



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۱۳

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۳ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، فولاد، فملی، شستا، کگل، پارسان و رانفور با کاهش ۱۳.۵۹۰ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۶۷.۰۷۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۲۰ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۱۶ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق های قابل معامله سهامی می باشد. در روز جاری همانند روز گذشته بسیاری از نمادها در اکثر گروه ها با صف فروش همراه بودند.

برای شاخص کل دو سناریو موجی محتمل است. در سناریو اول در صورت حفظ شدن کف ۱.۱۲۵.۰۰۰ (پایین ترین نقطه در چند ماه گذشته)، برای شاخص کل یک اصلاح ترکیبی به صورت زیگزاگ، ایکس موج و مثلث متصور هستیم و پس از اتمام این الگو برگشت بازار را در پیش خواهیم داشت. اما در سناریو دوم در صورت از دست دادن کف ۱.۱۲۵.۰۰۰ واحدی، برای شاخص کل یک ساختار زیگزاگ دوگانه را متصور هستیم که شاخص کل حتی می تواند به کمتر از ۱ میلیون واحد نیز برسد و پس از اتمام روند اصلاحی، شاهد رشد مناسبی از شاخص خواهیم بود. همچنین با توجه به تغییرات دامنه نوسان که در سه ماه گذشته اجرائی شده است، از نظر زمانی شاخص کل می تواند تا اواسط خرداد ماه موج اصلاحی خود را تکمیل نماید و وارد روند جدیدی شود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۵۳.۰۹۰ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۳۱۴، 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 | ۱۴۰۰/۰۲/۱۲ | ۱۴۰۰/۰۲/۱۳ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۱۱,۵۴۰ | ۵۳,۰۹۰ | ۳۶۰٪ |



گروه‌های مؤثر

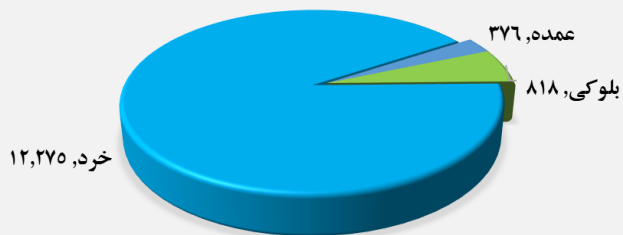
در گروه خودرو، شرکت ایران خودرو در فروردین ماه توانست فروش ۴۴۷۳ میلیارد تومانی را به ثبت برساند که این رقم با توجه به این که همواره مقدار فروش در فروردین کمتر از سایر ماه‌هاست، قابل قبول به نظر می‌رسد. مبلغ ۷۲۱۲ میلیارد تومانی فروش آن شرکت در اسفند ۹۹، بهترین فروش ماهانه شرکت بود. ایران خودرو در فروردین ماه تولید ۳۴ هزار دستگاه را گزارش کرده است. میانگین تولید ماهانه سال ۹۹، ۳۹ هزار دستگاه می‌باشد. در این ماه ۷۲ درصد فروش شرکت از محل گروه پژو است (۲۸ هزار دستگاه و ۳۲۲۶ میلیارد تومان درآمد). گروه دنا نیز با ۴۲۰۰ دستگاه و ۶۳۴ میلیارد تومان ۱۴ درصد از درآمد این ماه را شکل داده است. متوسط نرخ فروش محصولات در سال ۹۹، ۸۹ میلیون تومان بوده و در فروردین ۱۱۹ میلیون تومان به ازای هر دستگاه گزارش شده است. نرخ فروش گروه پژو، سمند و دنا، به ترتیب در فروردین ۱۱۴، ۱۰۷ و ۱۴۷ میلیون تومان گزارش شده است.

در گروه کاشی و سرامیک، صنایع کاشی و سرامیک سینا، در فروردین ماه ۴۷۲۵۴۲ متر مربع تولید داشته است. میانگین تولیدات سال ۹۹ به ۸۹۷۰۱۱ متر مربع رسید و این عدد در سال مالی ۹۸، ۸۹۰۰۰۰ متر مربع گزارش شده است. فروش فروردین ۳۴۰۰۹۳ متر مربع گزارش شده و این شرکت در سال ۹۸ مجموعاً ۱۰.۹۵۱.۷۳۲ متر مربع فروش را به ثبت رسانده بود و در سال ۹۹ نیز ۱۱.۴۰۲.۰۳۷ متر مربع فروش داشته است. درآمد شرکت در فروردین ماه ۲۰ میلیارد تومان می‌باشد. شرکت در سال ۹۸ و ۹۹ جمعاً به ترتیب ۲۸۳ و ۶۰۰ میلیارد تومان فروش داشته است. میانگین نرخ فروش شرکت در فروردین و اسفند به ترتیب ۵۸۱۰۰۰ ریال و ۵۳۵۰۰۰ ریال در هر متر مربع ثبت شده است.

تصویر کلی بازار

| فرا بورس | | بورس | |
|----------------------------|-----------------------------|----------------------------|--|
| ۱۷,۴۱۷ | شاخص کل | ۱,۱۶۷,۰۷۲ | شاخص کل |
| (۵۲.۹۹) | تغییر شاخص | (۱۳,۵۹۰.۶۲) | تغییر شاخص |
| ۱۱,۷۹۵,۳۶۸ | ارزش بازار (میلیارد ریال) | ۴۶,۶۹۷,۴۷۷ | ارزش بازار (میلیارد ریال) |
| ۱۰۰,۸۸۳ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۱۹,۰۷۲ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) |
| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | | بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | |
| | دماوند | | وپاسار |
| | شگویا | | وپخش |
| | وسپهر | | وساخت |
| | | | دعبید |
| | | | اپال |
| بیشترین تاثیر منفی در شاخص | | بیشترین تاثیر منفی در شاخص | |
| | آریا | | فارس |
| | کگهر | | فولاد |
| | هرمز | | فملی |
| | ومهان | | شتتا |
| | مارون | | کگل |
| | (۳,۰۵۸) | | ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال) |
| | ۴۴۸ | | ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال) |

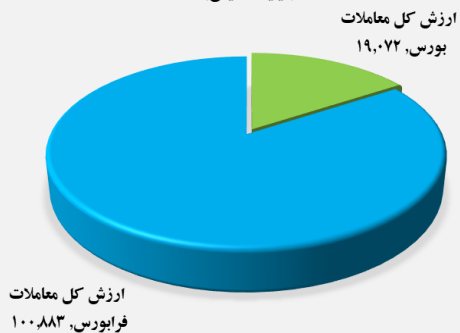
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد
(میلیارد ریال)



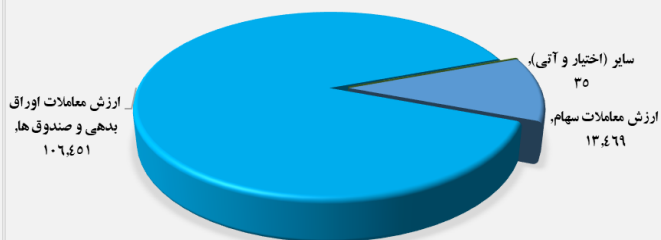
ارزش کل معاملات
(میلیارد ریال)



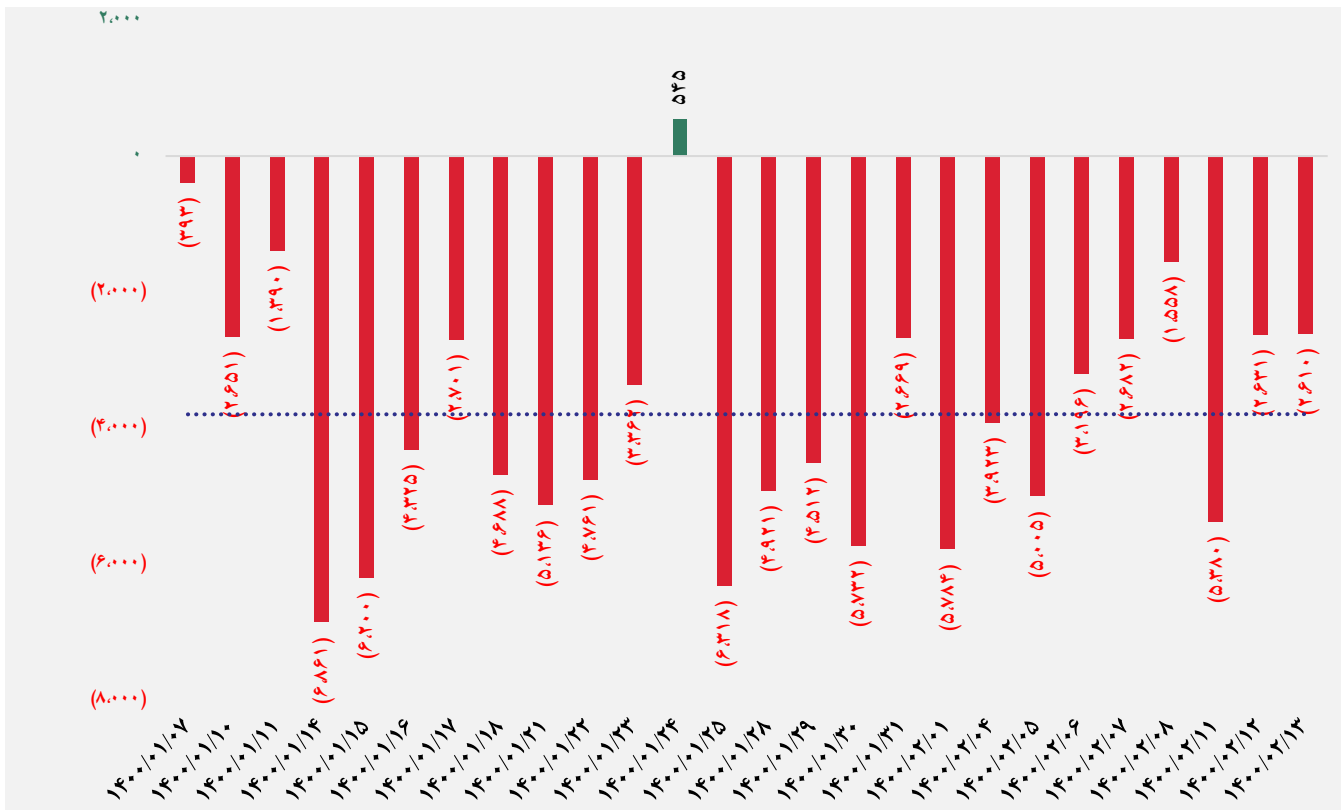
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس
(میلیارد ریال)



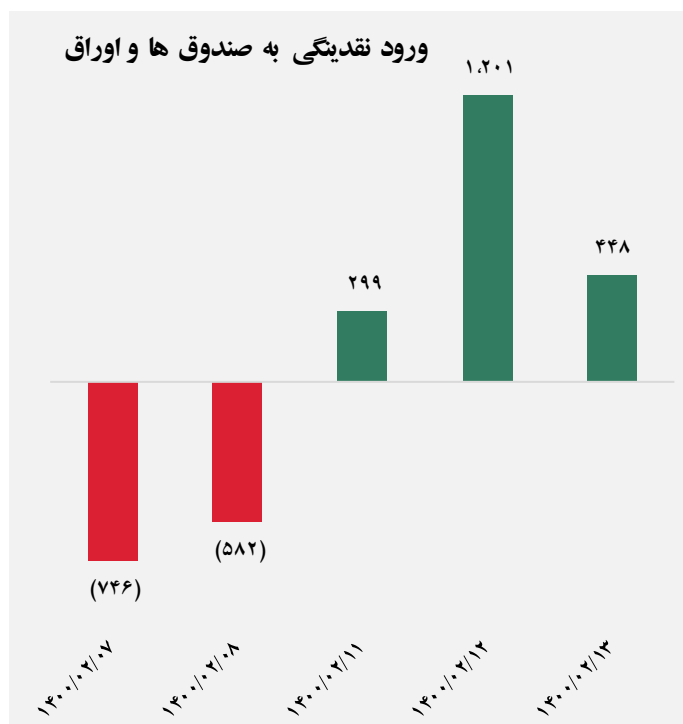
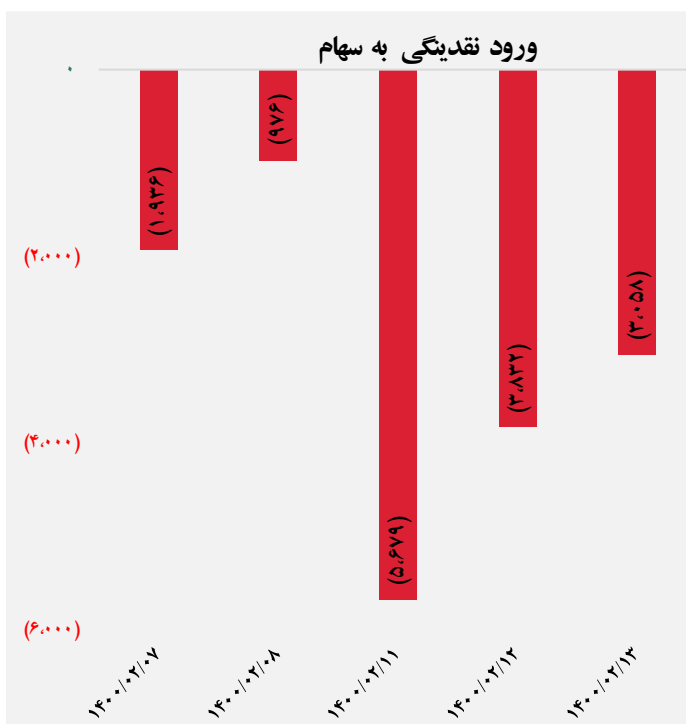
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها
(میلیارد ریال)



کل ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

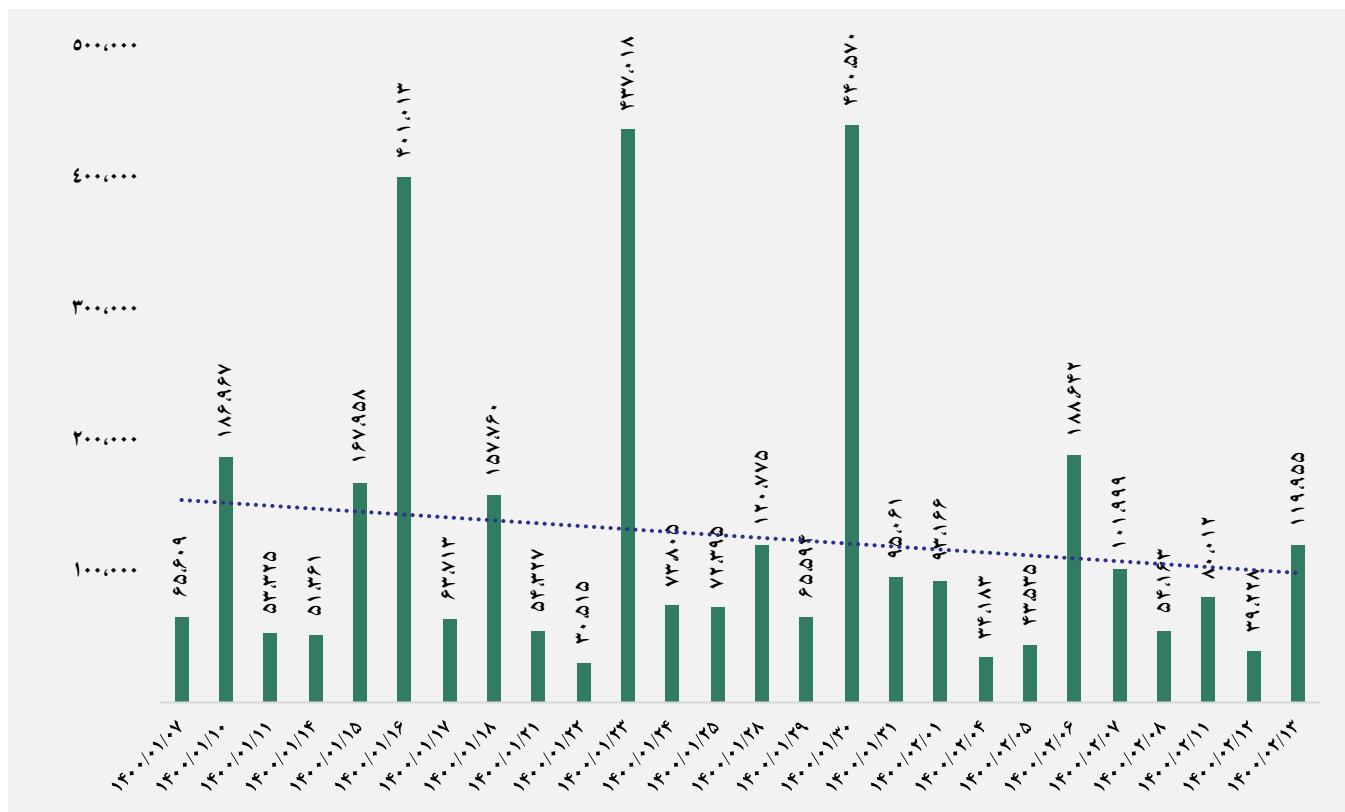


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

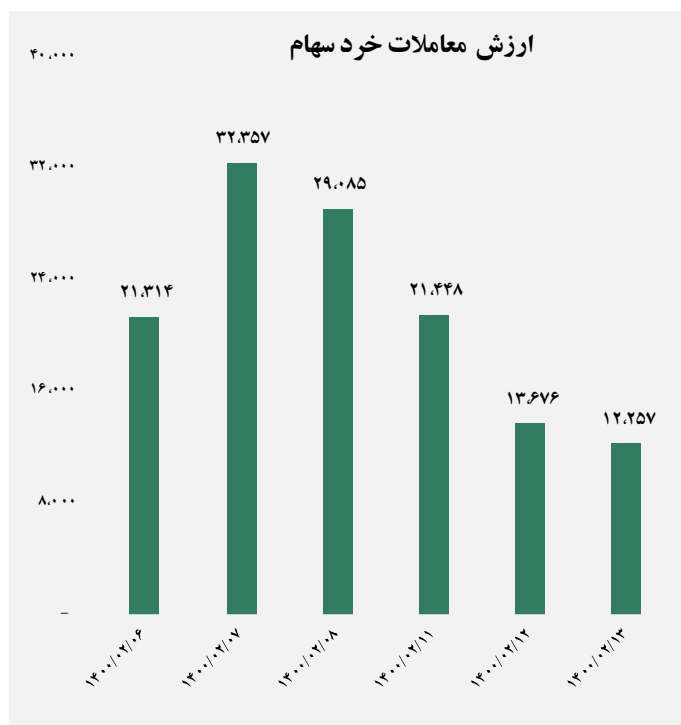
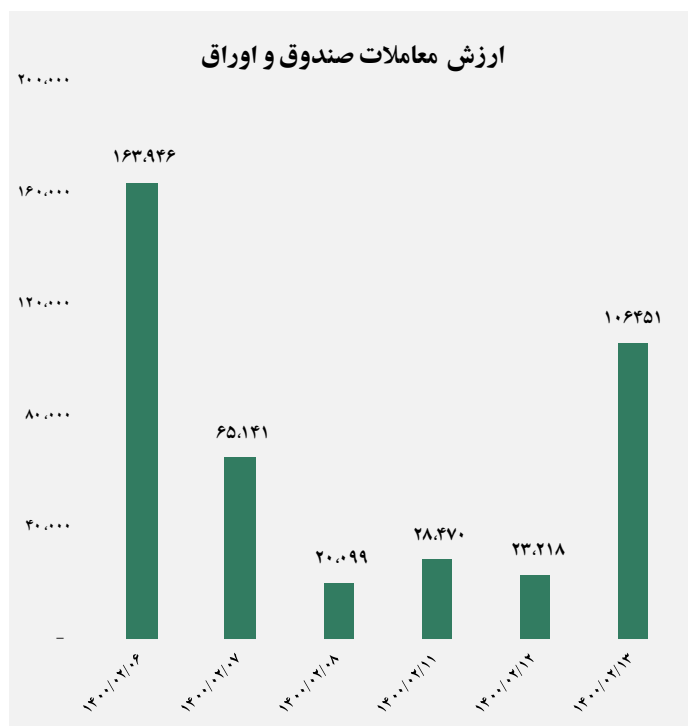


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

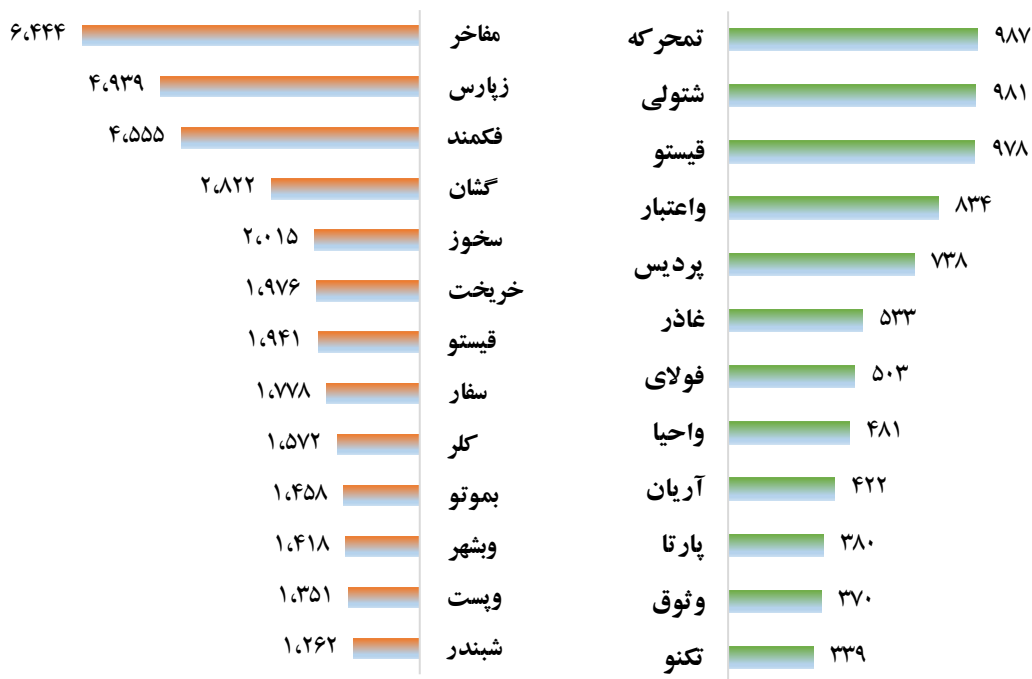


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

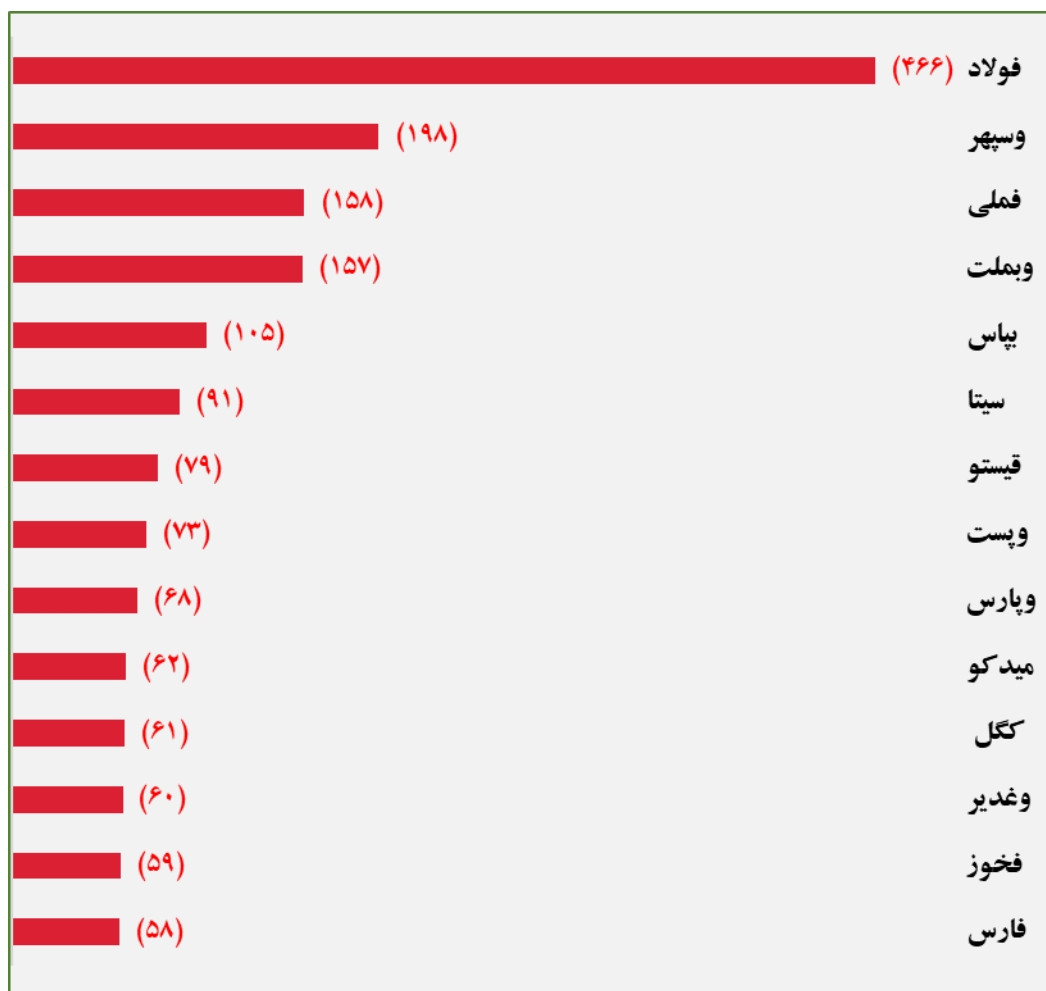


پول هوشمند

| خروج | ردیف | ورود | ردیف |
|--------|------|--------|------|
| وغدیر | ۱ | دماوند | ۱ |
| غگل | ۲ | وسپهر | ۲ |
| شکیر | ۳ | - | ۳ |
| کدما | ۴ | - | ۴ |
| وتوصا | ۵ | - | ۵ |
| بساما | ۶ | - | ۶ |
| پاکشو | ۷ | - | ۷ |
| پارسان | ۸ | - | ۸ |
| سکرما | ۹ | - | ۹ |
| سجام | ۱۰ | - | ۱۰ |



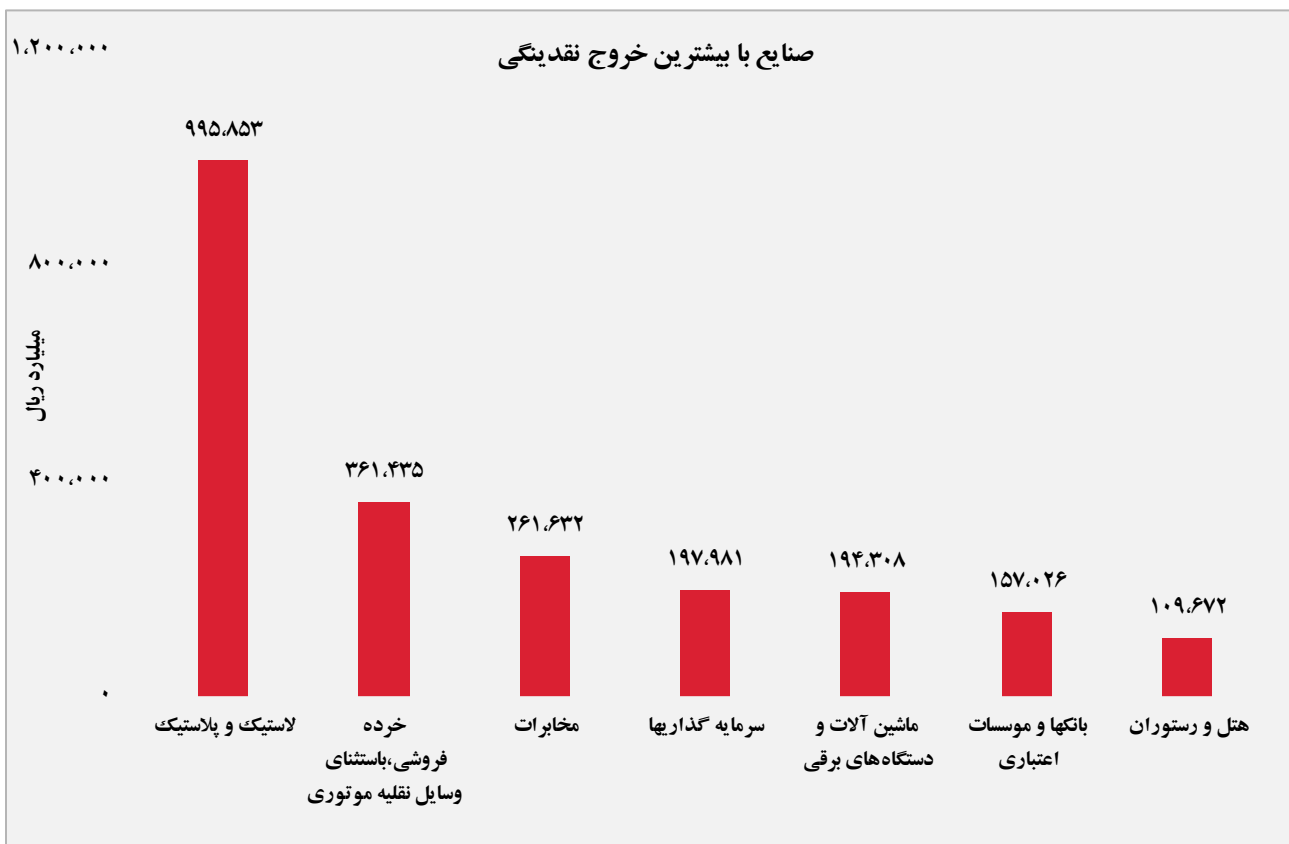
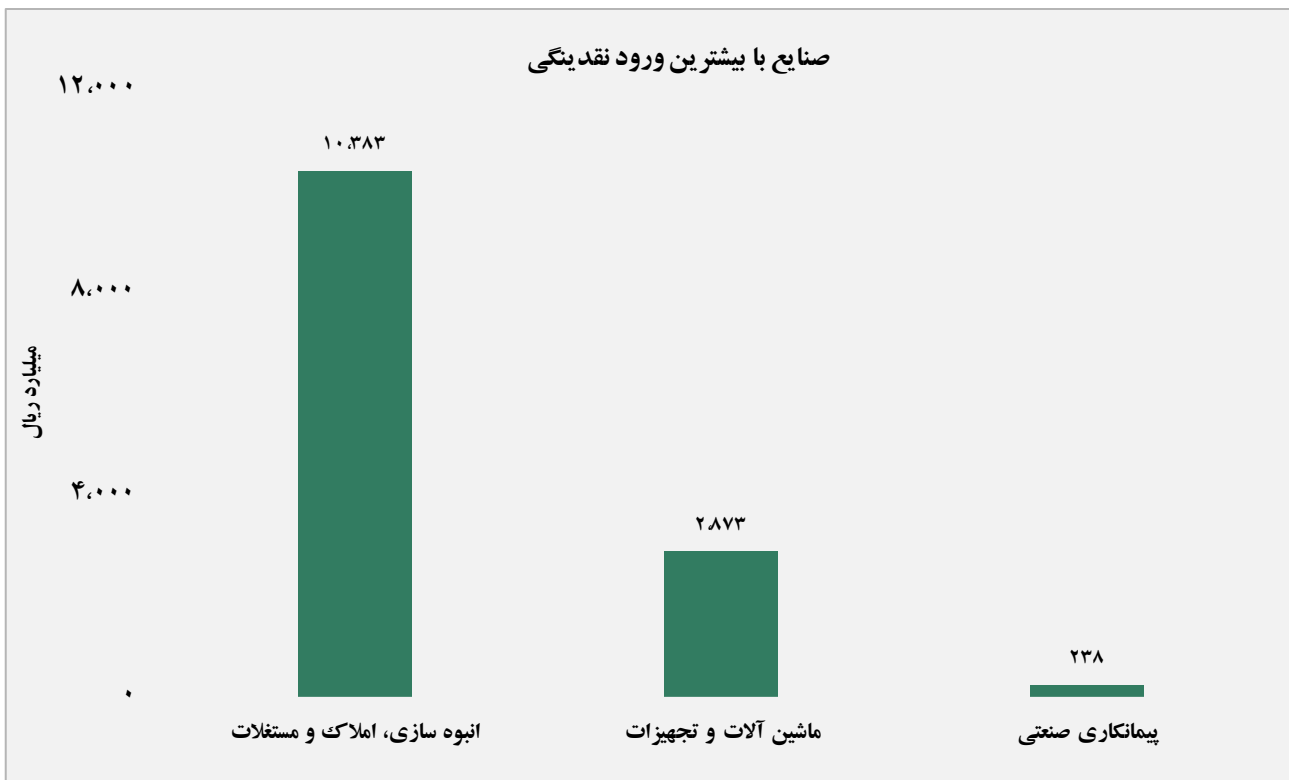
بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

| ردیف | نماد | ردیف | نماد |
|------|-------|------|-------|
| ۱ | فولاد | ۱۱ | کگل |
| ۲ | وسپهر | ۱۲ | وغدیر |
| ۳ | فملی | ۱۳ | فخوز |
| ۴ | وبملت | ۱۴ | فارس |
| ۵ | پپاس | ۱۵ | فایرا |
| ۶ | سیتا | ۱۶ | غگل |
| ۷ | وپست | ۱۷ | شغدیر |
| ۸ | وپارس | ۱۸ | شکبیر |
| ۹ | سیتا | ۱۹ | شستا |
| ۱۰ | میدکو | ۲۰ | پترول |

ورود و خروج نقدینگی به/از صنایع



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار