

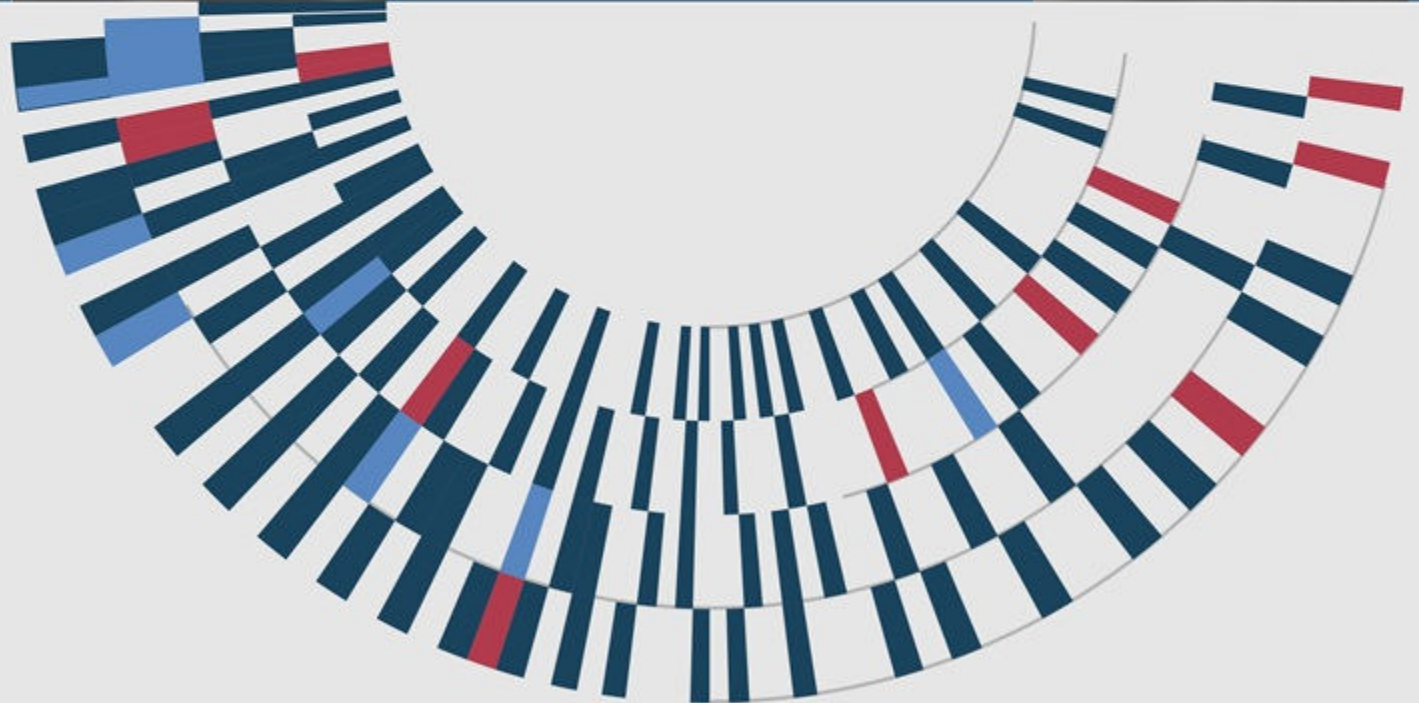
کاریزماتیک

CHARISMATICK

گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۳ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۲۲

 CHARISMA





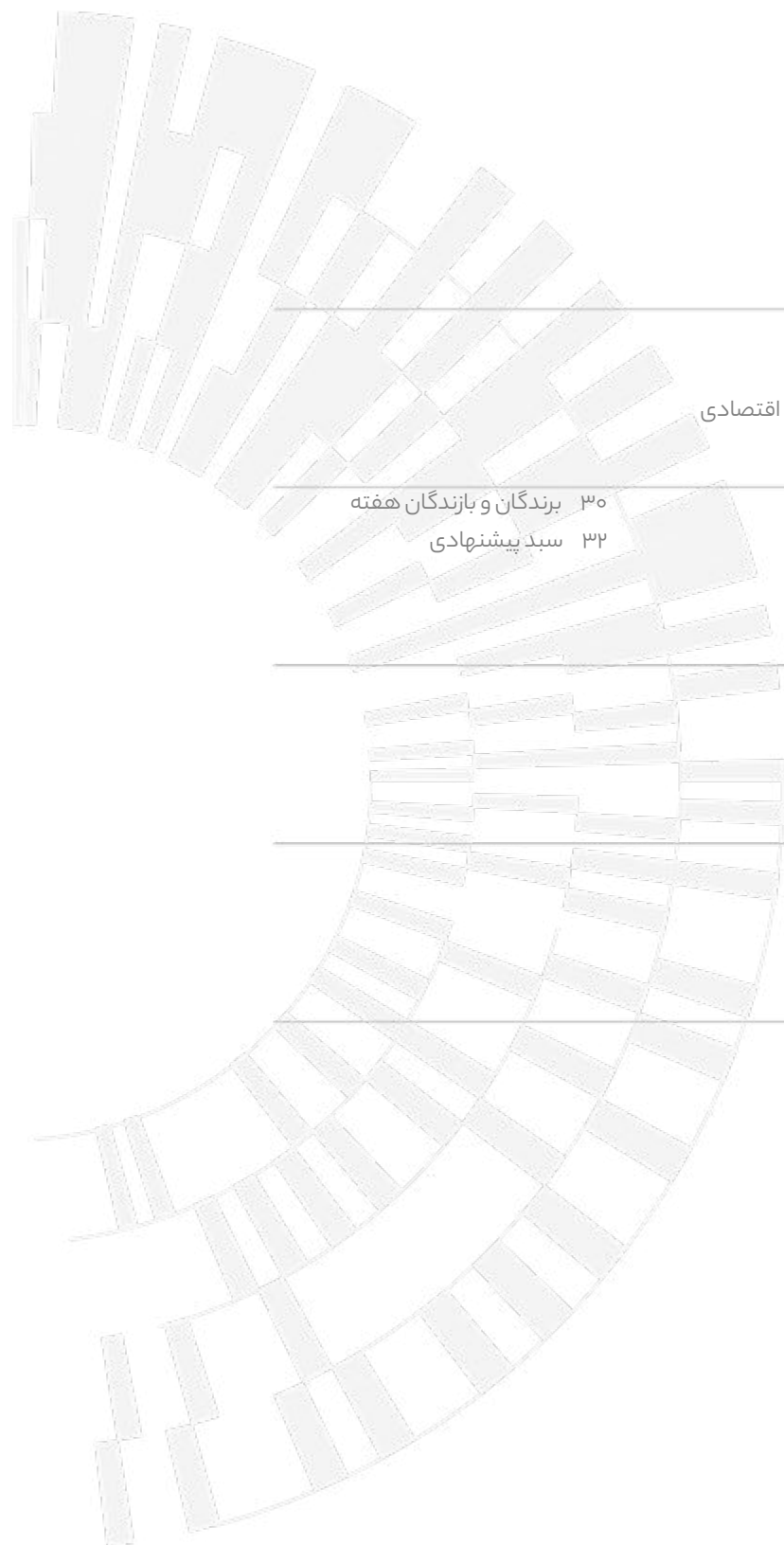
معرفی گزارش:

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	۲,۰۴۷	۰.۱%	فزر	-	۲,۰۶۹ ۱,۸۱۳	۶%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۳۰۰	-۱.۴%	فملی	بموتو، فباهنر	۹,۳۴۱ ۷,۹۴۳	-۱۱%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۱۹۴	-۲.۳%	فایرا	فنوال	۲,۴۲۴ ۲,۰۷۱	۲%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۱۳	-۱.۵%	فاسمین، فسرب، فروی، فراور، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کباقق، کاما	فمراد	۳,۴۴۴ ۲,۳۰۳	-۲۶%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۹۴	۰.۸%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کباقق، کاما	-	۲,۲۹۶ ۲,۰۲۴	-۲%
گندله – گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۶۹۰	-۰.۴%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۴,۸۴۳ ۳,۷۰۹	۲۶%
کنسانتره – چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۶۳	۰.۱%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۶۲۵ ۲,۸۹۹	۲۳%
شمش – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۱۵	۱.۴%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کوپر، فوکا، فنورد	۶۲۳ ۴۳۱	-۶%
شمش – فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۳۹۳	۳.۹%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کوپر، فوکا، فنورد	۲۲,۸۲۱ ۱۵,۷۵۵	۲۳%
اسلب – منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۳۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۶۷۰ ۴۴۸	-۴%
اسلب – فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۵۴۳	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۲۲,۵۴۳ ۱۶,۶۹۰	۳۵%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۵	-	ذوب، کویر	فولای	۷۵۵ ۵۴۶	-۱۳%
میلگرد – ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۰,۹۱۱	-۰.۵%	ذوب، کویر	فولای	۲۴,۷۴۷ ۱۷,۷۴۰	۱۸%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۰۸	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۷۸۰ ۵۵۵	-۱%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۷۰۵	-	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	۳۲۰	۱.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشای	شاروم، شفقارس		
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۹	۰.۹%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفقارس، شسینا		
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۷۰	۲.۴%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن		
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۱,۰۱۸	۵.۹%	آریا، شکبیر	-		
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۵۸	۴.۹%	جم، شکبیر، شاراک	-		
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۰	۳.۱%	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-		
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۵۲۵	-۲.۱%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی		
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۳۰	-۱.۱%	شگویا	-		
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۲۵	-۰.۶%	جم، شکبیر	جم پیلن		
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۶	۰.۵%	جم پیلن، مارون، شاراک	-		
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۴	۰.۱%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی		
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۹۸	-	شصفها، نوری	-		
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۶	۱.۳%	پارس	شجم، شبصیر		
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۵۸	۴.۰%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران		
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۷۱۰	۱.۱%	بوعلی	-		
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۱۰۰	۴.۸%	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	۱,۲۳۰	-۱.۲%	شبصیر	-		



انرژی و سایر محصولات

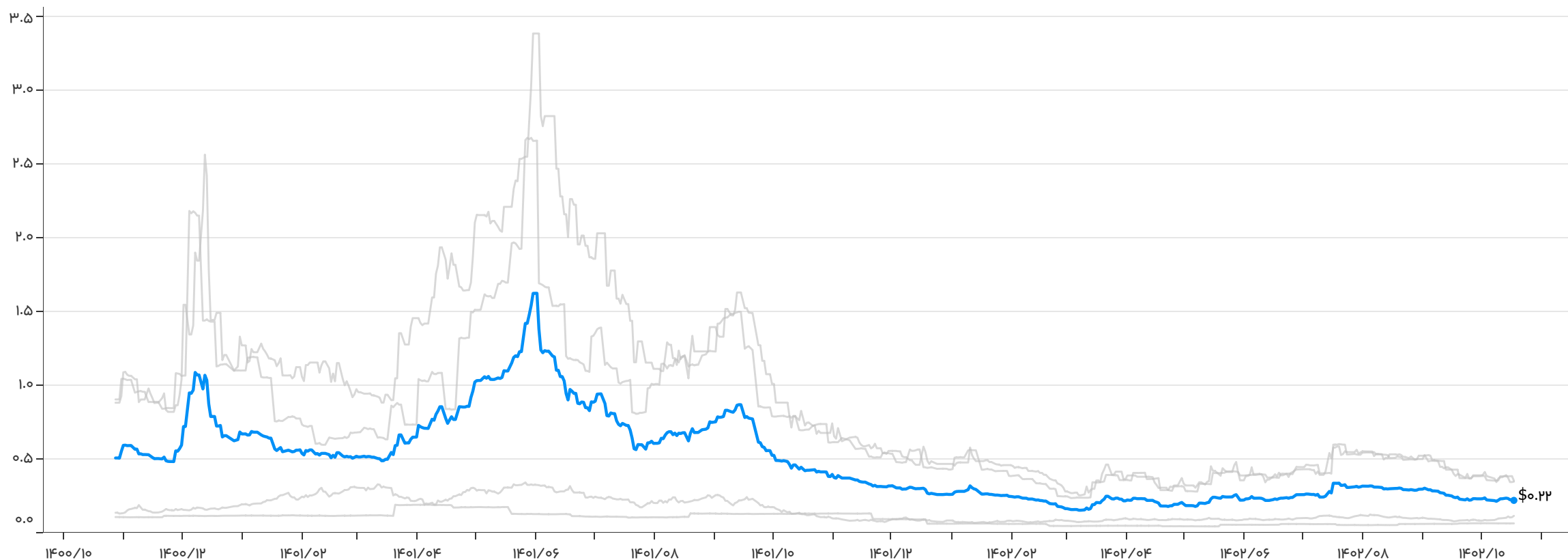
روند قیمتی ۱۲ ماهه		بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره		تاثیر در بهای تمام شده		تاثیر در فروش	تغییر نسبت به هفته گذشته	آخرین قیمت	واحد	مرجع قیمتی	عنوان
انرژی و فرآورده های نفتی			شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	-	-۰.۴%	۷۸	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت برنت
			شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	-	-۲.۱%	۷۲	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	نفت WTI
			-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	۲.۴%	۱۱۲	دلار/بشکه	بورس کالای نیویورک	نفت کوره
			-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	۱.۷%	۱۰۵	دلار/بشکه	بورس بین المللی اروپا	گازوئیل کم سولفور
			شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	-	۵.۳%	۱۸,۰۰۰	تومان/تن	بورس کالای ایران	لوب کات - پالایش نفت تهران
			-	شبهرن، شسپا، شنف، شرانل	-	-	-۴.۱%	۲۶,۲۷۹	تومان/تن	بورس کالای ایران	روغن پایه - نفت سپاهان
محصولات کشاورزی			-	شپاس	-	-	۴.۶%	۱۲,۹۴۲	تومان/تن	بورس کالای ایران	قیر - نفت پاسارگاد
			غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	-۲.۸%	۱۷۷	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	ذرت آمریکا
			غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	-	-	-	۳.۳%	۸۱۷	دلار/تن	بورس مالزی	روغن پالم خام
			-	-	-	-	۰.۹%	۱,۲۳۷	دلار/تن	بورس کالای نیویورک	شکر آمریکا
ارز و ارز دیجیتال			-	-	-	-	-۳.۲%	۲۱۹	دلار/تن	بورس کالای چیکاگو	گندم آمریکا
			-	-	-	-	۰.۱%	۱.۱۰	-	بازار فارکس	یورو به دلار
			-	-	-	-	۰.۲%	۱.۲۷	-	بازار فارکس	پوند به دلار
ارز و ارز دیجیتال			-	-	-	-	۰.۱%	۴۳,۷۶۳	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	۰.۱۲	۸.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ ۰.۱۳	۸%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۷	-۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ ۰.۱۳	-۵۰%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۵	۰.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ ۱.۵۵	-۴۹%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۶	-۷.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ ۰.۷۴	-۵۲%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۲	-۲.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ ۰.۵۴	-۴۶%

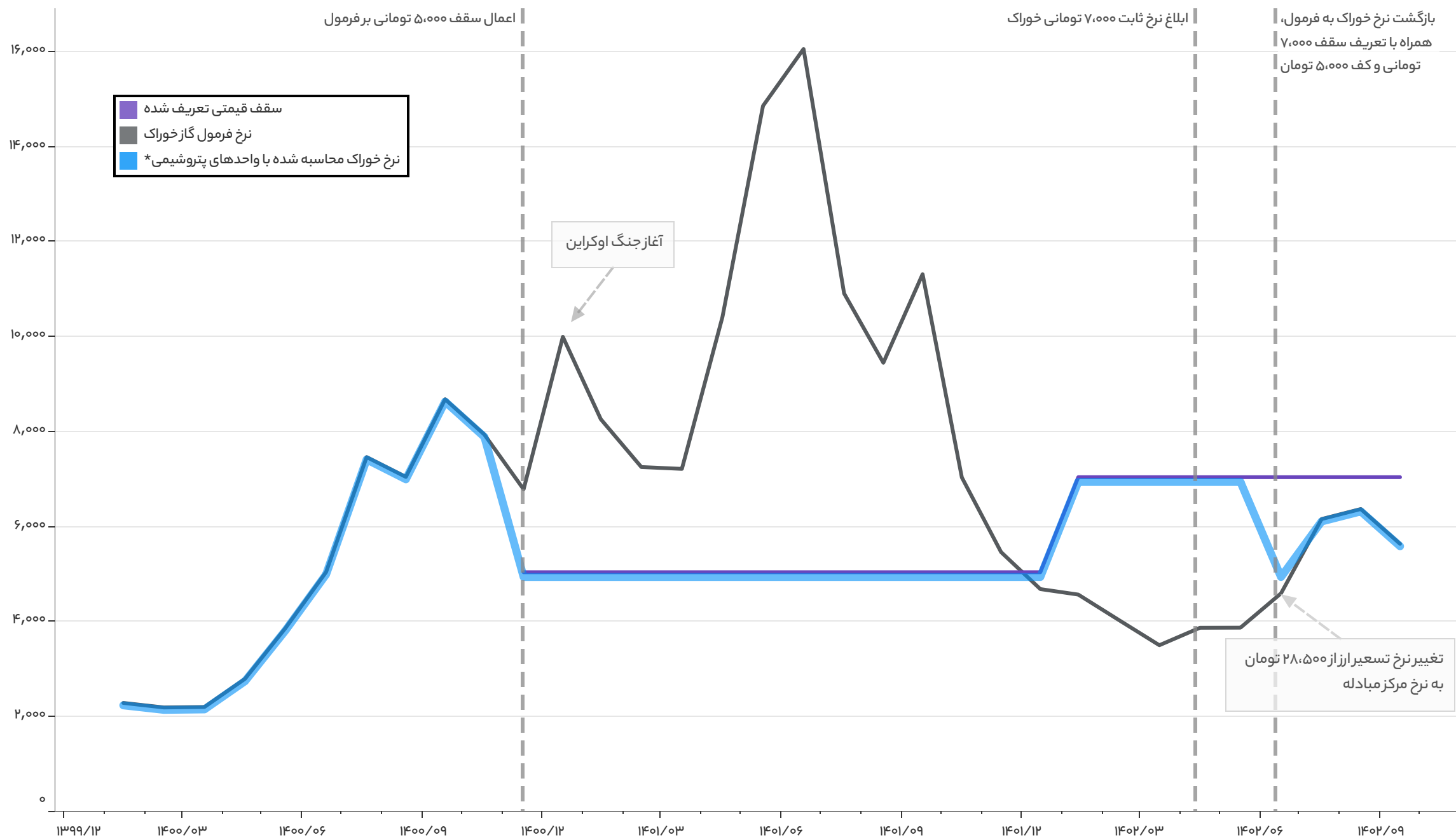
میانگین نرخ ۴ هاب گاز طبیعی

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

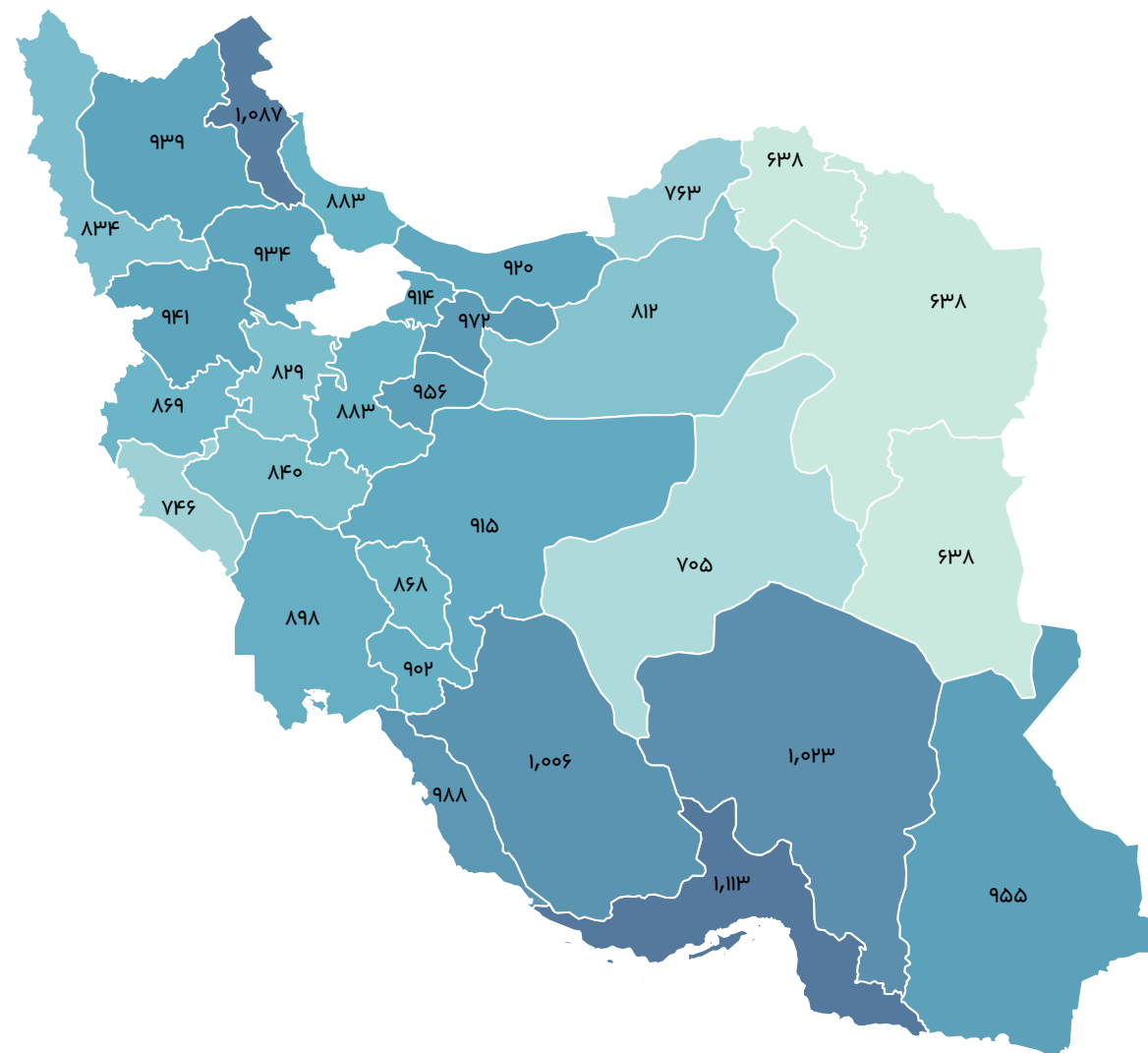


* نرخ خوراک گاز ابلاغ شده به واحدهای پتروشیمی برای مهر و آبان برابر فرمول فرض شده است و متعاقباً بروزرسانی خواهد شد.

- 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



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	-
	مرکزی	سیمان ساوه	۸۸۳	۸۸۳	-
	تهران	سیمان تهران	۹۶۹	۹۷۲	+۰.۲%
	اصفهان	سیمان سپاهان	۹۱۵	۹۱۵	-
	قم	سیمان نيزار قم	۹۳۷	۹۵۶	+۲.۱%
	سمنان	سیمان شاهرود	۸۰۵	۸۱۲	+۰.۸%
	یزد	گروه صنعتی و معدنی سیمان..	۷۳۱	۷۰۵	-۳.۶%
غرب	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۸۹۸	۸۹۸	-
	همدان	سیمان هگمتان	۸۲۹	۸۲۹	-
	ایلام	سیمان ایلام	۷۰۹	۷۴۶	+۵.۲%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۶۸	۸۶۸	-
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۸۴۶	۸۶۹	+۲.۶%
	لرستان	سیمان دورود	۹۱۴	۸۴۰	-۸.۱%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۸۷۹	۹۰۲	+۲.۶%
جنوب	کردستان	سیمان کردستان	۹۴۱	۹۴۱	-
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۱۴۹	۱,۱۱۳	-۳.۱%
	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۷۱	۹۸۸	+۱.۸%
شمال	فارس	سیمان داراب	۹۰۳	۱,۰۰۶	+۱۱.۵%
	مازندران	سیمان مازندران	۸۹۵	۹۲۰	+۲.۸%
	گیلان	سیمان خزر	۹۰۹	۸۸۳	-۲.۹%
شمال غرب	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۶۳	۷۶۳	-
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۲۰۹	۱,۰۸۷	-۱۰.۱%
	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
شمال شرق	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۱۰	۹۳۹	+۳.۲%
	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۱۱	۸۳۴	+۲.۹%
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۳	۶۳۸	+۰.۹%
جنوب شرق	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۳۸	۶۳۸	-
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۱,۱۰۸	۱,۰۲۳	-۷.۷%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۴۱	۹۵۵	+۱.۵%

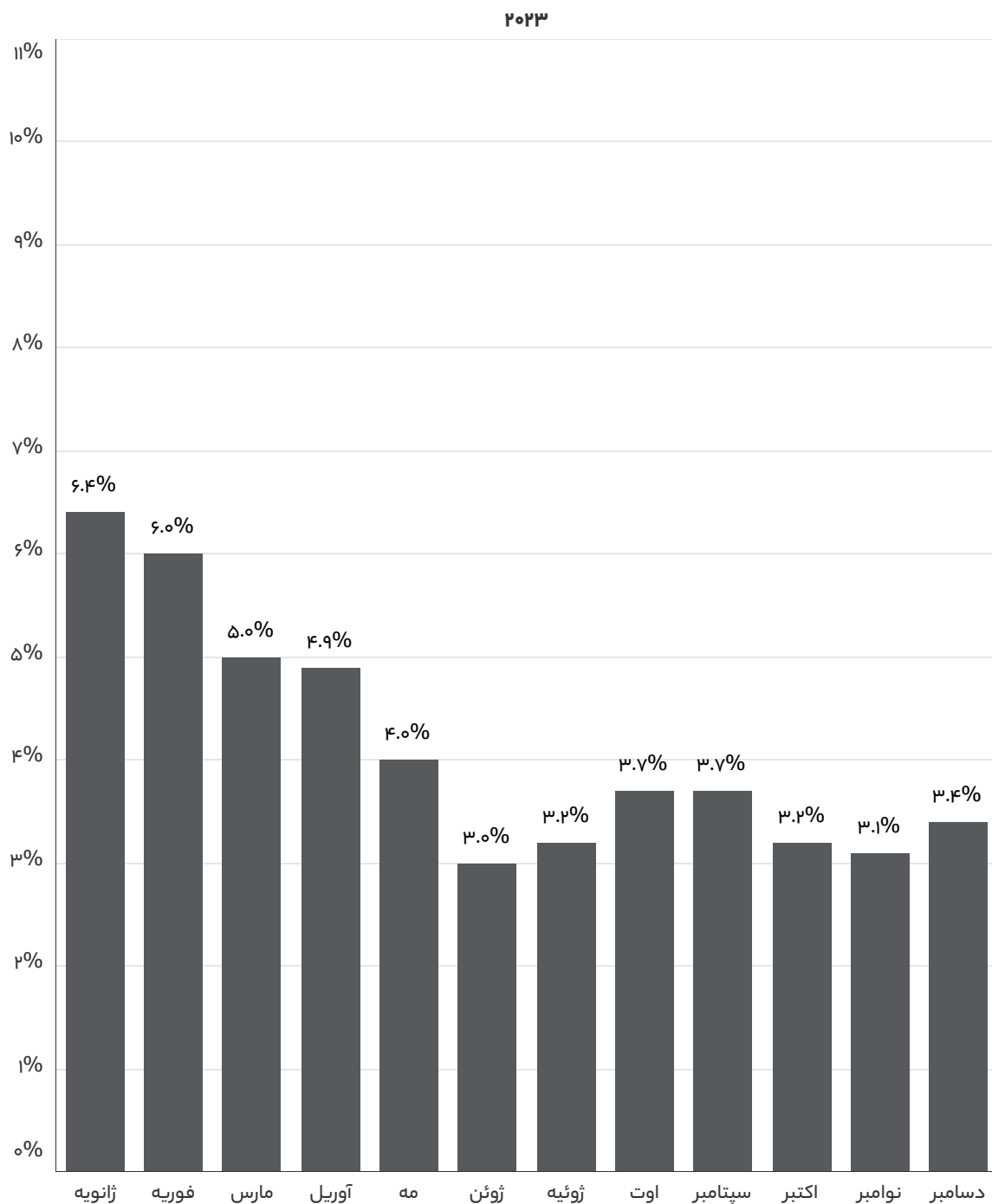
* قیمت سیمان براساس سیمان تیپ ۲ قله‌ای معامله شده در بورس کالا، و به صورت میانگین وزنی (براساس حجم معامله شده طی هفته) محاسبه شده است.



- ▲ قیمت طلا در روز جمعه با جهش ۲۰ دلاری به بالاترین رقم طی یک هفته گذشته رسید. تشدید درگیری در خاورمیانه خرید طلا به عنوان یک پشتوانه ایمن را افزایش داده است. از طرف دیگر کاهش تورم قیمت تولیدکننده در آمریکا احتمال کاهش زود هنگام نرخ بهره بانک مرکزی این کشور را بالا برده است. به گزارش رویترز، قیمت هر انس طلا در روز جمعه که در لحظاتی از ۲۰۶۰ دلار نیز عبور کرده بود، در نهایت با یک درصد افزایش با قیمت ۲۰۴۹ بسته شد.
- ▲ بازار طلا و سکه طی روزهای اخیر با رشد هیجانی مواجه شده است که علاوه بر موضوع جنگ یمن، عوامل دیگری نظیر ثبات مالیاتی خریداران و همچنین تغییر سازوکار واردات طلا و الزام به عرضه در مرکز مبادله به جهش قیمت‌ها شدت بخشیده است. در این راستا تنها طی دو هفته اخیر قیمت سکه بورسی از حدود ۲۹ میلیون و ۵۰۰ هزار تومان در ۹ دی ماه، به ۳۳ میلیون و ۳۰۰ هزار تومان در روز جاری رسید که بالاترین رقم ۸ ماه اخیر است.
- ▲ در هفته گذشته رکورد تازه‌ای در بازار گواهی سپرده شمش طلا در بورس کالا به ثبت رسید، به گونه ای که ۲۸۸ کیلوگرم طلا به ارزش ۹۹۴ میلیارد تومان در این بازار دادوستد شد. در هفته گذشته در بازار گواهی سپرده شمش طلا در بورس کالای ایران، حجم معاملات به ۲ میلیون و ۸۸۴ هزار و ۵۱۰ گواهی معادل ۲۸۸ کیلو و ۴۵۱ گرم به ارزش ۹۹۴ میلیارد تومان رسید. این در حالی است که رکورد پیشین متعلق به هفته دوازدهم بازاری یعنی از ۳۰ اردیبهشت تا ۴ خرداد ۱۴۰۲ بود که در هفته مذکور حجم معاملات معادل ۱۶۵ کیلوگرم به ارزش معاملات معادل ۶۱۰ میلیارد تومان بود.
- ▲ قیمت نفت برنت در روز دوشنبه افت قیمت داشت اما در روز سه‌شنبه به دلیل بحران خاورمیانه و توقف عرضه نفت لیبی، قیمت نفت اندکی افزایش یافت. همچنین به گزارش رویترز، کاهش بیش از حد انتظار ذخایر نفت خام آمریکا طی یک هفته گذشته قیمت نفت را در روز چهارشنبه بالا برده است. علاوه بر این، قیمت نفت در روز جمعه در پی حمله هوایی آمریکا و انگلیس علیه یمن افزایش یافت و به بالاتر از ۷۹ دلار رسید. نفت برنت در طول معاملات، تا بیش از سه دلار هم افزایش داشت و به بالای ۸۰ دلار رسیده بود که بالاترین قیمت امسال بود. در واقع، حمله هوایی آمریکا و انگلیس به یمن باعث تغییر مسیر کشتی‌های بیشتری از دریای سرخ شده و قیمت نفت را افزایش داده است.
- ▲ به گزارش بیزینس اینسایدر، حمله یمن به کشتی‌های تجاری در دریای سرخ باعث اختلال در زنجیره‌های جهانی عرضه شده است، اما به نظر می‌رسد صادرات نفت آمریکا از این حمله‌ها سود برده است. تحلیلگران عقیده دارند تقاضای جهانی به سمت عرضه نفت شیل آمریکا تغییر یافته است، چون راهی راحت‌تر و ایمن‌تر جهت خرید نفت مخصوصاً برای مشتریان اروپایی است. بسیاری از کشتی‌ها به خاطر حمله‌های یمن مسیر دریای سرخ را کنار می‌گذارند و از کانال سوئز که یک آبراه حیاتی بین آسیا و اروپاست عبور نمی‌کنند و به عوض قاره آفریقا را دور می‌زنند. بنابراین بسیاری از خریداران ترجیح می‌دهند به جای خاورمیانه از آمریکا نیز نشان می‌دهد صادرات نفت این کشور ۳۵ درصد افزایش هفتگی داشته است.
- ✓ طبق گزارش اداره اطلاعات انرژی آمریکا (EIA)، مصرف جهانی نفت و مایعات دیگر در سال میلادی گذشته، به بالاترین حد خود رسید و پیش‌بینی می‌شود در سال‌های ۲۰۲۴ و ۲۰۲۵ افزایش بیشتری پیدا کند. اما رشد مصرف، لزوماً به معنای آن نیست که قیمت‌ها برای تضمین تامین تقاضا، باید افزایش پیدا کنند. برخی از مقامات ارشد اوپک پلاس، این استدلال را تکرار کرده‌اند که قیمت‌ها به اندازه کافی بالا هستند تا سرمایه‌گذاری را تشویق کرده و امنیت عرضه را تضمین کنند.
- ▼ قیمت گاز طبیعی مایع (ال‌ان‌جی) در شمال آسیا، تحت تاثیر دورنمای هوای ملایم‌تر و ذخایر بالا که نیاز به خرید گاز بیشتر برای زمستان را کاهش داده، به پایین‌ترین قیمت در حدود ۷ ماه اخیر سقوط کرد. قیمت ال‌ان‌جی از اواسط اکتبر، تقریباً نصف شده و مایه آسودگی خیال خانوارها و کسب و کارهایی شده که پس از آغاز جنگ اوکراین در فوریه سال ۲۰۲۲ و شکل‌گیری بحران انرژی جهانی، با افزایش سرسام‌آور هزینه‌های انرژی خود روبه‌رو شدند. ذخایر بالای گاز در سراسر شمال آسیا نیز که خانه بزرگترین خریداران گاز طبیعی مایع است، به معنای آن است که فشار فوری برای تامین سوخت بیشتری وجود ندارد.
- ▼ عربستان سعودی، صادرکننده بزرگ نفت، در بحبوحه رقابت تامین‌کنندگان رقیب و نگرانی‌ها درباره مازاد عرضه و همزمان با کاهش قیمت نفت برنت در روز دوشنبه، قیمت نفت خام سبک خود را در ماه فوریه برای مشتریان آسیایی به پایین‌ترین سطح در ۲۷ ماه گذشته کاهش داد. آرامکو عربستان قیمت فروش رسمی (OSP) برای بارگیری عرب لایت در ماه فوریه در آسیا را با ۲ دلار کاهش در هر بشکه از ژانویه به ۱۰۵ دلار در هر بشکه نسبت به قیمت عمان / دبی رساند، سطحی که آخرین بار در نوامبر ۲۰۲۱ مشاهده شده بود.
- ✓ شبکه خبری فاکس نیوز آمریکا گزارش داد کشتی توقیف شده که قبلاً به نام سوئز راجان شناخته می‌شد، زمانی در مرکز اختلافات دیگری بین آمریکا و ایران قرار داشت که در نهایت منجر به توقیف بیش از یک میلیون بشکه نفت خام ایران توسط آمریکا شد. بنا بر گزارش‌ها، نیروهای مسلح ایرانی، صبح پنجشنبه سوار این کشتی شده و آن را توقیف کردند. بر اساس این گزارش، توقیف این کشتی از سوی ایران تنها یک روز پس از آن صورت می‌گیرد که حوثی‌ها (انصارالله یمن) بزرگترین حمله خود را تا امروز به خطوط کشتیرانی بین‌المللی در جنوب دریای سرخ انجام دادند.
- ✓ روز سه‌شنبه مرکز پژوهش‌های مجلس اعلام کرد که ناترازی گاز در سال ۱۴۰۱ از وضعیت ناترازی فصلی در زمستان، به کل سال تعمیم یافته و در سال گذشته، ایران روزانه ۱۲۳ میلیون متر مکعب با کمبود گاز مواجه بوده است. (معادل کل نیاز صنایع ایران به گاز) تا پیش از سال ۱۳۹۸، مدیریت ناترازی گاز تا حد بسیاری با مصرف سوخت مایع (گازوئیل و مازوت) در بخش نیروگاهی در زمستان قابل حل بود اما در سال‌های اخیر بخش صنعتی نظیر صنایع فولاد، پتروشیمی، سیمان و صنایع غیرعمده نیز با محدودیت گاز مواجه شده‌اند. تعمیم ناترازی به کل سال یعنی، حالا دیگر نه فقط در زمستان، بلکه در تابستان هم نیروگاه‌ها، گازوئیل و مازوت می‌سوزانند.

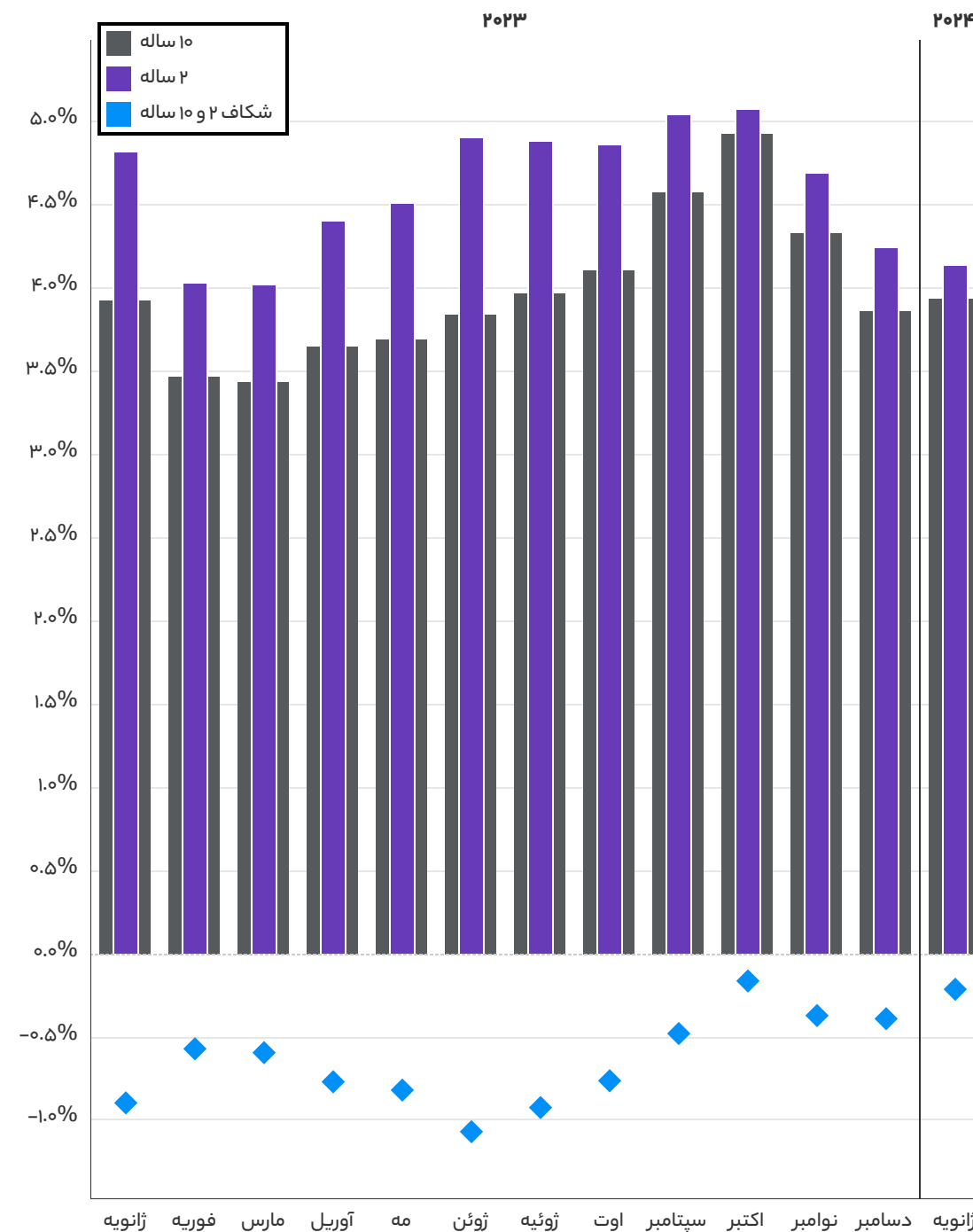
شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



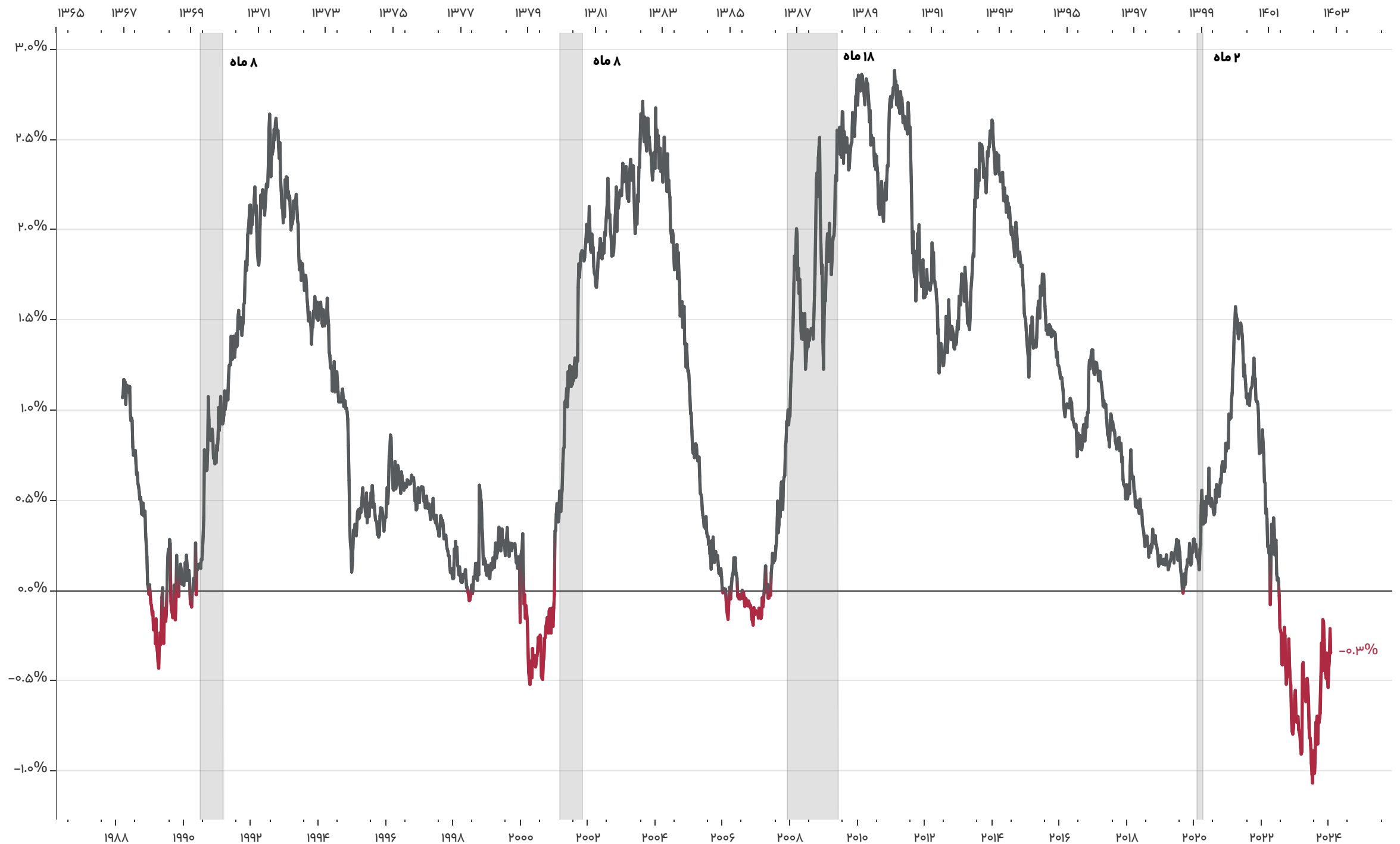
وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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



شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



بازار سهام

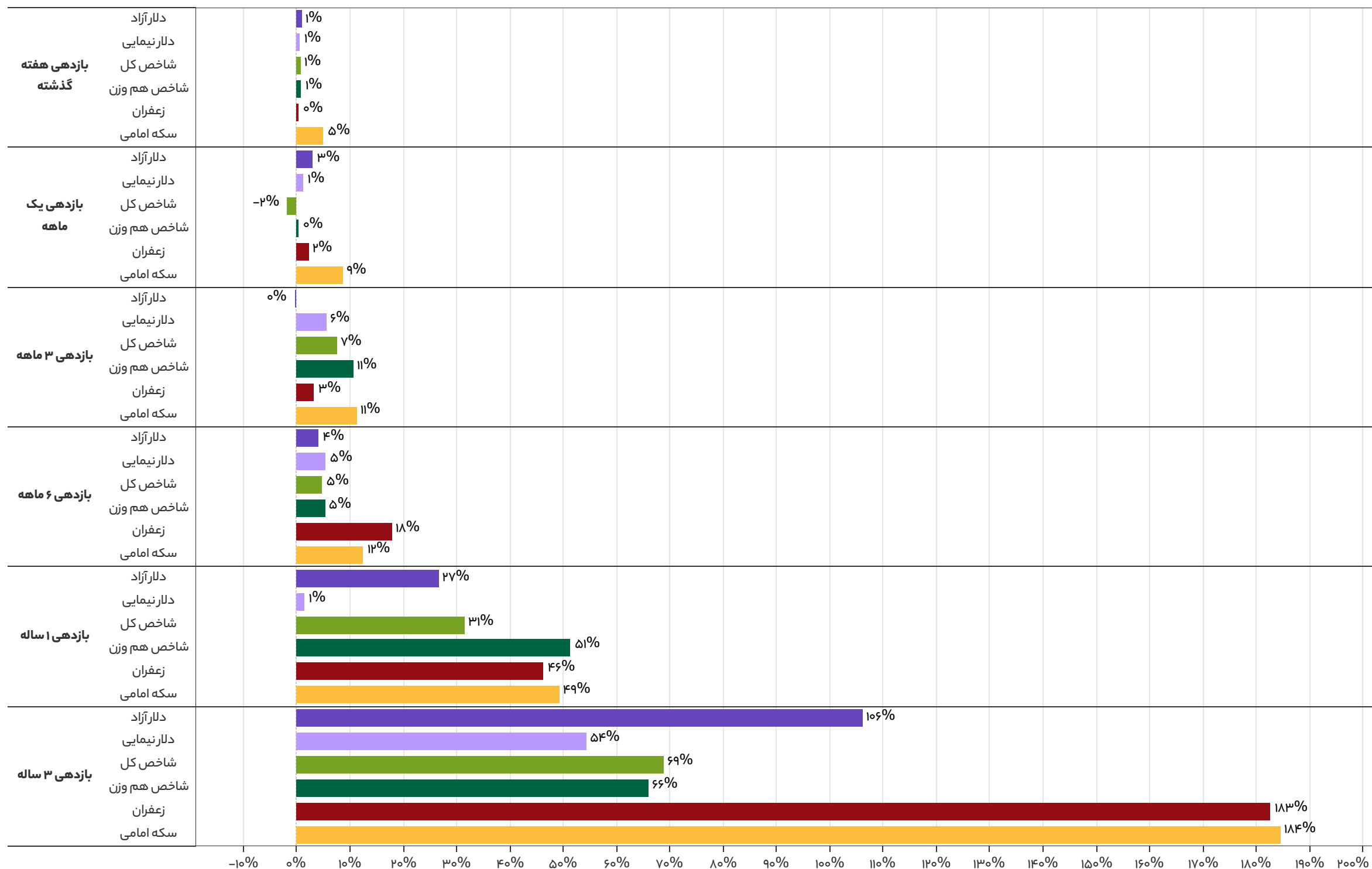
EQUITY MARKET

EQUITY MARKET





مقایسه بازده بورس با سایر دارایی‌ها در بازه‌های زمانی متفاوت



بازده طبقات دارایی طی یک سال گذشته

بازدهی دارایی‌های مختلف، طی یکسال گذشته به صورت ماهانه، مرتب شده براساس بازده در هر ماه، رنگ براساس دارایی

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

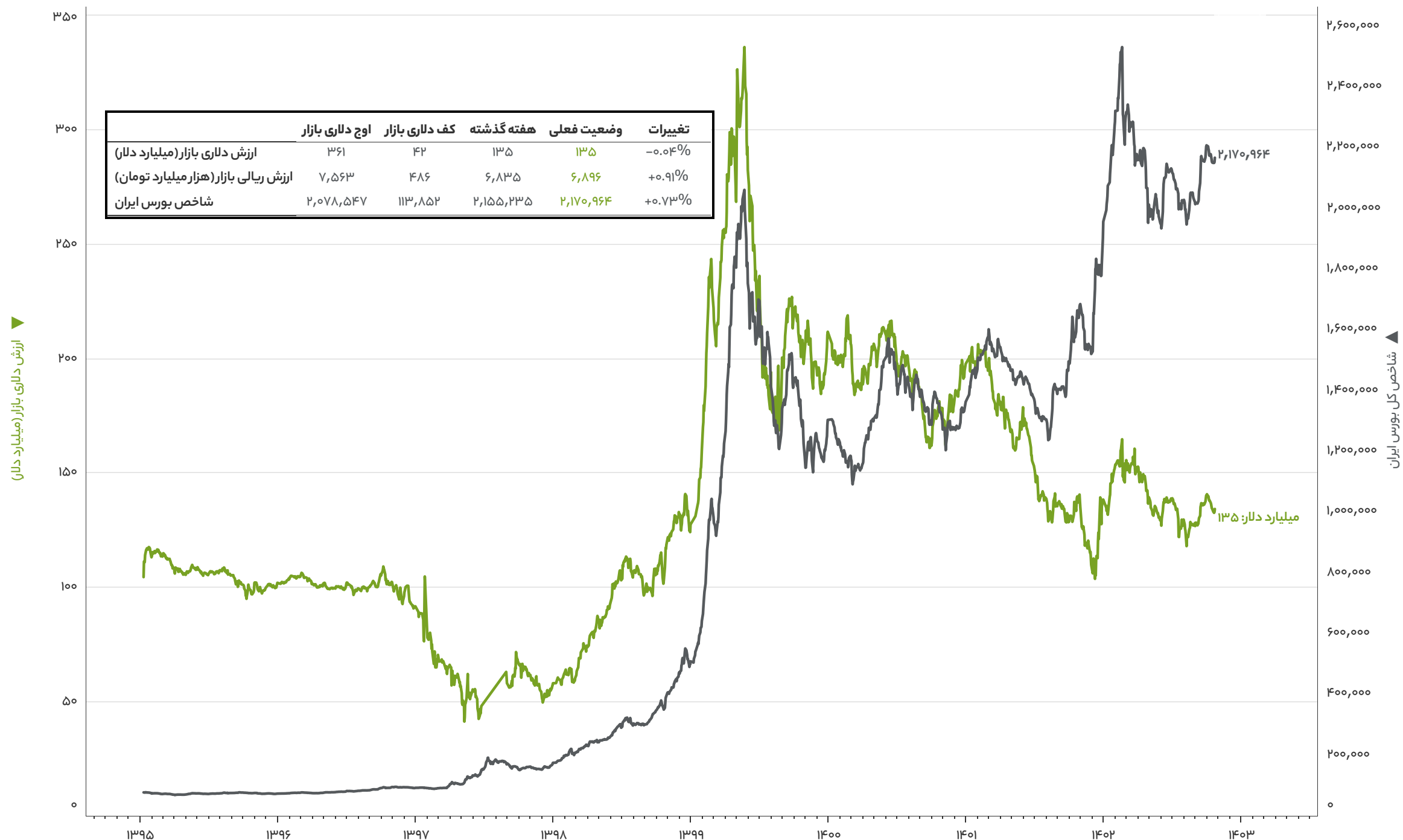
– بازده درآمد ثابت، براساس میانگین بازده اسناد خزانه در هر ماه محاسبه شده و اوراقی که کمتر از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند نیز از محاسبه حذف شده‌اند.

– بازده زعفران براساس بازده صندوق سرمایه‌گذاری 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 کاربریما ذکر گردیده، استفاده شده است.

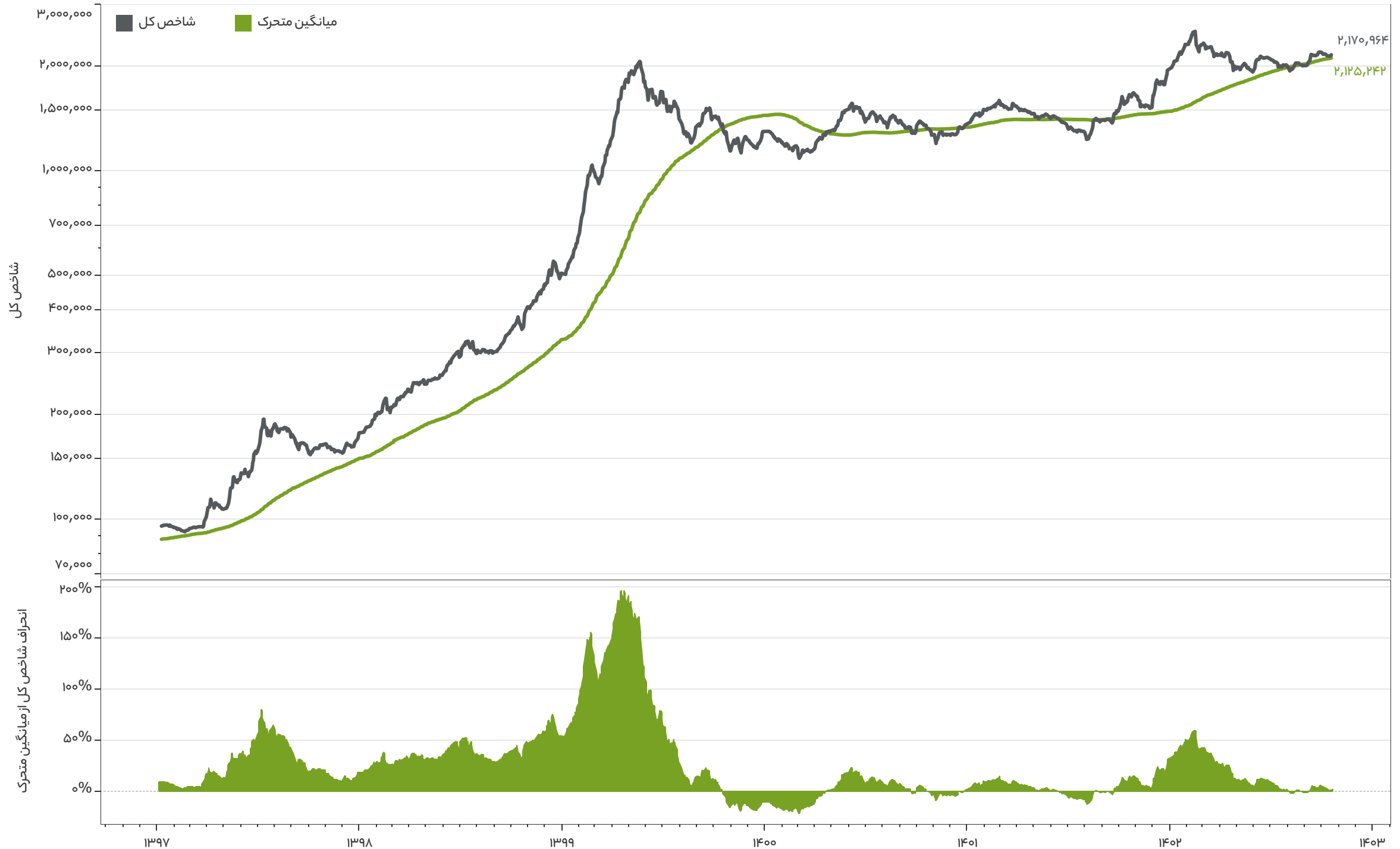
ارزش دلاری بازار

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

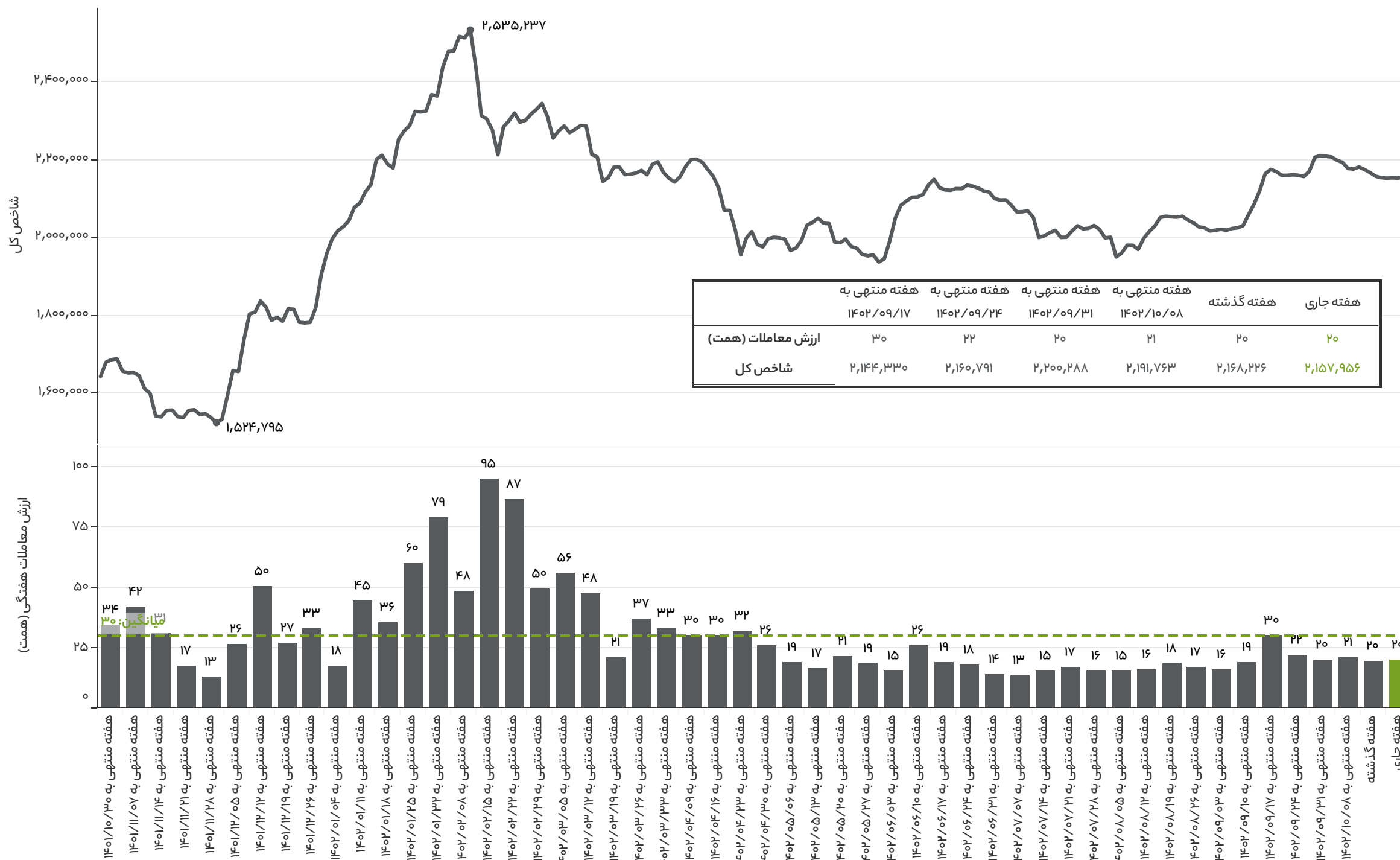
از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس





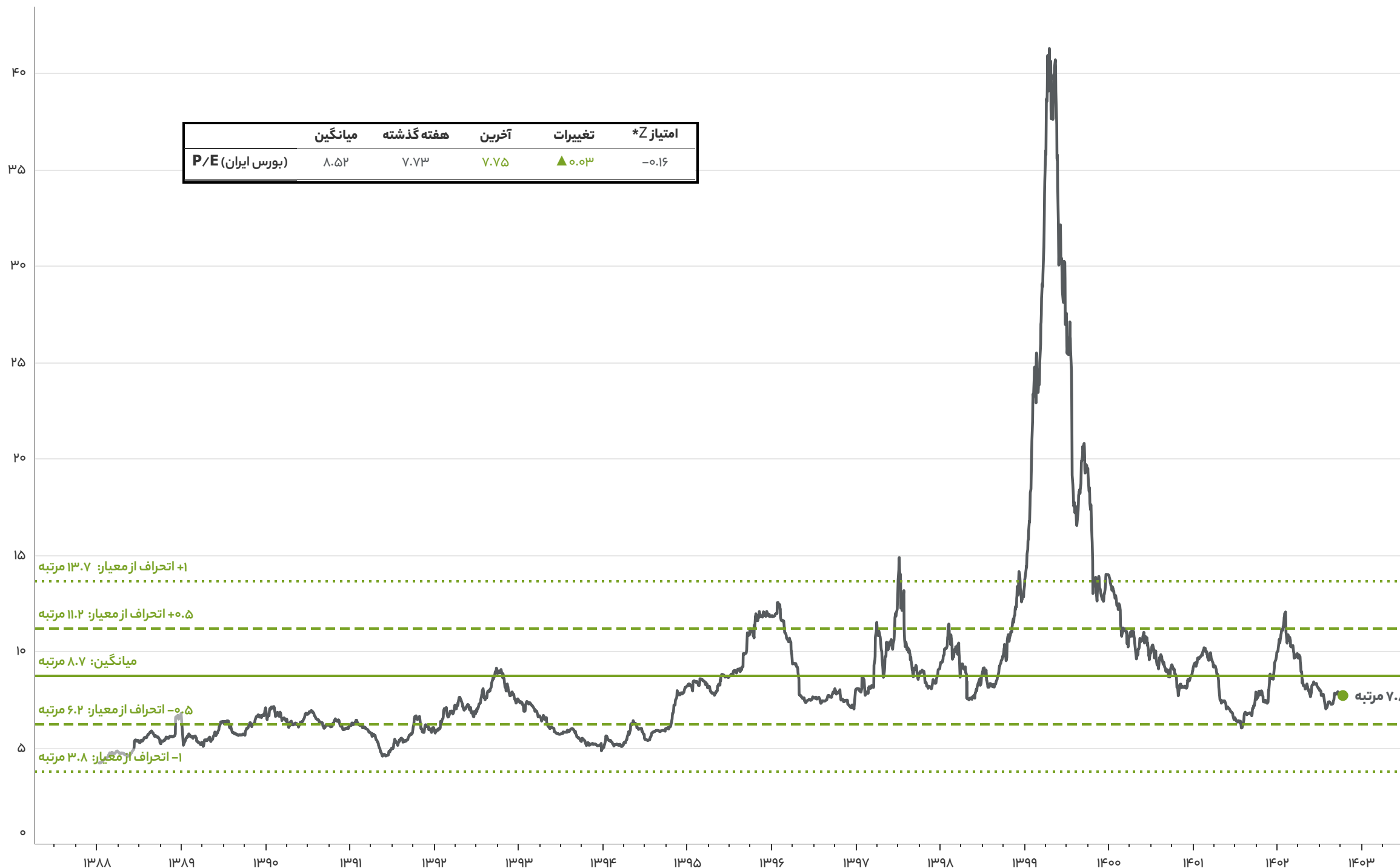
ارزش معاملات هفتگی بازار

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



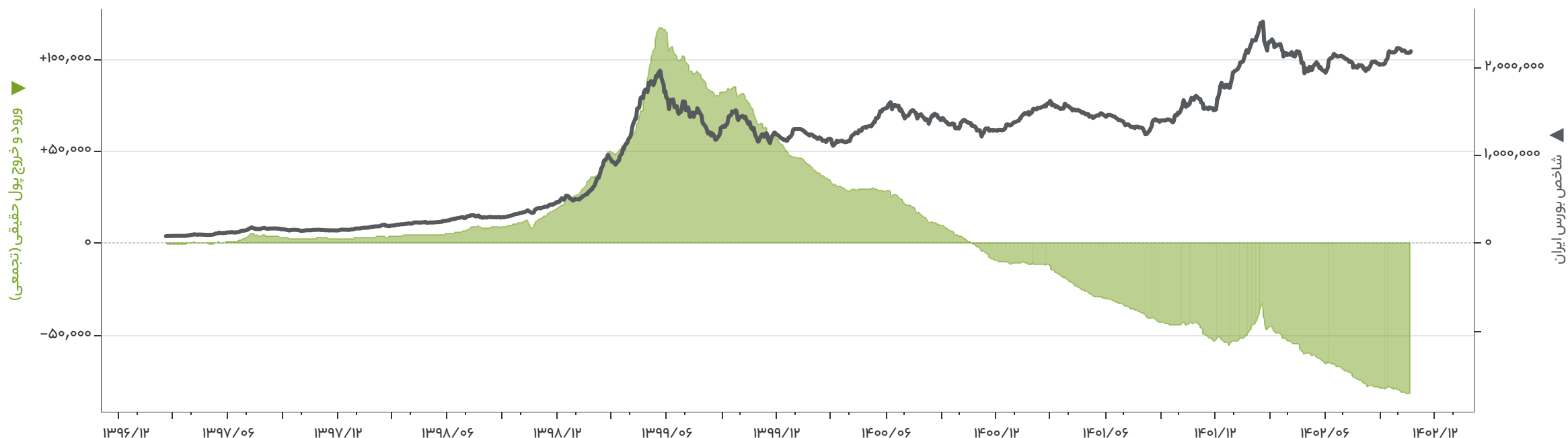
تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۷۵	۷.۷۳	۶.۰۷	۱۲.۸۰	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۴۴	۷.۴۲	۵.۶۴	۱۲.۵۷	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۸۳	۹.۸۱	۹.۰۳	۱۵.۰۹	۴۳.۵۱

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	۶۶	۶	۱۸۹	۱۹۹	
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۶۱	۸۷	۱۲۰	۱۲۳	۱۶۷	۲۰۶	۲۲۲	۴۰۵	۶۴۲	۳,۳۲۰	۳,۳۹۸	وزن
سهام هر سکتور از ارزش بازار	۰.۷%	۱.۰%	۱.۴%	۱.۴%	۱.۹%	۲.۴%	۲.۵%	۴.۶%	۷.۳%	۳۷.۹%	۳۸.۸%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۱۳.۵	۸.۸	۲۱.۴	۱۳.۰	۹.۵	۹.۸	۱۱.۲	۶.۰	۵.۱	۷.۹	۷.۳	
بازده سود نقدی	۲.۹%	۱۷.۴%	۲.۴%	۳.۲%	۶.۷%	۳.۶%	۴.۳%	۳.۱%	۱۴.۰%	۸.۸%	۸.۵%	سودآوری
نسبت تقسیم سود	۴۲%	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)	+۷۰۳%	+۷۷۰%	+۳۱۱%	+۱۴۸%	+۴۱۷%	+۴۵۸%	+۴۵۵%	+۹۱۷%	+۸۱۷%	+۹۳۹%	+۸۹۸%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۱۳%	+۱۱۳%	+۴۰%	-۶۰%	+۲۳%	-۴%	+۴%	-۷%	+۱۹%	+۶۲%	+۵%	
بازده از ابتدای سال	+۲۵۹%	+۴۰%	+۷۷%	+۵۹%	+۱۰۶%	+۱۱۷%	+۶۳%	+۱۰۵%	+۹۵%	+۸۲%	+۷۵%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	۴%	۰%	۰%	-۴%	۰%	۱%	۰%	۲%	۳%	۱%	۱%	

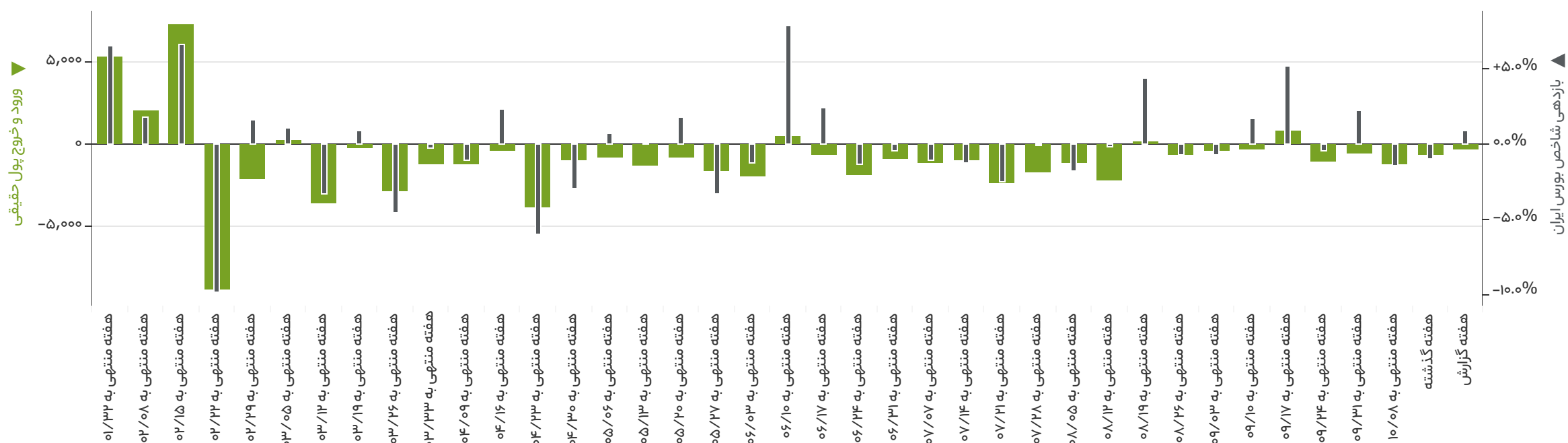
ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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



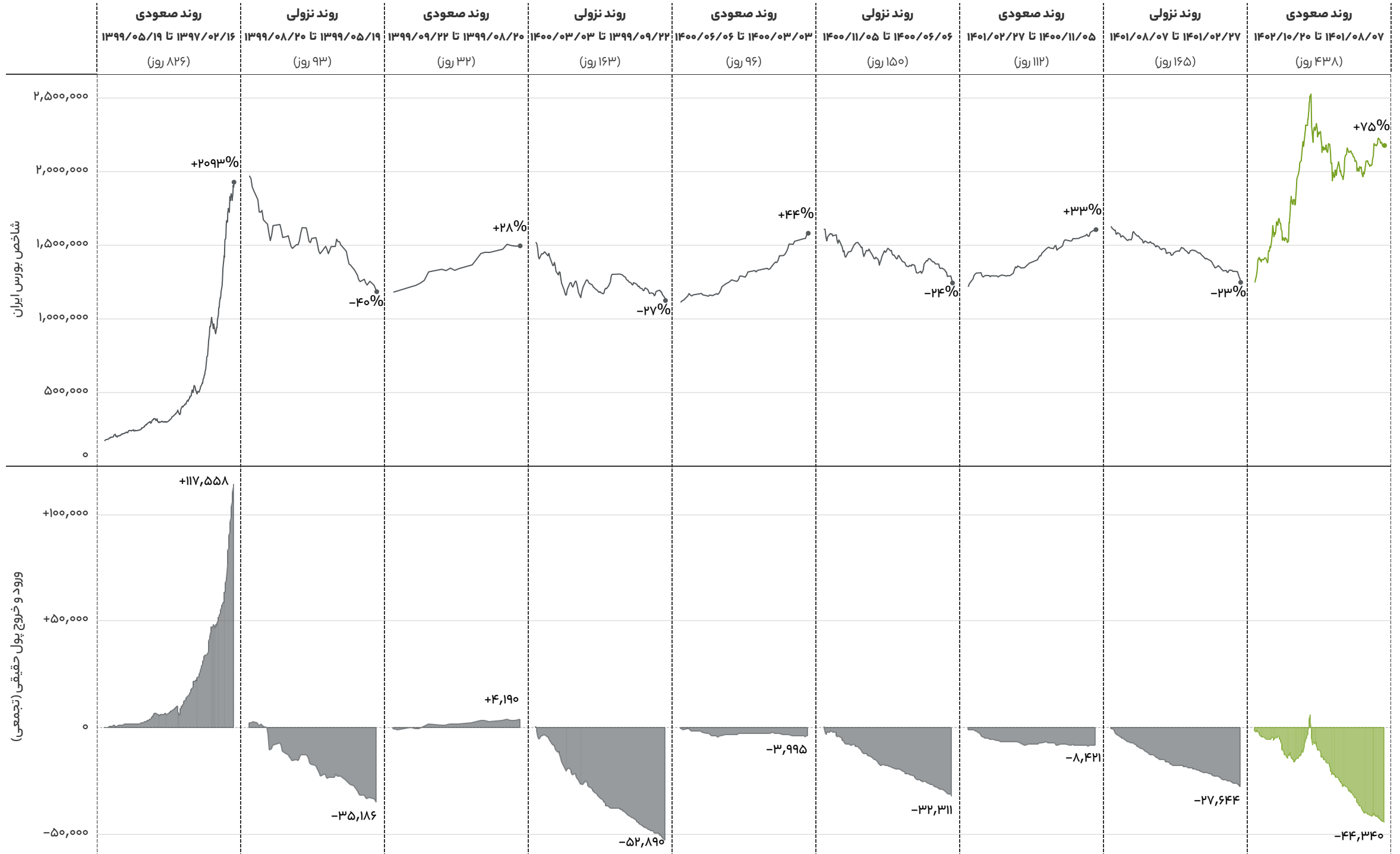
ورود و خروج پول حقیقی در مدت اخیر

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

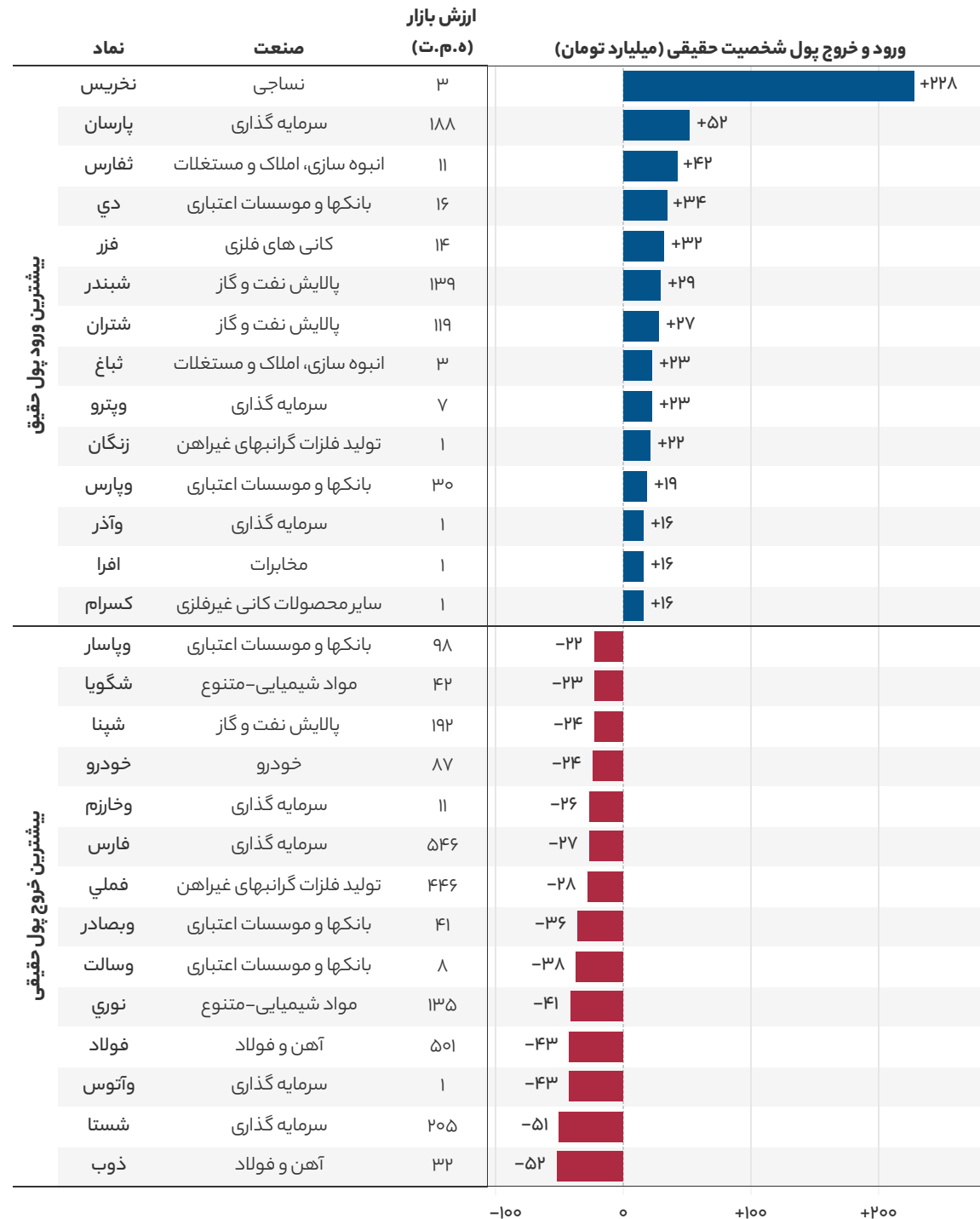
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۹۷، شاخص بورس ایران، خالص ورود و خروج پول اشخاص حقیقی در بورس تهران و فرابورس



ورود و خروج پول

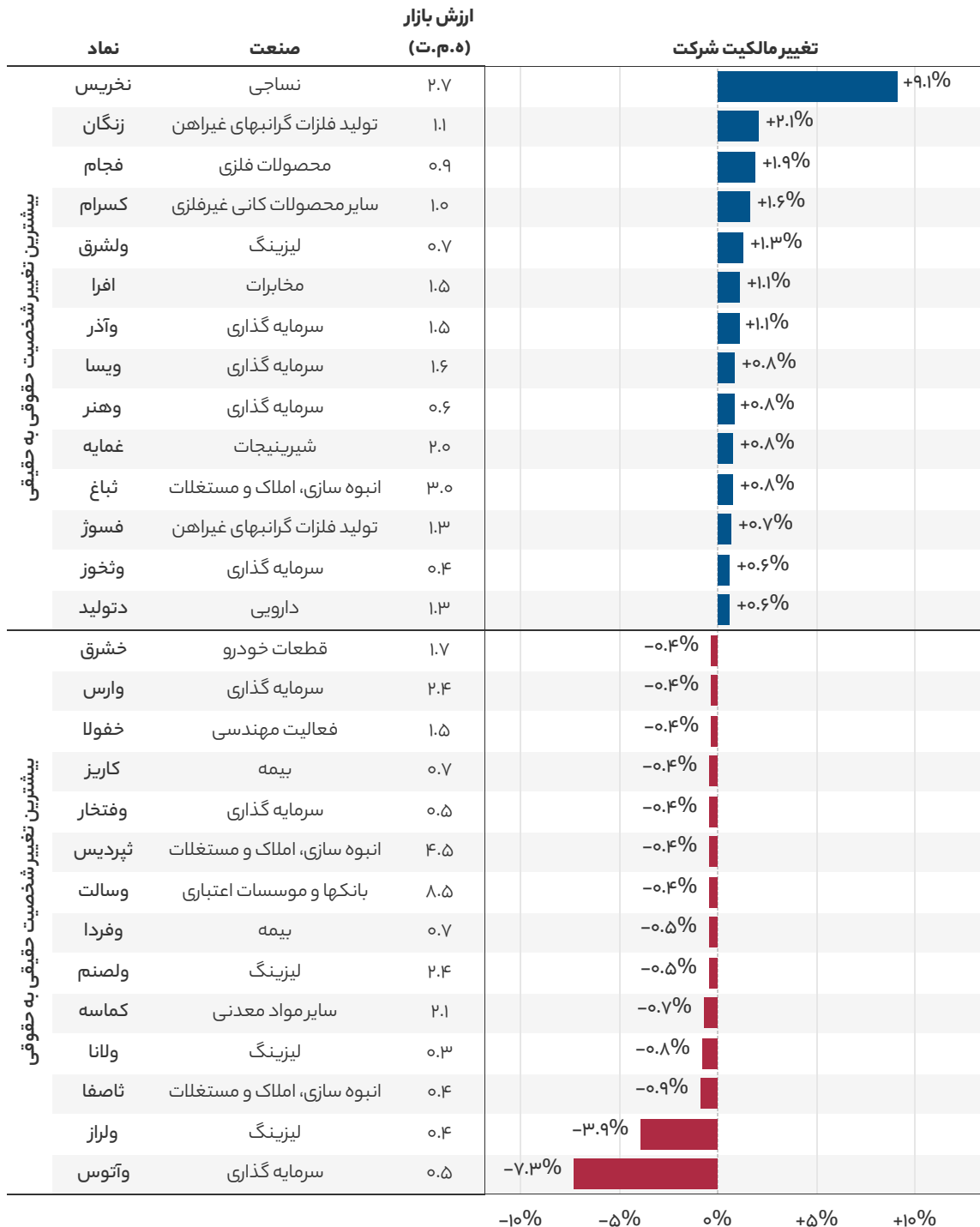
ورود و خروج پول حقیقی

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



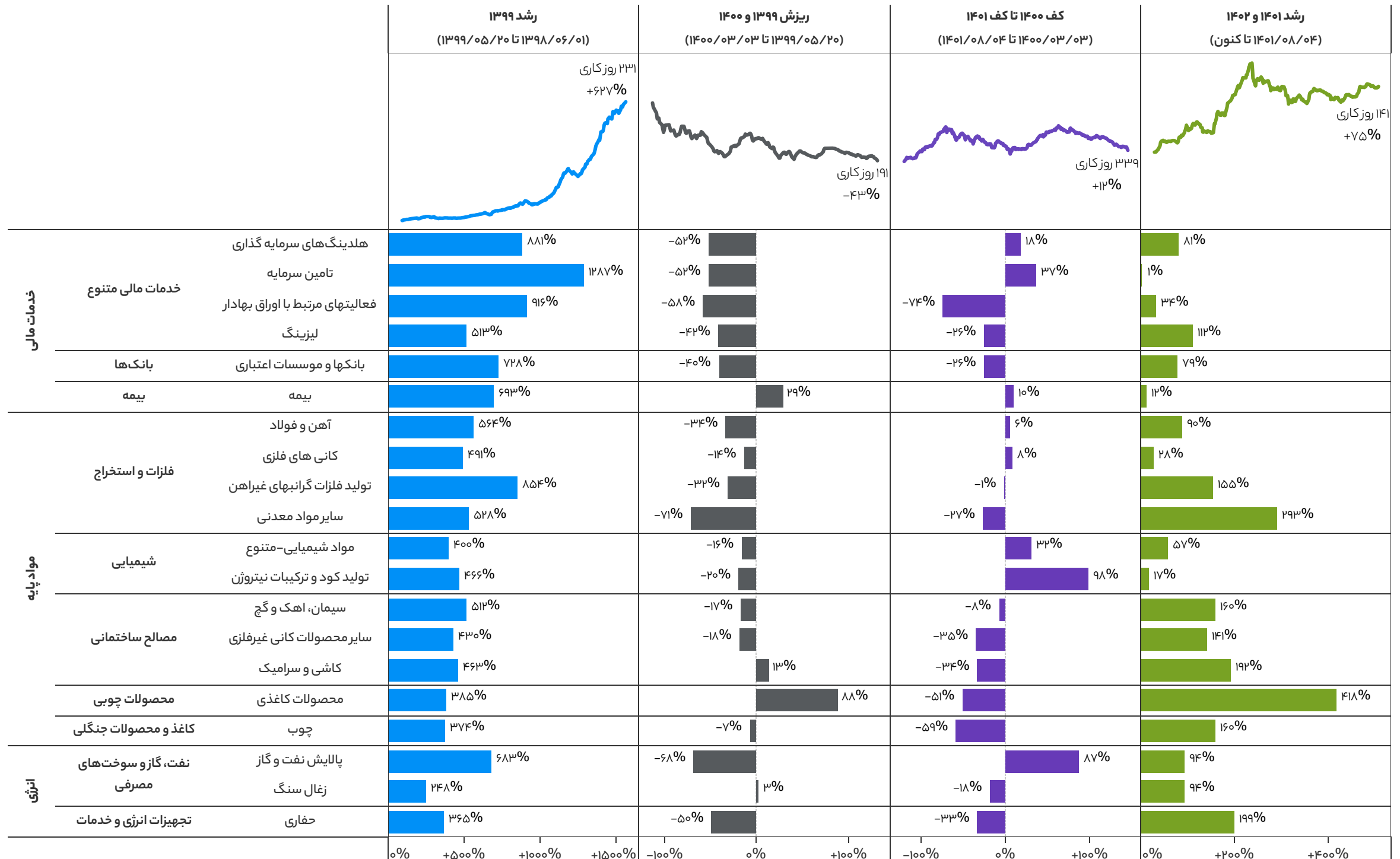
تغییر مالکیت شرکت

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



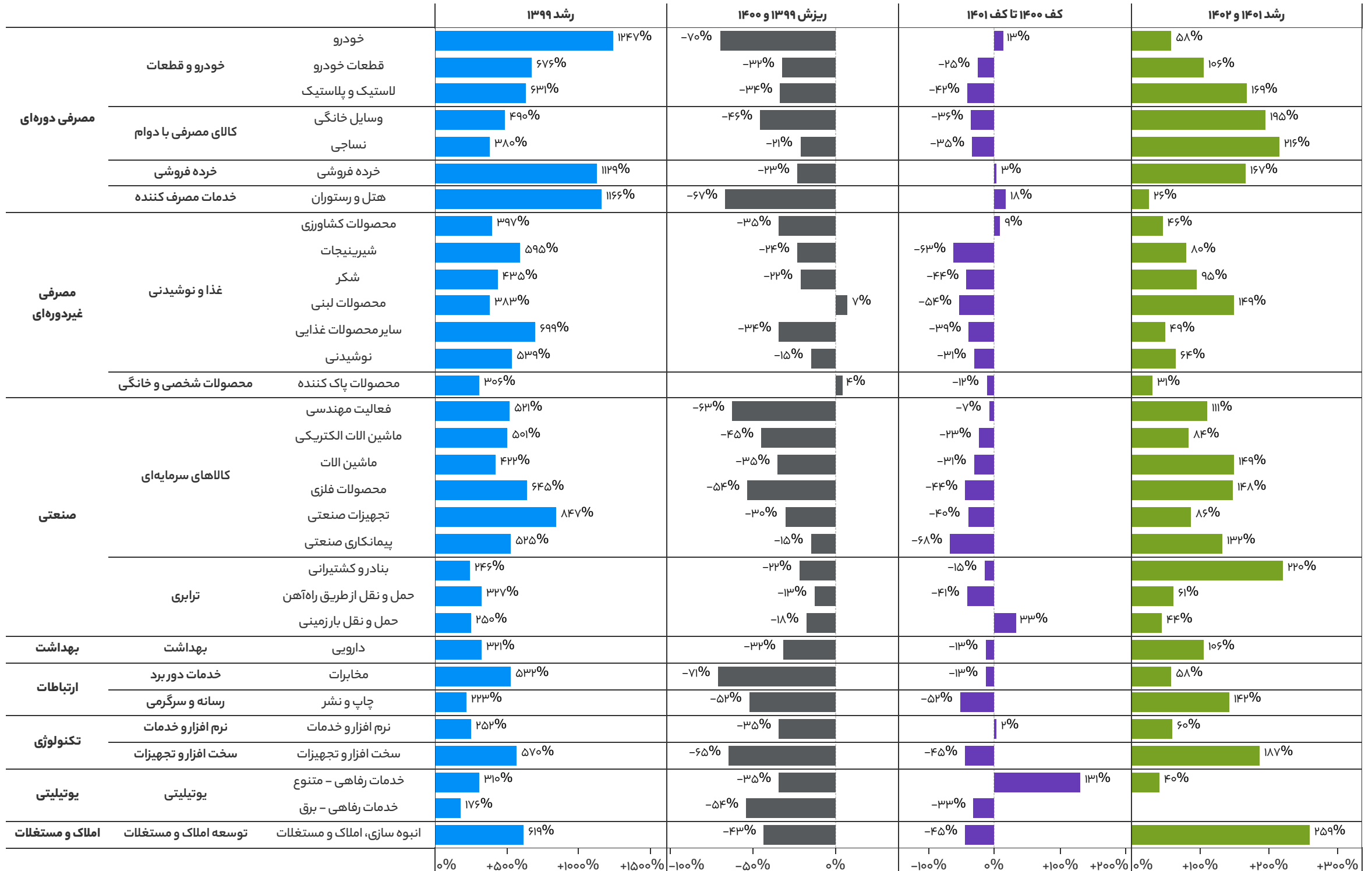
بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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)





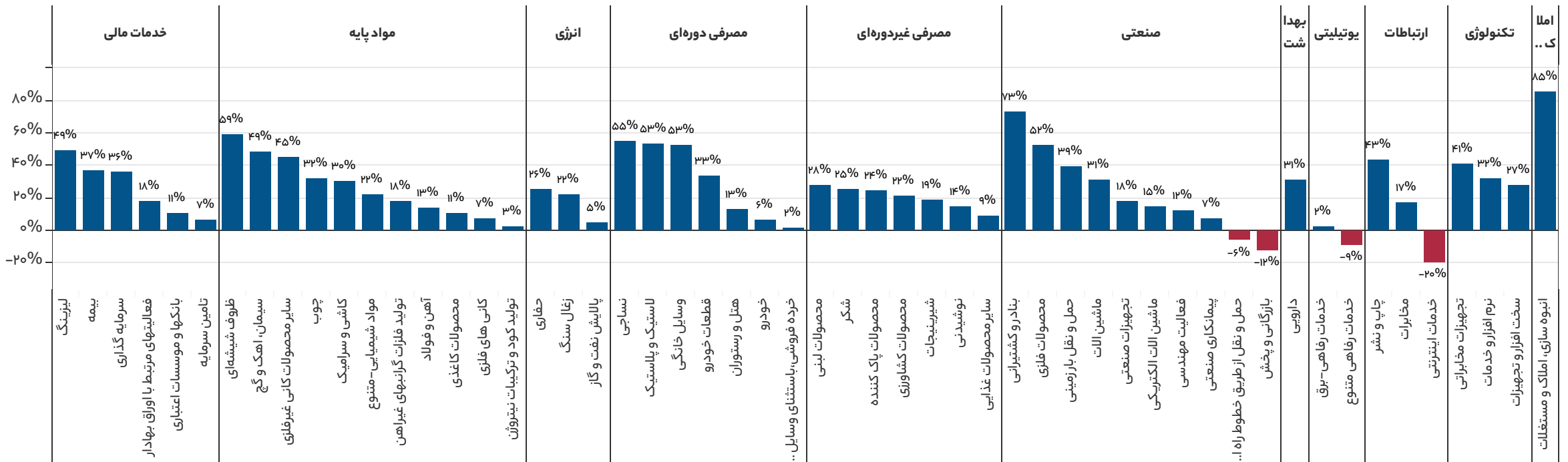
بازده صنایع از ابتدای هفته

(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)

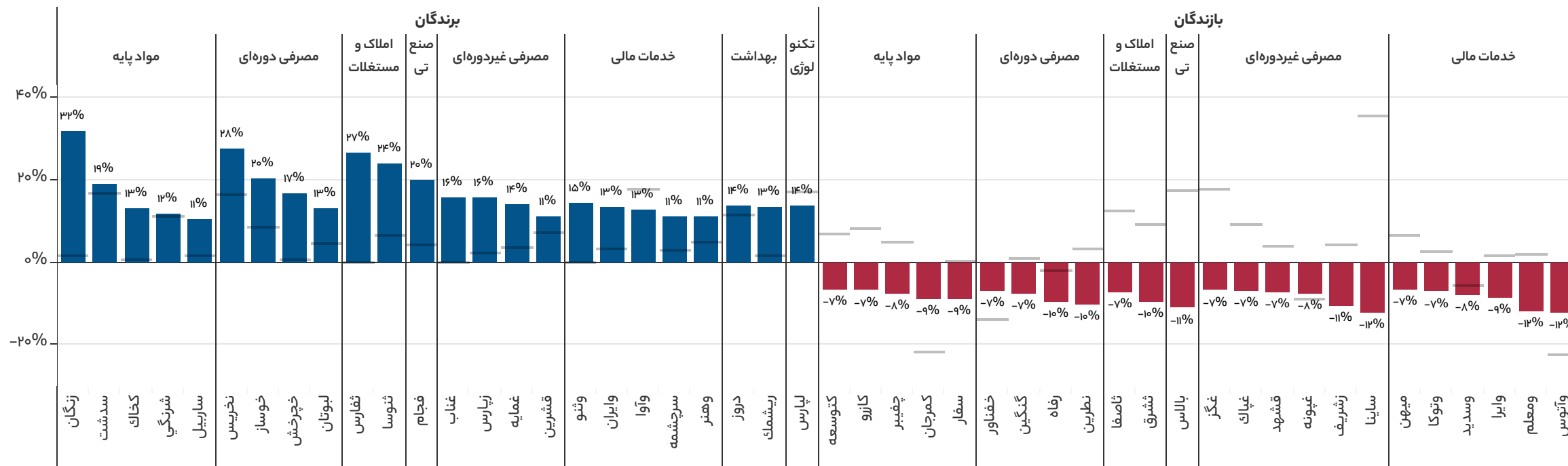


بازده صنایع از ابتدای سال

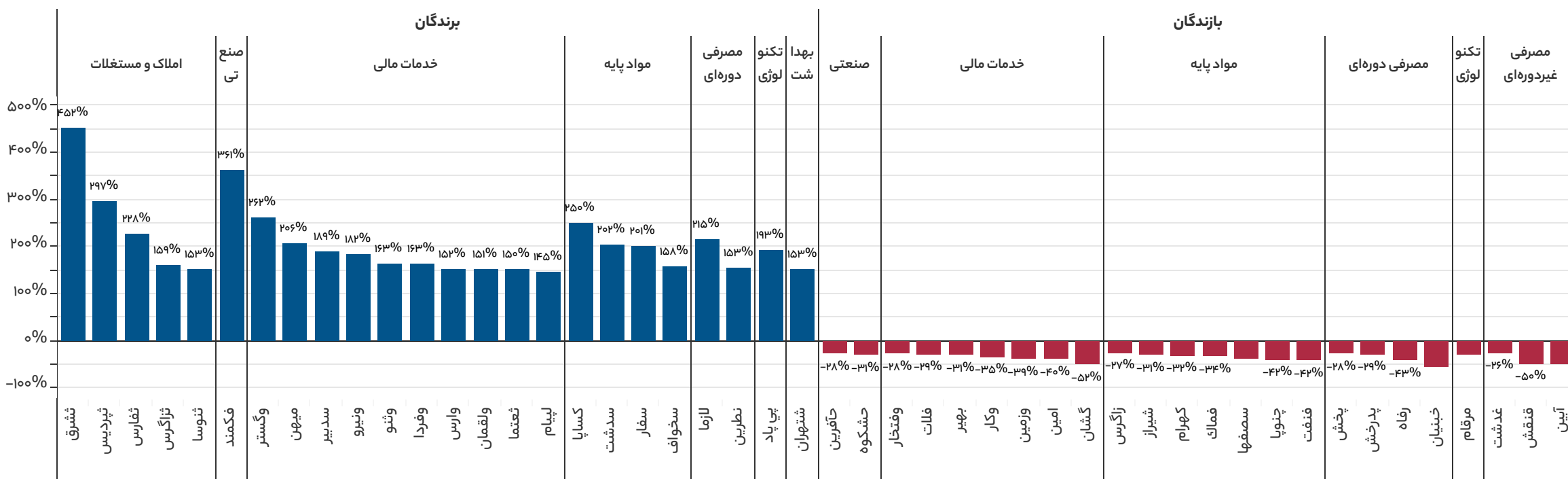
(مرتب شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده)



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

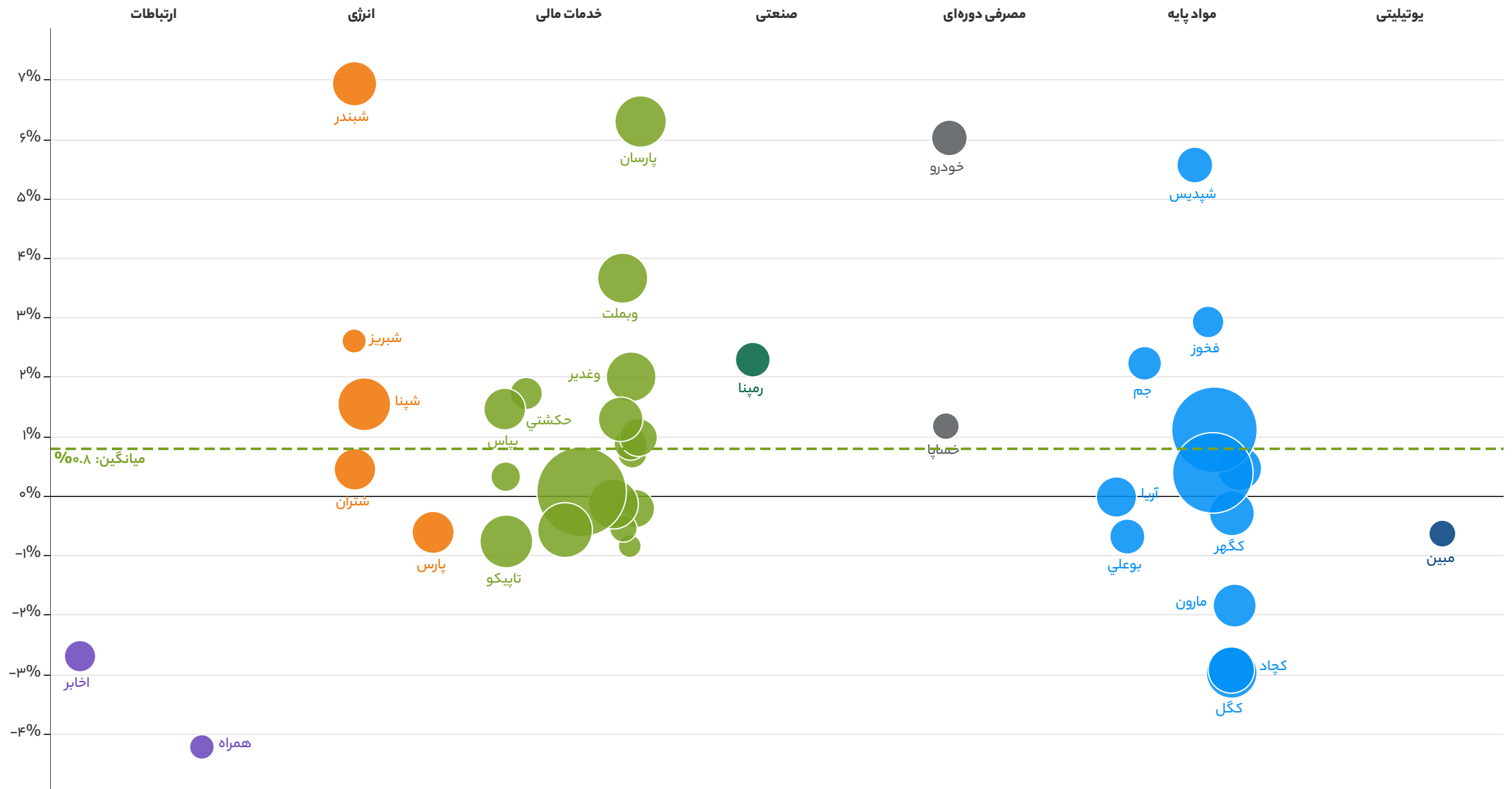


برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده براساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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

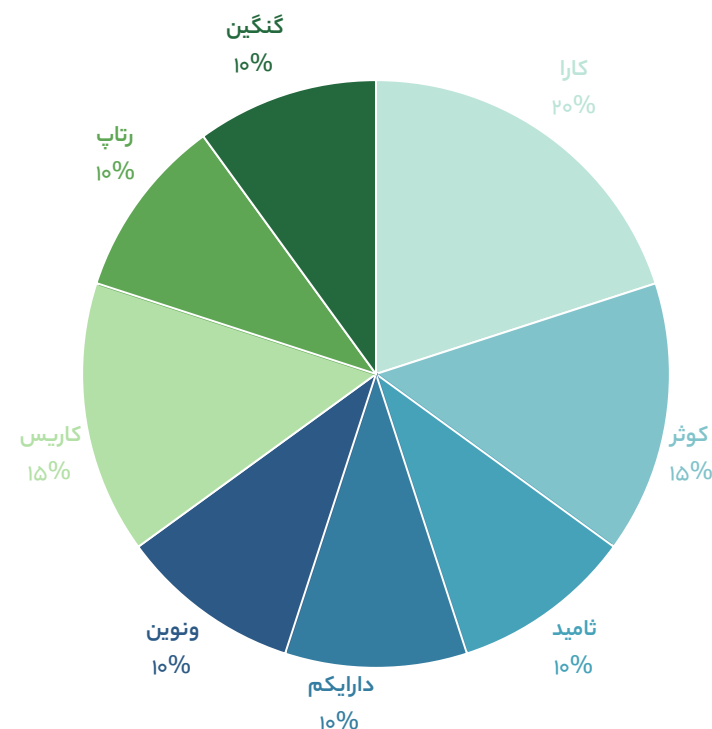


بازده هفته گذشته	شبندر	پارسان	خودرو	شپدیس	وبملت	فخوز	شیریز	رمپنا	جم	وعدیر	حکشتی	شپنا	پایاس	وامید	خسپا	فولاد	وپاسار	وصندوق	وگدیر	نوری	شتران	فملی	تامیکو	فارس	آریا	میدکو	ومعادن	کگل	تجارت	شتستا	پارس	مبین	بوعلی	تاپیکو	وسپهر	ماون	اخابر	کچاد	کگل	همراه
	+۷.۰%	+۶.۳%	+۶.۰%	+۵.۶%	+۳.۷%	+۲.۹%	+۲.۶%	+۲.۳%	+۲.۲%	+۲.۰%	+۱.۷%	+۱.۶%	+۱.۵%	+۱.۳%	+۱.۲%	+۱.۱%	+۱.۰%	+۰.۹%	+۰.۷%	+۰.۵%	+۰.۵%	+۰.۴%	+۰.۳%	+۰.۱%	۰%	-۰.۱%	-۰.۲%	-۰.۳%	-۰.۵%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۶%	-۰.۷%	-۰.۷%	-۰.۸%	-۱.۸%	-۲.۷%	-۲.۹%	-۳.۰%	-۴.۲%



سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما



وزن پیشنهادی	قیمت سهم	توضیحات	هدف قیمتی	نماد	افق زمانی
۱۰%	۳,۵۸۰	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۴,۱۰۰	رتاپ	میان مدت
۱۰%	۴۳,۲۵۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت	۵۶,۰۰۰	گنگین	
۱۵%	۲۳,۳۱۷	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	-	کاریس	
۱۰%	۲,۴۰۶	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت	۳,۲۰۰	تامید	بلند مدت
۱۰%	۱۸۴,۶۰۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۲۳۰,۰۰۰	دارایکم	
۱۰%	۵,۹۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۷,۶۰۰	ونوین	
۱۵%	۳,۵۸۴	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب و دریافت قراردادهای جدید بیمه‌ای	۴,۷۰۰	کوثر	
۲۰%	۱۶,۶۳۷	دارا بودن پورتفو بدون ریسک و سود بالاتر نسبت به سایر صندوق‌های درآمد ثابت	-	کارا	

تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



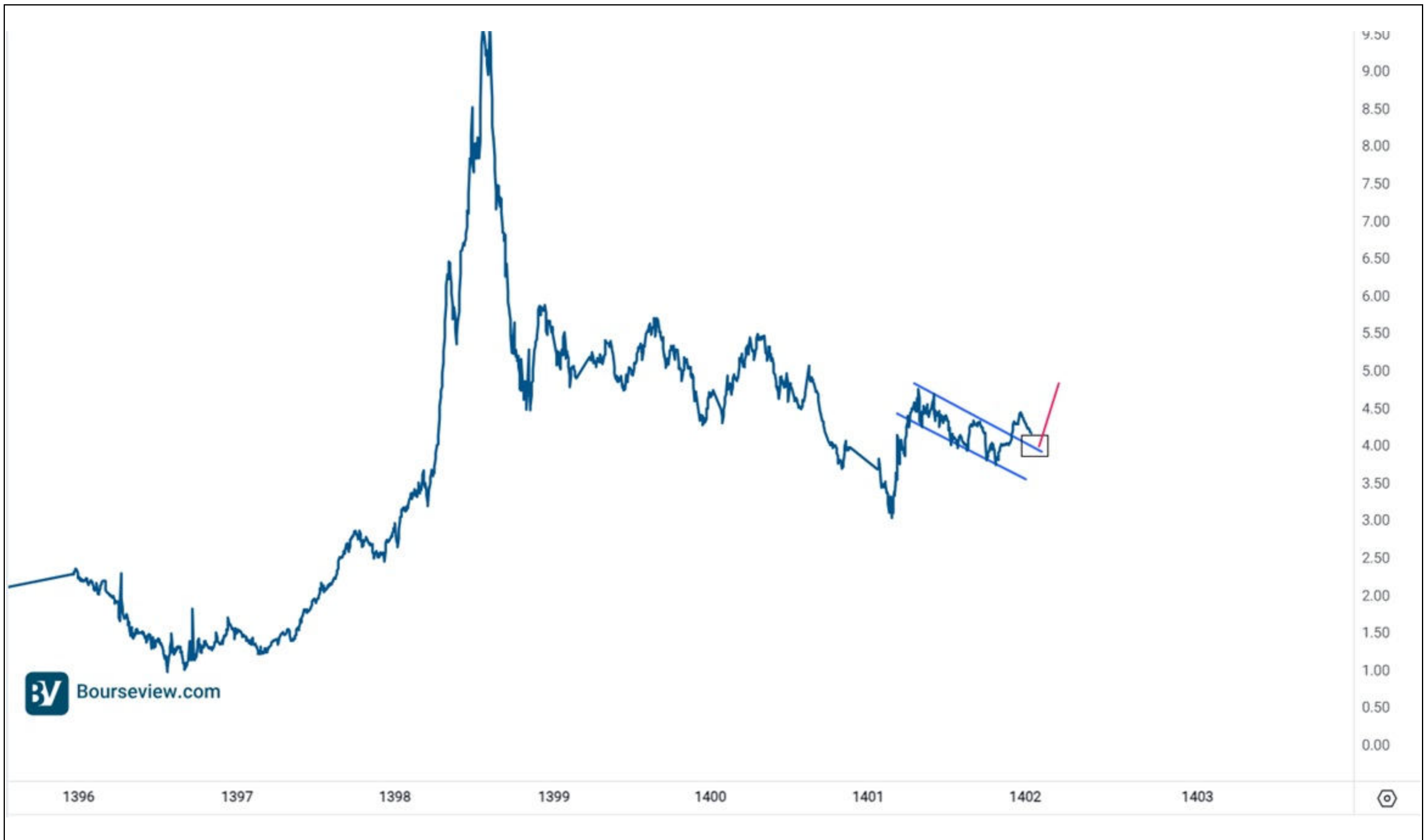
انتظار می‌رود رشد تا محدوده مقاومتی مشخص شده ادامه داشته باشد.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود بعد از اصلاح تا کف کانال، وارد مسیر صعودی شود.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود بعد از اصلاح تا حوالی سقف کانال شکسته شده، مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

توضیحات تحلیل



انتظار می‌رود مسیری مطابق تصویر طی کند.

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)

				وضعیت قیمتی			سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما		رشد سود ۱۴۰۳	نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		نمودار امتیاز Z	گران تر →	ارزان تر ←
گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)	سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	(فصله)	Z			
مواد پایه	الفین	مارون	۱۲	۱۲۴.۷	-۲%	۱۵,۵۹۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۳.۹	۷.۲	۷.۲	-۲.۲			
		آریا	۱۲	۱۱۰.۱	-	۸,۰۱۰	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۷	۶.۱	۶.۶	-۰.۹			
		جم	۱۲	۷۷.۸	+۲%	۴,۳۲۰	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۷	۴.۰	۴.۴	-۴.۱			
		شگویا	۱۲	۴۱.۹	-	۱,۷۴۸	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۶.۳	۴.۹	۶.۳	+۰.۰			
		جم پیلین	۱۲	۳۶.۷	+۲%	۱۸,۳۵۹	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۵	۴.۶	۵.۷	+۰.۶			
		شکبیر	۱۲	۲۶.۵	+۱%	۷,۳۵۰	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۶	۳.۰	۳.۳	-۸.۳			
		شاراک	۱۲	۲۴.۵	+۲%	۳,۰۴۰	۹۶%	۴۱۹	۲۱۴	۲ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۱	۳.۹	۳.۹	-۱.۹			
		شغذیر	۱۲	۸.۹	+۴%	۶,۸۶۰	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۷.۰	۴.۵	۶.۱	+۰.۲			
	آروماتیک	شبصیر	۱۲	۷.۷	+۲%	۳,۰۸۵	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۶	۳.۸	۴.۵	-۰.۴			
		نوری	۱۲	۱۳۵.۰	-	۱۴,۹۹۸	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۶	۷.۰	۸.۰	+۰.۶			
	اوره	بوعلی	۱۲	۸۳.۶	-۱%	۵,۸۲۵	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹.۱	۶.۵	۸.۹	+۴.۱			
		شیراز	۱۲	۳۶.۰	+۲%	۲,۳۵۶	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۵	۵.۲	۶.۰	+۱.۶			
		خراسان	۱۲	۲۴.۵	+۱%	۱۳,۶۶۵	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۸.۷	۶.۶	۷.۵	+۲.۹			
		کرماشا	۱۲	۱۹.۴	+۴%	۱,۸۳۶	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۶.۰	۴.۵	۴.۵	+۰.۷			
	متانول	زاگرس	۱۲	۳۰.۸	+۱%	۱۲,۸۲۵	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۶	۶.۳	۶.۵	-۲.۳			
		شخارک	۱۲	۲۸.۱	+۲%	۴,۶۷۶	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۹	۴.۸	۵.۷	-۱.۴			
		شغن	۱۲	۱۶.۷	-	۵۳۹	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۷.۷	۵.۴	۵.۲	-۱.۸			
	محصولات شیمیایی	شیران	۹	۲۷.۱	-	۴۹۷	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۱	۷.۵	۶.۵	+۰.۱			
	دوده صنعتی	شکربن	۱۲	۴.۲	+۲%	۶۶۳	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۷.۷	۵.۸	۶.۲	+۰.۱			
		شصدف	۱۲	۲.۶	+۲%	۳,۷۶۰	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۹.۶	۵.۹	۷.۳	-۱.۵			
		شدوص	۱۲	۲.۵	-	۲,۶۴۲	۹۳%	۱۹۳	۲۲۳	۲ Q	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۷.۲	۵.۴	۶.۷	+۰.۶			

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			برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران‌تر →	ارزان‌تر ←		
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)	گزارش شده	سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده‌نگر ۴ فصله	آینده‌نگر ۴ (فصله)				
فلزات و استخراج	فولاد	فولاد	۱۲	۵۰۰.۸	+۱%	۶۲۶	۵۰%	۸۵	۶۶	۲ Q	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۵.۰	۴.۱	۴.۴	+۰.۷				
		فخوز	۱۲	۶۹.۸	+۳%	۳۶۷	۴۶%	۳۵	۲۷	۲ Q	۶۵	۱۰۹	+۶۸%	۵.۷	۳.۰	۳.۶	-۳.۳				
		فولاز	۱۲	۳۸.۹	-	۱,۶۲۲	۷۶%	۱۹۹	۹۱	۲ Q	۱۷۴	۲۵۰	+۴۴%	۹.۳	۶.۰	۷.۱	+۱.۶				
		هرمز	۱۲	۳۳.۹	+۲%	۴۰۴	۵۱%	۶۵	۳۲	۲ Q	۶۸	۸۲	+۲۱%	۵.۹	۴.۶	۴.۸	-۰.۸				
		ارفع	۱۲	۳۰.۱	+۱%	۲,۵۱۰	۸۶%	۳۱۲	۳۰۹	۲ Q	۵۵۶	۶۴۸	+۱۷%	۴.۵	۳.۳	۴.۰	-۰.۲				
		فخاس	۱۲	۲۷.۹	+۱%	۱,۲۱۳	۴۹%	۱۰۰	۱۳۲	۲ Q	۲۴۲	۲۹۱	+۲۱%	۵.۰	۴.۰	۴.۳	-۳.۰				
	سنگ آهن	کگل	۱۲	۱۷۳.۳	-۳%	۵۲۵	۶۵%	۴۹	۱۲	۲ Q	۵۸	۹۴	+۶۱%	۹.۰	۵.۳	۵.۲	-۳.۵				
		کچاد	۱۲	۱۴۵.۰	-۳%	۵۳۴	۷۱%	۸۴	۳۹	۲ Q	۸۳	۹۹	+۱۹%	۶.۴	۴.۹	۵.۲	-۰.۸				
		کگهر	۹	۱۳۶.۹	-	۱,۸۲۵	۹۲%	۱۵۶	۱۴۸	۳ Q	۱۹۴	۱۶۳	-۱۶%	۹.۴	۱۲.۵	۱۰.۰	+۰.۹				
		کنور	۱۲	۲۴.۶	-	۱,۹۲۵	۹۴%	۱۴۷	۱۴۴	۲ Q	۲۲۴	۲۸۴	+۲۷%	۸.۶	۶.۰	۷.۹	-۰.۱				
	مس	فملی	۱۲	۴۴۵.۸	-	۷۴۳	۴۵%	۸۳	۵۴	۲ Q	۱۳۴	۱۴۹	+۱۲%	۵.۶	۴.۶	۴.۴	-۰.۶				
		محصولات فلزی	کوبیر	۱۲	۱۱.۹	-۲%	۲۲۸	۱۲%	۳۳	۱۵	۲ Q	۳۲	۴۲	+۳۲%	۷.۱	۵.۴	۵.۴	-۰.۹			
	فجر		۱۲	۶.۶	-۲%	۷۸۶	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۳.۹	۳.۵	۴.۰	+۰.۰				
	فروژ		۱۲	۴.۸	-	۴,۴۰۰	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۶.۸	۴.۸	۵.۲					
	فسپا		۱۲	۳.۲	+۱%	۸۲۷	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۳۶	-۱۶%	۵.۵	۶.۰	۵.۲	+۰.۴				
	فروسیل		۱۲	۲.۸	+۸%	۱,۷۸۰	۶۴%	۱۱۵	۵۷	۲ Q	۱۶۷	۲۳۶	+۴۲%	۱۰.۷	۷.۲	۷.۲	-۷.۱				
فروس	۱۲		۲.۸	+۳%	۳۴۹	۶۶%	۴۸	۲۴	۲ Q	۴۹	۶۶	+۳۵%	۷.۱	۴.۹	۵.۵	+۰.۳					
آلومینیوم	فولای	۱۲	۰.۹	+۷%	۷۹۵	۲۱%	۵۹	۴۵	۲ Q	۶۹	۷۶	+۱۰%	۱۱.۵	۱۰.۵	۱۱.۷	+۱.۴					
	فایرا	۱۲	۲۸.۹	+۱%	۷۶۰	۳۹%	۷۳	۵۶	۲ Q	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۸.۹	۶.۰	۷.۶	+۱.۸					
سرب و روی	طلا	۹	۱۴.۴	+۵%	۴,۸۰۰	۳۱۸%	۹۹۶	۶۷	۳ Q	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۶.۶	۶.۹	۳.۵	-۱.۳					
	فنوال	۱۲	۴.۱	+۲%	۷۹۷	۵۱%	۷۰	۴۱	۲ Q	۶۸	۹۴	+۳۸%	۱۱.۷	۸.۳	۹.۹	+۳.۴					
	کیمیا	۱۲	۱.۹	-	۶۴۴	۴۰%	۱۲۷	۱۲	۲ Q	۹۵	۱۲۱	+۲۸%	۶.۸	۵.۱	۴.۱	-۰.۳					
	فزرین	۱۲	۱.۵	+۱%	۴۸۴	۳۶%	۹۳	۲	۲ Q	۱۱۲	۱۷۰	+۵۱%	۴.۳	۲.۶	۲.۳	-۴.۶					
سایر کانی‌های فلزی	فتوسا	۱۲	۱.۱	-۱%	۷۹۸	۳۲%	۱۴۹	۳۵	۲ Q	۱۹۵	۲۱۴	+۹%	۴.۱	۳.۴	۲.۷	-۱.۷					
	کمنگنز	۱۲	۲.۴	+۵%	۱,۶۰۰	۶۴%	۱۱۴	۷۴	۲ Q	۱۸۴	۲۱۸	+۱۹%	۸.۷	۷.۰	۶.۷	-۰.۹					
	کتوسعه	۹	۲.۲	-۷%	۲,۰۸۰	۹۷%	۱۱۱	۱۱۴	۳ Q	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۲.۰	۱۱.۱	۸.۷						



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	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله				
مواد پایه مصالح ساختمانی	سیمان، آهک و گچ	ساوه	۱۲	۹.۵	-۳%	۱۴,۵۶۰	۹۵%	۱,۵۸۴	۱,۲۸۲	۲ Q	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۱	۴.۳	۵.۱	+۰.۸				
		سآبیک	۱۲	۸.۰	-	۲,۷۱۱	۹۳%	۲۴۹	۲۴۶	۲ Q	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۶.۹	۴.۸	۶.۲	+۲.۲				
		سفار	۱۲	۷.۱	-۹%	۳۰,۳۹۲	۹۵%	۱,۰۳۹	۸۴۰	۲ Q	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۱.۷	۱۵.۷	۱۸.۴	+۱.۳				
		سخوز	۱۲	۶.۸	+۲%	۴,۸۲۷	۹۰%	۷۱۹	۲۸۴	۲ Q	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۸	۳.۳	۳.۳	-۰.۸				
		سمازن	۹	۶.۸	+۳%	۲,۷۴۰	۸۱%	۲۹۰	۲۹۸	۳ Q	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۶.۹	۵.۸	۵.۳	+۱.۹				
		ساروم	۱۲	۵.۰	+۷%	۵,۰۰۳	۹۶%	۵۵۴	۴۵۱	۲ Q	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۶.۳	۴.۱	۵.۲	+۰.۱				
		سهگمت	۱۰	۴.۷	+۱%	۶,۳۹۶	۹۸%	۶۴۸	۷۷۸	۳ Q	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۶.۳	۴.۲	۴.۰	+۰.۲				
		سفانو	۱۲	۴.۱	+۲%	۸,۱۹۰	۹۷%	۱,۱۷۰	۶۹۵	۲ Q	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۹	۳.۲	۳.۶	+۰.۴				
		سرود	۱۲	۳.۸	+۳%	۴,۷۵۳	۹۶%	۴۹۶	۴۷۲	۲ Q	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۵	۴.۰	۴.۸	+۰.۴				
		سصوفی	۱۲	۳.۷	+۵%	۳,۳۸۵	۹۰%	۳۶۸	۳۳۷	۲ Q	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۶.۲	۴.۲	۵.۵	+۰.۸				
		سشمال	۹	۲.۹	-۱%	۱,۷۳۵	۸۹%	۱۷۰	۲۱۸	۳ Q	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۶.۴	۵.۰	۴.۸	+۰.۶				
		سبجنو	۱۲	۲.۶	-۱%	۶,۵۹۹	۹۶%	۵۷۳	۵۲۷	۲ Q	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۳	۵.۱	۵.۶	-۰.۵				
		سقاین	۱۲	۲.۴	+۷%	۵۹۵	۹۷%	۳۷	۲۴	۲ Q	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۲.۲	۹.۹	۱۰.۲	+۰.۶				
		سبهان	۱۲	۲.۳	+۵%	۱۱,۴۱۵	۹۷%	۷۳۶	۷۴۹	۲ Q	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۴	۴.۹	۵.۱	-۰.۳				
		سغرب	۱۲	۲.۱	-	۴,۲۳۶	۹۲%	۳۹۰	۴۱۰	۲ Q	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۴.۹	۳.۲	۳.۹	-۰.۷				
کاشی و سرامیک	فرآورده‌های نسوز	سقاش	۱۲	۲.۰	-	۹,۸۸۰	۹۵%	۱,۱۶۱	۵۷۴	۲ Q	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۹	۴.۴	۴.۹	-۰.۷				
		سخرز	۱۲	۱.۸	-	۳,۵۹۴	۹۵%	۳۵۸	۲۶۸	۲ Q	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۵	۵.۱	۶.۲	-۰.۱				
		کحافظ	۱۲	۳.۶	-۳%	۷۰۹	۱۰%	۸۲	۶۱	۲ Q	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۳	۳.۲	۳.۵	-۲.۸				
		کساوه	۱۲	۳.۳	-	۶,۲۰۵	۷۱%	۷۴۷	۲۹۰	۲ Q	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۶.۱	۴.۰	۴.۰	-۲.۰				
فرآورده‌های نسوز	کپشیر	کلوند	۱۲	۱.۸	-	۴,۵۱۳	۹۵%	۵۰۴	۳۸۱	۲ Q	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۶.۰	۴.۴	۵.۰	-۰.۲				
		کپشیر	۱۲	۲.۶	+۵%	۱,۰۲۴	۸۸%	۵۲	۶۰	۲ Q	۱۱۴	۱۰۰	-۱۲%	۹.۰	۹.۴	۹.۰	+۰.۷				



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

گروه صنعتی		فعالیت	نماد	وضعیت قیمتی				سود واقعی		برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		ارزان‌تر ←	نمودار امتیاز Z	گران‌تر →		
				سال مالی	ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)	تقسیم سود	۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)	گزارش شده	سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده‌نگر ۴ فصله				آینده‌نگر ۴ فصله	
انرژی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۹۲.۰	+۲%	۸۴۶	۶۳%	۱۷۰	۱۰۱	۲ Q	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴.۸	۴.۶	۴.۹	+۱.۵					
		شبندر	۱۲	۱۳۸.۵	+۷%	۱,۰۳۱	۷۶%	۳۰۴	۷۷	۲ Q	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۴.۲	۵.۷	۳.۸	+۱.۵					
		شتران	۱۲	۱۱۸.۵	-	۴۳۱	۳۱%	۱۰۹	۴۵	۲ Q	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۳	۴.۰	۳.۸	+۰.۹					
		شبریز	۱۲	۳۹.۹	+۳%	۱,۳۳۰	۷۶%	۳۳۵	۹۳	۲ Q	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۵.۵	۵.۰	۴.۵	-۰.۱					
		شاوان	۱۲	۱۶.۹	-	۲,۱۱۰	۷۳%	۵۵۵	۱۸۳	۲ Q	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۱	۸.۴	۴.۴	+۰.۶					
	نفت، گاز و سوخت‌های مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۱۹.۳	-۱%	۲۵۱	۸۸%	۳۱	۱۰	۲ Q	۳۵	۴۶	+۳۰%	۷.۱	۴.۹	۴.۷	-۳.۰				
		روانکار	شبه‌رن	۱۲	۲۷.۸	+۳%	۲,۳۲۶	۸۹%	۳۳۸	۱۷۷	۲ Q	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۲	۵.۷	۵.۶	+۱.۵				
			شسپا	۱۲	۲۷.۵	-	۴۹۲	۶۷%	۷۴	۴۵	۲ Q	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۲	۳.۹	۴.۴	-۰.۱				
			شنفت	۱۲	۱۷.۰	-۲%	۸۴۹	۸۲%	۱۰۸	۶۶	۲ Q	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۸.۰	۷.۶	۸.۴	+۰.۴				
			شرانل	۱۲	۱۵.۵	-۱%	۷,۷۴۵	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	+۱۰%	۱,۴۳۵	۵۹%	۱۶۹	۸۳	۲ Q	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۷.۰	۵.۰	۵.۱	-۰.۶				
			کطبس	۱۲	۱.۶	-	۲,۰۱۱	۶۲%	۱۹۳	۱۲۲	۲ Q	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۶.۷	۵.۶	۵.۳	-۱.۹				
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۳	-۱%	۵۱۸	۹۴%	۴۷	۲۷	۳ Q	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۱.۶	۸.۴	۶.۸	-۴.۸				
			تنوین	۱۲	۸.۴	+۲%	۲۱۹	۶۳%	۴۸	۱۷	۲ Q	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴.۴	۳.۱	۳.۲	-۳.۱				
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۶	+۱%	۸,۰۰۰	۹۱%	۸۸۸	۵۰۵	۲ Q	۱,۳۰۸	۱,۹۱۸	+۴۷%	۶.۱	۳.۶	۴.۲	-۰.۷				
	کاغذ و محصولات جنگلی	محصولات چوبی	چخزر	۱۲	۱.۳	-۱%	۶,۶۸۵	۹۶%	۳۲۲	۱۷۶	۲ Q	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۶.۵	۸.۹	۱۰.۳	+۰.۰				

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 →	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	۱۲.۲	-	۵,۰۷۰	۷۶%	۴۹۵	۳۳۹	۲ Q	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۶.۰	۴.۲	۴.۴	-۰.۲				
		دلر	۱۲	۸.۰	+۱%	۳,۵۷۰	۹۶%	۳۵۲	۲۶۴	۲ Q	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۷.۲	۶.۵	۶.۹	+۱.۲				
		دپارس	۱۲	۶.۷	-	۷,۰۲۳	۹۸%	۸۰۳	۲۶۴	۲ Q	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۷.۴	۶.۲	۵.۴	+۰.۳				
		دالبر	۱۲	۶.۵	+۵%	۶۸۳	۶۹%	۷۵	۵۰	۲ Q	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۶.۱	۴.۷	۴.۸	-۰.۹				
		دفرا	۱۲	۶.۰	+۹%	۴,۲۶۱	۷۹%	۳۹۳	۲۰۱	۲ Q	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۸.۵	۷.۰	۶.۷	+۲.۱				
		دفارا	۱۲	۵.۷	-	۳,۵۳۹	۹۹%	۴۵۲	۱۵۲	۲ Q	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۶.۳	۵.۳	۴.۶	+۰.۲				
		هجرت	۱۲	۴.۸	-۲%	۲,۹۸۵	۹۵%	۴۰۶	۲۳۶	۲ Q	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۵	۴.۲	۴.۵	-۰.۴				
		دقاضی	۱۲	۴.۴	+۲%	۲,۵۶۵	۹۶%	۲۷۷	۱۷۷	۲ Q	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۸	۵.۱	۵.۵	-۰.۱				
		دتوزیع	۱۲	۴.۱	+۳%	۲,۲۹۵	۹۴%	۴۴۹	۱۰۳	۲ Q	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۶.۹	۵.۰	۴.۹	-۰.۴				
		کاسپین	۱۲	۲.۹	-۲%	۲,۰۷۵	۹۵%	۲۳۴	۱۵۴	۲ Q	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۶.۵	۵.۰	۵.۵	+۰.۱				
		درازک	۱۲	۲.۷	-۱%	۱,۲۸۹	۱۰۴%	۲۱۳	۲۷	۲ Q	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۷	۳.۹	۳.۵	-۶.۶				
		دکپسول	۱۲	۲.۶	+۴%	۸,۸۱۰	۹۲%	۹۲۱	۶۰۳	۲ Q	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۸.۳	۶.۳	۷.۳	+۲.۱				
		دراز۱	۱۲	۲.۱	+۳%	۲,۱۰۰	۶۷%	۲۷۳	۱۱۰	۲ Q	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۶.۱	۵.۲	۴.۵	-۱.۳				

صفحه منتهی به: ۱۴۰۲/۱۰/۲۲



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	۳.۷	۳.۹	-۴.۱				
		سیمرغ	۹	۴.۶	-۶%	۳,۵۱۴	۲۴%	۳۹۱	۳۳۷	۳ Q	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۶.۵	۴.۵	۳.۷	-۱.۸				
		زفکا	۱۲	۲.۷	-۱%	۱,۷۹۷	۹۱%	۱۵۵	۱۰۵	۲ Q	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۹.۹	۶.۳	۷.۹	+۰.۵				
		تلیسه	۱۲	۲.۱	-۱%	۴۲۶	۹۲%	۲۵	۲۹	۲ Q	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۲.۵	۸.۴	۱۳.۴	+۰.۱				
		زگلدشت	۱۲	۱.۸	-	۲,۵۱۰	۹۵%	۹۶	۱۱۰	۲ Q	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۱.۵	۸.۳	۹.۱	+۰.۰				
		زملارد	۱۲	۱.۶	-۳%	۱,۹۹۰	۹۴%	۳۳	۶۳	۲ Q	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۳.۶	۱۰.۶	۱۰.۶	-۲.۹				
		زشریف	۹	۱.۶	-۱۱%	۶۵۱	۷۶%	۴۸	۵۸	۳ Q	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۸.۲	۶.۵	۵.۷	-۰.۷				
		زشگزا	۱۲	۱.۰	-	۱,۰۲۰	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۹.۴	۵.۲	۸.۲	+۰.۲				
	شیرینیجات	غصینو	۱۲	۱۴.۱	-۱%	۱,۴۱۲	۶۰%	۱۶۱	۷۴	۲ Q	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۶.۲	۴.۱	۴.۲	-۲.۲				
		غپینو	۱۲	۳.۵	-۳%	۳۹۲	۵۶%	۴۹	۲۵	۲ Q	۶۷	۹۴	+۳۹%	۵.۸	۳.۹	۴.۰	-۱.۲				
		غسالم	۱۲	۲.۱	+۲%	۴۶۵	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۶۵	۸۱	+۲۵%	۷.۲	۵.۶	۴.۸	-۰.۹				
		غمینو	۱۲	۱.۶	+۳%	۱,۰۴۳	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۶.۳	۴.۰	۴.۳	-۰.۲				
	محصولات لبنی	روغن خوراکی	۱۲	۱۵.۴	+۲%	۷۷۰	۵۴%	۱۲۶	۴۰	۲ Q	۸۳	۸۶	+۳%	۹.۳	۸.۶	۸.۱	+۰.۴				
		غگلپا	۱۲	۱.۵	+۱%	۴,۱۹۰	۷۴%	۴۶۵	۲۲۳	۲ Q	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۷.۱	۴.۷	۴.۹	-۰.۶				
		غشان	۱۲	۱.۲	-۲%	۷۱۶	۷۱%	۸۰	۲۶	۲ Q	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۸.۷	۶.۱	۵.۸	-۰.۴				
		غگلستا	۱۲	۱.۲	-۳%	۱,۸۶۲	۷۰%	۱۵۶	۴۹	۲ Q	۲۰۷			۹.۰							
محصولات شخصی و خانگی	محصولات پاک کننده	کیمیاتک	۱۲	۷.۰	+۱%	۱,۱۶۶	۶۴%	۱۰۲	۷۱	۲ Q	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۸.۱	۶.۶	۶.۸	+۰.۴				
		قرن	۱۲	۶.۶	-	۱,۰۹۳	۶۱%	۱۱۰	۶۲	۲ Q	۱۴۳	۲۰۰	+۴۰%	۷.۷	۵.۲	۵.۵	-۰.۷				
		شپاکسا	۹	۲.۷	+۸%	۲۹۵	۳۸%	-۲۴	۲۳	۳ Q	۴۶	۶۱	+۳۲%	۶.۴	۵.۸	۴.۰	-۳.۲				

۳ +۲ +۱ ۰ -۱ -۲ -۳

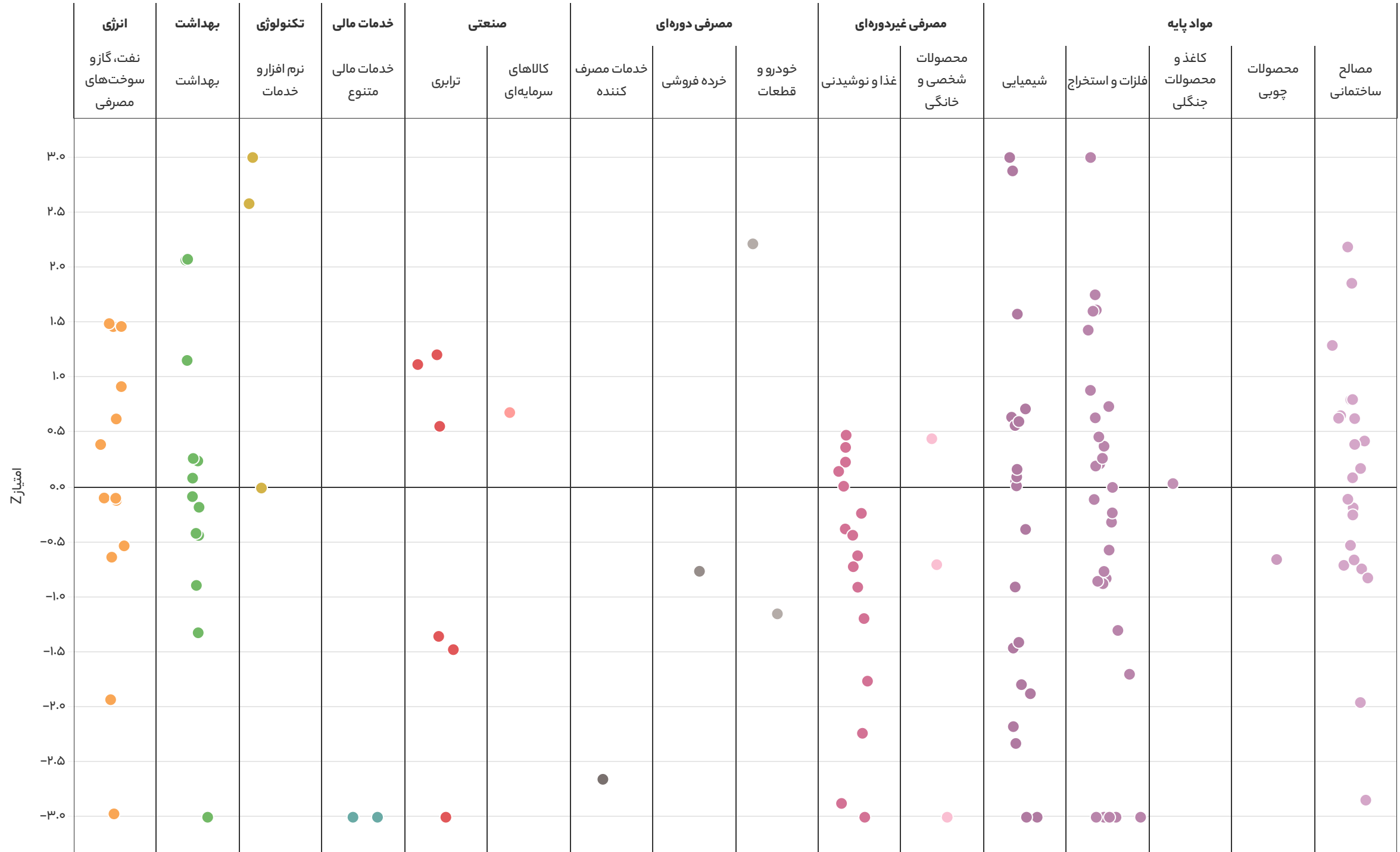
نسبت قیمت به سود (P/E) (بخش ۱: سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳)

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	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				
صنعتی	بنادر و کشتیرانی	حزرج	۱۲	۶۰.۸	-	۱,۸۸۹	۹۶%	۲۰۷	۱۹۸	۲ Q	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۶.۵	۴.۰	۵.۸	+۰.۶				
		حتاید	۱۲	۶۰.۶	+۳%	۵۴۷	۵۲%	۶۲	۴۳	۲ Q	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۵.۱	۳.۷	۳.۷	-۱.۵				
	ترابری	توریل	۱۲	۴۰.۲	+۵%	۶۰۰	۳۸%	۴۳	۱۸	۲ Q	۶۷	۸۶	+۲۹%	۹.۰	۶.۹	۶.۰	-۱.۴				
		حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	حآفرین	۱۲	۲۰.۰	+۵%	۲۶۵	۵۲%	۳۱	۱۳	۲ Q	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۴	۵.۵	۴.۶	-۵.۷			
		چپارسا	۶	۱.۶	+۱%	۶,۵۸۰	۸۹%	۶۳۱	۵۱۲	۳ Q	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۹.۲	۷.۶	۶.۵	+۱.۲				
کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳۰.۵	-۲%	۲۵۰	۳۱%	۲۶	۱۵	۲ Q	۲۰	۳۰	+۴۶%	۱۲.۳	۸.۴	۱۱.۴	+۰.۷				
	سیم و کابل	بکابل	۱۲	۲۰.۸	-۱%	۲,۷۶۰	۶۱%	۲۵۰	۱۲۷	۲ Q	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۲	۴.۷	۴.۳					
مصرفی دوره‌ای	خودرو و قطعات	تایرو تیوپ	۹	۵۰.۰	+۲%	۷۷۱	۷۵%	۲۵	۶۳	۳ Q	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۸.۹	۴.۶	۴.۶	-۱.۲				
		پلوله	۱۲	۰.۸	-۱%	۳,۶۸۰	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۷.۱	۱۶.۷	۲۰.۱	+۲.۲				
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۳۰.۸	-۶%	۷۵۳	۴۹%	۱۰۳	۴۷	۲ Q	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۶	۴.۰	۴.۰	-۰.۸			
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	رافزا	۱۲	۱.۶	-	۱,۶۲۶	۸۰%	۹۱	۹۹	۲ Q	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۱۱.۶	۹.۲	۱۱.۷	+۰.۰				

۳+ ۲+ ۱+ ۰ -۱ -۲ -۳

مقایسه ارزشیابی شرکت‌ها

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



ارتباط با ما

۰۲۱-۴۱۴۲۶

فکس:

۰۲۱-۴۱۴۲۶

شماره تماس:

www.charisma.ir

تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما:

info@ciaco.ir

پست الکترونیکی:

www.ciaco.ir

تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما:

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

شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک:

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

