

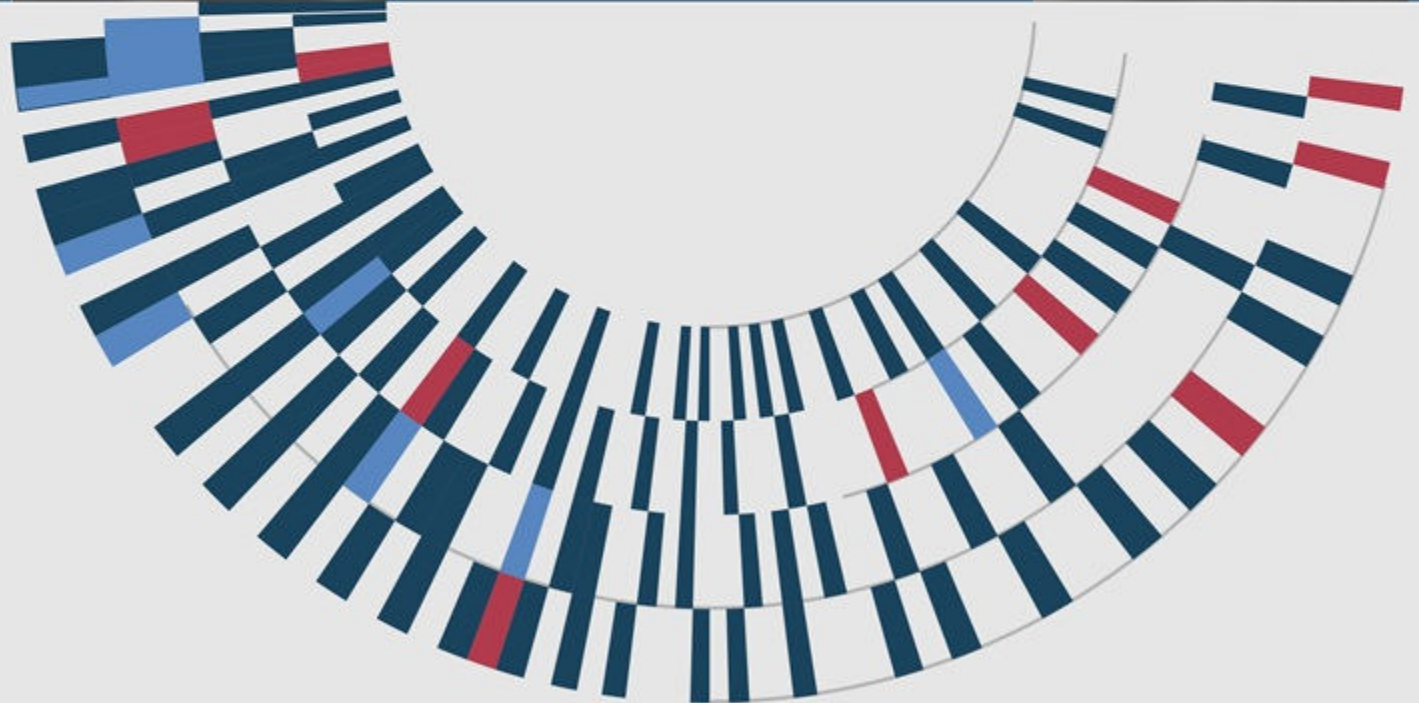
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۰ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۰۱

 CHARISMA





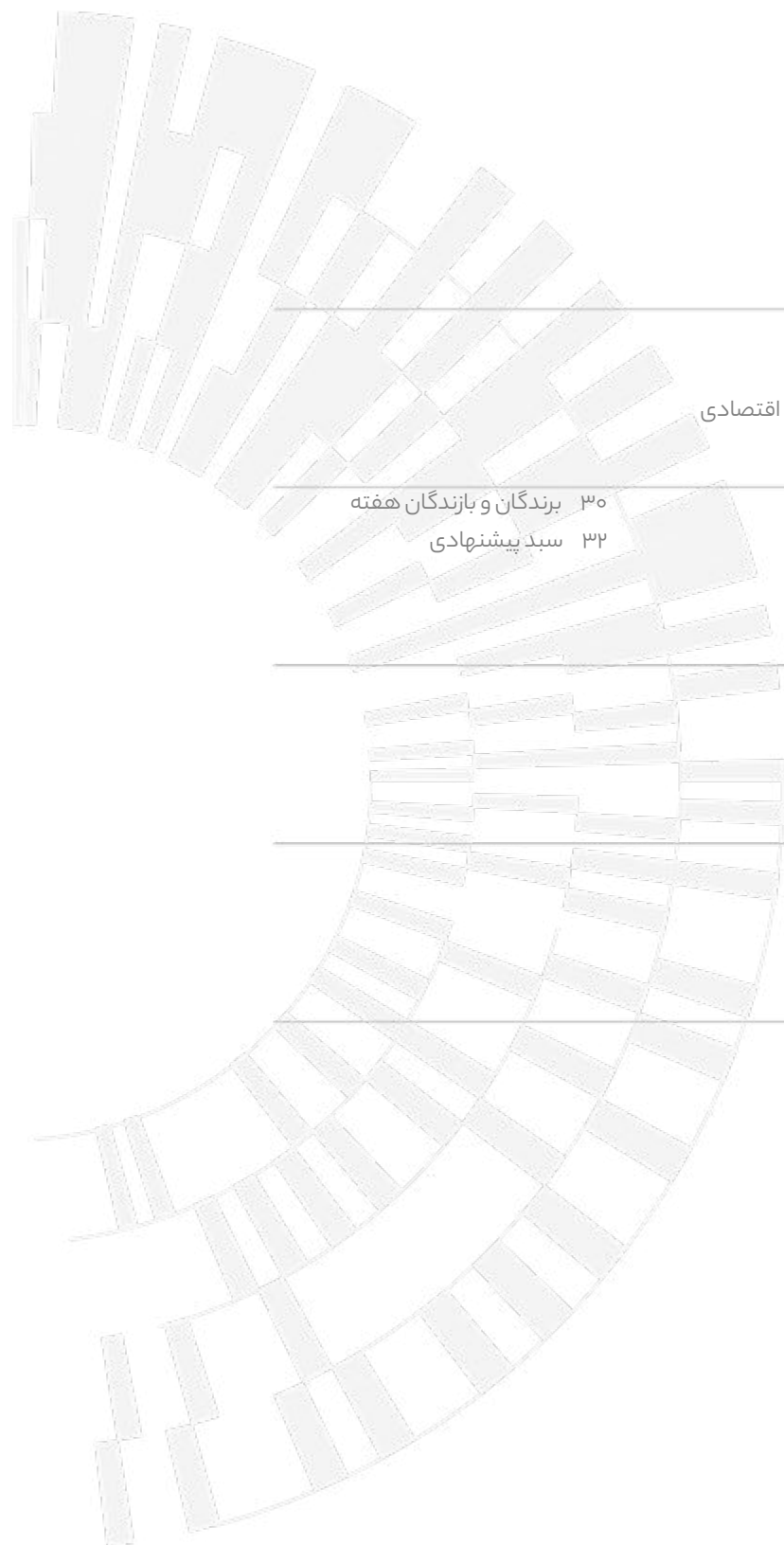
معرفی گزارش:

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



عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
طلا	بازار فارکس	دلار/انس	۲,۰۴۳	۱.۲%	فزر	-	۲,۰۶۹ ۱,۸۱۳	۱۲%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۵۷۶	۰.۶%	فملی	بموتو، فباهنر	۹,۳۴۱ ۷,۹۴۳	۲%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۳۱۵	۳.۶%	فایرا	فنوال	۲,۴۲۴ ۲,۰۷۱	۲%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۶۰۶	۳.۰%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزراین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۳,۴۴۴ ۲,۳۰۳	-۱۲%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۷۵	-	فاسمین، فسرب، فروی، فزراین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۲۹۶ ۲,۰۲۴	-۹%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۶۸	۰.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۸۴۳ ۳,۰۲۲	۵۴%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۲۵	۰.۷%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۶۲۵ ۲,۶۰۹	۳۵%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۹	-۱.۰%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۶۲۳ ۴۳۱	-۲%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۸۶۶	۱.۱%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۲۲,۸۲۱ ۱۵,۷۵۵	۱۴%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۳۰	۱.۹%	فولاد، فخور، هرمز	-	۶۷۰ ۴۴۸	۱۶%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۸۲۰	۰.۲%	فولاد، فخور، هرمز	-	۲۲,۰۸۰ ۱۳,۳۸۴	۴۸%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۸	-۲.۰%	ذوب، کویر	فولای	۷۵۵ ۵۴۶	-۱۱%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۰۲۷	-	ذوب، کویر	فولای	۲۴,۷۴۷ ۱۷,۴۲۳	۱۷%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۰۰	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۷۸۰ ۵۵۵	۱%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۹۰	-	فولاد	-	۸۶۰ ۶۴۰	-۱%



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	۳۱۵	۲۰٪-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۹۳	۶۰٪	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۱	-	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۳	۰۲٪	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۵۳۰	۸۲٪	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	۰۵٪	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۵	۰۶٪	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۲	۰۶٪	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱۰۲۱	۴۳٪	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	۱۱٪	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱۰۴۹	۵۱٪	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۰	۳۰٪	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶۰۷۹	۳۲٪	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۴۰	۵۷٪-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱۰۲۴۵	-	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

انرژی و فراورده های نفتی

محصولات کشاورزی

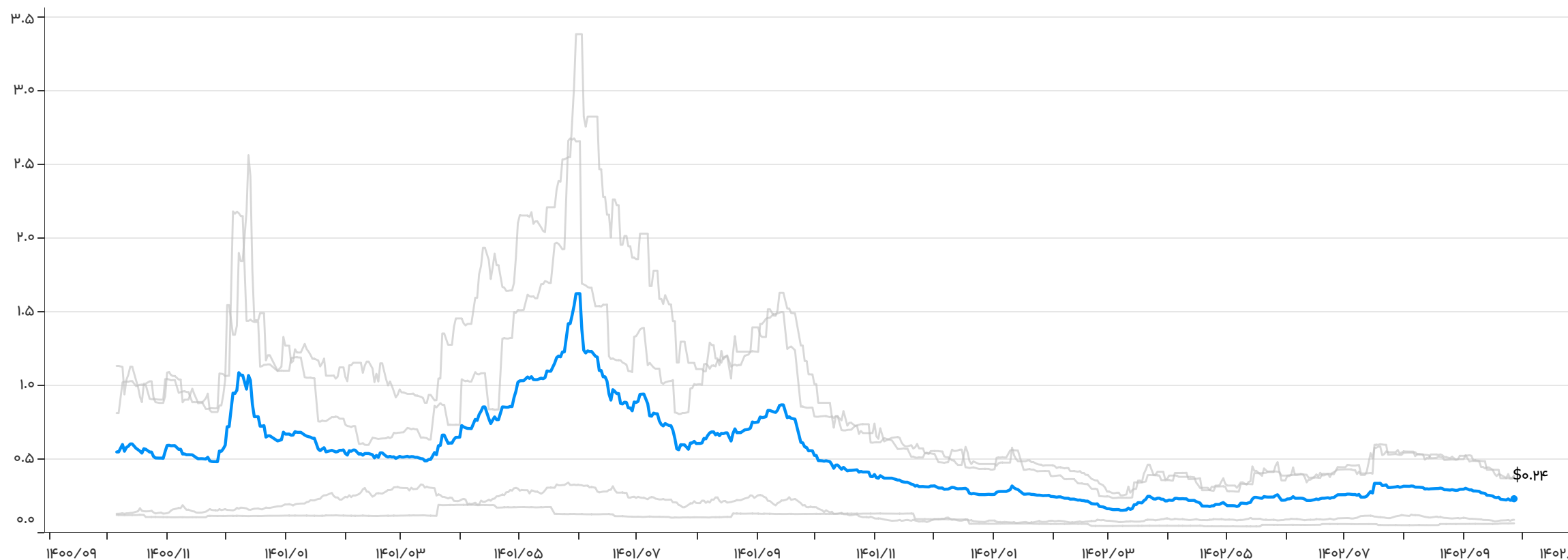
ارز و ارز دیجیتال

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
نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۹	۳.۳%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		
نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۴	۳.۰%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		
نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/بشکه	۱۱۲	۱.۶%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-		
گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۱۰۴	۱.۹%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-		
لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۱۵۹	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		
روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۷,۰۲۴	-۵.۱%	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-		
قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۲,۷۵۳	-۰.۴%	شپاس	-		
ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۸۶	-۲.۱%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		
روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۰۳	۰.۶%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		
شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۲۴۰	-۰.۱%	-	-		
گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۲۶	-۲.۱%	-	-		
یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۱۰	۱.۱%	-	-		
پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	۰.۱%	-	-		
بیتکوین	بایننس	دلار	۴۳,۷۴۳	۳.۷%	-	-		

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	۱.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۶	-۴۱%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۷	۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۴۹%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	۵.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۵۶%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	۳.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۸۰	-۵۱%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۴	۳.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۵۲%

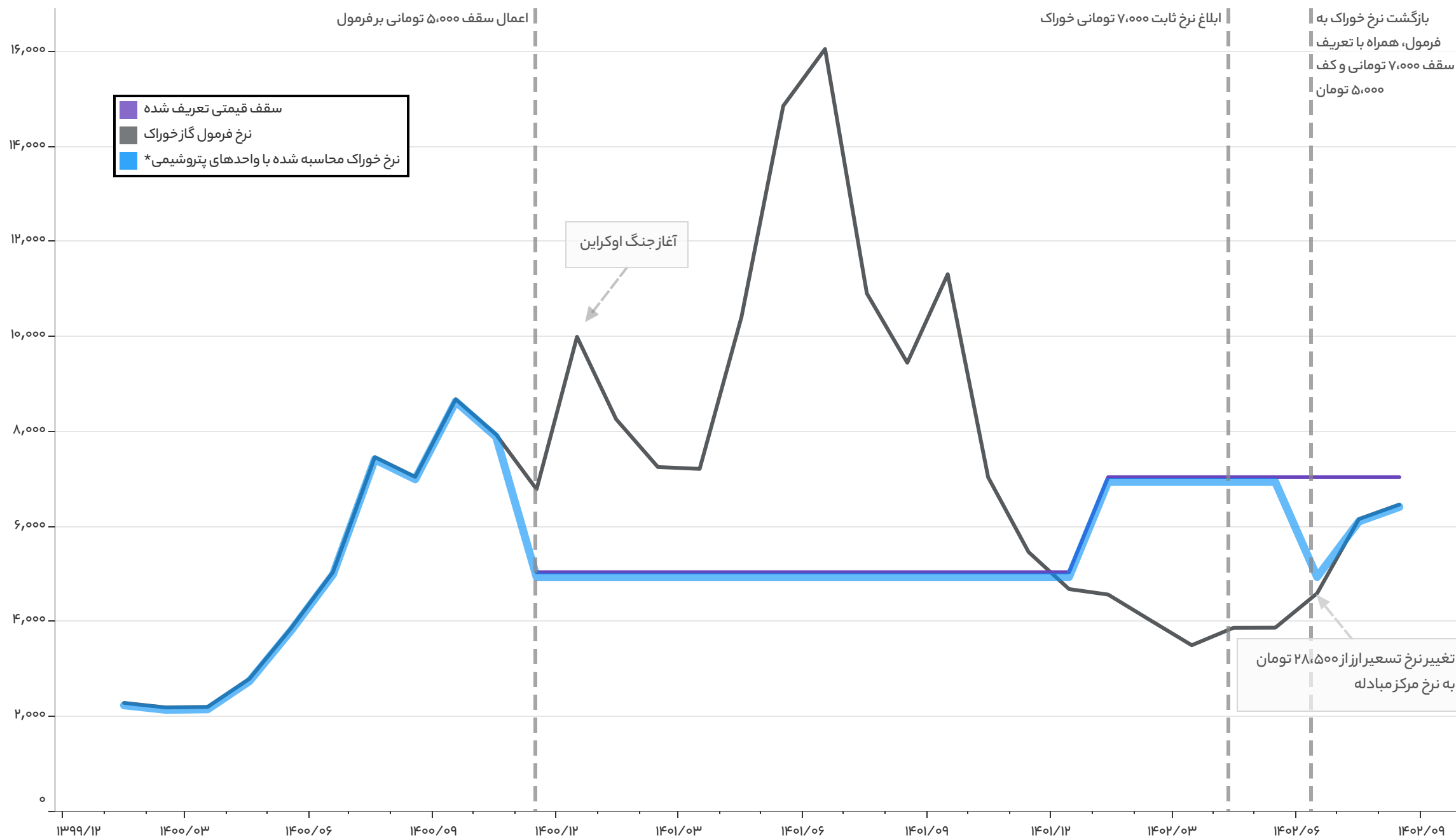
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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

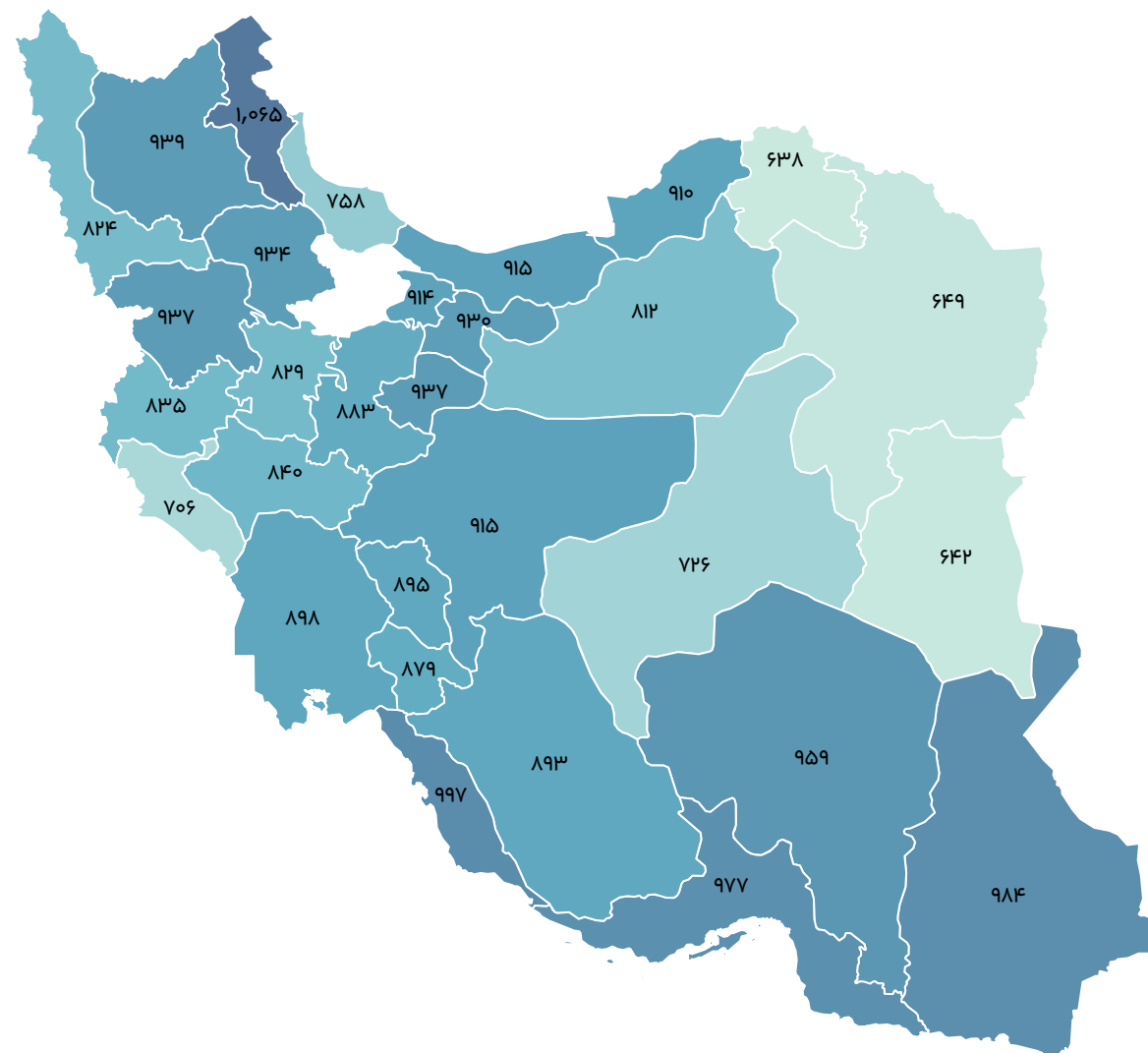


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بر روزرسانی خواهد شد.
- لازم به ذکر است که طبق ابلاغیه جدید، نرخ خوراک گاز واحدهای متانول، مشروط به تسویه بهای خوراک طی سی روز پس از دریافت صورت حساب، معادل ۹۵٪ نرخ خوراک گاز واحدهای پتروشیمی تعیین می گردد.



قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



* قیمت سیمان براساس سیمان تیپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (براساس 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	البرز	سیمان آبیک	۹۱۴	۹۱۴	-
	تهران	سیمان تهران	۹۷۳	۹۳۰	-۴.۵%
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۸۸۳	-
	قم	سیمان نیزازقم	۹۳۷	۹۳۷	-
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیما..	۷۵۰	۷۲۶	-۳.۳%
غرب	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۹۴۳	۸۹۸	-۴.۸%
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۹۵	۸۹۵	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۳۷	۸۳۵	-۰.۲%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۹۶۴	۸۷۹	-۸.۷%
	لرستان	سیمان دورود	۸۴۰	۸۴۰	-
شمال غرب	کردستان	سیمان کردستان	۹۳۷	۹۳۷	-
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۰۵۸	۱,۰۶۵	+۰.۷%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۲۶	۸۲۴	-۰.۳%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۸۳	۹۳۹	-۴.۵%
شمال	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
	گیلان	سیمان خزر	۷۹۶	۷۵۸	-۴.۷%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۸۸۵	۹۱۰	+۲.۸%
جنوب	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۴۰۷	۹۷۷	-۳۰.۶%
	فارس	سیمان داراب	۹۲۵	۸۹۳	-۳.۵%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۱,۰۰۸	۹۹۷	-۱.۱%
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۴۹	+۱.۷%
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۵۱	۶۴۲	-۱.۳%
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۸۱	۹۵۹	-۲.۳%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۴۵	۹۸۴	+۴.۱%

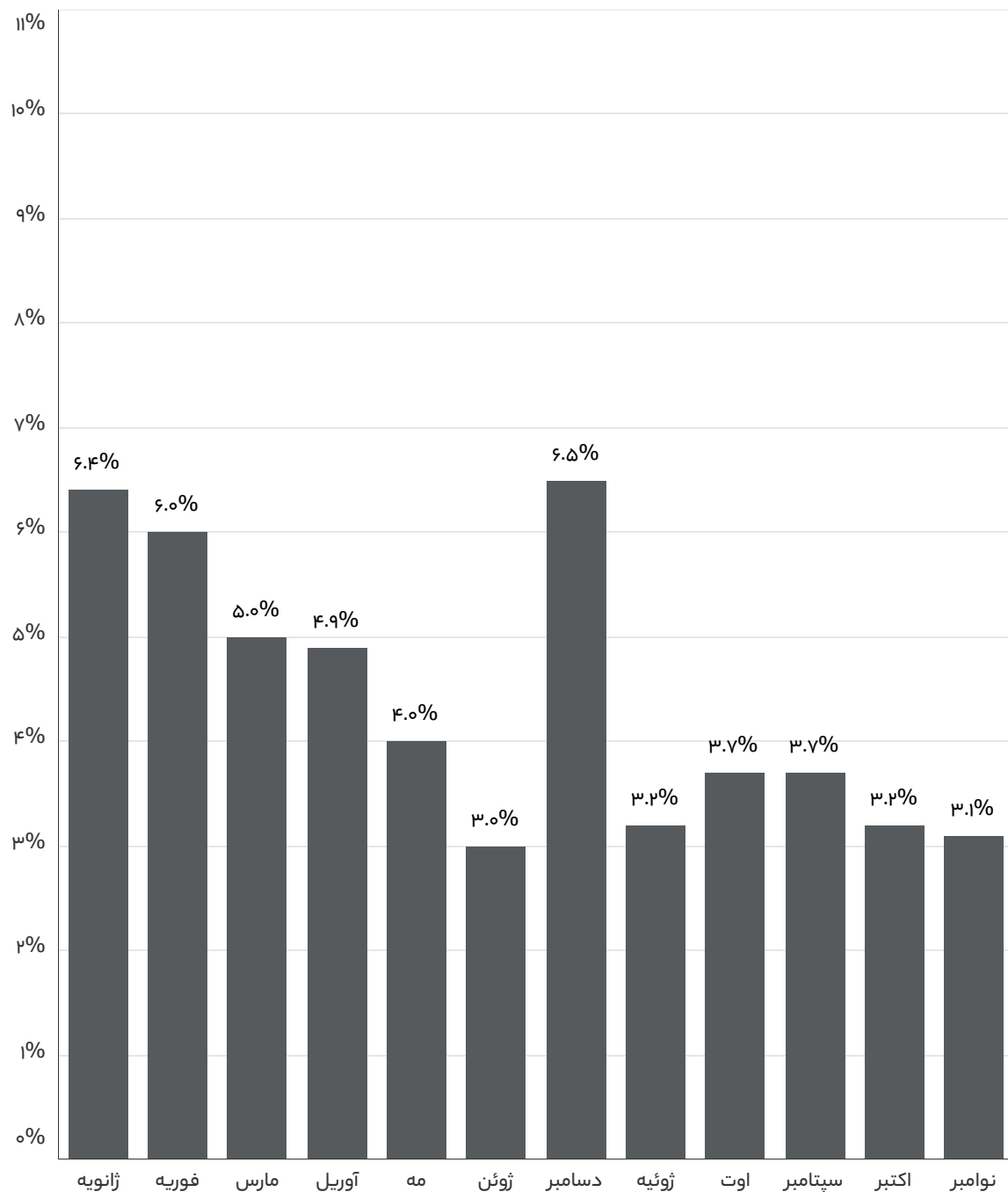


- ▲ به گزارش رویترز، قیمت طلا در اواسط هفته گذشته بالاتر از سطح ۲۰۴۰ دلار تثبیت شد و پس از کمی کاهش قیمت، در انتهای هفته نیز به قیمت‌های بالاتری دست یافت. دورنمای کاهش نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا در سال آینده میلادی از قیمت طلا حمایت کرده است. سرمایه‌گذاران منتظر انتشار شاخص تورم آمریکا در این هفته هستند. فدرال رزرو آمریکا هفته گذشته اعلام کرد دوره سیاست‌های سختگیرانه پولی به پایان رسیده و احتمال کاهش نرخ بهره در ۲۰۲۴ وجود دارد.
- ▲ آژانس بین‌المللی انرژی (IEA) در گزارش خود با عنوان "زغال سنگ ۲۰۲۳" اعلام کرد که تقاضای جهانی برای این منبع انرژی، امسال به بالاترین رقم خود در تاریخ خواهد رسید. این آژانس پیش‌بینی می‌کند که تقاضای جهانی برای زغال سنگ تا پایان سال ۲۰۲۳، ۱۰۴ درصد افزایش خواهد یافت و برای اولین بار از ۸۰۵ میلیارد تن فراتر خواهد رفت که دلیل آن عمدتاً افزایش مصرف این محصول در اقتصادهای نوظهور و در حال توسعه خواهد بود.
- ✓ اقتصادنیوز نوشت: قیمت سکه امامی در معاملات نقدی روز دوشنبه تشنج کرد و در حدود ۵۵۰ هزار تومان ارزان شد. فعالان اقتصادی می‌گویند در صورتی که طلا و دلار سیگنال صعودی به بازار سکه ارسال نکنند، احتمال عقب‌نشینی سکه به کانال ۲۸ میلیون تومان در روز جاری وجود دارد. با وجود این گمانه‌زنی‌ها و کاهش قیمت ارز در بازار و بازگشت قیمت دلار به کانال ۴۹ هزار تومان، اما قیمت طلا و سکه در بازار با ثبات نسبی همراه شد چراکه با اعلام شاخص‌های سیاسی و اقتصادی آمریکا قیمت طلای جهانی افزایش یافت.
- ▲ نفت برنت روز دوشنبه نوسان سه دلاری داشت و بین ۷۶ تا ۷۹.۵ دلار در نوسان بود. این افزایش قیمت در روز سه‌شنبه نیز اتفاق افتاد و سبب شد قیمت نفت به بالاترین حد دو هفته اخیر برسد. به گزارش رویترز، حمله یمنی‌ها به کشتی‌ها در دریای سرخ تجارت دریایی را مختل کرده و شرکت‌های کشتیرانی را مجبور به تغییر مسیر کشتی‌هایشان کرده است. حمله به کشتی‌ها باعث شده آمریکا و متحدانش به فکر ایجاد کارگروهی برای حفاظت از مسیر دریای سرخ باشند. اما تهران نسبت به این اقدام هشدار داده و آن را یک اشتباه بزرگ اعلام کرده است.
- ✓ به گزارش رویترز، بانک سرمایه‌گذاری گلدمن ساکس پیش‌بینی خود از قیمت نفت خام برنت در ۲۰۲۴ را ۱۰ دلار در هر بشکه پایین آورد و بین ۷۰ تا ۹۰ دلار اعلام کرد. این بانک افزایش تولید قابل توجه آمریکا را مانع بالا رفتن قیمت نفت می‌داند. این بانک همچنین اشاره کرد تصمیم اوپک برای کاهش عرضه، بهبود اقتصاد چین، پرکردن ذخایر استراتژیک نفتی آمریکا و احتمال رکود اقتصاد، مانع سقوط قیمت نفت خواهد شد.
- ✓ محمود نجفی عرب در نهمین نشست هیات نمایندگان اتاق تهران با اشاره به بحث انرژی و معضلات زیست محیطی حاصل از آن گفت: با توجه به تحقیقات یک اندیشکده محیط زیستی، در جهان تلاش می‌شود تا تولید گازهای گلخانه‌ای کاهش یافته و از مصرف سوخت فسیلی کاهش یابد. لذا همین موضوع درآمد ۴۰ کشور نفت‌خیز را کاهش می‌دهد، بطوری که ۲۸ کشور نفت‌خیز ممکن است تا سال ۲۰۴۰ بیش از نیمی از درآمد نفتی خود را دست بدهند. نجفی عرب اظهار داشت: از آنجا که صادرات نفت ایران به دلیل تحریم‌ها کاهش یافته در نتیجه ما به لحاظ کاهش درآمدهای نفتی در درجه چهارم قرار داریم، در حالی که اگر صادرات نفت ما بیش از میزان کنونی بود، احتمالاً در رتبه‌های اول خطر از دست دادن درآمدهای حاصل از نفت قرار می‌گرفتیم.
- ✓ طی هفت ماهه نخست سال، حدود ۱۹۵ هزار میلیارد تومان درآمد از محل صادرات نفت، گاز و فروش داخلی میعانات گازی محقق شده است. رقم مندرج در بودجه سال جاری ۶۰۳ همت بوده که پیش‌بینی می‌شود تا پایان سال ۴۳۷ همت از این محل محقق شود. به نظر می‌رسد مهمترین علت عدم تحقق درآمد نفت در بودجه امسال، بیش برآوردی قیمت نفت بوده است، به گونه‌ای که قیمت هر بشکه را ۸۵ دلار در نظر گرفتند، در حالی که عدد واقعی ۶۵ دلار بوده است.

شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته

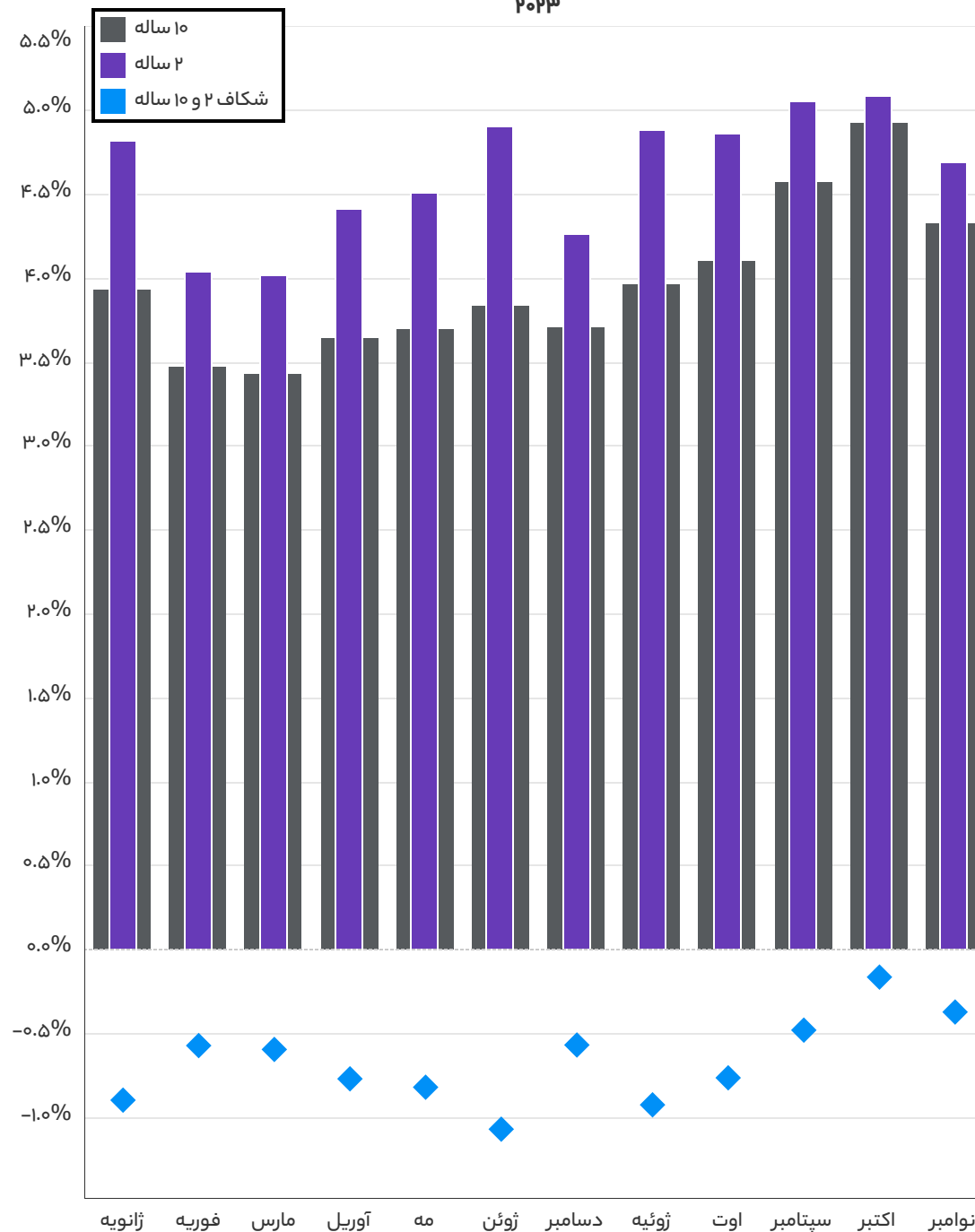
۲۰۲۳



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

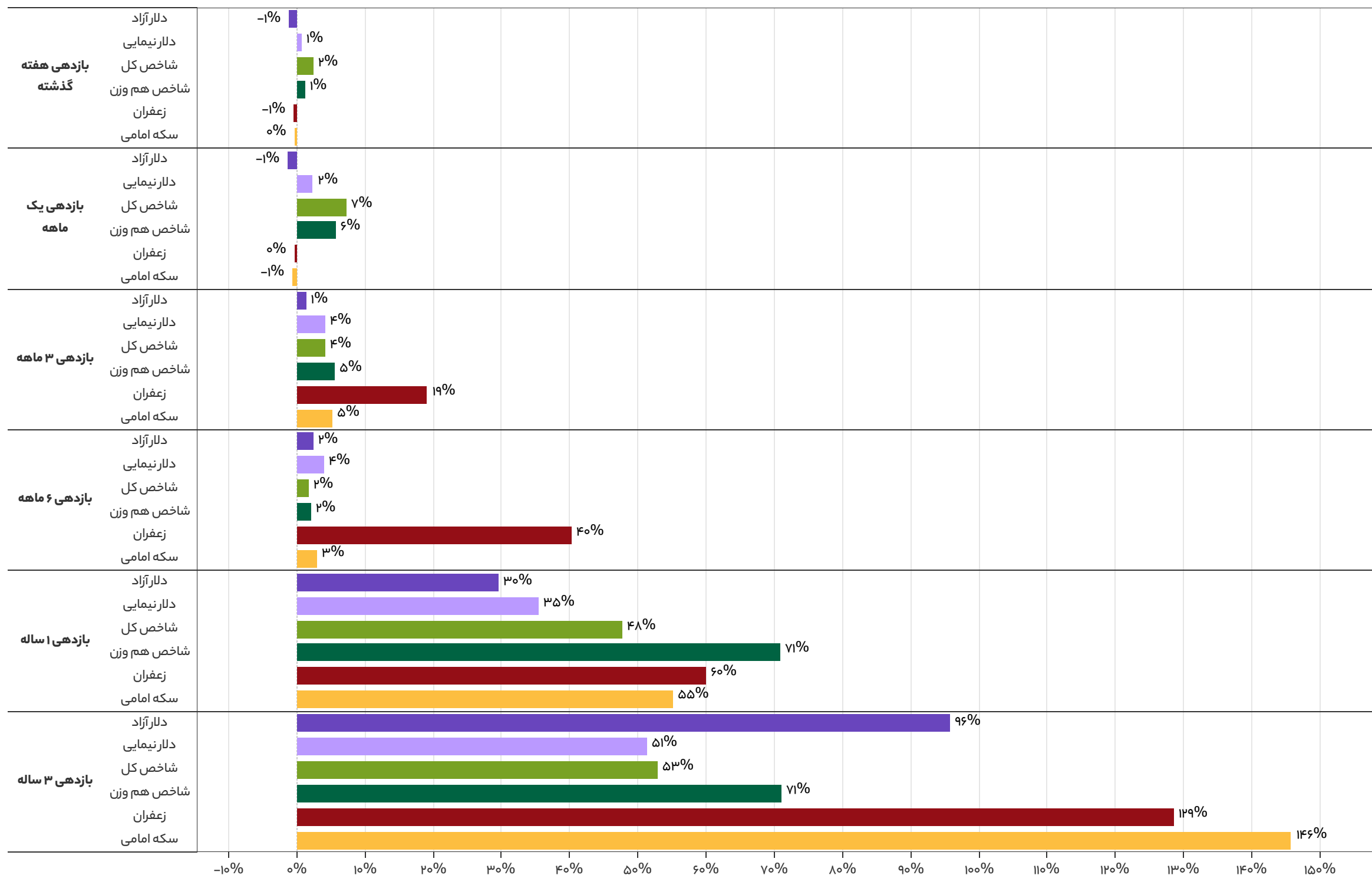
EQUITY MARKET

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 درهرماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۰۹	۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	هم وزن ۴۴٪	هم وزن ۵۷.۸٪
سکه امامی ▲ ۱۴.۷٪	سکه امامی ▲ ۳۱.۳٪	زعفران ▲ ۱۹.۰٪	شاخص کل ▲ ۳۰.۳٪	هم وزن ▲ ۲۹.۷٪	مسکن ▲ ۱۳.۴٪	مسکن ▲ ۴.۰٪	زعفران ▲ ۱۴.۶٪	سکه امامی ▲ ۳.۳٪	شاخص کل ▲ ۹.۳٪	سکه امامی ▲ ۴.۱٪	زعفران ▲ ۲۱.۶٪	هم وزن ۴۰٪	مسکن ▲ ۵۷.۶٪
دلار آزاد ▲ ۱۲.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۲۲.۰٪	سکه امامی ▲ ۱۷.۷٪	هم وزن ▲ ۲۴.۳٪	شاخص کل ▲ ۱۶.۴٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۸٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۸٪	زعفران ▲ ۲۰.۸٪	هم وزن ▲ ۸.۸٪	درآمد ثابت ▲ ۱.۹٪	هم وزن ▲ ۱.۹٪	سکه امامی ۳۹٪	مسکن ▲ ۵۷.۶٪
هم وزن ▲ ۱۰.۲٪	هم وزن ▲ ۱۷.۱٪	دلار آزاد ▲ ۱۴.۷٪	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٪	زعفران ▲ ۵۷.۴٪	سکه امامی ۳۹٪
شاخص کل ▲ ۶.۲٪	شاخص کل ▲ ۱۰.۸٪	دلار نیمایی ▲ ۱۲.۷٪	سکه امامی ▲ ۹.۷٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	دلار آزاد ▲ ۰.۸٪	زعفران ▼ ۲.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۱.۷٪	دلار آزاد ▲ ۱.۴٪	دلار آزاد ▲ ۰.۲٪	مسکن ▲ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▲ ۰.۴٪	زعفران ۳۰٪	سکه امامی ▲ ۵۳.۸٪
مسکن ▲ ۲.۹٪	دلار آزاد ▲ ۸.۶٪	مسکن ▲ ۹.۹٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	مسکن ▲ ۱.۸٪	زعفران ▲ ۰.۸٪	هم وزن ▼ ۲.۳٪	مسکن ▼ ۲.۲٪	دلار نیمایی ▲ ۰.۱٪	زعفران ▼ ۰.۱٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۱٪	دلار آزاد ▲ ۰.۱٪	دلار نیمایی ۲۵٪	شاخص کل ▲ ۳۵.۰٪
دلار نیمایی ▲ ۲.۸٪	مسکن ▲ ۸.۱٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	دلار آزاد ▲ ۰.۲٪	سکه امامی ▼ ۰.۴٪	سکه امامی ▲ ۰.۴٪	شاخص کل ▼ ۵.۶٪	سکه امامی ▼ ۳.۵٪	مسکن ▼ ۱.۰٪	دلار نیمایی ▼ ۰.۱٪	زعفران ▼ ۳.۶٪	سکه امامی ▼ ۰.۱٪	دلار آزاد ۲۰٪	دلار نیمایی ▲ ۳۳.۳٪
درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۱٪	شاخص کل ▼ ۷.۵٪	زعفران ▲ ۰.۰٪	زعفران ▼ ۰.۷٪	هم وزن ▼ ۰.۶٪	دلار آزاد ▼ ۶.۱٪	هم وزن ▼ ۶.۲٪	شاخص کل ▼ ۲.۳٪	مسکن ▼ ۰.۶٪	شاخص کل ▼ ۴.۱٪	مسکن ▼ ۰.۴٪	مسکن ۲۰٪	دلار آزاد ▲ ۲۶.۵٪
زعفران ▲ ۲.۰٪	زعفران ▼ ۲.۲٪	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٪	هم وزن ▼ ۴.۴٪	شاخص کل ▼ ۰.۶٪	درآمد ثابت ۰٪	درآمد ثابت ▲ ۲۳.۷٪

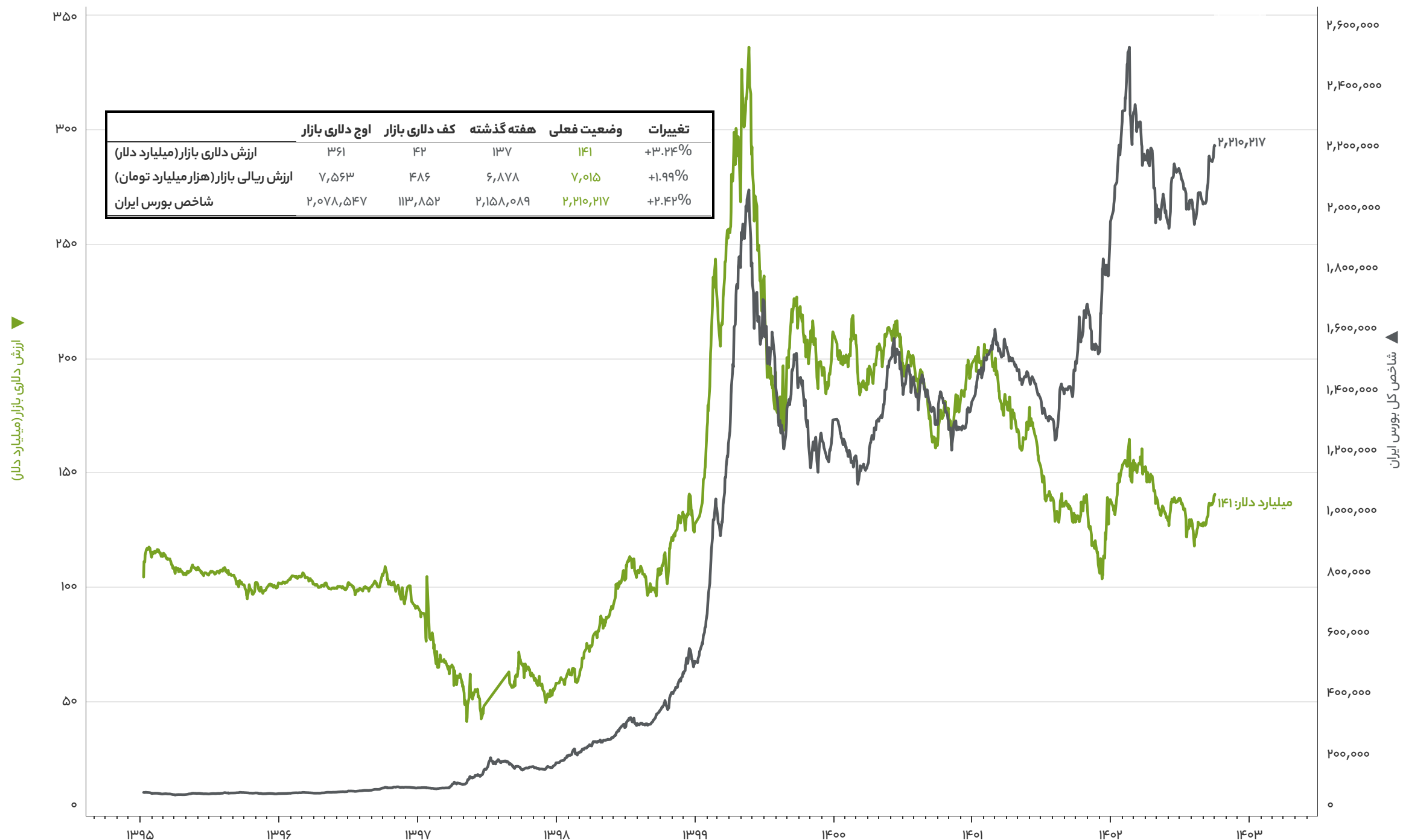
– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه درهر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری طلای سرخ نوویرا 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

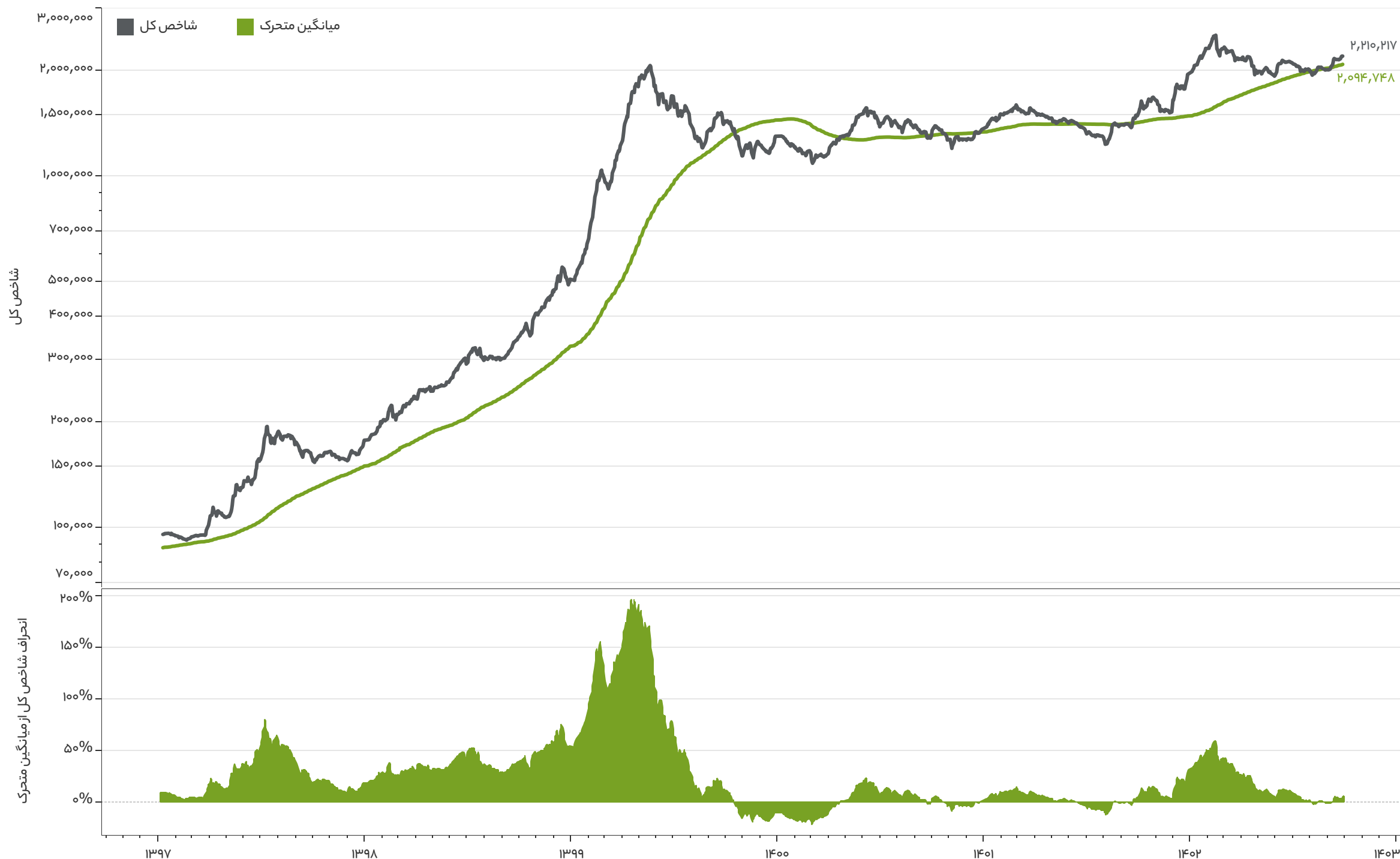
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





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



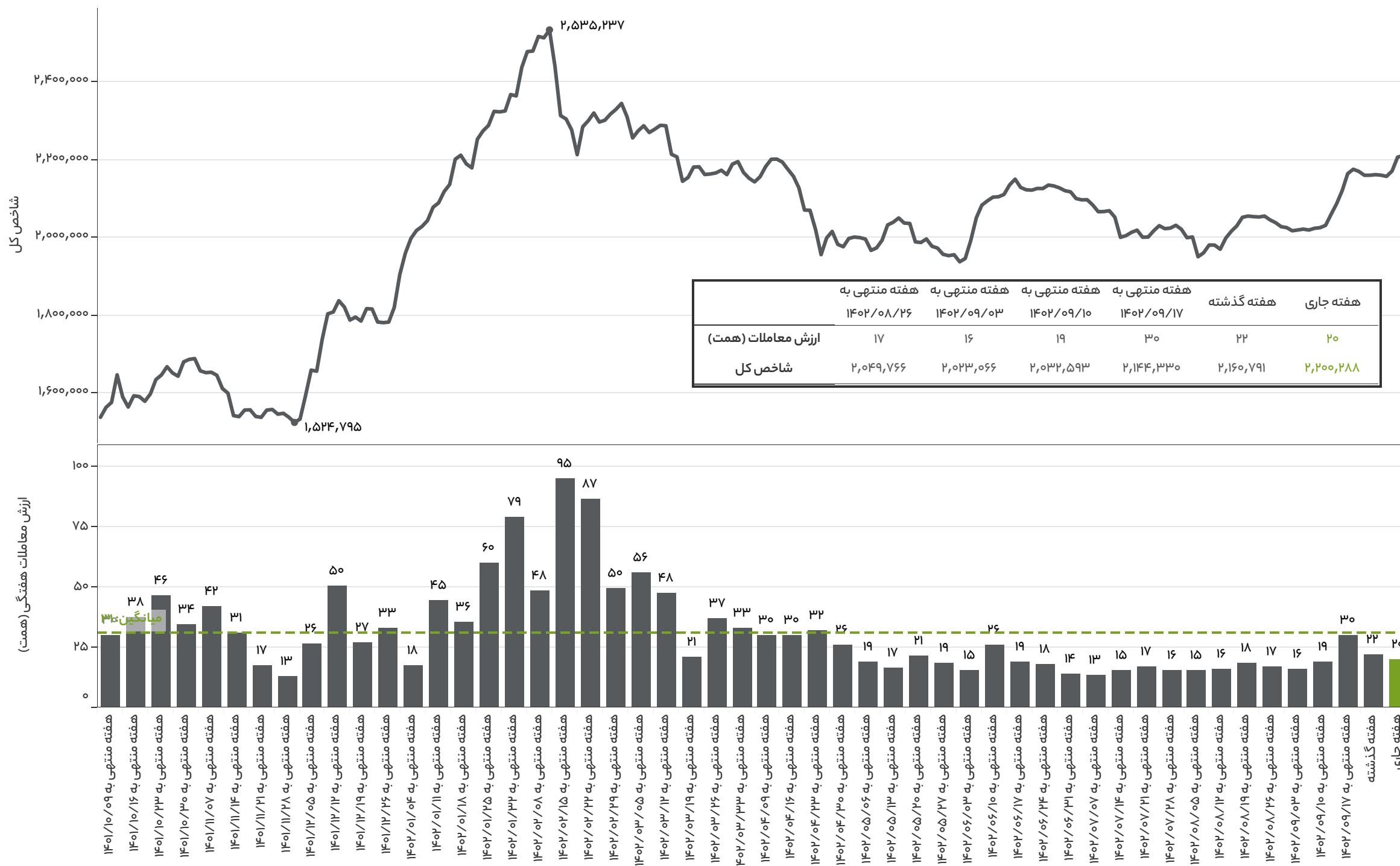
تأثير نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



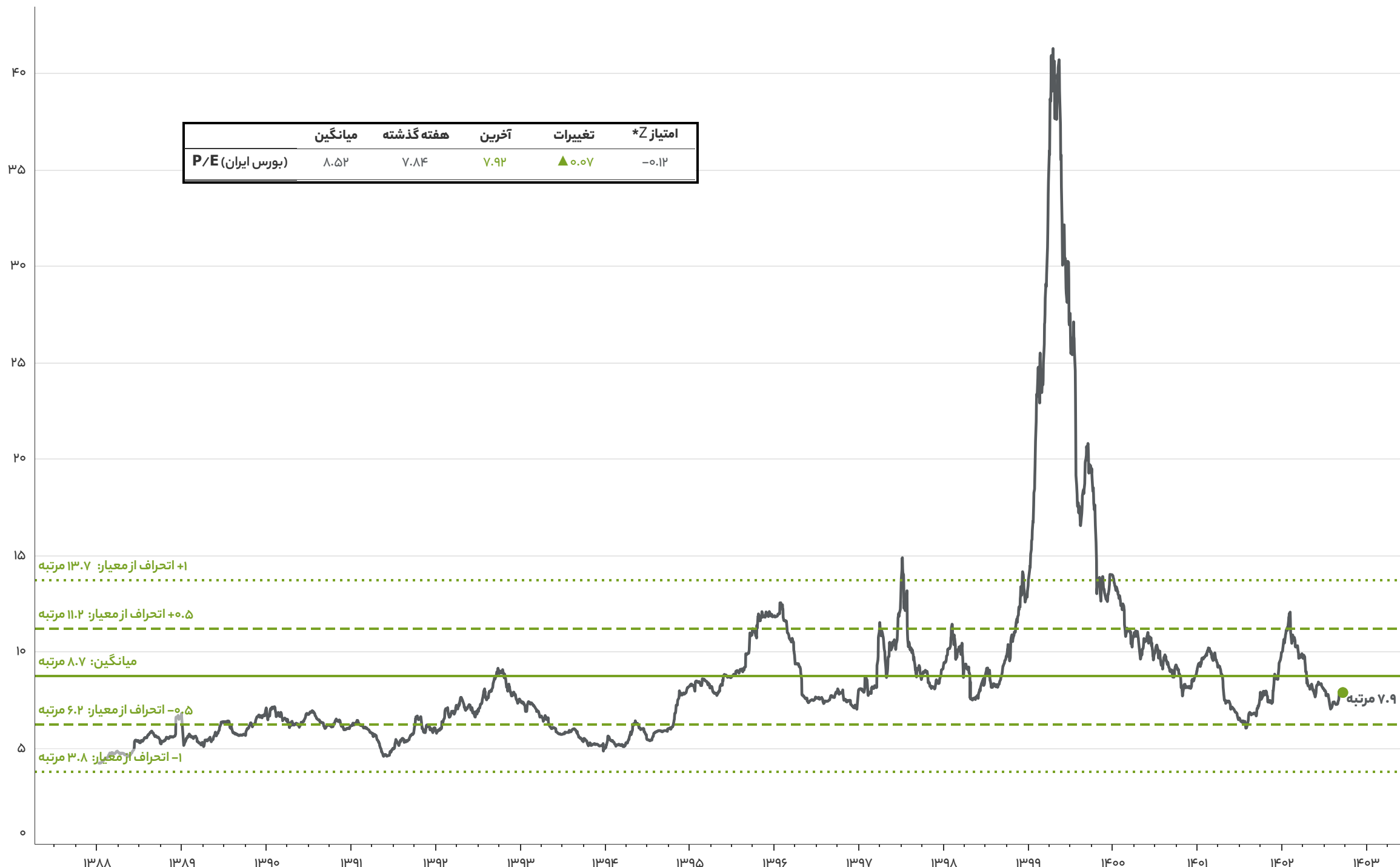
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

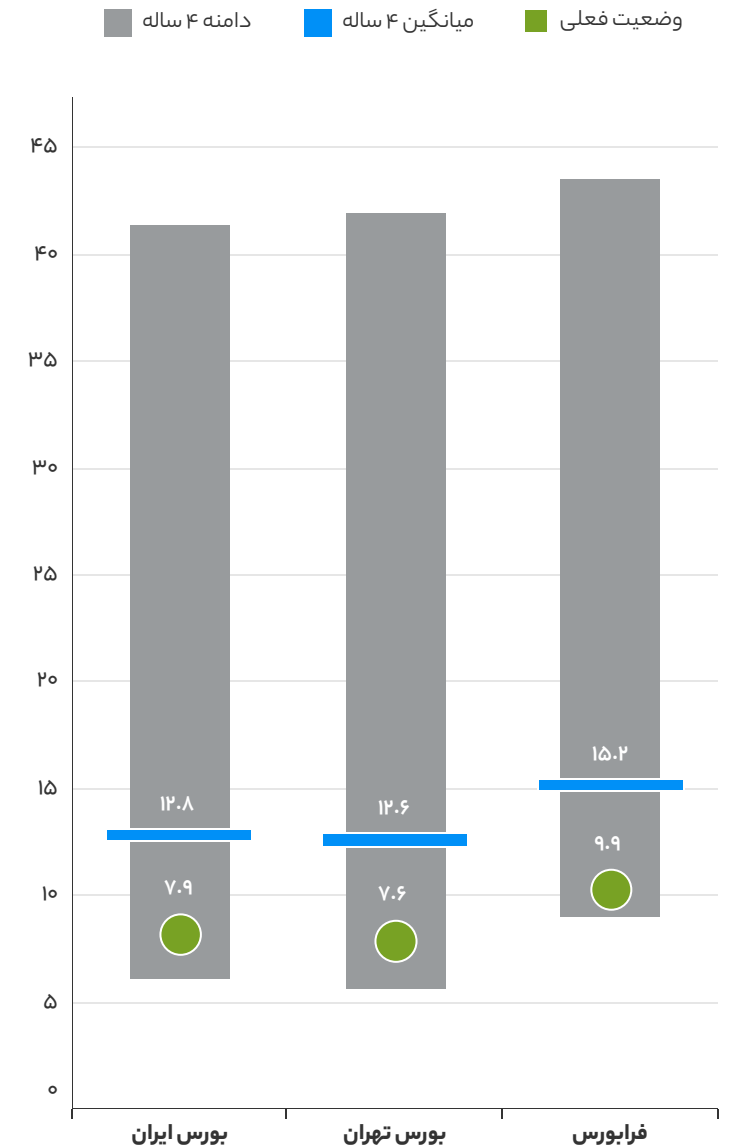
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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
+۰.۵۷	۷.۹۲	۷.۸۴	۶.۵۷	۱۲.۸۴	۴۱.۳۳
+۰.۱۵	۷.۶۲	۷.۴۶	۵.۶۴	۱۲.۶۰	۴۱.۹۹
-۰.۵۹	۹.۹۴	۱۰.۵۳	۹.۰۳	۱۵.۱۷	۴۳.۵۱

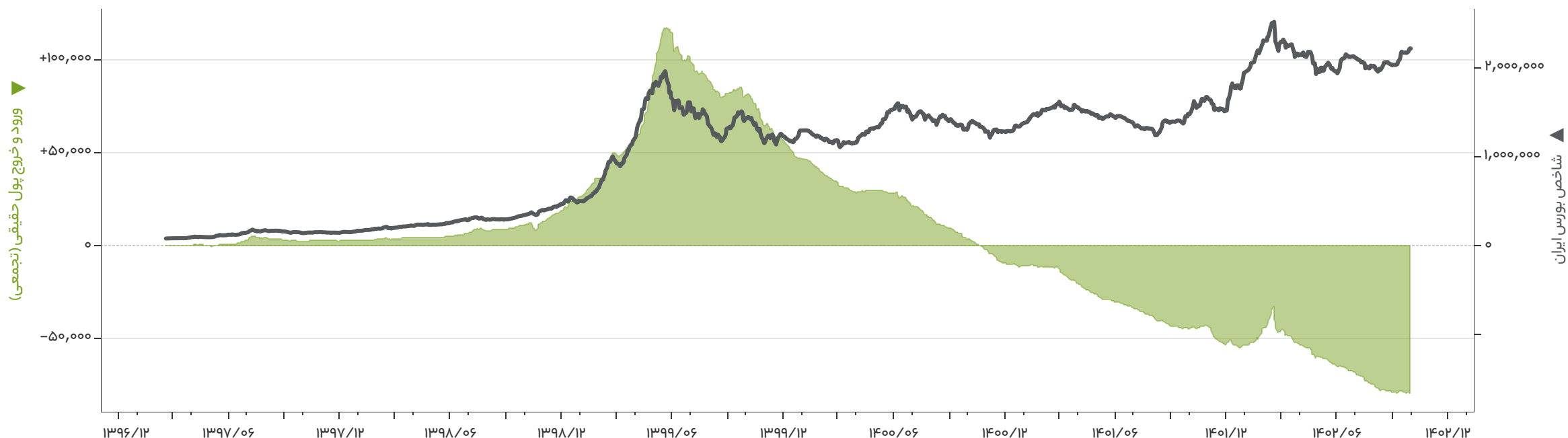


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	املاک و مستغلات	یوتیلیتی	تکنولوژی	ارتباطات	بهداشت	صنعتی	غیردوره‌ای مصرفی	مصرفی دوره‌ای	انرژی	مواد پایه	خدمات مالی	
تعداد سهام	۲۸	۱۱	۱۹	۵	۴۱	۶۳	۸۹	۶۵	۶	۱۸۹	۱۹۹	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۵۵	۹۲	۱۱۹	۱۲۸	۱۶۶	۲۰۸	۲۲۲	۳۹۴	۶۴۹	۳,۳۹۶	۳,۴۴۶	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۰%	۱.۳%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۵%	۴.۴%	۷.۳%	۳۸.۳%	۳۸.۸%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۲.۲	۹.۴	۲۱.۴	۱۳.۴	۹.۴	۹.۸	۱۱.۳	۵.۶	۵.۱	۸.۰	۷.۶	سودآوری
بازده سود نقدی	۳.۲%	۱۶.۴%	۲.۵%	۳.۱%	۶.۷%	۳.۶%	۴.۴%	۳.۲%	۱۳.۹%	۸.۶%	۸.۴%	
نسبت تقسیم سود	۴۱%	۱۰۰%	۶۰%	۴۱%	۷۶%	۳۷%	۵۴%	۳۴%	۶۳%	۷۲%	۶۳%	
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)	+۶۳۰%	+۸۱۸%	+۳۰۱%	+۱۶۰%	+۴۱۳%	+۴۶۹%	+۴۵۳%	+۸۹۷%	+۸۳۸%	+۹۵۷%	+۹۱۹%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۲%	+۱۲۴%	+۲%	-۵۹%	+۲۲%	-۳%	+۳%	-۹%	+۲۲%	+۶۵%	+۷%	
بازده از ابتدای سال	+۲۲۶%	+۴۸%	+۷۲%	+۶۷%	+۱۰۴%	+۱۲۱%	+۶۳%	+۱۰۰%	+۹۹%	+۸۵%	+۷۸%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	۵%	۱%	۲%	۲%	۳%	۱%	۱%	۳%	۲%	۳%	

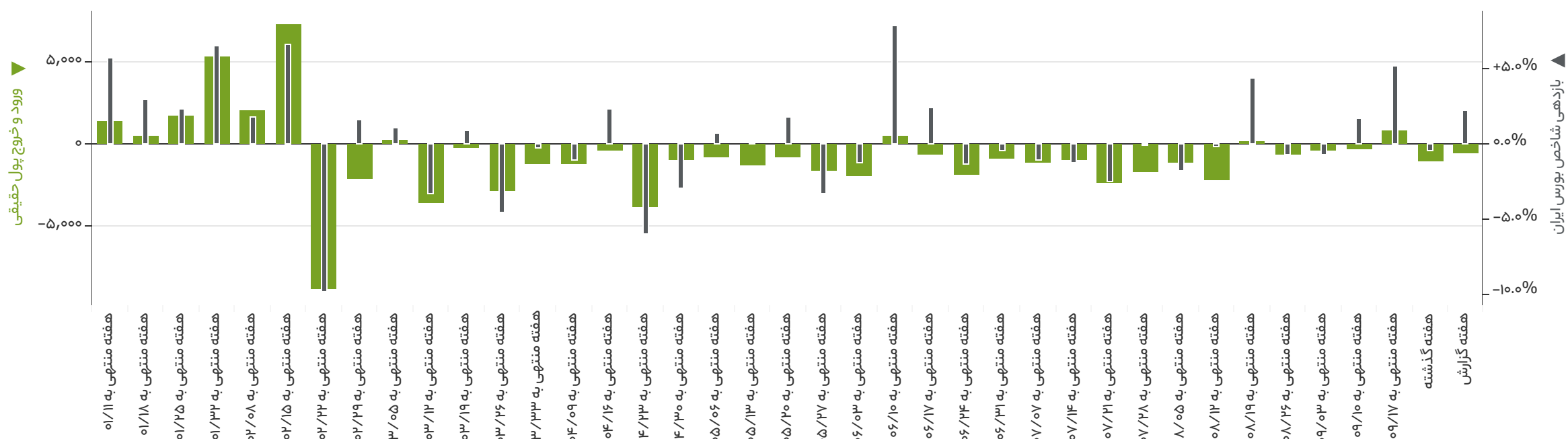
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



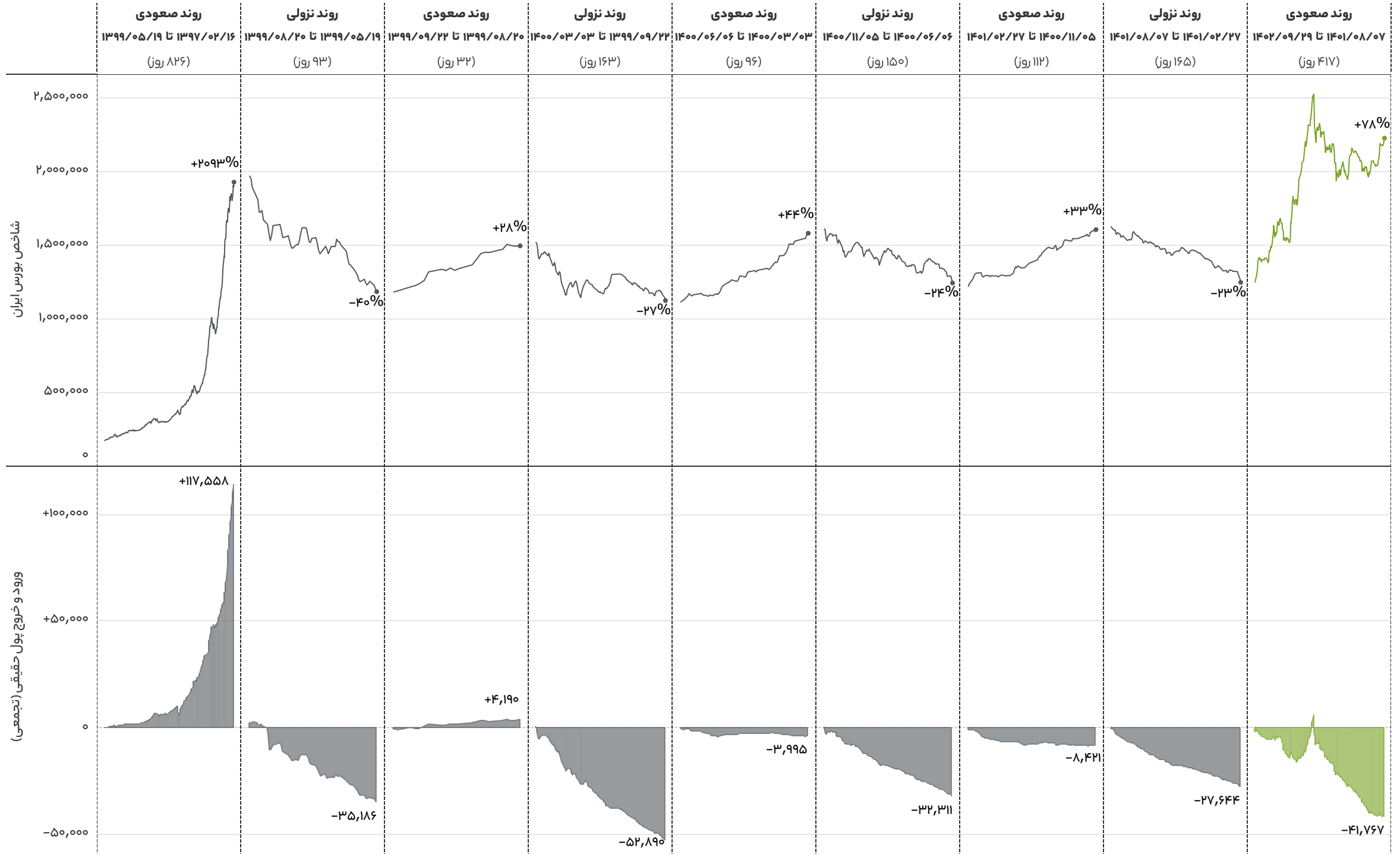
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

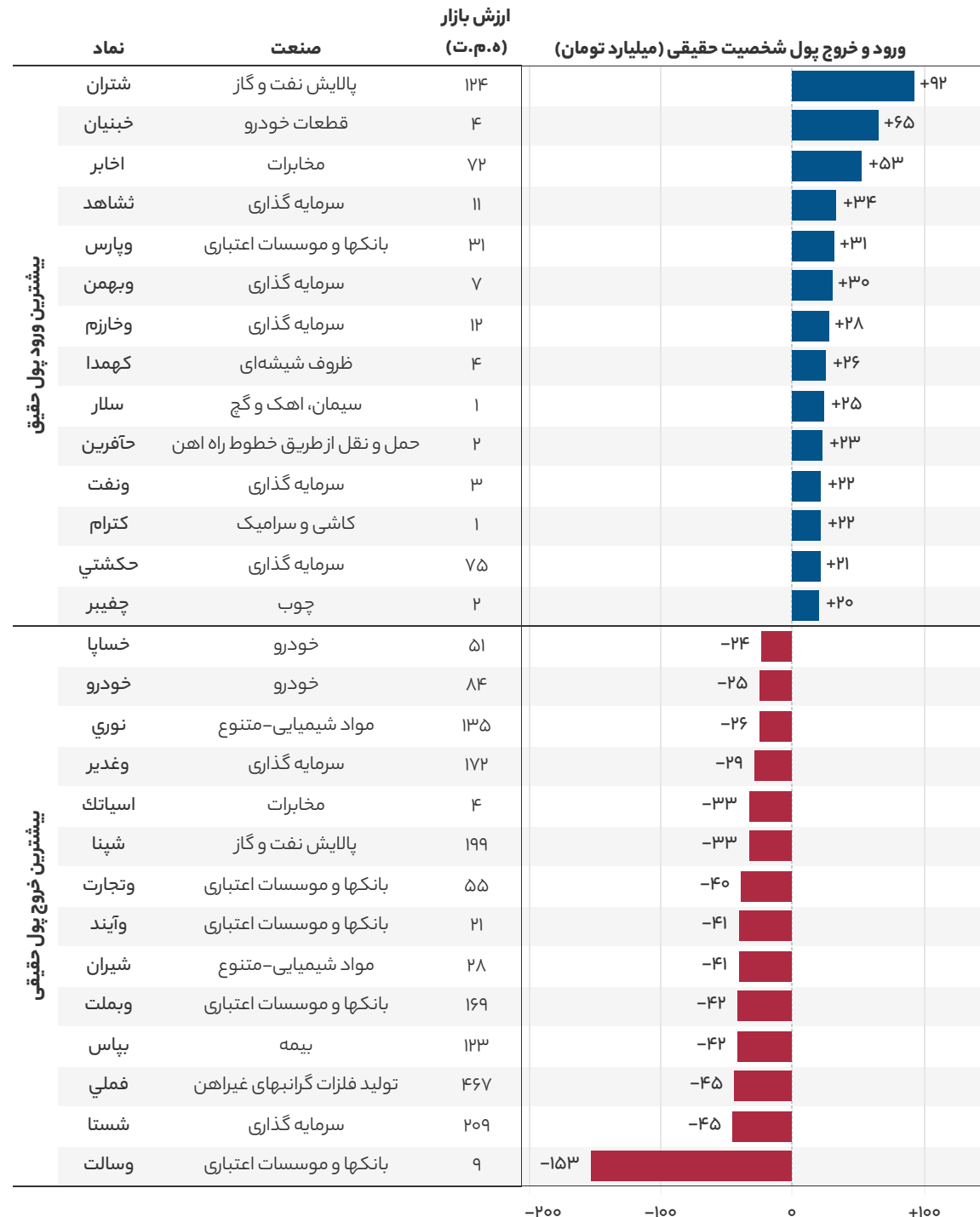
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

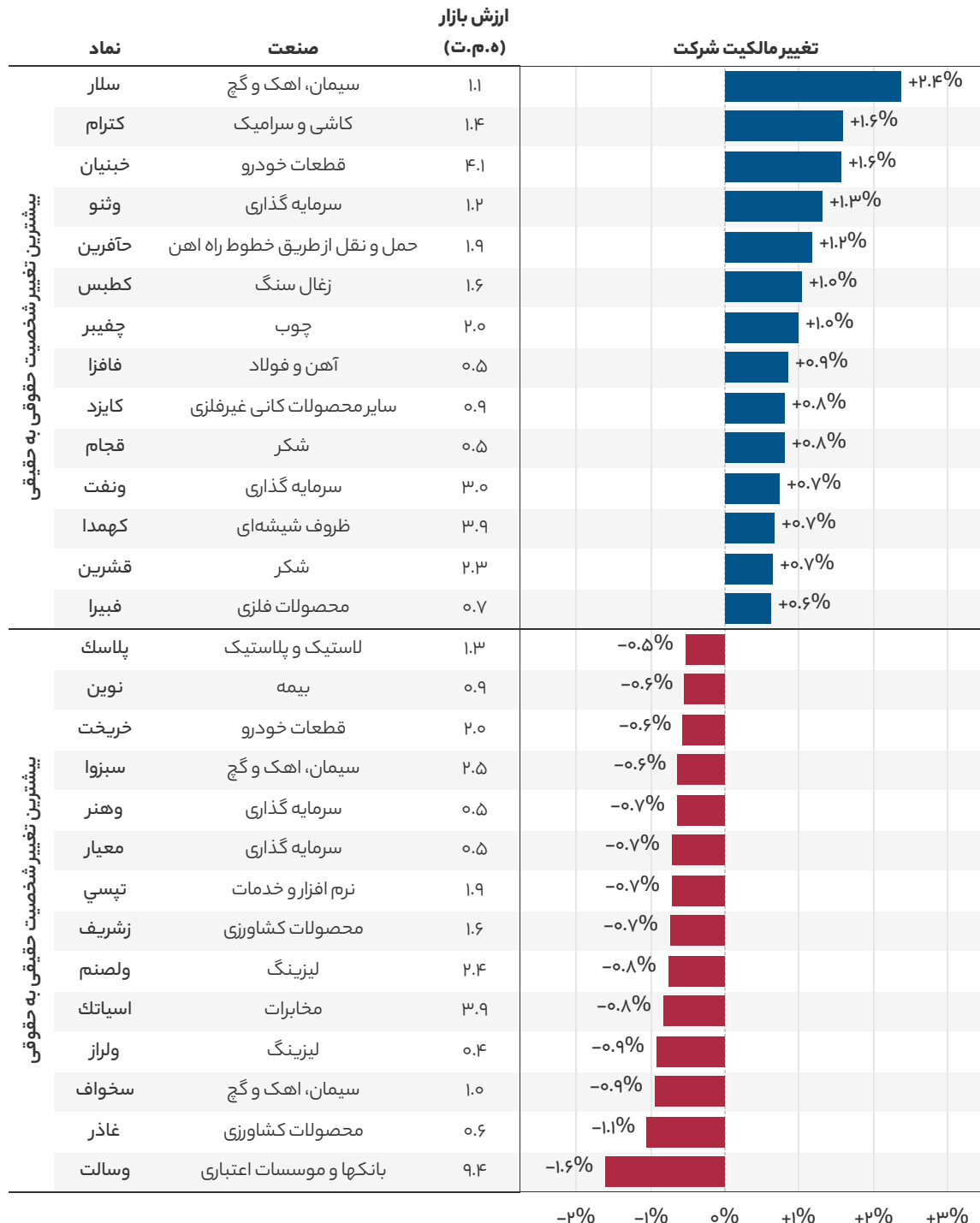
ورود و خروج پول حقیقی

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



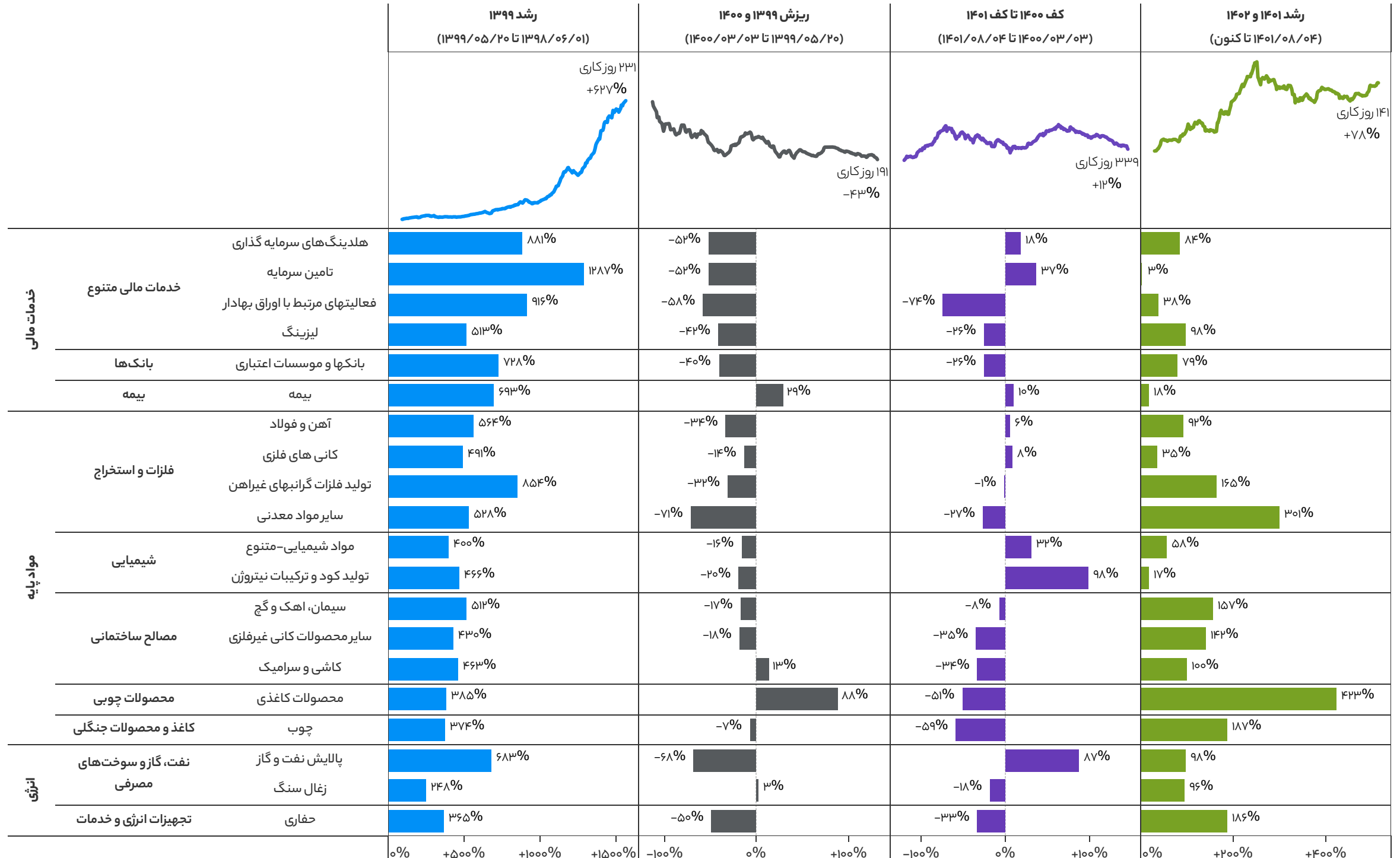
تغییر مالکیت شرکت

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



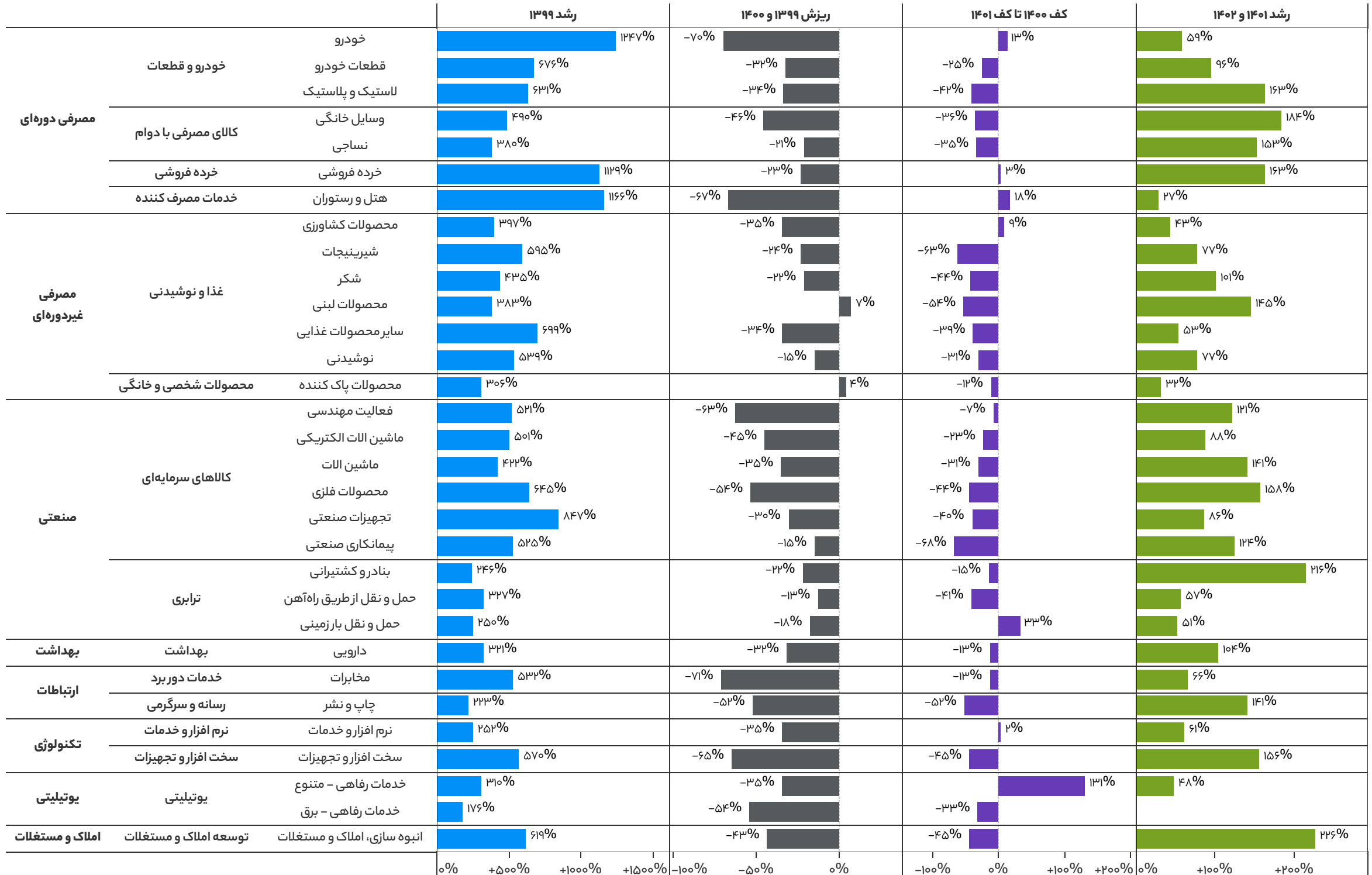
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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



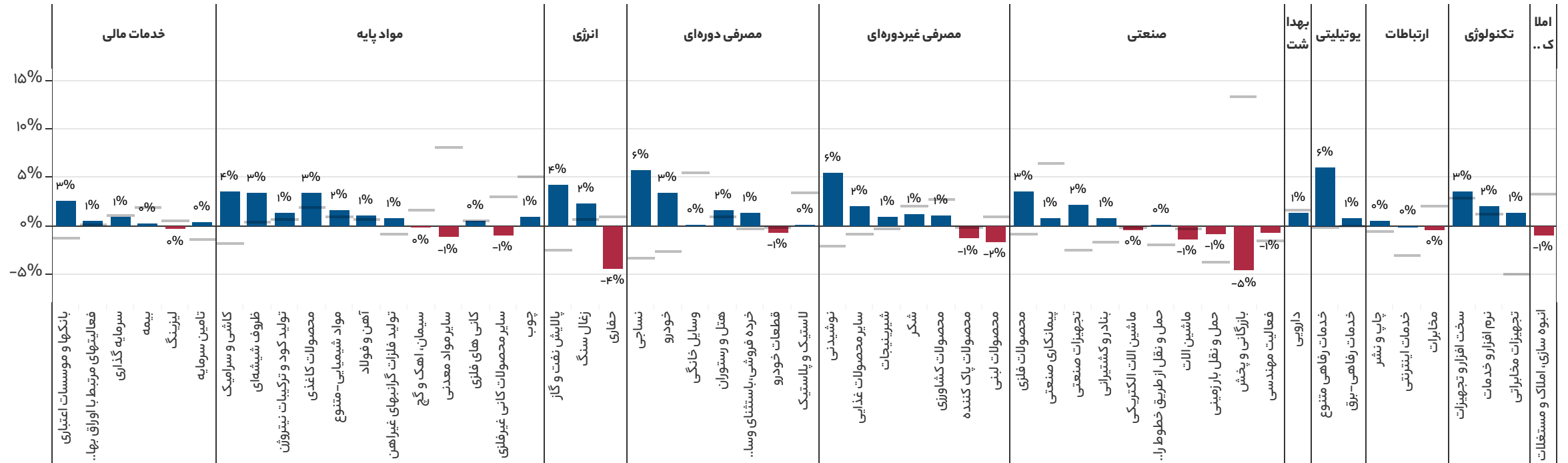


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



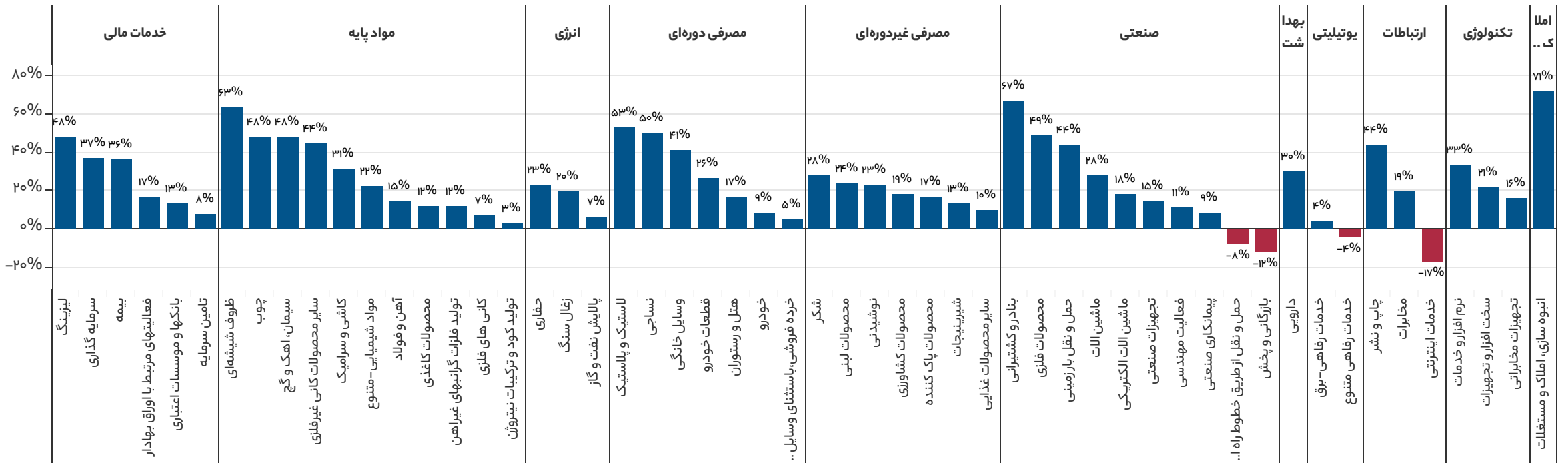
بازده صنایع از ابتدای هفته

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

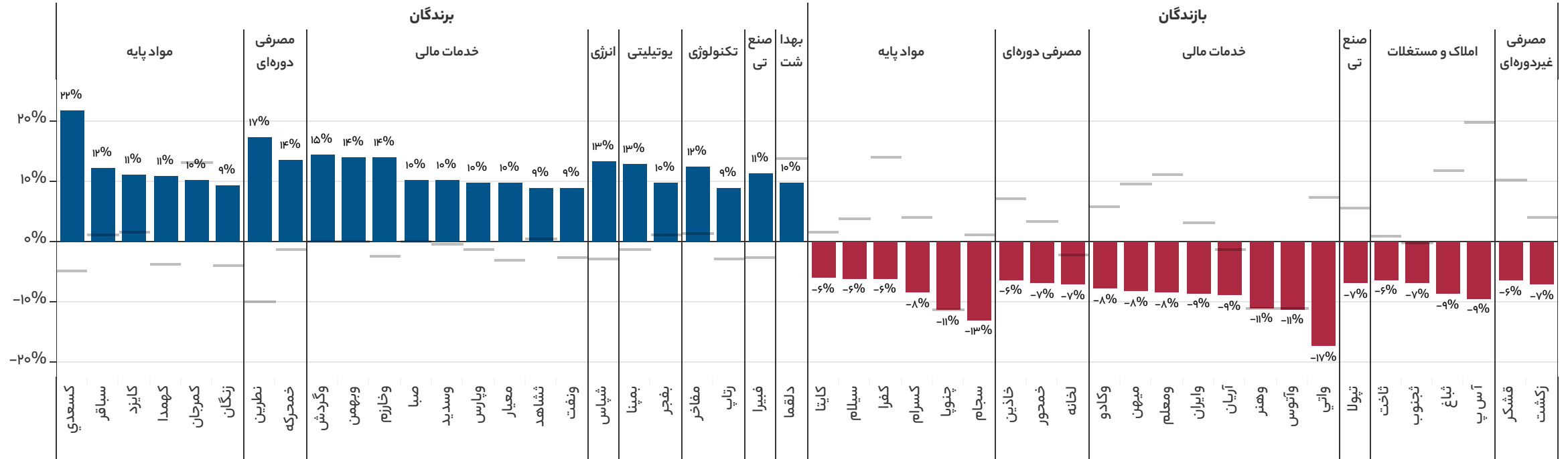


بازده صنایع از ابتدای سال

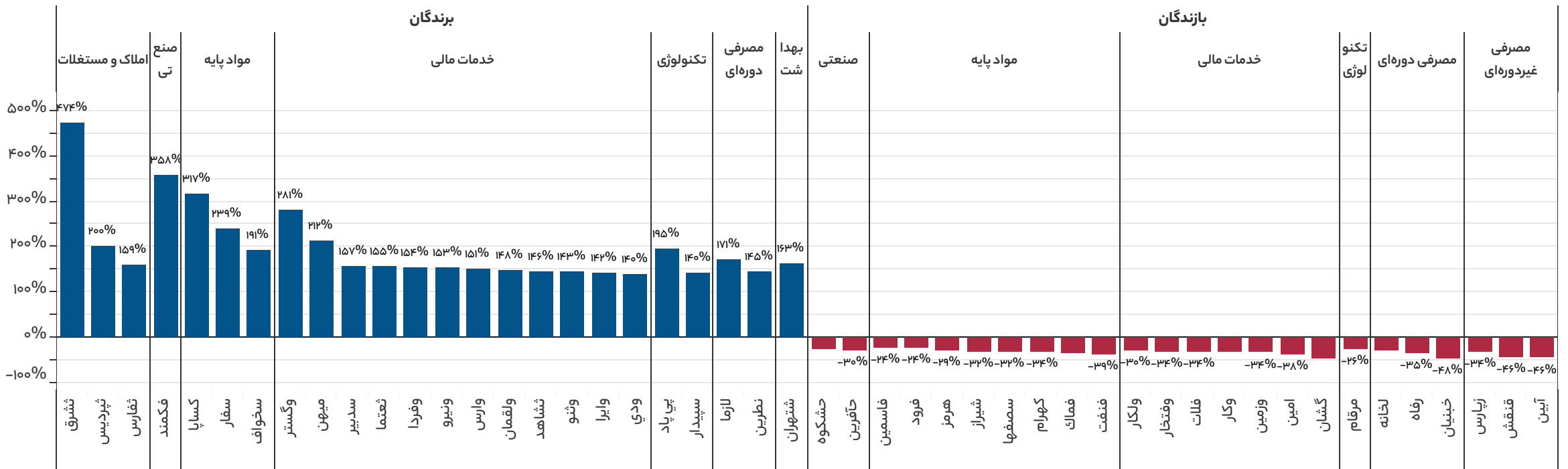
(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)



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

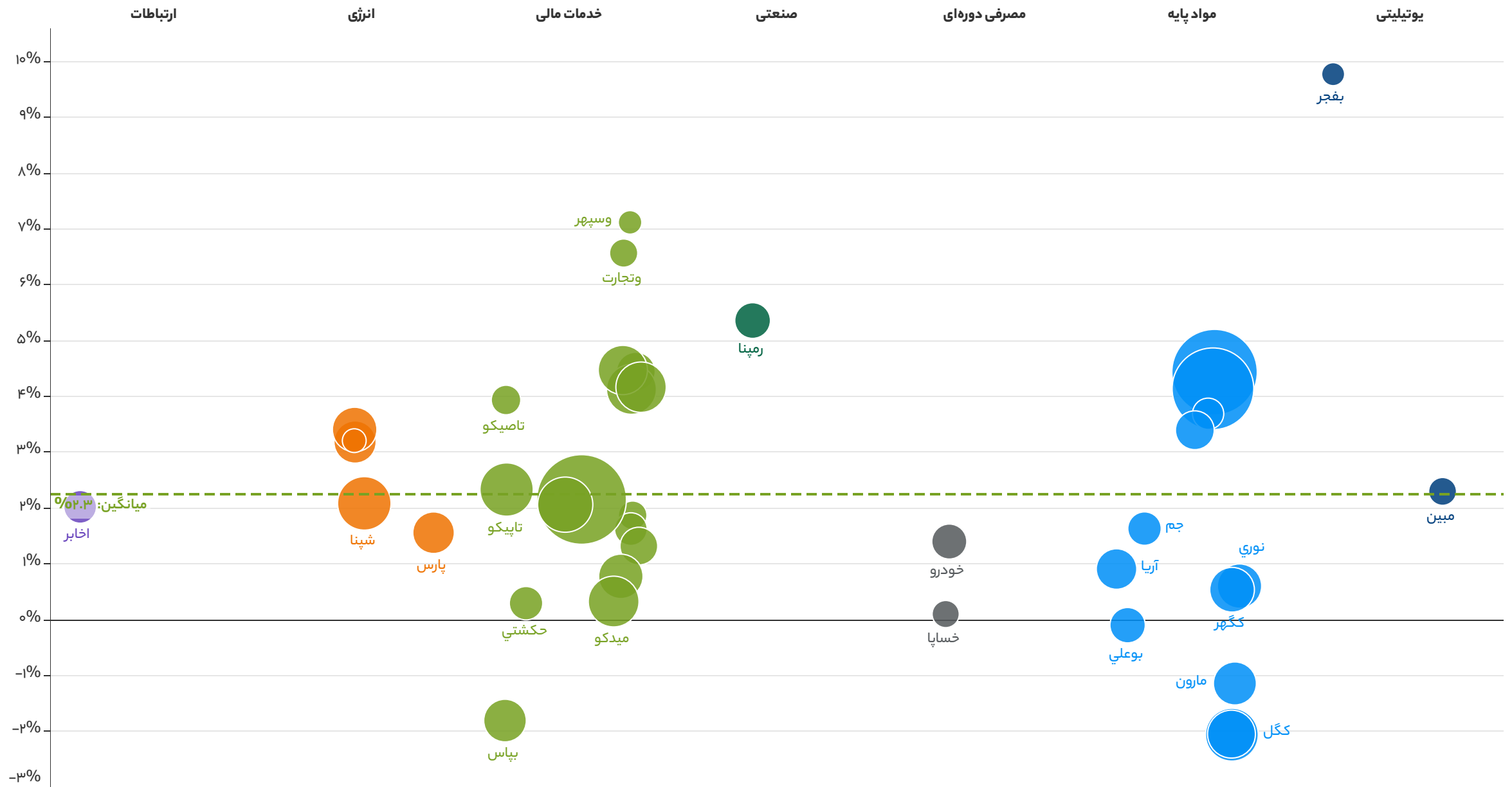


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

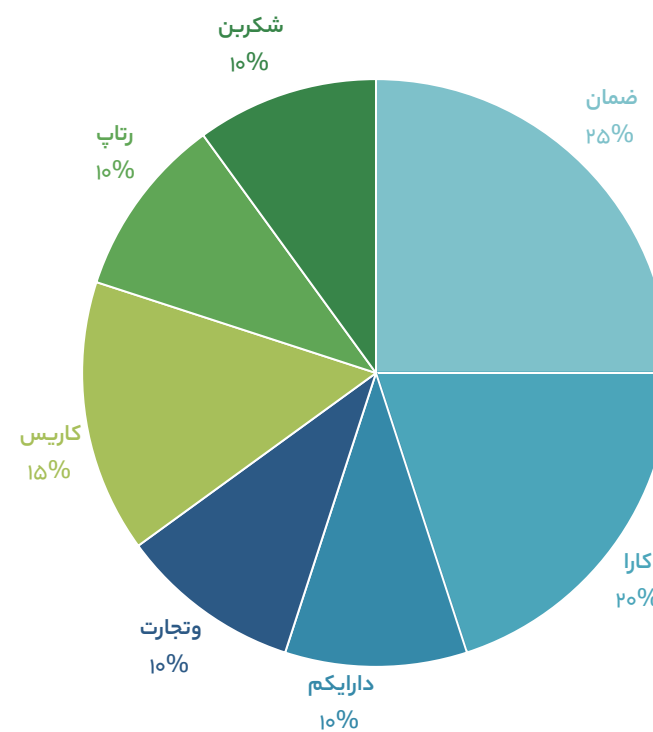


بازده هفته گذشته	بفجر	وسپهر	وتجارت	رمپنا	وبملت	ومعادن	فولاد	پارسان	قملي	وغدير	تاصيکو	فخوز	شبنر	شپدیس	شبریز	شتران	تاپیکو	مبین	فارس	شپنا	شتستا	اخابر	وگندیر	جم	وسندوق	پارس	خودرو	ویاسار	آریا	وامید	نوری	کگهر	میدکو	حکشتی	خسپا	بوعلی	مارون	پپاس	کچاد	کگل
	+۹.۸%	+۷.۱%	+۶.۶%	+۵.۴%	+۴.۵%	+۴.۵%	+۴.۴%	+۴.۲%	+۴.۱%	+۴.۱%	+۳.۹%	+۳.۷%	+۳.۴%	+۳.۴%	+۳.۲%	+۳.۲%	+۲.۳%	+۲.۳%	+۲.۲%	+۲.۱%	+۲.۱%	+۲.۰%	+۱.۹%	+۱.۶%	+۱.۶%	+۱.۶%	+۱.۴%	+۱.۳%	+۰.۹%	+۰.۸%	+۰.۶%	+۰.۶%	+۰.۳%	+۰.۳%	+۰.۱%	-۰.۱%	-۱.۱%	-۱.۸%	-۲.۰%	-۲.۰%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۸۴۵	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۶,۴۴۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و سود مناسب زیر مجموعه‌ها	۷,۰۰۰	شکرین	
۱۵%	۲۳,۴۸۱	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	کاریس	
۱۰%	۱۷۷,۱۰۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۲۳۰,۰۰۰	دارایکم	بلند مدت
۱۰%	۲,۴۵۸	وضعیت ارزندگی مناسب و پتانسیل تجدید ارزیابی	۳,۰۰۰	وتجارت	
۲۰%	۱۶,۳۹۶	دارا بودن پورتنفو بدون ریسک و سود بالاتر نسبت به سایر صندوق‌های درآمد ثابت	-	کارا	
۲۵%	۱۶,۶۰۰	تضمین اصل سرمایه سرمایه‌گذاران و پرتفوی متنوع	-	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



مهم‌ترین محدوده حمایتی در تصویر مشخص شده است.

توضیحات تحلیل



مهم‌ترین محدوده مقاومتی شاخص هم‌وزن 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



بعد از شکست خط روند نزولی، انتظار می‌رود رشد تا حوالی ۴.۸ واحد ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



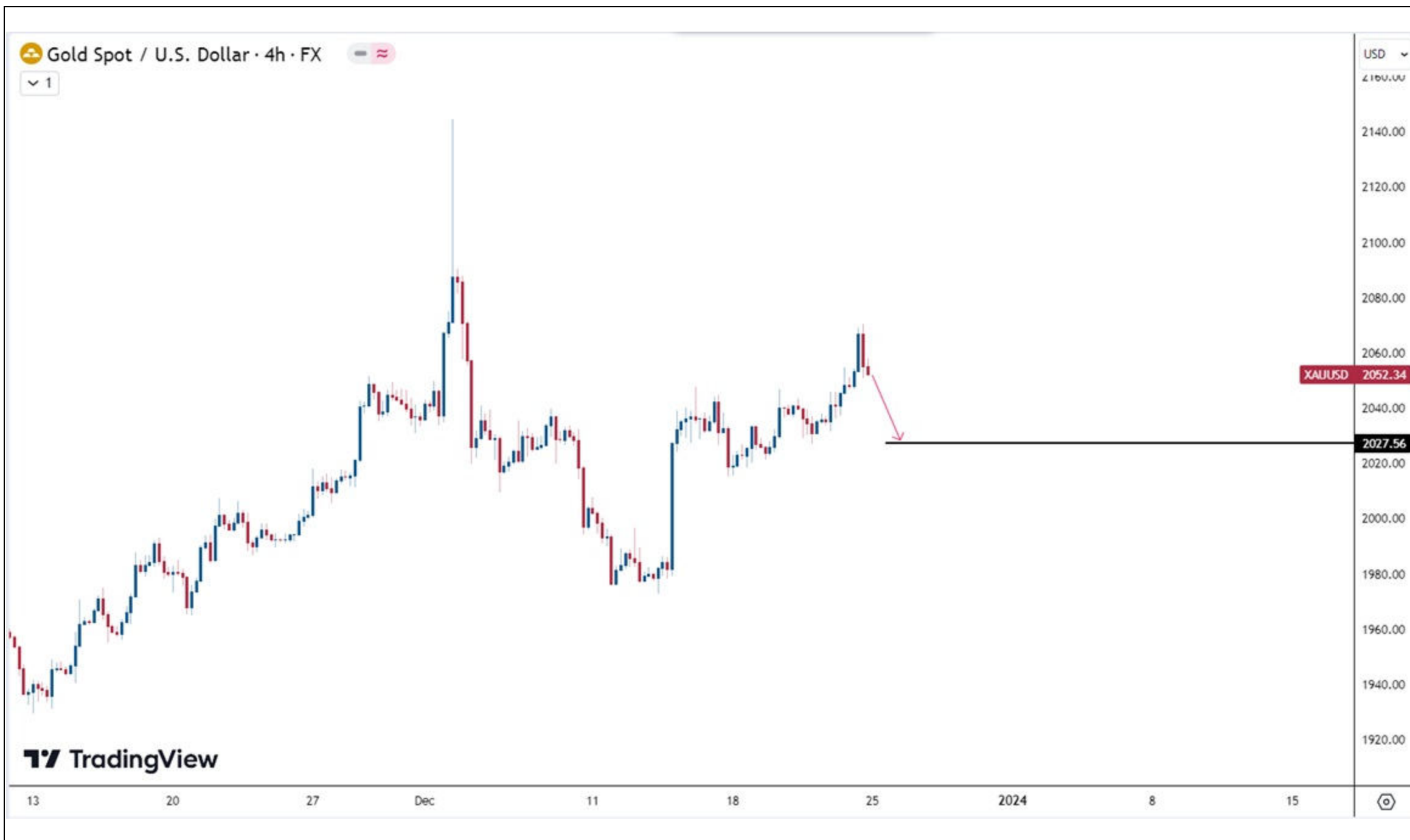
انتظار می‌رود بعد از اصلاح تا حوالی ۴۹ هزار تومان، مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مدتی در ناحیه مشخص شده در نوسان باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی ۲۰۲۷ دلار ادامه داشته باشد. (تایم فریم ۴ ساعته)

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود بعد از اصلاح تا حوالی ۷۳ دلار، وارد مسیر صعودی شود.

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.

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	۱۲۶.۴	-۱%	۱۵,۸۰۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۱	۷.۴	۷.۵	-۲.۰				
		آریا	۱۲	۱۱۲.۸	+۱%	۸,۲۰۵	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۹.۰	۶.۴	۶.۹	-۰.۷				
		جم	۱۲	۷۷.۸	+۲%	۴,۳۲۲	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۷	۴.۱	۴.۵	-۳.۹				
		شگویا	۱۲	۴۱.۹	+۲%	۱,۷۵۰	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۶.۳	۵.۰	۶.۴	+۰.۱				
		جم پیلن	۱۲	۳۶.۷	-	۱۸,۳۴۰	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۵	۴.۷	۵.۸	+۰.۶				
		شکبیر	۱۲	۲۶.۴	-	۷,۳۲۵	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۶	۳.۰	۳.۴	-۸.۱				
		شاراک	۱۲	۲۴.۸	+۱%	۳,۰۷۰	۹۶%	۴۱۹	۲۱۴	۲ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۱	۴.۱	۴.۰	-۱.۸				
		شغذیر	۱۲	۸.۸	-	۶,۷۹۹	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۹	۴.۶	۶.۲	+۰.۲				
		شصبیر	۱۲	۸.۰	+۵%	۳,۱۸۵	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۸	۴.۱	۴.۷	-۰.۱				
	آروماتیک	نوری	۱۲	۱۳۴.۹	+۱%	۱۴,۹۹۲	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۶	۷.۲	۸.۱	+۰.۷				
		بوعلی	۱۲	۸۶.۱	-	۶,۰۰۰	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹.۳	۶.۹	۹.۳	+۴.۲				
		شیراز	۱۲	۳۵.۲	+۵%	۲,۳۰۰	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۳	۵.۲	۶.۰	+۱.۶				
	اوره	خراسان	۱۲	۲۴.۹	-۱%	۱۳,۸۹۰	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۸.۹	۶.۸	۷.۸	+۳.۰				
		کرماشا	۱۲	۱۹.۰	+۱%	۱,۷۹۸	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۹	۴.۴	۴.۵	+۰.۷				
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۲.۳	+۵%	۱۳,۴۶۰	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۱۰.۱	۶.۸	۶.۹	-۲.۰				
		شخارک	۱۲	۲۷.۹	+۱%	۴,۶۵۳	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۸	۴.۸	۵.۸	-۱.۴				
		شفن	۱۲	۱۷.۸	+۴%	۵۷۴	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۸.۲	۶.۰	۵.۶	-۱.۶				
	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۲۷.۹	-۳%	۵۱۳	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۳	۷.۹	۶.۸	+۰.۲				
	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۴.۱	+۲%	۶۴۶	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۷.۵	۵.۸	۶.۲	+۰.۱				
		شصدف	۱۲	۲۰.۸	-۲%	۳,۹۸۰	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۱۰.۲	۶.۴	۷.۸	-۰.۸				
شدوص		۱۲	۲.۴	+۶%	۲,۵۳۶	۹۳%	۱۹۳	۲۲۳	۲ Q	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۶.۹	۵.۳	۶.۵	+۰.۵					



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					
فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۵۰۷.۲	+۴%	۶۳۴	۵۰%	۸۵	۶۶	۲ Q	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۵.۱	۴.۲	۴.۶	+۰.۹					
		فخوز	۱۲	۶۷.۶	+۴%	۳۵۶	۴۶%	۳۵	۲۷	۲ Q	۶۵	۱۰۹	+۶۸%	۵.۵	۳.۰	۳.۶	-۳.۴					
		فولاذ	۱۲	۳۸.۴	+۴%	۱,۶۰۱	۷۶%	۱۹۹	۹۱	۲ Q	۱۷۴	۲۵۰	+۴۴%	۹.۲	۶.۱	۷.۲	+۱.۶					
		هرمز	۱۲	۳۱.۶	-	۶۴۵	۵۱%	۱۱۲	۵۶	۲ Q	۱۱۷	۱۴۱	+۲۱%	۵.۵	۴.۳	۴.۶	-۱.۲					
		ارفع	۱۲	۳۰.۲	+۲%	۲,۵۲۰	۸۶%	۳۱۲	۳۰۹	۲ Q	۵۵۶	۶۴۸	+۱۷%	۴.۵	۳.۴	۴.۱	-۰.۲					
		فخاس	۱۲	۲۸.۵	+۴%	۱,۲۳۸	۴۹%	۱۰۰	۱۳۲	۲ Q	۲۴۲	۲۹۱	+۲۱%	۵.۱	۴.۲	۴.۵	-۲.۸					
	سنگ آهن	کگل	۱۲	۱۸۹.۸	-۲%	۵۷۵	۶۵%	۴۹	۱۲	۲ Q	۵۸	۹۴	+۶۱%	۹.۹	۶.۰	۵.۸	-۲.۹					
		کچاد	۱۲	۱۵۶.۹	-۲%	۵۷۸	۷۱%	۸۴	۳۹	۲ Q	۸۳	۹۹	+۱۹%	۶.۹	۵.۵	۵.۷	-۰.۳					
		کگهر	۹	۱۳۶.۷	+۱%	۱,۸۲۳	۹۲%	۱۵۶	۱۴۸	۳ Q	۱۹۴	۱۶۳	-۱۶%	۹.۴	۱۲.۷	۱۰.۱	+۱.۰					
		کنور	۱۲	۲۳.۷	-	۱,۸۵۶	۹۴%	۱۴۷	۱۴۴	۲ Q	۲۲۴	۲۸۴	+۲۷%	۸.۳	۵.۹	۷.۸	-۰.۲					
	مس	فملی	۱۲	۴۶۶.۸	+۴%	۷۷۸	۴۵%	۸۳	۵۴	۲ Q	۱۳۴	۱۴۹	+۱۲%	۵.۸	۴.۹	۴.۷	-۰.۲					
		کوبر	۱۲	۱۲.۳	+۱%	۳۲۹	۱۲%	۴۶	۲۰	۲ Q	۴۵	۵۹	+۳۲%	۷.۳	۵.۷	۵.۶	-۰.۷					
	محصولات فلزی	فجر	۱۲	۷.۲	+۲%	۸۴۹	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۴.۳	۳.۸	۴.۴	+۰.۱					
		فروژ	۱۲	۵.۰	-۱%	۴,۵۶۰	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۷.۱	۵.۱	۵.۵						
		فسپا	۱۲	۳.۳	+۲%	۸۴۴	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۲۶	-۱۶%	۵.۶	۶.۳	۵.۴	+۰.۴					
		فروس	۱۲	۲.۹	-۱%	۳۶۰	۶۶%	۴۸	۲۴	۲ Q	۴۹	۶۶	+۳۵%	۷.۴	۵.۲	۵.۸	+۰.۵					
		فروسیل	۱۲	۲.۳	+۵%	۱,۴۶۰	۶۴%	۱۱۵	۵۷	۲ Q	۱۶۷	۲۳۶	+۴۲%	۸.۸	۵.۹	۶.۰	-۱۰.۱					
		فولای	۱۲	۰.۹	-	۸۰۷	۲۱%	۵۹	۴۵	۲ Q	۶۹	۷۶	+۱۰%	۱۱.۷	۱۰.۸	۱۲.۱	+۱.۵					
		آلومینیوم	فایرا	۱۲	۲۸.۵	-۲%	۷۵۰	۳۹%	۷۳	۵۶	۲ Q	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۸.۷	۶.۰	۷.۶	+۱.۸				
		طلا	فرز	۹	۱۴.۰	+۲%	۴,۶۵۰	۳۱۸%	۹۹۶	۶۷	۳ Q	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۶.۴	۶.۸	۳.۴	-۱.۳				
سرب و روی	فتوال	۱۲	۳.۷	-۱%	۱,۰۹۵	۵۱%	۱۰۶	۶۱	۲ Q	۱۰۲	۱۴۱	+۳۸%	۱۰.۷	۷.۸	۹.۲	+۳.۱						
	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	-۲%	۴۹۸	۳۶%	۹۳	۲	۲ Q	۱۱۲	۱۷۰	+۵۱%	۴.۴	۲.۷	۲.۴	-۴.۲						
	فتوسا	۱۲	۱.۱	-۱%	۷۵۴	۳۲%	۱۴۹	۳۵	۲ Q	۱۹۵	۲۱۴	+۹%	۳.۹	۳.۳	۲.۶	-۱.۹						
سایرکانی‌های فلزی	کمنگنز	۱۲	۲.۴	+۸%	۱,۶۰۱	۶۴%	۱۱۴	۷۴	۲ Q	۱۸۴	۲۱۸	+۱۹%	۸.۷	۷.۱	۶.۸	-۰.۸						
سایر مواد معدنی	کتوسعه	۹	۲.۲	-۲%	۲,۰۶۰	۹۷%	۱۱۱	۱۱۴	۳ Q	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۱.۹	۱۱.۲	۸.۸							

اجماع تحلیلگران

ایجاد شده توسط: ۱۴۰۲/۱۰/۰۱

		امتیاز Z		نسبت P/e آینده نگر			برآورد سود کاریزما			سود واقعی		وضعیت قیمتی								
گران‌تر →	نمودار امتیاز Z	ارزان‌تر ←	آینده‌نگر ۴ (فصله)	آینده‌نگر ۴ فصله	با سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	رشد سود ۱۴۰۳	سود ۱۴۰۳	سود ۱۴۰۲	گزارش شده	۱۴۰۲ (تاکنون)	۱۴۰۱ (کل سال)	تقسیم سود	قیمت (تومان)	بازده هفتگی	ارزش بازار (همت)	سال مالی	نماد	فعالیت	گروه صنعتی
				+۰.۹	۵.۳	۴.۵	۶.۱	۲,۹۴۶	۲,۳۹۴	۲ Q	۱,۲۸۲	۱,۵۸۴	۹۵%	۱۴,۷۰۵	-	۹.۶	۱۲	ساوه	سیمان، اهک و گچ	مواد پایه
				+۲.۳	۶.۵	۵.۰	۷.۱	۵۰۶	۳۹۰	۲ Q	۲۴۶	۲۴۹	۹۳%	۲,۷۶۸	-	۸.۲	۱۲	سآبیک		
				+۱.۴	۲۱.۱	۱۸.۱	۲۴.۴	۱,۸۹۳	۱,۴۰۱	۲ Q	۸۴۰	۱,۰۳۹	۹۵%	۳۴,۲۳۵	-۳%	۸.۰	۱۲	سفار		
				-۰.۸	۳.۴	۳.۴	۴.۸	۱,۲۱۶	۹۹۶	۲ Q	۲۸۴	۷۱۹	۹۰%	۴,۷۸۲	+۱%	۶.۷	۱۲	سخوز		
				+۱.۸	۵.۳	۵.۸	۶.۸	۵۰۱	۳۹۵	۳ Q	۲۹۸	۲۹۰	۸۱%	۲,۶۶۹	+۲%	۶.۶	۹	سمازن		
				-۰.۱	۵.۰	۳.۹	۵.۹	۱,۰۷۷	۷۹۹	۲ Q	۴۵۱	۵۵۴	۹۶%	۴,۷۲۵	-	۴.۷	۱۲	ساروم		
				+۰.۰	۳.۹	۴.۱	۶.۲	۱,۶۶۸	۱,۰۱۲	۳ Q	۷۷۸	۶۴۸	۹۸%	۶,۳۱۰	+۲%	۴.۶	۱۰	سهگمت		
				+۰.۶	۳.۸	۳.۳	۵.۰	۲,۱۶۳	۱,۶۸۴	۲ Q	۶۹۵	۱,۱۷۰	۹۷%	۸,۳۶۹	-	۴.۲	۱۲	سفانو		
				+۰.۵	۵.۰	۴.۲	۵.۷	۱,۰۲۵	۸۶۶	۲ Q	۴۷۲	۴۹۶	۹۶%	۴,۹۰۵	-۱%	۴.۰	۱۲	سرود		
				+۰.۹	۵.۶	۴.۳	۶.۲	۷۱۴	۵۴۳	۲ Q	۳۳۷	۳۶۸	۹۰%	۳,۳۷۵	+۵%	۳.۷	۱۲	سصوفی		
				+۰.۸	۵.۱	۵.۳	۶.۶	۳۶۹	۲۷۱	۳ Q	۲۱۸	۱۷۰	۸۹%	۱,۷۹۵	+۴%	۳.۱	۹	سشمال		
				+۰.۰	۶.۱	۵.۷	۶.۸	۱,۱۲۶	۱,۰۴۷	۲ Q	۵۲۷	۵۷۳	۹۶%	۷,۰۸۹	-	۲.۸	۱۲	سبجنو		
				+۰.۶	۱۰.۰	۹.۷	۱۱.۷	۵۷	۴۹	۲ Q	۲۴	۳۷	۹۷%	۵۷۲	-	۲.۳	۱۲	سقاین		
				-۰.۳	۵.۰	۴.۸	۶.۲	۲,۰۲۸	۱,۷۷۶	۲ Q	۷۴۹	۷۳۶	۹۷%	۱۰,۹۹۹	-	۲.۲	۱۲	سبهان		
				-۰.۷	۴.۰	۳.۳	۵.۰	۱,۰۹۷	۸۵۶	۲ Q	۴۱۰	۳۹۰	۹۲%	۴,۲۶۵	-	۲.۱	۱۲	سغرب		
				-۰.۶	۵.۰	۴.۵	۶.۹	۱,۹۹۵	۱,۴۲۴	۲ Q	۵۷۴	۱,۱۶۱	۹۵%	۹,۸۸۰	+۵%	۲.۰	۱۲	سقاش		
				+۰.۱	۶.۵	۵.۴	۷.۷	۶۳۶	۴۸۰	۲ Q	۲۶۸	۳۵۸	۹۵%	۳,۷۱۱	-	۱.۹	۱۲	سخرز	کاشی و سرامیک	مواد پایه
				-۲.۳	۳.۸	۳.۴	۵.۶	۲۲۲	۱۳۵	۲ Q	۶۱	۸۲	۱۰%	۷۵۰	+۲%	۳.۹	۱۲	کحافظ		
				-۲.۰	۴.۰	۴.۰	۶.۰	۱,۳۷۶	۱,۰۰۹	۲ Q	۲۹۰	۷۴۷	۷۱%	۶,۰۳۰	+۲%	۳.۲	۱۲	کساوه		
				-۰.۱	۵.۲	۴.۶	۶.۱	۸۹۱	۷۵۳	۲ Q	۳۸۱	۵۰۴	۹۵%	۴,۵۸۱	-۱%	۱.۸	۱۲	کلوند	فرآورده‌های نسوز	مواد پایه
				+۰.۴	۷.۰	۷.۱	۶.۹	۱۶۷	۱۹۰	۲ Q	۱۰۰	۸۷	۸۸%	۱,۳۰۹	-	۲.۰	۱۲	کپشیر		



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	۱۹۸.۹	+۲%	۸۷۶	۶۳%	۱۷۰	۱۰۱	۲ Q	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۵.۰	۴.۹	۵.۱	+۱.۶				♦			
		شبندر	۱۲	۱۳۸.۱	+۳%	۱,۰۲۸	۷۶%	۳۰۴	۷۷	۲ Q	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴.۲	۵.۸	۳.۹	+۱.۵				♦			
		شتران	۱۲	۱۲۴.۳	+۳%	۴۵۲	۳۱%	۱۰۹	۴۵	۲ Q	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۵	۴.۳	۴.۱	+۱.۲				♦			
		شبریز	۱۲	۳۹.۴	+۳%	۱,۳۱۴	۷۶%	۳۳۵	۹۳	۲ Q	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۵.۴	۵.۰	۴.۵	-۰.۱			♦				
		شاوان	۱۲	۱۷.۴	+۵%	۲,۱۸۰	۷۳%	۵۵۵	۱۸۳	۲ Q	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۳	۸.۹	۴.۷	+۰.۸			♦				
	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۱۹.۹	+۲%	۲۵۲	۸۸%	۳۱	۱۰	۲ Q	۳۵	۴۶	+۳۰%	۷.۱	۵.۱	۴.۹	-۲.۸	♦					
		شسپا	۱۲	۲۸.۴	+۴%	۵۰۷	۶۷%	۷۴	۴۵	۲ Q	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۴	۴.۲	۴.۶	+۰.۲			♦				
		روانکار	شبه‌رن	۱۲	۲۷.۳	-	۲,۲۸۵	۸۹%	۳۳۸	۱۷۷	۲ Q	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۱	۵.۷	۵.۶	+۱.۵				♦		
			شنفت	۱۲	۱۷.۷	+۶%	۸۸۵	۸۲%	۱۰۸	۶۶	۲ Q	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۸.۳	۸.۱	۹.۰	+۰.۵			♦			
			شرانل	۱۲	۱۵.۴	+۱%	۷,۶۸۵	۸۵%	۱,۴۴۱	۵۷۶	۲ Q	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴.۶	۳.۸	۳.۶	-۰.۵			♦			
	زغال سنگ	کپور	۱۲	۲.۵	+۴%	۱,۴۹۱	۵۹%	۱۶۹	۸۳	۲ Q	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۷.۳	۵.۳	۵.۴	-۰.۴			♦				
		کطبس	۱۲	۱.۶	+۴%	۲,۰۶۸	۶۲%	۱۹۳	۱۲۲	۲ Q	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۶.۹	۵.۸	۵.۶	-۱.۶		♦					
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۶	-	۵۳۵	۹۴%	۴۷	۲۷	۳ Q	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۲.۰	۸.۹	۷.۱	-۴.۴	♦					
			تنوین	۱۲	۸.۶	-	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	۱.۶	+۳%	۷,۸۷۵	۹۱%	۸۸۸	۵۰۵	۲ Q	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۶.۰	۳.۶	۴.۲	-۰.۶			♦			
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۴	+۲%	۶,۹۳۰	۹۶%	۳۲۲	۱۷۶	۲ Q	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۷.۱	۹.۴	۱۰.۹	+۰.۲			♦			
																		-۳	-۲	-۱	۰	+۱	+۲	+۳

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	۱۲.۶	+۱%	۵,۲۵۵	۷۶%	۴۹۵	۳۳۹	۲ Q	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۶.۲	۴.۵	۴.۷	+۰.۱				
		دلر	۱۲	۷.۵	+۳%	۳,۳۳۸	۹۶%	۳۵۲	۲۶۴	۲ Q	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۶.۸	۶.۱	۶.۵	+۱.۰				
		دالبر	۱۲	۶.۴	+۶%	۶۷۴	۶۹%	۷۵	۵۰	۲ Q	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۶.۰	۴.۸	۴.۸	-۰.۹				
		دپارس	۱۲	۶.۳	+۲%	۶,۶۰۸	۹۸%	۸۰۳	۲۶۴	۲ Q	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۶.۹	۵.۹	۵.۱	+۰.۲				
		دفرا	۱۲	۵.۷	+۳%	۴,۰۴۰	۷۹%	۳۹۳	۲۰۱	۲ Q	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۸.۱	۶.۸	۶.۵	+۱.۹				
		دفارا	۱۲	۵.۴	-	۳,۳۹۷	۹۹%	۴۵۲	۱۵۲	۲ Q	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۶.۱	۵.۱	۴.۵	+۰.۲				
		هجرت	۱۲	۴.۵	-۱%	۲,۸۱۵	۹۵%	۴۰۶	۲۳۶	۲ Q	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۲	۴.۰	۴.۳	-۰.۶				
		دقاضی	۱۲	۴.۴	+۱%	۲,۶۱۵	۹۶%	۲۷۷	۱۷۷	۲ Q	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۹	۵.۳	۵.۷	+۰.۰				
		دتوزیع	۱۲	۴.۲	-	۲,۳۵۰	۹۴%	۴۴۹	۱۰۳	۲ Q	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۷.۱	۵.۳	۵.۱	-۰.۲				
		کاسپین	۱۲	۲.۹	+۶%	۲,۰۴۳	۹۵%	۲۳۴	۱۵۴	۲ Q	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۶.۴	۵.۰	۵.۵	+۰.۱				
		درازک	۱۲	۲.۶	+۱%	۱,۲۴۷	۱۰۴%	۲۱۳	۲۷	۲ Q	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۵	۳.۸	۳.۵	-۶.۸				
		دکپسول	۱۲	۲.۶	+۳%	۸,۵۰۰	۹۲%	۹۲۱	۶۰۳	۲ Q	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۸.۰	۶.۲	۷.۲	+۲.۰				
		دراز۱	۱۲	۲.۱	+۴%	۲,۱۲۰	۶۷%	۲۷۳	۱۱۰	۲ Q	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۶.۱	۵.۳	۴.۷	-۱.۱				

منطقه منتهی به: ۱۴۰۲/۱۰/۰۱



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 کاربریما		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		Z	Z	Z	
غذا و نوشیدنی	زراعت و خدمات وابسته	سپید	۱۲	۸.۲	+۲%	۲,۷۳۹	۵۵%	۲۱۳	۲۰۲	۲ Q	۴۹۶	۶۸۹	+۳۹%	۵.۵	۳.۸	۴.۰	-۳.۹					
		سیمرغ	۹	۴.۸	+۴%	۳,۶۸۵	۲۴%	۳۹۱	۳۳۷	۳ Q	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۶.۸	۴.۸	۳.۹	-۱.۳					
		زفکا	۱۲	۲.۹	+۳%	۱,۹۰۰	۹۱%	۱۵۵	۱۰۵	۲ Q	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۱۰.۵	۶.۹	۸.۵	+۰.۶					
		تلیسه	۱۲	۲.۲	+۳%	۴۳۲	۹۲%	۲۵	۲۹	۲ Q	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۲.۷	۸.۷	۱۳.۸	+۰.۲					
		زگلدشت	۱۲	۱.۷	+۱%	۲,۴۹۰	۹۵%	۹۶	۱۱۰	۲ Q	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۱.۴	۸.۴	۹.۲	+۰.۰					
		زملارد	۱۲	۱.۷	-	۲,۱۰۰	۹۴%	۳۳	۶۳	۲ Q	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۴.۴	۱۱.۴	۱۱.۴	-۲.۵					
		زشریف	۹	۱.۶	+۶%	۶۷۱	۷۶%	۴۸	۵۸	۳ Q	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۸.۵	۶.۹	۶.۰	-۰.۶					
	شیرینیجات	زشگزا	۱۲	۱.۰	-۱%	۱,۰۳۱	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۹.۵	۵.۴	۸.۴	+۰.۳					
		غصینو	۱۲	۱۴.۰	+۶%	۱,۴۰۳	۶۰%	۱۶۱	۷۴	۲ Q	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۶.۲	۴.۱	۴.۲	-۲.۲					
		غپینو	۱۲	۳.۵	+۳%	۳۹۱	۵۶%	۴۹	۲۵	۲ Q	۶۷	۹۴	+۳۹%	۵.۸	۴.۰	۴.۱	-۱.۱					
		غسالم	۱۲	۲.۱	-۱%	۴۶۸	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۶۵	۸۱	+۲۵%	۷.۲	۵.۸	۵.۰	-۰.۸					
	روغن خوراکی	غمینو	۱۲	۱.۵	-۱%	۱,۰۳۰	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۶.۲	۴.۰	۴.۳	-۰.۲					
		غگورش	۱۲	۱۴.۷	+۲%	۷۳۳	۵۴%	۱۲۶	۴۰	۲ Q	۸۳	۸۶	+۳%	۸.۸	۸.۳	۷.۹	+۰.۳					
		غگلپا	۱۲	۱.۶	-۶%	۴,۲۸۰	۷۴%	۴۶۵	۲۲۳	۲ Q	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۷.۳	۴.۹	۵.۱	-۰.۵					
محصولات لبنی	غگلستا	۱۲	۱.۲	+۲%	۱,۹۴۶	۷۰%	۱۵۶	۴۹	۲ Q	۲۰۷			۹.۴									
	غشان	۱۲	۱.۲	-۵%	۶۷۹	۷۱%	۸۰	۲۶	۲ Q	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۸.۲	۵.۹	۵.۶	-۰.۵						
	کیمیاتک	۱۲	۶.۷	-	۱,۱۱۰	۶۴%	۱۰۲	۷۱	۲ Q	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۷.۷	۶.۴	۶.۶	+۰.۳						
محصولات پاک کننده	قرن	۱۲	۶.۵	-۱%	۱,۰۸۷	۶۱%	۱۱۰	۶۲	۲ Q	۱۴۳	۲۰۰	+۴۰%	۷.۶	۵.۲	۵.۶	-۰.۷						
	شپاکسا	۹	۲.۶	-۲%	۲۷۹	۳۸%	-۲۴	۲۳	۳ Q	۴۶	۶۱	+۳۲%	۶.۱	۵.۶	۳.۸	-۳.۳						

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳



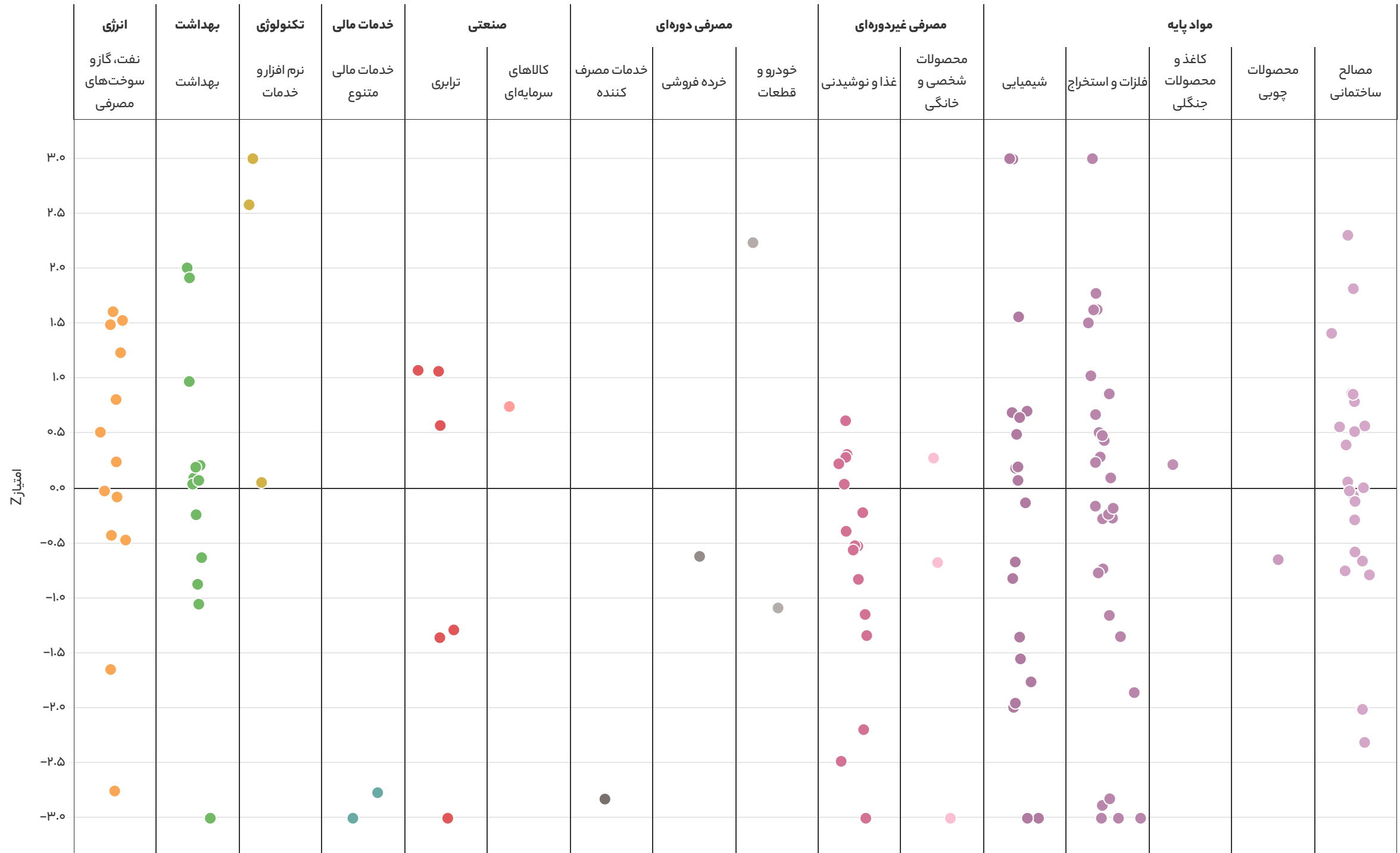
نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

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)				
صنعتی	بنادرو کشتیرانی	حزِر	۱۲	۶۰۸	-۳%	۱,۹۰۰	۹۶%	۲۰۷	۱۹۸	۲ Q	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۶.۶	۴.۱	۵.۹	+۰.۶				
		حتايد	۱۲	۶۰۷	+۲%	۵۵۶	۵۲%	۶۲	۴۳	۲ Q	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۵.۱	۳.۹	۳.۹	-۱.۳				
	ترابری	توریل	۱۲	۴۰۱	+۳%	۵۸۹	۳۸%	۴۳	۱۸	۲ Q	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸.۸	۶.۹	۶.۰	-۱.۴				
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	حآفرین	۱۲	۱.۹	+۲%	۲۵۷	۵۲%	۳۱	۱۳	۲ Q	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۲	۵.۵	۴.۶	-۵.۸			
		چپارسا	۶	۱.۶	+۲%	۶,۲۹۵	۸۹%	۶۳۱	۵۱۲	۳ Q	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸.۸	۷.۴	۶.۳	+۱.۱				
کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳۰۷	+۳%	۲۶۵	۳۱%	۲۶	۱۵	۲ Q	۲۰	۳۰	+۴۶%	۱۳.۱	۹.۰	۱۲.۳	+۰.۷				
	سیم و کابل	بکابل	۱۲	۲۰۹	-	۲,۷۹۵	۶۱%	۲۵۰	۱۲۷	۲ Q	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۳	۴.۹	۴.۴					
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	تایرو تیوپ	۹	۵.۱	-۱%	۷۷۶	۷۵%	۲۵	۶۳	۳ Q	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۹.۰	۴.۷	۴.۷	-۱.۱				
		پلوله	۱۲	۰.۸	-۴%	۳,۷۴۰	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۷.۴	۱۷.۲	۲۰.۸	+۲.۲				
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳۰۹	+۴%	۷۷۱	۴۹%	۱۰۳	۴۷	۲ Q	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۷	۴.۲	۴.۱	-۰.۶			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	رافزا	۱۲	۱.۷	+۵%	۱,۶۵۳	۸۰%	۹۱	۹۹	۲ Q	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۱۱.۸	۹.۶	۱۲.۱	+۰.۱				

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

مقایسه ارزشیابی شرکت‌ها

امتیاز Z نسبت قیمت به سود (P/e) شرکت‌ها، به تفکیک سکتور و گروه صنعتی



ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

@CharismaHolding

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما:

@CharismaTickReports

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

