

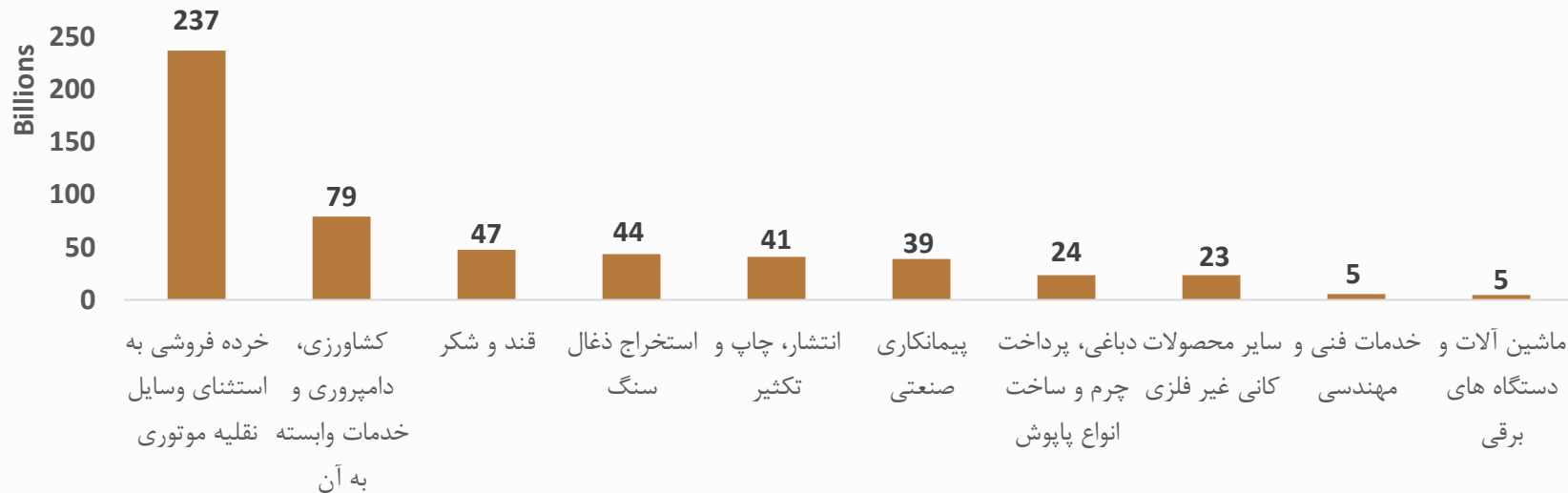
گزارش هفتگی بازار منتهی به ۲۳ شهریور ۱۴۰۱

شرکت کارگزاری بانک آینده





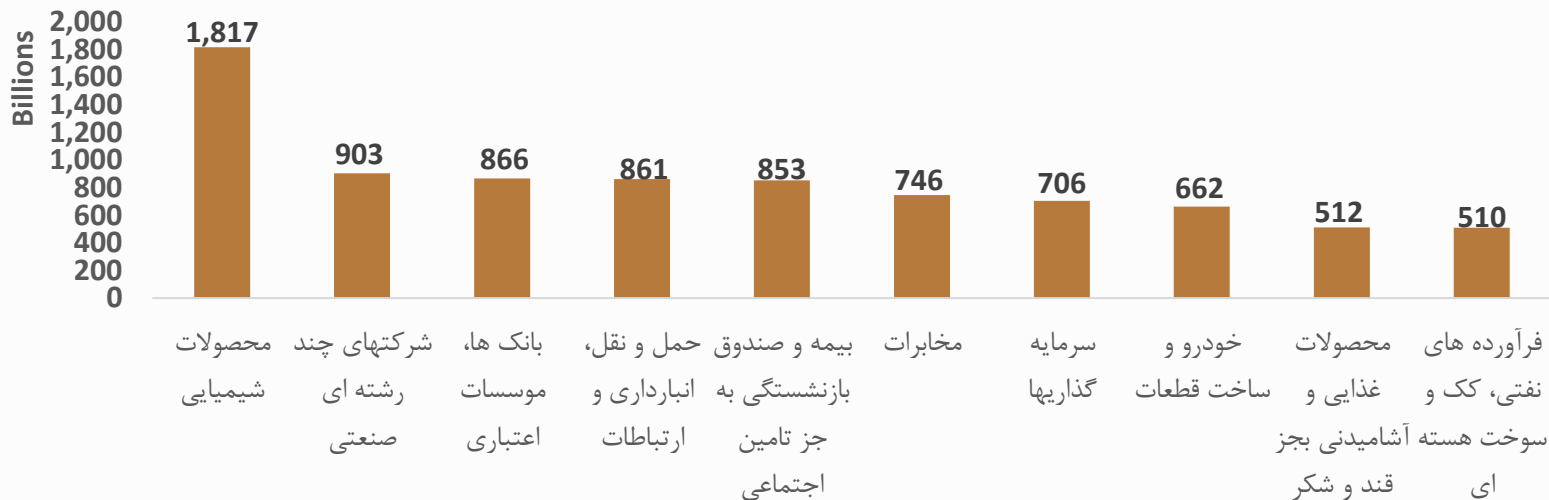
۱۰ صنعت برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• گروه خرده فروشی و کشاورزی این هفته مورد توجه حقیقی ها قرار گرفتند .



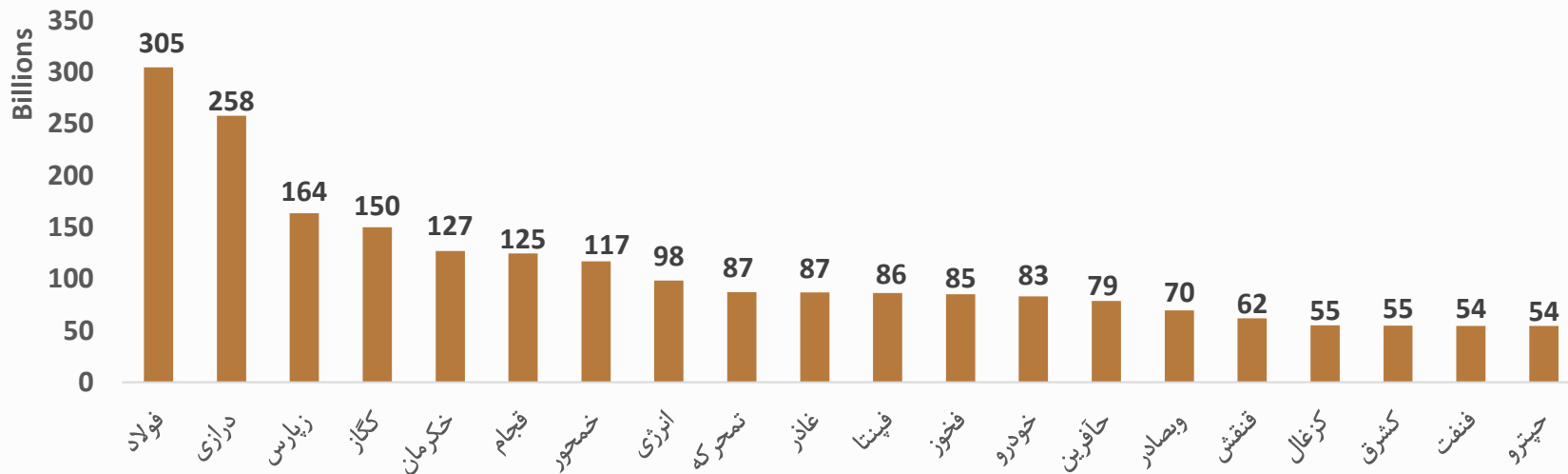
۱۰ صنعت برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنایع محصولات شیمیایی و شرکت های چند رشته ای در این هفته توسط حقوقی ها مورد حمایت قرار گرفتند.



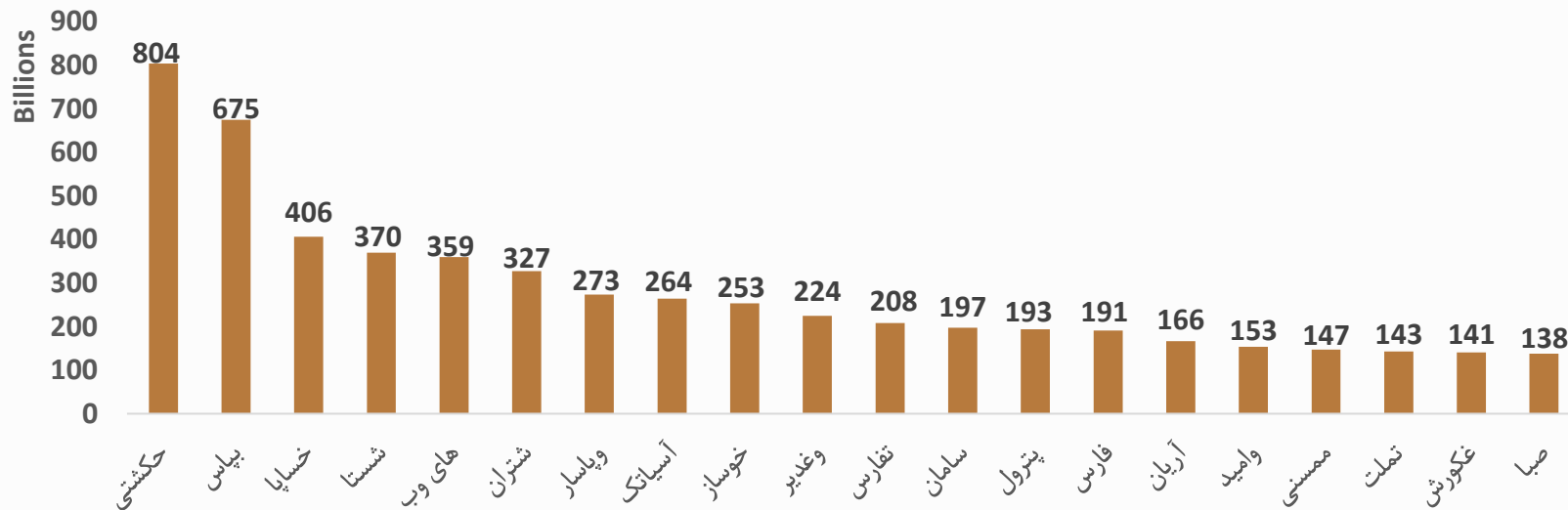
۲۰ نماد برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• بیشترین ورود پول حقیقی در این هفته متعلق به شرکت فولاد مبارکه اصفهان (فولاد) می باشد.



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

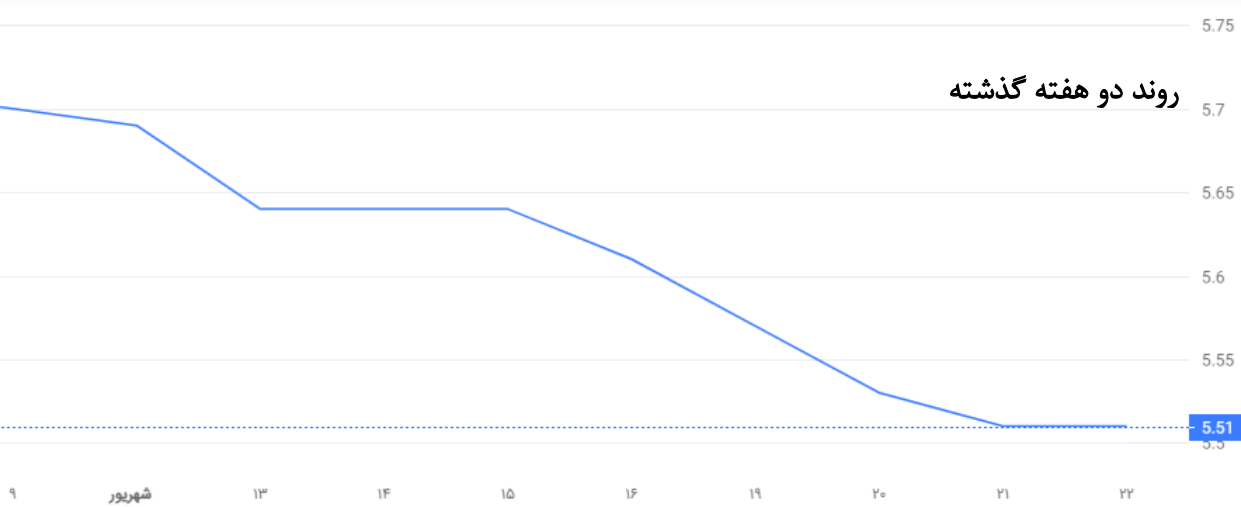


• بیشترین حمایت های حقوقی در این هفته از شرکت های حکشتی و بپاس بوده است.



شرکت کارگزاری بانک آینده

## روند P/E بازار سرمایه



• **p/e ttm** بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۶/۲۳ به عدد ۵.۵۲ رسید.



شرکت کارگزاری بانک آینده

۲۰ نماد با پایین

ترین نسبت

P/E TTM

## شرکت های سرمایه گذاری

P/E TTM	نماد
۱.۹۳	ثنور
۱.۹۶	ومدیر
۲.۶۱	پردیس
۲.۶۱	وآفر
۲.۶۴	وتوسم
۲.۶۸	وپویا
۲.۷۵	وبوعلی
۲.۸	وکبهن
۲.۸۱	وسکاب
۲.۸۵	وهامون
۳.۳۸	وسبحان
۳.۶۵	وصنعت
۳.۶۵	گوهران
۳.۷۷	اعتلا
۳.۷۸	سنوین
۳.۹۱	واتی
۴.۰۹	مدیریت
۴.۱۱	وخارزم
۴.۱۶	صبا
۴.۳۲	وصندوق

## شرکت های تولیدی و خدماتی

P/E TTM	نماد
۲.۴۱	وشهر
۲.۹۶	فزر
۳.۰۵	ثامید
۳.۰۵	فولاد
۳.۱۸	وبملت
۳.۲۳	شبندر
۳.۳۵	سامان
۳.۵۳	شتران
۳.۵۶	ونوین
۳.۶۱	شراز
۳.۶۹	هرمز
۳.۸۲	ولبهن
۳.۸۴	فخوز
۳.۸۵	فملی
۳.۸۶	شاوان
۳.۹	فسپا
۳.۹۵	مبین
۳.۹۹	فاسمین
۴.۰۶	شپنا
۴.۱۲	ولساپا



شرکت کارگزاری بانک آینده

بررسی ۲۰ اوراق  
با برترین ytm  
در تاریخ

۱۴۰۱/۰۶/۲۳

اوراق بدون کوپن (میانگین ytm امروز: ۲۱.۶۵٪)

YTM	نماد
۲۳.۰۲٪	اخزا۱۹۸
۲۲.۲۹٪	اخزا۰۰۶
۲۲.۲۸٪	اخزا۰۱۰
۲۲.۲۷٪	اخزا۰۰۷
۲۲.۲۷٪	اخزا۰۰۹
۲۲.۲۴٪	اخزا۰۰۸
۲۲.۲۳٪	اخزا۰۰۳
۲۲.۲۱٪	اخزا۰۰۲
۲۲.۱۸٪	اخزا۰۰۴
۲۲.۱۶٪	اخزا۰۰۵
۲۲.۱۴٪	اخزا۰۰۱
۲۱.۹۰٪	اخزا۹۰۲
۲۱.۸۳٪	اخزا۹۱۴
۲۱.۸۰٪	اخزا۹۰۵
۲۱.۷۰٪	اخزا۹۱۰
۲۱.۶۸٪	اخزا۹۰۳
۲۱.۵۳٪	اخزا۹۰۹
۲۱.۵۱٪	اخزا۸۲۰
۲۱.۴۷٪	اخزا۹۰۷
۲۱.۴۳٪	اخزا۸۲۱

اوراق کوپنی (میانگین ytm امروز: ۲۰.۴۵٪)

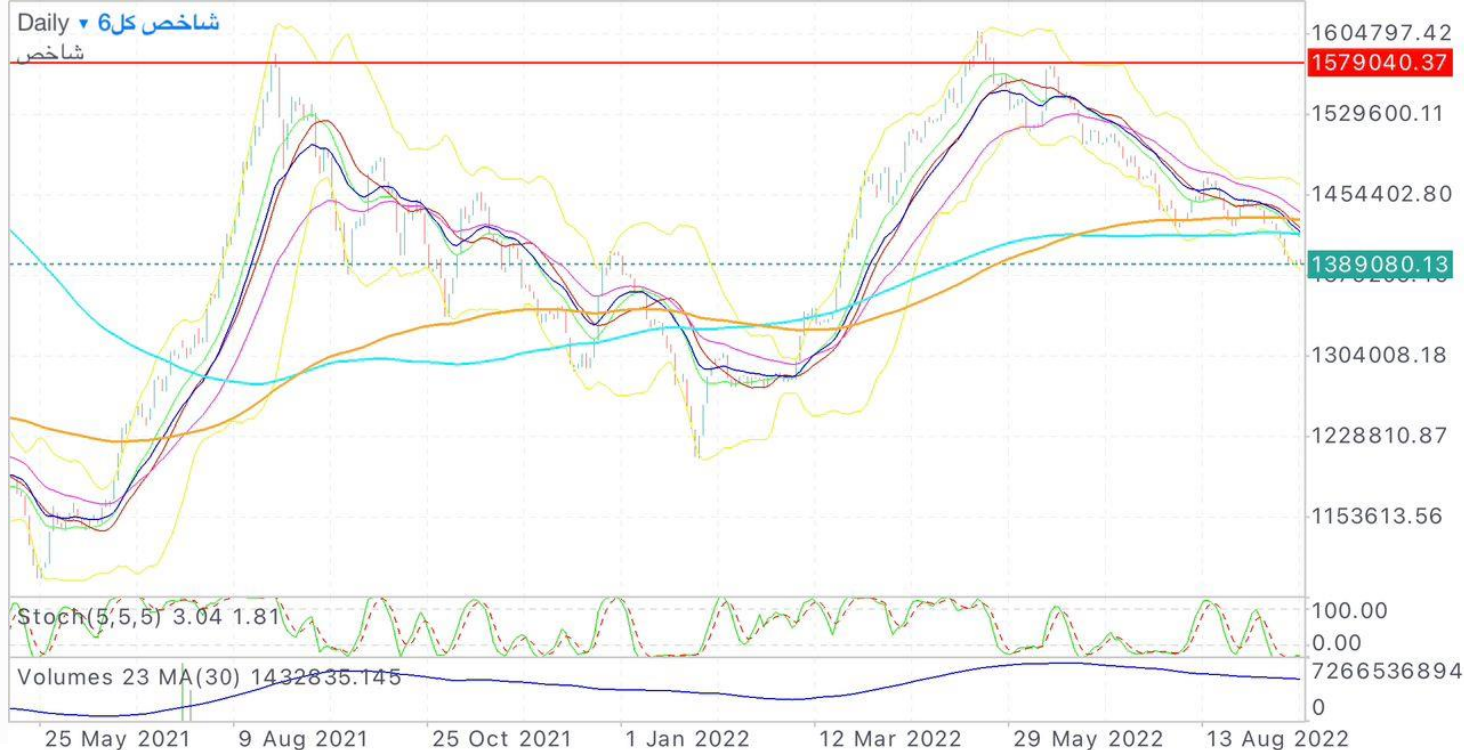
YTM	نماد
۴۵.۳۴٪	افاد۸۳
۳۸.۰۲٪	اراد۸۲
۳۶.۵۶٪	حکمت۰۱
۳۶.۵۰٪	افاد۵۴
۲۸.۸۳٪	گام۰۱۰۸۱۳
۲۷.۴۱٪	البرز۰۲
۲۷.۳۴٪	اراد۲۳
۲۵.۷۱٪	ماهان۰۱
۲۴.۶۲٪	افاد۵۵
۲۳.۶۶٪	گام۰۱۱۲۶۱
۲۳.۳۵٪	مبین۰۱۳
۲۳٪	اراد۱۰۱
۲۲.۹۲٪	گام۰۲۰۳۶۱
۲۲.۹۰٪	افاد۷۴
۲۲.۸۱٪	افاد۴
۲۲.۷۸٪	گام۰۲۰۱۱۳
۲۲.۷۸٪	مبین۰۱۶
۲۲.۶۶٪	گام۰۲۰۴۵۶
۲۲.۴۴٪	گام۰۲۰۲۱۳
۲۲.۳۸٪	افاد۸۴





شرکت کارگزاری بانک آینده

## تحلیل تکنیکال شاخص کل



در هفته های گذشته شاهد رنج زدن شاخص کل بودیم.

۱- در صورت صعود روند باید به مقاومت های، ۱.۴۰۰.۰۰۰، ۱.۴۳۰.۰۰۰، ۱.۴۵۰.۰۰۰ و ۱.۴۸۰.۰۰۰ واحد توجه شود.

۲- در صورت نزول باید به حمایت های ۱.۳۸۰.۰۰۰، ۱.۳۶۶.۰۰۰، ۱.۳۴۸.۰۰۰ و ۱.۳۳۸.۰۰۰ واحد امیدوار بود.

با توجه به شکست حمایت ۱.۴۰۰.۰۰۰ و تثبیت زیر آن، روند میان مدت شاخص کل از حالت صعودی در آمده است. برای قدرت گرفتن دوباره صعود، باید بالای عدد مذکور تثبیت بدهد. در حال حاضر شاخص در یک کانال نزولی در حال نوسان است و فعلا نزول تا حمایت ۱.۳۶۶.۰۰۰ محتمل ترین سناریو می باشد.



شرکت کارگزاری بانک آینده

## تحلیل تکنیکال شاخص کل هم وزن



در هفته های گذشته شاهد رشد شاخص هموزن بوده ایم.

۱- در صورت صعود نمودار شاخص کل هم وزن مقاومت های ۴۱۷.۰۰۰ ، ۴۲۱.۰۰۰ و ۴۲۵.۰۰۰ واحد را پیش رو خواهد داشت.

۲- در صورت نزول نمودار شاخص کل هم وزن حمایت های ۴۰۴.۰۰۰ واحد، ۳۹۴.۰۰۰ واحد و ۳۸۰.۰۰۰ 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 پس از تثبیت شاخص بالای حمایت ۴۰۴.۰۰۰ واحد، ترند میان مدت آن صعودی شده باشد. با توجه به تکمیل پولبک خود، احتمال رشد شاخص در روزهای آتی بالا می باشد.



شرکت کارگزاری بانک آینده

## بازدهی صنایع منتخب بازار سرمایه از ابتدای خردادماه ۱۴۰۱

صنعت	درصد بازدهی	صنعت	درصد بازدهی
خرده فروشی	۲۱.۱٪	خودرو و قطعات	-۴.۶٪
اطلاعات و ارتباطات	۱۹.۳٪	سیمان آهک گچ	-۵.۵٪
محصولات چوبی	۱۶.۲٪	چاپ	-۵.۸٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۴.۵٪	سرمایه گذاریها	-۶.۴٪
پیمانکاری صنعتی	۱۰.۴٪	دارویی	-۶.۵٪
سایر واسطه گریهای مالی	۴.۵٪	قند و شکر	-۶.۷٪
واسطه گریهای مالی و پولی	۲.۵٪	هتل و رستوران	-۶.۹٪
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲.۳٪	فرآورده های نفتی	-۷.۶٪
سایر حمل و نقل	-۰.۷٪	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	-۷.۶٪
رایانه	-۳.۱٪	استخراج سایر معادن	-۸.۲٪
فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۳.۵٪	ماشین آلات و تجهیزات	-۸.۶٪
بیمه و بازنشستگی	-۴.۶٪	شیمیایی	-۹.۹٪

- با توجه به تورم، شاهد بازدهی مناسب صنعت خرده فروشی بوده ایم.
- افزایش نرخ ها برای سرویس های مخابراتی و اینترنت، بازدهی صنعت اطلاعات و ارتباطات را بالا برده است.
- پس از سال ها نظام قیمت گذاری شرکت های عرضه برق و گاز در آستانه تغییر می باشد و این امر تاثیر بالایی در سودآوری این شرکت ها خواهد داشت.



شرکت کارگزاری بانک آینده

## پر بازده ترین و کم بازده ترین سهم های بازار سرمایه از ابتدای خرداد ماه ۱۴۰۱

نماد	درصد بازدهی
کورز	۳۸۳.۰٪
وسالت	۳۴۴.۷٪
غدشت	۱۳۷.۲٪
ثغرب	۱۰۸.۲٪
تفارس	۱۰۱.۶٪
کساپا	۹۳.۳٪
فجوش	۸۹.۸٪
اسیاتک	۸۹.۶٪
حپترو	۷۵.۶٪
خفولا	۷۵.۶٪
فمراد	۷۳.۵٪
آبین	۶۶.۸٪
غناپ	۶۶.۳٪
خپویش	۶۶.۱٪
تمحرکه	۵۸.۴٪
پشاهن	۵۵.۹٪
بالبر	۵۵.۳٪
سپر می	۵۳.۷٪
ممسنی	۴۹.۲٪
خبینان	۴۷.۷٪

نماد	درصد بازدهی
افرا	-۵۱.۲٪
شفن	-۴۶.۵٪
غمارگ	-۴۵.۸٪
پلاست	-۴۴.۰٪
وملل	-۴۳.۲٪
ثرود	-۴۲.۴٪
زاگرس	-۴۲.۰٪
انرژی ۳	-۴۱.۹٪
دسانکو	-۴۱.۳٪
ساینا	-۴۰.۴٪
دیران	-۴۰.۳٪
وبرق	-۳۹.۲٪
غدام	-۳۹.۲٪
غصینو	-۳۸.۸٪
فسازان	-۳۸.۷٪
زنجان	-۳۸.۳٪
ثقزوی	-۳۸.۲٪
رکیش	-۳۷.۹٪
کدما	-۳۷.۸٪
شوینده	-۳۷.۶٪

• در جدول پر بازده ترین نمادهای هفته اخیر، تعدادی از سهم هایی به چشم می خورد که بعد از مدت ها قابل معامله شدند.

• در جدول کمترین بازدهی آخرین شرکتی که به چشم می خورد شوینده است که با مشکل قیمت گذاری دستوری دست و پنجه نرم می کند.



شرکت کارگزاری بانک آینده

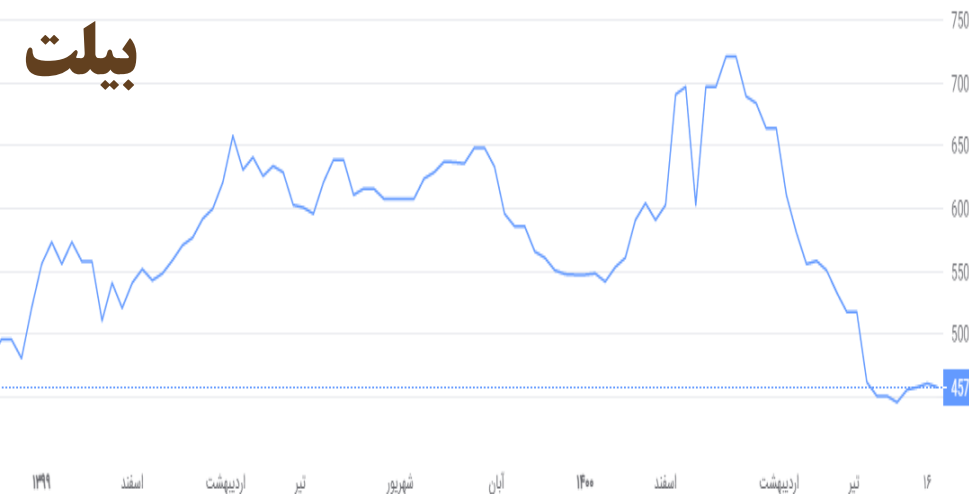
## وضعیت قیمت های جهانی (فولادی ها)



زمان	سقف	امروز
قیمت	۸۵۰	۴۴۰



زمان	سقف	امروز
قیمت	۸۰۰	۴۵۷





شرکت کارگزاری بانک آینده

# وضعیت قیمت های جهانی (فلزات رنگی)



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ -1%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ -20%

ریزش از سقف 28%

زمان	سقف	امروز
قیمت	۱۰۸۰۹	۷۸۱۱



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 13%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ -19%

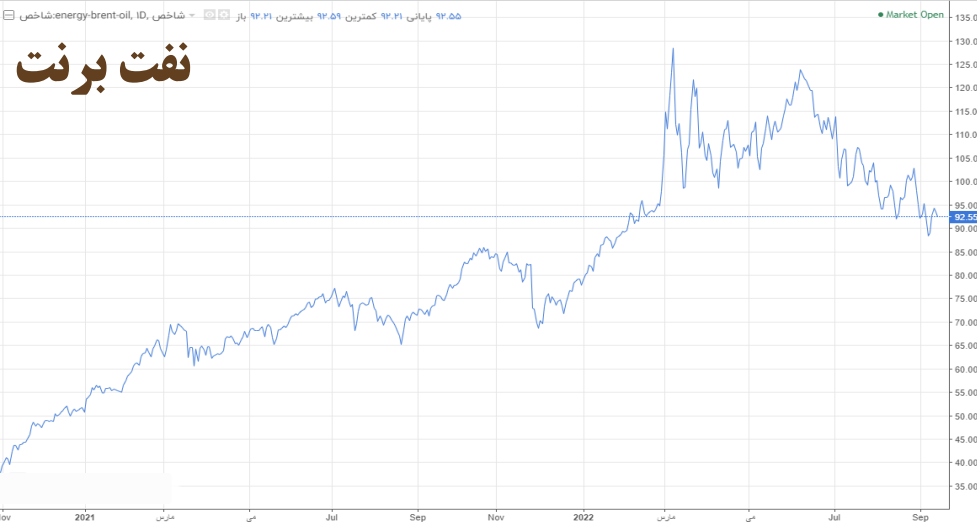
ریزش از سقف 44%

زمان	سقف	امروز
قیمت	۴۱۰۰	۲۳۰۱



شرکت کارگزاری بانک آینده

# وضعیت قیمت های جهانی (نفت و گاز)



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 82%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ 17%

ریزش از سقف 30%

زمان	سقف	امروز
قیمت	۱۳۳.۰۷	۹۲.۴۲



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 220%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ 117%

ریزش از سقف 11%

زمان	سقف	امروز
قیمت	۹.۴۲	۸.۳۴۸



شرکت کارگزاری بانک آینده

## وضعیت قیمت های جهانی (پتروشیمی ها)

## اوره



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 165%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ -20%

ریزش از سقف 27%

زمان	سقف	امروز
قیمت	۹۵۵	۶۹۳

## متانول



بازدهی از ابتدای ۲۰۲۱ 4%

بازدهی از ابتدای ۲۰۲۲ 0%

ریزش از سقف 29%

زمان	سقف	امروز
قیمت	۴۴۵	۳۱۸





• 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
صبا	۳,۵۲۸	۲,۵۶۵	-۱٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۵
اتکام	۳,۰۵۷	۲,۰۰۰	۲٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۷/۲۸
ولشرق	۲,۰۶۱	۱,۰۰۰	۳٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۶/۳۰
تاپیکو	۱۰,۵۵۰	۹,۱۳۰	۴٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۰۳
پردیس	۲,۵۵۰	۱,۴۲۰	۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
کاسپین	۱۱,۵۴۰	۹,۷۵۹	۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۳۰
خمهر	۱,۶۴۵	۵۳۳	۷٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۰
والبر	۴,۲۰۲	۲,۹۰۰	۸٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۱۲
دقازی	۱۳,۸۰۰	۱۱,۷۵۰	۸٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
دبالک	۵,۳۰۰	۳,۷۹۰	۱۱٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۷
وملل	۲,۵۷۰	۱,۳۰۵	۱۱٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۸
کزغال	۱۶,۱۳۰	۱۳,۴۶۰	۱۲٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۰۷
مادیرا	۲,۵۶۸	۱,۲۵۳	۱۴٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۰۲
ولتجار	۲,۷۷۲	۱,۳۰۱	۲۰٪	استفاده نشده	بله	۱۴۰۱/۰۷/۰۷
فن آوا	۶,۰۴۰	۳,۹۵۰	۲۲٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۷



# بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

نماد	نام	تعداد	حجم	ارزش	پایانی	درصد تفاوت	پایانی/قیمت روز
۷۰۰۱	اختیارخ شبندر-۵۶۵۰-۱۴۰۱/۰۷/۲۷	۱	۷	۹,۱۰۰,۰۰۰	۱,۳۰۰	۲.۸%	۱۸%
۸۰۰۷	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۶۱	۵,۷۲۷	۲,۳۰۹,۳۲۷,۰۰۰	۴۰۳	۰.۰%	۱۹%
۷۰۰۰	اختیارخ شستا-۷۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۹۶	۳۹,۸۶۱	۹,۳۸۱,۴۰۴,۰۰۰	۲۳۵	-۰.۳%	۲۵%
۶۰۱۲	اختیارخ اهرم-۹۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۳۰	۹۷	۵۳,۷۳۰	۶۴۹,۴۳۳,۰۰۰	۱,۲۰۹	-۰.۸%	۱۲%
۷۰۸۸	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۲	۵۸	۴,۰۱۵	۴۸۲,۹۲۵,۰۰۰	۱۲۰	-۰.۸%	۶%
۶۰۰۰	اختیارخ اهرم-۱۰۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۳۰	۷۵	۶۵,۴۷۲	۱۳۹,۶۸۳,۸۰۰	۲۱۳	-۰.۸%	۳%
۷۰۰۱	اختیارخ شستا-۸۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	۱۷	۱,۰۰۰	۱۴۰,۵۴۰,۰۰۰	۱۴۱	-۱.۰%	۱۵%
۸۰۰۶	اختیارخ خودرو-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۹	۴۳۹	۲۳۰,۱۲۲,۰۰۰	۵۲۴	-۱.۰%	۲۵%
۷۰۱۲	اختیارخ فولاد-۴۵۸۸-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۶	۱۰	۱۱,۷۳۱,۳۶۵	۶۴۸	-۱.۳%	۱۳%
۷۰۰۵	اختیارخ وپست-۴۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۲	۷	۱,۸۰۰	۳۶۳,۹۰۰,۰۰۰	۲۰۲	-۱.۴%	۵%

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



# بررسی اختیار معاملات برترین ارزش معاملات

پایانی/قیمت روز	درصد تفاوت	پایانی	ارزش	حجم	تعداد	نام	نماد
۸٪	-۳.۰٪	۱۶۶	۲۷,۹۴۳,۹۸۶,۰۰۰	۱۶۸,۷۹۱	۱,۸۸۷	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰/۱۰/۸/۰۴	ضخود۸۰۱۰
۱۱٪	-۴.۸٪	۲۰۸	۲۰,۷۷۷,۵۱۱,۰۰۰	۹۹,۹۱۸	۲۲۵	اختیارخ خساپا-۱۸۰۰-۱۴۰/۱۰/۸/۲۵	ضسپا۸۰۵۰
۲۵٪	-۰.۳٪	۲۳۵	۹,۳۸۱,۴۰۴,۰۰۰	۳۹,۸۶۱	۹۶	اختیارخ شستا-۷۰۰-۱۴۰/۱۰/۷/۱۷	ضستا۷۰۰۰
۵٪	-۹.۰٪	۸۹	۶,۶۸۳,۱۴۷,۰۰۰	۷۵,۰۷۱	۵۰۶	اختیارخ خساپا-۲۰۰۰-۱۴۰/۱۰/۸/۲۵	ضسپا۸۰۵۲
۱۷٪	-۲.۹٪	۳۶۴	۵,۴۹۵,۹۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۸۰	۶۸	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰/۱۰/۸/۰۴	ضخود۸۰۰۸
۳٪	-۱۶.۹٪	۴۰	۵,۳۷۸,۱۹۵,۰۰۰	۱۳۵,۶۲۳	۴۶۳	اختیارخ خساپا-۲۲۰۰-۱۴۰/۱۰/۸/۲۵	ضسپا۸۰۵۳
۵٪	-۱.۶٪	۴۷	۳,۲۱۱,۵۴۲,۰۰۰	۶۸,۷۲۵	۳۰۳	اختیارخ شستا-۹۰۰-۱۴۰/۱۰/۷/۱۷	ضستا۷۰۰۲
۱۹٪	۰.۰٪	۴۰۳	۲,۳۰۹,۳۲۷,۰۰۰	۵,۷۲۷	۶۱	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰/۱۰/۸/۰۴	ضخود۸۰۰۷
۱۴٪	-۴.۰٪	۲۸۷	۲,۱۲۱,۷۵۳,۰۰۰	۷,۴۰۵	۲۳	اختیارخ خودرو-۱۹۰۰-۱۴۰/۱۰/۹/۰۲	ضخود۹۰۰۴
۱۶٪	-۱۱.۶٪	۳۴۶	۱,۳۲۰,۲۰۷,۰۰۰	۳,۸۱۴	۸۱	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰/۱/۱۲/۰۳	ضخود۱۲۰۵

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



نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
پترول	۲۰	-	-
وجامی	۴۰	-	-
وثوق	۳۰	-	-
حسینا	۵,۳۲۰	-	-
فرا بورس	-	٪۲۰	سود انباشته و اندوخته
افق	-	٪۳۱۷	سود انباشته
بسویچ	-	٪۲۹۴	مازاد تجدید ارزیابی دارایی ها



## 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

