

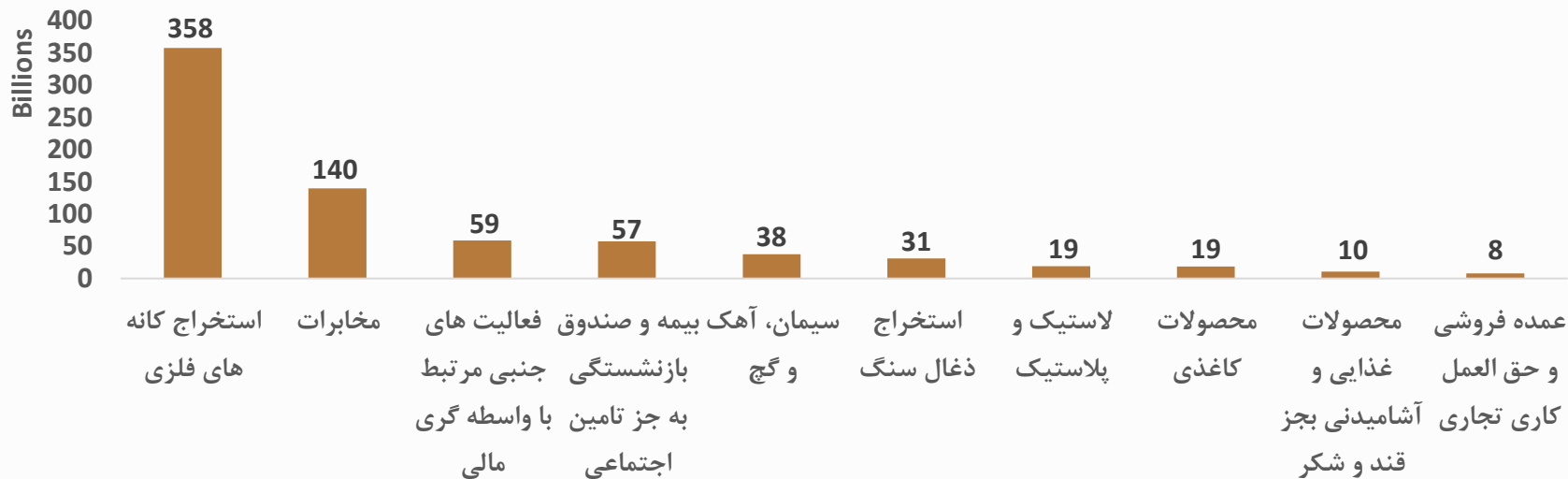
گزارش هفتگی بازار منتهی به ۱۹ مرداد ۱۴۰۱

شرکت کارگزاری بانک آینده





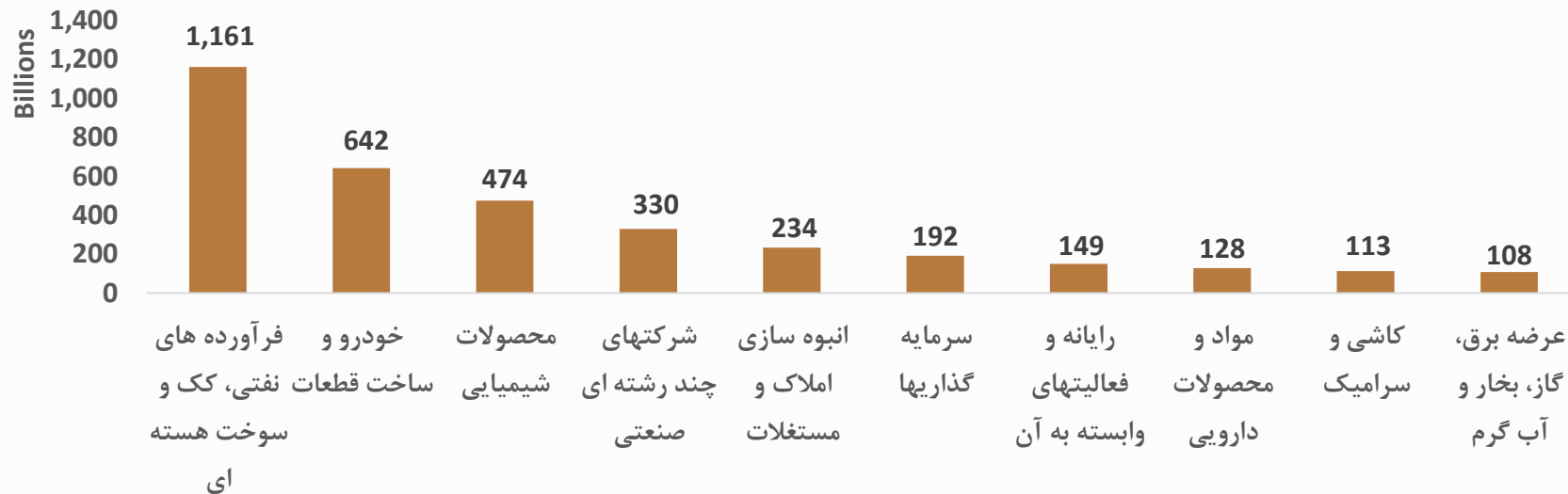
۱۰صنعت برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنعت استخراج کانه های فلزی این هفته مورد توجه حقیقی ها قرار گرفت .



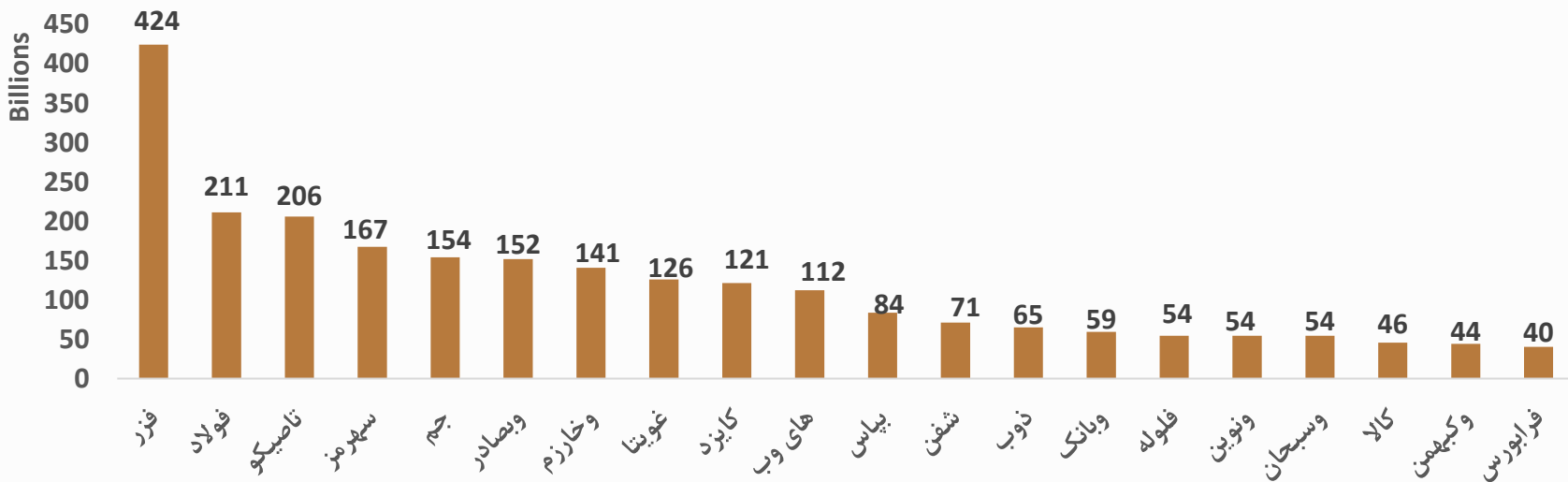
اصنعت برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنعت فرآورد های نفتی و خودرو در این هفته توسط حقوقی ها مورد حمایت قرار گرفت.



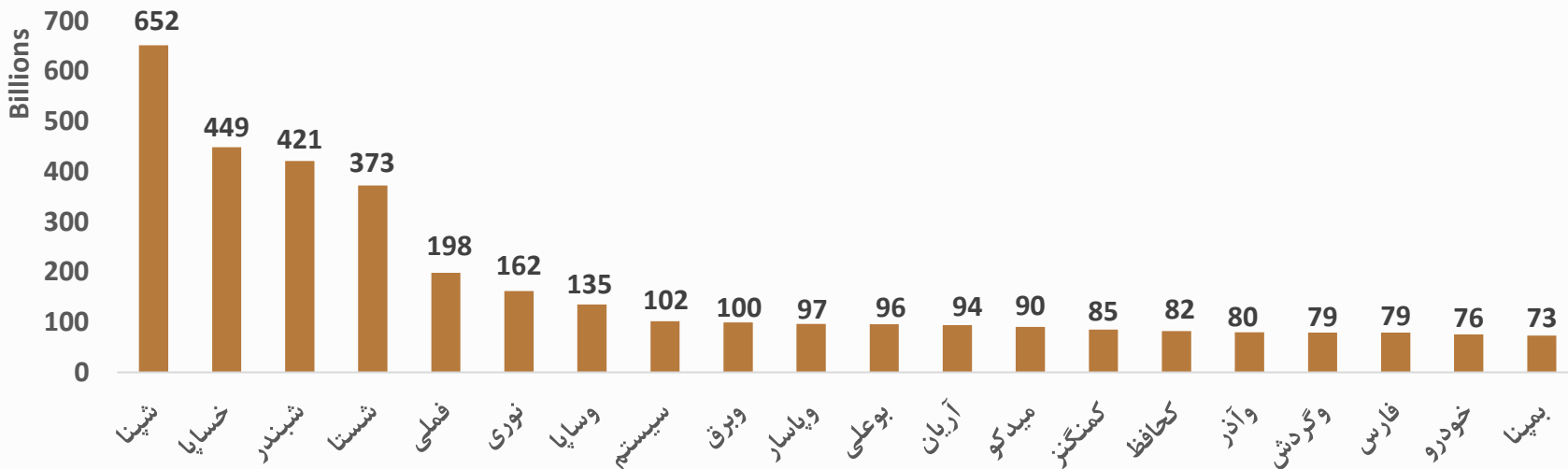
۲۰ نماد برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• بیشترین ورود پول حقیقی در این هفته متعلق به شرکت پویا زرکان آق دره (فزر) می باشد.



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



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



شرکت کارگزاری بانک آینده

## روند P/E بازار سرمایه



• روند p/e بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۵/۱۹ به عدد ۵.۸۳ رسید.

## شرکت های تولیدی و خدماتی

P/E TTM	نماد
۳.۱۴	ثامید
۳.۱۸	سامان
۳.۲۶	فولاد
۳.۲۹	ولبهمن
۳.۳۱	فزر
۳.۳۷	وبملت
۳.۴۲	شبندر
۳.۶	ونوین
۳.۶۹	شتران
۳.۷۱	هرمز
۳.۷۲	شراز
۳.۷۹	های وب
۳.۹۵	فروس
۳.۹۶	ولساپا
۴.۰۲	فسپا
۴.۱۳	فخوز
۴.۱۹	فاسمین
۴.۲۲	فملی
۴.۲۴	مبین
۴.۳۳	کرماشا

## شرکت های سرمایه گذاری

P/E TTM	نماد
۱.۶۸	ثنور
۲.۰۱	ومدیر
۲.۵۶	وآفر
۲.۵۷	وتوسم
۲.۶۲	وکبهمن
۲.۶۷	پرديس
۲.۷	وبوعلی
۲.۷۶	وسکاب
۲.۸۵	وهامون
۳.۵۲	سنوین
۳.۶۴	گوهران
۳.۸۴	اعتلا
۳.۹۸	وصنعت
۴.۰۴	وپویا
۴.۱۱	مدیریت
۴.۲۲	وخارزم
۴.۲۲	واتی
۴.۳	وبانک
۴.۳۶	وصندوق
۴.۳۸	ونیکی



شرکت کارگزاری بانک آینده

۲۰ نماد با پایین

ترین نسبت

P/E TTM



شرکت کارگزاری بانک آینده

## بازدهی صنایع منتخب بازار سرمایه از آخر اردیبهشت ماه ۱۴۰۱ تاکنون

صنعت	درصد بازدهی	صنعت	درصد بازدهی
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	سرمایه گذاریها	-۵.۳
خرده فروشی	۱۰	سیمان آهک گچ	-۵.۴
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲	اطلاعات و ارتباطات	-۶.۴
سایر حمل و نقل	۰.۷	شیمیایی	-۶.۶
قند و شکر	۰.۴	رایانه	-۶.۶
تجارت عمده و خرده فروشی	۰	فرآورده های نفتی	-۶.۹
ابزار پزشکی	۰	دارویی	-۷.۸
فعالیت مهندسی، تجزیه و تحلیل	-۱.۳	استخراج کانه های فلزی	-۱۱.۱
سایر واسطه گریهای مالی	-۱.۷	کانی غیر فلزی	-۱۱.۱
بیمه و بازنشستگی	-۳.۴	چندرشته ای صنعتی	-۱۱.۱
استخراج نفت گاز جز اکتشاف	-۴.۱	خودرو و قطعات	-۱۱.۲
واسطه گریهای مالی و پولی	-۴.۳	چاپ	-۱۱.۶

- بازدهی صنایع فوق از زمان شروع اصلاح بازار در اردیبهشت ماه در نظر گرفته شده است.
- در بازه زمانی اردیبهشت ماه ۱۴۰۱ تا کنون سه صنعت عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم ، خرده فروشی و حمل و نقل انبارداری و ارتباطات به ترتیب بیشترین درصد بازدهی را داشته اند.





شرکت کارگزاری بانک آینده

## پر بازده ترین و کم بازده ترین سهم از اردیبهشت

۱۴۰۱

نماد	درصد بازدهی
وسالت	۱۳۷
تفارس	۹۹
غدشت	۹۷
بهیر	۷۳
آبین	۷۱
اسیاتک	۶۰
سکرد	۵۹
مداران	۵۸
ثغرب	۵۵
حپترو	۵۵
خپویش	۵۰
سپرمی	۴۹
فلات	۴۹
کساپا	۴۴
خفولا	۴۳
قتربت	۴۳
کصدف	۴۲
خعمرا	۴۱
تاتمیس	۳۹
داراب	۳۷

نماد	درصد بازدهی
افرا	-۵۵
غدام	-۵۱
ثرود	-۵۰
شفن	-۴۸
دسانکو	-۴۸
انرژی ۳	-۴۷
رکیش	-۴۶
غمارگ	-۴۵
نوبین	-۴۴
بنو	-۴۴
سدبیر	-۴۴
تکشا	-۴۴
غصینو	-۴۳
غویتا	-۴۳
تلیسه	-۴۲
وآوا	-۴۲
کدما	-۴۱
دروز	-۴۱
فراپورس	-۴۱
دیران	-۴۰

• در جدول، پر بازده ترین شرکت ها از اردیبهشت ماه ۱۴۰۱ تاکنون، تعدادی از سهم های صنایع خودرویی، انبوه سازی، زراعت، سیمان، به چشم می خورد.

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

Daily ▼ 6 شاخص کل



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.

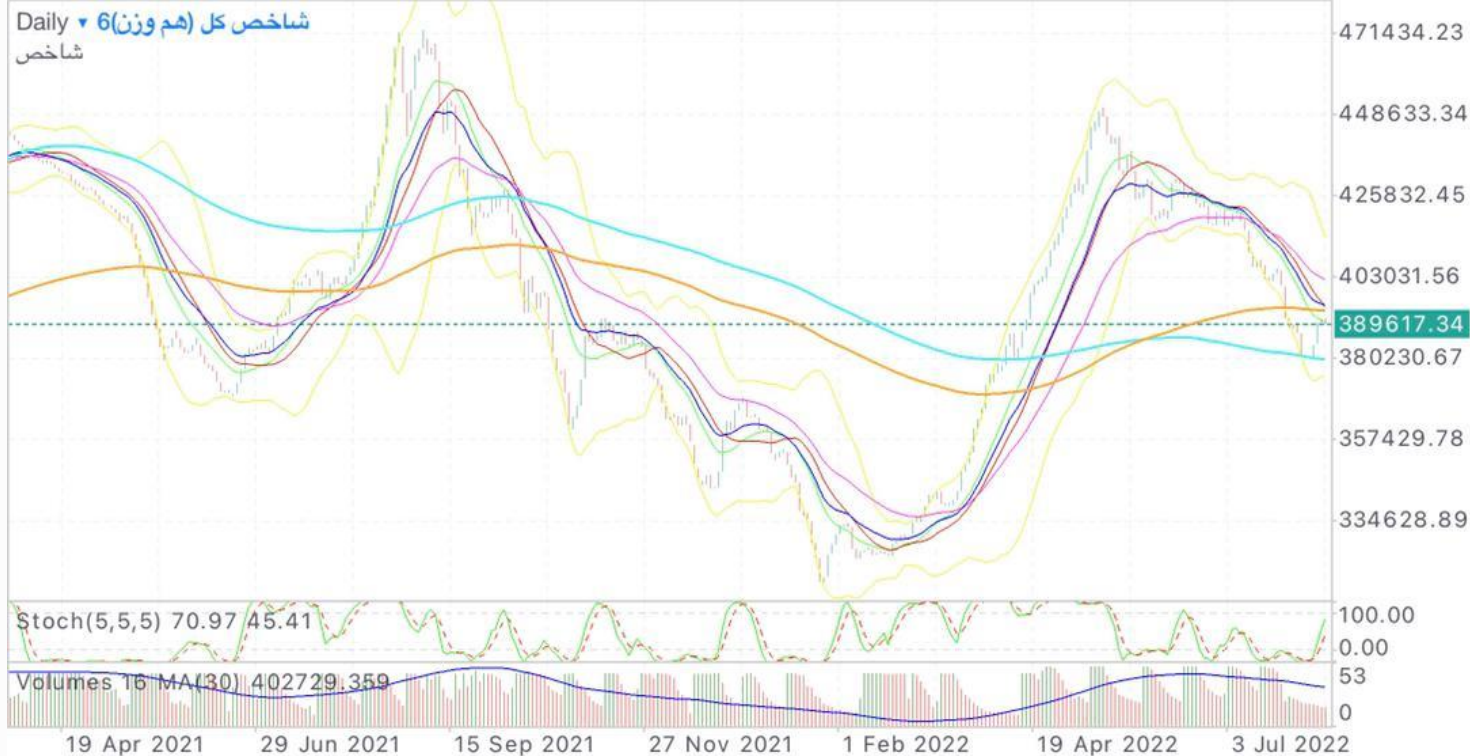
۲- در صورت نزول باید به حمایت های ۱.۴۳۰.۰۰۰ ، ۱.۴۱۴.۰۰۰ ، ۱.۴۰۰.۰۰۰ و ۱.۳۸۰.۰۰۰ واحد امیدوار بود.

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.



شرکت کارگزاری بانک آینده

# وضعیت قیمت های جهانی (فولادی ها)

## اسلب



زمان	سقف	امروز
قیمت	۸۵۰	۴۴۰

## بیلت



زمان	سقف	امروز
قیمت	۸۰۰	۴۵۰



شرکت کارگزاری بانک آینده

# وضعیت قیمت های جهانی (فلزات رنگی)

## مس



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 1%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ -19%

ریزش از سقف 26%

زمان	سقف	امروز
زمان	سقف	امروز
قیمت	۱۰۸۰۹	۷۹۶۲

## آلومینیوم



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 22%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ -13%

ریزش از سقف 39%

زمان	سقف	امروز
زمان	سقف	امروز
قیمت	۴۱۰۰	۲۴۷۴



شرکت کارگزاری بانک آینده

# وضعیت قیمت های جهانی (نفت و گاز)

## نفت برنت



85%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱

22%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲

28%

ریزش از سقف

زمان	سقف	امروز
قیمت	۱۳۳.۰۷	۹۵.۵۶

## گاز طبیعی



200%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱

103%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲

19%

ریزش از سقف

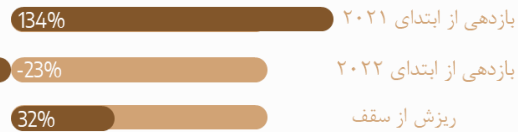
زمان	سقف	امروز
قیمت	۹.۴۲	۷.۸۹۹



شرکت کارگزاری بانک آینده

## وضعیت قیمت های جهانی (پتروشیمی ها)

### اوره



زمان	سقف	امروز
قیمت	۹۵۵	۶۵۰

### متانول



زمان	سقف	امروز
قیمت	۴۴۵	۳۱۴



• 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
رکیش	۲,۷۷۹	۱,۷۸۸	-۰.۳٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۵/۰۲۶
وثنو	۱,۷۱۰	۶۷۸	۲٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۲۲
وسپه	۴,۰۰۰	۲,۸۲۷	۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱
دلر	۱۹,۱۰۰	۱۷,۰۰۰	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱
هجرت	۱۷,۰۶۰	۱۴,۹۸۰	۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۱۹
میدکو	۱۷,۷۸۰	۱۵,۵۶۰	۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۲۵
دارو	۱۳,۹۱۰	۱۱,۷۳۰	۹٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۲۲
کفرا	۷,۱۷۰	۵,۴۵۰	۱۱٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۵/۱۹
کی بی سی	۸,۱۵۰	۶,۱۰۰	۱۵٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۱۰
وگستر	۲,۷۹۲	۱,۴۰۰	۱۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۴
وملل	۲,۸۹۲	۱,۴۰۴	۲۰٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۱۹





# بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

پایانی/قیمت روز	درصد تفاوت	پایانی	ارزش	حجم	تعداد	نام	نماد
۶۴٪	۹.۱٪	۲,۳۶۶	۹۱۰,۹۹۹,۰۰۰	۳۸۵	۳۵	اختیارخ حافرین-۱۰۰۰-۱۴۰۱۱۲۱۴	۱۲۰۰ ضحافرین
۲۱٪	۰.۰٪	۶۰۰	۷۲,۱۷۴,۶۶۰	۹۵	۴	اختیارخ وبملت-۲۲۹۱-۱۴۰۱/۰۸/۱۸	۸۰۴۸ ضملت
۱۲٪	-۱.۱٪	۲۳۶	۱۵۸,۶۲۷,۰۰۰	۶۷۳	۹	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۶۰۰۲ ضخود
۱۷٪	-۱.۴٪	۱,۷۵۳	۷۵,۳۹۸,۰۰۰	۴,۳۰۰	۱۱	اختیارخ اهرم-۹۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۳۰	۶۰۱۲ ضهرم
۲٪	-۱.۶٪	۱۵۲	۱۵۲,۰۰۰	۱	۱	اختیارخ سلام-۹۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۶۰۰۵ ضسلام
۴۸٪	-۱.۹٪	۳,۰۰۰	۳,۰۰۰,۰۰۰	۱	۱	اختیارخ شپنا-۳۳۵۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۹	۸۰۰۹ ضشپنا
۸٪	-۲.۰٪	۱۵۳	۲۷۳,۴۶۴,۰۰۰	۱,۷۸۲	۲۴	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۶۰۰۳ ضخود
۳۰٪	-۳.۱٪	۱,۶۵۸	۸۰,۹۸۷,۱۲۱	۲۷	۴	اختیارخ فولاد-۴۰۳۵-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۷۰۱۱ ضفلا
۲۰٪	-۳.۳٪	۱,۱۱۲	۷۴,۴۱۵,۰۲۴	۳۷	۷	اختیارخ فولاد-۴۵۸۸-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۷۰۱۲ ضفلا
۳۰٪	-۳.۳٪	۸۵۵	۹۱,۹۷۴,۹۰۰	۸۵	۴	اختیارخ وبملت-۲۱۳۳-۱۴۰۱/۰۸/۱۸	۸۰۴۷ ضملت

• 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
ضستا ۷۰۰۱	اختیارخ شستا-۸۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۴۳۱	۲۲۸,۵۳۰	۳۸,۹۷۶,۱۸۵,۰۰۰	۱۷۱	-۴.۲%	۱۸%
ضستا ۷۰۰۰	اختیارخ شستا-۷۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۱۰۰	۴۷,۰۵۳	۱۲,۴۹۶,۸۴۲,۰۰۰	۲۶۶	-۳.۶%	۲۹%
ضخود۷ ۸۰۰۷	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۴۰۰	۲۱,۰۰۶	۶,۹۱۵,۸۴۲,۰۰۰	۳۲۹	-۶.۰%	۱۷%
ضستا۳ ۷۰۰۳	اختیارخ شستا-۱۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۵۰۱	۱۷۴,۶۲۶	۴,۸۹۶,۴۳۷,۰۰۰	۲۸	-۱۰.۳%	۳%
ضستا۲ ۷۰۰۲	اختیارخ شستا-۹۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۱۲۶	۴۳,۱۲۹	۳,۴۴۳,۸۵۹,۰۰۰	۸۰	-۵.۲%	۹%
ضشنا۱۳ ۸۰۱۳	اختیارخ شپنا-۵۳۵۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۹	۴۸	۱,۱۶۲	۱,۵۶۱,۴۷۲,۰۰۰	۱,۳۴۴	-۷.۴%	۲۲%
ضسپا۷ ۸۰۴۷	اختیارخ خساپا-۱۵۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۸۰	۴,۵۵۴	۱,۵۵۸,۵۱۰,۰۰۰	۳۴۲	-۳.۸%	۱۹%
ضخود۱۰ ۸۰۱۰	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱۶۹	۱۳,۰۰۰	۱,۵۰۲,۸۲۰,۰۰۰	۱۱۶	-۱۰.۵%	۶%
ضخود۵ ۶۰۰۵	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۴۴۷	۵۴,۰۳۳	۱,۴۶۱,۲۱۰,۰۰۰	۲۷	-۵.۸%	۱%
ضخود۴ ۶۰۰۴	اختیارخ خودرو-۱۹۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۱۸۴	۱۴,۳۴۴	۱,۱۷۰,۱۳۲,۰۰۰	۸۲	-۳.۵%	۴%

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



نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
حبندر	۶۷۰	-	-
وسالت	۷۳۴	-	-
وسینا	۲۹	-	-
بجهرم	۸۳	-	-
اتکام	-	٪۶۰	مطالبات و آورده نقدی و اندوخته



## خدمات شرکت کارگزاری بانک 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

