



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۲۶

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۶ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، شستا، کگل، وغدیر، کویر و شتران با کاهش ۷۹۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۸۸.۸۰۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۴۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۳۷ 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 بعضی از نمادها در گروه فلزات اساسی، استخراج کانه‌های فلزی و دارویی با فشار عرضه همراه بودند.

در دو روز گذشته علی‌رغم اینکه بسیاری از نمادها همچنان با فشار عرضه همراه هستند، اما برچیده شدن صف‌های فروش در بسیاری از نمادها را می‌توان نشانه‌ای از تغییر در عرضه و تقاضای بازار سهام در دو روز گذشته نسبت به چند ماه گذشته دانست. همچنین برای نمادهای کوچک که قفل در صف فروش هستند، با تغییر در حجم مبنا و گره معاملاتی می‌توان، تقاضای بیشتری برای سهام این نوع شرکت‌ها ایجاد کرد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۵.۶۶۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۳۶۴، 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 ۷۲۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۸/۲۴ با ۲۳.۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۲۵	۱۴۰۰/۰۲/۲۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۴۴,۲۵۳	۵,۶۶۶	-۹۶٪



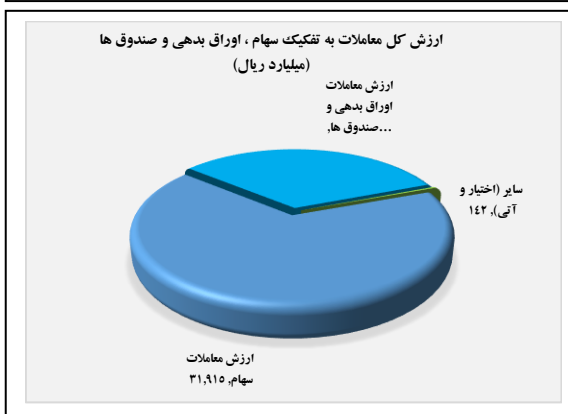
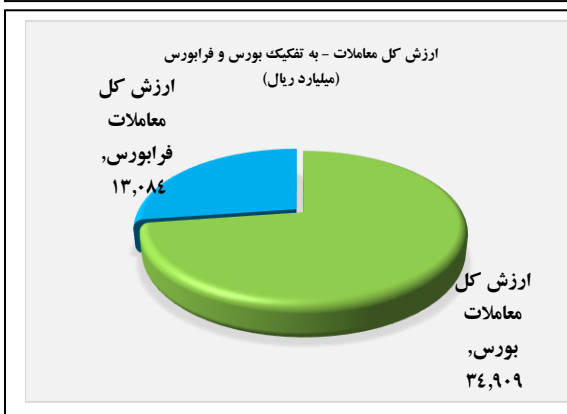
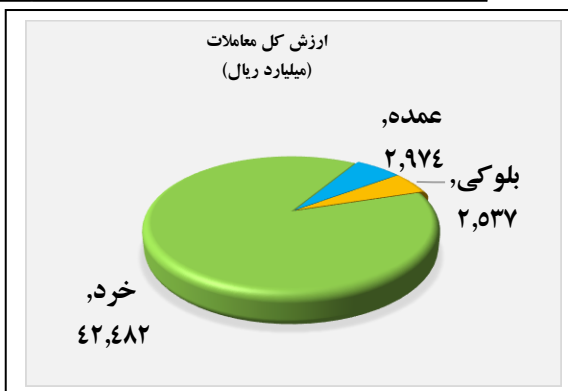
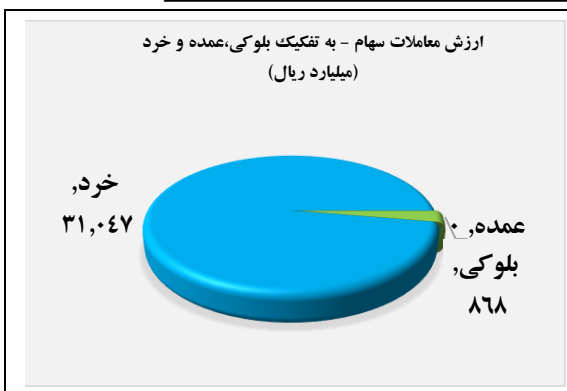
گروه‌های مؤثر

در گروه فرآورده‌های نفتی شرکت نفت ایرانول در فروردین ماه ۳۸ هزار مترمکعب تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه این شرکت در سال ۹۹، حدود ۴۸ هزار مترمکعب گزارش شده است. همچنین در فروردین این شرکت حدود ۳۷ هزار مترمکعب از انواع محصولات را به فروش رسانده است. شرکت نفت ایرانول در فروردین ماه فروش ۳۸۵ میلیارد تومانی گزارش کرده که میانگین فروش ماهانه شرکت در سال گذشته ۴۳۱ میلیارد تومان بوده است. نرخ فروش روانکار داخلی در ماه‌های فروردین و اسفند به ترتیب ۱۰۴ و ۱۳۰ میلیون ریال بوده است. نرخ فروش صادراتی نیز به ترتیب ۹۲ و ۱۳۳ میلیون ریال گزارش شده است. این شرکت از تاریخ ۱۸ آبان سال گذشته از سازمان حمایت مصرف کنندگان و تولید کنندگان مجوز افزایش نرخ ۴۰ و ۵۳ درصدی را برای محصولات بنزینی و دیزلی گرفته است.

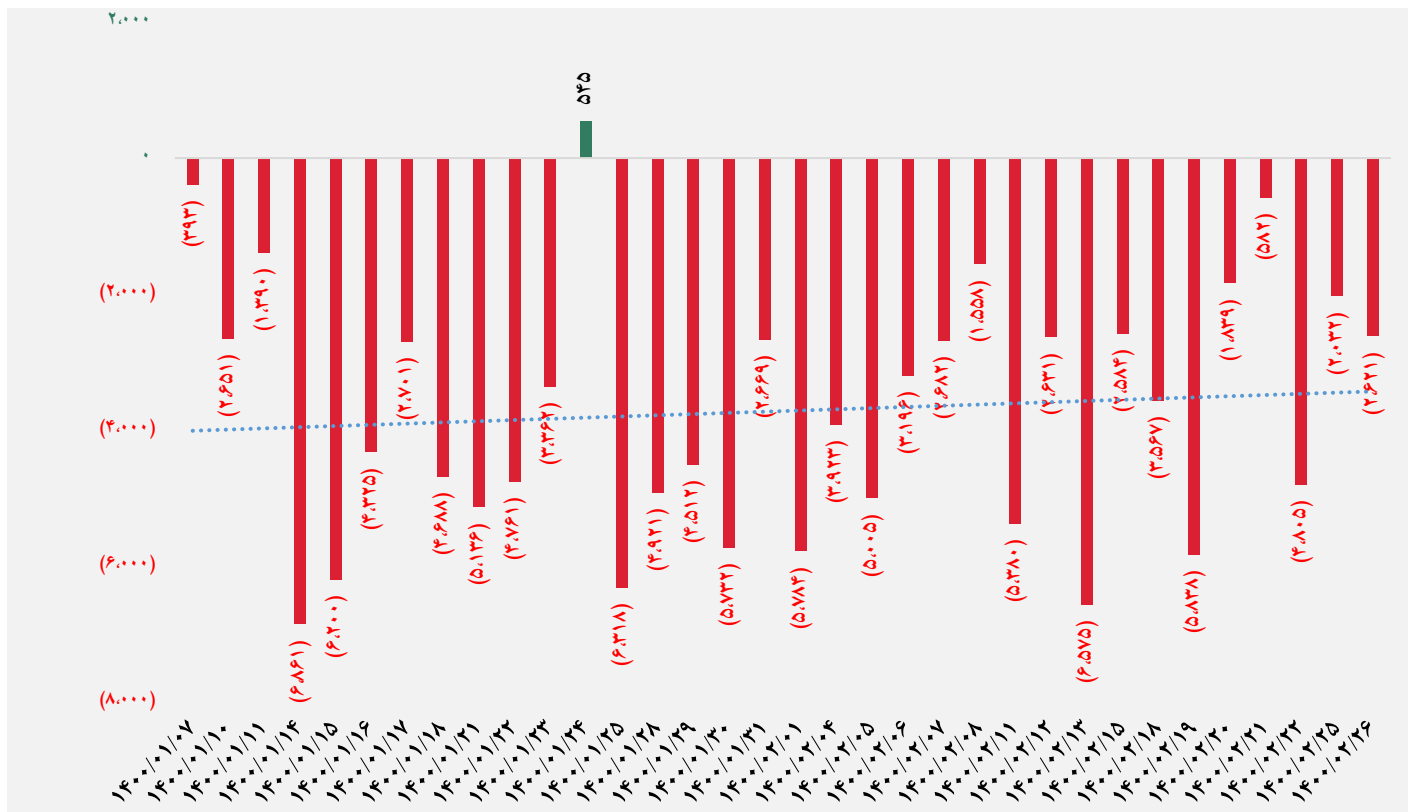
در گروه شیمیایی، شرکت پتروشیمی اراک در سال گذشته فروش ۱۱۱۵۵ میلیارد تومانی را داشته است. در فروردین ماه سال جاری نیز فروش ۱ هزار و ۲۰۰ میلیارد تومانی را ثبت کرده است. این شرکت در فروردین ماه ۶۰ هزار تن از محصولات اول زنجیره، تولید داشته است. قابل ذکر است که میانگین تولید ماهانه پتروشیمی اراک در سال مالی گذشته برابر با ۵۹ هزار تن است. این تولید کننده شیمیایی در سال گذشته به طور میانگین هر ماه ۷۳ هزار تن محصول به فروش رسانده است. در اولین ماه از سال جاری نیز فروش ۵۶ هزار تنی را گزارش کرده است. متوسط نرخ فروش سال گذشته هر کیلو محصول ۱۲۷۴۲ تومان بوده که در فروردین ماه با ۴ درصد افزایش نسبت به ماه گذشته به ۲۲۱۲۳ تومان رسید. برای سال مالی جاری نیز با نرخ فروش حدود ۳۵۰ میلیون ریالی برای محصول پلی پروپیلن، نرخ فروش حدود ۲۶۶ میلیون ریال برای محصول پلی اتیلن سبک خطی، می‌توان سودآوری حدود ۴۵۰۰ ریالی را به ازای هر سهم را برای این شرکت انتظار داشت.

تصویر کلی بازار

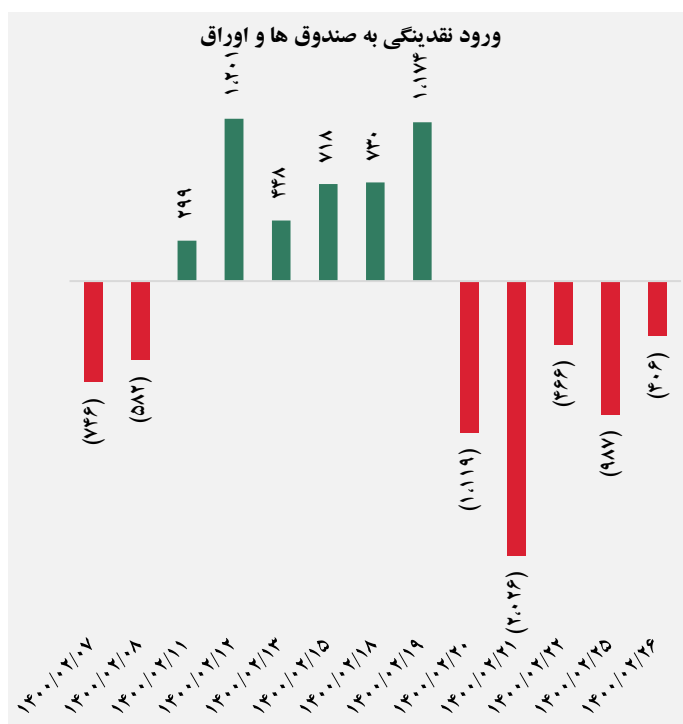
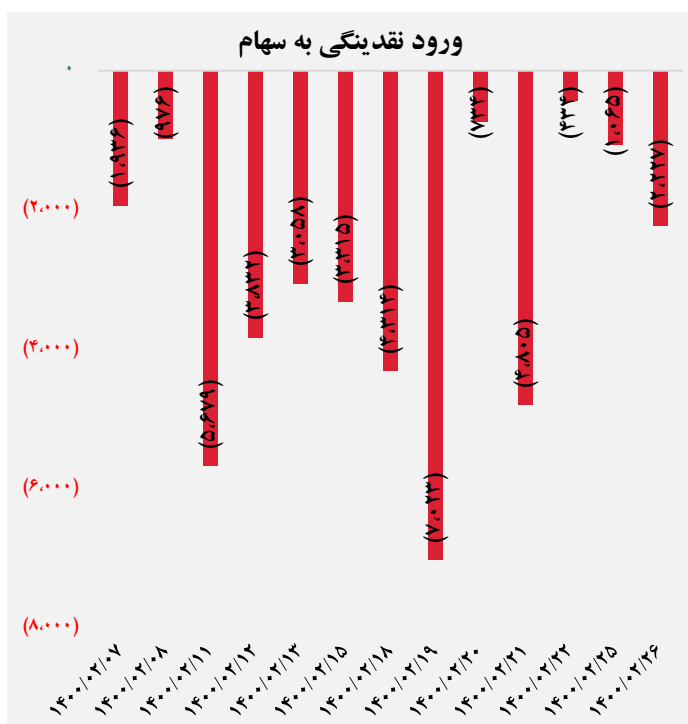
فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۶۷	شاخص کل	۱,۱۸۸,۸۰۶	شاخص کل
۱۱۳	تغییر شاخص	(۷۸۹)	تغییر شاخص
۱۱,۹۳۵,۲۷۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۷,۴۹۷,۰۹۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۳,۰۸۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۴,۹۰۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
	میدکو		فارس
	زاگرس		کچاد
	آریا		خودرو
	هرمز		خسپا
	ارفع		اپال
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
	ذوب		فولاد
	کزغال		فملی
	وسپهر		شستا
	شگویا		کگل
	توریل		وغدیر
	(۲,۲۲۷)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)
	(۴۰۶)		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)



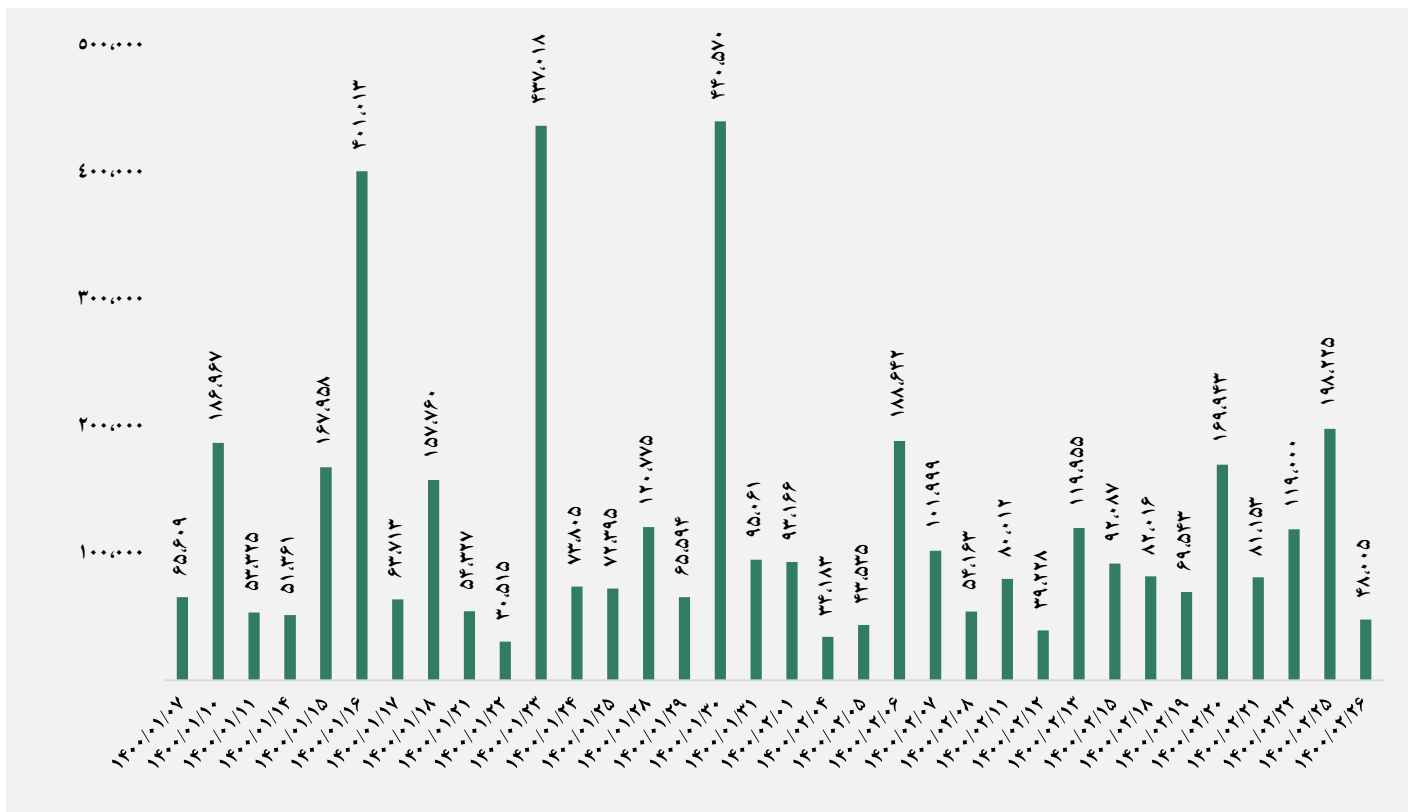
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



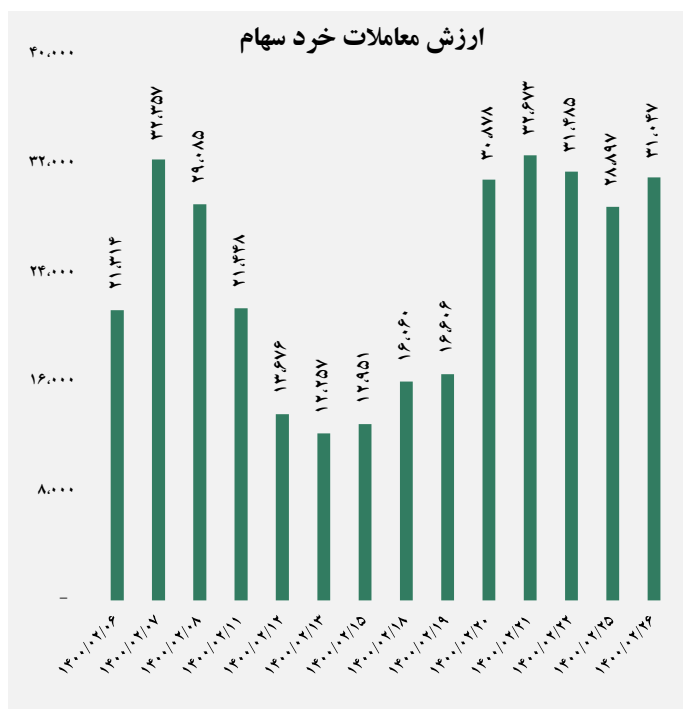
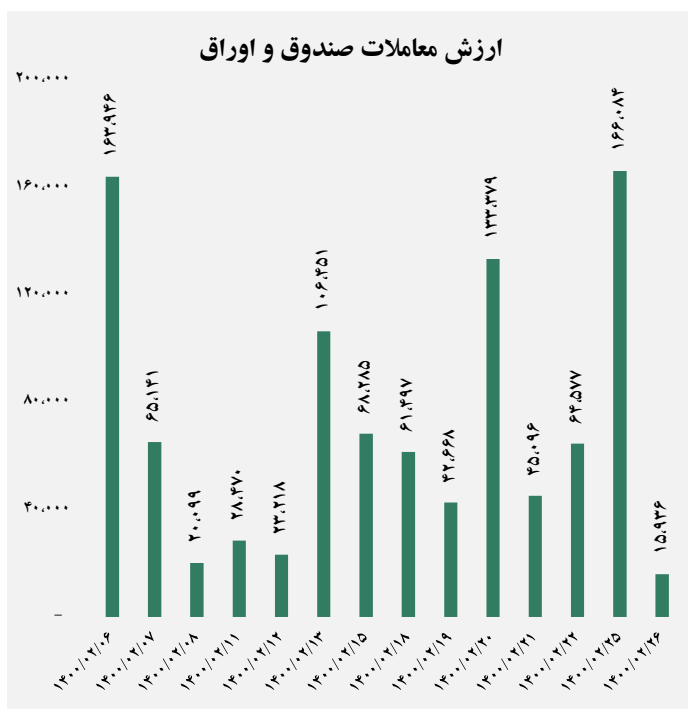
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

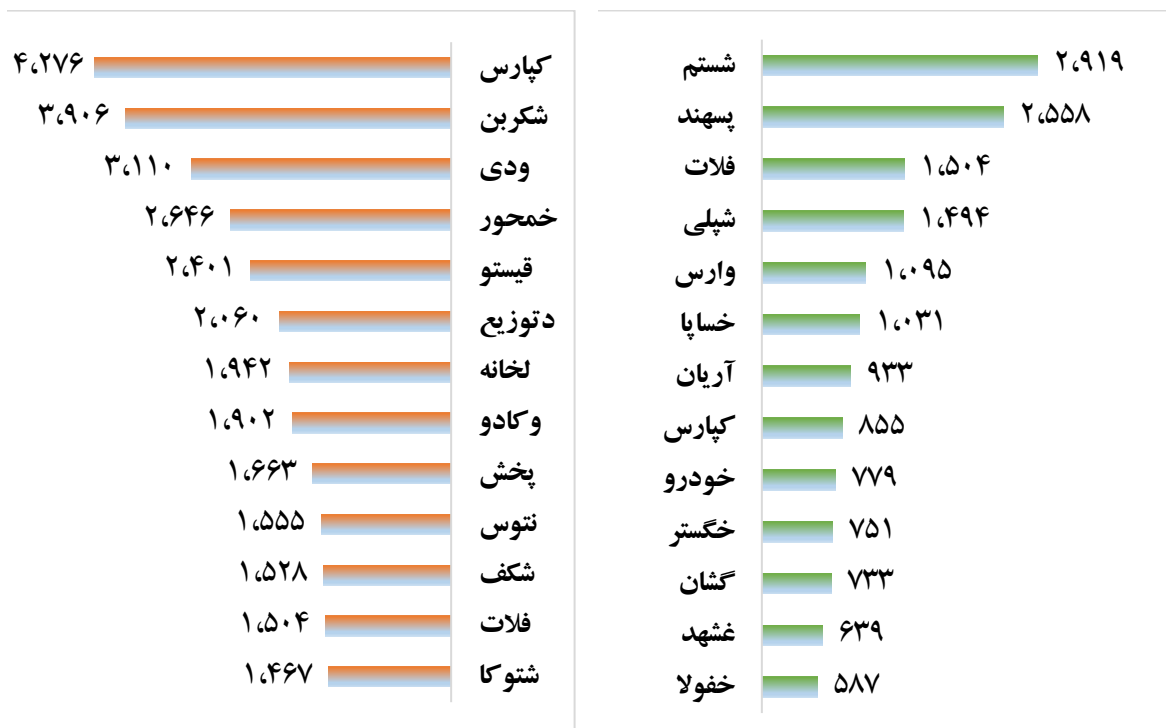


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





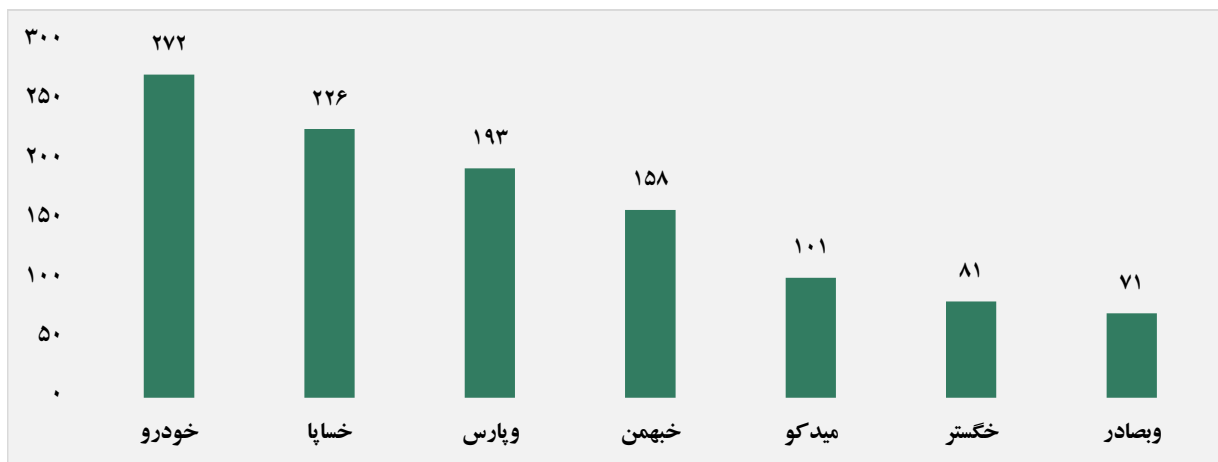
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



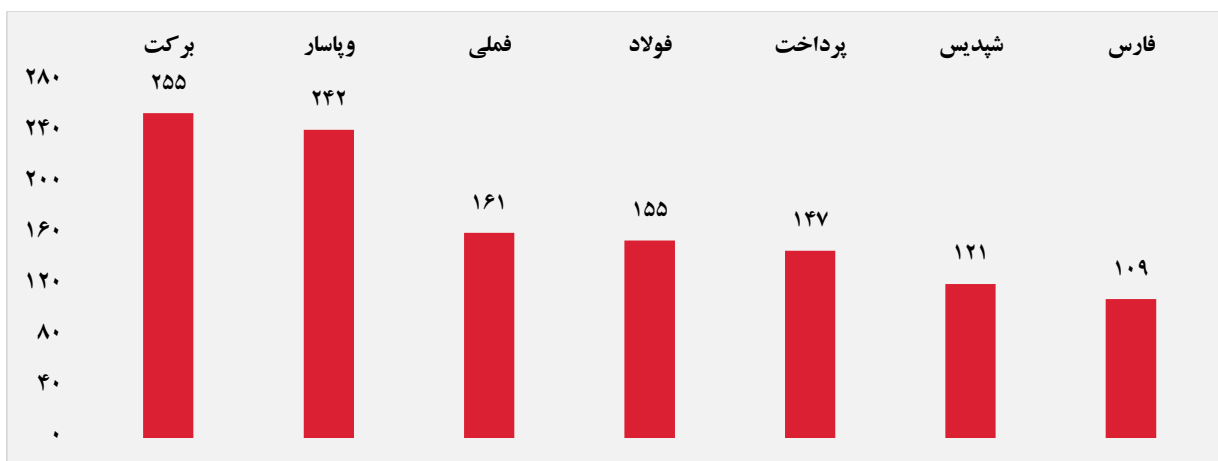
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شصدف	۱	فرآور
۲	وگردش	۲	وآذر
۳	فسازان	۳	وتوصا
۴	مادیرا	۴	وایران
۵	خفولا	۵	غزر
۶	خبهمن	۶	خمحور
۷	شپلی	۷	دزهرای
۸	ویارس	۸	فسپا
۹	سرچشمه	۹	کپارس
۱۰	قشرین	۱۰	خریخت

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

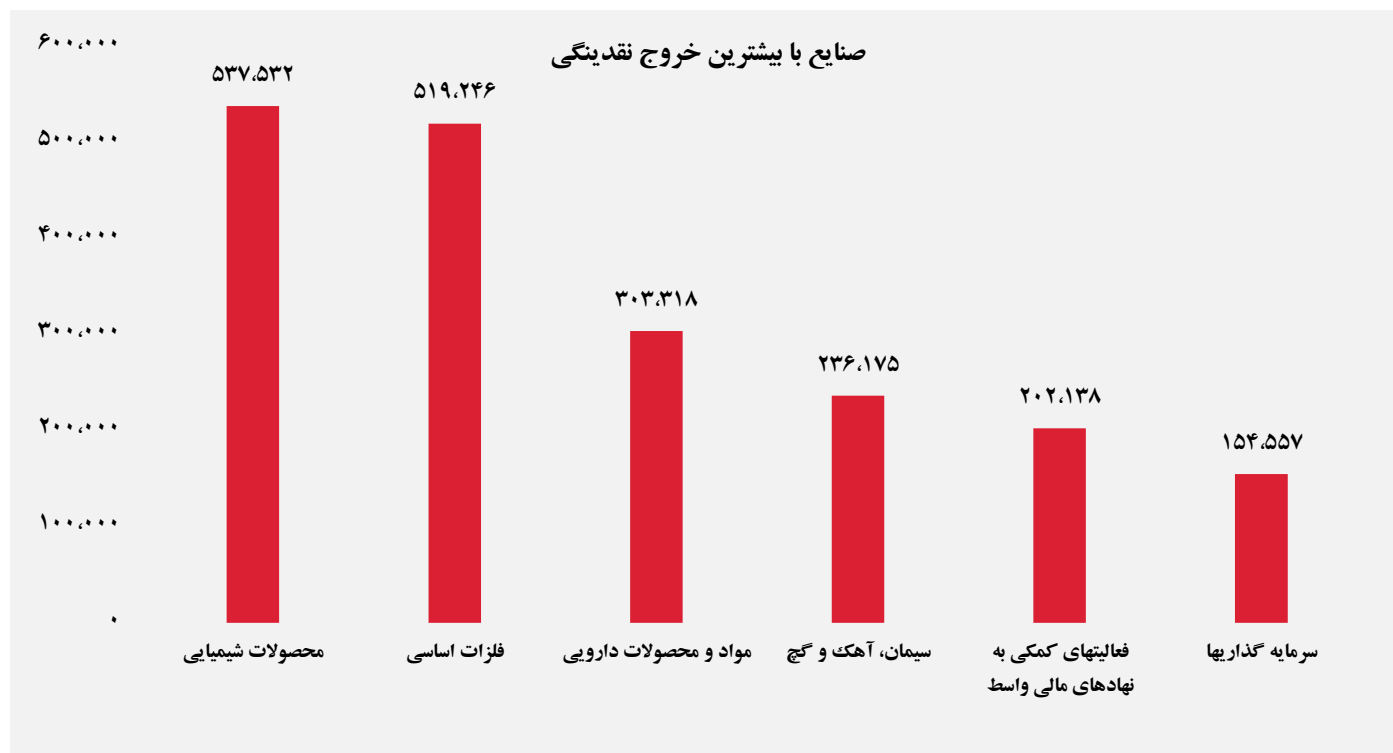
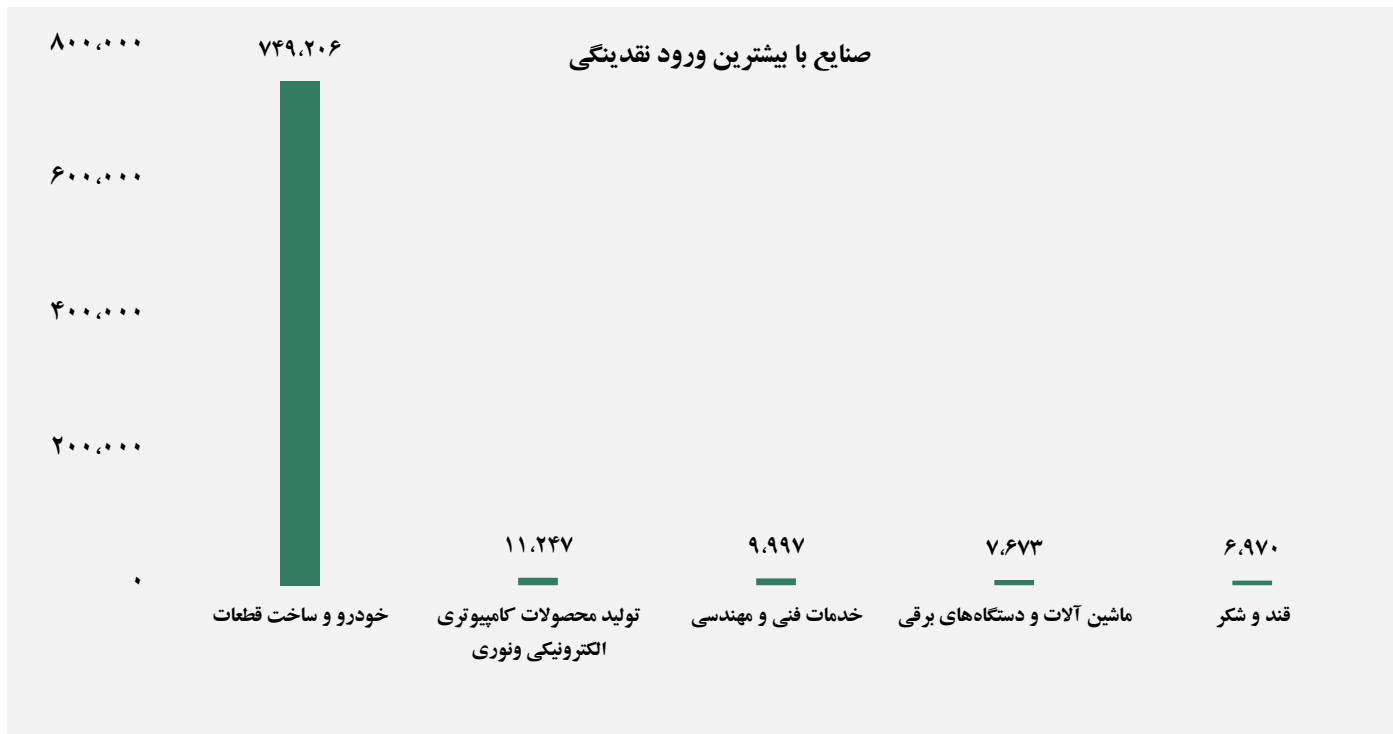


واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	خزامیا	۱۰	ونفت
۲	برکت	۱۱	شغدیر
۳	کزغال	۱۲	ختوقا
۴	ساراب	۱۳	پردیس
۵	ویست	۱۴	جم بیلن
۶	پرداخت	۱۵	بوعلی
۷	خمحرکه	۱۶	زاگرس
۸	آریا	۱۷	شبندر
۹	کاما	۱۸	شپترو



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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر