



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۲۷

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۲۷ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فولاد، وامید، شستا، شپنا، شتران و شبندر با کاهش ۱۴.۱۳۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۷۴.۶۷۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۴۵ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش محسوسی همراه بوده است. اما مبلغ ۲۵ 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 روز گذشته، در اکثر نمادها شاهد فشار عرضه بودیم.

با توجه به افزایش نرخ دلار در دو روز گذشته و گزارش ۱۲ ماهه ۹۹ مناسب برای بسیاری از شرکت‌های فعال در بازار سرمایه، امروز انتظار بازار صعودی را می‌رفت اما فشار عرضه‌های امروز باعث صف فروش بسیاری از نمادها شد که حتی در روز گذشته با صف خرید چند صد میلیونی به کار خود پایان داده بودند. بازار سرمایه با توجه به اتفاقاتی که در ۸ ماه گذشته افتاده، تعادل معاملاتی خود را از دست داده است و دیگر نمی‌توان همانند سال‌های گذشته با بررسی و تحلیل بعضی از پارامترهای خاص، بازار سهام را تحلیل و بررسی کرد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۰۵.۵۲۸ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام 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 ۷۱۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۰۷ با ۲۳.۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۲۶	۱۴۰۰/۰۲/۲۷	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۵,۶۶۶	۲۰۵,۵۲۸	۳۵۲۷٪



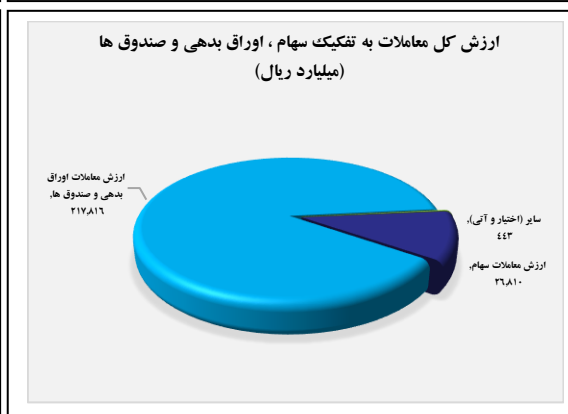
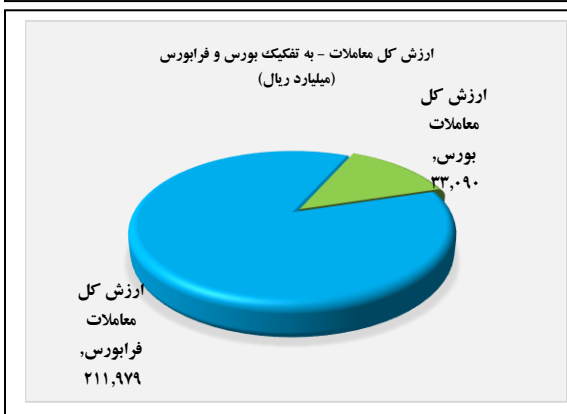
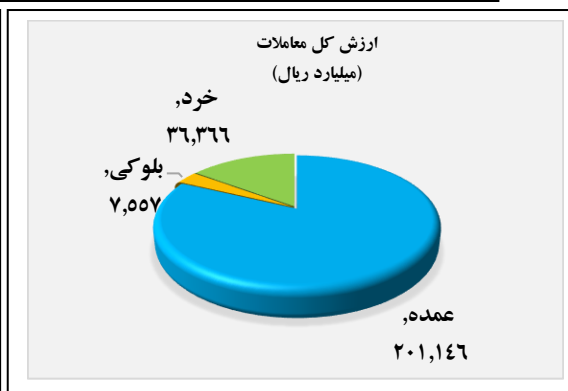
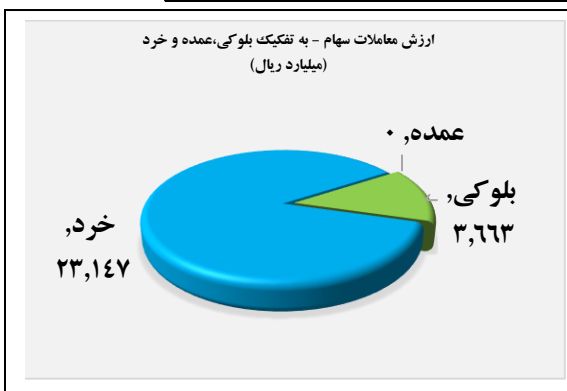
## گروه‌های مؤثر

در گروه ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی، شرکت نیرو ترانس در زمستان به ازای هر سهم ۱۰۴ تومان سود محقق کرده که این عدد در سه فصل قبل ۱۳، ۸ و ۲۷ تومان بوده است. مجموع سود ۱۲ ماهه شرکت ۱۵۲ تومان بوده که نسبت به دوره مشابه سال قبل ۱۳۰ درصد رشد داشته است. این شرکت در زمستان فروش ۲۹۵ میلیارد تومانی داشته که میانگین سه فصل قبل ۹۶ میلیارد تومان بوده است. حاشیه سود ناخالص مشابه فصل قبل ۵۵ درصد بوده که نسبت به ۶ ماهه اول سال رشد چشمگیری را تجربه کرده است. شرکت نیرو ترانس مالک ۱۰۰ درصدی شرکت سرو نیروی شیراز است که محصول GIS را به فروش می‌رساند و فروش‌های مناسب شرکت سرو نیرو سود تلفیقی شرکت نیرو ترانس را در ۱۲ ماهه به ۱۷۴ تومان رسانده است.

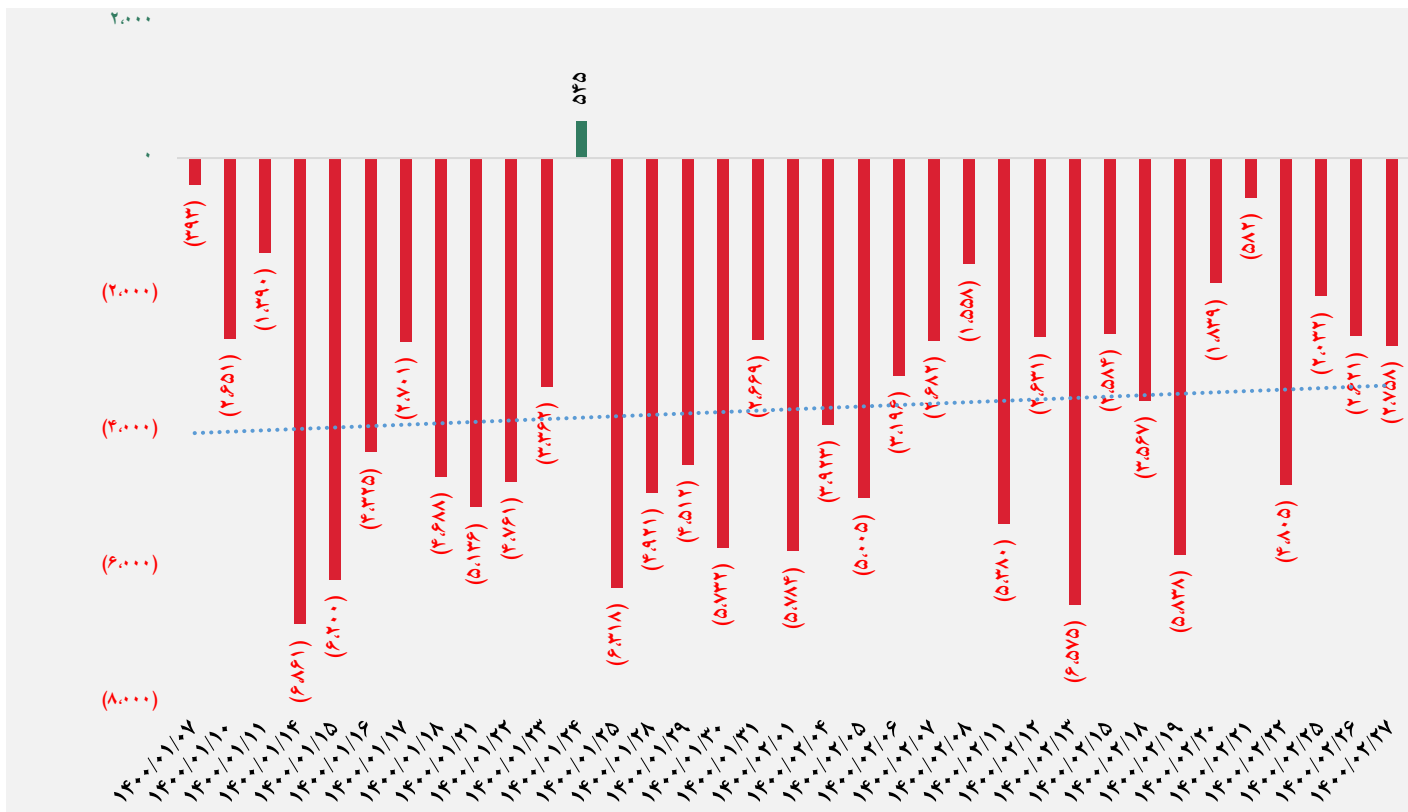
در گروه کانه‌های فلزی، شرکت توسعه و معدنی صبا نور در زمستان به ازای هر سهم ۲۹۶ تومان سود محقق کرده که این عدد در سه فصل قبل به ترتیب ۲۲۷، ۱۰۲ و ۱۱۹ بوده است. سود ۱۲ ماهه به ۷۴۴ تومان رسید که نسبت به سال قبل رشد ۳۸۰ درصدی را تجربه کرده است. این شرکت در زمستان فروش ۱۱۲۷ میلیارد تومانی داشته است. در حالی که میانگین فروش در ۳ فصل اول سال فقط ۳۶۰ میلیارد تومان بوده است. حاشیه سود ناخالص این فصل ۷۴ درصد بوده که در حدود فصل قبل است و نسبت به ۶ ماهه اول سال رشد داشته است. شرکت در فصل زمستان به سود عملیاتی ۸۲۶ میلیارد تومانی رسیده که میانگین سه فصل اول سال ۲۳۵ میلیارد تومان بوده است. سود خالص فصل زمستان این شرکت ۸۶۸ میلیارد بوده در حالی که میانگین سه فصل اول ۴۳۹ میلیارد می‌باشد. شرکت توسعه و معدنی صبا نور در ۱۲ ماهه مجموعاً ۲۱۸۴ میلیارد تومان سود خالص محقق کرده است.

## تصویر کلی بازار

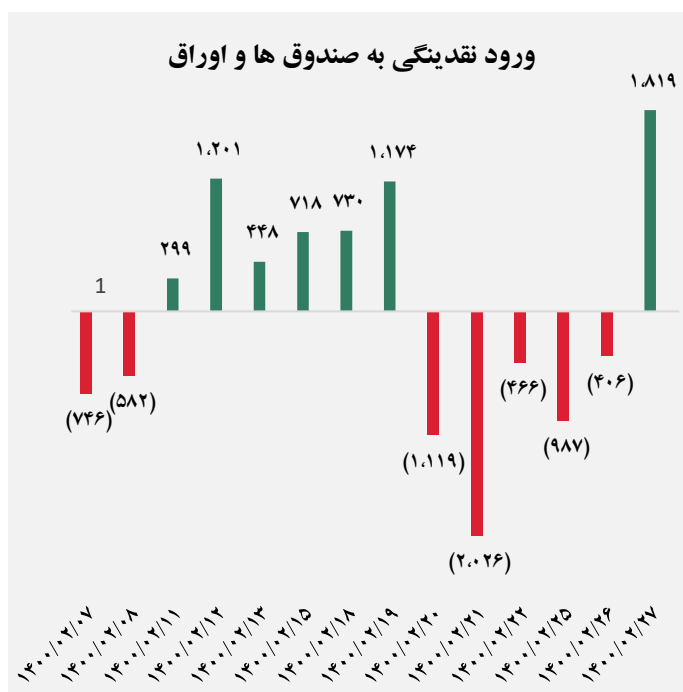
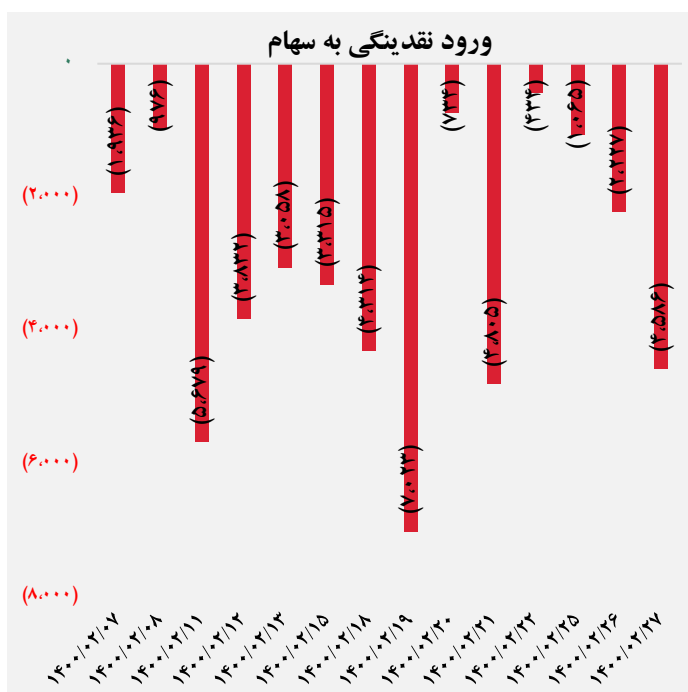
بورس		فرا بورس	
شاخص کل	۱,۱۷۴,۶۷۲	شاخص کل	۱۷,۷۵۷
تغییر شاخص	(۱۴,۱۳۸)	تغییر شاخص	۸۹
ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۹۳۰,۱۶۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۱۱,۹۹۵,۲۰۹
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۳,۰۸۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۱۱,۹۷۹
<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>	
فارس		میدکو	
تاپیکو		بپاس	
نوری		زاگرس	
اپال		کرغال	
ونیکی		ارفع	
<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>	
فملی		شگویا	
فولاد		ذوب	
وامید		مارون	
شستا		بجهرم	
شپنا		کرمان	
ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	(۴,۵۸۶)
ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	۱,۸۱۹



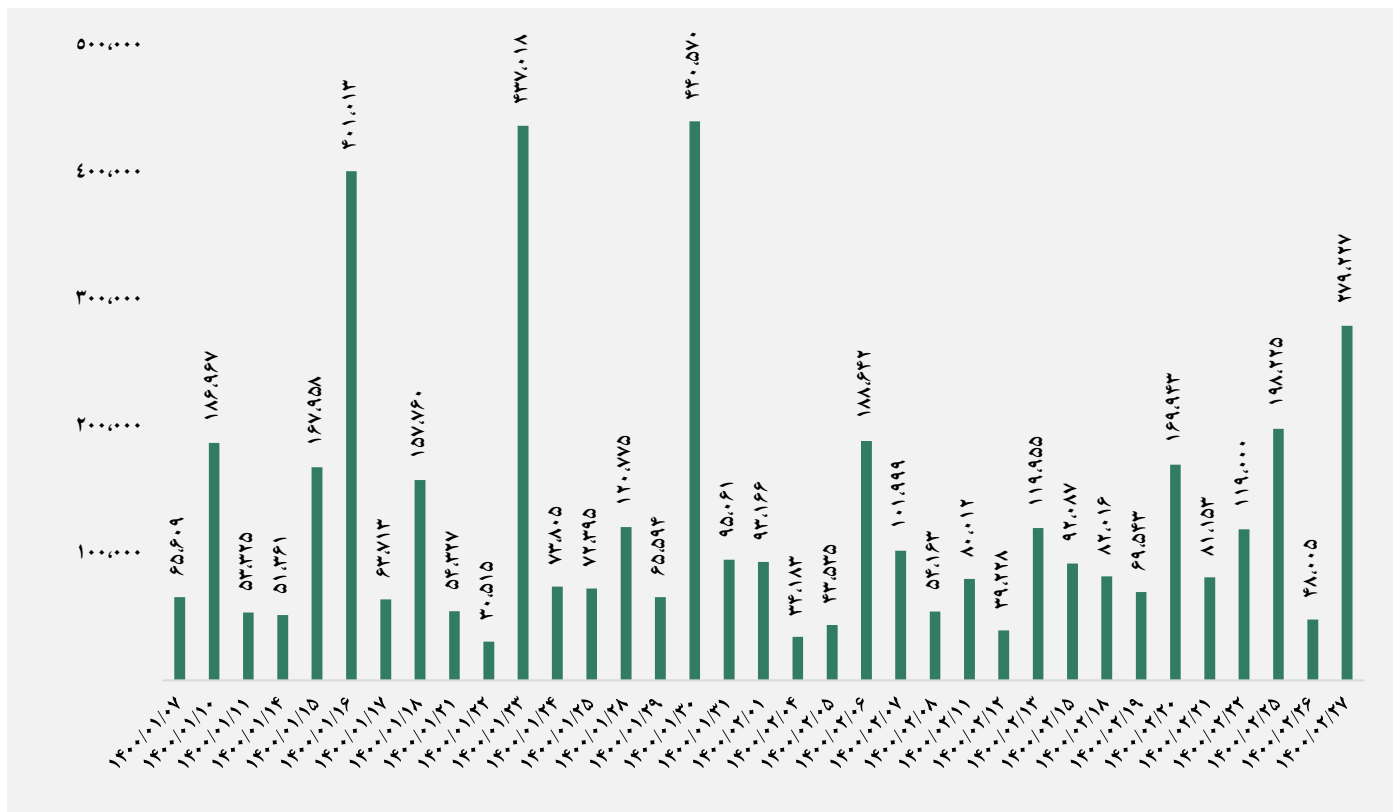
## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



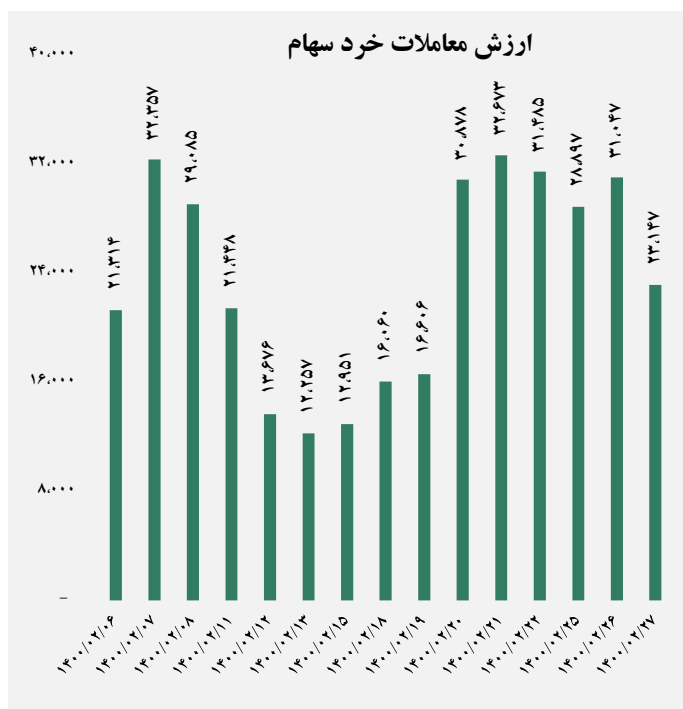
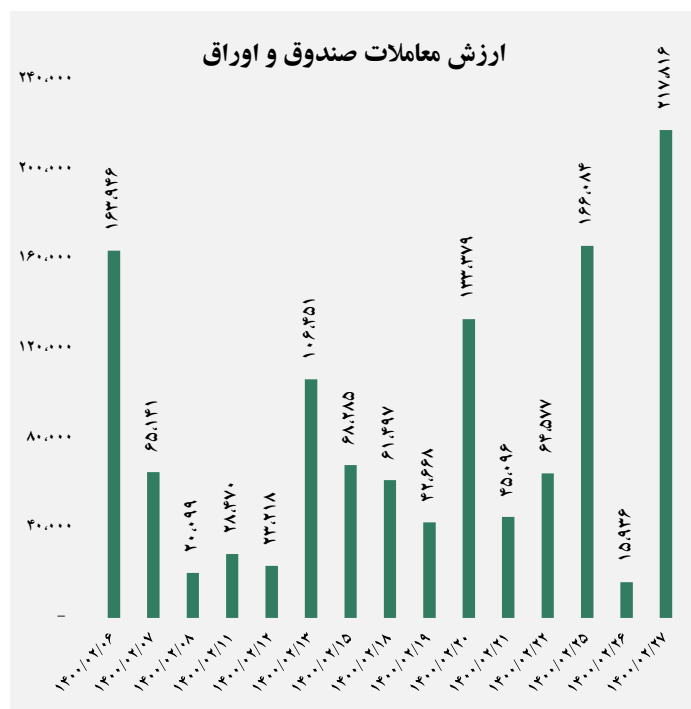
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

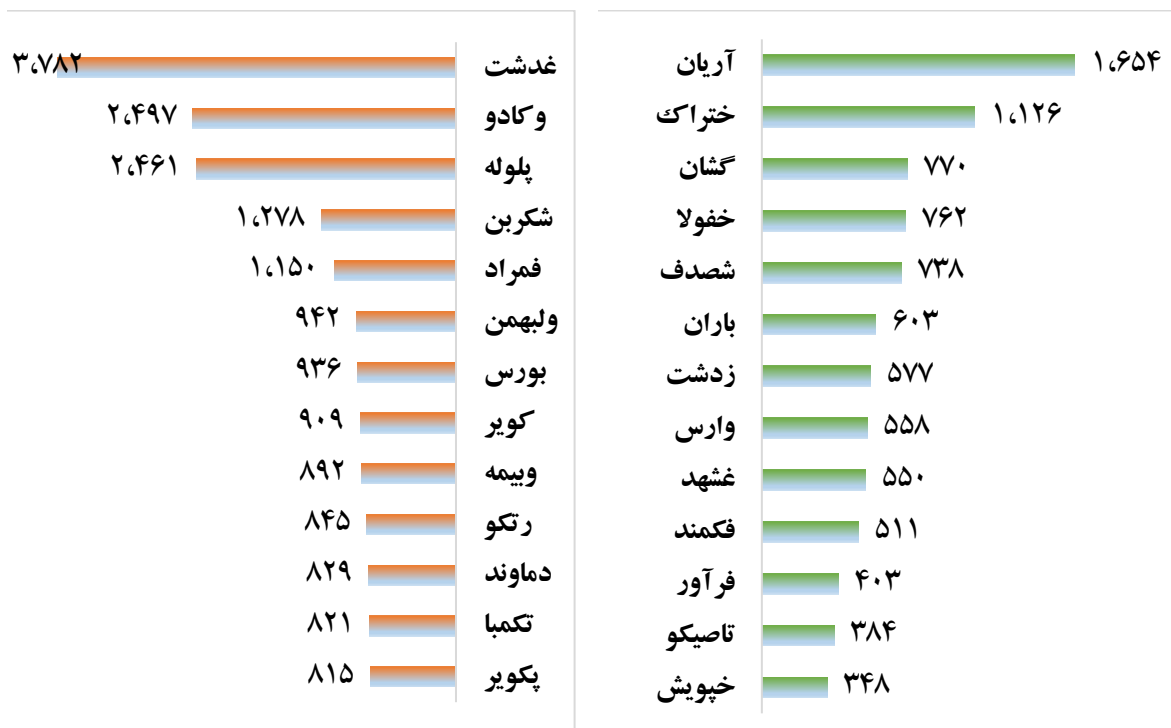


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





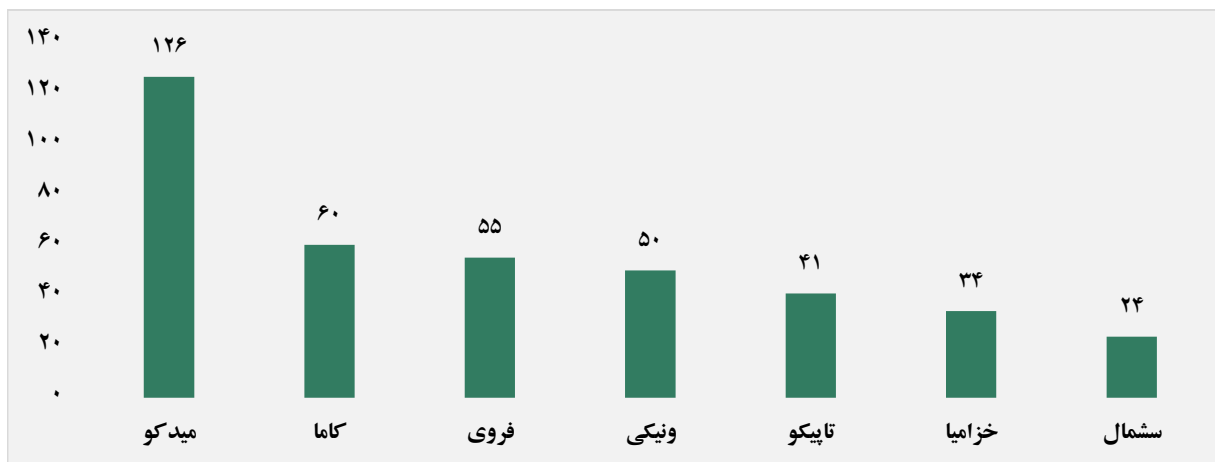
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



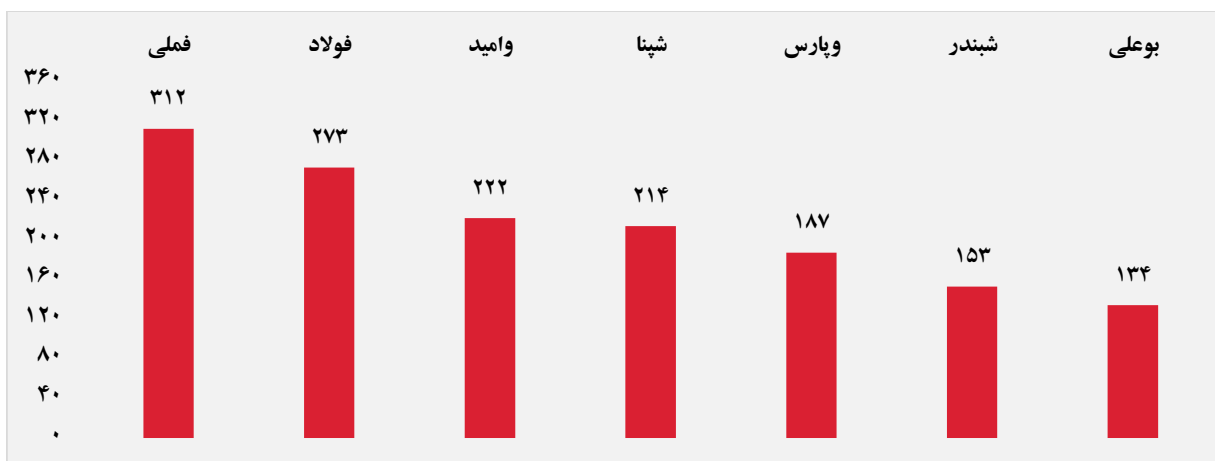
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	پارتا	۱	کاما
۲	کزغال	۲	فروی
۳	بوعلی	۳	وخارزم
۴	-	۴	بموتو
۵	-	۵	فرآور
۶	-	۶	خمحور
۷	-	۷	فسا
۸	-	۸	کسرام
۹	-	۹	کوثر
۱۰	-	۱۰	غالبر

### سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



### سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

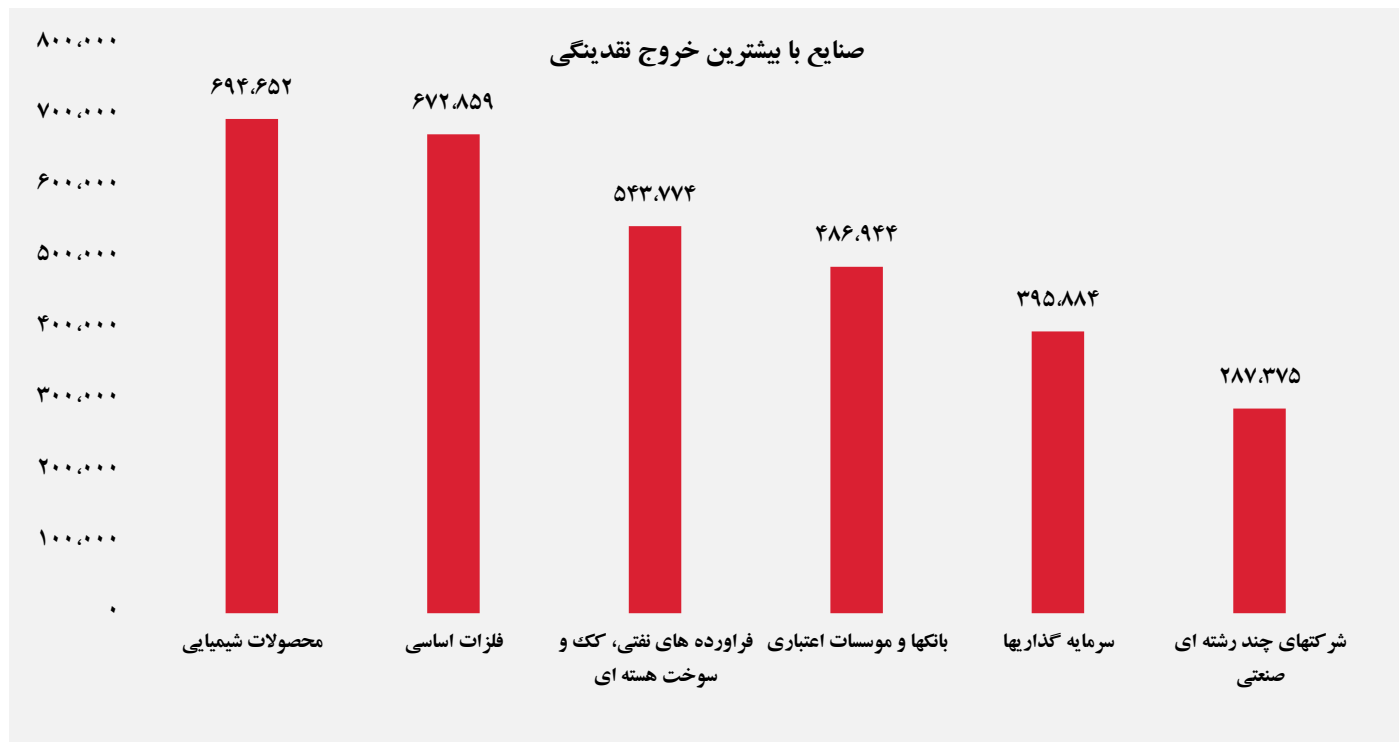
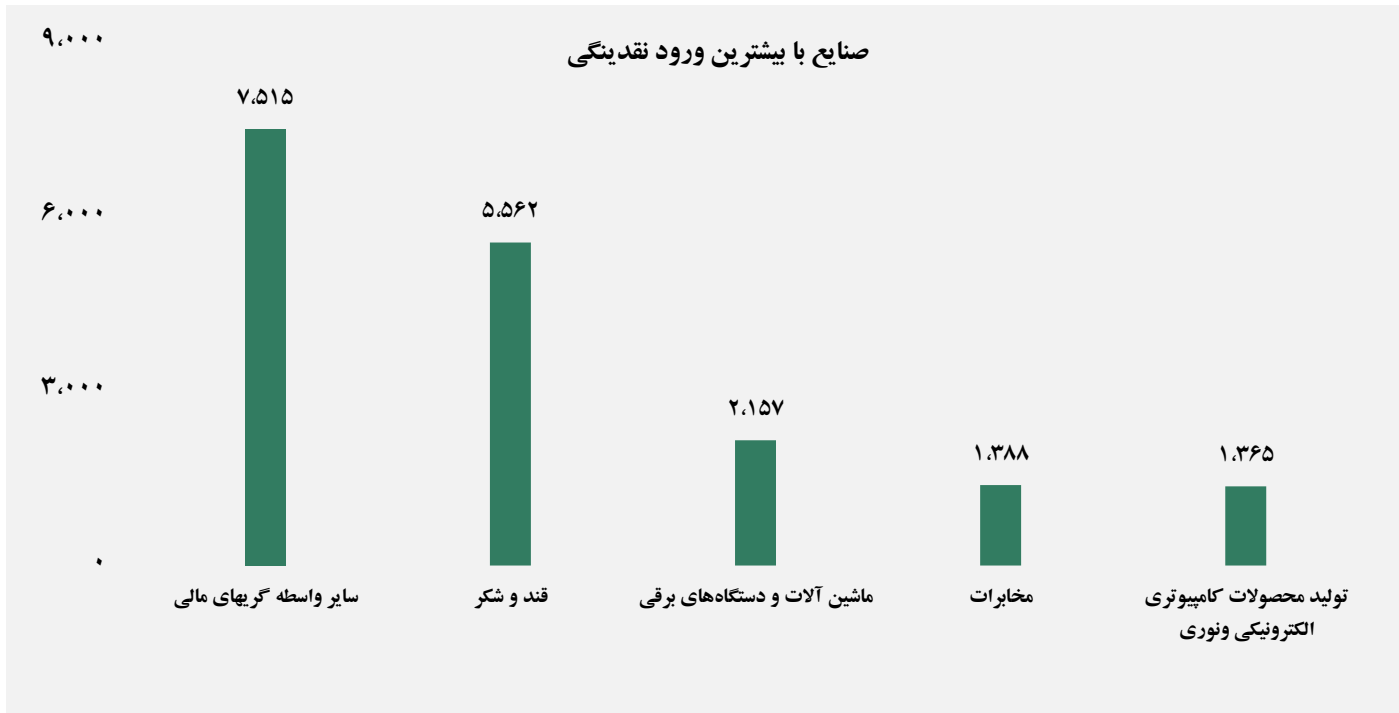


### واچ لیست

نماد	ردیف	نماد	ردیف
پرداخت	۱۰	ساراب	۱
زاگرس	۱۱	کزغال	۲
شمال	۱۲	پرکت	۳
کاما	۱۳	ویست	۴
وساخت	۱۴	شغدیر	۵
حتاید	۱۵	شرانل	۶
سمازن	۱۶	بوعلی	۷
جم پیلن	۱۷	خزامیا	۸
سخوز	۱۸	شپلی	۹



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار