



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۴/۲۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۲۸ تیر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای تایپکو، رمینا، فارس، کچاد، کگل و اخبار با افزایش ۸,۴۲۰ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۱۱,۲۷۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۱۶ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۵۳ 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 ۲۵ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. در یک ماه گذشته اکثر سهام ها رشد قیمتی ۱۵ الی ۲۰ درصدی را به واسطه اصلاح ۷ الی ۸ ماهه به دست آوردند. این در حالی است که P/E سهم ها با دلار ۲۰ تا ۲۱ هزار تومان در محدوده های ۳ تا ۴ رسیده بود. با توجه به اتفاقات اخیر در حوزه سیاسی و اقتصادی و عدم کاهش قیمت دلار تا حد زیادی به بازار سرمایه کمک شد. قیمت ها در حال حاضر نشان می دهند دلار در محدوده ۲۱ تا ۲۳ هزار تومان در حال بسته شدن است و تغییرات خاصی را نخواهد داشت. بنابراین شاهد این مسئله هستیم که افراد اقدام به خرید سهم هایی با P/E پایین در بازار کرده اند. همین موارد باعث رشد کلی بازار در یک ماه اخیر شده است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۴۸,۰۱۴ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش 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 ۷۱۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۸ با ۲۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۲۷	۱۴۰۰/۰۴/۲۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۶۷,۷۷۴	۱۴۸,۰۱۴	۱۱۸٪



گروه‌های مؤثر

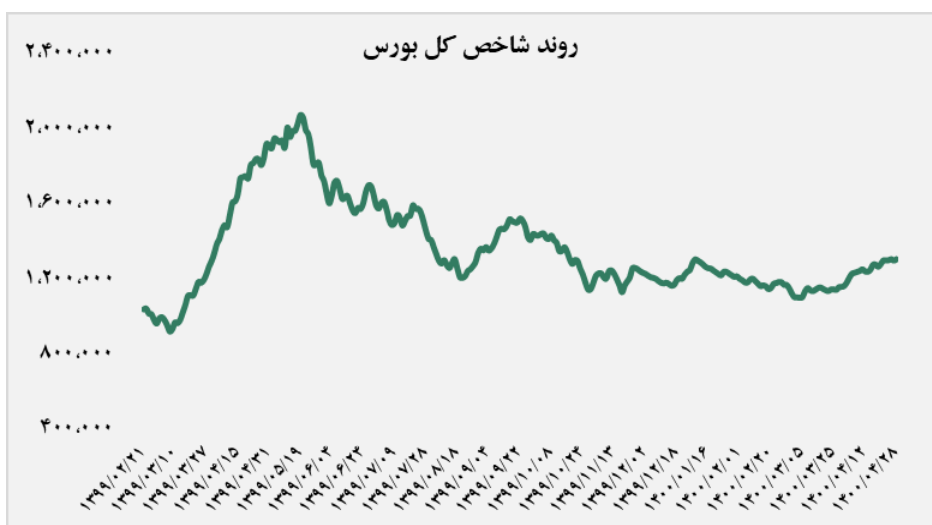
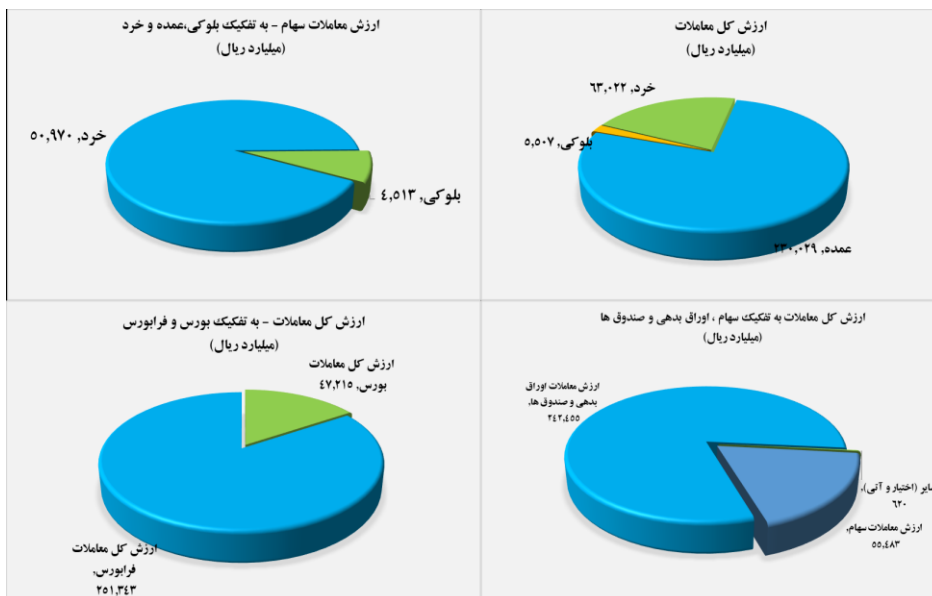
در گروه فلزات اساسی، شرکت ذوب آهن اصفهان که در سه ماهه ۵۶۶ هزار تن تولید داشت، در اردیبهشت ماه تولید ۲۰۰ هزار تنی داشت و در خرداد نیز تولید ۱۶۴ هزار تنی را ثبت کرده است. فروش ذوب در سه ماهه برابر با ۱۹۳ تن با میانگین ماهانه ۱۸۰ هزار تن بود در اردیبهشت فروش ۱۹۳ هزار تنی را گزارش کرد و در خرداد توانست فروش ۱۸۷ هزار تنی داشته باشد. مبلغ فروش این فولادساز در فصل اول برابر با ۷،۵۸۵ میلیارد تومان بود که میانگین ماهانه‌ای برابر با ۲،۵۲۸ میلیارد تومان داشت. ذوب فروش ۲،۵۹۷ میلیارد تومانی را برای اردیبهشت ماه گزارش کرد و در خرداد نیز توانست به مبلغ ۲،۶۷۵ میلیارد تومانی دست یابد. نرخ فروش تیرآهن نسبت به ماه گذشته رشد ۶ درصدی داشته و به ۱۳۴،۵۱۴ ریال/کیلو رسیده و نرخ فروش شمش با ۸ درصد افزایش نسبت به ماه گذشته برابر ۱۲۰،۵۵۴ ریال/کیلو است.

در گروه شیمیایی، شرکت پتروشیمی غدیر در خرداد ماه تولیدی برابر با ۵،۵۹۲ تن گزارش داده است. قابل ذکر است میانگین تولید ماهانه شرکت در سال جاری ۷،۶۰۰ تن است. فروش شرکت در سه ماهه برابر با ۲۴،۰۲۷ تن بوده که در اردیبهشت ماه تولیدی برابر ۸،۶۰۱ تن داشت و در خرداد ماه این مقدار ۷،۶۳۱ گزارش شده است. نرخ فروش PVC نسبت به ماه گذشته ۱۰ درصد کاهش داشته و برابر با ۳۰۷،۲۶۷ ریال/کیلو است و شرکت توانسته در خرداد فروش ۲۳۴ میلیارد تومانی را گزارش کند. فروش شرکت در فصل اول مبلغ ۷۸۷ میلیارد تومان بوده است.

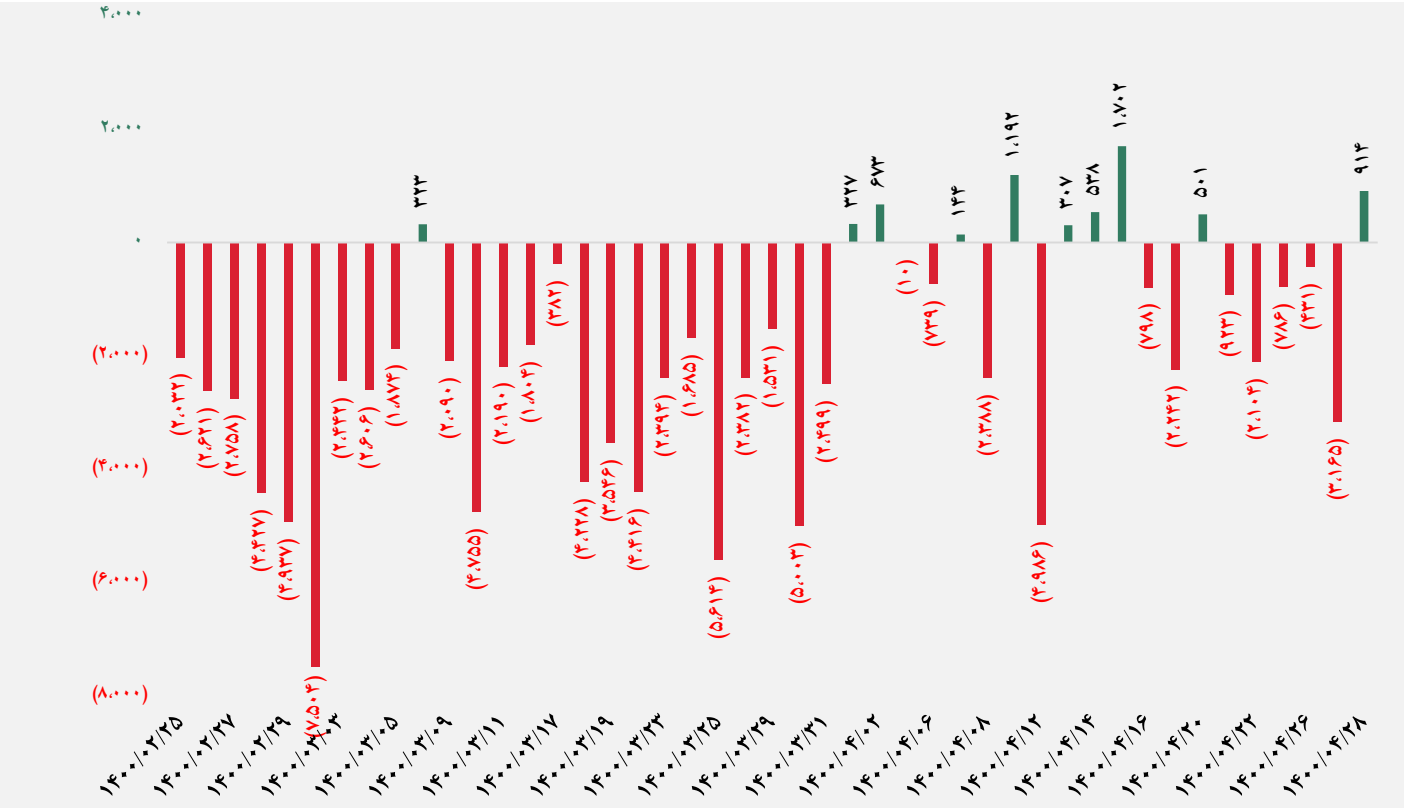
در همین گروه، شرکت صنایع شیمیایی فارس سال مالی شرکت منتهی به شهریور دارد. میانگین تولید ماهانه‌ی پودر و مایعات البسه در سال مالی ۳،۵۱۱،۹۹ تن بوده است. تولید خرداد ۳،۶۷۹ تن گزارش شده و میانگین تولید ۹ ماهه به ۲،۸۳۸ تن رسیده است. فروش پودر و مایعات البسه در خرداد ۳،۶۷۹ تن گزارش شده است. میانگین فروش سال مالی ۴،۳۳۷،۹۹ تن بوده و میانگین فروش ۹ ماهه سال مالی ۱۴۰۰ به ۳،۷۰۸ تن رسیده است. شرکت در خرداد فروش ۵۶ میلیارد تومانی را گزارش کرده است. فروش ۹ ماهه سال جاری به ۵۰۹ میلیارد تومان رسیده، فروش ۹ ماه سال مالی ۳۶۰،۹۹ میلیارد تومان بوده است. میانگین نرخ فروش پودر و مایعات البسه در سال مالی ۸۲،۸۹۷،۹۹ ریال بوده، در خرداد فروش شرکت با نرخ ۱۱۷،۰۶۰ ریال و در اردیبهشت با ۱۲۸،۳۹۶ ریال انجام شده است.

تصویر کلی بازار

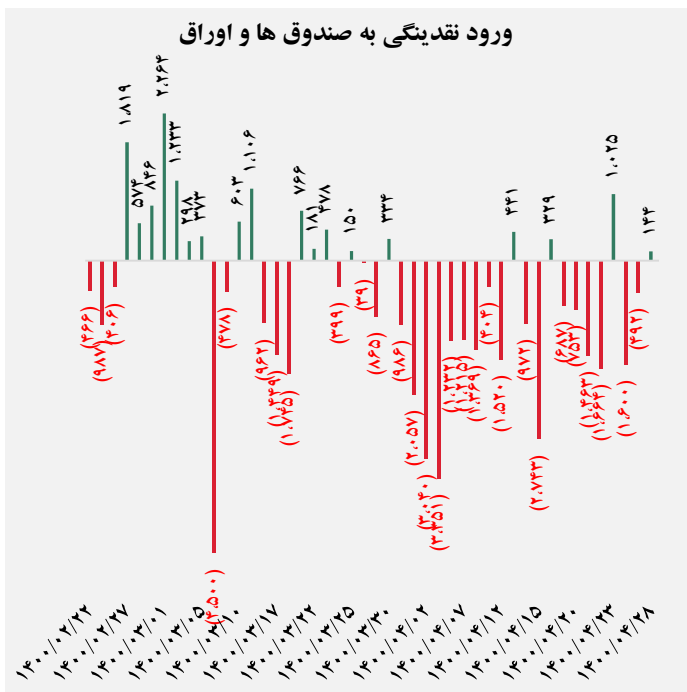
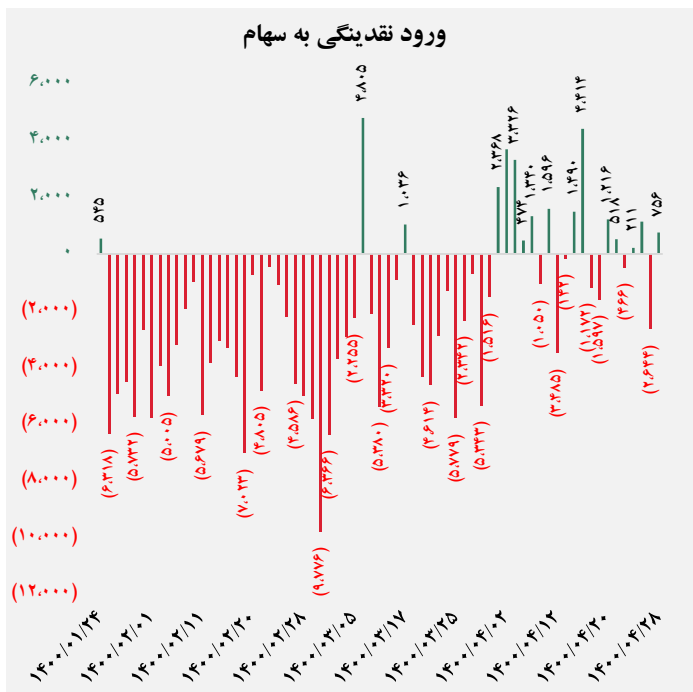
فرا بورس		بورس	
۱۹,۰۴۹	شاخص کل	۱,۳۱۱,۲۷۷	شاخص کل
۲۰۳	تغییر شاخص	۸,۴۲۰	تغییر شاخص
۱۰,۵۳۲,۲۲۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۳,۴۰۸,۸۸۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۵۱,۳۴۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۷,۲۱۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
	بیاس		تاپیکو
	آریا		رمپنا
	زاگرس		فارس
	صبا		کچاد
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
	وملل		ویپارس
	دی		فایرا
	بنو		وسگلستا
	مادیرا		خسپا



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



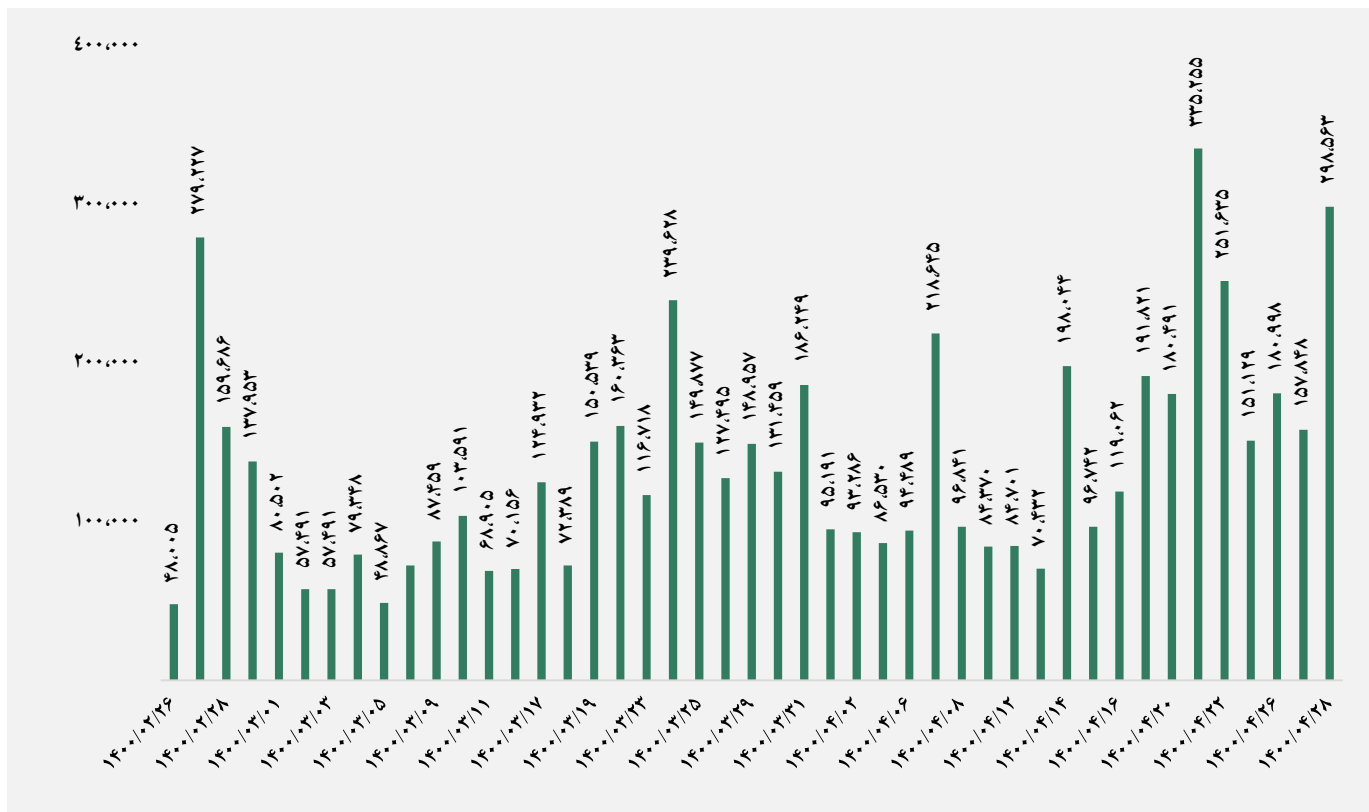
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



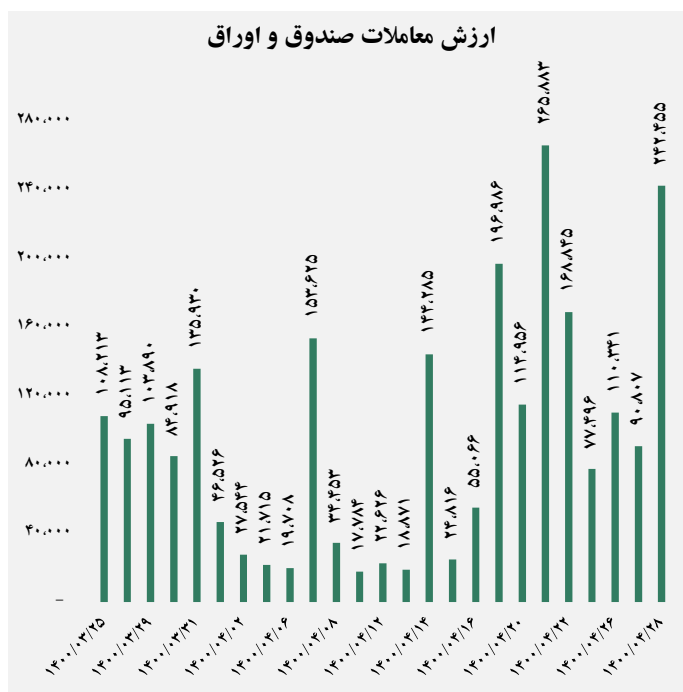
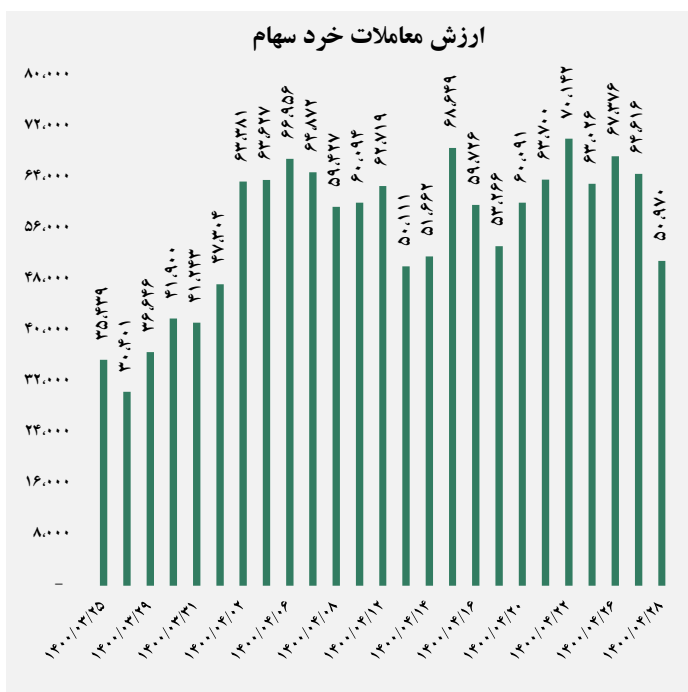
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



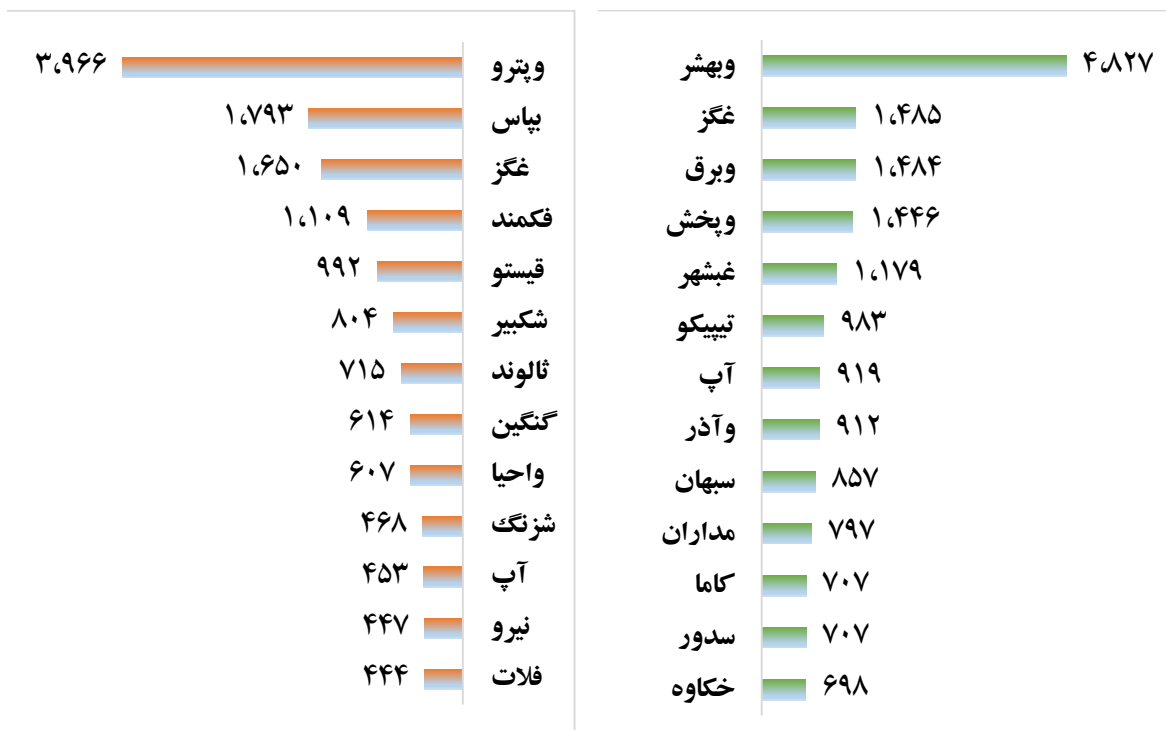
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



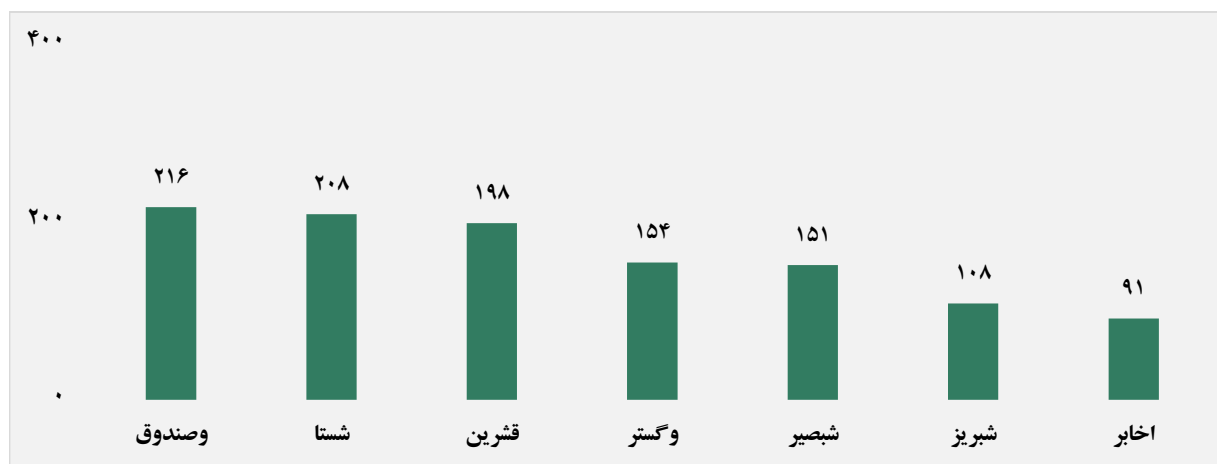
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



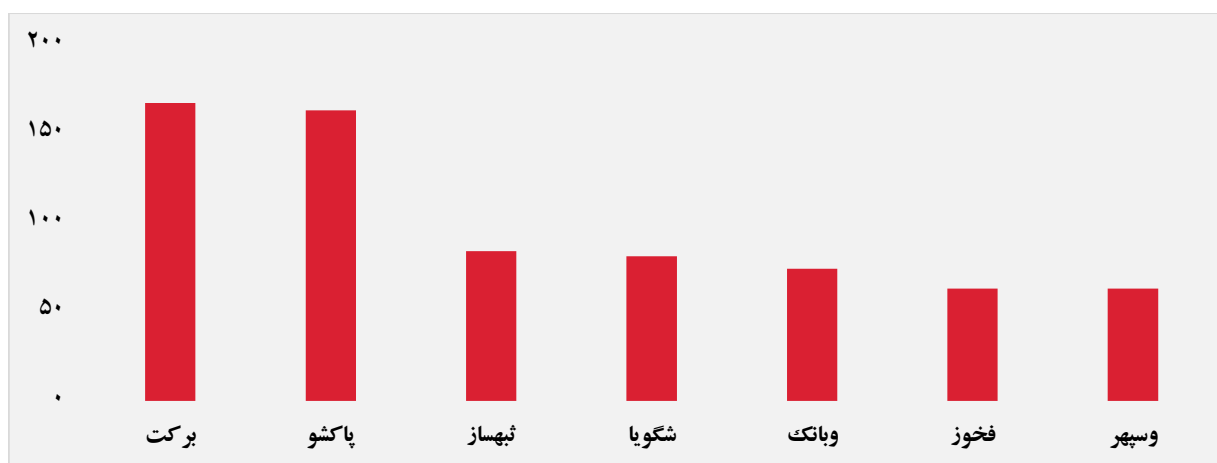
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	لطیف	۱	تابا
۲	چخزر	۲	ومشان
۳	کماسه	۳	ولانا
۴	لخزر	۴	کفرآور
۵	فگستر	۵	وگستر
۶	قشرین	۶	بالاس
۷	کلوند	۷	تکنار
۸	غشوکو	۸	پدرخش
۹	کمینا	۹	ساینا
۱۰	شپارس	۱۰	قعجام

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



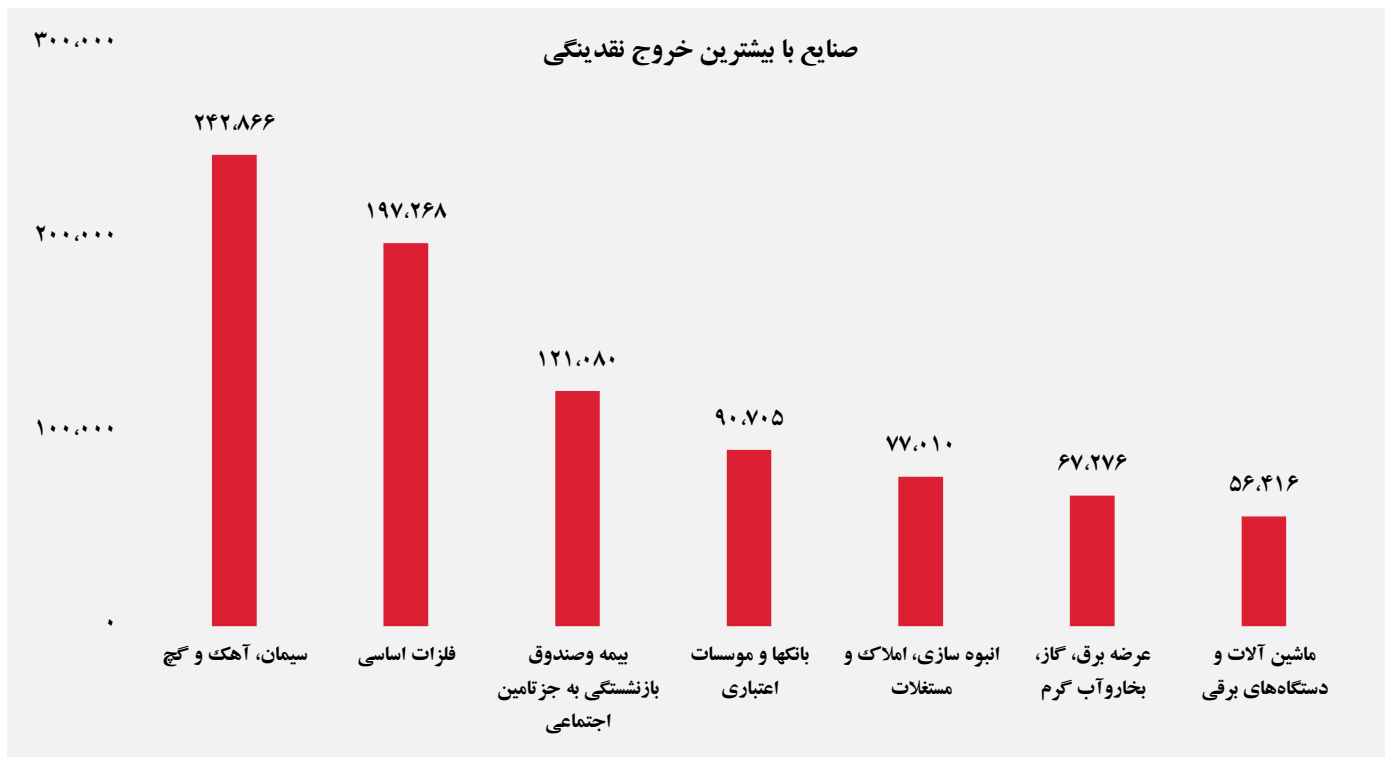
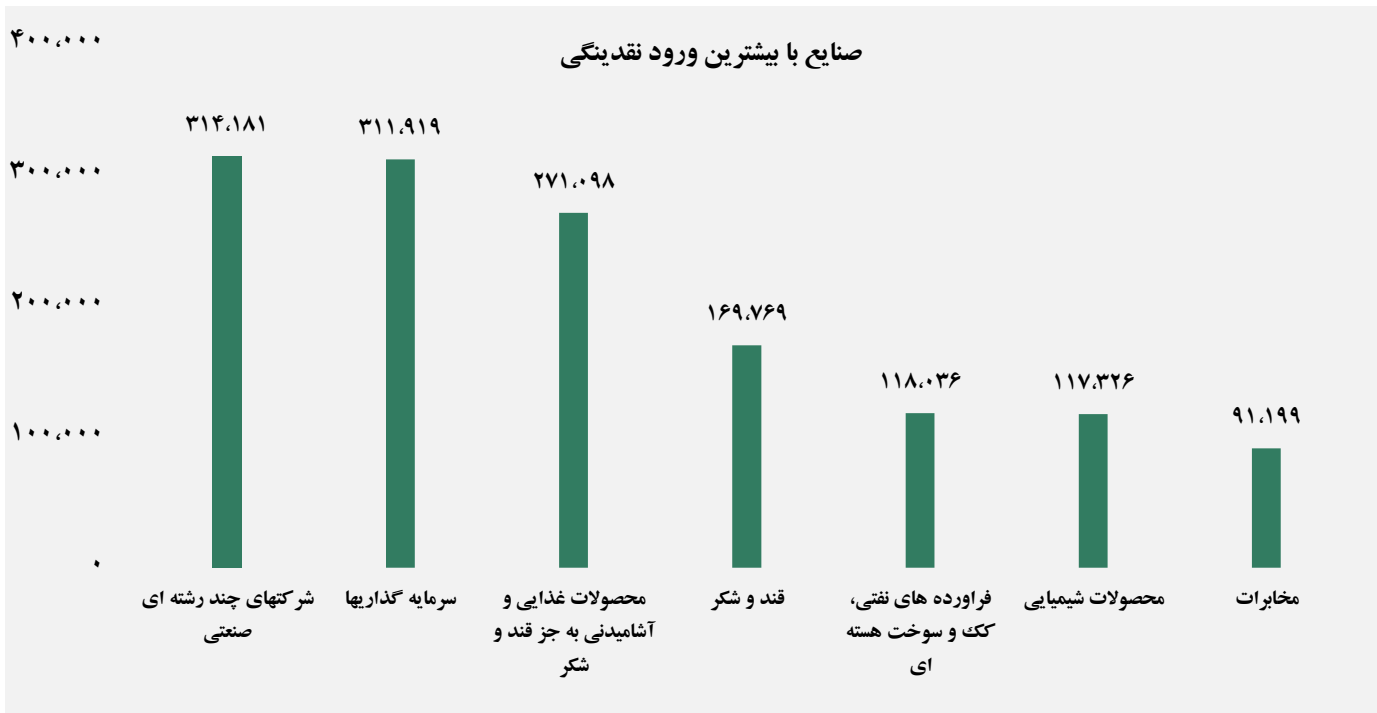
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	غکورش
۲	آپ	۱۱	میهن
۳	سصوفی	۱۲	شغدیر
۴	سپاها	۱۳	غفارس
۵	بورس	۱۴	خوساز
۶	ثنوسا	۱۵	تاپکیش
۷	گشان	۱۶	سمازن
۸	سفارس	۱۷	ولکار
۹	سیلام	۱۸	ساراب

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار