



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۲۵

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۲۵ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای سصفها، فملی، وامید، تاپیکو، سکرد و رمینا با کاهش ۴۴ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۵۰,۱۶۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۵۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۴۱ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق‌های قابل معامله سهامی می‌باشد. در اوایل ساعت معاملاتی روز جاری شاهد افزایش تقاضا در کلیت بازار بودیم اما هر چه به انتهای زمان معاملاتی نزدیک شدیم، فروشنده‌گان بر خریداران غلبه کردند و بعضی نمادها نیز با صف فروش به کار خود پایان دادند.

در چند ماه گذشته با شروع نشست‌های سیاسی ایران با کشورهای ۱+۵، بسیاری از سرمایه‌گذاران و فعالین اقتصادی انتظار دلار کمتر از ۱۹۰ هزار ریال را داشتند اما آنچه از وضعیت اقتصادی کشور نمایان است، کاهش بیشتر نرخ دلار دور از واقعیت‌های اقتصادی خواهد بود و حتی اگر تحریم‌های نفتی و مالی نیز برداشته شود، با توجه به اینکه ۳ ماه از سال جاری گذشته و زمان بر بودن درخواست مشتریان جدید برای نفت ایران، باید انتظار کسری بودجه سنگینی بود و اگر تحریم‌ها همچنان ادامه‌دار باشد، وضعیت پول ملی کشور همانند اوایل سال گذشته، مجدداً تضعیف خواهد شد و نرخ برابری ریال به دلار به بیش از ۲۵۰ هزار ریال خواهد رسید. در مجموع انتظار کاهش نرخ دلار و تثبیت آن با توجه به شرایط سیاسی و اقتصادی حاکم، دور از انتظار می‌باشد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۸۳,۲۹۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش 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 ۷۲۲، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۸ با ۲۵,۶٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۲۴	۱۴۰۰/۰۳/۲۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۷۸,۴۹۵	۸۳,۲۹۱	-۵۳٪

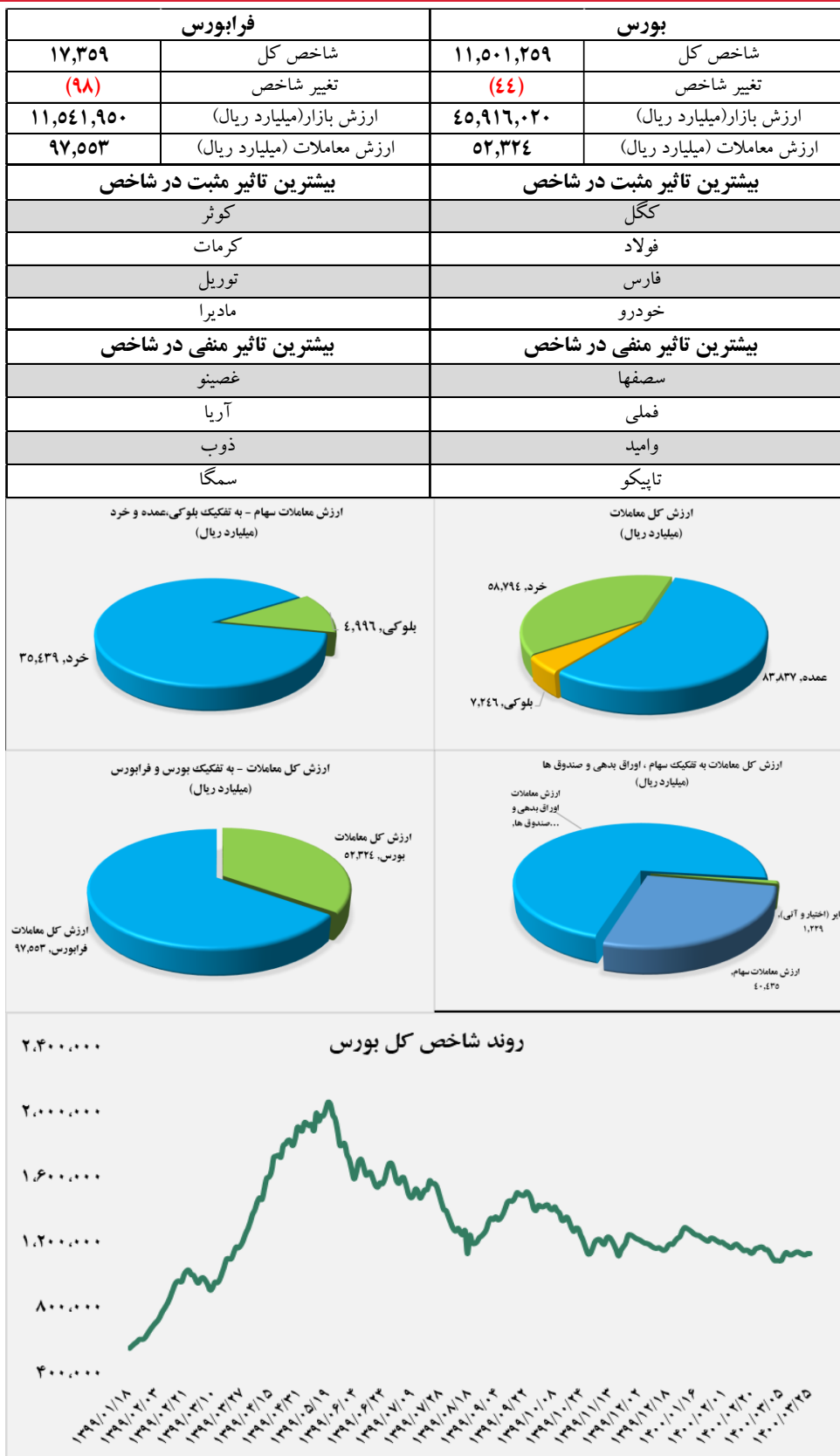


گروه‌های مؤثر

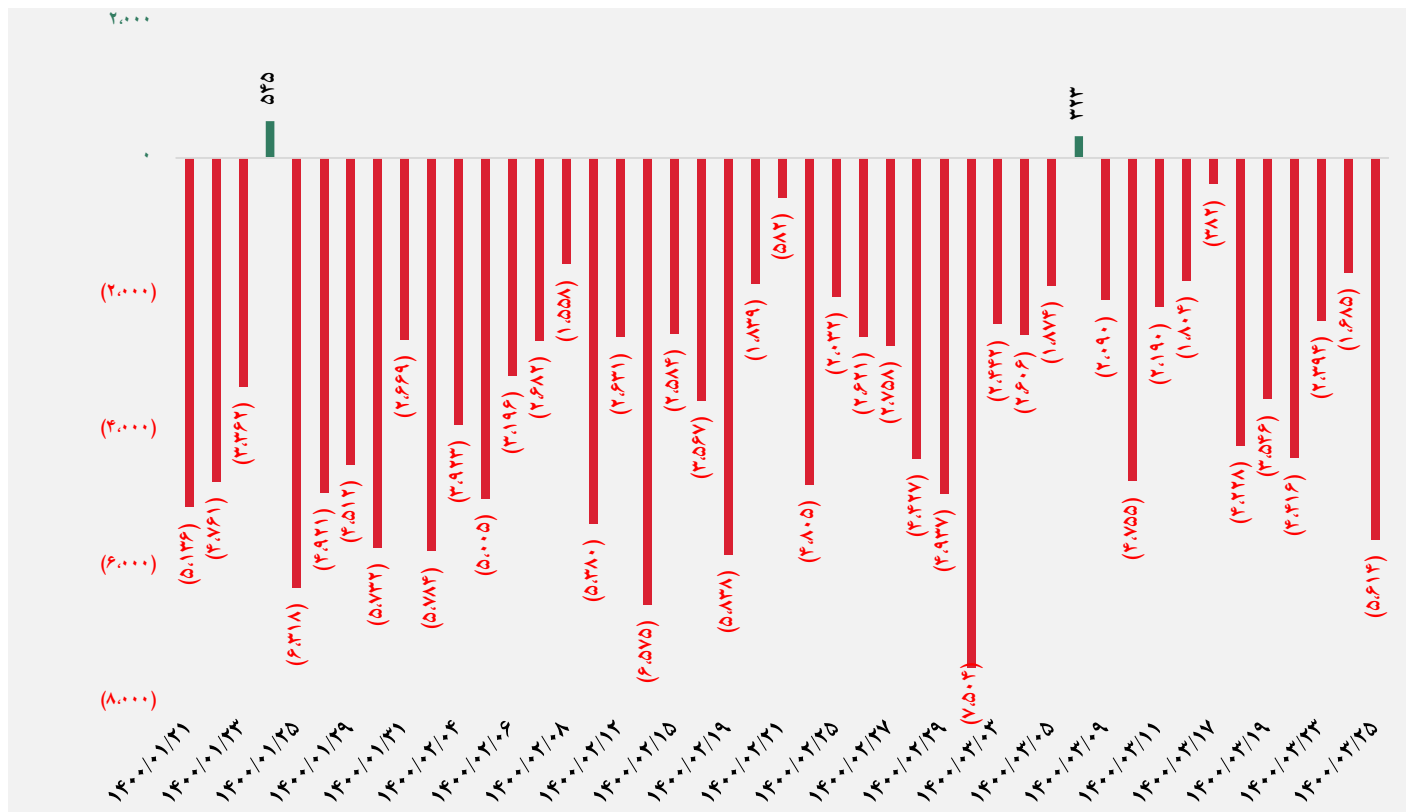
در گروه ساخت محصولات فلزی، شرکت لامیران سال مالی منتهی به شهریور ماه دارد. این شرکت در اردیبهشت ۸ میلیون تیغ صورت تراشی و ۲۹۰ هزار تیغ یکبار مصرف تولید کرده است. متوسط تولید ۷ ماه گذشته برای این دو محصول به ترتیب ۱۱ میلیون و ۶۵۴ هزار عدد محصول بوده است. این تولید کننده انواع تیغ در اردیبهشت ۱۳ میلیون تیغ صورت تراشی و ۵۶۲ هزار عدد تیغ یکبار مصرف فروخته است. متوسط فروش مهر ماه تا فروردین برای این دو محصول به ترتیب ۱۰ میلیون و ۵۸۲ هزار محصول بوده است. شرکت در اردیبهشت ماه ۸ میلیارد تومان فروش داشته است. متوسط فروش ماهانه به استثنای فروردین و دی ماه ۷ میلیارد تومان گزارش شده است. نرخ فروش تیغ صورت از مهر تاکنون حدود ۵ هزار ریال به ازای هر محصول و نرخ فروش تیغ یکبار مصرف نیز در ۷ ماه گذشته حدود ۱۹ هزار ریال و نرخ اردیبهشت ماه ۲۲ هزار ریال به ازای هر محصول بوده است. این نرخ‌ها در سال مالی قبل به طور متوسط ۳۲۲۳ ریال و ۱۵۸۷۸ ریال به ازای هر محصول گزارش شده است.

در گروه شیمیایی، شرکت بین المللی محصولات پارس سال مالی منتهی به شهریور دارد. میانگین تولید ماهانه محصولات پودر و مایعات البسه در سال مالی ۹۹، ۳۵۱۱ تن بوده است. میانگین تولید شش ماهه سال مالی ۱۴۰۰ به ۳۳۲۰ تن رسیده و در فروردین و اردیبهشت ماه به ترتیب ۶۶۳ و ۲۰۶۰ تن تولید گزارش شده است. فروش پودر و مایعات البسه در فروردین ۱۰۲۹ تن و در اردیبهشت ماه ۲۸۹۶ تن گزارش شده است. میانگین فروش سال مالی ۹۹، ۴۳۳۷ تن و میانگین ۶ ماهه سال مالی جاری نیز ۴۲۹۵ تن می باشد. این شرکت در بهمن و اسفند ماه فروش‌های ۷۲ و ۷۱ میلیارد تومانی داشته است و میانگین فروش ماهانه سال مالی گذشته ۴۱ میلیارد تومان و میانگین ۶ ماهه سال مالی جاری ۶۳ میلیارد تومان است. در اردیبهشت ۵۴ میلیارد تومان فروش گزارش شده است. میانگین نرخ فروش پودر و مایعات البسه در سال مالی ۹۹، ۸۲۸۹۷ ریال بوده و در فروردین فروش شرکت با نرخ ۱۲۱۹۸۶ ریال و در اردیبهشت با ۱۲۸۳۹۶ ریال انجام شده است.

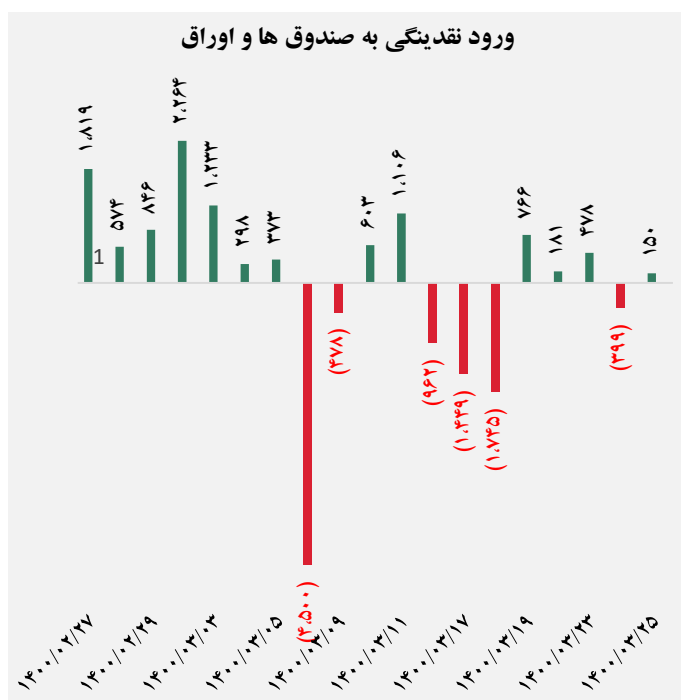
تصویر کلی بازار



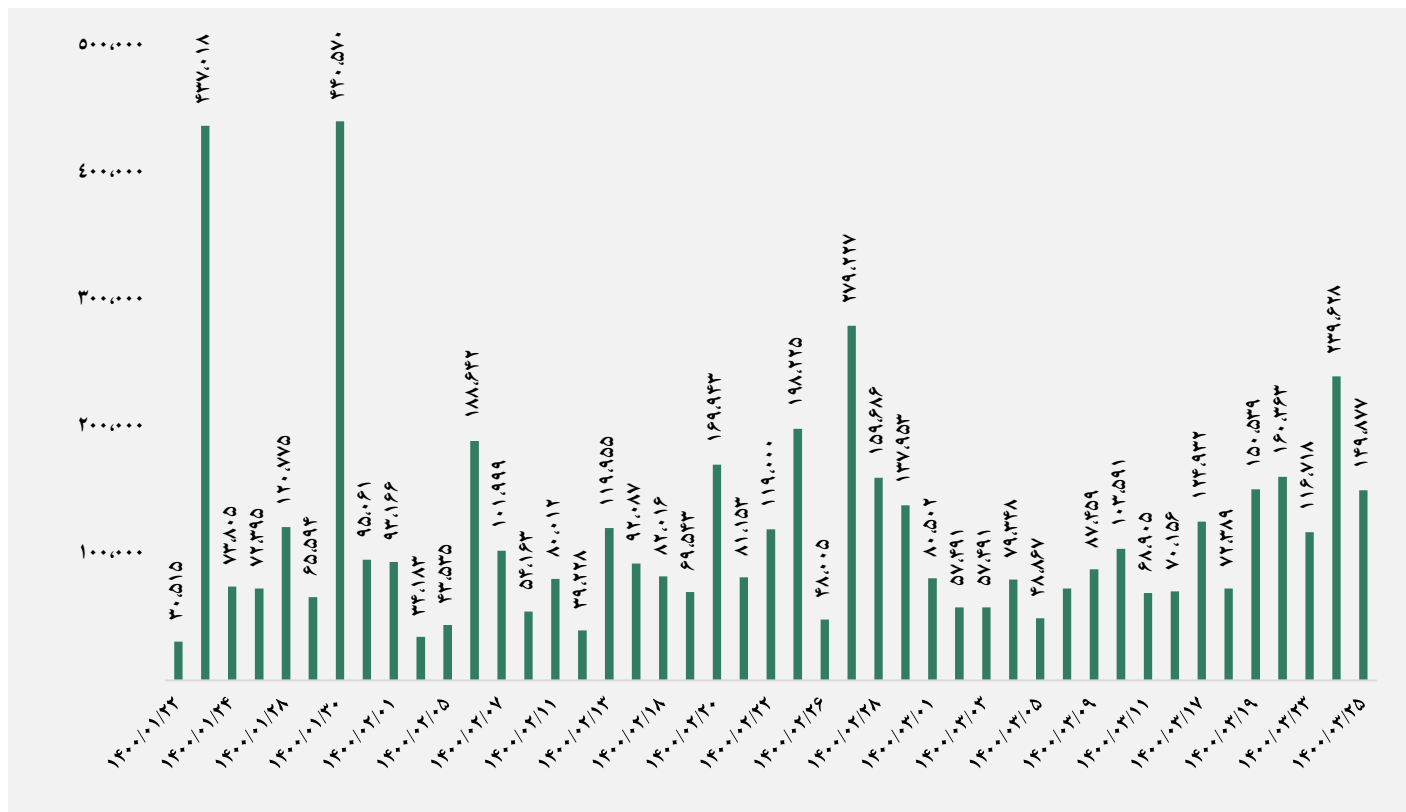
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



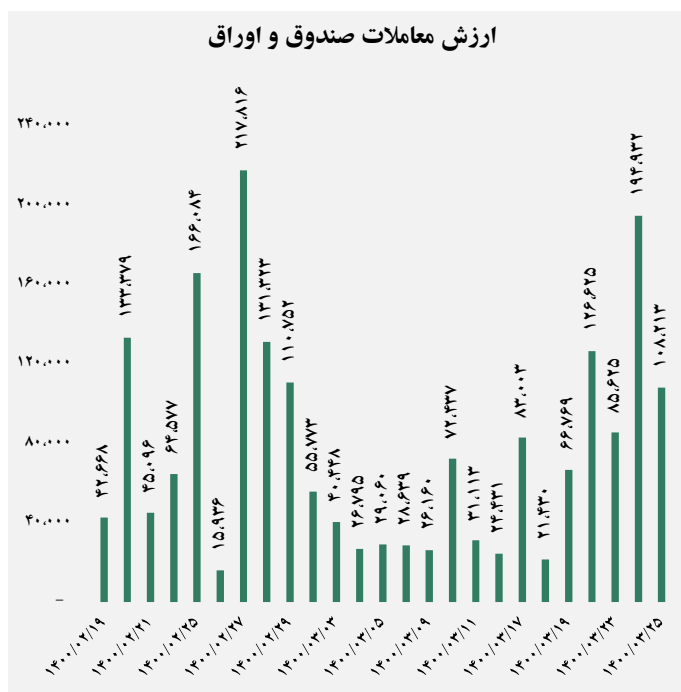
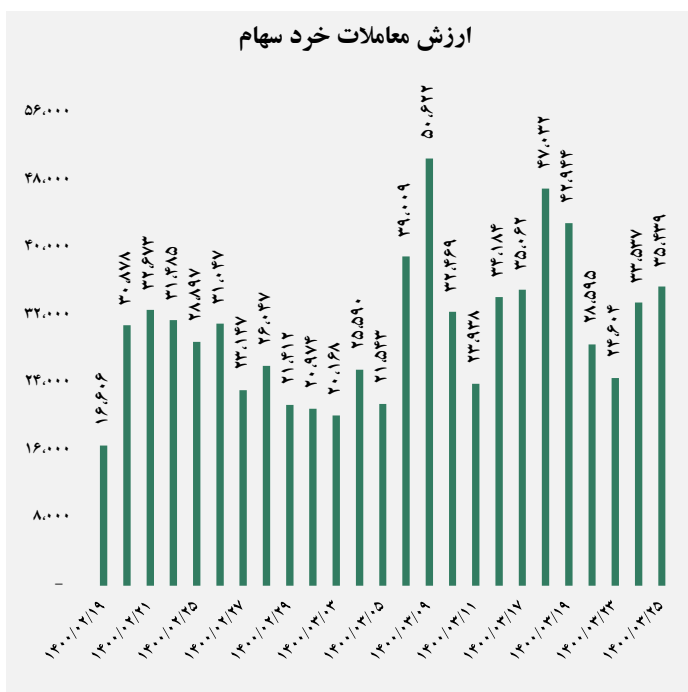
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

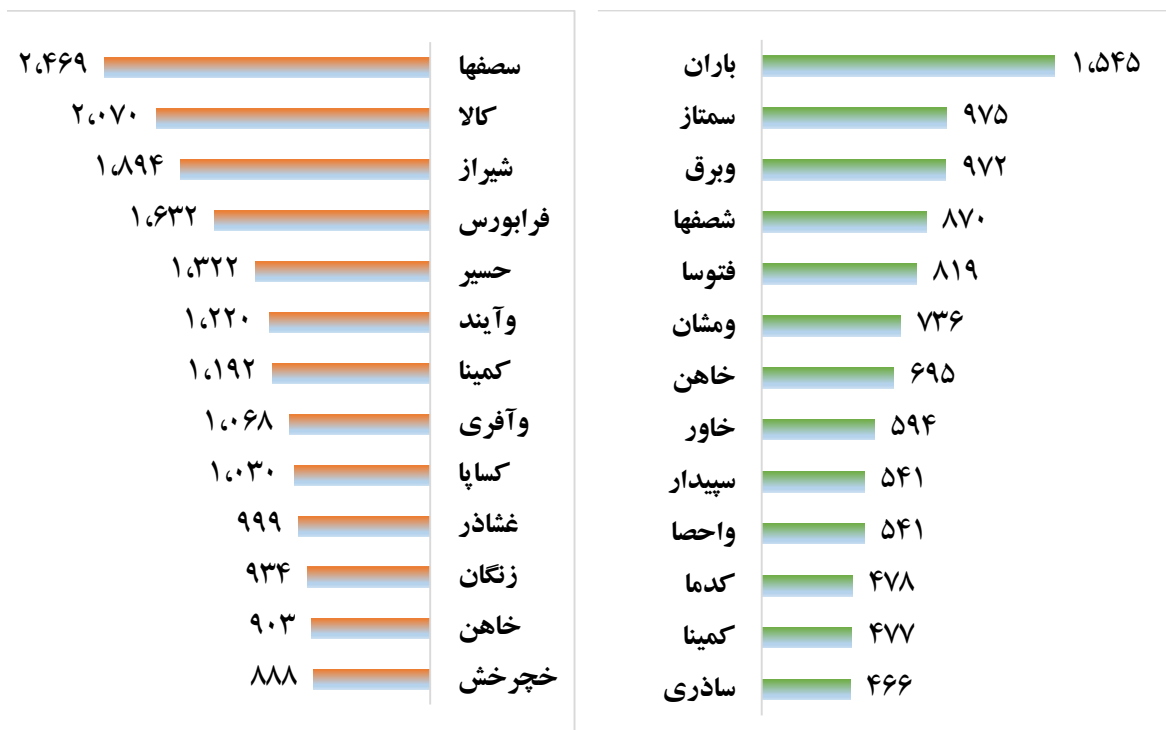


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





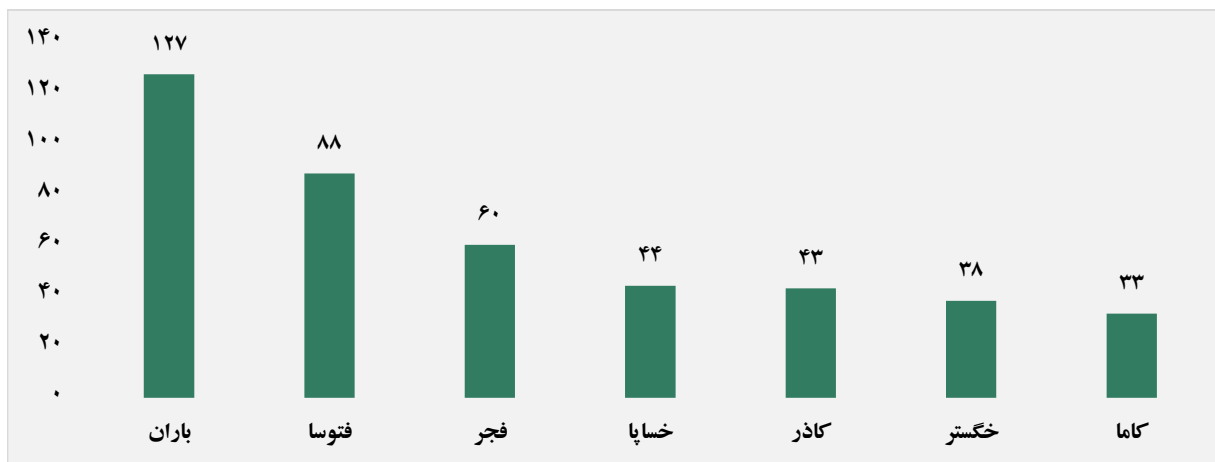
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



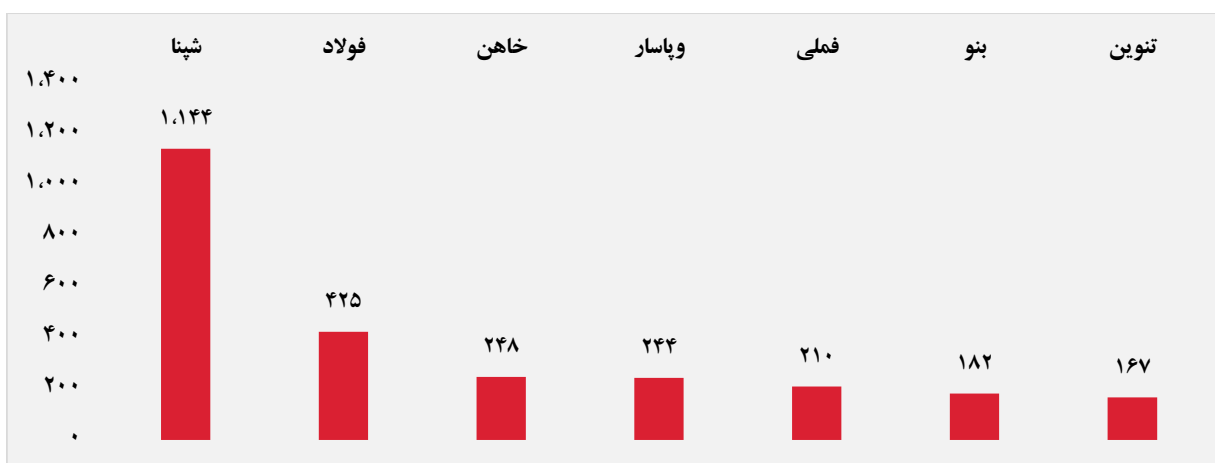
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	باران	۱	شپنا
۲	فتوسا	۲	خاهن
۳	فجر	۳	تنوین
۴	کاذر	۴	سمگا
۵	سپیدار	۵	شیراز
۶	فگستر	۶	پکویر
۷	غگلپا	۷	خودرو
۸	سمایه	۸	فراپورس
۹	زگلدشت	۹	غصینو
۱۰	خریخت	۱۰	وآفری

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



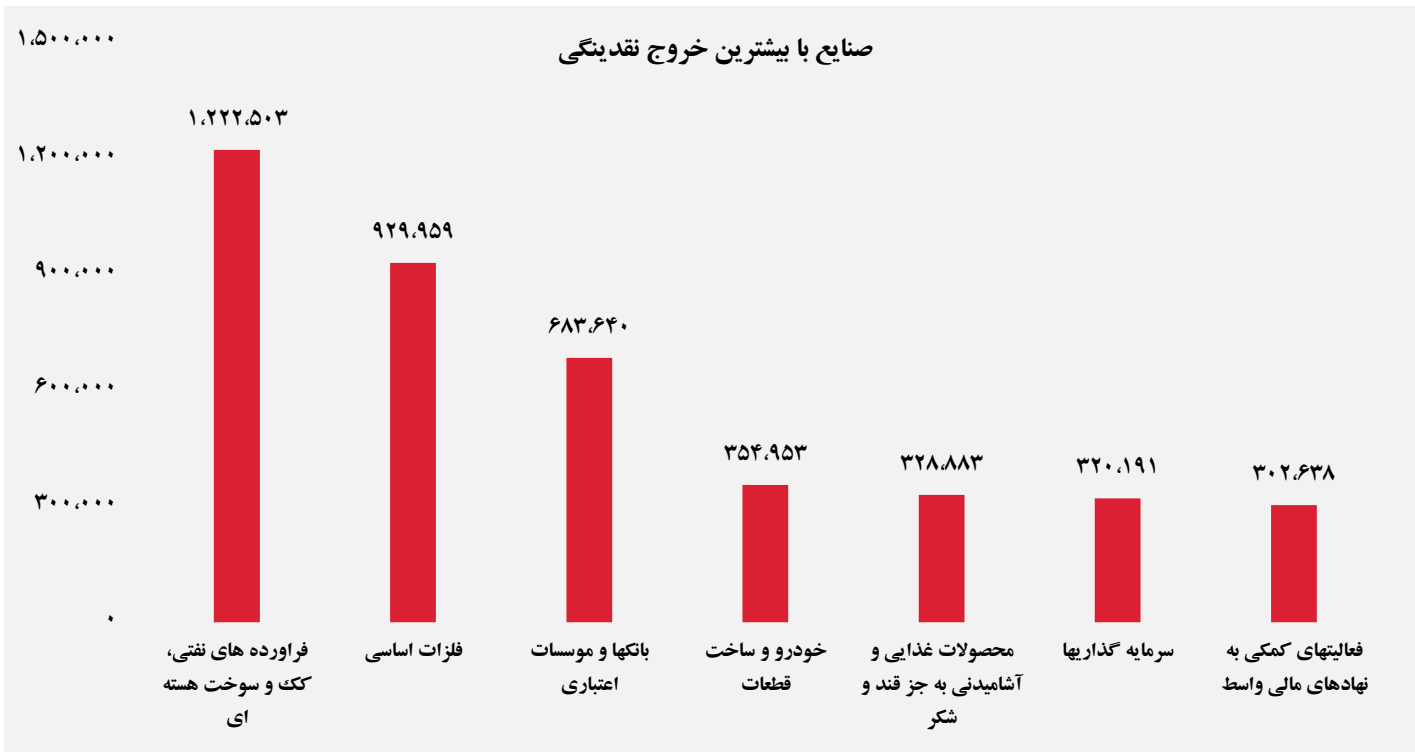
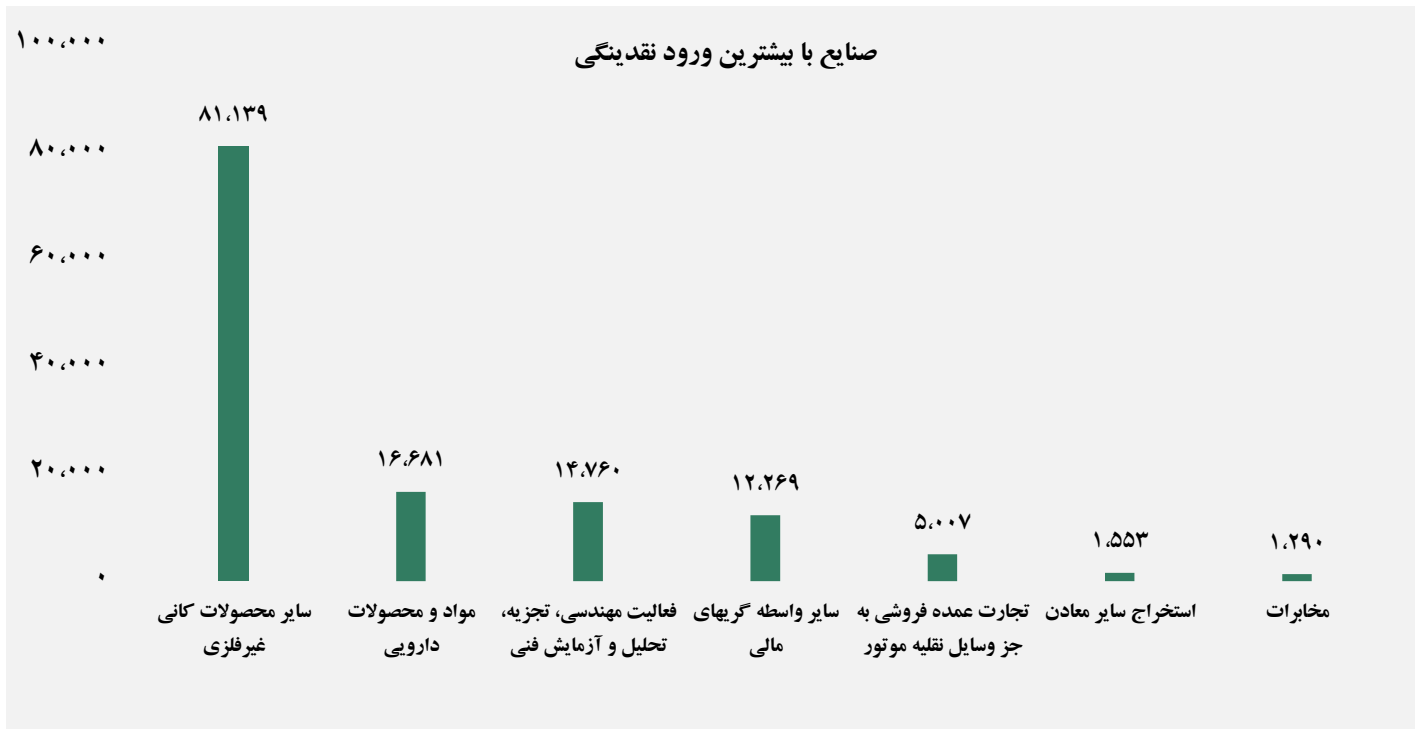
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فزرین	۱۰	شغدیر
۲	غکورش	۱۱	غفارس
۳	کسرا	۱۲	وساخت
۴	باران	۱۳	سیمرغ
۵	بنو	۱۴	کزغال
۶	سمگا	۱۵	کیما
۷	خاهن	۱۶	شرانل
۸	فجر	۱۷	خگستر
۹	ساراب	۱۸	گشان

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار