



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۱۹

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۱۹ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، شستا، فولاد، شپنا، فملی و تاپیکو با کاهش ۱۱,۳۰۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۷۰,۷۲۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۵۰ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۵۶ 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 ۲۲ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. در روزهای معاملاتی هفته گذشته تقریباً ارزش معاملات خرد بیش از ۵۰ هزار میلیارد ریال بود که در مقایسه با روزهای مشابه سال قبل فاصله بسیار دارد، اما نسبت به روزهای رکود و نزول بازار شرایط بسیار بهتری داشت. همچنین نرخ دلار نیز یکی از نشانه های قوی ادامه روند صعودی بورس در هفته های آینده است. برخلاف آن که انتظار کاهش از نرخ دلار و رسیدن آن به محدوده ۱۸ هزار تومان می رفت، این روزها نرخ دلار افزایشی بوده است و نرخ دلار در سامانه نیما به بیش از ۲۲ هزار تومان رسیده است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۸۵,۳۱۰ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۷۰۴، 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 ۲۷,۸٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۱۶	۱۴۰۰/۰۴/۱۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۴۳,۲۹۵	۸۵,۳۱۰	۹۷٪



گروه‌های مؤثر

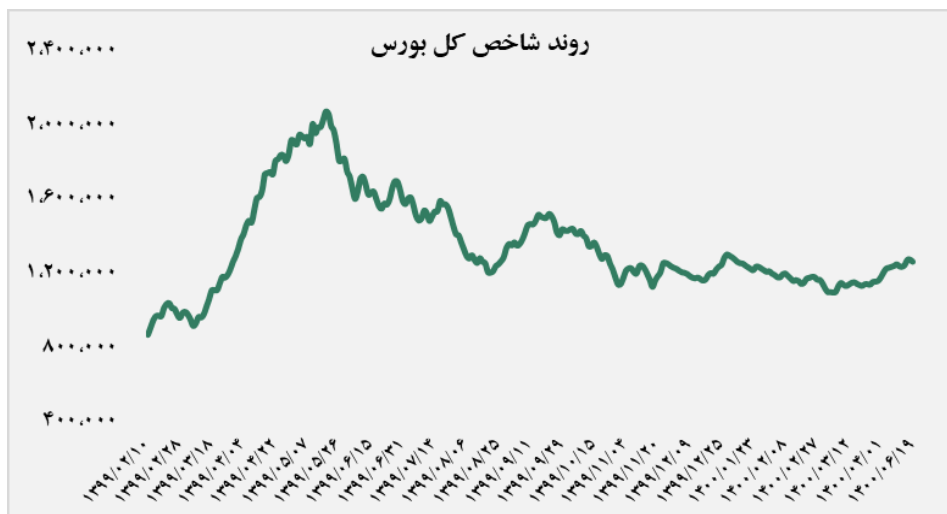
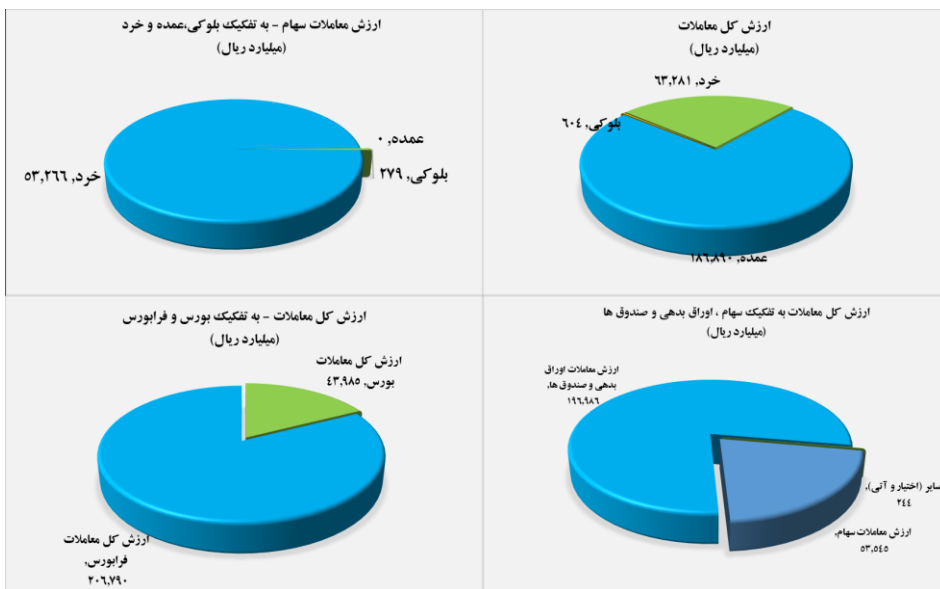
در گروه شیمیایی، شرکت کربن ایران بطور میانگین هر ماه ۳،۸۳۲ تن تولید داشت و در اردیبهشت ماه نیز توانست تولید ۳،۷۶۰ تنی داشت که در خرداد این مقدار به ۴،۱۲۵ تن رسیده است. این شرکت که هر ماه بطور میانگین ۳،۶۳۰ تن فروش داشت، در اردیبهشت فروش خود را ۴،۲۳۵ تن گزارش کرد که در خرداد فروش ۳،۷۹۰ تنی را ثبت کرده است. شکرین در سه ماهه فروشی برابر با ۲۴۶ میلیارد تومان داشت و در اردیبهشت نیز فروش ۹۷ میلیارد تومانی را گزارش کرد. در خرداد نیز شرکت توانسته فروش ۸۷ میلیارد تومانی داشته باشد. در این ماه نرخ فروش دوده با ۱ درصد کاهش نسبت به ماه گذشته به ۲۲۸،۳۶۳ ریال/کیلو رسیده است.

در گروه تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری، شرکت صنایع ماشین‌های اداری ایران در خرداد ماه فروش ۳۰۶ میلیاردی داشته که رکورد فروش تاریخی را شکسته است و فروش سه ماهه به ۷۱۳ میلیارد تومان رسیده است. مجموع فروش سال گذشته ۲،۲۲۲ میلیارد بوده است. مادیرا در این ماه ۳۸ هزار دستگاه فروش داشته که ۲۵،۳ هزار دستگاه سهم محصولات نمایشی بوده است. میانگین فروش در سال گذشته ۳۶ هزار دستگاه بوده و شرکت در سال گذشته مجموعاً ۴۳۶ هزار دستگاه فروخته است. نرخ فروش محصولات نمایشی در خرداد ماه ۸ میلیون تومان و محصولات لوازم خانگی ۸،۷ میلیون تومان به ازای هر دستگاه بوده است. شرکت این دو محصول را در ۳ ماهه به ترتیب با نرخ ۷ و ۹،۲ میلیون تومان و در سال گذشته با نرخ ۴،۷ و ۷ میلیون تومان فروخته است.

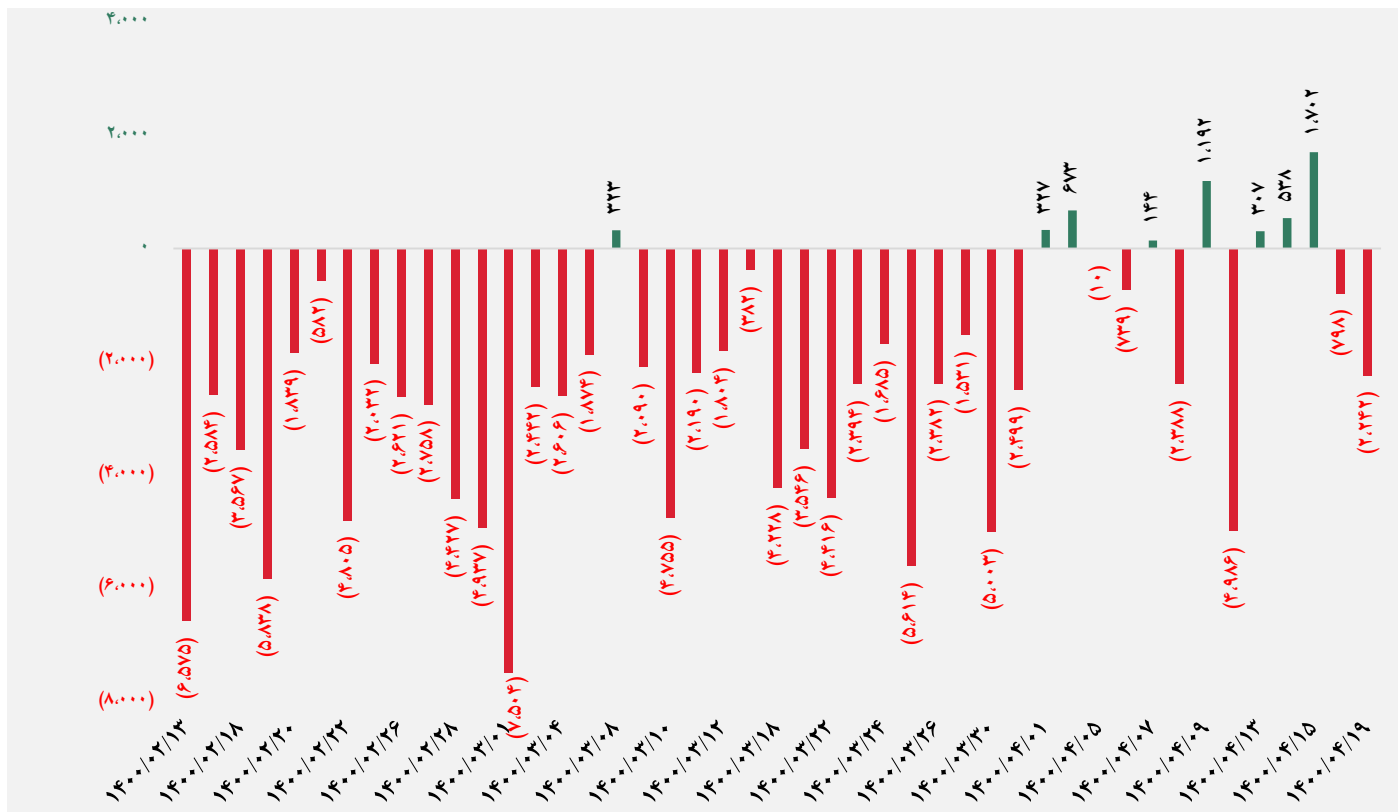
در گروه خودرو و قطعه‌سازی، شرکت لنت ترمز ایران که در آذر، دی، بهمن، اسفند، فروردین و اردیبهشت ۱۰،۷، ۱۱، ۲۹، ۳ و ۹ میلیارد تومان فروش داشت. در این ماه فروش ۱۱ میلیارد تومانی را داشته است. مقدار فروش کل که در آذر، دی و بهمن برابر با ۲۶۲، ۱۶۴ و ۲۵۸ تن بود و در اسفند با ثبت یک رکورد در فروش ۴۷۲ تن گزارش شده بود. در فروردین ۶۴ تن به ثبت رسید و در اردیبهشت ماه ۱۶۷ تن گزارش شد. در ماه خرداد مقدار فروش ۲۳۰ تنی را گزارش کرده است. این شرکت در سال ۹۹ و ۹۸ به طور متوسط هر ماه ۲۱۸ و ۱۸۹ تن تولید داشت. در فروردین ۱۴۷ تن تولید کرد. در اردیبهشت ۲۹۰ تن تولید داشت. در خرداد نیز همچون اردیبهشت تولید خوب ۲۹۹ تنی را ثبت کرده است. نرخ فروش هم در خرداد ماه ۴۵۸،۰۳۹ ریال گزارش شده است. نرخ فروش ماه گذشته ۵۲۷،۳۳۵ ریال بر کیلو بود.

تصویر کلی بازار

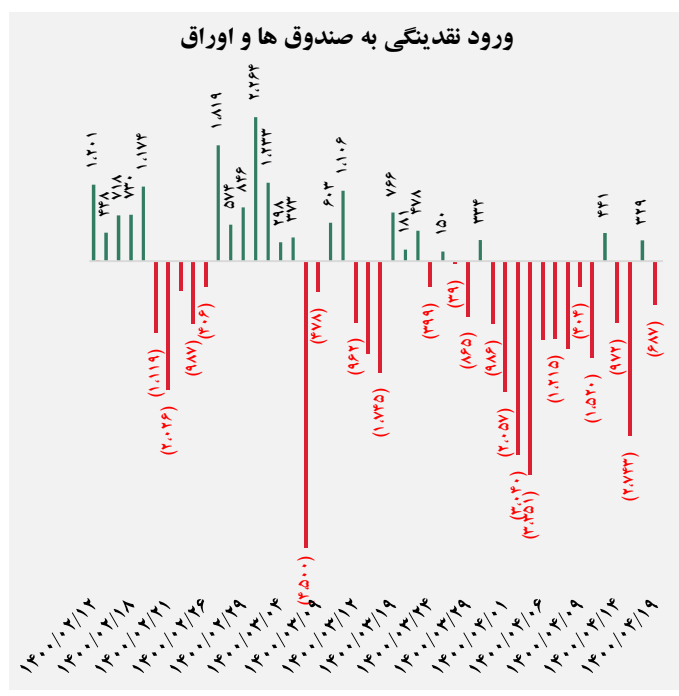
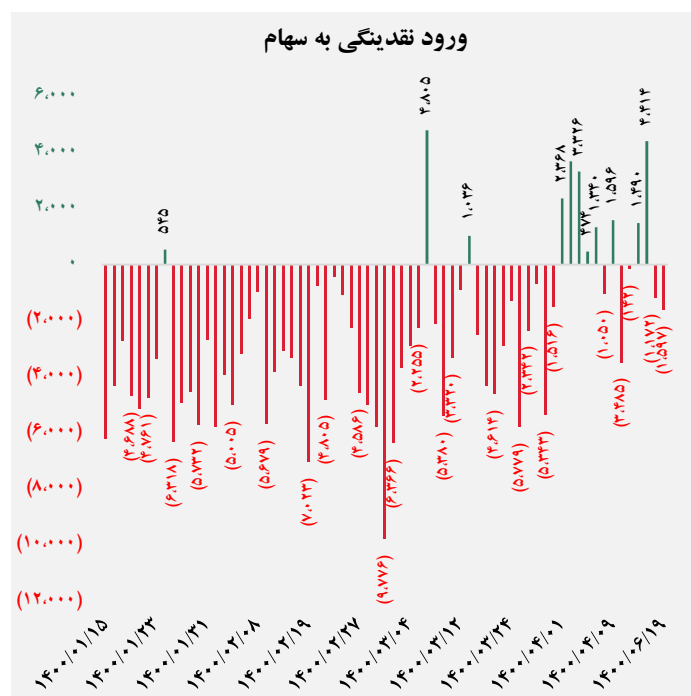
فرا بورس		بورس	
۱۸,۴۲۶	شاخص کل	۱,۲۷۰,۷۲۹	شاخص کل
۵۸	تغییر شاخص	۱۱,۳۰۶	تغییر شاخص
۱۲,۱۴۵,۰۳۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۴۹,۵۲۹,۳۰۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۰۶,۷۹۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۳,۹۸۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
مارون		رمپنا	
دماوند		پارس	
وهور		مبین	
غصینو		اخابر	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
زاگرس		فارس	
آریا		شستا	
هرمز		فولاد	
شگویا		شپنا	



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

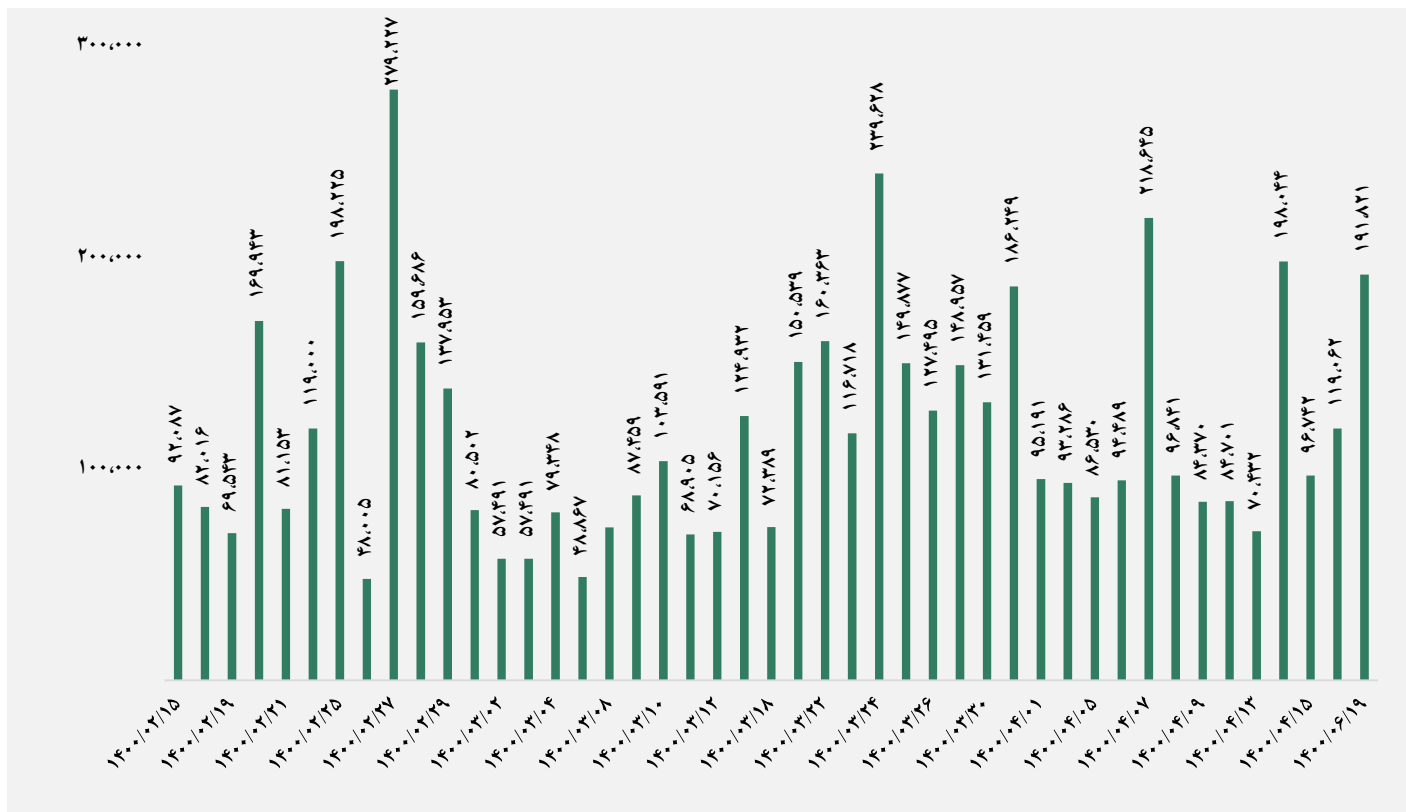


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

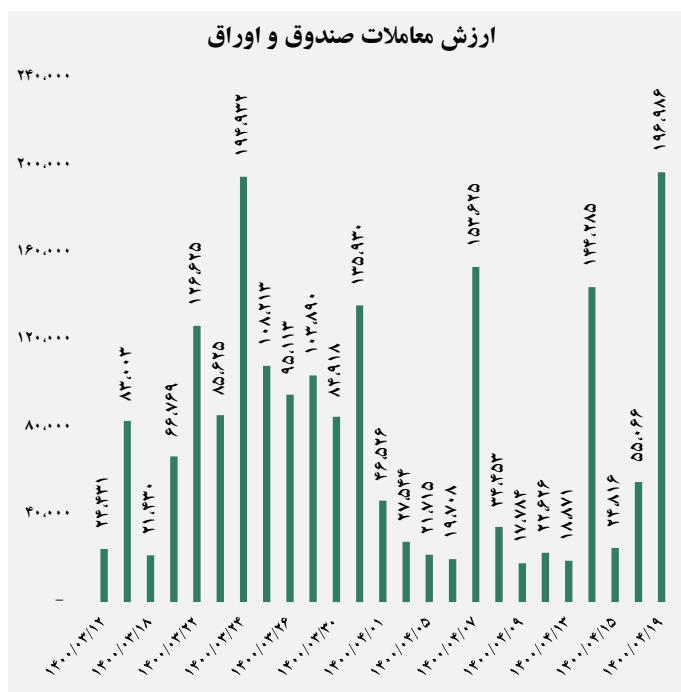
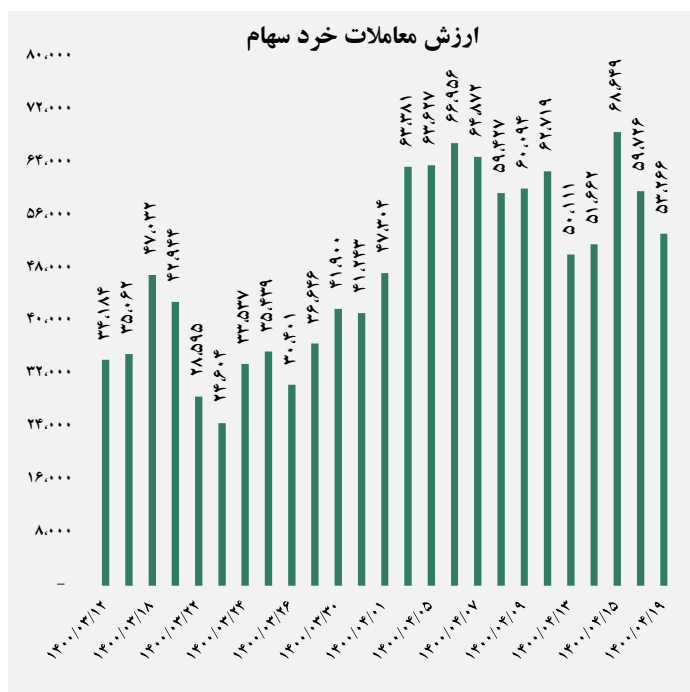


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

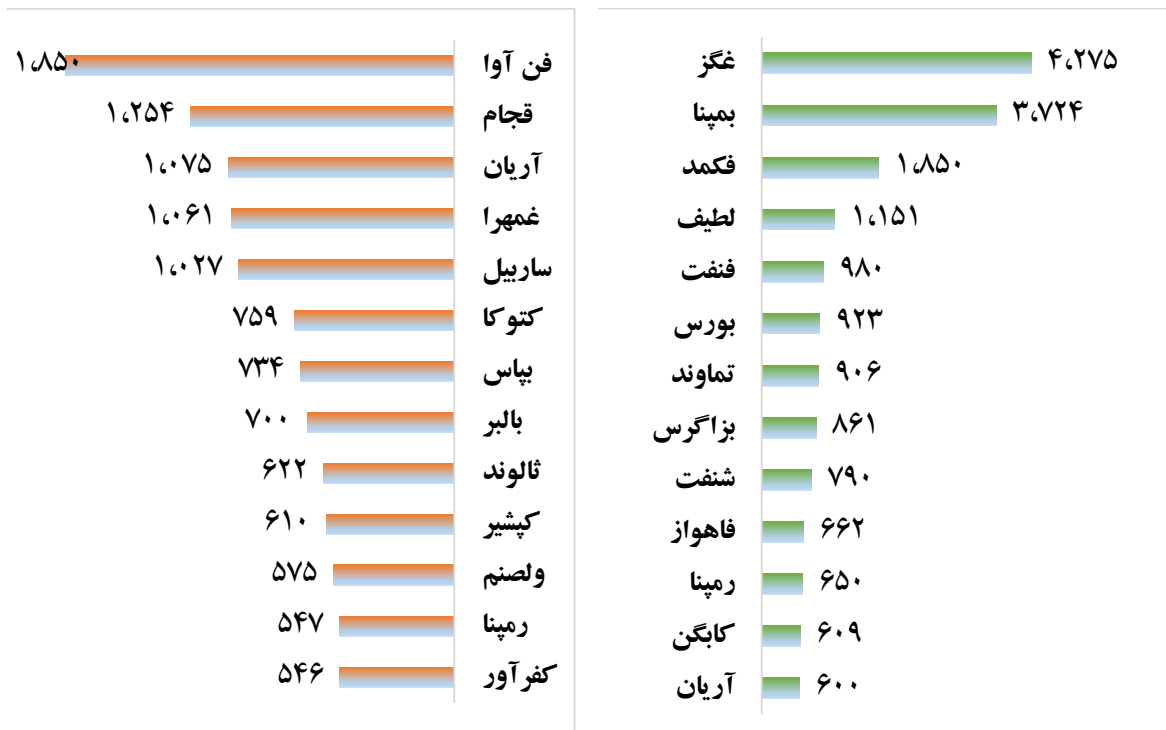


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





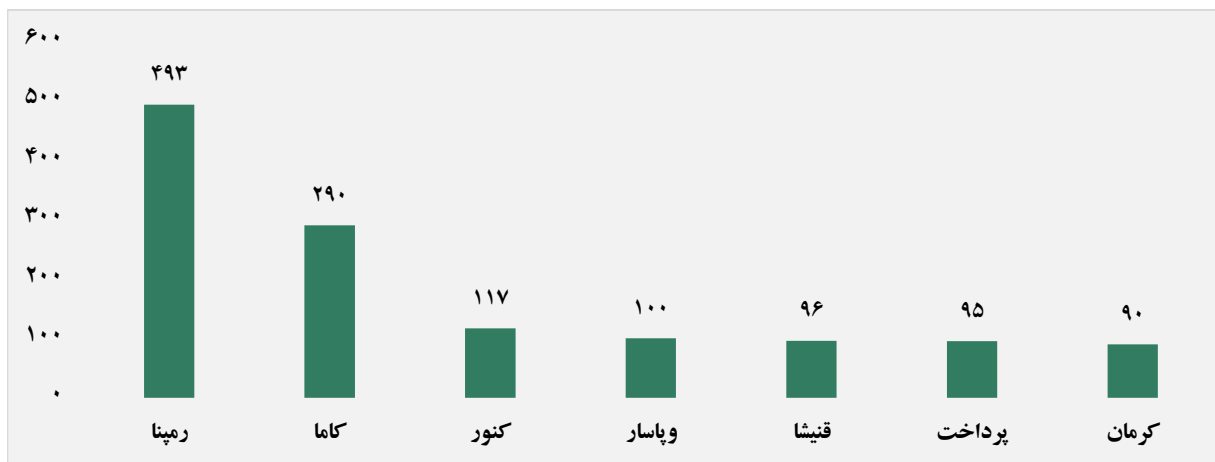
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



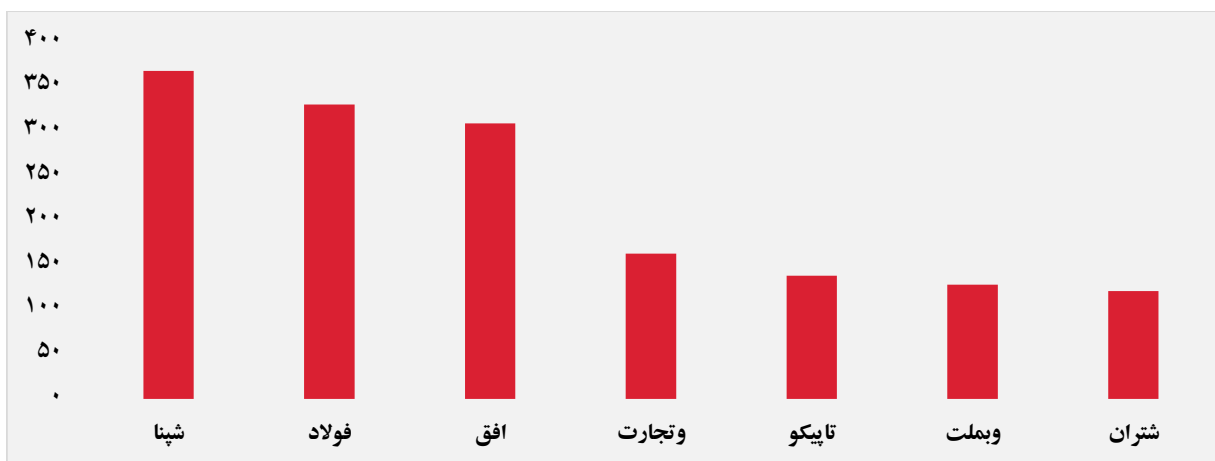
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	قیشا	۱	زکشت
۲	پرداخت	۲	کیسون
۳	مارون	۳	شپترو
۴	ولکار	۴	وسرضوی
۵	قشرین	۵	وسگلستا
۶	لطیف	۶	ثپردیس
۷	گوهران	۷	آریان
۸	سخزر	۸	ولصنم
۹	بوعلی	۹	فن آوا
۱۰	شنت	۱۰	امید

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



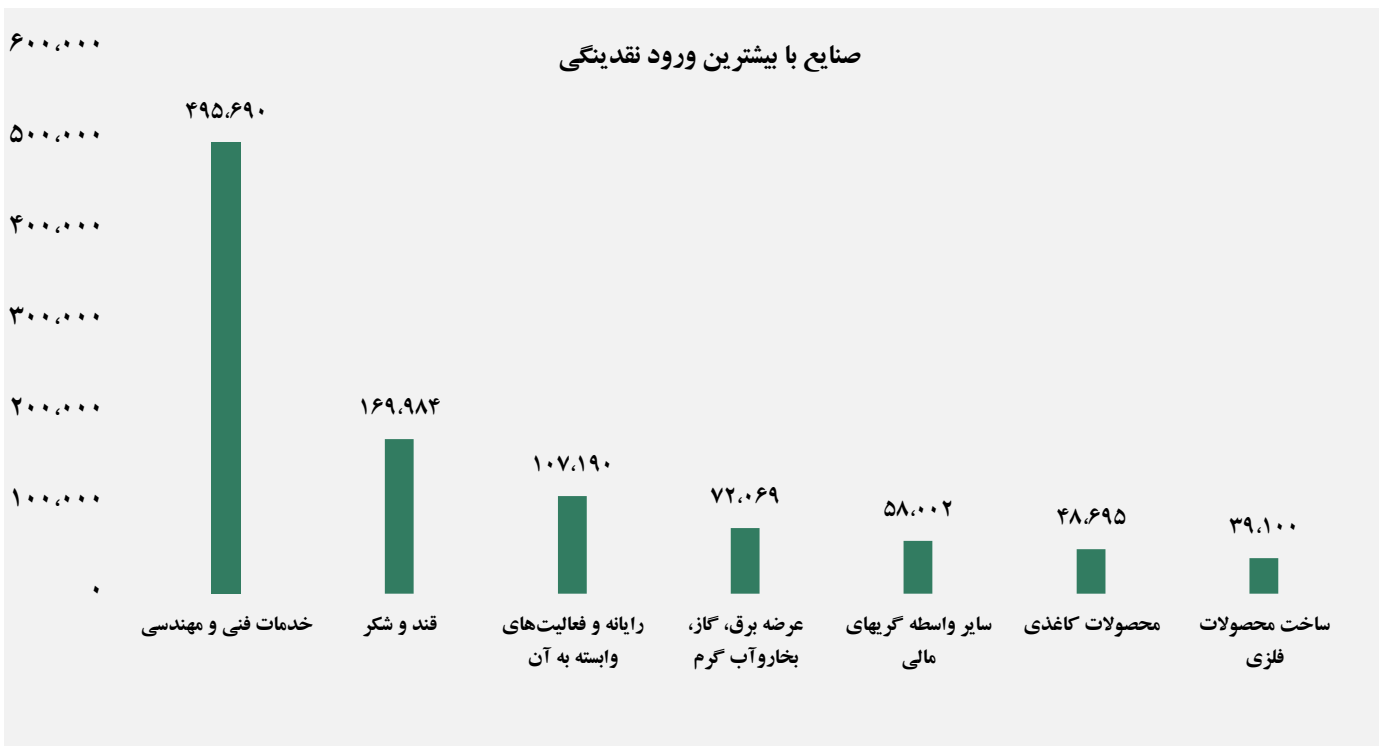
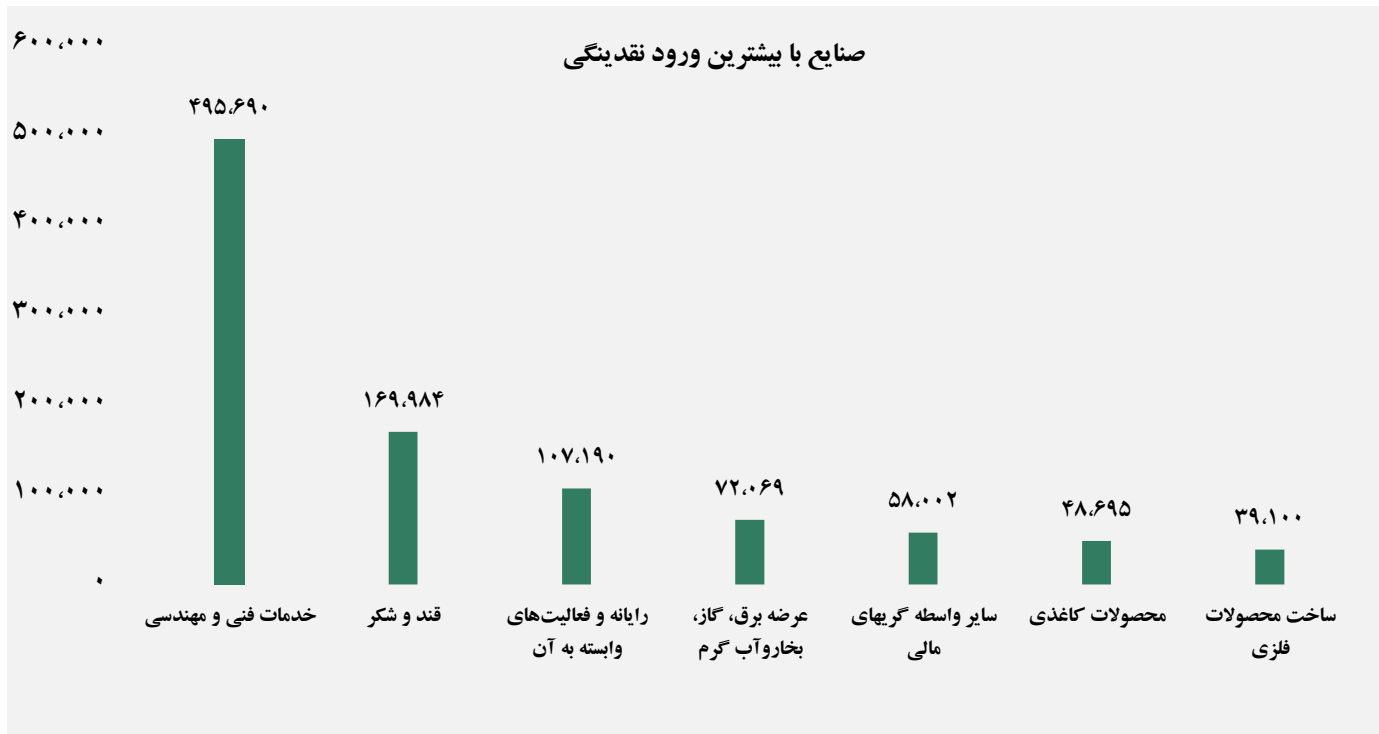
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ولکار	۱۰	کاما
۲	گشان	۱۱	بوعلی
۳	برکت	۱۲	کنور
۴	افق	۱۳	غپاک
۵	فزرین	۱۴	حخزر
۶	غفارس	۱۵	سصوفی
۷	ثعمرا	۱۶	پیوند
۸	سمگا	۱۷	سفارس
۹	ثغرب	۱۸	غکورث

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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر