



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۱۶

[www.sfg.ir](http://www.sfg.ir) - [info@sfg.i](mailto:info@sfg.i)



## تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۱۶ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، وغدیر، رمپنا، فملی، مبین و نوری با افزایش ۸۳۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۸۲,۰۲۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۱۹ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۶۳ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق های قابل معامله سهامی می باشد. در روز جاری ۵۳ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. در سه ماه گذشته عملکرد ماهانه بسیاری از شرکت ها نسبت به مدت مشابه سال گذشته و حتی از میانگین عملکرد ۱۲ ماهه سال مالی گذشته بهتر بوده است. به نظر می رسد با توجه به نرخ رشد کامودیتی ها در چند ماه اخیر و تثبیت نرخ های جهانی اکثر کامودیتی ها، سود فصل بهار سال جاری شرکت های کامودیتی محور را با رشد بااهمیتی افزایش دهد. همچنین با توجه به میزان ارزش معاملات و بهبود آن و همچنین با توجه به تداوم ورود نقدینگی حقیقی ها به بازار می توان نسبت به روند صعودی شاخص کل بورس همچنان امیدوار بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۳,۲۹۵ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۳۴ 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	۱۴۰۰/۰۴/۱۵	۱۴۰۰/۰۴/۱۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۱,۰۱۰	۴۳,۲۹۵	۲۹۳٪



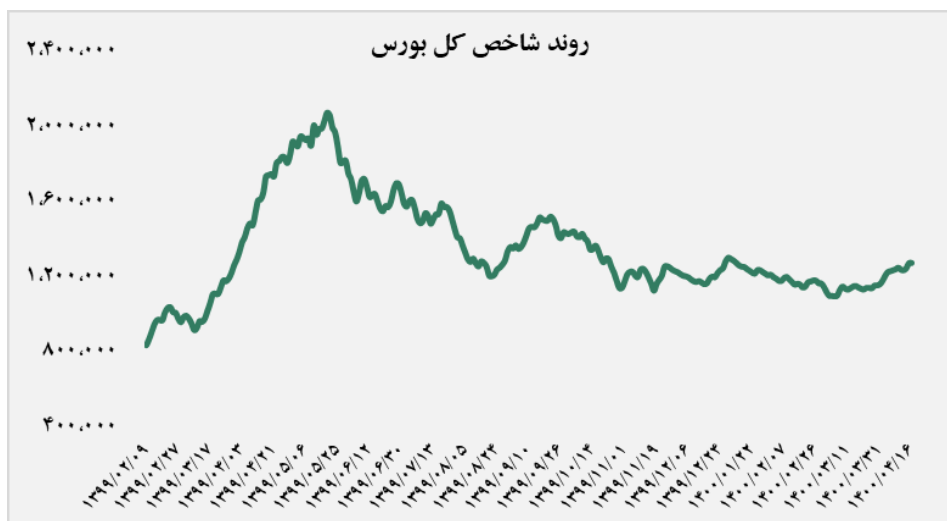
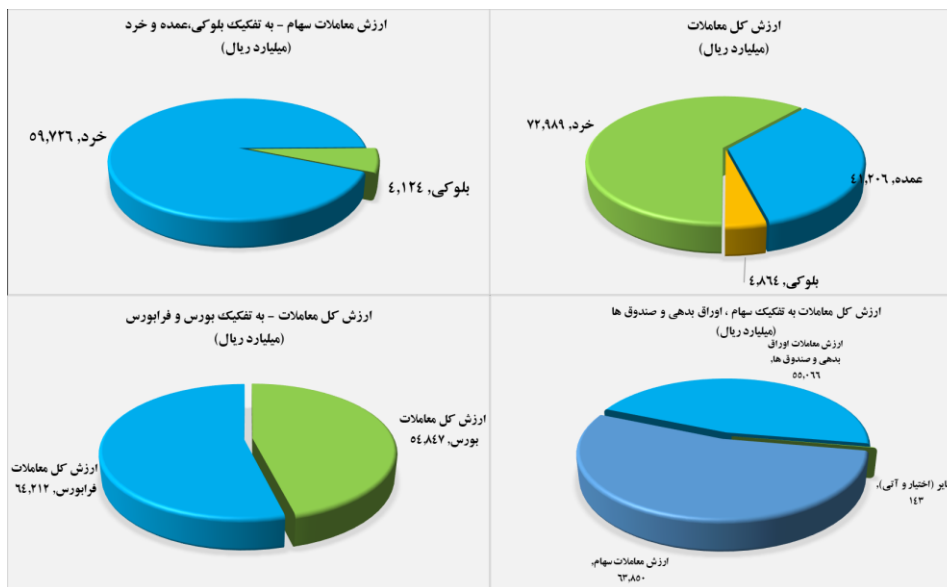
## گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، فولاد هرمزگان در فصل اول تا سوم ۹۹ به طور متوسط هر ماه فروش ۵۵۷، ۸۷۱ و ۱،۱۳۰ میلیارد تومانی را روانه کدال کرده بود. در دی و بهمن ماه فروش ۱،۶۰۰ میلیارد تومانی را داشت و در اسفند یک فروش مناسب ۲،۶۰۰ میلیارد تومانی را ثبت کرد. در فروردین فروش ۹۷۵ میلیارد تومانی را داشت و در اردیبهشت عدد خوب ۲،۳۳۳ میلیارد تومانی و خرداد ماه نیز مبلغ فروش ۱،۹۳۴ میلیارد تومان است. فروش سه ماهه امسال رشد ۲۱۲ درصدی نسبت به سه ماهه ابتدایی سال ۹۹ دارد. متوسط تولید در دو سال گذشته به طور متوسط هر ماه ۱۲۶ و ۱۲۱ هزار تن بوده است. در فروردین و اردیبهشت نیز تولید ۱۴۵ و ۱۳۱ هزار تن و در خرداد ۱۱۴ تن است. موجودی اول سال شرکت در سال ۹۹ برابر ۱۶۷ هزار تن بوده است که با فروش ۷۱ و ۱۶۱ هزار تنی دو ماه ابتدایی و ۱۳۱ هزار تنی خرداد در انتهای فصل ابتدایی ۱۴۰۰ به ۱۹۳ هزار تن رسیده است. نرخ فروش اسلب فولاد هرمزگان در سال ۹۹ برابر ۹،۱۰۰ تومان برای هر کیلو بوده است که در فروردین ۱۳،۸۰۰ و اردیبهشت ۱۴،۴۰۰ تومان و خرداد ۱۴،۲۰۰ تومان است.

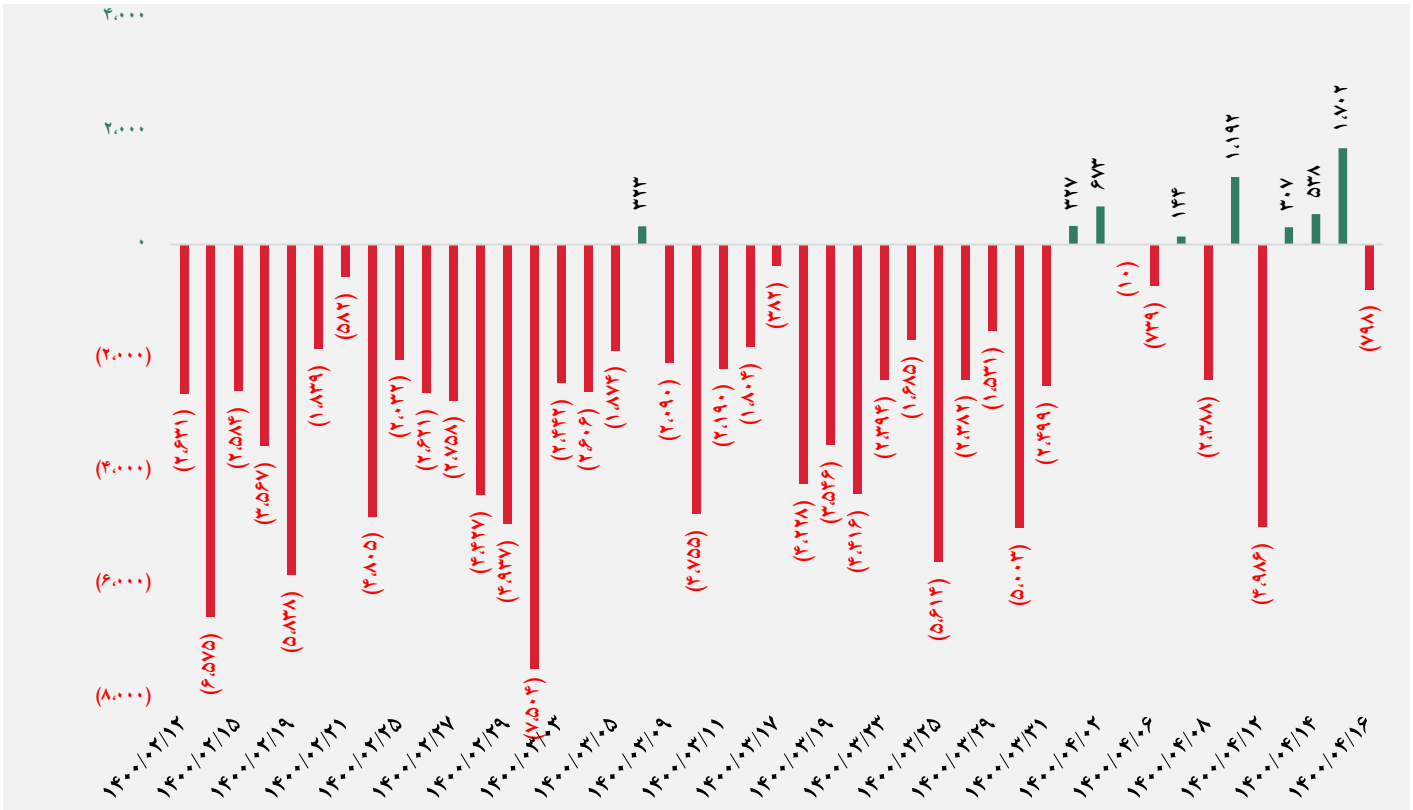
در گروه سیمان، شرکت سیمان خوزستان در خرداد ماه ۲۱۶ هزار تن کلینکر به عنوان ماده اولیه تولید کرده است که رقمی بالاتر از میانگین ماهانه سال گذشته (۱۹۰ هزار تن) است. این رقم در در ماه‌های فروردین و اردیبهشت به ترتیب ۲۰۸ و ۲۰۰ هزار تن بود. مقدار فروش سیمان و کلینکر شرکت در خرداد ۱۸۱ هزار تن بوده است. میانگین ماهانه در سال قبل ۲۰۶ هزار تن و فروش دو ماه اول سال به ترتیب ۱۶۸ و ۲۳۱ هزار تن بوده است. سیمان خوزستان با این میزان فروش، ۷۷ میلیارد تومان درآمد شناسایی کرد. فروش ۹۷ میلیارد تومانی اردیبهشت که بهترین مبلغ فروش ماهانه شرکت بوده و فروش فروردین ۶۵ میلیارد تومان است. این شرکت در سه ماهه با ۲۳۵ میلیارد تومان، ۱۳۵ درصد از فروش ۱۰۱ میلیارد تومانی سه ماه ابتدایی سال قبلی پیشی گرفته است. میانگین نرخ فروش محصولات نیز با ۴۲۳ تومان در هر کیلو یک درصد نسبت به نرخ ماه اردیبهشت افزایش داشته است.

## تصویر کلی بازار

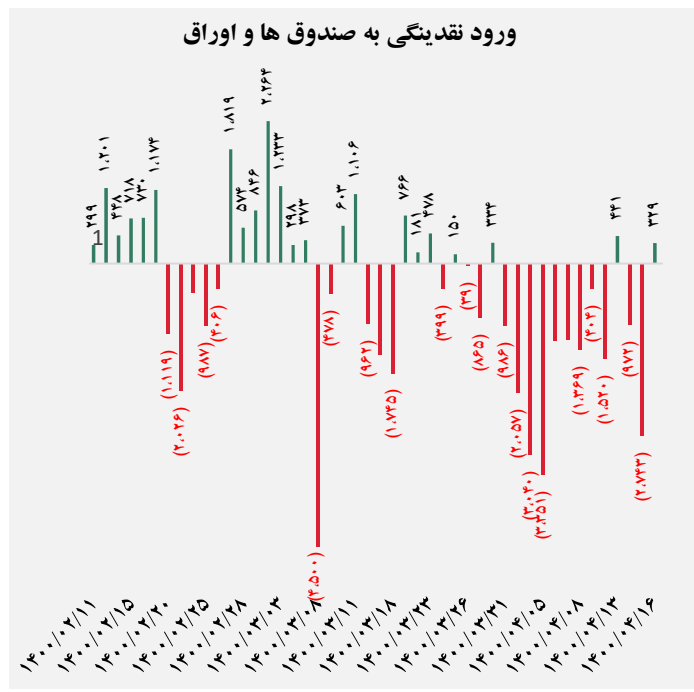
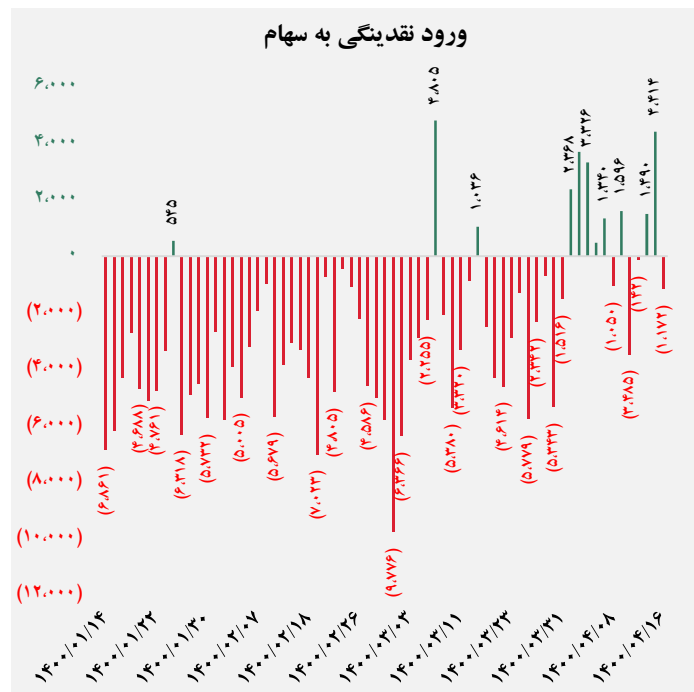
فرا بورس		بورس	
۱۸,۳۶۷	شاخص کل	۱,۲۸۲,۰۱۸	شاخص کل
۲۶	تغییر شاخص	۸۳۱	تغییر شاخص
۱۲,۱۶۳,۶۶۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۰,۳۸۲,۳۱۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۶۴,۲۱۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۴,۸۴۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
غصینو		فارس	
مارون		وغدیر	
شراز		رمینا	
وهور		فملی	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
ذوب		فولاد	
شگویا		فخوز	
هرمز		شتران	
صبا		شستا	



## کل ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



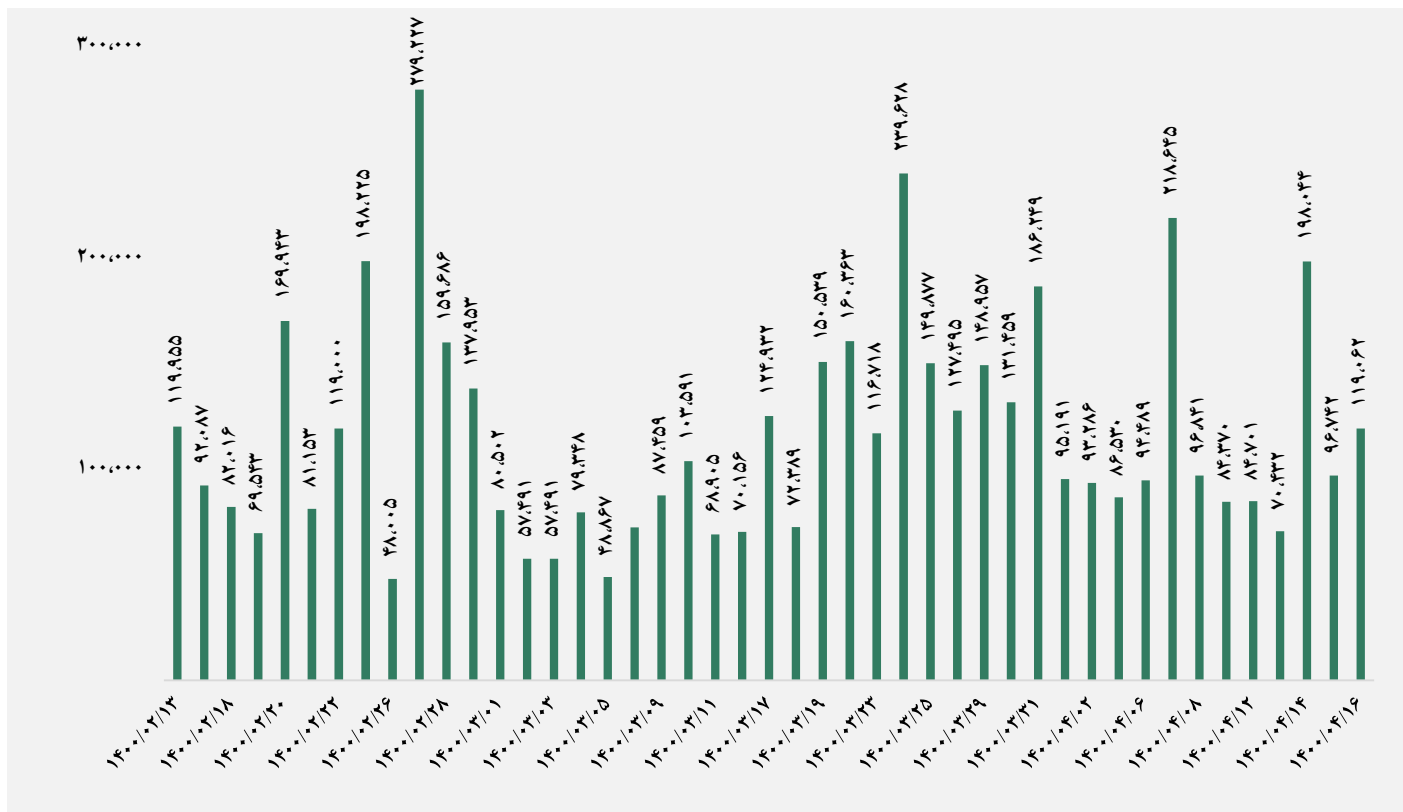
## ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



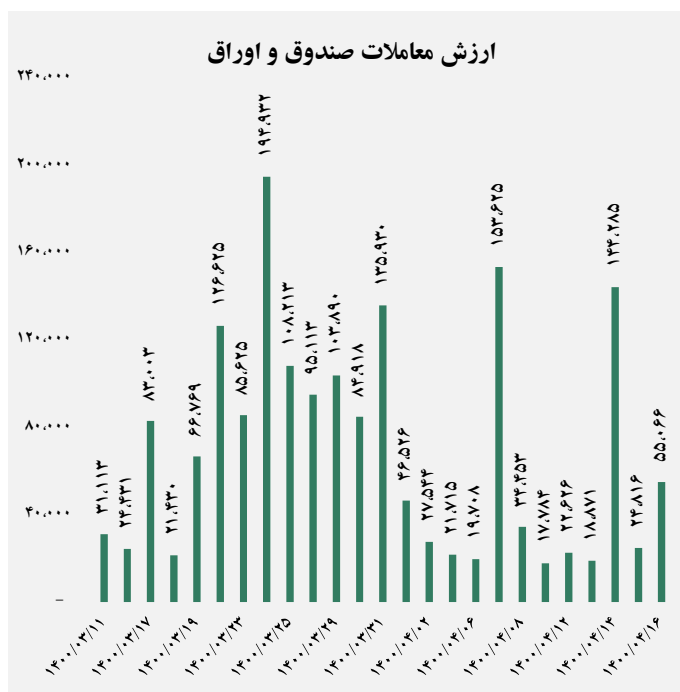
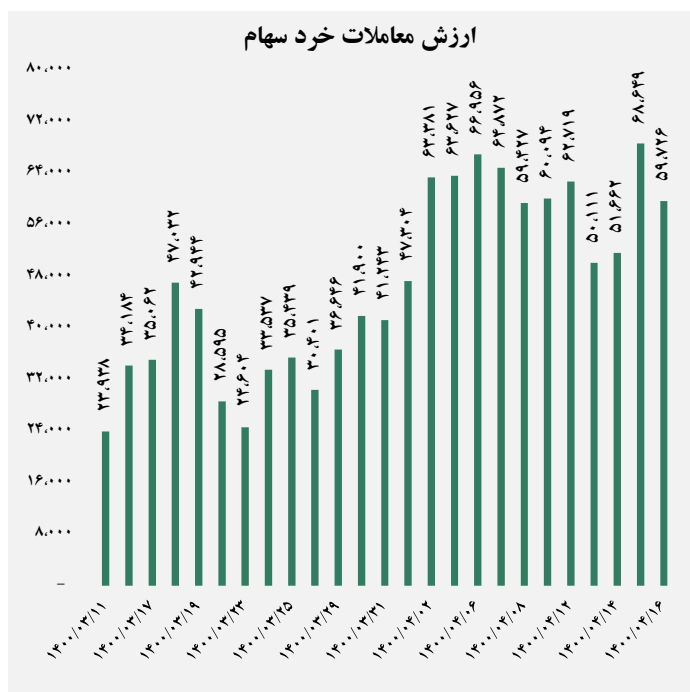
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



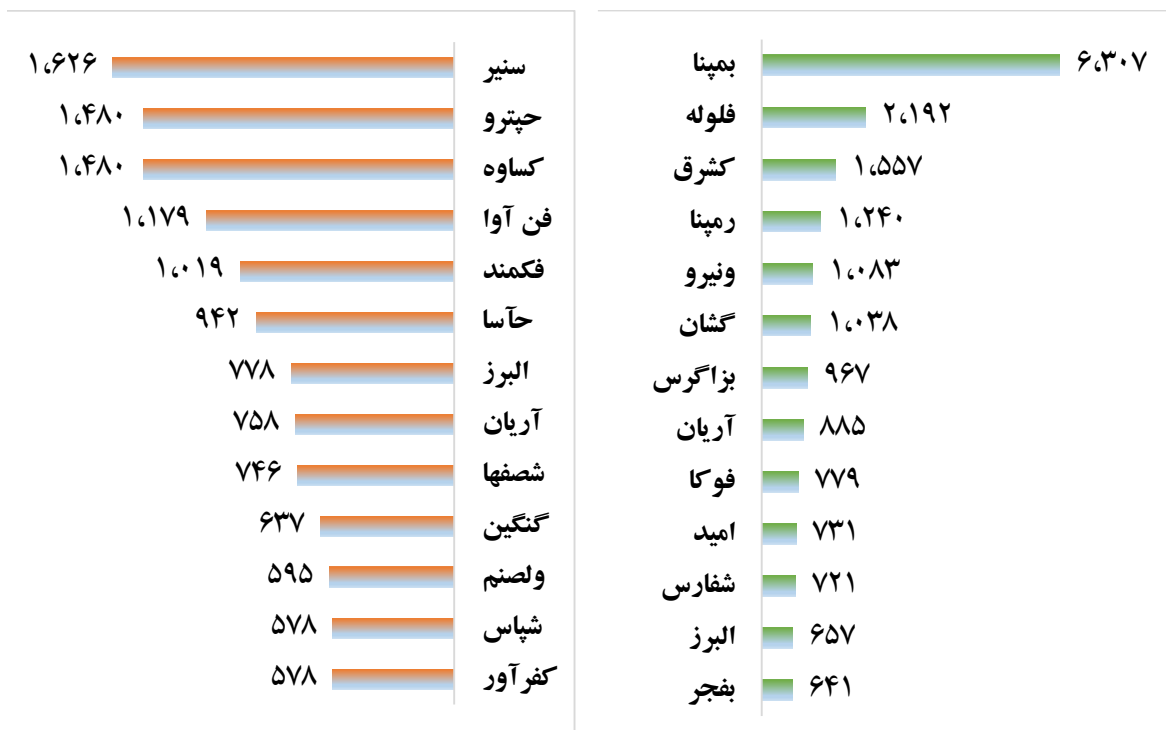
## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



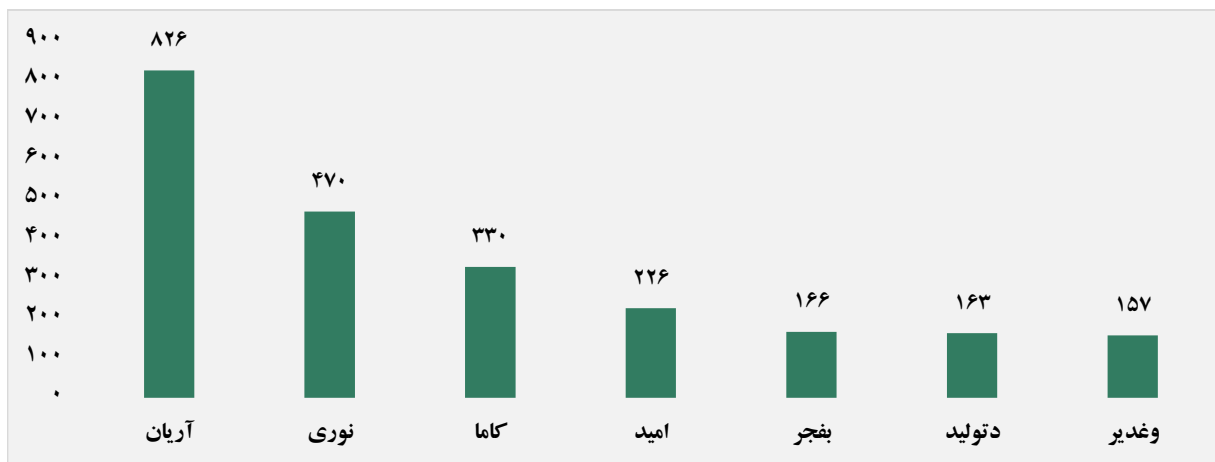
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



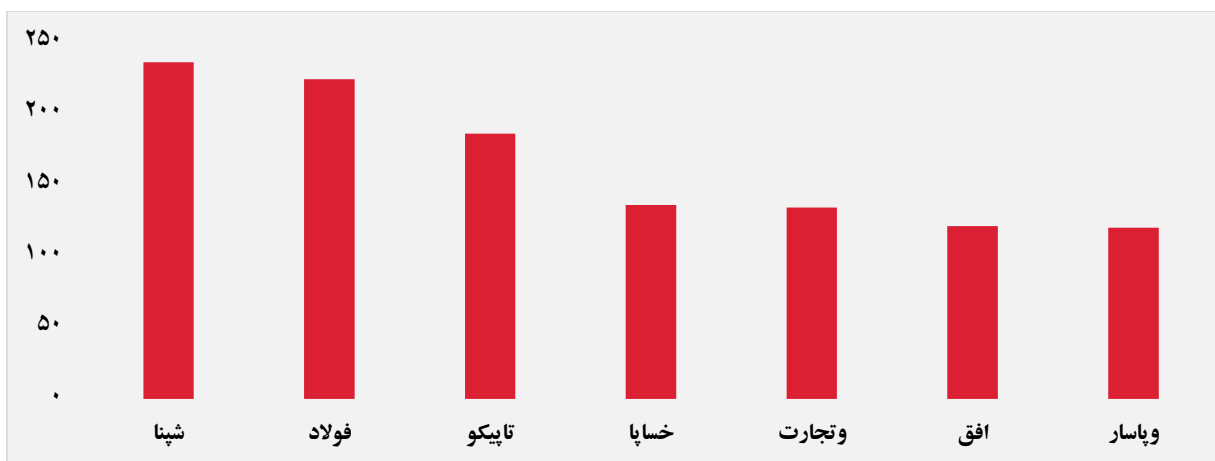
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	غپآذر	۱	معیار
۲	دلتما	۲	شسینا
۳	دتولید	۳	ولغدر
۴	گدنا	۴	فپنتا
۵	فگستر	۵	غنوش
۶	مفاخر	۶	ومشان
۷	بموتو	۷	کلر
۸	دفارا	۸	سارییل
۹	پسهند	۹	فلامی
۱۰	فافزا	۱۰	وگستر

### سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



### سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

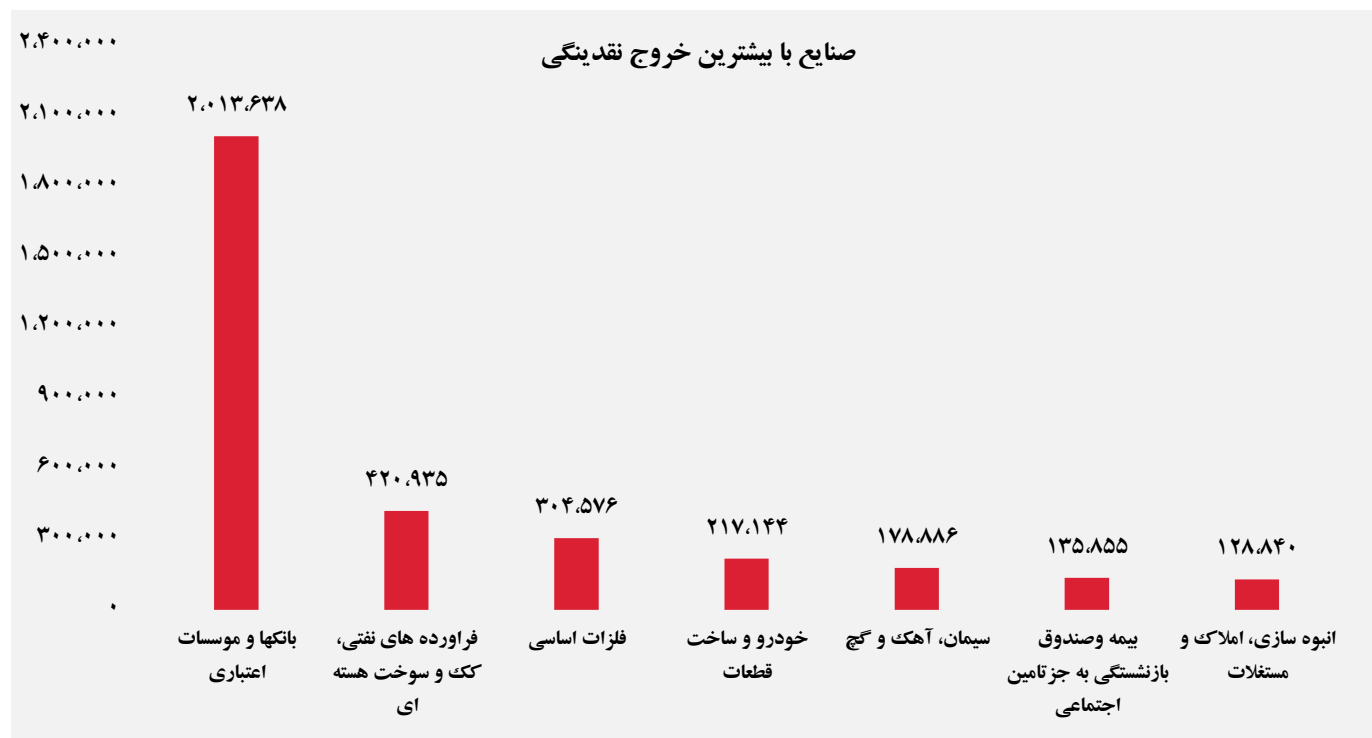
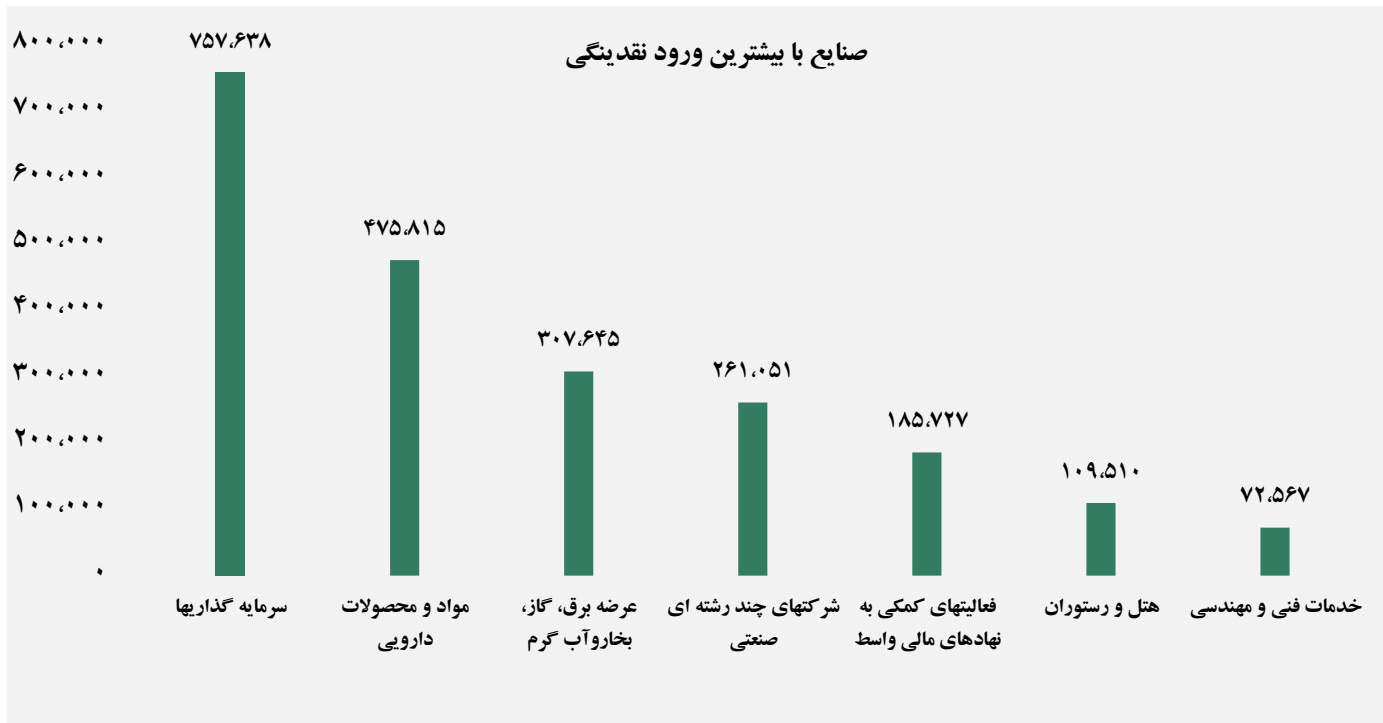


### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ثعمرا	۱۰	سمگا
۲	برکت	۱۱	غفارس
۳	ونفت	۱۲	آریان
۴	نوری	۱۳	کیمیا
۵	کیسون	۱۴	غکورش
۶	ثغرب	۱۵	کرغال
۷	فزرین	۱۶	گنکین
۸	غپاک	۱۷	غدیس
۹	کاما	۱۸	سخوز



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار