



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۰۶

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۶ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شستا، تاپیکو، جم، نوری، خودرو و حساسا با افزایش ۴,۷۴۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۳۸,۴۸۵ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش همراه بوده است. مبلغ ۷۲ 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 ۷۷ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

یک الی دو هفته اول بعد از انتخابات ریاست جمهوری معمولاً بازار مثبت بوده است و دلیل آن نیز، کاهش عدم اطمینان در بازار با مشخص شدن نتایج انتخابات است. در چند روز گذشته، تحولات بازار ارز و اظهارنظرهای رئیس جمهور منتخب نیز بر رشد بازار بی‌تاثیر نبود. همچنین در این مدت پولی از بورس خارج نشده است. ارزش معاملات خرد در بازار بورس و فرابورس رشد ۴۶ درصدی نسبت به هفته قبل از انتخابات داشت و به میانگین روزانه ۴۵۸۰ میلیارد تومان رسیده است و در مقایسه با میانگین از اول سال (۲۶۵۴ میلیارد تومان) رشد ۷۳ درصدی را نشان می‌دهد. در روزهای آتی به نظر می‌رسد باید منتظر اخبار مربوط به کابینه دولت، برجام و قیمت‌های جهانی باشیم. همچنین گزارشات سه ماهه شرکت‌ها نیز در حال انتشار است و بر روند کلی بازار تأثیرگذار خواهند بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳,۶۰۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه 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	۱۴۰۰/۰۴/۰۵	۱۴۰۰/۰۴/۰۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲,۵۷۱	۳,۶۰۳	۴۰٪



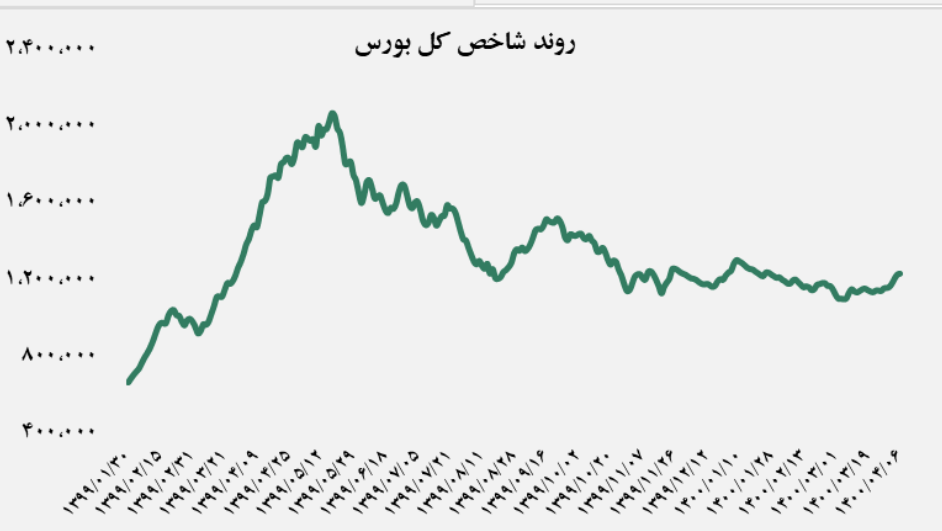
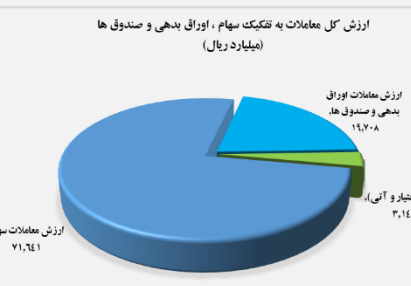
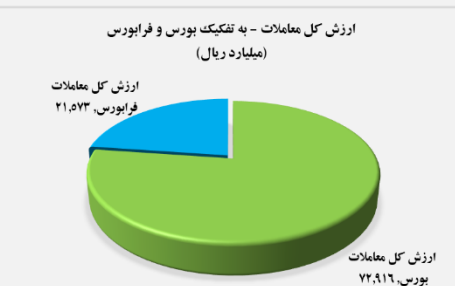
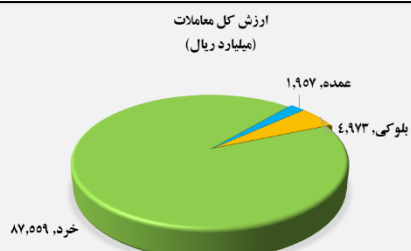
## گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پلیمر آریا ساسول به طور متوسط تولید اتیلن و سی تری پلاس به عنوان محصول ابتدای زنجیره در سال گذشته بر عدد ۹۰ هزار تن استوار بوده در سال جاری متوسط تولید ۹۵ هزار تن است. خرداد ماه نیز ۹۷ هزار تنی را دارد. شرکت در سال گذشته متوسط فروش ۹۲ هزار تنی انواع محصول را داشته است که در سه ماه ابتدای سال ۷۵، ۷۶ و ۷۹ هزار تنی را ثبت کرده است. آریاساسول در سال گذشته هر ماه ۱,۵۰۰ میلیارد فروش داشته است که در سه ماه ابتدای سال ۱۴۰۰ فروش‌های شرکت برابر ۱,۷۵۴، ۱,۶۲۶ و ۱,۴۳۴ میلیارد تومان است. فروش سه ماهه ابتدای سال جاری رشد ۹۶ درصدی نسبت به مدت مشابه دارد. شرکت در سال جاری ۵۱ هزار تن به موجودی انواع پلی اتیلن خود افزوده است که با نرخ‌های خرداد، در حدود ۹۰۰ میلیارد می‌توانست به فروش سه ماهه شرکت اضافه کند. در حالی متوسط نرخ انواع پلی اتیلن شرکت در سال ۹۹ برابر ۱۹,۵۰۰ تومانی را ثبت کرده بود که در سه ماهه اول سال جاری به ۲۴ هزار تومان رسیده است.

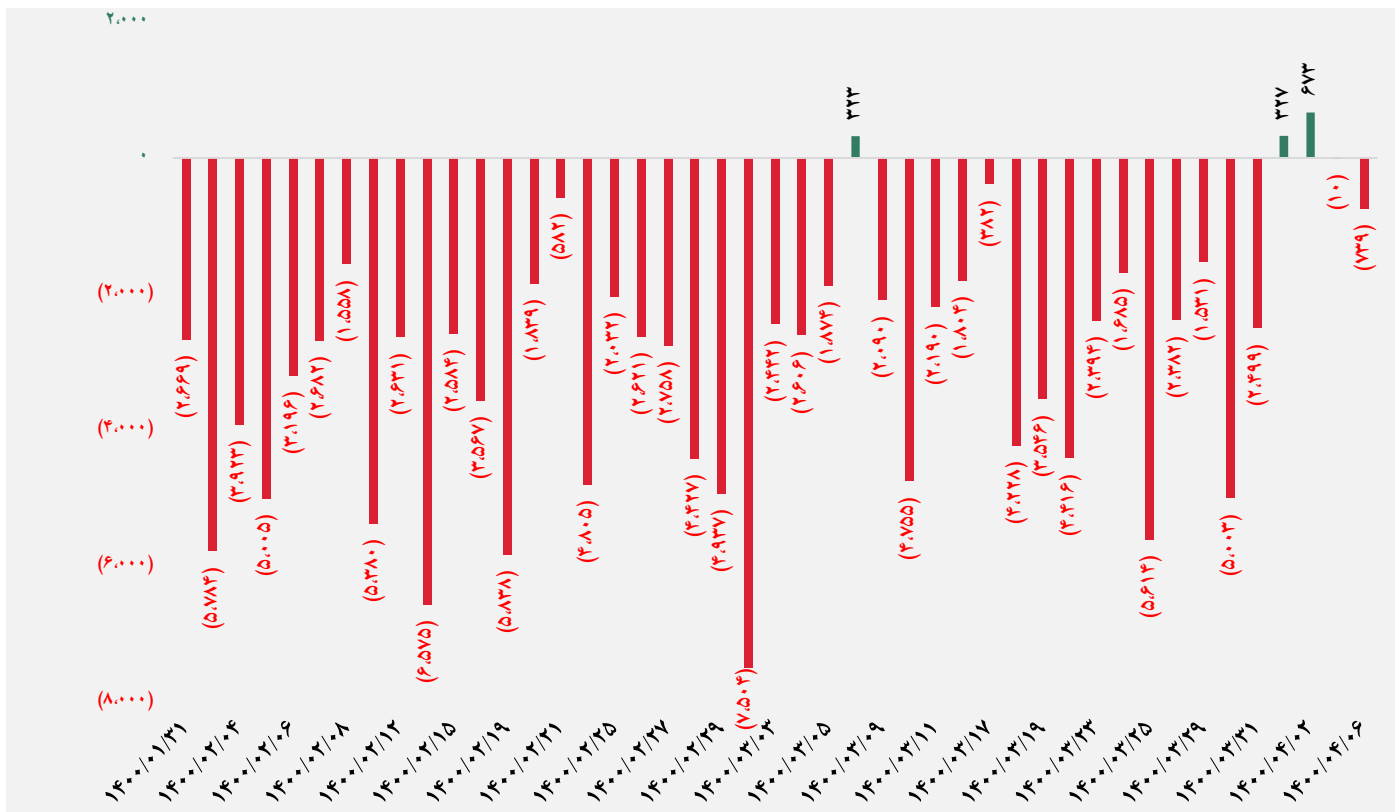
در گروه شیمیایی، متوسط تولید ماهانه شرکت صنایع بهداشتی سینا در سال مالی منتهی به آذر ۹۹، ۲۹۶۰ تن محصول بوده است. در شش ماه ابتدای سال ۲,۸۰۰ تن تولید داشته است و تولید خرداد برابر با ۲,۸۳۰ تن است. فروش شرکت در سال گذشته ۳۷ هزار تن محصول (متوسط ماهانه ۳,۱۱۱) و در شش ماهه ۱۶ هزار تن (متوسط ماهانه ۲,۷۰۰ تن) بوده است. فروش خرداد ماه سال جاری برابر با ۲,۳۰۰ تن است. میانگین فروش شرکت در چهار فصل سال مالی ۹۹ برای هر ماه به ترتیب ۱۸، ۲۰، ۱۹ و ۳۰ میلیارد تومان بوده است. در فصل اول و دوم امسال متوسط فروش ۳۱ و ۲۳ میلیارد ثبت شده است. فروش خرداد برابر با ۲۵ میلیارد تومان است. فروش شش ماه امسال رشد ۴۹ درصدی نسبت به مدت مشابه سال گذشته دارد. متوسط نرخ فروش در سال مالی گذشته ۶,۷۰۰ تومان برای هر کیلو بوده که در شش ماهه امسال ۱۰ هزار تومان است. نرخ خرداد نسبت به ماه قبل ۳ درصد کاهش را نشان می‌دهد و برابر با ۱۰,۸۰۰ تومان است.

## تصویر کلی بازار

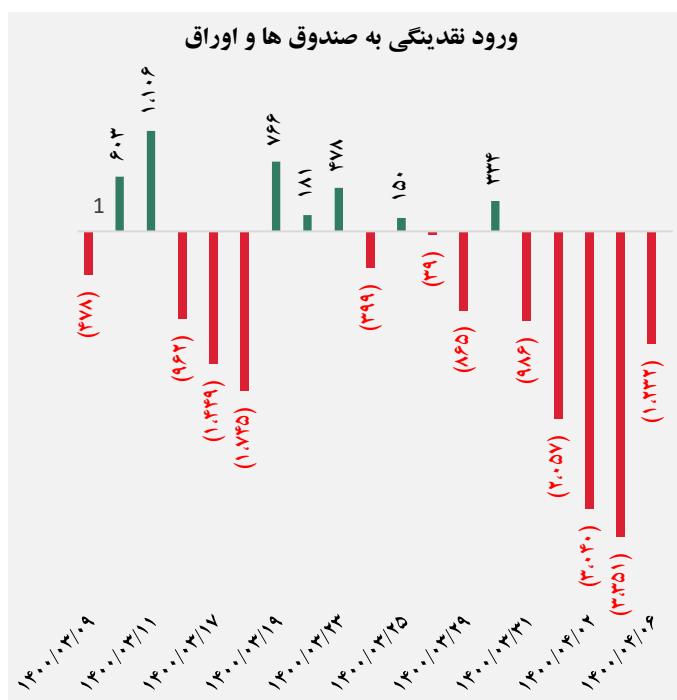
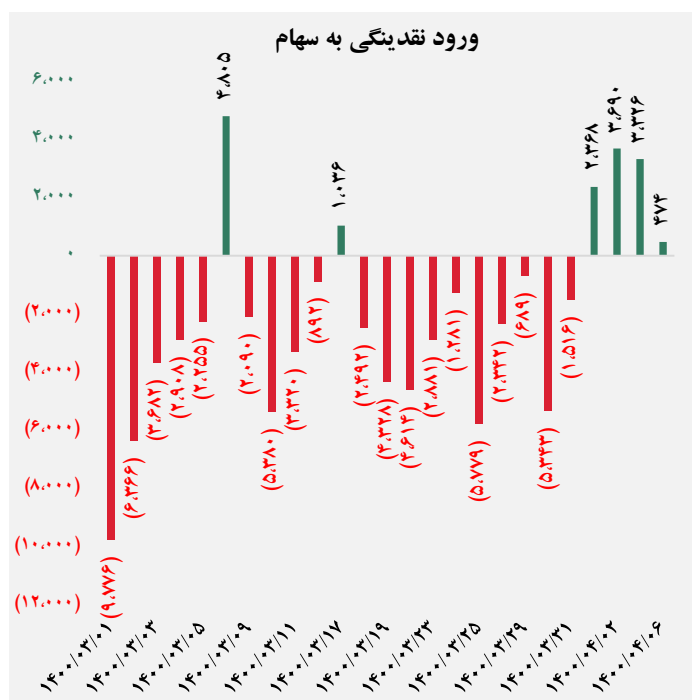
فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۶۷	شاخص کل	۱,۲۳۸,۴۸۵	شاخص کل
۱	تغییر شاخص	۴,۷۴۷	تغییر شاخص
۱۱,۷۶۸,۲۹۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۳۹۹,۶۳۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۱,۵۷۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۷۲,۹۱۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>	
صبا		شستا	
ارفع		تاپیکو	
فرا بورس		جم	
کگهر		نوری	
<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>	
غصینو		فولاد	
دماوند		فملی	
ذوب		شپنا	
سمگا		فارس	



## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



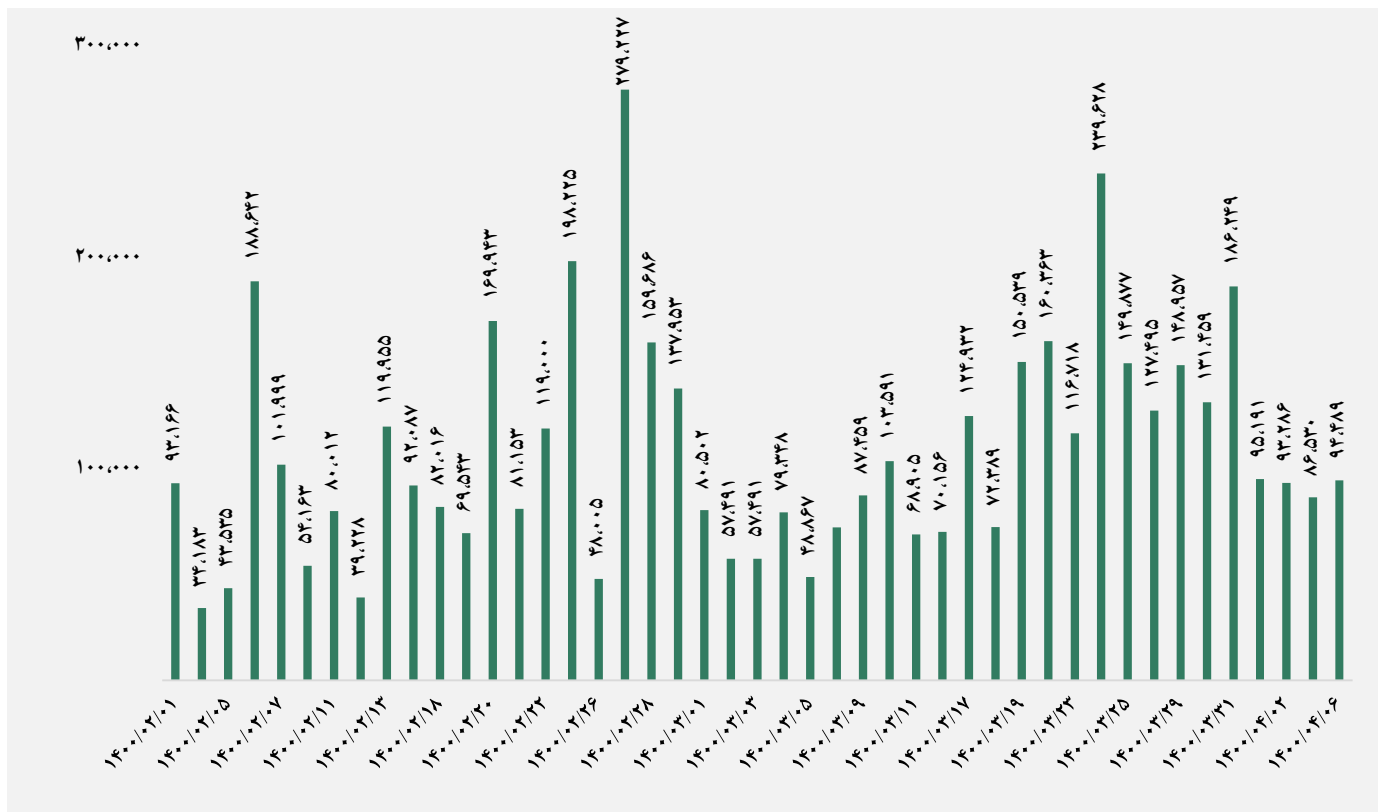
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



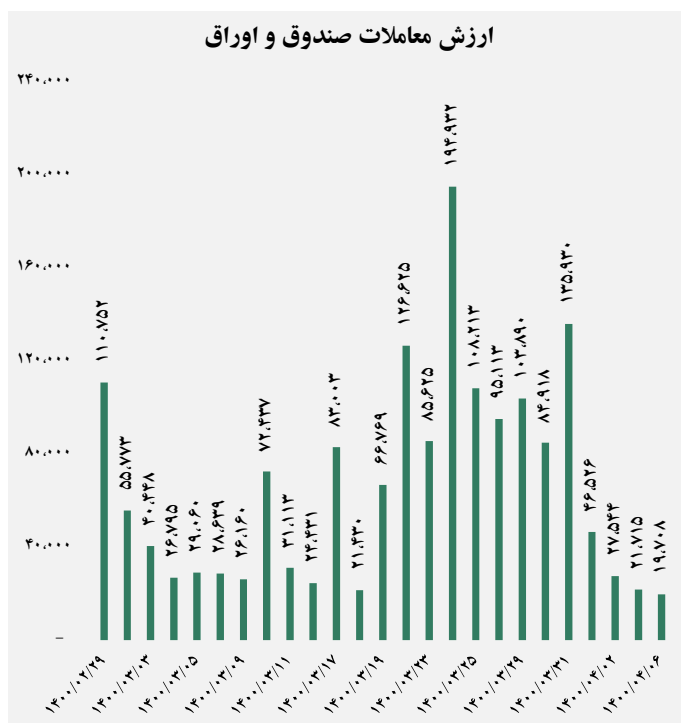
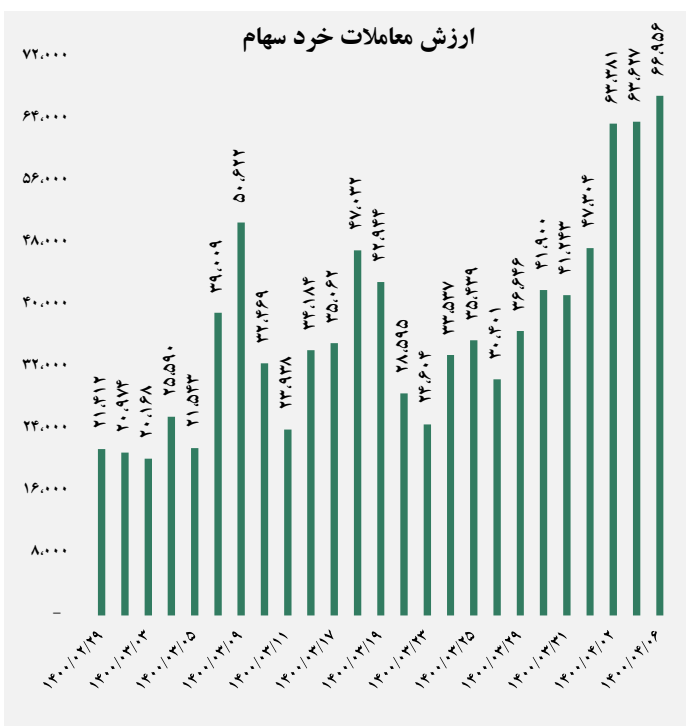
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



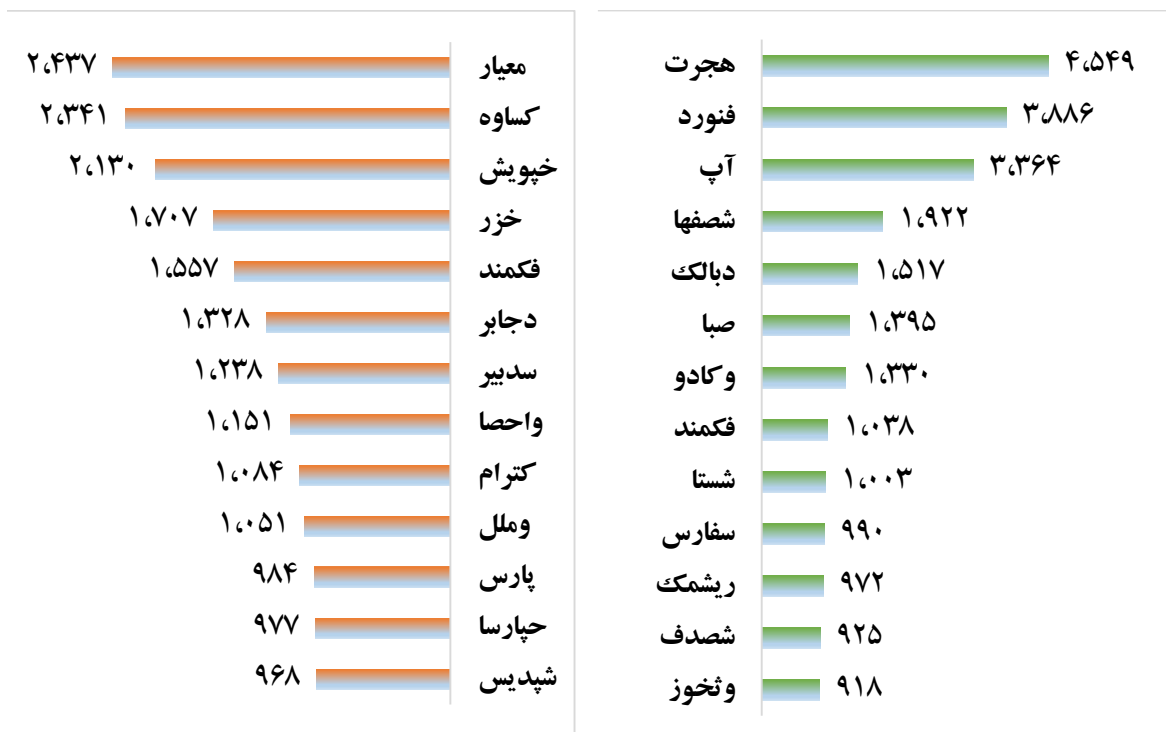
## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



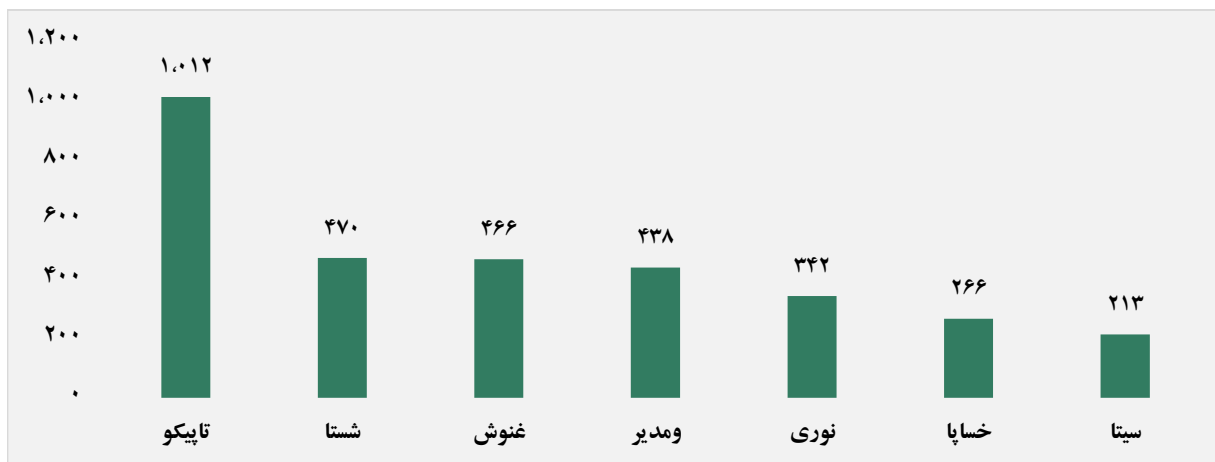
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



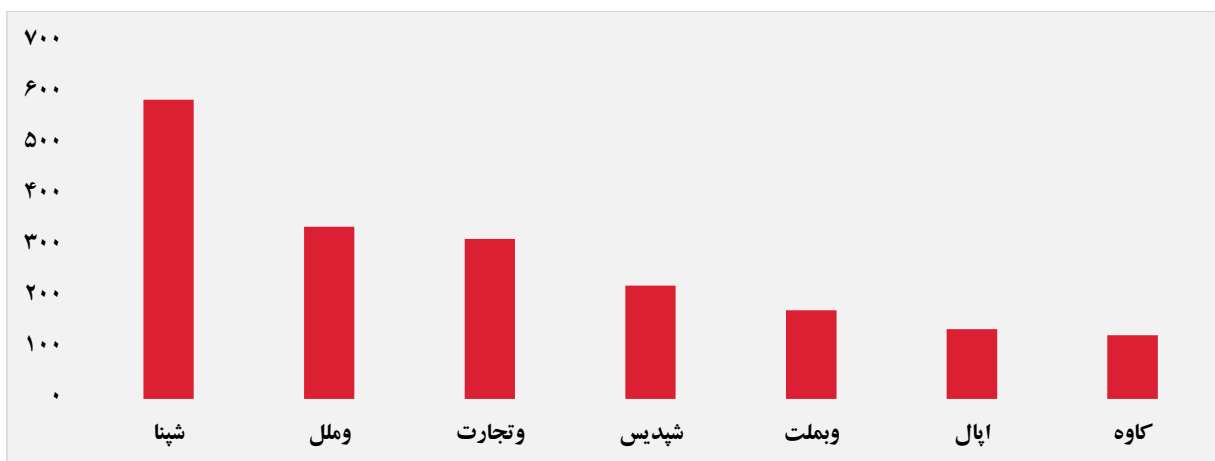
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	رافزا	۱	برکت
۲	تکشا	۲	کپارس
۳	ولانا	۳	غپآذر
۴	کی بی سی	۴	داوه
۵	حسیر	۵	افرا
۶	ومدیر	۶	غشاذر
۷	خشرق	۷	خفولا
۸	ثفارس	۸	قصفها
۹	سیتا	۹	مرقام
۱۰	سشرق	۱۰	غبهوش

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



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

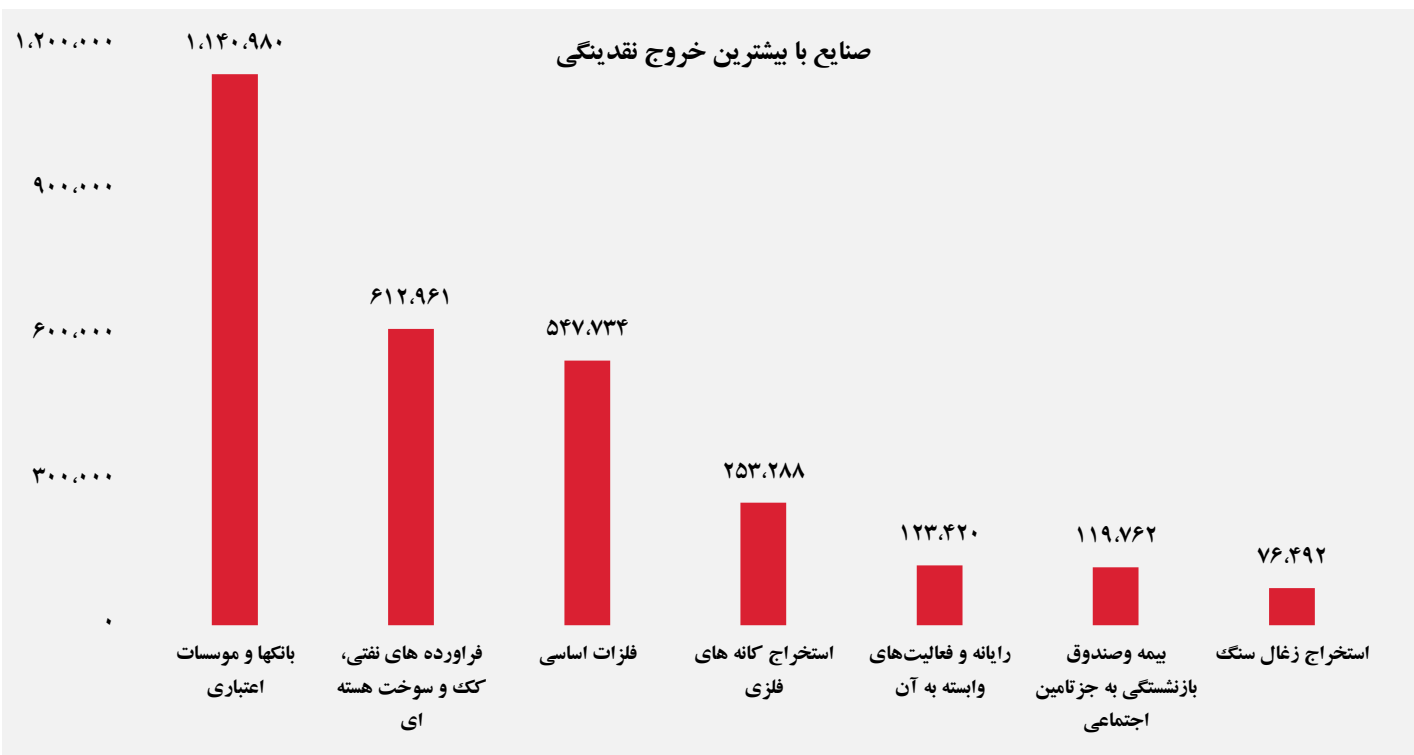
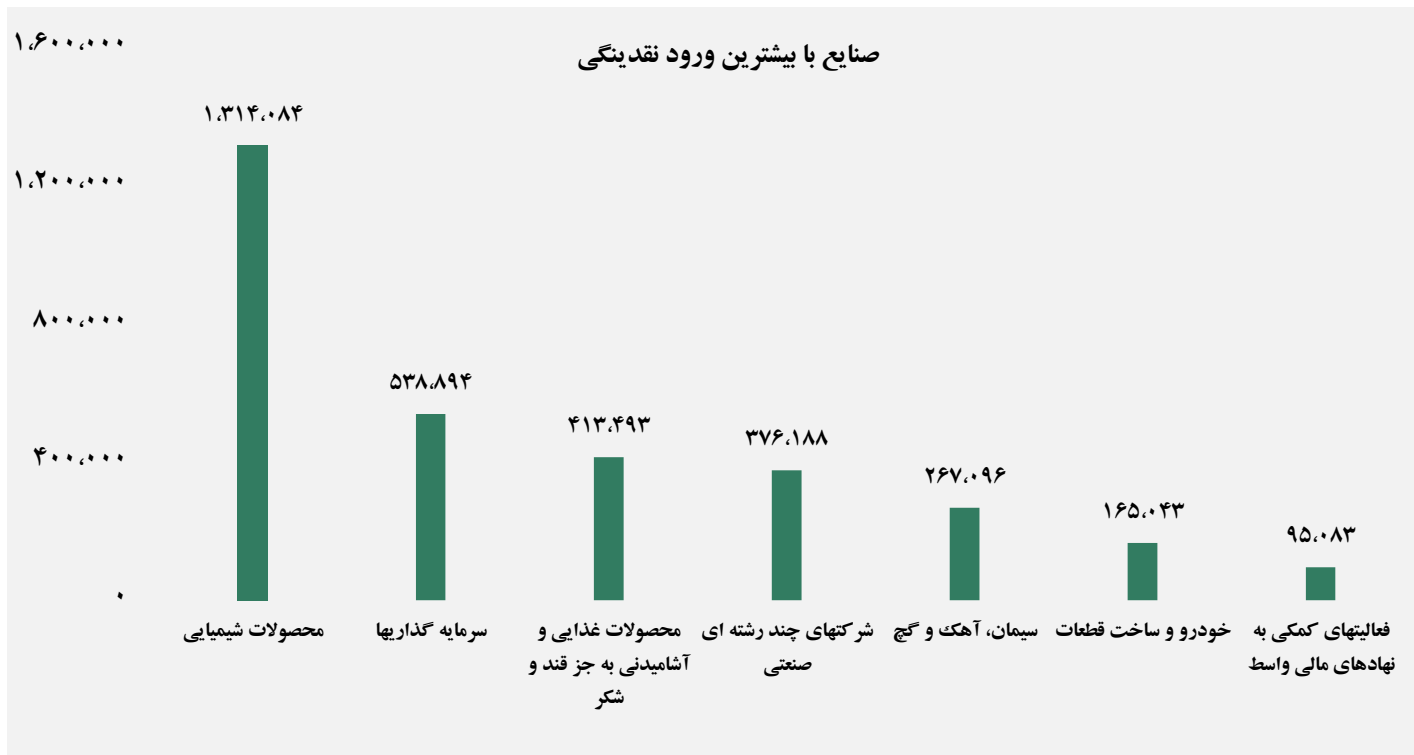


### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	غکورش
۲	فراپورس	۱۱	کزغال
۳	غشاذر	۱۲	بورس
۴	کالا	۱۳	تاپکیش
۵	زکوثر	۱۴	شغدیر
۶	سیلام	۱۵	نوری
۷	شفیبر	۱۶	کسرا
۸	دتوزیع	۱۷	کبافق
۹	فرزین	۱۸	غفارس



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار