



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۱۲

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۱۲ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، شستا، فملی، شپنا، وبملت و خودرو با کاهش ۱۰,۹۲۶ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۴۶,۰۵۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۵ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته تغییری نداشته است. مبلغ ۶۵ 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 ۷۶ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. شاخص کل بورس تهران در دو هفته گذشته با رشد مناسبی همراه بود. بطوریکه این شاخص از ۱ میلیون و ۱۷۰ هزار واحد شروع به افزایش و تا ۱ میلیون و ۲۵۸ هزار واحد نیز ادامه‌دار بوده است. در روز جاری برعکس روزهای معاملاتی گذشته، فشار فروش بر بازار حاکم بود و اکثر نمادهای بزرگ که در ۱۰ روز اخیر با رشد همراه بوده‌اند، با صف فروش مواجه شدند و با صف فروش به استقبال روز معاملاتی فردا رفته‌اند. قیمت دلار نیز حوالی ۲۵۰ هزار ریال در حال معامله و درگیر نقطه مقاومتی خود می‌باشد. از نظر تکنیکال اگر قیمت دلار بالای محدوده ۲۶۰ هزار ریال تثبیت شود، به راحتی می‌تواند سمت نقاط بالاتر رود. بنابراین بسیاری از فعالان در بازار سرمایه نگاه ویژه‌ای به محدوده‌های اشاره شده در نرخ دلار دارند و این موضوع را در تصمیمات سرمایه‌گذاری‌شان لحاظ کرده‌اند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۷,۹۹۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۸۳۴ 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 ۷۲۲، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۸ با ۲۸,۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۰۹	۱۴۰۰/۰۴/۱۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳,۷۲۴	۷,۹۹۳	۱۱۵٪



گروه‌های مؤثر

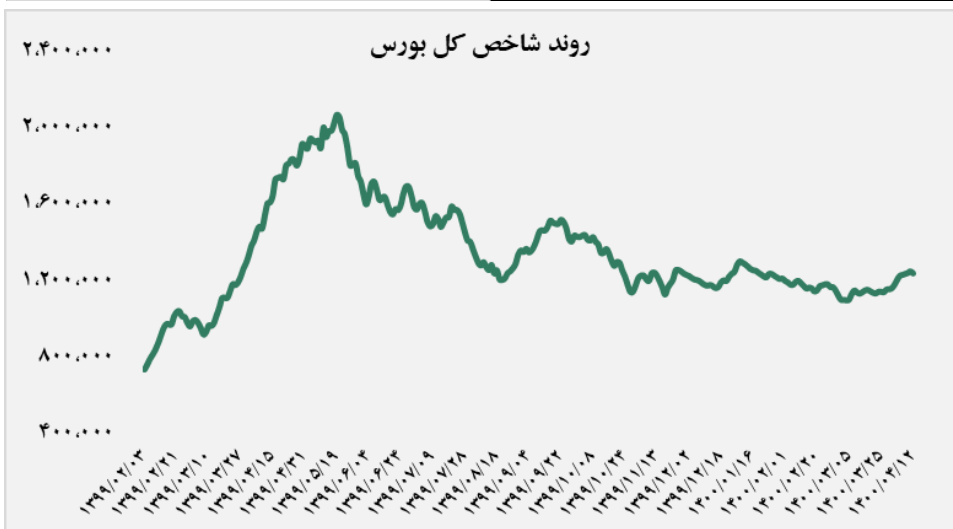
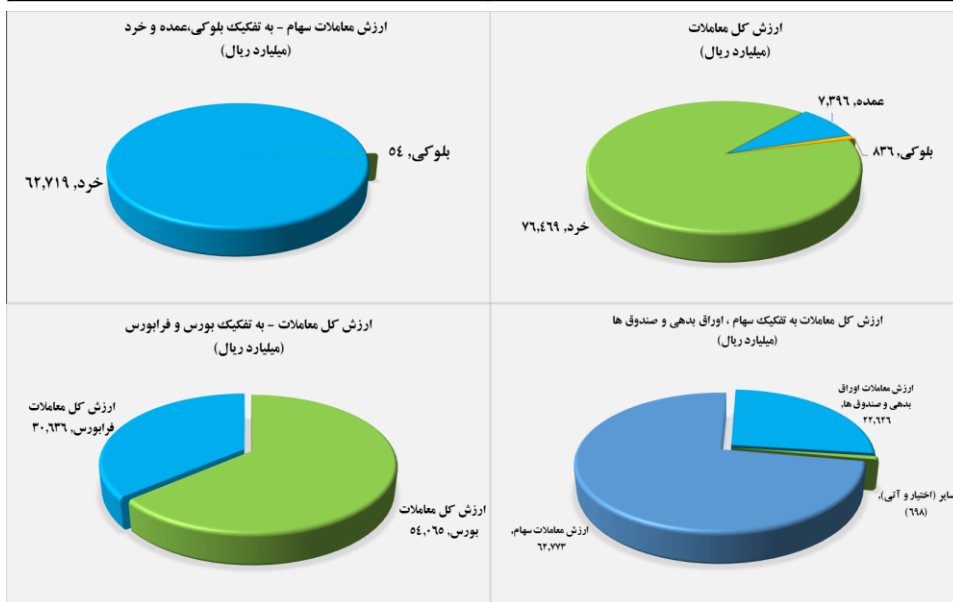
در گروه فلزات اساسی، شرکت ملی صنایع مس ایران در سال گذشته به طور متوسط ۳,۵۰۰ میلیارد تومان فروش داشت. در فروردین ۱,۴۰۰ میلیارد، اردیبهشت ۵,۶۰۰ و خرداد عدد ۶,۶۰۰ میلیارد تومانی را دارد. مقدار تولید کاتد و مفتول شرکت به صورت متوسط در سال ۹۹ در هر ماه ۲۴ هزار تن است و در سال ۱۴۰۰ در دو ماه اول ۲۴ و ۲۶ هزار تن و خرداد ۲۵,۵۰۰ تن است. مقدار فروش کاتد و مفتول به طور متوسط در سال گذشته به طور متوسط ۲۲,۷۰۰ تن بوده است و سال ۱۴۰۰ فروش‌های ۶,۰۰۰ و ۲۳,۰۰۰ تنی و خرداد ۲۵ هزار تن است. متوسط نرخ کاتد در ۶ ماهه ۹۹، ۹۷ هزار تومان بوده در نیمه دوم سال گذشته برابر با ۱۸۰ هزار تومان ثبت شد و در دو ماه ابتدای سال جاری ۲۱۴ و ۲۲۰ هزار تومان می‌باشد و خرداد با ۵ درصد رشد به ۲۳۳ هزار تومان رسیده است.

در گروه شیمیایی شرکت پتروشیمی تندگویان در سال گذشته به طور متوسط ۴۴ هزار تن PTA به عنوان محصول ابتدای زنجیره تولید کرده است. تولید در اردیبهشت ۳۶ و خرداد ۵۲ هزار تن بوده است. در سال ۹۹ متوسط فروش ماهانه ۵۱ هزار تنی را در داشته و در خرداد نیز در همین حدود بوده و فروش ۵۰ هزار تنی را ثبت کرده است. این شرکت یک روند درآمدی خوب در سال ۹۹ داشت و در ماه‌های آخر سال گذشته به فروش‌های بالای ۱۰۰۰ میلیارد تومان رسید. در خرداد امسال ۱,۲۸۸ میلیارد تومان فروش گزارش کرده که هر چند پایین‌تر از فروش ۱,۵۷۴ میلیاردی فروردین و ۱,۳۷۴ میلیاردی اردیبهشت است، اما رقم خوبی برای شرکت محسوب می‌شود. نرخ فروش محصولات در سال گذشته به طور متوسط ۱۶,۰۰۰ تومان در هر کیلو بوده و در خرداد به ۲۵ هزار و ۷۰۰ تومان رسیده است.

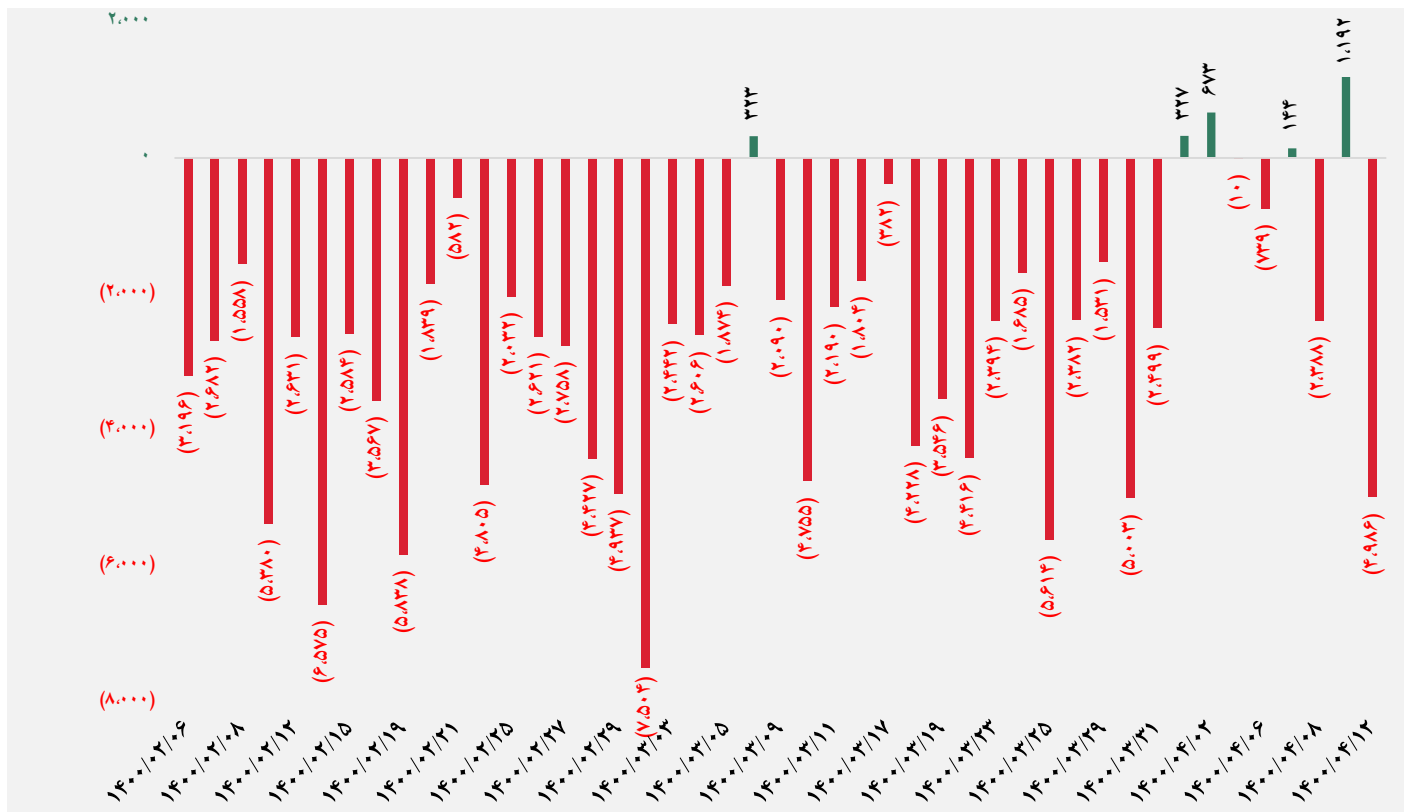
در بازارهای بین‌المللی نیز قیمت جهانی گاز طبیعی به دلیل دمای بالا که تقاضا برای تولید نیرو در نیمکره شمالی برای دستگاه‌های خنک‌کننده هوا را افزایش داده و همچنین اقدام معامله گران بعضی مناطق برای پر کردن مخازن پیش از زمستان، به بالاترین رکورد چند سال اخیر صعود کرده است. قیمت محموله‌های گاز طبیعی که به آسیا تحویل داده می‌شوند، هفته جاری به بالای ۴۶ سنت به ازای هر مترمکعب صعود کرد که بالاترین رکورد قیمت برای این وقت از سال از سال ۲۰۱۳ تاکنون به شمار می‌رود. این اتفاق بر روی نرخ خوراک گاز شرکت‌های پتروشیمی داخلی در گزارش ۶ ماهه اول سال جاری تاثیر مستقیم خواهد گذاشت.

تصویر کلی بازار

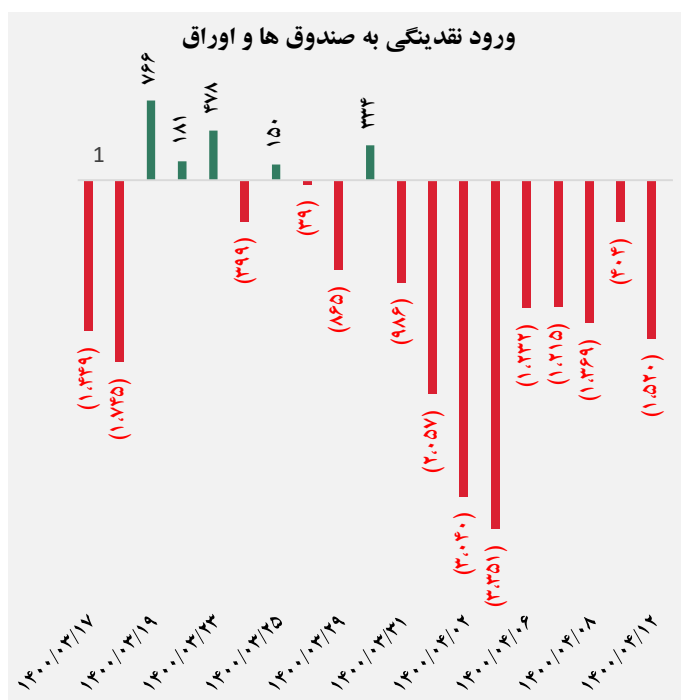
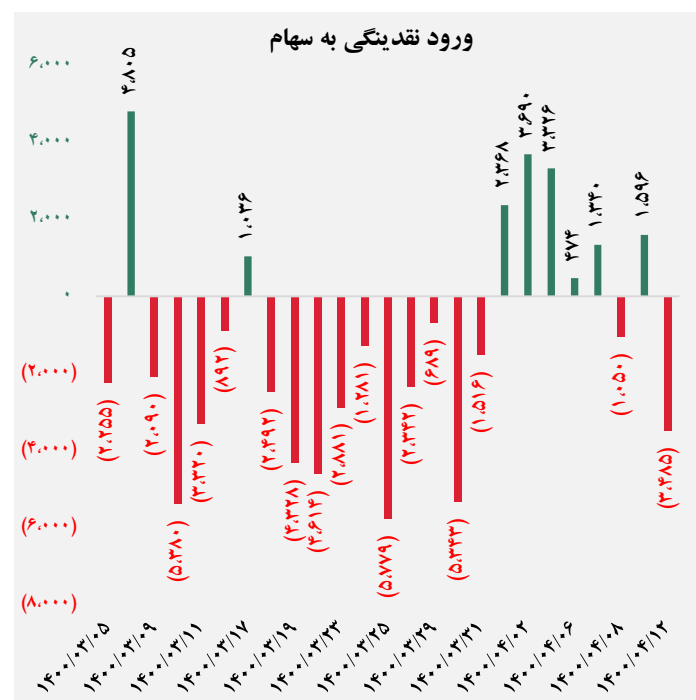
فرا بورس		بورس	
۱۸,۱۱۱	شاخص کل	۱,۲۴۶,۰۵۵	شاخص کل
۲۳	تغییر شاخص	(۱۰,۹۲۳)	تغییر شاخص
۱۱,۹۹۳,۲۹۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۶۴۴,۷۹۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۰,۶۳۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۴,۰۶۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
مارون		نوری	
آریا		پارس	
زاگرس		شفن	
وسپهر		شخارک	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
صبا		فولاد	
ذوب		شستا	
هرمز		فملی	
فرا بورس		شپنا	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

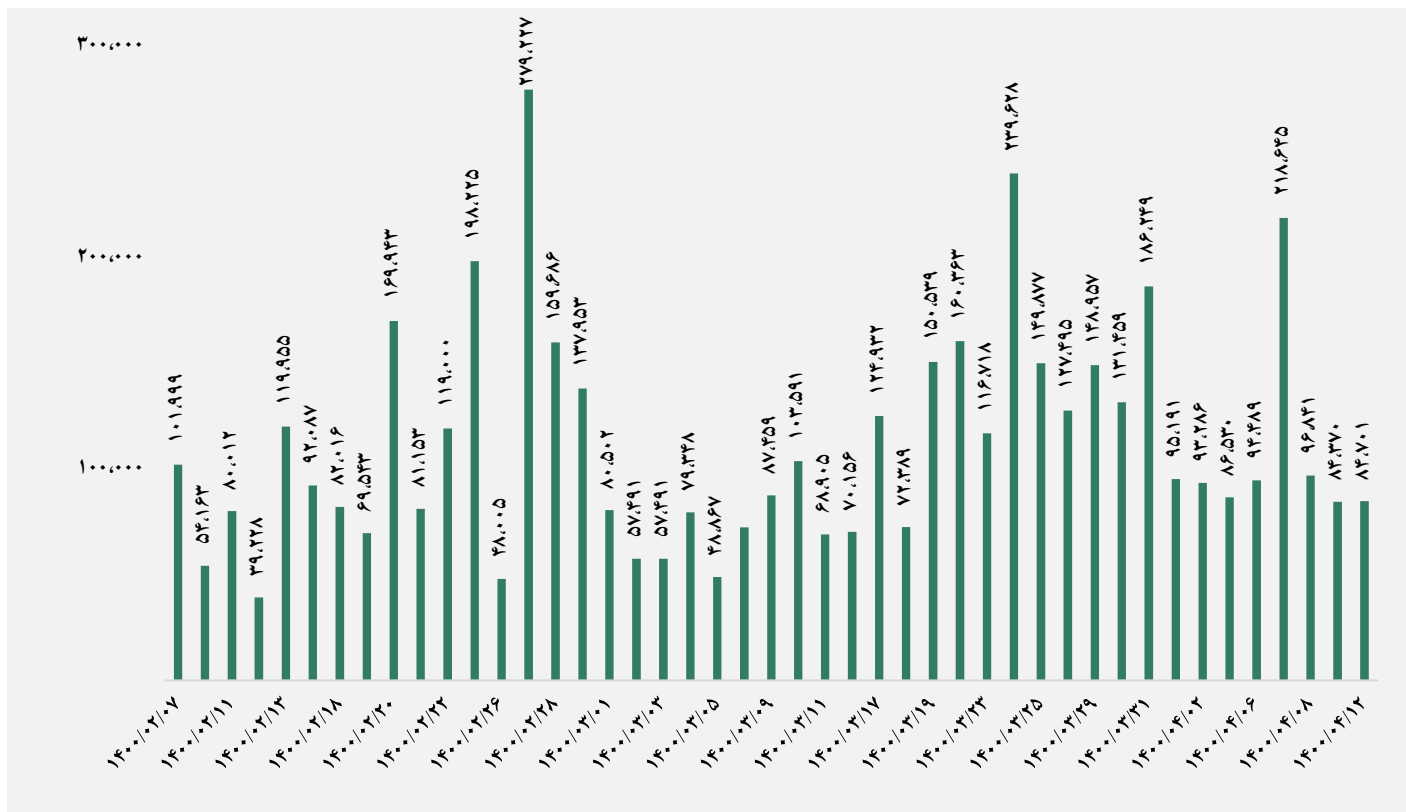


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

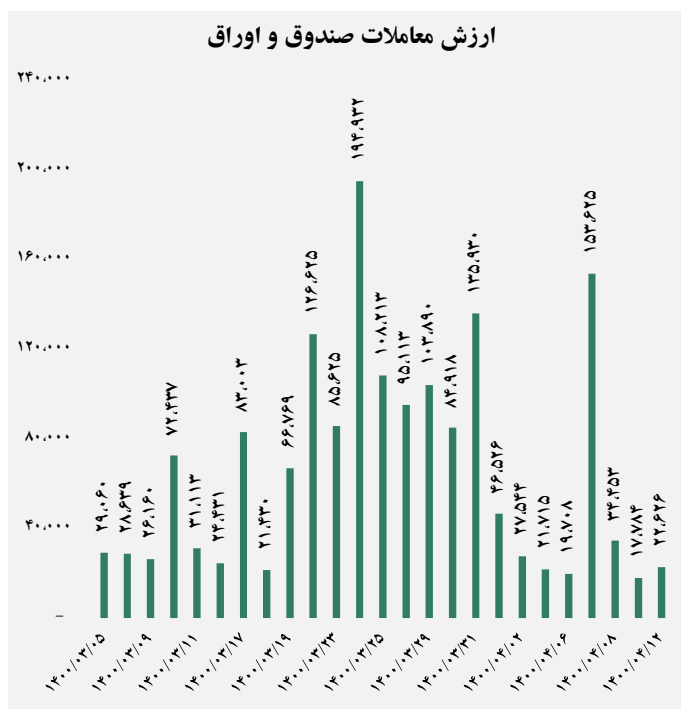
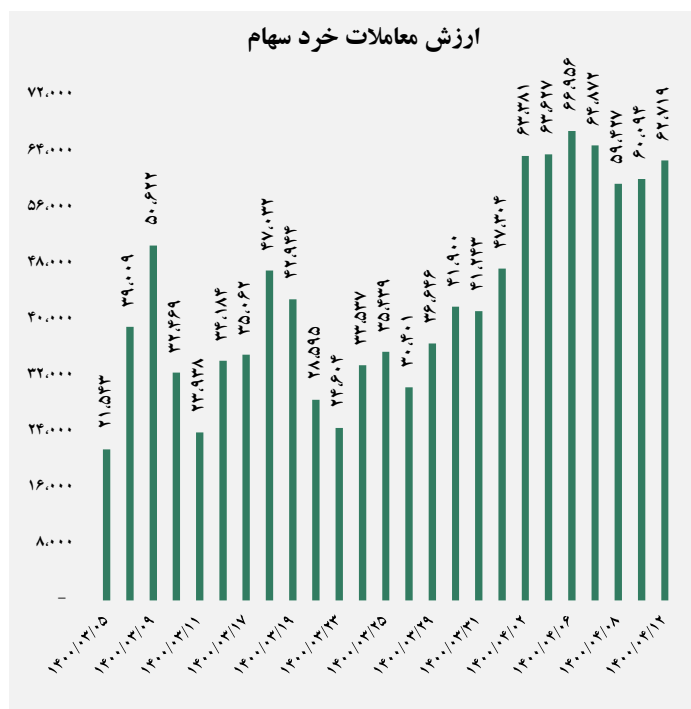


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

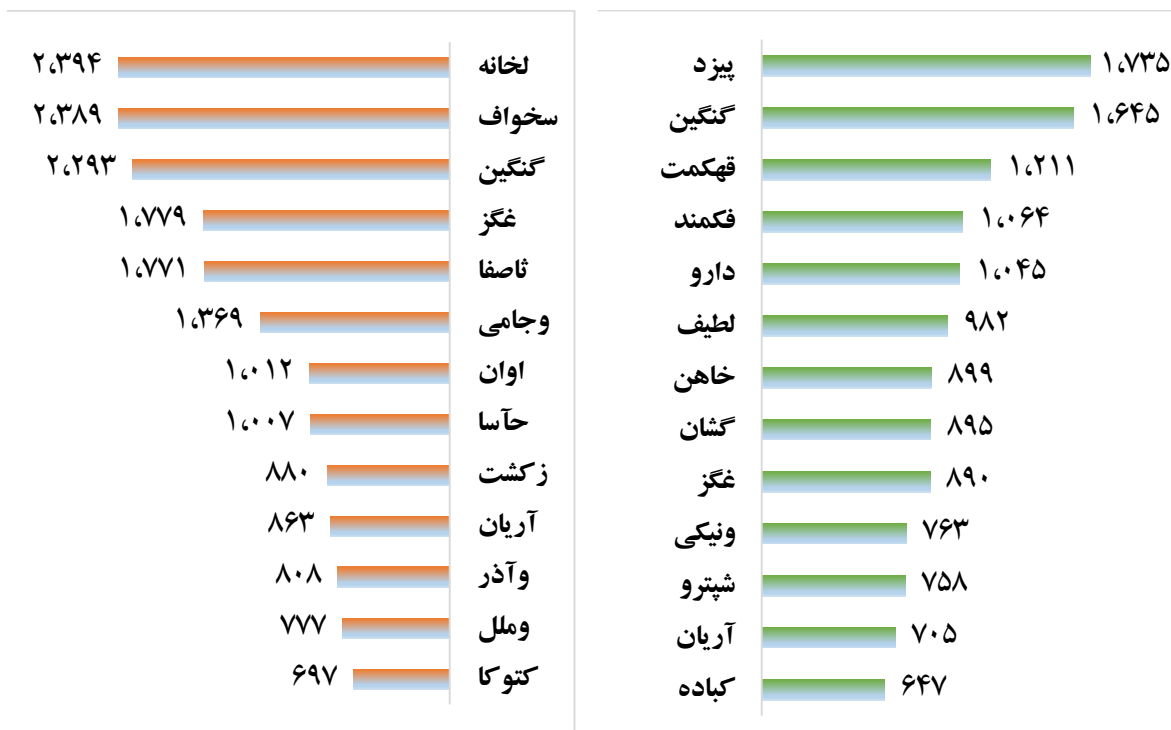


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





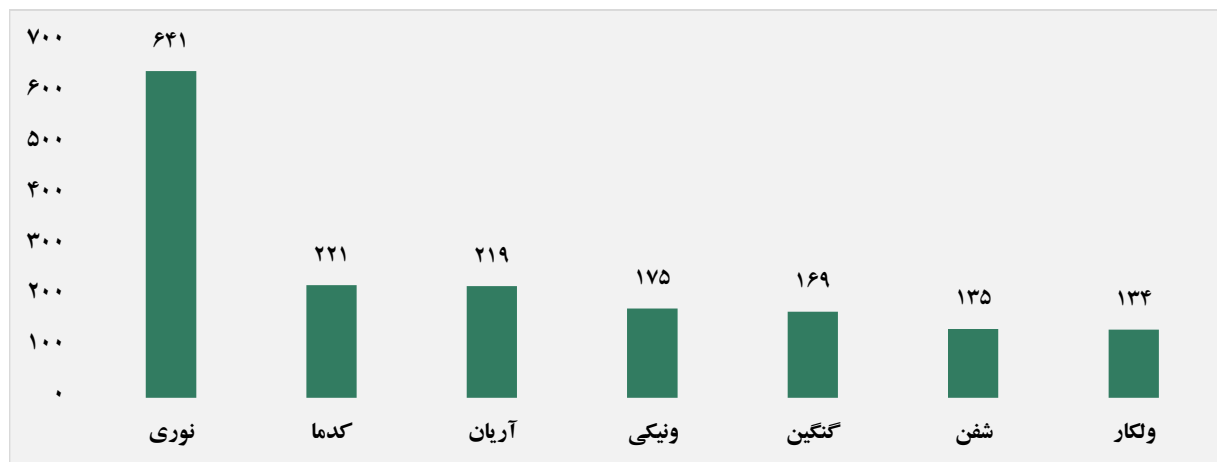
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



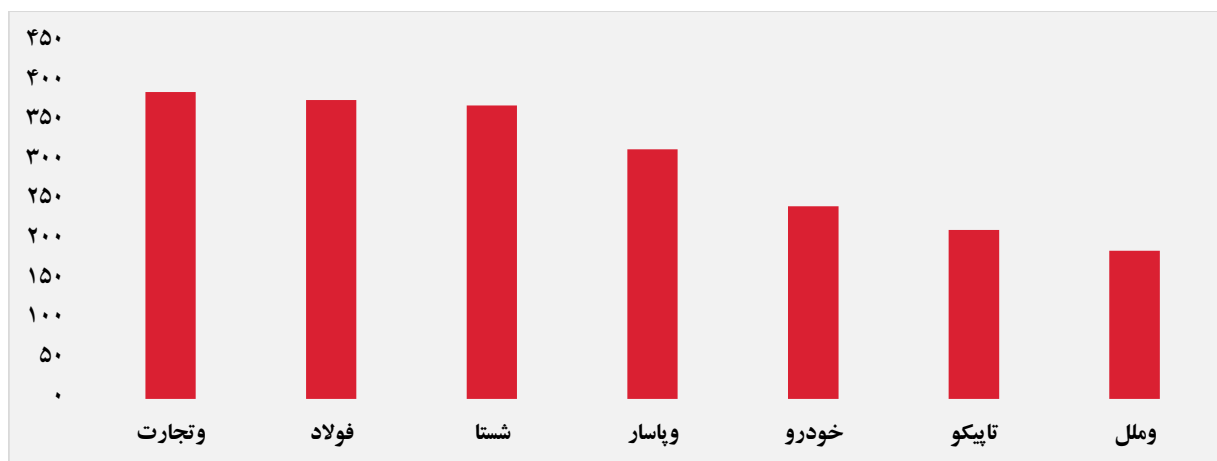
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	سپیدار	۱	شستا
۲	چخزر	۲	خکار
۳	غگلیا	۳	کساپا
۴	شصدف	۴	برکت
۵	ولکار	۵	شلعاب
۶	ثرود	۶	مفاخر
۷	غبهوش	۷	زنگان
۸	بوعلی	۸	غبهار
۹	تیمپی	۹	زقیام
۱۰	زکوثر	۱۰	تکنو

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



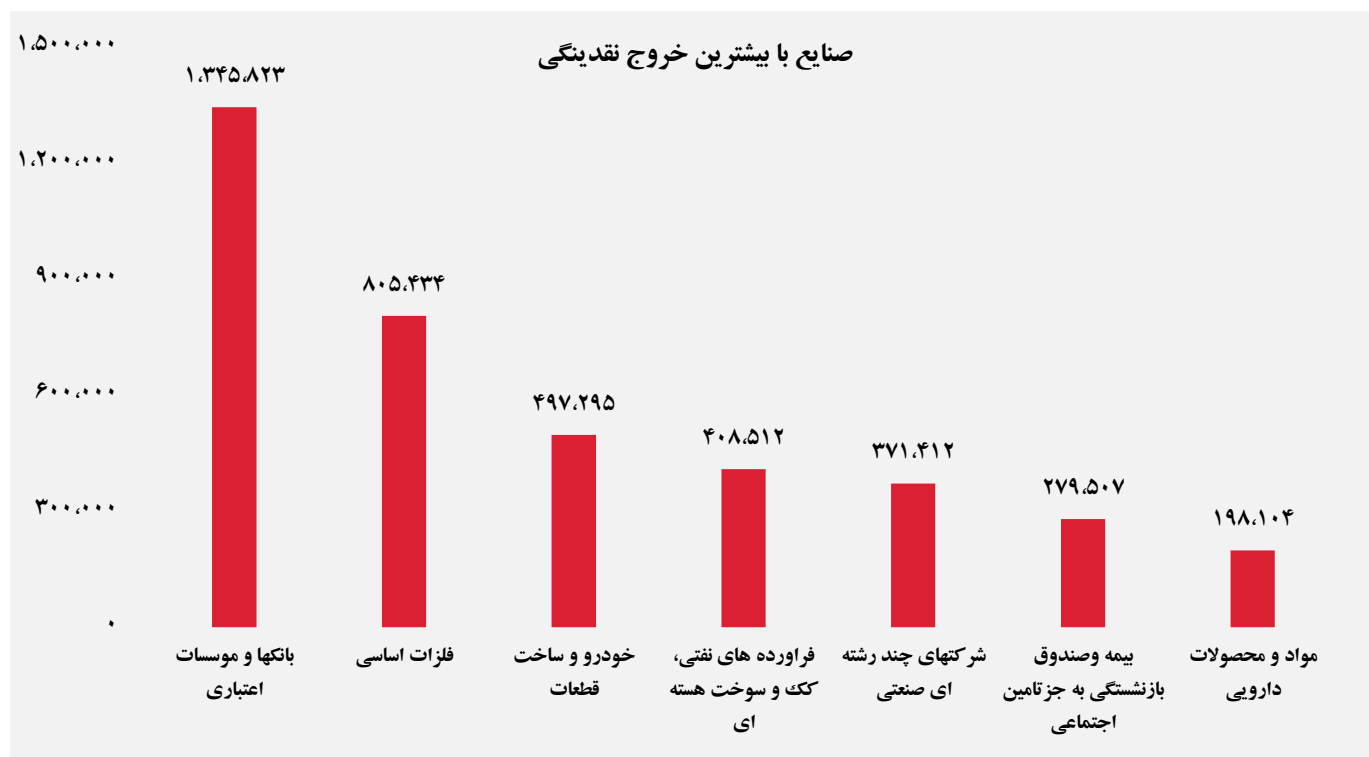
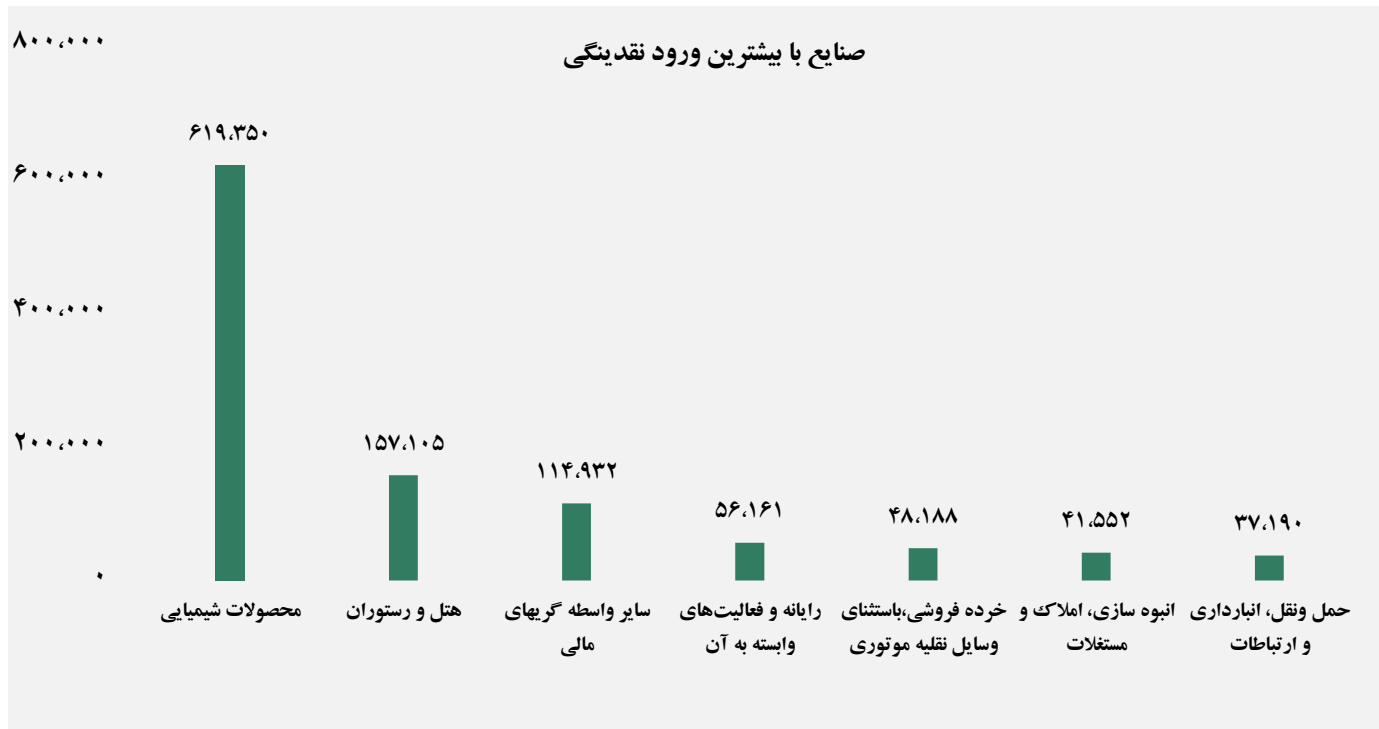
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	نوری
۲	ولکار	۱۱	زفکا
۳	غدیس	۱۲	فرزین
۴	غپاک	۱۳	بوعلی
۵	گنگین	۱۴	تاپکیش
۶	حفارس	۱۵	زاگرس
۷	وآوا	۱۶	سصوفی
۸	سیلام	۱۷	کخاک
۹	خاور	۱۸	اتکای

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار