



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۰۵

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۵ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شستا، فولاد، اخبر، تایپکو، شینا و وغدیر با افزایش ۲۰,۷۲۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۳۳,۷۸۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۷۱ 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 ۸۲ درصد از کل ارزش معاملات مربوط به معاملات خرد بود.

شاخص کل درون یک ساختار اصلاحی بصورت WXY در حال اصلاح است که نهایتاً اصلاح قیمتی آن در محدوده ۱,۱ میلیون واحد خواهد بود و از همین محدوده موفق به برگشت خواهد شد و به نظر می‌رسد که در گام اول شاخص کل تا محدوده فیبوی ۰,۲۳ اصلاح اخیر بر روی ۱,۳۳ میلیون واحد رشد کند. اگر به بررسی اتفاقات اخیر شاخص کل از نمایی نزدیک‌تر پردازیم متوجه می‌شویم که در یک ماه اخیر شاخص کل درون یک کانال صعودی با شیب مناسبی در حال رشد بوده است. اما به نظر می‌رسد هنوز آخرین روند اصلاحی به صورت کامل تکمیل نشده باشد و از حوالی سقف ۱,۳۳۰ میلیون واحدی یک اصلاح برای تکمیل آخرین شاخه اصلاحی از Y باشیم و بعد تا حوالی ۱,۵ میلیون واحد ادامه رشد را برای شاخص کل داشته باشیم.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲,۵۷۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مباحه عام دولت با نماد اراد ۵۰، 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	۱۴۰۰/۰۴/۰۲	۱۴۰۰/۰۴/۰۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۹,۴۶۲	۲,۵۷۱	-۷۳٪



## گروه‌های مؤثر

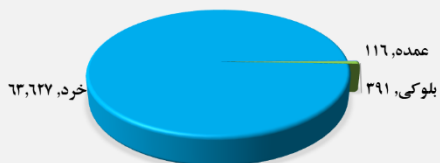
در گروه فلزات اساسی، فولاد مبارکه اصفهان هر ماه در بازه ی ۶۰۰ الی ۷۰۰ هزار تن تولید محصول نهایی دارد. در اردیبهشت ماه سال جاری ۸۲۲ هزار تن و در خرداد ماه ۵۹۸ هزار تن تولید داشته است. این فولادساز به طور متوسط هر ماه ۶۶۰ هزار تن فروش داشته که در اردیبهشت ماه توانست ۷۳۷ هزار تن فروش داشته باشد و در خرداد نیز فروش ۷۱۰ هزار تنی را گزارش کرده است. فولاد در سه ماهه سال جاری مبلغ فروش ۳۳،۶۶۵ هزار میلیارد تومانی را ثبت کرده است، در حالیکه در مدت مشابه سال گذشته مبلغ فروش حدود ۱۲ هزار ۷۰۰ میلیارد تومان بود. در اردیبهشت ماه سال جاری فروش ۱۲،۵ هزار میلیارد تومانی را گزارش کرد. در خرداد نیز توانسته فروش ۱۲،۱ هزار میلیارد تومانی را داشته باشد. نرخ فروش محصولات شرکت در خرداد ماه نسبت به ماه گذشته رشد ۱ درصدی داشته و برابر با ۸۴۳،۱۷۰ ریال برای هر کیلو بوده همچنین نرخ محصولات گرم شرکت نیز با ۳ درصد افزایش به ۱۷۷،۰۵۰ ریال به ازای هر کیلو رسیده است.

در گروه زغال سنگ، متوسط تولید سال ۹۹ شرکت زغال سنگ پرورده طبس برابر ۵۱ هزار تن محصول برای هر ماه بوده است. در سه ماه ابتدای امسال به ترتیب ۴۳، ۲۳ و ۳۴ هزار تن تولید داشته است. گفته می‌شود کاهش ۳۵ درصد مقدار تولید نسبت به سال گذشته، به علت اورهال شرکت است. در سال گذشته ۶۱۶ هزار تن تولید داشت و ۵۹۴ هزار تن فروش ثبت شد. در سه ماه امسال نیز فروش ۷۰، ۲۲ و ۲۳ هزار تنی را داشته است. شرکت در حالی در سال ۹۹ متوسط فروش ماهانه ۱۱۹ میلیاردی را داشته است، در فروردین فروش عالی ۲۱۸ میلیاردی را داشته و در اردیبهشت و خرداد ۷۴ و ۸۷ میلیارد فروش گزارش کرده است. بر عکس حجم تولید و فروش، نرخ‌ها به واسطه افزایش قیمت شمش فخور در بهترین شرایط ممکن است. متوسط نرخ فروش سال گذشته ۲،۴۰۰ تومان بوده که در خرداد ۳،۶۰۰ تومان در هر کیلو است.

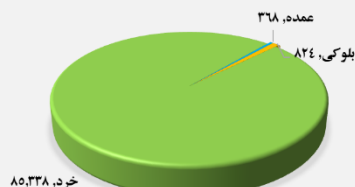
## تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۶۷	شاخص کل	۱,۲۳۳,۷۸۳	شاخص کل
۱۵۱	تغییر شاخص	۲۰,۷۲۸	تغییر شاخص
۱۱,۷۸۳,۵۹۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۲۱۲,۸۹۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۲,۸۶۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۶۳,۶۶۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>	
آریا		شستا	
صبا		فولاد	
ذوب		اخابر	
ارفع		تاپیکو	
<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>	
غصینو		وسر ضوی	
دماوند		وتجارت	
سمگا		پاسا	
تبرک		سدشت	

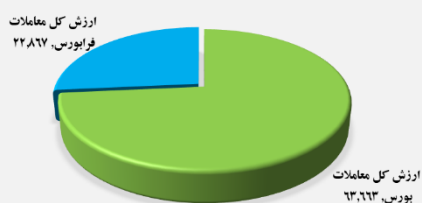
ارزش معاملات سهام - به تفکیک بلوکی، عمده و خرد (میلیارد ریال)



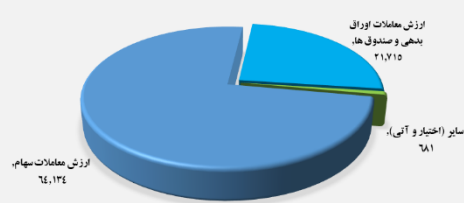
ارزش کل معاملات (میلیارد ریال)



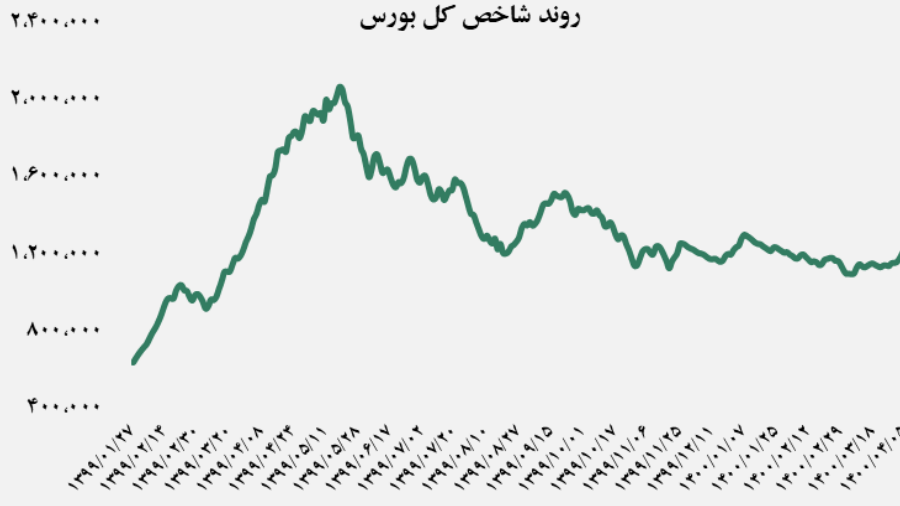
ارزش کل معاملات - به تفکیک بورس و فرا بورس (میلیارد ریال)



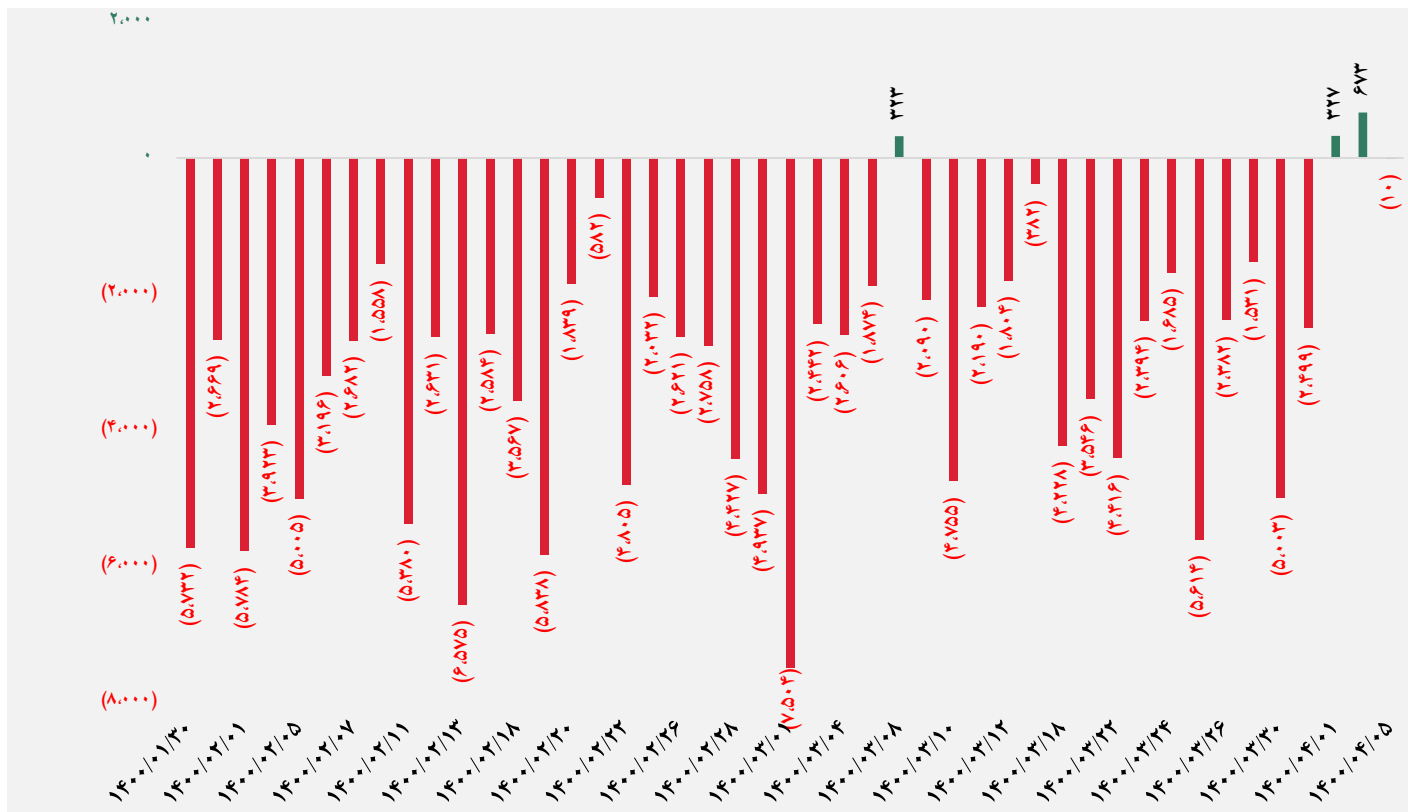
ارزش کل معاملات به تفکیک سهام، اوراق بدهی و صندوق ها (میلیارد ریال)



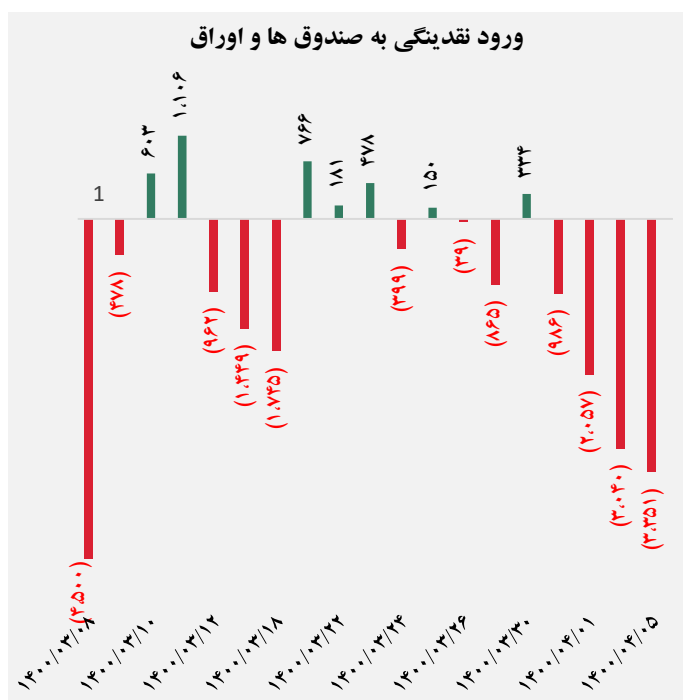
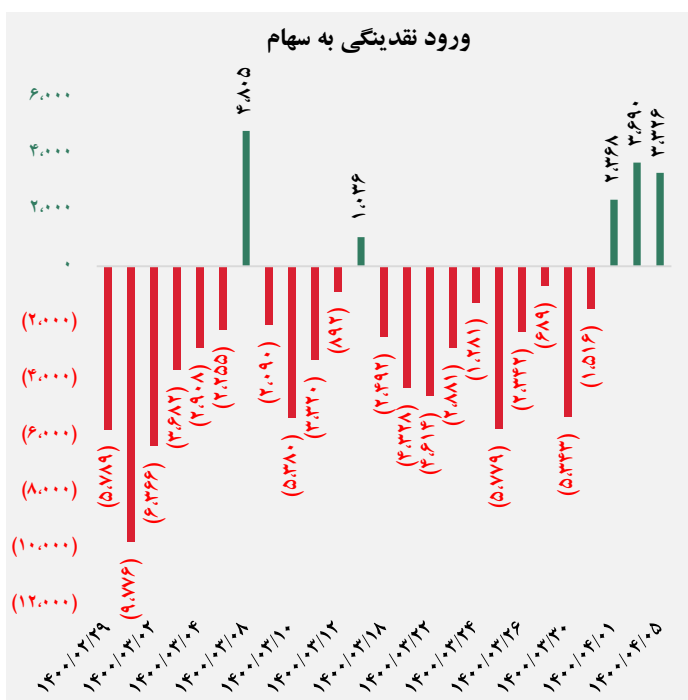
روند شاخص کل بورس



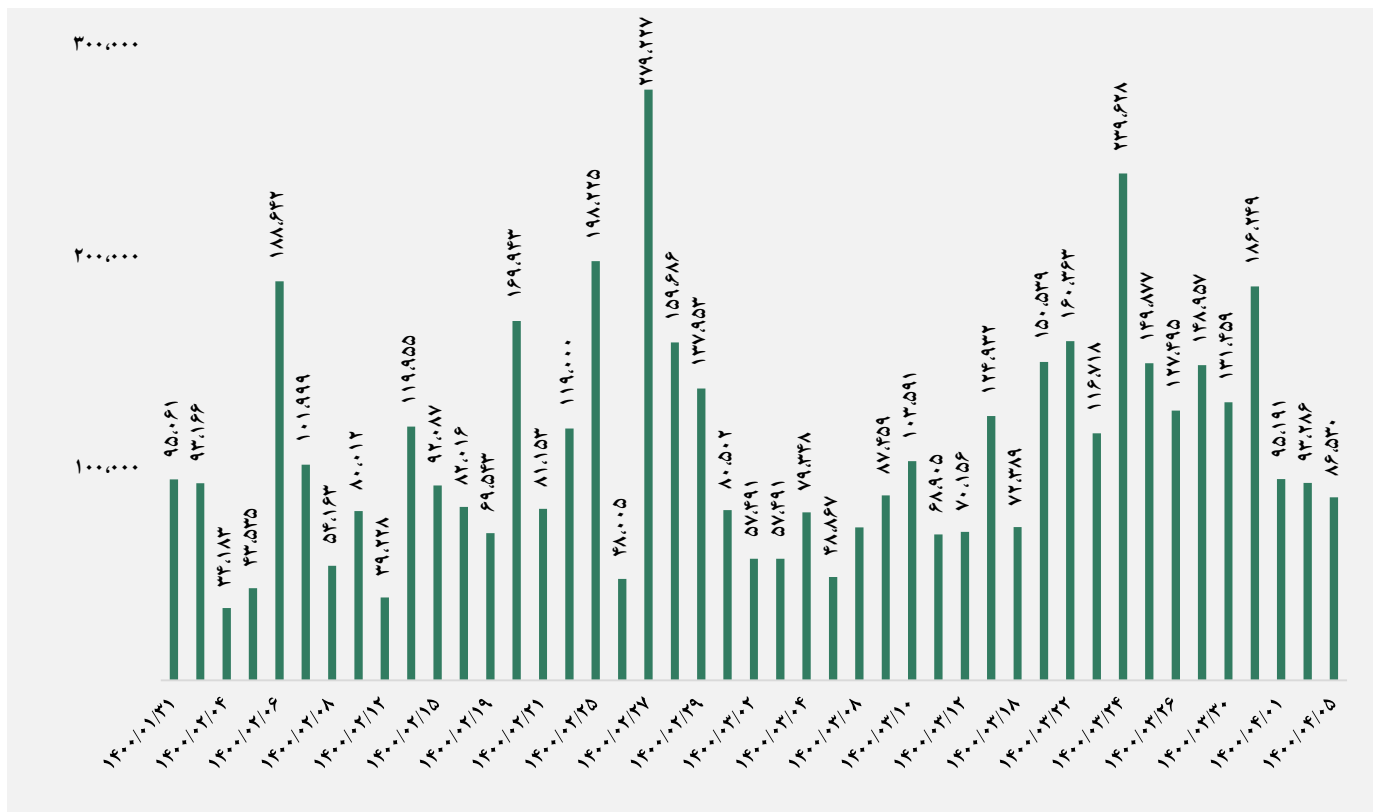
## کل ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



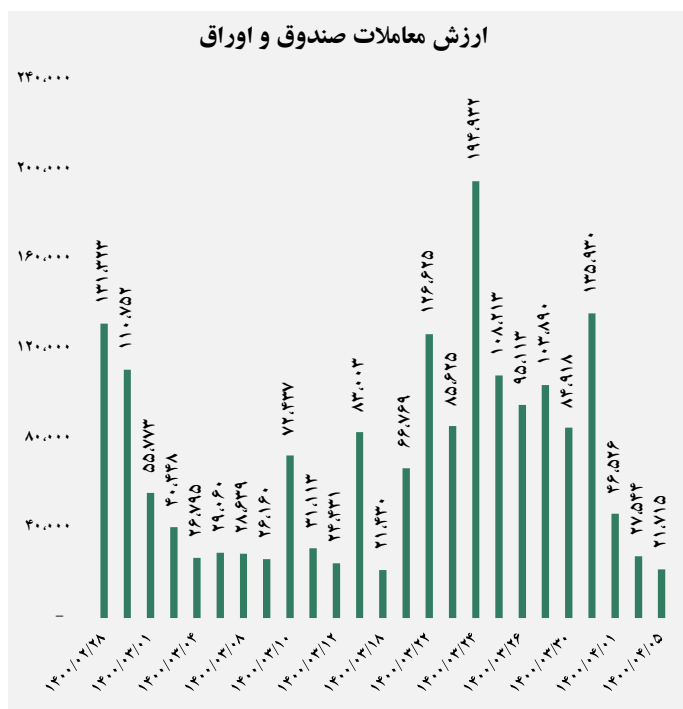
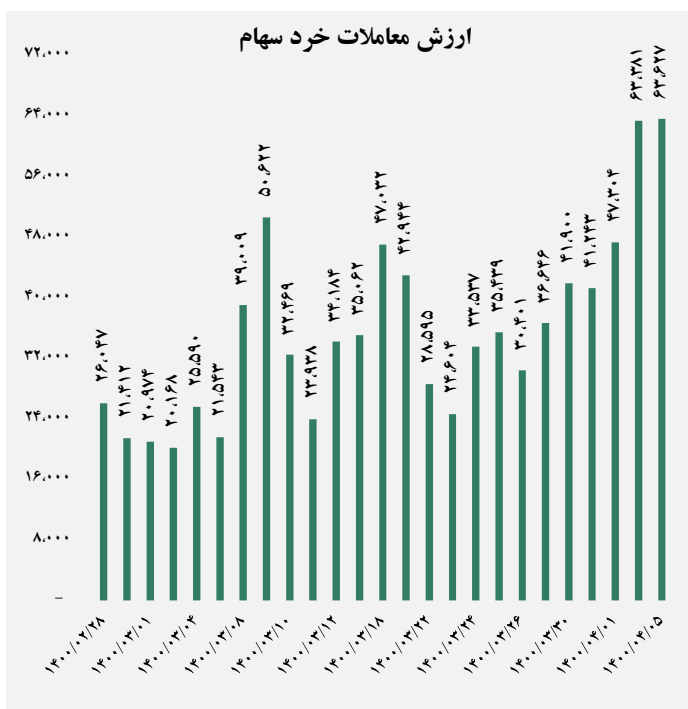
## ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

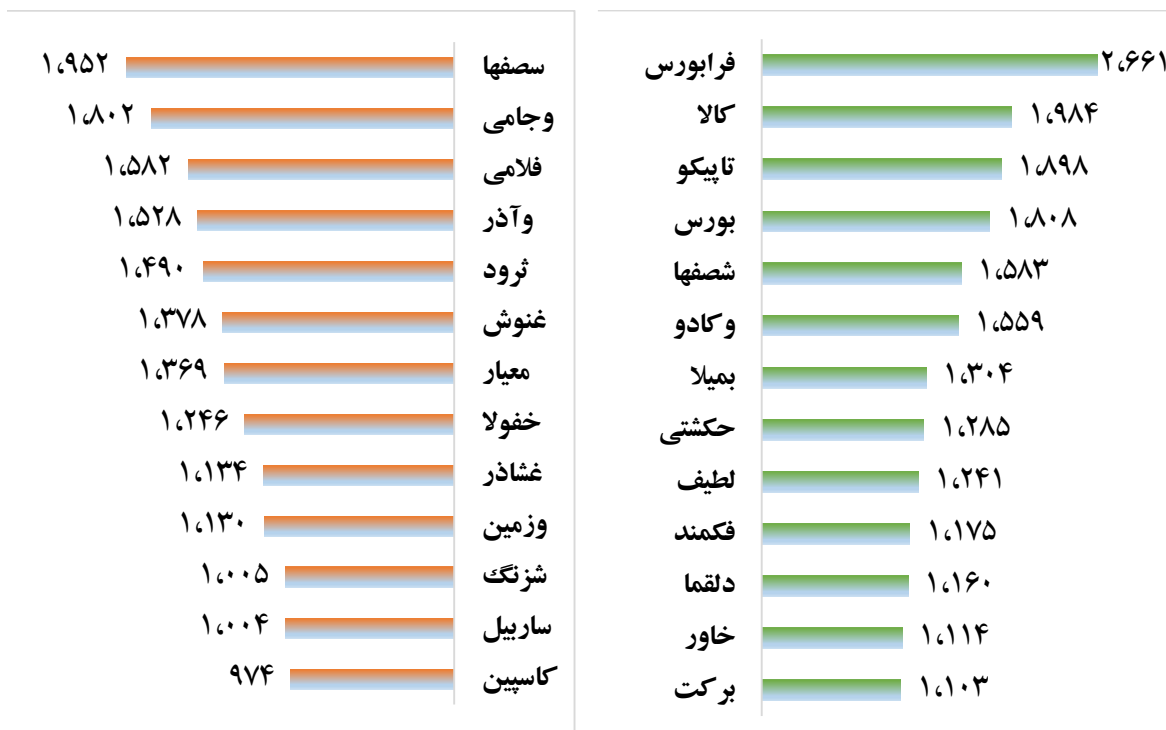


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





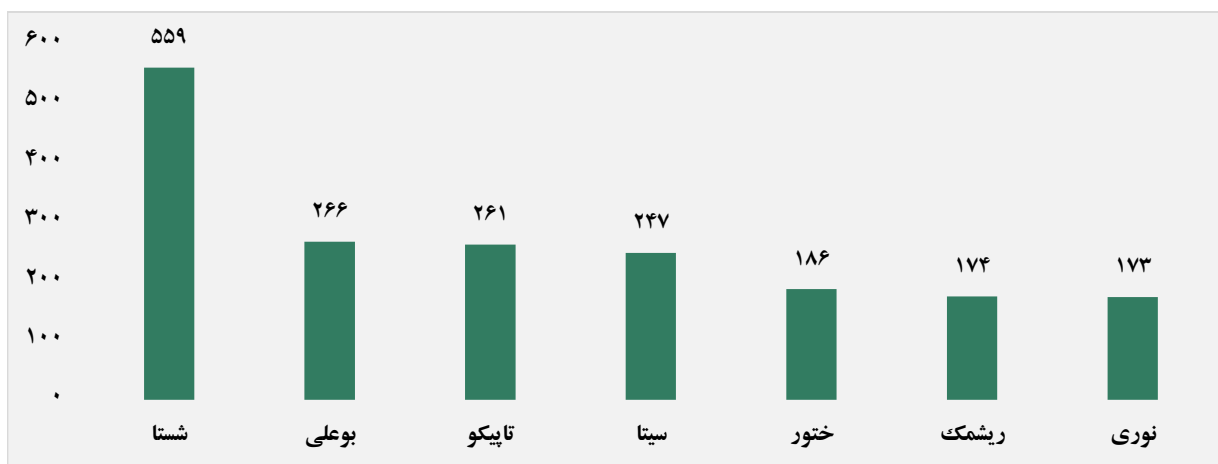
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



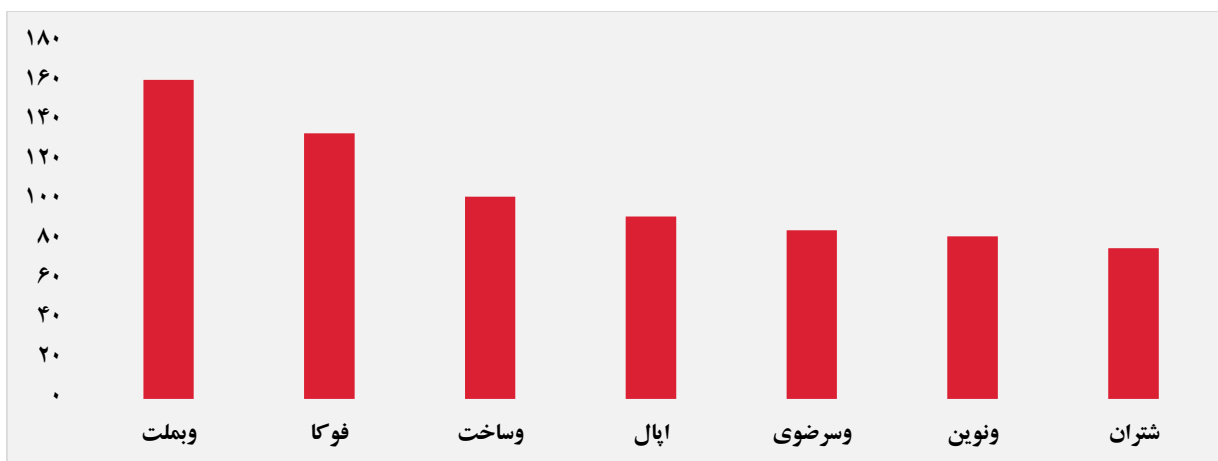
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	تاپیکو	۱	فملی
۲	بوعلی	۲	حریل
۳	سیتا	۳	مرقام
۴	تاصیکو	۴	شلرد
۵	مبین	۵	کخاک
۶	کرمانشاه	۶	فولاد
۷	وآوا	۷	فلوله
۸	وامید	۸	دشیمی
۹	غگلیا	۹	کسرا
۱۰	گکوثر	۱۰	دقاضی

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



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



### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	نفارس	۱۰	دتوزیع
۲	کبافق	۱۱	فرزین
۳	وساخت	۱۲	لکما
۴	غکورش	۱۳	شغدیر
۵	بوعلی	۱۴	قشکر
۶	کزغال	۱۵	تاپکیش
۷	وآوا	۱۶	ستران
۸	حتاید	۱۷	ودی
۹	غفارس	۱۸	نوری





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

