



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۱۲



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۲ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، شستا، فارس، کچاد، کگل و تاییکو با کاهش ۱۳.۶۲۶ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۸۰.۷۱۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۴۲ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۲۰ 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 روز گذشته بسیاری از نمادها در اکثر گروه‌ها با صف فروش همراه بودند.

در روزهای آخر هفته گذشته، بازار سهام وضعیت متعادل تری نسبت به دو روز گذشته داشت و انتظار بهتر شدن کلیت بازار در هفته جاری می‌رفت اما خبرهای مثبت از رفع تحریم‌ها و کاهش دلار به حدود ۲۲۵ هزار ریال، فشار فروش را در بازار بیشتر کرد، تا جائیکه در روز جاری اکثر نمادها در همه گروه‌ها به جزء بانکی با صف فروش همراه بودند. به نظر می‌رسد تا زمانیکه وضعیت نرخ دلار برای سرمایه‌گذاران و فعالین بازار سرمایه با ثبات همراه نگردد، شاهد افزایش تقاضا در کلیت بازار نخواهیم بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱.۵۴۰ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۶۳۴، 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 ۷۲۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۳/۲۴ با ۲۲.۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۱۱	۱۴۰۰/۰۲/۱۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳۴,۹۷۶	۱۱,۵۴۰	-۶۷٪



گروه‌های مؤثر

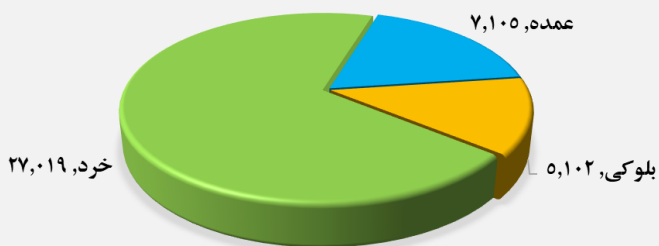
در گروه نهاد مالی واسط، تأمین سرمایه ملت در سه فصل اول سال مالی ۹۹، به ترتیب درآمد ۱۳۱، ۱۵۳ و ۱۴۵ میلیارد تومانی را داشته و در فصل آخر نیز ۱۸۱ میلیارد تومان درآمد گزارش کرده است و نهایتاً به درآمد سالانه ۶۱۰ میلیارد تومانی در سال ۹۹ رسیده که رشد ۳۱ درصدی نسبت به سال گذشته دارد. در سال مالی گذشته ۴۶۴ میلیارد تومان درآمد گزارش کرده بود. سود عملیاتی ۱۲ ماهه شرکت ۵۸۶ میلیارد تومان است که رشد ۳۰ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه ۹۸ دارد. این شرکت در کل سال مالی ۹۸، سود عملیاتی ۴۵۰ میلیارد تومانی داشته است. همچنین حاشیه سود عملیاتی در سال ۹۹ حدود ۹۶ درصد رقم خورد که در سال مالی ۹۸ حاشیه سود عملیاتی ۹۷ درصد بود. شرکت تأمین سرمایه ملت در فصل چهارم سال جاری ۱۴۴ ریال سود به ازای هر سهم محقق کرده است. در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب سود هر سهم ۱۰۳، ۱۱۹ و ۱۱۳ ریال بوده است. نهایتاً تملت در ۱۲ ماهه توانسته است ۴۷۹ ریال سود بسازد که ۲۹ درصد بیشتر از سود سال گذشته است. سود سال ۹۸ این شرکت ۳۷۱ ریال به ازای هر سهم گزارش شده بود.

در گروه سیمان، شرکت سیمان کردستان در فروردین ۶۷ هزار تن تولید سیمان داشته که میانگین تولیدات سال مالی جاری به ۸۰ هزار تن رسیده است و این عدد در سال مالی قبل ۹۴ هزار تن گزارش شده است (سال مالی شرکت آذر می‌باشد). فروش سیمان در فروردین ۶۶ هزار تن گزارش شده و شرکت در سال مالی جاری به طور متوسط هر ماه ۷۹.۵ هزار تن فروش داشته که این عدد برای سال مالی قبل ۹۴ هزار تن بوده است. درآمد فروش شرکت در فروردین ۱۹ میلیارد تومان می‌باشد. شرکت در سال مالی گذشته و جاری جمعا به ترتیب ۲۷۳ و ۹۲ میلیارد تومان فروش داشته است. میانگین نرخ فروش سیمان این شرکت در اسفند و فروردین در حدود ۲۹۰ هزار تومان در هر تن گزارش شده که متوسط این نرخ در سال مالی ۹۹، ۲۳۸ هزار تومان در هر تن بوده است.

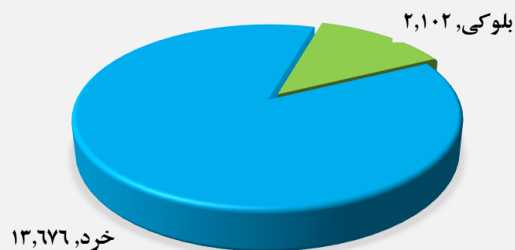
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۴۷۰	شاخص کل	۱,۱۸۰,۷۱۲	شاخص کل
(۱۰۲.۴۱)	تغییر شاخص	(۱۳,۶۲۶.۲۱)	تغییر شاخص
۱۱,۸۳۱,۳۶۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۷,۲۳۹,۶۶۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۶,۸۵۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۲,۳۷۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
دماوند		وبملت	
خدیزل		وپاسار	
		وپخش	
		وساخت	
		ثمسکن	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
زاگرس		فولاد	
ککهر		فملی	
آریا		شستا	
شگویا		فارس	
مارون		کچاد	
(۳,۸۳۲)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۱,۲۰۱		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	

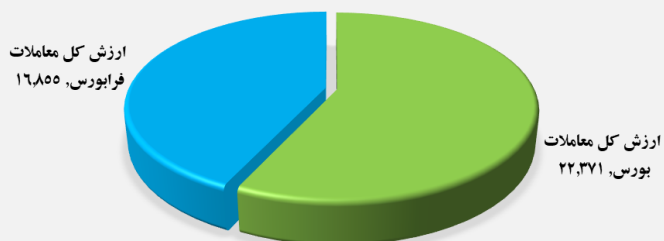
ارزش کل معاملات
(میلیارد ریال)



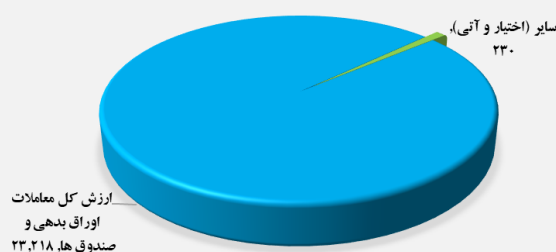
ارزش کل معاملات سهام
(میلیارد ریال)



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

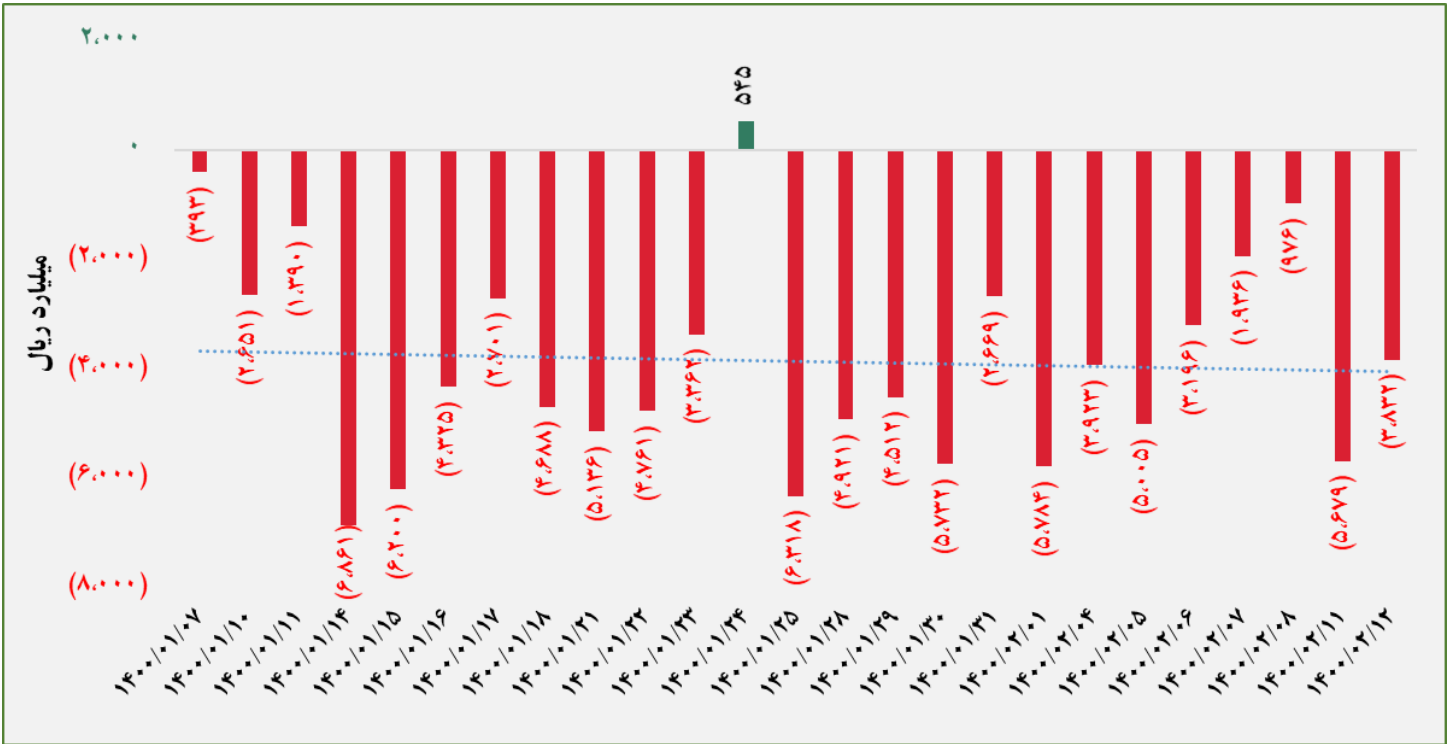


ارزش کل معاملات سهام - به تفکیک اوراق بدهی و صندوق ها
(میلیارد ریال)

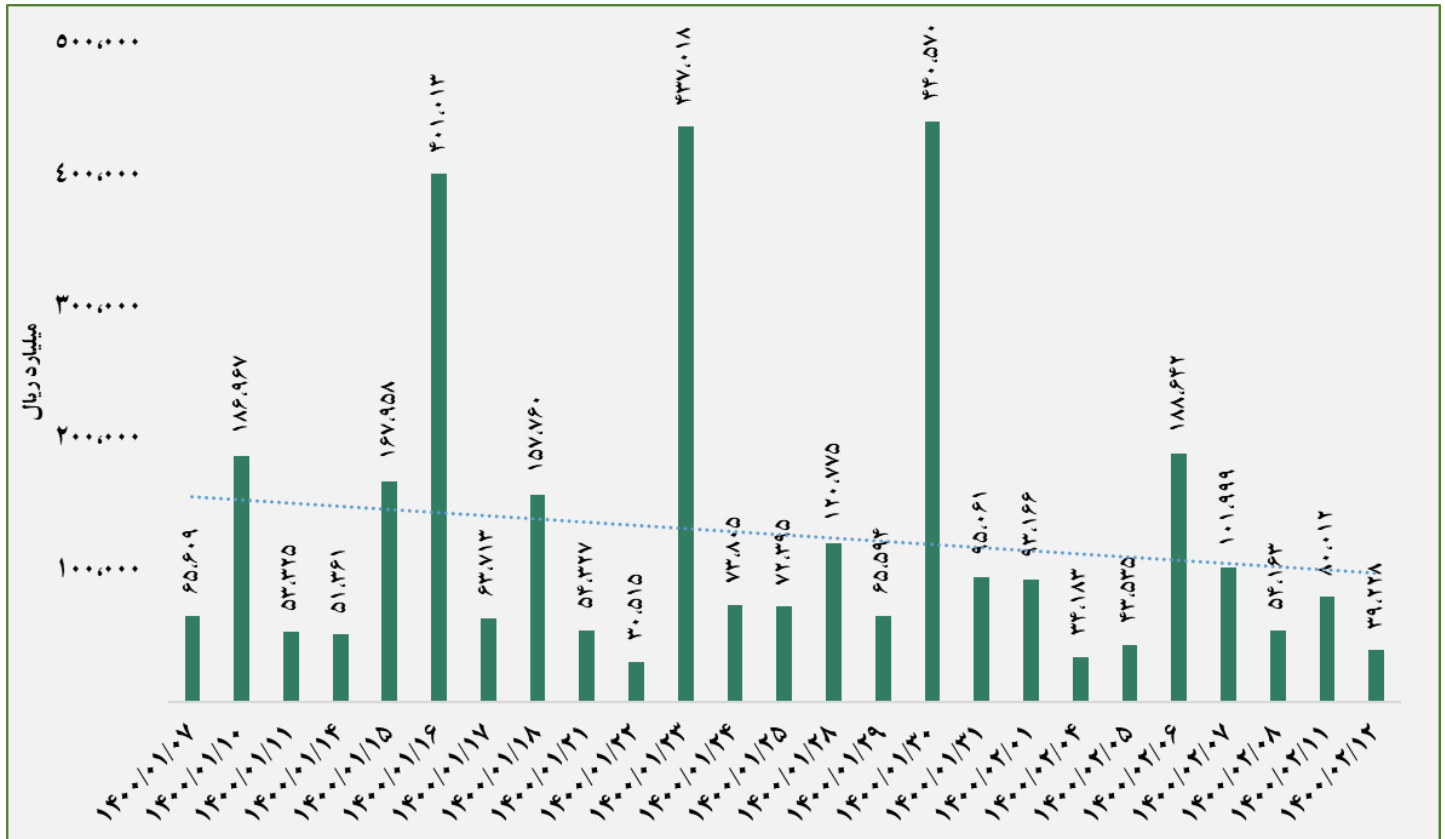




ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



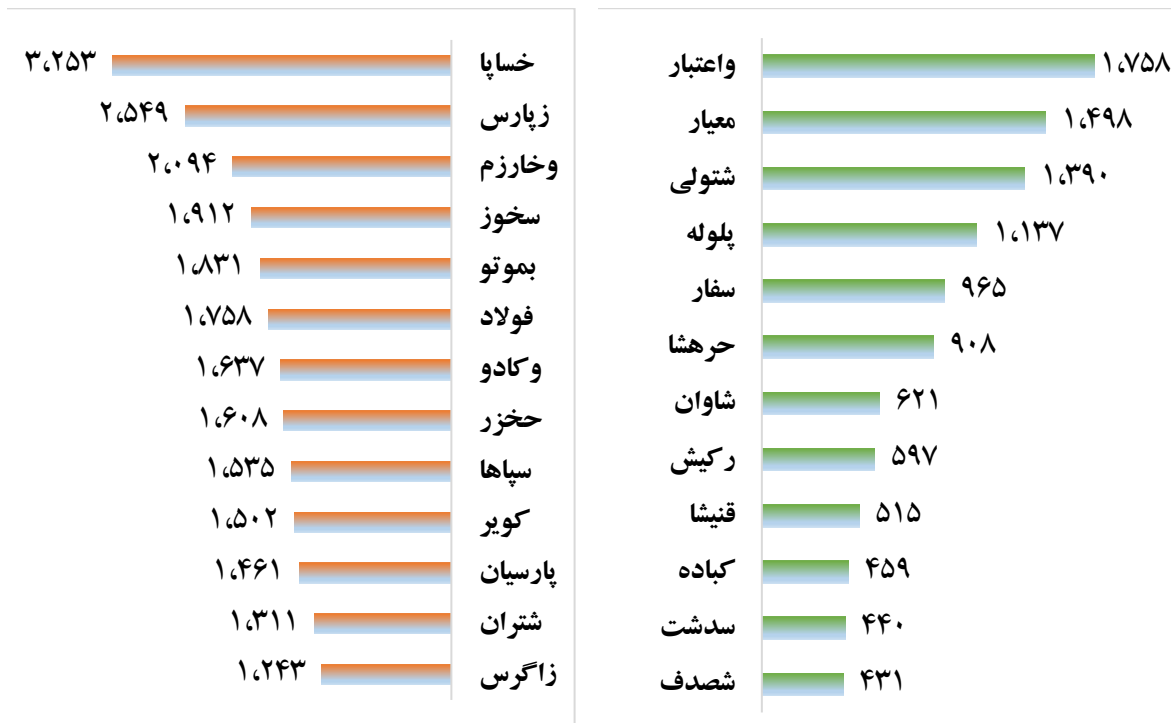
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

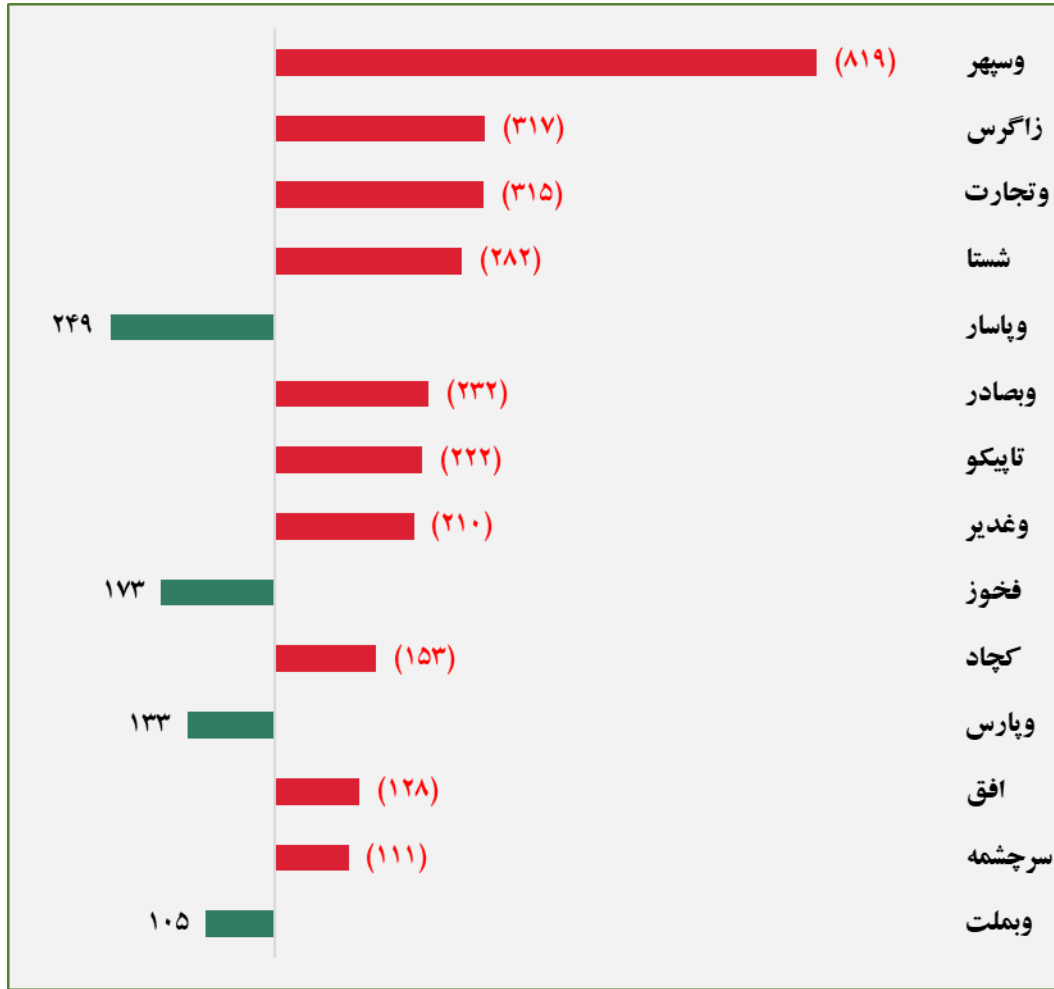


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	وپخش	۱	قنیشا
۲	وسپهر	۲	تپکو
۳	شهران	۳	وتجارت
۴	-	۴	وصادر
۵	-	۵	ولانا
۶	-	۶	وملت
۷	-	۷	بفجر
۸	-	۸	کرمان
۹	-	۹	زاگرس
۱۰	-	۱۰	سمتاز



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	وساخت	۱۱	بوعلی
۲	زاگرس	۱۲	وسپهر
۳	ساراب	۱۳	سرچشمه
۴	سمازن	۱۴	شپدیس
۵	برکت	۱۵	شرانل
۶	افق	۱۶	دماوند
۷	وتوس	۱۷	نوری
۸	جم بیلن	۱۸	کاوه
۹	ثمسکن	۱۹	پارس
۱۰	ورازی	۲۰	آریا



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۱۹,۲۹۷
۲	قند و شکر	۱۱,۰۷۵
۳۱	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	۳,۸۶۹
۱۵	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۲,۳۶۳
۶	ساخت محصولات فلزی	۱,۲۵۳
۳۴	مواد و محصولات دارویی	۷۰۶
۱۷	لاستیک و پلاستیک	۲۲۰
۴	خدمات فنی و مهندسی	۰
۵	محصولات کاغذی	۰
۷	هتل و رستوران	۰
۹	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۰
۱۰	محصولات چوبی	۰
۱۱	استخراج سایر معادن	۰
۱۳	پیمانکاری صنعتی	۰
۱۴	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۰
۲۳	استخراج زغال سنگ	۰
۱۲	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۸۹۲
۱۹	ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی	-۱,۴۴۴
۲۸	ماشین‌آلات و تجهیزات	-۲,۰۰۹
۱۸	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۶۷۶
۸	اطلاعات و ارتباطات	-۵,۲۳۵
۳۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۶,۵۱۸
۱۶	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	-۶,۶۲۰
۲۴	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-۱۱,۳۵۴
۲۲	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۱۱,۷۶۶
۲۱	خودرو و ساخت قطعات	-۱۵,۲۱۹
۲۷	تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	-۱۵,۸۳۱
۲۰	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۱۵,۸۸۱
۲۶	مخابرات	-۲۷,۹۶۶
۲۵	زراعت و خدمات وابسته	-۲۸,۵۸۳
۳۰	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسطه	-۶۳,۸۲۲
۲۹	خرده‌فروشی، باستان‌شناسی و وسایل نقلیه موتوری	-۷۸,۴۴۷
۳۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۰۳,۲۸۶
۳	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۰۶,۶۶۷
۳۷	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	-۱۶۶,۹۱۳
۳۶	سیمان، آهنک و گچ	-۲۳۰,۷۲۳
۳۵	استخراج کانه‌های فلزی	-۲۸۰,۲۴۹
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۲۹۴,۲۱۵
۳۸	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	-۳۴۹,۵۶۳
۴۲	فلزات اساسی	-۴۶۲,۰۳۲
۴۱	سرمایه‌گذارها	-۷۱۰,۰۷۹
۴۰	محصولات شیمیایی	-۸۶۳,۷۱۳
جمع		-۳,۸۲۳,۹۲۰