



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۲۹

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۲۹ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فارس، شینا، شستا، رمپنا، خودرو و وغدیر با کاهش ۱۸.۷۴۶ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۵۴.۷۶۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۳۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. 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، اکثر نمادها در بسیاری از گروه‌ها با فشار عرضه مواجه بودند.

یکی از مشکلات اصلی بازار سرمایه در چند وقت اخیر، عدم تعادل در بعضی از نمادهای بزرگ و تاثیر گذار است که در اوایل سال گذشته با جهش قیمتی زیادی مواجه شده بودند و در حال حاضر هنوز به نقطه تعادل معاملاتی خود نرسیده‌اند. هر چه تعداد نمادهای متعادل در بازار سهام بیشتر شود، به بهتر شدن اوضاع کلی در بازار سهام کمک شایانی خواهد کرد. البته تنها این موضوع برای کمک به کلیت بازار برای خروج از بحران فعلی کافی نخواهد بود و ریسک‌های فعلی حاکم بر بازار اعم از انتخابات ریاست جمهوری، موضوع برجام و از همه مهمتر مشخص شدن کف قیمتی نرخ دلار باید برداشته شوند تا بازار به حالت تعادلی خود مانند سال‌های گذشته (به جزء سال ۱۳۹۹) برگردد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۸۷.۳۹۶ 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 ۸۰۴، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۱ با ۲۲.۸٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۲/۲۸	۱۴۰۰/۰۲/۲۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۱۹,۵۰۴	۸۷,۳۹۶	-۲۷٪



## گروه‌های مؤثر

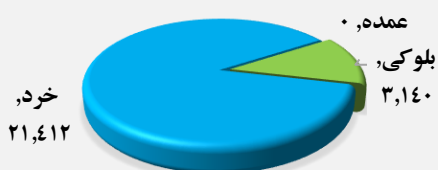
در گروه زغال سنگ، شرکت زغال سنگ پرورده طبس در ۱۲ ماهه سال مالی ۱۳۹۹، ۴۱۱ تومان به ازای هر سهم سود ساخته است. این شرکت در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب ۵۵، ۹۳ و ۸۸ تومان به ازای هر سهم سود محقق کرده بود و در فصل چهارم نیز ۱۷۵ تومان سود داشته است. سود سال مالی ۱۳۹۸ برای این شرکت ۱۰۶ تومان به ازای هر سهم بوده است. سود ۱۲ ماهه سال مالی گذشته رشد ۳۰۵ درصدی نسبت به ۱۲ ماهه ۹۸ دارد. در فصل اول فروش ۲۱۵ میلیارد تومان، فصل دوم فروش ۳۰۸ میلیارد تومان و در فصل سوم فروش شرکت عدد ۳۶۴ میلیارد تومان بوده است و در فصل چهارم فروش این شرکت به ۵۴۴ میلیارد تومان رشد پیدا کرد. کل فروش ۱۲ ماهه سال مالی ۹۸، ۶۹۶ میلیارد تومان و فروش کل ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۱۴۳۰ میلیارد تومان بوده است. این تولید کننده زغال سنگ در سال مالی ۹۹، ۸۰۳ میلیارد تومان سود عملیاتی شناسایی کرده که ۲۹۴ درصد بیشتر از مدت مشابه سال قبل است. در کل سال مالی ۹۸ این شرکت ۲۰۴ میلیارد تومان سود عملیاتی گزارش کرده بود. حاشیه سود شرکت در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۵۷ درصد بوده و در سال مالی ۱۳۹۸، ۳۱ درصد ثبت شده است. با توجه به قیمت‌های زغال سنگ، این شرکت در سال مالی جاری می‌تواند به سود حدود ۶۰۰ الی ۶۵۰ تومان به ازای هر سهم دست یابد.

در گروه پتروشیمی، پتروشیمی تندگویان در فصل اول و دوم سال مالی گذشته به ترتیب ۱۳۶ و ۱۷۶ ریال سود به ازای هر سهم ساخته بود. این ارقام در فصل سوم و چهارم سال به ترتیب ۲۶۷ و ۲۶۸ ریال بود و بنابراین مجموع سود سالانه به ۸۴۷ ریال رسید که ۷۰ درصد رشد سالانه را نشان می‌دهد. این شرکت در فصل زمستان فروش خوب ۳۵۹۲ میلیارد تومانی را گزارش کرده که نسبت به فصل پاییز ۳۵ درصد رشد را نشان می‌دهد. اما به علت افزایش ۴۷ درصدی بهای تمام شده و کاهش حاشیه سود عملیاتی از ۲۹ درصد به ۲۱ درصد سود عملیاتی زمستان با رقم ۷۵۵ میلیارد تومان تقریباً برابر با فصل پاییز گزارش شد. شرکت پتروشیمی تندگویان در سال مالی ۹۸ حاشیه سود ناخالص ۲۶ درصدی و خالص ۱۷ درصدی داشته است که در سال مالی ۹۹ این پارامترها بهبود یافت و به حاشیه سود ناخالص ۲۹ درصدی و خالص ۲۰ درصدی رسید.

## تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۹۰	شاخص کل	۱,۱۵۴,۷۶۷	شاخص کل
۱۷	تغییر شاخص	(۱۸,۷۴۶)	تغییر شاخص
۱۱,۹۰۸,۱۵۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۲۱۶,۴۹۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۰۰,۴۷۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۷,۴۸۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>	
میدکو		برکت	
پپاس		اپال	
غگیلا		پاکشو	
شصدف		پارس	
هرمز		ویارس	
<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>	
زاگرس		فملی	
کگهر		فارس	
ذوب		شینا	
وملل		شستا	
ساره		رمینا	
(۵,۷۸۹)		ورود ( خروج ) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال )	
۸۴۶		ورود ( خروج ) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال )	

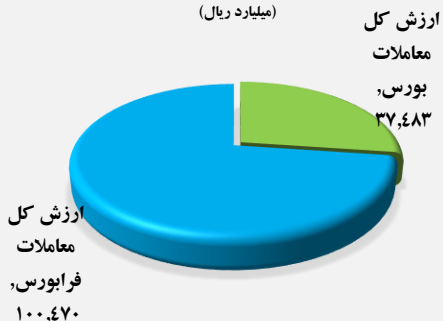
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد  
(میلیارد ریال)



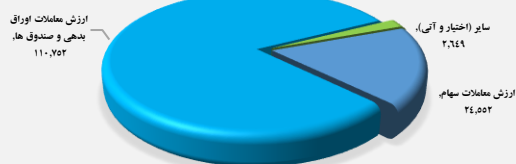
ارزش کل معاملات  
(میلیارد ریال)



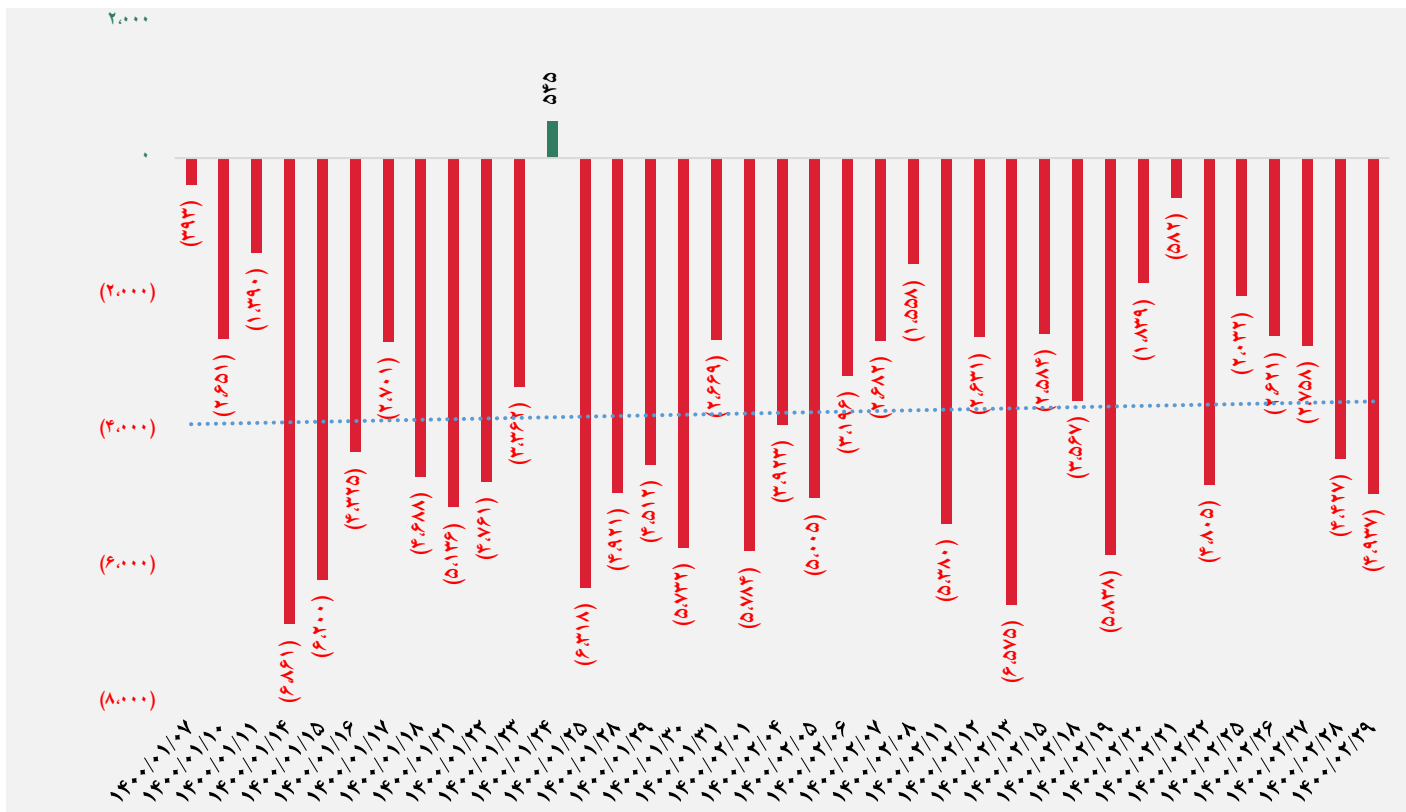
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس  
(میلیارد ریال)



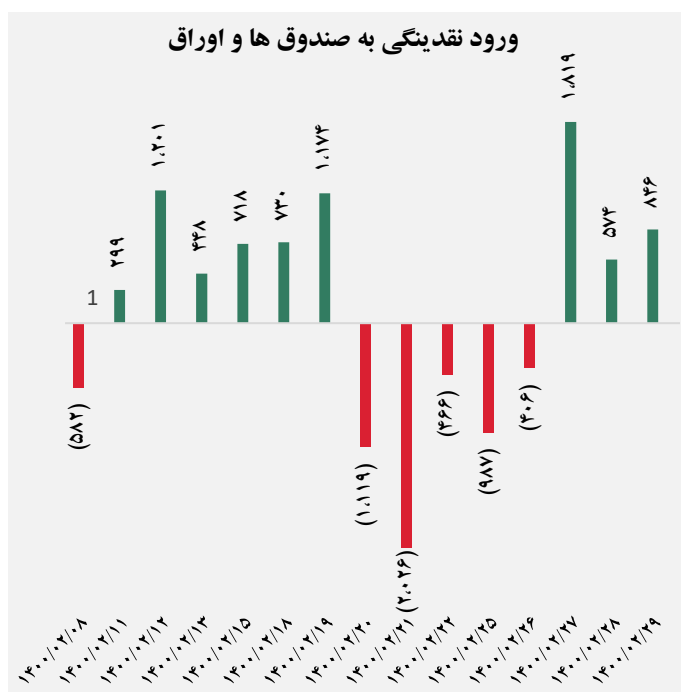
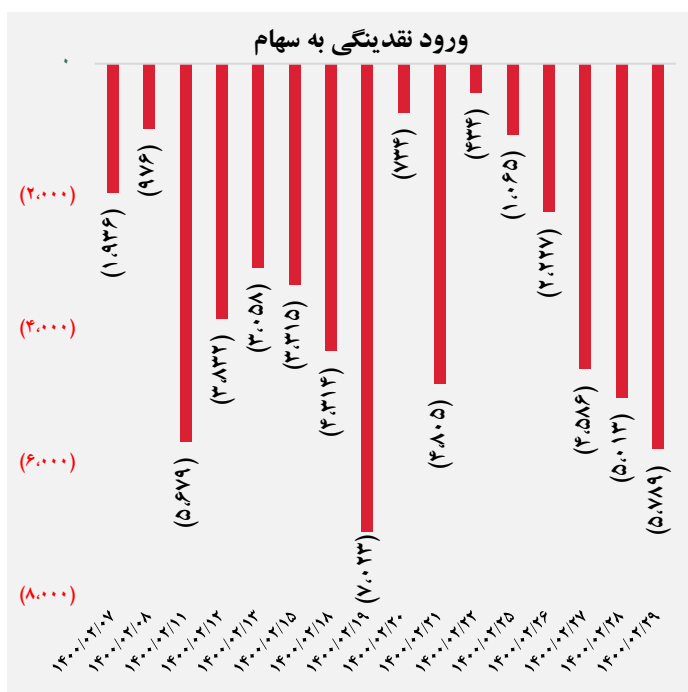
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها  
(میلیارد ریال)



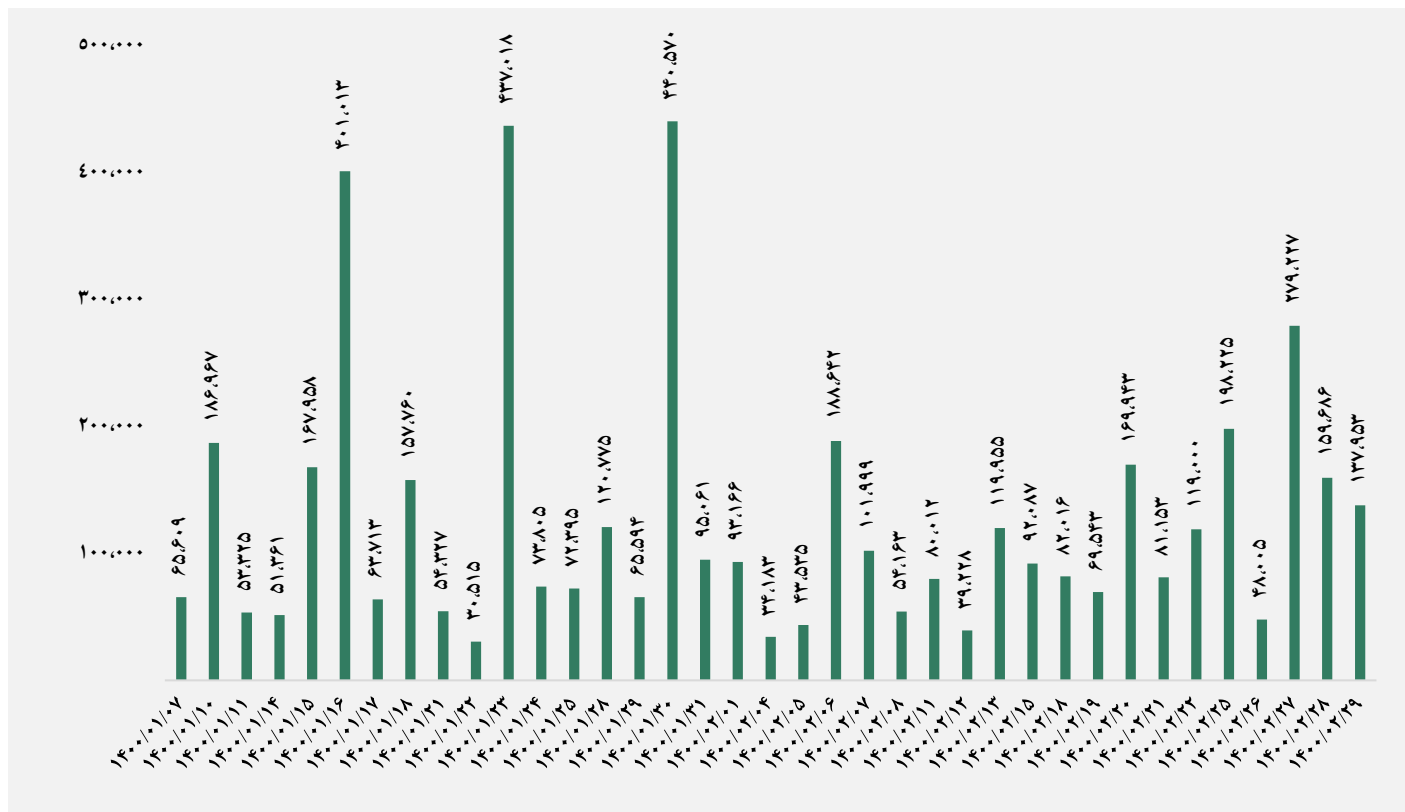
## کل ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



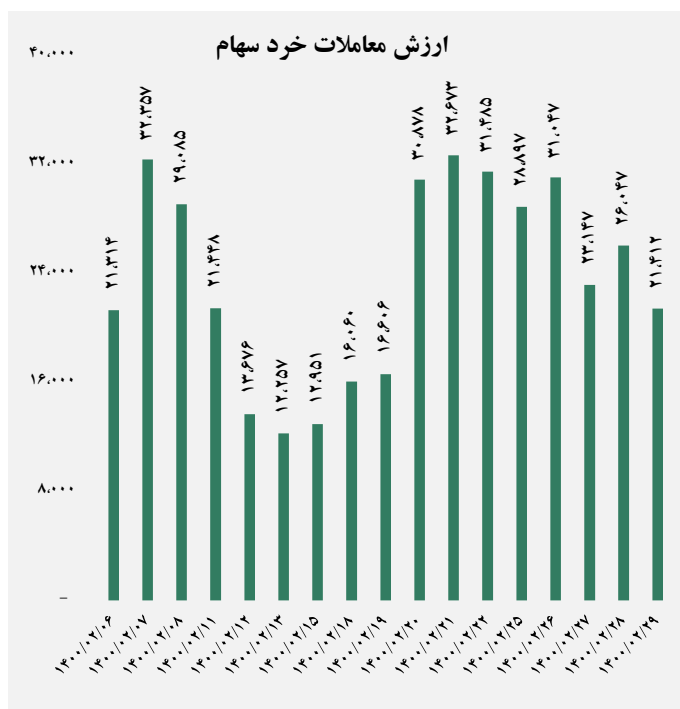
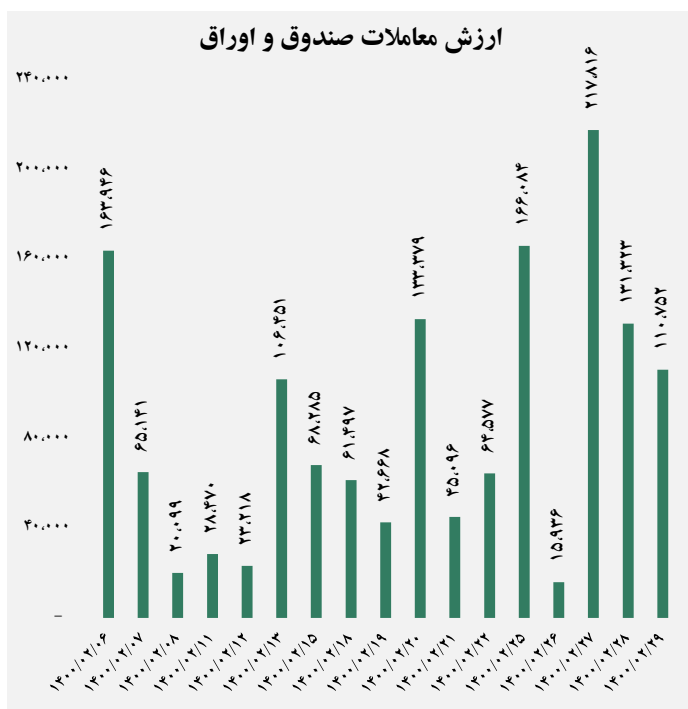
## ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

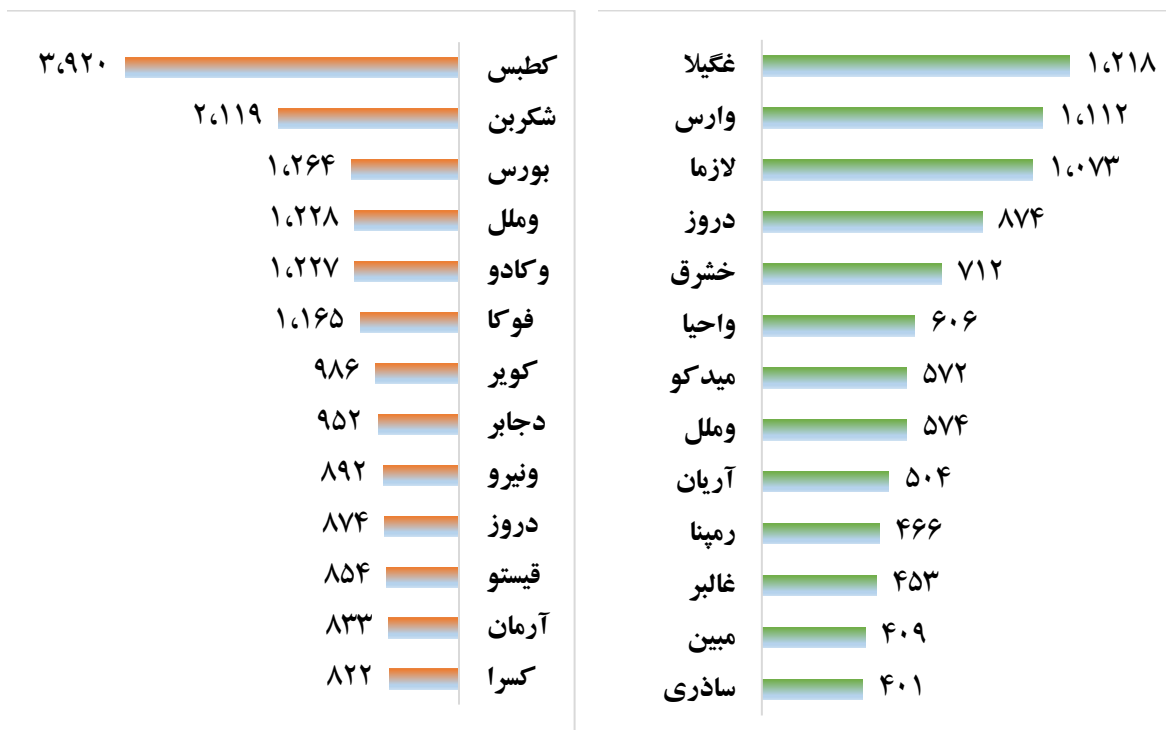


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





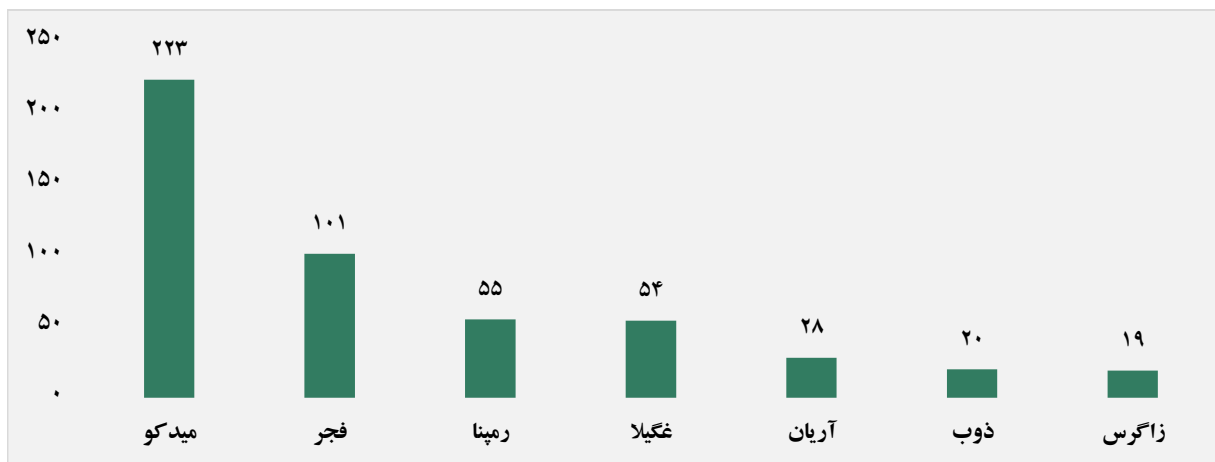
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



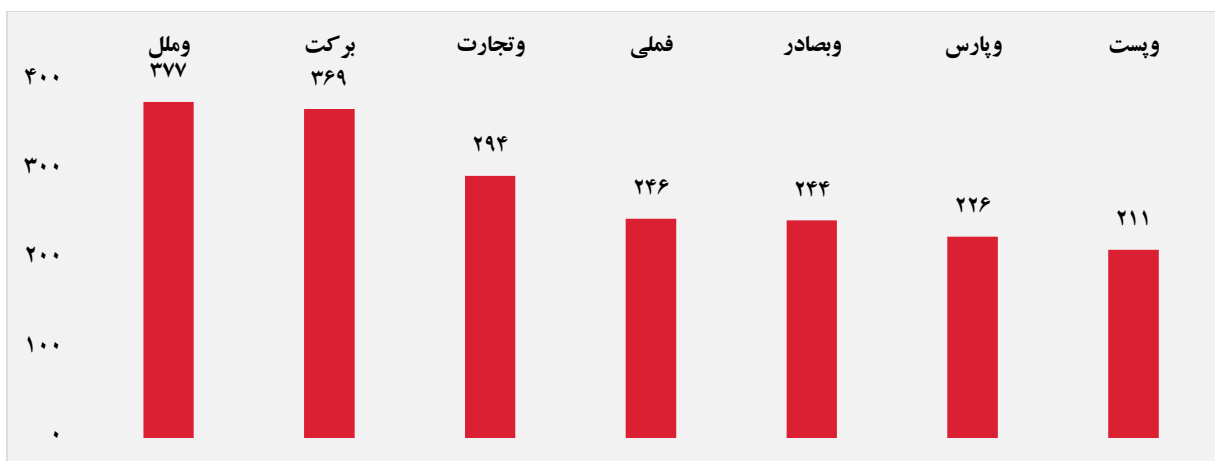
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	اپال	۱	وپست
۲	ثامید	۲	هرمز
۳	ساذری	۳	کویر
۴	فیستم	۴	شیران
۵	شستم	۵	وساغربی
۶	شپلی	۶	مادیرا
۷	غگیلا	۷	بورس
۸	میدکو	۸	لوتوس
۹	-	۹	وشهر
۱۰	-	۱۰	شغدیر

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



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



### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	وملل
۲	کزغال	۱۱	واتی
۳	ویست	۱۲	وساخت
۴	زاگرس	۱۳	حتاید
۵	شغدیر	۱۴	سشرق
۶	وسبحان	۱۵	سصوفی
۷	ساراب	۱۶	گشان
۸	بوعلی	۱۷	ولپارس
۹	شپاکسا	۱۸	سرخوز



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

