



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۱۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۱ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، شپدیس، کچاد، نوری، شفن و وپارس با کاهش ۲,۳۴۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۵۷,۸۹۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۵ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق‌های قابل معامله سهامی می‌باشد. در روز جاری ۷۱ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

می‌توان این‌طور تلقی کرد که در شرایط کنونی به دلایلی که در یک سال گذشته در بازار سرمایه اتفاق افتاده است، فعالان بازار سرمایه با احتیاط بیشتری اقدام به معامله سهام می‌کنند و به همین دلیل به جای اینکه شاهد رشد قوی و یک دست در اکثر گروه‌ها باشیم، بازار سهام خود را در قالب رشد آهسته در اکثر صنایع بورسی نشان می‌دهد. بطوریکه بعد از دو الی سه روز مثبت شدن قیمت سهام در یک گروه، در روزهای بعد شاهد خروج پول در صنایع رشد کرده به صنایع جا مانده هستیم.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳,۷۴۵ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با اراد ۵۰، بیشترین ارزش معاملات را در بازار اوراق با درآمد ثابت به خود اختصاص داده است. در بین اوراق خزانه، بالاترین نرخ مؤثر بازده تا سررسید اخزاها نیز مربوط به نماد اخزا ۷۱۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۸ با ۲۹,۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۱۰	۱۴۰۰/۰۵/۱۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳,۷۰۶	۳,۷۴۵	۱٪



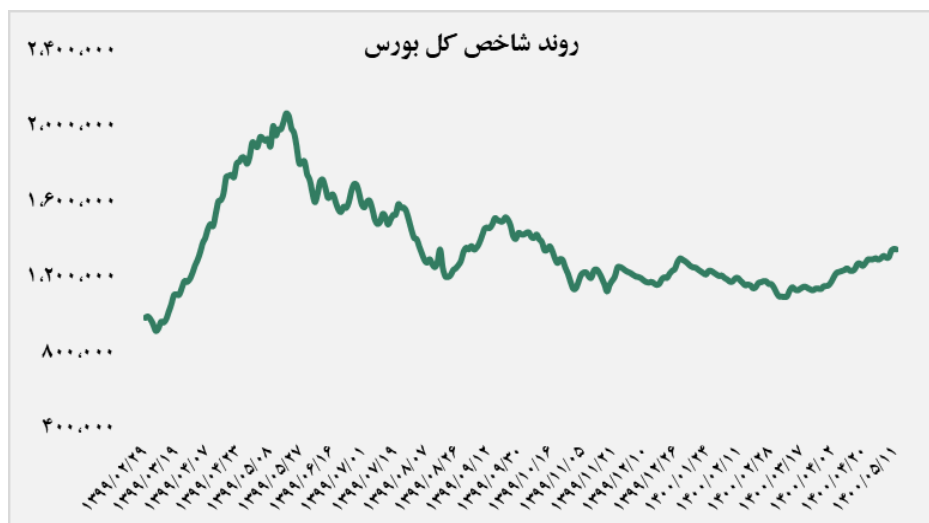
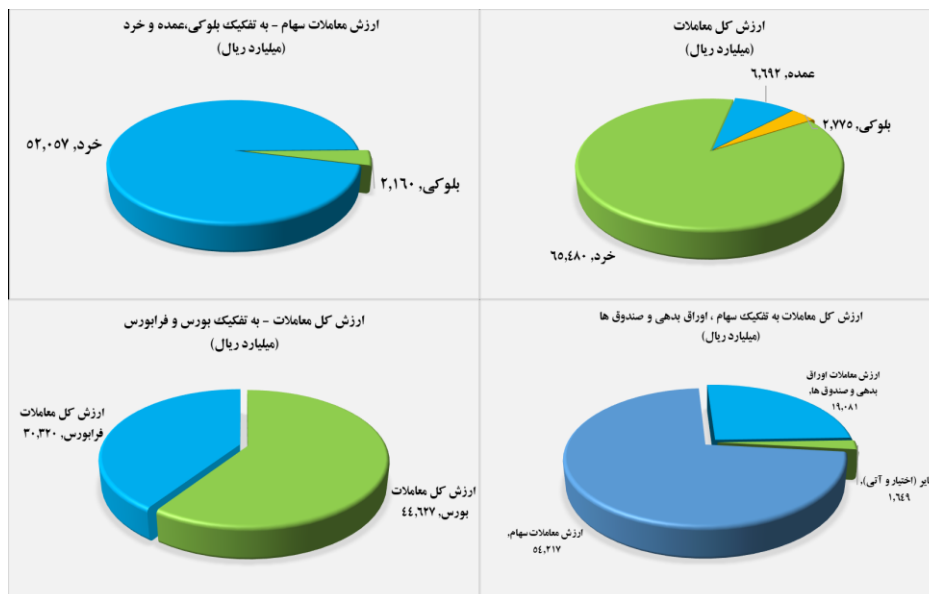
گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، فولاد امیرکبیر کاشان در تیر ماه به دلیل محدودیت‌های برق ۸,۸۴۸ تن محصول گالوانیزه تولید کرده، میانگین تولید ماهانه این محصول در سال ۹۹، ۱۲,۶۹۰ تن و میانگین تولید ۳ ماه ابتدای سال جاری ۱۴,۰۴۲ تن بوده است. در تیر ماه شرکت ۹,۷۲۷ تن محصول گالوانیزه به فروش رسانده (۷۲۲ تن سهم صادرات)، میانگین فروش ماهانه در سال ۹۹، ۱۳,۲۴۲ تن (۶۶۵ تن سهم صادرات) و در سال ۹۸، ۱۲,۳۳۵ تن (۲,۵۰۱ تن سهم صادرات) بوده است. پس از فروش عالی ۴۹۸ میلیارد تومانی خرداد، شرکت در تیر ۳۰۹ میلیارد تومان فروش به ثبت رسانده است. میانگین فروش ماهانه سال ۹۹، ۲۳۰ میلیارد تومان است. میانگین نرخ فروش محصول گالوانیزه در سال ۹۹، ۱۶۷,۹۰۷ ریال بوده و در ۳ ماهه به ۳۰۳,۴۸۳ ریال در هر کیلو رسیده و نرخ فروش تیر ماه ۳۱۷,۷۶۹ ریال گزارش شده است.

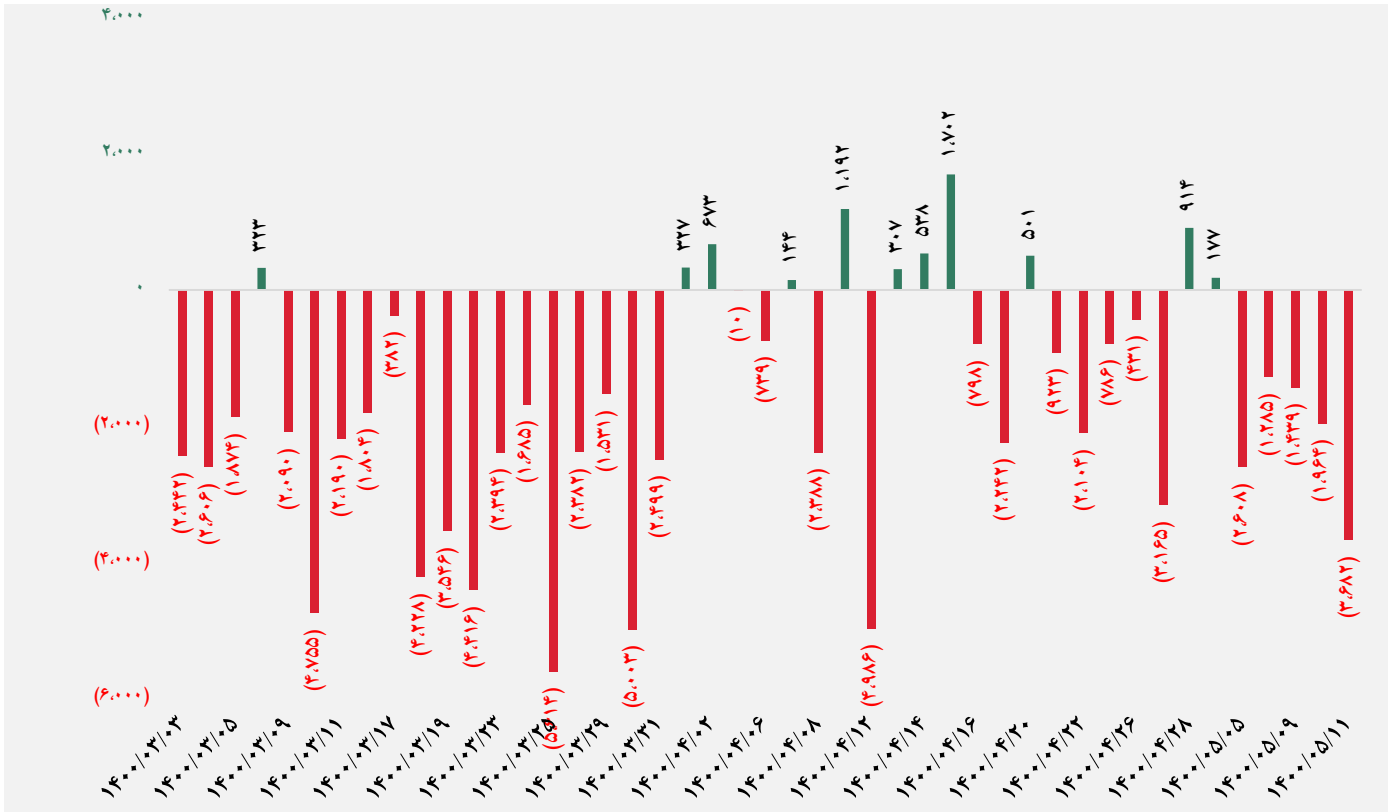
در گروه شیمیایی، متوسط فروش شش ماهه اول سال مالی گذشته شرکت معدنی املاح ایران برای هر ماه بر اعداد ۲۶ و ۴۰ میلیارد تومان استوار بوده که در فروردین هم عدد خوب ۳۹ میلیارد تومانی را دارد و در اردیبهشت رکورد فروش تاریخ شرکت با ۵۲ میلیارد تومان شکسته شد و خرداد ۴۹ میلیارد تومان فروش داشت و تیر نیز در حدود خرداد با ۴۹ میلیارد تومان است. مقدار تولید متوسط شرکت ۱۵,۶۰۰ تن سدیم سولفات است که در ماه مورد گزارش ۱۵,۶۰۰ تن تولید دارد. بزرگترین تولیدکننده سدیم سولفات خاورمیانه در سال گذشته فروش‌هایی در حد تولیدات داشته و در سه ماهه ۴۶ هزار تن فروش داشت و در تیر نیز ۱۶ هزار تن فروش گزارش کرده است. نرخ‌های فروش در سال ۹۹ بسته به مقدار فروش سهمیه به میزان ۶۰ درصد و ۴۰ درصد آزاد شرکت، نرخ‌های متفاوتی ثبت کرده است. با افزایش نرخ‌های فروش از ابتدای دی ماه، نرخ فروش شرکت در حدود ۲,۸۰۰ تومان در هر کیلو ثبت شده است، در فصل اول ۱۴۰۰، نرخ فروش ۲,۶۰۰ تومان بود.

تصویر کلی بازار

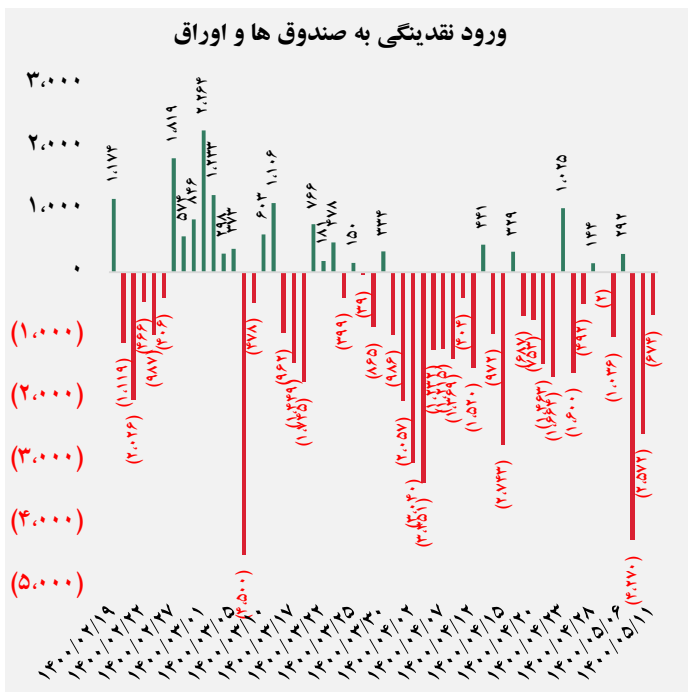
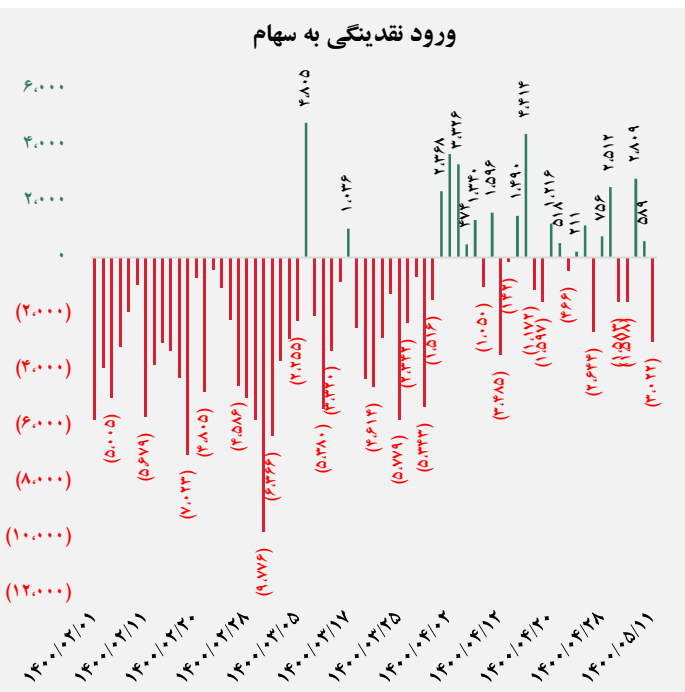
فرا بورس		بورس	
۱۹,۸۷۰	شاخص کل	۱,۳۵۷,۸۹۸	شاخص کل
۸۷	تغییر شاخص	(۲,۳۴۷)	تغییر شاخص
۱۰,۹۵۲,۱۹۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۴,۶۹۳,۹۳۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۰,۳۲۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۴,۶۲۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
فرا بورس		میدکو	
بنو		خودرو	
هرمز		وغدیر	
وهور		حساپا	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
زاگرس		فملی	
دی		شپدیس	
آریا		کچاد	
شگویا		نوری	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

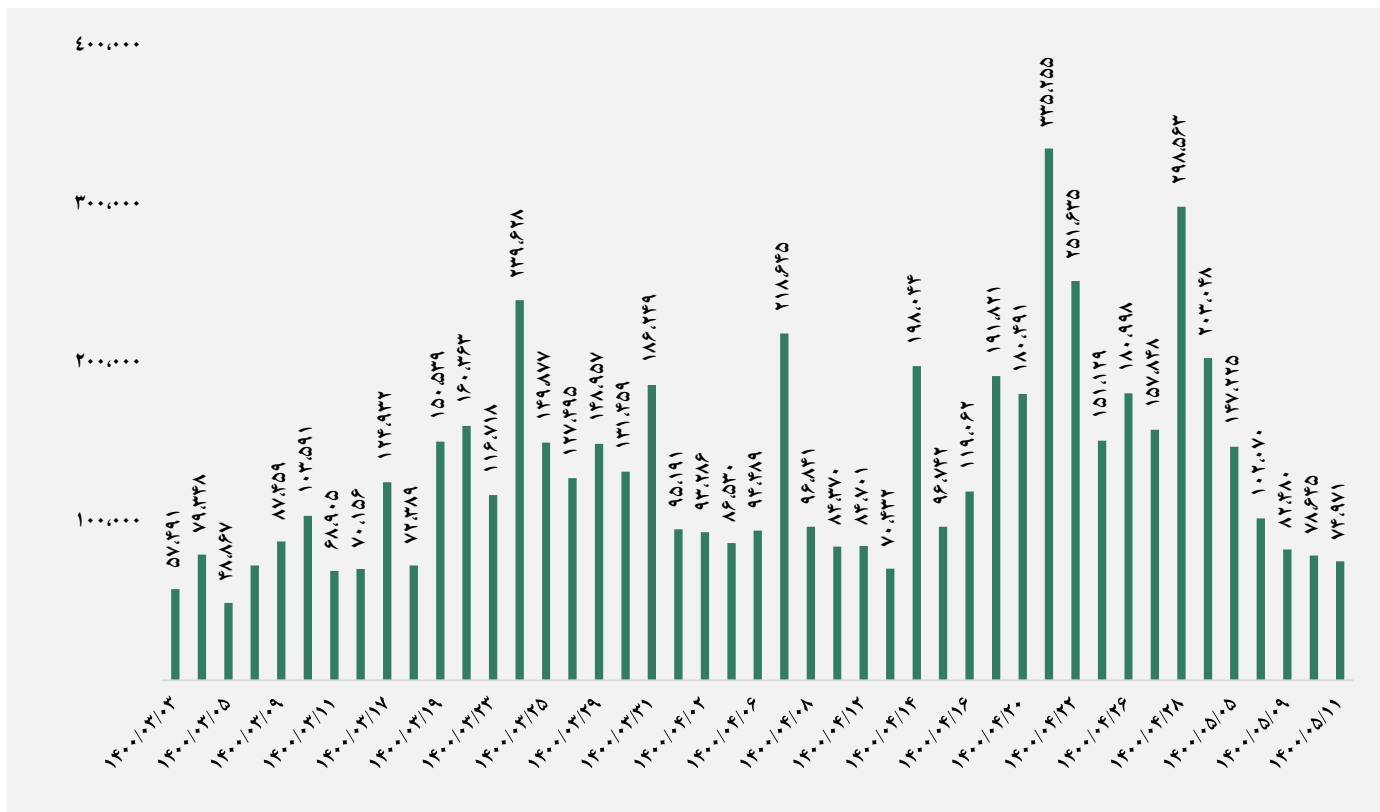


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

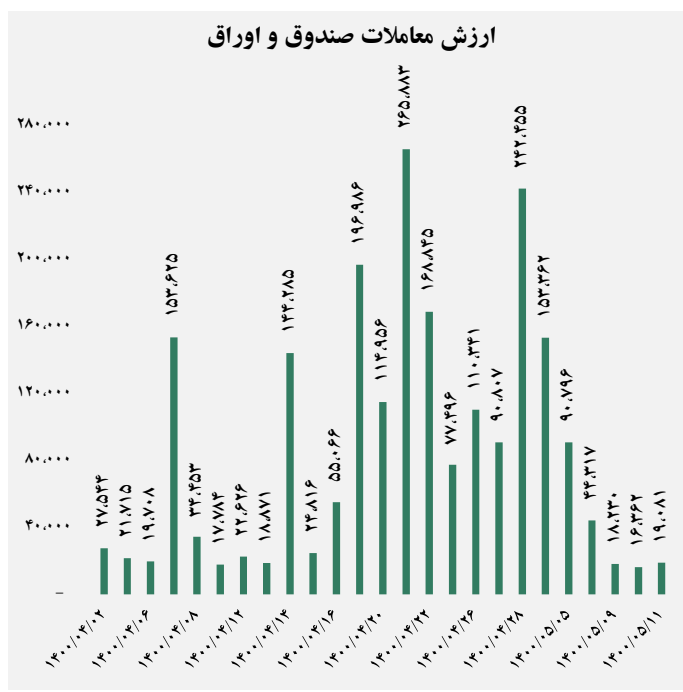
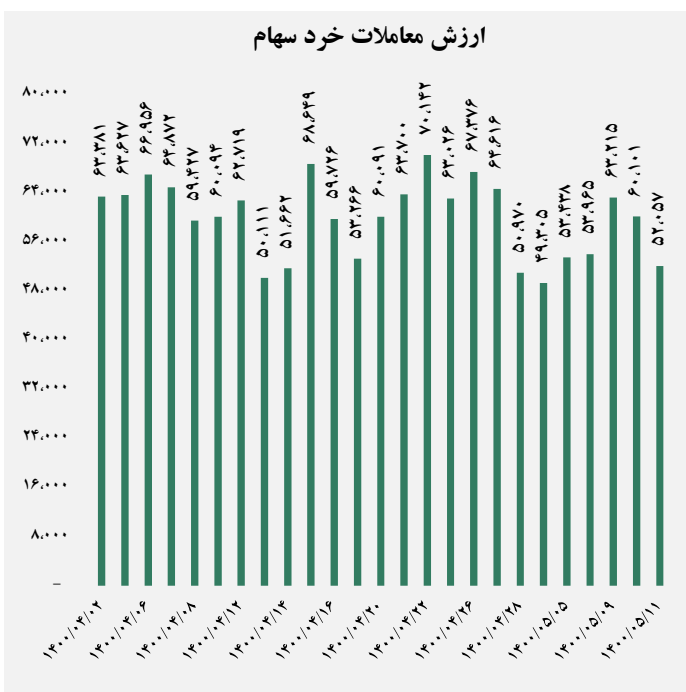


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

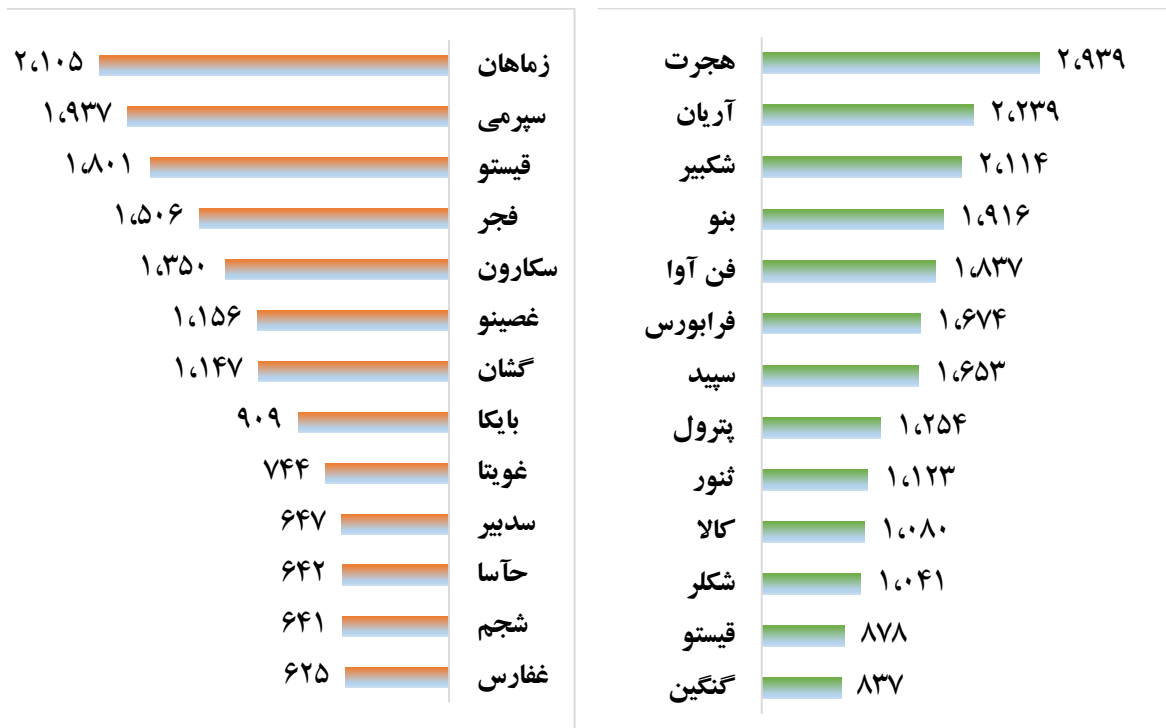


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





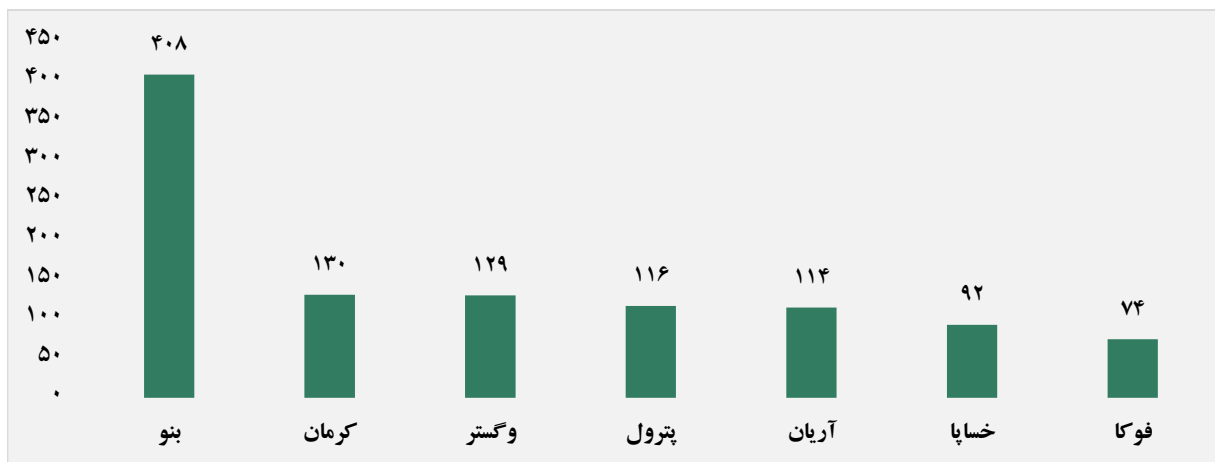
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



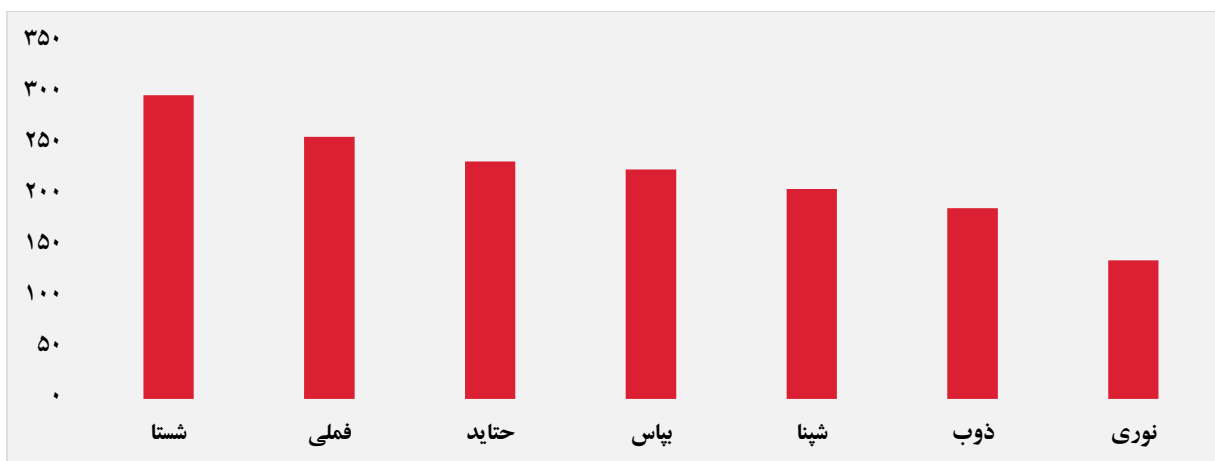
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شدوص	۱	نمرینو
۲	شکلر	۲	شرنگی
۳	بنو	۳	سفار
۴	خدیزل	۴	ساینا
۵	رنیک	۵	تکنار
۶	فاهواز	۶	تامان
۷	ثنور	۷	خفنر
۸	خصدرا	۸	نظرین
۹	وساپا	۹	سکaron
۱۰	خساپا	۱۰	دسانکو

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



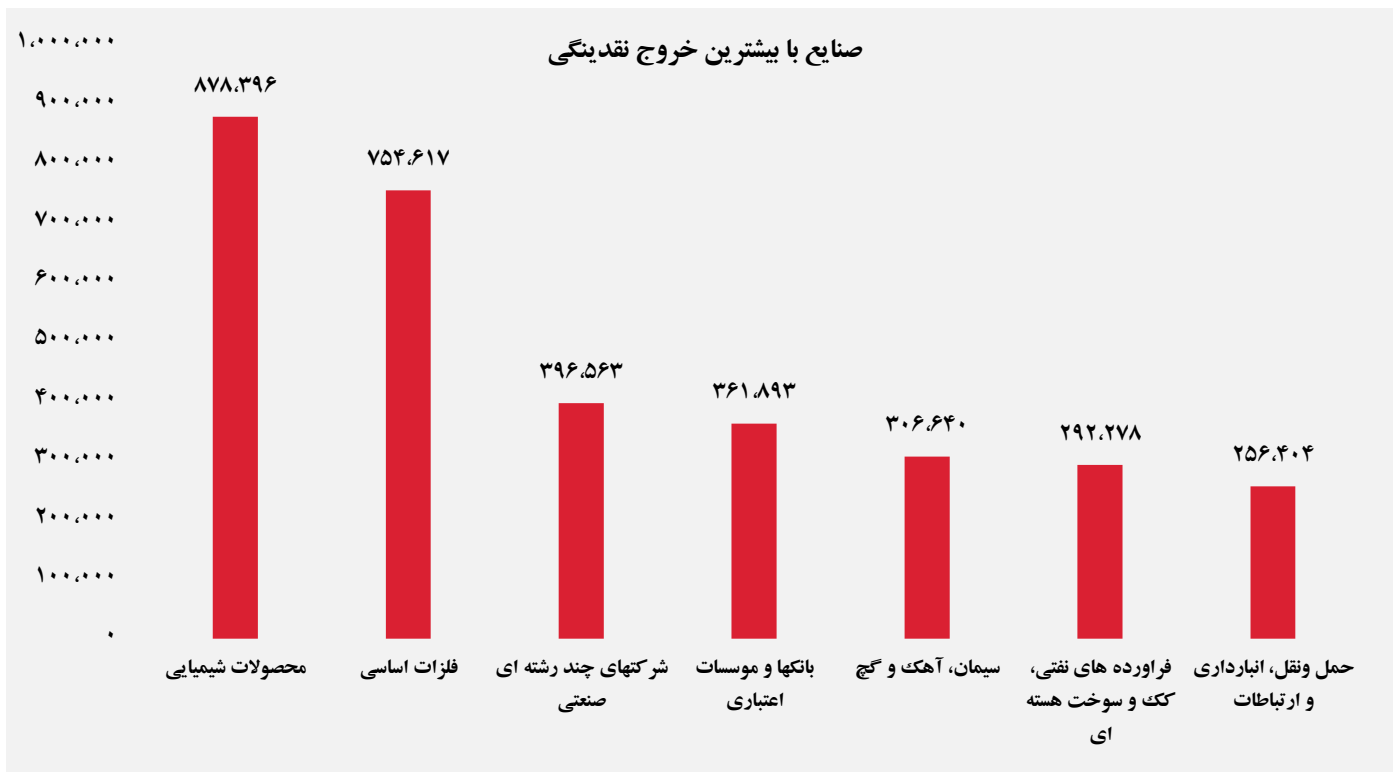
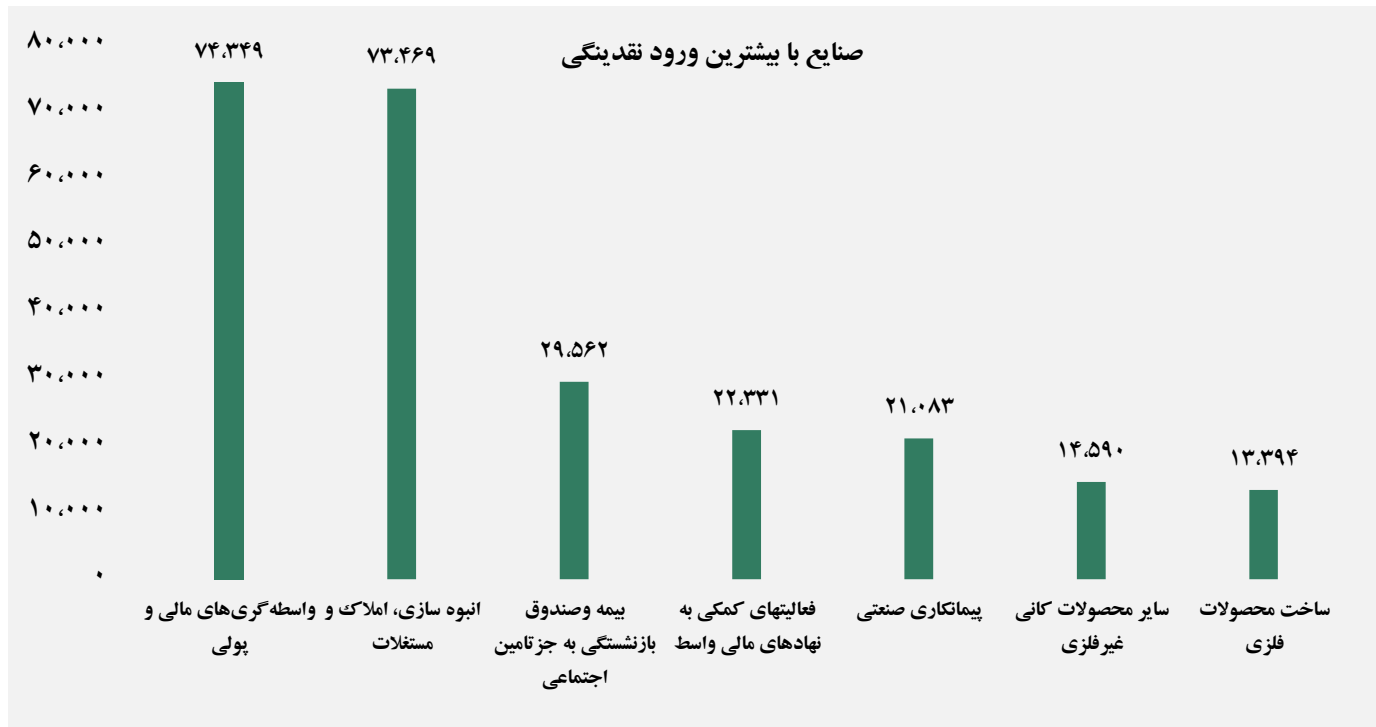
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	حتاید	۱۰	جم بیلن
۲	غدیس	۱۱	زاگرس
۳	غفارس	۱۲	فرزین
۴	شاوان	۱۳	تاپکیش
۵	برکت	۱۴	شاراک
۶	سپید	۱۵	کبافق
۷	شغدیر	۱۶	بنو
۸	خاور	۱۷	نوری
۹	خفنر	۱۸	قچار

ورود و خروج نقدینگی به/از صنایع (میلیون ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار