



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۲/۱۱



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۱۱ اردیبهشت ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، فارس، شستا، کچاد، تاپیکو و فخوز با کاهش ۱۳.۵۴۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۱۹۴.۳۰۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش محسوسی همراه بوده است. مبلغ ۲۹ 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 بسیاری از نمادها در اکثر گروه‌ها با صف فروش همراه بودند.

در روزهای پایانی هفته گذشته، بازارهای جهانی کامودیتی‌ها در اکثر محصولات فلزی و پتروشیمی به طور صعودی به کار خود پایان داده بودند. بطوریکه قیمت مس جهانی به حدود ۱۰ هزار دلار در هر تن نیز رسید و در پایان روز معاملاتی جمعه در ۹۸۰۹ دلار بسته شد. قیمت شمش بیلت شرکت‌های ایرانی حدود ۶۰۰ دلار در هر تن در هفته گذشته در بازارهای بین‌المللی معامله شده است. هر تن اوره در منطقه خلیج فارس حدود ۳۴۴ دلار در هر تن در حال خرید و فروش می‌باشد (در آخرین گزارش ماهانه پتروشیمی پردیس، اوره صادراتی را در حدود ۳۰۰ دلار به فروش رسانده بود). اما بازار سرمایه ایران در روز جاری به موارد ذکر شده در بالا هیچ اهمیتی نداده است و همانند روزهای اول هفته گذشته، اکثر نمادها، بدون توجه به وضعیت عملیاتی‌شان با صف فروش به استقبال روز معاملاتی فردا رفته‌اند. در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳۴.۹۷۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۵۵۴، 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 ۲۳.۳٪ سود است.

| شرح | ۱۴۰۰/۰۲/۰۸ | ۱۴۰۰/۰۲/۱۱ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۲,۶۴۷ | ۳۴,۹۷۶ | ۱۲۲۱٪ |



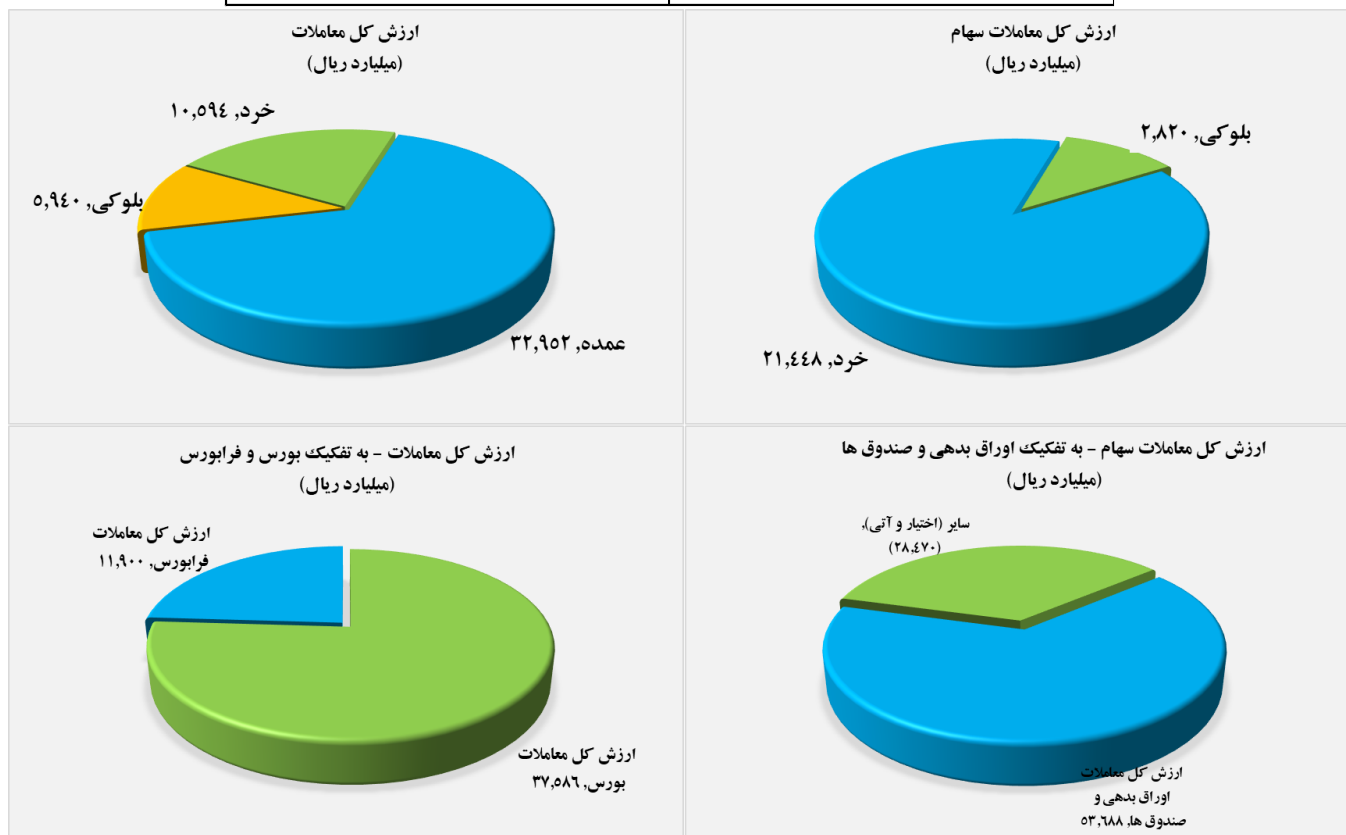
گروه‌های مؤثر

در گروه ذغال سنگ، شرکت صنعتی و معدنی شمال شرق شاهرود در فروردین ماه ۵۰۶۷ تن محصول تولید کرده که نسبت به اسفند ماه افت ۱۳ درصدی و نسبت به متوسط سال گذشته افت ۲۷ درصدی داشته است. این شرکت دو محصول ذغال سنگ کک شو و ذغال سنگ کک شو کیفی درجه یک را تولید میکند. مقدار فروش شرکت در فروردین ماه کاهش ۲۰ درصدی نسبت به اسفند ماه داشته و به ۷۹۷۲ تن رسیده است. تولید کل این شرکت نسبت به متوسط سال گذشته نیز با افت ۲۶ درصد روبرو بوده است. مبلغ فروش فروردین ماه این شرکت با اهرم نرخ فروش، با افت کمتری همراه بوده و با ۸ درصد کاهش به ۷.۴ میلیارد تومان رسیده است. نرخ فروش ذغال سنگ کک شو کیفی با ۱۴ درصد رشد به ۱۰۲۲ تومان به ازای هر کیلو و نرخ ذغال سنگ کک شو کیفی درجه یک با ۸ درصد رشد به ۲۲۱۰ تومان به ازای هر کیلو افزایش پیدا کرده است.

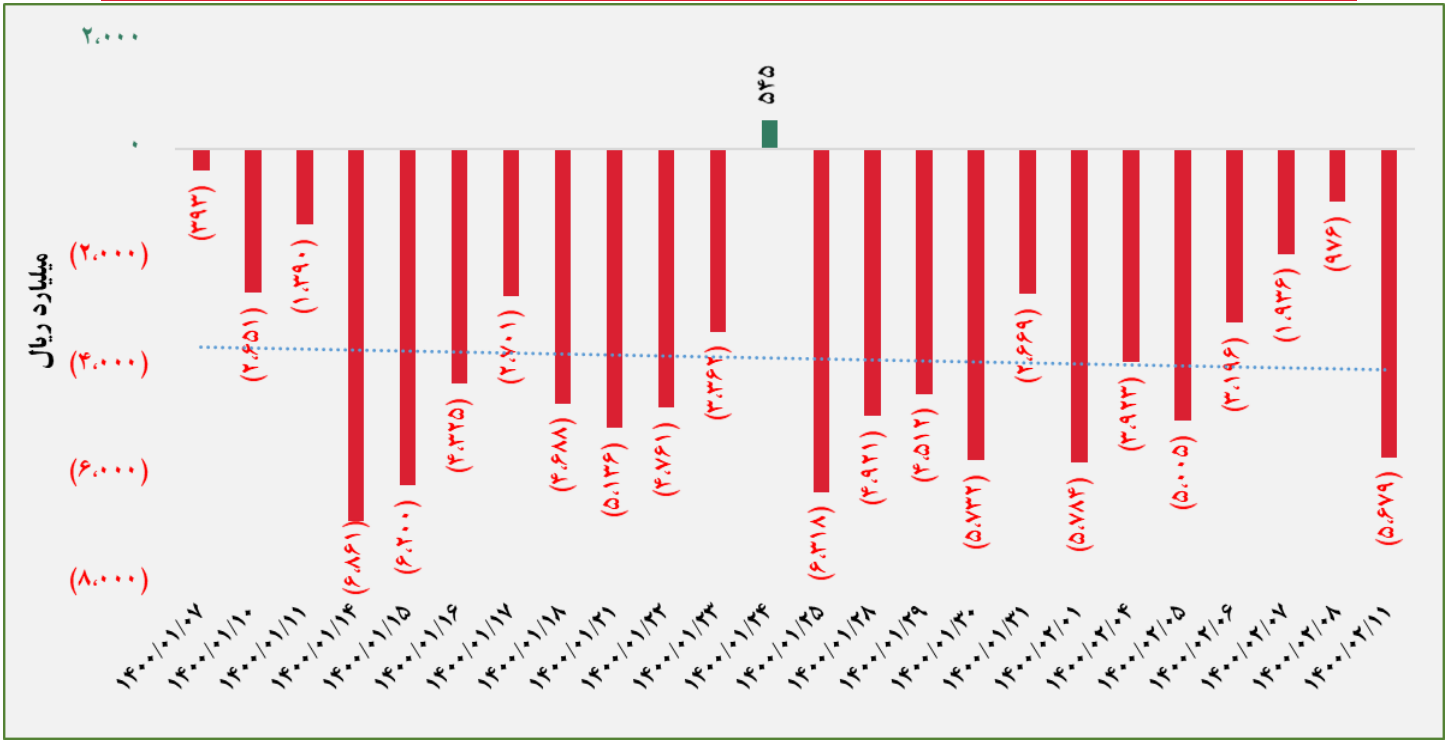
در گروه شیمیایی، پتروشیمی مارون با بازیافت اتان از گاز طبیعی برای تولید محصولات شیمیایی و پلیمری استفاده می‌کند. مقدار تولید اتان به عنوان محصول ابتدای زنجیره تولید در فروردین ۱۴۰۰ به ۱۷۲۱۴۲ تن بوده که نسبت به اسفند ماه رشد ۶.۶ درصد و نسبت به متوسط سال گذشته رشد ۱۰ درصدی را ثبت کرده است. مقدار فروش این شرکت در اولین ماه ابتدایی سال رشد ۲۱ درصدی را نسبت به اسفند ماه ثبت کرده و به ۱۶۴ هزار تن رسیده است. چهار محصول اصلی این شرکت برای فروش شامل اتیلن، پلی اتیلن سنگین، منواتیلن گلایکول و پلی پروپیلن است که در فروردین ماه مقدار فروش پلی اتیلن سنگین کاهش قابل توجه داشته ولی فروش منواتیلن گلایکول با افزایش همراه بوده است. فروش پتروشیمی مارون از نظر مبلغی در نتیجه افزایش مقدار فروش نیز با رشد ۱۴ درصدی همراه بود و به ۲۹۴۵ میلیارد تومان رسیده است. مبلغ فروش شرکت نسبت به متوسط سال گذشته رشد ۷۷ درصدی را رقم زده است. نرخ فروش این شرکت در فروردین ماه افت ۶ درصدی نسبت به اسفند ماه داشته اما نسبت به متوسط سال گذشته، با رشد ۵۵ درصدی همراه بوده است.

تصویر کلی بازار

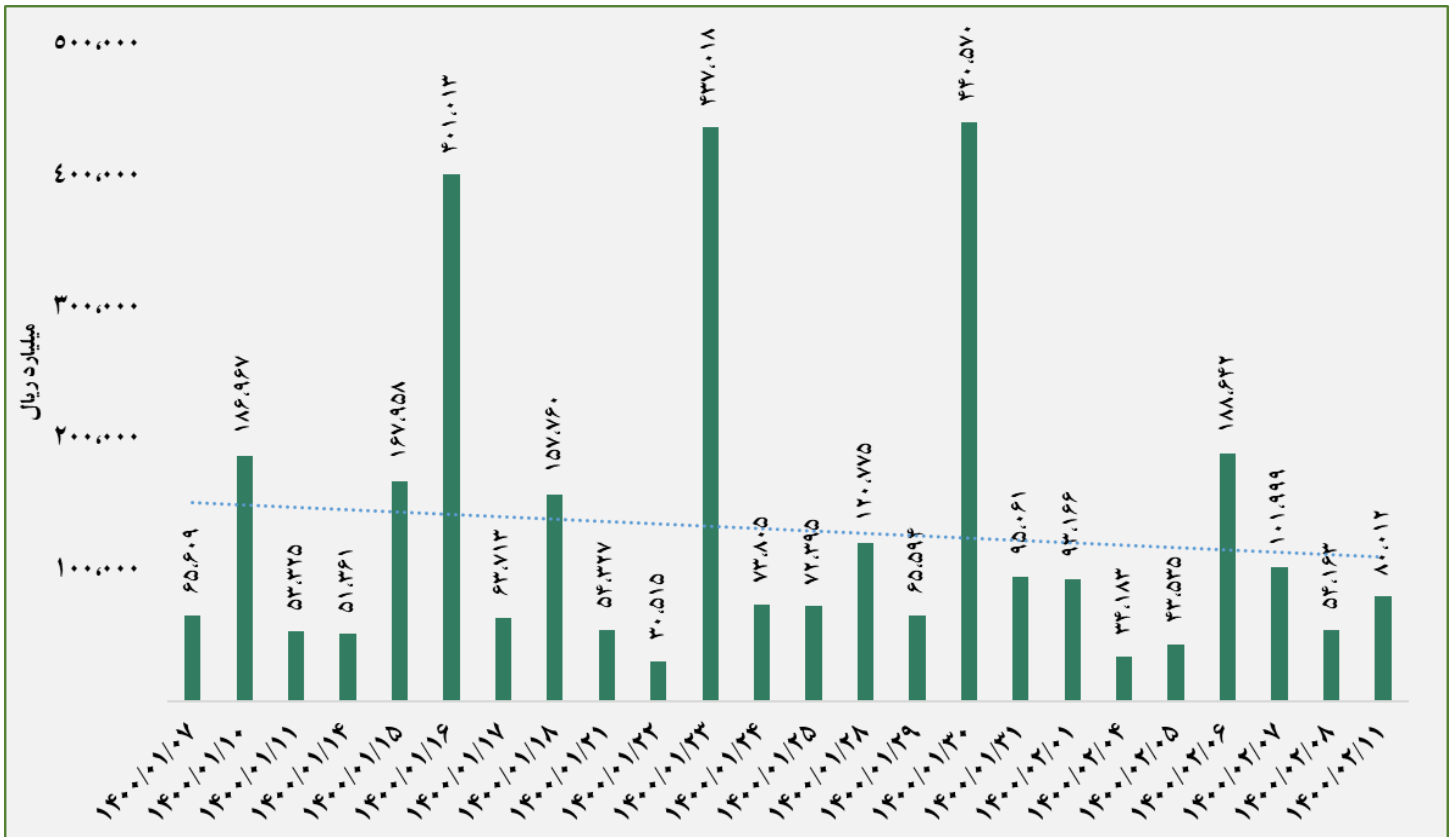
| فرا بورس | | بورس | |
|----------------------------|-----------------------------|--|-----------------------------|
| ۱۷,۵۷۲ | شاخص کل | ۱,۱۹۴,۳۰۳ | شاخص کل |
| (۸۷.۰۰) | تغییر شاخص | (۱۳,۵۴۷.۰۰) | تغییر شاخص |
| ۱۱,۹۰۰,۶۵۱ | ارزش بازار (میلیارد ریال) | ۴۷,۷۸۶,۱۹۹ | ارزش بازار (میلیارد ریال) |
| ۴۲,۴۲۶ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۳۷,۵۸۶ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) |
| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | | بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | |
| خدیزل | | وپاسار | |
| کرمان | | خبهن | |
| دماوند | | جم پیلن | |
| صبا | | سپ | |
| میدکو | | ویملت | |
| بیشترین تاثیر منفی در شاخص | | بیشترین تاثیر منفی در شاخص | |
| وسپهر | | فولاد | |
| مارون | | فملی | |
| آریا | | فارس | |
| هرمز | | شستا | |
| شگویا | | کچاد | |
| (۵,۲۷۹) | | ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال) | |
| ۲۹۹ | | ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال) | |



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

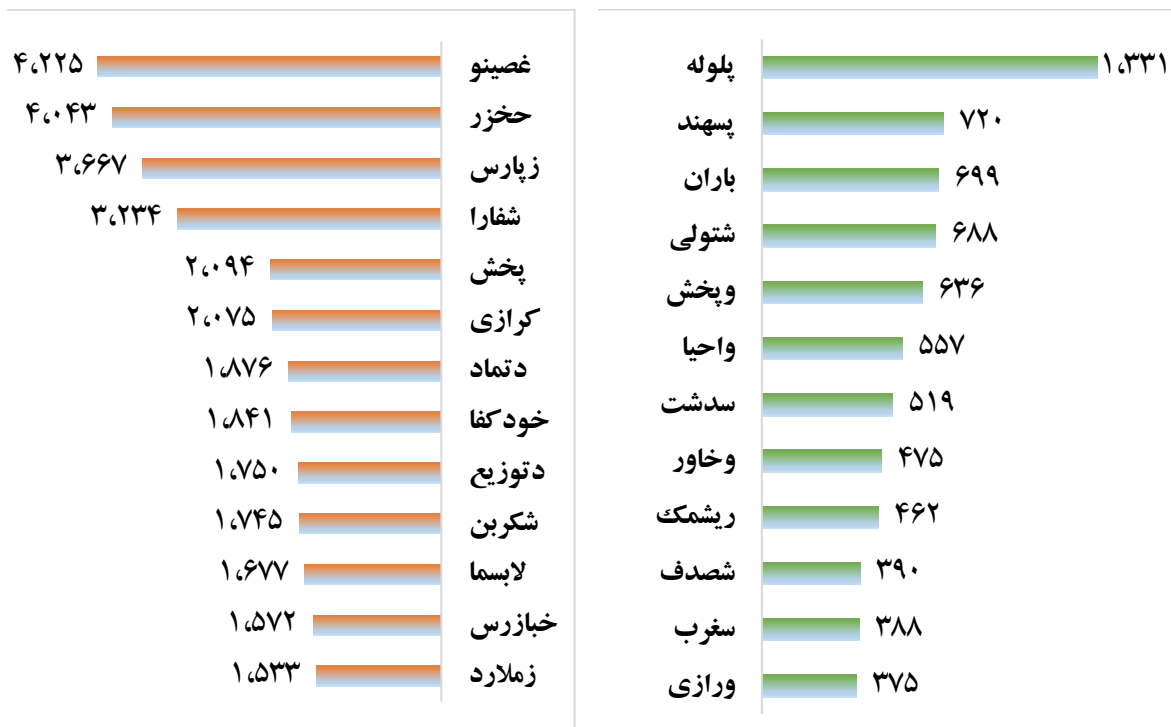


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

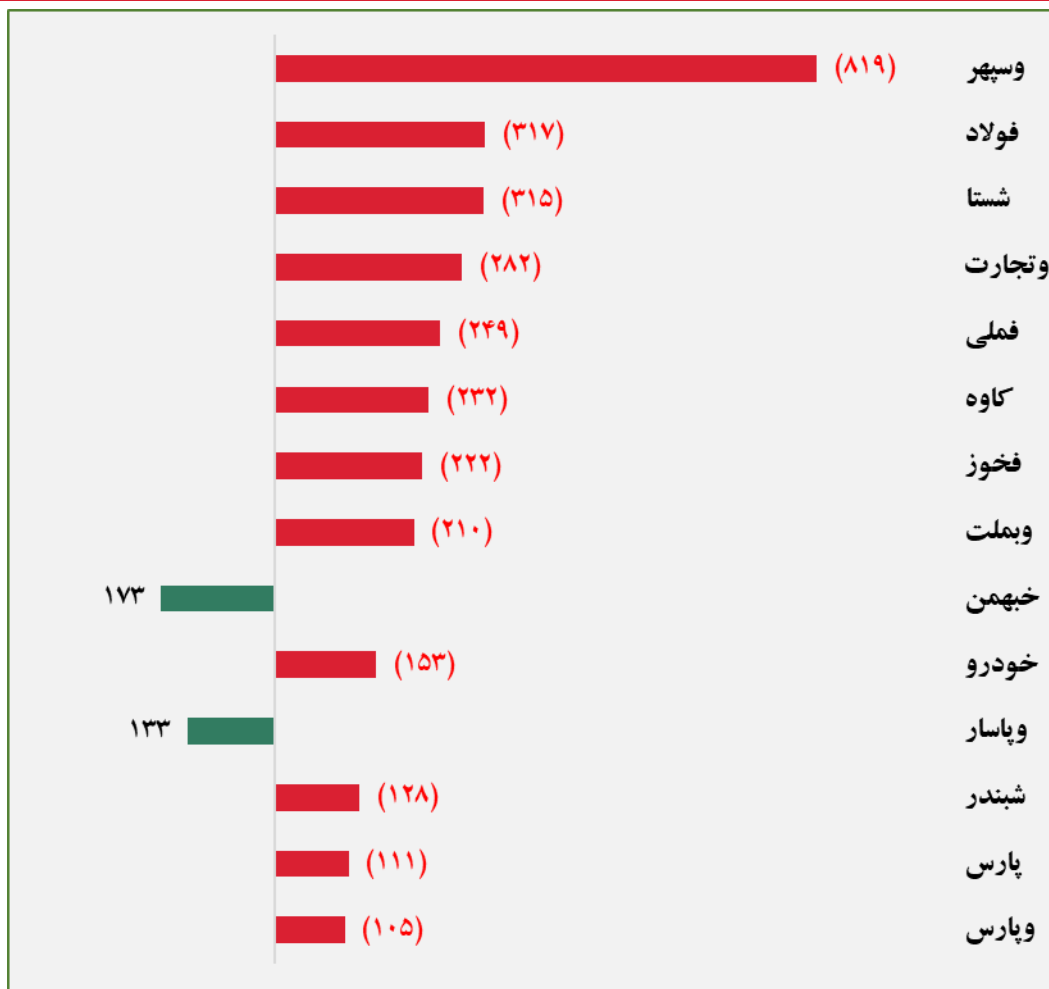


پول هوشمند

| ردیف | ورود | ردیف | خروج |
|------|--------|------|--------|
| ۱ | غگیلا | ۱ | پارس |
| ۲ | شتهران | ۲ | شتوکا |
| ۳ | کایتا | ۳ | وکار |
| ۴ | - | ۴ | غسالم |
| ۵ | - | ۵ | مادیرا |
| ۶ | - | ۶ | وسبحان |
| ۷ | - | ۷ | ساوه |
| ۸ | - | ۸ | غصینو |
| ۹ | - | ۹ | کوبیر |
| ۱۰ | - | ۱۰ | سبخاش |



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

| ردیف | نماد | ردیف | نماد |
|------|---------|------|-------|
| ۱ | ساراب | ۱۱ | شغدیر |
| ۲ | ورازی | ۱۲ | بوعلی |
| ۳ | برکت | ۱۳ | کاوه |
| ۴ | گشان | ۱۴ | پارس |
| ۵ | جم پیلن | ۱۵ | سخوز |
| ۶ | وتوس | ۱۶ | افق |
| ۷ | کروی | ۱۷ | کرمان |
| ۸ | سمازن | ۱۸ | دلر |
| ۹ | وسپهر | ۱۹ | زاگرس |
| ۱۰ | وساخت | ۲۰ | نوری |



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

| ردیف | صنعت | مبلغ (میلیون ریال) |
|------|---|--------------------|
| ۱ | واسطه‌گری‌های مالی و پولی | ۳۰,۴۴۱ |
| ۲ | قند و شکر | ۱۲,۸۰۳ |
| ۳ | بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی | ۵,۶۳۸ |
| ۴ | خدمات فنی و مهندسی | ۳,۸۷۷ |
| ۵ | محصولات کاغذی | ۱,۰۳۸ |
| ۶ | ساخت محصولات فلزی | ۹۹۵ |
| ۷ | هتل و رستوران | ۲۷۵ |
| ۱۲ | سایر محصولات کانی غیر فلزی | -۲۴ |
| ۱۳ | پیمانکاری صنعتی | -۴۴ |
| ۱۴ | فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه | -۱,۳۳۲ |
| ۱۵ | رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن | -۱,۷۱۲ |
| ۱۶ | فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی | -۳,۱۳۶ |
| ۱۷ | لاستیک و پلاستیک | -۳,۶۷۶ |
| ۱۸ | ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی | -۳,۶۸۴ |
| ۱۹ | ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی | -۳,۷۸۹ |
| ۲۰ | حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات | -۵,۰۰۸ |
| ۲۱ | خودرو و ساخت قطعات | -۸,۱۰۵ |
| ۲۲ | استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف | -۹,۰۰۶ |
| ۲۳ | استخراج زغال سنگ | -۱۰,۵۷۴ |
| ۲۴ | سایر واسطه‌گری‌های مالی | -۱۸,۸۲۷ |
| ۲۵ | زراعت و خدمات وابسته | -۲۷,۲۴۳ |
| ۲۶ | مخابرات | -۲۷,۲۷۷ |
| ۲۷ | تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری | -۳۲,۳۷۶ |
| ۲۸ | ماشین‌آلات و تجهیزات | -۳۳,۹۴۹ |
| ۲۹ | خرده‌فروشی، باستان‌شناسی و وسایل نقلیه موتوری | -۴۶,۱۳۱ |
| ۳۰ | فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط | -۵۹,۳۰۷ |
| ۳۱ | انبوه‌سازی، املاک و مستغلات | -۶۵,۲۹۴ |
| ۳۲ | محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر | -۸۱,۰۹۷ |
| ۳۳ | عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم | -۸۶,۸۷۴ |
| ۳۴ | مواد و محصولات دارویی | -۹۳,۵۰۴ |
| ۳۵ | استخراج کانه‌های فلزی | -۲۲۶,۷۱۶ |
| ۳۶ | سیمان، آهک و گچ | -۲۵۲,۷۵۸ |
| ۳۷ | فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای | -۴۳۵,۵۸۱ |
| ۳۸ | شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی | -۴۳۸,۸۰۰ |
| ۳۹ | بانکها و موسسات اعتباری | -۶۸۷,۰۹۳ |
| ۴۰ | محصولات شیمیایی | -۷۸۲,۱۲۸ |
| ۴۱ | سرمایه‌گذارها | -۱,۰۰۱,۸۸۰ |
| ۴۲ | فلزات اساسی | -۱,۲۷۹,۲۱۴ |
| | جمع | -۵,۶۷۱,۰۷۲ |