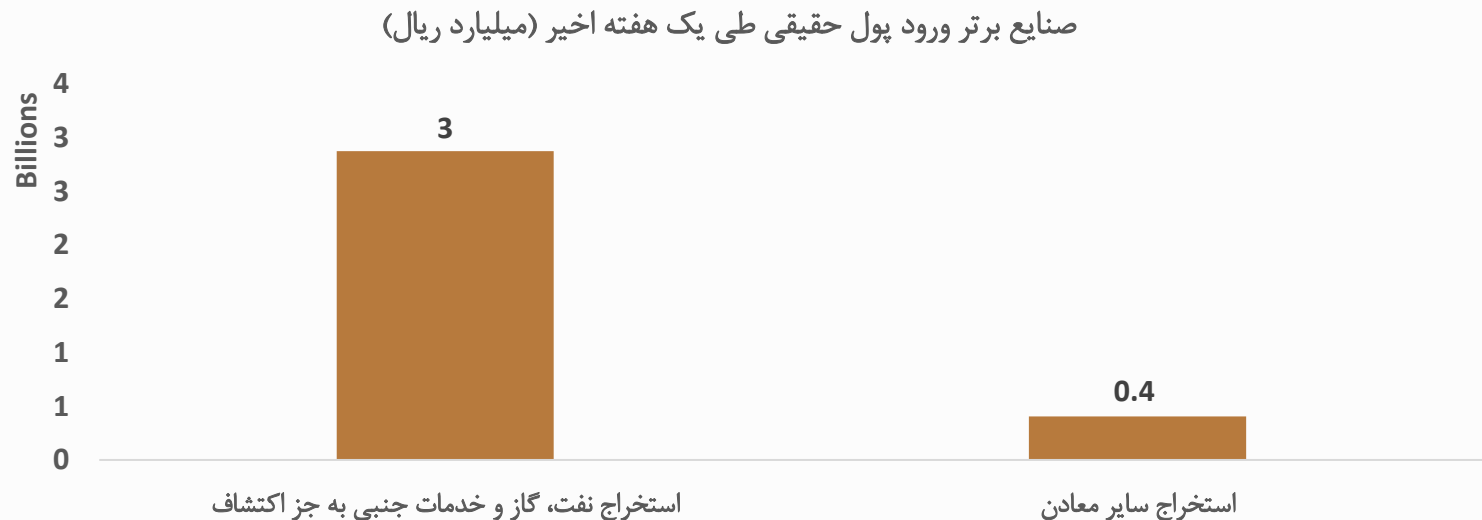


گزارش هفتگی بازار منتهی به ۱۲ مرداد ۱۴۰۱

شرکت کارگزاری بانک آینده

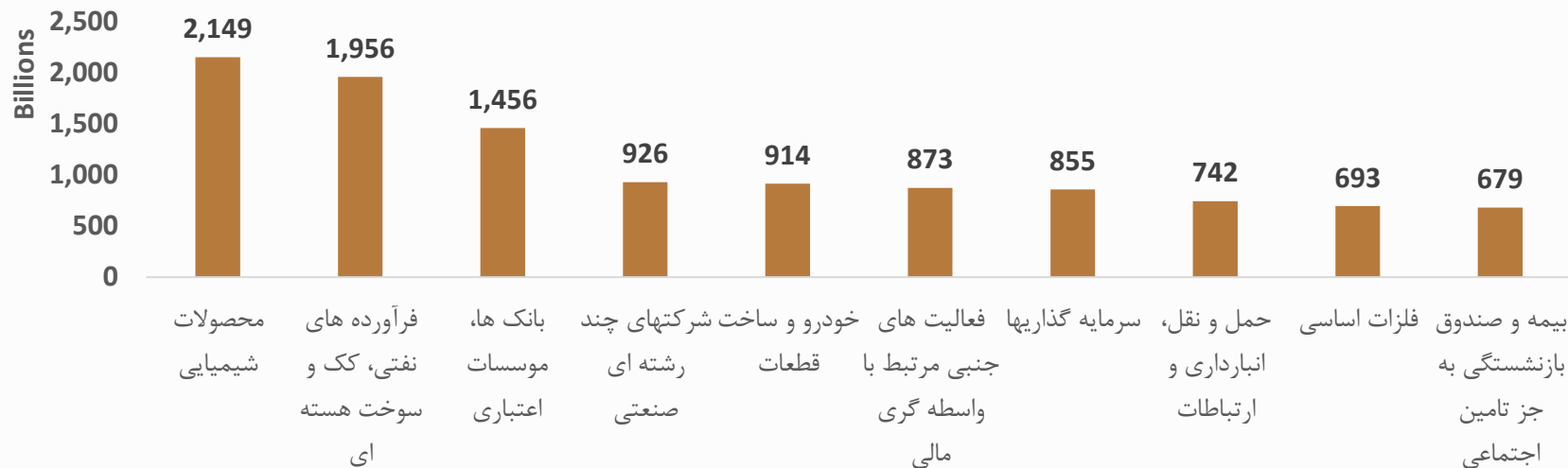




- به علت پایین بودن ارزش معاملات و باتوجه به خروج پول حقیقی سنگین در این هفته تنها دو صنعت استخراج نفت و گاز و استخراج سایر معادن ورود پول حقیقی داشتند.



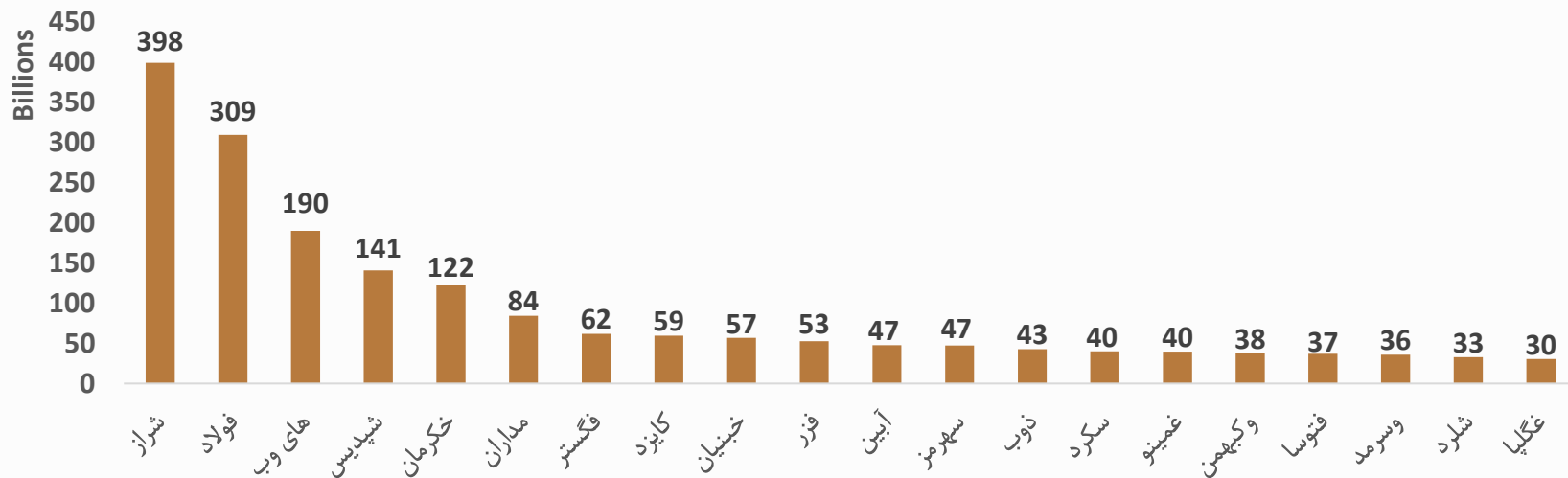
۱۰ صنعت برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنعت محصولات شیمیایی و فرآورده های نفتی در این هفته توسط حقوقی ها مورد حمایت قرار گرفت.



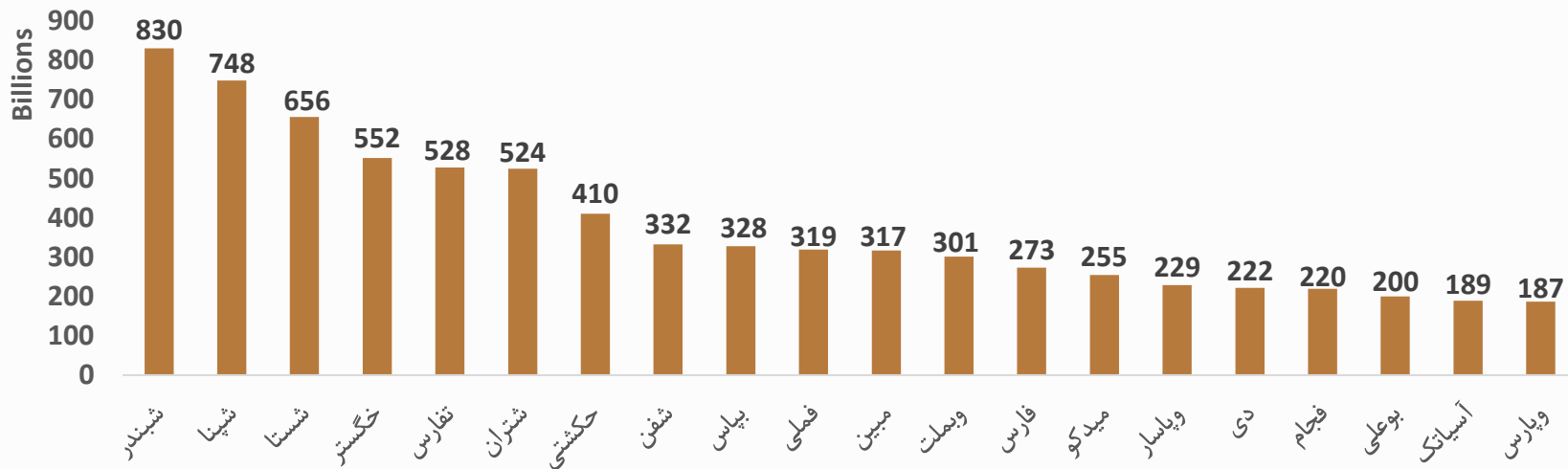
۲۰ نماد برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• بیشترین ورود پول حقیقی در این هفته متعلق به شرکت پالایش نفت شیراز (شراز) می باشد.



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

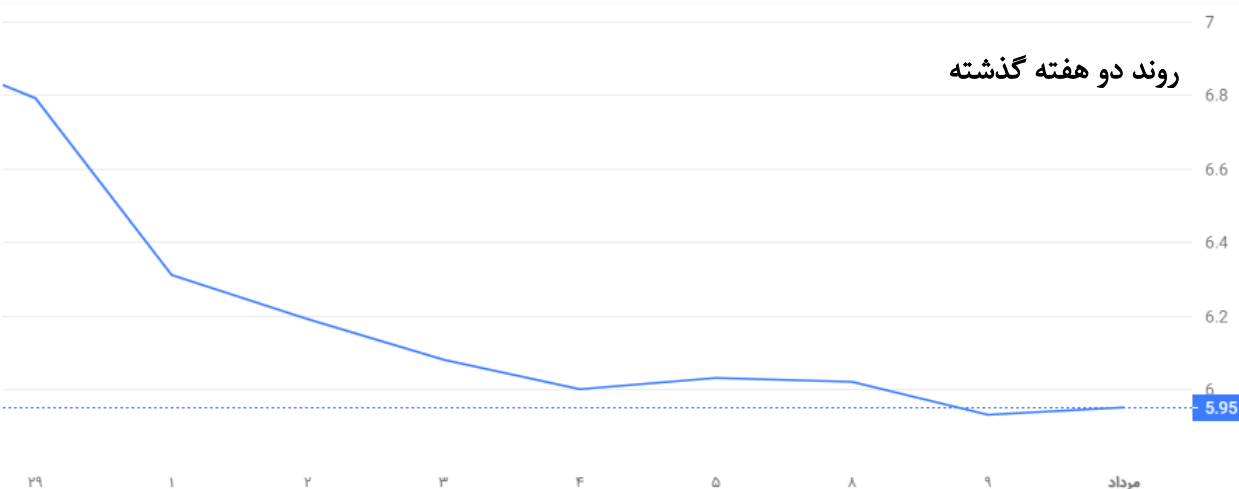


• بیشترین حمایت های حقوقی در این هفته از شرکت های شبندر و شپنا بوده است.



شرکت کارگزاری بانک آینده

روند P/E بازار سرمایه



• p/e ttm بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۵/۱۲ به عدد ۵.۸۷ رسید.



شرکت کارگزاری بانک آینده

۲۰ نماد با پایین

ترین نسبت

P/E TTM

شرکت های سرمایه گذاری

نماد	P/E TTM
ثنور	۱.۷
ومدیر	۱.۹۶
پردیس	۲.۵۳
وتوسم	۲.۵۴
وکبهن	۲.۵۷
وآفر	۲.۵۸
وبوعلی	۲.۶۸
وسکاب	۲.۷
وهامون	۲.۷۶
سنوین	۳.۴۴
گوهران	۳.۶۴
اعتلا	۳.۸۱
وپویا	۳.۹۴
وصنعت	۳.۹۵
وبانک	۴.۰۳
واتی	۴.۰۶
وخارزم	۴.۰۹
مدیریت	۴.۱۳
ونیکی	۴.۲۹
وصندوق	۴.۳۴

شرکت های تولیدی و خدماتی

نماد	P/E TTM
ثامید	۳.۰۸
وبملت	۳.۲
ولبهن	۳.۲۹
ونوین	۳.۴
شبندر	۳.۶۱
هرمز	۳.۷۲
شتران	۳.۷۵
ولسپا	۳.۹
های وب	۳.۹۳
فسپا	۳.۹۷
فخوز	۴.۰۹
فاسمین	۴.۰۹
فروس	۴.۱۱
فملی	۴.۱۲
کرماشا	۴.۲۲
مبین	۴.۲۳
فجر	۴.۳۳
حتاید	۴.۳۸
کقزوی	۴.۴۴
وپست	۴.۴۸



شرکت کارگزاری بانک آینده

بازدهی صنایع منتخب بازار سرمایه از ابتدای اسفند ۱۴۰۰

صنعت	درصد بازدهی	صنعت	درصد بازدهی
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۶۴	سایر حمل و نقل	۲۲
فرآورده های نفتی	۴۸	استخراج زغال سنگ	۲۰
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۷	قند و شکر	۲۰
خرده فروشی	۴۴	استخراج سایر معادن	۱۹
اطلاعات و ارتباطات	۴۳	دستگاههای برقی	۱۶
سیمان آهک گچ	۳۶	فنی و مهندسی	۱۳
واسطه گریه های مالی و پولی	۳۳	خودرو و قطعات	۱۳
سایر واسطه گریه های مالی	۳۰	انبوه سازی املاک و مستغلات	۱۳
زراعت و خدمات وابسته	۲۳	منسوجات	۱۲
دارویی	۲۲	محصولات فلزی	۱۱
کانی غیر فلزی	۲۲	کاشی و سرامیک	۱۱
شیمیایی	۲۲	ماشین آلات و تجهیزات	۱۰

- در بازه زمانی ابتدای اسفند ماه ۱۴۰۰ تا کنون چهار صنعت عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم ، فرآورده نفتی، حمل و نقل انبارداری و ارتباطات و خرده فروشی به ترتیب بیشترین درصد بازدهی را داشته اند.



شرکت کارگزاری بانک آینده

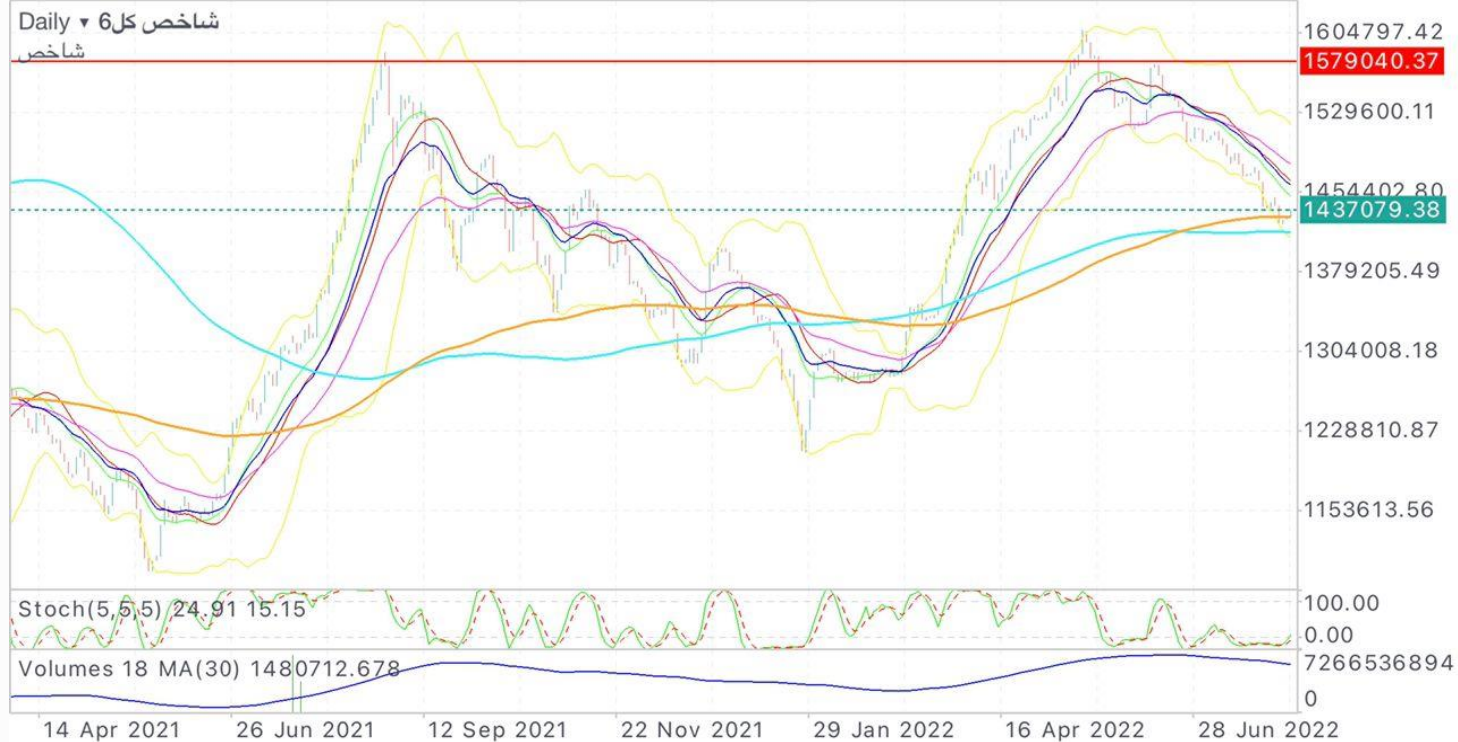
پر بازده ترین و کم بازده ترین سهام از ابتدای اسفند ۱۴۰۰

نماد	درصد بازدهی
وسالت	۸۴۴
فبستم	۵۷۴
پشاهن	۴۴۶
آبین	۳۴۹
بتک	۲۷۰
بهیر	۲۳۳
نبروج	۲۰۶
سکرد	۲۰۴
ثغرب	۱۸۹
وآذر	۱۷۹
خبنيان	۱۷۰
واحصا	۱۶۵
خچرخش	۱۶۲
کساپا	۱۶۱
اسیاتک	۱۶۱
فافزا	۱۴۵
حپترو	۱۴۱
سپرمی	۱۳۴
فمراد	۱۲۵
خعمرا	۱۱۵

نماد	درصد بازدهی
دسانکو	-۴۶
قشیر	-۴۵
زنجان	-۴۵
وشمال	-۴۴
ثاباد	-۴۴
رکیش	-۴۴
دروز	-۴۱
انرژی ۳	-۳۷
سخواف	-۳۷
تکشا	-۳۶
غصینو	-۳۵
سمایه	-۳۵
حاریا	-۳۵
سمگا	-۳۵
وآفر	-۳۵
وملل	-۳۵
حشکوه	-۳۴
بشهاب	-۳۲
شفن	-۳۱
حگردش	-۳۱

- در جدول، پر بازده ترین شرکت ها از ابتدای اسفند ماه ۱۴۰۰ تاکنون، تعدادی از سهم های صنایع خودرویی، انبوه سازی، زراعت، سرمایه گذاری، به چشم می خورد.

- در جدول کمترین بازدهی نیز تعدادی از سهم های صنایع سرمایه گذاری، حمل و نقل و دارویی به چشم می خورد که دلیل افت این نمادها، افزایش قابل توجه و رسیدن به نقطه مقاومتی قیمت سهم آنها بوده است .



شرکت کارگزاری بانک آینده

تحلیل تکنیکال شاخص کل

با برخورد به حمایت خود، شاهد مثبت شدن شاخص کل بودیم.

۱- در صورت صعود روند باید به مقاومت های ۱.۴۵۰.۰۰۰ ، ۱.۴۸۰.۰۰۰ ، ۱.۵۰۰.۰۰۰ و ۱.۵۱۵.۰۰۰ واحد توجه شود.

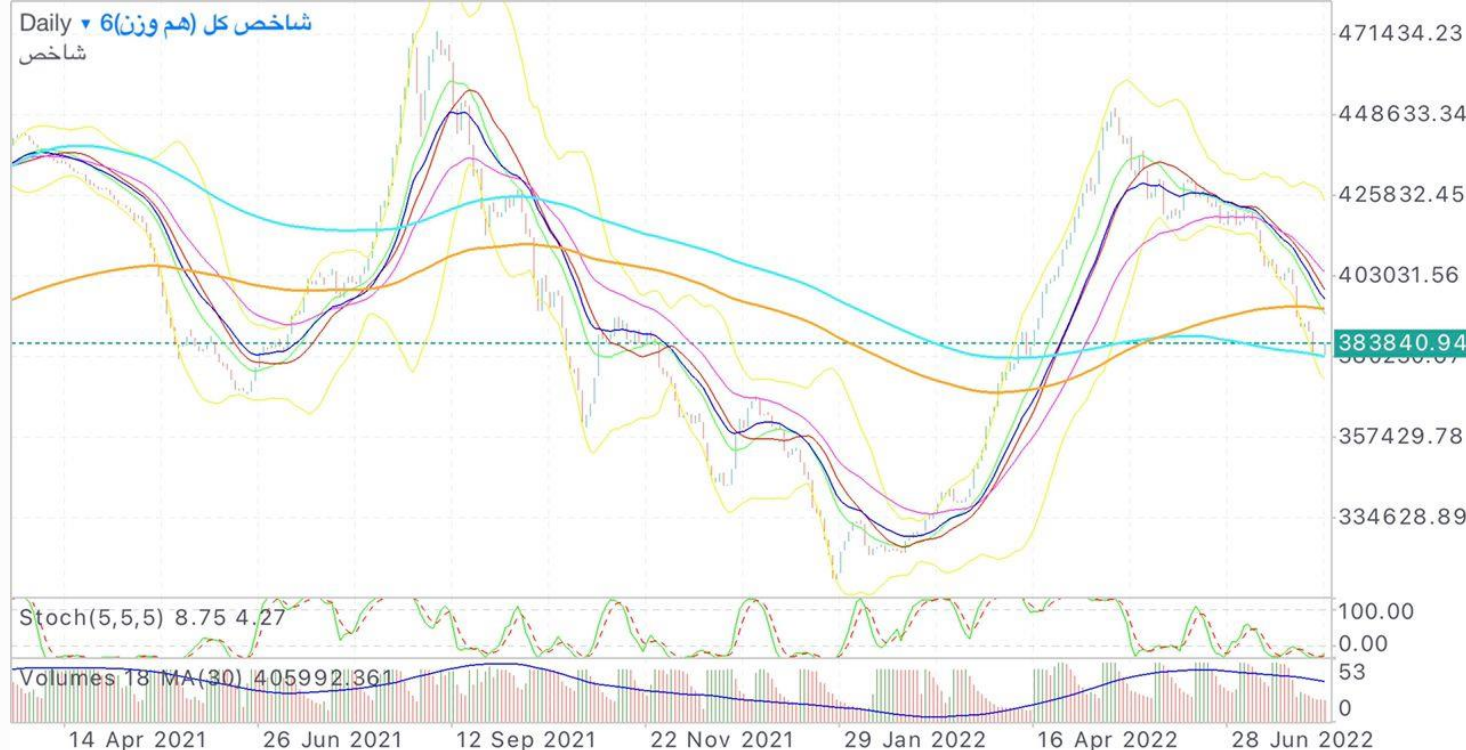
۲- در صورت نزول باید به حمایت های ۱.۴۳۰.۰۰۰ ، ۱.۴۱۴.۰۰۰ ، ۱.۴۰۰.۰۰۰ و ۱.۳۸۰.۰۰۰ واحد امیدوار بود.

در تایم فریم هفتگی نمودار، الگوی Bullish Triangle دیده می شود و عدد کنونی شاخص هم در کف کانال قرار دارد. همچنین اگر در تایم فریم دیلی به نمودار میان مدت شاخص توجه کنیم، الگوی Cup & Handle را مشاهده می کنیم که با برخورد با مووینگ ۲۰۰ روزه واکنش مثبت داده است. بنابر این از لحاظ تکنیکالی به نظر می رسد ریزش شاخص کل در روزهای پایانی خود باشد.



شرکت کارگزاری بانک آینده

تحلیل تکنیکال شاخص کل هم وزن



در هفته های گذشته پس از ریزش شاخص کل شاهد ریزش شاخص کل هم وزن نیز بوده ایم.

۱- در صورت صعود نمودار شاخص کل هم وزن مقاومت های ۳۹۴.۰۰۰ و ۴۰۴.۰۰۰ واحد را پیش رو خواهد داشت.

۲- در صورت نزول نمودار شاخص کل هم وزن حمایت های ۳۸۰.۰۰۰ واحد، ۳۷۰.۰۰۰ واحد و ۳۶۰.۰۰۰ واحد پیش روی نمودار خواهد بود.

در نمودار روزانه شاخص به حمایت مووینگ ۲۰۰ روزه خود برخورد کرده و واکنش مثبت داده است. به نظر می رسد تا حمایت ۳۷۰.۰۰۰ واحد احتمال ریزش همچنان وجود داشته باشد. در صورت شکست مقاومت ۳۹۴.۰۰۰ واحد، روند میان مدت شاخص دوباره صعودی خواهد شد.



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 جهانی	۷,۷۹۱	۷,۷۷۶	۰.۲٪	۷,۶۳۷	۲.۰٪	۷,۳۳۹	۷,۹۸۲	۹,۷۸۱
آلومینیم جهانی	۲,۴۲۷	۲,۴۱۸	۰.۴٪	۲,۴۲۷	۰.۰٪	۲,۴۲۵	۲,۴۶۷	۲,۸۴۹
روی جهانی	۳,۲۷۴	۳,۲۸۵	-۰.۴٪	۳,۰۳۸	۷.۸٪	۳,۰۰۲	۳,۱۱۳	۳,۶۵۰
نفت برنت	۹۹.۹	۱۰۰.۲	-۰.۳٪	۱۰۲.۳	-۲.۳٪	۱۰۶.۹	۱۱۳.۸	۷۸.۹
گاز طبیعی	۷.۸۳	۷.۶۶	۲.۳٪	۸.۶۰	-۹.۰٪	۷.۸۹	۵.۸۷	۳.۷۶
اوره خلیج فارس	۶۷۵	۶۷۵	۰.۰٪	۵۶۳	۱۹.۹٪	۵۷۵	۶۱۲	۸۶۵
متانول پلتس	۳۰۵	۳۰۵	۰.۰٪	۳۰۲	۱.۰٪	۲۹۷	۳۱۵	۳۱۹
اسلب فوب ایران	۵۲۵	۵۲۵	۰.۰٪	۵۲۵	۰.۰٪	۵۲۵	۵۲۵	۵۶۸
بیلت فوب ایران	۵۱۷	۵۱۷	۰.۰٪	۵۱۷	۰.۰٪	۵۱۷	۵۱۷	۵۴۳
دلار آزاد	۳۱,۳۶۰	۳۱,۶۱۰	-۰.۸٪	۳۱,۹۲۰	-۱.۸٪	۳۱,۷۵۰	۳۱,۷۰۰	۲۹,۷۰۰
دلار نیما	۲۶,۵۹۹	۲۶,۵۴۸	۰.۲٪	۲۶,۶۴۲	-۰.۲٪	۲۶,۲۳۲	۲۵,۸۵۶	۲۴,۷۴۶



شرکت کارگزاری بانک آینده

بررسی NAV شرکت ومعادن

بررسی پورتفوی غیر بورسی (اعداد به میلیارد ریال)

نام	% مالکیت	ارزش بازار	درصد از ارزش بازار	ارزش افزوده
کگل	۱۶٪	۴۱۲,۸۵۵	۲۸٪	۳۹۳,۲۳۹
کچاد	۱۷٪	۲۹۸,۵۶۳	۲۰٪	۲۸۴,۱۰۴
کگهر	۱۸٪	۲۳۱,۹۱۴	۱۶٪	۲۲۶,۳۲۳
کنورح	۶۴٪	۱۵۰,۶۳۱	۱۱٪	۱۵۰,۱۸۳
کگلج	۵٪	۱۲۷,۳۰۷	۹٪	۱۲۰,۴۷۳
فخاس	۳۲٪	۱۲۲,۳۷۵	۸٪	۱۱۶,۲۸۲
سایر	۰٪	۱۱۹,۸۳۸	۸٪	۴۶,۳۱۳
جمع کل	-	۱,۴۶۳,۴۸۳	۱۰۰٪	۱,۳۳۶,۹۱۷

بررسی پورتفوی بورسی (اعداد به میلیارد ریال)

نام	% مالکیت	ارزش روز	درصد از ارزش روز	ارزش افزوده
توسعه آهن و فولاد گل گهر	۱۰٪	۵۷,۱۸۸	۵۵٪	۴۶,۹۷۴
کک طبیس	۵۰٪	۱۱,۵۷۲	۱۱٪	۹,۴۳۰
سرمایه گذاری پرتو تابان معادن و فلزات	۹۹٪	۲,۰۰۰	۲٪	۱,۹۰۷
سایر	۰٪	۳۳,۶۷۵	۳۲٪	۲
جمع کل	-	۱۰۴,۴۳۵	۱۰۰٪	۵۸,۳۱۳



شرکت کارگزاری بانک آینده

بررسی NAV شرکت ومعادن

محاسبه NAV	
۲۸۹,۰۷۸	ارزش دفتری حقوق صاحبان سهام (میلیارد ریال)
۱,۳۳۶,۹۱۷	افزایش (کاهش) پورتهوی بورسی (میلیارد ریال)
۵۸,۳۱۳	افزایش (کاهش) پورتهوی غیر بورسی (میلیارد ریال)
.	اضافه می شود: ذخیره کاهش ارزش سرمایه گذاری ها (میلیارد ریال)
.	اضافه می شود: سود تقسیمی شرکت های زیرمجموعه (میلیارد ریال)
۳۶	سود (زیان) واگذاری سرمایه گذاری ها (میلیارد ریال)
۱,۶۸۴,۳۴۶	جمع مبالغ فوق (میلیارد ریال)
۱۹۲,۴۲۸	سرمایه ثبت شده و نشده (میلیارد ریال)
۸,۷۵۳	NAV (ریال)
۴,۹۹۲	قیمت تابلو (ریال)
۵۷٪	P/NAV

- ارزش روز پورتهوی بورسی شرکت ۱,۴۶۳,۴۸۳ میلیارد ریال و ارزش افزوده بورسی شرکت مبلغ ۱,۳۳۶,۹۱۷ میلیارد ریال می باشد.
- مهمترین شرکتهای بورسی آن عبارتند از: معدنی و صنعتی گل گهر، معدنی و صنعتی چادرملو، سنگ آهن گهرزمین.
- ارزش برآوردی پورتهوی غیر بورسی شرکت ۱۰۴,۴۳۵ میلیارد ریال و ارزش افزوده غیر بورسی شرکت مبلغ ۵۸,۳۱۳ میلیارد ریال می باشد.
- بدین ترتیب NAV هر سهم ومهان ۸,۷۵۳ ریال و نسبت P/NAV روز شرکت ۵۷ درصد 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 قیمت سهم نسبت به حق تقدم با فرض پرداخت ۱۰۰ تومان	نوع حق تقدم	تعلق سود تقسیمی به حق تقدم	تاریخ انقضا حق تقدم
وثنو	۱,۷۱۵	۶۶۷	۳٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۲۲
رکیش	۲,۸۲۱	۱,۷۱۵	۴٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۵/۰۲۶
وسپه	۳,۹۹۹	۲,۷۸۵	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱
هجرت	۱۶,۹۷۰	۱۵,۰۳۰	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۱۹
دارو	۱۳,۷۰۰	۱۱,۹۳۰	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۲۲
دلر	۱۹,۱۹۰	۱۷,۰۱۰	۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱
میدکو	۱۷,۷۴۰	۱۵,۵۷۰	۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۲۵
شپترو	۱,۶۵۶	۴۷۸	۱۲٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۱۳
کی بی سی	۸,۳۱۰	۶,۳۰۰	۱۴٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۱۰
وگستر	۲,۸۵۰	۱,۴۴۲	۱۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۴
کفرا	۷,۰۷۰	۵,۰۵۰	۱۷٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۱۹
وملل	۳,۰۱۷	۱,۳۸۱	۲۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۱۹



بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

نماد	نام	تعداد	حجم	ارزش	پایانی	درصد تفاوت	پایانی/قیمت روز
ضخود ۵۰۰۱	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۱,۴۳۸	۲۴۹,۰۵۵	۴,۹۳۵,۶۴۱,۰۰۰	۲۰	۲.۷٪	۱٪
ضخود ۵۰۰۰	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۴۳۹	۶۰,۳۷۲	۷,۲۸۱,۴۹۰,۰۰۰	۱۲۱	۲.۷٪	۶٪
ضسلا ۶۰۰۳	اختیارخ سلام-۷۵۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۳	۳۲	۳۹,۹۶۰,۰۰۰	۱,۲۴۹	۰.۷٪	۱۴٪
ضخود ۶۰۰۲	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۳۴	۲,۰۳۳	۳۶۲,۴۴۵,۰۰۰	۱۷۸	-۰.۴٪	۱۰٪
ضرنا ۶۰۰۱	اختیارخ ورن-۳۷۵۰-۱۴۰۱/۰۶/۲۸	۱	۵	۵,۳۵۰,۰۰۰	۱,۰۷۰	-۰.۴٪	۲۲٪
ضخود ۶۰۰۱	اختیارخ خودرو-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۱۸	۱,۹۰۰	۵۳۴,۱۶۰,۰۰۰	۲۸۱	-۰.۵٪	۱۵٪
ضسلا ۶۰۰۴	اختیارخ سلام-۸۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۷	۱۳۱	۱۱۴,۶۵۲,۰۰۰	۸۷۵	-۰.۷٪	۱۰٪
ضخود ۵۰۰۲	اختیارخ خودرو-۱۹۰۰-۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۸	۳,۰۹۰	۳,۰۹۰,۰۰۰	۱	-۱.۶٪	۰٪
ضهرم ۶۰۱۲	اختیارخ اهرم-۹۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۳۰	۹۴	۵۸,۶۸۸	۱,۰۰۹,۲۸۱,۲۰۰	۱,۷۲۰	-۲.۳٪	۱۶٪
ضهای ۷۰۰۰	اختیارخ های وب-۱۵۴۹-۰۱/۰۷/۱۰	۲	۱۳	۴۴,۳۷۴,۸۲۶	۱,۰۲۹	-۲.۷٪	۴۱٪

• 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
ضخود۵۰۰	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۴۳۹	۶۰,۳۷۲	۷,۲۸۱,۴۹۰,۰۰۰	۱۲۱	۲.۷٪	۶٪
ضتفارس۶۰۰	اختیارخ تفارس-۴۰۰۰-۱۴۰۲/۰۶/۲۹	۲۰	۲,۰۰۰	۵,۵۵۶,۰۰۰,۰۰۰	۲,۷۷۸	-۱۶.۵٪	۴۸٪
ضخود۸۰۰۷	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۲۰۳	۱۹,۰۶۳	۵,۳۱۰,۳۴۷,۰۰۰	۲۷۹	-۵.۸٪	۱۵٪
ضخود۵۰۰۱	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۱,۴۳۸	۲۴۹,۰۵۵	۴,۹۳۵,۶۴۱,۰۰۰	۲۰	۲.۷٪	۱٪
ضستا۷۰۰۳	اختیارخ شستا-۱۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۳۶۷	۱۳۳,۶۳۱	۳,۶۸۰,۰۱۹,۰۰۰	۲۸	-۱۱.۳٪	۳٪
ضستا۷۰۰۲	اختیارخ شستا-۹۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۱۷۲	۴۶,۴۷۱	۳,۵۰۷,۶۴۳,۰۰۰	۷۵	-۵.۵٪	۸٪
ضخود۸۰۰۸	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۷۱	۱۰,۴۹۳	۲,۳۱۷,۴۸۵,۰۰۰	۲۲۱	-۸.۰٪	۱۲٪
ضخود۸۰۱۰	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱۶۸	۱۳,۶۴۲	۱,۶۲۰,۶۱۸,۰۰۰	۱۱۹	-۱۳.۳٪	۶٪
ضستا۷۰۰۱	اختیارخ شستا-۸۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۳۵	۹,۰۰۵	۱,۴۷۳,۸۴۷,۰۰۰	۱۶۴	-۴.۳٪	۱۸٪
ضسپا۸۰۴۷	اختیارخ خسپا-۱۵۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۹۷	۴,۷۴۰	۱,۲۶۴,۰۹۰,۰۰۰	۲۶۷	-۷.۸٪	۱۶٪

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



نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
فولاد	۱,۷۰۰	-	-
غازر	۲۵۰	-	-
شفن	۵۲۰	-	-
اخابر	۷۹	-	-
بهیر	۵۰	-	-
بورس	-	٪۳۰	سود انباشته و اندوخته
ومعلم	-	٪۷۹	سود انباشته و مطالبات و آورده نقدی
فولاد	-	٪۸۱	سود انباشته



خدمات شرکت کارگزاری بسالک آینده

امراز هویت غیر حضوری

دریافت کد بورسی به صورت آنلاین

باشگاه مشتریان

بورس کالا و انرژی

اختیار معامله

صندوق های سرمایه گذاری درآمد ثابت

صندوق گسترش فردای ایرانیان



صندوق گنجینه آینده روشن

