



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۱۹

[www.sfg.ir](http://www.sfg.ir) - [info@sfg.i](mailto:info@sfg.i)



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۹ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فارس، فملی، شستا، کچاد، تایپکو و شپنا با کاهش ۱۵.۵۹۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۵۱.۸۷۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش 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 بیشتر نمادها در اکثر گروه‌ها با کاهش تقاضا و فشار عرضه همراه بودند.

شاخص کل از نظر تکنیکال از سقف مرداد ماه سال گذشته تا به امروز یک حرکت دیامتریک داشته است. طی ۳ ماه اخیر حرکت شاخص کل علی‌رغم تغییراتی که در دامنه نوسان ایجاد شده بود، شاخه F از این موج اصلاحی را تکمیل کرد و در حال حاضر نیز در حال تکمیل موج G می‌باشد. به نظر می‌رسد شاخص کل تا حوالی ۱ میلیون الی ۱.۰۵۰.۰۰۰ واحد نزول پیدا کند و بعد از اتمام الگو جاری، می‌توان انتظار رشد حرکتی به سمت ۱.۵۰۰.۰۰۰ واحد را داشت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲.۱۰۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق منفعت دولت با نماد افاد ۶۱۴، 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 ۸۰۴، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۱ با ۲۳.۲٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۱۸	۱۴۰۰/۰۲/۱۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۸,۲۸۵	۲,۱۰۲	-۹۳٪



## گروه‌های مؤثر

در گروه سیمان، شرکت سیمان ساوه در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۷۲۱ میلیارد تومان فروش داشت که نسبت به دوره ۱۲ ماهه سال مالی ۱۳۹۸، ۸۴ درصد رشد را ثبت کرده است. همچنین فروش فصل چهارم که ۱۹۹ میلیارد تومان بود، نسبت به فصل گذشته کاهش ۹ درصدی داشته است. حاشیه سود ناخالص، عملیاتی و خالص در فصل چهارم به ترتیب ۶۰، ۳۷ و ۳۹ درصد بوده که نسبت به فصل قبل افت تقریبی ۹ درصدی را داشته است. این شرکت در نه ماهه سال مالی گذشته ۳۹۹۰ ریال سود به ازای هر سهم کسب کرده بود. در فصل چهارم نیز توانست سود ۱۱۸۴ ریالی را به دست آورد و سود ۱۲ ماهه خود را به ۵۱۷۵ ریال رسانده است.

در گروه فلزات اساسی،

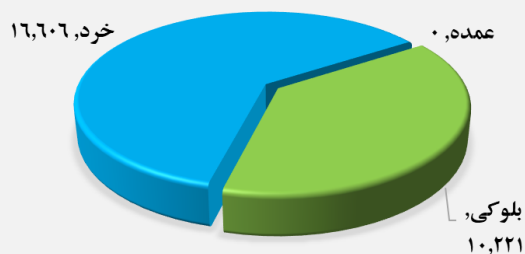
در گروه دارویی، شرکت سینا دارو در فروردین ماه ۱۶ میلیارد تومان فروش داشته و نسبت به مدت مشابه سال مالی ۱۳۹۸ کاهش ۳۴ درصدی داشته است. کل فروش سال گذشته ۴۱۱ میلیارد تومان بود. قطره و پماد محصولات اصلی این شرکت بوده و تقریباً ۷۰ درصد درآمد را تشکیل می‌دهند. نرخ قطره در این ماه ۵۴۱۶ تومان و پماد ۳۳۵۹ تومان به ازای هر عدد بوده است. شرکت محصول قطره را در سال مالی ۱۳۹۸، ۲۸۹۸ تومان و پماد را با نرخ ۲۱۶۲ تومان فروخته است.

در گروه استخراج کانه‌های فلزی، شرکت باما در فروردین ماه فروش ۱۱۴ میلیارد تومانی داشته است. شرکت در سال مالی گذشته ۷۴۱ میلیارد تومان فروش داشته که میانگین ماهانه فروش ۶۲ میلیارد تومان بوده است. میزان فروش محصولات سرب و روی این ماه ۲۸۱۲ تن بوده که در سال گذشته به طور میانگین ماهانه ۳۰۶۹ تن فروخته است. میزان تولید محصولات سرب و روی باما در این ماه ۶۸۶۵ تن بود که نسبت به ماه گذشته رشد تقریباً ۲ برابری داشته است. این شرکت در سال گذشته به طور میانگین ماهانه ۳۱۴۵ تن تولید داشته است. نرخ فروش شمش روی در این ماه ۶۴ هزار تومان به ازای هر کیلو بوده که این عدد برای سال مالی گذشته، ۴۳ هزار تومان بوده است.

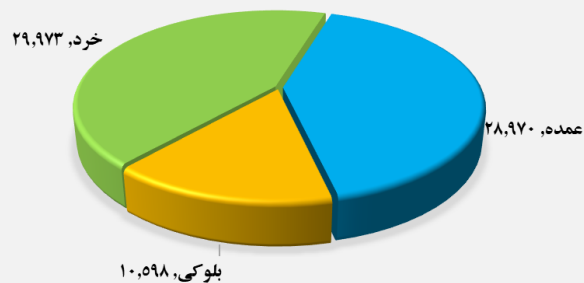
## تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۲۲۷	شاخص کل	۱,۱۵۱,۸۷۲	شاخص کل
(۱۳۸.۱۶)	تغییر شاخص	(۱,۲۰۷.۴۰)	تغییر شاخص
۱۱,۶۶۵,۱۳۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۰۷۹,۹۷۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۶,۰۲۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۳,۵۲۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>	
دماوند		سپ	
-		سازاب	
-		اپال	
-		فنوال	
-		واعتبار	
<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>	
بیاس		فولاد	
مارون		فارس	
آریا		فملی	
میدکو		شستا	
هرکز		کچاد	
(۷,۰۲۳)		ورود ( خروج ) نقدینگی به سهام ( میلیارد ریال )	
۱,۱۷۴		ورود ( خروج ) نقدینگی به صندوق ها و اوراق ( میلیارد ریال )	

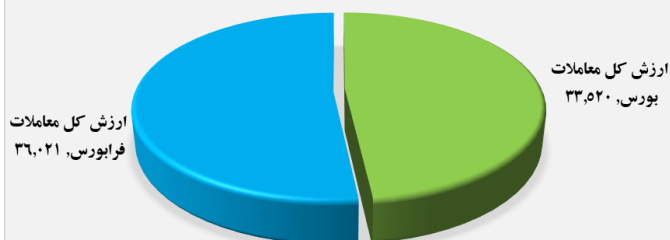
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد  
(میلیارد ریال)



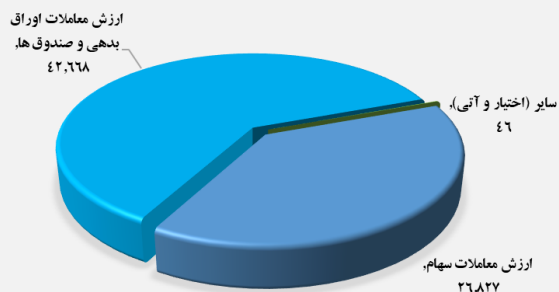
ارزش کل معاملات  
(میلیارد ریال)



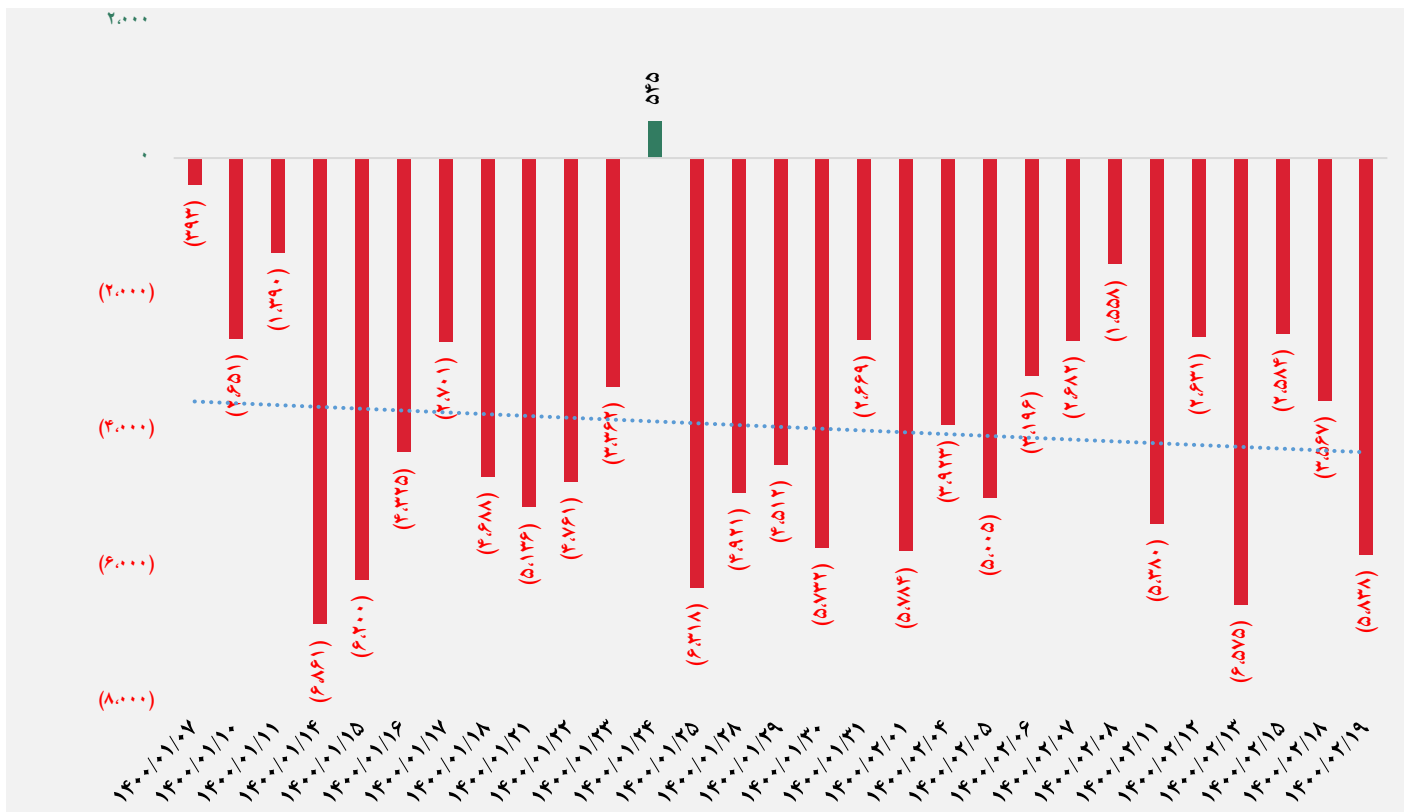
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس  
(میلیارد ریال)



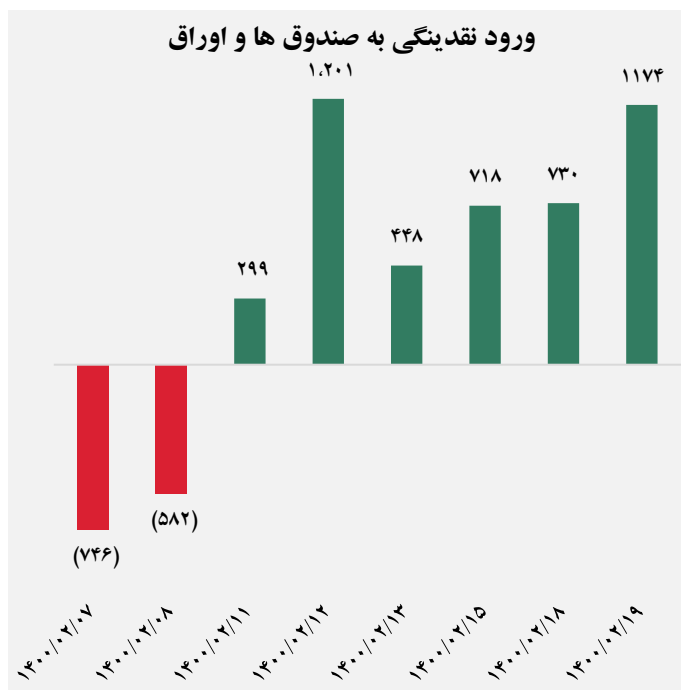
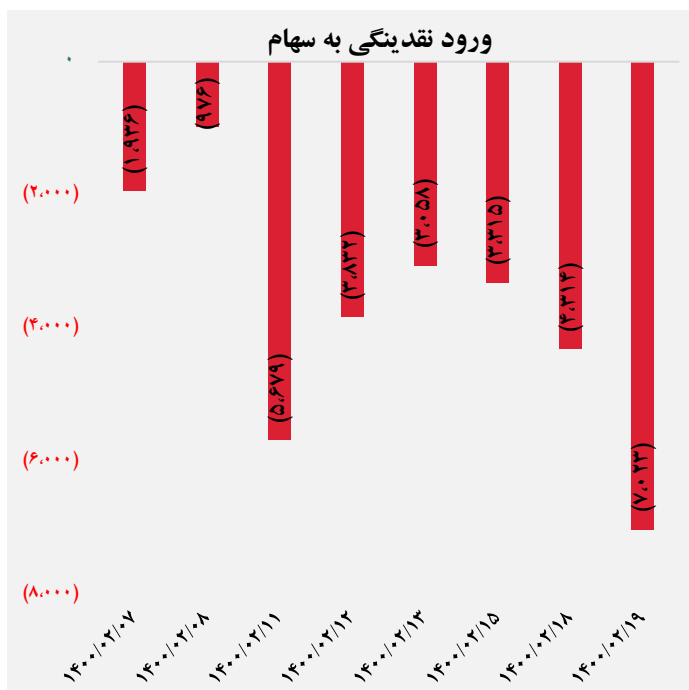
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها  
(میلیارد ریال)



## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



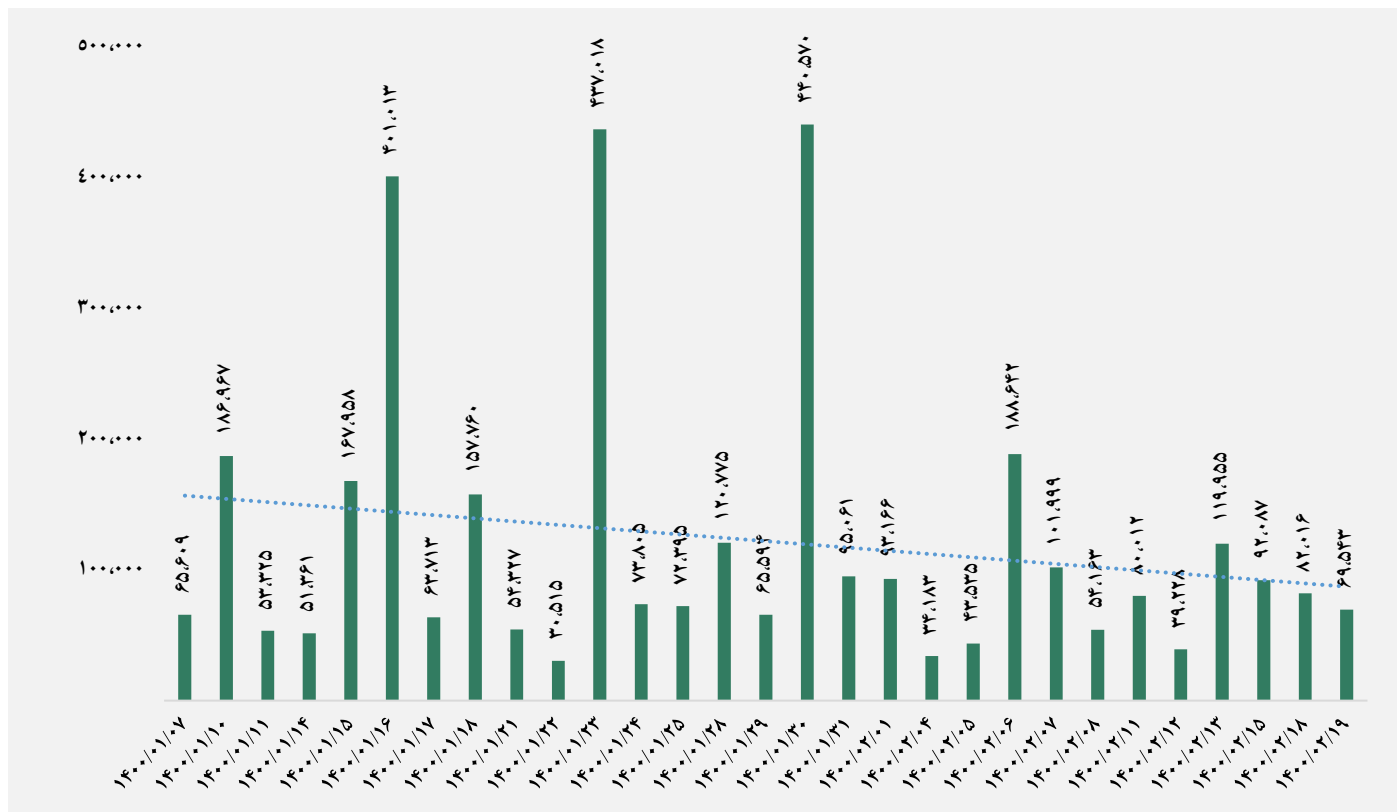
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



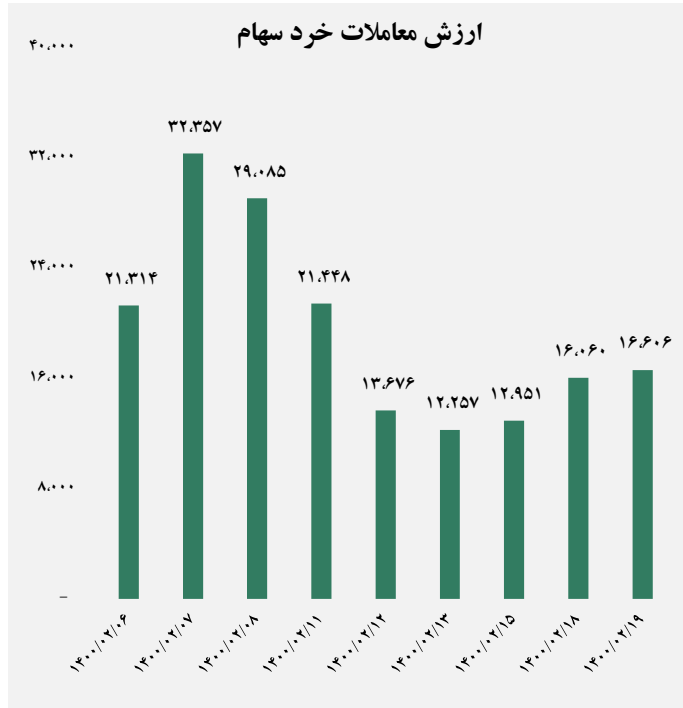
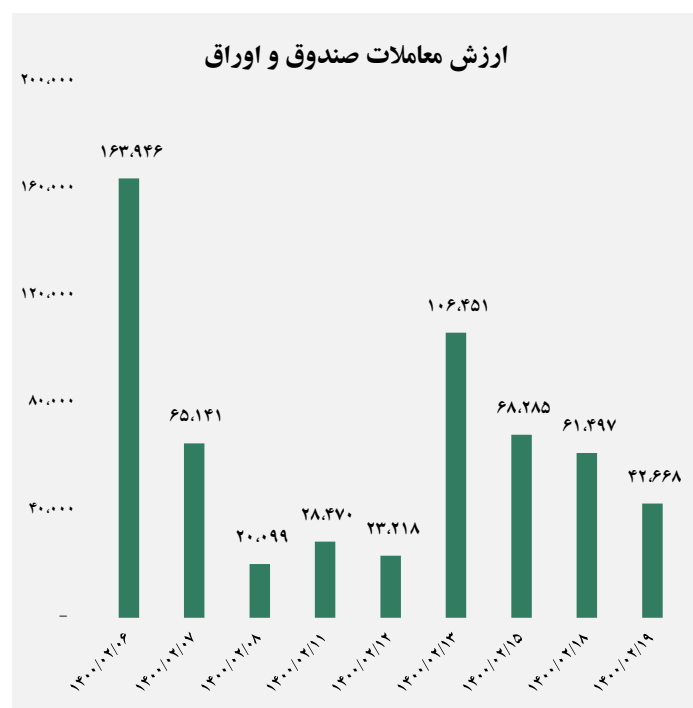
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



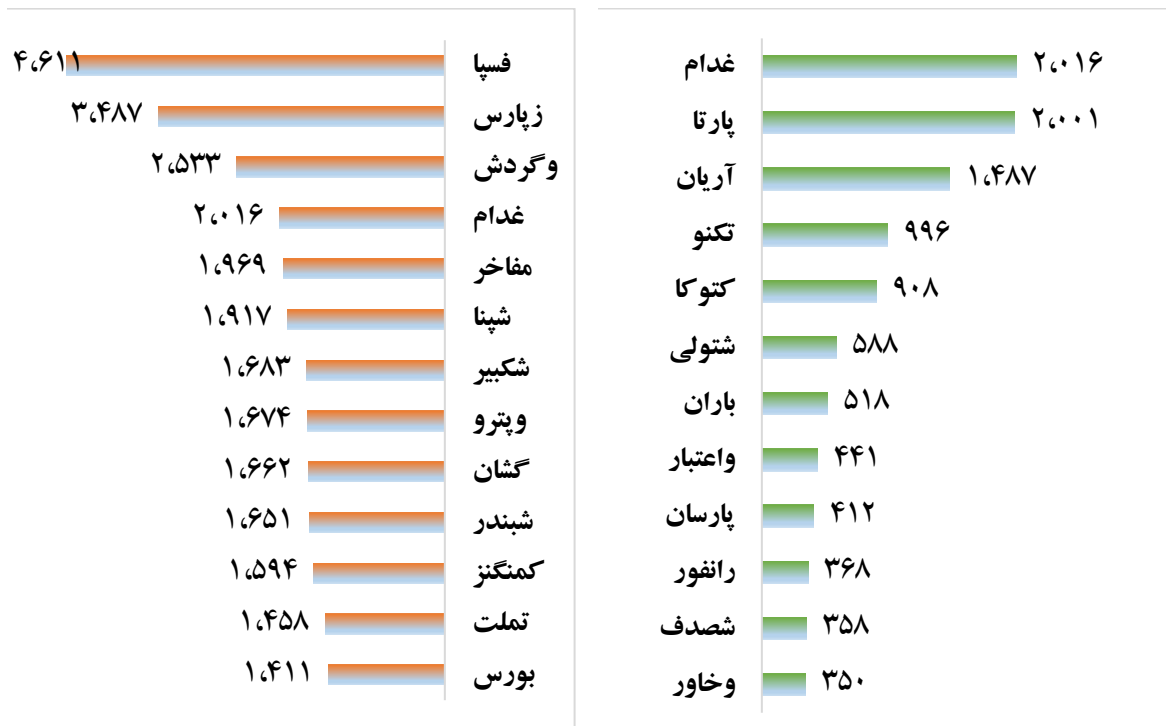
## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

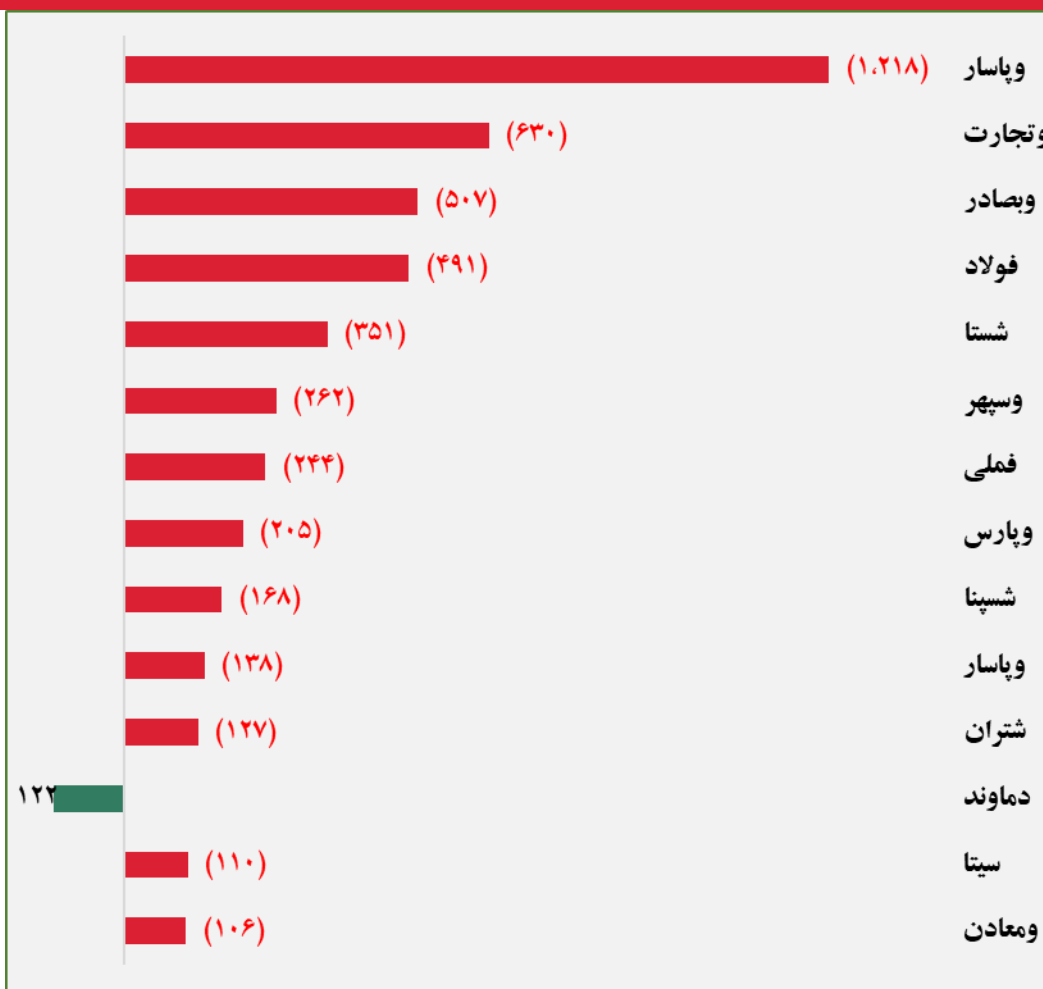


## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	پارتا	۱	وتجارت
۲	-	۲	وبصادر
۳	-	۳	وساپا
۴	-	۴	ومعادن
۵	-	۵	وگردش
۶	-	۶	دعبید
۷	-	۷	تماوند
۸	-	۸	شصفا
۹	-	۹	شراز
۱۰	-	۱۰	وتوس



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)

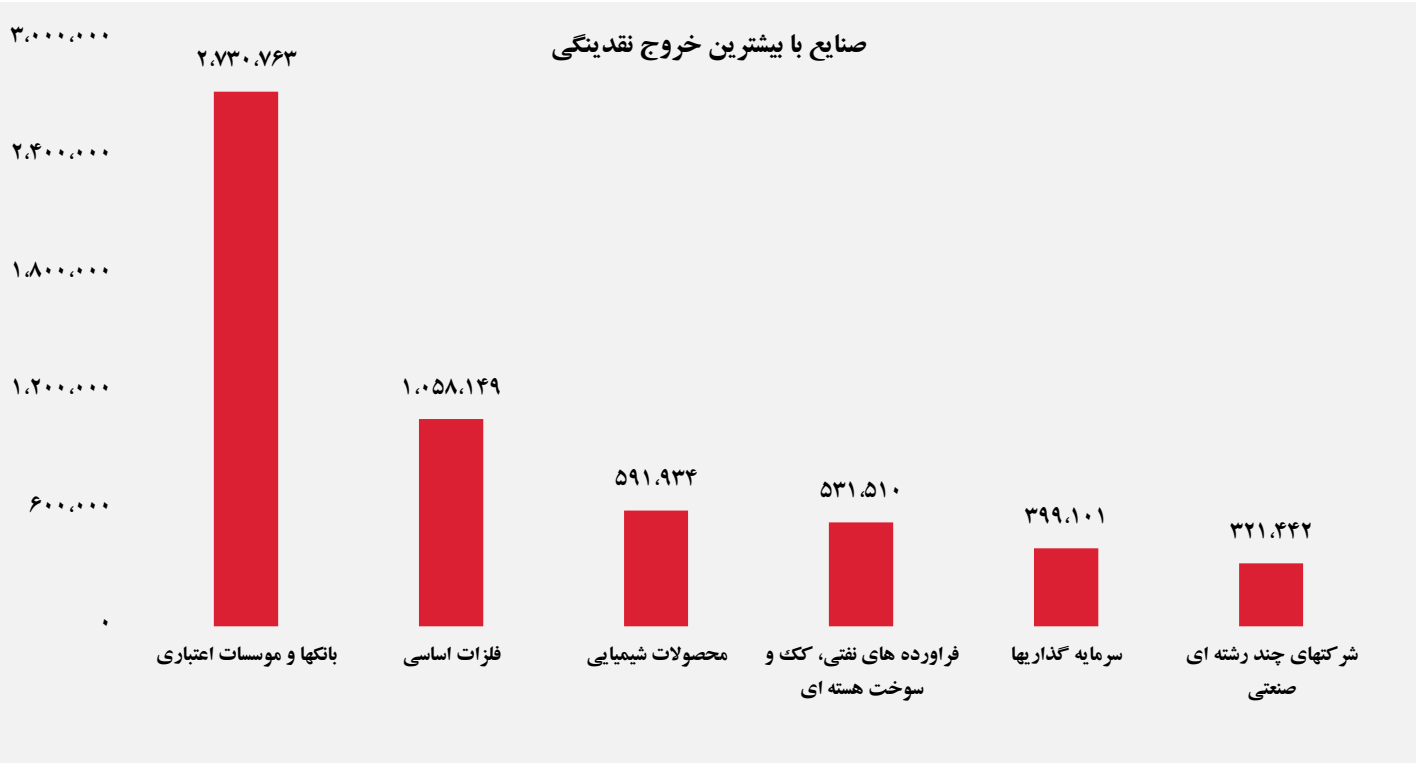
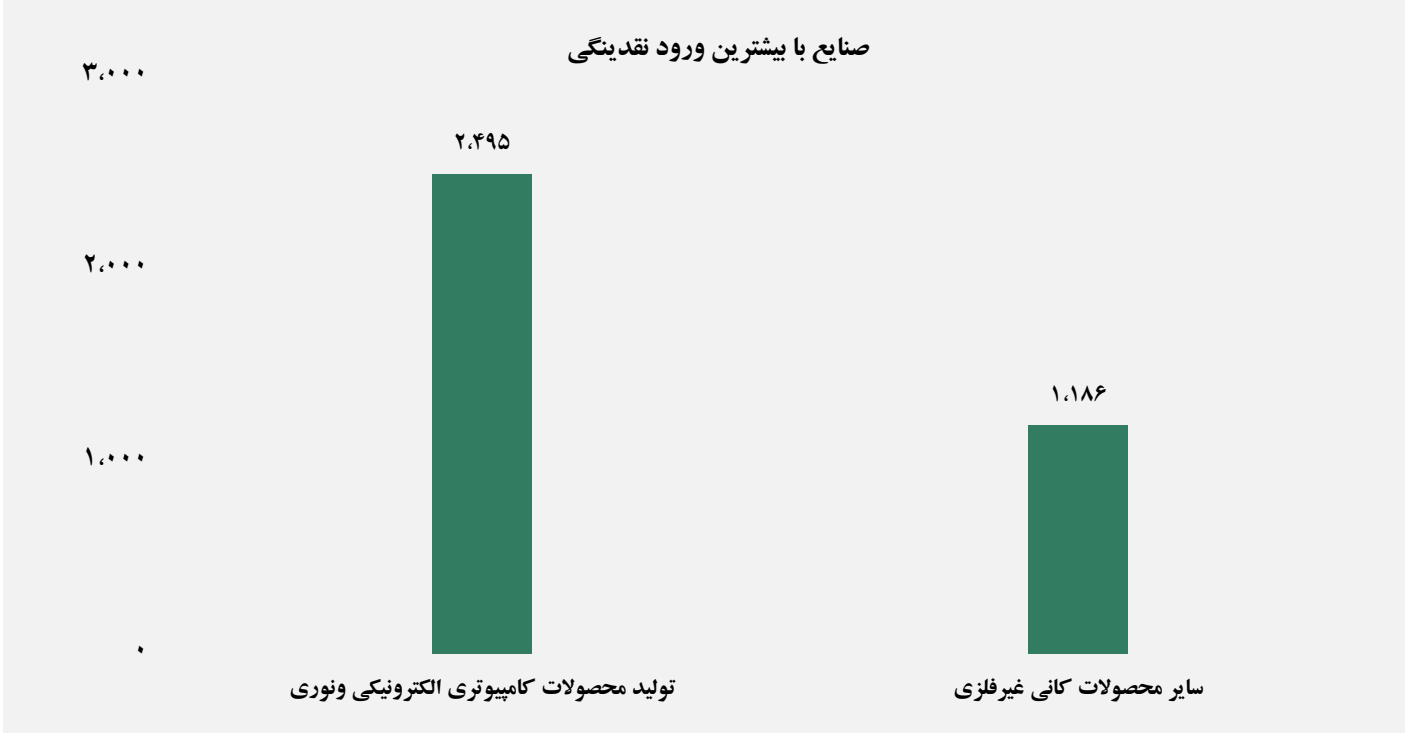


## واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	و پاسار	۱۱	شتران
۲	وتجارت	۱۲	سیتا
۳	وبصادر	۱۳	ومعادن
۴	فولاد	۱۴	تاپیکو
۵	شستا	۱۵	شبندر
۶	وسپهر	۱۶	فخوز
۷	فملی	۱۷	وگردش
۸	و پارس	۱۸	خودرو
۹	شپینا	۱۹	اپال
۱۰	وساپا	۲۰	هرمز



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار