



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۲۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۲۱ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، فملی، فارس، شستا، کگل، شپنا و معادن با افزایش ۲۱.۹۳۴ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۷۹.۶۱۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۴۳ 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 بعد از مدت‌ها شاهد افزایش تقاضا در بسیاری از نمادها در اکثر گروه‌ها بودیم.

بازار سهام امروز متفاوت‌تر نسبت به چند وقت گذشته ظاهر شد. بعضی از نمادها که در چند ماه گذشته قفل در صف فروش بودند، امروز حتی بعد از جمع‌آوری صف‌های فروش در ناحیه قیمتی مثبت نیز معامله شدند. هر چند روند نزولی اکثر شرکت‌ها تغییر نکرده است اما با توجه به وضعیت بنیادی شرکت‌ها و همچنین شرایط سیاسی (انتخابات ریاست جمهوری در اواخر خرداد ماه) می‌توان امید به تغییر روند بسیاری از سهم‌ها با نسبت پی بر ای کمتر از ۶ واحد، داشت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱.۵۴۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق منفعت دولت با نماد افاد ۸۴۴ 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 ۲۳.۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۱۴۰۰/۰۲/۲۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۱,۶۹۳	۱,۵۴۶	-۸۷٪



گروه‌های مؤثر

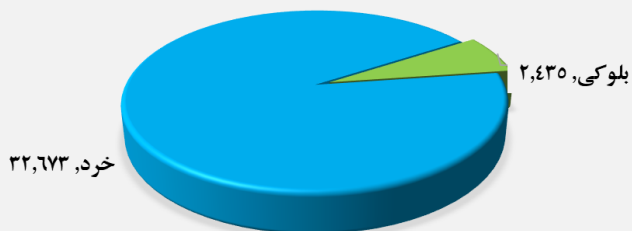
در گروه محصولات فلزی، شرکت آهن و فولاد ارفع در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۲۱۵ تومان سود به ازای هر سهم محقق ساخته است. این شرکت در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب ۲۷، ۴۷ و ۵۴ تومان سود به ازای هر سهم ثبت کرده بود و در فصل چهارم سود ۸۷ تومانی را گزارش کرده است. سود ۱۲ ماهه سال مالی ۹۸، ۶۵ تومان بوده است. در فصل اول فروش ۱۰۹۴ میلیارد تومان، حاشیه سود ۳۱ درصد، سود عملیاتی ۴۱۴ میلیارد تومان و سود خالص نیز ۳۳۴ میلیارد تومانی را داشته است. این شرکت فولادی در فصل دوم سال مالی گذشته فروش ۱۴۷۴ میلیارد تومانی را گزارش کرد که با حاشیه سود ۳۸ درصدی، سود ناخالص ۵۵۹ میلیارد تومانی را به همراه داشته و در همین فصل سود عملیاتی و خالص به ترتیب برابر با ۷۷۶ و ۵۵۵ میلیارد تومان بوده است. شرکت آهن و فولاد ارفع در فصل پاییز فروش ۱۷۴۳ میلیارد تومانی، حاشیه سود ۳۶ درصدی، سود عملیاتی ۷۲۴ میلیارد تومانی و سود خالص ۶۴۹ میلیارد تومانی را روانه کدال کرده است. در چهارمین فصل سال گذشته نیز فروش شرکت با رشد ۵۰ درصدی نسبت به فصل سوم به ۲۶۰۰ میلیارد تومان رسیده است. حاشیه سود با افزایش ۲ درصدی به ۳۸ درصد رسید و سود عملیاتی و خالص شرکت نیز به ۹۴۷ و ۱۰۳۹ میلیارد تومان گزارش شده است.

در گروه سیمان، شرکت سیمان هگمتان در اسفند و فروردین سال مالی ۱۴۰۰، ۱۶۰ و ۱۵۲ هزار تن تولید سیمان داشته و میانگین تولیدات سال ۹۹، ۱۵۱ هزار تن در هر ماه بوده است که این عدد برای سال مالی ۹۸، ۱۶۳ هزار تن گزارش شده است (سال مالی این شرکت دی ماه می باشد). فروش سیمان در اسفند و فروردین به ترتیب ۱۶۵ و ۱۵۲ هزار تن گزارش شده و این شرکت در سال مالی ۹۹ به طور متوسط ۱۵۲ هزار تن فروش داشته که این عدد در سال مالی ۹۸ ۱۶۳ هزار تن بوده است. درآمد فروش شرکت در فروردین ماه ۴۴ میلیارد تومان می باشد. این شرکت در سال مالی ۹۸ و ۹۹ به ترتیب ۳۰۲ و ۴۲۰ میلیارد تومان در ۱۲ ماهه سال مالی فروش داشته است. میانگین نرخ فروش این شرکت در اسفند ماه ۲۸۵۶ ریال در هر کیلو بود اما متوسط این نرخ در سال مالی ۹۹، ۲۲۰۰ ریال بر کیلو گرم بوده است.

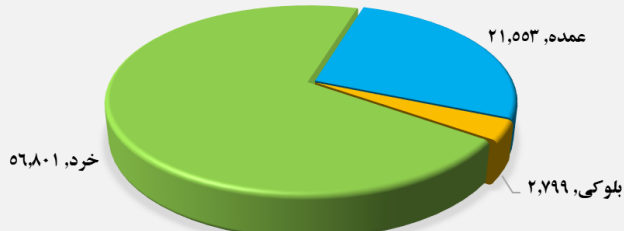
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۴۲۷	شاخص کل	۱,۱۷۹,۶۱۷	شاخص کل
۱۵۳	تغییر شاخص	۲۱,۹۳۴	تغییر شاخص
۱۱,۸۰۰,۷۰۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۷,۱۷۸,۴۹۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۳,۷۵۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۷,۴۰۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
آریا		فولاد	
میدکو		فملی	
زاگرس		فارس	
ذوب		شستا	
شگویا		کگل	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کتوکا		پرداخت	
درهاور		اخابر	
مارون		فخاس	
بساما		شیراز	
کرغال		حکشتی	
۱,۴۲۳	ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	۲۱,۰۲۶	ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)

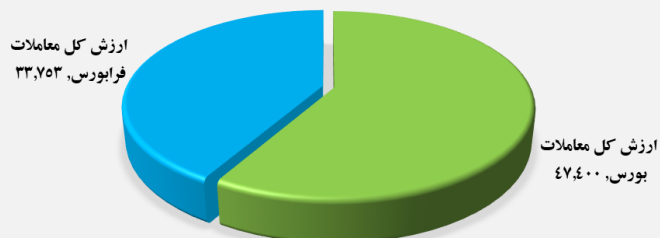
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد (میلیارد ریال)



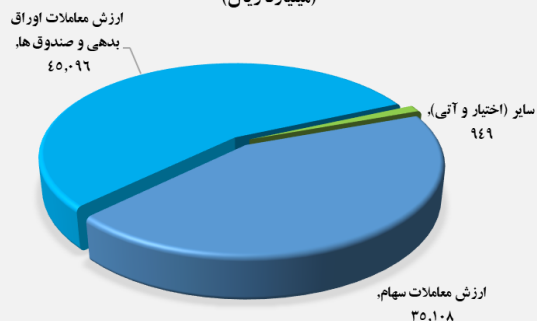
ارزش کل معاملات (میلیارد ریال)



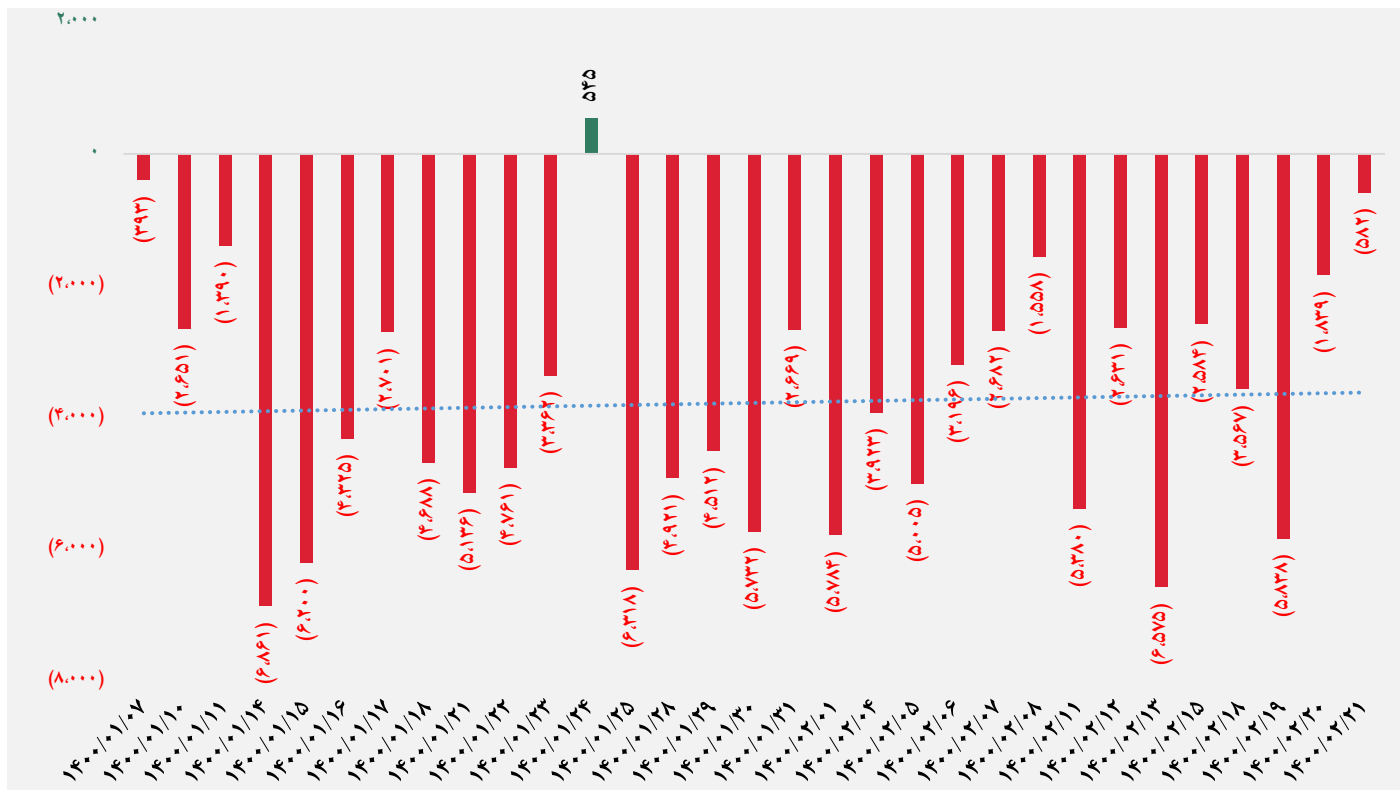
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس (میلیارد ریال)



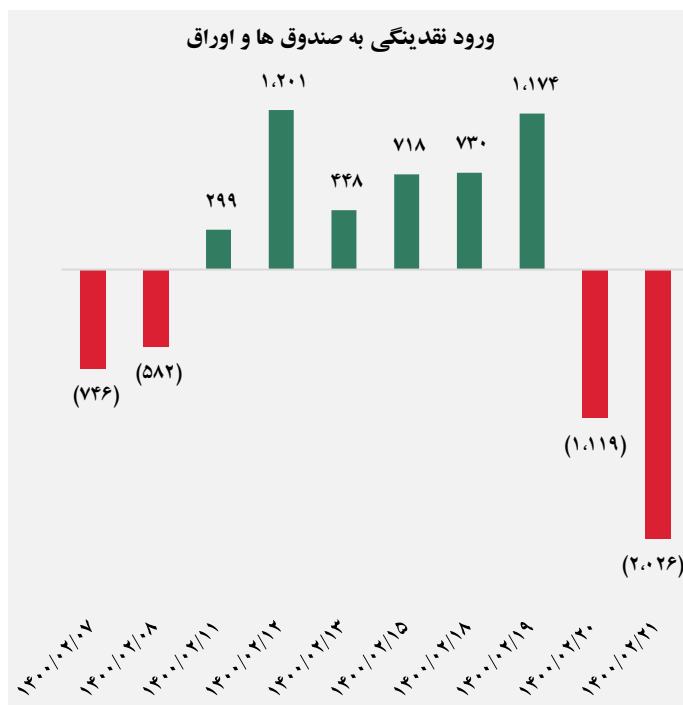
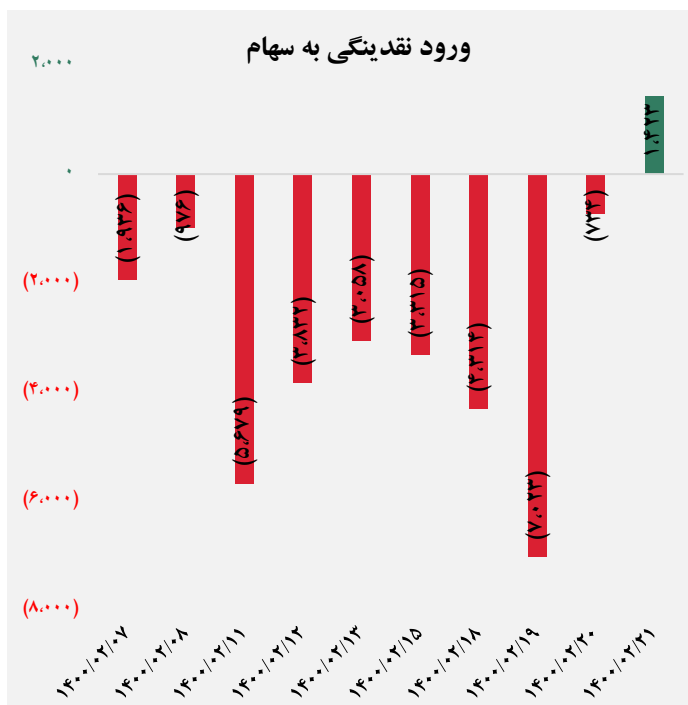
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها (میلیارد ریال)



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

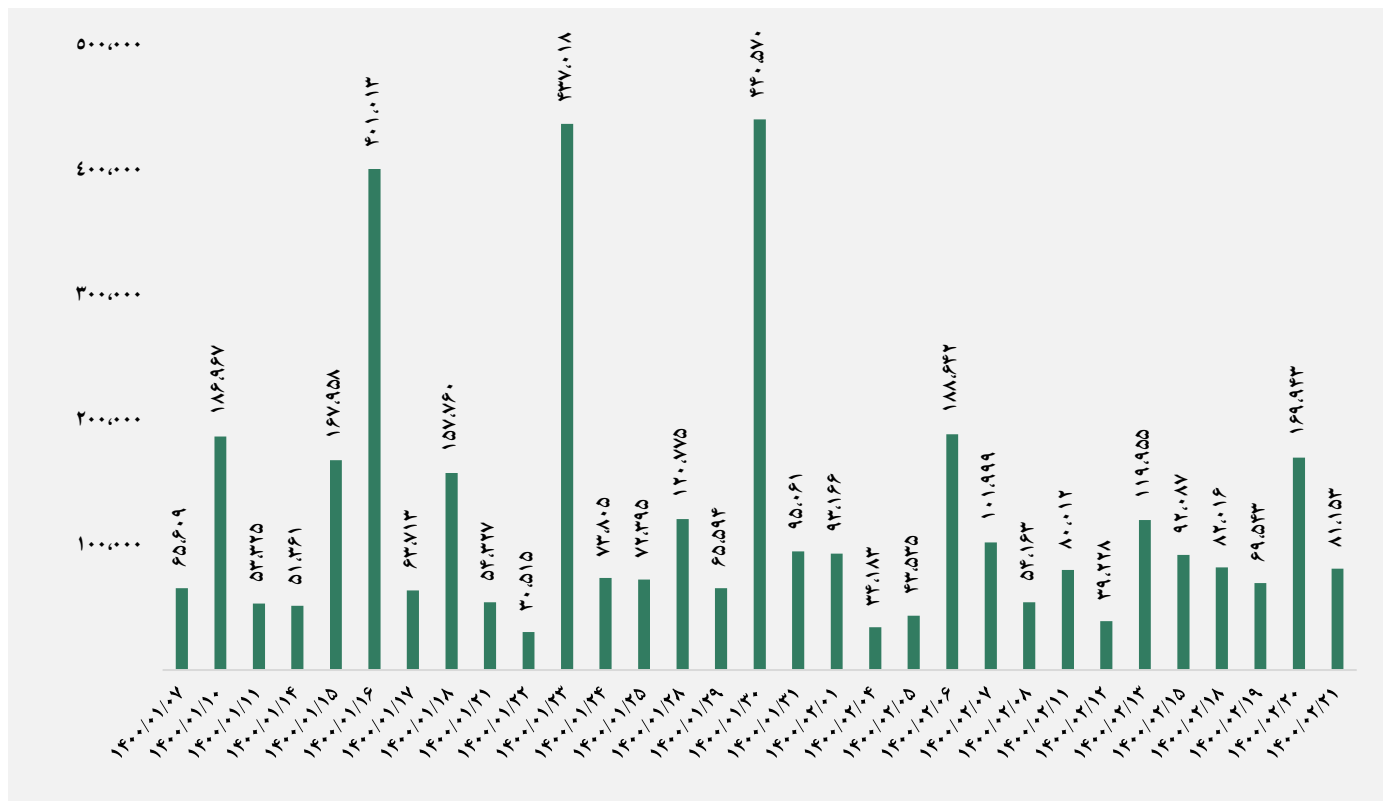


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

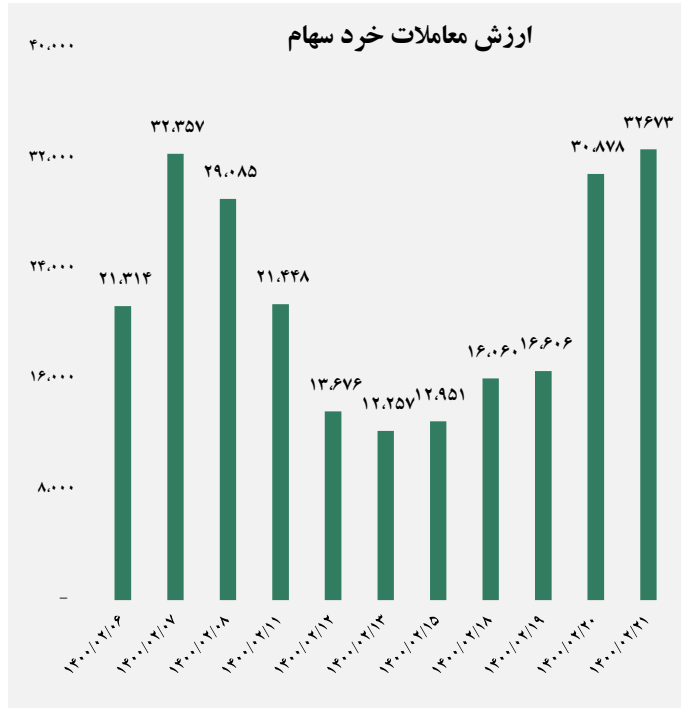
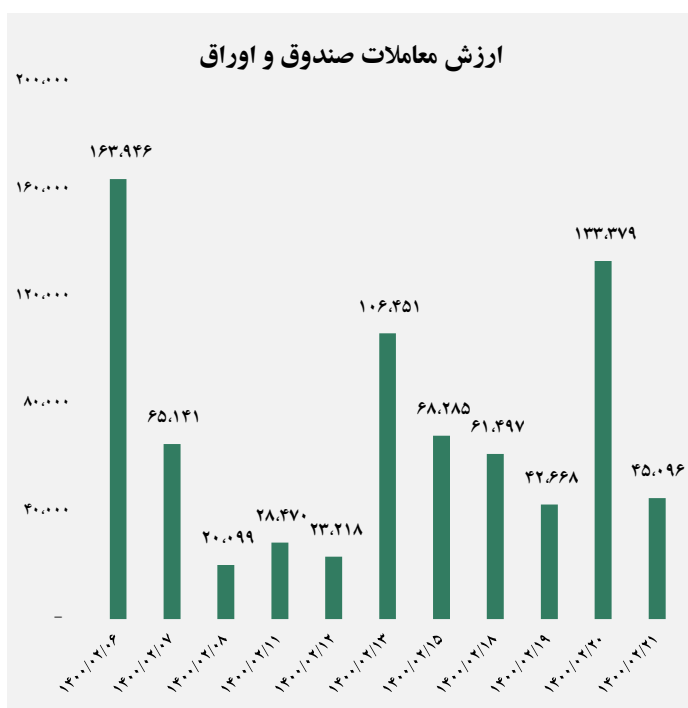


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



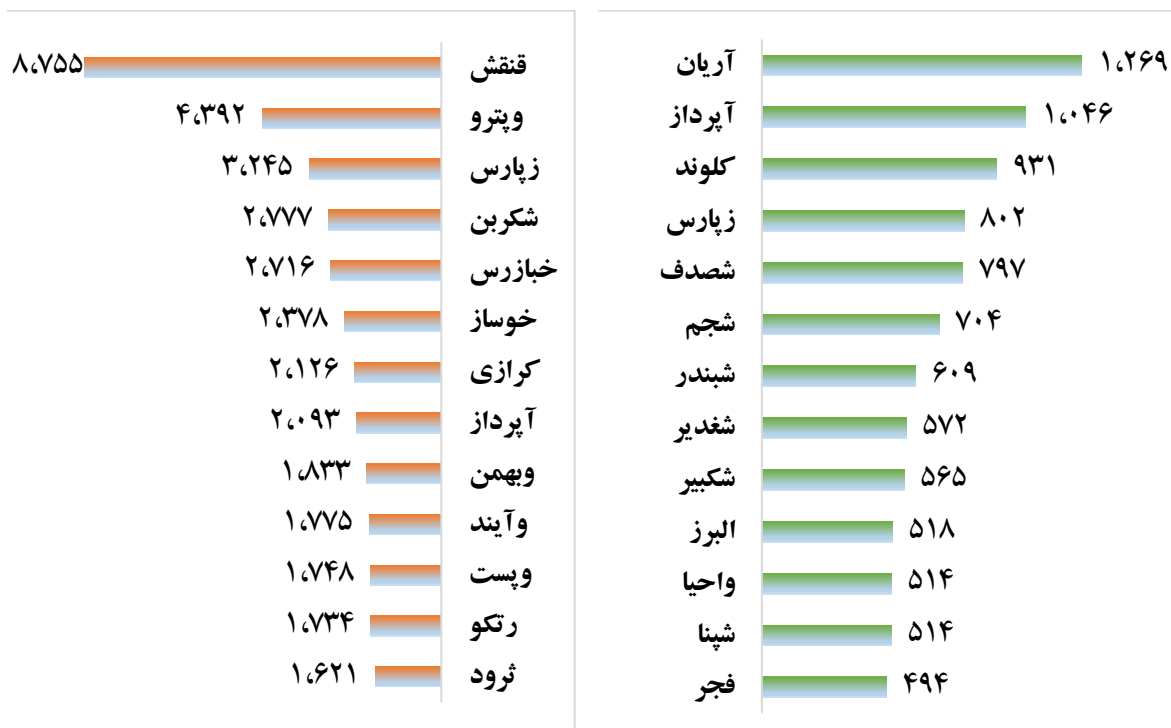
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

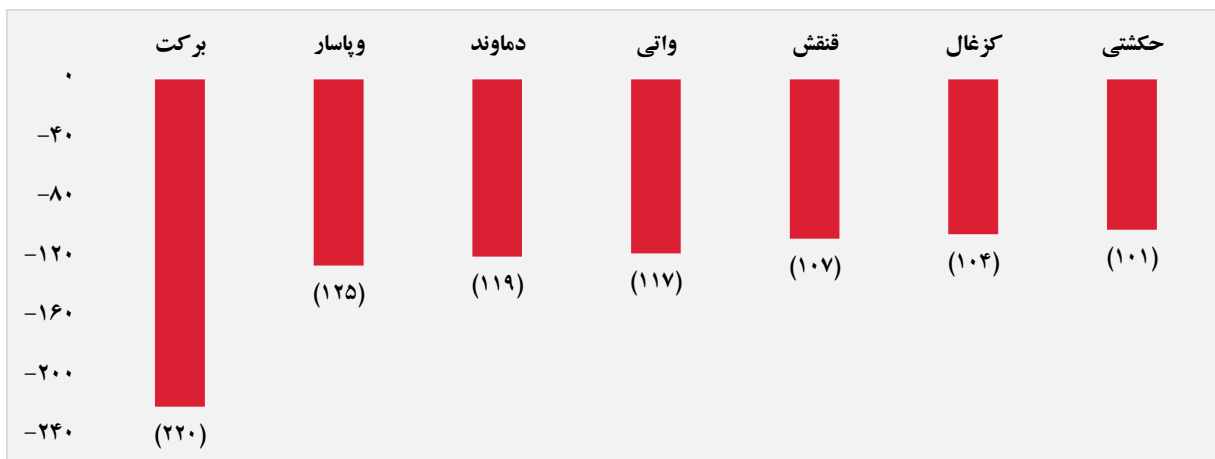
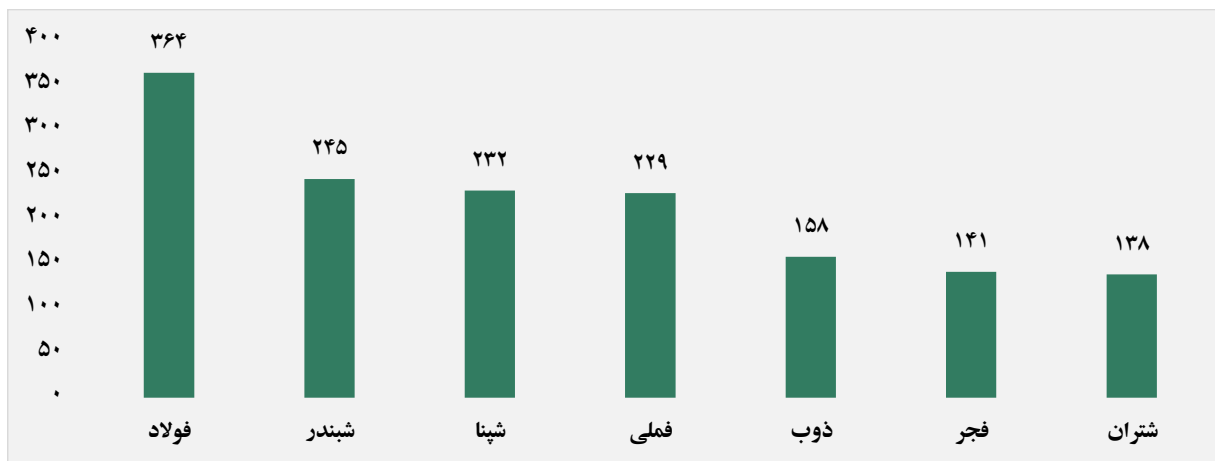


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شبندر	۱	دماوند
۲	ذوب	۲	واتی
۳	فجر	۳	قنقش
۴	آریا	۴	حکشتی
۵	شبریز	۵	شکلر
۶	ومعادن	۶	شپاکسا
۷	پارسان	۷	پارسیان
۸	شاوان	۸	شجم
۹	فاسمین	۹	دعید
۱۰	تیسکو	۱۰	پرداخت



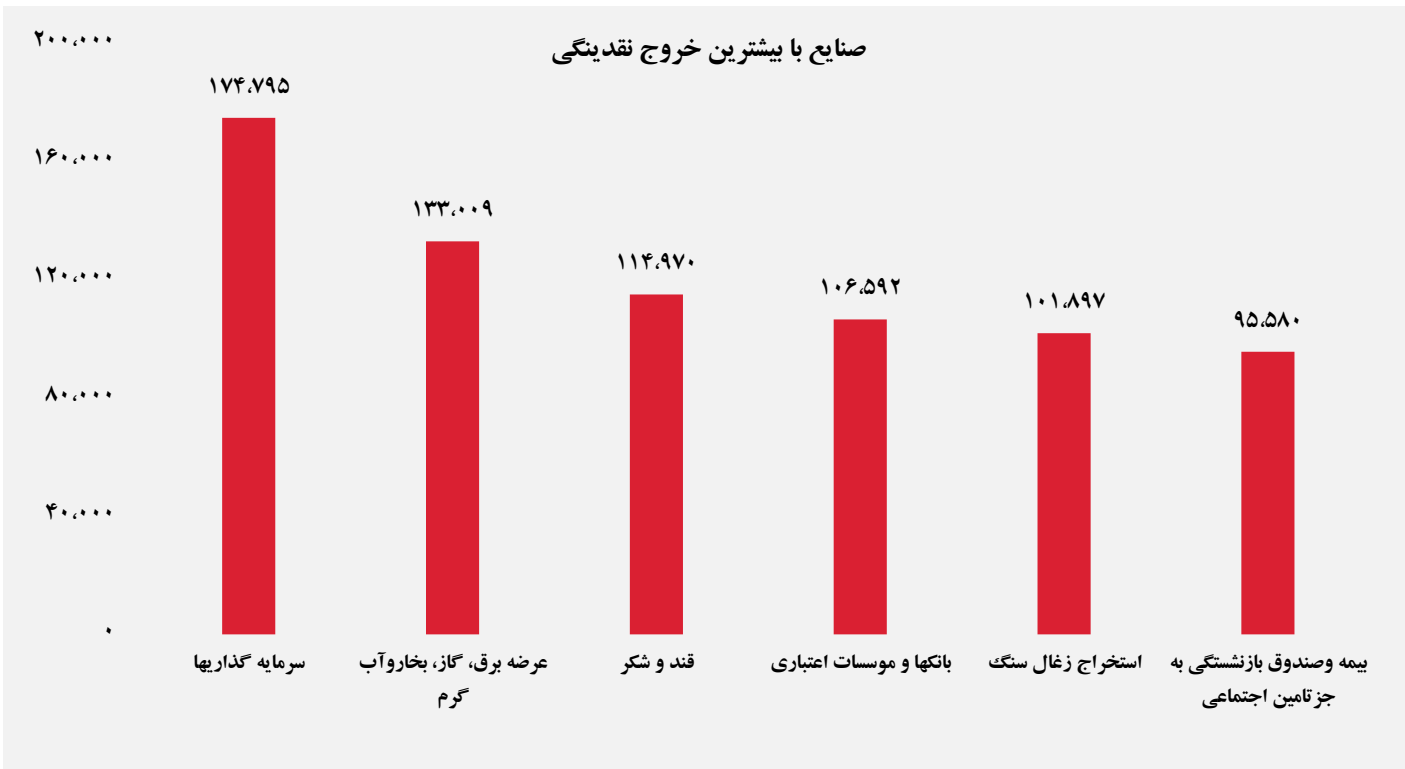
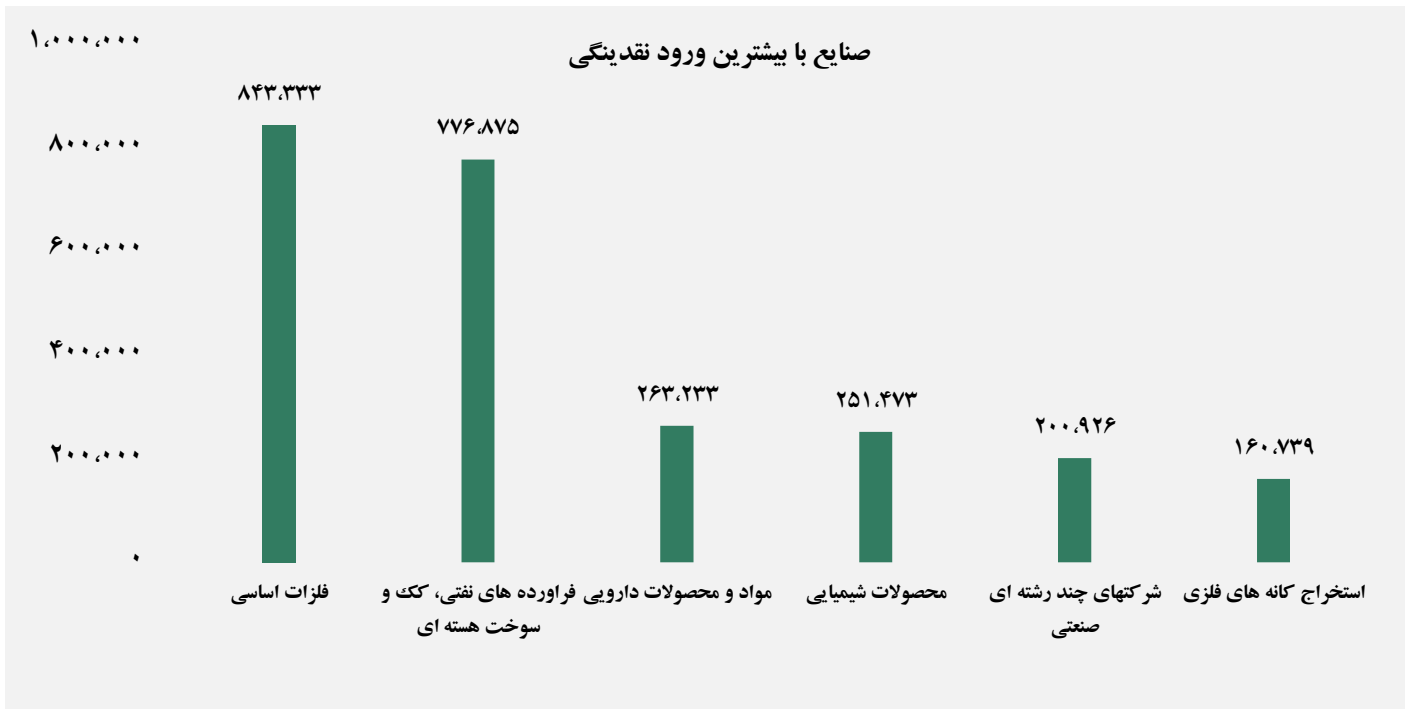
بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کزغال	۱۰	وزمین
۲	ساراب	۱۱	واتی
۳	برکت	۱۲	حکشتی
۴	شغدیر	۱۳	زاگرس
۵	شاوان	۱۴	وبوعلی
۶	حتاید	۱۵	بوعلی
۷	شپاکسا	۱۶	آریا
۸	دماوند	۱۷	شبریز
۹	سمازن	۱۸	فباهر

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار