



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۰۲

[www.sfg.ir](http://www.sfg.ir) - [info@sfg.i](mailto:info@sfg.i)



## تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۲ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، فملی، کگل، فارس، کچاد و شستا با افزایش ۲۶,۰۹۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۱۳,۰۱۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۳ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۷۰ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق‌های قابل معامله سهامی می‌باشد.

بورس همیشه با ریسک و ابهام مترادف بوده است. مهمترین ابهامات بازار در فصل بهار مربوط به انتخابات ریاست جمهوری و مذاکرات وین درباره برجام بود. روزهای اول سال اغلب تحلیلگران سیاسی و اقتصادی امیدوار بودند مذاکرات قبل از انتخابات به نتیجه برسد اما امروز بسیاری امید به پایان مذاکرات در دولت روحانی را ندارند. از اخبار خوب فصل بهار نیز می‌توان به شروع روند آزادسازی قیمت‌ها در برخی صنایع بورسی اشاره کرد. از چند ماه قبل ایده عرضه خودرو در بورس کالا مطرح شده است که تاکنون به نتیجه نرسیده و به نظر قرار است این طرح بایگانی شود. اما سیمان، قند و شکر صنایع خوش اقبال بازار بودند و توانستند بخش زیادی از مسیر آزادسازی قیمت‌ها را طی کنند. در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۹,۴۶۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق منفعت دولتی با نماد افاد ۴۴، 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 ۲۹,۱٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۰۱	۱۴۰۰/۰۴/۰۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۵,۶۸۱	۹,۴۶۲	۶۷٪



## گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، فولاد امیرکبیر کاشان در خرداد ۱۴,۴۳۲ تن محصول گالوانیزه تولید کرده، میانگین تولید ماهانه این محصول در سال ۹۹، ۱۲,۶۹۰ تن و تولید فروردین و اردیبهشت ۱۳,۵۰۷ و ۱۴,۱۸۶ تن بوده است. در خرداد ماه شرکت ۲۰,۵۹۸ تن محصول به فروش رسانده (۳,۶۱۵ تن سهم صادرات)، میانگین فروش ماهانه در سال ۹۹، ۱۳,۲۴۲ تن (۶۶۵ تن سهم صادرات) و در سال ۹۸، ۱۲,۳۳۵ تن (۲,۵۰۱ تن سهم صادرات) بوده است. فروش خرداد ماه ۴۹۸ میلیارد تومان گزارش شده، میانگین فروش ماهانه سال ۹۹، ۲۳۰ میلیارد تومان است. میانگین نرخ فروش محصول گالوانیزه در سال ۹۸، ۷۹,۱۶۶ ریال بوده، در سال ۹۹ به ۱۶۷,۹۰۷ ریال رسیده و نرخ فروش خرداد ماه ۲۶۳,۱۹۴ ریال گزارش شده است.

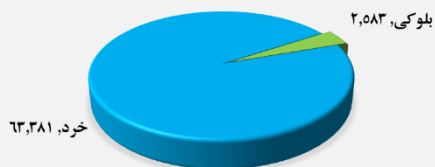
شرکت نفت بهران در مجمع عادی سالیانه ۱۱۵ تومان سود به ازای هر سهم معادل ۸۳ درصد سود خالص دوره را تقسیم نمود. شپهرن ۴۲٪ سهم بازار روغن پایه و روانکار را دارد. تولید شرکت در سال ۹۹ حدود ۶ درصد رشد داشته است. در بخش روانکار ۷ درصد و در بخش روغن پایه ۱۲ درصد افزایش تولید داشته است. رقم صادرات شرکت در سال گذشته بیشتر از بودجه و حدود ۸۱ میلیون دلار بوده است. این شرکت برای سال جاری قصد دارد صادرات را تا ۱۰۰ میلیون دلار افزایش دهد. از اقدامات مهم انجام شده در سال گذشته، ارائه روغن موتور ویژه هواپیماهای سبک و فوق سبک با نام بهران اوج بوده است. هم چنین رشد حدود ۷ درصدی صادرات پارافین و ورود به بازارهای جدید اوکراین و افغانستان و صادرات روغن پایه به سوریه، پاکستان و افغانستان از دیگر دستاوردهای شرکت است. مذاکرات با سازمان حمایت برای گرفتن مجور افزایش نرخ در حال انجام است و تمامی مدارک و مستندات لازم ارسال شده است.

طبق گفته مدیر عامل اولویت بهران تامین بازار داخل است و صادرات در رتبه دوم قرار دارد. وی اضافه نمود که طبق نامه سازمان حمایت شرکت های فعال در این حوزه موظف اند معادل سهم بازار سال گذشته روغن دیزل به بازار عرضه کنند. بهران تکلیف داشت هفته‌ای ۵ میلیون لیتر روغن دیزل را داخلی بفروشد که از این مقدار حدود ۲ میلیون لیتر را هفتگی به فروش رساند. در بخش پالایشگاه پروژه های خوبی از جمله توسعه ظرفیت ۴۰ میلیون لیتری در دست بررسی است.

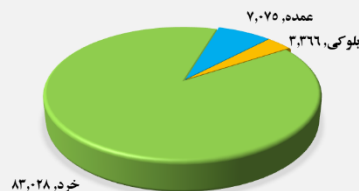
## تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۶۱۶	شاخص کل	۱,۲۱۳,۰۲۲	شاخص کل
۱۸۷	تغییر شاخص	۲۶,۱۰۱	تغییر شاخص
۱۱,۶۷۶,۹۷۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۸,۳۹۳,۰۱۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۵,۶۶۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۶۷,۸۰۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
	کگلهر		فولاد
	آریا		فملی
	ذوب		کگل
	شگویا		فارس
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
	اتکای		رانفور
	شرانل		وسکرمان
	کاسپین		وساخت
	بمپنا		خاهن

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



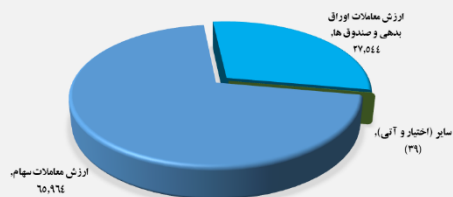
ارزش کل معاملات (میلیارد ریال)



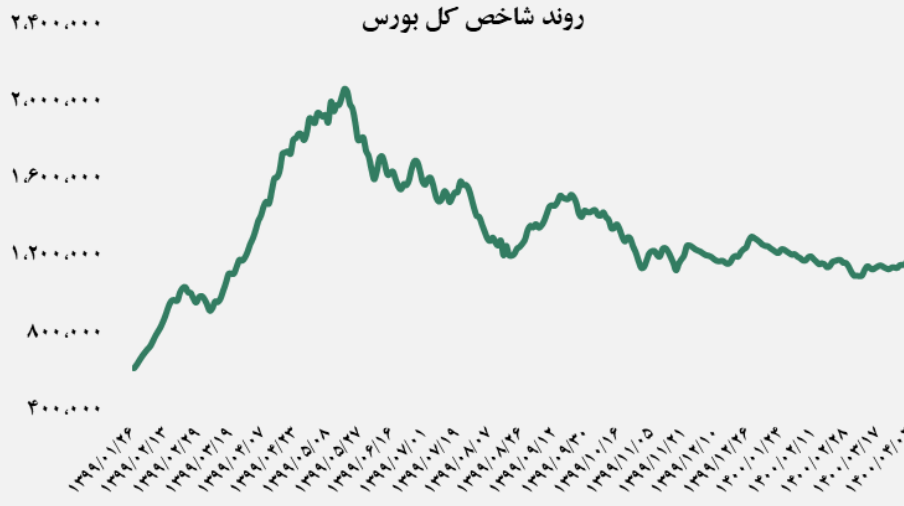
ارزش کل معاملات - به تکنیک بورس و فرا بورس (میلیارد ریال)



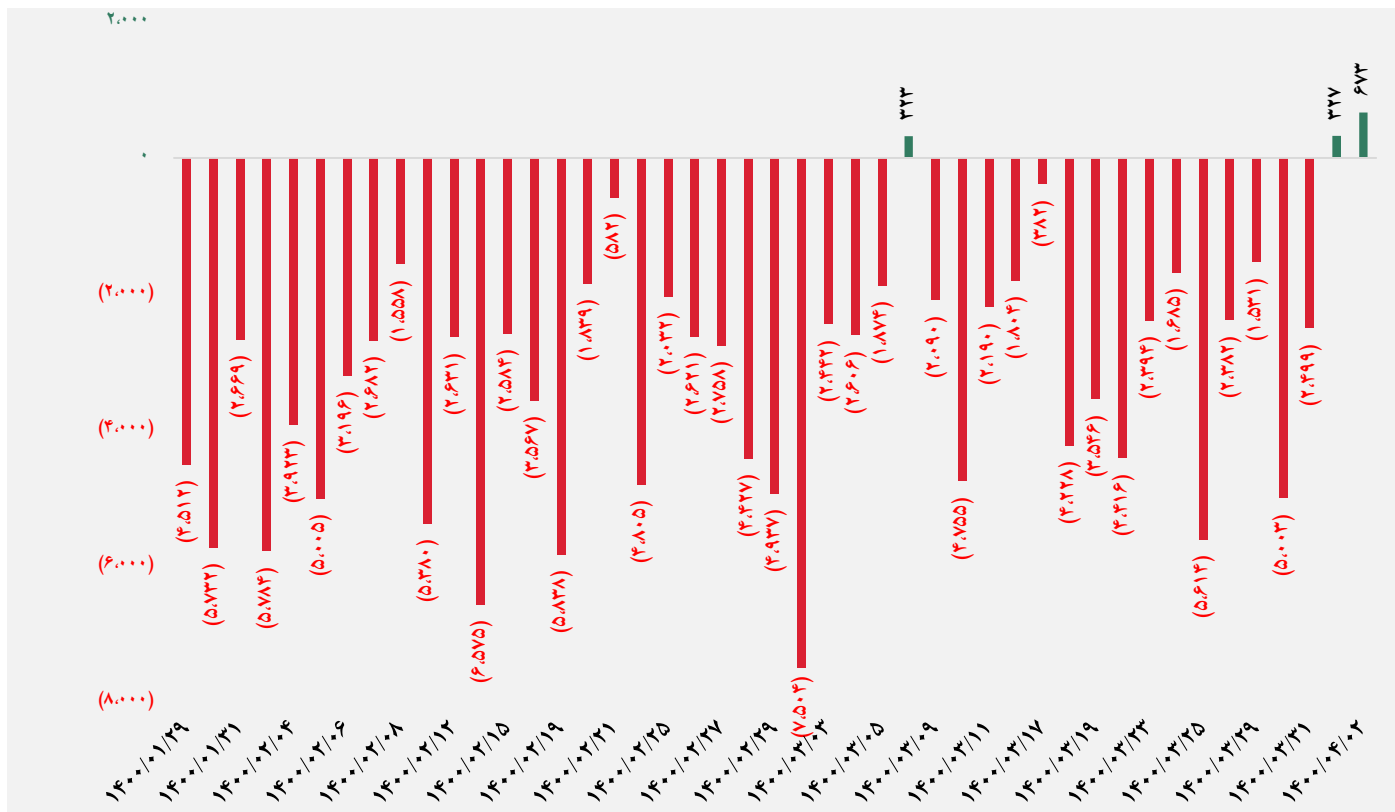
ارزش کل معاملات به تکنیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها (میلیارد ریال)



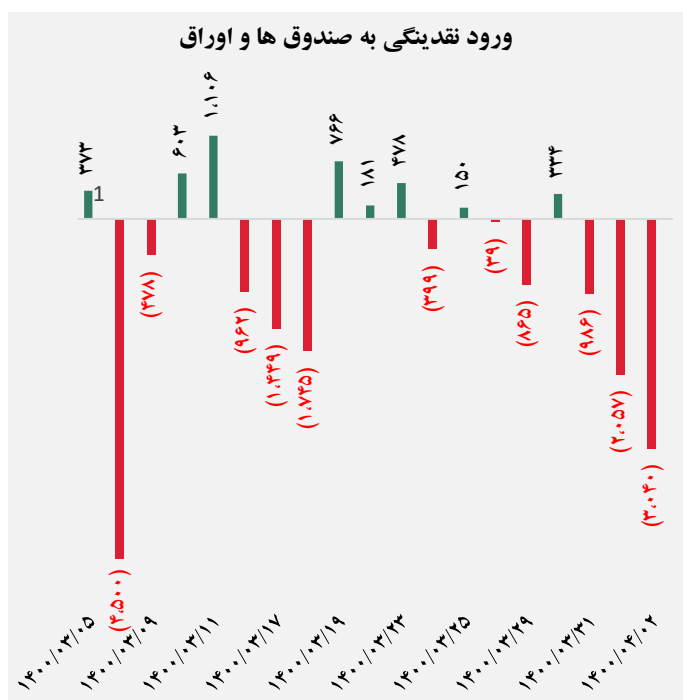
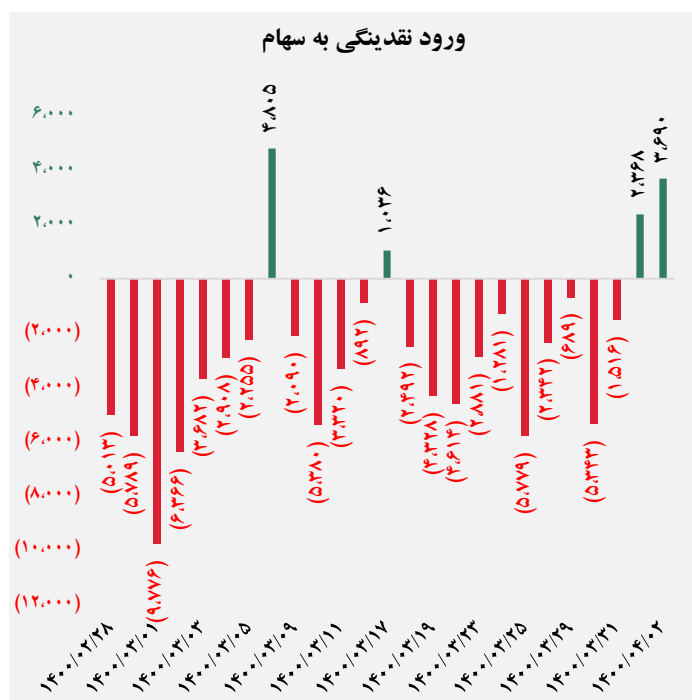
روند شاخص کل بورس



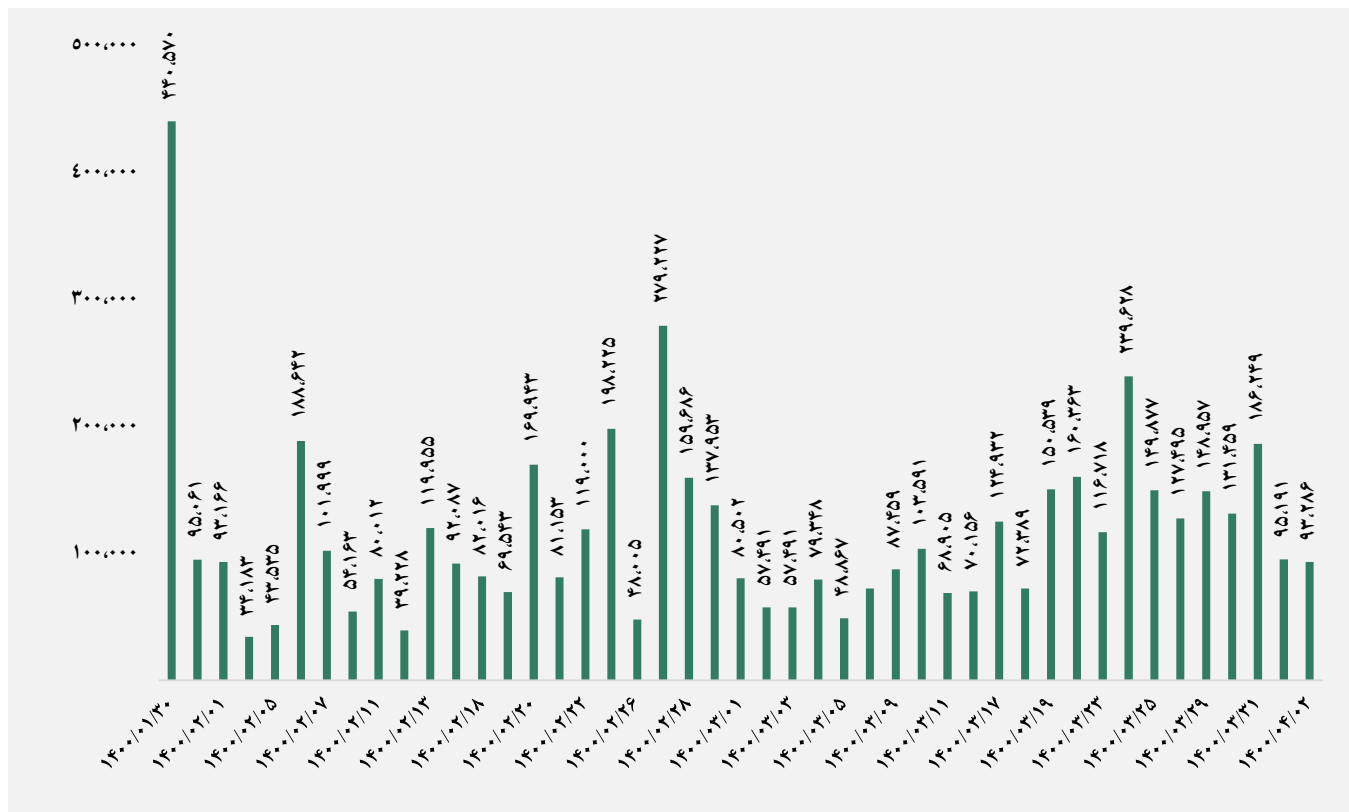
## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



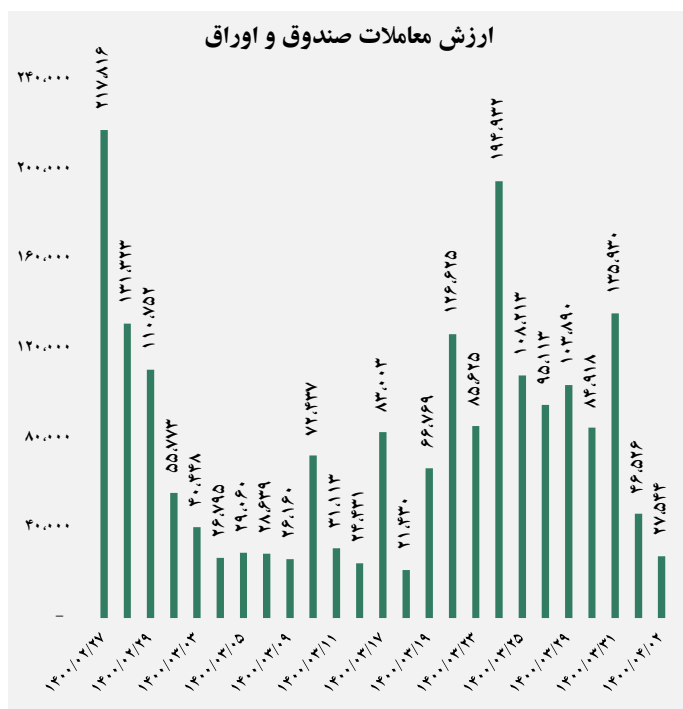
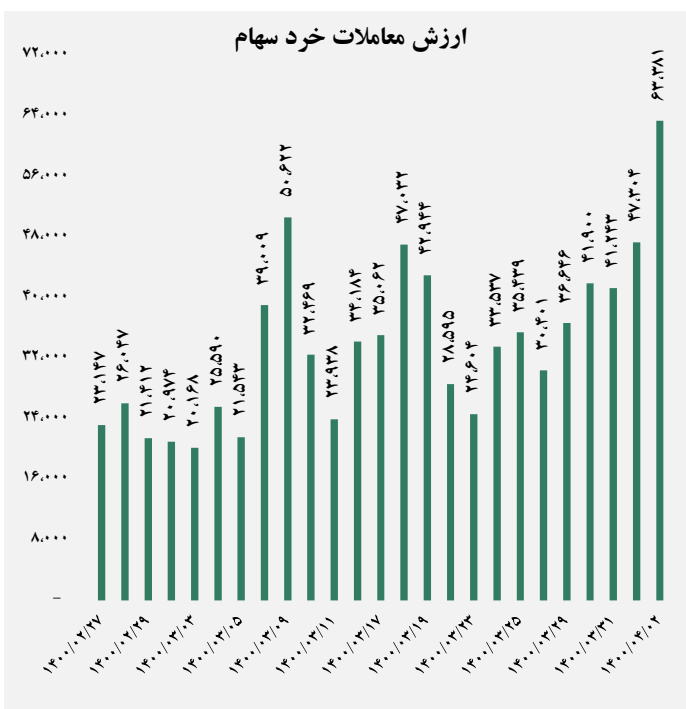
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

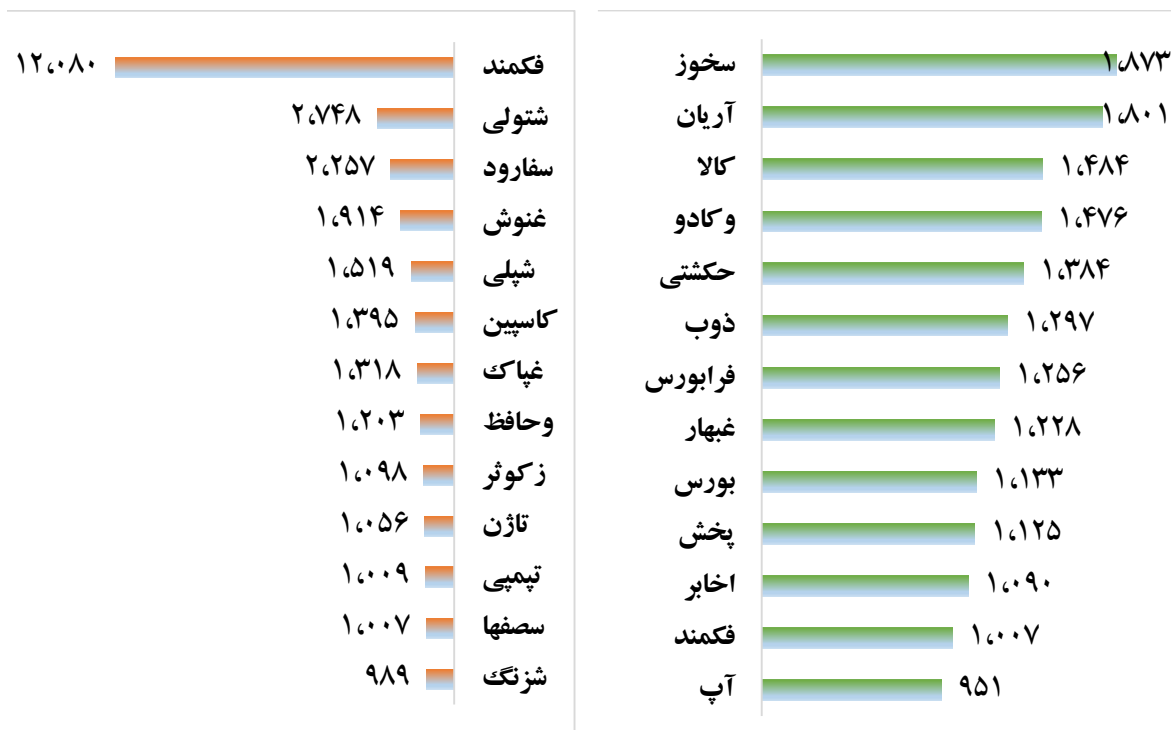


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





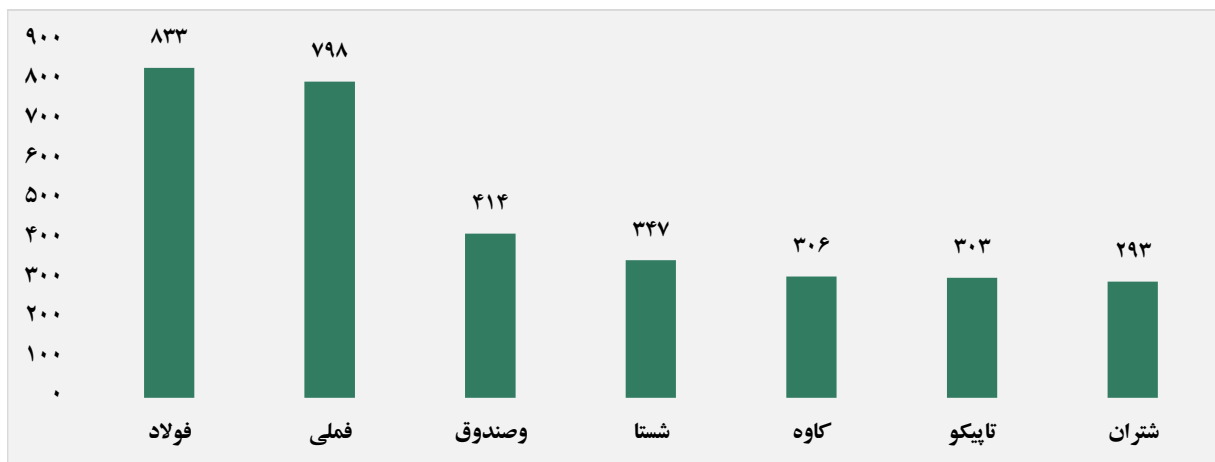
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



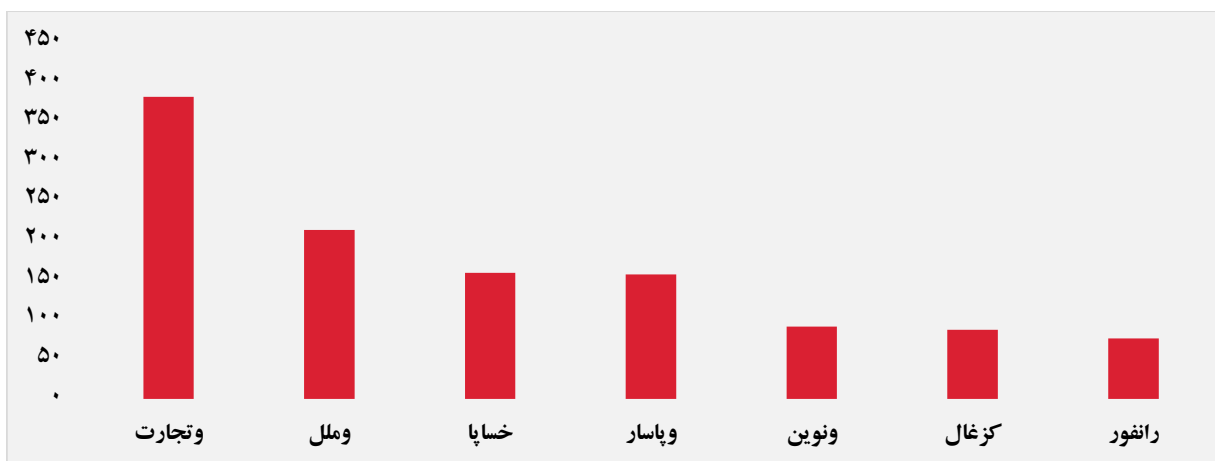
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	فولای	۱	خرینگ
۲	کلر	۲	پدرخش
۳	کزغال	۳	ختور
۴	زملارد	۴	سخاش
۵	شاروم	۵	ولشرق
۶	پیزد	۶	نمرینو
۷	شدوص	۷	دتوزیع
۸	قصفها	۸	دشیمی
۹	رنیک	۹	خلنت
۱۰	پردیس	۱۰	خچرخش

### سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



### سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

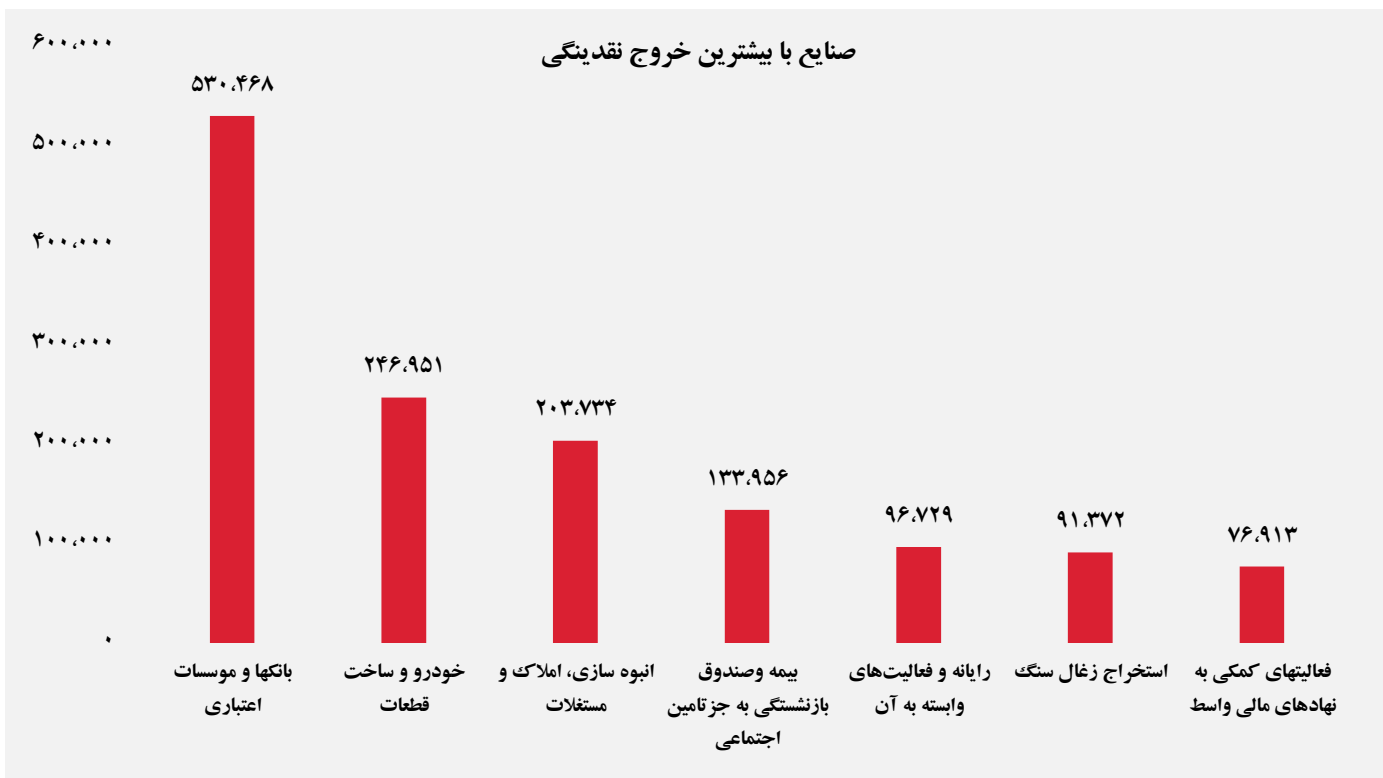
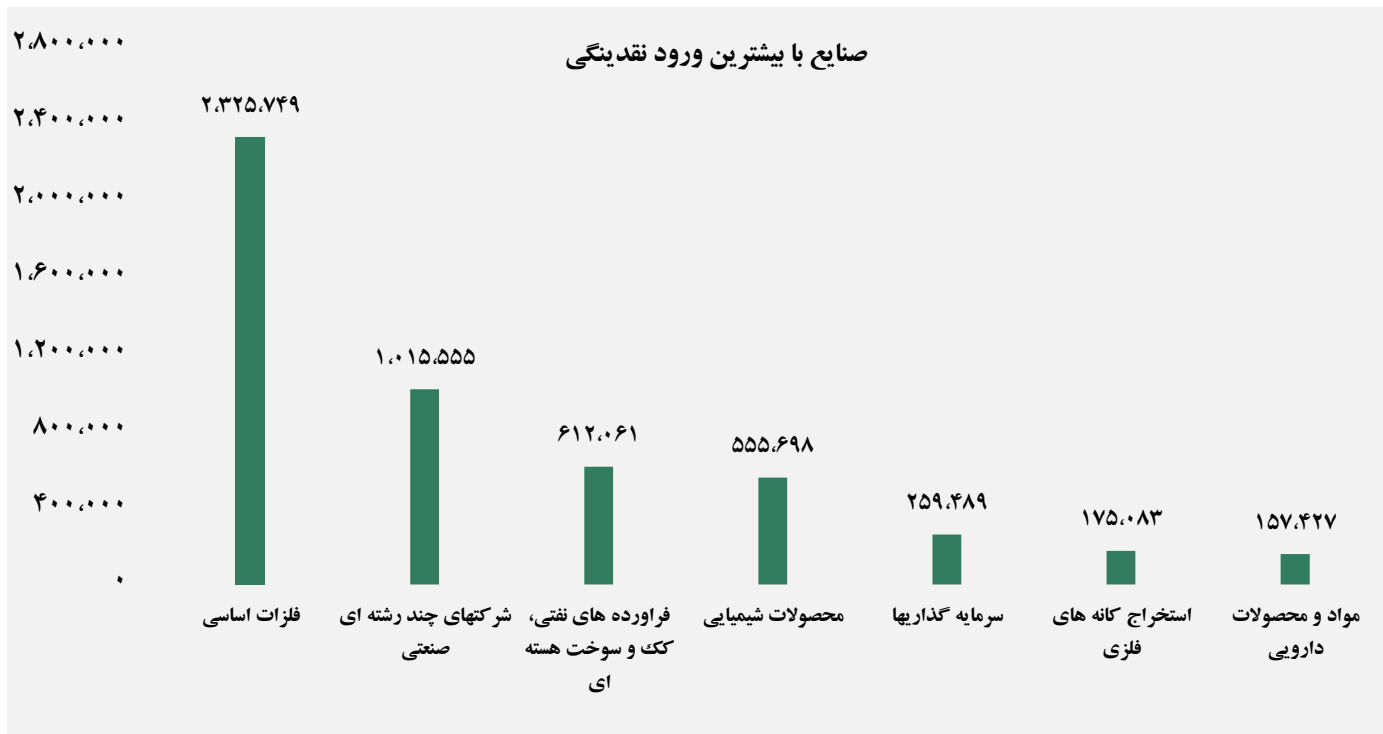


### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	تاپکیش	۱۰	شبریز
۲	کرغال	۱۱	وآیند
۳	حتاید	۱۲	چفبیر
۴	غکورش	۱۳	فجر
۵	دتوزیع	۱۴	تکمبا
۶	فزرین	۱۵	ونفت
۷	وآوا	۱۶	کیمیا
۸	وساخت	۱۷	شغدیر
۹	خزامیا	۱۸	خوساز



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار