



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۰۸

www.sfg.ir - info@sfg.i

تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۸ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، فارس، فملی، کگل، شستا، کچاد و تایپکو با افزایش ۳۰,۱۳۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۳۹,۴۷۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش همراه بوده است. مبلغ ۴۷ 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 صنایع با معاملات در بازه قیمتی مثبت به کار خود پایان دادند.

در روز جاری بسیاری از نمادهای بزرگ و کوچک با افزایش تقاضا مواجه شده بودند، بطوریکه بعضی از نمادهای کوچک بعد از مدتها، صف فروش آنها برداشته شد و روز متعادلی را سپری کردند. نرخ دلار در بازار آزاد به حوالی ۲۴۰ هزار ریال رسیده است. نرخ‌های جهانی کامودیتی‌ها نیز همانند هفته‌های گذشته به طور مثبت به کار خود پایان داده‌اند. نرخهای فروش داخلی و صادراتی محصولات بسیاری از شرکت‌های فعال در بازار سرمایه در اردیبهشت ماه بیشتر از ماه‌های گذشته بوده و مبلغ فروش ماهانه نیز رشد بااهمیتی را به ثبت رسانده است. مجموع موارد ذکر شده نشان از تغییر رقم سودآوری به طور بااهمیتی برای بسیاری از شرکت‌ها در سال جاری نسبت به سال‌های گذشته دارد و نسبت پی بر ای این شرکت‌ها حتی به کمتر از ۴ واحد نیز رسیده است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۸,۴۱۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۳۶۴، 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 ۷۱۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۸ با ۲۳,۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۰۵	۱۴۰۰/۰۳/۰۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۷,۲۰۶	۸,۴۱۲	۱۷٪



گروه‌های مؤثر

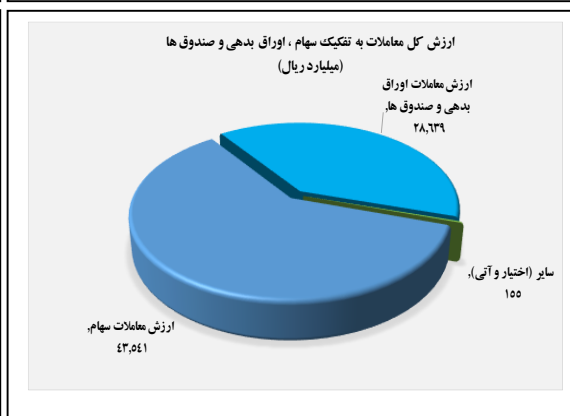
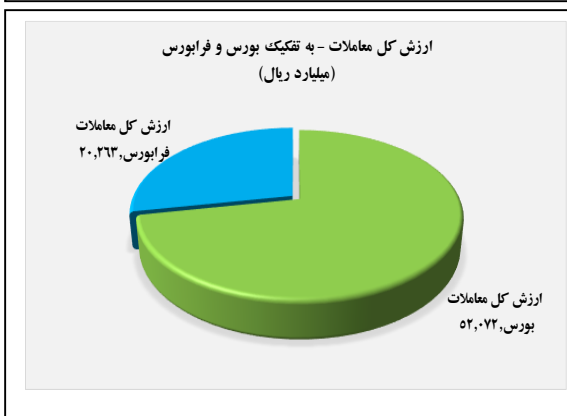
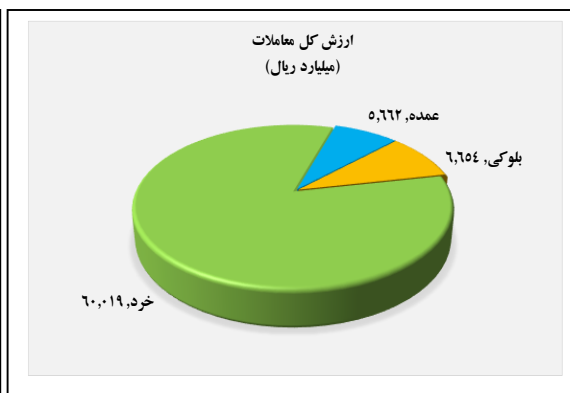
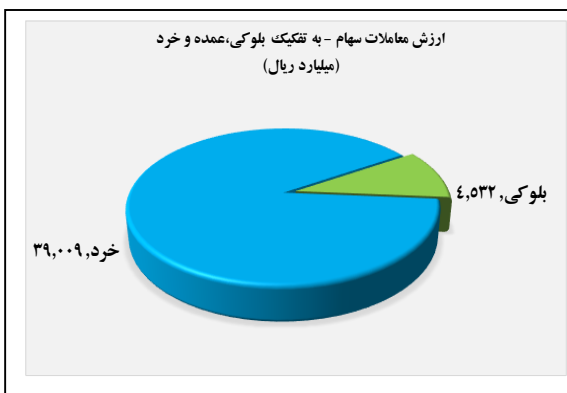
در گروه شیمیایی، پتروشیمی اراک در سال گذشته ۱۱,۱۵۵ میلیارد تومان در ۱۲ ماهه فروش داشته است. در فروردین ماه سال جاری فروش ۱۲۴۷ میلیارد تومانی را به ثبت رساند و در اردیبهشت ماه نیز با فروش ۱۴۰۴ میلیارد تومانی همراه بوده است. این شرکت در فروردین ماه ۶۰ هزار تن از محصولات اول زنجیره تولید داشت که این مقدار در اردیبهشت برابر با ۵۹ هزار تن است. قابل ذکر است که میانگین تولید ماهانه این شرکت در سال گذشته برابر با ۵۹ هزار تن بود. این تولید کننده شیمیایی در سال گذشته به طور میانگین هر ماه ۷۳ هزار تن محصول به فروش رسانده است. در اولین ماه از سال جاری نیز فروش ۵۶ هزار تنی داشت که در اردیبهشت فروش خود را به ۶۰ هزار تن افزایش داده است. متوسط نرخ فروش فروردین ماه محصولات ۲۲,۱۲۳ تومان به ازای هر کیلو بوده که در اردیبهشت ماه با ۵ درصد افزایش نسبت به ماه گذشته به ۲۳,۳۳۲ تومان رسید.

در گروه شیمیایی، شرکت پاکسان سال مالی منتهی به آذر ماه دارد. این شرکت در اردیبهشت ۸ هزار و ۶۰۰ تن تولید داشته است. متوسط تولید ماهانه شرکت در سال مالی منتهی به آذر ماه ۱۰ هزار و ۶۰۰ تن ثبت شده است. متوسط فروش سال مالی گذشته ۱۲۱ میلیارد تومان برای هر ماه بوده است. شرکت در اردیبهشت فروش خوب ۱۶۱ میلیارد تومانی را گزارش کرده است و در ۴ ماه ابتدای سال مالی خود متوسط فروش ۱۵۰ میلیارد تومان ثبت شده است. نرخ پودر به عنوان محصول اصلی به طور متوسط در سال مالی گذشته ۷۷۰۰ تومان برای هر کیلو بوده است. پاکسان در اردیبهشت ماه پودر را با نرخ ۱۱۲۰۰ تومان فروخته است. متوسط نرخ فروش آذر تا فروردین ۱۰۴۰۰ تومان به ازای هر کیلو گزارش شده است.

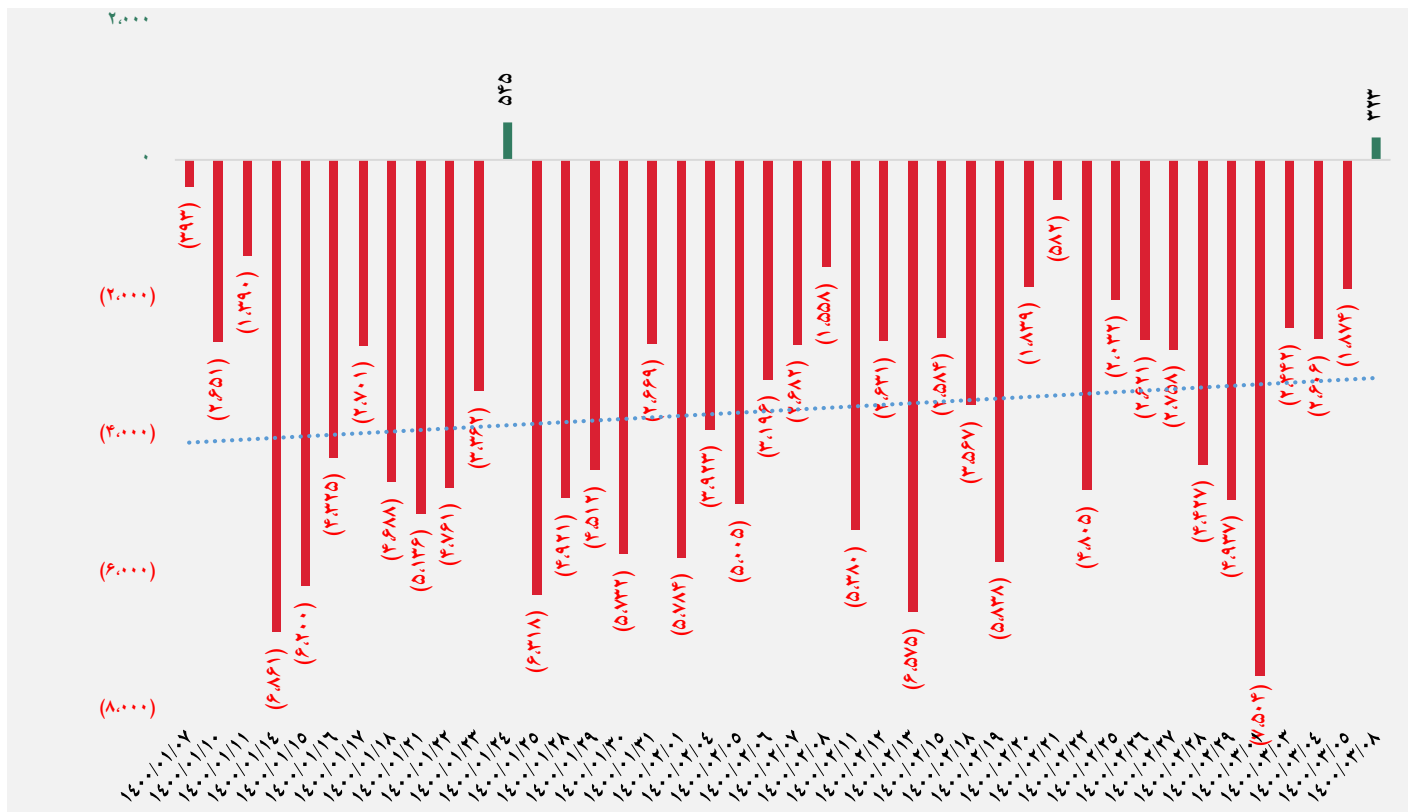
در گروه فعالیت‌های کمکی به نهاد مالی واسط، شرکت فرابورس ایران در اردیبهشت ماه سال جاری کمترین درآمد ماهانه در ۱۷ ماه اخیر را داشته و رقم ۲۸ میلیارد تومانی را گزارش کرده است. این شرکت در تیر، مرداد، شهریور، مهر، آبان، آذر، دی، بهمن، اسفند و فروردین سال جاری به ترتیب ۲۳۷، ۱۷۱، ۱۱۲، ۸۶، ۵۶، ۱۵۷، ۱۰۲، ۵۲، ۸۷ و ۳۳ میلیارد تومان درآمد داشته است. میانگین درآمد ماهانه سال مالی ۹۹ و ۹۸ به ترتیب، ۱۱۶ و ۳۱ میلیارد تومان بوده است.

تصویر کلی بازار

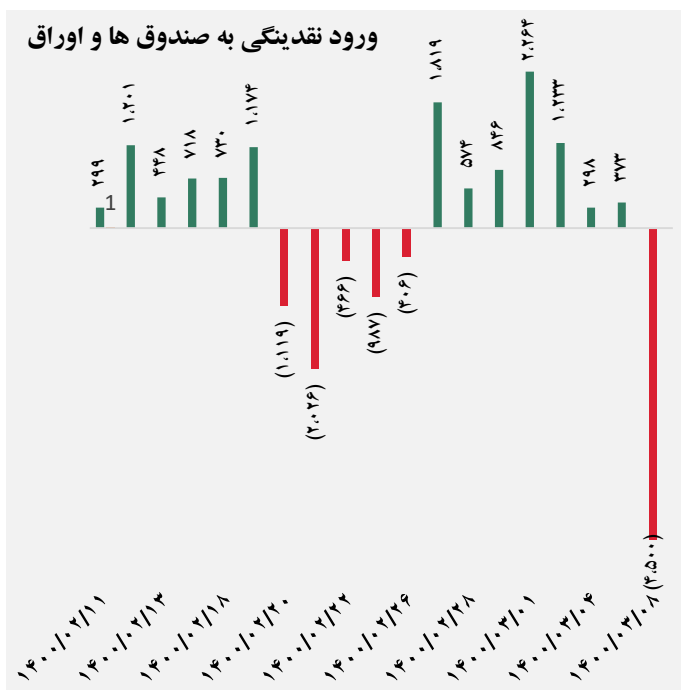
فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۳۲	شاخص کل	۱,۱۳۹,۴۷۹	شاخص کل
۱۴۹	تغییر شاخص	۳۰,۱۳۱	تغییر شاخص
۱۱,۸۲۱,۹۳۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۵,۵۸۷,۷۸۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۰,۲۶۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۲,۰۷۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
آریا		فولاد	
هرمز		فارس	
پپاس		فملی	
زاگرس		کگل	
شگویا		شستا	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
غصینو		وامید	
غگلستا		کویر	
وهور		وسخوز	
مارون		ثشاهد	
کگهر		رکیش	
۴,۸۰۵		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۴,۵۰۰		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



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

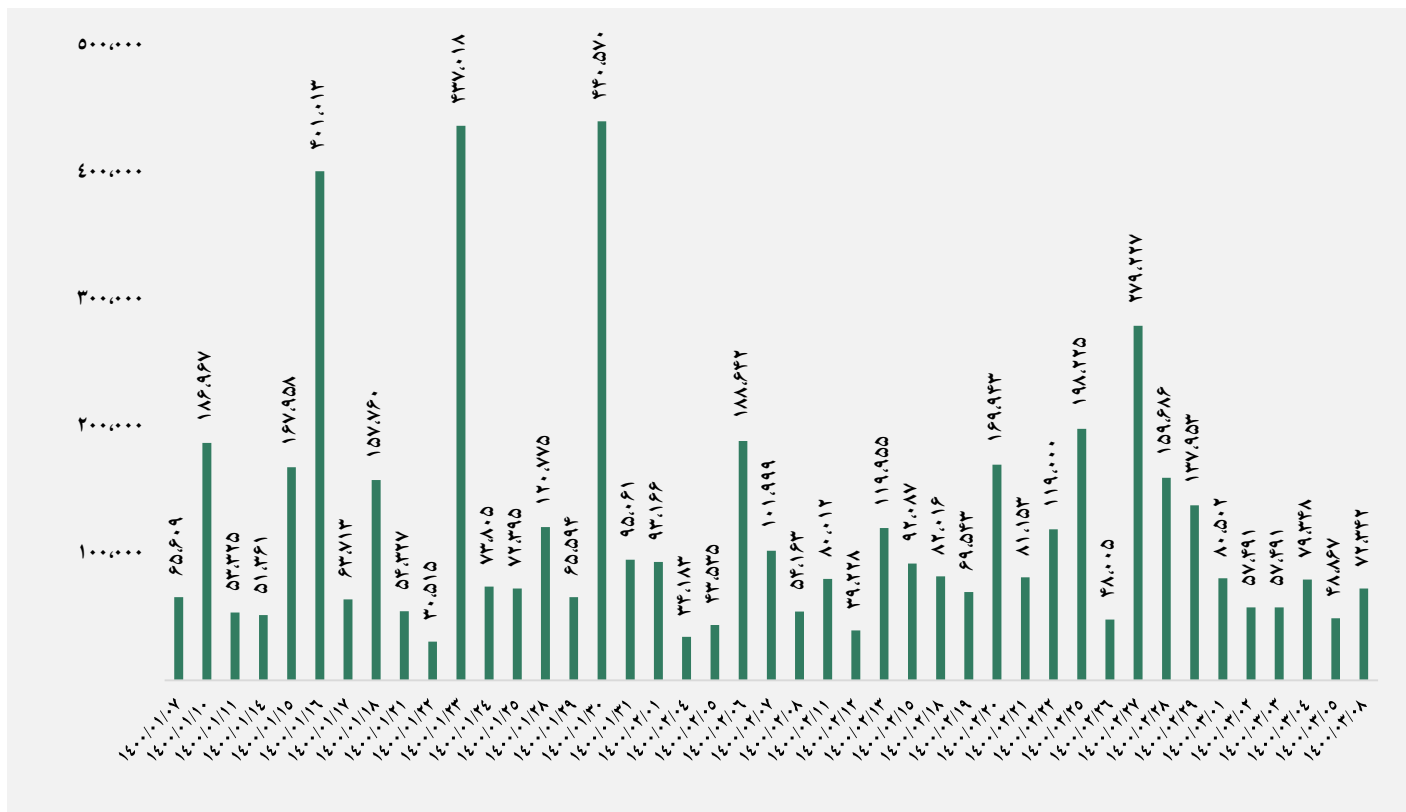


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

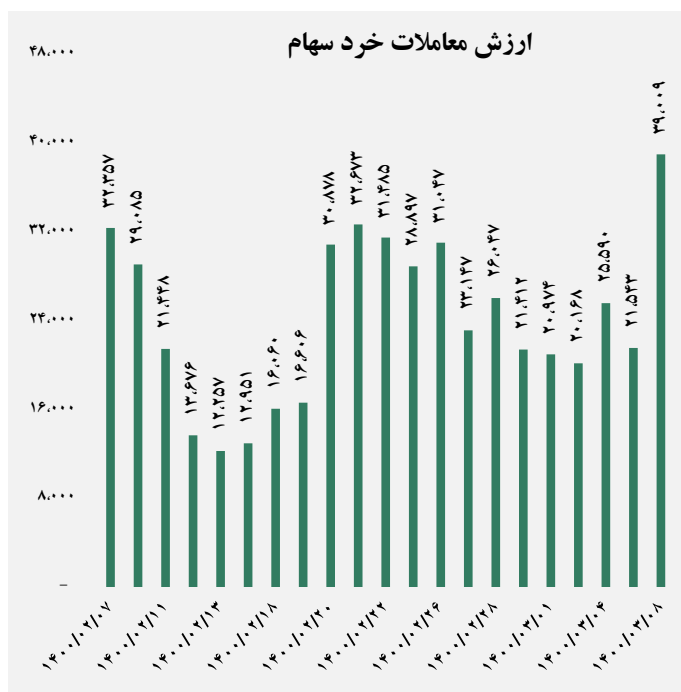
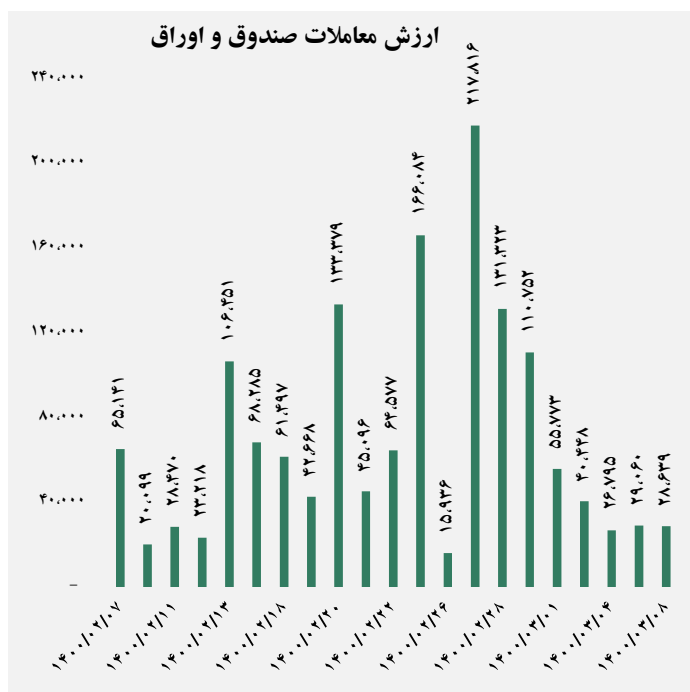




ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



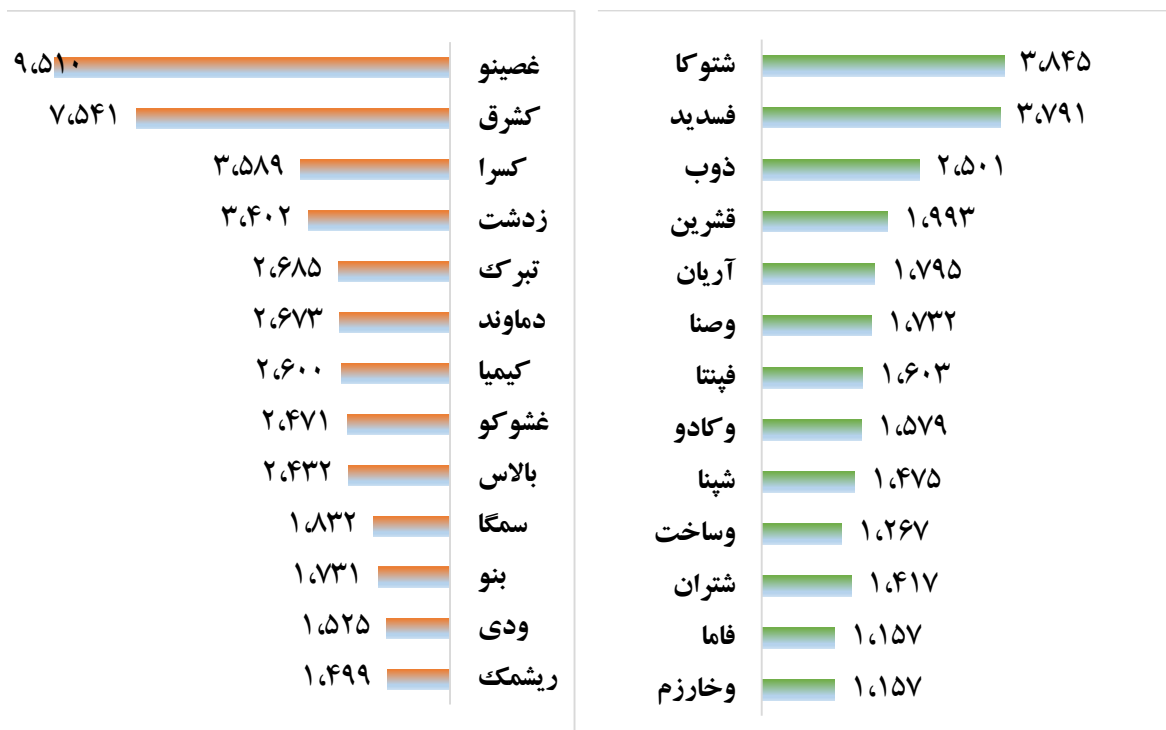
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



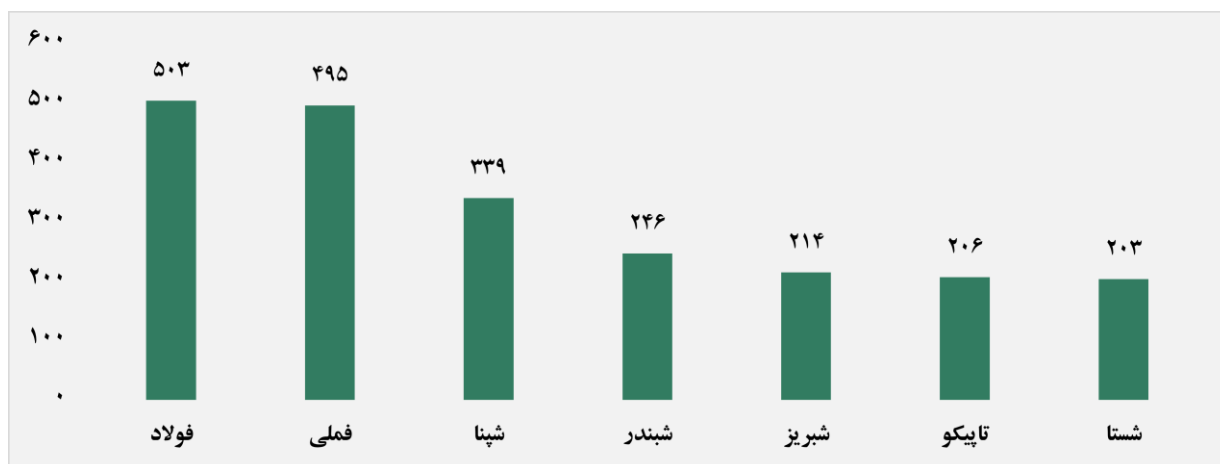
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



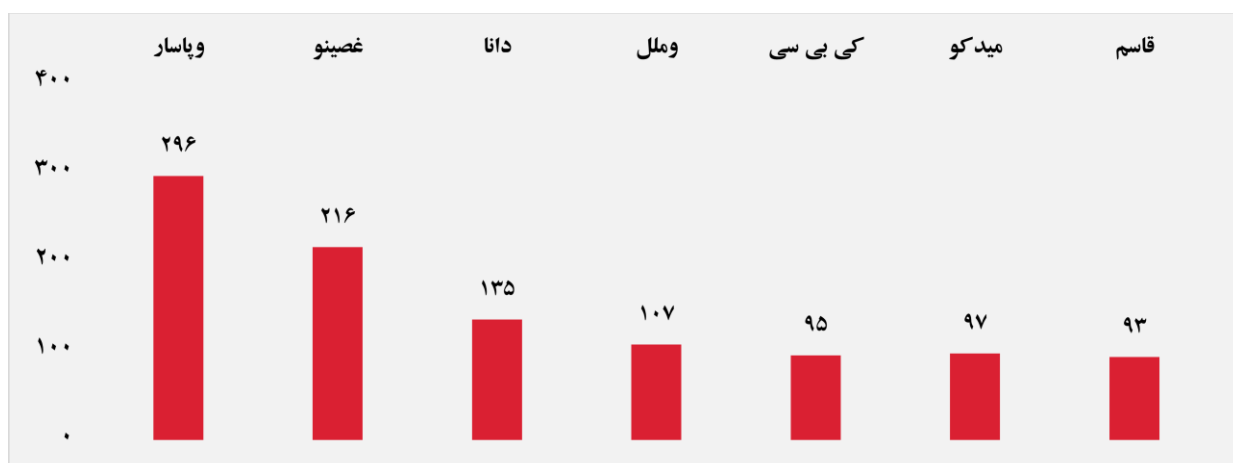
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	چخزر	۱	کی بی سی
۲	بموتو	۲	کمنگنز
۳	فسازان	۳	نمرینو
۴	ساوه	۴	وبرق
۵	سهگمت	۵	پسهند
۶	سخزر	۶	شکلر
۷	شاون	۷	لسرما
۸	وپویا	۸	سبجنو
۹	قیستو	۹	ختراک
۱۰	خراسان	۱۰	غگکپا

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



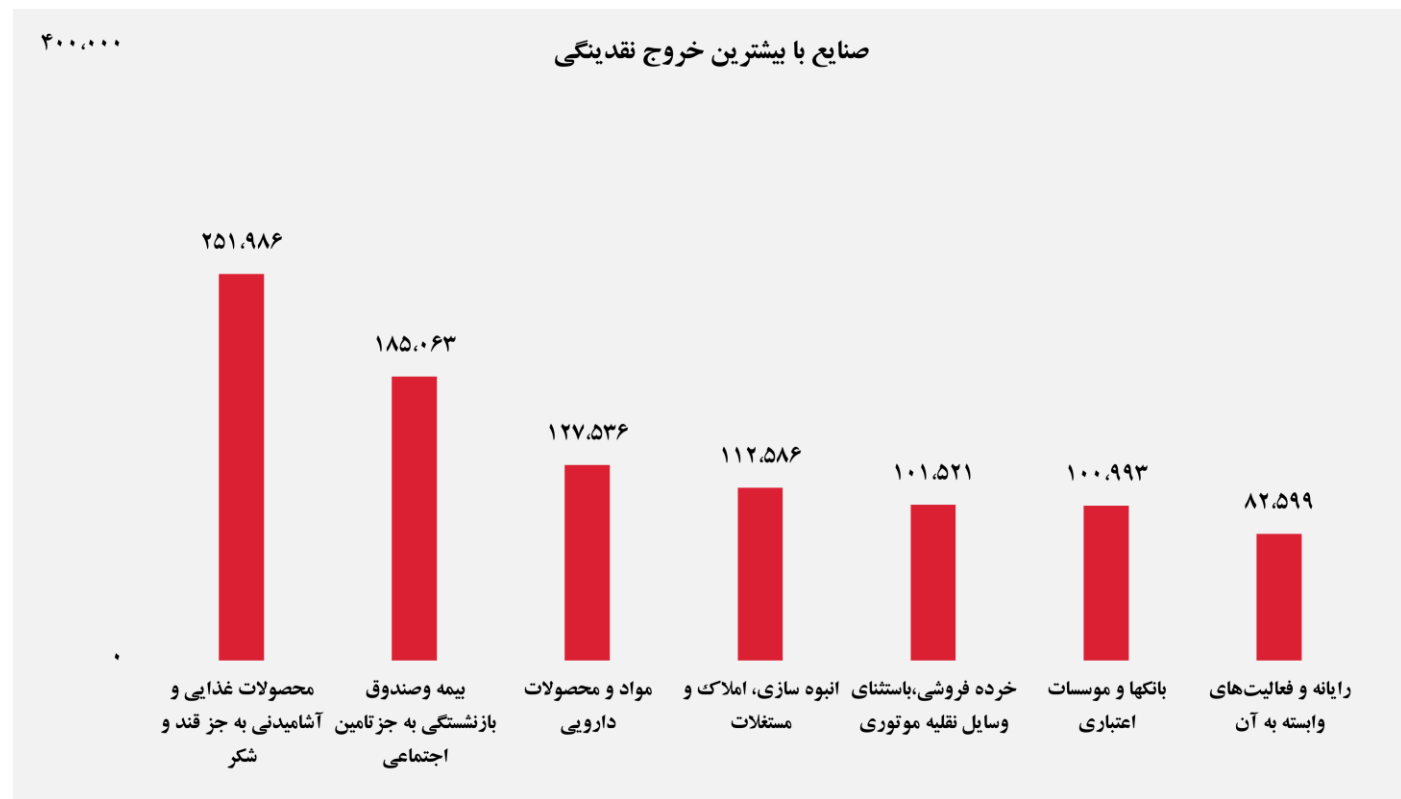
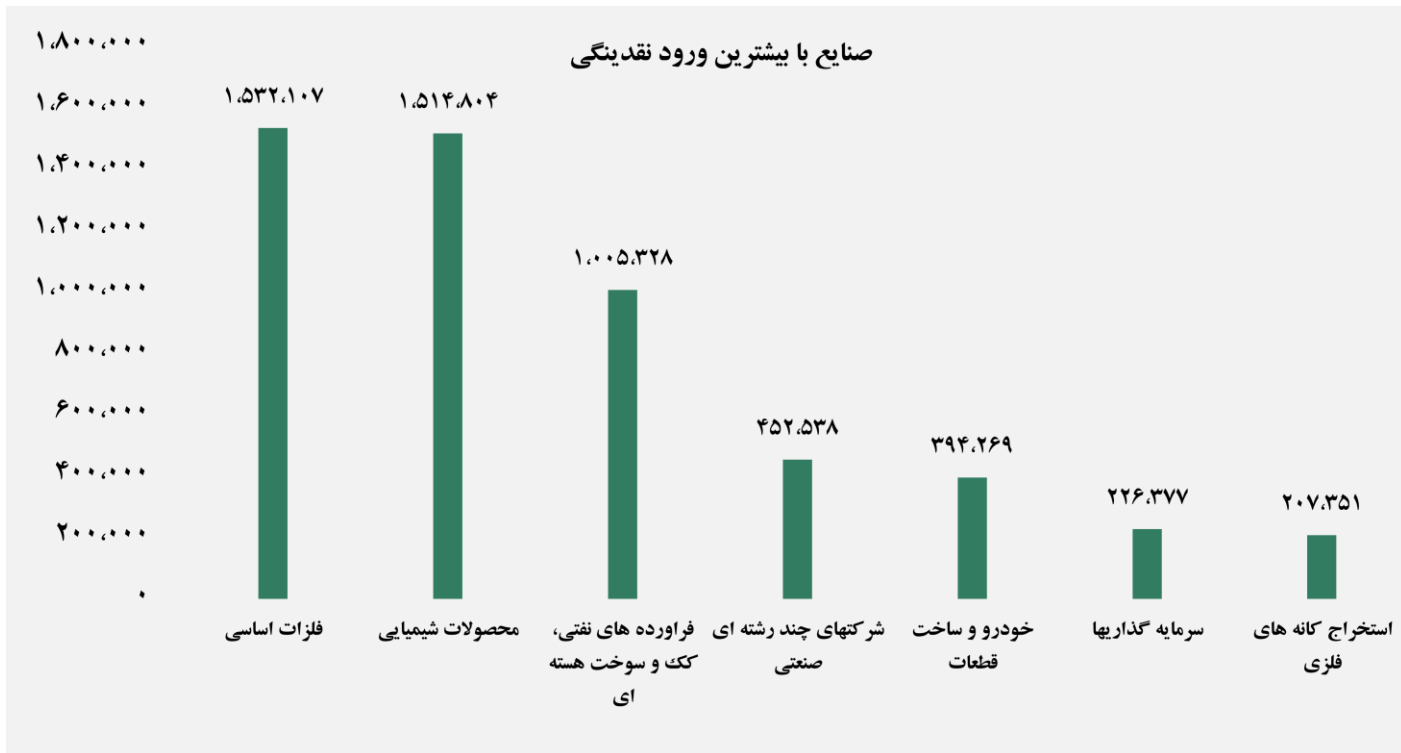
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کویر	۱۰	وپویا
۲	ستران	۱۱	حخزر
۳	دانا	۱۲	پتایر
۴	گشان	۱۳	برکت
۵	شغدیر	۱۴	ولپارس
۶	ویمه	۱۵	قاسم
۷	کفپارس	۱۶	ساراب
۸	خاذین	۱۷	شپدیس
۹	شاون	۱۸	توریل

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار