



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۰۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۸ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای امید، معادن، کگل، اخبر، فملی و فولاد با افزایش ۴,۷۲۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۴۸,۵۳۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۷ 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. در روز جاری ۳۲ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. نرخ دلار از هفته گذشته روند صعودی به خود گرفته و از حوالی ۲۳,۶۰۰ تومان به بالای ۲۵ هزار تومان رسیده است. در نمودار دلار به ریال نیز کف قیمتی حوالی ۲۱ هزار تومان به وضوح قابل رویت است و در حال حاضر نباید انتظار برگشت قیمت دلار و از آن مهمتر تثبیت قیمت دلار به سمت ۲۱ هزار تومان باشیم. اما سقف قیمتی نرخ دلار هر چند که در بازه ۲۵,۲۰۰ الی ۲۶,۰۰۰ تومان مقاومت محکمی دارد، اما با توجه به شرایط سیاسی و اقتصادی کشور، نرخ دلار می‌تواند به راحتی به بیش از ۲۶ هزار تومان برسد. اگرچه بازار سرمایه از این اتفاق بهره خواهد برد اما اکثر مردم قدرت تحمل کاهش بیشتر ارزش پولی را ندارند و امید می‌رود دولت جدید بتواند از این وضعیت جلوگیری کند. در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۳,۲۸۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۵۴ 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 ۲۲,۲٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	۱۴۰۰/۰۴/۰۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۳۹,۴۹۱	۲۳,۲۸۱	-۸۳٪



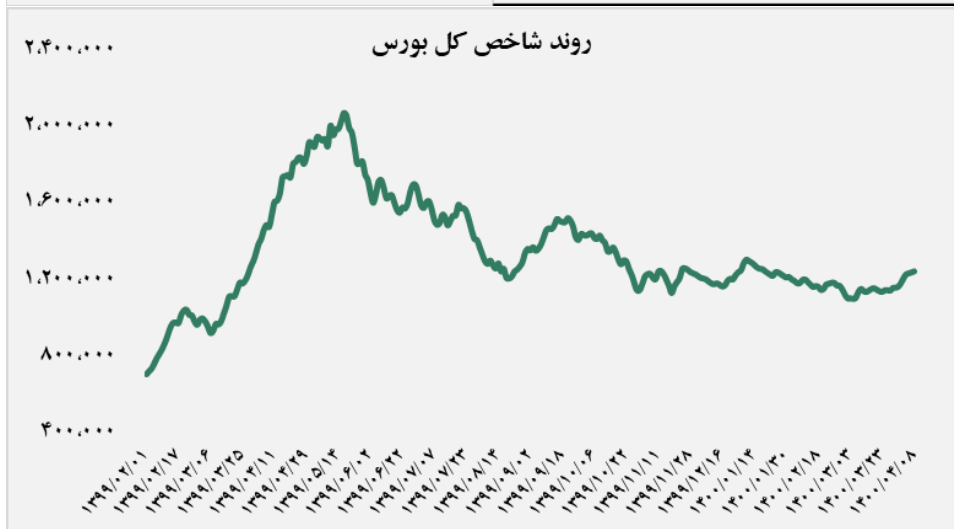
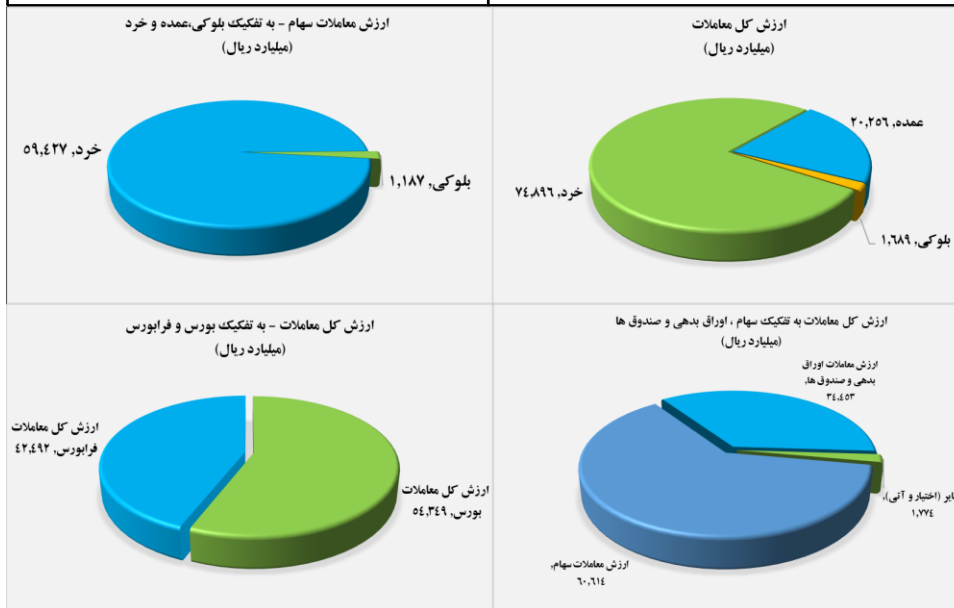
گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد خراسان در فروردین الی خرداد به ترتیب ۱۳۵۶۰۳، ۱۳۷۵۵۸ و ۱۳۴۰۴۳ تن آهن اسفنجی تولید کرده، میانگین تولید این محصول در سال ۹۹، ۹۹۶۵۰ تن بوده است. در خرداد فروش ۶۰,۷۹۰ تنی گزارش شده است. در فروردین ۳۸,۶۳۷ تن و در اردیبهشت ۱۶,۷۷۵ تن شمش به فروش رسیده، میانگین فروش ماهانه این محصول در سال ۹۹، ۳۱۵۰۵ تن بوده است. شرکت پس از فروش‌های جذاب ۹۱۲ میلیارد تومانی اسفند و فروردین، در اردیبهشت فروش ۸۸۰ میلیارد تومانی به ثبت رساند. در خرداد ماه فروش خوب ۱,۳۶۶ میلیارد تومان گزارش شده است. میانگین فروش ماهانه سال ۹۹، ۶۰۱ میلیارد تومان بوده است. شمش در این ماه با نرخ ۱۲۱,۷۲۳ ریال معامله شده، نرخ اردیبهشت ۱۱۳,۵۰۱ ریال و میانگین نرخ این محصول در سال ۹۸، ۳۸۸۵۸ و در سال ۹۹، ۸۲۶۵۹ ریال بوده است.

در همین گروه، شرکت غلتک سازان سپاهان در خرداد ماه از نظر مقداری فروش خوب ۱۷,۸۶۱ تن را داشته است. مقدار فروش کل در آذر، دی، بهمن، اسفند، فروردین و اردیبهشت ۱۷۱۸۷، ۹۱۹۲، ۱۷۱۵۹، ۱۲۵۷۷، ۱۸۳۷۰ و ۱۱۶۴۱ تن گزارش شد بود. شرکت این ماه ۱۴,۳۷۴ تن محصول تولید کرده است. در اردیبهشت و فروردین تولید ۱۴,۹۸۹ و ۱۵,۴۹۴ را داشت. اسفند با تولید ۱۵,۶۴۳ تن محصول رکورد زده بود. در بهمن تولید خوب ۱۴,۸۱۸ تنی را داشته است. در دی ۱۲,۵۰۵ و در آبان و آذر اعداد ۱۳,۴۷۶ و ۱۳,۹۸۶ را ثبت کرده بود. میانگین تولید ماهانه سال ۹۹ برابر ۱۳,۲۳۸ تن و میانگین ماهانه سال ۹۸ برابر ۱۰,۹۳۰ تن بوده است. مبلغ فروش این تولیدکننده شمش در این ماه عدد مناسب ۲۳۰ میلیارد تومان بوده است. در آبان، آذر، دی، بهمن، اسفند، فروردین و اردیبهشت ماه ۱۲۸، ۱۸۱، ۹۸، ۱۹۰، ۱۵۱، ۲۲۴ و ۱۴۴ میلیارد تومان ثبت شده بود. نرخ فروش شمش در این ماه ۱۲۶,۰۲۱ ریال گزارش شده است. نرخ ماه قبل ۱۱۵,۳۷۸ ریال بود.

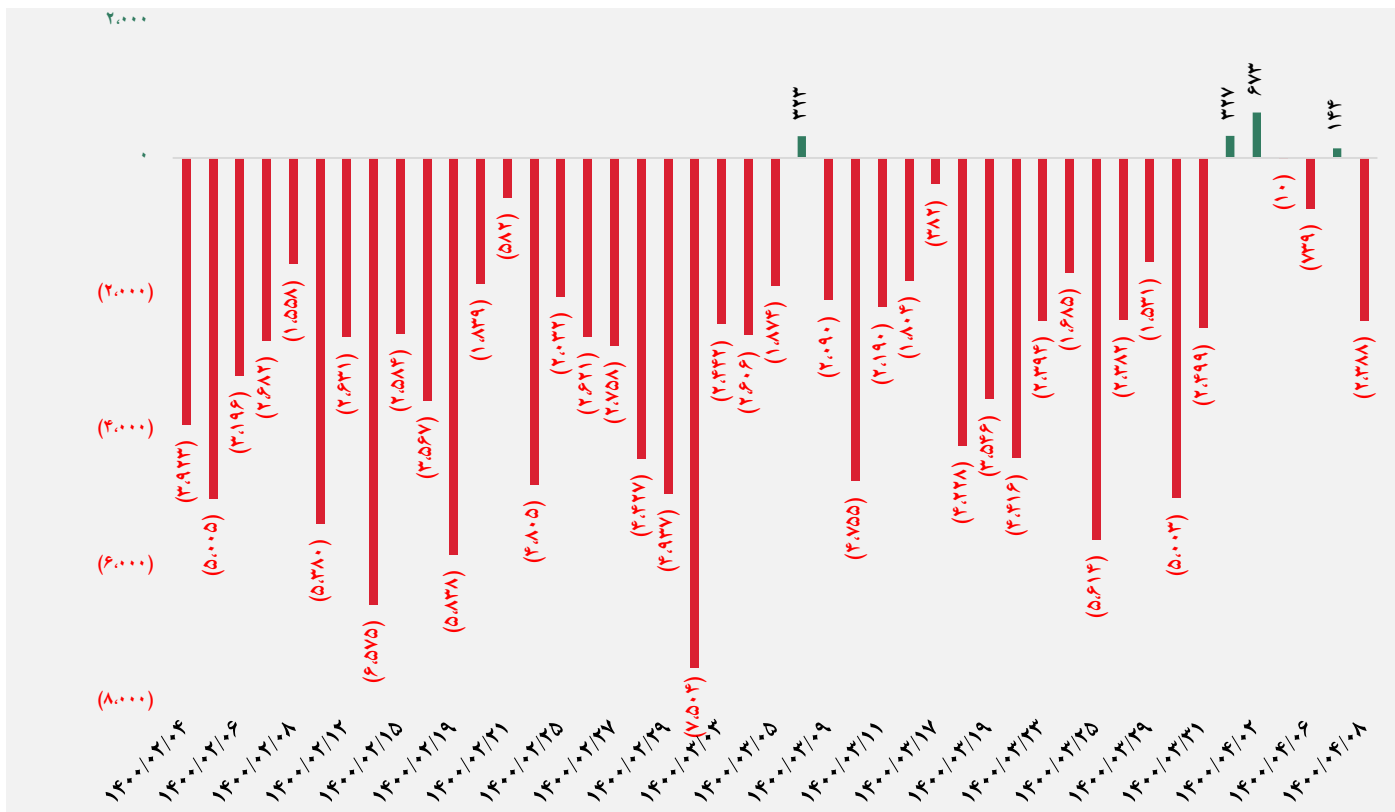
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۷,۹۶۴	شاخص کل	۱,۲۴۸,۵۳۹	شاخص کل
۱۶۴	تغییر شاخص	۴,۷۲۷	تغییر شاخص
۱۱,۸۹۸,۰۲۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۷۷۵,۹۴۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۴۲,۴۹۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۴,۳۴۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
	آریا		وامید
	زاگرس		ومعادن
	شگویا		کگل
	هرمز		اخابر
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
	ودی		شستا
	غویتا		فارس
	وهور		شپنا
	زفکا		وسصفا

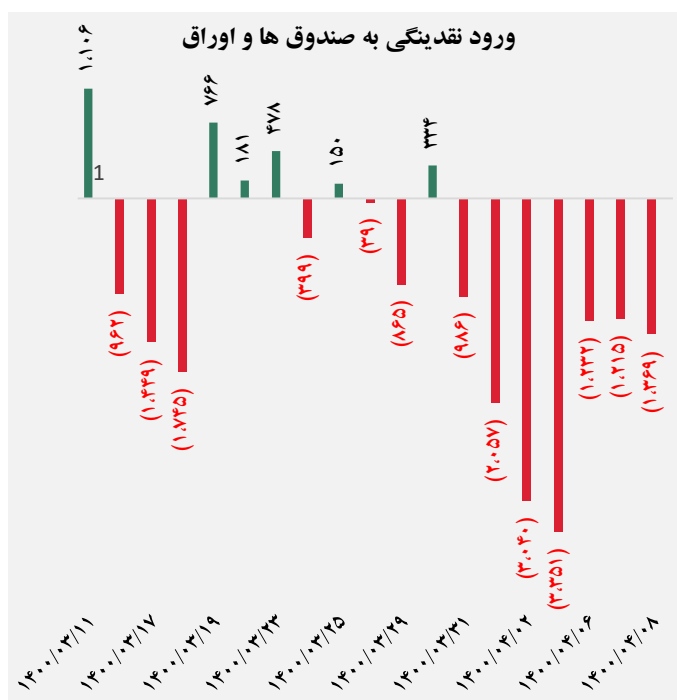
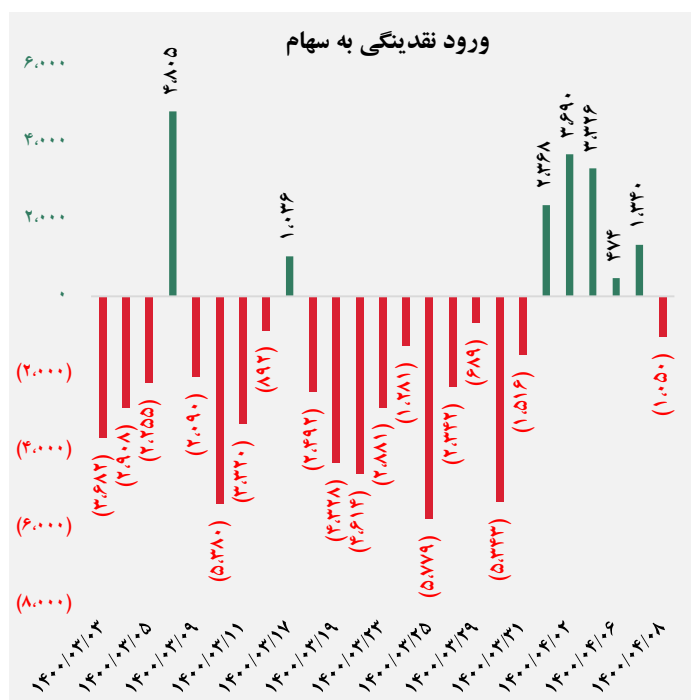


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

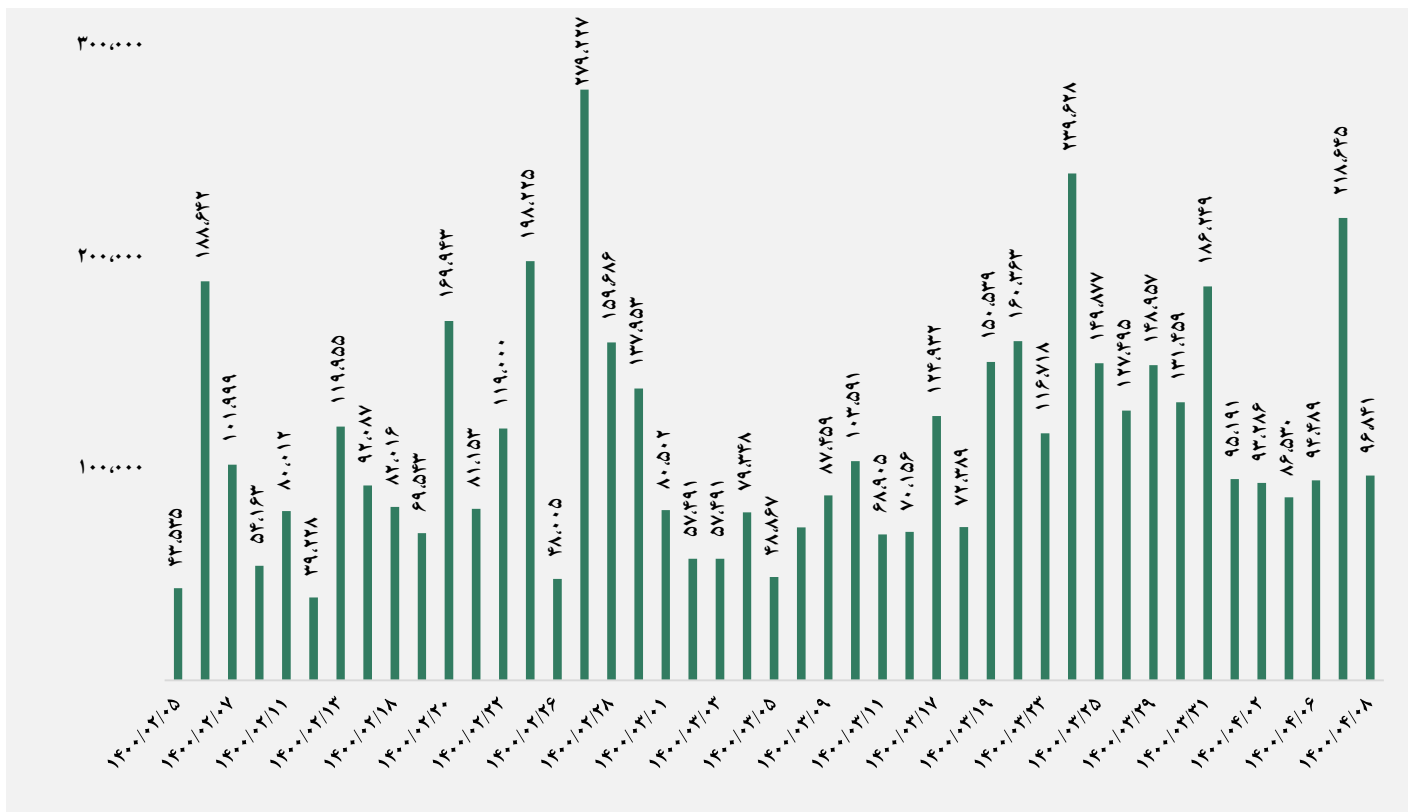


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

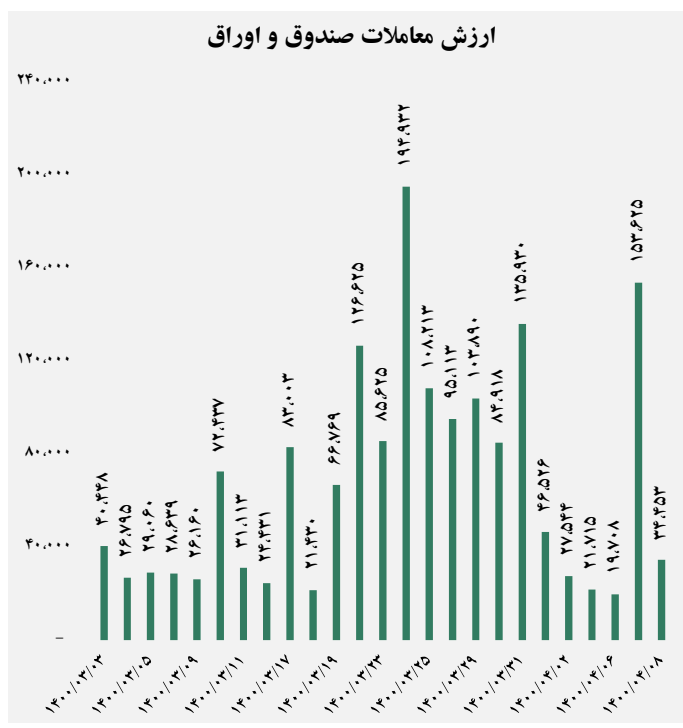
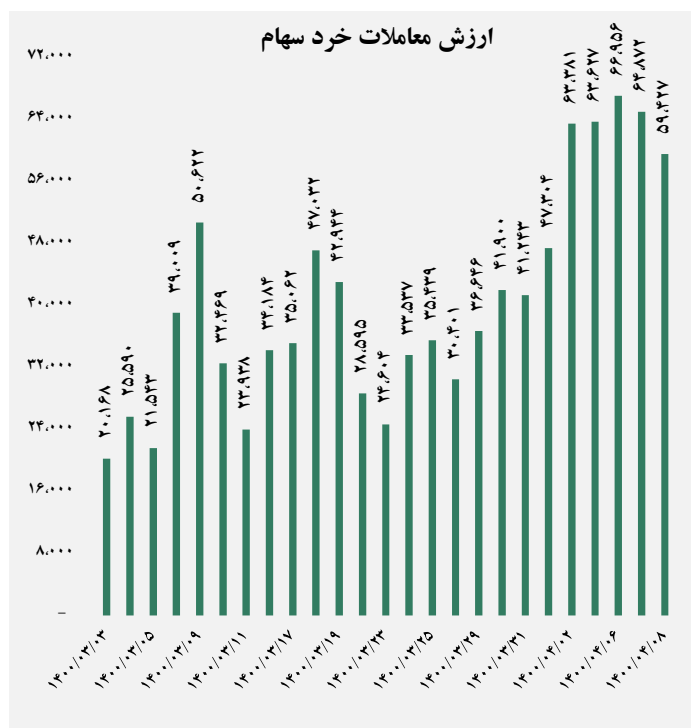




ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



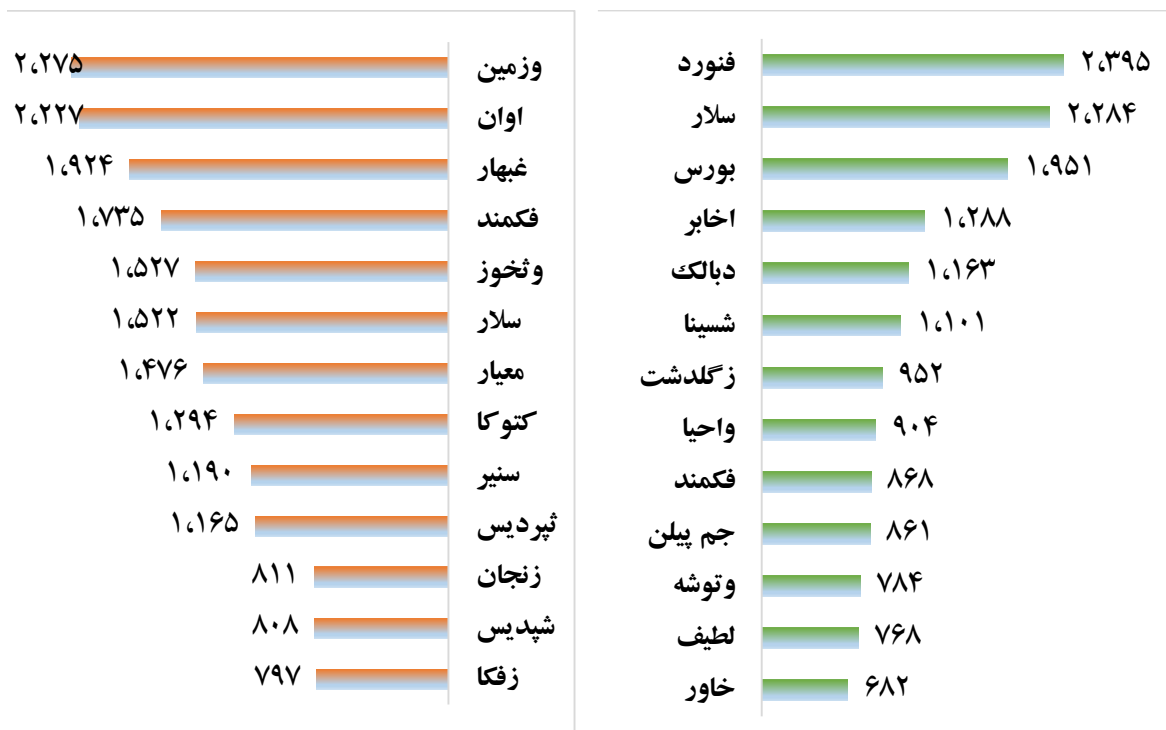
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



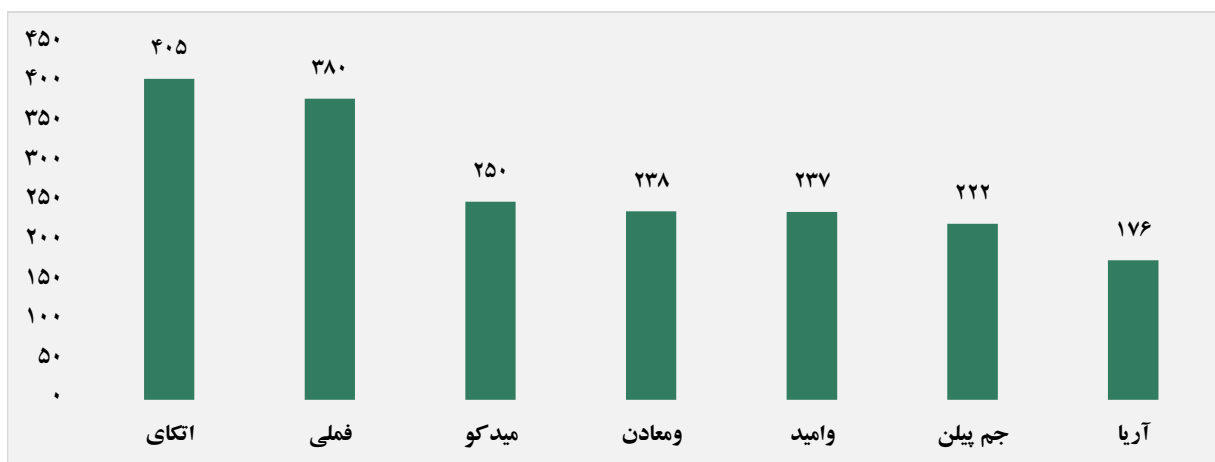
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



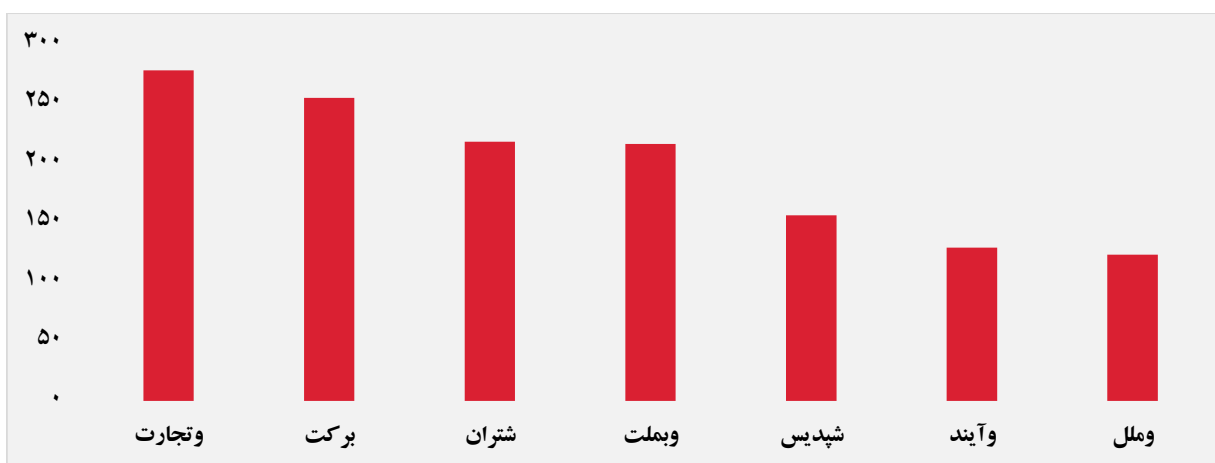
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	وسپه	۱	زقیام
۲	شاروم	۲	اوان
۳	ویپخش	۳	ولانا
۴	فسازان	۴	ددام
۵	کخاک	۵	کتوکا
۶	غفارس	۶	لخزر
۷	دکوثر	۷	سکرد
۸	میدکو	۸	چفیر
۹	جم پیلن	۹	دقاضی
۱۰	مبین	۱۰	پاکشو

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



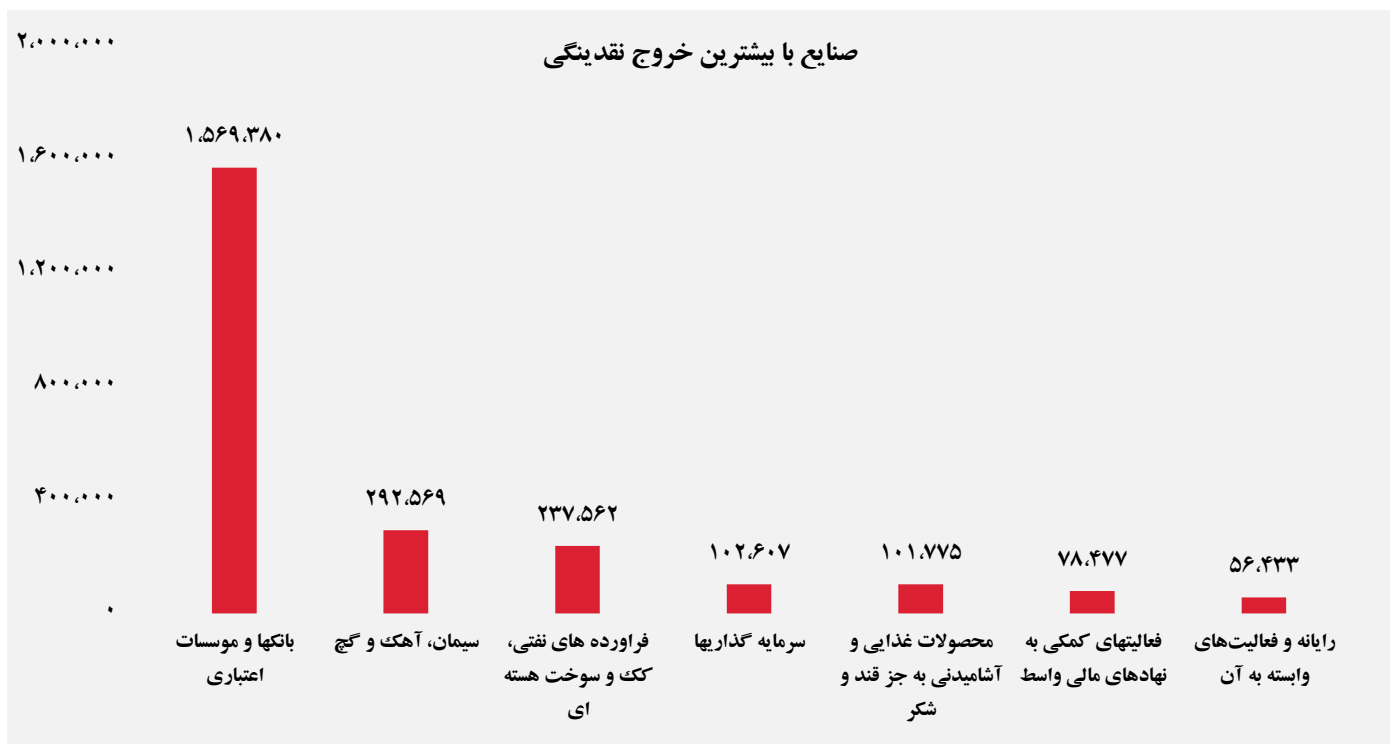
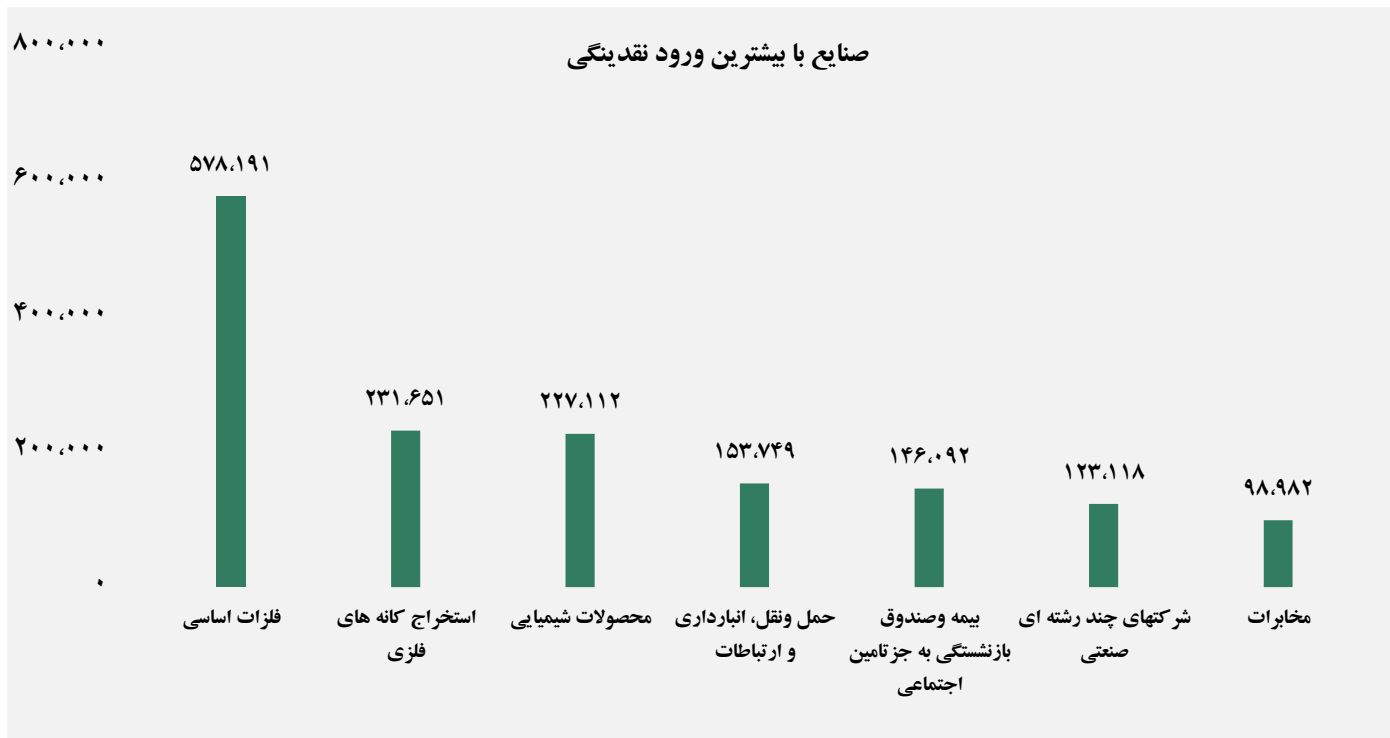
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	غکورش
۲	ددام	۱۱	دتوزیع
۳	ومدیر	۱۲	ثقفارس
۴	فراپورس	۱۳	شرانل
۵	فزرین	۱۴	زاگرس
۶	جم پیلن	۱۵	خوساز
۷	اتکای	۱۶	خموتور
۸	وآوا	۱۷	چفبیر
۹	کبافق	۱۸	خزامیا

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار