



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

## گزارش روزانه تحلیل بازار



## تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۴ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، شستا، فولاد، کچاد، وغدیر، خودرو و کگل با کاهش ۷۷۱۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۹۹.۳۳۵ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۳۵ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش ۶۲ درصدی همراه بوده است. مبلغ ۱۷ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق های قابل معامله سهامی می باشد. در روز جاری بسیاری از نمادها با صف فروش به کار خود پایان دادند.

در بازار امروز بیش از ۴۰۰ نماد، قفل در صف فروش به کار خود پایان داده اند. به نظر می رسد تا زمانیکه دلار تکلیف آن مشخص نگردد، همچنان شاهد فشار فروش مخصوصا در نمادهای کوچک باشیم. در بعضی از نمادها کمتر از ۵ هزار برگ سهم معامله شده است که خود نشان از عدم نقدشوندگی در این نوع نمادها است. یکی از راه حلها برای برطرف شدن صف فروش و افزایش نقدشوندگی، تغییر متقارن دامنه نوسان در محدوده ۱۵ درصد و از طرفی افزایش در حجم مبنا همان نمادها می باشد که در این صورت سهامداری که واقعا نیاز به نقدینگی دارد، قادر به فروش سهام خود خواهد بود و از طرف دیگر سهامداری که تصمیم به نگهداری سهام خود گرفته، نیز ترسی از ریزش شدید قیمت ها با توجه به حجم مبنای بالا، ندارد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲.۱۸۹ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اسناد خزانه با نماد اخزا ۸۱۷ 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 ۹۰۵، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۲/۱۸ با ۲۲.۳٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۰۱	۱۴۰۰/۰۲/۰۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳۱,۱۳۹	۲,۱۸۹	-۹۳%

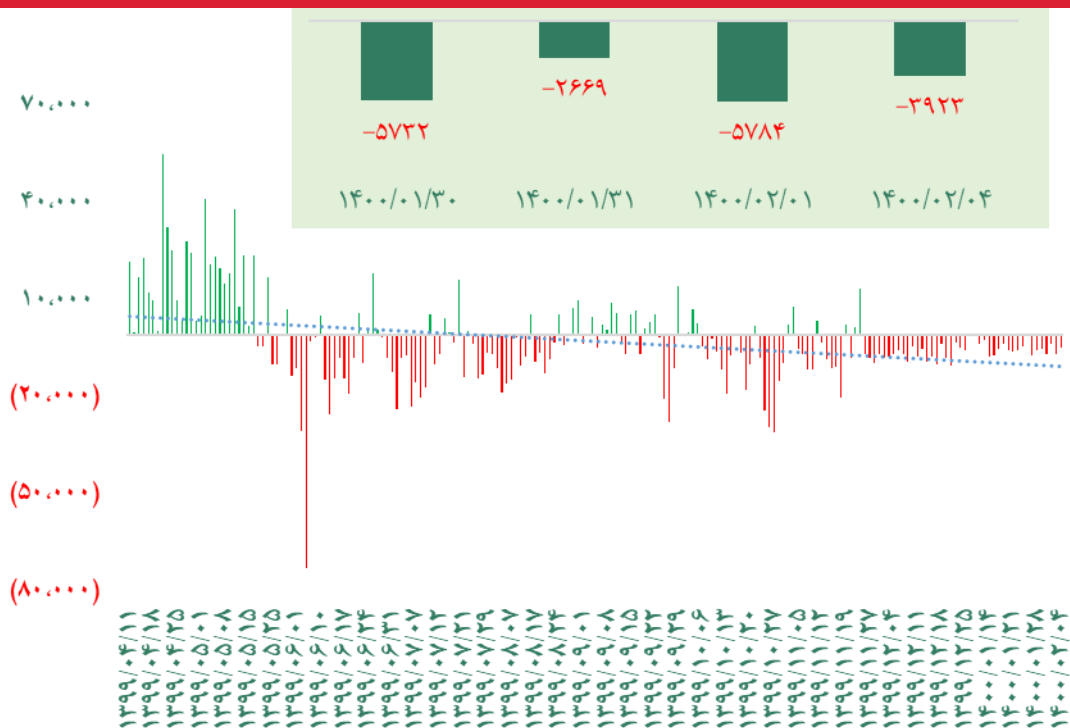


## گروه‌های مؤثر

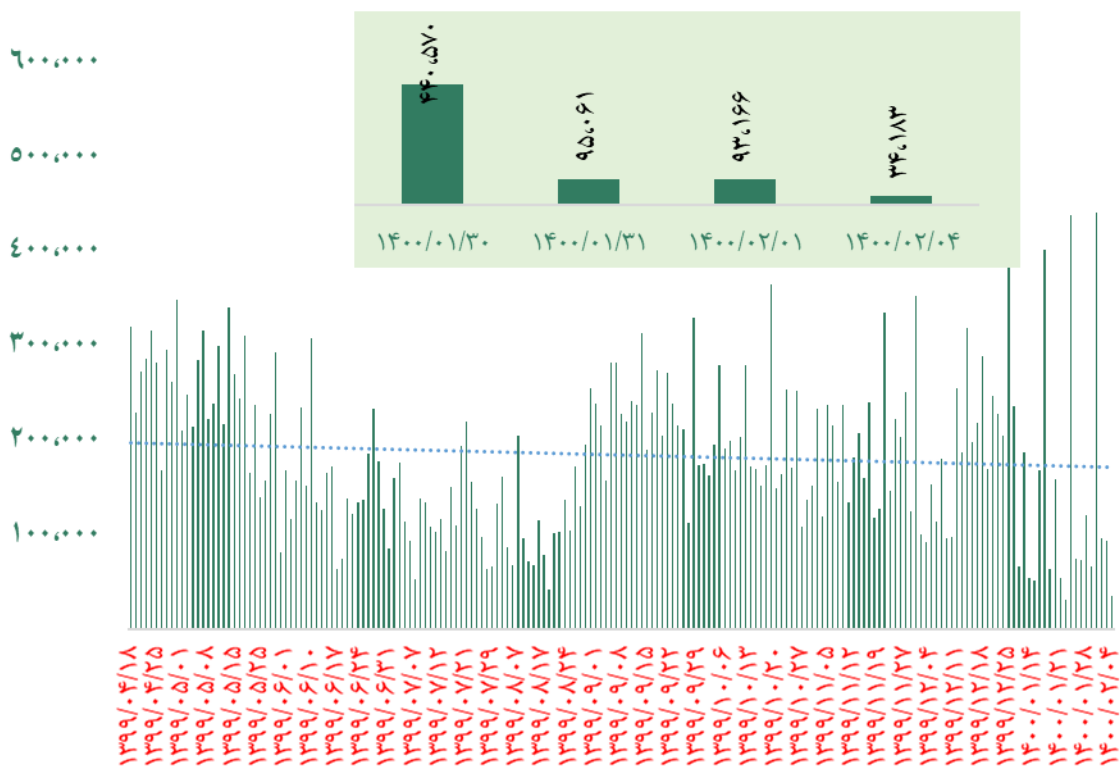
در گروه فلزات اساسی، فولاد امیرکبیر کاشان در اسفند ماه ۱۲۰۸۱ تن محصول گالوانیزه تولید کرده است که میانگین تولید سال گذشته به ۱۲۶۹۰ تن رسیده و میانگین تولید این محصول در سال مالی ۹۸، ۱۲۳۹۵ تن بوده است. فروش این شرکت در اسفند ماه ۱۱۶۳۸ تن گزارش شده است. در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته، این شرکت ۱۵۸۸۹۹ تن محصول گالوانیزه فروخته که ۷۹۸۴ تن سهم صادرات بود و فروش سال مالی ۹۸، ۱۴۸۰۲۱ تن که ۳۰۰۱۸ تن سهم صادرات را تشکیل می‌داد. در بهمن و اسفند فروش‌های آن شرکت رقم ۳۲۰۰ و ۲۷۵۰ میلیارد ریال ثبت شده است. فروش سال مالی گذشته به ۲۷۵۵۰ میلیارد ریال رسیده و فروش ۱۲ ماهه سال مالی ۹۸، ۱۴۸۸۵۵ میلیارد ریال بود اما فروش در ۹ ماهه سال مالی گذشته به ۱۴۸۸۸۵ میلیارد ریال رسیده است.

قیمت اکریلونیتریل بودتادین استایرن آسیا در هفته گذشته ۲۰ دلار بالا رفت و به ۲۴۲۰ دلار در هر تن به ای سی اف ار چین و ۲۴۸۰ دلار در سی اف ار جنوب شرق آسیا رسید. دلیل اصلی صعود، رشد قیمت خوراک استایرن بابت عرضه محدود بوده است. تغییرات قیمتی محصول ABS در مقایسه با استایرن کم نوسان تر ظاهر می‌شود، چرا که فروشندگان وارد فضای فشار فروش در قیمت‌های ارزان تر نمی‌شوند. در چین تنها خریدارانی که به جنوب آسیا صادر می‌کنند، می‌توانند از پس قیمت بازارهای نقد برآیند چرا که از تخفیفات روی کالای صادراتی بهره می‌برند. بنابراین کارخانجات لوازم خانگی بزرگ در ظرفیت کامل مشغول به کار هستند اما کارخانجات در مقیاس کوچک ممکن است به واسطه افزایش قیمت مواد خام نرخ فعالیت خود را کم کنند. در داخل کشور نیز پتروشیمی قائد بصیر در وضعیت مناسبی به سر می‌برد و در سال جاری با حفظ قیمت‌های فعلی ABS، می‌توان امید به جهش سودآوری این شرکت داشت.

## ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

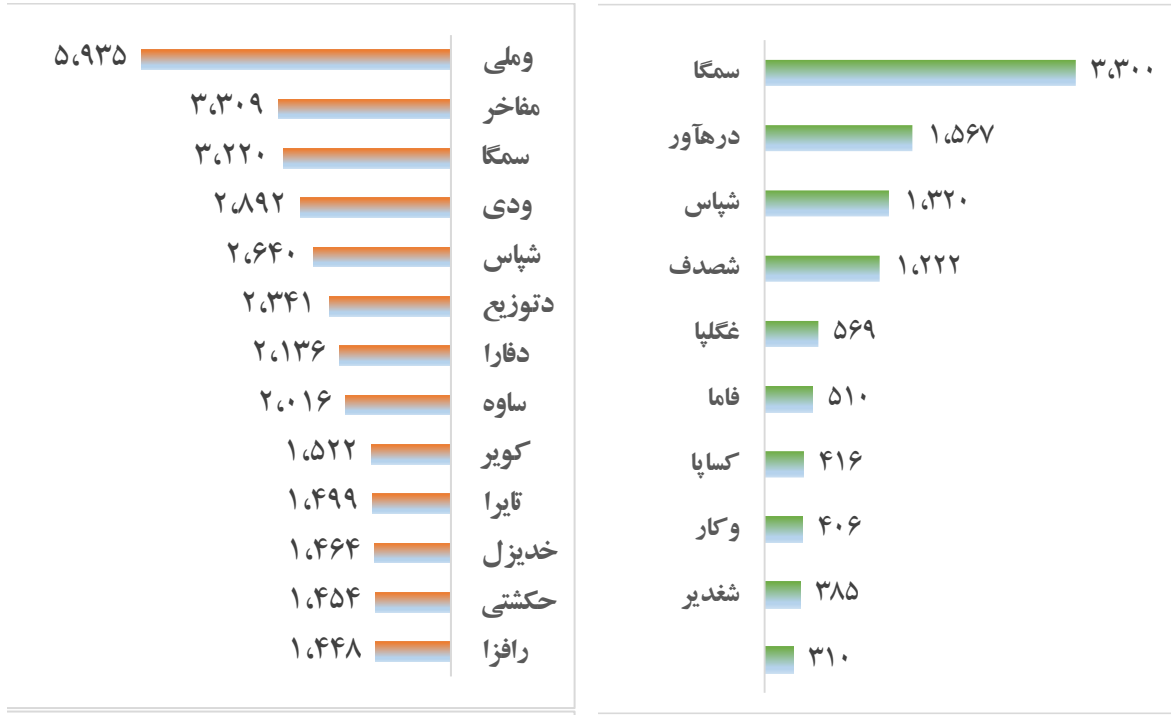


## روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	وکار	۱	ساراب
۲		۲	زفکا
۳		۳	وساریل
۴		۴	غگلیا
۵		۵	شبهرن
۶		۶	وپویا
۷	—	۷	زپارس
۸	—	۸	کویر
۹	—	۹	کرمان
۱۰	—	۱۰	دفارا



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



## واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ساراب	۱۱	بوعلی
۲	برکت	۱۲	سمازن
۳	افق	۱۳	شرانل
۴	سمگا	۱۴	نوری
۵	وساخت	۱۵	شمال
۶	شغدیر	۱۶	وصنعت
۷	دماوند	۱۷	سیتا
۸	خریخت	۱۸	آریا
۹	زاگرس	۱۹	سخوز
۱۰	ونفت	۲۰	فاسمین



## ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۶۷
۲	محصولات کاغذی	۰
۳	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۰
۴	تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی ونوری	۰
۵	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۰
۶	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۰
۷	محصولات چوبی	۰
۸	ساخت محصولات فلزی	۰
۹	قند و شکر	۰
۱۰	استخراج سایر معادن	۰
۱۱	پیمانکاری صنعتی	۰
۱۲	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۰
۱۳	استخراج زغال سنگ	۰
۱۴	زراعت و خدمات وابسته	۰
۱۵	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	-۸۷
۱۶	اطلاعات و ارتباطات	-۴۷۷
۱۷	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۴۹۳
۱۸	مخابرات	-۱,۳۹۷
۱۹	خدمات فنی و مهندسی	-۲,۷۱۰
۲۰	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۷۱۳
۲۱	هتل و رستوران	-۶,۰۷۸
۲۲	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-۸,۵۵۰
۲۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۱,۸۰۳
۲۴	لاستیک و پلاستیک	-۱۲,۹۳۰
۲۵	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۳,۰۶۰
۲۶	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۱۳,۹۷۷
۲۷	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسطه	-۲۳,۳۶۷
۲۸	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	-۵۴,۴۱۸
۲۹	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۶۹,۳۳۶
۳۰	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۸۹,۰۳۸
۳۱	خودرو و ساخت قطعات	-۹۲,۰۲۴
۳۲	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۱۰۱,۸۰۱
۳۳	سرمایه گذاریها	-۱۲۵,۸۰۶
۳۴	مواد و محصولات دارویی	-۱۷۵,۳۴۲
۳۵	خرده فروشی، باستانی وسایل نقلیه موتوری	-۱۸۳,۶۱۰
۳۶	سیمان، آهک و گچ	-۲۰۸,۹۲۱
۳۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۲۴۳,۶۲۶
۳۸	استخراج کانه های فلزی	-۳۳۸,۲۴۴
۳۹	محصولات شیمیایی	-۳۴۰,۲۰۲
۴۰	شرکت‌های چند رشته ای صنعتی	-۴۲۴,۰۶۲
۴۱	فلزات اساسی	-۵۴۲,۵۰۸
۴۲	بانکها و موسسات اعتباری	-۸۳۳,۳۸۴
	جمع	-۳,۹۲۰,۸۹۷