



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۳/۳۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۳۱ خرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شستا، تجارت، رمینا، فارس، خودرو و وبصادر با افزایش ۴,۸۳۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۱۶۸,۵۹۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۸۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش 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 روز جاری بیشتر نمادها در گروه بانک و خودرو با افزایش تقاضا همراه بودند و کلیت بازار نیز در نیمه دوم زمان معاملاتی با افزایش تقاضا همراه شدند.

از نظر تحلیل نموداری، شاخص کل در روز جاری توانسته از سقف کوتاه مدتی قبلی خود که در اواسط ماه جاری تشکیل داده بود، عبور کند. در روند کوتاه مدت، شاخص کل تا محدوده ۱,۱۹۰,۰۰۰ الی ۱,۲۰۰,۰۰۰ واحد مقاومت مهمی را پیش رو ندارد و می‌تواند در روزهای آتی تا این محدوده نیز رشد داشته باشد. با عبور از محدوده ذکر شده، تغییر روند کلی بازار نیز به وضوح نمایان خواهد شد. به نظر می‌رسد در آن محدوده از شاخص کل، حجم و ارزش معاملات به مراتب افزایش پیدا می‌کند و بسیاری از فعالین بازار که از چند وقت گذشته فروشنده سهام خود بودند، در آن محدوده به احتمال فراوان به بازار سهام بخواهند گشت و به امید فتح قله ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد در شاخص کل اقدام به خرید خواهند کرد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۹۵,۷۳۵ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۳۲۴، 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 ۷۱۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۲۵ با ۲۲,۶٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۳/۳۰	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۷۰,۴۳۶	۹۵,۷۳۵	۳۶٪



گروه‌های مؤثر

در گروه فرآورده‌های نفتی، شرکت نفت ایرانول در مجمع عادی سالانه در روز گذشته، ۵۰۰ تومان سود به ازای هر سهم (معادل ۹۱ درصد سود هر سهم سال گذشته) را تقسیم نمود. در ادامه به موضوعات مهم مطرح شده در مجمع خواهیم پرداخت.

➤ پروژه موم‌گیری تهران تاکنون حدود ۲۵ درصد پیشرفت داشته است و تا پایان سال جاری به اتمام می‌رسد. این پروژه بازگشت سرمایه ۸ ماهه دارد. پروژه موم‌گیری آبادان نیز از اواخر سال جاری شروع و تا پایان سال ۱۴۰۱ به اتمام خواهد رسید.

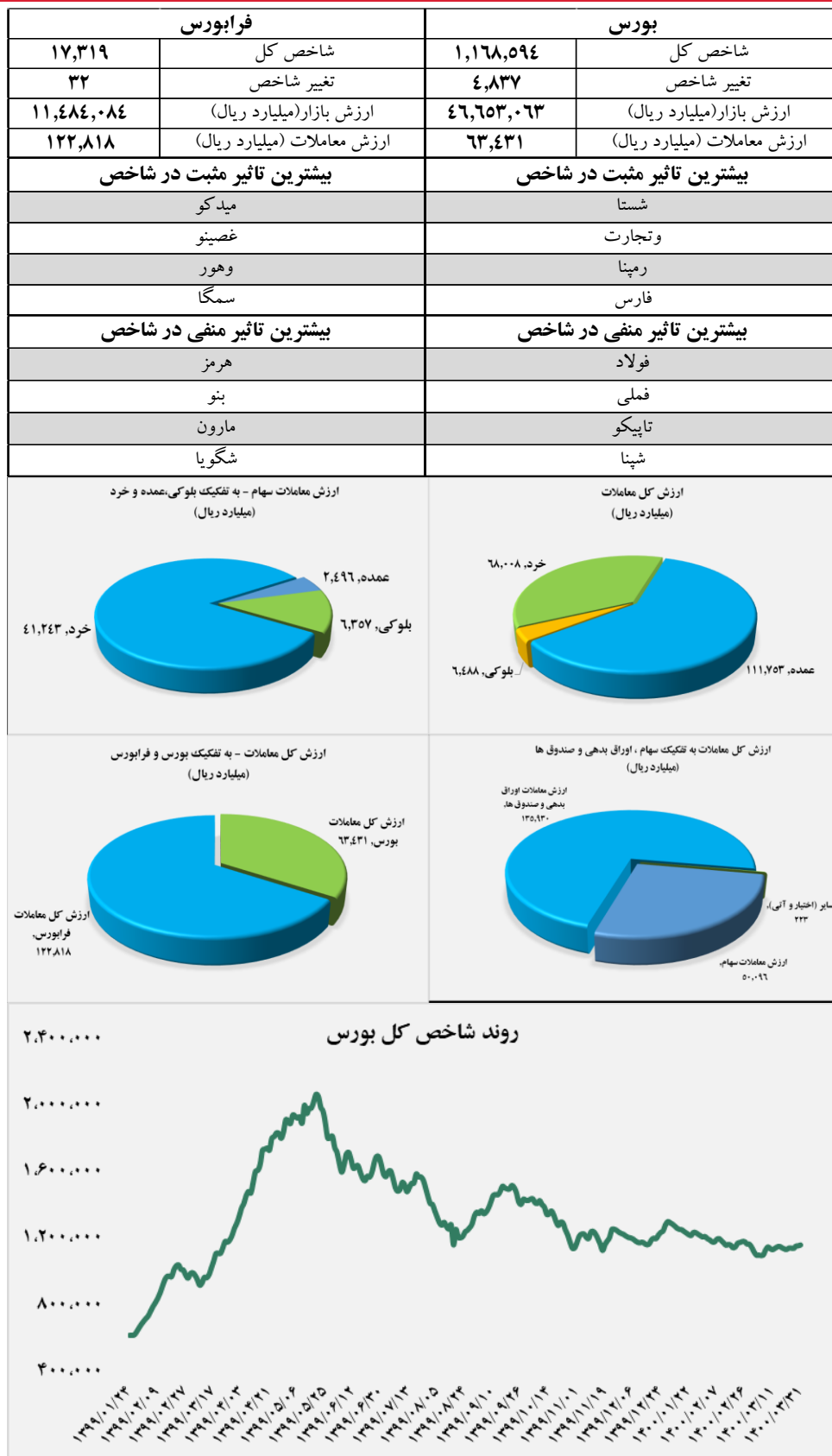
➤ با توجه به حجم خرید بالای بشکه، خط تولید بشکه سازی توسط شرکت تا اواخر شهریور ماه راه اندازی می‌شود. شرکت در آبادان نیز قصد راه اندازی خط بشکه سازی دارد.

➤ متوسط نرخ لوبکات در سه ماه اول سال گذشته ۲ هزار تومان و سه ماهه اول سال جاری بین ۹ الی ۱۰ هزار تومان در هر کیلو بوده است. شرکت‌های روغن ساز، برای افزایش نرخ روغن موتور باید بتوانند رضایت سازمان حمایت را داشته باشند و مذاکرات لازم با تمام حوزه‌های مرتبط انجام شده و قرار بر آن است که در تیر ماه در این مورد تصمیم‌گیری نهایی شود. احتمالاً برای سال جاری در دو مرحله افزایش قیمت محصولات روغنی در نظر گرفته شود.

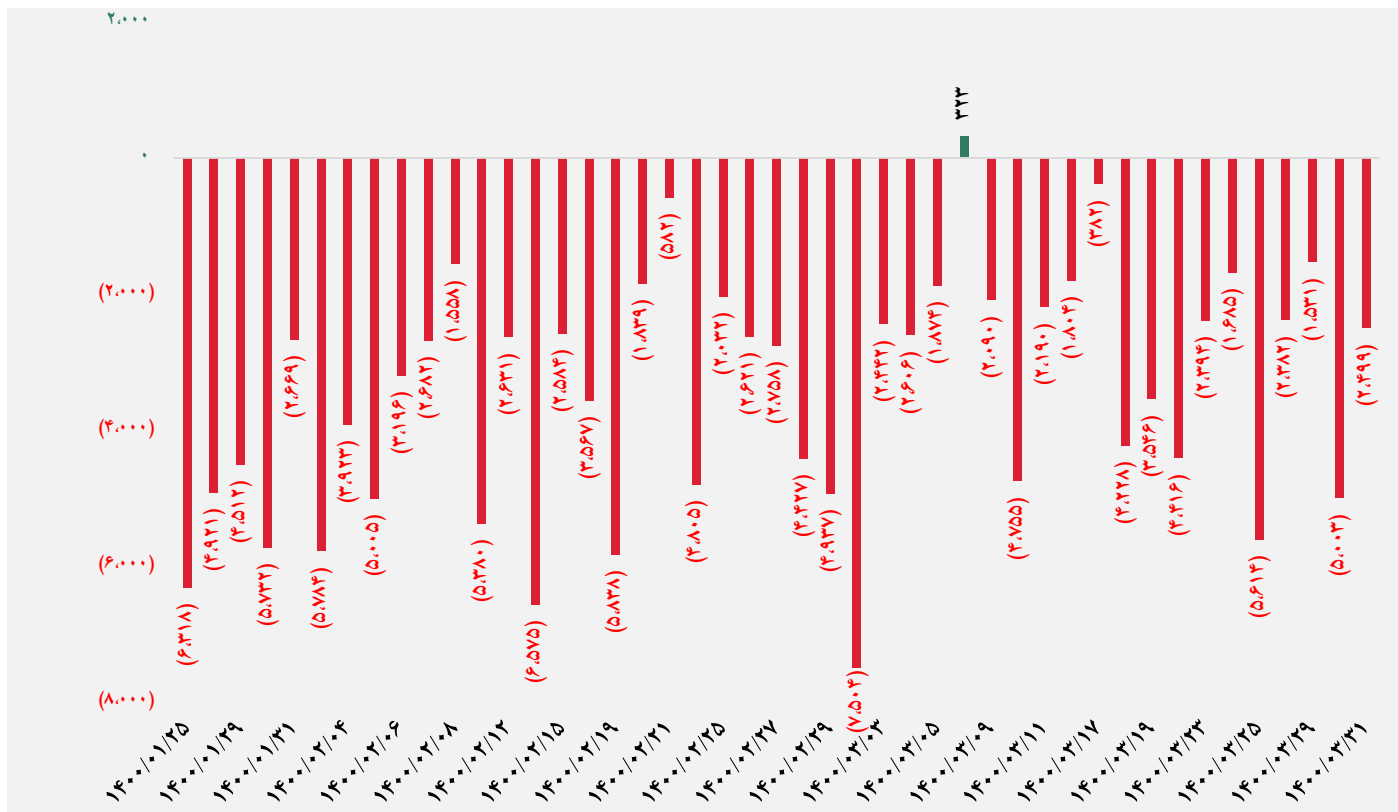
➤ شرکت نفت ایرانول سعی دارد تولید سال جاری را به سطح ظرفیت اسمی برساند و تمرکز بیشتر این شرکت بر روی فروش صادراتی محصولات نهایی با ارزش افزوده بیشتر می‌باشد. فروش‌های داخلی شرکت نیز تماماً در بورس کالا انجام می‌شود.

زمان اورهال شرکت نیز از روز شنبه هفته جاری آغاز شده و قرار است کمتر از ۲۰ الی ۲۵ روز به مدار تولید بازگردد. در مورد مواد اولیه لوبکات نیز توافقی انجام شده که از پالایشگاه بندرعباس و تبریز تامین شوند و آتش سوزی پالایشگاه تهران مشکلی را به لحاظ تامین لوبکات برای شرکت ایجاد نکرده است و این شرکت ذخایر کافی لوبکات را دارد.

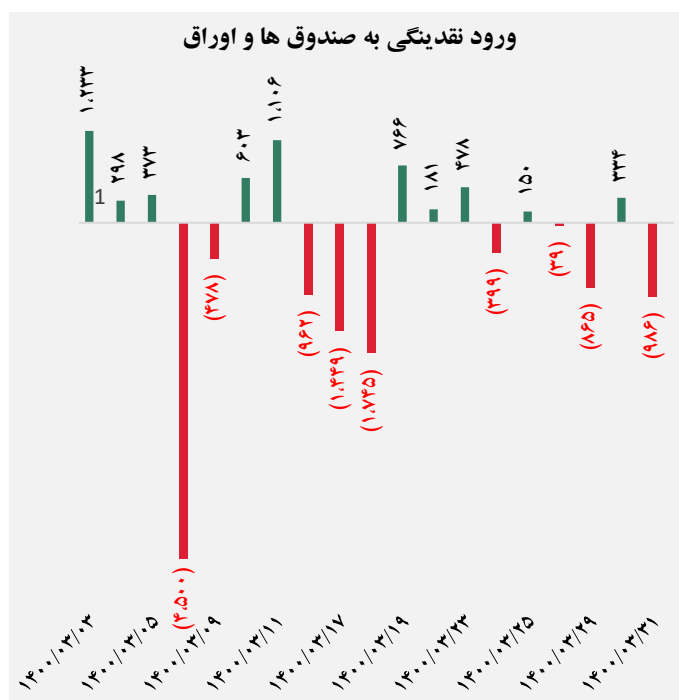
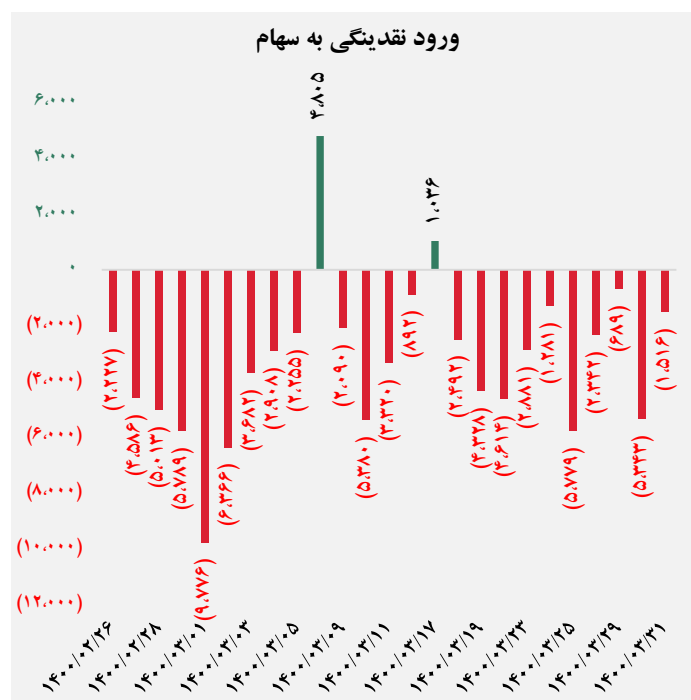
تصویر کلی بازار



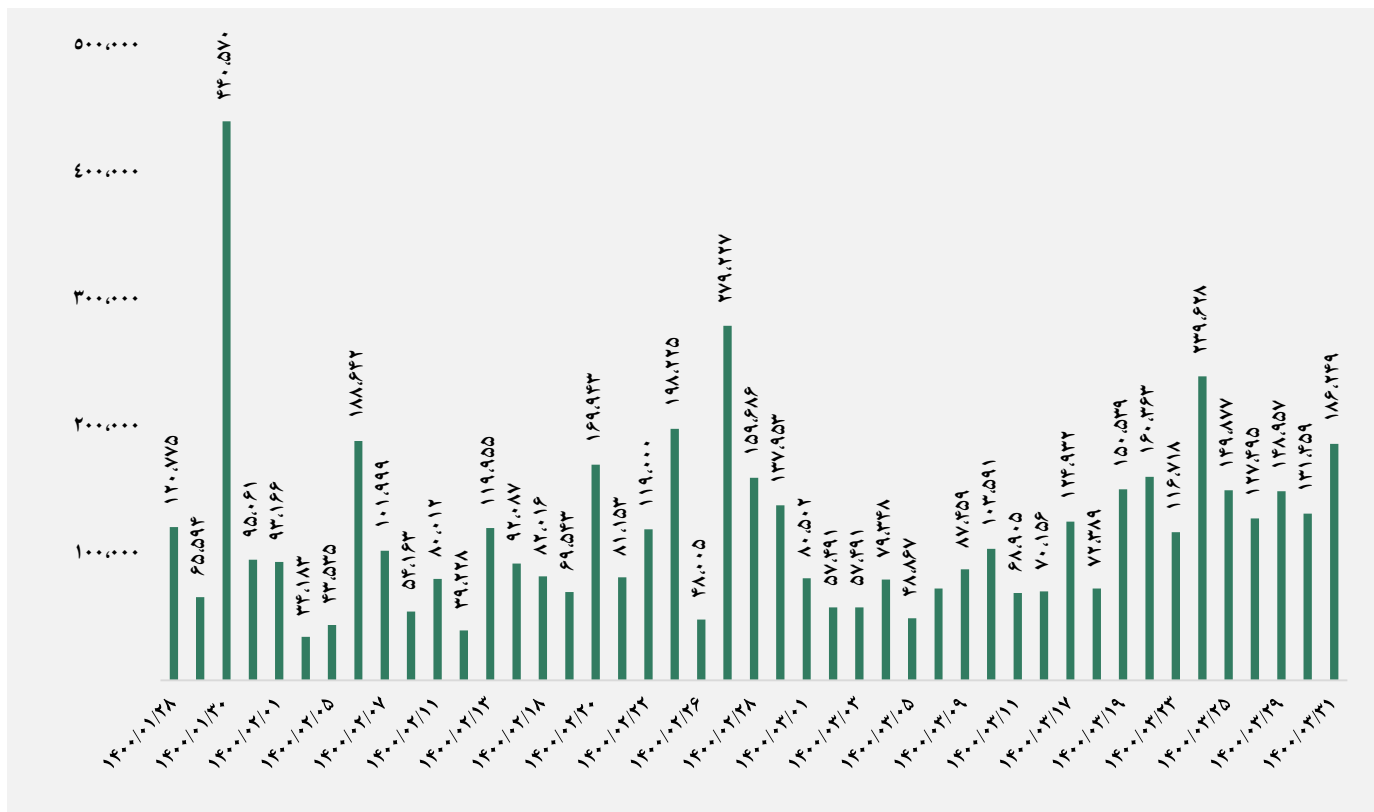
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



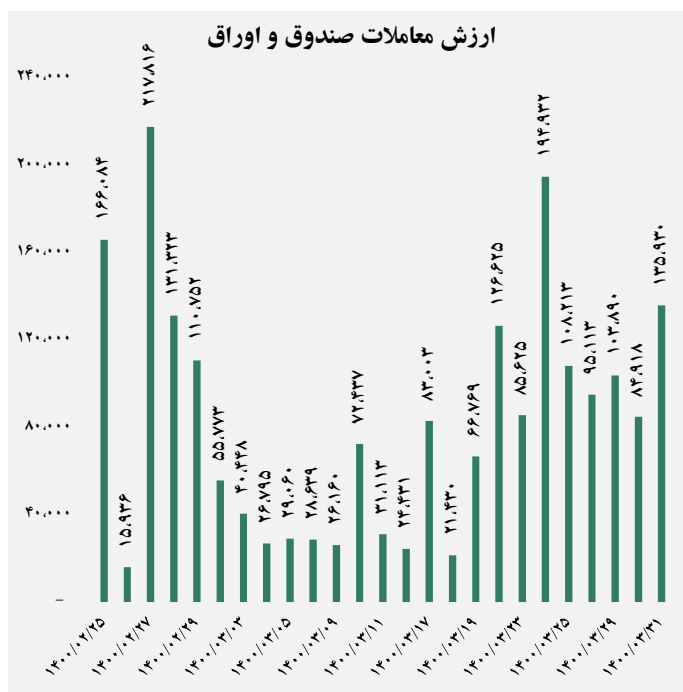
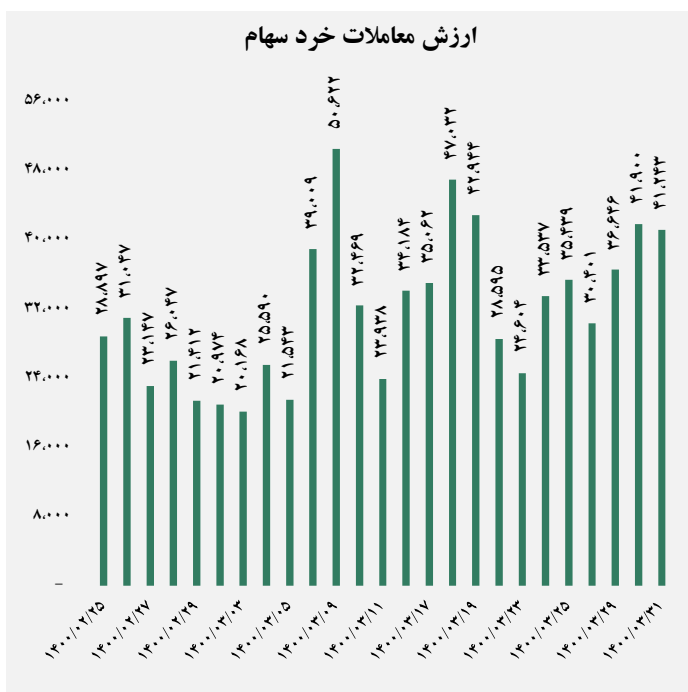
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

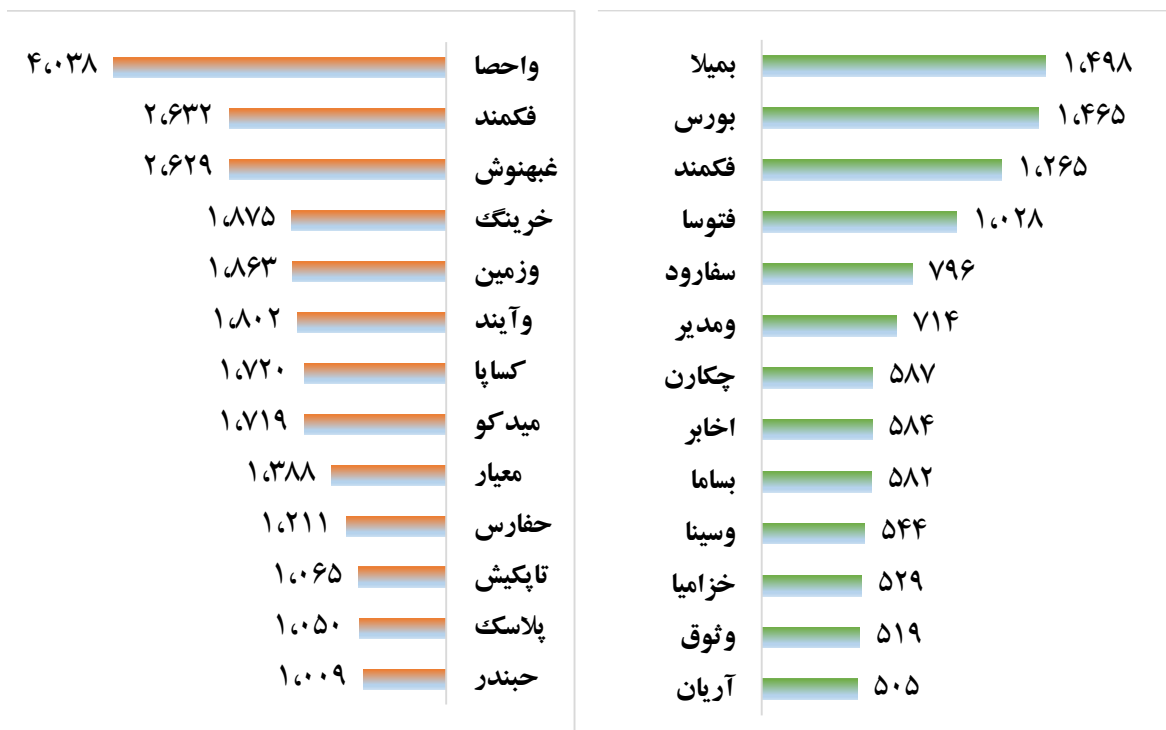


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





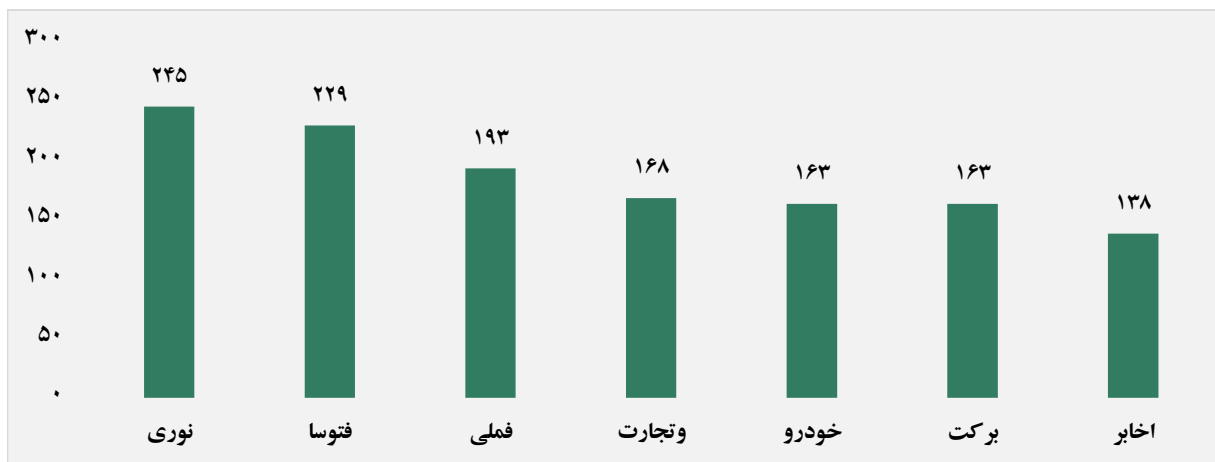
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



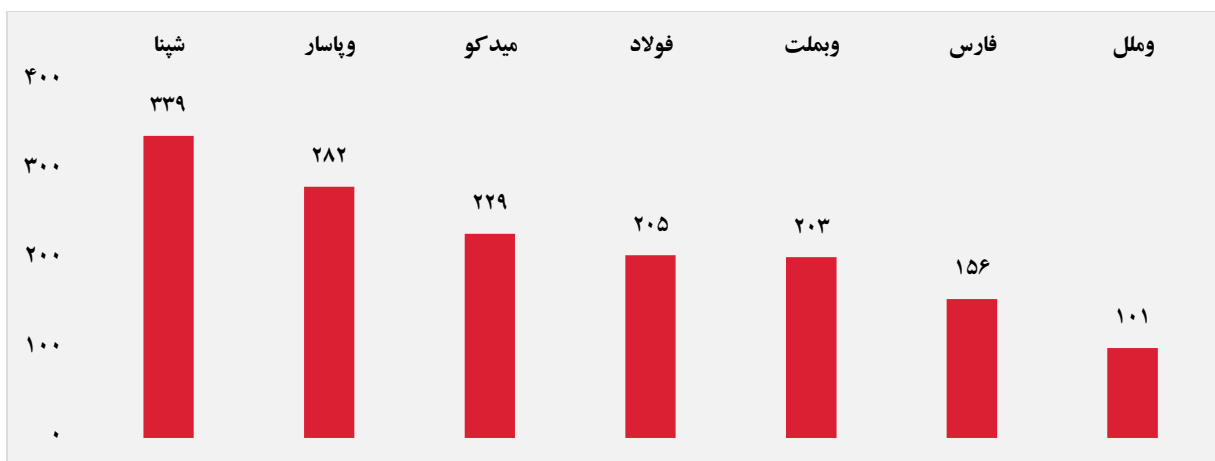
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	فتوسا	۱	وآیند
۲	اخابر	۲	شپلی
۳	خساپا	۳	ساراب
۴	اتکای	۴	سخوز
۵	همراه	۵	غگل
۶	رمپنا	۶	بهپاک
۷	ولکار	۷	سدور
۸	هجرت	۸	کیمیا
۹	رافزا	۹	شاملا
۱۰	شاراک	۱۰	وسهدا

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



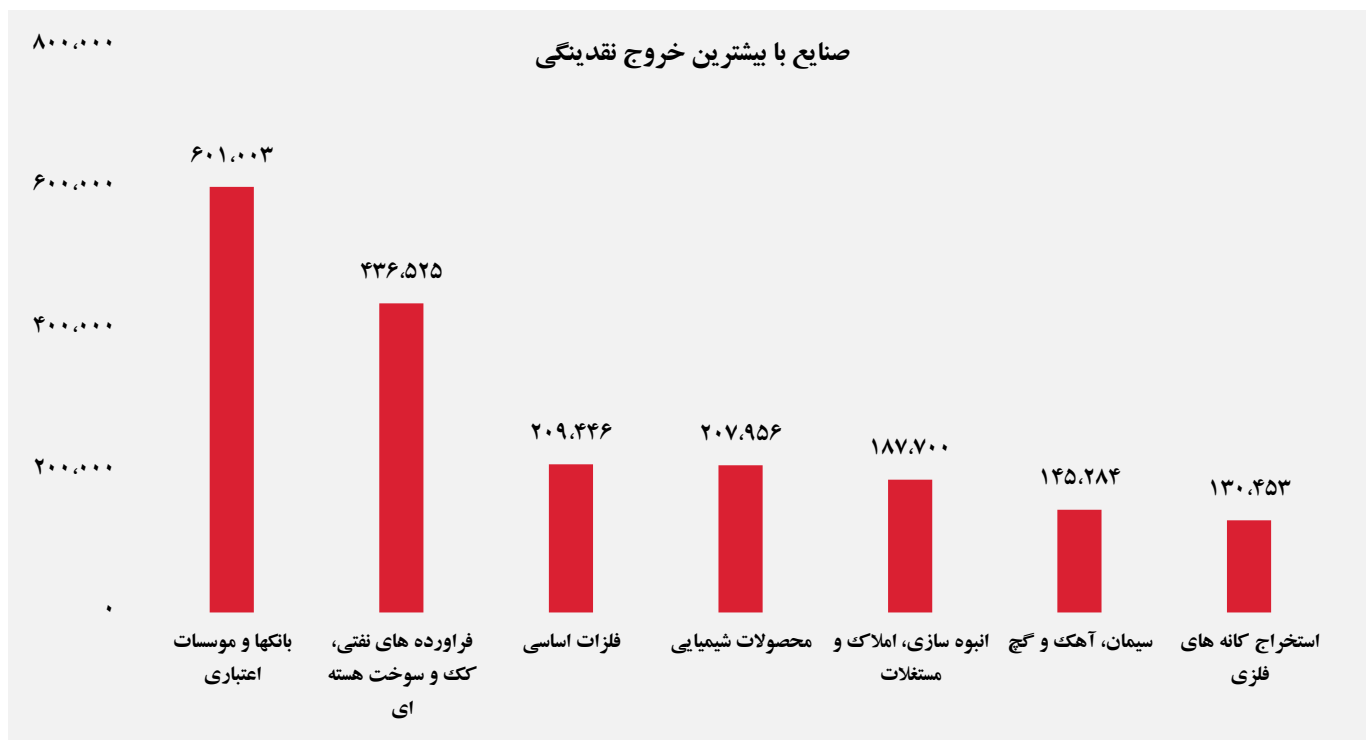
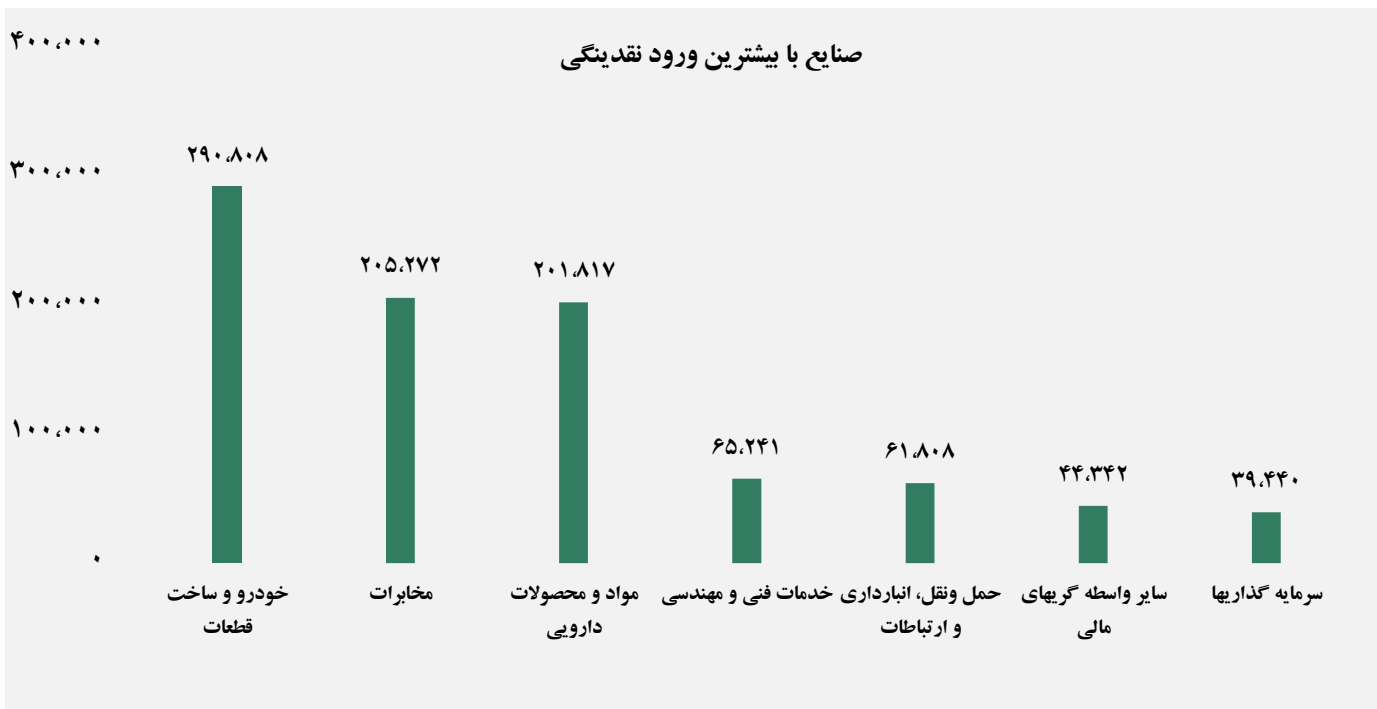
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	غکورش	۱۰	دارو
۲	فرزین	۱۱	شپلی
۳	ساراب	۱۲	ودی
۴	نوری	۱۳	کیمیا
۵	سمگا	۱۴	ستران
۶	کزغال	۱۵	خموتور
۷	غگل	۱۶	ثشاهد
۸	خگستر	۱۷	خزامیا
۹	فراپورس	۱۸	کسرا

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار