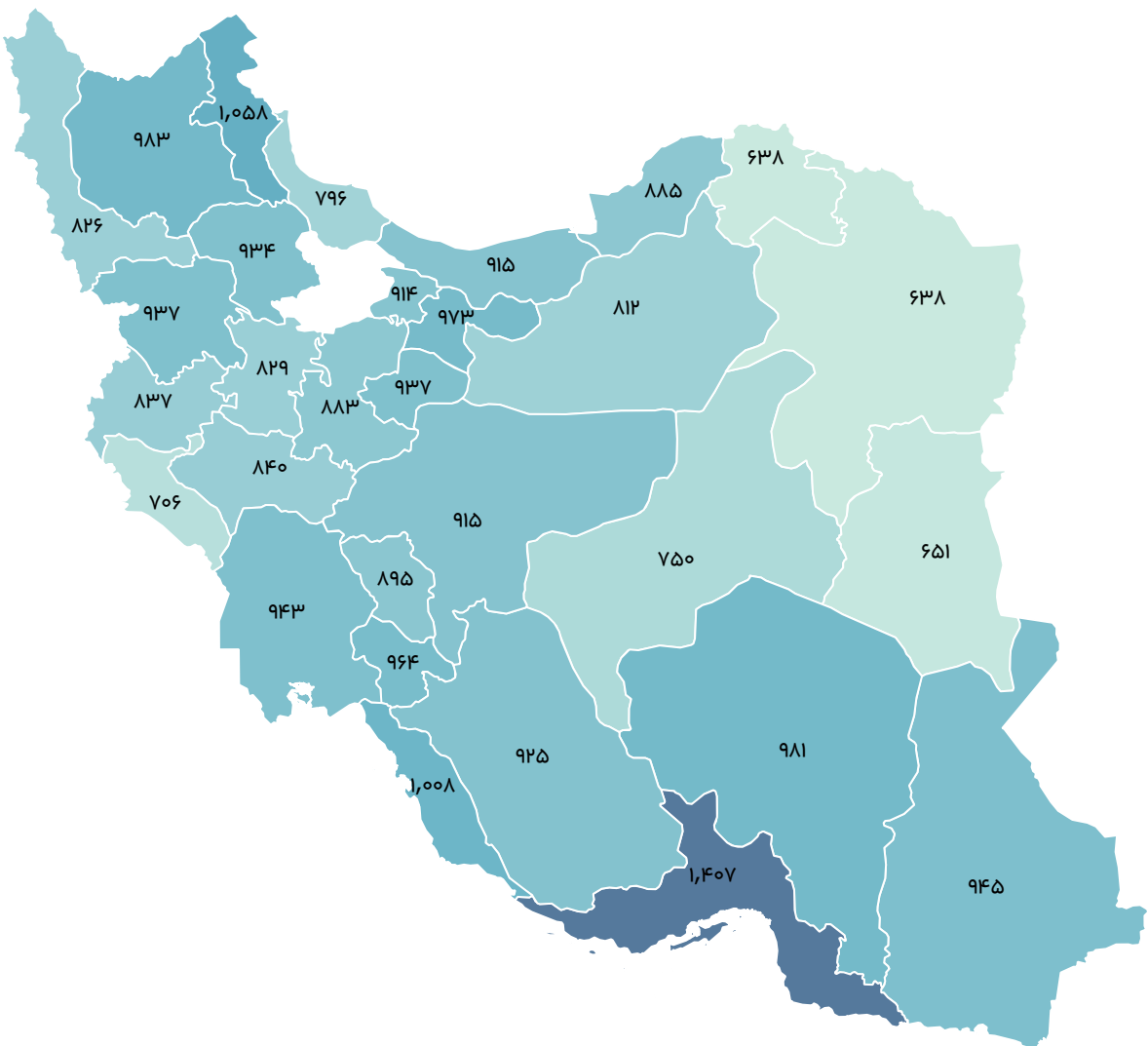


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بر روزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.



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 گزارش	هفته گذشته	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	تهران	سیمان تهران	۹۴۱	۹۷۳	+۳.۴%
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۸۸۳	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	قم	سیمان نیزار قم	۹۵۷	۹۳۷	-۲.۱%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۲۳	۸۱۲	-۱.۳%
	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیما..	۷۱۲	۷۵۰	+۵.۵%
غرب	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۸۷	۹۴۳	-۴.۴%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۹۵	۸۹۵	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۵۷	۸۳۷	-۲.۴%
	لرستان	سیمان دورود	۸۴۰	۸۴۰	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۹۹	۹۶۴	+۷.۲%
شمال غرب	کردستان	سیمان کردستان	۹۳۷	۹۳۷	-
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۱۰۸	۱,۰۵۸	-۴.۵%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۰۴	۸۲۶	+۲.۸%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۳۹	۹۸۳	+۴.۷%
شمال	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
	گیلان	سیمان خزر	۹۳۹	۷۹۶	-۱۵.۲%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۴۶	۸۸۵	+۱۸.۷%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۲۱۲	۱,۴۰۷	+۱۶.۱%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۱,۰۴۱	۱,۰۰۸	-۳.۲%
	فارس	سیمان داراب	۹۱۷	۹۲۵	+۰.۸%
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۵۱	+۲.۰%
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۸۱	۹۸۱	-
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۱,۱۸۵	۹۴۵	-۲۰.۳%



معادن و فنرات

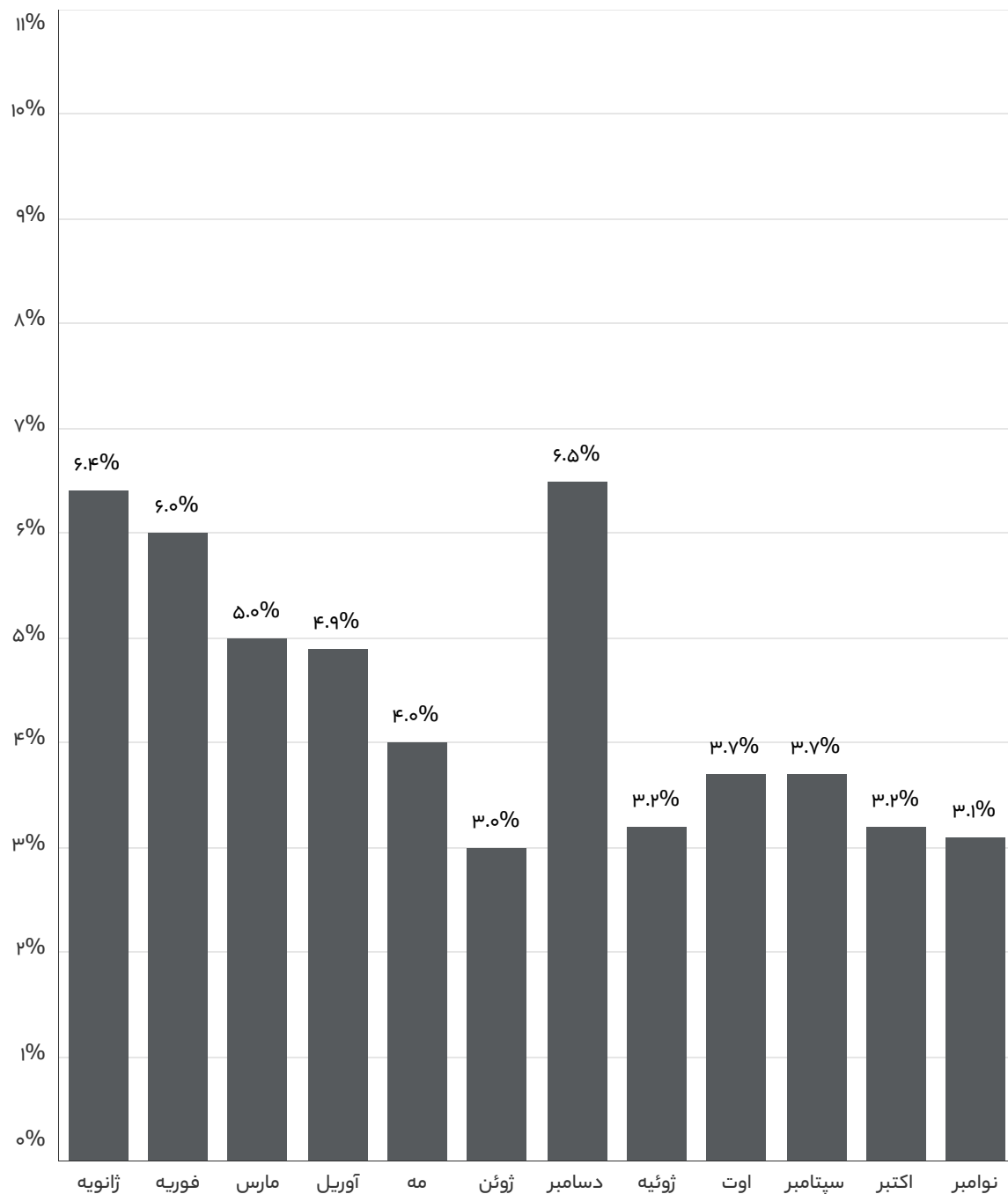
انرژی

- ▲ به گزارش رویترز، گزارش بهتر از حد انتظار بازار اشتغال در آمریکا باعث شد معامله‌گران احتمال کاهش نرخ بهره تا ماه مارس را پایین بیاورند. در نتیجه دلار و سود اوراق قرضه خزانه‌داری آمریکا تقویت شد و قیمت طلا در اواسط هفته کاهش یافت و در روز دوشنبه به پایین‌ترین رقم طی سه هفته گذشته رسید. سپس پنجشنبه، پس از اینکه فدرال رزرو آمریکا پایان چرخه انقباض خود را اعلام کرد، باعث کاهش دلار و بازده خزانه‌داری شد و طلا با جهش ۶۰ دلاری به بالاترین سطح یک هفته‌ای خود رسید و با بیش از ۵ درصد افزایش از ۲۰۳۵ دلار عبور کرد.
- ▼ به گزارش رویترز، قیمت نفت در اواسط هفته با یک کاهش ۳ درصدی به پایین‌ترین رقم طی ۶ ماه گذشته رسید. مازاد عرضه و نگرانی در مورد ضعف تقاضا از عوامل اصلی سقوط قیمت نفت بوده است. بالاتر از حد انتظار بودن نرخ تورم در آمریکا در ماه نوامبر باعث شد احتمال کاهش نرخ بهره فدرال رزرو در اوایل سال آینده میلادی کاهش یابد که بر مصرف تاثیر می‌گذارد. در این بین، متوسط تولید هفتگی نفت خام روسیه افزایش یافته و به بالاترین سطح از ماه ژوئیه رسیده است. بدین ترتیب نگرانی در مورد مازاد عرضه افزایش یافته و تردیدها نسبت به تاثیر قرارداد کاهش تولید اوپک پلاس را بیشتر کرده است. از سوی دیگر قیمت نفت در آستانه اجلاس فدرال رزرو برای تعیین نرخ بهره و انتشار اطلاعات تورم اندکی افزایش داشت.
- ✓ اوپک در جدیدترین گزارش ماهانه خود اعلام کرد دید خوش بینانه محتاطانه‌ای نسبت به عوامل تاثیرگذار بر پویایی بازار نفت در سال ۲۰۲۴ دارد و اعلام کرد سفته‌بازان نقش بزرگی در پایین رفتن قیمت‌ها ایفا کرده‌اند. در گزارش اوپک درباره قیمت‌ها در نوامبر آمده: قیمت معاملات آتی نفت، افت قابل توجهی را در بحبوحه نوسانات شدید بازار معاملات آتی، تجربه کرد. پویایی بازار تحت تاثیر نگرانی‌های اغراق‌آمیز نسبت به رشد تقاضا برای نفت قرار گرفت که بر فضای بازار، تاثیر منفی داشت. اوپک پیش بینی خود از میزان رشد تقاضای جهانی برای نفت در سال ۲۰۲۳ را بدون تغییر در ۲۰۴۶ میلیون بشکه در روز حفظ کرد و انتظار دارد تقاضا در سال میلادی آینده، به ۲۰۲۵ میلیون بشکه در روز رشد کند که نسبت به برآورد ماه گذشته این گروه، تغییری نکرده است.
- ▲ آژانس بین‌المللی انرژی (IEA) در جدیدترین گزارش ماهانه خود با اشاره به بهبود چشم‌انداز آمریکا و کاهش قیمت نفت، پیش‌بینی خود از میزان رشد تقاضای جهانی برای نفت در سال میلادی آینده را با وجود کندی رشد اقتصادی، افزایش داد. با وجود این بازبینی صعودی، هنوز فاصله قابل توجهی بین برآورد آژانس بین‌المللی انرژی که نماینده کشورهای صنعتی است و گروه تولیدکنندگان نفت اوپک در خصوص چشم انداز تقاضا در سال ۲۰۲۴ وجود دارد. این دو سازمان در سال‌های اخیر بر سر مسائلی مانند تقاضای بلندمدت و نیاز به سرمایه‌گذاری در ظرفیت جدید تولید، با یکدیگر درگیر شده‌اند.
- ▼ به گزارش رویترز، نشست تغییرات آب‌وهوایی دبی موسوم به کاپ ۲۸، امروز توافقی را تصویب کردند که برای نخستین بار کشورها را به گذار از سوخت‌های فسیلی برای جلوگیری از بدتر شدن تغییرات آب‌وهوایی تشویق می‌کند. در جریان برگزاری این کنفرانس کشورهای عمدتاً اروپایی و ثروتمند خواستار حذف تدریجی سوخت‌های فسیل و گنجاندن این گزینه در توافق پایانی بودند، در حالی که سایر کشورها اصرار داشتند هرگونه حذف تدریجی سوخت فسیلی باید توسط کشورهای ثروتمندی انجام شود که چندین دهه از منابع آنها بهره‌برداری کرده‌اند.
- ✓ «احمد معروف‌خانی» رئیس اتحادیه صادرکنندگان فرآورده‌های نفت، گاز، پالایش و پتروشیمی در نشستی خبری اظهار داشت: هر چند وقت یکبار، اخباری از افغانستان پخش می‌شود که تانکرهای حاوی بنزین صادراتی ایران بازگشت داده شده است که این اخبار، فضا سازی‌های نادرست علیه ایران است. وی با بیان اینکه "فضاسازی طالبان برای بازگشت محموله‌های بنزین غیرواقعی و شیطنت است"، گفت: به هیچ وجه مرز افغانستان، ملاک سنجش استاندارد فرآورده‌های نفتی نیست و هیچ مکانیزم استنادی در آنجا حاکم نیست.
- ✓ برنامه گفتگوی ویژه خبری شبکه خبر سیما با حضور آقای حمیدرضا حاجی بابایی، رئیس کمیسیون تلفیق بودجه مجلس شورای اسلامی و آقای داود منظور، رئیس سازمان برنامه و بودجه کشور به بررسی لایحه بودجه ۱۴۰۳ در مجلس پرداخت. در این برنامه از داود منظور در مورد ناترازی انرژی و افزایش قیمت آن‌ها سوال شد. وی در پاسخ به این سوال گفت: دولت فعلاً بنایی برای اینکه اصلاح قیمت انرژی بکند، ندارد.

شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته

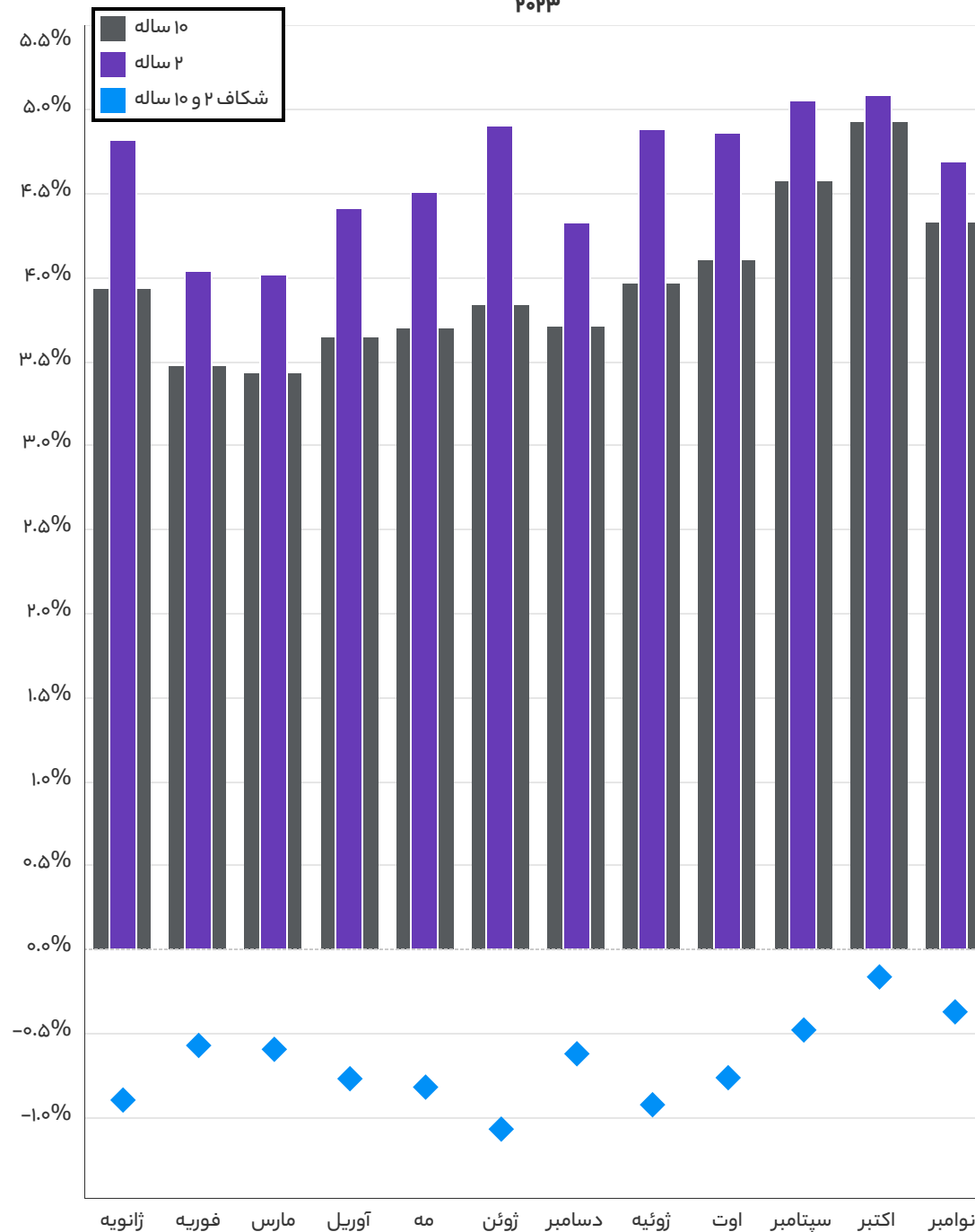
۲۰۲۳



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

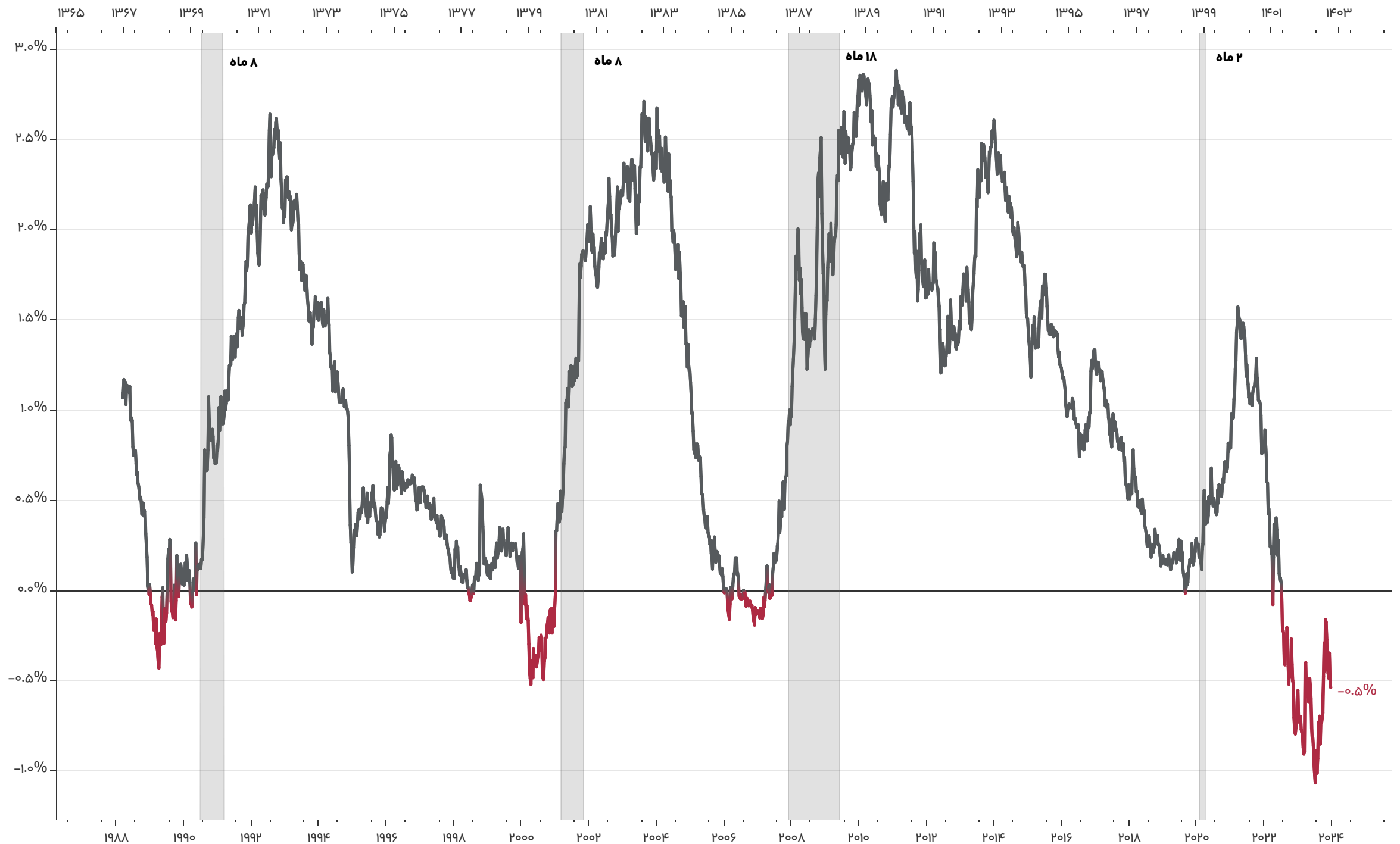
ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده

۲۰۲۳



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

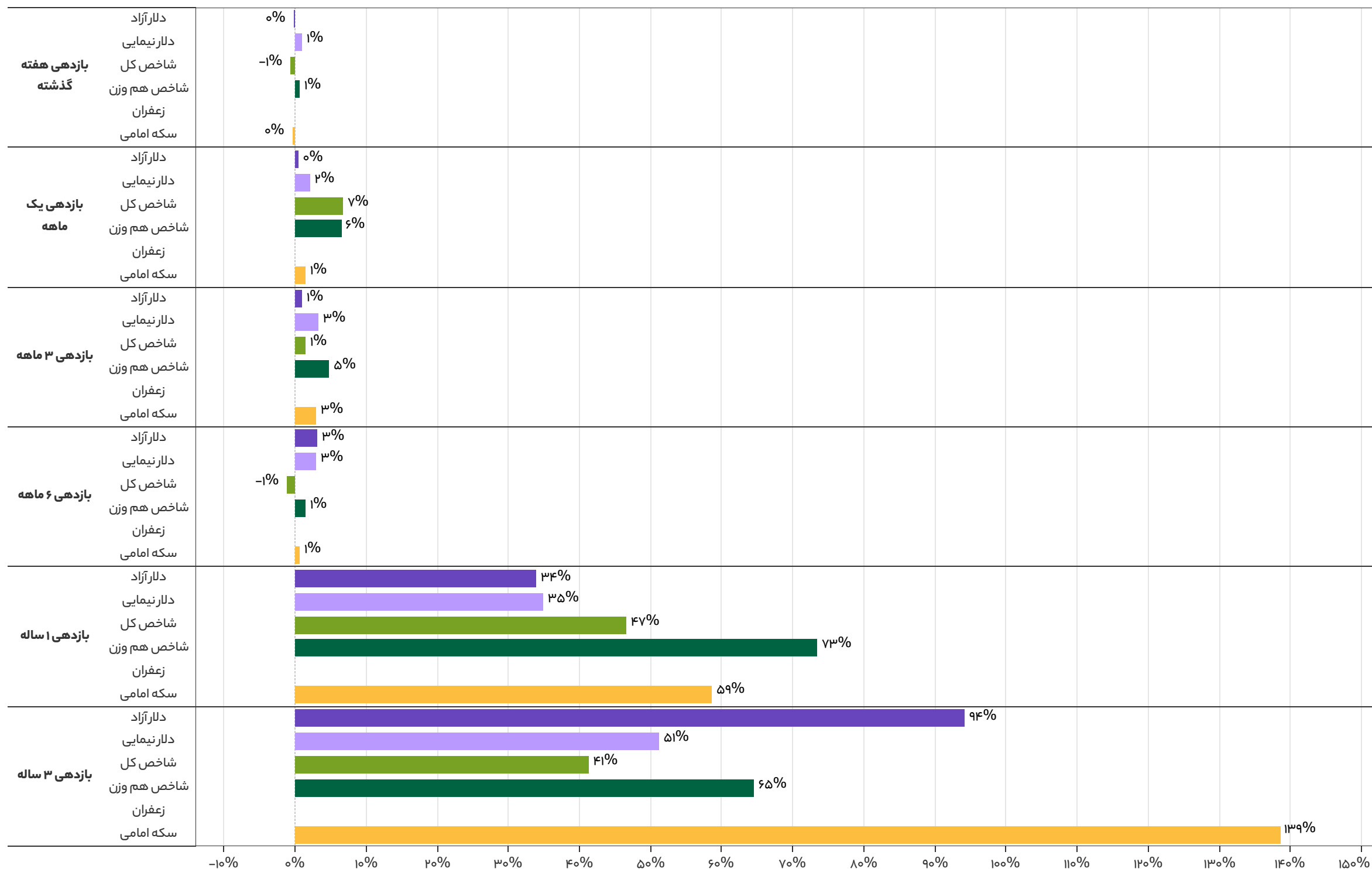
EQUITY MARKET

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												بازده سال	نوسان
۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	بازده سال	نوسان
سکه امامی ▲ ۱۴.۷%	سکه امامی ▲ ۳۱.۳%	سکه امامی ▲ ۱۷.۷%	شاخص کل ▲ ۳۰.۳%	هم وزن ▲ ۲۹.۷%	مسکن ▲ ۱۳.۴%	مسکن ▲ ۴.۰%	زعفران ▲ ۱۲.۳%	زعفران ▲ ۳.۶%	شاخص کل ▲ ۹.۳%	سکه امامی ▲ ۴.۱%	زعفران ▲ ۹.۲%	زعفران ▲ ۹۲.۴%	هم وزن ۴۴%
دلار آزاد ▲ ۱۲.۰%	دلار نیمایی ▲ ۲۲.۰%	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷%	هم وزن ▲ ۲۴.۳%	شاخص کل ▲ ۱۶.۴%	دلار نیمایی ▲ ۲.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۸%	سکه امامی ▲ ۳.۳%	هم وزن ▲ ۸.۸%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	هم وزن ▲ ۱.۹%	مسکن ▲ ۵۹.۴%	شاخص کل ۴۰%
هم وزن ▲ ۱۰.۲%	هم وزن ▲ ۱۷.۱%	زعفران ▲ ۱۴.۵%	مسکن ▲ ۱۴.۲%	دلار آزاد ▲ ۳.۷%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	دلار نیمایی ▼ ۰.۵%	دلار آزاد ▲ ۰.۰%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	دلار آزاد ▲ ۱.۵%	درآمد ثابت ▲ ۱.۹%	هم وزن ▲ ۵۹.۲%	سکه امامی ۳۹%
شاخص کل ▲ ۶.۲%	شاخص کل ▲ ۱۰.۸%	دلار نیمایی ▲ ۱۲.۷%	سکه امامی ▲ ۹.۷%	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 ▲ ۰.۴%	سکه امامی ▲ ۵۴.۶%	دلار نیمایی ۲۵%
زعفران ▲ ۳.۱%	دلار آزاد ▲ ۸.۶%	مسکن ▲ ۹.۹%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	مسکن ▲ ۱.۸%	دلار آزاد ▲ ۰.۸%	هم وزن ▼ ۲.۳%	مسکن ▼ ۲.۲%	دلار نیمایی ▲ ۰.۱%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	دلار نیمایی ▼ ۰.۱%	دلار آزاد ▲ ۰.۱%	دلار نیمایی ▲ ۴۸.۳%	دلار آزاد ۲۰%
مسکن ▲ ۲.۹%	مسکن ▲ ۸.۱%	درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۰.۸%	زعفران ▼ ۰.۱%	سکه امامی ▲ ۰.۴%	شاخص کل ▼ ۵.۶%	سکه امامی ▼ ۳.۵%	مسکن ▼ ۱.۰%	دلار نیمایی ▼ ۰.۱%	شاخص کل ▼ ۴.۱%	سکه امامی ▼ ۰.۱%	شاخص کل ▲ ۳۵.۲%	مسکن ۲۰%
دلار نیمایی ▲ ۲.۸%	درآمد ثابت ▲ ۲.۱%	شاخص کل ▼ ۷.۵%	دلار آزاد ▲ ۰.۲%	سکه امامی ▼ ۰.۴%	هم وزن ▼ ۰.۶%	دلار آزاد ▼ ۶.۱%	هم وزن ▼ ۶.۲%	شاخص کل ▼ ۲.۳%	مسکن ▼ ۰.۶%	هم وزن ▼ ۴.۴%	مسکن ▼ ۰.۴%	دلار آزاد ▲ ۲۷.۲%	زعفران ۲۰%
درآمد ثابت ▲ ۲.۰%	زعفران ▲ ۱.۰%	هم وزن ▼ ۸.۷%	دلار نیمایی ▼ ۲.۰%	دلار نیمایی ▼ ۱.۸%	شاخص کل ▼ ۱.۰%	سکه امامی ▼ ۱۱.۱%	شاخص کل ▼ ۸.۸%	هم وزن ▼ ۵.۲%	سکه امامی ▼ ۱.۶%	زعفران ▼ ۴.۷%	شاخص کل ▼ ۰.۶%	درآمد ثابت ▲ ۲۵.۳%	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.

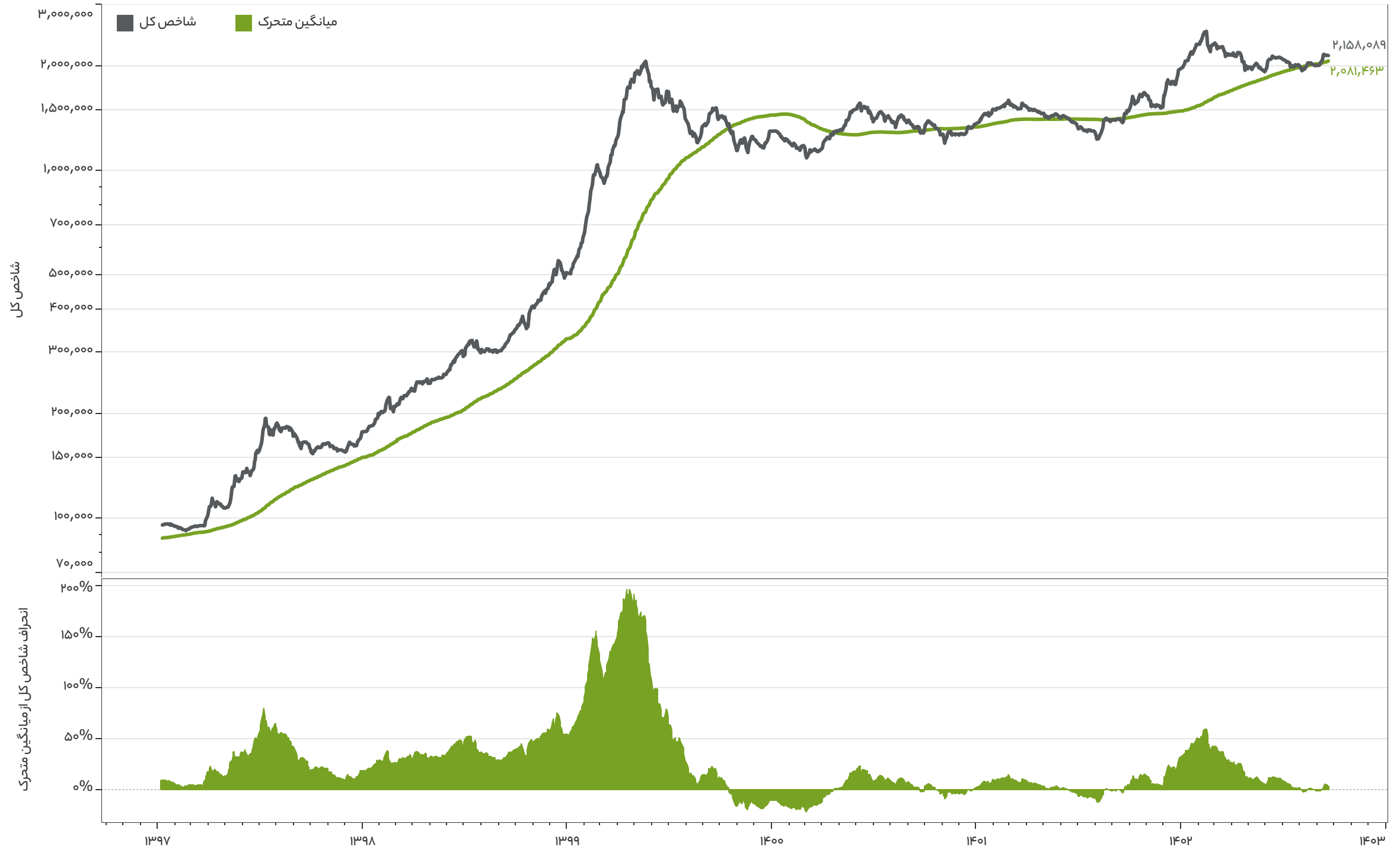
ارزش دلاری بازار

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

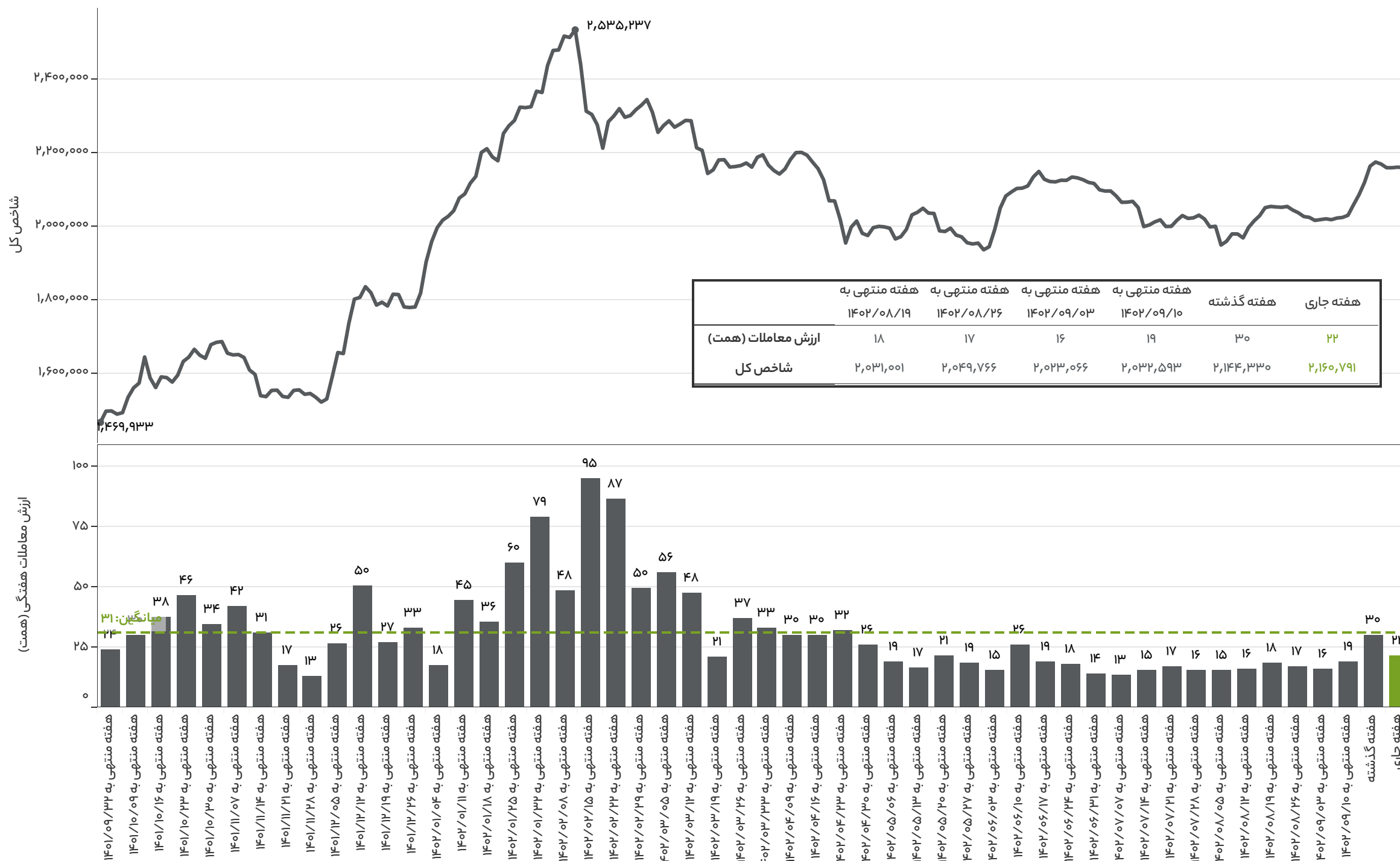
از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس





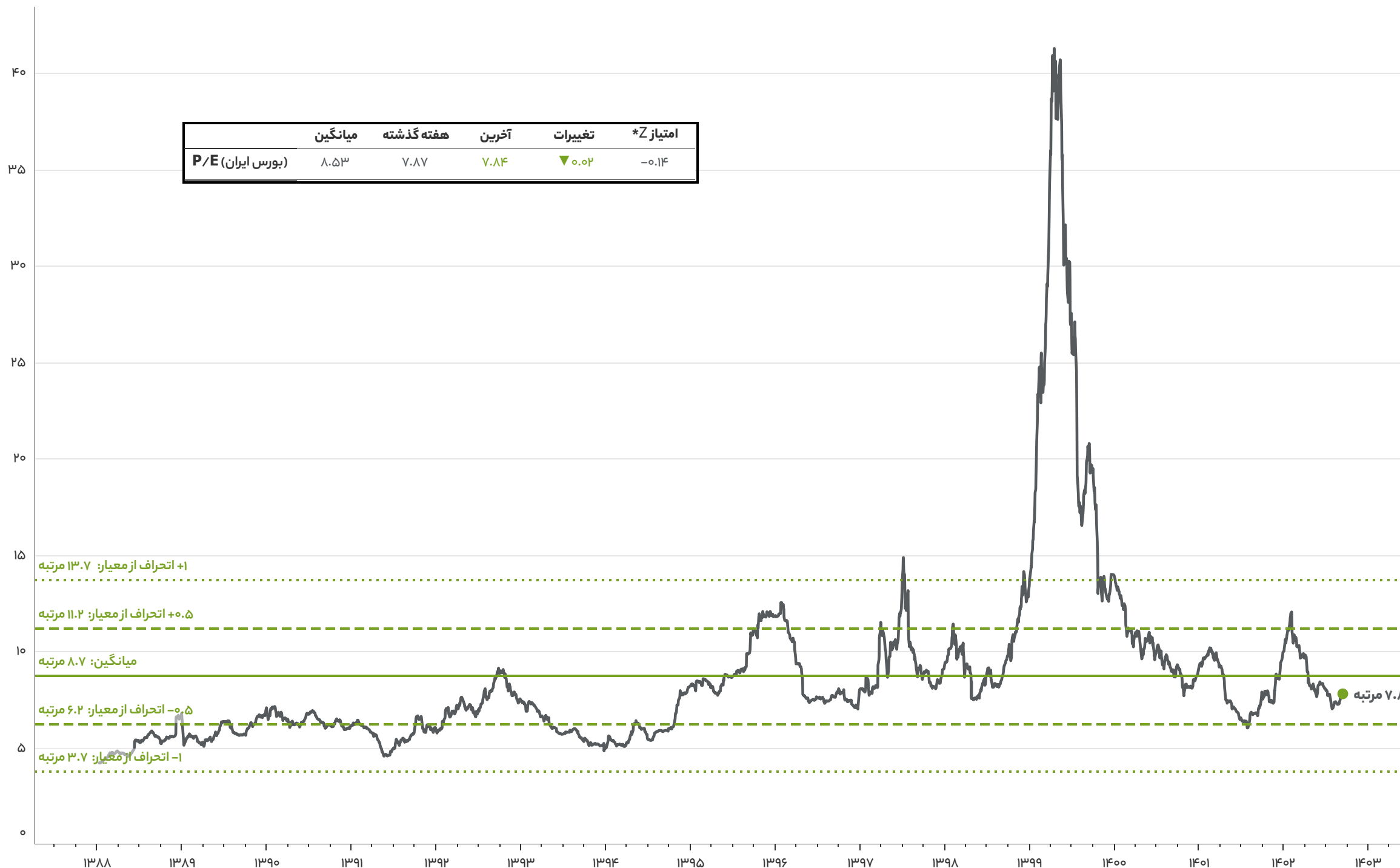
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

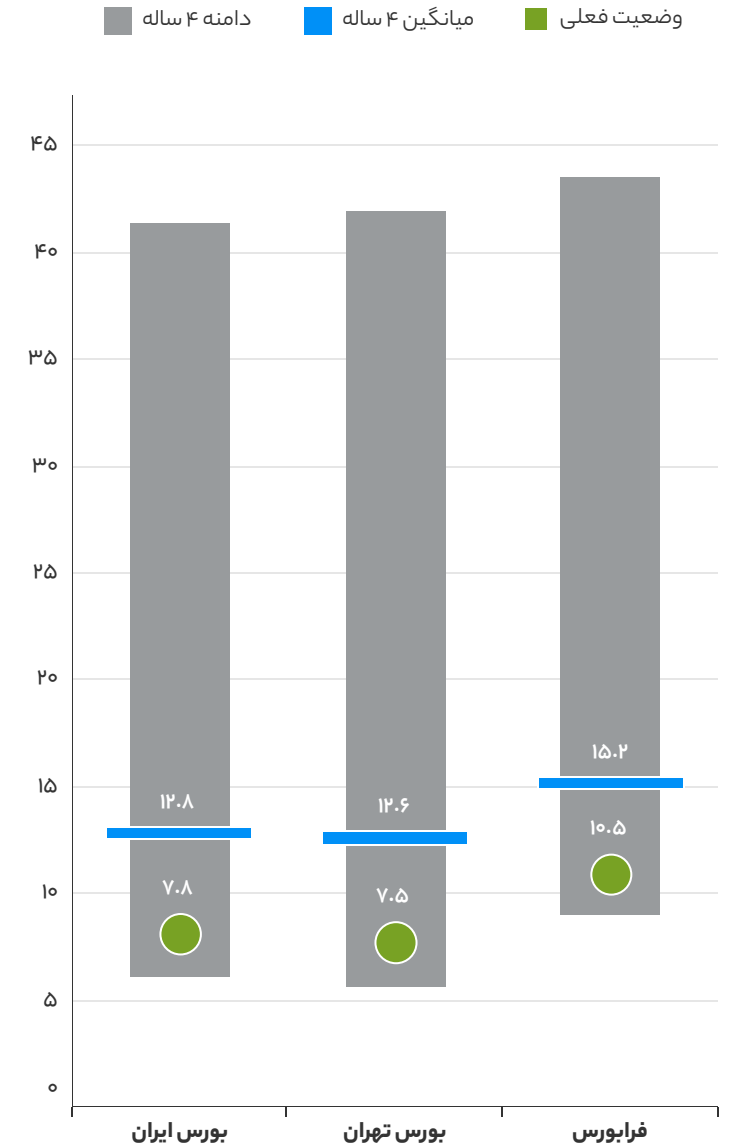
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۸۴	۷.۸۷	۶.۰۷	۱۲.۸۴	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۴۶	۷.۵۳	۵.۶۴	۱۲.۶۱	۴۱.۹۹
فرابورس	۱۰.۵۳	۱۰.۱۳	۹.۰۳	۱۵.۱۹	۴۳.۵۱



بازدهی و ارزشیابی سکتورها

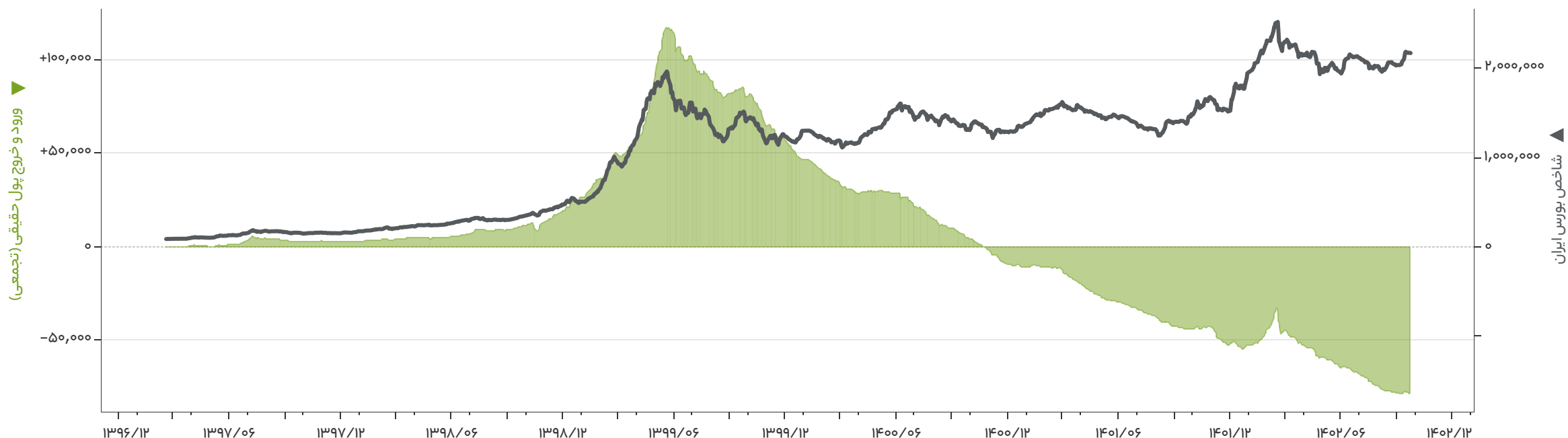
بازار سهام

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	تکنولوژی	ارتباطات	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	خدمات مالی	مواد پایه	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۱۹	۵	۴۱	۶۳	۸۹	۶۵	۶	۱۹۹	۱۸۹	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۵۶	۸۸	۱۱۸	۱۲۵	۱۶۲	۲۰۳	۲۱۹	۳۸۹	۶۳۱	۳,۳۲۱	۳,۳۲۸	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۰%	۱.۴%	۱.۵%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۵%	۴.۵%	۷.۳%	۳۸.۴%	۳۸.۵%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۲.۸	۸.۹	۲۱.۳	۱۳.۳	۹.۱	۹.۶	۱۱.۲	۵.۷	۵.۰	۷.۵	۷.۹	سودآوری
بازده سود نقدی	۲.۸%	۱۷.۱%	۲.۵%	۳.۱%	۶.۵%	۴.۰%	۴.۲%	۲.۲%	۱۴.۳%	۹.۲%	۸.۶%	
نسبت تقسیم سود	۴۲%	۱۰۰%	۶۰%	۴۱%	۷۶%	۳۶%	۵۴%	۳۴%	۶۳%	۶۳%	۷۲%	
بتا به شاخص کل	۰.۸	۱.۰	۰.۶	۱.۳	۰.۷	۱.۱	۰.۸	۱.۰	۱.۲	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۶۴۱%	+۷۷۸%	+۲۹۷%	+۱۵۵%	+۴۰۱%	+۴۵۴%	+۴۴۷%	+۸۸۸%	+۸۱۲%	+۸۹۴%	+۹۳۲%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۳%	+۱۱۴%	+۲%	-۵۹%	+۱۹%	-۵%	+۳%	-۱۰%	+۱۸%	+۴%	+۶۱%	
بازده از ابتدای سال	+۲۳۱%	+۴۲%	+۷۱%	+۶۳%	+۱۰۰%	+۱۱۵%	+۶۱%	+۹۹%	+۹۴%	+۷۳%	+۸۰%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۱%	-۱%	۳%	۲%	۱%	-۱%	۰%	-۱%	-۳%	۰%	۰%	



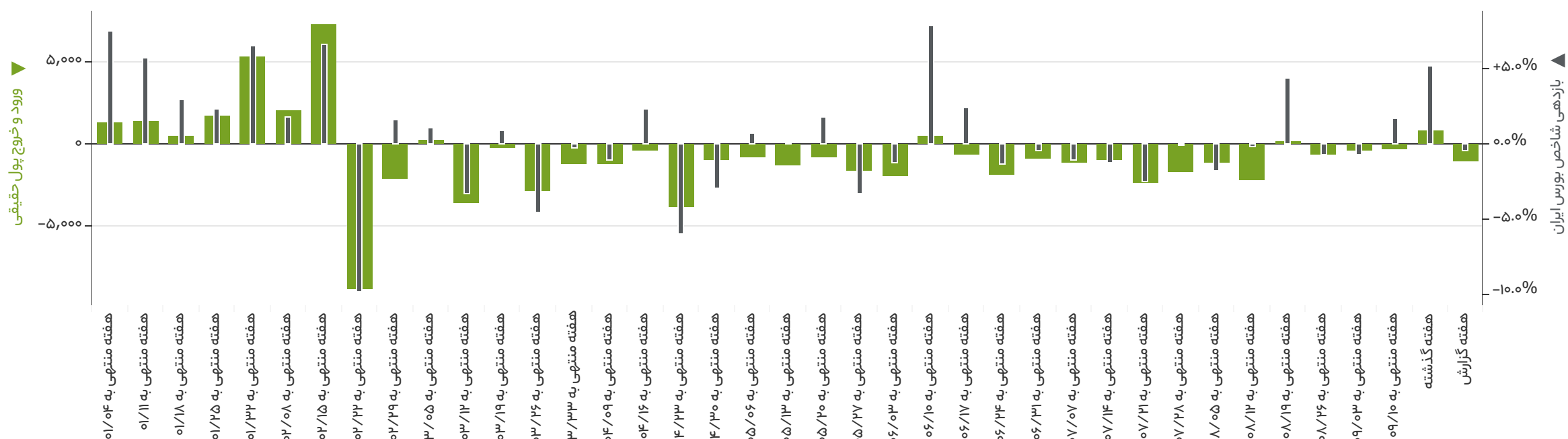
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



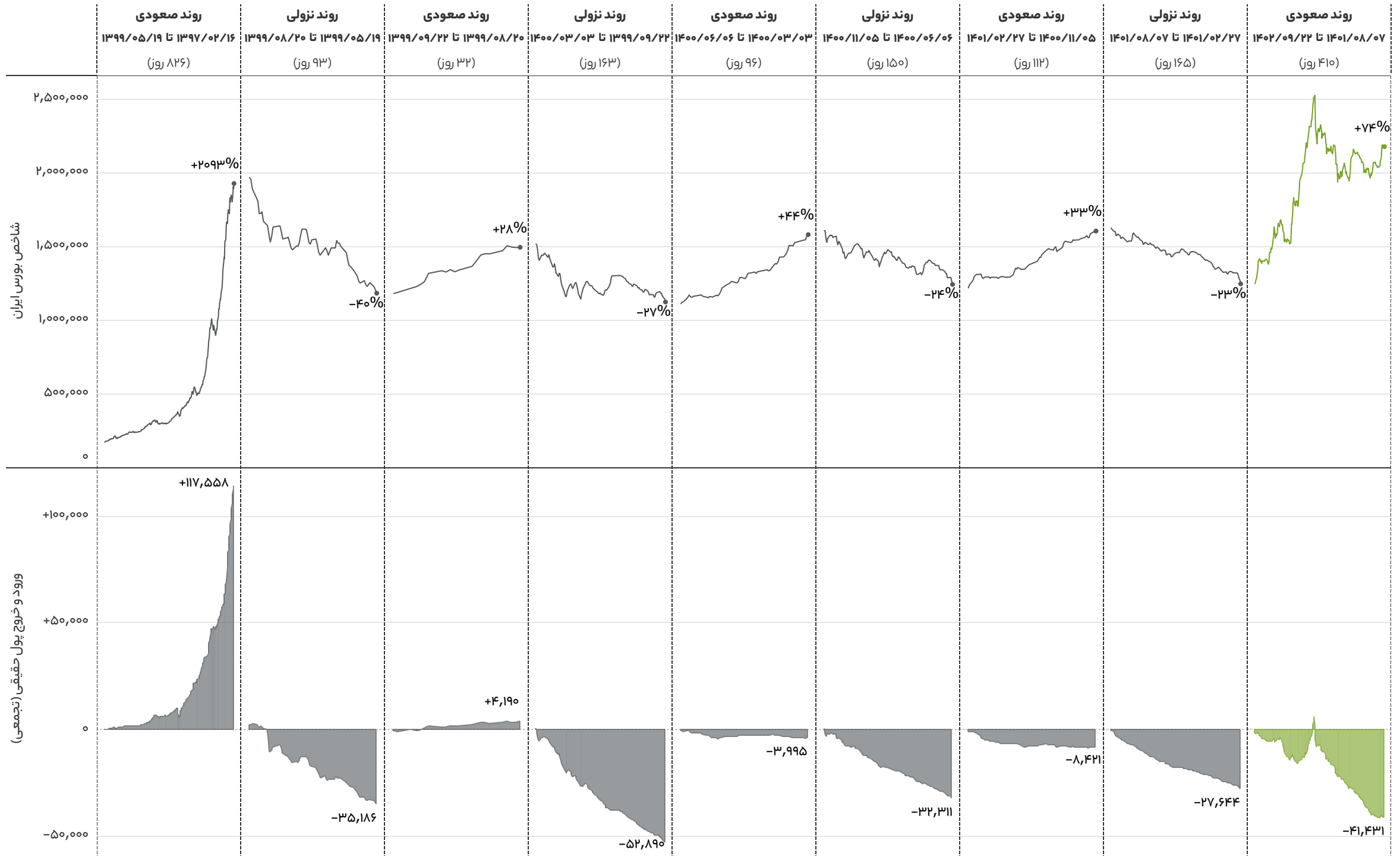
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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



ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

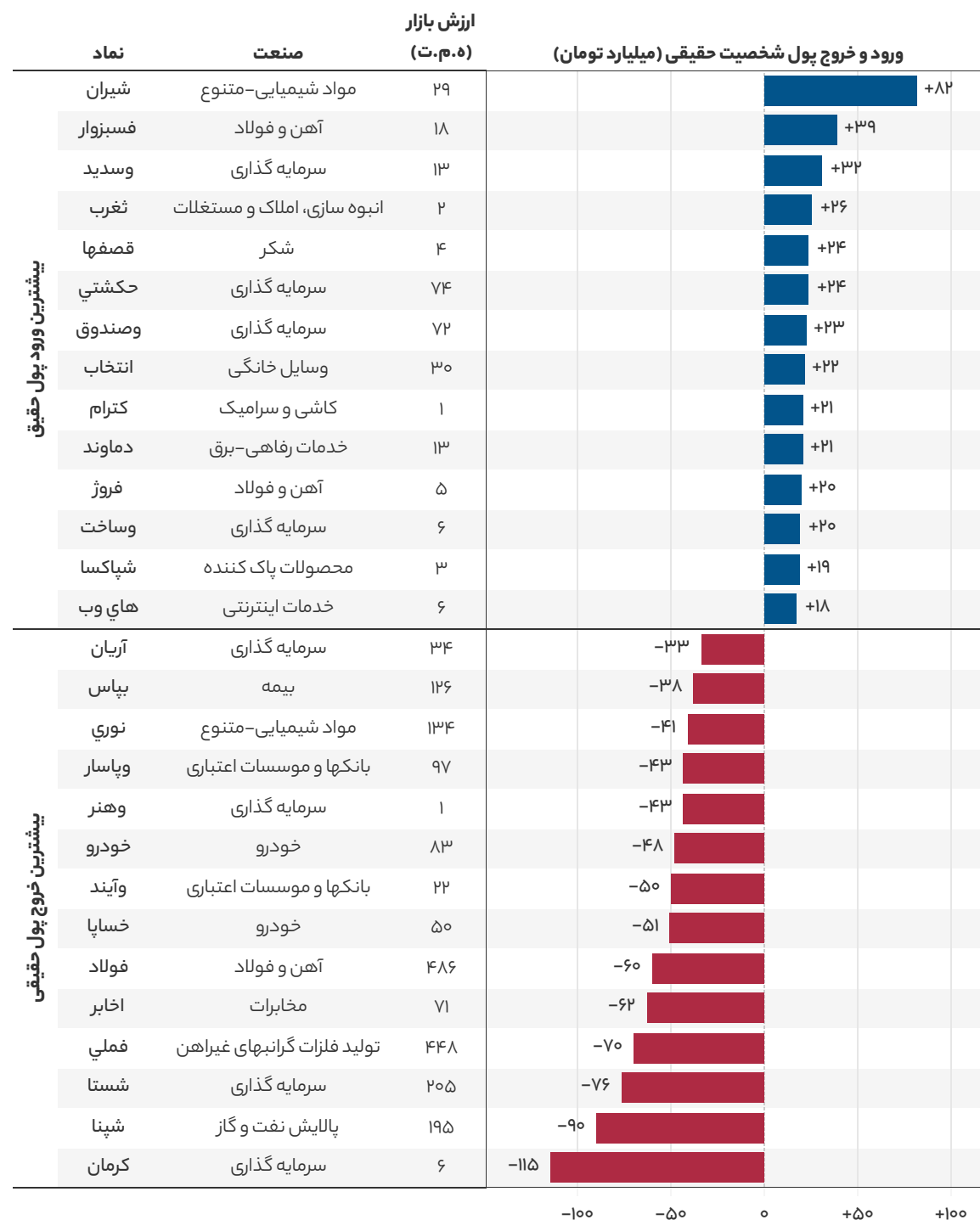
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

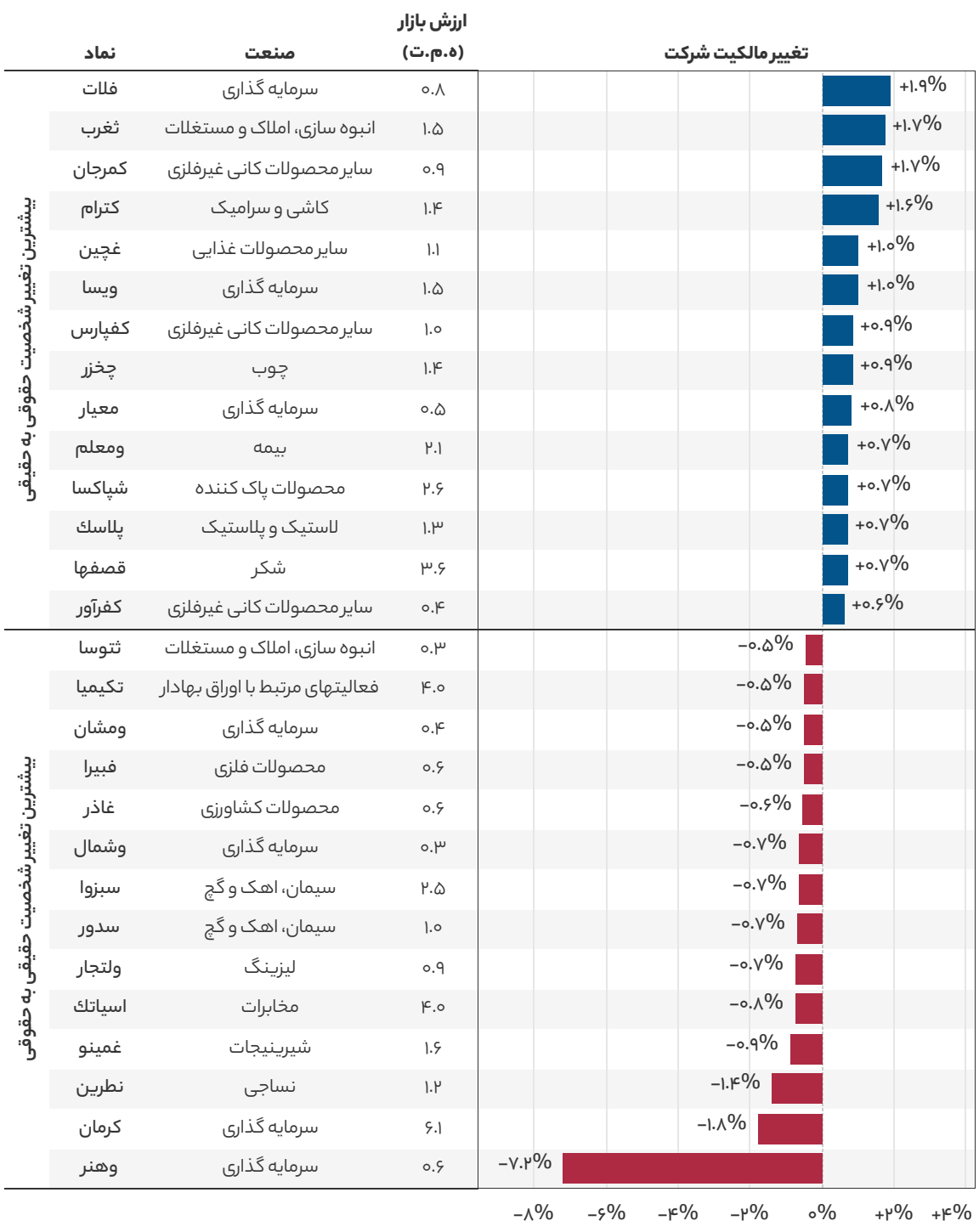
ورود و خروج پول حقیقی

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



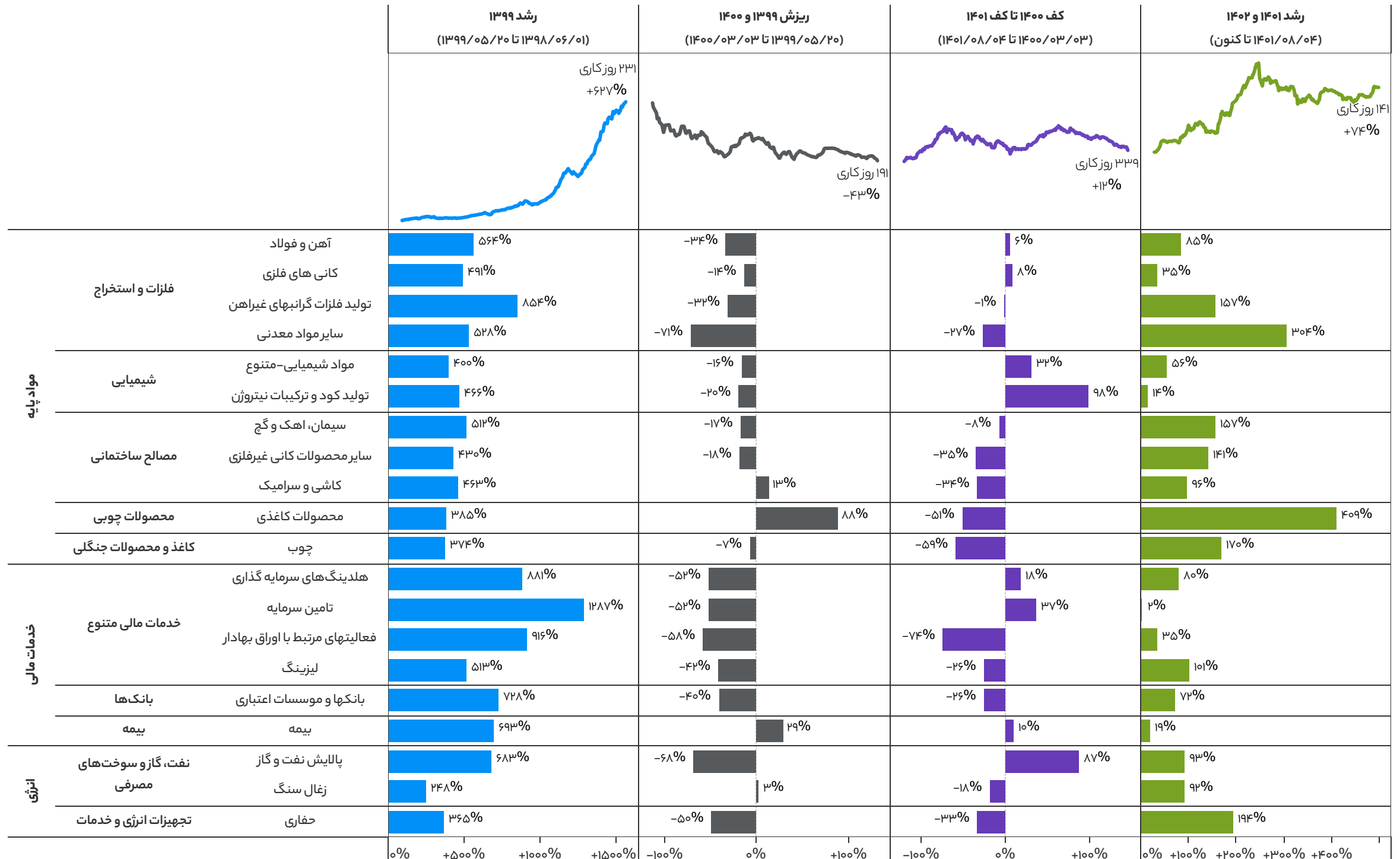
تغییر مالکیت شرکت

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



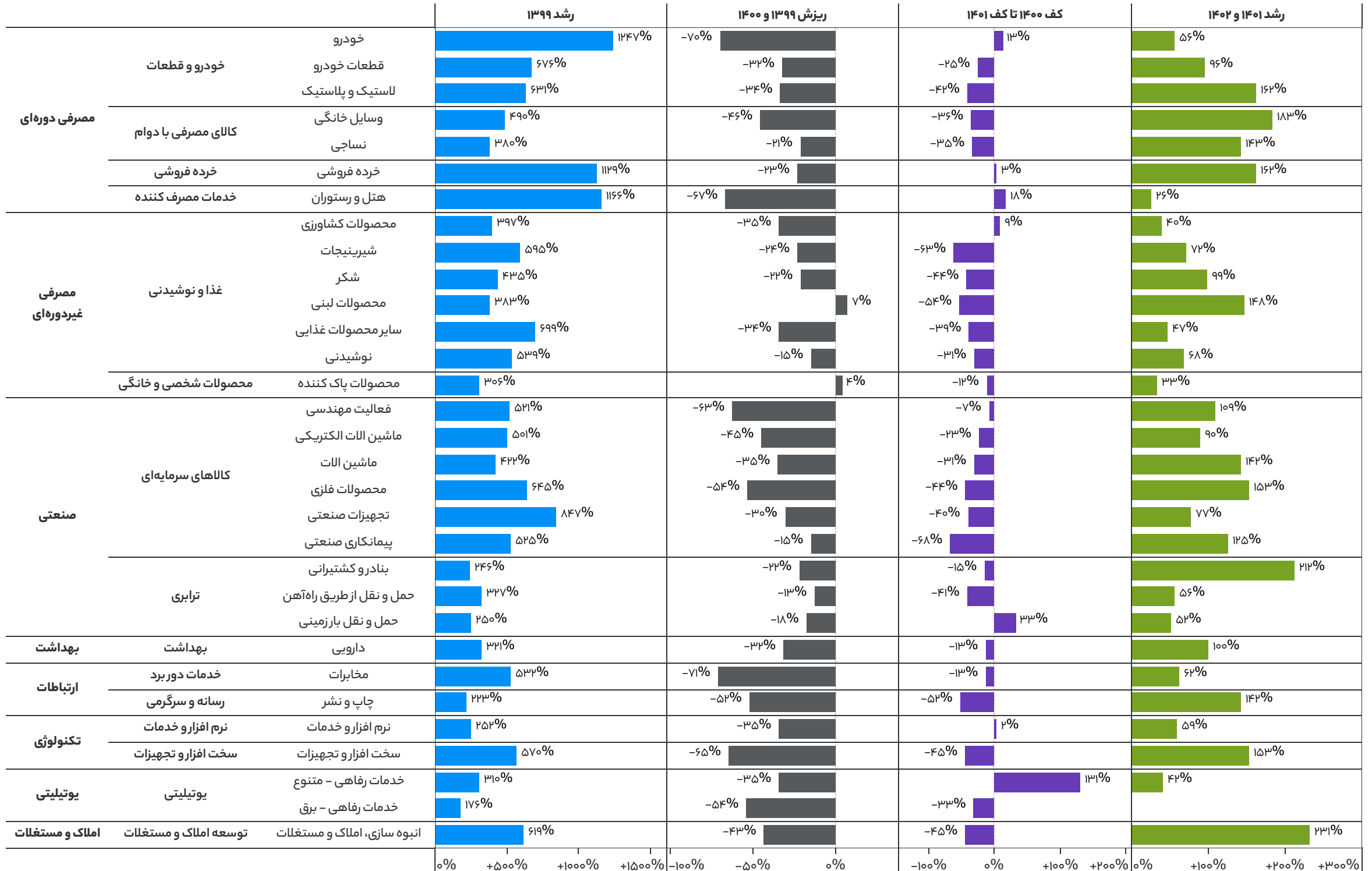
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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



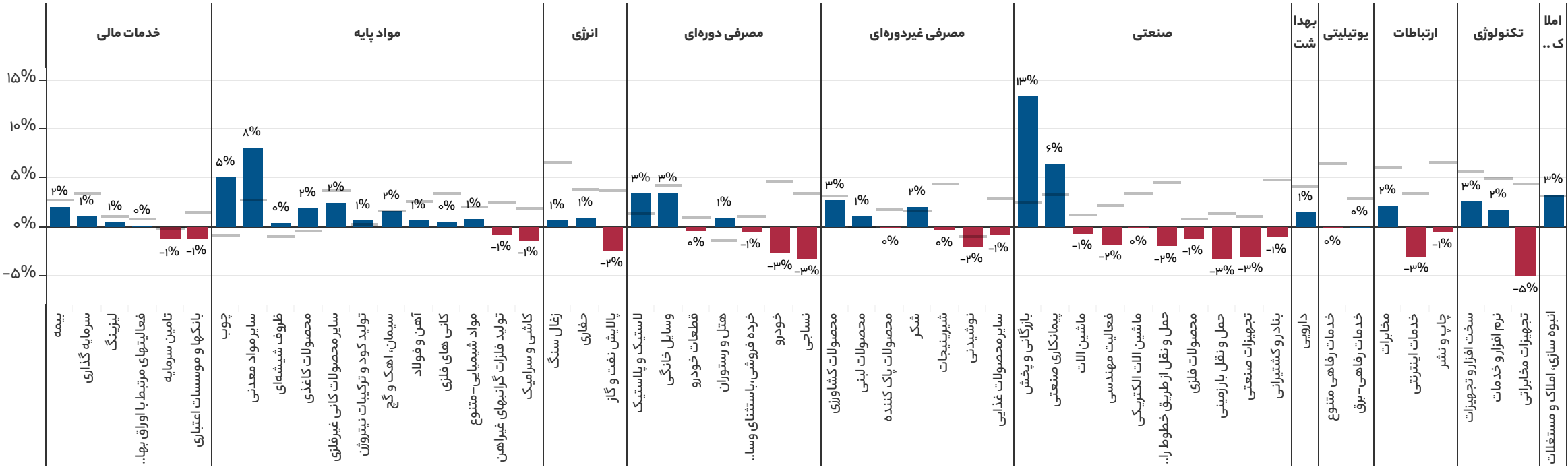


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



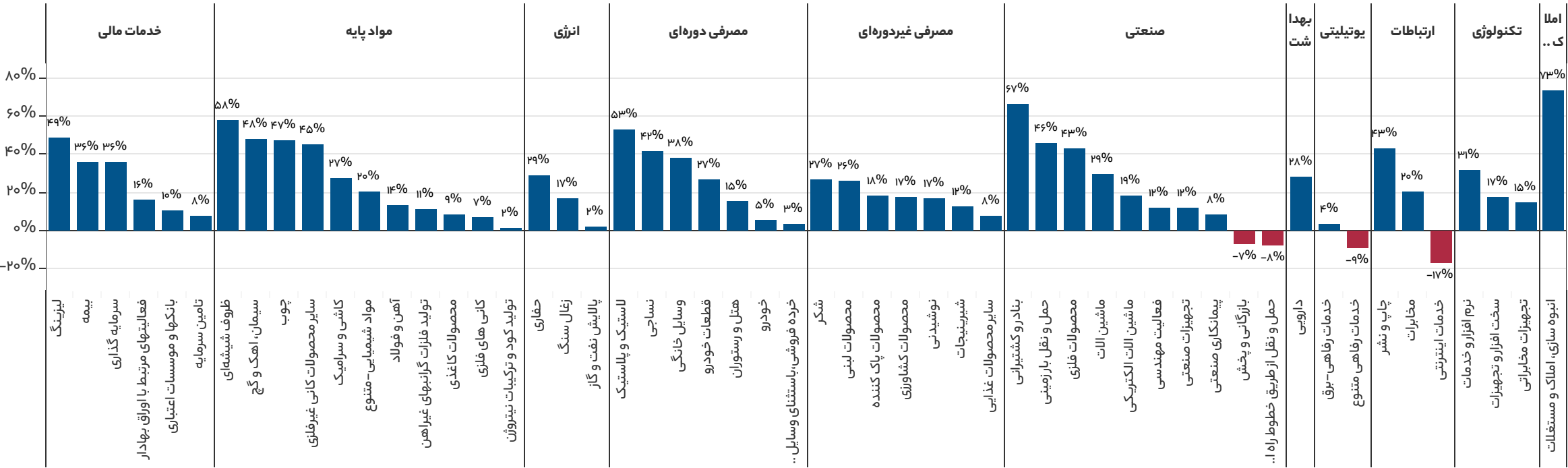
بازده صنايع از ابتدای هفته

(مرتب شده براساس سكتور، بازده تعديل شده، بازده هفته گزارش با نمودار ميله‌اي و بازده هفته گذشته با خط هاي خاكستري رنگ نشان داده شده‌است)



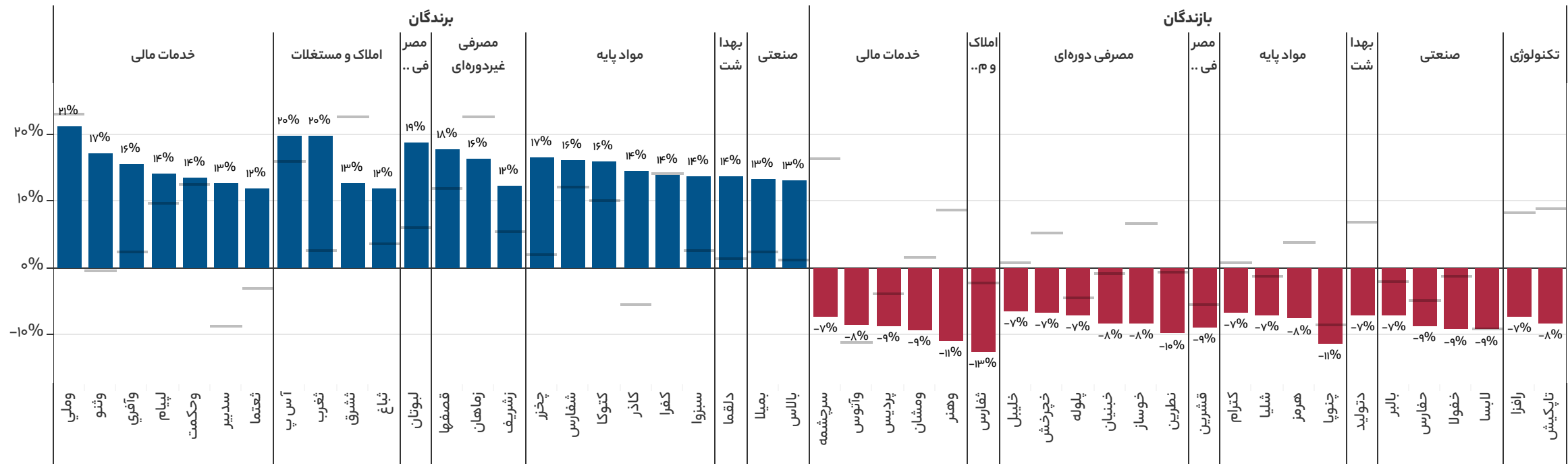
بازده صنايع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سكتور، بازده تعديل شده)



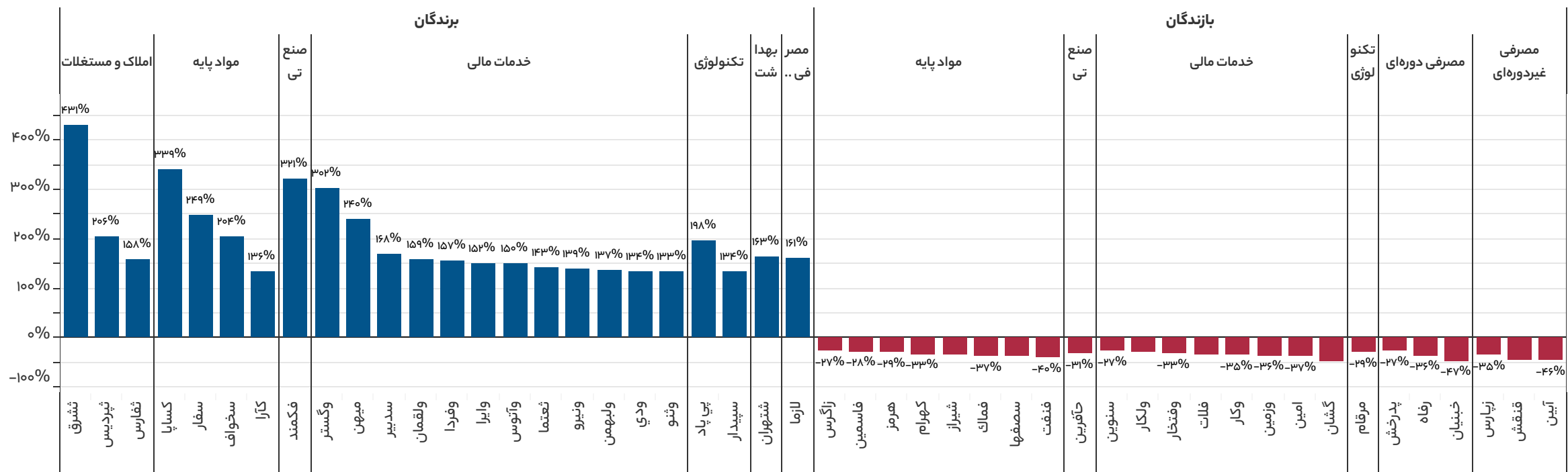
برندگان و بازندگان هفته

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



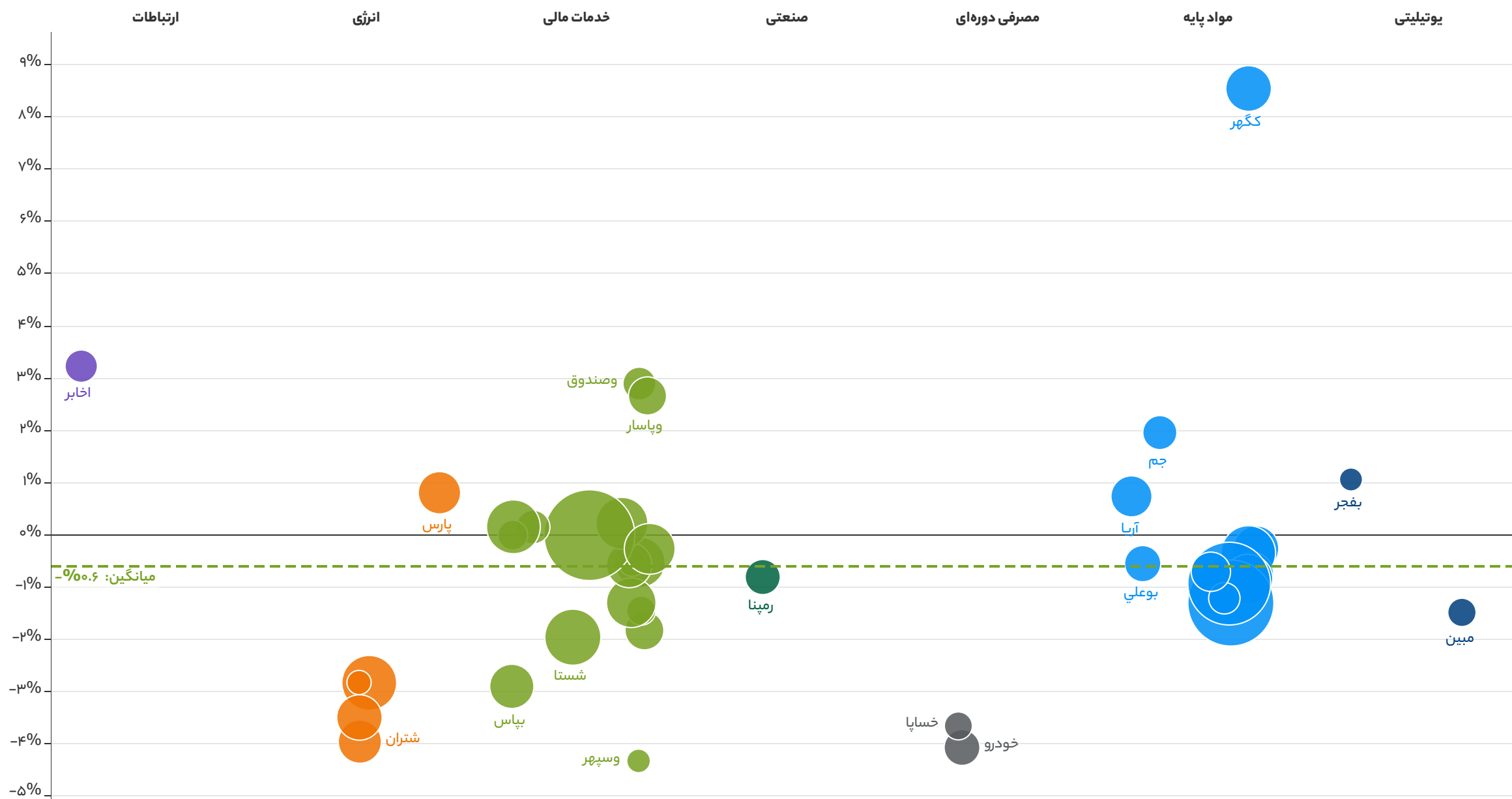
برندگان و بازندگان سال

(پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین 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، بازده تعدیل شده، اندازه دایره بر اساس ارزش بازار، میانگین بازدهی بر اساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم

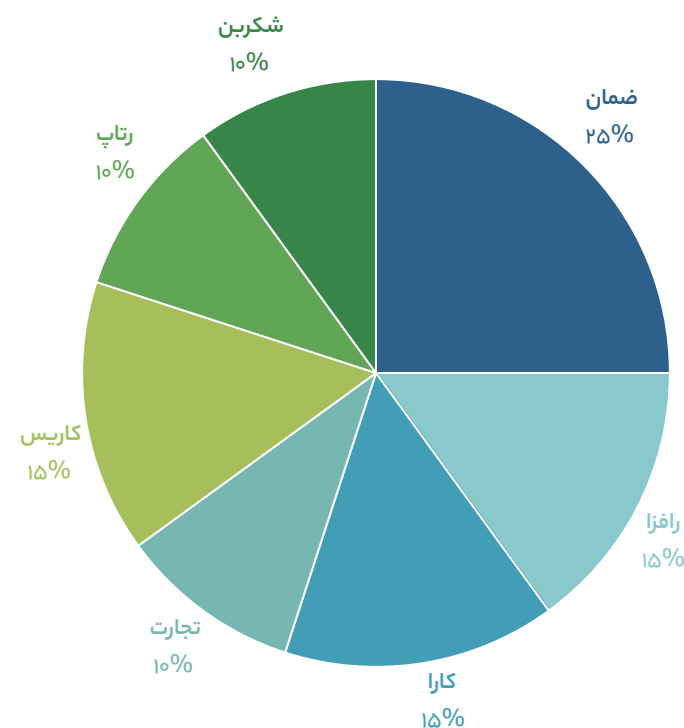


وسمهر	۴۳٪
خودرو	۴۰.۱٪
شتان	۴۰.۰٪
خسپا	۳۷٪
شبندر	۳۵٪
پپاس	۲۰.۹٪
شپنا	۲۰.۸٪
شبریز	۲۰.۸٪
شستا	۲۰.۰٪
ومعادن	۱۸.۸٪
مبین	۱۵٪
وگعدیر	۱۴٪
فولاد	۱۳٪
وبملت	۱۳٪
فخوز	۱۲٪
فملی	۹٪
کچاد	۸.۸٪
رمپنا	۸.۸٪
مارون	۸.۷٪
شپدیس	۸.۷٪
وامید	۶٪
یوعلی	۵٪
وغدیر	۵٪
وتجارت	۵٪
کگل	۳٪
پارسان	۳٪
نوری	۳٪
فارس	۰٪
تاسیکو	۰٪
حکشتی	۲٪
تاپیکو	۲٪
میدکو	۲٪
آریا	۱.۷٪
پارس	۱.۸٪
بفجر	۱.۱٪
چم	۲.۰٪
وپاسار	۲.۷٪
وصندوق	۲.۹٪
اخابر	۳.۲٪
کگهر	۸.۶٪
بازده هفته گذشته	



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۵۳۴	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۶,۲۵۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و سود مناسب زیر مجموعه‌ها	۷,۰۰۰	شکربن	
۱۵%	۲۲,۷۸۱	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	کاریس	
۱۰%	۲,۳۰۷	وضعیت ارزندگی مناسب و پتانسیل تجدید ارزیابی	۳,۰۰۰	تجارت	بلند مدت
۱۵%	۱۵,۴۸۰	تغییر فرمول درآمدی و سود مناسب	۱۸,۰۰۰	رافزا	
۱۵%	۱۶,۳۲۰	دارا بودن پورتفو بدون ریسک و سود بالاتر نسبت به سایر صندوق‌های درآمد ثابت	-	کارا	
۲۵%	۱۶,۲۷۹	جهت افزایش متنوع سازی سبد و کاهش ریسک سبد	-	ضمان	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود بعد از اصلاحی موقت تا حوالی محدوده مشخص شده، روند صعودی تا حوالی ۲,۲۶۰ هزار واحد طی کند.

توضیحات تحلیل



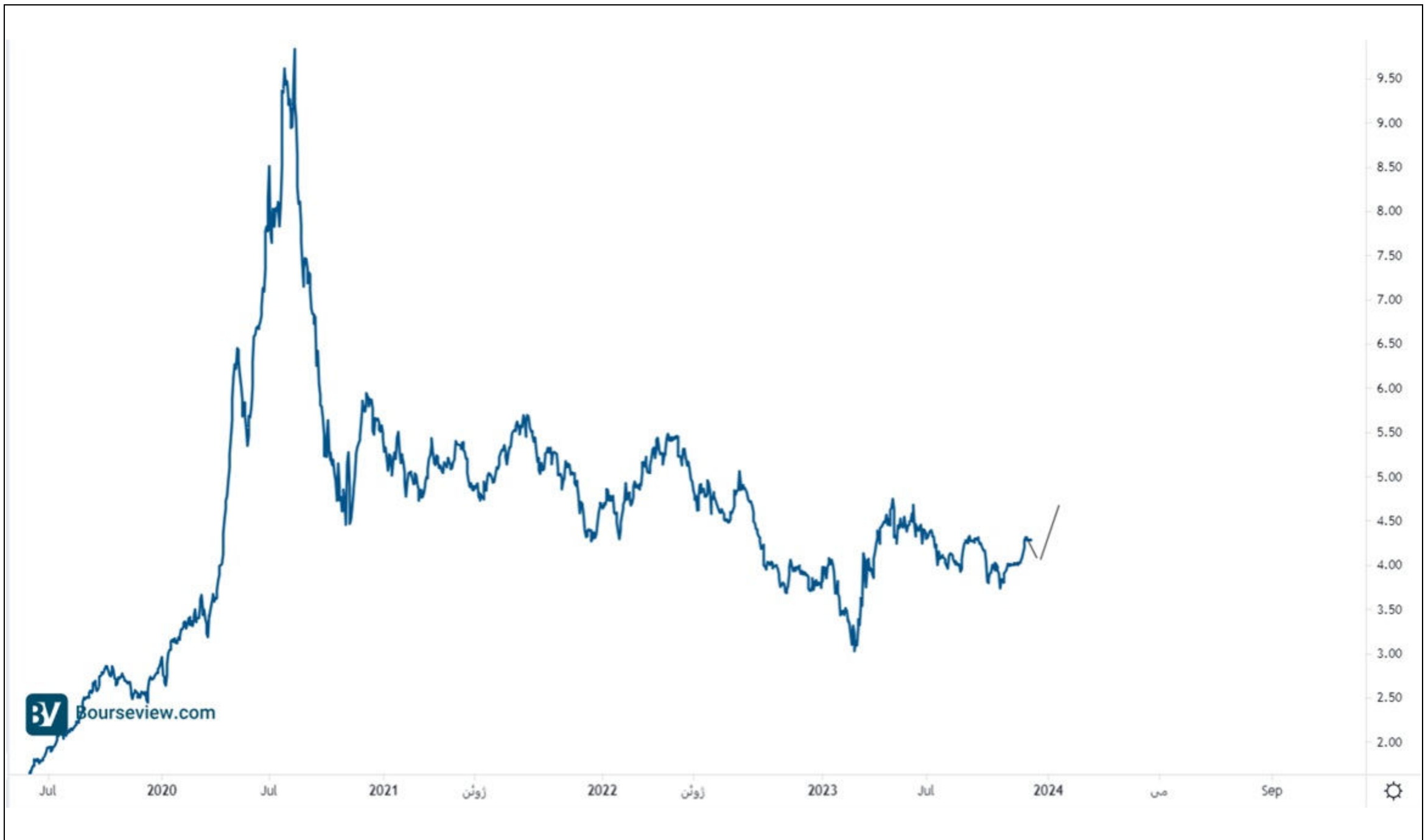
مادامی که خط روند ترسیم شده حفظ می‌شود، انتظار می‌رود روند صعودی تا حوالی ۷۸۰ هزار واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین محدوده مقاومتی شاخص هم وزن در تصویر مشخص شده است. انتظار می‌رود در صورت عدم عبور از این محدوده مقاومتی، روندی اصلاحی تا حوالی کف کانل ترسیم شده داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود بعد از اصلاحی موقت، مسیر صعودی را مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



هم اکنون در محدوده حمایتی مهمی است. باید دید واکنش به محدوده حمایتی مشخص شده به چه صورت است.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مدتی در ناحیه مشخص شده در نوسان باشد.

توضیحات تحلیل



(تایم فریم ۴۵ دقیقه). محدوده ۲۰۱۷ - ۲۰۰۸ دلار، مشخص‌کننده دو سناریو قرمز و آبی رنگ می‌باشد

توضیحات تحلیل



هم‌اکنون در حوالی مقاومت ۷۷ دلاری است و در صورت عبور از این محدوده انتظار می‌رود رشدی تا حوالی ۸۲ دلار تجربه کند. در غیر این صورت انتظار می‌رود به حوالی کف قبلی و ۷۰ دلار بازگردد.

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 می‌پردازد.

بخش، سه معیار برای P/E آینده‌نگر 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 نسبت‌های P/E با سود تقسیمی برآوردی مجمع پیش رو شرکت تعدیل شده‌اند.

همچنین در این بخش معیاری برای سنجش ارزشگذاری نسبی سهام، توسط تیم تحلیل گری کاریزما به نام امتیاز Z نسبت P/E آینده‌نگر ۴ فصله طراحی شده که برای هر شرکت به صورت مجزا تهیه گردیده است. هدف از طراحی این معیار، مقایسه نسبت P/E آینده‌نگر ۴ فصله با نسبت P/E آینده‌نگر تاریخی سهم می‌باشد. 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 دهنده‌ی ارزان بودن نسبی سهم و امتیاز Z بالا نشان دهنده‌ی گران بودن نسبی سهم می‌باشد. همچنین دیتای تاریخی استفاده شده برای محاسبه این معیار، در صورت معامله شدن سهم ۵ سال می‌باشد.

همچنین دسته‌بندی سهم‌های گزارش شده بر اساس سکتور و فعالیت شرکت می‌باشد و ترتیب شرکت‌ها نیز بر اساس ارزش بازار خواهد بود.

بدیهی است که معیار ذکر شده یک روش آماری بوده و بسیاری از عوامل تاثیرگذار بر نسبت P/E را در نظر نمی‌گیرد. همچنین لازم به ذکر است که استفاده از نسبت P/E به تنهایی برای تعیین ارزشگذاری سهام نمی‌تواند روشی قابل اتکایی باشد و بسته به شرایط، سایر روش‌ها نیز باید مدنظر سرمایه‌گذاران 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 سرمایه‌گذاری کاریزما مسئولیتی در خصوص صحت اطلاعات مزبور بر عهده نخواهد داشت.

جداول یا نمودارهای پیش‌رو به منظور پیشنهاد خرید یا فروش هیچ گونه اوراق بهادار نبوده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در برابر معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش صورت گیرد، هیچ گونه مسئولیتی نمی‌پذیرد.



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 شیمیایی	الفین	مارون	۱۲	۱۲۷.۸	-۱%	۱۵,۹۸۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۳	۷.۵	۷.۶	-۱.۹				
		آریا	۱۲	۱۱۱.۸	+۱%	۸,۱۳۰	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۹	۶.۳	۶.۹	-۰.۷				
		جم	۱۲	۷۶.۵	+۲%	۴,۲۵۲	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۶	۴.۰	۴.۴	-۴.۱				
		شگویا	۱۲	۴۱.۰	+۱%	۱,۷۱۳	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۶.۲	۴.۹	۶.۳	+۰.۰				
		جم پیلین	۱۲	۳۶.۸	-	۱۸,۳۷۵	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۵	۴.۷	۵.۸	+۰.۶				
		شکبیر	۱۲	۲۶.۴	+۳%	۷,۳۴۰	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۶	۳.۰	۳.۴	-۸.۱				
		شاراک	۱۲	۲۴.۶	-۲%	۳,۰۴۹	۹۶%	۴۱۹	۲۱۴	۲ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۱	۴.۰	۴.۰	-۱.۸				
		شغدیر	۱۲	۸.۸	+۲%	۶,۷۹۰	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۹	۴.۶	۶.۲	+۰.۲				
		شبصیر	۱۲	۷.۶	-۱%	۳,۰۳۵	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۵	۳.۸	۴.۵	-۰.۴				
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۳۴.۱	-	۱۴,۹۰۰	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۶	۷.۱	۸.۰	+۰.۷				
		بوعلی	۱۲	۸۶.۲	-۱%	۶,۰۰۵	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹.۳	۶.۹	۹.۳	+۴.۲				
		شیراز	۱۲	۳۳.۷	-۱%	۲,۲۰۰	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۱	۵.۰	۵.۷	+۱.۴				
	اوره	خراسان	۱۲	۲۵.۲	-	۱۴,۱۰۰	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۹.۰	۶.۹	۷.۹	+۳.۰				
		کرماشا	۱۲	۱۸.۹	-۲%	۱,۷۸۴	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۸	۴.۴	۴.۵	+۰.۷				
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۰.۸	-۴%	۱۲,۸۲۰	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۶	۶.۴	۶.۶	-۲.۲				
		شخارک	۱۲	۲۷.۶	-	۴,۶۰۰	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۷	۴.۸	۵.۷	-۱.۴				
		شغن	۱۲	۱۷.۱	-۴%	۵۵۱	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۷.۸	۵.۷	۵.۴	-۱.۷				
	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۲۸.۷	+۴%	۵۲۷	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۵	۸.۲	۷.۰	+۰.۳				
	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۴.۱	+۲%	۶۳۵	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۷.۴	۵.۷	۶.۱	+۰.۰				
		شصدف	۱۲	۲.۸	+۱۰%	۴,۰۷۰	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۱۰.۴	۶.۶	۸.۰	-۰.۶				
		شدوص	۱۲	۲.۳	-۲%	۲,۳۹۳	۹۳%	۱۹۳	۲۲۳	۲ Q	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۶.۵	۵.۰	۶.۲	+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				سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		نمودار امتیاز Z	گران‌تر →	ارزان‌تر ←
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	۱۴۰۱	۱۴۰۲		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(آینده نگر ۴ فصله)			
				سال مالی	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	(کل سال)	(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	۴۸۵.۶	-۱%	۶۰۷	۵۰%	۸۵	۶۶	۲ Q	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۴.۹	۴.۰	۴.۴	+۰.۷			
		فخوز	۱۲	۶۵.۲	-۱%	۳۴۳	۴۶%	۳۵	۲۷	۲ Q	۶۵	۱۰۹	+۶۸%	۵.۳	۲.۹	۳.۵	-۳.۷			
		فولاز	۱۲	۳۶.۹	+۳%	۱,۵۳۸	۷۶%	۱۹۹	۹۱	۲ Q	۱۷۴	۲۵۰	+۴۴%	۸.۹	۵.۸	۶.۹	+۱.۵			
		هرمز	۱۲	۳۱.۶	-۸%	۶۴۵	۵۱%	۱۱۲	۵۶	۲ Q	۱۱۷	۱۴۱	+۲۱%	۵.۵	۴.۳	۴.۶	-۱.۲			
		ارفع	۱۲	۲۹.۶	-۱%	۲,۴۷۰	۸۶%	۳۱۲	۳۰۹	۲ Q	۵۵۶	۶۴۸	+۱۷%	۴.۴	۳.۳	۴.۰	-۰.۲			
		فخاس	۱۲	۲۷.۳	-۲%	۱,۱۸۶	۴۹%	۱۰۰	۱۳۲	۲ Q	۲۴۲	۲۹۱	+۲۱%	۴.۹	۴.۰	۴.۳	-۳.۱			
	سنگ آهن	کگل	۱۲	۱۹۳.۷	-	۵۸۷	۶۵%	۴۹	۱۲	۲ Q	۵۸	۹۴	+۶۱%	۱۰.۱	۶.۱	۵.۹	-۲.۸			
		کچاد	۱۲	۱۶۰.۲	-۱%	۵۹۰	۷۱%	۸۴	۳۹	۲ Q	۸۳	۹۹	+۱۹%	۷.۱	۵.۶	۵.۸	-۰.۲			
		کگهر	۹	۱۳۶.۰	+۹%	۱,۸۱۳	۹۲%	۱۵۶	۱۴۸	۳ Q	۱۹۴	۱۶۳	-۱۶%	۹.۴	۱۲.۶	۱۰.۱	+۱.۰			
		کنور	۱۲	۲۳.۶	-	۱,۸۴۹	۹۴%	۱۴۷	۱۴۴	۲ Q	۲۲۴	۲۸۴	+۲۷%	۸.۳	۵.۹	۷.۸	-۰.۲			
	مس	فملی	۱۲	۴۴۸.۲	-۱%	۷۴۷	۴۵%	۸۳	۵۴	۲ Q	۱۳۴	۱۴۹	+۱۲%	۵.۶	۴.۷	۴.۵	-۰.۴			
	محصولات فلزی	کویر	۱۲	۱۲.۱	-۳%	۳۲۵	۱۲%	۴۶	۲۰	۲ Q	۴۵	۵۹	+۳۲%	۷.۲	۵.۶	۵.۶	-۰.۸			
		فجر	۱۲	۷.۰	-۱%	۸۳۱	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۴.۲	۳.۷	۴.۳	+۰.۱			
		فروژ	۱۲	۵.۱	+۶%	۴,۶۰۰	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۷.۱	۵.۲	۵.۵				
		فسپا	۱۲	۳.۲	+۶%	۸۲۵	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۲۶	-۱۶%	۵.۵	۶.۱	۵.۳	+۰.۴			
		فروس	۱۲	۲.۹	+۴%	۳۶۳	۶۶%	۴۸	۲۴	۲ Q	۴۹	۶۶	+۳۵%	۷.۴	۵.۲	۵.۸	+۰.۵			
		فروسیل	۱۲	۲.۲	-۱%	۱,۳۹۰	۶۴%	۱۱۵	۵۷	۲ Q	۱۶۷	۲۳۶	+۴۲%	۸.۳	۵.۶	۵.۷	-۱۱.۱			
		فولای	۱۲	۰.۹	-	۸۰۷	۲۱%	۵۹	۴۵	۲ Q	۶۹	۷۶	+۱۰%	۱۱.۷	۱۰.۸	۱۲.۱	+۱.۵			
	آلومینیوم	فایرا	۱۲	۲۹.۱	-	۷۶۶	۳۹%	۷۳	۵۶	۲ Q	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۸.۹	۶.۱	۷.۸	+۱.۹			
	طلا	فرز	۹	۱۳.۷	-	۴,۵۷۰	۳۱۸%	۹۹۶	۶۷	۳ Q	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۶.۳	۶.۷	۳.۴	-۱.۴			
	سرب و روی	فئوال	۱۲	۳.۸	-۲%	۱,۱۱۱	۵۱%	۱۰۶	۶۱	۲ Q	۱۰۲	۱۴۱	+۳۸%	۱۰.۹	۷.۹	۹.۳	+۳.۲			
		کیمیا	۱۲	۱.۹	-	۶۴۴	۴۰%	۱۲۷	۱۲	۲ Q	۹۵	۱۲۱	+۲۸%	۶.۸	۵.۲	۴.۲	-۰.۳			
		فرزین	۱۲	۱.۵	+۶%	۵۰۷	۳۶%	۹۳	۲	۲ Q	۱۱۲	۱۷۰	+۵۱%	۴.۵	۲.۸	۲.۴	-۴.۱			
		فتوسا	۱۲	۱.۱	-۲%	۷۶۱	۳۲%	۱۴۹	۳۵	۲ Q	۱۹۵	۲۱۴	+۹%	۳.۹	۳.۳	۲.۷	-۱.۸			
	سایر مواد معدنی	کتوسعه	۹	۲.۳	+۵%	۲,۱۰۵	۹۷%	۱۱۱	۱۱۴	۳ Q	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۲.۱	۱۱.۴	۹.۰				
	سایر کانی‌های فلزی	کمنگنز	۱۲	۲.۲	+۱%	۱,۴۸۹	۶۴%	۱۱۴	۷۴	۲ Q	۱۸۴	۲۱۸	+۱۹%	۸.۱	۶.۶	۶.۳	-۱.۱			

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			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		ارزان‌تر ←	نمودار امتیاز Z	گران‌تر →	
				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)				
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوه	۱۲	۹۰.۵	-	۱۴,۶۷۵	۹۵%	۱,۵۸۴	۱,۲۸۲	۲ Q	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۱	۴.۴	۵.۳	+۰.۹				
		سفار	۱۲	۸۰.۲	+۱%	۳۵,۲۱۹	۹۵%	۱,۰۳۹	۸۴۰	۲ Q	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۵.۱	۱۸.۶	۲۱.۷	+۱.۴				
		سآبیک	۱۲	۸۰.۲	-	۲,۷۶۶	۹۳%	۲۴۹	۲۴۶	۲ Q	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۷.۱	۵.۰	۶.۵	+۲.۳				
		سخوز	۱۲	۶۰.۶	+۵%	۴,۷۱۵	۹۰%	۷۱۹	۲۸۴	۲ Q	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴۰.۷	۳۰.۳	۳۰.۳	-۰.۸				
		سمازن	۹	۶۰.۴	+۴%	۲,۶۰۹	۸۱%	۲۹۰	۲۹۸	۳ Q	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۶.۶	۵.۶	۵.۱	+۱.۷				
		ساروم	۱۲	۴۰.۷	+۱%	۴,۷۳۱	۹۶%	۵۵۴	۴۵۱	۲ Q	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۹	۳.۹	۵.۰	-۰.۱				
		سهگمت	۱۰	۴۰.۵	+۲%	۶,۱۹۹	۹۸%	۶۴۸	۷۷۸	۳ Q	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۶.۱	۴.۰	۳.۸	-۰.۱				
		سفانو	۱۲	۴۰.۲	-	۸,۳۹۸	۹۷%	۱,۱۷۰	۶۹۵	۲ Q	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۵.۰	۳.۳	۳.۸	+۰.۶				
		سرود	۱۲	۴۰.۰	+۴%	۴,۹۳۱	۹۶%	۴۹۶	۴۷۲	۲ Q	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۷	۴.۲	۵.۱	+۰.۵				
		سصوفی	۱۲	۳۰.۶	-	۳,۲۲۸	۹۰%	۳۶۸	۳۳۷	۲ Q	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۵.۹	۴.۰	۵.۳	+۰.۷				
		سشمال	۹	۲۰.۹	+۴%	۱,۷۲۱	۸۹%	۱۷۰	۲۱۸	۳ Q	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۶.۳	۵.۰	۴.۸	+۰.۷				
		سبجنو	۱۲	۲۰.۸	-۳%	۷,۱۰۰	۹۶%	۵۷۳	۵۲۷	۲ Q	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۸	۵.۷	۶.۱	+۰.۰				
		سقاین	۱۲	۲۰.۳	-	۵۷۱	۹۷%	۳۷	۲۴	۲ Q	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۱.۷	۹.۷	۱۰.۰	+۰.۶				
		سبهان	۱۲	۲۰.۲	-۵%	۱۱,۰۲۱	۹۷%	۷۳۶	۷۴۹	۲ Q	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۲	۴.۸	۵.۰	-۰.۳				
		سغرب	۱۲	۲۰.۱	-	۴,۲۶۹	۹۲%	۳۹۰	۴۱۰	۲ Q	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۵.۰	۳.۳	۴.۰	-۰.۷				
		سقاش	۱۲	۱۰.۹	-۲%	۹,۴۰۵	۹۵%	۱,۱۶۱	۵۷۴	۲ Q	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۶	۴.۲	۴.۷	-۰.۸				
		کاشی و سرامیک	سخرز	۱۲	۱۰.۹	-۶%	۳,۷۲۰	۹۵%	۳۵۸	۲۶۸	۲ Q	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۷	۵.۴	۶.۵	+۰.۱			
کحافظ	۱۲		۳۰.۸	-۱%	۷۳۸	۱۰%	۸۲	۶۱	۲ Q	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۵	۳.۴	۳.۷	-۲.۴					
کساوه	۱۲		۳۰.۱	-۱%	۵,۹۲۰	۷۱%	۷۴۷	۲۹۰	۲ Q	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۵.۹	۳.۹	۳.۹	-۲.۱					
فرآورده‌های نسوز	کلوند	۱۲	۱۰.۹	-۱%	۴,۶۵۰	۹۵%	۵۰۴	۳۸۱	۲ Q	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۶.۲	۴.۷	۵.۳	+۰.۰					
	کپشیر	۱۲	۲۰.۰	-	۱,۳۰۹	۸۸%	۸۷	۱۰۰	۲ Q	۱۹۰	۱۶۷	-۱۲%	۶.۹	۷.۱	۷.۰	+۰.۴					

۳ + ۲ + ۱ ۰ -۱ -۲ -۳



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

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	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)						
انرژی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۹۴.۸	-۳%	۸۵۸	۶۳%	۱۷۰	۱۰۱	۲ Q	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴.۹	۴.۸	۵.۰	+۱.۶						
		شبندر	۱۲	۱۳۳.۵	-۳%	۹۹۴	۷۶%	۳۰۴	۷۷	۲ Q	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴.۱	۵.۶	۳.۸	+۱.۴						
		شتران	۱۲	۱۲۰.۸	-۴%	۴۳۹	۳۱%	۱۰۹	۴۵	۲ Q	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۴	۴.۲	۴.۰	+۱.۱						
		شبریز	۱۲	۳۸.۲	-۳%	۱,۲۷۳	۷۶%	۳۳۵	۹۳	۲ Q	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۵.۲	۴.۹	۴.۴	-۰.۲						
		شاوان	۱۲	۱۶.۶	-۲%	۲,۰۸۰	۷۳%	۵۵۵	۱۸۳	۲ Q	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۱	۸.۴	۴.۴	+۰.۶						
	نفت، گاز و سوخت های مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۱۸.۱	+۱%	۲۴۸	۸۸%	۳۱	۱۰	۲ Q	۳۵	۴۶	+۳۰%	۷.۰	۵.۰	۴.۸	-۲.۹					
		روانکار	شبهرن	۱۲	۲۷.۴	-۱%	۲,۲۹۲	۸۹%	۳۳۸	۱۷۷	۲ Q	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۱	۵.۷	۵.۶	+۱.۵					
			شسپا	۱۲	۲۷.۳	-۲%	۴۸۸	۶۷%	۷۴	۴۵	۲ Q	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۲	۴.۰	۴.۴	+۰.۰					
			شنفت	۱۲	۱۶.۷	-۳%	۸۳۵	۸۲%	۱۰۸	۶۶	۲ Q	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۷.۹	۷.۶	۸.۴	+۰.۴					
			شرانل	۱۲	۱۵.۲	-	۷,۶۱۵	۸۵%	۱,۴۴۱	۵۷۶	۲ Q	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴.۵	۳.۸	۳.۶	-۰.۵					
			زغال سنگ	کپرور	۱۲	۲.۵	+۳%	۱,۴۳۸	۵۹%	۱۶۹	۸۳	۲ Q	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۷.۰	۵.۱	۵.۲	-۰.۶				
		کطبس		۱۲	۱.۶	+۲%	۱,۹۸۴	۶۲%	۱۹۳	۱۲۲	۲ Q	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۶.۶	۵.۶	۵.۴	-۱.۹					
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۷	-۲%	۵۳۷	۹۴%	۴۷	۲۷	۳ Q	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۰	۸.۹	۷.۲	-۴.۳					
			تنوین	۱۲	۸.۶	-۳%	۲۲۴	۶۳%	۴۸	۱۷	۲ Q	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴.۵	۳.۲	۳.۳	-۲.۸					
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۵	+۲%	۷,۶۵۰	۹۱%	۸۸۸	۵۰۵	۲ Q	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۵.۸	۳.۵	۴.۰	-۰.۸					
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۴	+۱۷%	۶,۸۰۵	۹۶%	۳۲۲	۱۷۶	۲ Q	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۶.۸	۹.۲	۱۰.۷	+۰.۲					

گزارش

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	۱۲.۵	-	۵,۲۰۰	۷۶%	۴۹۵	۳۳۹	۲ Q	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۶.۱	۴.۴	۴.۶	+۰.۰				
		دلر	۱۲	۷.۳	+۲%	۳,۲۵۰	۹۶%	۳۵۲	۲۶۴	۲ Q	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۶.۶	۵.۹	۶.۴	+۰.۹				
		دپارس	۱۲	۶.۲	+۳%	۶,۴۸۰	۹۸%	۸۰۳	۲۶۴	۲ Q	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۶.۸	۵.۸	۵.۰	+۰.۲				
		دالبر	۱۲	۶.۰	+۲%	۶۳۴	۶۹%	۷۵	۵۰	۲ Q	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۵.۶	۴.۵	۴.۵	-۱.۱				
		دفرا	۱۲	۵.۵	+۴%	۳,۹۱۷	۷۹%	۳۹۳	۲۰۱	۲ Q	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۸	۶.۵	۶.۳	+۱.۸				
		دفارا	۱۲	۵.۴	-	۳,۳۹۲	۹۹%	۴۵۲	۱۵۲	۲ Q	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۶.۰	۵.۱	۴.۵	+۰.۲				
		هجرت	۱۲	۴.۵	+۱%	۲,۸۳۵	۹۵%	۴۰۶	۲۳۶	۲ Q	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۲	۴.۱	۴.۳	-۰.۶				
		دقاضی	۱۲	۴.۴	+۵%	۲,۵۶۵	۹۶%	۲۷۷	۱۷۷	۲ Q	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۸	۵.۲	۵.۶	+۰.۰				
		دتوزیع	۱۲	۴.۲	+۱%	۲,۳۳۵	۹۴%	۴۴۹	۱۰۳	۲ Q	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۷.۰	۵.۲	۵.۰	-۰.۳				
		کاسپین	۱۲	۲.۷	+۳%	۱,۹۳۴	۹۵%	۲۳۴	۱۵۴	۲ Q	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۶.۱	۴.۷	۵.۲	-۰.۲				
		درازک	۱۲	۲.۶	-۱%	۱,۲۳۸	۱۰۴%	۲۱۳	۲۷	۲ Q	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۵	۳.۸	۳.۴	-۶.۸				
		دکپسول	۱۲	۲.۵	-	۸,۲۸۰	۹۲%	۹۲۱	۶۰۳	۲ Q	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۷.۸	۶.۰	۷.۰	+۱.۹				
		درازی	۱۲	۲.۰	-۲%	۱,۹۹۵	۶۷%	۲۷۳	۱۱۰	۲ Q	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۵.۸	۵.۰	۴.۴	-۱.۷				

مقیاس امتیاز Z: ۱۴۰۲/۰۹/۲۴



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 →	نمودار امتیاز Z	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)			
غذا و نوشیدنی مصرفی غیردوره‌ای	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۸.۱	-۲%	۲,۶۸۵	۵۵%	۲۱۳	۲۰۲	۲ Q	۶۸۹	+۳۹%	۵.۴	۳.۷	۳.۹	-۴.۱				
		سیمرغ	۹	۴.۶	+۴%	۳,۵۴۶	۲۴%	۳۹۱	۳۳۷	۳ Q	۸۹۸	+۶۵%	۶.۵	۴.۶	۳.۸	-۱.۶				
		زفکا	۱۲	۲.۸	+۱%	۱,۸۴۴	۹۱%	۱۵۵	۱۰۵	۲ Q	۲۶۵	+۴۷%	۱۰.۲	۶.۷	۸.۳	+۰.۶				
		تلیسه	۱۲	۲.۱	-	۴۲۰	۹۲%	۲۵	۲۹	۲ Q	۴۸	+۴۱%	۱۲.۴	۸.۵	۱۳.۴	+۰.۲				
		زگلدشت	۱۲	۱.۷	-۱%	۲,۴۷۵	۹۵%	۹۶	۱۱۰	۲ Q	۲۸۵	+۳۱%	۱۱.۳	۸.۳	۹.۲	+۰.۰				
		زملارد	۱۲	۱.۷	+۹%	۲,۰۹۶	۹۴%	۳۳	۶۳	۲ Q	۱۷۹	+۲۳%	۱۴.۴	۱۱.۴	۱۱.۳	-۲.۵				
		زشریف	۹	۱.۵	+۱۲%	۶۳۵	۷۶%	۴۸	۵۸	۳ Q	۱۱۱	+۴۰%	۸.۰	۶.۵	۵.۷	-۰.۷				
		زشگزا	۱۲	۱.۰	+۷%	۱,۰۳۷	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۸۹	+۷۴%	۹.۵	۵.۴	۸.۵	+۰.۳				
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۳.۳	-۳%	۱,۳۲۵	۶۰%	۱۶۱	۷۴	۲ Q	۳۱۲	+۳۸%	۵.۹	۳.۹	۴.۰	-۲.۴				
		غپینو	۱۲	۳.۴	-۱%	۳۷۹	۵۶%	۴۹	۲۵	۲ Q	۹۴	+۳۹%	۵.۶	۳.۹	۳.۹	-۱.۲				
		غسالم	۱۲	۲.۱	+۱%	۴۷۳	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۸۱	+۲۵%	۷.۳	۵.۸	۵.۰	-۰.۸				
		غمینو	۱۲	۱.۶	-۲%	۱,۰۴۱	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۲۴۵	+۴۹%	۶.۳	۴.۱	۴.۴	-۰.۲				
	محصولات لبنی	غگورش	۱۲	۱۴.۴	-۲%	۷۲۲	۵۴%	۱۲۶	۴۰	۲ Q	۸۶	+۳%	۸.۷	۸.۲	۷.۸	+۰.۳				
		غگلپا	۱۲	۱.۷	-۱%	۴,۵۳۰	۷۴%	۴۶۵	۲۲۳	۲ Q	۸۴۶	+۴۴%	۷.۷	۵.۲	۵.۴	-۰.۴				
		غشان	۱۲	۱.۲	+۳%	۷۱۵	۷۱%	۸۰	۲۶	۲ Q	۱۱۳	+۳۷%	۸.۷	۶.۲	۵.۹	-۰.۴				
		غگلستا	۱۲	۱.۲	-	۱,۹۰۵	۷۰%	۱۵۶	۴۹	۲ Q	۲۰۷		۹.۲							
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	کیمیاتک	۱۲	۶.۷	-	۱,۱۱۰	۶۴%	۱۰۲	۷۱	۲ Q	۱۶۷	+۱۶%	۷.۷	۶.۴	۶.۶	+۰.۳				
		قرن	۱۲	۶.۶	-	۱,۱۰۰	۶۱%	۱۱۰	۶۲	۲ Q	۲۰۰	+۴۰%	۷.۷	۵.۳	۵.۷	-۰.۶				
		شپاکسا	۹	۲.۶	+۱۰%	۲۸۴	۳۸%	-۲۴	۲۳	۳ Q	۶۱	+۳۲%	۶.۲	۵.۷	۳.۹	-۳.۳				

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

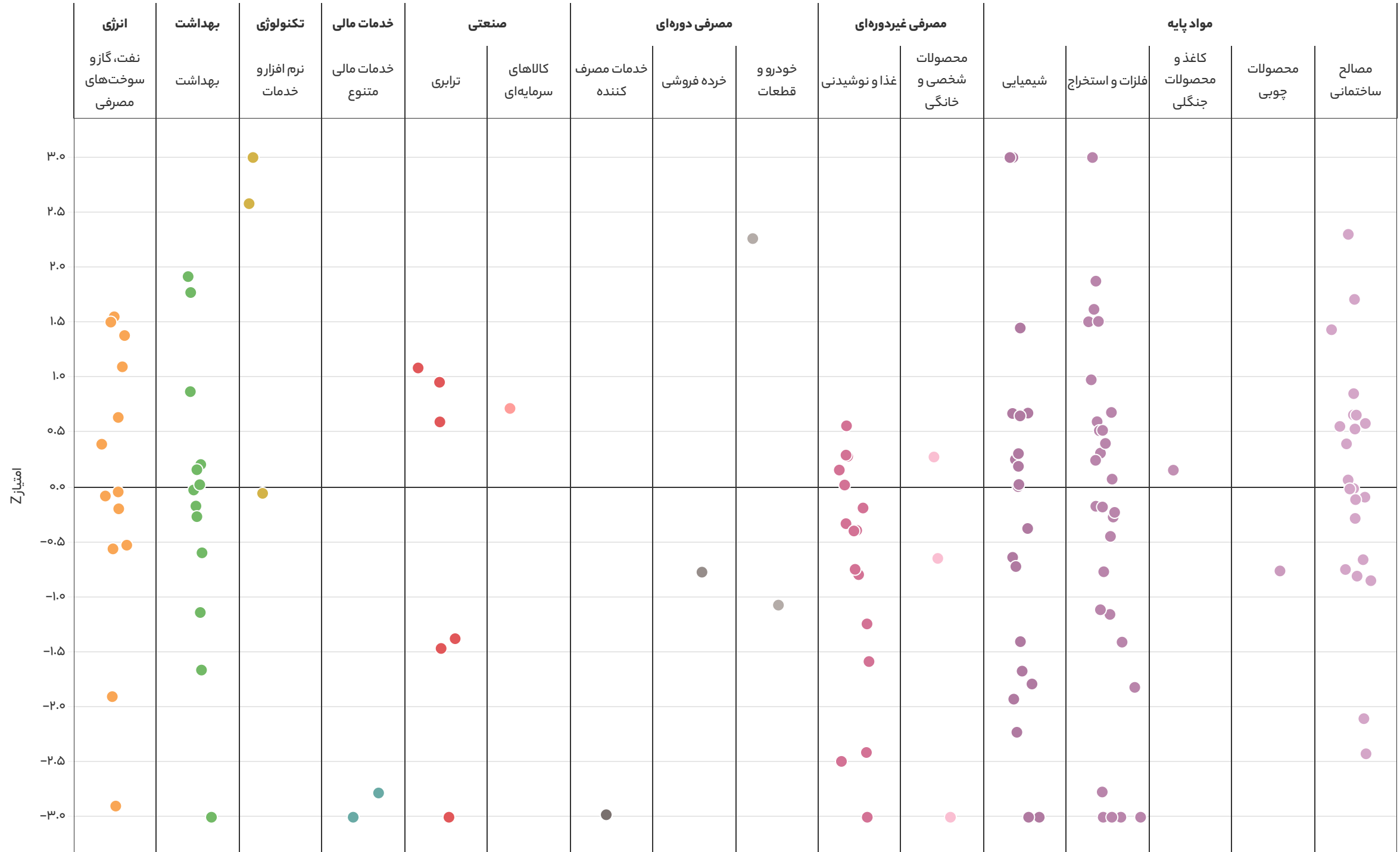


نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران‌تر →	نمودار امتیاز Z	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 (Z)				
صنعتی	بنادرو کشتیرانی	حزیر	۱۲	۷.۱	-۱%	۱,۹۶۲	۹۶%	۲۰۷	۱۹۸	۲ Q	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۶.۸	۴.۳	۶.۱	+۰.۶				
		حتاید	۱۲	۶.۶	+۱%	۵۴۷	۵۲%	۶۲	۴۳	۲ Q	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۵.۱	۳.۸	۳.۸	-۱.۴				
	ترابری	توریل	۱۲	۴.۰	-۲%	۵۷۱	۳۸%	۴۳	۱۸	۲ Q	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸.۶	۶.۶	۵.۸	-۱.۵				
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	حتآفرین	۱۲	۱.۹	-۴%	۲۵۲	۵۲%	۳۱	۱۳	۲ Q	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۱	۵.۴	۴.۵	-۶.۰			
			چپارسا	۶	۱.۵	-۲%	۶,۱۷۰	۸۹%	۶۳۱	۵۱۲	۳ Q	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸.۶	۷.۲	۶.۲	+۱.۰			
	کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۶	+۸%	۲۵۷	۳۱%	۲۶	۱۵	۲ Q	۲۰	۳۰	+۴۶%	۱۲.۷	۸.۷	۱۱.۹	+۰.۷			
سیم و کابل		بکابل	۱۲	۲.۸	-۴%	۲,۷۲۰	۶۱%	۲۵۰	۱۲۷	۲ Q	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۱	۴.۷	۴.۳					
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	تایرو تیوپ	۹	۵.۱	+۷%	۷۸۱	۷۵%	۲۵	۶۳	۳ Q	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۹.۰	۴.۸	۴.۷	-۱.۱				
		پلاستیک	۱۲	۰.۹	-۷%	۳,۹۱۰	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۸.۲	۱۸.۰	۲۱.۷	+۲.۳				
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۷	-	۷۳۸	۴۹%	۱۰۳	۴۷	۲ Q	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۵	۴.۰	۴.۰	-۰.۸			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	رافزا	۱۲	۱.۶	-۷%	۱,۵۵۵	۸۰%	۹۱	۹۹	۲ Q	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۱۱.۱	۹.۰	۱۱.۳	-۰.۱				

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

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما:

@CharismaTickReports

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

