



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۱۴

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۴ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای تایپکو، شینا، فملی، شپدیس، اخبر و وپارس با افزایش ۱۰,۸۹۳ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۵۴,۶۱۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۰۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته رشد داشته است. مبلغ ۵۵ 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 ۲۸ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

با توجه به شرایط کلی بازار سرمایه و اصول حاکم بر این بازار، انتظار روزهای مثبت به صورت مستمر و پایدار منطقی به نظر نمی‌رسد. در روز گذشته شاهد افزایش در سمت عرضه بودیم اما در بازار روند منفی جدیدی شکل نگرفته است و به نظر می‌رسد سمت تقاضا دوباره قوی گردد و اگر به صورت میان مدت به بازار نگاه کنیم، روند بازار صعودی خواهد بود و بسیاری از نمادها سقف قیمتی قبلی خود را در بازه کوتاه مدت پس خواهند گرفت. با توجه به افزایش نرخ دلار انتظار می‌رود در روزهای آینده گروه‌های فرآورده‌های نفتی، فلزات اساسی و پتروشیمی‌ها از وضعیت تقاضای بهتری نسبت به دیگر نمادهای بازار سهام برخوردار باشند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۳۰,۲۷۰ 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 ۸۰۵، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۲ با ۳۷,۸٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۱۳	۱۴۰۰/۰۴/۱۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲,۱۹۴	۱۳۰,۲۷۰	۵۸۳۸٪



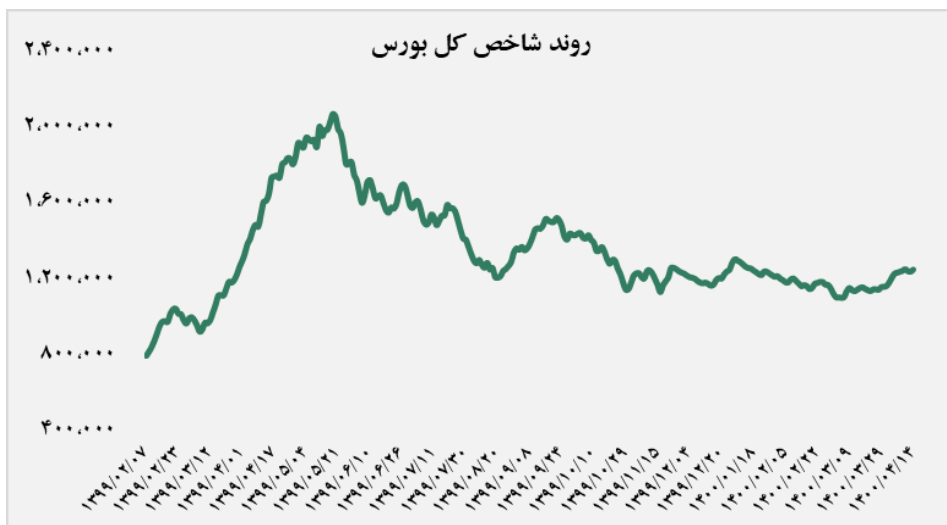
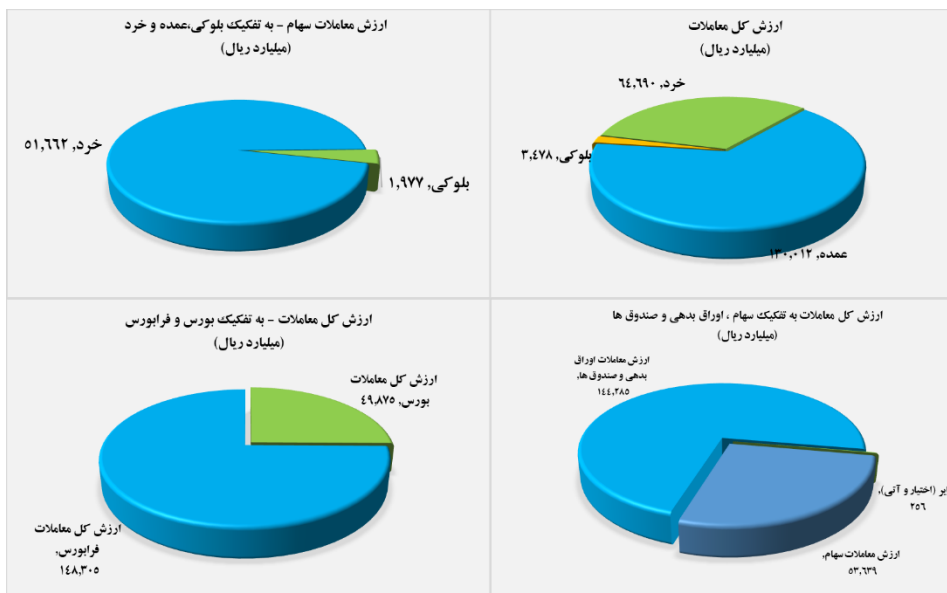
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، متوسط تولید ۱۲ ماه پتروشیمی زاگرس در سال ۹۹، ۲۵۱ هزار تن بوده است. در سه ماه اخیر متوسط تولید ۲۶۲ هزار و خرداد ۲۵۷ هزار تن است. در سال ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۲۵۳ هزار تن فروش داشت. سال مالی جاری را با فروش عالی ۲۹۵ و ۳۰۵ هزار تنی شروع کرد و خرداد نیز ۲۲۷ هزار تن فروخته است. متوسط نرخ فروش شرکت در سال ۹۹ در حدود ۱۶۶ دلار بوده است. در اسفند حوالی ۲۹۴ دلار صادر کرده است در فروردین و اردیبهشت اعداد عالی ۳۱۴ و ۳۰۵ دلاری را دارد و خرداد ۳۲۱ دلار است. متوسط فروش ماهانه فصل اول و دوم در سال ۹۹، ۷۰۰ و ۷۵۸ میلیارد بود. در فصل سوم متوسط فروش ۱،۷۰۰ میلیارد بود. در فصل انتهایی متوسط فروش ۱،۳۰۰ میلیارد بود. از نظر مبلغ فروش، این شرکت در فروردین ماه سال جاری رکورد زده و فروش ۲،۱۰۶ میلیاردی را دارد و اردیبهشت فروش به میزان ۲،۰۲۴ میلیارد دارد و خرداد نیز ۱،۴۷۰ میلیارد است.

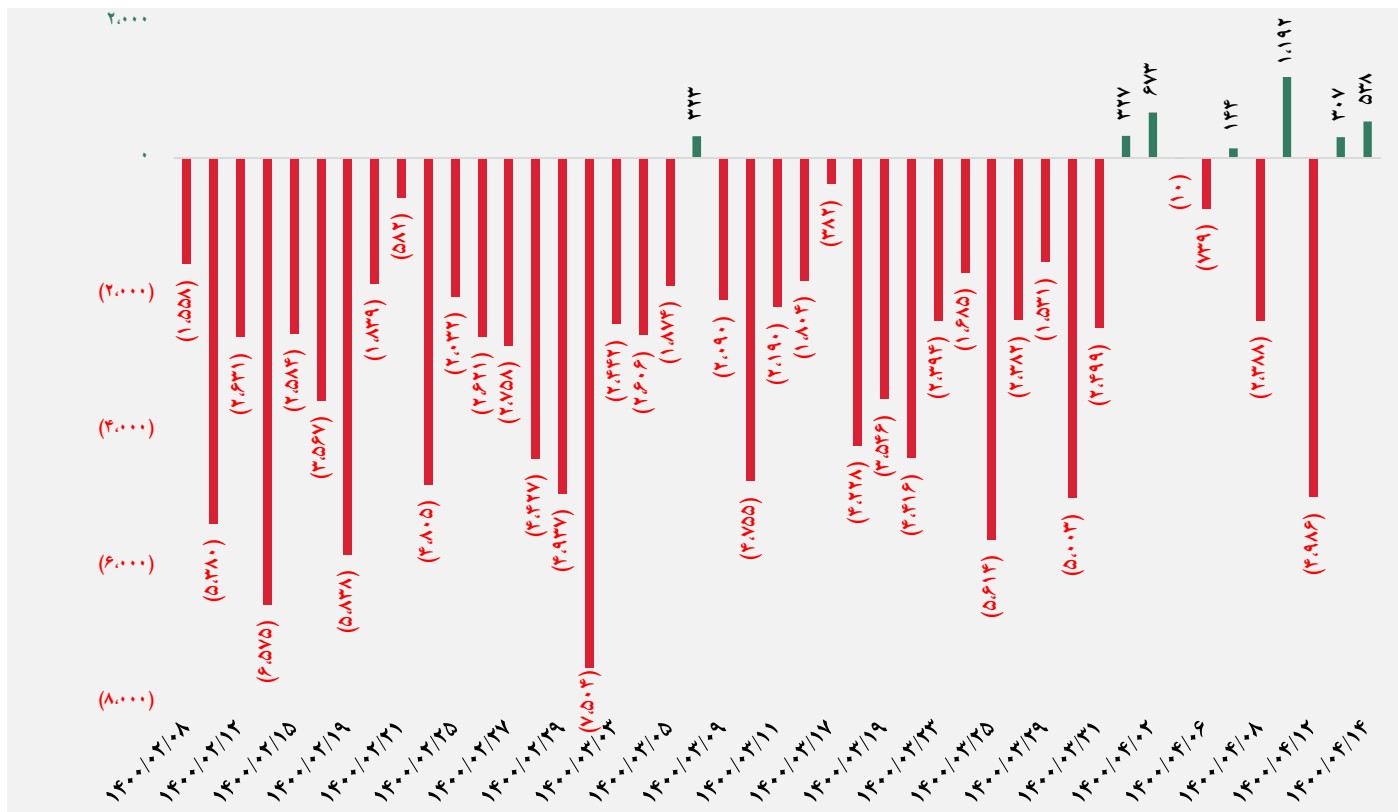
در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد خوزستان هر ماه در بازه‌ی ۳۰۰ تا ۳۳۰ هزار تن تولید محصول نهایی دارد، در اردیبهشت ۳۰۶ و در خرداد ۲۹۳ هزار تن تولید داشته است. این فولادساز در هر ماه بطور متوسط ۲۸۶ هزار تن فروش داشت که در اردیبهشت و خرداد ماه فروش ۳۰۵ و ۲۷۸ هزار تنی را گزارش کرده است. فولاد خوزستان در سال گذشته فروش ۳،۶۴۷ میلیارد تومانی را ثبت کرده بود و در سال جاری بطور میانگین هر ماه فروش ۳،۶۳۶ میلیارد تومانی را گزارش کرده که در اردیبهشت و خرداد به ترتیب فروشی برابر با ۳،۹۳۷ و ۳،۵۷۶ میلیارد تومان داشته است. نرخ فروش بلوم و بیلت صادراتی شرکت در خرداد برابر با ۱۱۷،۱۶۸ ریال برای هر کیلو بوده است. نرخ اسلب صادراتی نیز برابر با ۱۳۰،۸۸۷ ریال/کیلو گزارش شده است. نرخ داخلی اسلب و بلوم و بیلت به ترتیب برابر با ۱۲۳،۲۷۲ و ۱۶۸،۷۶۵ ریال به ازای هر کیلو است.

تصویر کلی بازار

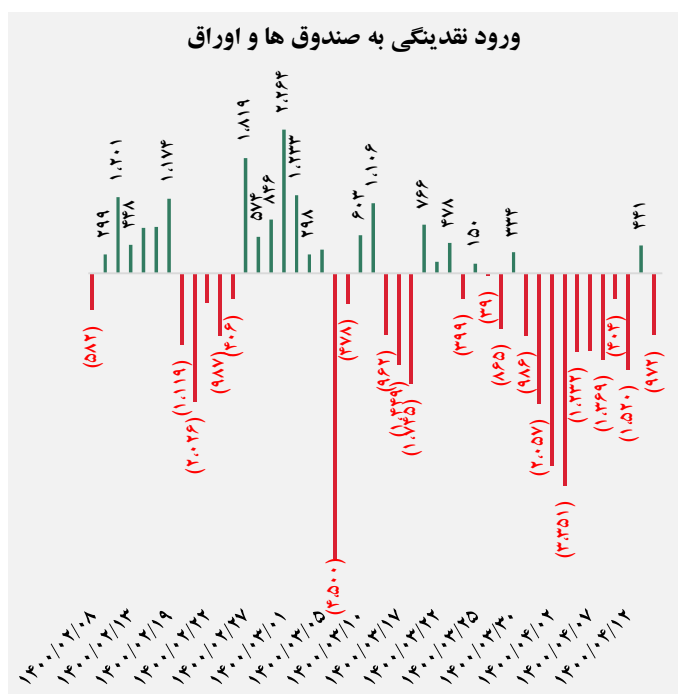
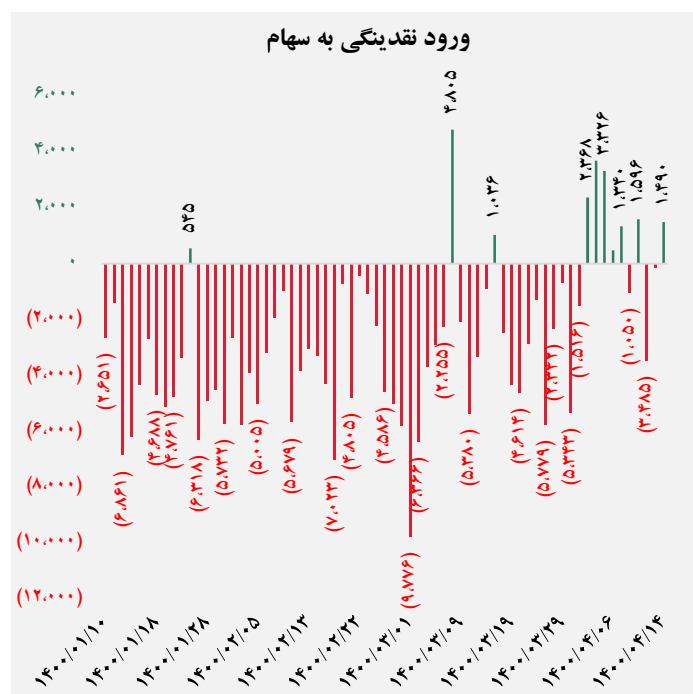
فرا بورس		بورس	
۱۸,۲۱۰	شاخص کل	۱,۲۵۴,۶۱۲	شاخص کل
۹۴	تغییر شاخص	۱۰,۸۹۳	تغییر شاخص
۱۲,۰۵۹,۶۸۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۸۳۱,۲۴۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۴۸,۳۰۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۹,۸۷۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
شگویا		تاپیکو	
مازون		شپنا	
ومهان		فملی	
سمگا		شپدیس	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
آریا		شستا	
کوثر		نوری	
حآسا		شفارس	
بمپنا		وسکرمان	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

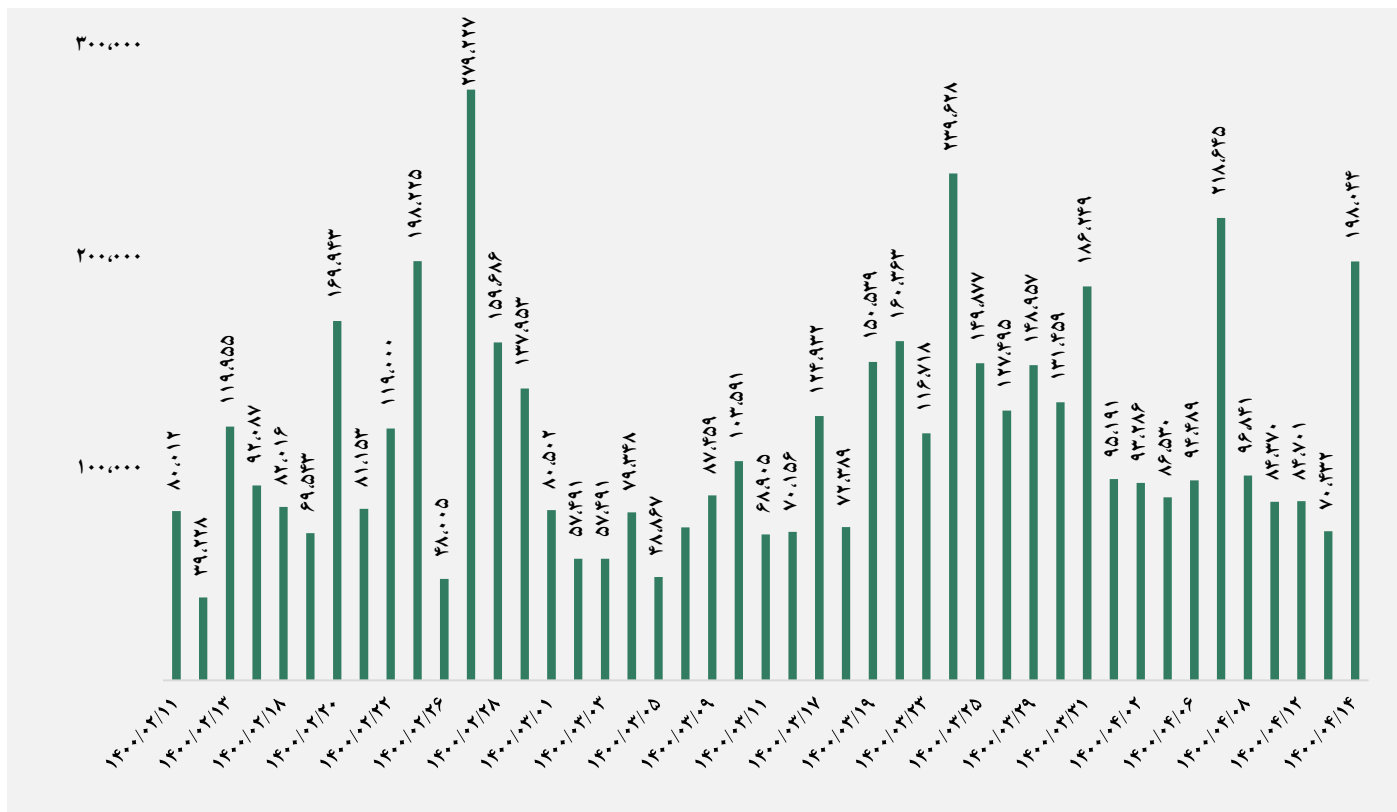


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

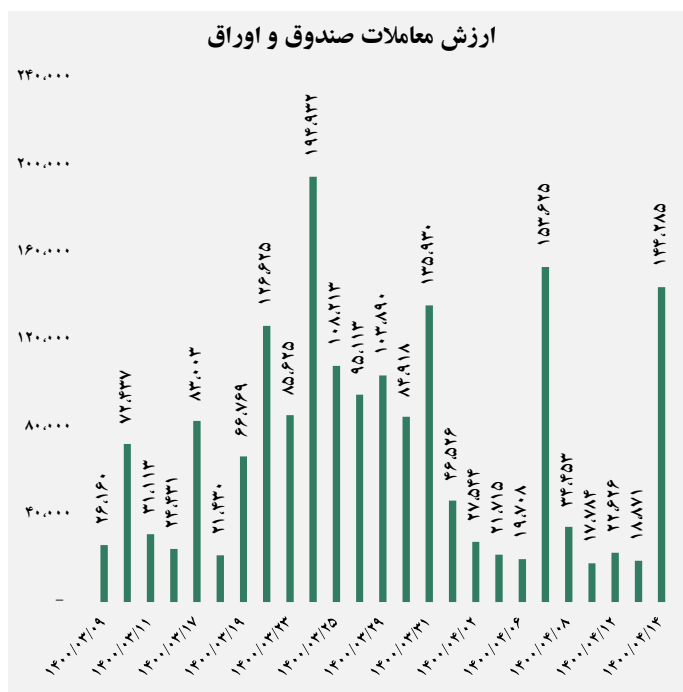
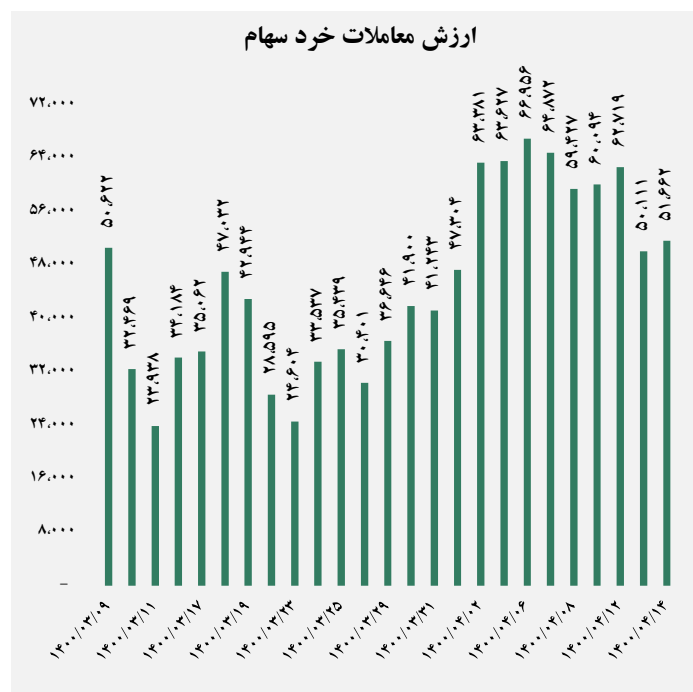


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

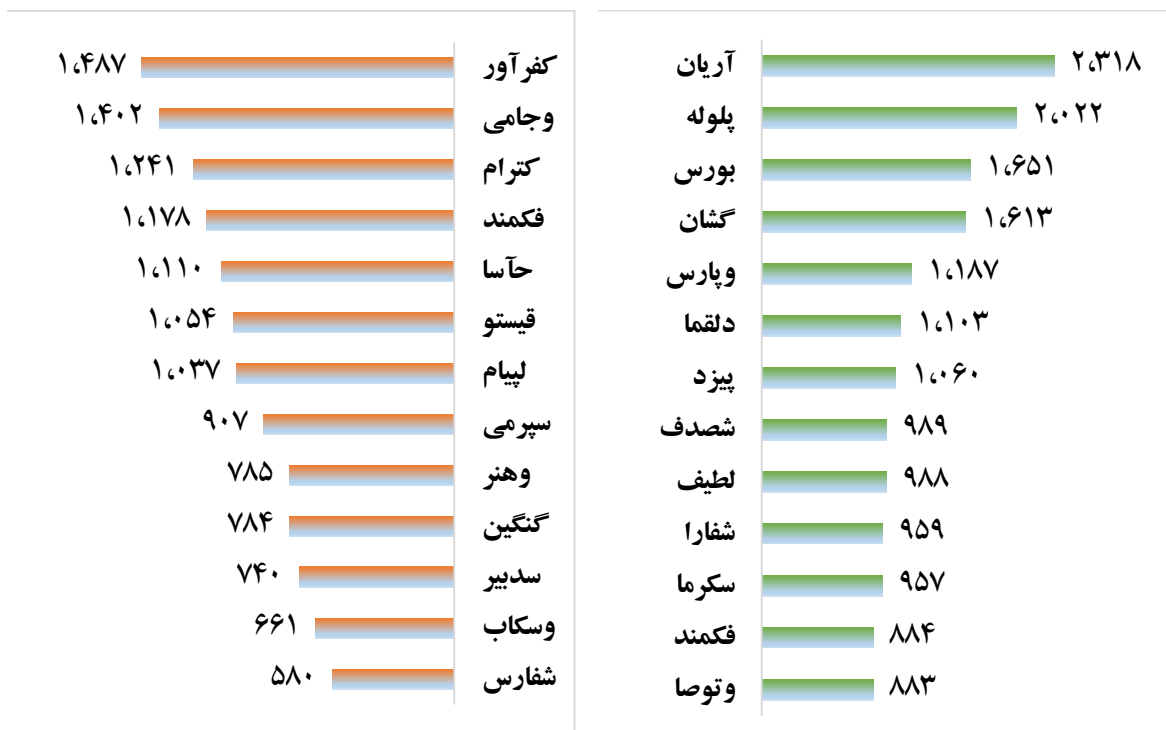


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





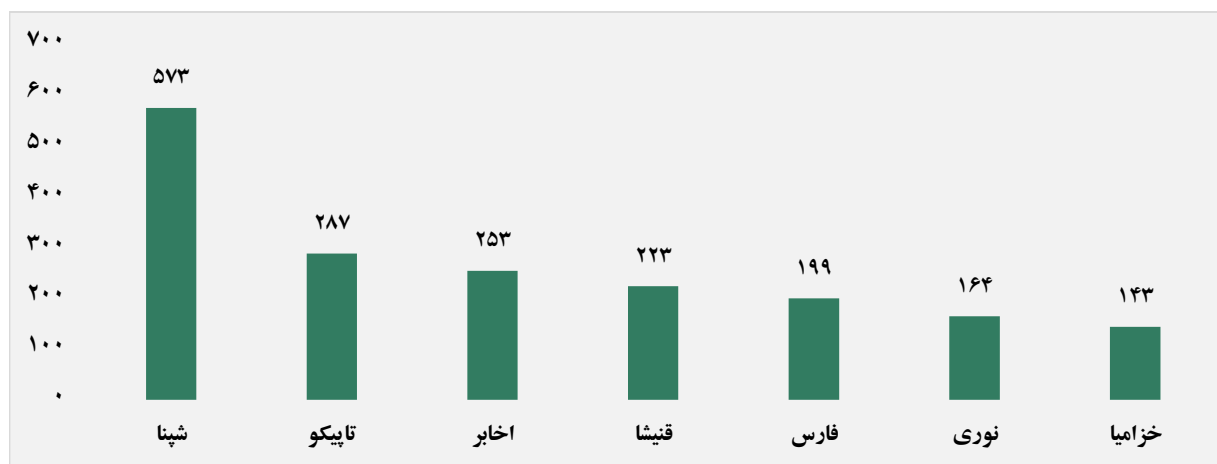
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



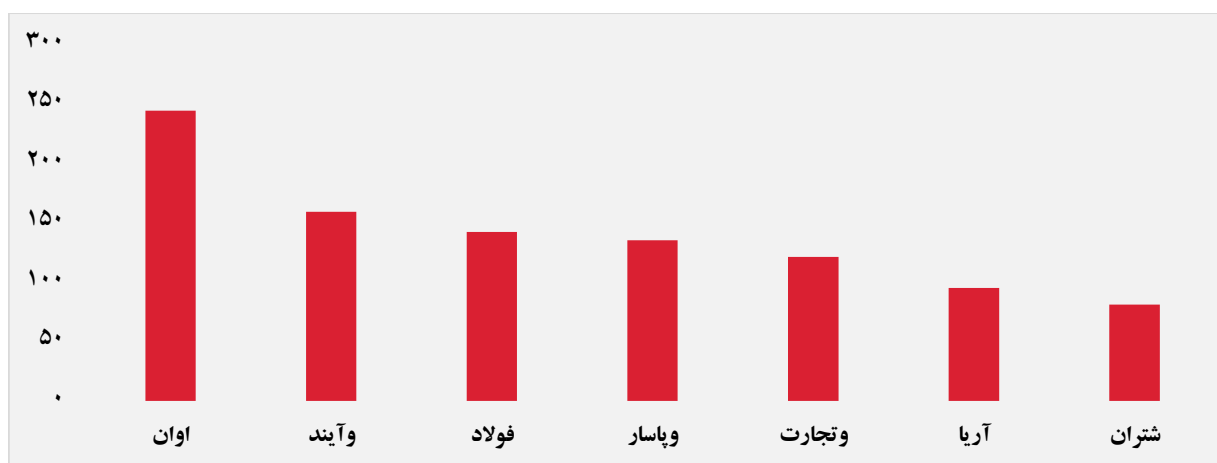
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	سرود	۱	غچین
۲	سمازن	۲	شپترو
۳	شجم	۳	دارو
۴	تاپیکو	۴	ولانا
۵	سمگا	۵	فافزا
۶	بترانس	۶	وساشرقی
۷	کابگن	۷	سدبیر
۸	خزامیا	۸	ساینا
۹	وپارس	۹	دقاضی
۱۰	غفارس	۱۰	دشیری

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



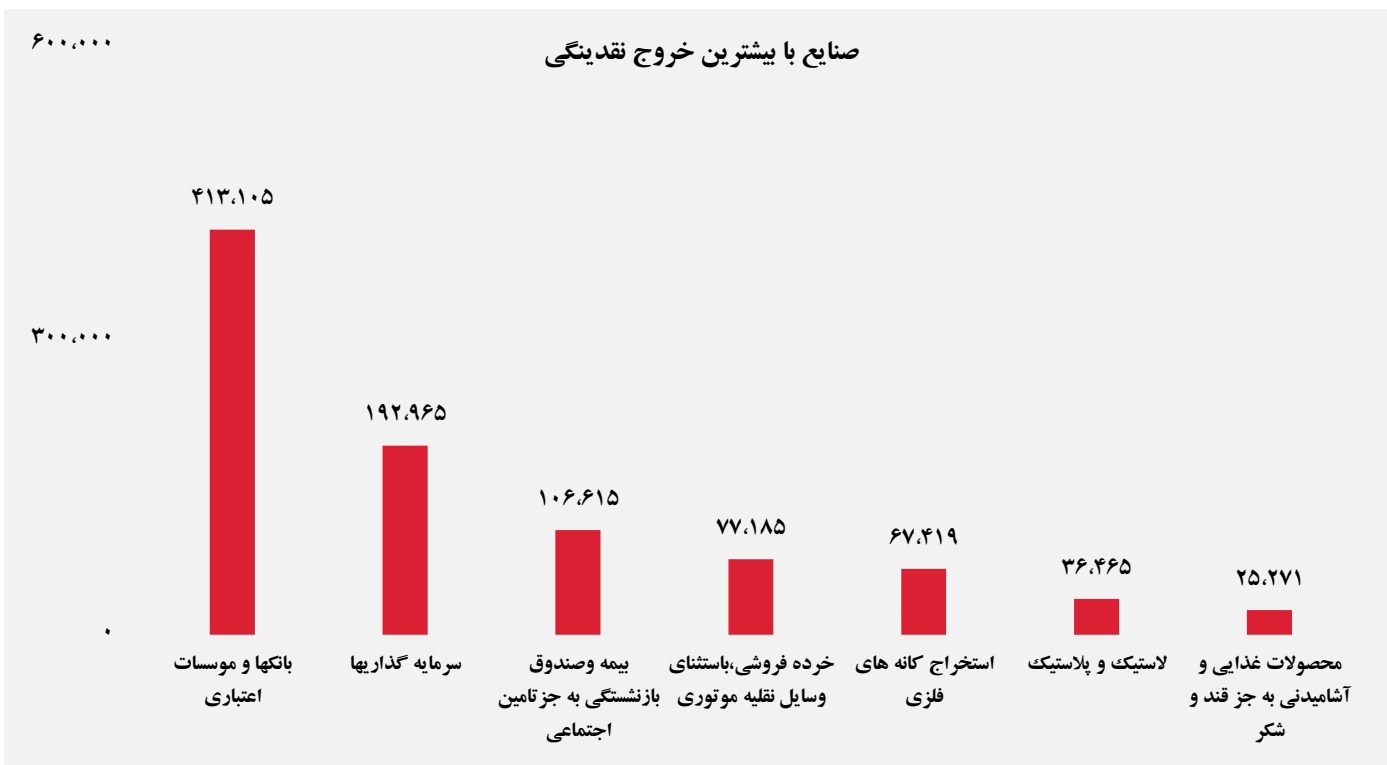
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	غدیس
۲	فراپورس	۱۱	سیمرخ
۳	غپاک	۱۲	تبرک
۴	فزرین	۱۳	شبریز
۵	قرن	۱۴	خزامیا
۶	سیلام	۱۵	نقارس
۷	کرمانشاه	۱۶	وآوا
۸	نور	۱۷	وساخت
۹	کزغال	۱۸	غفارس

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار