



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۱۵

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۱۵ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، فولاد، شستا، پارسان، وغدیر و شپنا با افزایش ۲۶,۵۶۹ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۸۱,۱۳۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۷۳ 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 از محدوده ۱,۱۶۰,۰۰۰ واحد شروع به افزایش کرد و در حال حاضر نیز در محدوده ۱,۲۸۱,۰۰۰ در حال معامله است و رشد حدود ۱۱ درصدی را تجربه کرده و در بالای مووینگ اوریج ۲۰۰ روزه به استقبال روز معاملاتی فردا رفته است. اولین ناحیه مقاومتی پیش روی شاخص محدوده ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحد می‌باشد. به نظر می‌رسد بازار تا محدوده اشاره شده، مشکلی برای رشد نداشته باشد و در آن محدوده نیاز به استراحت دارد. اما در بازه میان مدت انتظار می‌رود شاخص کل تا حوالی ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد به رشد خود ادامه دهد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱,۰۱۰ 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 ۸۰۵، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۲ با ۲۳,۳٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۱۴	۱۴۰۰/۰۴/۱۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۳۰,۲۷۰	۱۱,۰۱۰	-۹۲٪



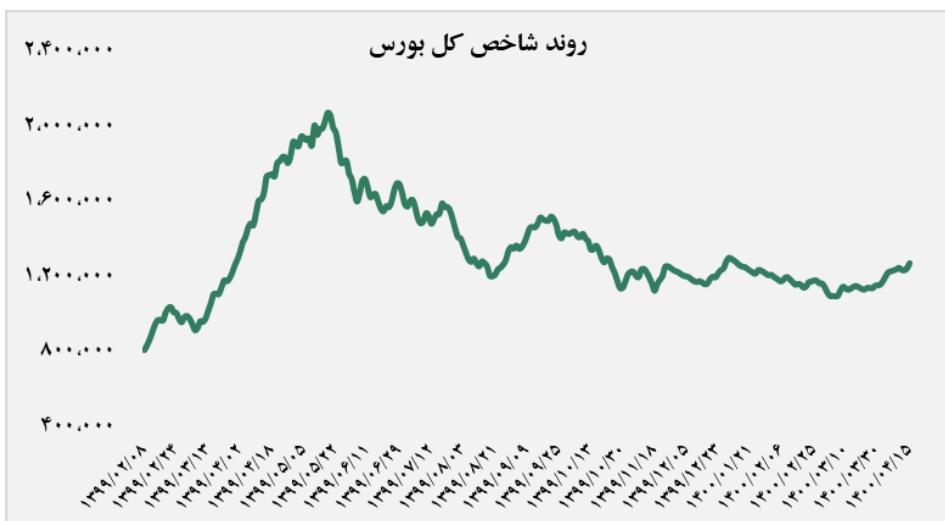
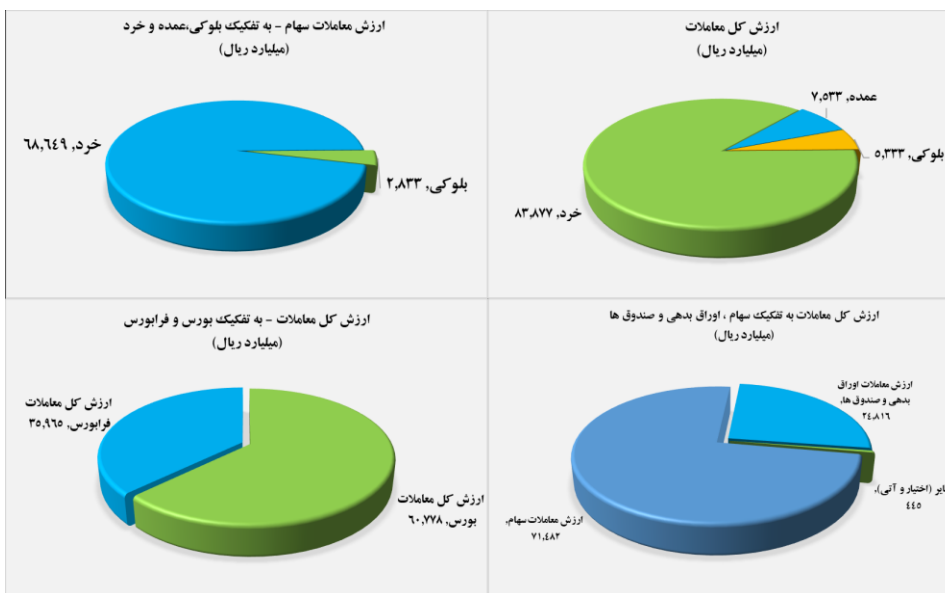
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، سال مالی شرکت صنایع شیمیایی ایران منتهی به آذر ماه است و در سال مالی گذشته متوسط تولیدات شرکت بر عدد ۱۴,۷۵۰ تن استوار بوده است. در فصل اول سال مالی جدید ۱۷,۴۸۴ تن به طور متوسط تولید داشته است و در فصل دوم هم متوسط تولید ۱۸,۱۰۰ تن است. این شرکت در فصل اول و دوم سال مالی قبل به طور متوسط هر ماه ۱۹۶ و ۱۴۰ میلیارد فروش داشت. در فصل سوم و چهارم متوسط فروش ۲۲۶ و ۳۸۹ میلیارد تومانی را گزارش کرده بود، در فصل اول سال مالی ۱۴۰۰ هر ماه ۴۳۷ میلیارد تومان فروش زده است و در دو ماه بعدی نیز ۴۳۲ و ۴۶۱ میلیارد ارقام فروش گزارش شده بر روی کدال است. در خرداد عالی بوده و رکورد فروش تاریخ شرکت با ۶۲۰ میلیارد تومان ثبت شده است. مقدار فروش LAB شرکت صنایع شیمیایی ایران در ماه جاری ۱۲,۱۷۱ تن (میانگین سال قبل ۸,۶۰۰ و شش ماهه ابتدای سال جاری ۹,۶۱۲ تن) و نرمال پارافین ۱۰,۲۸۲ تن (میانگین سال قبل ۶,۸۰۰ و شش ماهه ۱۴۰۰ برابر ۷,۶۵۳) تن است. در ماه جاری ۵,۷۰۰ تن صادرات LAB داشته است. نرخ فروش تمامی محصولات شرکت در ماه جاری به طور متوسط ۲۷ هزار تومان است و افزایش ۶۸ درصدی نسبت به میانگین سال مالی قبل دارد.

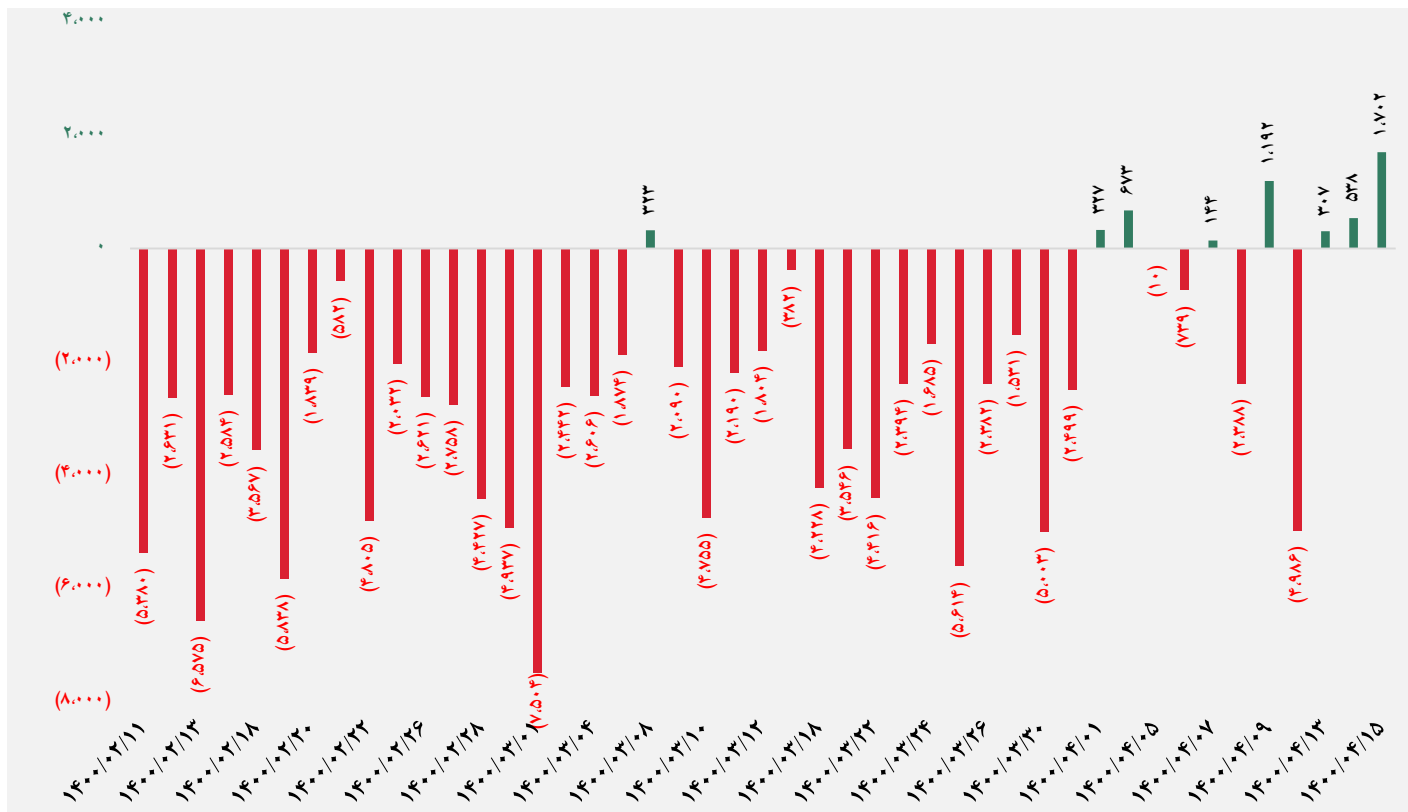
در گروه لاستیک، شرکت ایران یاساتایرورابر در خرداد و اردیبهشت و فروردین ماه ۱,۶۱۳ و ۱,۳۶۲ و ۷۰۶ تن تولید داشته است. متوسط تولید سال مالی قبل ۱,۳۵۳ تن بوده است. فروش ایران یاساتایرورابر در خرداد و اردیبهشت و فروردین ۲,۰۰۳ و ۱,۶۵۴ و ۱,۲۰۶ تن ثبت شده است. در دوازده ماه سال قبل طور متوسط این تولید کننده تایر ۱,۳۴۹ تن فروش داشته است. شرکت که بطور متوسط هر ماه ۶۳ میلیارد تومان فروش داشته است، در فروردین ماه فروش ۶۶ میلیارد تومانی و اردیبهشت ماه ۸۸ و در خرداد فروش عالی ۱۱۳ میلیارد تومانی ثبت کرده است. نرخ فروش تایر و تیوپ در خرداد ۵۴۳,۷۰۹ و ۶۹۸,۰۰۰ ریال به ازای کیلو بوده است. متوسط نرخ فروش سه ماهه امسال ۵۳۲,۰۹۴ و ۶۵۲,۰۷۴ ریال و متوسط نرخ فروش ماهانه این دو محصول در سال مالی قبل به ترتیب ۴۲۶,۲۱۵ و ۵۶۰,۱۲۶ ریال به ازای هر کیلو گزارش شده است.

تصویر کلی بازار

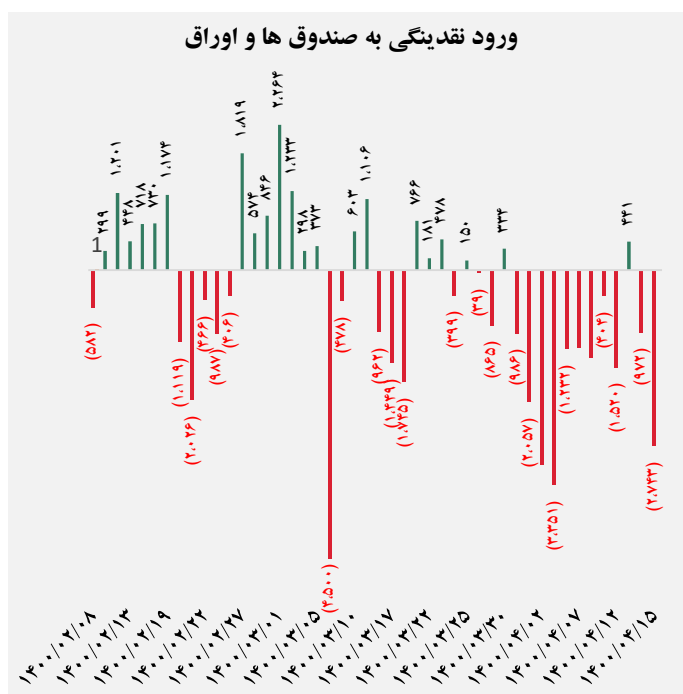
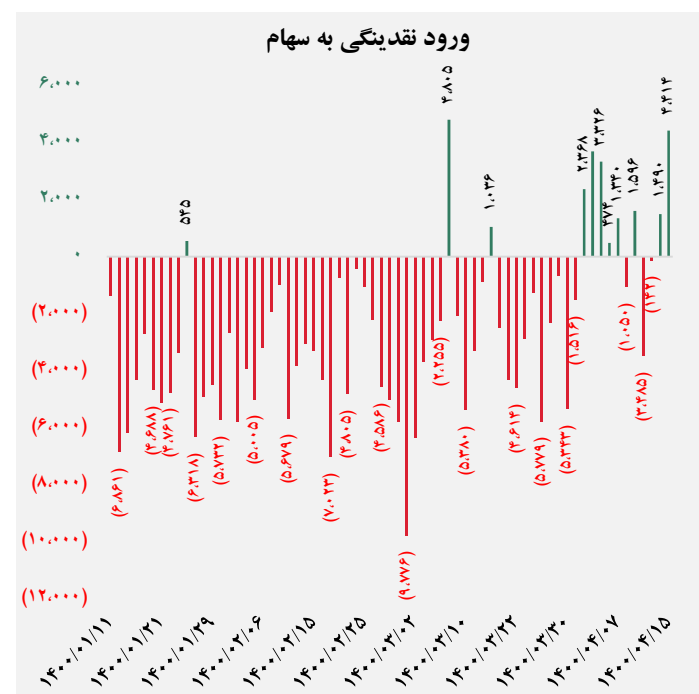
فرا بورس		بورس	
۱۸,۳۴۱	شاخص کل	۱,۲۸۱,۱۳۰	شاخص کل
۱۳۰	تغییر شاخص	۲۶,۵۶۹	تغییر شاخص
۱۲,۱۴۵,۹۹۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۰,۸۶۲,۸۰۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۵,۹۶۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۶۰,۷۷۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
صبا		فارس	
غصینو		فولاد	
ذوب		فملی	
ومهان		شستا	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کوثر		بشهاب	
کرمان		برکت	
فرا بورس		لخزر	
پخش		ثوسا	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



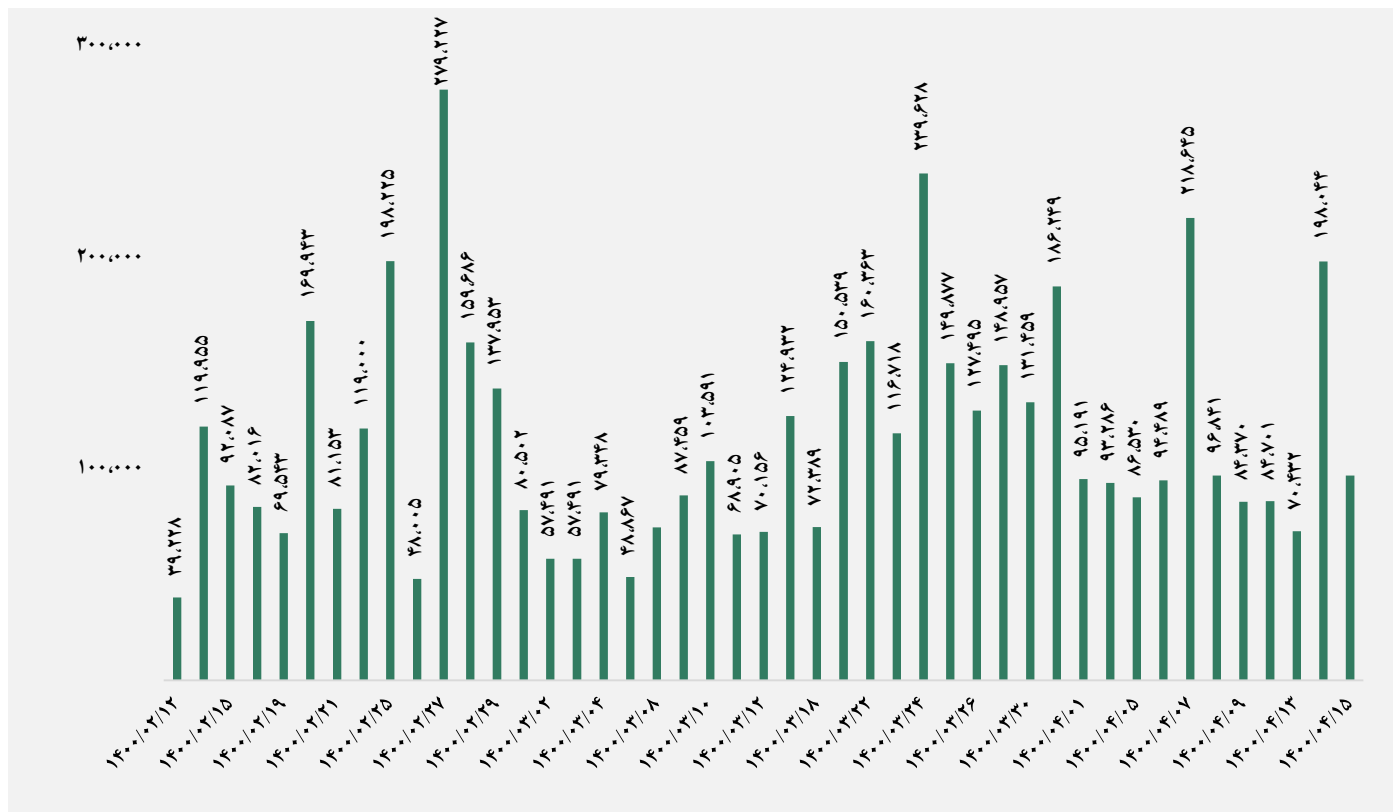
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



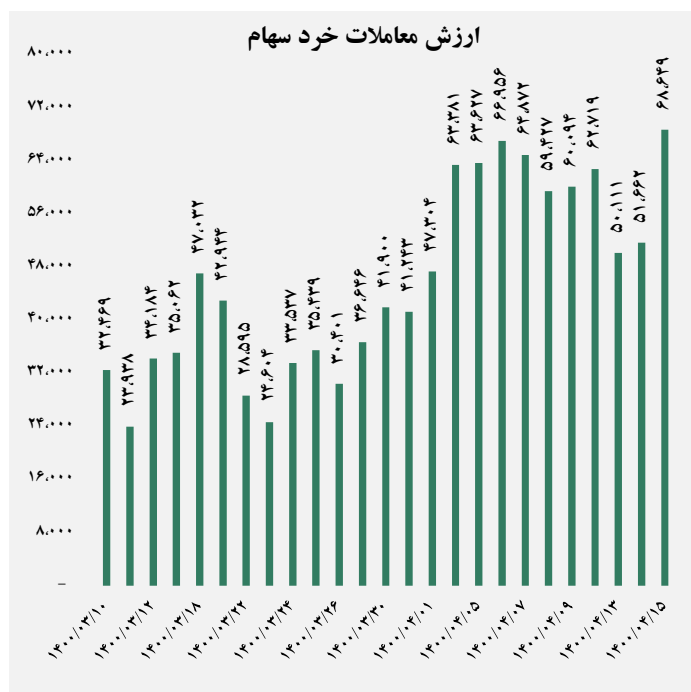
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



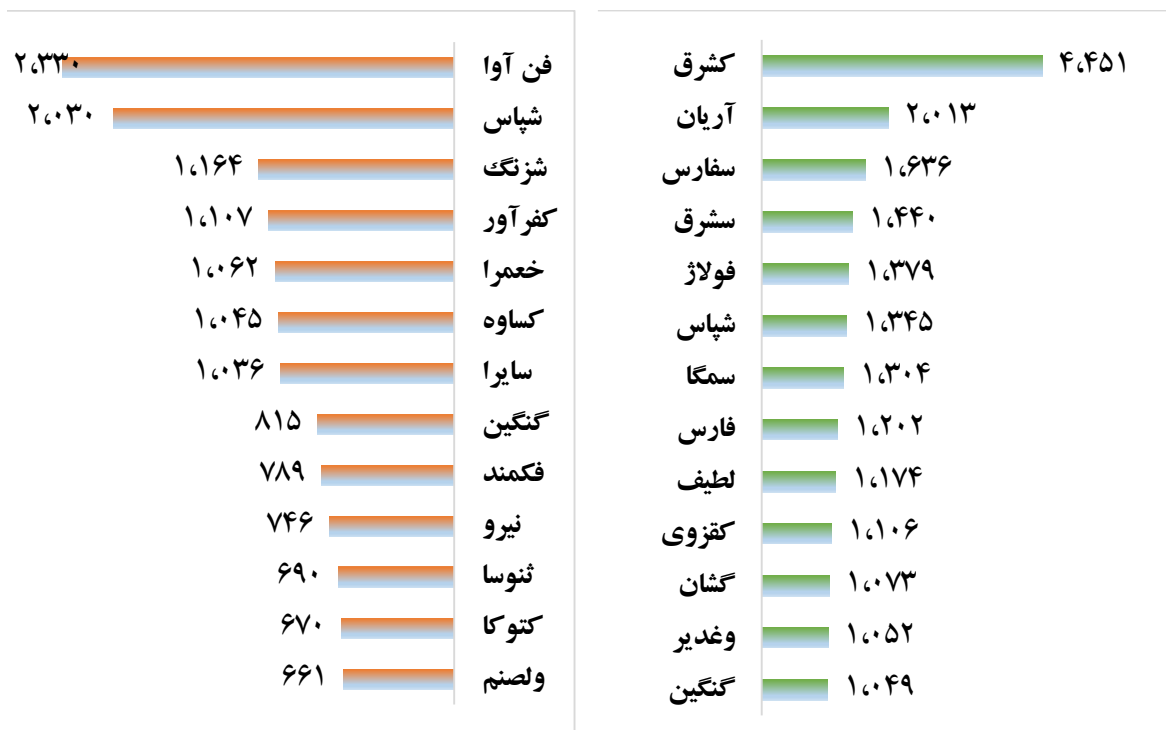
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



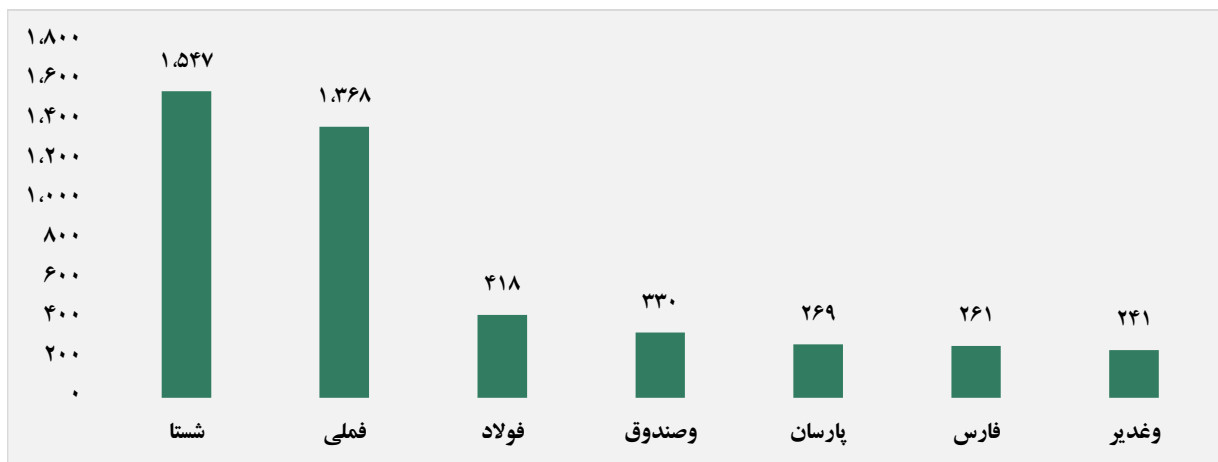
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



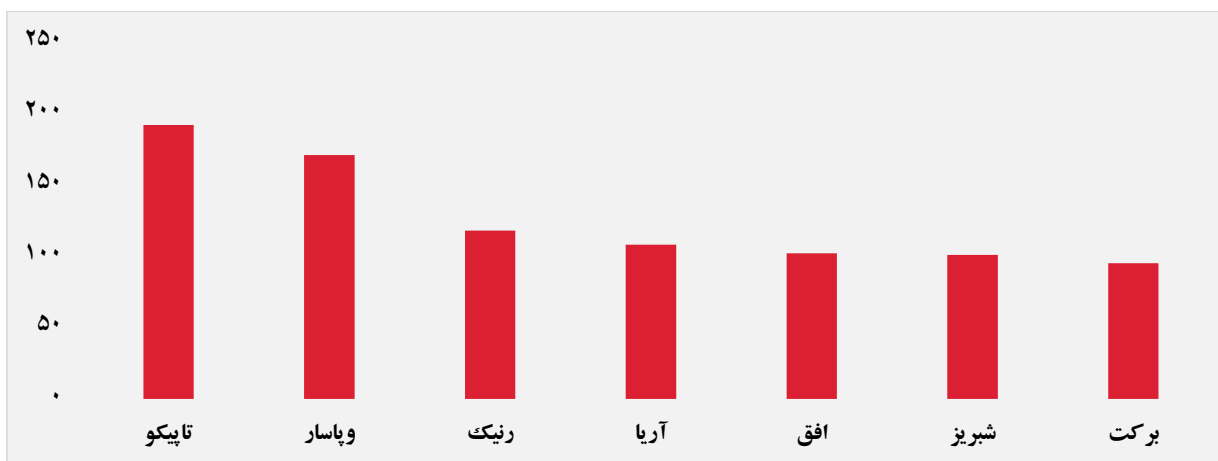
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	گدنا	۱	بشهاب
۲	وگستر	۲	وجامی
۳	وثوق	۳	غپآذر
۴	دابور	۴	دلتما
۵	بمینا	۵	شسینا
۶	شبصیر	۶	کلر
۷	بالاس	۷	قنیشا
۸	کرغال	۸	ثغرب
۹	حسینا	۹	اولن
۱۰	غدیس	۱۰	لخزر

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



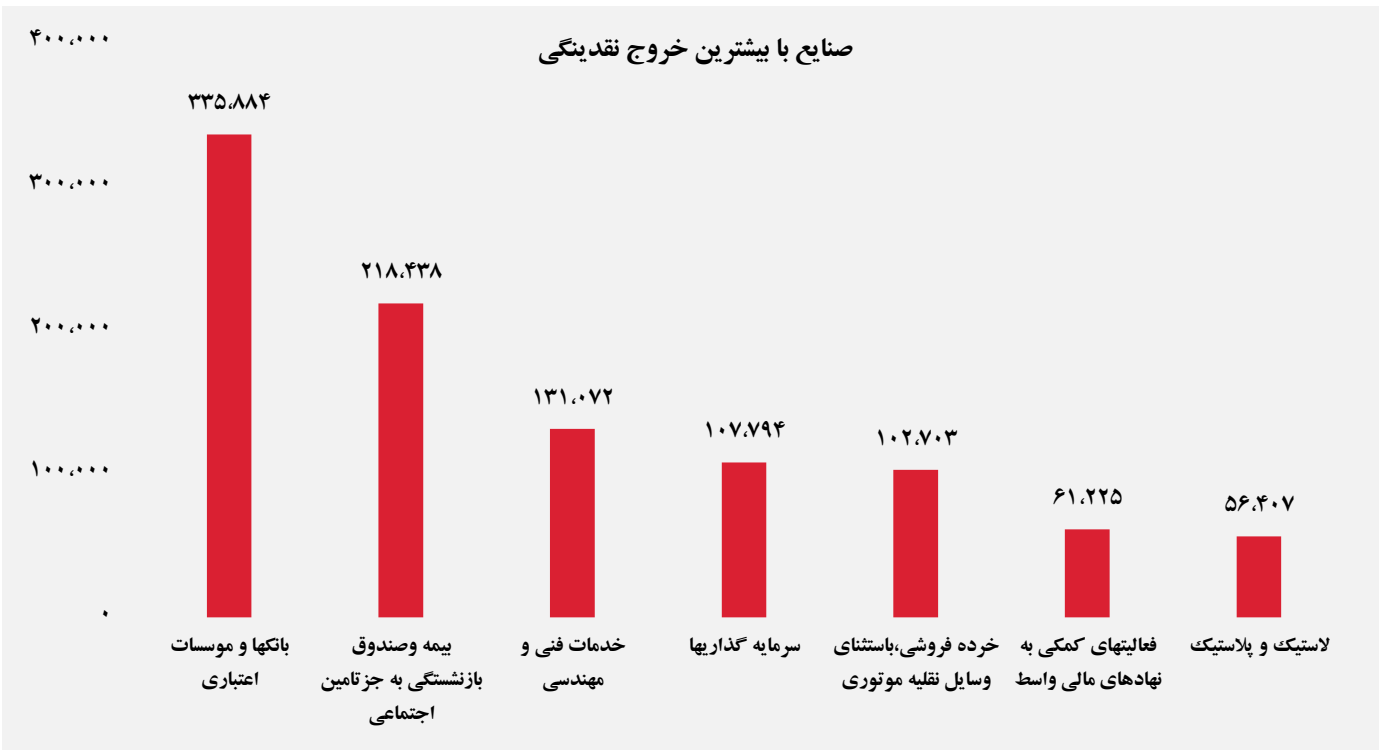
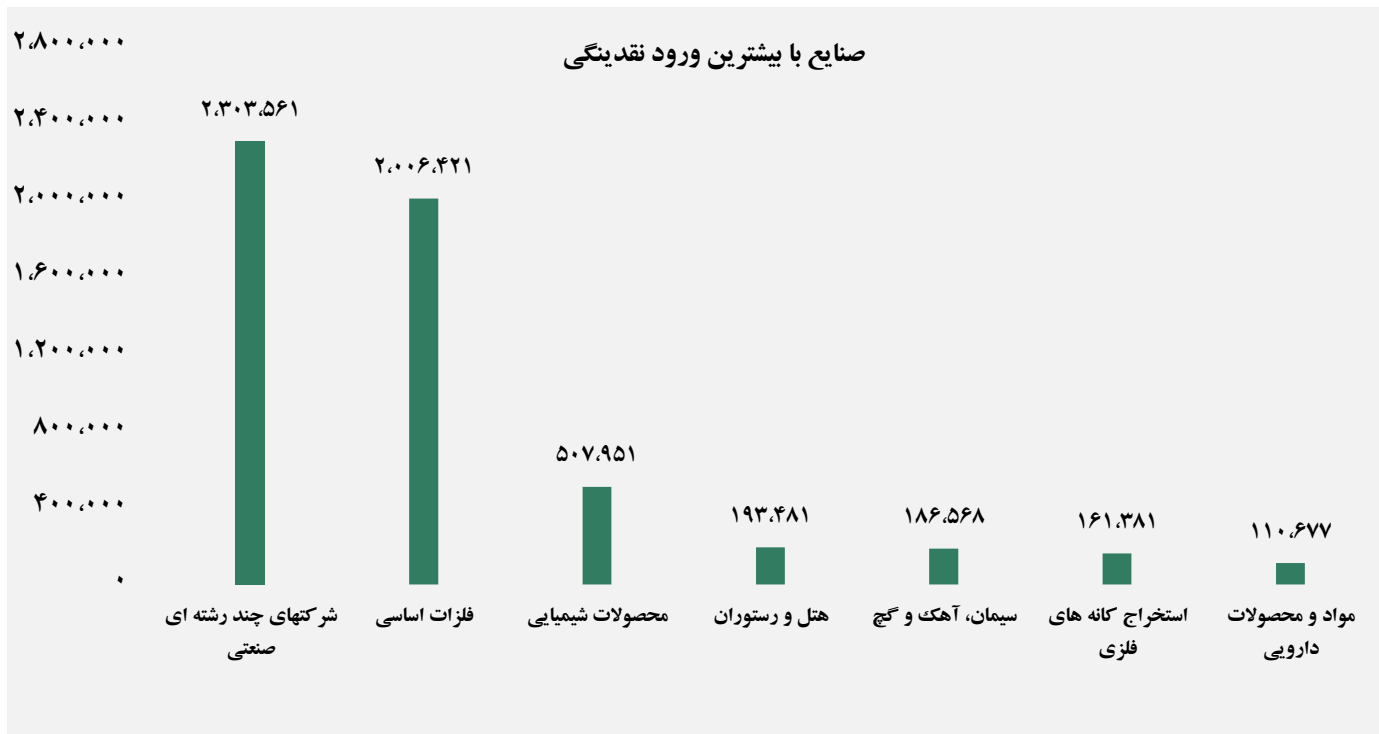
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	سغرب	۱۰	ودی
۲	برکت	۱۱	نوری
۳	فراپورس	۱۲	ومدیر
۴	اعنلا	۱۳	غپاک
۵	فزرین	۱۴	شغدیر
۶	شپاس	۱۵	شراز
۷	کزغال	۱۶	سامان
۸	غدیس	۱۷	افق
۹	رنیک	۱۸	کسرا

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار