



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۲۶

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۲۶ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای میدکو، شپنا، پارسان، شتران، تایپکو و شبریز با افزایش ۵,۷۲۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۱۱,۲۲۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۸۱ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۷۴ 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 ۴۱ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. بسیاری از نمادهای معاملاتی در روز معاملاتی جاری و آینده به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه متوقف خواهند شد. بعضی از فعالین بازار سرمایه میل و رغبتی برای شرکت در مجامع عادی سالیانه را به دلیل های مختلف مانند تأخیر در پرداخت سود مجمع و یا عدم تقسیم سود جذاب توسط شرکتها را ندارند. بنابراین بخشی از فشار فروش امروز را می توان به موضوع اشاره شده ربط داد و قسمت دیگری از فشار فروش را نیز به دلیل برخورد شاخص کل به نقطه مقاومتی در محدوده ۱,۳۰۰,۰۰۰ الی ۱,۳۱۵,۰۰۰ واحد دانست. اما به نظر می رسد، بازار سهام در روزهای آینده با تقاضای بیشتری همراه شود و اکثر نمادها مجدداً به روند صعودی خود بخواهند گشت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۹۳,۱۰۲ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش 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 ۷۱۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۸ با ۲۲٪ سود است.

| شرح | ۱۴۰۰/۰۴/۲۳ | ۱۴۰۰/۰۴/۲۶ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۶۵,۷۸۲ | ۹۳,۱۰۲ | ۴۲٪ |

گروه های مؤثر

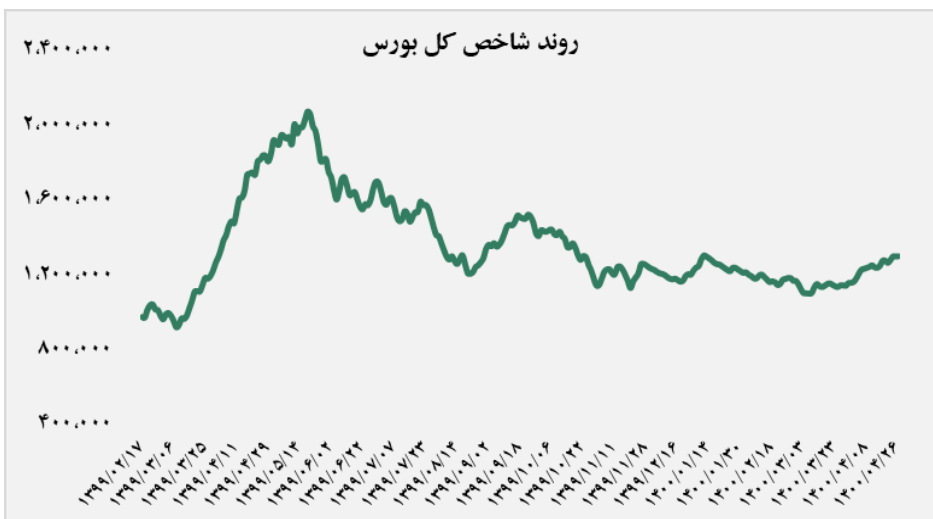
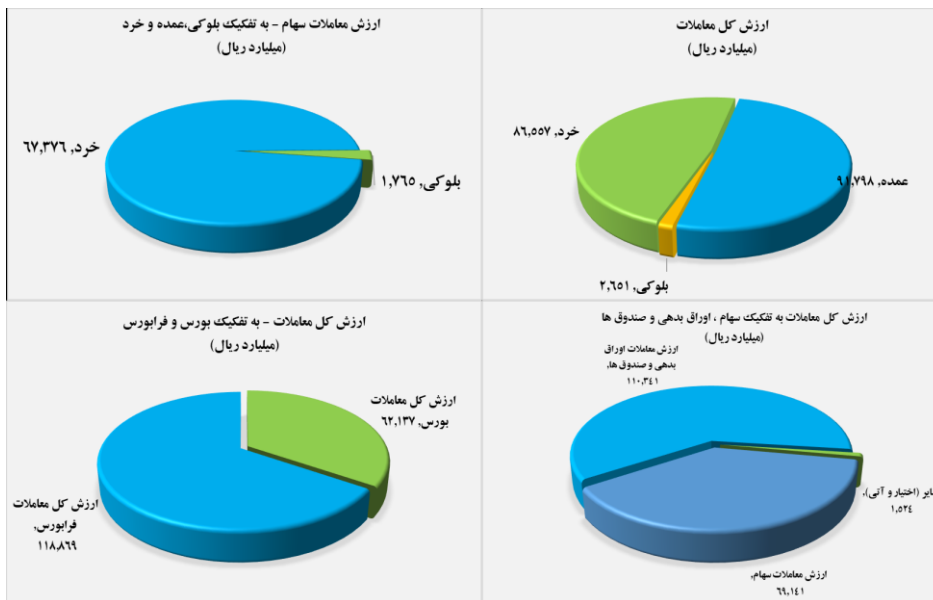


در گروه شیمیایی، شرکت پتروشیمی قائد بصیر در حالی در سال ۱۳۹۹ هر ماه ۳,۵۰۰ تن تولید داشت که در فروردین سال جاری اورهال داشت و ۶۸۸ تن تولید گزارش کرد و در اردیبهشت و خرداد ۳,۳۰۰ و ۳,۴۵۰ تن تولید دارد. جمع فروش سال ۹۹، ۳۸,۹۰۰ تن بوده است و سال را با موجودی ۵,۳۰۰ تنی به پایان رساند. در فروردین ۲,۰۰۰ تن، اردیبهشت ۲,۸۵۰ و خرداد نیز ۲,۸۸۳ تن فروش ثبت کرده است. در فصل اول و دوم ۹۹ متوسط فروش هر ماه ۶۶ میلیارد و ۱۰۳ میلیارد تومانی را داشت، در فصل سوم به ۱۳۴ میلیارد تومان رسید. در دی و بهمن فروش های فوق العاده ۲۰۳ و ۱۸۱ میلیاردی را ثبت کرد و در اسفند موجودی نگه داشته بود و فروش ۱۴۱ میلیارد تومانی را داشت و سال مالی ۱۴۰۰ را با فروش ۱۳۵ میلیارد تومانی آغاز کرد، در اردیبهشت ۱۹۶ میلیارد تومان و خرداد نیز ۱۹۰ میلیارد تومان فروش دارد. فروش سه ماهه امسال رشد ۴۵ درصدی نسبت به مدت مشابه سال قبل دارد. میانگین نرخ های فروش هر کیلو ABS در سال ۹۸، ۱۹ هزار تومان بود، سال ۹۹ متوسط نرخ فروش با رشد ۹۴ درصدی به ۳۷ هزار تومان رسیده است و نرخ سه ماهه امسال نیز رشد ۸۲ درصدی به متوسط سال ۹۹ دارد و برابر ۶۷ هزار تومان در هر کیلو است.

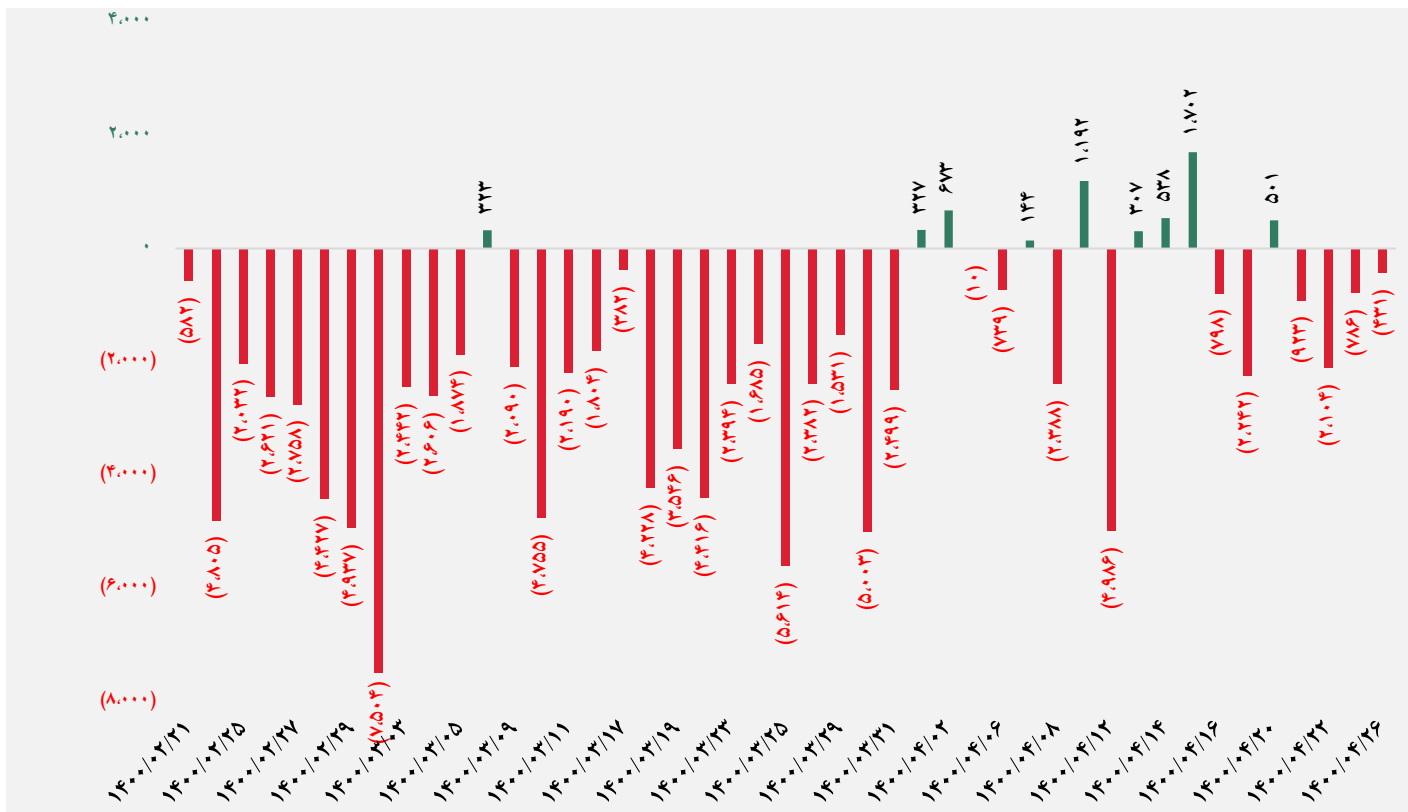
در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد آلیاژی ایران در خرداد ماه ۴۳,۴۵۸ تن تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه سال ۹۹، ۳۹ و سال ۹۸، ۳۶ هزار تن بوده است. در خرداد ۴۲,۸۱۱ تن فروش گزارش شده است. در سال ۹۸ میانگین فروش ۳۶ هزار تن بوده و در سال ۹۹ این عدد به ۳۹ هزار تن رسیده است. شرکت در خرداد ماه فروش خوب ۸۸۴ میلیارد تومانی را گزارش کرد و فروش فروردین و اردیبهشت ۵۶۵ و ۷۶۸ میلیارد تومان و میانگین فروش ماهانه سال قبل ۵۳۳ میلیارد تومان بوده است. نرخ فروش محصول آلیاژی در ماه مورد گزارش ۲۳۲,۰۹۰ ریال در هر کیلو گزارش شده، در اردیبهشت محصول آلیاژی با نرخ ۲۲۰,۴۶۰ ریال به فروش رسیده است. میانگین نرخ فروش سال ۹۹ و ۹۸ به ترتیب ۱۴۲,۸۷۰ و ۶۹,۶۴۶ ریال در هر کیلو می باشد.

تصویر کلی بازار

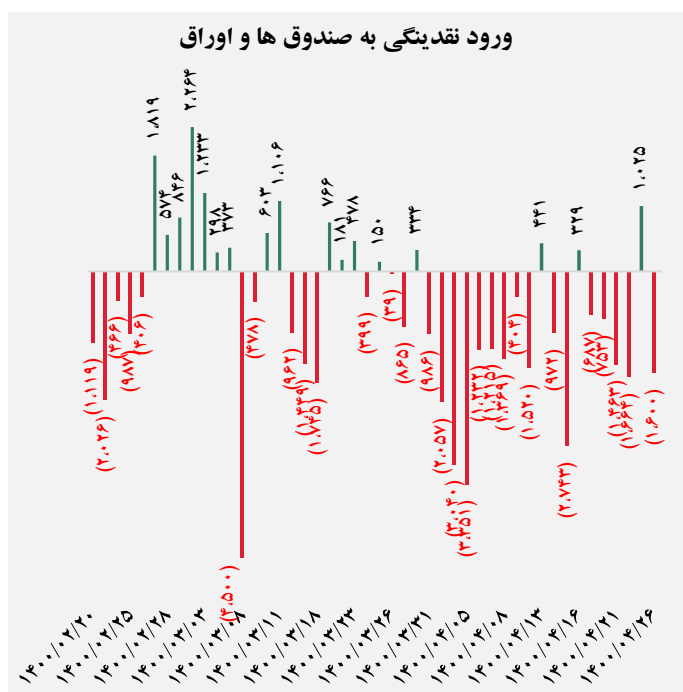
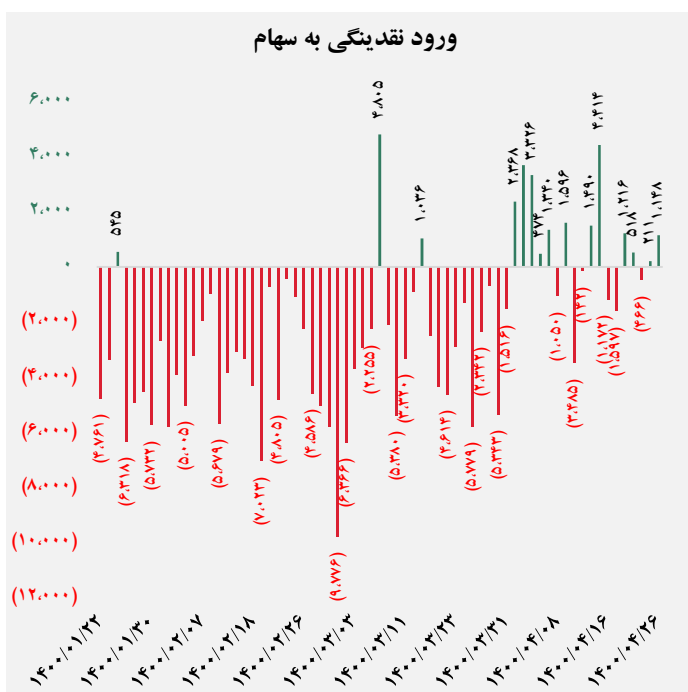
| فرا بورس | | بورس | |
|----------------------------|-----------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| ۱۸,۹۸۷ | شاخص کل | ۱,۳۱۱,۲۲۰ | شاخص کل |
| (۲) | تغییر شاخص | ۵,۷۲۴ | تغییر شاخص |
| ۱۰,۵۱۱,۹۲۷ | ارزش بازار (میلیارد ریال) | ۵۳,۴۶۶,۴۳۰ | ارزش بازار (میلیارد ریال) |
| ۱۱۸,۸۶۹ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۶۲,۱۳۷ | ارزش معاملات (میلیارد ریال) |
| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | | بیشترین تاثیر مثبت در شاخص | |
| صبا | | میدکو | |
| دی | | شپنا | |
| شراز | | پارسان | |
| شاوان | | شتران | |
| بیشترین تاثیر منفی در شاخص | | بیشترین تاثیر منفی در شاخص | |
| غصینو | | کچاد | |
| آریا | | شپدیس | |
| زاگرس | | فخوز | |
| وملل | | ویارس | |



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



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

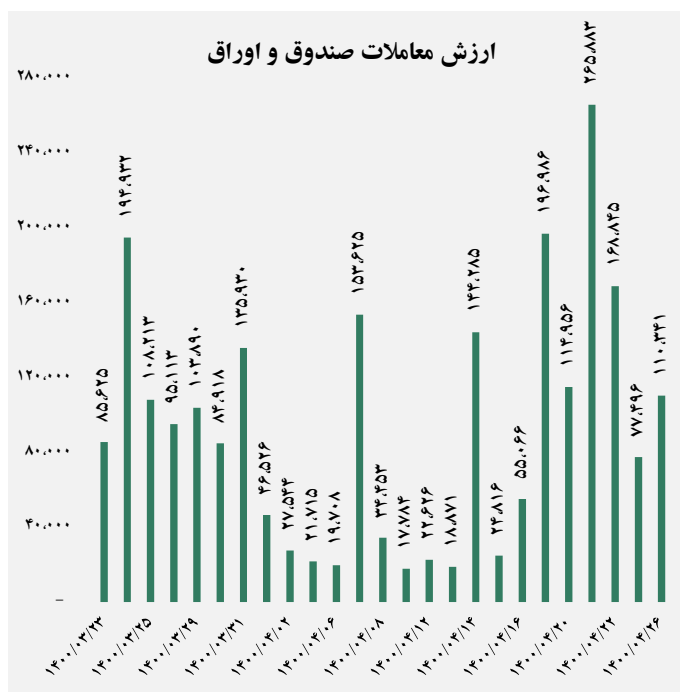
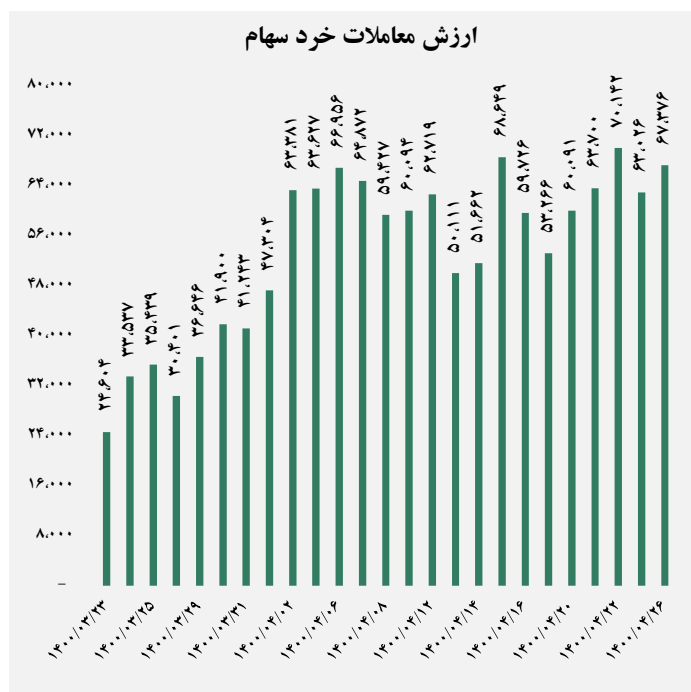


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

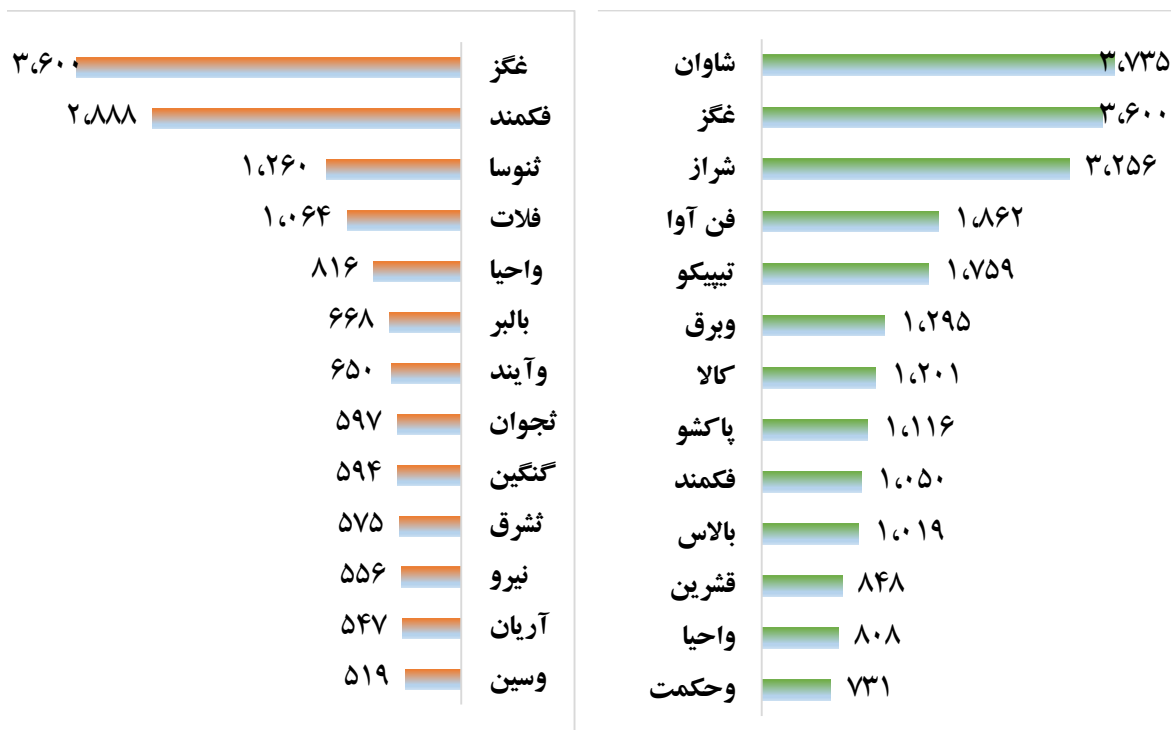


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





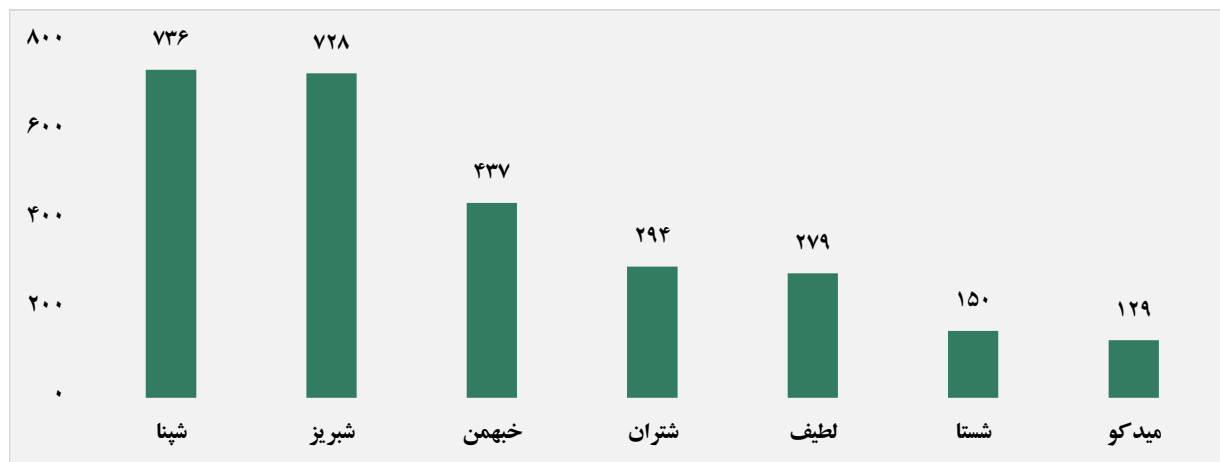
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



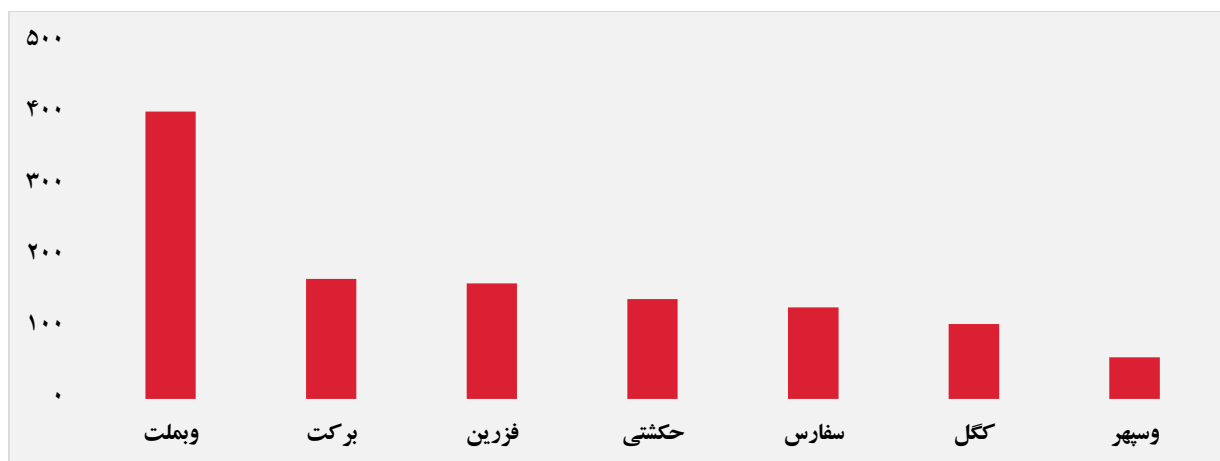
پول هوشمند

| ردیف | ورود | ردیف | خروج |
|------|-------|------|--------|
| ۱ | لطیف | ۱ | ومشان |
| ۲ | کماسه | ۲ | کفرآور |
| ۳ | سدور | ۳ | حآسا |
| ۴ | ساوه | ۴ | معیار |
| ۵ | سرود | ۵ | وآذر |
| ۶ | شبریز | ۶ | نمرینو |
| ۷ | دشیمی | ۷ | غازر |
| ۸ | شراز | ۸ | فنورد |
| ۹ | آبادا | ۹ | شکرین |
| ۱۰ | بوعلی | ۱۰ | کپارس |

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



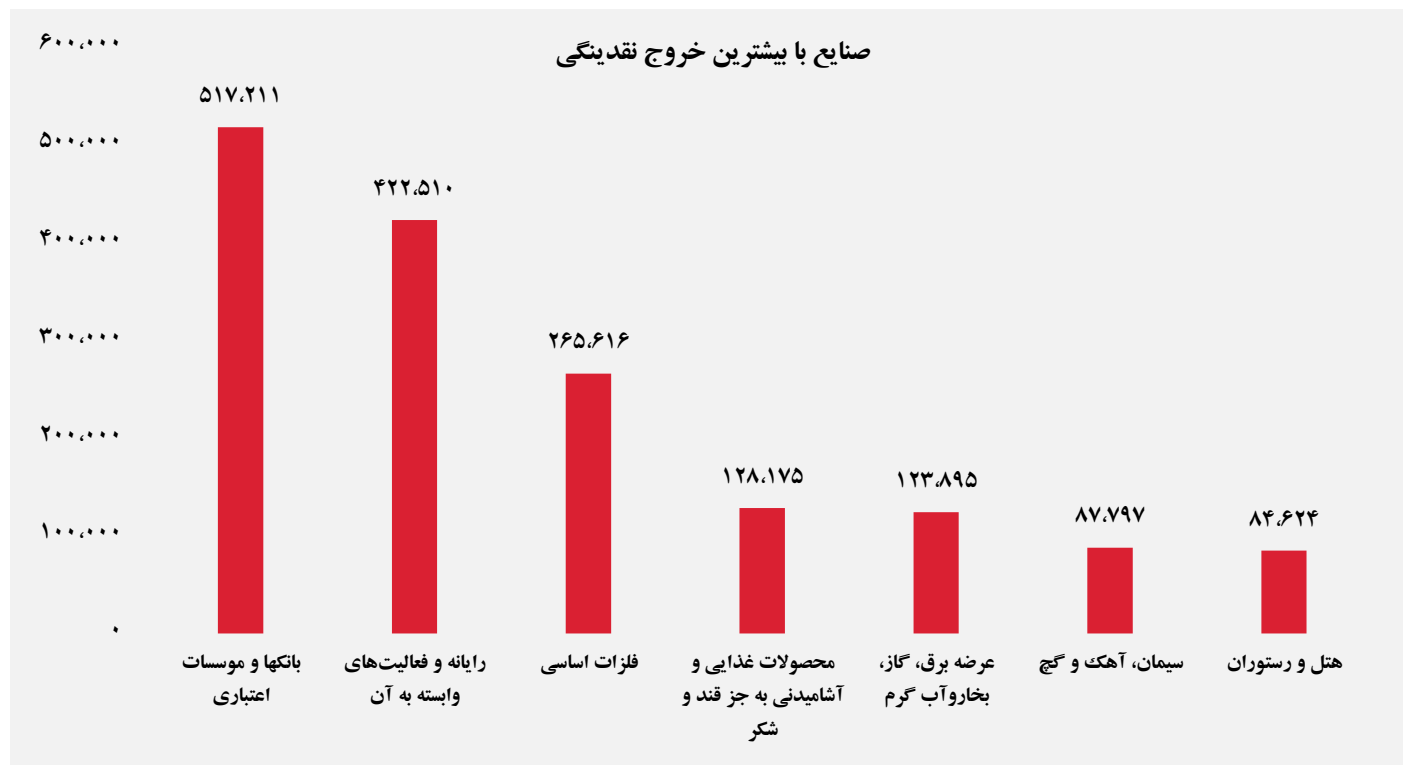
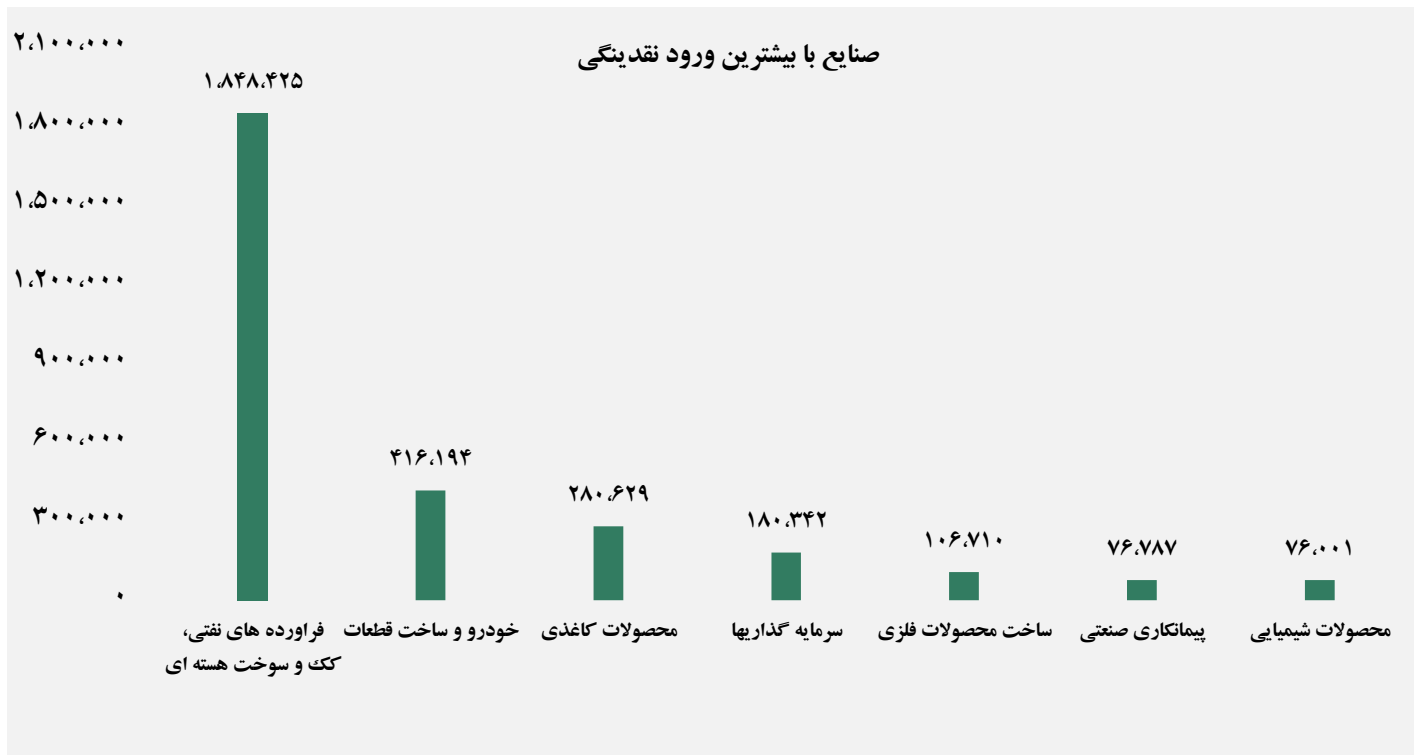
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

| ردیف | نماد | ردیف | نماد |
|------|--------|------|--------|
| ۱ | فزرین | ۱۰ | دسانکو |
| ۲ | برکت | ۱۱ | خفنر |
| ۳ | گشان | ۱۲ | تاپکیش |
| ۴ | ولکار | ۱۳ | کاما |
| ۵ | ثنوسا | ۱۴ | آپ |
| ۶ | شیریز | ۱۵ | کیمیا |
| ۷ | دتوزیع | ۱۶ | شراز |
| ۸ | بورس | ۱۷ | کسرا |
| ۹ | غفارس | ۱۸ | فجر |

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار