



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۲۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه شنبه ۲۸ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای خودرو، و تجارت، اخبار، خسپا، وبصادر، حکشتی و غبشهر با کاهش ۱.۱۳۰ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۷۳.۵۳۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۰۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. اما مبلغ ۳۰ 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، اکثر نمادها در گروه های خودرو، دارو و سیمان با فشار عرضه مواجه بودند.

در روزهای گذشته خبرهایی حاکی از سرمایه‌گذاری حدود ۱۰ میلیون ایرانی در بازار ارزهای دیجیتال دارد. به نظر می‌رسد اکثر سرمایه‌گذاران ایرانی فعال در بازار ارز دیجیتال از بازار سرمایه به سمت این بازار جدید سوق پیدا کردند. این موضوع حتی می‌تواند در بلندمدت بر بازار بورس و فرابورس تهران اثر منفی بگذارد و مانع تزریق پول جدیدی به بازار سرمایه کشور گردد. باید منتظر ماند تا اثر محدودیت انتقال وجه در صرافی‌های ارز دیجیتال ایرانی که در روز گذشته به تصویب دولتمردان رسید، مشخص و نهایی گردد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱۹.۵۰۴ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش 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	۱۴۰۰/۰۲/۲۷	۱۴۰۰/۰۲/۲۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۰۵,۵۲۸	۱۱۹,۵۰۴	-۴۲٪



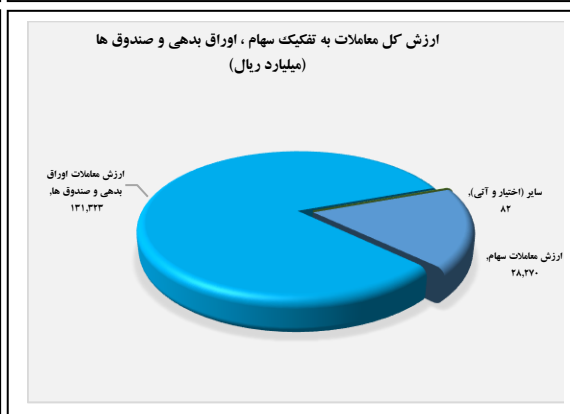
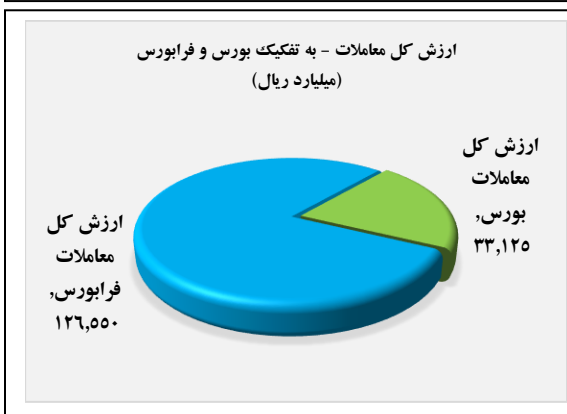
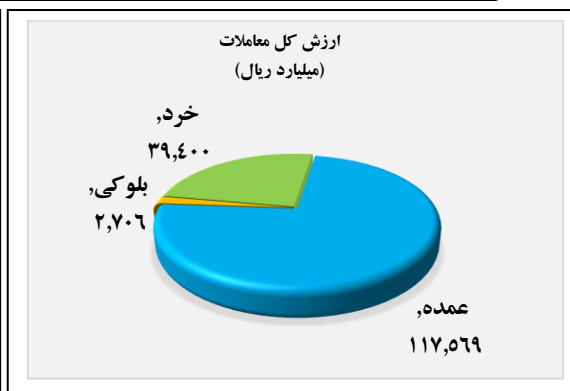
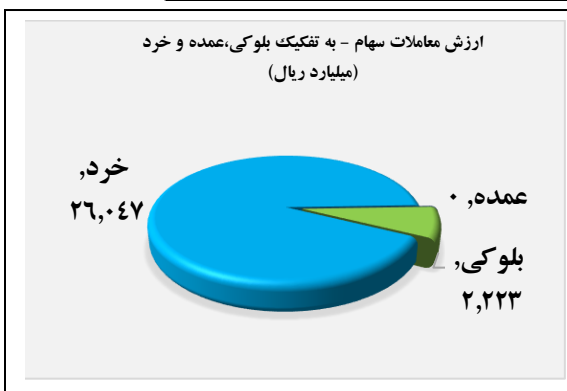
گروه‌های مؤثر

در گروه پتروشیمی، شرکت پتروشیمی غدیر در ۱۲ ماهه ۱۰۰۲ تومان سود به ازای هر سهم ساخته است. شرکت در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب ۶۳،۱۵۸ و ۳۱۹ تومان سود ثبت کرده بود و در فصل چهارم نیز ۴۶۱ تومان سود داشته است. سود سال گذشته این شرکت ۱۷۶ تومان بوده است. سود ۱۲ ماهه ۹۹ رشد ۴۶۸ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه ۹۸ دارد. در فصل اول شرکت پتروشیمی غدیر فروش ۲۷۴ میلیارد تومانی و در فصل دوم فروش ۴۵۶ میلیارد تومانی را داشت و در فصل سوم فروش شرکت عدد ۷۴۹ میلیارد تومان بوده است و در آخرین فصل نیز با رشد مناسب فروش ۱۰۹۶ میلیارد تومانی را به همراه داشته است. فروش ۱۲ ماهه سال مالی ۹۸ و ۹۹ به ترتیب ۱۰۱۰ و ۲۵۷۵ میلیارد تومان گزارش شده است. این تولید کننده محصول پی وی سی در سال مالی ۹۹، ۱۳۲۴ میلیارد تومان سود عملیاتی شناسایی کرده که ۴۹۰ درصد بیشتر از مدت مشابه سال قبل است. در ۱۲ ماهه سال مالی ۹۸ این شرکت ۲۲۴ میلیارد تومان سود عملیاتی گزارش کرده بود. حاشیه سود شرکت در ۱۲ ماهه سال گذشته ۵۶ درصد بوده که در سال مالی ۹۸ حدود ۲۷ درصد ثبت شده است.

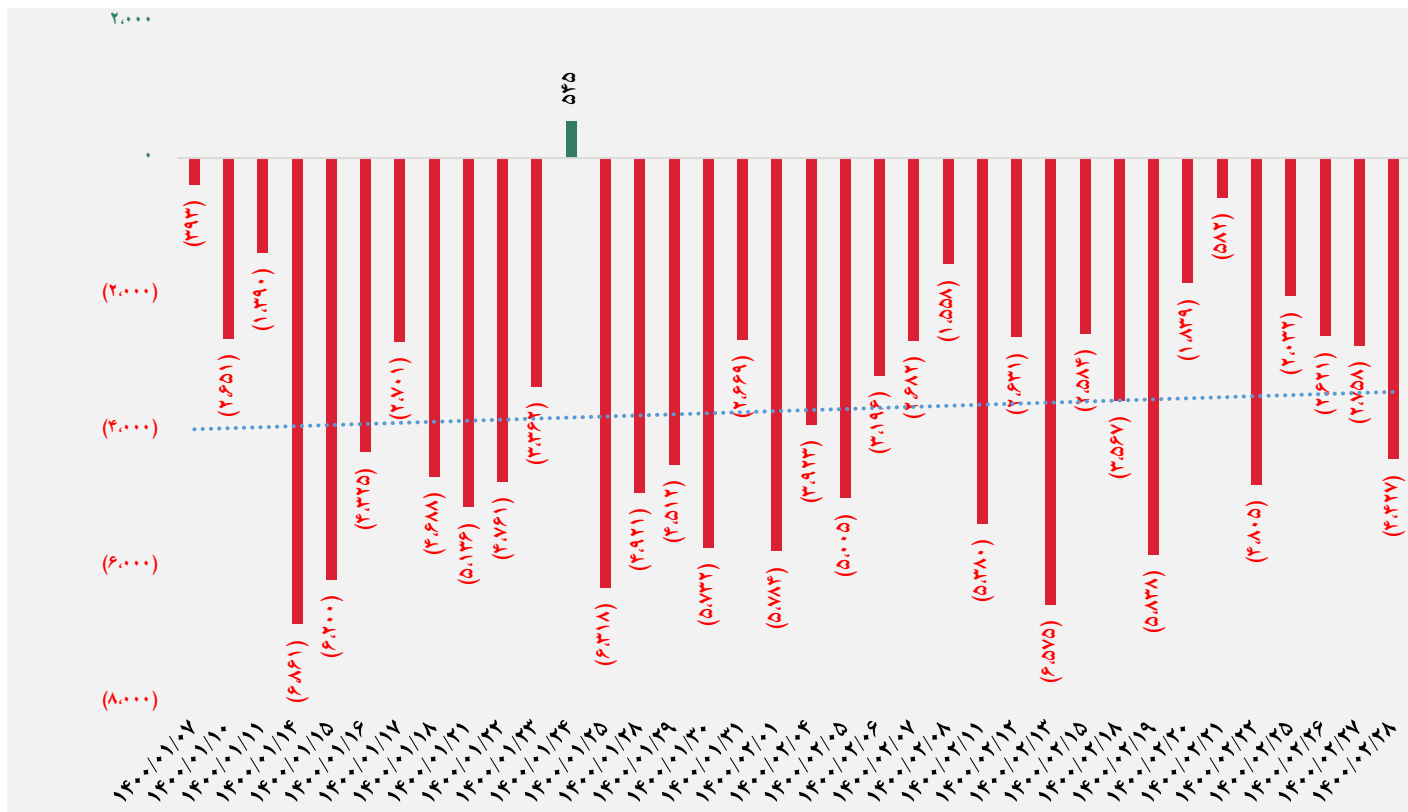
در گروه فلزات اساسی، شرکت صنایع مس شهید باهنر در سه فصل ابتدای سال مالی ۹۹ به ازای هر سهم به ترتیب ۲۴۵، ۱۸۹ و ۶۰ تومان سود گزارش کرده است. سود دوره جاری رشد ۱۲۴ درصدی نسبت به مدت مشابه سال گذشته دارد. فروش این شرکت در سه فصل ابتدای سال مالی به طور متوسط ۶۹۶ میلیارد تومان بوده است. این شرکت فروش ۹۸۹ میلیارد تومانی را برای فصل چهارم سال مالی گذشته گزارش داده و حاشیه سود شرکت در سال مالی ۹۹ مشابه سال مالی قبل معادل ۲۶ درصد بوده است. همچنین این شرکت فروش حدود ۳ هزار و ۱۰۰ میلیارد تومانی را در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته داشته و در مدت مشابه سال مالی ۹۸ فروش این شرکت ۱ هزار و ۳۰۰ میلیارد تومان ثبت شده است که صورت سود و زیان این شرکت حاکی از رشد ۱۳۱ درصدی در مبلغ فروش دارد.

تصویر کلی بازار

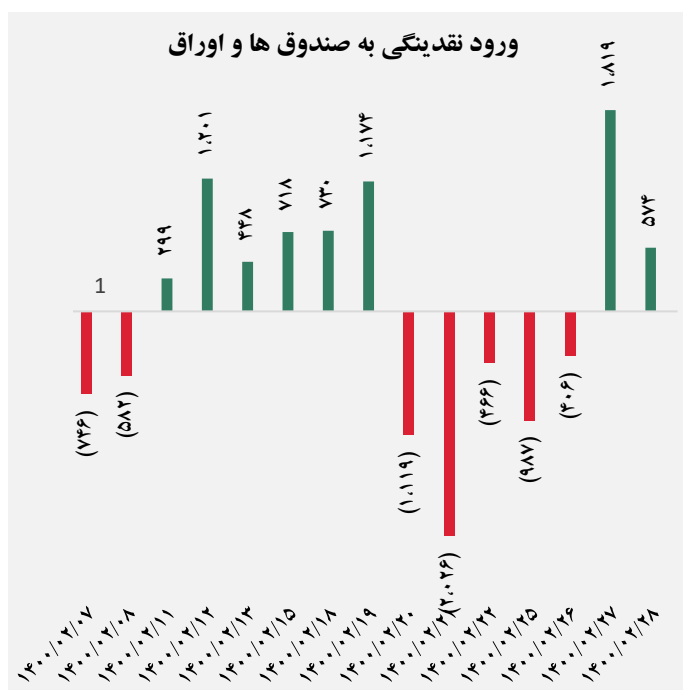
فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۷۵	شاخص کل	۱,۱۷۳,۵۳۰	شاخص کل
۱۸	تغییر شاخص	(۱,۱۳۰)	تغییر شاخص
۱۲,۰۰۳,۹۹۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۹۶۴,۵۱۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۲۶,۵۴۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۳,۱۲۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
میدکو		فملی	
بپاس		کچاد	
غگیلا		ومعادن	
کزغال		تاپیکو	
سرچشمه		فارس	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
شگویا		خودرو	
کگهر		وتجارت	
مارون		اخبار	
چخزر		خسپا	
ذوب		وبصادر	
(۵,۰۱۳)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۵۷۴		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



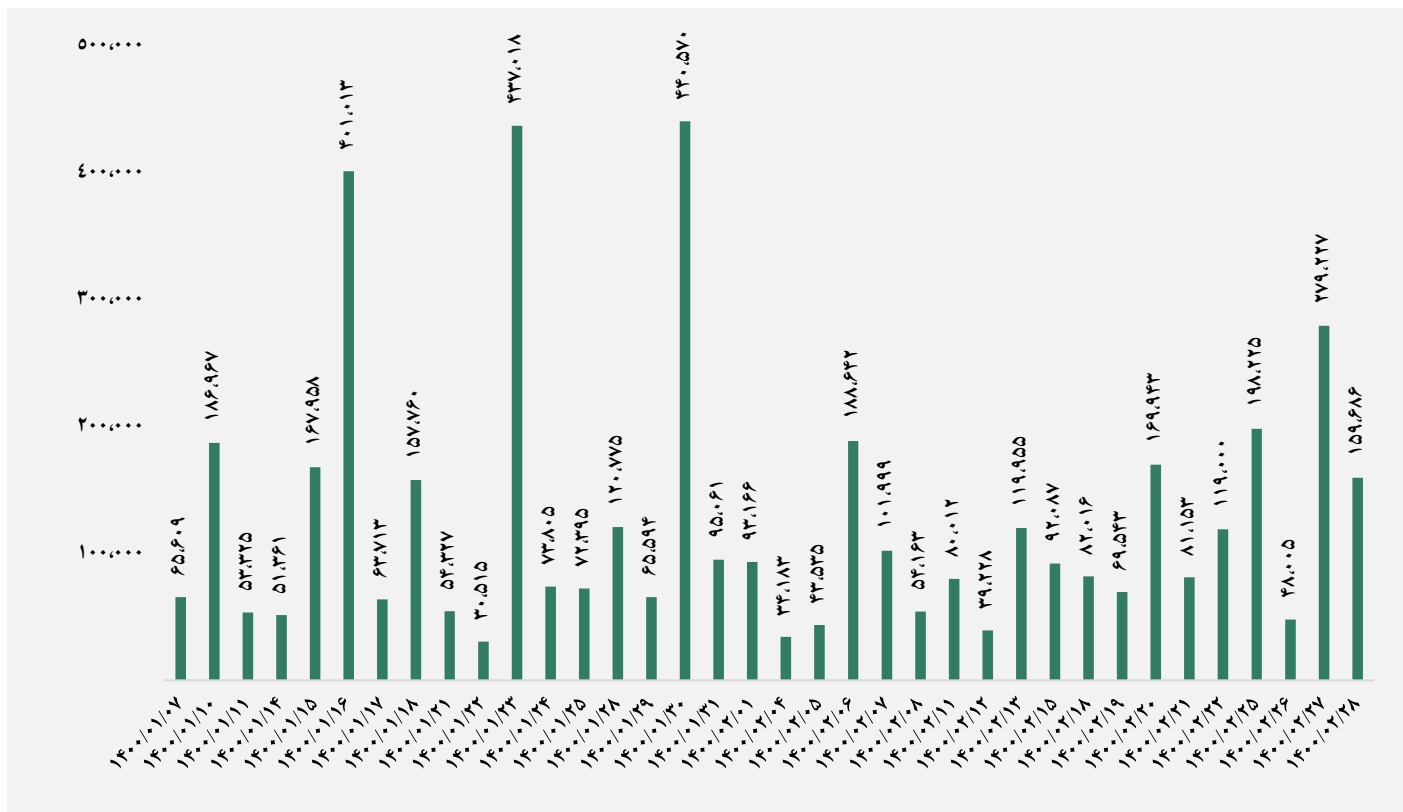
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



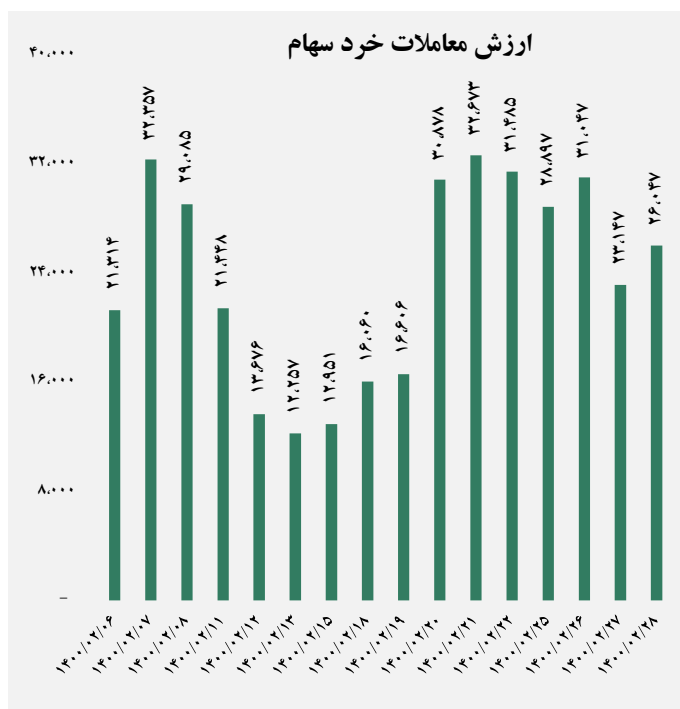
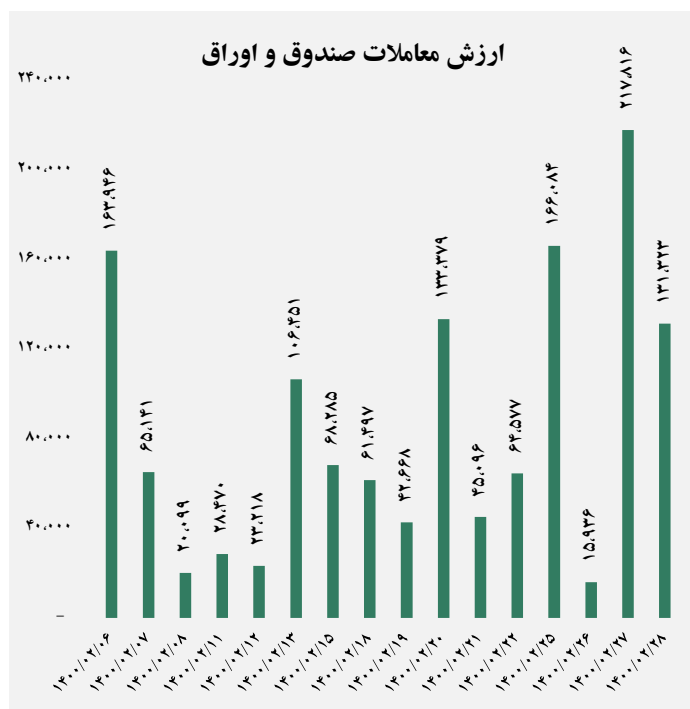
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

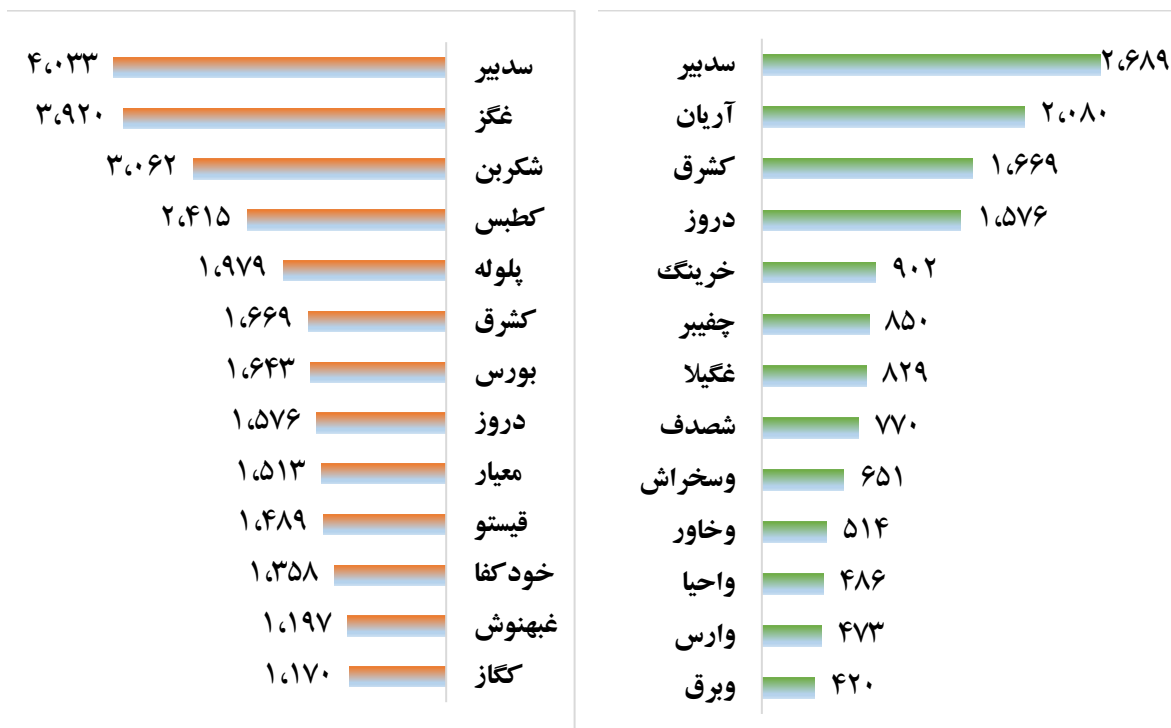


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





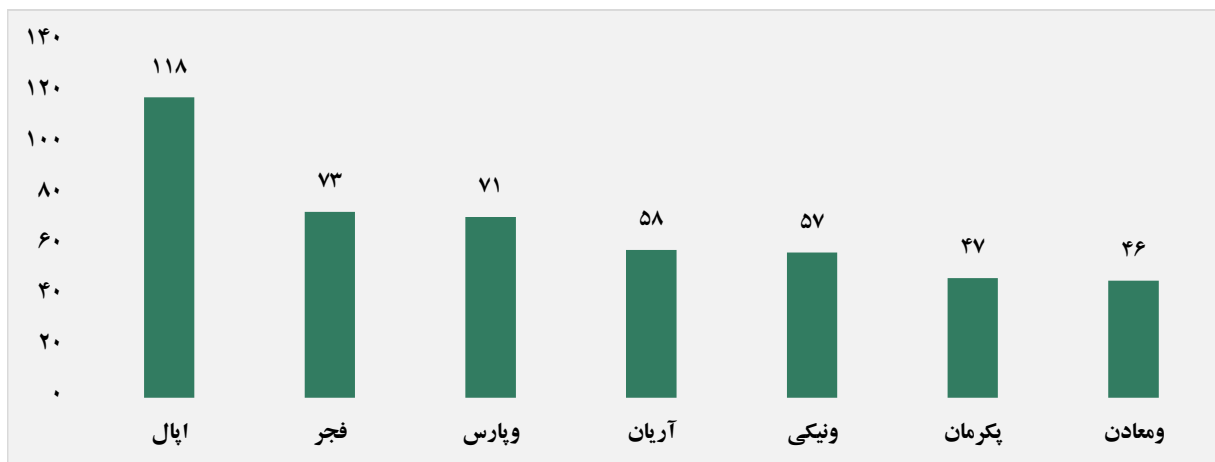
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



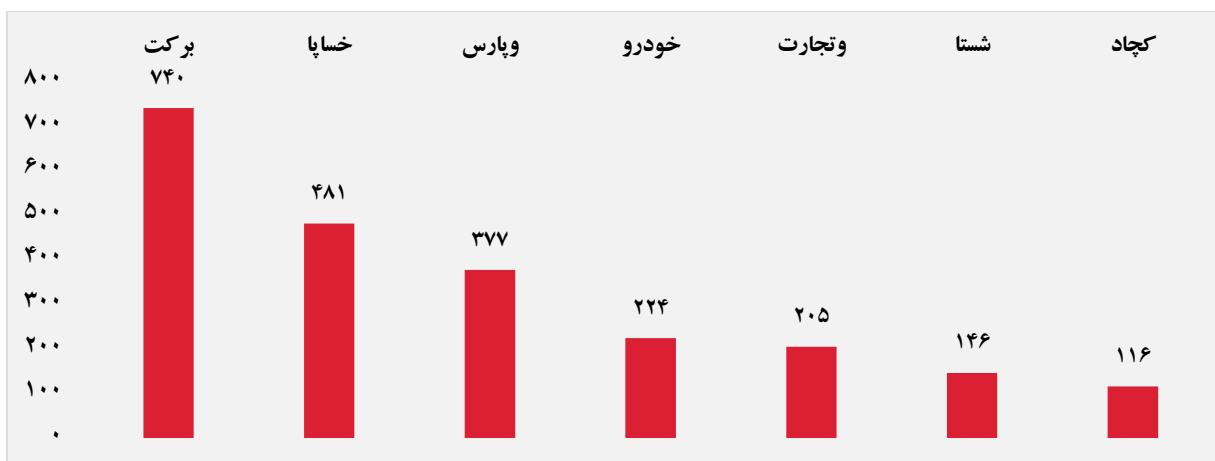
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	آریان	۱	سدبیر
۲	غگیلا	۲	وبرق
۳	وخواور	۳	خفولا
۴	شپلی	۴	غشهد
۵	فجر	۵	خاور
۶	اپال	۶	سباقر
۷	کزغال	۷	کوبیر
۸	ومعادن	۸	وپترو
۹	کماسه	۹	گشان
۱۰	وبانک	۱۰	کاما

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



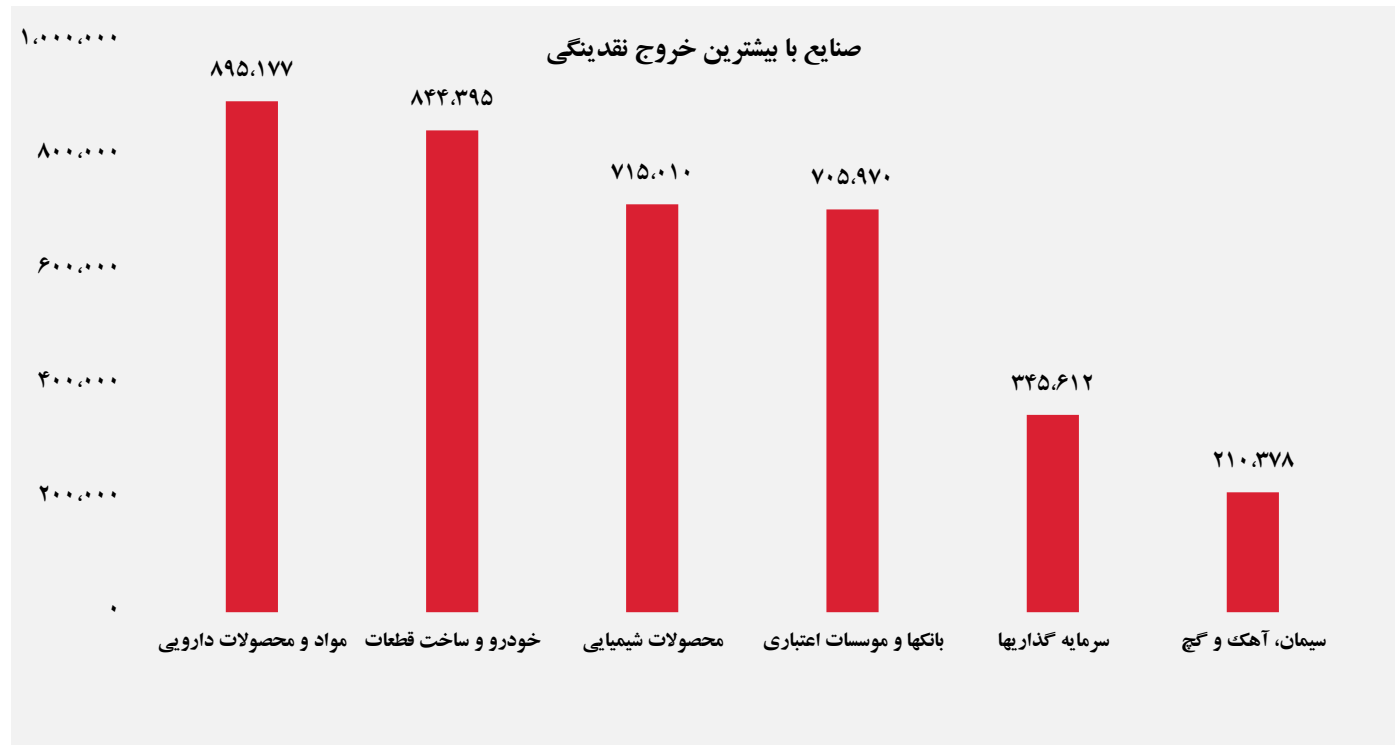
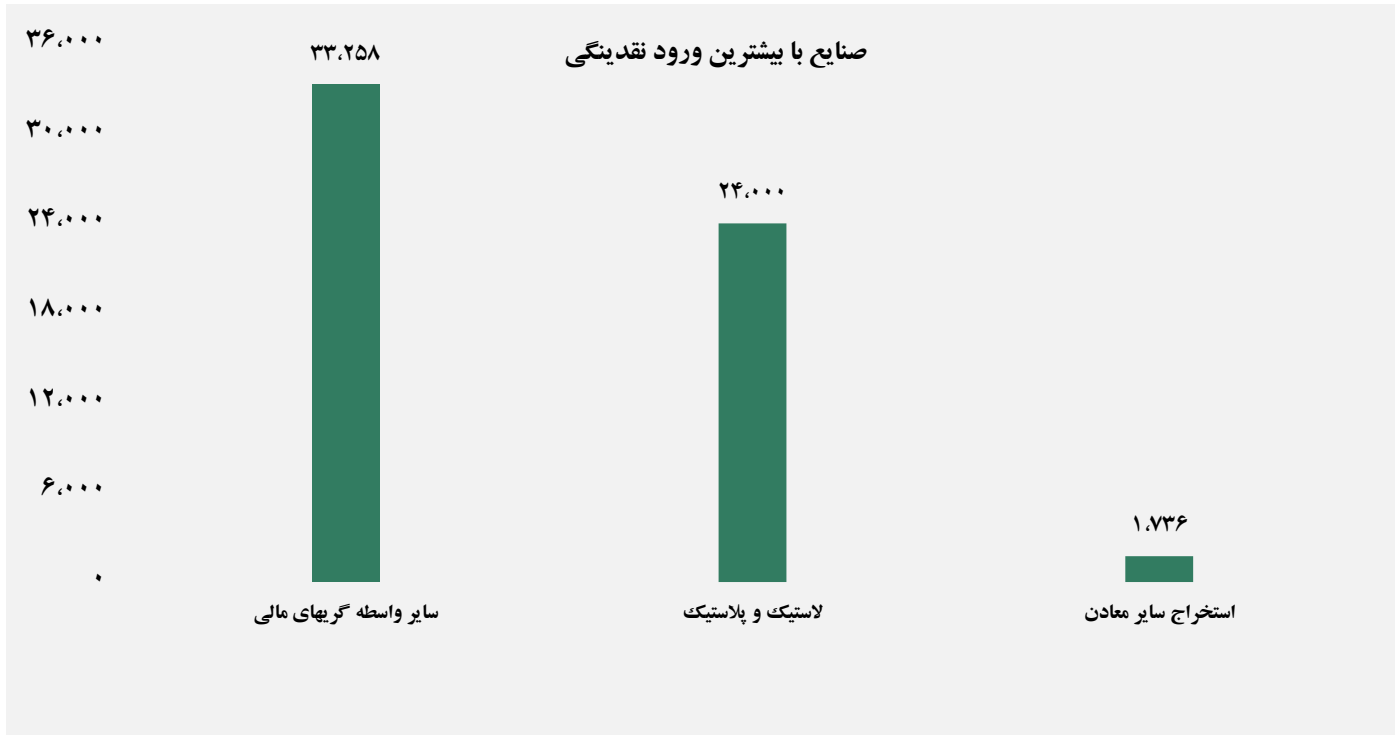
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	گشان	۱۰	وپست
۲	برکت	۱۱	خزامیا
۳	شغدیر	۱۲	شفا
۴	کزغل	۱۳	شمال
۵	حتاید	۱۴	شپلی
۶	سصوفی	۱۵	پردیس
۷	ساراب	۱۶	زاگرس
۸	بوعلی	۱۷	سمازن
۹	غبشهر	۱۸	پکرمان

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار