



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۱۰

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۰ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فولاد، وبملت، شستا، تاپیکو، خودرو و اخبر با کاهش ۱۰,۹۶۳ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۴۵,۹۷۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۰۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش همراه بوده است. مبلغ ۴۶ 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 شاهد فشار فروش در بسیاری از نمادها در اکثر گروه‌ها بودیم.

شاخص کل در محدوده ۱,۱۷۰,۰۰۰ الی ۱,۲۰۰,۰۰۰ واحد با مقاومت مهمی رو به رو است. شکست این محدوده به عنوان تغییر روند کوتاه مدتی بازار به شمار می‌آید. اغلب نمودارها در گروه‌های مختلف دچار واگرایی‌های مثبت شده‌اند و بیشتر اندیکاتورها در محدوده اشباع فروش قرار دارند. نمودار اکثر شاخص‌ها نیز شبیه شاخص کل می‌باشند و در حال حاضر درگیر مقاومت مهمی هستند. اما با توجه به افزایش حجم و ارزش معاملات خرد در دو روز گذشته و موارد ذکر شده دیگر، احتمال شکست ناحیه مقاومتی در اکثر گروه‌ها در روزهای آینده وجود دارد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۵۱,۰۵۰ 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 ۸۱۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۱۰/۰۶ با ۲۴,۸٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۰۹	۱۴۰۰/۰۳/۱۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۵,۱۶۶	۵۱,۰۵۰	۲۳۷٪



گروه‌های مؤثر

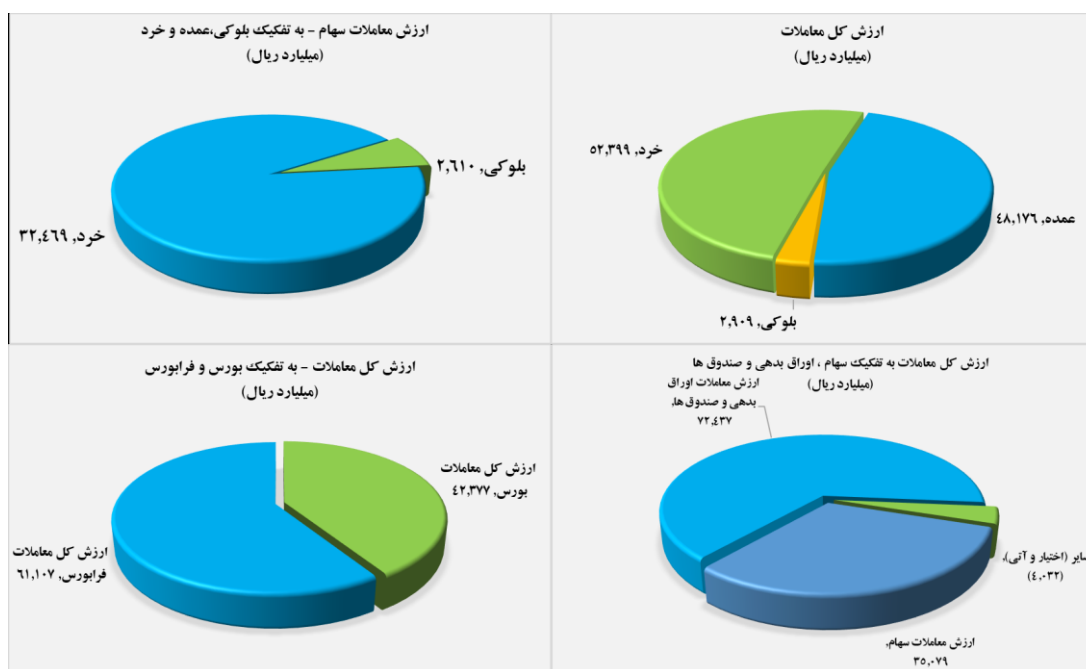
در گروه سیمان، شرکت سیمان سپاهان در اردیبهشت ماه ۲۷۲ هزار تن تولید کلینکر داشته و میانگین تولیدات سال مالی جاری به ۲۱۸ هزار تن رسیده است که این عدد در سال مالی قبل ۱۹۴ هزار تن گزارش شده است (سال مالی شرکت شهریور می باشد). فروش سیمان و کلینکر در اردیبهشت ۲۰۷ هزار تن گزارش شد. شرکت در سال مالی جاری مجموعاً ۱,۷۳۷,۰۰۰ تن فروش داشته (میانگین ماهانه ۲۱۷ هزار تن بوده است) و فروش سال مالی قبل به ۲,۳۳۰,۰۰۰ تن گزارش ثبت شده است. درآمد فروش شرکت در اردیبهشت ۷۸ میلیارد تومان می باشد (میانگین ماهانه ۷۲ میلیارد تومان بوده است)، شرکت در سال مالی ۹۹ و ۱۴۰۰ جمعاً به ترتیب ۴۲۰ و ۵۷۹ میلیارد تومان فروش داشته است. میانگین نرخ فروش شرکت در اسفند، فروردین و اردیبهشت به ترتیب ۲۹۸۴، ۳۰۴۶ و ۳۴۴۱ ریال بر کیلوگرم بود.

در گروه زراعت و خدمات وابسته، شرکت سیمرغ در اردیبهشت ۵۶۰۳ تن تولید تخم مرغ داشته و میانگین تولید سال مالی ۱۴۰۰ به ۵۰۵۲ تن رسیده است. این عدد در سال مالی گذشته ۵۰۷۹ تن گزارش شده است (سال مالی شرکت منتهی به آذر ماه می باشد). مقدار فروش در اردیبهشت ۵۸۴۹ تن تخم مرغ گزارش شده و شرکت در سال مالی گذشته ۶۱۴۴۸ تن فروش داشته و سال مالی ۱۴۰۰ تاکنون به ۲۵۷۹۳ تن تخم مرغ رسیده است. درآمد فروش شرکت از محل فروش تخم مرغ در اردیبهشت ۷۰ میلیارد تومان می باشد. شرکت در سال مالی ۹۹ و ۱۴۰۰ به ترتیب ۶۵۱ و ۳۶۳ میلیارد تومان فروش از این محل داشته است. میانگین نرخ فروش تخم مرغ شرکت در اردیبهشت ۱۲۰۳۳۷ ریال بر کیلوگرم بود و متوسط این نرخ در سال مالی گذشته ۱۷۰۳۰۸ ریال بر کیلوگرم ثبت شده است.

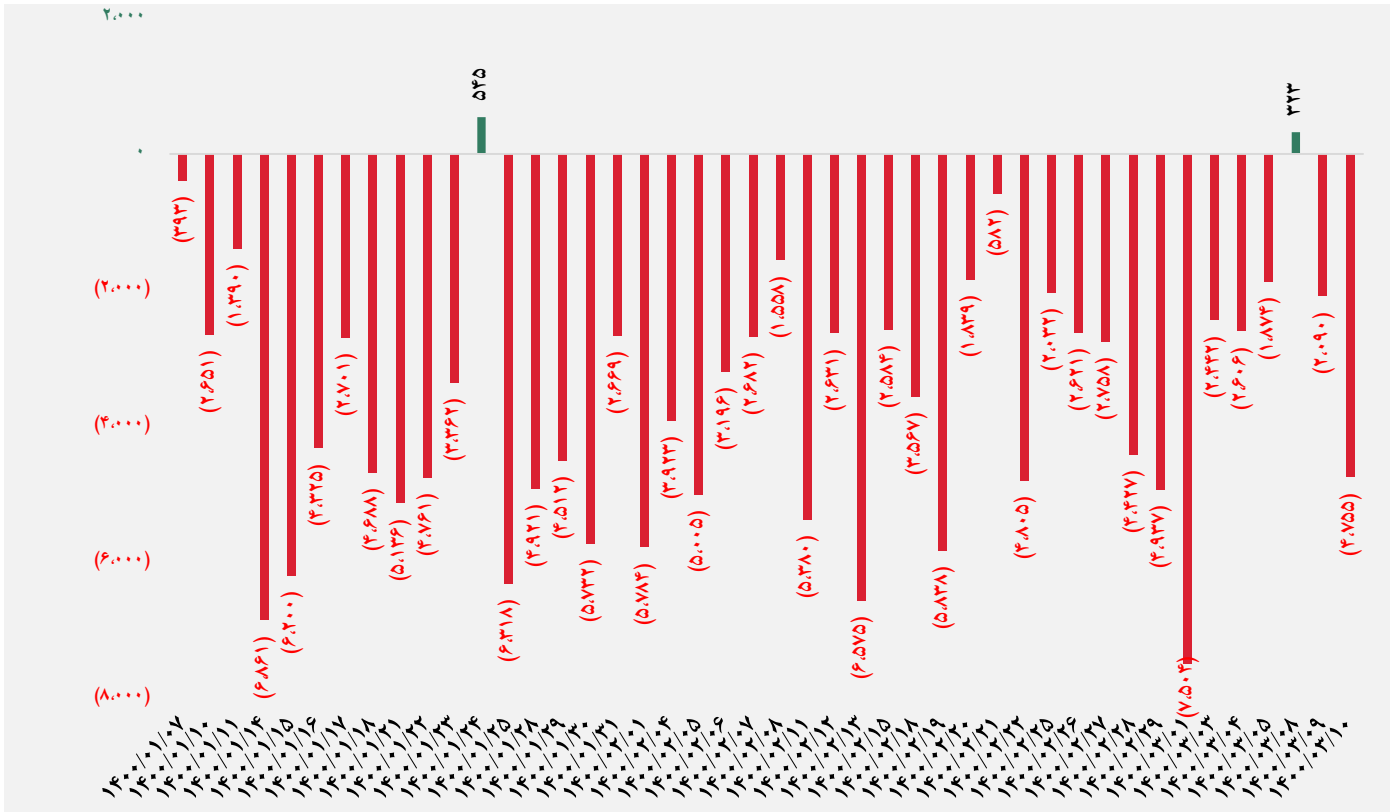
در بازارهای جهانی نیز متوسط نرخ گاز در هفته اخیر حدود ۲۰ سنت به ازای هر مترمکعب بوده است. این نرخ تاثیر مستقیم بر نرخ خوراک شرکت‌های پتروشیمی داخلی دارد. در ماه فروردین و اردیبهشت به ترتیب نرخ گاز ۱۷,۱ و ۱۹,۱ سنت در بازارهای جهانی ثبت شده بود.

تصویر کلی بازار

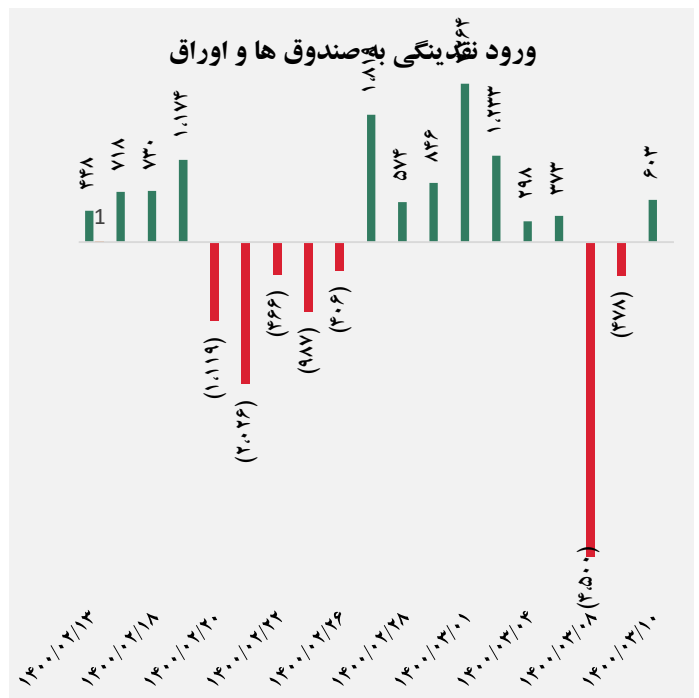
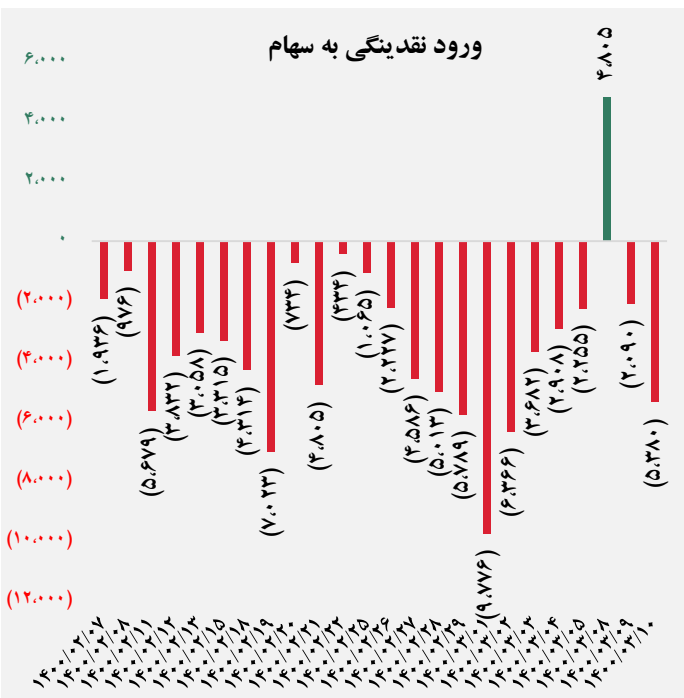
فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۲۴	شاخص کل	۱,۱۴۵,۹۷۰	شاخص کل
(۱۱۷)	تغییر شاخص	(۱۰,۹۶۳)	تغییر شاخص
۱۱,۸۱۵,۵۷۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۵,۸۳۵,۳۳۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۶۱,۱۰۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۲,۳۷۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
	بپاس		شپنا
	مادیرا		اپال
	ودی		برکت
	بگیلا		غکورش
	وملل		سپ
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
	غصینو		فملی
	هرمز		فولاد
	شگویا		وبملت
	سمگا		شستا
	کگهر		تاپیکو
۵,۳۸۰		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۶۰۳		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



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

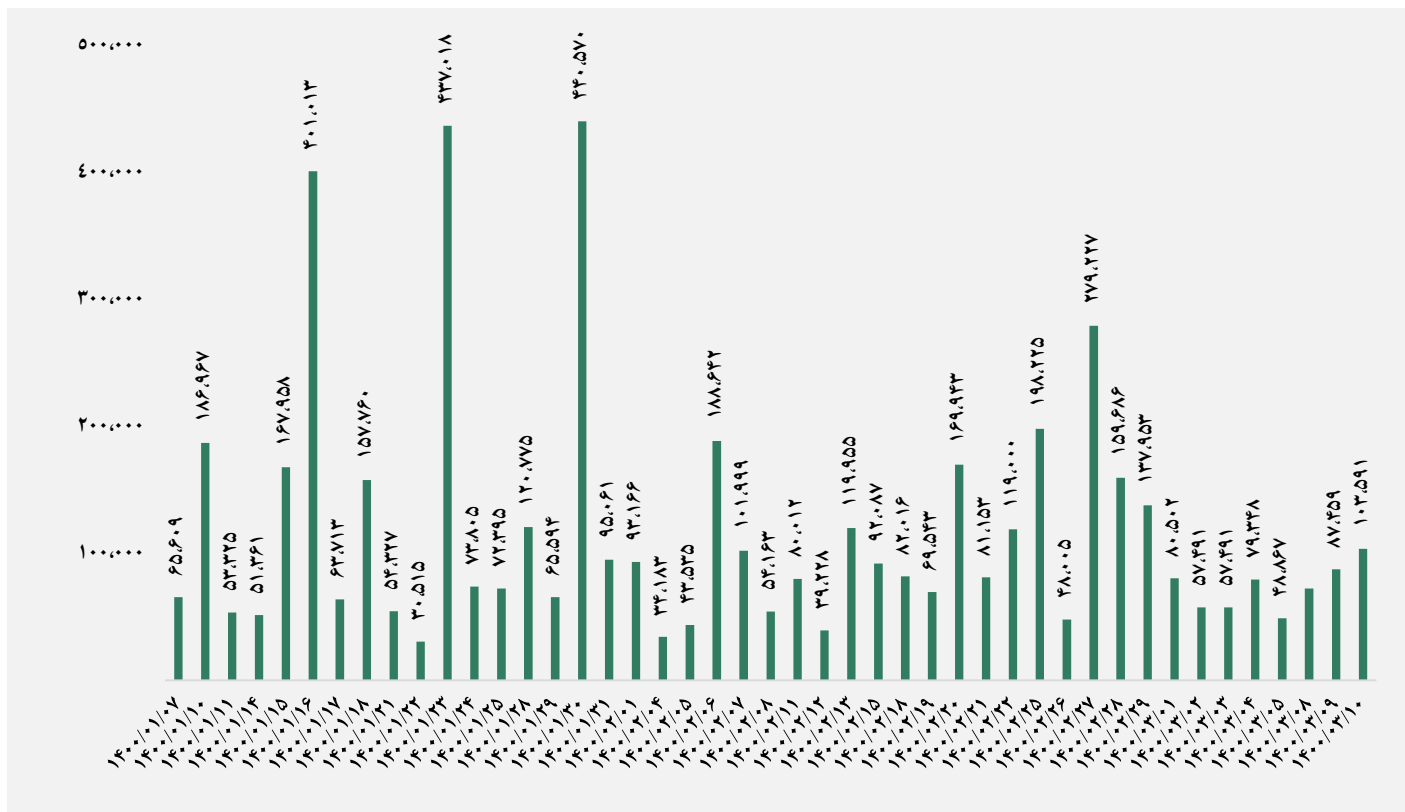


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

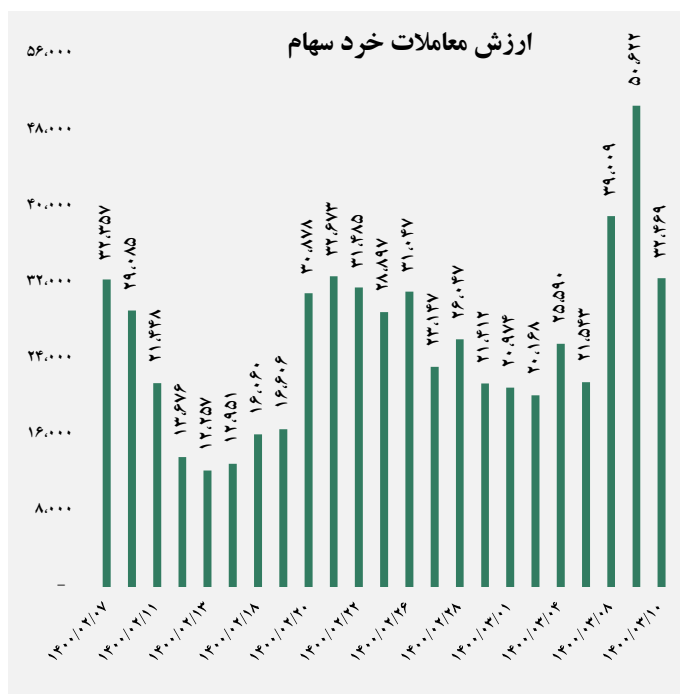
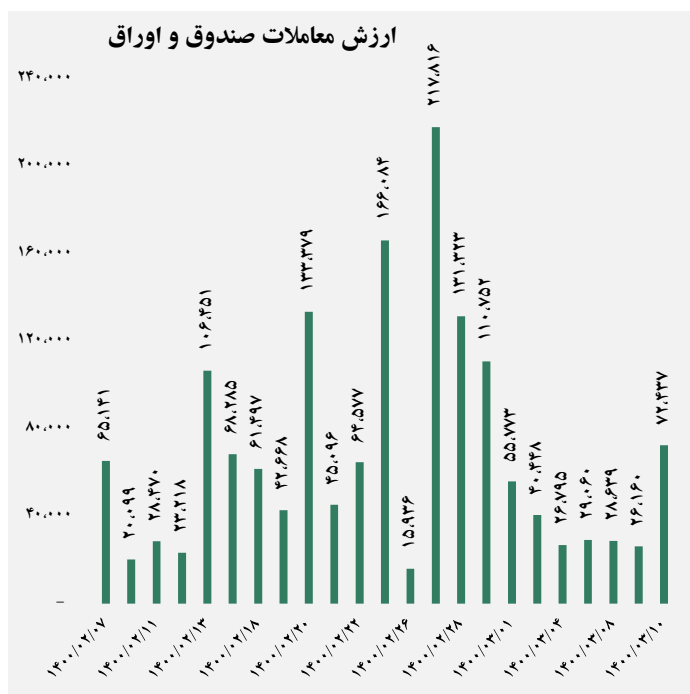


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

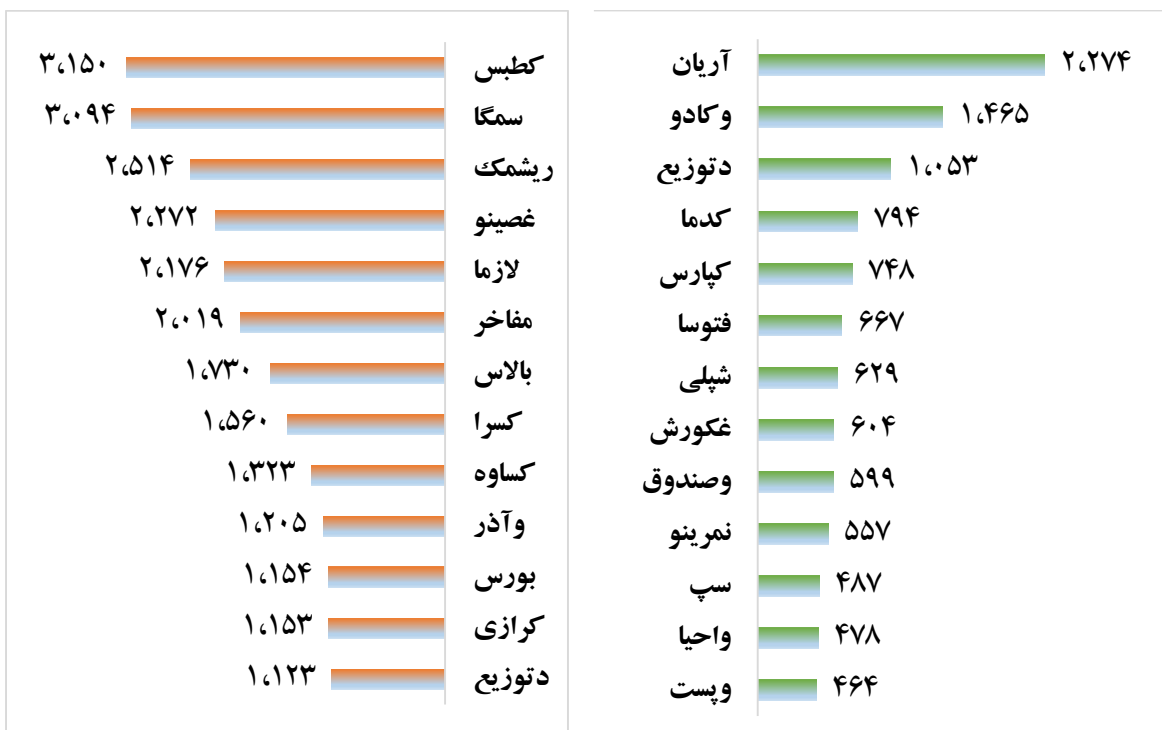


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





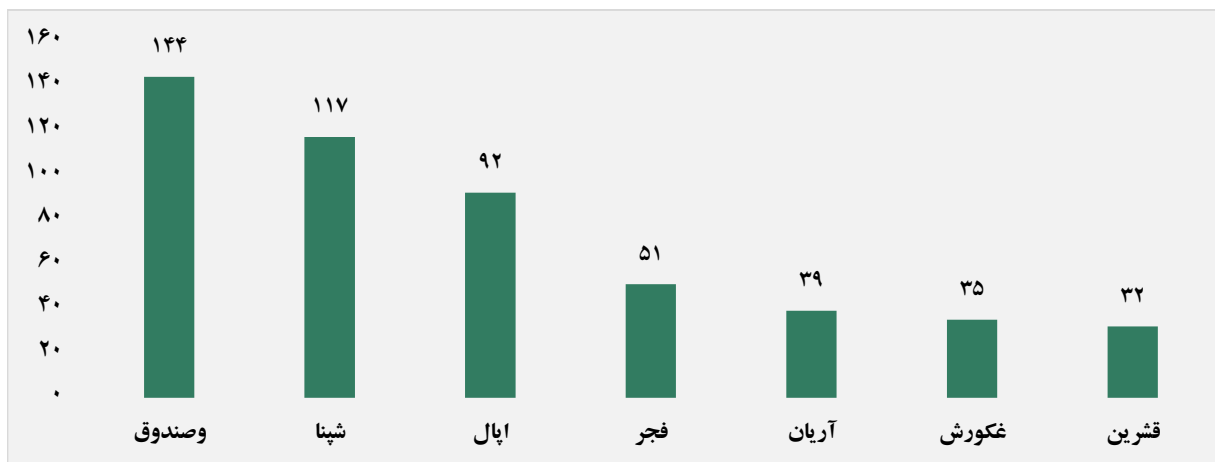
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



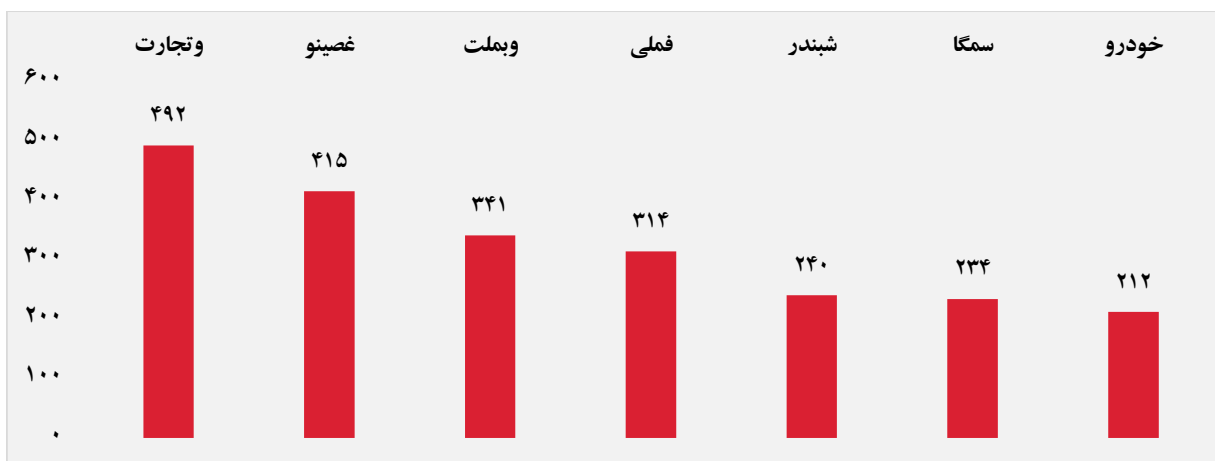
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	کماسه	۱	وملی
۲	غزر	۲	فسپا
۳	وکادو	۳	فرآور
۴	اپال	۴	فسرب
۵	خاور	۵	کمنگنز
۶	شفارا	۶	غصینو
۷	بگیلان	۷	کپارس
۸	آریان	۸	سدور
۹	گکوثر	۹	گشان
۱۰	ثامید	۱۰	کطیس

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



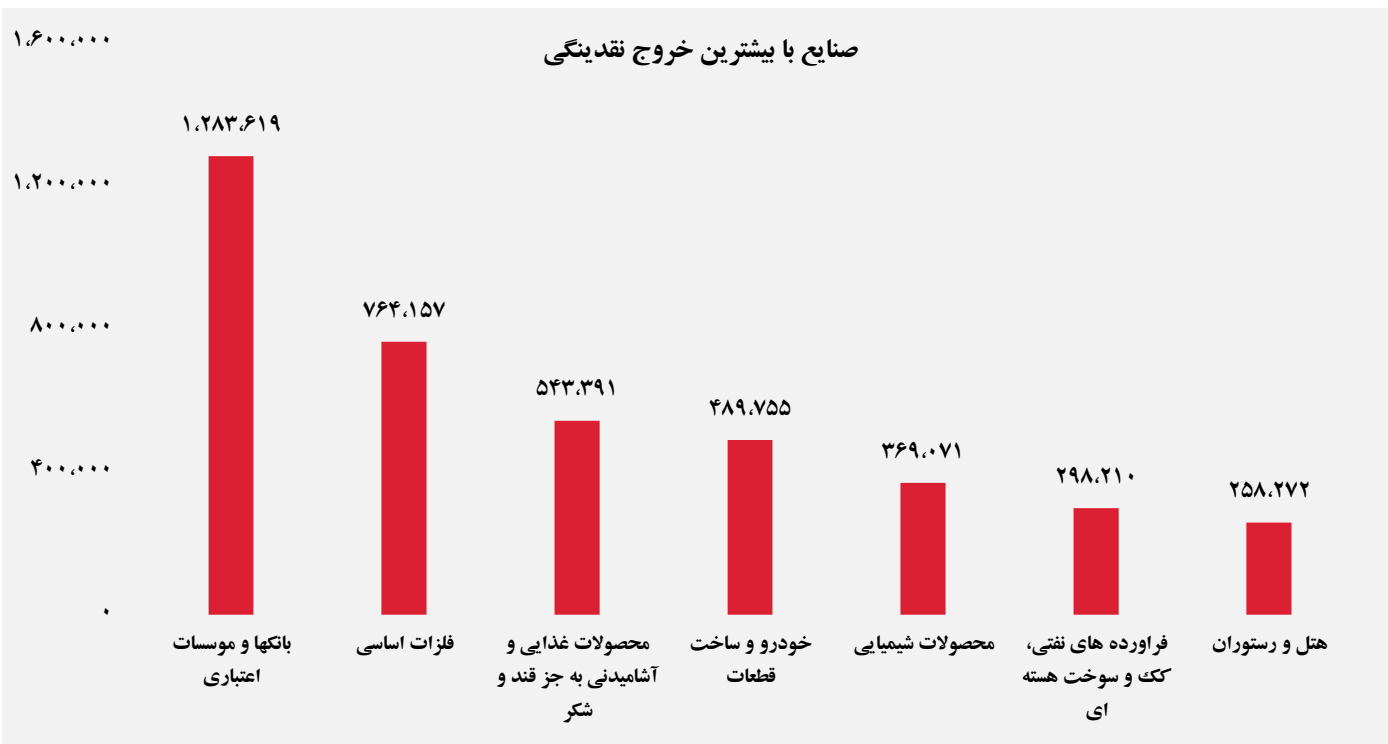
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	فروس
۲	فجر	۱۱	دکوتر
۳	ودی	۱۲	سمگا
۴	شغدیر	۱۳	مادیرا
۵	ویست	۱۴	وساخت
۶	غصینو	۱۵	وپترو
۷	غزر	۱۶	سصوفی
۸	گشمان	۱۷	غگل
۹	کزغال	۱۸	شپنا

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار