



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۰۴

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۴ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، فملی، شپنا، شستا، شبندر، نوری و شتران با افزایش ۹,۷۴۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۰۵,۴۴۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۹ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش همراه بوده است. مبلغ ۳۲ 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 روزهای گذشته بسیاری از نمادها در گروه فرآورده‌های نفتی، شیمیایی و سیمان با معاملات در بازه قیمتی مثبت به کار خود پایان دادند و شاهد فشار فروش کمتری در کلیت بازار بودیم.

از لحاظ تحلیل نموداری، محدوده بین ۱,۰۳۸,۰۰۰ الی ۱,۰۰۰,۰۰۰ واحد حمایت قوی برای شاخص کل به شمار می‌آید و رسیدن شاخص کل به کمتر از این اعداد با توجه به وضعیت عملیاتی شرکت‌های بزرگ از شانس بسیار کمی برخوردار است. در حال حاضر کلیت بازار سرمایه تحت شعاع انتخابات ریاست جمهوری قرار دارد و به نظر می‌رسد تا قبل از انتخابات، اتفاق مثبتی در بازار بورس و فرابورس تهران نخواهد افتاد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۳,۶۵۵ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۵ 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 ۸۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ با ۲۳,۲٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۰۳	۱۴۰۰/۰۳/۰۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۴,۰۰۴	۱۳,۶۵۵	-۴۳٪



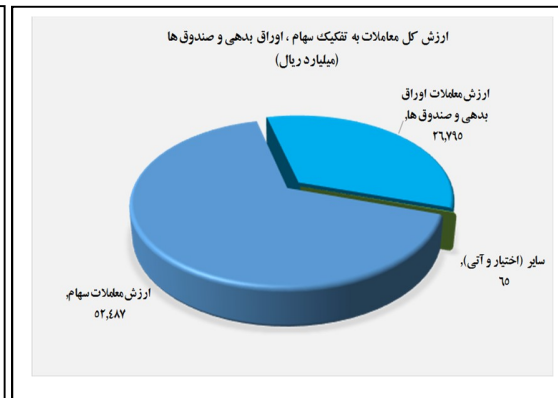
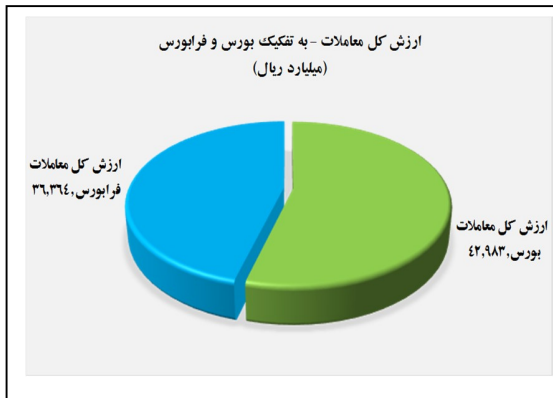
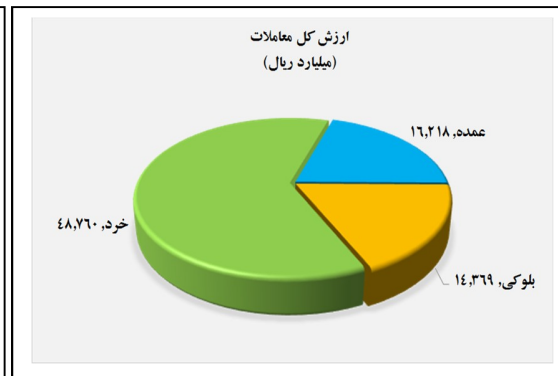
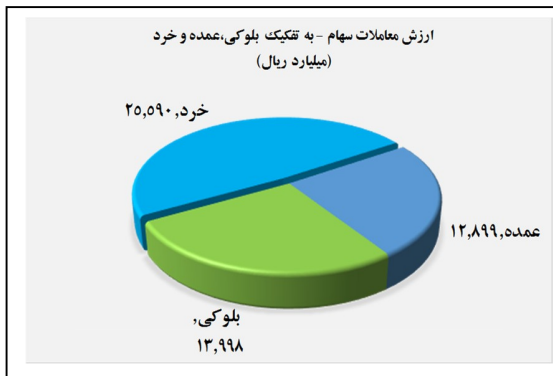
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت کربن ایران در سال ۹۹ به طور میانگین هر ماه ۳۵۱۱ تن تولید داشته و در فروردین ماه سال جاری نیز توانست تولید ۳۶۱۰ تنی را به ثبت برساند که در اردیبهشت این مقدار به ۳۷۶۰ تن رسیده است. این شرکت در سال مالی گذشته هر ماه به طور متوسط ۳۷۱۹ تن فروش داشت. در اولین ماه از سال جاری فروش خود را ۲۸۶۶ تن گزارش کرد که در اردیبهشت ماه فروش خوب ۴۲۳۵ تنی را ثبت کرده است. شرکت کربن ایران در سال مالی گذشته فروشی برابر با ۵۹۶ میلیارد تومان داشت و در فروردین سال جاری نیز فروش ۶۲ میلیارد تومانی را گزارش کرد. در اردیبهشت نیز شرکت توانسته فروش ۹۷ میلیارد تومانی داشته باشد. در اردیبهشت ماه نرخ فروش دوده با ۶ درصد افزایش نسبت به ماه گذشته به ۲۲۹۹۵۹ ریال در هر کیلو رسیده است.

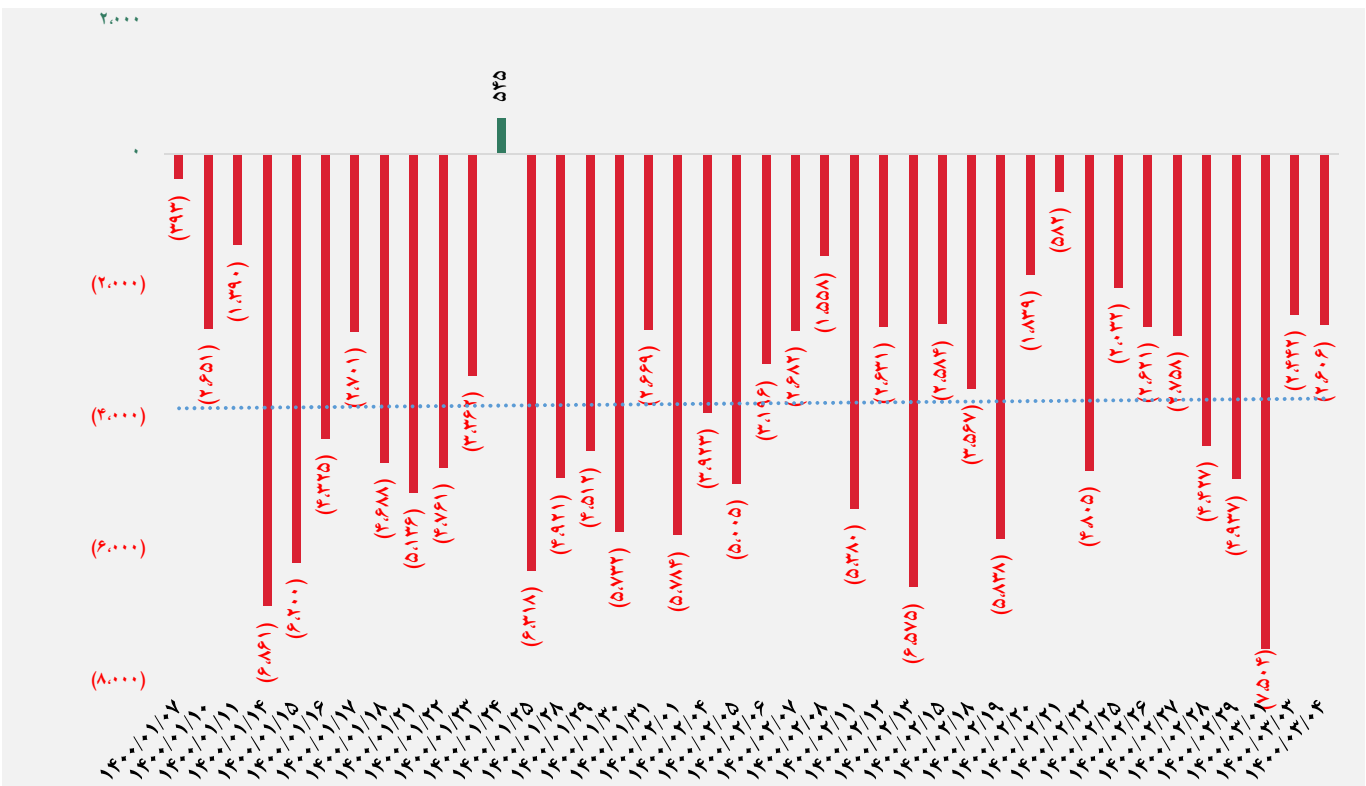
در گروه لاستیک و پلاستیک، مجتمع صنایع لاستیک یزد در سال مالی ۹۹ به طور میانگین هر ماه ۲۸۱۶ تن تولید داشته که در فروردین ماه سال جاری تولید ۱۱۷۶ تنی را گزارش کرد و در اردیبهشت توانسته تولید ۲۹۵۱ تنی داشته باشد. این شرکت در سال ۹۹ هر ماه به طور میانگین ۲۶۵۹ تن فروش را گزارش کرده است. در فروردین ماه نیز فروش ۱۴۴۲ تنی داشته و در اردیبهشت ماه فروش ۲۸۰۱ تنی را گزارش کرده است. این شرکت در سال گذشته به طور متوسط هر ماه ۱۰۷ میلیارد تومان فروش ثبت کرده بود که مبلغ فروش فروردین ماه برابر با ۸۲ میلیارد تومان بود و در اردیبهشت ماه نیز توانسته فروش ۱۵۸ میلیارد تومانی را گزارش کند. نرخ فروش هر کیلو تایر رادیال در فروردین ماه سال جاری ۵۹۰۴۴۰ ریال در هر کیلو بوده که در اردیبهشت نسبت به ماه گذشته تغییر محسوسی نداشته و برابر با ۵۹۰۴۲۳ ریال ثبت شده است.

تصویر کلی بازار

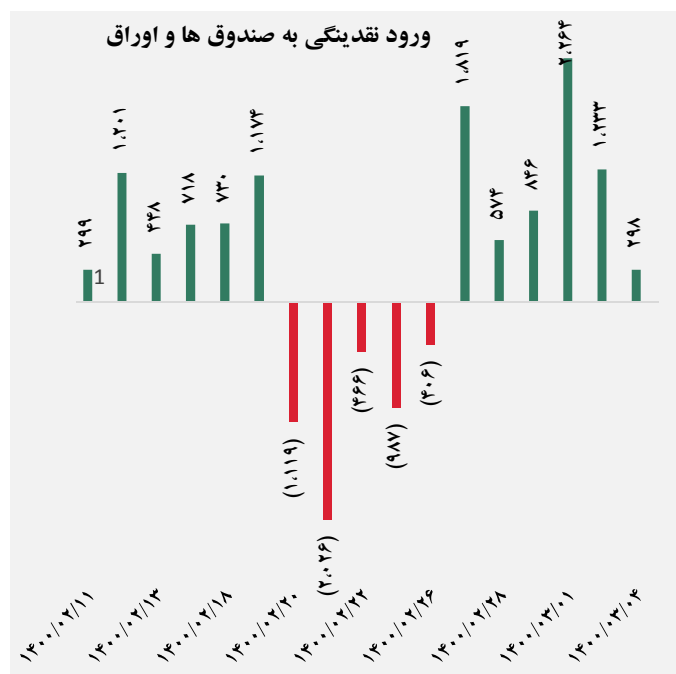
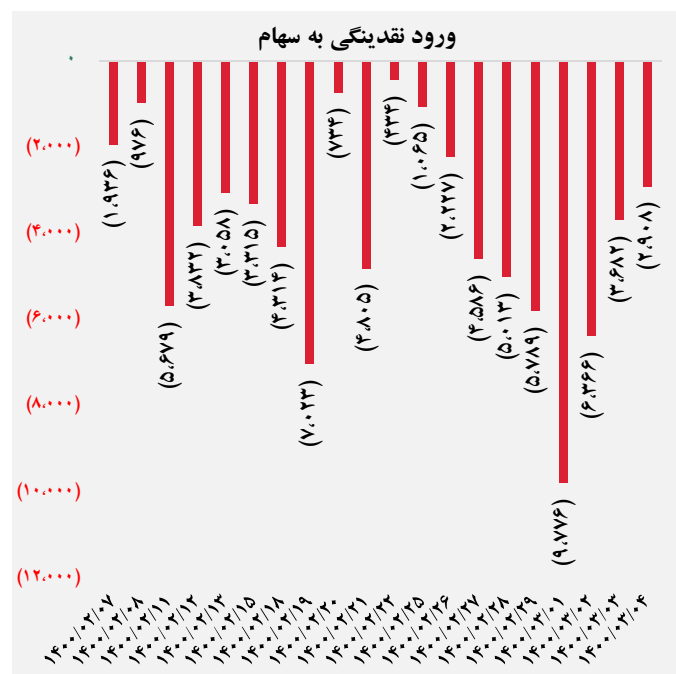
فرا بورس		بورس	
۱۷,۵۵۲	شاخص کل	۱,۱۰۵,۴۴۴	شاخص کل
۷۶	تغییر شاخص	۹,۷۴۷	تغییر شاخص
۱۱,۷۰۸,۸۲۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۴,۱۳۶,۸۹۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۶,۳۶۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۲,۹۸۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
میدکو		فارس	
آریا		فملی	
هرمز		شپنا	
زاگرس		شستا	
ذوب		شپندر	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
پپاس		ویاسار	
کگهر		رمپنا	
بگیلان		وسخوز	
اتکای		و تجارت	
بساما		ویملت	
(۲,۹۰۸)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۲۹۸		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



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

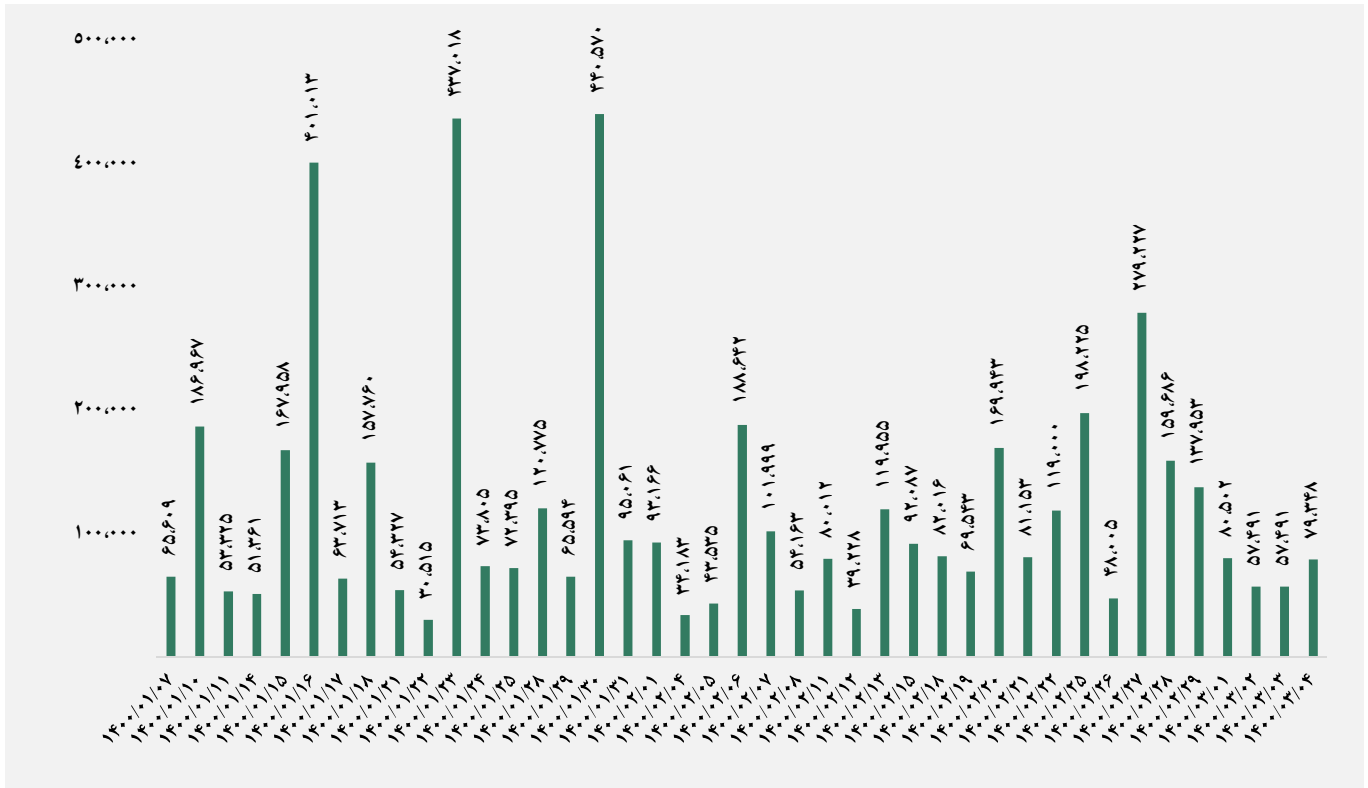


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

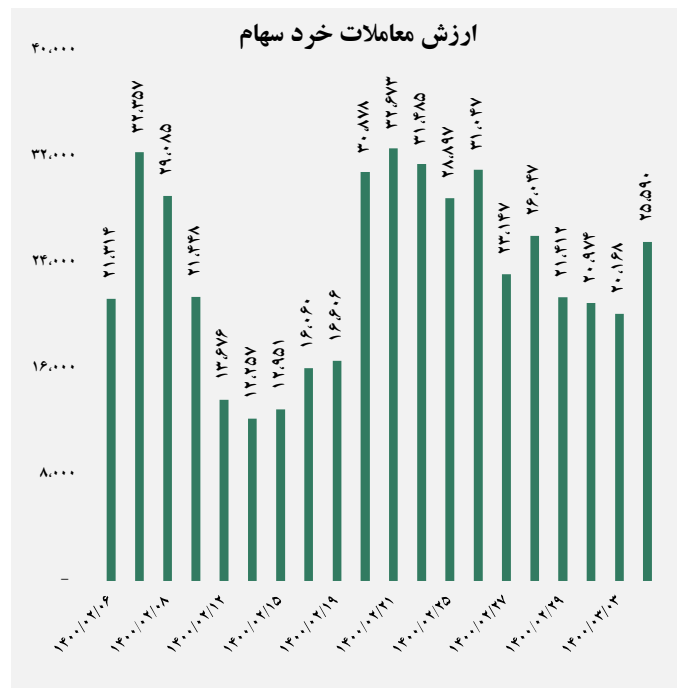
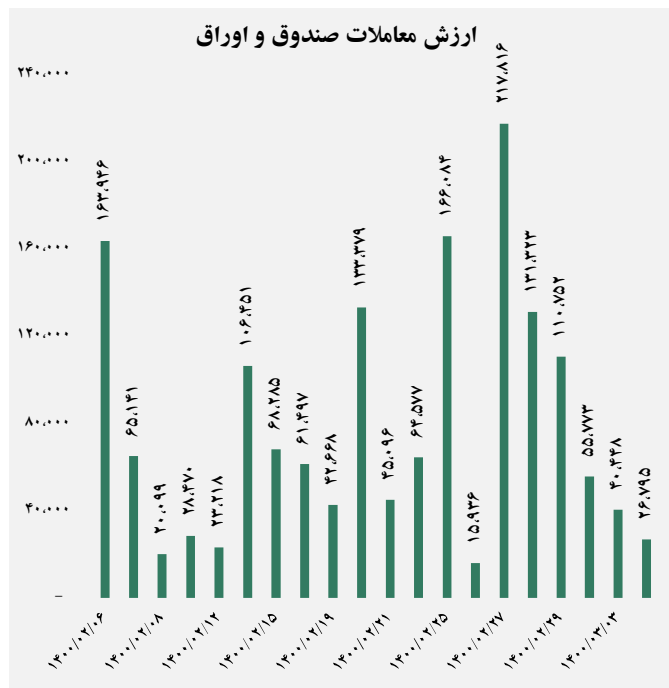


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



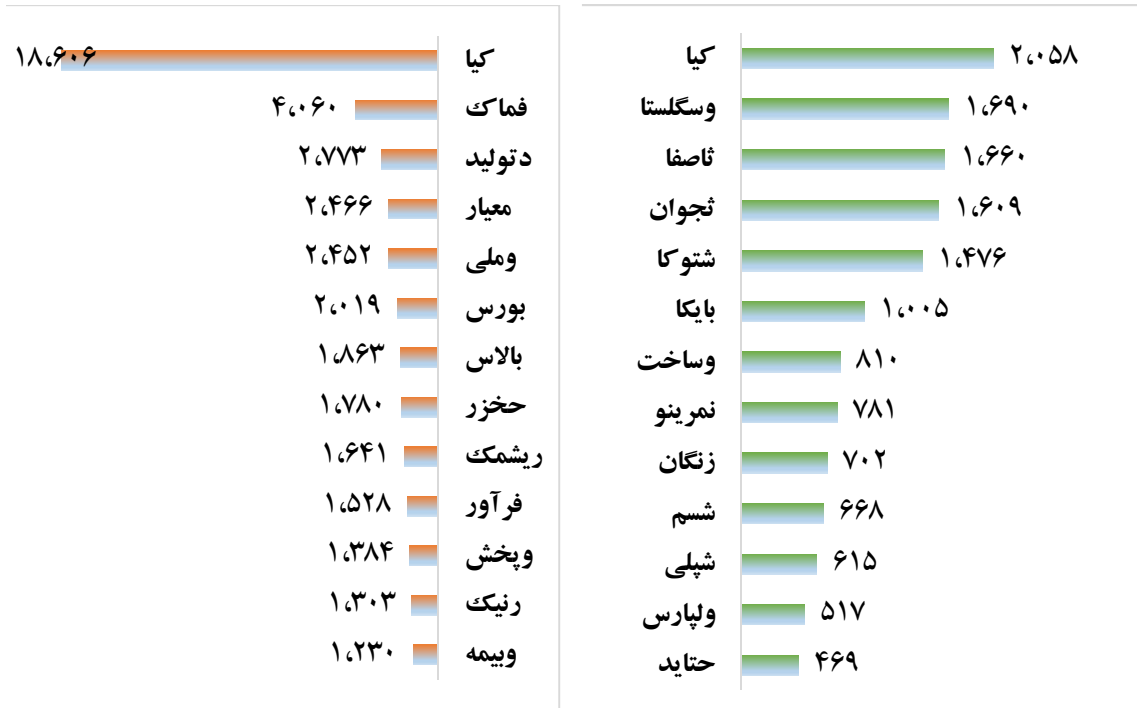
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

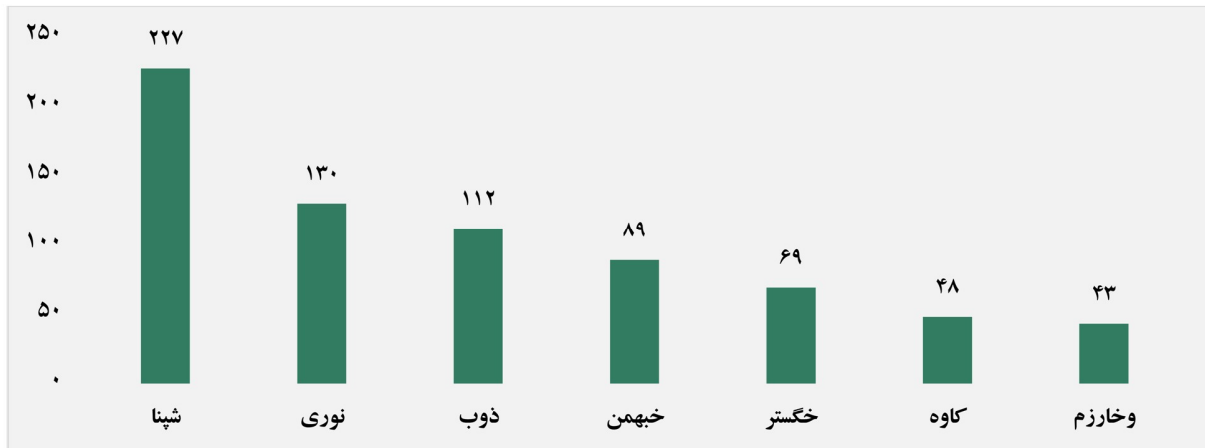


پول هوشمند

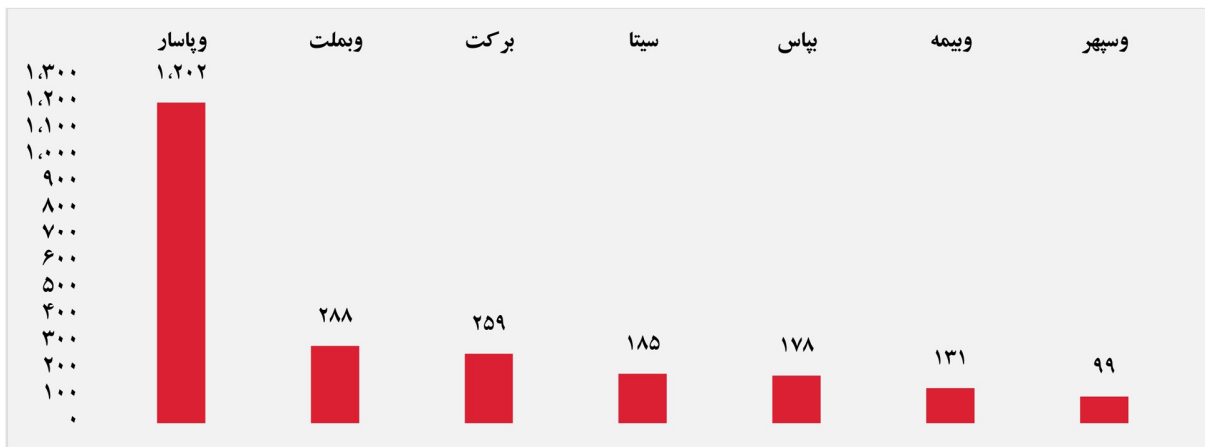
ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	وتوصا	۱	شراز
۲	شوینده	۲	فرآور
۳	حتاید	۳	خصدرا
۴	ورنا	۴	وایران
۵	وخارزم	۵	مفاخر
۶	شپنا	۶	وسخوز
۷	فگستر	۷	غمینو
۸	پارسیان	۸	ریشمک
۹	ساروم	۹	دزهرای
۱۰	ثامید	۱۰	ولملت



سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	نوری
۲	غشان	۱۱	وپست
۳	ساراب	۱۲	وییمه
۴	خزامیا	۱۳	وپاسار
۵	شغدیر	۱۴	بوعلی
۶	سصوفی	۱۵	خراسان
۷	وساخت	۱۶	ختوقا
۸	حتاید	۱۷	خاذین
۹	پیاس	۱۸	سمازن



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

