

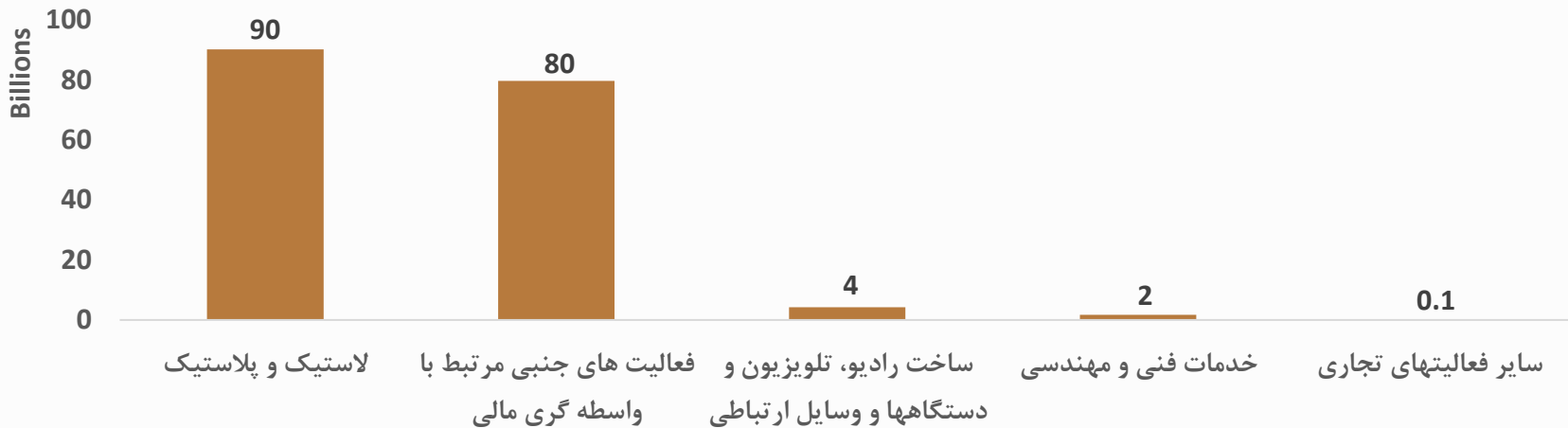
گزارش هفتگی بازار منتهی به ۶ مهر ۱۴۰۱

شرکت کارگزاری بانک آینده





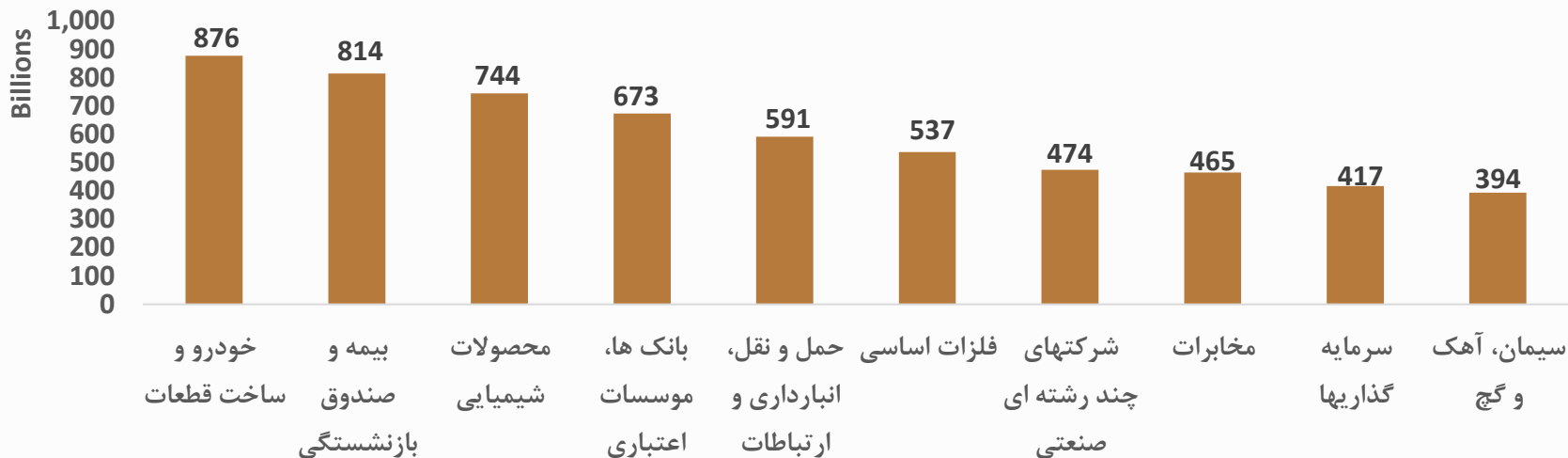
صنایع برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• گروه لاستیک این هفته مورد توجه حقیقی ها قرار گرفتند .



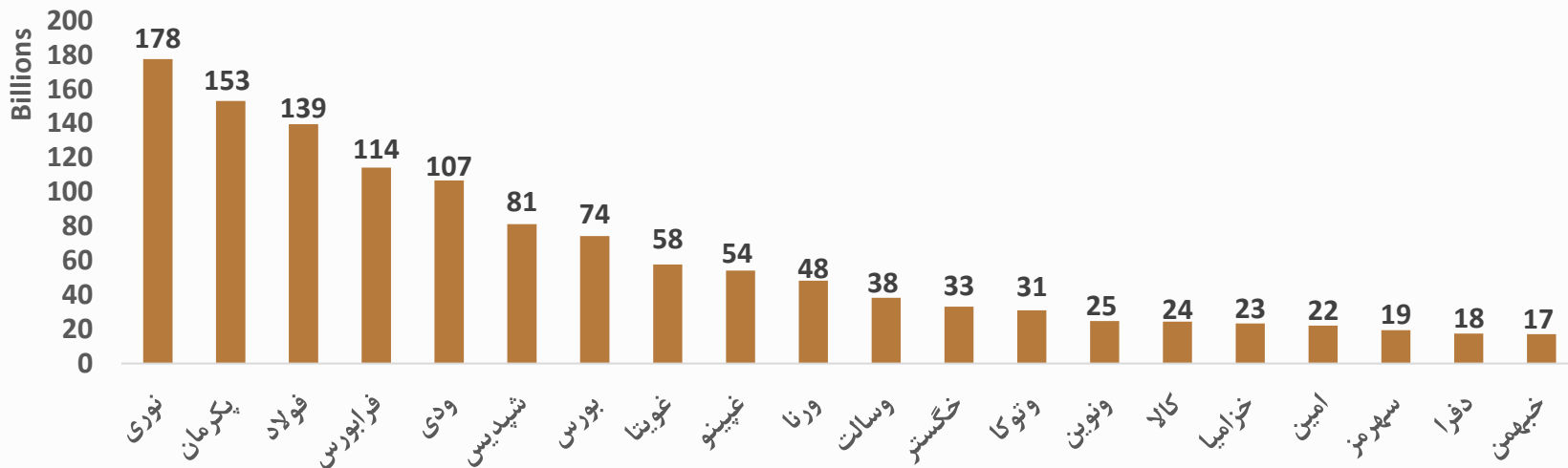
صنایع برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• صنایع خودرو و بیمه در این هفته توسط حقوقی ها مورد حمایت قرار گرفتند.



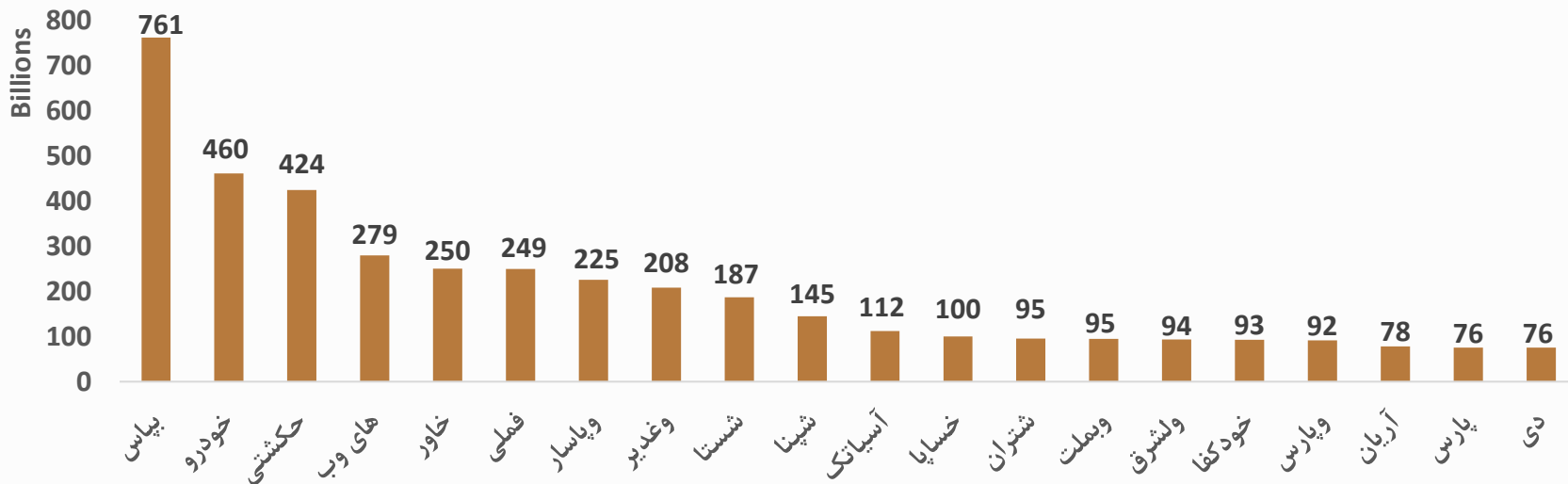
۲۰ نماد برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



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



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

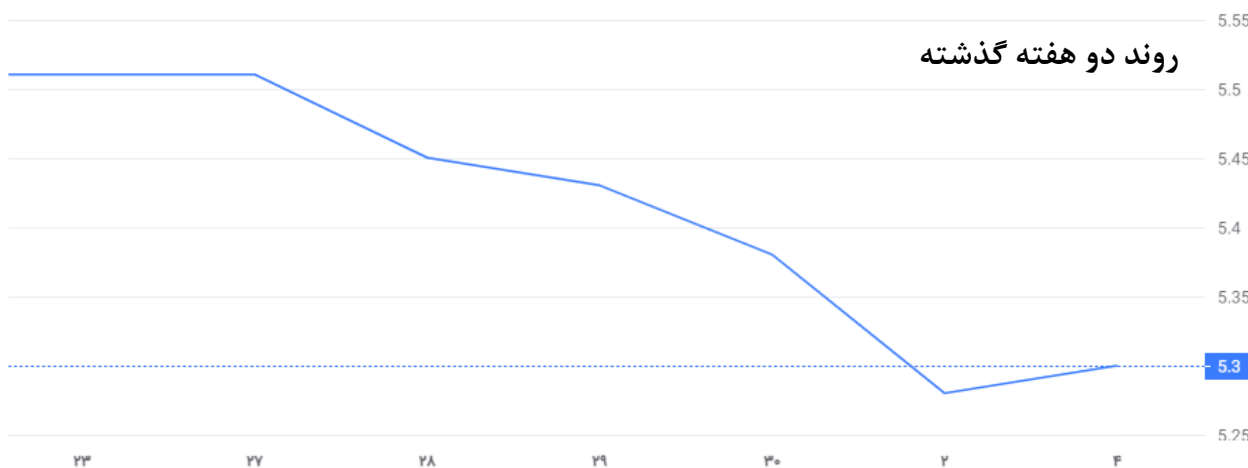


• بیشترین حمایت های حقوقی در این هفته از شرکت های بپاس و خودرو بوده است.



شرکت کارگزاری بانک آینده

روند P/E بازار سرمایه



• روند p/e ttm بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۷/۰۶ به عدد ۵.۳۰ رسید.

شرکت های تولیدی و خدماتی

P/E TTM	نماد
۲.۸۷	فزر
۲.۹۵	ثامید
۲.۹۸	فولاد
۳.۱۲	وبملت
۳.۱۴	سامان
۳.۲۱	شبندر
۳.۴۱	شتران
۳.۴۷	شراز
۳.۴۹	ولبهن
۳.۵	ونوین
۳.۶	فخوز
۳.۶۳	هرمز
۳.۶۴	شاوان
۳.۷	فسپا
۳.۷۵	فاسمین
۳.۷۶	فملی
۳.۸۴	سفارس
۳.۸۵	مبین
۳.۸۵	فروس
۳.۹۲	شپنا

شرکت های سرمایه گذاری

P/E TTM	نماد
۱.۷۲	ثنور
۱.۸۷	ومدیر
۲.۴۲	وآفر
۲.۵۳	پرديس
۲.۶۱	وتوسم
۲.۶۷	وبوعلی
۲.۶۷	وسبحان
۲.۶۸	وپویا
۲.۷۳	وسکاب
۲.۷۵	وکبهن
۲.۷۶	وهامون
۳.۵۷	اعتلا
۳.۶۷	گوهران
۳.۷	وصنعت
۳.۷۶	سنوین
۳.۸۹	واتی
۳.۹	وخارزم
۳.۹۶	مدیریت
۴.۲۶	تاصیکو
۴.۲۶	وصندوق



شرکت کارگزاری بانک آینده

۲۰ نماد با پایین
ترین نسبت
P/E TTM



شرکت کارگزاری بانک آینده

بازدهی صنایع منتخب بازار سرمایه از خرداد ماه ۱۴۰۱ تا کنون

صنعت	درصد بازدهی	صنعت	درصد بازدهی
خرده فروشی	۲۰.۷	رایانه	-۵.۶
سایر واسطه گریهای مالی	۱۳.۵	بیمه و بازنشستگی	-۶
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۱.۷	هتل و رستوران	-۷.۱
محصولات چوبی	۱۰.۷	سرمایه گذاریها	-۷.۳
اطلاعات و ارتباطات	۱۰.۳	سیمان آهک گچ	-۸.۱
پیمانکاری صنعتی	۹.۹	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	-۹.۱
واسطه گریهای مالی و پولی	۳.۳	فرآورده های نفتی	-۹.۹
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۰.۸	دارویی	-۱۰.۱
تجارت عمده و خرده فروشی وسائط نقلیه موتور	۰	استخراج زغال سنگ	-۱۰.۲
ابزار پزشکی	۰	قند و شکر	-۱۰.۳
سایر حمل و نقل	-۴.۷	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱۱.۲
خودرو و قطعات	-۴.۹	شیمیایی	-۱۳.۱

- بازدهی صنایع فوق از زمان شروع اصلاح بازار در اوایل خرداد ماه در نظر گرفته شده است.
- در بازه زمانی خرداد ماه ۱۴۰۱ تا کنون سه صنعت خرده فروشی ، سایر واسطه گریهای مالی و عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم به ترتیب بیشترین درصد بازدهی را داشته اند.



شرکت کارگزاری بانک آینده

پر بازده ترین و کم
بازده ترین سهم از
خرداد ۱۴۰۱ تا کنون

نماد	درصد بازدهی
وسالت	۴۰.۸
غدشت	۱۱۳
کسپا	۹۹
تفارس	۹۳
بتک	۹۰
فجوش	۸۶
غنا	۷۸
ثغرب	۷۵
فمراد	۷۳
خبنیان	۶۷
حپترو	۶۷
اسیاتک	۶۵
خپویش	۶۴
آبین	۶۳
پشاهن	۵۵
تمحرکه	۵۳
بالبر	۵۳
خفولا	۵۲
خکاوه	۴۵
اتکاسا	۴۴

نماد	درصد بازدهی
افرا	-۵۴
شفن	-۵۲
پلاست	-۵۰
دیران	-۴۸
وملل	-۴۷
دسانکو	-۴۷
غمارگ	-۴۶
ووبرق	-۴۶
ثرود	-۴۵
انرژی ۳	-۴۴
زاگرس	-۴۴
غصینو	-۴۴
ثقزوی	-۴۴
رکیش	-۴۳
کفرآور	-۴۳
زنجان	-۴۳
ساینا	-۴۳
فسازان	-۴۳
سدبیر	-۴۳
سلار	-۴۲

- در جدول، پر بازده ترین شرکت ها از ابتدای خرداد ماه ۱۴۰۱ تاکنون، تعدادی از سهم های صنایع خودرویی، انبوه سازی و زراعت 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

بررسی ۲۰ اوراق با برترین ytm در تاریخ ۱۴۰۱/۰۷/۰۶

اوراق بدون کوپن (میانگین ytm امروز: ۲۲.۴۶٪)

YTM	نماد
۲۳.۶۰٪	۰۱۰اخزا
۲۳.۳۰٪	۰۰۴اخزا
۲۳.۲۳٪	۰۰۲اخزا
۲۳.۲۲٪	۰۰۶اخزا
۲۳.۲۰٪	۰۰۵اخزا
۲۳.۱۱٪	۰۰۳اخزا
۲۳.۱۱٪	۰۰۹اخزا
۲۳.۰۶٪	۰۰۷اخزا
۲۳.۰۲٪	۸۱۹اخزا
۲۲.۹۸٪	۱۰۱۱اخزا
۲۲.۸۷٪	۰۰۸اخزا
۲۲.۸۴٪	۹۰۷اخزا
۲۲.۸۲٪	۰۰۱اخزا
۲۲.۶۶٪	۹۱۴اخزا
۲۲.۶۰٪	۹۰۸اخزا
۲۲.۵۹٪	۹۰۶اخزا
۲۲.۵۷٪	۹۱۰اخزا
۲۲.۳۱٪	۸۲۱۱اخزا
۲۲.۲۵٪	۹۰۵اخزا
۲۲.۲۰٪	۹۰۲اخزا

اوراق کوپنی (میانگین ytm امروز: ۲۰.۲۲٪)

YTM	نماد
۴۹.۰۵٪	۴۵اراد
۴۸.۵۲٪	۸۲اراد
۴۵.۳۴٪	۸۳افاد
۲۸.۵۱٪	۰۱۰۸۱۳گام
۲۷.۴۱٪	۰۲البرز
۲۵.۷۱٪	۰۱ماهان
۲۳.۵۷٪	۰۲۰۴۵۶گام
۲۳.۳۵٪	۰۱۳مبین
۲۳.۲۳٪	۷۴افاد
۲۳.۱۶٪	۰۱۱۲۶۱گام
۲۲.۸۱٪	۴افاد
۲۲.۷۸٪	۰۱۶مبین
۲۲.۷۲٪	۰۲۰۱۱۳گام
۲۲.۳۸٪	۸۴افاد
۲۲.۳۸٪	۰۲۰۲۱۳گام
۲۲.۲۶٪	۰۱۴مبین
۲۲.۲۰٪	۵۳اراد
۲۲.۱۰٪	۰۲مهان
۲۲.۰۱٪	۱۱۲اراد
۲۲٪	۳۹اراد



شرکت کارگزاری بانک آینده

تحلیل تکنیکال شاخص کل



در هفته های گذشته شاهد ریزش شاخص کل بودیم.

۱- در صورت صعود روند باید به مقاومت های، ۱۳۸۳۰۰۰۰ ، ۱۳۹۸۰۰۰۰ ، ۱۴۱۷۰۰۰۰ و ۱۴۲۷۰۰۰۰ واحد توجه شود.

۲- در صورت نزول باید به حمایت های ۱۳۴۰۰۰۰۰ ، ۱۳۰۵۰۰۰۰ ، ۱۲۹۰۰۰۰۰ و ۱۲۷۵۰۰۰۰ واحد امیدوار بود.

با توجه به شکست حمایت محدوده ۱۴۰۰۰۰۰ 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 محدوده حمایت ۱۳۰۰۰۰۰۰ محتمل ترین سناریو می باشد.



شرکت کارگزاری بانک آینده

تحلیل تکنیکال شاخص کل هم وزن



در هفته های گذشته شاهد ریزش شاخص هموزن بوده ایم.

۱- در صورت صعود نمودار شاخص کل هم وزن مقاومت های ۳۹۶.۰۰۰ ، ۴۰۴.۰۰۰ و ۴۱۶.۰۰۰ واحد را پیش رو خواهد داشت.

۲- در صورت نزول نمودار شاخص کل هم وزن حمایت های ۳۸۲.۰۰۰ واحد، ۳۸۰.۰۰۰ واحد و ۳۶۸.۰۰۰ واحد پیش روی نمودار خواهد بود.

در نمودار روزانه شاخص با توجه به شکست حمایت مهم ۳۹۵.۰۰۰ واحد، در صورت تثبیت زیر عدد مذکور، مثبت های این دو روز پولبک محسوب شده و ریزش بیشتر شاخص محتمل ترین سناریو است. در صورت بازگشت به بالای عدد مذکور و تثبیت، روند میان مدت شاخص صعودی شده و خرید پیشنهاد می شود.



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	۷,۲۳۵	۷,۲۷۹	-۰.۶%	۷,۶۶۲	-۵.۶%	۷,۷۸۹	۷,۸۶۲	۹,۷۸۱
آلومینیم جهانی	۲,۱۰۰	۲,۱۱۲	-۰.۶%	۲,۲۰۹	-۴.۹%	۲,۲۷۵	۲,۳۹۰	۲,۸۴۹
روی جهانی	۲,۸۱۹	۲,۸۴۳	-۰.۸%	۳,۰۹۸	-۹.۰%	۳,۲۴۱	۳,۴۷۶	۳,۶۵۰
نفت برنت	۸۴.۸	۸۴.۸	-۰.۱%	۹۰.۳	-۶.۲%	۹۳.۸	۹۸.۱	۷۸.۹
گاز طبیعی	۶.۸۶	۶.۸۰	۰.۹%	۷.۷۸	-۱۱.۹%	۹.۰۴	۹.۱۱	۳.۷۶
اوره خلیج فارس	۷۰.۸	۷۰.۸	۰.۰%	۷۰.۸	۰.۰%	۶۹۳	۷۶۰	۸۶۵
متانول پلتس	۳۲۴	۳۲۴	۰.۰%	۳۲۴	۰.۰%	۳۱۸	۳۱۱	۳۱۹
اسلب فوب ایران	۴۳۰	۴۳۰	۰.۰%	۴۳۰	۰.۰%	۴۳۰	۴۴۰	۵۶۸
بیلت فوب ایران	۴۵۵	۴۵۵	۰.۰%	۴۵۵	۰.۰%	۴۵۵	۴۵۵	۵۴۳
دلار آزاد	۳۱,۷۲۰	۳۱,۷۳۰	۰.۰%	۳۱,۷۲۰	۰.۰%	۳۱,۵۲۰	۲۹,۹۳۰	۲۹,۷۰۰
دلار نیما	۲۷,۰۳۲	۲۷,۰۴۷	-۰.۱%	۲۷,۱۰۳	-۰.۳%	۲۷,۰۶۹	۲۶,۷۰۶	۲۴,۷۴۶

بررسی حق تقدم های منتخب



شرکت کارگزاری بانک آینده

در جدول زیر به بررسی ارزشمندی 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
قنیشا	۲,۲۴۰	۱,۴۴۶	-۸٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۸/۲۹
پردیس	۲,۴۷۳	۱,۳۹۵	۳.۳٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
صبا	۳,۲۱۳	۲,۰۹۱	۳.۹٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۵
درازک	۱۱,۹۷۰	۱۰,۵۰۰	۴.۱٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۸
پارسیان	۳,۱۰۷	۱,۹۸۵	۴.۱٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۸/۲۹
تاپیکو	۱۰,۰۲۰	۸,۶۱۰	۴.۳٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۰۳
دبالک	۴,۷۸۴	۳,۵۰۴	۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۷
اتکام	۳,۱۷۷	۱,۹۷۱	۶.۹٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۷/۲۸
والبر	۴,۱۳۹	۲,۸۶۸	۷.۰٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۱۲
وملل	۲,۳۶۰	۱,۱۶۹	۸.۸٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۸
دقازی	۱۳,۴۹۰	۱۱,۳۷۰	۹.۱٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
کاسپین	۱۱,۵۳۰	۹,۵۵۲	۹.۳٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۳۰
خمهر	۱,۸۸۳	۶۶۳	۱۳٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۰
ولتجار	۲,۶۱۱	۱,۰۶۶	۲۶٪	استفاده نشده	بله	۱۴۰۱/۰۷/۰۷
فن آوا	۵,۸۲۰	۳,۳۹۰	۳۳٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۱۷



بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

پایانی/قیمت روز	درصد تفاوت	پایانی	ارزش	حجم	تعداد	نام	نماد
۱۵٪	۹.۳٪	۲۲۰	۱,۱۰۰,۰۰۰	۵	۱	اختیارخ و تجارت-۱۱۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۲۰	ضجار۷۰۵۸
۱۱٪	۲.۲٪	۵۷۰	۵۷۰,۰۰۰	۱	۱	اختیارخ فملی-۴۳۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۰	ضملی۷۰۰۸
۴۰٪	۲.۱٪	۱,۲۰۰	۱۶۷,۱۷۶,۸۰۰	۴۲	۲	اختیارخ های وب-۱۷۴۵-۰۱/۰۷/۱۰	ضهای۷۰۰۱
۸٪	۰.۹٪	۱۶۰	۳۶,۸۳۰,۰۰۰	۲۳۰	۶	اختیارخ خودرو-۱۹۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۲	ضخود۷۰۸۷
۳٪	۰.۶٪	۶۶	۲۹۱,۰۶۰,۰۰۰	۴,۴۳۴	۵۷	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۲	ضخود۷۰۸۸
۱۲٪	۰.۱٪	۳۵۸	۲۳,۷۶۴,۰۴۰	۲۰	۳	اختیارخ های وب-۲۶۴۸-۰۱/۰۷/۱۰	ضهای۷۰۰۶
۲۳٪	-۰.۱٪	۲۱۳	۶۵,۸۸۶,۰۰۰	۳۰۹	۸	اختیارخ شستا-۷۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	ضستا۷۰۰۰
۲٪	-۰.۸٪	۱۹	۱,۲۲۷,۵۰۳,۰۰۰	۶۴,۶۶۶	۲۸۳	اختیارخ شستا-۹۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۱۷	ضستا۷۰۰۲
۳۳٪	-۰.۹٪	۹۹۰	۱۶,۴۲۴,۱۰۰	۵	۱	اختیارخ های وب-۲۰۴۶-۰۱/۰۷/۱۰	ضهای۷۰۰۳
۲۴٪	-۱.۰٪	۴۹۹	۲۳۰,۸۱۵,۰۰۰	۴۶۳	۹	اختیارخ خودرو-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	ضخود۸۰۰۶

• 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
۸۰۰۷	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۳۹۴	۱۰۳,۰۸۳	۴۴,۴۳۴,۵۵۴,۰۰۰	۴۳۱	-۲.۶%	۲۱٪
۸۰۱۰	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱,۹۴۱	۱۶۴,۶۵۰	۲۱,۵۷۴,۰۷۲,۰۰۰	۱۳۱	-۲.۶%	۶٪
۸۰۴۹	اختیارخ حسا-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۹۵	۸۱,۰۰۱	۱۷,۰۱۰,۲۱۱,۰۰۰	۲۱۰	-۱.۷%	۱۱٪
۱۲۰۰	اختیارخ اهرم-۷۰۰۰-۱۴۰۱/۱۲/۲۲	۱۶	۴,۲۵۷	۱۵,۴۸۶,۲۰۵,۰۰۰	۳,۶۳۸	-۹.۳%	۳۷٪
۱۲۰۲	اختیارخ حسا-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۱۲/۱۰	۴۹	۴۶,۰۵۱	۱۴,۵۵۳,۸۵۰,۰۰۰	۳۱۶	-۷.۳%	۱۷٪
۹۰۰۲	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۹/۰۲	۶۴	۳۱,۰۴۰	۱۴,۳۸۸,۰۰۰,۰۰۰	۴۶۴	-۴.۱%	۲۲٪
۱۲۰۳	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۱۲/۰۳	۱۶	۱۶,۰۰۰	۷,۳۹۲,۰۰۰,۰۰۰	۴۶۲	-۸.۹%	۲۲٪
۸۰۵۳	اختیارخ حسا-۲۲۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۵۹۷	۱۹۲,۴۴۴	۶,۲۱۴,۳۳۴,۰۰۰	۳۲	-۱۸.۸%	۲٪
۸۰۵۲	اختیارخ حسا-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۲۵	۶۵۹	۵۶,۷۰۶	۳,۶۰۵,۳۷۵,۰۰۰	۶۴	-۹.۹%	۳٪
۱۲۰۵	اختیارخ اهرم-۱۱۰۰۰-۱۴۰۱/۱۲/۲۲	۵۲	۳,۳۲۶	۲,۴۵۲,۵۶۹,۰۰۰	۷۳۷	-۲۰.۶%	۸٪

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



نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
بفجر	۴,۳۵۰	-	-
مارون	۱۷,۵۰۰	-	-
کطبس	۸۵۰	-	-
کویر	-	٪۵۰	سود انباشته



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 فرمای ایرانیان



صندوق گنجینه آینده روشن

