



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۳۰

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۳۰ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، شستا، فارس، نوری، و تجارت و جم با افزایش ۱,۶۹۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۶۳,۷۲۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۳۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۴۶ 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 بعضی از نمادها در گروه شیمیایی و بانک با افزایش تقاضا همراه بودند اما کلیت بازار همانند روزهای معاملاتی گذشته به صورت متعادل رو به پایین به کار خود پایان داد.

بازار بعد از انتخابات و با توجه به این که یک دوره طولانی مدت افت و بی‌تعادلی را گذرانده است به لحاظ تکنیکالی باید شاهد روند متعادل رو به مثبت در آن باشیم زیرا به نظر می‌رسد ریزش بیشتر قیمت در کلیت نمادها در بازار سهام به اتمام رسیده باشد. البته این روند به یک باره رخ نمی‌دهد و با رشد ملایمی شاخص کل تا شهریور ماه انتظار می‌رود یک دوره صعودی جدید را تجربه کند و از حوالی یک میلیون و ۳۰۰ واحد بگذرد که این عدد به هیچ وجه دور از انتظار نیست. همچنین با توجه به فروش ماهانه‌ها در فصل بهار سال جاری، انتظار می‌رود گزارش سه ماهه اکثر شرکت‌ها در گروه‌های فلزات اساسی، شیمیایی، فرآورده‌های نفتی، بانک و سیمان نسبت به سه ماهه اول سال گذشته با رشد مناسبی همراه باشند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۷۰,۴۳۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش 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 ۷۱۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۰۷ با ۲۷,۴٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۲۹	۱۴۰۰/۰۳/۳۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۸۷,۴۱۶	۷۰,۴۳۶	-۱۹٪



گروه‌های مؤثر

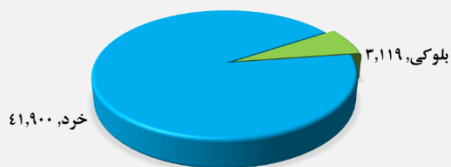
در گروه سایر محصولات کانی غیرفلزی، شرکت سرمایه‌های صنعتی اردکان در ۹ ماهه سال مالی گذشته ۱۴۰ میلیارد تومان فروش داشت که در ۱۲ ماهه فروش خود را به ۱۹۳ میلیارد تومان رسانده که فروش فصل زمستان نسبت به پاییز تغییر چندانی نداشته است در حالی که بهای تمام شده شرکت نسبت به فصل گذشته رشد ۸ درصدی را تجربه کرده است. این تولید کننده در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب حاشیه سود ۴۷، ۴۳ و ۴۹ درصدی داشته که در فصل چهارم حاشیه سود ۴۵ درصدی را گزارش داد. سود هر سهم کسرا در سه فصل اخیر ۱۱۵، ۱۶۰ و ۱۸۸ ریال بوده که در فصل چهارم حاشیه سود ۴۵ درصدی را ثبت کرده است. سود هر سهم کسرا در سه فصل اخیر ۱۱۵، ۱۶۰ و ۱۸۸ ریال بوده که در فصل چهارم با ۱۳۴ درصد افزایش نسبت به فصل سوم سود ۴۴۱ ریالی را گزارش کرده و سود هر سهم خود را در ۱۲ ماهه به ۹۰۴ ریال رسانده و در صورت مالی تلفیقی نیز سود ۱۱۰۶ ریالی را گزارش کرده است.

در گروه فلزات اساسی، شرکت تولیدی فولاد سپید فراب کویر در ۹ ماهه ۵۵۶۷ میلیارد تومان فروش داشت و فروش خود را ۱۲ ماهه به ۷۹۸۷ میلیارد تومان رسانده که فروش فصل زمستان نسبت به پاییز افت ۹ درصدی داشته است. اما بهای تمام شده شرکت نسبت به فصل قبل رشد ۴ درصدی را تجربه کرده است. این تولید کننده در فصل اول، دوم و سوم به ترتیب حاشیه سود ۲۳، ۳۰ و ۲۴ درصدی داشته که در فصل چهارم حاشیه سود ۱۳ درصدی را گزارش داد. سود هر سهم شرکت تولیدی فولاد سپید فراب کویر در سه فصل اخیر ۲۰۰، ۵۲۶ و ۵۳۸ ریال بوده که در فصل چهارم با ۵۵ درصد کاهش نسبت به فصل سوم، سود ۲۴۳ ریالی را گزارش کرده و سود هر سهم خود را در ۱۲ ماهه به ۱۵۰۸ ریال رسانده است.

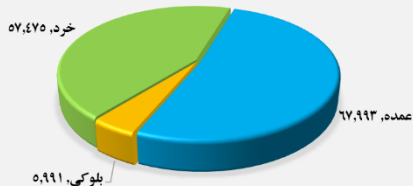
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۲۸۴	شاخص کل	۱,۱۶۳,۷۲۳	شاخص کل
(۲۸)	تغییر شاخص	۱,۶۹۱	تغییر شاخص
۱۱,۴۷۱,۱۳۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۶,۴۵۸,۳۲۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۸۱,۳۰۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۰,۱۵۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
شگویا		شستا	
غصینو		فارس	
کوثر		نوری	
فرا بورس		و تجارت	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
آریا		فملی	
تبرک		خودرو	
زاگرس		خسپا	
سمگا		ویملت	

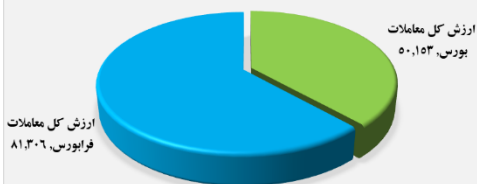
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد (میلیارد ریال)



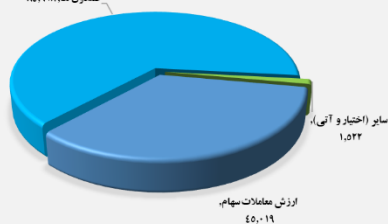
ارزش کل معاملات (میلیارد ریال)



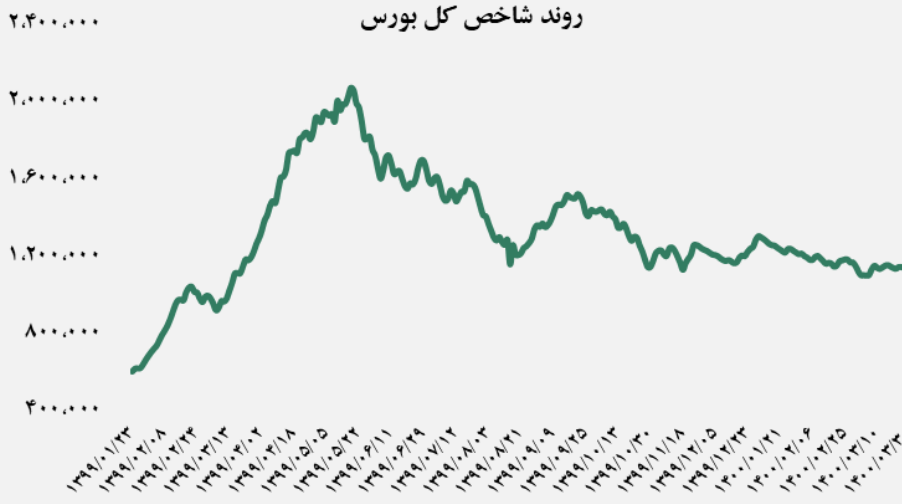
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس (میلیارد ریال)



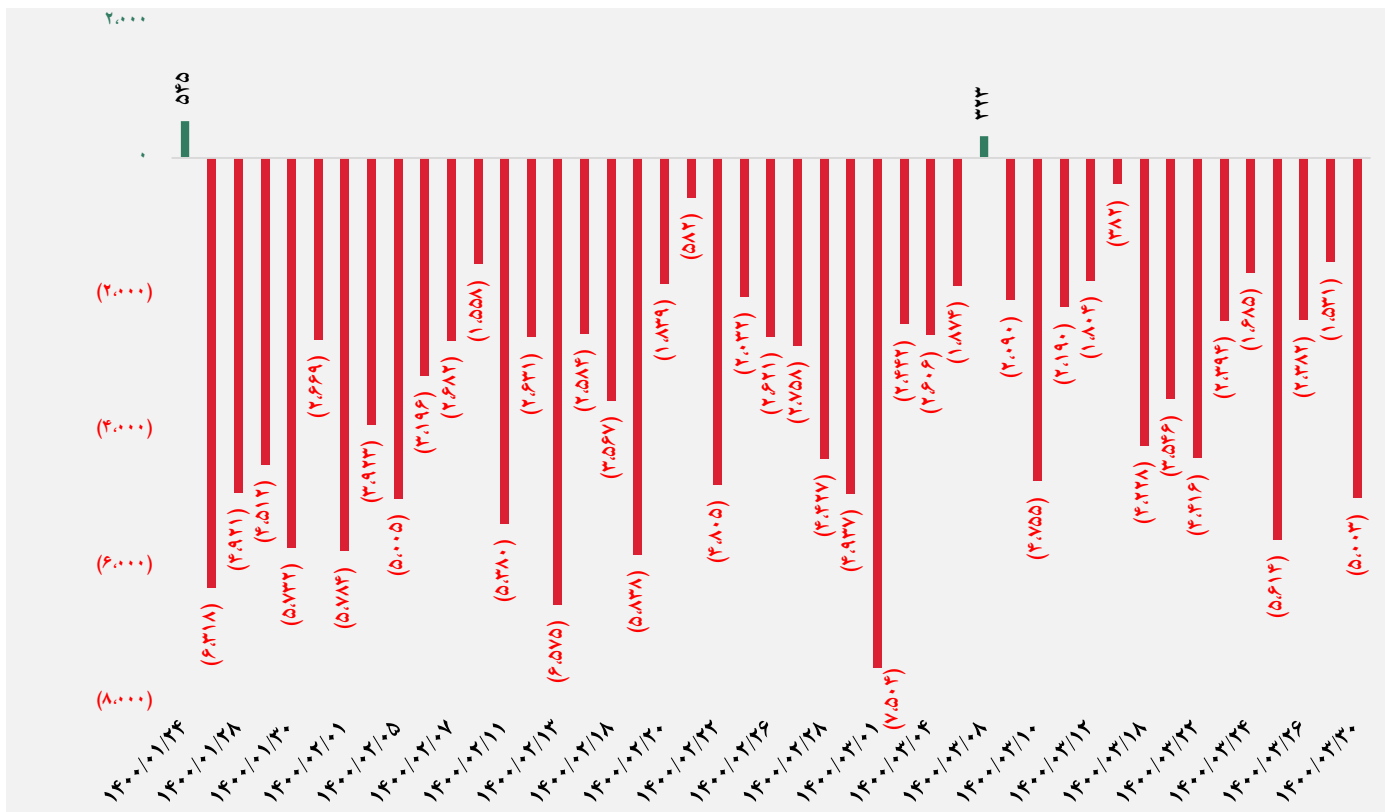
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها (میلیارد ریال)



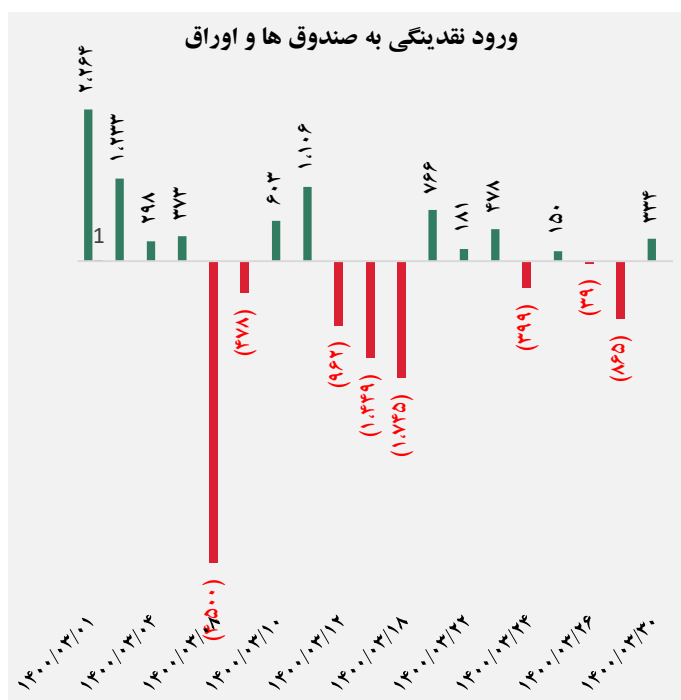
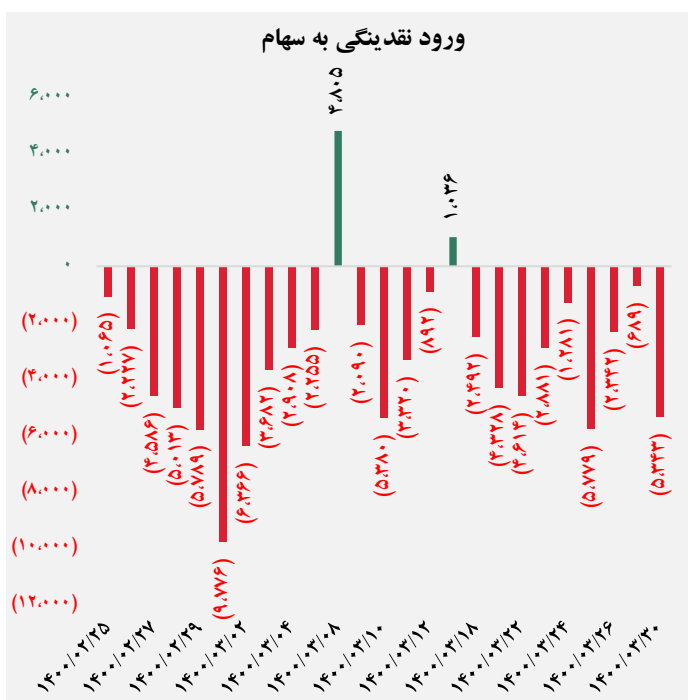
روند شاخص کل بورس



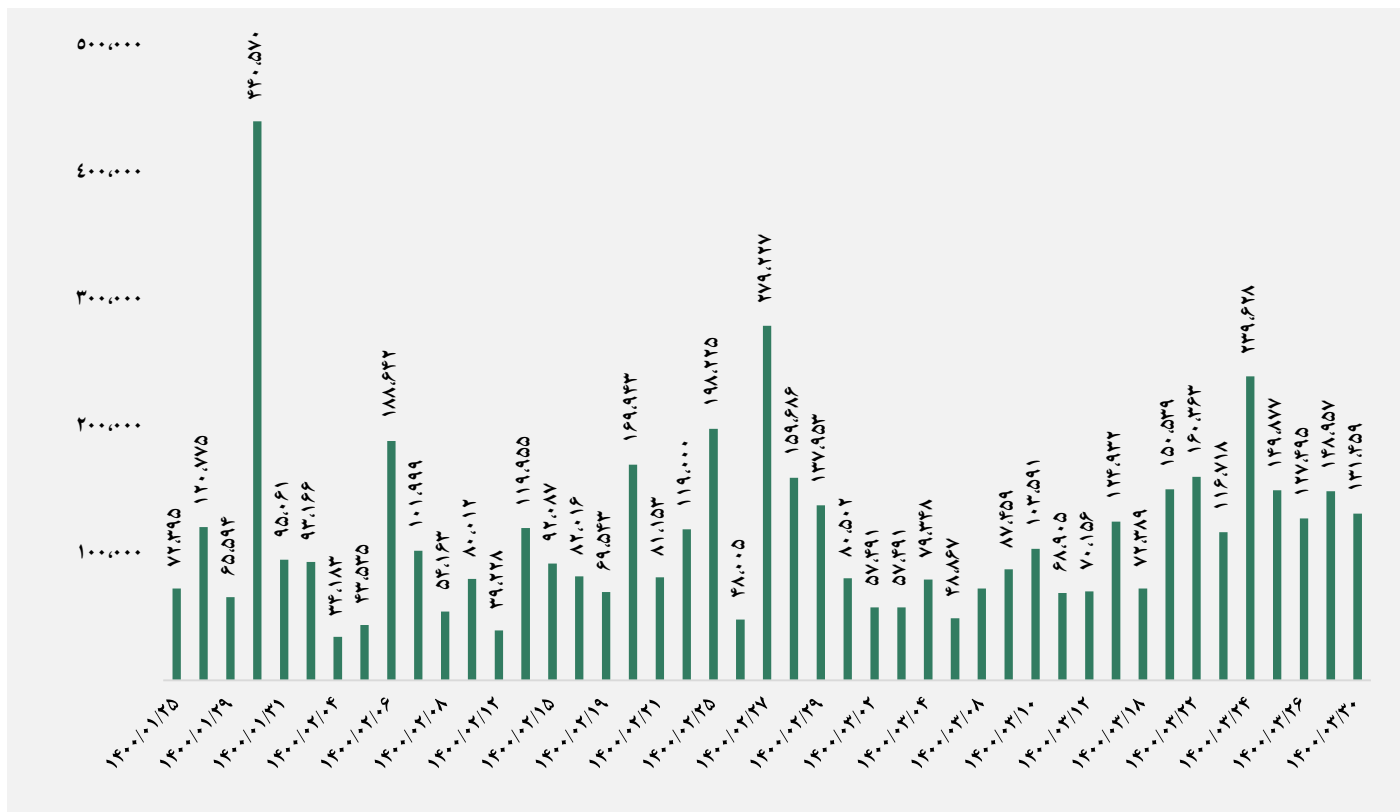
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



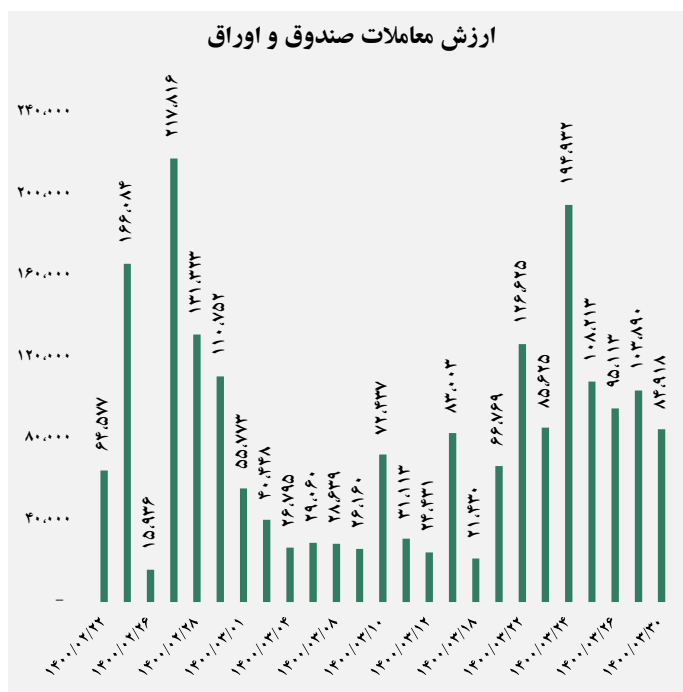
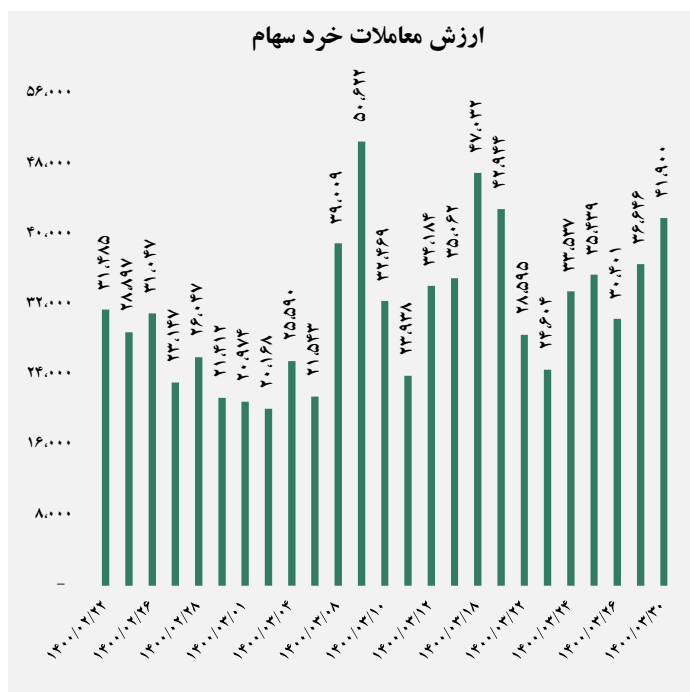
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

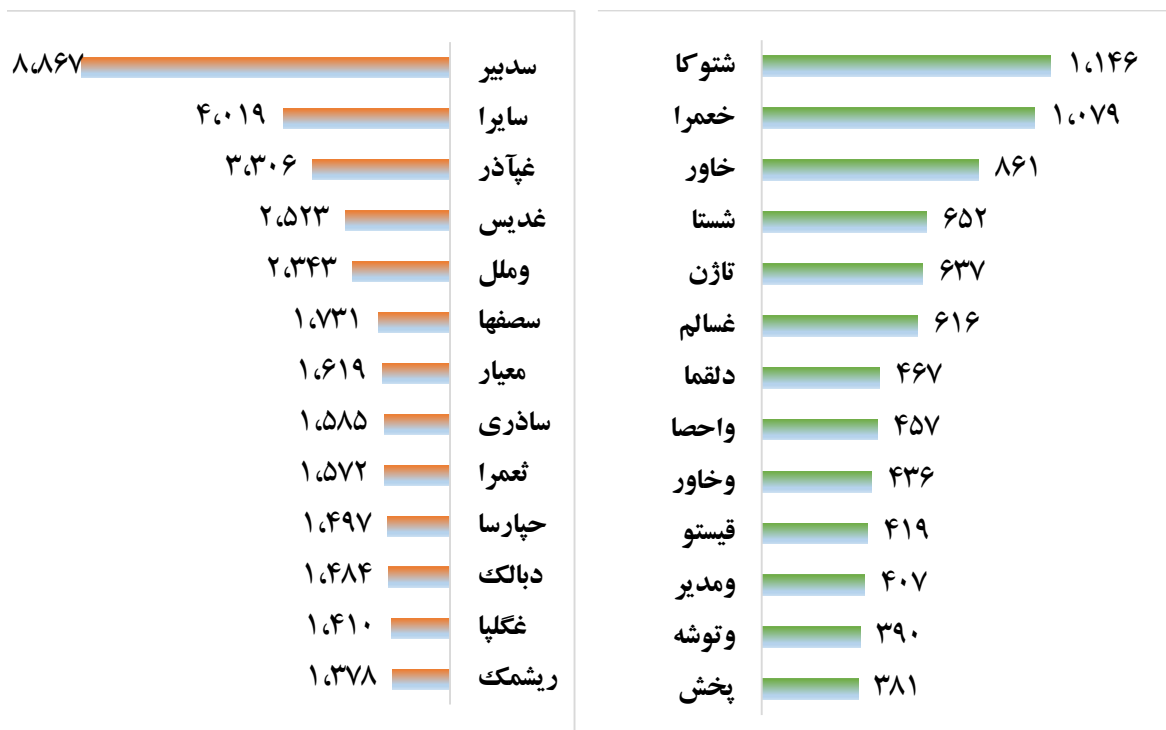


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





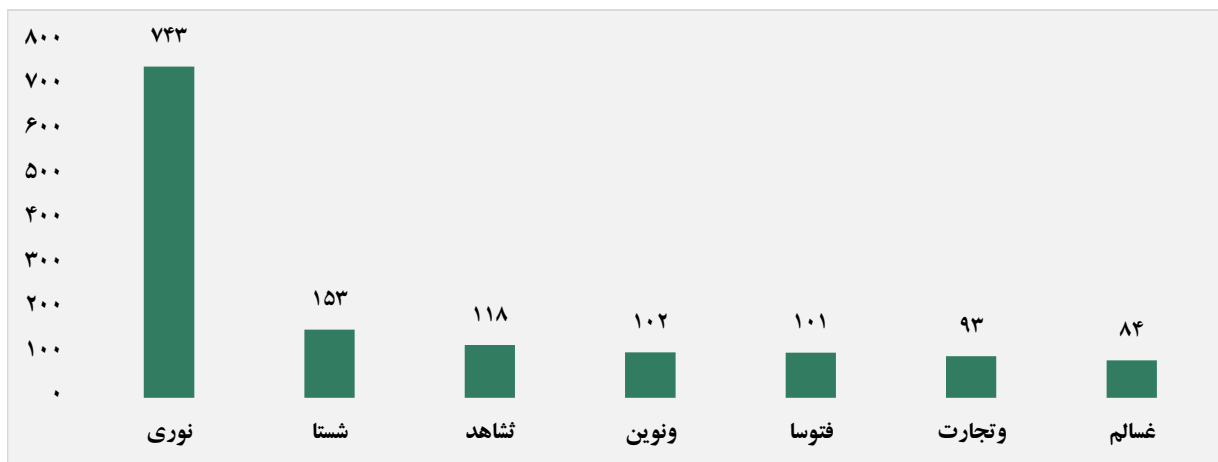
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



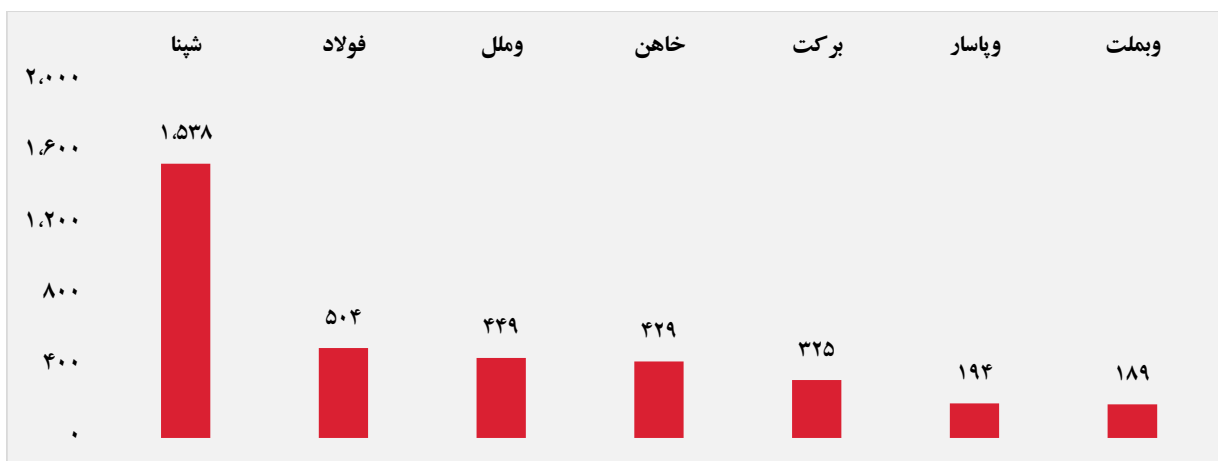
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شستا	۱	شپنا
۲	ثشاهد	۲	فولاد
۳	ونوین	۳	خاهن
۴	فتوسا	۴	سامان
۵	غسالم	۵	وآیند
۶	سپ	۶	شبریز
۷	چدن	۷	شپدیس
۸	ساروج	۸	سمگا
۹	وتوشه	۹	خودکفا
۱۰	خصدرا	۱۰	شکیر

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

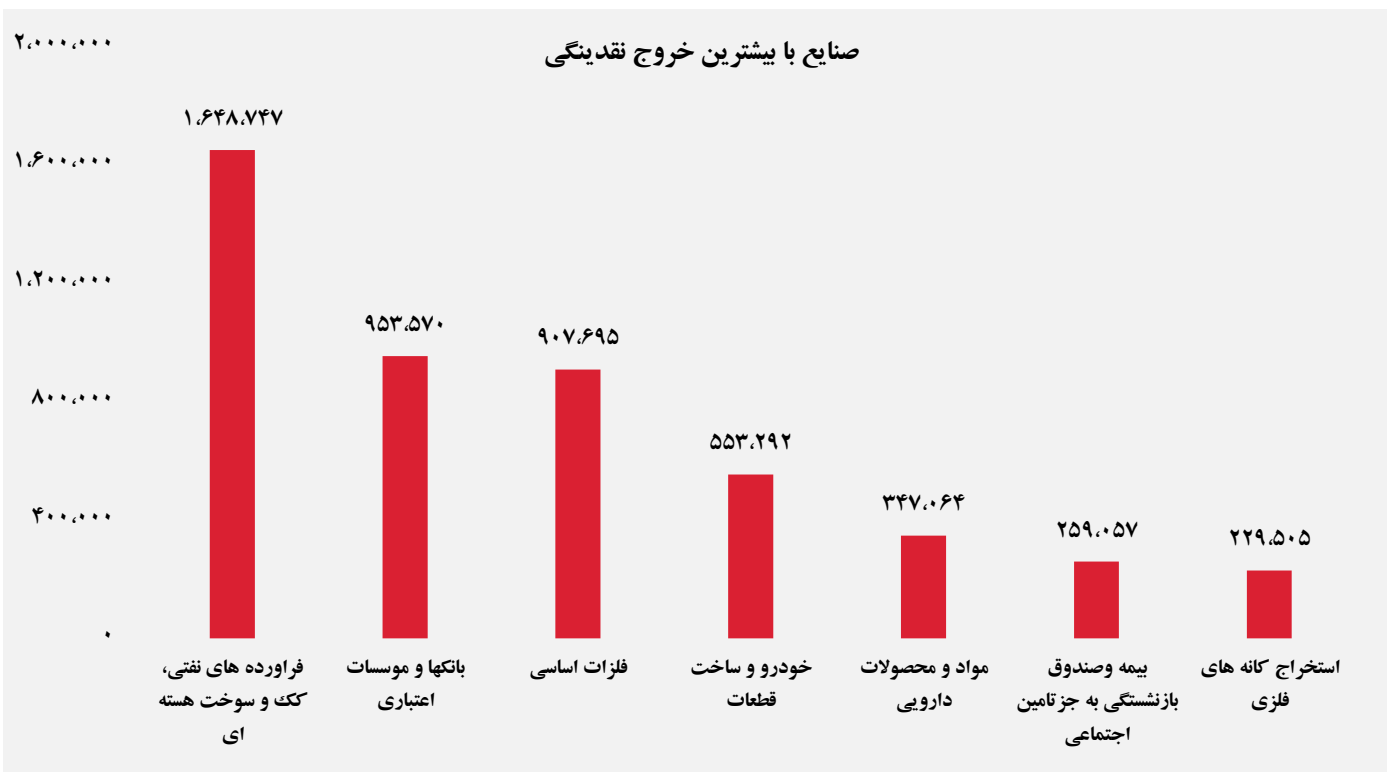
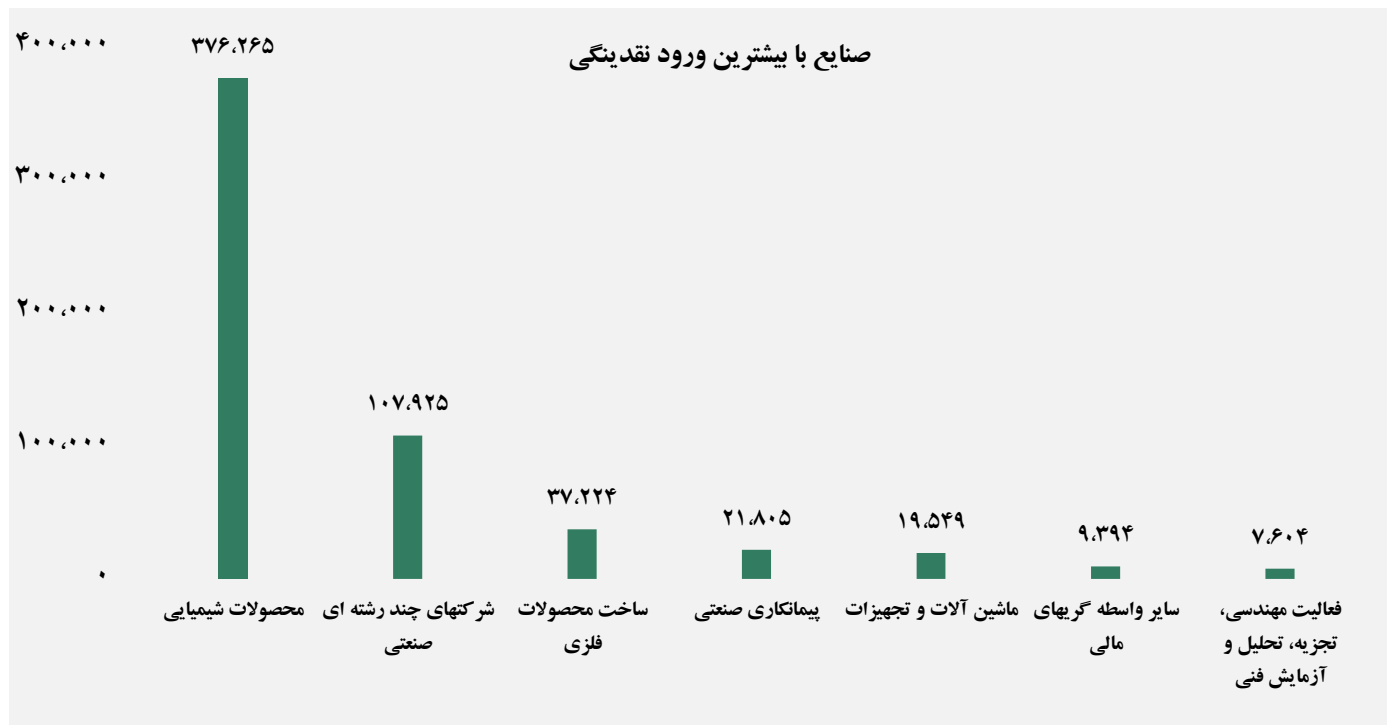


واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	شاهد
۲	نوری	۱۱	خاهن
۳	وساخت	۱۲	خزامیا
۴	فراپورس	۱۳	فجر
۵	غکورس	۱۴	کفپارس
۶	کالا	۱۵	حتاید
۷	فرزین	۱۶	وملل
۸	شپلی	۱۷	ودی
۹	کیمیا	۱۸	شغدیر



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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر