



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۰۹

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۹ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شستا، پارس، شتران، شپدیس، نوری و پارسان با افزایش ۸,۳۹۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۵۶,۹۱۵ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۵ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش همراه بوده است. مبلغ ۶۴ 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 ۷۵ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

شاخص کل بورس تهران امروز روی مدار صعود باقی ماند و برای چندمین روز متوالی با سیگنال‌های دلار با رشد همراه بود. دلار در بازار آزاد منطقه فراتر از ۲۵ هزار تومان را لمس کرد و به این ترتیب، سرمایه‌گذاران بازار سهام سعی در رسیدگی به پرتفوی سرمایه‌گذاری خود داشتند تا به بهترین شکل بتوانند از افزایش نرخ دلار، به سود بهتری در بازار سرمایه برسند. درست است که شاخص کل در نقطه یک میلیون و ۲۵۰ هزار واحدی با مقاومت جزئی همراه است، ولی به طور کلی، شاخص با رشد ۸ هزار واحدی، در بالای نقطه مقاومتی اشاره شده به کار خود پایان داده است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳,۷۲۴ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق منفعت دولت با نماد افاد۵۳۴، 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 ۸۰۵، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۲ با ۲۳,۴٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۰۸	۱۴۰۰/۰۴/۰۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۳,۲۸۱	۳,۷۲۴	-۸۴٪



گروه‌های مؤثر

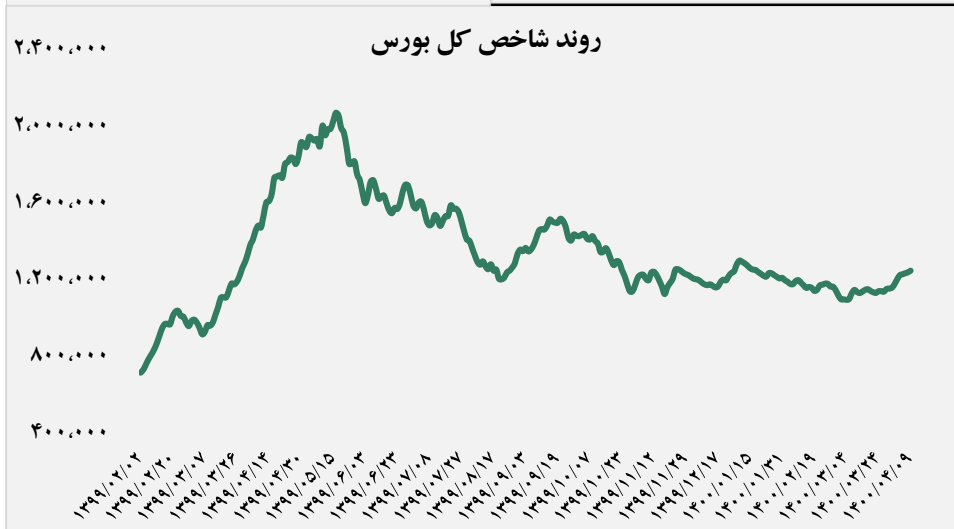
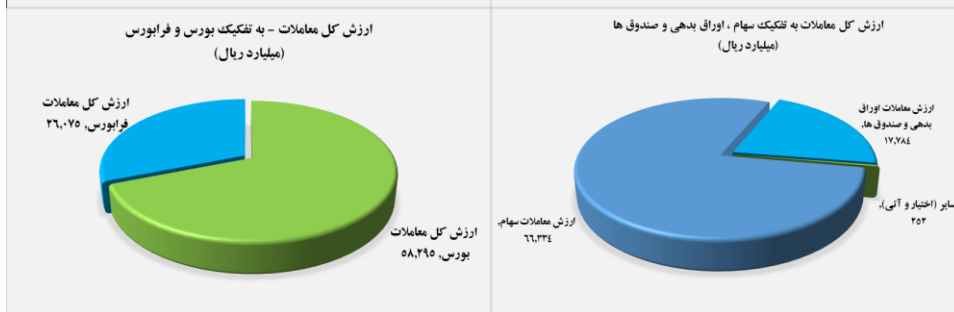
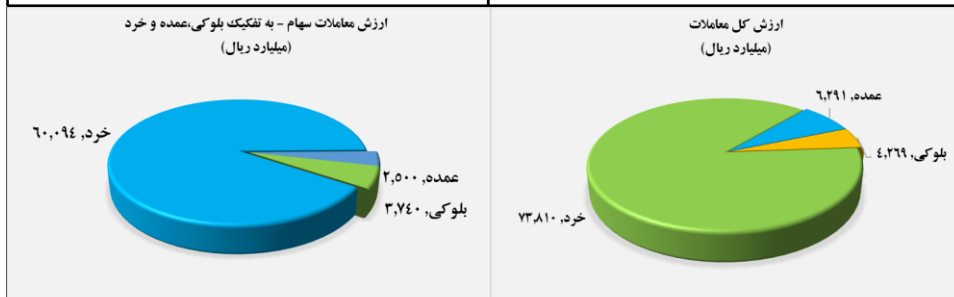
در گروه فلزات اساسی، شرکت ذوب روی اصفهان در اردیبهشت ماه ۶۳۶ تن شمش فروخت. در فروردین فروش شمش نداشت. اسفند ۱،۴۲۲ تن شمش روی فروخت. در بهمن شمش روی تولیدی خود را دپو کرد و فروش نداشت. در خرداد ماه سال جاری ماه ۱،۵۳۹ تن محصول تولید داشته است. در اردیبهشت ۱،۶۴۲ تن محصول تولید کرد. میانگین تولید ماهانه کل دوازده ماه سال گذشته ۱،۴۱۳ تن می باشد. از نظر مبلغی نیز در خرداد ماه سال جاری ۳ میلیارد تومان فروش داشته است. در اردیبهشت ۴۲ میلیارد تومان فروش داشت. کل مبلغ فروش سالهای ۹۹ و ۹۸ حدود ۵۳۷ و ۲۸۱ میلیارد تومان بود.

در گروه شیمیایی شرکت پتروشیمی جم در خردادماه ۹۸ هزار تن اتیلن به عنوان محصول ابتدای خط تولید داشته است. میانگین ماهانه سال ۹۹ برابر با ۱۰۰ هزار تن بود. فروش محصولات در ماه خرداد با ۱۷۸ هزار تن، بالاتر از میانگین ثبت شده در سال گذشته (۱۵۹ هزار تن) بوده است. در سال ۹۹، فروش ماهانه جم یک روند صعودی پر قدرت داشت و از ارقام زیر ۱۰۰۰ میلیارد تومان شروع و به حدود ۳۰۰۰ میلیارد تومان رسید. در سال جدید پس از فروش های ۲۹۱۱ و ۲۷۳۹ میلیاردی فروردین و اردیبهشت، در خرداد به مرز سه هزار میلیاردی برگشت و ۳۲۳۹ میلیارد تومان درآمد گزارش کرد. این رقم پس از فروش ۳۲۵۶ میلیاردی بهمن ماه سال قبل، دومین ماه خوب شرکت از این منظر است. میانگین نرخ فروش مجموع محصولات شرکت در خرداد ۱۸،۱۲۹ تومان به ازای هر کیلو بود که نسبت به اردیبهشت ۱ درصد رشد را نشان می دهد.

در گروه زراعت و خدمات وابسته، تولیدات شرکت کشت و دام گلدشت نمونه اصفهان در سال ۹۹ برابر با ۴۶ هزار تن لبنیات و ۱،۸۸۴ راس دام بوده است که در اردیبهشت ماه سال جاری برابر با ۴،۴۱۳ تن لبنیات و ۱۴۰ راس دام گزارش شد که این مقادیر در خرداد به ۴،۲۱۱ تن لبنیات و ۱۳۷ راس دام رسیده است. این شرکت در سال گذشته ۴۵ هزار تن و ۱،۷۴۵ راس دام به مبلغ ۱۸۷ میلیارد تومان فروخته و در سال جاری فروش اردیبهشت و خرداد خود را ۴،۲۵۵ و ۴،۰۷۵ تن در حدود ۴۴ میلیارد تومان گزارش کرده است. نرخ فروش شیر در اردیبهشت ماه برابر با ۴۹،۱۵۲ ریال/کیلو بوده و در خرداد به ۴۹،۶۸۰ ریال/کیلو رسیده است.

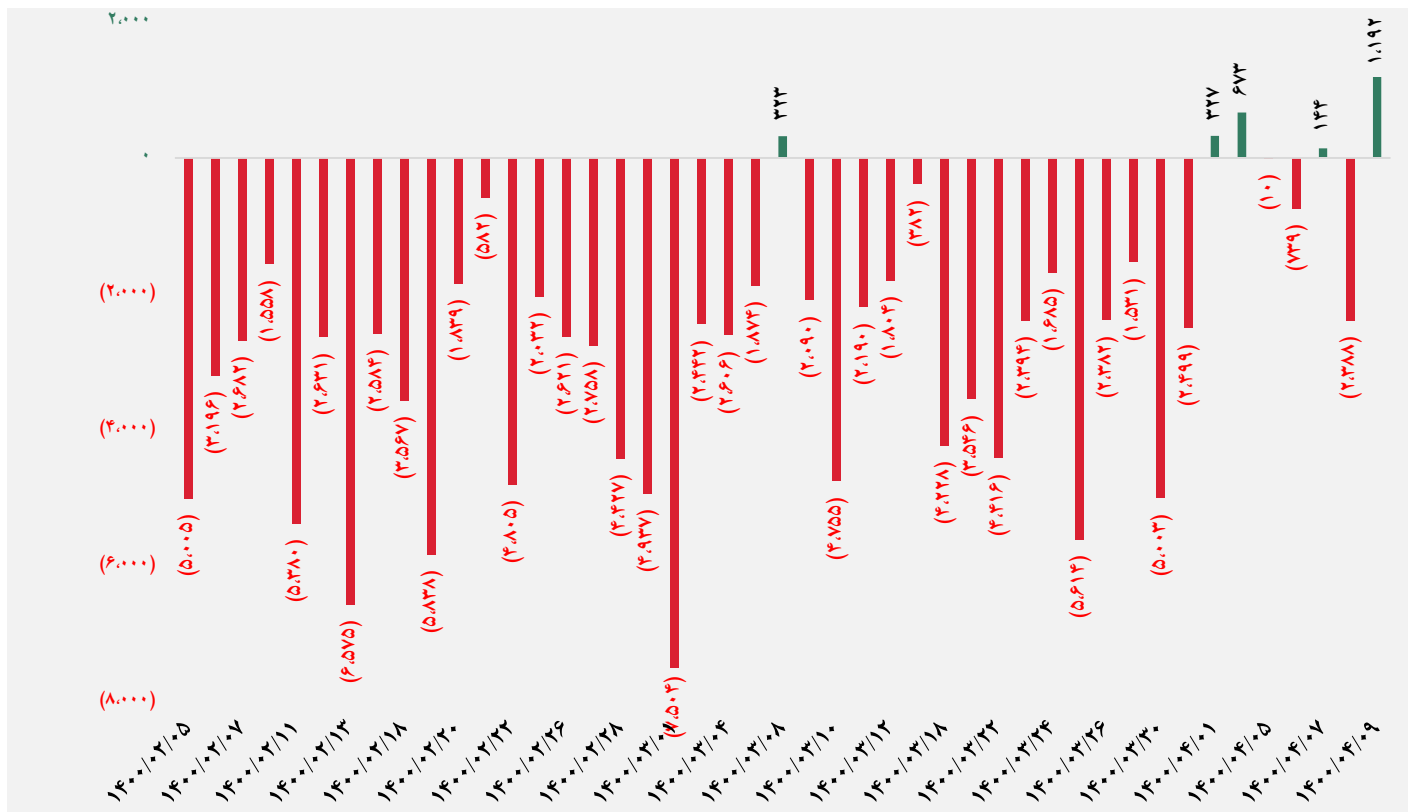
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۱۸,۰۸۷	شاخص کل	۱,۲۵۶,۹۶۰	شاخص کل
۱۲۳	تغییر شاخص	۸,۴۴۳	تغییر شاخص
۱۱,۹۷۹,۸۱۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۰,۱۱۱,۸۹۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۶,۰۷۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۸,۲۹۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
زاگرس		شستا	
آریا		پارس	
شگویا		شتران	
کگهر		شپدیس	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
پساما		فولاد	
فرا بورس		وپارس	
ذوب		وسکرمان	
هرمز		بوعلی	

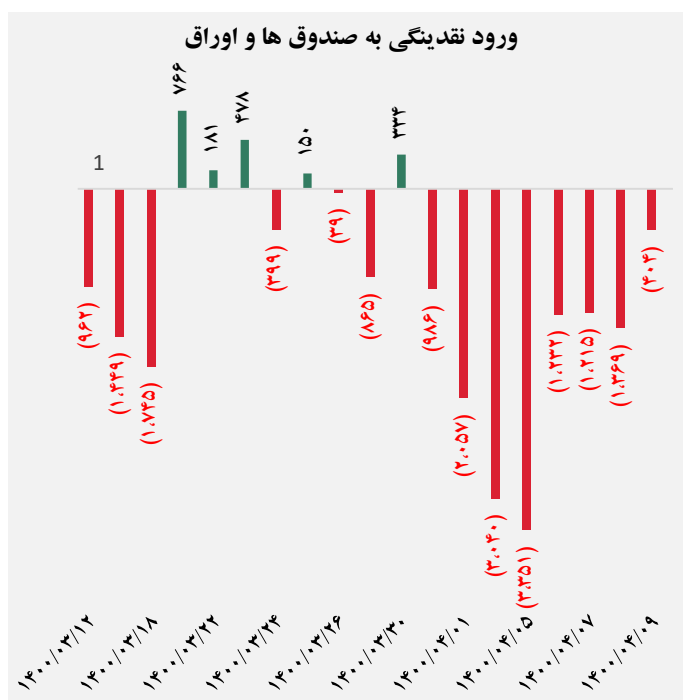
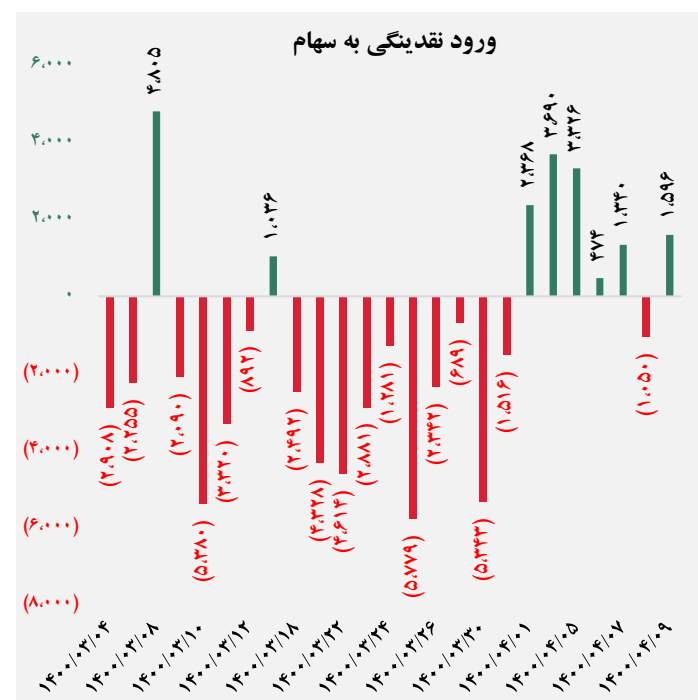


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

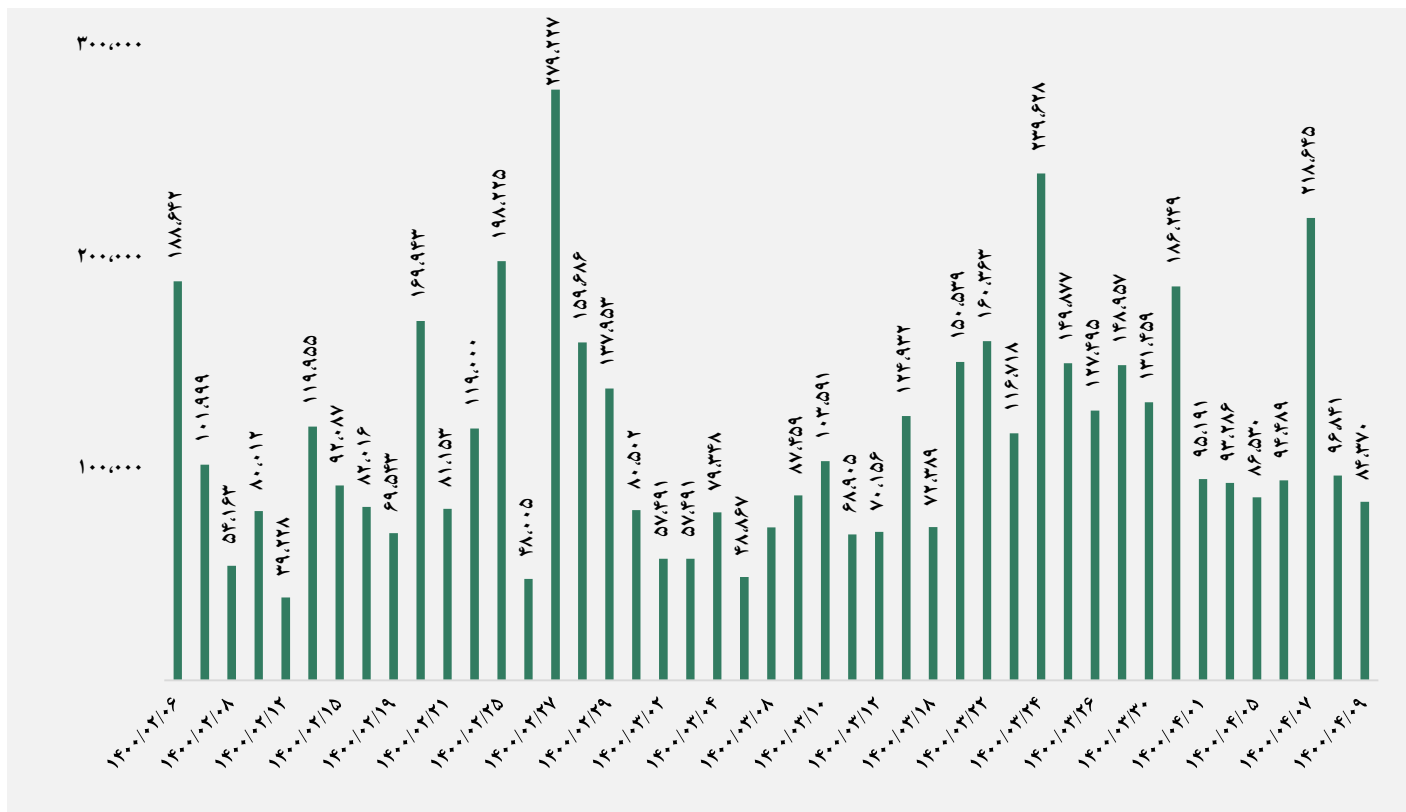


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

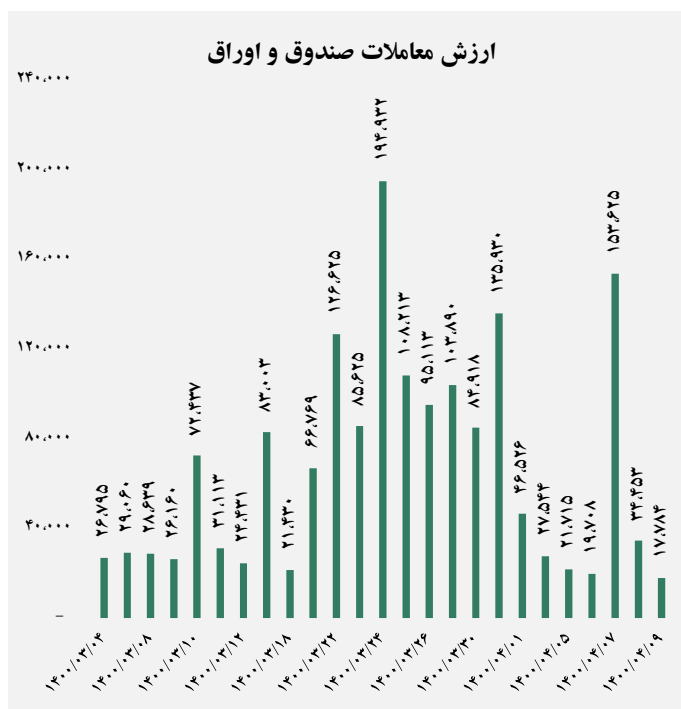
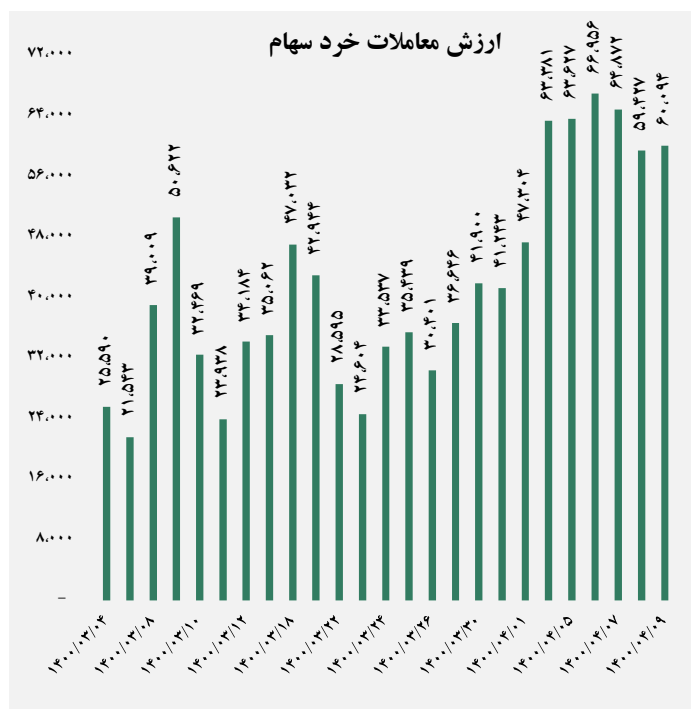


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

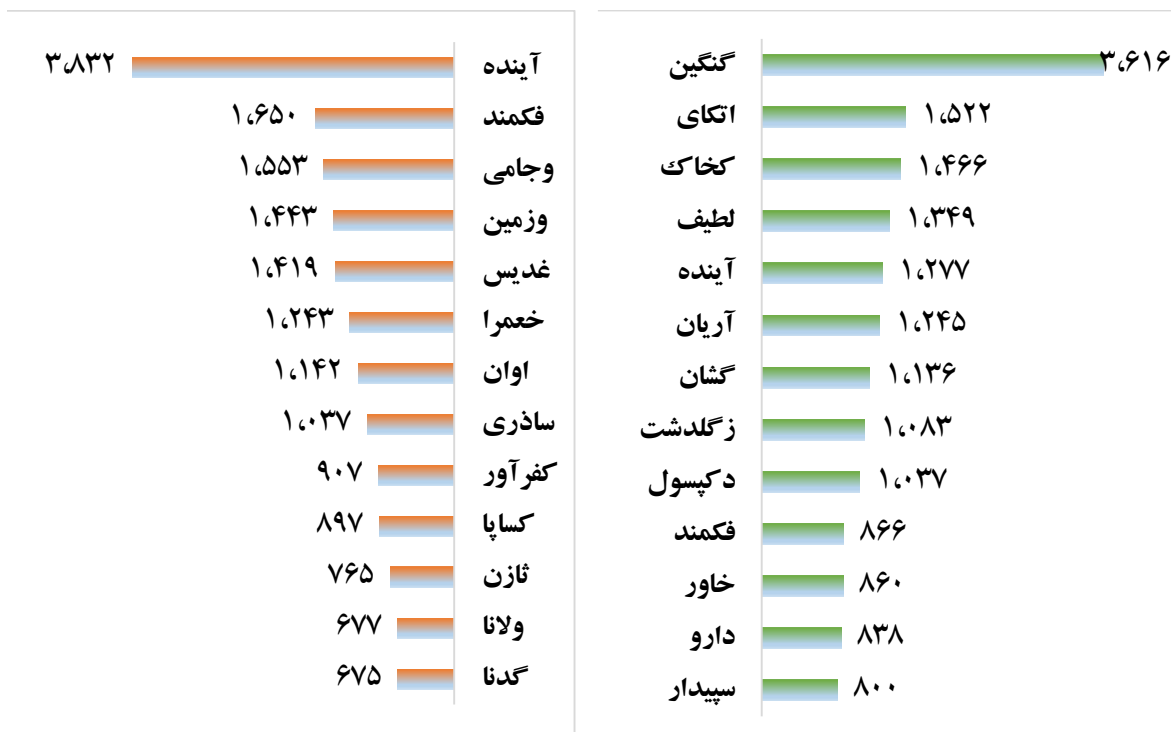


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



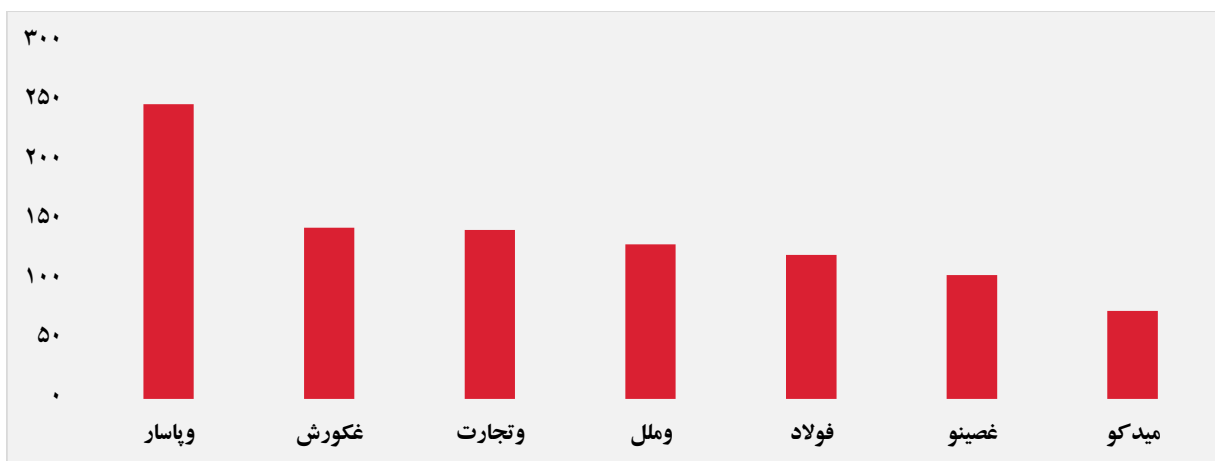
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	چخزر	۱	فنورد
۲	رافزا	۲	فلامی
۳	سپیدار	۳	وثوق
۴	شاروم	۴	خکار
۵	بمینا	۵	سصفها
۶	قزوین	۶	کپارس
۷	خکمک	۷	دبالک
۸	زملارد	۸	خرینگ
۹	غهنوش	۹	حتوکا
۱۰	دلقما	۱۰	فراپورس

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



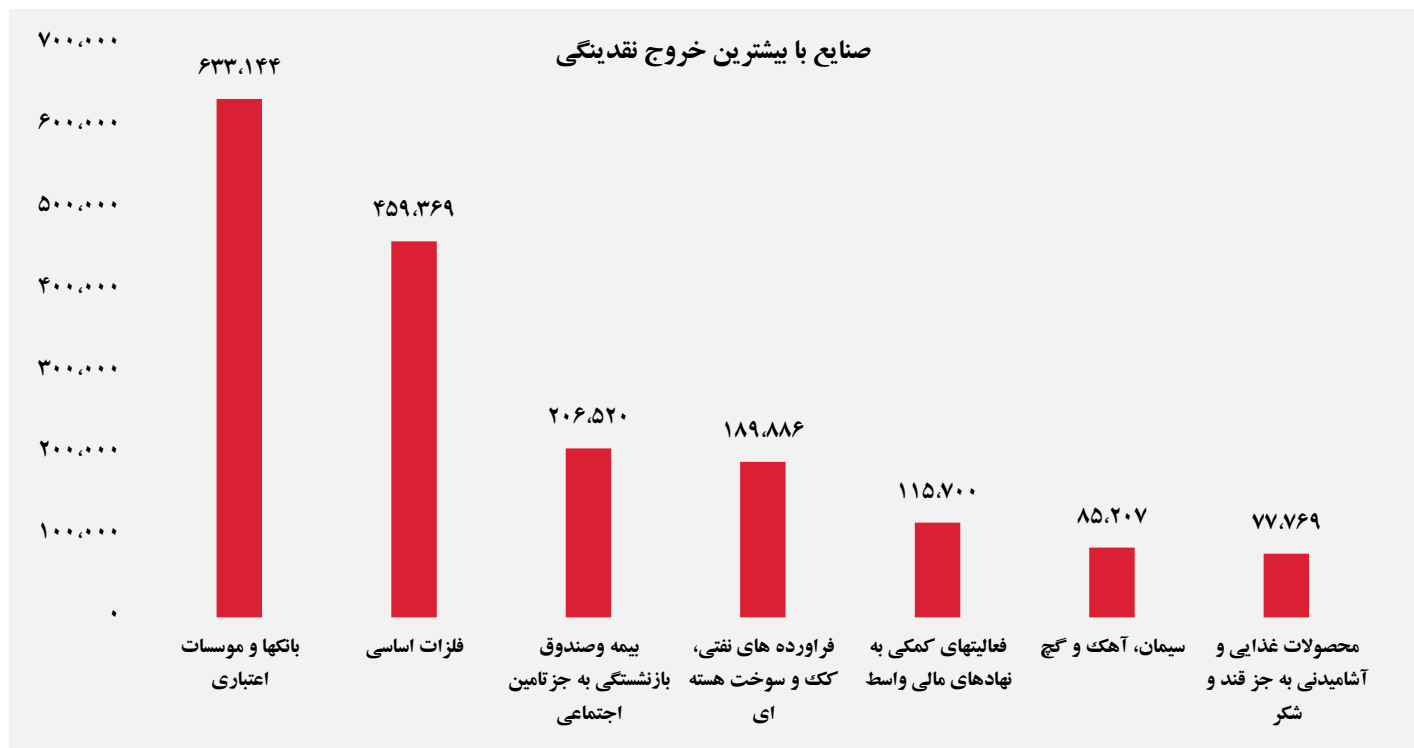
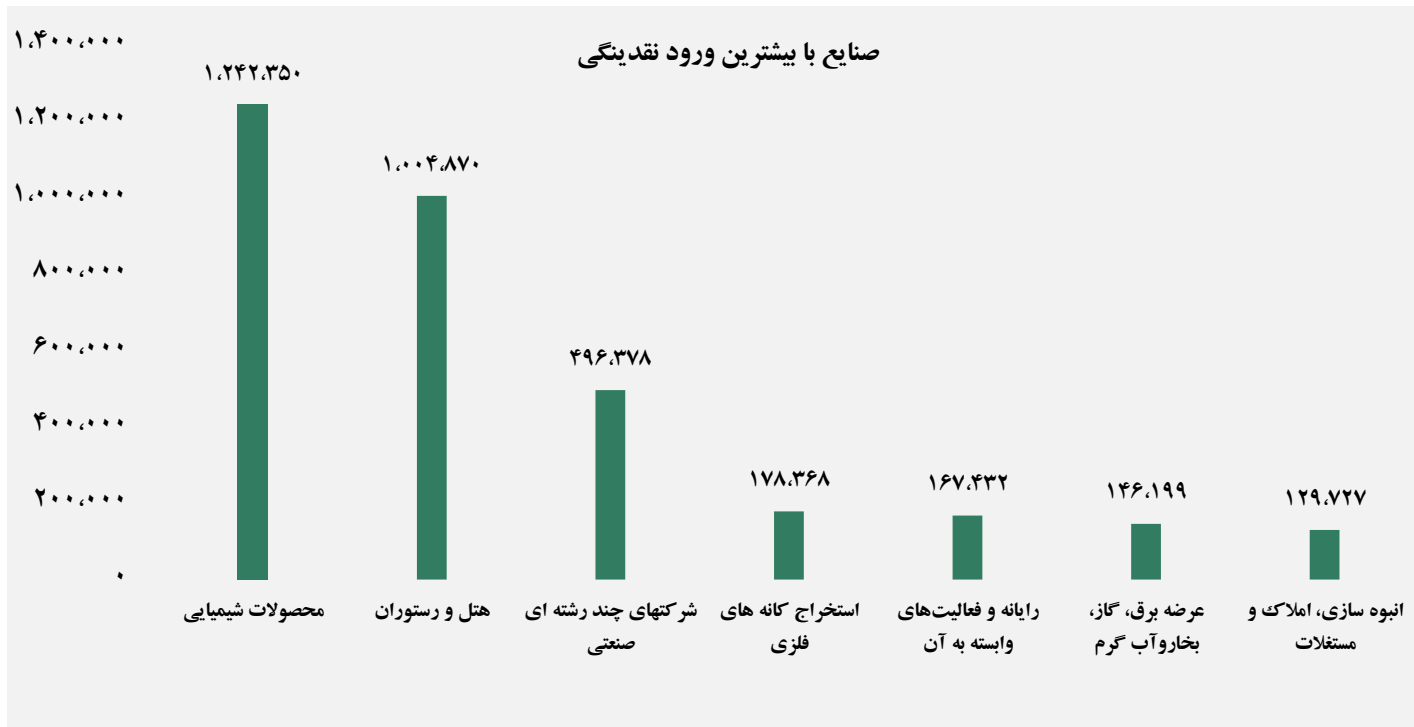
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	غپاک	۱۰	زاگرس
۲	برکت	۱۱	ددام
۳	گنگین	۱۲	وایران
۴	فراپورس	۱۳	نوری
۵	غکورش	۱۴	ثفارس
۶	پورس	۱۵	سمگا
۷	چفبیر	۱۶	پارس
۸	فزرین	۱۷	سصوفی
۹	تاپکیش	۱۸	ومدیر

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار