



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۱۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۱۸ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای شستا، فارس، شینا، شتران، شبندر، خودرو و وغدیر با کاهش ۴.۷۵۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۶۷.۵۰۶ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۲ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۲۱ 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 بیشتر نمادها در اکثر گروه ها مانند بانک، فلزات اساسی، شیمیایی و... با کاهش تقاضا و فشار عرضه همراه بودند.

همانطور که در حجم و ارزش معاملات در چند وقت گذشته و جاری نمایان است، بازار سهام میل و رغبتی برای ایجاد افزایش تقاضا در خود نمی بیند و به نظر می رسد عامل اصلی این اتفاق، کاهش نرخ دلار و بالطبع کاهش تورم انتظاری در اقتصاد کشور می باشد. نرخ دلار در سامانه نیما بعد از مدت ها به کمتر از ۲۲۰ هزار ریال رسیده است و انتظار می رود تا زمانی که کف قیمتی دلار برای تحلیلگران و فعالین بورسی مشخص نگردد، افزایش قابل توجهی در ارزش معاملات در بازار سهام نخواهیم داشت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۸.۲۸۵ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته 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 ۸۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ با ۲۳.۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۱۵	۱۴۰۰/۰۲/۱۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۵۴,۹۷۸	۲۸,۲۸۵	-۴۹٪



گروه‌های مؤثر

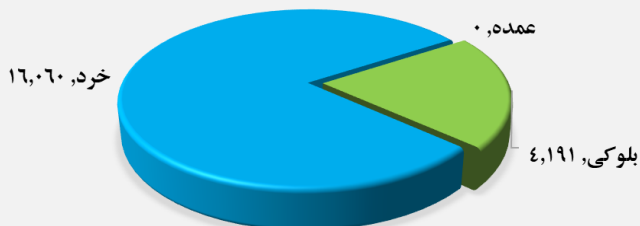
در گروه شیمیایی، شرکت دوده صنعتی پارس در سه فصل اول سال مالی گذشته به ترتیب ۶۱، ۸۱ و ۹۷ میلیارد تومان فروش داشت و در فصل آخر نیز ۱۰۲ میلیارد تومان فروش گزارش کرده است و نهایتاً به فروش سالانه ۳۴۱ میلیارد تومانی در سال ۱۳۹۹ رسیده که رشد ۲۹ درصدی نسبت به مدت مشابه سال ۱۳۹۸ دارد. در سال مالی ۱۳۹۸، ۲۶۴ میلیارد تومان فروش گزارش کرده بود. حاشیه سود ناخالص فصل اول ۲۹ درصد، در فصل دوم ۲۸ درصد و فصل سوم ۲۴ درصد ثبت شد. در فصل آخر نیز حاشیه سود ۲۸ درصد بوده است. در سال مالی ۹۸ حاشیه سود ناخالص ۲۰ درصد بود. سود عملیاتی ۱۲ ماهه این شرکت ۸۴ میلیارد تومان است که رشد ۷۹ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه ۹۸ دارد. شرکت در کل سال مالی گذشته سود عملیاتی ۴۷ میلیارد تومانی داشته است. شرکت دوده صنعتی پارس در فصل چهارم سال مالی ۱۳۹۹، ۴۴۸ ریال سود به ازای هر سهم محقق کرده است. در فصل اول، دوم و سوم سود هر سهم شرکت به ترتیب ۲۷۵، ۳۰۱ و ۳۹۱ ریال بوده است. نهایتاً این شرکت در ۱۲ ماهه سال مالی ۱۳۹۹ توانست ۱۴۱۴ ریال سود به ازای هر سهم بسازد که ۹۲ درصد بیشتر از سود سال گذشته است.

در گروه فلزات اساسی، شرکت ذوب روی اصفهان در سه فصل اول به ترتیب فروش ۵۲، ۱۳۰ و ۱۴۶ میلیارد تومانی را داشت و در فصل آخر هم ۲۰۹ میلیارد تومان فروش گزارش کرده است و نهایتاً در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته به فروش ۵۳۷ میلیارد تومانی رسید که رشد ۸۰ درصدی نسبت به مدت مشابه سال گذشته دارد. در سال مالی ۹۸، این شرکت فروش ۲۹۸ میلیارد تومانی را گزارش کرده بود. حاشیه سود ناخالص فصل اول ۵۳ درصد، در فصل دوم ۵۸ درصد و فصل سوم ۵۶ درصد گزارش کرده بود و در فصل آخر نیز حاشیه سود به ۴۳ درصد رسیده است. در سال مالی ۱۳۹۸ نیز حاشیه سود ناخالص ۳۸ درصد ثبت شده بود. سود عملیاتی ۱۲ ماهه این شرکت ۲۶۵ میلیارد تومان است که رشد ۱۱۶ درصدی نسبت به سال مالی ۱۳۹۸ دارد. همچنین این شرکت در سال مالی ۱۳۹۸، ۱۲۳ میلیارد تومان سود عملیاتی همراه بوده است. این شرکت در فصل چهارم سال مالی گذشته به ازای هر سهم ۷۶۱ ریال سود داشته است. در نهایت شرکت ذوب و روی اصفهان ۶۹۳۸ ریال سود به ازای هر سهم در ۱۲ ماهه سال مالی ۱۳۹۹ محقق کرده است.

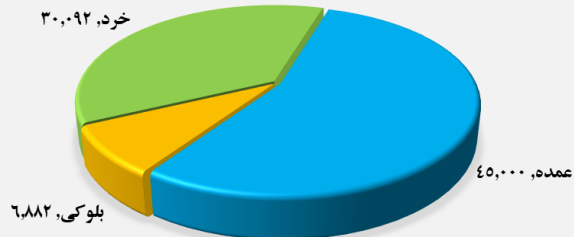
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۳۶۵	شاخص کل	۱,۱۶۷,۴۹۸	شاخص کل
(۵۹.۷۷)	تغییر شاخص	(۴,۷۶۴.۰۷)	تغییر شاخص
۱۱,۷۵۸,۶۲۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۷۰۴,۵۱۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۵۵,۰۰۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۶,۹۶۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
دماوند		فملی	
-		وپاسار	
-		دعیید	
-		جم پیلن	
-		وبصادر	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کگهر		شستا	
آریا		فارس	
ذوب		شینا	
شگویا		شتران	
ارفع		شبندر	
(۴,۳۱۴)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۷۳۰		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	

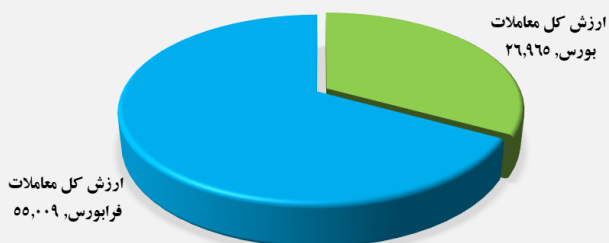
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد
(میلیارد ریال)



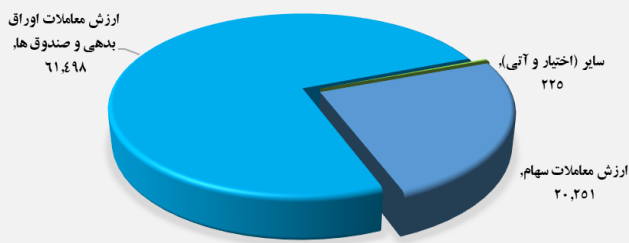
ارزش کل معاملات
(میلیارد ریال)



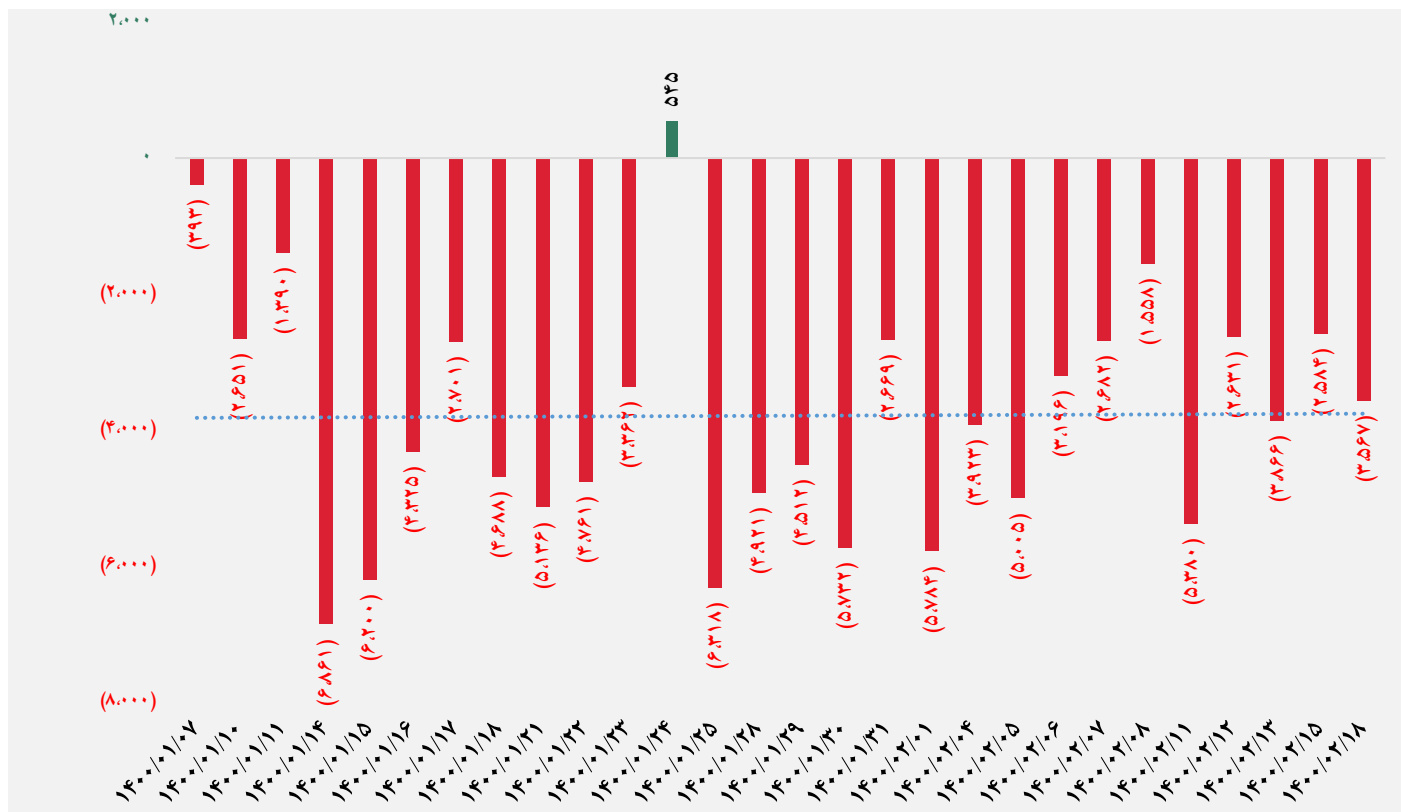
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس
(میلیارد ریال)



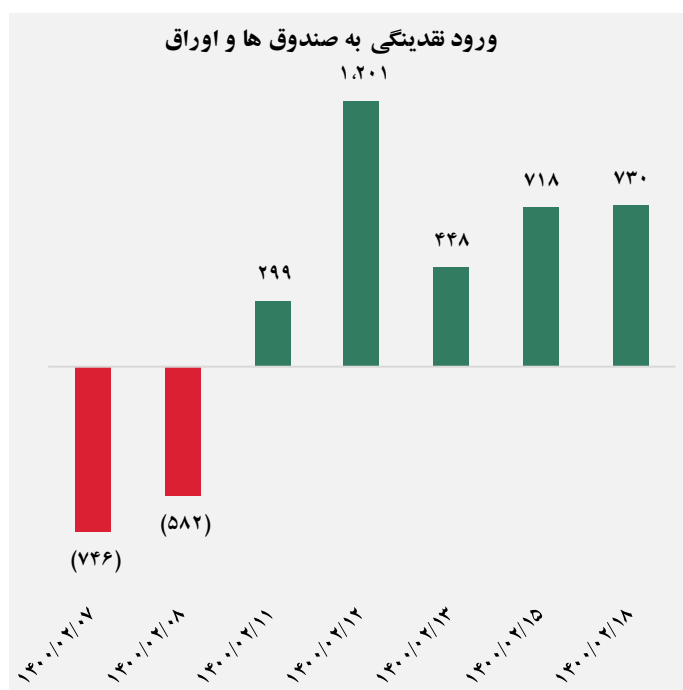
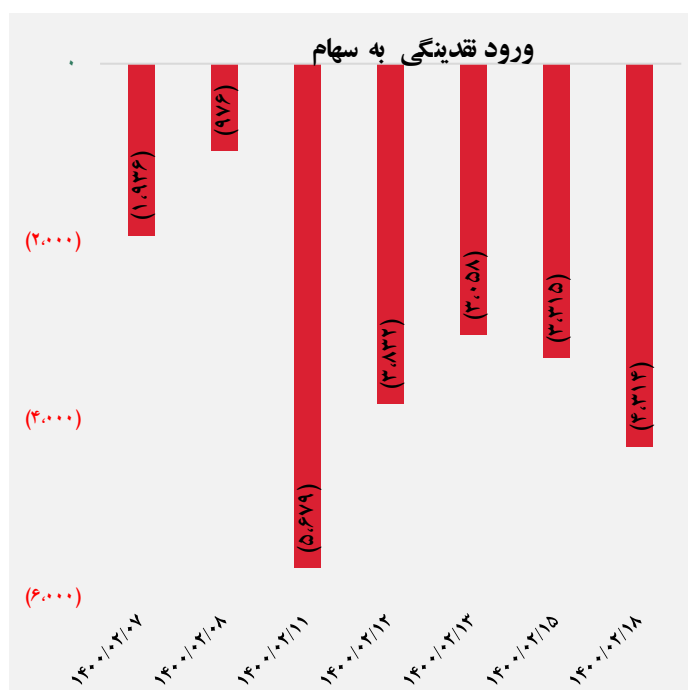
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها
(میلیارد ریال)



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

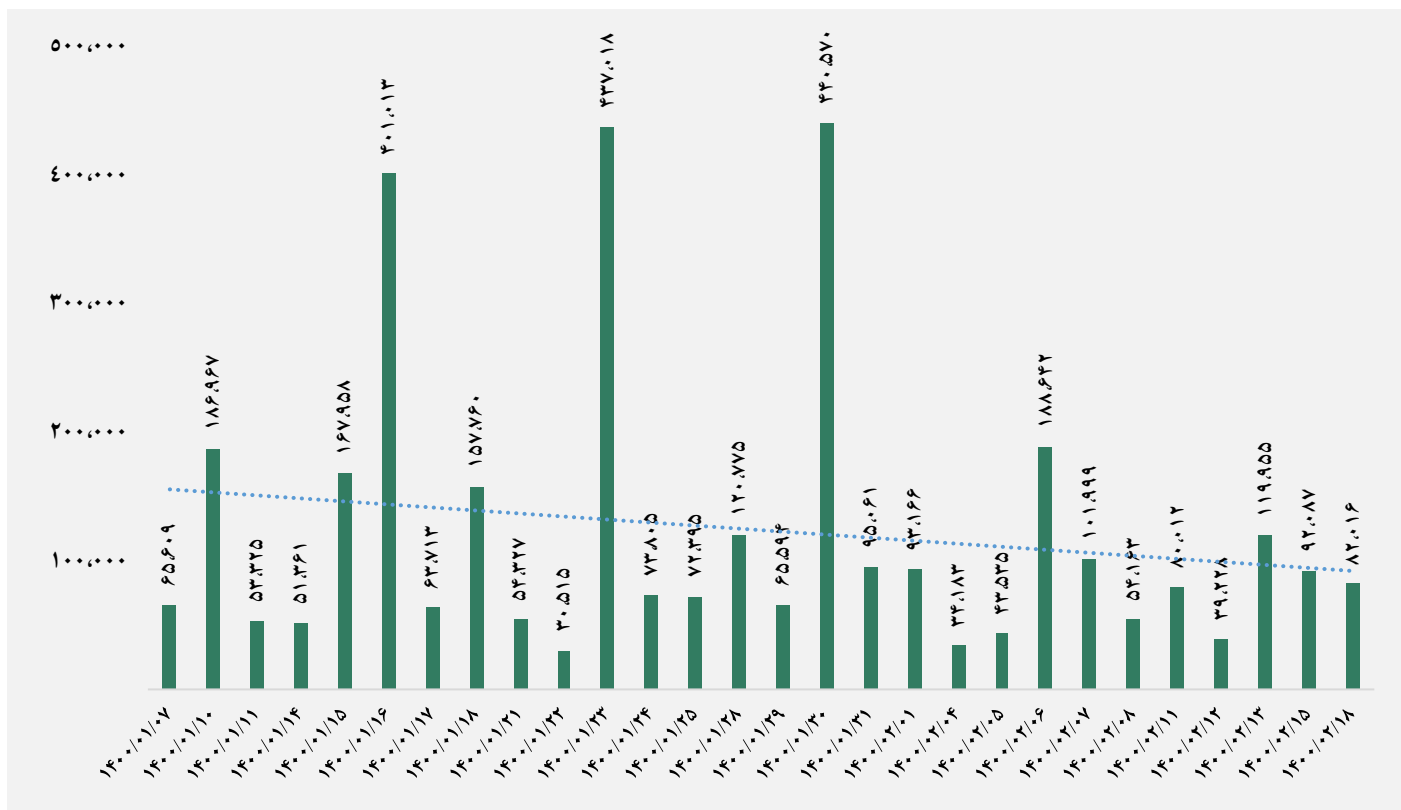


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

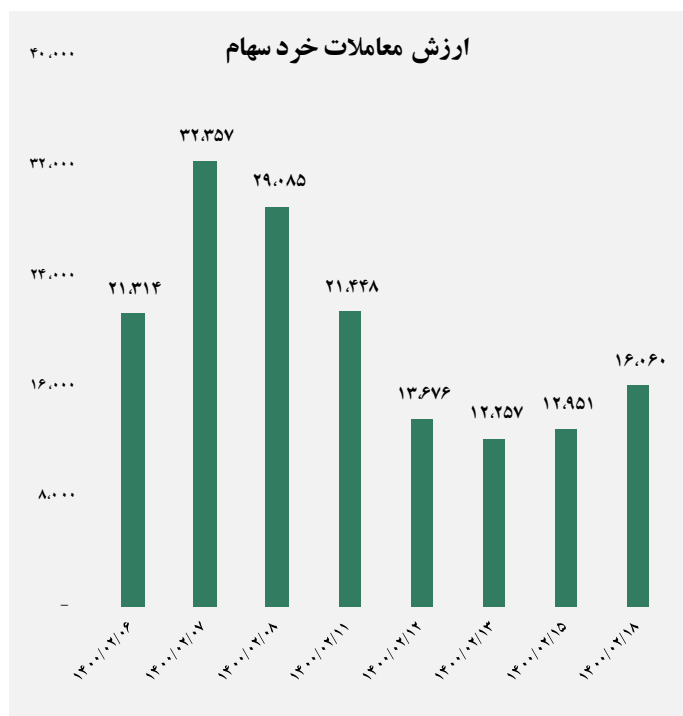
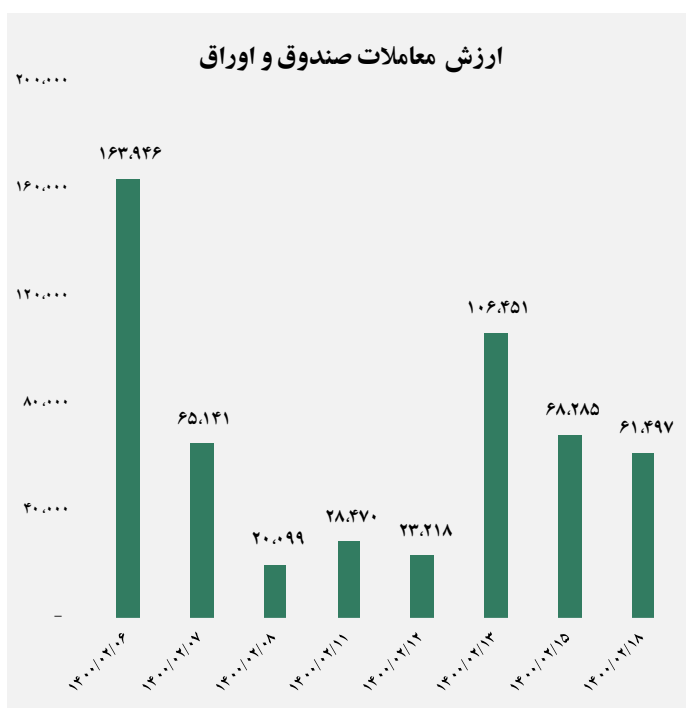


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



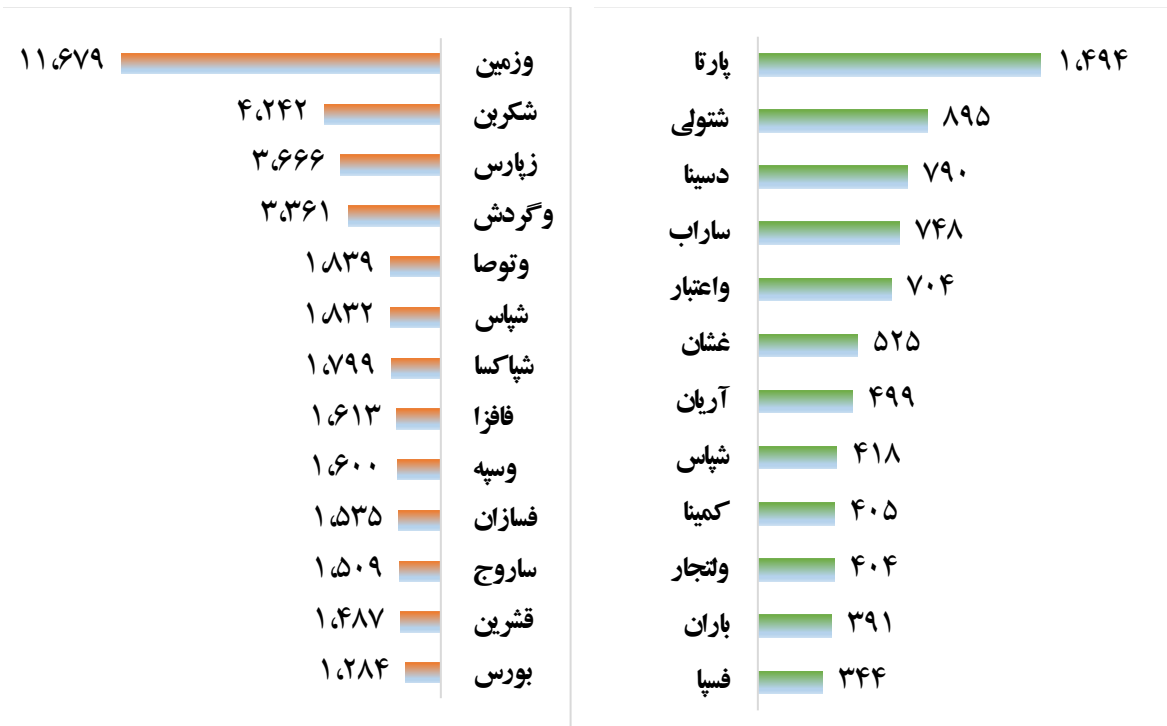
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



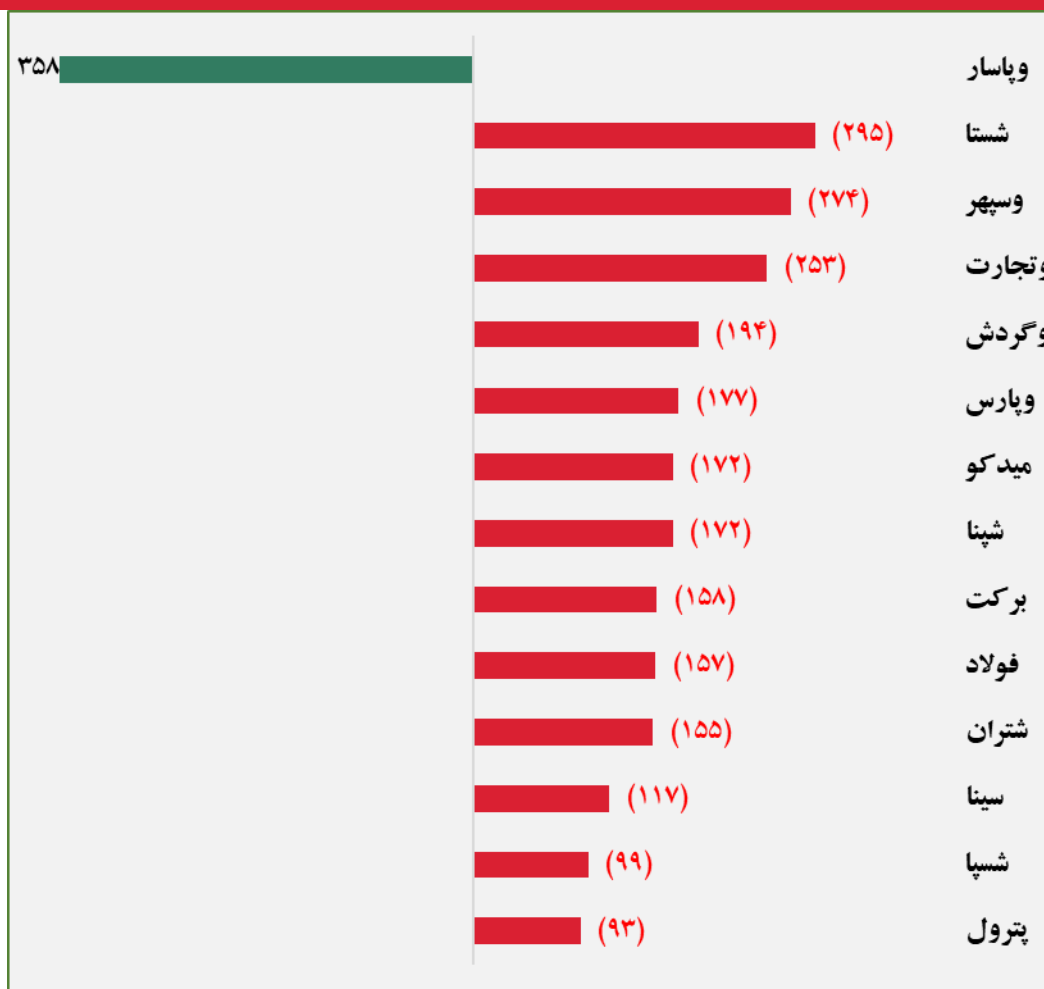
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	تماوند	۱	شصفا
۲	پارتا	۲	مفاخر
۳	-	۳	وزمین
۴	-	۴	وتوس
۵	-	۵	ونفت
۶	-	۶	ساروم
۷	-	۷	وگردش
۸	-	۸	شاملا
۹	-	۹	ساروج
۱۰	-	۱۰	شسپا

گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)

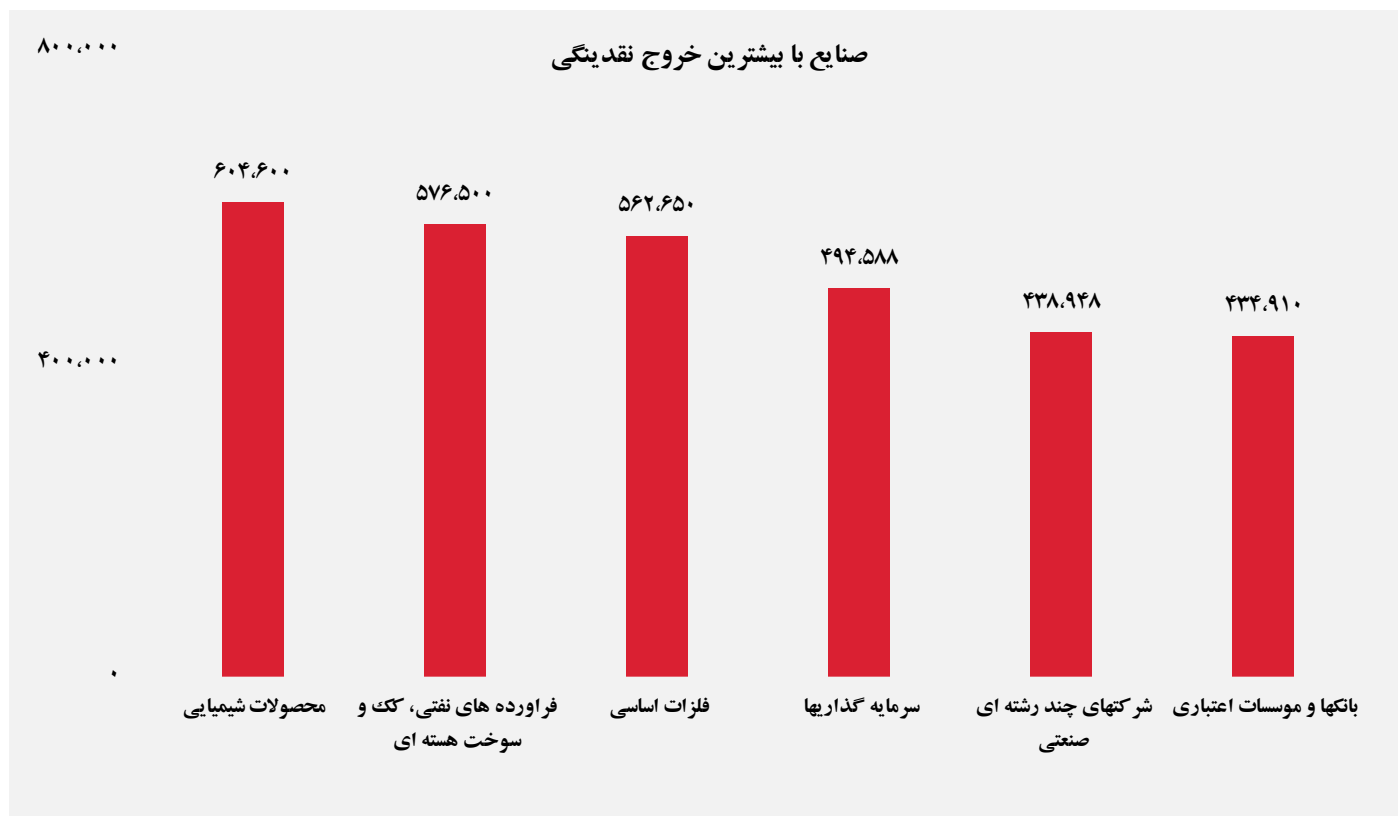
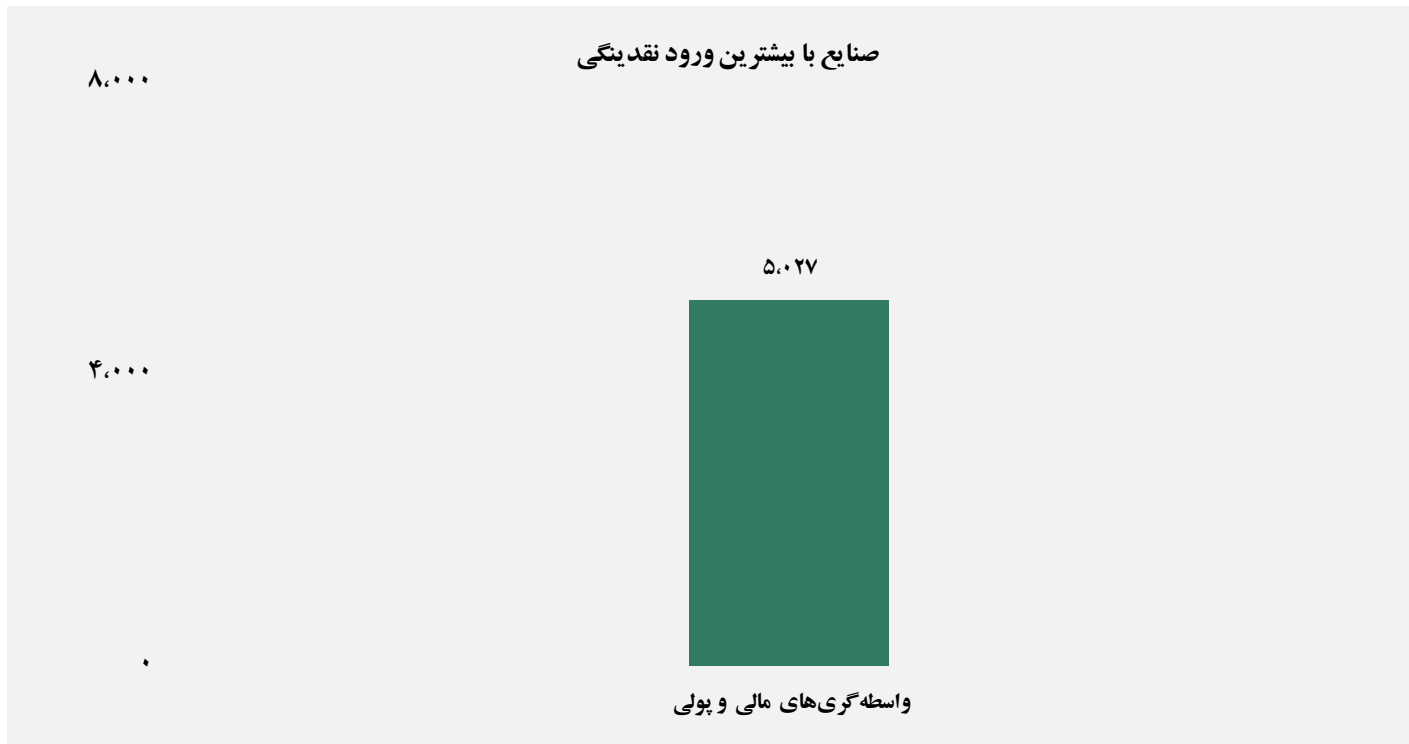


واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	جم پیلن	۱۱	دماوند
۲	برکت	۱۲	ونفت
۳	شغدیر	۱۳	ورازی
۴	ساراب	۱۴	فاسمین
۵	وساخت	۱۵	وگردش
۶	دعید	۱۶	زاگرس
۷	سمازن	۱۷	ویپاسار
۸	وزمین	۱۸	سفارس
۹	بوعلی	۱۹	شپدیس
۱۰	وتوس	۲۰	آریا



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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر