



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۱۹

www.sfg.ir - info@sfg.i

تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۱۹ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فولاد، شستا، وغدیر، کچاد و شتران با کاهش ۸,۸۲۴ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۵۱,۸۴۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۵۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش همراه بوده است. مبلغ ۳۷ 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 در گروه‌های خودرو و بانک شاهد تحركات مثبتی از طرف خریداران بودیم.

اگرچه بازار سهام در روز جاری به صورت منفی به کار خود پایان داد اما کندل هفتگی در بسیاری از نمادها و صنایع به طور مثبت بسته شده‌اند. همچنین نمودار بسیاری از نمادهای شاخص‌ساز و حتی بعضی از صنایع مهم مانند شیمیایی، با خروج از روند نزولی ۸ ماهه همراه بوده‌اند. یکی از تفاوت‌های اصلی بازار سرمایه در هفته جاری نسبت به هفته‌ها و یا حتی ماه‌های گذشته را می‌توان به متعادل شدن بسیاری از نمادهای کوچک در بازار بورس و فرابورس دانست. به نظر می‌رسد در هفته‌های آینده قیمت سهام در بسیاری از نمادها، بالاتر از کندل هفته جاری معامله شوند و فشار فروش ماه‌های گذشته در هفته‌های آینده تکرار نشود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۵۳,۷۶۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۲۱۴، 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 ۸۰۹، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۹/۲۳ با ۲۲,۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۳/۱۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲,۷۳۲	۵۳,۷۶۳	۱۸۶۸٪

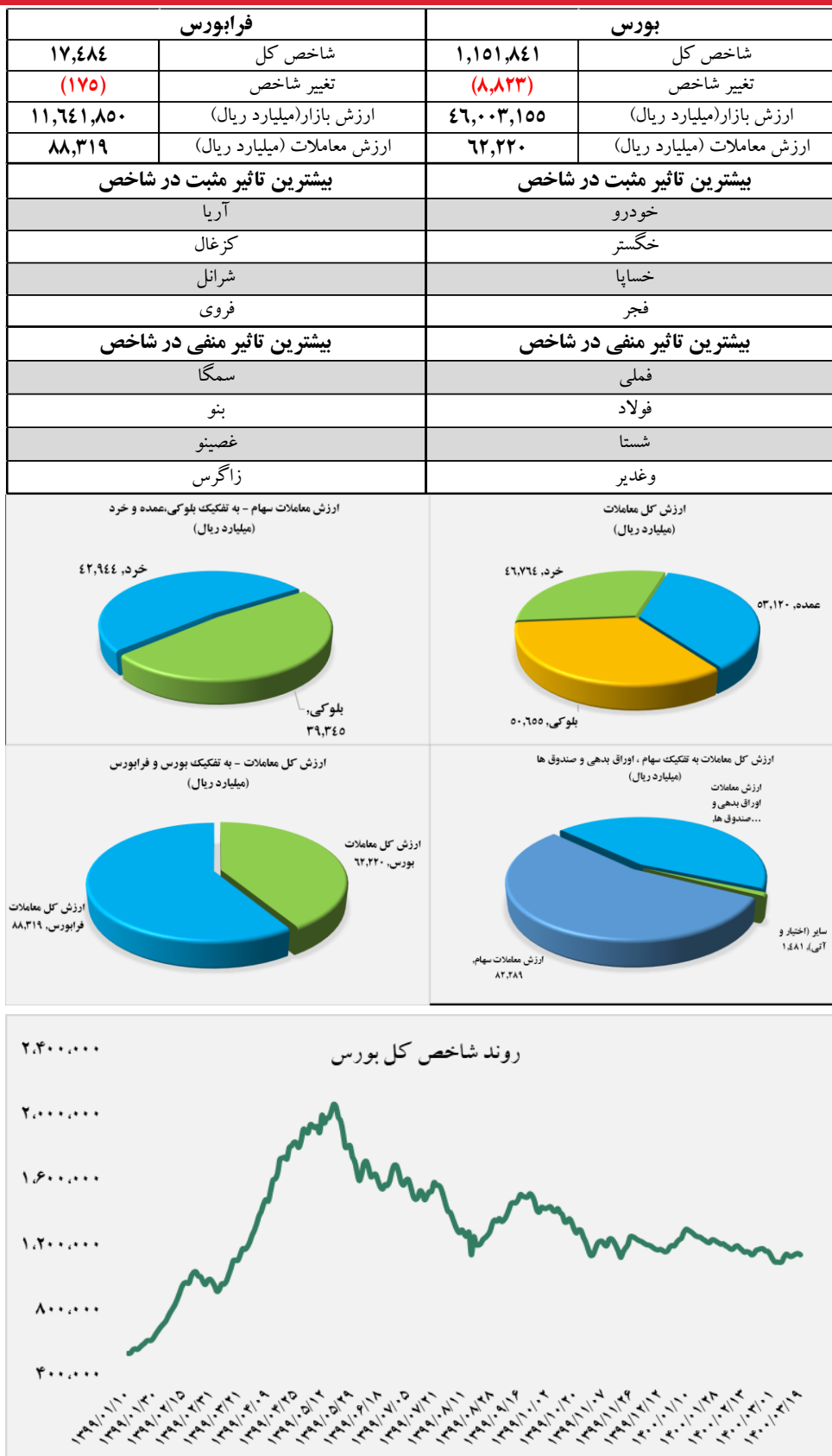


گروه‌های مؤثر

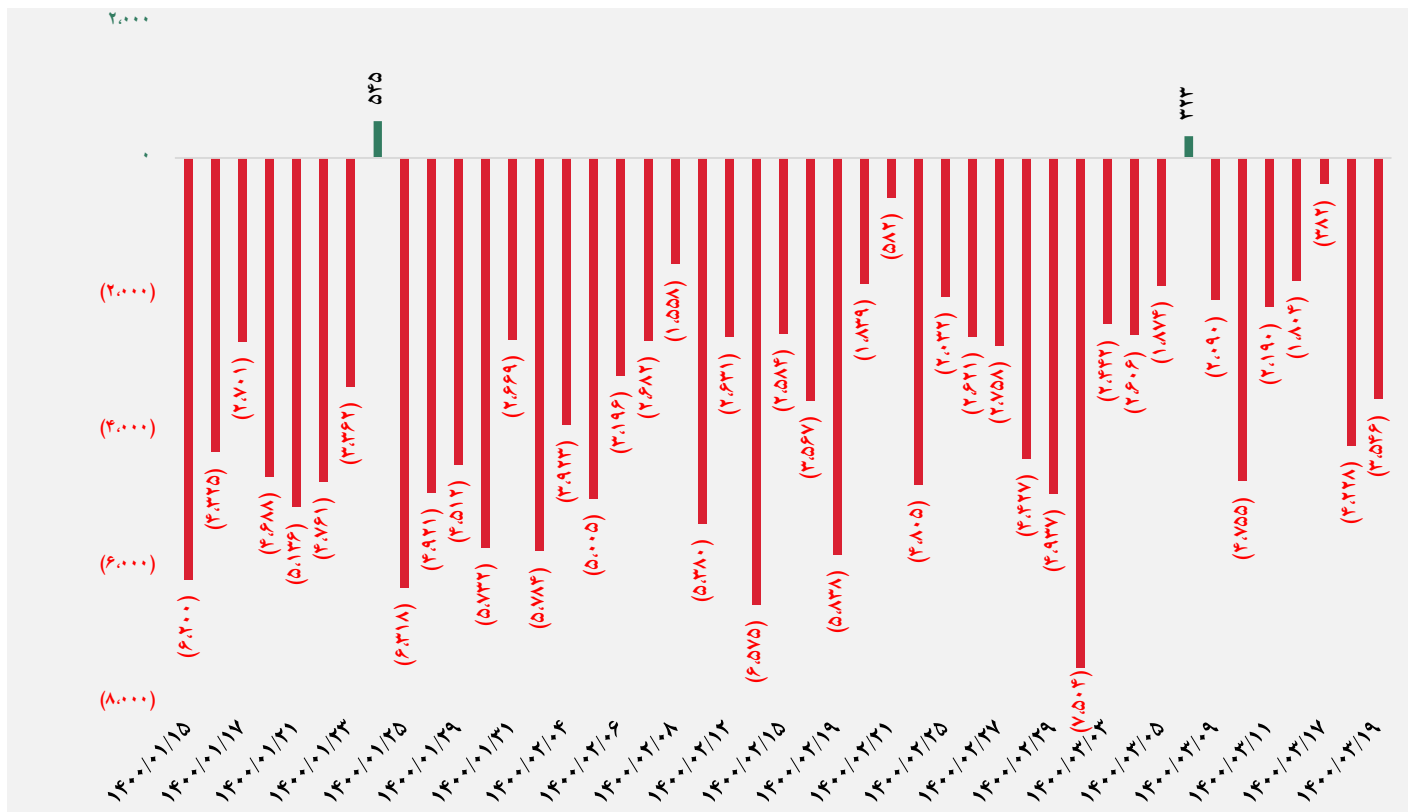
در گروه فلزات اساسی، شرکت ذوب روی اصفهان نیز همانند سایر شرکت‌های سرب و روی فروش منظمی ندارد و شرکت هر ماه با توجه به شرایط صادرات و نرخ‌های جهانی محصولات خود را به فروش می‌رساند. این شرکت در اردیبهشت ماه ۶۳۶ تن شمش روی فروخت. در فروردین ماه فروش شمش نداشت. اسفند ماه نیز ۱۴۲۲ تن شمش روی به فروش رساند. در بهمن ماه شمش روی تولیدی خود را دپوی کرد و فروشی را به ثبت نرساند. اما در دی ماه فروش ۱۸۲۴ تنی را گزارش کرده بود. همچنین در اردیبهشت ماه سال جاری ۱۶۴۲ تن محصول تولید کرده است. در مهر، آبان، آذر، دی، بهمن، اسفند سال مالی گذشته و فروردین ماه سال جاری به ترتیب ۱۲۳۶، ۱۰۷۷، ۱۶۵۸، ۱۳۵۴، ۱۴۱۲، ۱۳۵۳ و ۱۳۱۷ تن تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه در سال مالی گذشته ۱۴۱۳ تن می‌باشد. از نظر مبلغی هم در اردیبهشت ماه ۴۲ میلیارد تومان فروش داشته است. مبلغ فروش کل در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته حدود ۵۳۷ میلیارد تومان و همین رقم در سال مالی ۹۸ حدود ۲۸۱ میلیارد تومان بود. نرخ فروش محصول شمش روی در اردیبهشت ماه حدود ۶۱ هزار تومان در هر کیلو بوده است.

در گروه فرآورده‌های نفتی، شرکت نفت سپاهان در ۱۲ ماهه ۱۷۸ تومان به ازای هر سهم سود ساخته است. این شرکت در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب ۱۹، ۴۴ و ۶۰ تومان سود ثبت کرده بود و در فصل چهارم سود ۵۵ تومانی را گزارش کرده است. سود سال گذشته این شرکت ۱۰۶ تومان بوده است. در فصل اول، فروش ۸۸۰ میلیارد تومان، حاشیه سود ۲۷ درصد، سود عملیاتی ۱۷۷ میلیارد تومان و سود خالص ۱۸۳ میلیارد تومانی را داشته است. این شرکت در فصل دوم فروش ۱۵۵۹ میلیارد تومانی را گزارش کرد که با حاشیه سود ۲۷ درصدی، سود ناخالص ۴۱۷ میلیارد تومانی را داشته است. در فصل دوم، سود عملیاتی و خالص شرکت برابر با ۳۵۴ و ۴۲۱ میلیارد تومان بوده است. شرکت نفت سپاهان در پاییز نیز فروش ۲۲۰۰ میلیارد تومانی، حاشیه سود ۳۳ درصدی، سود عملیاتی ۵۵۶ میلیارد تومانی و سود خالص ۵۶۷ میلیارد تومانی را روانه کدال کرد. در چهارمین فصل سال گذشته نیز فروش آن شرکت با رشد ۱۵ درصدی نسبت به فصل سوم به ۲۵۰۰ میلیارد تومان رسیده است. حاشیه سود با کاهش ۸ درصدی به ۲۵ درصد رسیده و سود عملیاتی و خالص شرکت نیز ۴۷۱ و ۵۲۵ میلیارد تومان گزارش شده است.

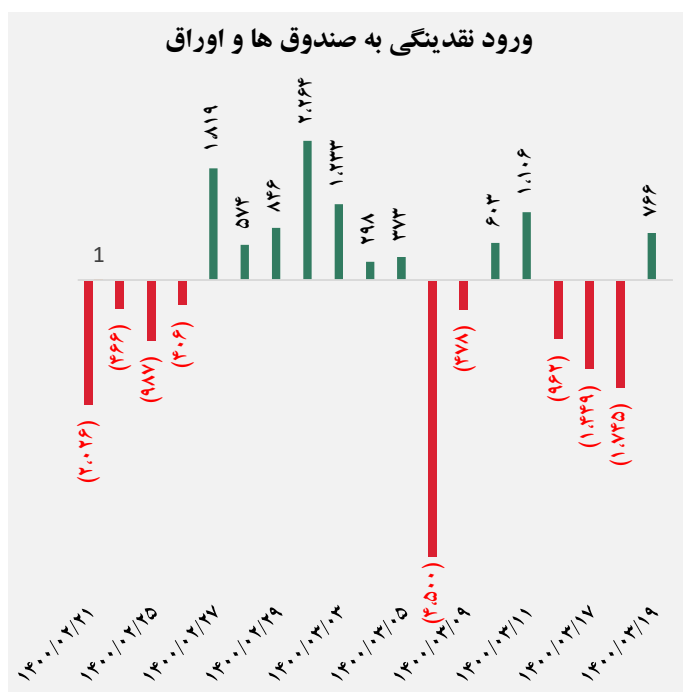
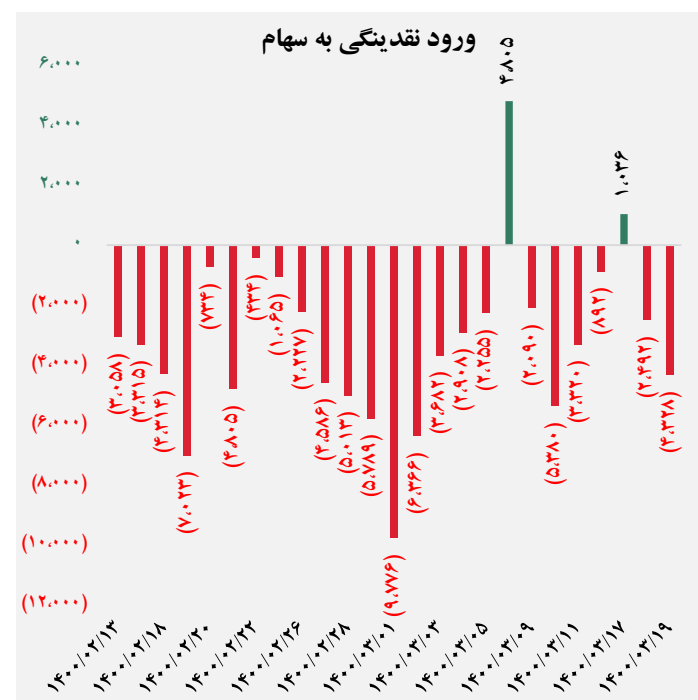
تصویر کلی بازار



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

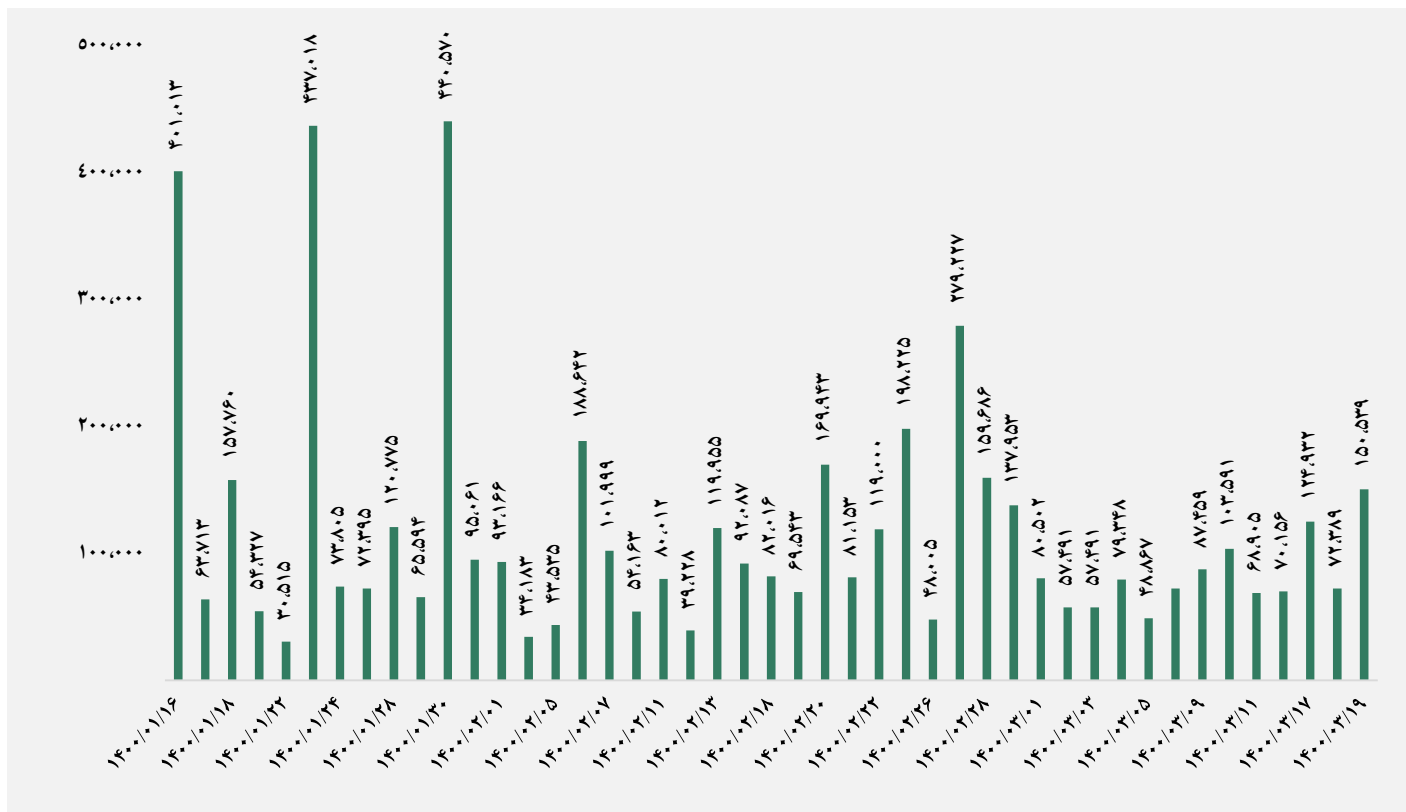


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

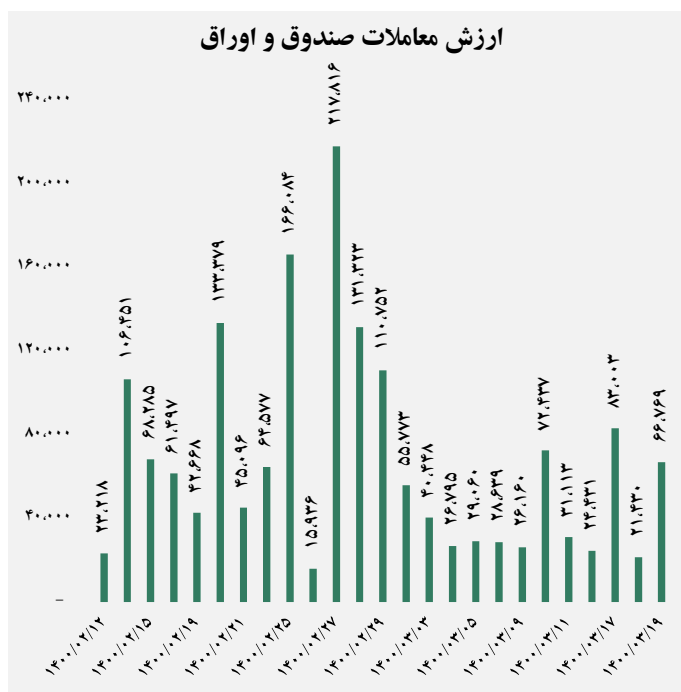
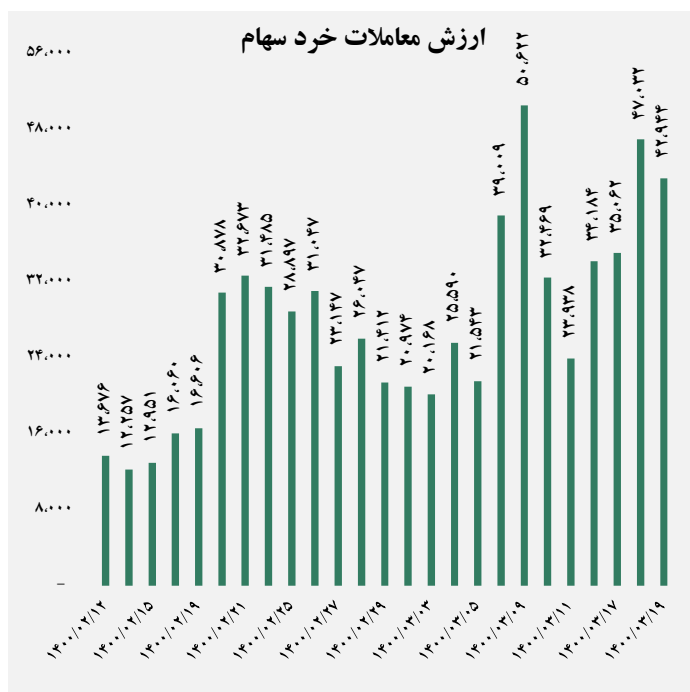


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

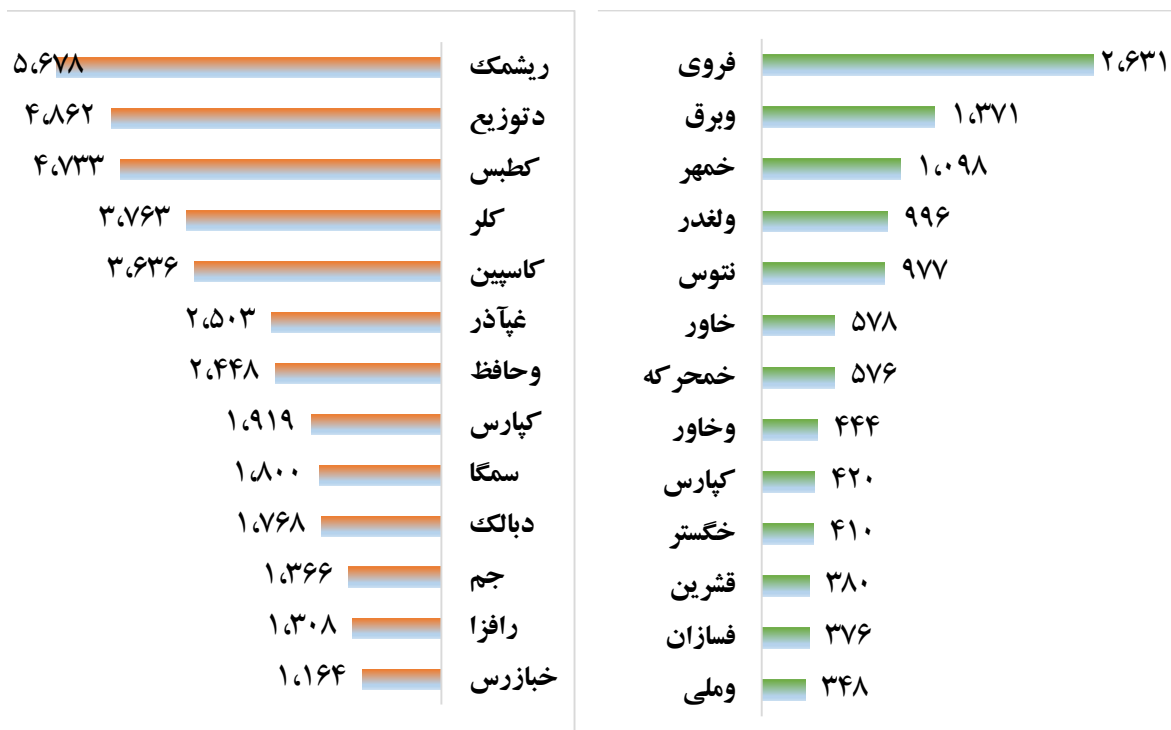


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





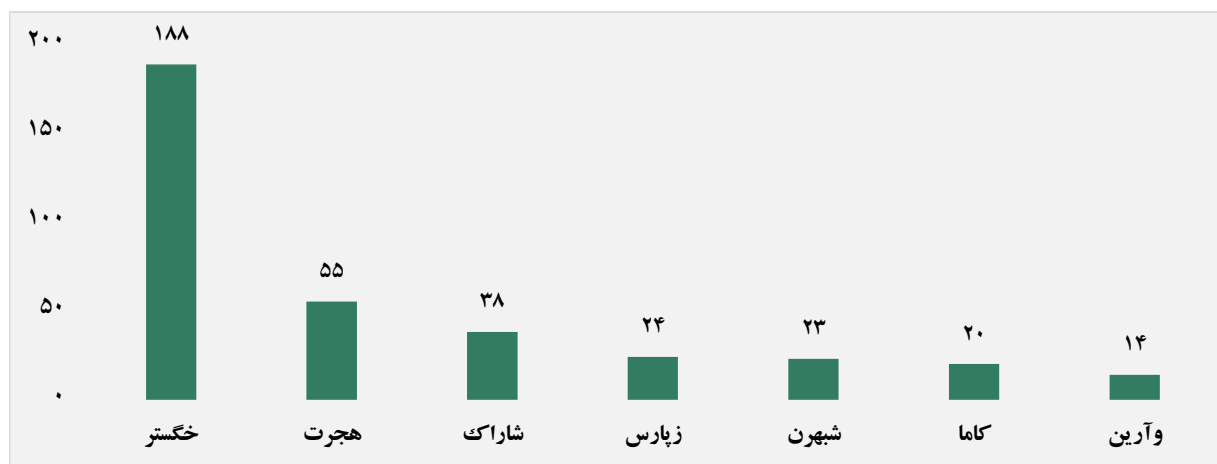
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



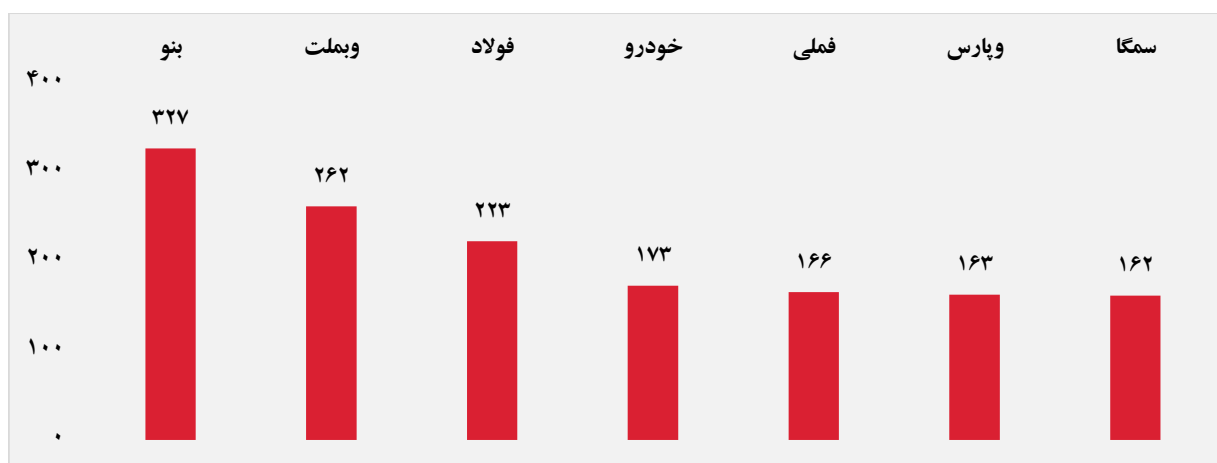
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	خگستر	۱	بنو
۲	وآرین	۲	سمگا
۳	غشهداب	۳	برکت
۴	تلیسه	۴	جم
۵	فالوم	۵	نشاهد
۶	غشان	۶	کوثر
۷	وبرق	۷	رانفور
۸	وملی	۸	کمنگنز
۹	خمهر	۹	امید
۱۰	وصنا	۱۰	کلر

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



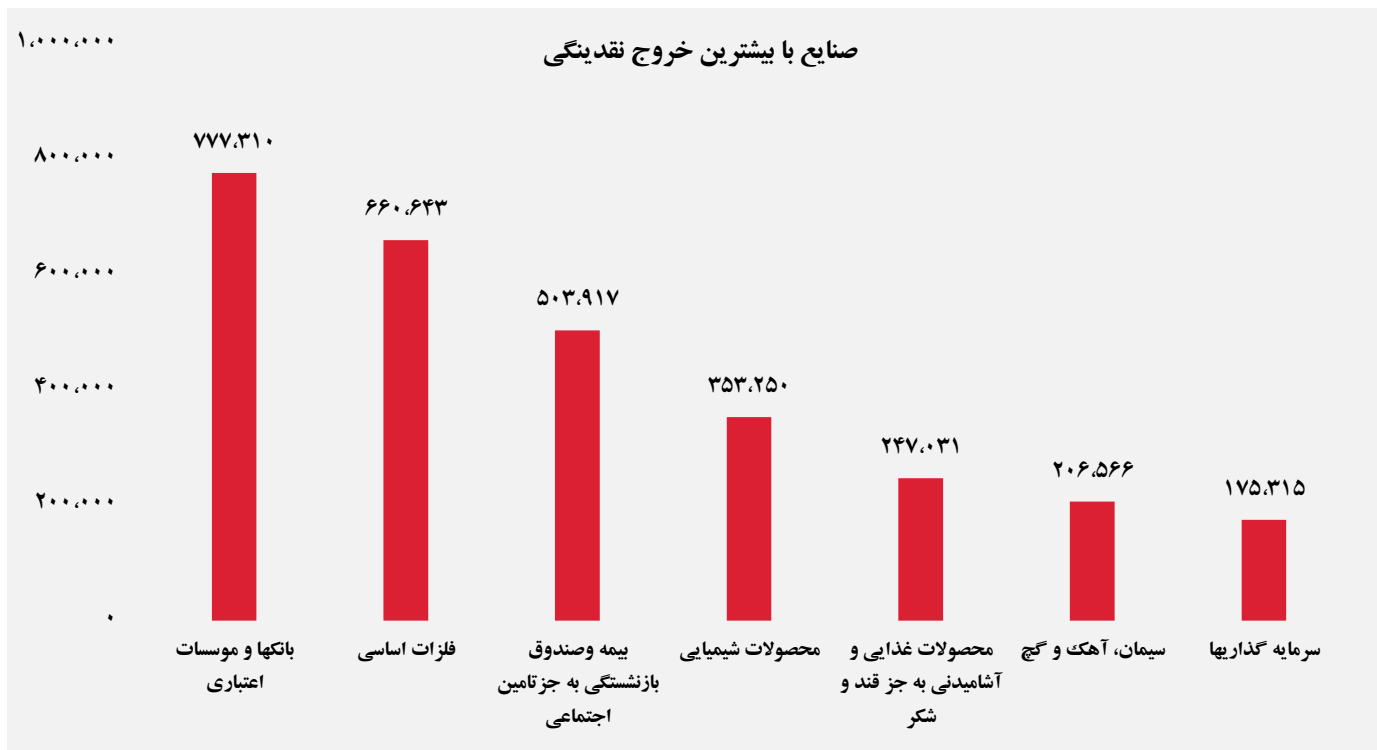
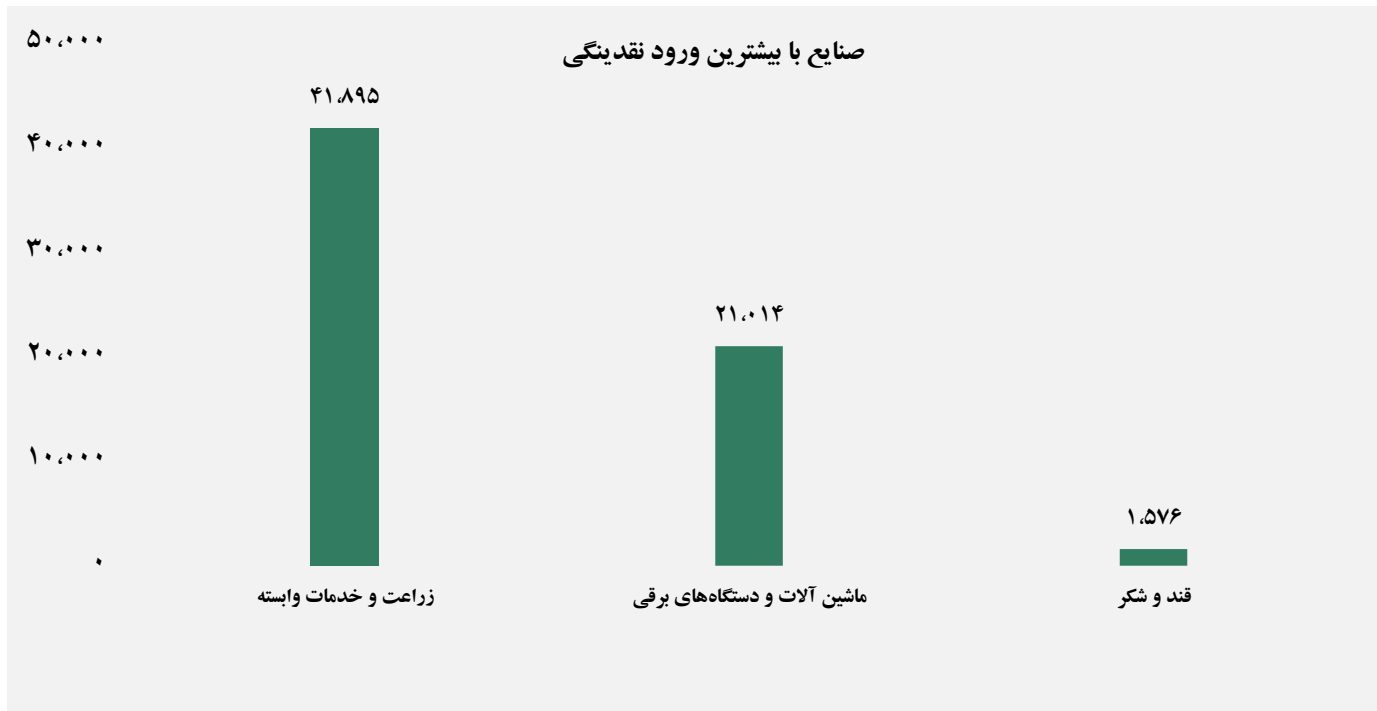
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	کسرا
۲	کیمیا	۱۱	سیمرخ
۳	غکورش	۱۲	تاپکیش
۴	فزرین	۱۳	غشهداب
۵	کرغال	۱۴	فجر
۶	رنیک	۱۵	زینا
۷	غصینو	۱۶	گشان
۸	بنو	۱۷	خوساز
۹	کرازی	۱۸	ودی

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار