



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۲۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۲۱ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، کگل، پارسان، فارس، وغدیر و سپیدیس با افزایش ۱۹,۰۷۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۰۴,۳۳۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۳۳۵ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۶۸ 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 ۲۰ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

شاخص کل بورس بعد از سه ماه، از محدوده ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحد عبور کرده است و با تثبیت بالای این عدد، تقاضای جدیدی را در بازار سهام شاهد خواهیم بود. نمودار روزانه بسیاری از نمادها در حال خروج از روند نزولی ۱۰ ماهه خود هستند و این موضوع می‌تواند نویدی برای ادامه رشد بازار سهام در روزها و ماه‌های آینده باشد. اگرچه برای خرید مجدد سهام با توجه به رشد حدود ۱۵ درصدی در بسیاری از نمادها، باید تمام جوانب احتیاط را بیشتر رعایت کرد تا به راحتی حد ضرر فعال نشود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۵۴,۶۹۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش 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 ۸۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ با ۲۴.۸٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۲۰	۱۴۰۰/۰۴/۲۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۰۵,۳۵۸	۲۵۴,۶۹۱	۱۴۲٪



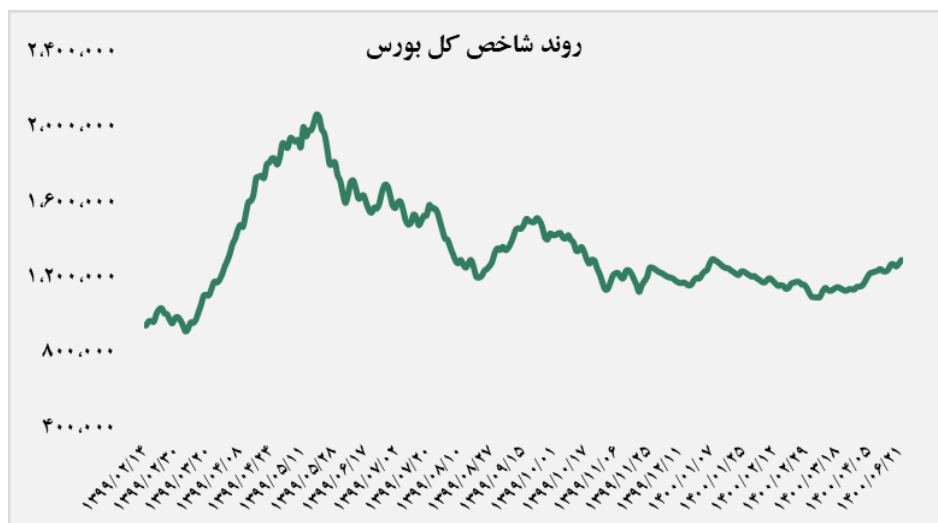
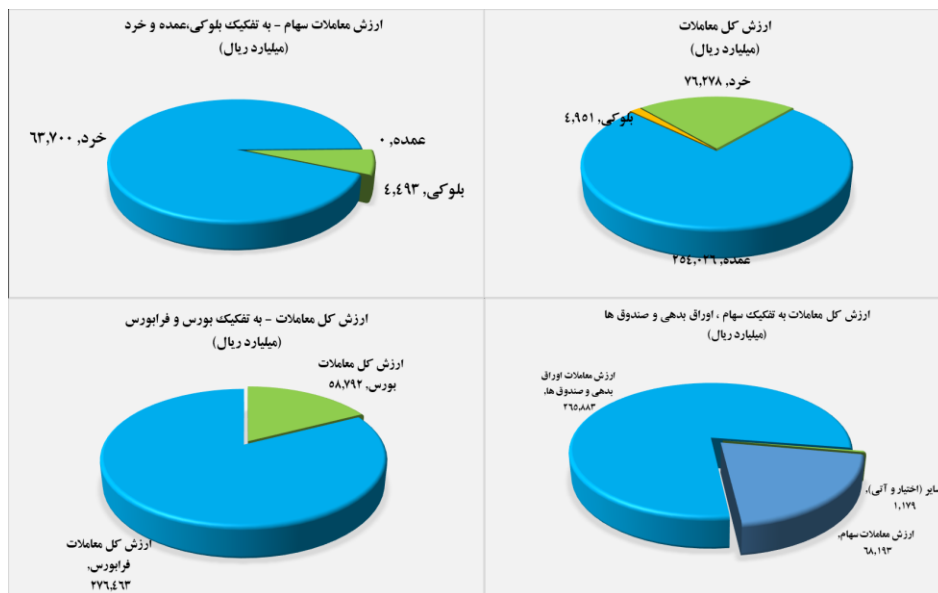
گروه‌های مؤثر

در گروه خودرو، شرکت ایران خودرو در خرداد توانست فروش ۴،۷۷۵ میلیارد تومانی را به ثبت برساند که این رقم بعد از اسفند و آذر ماه سال ۹۹، بهترین فروش ماهانه شرکت محسوب می‌شود. مبلغ فروش در مقایسه با ماه اردیبهشت ۱۲۲ درصد افزایش داشته است. مبلغ فروش مجموع فصل اول سال نسبت به مدت مشابه سال گذشته، رشد ۲،۵ برابری را نشان می‌دهد. شرکت در ماه خرداد تولید ۴۲ هزار دستگاه را گزارش کرده است. میانگین تولید ماهانه سال ۹۹، ۳۹ هزار دستگاه بوده است. در این ماه ۷۸ درصد فروش شرکت از محل گروه پژو است (۲۹ هزار دستگاه و ۳۷۱۵ میلیارد تومان درآمد). گروه سمند نیز با ۴ هزار دستگاه و ۵۰۸ میلیارد تومان، ۱۱ درصد از درآمد این ماه را شکل داده است. متوسط نرخ فروش محصولات در سال ۹۹، ۸۹ میلیون تومان بوده است و در خرداد ۱۳۰ میلیون تومان به ازای هر دستگاه گزارش شد. نرخ فروش گروه پژو، سمند و دنا محصولات پر فروش، به ترتیب در این ماه ۱۲۵، ۱۲۶ و ۲۰۱ میلیون تومان گزارش شده است.

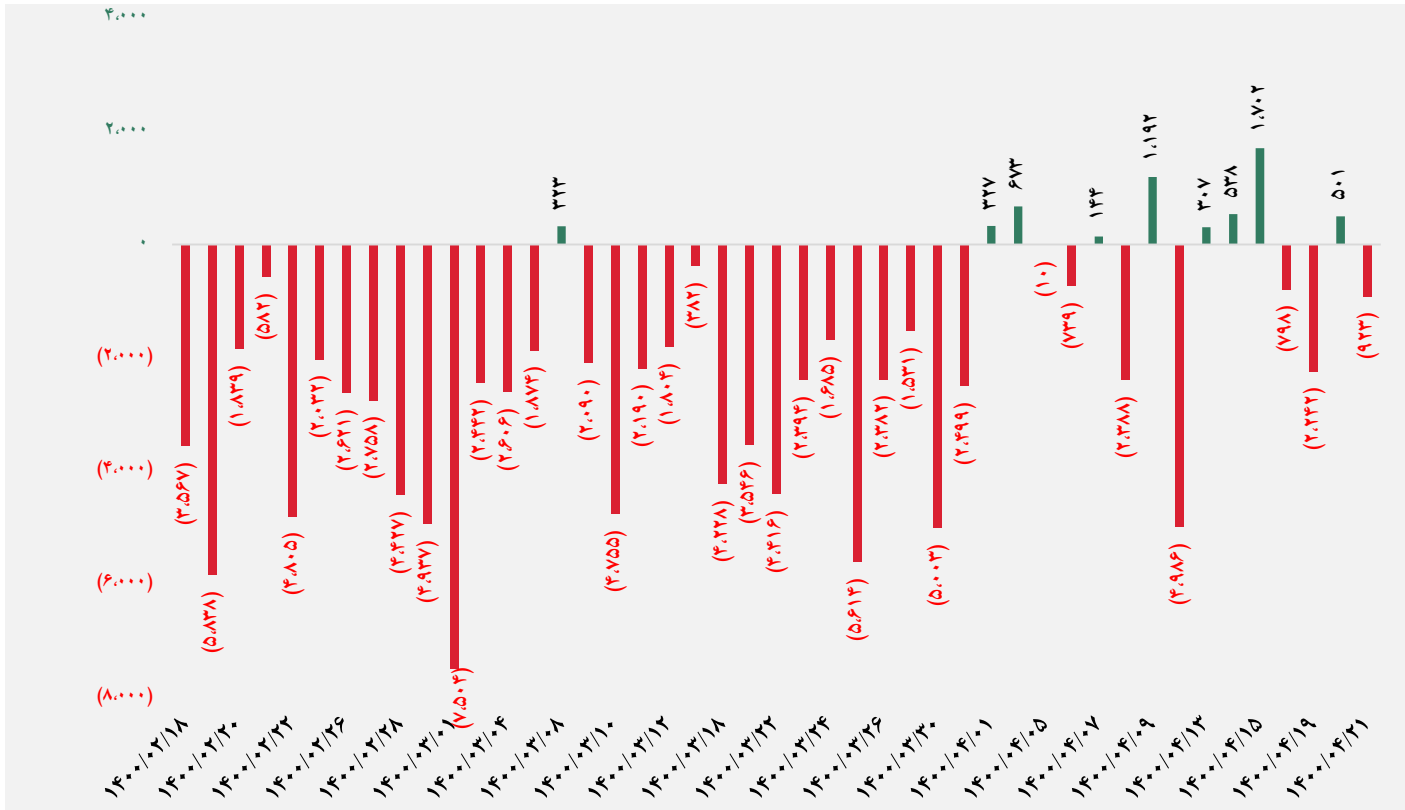
در گروه کاغذ، سال مالی شرکت صنایع کاغذ پارس منتهی به آبان است. این شرکت در سال مالی ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۴،۹۳۲ تن تولید داشته است. شرکت در خرداد ۵،۶۲۵ تن و در شش ماه گذشته به طور متوسط ۵،۵۶۴ تن تولید داشته است. این تولیدکننده محصولات کاغذی در خرداد ۴،۰۴۷ تن و در ۵ ماه گذشته به طور متوسط ۵،۵۸۲ تن فروش ثبت کرده است. متوسط فروش در سال مالی قبل ۵،۰۸۷ تن ثبت شده است. شرکت سال مالی گذشته خود را با متوسط فروش ۴۳ میلیارد تومان به پایان رساند. خرداد ماه فروش ۷۱ میلیارد تومان و متوسط فروش آذر تا اردیبهشت ۸۴ میلیارد تومان گزارش شده است. نرخ فروش کاغذ در خرداد ۱۸۵،۷۷۱ ریال به ازای هر کیلو و متوسط نرخ آذر تا اردیبهشت ۱۶۸،۵۵۱ ریال به ازای هر کیلو بوده است. متوسط نرخ فروش ۱۲ ماه گذشته ۱۰۶،۷۱۳ ریال به ازای هر کیلو گزارش شده است.

تصویر کلی بازار

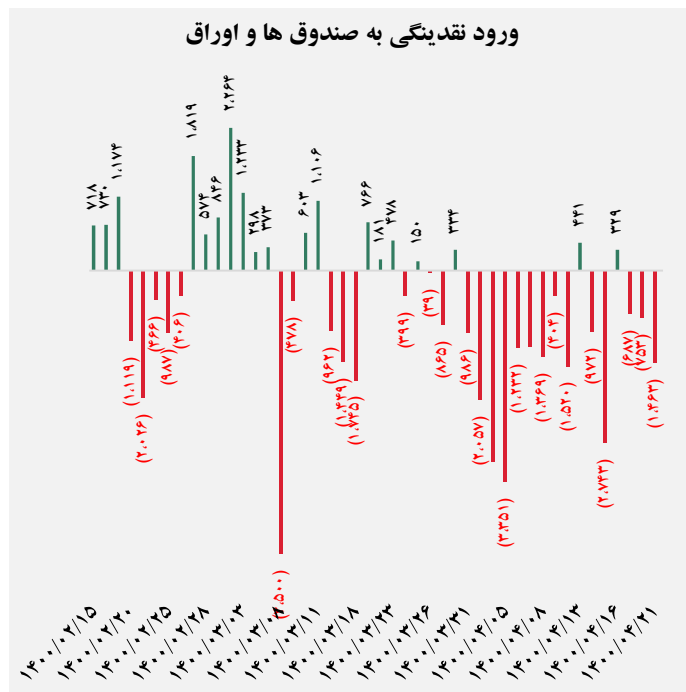
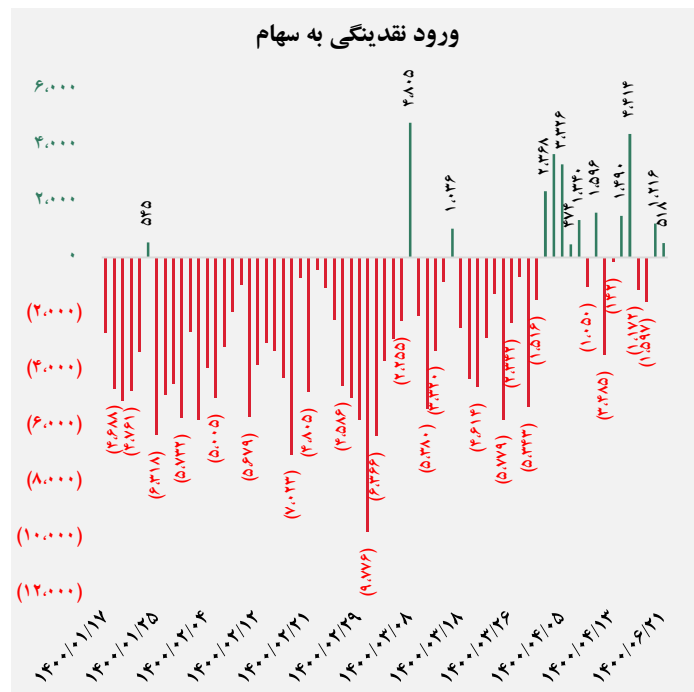
فرا بورس		بورس	
۱۸,۸۸۱	شاخص کل	۱,۳۰۴,۳۳۲	شاخص کل
۲۶۲	تغییر شاخص	۱۹,۰۷۷	تغییر شاخص
۱۰,۴۵۴,۳۲۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۱,۴۵۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۷۶,۴۶۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۸,۷۹۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
مارون		فولاد	
کگل		کگل	
زاگرس		پارسان	
وملل		فارس	
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
صبا		وسکرشا	
دماوند		برکت	
وهور		بورس	
بزاگرس		وسر ضوی	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



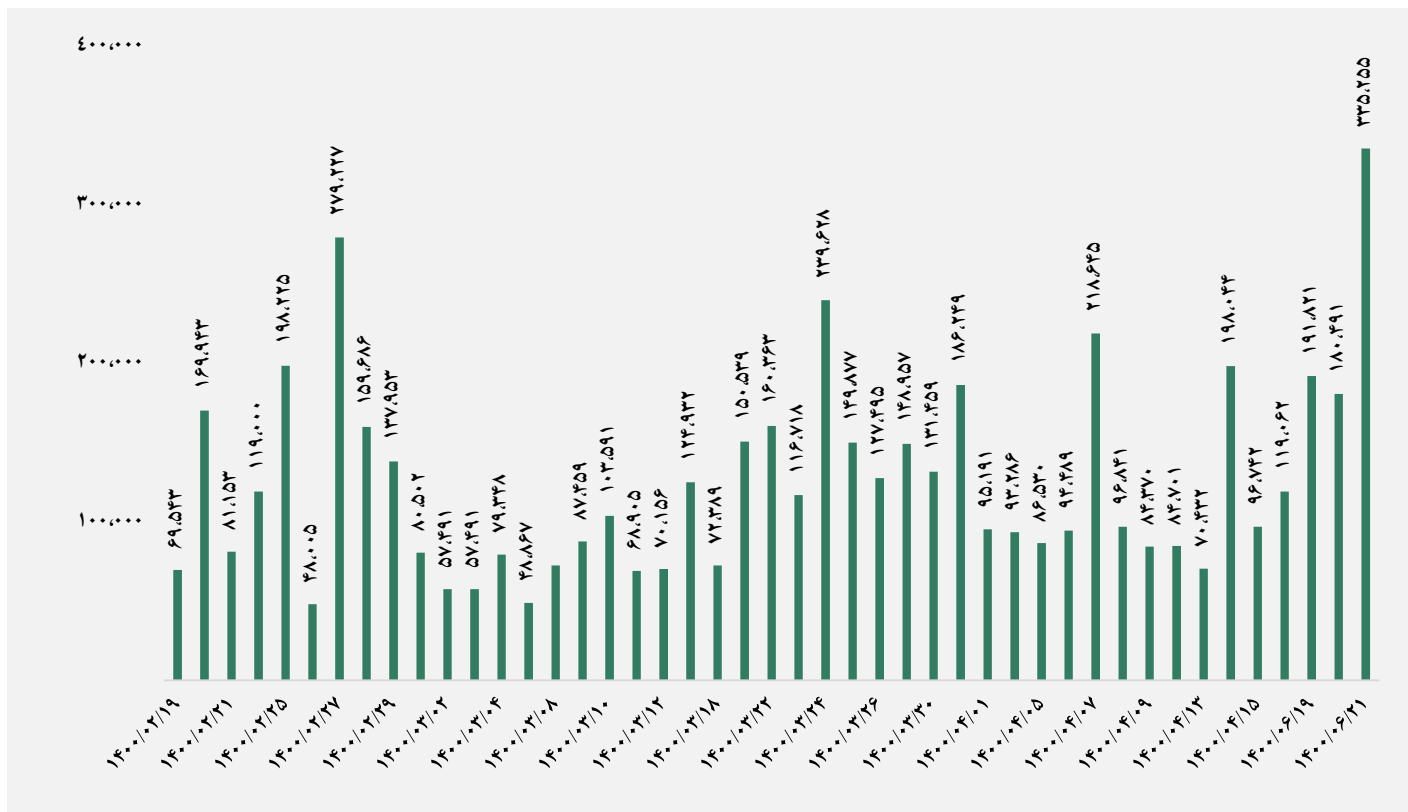
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



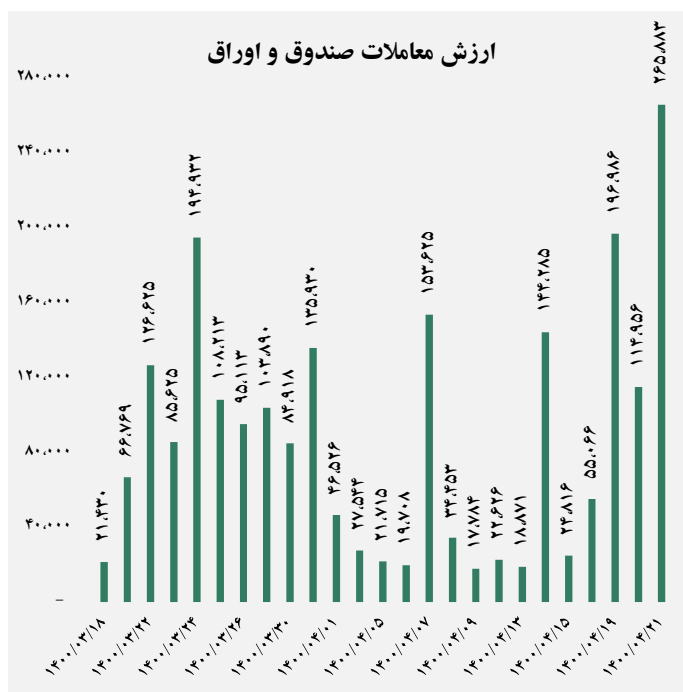
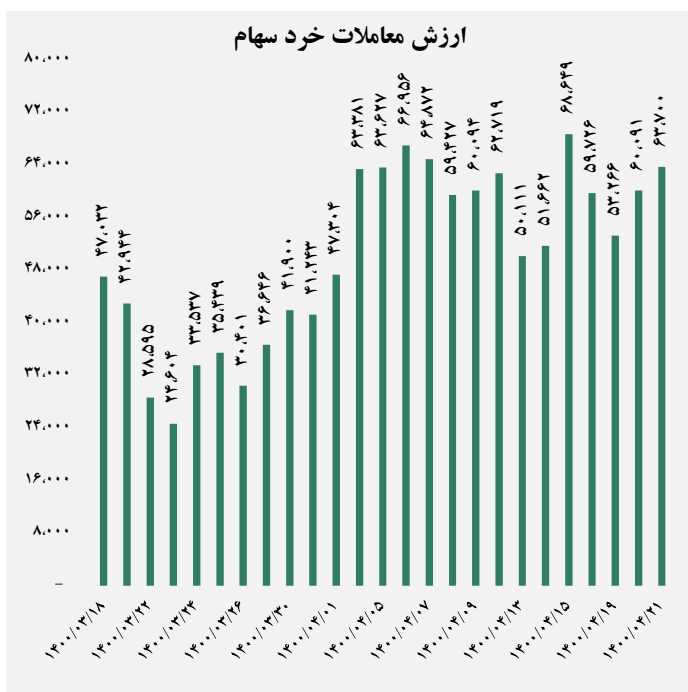
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



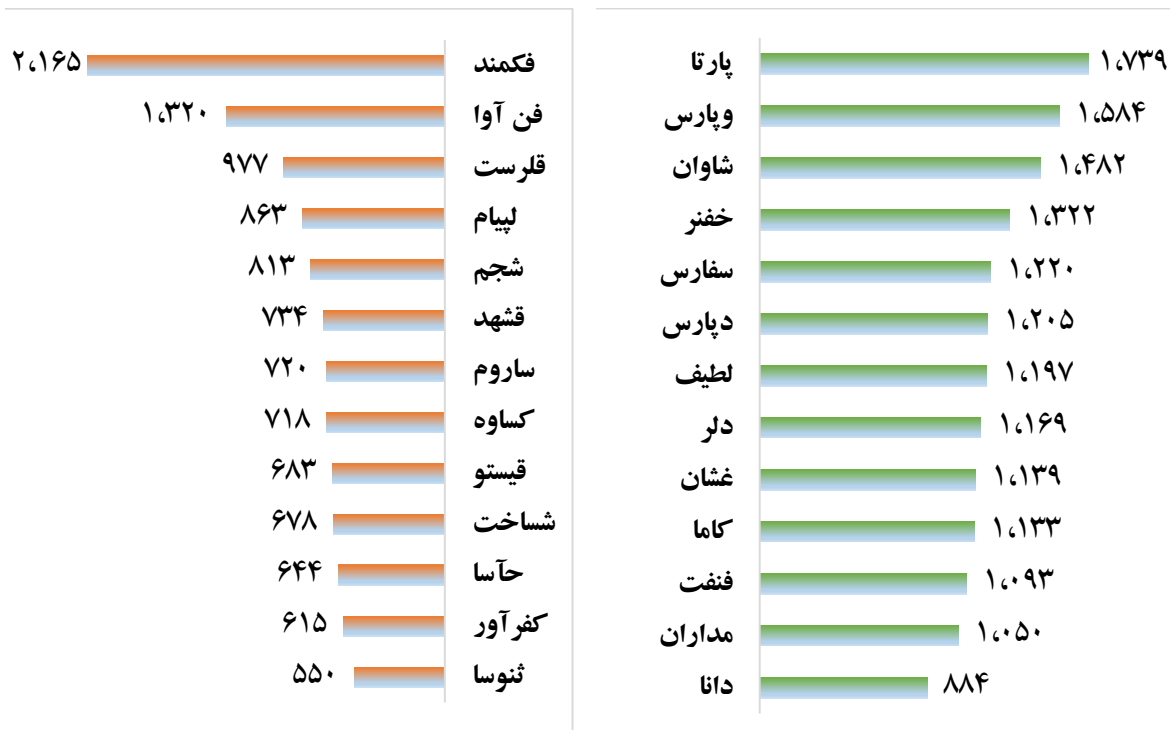
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



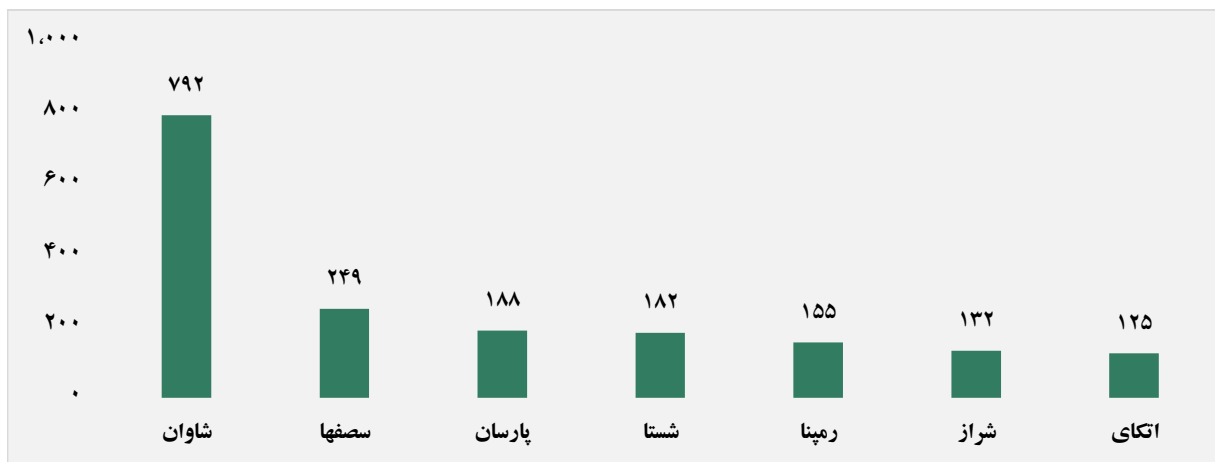
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



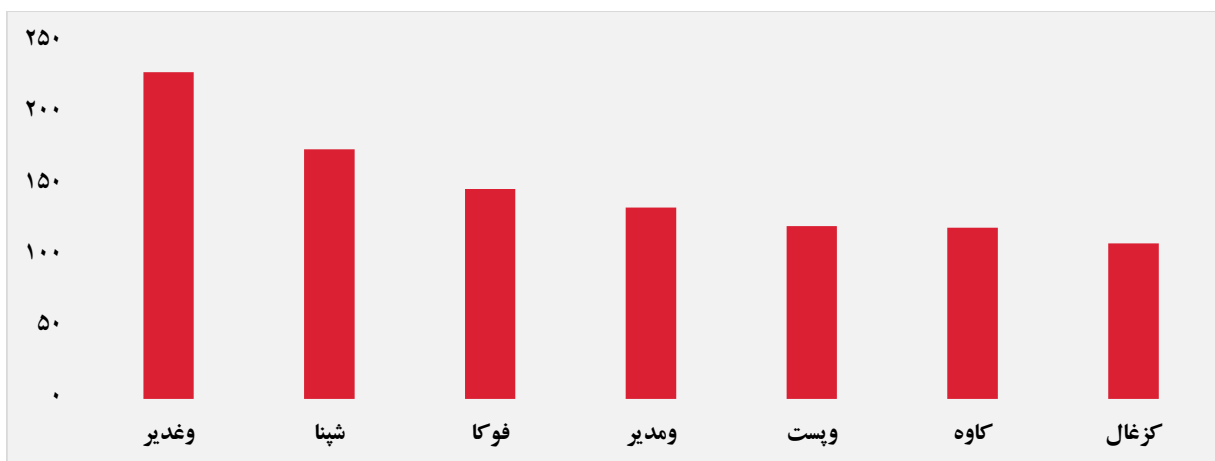
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	گدنا	۱	ولانا
۲	ومشان	۲	فولای
۳	شاون	۳	تمحرکه
۴	رافزا	۴	سفار
۵	مفاخر	۵	زنگان
۶	وثوق	۶	بشهاب
۷	سغرب	۷	زمگسا
۸	پاسا	۸	غگلستا
۹	چپارس	۹	پدرخش
۱۰	شاملا	۱۰	ساروم

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



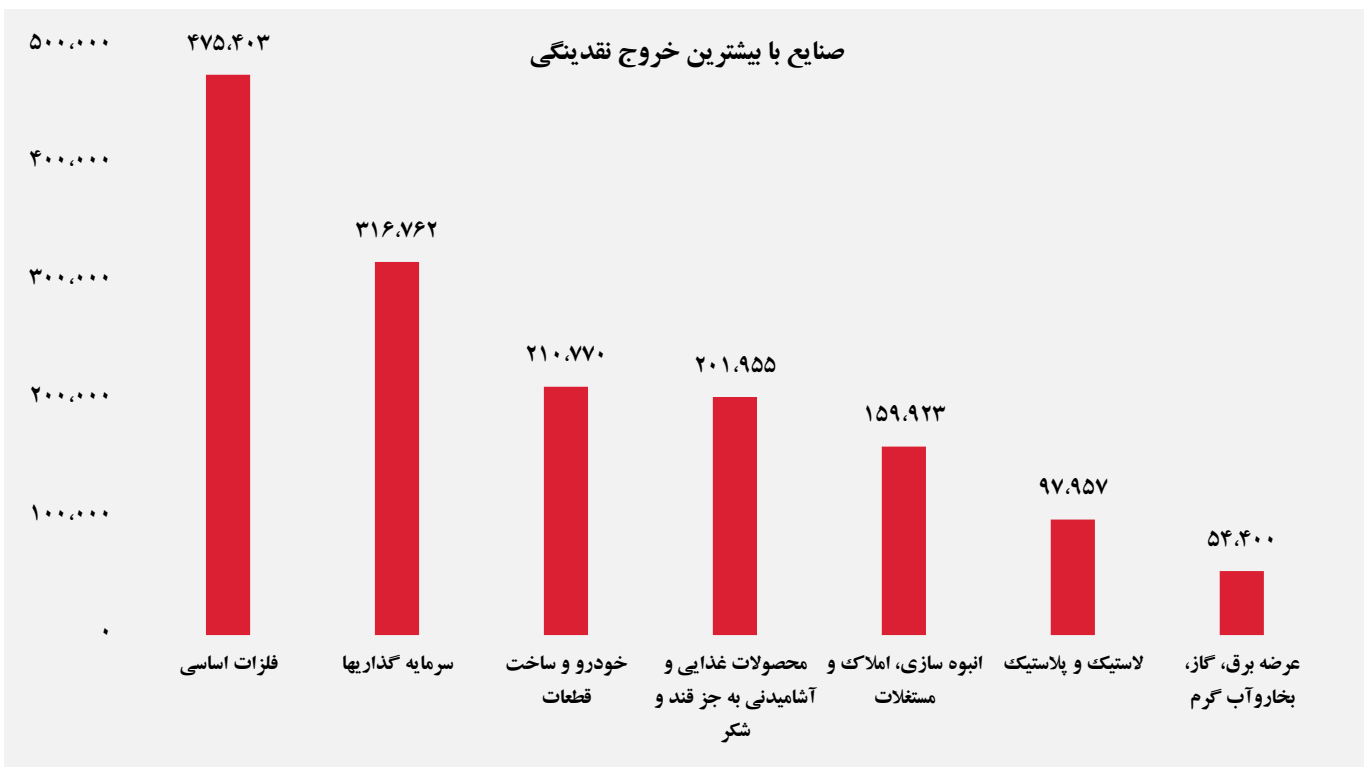
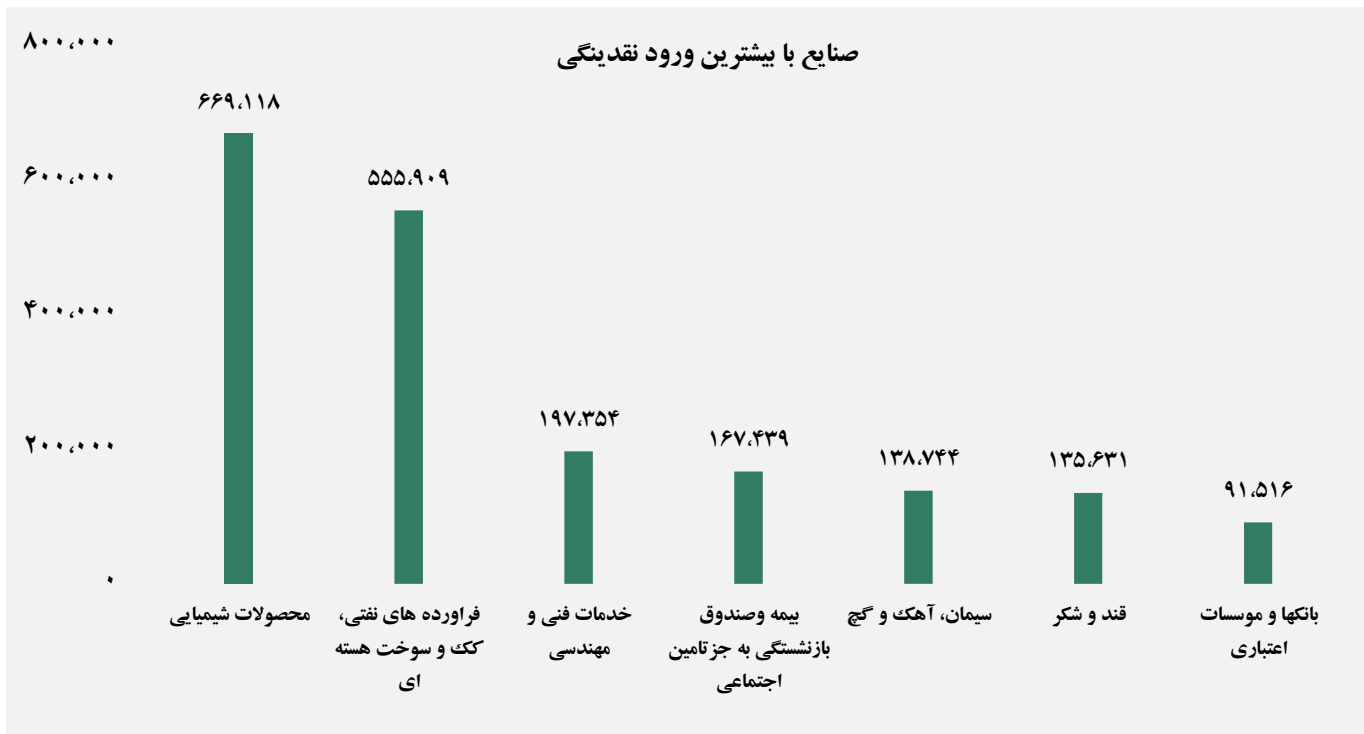
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	شاوان	۱۰	فیرا
۲	برکت	۱۱	ولکار
۳	شراز	۱۲	شغدیر
۴	میهن	۱۳	غدیس
۵	ولصنم	۱۴	فجر
۶	فزرین	۱۵	کرغال
۷	قشکر	۱۶	ثغرب
۸	غفارس	۱۷	ستران
۹	سصوفی	۱۸	وپست

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار