

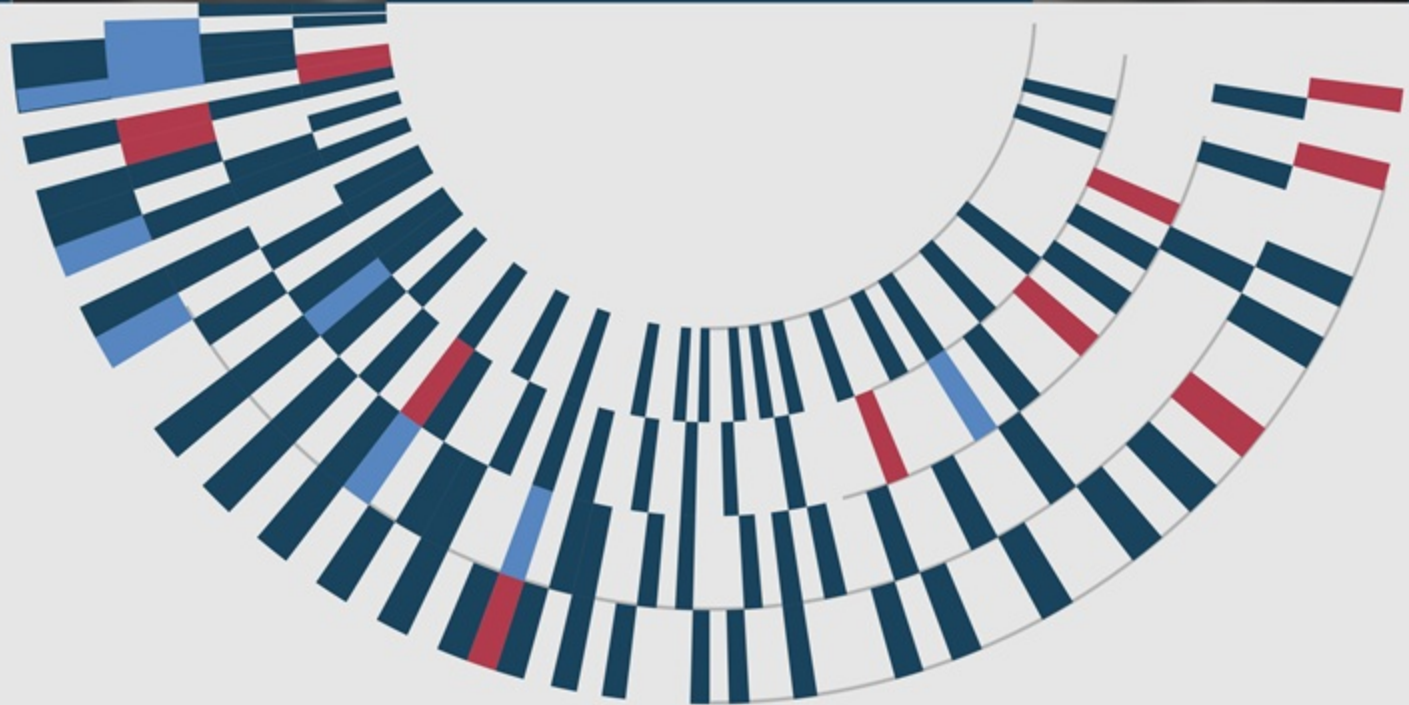


# کاریزماتیک

CHARISMATICK

## گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۲ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۱۵





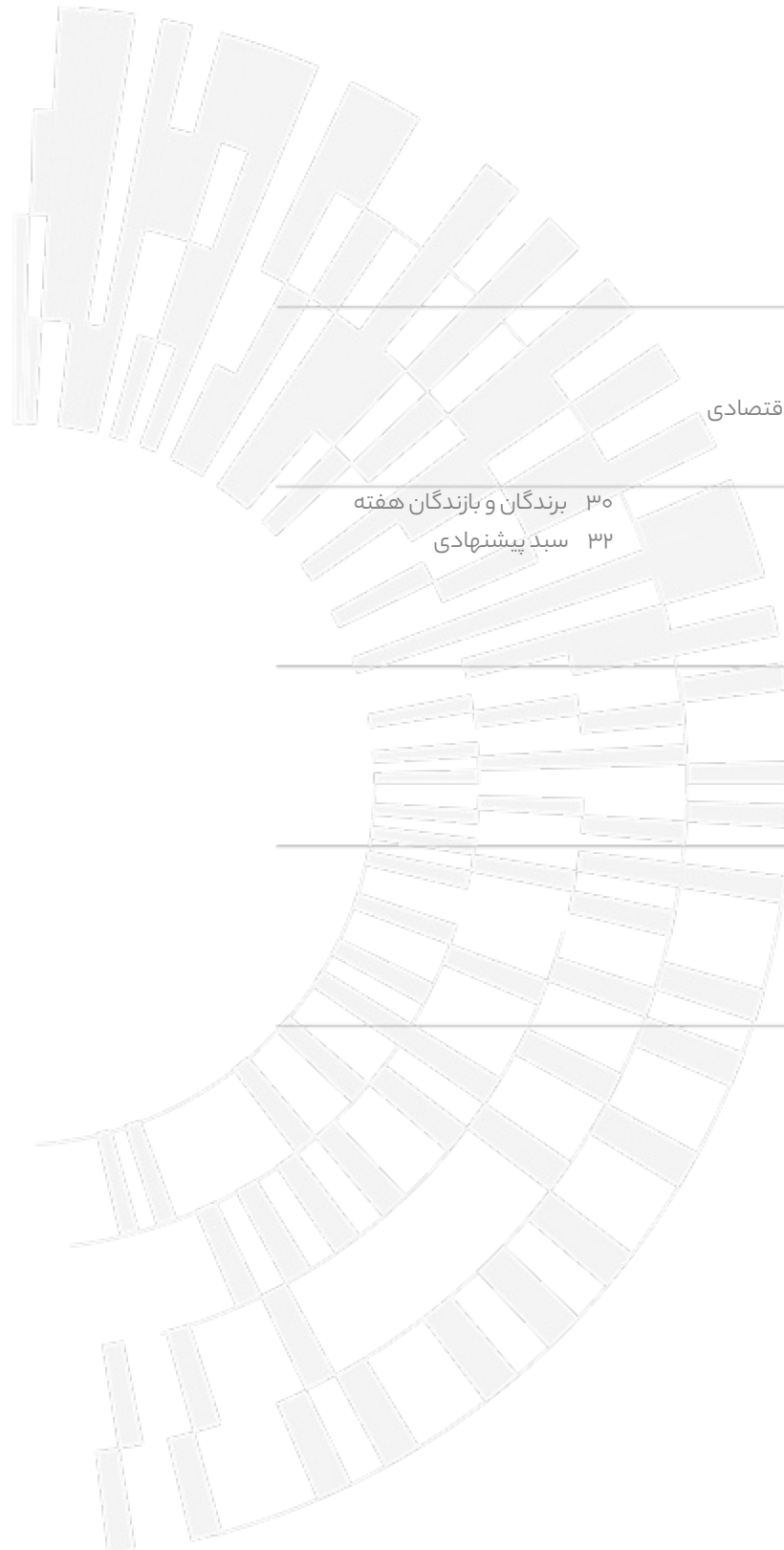
## معرفی گزارش:

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 هیچ‌گونه 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.

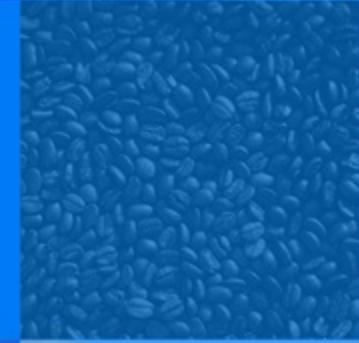


<p>۰۳</p>	<p>کامودیتی</p>	<p>۰۴ فلزات و معادن ۰۵ پتروشیمی ۰۶ انرژی و سایر محصولات ۰۷ گاز طبیعی</p>	<p>۰۹ سیمان ۱۰ اخبار و معیارهای تاثیرگذار ۱۲ وارونگی منحنی بازده و رکود اقتصادی</p>
<p>۱۲</p>	<p>بازار سهام</p>	<p>۱۴ مروری بر بازارهای موازی ۱۶ بررسی بلندمدت بازار سهام ۱۸ نرخ بهره و رونق بازار سهام ۱۹ ارزش معاملات</p>	<p>۳۰ برندگان و بازندگان هفته ۳۲ سبد پیشنهادی</p>
<p>۳۱</p>	<p>تحلیل تکنیکال</p>	<p>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</p>	<p>۳۷ دلار آمریکا (بازار آزاد) ۳۸ سکه امامی ۳۹ طلای جهانی ۴۰ نفت برنت</p>
<p>۴۱</p>	<p>اجماع تحلیل گران</p>	<p>۴۴ نسبت قیمت به سود (سال مالی ۱۴۰۲ و ۱۴۰۳) ۵۱ ارزشیابی سکتورها بر اساس نسبت قیمت به سود</p>	

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	۲,۰۴۴	-۱.۱%	فزر	-	۱,۸۱۳ - ۲,۰۶۹	۶%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۴۲۱	-۱.۷%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۹,۳۴۱	-۹%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۲۴۵	-۵.۴%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ - ۲,۴۲۴	۲%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۵۵۰	-۴.۵%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزیرین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۳۰۳ - ۳,۴۴۴	-۲۳%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۷۸	۰.۳%	فاسمین، فسرب، فروی، فزیرین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۲۹۶	-۵%
گندله - گل گهر	بورس کالای ایران	تومان/تن	۴,۷۰۸	۰.۵%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۳,۰۲۲ - ۴,۸۴۳	۵۶%
کنسانتره - چادرملو	بورس کالای ایران	تومان/تن	۳,۵۶۱	۱.۲%	کگل، کچاد، کگهر، کنور، اپال، واحیا	فولاد، فخوز، هرمز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	۲,۷۶۶ - ۳,۶۲۵	۲۹%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۸	-	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کویر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۶۲۳	-۸%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۸,۶۶۰	-۲.۷%	فخوز، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان، کطبس، کپور، کزغال، کشرق	کویر، فوکا، فنورد	۱۵,۷۵۵ - ۲۲,۸۲۱	۱۸%
اسلب - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۳۰	-	فولاد، فخوز، هرمز	-	۴۴۸ - ۶۷۰	۷%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۲,۵۴۳	۱۳.۷%	فولاد، فخوز، هرمز	-	۱۶,۶۹۰ - ۲۲,۵۴۳	۲۷%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۵	-	ذوب، کویر	فولای	۵۴۶ - ۷۵۵	-۱۴%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۰۱۱	-۰.۶%	ذوب، کویر	فولای	۱۷,۴۲۳ - ۲۴,۷۴۷	۲۱%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۰۸	۱.۳%	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ - ۷۸۰	-۱%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۷۰۵	۲.۲%	فولاد	-	۶۴۰ - ۸۶۰	-۱%

عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تأثیر در فروش	تأثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه
اوره	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۳۱۵	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشاه	شاروم، سفارس	۲۸۵ - ۴۶۵	-۳۲%
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۷۶	-۵.۶%	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفسار، شسینا	۲۳۵ - ۳۲۵	-۱۴%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۹۷۹	۰%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۱	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۸۰	-۸%
پلی اتیلن سبک خطی	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۱۳	-	جم، شکبیر، شاراک	-	۸۸۱ - ۱,۰۵۸	-۵%
پلی اتیلن سنگین	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۳۱	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	-	۸۹۵ - ۱,۰۱۰	-۳%
مونواتیلن گلاکول	چین CFR	دلار/تن	۵۳۶	۱.۱%	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۳۶	۲%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۹۹	-۴%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۳۰	-۱.۸%	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۹۹۴	-۶%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۲	-	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۵۱	-۴%
پاراژایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۱۳	-۰.۸%	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۵۴ - ۱,۱۵۸	۲%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۹۸	۵.۱%	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۷۹	۲%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۳۳	-۱.۵%	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۶۸	-۱۰%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۲۱	۱.۳%	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۳۷	-۲%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۶۴۰	-۲.۲%	بوعلی	-	۶,۵۳۹ - ۸,۳۵۵	۲%
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۵۵	۱۰.۵%	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۲۳۹	۱۳%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۴۰	-	شغدیر، ارون، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۷۴۰ - ۹۱۴	-۱۷%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۴۵	-	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۱۹	-۶%

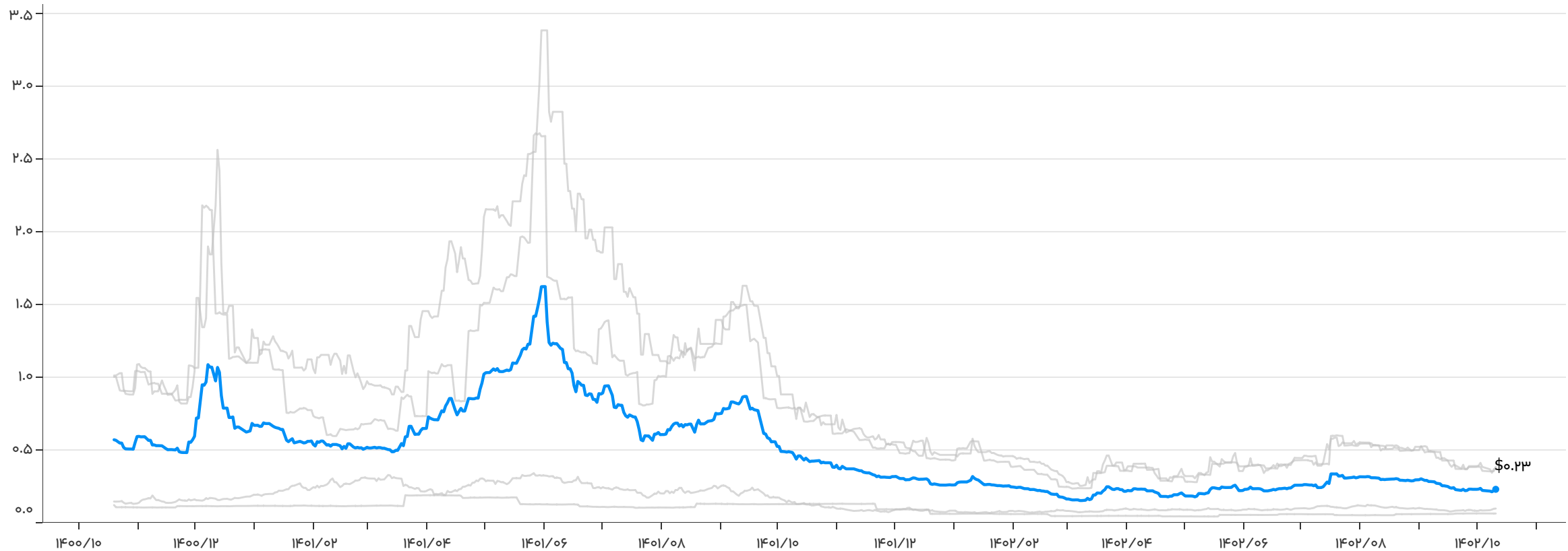


عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه	
انرژی و فرآورده های نفتی	نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۹	۲.۲%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شراز، شاولان	۷۲ - ۹۴	-۸%
	نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۴	۳.۳%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شراز، شاولان	۶۶ - ۹۱	-۸%
	نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/بشکه	۱۱۰	۲.۸%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شراز، شاولان	-	۹۷ - ۱۴۶	-۲۰%
	گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۱۰۴	۲.۸%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شراز، شاولان	-	۸۹ - ۱۳۴	-۱۸%
	لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۷,۰۸۷	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شراز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۱۰,۹۸۱ - ۲۱,۶۳۴	۵۴%
	روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۷,۴۱۱	-	شبهرن، شسپا، شنفت، شرانل	-	۲۱,۷۹۵ - ۴۱,۳۶۵	۶%
	قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۲,۳۷۶	-۱.۹%	شپاس	-	۱۱,۴۰۰ - ۱۷,۱۴۰	۳%
محصولات کشاورزی	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۸۲	-۱.۹%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۸۲ - ۲۶۹	-۳۲%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۷۹۱	-۱.۷%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸ - ۹۶۸	-۱۳%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۲۲۶	-	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۱۷%
	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۲۷	-۱.۸%	-	-	۱۹۹ - ۲۹۰	-۱۷%
ارز و ارز دیجیتال	یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۰۹	-۱.۰%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	۱%
	پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۷	-۰.۳%	-	-	۱.۲۰ - ۱.۳۱	۴%
	بیتکوین	بایننس	دلار	۴۳,۷۰۲	۳.۹%	-	-	۱۹,۳۴۳ - ۴۴,۰۳۹	۱۲۶%

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	۰.۱۰	۱.۰%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۷ - ۰.۱۳	-۱۷%
آلبرتا	دلار \ مترمکعب	۰.۰۷	-۰.۱%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۰۵ - ۰.۱۳	-۴۹%
هلند (TTF)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۸	۲.۴%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۶ - ۱.۵۵	-۴۹%
انگلستان (NBP)	دلار \ مترمکعب	۰.۳۹	۷.۸%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۲۴ - ۰.۷۴	-۴۵%
میانگین ۴ هاب	دلار \ مترمکعب	۰.۲۳	۴.۲%	-	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشا، زاگرس، شخارک، شفن	۰.۱۶ - ۰.۵۴	-۴۵%

## 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

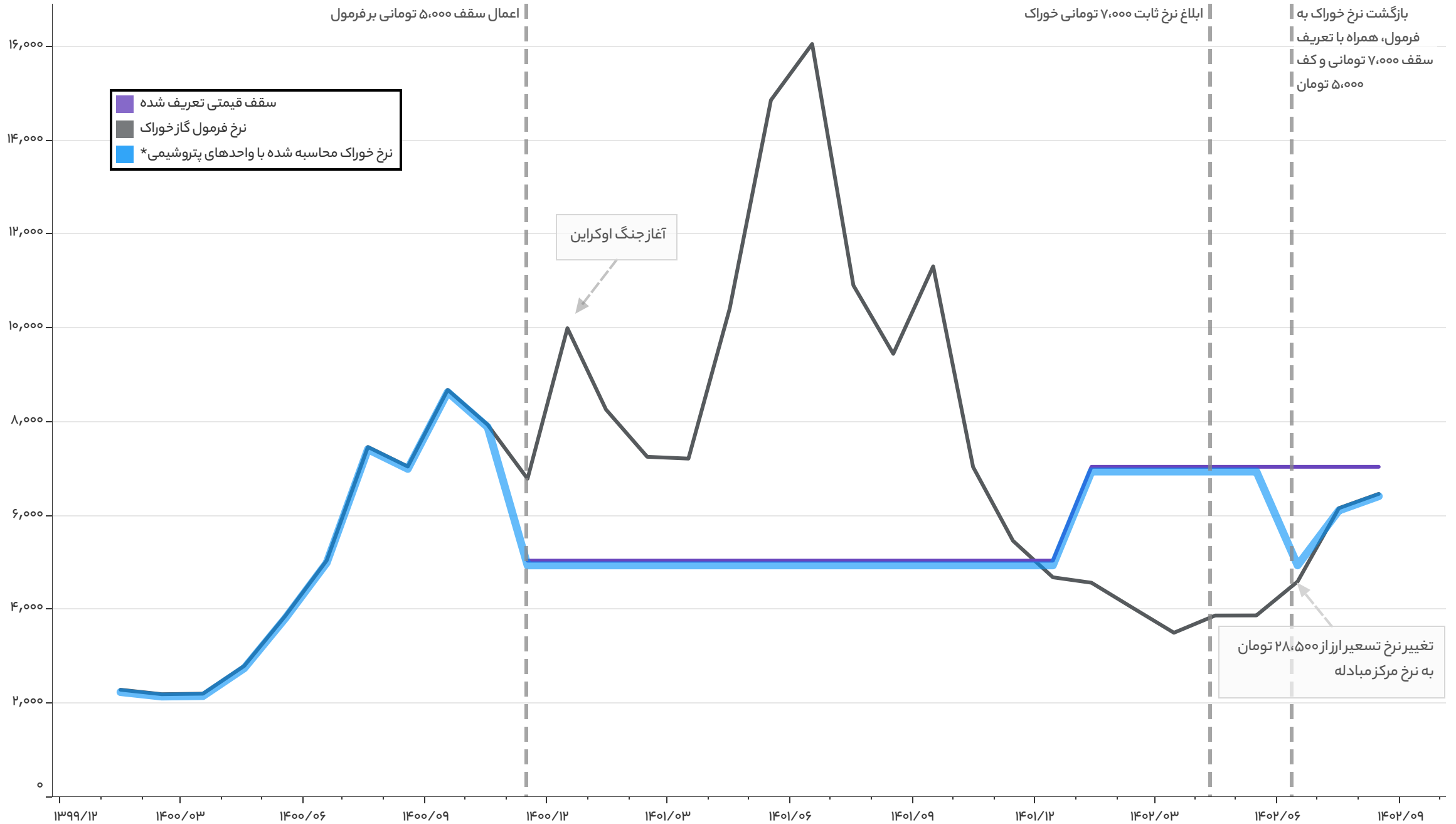






## فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

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 بروز رسانی 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 می‌گردد.



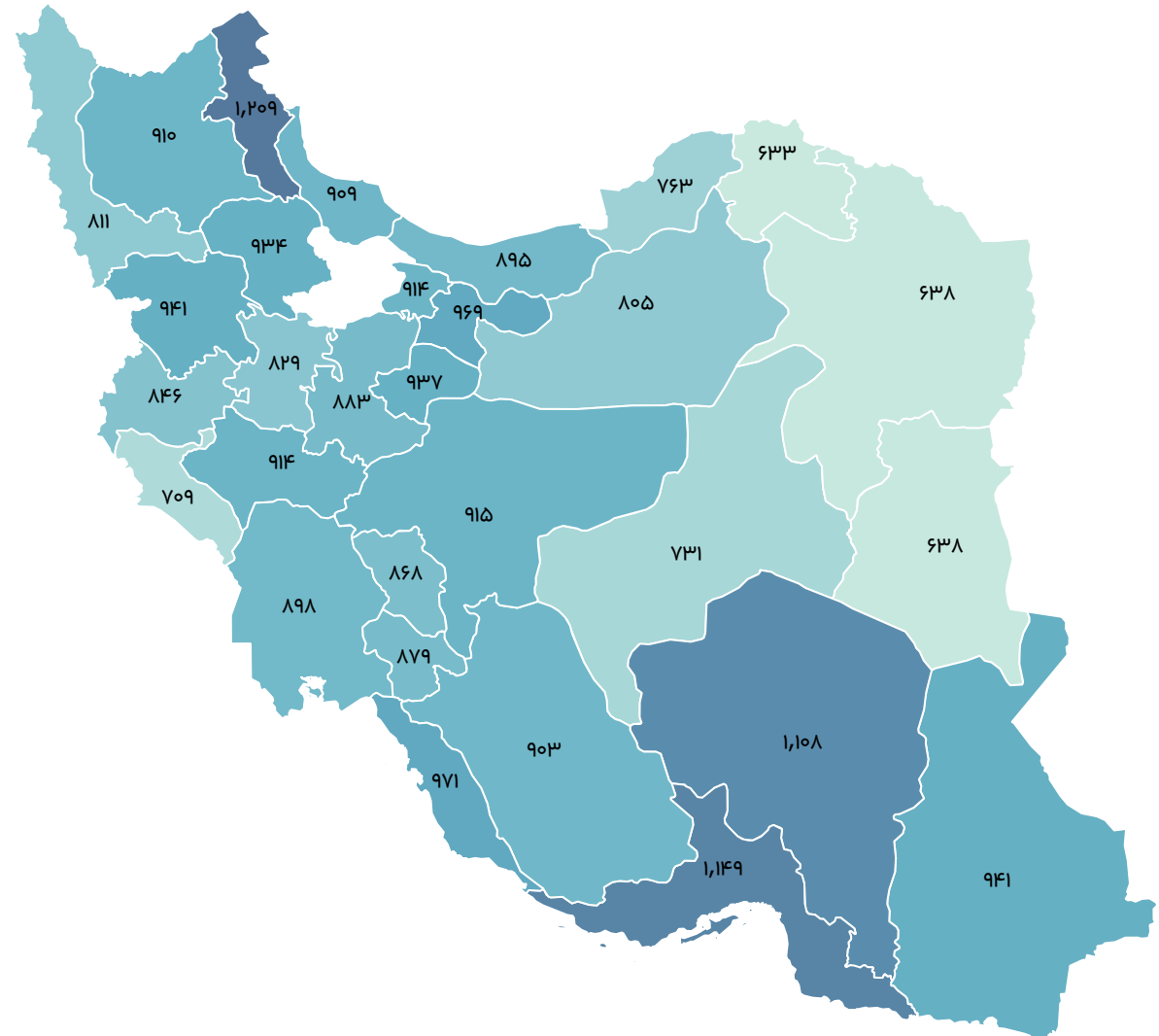
### آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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

منطقه	استان	شرکت دنبال کننده	هفته گذشته	هفته گزارش	تغییرات به هفته گذشته
مرکز	البرز	سیمان آبیک	۸۰۲	۹۱۴	+۱۳.۹%
	تهران	سیمان تهران	۸۰۹	۹۶۹	+۱۹.۹%
	مرکزی	سیمان ساوه	۷۶۵	۸۸۳	+۱۵.۳%
	اصفهان	سیمان سپاهان	۷۳۷	۹۱۵	+۲۴.۲%
	سمنان	سیمان شاهرود	۶۲۲	۸۰۵	+۲۹.۴%
	قم	سیمان نیزار قم	۸۱۵	۹۳۷	+۱۴.۹%
غرب	یزد	گروه صنعتی ومعدنی سیمان..	۷۱۴	۷۳۱	+۲.۴%
	خوزستان	شرکت سیمان خوزستان	۷۹۹	۸۹۸	+۱۲.۳%
	همدان	سیمان هگمتان	۷۴۹	۸۲۹	+۱۰.۶%
	ایلام	سیمان ایلام	۶۰۸	۷۰۹	+۱۶.۷%
	چهارمحال و بختیاری	صنایع سیمان شهرکرد	۸۰۵	۸۶۸	+۷.۸%
	کرمانشاه	صنایع سیمان غرب	۷۹۸	۸۴۶	+۶.۰%
	لرستان	سیمان دورود	۵۸۰	۹۱۴	+۵۷.۵%
	کهگیلویه و بویراحمد	سیمان یاسوج	۹۰۱	۸۷۹	-۲.۳%
	کردستان	سیمان کردستان	۷۹۶	۹۴۱	+۱۸.۱%
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۱,۰۴۷	۱,۱۴۹	+۹.۷%
جنوب	بوشهر	سیمان مند دشتی	۸۳۵	۹۷۱	+۱۶.۳%
	فارس	سیمان داراب	۷۸۰	۹۰۳	+۱۵.۸%
	مازندران	سیمان مازندران	۷۹۰	۸۹۵	+۱۳.۴%
شمال	گیلان	سیمان خزر	۶۳۷	۹۰۹	+۴۲.۶%
	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۷۱۴	۷۶۳	+۶.۸%
شمال غرب	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۸۹۹	۱,۲۰۹	+۳۴.۴%
	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۸۵۴	۹۱۰	+۶.۶%
شمال شرق	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۶۷۰	۸۱۱	+۲۱.۰%
	زنجان	سیمان خمسه	۸۷۸	۹۳۴	+۶.۴%
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۵۵۹	۶۳۳	+۱۳.۲%
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۵۴۳	۶۳۸	+۱۷.۶%
	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۵۹۲	۶۳۸	+۷.۷%
جنوب شرق	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۸۵۹	۱,۱۰۸	+۲۹.۰%
	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۸۴۱	۹۴۱	+۱۱.۸%

### قیمت منطقه‌ای سیمان\* در هفته گزارش

براساس شرکت دنبال کننده 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.

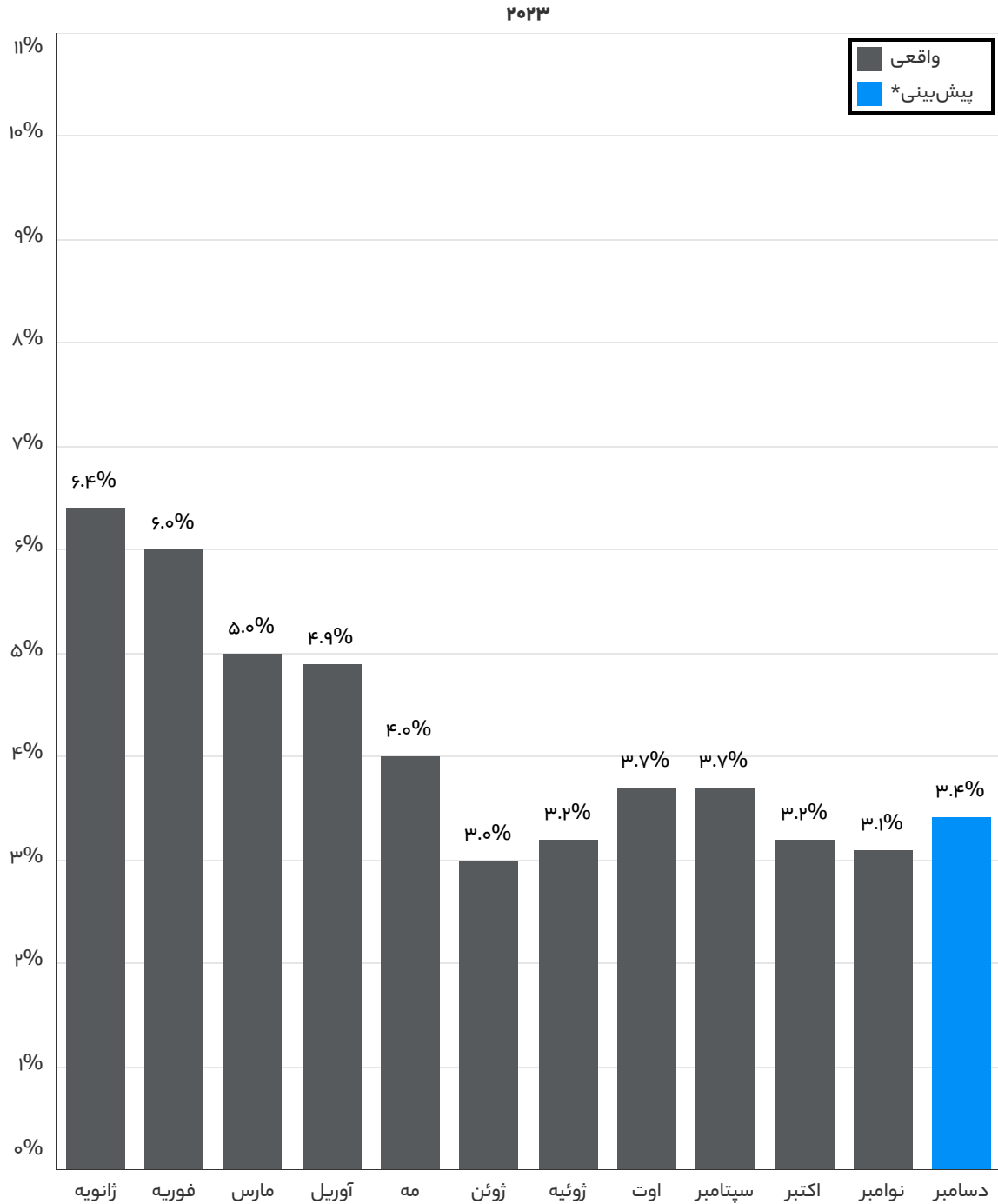
# اخبار و معیارهای تاثیرگذار

- ✓ طلا بهترین عملکرد خود را از سال ۲۰۲۰ تا کنون، در سال ۲۰۲۳ تجربه کرد و اکنون بالاتر از ۲۰۰۰ دلار در هر اونس معامله می‌شود. امید به آسان‌تر شدن سیاست‌های پولی فدرال رزرو آمریکا و پایین آمدن نرخ بهره در اوایل ۲۰۲۴ از قیمت طلا حمایت کرده است. طلا ۱۳ درصد طی یک سال گذشته افزایش قیمت داشته و بین پایین‌ترین رقم ۱۸۰۰ دلار تا اوج ۲۱۳۵ دلار در نوسان بوده است. طلا در روز آخر سال میلادی بالاتر از ۲۰۶۰ دلار معامله شد اما با وارد شدن به سال جدید میلادی قیمت طلا کاهش پیدا کرد و در محدوده ۲۰۴۱ تا ۲۰۴۵ دلار معامله شد.
- ✓ طی آذرماه سال جاری حدود ۶ تن طلا از گمرکات مختلف ترخیص شده که یک رکورد محسوب می‌شود. در این راستا بانک مرکزی ضوابط جدید واردات طلا را ابلاغ کرد و به موجب این مقررات که در تاریخ ۷ دی ۱۴۰۲ ابلاغ شده است، تأمین ارز برای واردات طلا از محل ارز حاصل از صادرات خود و به صورت شمش منوط به تحویل، عرضه و فروش آن در بستر مرکز مبادله ارز و طلای ایران شده است.
- ✓ در ۹ ماهه ابتدای سال ۱۴۰۱ در مجموع ۱۰۵ هزار تن تیرآهن به ارزش ۶۵ میلیون دلار و در ۹ ماهه ابتدای سال جاری ۱۳۷ هزار تن تیرآهن به ارزش ۷۵ میلیون دلار صادر شده است. بر این اساس صادرات تیرآهن در ۹ ماهه ابتدای امسال نسبت به مدت مشابه سال گذشته به لحاظ ارزش ۱۵.۴ و به لحاظ وزنی ۳۰ درصد رشد داشته است.
- ▲ به گزارش رویترز، قیمت نفت در ۲۰۲۳ در بحبوحه تنش‌های ژئوپلیتیکی و نگرانی نسبت به سطح تولید نفت تولیدکنندگان بزرگ دنیا، حدود ۱۰ درصد کاهش یافته است. قیمت جهانی نفت اولین روز معاملاتی سال جدید میلادی را تحت تاثیر کم‌رنگ شدن انتظارات برای کاهش نرخ بهره فدرال رزرو با کاهش ۱.۵ درصدی به پایان برد. اما قیمت نفت در روز سه‌شنبه با افزایش قیمت ۱.۷۵ درصدی به قیمت ۷۸.۳۹ دلار رسید و انتهای هفته با قیمت ۷۸.۸ دلار بسته شد.
- ✓ در هفته‌های اخیر آنگولا از اوپک خارج شد. وزیر منابع طبیعی آنگولا دلیل خروج این کشور از اوپک را اختلاف بر سر پایین بودن سهمیه تولید نفت اعلام کرد. به گزارش رویترز، به دنبال خروج آنگولا از این گروه و همچنین کاهش تولید، اوپک در نیمه اول ۲۰۲۴ با کاهش تقاضا برای نفت خام خود مواجه خواهد شد، چون سهم این گروه از بازار جهانی به پایین‌ترین سطح از بحران کرونا می‌رسد. این بدان معناست که اوپک برای افزایش تولید خود با مشکل مواجه خواهد شد، مگر آن که تقاضای جهانی برای نفت بالا رود و با آماده پذیرش قیمت پایین نفت شود.
- ▲ سینوپک در گزارش دورنمای ۲۰۲۶ که در پکن منتشر شد، پیش‌بینی کرد عرضه انرژی غیرفسیلی که در راس آن‌ها خورشیدی و بادی وجود دارند، احتمالاً از معادل ۳ میلیارد تن استاندارد زغال سنگ تا سال ۲۰۲۵ فراتر خواهد رفت و به منبع اصلی انرژی برای بیش از نیمی از مصرف انرژی اولیه تبدیل خواهد شد. این گول انرژی چینی پیش‌بینی کرد مصرف نفت در اواسط سال‌های ۲۰۲۶ تا ۲۰۳۰، به ۸۰۰ میلیون تن معادل حدود ۱۶ میلیون بشکه در روز می‌رسد که بخشی از آن به دلیل رشد سریع‌تر از حد انتظار در بخش خودروهایی انرژی جدید است.
- ✓ به گزارش رویترز، قطر اعلام کرد طبق توافق با شرکت شل در سنگاپور، به مدت ۵ سال سالانه تا ۱۸ میلیون بشکه نفت خام در اختیار این شرکت قرار می‌دهد. شرکت قطر انرژی اعلام کرد این اولین قرارداد ۵ ساله فروش نفت این کشور بوده است. این شرکت توافقنامه‌ای با شرکت تجارت شرق شل امضا کرده که طبق آن سالانه ۱۸ میلیون بشکه درجات نفتی قطر لند و قطر مارین از اول ژانویه در اختیار شل قرار می‌گیرد.
- ✓ به گزارش رویترز، اطلاعات ردیابی نفتکش‌ها نشان می‌دهد صادرات گاز طبیعی مایع آمریکا در دسامبر ۲۰۲۳ به یک رکورد ماهانه و سالانه رسیده بود. بدین ترتیب آمریکا قطر و استرالیا را پشت سر گذاشته و بزرگ‌ترین صادرکننده گاز طبیعی مایع در ۲۰۲۳ بوده است. همچنین بر اساس داده‌های ردیابی کشتی که توسط بلومبرگ گردآوری شده است، ارسال محموله‌های ال‌ان‌جی به چین، در سال میلادی گذشته ۱۲ درصد افزایش یافت و به حدود ۷۱ میلیون تن رسید. به این ترتیب چین با افزایش خرید در سال ۲۰۲۳، دوباره در جایگاه بزرگ‌ترین خریدار گاز طبیعی مایع (ال‌ان‌جی) در جهان ایستاد.
- ▲ رویترز طی گزارشی تایید نشده به نقل از منابع پالایشگاهی و تجاری نوشت تجارت نفت چین با ایران متوقف شده است، زیرا تهران قیمت‌های بالاتری را از مشتری اصلی خود می‌خواهد و عرضه نفت ارزان را برای بزرگ‌ترین واردکننده نفت خام در جهان کاهش داده است. همچنین به گزارش بلومبرگ، واردات نفت خام هند از روسیه به عنوان بزرگ‌ترین عرضه‌کننده نفت به این کشور در ماه دسامبر به پایین‌ترین رقم از ژانویه ۲۰۲۳ رسید. شش نفتکش حامل درجه نفتی سوکول روسیه نتوانستند محموله خود را به خاطر مشکلات پرداخت در بحبوحه سخت‌تر شدن تحریم‌ها علیه روسیه تحویل دهند.
- ✓ دی ماه ۱۴۰۰ قرارداد سوآپ گاز بین ایران، ترکمنستان و آذربایجان به امضا رسید. حجم گاز انتقالی، با امضای تفاهم نامه ای در خرداد سال ۱۴۰۱ دو برابر شد. خرداد ۱۴۰۲ وزیر نفت اعلام کرد که به زودی قراردادی با ترکمنستان امضا می‌شود که روزانه ۱۰ میلیون مترمکعب (علاوه بر سوآپ) واردات گاز از ترکمنستان صورت بگیرد. اگرچه تا امروز، ترکمن‌ها زیر بار امضای این قرارداد نرفته‌اند، اما در توافقی با ایران، هرچه بیش از میزان سوآپ، گاز بتوانند تحویل ایران دهند، به عنوان واردات گاز، آن را به ایران می‌فروشند. اما در روز پنجشنبه، سوآپ گاز و همچنین واردات آن، متوقف شده است. اخبار نشان می‌دهد که مذاکرات دو طرف برای برقراری دوباره این تجارت گازی آغاز شده، اما فعلاً مشخص نیست که این توقف، موقتی بوده یا ممکن است ادامه یابد.
- ✓ رئیس مرکز کنترل گاز کشور با بیان اینکه میزان مصرف گاز بخش خانگی به ۶۵ درصد از تولید رسیده است گفت: اگر فقط ۱۰ درصد در مصرف گاز صرفه‌جویی کنیم تا ۵۰ میلیون متر مکعب در مصرف گاز صرفه‌جویی خواهد شد. از سوی دیگر، طبق گزارش مرکز پژوهش‌های مجلس، ناترازی بنزین در ایران در سال ۱۴۰۲ به رقم ۱۰ میلیون لیتر در روز رسیده است که سالانه خسارتی ۳ میلیارد دلاری به کشور وارد می‌کند. (معادل درآمد فروش یک ماه نفت ایران) پیوستن ایران به باشگاه واردکنندگان بنزین در حالی است که براساس آمار گمرک این کشور در سال ۹۹ حدود ۳ میلیارد دلار بنزین صادر کرده است. در واقع افت ۶ میلیارد دلاری درآمد ارزی بنزین، نیمی از افزایش درآمد دولت از صادرات نفت و بی‌اثرسازی تحریم‌ها را با خود خنثی کرده است.



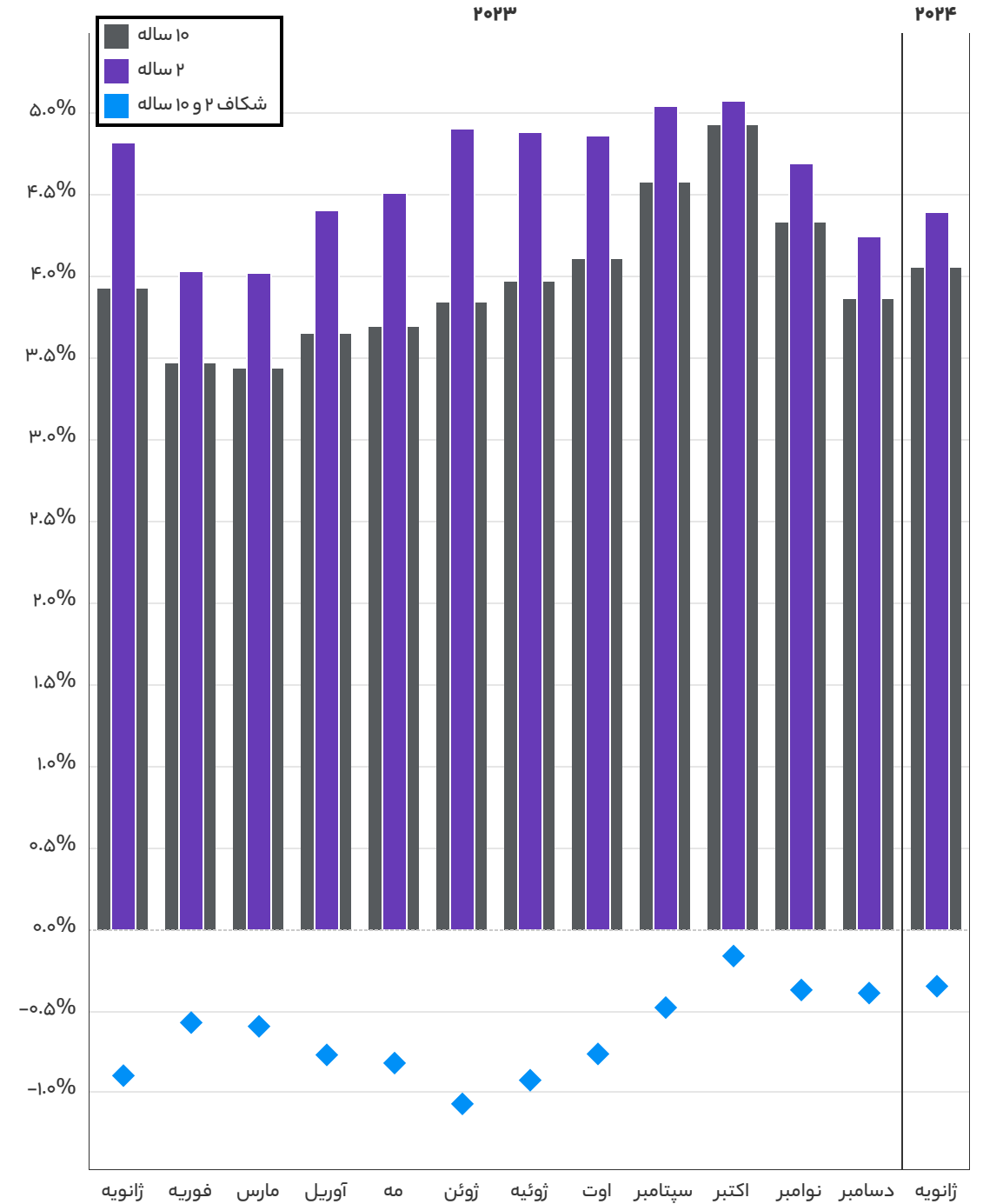
### شاخص قیمت مصرف‌کننده در آمریکا

ماهانه، نقطه به نقطه، یکسال گذشته



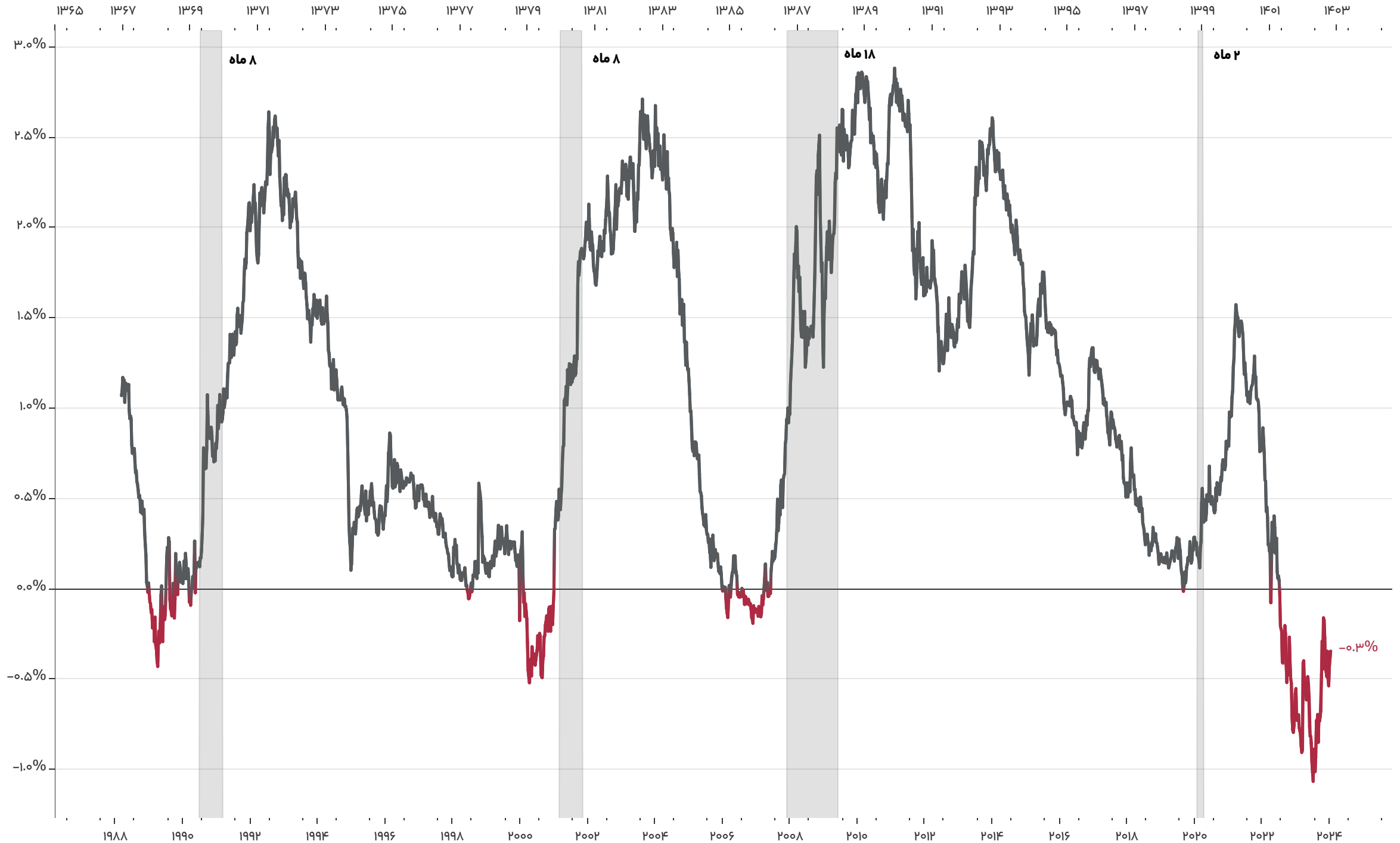
### وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

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



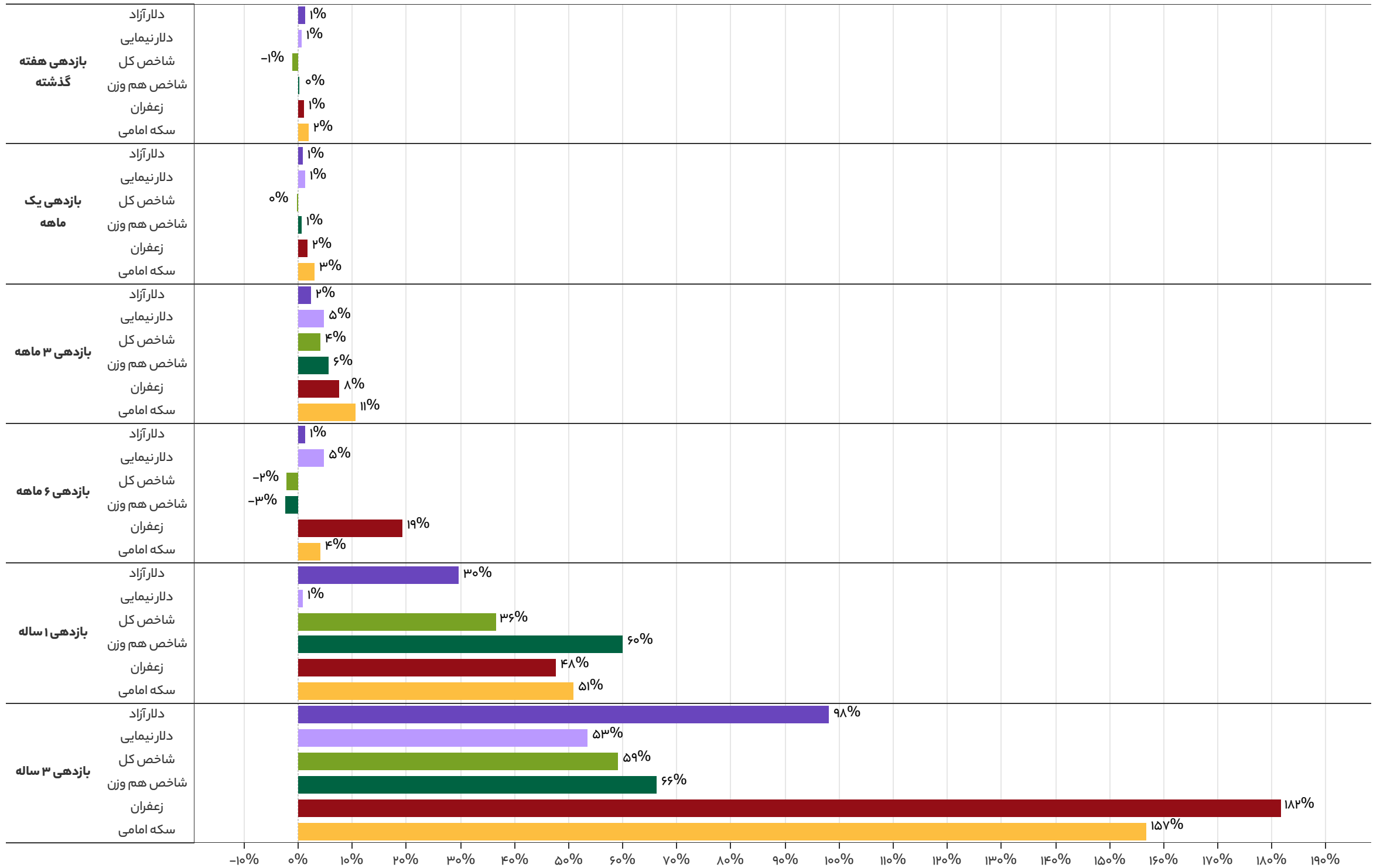
# بازار سهام

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 هرماه، رنگ براساس دارایی

۱۲ ماه گذشته												بازده سال	نوسان
۱۴۰۱/۱۰	۱۴۰۱/۱۱	۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	۱۴۰۲/۰۹	بازده سال	نوسان
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 درآمدهای 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.

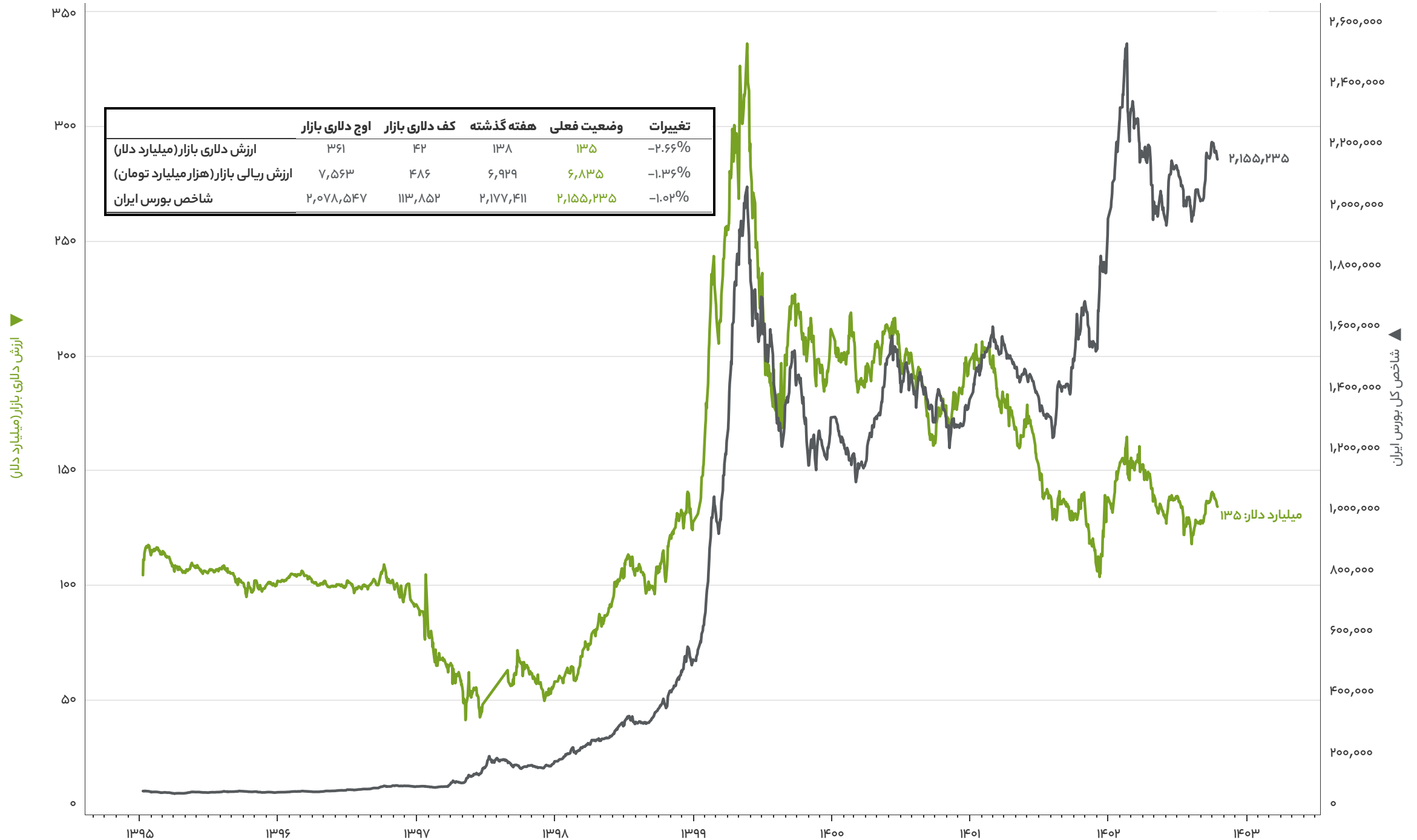
بازده مسکن با استفاده از آمار بانک مرکزی اعلام شده برای میانگین قیمت مسکن در مناطق ۲۲ گانه تهران محاسبه شده و برای ماه‌های اعلام نشده، از برآورد سناریو محتمل مدل‌های آماری و اقتصادی که در گزارش ماهنامه دیدگاه بازار کاربریما ذکر گردیده، استفاده شده است.





## ارزش دلاری بازار

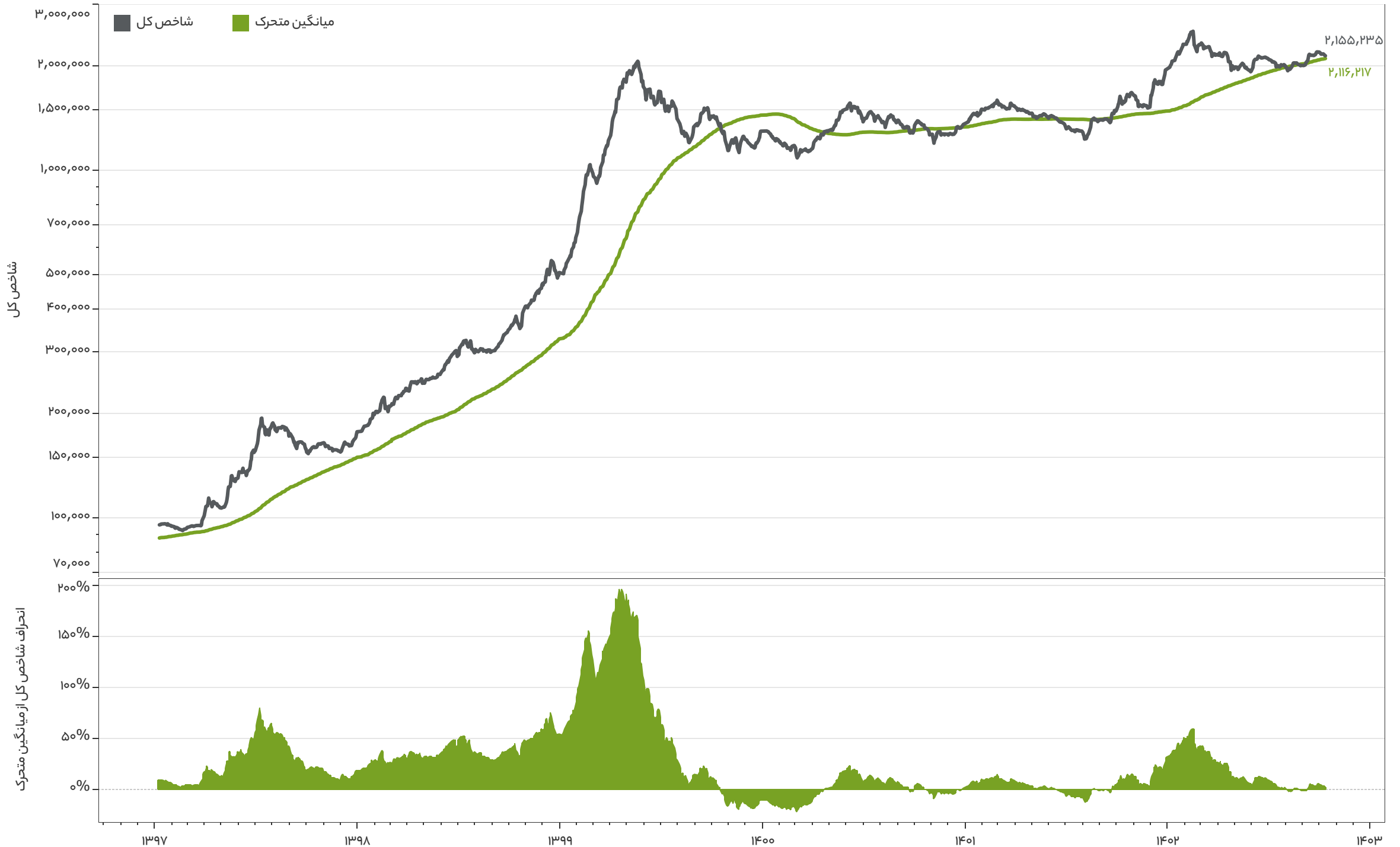
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





## شاخص کل و میانگین متحرک

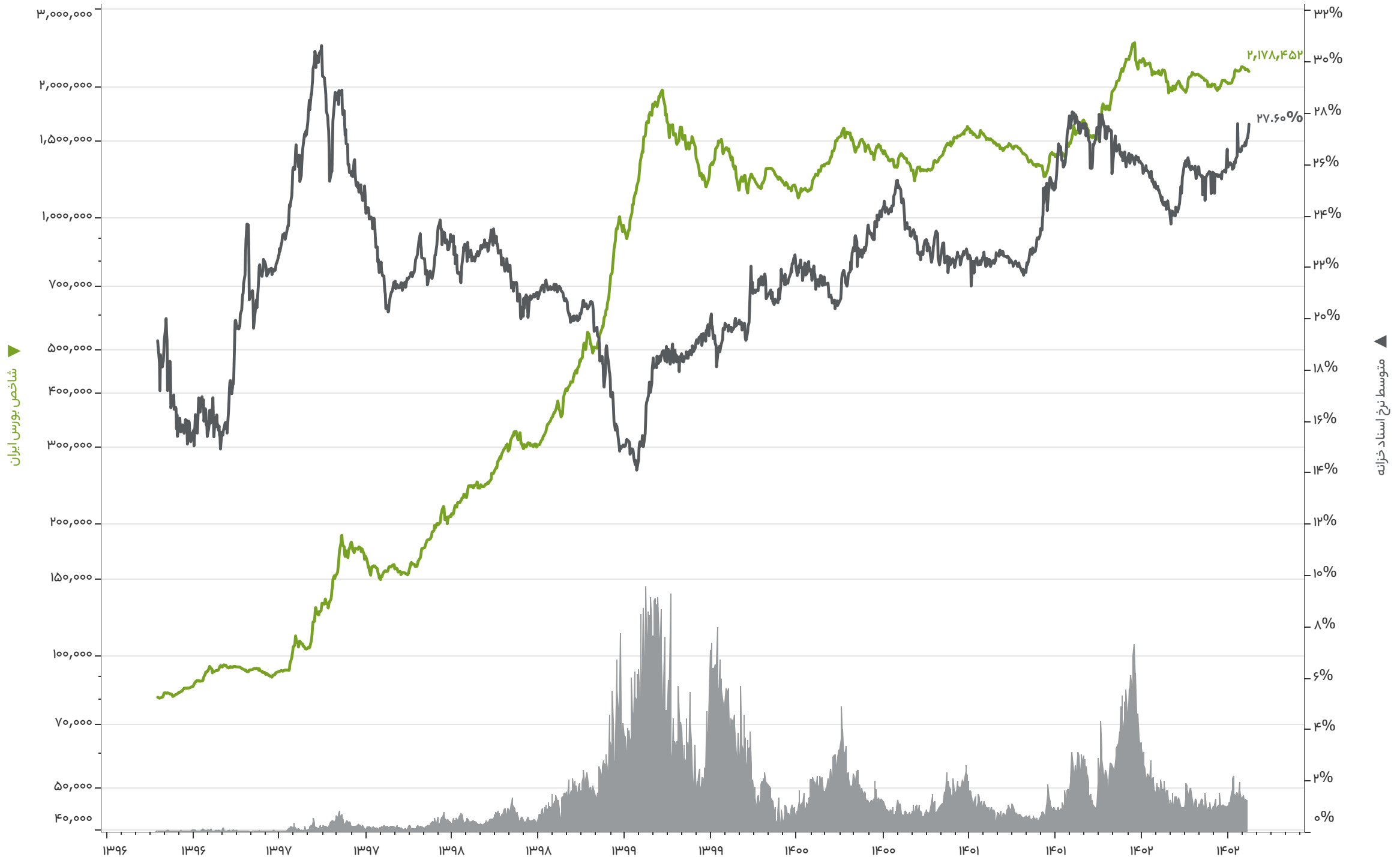
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





## تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

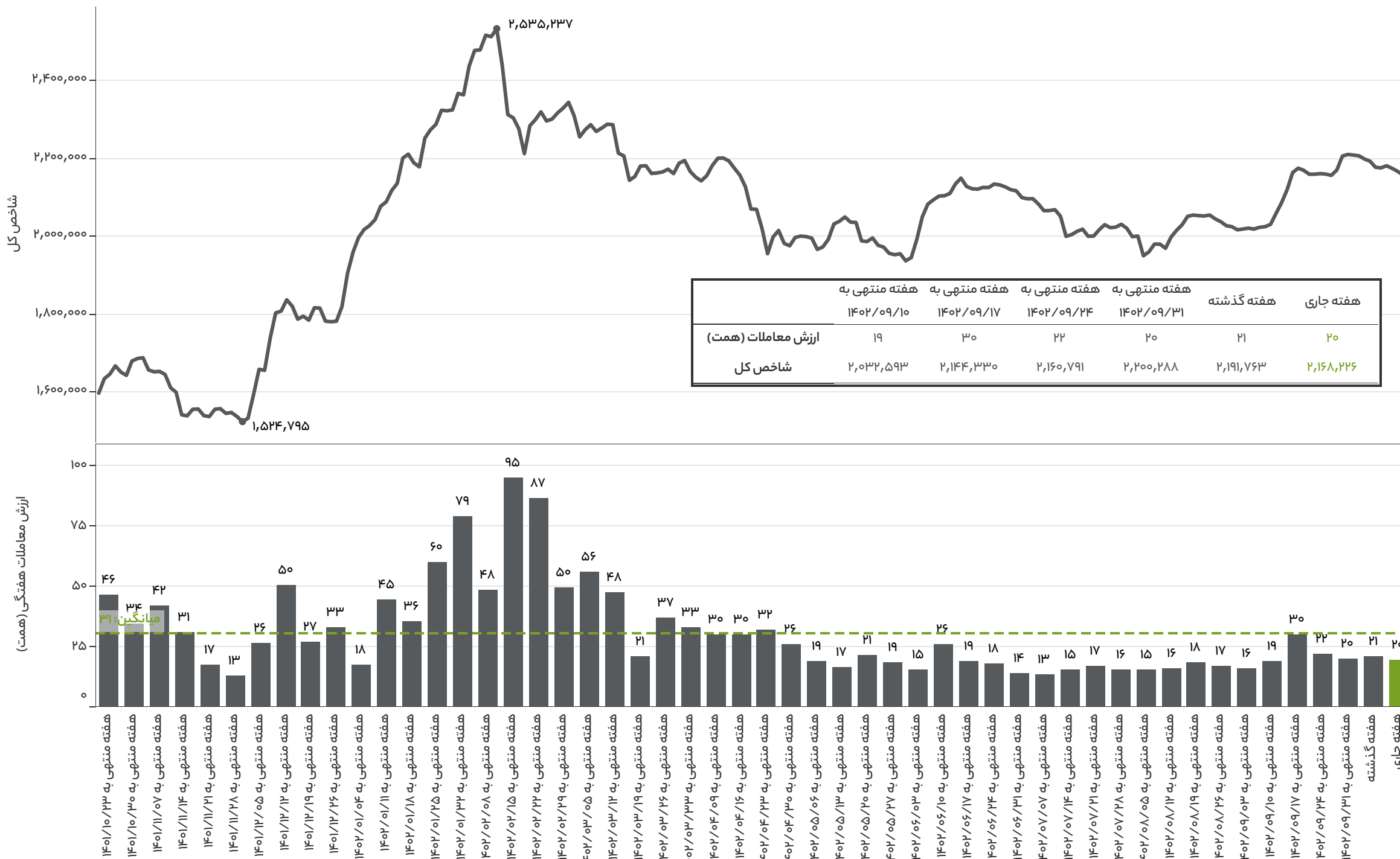
از آذر ۱۳۹۴، شاخص بورس ایران محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، میانگین روزانه نرخ اسناد خزانه، ارزش معاملات براساس مجموع معاملات بورس تهران و فرابورس





### ارزش معاملات هفتگی بازار

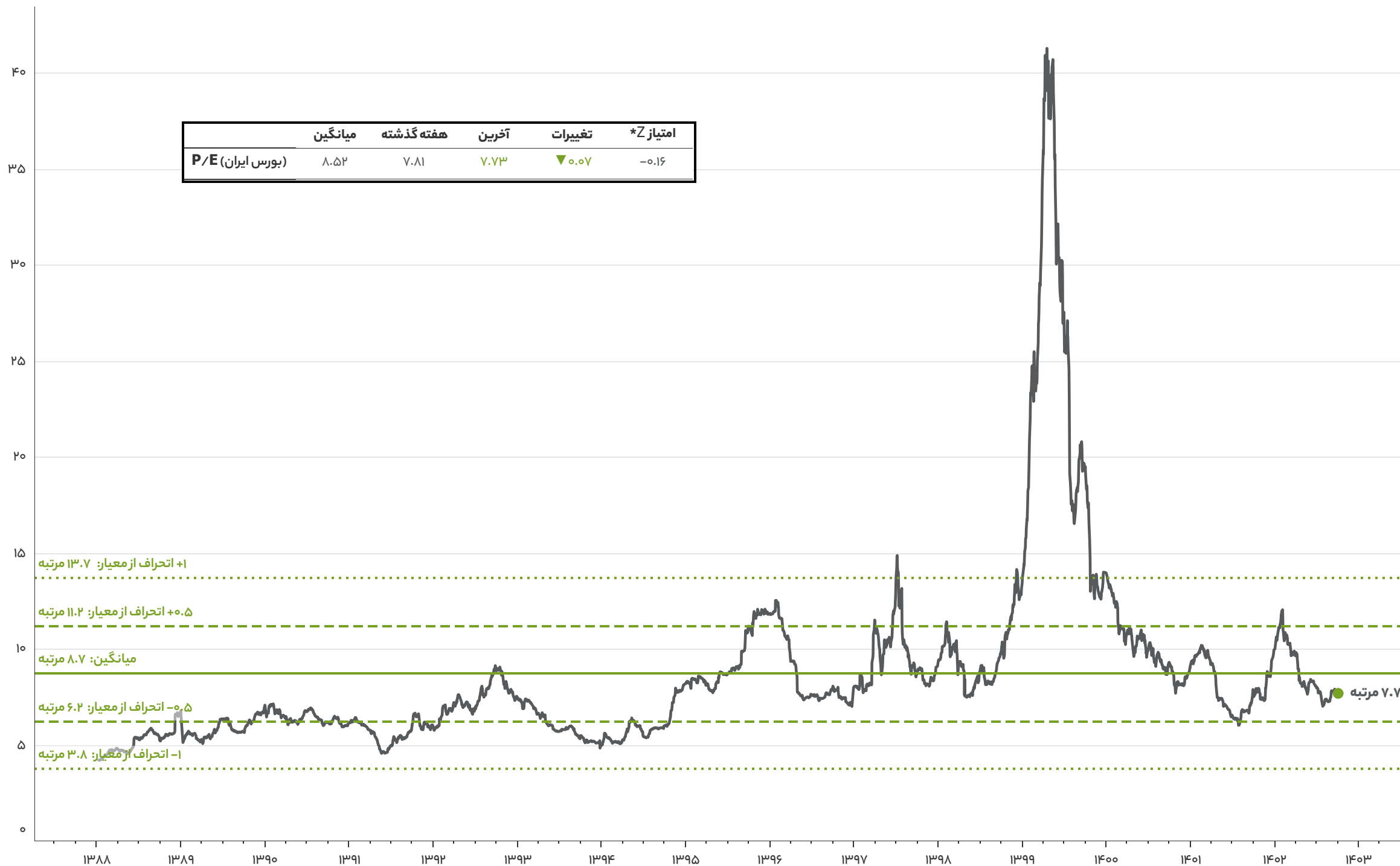
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





## نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

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





## 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	۷.۷۳	۷.۸۱	۶.۰۷	۱۲.۸۲	۴۱.۳۳
بورس تهران	۷.۴۲	۷.۵۰	۵.۶۴	۱۲.۵۹	۴۱.۹۹
فرابورس	۹.۸۲	۹.۸۷	۹.۰۳	۱۵.۱۲	۴۳.۵۱

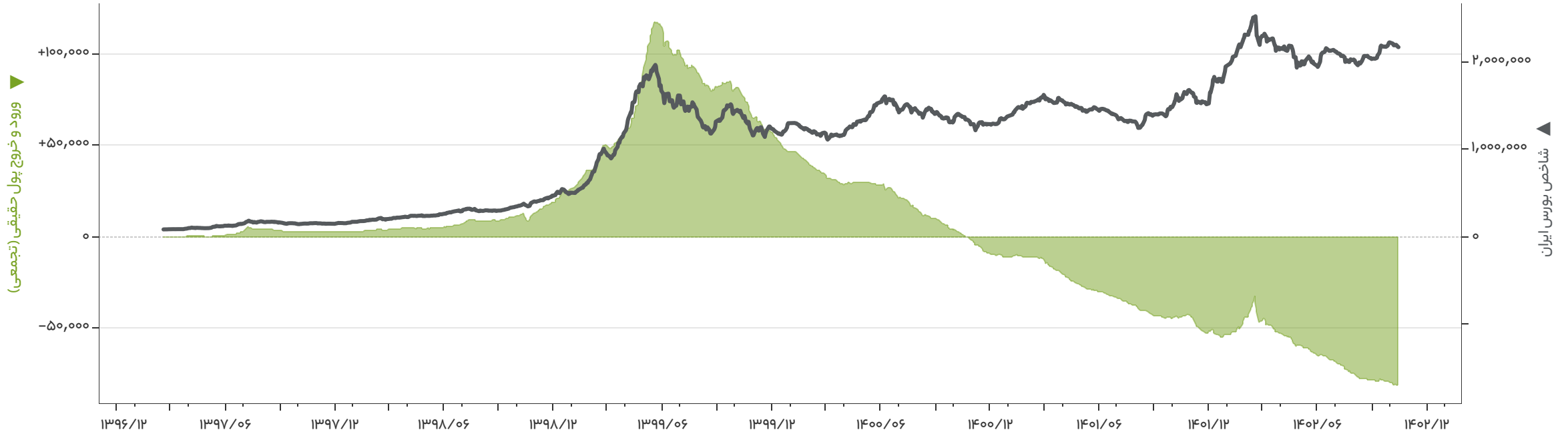


## بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	خدمات مالی	مواد پایه	انرژی	مصرفی دوره‌ای	مصرفی غیردوره‌ای	صنعتی	بهداشت	ارتباطات	تکنولوژی	یوتیلیتی	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۹۹	۱۸۹	۶	۶۶	۸۹	۶۳	۴۱	۵	۱۹	۱۱	۲۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۳,۳۷۱	۳,۲۹۱	۶۱۸	۳۹۴	۲۲۲	۲۰۱	۱۶۶	۱۲۷	۱۲۰	۸۷	۵۸	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۳۸.۹%	۳۸.۰%	۷.۱%	۴.۶%	۲.۶%	۲.۳%	۱.۹%	۱.۵%	۱.۴%	۱.۰%	۰.۷%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۷.۴	۷.۸	۴.۹	۵.۹	۱۱.۳	۹.۶	۹.۴	۱۳.۳	۲۱.۳	۸.۹	۱۳.۰	سودآوری
بازده سود نقدی	۷.۸%	۹.۲%	۱۴.۶%	۲.۲%	۴.۱%	۳.۶%	۶.۶%	۳.۱%	۲.۵%	۱۷.۲%	۲.۸%	
نسبت تقسیم سود	۶۲%	۷۳%	۶۳%	۳۴%	۵۴%	۳۷%	۷۶%	۴۱%	۶۰%	۱۰۰%	۴۱%	
بتا به شاخص کل	۱.۰	۱.۰	۱.۲	۱.۰	۰.۸	۱.۱	۰.۷	۱.۴	۰.۶	۱.۰	۰.۸	β
بازده از ابتدای روند صعودی (۱۳۹۸/۰۶/۰۱)	+۸۹۴%	+۹۲۵%	+۷۹۳%	+۹۰۷%	+۴۵۳%	+۴۵۲%	+۴۱۶%	+۱۶۰%	+۳۱۰%	+۷۷۱%	+۶۷۳%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۴%	+۶۰%	+۱۶%	-۸%	+۳%	-۵%	+۲۲%	-۵۹%	+۳%	+۱۱۳%	+۸%	
بازده از ابتدای سال	+۷۴%	+۸۰%	+۹۰%	+۱۰۳%	+۶۳%	+۱۱۴%	+۱۰۵%	+۶۶%	+۷۷%	+۴۰%	+۲۴۵%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	-۱%	-۳%	۱%	۰%	۰%	۰%	۱%	۱%	-۱%	۷%	

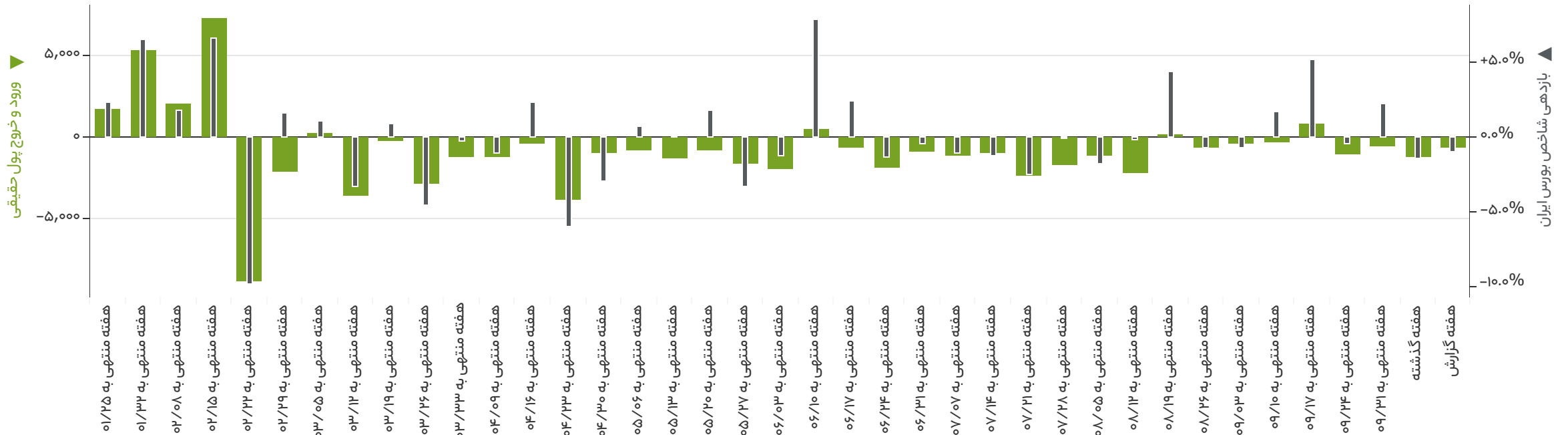
## ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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

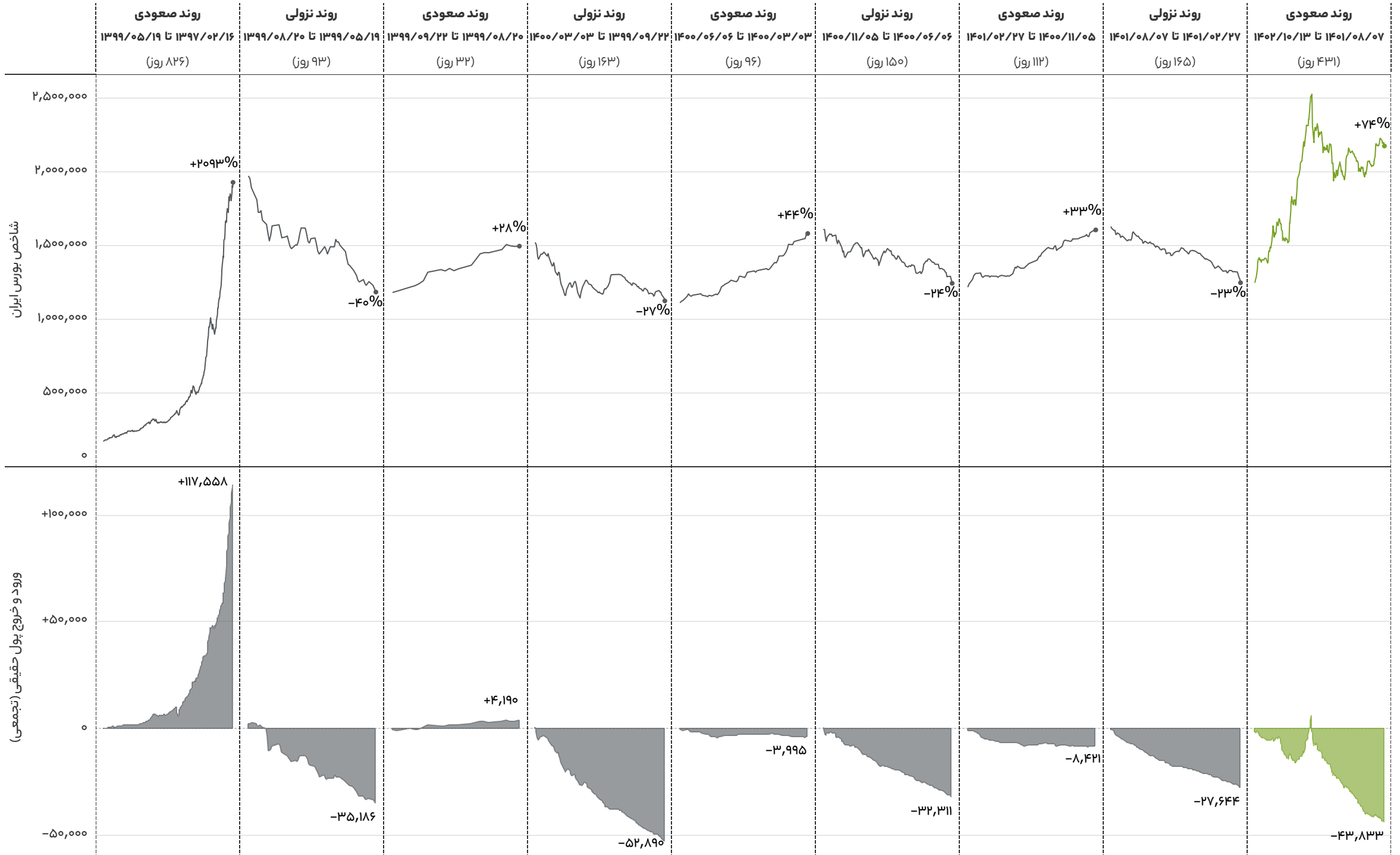
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





## 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





## تغییر مالکیت شرکت

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

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	تغییر مالکیت شرکت	
			تغییر مالکیت شرکت	ارزش بازار (ت.م.ه)
نخریس	نساجی	۲.۱	+۹.۵%	
حآفرین	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۱.۹	+۳.۲%	
غشصفا	محصولات لبنی	۲.۰	+۲.۰%	
وآوا	سرمایه گذاری	۰.۷	+۱.۷%	
حفارس	حمل و نقل بارزمینی	۳.۷	+۱.۴%	
والماس	سرمایه گذاری	۱.۲	+۱.۲%	
غیاذر	محصولات لبنی	۱.۳	+۱.۱%	
ثراگرس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۴	+۰.۹%	
ثباغ	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲.۸	+۰.۹%	
حشکوه	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۰.۶	+۰.۹%	
ساینا	محصولات پاک کننده	۱.۷	+۰.۹%	
ومشان	سرمایه گذاری	۰.۴	+۰.۸%	
خنصیر	قطعات خودرو	۲.۲	+۰.۷%	
نظرین	نساجی	۱.۶	+۰.۷%	
زیبنا	محصولات کشاورزی	۱.۷	-۰.۴%	
تکیمیا	فعالیت‌های مرتبط با اوراق بهادار	۴.۰	-۰.۵%	
ولصنم	لیزینگ	۲.۴	-۰.۵%	
سیمرغ	محصولات کشاورزی	۴.۸	-۰.۵%	
ولپارس	لیزینگ	۱.۱	-۰.۵%	
شکرین	مواد شیمیایی-متنوع	۴.۲	-۰.۶%	
وحافظ	بیمه	۱.۷	-۰.۶%	
غدشت	محصولات کشاورزی	۱.۷	-۰.۶%	
معیار	سرمایه گذاری	۰.۵	-۰.۸%	
زشریف	محصولات کشاورزی	۱.۸	-۰.۸%	
دی	بانکها و موسسات اعتباری	۱۴.۶	-۱.۰%	
وفتخار	سرمایه گذاری	۰.۵	-۱.۱%	
ولراز	لیزینگ	۰.۴	-۱.۶%	
تمحرکه	ماشین الات	۰.۳	-۵.۲%	

## ورود و خروج پول حقیقی

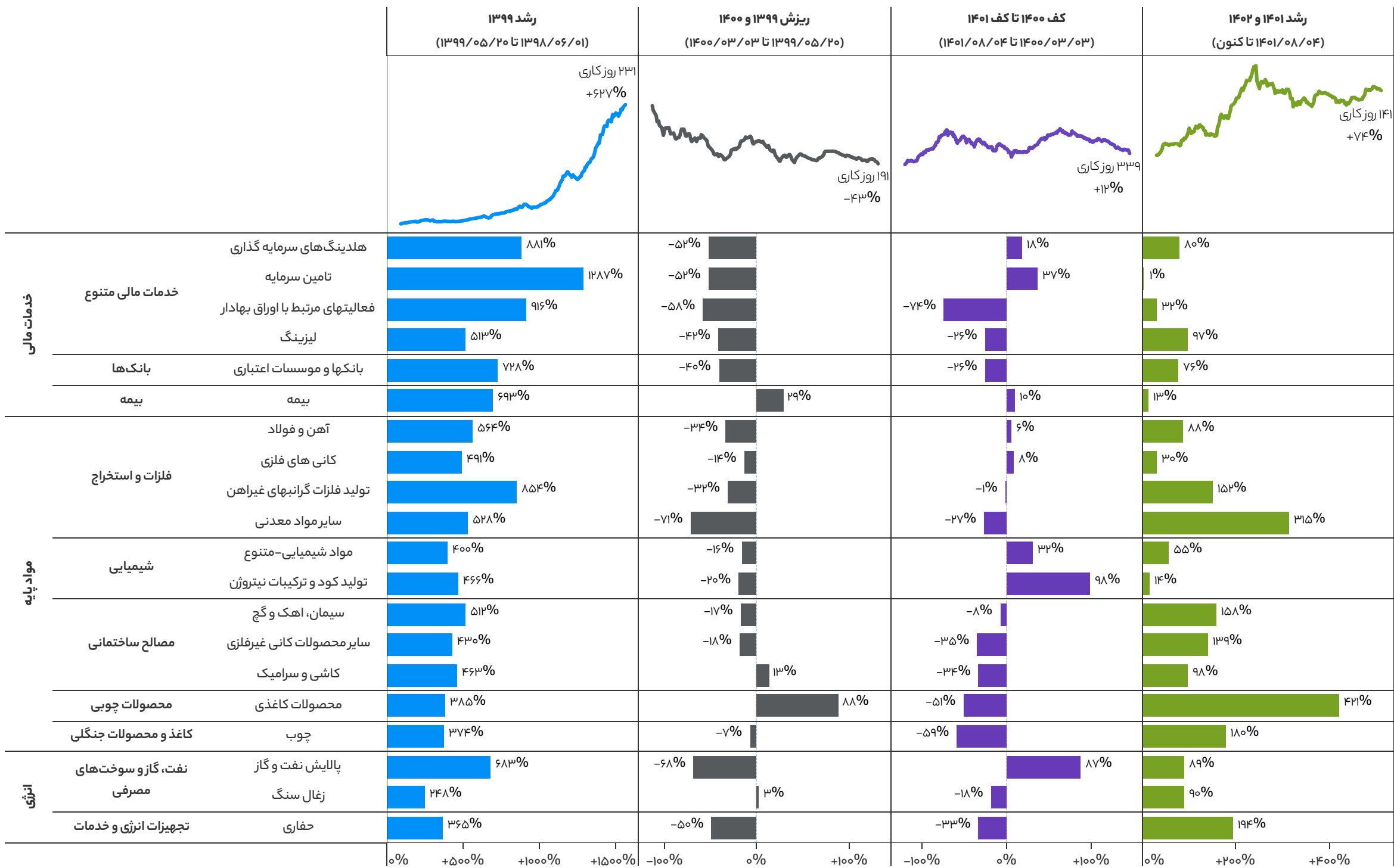
طی دوره گذشته، میلیارد تومان، ارزش بازار بر حسب هزار میلیارد تومان

نماد	صنعت	ارزش بازار (ت.م.ه)	ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	
			ورود و خروج پول شخصیت حقیقی (میلیارد تومان)	ارزش بازار (ت.م.ه)
نخریس	نساجی	۲	+۱۷۷	
حآفرین	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۲	+۶۱	
حفارس	حمل و نقل بارزمینی	۴	+۵۵	
غشصفا	محصولات لبنی	۲	+۴۰	
ثشاهد	سرمایه گذاری	۱۱	+۲۹	
وتوس	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴	+۲۵	
ثباغ	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳	+۲۲	
ذوب	آهن و فولاد	۳۳	+۲۰	
کتوکا	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۴	+۲۰	
فاراک	محصولات فلزی	۴	+۲۰	
پکرمان	لاستیک و پلاستیک	۱۰	+۱۸	
خنصیر	قطعات خودرو	۲	+۱۶	
ثنوسا	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳	+۱۶	
ارفع	آهن و فولاد	۳۰	+۱۶	
ملت	بیمه	۶	-۲۵	
سیمرغ	محصولات کشاورزی	۵	-۲۷	
خسپا	خودرو	۴۸	-۲۷	
شگویا	مواد شیمیایی-متنوع	۴۲	-۳۱	
وغدیر	سرمایه گذاری	۱۶۷	-۳۱	
ومعادن	سرمایه گذاری	۹۹	-۳۴	
شستا	سرمایه گذاری	۲۰۶	-۳۵	
فولاد	آهن و فولاد	۴۹۵	-۳۸	
هرمز	آهن و فولاد	۳۳	-۳۹	
خودرو	خودرو	۸۲	-۵۰	
فملی	تولید فلزات گرانبهای غیراهن	۴۴۴	-۵۴	
نوری	مواد شیمیایی-متنوع	۱۳۴	-۵۵	
شپنا	پالایش نفت و گاز	۱۸۹	-۵۷	
دی	بانکها و موسسات اعتباری	۱۵	-۱۴۹	



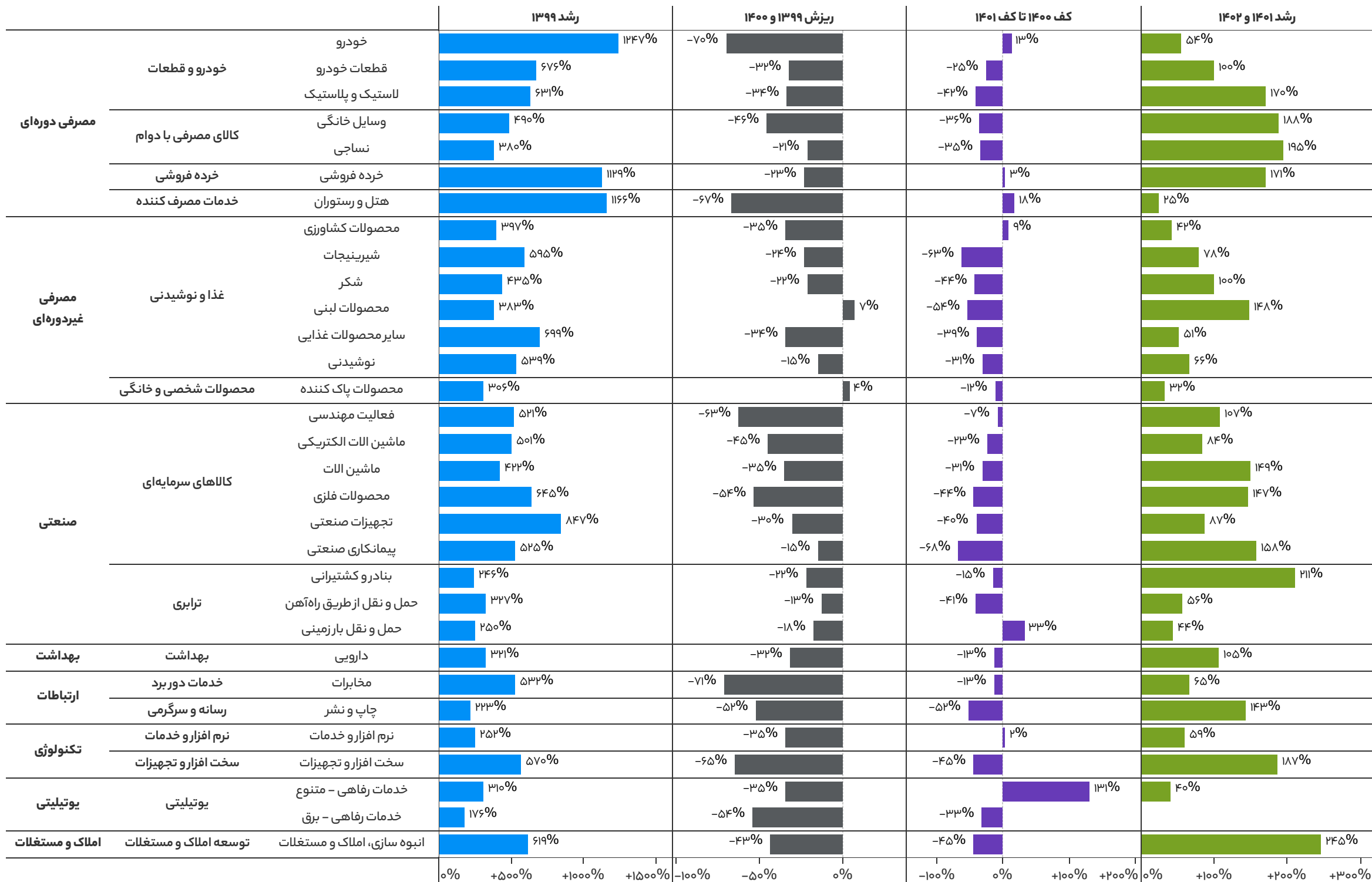
## بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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



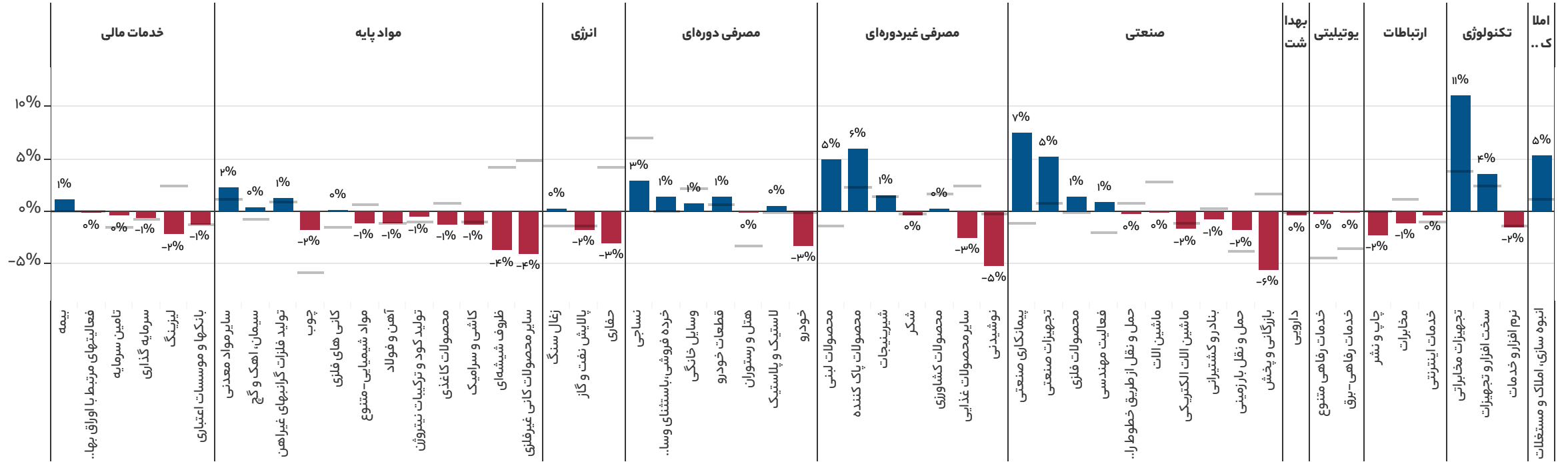


بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)

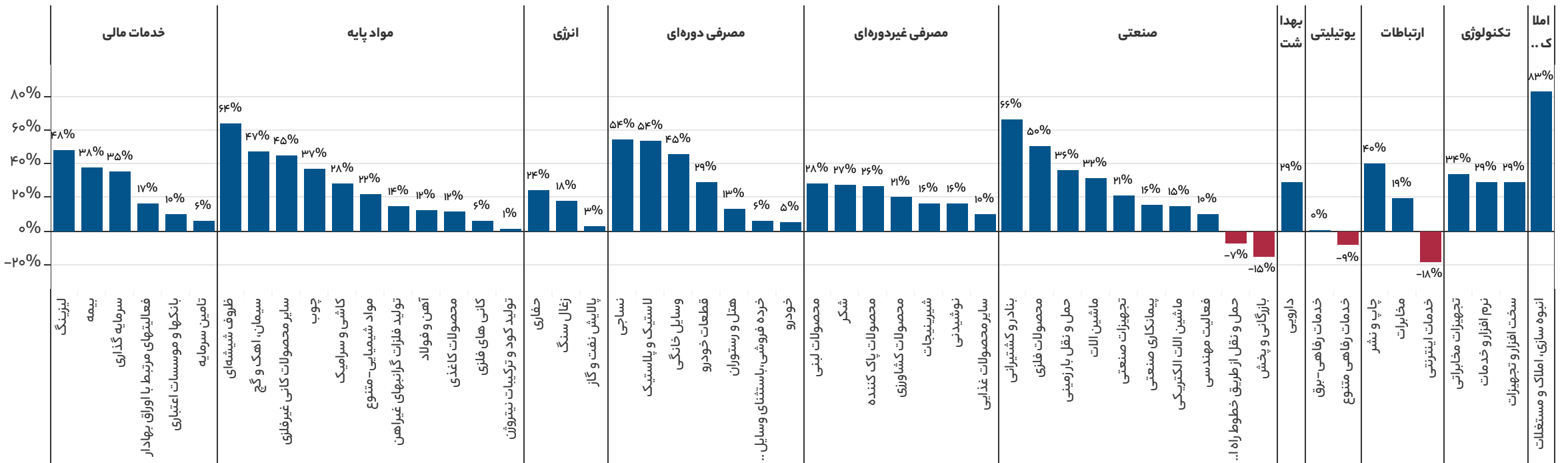




بازدهی صنایع از ابتدای هفته (مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی هفته گزارش با نمودار میله‌ای و بازدهی هفته گذشته با خط‌های خاکستری رنگ نشان داده شده است)

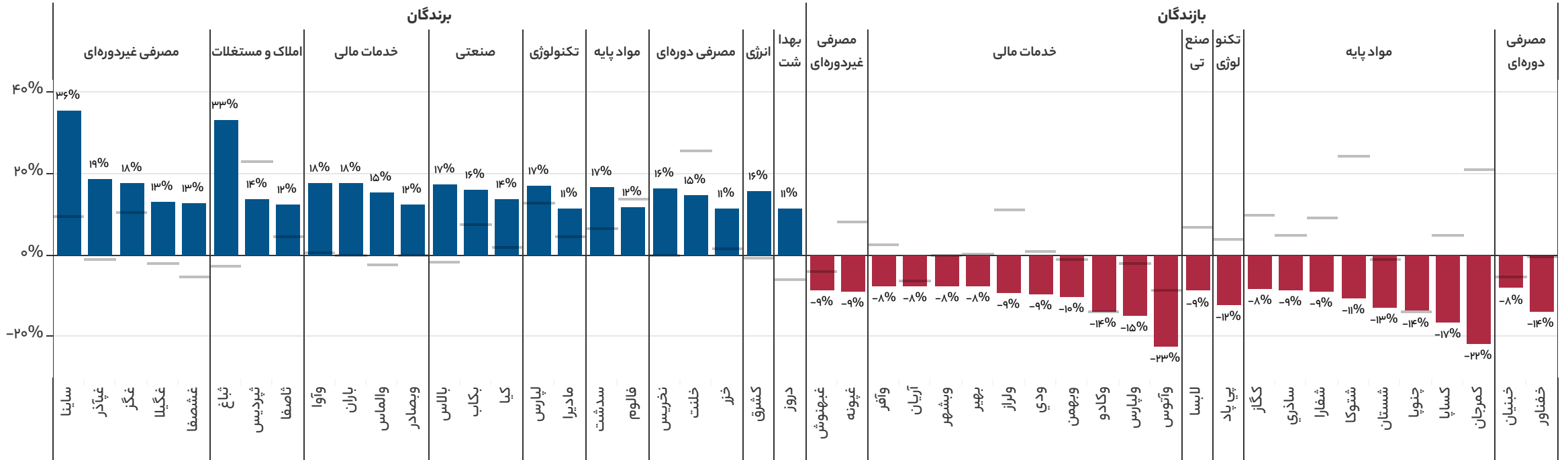


بازدهی صنایع از ابتدای سال (مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

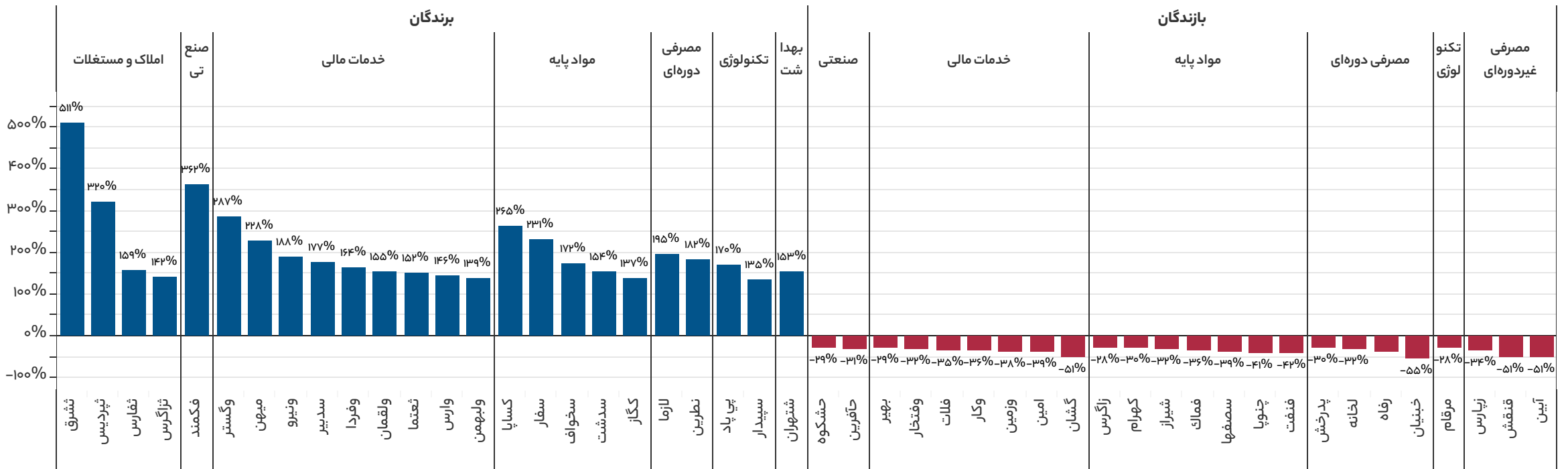




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



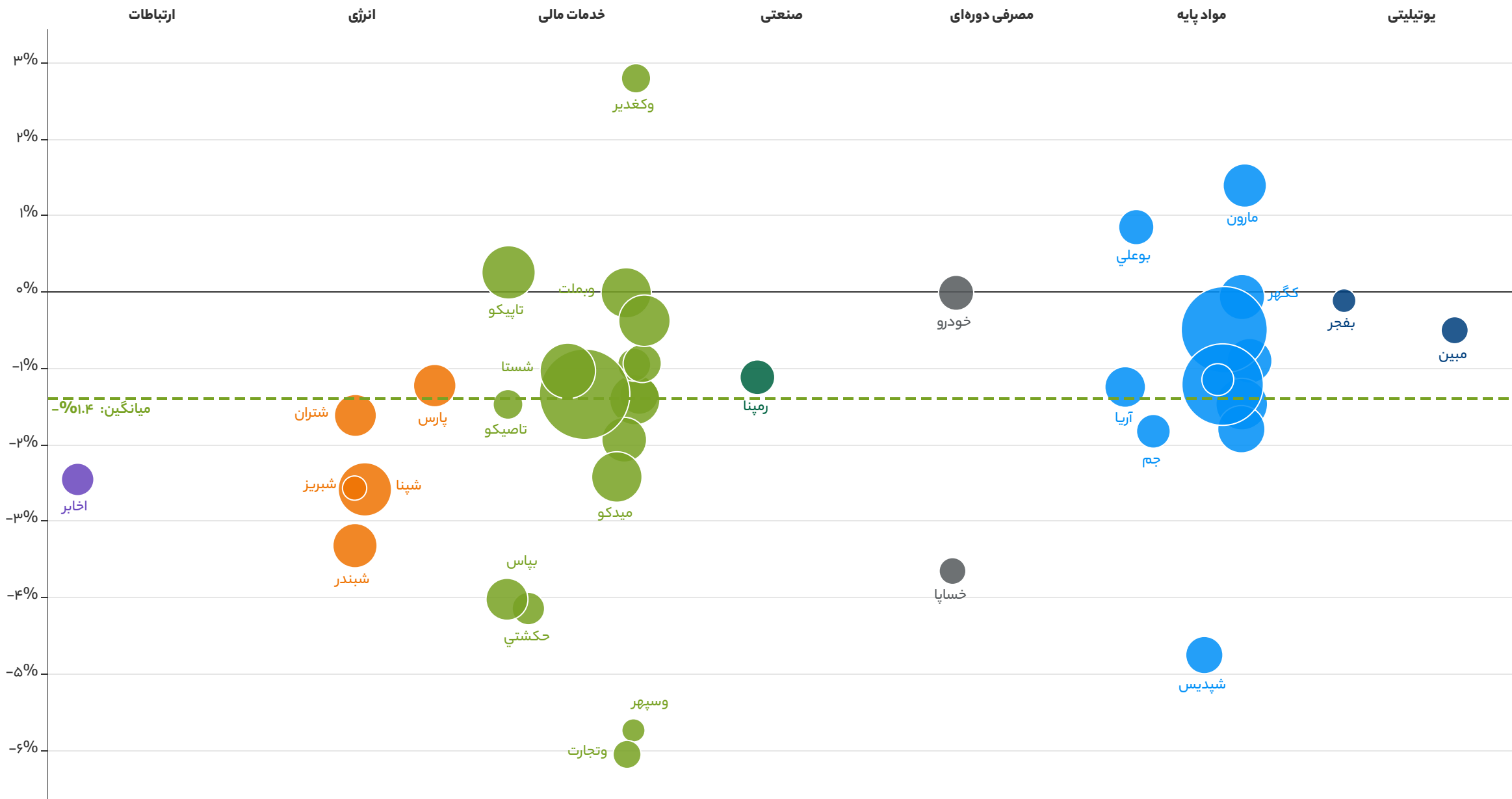
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





## 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

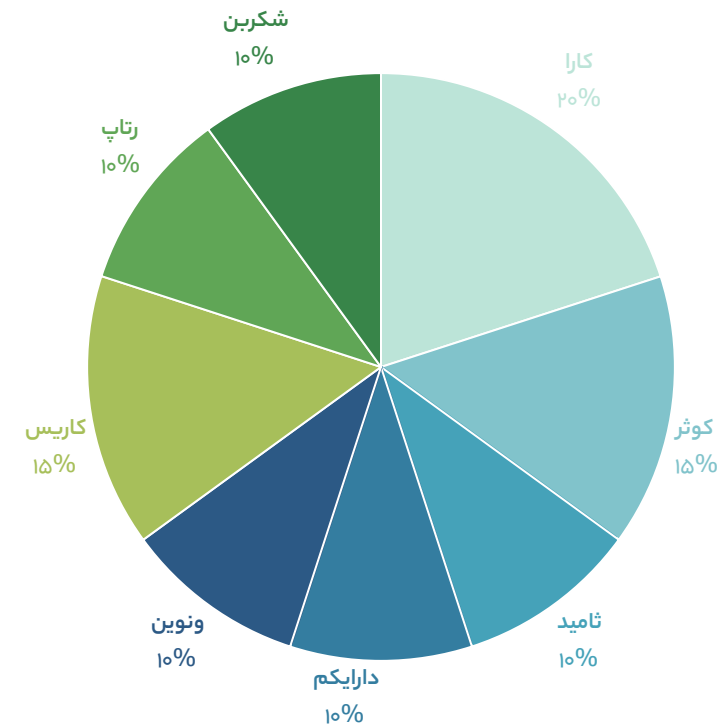


بازده هفته گذشته	وگدیر	مارون	بوعلی	تاپیکو	وبملت	خودرو	کگهر	بفجر	پارسان	فولاد	مبین	نوری	وپاسار	وصندوق	شستا	رمپنا	فخوز	فملي	پارس	آریا	فارس	ومعادن	وغدیر	کگل	تاصیکو	شتران	کچاد	چم	وامید	میدکو	اخابر	شبریز	شپنا	شبندر	خسپا	پاس	حکشتی	شپدیس	وسپهر	وتجارت
+۲.۸%	+۱.۴%	+۰.۹%	+۰.۳%	۰%	۰%	-۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۱%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۵%	-۰.۹%	-۰.۹%	-۰.۹%	-۱.۰%	-۱.۱%	-۱.۱%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۱.۳%	-۱.۳%	-۱.۴%	-۱.۵%	-۱.۵%	-۱.۶%	-۱.۸%	-۱.۸%	-۱.۹%	-۲.۴%	-۲.۴%	-۲.۶%	-۲.۶%	-۳.۳%	-۳.۶%	-۴.۰%	-۴.۱%	-۴.۷%	-۵.۷%	-۶.۰%

## سبد پیشنهادی کاریزما

تهیه شده توسط تیم حرفه‌ای سبدگردانی کاریزما

افق زمانی	نماد	هدف قیمتی	توضیحات	قیمت سهم	وزن پیشنهادی
میان مدت	رتاپ	۴,۱۰۰	تغییر فرمول کارمزد تراکنش‌ها با تاثیر مثبت برای شرکت‌های PSP	۳,۶۵۲	۱۰%
	شکرین	۷,۰۰۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و سود مناسب زیر مجموعه‌ها	۶,۵۰۰	۱۰%
	کاریس	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	۲۳,۱۵۳	۱۵%
بلند مدت	تامید	۳,۲۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب در صنعت	۲,۴۸۳	۱۰%
	دارایکم	۲۳۰,۰۰۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) و پتانسیل رشد	۱۸۱,۴۳۰	۱۰%
	ونوین	۷,۶۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب	۵,۸۷۰	۱۰%
	کوثر	۴,۷۰۰	نسبت قیمت به خالص ارزش دارایی (P/NAV) مناسب و دریافت قراردادهای جدید بیمه‌ای	۳,۶۶۸	۱۵%
	کارا	-	دارا بودن پورتفو بدون ریسک و سود بالاتر نسبت به سایر صندوق‌های درآمد ثابت	۱۶,۵۵۹	۲۰%





# تحليل تکنیکال

TECHNICAL ANALYSIS

TECHNICAL ANALYSIS





Bourseview.com

مهم‌ترین مقاومت در تصویر مشخص شده است (حوالی ۲,۱۶۰ هزار واحد). در صورت عدم تثبیت بالای این مقاومت، انتظار می‌رود اصلاح تا حوالی ۲,۱۲۰ هزار واحد ادامه داشته باشد.

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 عبور از این محدوده مقاومتی، عملکرد شاخص هم‌وزن نسبت به شاخص هم‌وزن به شاخص کل بهتر باشد.

توضیحات تحلیل



BY Bourseview.com

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

توضیحات تحلیل

# اجماع تحلیل‌گران

CONSENSUS ESTIMATES

CONSENSUS ESTIMATES



## معرفی بخش

بخش اجماع تحلیل‌گران کاریزما با تجمیع برآوردهای سود تیم تحلیل‌گری شرکت سیدگردانی 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 تحلیل‌گری 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 تحلیل‌گران 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 هیچ‌گونه اوراق بهادار نبوده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در برابر معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش صورت گیرد، هیچ‌گونه مسئولیتی نمی‌پذیرد.

گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران تر	ارزان 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		
الفین	مارون		۱۲	۱۲۷.۰	+۱%	۱۵,۸۸۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۲	۷.۵	۷.۵	-۲.۰		
	آریا		۱۲	۱۱۰.۱	-۱%	۸,۰۱۰	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۷	۶.۲	۶.۸	-۰.۸		
	جم		۱۲	۷۶.۱	-۲%	۴,۲۲۵	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۶	۴.۰	۴.۴	-۴.۱		
	شگویا		۱۲	۴۱.۸	-	۱,۷۴۴	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۶.۳	۵.۰	۶.۴	+۰.۱		
	جم پیلین		۱۲	۳۶.۰	-۱%	۱۸,۰۱۳	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۳	۴.۶	۵.۷	+۰.۶		
	شکبیر		۱۲	۲۶.۳	-۴%	۷,۲۹۵	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۶	۳.۰	۳.۳	-۸.۲		
	شاراک		۱۲	۲۴.۱	-۱%	۲,۹۹۴	۹۶%	۴۱۹	۲۱۴	۲ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۰	۳.۹	۳.۹	-۱.۹		
	شغدیر		۱۲	۸.۶	-۱%	۶,۵۸۵	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۷	۴.۴	۶.۰	+۰.۱		
	شصبصیر		۱۲	۷.۵	-۱%	۳,۰۱۰	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۵	۳.۸	۴.۵	-۰.۴		
شیمیایی	آروماتیک		۱۲	۱۳۴.۳	-۱%	۱۴,۹۲۶	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۶	۷.۱	۸.۱	+۰.۷		
	بوعلی		۱۲	۸۴.۱	+۱%	۵,۸۶۴	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹.۱	۶.۷	۹.۱	+۴.۱		
	شیراز		۱۲	۳۵.۴	-۲%	۲,۳۱۵	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۴	۵.۲	۶.۰	+۱.۶		
	اوره		۱۲	۲۴.۱	-۳%	۱۳,۴۹۰	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۸.۶	۶.۶	۷.۶	+۲.۹		
متانول	کرماشا		۱۲	۱۸.۷	+۱%	۱,۷۶۹	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۸	۴.۴	۴.۴	+۰.۶		
	زاگرس		۱۲	۳۰.۳	-۴%	۱۲,۶۴۰	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۴	۶.۳	۶.۵	-۲.۳		
	شخارک		۱۲	۲۷.۶	-۱%	۴,۵۹۵	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۷	۴.۸	۵.۷	-۱.۴		
محصولات شیمیایی	شغن		۱۲	۱۶.۷	-۴%	۵۳۸	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۷.۷	۵.۵	۵.۲	-۱.۷		
	شیران		۹	۲۶.۹	-۳%	۴۹۵	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۰	۷.۶	۶.۶	+۰.۱		
دوده صنعتی	شکرین		۱۲	۴.۲	-۱%	۶۵۱	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۷.۵	۵.۸	۶.۲	+۰.۱		
	شصدف		۱۲	۲.۶	-۴%	۳,۶۷۰	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۹.۴	۵.۹	۷.۲	-۱.۵		
	شدوص		۱۲	۲.۵	-	۲,۶۴۲	۹۳%	۱۹۳	۲۲۳	۲ Q	۳۶۷	۴۳۶	+۱۹%	۷.۲	۵.۵	۶.۸	+۰.۶		



گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران تر	ارزان 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		
فولاد	فولاد	فولاد	۱۲	۴۹۵.۲	-	۶۱۹	۵۰%	۸۵	۶۶	۲ Q	۱۲۵	۱۴۰	+۱۲%	۵.۰	۴.۱	۴.۵	+۰.۸		
	فخوز	فخوز	۱۲	۶۷.۸	-۱%	۳۵۷	۴۶%	۳۵	۲۷	۲ Q	۶۵	۱۰۹	+۶۸%	۵.۵	۳.۰	۳.۶	-۳.۴		
	فولاذ	فولاذ	۱۲	۳۸.۹	-۲%	۱,۶۲۰	۷۶%	۱۹۹	۹۱	۲ Q	۱۷۴	۲۵۰	+۴۴%	۹.۳	۶.۱	۷.۳	+۱.۷		
	هرمز	هرمز	۱۲	۳۳.۴	+۱%	۳۹۸	۵۱%	۶۵	۳۲	۲ Q	۶۸	۸۲	+۲۱%	۵.۸	۴.۶	۴.۸	-۰.۸		
	ارفع	ارفع	۱۲	۲۹.۹	-	۲,۴۹۵	۸۶%	۳۱۲	۳۰۹	۲ Q	۵۵۶	۶۴۸	+۱۷%	۴.۵	۳.۳	۴.۱	-۰.۲		
	فخاس	فخاس	۱۲	۲۷.۶	-۱%	۱,۲۰۲	۴۹%	۱۰۰	۱۳۲	۲ Q	۲۴۲	۲۹۱	+۲۱%	۵.۰	۴.۰	۴.۴	-۳.۰		
سنگ آهن	کگل	کگل	۱۲	۱۷۸.۵	-۱%	۵۴۱	۶۵%	۴۹	۱۲	۲ Q	۵۸	۹۴	+۶۱%	۹.۳	۵.۶	۵.۴	-۳.۲		
	کچاد	کچاد	۱۲	۱۴۹.۳	-۲%	۵۵۰	۷۱%	۸۴	۳۹	۲ Q	۸۳	۹۹	+۱۹%	۶.۶	۵.۲	۵.۴	-۰.۵		
	کگهر	کگهر	۹	۱۳۷.۳	-	۱,۸۳۰	۹۲%	۱۵۶	۱۴۸	۳ Q	۱۹۴	۱۶۳	-۱۶%	۹.۵	۱۲.۷	۱۰.۲	+۱.۱		
	کنور	کنور	۱۲	۲۴.۵	-۳%	۱,۹۲۰	۹۴%	۱۴۷	۱۴۴	۲ Q	۲۲۴	۲۸۴	+۲۷%	۸.۶	۶.۱	۸.۱	-۰.۱		
مس	فملی	فملی	۱۲	۴۴۴.۰	-۱%	۷۴۰	۴۵%	۸۳	۵۴	۲ Q	۱۳۴	۱۴۹	+۱۲%	۵.۵	۴.۷	۴.۵	-۰.۵		
	کویر	کویر	۱۲	۱۲.۲	-۱%	۲۳۴	۱۲%	۳۳	۱۵	۲ Q	۳۲	۴۲	+۳۲%	۷.۳	۵.۷	۵.۶	-۰.۷		
فلزات و استخراج مواد پایه	فخر	فخر	۱۲	۶.۸	+۳%	۸۰۴	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۴.۰	۳.۶	۴.۲	+۰.۰		
	فروژ	فروژ	۱۲	۴.۸	-۳%	۴,۳۹۵	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۶.۸	۴.۹	۵.۳			
	فسپا	فسپا	۱۲	۳.۲	-۱%	۸۱۷	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۳۶	-۱۶%	۵.۴	۶.۱	۵.۲	+۰.۴		
	فروس	فروس	۱۲	۲.۷	-۳%	۳۴۰	۶۶%	۴۸	۲۴	۲ Q	۴۹	۶۶	+۳۵%	۶.۹	۴.۹	۵.۴	+۰.۲		
	فروسیل	فروسیل	۱۲	۲.۶	+۱%	۱,۶۴۸	۶۴%	۱۱۵	۵۷	۲ Q	۱۶۷	۲۳۶	+۴۲%	۹.۹	۶.۸	۶.۷	-۸.۰		
	فولای	فولای	۱۲	۰.۸	-۶%	۷۴۶	۲۱%	۵۹	۴۵	۲ Q	۶۹	۷۶	+۱۰%	۱۰.۸	۱۰.۰	۱۱.۲	+۱.۳		
آکومینیوم	فایرا	فایرا	۱۲	۲۸.۷	-۱%	۷۵۵	۳۹%	۷۳	۵۶	۲ Q	۸۶	۱۲۵	+۴۶%	۸.۸	۶.۰	۷.۶	+۱.۸		
طلا	فرز	فرز	۹	۱۳.۷	-۲%	۴,۵۵۵	۳۱۸%	۹۹۶	۶۷	۳ Q	۷۲۹	۷۹۸	+۱۰%	۶.۳	۶.۶	۳.۴	-۱.۴		
سرب و روی	فنوال	فنوال	۱۲	۴.۰	+۷%	۷۸۰	۵۱%	۷۰	۴۱	۲ Q	۶۸	۹۴	+۳۸%	۱۱.۵	۸.۳	۹.۸	+۳.۴		
	کیمیا	کیمیا	۱۲	۱.۹	-	۶۴۴	۴۰%	۱۲۷	۱۲	۲ Q	۹۵	۱۲۱	+۲۸%	۶.۸	۵.۲	۴.۲	-۰.۳		
	فرزین	فرزین	۱۲	۱.۴	-۱%	۴۸۰	۳۶%	۹۳	۲	۲ Q	۱۱۲	۱۷۰	+۵۱%	۴.۳	۲.۶	۲.۳	-۴.۵		
	فتوسا	فتوسا	۱۲	۱.۲	+۶%	۸۰۹	۳۲%	۱۴۹	۳۵	۲ Q	۱۹۵	۲۱۴	+۹%	۴.۱	۳.۵	۲.۸	-۱.۶		
سایر مواد معدنی	کتوسعه	کتوسعه	۹	۲.۴	+۷%	۲,۲۳۰	۹۷%	۱۱۱	۱۱۴	۳ Q	۱۷۴	۲۱۲	+۲۲%	۱۲.۸	۱۲.۱	۹.۵			
سایر کانی‌های فلزی	کمنگنز	کمنگنز	۱۲	۲.۲	-	۱,۵۱۸	۶۴%	۱۱۴	۷۴	۲ Q	۱۸۴	۲۱۸	+۱۹%	۸.۳	۶.۷	۶.۵	-۱.۰		



گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			سود واقعی		گزارش شده	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)	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	ساوه	۱۲	۹.۸	+۲%	۱۵,۰۰۰	۹۵%	۱,۵۸۴	۱,۲۸۲	۲ Q	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۳	۴.۶	۵.۴	+۰.۹		
		سایبک	۱۲	۸.۰	-۳%	۲,۷۱۹	۹۳%	۲۴۹	۲۴۶	۲ Q	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۷.۰	۴.۹	۶.۴	+۲.۲		
		سفار	۱۲	۷.۸	-	۳۳,۴۰۰	۹۵%	۱,۰۳۹	۸۴۰	۲ Q	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۳.۸	۱۷.۶	۲۰.۶	+۱.۴		
		سخوز	۱۲	۶.۷	-۲%	۴,۷۵۰	۹۰%	۷۱۹	۲۸۴	۲ Q	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۸	۳.۳	۳.۴	-۰.۸		
		سمازن	۹	۶.۶	-	۲,۶۶۲	۸۱%	۲۹۰	۲۹۸	۳ Q	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۶.۷	۵.۸	۵.۲	+۱.۸		
		ساروم	۱۲	۴.۷	-۱%	۴,۶۸۹	۹۶%	۵۵۴	۴۵۱	۲ Q	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۹	۳.۸	۴.۹	-۰.۲		
		سهگمت	۱۰	۴.۶	-۱%	۶,۳۱۱	۹۸%	۶۴۸	۷۷۸	۳ Q	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۶.۲	۴.۳	۴.۰	+۰.۲		
		سفانو	۱۲	۴.۰	-۱%	۸,۰۶۰	۹۷%	۱,۱۷۰	۶۹۵	۲ Q	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۸	۳.۲	۳.۶	+۰.۴		
		سرود	۱۲	۳.۷	-۳%	۴,۶۲۰	۹۶%	۴۹۶	۴۷۲	۲ Q	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۳	۳.۹	۴.۷	+۰.۴		
		سصوفی	۱۲	۳.۶	-	۳,۲۳۵	۹۰%	۳۶۸	۳۳۷	۲ Q	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۶.۰	۴.۰	۵.۳	+۰.۷		
		شمال	۹	۳.۰	+۱%	۱,۷۵۵	۸۹%	۱۷۰	۲۱۸	۳ Q	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۶.۵	۵.۱	۴.۹	+۰.۷		
		سبجنو	۱۲	۲.۶	-۲%	۶,۶۶۰	۹۶%	۵۷۳	۵۲۷	۲ Q	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۴	۵.۳	۵.۷	-۰.۴		
		سقاین	۱۲	۲.۲	+۲%	۵۵۸	۹۷%	۳۷	۲۴	۲ Q	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۱.۴	۹.۴	۹.۸	+۰.۵		
		سبهان	۱۲	۲.۲	+۱%	۱۰,۸۷۴	۹۷%	۷۳۶	۷۴۹	۲ Q	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۱	۴.۸	۵.۰	-۰.۳		
		سغرب	۱۲	۲.۱	-۱%	۴,۲۴۲	۹۲%	۳۹۰	۴۱۰	۲ Q	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۵.۰	۳.۳	۴.۰	-۰.۷		
سشاش	۱۲	۲.۰	-	۹,۸۸۰	۹۵%	۱,۱۶۱	۵۷۴	۲ Q	۱,۴۲۴	۱,۹۹۵	+۴۰%	۶.۹	۴.۵	۵.۰	-۰.۶				
سخرز	۱۲	۱.۸	-۱%	۳,۵۸۶	۹۵%	۳۵۸	۲۶۸	۲ Q	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۵	۵.۲	۶.۳	-۰.۱				
کاشی و سرامیک	کحافظ	۱۲	۳.۸	+۲%	۷۳۱	۱۰%	۸۲	۶۱	۲ Q	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۴	۳.۴	۳.۷	-۲.۵			
	کساوه	۱۲	۳.۳	-	۶,۲۰۵	۷۱%	۷۴۷	۲۹۰	۲ Q	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۶.۱	۴.۱	۴.۱	-۱.۹			
	کلوند	۱۲	۱.۸	-۵%	۴,۵۰۵	۹۵%	۵۰۴	۳۸۱	۲ Q	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۶.۰	۴.۵	۵.۱	-۰.۱			
فرآورده‌های نسوز	کپشیر	۱۲	۲.۴	+۱%	۹۷۸	۸۸%	۵۲	۶۰	۲ Q	۱۱۴	۱۰۰	-۱۲%	۸.۶	۹.۱	۸.۷	+۰.۶			



گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران تر	ارزان 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	نمودار امتیاز Z			
انرژی	پالایش نفت	شپنا	۱۲	۱۸۹.۱	-۳%	۸۳۳	۶۳%	۱۷۰	۱۰۱	۲ Q	۱۷۶	۱۶۹	-۴%	۴.۷	۴.۶	۴.۹	+۱.۵				
		شبندر	۱۲	۱۲۹.۵	-۳%	۹۶۴	۷۶%	۳۰۴	۷۷	۲ Q	۲۴۴	۱۵۷	-۳۶%	۳.۹	۵.۴	۳.۶	+۱.۲				
		شتران	۱۲	۱۱۸.۰	-۲%	۴۲۹	۳۱%	۱۰۹	۴۵	۲ Q	۱۰۰	۹۶	-۳%	۴.۳	۴.۱	۳.۹	+۱.۰				
		شبریز	۱۲	۳۸.۹	-۳%	۱,۲۹۶	۷۶%	۳۳۵	۹۳	۲ Q	۲۴۴	۲۴۰	-۲%	۵.۳	۵.۰	۴.۵	-۰.۱				
		شاوان	۱۲	۱۶.۹	-۲%	۲,۱۱۰	۷۳%	۵۵۵	۱۸۳	۲ Q	۵۱۱	۲۱۸	-۵۷%	۴.۱	۸.۶	۴.۵	+۰.۷				
	سوخت‌های نفت، گاز و مصرفی	پالایش گاز	پارس	۱۲	۱۲۰.۰	-۱%	۲۵۲	۸۸%	۳۱	۱۰	۲ Q	۳۵	۴۶	+۳۰%	۷.۱	۵.۱	۴.۹	-۲.۷			
			شسپا	۱۲	۲۷.۴	-۲%	۴۹۰	۶۷%	۷۴	۴۵	۲ Q	۹۴	۱۰۶	+۱۲%	۵.۲	۴.۰	۴.۵	+۰.۰			
		روانکار	شبه‌رن	۱۲	۲۶.۹	-	۲,۲۵۰	۸۹%	۳۳۸	۱۷۷	۲ Q	۳۷۵	۳۶۰	-۴%	۶.۰	۵.۶	۵.۵	+۱.۴			
			شنفت	۱۲	۱۷.۳	-۱%	۸۶۴	۸۲%	۱۰۸	۶۶	۲ Q	۱۰۶	۱۰۳	-۳%	۸.۱	۷.۹	۸.۷	+۰.۵			
			شرانل	۱۲	۱۵.۷	-۲%	۷,۸۶۰	۸۵%	۱,۴۴۱	۵۷۶	۲ Q	۱,۶۸۵	۱,۷۵۸	+۴%	۴.۷	۳.۹	۳.۷	-۰.۳			
زغال سنگ	کپور	۱۲	۲.۲	-۵%	۱,۳۰۰	۵۹%	۱۶۹	۸۳	۲ Q	۲۰۵	۲۶۹	+۳۱%	۶.۳	۴.۶	۴.۷	-۱.۰					
	کطبس	۱۲	۱.۶	-۵%	۲,۰۰۳	۶۲%	۱۹۳	۱۲۲	۲ Q	۳۰۰	۳۳۳	+۱۱%	۶.۷	۵.۶	۵.۴	-۱.۸					
خدمات مالی	خدمات مالی متنوع	تامین سرمایه	امین	۶	۹.۴	-۱%	۵۲۲	۹۴%	۴۷	۲۷	۳ Q	۴۵	۶۵	+۴۶%	۱۱.۷	۸.۷	۷.۰	-۴.۶			
		تتوین	۱۲	۸.۳	-۲%	۲۱۵	۶۳%	۴۸	۱۷	۲ Q	۵۰	۶۱	+۲۳%	۴.۳	۳.۱	۳.۲	-۳.۱				
مواد پایه	محصولات چوبی	محصولات کاغذی	لطیف	۱۲	۱.۶	-	۷,۹۴۵	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	-۲%	۶,۷۸۵	۹۶%	۳۲۲	۱۷۶	۲ Q	۴۰۵	۷۲۷	+۸۰%	۱۶.۸	۹.۲	۱۰.۷	+۰.۱			

# 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		گران تر →	← ارزان 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	Z (فصله)		
بهداشت	دارویی	ددانا	۱۲	۱۲.۲	-۴%	۵,۰۶۵	۷۶%	۴۹۵	۳۳۹	۲ Q	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۵.۹	۴.۳	۴.۵	-۰.۱			
		دلر	۱۲	۸.۰	+۲%	۳,۵۵۰	۹۶%	۳۵۲	۲۶۴	۲ Q	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۷.۲	۶.۶	۷.۰	+۱.۲			
		دپارس	۱۲	۶.۷	-۳%	۷,۰۲۶	۹۸%	۸۰۳	۲۶۴	۲ Q	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۷.۴	۶.۳	۵.۵	+۰.۳			
		دالبر	۱۲	۶.۲	-۶%	۶۵۰	۶۹%	۷۵	۵۰	۲ Q	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۵.۸	۴.۶	۴.۷	-۱.۰			
		دفارا	۱۲	۵.۶	+۱%	۳,۵۳۰	۹۹%	۴۵۲	۱۵۲	۲ Q	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۶.۳	۵.۴	۴.۷	+۰.۳			
		دفرا	۱۲	۵.۵	+۲%	۳,۹۰۶	۷۹%	۳۹۳	۲۰۱	۲ Q	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۸	۶.۵	۶.۳	+۱.۸			
		هجرت	۱۲	۴.۹	+۸%	۳,۰۶۰	۹۵%	۴۰۶	۲۳۶	۲ Q	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۶	۴.۴	۴.۷	-۰.۲			
		دقاضی	۱۲	۴.۳	-۲%	۲,۵۲۵	۹۶%	۲۷۷	۱۷۷	۲ Q	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۷	۵.۱	۵.۵	-۰.۱			
		دتوزیع	۱۲	۴.۰	-۵%	۲,۲۳۵	۹۴%	۴۴۹	۱۰۳	۲ Q	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۶.۷	۵.۰	۴.۸	-۰.۵			
		کاسپین	۱۲	۳.۰	-۲%	۲,۱۲۰	۹۵%	۲۳۴	۱۵۴	۲ Q	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۶.۷	۵.۳	۵.۷	+۰.۳			
		درازک	۱۲	۲.۷	-	۱,۳۰۰	۱۰۴%	۲۱۳	۲۷	۲ Q	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۸	۴.۰	۳.۶	-۰.۳			
		دکپسول	۱۲	۲.۵	-	۸,۴۹۰	۹۲%	۹۲۱	۶۰۳	۲ Q	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۸.۰	۶.۲	۷.۲	+۲.۰			
دراز	۱۲	۲.۰	+۲%	۲,۰۴۶	۶۷%	۲۷۳	۱۱۰	۲ Q	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۵.۹	۵.۱	۴.۵	-۱.۴					





گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران تر	ارزان 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		
غذا و نوشیدنی	زراعت و خدمات وابسته	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	+۱%	۳,۷۱۹	۲۴%	۳۹۱	۳۳۷	۳ Q	۵۴۴	۸۹۸	+۶۵%	۶.۸	۴.۹	۳.۹	-۱.۳		
		زفکا	۱۲	۲.۷	-۳%	۱,۸۱۲	۹۱%	۱۵۵	۱۰۵	۲ Q	۱۸۱	۲۶۵	+۴۷%	۱۰.۰	۶.۵	۸.۱	+۰.۵		
		تلیسه	۱۲	۲.۱	+۴%	۴۳۰	۹۲%	۲۵	۲۹	۲ Q	۳۴	۴۸	+۴۱%	۱۲.۷	۸.۷	۱۳.۷	+۰.۲		
		زشریف	۹	۱.۸	+۴%	۷۲۹	۷۶%	۴۸	۵۸	۳ Q	۷۹	۱۱۱	+۴۰%	۹.۲	۷.۵	۶.۵	-۰.۳		
		زگلدشت	۱۲	۱.۸	-	۲,۵۰۰	۹۵%	۹۶	۱۱۰	۲ Q	۲۱۸	۲۸۵	+۳۱%	۱۱.۵	۸.۴	۹.۳	+۰.۰		
	شیرینیجات	زملارد	۱۲	۱.۶	-۳%	۲,۰۶۰	۹۴%	۳۳	۶۳	۲ Q	۱۴۶	۱۷۹	+۲۳%	۱۴.۱	۱۱.۲	۱۱.۱	-۲.۶		
		زשگزا	۱۲	۱.۰	-۲%	۱,۰۱۷	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۹.۳	۵.۳	۸.۳	+۰.۳		
		غصینو	۱۲	۱۴.۲	-۳%	۱,۴۲۴	۶۰%	۱۶۱	۷۴	۲ Q	۲۲۶	۳۱۲	+۳۸%	۶.۳	۴.۲	۴.۳	-۲.۱		
		غپینو	۱۲	۳.۶	-۱%	۴۰۵	۵۶%	۴۹	۲۵	۲ Q	۶۷	۹۴	+۳۹%	۶.۰	۴.۱	۴.۲	-۱.۰		
محصولات لبنی	غسالم	۱۲	۲.۰	+۱%	۴۵۴	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۶۵	۸۱	+۲۵%	۷.۰	۵.۶	۴.۸	-۰.۹			
	غمینو	۱۲	۱.۵	-	۱,۰۰۹	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۶.۱	۳.۹	۴.۲	-۰.۳			
	غگورش	۱۲	۱۵.۱	+۴%	۷۵۶	۵۴%	۱۲۶	۴۰	۲ Q	۸۳	۸۶	+۳%	۹.۱	۸.۶	۸.۱	+۰.۴			
	غگلپا	۱۲	۱.۵	+۲%	۴,۱۶۵	۷۴%	۴۶۵	۲۲۳	۲ Q	۵۸۸	۸۴۶	+۴۴%	۷.۱	۴.۸	۴.۹	-۰.۶			
محصولات پاک کننده	غشان	۱۲	۱.۳	+۴%	۷۳۴	۷۱%	۸۰	۲۶	۲ Q	۸۲	۱۱۳	+۳۷%	۸.۹	۶.۴	۶.۱	-۰.۳			
	غگلستا	۱۲	۱.۲	-۱%	۱,۹۲۴	۷۰%	۱۵۶	۴۹	۲ Q	۲۰۷			۹.۳						
	کیمیاتک	۱۲	۶.۹	-۱%	۱,۱۴۹	۶۴%	۱۰۲	۷۱	۲ Q	۱۴۵	۱۶۷	+۱۶%	۷.۹	۶.۶	۶.۸	+۰.۵			
محصولات شخصی و خانگی	قرن	۱۲	۶.۶	-	۱,۰۹۳	۶۱%	۱۱۰	۶۲	۲ Q	۱۴۳	۲۰۰	+۴۰%	۷.۷	۵.۳	۵.۶	-۰.۷			
	شپاکسا	۹	۲.۵	-۲%	۲۷۳	۳۸%	-۲۴	۲۳	۳ Q	۴۶	۶۱	+۳۲%	۵.۹	۵.۵	۳.۷	-۳.۴			

مصرفی غیردوره‌ای

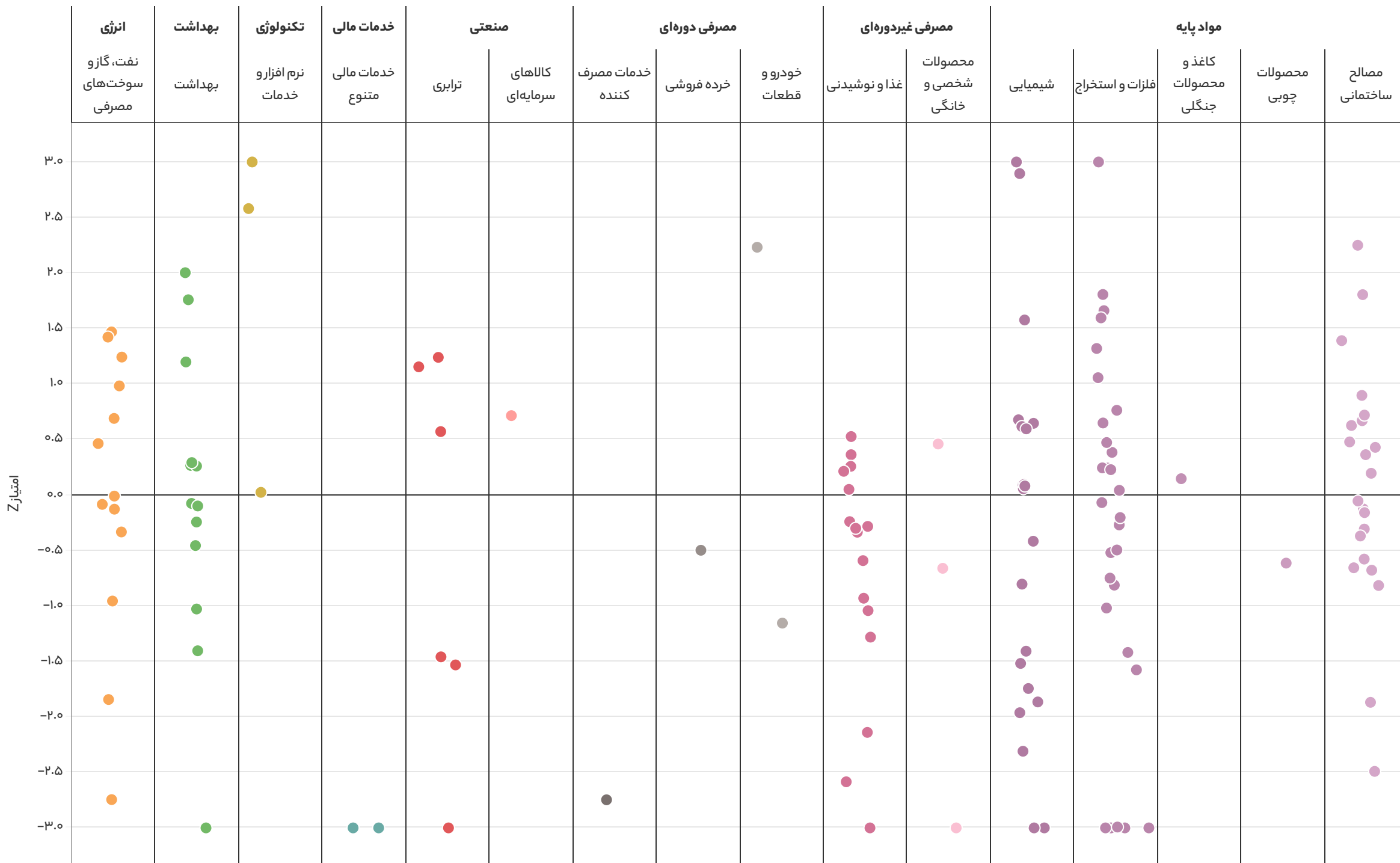


گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			تقسیم سود	سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران تر
				ارزش بازار (همت)	بازده هفتگی	قیمت (تومان)		۱۴۰۱ (کل سال)	۱۴۰۲ (تاکنون)		سود ۱۴۰۲	سود ۱۴۰۳	رشد سود ۱۴۰۳	با سود ۱۴۰۲	با سود ۱۴۰۳	آینده نگر ۴ فصله	آینده نگر ۴ فصله	ارزان تر	
صنعتی	بنادر و کشتیرانی	حزر	۱۲	۶.۸	-۲%	۱,۸۹۶	۹۶%	۲۰۷	۱۹۸	۲ Q	۲۸۹	۴۱۷	+۴۵%	۶.۶	۴.۱	۵.۹	+۰.۶		
		حتاید	۱۲	۶.۴	-	۵۳۲	۵۲%	۶۲	۴۳	۲ Q	۱۰۸	۱۳۷	+۲۷%	۴.۹	۳.۷	۳.۷	-۱.۵		
	ترابری	توریل	۱۲	۴.۰	-	۵۷۲	۳۸%	۴۳	۱۸	۲ Q	۶۷	۸۶	+۲۹%	۸.۶	۶.۶	۵.۸	-۱.۵		
	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	حآفرین	۱۲	۱.۹	+۳%	۲۵۳	۵۲%	۳۱	۱۳	۲ Q	۴۱	۴۸	+۱۶%	۶.۱	۵.۴	۴.۵	-۵.۹		
	چپارسا	۶	۱.۶	+۴%	۶,۵۰۵	۸۹%	۶۳۱	۵۱۲	۳ Q	۷۱۷	۹۰۱	+۲۶%	۹.۱	۷.۷	۶.۵	+۱.۲			
کالاهای سرمایه‌ای	محصولات فلزی	چدن	۱۲	۳.۶	-	۲۵۶	۳۱%	۲۶	۱۵	۲ Q	۲۰	۳۰	+۴۶%	۱۲.۶	۸.۷	۱۱.۹	+۰.۷		
	سیم و کابل	بکابل	۱۲	۲.۹	-۲%	۲,۸۰۰	۶۱%	۲۵۰	۱۲۷	۲ Q	۴۴۲	۵۴۷	+۲۴%	۶.۳	۴.۹	۴.۴			
مصرفی دورهای	خودرو و قطعات	تایرو تیوپ	۹	۴.۹	-	۷۵۶	۷۵%	۲۵	۶۳	۳ Q	۸۶	۱۷۴	+۱۰۲%	۸.۸	۴.۶	۴.۶	-۱.۲		
		پلاستیک	۱۲	۰.۸	+۴%	۳,۷۱۵	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۷.۳	۱۷.۱	۲۰.۶	+۲.۲		
	خرده فروشی	چندرشته‌ای	قاسم	۱۲	۴.۰	+۳%	۷۹۹	۴۹%	۱۰۳	۴۷	۲ Q	۱۳۵	۱۷۱	+۲۷%	۵.۹	۴.۴	۴.۳	-۰.۵	
تکنولوژی	نرم افزار و خدمات	رافزا	۱۲	۱.۶	+۳%	۱,۶۲۴	۸۰%	۹۱	۹۹	۲ Q	۱۴۱	۱۷۲	+۲۲%	۱۱.۵	۹.۴	۱۱.۸	+۰.۰		



## مقایسه ارزشیابی شرکتها

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



## ارتباط با ما

فکس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶  
شماره تماس: ۰۲۱-۴۱۴۲۶  
تارنمای گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: [www.charisma.ir](http://www.charisma.ir)  
شناسه کانال تلگرام گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما: [@CharismaHolding](https://t.me/CharismaHolding)

پست الکترونیکی: [info@ciaco.ir](mailto:info@ciaco.ir)  
تارنمای شرکت مشاور سرمایه گذاری کاریزما: [www.ciaco.ir](http://www.ciaco.ir)  
شناسه کانال تلگرام گزارشات کاریزماتیک: [@CharismaTickReports](https://t.me/CharismaTickReports)  
تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، کوچه حکیم اعظم، پلاک ۱۷

