



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۲۳

www.sfg.ir - info@sfg.i

تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۳ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، تاپیکو، رمینا، وپارس، وبصادر و شتران با کاهش ۳,۶۶۳ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۴۱,۲۹۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۱۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۲۸ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق‌های قابل معامله سهامی می‌باشد. همچنین در روز جاری شاهد افزایش تقاضا در گروه خودرو بودیم.

در بحث اقتصادی، آنچه که در بین سخنان کاندیدهای ریاست جمهوری به صورت اجماع تکرار می‌شود، کاهش نرخ سود بانکی است. در حال حاضر همه کاندیدها مخالف افزایش نرخ بهره بانکی هستند و این مخالفت با افزایش نرخ بهره بانکی و کاهش آن می‌تواند افسارگسیختگی در حوزه بانکی را کمی کنترل کند و همچنین این کاهش احتمالی می‌تواند در این مقطع زمانی بسیار به نفع بازار سرمایه باشد و در زمانی که نسبت P/Ettm بعد از دوره مجامع با کاهش همراه می‌شود، اگر کاهش نرخ بهره بانکی نیز اتفاق افتد، بازار سرمایه مجدداً با اقبال مناسبی از طرف سرمایه‌گذاران همراه خواهد شد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۷۶,۴۳۹ 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 ۸۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ با ۲۳.۸٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۲۲	۱۴۰۰/۰۳/۲۳	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲,۲۱۵	۷۶,۴۳۹	۳۳۵۱٪



گروه‌های مؤثر

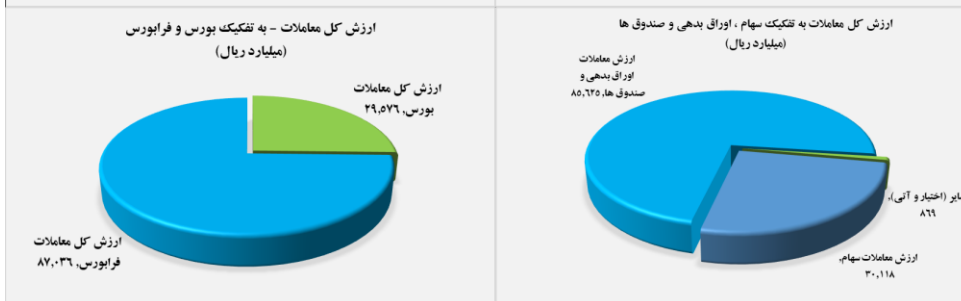
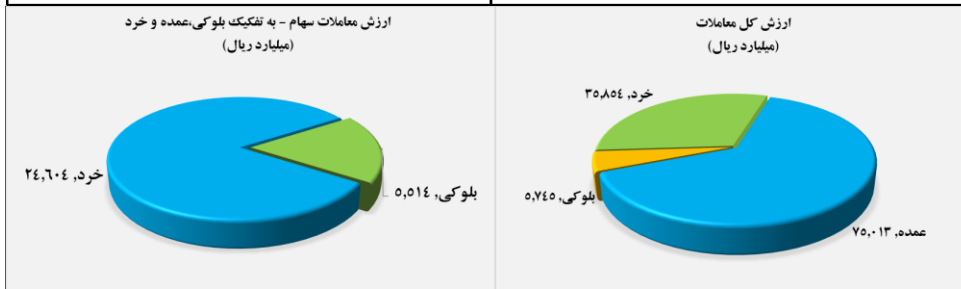
در گروه استخراج کانه‌های فلزی، شرکت سنگ آهن گهرزمین در اردیبهشت ماه ۱ میلیون و ۲۰۰ هزار تن کلوخه و ۴۴۷ هزار تن کنسانتره و ۶۹۳ هزار تن سنگ دانه بندی تولید کرده است. متوسط تولید چهار ماه گذشته برای این محصولات به ترتیب ۱,۴ میلیون تن، ۳۹۰ هزار تن و ۵۱۰ هزار تن بوده است. این تولید کننده سنگ آهن در اردیبهشت ۸۳۹ هزار تن کلوخه، ۵۶ هزار تن کنسانتره و ۱۰۳ هزار تن سنگ دانه بندی فروخته است. متوسط فروش چهار ماه محصولات ۸۶۳ هزار تن، ۲۱۶ هزار تن و ۱۶۵ هزار تن گزارش شده است. سنگ آهن گهر زمین در اردیبهشت ماه درآمد ۱۸۸۱ میلیارد تومانی و متوسط درآمد چهار ماه گذشته ۱۴۳۰ میلیارد تومان بوده است. متوسط درآمد سال مالی گذشته نیز ۸۱۷ میلیارد تومان ثبت شده است. نرخ فروش کلوخه در اردیبهشت ماه ۹۸۸۰ ریال و نرخ فروش محصول دانه بندی شده ۱۰۰۸۰ ریال گزارش شده است. متوسط نرخ فروش ۴ ماه گذشته کنسانتره، کلوخه و سنگ دانه بندی به ترتیب ۲۱۹۳۹، ۸۹۷۴ و ۱۱۱۲۴ ریال بوده است. این شرکت در سال مالی ۹۹ کنسانتره و کلوخه را با نرخ‌های ۱۱۸۵۸ و ۴۴۴۴ ریال و دانه بندی را با نرخ ۴۵۵۲ ریال به ازای هر کیلو به فروش رسانده است.

در گروه کاغذ، شرکت کاغذ پارس سال مالی منتهی به آبان دارد. این شرکت در سال مالی ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۴۹۳۲ تن تولید داشته است. شرکت در اردیبهشت ماه ۶۱۷۸ تن و در ۵ ماه گذشته به طور متوسط ۵۳۶۹ تن فروش ثبت کرده است. متوسط فروش در سال مالی قبل ۵۰۸۷ تن ثبت شده است. شرکت کاغذ پارس سال مالی گذشته خود را با متوسط فروش ۴۳ میلیارد تومانی به پایان رساند. اردیبهشت ماه فروش عالی ۱۱۶ میلیارد تومانی و متوسط فروش آذر تا فروردین ۷۸ میلیارد تومان گزارش شده است. نرخ فروش کاغذ در اردیبهشت ماه ۱۹۵۹۲۸ ریال به ازای هر کیلو و متوسط نرخ آذر تا فروردین نیز ۱۶۳۰۷۶ ریال به ازای هر کیلو بوده است. متوسط نرخ فروش ۱۲ ماهه گذشته ۱۰۶۷۱۳ ریال به ازای هر کیلو گزارش شده است.

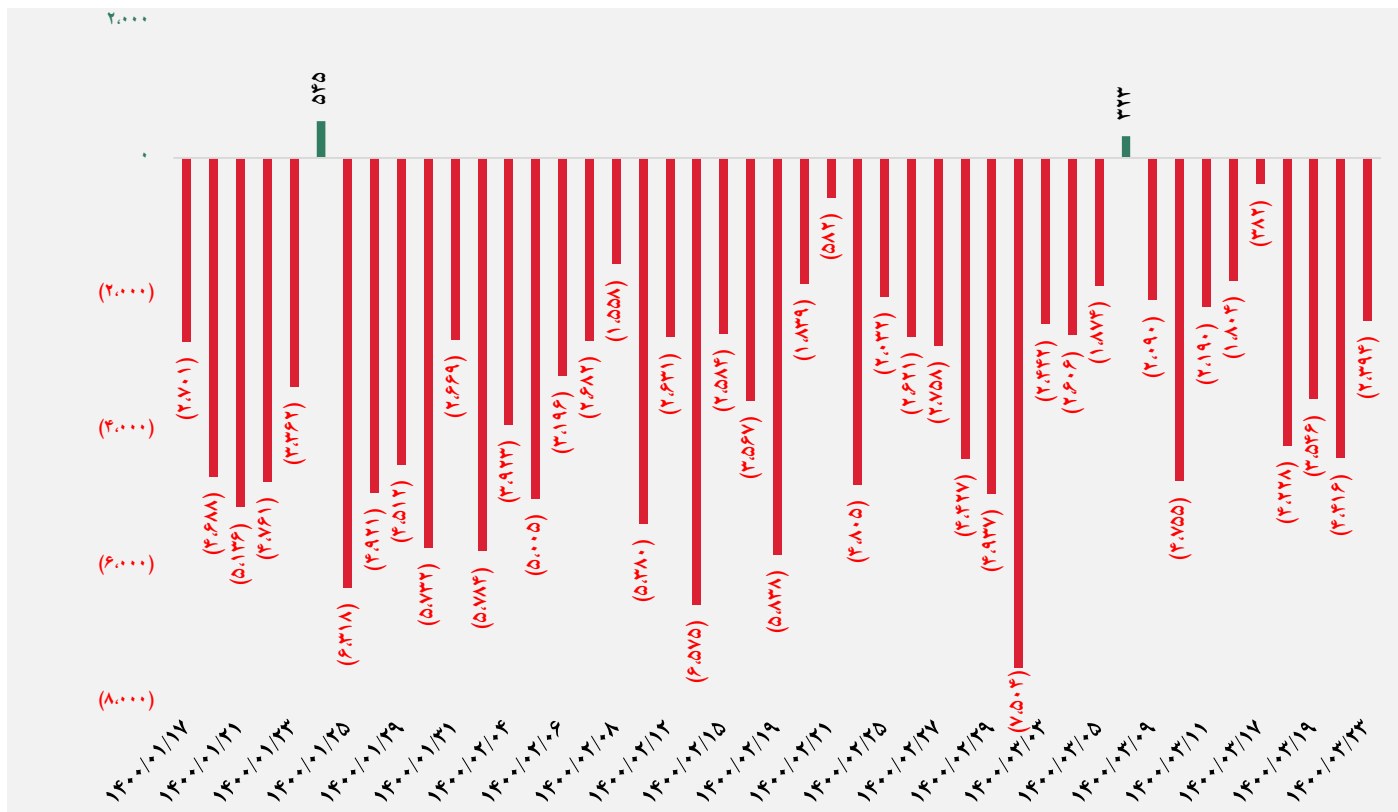
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۴۳۴	شاخص کل	۱,۱۴۱,۲۹۰	شاخص کل
(۱۷)	تغییر شاخص	(۳,۶۶۵)	تغییر شاخص
۱۱,۵۹۴,۶۰۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۵,۵۶۴,۰۸۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۸۷,۰۳۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۹,۵۷۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)

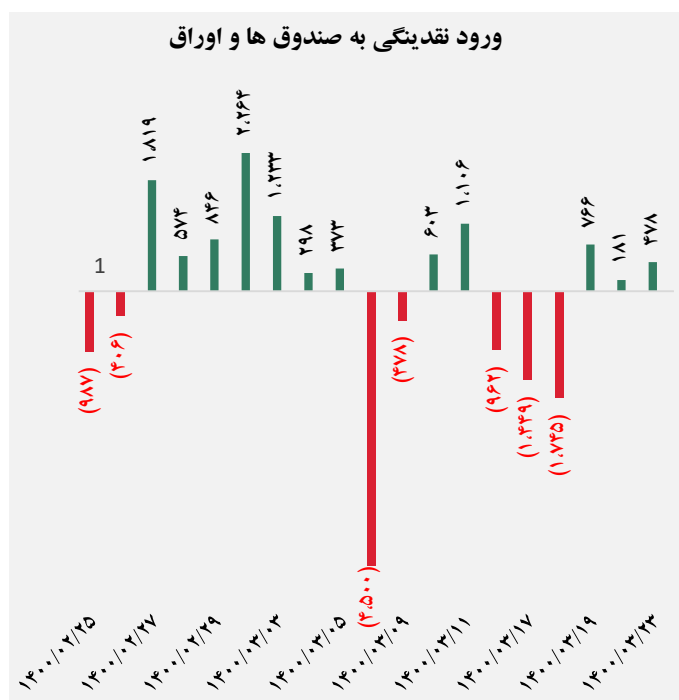
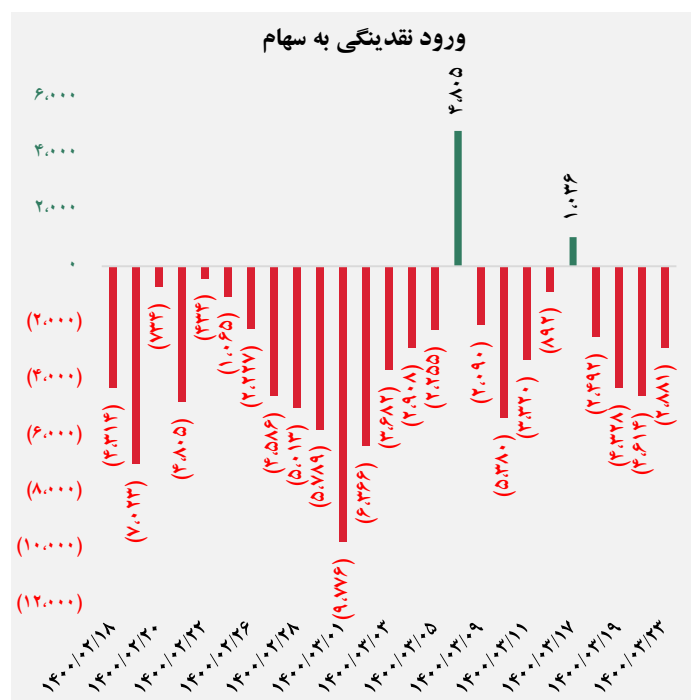
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
آریا		کگل	
غصینو		شپنا	
دماوند		خودرو	
زاگرس		نوری	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
سمگا		فارس	
بنو		تاپیکو	
کوثر		رپنا	
غویتا		ویارس	



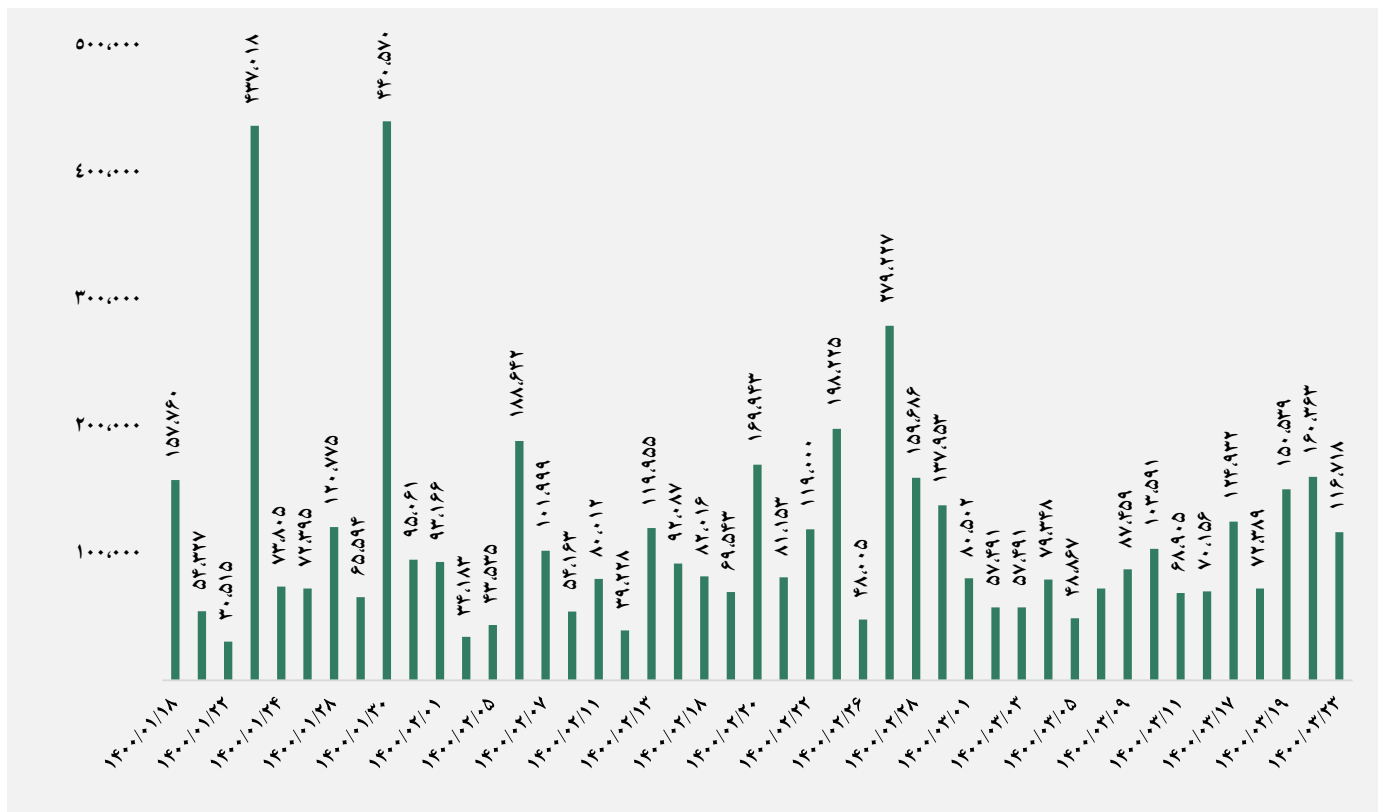
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



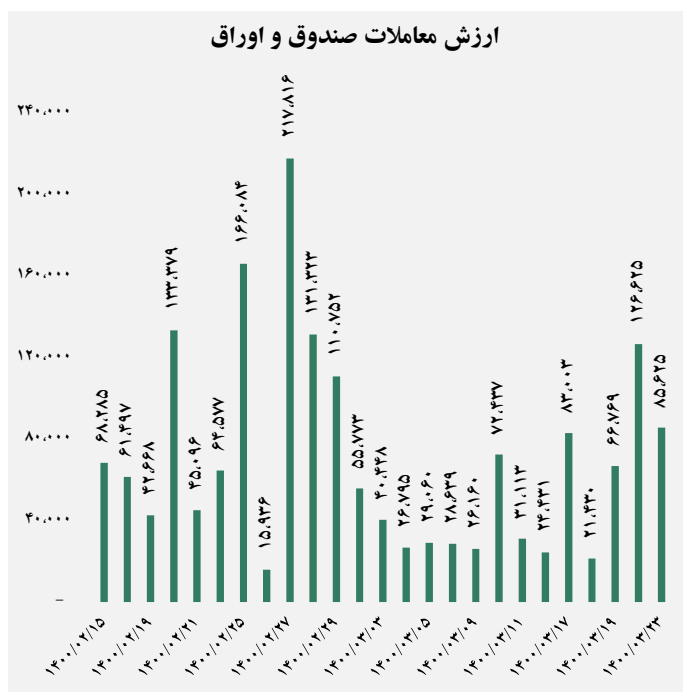
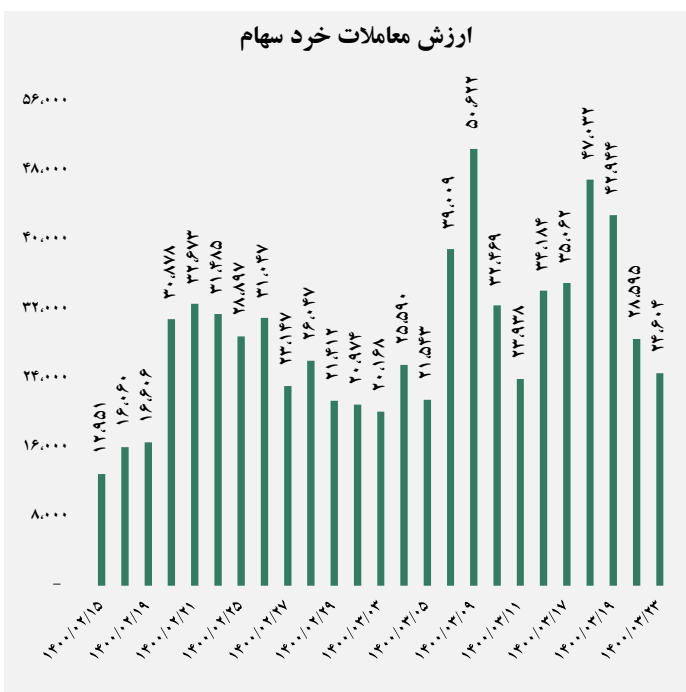
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

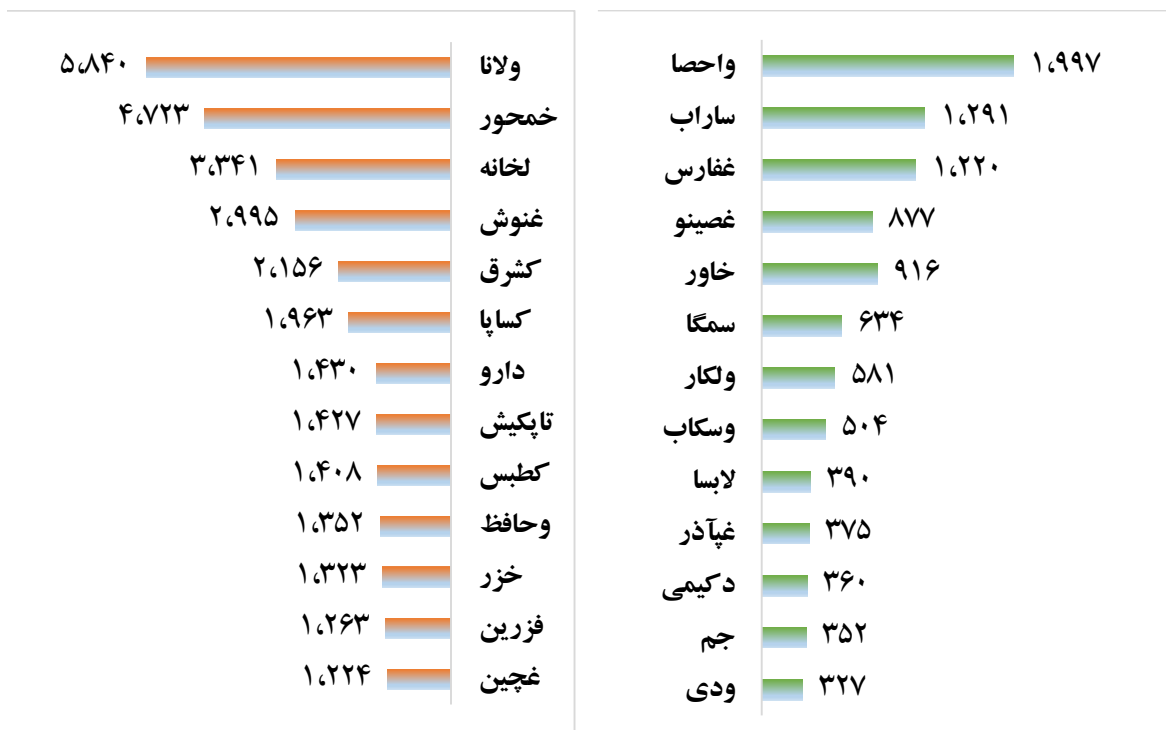


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





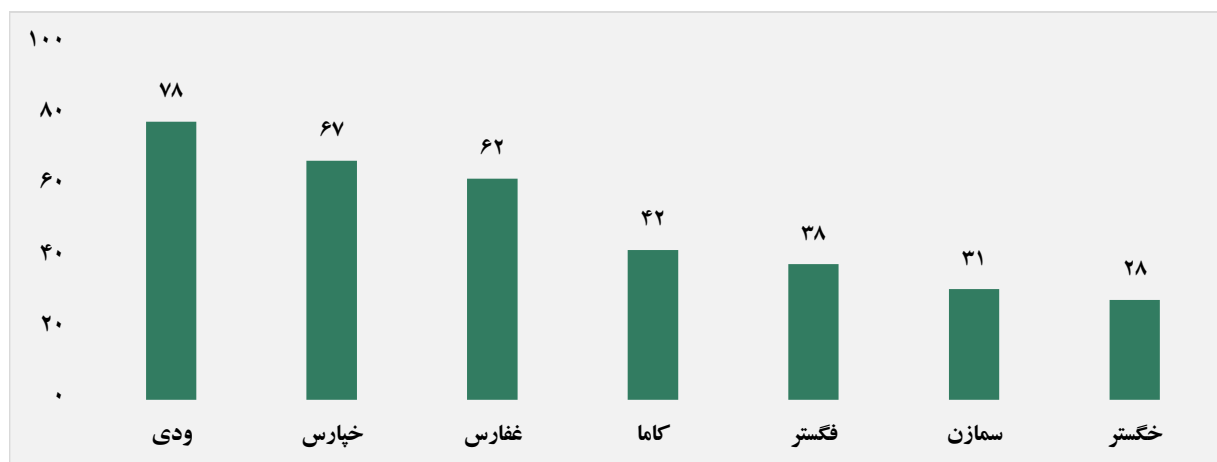
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



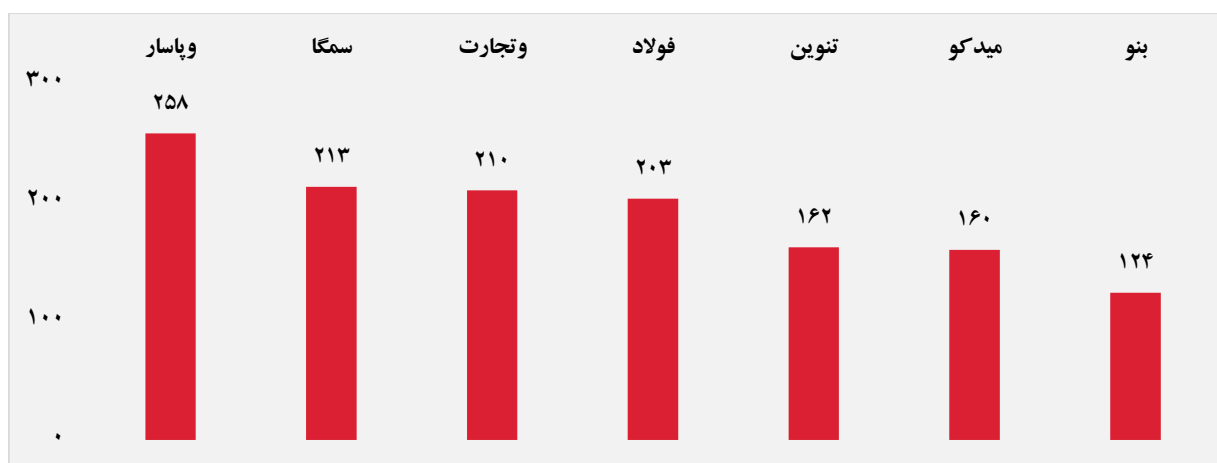
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	غفارس	۱	لابسا
۲	وسکاب	۲	قشرین
۳	دکیمی	۳	وايران
۴	خفنر	۴	چارسا
۵	سمازن	۵	تیمپی
۶	اپرداز	۶	معیار
۷	فگستر	۷	وبرق
۸	سبزوا	۸	غچین
۹	چکارن	۹	خمحور
۱۰	وپویا	۱۰	سیمغ

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



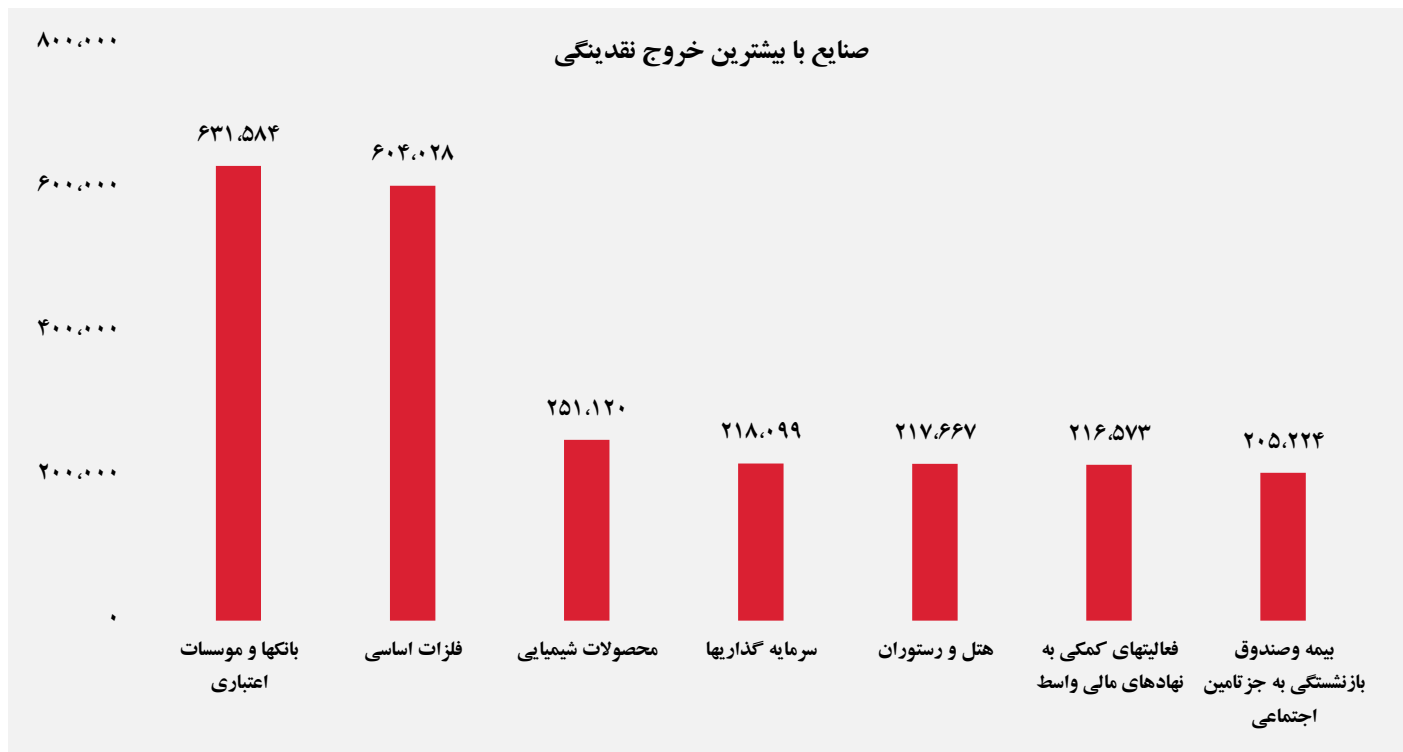
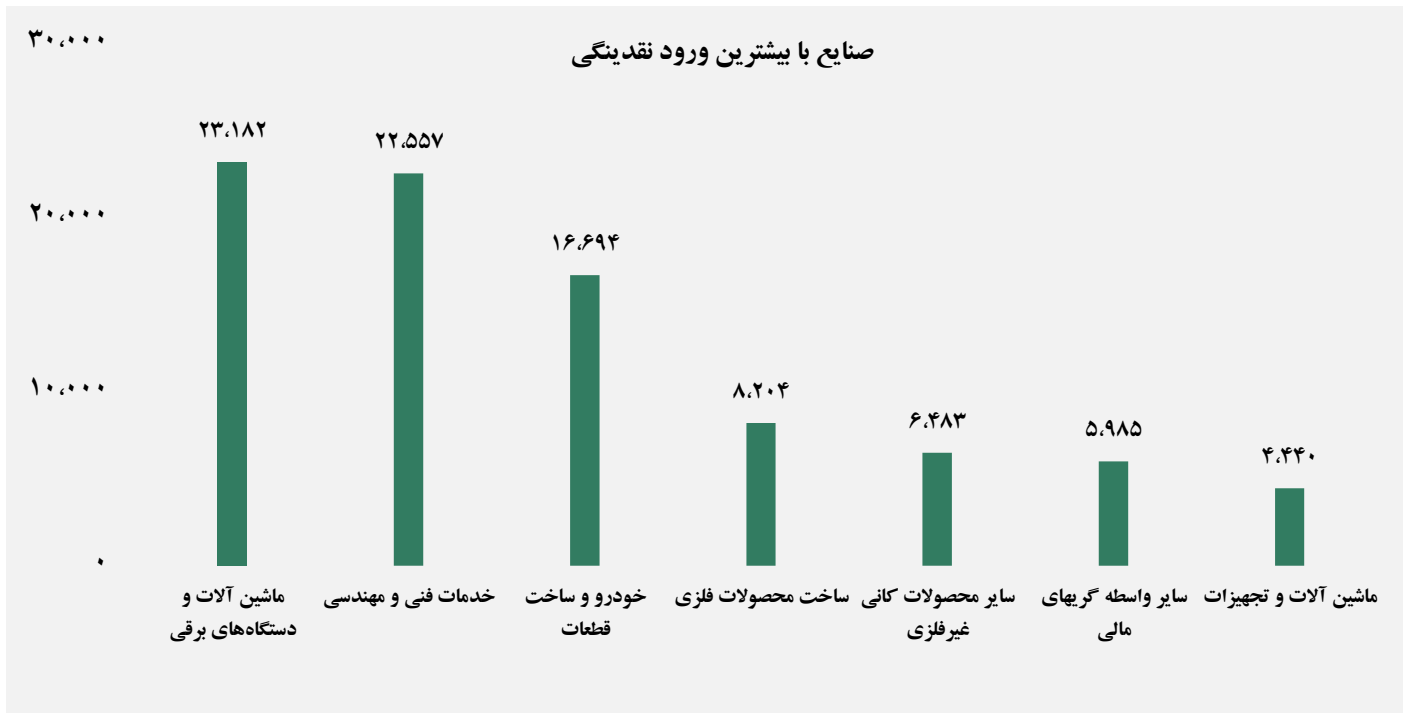
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	سمگا	۱۰	وپست
۲	غکورش	۱۱	گشان
۳	سیمرغ	۱۲	سمازن
۴	غفارس	۱۳	حتاید
۵	ودی	۱۴	خوساز
۶	خموتور	۱۵	سصوفی
۷	فجر	۱۶	خزامیا
۸	وساخت	۱۷	شغدیر
۹	بنو	۱۸	کرغال

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار