



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۱۳

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۳ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای شستا، شپنا، شتران، اخبر، وبملت و امید با کاهش ۲,۳۱۹ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۴۳,۷۹۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۳ 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. در سال گذشته، کارشناسان بورسی یکی از دلایل اصلی سقوط بازار سرمایه را افزایش نرخ سود بین بانکی اعلام می‌کردند. بطوریکه وزیر اقتصاد یکی از عوامل سقوط بورس در سال گذشته را نیز همین موضوع اعلام کرد. حالا مدتی است که نرخ سود بین بانکی در مسیر کاهشی قرار گرفته است و طبق آخرین اطلاعات منتشر شده بر روی سایت بانک مرکزی این نرخ به مرز ۱۸ درصد رسیده است. با توجه به شرایط تورمی که برای ادامه سال پیش‌بینی می‌گردد، سپرده‌گذاری در بانک برای دریافت سود، نرخ سود واقعی منفی را به همراه خواهد داشت و گزینه مناسبی برای سرمایه‌گذاری به شمار نمی‌آید. به نظر می‌رسد، اگر نرخ سود بین بانکی در همین سطح بماند، توجه و نگاه‌ها به بازار سرمایه در ادامه سال به مراتب بیشتر از حال حاضر خواهد شد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲,۱۹۴ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۵۰۴، 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	۱۴۰۰/۰۴/۱۲	۱۴۰۰/۰۴/۱۳	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۷,۹۹۳	۲,۱۹۴	-۷۳٪



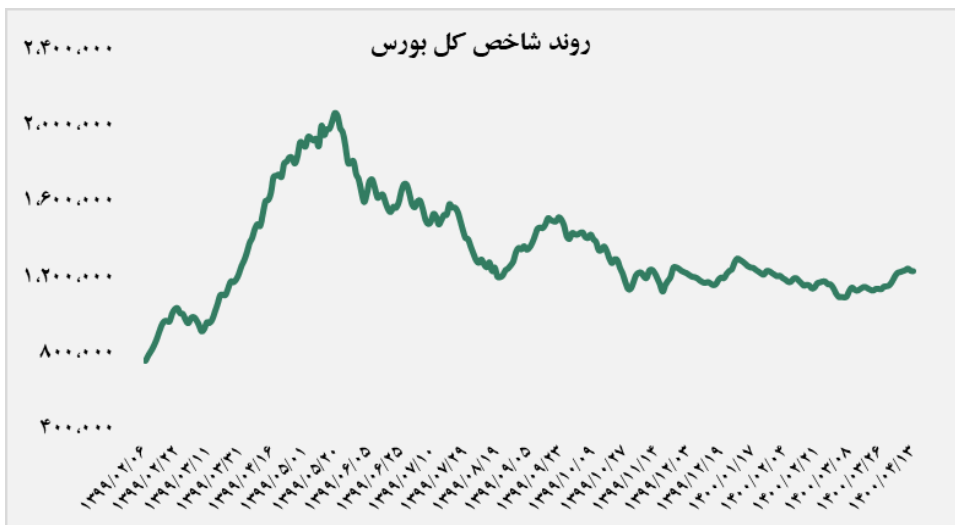
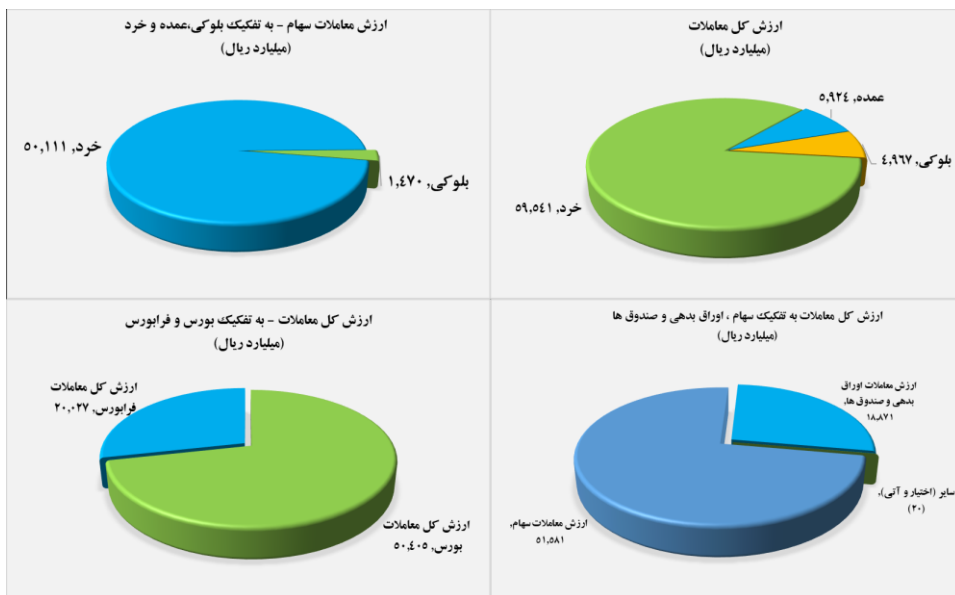
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت جم پیلن از نظر مقداری ۲۰،۵۲۲ تن فروش در این ماه داشته است. در فروردین و اردیبهشت فروش ۱۲،۱۲۲ و ۱۹،۰۸۰ تنی را گزارش کرده بود. این پنجمین ماه متوالی هست که شرکت مقداری کمتر از میزان تولید خود به فروش می‌رساند و به حجم موجودی افزوده شده است. جم پیلن در این ماه فروش ۶۵۴ میلیارد تومانی داشته است. در فروردین و اردیبهشت ۵۳۸ و ۷۹۸ میلیارد تومان محصول به فروش رسانده بود. فروش سال ۹۹، ۶،۵۸۰ میلیارد ثبت شد که این عدد در سال ۹۸ برابر با ۳،۳۲۴ میلیارد تومان بوده است. در اردیبهشت ۲۸،۰۳۷ تن محصول تولید کرد. این شرکت در ماه گذشته تولید ۲۶،۰۷۸ تن محصول را داشته است. میانگین تولید ماهانه سال ۹۹ و ۹۸ به ترتیب ۲۳،۹۵۹ و ۲۳،۲۰۳ تن می‌باشد. نرخ فروش شرکت در این ماه ۳۱۸،۶۳۰ ریال/کیلو بوده است. نرخ فروش در فروردین و اردیبهشت ۴۴۳،۶۱۷ و ۴۱۸،۲۶۶ ریال/کیلو بود.

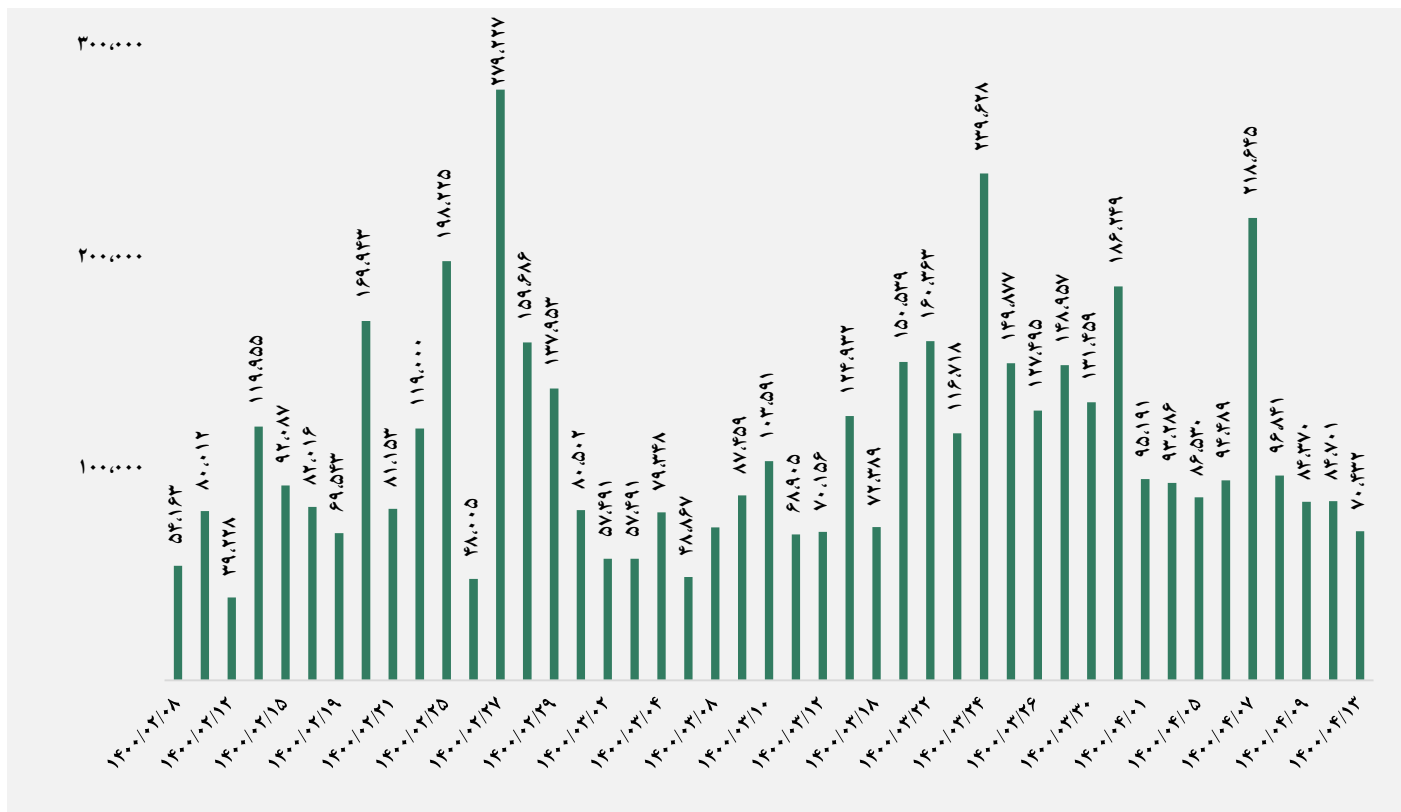
در گروه فلزات اساسی متوسط تولید ماهانه شمش آهن و فولاد ارفع در سال ۹۹، ۶۸ هزار تن ثبت شد. ارفع در ماه فروردین عدد ۷۹ هزار تن را ثبت و در اردیبهشت این رقم را تکرار کرد. در خرداد نیز رقم تولید ۷۲ هزار تن بود. همچنین در سال گذشته به طور میانگین ۶۷ هزار تن شمش در هر ماه به فروش رسانده که این رقم در فروردین ماه ۳۱ و اردیبهشت ۴۶ هزار تن گزارش شده و در خرداد نیز با ۶۰ هزار تن فروش، بالاتر از ماه‌های قبلی ثبت کرد. درآمد ماهانه ارفع در سال گذشته رشد خوبی را داشت و در اسفند عدد مناسب ۱،۱۲۶ میلیارد تومانی را ثبت کرد. خرداد امسال با رقم ۷۷۷ میلیارد تومانی، جزو ماه‌های عالی از لحاظ درآمد بود. در خرداد نیز مانند دو ماه ابتدایی سال، حجم تولید بیشتر از فروش بوده و بنابراین مقدار زیادی کالای ساخته شده وجود دارد که می‌تواند مبالغ فروش ماه‌های بعدی را تقویت کند. نرخ فروش شمش متوسط سال گذشته ۸،۵۲۵ تومان/کیلو ثبت شد. در خردادماه با میانگین نرخ فروش ۱۲،۸۹۹ تومانی به ازای هر کیلوگرم محصول، با رشد ماهانه ۹ درصدی بهترین نرخ ماهانه خود را به ثبت رساند.

تصویر کلی بازار

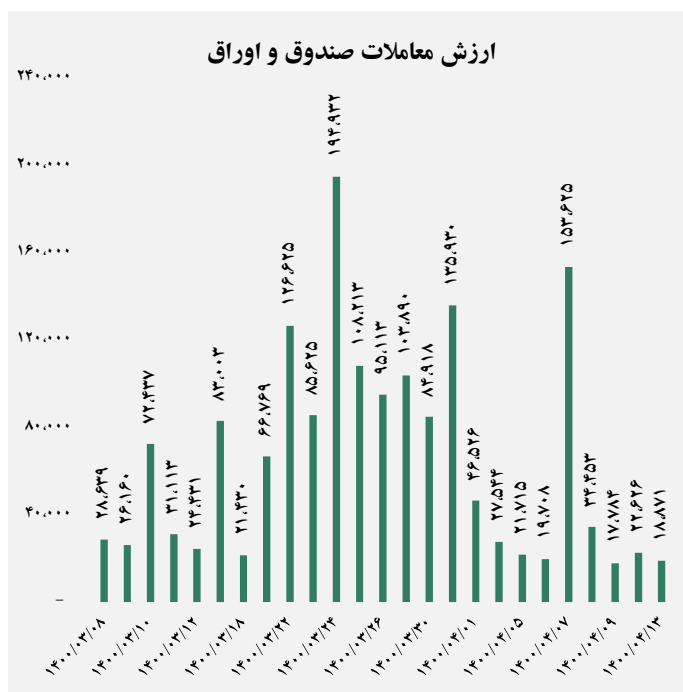
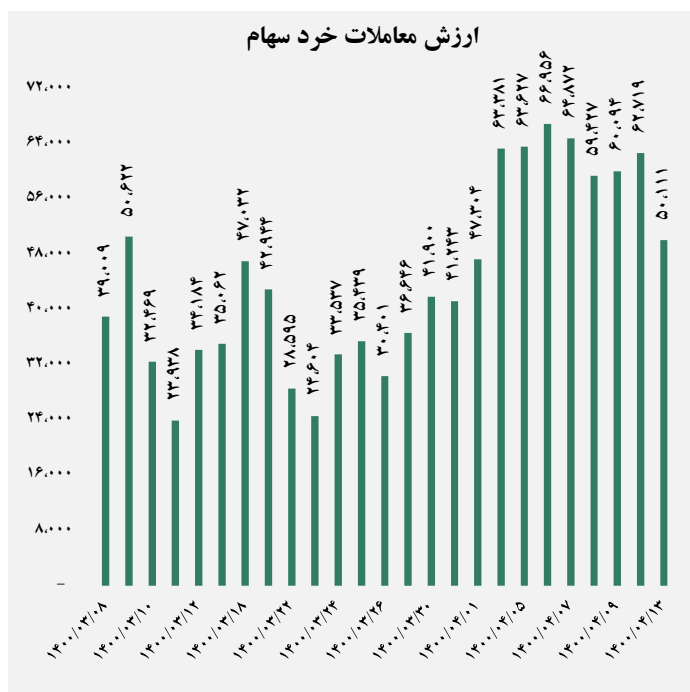
فرا بورس		بورس	
۱۸,۱۱۶	شاخص کل	۱,۲۴۳,۷۹۲	شاخص کل
۴	تغییر شاخص	۲,۳۱۹	تغییر شاخص
۱۱,۹۹۷,۰۳۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۵۵۹,۷۳۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۰,۰۲۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۰,۴۰۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
	مارون		پارسیان
	غصینو		شبریز
	شگویا		پارسیان
	دماوند		افق
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
	ذوب		شستا
	آریا		شپنا
	کوثر		شتران
	بمپنا		اخابر



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

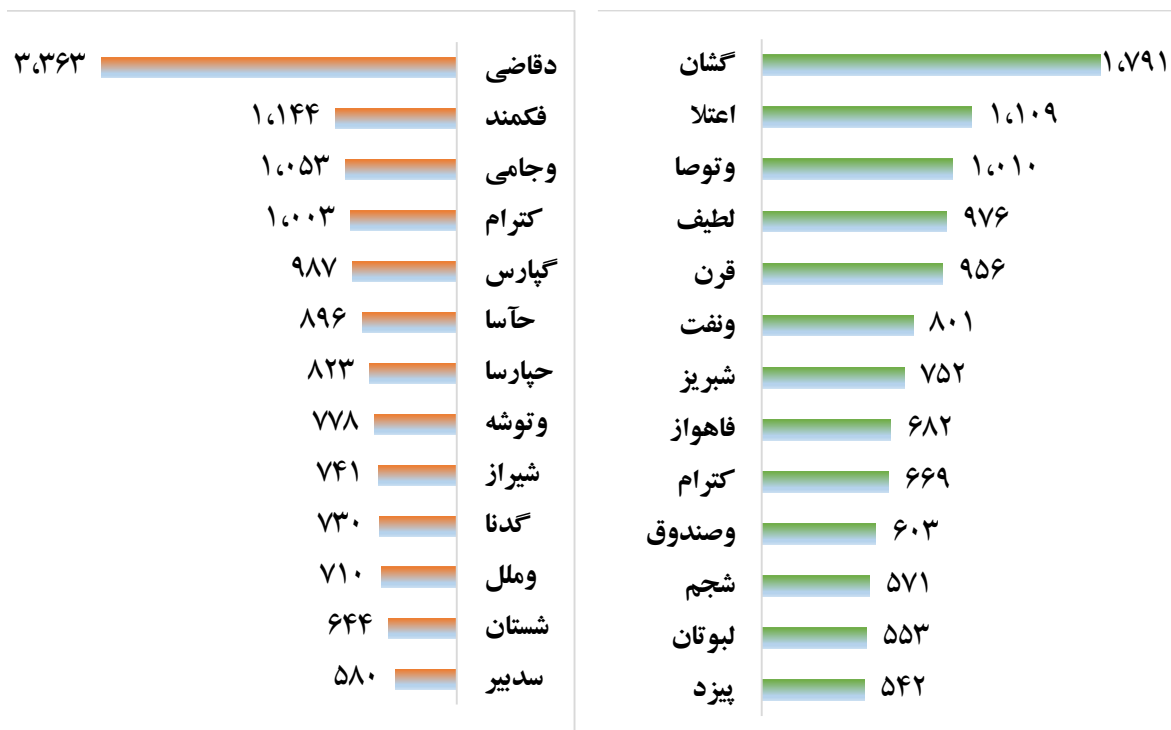


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





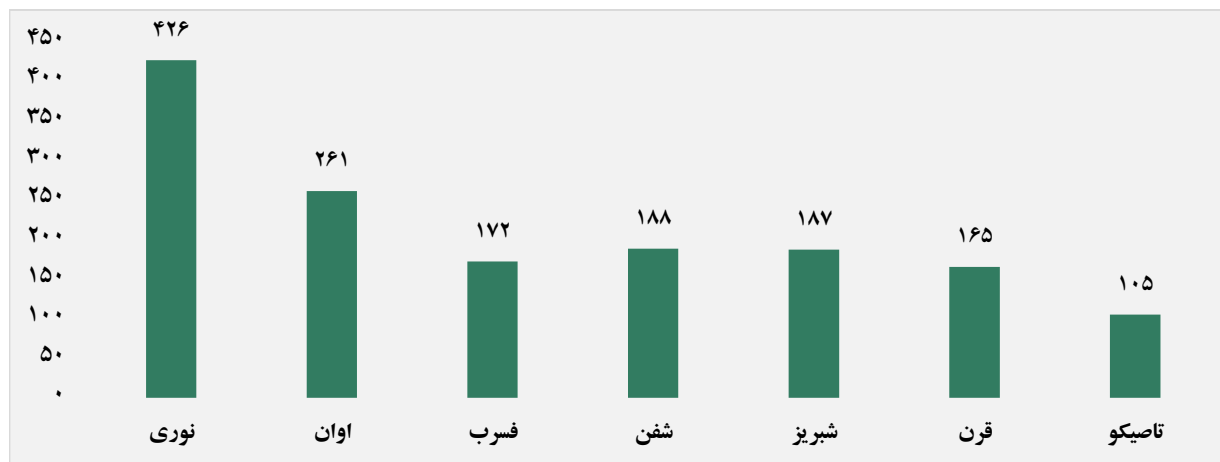
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



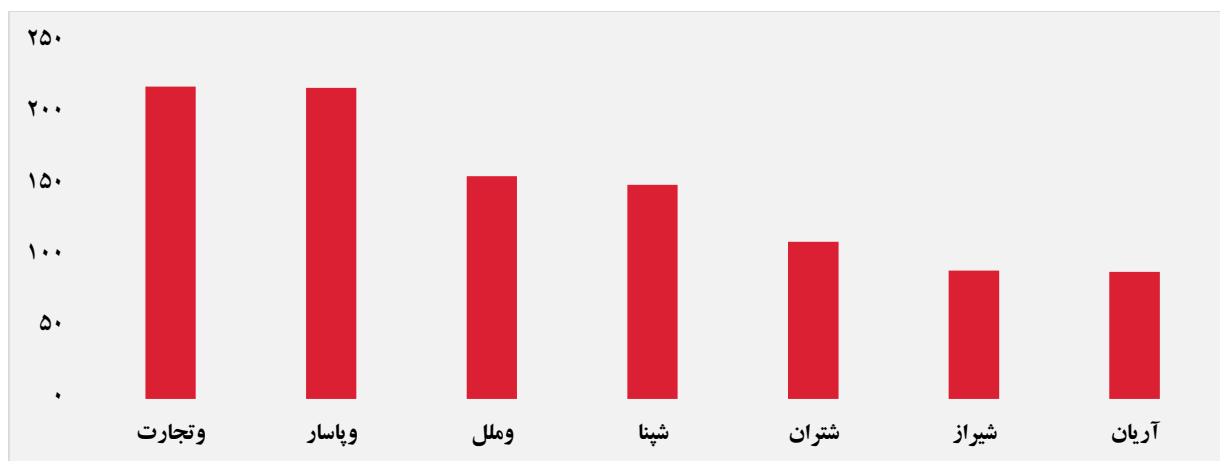
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	کحافظ	۱	چپارسا
۲	لبوتان	۲	وسگلستا
۳	سپیدار	۳	وآذر
۴	شصدف	۴	مفاخر
۵	غدیس	۵	وحافظ
۶	زفکا	۶	لپارس
۷	دسبحان	۷	داوه
۸	پکویر	۸	ریشمک
۹	فگستر	۹	ومعلم
۱۰	فسپا	۱۰	خاهن

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

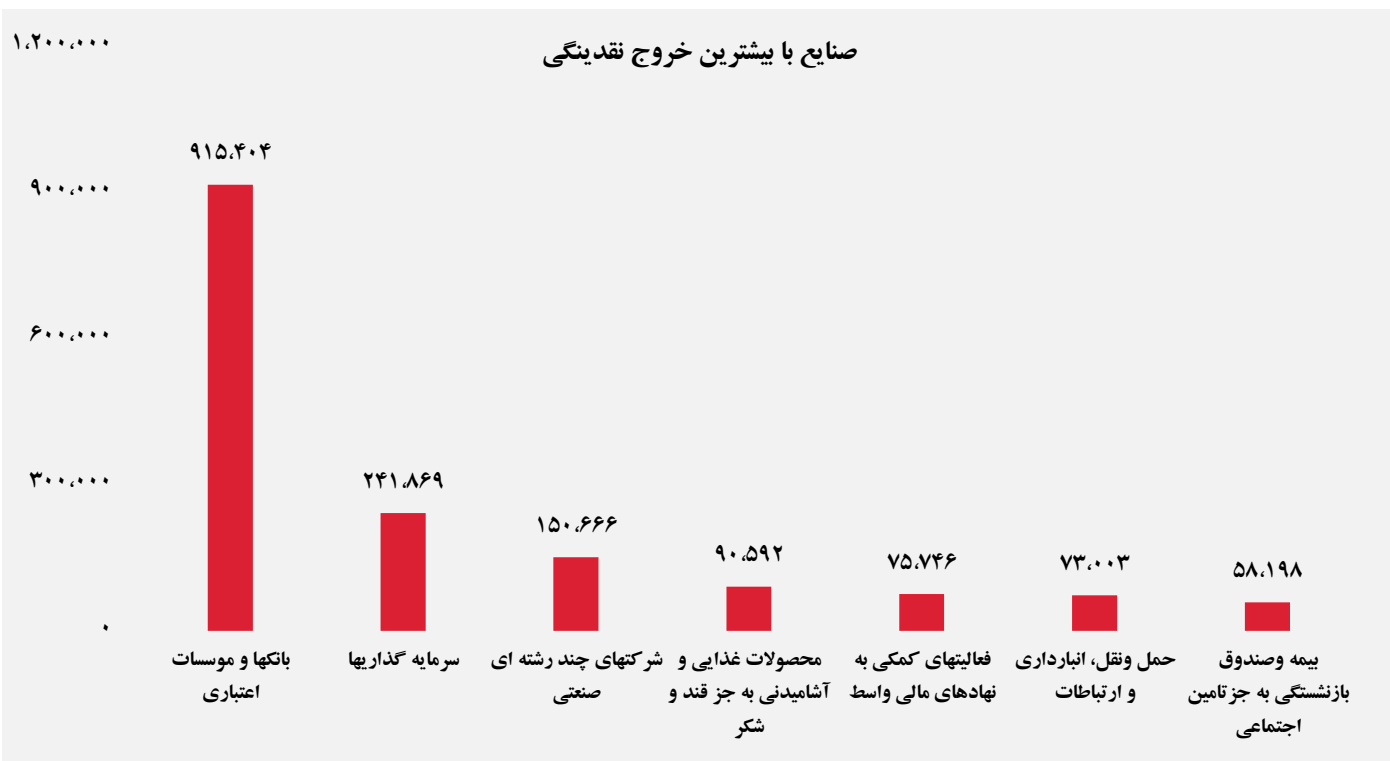
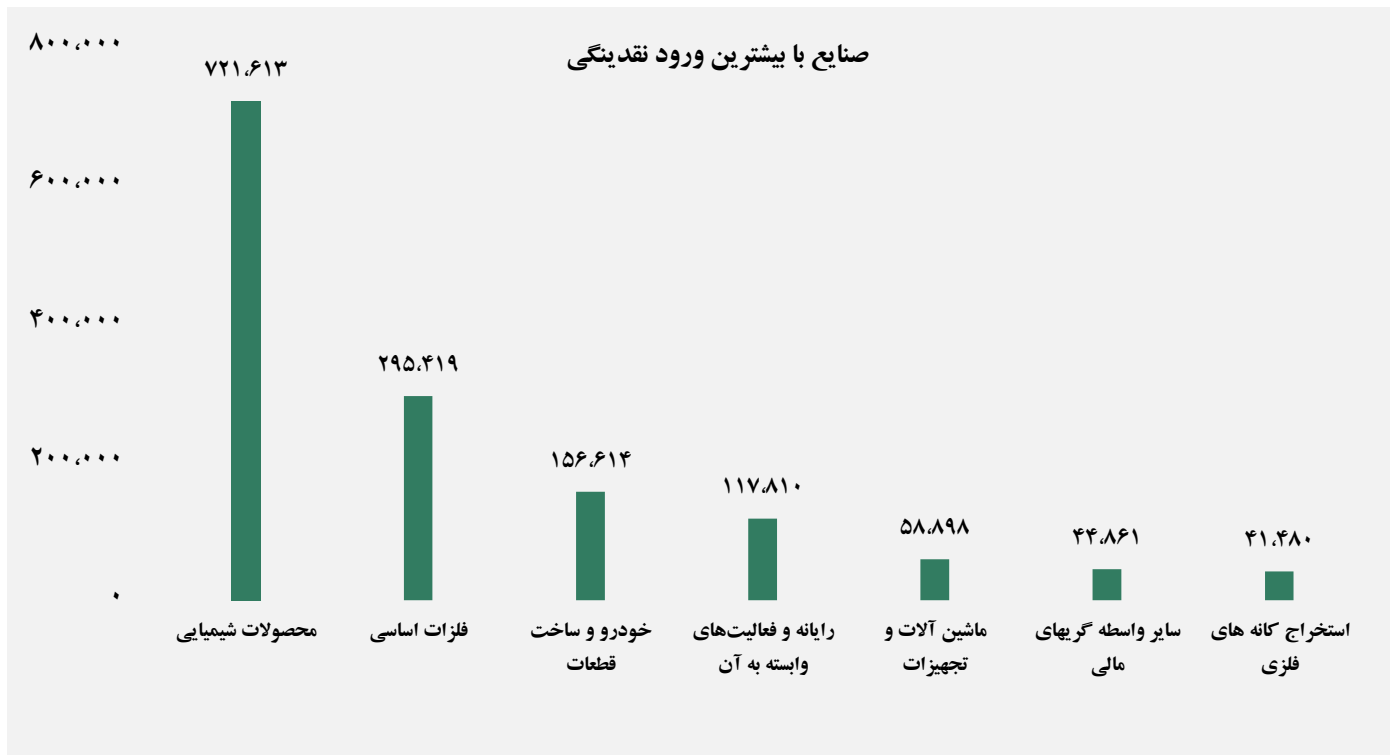


واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	زاگرس
۲	فراپورس	۱۱	شبریز
۳	ولکار	۱۲	خریخت
۴	قرن	۱۳	تاپکیش
۵	غپاک	۱۴	حفارس
۶	نوری	۱۵	کبافق
۷	بورس	۱۶	شغدیر
۸	سیلام	۱۷	غدیس
۹	ونفت	۱۸	چفبیر



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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر