



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۱۵

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۱۵ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فملی، وپاسار، فولاد، وبملت، فارس، شستا و فخوز با افزایش ۵.۲۰۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۷۲.۲۴۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۲ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۲۳ 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 برعکس روز گذشته بعضی از نمادها در گروه های بانک، فلزات اساسی و شیمیایی با معاملات بهتری داشتند و با افزایش تقاضا همراه بودند.

در چند روز گذشته خبرهای متفاوتی از تحولات ارزی به بازار سهام مخابره شده است. خبر آزاد سازی دارایی های ارزی ایران در چند کشور، نرخ ارز را در دو روز کاری گذشته حدود ۲ هزار تومان کاهش داده است. اما آنچه مشخص است، اختلافاتی بر سر برجام بین ایران و گروه ۱+۵ وجود دارد که هنوز به صورت کامل برطرف نشده است. هر چه مدت زمان توافق نهایی برجام به طول بیانجامد، بازار سرمایه نیز در بلاتکلیفی به سر خواهد برد و به نظر می رسد، تا مشخص نشدن کف قیمتی قطعی برای نرخ دلار، بازار سهام دستخوش تغییرات قیمتی مهمی نخواهد شد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۵۴.۹۷۸ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، تغییر محسوسی نداشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۳۴، 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 ۹۰۱، تاریخ سررسید ۱۴۰۱/۰۶/۲۱ با ۲۲.۳٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۱۳	۱۴۰۰/۰۲/۱۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۵۳,۰۹۰	۵۴,۹۷۸	۴٪

گروه های مؤثر



در گروه شیمیایی، مقدار تولید پتروشیمی بوعلی سینا به طور متوسط در سال گذشته برای هر ماه ۱۱۹ هزار تن بوده است که در فروردین با افزایش چشمگیر به ۱۴۸ هزار تن رسیده است. این شرکت در سال گذشته به طور متوسط فروش ۱۳۹ هزار تنی داشته است و این عدد در اسفند و فروردین به ترتیب ۱۴۲ و ۱۵۱ هزار تن بوده است. متوسط مبلغ فروش شرکت در سال قبل ۱۰۷۰ میلیارد تومان بوده است که این عدد در فروردین و اسفند به ترتیب ۶۵۰ و ۱۸۰۹ میلیارد تومان ثبت شده است. نرخ فروش محصولات در سال گذشته به طور متوسط ۷۵۰۰ تومان در هر کیلو بوده و این عدد در فروردین به ۱۲۶۵۳ تومان به ازای هر کیلو رسیده است.

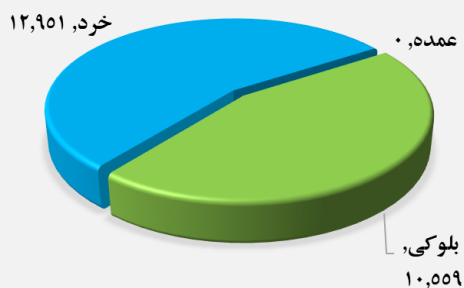
در گروه خودرو، شرکت خودروسازی سایپا در فروردین ماه فروش ۲۱۹۸ میلیارد تومانی داشته است. فروش کل سال مالی قبل ۱۶۱۶۱ میلیارد تومان و میانگین ماهانه ۱۳۴۷ میلیارد تومان ثبت شده است. این شرکت در فروردین ۲۱ هزار ۳۰۰ دستگاه خودرو تولید داشته در حالی که میانگین فروش ماهانه سال گذشته ۲۴ هزار و ۸۰۰ دستگاه می باشد و فروش فروردین ماه سال مالی گذشته نیز ۱۶ هزار و ۸۰۰ دستگاه بوده است. شرکت در فروردین ماه به طور میانگین هر دستگاه خودرو را به قیمت ۹۱ میلیون تومان فروخته که میانگین این نرخ در سال مالی گذشته ۵۴ میلیون تومان بوده است.

در گروه شیمیایی، پتروشیمی تخت جمشید سال مالی منتهی به شهریور دارد. در فروردین ماه این شرکت ۷۰۴۲ تن تولید داشته، میانگین تولیدات سال مالی ۱۴۰۰ به ۶۲۷۱ تن رسیده و این عدد در سال مالی گذشته ۴۹۲۵ تن گزارش شده است. فروش فروردین ماه ۵۲۳۰ تن بوده و در سال جاری در مجموع ۴۲۵۵۶ تن فروش داشته و فروش سال مالی قبل نیز ۵۸۸۵۱ تن ثبت شده است. درآمد فروش شرکت در فروردین ماه ۱۹۸ میلیارد تومان می باشد، متوسط مبلغ فروش ماهانه در سال مالی جاری ۲۱۲ میلیارد تومان است. میانگین نرخ فروش شرکت در اسفند و فروردین به ترتیب ۳۴۹۰۹۷ و ۳۷۸۷۰۷ ریال در هر کیلو گزارش شده است.

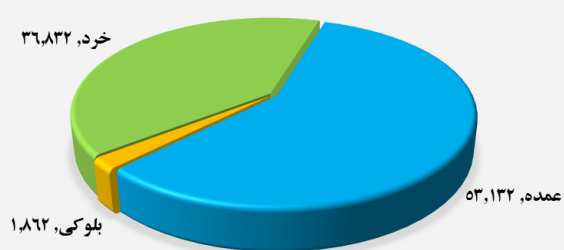
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۴۲۵	شاخص کل	۱,۱۷۲,۲۴۹	شاخص کل
۷۸۹	تغییر شاخص	۵,۲۰۳,۸۶	تغییر شاخص
۱۱,۷۹۹,۱۴۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۹۰۰,۰۸۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۶۰,۴۹۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۱,۵۸۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
میدکو		فملی	
آریا		وپارس	
دماوند		فولاد	
زاگرس		وبملت	
شگویا		فارس	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کگهر		شینا	
ذوب		رمپنا	
ارفع		شتران	
مارون		خودرو	
بجهرم		شبندر	
(۳,۳۱۵)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۷۱۸		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	

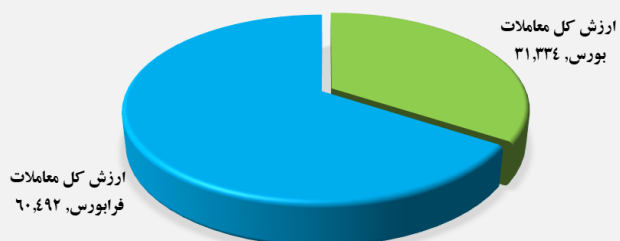
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد
(میلیارد ریال)



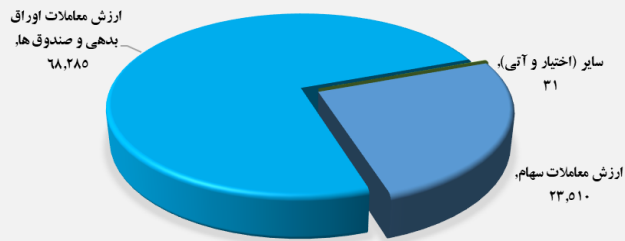
ارزش کل معاملات
(میلیارد ریال)



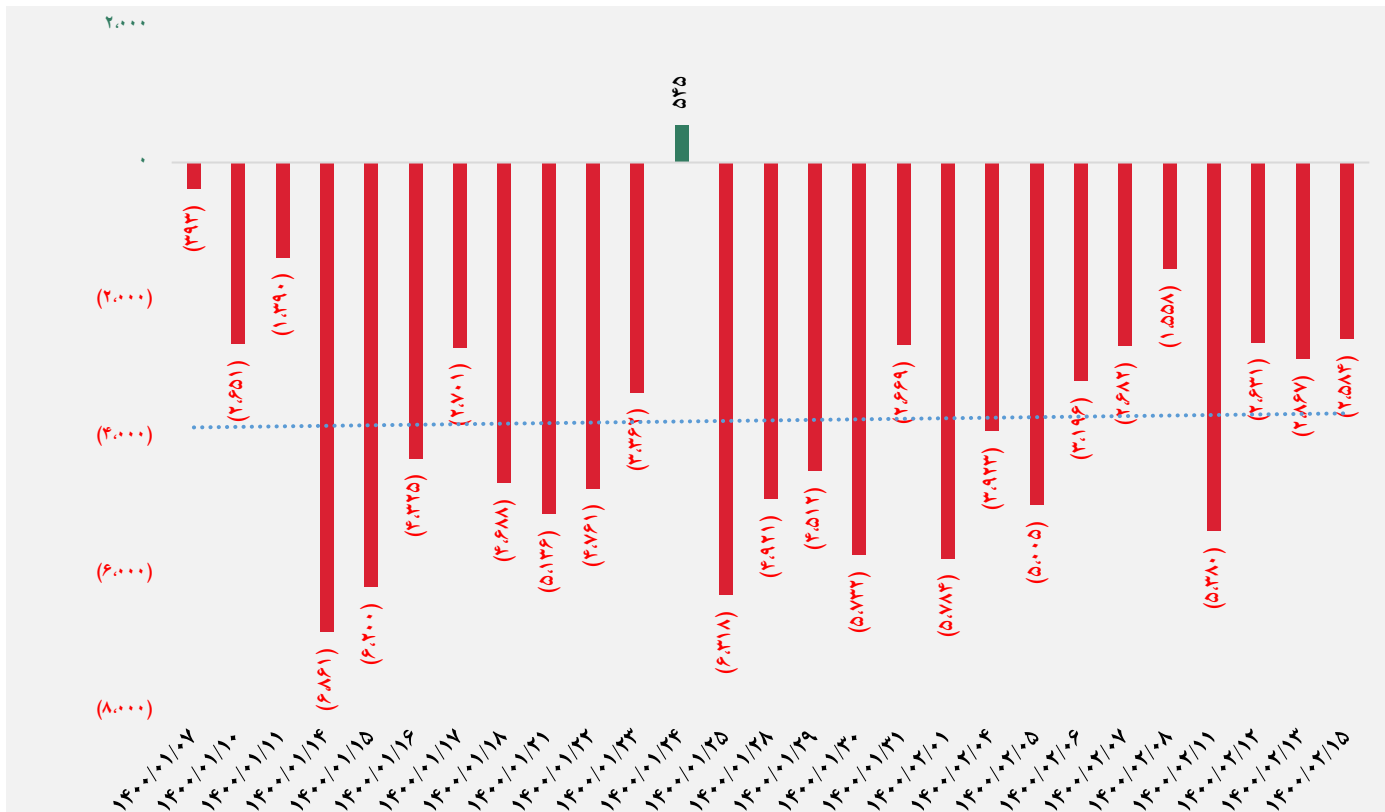
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس
(میلیارد ریال)



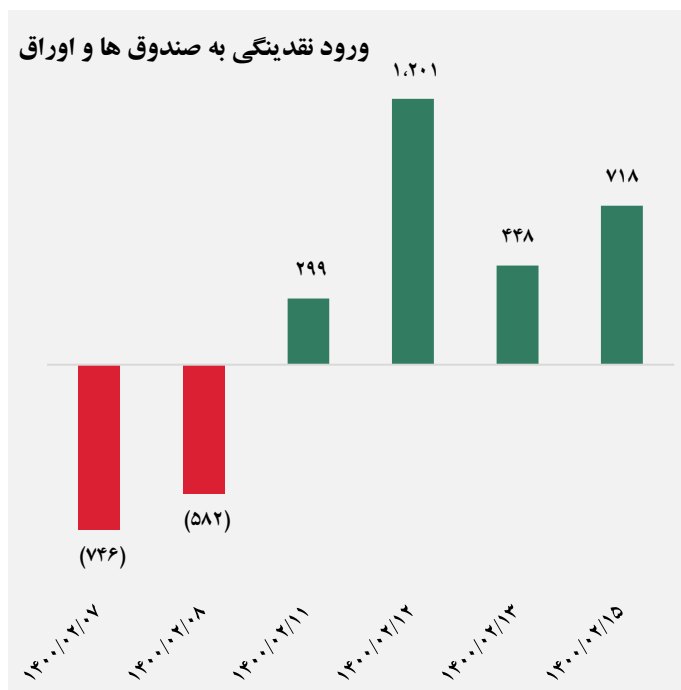
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها
(میلیارد ریال)



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

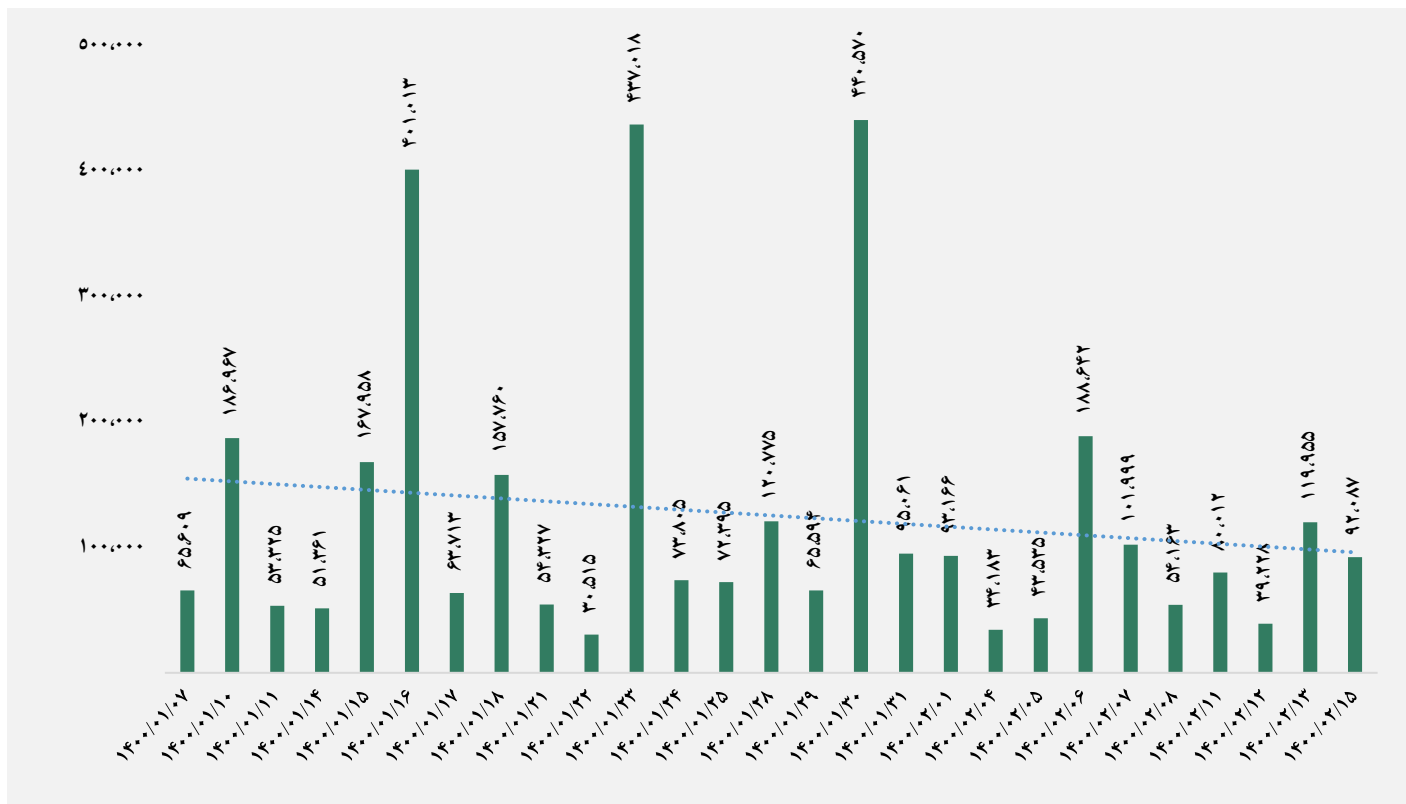


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

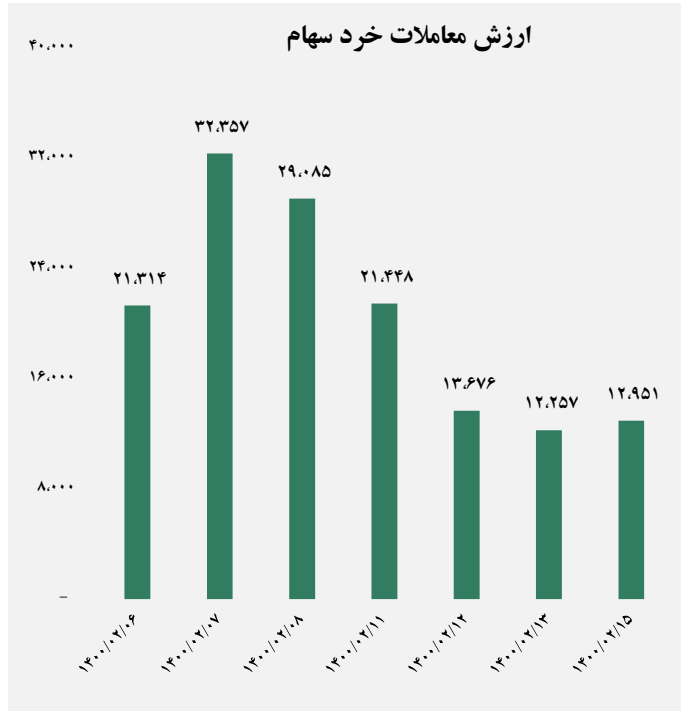
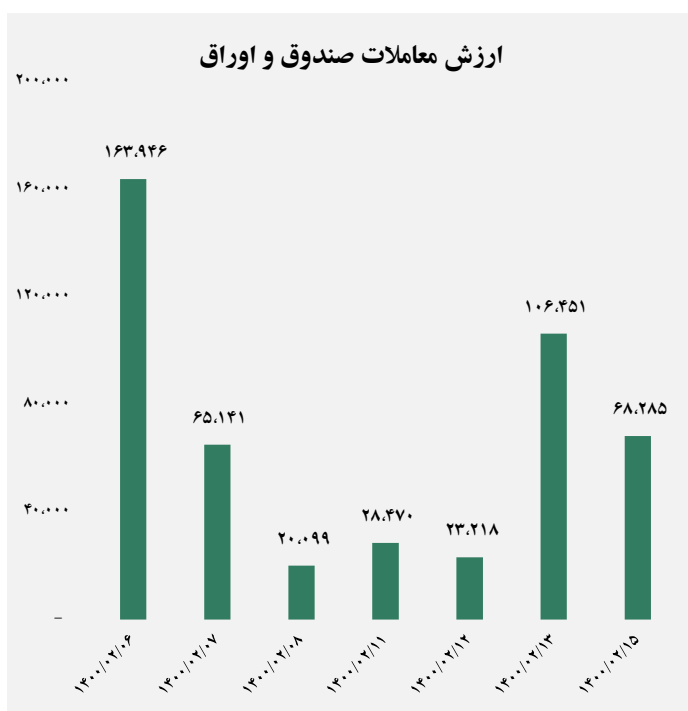


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

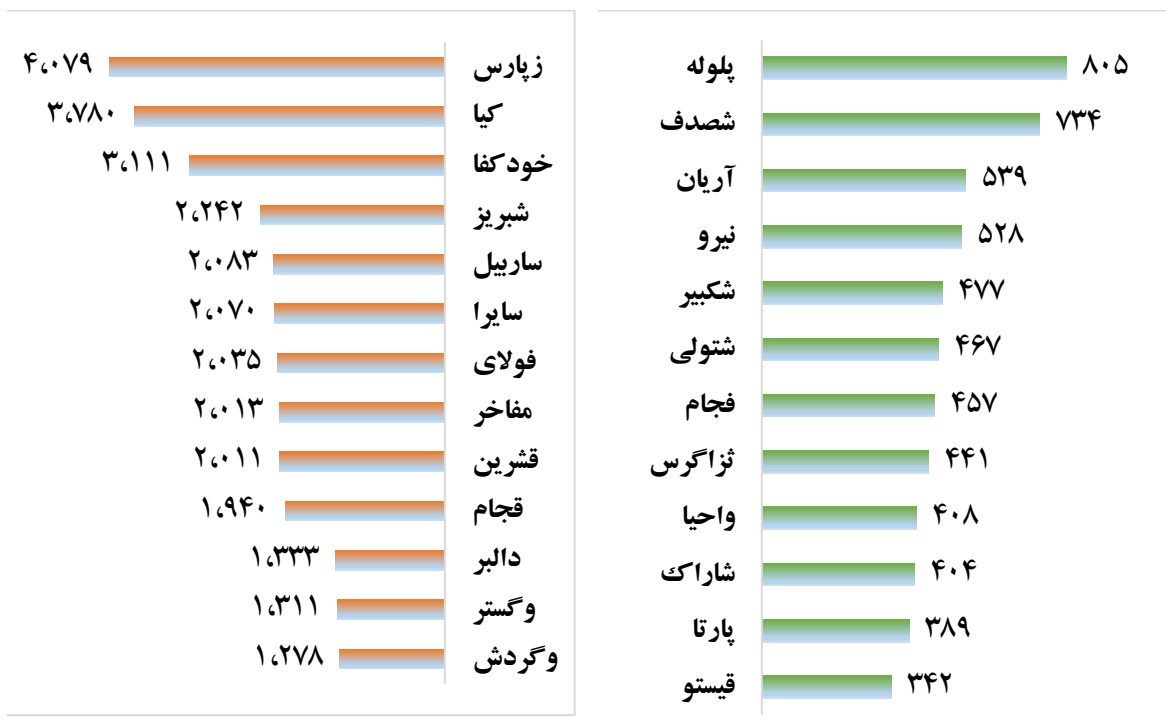


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

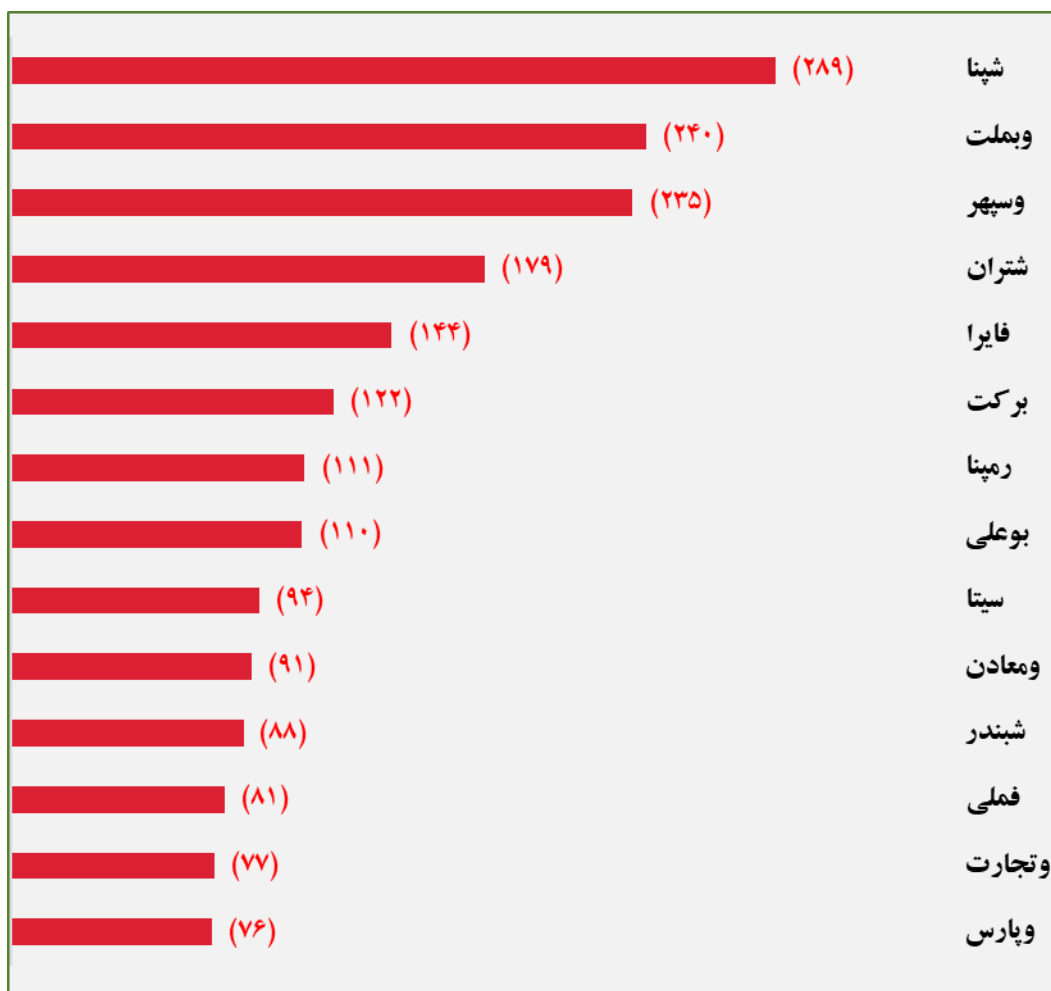


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	پارتا	۱	شپنا
۲	دعبید	۲	رمپنا
۳	شصدف	۳	ومعادن
۴	-	۴	رانفور
۵	-	۵	خودرو
۶	-	۶	شبهرن
۷	-	۷	بساما
۸	-	۸	وسکرد
۹	-	۹	پکرمان
۱۰	-	۱۰	وپستر



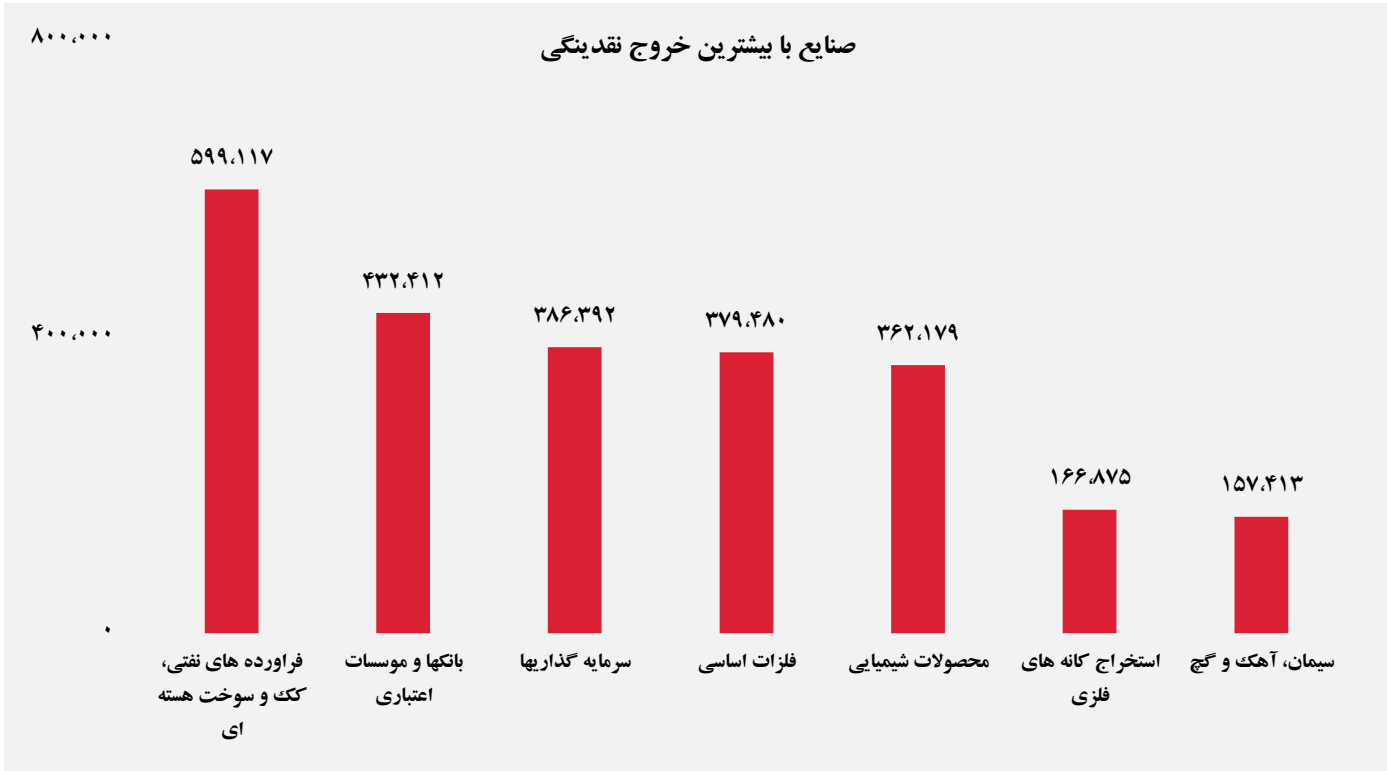
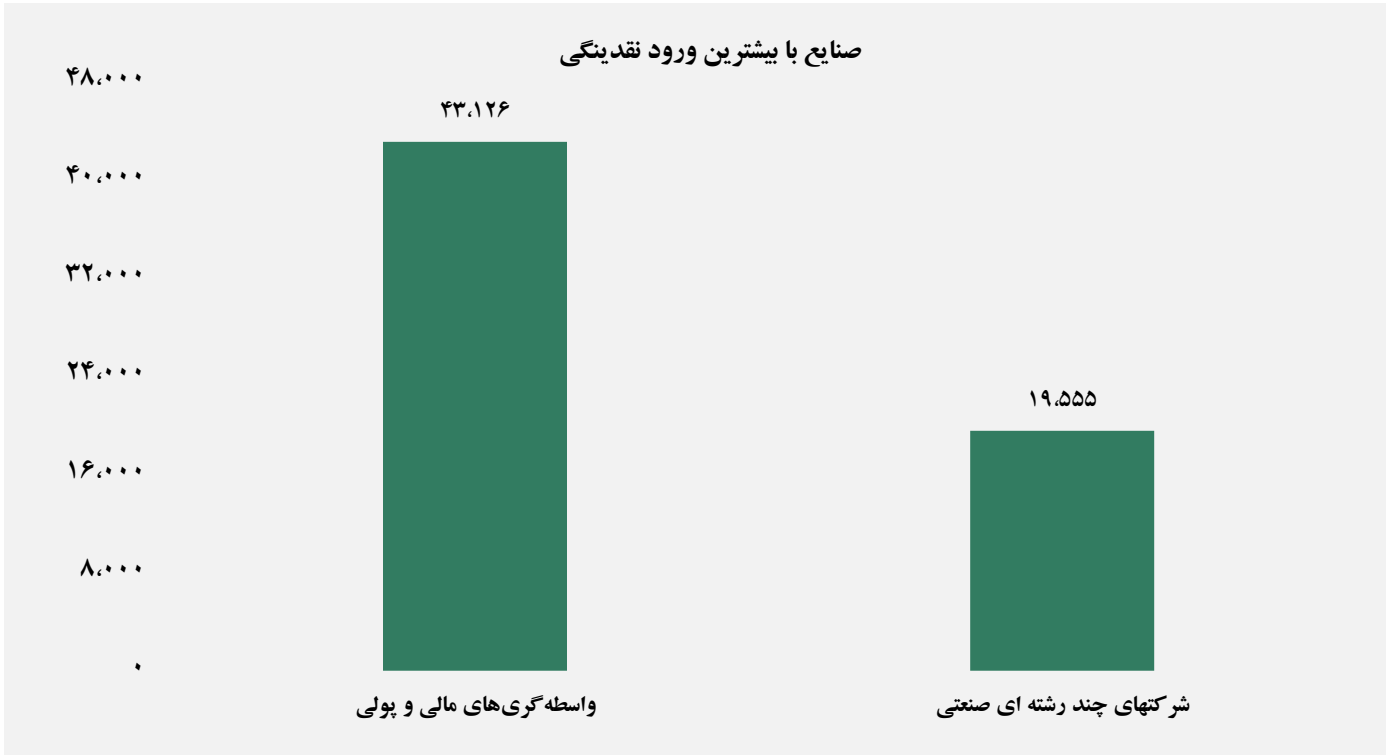
بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	فایرا
۲	جم پیلن	۱۲	افق
۳	وساخت	۱۳	شپنا
۴	ساراب	۱۴	ورازی
۵	بوعلی	۱۵	فاسمین
۶	سمازن	۱۶	زاگرس
۷	وتوس	۱۷	بساما
۸	شغدیر	۱۸	پکرمان
۹	دماوند	۱۹	شکبیر
۱۰	فباهنر	۲۰	پارتا

ورود و خروج نقدینگی به/از صنایع (میلیون ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار