



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۲۲

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۲۲ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، شستا، جم، شفن، رمینا و فارس با کاهش ۴۱۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۰۳,۹۲۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۶۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۷۴ 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 ۴۵ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. علی‌رغم اینکه شاخص کل به نقطه مقاومتی خود رسیده اما حجم و ارزش معاملاتی در روز جاری بسیار مناسب بوده است. رکورد ارزش معاملات سهام خرد در سال ۱۴۰۰ نیز امروز شکسته شد و حتی با توجه به برخورد شاخص کل به نقطه مقاومتی، اما شاهد صف‌های فروش سنگین و زیادی در بازار نبودیم که نشان از خریدار تازه نفس می‌باشد. امید می‌رود در روزهای آینده قیمت سهام بعضی از شرکت‌ها در برخی صنایع به رشدشان ادامه دهند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۶۹,۹۶۱ 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 ۲۷,۶٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۲۱	۱۴۰۰/۰۴/۲۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۵۴,۶۹۱	۶۹,۹۶۱	-۷۳٪



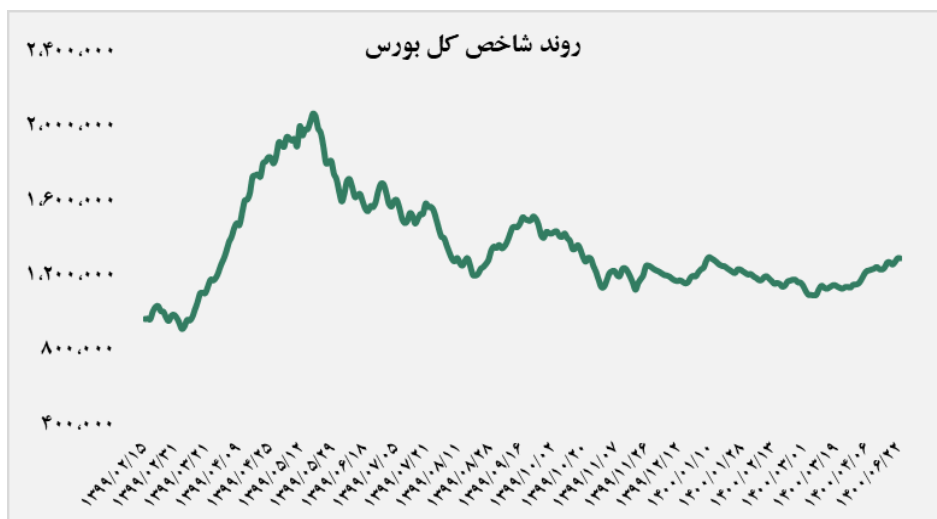
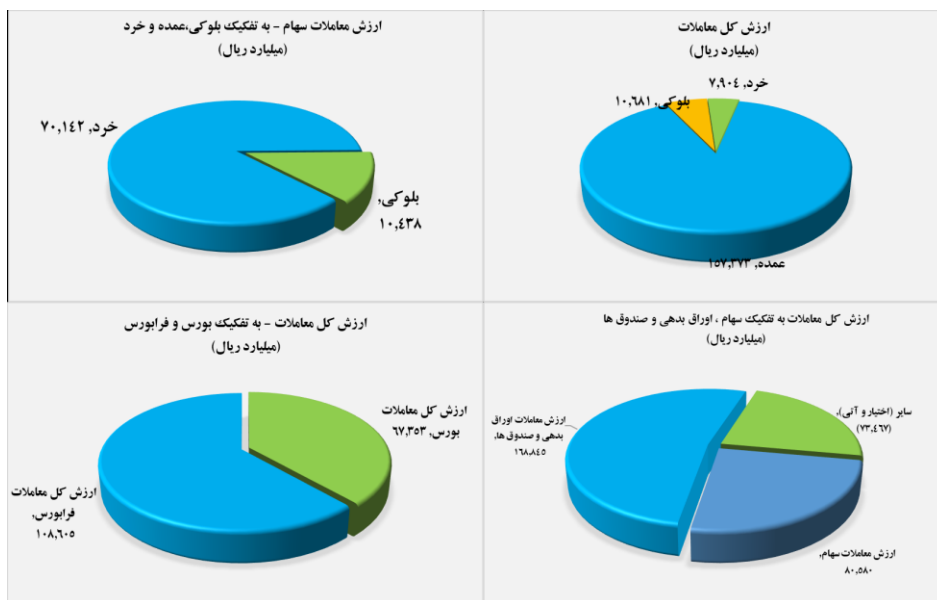
گروه‌های مؤثر

در گروه استخراج کانه‌های فلزی، شرکت توسعه و معدنی صبانور در خردادماه ۲۸۱ میلیارد تومان فروش داشته و جمع فروش ۳ ماهه به ۸۱۷ میلیارد تومان رسیده است. جمع کل فروش سال ۹۹، ۲,۰۸۸ میلیارد تومان بوده است. مقدار فروش گندله خرداد ۴,۷ هزار تن و کنسانتره ۱۲۰ هزار تن است. متوسط فروش ماهیانه این دو محصول در سال گذشته به ترتیب ۳۹,۷ و ۶۸,۲ هزار تن و متوسط فروش در ۳ ماهه اول سال جاری ۲۶,۴ و ۸۸,۶ هزار تن شده است. شرکت در سال ۹۹ جمعا ۴۷۶ هزار تن گندله و ۸۱۸ هزار تن کنسانتره فروخته است. صبانور ماهیانه ۳۶ هزار تن گندله و ۱۱۴ هزار تن کنسانتره تولید می‌کند. نرخ کنسانتره در این ماه ۲,۲۰۵ تومان و گندله نیز ۳,۱۹۴ تومان به ازای هر کیلوگرم بوده‌اند. نرخ کنسانتره ۳٪ و نرخ گندله نیز ۳٪ نسبت به ماه گذشته رشد داشته‌اند. شرکت در سال مالی گذشته کنسانتره را با نرخ ۱,۴۱۹ و گندله را با نرخ ۱,۹۴۵ تومان به ازای هر کیلوگرم فروخته است.

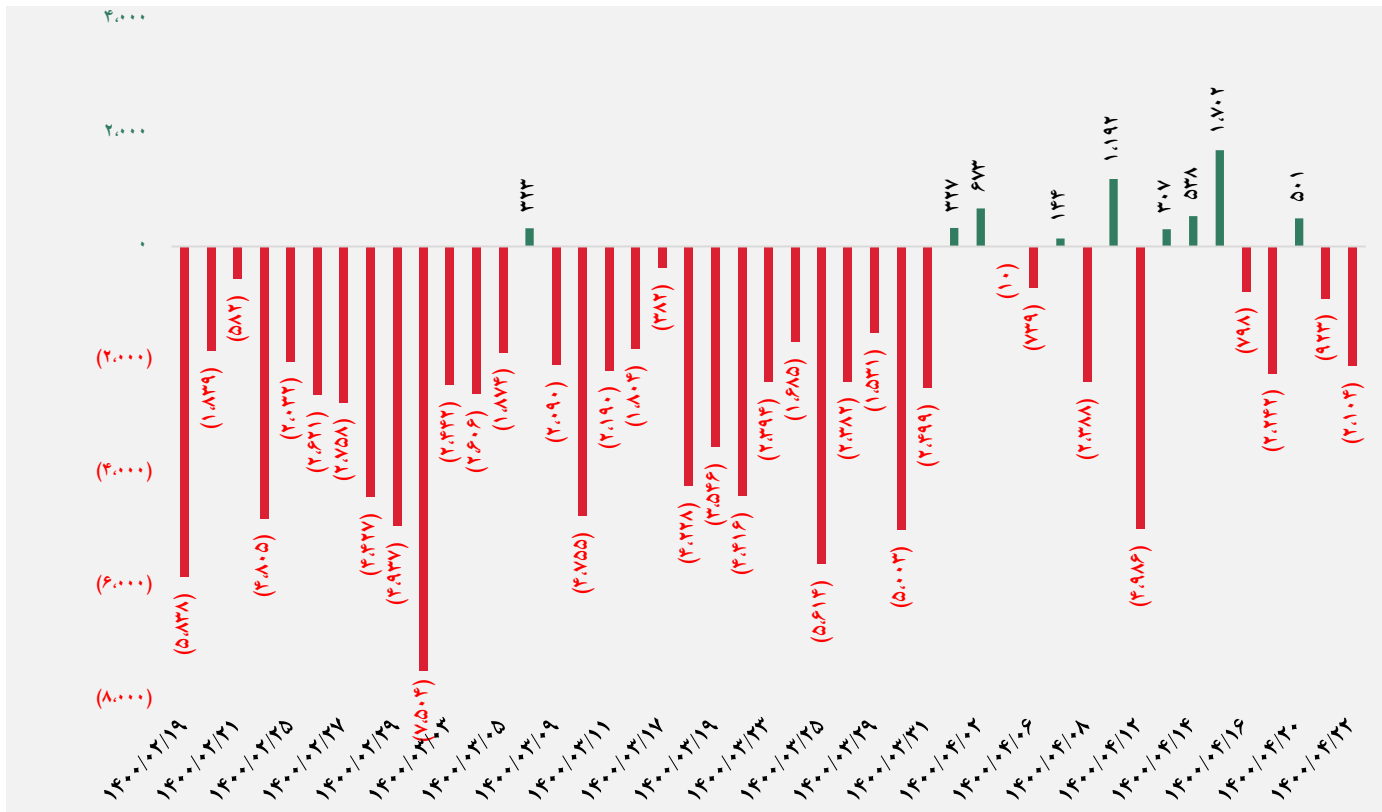
تولید کنسانتره در شرکت معدنی و صنعتی چادرملو به عنوان محصولات ابتدای زنجیره به طور متوسط برای هر ماه در سال قبل بر ۸۷۰ هزار تن استوار است. در سه ماهه ابتدای سال به طور متوسط برابر ۹۴۲ هزار و ۱,۰۴۰ هزار تن است. متوسط فروش شش ماه ابتدای سال ۹۹ هر ماه ۱,۰۵۳ میلیارد تومان بوده است، در پاییز متوسط ماهانه ۲,۶۰۰ میلیارد تومانی ثبت شد و در سه ماه بعدی به ترتیب ۲,۸۰۰، ۳,۹۰۰ و ۳,۲۰۰ میلیارد تومان فروش دارد. در فروردین نیز فروش ۲,۵۴۶ میلیارد تومانی را ثبت کرد، اردیبهشت ۲,۶۱۰ بود و خرداد با ۳,۶۶۲ میلیارد تومان رقم خوبی را به ثبت رساند. فروش فولاد خرداد شرکت ۱۲۶ هزار تن (میانگین ۱۲ ماهه ۹۹ ماهانه ۸۴ هزار تن)، کنسانتره ۷۳۰ هزار تن (میانگین ماهانه ۵۸۰ هزار تن) و گندله ۵۰ هزار تن (میانگین ماهانه ۱۱۸ هزار تن) است. نرخ فروش شمش فولادی شرکت ۱۲ ماهه ۹۹، ۹,۰۰۰ تومان در هر کیلو بوده و متوسط سه ماهه سال جاری نرخ فروش شمش فولاد ۱۱,۵۰۰ و خرداد ماه نیز ۱۲,۲۰۰ تومان در هر کیلو گرم است.

تصویر کلی بازار

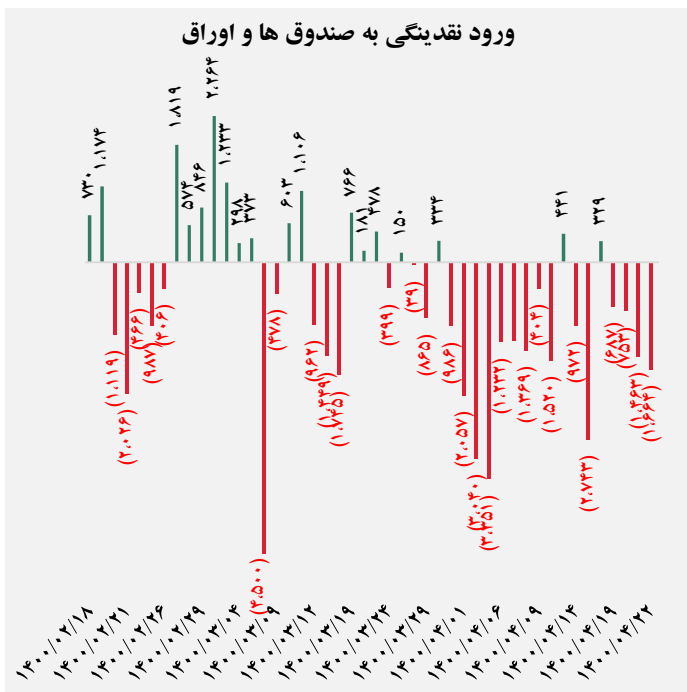
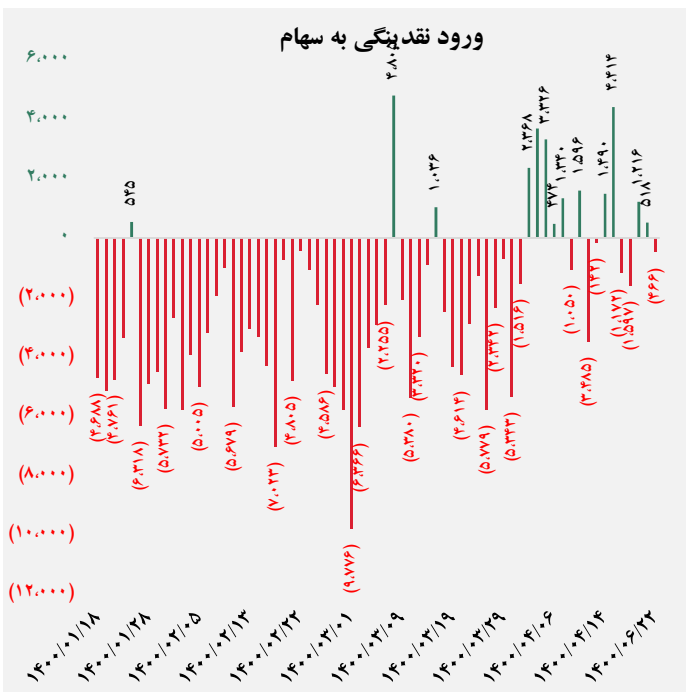
فرا بورس		بورس	
۱۸,۹۴۸	شاخص کل	۱,۳۰۳,۹۲۱	شاخص کل
۶۶	تغییر شاخص	۴۱۴	تغییر شاخص
۱۰,۴۹۰,۵۱۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۱,۳۰۲,۴۶۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۰۸,۶۰۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۶۷,۳۵۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
دی		کگل	
مارون		ومعادن	
کگهر		نوری	
شاون		کچاد	
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
آریا		فملی	
وهور		شستا	
شگویا		جم	
دماوند		شفن	



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

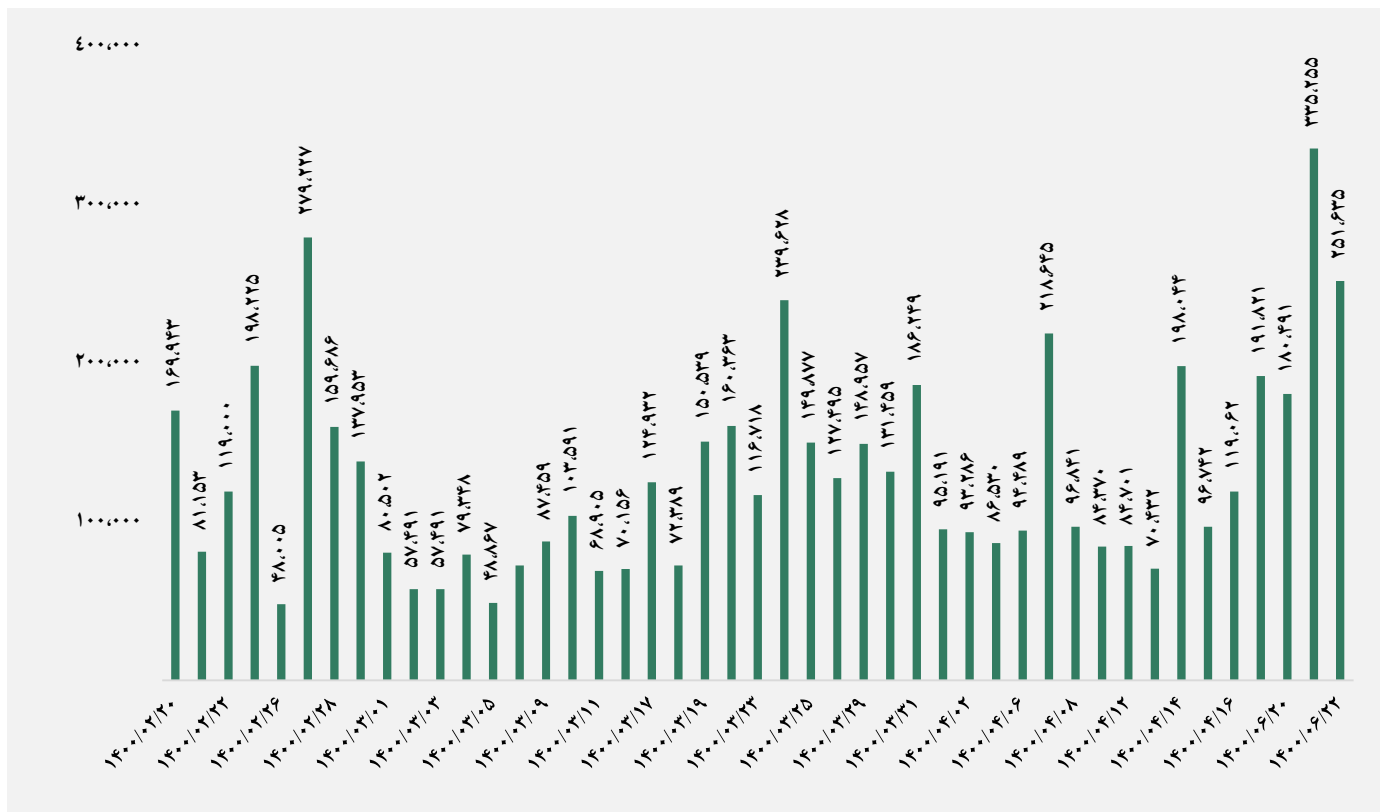


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

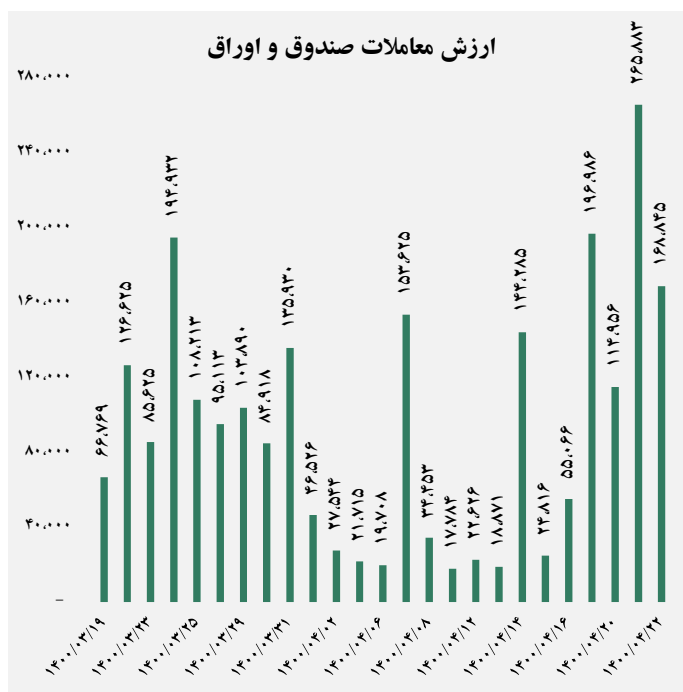
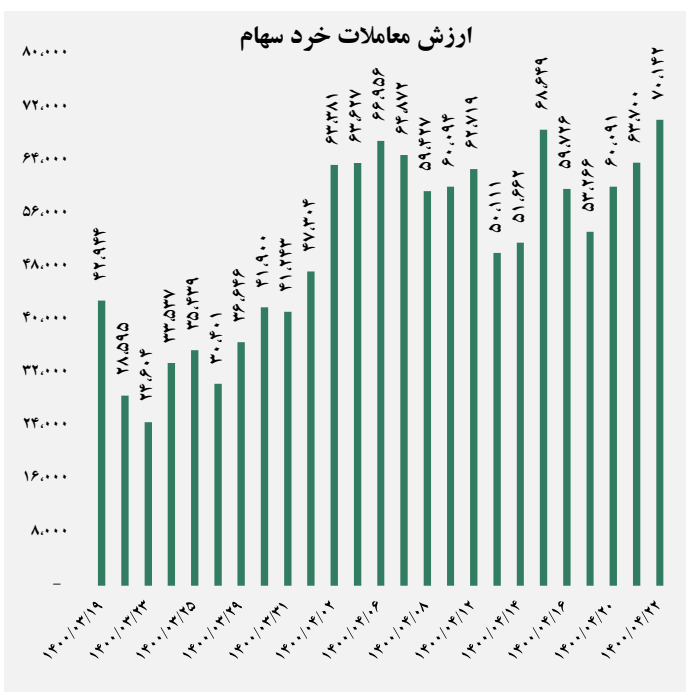


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

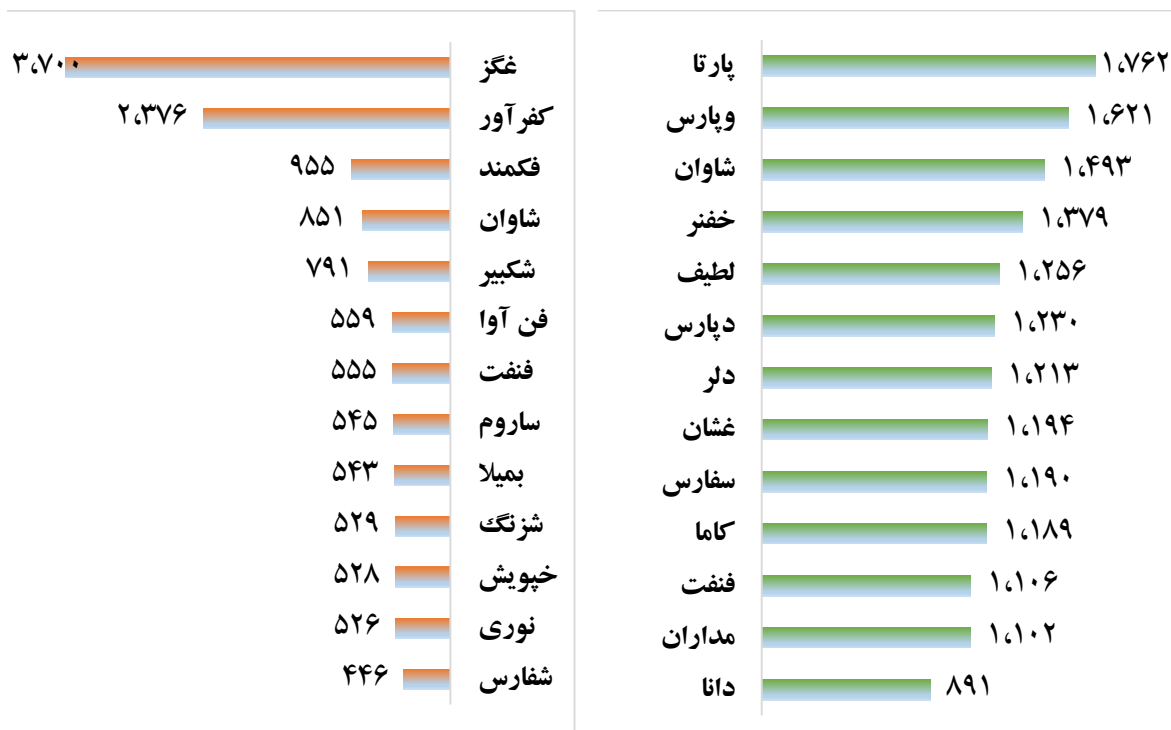


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





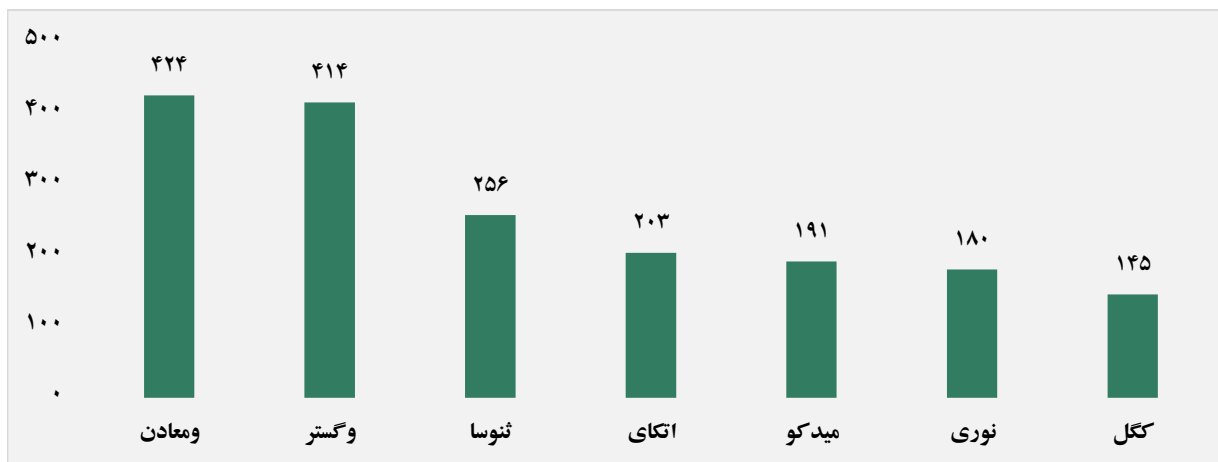
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



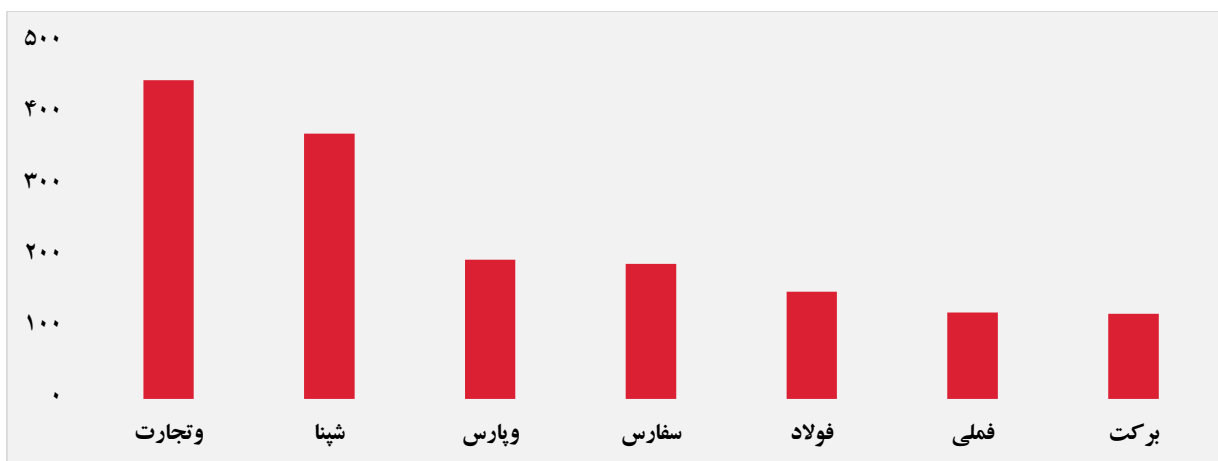
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	ومشان	۱	معیار
۲	وگستر	۲	گپارس
۳	فنف	۳	خفولا
۴	شاوان	۴	خزر
۵	شصدف	۵	غنوش
۶	مفاخر	۶	شسینا
۷	تاپکیش	۷	تمحرکه
۸	کاما	۸	غالبر
۹	مداران	۹	زمگسا
۱۰	سغرب	۱۰	سارییل

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



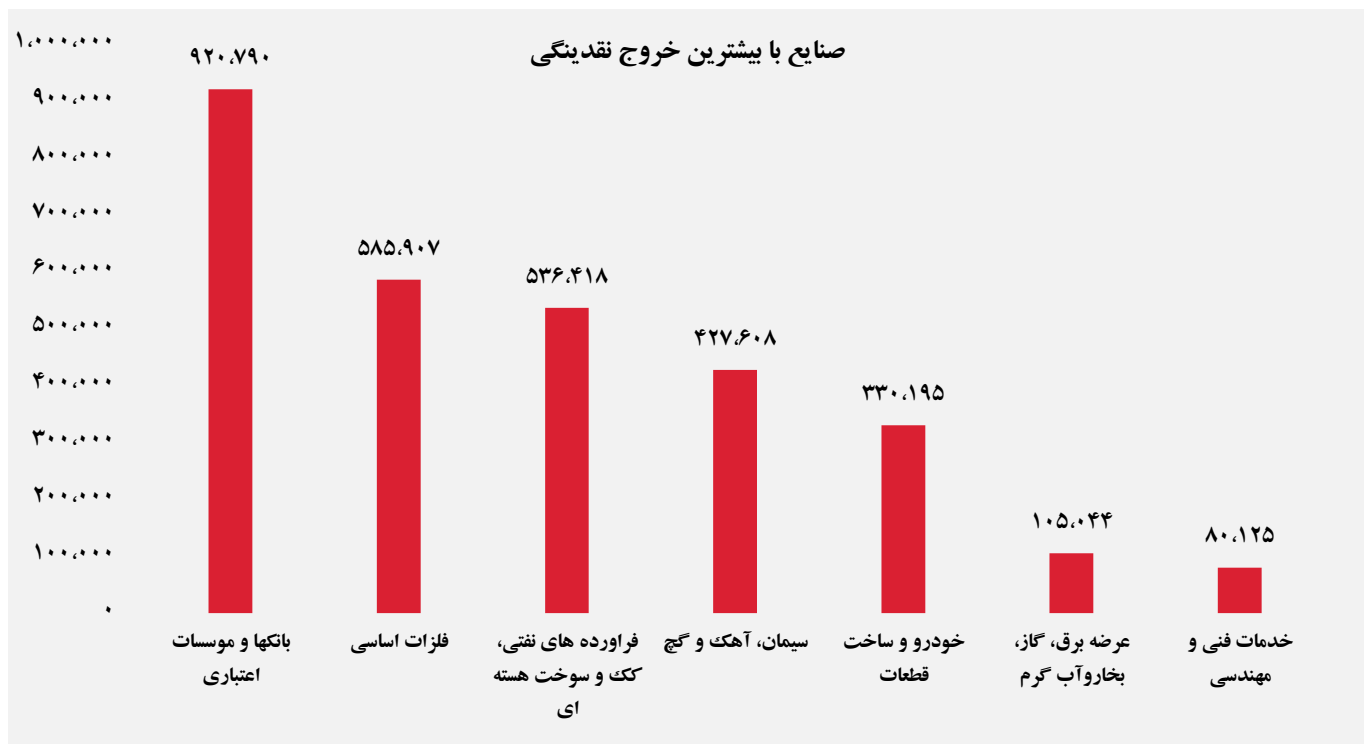
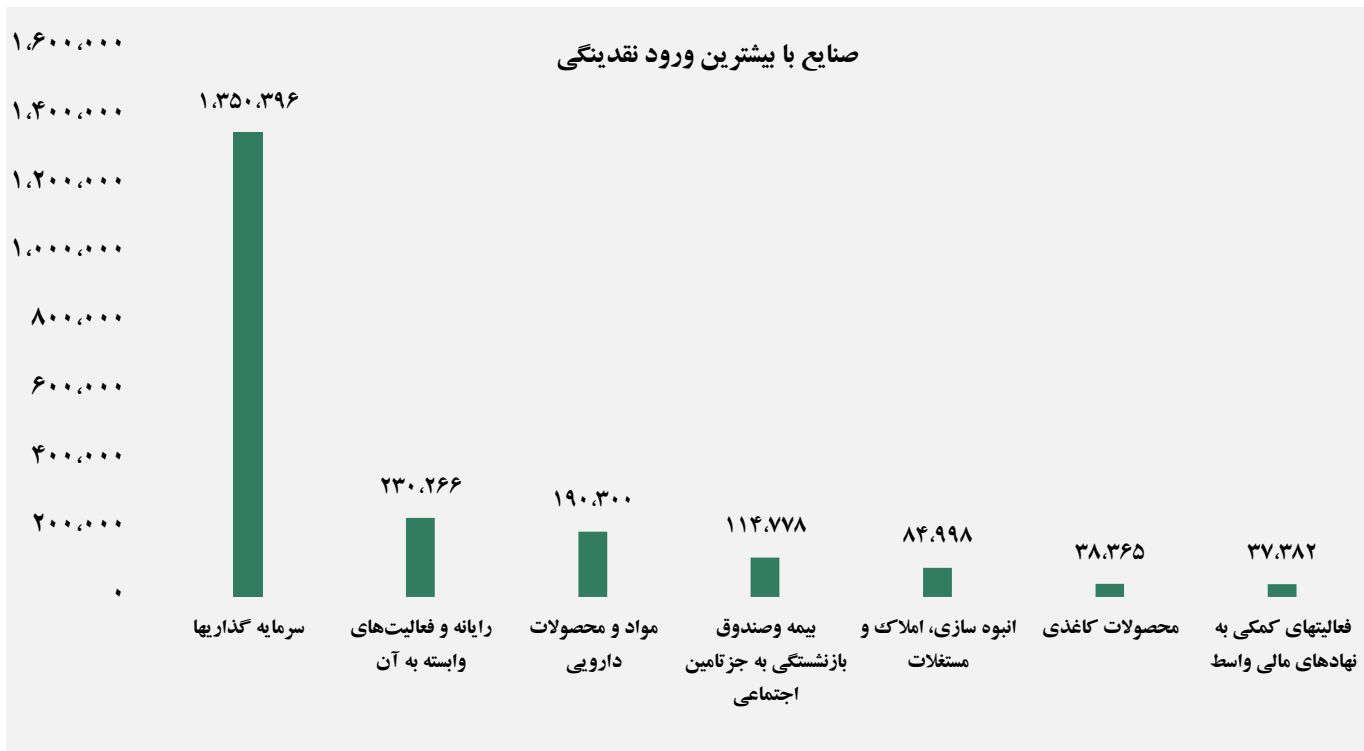
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ثنوسا	۱۰	فزرین
۲	کنور	۱۱	سفارس
۳	شاوان	۱۲	بورس
۴	برکت	۱۳	ولکار
۵	شغدیر	۱۴	شفا
۶	تاپکیش	۱۵	کسرا
۷	غفارس	۱۶	دتوزیع
۸	کاما	۱۷	ثعمرا
۹	غدیس	۱۸	اتکای

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار