



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۰۷

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۷ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شستا، کچاد، و تجارت، و بملت، جم و اخبر با افزایش ۵,۲۶۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۴۳,۷۴۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۱۹ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش 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. در روز جاری ۳۲ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

در بازار جهانی قیمت کامودیتی‌ها پس از یک اصلاح محسوس در هفته‌های گذشته، بخشی از ریزش خود را باز پس گرفته اما در حال حاضر به صورت منفی در حال معامله هستند. به نظر می‌رسد بازارهای جهانی تحت تاثیر شیوع کرونای هندی و بسته انبساطی بایدن باشند. همچنین بعد از مدت‌ها، شاخص دلار در حال تقویت می‌باشد و این موضوع می‌تواند در بلندمدت بر روی قیمت کامودیتی‌ها اثر منفی بگذارد. در داخل کشور نیز قیمت ارز در بازار آزاد و بازار نیما همگی با رشد نسبی همراه بوده و مذاکرات برجانی به مرحله حساس تصمیم‌گیری رسیده و طرف‌ها مواضع خود را جدی‌تر از قبل پیگیری می‌کنند و احتمال بدون نتیجه بودن مذاکرات هم مطرح شده و ضمن اینکه مهلت همکاری ایران با آژانس اتمی پایان یافته است. عامل‌های بازار جهانی و نرخ دلار در داخل کشور در حال حاضر در حال خنثی کردن همدیگر هستند و این موضوع می‌تواند حداقل در بازه کوتاه مدت اثر منفی بر روی بازار سهام نداشته باشد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۳۹,۴۹۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی 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 ۲۵,۲٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۰۶	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳,۶۰۳	۱۳۹,۴۹۱	۳۷۷۲٪



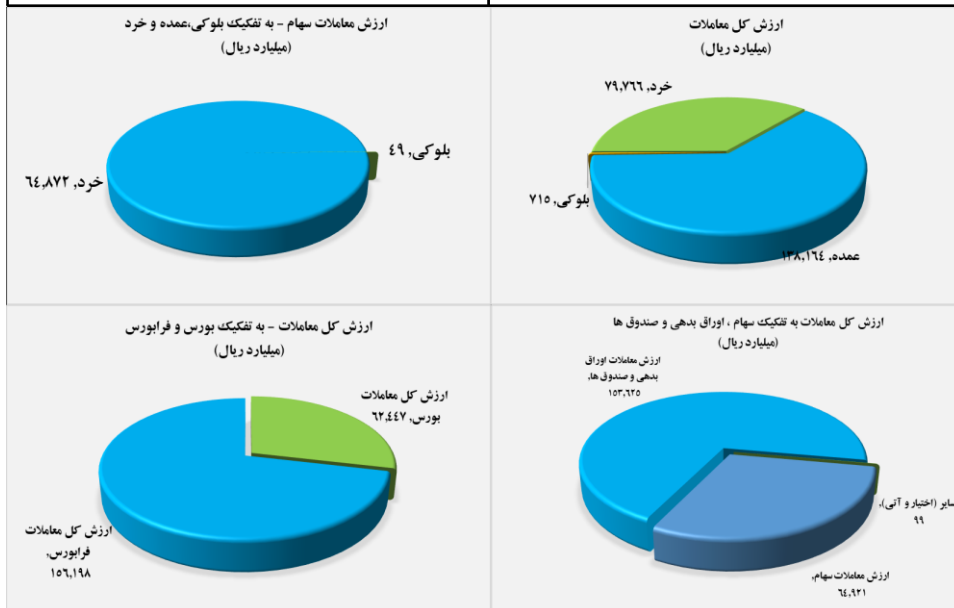
گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، شرکت آلومینیم ایران که بطور میانگین هر ماه ۱۵,۲ هزار تن تولید دارد در اردیبهشت تولید ۱۴,۹ هزار تنی داشت و در خرداد ماه تولیدی برابر با ۱۵,۴ هزار تن گزارش کرده است. این شرکت در سه ماهه تولیدی برابر با ۴۵,۶ هزار تن داشته است. این آلومینیوم‌ساز هر ماه بطور میانگین ۱۵,۷ هزار تن فروش دارد. در اردیبهشت فروشی برابر با ۱۹,۵ هزار تن داشت که در خرداد این مقدار ۱۸,۷ هزار تن بوده است. شرکت در سه ماهه فروش ۴۷ هزار تنی داشته است. میانگین ماهانه فروش فایرا ۸۱۳ میلیارد تومان است که در اردیبهشت ماه فروش ۱,۰۱۲ میلیارد تومانی و در خرداد فروش ۹۶۷ میلیارد تومانی را گزارش کرده است. نرخ فروش محصولات شرکت نسبت به ماه گذشته بطور متوسط کاهش ۱ درصدی داشته است.

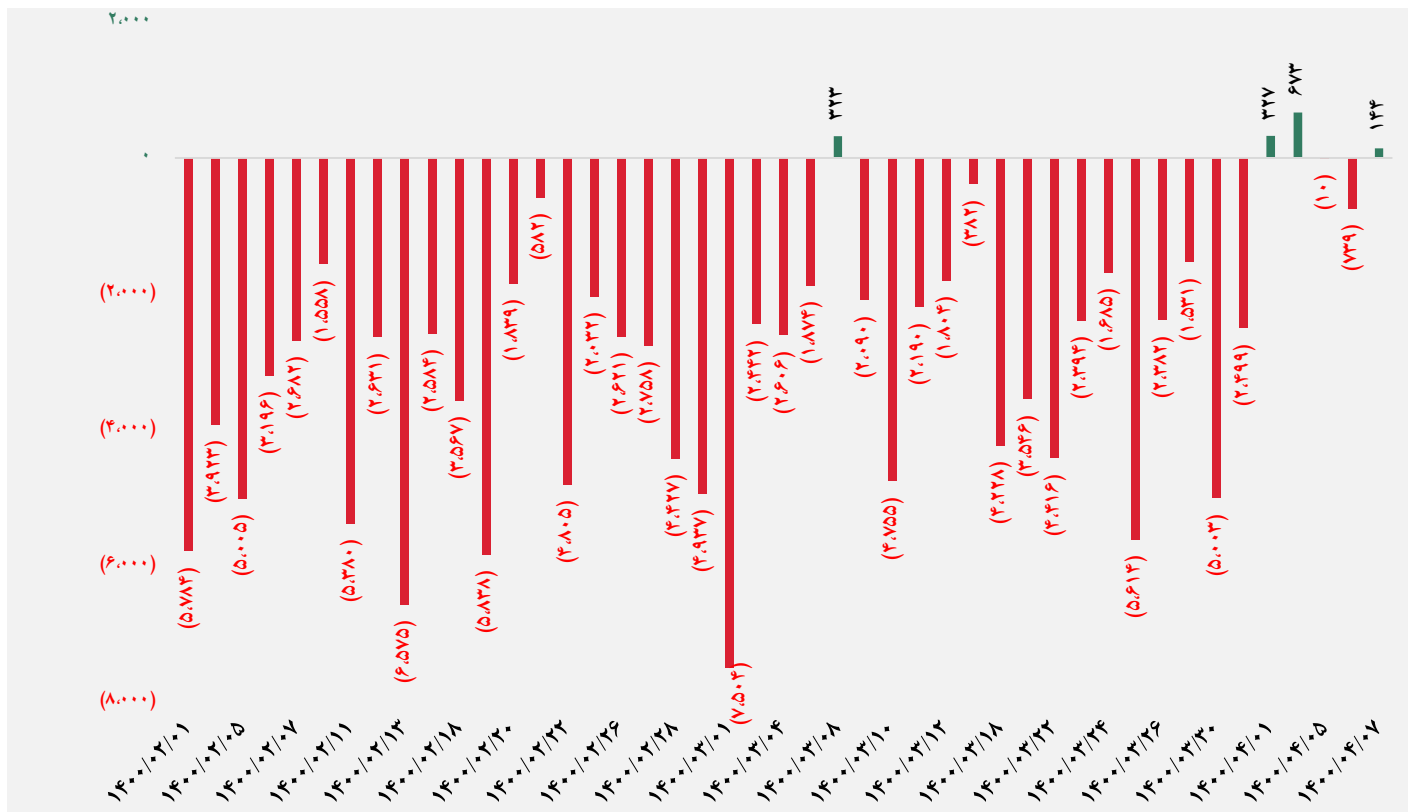
در گروه شیمیایی، شرکت پلی اکریل ایران در ششمین ماه سال مالی فروش ۱۴۵ میلیاردی ثبت کرده، در حالی که میانگین فروش ۵ ماه ابتدایی برابر با ۱۲۹ میلیارد است. شرکت در سال مالی قبل فروش ۹۷۵ میلیاردی داشته که میانگین فروش ماهیانه ۸۱ میلیارد تومان بود. پلی اکریل در خرداد ۴,۰۸۲ محصولات پلی استر تولید کرده است. محصولات اکریلک در دو ماه گذشته تولید نشده است. میانگین این اعداد در پنج ماهه قبل ۴,۵۰۰ و ۳۱۱ تن بوده‌اند. میانگین تولید این دو محصول در سال قبل ۳,۸۸۶ و ۴۵۱ تن می‌باشد. شرکت در خرداد ماه ۴,۴۰۰ تن محصولات پلی استر و ۶۳ تن محصولات اکریلک فروخته است که این اعداد به طور میانگین ۵ ماهه برابر با ۴,۰۰۰ و ۳۵۴ تن بود. میانگین فروش این دو محصول در سال قبل ۳,۸۷۱ و ۴۶۷ تن ثبت شده است. نرخ فروش نخ پلی استر در این ماه ۳۳ هزار تومان به ازای هر کیلوگرم و الیاف اکریلک ۶۷ هزار تومان بوده است. میانگین نرخ سال قبل این دو محصول به ترتیب ۱۷ و ۳۷ هزار تومان می‌باشد.

تصویر کلی بازار

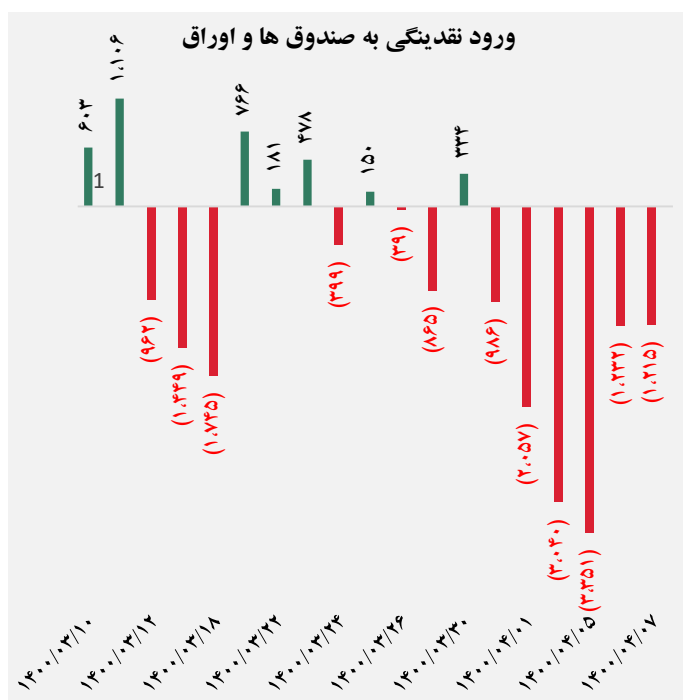
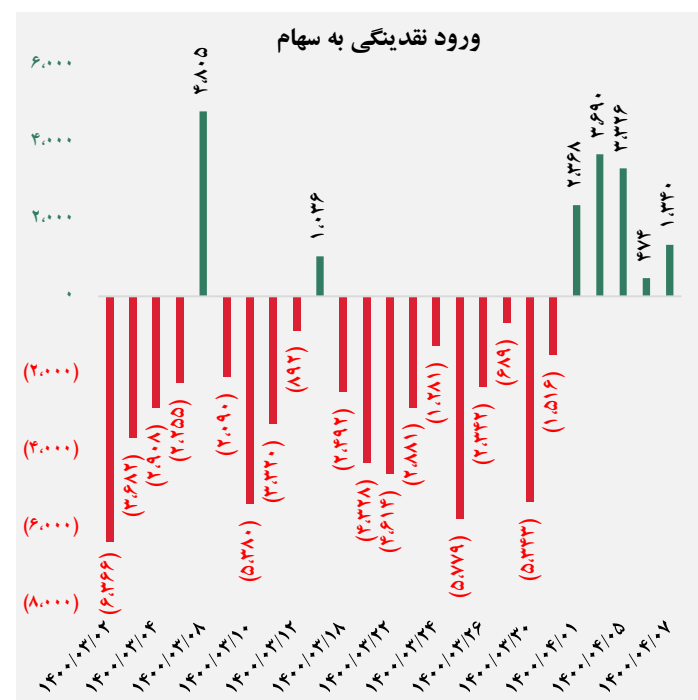
فرا بورس		بورس	
۱۷,۷۹۹	شاخص کل	۱,۲۴۳,۷۴۷	شاخص کل
۳۱	تغییر شاخص	۵,۲۶۱	تغییر شاخص
۱۱,۷۸۸,۹۴۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۶۰۹,۵۰۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۵۶,۱۹۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۶۲,۴۴۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
صبا		شستا	
هرمز		کچاد	
غصینو		و تجارت	
زاگرس		وبملت	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
آریا		فارس	
آ س پ		شپنا	
سمگا		فملی	
شگویا		برکت	



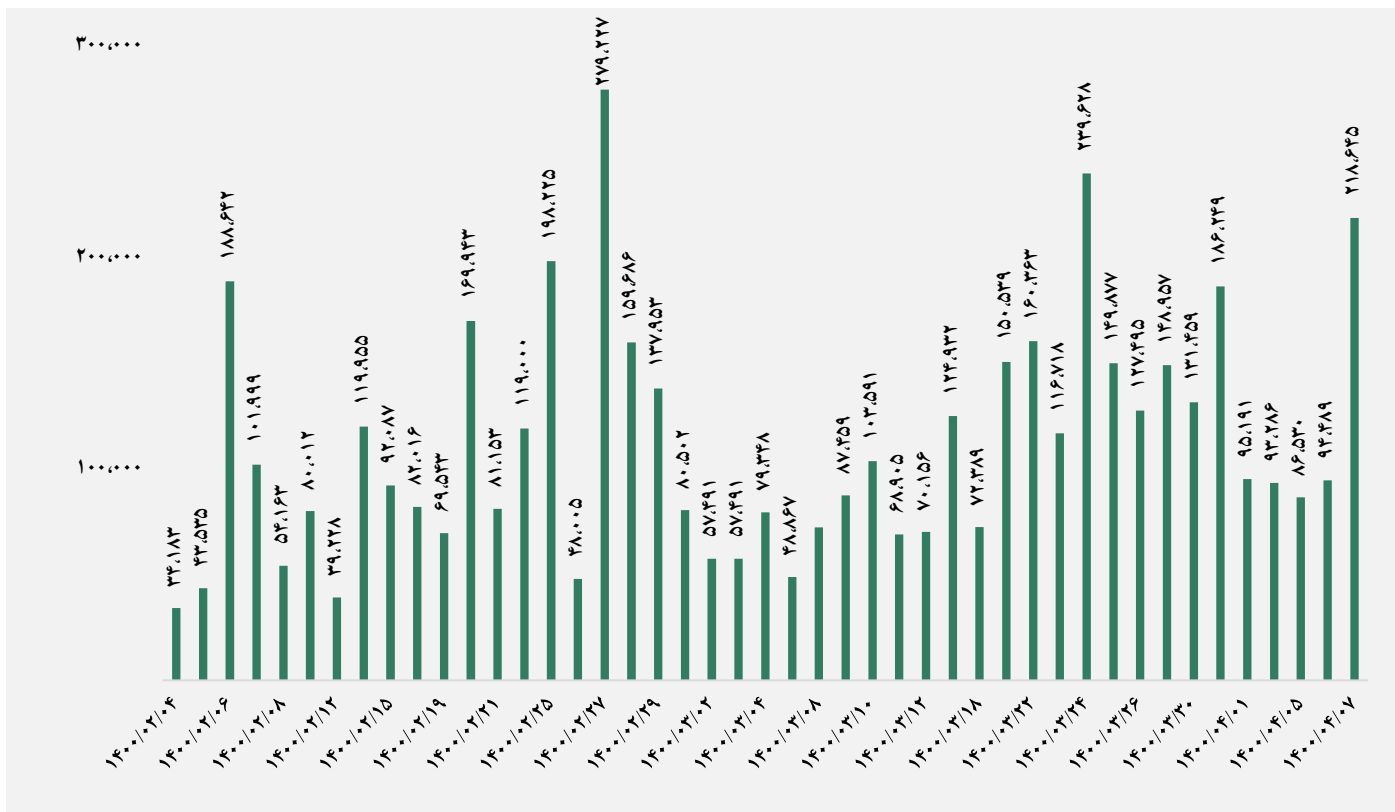
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



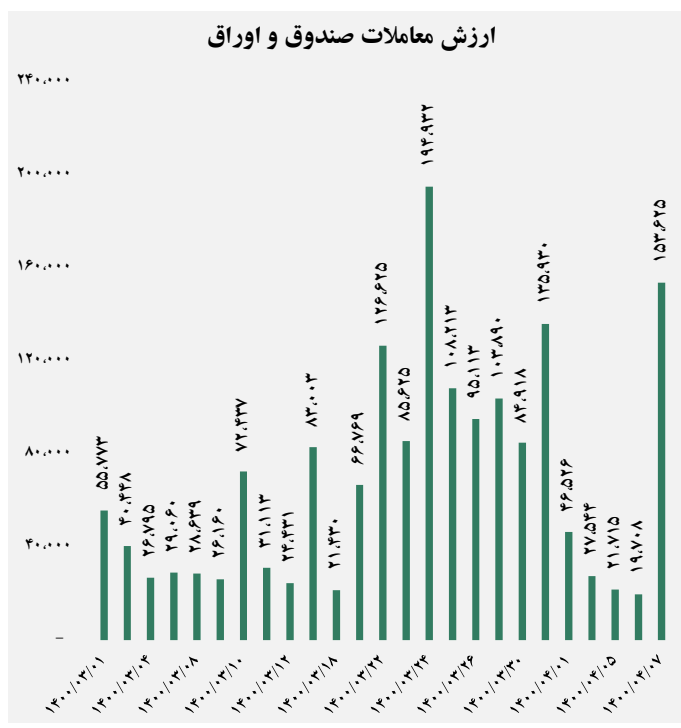
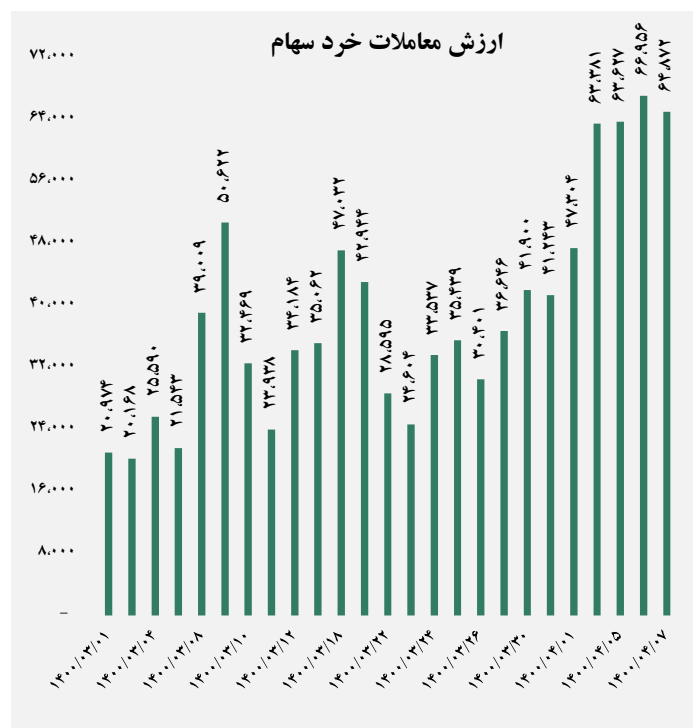
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

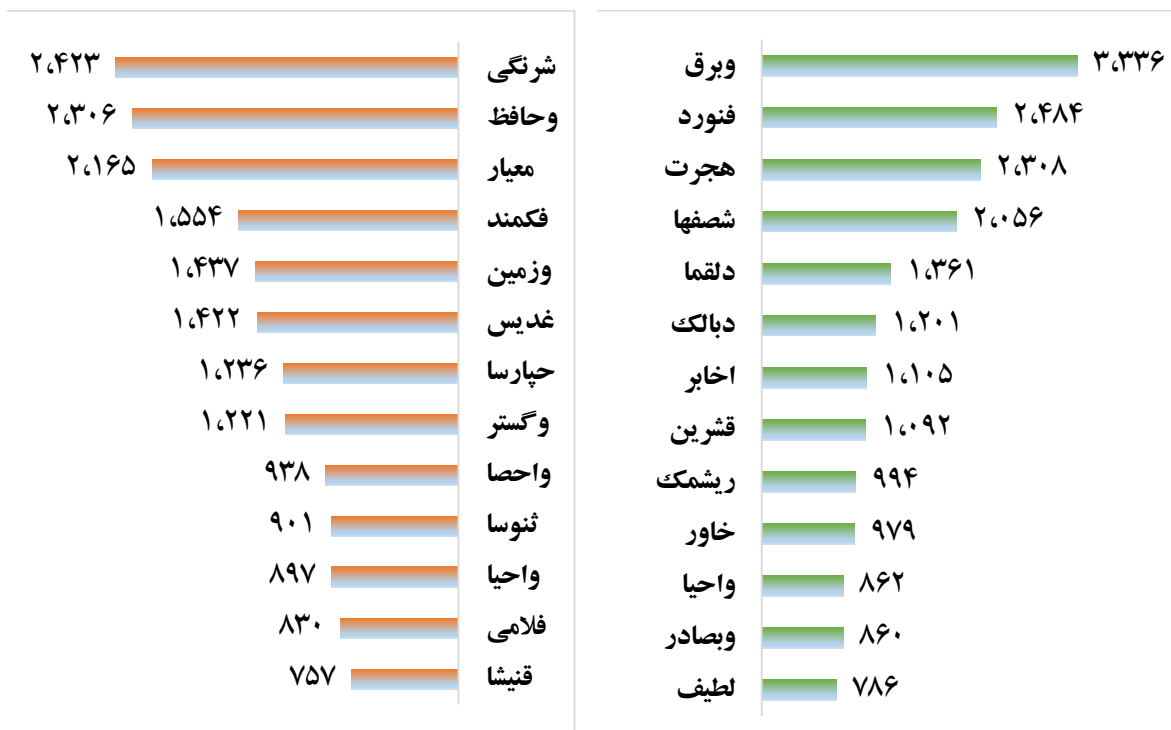


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





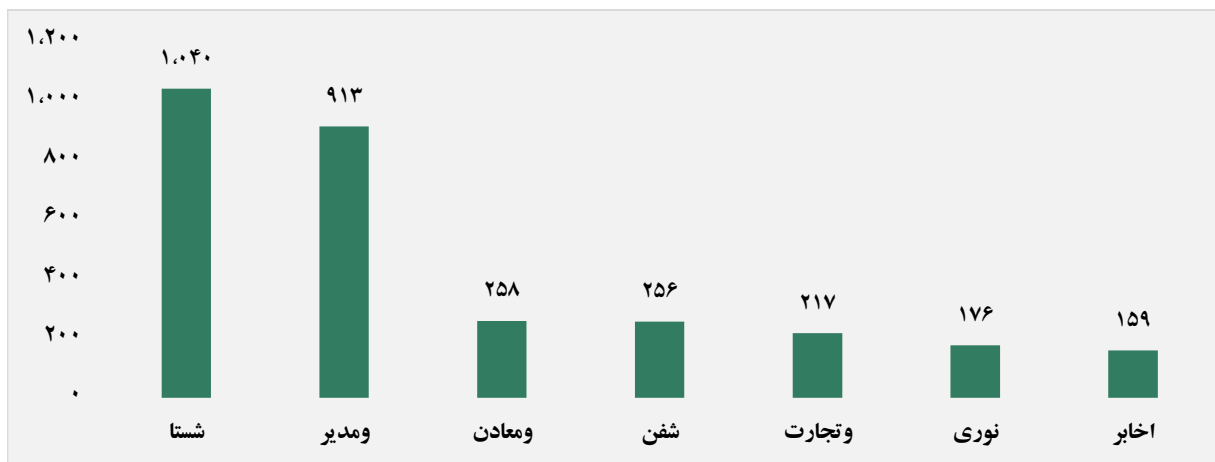
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



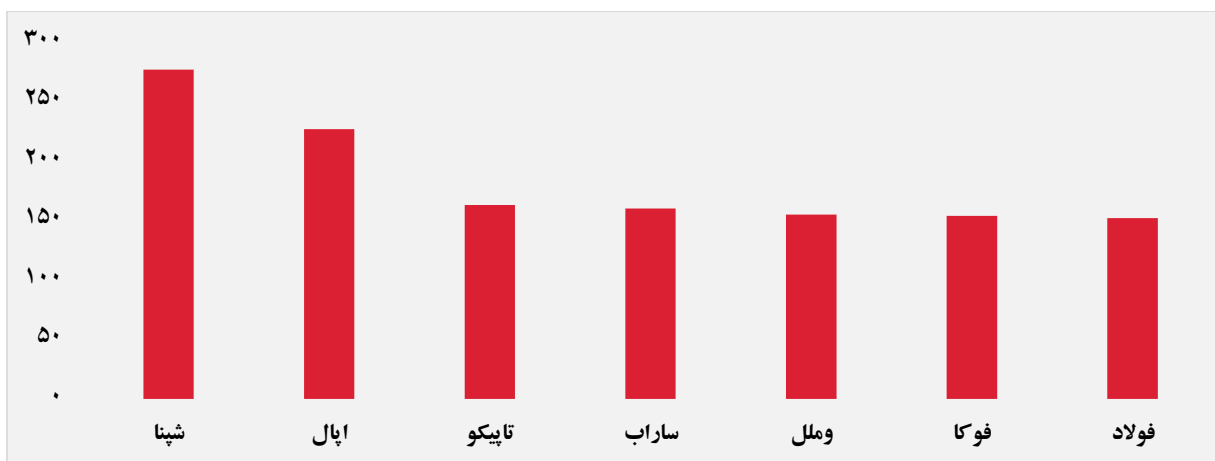
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	گدنا	۱	گپارس
۲	رافزا	۲	زنگان
۳	شفن	۳	غپاک
۴	کلر	۴	رتکو
۵	ومدیر	۵	فراپورس
۶	شکرین	۶	تمحرکه
۷	شصدف	۷	غگلپا
۸	اپ	۸	تکشا
۹	کمینا	۹	خرینگ
۱۰	حیندر	۱۰	آ س پ

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

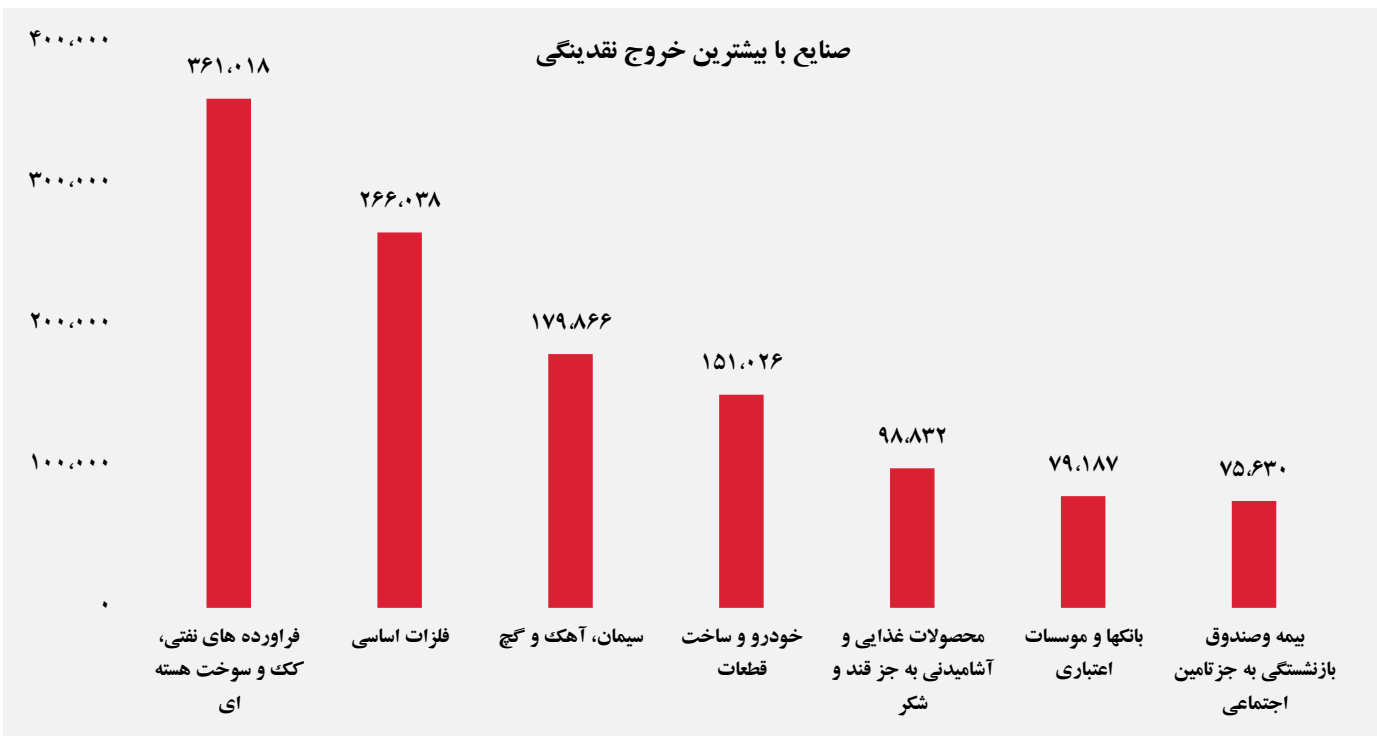
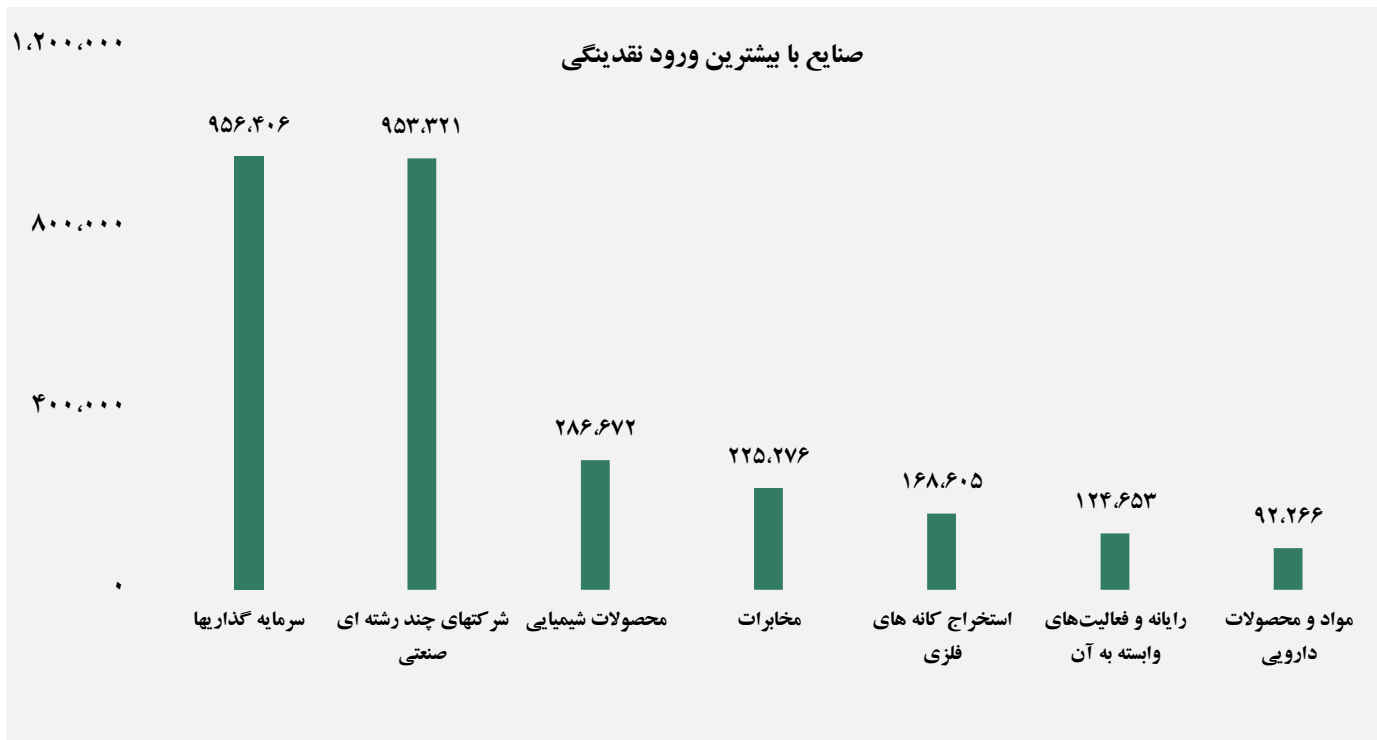


واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	غپاک	۱۰	کبافق
۲	فرا بورس	۱۱	بورس
۳	ومدير	۱۲	تاپکیش
۴	ساراب	۱۳	غگورش
۵	نفارس	۱۴	شغدیر
۶	پرکت	۱۵	سیلام
۷	آپ	۱۶	زاگرس
۸	چفیر	۱۷	دتوزیع
۹	کالا	۱۸	سصوفی



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار