

گزارش هفتگی بازار منتهی به ۲۶ مرداد ۱۴۰۱

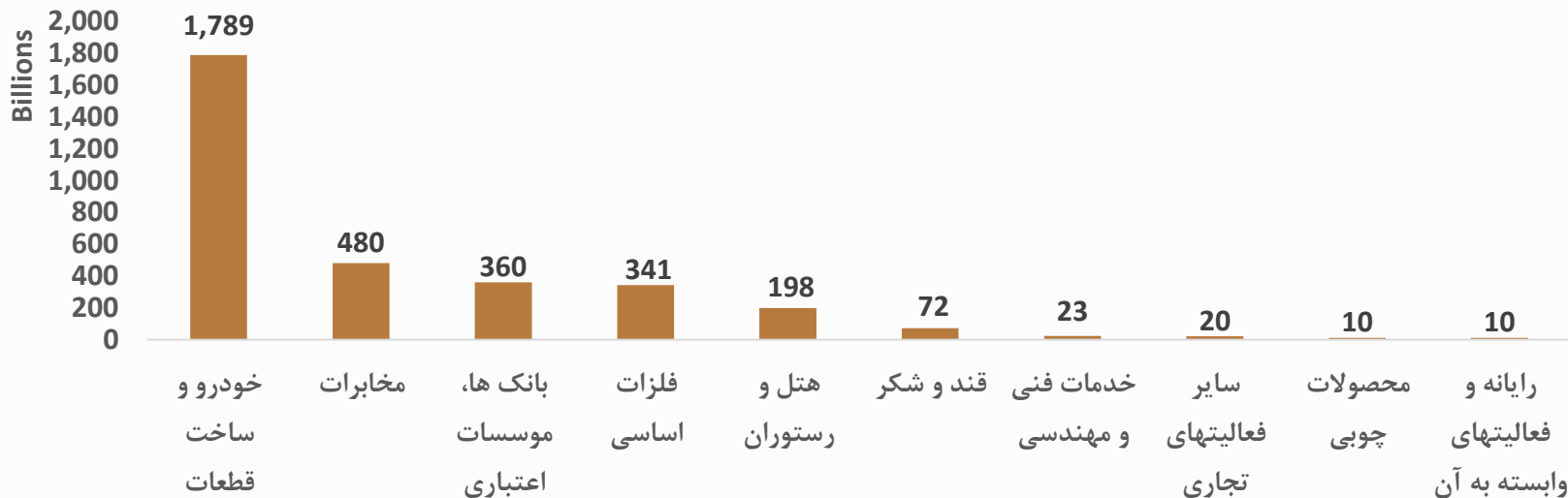
شرکت کارگزاری بانک آینده





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

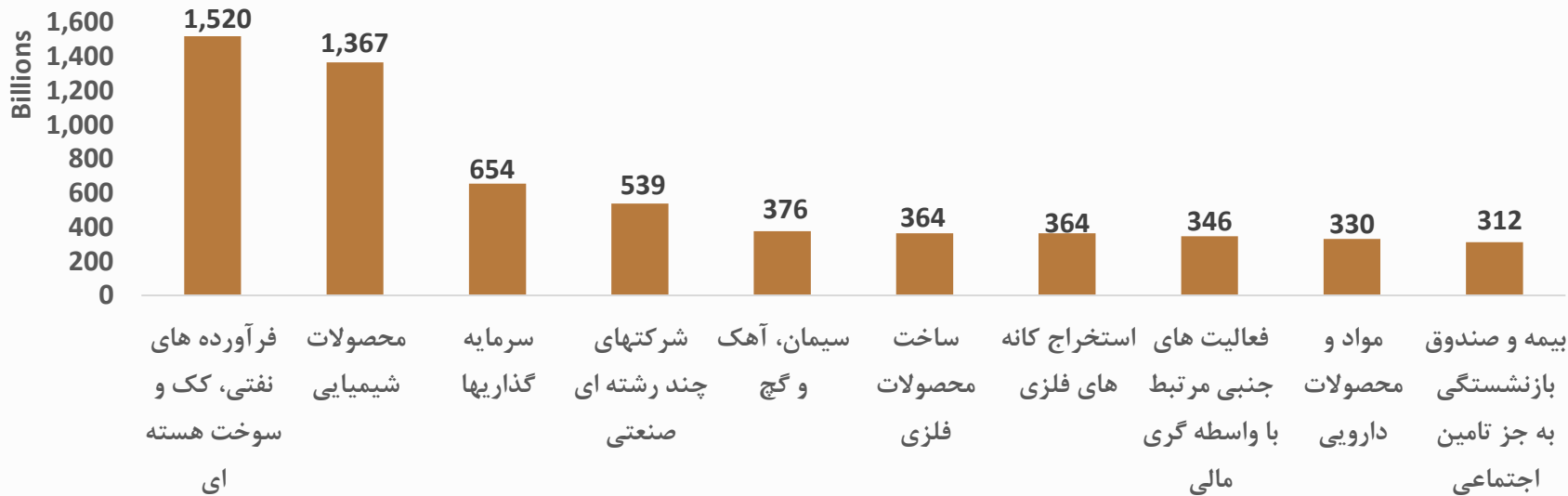
۱۰ صنعت برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنعت خودرو و مخابرات این هفته مورد توجه حقیقی ها قرار گرفت .



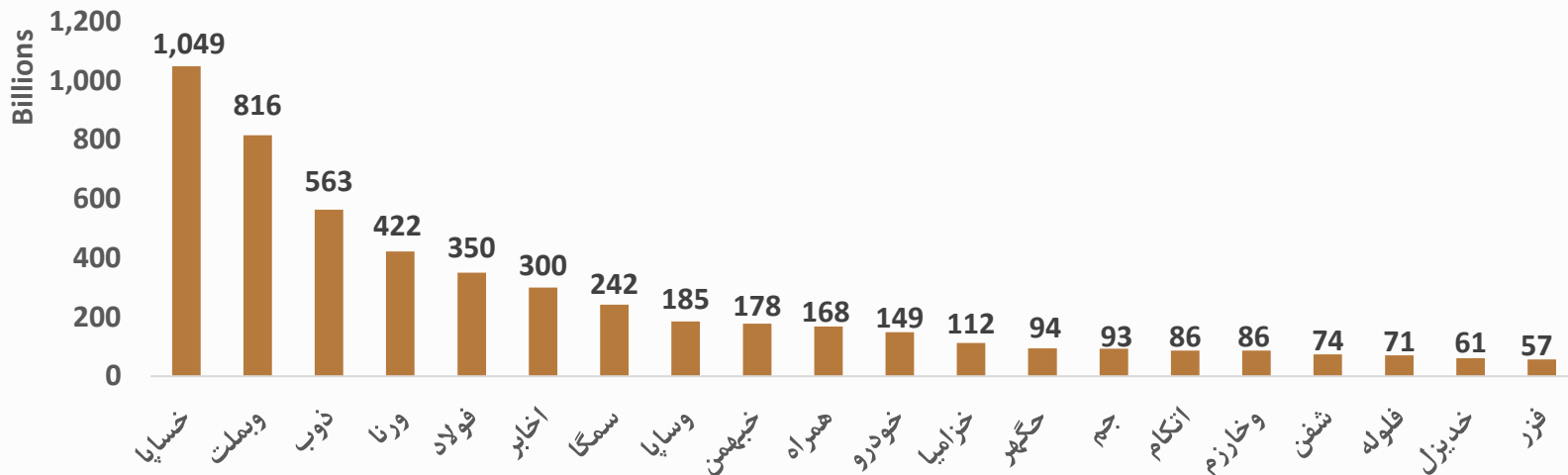
اصنعت برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



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



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

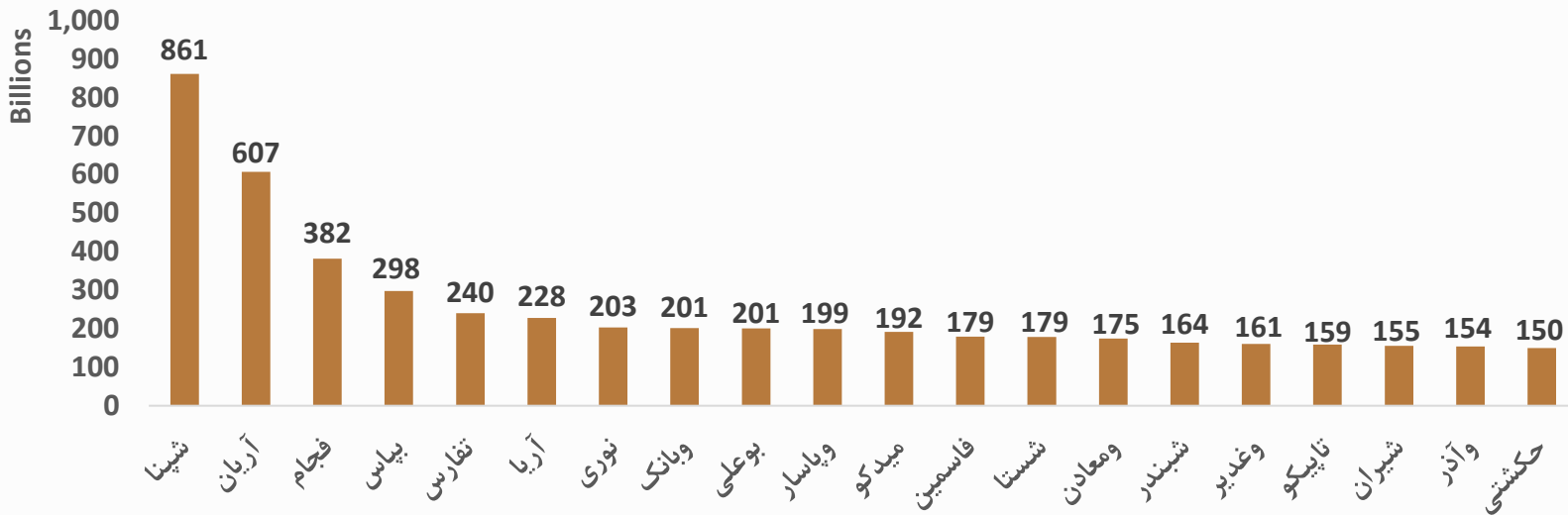


• بیشترین ورود پول حقیقی در این هفته متعلق به شرکت سایپا (خسپایا) می باشد.



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

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



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



شرکت کارگزاری بانک آینده

## روند P/E بازار سرمایه



• روند P/E بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۵/۲۶ به عدد ۵.۷۷ رسید.



شرکت کارگزاری بانک آینده

۲۰ نماد با پایین  
ترین نسبت  
P/E TTM

## شرکت های سرمایه گذاری

P/E TTM	نماد
۱.۷۲	ثنور
۱.۹۸	ومدیر
۲.۶۲	پردیس
۲.۶۷	وتوسم
۲.۷۳	وبوعلی
۲.۷۳	وآفر
۲.۷۵	وکبهن
۲.۷۸	وهامون
۲.۹۱	وسکاب
۳.۶۴	گوهران
۳.۶۸	سنوین
۳.۷۳	اعتلا
۴.۱۴	وپویا
۴.۱۷	مدیریت
۴.۱۸	واتی
۴.۳۳	وصنعت
۴.۴۲	وخارزم
۴.۴۳	وصندوق
۴.۴۷	ونیکی
۴.۵۵	وبانک

## شرکت های تولیدی و خدماتی

P/E TTM	نماد
۲.۶۹	وشهر
۳.۱۵	ثامید
۳.۲۲	شبندر
۳.۲۸	شراز
۳.۲۸	فولاد
۳.۵۱	سامان
۳.۶۳	شتران
۳.۷۶	وبملت
۳.۸۷	ولبهمن
۳.۹۳	فسپا
۳.۹۵	شاون
۴.۰۳	فروس
۴.۱	فملی
۴.۱۲	فاسمین
۴.۱۴	فخوز
۴.۱۵	شپنا
۴.۱۸	ونوین
۴.۲	مبین
۴.۲۷	کرماشا
۴.۴۱	ولساپا



شرکت کارگزاری بانک آینده

## بازدهی صنایع منتخب بازار سرمایه از خرداد ماه ۱۴۰۱ تا کنون

صنعت	درصد بازدهی	صنعت	درصد بازدهی
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵.۲	سرمایه گذاریها	-۴.۸
خرده فروشی	۱۱.۲	بیمه و بازنشستگی	-۵.۰۲
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۸.۳	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	-۵.۰۸
اطلاعات و ارتباطات	۸.۰۹	سیمان آهک گچ	-۵.۳
واسطه گریه‌های مالی و پولی	۳.۶	رایانه	-۶.۵
قند و شکر	۲.۴	شیمیایی	-۷.۲
سایر حمل و نقل	۰	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	-۷.۴
تجارت عمده و خرده فروشی وسائط نقلیه	۰	چندرشته ای صنعتی	-۹.۱
موتور	۰	دارویی	-۹.۱۲
ابزار پزشکی	۰	استخراج کانه های فلزی	-۹.۸
سایر واسطه گریه‌های مالی	-۰.۳	فرآورده های نفتی	-۱۰.۲
خودرو و قطعات	-۲.۱	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۰.۳
بانکها و موسسات اعتباری	-۴.۶		

- بازدهی صنایع فوق از زمان شروع اصلاح بازار در اواخر اردیبهشت ماه در نظر گرفته شده است.
- در بازه زمانی خرداد 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 خرداد ۱۴۰۱

نماد	درصد بازدهی
وسالت	۲۵۱
غدشت	۱۲۶
فجوش	۱۱۸
تفارس	۱۰۹
اسیاتک	۹۲
خپویش	۷۹
ثغرب	۷۳
آبین	۶۵
کساپا	۶۳
حپترو	۶۳
خفولا	۵۸
خعمرا	۵۷
سپرمی	۵۵
بتک	۵۱
بهیر	۵۰
وحافظ	۴۹
سکرد	۴۸
غناپ	۴۷
سهرمز	۴۶
تاتمس	۴۳

نماد	درصد بازدهی
افرا	-۵۱
دسانکو	-۴۹
شفن	-۴۹
ثرود	-۴۸
غدام	-۴۸
غصینو	-۴۷
سدبیر	-۴۶
بنو	-۴۵
غمارگ	-۴۵
تلیسه	-۴۴
رکیش	-۴۴
ریشمک	-۴۳
انرژی ۳	-۴۳
زماهان	-۴۱
دروز	-۴۱
کدما	-۴۱
داوه	-۴۰
غویتا	-۴۰
سیمرغ	-۴۰
زاگرس	-۳۹

• در جدول، پر بازده ترین شرکت ها از ابتدای خرداد 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.



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، ۱.۴۸۰.۰۰۰ ، ۱.۵۰۰.۰۰۰ ، ۱.۵۱۵.۰۰۰ و ۱.۵۴۵ واحد توجه شود.

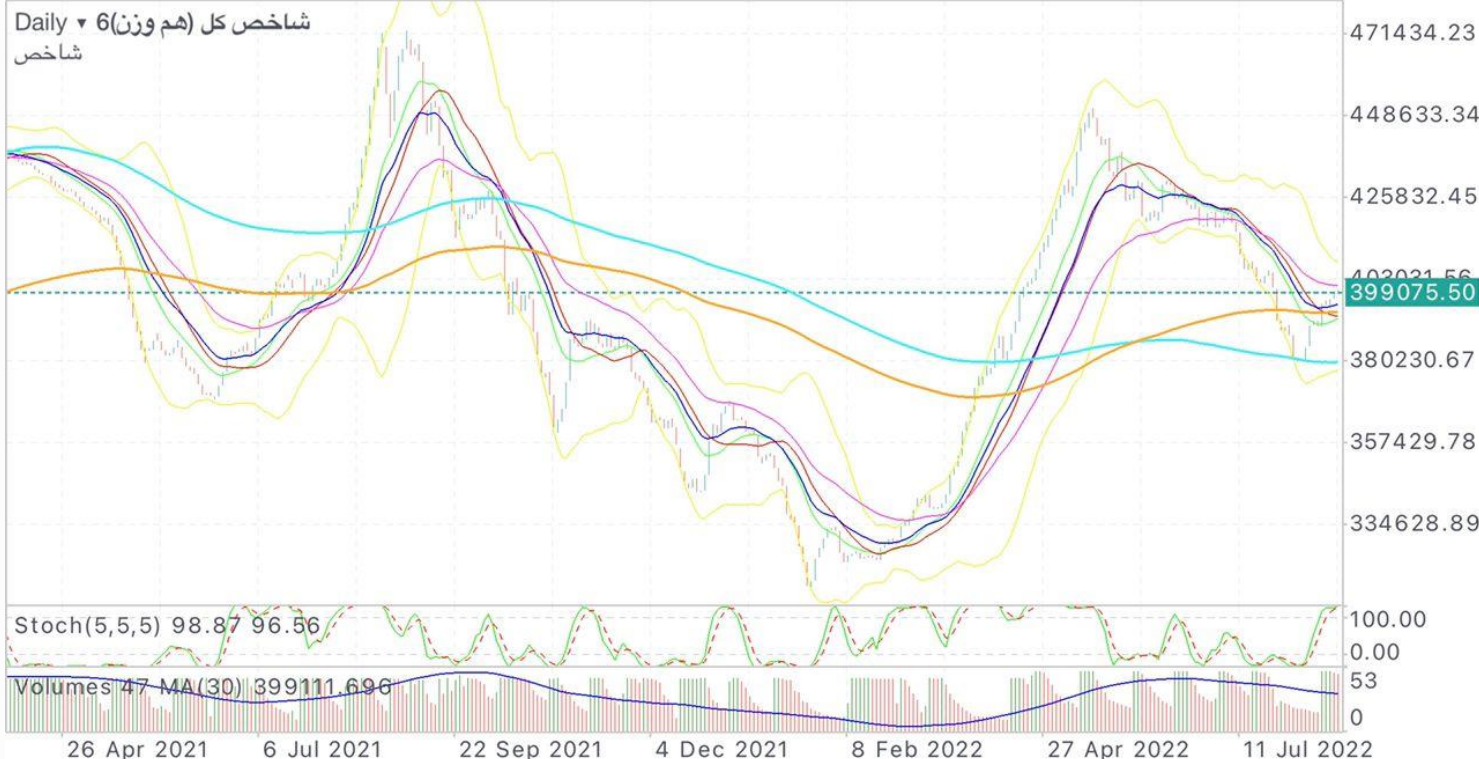
۲- در صورت نزول باید به حمایت های ۱.۴۵۰.۰۰۰ ، ۱.۴۳۰.۰۰۰ ، ۱.۴۱۴.۰۰۰ و ۱.۴۰۰.۰۰۰ واحد امیدوار بود.

در تایم فریم هفتگی نمودار، الگوی Bullish Triangle دیده می شود که روند بلند مدت شاخص را مثبت نشان می دهد. 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 شاهد مرحله جدید از رشد شاخص کل باشیم.



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 ۴۰۴.۰۰۰ و ۴۱۷.۰۰۰ واحد را پیش رو خواهد داشت.

۲- در صورت نزول نمودار شاخص کل هم وزن حمایت های ۳۹۴.۰۰۰ واحد، ۳۸۰.۰۰۰ واحد و ۳۷۰.۰۰۰ 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 از احتمال ریزش شاخص به شدت کاسته شده باشد. برای تصمیم نهایی نیاز است واکنش آن را به مقاومت ۴۰۴.۰۰۰ واحد بررسی کنیم. در صورت شکست این عدد و تثبیت بالای آن، رالی جدید صعودی روند آغاز می گردد.



# 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	۷,۹۳۹	۸,۰۰۸	-۰.۹%	۸,۰۷۲	-۰.۶%	۷,۷۰۴	۷,۴۱۰	۹,۷۸۱
آلومینیم	۲,۴۱۲	۲,۳۹۹	+۰.۵%	۲,۴۹۸	-۳.۴%	۲,۳۸۹	۲,۴۳۵	۲,۸۴۹
روی	۳,۵۶۵	۳,۶۳۹	-۲.۰%	۳,۶۱۸	-۱.۵%	۳,۲۸۶	۲,۹۹۳	۳,۶۵۰
نفت برنت	۹۱.۷	۹۱.۹	-۰.۳%	۹۷.۲	-۵.۶%	۹۷.۰	۱۰۵.۸	۷۸.۹
گاز طبیعی	۹.۴۵	۹.۳۹	+۰.۶%	۸.۲۵	+۱۴.۵%	۸.۲۴	۷.۴۷	۳.۷۶
اوره	۶۴۲	۶۴۲	+۰.۰%	۶۵۰	-۱.۲%	۶۷۵	۵۷۵	۸۶۵
متانول	۳۰.۸	۳۰.۸	+۰.۰%	۳۱.۰	-۰.۶%	۳۰.۵	۲۹۷	۳۱۹
اسلب	۴۴۰	۴۴۰	+۰.۰%	۴۴۰	+۰.۰%	۵۲۵	۵۲۵	۵۶۸
بیلت	۴۴۵	۴۴۵	+۰.۰%	۴۴۵	+۰.۰%	۴۵۰	۵۱۷	۵۴۳
دلار آزاد	۲۹,۸۰۰	۳۰,۱۲۰	-۱.۱%	۳۱,۰۲۰	-۳.۹%	۳۱,۲۲۰	۳۱,۸۴۰	۲۹,۷۰۰
دلار نیما	۲۶,۵۲۴	۲۶,۵۴۴	-۰.۱%	۲۶,۷۱۳	-۰.۷%	۲۶,۵۹۹	۲۶,۳۱۲	۲۴,۷۴۶



شرکت کارگزاری بانک آینده

## تحلیل بنیادی شرکت حمل و نقل بین المللی خلیج فارس (حفارس)

کارشناسی سال مالی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹	فصل اول منتهی به ۱۴۰۱/۰۳	۱۲ ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲	۱۲ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲	۱۲ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲	۱۲ ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۱۲	۱۲ ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲	شرح
۱۲,۹۶۶,۴۷۲	۴,۵۰۵,۱۷۹	۷,۶۰۹,۱۲۳	۵,۱۸۲,۹۸۳	۲,۶۹۴,۸۶۱	۱,۲۵۵,۳۴۲	۱,۲۳۹,۲۲۲	درآمد ارائه خدمات
(۱۲,۵۴۷,۱۵۹)	(۴,۳۹۱,۶۵۵)	(۷,۵۴۵,۳۵۱)	(۵,۷۴۴,۸۱۴)	(۲,۷۲۷,۲۷۴)	(۱,۴۷۴,۵۱۸)	(۱,۵۲۷,۹۵۱)	هزینه ارائه خدمات
۴۱۹,۳۱۳	۱۱۳,۵۲۴	۶۳,۷۷۲	(۵۶۱,۸۳۱)	(۳۲,۴۱۳)	(۲۱۹,۱۷۶)	(۲۸۸,۷۲۹)	سود (زیان) ناخالص
۹۶,۱۸۸	۴,۰۹۵	(۷۹,۹۸۹)	(۷۷۲,۰۳۵)	(۱۴۶,۴۵۴)	(۳۱۸,۷۷۳)	(۳۷۳,۲۳۹)	سود (زیان) عملیاتی
۱۶۱,۵۷۳	۵۲,۵۶۱	۱۲,۲۷۷	۹۳۸,۷۲۱	۲,۵۴۸	(۲۲۲,۹۳۴)	(۳۸۶,۴۶۴)	سود (زیان) قبل از کسر مالیات
۱۵۱,۱۲۶	۴۲,۱۱۴	(۱۱۵,۰۳۲)	۷۹۹,۸۷۸	۲,۵۴۸	(۲۲۲,۹۳۴)	(۳۸۶,۴۶۴)	سود (زیان) خالص پس از کسر مالیات
۲,۵۲۳,۹۰۴	۲,۵۲۳,۹۰۴	۲,۵۲۳,۹۰۴	۲,۵۲۳,۹۰۴	۲,۵۲۳,۹۰۴	۲,۵۲۳,۹۰۴	۲,۵۲۳,۹۰۴	سرمایه
۶۰	۱۷	(۴۶)	۳۱۷	۱	(۸۸)	(۱۵۳)	سود هر سهم پس از کسر مالیات

- زیان هر سهم شرکت برای سال ۱۴۰۰ برابر با (۴۶) ریال می باشد.
- پیش بینی سود هر سهم شرکت برای سال ۱۴۰۱ برابر با ۶۰ ریال می باشد.

P/E

۱۷۷

EPS

۶۰



• 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
کفرا	۶,۷۱۰	۵,۸۵۰	-۲٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۱۸
وسپه	۴,۰۱۱	۲,۸۵۲	۴٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱
دلر	۱۹,۰۵۰	۱۷,۲۰۰	۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱
دارو	۱۳,۵۰۰	۱۱,۷۰۰	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۶
وهامون	۱,۷۸۲	۶۶۰	۷٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۲۰
پردیس	۲,۵۸۹	۱,۳۹۴	۸٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
رکیش	۳,۱۰۹	۱,۷۲۹	۱۴٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۵/۰۲۶
وگستر	۳,۰۰۲	۱,۶۰۰	۱۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۴
وملل	۲,۸۹۰	۱,۳۸۰	۲۱٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۱۹



# بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

نماد	نام	تعداد	حجم	ارزش	پایانی	درصد تفاوت	پایانی/قیمت روز
ضجار۷۰۵۸	اختیارخ وتجارت-۱۱۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۲۰	۲۱	۲,۰۰۱	۲۰,۶۶۰,۰۰۰	۱۰	۳۸.۳%	۱%
ضخود۶۰۰۰	اختیارخ خودرو-۱۵۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۳	۲۱	۱۴,۶۸۰,۰۰۰	۶۹۹	۰.۹%	۳۱%
ضخود۶۰۰۱	اختیارخ خودرو-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۵	۲۷۲	۱۶۴,۲۷۰,۰۰۰	۶۰۴	۰.۷%	۲۷%
ضذوب۸۰۰۲	اختیارخ ذوب-۲۳۴۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱	۱۳	۶,۸۷۷,۰۰۰	۵۲۹	۰.۱%	۱۸%
ضجار۷۰۴۵	اختیارخ وتجارت-۱۴۸۰-۱۴۰۱/۰۷/۲۰	۱۱۵	۶,۴۹۷	۲,۰۶۷,۱۱۶,۰۰۰	۳۱۸	۰.۱%	۱۸%
ضخود۶۰۰۳	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۴	۴۷۴	۲۰,۱۳۵,۰۰۰	۴۲۵	-۰.۲%	۱۹%
ضخود۶۰۰۵	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۲,۰۱۰	۱۵۱,۵۴۰	۳۴,۰۵۵,۷۰۴,۰۰۰	۲۲۵	-۰.۲%	۱۰%
ضخود۶۰۰۲	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۳	۳۶	۱۸,۹۶۰,۰۰۰	۵۲۷	-۰.۳%	۲۴%
ضفلا۷۰۱۰	اختیارخ فولاد-۳۴۸۳-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۱	۱	۳,۷۹۸,۹۰۰	۲,۱۰۰	-۰.۴%	۳۸%
ضفلا۷۰۱۱	اختیارخ فولاد-۴۰۳۵-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۲	۴۰	۱۱۲,۱۵۸,۰۰۰	۱,۵۵۰	-۰.۴%	۲۸%

• 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
۶۰۰۵	اختیار خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۲,۰۱۰	۱۵۱,۵۴۰	۳۴,۰۵۵,۷۰۴,۰۰۰	۲۲۵	-۰.۲٪	۱۰٪
۸۰۱۰	اختیار خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۴۹۴	۶۱,۵۳۰	۱۹,۷۹۸,۵۴۰,۰۰۰	۳۲۲	-۴.۶٪	۱۵٪
۶۰۰۶	اختیار خودرو-۲۲۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	۱,۰۴۶	۲۰۱,۰۴۰	۱۱,۷۵۹,۱۴۸,۰۰۰	۵۸	-۱.۷٪	۳٪
۷۰۰۳	اختیار شستا-۱۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۸۲۰	۲۴۰,۳۸۶	۱۰,۳۵۴,۴۸۶,۰۰۰	۴۳	-۸.۱٪	۴٪
۸۰۵۰	اختیار خساپا-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۲۳۳	۱۶,۷۶۷	۷,۱۲۸,۶۹۳,۰۰۰	۴۲۵	-۲.۵٪	۲۰٪
۸۰۰۷	اختیار خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱۹۲	۱۱,۱۳۰	۶,۵۹۵,۱۰۴,۰۰۰	۵۹۳	-۳.۳٪	۲۷٪
۸۰۵۳	اختیار خساپا-۲۲۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۳۵۶	۴۳,۳۹۰	۵,۲۲۳,۰۳۱,۰۰۰	۱۲۰	-۶.۹٪	۶٪
۸۰۴۷	اختیار خساپا-۱۵۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۱۸۶	۵,۸۳۸	۴,۲۲۴,۸۱۷,۰۰۰	۷۲۴	-۲.۵٪	۳۳٪
۸۰۱۴	اختیار شپنا-۵۸۵۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۹	۱۱۲	۵,۹۱۱	۴,۱۹۰,۸۹۹,۰۰۰	۷۰۹	-۱۰.۴٪	۱۲٪
۸۰۵۴	اختیار خساپا-۲۴۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۲۸۵	۶۳,۰۲۴	۳,۵۰۲,۹۸۱,۰۰۰	۵۶	-۱۳.۲٪	۳٪

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





نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
چکارن	۱۵	-	-
حفاری	۱۹۰	-	-
تبرک	۲۰۰	-	-
قچار	۱۵۰	-	-
فایرا	۱,۳۵۰	-	-



## 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

