

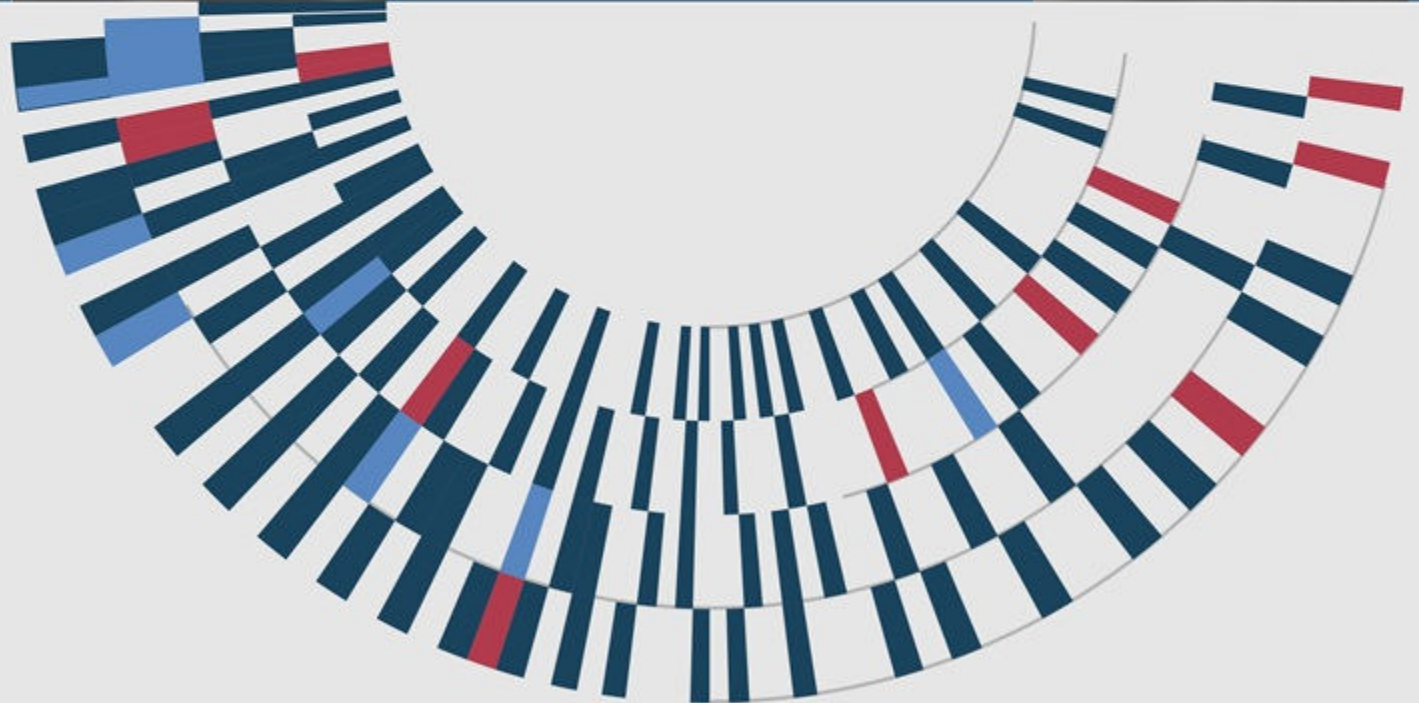
کاریزما تیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۱ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۰۸

 CHARISMA





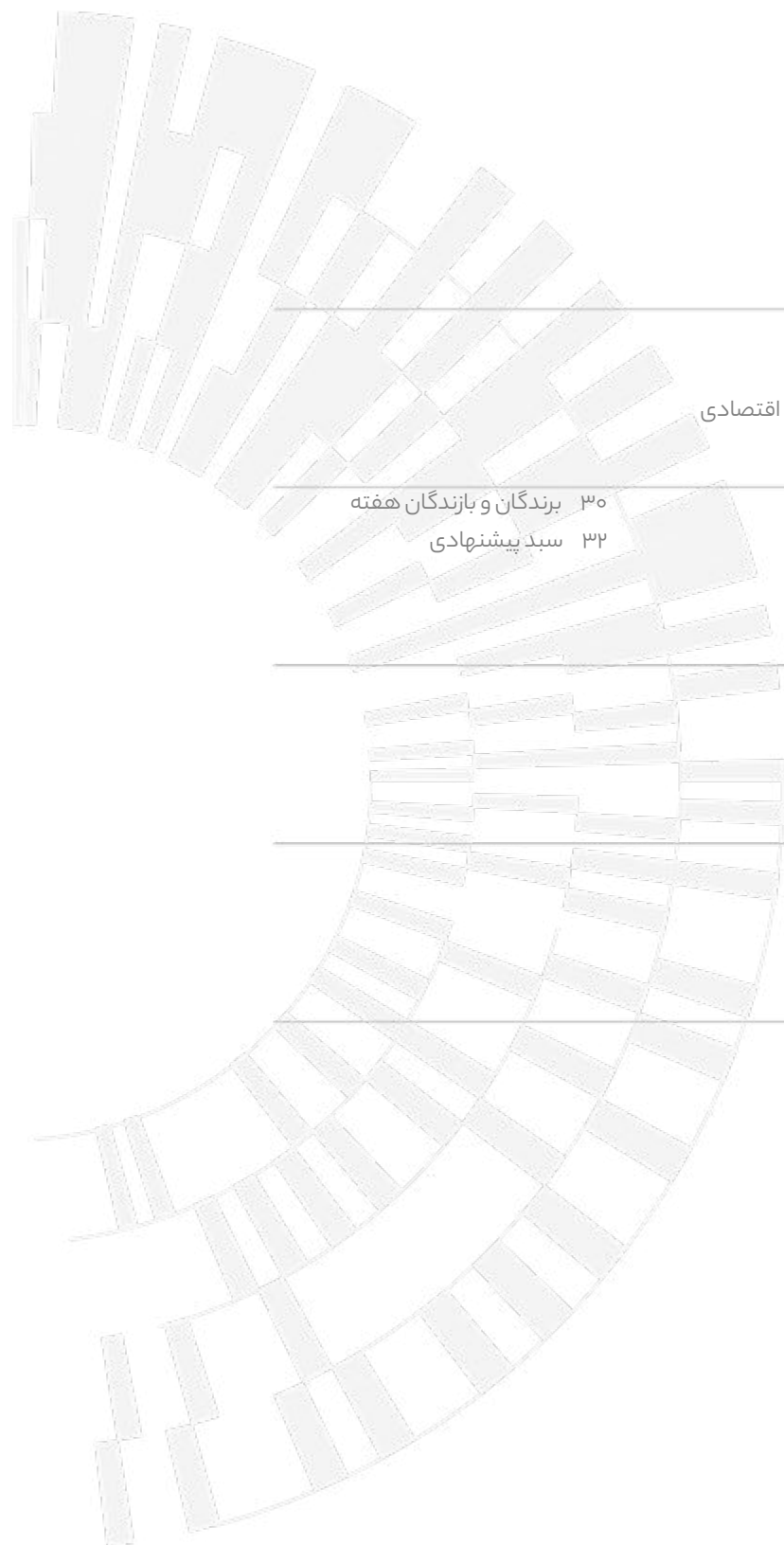
معرفی گزارش:

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	۲,۰۶۶	۱.۱%	فزر	-	۲,۰۶۹ ۱,۸۱۳	۱۱%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۶۲۱	۰.۵%	فملی	بموتو، فباهنر	۹,۳۴۱ ۷,۹۴۳	۰%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۳۴۴	۱.۲%	فایرا	فنوال	۲,۴۲۴ ۲,۰۷۱	۳%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۶۳۴	۱.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۳,۴۴۴ ۲,۳۰۳	-۱۳%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۸۶	۰.۵%	فاسمین، فسرب، فروی، فزرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۲۹۶ ۲,۰۲۴	-۸%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۸۷	۰.۴%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۸۴۳ ۳,۰۲۲	۵۵%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۱۹	-۰.۲%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخور، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۶۲۵ ۲,۷۶۶	۲۷%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۸	-۰.۲%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۶۲۳ ۴۳۱	-۲%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۸۰	۱.۷%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۲۲,۸۲۱ ۱۵,۷۵۵	۱۸%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۳۰	-	فولاد، فخور، هرمز	-	۶۷۰ ۴۴۸	۱۴%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۸۲۰	-	فولاد، فخور، هرمز	-	۲۲,۰۸۰ ۱۶,۶۹۰	۱۲%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۵	-۰.۴%	ذوب، کوپر	فولای	۷۵۵ ۵۴۶	-۱۳%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۱۴۳	۰.۶%	ذوب، کوپر	فولای	۲۴,۷۴۷ ۱۷,۴۲۳	۲۱%
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	رند قیمتی ۱۲ ماهه
اوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۲۰	۱.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماش	شاروم، شفارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۹۳	-	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفارس، 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	-	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۵۳۰	-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	-	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۵	-	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۲	-	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۱	-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	-	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۹	-	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۰	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۷۹۰	-	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم		
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۴۰	-	شغدیر، اروند، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-		
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۴۵	-	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

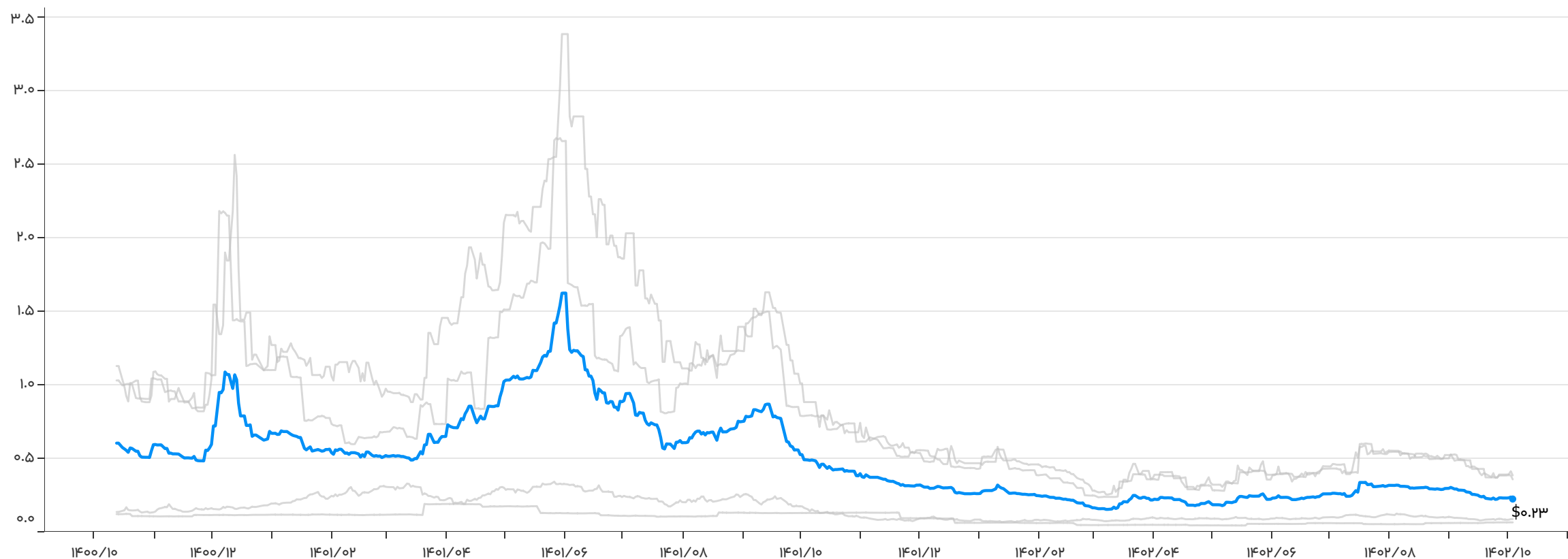
راند قیمتی ۱۲ ماهه												بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش		تغییر نسبت به هفته گذشته		آخرین قیمت		واحد		مرجع قیمتی		عنوان	
انرژی و فرآورده‌های نفتی			-۲%		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-		-۲.۷%		۷۷		دلار/بشکه		بورس بین‌المللی اروپا		نفت برنت								
			-۳%		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-		-۳.۵%		۷۱		دلار/بشکه		بورس بین‌المللی اروپا		نفت WTI								
			-۱۵%		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-		-۴.۵%		۱۵۷		دلار/بشکه		بورس کالای نیویورک		نفت کوره								
			-۱۴%		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		-		-		-۳.۴%		۱۵۱		دلار/بشکه		بورس بین‌المللی اروپا		گازوئیل کم سولفور								
			۶۶%		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان		تومان/تن		-۵.۹%		۱۷,۵۸۷		تومان/تن		بورس کالای ایران		لوب کات - پالایش نفت تهران								
			۷%		-		شبهرن، شسپا، شنف، شرانل		تومان/تن		۱.۴%		۲۷,۴۱۱		تومان/تن		بورس کالای ایران		روغن پایه - نفت سپاهان								
محصولات کشاورزی			۱۳%		-		شپاس		تومان/تن		-۱.۱%		۱۲,۶۵۹		تومان/تن		بورس کالای ایران		قیر - نفت پاسارگاد								
			-۲۷%		غکورشن، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		دلار/تن		۵.۳%		۱۸۷		دلار/تن		بورس کالای چیکاگو		ذرت آمریکا								
			-۱۳%		غکورشن، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار		-		دلار/تن		۵.۱%		۸۵۴		دلار/تن		بورس مالزی		روغن پالم خام								
			-۷%		-		-		دلار/تن		-۱.۱%		۱,۲۲۶		دلار/تن		بورس کالای نیویورک		شکر آمریکا								
ارز و ارز دیجیتال			-۱۵%		-		-		دلار/تن		۲.۶%		۲۳۲		دلار/تن		بورس کالای چیکاگو		گندم آمریکا								
			۴%		-		-		-		۵.۳%		۱.۱۵		-		بازار فارکس		یورو به دلار								
			۵%		-		-		-		۵.۴%		۱.۲۸		-		بازار فارکس		پوند به دلار								
			۱۴۸%		-		-		-		-۳.۸%		۴۲,۵۷۴		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	۰.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۴	-۳۱%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۷	-۰.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۴۹%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	-۶.۶%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۵۱%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۶	-۶.۹%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۸۰	-۵۵%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۳	-۵.۷%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۵۱%

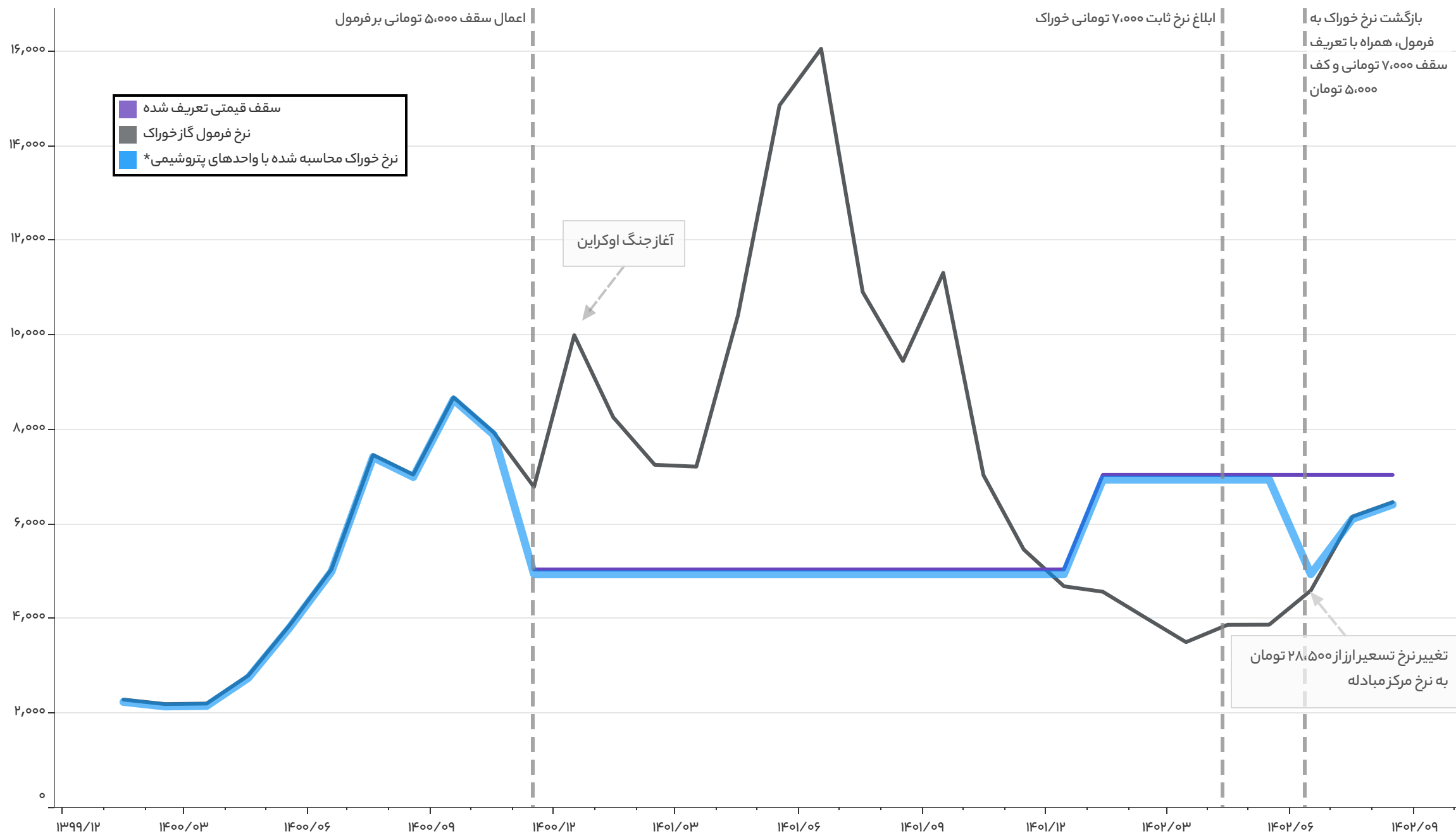
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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



فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

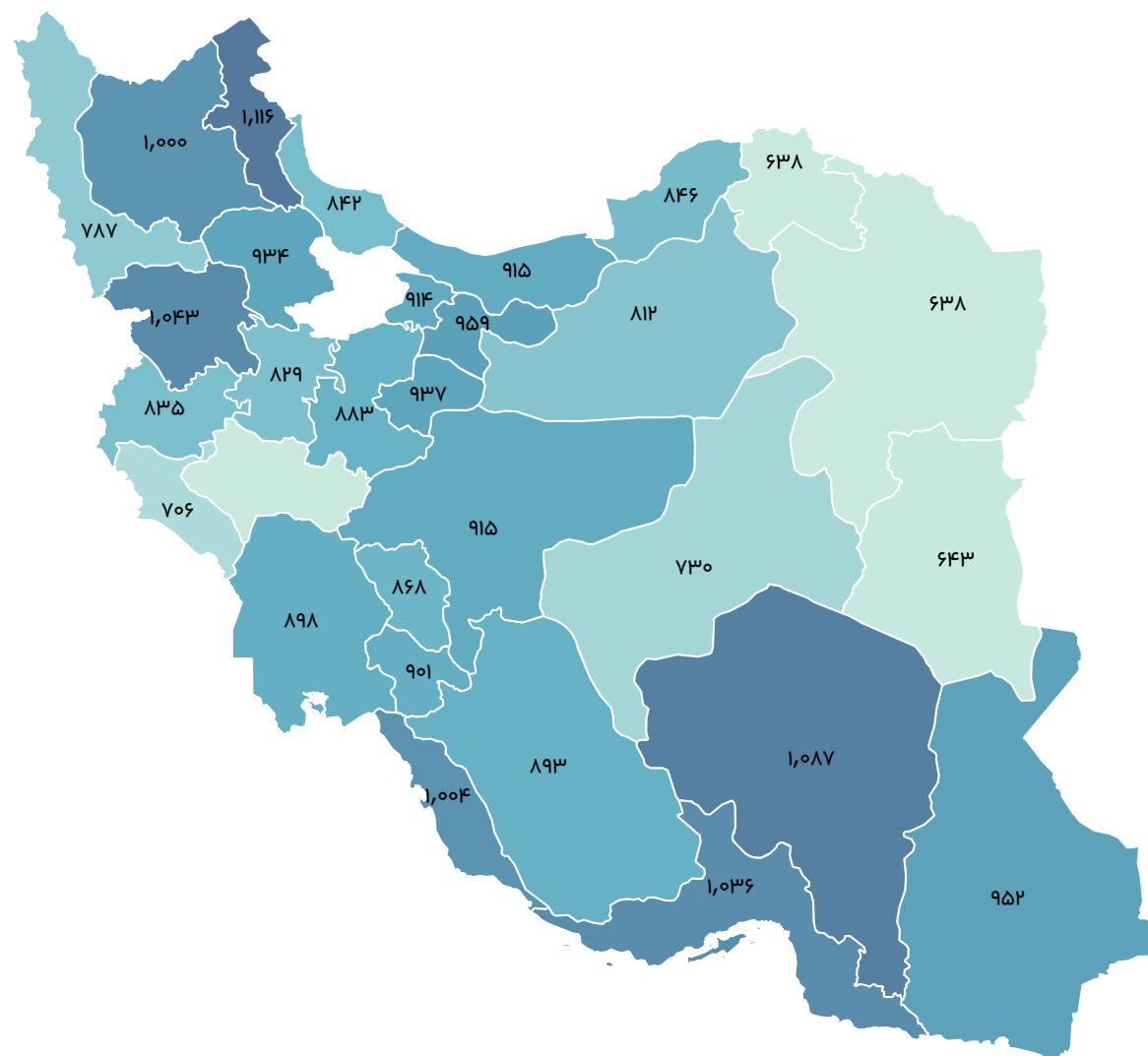
نرخ بدست آمده از فرمول گاز خوراک در برابر نرخ خوراک محاسبه شده با صنایع پتروشیمی با اعمال سقف قیمتی، از ابتدای سال ۱۴۰۰، تومان به ازای هر مترمکعب



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

قیمت منطقه‌ای سیمان* در هفته گزارش

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



آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	البرز	سیمان آبیگ	۹۱۴	۹۱۴	-
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۸۸۳	-
	تهران	سیمان تهران	۹۳۰	۹۵۹	+۳.۲%
	قم	سیمان نیزار قم	۹۳۷	۹۳۷	-
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۱۲	۸۱۲	-
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیما..	۷۲۶	۷۳۰	+۰.۵%
غرب	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۸۹۸	-
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۹۵	۸۶۸	-۳.۰%
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۶	۷۰۶	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۳۵	۸۳۵	-
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۹۰۱	+۲.۴%
	لرستان	سیمان دورود	۸۴۰		
شمال غرب	کردستان	سیمان کردستان	۹۳۷	۱,۰۴۳	+۱۱.۳%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۰۶۵	۱,۱۱۶	+۴.۸%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۲۴	۷۸۷	-۴.۵%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۳۹	۱,۰۰۰	+۶.۵%
جنوب	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۹۷۷	۱,۰۳۶	+۶.۱%
	فارس	سیمان داراب	۸۹۳	۸۹۳	-
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۹۷	۱,۰۰۴	+۰.۸%
شمال	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
	گیلان	سیمان خزر	۷۵۸	۸۴۲	+۱۱.۰%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۹۱۰	۸۴۶	-۷.۰%
شمال شرق	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۴۹	۶۳۸	-۱.۷%
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۴۲	۶۴۳	+۰.۱%
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۵۹	۱,۰۸۷	+۱۳.۴%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۸۴	۹۵۲	-۳.۳%

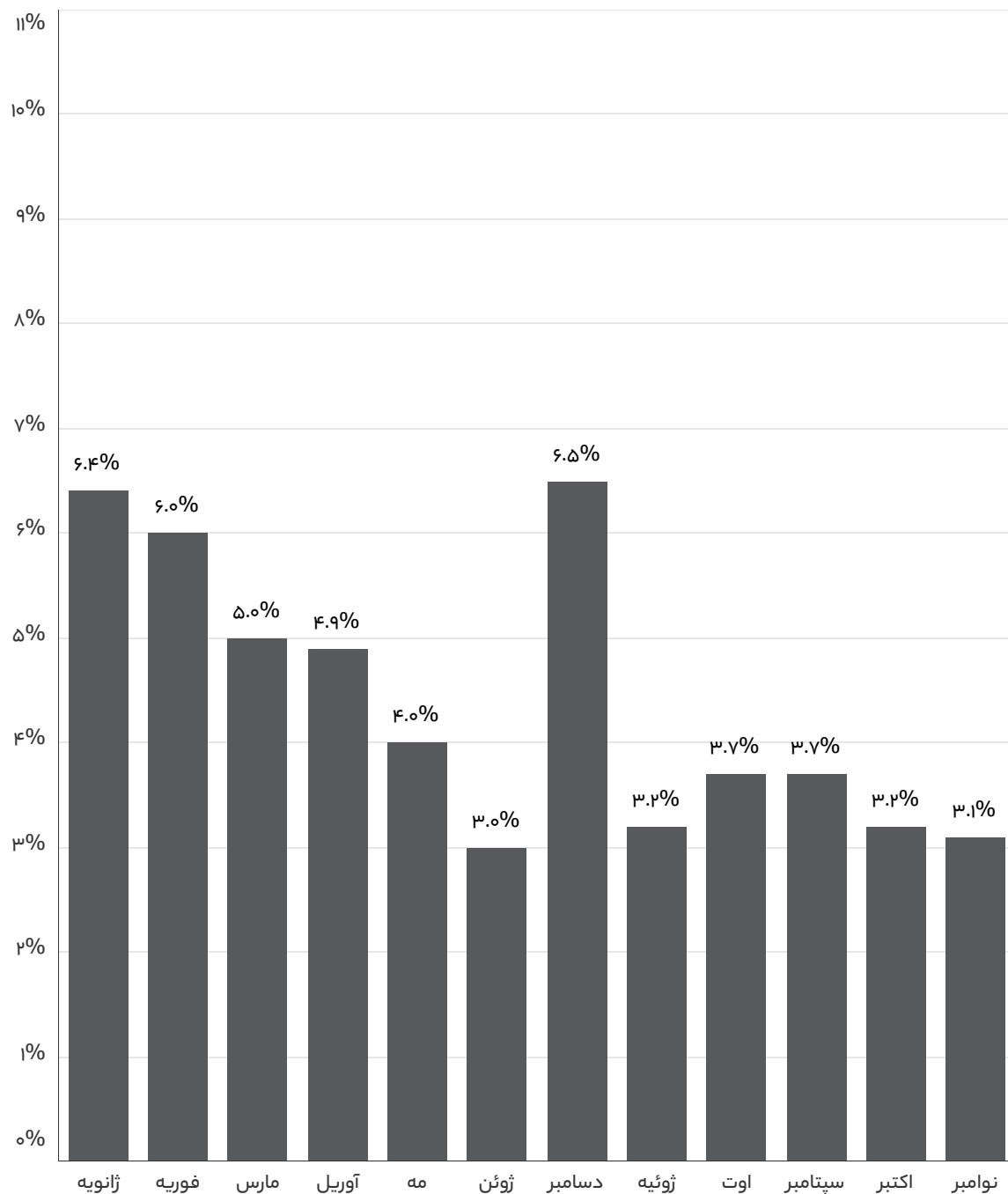
* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ فله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (بر اساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.

- ▲ به گزارش رویترز، کاهش ارزش دلار و سود اوراق قرضه خزانه داری آمریکا به دنبال افزایش احتمال پایین آمدن نرخ بهره فدرال رزرو در اوایل سال آینده میلادی، قیمت طلا را به بالاترین رقم طی دو هفته گذشته رسانده است. از سوی دیگر، پایین آمدن نرخ بهره هزینه نگهداری طلا به عنوان یک سرمایه غیرسودده را کاهش داده و تمایل برای خرید آن را بالا می برد. این عوامل سبب شد طی هفته گذشته قیمت طلا به بالاتر از ۲۰۷۵ دلار برسد.
- ✓ سیدمحمدهادی سبحانیان، رئیس سازمان امور مالیاتی درخصوص اخبار مبنی بر افزایش مالیات بر طلافروشان از اول دی ماه که در فضای مجازی دست به دست می شود، گفت: هیچ مالیات جدید یا افزایش نرخ در حوزه مالیات ستانی از صنف طلا وضع نشده و اصل طلا و جواهر و پلاتین به کار رفته در مصنوعات ساخته شده از فلزات مزبور، معاف از مالیات بر ارزش افزوده است.
- ▲ به گزارش رویترز، با خروج آنگولا از سازمان کشورهای صادرکننده نفت خام یعنی اوپک، اعضای این گروه به ۱۲ کشور می رسد. آنگولا که از سال ۲۰۰۷ به اوپک پیوسته بود، روزانه ۱.۱ میلیون بشکه نفت تولید می کند؛ این درحالی است که تولید کل اوپک حدود ۲۸ میلیون بشکه در روز است. پیش از این هم اکوادور در سال ۲۰۲۰ و قطر در سال ۲۰۱۹ از اوپک خارج شدند.
- ▲ قیمت نفت بیش از ۲ درصد در روز سه شنبه افزایش یافت و به بالاترین رقم طی ماه جاری رسید. نفت هفته گذشته هم بیش از ۳ درصد افزایش قیمت داشت. امید به کاهش نرخ بهره فدرال رزرو آمریکا که باعث رشد اقتصاد و بالا رفتن تقاضا برای سوخت می شود، از عوامل افزایش قیمت نفت بوده است. اما دورنمای طولانی شدن جنگ غزه و گسترش این درگیری به کشتی ها در دریای سرخ همچنان بر بازار تاثیر می گذارد. در این بین، یمن هم یک کشتی باری را در دریای سرخ مورد حمله موشکی قرار داده است.
- ▼ براساس گزارشی که توسط S&P Global Commodity Insights منتشر شد، آمریکا قرار است در ۳ ماهه چهارم سال جاری میلادی، رکورد جهانی ۱۳.۳ میلیون بشکه در روز نفت خام و میعانات تولید کند و در مسیر تولید نفت بیش از هر کشور دیگری در تاریخ قرار بگیرد. براساس گزارش اداره اطلاعات انرژی آمریکا، ماه گذشته تولید هفتگی نفت آمریکا به ۱۳.۲ میلیون بشکه در روز رسید. این دقیقاً بالاتر از رکورد تولید ۱۳.۱ میلیون بشکه ای دوران دونالد ترامپ است که در اوایل سال ۲۰۲۰ درست قبل از بحران کرونا باعث سقوط تولید و قیمت ها شد.
- ▲ شرکت تحلیل بازار CMI در تازه ترین گزارش خود از پیش بینی آینده متانول تجدیدپذیر، حجم این بازار در سال ۲۰۳۰ را حدود ۳۶۹ میلیون دلار ارزیابی نموده است. براساس گزارش منتشر شده از سوی CMI، از آنجا که متانول های تجدیدپذیر به عنوان مدرن ترین سوخت ممکن در پیش روی صنایع مهمی چون برق، حمل و نقل، مواد شیمیایی و تولید برق سبز جهان محسوب می شوند، آینده این بازار رو به رشد خواهد بود.
- ✓ گمرک ایران برای نخستین بار اقدام به انتشار تجارت خارجی کشور با احتساب آمار صادرات نفت، برق و خدمات فنی و مهندسی در دولت سیزدهم کرد. محمد رضوانی فر، معاون وزیر اقتصاد و رئیس کل گمرک ایران با اعلام این خبر گفت: میزان صادرات نفت در ۹ ماهه امسال به ۲۶ میلیارد و ۴۶۰ میلیون دلار رسیده است. همچنین درخصوص صادرات کالاهای پتروشیمی در ۹ ماهه سال جاری افزود: در این مدت ۳۸ میلیون و ۲۰۰ هزار تن کالاهای پتروشیمی به ارزش ۱۵ میلیارد دلار به خارج از کشور صادر شده که به رغم افزایش ۲۶.۵۲ درصدی در وزن، به دلیل کاهش قیمت های جهانی این محصول به لحاظ ارزشی ۱۱.۸۴ درصد کاهش داشته است.
- ✓ بر اساس مصوب نمایندگان مجلس در بخش اول لایحه بودجه سال آینده که شامل منابع درآمدی دولت است، منابع حاصل از نفت، گاز و فرآورده های نفتی در سال آینده ۵۸۲ هزار میلیارد تومان برآورد شده است که نسبت به رقم مشابه در قانون بودجه سال جاری ۳.۵ درصد کاهش خواهد داشت.
- ✓ طبق بررسی های خبرنگار اقتصادی خبرگزاری فارس، عدم تحقق ۴۵ درصدی درآمد نفتی ناشی از دو نکته است. از یک سو در قانون بودجه ۱۴۰۲، دولت در ابتدا قیمت هر بشکه نفت را ۷۰ دلار برآورد کرده بود که بعد از دخالت مجلس و افزایش ردیف هزینه ها، قیمت نفت به رقم ۸۵ دلار بیش برآورد شد. از سوی دیگر، با توجه به تعیین سهمیه نفت برای «نیروهای مسلح» و «تهاتر نفت در پروژه های زیرساختی»، عملاً وزارت نفت باید میزان صادرات نفت را به ۱.۸ میلیون بشکه در روز برساند تا پس از کسر دو سهم ذکر شده، بتواند درآمد نفتی دولت را به طور کامل محقق کند. درحالی که طبق آمار عدد ۱.۴ از ۱.۸ میلیون بشکه برآورد شده، تاکنون محقق شده است. در مجموع عدم تحقق درآمدهای نفتی ۱۴۰۲، به معنای افت صادرات نفت ایران نیست بلکه با وجود تداوم روند صعودی، بیش برآوردهای غیرواقعی در قیمت و رقم فروش منجر به کسری بودجه دولت از این محل شده است.

شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته

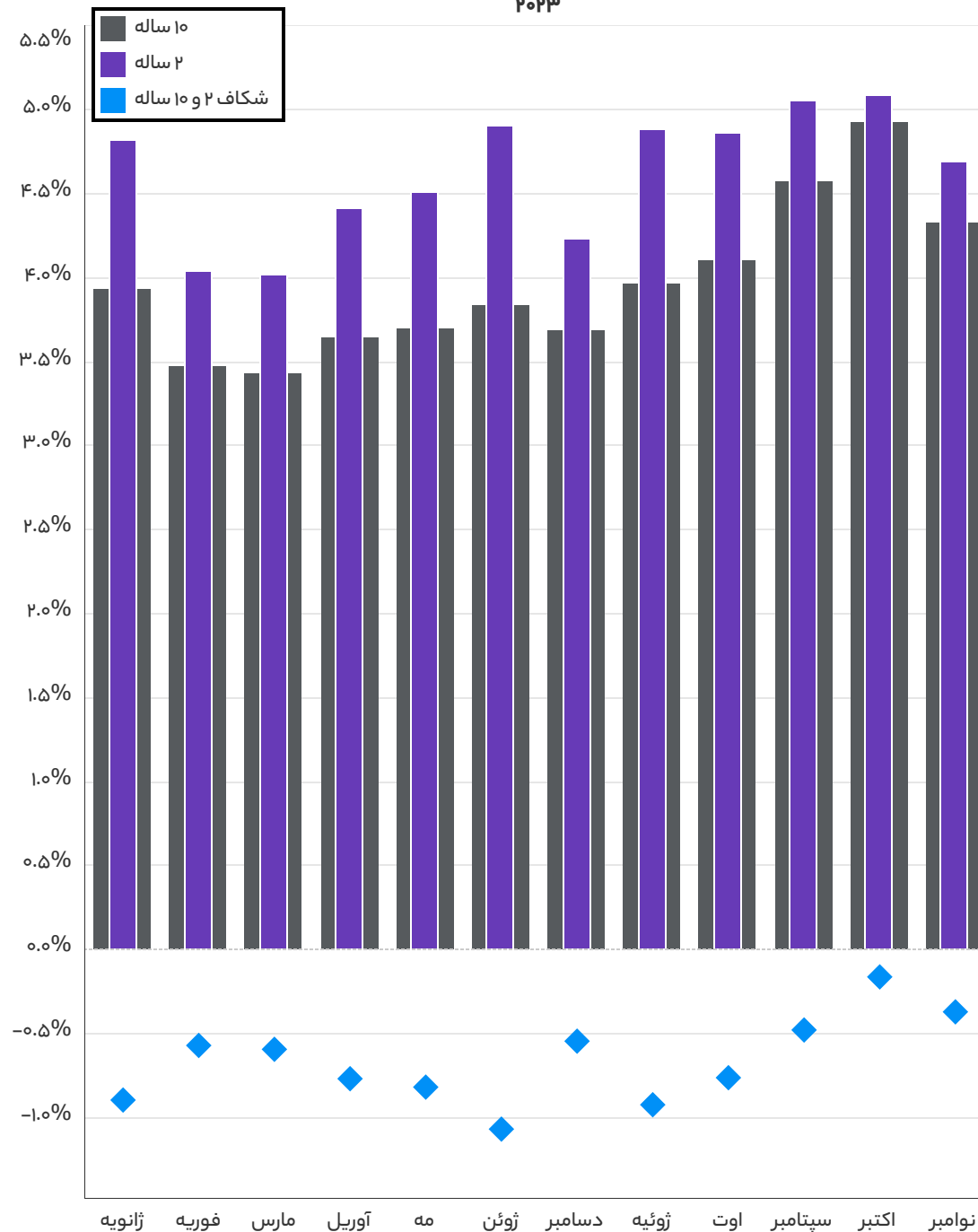
۲۰۲۳



وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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

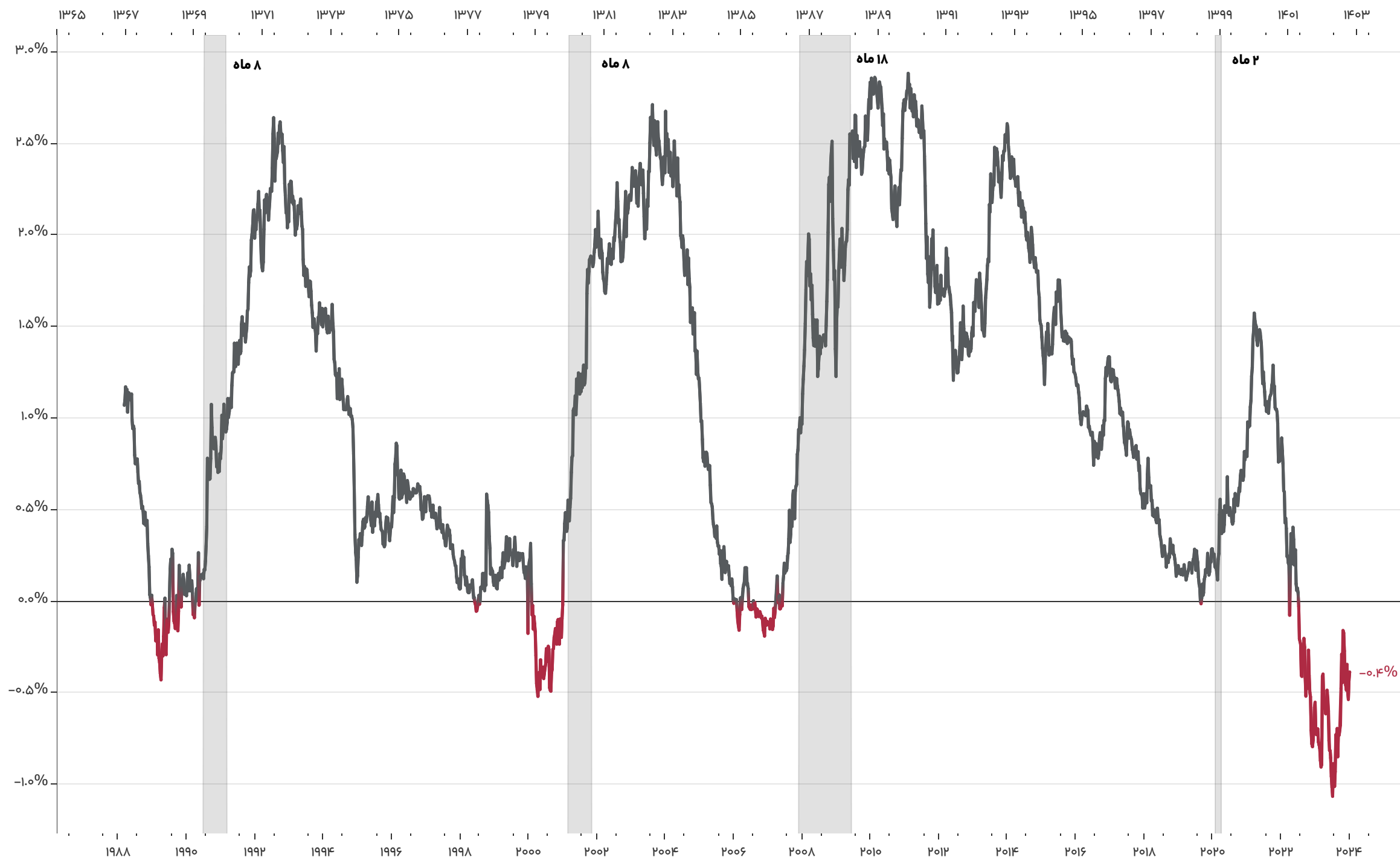
۲۰۲۳





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

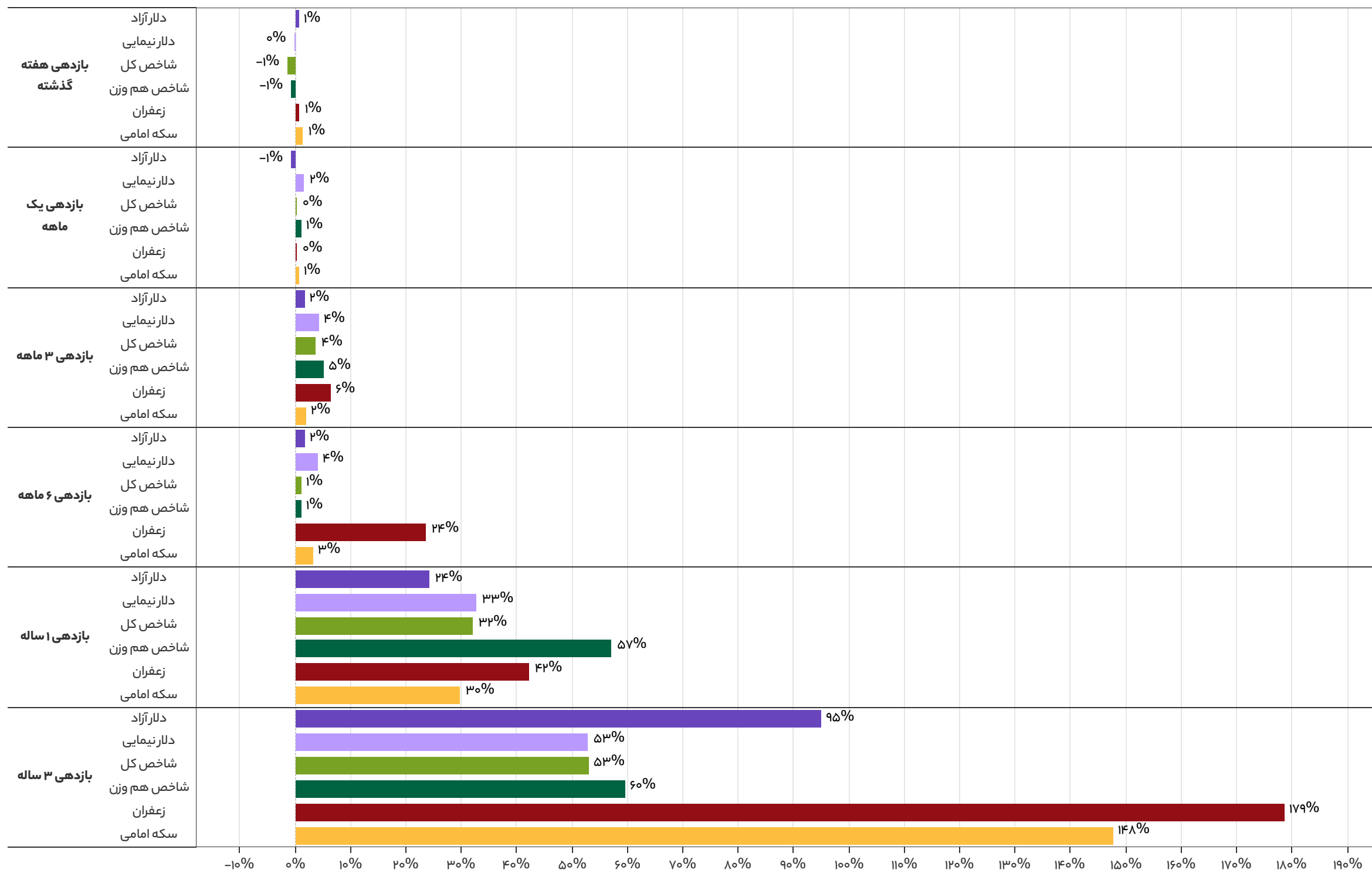
EQUITY MARKET

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 در هر ماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												نوسان	بازده سال
۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	۱۴۰۲/۰۹	هم وزن ۴۴٪	هم وزن ۴۵.۹٪
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٪	شاخص کل ▲ ۹.۴٪	شاخص کل ۴۰٪	زعفران ▲ ۴۴.۲٪
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٪	هم وزن ▲ ۸.۲٪	سکه امامی ۳۸٪	مسکن ▲ ۴۲.۶٪
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٪	دلار نیمایی ▲ ۲.۲٪	سکه امامی ۳۳.۳٪	دلار نیمایی ۲۵٪
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٪	درآمد ثابت ▲ ۲.۰٪	مسکن ۲۱٪	درآمد ثابت ▲ ۲۳.۶٪
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٪	زعفران ▲ ۱.۵٪	زعفران ۲۰٪	سکه امامی ▲ ۱۸.۲٪
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٪	سکه امامی ▲ ۰.۸٪	دلار آزاد ▲ ۱۵.۶٪	دلار آزاد ۱۸٪
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 ▼ ۰.۸٪	درآمد ثابت ۰٪	دلار نیمایی ▲ ۱۱.۸٪
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٪	مسکن ▼ ۲.۲٪	درآمد ثابت ۰٪	دلار نیمایی ▲ ۱۱.۸٪

– 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.

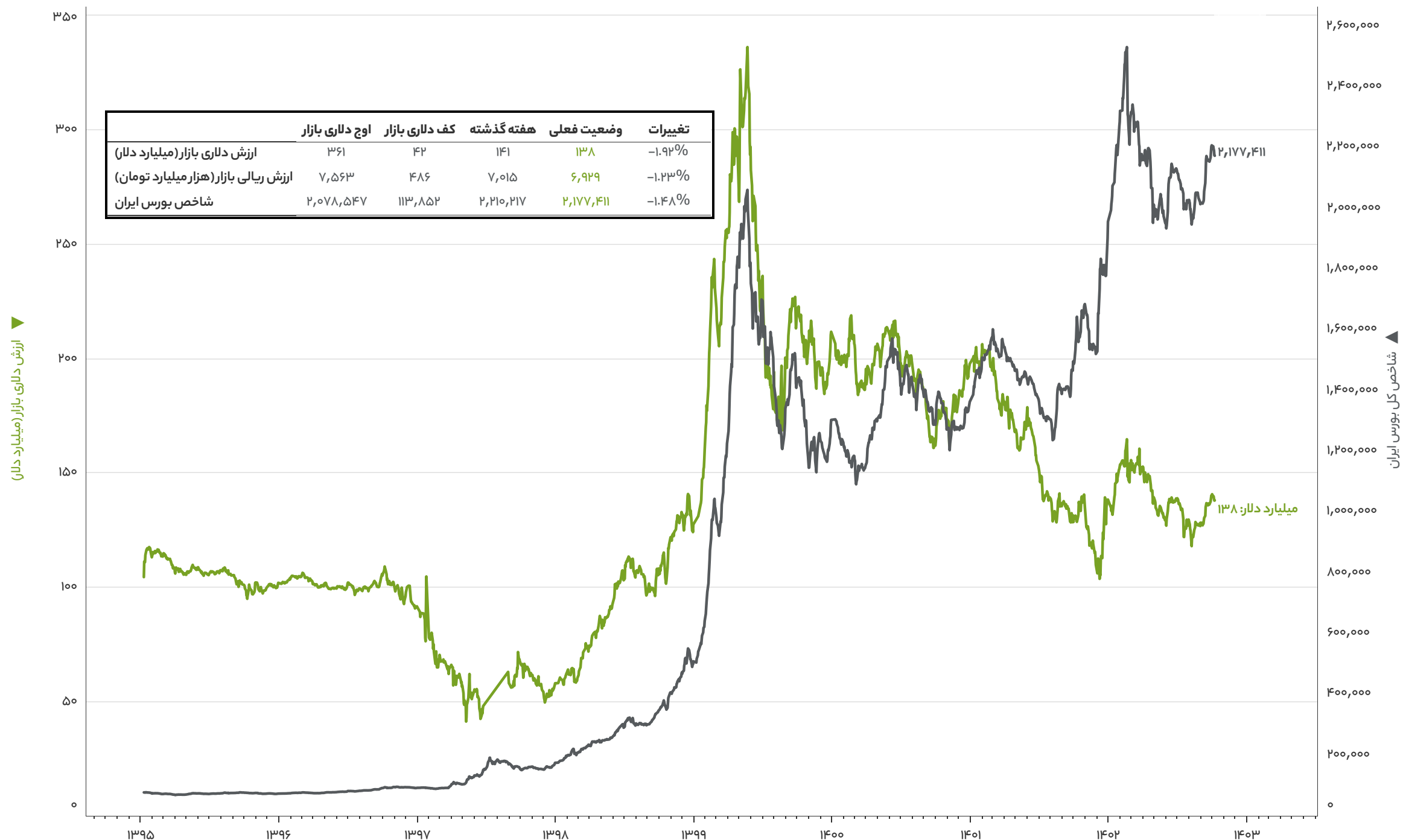
– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری طلای سرخ نوویرا محاسبه شده است.

– 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 کاربریما ذکر گردیده، استفاده شده است.



ارزش دلاری بازار

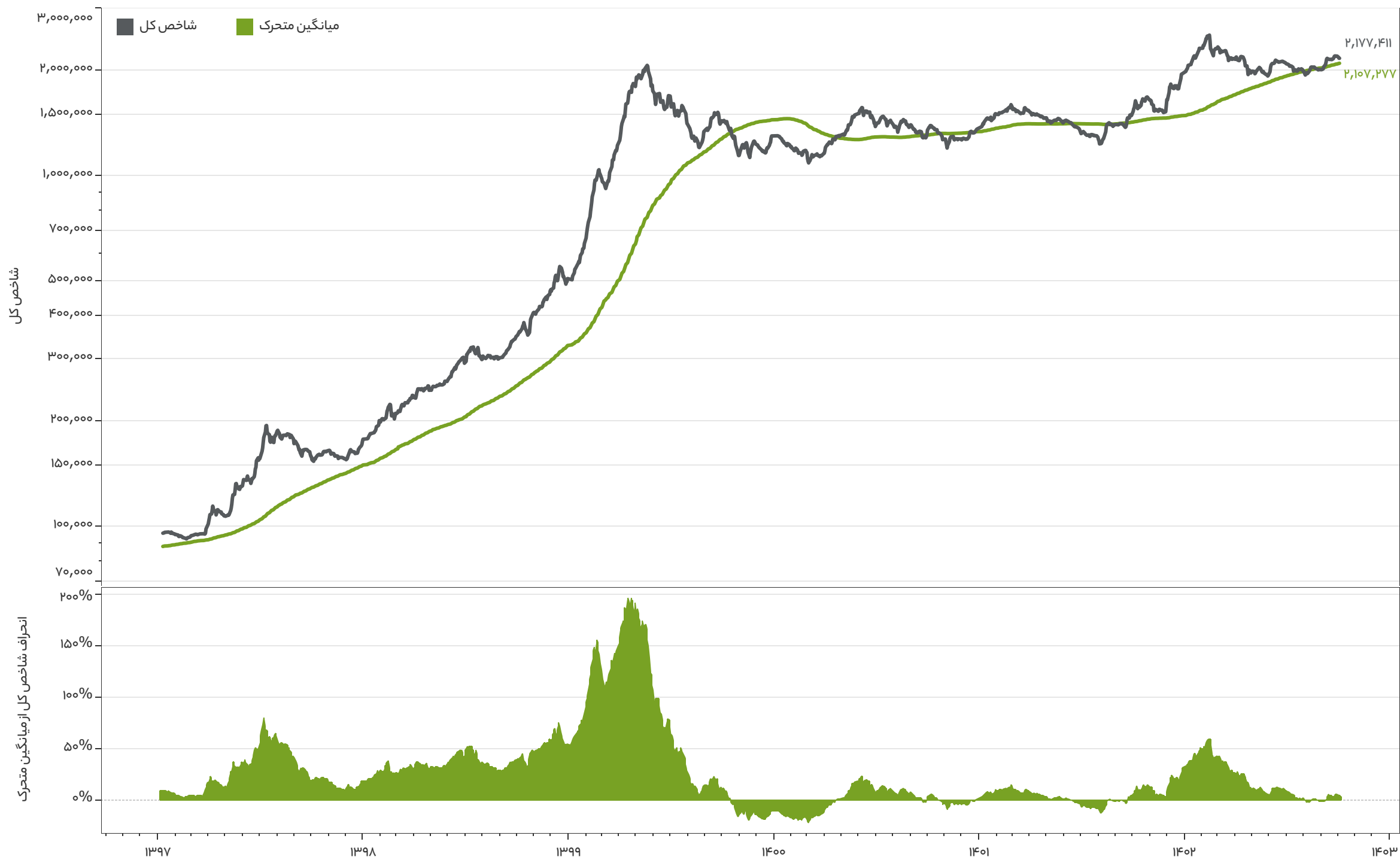
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





شاخص کل و میانگین متحرک

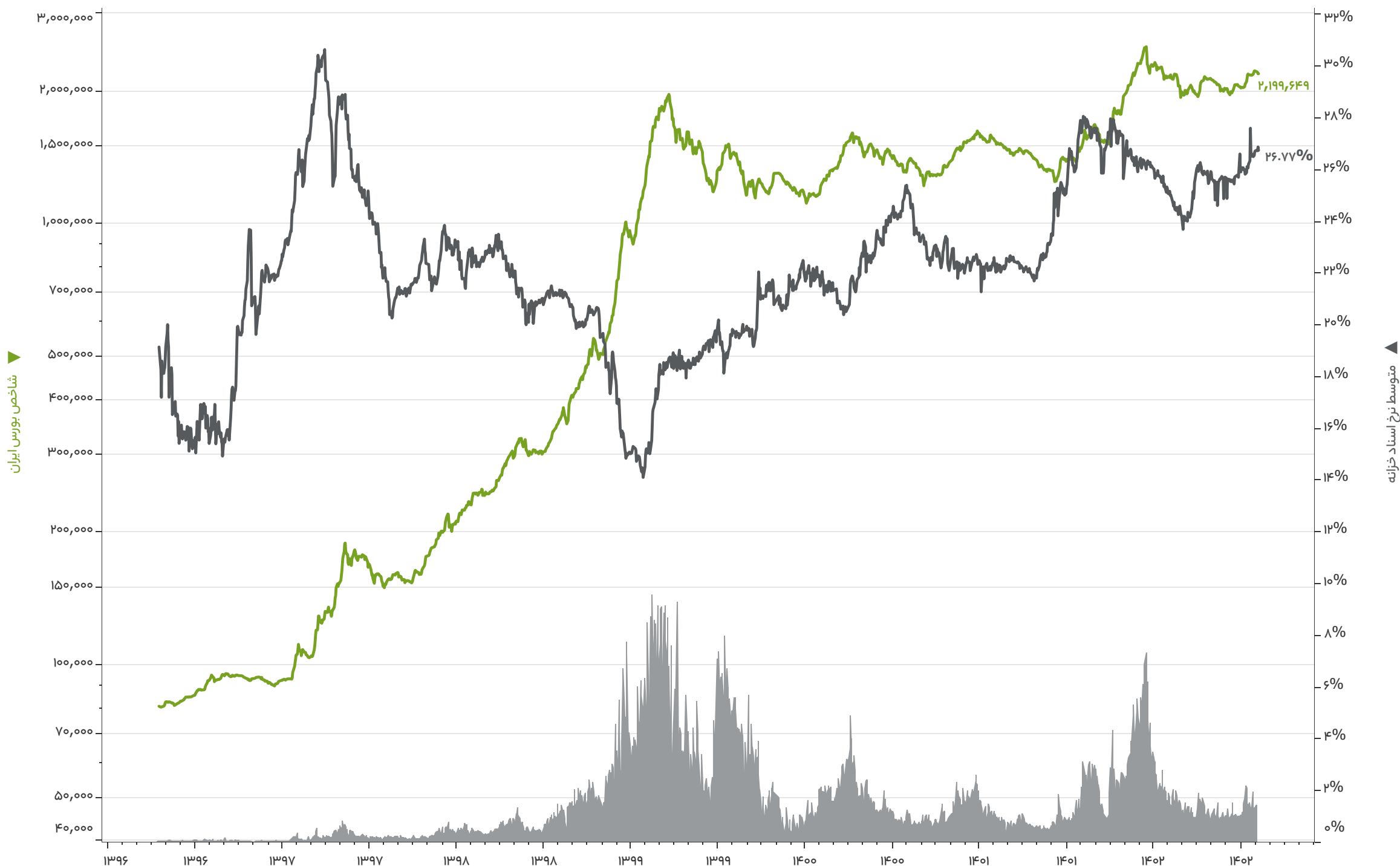
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





تأثير نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

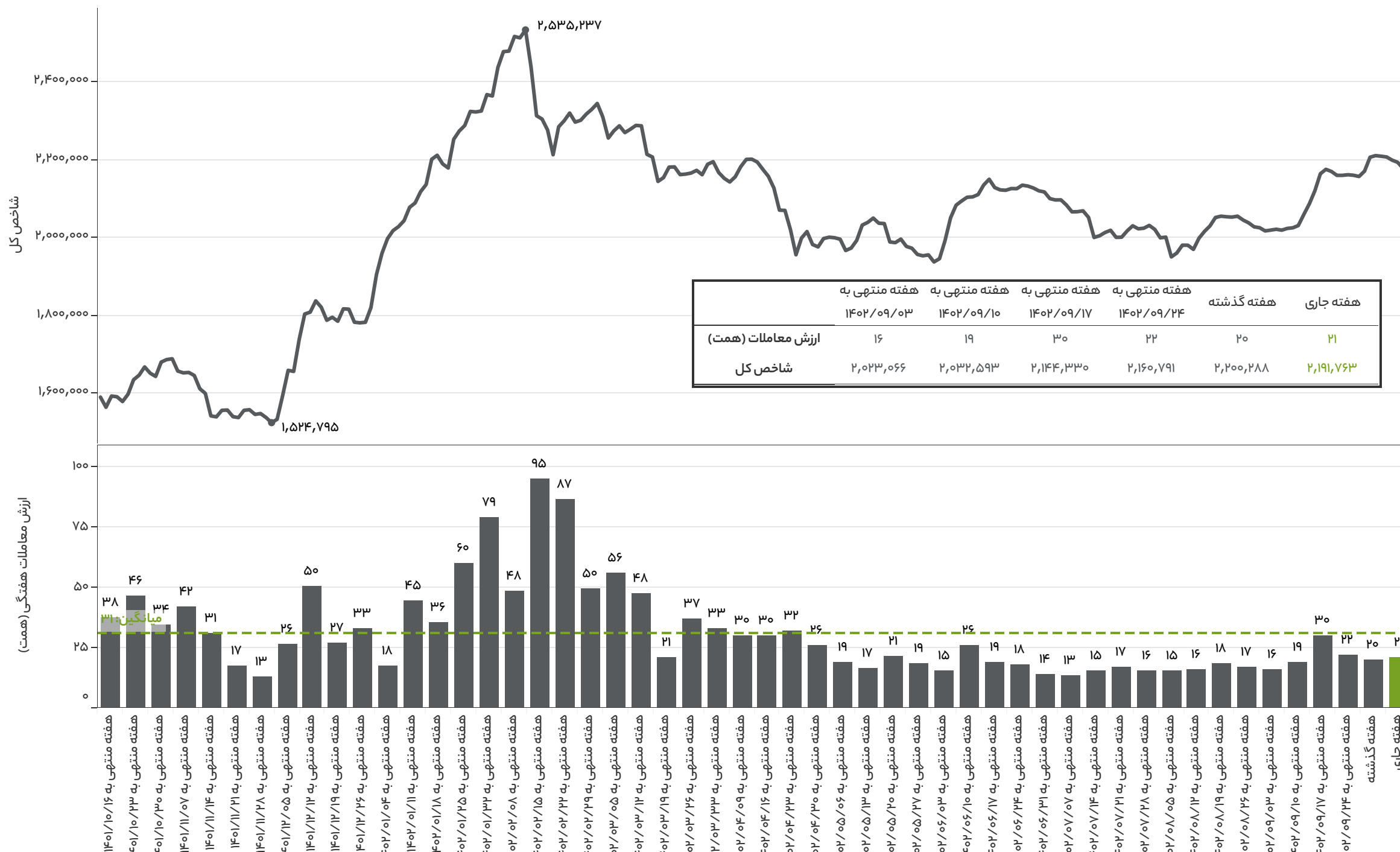
از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس





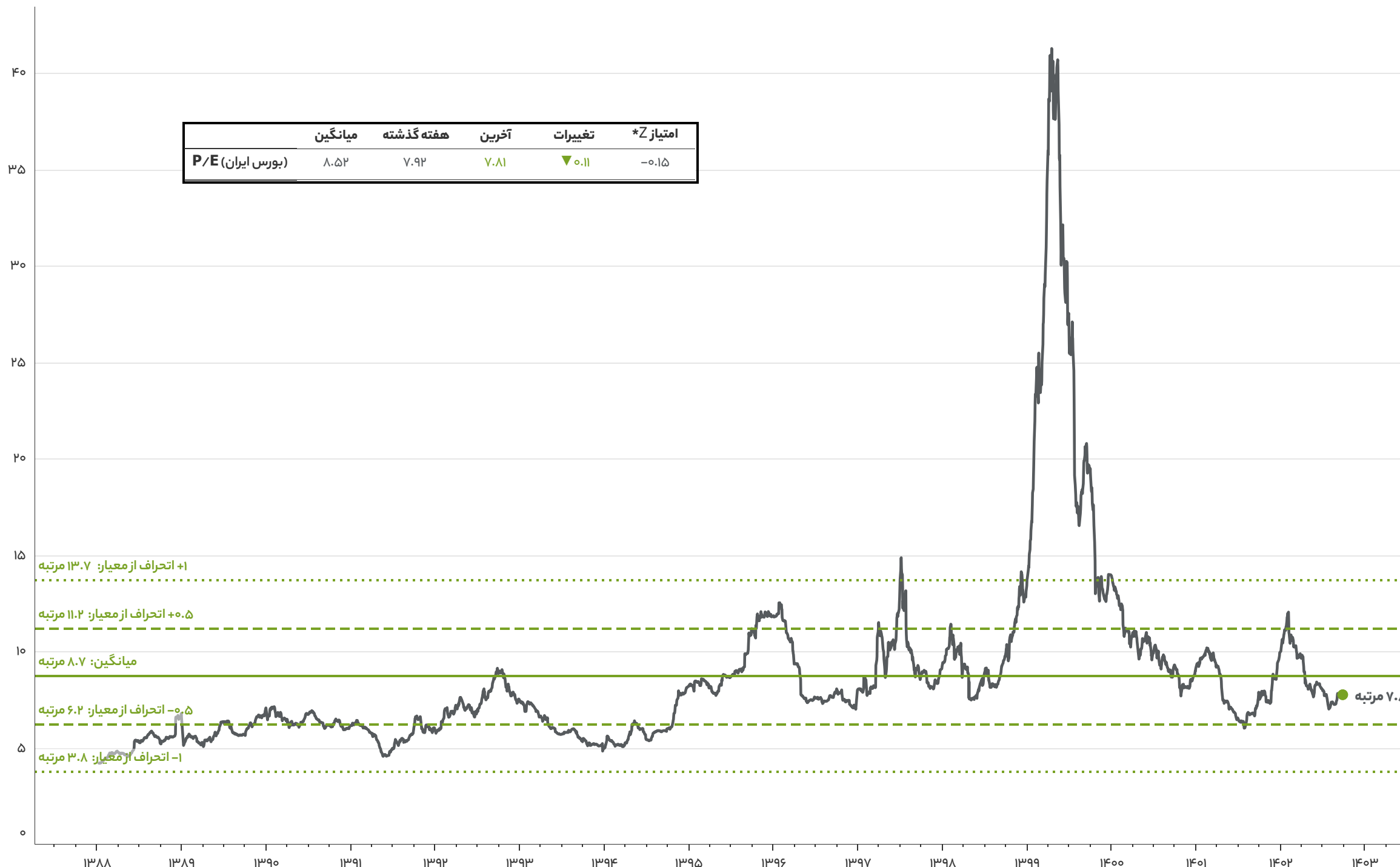
ارزش معاملات هفتگی بازار

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.

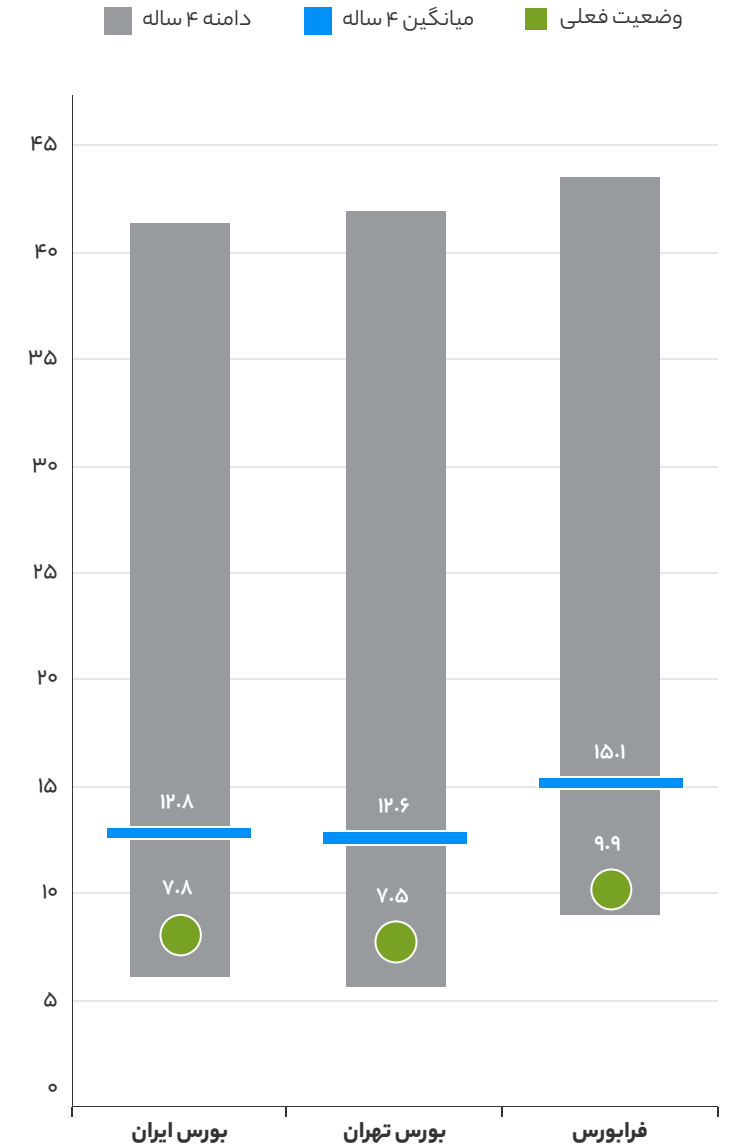
ارزش نسبی فرابورس به بورس

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
بورس ایران	۷.۸۱	۷.۹۲	۶.۰۷	۱۲.۸۳	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۵۰	۷.۶۲	۵.۶۴	۱۲.۶۰	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۸۷	۹.۹۴	۹.۰۳	۱۵.۱۵	۴۳.۵۱

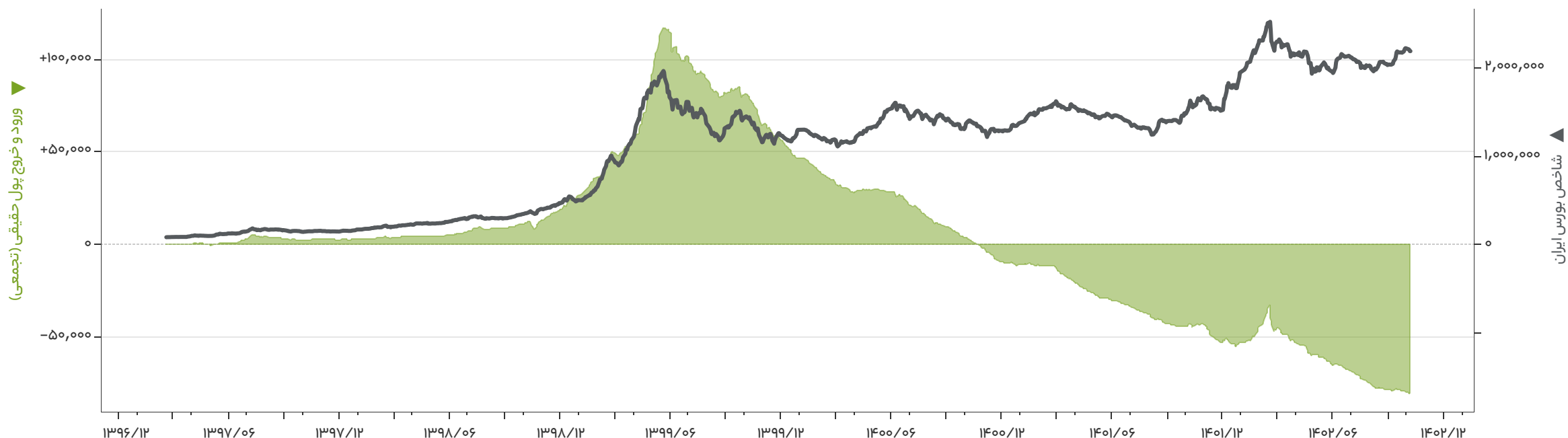


بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	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	۸۸	۱۱۸	۱۲۷	۱۶۷	۲۰۲	۲۲۱	۳۸۹	۶۳۷	۳,۳۳۰	۳,۴۰۴	
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۶%	۱.۰%	۱.۴%	۱.۵%	۱.۹%	۲.۳%	۲.۵%	۴.۵%	۷.۳%	۳۸.۱%	۳۹.۰%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۱.۴	۸.۹	۲۱.۲	۱۳.۵	۹.۵	۹.۶	۱۱.۳	۵.۸	۵.۰	۷.۹	۷.۵	سودآوری
بازده سود نقدی	۲.۹%	۱۷.۱%	۲.۵%	۳.۰%	۶.۶%	۳.۶%	۴.۱%	۲.۲%	۱۴.۱%	۸.۹%	۷.۷%	
نسبت تقسیم سود	۴۱%	۱۰۰%	۶۰%	۴۱%	۷۶%	۳۷%	۵۴%	۳۴%	۶۳%	۷۲%	۶۲%	
بتا به شاخص کل	۰.۸	۱.۰	۰.۶	۱.۴	۰.۷	۱.۱	۰.۸	۱.۰	۱.۲	۱.۰	۱.۰	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۶۲۵%	+۷۷۸%	+۳۰۰%	+۱۵۸%	+۴۱۶%	+۴۵۴%	+۴۵۰%	+۸۹۱%	+۸۲۲%	+۹۳۸%	+۹۰۵%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱%	+۱۱۴%	+۲%	-۵۹%	+۲۳%	-۵%	+۳%	-۱۰%	+۲۰%	+۶۲%	+۵%	
بازده از ابتدای سال	+۲۲۴%	+۴۲%	+۷۲%	+۶۵%	+۱۰۶%	+۱۱۵%	+۶۲%	+۹۹%	+۹۶%	+۸۲%	+۷۵%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	-۴%	۰%	-۱%	۱%	-۳%	۰%	-۱%	-۲%	-۱%	-۱%	

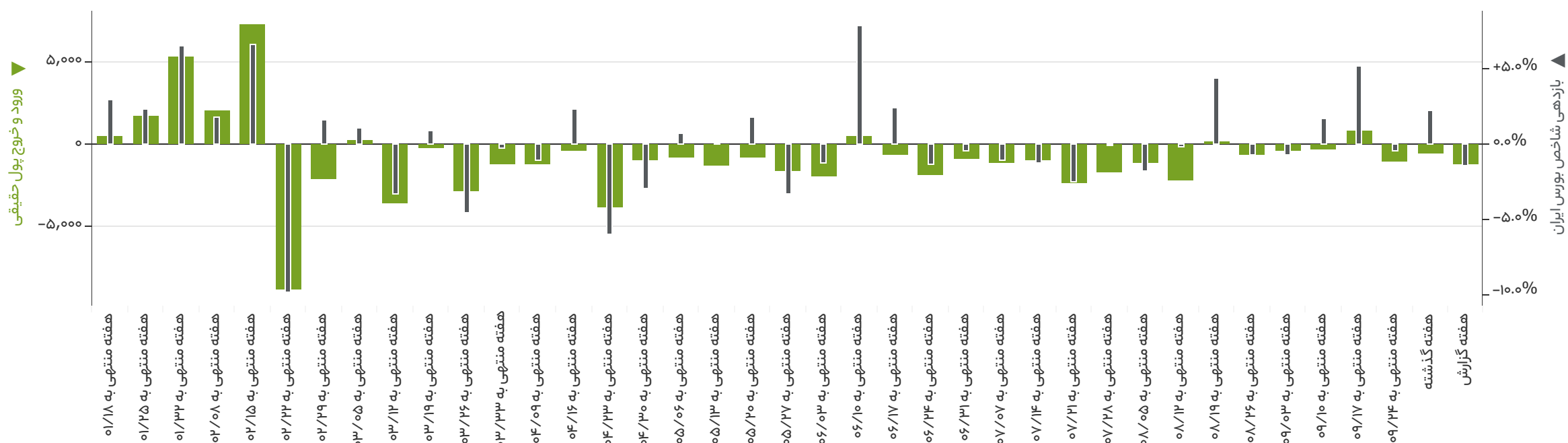
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

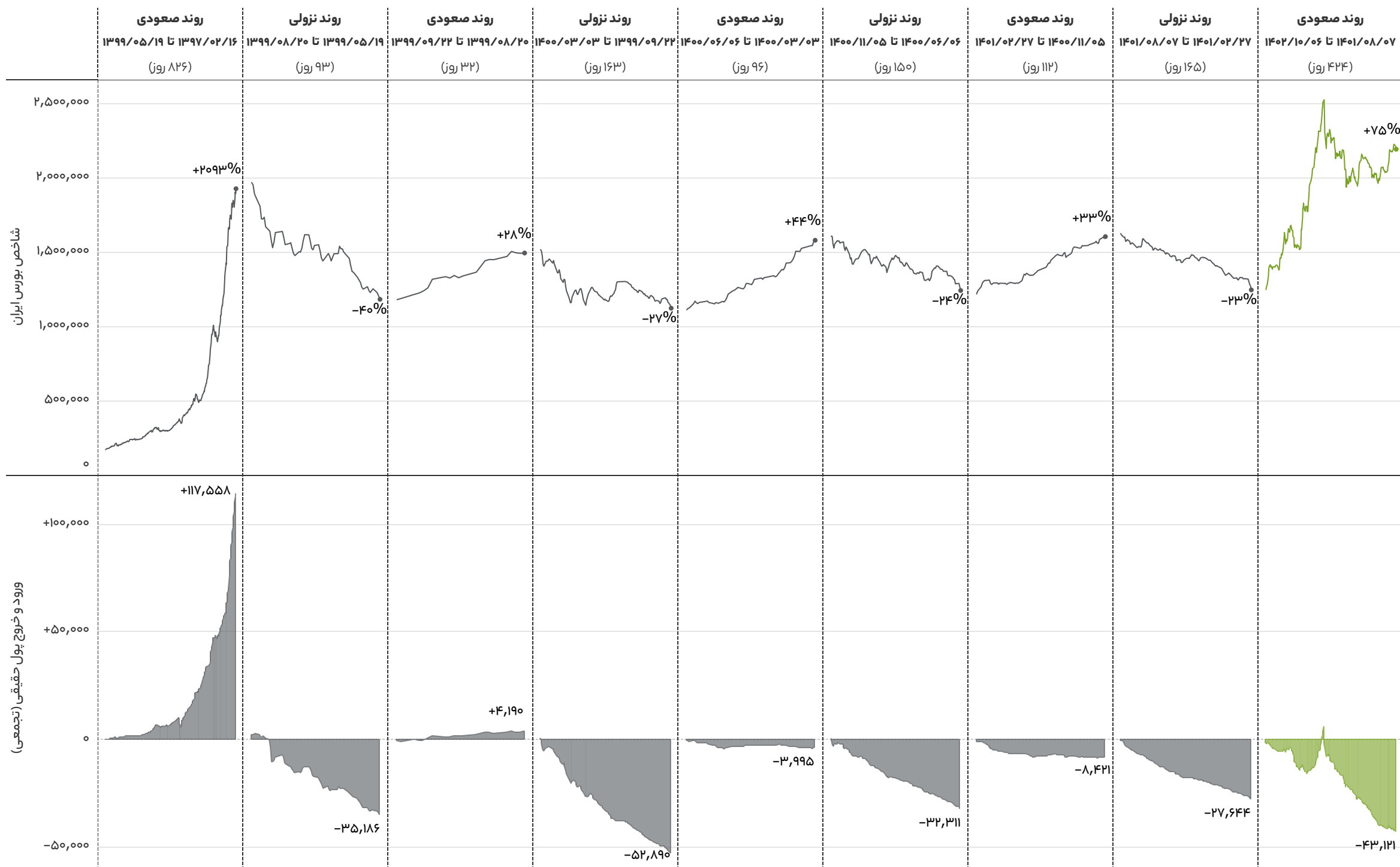
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





ورود و خروج پول در روندهای کوتاه مدتی اخیر

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

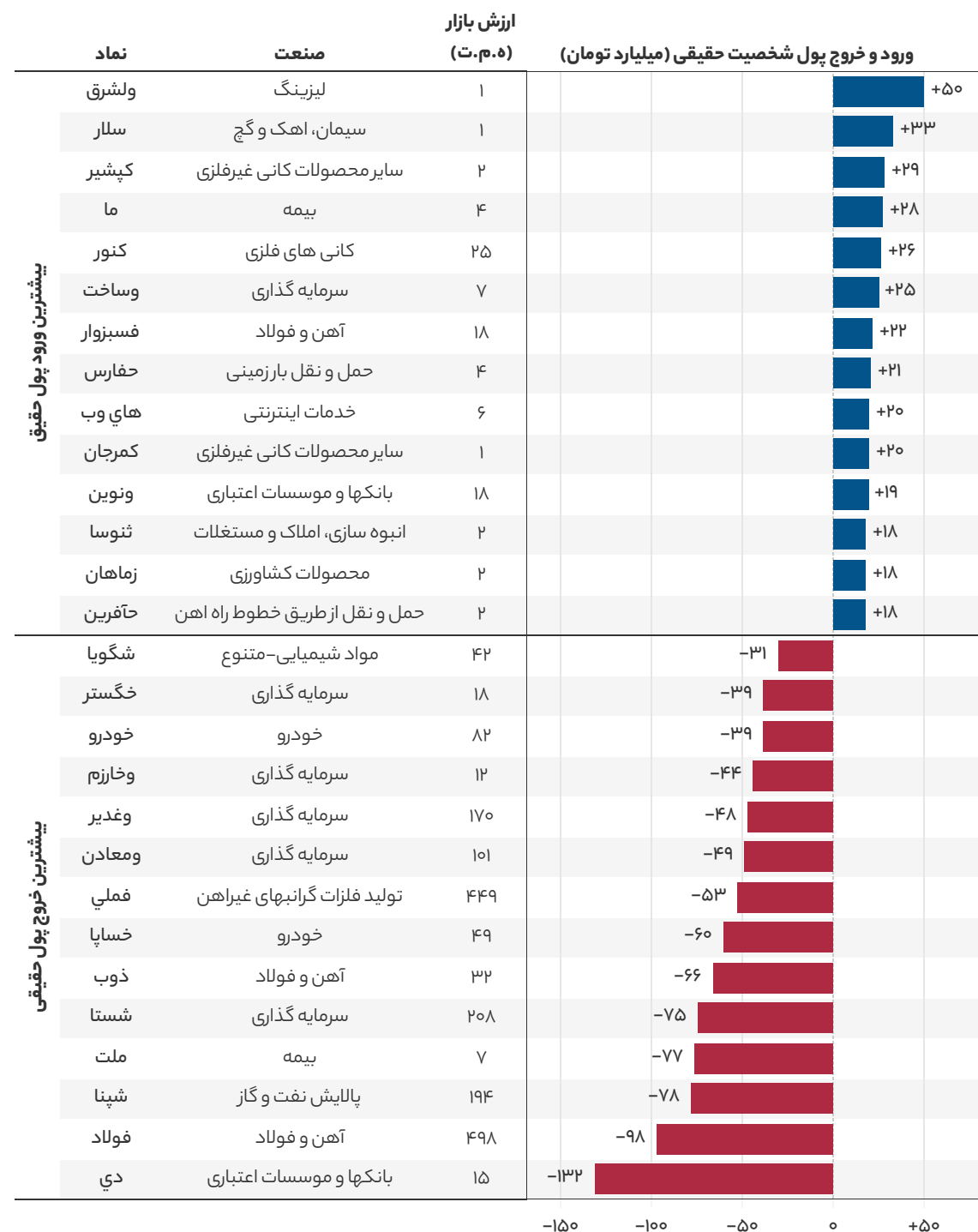




ورود و خروج پول

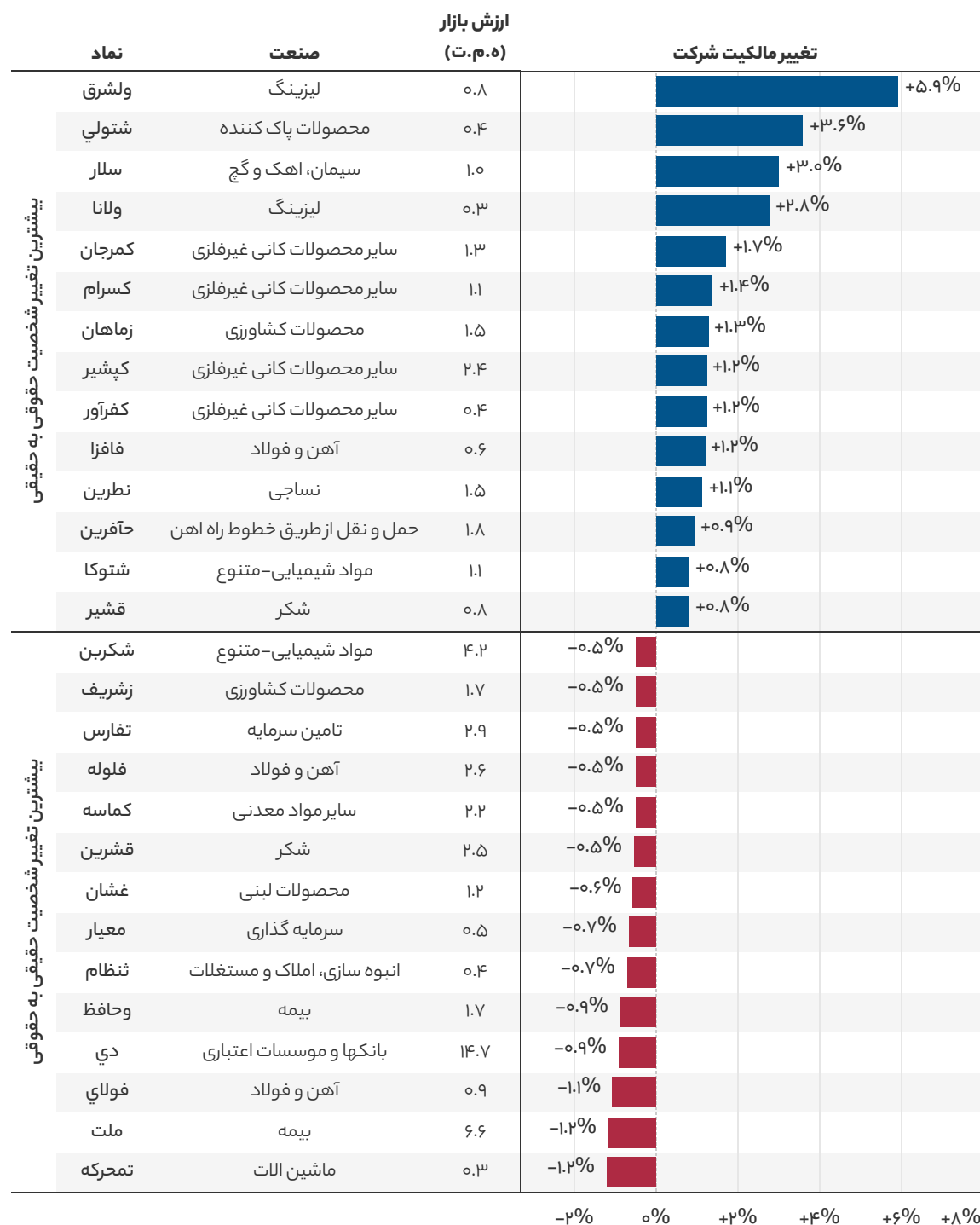
ورود و خروج پول حقيقي

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



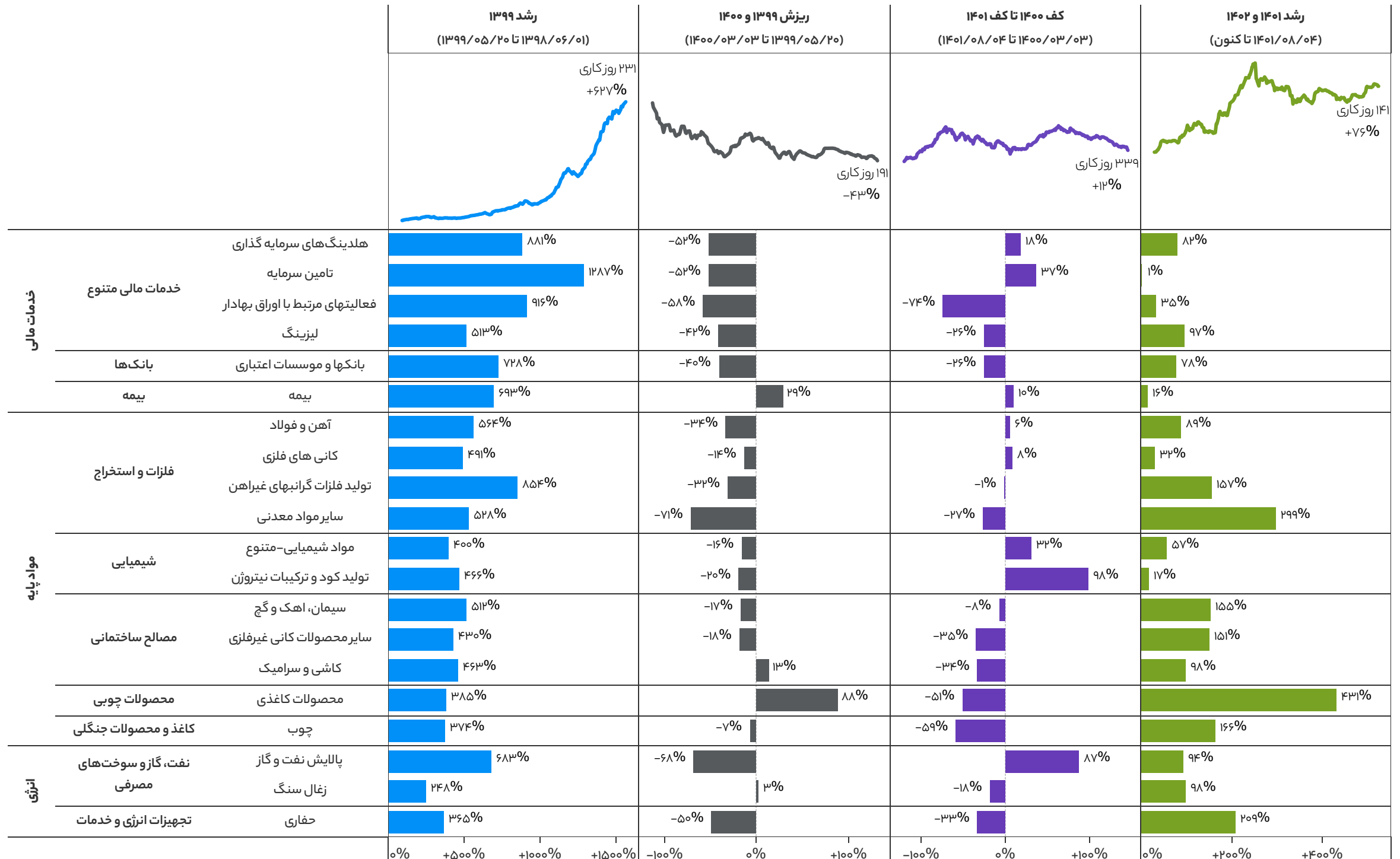
تغيير مالکيت شرکت

طی دوره گذشته، مثبت به معنای تبديل حقوقی به حقيقي، ارزش بازار بر حسب هزار ميليارد تومان

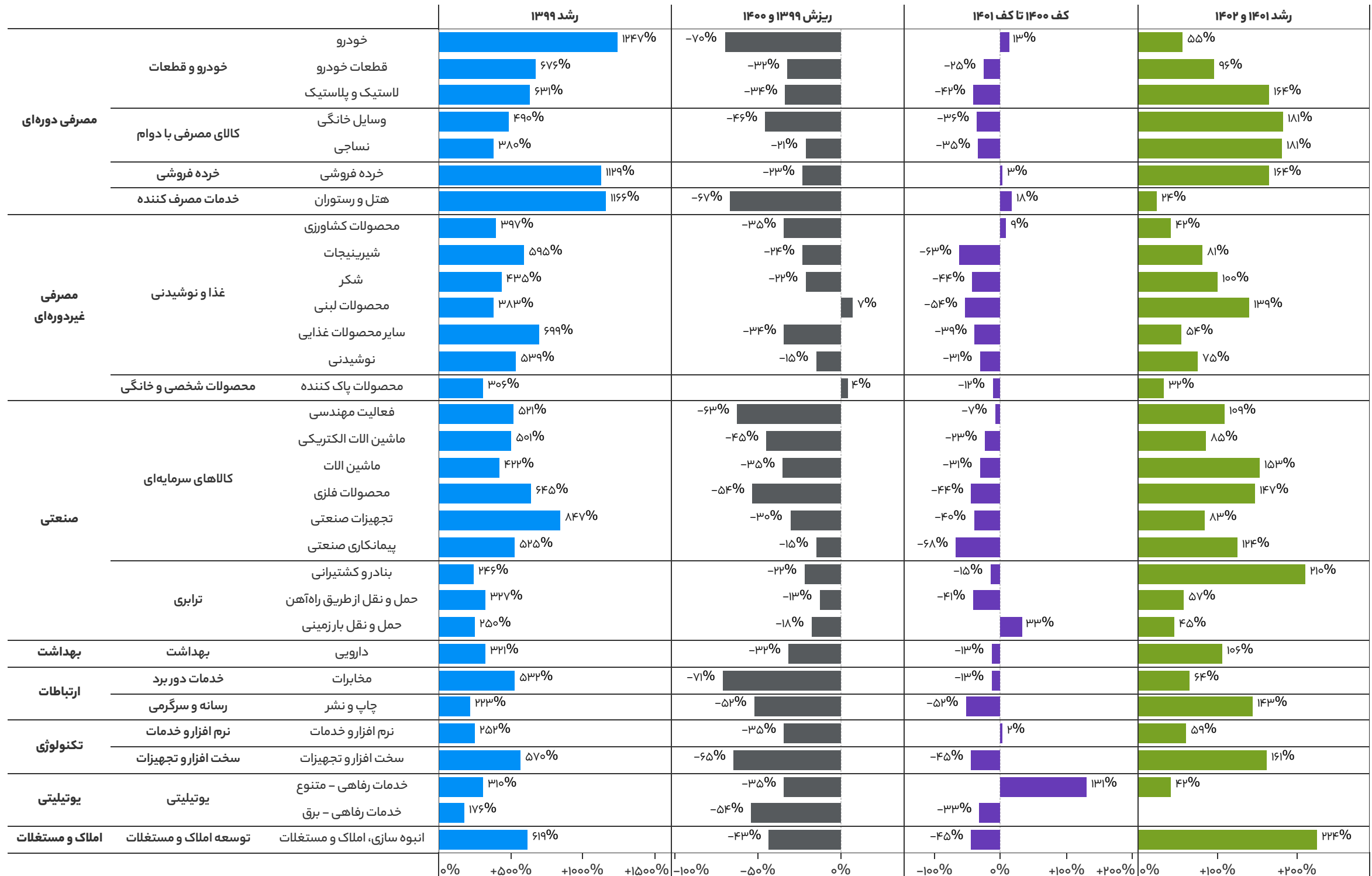


بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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

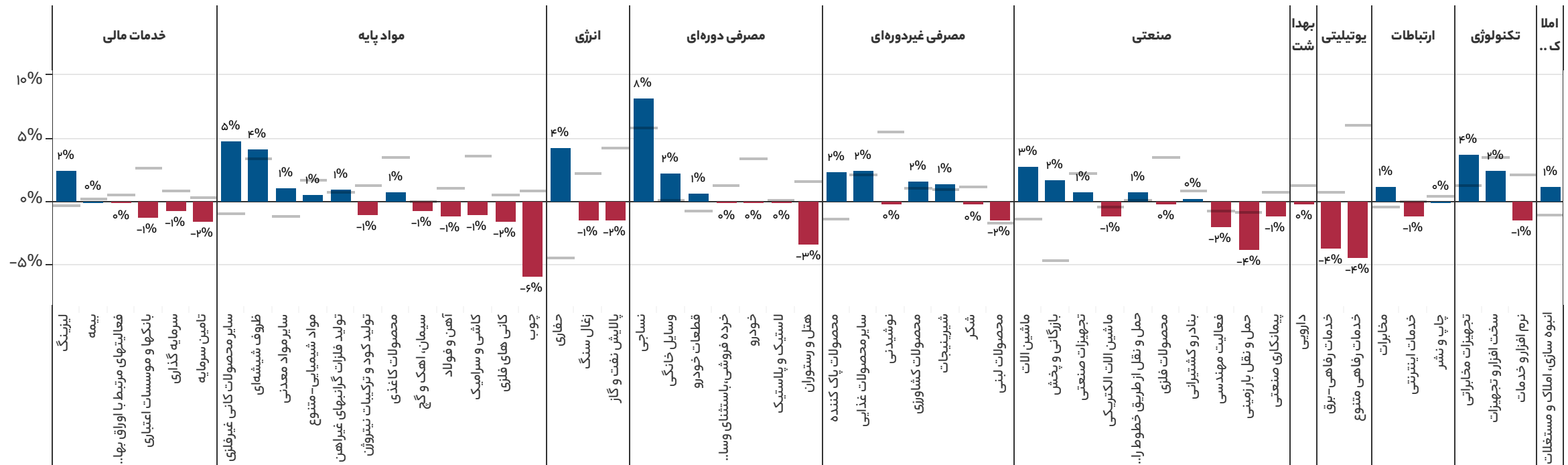


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



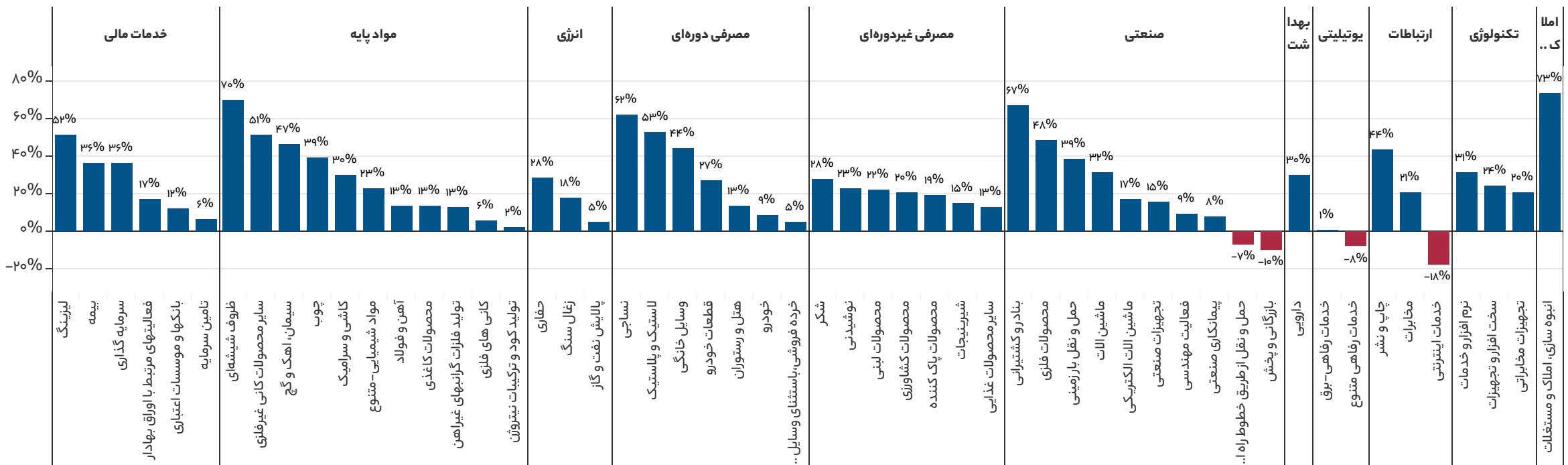
بازده صنایع از ابتدای هفته

(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)



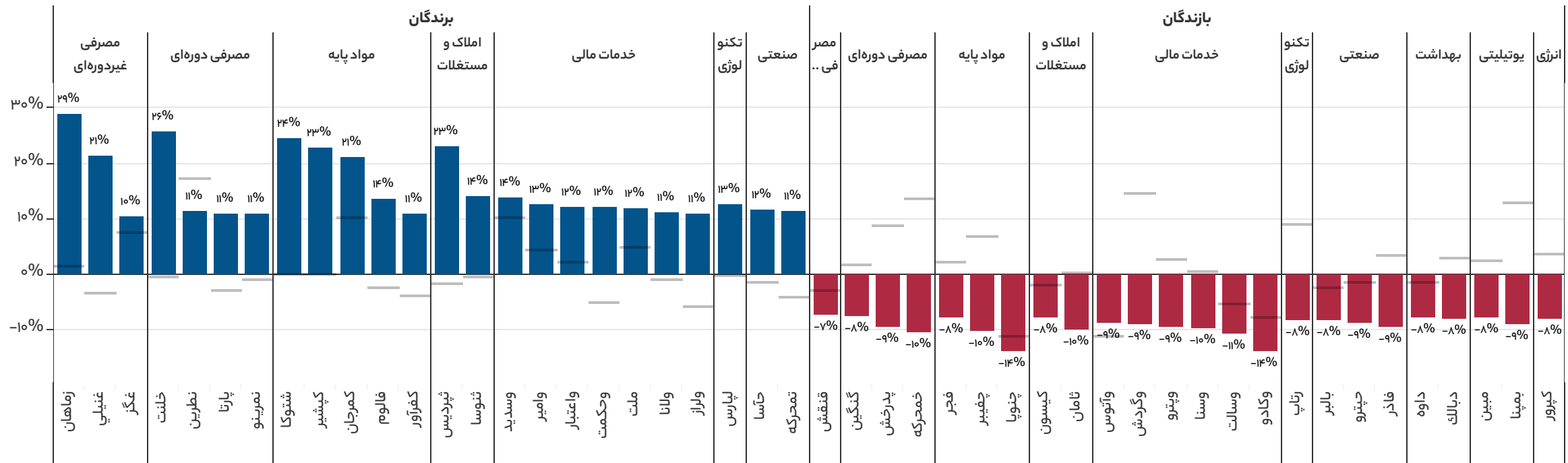
بازده صنایع از ابتدای سال

(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)



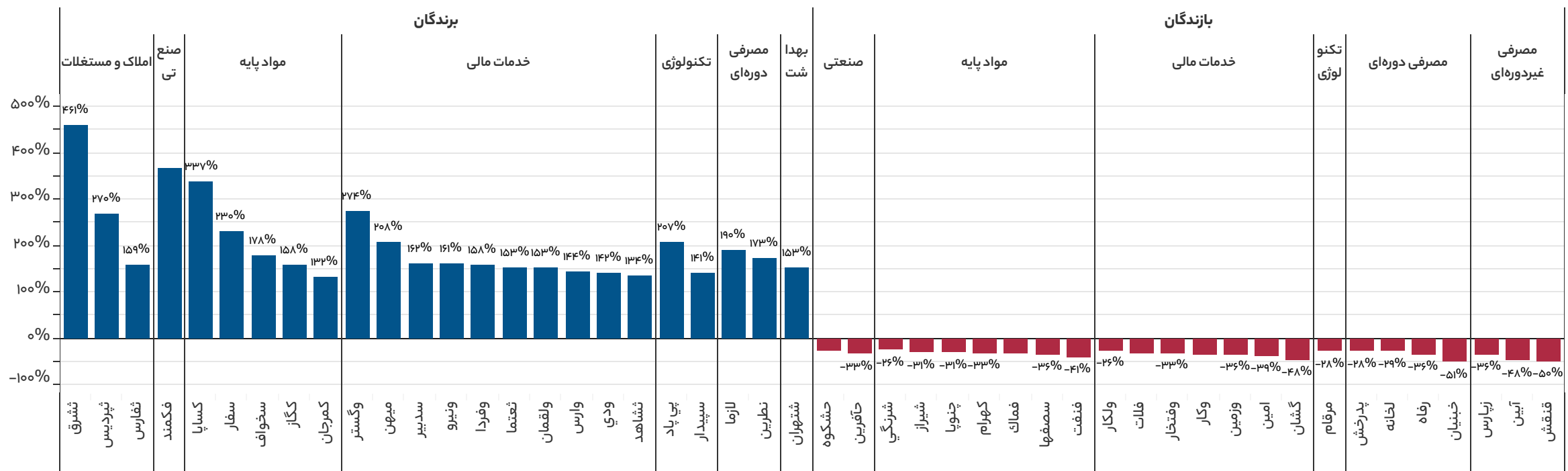
برندگان و بازندگان هفته

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



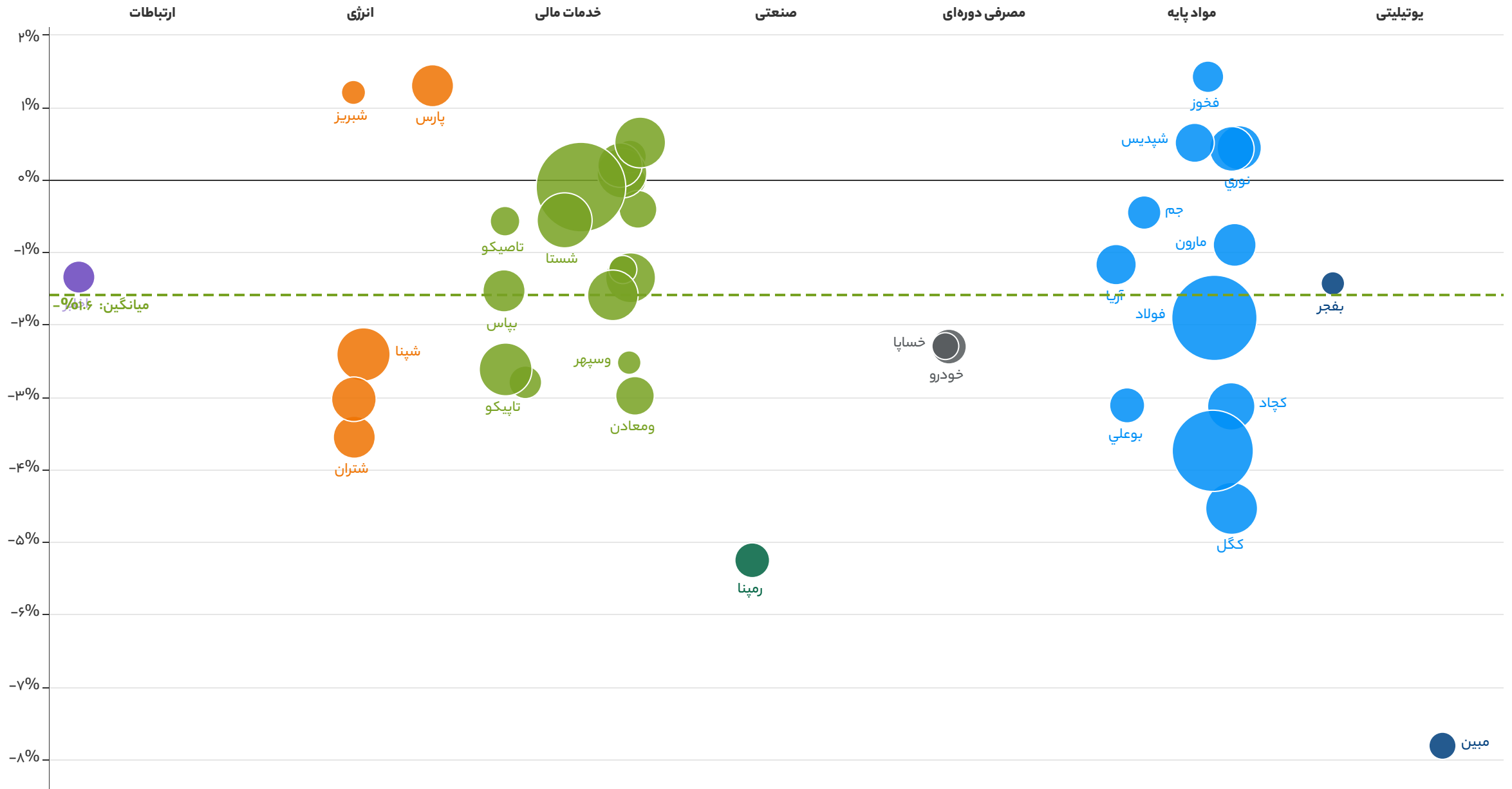
برندگان و بازندگان سال

(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 براساس ارزش بازار، میانگین بازدهی براساس میانگین وزنی ارزش بازار هر سهم

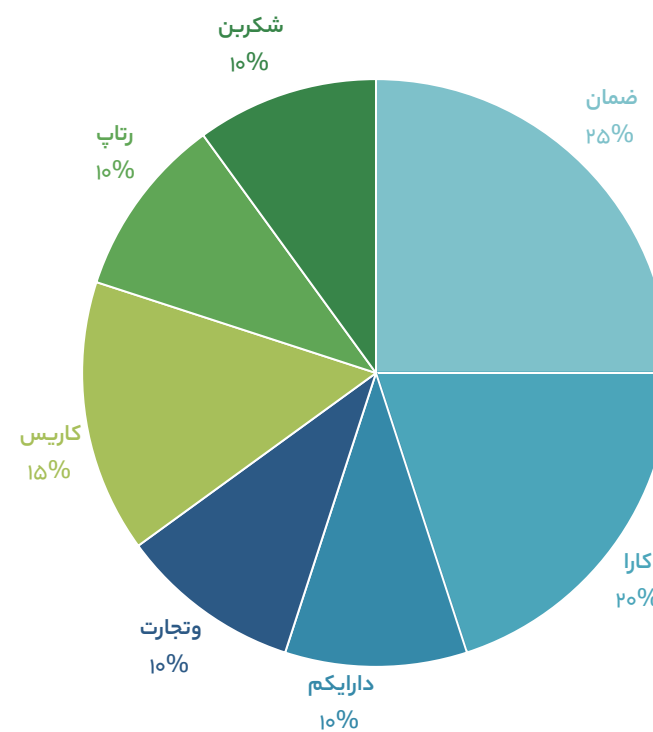


بازدهی تعدیل شده	فخوز	پارس	شیریز	پارسان	شپدیس	نوری	کهر	وسندوق	وامید	وبملت	وکفدیر	فارس	وپاسار	جم	شستا	تامینکو	مارون	آریا	وتجارت	اخابر	وغدیر	بفجر	پپاس	میدکو	فولاد	خسپا	خودرو	شپنا	وسپهر	تاپیکو	مکشتی	ومعادن	شندر	بوعلی	کچاد	شتران	فملی	کگل	رمپنا	مبین
بازدهی تعدیل شده هفته گذشته	+1.4%	+1.3%	+1.2%	+0.5%	+0.5%	+0.5%	+0.4%	+0.3%	+0.2%	+0.1%	0%	-0.1%	-0.4%	-0.4%	-0.5%	-0.6%	-0.9%	-1.2%	-1.2%	-1.3%	-1.3%	-1.4%	-1.5%	-1.6%	-1.9%	-2.3%	-2.3%	-2.4%	-2.5%	-2.6%	-2.8%	-3.0%	-3.0%	-3.1%	-3.1%	-3.5%	-3.7%	-4.5%	-5.2%	-7.8%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۴۸۲	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۶,۵۷۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و سود مناسب زیر مجموعه‌ها	۷,۰۰۰	شکربن	
۱۵%	۲۳,۳۱۲	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	کاریس	
۱۰%	۱۷۸,۶۲۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۲۳۰,۰۰۰	دارایکم	بلند مدت
۱۰%	۲,۴۱۵	وضعیت ارزندگی مناسب و پتانسیل تجدید ارزیابی	۳,۰۰۰	تجارت	
۲۰%	۱۶,۴۶۹	دارا بودن پورتنفو بدون ریسک و سود بالاتر نسبت به سایر صندوق‌های درآمد ثابت	-	کارا	
۲۵%	۱۶,۴۷۴	تضمین اصل سرمایه‌گذاران و پرتفوی متنوع	-	ضمان	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





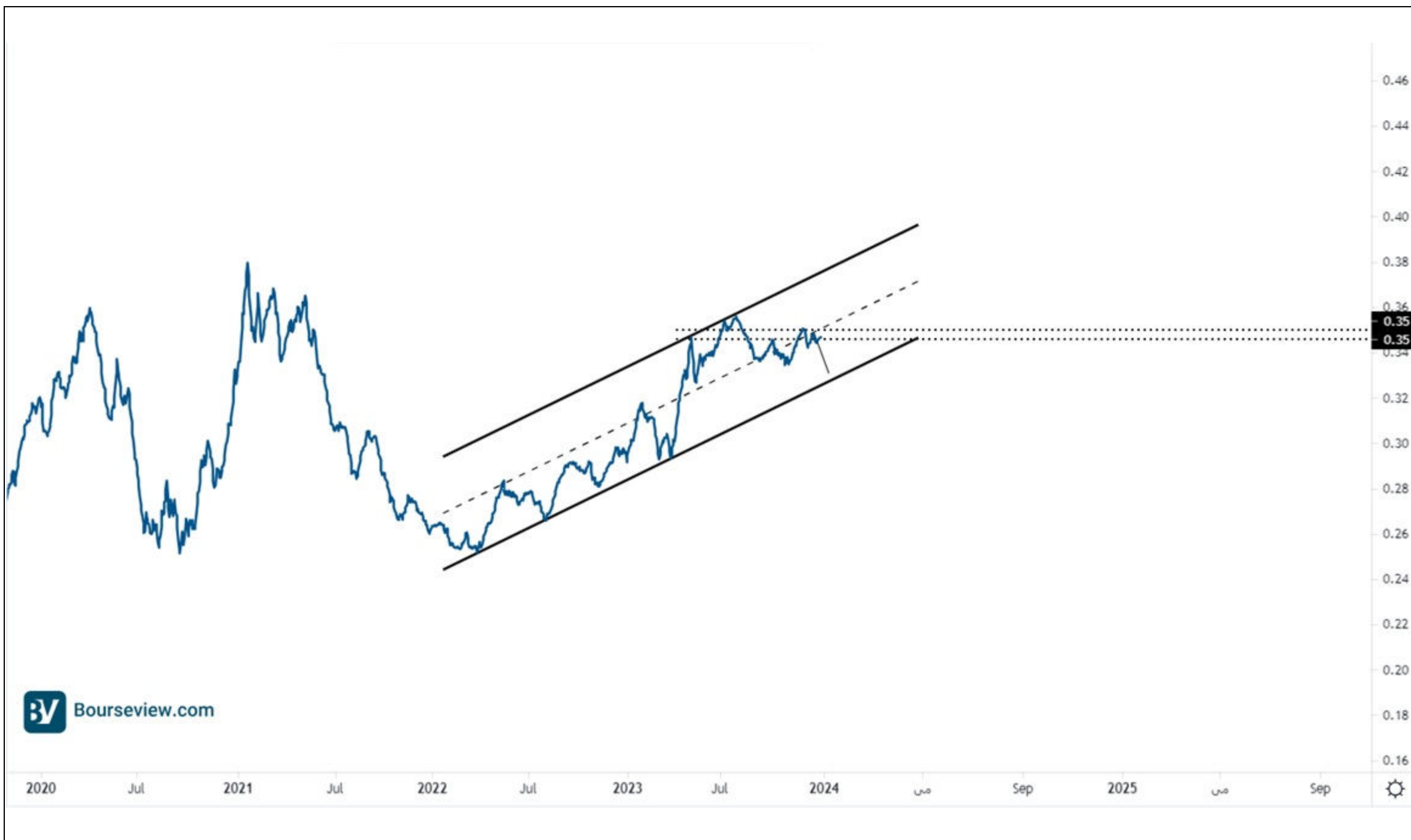
انتظار می‌رود بعد از اصلاحی موقت تا حوالی محدوده مشخص شده، روند صعودی تا حوالی ۲,۲۶۰ هزار واحد طی کند.

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 ۴۹.۸ هزار تومان، مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



مدتی است در یک ناحیه مثلثی شکل متراکم شده است. باید دید واکنش به سقف و کف این تراکم به چه صورت خواهد بود.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند. (تایم فریم ۱ 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 می پردازد.

بخش، سه معیار برای P/E آینده نگر گزارش شده که اولین معیار آن با سود سال مالی جاری شرکت محاسبه گردیده است، دومین معیار با استفاده از سود سال مالی آینده و سومین معیار نیز با استفاده از سود برآوردی ۴ فصل پیش رو شرکت محاسبه شده است. شایان ذکر است که تمامی نسبت های P/E با سود تقسیمی برآوردی مجمع پیش رو شرکت تعدیل شده اند.

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

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

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 P/e آینده نگر																امتیاز Z		نمودار امتیاز Z		گران تر		ارزان تر	
		نسبت P/e آینده نگر				برآورد سود کاریزما				سود واقعی				وضعیت قیمتی				امتیاز Z		نمودار امتیاز Z		گران تر		ارزان تر	
		آینده نگر ۴ فصله				سود ۱۴۰۲ / سود ۱۴۰۳				سود ۱۴۰۱ (کل سال) / سود ۱۴۰۲ (تاکنون)				ارزش بازار (همت) / قیمت (تومان) / بازده هفتگی				امتیاز Z		نمودار امتیاز Z		گران تر		ارزان تر	
		آینده نگر ۴ فصله				سود ۱۴۰۲ / سود ۱۴۰۳				سود ۱۴۰۱ (کل سال) / سود ۱۴۰۲ (تاکنون)				ارزش بازار (همت) / قیمت (تومان) / بازده هفتگی				امتیاز Z		نمودار امتیاز Z		گران تر		ارزان تر	
مواد پایه	شیمیایی	الفین	ناماد	سال مالی	۱۲	۱۲۵.۳	۱۵,۶۶۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۰	۷.۴	۷.۴	-۲.۰							
			مارون	۱۲	۱۱۱.۵	۸,۱۱۰	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۸	۶.۳	۶.۸	-۰.۷								
			آریا	۱۲	۷۷.۵	۴,۳۰۳	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۷	۴.۱	۴.۴	-۴.۰								
			جم	۱۲	۴۱.۹	۱,۷۵۰	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۶.۳	۵.۰	۶.۴	+۰.۱								
			شگویا	۱۲	۳۶.۴	۱۸,۱۹۵	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۴	۴.۶	۵.۷	+۰.۶								
			جم پیلین	۱۲	۲۷.۲	۷,۵۶۵	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۷	۳.۱	۳.۵	-۷.۶								
			شکبیر	۱۲	۲۴.۳	۳,۰۱۱	۹۶%	۴۱۹	۲۱۴	۲ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۰	۴.۰	۳.۹	-۱.۸								
			شاراک	۱۲	۸.۷	۶,۶۷۶	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۸	۴.۵	۶.۱	+۰.۱								
			شغذیر	۱۲	۷.۶	۳,۰۵۵	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۶	۳.۹	۴.۵	-۰.۳								
			شبصیر	۱۲	۱۳۵.۵	۱۵,۰۶۰	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۷	۷.۲	۸.۱	+۰.۷								
	اوره	متانول	نوری	۱۲	۸۳.۴	۵,۸۱۴	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹.۰	۶.۶	۹.۰	+۴.۱								
			بوعلی	۱۲	۳۶.۰	۲,۳۵۳	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۵	۵.۳	۶.۱	+۱.۶								
			شیراز	۱۲	۲۴.۹	۱۳,۹۲۰	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۸.۹	۶.۸	۷.۸	+۳.۰								
			خراسان	۱۲	۱۸.۶	۱,۷۵۸	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۷	۴.۳	۴.۴	+۰.۶								
			کرماشا	۱۲	۳۱.۵	۱۳,۱۲۵	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۸	۶.۶	۶.۷	-۲.۱								
			زاگرس	۱۲	۲۷.۸	۴,۶۳۷	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۸	۴.۸	۵.۸	-۱.۴								
			شخارک	۱۲	۱۷.۳	۵۶۰	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۸.۰	۵.۸	۵.۵	-۱.۶								
			شغن	۱۲	۲۷.۸	۵۱۱	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۳	۷.۹	۶.۸	+۰.۲								
	دوده صنعتی	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۴.۲	۶۵۸	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۷.۶	۵.۹	۶.۳	+۰.۱								
			شکربن	۱۲	۲.۷	۳,۸۱۵	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۹.۷	۶.۱	۷.۵	-۱.۲								
			شصدف	۱۲	۲.۵	۲,۶۳۲	۹۳%	۱۹۳	۲۲۳	۲ Q	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۷.۲	۵.۵	۶.۸	+۰.۶								
			شدوص	۱۲																					



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)			
فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۴۹۷.۶	-۲%	۶۲۲	۵۰%	۸۵	۶۶	۲ Q	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۵.۰	۴.۱	۴.۵	+۰.۸			
		فخوز	۱۲	۶۸.۶	+۱%	۳۶۱	۴۶%	۳۵	۲۷	۲ Q	۶۵	۱۰۹	+۶۸%	۵.۶	۳.۰	۳.۶	-۳.۳			
		فولاز	۱۲	۳۹.۶	+۳%	۱,۶۵۲	۷۶%	۱۹۹	۹۱	۲ Q	۱۷۴	۲۵۰	+۴۴%	۹.۵	۶.۳	۷.۴	+۱.۷			
		هرمز	۱۲	۳۳.۲	+۵%	۳۹۵	۵۱%	۶۵	۳۲	۲ Q	۶۸	۸۲	+۲۱%	۵.۸	۴.۵	۴.۸	-۰.۹			
		ارفع	۱۲	۳۰.۰	-۱%	۲,۵۰۰	۸۶%	۳۱۲	۳۰۹	۲ Q	۵۵۶	۶۴۸	+۱۷%	۴.۵	۳.۳	۴.۱	-۰.۲			
		فخاس	۱۲	۲۷.۸	-۲%	۱,۲۰۹	۴۹%	۱۰۰	۱۳۲	۲ Q	۲۴۲	۲۹۱	+۲۱%	۵.۰	۴.۱	۴.۴	-۳.۰			
	سنگ آهن	کگل	۱۲	۱۸۱.۲	-۵%	۵۴۹	۶۵%	۴۹	۱۲	۲ Q	۵۸	۹۴	+۶۱%	۹.۴	۵.۷	۵.۵	-۳.۱			
		کچاد	۱۲	۱۵۲.۰	-۳%	۵۶۰	۷۱%	۸۴	۳۹	۲ Q	۸۳	۹۹	+۱۹%	۶.۷	۵.۳	۵.۵	-۰.۴			
		کگهر	۹	۱۳۷.۳	-	۱,۸۳۱	۹۲%	۱۵۶	۱۴۸	۳ Q	۱۹۴	۱۶۳	-۱۶%	۹.۵	۱۲.۸	۱۰.۲	+۱.۱			
		کنور	۱۲	۲۵.۲	+۶%	۱,۹۷۲	۹۴%	۱۴۷	۱۴۴	۲ Q	۲۲۴	۲۸۴	+۲۷%	۸.۸	۶.۳	۸.۳	+۰.۰			
	مس	فملی	۱۲	۴۴۹.۴	-۴%	۷۴۹	۴۵%	۸۳	۵۴	۲ Q	۱۳۴	۱۴۹	+۱۲%	۵.۶	۴.۷	۴.۵	-۰.۴			
	محصولات فلزی	کویر	۱۲	۱۲.۳	-	۳۲۹	۱۲%	۴۶	۲۰	۲ Q	۴۵	۵۹	+۳۲%	۷.۳	۵.۷	۵.۶	-۰.۷			
		فجر	۱۲	۶.۶	-۸%	۷۸۳	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۳.۹	۳.۵	۴.۰	+۰.۰			
		فروژ	۱۲	۵.۰	-۱%	۴,۵۱۵	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۷.۰	۵.۱	۵.۴	+۰.۴			
		فسپا	۱۲	۳.۲	-۲%	۸۲۷	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۲۶	-۱۶%	۵.۵	۶.۱	۵.۳	+۰.۴			
		فروس	۱۲	۲.۸	-۳%	۳۴۹	۶۶%	۴۸	۲۴	۲ Q	۴۹	۶۶	+۳۵%	۷.۱	۵.۰	۵.۶	+۰.۳			
		فروسیل	۱۲	۲.۴	+۲%	۱,۴۹۰	۶۴%	۱۱۵	۵۷	۲ Q	۱۶۷	۲۳۶	+۴۲%	۸.۹	۶.۱	۶.۱	-۹.۸			
		فولای	۱۲	۰.۹	-۲%	۷۹۰	۲۱%	۵۹	۴۵	۲ Q	۶۹	۷۶	+۱۰%	۱۱.۴	۱۰.۶	۱۱.۹	+۱.۵			
فلزات و استخراج	آلومینیوم	فایرا	۱۲	۲۹.۰	+۲%	۷۶۵	۳۹%	۷۳	۵۶	۲ Q	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۸.۹	۶.۱	۷.۷	+۱.۹			
	طلا	فرز	۹	۱۴.۰	-	۴,۶۵۵	۳۱۸%	۹۹۶	۶۷	۳ Q	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۶.۴	۶.۸	۳.۴	-۱.۳			
	سرب و روی	فئوال	۱۲	۳.۷	-	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	-۳%	۴۸۴	۳۶%	۹۳	۲	۲ Q	۱۱۲	۱۷۰	+۵۱%	۴.۳	۲.۶	۲.۳	-۴.۴			
		فتوسا	۱۲	۱.۱	+۱%	۷۶۰	۳۲%	۱۴۹	۳۵	۲ Q	۱۹۵	۲۱۴	+۹%	۳.۹	۳.۳	۲.۶	-۱.۸			
	سایر کانی‌های فلزی	کمنگنز	۱۲	۲.۲	-۵%	۱,۵۱۷	۶۴%	۱۱۴	۷۴	۲ Q	۱۸۴	۲۱۸	+۱۹%	۸.۳	۶.۷	۶.۴	-۱.۰			
	سایر مواد معدنی	کتوسعه	۹	۲.۲	+۱%	۲,۰۸۵	۹۷%	۱۱۱	۱۱۴	۳ Q	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۲.۰	۱۱.۳	۸.۹				

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

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)				
فوند پایه مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوه	۱۲	۹۰.۵	-	۱۴,۶۸۰	۹۵%	۱,۵۸۴	۱,۲۸۲	۲ Q	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۱	۴.۴	۵.۳	+۰.۹				
		سآبیک	۱۲	۸۰.۳	+۱%	۲,۷۹۶	۹۳%	۲۴۹	۲۴۶	۲ Q	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۷.۲	۵.۰	۶.۵	+۲.۳				
		سفار	۱۲	۷۰.۸	-۳%	۳۳,۳۱۲	۹۵%	۱,۰۳۹	۸۴۰	۲ Q	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۳.۸	۱۷.۶	۲۰.۶	+۱.۴				
		سخوز	۱۲	۶۰.۸	+۱%	۴,۸۲۶	۹۰%	۷۱۹	۲۸۴	۲ Q	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۸	۳.۴	۳.۴	-۰.۷				
		سمازن	۹	۶۰.۶	-	۲,۶۷۵	۸۱%	۲۹۰	۲۹۸	۳ Q	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۶.۸	۵.۸	۵.۳	+۱.۸				
		ساروم	۱۲	۴۰.۷	+۱%	۴,۷۴۹	۹۶%	۵۵۴	۴۵۱	۲ Q	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۹	۳.۹	۵.۰	-۰.۱				
		سهگمت	۱۰	۴۰.۷	+۱%	۶,۳۸۱	۹۸%	۶۴۸	۷۷۸	۳ Q	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۶.۳	۴.۳	۴.۱	+۰.۳				
		سفانو	۱۲	۴۰.۱	-۳%	۸,۱۰۳	۹۷%	۱,۱۷۰	۶۹۵	۲ Q	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۸	۳.۲	۳.۶	+۰.۴				
		سرود	۱۲	۳۰.۹	-۲%	۴,۷۸۵	۹۶%	۴۹۶	۴۷۲	۲ Q	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۵	۴.۱	۴.۹	+۰.۵				
		سصوفی	۱۲	۳۰.۶	-۴%	۳,۲۳۳	۹۰%	۳۶۸	۳۳۷	۲ Q	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۶.۰	۴.۰	۵.۳	+۰.۷				
		ششمال	۹	۳۰.۰	-۳%	۱,۷۴۶	۸۹%	۱۷۰	۲۱۸	۳ Q	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۶.۴	۵.۱	۴.۹	+۰.۷				
		سبجنو	۱۲	۲۰.۷	-۴%	۶,۸۲۰	۹۶%	۵۷۳	۵۲۷	۲ Q	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۵	۵.۴	۵.۹	-۰.۲				
		سقاین	۱۲	۲۰.۲	-۴%	۵۴۸	۹۷%	۳۷	۲۴	۲ Q	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۱.۲	۹.۳	۹.۶	+۰.۴				
		سبهان	۱۲	۲۰.۲	-۲%	۱۰,۷۸۳	۹۷%	۷۳۶	۷۴۹	۲ Q	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۱	۴.۷	۴.۹	-۰.۳				
		سغرب	۱۲	۲۰.۱	-	۴,۲۸۵	۹۲%	۳۹۰	۴۱۰	۲ Q	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۵.۰	۳.۴	۴.۰	-۰.۶				
	سشاش	۱۲	۲۰.۰	-	۹,۸۸۰	۹۵%	۱,۱۶۱	۵۷۴	۲ Q	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۹	۴.۵	۵.۰	-۰.۶					
	سخرز	۱۲	۱۰.۸	-۳%	۳,۶۱۰	۹۵%	۳۵۸	۲۶۸	۲ Q	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۵	۵.۲	۶.۳	+۰.۰					
	کاشی و سرامیک	کحافظ	۱۲	۳۰.۷	-۴%	۷۱۹	۱۰%	۸۲	۶۱	۲ Q	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۳	۳.۳	۳.۶	-۲.۶				
		کساوه	۱۲	۳۰.۳	+۳%	۶,۲۰۵	۷۱%	۷۴۷	۲۹۰	۲ Q	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۶.۱	۴.۱	۴.۱	-۱.۹				
		کلوند	۱۲	۱۰.۹	+۴%	۴,۷۴۲	۹۵%	۵۰۴	۳۸۱	۲ Q	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۶.۳	۴.۸	۵.۴	+۰.۱				
فرآورده های نسوز		کپشیر	۱۲	۲۰.۴	+۲۳%	۹۶۵	۸۸%	۵۲	۶۰	۲ Q	۱۱۴	۱۰۰	-۱۲%	۸.۵	۹.۰	۸.۶	+۰.۶				



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		رشد سود ۱۴۰۳	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	۱۹۴.۱	-۲%	۸۵۵	۶۳%	۱۷۰	۱۰۱	۲ Q	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴.۹	۴.۷	۵.۰	+۱.۵					◆	
		شبندر	۱۲	۱۳۳.۹	-۳%	۹۹۷	۷۶%	۳۰۴	۷۷	۲ Q	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴.۱	۵.۶	۳.۸	+۱.۴					◆	
		شتران	۱۲	۱۱۹.۹	-۴%	۴۳۶	۳۱%	۱۰۹	۴۵	۲ Q	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۴	۴.۲	۳.۹	+۱.۱					◆	
		شبریز	۱۲	۳۹.۹	+۱%	۱,۳۳۰	۷۶%	۳۳۵	۹۳	۲ Q	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۵.۵	۵.۱	۴.۶	+۰.۰				◆		
		شاوان	۱۲	۱۷.۲	-۲%	۲,۱۴۵	۷۳%	۵۵۵	۱۸۳	۲ Q	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۲	۸.۷	۴.۶	+۰.۸				◆		
	نفت، گاز و سوخت های مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۲۱.۵	+۱%	۲۵۵	۸۸%	۳۱	۱۰	۲ Q	۳۵	۴۶	+۳۰%	۷.۲	۵.۱	۴.۹	-۲.۶	◆				
		شسپا	۱۲	۲۷.۹	-۲%	۴۹۹	۶۷%	۷۴	۴۵	۲ Q	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۳	۴.۱	۴.۵	+۰.۱				◆		
		روانکار	شبهرن	۱۲	۲۷.۰	-۱%	۲,۲۵۹	۸۹%	۳۳۸	۱۷۷	۲ Q	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۰	۵.۶	۵.۶	+۱.۴					◆
			شنفت	۱۲	۱۷.۵	-۱%	۸۷۳	۸۲%	۱۰۸	۶۶	۲ Q	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۸.۲	۸.۰	۸.۸	+۰.۵					◆
			شرانل	۱۲	۱۶.۰	+۴%	۷,۹۹۵	۸۵%	۱,۴۴۱	۵۷۶	۲ Q	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴.۷	۴.۰	۳.۷	-۰.۲				◆	
	زغال سنگ	کپرور	۱۲	۲.۳	-۸%	۱,۳۷۰	۵۹%	۱۶۹	۸۳	۲ Q	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۶.۷	۴.۸	۵.۰	-۰.۷				◆		
		کطبس	۱۲	۱.۷	+۲%	۲,۱۱۴	۶۲%	۱۹۳	۱۲۲	۲ Q	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۷.۰	۶.۰	۵.۷	-۱.۵				◆		
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۵	-۲%	۵۲۶	۹۴%	۴۷	۲۷	۳ Q	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۱.۸	۸.۸	۷.۰	-۴.۵	◆				
			تنوین	۱۲	۸.۴	-۳%	۲۱۸	۶۳%	۴۸	۱۷	۲ Q	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴.۴	۳.۱	۳.۲	-۳.۰	◆				
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۶	+۱%	۷,۹۷۰	۹۱%	۸۸۸	۵۰۵	۲ Q	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۶.۱	۳.۷	۴.۲	-۰.۶				◆	
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۴	-	۶,۹۵۰	۹۶%	۳۲۲	۱۷۶	۲ Q	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۷.۲	۹.۴	۱۰.۹	+۰.۲				◆	

-۳ -۲ -۱ ۰ +۱ +۲ +۳

اجماع تحلیلگران

گزارشگر	نمودار امتیاز Z	ارزان‌تر	امتیاز Z		نسبت P/e آینده نگر		برآورد سود کاریزما		سود واقعی		وضعیت قیمتی			گروه صنعتی				
			آینده‌نگر ۴ فصله	آینده‌نگر ۴ فصله	رشد سود	سود ۱۴۰۳	سود ۱۴۰۲	گزارش شده	۱۴۰۲ (تاکنون)	۱۴۰۱ (کل سال)	تقسیم سود	قیمت (تومان)	بازده هفتگی		ارزش بازار (همت)	سال مالی		
					۴.۷	۴.۵	۶.۲	۱,۰۷۴	۸۵۲	۲ Q	۳۳۹	۴۹۵	۷۶%	۵,۲۵۰	-	۱۲.۶	۱۲	ددانا
					۶.۸	۶.۴	۷.۱	۴۹۲	۴۹۳	۲ Q	۲۶۴	۳۵۲	۹۶%	۳,۴۹۰	+۵%	۷.۹	۱۲	دلر
					۵.۶	۶.۶	۷.۶	۱,۰۱۸	۹۵۳	۲ Q	۲۶۴	۸۰۳	۹۸%	۷,۲۳۹	+۱۰%	۶.۹	۱۲	دپارس
					۴.۹	۴.۹	۶.۱	۱۳۴	۱۱۳	۲ Q	۵۰	۷۵	۶۹%	۶۸۸	+۲%	۶.۵	۱۲	دالبر
					۴.۶	۵.۳	۶.۲	۵۹۱	۵۶۱	۲ Q	۱۵۲	۴۵۲	۹۹%	۳,۵۰۲	+۳%	۵.۶	۱۲	دفارا
					۶.۲	۶.۴	۷.۷	۵۶۰	۵۰۱	۲ Q	۲۰۱	۳۹۳	۷۹%	۳,۸۴۷	-۵%	۵.۴	۱۲	دفرا
					۴.۳	۴.۱	۵.۲	۶۰۶	۵۴۳	۲ Q	۲۳۶	۴۰۶	۹۵%	۲,۸۳۵	+۱%	۴.۵	۱۲	هجرت
					۵.۶	۵.۲	۶.۹	۴۵۲	۳۷۷	۲ Q	۱۷۷	۲۷۷	۹۶%	۲,۵۸۰	-۱%	۴.۴	۱۲	دقاضی
					۵.۱	۵.۳	۷.۱	۴۰۵	۳۳۲	۲ Q	۱۰۳	۴۴۹	۹۴%	۲,۳۵۰	-	۴.۲	۱۲	دتوزیع
					۵.۸	۵.۴	۶.۸	۳۶۵	۳۱۸	۲ Q	۱۵۴	۲۳۴	۹۵%	۲,۱۶۰	+۶%	۳.۰	۱۲	کاسپین
					۳.۶	۴.۰	۵.۸	۲۷۶	۲۲۵	۲ Q	۲۷	۲۱۳	۱۰۴%	۱,۲۹۴	+۴%	۲.۷	۱۲	درازک
					۷.۲	۶.۲	۸.۰	۱,۲۷۵	۱,۰۶۵	۲ Q	۶۰۳	۹۲۱	۹۲%	۸,۵۰۰	-	۲.۶	۱۲	دکپسول
					۴.۴	۵.۰	۵.۸	۳۷۵	۳۴۶	۲ Q	۱۱۰	۲۷۳	۶۷%	۲,۰۱۵	-۵%	۲.۰	۱۲	دراز۱

تهیه شده: ۱۴۰۲/۱۰/۱۵
منتهی به: ۱۴۰۲/۱۰/۱۵



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)				
مصرفی غیردوره‌ای	غذا و نوشیدنی	سپید	۱۲	۸.۲	-	۲,۷۳۹	۵۵%	۲۱۳	۲۰۲	۲ Q	۴۹۶	۶۸۹	+۳۹%	۵.۵	۳.۸	۴.۰	-۳.۹				
		سیمرغ	۹	۴.۸	-	۳,۷۰۰	۲۴%	۳۹۱	۳۳۷	۳ Q	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۶.۸	۴.۹	۳.۹	-۱.۳				
		زفکا	۱۲	۲.۸	-۲%	۱,۸۶۰	۹۱%	۱۵۵	۱۰۵	۲ Q	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۱۰.۳	۶.۷	۸.۳	+۰.۶				
		تلیسه	۱۲	۲.۱	-۴%	۴۱۵	۹۲%	۲۵	۲۹	۲ Q	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۲.۲	۸.۴	۱۳.۳	+۰.۱				
		زگلدشت	۱۲	۱.۷	-	۲,۴۹۰	۹۵%	۹۶	۱۱۰	۲ Q	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۱.۴	۸.۴	۹.۲	+۰.۰				
		زملارد	۱۲	۱.۷	+۱%	۲,۱۱۵	۹۴%	۳۳	۶۳	۲ Q	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۴.۵	۱۱.۵	۱۱.۴	-۲.۴				
		زشریف	۹	۱.۷	+۴%	۷۰۰	۷۶%	۴۸	۵۸	۳ Q	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۸.۸	۷.۲	۶.۲	-۰.۴				
		زشگزا	۱۲	۱.۰	+۱%	۱,۰۴۱	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۹.۶	۵.۵	۸.۵	+۰.۳				
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۴.۸	+۵%	۱,۴۷۵	۶۰%	۱۶۱	۷۴	۲ Q	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۶.۵	۴.۴	۴.۵	-۲.۰				
		غپینو	۱۲	۳.۷	+۵%	۴۱۰	۵۶%	۴۹	۲۵	۲ Q	۶۷	۹۴	+۳۹%	۶.۱	۴.۲	۴.۳	-۱.۰				
		غسالم	۱۲	۲.۰	-۴%	۴۵۰	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۶۵	۸۱	+۲۵%	۶.۹	۵.۵	۴.۸	-۱.۰				
		غمینو	۱۲	۱.۵	-۲%	۱,۰۰۷	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۶.۱	۳.۹	۴.۲	-۰.۳				
	محصولات لبنی	غگورش	۱۲	۱۴.۶	-۱%	۷۲۸	۵۴%	۱۲۶	۴۰	۲ Q	۸۳	۸۶	+۳%	۸.۷	۸.۲	۷.۸	+۰.۳				
		غگلپا	۱۲	۱.۵	-۵%	۴,۰۷۵	۷۴%	۴۶۵	۲۲۳	۲ Q	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۶.۹	۴.۷	۴.۸	-۰.۶				
		غگلستا	۱۲	۱.۲	-	۱,۹۳۷	۷۰%	۱۵۶	۴۹	۲ Q	۲۰۷			۹.۴							
		غشان	۱۲	۱.۲	+۴%	۷۰۹	۷۱%	۸۰	۲۶	۲ Q	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۸.۶	۶.۲	۵.۹	-۰.۴				
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	کیمیاتک	۱۲	۷.۰	+۵%	۱,۱۶۱	۶۴%	۱۰۲	۷۱	۲ Q	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۸.۰	۶.۷	۶.۹	+۰.۵				
		قرن	۱۲	۶.۶	+۱%	۱,۰۹۸	۶۱%	۱۱۰	۶۲	۲ Q	۱۴۳	۲۰۰	+۴۰%	۷.۷	۵.۳	۵.۷	-۰.۷				
		شپاکسا	۹	۲.۶	-	۲۸۰	۳۸%	-۲۴	۲۳	۳ Q	۴۶	۶۱	+۳۲%	۶.۱	۵.۶	۳.۸	-۳.۳				

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

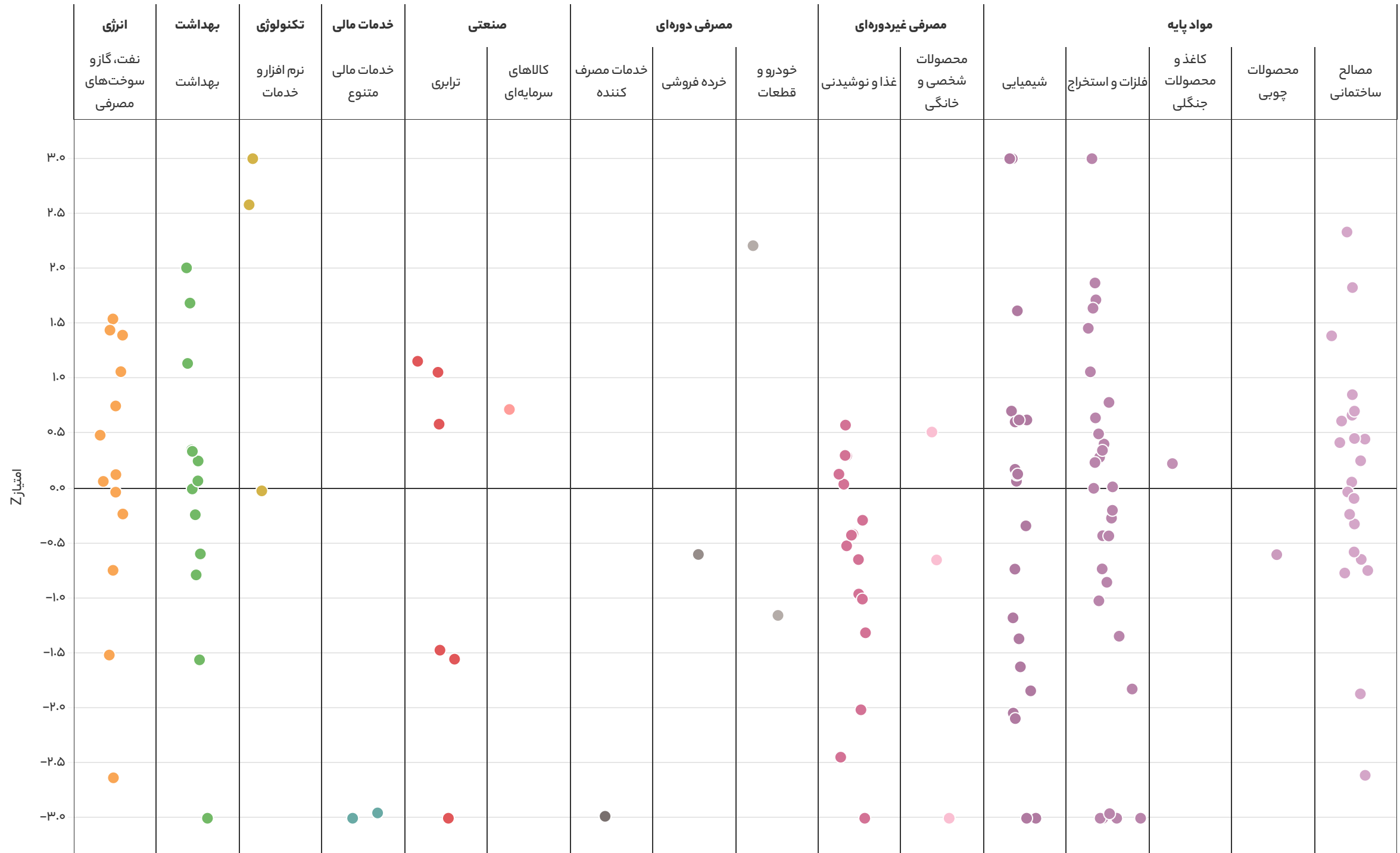


نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

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	حزرج	۱۲	۷.۰	+۲%	۱,۹۳۳	۹۶%	۲۰۷	۱۹۸	۲ Q	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۶.۷	۴.۲	۶.۰	+۰.۶				
		حتاید	۱۲	۶.۴	-۵%	۵۳۰	۵۲%	۶۲	۴۳	۲ Q	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۴.۹	۳.۷	۳.۷	-۱.۶				
	ترابری	توریل	۱۲	۴.۰	-۳%	۵۷۰	۳۸%	۴۳	۱۸	۲ Q	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸.۶	۶.۶	۵.۸	-۱.۵				
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	حتاقرین	۱۲	۱.۸	-۵%	۲۴۵	۵۲%	۳۱	۱۳	۲ Q	۴۱	۴۸	+۱۶%	۵.۹	۵.۲	۴.۴	-۶.۳			
		چپارسا	۶	۱.۶	-	۶,۲۸۵	۸۹%	۶۳۱	۵۱۲	۳ Q	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۸.۸	۷.۴	۶.۳	+۱.۱				
کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۶	-۳%	۲۵۷	۳۱%	۲۶	۱۵	۲ Q	۲۰	۳۰	+۴۶%	۱۲.۷	۸.۸	۱۱.۹	+۰.۷				
	سیم و کابل	بکابل	۱۲	۲.۹	+۳%	۲,۸۶۵	۶۱%	۲۵۰	۱۲۷	۲ Q	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۵	۵.۰	۴.۵					
مصرفی دورهای	خودرو و قطعات	تایرو تیوپ	۹	۴.۹	-۳%	۷۵۶	۷۵%	۲۵	۶۳	۳ Q	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۸.۸	۴.۶	۴.۶	-۱.۲				
		پلاستیک	پلوله	۱۲	۰.۸	-۴%	۳,۵۸۰	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۶.۶	۱۶.۵	۱۹.۹	+۲.۲			
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳.۹	+۱%	۷۷۵	۴۹%	۱۰۳	۴۷	۲ Q	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۷	۴.۲	۴.۲	-۰.۶			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	رافزا	۱۲	۱.۶	-۴%	۱,۵۸۳	۸۰%	۹۱	۹۹	۲ Q	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۱۱.۳	۹.۱	۱۱.۵	+۰.۰				

مقایسه ارزشدگی شرکت‌ها

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



ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

