



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۰۵

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۵ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، رمینا، فولاد، فخوز، نوری، وبملت و فملی با افزایش ۳,۹۱۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۰۹,۳۷۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۴۹ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۲۷ 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 گروه فرآورده‌های نفتی، شیمیایی، سیمان و فلزات با معاملات در بازه قیمتی مثبت به کار خود پایان دادند و شاهد فشار فروش کمتری در کلیت بازار نسبت به هفته گذشته بودیم.

علی‌رغم افزایش قابل توجه نرخ‌های جهانی بسیاری از کامودیتی‌ها در سه ماه گذشته، اما فعالین بازار سرمایه در داخل کشور به دلیل ابهامات حاکم بر نرخ دلار، بیشتر تمایل به فروش سهام خود داشته‌اند. با توجه به نظرات بسیاری از سیاستمداران کشور در مورد نرخ ارز و انتظار کاهش شدید نرخ دلار از طرف آنها، فعالین بازار سهام را برای تعیین نرخ دلار برای تحلیل به اشتباه انداخته است. اما آنچه در واقعیت در حال رخ دادن است، عدم تمایل نرخ دلار به کمتر از ۲۰۰ هزار ریال با توجه به وضعیت اقتصادی حاکم بر کشور می‌باشد. بنابراین با مشخص شدن وضعیت سیاسی کشور در دو ماه آینده، وضعیت بازار سرمایه نیز به مراتب بهتر از حال حاضر خواهد شد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۷,۲۰۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق اجاره تابان سپهر با نماد تابان ۴۲، 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 ۲۴,۶٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۰۴	۱۴۰۰/۰۳/۰۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۳,۶۵۵	۷,۲۰۶	-۴۷٪



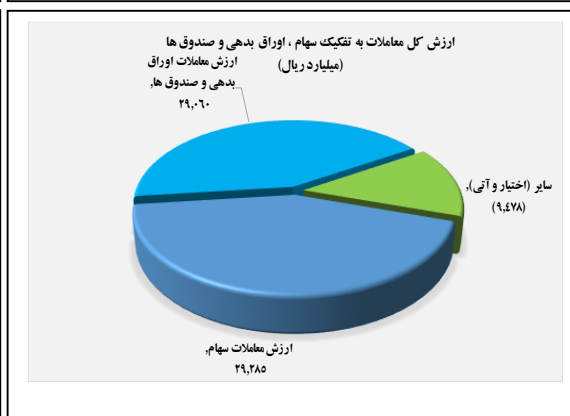
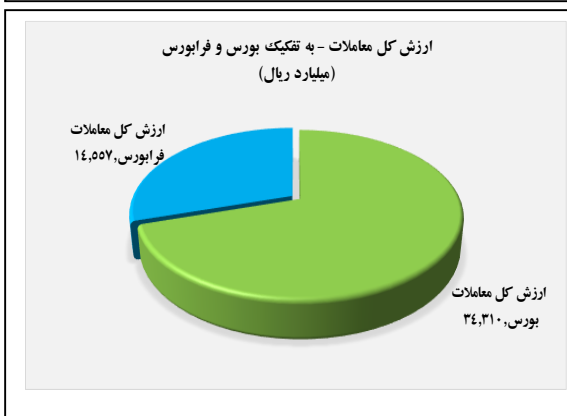
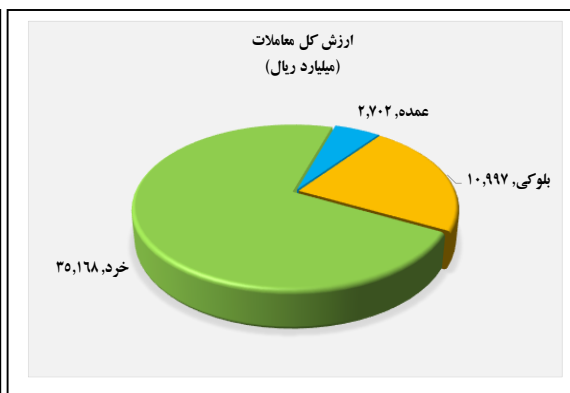
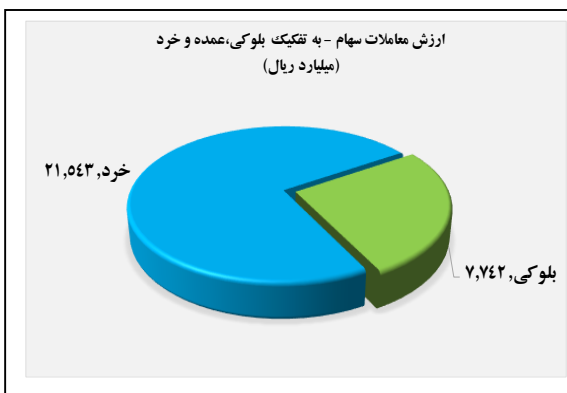
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی فن آوران به طور متوسط در سال گذشته ۸۰ هزار تن تولید داشته و در ماه اردیبهشت ۸۲ هزار تن گزارش شده است. مقدار تولید اسید استیک آن شرکت میانگین ماهانه ۱۲ هزار و ۳۰۰ تنی داشت که در اردیبهشت رقم ۹ هزار و ۲۰۰ تن به ثبت رسید. این شرکت در سال ۹۹ به طور متوسط ۷۵ هزار تن متانول فروخته است. مقدار فروش متانول در اردیبهشت کمتر از میانگین و ۳۹ هزار تن گزارش شد اما در بخش اسید استیک جبران کرد. میانگین ماهانه فروش اسید استیک ۱۲ هزار و ۹۰۰ تن بوده که در اردیبهشت به ۱۶ هزار و ۲۰۰ تن رسید. مبلغ فروش شرکت در اردیبهشت ۵۸۳ میلیارد تومان بوده که هر چند این رقم به ارقام فروش بالاتر از ۸۰۰ میلیارد در ماه‌های بهمن و اسفند نرسیده اما با توجه به حجم فروش، رقم خوبی به شمار می‌رود. رقم فروش فروردین ۴۸۰ میلیارد تومان بوده که با این حساب مبلغ فروش دو ماه اول سال جاری نسبت به دو ماه اول سال قبل ۲,۵ برابر شده است. در این ماه نرخ متانول صادراتی ۶۹۹۳ تومان به ازای هر کیلو و نرخ اسید استیک داخلی ۲۱۵۰۰ تومان برای هر کیلو ثبت شده است.

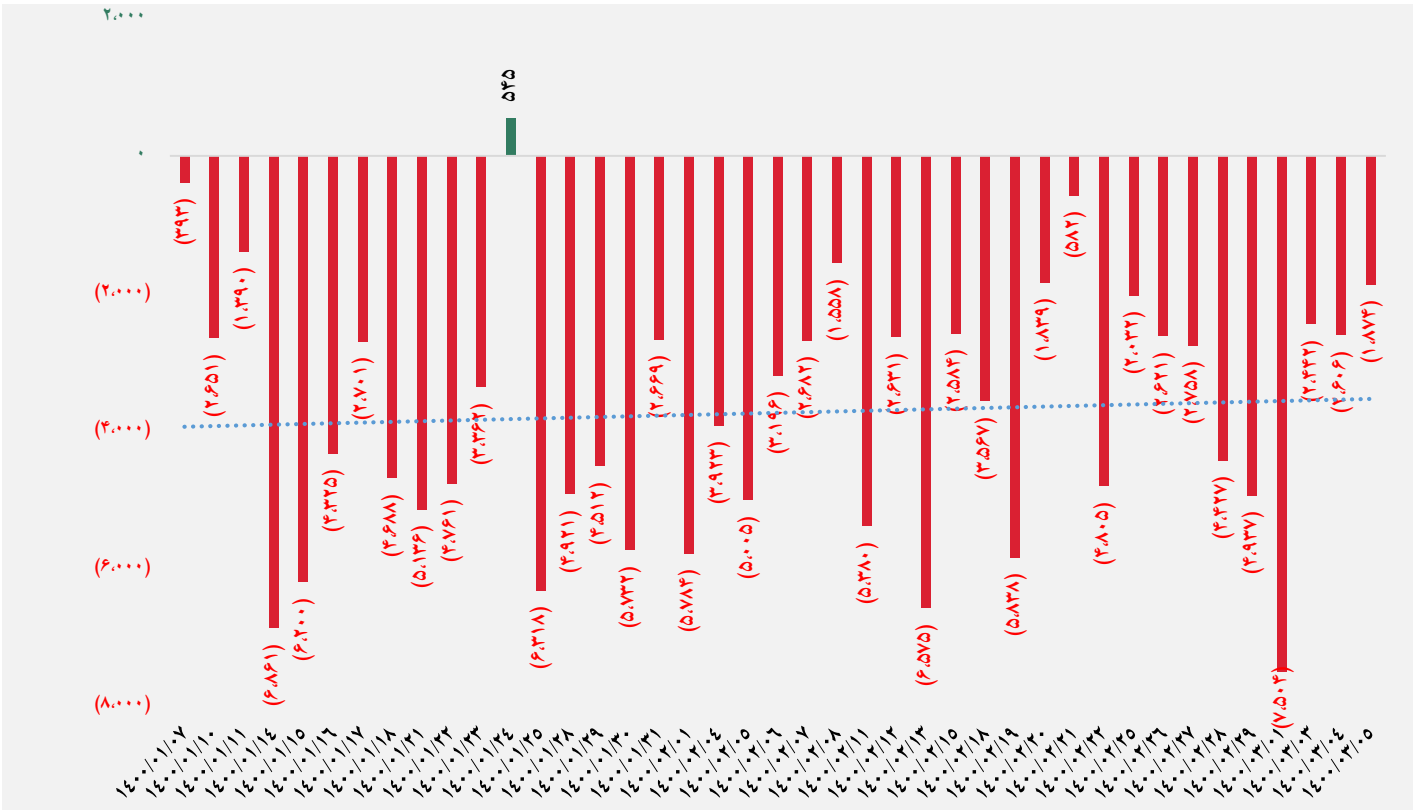
در گروه فلزات اساسی، فولاد هرمزگان در فصل اول الی سوم سال مالی قبل به طور متوسط هر ماه فروش ۵۵۷، ۸۷۱ و ۱۱۳۰ میلیارد تومانی را روانه کدال کرده بود. در دی و بهمن ماه یک فروش مناسب ۱۶۰۰ میلیارد تومانی را داشت و در اسفند ماه سال گذشته ۲۶۰۰ میلیارد تومان فروش را به ثبت رساند. در فروردین ماه سال جاری نیز فروش ۹۷۵ میلیارد تومانی را داشت و در اردیبهشت ماه ۲۳۳۳ میلیارد تومان فروش همراه بوده است. تولید در دو سال گذشته به طور متوسط هر ماه ۱۲۶ و ۱۲۱ هزار تن بوده است. در فروردین و اردیبهشت ماه نیز تولید ۱۴۵ و ۱۳۱ هزار تن است. موجودی اول سال شرکت در سال ۹۹ برابر با ۱۶۷ هزار تن بوده که با فروش ۷۱ و ۱۶۱ هزار تنی دو ماه ابتدایی در انتهای اردیبهشت به ۲۱۰ هزار تن رسیده است. نرخ فروش اسلب فولاد هرمزگان در سال ۹۹ برابر ۹۱۰۰ تومان برای هر کیلو بوده است که در فروردین ۱۳۸۰۰ و اردیبهشت ۱۴۴۰۰ تومان است.

تصویر کلی بازار

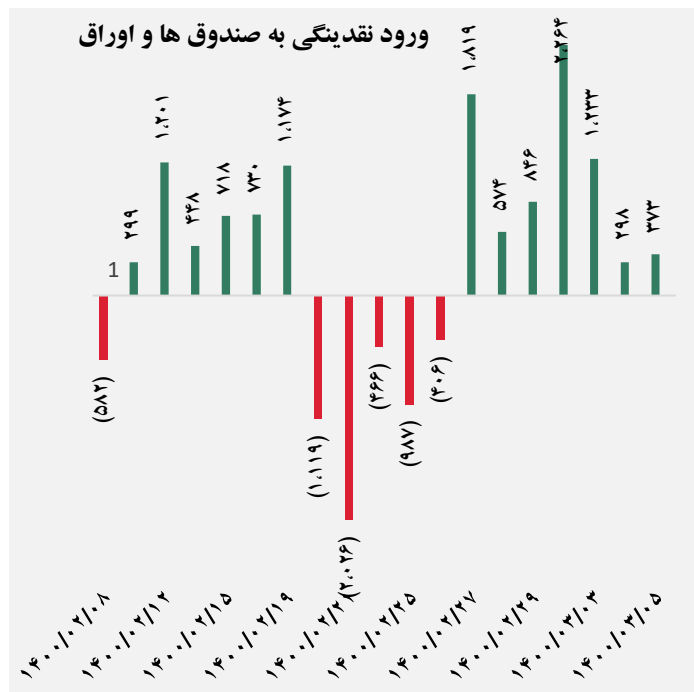
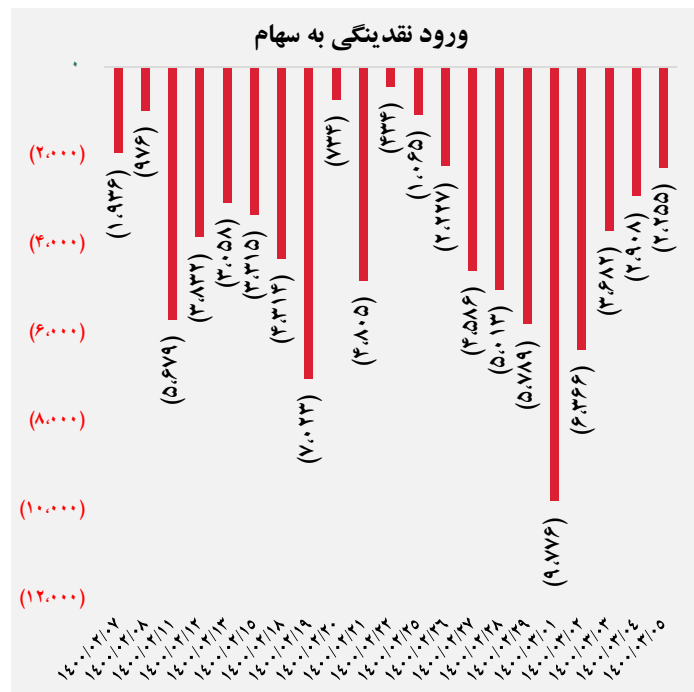
فرا بورس		بورس	
۱۷,۵۸۲	شاخص کل	۱,۱۰۹,۳۷۰	شاخص کل
۲۹	تغییر شاخص	۳,۹۱۵	تغییر شاخص
۱۱,۷۲۸,۴۸۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۴,۲۹۹,۲۰۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۴,۵۵۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۴,۳۰۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
زاگرس		فارس	
بپاس		رهمنا	
هرمز		فولاد	
آریا		فخوز	
میدکو		نوری	
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
کگهر		و صندوق	
مارون		حکشتی	
بمپنا		ونیک	
شگویا		وسخوز	
بساما		داسوه	
(۲,۲۵۵)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۳۷۳		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



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

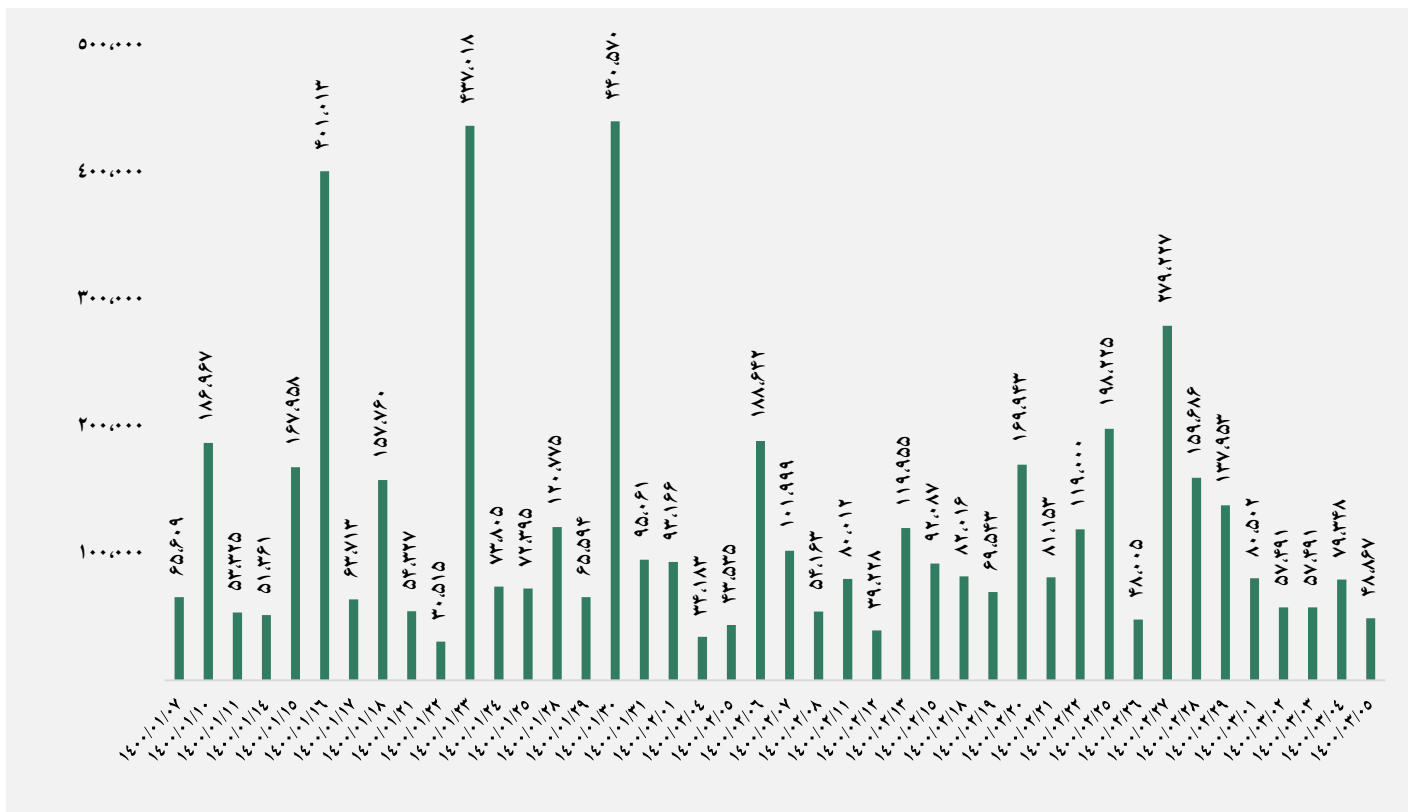


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

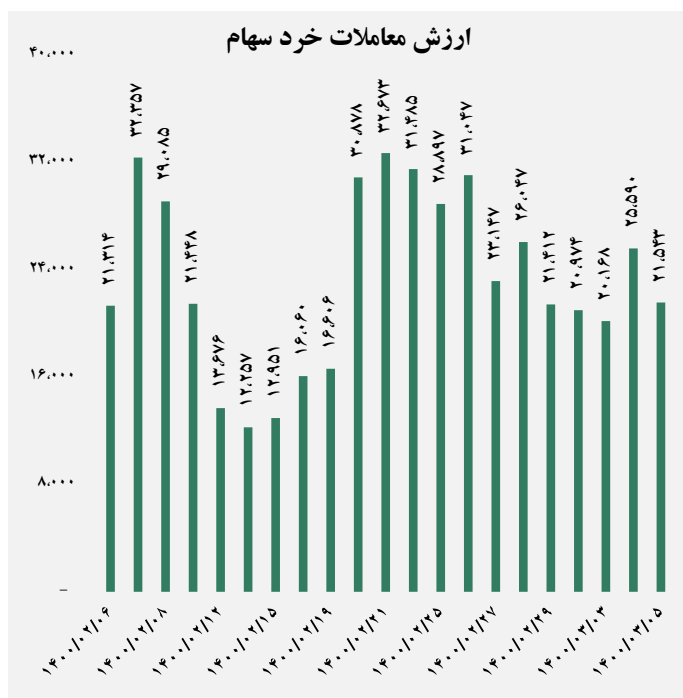
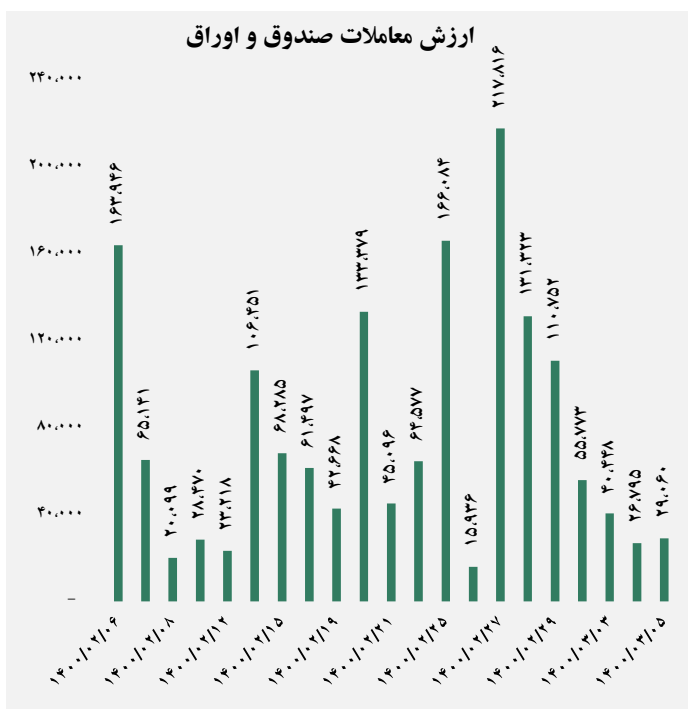


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

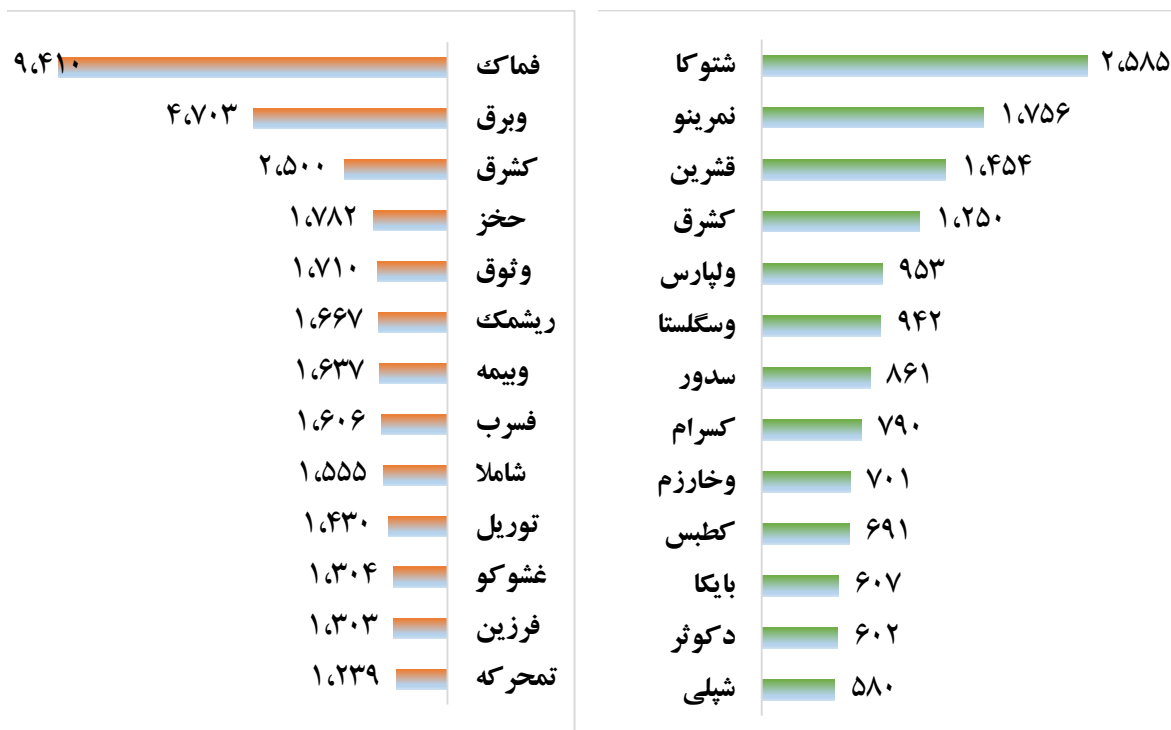


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



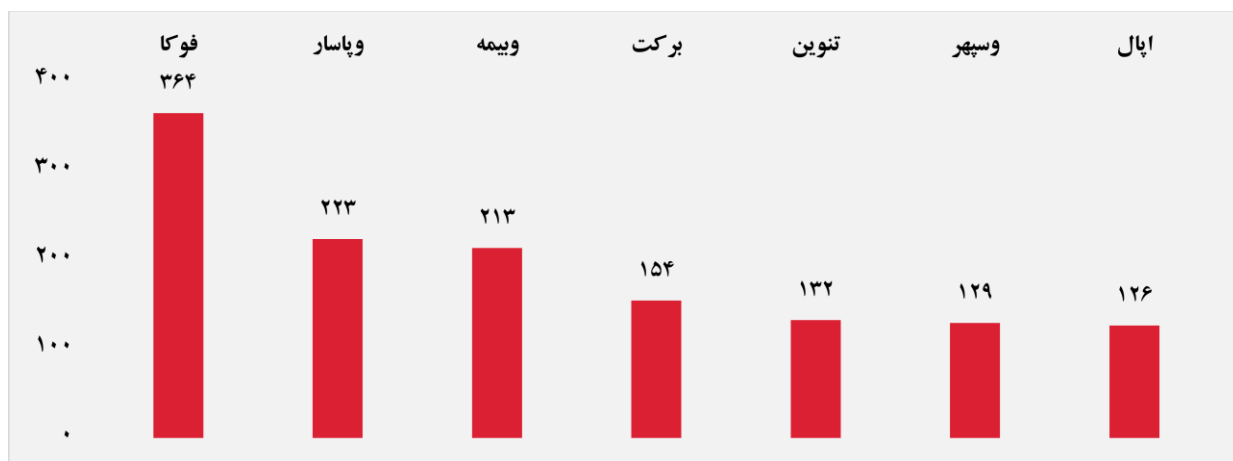
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	سبجنو	۱	وییمه
۲	رمپنا	۲	خزامیا
۳	درازک	۳	پرداخت
۴	پکرمان	۴	وسخوز
۵	فاسمین	۵	کمنگنز
۶	فگستر	۶	کامل
۷	والبر	۷	وسلرستا
۸	بموتو	۸	غشوکو
۹	حفاری	۹	تايرا
۱۰	شپترو	۱۰	فسرب

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



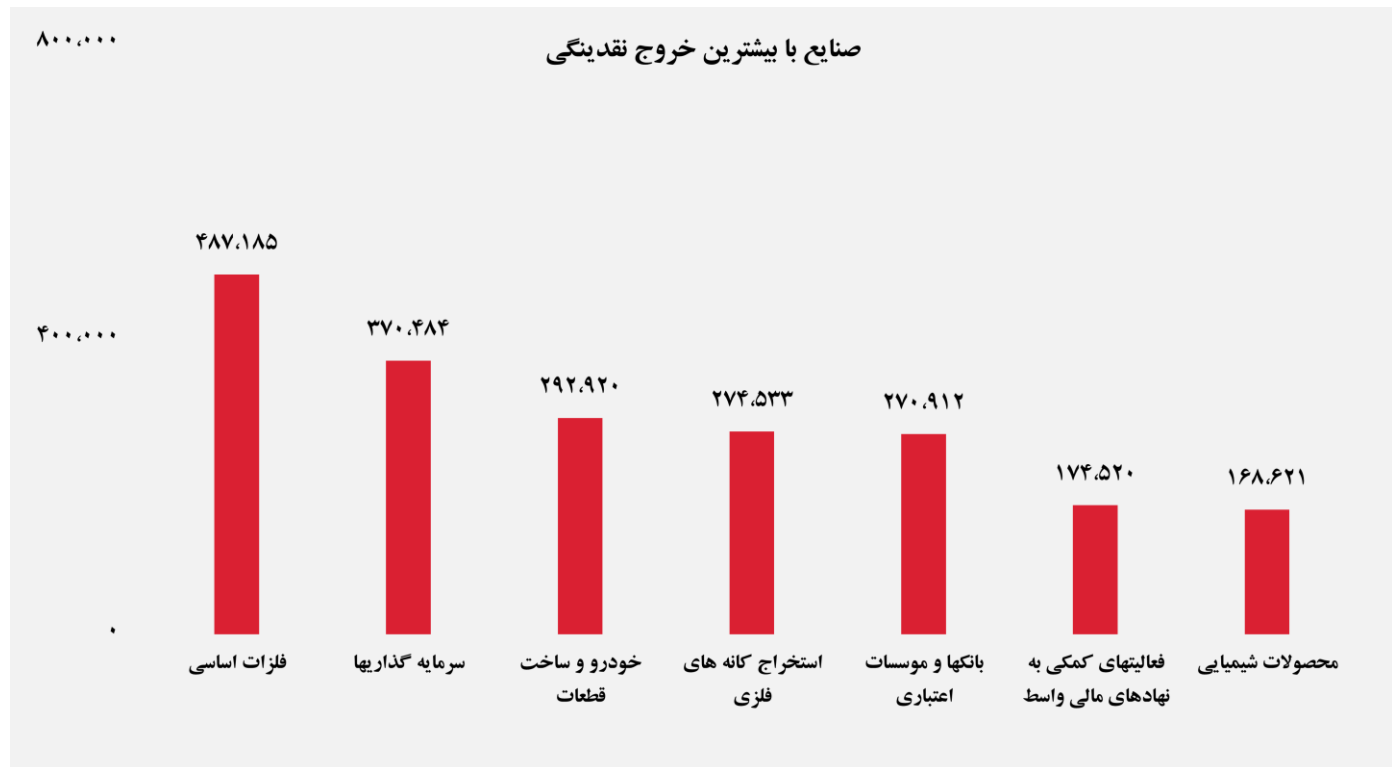
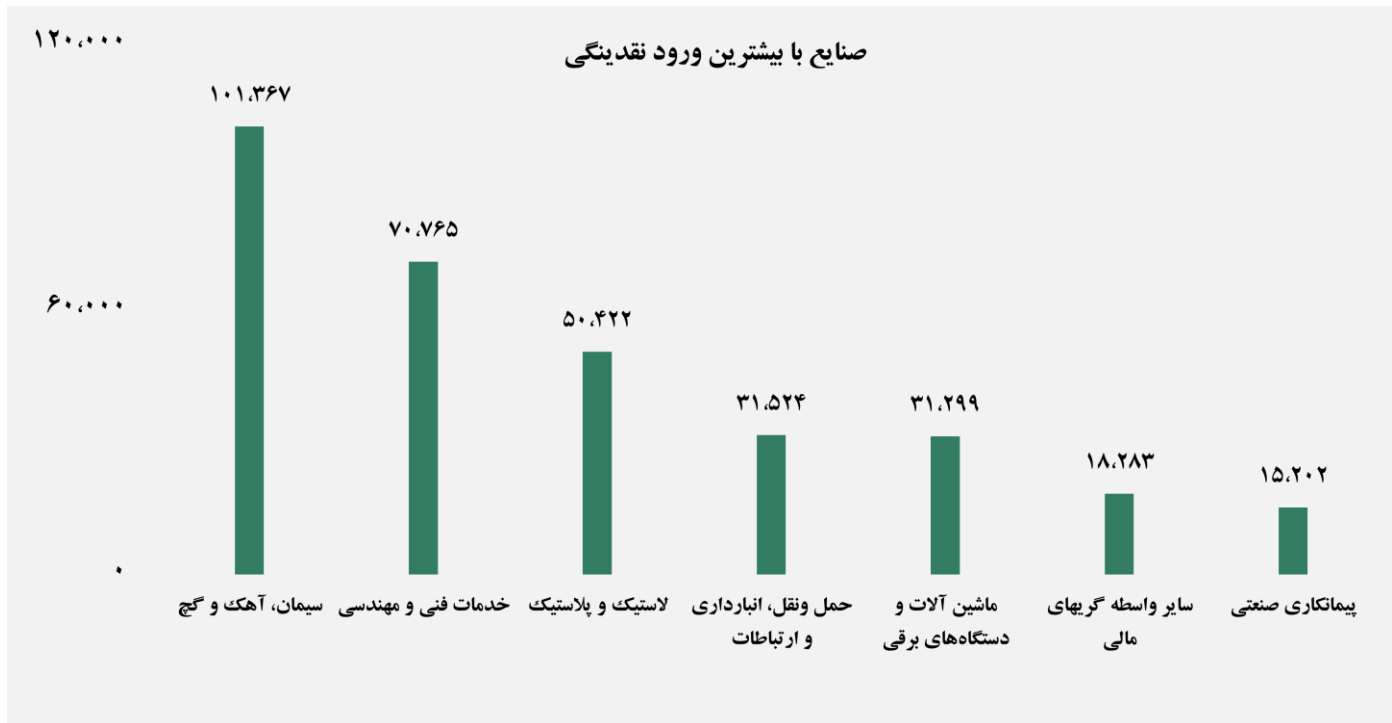
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فوکا	۱۰	تنوین
۲	برکت	۱۱	ساراب
۳	خزامیا	۱۲	سشرق
۴	سصوفی	۱۳	فباهر
۵	گشان	۱۴	نوری
۶	کاما	۱۵	وتوصا
۷	وییمه	۱۶	دزهرای
۸	پکرمان	۱۷	بوعلی
۹	زاگرس	۱۸	خفنر

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار