

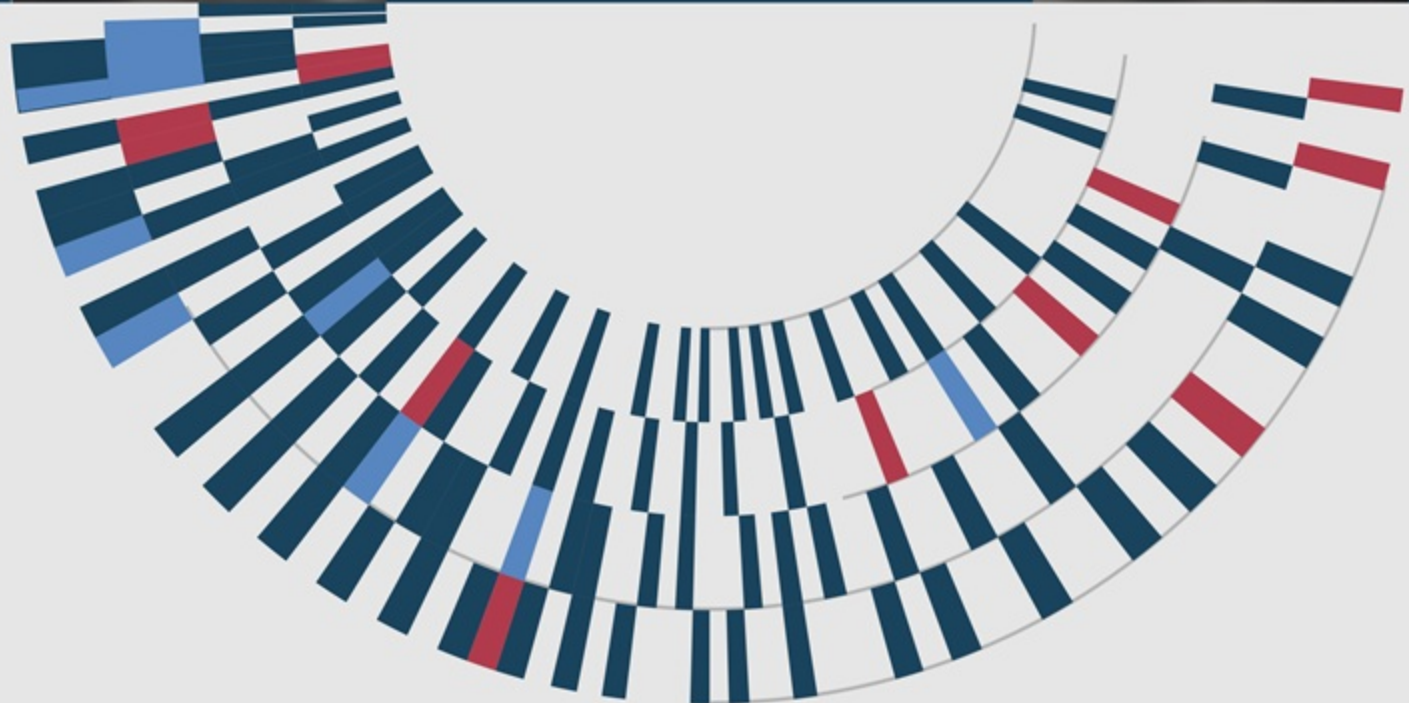


# کاریزماتیک

CHARISMATICK

## گزارش بازار سرمایه

شماره ۳۱ | هفته منتهی به ۱۴۰۲/۱۰/۰۸





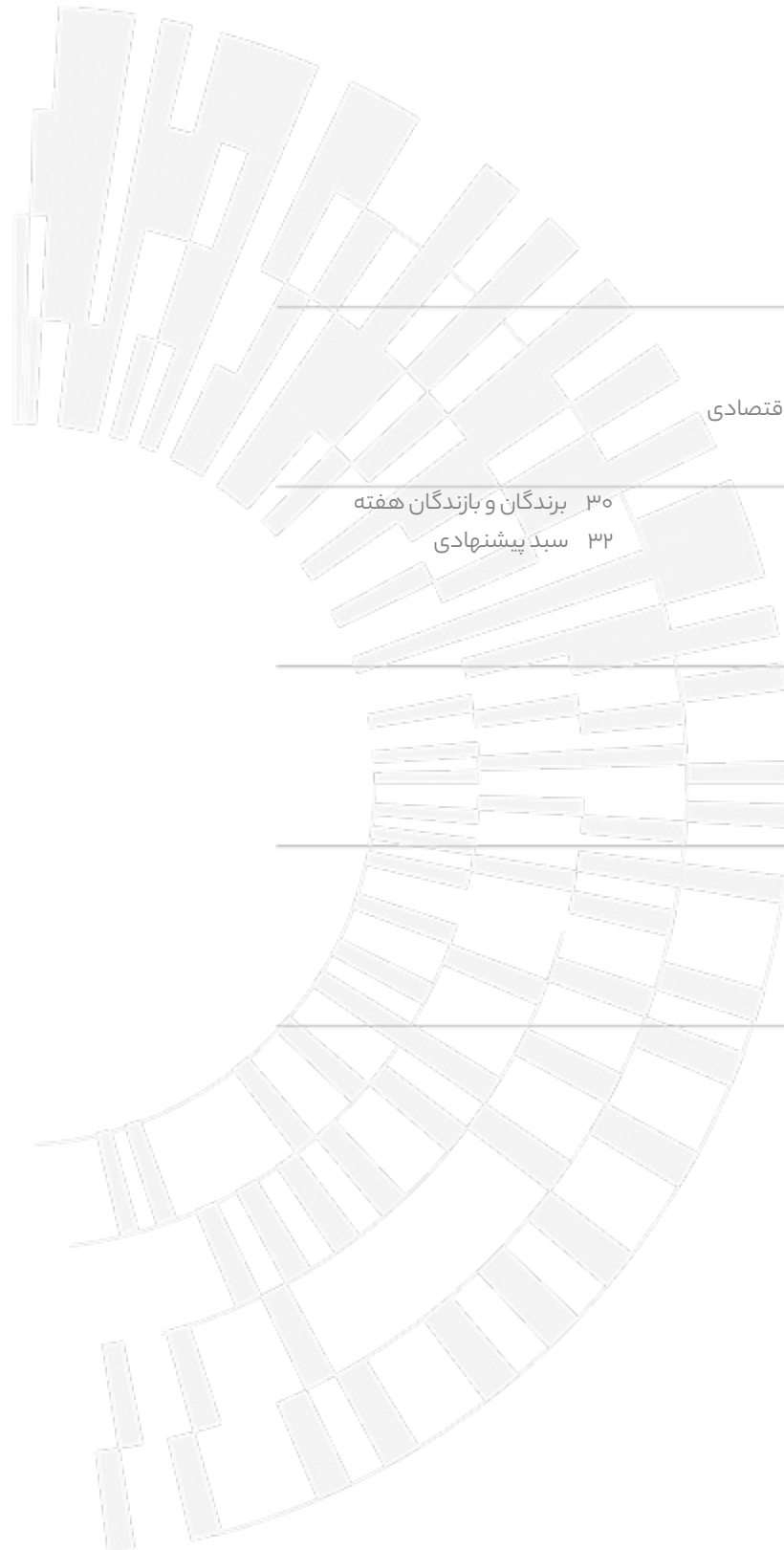
## معرفی گزارش:

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	۲,۰۶۶	۱.۱%	فزر	-	۱,۸۱۳ - ۲,۰۶۹	۱۱%
مس	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۸,۶۲۱	۰.۵%	فملی	بموتو، فباهنر	۷,۹۴۳ - ۹,۳۴۱	۵%
آلومینیوم	کامکس	دلار/تن	۲,۳۴۴	۱.۲%	فایرا	فنوال	۲,۰۷۱ - ۲,۴۲۴	۳%
روی	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۶۳۴	۱.۱%	فاسمین، فسرب، فروی، فرآور، فزین، کیمیا، فگستر، فتوسا، زنگان، کبافق، کاما	فمراد	۲,۳۵۳ - ۳,۴۴۴	-۱۳%
سرب	بورس فلزات لندن	دلار/تن	۲,۰۸۶	۰.۵%	فاسمین، فسرب، فروی، فزین، کیمیا، فتوسا، کبافق، کاما	-	۲,۰۲۴ - ۲,۲۹۶	-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	۳,۰۲۲ - ۴,۸۴۳	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	۲,۷۶۶ - ۳,۶۲۵	۲۷%
شمش - منطقه CIS	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۵۰۸	-۰.۲%	فخور، کاوه، فخاس، ذوب، فولاز، ارفع، فسازان	کویر، فوکا، فنورد	۴۳۱ - ۶۲۳	-۲%
شمش - فولاد خوزستان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۱۸۰	۱.۷%	فخور، 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، فخور، هرمز	-	۴۴۸ - ۶۷۰	۱۴%
اسلب - فولاد هرمزگان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۹,۸۲۰	-	فولاد، فخور، هرمز	-	۱۶,۶۹۰ - ۲۲,۰۸۰	۱۲%
میلگرد	بنادر ترکیه FOB	دلار/تن	۶۰۵	-۰.۴%	ذوب، کویر	فولای	۵۴۶ - ۷۵۵	-۱۳%
میلگرد - ذوب آهن اصفهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۱,۱۴۳	۰.۶%	ذوب، کویر	فولای	۱۷,۴۲۳ - ۲۴,۷۴۷	۲۱%
ورق گرم	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۰۰	-	فولاد، فوکا، فنورد	فجر، فسپا	۵۵۵ - ۷۸۰	۹%
ورق سرد	دریای سیاه FOB	دلار/تن	۶۹۰	-	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	۳۲۰	۱.۶%	شپدیس، خراسان، شیراز، کرماشاه	شاروم، سفارس	۲۸۵ - ۴۶۵	-۳۱%
متانول	چین CFR	دلار/تن	۲۹۳	-	زاگرس، شخارک، شفن، شیراز	شفسارس، شسینا	۲۳۵ - ۳۲۵	-۶%
اتیلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۸۵۰	-	مارون، آریا، جم، شکبیر، شاراک	شغدیر، جم پیلن	۷۳۰ - ۹۷۹	-۳%
پلی اتیلن سبک	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۹۶۱	-	آریا، شکبیر	-	۸۷۵ - ۱,۰۸۰	-۷%
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	-۲%
مونواتیلن گلایکول	چین CFR	دلار/تن	۵۳۰	-	مارون، شاراک	شگویا، شپلی	۴۵۰ - ۵۳۲	۸%
PET	جنوب شرق آسیا FOB	دلار/تن	۹۴۰	-	شگویا	-	۹۳۰ - ۱,۰۹۹	-۳%
پروپیلن	چین CFR	دلار/تن	۸۴۵	-	جم، شکبیر	جم پیلن	۷۳۵ - ۹۹۴	-۵%
پلی پروپیلن	خلیج فارس FOB	دلار/تن	۸۶۲	-	جم پیلن، مارون، شاراک	-	۸۰۰ - ۹۵۱	-۳%
پارازایلن	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۰۲۱	-	شصفها، نوری	شگویا، شپلی	۹۳۸ - ۱,۱۵۸	۹%
ارتوزایلن	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	-	شصفها، نوری	-	۹۴۰ - ۱,۱۷۹	-۴%
استایرن	چین CFR	دلار/تن	۱,۰۴۹	-	پارس	شجم، شبصیر	۸۷۸ - ۱,۱۶۸	۵%
بنزن	چین CFR	دلار/تن	۹۱۰	-	نوری، بوعلی، شصفها	شیران	۷۵۲ - ۱,۰۳۷	۵%
تولوئن	چین CFR	دلار/تن	۶,۷۹۰	-	بوعلی	-	۶,۳۹۹ - ۸,۳۵۵	۶%
بوتادین	چین CFR	دلار/تن	۹۵۰	-	جم، شکبیر، شاراک	شجم	۶۴۰ - ۱,۲۳۹	۹%
PVC	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۷۴۰	-	شغدیر، ارون، آبادان، پتروشیمی بندر امام	-	۷۴۰ - ۹۱۴	-۱۶%
ABS	جنوب شرق آسیا CFR	دلار/تن	۱,۲۴۵	-	شبصیر	-	۱,۲۳۰ - ۱,۴۱۹	-۶%

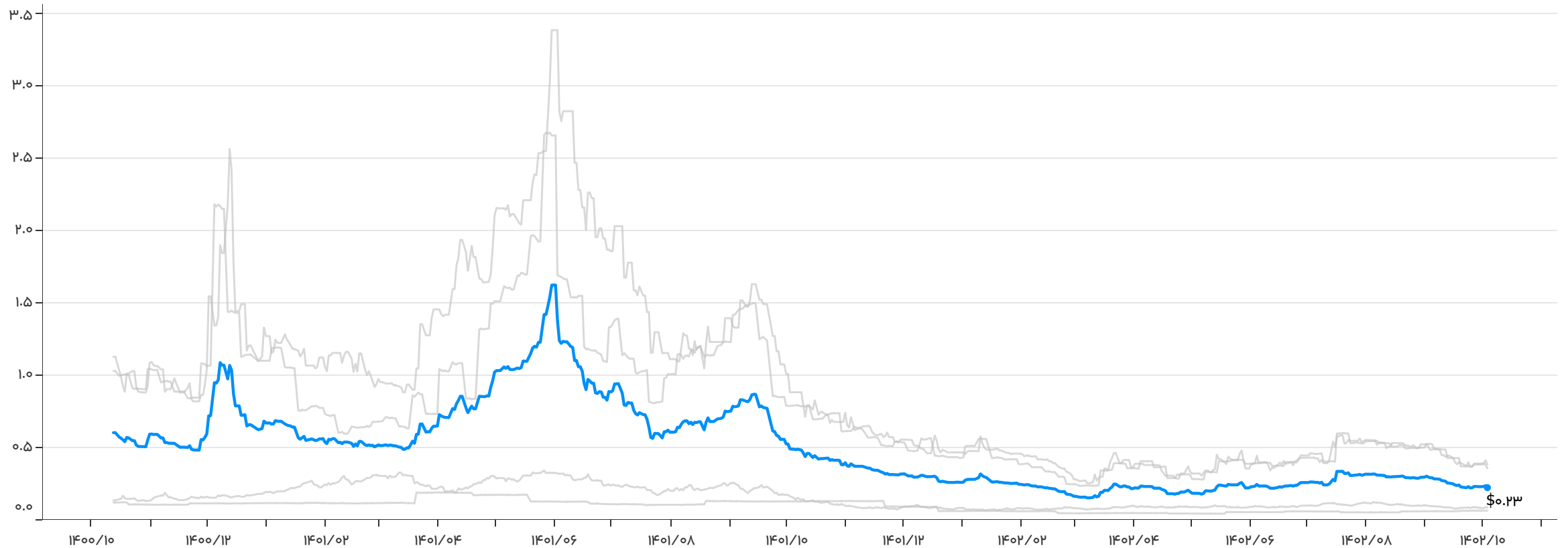


عنوان	مرجع قیمتی	واحد	آخرین قیمت	تغییر نسبت به هفته گذشته	تاثیر در فروش	تاثیر در بهای تمام شده	بازه قیمتی سالانه به همراه تغییر قیمت طی دوره	روند قیمتی ۱۲ ماهه	
انرژی و فرآورده های نفتی	نفت برنت	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۷	-۲.۷%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۷۲ - ۹۴	-۲%
	نفت WTI	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۷۱	-۳.۰%	-	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	۶۶ - ۹۱	-۳%
	نفت کوره	بورس کالای نیویورک	دلار/بشکه	۱۰۷	-۴.۵%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۹۷ - ۱۴۶	-۱۵%
	گازوئیل کم سولفور	بورس بین المللی اروپا	دلار/بشکه	۱۰۱	-۳.۴%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	-	۸۹ - ۱۳۴	-۱۴%
	لوب کات - پالایش نفت تهران	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۷,۰۸۷	-۵.۹%	شپنا، شتران، شبندر، شبریز، شرارز، شاولان	شبهرن، شسپا، شنفت، شرانل	۱۰,۳۰۳ - ۲۱,۶۳۴	۶۶%
	روغن پایه - نفت سپاهان	بورس کالای ایران	تومان/تن	۲۷,۴۱۱	۱.۴%	شبهرن، شسپا، شنفت، شرانل	-	۲۱,۷۹۵ - ۴۱,۳۶۵	۷%
	قیر - نفت پاسارگاد	بورس کالای ایران	تومان/تن	۱۲,۶۰۹	-۱.۱%	شپاس	-	۱۱,۲۸۱ - ۱۷,۱۴۰	۱۳%
محصولات کشاورزی	ذرت آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۱۸۷	۰.۳%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۱۸۳ - ۲۶۹	-۲۷%
	روغن پالم خام	بورس مالزی	دلار/تن	۸۰۴	۰.۱%	-	غکورش، غبشهر، غمارگ، بهپاک، غبهار	۷۲۸ - ۹۶۸	-۱۳%
	شکر آمریکا	بورس کالای نیویورک	دلار/تن	۱,۲۲۶	-۱.۱%	-	-	۱,۱۹۷ - ۱,۷۱۶	-۷%
	گندم آمریکا	بورس کالای چیکاگو	دلار/تن	۲۳۲	۲.۶%	-	-	۱۹۹ - ۲۹۰	-۱۵%
ارز و ارز دیجیتال	یورو به دلار	بازار فارکس	-	۱.۱۰	۰.۳%	-	-	۱.۰۵ - ۱.۱۲	۴%
	پوند به دلار	بازار فارکس	-	۱.۲۸	۰.۴%	-	-	۱.۲۰ - ۱.۳۱	۵%
	بیتکوین	بایننس	دلار	۴۲,۰۷۴	-۳.۸%	-	-	۱۶,۹۶۵ - ۴۴,۰۳۹	۱۴.۸%

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

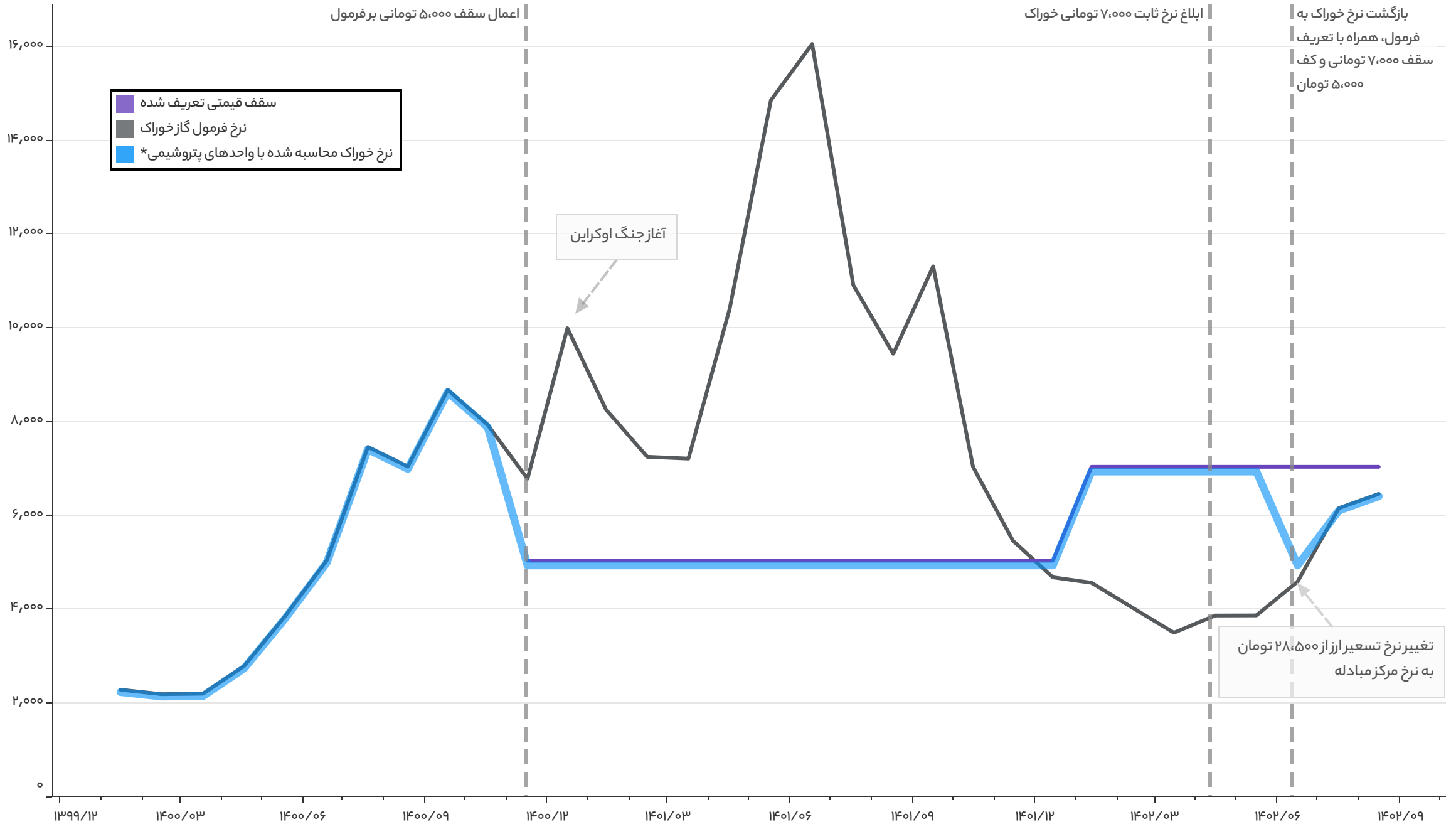






## فرمول گاز خوراک و سقف قیمتی

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 متعاقبا 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 می‌گردد.



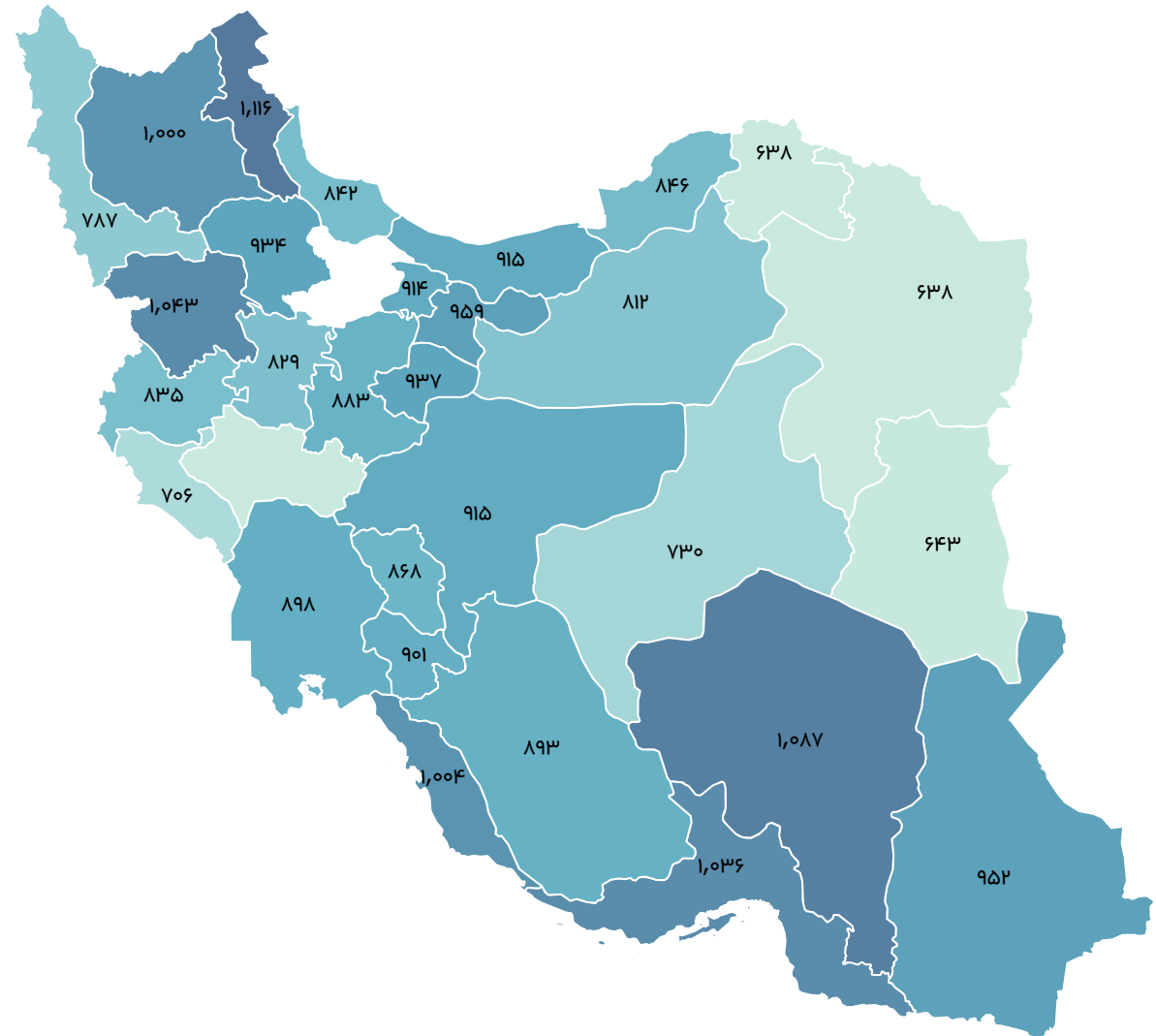
### آخرین وضعیت قیمت سیمان در بورس کالا

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 آبیک	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 سیمان..	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		
	کردستان	سیمان کردستان	۹۳۷	۱,۰۴۳	+۱۱.۳%
	اردبیل	سیمان آرتا اردبیل	۱,۰۶۵	۱,۱۱۶	+۴.۸%
شمال غرب	آذربایجان غربی	سیمان ارومیه	۸۲۴	۷۸۷	-۴.۵%
جنوب	آذربایجان شرقی	کارخانجات سیمان صوفیان	۹۳۹	۱,۰۰۰	+۶.۵%
	زنجان	سیمان خمسه	۹۳۴	۹۳۴	-
	هرمزگان	سیمان هرمزگان	۹۷۷	۱,۰۳۶	+۶.۱%
	فارس	سیمان داراب	۸۹۳	۸۹۳	-
شمال	بوشهر	سیمان مند دشتی	۹۹۷	۱,۰۰۴	+۰.۸%
	مازندران	سیمان مازندران	۹۱۵	۹۱۵	-
	گیلان	سیمان خزر	۷۵۸	۸۴۲	+۱۱.۰%
شمال شرق	گلستان	سیمان پیوند گلستان	۹۱۰	۸۴۶	-۷.۰%
	خراسان شمالی	سیمان بجنورد	۶۳۸	۶۳۸	-
	خراسان رضوی	سیمان شرق	۶۴۹	۶۳۸	-۱.۷%
جنوب شرق	خراسان جنوبی	شرکت سیمان قاین	۶۴۲	۶۴۳	+۰.۱%
	کرمان	سیمان ممتازان کرمان	۹۵۹	۱,۰۸۷	+۱۳.۴%
جنوب شرق	سیستان و بلوچستان	سیمان خاش	۹۸۴	۹۵۲	-۳.۳%

### قیمت منطقه‌ای سیمان\* در هفته گزارش

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



\* قیمت سیمان بر اساس سیمان تپ ۲ قله‌ای 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 خزانه‌داری 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 می‌برد. این عوامل سبب شد طی هفته گذشته قیمت طلا به بالاتر از ۲۰۷۵ دلار برسد.
- ✓

سیدمحمدهادی سبحانین، رئیس سازمان امور مالیاتی درخصوص اخبار مبنی بر افزایش مالیات بر پلافروشان از اول دی ماه که در فضای مجازی دست به دست می‌شود، گفت: هیچ مالیات جدید یا افزایش نرخ در حوزه مالیات‌ستانی از صنف طلا وضع نشده و اصل طلا و جواهر و پلاتین به کاررفته 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 می‌رسد. آنگولا که از سال ۲۰۰۷ به اوپک پیوسته بود، روزانه ۱.۱ میلیون بشکه نفت تولید می‌کند؛ 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 سه‌شنبه 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 می‌شود، از عوامل افزایش قیمت نفت بوده است. اما دورنمای طولانی شدن جنگ غزه و گسترش این درگیری به کشتی‌ها در دریای سرخ همچنان بر بازار تاثیر می‌گذارد. 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 بشکه‌ای دوران دونالد ترامپ است که در اوایل سال ۲۰۲۰ درست قبل از بحران کرونا باعث سقوط تولید و قیمت‌ها شد.
- ▲

شرکت تحلیل بازار CMI در تازه‌ترین گزارش خود از پیش‌بینی 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 متانول‌های تجدیدپذیر به عنوان مدرن‌ترین سوخت ممکن در پیش روی صنایع مهمی چون برق، حمل‌ونقل، مواد شیمیایی و تولید برق سبز جهان محسوب می‌شوند، 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 رضوانی‌فر، 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 در خصوص 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 قیمت‌های 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 فرآورده‌های 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.
- ✓

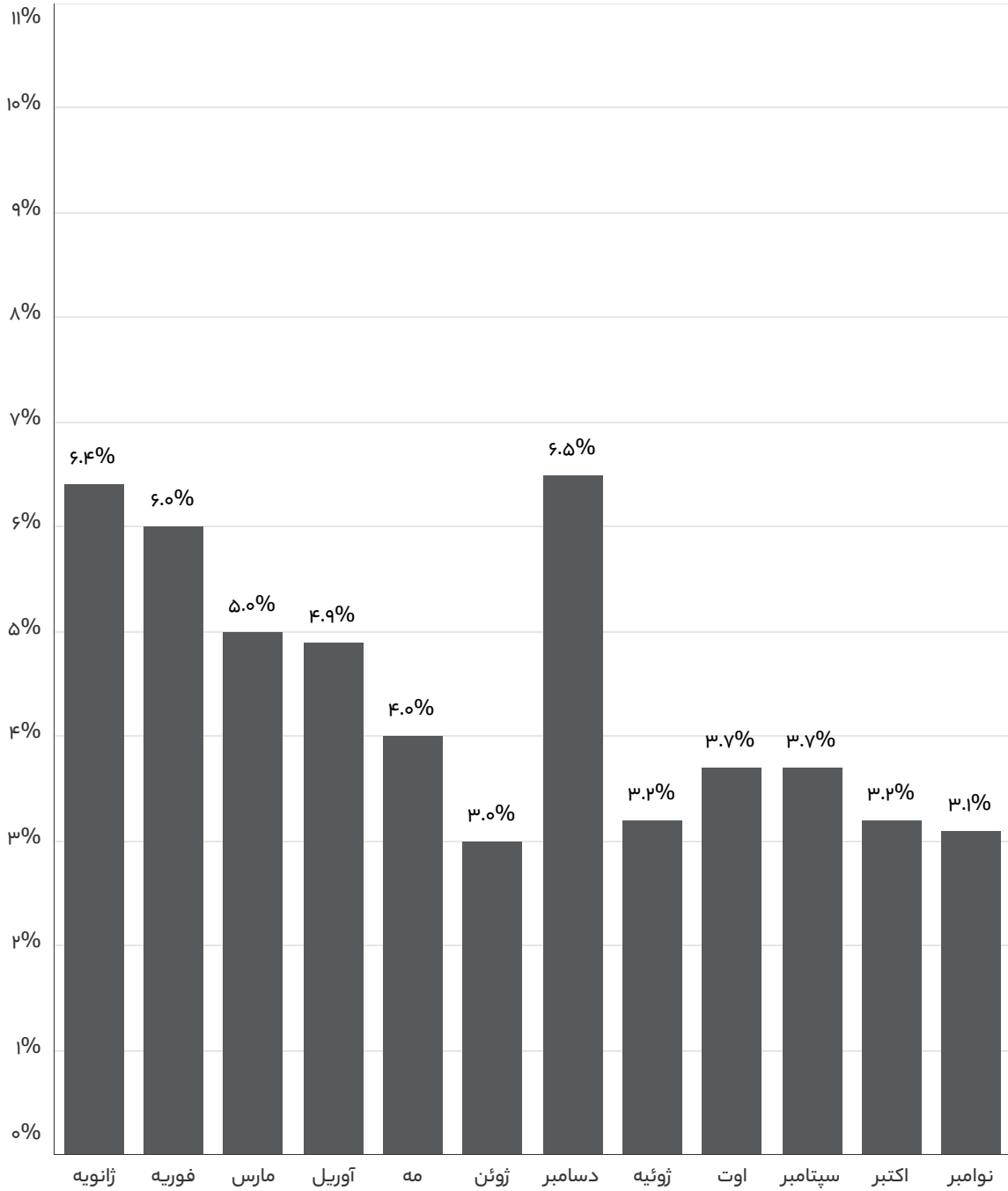
طبق بررسی‌های خبرنگار اقتصادی خبرگزاری فارس، عدم تحقق ۴۵ درصدی درآمد نفتی ناشی از دو نکته است. از یک سو در قانون بودجه ۱۴۰۲، دولت در ابتدا قیمت هر بشکه نفت را ۷۰ دلار برآورد کرده بود که بعد از دخالت مجلس و افزایش ردیف هزینه‌ها، قیمت نفت به رقم ۸۵ دلار بیش برآورد شد. از سوی دیگر، با توجه به تعیین سهمیه نفت برای «نیروهای مسلح» و «تهاتر نفت در پروژه‌های 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. درحالی‌که 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

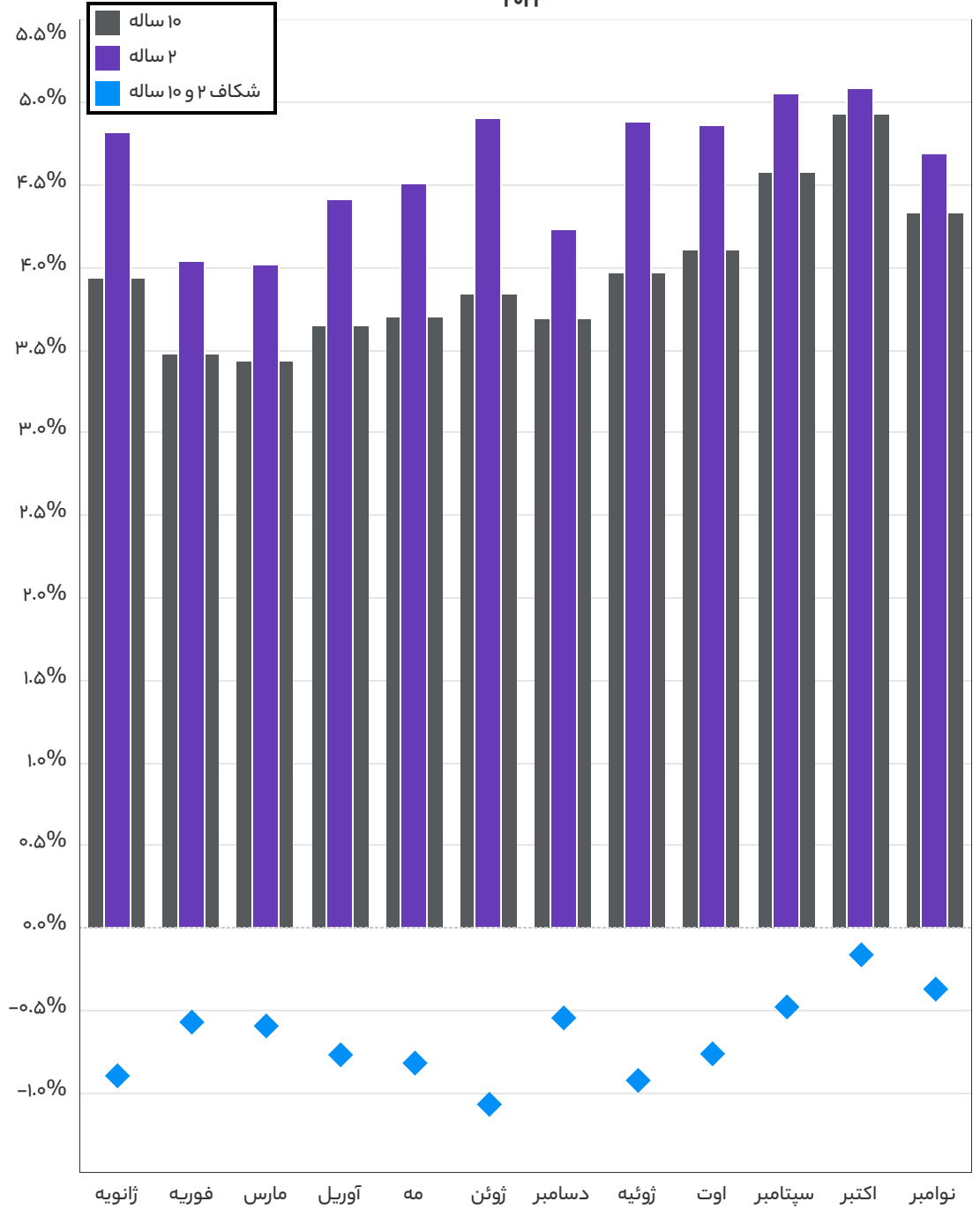
۲۰۲۳



### وضعیت بازده اسناد خزانه آمریکا

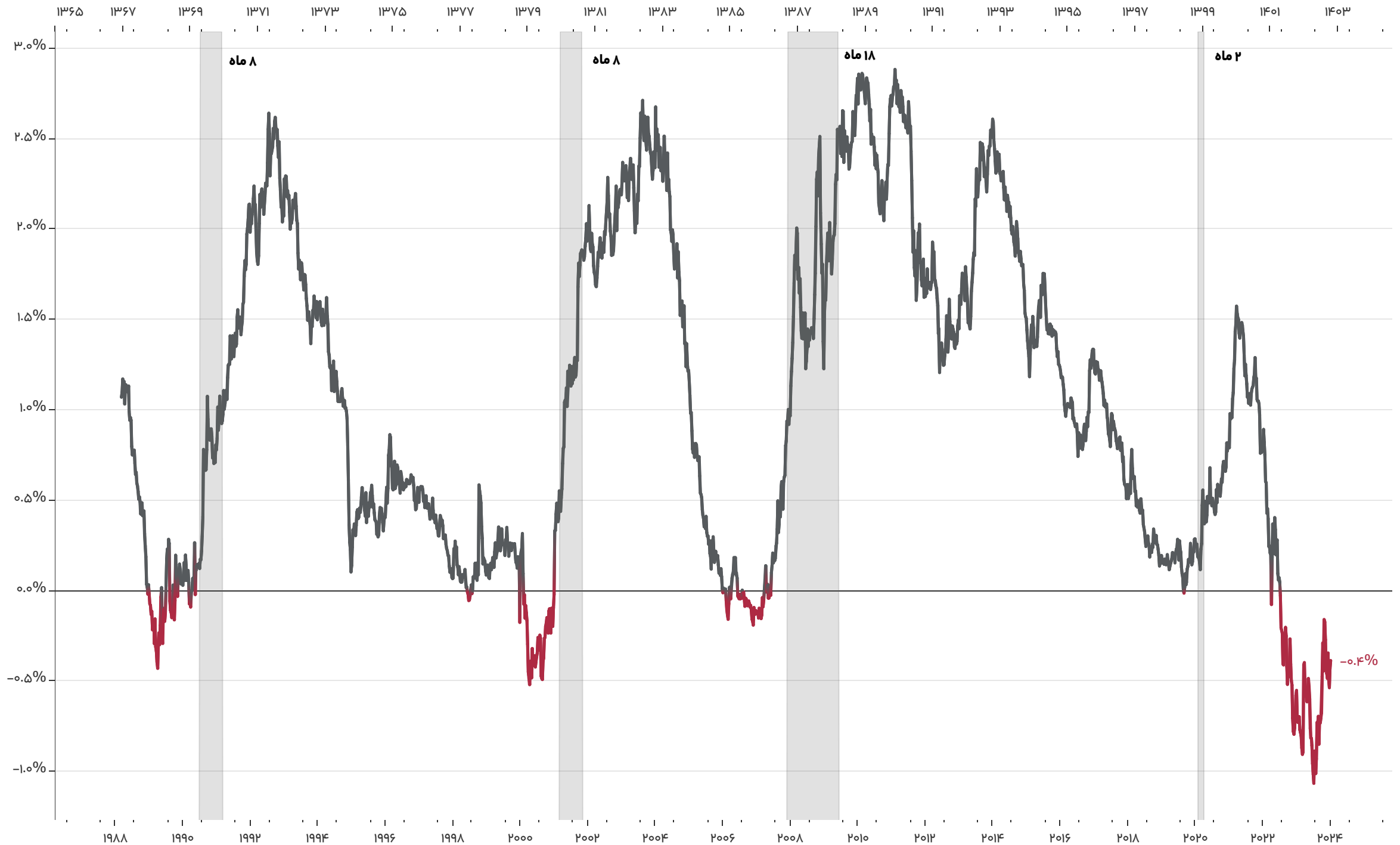
ماهانه، بازده اوراق خزانه ۱۰ ساله در برابر اسناد خزانه ۲ ساله در آمریکا، همراه با اسپرد نرخ بازده

۲۰۲۳



## شکاف نرخ بهره و رکودهای اقتصادی در آمریکا

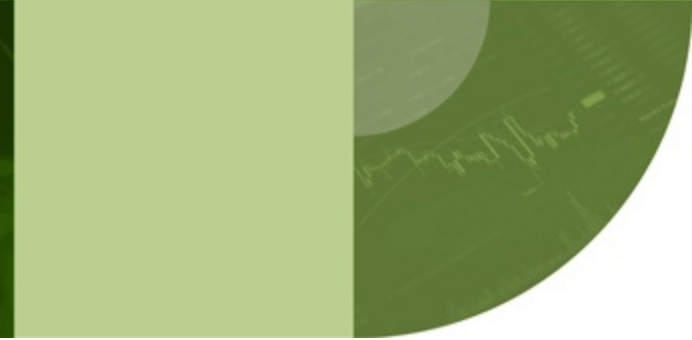
اسپرد نرخ بهره ۲ ساله و ۱۰ ساله اسناد و اوراق خزانه در آمریکا، هفتگی، از ابتدای سال ۱۹۸۸ میلادی، وارونگی منحنی بازده به عنوان یکی از معیارهای انتظارات رکودی در مقابل رکودهای اقتصادی متعاقب



# بازار سهام

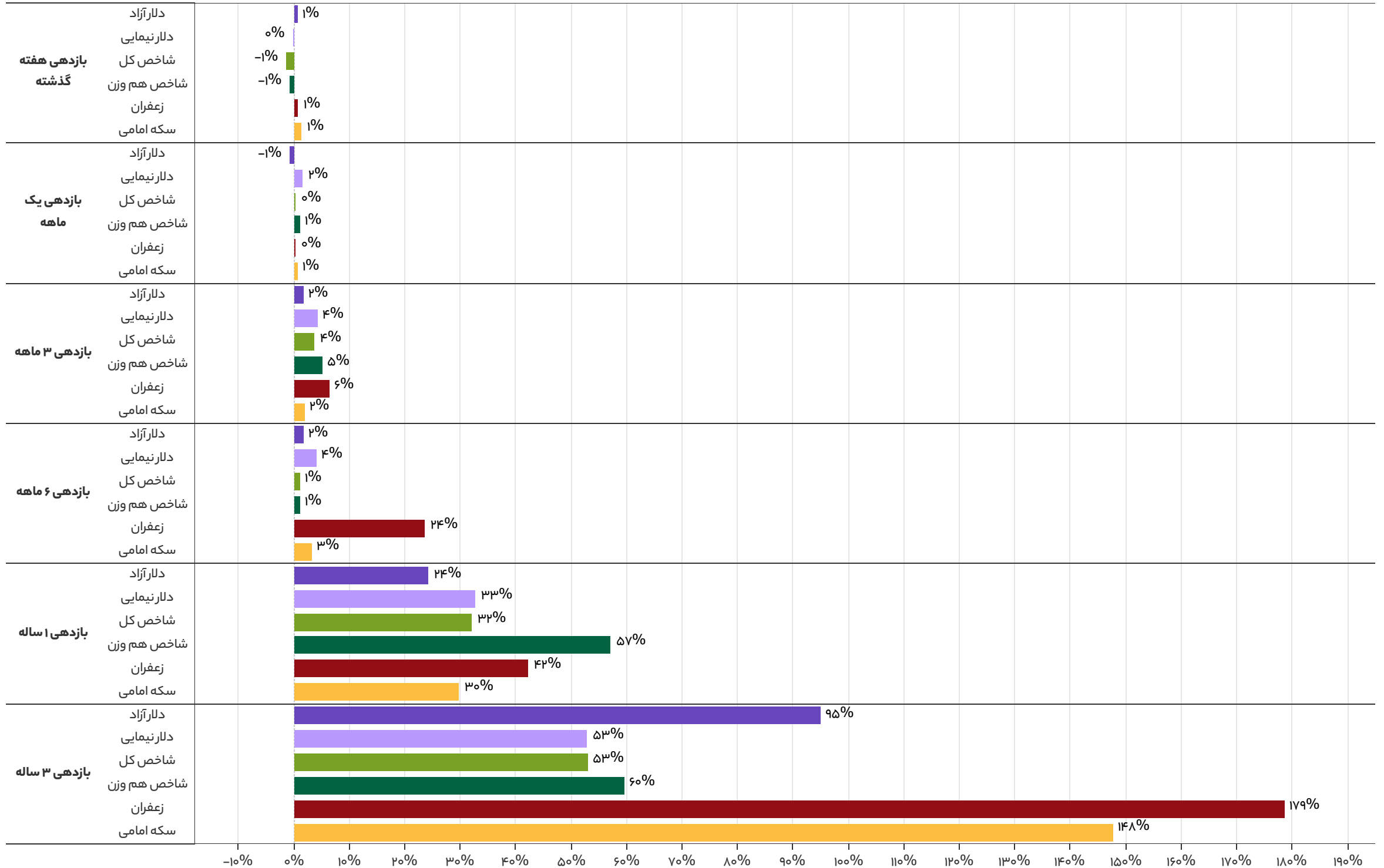
EQUITY MARKET

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 هرماه، رنگ براساس دارایی

												۱۲ ماه گذشته	
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 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

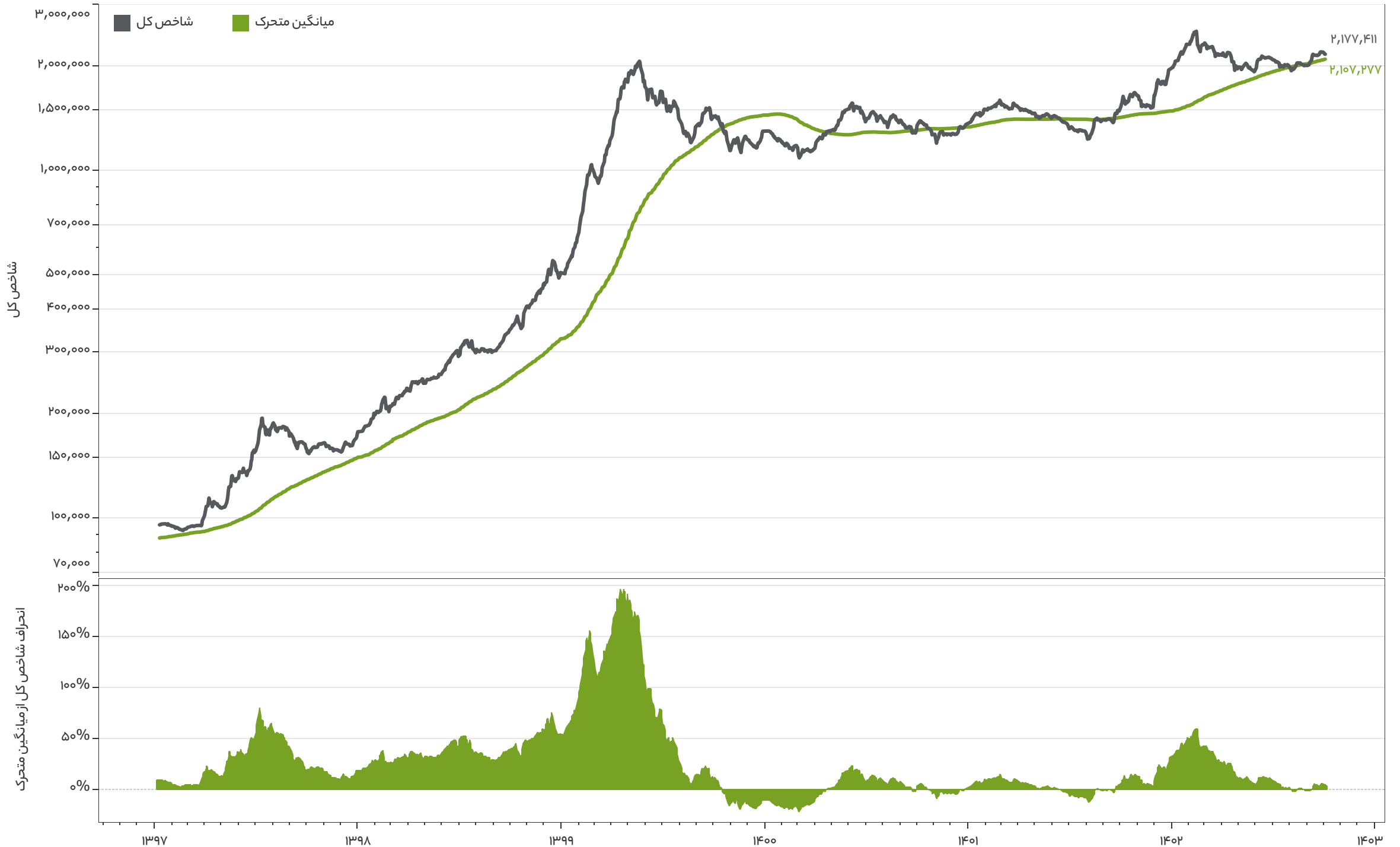
از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده است





## شاخص کل و میانگین متحرک

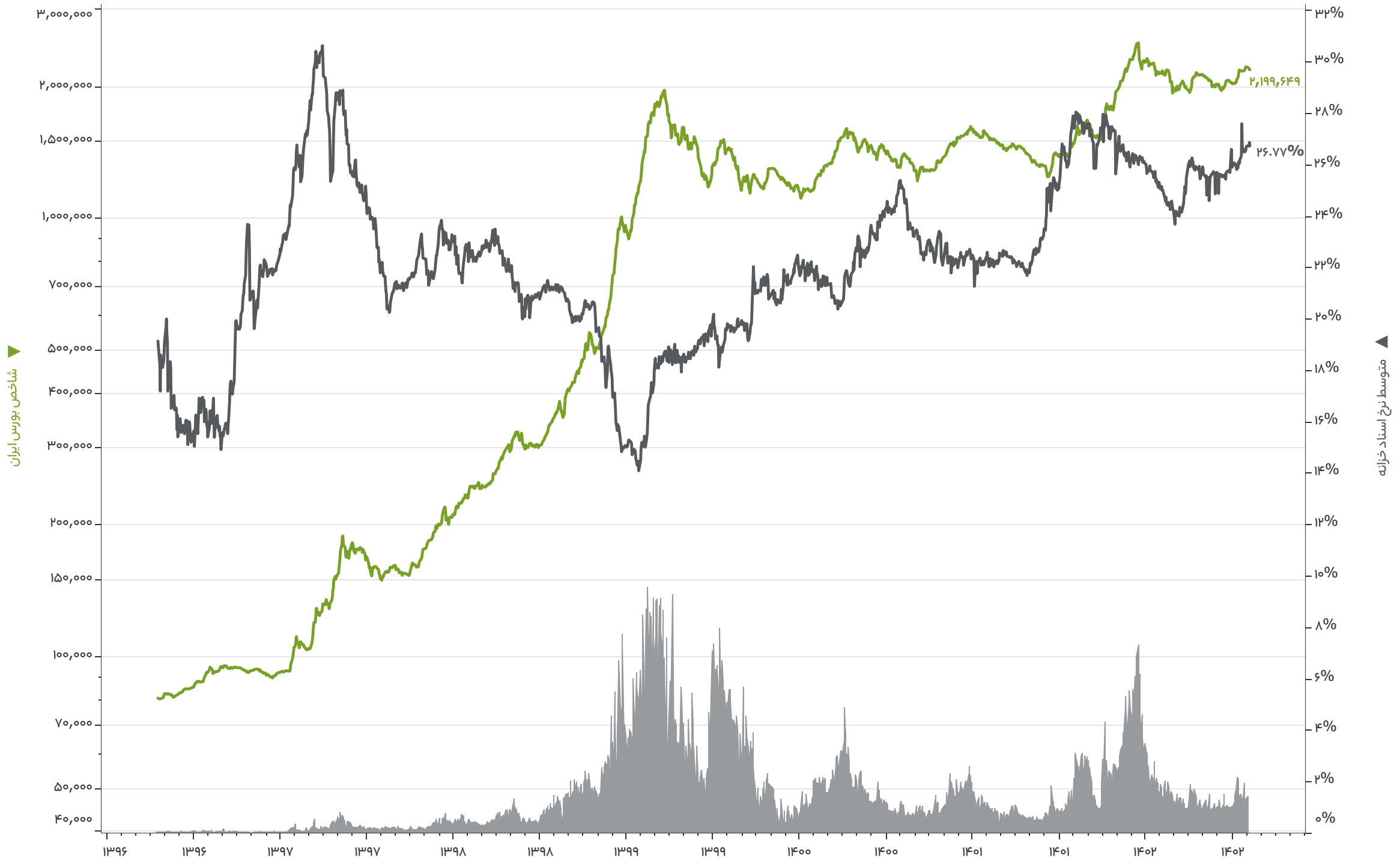
شاخص کل بورس تهران در برابر میانگین متحرک ۲۰۰ روزه، از مرداد ۱۳۹۷، محور لگاریتمی و بزرگنمایی شده، همراه با انحراف شاخص از میانگین متحرک به درصد





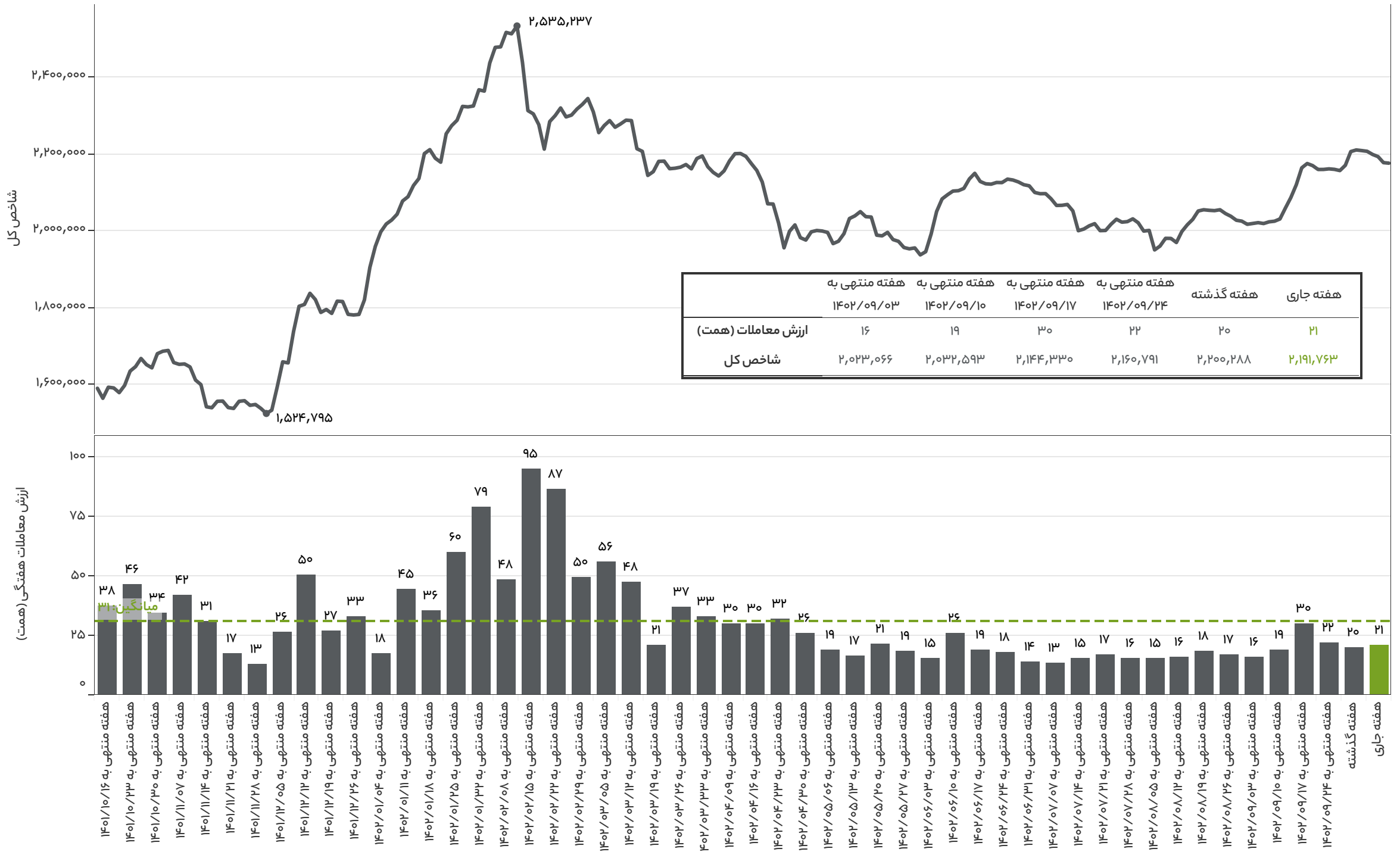
## تاثیر نرخ بهره بر ارزش معاملات و بازار

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



ارزش معاملات هفتگی بازار

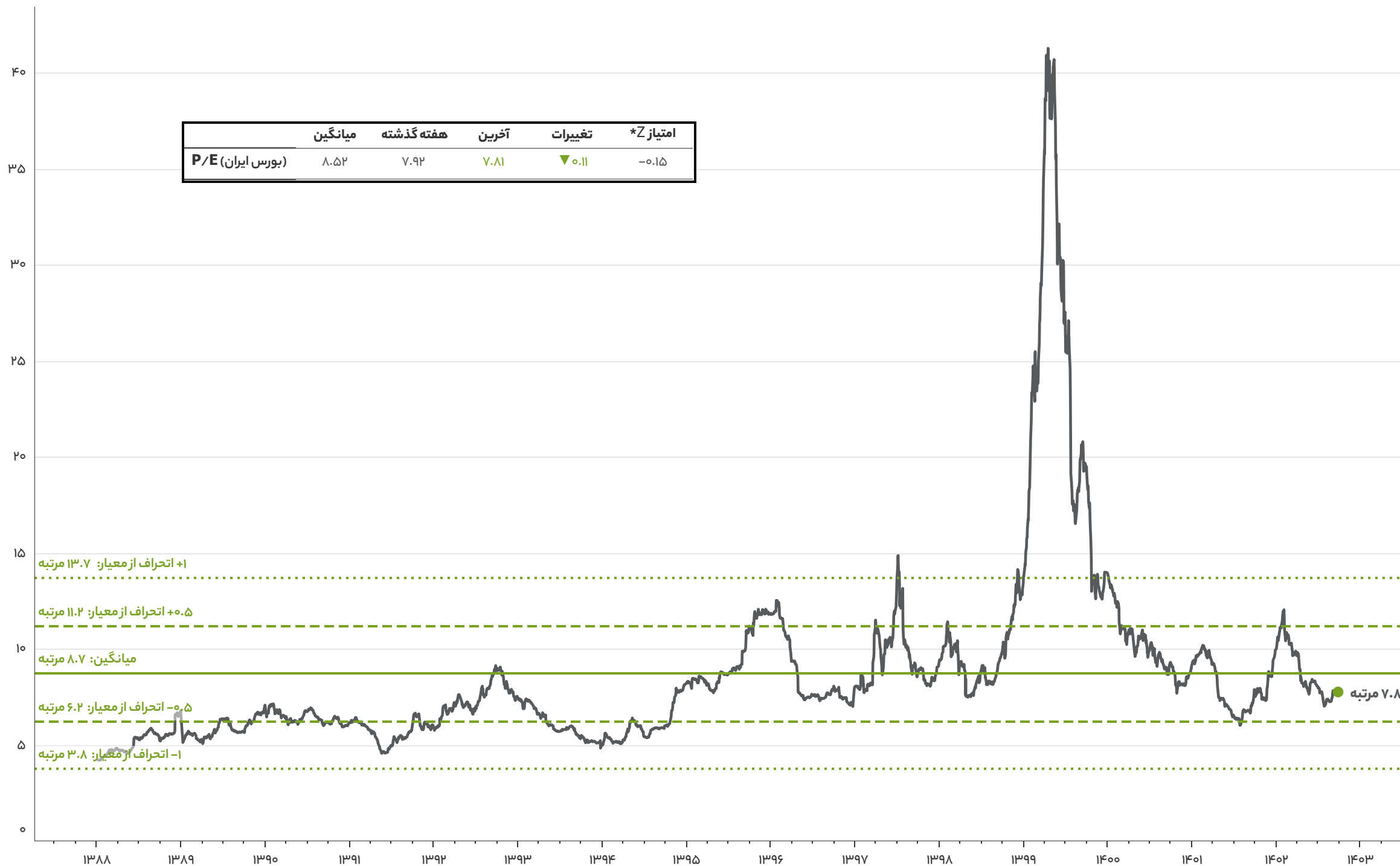
ارزش معاملات سهام در هر هفته، طی ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان، در برابر شاخص کل





## نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

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



\*امتیاز Z یا امتیاز استاندارد تفاوت آخرین عدد برای نسبت قیمت به سود را بر حسب انحراف از معیار محاسبه می‌نماید که در اینجا می‌تواند یک معیار برای سنجش گران یا ارزان بودن بازار نسبت به میانگین باشد.



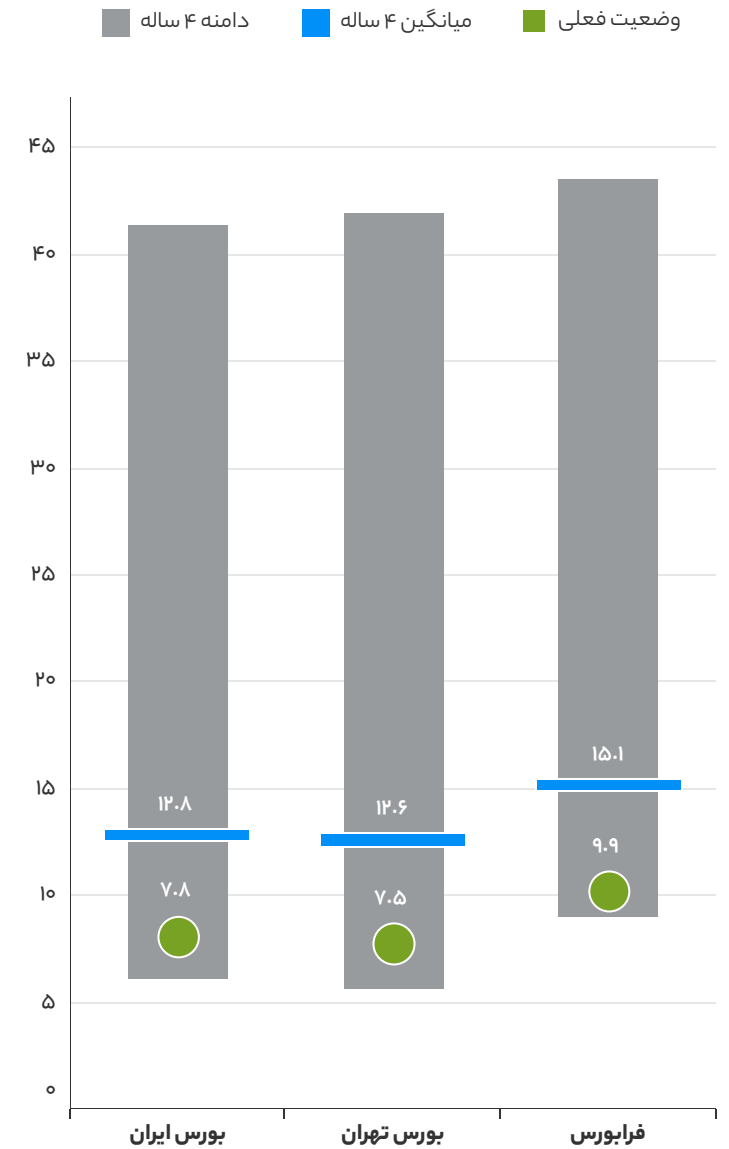
## ارزش نسبی فرابورس به بورس

نسبت پی به ای فرابورس به بورس تهران، گذشته نگر، ۴ سال گذشته، بزرگنمایی شده



## وضعیت پی به ای بازارها

گذشته نگر، ۴ سال گذشته



تغییرات طی دوره	وضعیت فعلی	هفته گذشته	کمینه ۴ ساله	میانگین ۴ ساله	پیشینه ۴ ساله
بورس ایران	۷.۸۱	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



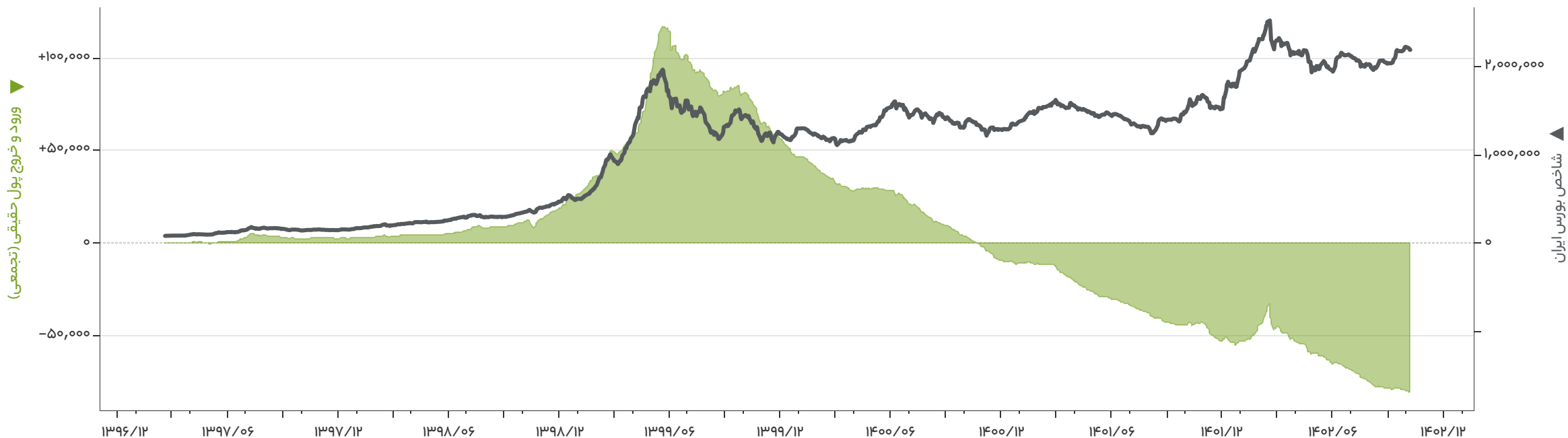
## بازدهی و ارزشیابی سکتورها

	خدمات مالی	مواد پایه	انرژی	مصرفی دوره‌ای	مصرفی غیردوره‌ای	صنعتی	بهداشت	ارتباطات	تکنولوژی	یوتیلیتی	املاک و مستغلات	
تعداد سهام	۱۹۹	۱۸۹	۶	۶۵	۸۹	۶۳	۴۱	۵	۱۹	۱۱	۲۸	وزن
ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	۳,۴۰۴	۳,۳۳۰	۶۳۷	۳۸۹	۲۲۱	۲۰۲	۱۶۷	۱۲۷	۱۱۸	۸۸	۵۵	
سهم هر سکتور از ارزش بازار	۳۹.۰%	۳۸.۱%	۷.۳%	۴.۵%	۲.۵%	۲.۳%	۱.۹%	۱.۵%	۱.۴%	۱.۰%	۰.۶%	
نسبت قیمت به سود (P/E) گذشته‌نگر	۷.۵	۷.۹	۵.۰	۵.۸	۱۱.۳	۹.۶	۹.۵	۱۳.۵	۲۱.۲	۸.۹	۱۱.۴	سودآوری
بازده سود نقدی	۷.۷%	۸.۹%	۱۴.۱%	۲.۲%	۴.۱%	۳.۶%	۶.۶%	۳.۰%	۲.۵%	۱۷.۱%	۲.۹%	
نسبت تقسیم سود	۶۲%	۷۲%	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)	+۹۰۵%	+۹۳۸%	+۸۲۲%	+۸۹۱%	+۴۵۰%	+۴۵۴%	+۴۱۶%	+۱۵۸%	+۳۰۰%	+۷۷۸%	+۶۲۵%	بازده بلندمدت
بازده از سقف بازار (۱۳۹۹/۰۵/۲۰)	+۵%	+۶۲%	+۲۰%	-۱۰%	+۳%	-۵%	+۲۳%	-۵۹%	+۲%	+۱۱۴%	+۱%	
بازده از ابتدای سال	+۷۵%	+۸۲%	+۹۶%	+۹۹%	+۶۲%	+۱۱۵%	+۱۰۶%	+۶۵%	+۷۲%	+۴۲%	+۲۲۴%	بازده کوتاه‌مدت
بازده هفته گذشته	-۱%	-۱%	-۲%	-۱%	۰%	-۳%	۱%	-۱%	۰%	-۴%	-۱%	



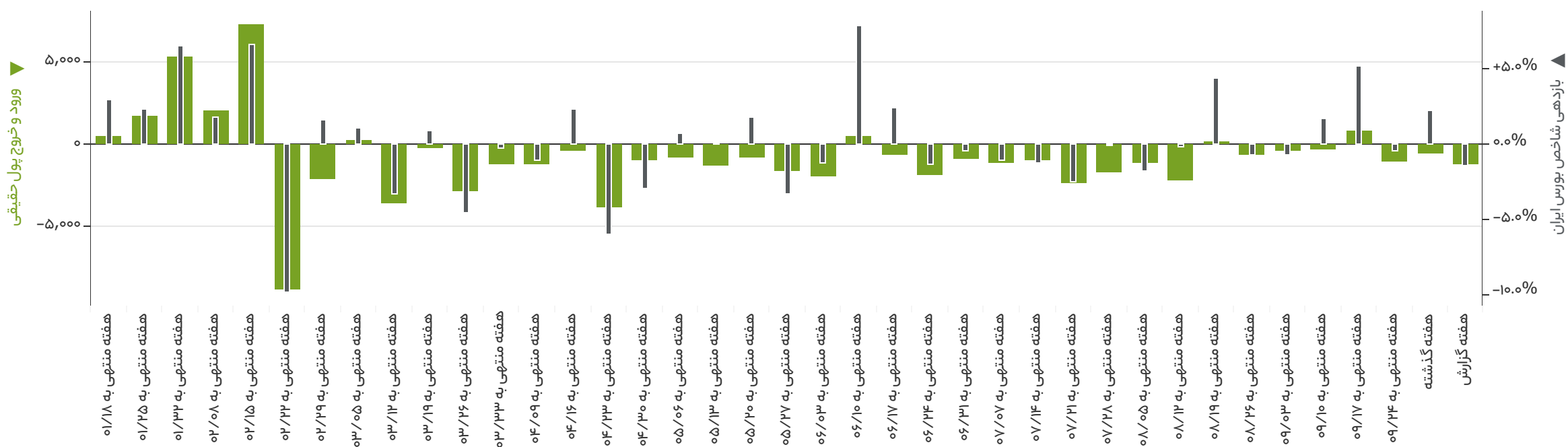
## ورود و خروج پول به صورت تجمعی

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

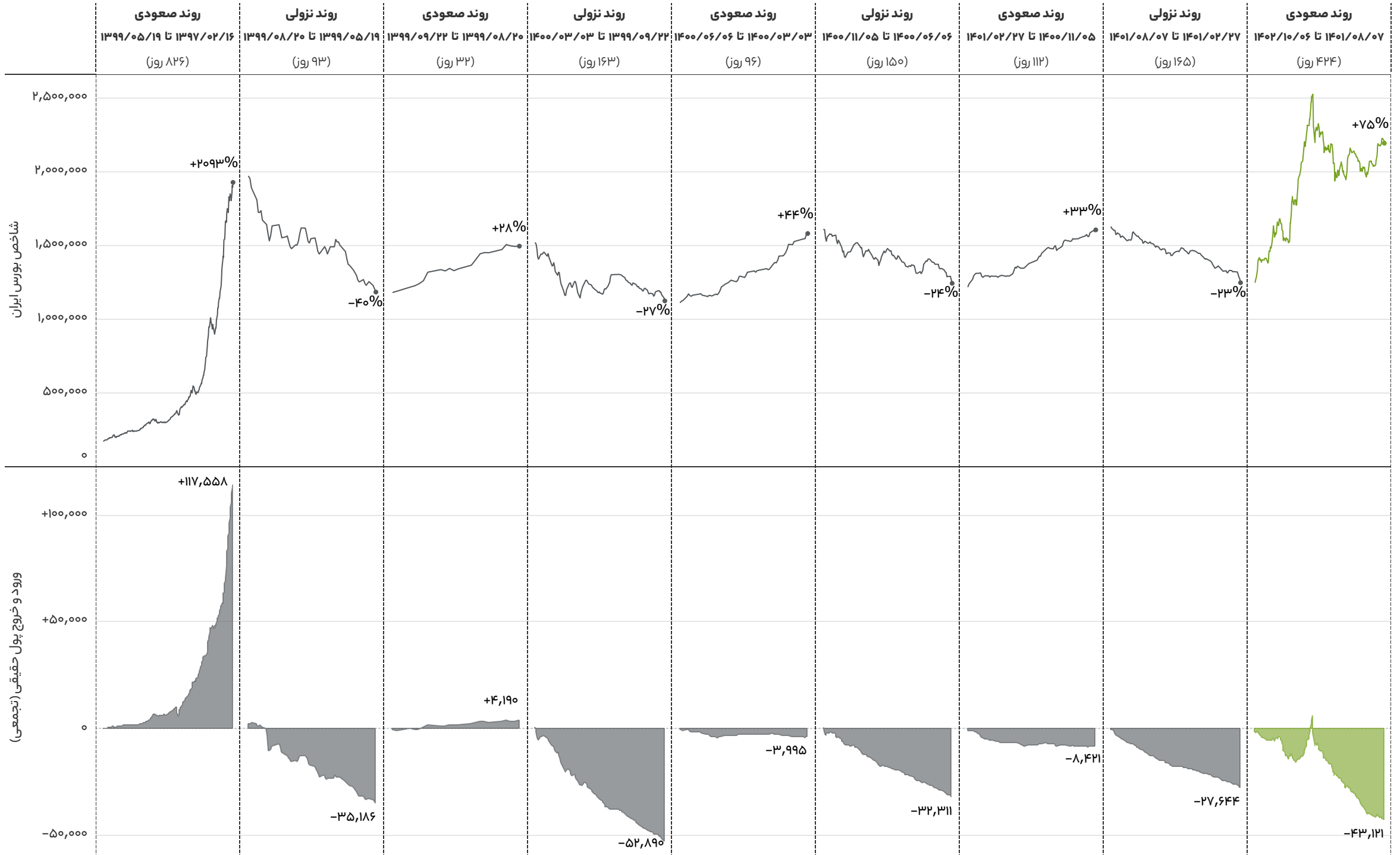
۹ ماه گذشته، هفتگی، ورود و خروج پول به هزار میلیارد تومان، در مقابل بازده شاخص بورس ایران





## 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



## 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	
			بیشترین تغییر شخصیت حقوقی به حقیقی	بیشترین تغییر شخصیت حقیقی به حقوقی
ولشرق	لیزینگ	۰.۸	+۵.۹%	
شتولی	محصولات پاک کننده	۰.۴	+۳.۶%	
سلار	سیمان، اهک و گچ	۱.۰	+۳.۰%	
ولانا	لیزینگ	۰.۳	+۲.۸%	
کمرجان	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱.۳	+۱.۷%	
کسرام	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱.۱	+۱.۴%	
زماهان	محصولات کشاورزی	۱.۵	+۱.۳%	
کپشیر	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۲.۴	+۱.۲%	
کفرآور	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۰.۴	+۱.۲%	
فافزا	آهن و فولاد	۰.۶	+۱.۲%	
نظرین	نساجی	۱.۵	+۱.۱%	
حآفرین	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۱.۸	+۰.۹%	
شتوکا	مواد شیمیایی-متنوع	۱.۱	+۰.۸%	
قشیر	شکر	۰.۸	+۰.۸%	
شکرین	مواد شیمیایی-متنوع	۴.۲	-۰.۵%	
زشریف	محصولات کشاورزی	۱.۷	-۰.۵%	
تفارس	تامین سرمایه	۲.۹	-۰.۵%	
فلوله	آهن و فولاد	۲.۶	-۰.۵%	
کماسه	سایر مواد معدنی	۲.۲	-۰.۵%	
قشرین	شکر	۲.۵	-۰.۵%	
غشان	محصولات لبنی	۱.۲	-۰.۶%	
معیار	سرمایه گذاری	۰.۵	-۰.۷%	
ثنظام	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۴	-۰.۷%	
وحافظ	بیمه	۱.۷	-۰.۹%	
دی	بانکها و موسسات اعتباری	۱۴.۷	-۰.۹%	
فولای	آهن و فولاد	۰.۹	-۱.۱%	
ملت	بیمه	۶.۶	-۱.۲%	
تمحرکه	ماشین الات	۰.۳	-۱.۲%	

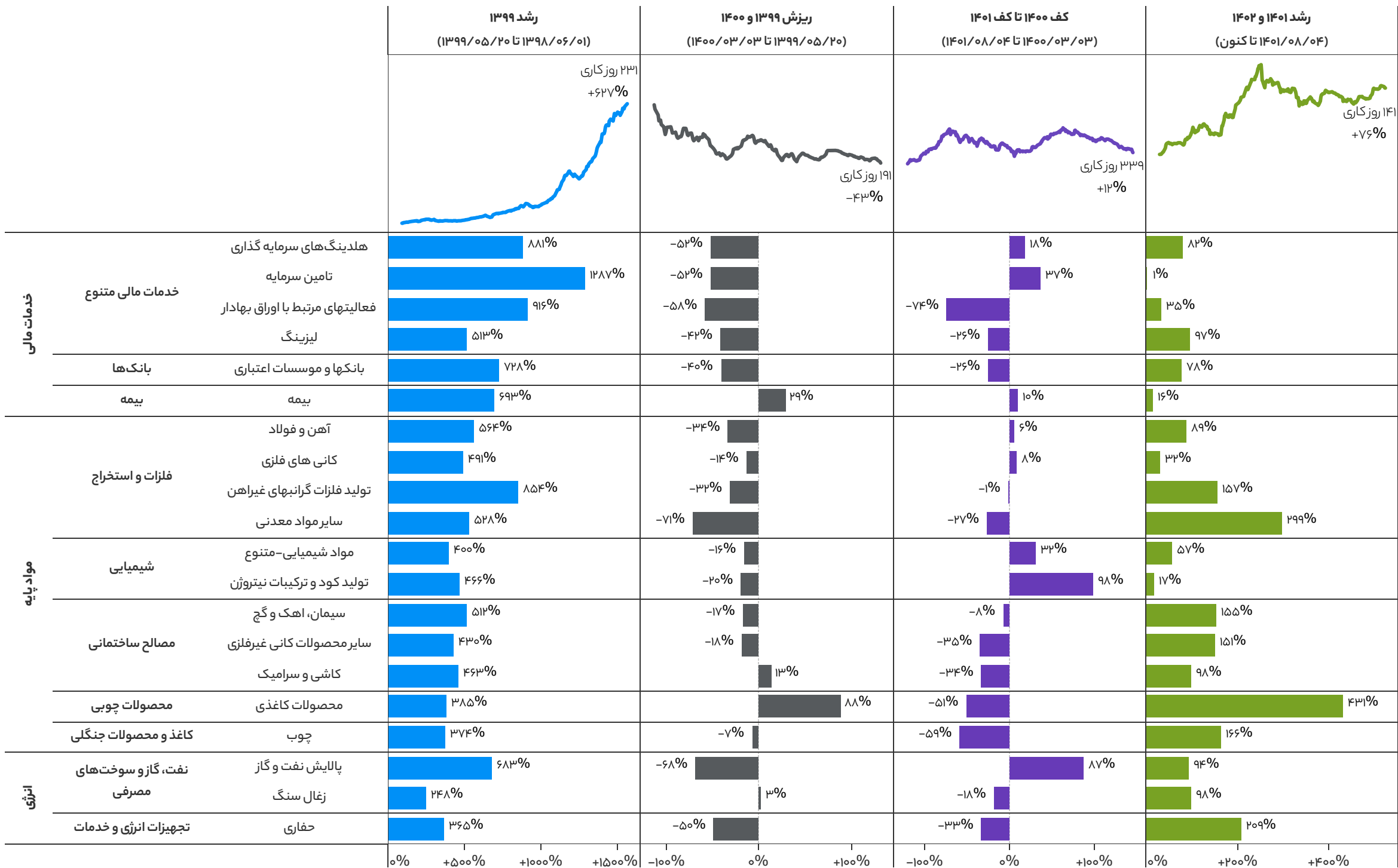
## ورود و خروج پول حقیقی

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)	
			بیشترین ورود پول حقیقی	بیشترین خروج پول حقیقی
ولشرق	لیزینگ	۱	+۵۰	
سلار	سیمان، اهک و گچ	۱	+۳۳	
کپشیر	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۲	+۲۹	
ما	بیمه	۴	+۲۸	
کنور	کانی های فلزی	۲۵	+۲۶	
وساخت	سرمایه گذاری	۷	+۲۵	
فسبزووار	آهن و فولاد	۱۸	+۲۲	
حفارس	حمل و نقل بازمینی	۴	+۲۱	
های وب	خدمات اینترنتی	۶	+۲۰	
کمرجان	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱	+۲۰	
ونوین	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸	+۱۹	
ثنوسا	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲	+۱۸	
زماهان	محصولات کشاورزی	۲	+۱۸	
حآفرین	حمل و نقل از طریق خطوط راه آهن	۲	+۱۸	
شگوبا	مواد شیمیایی-متنوع	۴۲	-۳۱	
خگستر	سرمایه گذاری	۱۸	-۳۹	
خودرو	خودرو	۸۲	-۳۹	
وخارزم	سرمایه گذاری	۱۲	-۴۴	
وغدیر	سرمایه گذاری	۱۷۰	-۴۸	
ومعادن	سرمایه گذاری	۱۰۱	-۴۹	
فملی	تولید فلزات گرانبهای غیرآهن	۴۴۹	-۵۳	
خساپا	خودرو	۴۹	-۶۰	
ذوب	آهن و فولاد	۳۲	-۶۶	
شستا	سرمایه گذاری	۲۰۸	-۷۵	
ملت	بیمه	۷	-۷۷	
شپنا	پالایش نفت و گاز	۱۹۴	-۷۸	
فولاد	آهن و فولاد	۴۹۸	-۹۸	
دی	بانکها و موسسات اعتباری	۱۵	-۱۳۲	

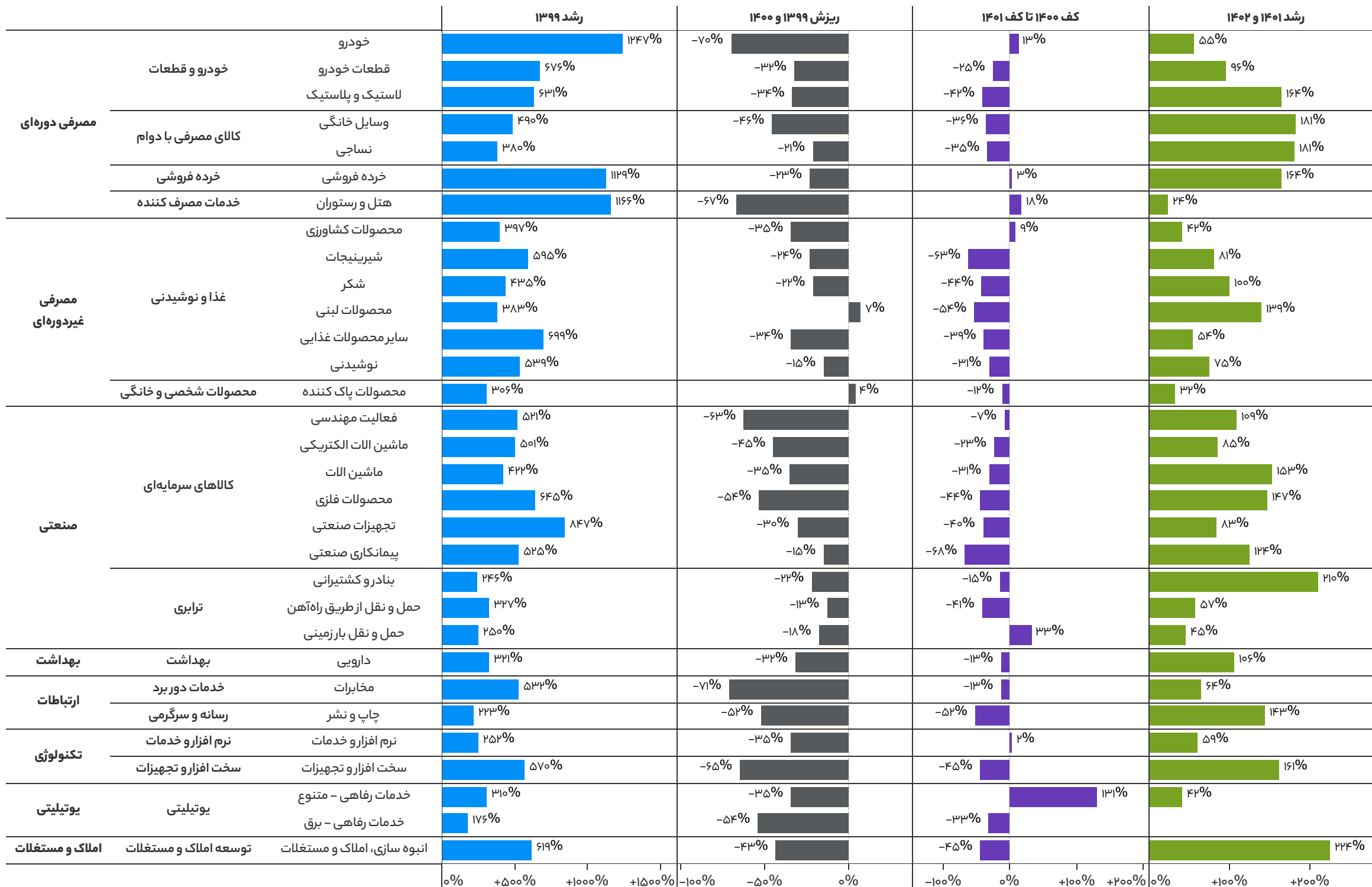
### بازدهی صنایع طی روندهای بلندمدت بازار

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





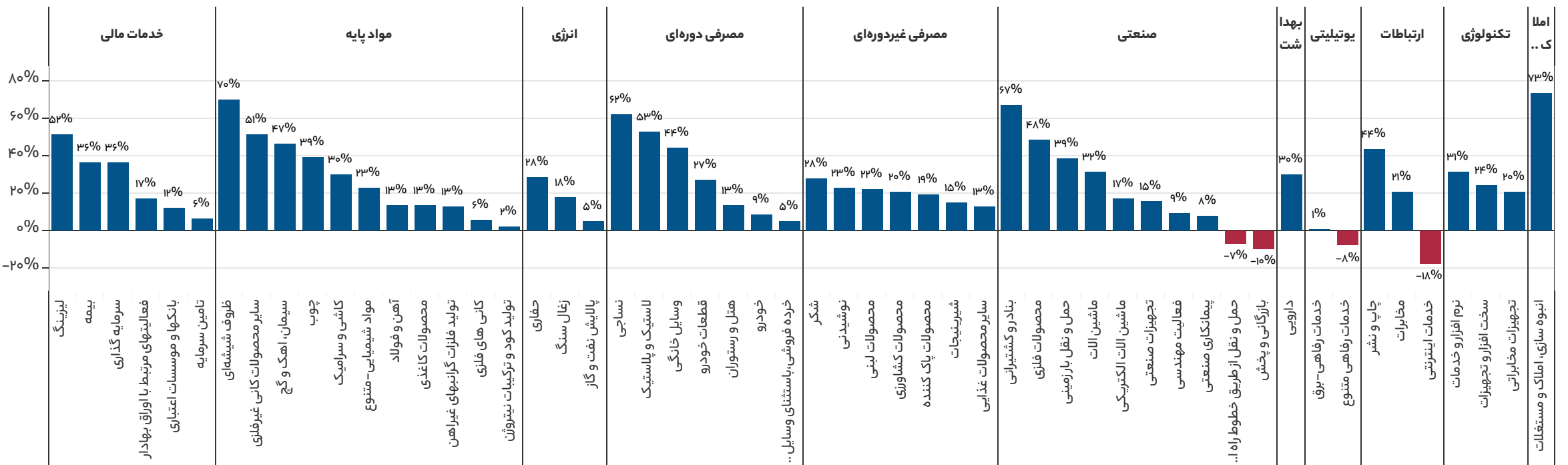
بازدهی صنایع در روندهای بازار (ادامه)



بازدهی صنایع از ابتدای هفته (مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده، بازدهی هفته گذشته با خط های خاکستری رنگ نشان داده شده است)

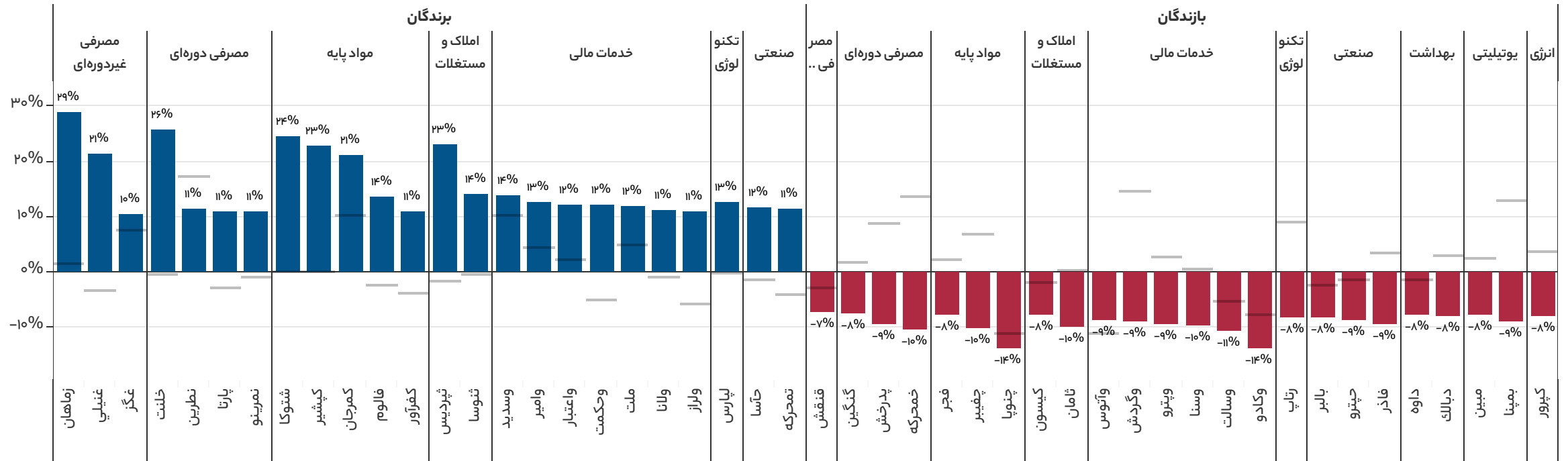


بازدهی صنایع از ابتدای سال (مرتب شده بر اساس سکتور، بازدهی تعدیل شده)

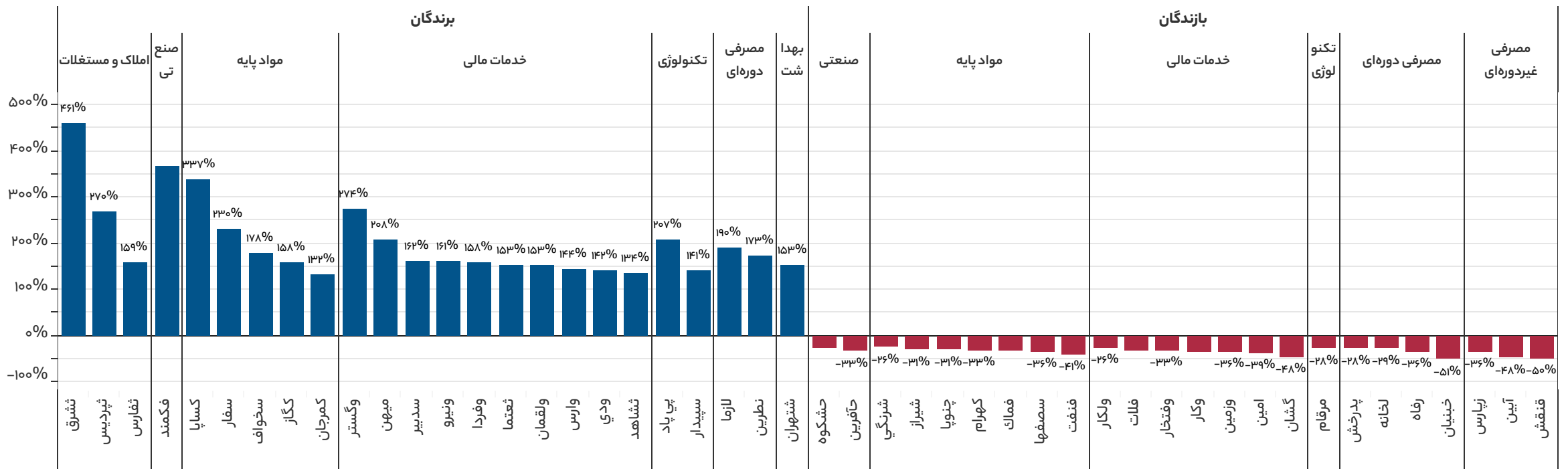




برندگان و بازندگان هفته (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها در هفته گذشته، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)



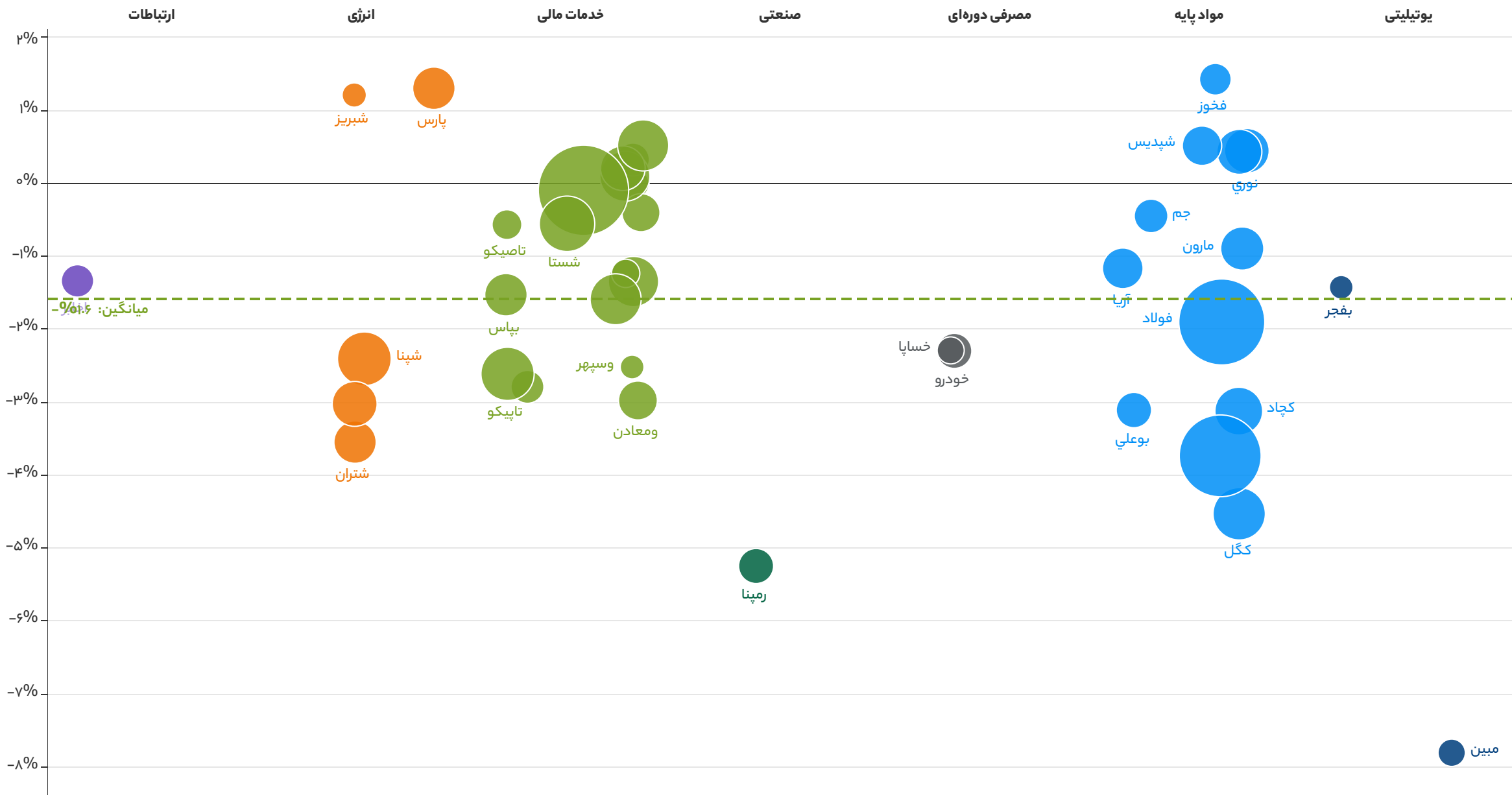
برندگان و بازندگان سال (پربازده‌ترین و کم‌بازده‌ترین نمادها از ابتدای سال، تفکیک شده بر اساس سکتور، بازده تعدیل شده، همراه با بازده هفته گذشته)





## بازدهی بزرگ‌ترین ۴۰ شرکت سهامی طی هفته گذشته

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



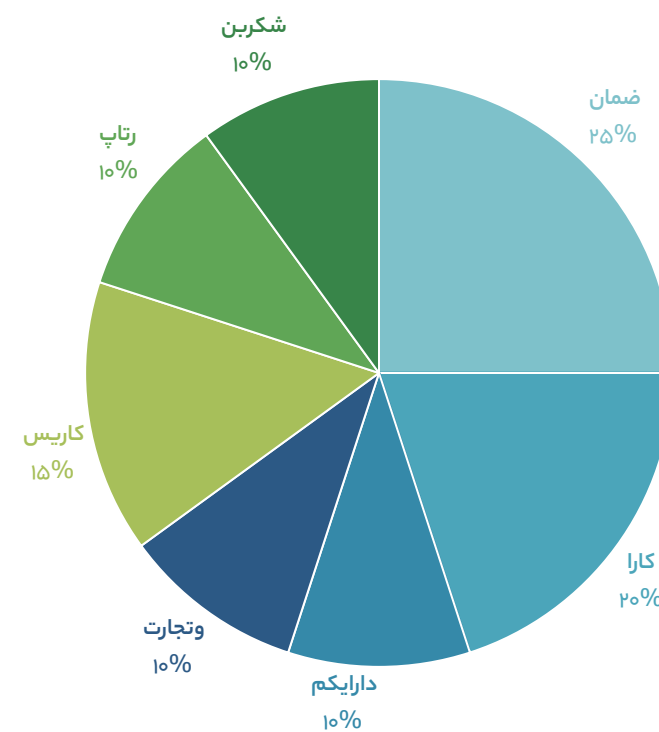
بازدهی هفته گذشته	فخوز	پارس	شبریز	پارسان	شپدیس	نوری	کگهر	وسندوق	وامید	وبملت	وکفدیر	فارس	وپاسار	جم	شستا	تامیکو	ماون	آریا	وتجارت	اخابر	وغذیر	بفجر	پپاس	میدکو	فولاد	خسایا	خودرو	شپنا	وسپهر	تاپیکو	مکشتی	ومعادن	شبنر	بوعلی	کچاد	شتران	فملی	کگل	رمپنا	مبین
	+۱.۴%	+۱.۳%	+۱.۲%	+۰.۵%	+۰.۵%	+۰.۵%	+۰.۴%	+۰.۳%	+۰.۲%	+۰.۱%	۰%	-۰.۱%	-۰.۴%	-۰.۴%	-۰.۵%	-۰.۶%	-۰.۹%	-۱.۲%	-۱.۲%	-۱.۳%	-۱.۳%	-۱.۴%	-۱.۵%	-۱.۶%	-۱.۹%	-۲.۳%	-۲.۳%	-۲.۴%	-۲.۵%	-۲.۶%	-۲.۸%	-۳.۰%	-۳.۰%	-۳.۱%	-۳.۱%	-۳.۵%	-۳.۷%	-۴.۵%	-۵.۲%	-۷.۸%



## 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	۳,۴۸۲	۱۰%
	شکرین	۷,۰۰۰	بالا بودن نرخ فروش محصول و سود مناسب زیر مجموعه‌ها	۶,۵۷۰	۱۰%
	کاریس	-	دارا بودن پرتفوی متنوع و مناسب با ریسک پایین	۲۳,۳۱۲	۱۵%
بلند مدت	دارایکم	۲۳۰,۰۰۰	پایین بودن نسبت قیمت به خالص ارزش‌داری (P/NAV) و پتانسیل رشد	۱۷۸,۶۲۰	۱۰%
	وتجارت	۳,۰۰۰	وضعیت ارزندگی مناسب و پتانسیل تجدید ارزیابی	۲,۴۱۵	۱۰%
	کارا	-	دارا بودن پورتفو بدون ریسک و سود بالاتر نسبت به سایر صندوق‌های درآمد ثابت	۱۶,۴۶۹	۲۰%
	ضمان	-	تضمین اصل سرمایه‌گذاران و پرتفوی متنوع	۱۶,۴۷۴	۲۵%





# 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 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 برحسب 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 برعهده 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			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)		
الفین	مارون		۱۲	۱۲۵.۳	-۱%	۱۵,۶۶۰	۷۸%	۱,۳۶۴	۲۰۸	۲ Q	۱,۱۱۹	۲,۱۱۰	+۸۹%	۱۴.۰	۷.۴	۷.۴	-۲.۰			
	آریا		۱۲	۱۱۱.۵	-۱%	۸,۱۱۰	۹۵%	۸۰۲	۴۱۸	۲ Q	۹۱۶	۱,۲۰۹	+۳۲%	۸.۸	۶.۳	۶.۸	-۰.۷			
	جم		۱۲	۷۷.۵	-	۴,۳۰۳	۹۹%	۵۶۰	۲۱۴	۲ Q	۶۴۲	۹۵۱	+۴۸%	۶.۷	۴.۱	۴.۴	-۴.۰			
	شگویا		۱۲	۴۱.۹	-	۱,۷۵۰	۹۱%	۱۴۳	۱۸۱	۲ Q	۲۷۷	۳۱۷	+۱۴%	۶.۳	۵.۰	۶.۴	+۰.۱			
	جم پیلین		۱۲	۳۶.۴	-۱%	۱۸,۱۹۵	۹۹%	۲,۱۰۹	۱,۶۲۷	۲ Q	۲,۸۴۰	۳,۴۹۲	+۲۳%	۶.۴	۴.۶	۵.۷	+۰.۶			
	شکبیر		۱۲	۲۷.۲	+۳%	۷,۵۶۵	۸۸%	۱,۱۶۸	۶۰۸	۲ Q	۱,۵۹۸	۲,۰۷۸	+۳۰%	۴.۷	۳.۱	۳.۵	-۷.۶			
	شاراک		۱۲	۲۴.۳	-۲%	۳,۰۱۱	۹۶%	۴۱۹	۲۱۴	۲ Q	۶۰۱	۶۴۷	+۸%	۵.۰	۴.۰	۳.۹	-۱.۸			
	شغدیر		۱۲	۸.۷	-۲%	۶,۶۷۶	۹۱%	۱,۰۹۶	۶۴۸	۲ Q	۹۸۷	۱,۳۷۴	+۳۹%	۶.۸	۴.۵	۶.۱	+۰.۱			
شیمیایی	شبصیر		۱۲	۷.۶	-۴%	۳,۰۵۵	۸۱%	۳۷۶	۲۸۱	۲ Q	۵۴۹	۷۱۹	+۳۱%	۵.۶	۳.۹	۴.۵	-۰.۳			
	آروماتیک		۱۲	۱۳۵.۵	-	۱۵,۰۶۰	۱۰۰%	۱,۳۱۴	۹۸۲	۲ Q	۱,۷۳۷	۱,۹۳۹	+۱۲%	۸.۷	۷.۲	۸.۱	+۰.۷			
	بوعلی		۱۲	۸۳.۴	-۳%	۵,۸۱۴	۹۵%	۵۶۳	۴۵۲	۲ Q	۶۴۳	۸۱۸	+۲۷%	۹.۰	۶.۶	۹.۰	+۴.۱			
	شیراز		۱۲	۳۶.۰	+۲%	۲,۳۵۳	۲۱%	۷۶۱	۲۲۴	۲ Q	۳۶۳	۴۳۵	+۲۰%	۶.۵	۵.۳	۶.۱	+۱.۶			
	اوره		۱۲	۲۴.۹	-	۱۳,۹۲۰	۸۳%	۲,۸۱۰	۸۶۰	۲ Q	۱,۵۶۹	۱,۹۰۲	+۲۱%	۸.۹	۶.۸	۷.۸	+۳.۰			
	کرماش		۱۲	۱۸.۶	-۲%	۱,۷۵۸	۴۸%	۴۵۸	۱۲۴	۲ Q	۳۰۶	۳۸۰	+۲۴%	۵.۷	۴.۳	۴.۴	+۰.۶			
	زاگرس		۱۲	۳۱.۵	-۲%	۱۳,۱۲۵	۷۲%	۱,۲۶۵	۴۷۲	۲ Q	۱,۳۳۸	۱,۹۰۳	+۴۲%	۹.۸	۶.۶	۶.۷	-۲.۱			
	متانول		۱۲	۲۷.۸	-	۴,۶۳۷	۹۹%	۶۴۱	۲۸۸	۲ Q	۵۹۵	۸۸۶	+۴۹%	۷.۸	۴.۸	۵.۸	-۱.۴			
محصولات شیمیایی	شغن		۱۲	۱۷.۳	-۲%	۵۶۰	۸۹%	۱۰۲	۲۰	۲ Q	۷۰	۹۰	+۲۸%	۸.۰	۵.۸	۵.۵	-۱.۶			
	شیران		۹	۲۷.۸	-	۵۱۱	۷۵%	۵۶	۴۶	۳ Q	۶۲	۷۳	+۱۸%	۸.۳	۷.۹	۶.۸	+۰.۲			
دوده صنعتی	شکرین		۱۲	۴.۲	+۲%	۶۵۸	۸۲%	۶۴	۴۰	۲ Q	۸۶	۱۰۳	+۲۰%	۷.۶	۵.۹	۶.۳	+۰.۱			
	شصدف		۱۲	۲.۷	-۴%	۳,۸۱۵	۷۳%	۳۹۲	۲۱۷	۲ Q	۳۹۲	۵۹۷	+۵۲%	۹.۷	۶.۱	۷.۵	-۱.۲			
	شدوص		۱۲	۲.۵	+۴%	۲,۶۳۲	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	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			
	کویر	۱۲	۱۲.۳	-	۳۲۹	۱۲%	۴۶	۲۰	۲ Q	۴۵	۵۹	+۳۲%	۷.۳	۵.۷	۵.۶	-۰.۷			
فلزات و استخراج	فجر	۱۲	۶.۶	-۸%	۷۸۳	۴۹%	۱۰۱	۱۲۵	۲ Q	۲۰۰	۲۱۱	+۶%	۳.۹	۳.۵	۴.۰	+۰.۰			
	فروز	۱۲	۵.۰	-۱%	۴,۵۱۵	۱۰۰%	۵۳۹	۲۷۳	۲ Q	۶۴۵	۸۰۴	+۲۵%	۷.۰	۵.۱	۵.۴				
	فسپا	۱۲	۳.۲	-۲%	۸۲۷	۵۴%	۱۲۴	۶۷	۲ Q	۱۵۰	۱۳۶	-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			
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	فنونال	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				



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	۹.۵	-	۱۴,۶۸۰	۹۵%	۱,۵۸۴	۱,۲۸۲	۲ Q	۲,۳۹۴	۲,۹۴۶	+۲۳%	۶.۱	۴.۴	۵.۳	+۰.۹		
		سایبک	۱۲	۸.۳	+۱%	۲,۷۹۶	۹۳%	۲۴۹	۲۴۶	۲ Q	۳۹۰	۵۰۶	+۳۰%	۷.۲	۵.۰	۶.۵	+۲.۳		
		سفار	۱۲	۷.۸	-۳%	۳۳,۳۱۲	۹۵%	۱,۰۳۹	۸۴۰	۲ Q	۱,۴۰۱	۱,۸۹۳	+۳۵%	۲۳.۸	۱۷.۶	۲۰.۶	+۱.۴		
		سخوز	۱۲	۶.۸	+۱%	۴,۸۲۶	۹۰%	۷۱۹	۲۸۴	۲ Q	۹۹۶	۱,۲۱۶	+۲۲%	۴.۸	۳.۴	۳.۴	-۰.۷		
		سمازن	۹	۶.۶	-	۲,۶۷۵	۸۱%	۲۹۰	۲۹۸	۳ Q	۳۹۵	۵۰۱	+۲۷%	۶.۸	۵.۸	۵.۳	+۱.۸		
		ساروم	۱۲	۴.۷	+۱%	۴,۷۴۹	۹۶%	۵۵۴	۴۵۱	۲ Q	۷۹۹	۱,۰۷۷	+۳۵%	۵.۹	۳.۹	۵.۰	-۰.۱		
		سهگمت	۱۰	۴.۷	+۱%	۶,۳۸۱	۹۸%	۶۴۸	۷۷۸	۳ Q	۱,۰۱۲	۱,۶۶۸	+۶۵%	۶.۳	۴.۳	۴.۱	+۰.۳		
		سفانو	۱۲	۴.۱	-۳%	۸,۱۰۳	۹۷%	۱,۱۷۰	۶۹۵	۲ Q	۱,۶۸۴	۲,۱۶۳	+۲۸%	۴.۸	۳.۲	۳.۶	+۰.۴		
		سرود	۱۲	۳.۹	-۲%	۴,۷۸۵	۹۶%	۴۹۶	۴۷۲	۲ Q	۸۶۶	۱,۰۲۵	+۱۸%	۵.۵	۴.۱	۴.۹	+۰.۵		
		سصوفی	۱۲	۳.۶	-۴%	۳,۲۳۳	۹۰%	۳۶۸	۳۳۷	۲ Q	۵۴۳	۷۱۴	+۳۱%	۶.۰	۴.۰	۵.۳	+۰.۷		
		سشمال	۹	۳.۰	-۳%	۱,۷۴۶	۸۹%	۱۷۰	۲۱۸	۳ Q	۲۷۱	۳۶۹	+۳۶%	۶.۴	۵.۱	۴.۹	+۰.۷		
		سبجنو	۱۲	۲.۷	-۴%	۶,۸۲۰	۹۶%	۵۷۳	۵۲۷	۲ Q	۱,۰۴۷	۱,۱۲۶	+۷%	۶.۵	۵.۴	۵.۹	-۰.۲		
		سقاین	۱۲	۲.۲	-۴%	۵۴۸	۹۷%	۳۷	۲۴	۲ Q	۴۹	۵۷	+۱۶%	۱۱.۲	۹.۳	۹.۶	+۰.۴		
		سبهان	۱۲	۲.۲	-۲%	۱۰,۷۸۳	۹۷%	۷۳۶	۷۴۹	۲ Q	۱,۷۷۶	۲,۰۲۸	+۱۴%	۶.۱	۴.۷	۴.۹	-۰.۳		
		سغرب	۱۲	۲.۱	-	۴,۲۸۵	۹۲%	۳۹۰	۴۱۰	۲ Q	۸۵۶	۱,۰۹۷	+۲۸%	۵.۰	۳.۴	۴.۰	-۰.۶		
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				
کاشی و سرامیک	سخزر	۱۲	۱.۸	-۳%	۳,۶۱۰	۹۵%	۳۵۸	۲۶۸	۲ Q	۴۸۰	۶۳۶	+۳۲%	۷.۵	۵.۲	۶.۳	+۰.۰			
	کحافظ	۱۲	۳.۷	-۴%	۷۱۹	۱۰%	۸۲	۶۱	۲ Q	۱۳۵	۲۲۲	+۶۵%	۵.۳	۳.۳	۳.۶	-۲.۶			
	کساوه	۱۲	۳.۳	+۳%	۶,۲۰۵	۷۱%	۷۴۷	۲۹۰	۲ Q	۱,۰۰۹	۱,۳۷۶	+۳۶%	۶.۱	۴.۱	۴.۱	-۱.۹			
	کلوند	۱۲	۱.۹	+۴%	۴,۷۴۲	۹۵%	۵۰۴	۳۸۱	۲ Q	۷۵۳	۸۹۱	+۱۸%	۶.۳	۴.۸	۵.۴	+۰.۱			
فرآورده‌های نسوز	کپشیر	۱۲	۲.۴	+۲۳%	۹۶۵	۸۸%	۵۲	۶۰	۲ Q	۱۱۴	۱۰۰	-۱۲%	۸.۵	۹.۰	۸.۶	+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			نمودار امتیاز Z	
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 سوخت‌های 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	کپور	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			
		تتوین	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			



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	۱۲.۶	-	۵,۲۵۰	۷۶%	۴۹۵	۳۳۹	۲ Q	۸۵۲	۱,۰۷۴	+۲۶%	۶.۲	۴.۵	۴.۷	+۰.۱			
		دلر	۱۲	۷.۹	+۵%	۳,۴۹۰	۹۶%	۳۵۲	۲۶۴	۲ Q	۴۹۳	۴۹۲	۰%	۷.۱	۶.۴	۶.۸	+۱.۱			
		دپارس	۱۲	۶.۹	+۱۰%	۷,۲۳۹	۹۸%	۸۰۳	۲۶۴	۲ Q	۹۵۳	۱,۰۱۸	+۷%	۷.۶	۶.۶	۵.۶	+۰.۳			
		دالبر	۱۲	۶.۵	+۲%	۶۸۸	۶۹%	۷۵	۵۰	۲ Q	۱۱۳	۱۳۴	+۱۸%	۶.۱	۴.۹	۴.۹	-۰.۸			
		دفارا	۱۲	۵.۶	+۳%	۳,۵۰۲	۹۹%	۴۵۲	۱۵۲	۲ Q	۵۶۱	۵۹۱	+۵%	۶.۲	۵.۳	۴.۶	+۰.۲			
		دفرا	۱۲	۵.۴	-۵%	۳,۸۴۷	۷۹%	۳۹۳	۲۰۱	۲ Q	۵۰۱	۵۶۰	+۱۲%	۷.۷	۶.۴	۶.۲	+۱.۷			
		هجرت	۱۲	۴.۵	+۱%	۲,۸۳۵	۹۵%	۴۰۶	۲۳۶	۲ Q	۵۴۳	۶۰۶	+۱۱%	۵.۲	۴.۱	۴.۳	-۰.۶			
		دقاضی	۱۲	۴.۴	-۱%	۲,۵۸۰	۹۶%	۲۷۷	۱۷۷	۲ Q	۳۷۷	۴۵۲	+۲۰%	۶.۹	۵.۲	۵.۶	+۰.۰			
		دتوزیع	۱۲	۴.۲	-	۲,۳۵۰	۹۴%	۴۴۹	۱۰۳	۲ Q	۳۳۲	۴۰۵	+۲۲%	۷.۱	۵.۳	۵.۱	-۰.۲			
		کاسپین	۱۲	۳.۰	+۶%	۲,۱۶۰	۹۵%	۲۳۴	۱۵۴	۲ Q	۳۱۸	۳۶۵	+۱۵%	۶.۸	۵.۴	۵.۸	+۰.۳			
		درازک	۱۲	۲.۷	+۴%	۱,۲۹۴	۱۰۴%	۲۱۳	۲۷	۲ Q	۲۲۵	۲۷۶	+۲۳%	۵.۸	۴.۰	۳.۶	-۰.۴			
		دکپسول	۱۲	۲.۶	-	۸,۵۰۰	۹۲%	۹۲۱	۶۰۳	۲ Q	۱,۰۶۵	۱,۲۷۵	+۲۰%	۸.۰	۶.۲	۷.۲	+۲.۰			
دراز	۱۲	۲.۰	-۵%	۲,۰۱۵	۶۷%	۲۷۳	۱۱۰	۲ Q	۳۴۶	۳۷۵	+۸%	۵.۸	۵.۰	۴.۴	-۱.۶					





گروه صنعتی	فعالیت	نماد	سال مالی	وضعیت قیمتی			سود واقعی		گزارش شده	برآورد سود کاریزما			نسبت P/e آینده نگر			امتیاز Z		گران تر
				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	-	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	
	شیرینیجات	زשگزا	۱۲	۱.۰	+۱%	۱,۰۴۱	۵۶%	۸۱	۹۰	۲ Q	۱۰۹	۱۸۹	+۷۴%	۹.۶	۵.۵	۸.۵	+۰.۳	
		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	
غسالام		۱۲	۲.۰	-۴%	۴۵۰	۴۱%	۶۵	۱۸	۲ Q	۶۵	۸۱	+۲۵%	۶.۹	۵.۵	۴.۸	-۱.۰		
محصولات لبنی	غمینو	۱۲	۱.۵	-۲%	۱,۰۰۷	۴۳%	۱۴۹	۶۷	۲ Q	۱۶۵	۲۴۵	+۴۹%	۶.۱	۳.۹	۴.۲	-۰.۳		
	غکورش	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	



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)		
صنعتی	بنادر و کشتیرانی	حزر	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	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				
مصروفی 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	۱۲	۰.۸	-۴%	۳,۵۸۰	۴۳%	۶۰۶	۱۵۸	۲ Q	۲۱۵	۲۲۰	+۲%	۱۶.۶	۱۶.۵	۱۹.۹	+۲.۲			
خرده‌فروشی	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			



## 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

