



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۰۵



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۵ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فولاد، فارس، شستا، کچاد، وغدیر و تاپیکو با کاهش ۱۱۵۱۰ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۸۷.۸۳۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۴۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش ۲۴ درصدی همراه بوده است. مبلغ ۱۷ 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 همانند روزهای گذشته، بسیاری از نمادها با صف فروش به کار خود پایان دادند.

سه روز کاری از اردیبهشت ماه نیز می‌گذرد اما بازار همچنان با فروشنده‌های زیادی مواجه است و اکثر نمادها با صف فروش همراه هستند. اما معمولاً اردیبهشت ماه به خاطر انتشار گزارش ماهانه فروردین و از آن مهمتر گزارش ۱۲ ماهه سال مالی ۹۹، برای تغییر روند بازار از اهمیت بالایی برخوردار است. گزارش ماهانه فروردین می‌تواند اطمینان‌خاطری برای فعالین در بورس باشد که اثر تثبیت نرخ‌های داخلی و افزایش نرخ‌های جهانی را بهتر درک کنند و نگران کاهش سود در آینده نباشند. انتشار گزارش ۱۲ ماهه هم با توجه به انتظار گزارش‌های قوی در فصل زمستان، می‌تواند نسبت پی بر ای چهار فصل گذشته بازار را کاهش دهد. بنابراین هر چه بازار زودتر به سمت نسبت پی بر ای تاریخی حرکت کند، با تقاضای بیشتری همراه خواهد شد و دیگر شاهد وضعیت جاری نخواهیم بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۷.۵۰۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مباحه عام دولت با نماد اراد ۴۱۴ 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 ۹۰۹، تاریخ سررسید ۱۶/۰۳/۱۴۰۲ با ۲۲.۲٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۰۴	۱۴۰۰/۰۲/۰۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲,۱۸۹	۷,۵۰۲	۲۴۳٪



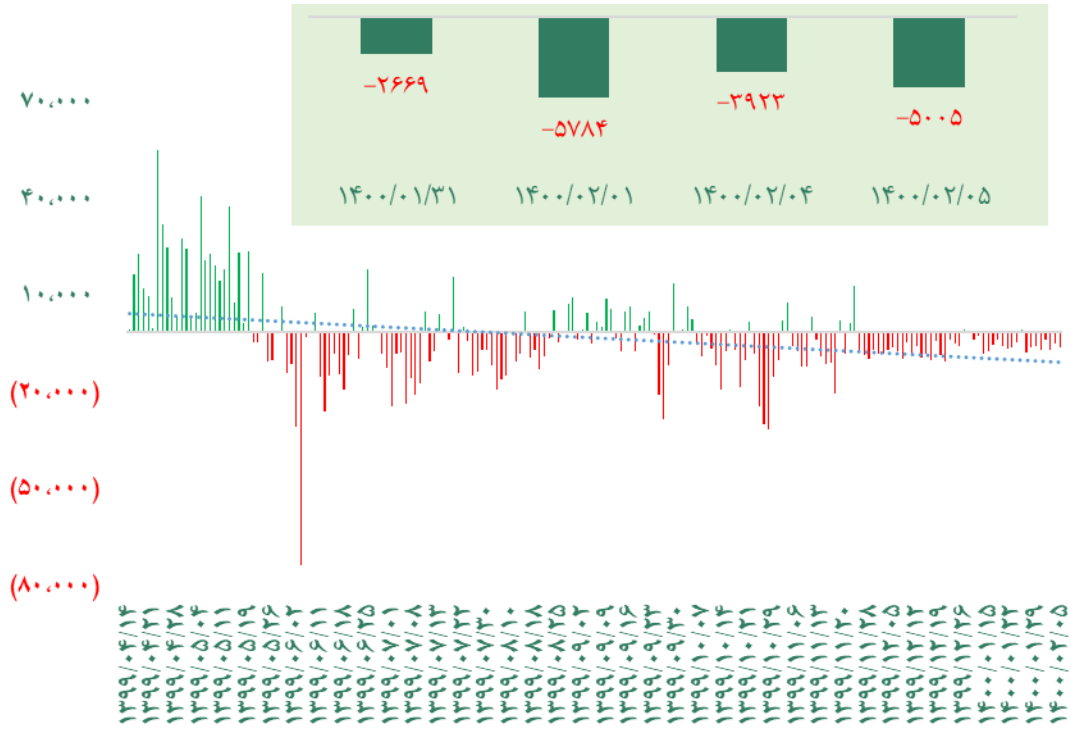
گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، فولاد خوزستان که در سال گذشته هر ماه در بازه ی ۳۰۰ الی ۳۳۰ هزار تن محصول نهایی داشت، در فروردین سال جاری ۳۲۹ هزار تن تولید را ثبت کرده است. این فولاد ساز در سال گذشته به طور متوسط هر ماه ۳۱۵ هزار تن فروش داشت که در فروردین ماه فروش ۲۷۵ هزار تنی را گزارش داده است. این شرکت در سال گذشته فروش ۳۰۶۴۷۰ میلیارد ریالی را ثبت کرده بود و در اولین ماه از سال جاری فروش ۳۳۹۴۰ میلیارد ریالی را گزارش کرده است. شرکت فولاد خوزستان در سال گذشته در هر ماه به طور میانگین ۲۵۵۴۰ میلیارد ریال فروش داشت. نرخ فروش بلوم و بیلت صادراتی این شرکت در فروردین ماه برابر با ۱۲۵۲۶۰ ریال در هر کیلو بوده است. نرخ اسلب صادراتی نیز برابر با ۱۳۰۷۱۰ ریال در هر کیلو گزارش شده است. نرخ داخلی اسلب و بیلت در فروردین به ترتیب برابر با ۱۳۸۸۸۹ و ۱۰۸۳۹۵ ریال به ازای هر کیلو بود.

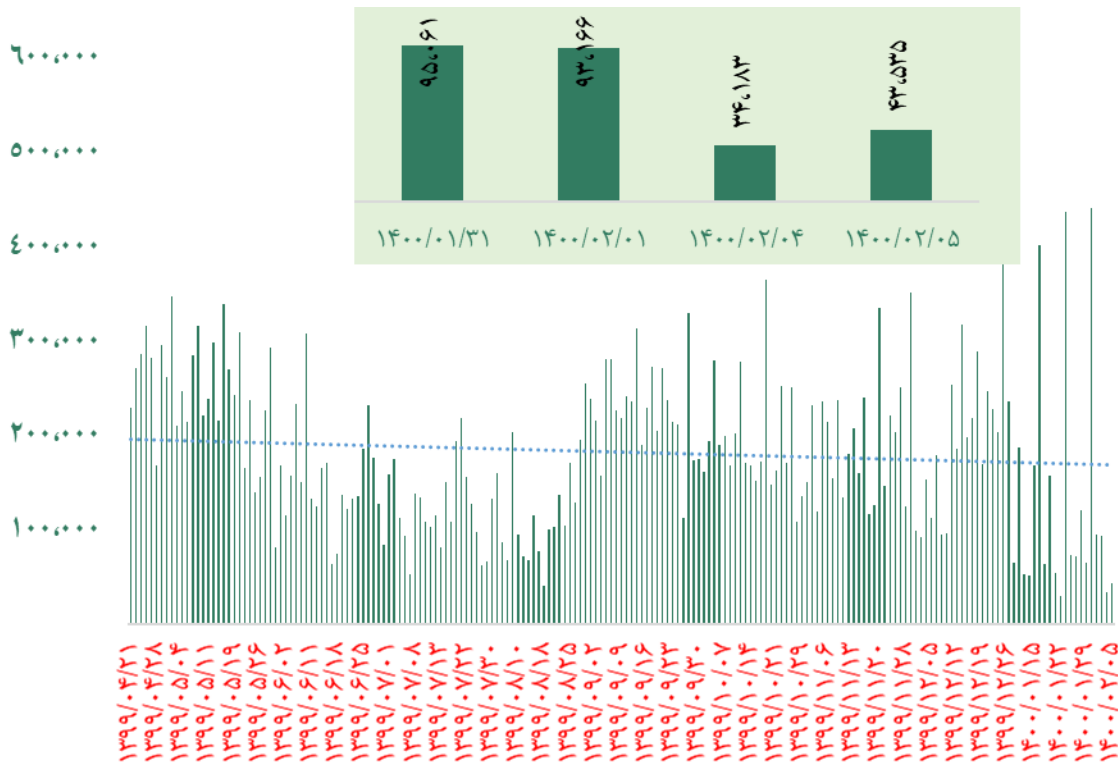
در گروه شوینده، شرکت صنایع بهداشتی ساین، متوسط تولید ماهانه این شرکت در سال مالی منتهی به آذر ۹۹، ۲۹۶۰ تن محصول بوده است. در سه ماه آخر سال گذشته (دی، بهمن و اسفند) تولیدات این شرکت به ترتیب هر ماه، ۳۳۰۰، ۴۰۰۰ و ۳۰۰۰ تن است و در فرودین ۱۵۸۰ تن بود. فروش این شرکت در سال مالی گذشته ۳۷ هزار تن محصول (متوسط ماهانه ۳۱۱۱ تن) ثبت شده است. میانگین فروش ریالی شرکت صنایع بهداشتی ساین در ۴ فصل سال مالی ۹۹ برای هر ماه برابر با ۱۸۰، ۲۰۰، ۱۹۰ و ۳۰۰ میلیارد ریال بوده است. در آذر ماه فروش شرکت ۴۲۰ میلیارد ریال، در دی ماه ۲۳۰ میلیارد ریال، بهمن ۳۷۰ میلیارد ریال، فروش اسفند ۳۳۰ میلیارد ریال و فروش فروردین ماه هم ۲۳۰ میلیارد ریال گزارش داده است. متوسط نرخ فروش در سال مالی گذشته ۶۷ هزار ریال برای هر کیلو بوده که در فروردین ۱۱۰ هزار ریال گزارش شده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

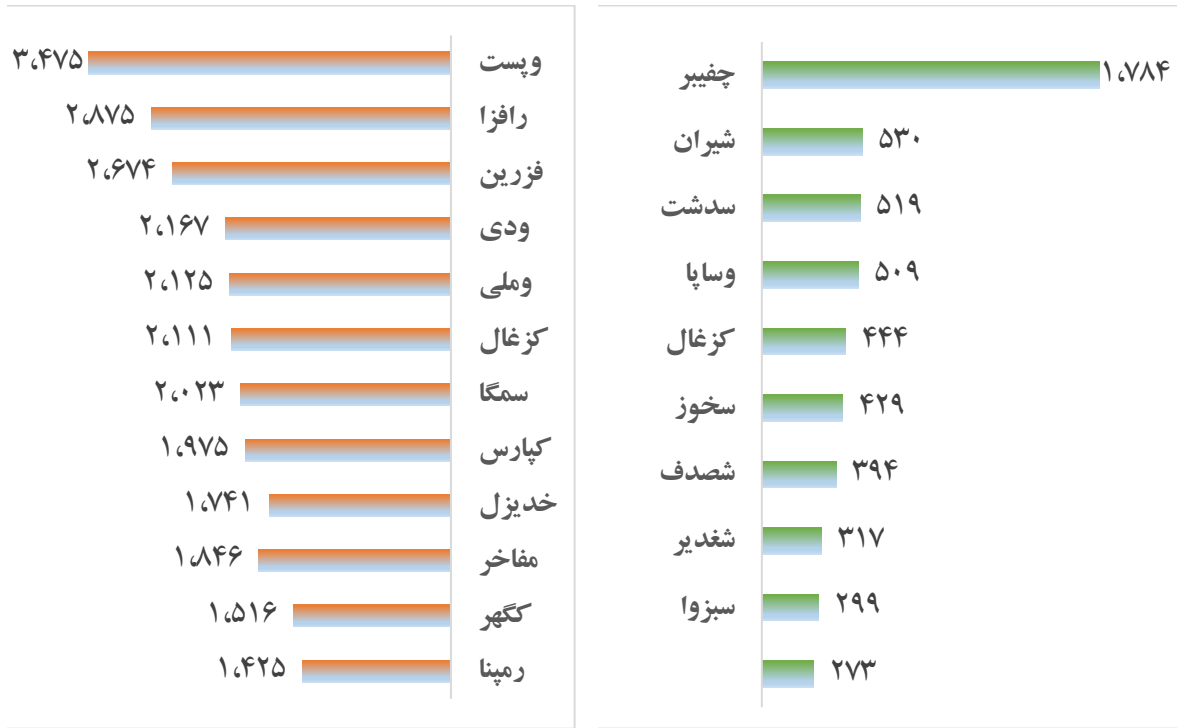


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

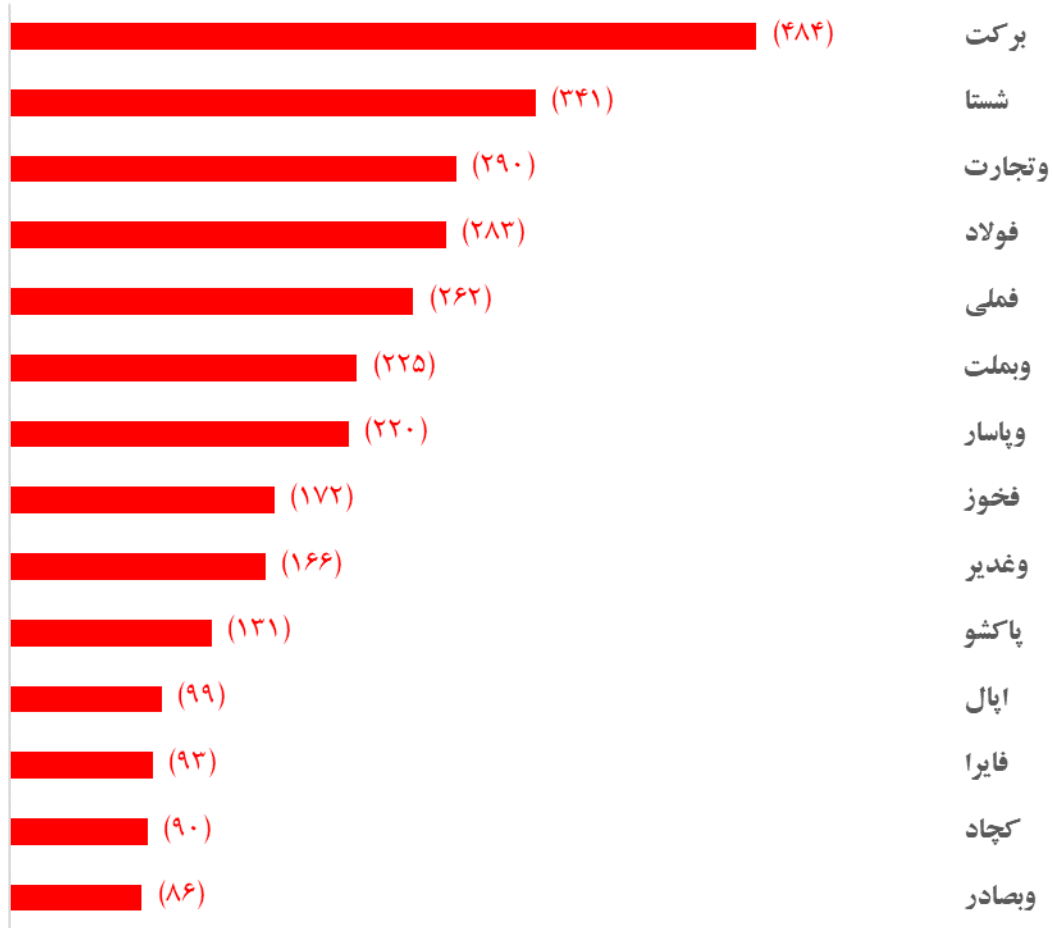


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	-	۱	و آذر
۲	-	۲	شبهرن
۳	-	۳	تاصیکو
۴	-	۴	و پویا
۵	-	۵	وغدیر
۶	-	۶	سرچشمه
۷	-	۷	کویر
۸	-	۸	پاکشو
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	ونفت
۲	شغدیر	۱۲	آریا
۳	وساخت	۱۳	سمازن
۴	سخوز	۱۴	ساراب
۵	افق	۱۵	ششمال
۶	نوری	۱۶	سمگا
۷	وپست	۱۷	جم بیلن
۸	زاگرس	۱۸	تیپیکو
۹	بوعلی	۱۹	فایرا
۱۰	دماوند	۲۰	خریخت



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۸	ساخت محصولات فلزی	۲,۳۵۳
۱	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۱۲
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
۱۰	استخراج سایر معادن	۰
۱۱	پیمانکاری صنعتی	۰
۱۵	واسطه‌گری های مالی و پولی	۰
۱۶	اطلاعات و ارتباطات	۰
۱۷	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۰
۲۰	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	۰
۲۴	لاستیک و پلاستیک	-۶۳
۱۳	استخراج زغال سنگ	-۵۱۵
۱۲	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۹۰۶
۹	قند و شکر	-۳,۳۶۷
۱۹	خدمات فنی و مهندسی	-۶,۷۹۶
۲۵	ماشین آلات و تجهیزات	-۸,۳۴۶
۲۲	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-۸,۵۰۵
۳۱	خودرو و ساخت قطعات	-۱۸,۳۲۶
۱۸	مخابرات	-۲۱,۰۰۶
۲۷	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسطه	-۲۵,۲۳۰
۲۶	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۲۶,۱۵۹
۲۹	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۲۸,۳۹۳
۱۴	زراعت و خدمات وابسته	-۳۵,۵۵۷
۲۸	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	-۳۷,۱۴۷
۲۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۳۹,۰۴۳
۲۱	هتل و رستوران	-۶۵,۶۶۴
۳۵	خرده فروشی، باستان‌های وسایل نقلیه موتوری	-۷۰,۶۲۶
۳۰	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۷۵,۸۲۳
۳۲	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۷۶,۰۹۸
۳۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۲۷,۷۲۸
۳۳	سرمایه گذاریها	-۱۳۳,۶۹۸
۳۶	سیمان، آهک و گچ	-۱۹۰,۳۹۹
۳۸	استخراج کانه های فلزی	-۲۹۹,۶۲۹
۳۴	مواد و محصولات دارویی	-۵۱۱,۴۹۷
۴۰	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۵۴۰,۷۹۳
۳۹	محصولات شیمیایی	-۷۱۱,۸۳۵
۴۱	فلزات اساسی	-۹۴۸,۵۷۹
۴۲	بانکها و موسسات اعتباری	-۹۹۰,۸۵۵
جمع		-۵,۰۰۰,۲۱۸