



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۰۸



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۸ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای وبملت، فارس، فملی، وپاسار، و تجارت، فولاد و وبصادر با افزایش ۵.۰۷۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۲۰۷.۷۰۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۵۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۴۱ 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 قوی تری نسبت به روزهای گذشته همراه بودند.

اصلاح قیمتی اکثر نمادها در چند ماه گذشته و بهبود شرایط بنیادی بسیاری از شرکت‌ها را می‌توان دو عاملی دانست که در نحوه معاملات امروز و روز گذشته اثرگذار بوده است. در چند وقت گذشته، کلیت بازار به صورت محسوسی از حالت تحلیلی خود خارج شده بود و با کمک نرخ‌های کامودیتی در بازارهای جهانی از یک طرف و عدم تمایل کاهش نرخ دلار از طرف دیگر، بازار به سمت منطقی شدن در حال حرکت است. به نظر می‌رسد در روزهای آینده اگر اتفاقات سیاسی جدیدی رخ ندهد، کلیت بازار حداقل به سمت تعادل پیش برود و صف‌های فروش یکی پس از دیگری برچیده شوند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲.۶۴۷ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق اسناد خزانه با نماد اخزا ۹۰۸ 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 ۷۲۲، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۸ با ۲۲.۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۰۷	۱۴۰۰/۰۲/۰۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۴۸,۷۸۷	۲,۶۴۷	-۹۵٪



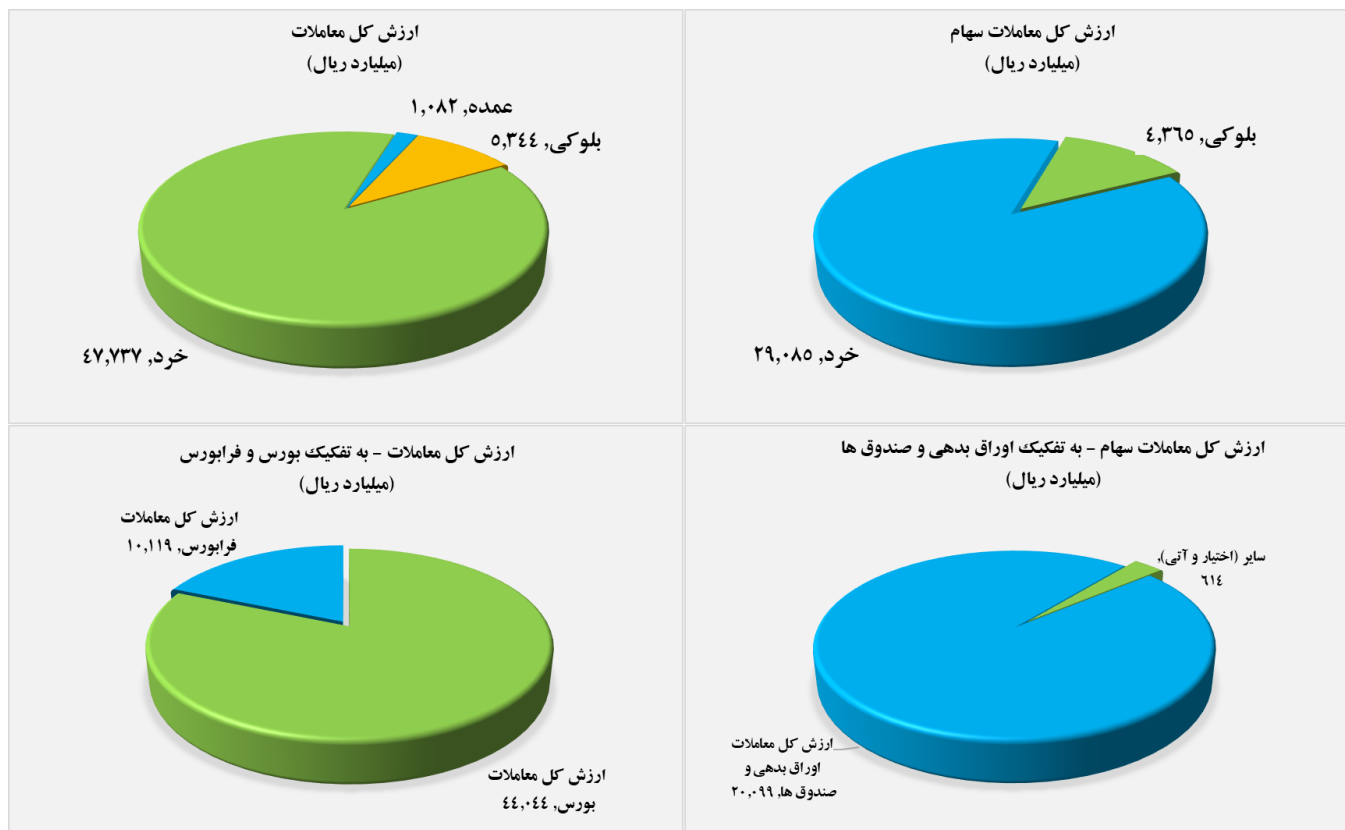
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی خارک در فروردین ۵۵.۲۸۷ تن متانول و ۲۱.۲۵۲ تن LPG تولید کرده است. میانگین تولید سال مالی گذشته هر یک از این دو محصول به ترتیب ۵۳.۰۹۴ و ۲۰.۳۲۱ تن بوده است. در فروردین ماه این شرکت ۴۵.۰۳۷ تن متانول فروخته و در پایان ماه موجودی انبار این محصول به ۷۱.۹۰۵ تن رسیده است. مقدار فروش LPG در فروردین ۱۷.۸۰۹ تن گزارش شده است. پتروشیمی خارک در فروردین ماه فروش مناسب ۷۵۶۰ میلیارد ریالی را به ثبت رسانده است. این شرکت مجموعاً در سال ۹۸، ۲۶۱۹۰ میلیارد ریال و در سال مالی گذشته، ۵۱۹۴۰ میلیارد ریال فروش داشته است. نرخ فروش متانول در فروردین ماه ۶۹۸۸۹ ریال در هر کیلو و نرخ فروش اسفند ۷۲۸۴۲ ریال گزارش شده است.

در گروه فرآورده‌های نفتی، شرکت نفت سپاهان به طور متوسط تولید ماهانه ۵۹۴ هزار تنی را در سال گذشته ثبت کرده بود. متوسط فروش ماهانه نیمه اول و دوم سال گذشته برابر با ۴۱۲ و ۷۹۰ میلیارد ریال برای هر ماه بود که در فروردین ماه فروش ۷۴۷۰ میلیارد ریالی را روانه کدال کرده است. در سال مالی ۹۹، این شرکت ۷۰۲ هزار تن محصول به فروش رسانده که میانگین ماهانه ۵۸ هزار تنی را داشت. در فروردین با وجود تعطیلات عید نوروز، شرکت نفت سپاهان ۵۰ هزار تن محصول فورخته است که نسبت به ۲۳ هزار تن فروش فروردین ماه سال گذشته رشد خوبی داشته است. متوسط نرخ فروش روانکار داخلی در سال ۹۹ برابر با ۱۳۰ هزار ریال در هر کیلو بوده که در اسفند و فروردین ماه برابر با ۱۸۷ هزار و ۲۰۰ هزار ریال ثبت شده است. نرخ روانکار صادراتی به طور متوسط در سال گذشته ۹۰ هزار ریال در هر کیلو بوده که در اسفند و فروردین به ترتیب برابر با ۱۳۳ هزار و ۱۷۹ هزار ریال ثبت شده است.

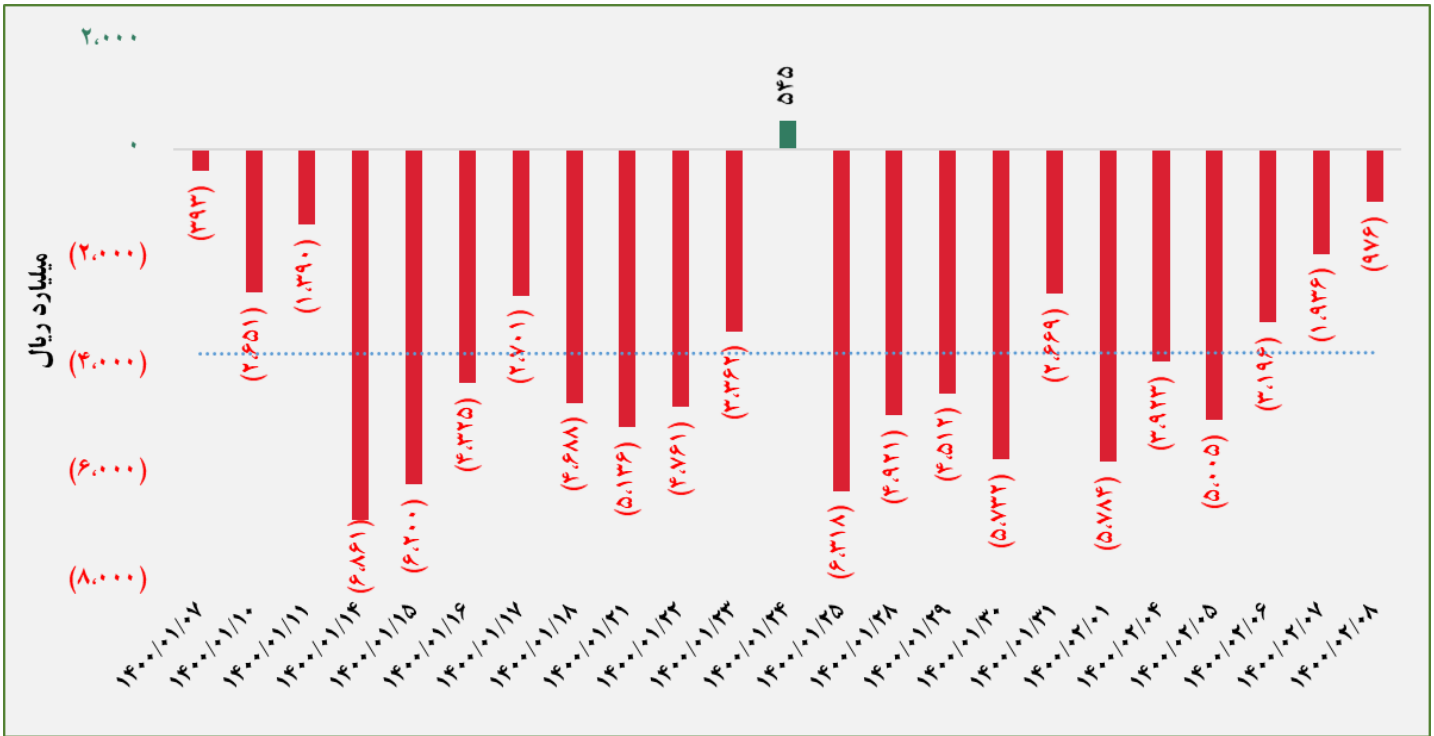
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۶۰	شاخص کل	۱,۲۰۷,۶۹۱	شاخص کل
۲۳.۰۰	تغییر شاخص	۵,۰۶۱.۰۰	تغییر شاخص
۱۱,۹۶۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۸,۳۲۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۰,۱۲۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۴,۰۹۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
رمینا		ویملت	
اخابر		فارس	
شپنا		فملی	
شتران		ویارس	
شبندر		وتجارت	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کگهر		آریا	
وهور		میدکو	
غصینو		صبا	
کزغال		ومهان	
مادیرا		کرمان	
(۹۷۶)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
(۵۸۲)		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	

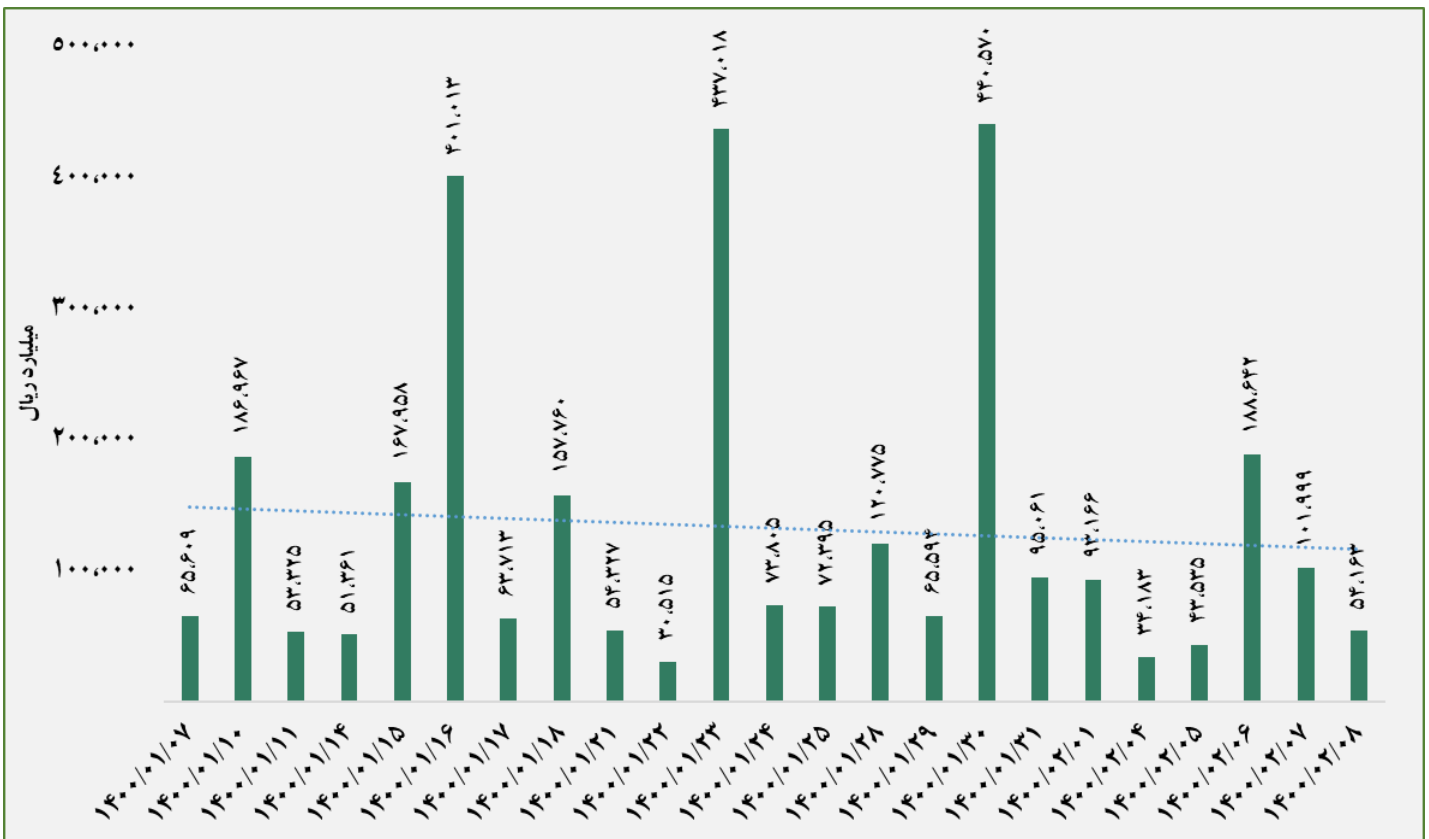




ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



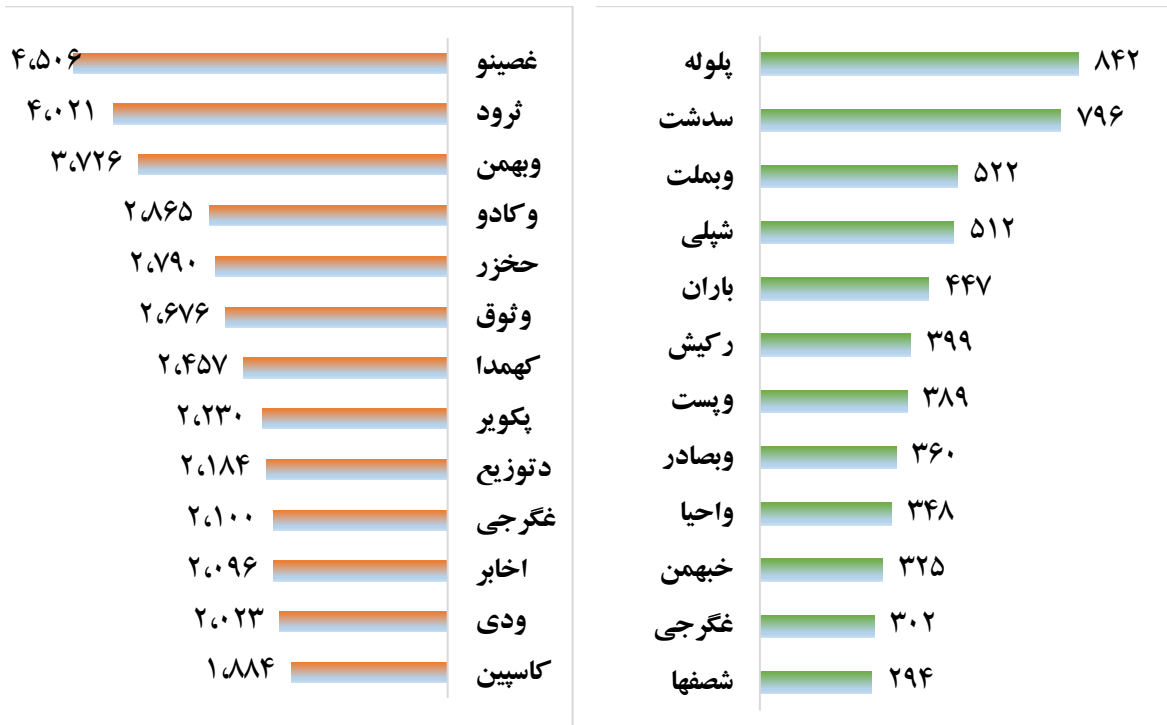
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

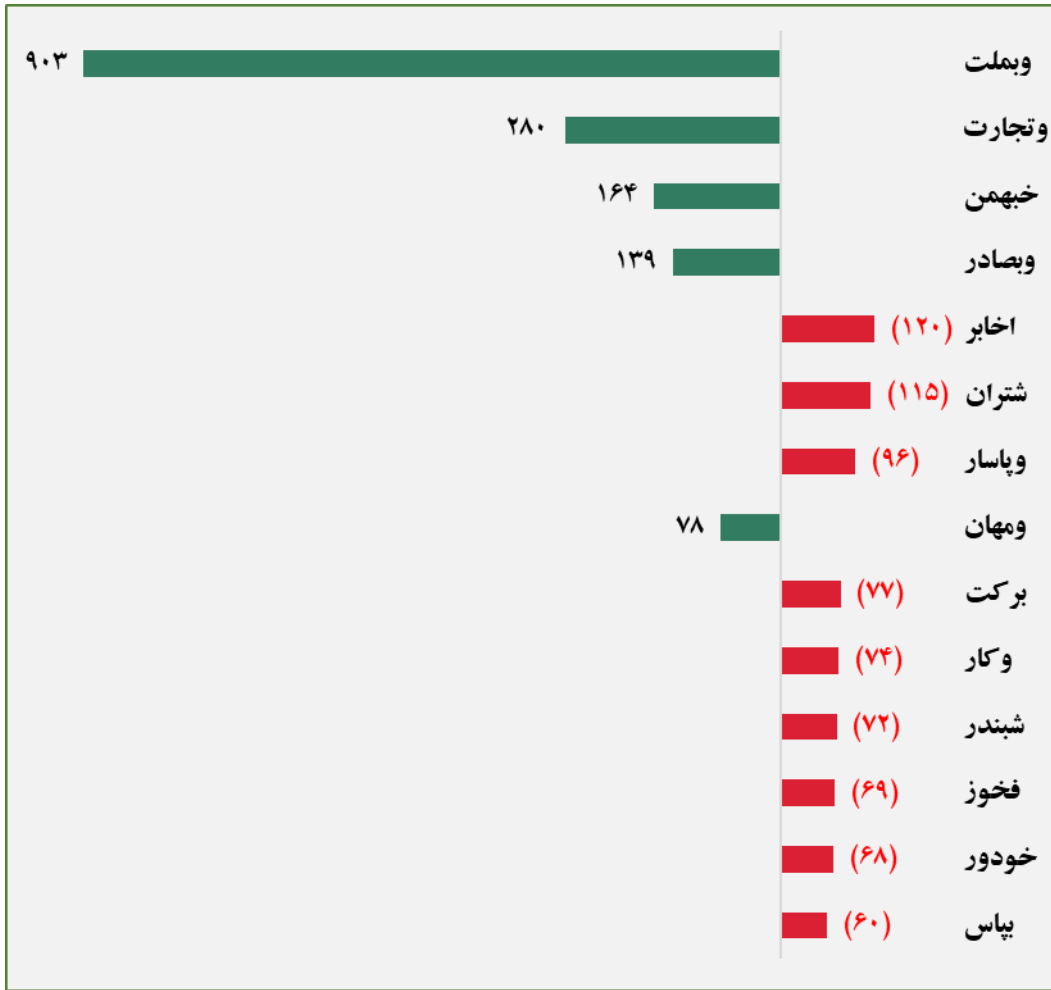


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	وبملت	۱	اخابر
۲	وتجارت	۲	وتوس
۳	وبصادر	۳	وپست
۴	ومهان	۴	ساوه
۵	وسينا	۵	سقاش
۶	-	۶	بساما
۷	-	۷	وسبحان
۸	-	۸	شيراز
۹	-	۹	حكشتى
۱۰	-	۱۰	پاكشو



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	اخابر	۱۱	بوعلی
۲	شتران	۱۲	سینا
۳	وپاسار	۱۳	شبریز
۴	برکت	۱۴	افق
۵	وکار	۱۵	کزغال
۶	شبندر	۱۶	شپنا
۷	فخوز	۱۷	شرانل
۸	خودرو	۱۸	وپست
۹	پیاس	۱۹	فارس
۱۰	وتوس	۲۰	شاراک



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	بانکها و موسسات اعتباری	۱,۱۲۹,۸۱۲
۲	خودرو و ساخت قطعات	۶۷,۴۰۳
۳	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۱۳,۲۵۰
۴	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۱,۵۱۵
۵	هتل و رستوران	-۳۵۷
۶	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱,۳۳۶
۷	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۱,۸۳۹
۱۳	قند و شکر	-۲,۰۵۳
۱۵	پیمانکاری صنعتی	-۲,۳۲۶
۱۶	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	-۳,۱۵۷
۱۷	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۶۹۳
۱۸	ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی	-۴,۰۲۰
۱۹	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۵,۰۹۰
۲۰	لاستیک و پلاستیک	-۱۳,۱۵۴
۲۱	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-۱۵,۹۲۲
۲۲	ماشین‌آلات و تجهیزات	-۱۹,۲۷۸
۲۳	تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	-۲۰,۰۴۲
۲۴	خدمات فنی و مهندسی	-۲۹,۵۲۷
۲۵	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۳۰,۳۵۴
۲۶	سرمایه‌گذارها	-۵۲,۱۸۱
۲۷	زراعت و خدمات وابسته	-۵۲,۷۵۹
۲۸	شرکتهای چند رشته‌ای صنعتی	-۵۳,۴۹۹
۲۹	استخراج زغال سنگ	-۵۴,۳۹۸
۳۰	خرده‌فروشی، باستان‌شناسی و وسایل نقلیه موتوری	-۵۴,۷۷۵
۳۱	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسطه	-۵۸,۱۵۱
۳۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۶۰,۷۶۶
۳۳	فلزات اساسی	-۶۸,۵۶۳
۳۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۸۲,۲۷۹
۳۵	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	-۸۷,۲۶۸
۳۶	استخراج کانه‌های فلزی	-۸۷,۵۳۳
۳۷	مخابرات	-۱۱۴,۲۴۳
۳۸	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	-۱۷۵,۳۴۷
۳۹	مواد و محصولات دارویی	-۱۸۱,۹۶۳
۴۰	محصولات شیمیایی	-۲۱۸,۸۹۸
۴۱	سیمان، آهک و گچ	-۲۶۱,۵۲۷
۴۲	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	-۳۶۱,۸۶۹
	جمع	-۹۷۳,۱۹۷