



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۲۰

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۲۰ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فملی، فولاد، شستا، فارس، وغدیر، فحوز و وپاسار با افزایش ۵.۵۷۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۵۷.۴۶۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۷۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۴۰ 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 برخلاف روزهای گذشته شاهد افزایش تقاضا در بسیاری از نمادها در اکثر گروه‌ها بودیم.

در روز جاری برخلاف روزهای گذشته شاهد افزایش تقاضا در اکثر نمادهای شاخص‌ساز در بازار بورس و فرابورس تهران بودیم. قابل ذکر است، هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار در جلسه عصر روز گذشته ۱۹ اردیبهشت ۱۴۰۰؛ با توجه به مصوبه شورای عالی بورس مبنی بر افزایش تدریجی و پیروی مطالعات صورت گرفته در خصوص متقارن سازی دامنه در همین مقطع و سپس افزایش تدریجی دامنه به صورت متقارن تصمیم گرفت. از همین رو دامنه نوسان به جای ۶+ و ۳- به مثبت و منفی ۵ و حداقل ارزش ریالی حجم مبنا برای تمامی نمادهای معاملاتی به ۱۵ میلیارد ریال از روز شنبه ۱۴۰۰/۰۲/۲۵ تغییر خواهد یافت. به نظر می‌رسد با تغییر دامنه نوسان از تعداد صف فروش‌ها مخصوصاً در نمادهای کوچک نیز کاسته شود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱.۶۹۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه دولت با نماد اراد ۷۰۴، 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 ۱۴۰۰/۰۲/۱۹ با ۲۳.۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۱۹	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲,۱۰۲	۱۱,۶۹۳	۴۵۶٪



## گروه‌های مؤثر

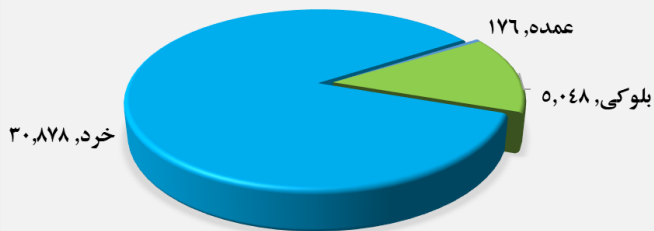
در گروه سایر محصولات کانی غیرفلزی، شرکت صنایع خاک چینی ایران در ۱۲ ماهه ۲۶۰ تومان به ازای هر سهم سود ساخته است. این شرکت در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب ۶۵، ۸۲ و ۵۵ تومان سود به ازای هر سهم ثبت کرده بود و در فصل چهارم نیز ۵۸ تومان سود به ازای هر سهم داشته است. سود ۱۲ ماهه سال مالی ۹۹ نیز ۱۱۲ تومان بوده است. سود سال مالی گذشته رشد ۱۳۲ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه سال مالی ۱۳۹۸ دارد. در فصل اول فروش ۷۴ میلیارد تومان و در فصل دوم و سوم به ترتیب مبلغ فروش ۹۸ و ۱۰۰ میلیارد تومان را به ثبت رساند و در آخرین فصل نیز فروش ۱۲۱ میلیارد تومانی داشته است. کل مبلغ فروش در سال مالی ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹ به ترتیب ۲۰۹ و ۳۹۳ میلیارد تومان می باشد. این تولید کننده محصولات فرآوری شده در سال مالی گذشته، ۳۳۹ میلیارد تومان سود عملیاتی شناسایی کرده که ۱۰۲ درصد بیشتر از مدت مشابه سال مالی ۹۸ است. حاشیه سود ۱۲ ماهه سال مالی ۱۳۹۹ شرکت صنایع خاک چینی ۸۴ درصد بوده است و در سال مالی ۱۳۹۸ این نسبت ۷۸ درصد ثبت شده است. با افتتاح طرح توسعه این شرکت در چند ماه گذشته، به نظر می رسد در سال جاری با جهش سودآوری همراه شود.

در گروه شیمیایی، شرکت معدنی املاح ایران در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته توانست ۲۸۵ تومان سود به ازای هر سهم بسازد. این شرکت در فصل چهارم ۷۴ تومان سود به ازای هر سهم محقق کرده که در حدود فصل سوم است. در فصل اول، دوم و سوم سود شرکت به ترتیب ۶۶، ۷۰ و ۷۵ تومان به ازای هر سهم بوده است. سود سال ۱۳۹۸ این شرکت نیز ۲۱۵ تومان گزارش شد. این تولید کننده سولفات در فصل اول فروش ۷۴ میلیارد تومانی را داشت و در فصل دوم، سوم و چهارم به ترتیب ۸۴، ۱۰۲ و ۱۳۷ میلیارد تومان فروش گزارش کرده است. جمع فروش سال جاری رشد ۳۶ درصدی نسبت به مدت مشابه سال مالی ۹۸ دارد. سال مالی ۱۳۹۸ نیز ۲۹۰ میلیارد تومان فروش را به ثبت رسانده بود. حاشیه سود فصل اول و دوم ۶۱ درصد و فصل سوم ۶۷ درصد ثبت شد. در فصل آخر نیز حاشیه سود به ۶۴ درصد رسید. اما در سال مالی ۱۳۹۸ حاشیه سود این شرکت ۶۸ درصد بود. سود عملیاتی ۱۲ ماهه سال ۹۹ شرکت ۲۳۹ میلیارد تومان است که رشد ۲۸ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه سال مالی ۹۸ دارد.

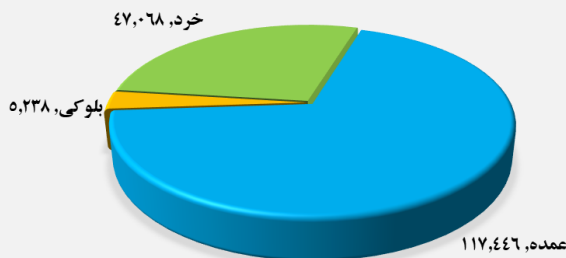
## تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۳۶۸	شاخص کل	۱,۱۵۷,۶۱۲	شاخص کل
۳۸	تغییر شاخص	۵,۷۲۸	تغییر شاخص
۱۱,۶۹۳,۸۷۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۳۱۱,۲۲۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۲۴,۸۸۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۴,۸۸۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>	
آریا		فملی	
ذوب		فولاد	
شگویا		شستا	
دماوند		فارس	
صبا		وغدیر	
<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>	
کگهر		رمپنا	
درهاور		خودرو	
حآسا		کلوند	
زاگرس		همراه	
ارفع		وتوکا	
<b>(۷۳۴)</b>		ورود ( خروج ) نقدینگی به سهام ( میلیارد ریال )	
<b>(۱,۱۱۹)</b>		ورود ( خروج ) نقدینگی به صندوق ها و اوراق ( میلیارد ریال )	

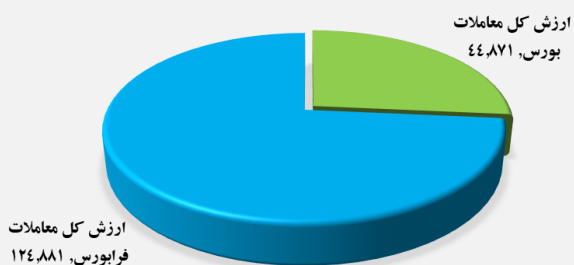
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد  
(میلیارد ریال)



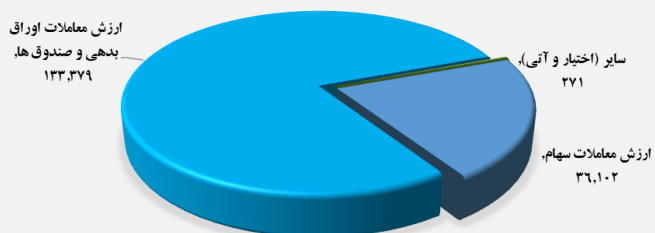
ارزش کل معاملات  
(میلیارد ریال)



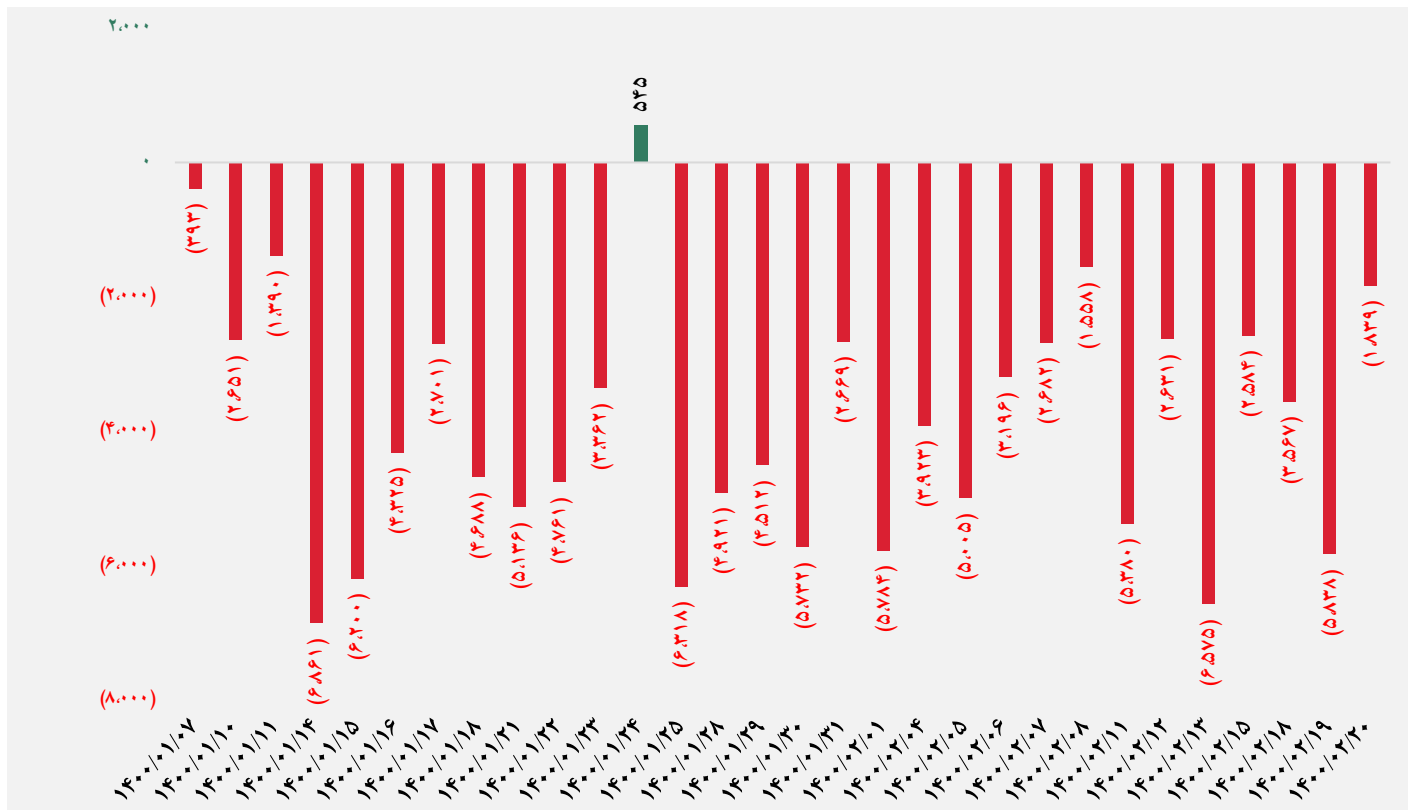
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس  
(میلیارد ریال)



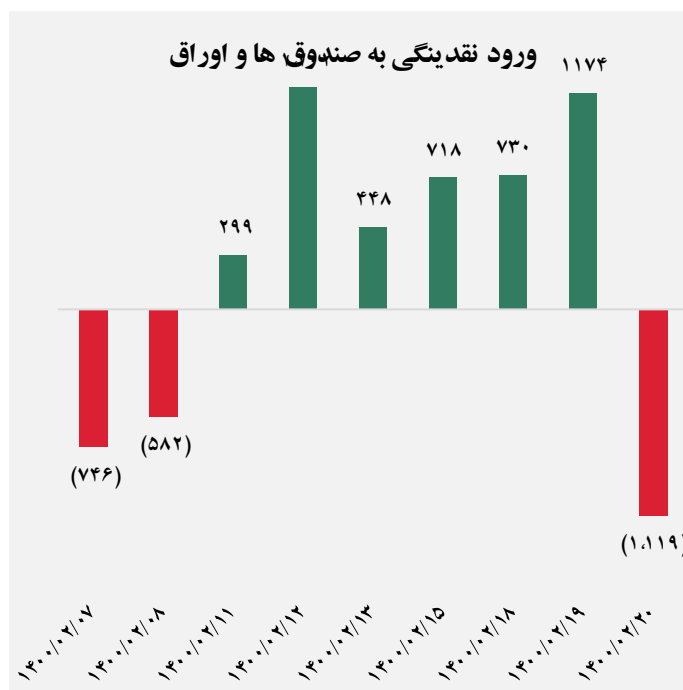
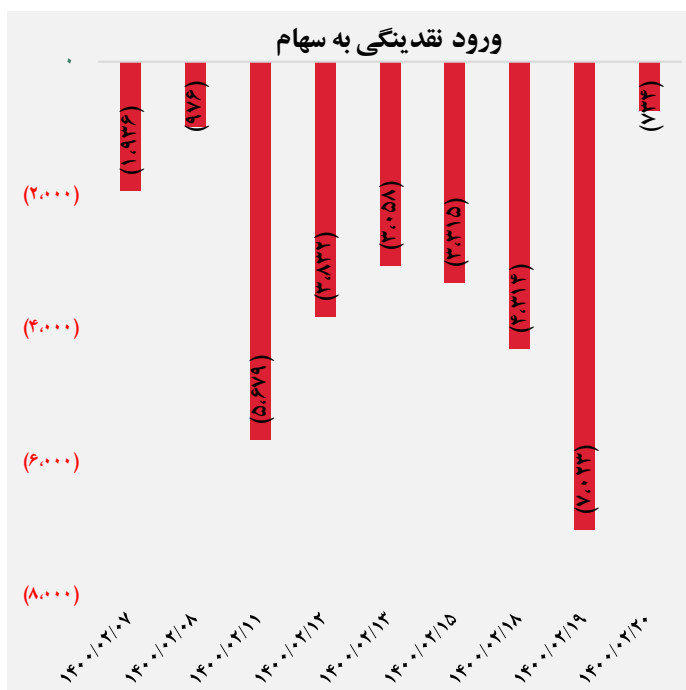
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها  
(میلیارد ریال)



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

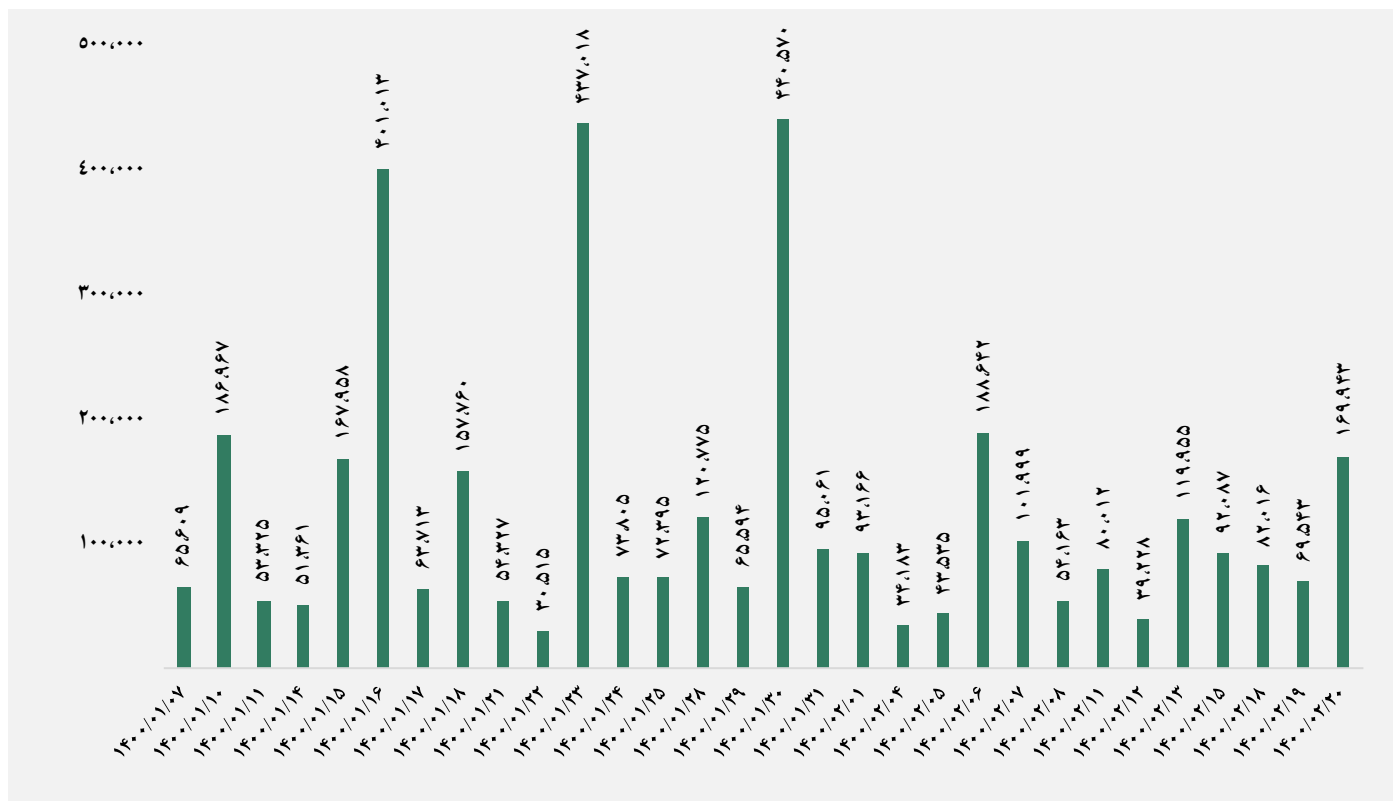


## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال) (خروج)

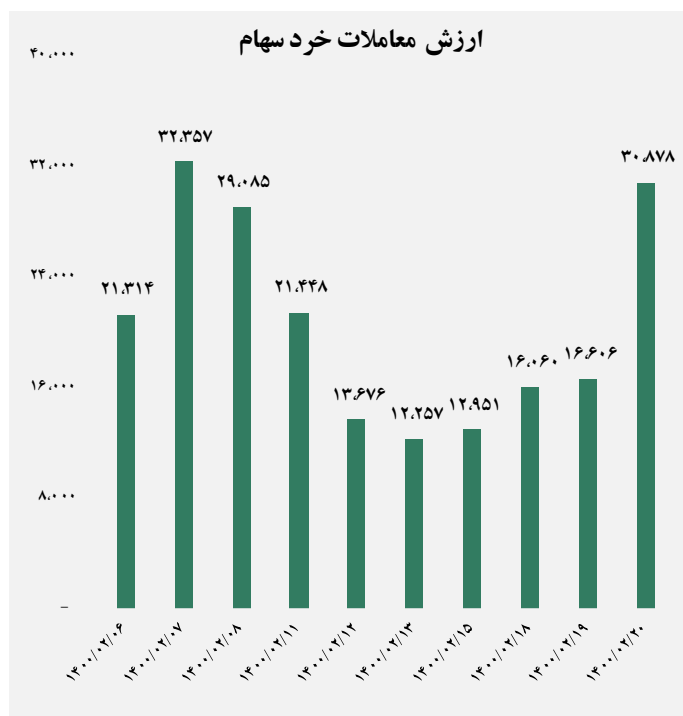
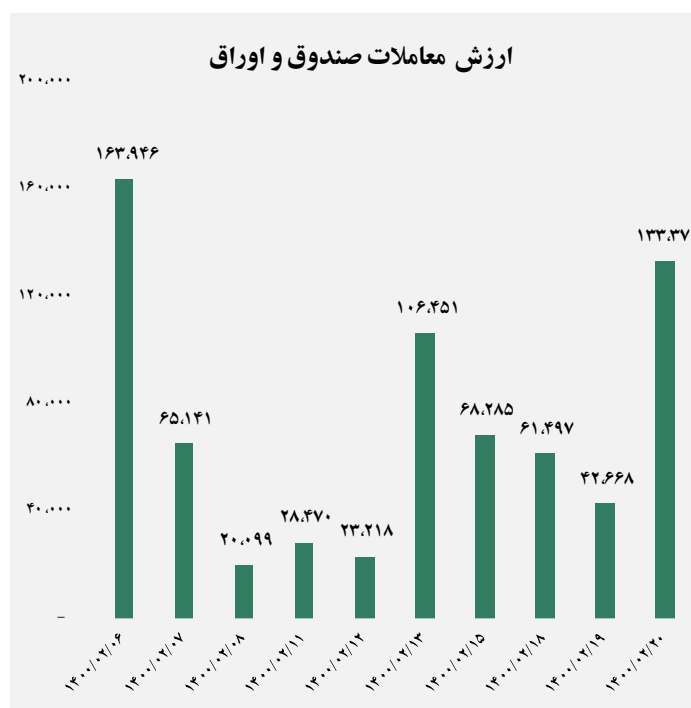


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

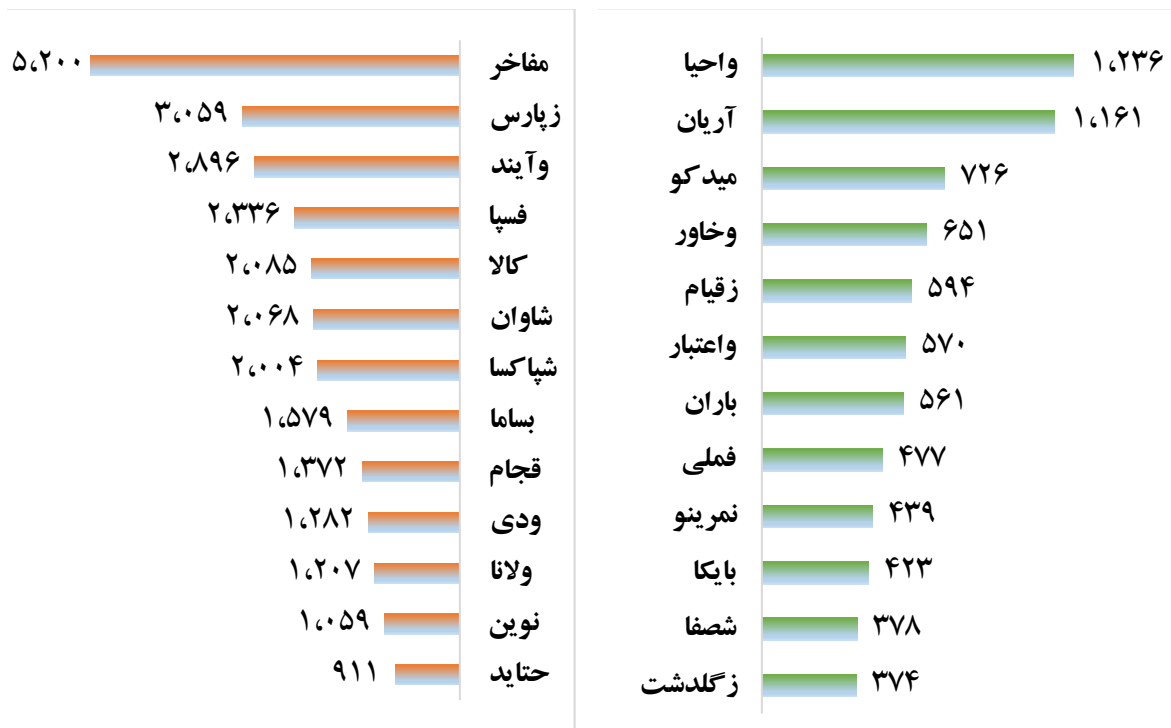


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





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

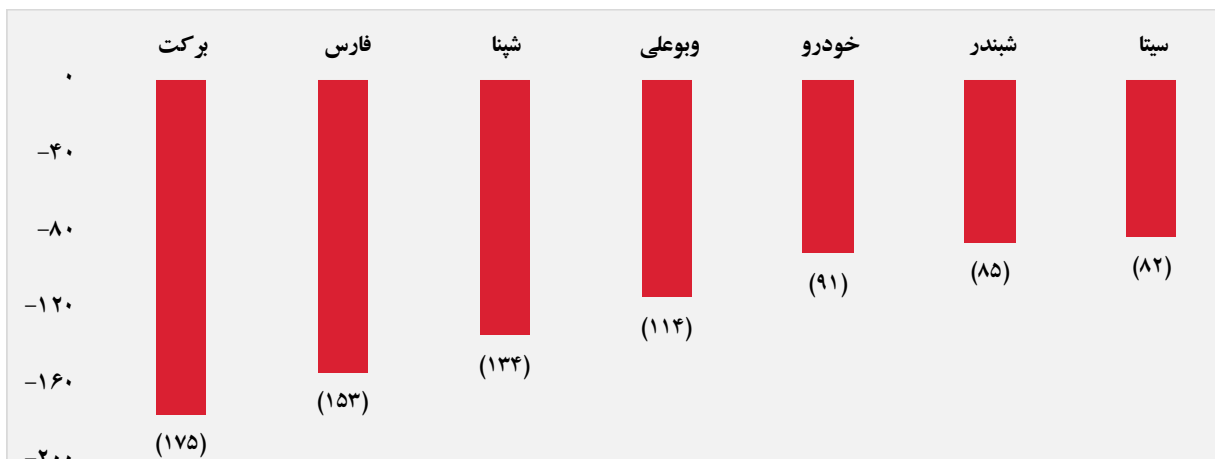
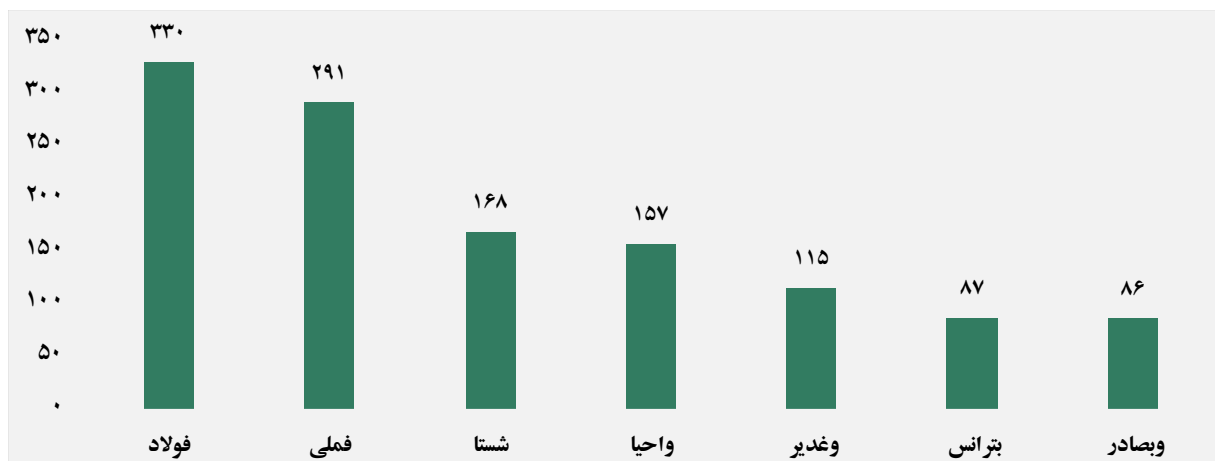


## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	فولاد	۱	تماوند
۲	فملی	۲	اخبار
۳	واحیا	۳	شبصیر
۴	ذوب	۴	بموتو
۵	و غدیر	۵	حآس
۶	پارسان	۶	فخاس
۷	البرز	۷	مفاخر
۸	شفارا	۸	کروی
۹	-	۹	بساما
۱۰	-	۱۰	وامید



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



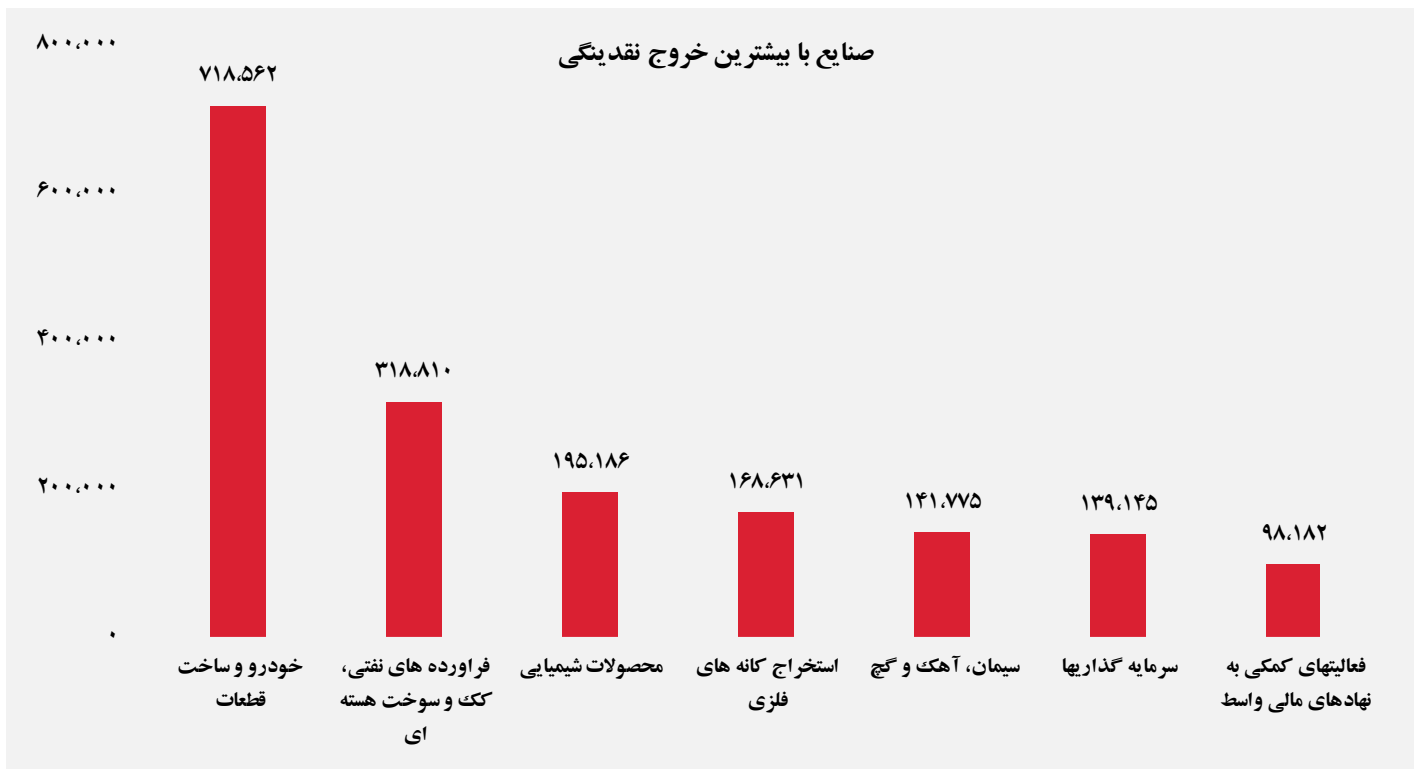
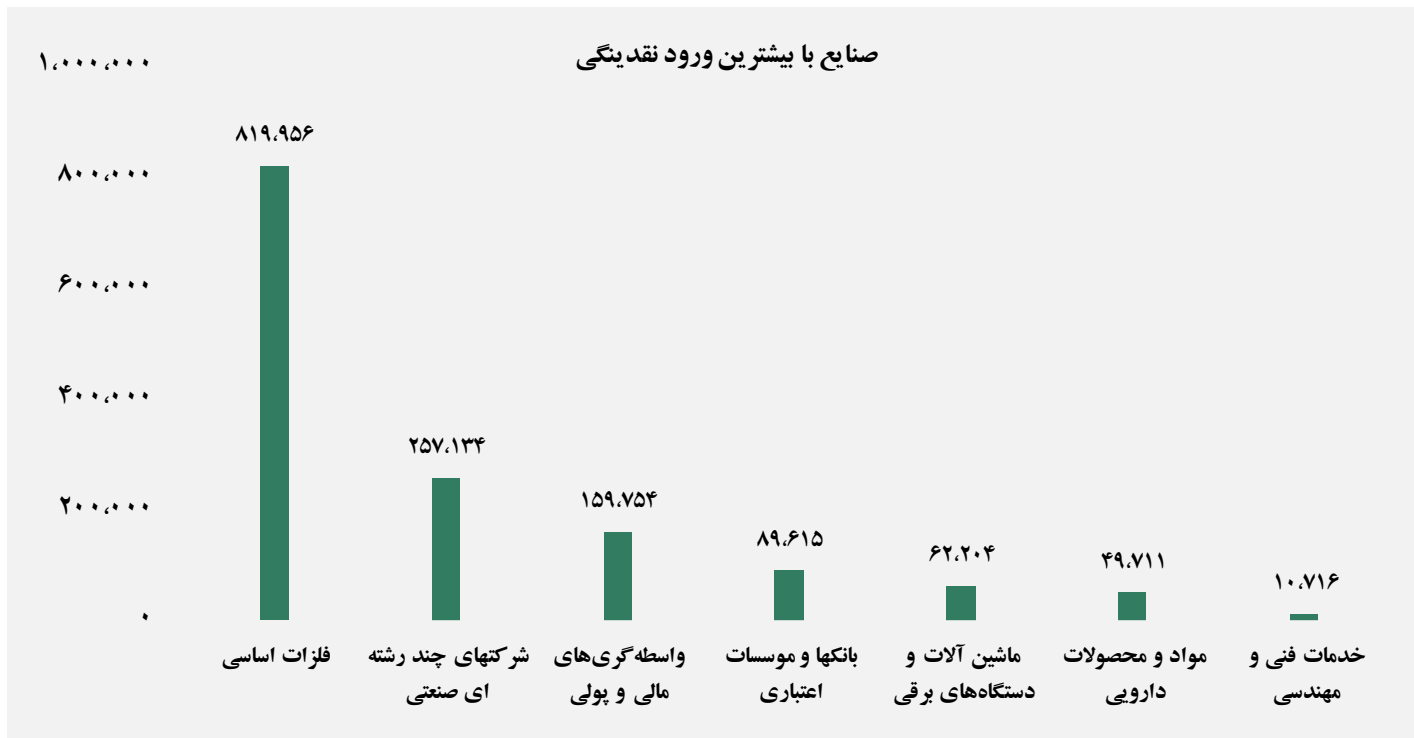
## واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	فباهر
۲	وساخت	۱۱	سمازن
۳	شپلی	۱۲	غگل
۴	ساراب	۱۳	شبندر
۵	بوعلی	۱۴	شرانل
۶	وبوعلی	۱۵	شپنا
۷	دماوند	۱۶	آریا
۸	زاگرس	۱۷	سخوز
۹	شغدیر	۱۸	پترول





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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر