



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۱۲

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۱۲ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، شینا، فارس، شتران، وغدیر و خودرو با افزایش ۸,۱۹۰ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۴۸,۶۶۶ 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 ۴۵ 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 برخلاف روز گذشته اکثر نمادها در بیشتر گروه‌ها با افزایش تقاضا همراه بوده‌اند.

آنچه که از افزایش در ارزش معاملات خرد در روزهای گذشته به نظر می‌رسد، بهبود در تقاضا و کاهش فشار فروش در روزهای آینده منتهی به اواخر خرداد ماه در بازار سهام است. تمام شرایط از جمله عملکرد ماهانه شرکت‌ها، نرخ‌های جهانی کامودیتی‌ها و حتی نرخ دلار حاکی از رشد حدود ۱۰ الی ۱۵ درصدی در کلیت بازار سرمایه تا انتهای خرداد ماه دارد. همچنین کمتر از ۱۲ روز کاری تا پایان فصل بهار باقی مانده است و همین زمان باقی مانده نیز برای رشد مقطعی کافی می‌باشد. به نظر می‌رسد در هفته آینده باید شاهد افزایش بیشتر تقاضا در کلیت بازار نسبت به روز جاری بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۵,۵۷۸ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۷۴۴، 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.

| شرح | ۱۴۰۰/۰۳/۱۱ | ۱۴۰۰/۰۳/۱۲ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۱۹,۲۹۷ | ۵,۵۷۸ | -۷۱٪ |



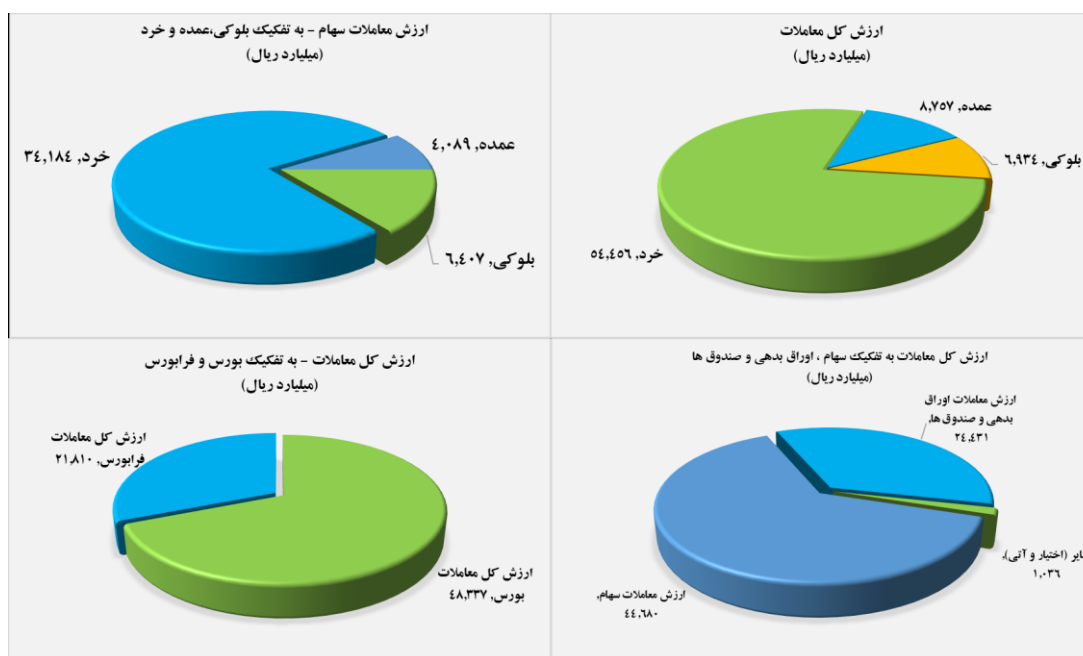
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت کربن ایران که در ۹ ماهه سال مالی گذشته ۳۴۴ میلیارد تومان فروش داشت، فروش خود را در ۱۲ ماهه به ۵۹۷ میلیارد تومان رسانده که فروش فصل زمستان نسبت به پاییز رشد ۵۴ درصدی داشته و در حالی که بهای تمام شده شرکت نسبت به فصل گذشته رشد ۴۲ درصدی را تجربه کرده است. این تولید کننده دوده صنعتی در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب حاشیه سود ۱۹، ۱۷ و ۲۵ درصدی داشته که در فصل چهارم توانسته حاشیه سود خود را تا ۳۱ درصد افزایش دهد. سود هر سهم این شرکت در سه فصل اول سال مالی گذشته به ترتیب ۳۴۲، ۲۴۸ و ۷۱۱ ریال بوده که در فصل چهارم با ۵۸۲ درصد رشد نسبت به فصل گذشته، سود ۴۸۴۷ ریالی را گزارش کرده و سود هر سهم خود را در ۱۲ ماهه به ۶۱۴۸ ریال افزایش داده است. در فصل آخر علاوه بر رشد فروش شرکت و کسب سود بالاتر از این طریق، شرکت همچنین ۹۰ میلیارد تومان سود دریافتی از زیرمجموعه‌هایی مانند شرکت صنایع لاستیک سهند، شرکت دوده صنعتی پارس و سرمایه گذاری توسعه صنعت شیمیایی داشته است.

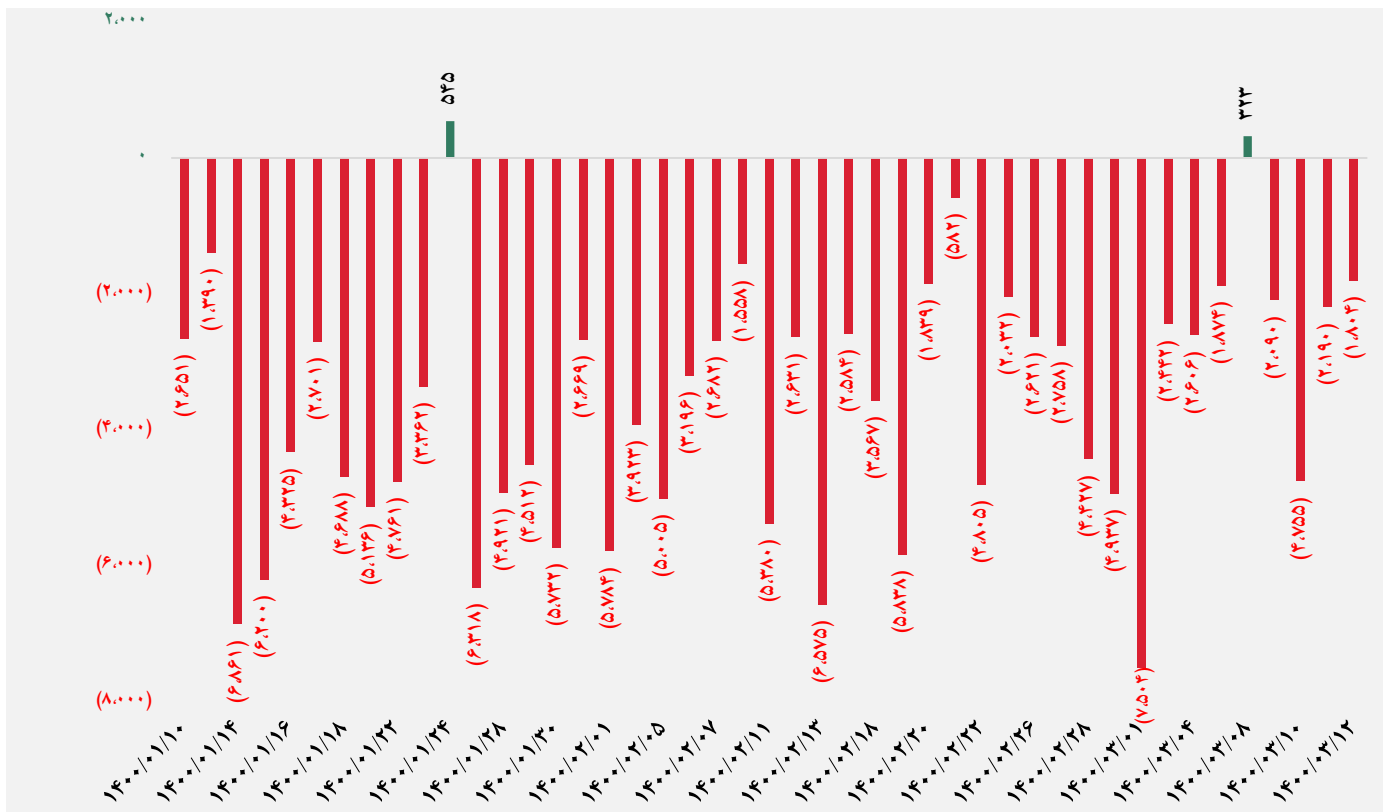
در گروه ذغال سنگ، شرکت صنعتی و معدنی شمال شرق شاهرود در اردیبهشت ماه ۵۴۵۶ تن محصول تولید کرده که نسبت به فروردین ماه افت ۸ درصدی داشته است. این شرکت دو محصول ذغال سنگ کک شو و ذغال سنگ کک شو کیفی درجه یک را تولید می‌کند. مقدار فروش شرکت در اردیبهشت ماه رشد مطلوب ۱۷ درصدی را ثبت کرده و به ۹۴۱۹ تن رسیده است. مقدار فروش نسبت به متوسط سال گذشته رشد ۸ درصدی داشته است. علی رغم افزایش مقدار فروش، مبلغ فروش کاهش ۸ درصدی داشته است. دلیل کاهش مبلغ فروش، کاهش نرخ فروش محصول ذغال سنگ کک شو کیفی درجه یک است. نرخ فروش ذغال سنگ کک شو کیفی با ۱۸ درصد کاهش به ۸۳۵ تومان و نرخ ذغال سنگ کک شو کیفی درجه یک با ۲ درصد رشد به ۲۲۴۵ تومان افزایش پیدا کرده است.

تصویر کلی بازار

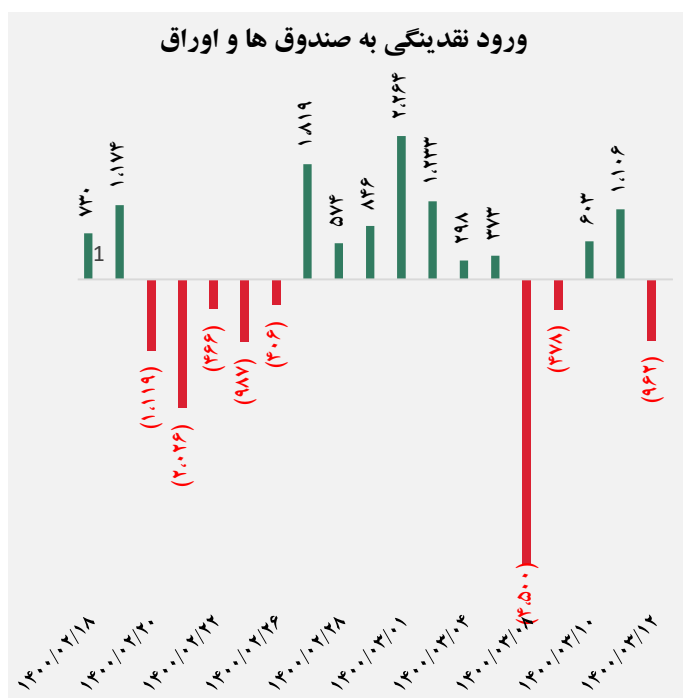
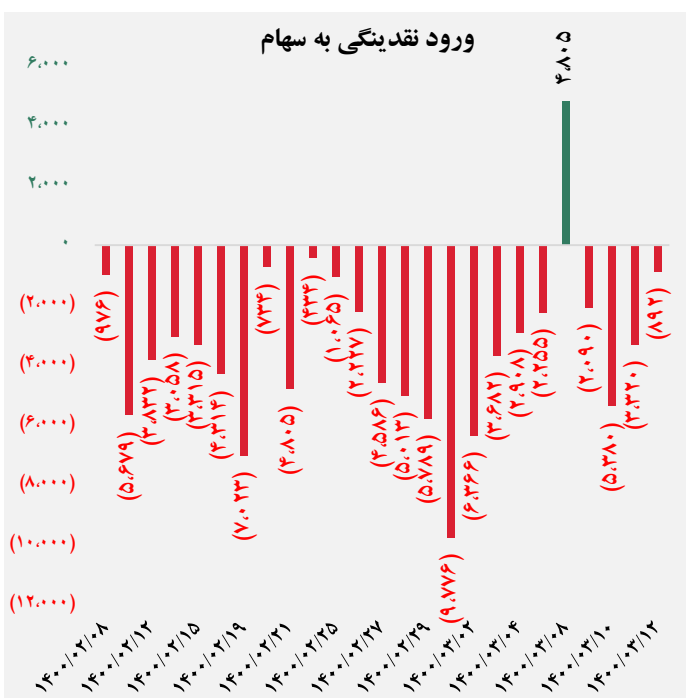
| فرا بورس | | بورس | |
|-----------------------------------|-----------------------------|---|-----------------------------|
| ۱۷,۶۹۳ | شاخص کل | ۱,۱۴۸,۶۶۶ | شاخص کل |
| ۱۵ | تغییر شاخص | ۸,۱۹۰ | تغییر شاخص |
| ۱۱,۷۸۸,۴۳۷ | ارزش بازار (میلیارد ریال) | ۴۵,۹۲۶,۳۷۷ | ارزش بازار (میلیارد ریال) |
| ۲۱,۸۱۰ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۴۸,۳۳۷ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) |
| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | | بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | |
| آریا | | فولاد | |
| وهور | | شپنا | |
| ذوب | | فارس | |
| زاگرس | | شتران | |
| کگهر | | وغدیر | |
| بیشترین تاثیر منفی در شاخص | | بیشترین تاثیر منفی در شاخص | |
| غوینا | | کگل | |
| تاپکیش | | خمتور | |
| مارون | | وامید | |
| دماوند | | فخوز | |
| کوثر | | وسخوز | |
| ۸۹۲ | | ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال) | |
| ۹۶۲ | | ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال) | |



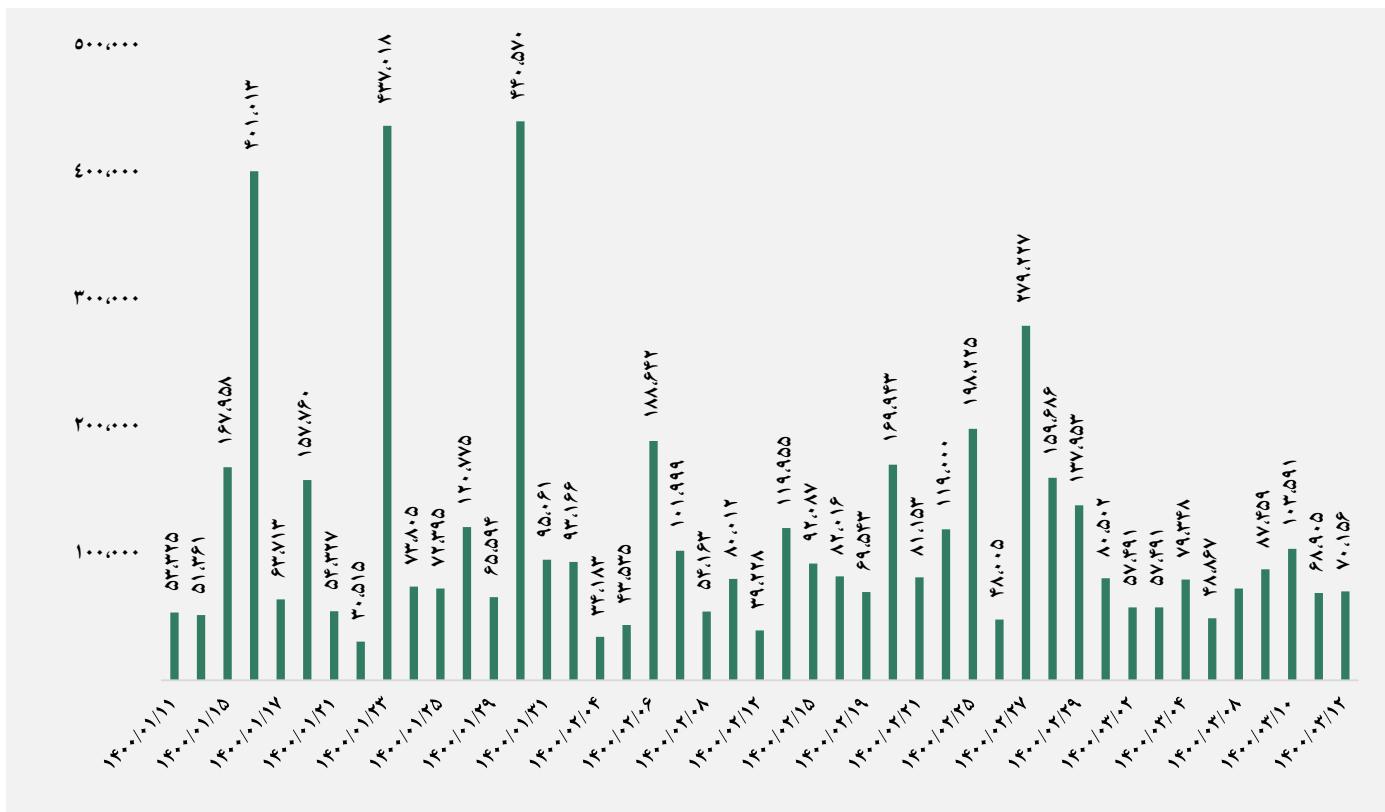
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



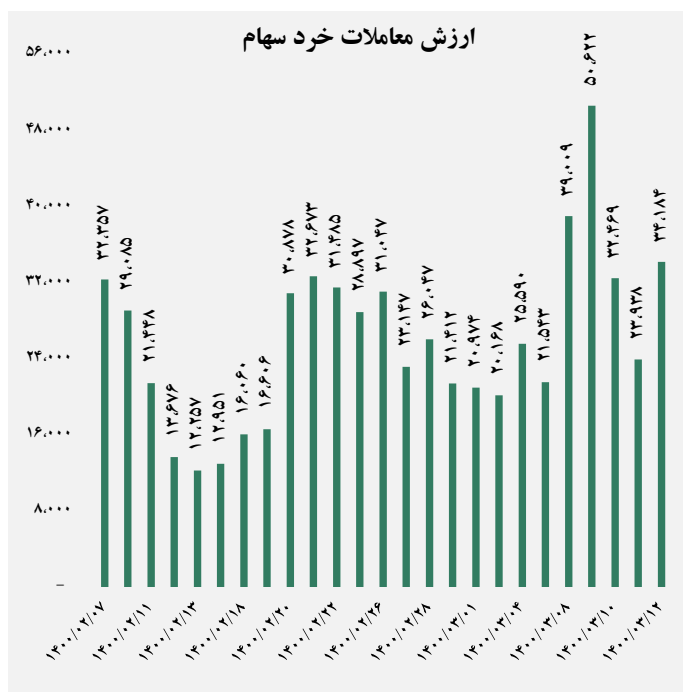
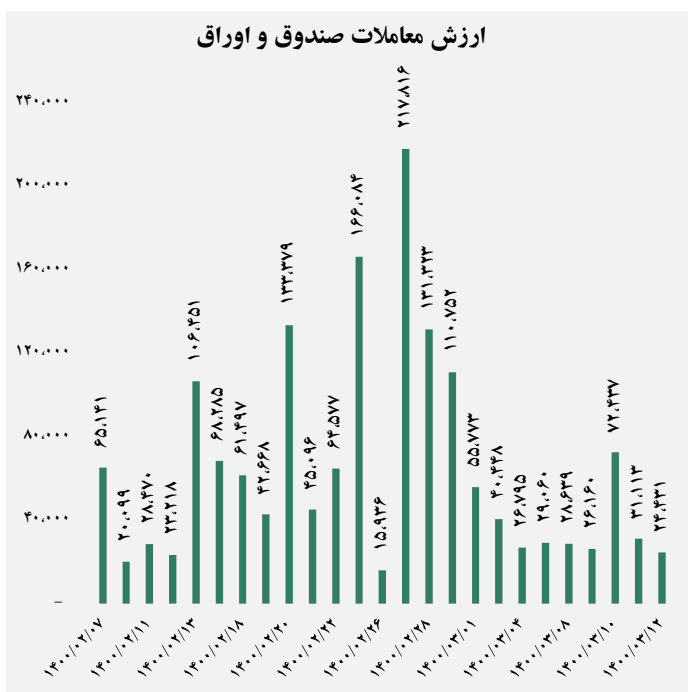
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



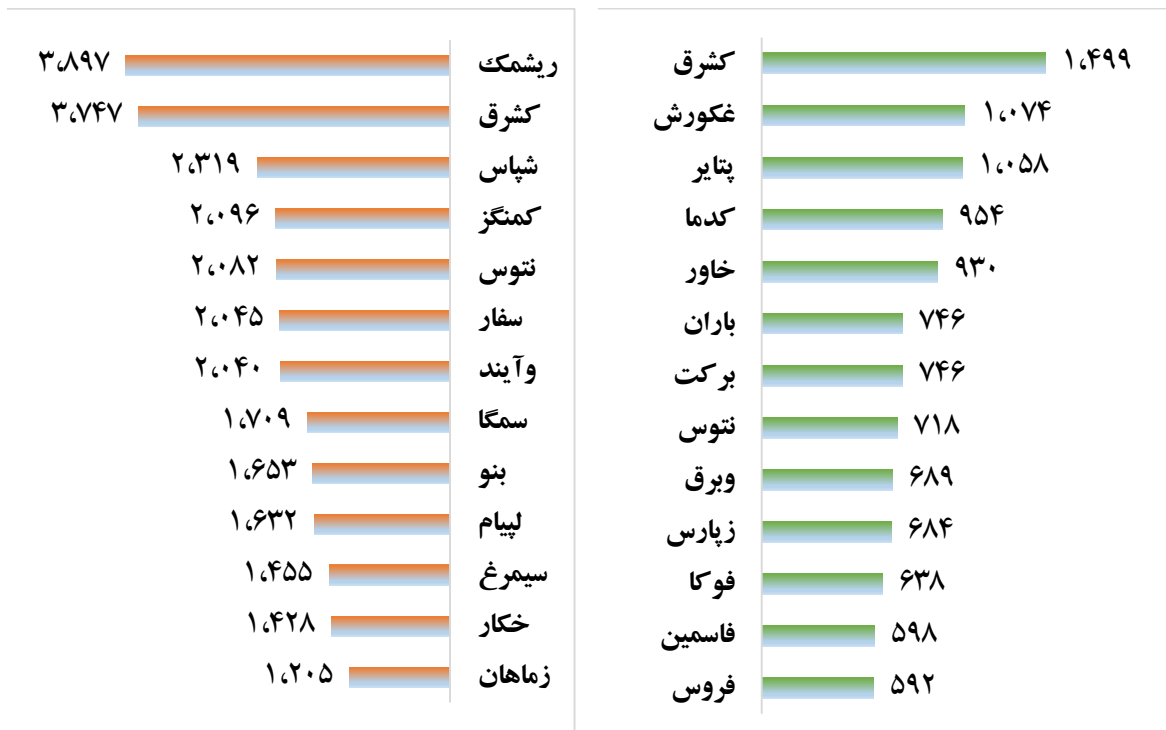
ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



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



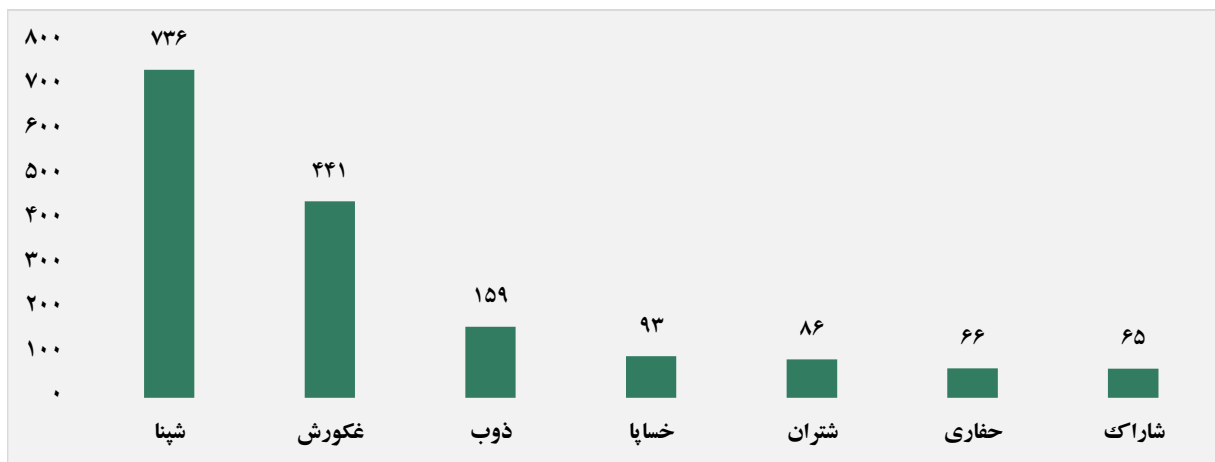
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



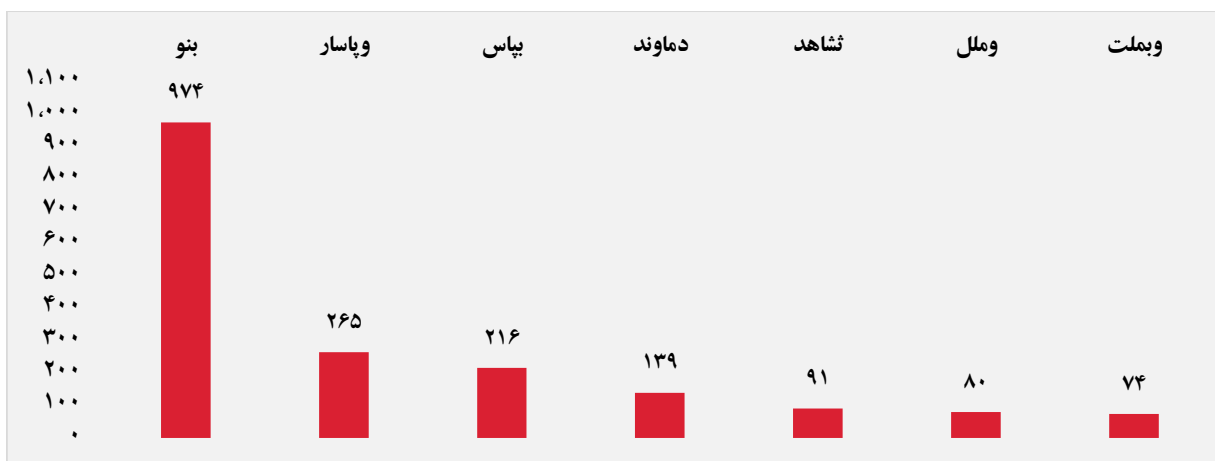
پول هوشمند

| ردیف | ورود | ردیف | خروج |
|------|----------|------|--------|
| ۱ | غزر | ۱ | لیپام |
| ۲ | کاما | ۲ | وایران |
| ۳ | پکویر | ۳ | شاروم |
| ۴ | شپنا | ۴ | زماهان |
| ۵ | ذوب | ۵ | سفتنو |
| ۶ | ولملت | ۶ | کسرا |
| ۷ | خریخت | ۷ | وسخوز |
| ۸ | ٹیہسازان | ۸ | حریل |
| ۹ | ناخت | ۹ | شرق |
| ۱۰ | غپینو | ۱۰ | ریشمک |

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



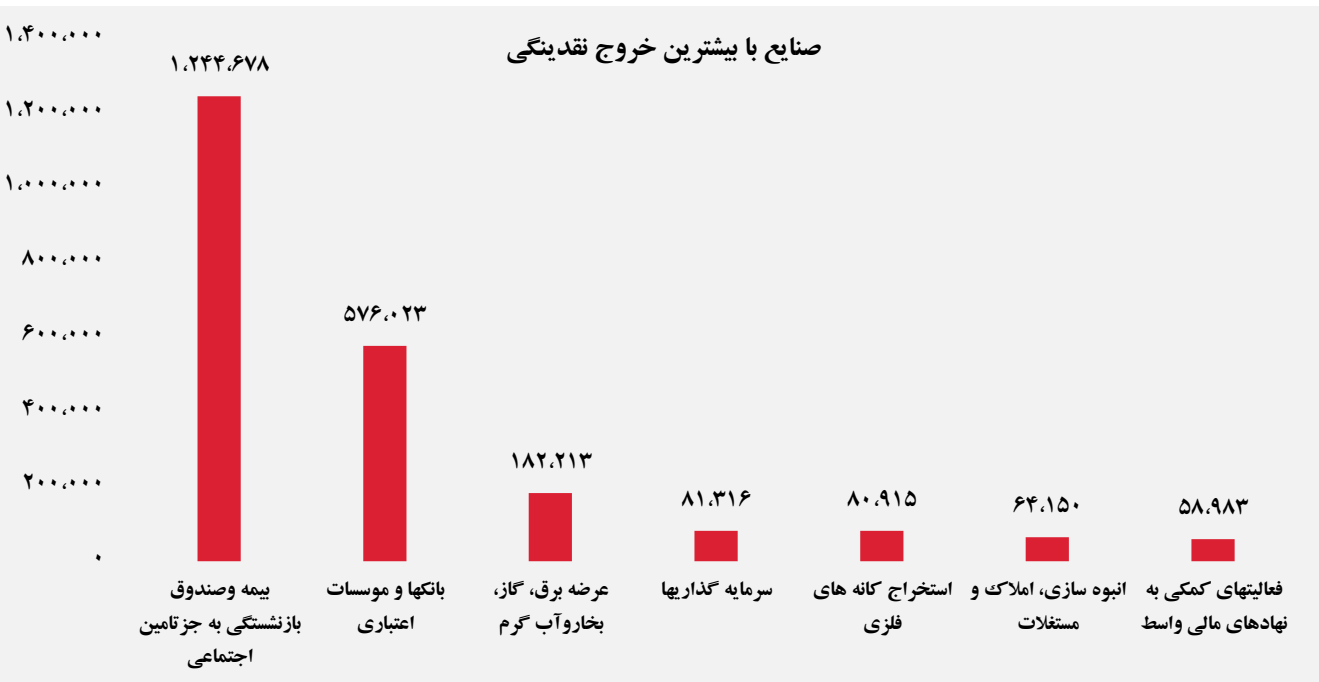
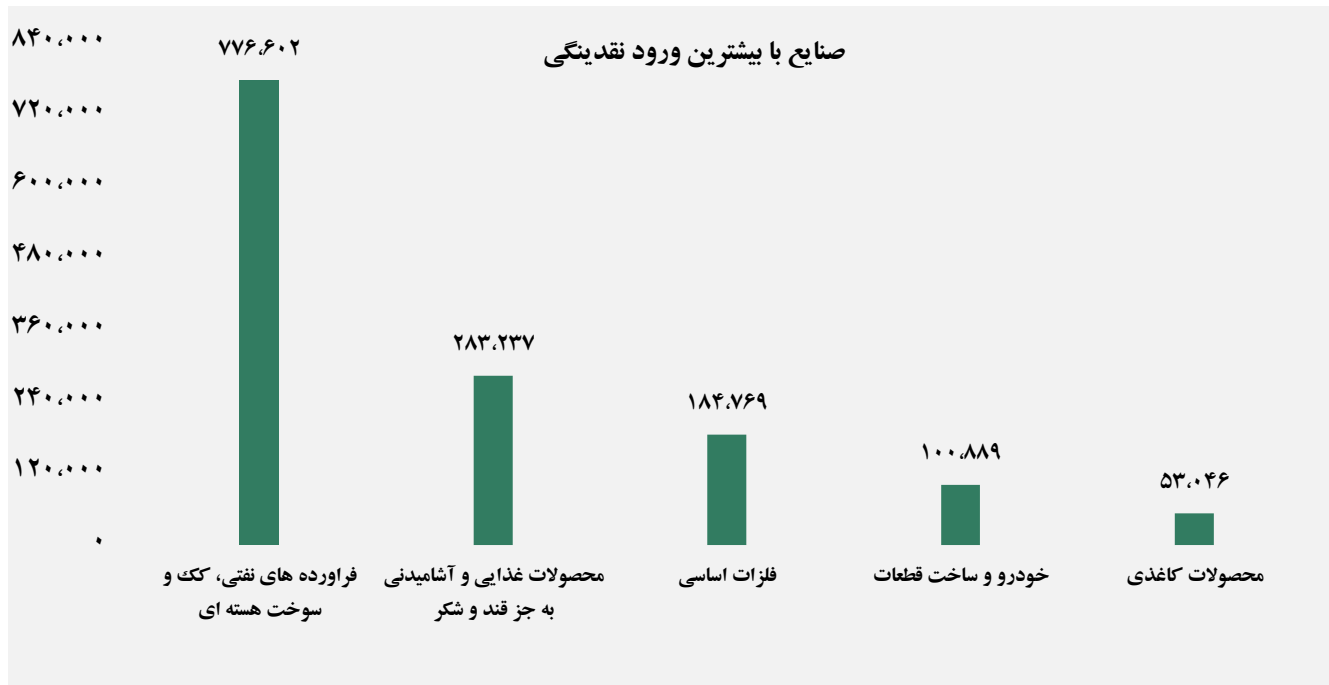
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

| ردیف | نماد | ردیف | نماد |
|------|--------|------|--------|
| ۱ | بنو | ۱۰ | ستران |
| ۲ | شپلی | ۱۱ | ثران |
| ۳ | غکورش | ۱۲ | ساراب |
| ۴ | فجر | ۱۳ | خفتر |
| ۵ | شغدیر | ۱۴ | کویر |
| ۶ | نشاهد | ۱۵ | خازین |
| ۷ | دماوند | ۱۶ | ولپارس |
| ۸ | خمتور | ۱۷ | توریل |
| ۹ | غزر | ۱۸ | سصوفی |

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار