

گزارش هفتگی بازار منتهی به ۲۰ مهر ۱۴۰۱

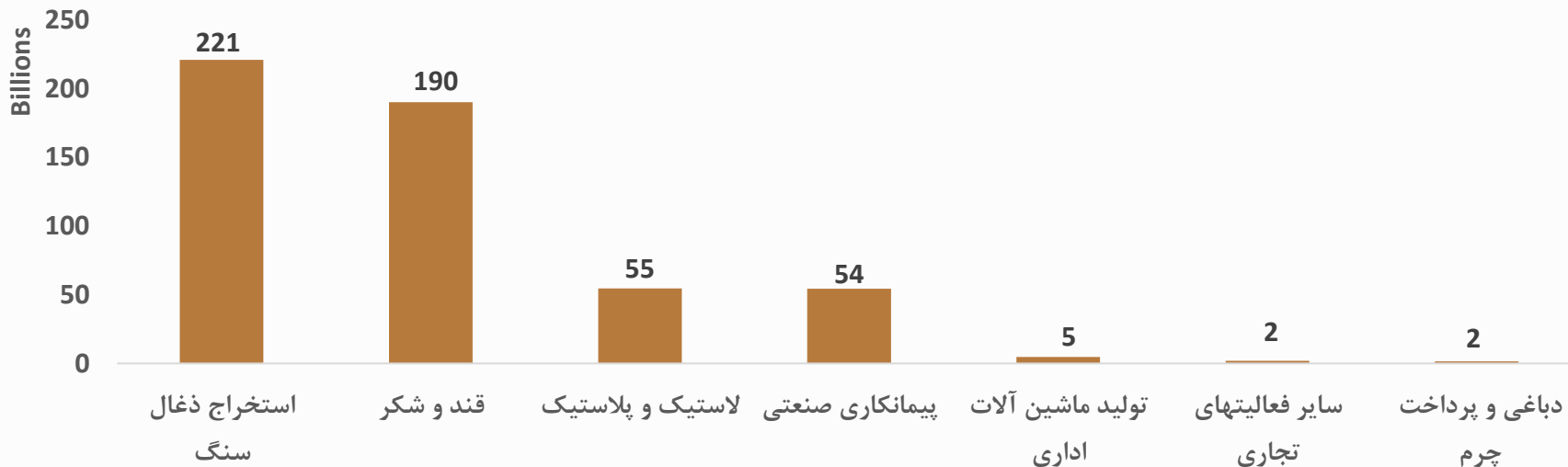
شرکت کارگزاری بانک آینده





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

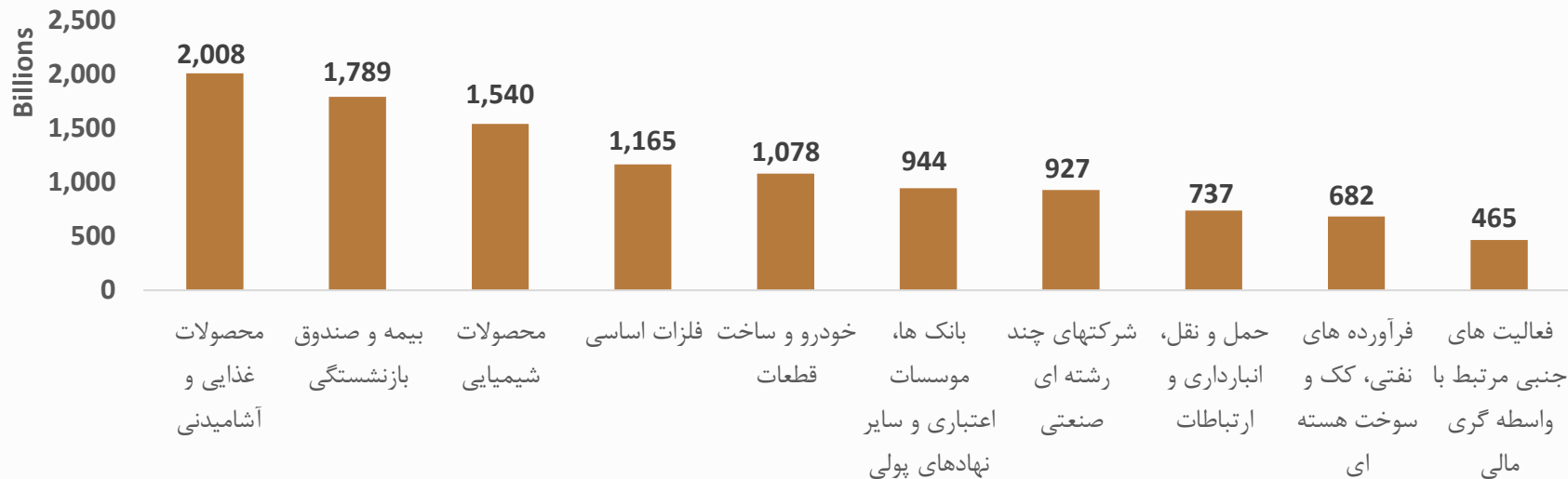
صنایع برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



- گروه استخراج ذغال سنگ این هفته مورد توجه حقیقی ها قرار گرفتند.



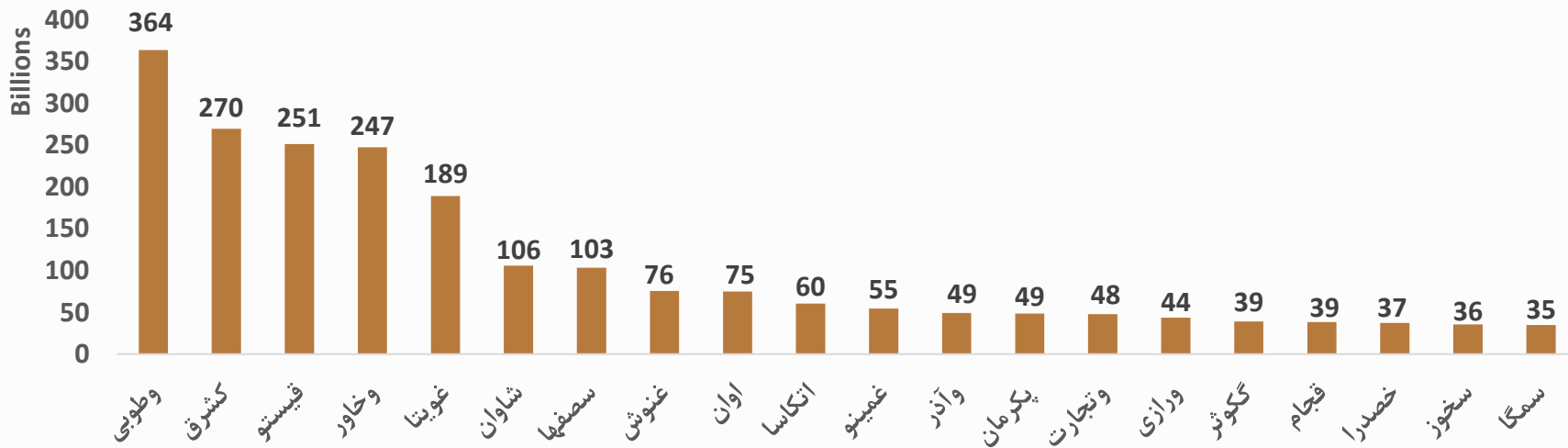
صنایع برتر ورود پول حقوقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



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



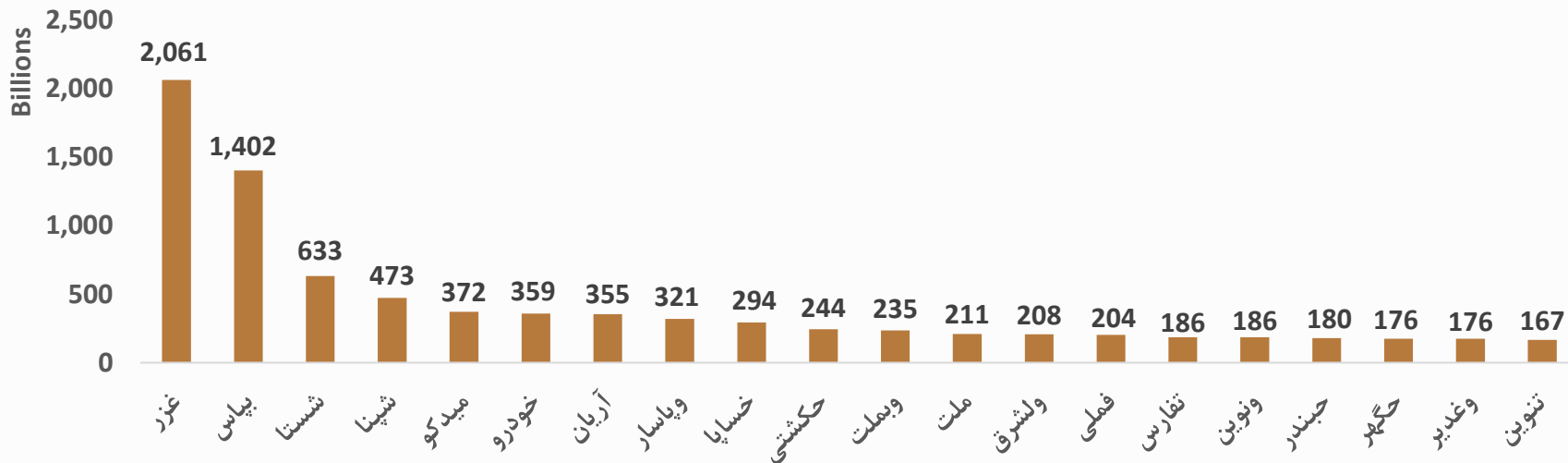
۲۰ نماد برتر ورود پول حقیقی طی یک هفته اخیر (میلیارد ریال)



• بیشترین ورود پول حقیقی در این هفته متعلق به شرکت سرمایه گذاری اقتصاد شهر طوبی (وطنی) می باشد که در واقع در این هفته عرضه شد.



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

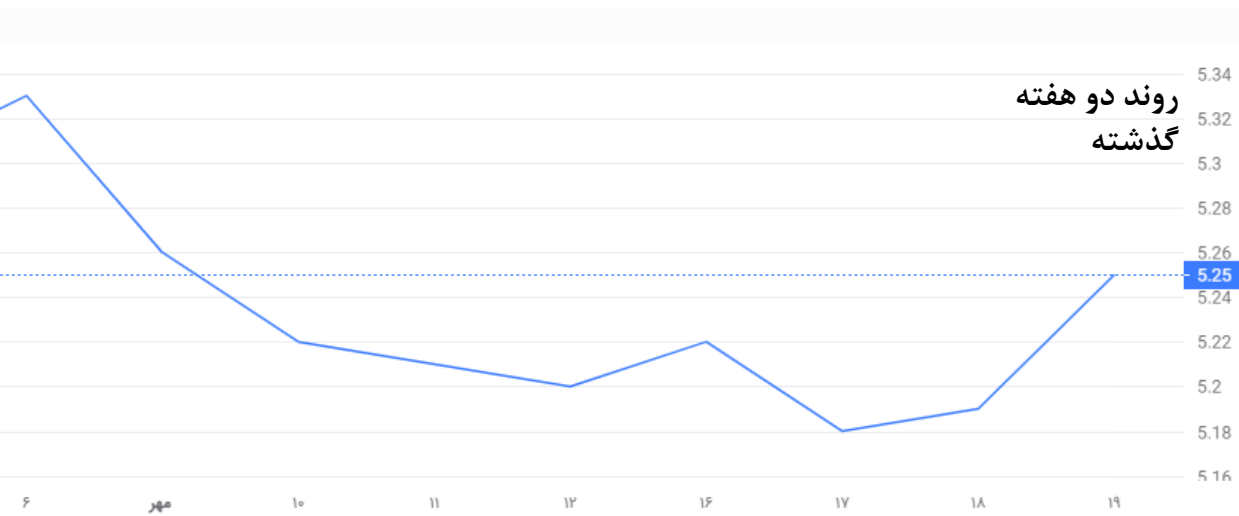


• بیشترین حمایت های حقوقی در این هفته از شرکت های غزر و پپاس بوده است.



شرکت کارگزاری بانک آینده

## روند P/E بازار سرمایه



• روند p/e بازار در پایان معاملات ۱۴۰۱/۰۷/۲۰ به عدد ۵.۲۸ رسید.

## شرکت های تولیدی و خدماتی

P/E TTM	نماد
۲.۲۷	وشهر
۲.۷۹	فزر
۲.۷۹	ثامید
۲.۹۶	سامان
۲.۹۹	فولاد
۳.۰۲	وبملت
۳.۲۵	شبندر
۳.۳۹	ونوین
۳.۴۲	شتران
۳.۵۴	فخوز
۳.۵۶	بفجر
۳.۵۷	هرمز
۳.۵۹	شراز
۳.۶۲	فسپا
۳.۶۸	فجر
۳.۷	مبین
۳.۷۵	فملی
۳.۷۶	فروس
۳.۸	فاسمین
۳.۸۴	شغدیر

## شرکت های سرمایه گذاری

P/E TTM	نماد
۱.۵۵	ثنور
۱.۸۶	ومدیر
۲.۳	ودانا
۲.۴۶	پردیس
۲.۵۶	وپویا
۲.۵۹	وتوسم
۲.۶۳	وکبهن
۲.۶۴	وسبحان
۲.۶۸	وهامون
۲.۷	وسکاب
۲.۷۱	وآفر
۲.۸۹	اعتلا
۳.۰۵	مدیریت
۳.۳۵	وخارزم
۳.۴۵	وصنعت
۳.۶۷	گوهران
۳.۷۲	سنوین
۳.۷۷	واتی
۴.۱۹	تاصیکو
۴.۲۵	ومهان



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	۲۰.۵	سیمان آهک گچ	-۹
سایر واسطه گریهای مالی	۱۵.۱	خودرو و قطعات	-۹.۱
محصولات چوبی	۶.۱	سایر حمل و نقل	-۹.۵
اطلاعات و ارتباطات	۲.۶	بیمه و بازنشستگی	-۱۱.۸
تجارت عمده و خرده فروشی وسائط نقلیه موتور	۰	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	-۱۱.۹
ابزار پزشکی	۰	هتل و رستوران	-۱۲
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۰.۴	دارویی	-۱۲.۴
حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	-۴.۶	قند و شکر	-۱۳
پیمانکاری صنعتی	-۶.۸	شیمیایی	-۱۳.۱
فرآورده های نفتی	-۷.۶	فنی و مهندسی	-۱۳.۶
رایانه	-۷.۹	فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط	-۱۴.۱
سرمایه گذاریها	-۸.۱	منسوجات	-۱۴.۶

- 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 محصولات چوبی 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	۴۸۵
وآتوس	۱۸۹
کساپا	۱۰۱
غدشت	۹۹
بتک	۹۶
گدنا	۹۵
تفارس	۸۵
بالبر	۸۴
دانا	۸۲
ولشرق	۷۴
فجوش	۷۳
خبنيان	۶۷
غناپ	۶۶
تمحرکه	۶۵
ثغرب	۶۴
خفولا	۶۴
اتکاسا	۵۳
خپویش	۵۳
سپرمی	۵۱
اسیاتک	۴۸

نماد	درصد بازدهی
دسانکو	-۵۵
افرا	-۵۴
پلاست	-۵۳
شفن	-۵۱
وملل	-۵۰
کفرآور	-۴۹
ثقزوی	-۴۹
انرژی ۳	-۴۹
ثرود	-۴۹
تکشا	-۴۸
فسازان	-۴۷
رکیش	-۴۷
سدبیر	-۴۷
زنجان	-۴۷
مفاخر	-۴۷
بنو	-۴۷
ووبرق	-۴۶
غدام	-۴۶
ساینا	-۴۶
غمارگ	-۴۶

- 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  
۱۴۰۱/۰۷/۲۰

اوراق بدون کوپن (میانگین ytm امروز: ۲۲.۷۴٪)

YTM	نماد
۲۳.۹۹٪	اخزا۱۱
۲۳.۴۵٪	اخزا۱۱
۲۳.۴۴٪	اخزا۰۲
۲۳.۴۴٪	اخزا۰۳
۲۳.۴۴٪	اخزا۰۴
۲۳.۴۴٪	اخزا۰۶
۲۳.۴۴٪	اخزا۰۷
۲۳.۴۴٪	اخزا۱۰
۲۳.۴۳٪	اخزا۰۸
۲۳.۴۳٪	اخزا۰۹
۲۳.۴۲٪	اخزا۰۵
۲۳٪	اخزا۱۱
۲۲.۹۵٪	اخزا۱۹
۲۲.۹۴٪	اخزا۰۹
۲۲.۹۳٪	اخزا۱۴
۲۲.۹۲٪	اخزا۰۶
۲۲.۹۰٪	اخزا۰۷
۲۲.۸۳٪	اخزا۰۳
۲۲.۸۰٪	اخزا۰۸
۲۲.۸۰٪	اخزا۱۰

اوراق کوپنی (میانگین ytm امروز: ۱۹.۸۷٪)

YTM	نماد
۴۰.۸۷٪	افاد۸۳
۳۳.۳۸٪	اراد۴۵
۲۷.۴۱٪	البرز۰۲
۲۶.۱۵٪	اراد۸۶
۲۵.۷۱٪	ماهان۰۱
۲۳.۷۰٪	اراد۸۲
۲۳.۵۷٪	گام۰۲۰۳۶۱
۲۳.۵۷٪	گام۰۲۰۴۵۶
۲۳.۴۶٪	گام۰۱۱۲۶۱
۲۳.۲۳٪	افاد۷۴
۲۲.۸۷٪	اراد۹۳
۲۲.۷۸٪	گام۰۲۰۱۱۳
۲۲.۷۸٪	مبین۰۱۶
۲۲.۳۸٪	افاد۸۴
۲۲.۲۹٪	اراد۱۱۲
۲۲.۲۴٪	اراد۴۰
۲۲.۲۲٪	تابان۰۳
۲۲.۲۰٪	اراد۵۳
۲۲.۰۹٪	گام۰۲۰۲۱۳
۲۲٪	اراد۳۹



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، ۱.۳۲۸.۰۰۰ ، ۱.۳۴۶.۰۰۰ ، ۱.۳۸۵.۰۰۰ و ۱.۴۰۰.۰۰۰ واحد توجه شود.

۲- در صورت نزول باید به حمایت های ۱.۳۰۰.۰۰۰ ، ۱.۲۹۰.۰۰۰ ، ۱.۲۷۵.۰۰۰ و ۱.۲۴۷.۰۰۰ واحد امیدوار بود.

با توجه به شکست کف کانال بلند مدت شاخص و تثبیت زیر آن، به نظر می رسد مثبت های دو روز گذشته پولبک بوده و شاخص کل وارد مرحله جدیدی از معاملات نزولی خود شده است. در صورت شکست مقاومت ۱.۳۲۸.۰۰۰ واحد و تثبیت بالای آن، می توان به صعود دوباره شاخص کل امیدوار بود. در شرایط کنونی، ورود به بازار پیشنهاد نمی شود.



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 ۳۸۱.۰۰۰ ، ۳۸۴.۰۰۰ و ۳۸۸.۰۰۰ واحد را پیش رو خواهد داشت.

۲- در صورت نزول نمودار شاخص کل هم وزن حمایت های ۳۷۵.۰۰۰ واحد، ۳۶۹.۰۰۰ واحد و ۳۶۰.۰۰۰ واحد پیش روی نمودار خواهد بود.

در نمودار روزانه شاخص با توجه به شکست محدوده حمایتی مهم آن، روند میان مدت شاخص نزولی شده است. در صورت شکست محدوده مقاومتی پیش رو و تثبیت بالای آن، روند صعودی خواهد شد. در غیر این صورت و با ثبات شرایط کنونی، شاهد ریزش بیشتر شاخص کل هموزن خواهیم بود.



# 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	۷,۵۷۴	۷,۵۸۹	-۰.۲٪	۷,۷۱۷	-۱.۹٪	۷,۴۶۶	۷,۹۸۵	۹,۷۸۱
آلومینیم جهانی	۲,۲۱۶	۲,۲۵۱	-۱.۶٪	۲,۳۶۵	-۶.۳٪	۲,۱۴۱	۲,۲۹۰	۲,۸۴۹
روی جهانی	۲,۹۴۹	۲,۹۳۷	۰.۴٪	۳,۰۸۲	-۴.۳٪	۲,۸۸۶	۳,۲۰۵	۳,۶۵۰
نفت برنت	۹۴.۳	۹۳.۷	۰.۶٪	۹۳.۷	۰.۶٪	۸۷.۹	۹۴.۲	۷۸.۹
گاز طبیعی	۶.۶۱	۶.۵۹	۰.۳٪	۶.۹۶	-۵.۰٪	۷.۰۲	۸.۳۳	۳.۷۶
اوره خلیج فارس	۶۴۵	۶۴۵	۰.۰٪	۶۱۰	۵.۷٪	۷۰۸	۶۹۳	۸۶۵
متانول پلتس	۳۳۱	۳۳۱	۰.۰٪	۳۳۱	۰.۰٪	۳۲۴	۳۱۸	۳۱۹
اسلب فوب ایران	۴۳۰	۴۳۰	۰.۰٪	۴۳۰	۰.۰٪	۴۳۰	۴۴۰	۵۶۸
بیلت فوب ایران	۴۶۱	۴۶۱	۰.۰٪	۴۵۸	۰.۷٪	۴۵۳	۴۵۷	۵۴۳
دلار آزاد	۳۲,۶۷۰	۳۲,۷۰۰	-۰.۱٪	۳۲,۷۸۰	-۰.۳٪	۳۱,۸۵۰	۳۱,۰۷۰	۲۹,۷۰۰
دلار نیما	۲۷,۲۶۳	۲۷,۲۱۲	۰.۲٪	۲۷,۲۲۴	-۰.۱٪	۲۷,۰۳۲	۲۷,۰۷۱	۲۴,۷۴۶



• 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	۱,۹۵۲	۹۸۱	-۱٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۸/۲۹
تاپیکو	۹,۷۶۰	۸,۵۶۰	۲٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۰۳
پارسیان	۲,۹۵۹	۱,۸۸۷	۳٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۸/۲۹
والبر	۴,۰۲۸	۲,۸۵۰	۵٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۱۲
اتکام	۳,۰۷۹	۱,۹۲۰	۵٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۷/۲۸
درازک	۱۱,۲۵۰	۹,۶۰۰	۶٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۸
لوتوس	۴,۶۴۱	۳,۳۴۰	۷٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۹/۱۰
پردیس	۲,۴۲۴	۱,۲۵۷	۷٪	عادی	بله	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
وپویا	۱,۹۳۵	۸۰۰	۸٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۰۸
کاسپین	۱۰,۴۷۰	۸,۶۸۰	۸٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۳۰
دقازی	۱۳,۳۶۰	۱۱,۲۴۰	۹٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۱
دسبحا	۷,۵۸۰	۵,۵۱۰	۱۶٪	عادی	خیر	۱۴۰۱/۰۸/۲۱
امید	۵,۱۴۰	۳,۴۰۰	۱۷٪	استفاده نشده	خیر	۱۴۰۱/۰۷/۲۳



# بررسی اختیار معاملات برترین درصد تفاوت ها

نماد	نام	تعداد	حجم	ارزش	پایانی	درصد تفاوت	پایانی/قیمت روز
ضجار۱۰۲۷	اختیارخ و تجارت-۱۱۰۰-۱۴۰۱/۱۰/۰۷	۵	۳۳۷	۵۴,۵۷۶,۰۰۰	۱۶۲	۸.۰٪	۱۲٪
ضپیک۷۰۵۱	اختیارخ تایپیکو-۸۰۵۳-۰۱/۰۷/۲۰	۱	۲	۲,۸۳۹,۸۰۶	۱,۱۶۱	۴.۹٪	۱۲٪
ضفلا۷۰۱۰	اختیارخ فولاد-۳۴۸۳-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۴	۱۹	۵۱,۲۸۳,۳۴۱	۱,۴۹۲	۱.۶٪	۲۹٪
ضفلا۷۰۱۲	اختیارخ فولاد-۴۵۸۸-۱۴۰۱/۰۷/۲۴	۴	۴	۳,۰۳۰,۰۷۵	۴۱۹	۱.۰٪	۸٪
ضجار۷۰۵۸	اختیارخ و تجارت-۱۱۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۲۰	۵	۵۲	۱۳,۴۸۰,۰۰۰	۲۵۹	۰.۹٪	۱۹٪
ضجار۷۰۵۶	اختیارخ و تجارت-۱۳۰۰-۱۴۰۱/۰۷/۲۰	۱۸	۱,۵۴۳	۹۳,۸۰۸,۰۰۰	۶۱	۰.۷٪	۴٪
ضخود۸۰۰۷	اختیارخ خودرو-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۴	۱۱۱	۳۱,۲۳۳,۰۰۰	۲۸۱	۰.۷٪	۱۴٪
ضستا۹۰۰۱	اختیارخ شستا-۷۰۰-۱۴۰۱/۰۹/۰۲	۲	۱۱	۱,۸۹۴,۰۰۰	۱۷۲	۰.۲٪	۲۰٪
ضپیک۷۰۵۲	اختیارخ تایپیکو-۸۸۷۱-۰۱/۰۷/۲۰	۱	۱	۹۷۸,۴۰۰	۸۰۰	۰.۲٪	۸٪
ضحسیر۶۰۰	اختیارخ حسیر-۱۵۰۰۰-۱۴۰۲۰۶۲۷	۱	۲۰	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۵۰۰	۰.۰٪	۹٪

• 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
۱۲۰۲	اختیارخ حساپا-۱۷۰۰-۱۴۰/۱۲/۱۰	۱۵۱	۶۴,۰۱۱	۱۵,۸۳۳,۶۴۴,۰۰۰	۲۴۷	-۹.۲٪	۱۴٪
۱۲۰۴	اختیارخ حساپا-۱۹۰۰-۱۴۰/۱۲/۱۰	۴۵۱	۱۱۴,۹۶۷	۱۵,۱۸۰,۷۰۵,۰۰۰	۱۳۲	-۱۴.۰٪	۷٪
۶۰۰۴	اختیارخ شستا-۱۰۰۰-۱۴۰۲/۰۶/۰۸	۵۶۹	۱۴۷,۶۷۱	۱۱,۸۶۸,۹۰۰,۰۰۰	۸۰	-۲۳.۶٪	۹٪
۱۱۰۲	اختیارخ خاور-۲۰۰۰-۱۴۰۱۱۱۰۹	۴۰	۲۰,۳۷۰	۹,۷۳۳,۵۱۰,۰۰۰	۴۷۸	-۷.۳٪	۲۱٪
۸۰۴۹	اختیارخ حساپا-۱۷۰۰-۱۴۰/۱۰۸/۲۵	۸۰	۶۷,۰۸۳	۹,۵۹۲,۸۶۹,۰۰۰	۱۴۳	-۳.۴٪	۸٪
۱۲۰۳	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰/۱۲/۰۳	۲۹	۲۶,۱۳۵	۹,۱۴۰,۶۷۰,۰۰۰	۳۵۰	-۷.۸٪	۱۸٪
۸۰۰۵	اختیارخ خودرو-۱۸۰۰-۱۴۰/۱۰۸/۰۴	۳۸	۳۷,۰۲۰	۸,۲۴۶,۰۰۰,۰۰۰	۲۲۳	-۱.۵٪	۱۱٪
۸۰۱۰	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰/۱۰۸/۰۴	۸۴۳	۱۵۲,۰۷۹	۷,۹۶۴,۲۶۰,۰۰۰	۵۲	-۲.۹٪	۳٪
۱۲۰۵	اختیارخ حساپا-۲۰۰۰-۱۴۰/۱۲/۱۰	۲۵۸	۵۰,۰۲۶	۵,۴۲۹,۳۵۲,۰۰۰	۱۰۹	-۱۸.۳٪	۶٪
۱۲۰۵	اختیارخ خودرو-۲۰۰۰-۱۴۰/۱۲/۰۳	۱۱۴	۲۵,۷۸۸	۵,۲۸۵,۴۱۶,۰۰۰	۲۰۵	-۱۰.۶٪	۱۰٪

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





نماد	تقسیم سود (ریال)	درصد افزایش سرمایه	افزایش سرمایه از محل
کفرآور	۷۲۵	-	-
دابور	-	%۱۰۰	مطالبات و آورده نقدی
خنصیر	-	%۱۶	سود انباشته
سپ	-	%۶۳	سود انباشته و مطالبات و آورده نقدی
مفاخر	-	%۳۹۳	تجدید ارزیابی دارایی ها



## خدمات شرکت کارگزاری ببانک 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

