



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۲۰

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۰ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، فملی، کگل، شپدیس، شپنا و جم با افزایش ۵,۱۱۹ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۲۸۵,۲۸۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۸۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۶۴ 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 ۳۵ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. شاخص کل خط روند نزولی خودش را شکسته است و از زمان ریزش شاخص کل اگر یک اندیکاتور ایچیمو کو روی نمودار تحلیل تکنیکال شاخص کل فعال کنیم، ملاحظه می‌شود که هیچ گاه شاخص کل در این مدت نتوانسته بود ابر کومو را به سمت بالا بشکند. اما این بار هم خط روند نزولی شکسته شد و همچنین ابر کومو به سمت بالا شکسته شده است و خطوط ابر کومو نیز از خود ابر خارج شده که این یک معیار بسیار خوب است. اولین ناحیه مقاومتی برای شاخص کل حوالی ۱,۳۰۰,۰۰۰ الی ۱,۳۲۰,۰۰۰ واحد می‌باشد که با عبور از این محدوده، شاخص کل می‌تواند به سمت مقاومت ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحدی نیز حرکت کند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۰۵,۳۵۸ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۲۱۴، 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 ۳۱,۶٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۱۹	۱۴۰۰/۰۴/۲۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۸۵,۳۱۰	۱۰۵,۳۵۸	۲۴٪



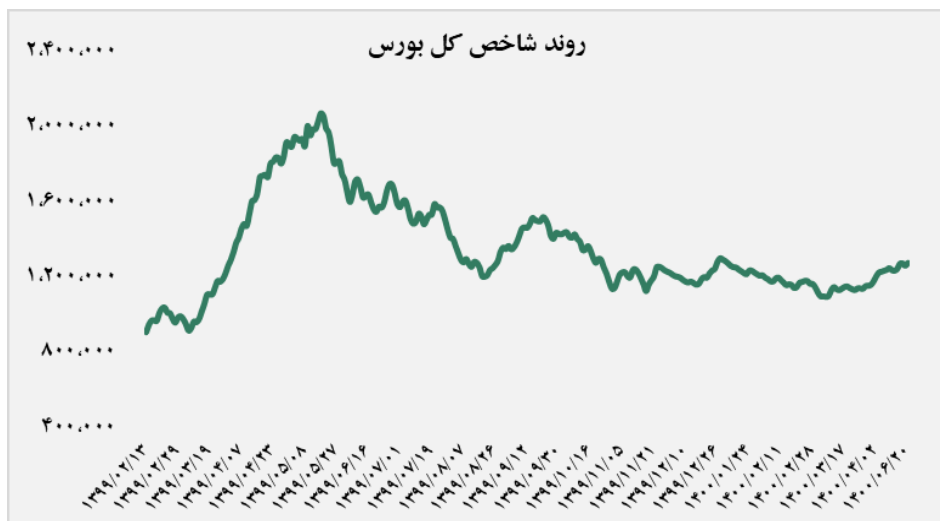
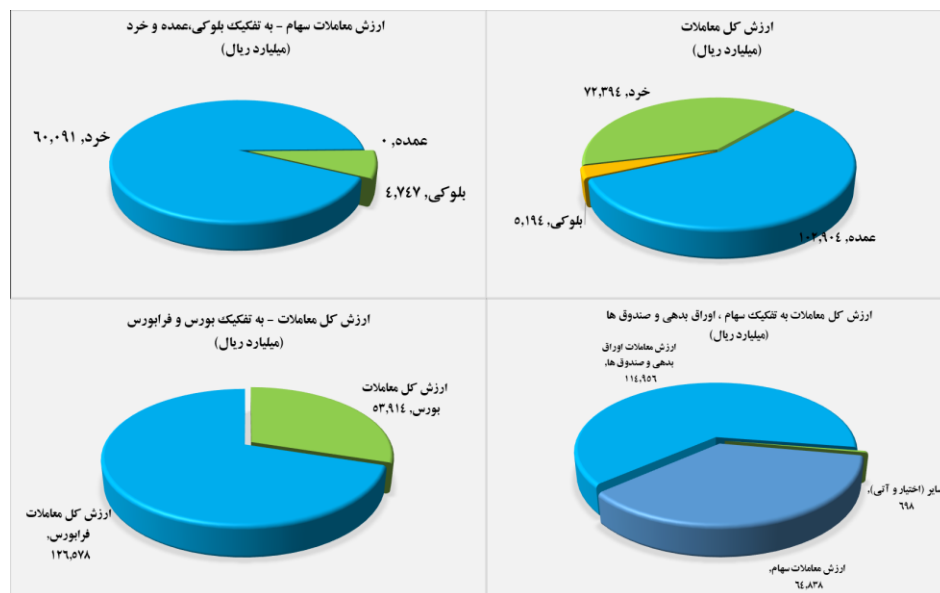
## گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، مقدار تولید متانول در شرکت پتروشیمی فن آوران به طور متوسط در سال گذشته ۸۰ هزار تن بوده و در ماه خرداد ۸۵ هزار تن گزارش شده است. مقدار تولید اسید استیک شرکت میانگین ماهانه ۱۲,۳ هزار تنی داشت که در خرداد رقم ۱۱,۷ هزار تن به ثبت رسید. این شرکت در سال ۹۹ به طور متوسط ۷۵ هزار تن متانول فروخته است. مقدار فروش متانول در خرداد در حدود میانگین و ۷۴,۶ هزار تن گزارش شد. در بخش اسید استیک نیز میانگین ماهانه فروش ۱۲,۹ هزار تن بوده که در خرداد به ۱۳,۴ هزار تن رسید. مبلغ فروش شرکت در خرداد ۷۷۸ میلیارد تومان بوده که این رقم پس از فروش‌های بالاتر از ۸۰۰ میلیارد در ماه‌های بهمن و اسفند سال گذشته، بهترین درآمد ماهانه شرکت را به ثمر رسانده است. رقم فروش فروردین ۴۸۰ میلیارد و اردیبهشت ۵۸۴ میلیارد تومان بوده است. در این ماه نرخ متانول صادراتی ۶,۶۶۳ تومان برای هر کیلو و نرخ اسید استیک داخلی ۲۲,۲۸۰ تومان (متوسط سال قبل ۹,۳۰۰) برای هر کیلو ثبت شده است. نرخ متانول سی اف آر چین نیز در محدوده ۳۰۴ دلار در هر تن در هفته گذشته معامله شده است.

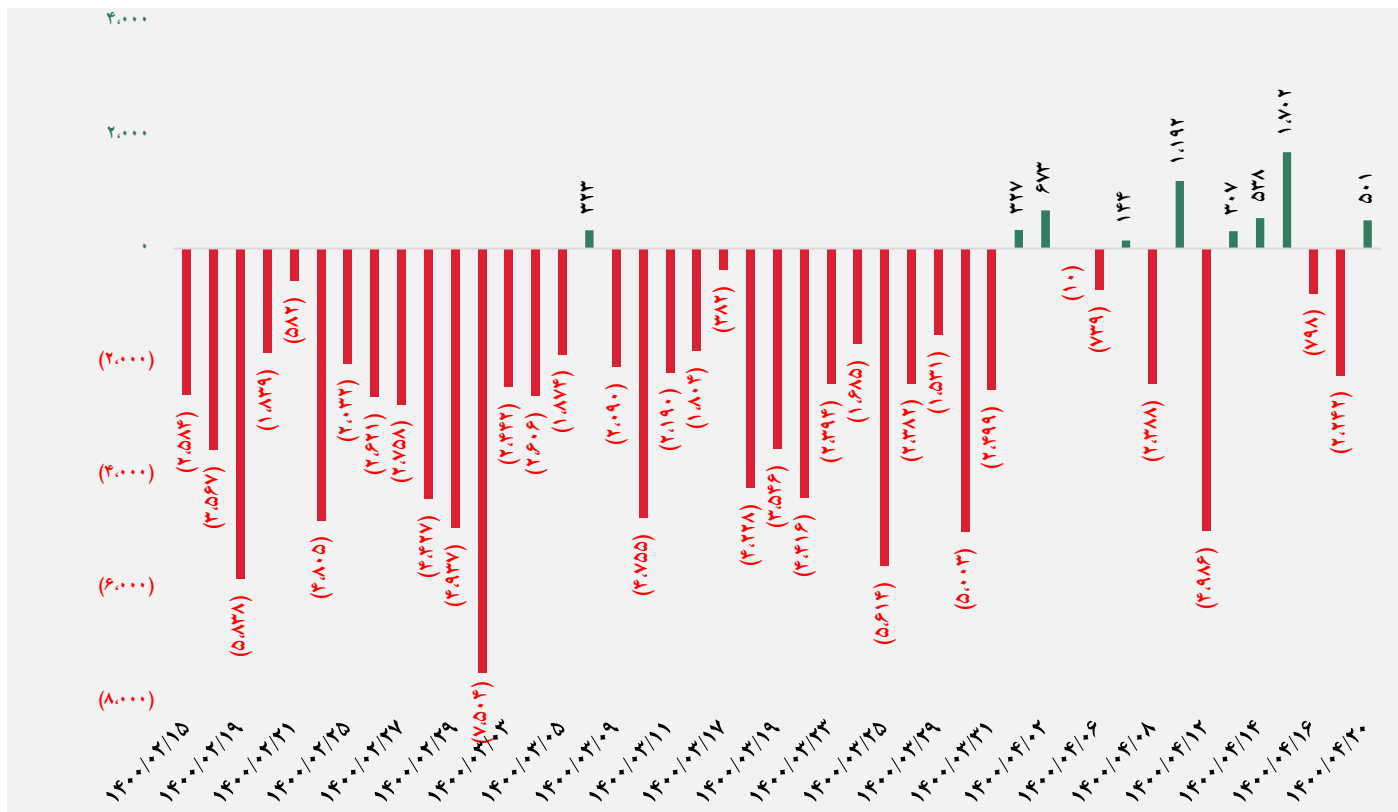
در گروه ساخت محصولات فلزی، شرکت صنعتی آما در خرداد ماه فروش ۶۵ میلیارد تومانی داشته است. این شرکت در آذر، دی، بهمن، اسفند، فروردین و اردیبهشت ۶۱، ۶۸، ۷۴، ۸۷، ۴۰ و ۶۳ میلیارد تومان فروش داشت. مقدار فروش کل که در فروردین و اردیبهشت ۱,۳۲۲ و ۱,۷۲۹ تن گزارش شد بود. در خرداد ماه مقدار فروش ۱,۸۸۸ تن به ثبت رسیده است. شرکت این ماه تولید ۱,۹۷۴ تنی را داشته است. میانگین تولید ماهانه دوازده ماه گذشته ۱,۹۱۹ تن می‌باشد. نرخ فروش الکتروود جوشکاری شرکت هم در این ماه ۳۷۶,۲۶۸ بوده که در ماه قبل ۳۸۵,۵۵۵ ریال/کیلو بود.

## تصویر کلی بازار

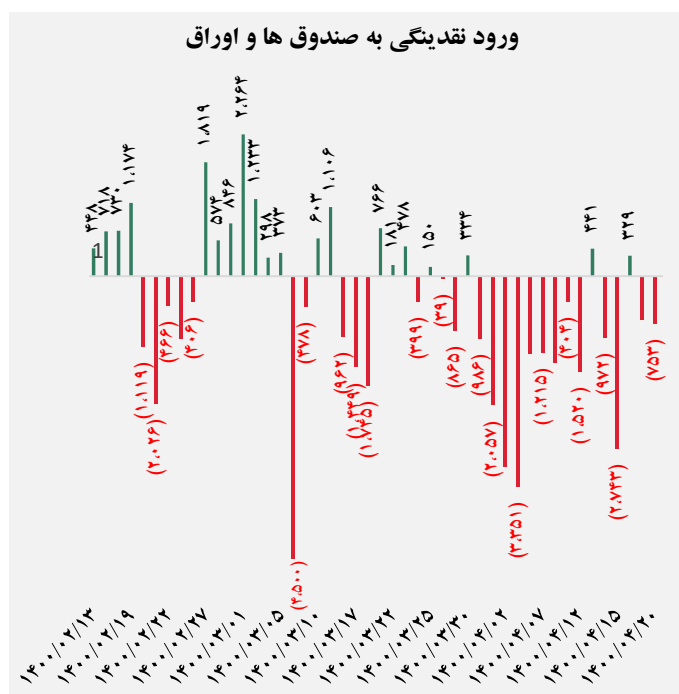
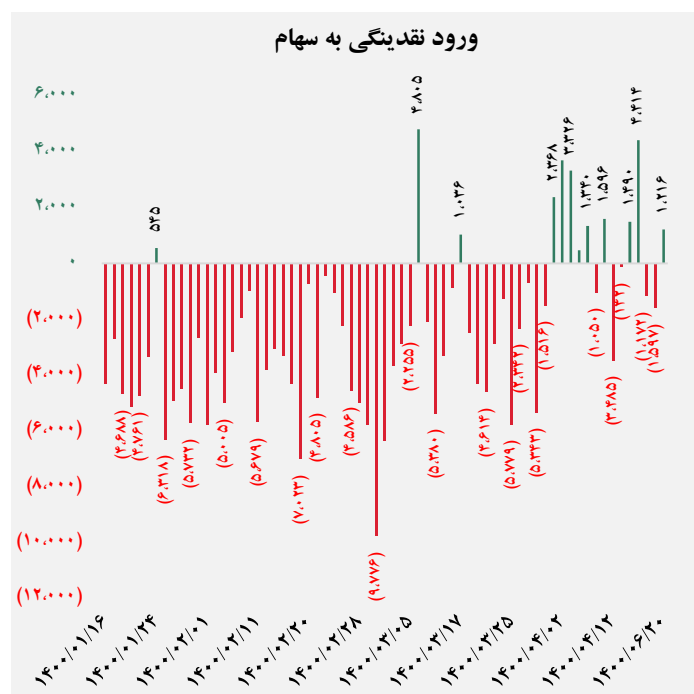
فرا بورس		بورس	
۱۸,۶۱۸	شاخص کل	۱,۲۸۵,۲۸۲	شاخص کل
۱۹۱	تغییر شاخص	۱۴,۵۳۸	تغییر شاخص
۱۰,۳۳۰,۹۲۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۰,۵۵۲,۴۴۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۳۶,۵۷۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۳,۹۱۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر مثبت در شاخص</b>	
مارون		فولاد	
کگهر		فملی	
ذوب		کگل	
شگویا		شپدیس	
<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تأثیر منفی در شاخص</b>	
زاگرس		شستا	
غصینو		وسهدا	
دماوند		وسر ضوی	
بگیلا		کچاد	



## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

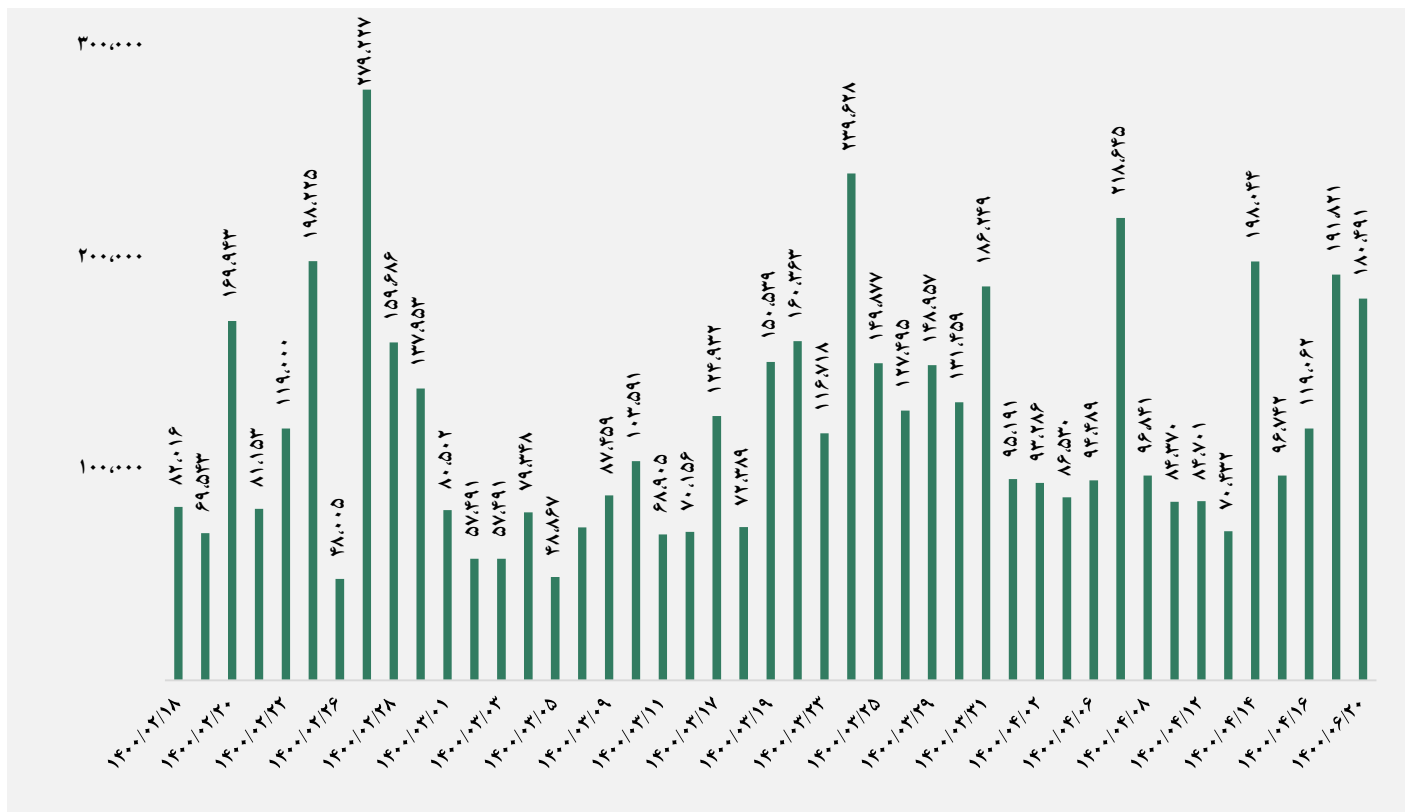


## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

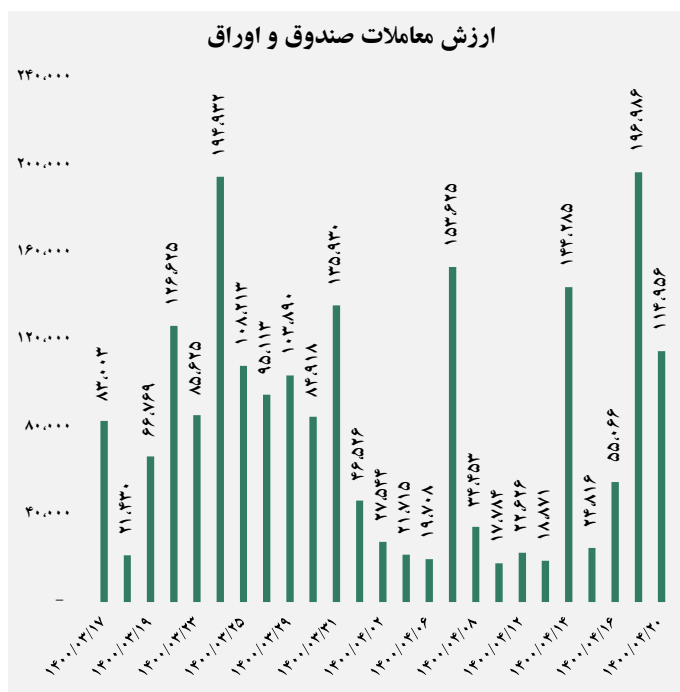
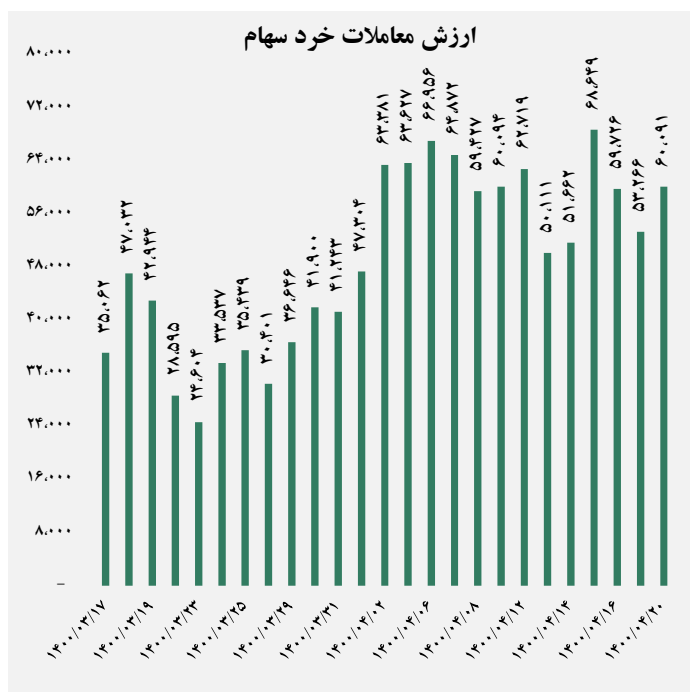


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

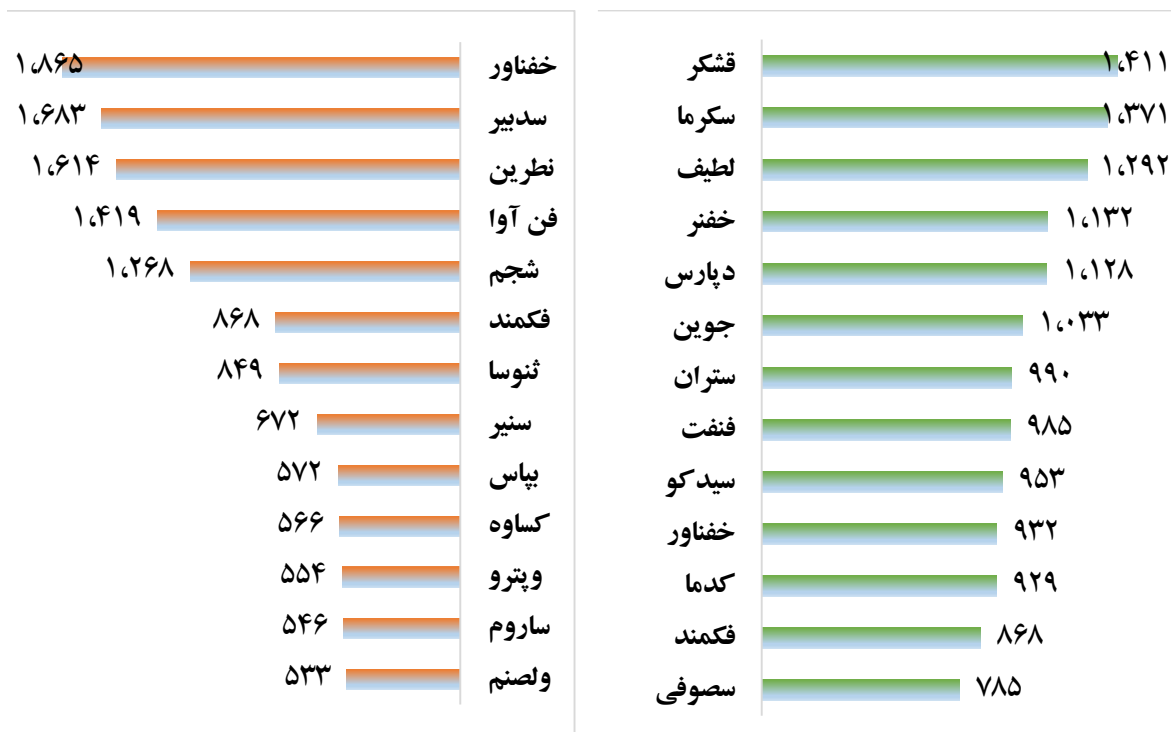


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





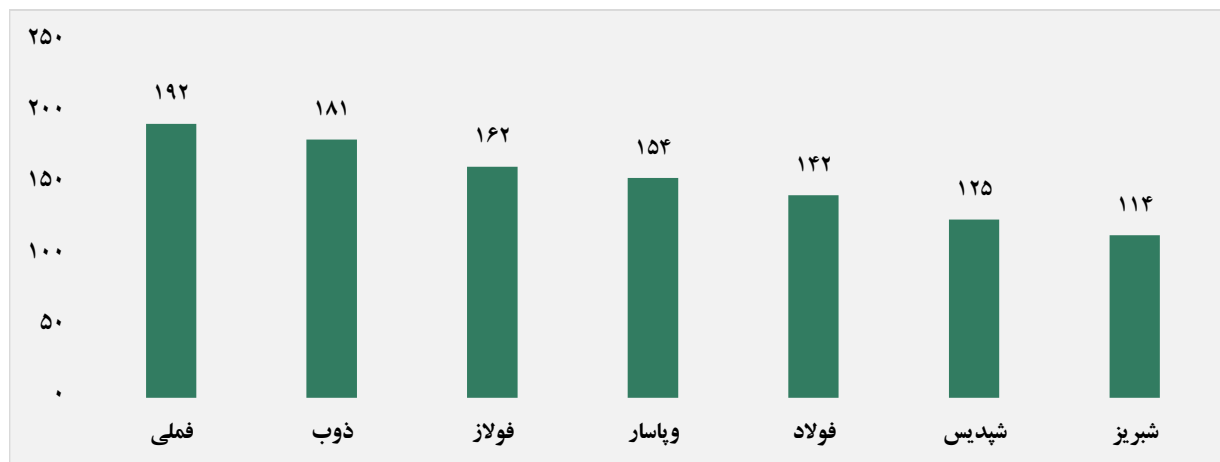
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



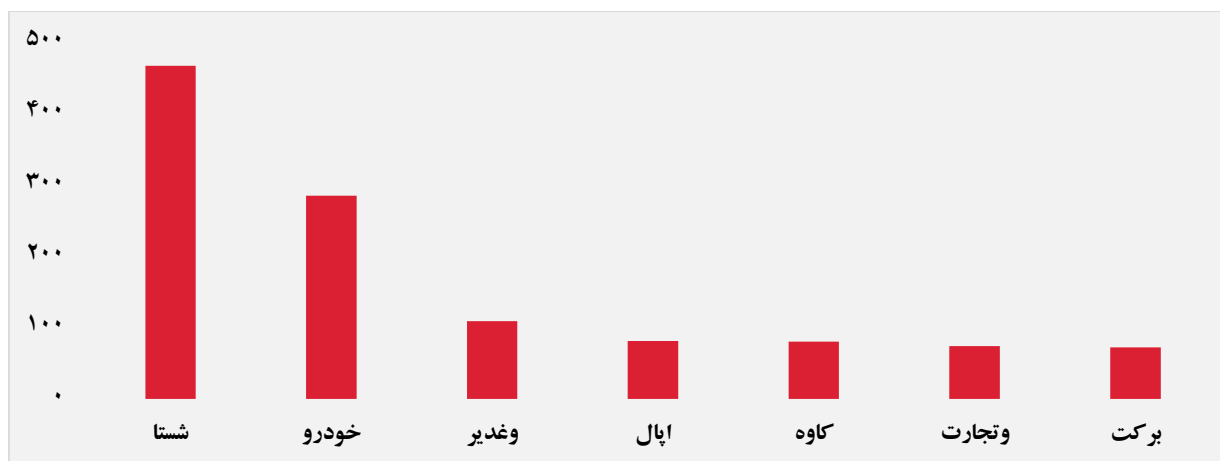
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	زنگان	۱	سفار
۲	کلر	۲	معیار
۳	قنیشا	۳	غنوش
۴	پیزد	۴	وملی
۵	قزوین	۵	غالبر
۶	سقاین	۶	غاذر
۷	قشیر	۷	لخزر
۸	سمازن	۸	سنیر
۹	سرود	۹	شرنگی
۱۰	سباقر	۱۰	پدرخش

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



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



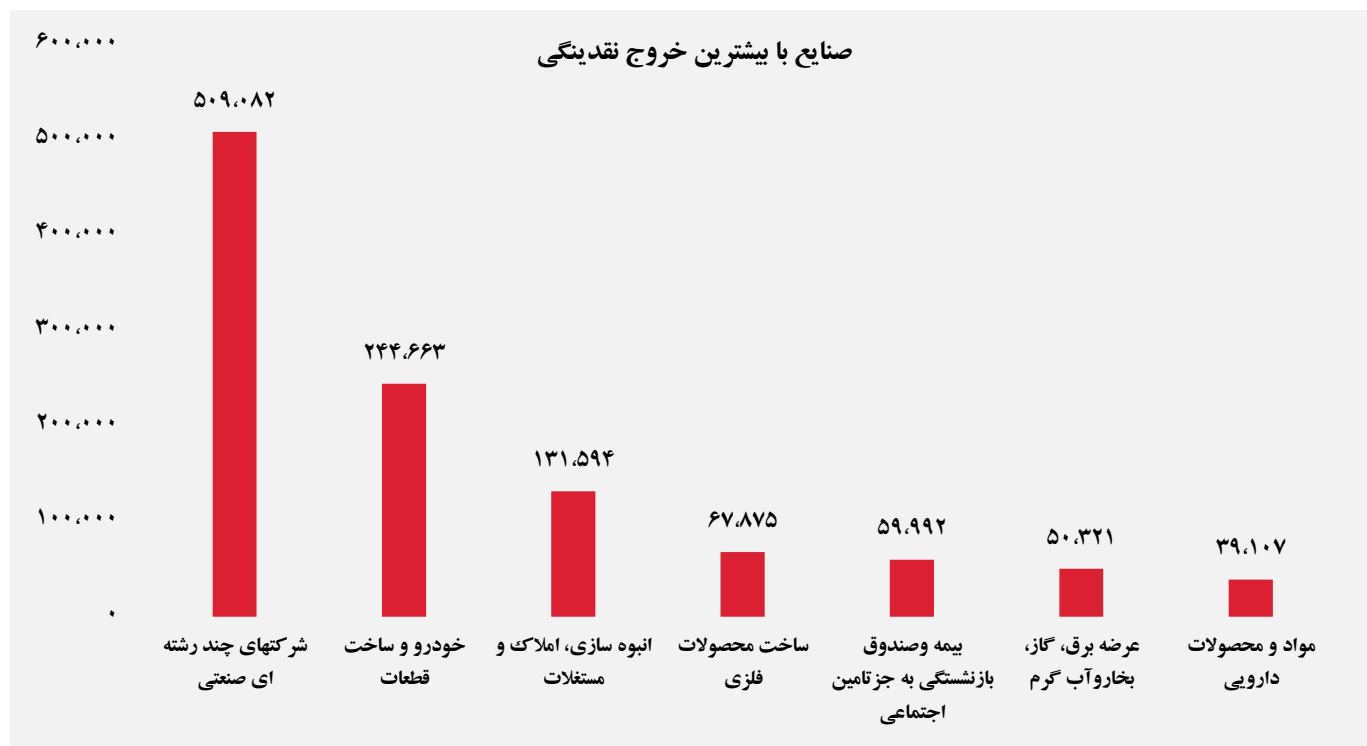
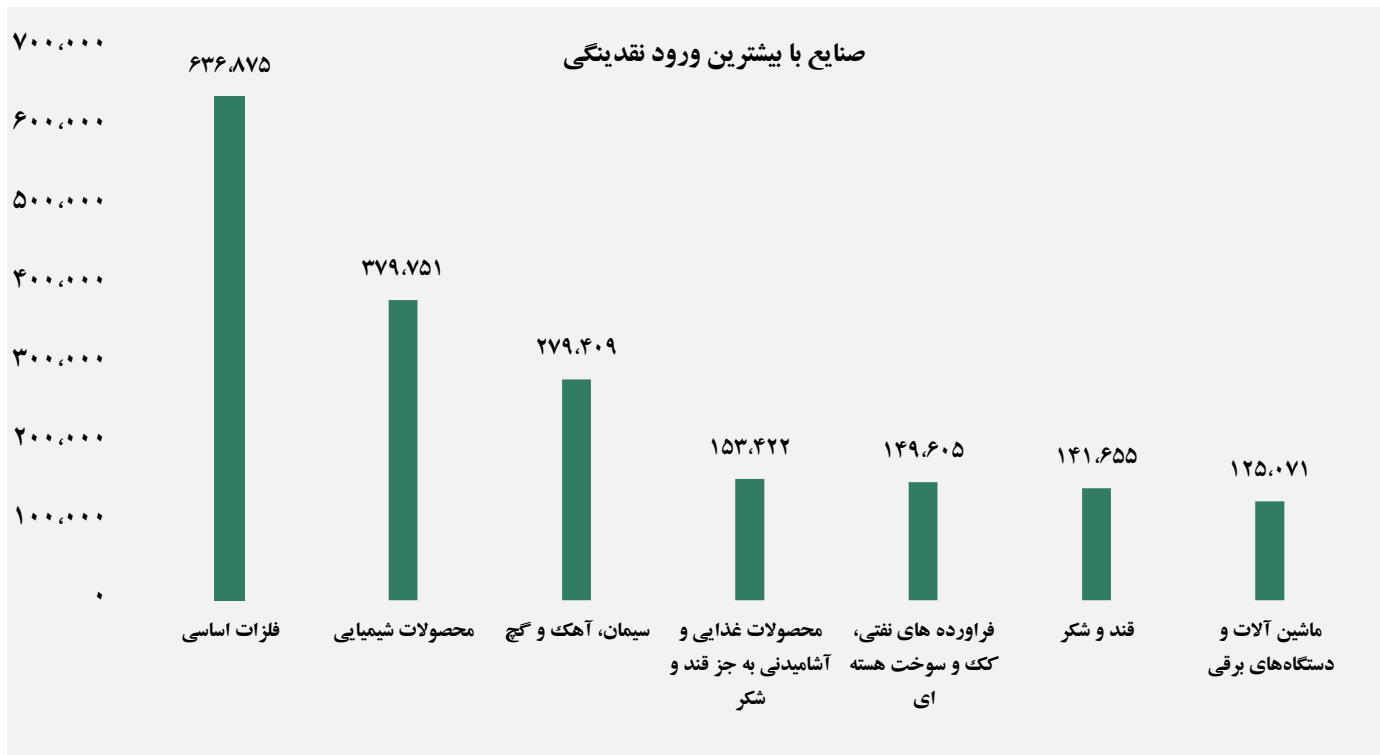
### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ولصنم	۱۰	ثعمرا
۲	برکت	۱۱	سمازن
۳	ولکار	۱۲	سخوز
۴	بورس	۱۳	کیمیا
۵	ثغرب	۱۴	غفارس
۶	فزرین	۱۵	سهرمز
۷	گشان	۱۶	وتوصا
۸	وپترو	۱۷	وپست
۹	زاگرس	۱۸	کسرا





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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار