



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۰۹

www.sfg.ir - info@sfg.i

تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۹ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، فملی، شستا، کگل، فارس، تاپیکو و شپنا با افزایش ۱۷,۳۷۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۵۶,۹۱۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش همراه بوده است. مبلغ ۶۲ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق‌های قابل معامله سهامی می‌باشد که بالاترین ارزش معاملات خرد در سال ۱۴۰۰ به شمار می‌آید.

در روز جاری علی‌رغم فشار فروش که بر روی اکثر سهام شرکت‌های بزرگ حاکم بود، شاخص کل توانست به بالای کف قبلی خود در ۱,۱۳۵,۰۰۰ واحد نفوذ کند. با توجه به تغییر دامنه نوسان در چند ماه گذشته از منفی ۵ به منفی ۲، روند شکل‌گیری شاخص کل با تغییراتی همراه شده است و نمی‌توان در حال حاضر به طور قاطع در مورد اتمام روند اصلاحی شاخص کل نظر داد. اما می‌توان گفت که این شاخص در آخرین موج اصلاحی خود (کارکشن G) قرار دارد و برگشت شاخص به بیش از ۱,۲۰۰,۰۰۰ نشان از اتمام روند اصلاحی شاخص کل در بلندمدت می‌باشد. در این صورت شاخص کل بعد از اتمام اصلاح، در بازه کوتاه مدت می‌تواند حداقل در اولین مرحله تا ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحد رشد کند و در میان مدت نیز پتانسیل رشد تا حوالی ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد را نیز دارد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۵,۱۶۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۳۵۴، 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 ۲۴,۳٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۰۸	۱۴۰۰/۰۳/۰۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۸,۴۱۲	۱۵,۱۶۶	۸۰٪



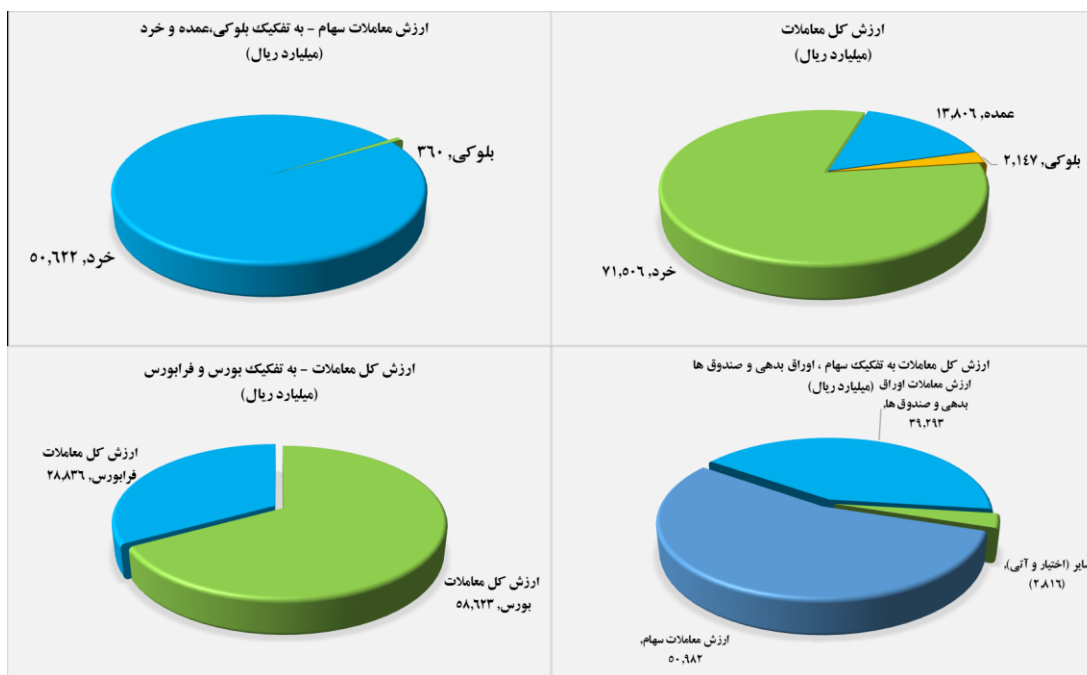
گروه‌های مؤثر

در گروه ماشین آلات و دستگاه‌های برقی، شرکت موتورن سال مالی منتهی به شهریور ماه دارد. شرکت در اردیبهشت فروش ۱۶۶ میلیارد تومانی را ثبت کرده است. متوسط فروش ۷ ماه گذشته ۱۲۴ میلیارد تومان بوده است. تولید محصول صنعتی در اردیبهشت ۱۸,۲۸۹ دستگاه در سایت کدال ثبت شده است. متوسط تولید از مهر ماه تا فروردین ۱۷,۰۹۱ دستگاه گزارش شده است. فروش اردیبهشت ماه ۱۳,۰۰۴ دستگاه و متوسط فروش از ابتدای سال مالی تا فروردین ۱۳,۳۱۶ دستگاه بوده است. نرخ فروش در اردیبهشت ماه ۴ میلیون و ۳۹۶ هزار تومان و متوسط نرخ فروش ماهانه ۳ میلیون و ۶۰۰ هزار تومان می‌باشد. محصول کولری فصلی به فروش می‌رسد. تولید اردیبهشت ماه برای این نوع محصول ۷۷,۳۲۰ دستگاه گزارش شده است. این شرکت در اردیبهشت ۸۷,۷۴۰ دستگاه کولر فروخته است. فروش فروردین هم حدود ۴۰ هزار دستگاه بوده است. اما در اسفند و بهمن مقدار فروش ۲۱۳ و ۱۲۱ هزار دستگاه ثبت شده است. نرخ اردیبهشت ماه برای این نوع محصول ۱ میلیون و ۷۰۰ هزار تومان و متوسط نرخ ۵ ماه گذشته ۸۰۰ هزار تومان گزارش شده است.

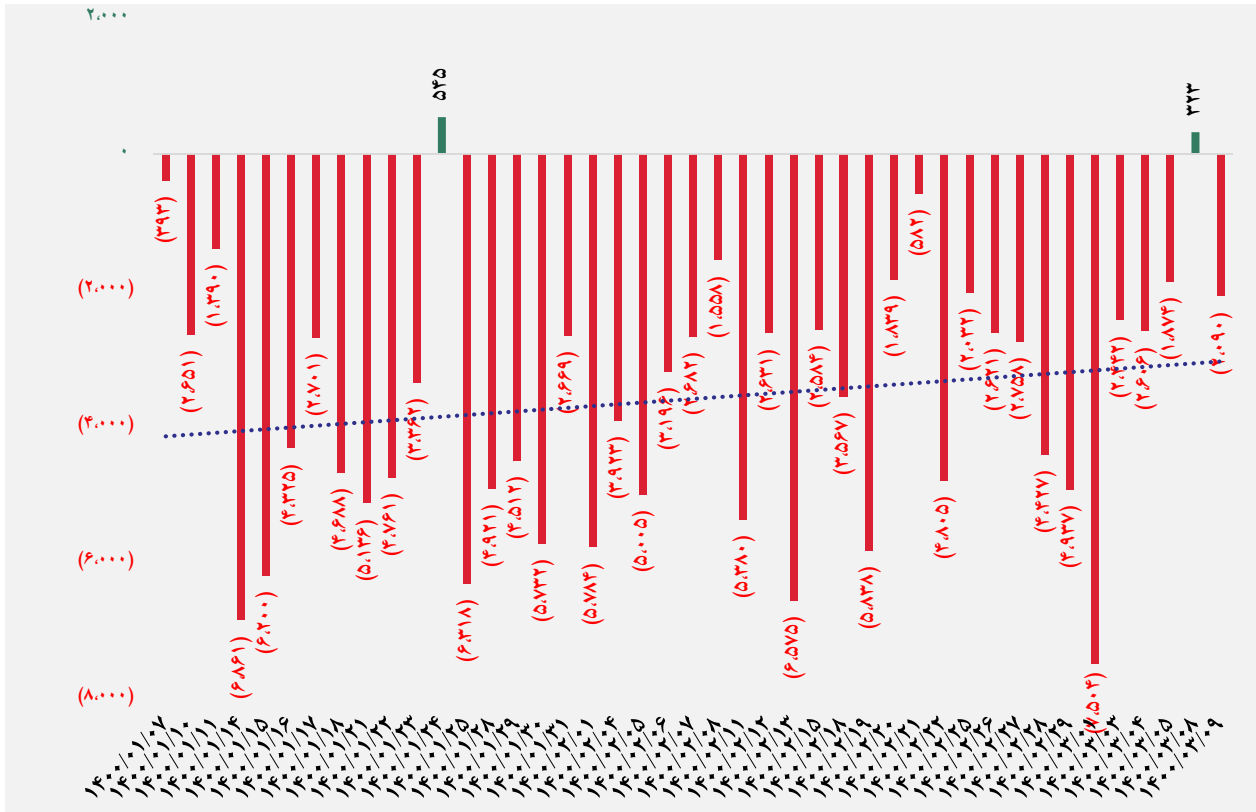
در گروه لاستیک و پلاستیک، گروه صنعتی بارز در اردیبهشت ماه ۸,۳۸۹ تن تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه سال مالی ۹۸، ۶۴۷۸ تن و در سال ۹۹ نیز ۷۶۰۵ تن بوده است. فروش در اردیبهشت ماه نیز ۸۲۹۹ تن گزارش شده و میانگین فروش سال مالی ۹۹ و ۹۸ به ترتیب ۷۰۷۹ و ۶۳۱۴ تن بوده است. در اردیبهشت ماه فروش مناسب ۴۴۳ میلیارد تومان گزارش شده است. میانگین فروش ماهانه سال گذشته ۲۸۰ میلیارد تومان بوده است. نرخ فروش تایر رادیال در اردیبهشت ۵۲۸,۰۴۸ ریال گزارش شده و میانگین نرخ فروش سال مالی ۹۹ و ۹۸ به ترتیب ۳۹۳,۷۶۵ و ۲۲۶,۰۰۶ ریال بوده است.

تصویر کلی بازار

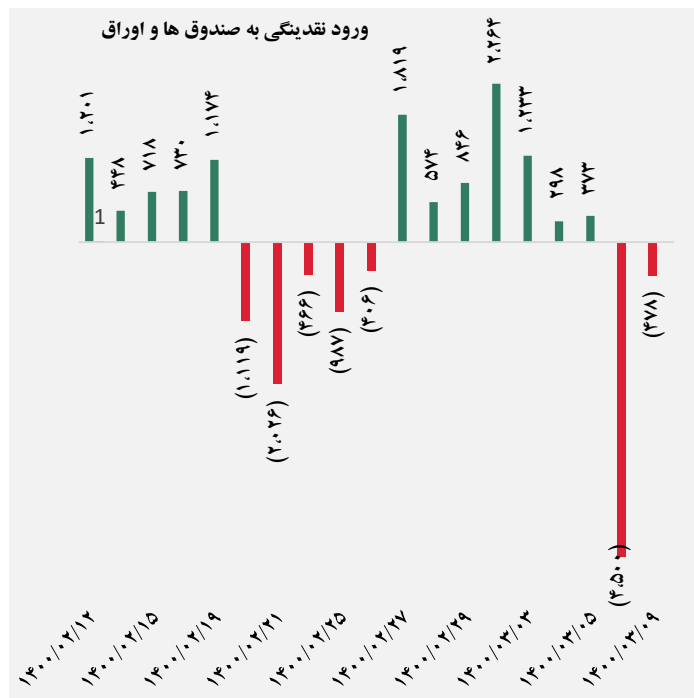
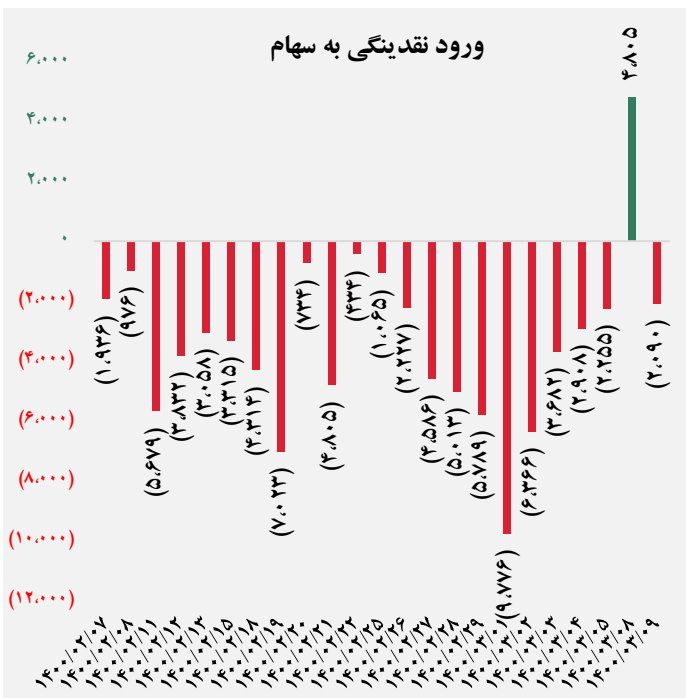
فرا بورس		بورس	
۱۷,۸۴۱	شاخص کل	۱,۱۵۶,۸۹۲	شاخص کل
۱۰۹	تغییر شاخص	۱۷,۳۵۶	تغییر شاخص
۱۱,۸۹۳,۳۴۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۲۷۷,۶۴۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۸,۸۳۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۸,۶۲۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
میدکو		فولاد	
آریا		فملی	
ذوب		شستا	
هرمز		کگل	
بپاس		فارس	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کگهر		رمپنا	
غصینو		وامید	
سمگا		دجابر	
ودی		دکیمی	
شپاس		زکوثر	
۲,۰۹۰		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۴۷۸		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

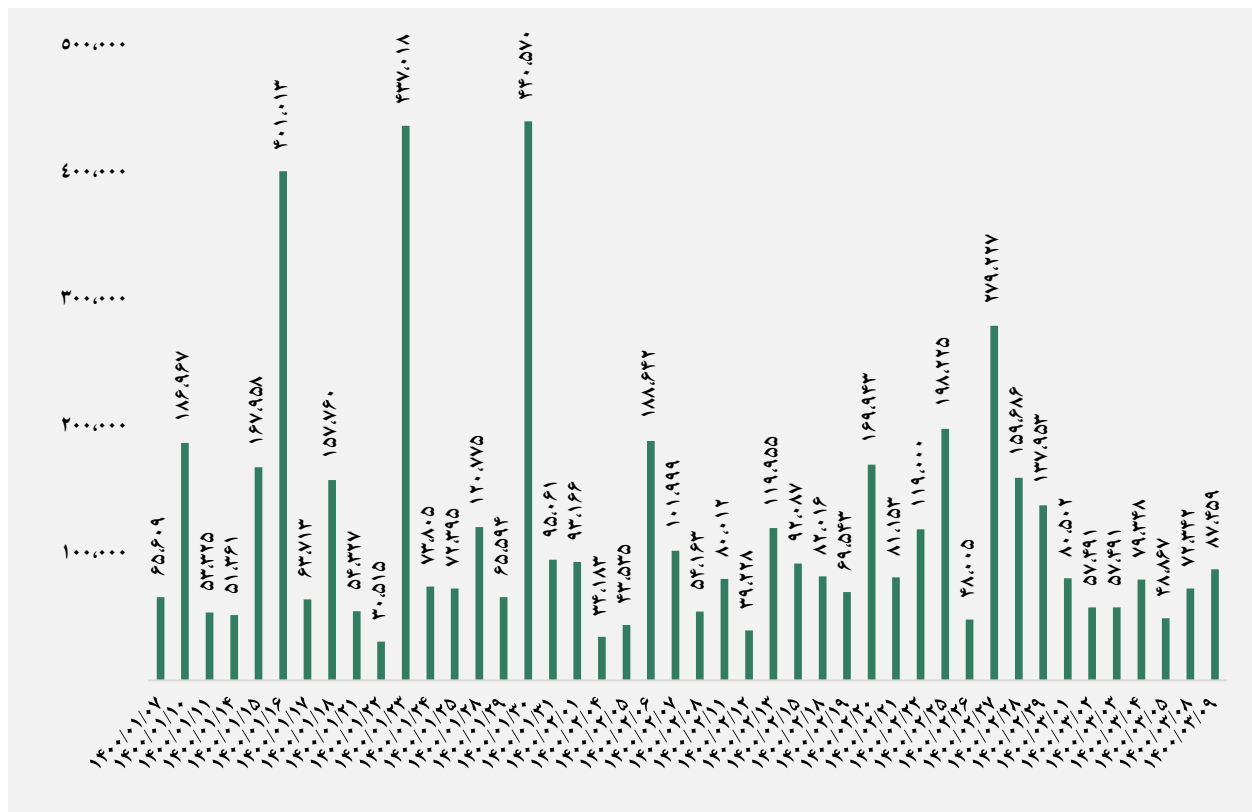


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

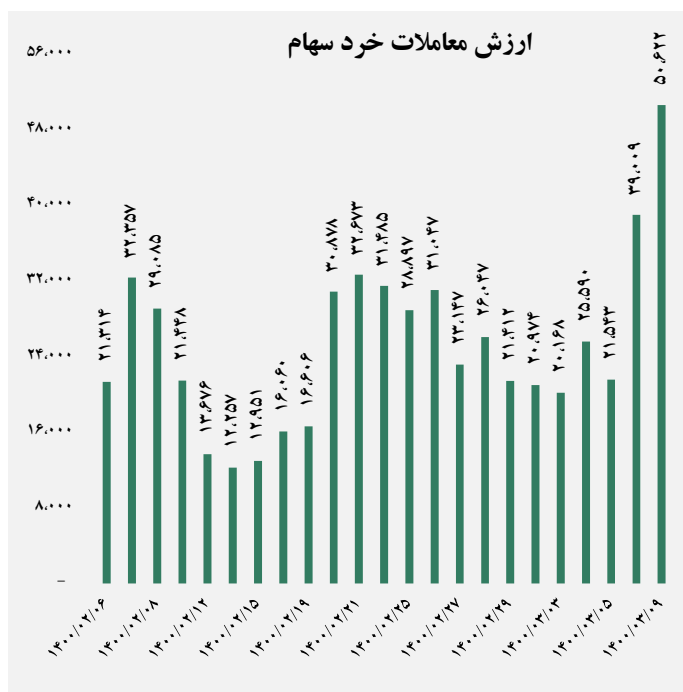
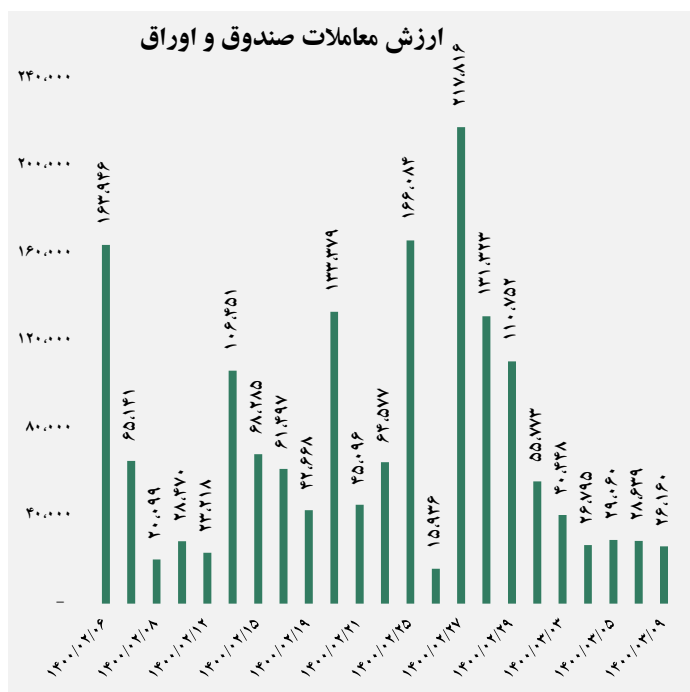


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

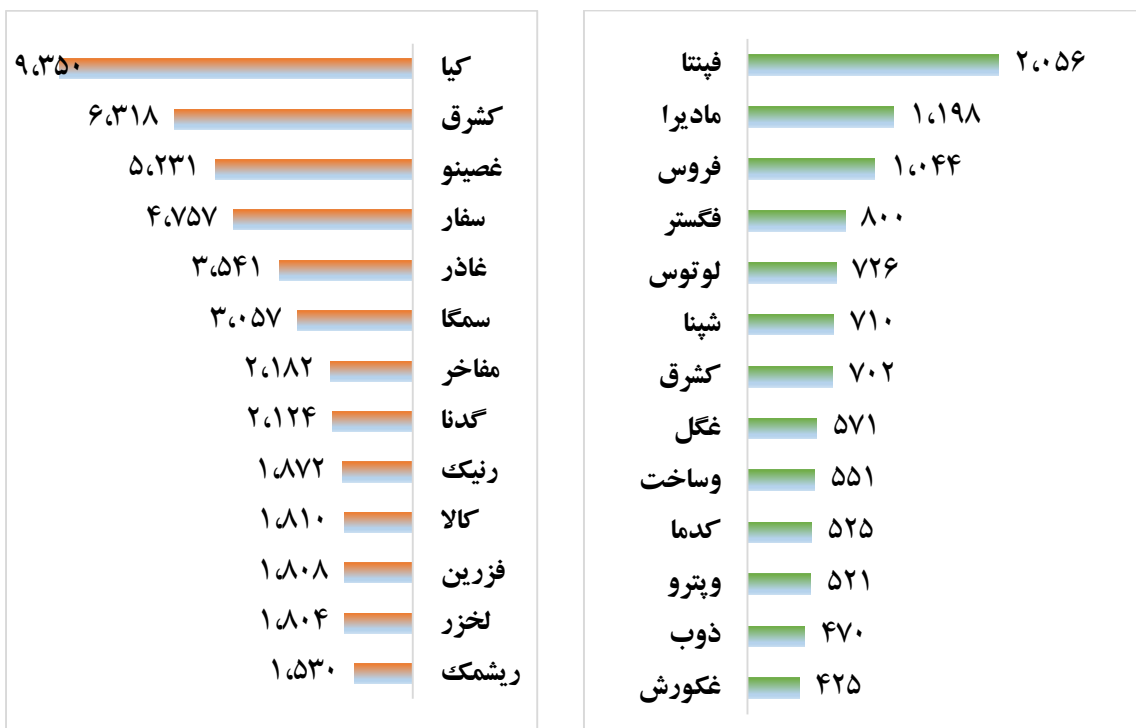
ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



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



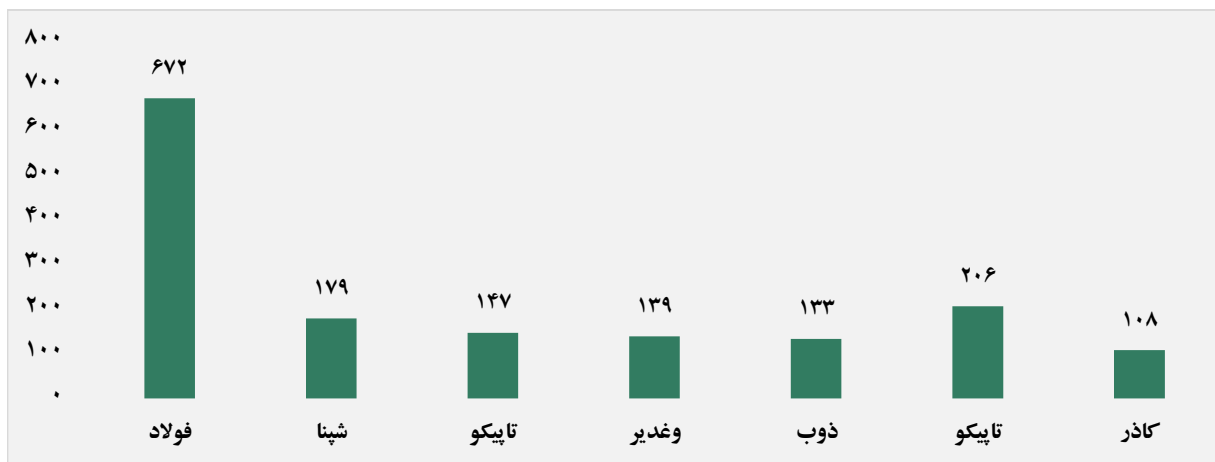
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



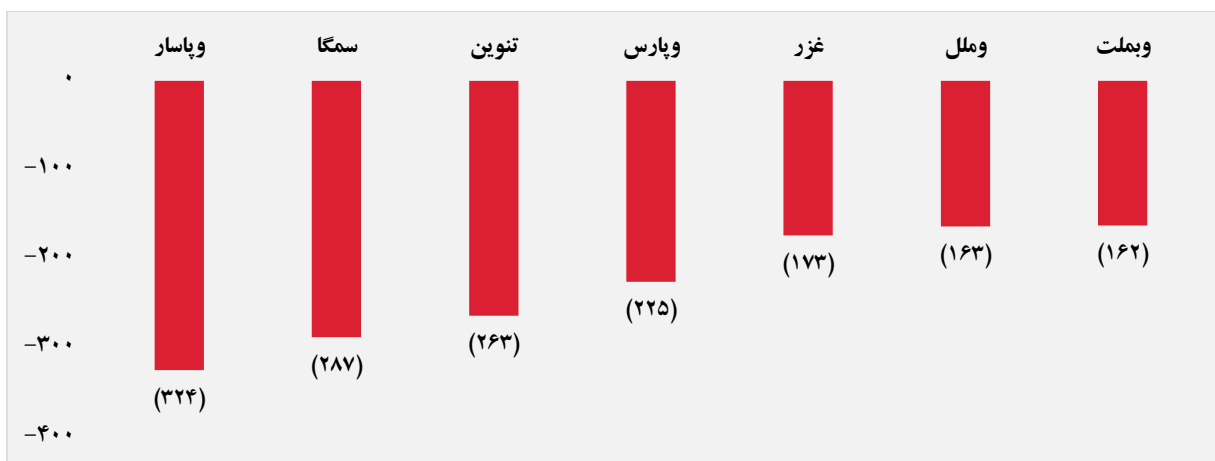
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	اپال	۱	فرآور
۲	پارس	۲	وبملت
۳	ثمسکن	۳	خزامیا
۴	شینا	۴	شاروم
۵	ذوب	۵	ورنا
۶	تاپیکو	۶	ساروم
۷	وغدیر	۷	شاملا
۸	تیپیکو	۸	حریل
۹	قاسم	۹	دزهرای
۱۰	کماسه	۱۰	غگلیا

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ودی	۱۰	ستران
۲	برکت	۱۱	خفصر
۳	وساخت	۱۲	خزامیا
۴	شغدیر	۱۳	حخزر
۵	کزغال	۱۴	دکوتر
۶	ساراب	۱۵	کفپارس
۷	غزر	۱۶	سصوفی
۸	گشان	۱۷	سمگا
۹	پکویر	۱۸	دانا

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

