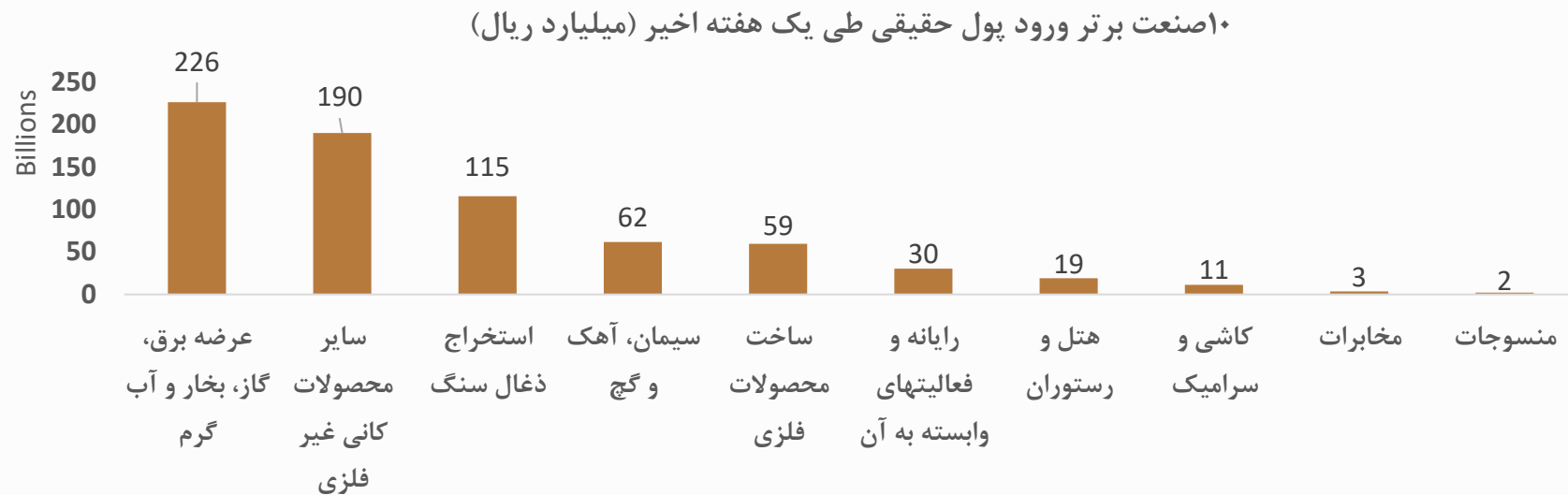


گزارش هفتگی بازار منتهی به ۱۸ خرداد ۱۴۰۱

شرکت کارگزاری بانک آینده



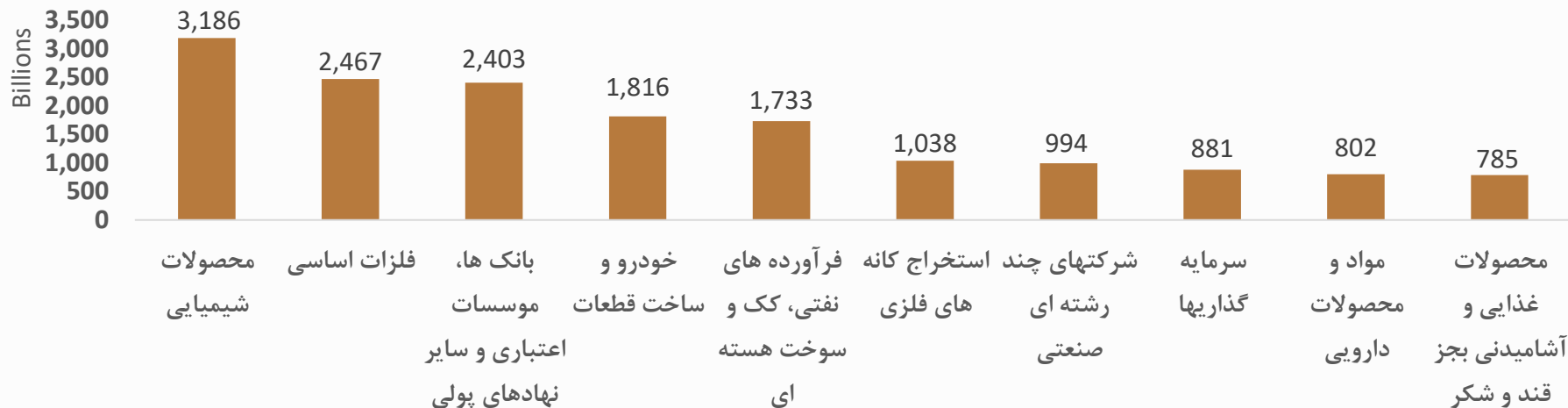


- صنعت عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم این هفته مورد توجه حقیقی ها قرار گرفته و بیشترین ورود پول حقیقی را در این هفته داشته است.



۱۰ صنعت برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)

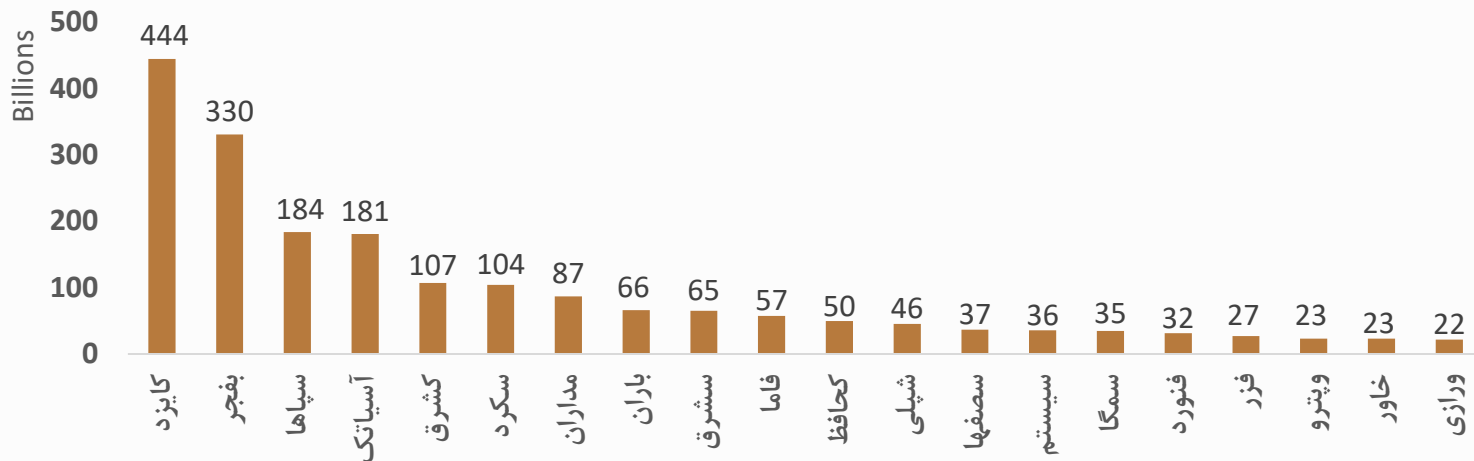
۱۰ صنعت برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنعت محصولات شیمیایی در این هفته توسط حقوقی ها مورد حمایت قرار گرفت.



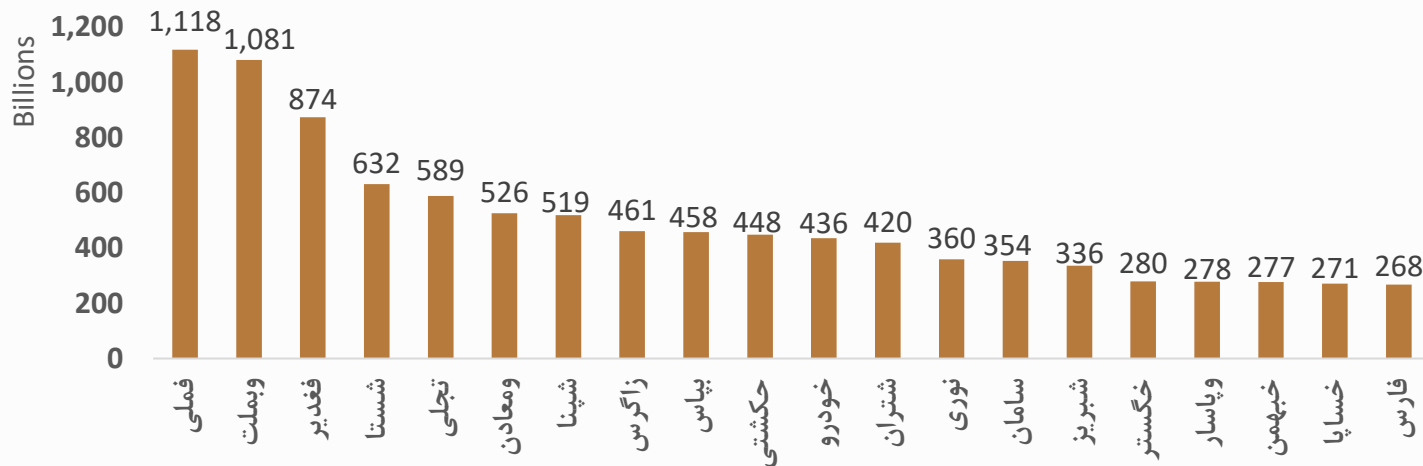
۲۰ نماد برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



- بیشترین ورود پول حقیقی در این هفته متعلق به شرکت فجر انرژی خلیج فارس می باشد. (شرکت فرانسوز یزد با توجه به این که تازه در بورس عرضه شده است معیار مناسبی نمی باشد)



۲۰ نماد برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)

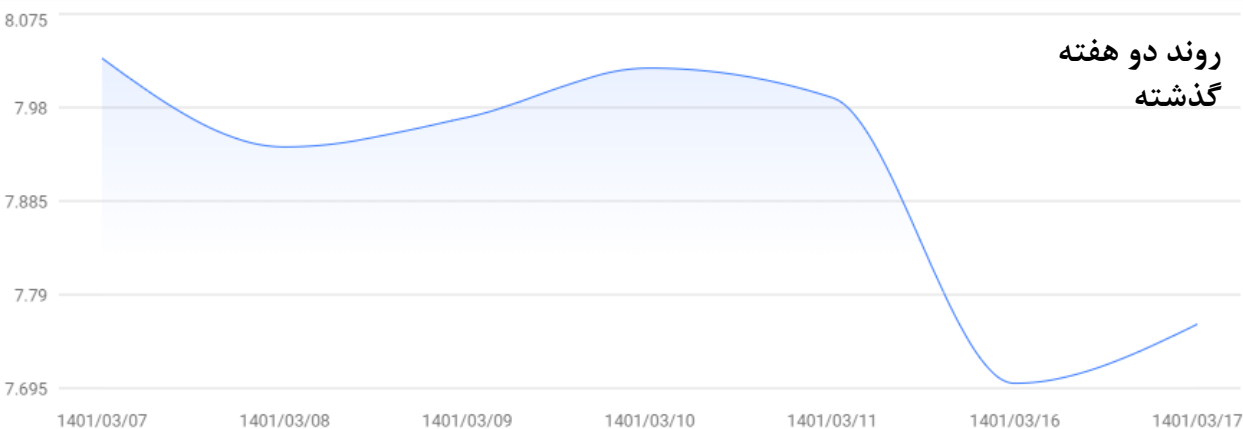


• بیشترین حمایت های حقوقی در این هفته از شرکت های فملی و وبملت بوده است.



شرکت کارگزاری بانک آینده

روند P/E بازار سرمایه



• **p/e ttm** بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۳/۱۸ به عدد ۷.۷۷ رسید.



شرکت کارگزاری بانک آینده

۲۰ نماد با پایین
ترین نسبت
P/E TTM

شرکت های سرمایه گذاری

نماد	P/E TTM
ثنور	۱.۹۹
ومدیر	۲.۱۱
وسکاب	۲.۵۷
مدیریت	۲.۶۹
وتوسم	۲.۷۸
وهامون	۳.۲۵
پردیس	۳.۴۷
وپویا	۳.۷۲
گوهرا	۴.۰۵
وآوا	۴.۴۸
وصنا	۴.۶۵
وصنعت	۴.۷۶
واتی	۴.۸۶
وخارزم	۴.۹۳
ونیکی	۴.۹۴
اعتلا	۵.۳۹
سنوین	۵.۵۶
ومهان	۵.۶۳
وسپه	۵.۷۷
وسبحان	۵.۸۶

شرکت های تولیدی و خدماتی

نماد	P/E TTM
ثامید	۳.۳۲
فزر	۴.۰۸
ولبهمن	۴.۱۱
وتجارت	۴.۲۵
بفجر	۴.۲۷
فسپا	۴.۵۲
فخوز	۴.۵۲
وبصادر	۴.۶۲
های وب	۴.۶۵
فولاد	۴.۶۸
دتهرا	۴.۸
وبملت	۴.۸۷
هرمز	۴.۹۲
اتکام	۴.۹۳
فسبزوار	۵.۰۸
ولساپا	۵.۲۷
فجر	۵.۲۹
فروس	۵.۳
وپست	۵.۳۵
سیمرغ	۵.۴۱



شرکت کارگزاری بانک آینده

بازدهی صنایع منتخب بازار سرمایه از ابتدای اسفند ۱۴۰۰

صنعت	درصد بازدهی	صنعت	درصد بازدهی
اطلاعات و ارتباطات	۵۹	سایر واسطه گریهای مالی	۳۵
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	فنی و مهندسی	۳۴
استخراج زغال سنگ	۴۸	دارویی	۳۲
فرآورده های نفتی	۴۶	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۳۲
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۴	انبوه سازی املاک و مستغلات	۳۰
سیمان آهک گچ	۴۳	دستگاه های برقی	۲۹
زراعت و خدمات وابسته	۴۲	محصولات فلزی	۲۷
استخراج سایر معادن	۴۱	غذایی بجز قند و شکر	۲۷
واسطه گری های مالی و پولی	۳۷	لاستیک و پلاستیک	۲۶
قند و شکر	۳۵	شیمیایی	۲۵
منسوجات	۳۵	ماشین آلات و تجهیزات	۲۲
کانی غیر فلزی	۳۵	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۱۹

- در بازه زمانی ابتدای اسفند ماه ۱۴۰۰ تا کنون سه صنعت اطلاعات و ارتباطات، عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم و استخراج زغال سنگ به ترتیب بیشترین درصد بازدهی را داشته اند.



شرکت کارگزاری بانک آینده

پربازده ترین و کم بازده ترین سهم از نظر تغییر قیمت از ابتدای اسفند ۱۴۰۰

نماد	درصد بازدهی
فمراد	۲۱۸
خچرخش	۲۰۳
اسیاتک	۱۶۳
وآذر	۱۶۲
سکرد	۱۵۷
زملارد	۱۳۹
سبزوا	۱۳۵
تلیسه	۱۲۵
ثغرب	۱۲۲
سفار	۱۱۷
زدشت	۱۱۵
ورنا	۱۰۷
ورازی	۱۰۴
غگل	۱۰۱
حپترو	۹۹
غاذر	۹۸
قثابت	۹۶
خدیزل	۹۵
خکاوه	۹۲
سصفها	۹۱

نماد	درصد بازدهی
وتعاون	-۶
امید	-۶
فجهان	-۷
وتوصا	-۷
تکشا	-۷
وبصادر	-۸
اپال	-۹
غپآذر	-۹
شفارا	-۱۳
تماوند	-۱۳
بشهاب	-۱۴
وسینا	-۱۴
توسن	-۱۵
رکیش	-۱۵
سمگا	-۱۶
ثاباد	-۱۷
دسانکو	-۱۸
دروز	-۲۰
ثامان	-۲۰
قشیر	-۲۸

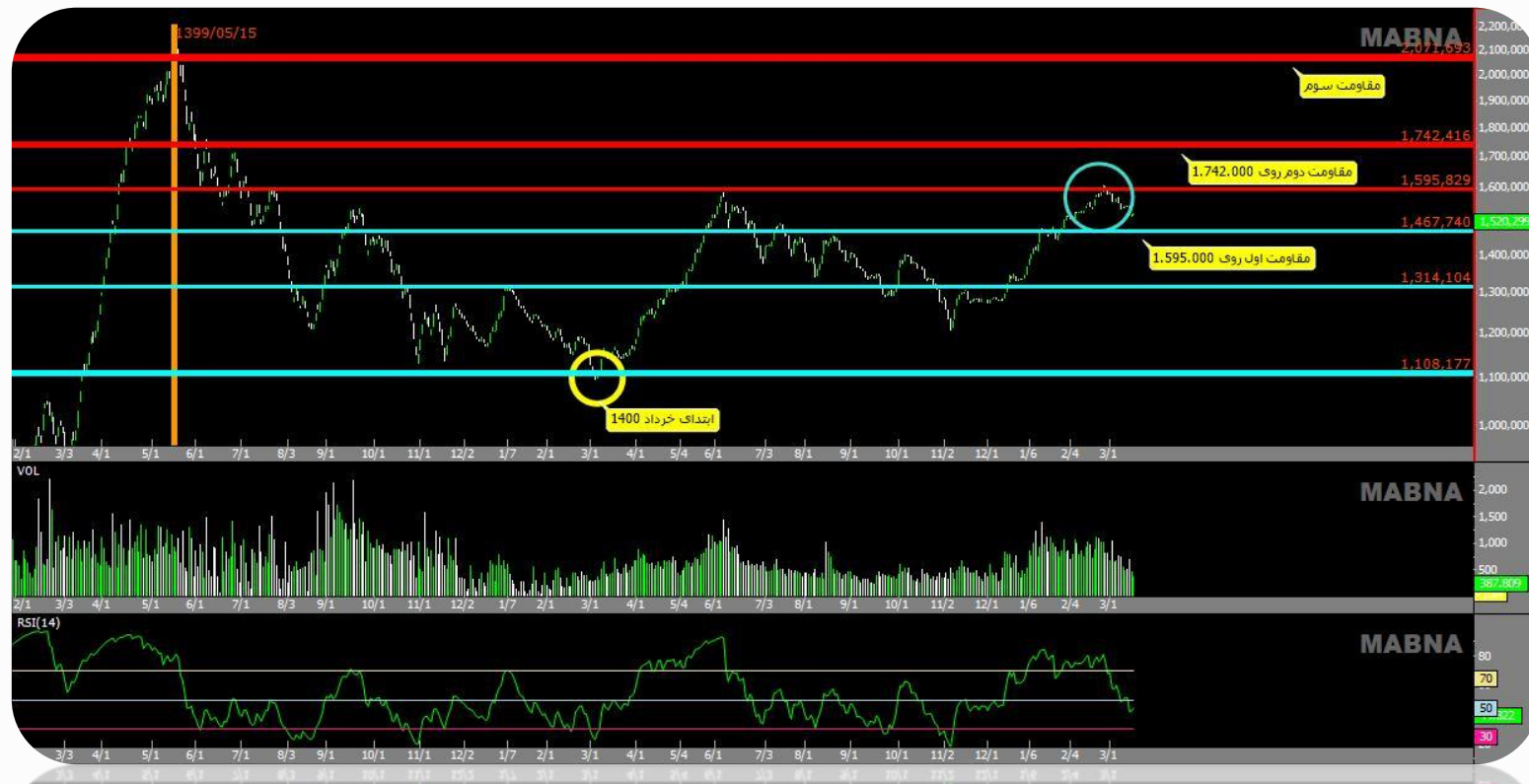
- در جدول، پربازده ترین شرکت ها از ابتدای اسفند ماه ۱۴۰۰ تاکنون، تعدادی از سهم های صنایع فلزی، خودرویی، اطلاعات و ارتباطات، انبوه سازی، سیمانی و زراعتی به چشم می خورد.

- در جدول کمترین بازدهی نیز دو شرکت قندی و انبوه سازی به چشم می خورد که دلیل افت این دو نماد، افزایش قابل توجه و رسیدن به نقطه مقاومتی قیمت سهم آنها بوده است.



شرکت کارگزاری بانک آینده

تحلیل تکنیکال شاخص کل



در هفته های گذشته شاهد نزدیک شدن شاخص کل به مقاومت خود و ریزش خفیف نمودار قیمتی آن بوده ایم.

۱- نمودار شاخص کل در حال حاضر مقاومت ۱.۵۹۵.۰۰۰ واحدی خود را لمس نموده است. در صورت شکست مقاومت خود می تواند تا مقاومت های ۱.۷۴۲.۰۰۰ و ۲.۰۷۱.۰۰۰ واحد نیز رشد نماید. که تا کنون نسبت به مقاومت خود واکنش داده و در حال نزول است.

۲- در صورت نزول و عدم شکست مقاومت فعلی خود می تواند تا حمایت های ۱.۴۶۷.۰۰۰ واحد، ۱.۳۱۴.۰۰۰ واحد، ۱.۱۰۸.۰۰۰ واحد کاهش یابد.



شرکت کارگزاری بانک آینده

تحلیل تکنیکال شاخص کل هم وزن



در هفته های گذشته با توجه به ریزش شاخص کل، شاهد ریزش شاخص کل هم وزن نیز بوده ایم.

۱- در صورت صعود نمودار شاخص کل هم وزن مقاومت های ۴۶۹.۵۰۴ و ۵۳۰.۶۱۴ واحد را پیش رو خواهد داشت.

۲- در صورت نزول نمودار شاخص کل هم وزن حمایت های ۳۸۹.۳۸۵ واحد، ۳۶۳.۱۱۸ واحد، و ۳۱۱.۲۳۷ واحد پیش روی نمودار خواهد بود.

با توجه به نمودار سهم می توان مشاهده کرد که روند نزولی شاخص کل هم وزن تا نزدیکی اولین حمایت خود یعنی ۳۸۹.۳۸۵ واحد محتمل است.



بررسی گزیده قیمت های جهانی



شرکت کارگزاری بانک
آینده

کالا	قیمت روز	قیمت دیروز	درصد تغییر	قیمت هفته قبل	درصد تغییر	قیمت هفته ما قبل	قیمت ماه قبل	اول سال
مس	۹,۶۶۸	۹,۷۲۵	-۰.۶٪	۹,۵۰۹	۱.۷٪	۹,۳۸۱	۹,۲۷۸	۹,۷۸۱
آلومینیم	۲,۸۱۴	۲,۷۹۲	۰.۸٪	۲,۷۳۱	۳.۰٪	۲,۸۷۴	۲,۷۵۸	۲,۸۴۹
روی	۳,۷۹۵	۳,۷۸۹	۰.۲٪	۳,۸۷۰	-۱.۹٪	۳,۷۵۷	۳,۶۲۳	۳,۶۵۰
نفت برنت	۱۲۲.۱	۱۲۱.۲	۰.۷٪	۱۱۶.۳	۵.۰٪	۱۱۱.۴	۱۰۵.۲	۷۸.۹
گاز طبیعی	۹.۳۲	۹.۳۲	۰.۰٪	۸.۷۶	۶.۴٪	۸.۹۱	۷.۰۴	۳.۷۶
اوره	۷۰۰	۷۰۰	۰.۰٪	۷۰۰	۰.۰٪	۷۰۰	۷۲۰	۸۶۵
متانول	۳۵۱	۳۵۱	۰.۰٪	۳۴۷	۱.۲٪	۳۴۰	۳۴۷	۳۱۹
اسلب	۵۷۰	۵۷۰	۰.۰٪	۶۳۰	-۹.۵٪	۶۵۵	۷۸۵	۵۶۸
بیلت	۵۵۷	۵۵۷	۰.۰٪	۵۵۵	۰.۴٪	۵۸۰	۶۶۳	۵۴۳
دلار آزاد	۳۱,۸۲۰	۳۱,۹۵۰	-۰.۴٪	۳۱,۸۵۰	-۰.۱٪	۳۰,۲۵۰	۲۸,۴۲۰	۲۹,۷۰۰
دلار نیما	۲۴,۷۰۶	۲۴,۶۱۹	۰.۴٪	۲۴,۴۳۴	۱.۱٪	۲۴,۴۳۴	۲۴,۹۲۵	۲۴,۷۴۶

- با توجه به حمایت های کشور چین از بخش تولید به کمک بسته های نقدینگی، شاهد رشد قیمت کامودیتی ها در هفته گذشته بودیم.
- اما در جلسه فردا که برای اروپا برگزار می شود، بنا است که نرخ بهره اتحادیه اروپا افزایش یابد که این موضوع سیگنالی منفی برای کلیت کامودیتی ها در هفته های آتی می باشد.



• در جدول زیر به بررسی ارزندگی حق تقدم های قابل معامله بازار پرداخته ایم.

نام سهام	قیمت سهم	قیمت حق تقدم	درصد اختلاف با فرض پرداخت ۱۰۰ تومان	نوع حق تقدم	تعلق سود تقسیمی به حق تقدم	تاریخ انقضا حق تقدم
بکام	۱,۶۸۲	۶۵۰	۲٪	استفاده نشده	بله	۱۴۰۱/۰۳/۲۶
ساروم	۲۹,۲۶۰	۲۷,۰۵۰	۴٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۴/۱۴
شپترو	۲,۰۰۵	۸۹۸	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۴/۱۴
وثنو	۲,۳۶۸	۱,۲۳۱	۶٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۴/۲۳
شتوکا	۱۷,۷۴۰	۱۵,۵۰۰	۸٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۴/۰۶
کخاک	۱۴,۹۳۰	۱۳,۴۰۰	۱۳٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۳/۱۴
سخاش	۶۰,۹۹۰	۵۲,۱۰۰	۱۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۳/۲۹
ومعادن	۵,۶۷۰	۳,۹۰۰	۱۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۰۸
کمینا	۱۱,۵۳۰	۸,۸۰۰	۱۸٪	استفاده نشده	بله	۱۴۰۱/۰۳/۳۰
مادیرا	۳,۰۰۵	۱,۴۴۰	۲۳٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۴/۰۴
شفن	۱۲,۱۲۰	۸,۸۰۰	۲۴٪	استفاده نشده	بله	۱۴۰۱/۰۳/۲۹
فگستر	۷,۴۶۰	۴,۸۰۰	۲۹٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۳/۲۳
فجهان	۳,۴۷۲	۱,۶۴۳	۳۱٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۴/۰۳
شبریز	۲۲,۷۵۰	۱۴,۶۹۰	۴۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۴/۱۶
صبا	۴,۸۵۰	۲,۲۴۸	۴۹٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۴/۰۲



بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

نماد	نام	تعداد	حجم	ارزش	پایانی	درصد تفاوت	پایانی / قیمت روز
خود۴۰۰۹	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۴/۰۸	۱	۲۲	۳,۴۹۸,۰۰۰	۱۵۹	۴.۰٪	۸٪
ضمنت۳۰۰۸	اختیارخ وبملت-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۳۰	۱,۰۶۷	۱,۹۲۰,۷۵۹,۰۰۰	۱,۸۰۰	۲.۹٪	۴۹٪
ضمنت۳۰۱۰	اختیارخ وبملت-۲۵۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۳۳	۷۱۱	۷۸۲,۹۴۸,۰۰۰	۱,۱۰۱	۲.۹٪	۳۰٪
ضمنت۳۰۰۹	اختیارخ وبملت-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۲۲	۱,۱۰۱	۱,۷۷۲,۶۴۹,۰۰۰	۱,۶۱۰	۲.۶٪	۴۳٪
ضمنت۳۰۱۱	اختیارخ وبملت-۳۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۲۸	۴۷۰	۲۸۸,۰۹۱,۰۰۰	۶۱۳	۲.۶٪	۱۷٪
ضمنت۳۰۱۲	اختیارخ وبملت-۳۵۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۱۱۵	۳,۳۵۵	۳۸۴,۲۱۶,۰۰۰	۱۱۵	۲.۵٪	۳٪
ضفلا۳۰۱۲	اختیارخ فولاد-۱۰۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۱۰۶	۲,۲۴۲	۲,۲۸۶,۳۵۶,۰۰۰	۱,۰۲۰	۲.۴٪	۹٪
ضفلا۳۰۰۹	اختیارخ فولاد-۷۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۸	۵	۱۹	۷۷,۱۸۰,۰۰۰	۴,۰۶۲	۲.۰٪	۳۶٪
ضسپا۳۰۱۲	اختیارخ خساپا-۱۴۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۲	۸۲۱	۳۳۰,۳۴۰,۰۰۰	۴۰۲	۱.۷٪	۲۲٪
ضسپا۳۰۱۱	اختیارخ خساپا-۱۲۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۳۵	۳,۵۰۰	۲,۱۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۶۰۹	۱.۴٪	۳۳٪

• در جدول فوق ۱۰ اختیار خرید ارزنده بازار قرار گرفته اند.



بررسی اختیار معاملات برترین ارزش معاملات

نماد	نام	تعداد	حجم	ارزش	پایانی	درصد تفاوت	پایانی / قیمت روز
زستا۷۰۰۳	اختیارخ شستا-۱۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۱,۸۶۱	۱۰۸,۷۳۲	۱۳,۷۵۶,۷۸۶,۰۰۰	۱۲۷	-۱۶.۸٪	۱۳٪
زهرم۶۰۰۳	اختیارخ اهرم-۱۳۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۳۰	۷۴۶	۷۴,۵۸۶	۱,۰۸۱,۸۷۱,۰۰۰	۱,۴۵۱	-۱۵.۰٪	۱۲٪
زخود۴۰۱۱	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۴/۰۸	۱,۰۴۷	۴۳,۵۲۲	۵,۴۵۷,۵۱۴,۰۰۰	۱۲۵	-۴.۱٪	۶٪
زسپا۳۰۱۳	اختیارخ خساپا-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۲۲۴	۱۴,۹۶۰	۳,۱۶۷,۷۱۷,۰۰۰	۲۱۲	۱.۲٪	۱۲٪
زستا۷۰۰۵	اختیارخ شستا-۱۲۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۲۱۹	۱۴,۳۳۶	۷۱۳,۹۴۲,۰۰۰	۵۰	-۲۹.۵٪	۵٪
زسپا۸۰۵۰	اختیارخ خساپا-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۱۴۶	۹,۱۵۰	۲,۸۳۷,۱۴۰,۰۰۰	۳۱۰	-۱۵.۰٪	۱۷٪
زستا۷۰۰۱	اختیارخ شستا-۸۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۱۱۱	۹,۰۲۷	۲,۲۳۸,۸۷۳,۰۰۰	۲۴۸	-۸.۶٪	۲۶٪
زسپا۳۰۱۵	اختیارخ خساپا-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۱۵۹	۷,۴۹۱	۴۰,۹۶۱,۰۰۰	۵	-۹.۳٪	۰٪
زخود۴۰۱۲	اختیارخ خودرو-۲۲۰۰-۱۴۰۱/۰۴/۰۸	۱۲۵	۶,۸۸۵	۱۹۹,۸۲۲,۰۰۰	۲۹	-۹.۲٪	۱٪
زخود۸۰۰۹	اختیارخ خودرو-۱۹۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۹۵	۵,۸۰۱	۹۳۵,۰۳۰,۰۰۰	۱۶۱	-۱.۰٪	۸٪

• در جدول فوق ۱۰ اختیار خرید جذاب بازار قرار گرفته اند.



نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
وبوعلی	۳۰۰	-	-
پارسیان	۵۰	-	-
دتوزیع	۴,۲۴۰	-	-
زمگسا	۲,۰۴۰	-	-
غگلستا	۶۲۰	-	-
سپید	۸۰۰	-	-
داسوه	۲,۲۰۰	-	-
دلر	-	۱۰۰٪	مطالبات و آورده نقدی
پارتا	-	۱۱۴٪	مازاد تجدید ارزیابی دارایی ها
وگستر	-	۱۰۰٪	مطالبات و آورده نقدی



شرکت کارگزاری بانک آینده

اهم مجامع هفته پیش رو

نماد	موضوع	EPS	آخرین درصد تقسیم سود	محاسبه درصد بازگشت پول در صورت خرید	تاریخ
تجلی	مجمع عادی سالیانه	۳۱	۱۱٪	۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۱
شفارا	مجمع عادی سالیانه	۱۵۷	۰٪	۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
قمرو	تصمیم گیری در خصوص افزایش سرمایه	-	-	-	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
وسپهر	مجمع عادی سالیانه	۱,۰۹۳	۸۶٪	۱۱٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
بیپاس	مجمع عادی سالیانه	۱,۰۱۹	۱۰٪	۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
دتماد	مجمع عادی سالیانه	۵,۸۲۴	۹۳٪	۱۳٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
همراه	مجمع عادی سالیانه	۱,۰۳۹	۹۲٪	۱۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
فروی	مجمع عادی سالیانه	۷۳۰	۶۳٪	۳٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
سیستم	مجمع عادی سالیانه	۵۲۱	۷۴٪	۶٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۳
شکلر	تصمیم گیری در خصوص افزایش سرمایه	-	-	-	۱۴۰۱/۰۳/۲۳
فگستر	مجمع عادی سالیانه	۱,۰۸۴	۸۰٪	۱۲٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۴
والبر	مجمع عادی سالیانه	۶۳۲	۴۲٪	۳٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۴
کلر	مجمع عادی سالیانه	۵,۲۸۵	۹۷٪	۶٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۴
کرازی	مجمع عادی سالیانه	۱۸۳	۲۲٪	۳٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
شپترو	مجمع عادی سالیانه	(۳۷۹)	۰٪	۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
دفارا	مجمع عادی سالیانه	۱,۷۷۷	۱۰۰٪	۱۴٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
هرمز	مجمع عادی سالیانه	۳,۲۰۹	۲۲٪	۴٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
غصینو	مجمع عادی سالیانه	۵۷۴	۲۶٪	۱٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
زپارس	مجمع عادی سالیانه	۷۲۴	۲۰٪	۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
خزر	مجمع عادی سالیانه	۱,۳۴۸	۹۷٪	۶٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵
خمحرکه	مجمع عادی سالیانه	۸۰	۱۰٪	۰٪	۱۴۰۱/۰۳/۲۵



شرکت کارگزاری بانک آینده

واچ لیست پیشنهادی کارگزاری بانک آینده

نماد	توضیحات
سپید	اصلاح قیمت در هفته های گذشته، محدوده مناسب تکنیکالی، پی بر ای مناسب شرکت با توجه به افزایش نرخ محصولات
سپاها	پی بر ای مناسب شرکت، محدوده مناسب تکنیکالی، احتمال افزایش نرخ سیمان
ونوین	محدوده قیمتی مناسب از لحاظ تکنیکالی، اصلاح مناسب قیمتی، عقب ماندگی صنعت بانکداری از سایر صنایع
شوینده	اصلاح قیمت در هفته های گذشته، محدوده مناسب تکنیکالی، احتمال افزایش نرخ محصولات در هفته های آتی



خدمات شرکت کارگزاری بـانـکـی آینـده

تخفیف کارمزد معاملات

ارائه اعتبار به محض ورود

ارائه تحلیل هفتگی

اعتبار بدون هزینه مالی

صندوق های سرمایه گذاری درآمد ثابت

صندوق گسترش فردای ایرانیان



صندوق گنجینه آینده روشن

