



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۰۷



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۷ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، فملی، فارس، شستا، فخوز، وغدیر و شپنا با افزایش ۱۵.۶۸۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۲۰۲.۶۴۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۰۲ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۴۳ 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 بسیاری از نمادها با تقاضای قوی‌تری نسبت به روزهای گذشته همراه بودند.

امروز بازار نسبتاً بهتری را شاهد بودیم که می‌توان تفاوت محسوس بازار امروز نسبت به روزهای گذشته را از سایت بورس اوراق بهادار تهران نیز مشاهده کرد. بسیاری از نمادها در بازه قیمتی مثبت معامله شدند و حتی با صف خرید نیز به کار خود پایان دادند. اما همچنان در طرف مقابل بسیاری از نمادها با صف فروش همراه بودند و قدرت طرف تقاضا در آن نمادها آنچنان با روزهای گذشته نیز تفاوتی نداشت. به نظر می‌رسد موارد مهمی اعم از افزایش محسوس در سودآوری ۱۲ ماهه سال مالی ۹۹ بسیاری از شرکت‌ها نسبت به سال مالی ۹۸، گزارش ماهانه مناسب فروردین، عدم کاهش محسوس نرخ دلار و افزایش مجدد کامودیتی‌ها، تلنگری به فروشندگانی که در صف فروش قرار دارند، زده و آنها را هوشیارتر از قبل کرده است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۸.۷۸۷ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۵۵۴ 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 ۸۰۷، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۷/۱۹ با ۲۲.۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۰۶	۱۴۰۰/۰۲/۰۷	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۵۰,۷۶۳	۴۸,۷۸۷	-۶۸٪



گروه‌های مؤثر

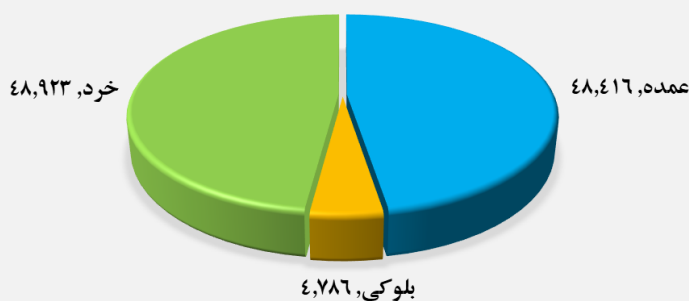
در گروه شیمیایی، پتروشیمی پردیس در سال مالی گذشته (سال مالی این شرکت ۰۶/۳۱ می باشد) به طور متوسط ماهانه ۱۴۳ هزار تن آمونیاک تولید کرده است. در سه ماه ابتدای سال مالی هر ماه به طور متوسط ۱۷۵ هزار تن تولید کرده است. در سه ماه بعدی به دلیل افت فشار گاز میانگین ۱۶۰ هزار تنی را داشت و در فروردین ماه نیز رکورد تولید شرکت با ۱۹۱ هزار تن ثبت شده است. مقدار فروش اوره داخلی شرکت در فروردین ماه ۱۲۵ هزار تن (میانگین ۱۲ ماهه گذشته ۹۷ هزار تن)، اوره صادراتی ۱۶۷ هزار تن (میانگین ۱۷۰ هزار تن) بوده است. فروش‌های آن شرکت در فصل پاییز به ترتیب از مهرماه ۱۶۸۵۰، ۱۲۷۸۰ و ۱۶۹۵۰ میلیارد ریال ثبت شده است. در دی ماه با وجود فروش از موجودی‌ها ۱۲ هزار میلیارد ریال ثبت شده بود و در بهمن نیز ۸۸۰۰ میلیارد ریال اما در اسفند ماه با فروش عالی ۱۸۷۷۰ میلیارد ریالی را داشته و حالا در فروردین نیز با فروش مناسب ۱۷۸۵۰ میلیارد ریالی همراه بوده است. نرخ اوره صادراتی به صورت ریالی ۵ درصد نسبت به اسفند ماه بیشتر بوده و احتمالاً حوالی ۳۰۰ دلار محصول اوره را به فروش رسانده است.

در گروه شیمیایی، پتروشیمی غدیر، در فروردین ماه تولید برابر با ۷۹۰۰ تن را ثبت کرده است. قابل ذکر است میانگین تولید ماهانه آن شرکت در سال گذشته ۱۰ هزار تن بود. مقدار فروش شرکت در سال ۹۹ برابر با ۱۱۴۰۳۳ تن بوده که در فروردین ماه سال جاری برابر با ۷۷۹۵ تن است. نرخ فروش PVC نسبت به ماه گذشته ۱۱ درصد افزایش داشته و برابر با ۳۳۱.۴۹۹ ریال در هر کیلو است و پتروشیمی غدیر توانسته در فروردین فروش ۲۵۸۴ میلیارد ریالی را گزارش کند که میانگین فروش ماهانه آن شرکت در سال مالی گذشته مبلغ ۲۱۴۵ میلیارد ریال بوده است.

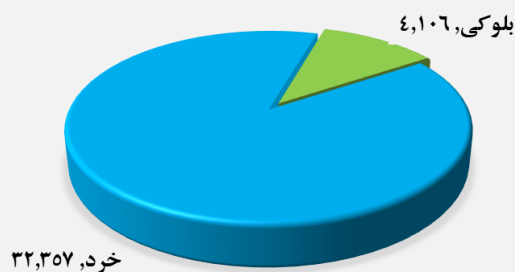
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۳۶	شاخص کل	۱,۲۰۲,۶۳۸	شاخص کل
۳۲.۳۶	تغییر شاخص	۱۵,۶۸۲.۰۰	تغییر شاخص
۱۱,۹۴۳,۹۱۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۸,۱۱۸,۰۸۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۵۸,۲۵۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۳,۷۷۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
آریا		فولاد	
هرمز		فملی	
شگویا		فارس	
ارفع		شستا	
زاگرس		فخوز	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کگهر		رمینا	
وهور		اخابر	
شاون		فخاس	
شراز		وامید	
کزغال		همراه	
(۱,۹۴۲)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
(۷۴۶)		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	

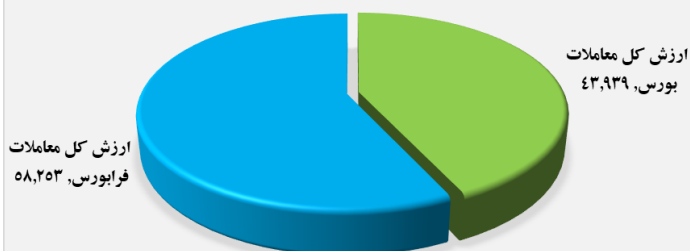
ارزش کل معاملات
(میلیارد ریال)



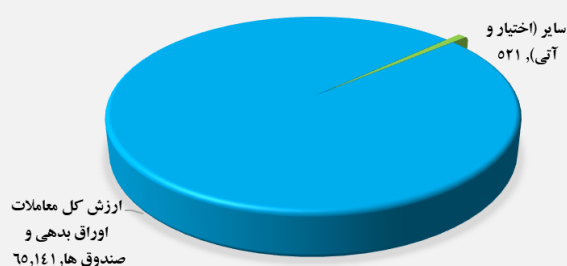
ارزش کل معاملات سهام
(میلیارد ریال)



ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس
(میلیارد ریال)

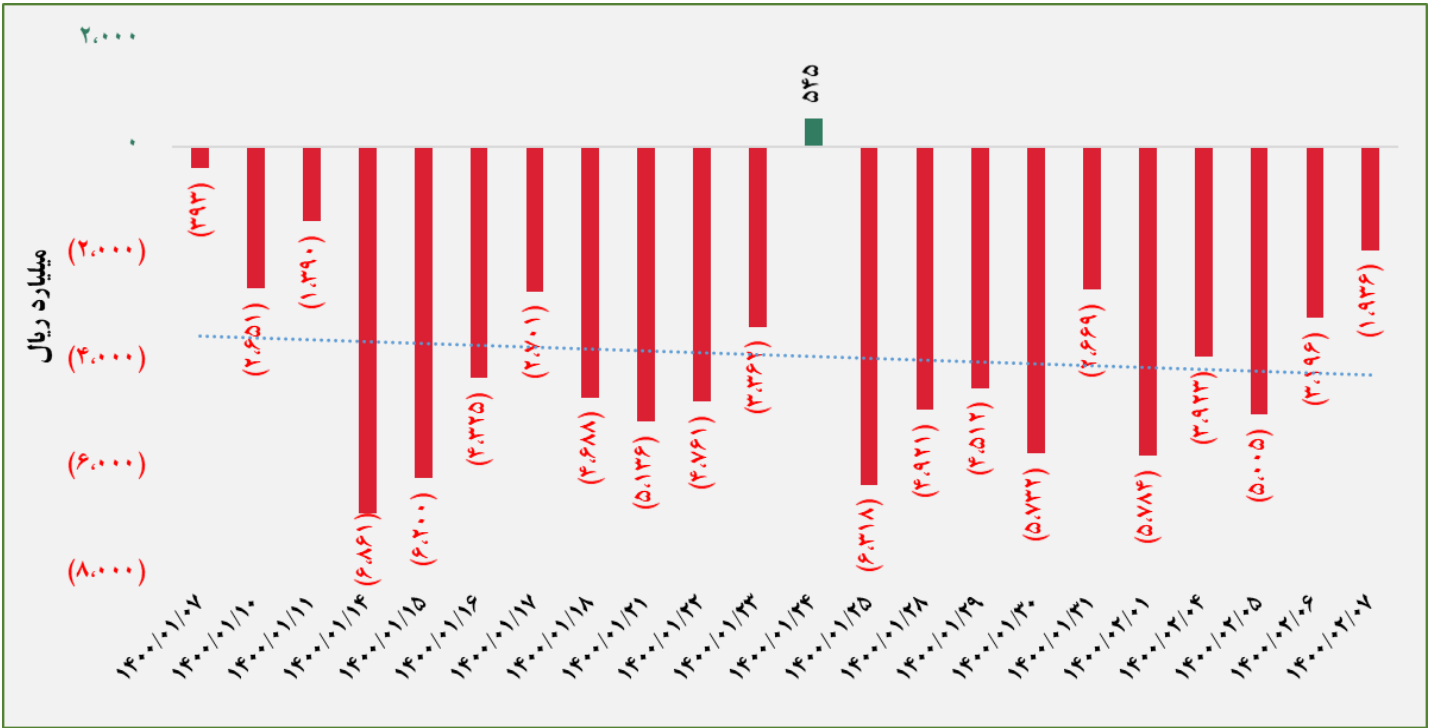


ارزش کل معاملات سهام - به تفکیک اوراق بدهی و صندوق ها
(میلیارد ریال)

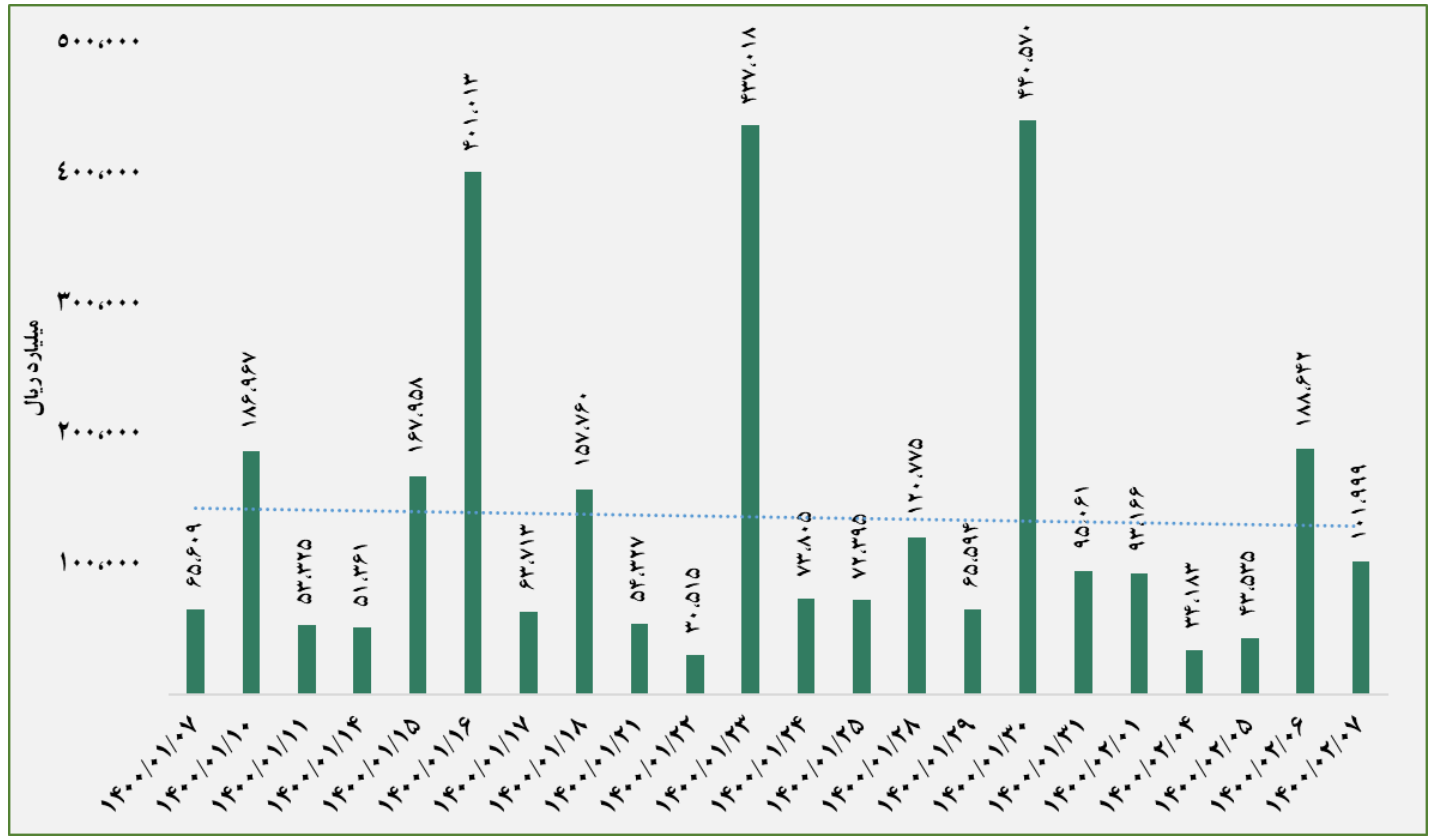




ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



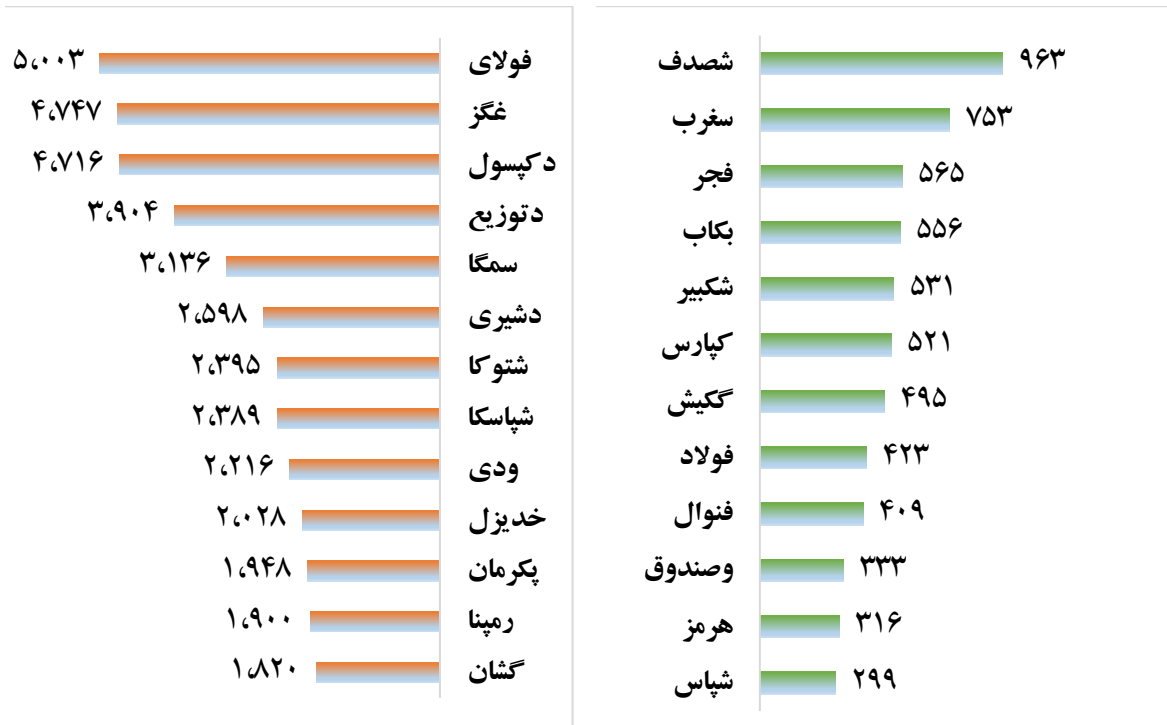
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

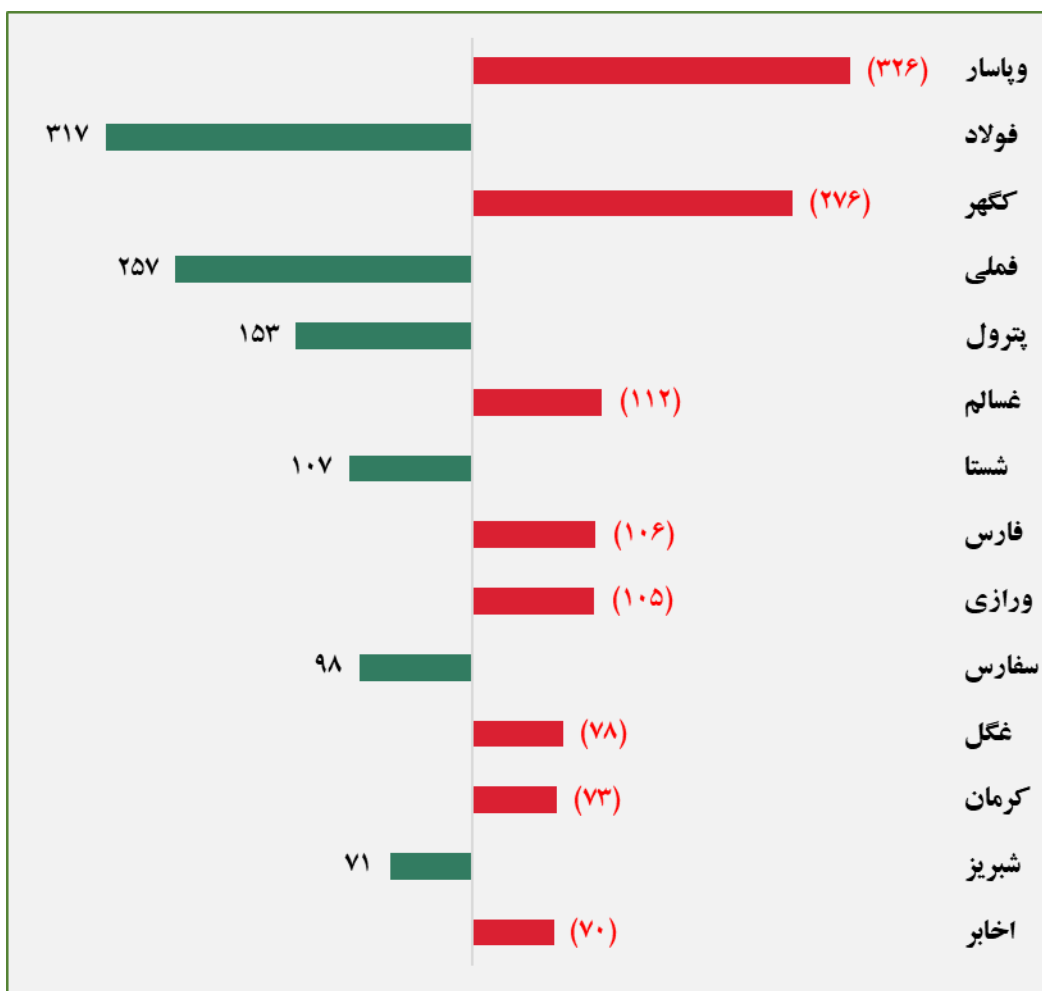


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	فولاد	۱	کگهر
۲	فملی	۲	غسالم
۳	فخوز	۳	کرمان
۴	شگویا	۴	زشریف
۵	قیستو	۵	فخاس
۶	تاصیکو	۶	فاسمین
۷		۷	کروی
۸	-	۸	شبهرن
۹	-	۹	وسبحان
۱۰	-	۱۰	شتوکا



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	غساله
۲	شغدیر	۱۲	غگل
۳	فباهنر	۱۳	فاسمین
۴	ورازی	۱۴	شراز
۵	شاوان	۱۵	ساراب
۶	سفارس	۱۶	آریا
۷	حتاید	۱۷	جم پیلن
۸	زشریف	۱۸	شپاکسا
۹	کروی	۱۹	خگستر
۱۰	نوری	۲۰	شبندر



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	فلزات اساسی	۴۸۶,۲۸۰
۲	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۷۷,۹۹۴
۳	واسطه گری های مالی و پولی	۳۵,۲۳۱
۴	خودرو و ساخت قطعات	۳۲,۹۲۷
۵	پیمانکاری صنعتی	۱۰,۷۶۴
۶	قند و شکر	۷,۵۹۹
۷	هتل و رستوران	۹۱۴
۱۱	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۵
۱۲	محصولات چوبی	-۵۴
۱۳	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۵۱۱
۱۴	استخراج سایر معادن	-۱,۰۹۴
۱۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱,۳۳۸
۱۶	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	-۳,۱۷۳
۱۷	ماشین آلات و دستگاه های برقی	-۳,۵۸۰
۱۸	ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی	-۳,۷۰۴
۱۹	تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	-۸,۷۰۰
۲۰	سایر واسطه گری های مالی	-۱۲,۸۱۰
۲۱	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۹,۳۷۰
۲۲	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۲۱,۸۷۷
۲۳	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۲۲,۴۰۷
۲۴	استخراج زغال سنگ	-۲۳,۱۵۶
۲۵	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۲۴,۴۹۵
۲۶	لاستیک و پلاستیک	-۲۵,۷۶۹
۲۷	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۲۶,۹۲۳
۲۸	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۳۹,۷۰۶
۲۹	محصولات شیمیایی	-۵۱,۱۹۶
۳۰	سرمایه گذاریها	-۵۴,۸۸۱
۳۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۶۱,۳۲۹
۳۲	خدمات فنی و مهندسی	-۶۱,۴۰۵
۳۳	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۶۲,۸۱۷
۳۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۸۰,۵۸۹
۳۵	مخابرات	-۸۹,۶۷۲
۳۶	زراعت و خدمات وابسته	-۹۴,۸۴۰
۳۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۰۵,۷۴۸
۳۸	مواد و محصولات دارویی	-۱۷۳,۴۸۸
۳۹	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۲۱۴,۲۴۴
۴۰	سیمان، آهک و گچ	-۳۰۶,۹۹۸
۴۱	استخراج کانه های فلزی	-۳۸۴,۳۳۵
۴۲	بانکها و موسسات اعتباری	-۶۰۳,۴۲۲
جمع		-۱,۹۳۱,۹۲۷