



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۱۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۱۸ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای وبملت، خودرو، رمینا، تجارت، پارسان و فارس با افزایش ۳,۳۶۳ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۶۰,۵۶۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۲ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۵۶ 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 فشار فروش بیشتری را نسبت به روز گذشته در اکثر نمادها را شاهد بودیم.

به نظر می‌رسد بازار سرمایه همچنان با فشار فروش همراه است اما نسبت به ماه گذشته بهبود در کلیت بازار سهام به وضوح به چشم می‌آید و بسیاری از نمادهای کوچک که در چند هفته اخیر با صف فروش همراه بودند، در حال حاضر متعادل و حتی مثبت در حال معامله هستند. انتظار می‌رود صرف نظر از هر نتیجه‌ای در انتخابات ریاست جمهوری، بازار سرمایه به مدار مثبت خود برگردد و دیگر شاهد اتفاقاتی همانند چند ماه گذشته در بازار سرمایه کشور نباشیم.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲,۷۳۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۷۹، 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 ۷۲۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۳/۲۴ با ۲۵,۴۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۱۷	۱۴۰۰/۰۳/۱۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱,۹۹۵	۲,۷۳۲	۳۷٪



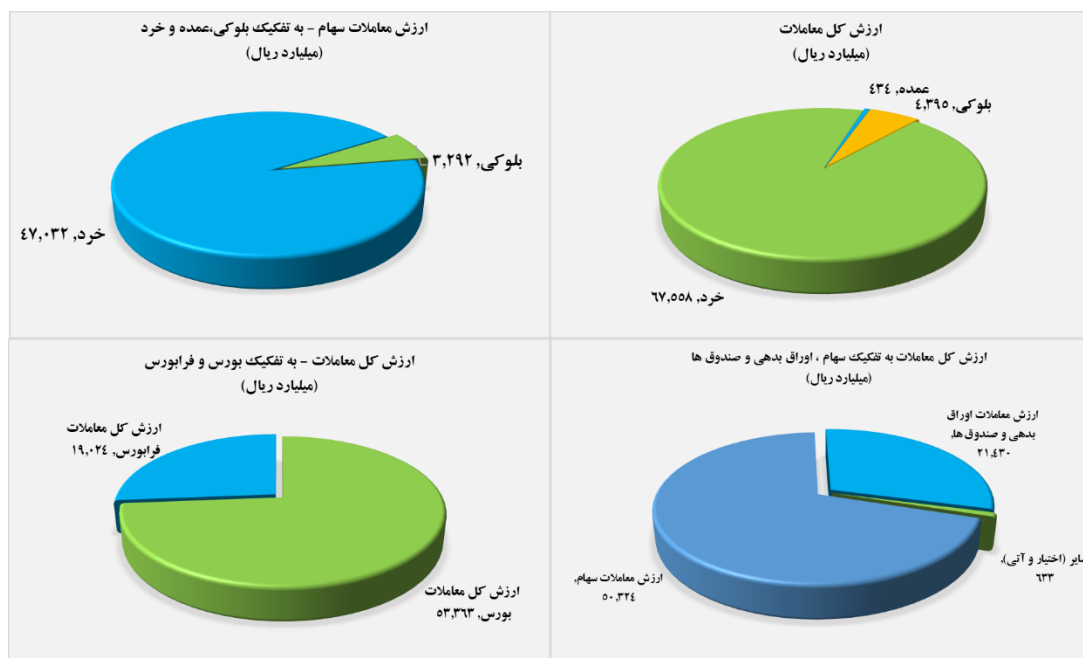
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی آبادان در ۱۲ ماهه سال مالی ۹۹، ۳۲ ریال سود به ازای هر سهم ساخته است. این شرکت در حالی که در شش ماهه، ۱۸۰ ریال زیان به ازای هر سهم داشت، در فصل سوم و چهارم توانسته است به ترتیب ۶۰ و ۱۶۰ ریال سود به ازای هر سهم بسازد. در فصل اول فروش ۲۰ میلیارد تومان، زیان عملیاتی ۸۰ میلیارد تومان و زیان خالص نیز ۱۶ میلیارد تومان ثبت شده است. این تولید کننده PVC در فصل دوم فروش ۹۴ میلیارد تومانی را گزارش کرد و زیان ناخالص ۲۱ میلیارد تومانی را داشته است. در فصل دوم زیان عملیاتی و خالص شرکت برابر با ۷۶ و ۸۴ میلیارد تومان بوده است. پتروشیمی آبادان در پاییز فروش ۳۲۷ میلیارد تومانی، حاشیه سود ۱۲ درصدی، سود عملیاتی ۴۷ میلیاردی و سود خالص ۳۲ میلیارد تومانی را روانه کدال کرد. در فصل زمستان نیز مبلغ فروش این شرکت به ۳۹۲ میلیارد تومان رسید و حاشیه سود با افزایش ۱۵ درصدی نسبت به فصل پاییز به ۳۳ درصد رسیده و سود عملیاتی و خالص شرکت نیز ۶۹ و ۸۶ میلیارد تومان گزارش شده است.

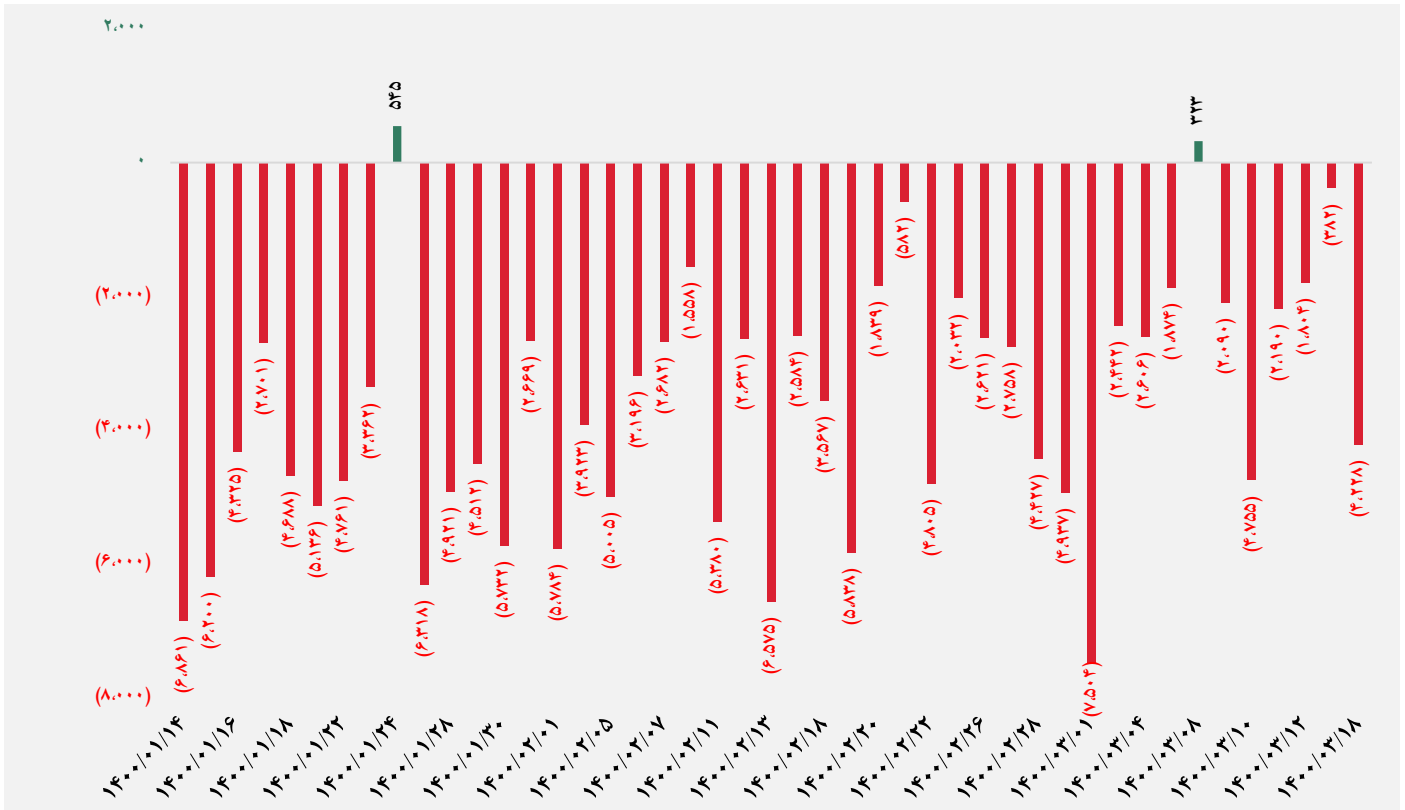
در گروه خودرو، شرکت لنت ترمز ایران که در آذر، دی، بهمن، اسفند و فروردین به ترتیب ۷، ۱۰، ۱۱، ۲۹ و ۳ میلیارد تومان فروش داشت، در اردیبهشت ماه نیز فروش ۹ میلیارد تومانی را ثبت کرده است. مقدار فروش کل که در آذر، دی و بهمن برابر با ۲۶۲، ۱۶۴ و ۲۵۸ تن بود و در اسفند ماه با ثبت یک رکورد در فروش ۴۷۲ تن گزارش شده بود. در فروردین مقدار فروش ۶۴ تن و در اردیبهشت ماه نیز فروش ۱۶۷ تن همراه بوده است. این شرکت در سال ۹۹ و ۹۸ به طور متوسط هر ماه ۲۱۸ و ۱۸۹ تن تولید داشت. در فروردین ۱۴۷ تن تولید کرد و در اردیبهشت نیز ۲۹۰ تن تولید داشته است. نرخ فروش در اردیبهشت ماه ۵۲۷,۳۳۵ ریال به ازای هر کیلو گزارش شده است. نرخ فروش در ماه گذشته نیز ۵۰۸,۰۹۴ ریال در هر کیلو بود.

تصویر کلی بازار

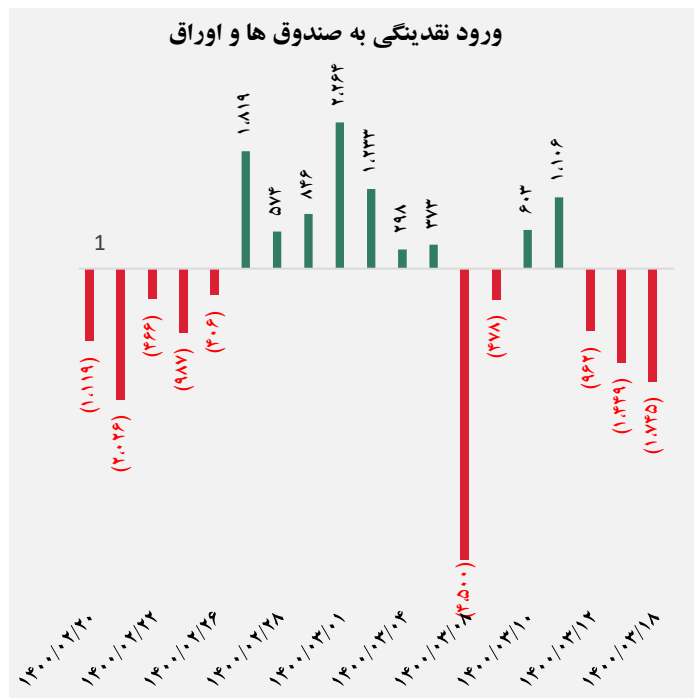
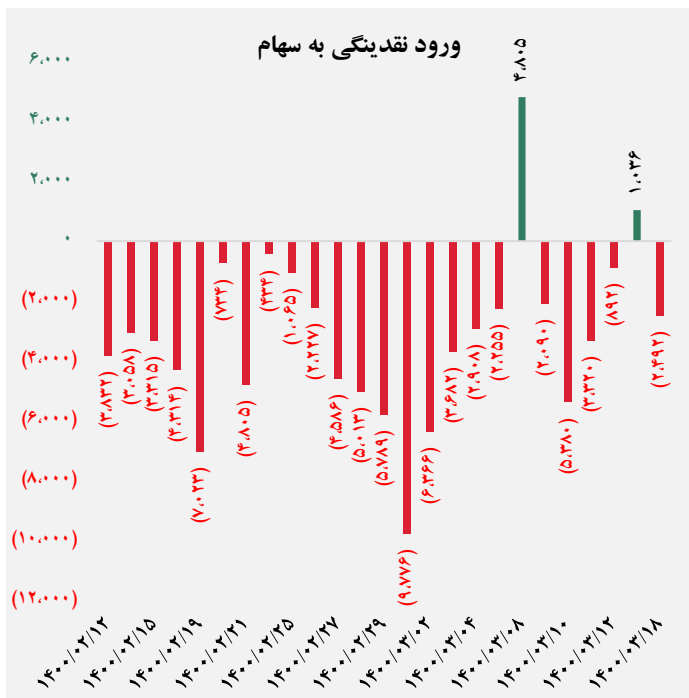
فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۶۰	شاخص کل	۱,۱۶۰,۵۶۸	شاخص کل
(۵۹)	تغییر شاخص	۳,۳۶۲	تغییر شاخص
۱۱,۷۶۰,۵۳۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۳۶۳,۹۷۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۹,۰۲۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۳,۶۳۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
زاگرس		وبملت	
ومهان		خودرو	
بگیلان		رمپنا	
کزغال		وتجارت	
شگویا		پارسان	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
غصینو		فولاد	
آریا		فملی	
دماوند		فخوز	
ذوب		نوری	
مارون		وسخوز	
(۲,۴۹۲)		ورود (خروج) نقدینگی به سهام (میلیارد ریال)	
(۱,۷۴۵)		ورود (خروج) نقدینگی به صندوق ها و اوراق (میلیارد ریال)	



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

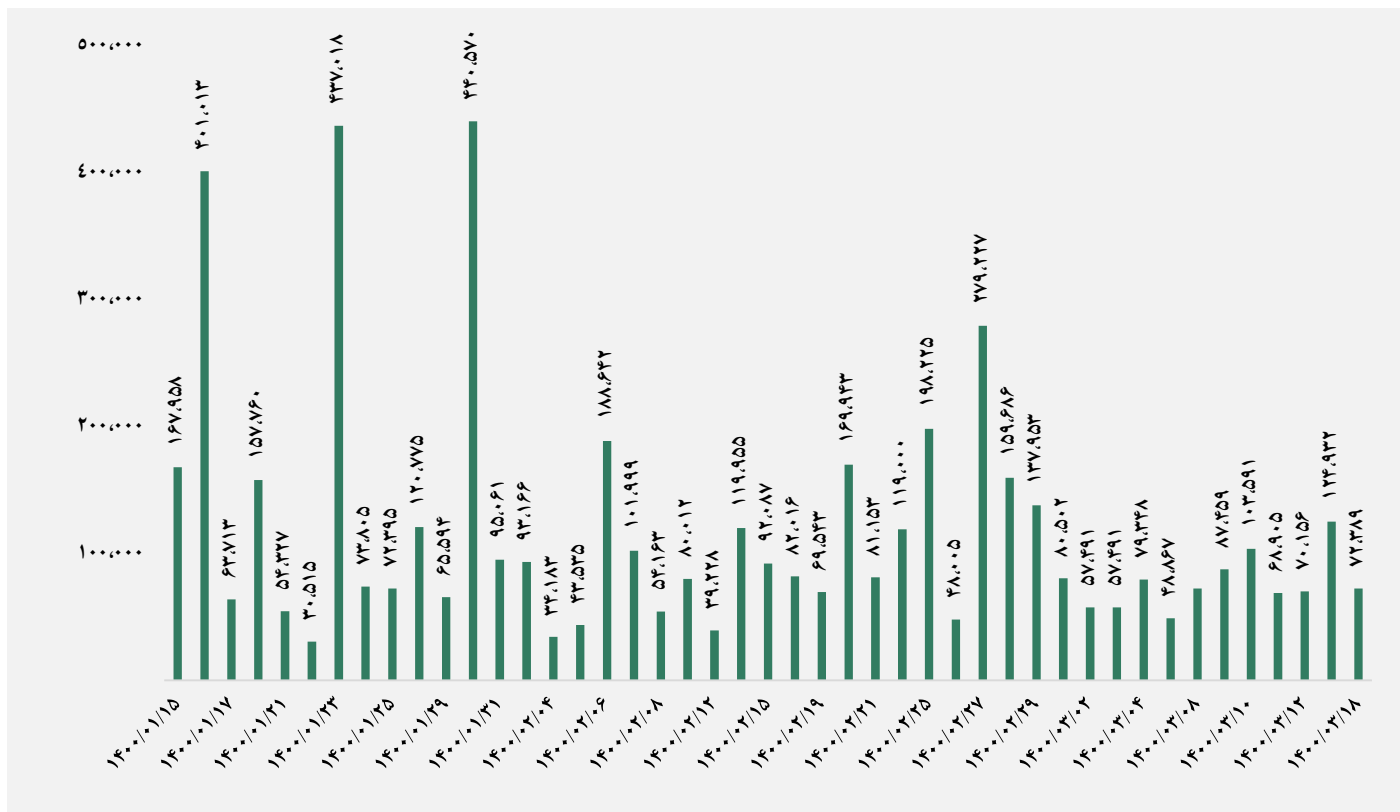


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

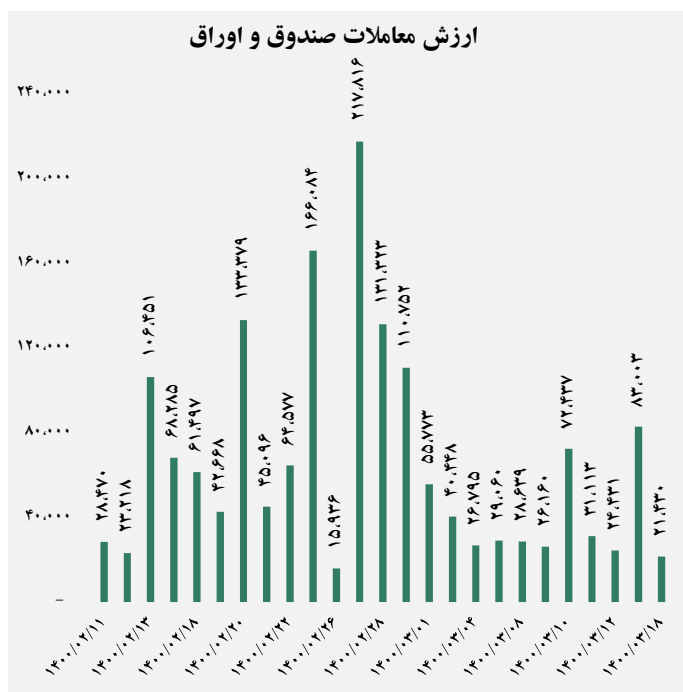
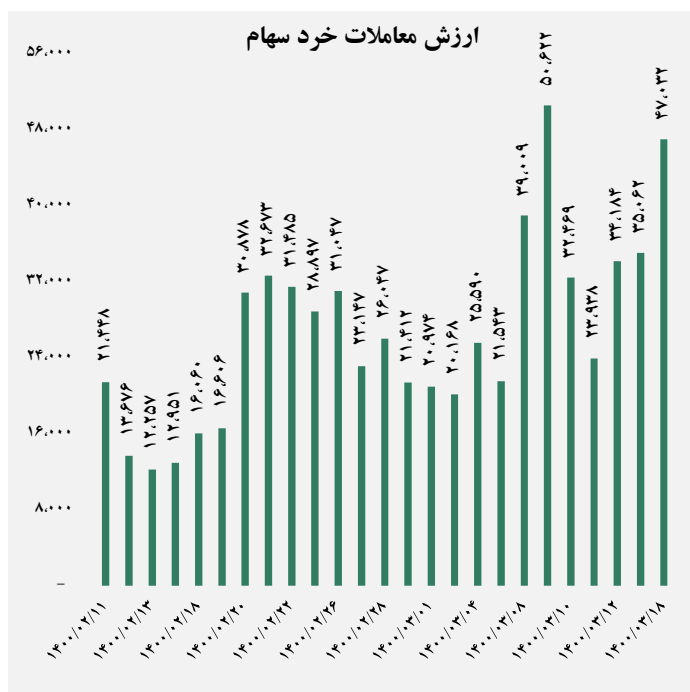


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

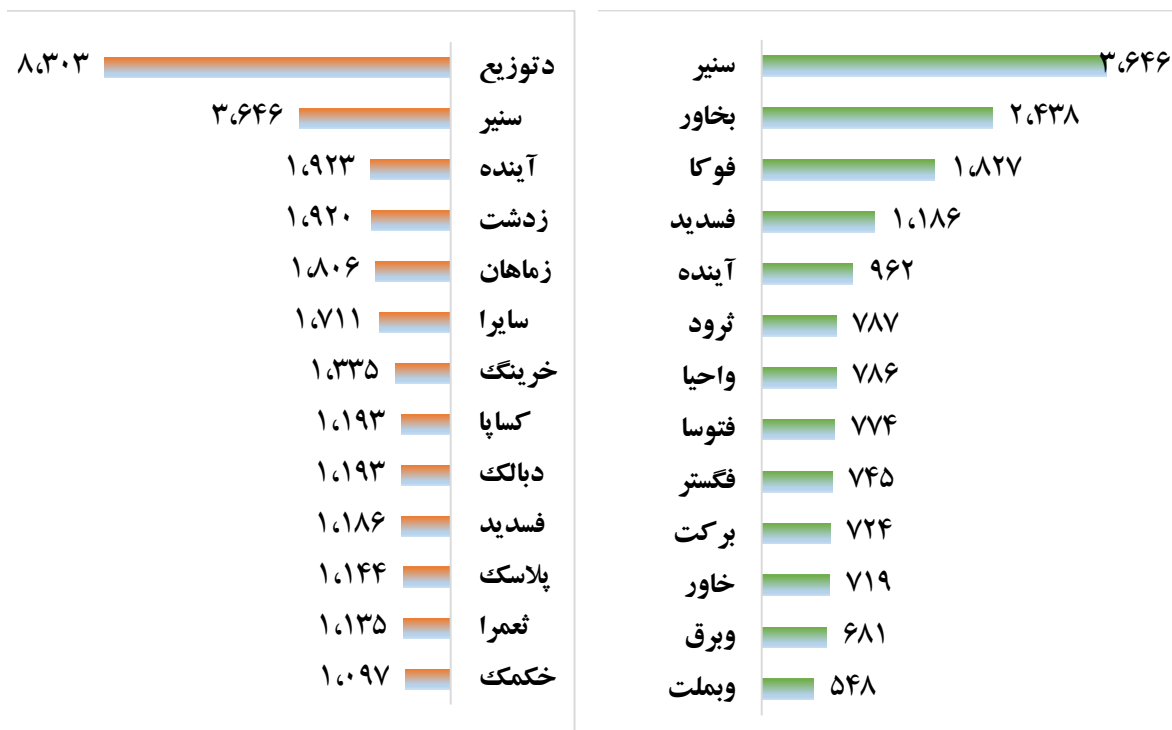


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





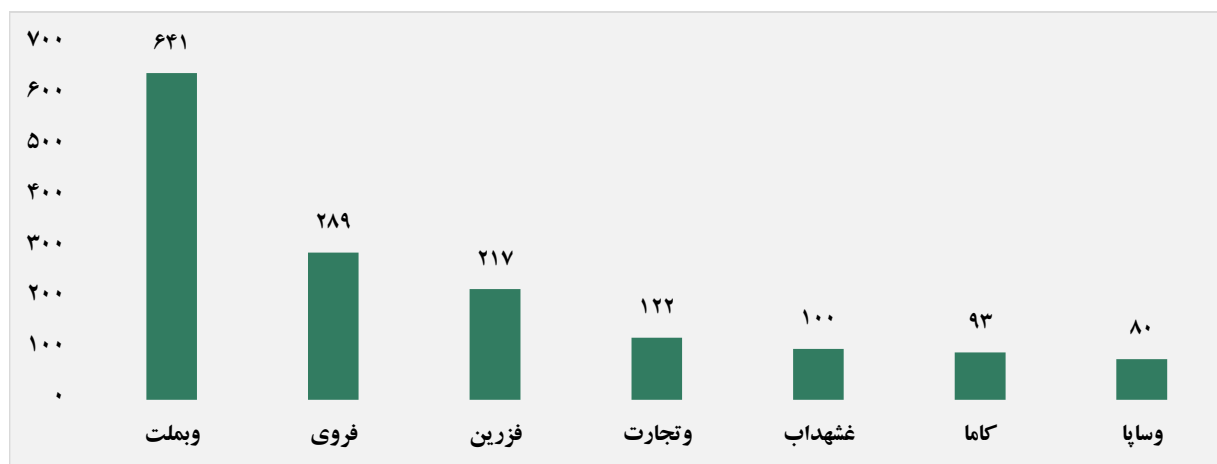
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



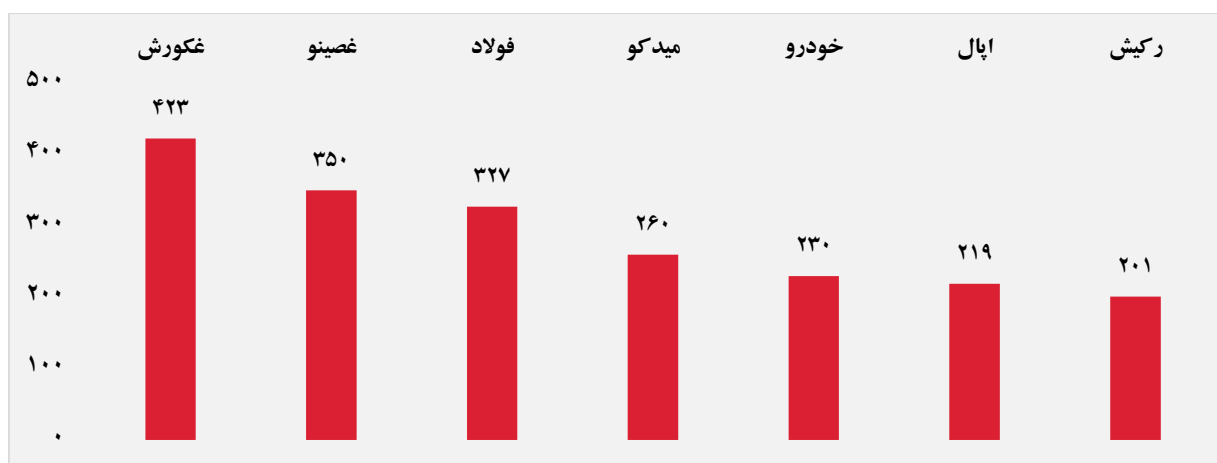
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	چخزر	۱	زنگان
۲	شاروم	۲	معیار
۳	فروی	۳	شتوکا
۴	زپارس	۴	فلوله
۵	ثرود	۵	کسرا
۶	کی بی سی	۶	کمنگنز
۷	پیزد	۷	شدوص
۸	خاذین	۸	تاپکیش
۹	ولملت	۹	سبهان
۱۰	وپویا	۱۰	کسعدی

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



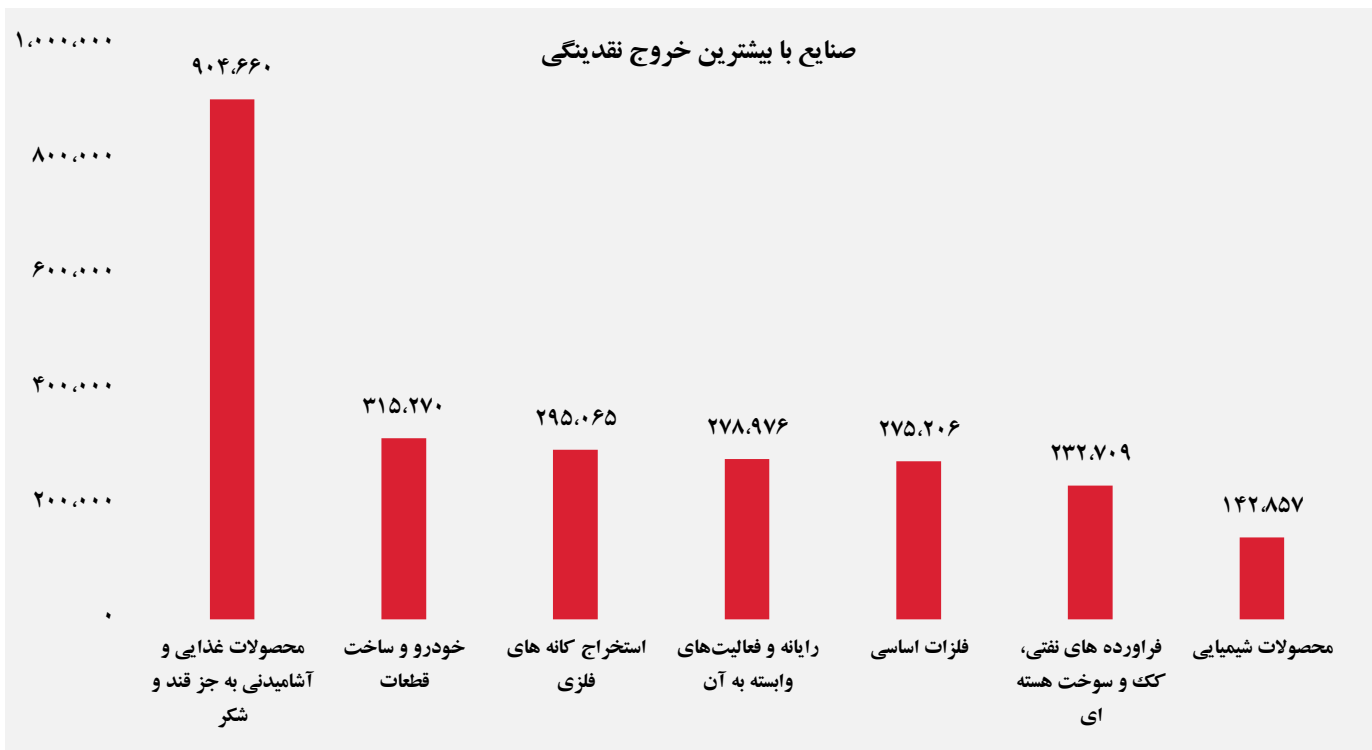
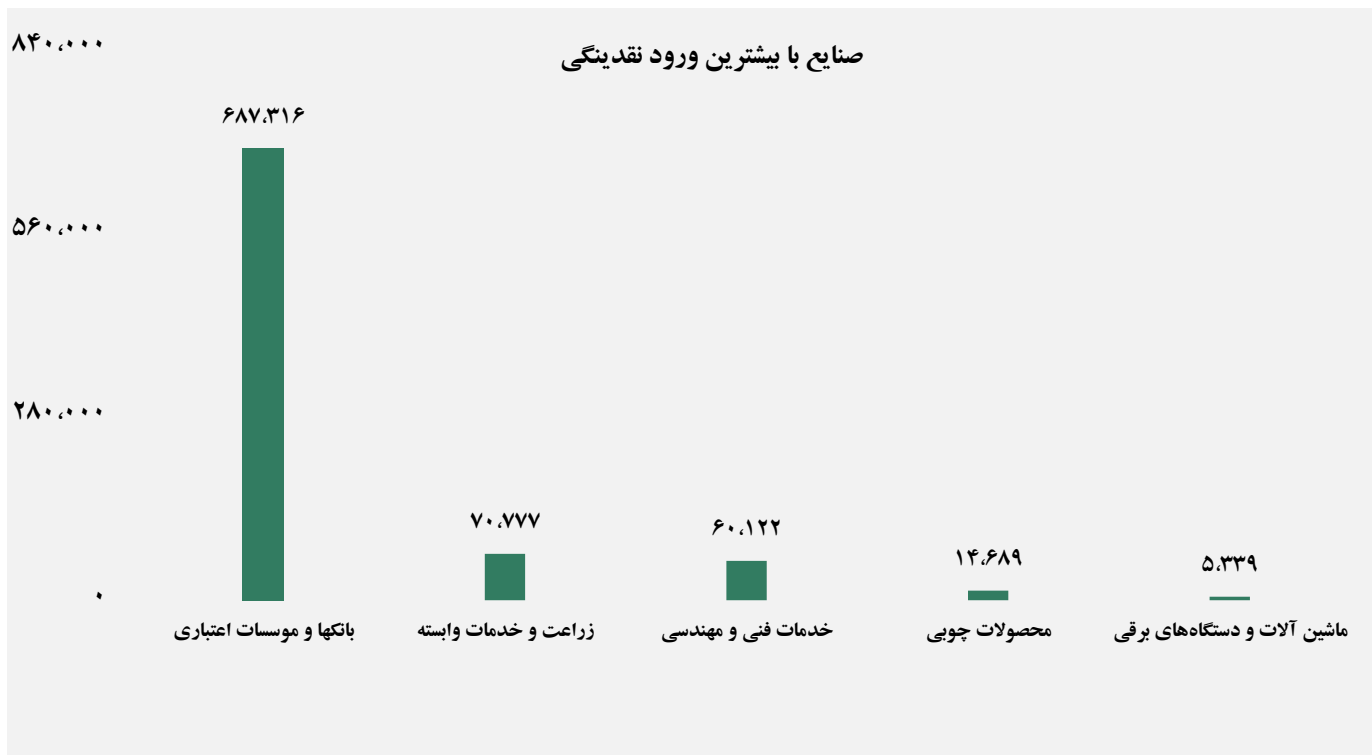
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فزرین	۱۰	کرازی
۲	غکورش	۱۱	سصوفی
۳	کسرا	۱۲	رکیش
۴	تاپکیش	۱۳	غشهداب
۵	غشان	۱۴	حتاید
۶	کزغال	۱۵	خمتور
۷	ودی	۱۶	غصینو
۸	کاما	۱۷	وساخت
۹	فجر	۱۸	تلیسه

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار