



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۰۶



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۶ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای کگل، کچاد، شینا، فارس، شتران، شبندر و خودرو با کاهش ۹۰۴ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۸۶.۹۳۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۸۹ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۲۸ 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 برخلاف روزهای گذشته، بسیاری از نمادها در بازه قیمتی مثبت به کار خود پایان دادند.

با ارائه گزارش مناسب فروردین ماه از طرف چند شرکت بزرگ، شاهد رونق معاملاتی در آن نمادها در تابلوی معاملاتی بورس تهران در روز جاری بودیم. بطوریکه نماد فملی در گروه فلزات اساسی و نماد نوری در گروه شیمیایی با افزایش تقاضای قوی مواجه و با صف خرید به استقبال روز معاملاتی فردا رفته‌اند. اما بسیاری از نمادهای کوچک در روز جاری همانند روزهای گذشته با فشار فروش همراه بودند. به نظر می‌رسد علاوه بر تاثیر مثبت گزارشات مناسب ماهانه و ۱۲ ماهه سال مالی گذشته، بازار بورس و فرابورس در این روزها نیاز به تزریق نقدینگی از سمت خارج از بازار نیز می‌باشد تا به گونه‌ای ترس و فشار فروش حاکم بر بازار را خنثی کند و حداقل بازار را به تعادل برساند تا شاهد صف‌های فروش در بسیاری از نمادها نباشیم.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۵۰.۷۶۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مباحه عام دولت با نماد اراد ۲۱۴ 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 ۷۱۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۰۷ با ۲۲.۹٪ سود است.



شرح	۱۴۰۰/۰۲/۰۵	۱۴۰۰/۰۲/۰۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۷,۵۰۲	۱۵۰,۷۶۳	۱۹۱۰٪

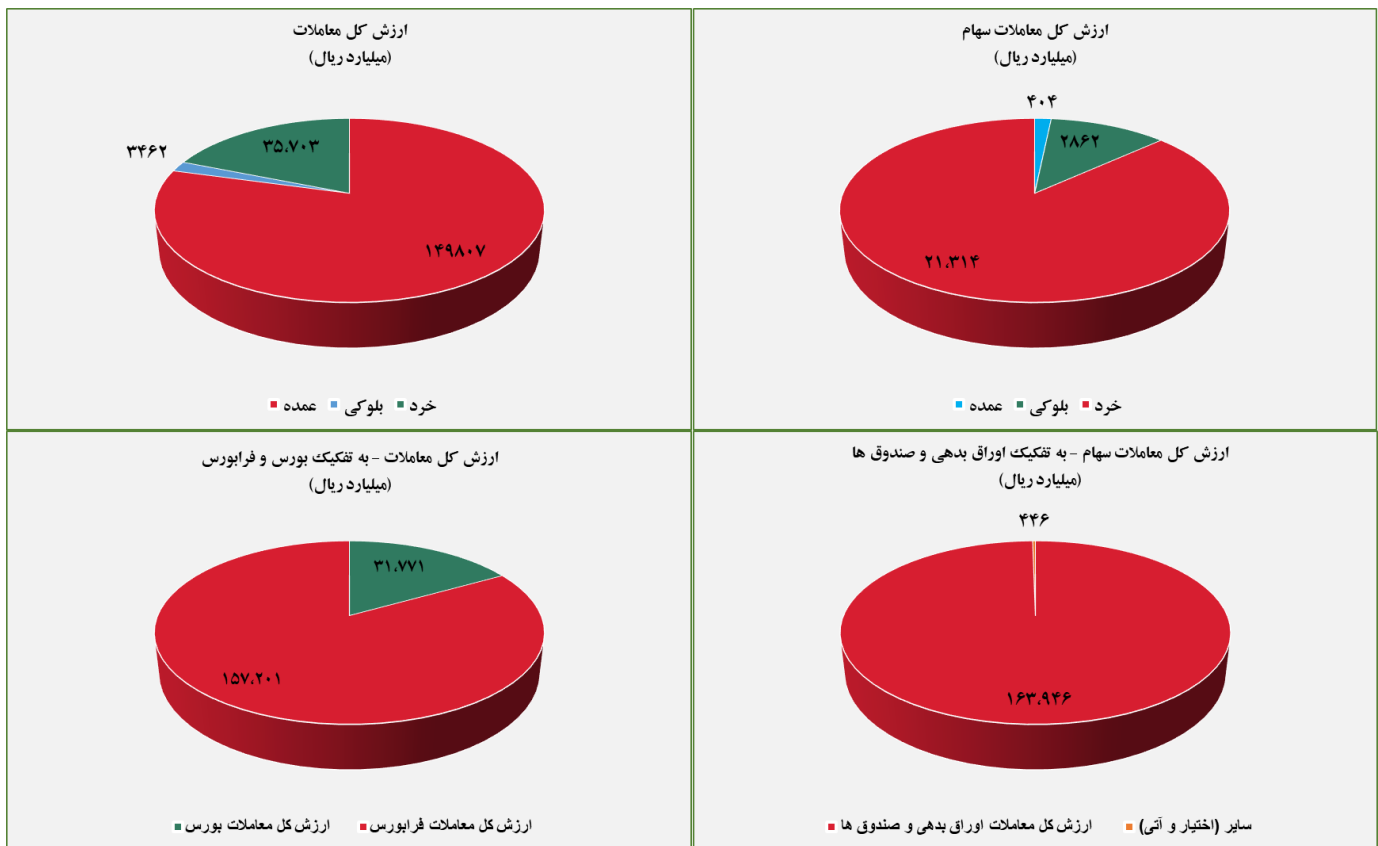
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی خراسان در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته مبلغ ۸۰۳۰ ریال سود به ازای هر سهم ساخته است. این شرکت در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب ۱۳۷۰، ۱۴۹۰ و ۲۹۰۰ ریال سود ثبت کرده بود و در فصل چهارم نیز ۲۲۶۰ ریال سود داشته است. سود سال گذشته این شرکت ۴۸۸۰ ریال به ازای هر سهم بوده است. سود ۱۲ ماهه سال مالی ۹۹ رشد ۶۴ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه ۹۸ دارد. پتروشیمی خراسان در فصل اول فروش ۳۵۳۰ میلیارد ریالی و در فصل دوم فروش ۳۶۸۰ میلیارد ریالی را داشت و در فصل سوم فروش شرکت با رشد مناسبی به رقم ۸۱۴۰ میلیارد ریال رسید و در آخرین فصل نیز به دلیل قطعی گاز، فروش ۶۸۱۰ میلیارد ریالی را به ثبت رساند. این شرکت اوره ساز در سال مالی گذشته ۱۳۷۰۰ میلیارد ریال سود عملیاتی شناسایی کرده که ۶۹ درصد بیشتر از مدت مشابه سال قبل است. حاشیه سود این شرکت در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۶۸ درصد بوده که در سال مالی ۹۸، ۶۳ درصد ثبت شده است. به نظر می‌رسد در سال جاری نیز این شرکت بتواند حدود ۱۲ هزار ریال سود به ازای هر سهم محقق سازد.

در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد آلیاژی ایران در فروردین ماه ۳۶ هزار و ۶۰۰ تن تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه در سال مالی گذشته، ۳۹ هزار تن و در سال مالی ۹۸ نیز ۳۶ هزار تن بوده است. این شرکت در فروردین ماه ۲۸ هزار تن فروش داشته است. در سال مالی ۹۸ میانگین مقدار فروش ماهانه ۳۶ هزار تن و در سال مالی ۹۹ نیز مقدار فروش ۳۹ هزار تن بوده است. مبلغ فروش آن شرکت در فروردین ماه ۵۶۵۰ میلیارد ریال گزارش شده بطوریکه فروش فروردین سال مالی گذشته ۱۹۸۰ میلیارد ریال و میانگین فروش ماهانه سال مالی قبل نیز ۵۳۳۰ میلیارد ریال بوده است. نرخ فروش محصول آلیاژی در فروردین ماه ۲۱۵.۳۸۹ ریال در هر کیلو گزارش شده که در اسفند ماه محصول آلیاژی با نرخ ۲۰۹.۴۹۷ ریال به فروش رسیده است.

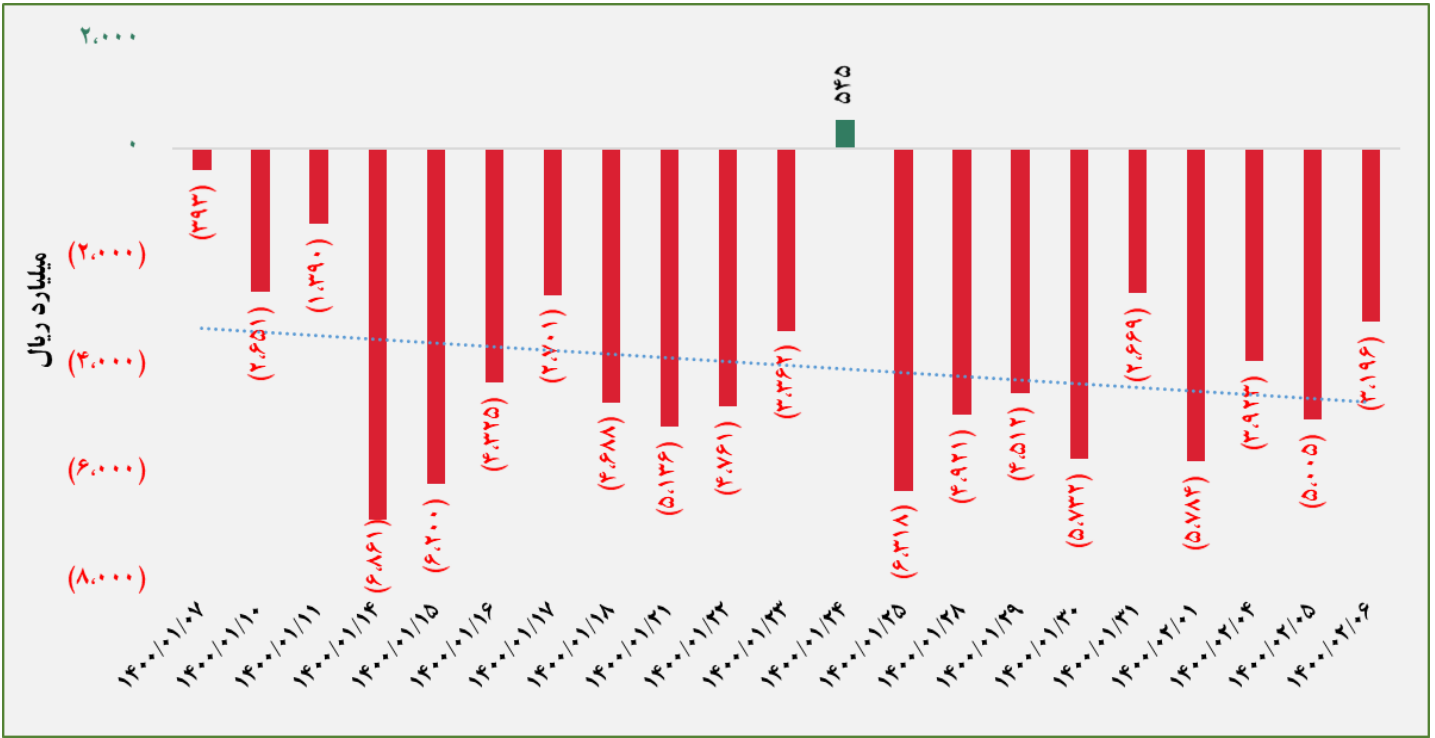
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۰۴	شاخص کل	۱,۱۸۶,۹۳۳	شاخص کل
۷.۲۹	تغییر شاخص	(۹۰.۹۸۹)	تغییر شاخص
۱۱,۹۲۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۷.۷۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۵۷,۱۹۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۱,۴۴۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
آریا		فملی	
شگویا		فولاد	
هرمز		شستا	
ومهان		نوری	
زاگرس		فخوز	
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
مارون		کگل	
ذوب		کچاد	
کگهر		شپنا	
ارفع		فارس	
بیچهرم		شتران	

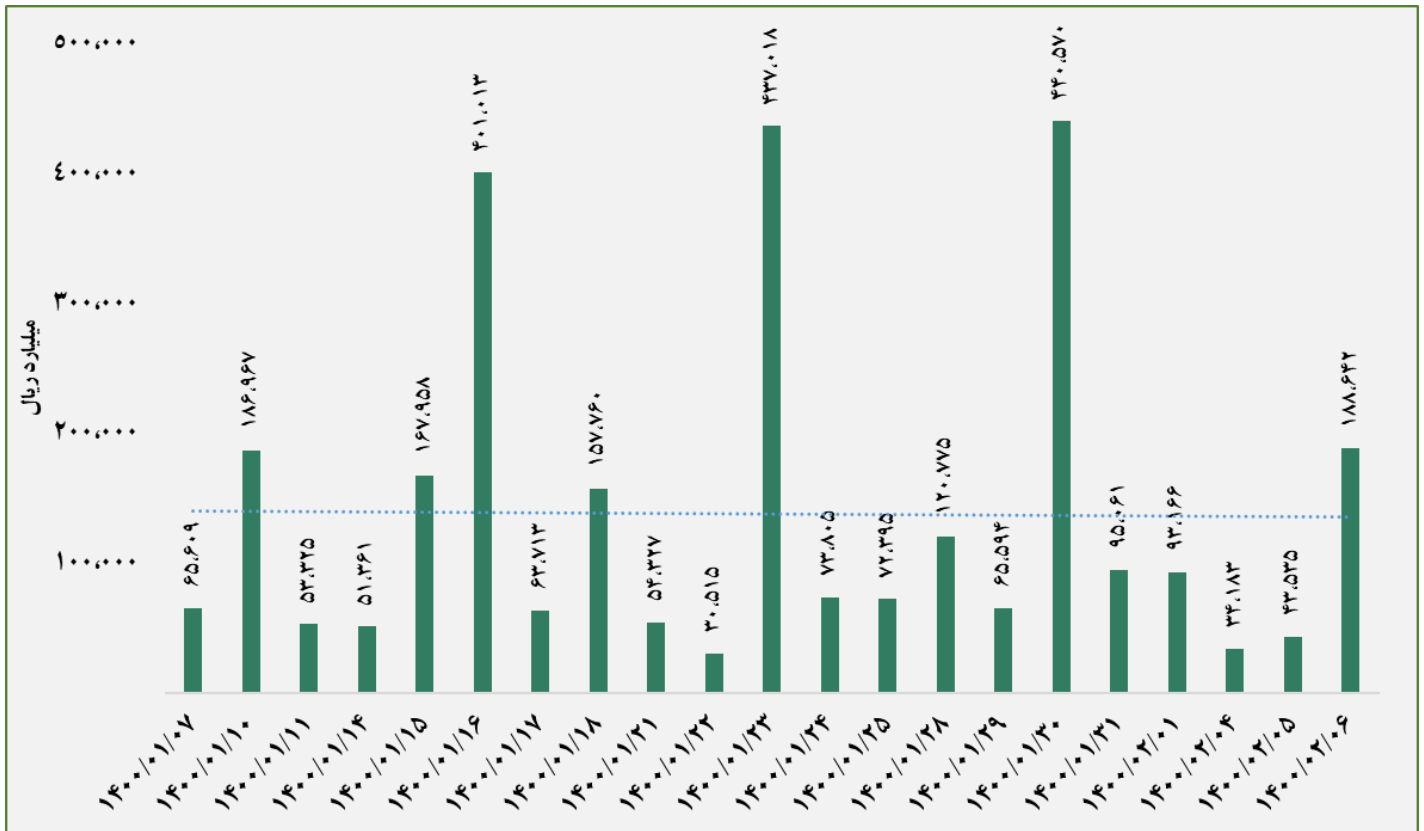




ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



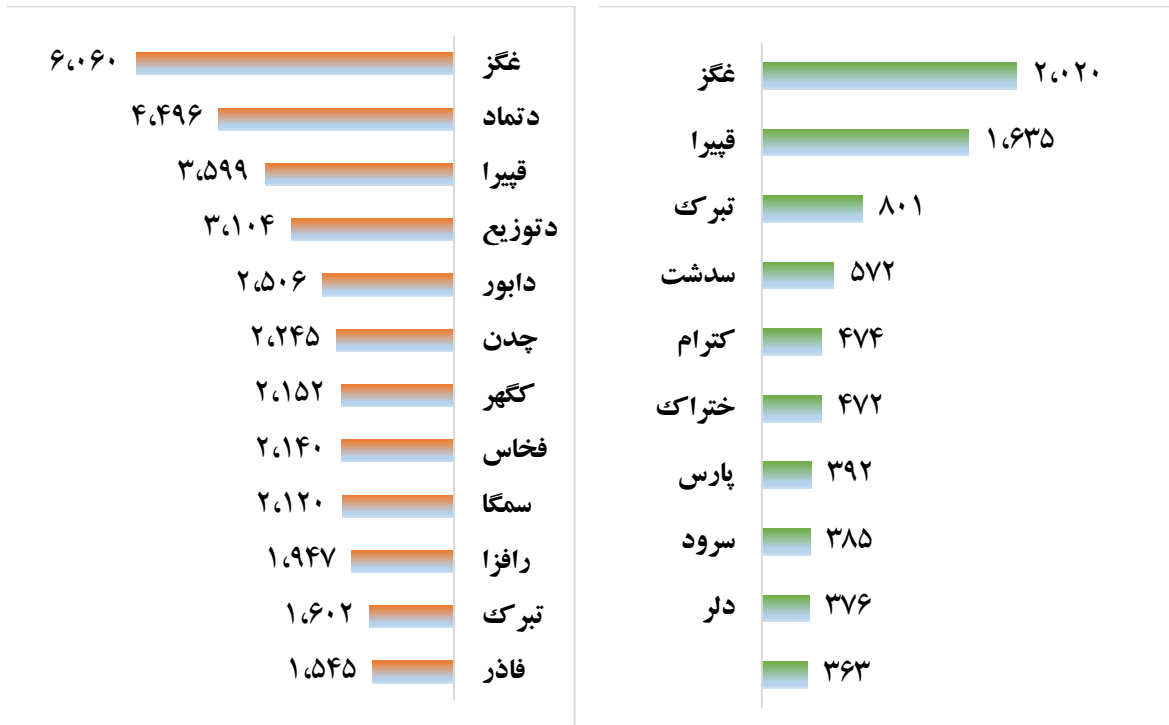
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

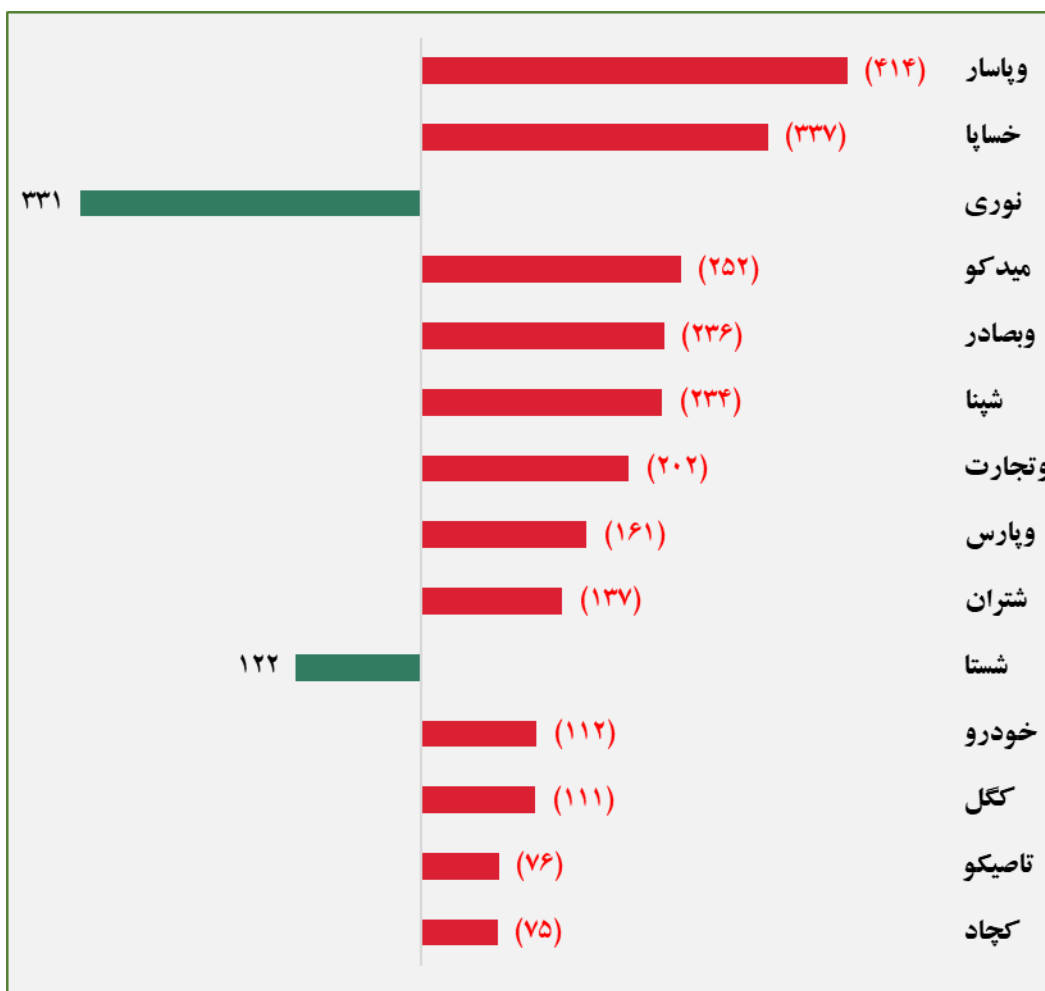


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	نوری	۱	قیبرا
۲	فملی	۲	بفجر
۳	-	۳	خبهن
۴	-	۴	سخاش
۵	-	۵	شبهرن
۶	-	۶	خریخت
۷	-	۷	کرمان
۸	-	۸	وبویا
۹	-	۹	دابور
۱۰	-	۱۰	کویر



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	آریا
۲	نوری	۱۲	وساپا
۳	شغدیر	۱۳	ویاسار
۴	افق	۱۴	بیوند
۵	شرانل	۱۵	شبریز
۶	زاگرس	۱۶	سمازن
۷	شپنا	۱۷	وکبهن
۸	پترول	۱۸	جم پیلن
۹	خراسان	۱۹	دلر
۱۰	خریخت	۲۰	شتران



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	محصولات شیمیایی	۱۱۹,۴۷۱
۲	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۶۰,۱۲۸
۳	ساخت محصولات فلزی	۱,۹۸۵
۴	سایر محصولات کانی غیر فلزی	۲۷
۵	قند و شکر	-۵
۶	لاستیک و پلاستیک	-۶۴
۷	استخراج زغال سنگ	-۱۶۹
۸	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۸۳۰
۹	استخراج سایر معادن	-۸۷۶
۱۰	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۱,۵۶۵
۱۱	فعالتهای کمکی به نهادهای مالی واسط	-۳,۵۶۴
۱۲	تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی ونوری	-۴,۱۲۷
۱۳	ماشین آلات و دستگاههای برقی	-۶,۲۴۶
۱۴	رایانه و فعالتهای وابسته به آن	-۶,۴۰۱
۱۵	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۹,۳۱۰
۱۶	مخابرات	-۱۰,۵۵۹
۱۷	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۱,۰۸۰
۱۸	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۹,۰۰۱
۱۹	زراعت و خدمات وابسته	-۳۱,۵۷۲
۲۰	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۶۳,۹۲۶
۲۱	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۶۸,۶۷۲
۲۲	سرمایه گذاریها	-۷۹,۰۱۶
۲۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۸۰,۰۷۴
۲۴	مواد و محصولات دارویی	-۱۰۸,۸۰۹
۲۵	سیمان، آهک و گچ	-۱۲۸,۵۲۰
۲۶	فلزات اساسی	-۳۱۲,۰۳۰
۲۷	استخراج کانه های فلزی	-۳۲۰,۶۷۹
۲۸	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۴۲۹,۲۱۲
۲۹	خودرو و ساخت قطعات	-۵۲۹,۱۹۶
۳۰	بانکها و موسسات اعتباری	-۱,۱۵۲,۱۷۰
	جمع	-۳,۱۹۶,۰۶۲