



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۱۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۱۱ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای وبملت، شستا، شبندر، خودرو، پارسان و فملی با کاهش ۵,۴۳۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۴۰,۴۹۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۳۰ 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 همانند روز گذشته شاهد فشار فروش در بسیاری از نمادها در اکثر گروه‌ها بودیم.

انتشار گزارش‌های مناسب در اردیبهشت ماه، گزارش ۱۲ ماهه سال مالی ۹۹ و حتی تغییر و تحولات در بورس کالا نیز هنوز نتوانسته از فشار فروش سهام در بازار سرمایه برای مدتی بکاهد و باعث تغییر روند جدیدی در این بازار شود. برخی شرکت‌ها در چند وقت اخیر در بعضی از صنایع با افزایش نرخ محصولات همراه بودند اما سهام همان شرکت‌ها در بازار سرمایه همچنان با صف فروش همراه است. یکی از دلایل اصلی برای شرایط حاکم بر بازار سهام را می‌توان به نحوه انتخاب سهام توسط فعالین بازار سرمایه (به ویژه فعالین جدید) در یک سال گذشته دانست. در سال گذشته ملاک خرید سهام برای قشر زیادی از فعالین بازار سرمایه، سایت کدال و صورتهای مالی نبود و جو بازار، تعیین‌کننده عوامل اصلی در بازار سرمایه به شمار می‌رفت. بنابراین تا زمانی که دلایل بنیادی جزء موارد اصلی در انتخاب سهام، جایگزین موارد دیگر نشود، نمی‌توان امید به کاهش فشار فروش در اکثر نمادها داشت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۹,۲۹۷ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۵۴ 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 ۷۱۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۲۵ با ۲۴,۱٪ سود است.



درصد تغییر	۱۴۰۰/۰۳/۱۱	۱۴۰۰/۰۳/۱۰	شرح
-۶۲٪	۱۹,۲۹۷	۵۱,۰۵۰	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)

گروه‌های مؤثر

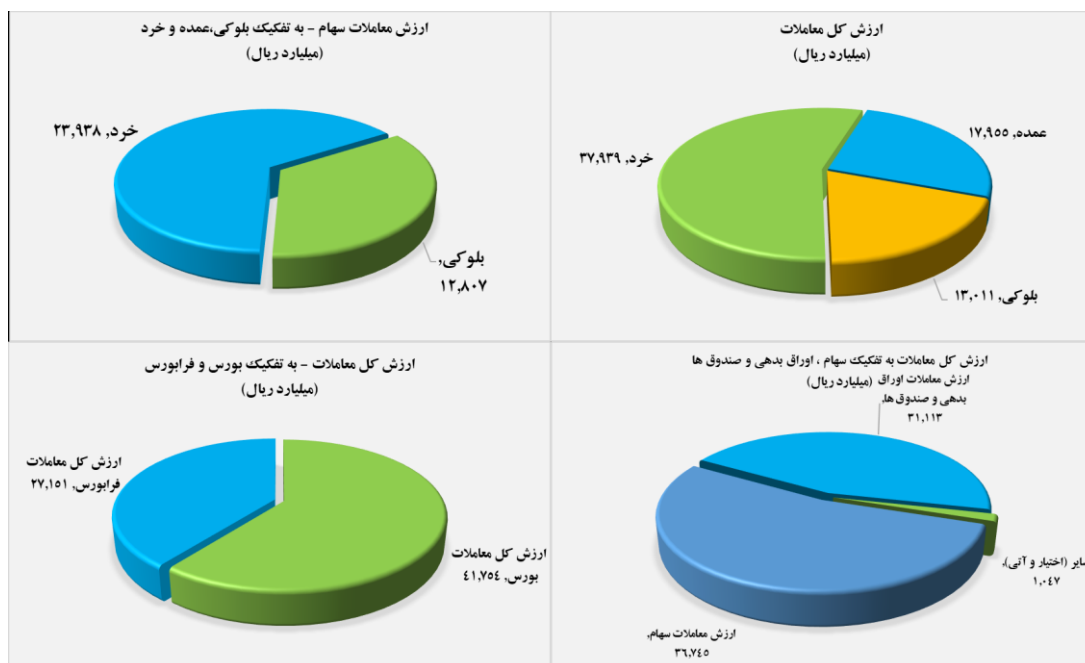
در گروه کاشی و سرامیک، شرکت کاشی پارس که در آذر، دی، بهمن، اسفند و فروردین به ترتیب ۳۱، ۲۶، ۳۶، ۴۲ و ۱۰ میلیارد تومان فروش داشت، در اردیبهشت ماه فروش ۳۱ میلیارد تومانی را روانه کدال کرده است. شرکت در اردیبهشت ماه ۴۱۴ هزار متر مربع انواع کاشی فروخت. مقدار فروش که در آذر، دی، بهمن، اسفند سال گذشته و فروردین ۱۴۰۰ به ترتیب برابر با ۴۱۹، ۳۵۷، ۴۲۲، ۵۹۲ و ۱۱۵ هزار متر مربع انواع کاشی بود، در اردیبهشت ماه ۴۱۴ هزار متر مربع از انواع کاشی را به فروش رسانده است. مقدار تولید شرکت نیز به طور متوسط در هر ماه ۳۷۷ هزار متر مربع است و این عدد در اردیبهشت ماه ۴۱۳ هزار متر مربع ثبت کرده است. نرخ فروش نیز در اردیبهشت ماه ۷۶ هزار تومان بر متر مربع گزارش شده است. در دی، بهمن و اسفند نرخ فروش ۷۳، ۷۴ و ۸۸ هزار تومان بر متر مربع بود.

در گروه شیمیایی، شرکت دوده صنعتی پارس در سال مالی ۹۹ و ۹۸ به طور متوسط هر ماه ۲,۱۱۲ و ۲,۱۸۷ تن دوده تولید کرده بود و در اردیبهشت تولید به ۳,۱۷۰ تن رشد پیدا کرده است. در اردیبهشت ماه این شرکت ۳۰۵۵ تن محصول فروخته است. در فروردین ۲۰۷۴ تن فروش داشت. در ۱۲ ماه گذشته به طور متوسط ۲۲۲۶ تن فروش در هر ماه داشته است. این شرکت در آذر، دی، بهمن و اسفند سال گذشته به ترتیب ۴۱، ۳۲، ۲۷ و ۳۹ میلیارد تومان فروش گزارش کرده بود. در فروردین ماه فروش ۴۶ میلیارد تومان ثبت شده است. فروش سال مالی ۹۹ و ۹۸ به ترتیب برابر با ۳۳۸ و ۲۶۴ میلیارد تومان بوده است. نرخ فروش در اردیبهشت ۲۳۰,۱۳۹ ریال در هر کیلو بود و نرخ ماه گذشته نیز ۲۲۳,۳۸۵ ریال در هر کیلو ثبت شده است.

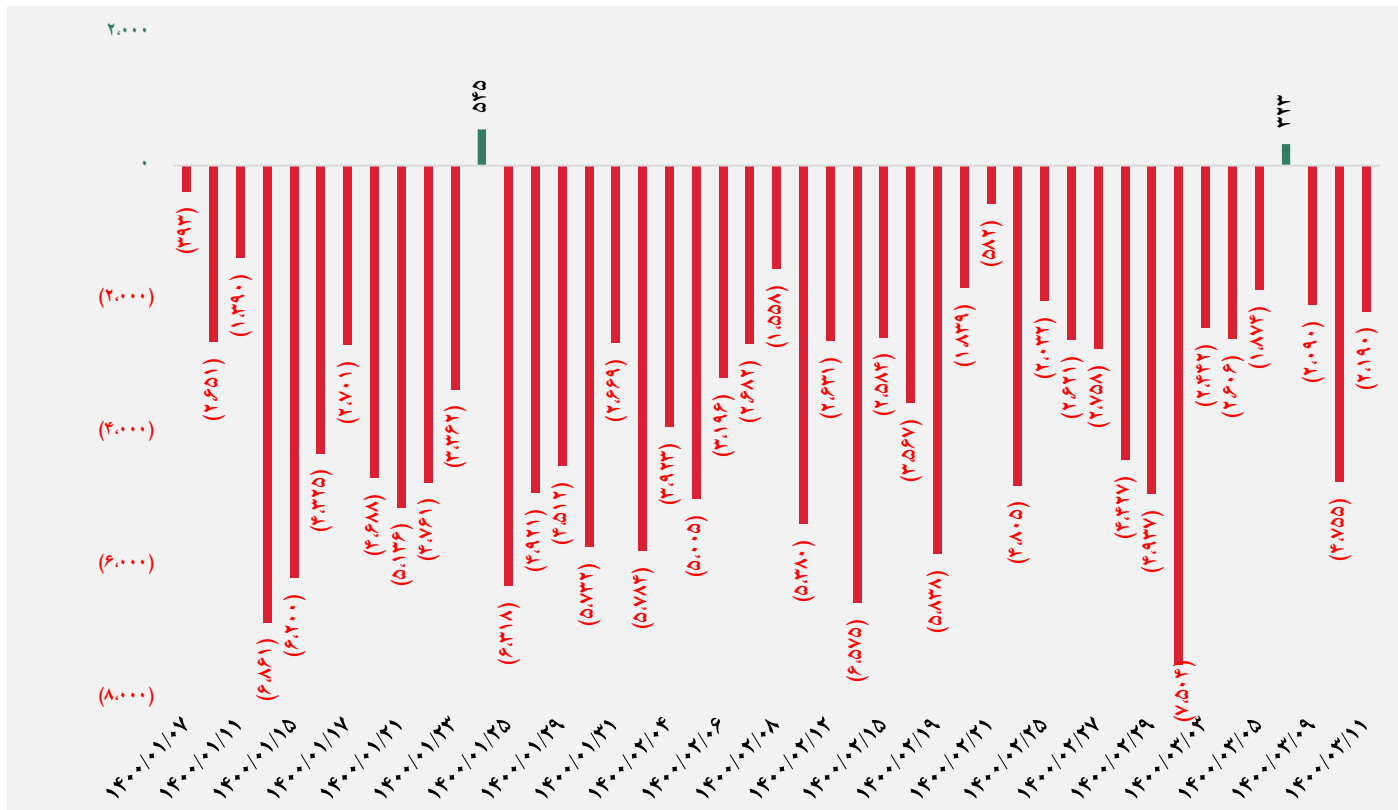
در گروه سرمایه گذاری، شرکت سرمایه گذاری صبا تأمین در اردیبهشت ماه ۹ میلیارد تومان سود حاصل از واگذاری سهام و ۴۷۰ میلیارد سود سهام بدست آورد. در فروردین ماه نیز ۲۰ میلیارد تومان سود حاصل از واگذاری سهام شناسایی کرده بود. در اسفند ماه ۲۸ میلیارد تومان و در بهمن ماه نیز ۳۲ میلیارد تومان سود واگذاری سهام و ۱۱۳ میلیارد تومان نیز سود مجمع داشت.

تصویر کلی بازار

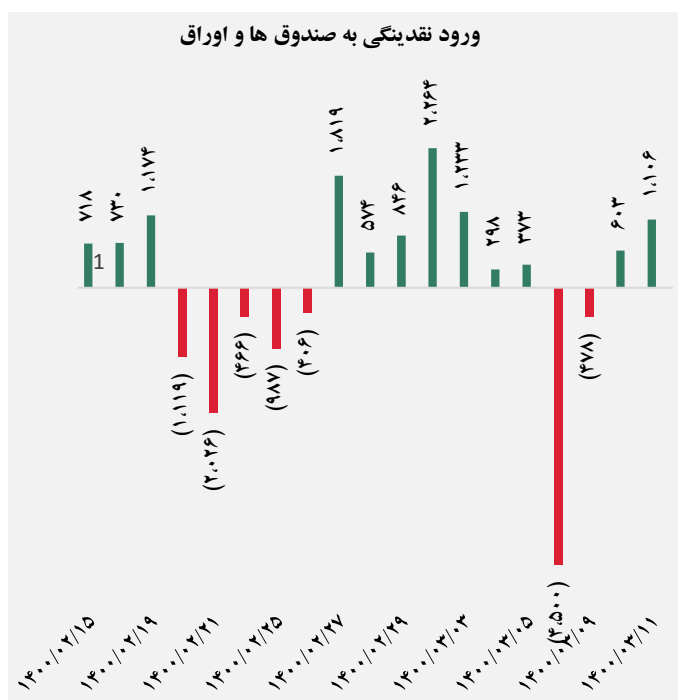
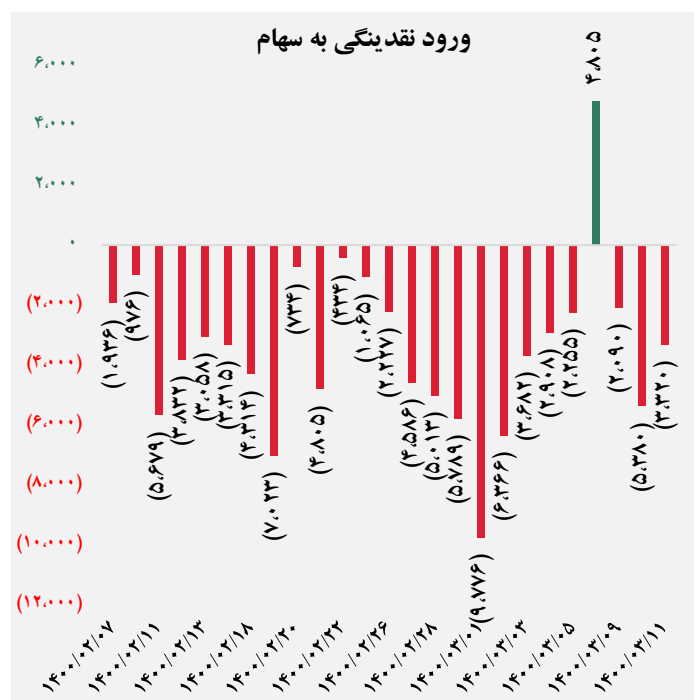
فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۷۷	شاخص کل	۱,۱۴۰,۴۹۷	شاخص کل
۴۸	تغییر شاخص	(۵,۴۳۲)	تغییر شاخص
۱۱,۷۸۴,۳۴۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	(۴۵,۶۱۰,۵۵۴)	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۷,۱۵۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۱,۷۵۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
آریا		فارس	
شبصیر		برکت	
دماوند		اپال	
زاگرس		غکورش	
بپیوند		شفت	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
بزاگرس		وبملت	
شگویا		شستا	
بنو		شیندر	
کگهر		خودرو	
وهور		پارسان	
۳,۳۲۰		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
۱,۱۰۶		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



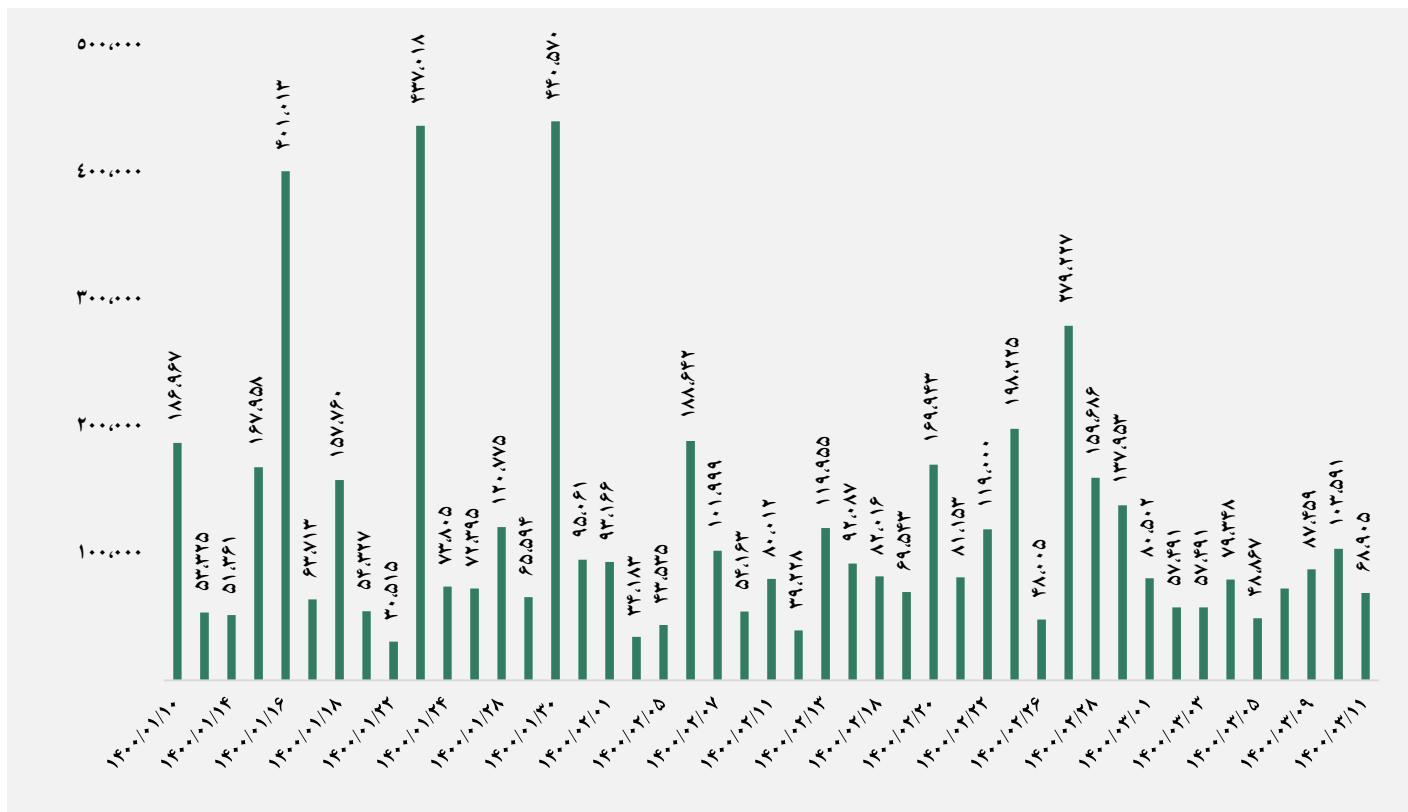
کل ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



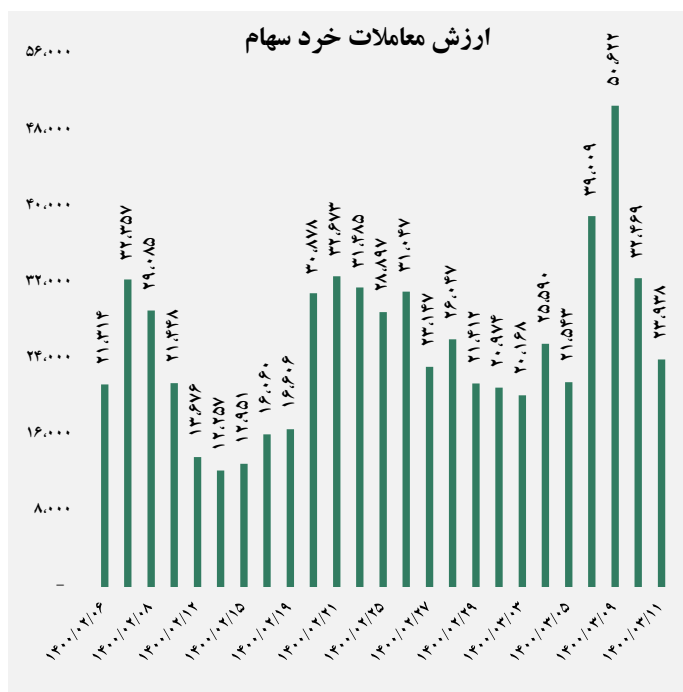
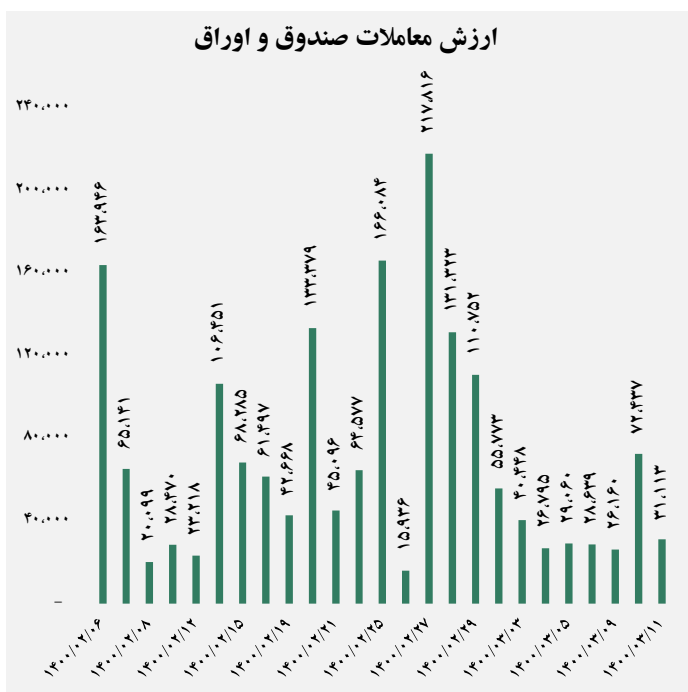
ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

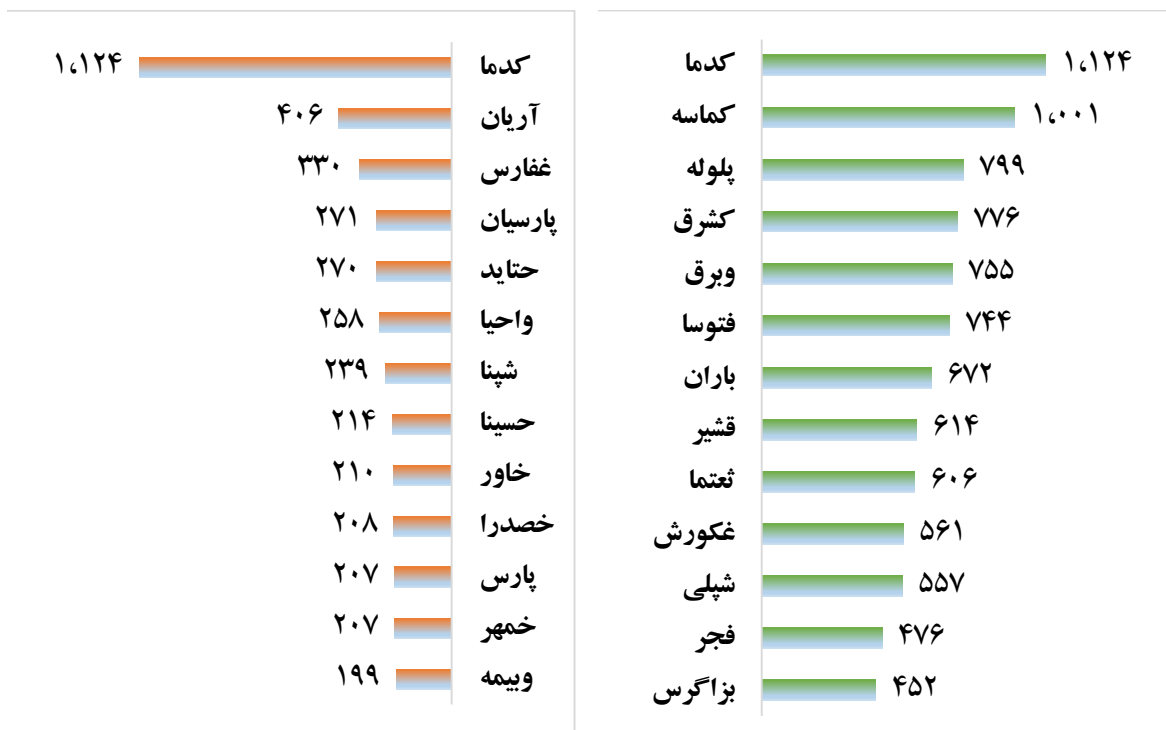


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





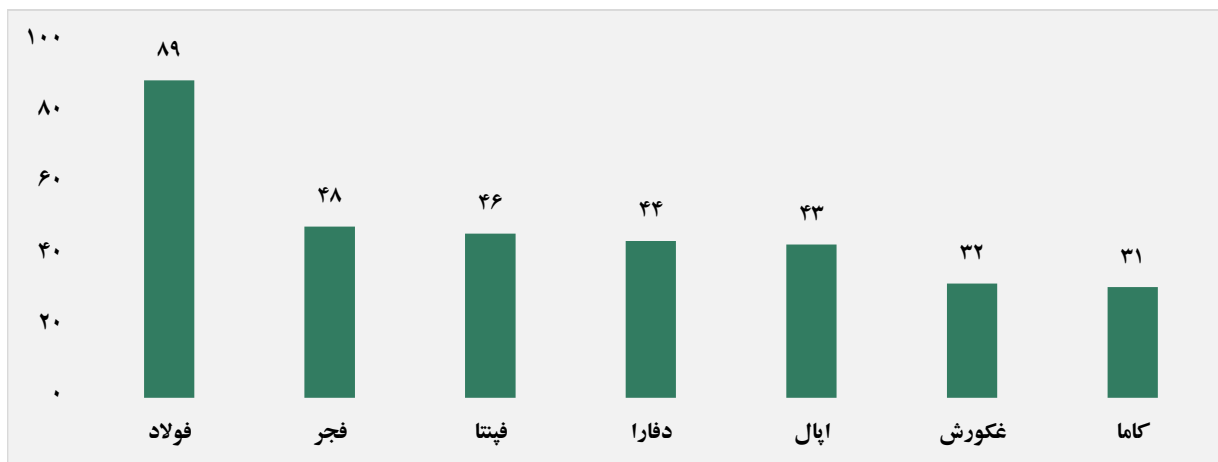
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



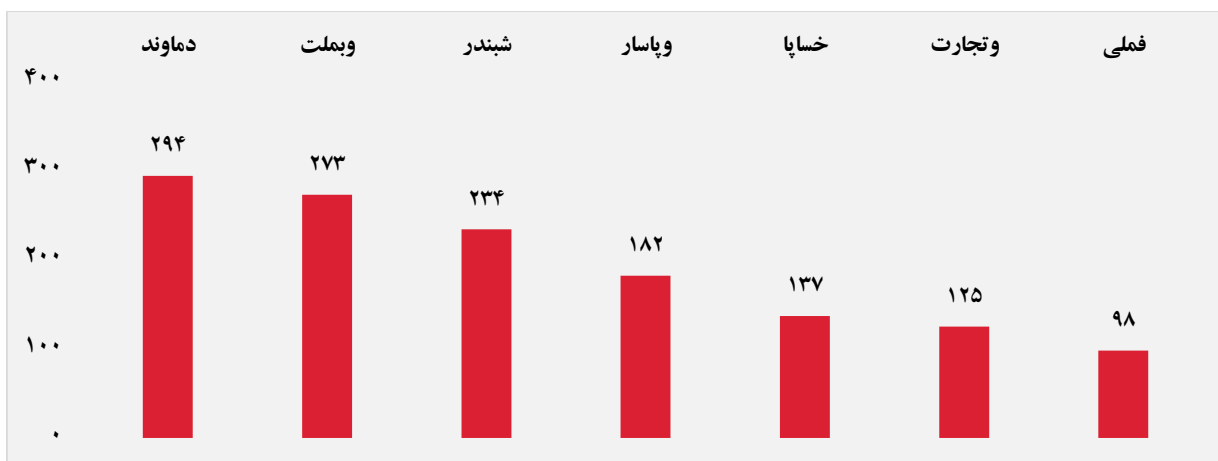
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	چخزر	۱	شتوکا
۲	سپیدار	۲	غشوکو
۳	شبصیر	۳	درهاور
۴	پیزد	۴	وملی
۵	ولپارس	۵	کاذر
۶	پتایر	۶	کشرق
۷	ویمه	۷	کی بی سی
۸	کویر	۸	سدور
۹	دکوثر	۹	فرآور
۱۰	غپینو	۱۰	دکیمی

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



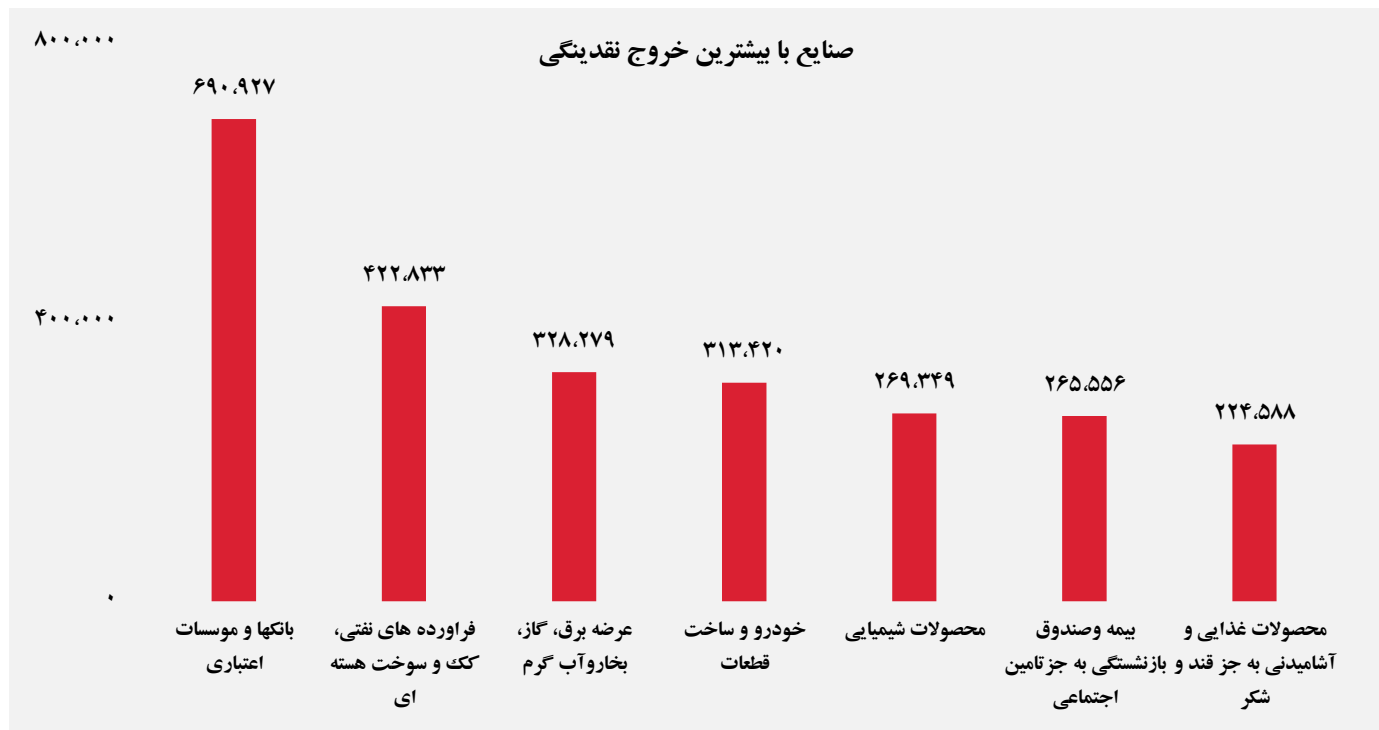
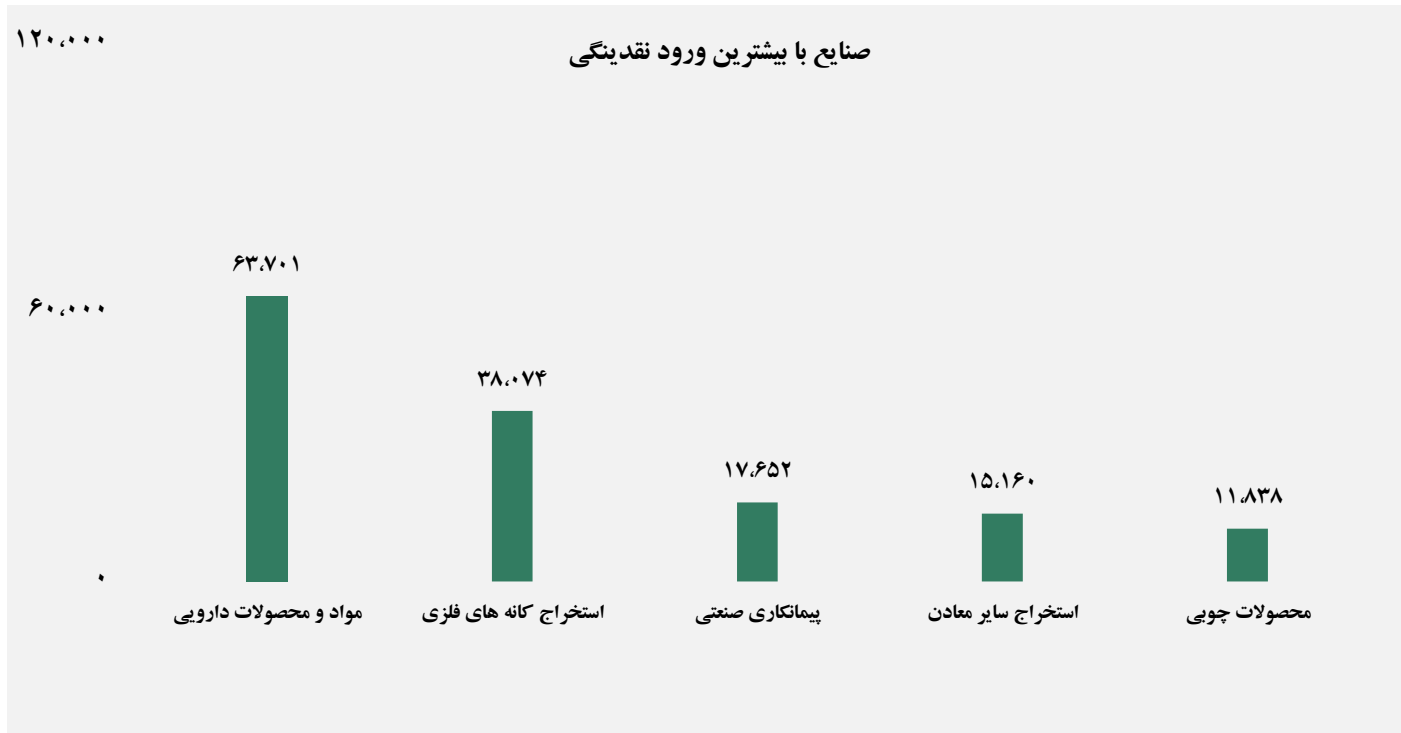
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	وساخت	۱۰	دماوند
۲	گشان	۱۱	غزر
۳	حتاید	۱۲	خمهور
۴	شغدیر	۱۳	ساراب
۵	ودی	۱۴	قاسم
۶	کزغال	۱۵	خودکفا
۷	چکاپا	۱۶	آرمان
۸	برکت	۱۷	زاگرس
۹	وپست	۱۸	نتران

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار