



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۰۴

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۴ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای کگل، فولاد، کچاد، وامید، ومعادن و شپدیس با افزایش ۱۲,۱۱۳ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۲۳,۴۲۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۰۳ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۲ 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 ۲۶ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

ناامیدی معامله‌گران از احیای توافق هسته‌ای در دولت دوازدهم مهم‌ترین عاملی بوده که جهت انتظارات معامله‌گران بازار ارز را در روزهای اخیر تحت تاثیر قرار داده است. علاوه بر این، اخباری شنیده می‌شود که در صورت خروج ایران از مذاکرات هسته‌ای، آمریکا تحریم‌های جدیدی را علیه صنعت نفت ایران اعمال خواهد کرد. این موضوعات باعث رشد مجدد دلار شده است. همچنین در یک ماه گذشته نرخ دلار بعد از لمس قیمت‌های حوالی ۲۵,۵۰۰ تومان شروع به اصلاح کرد و تا ۲۴ هزار تومان نیز کاهش داشت اما در دو روز اخیر با توجه به موارد ذکر شده در بالا، مجدد به مدار صعودی برگشته است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۲۷,۳۵۸ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش 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 ۴، تاریخ سررسید ۱۴۰۳/۰۵/۲۲ با ۲۲,۲٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۴/۲۸	۱۴۰۰/۰۵/۰۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۴۸,۰۱۴	۱۲۷,۳۵۸	-۱۴٪



گروه‌های مؤثر

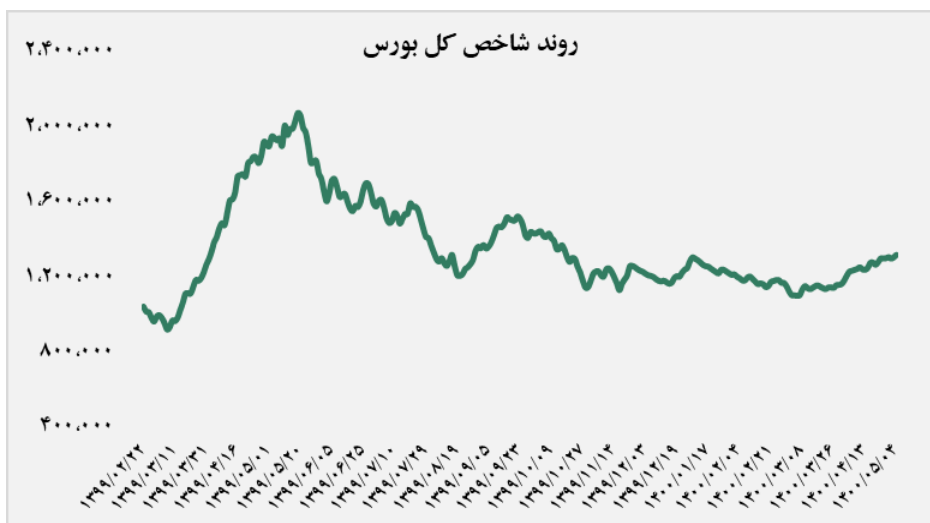
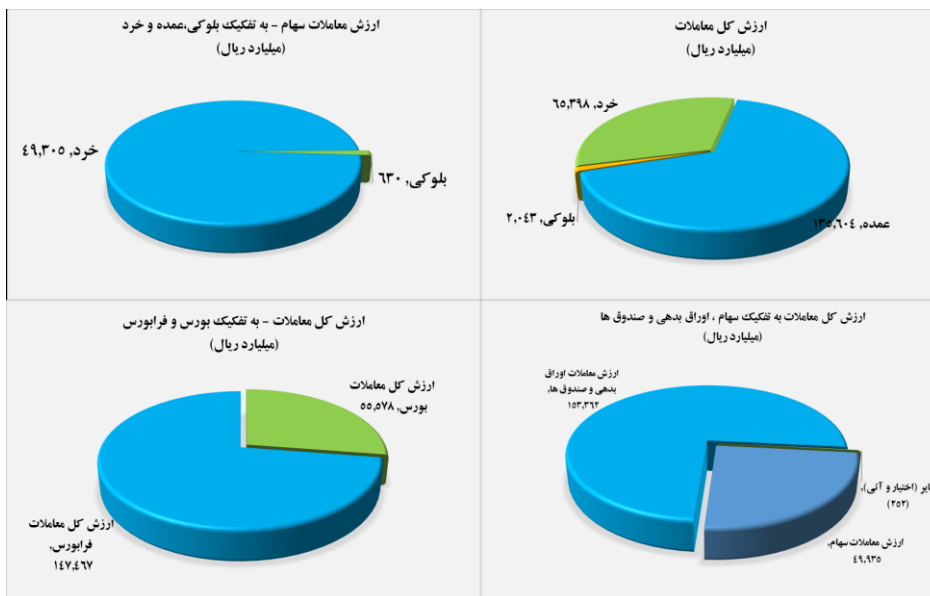
در گروه شیمیایی، پتروشیمی پردیس در سال مالی گذشته هر ماه ۱۴۳ هزار تن به طور متوسط آمونیاک تولید کرده است. در فصل اول تا سوم سال مالی ۱۴۰۰ متوسط تولید ماهانه بر اعداد ۱۷۵، ۱۶۱ و ۱۸۴ هزار تن استوار است. مقدار فروش اوره داخلی شرکت در خرداد ماه ۴۵ هزار تن (میانگین دوازده ماه گذشته ۹۲ هزار تن)، اوره صادراتی ۲۰۵ هزار تن (میانگین ۹ ماه ابتدایی برابر ۱۷۸ هزار تن) بوده است. متوسط فروش سال مالی گذشته برابر ۶۵۹ میلیارد تومان بوده است که در سال جاری با رشد خیره کننده ۱۲۶ درصدی به ۱,۵۰۰ میلیارد تومان رسیده است. در سه ماه اخیر نیز به ترتیب از فروردین ۱,۶۰۰، ۱,۴۵۰ و ۱,۵۵۰ میلیارد تومان فروش دارد. نرخ اوره صادراتی به صورت ریالی ۵ درصد کمتر از ماه قبل و احتمالاً حدود ۲۸۳ دلار به فروش رسیده است. نرخ داخلی اوره ۴,۶۰۰ تومان به ازای هر کیلو است.

در گروه کاشی و سرامیک، شرکت کاشی پارس که در فروردین و اردیبهشت ۱۰ و ۳۱ میلیارد تومان فروش داشت. در خرداد ماه فروش ۳۵ میلیارد تومانی را داشته است. این شرکت در خرداد ماه ۳۸۳ هزار متر مربع انواع کاشی فروخت. مقدار فروش کل که در فروردین و اردیبهشت برابر با ۱۱۵ و ۴۱۴ هزار متر مربع انواع کاشی بود. مقدار تولید شرکت نیز به صورت متوسط در هر ماه ۳۷۷ هزار متر مربع است و این عدد را در خرداد ماه ۳۷۹ هزار متر مربع ثبت کرده است. نرخ فروش کاشی دیوار در خرداد ماه ۸۰ هزار تومان بر متر مربع بوده است. نرخ ماه گذشته ۶۹ هزار تومان بوده است.

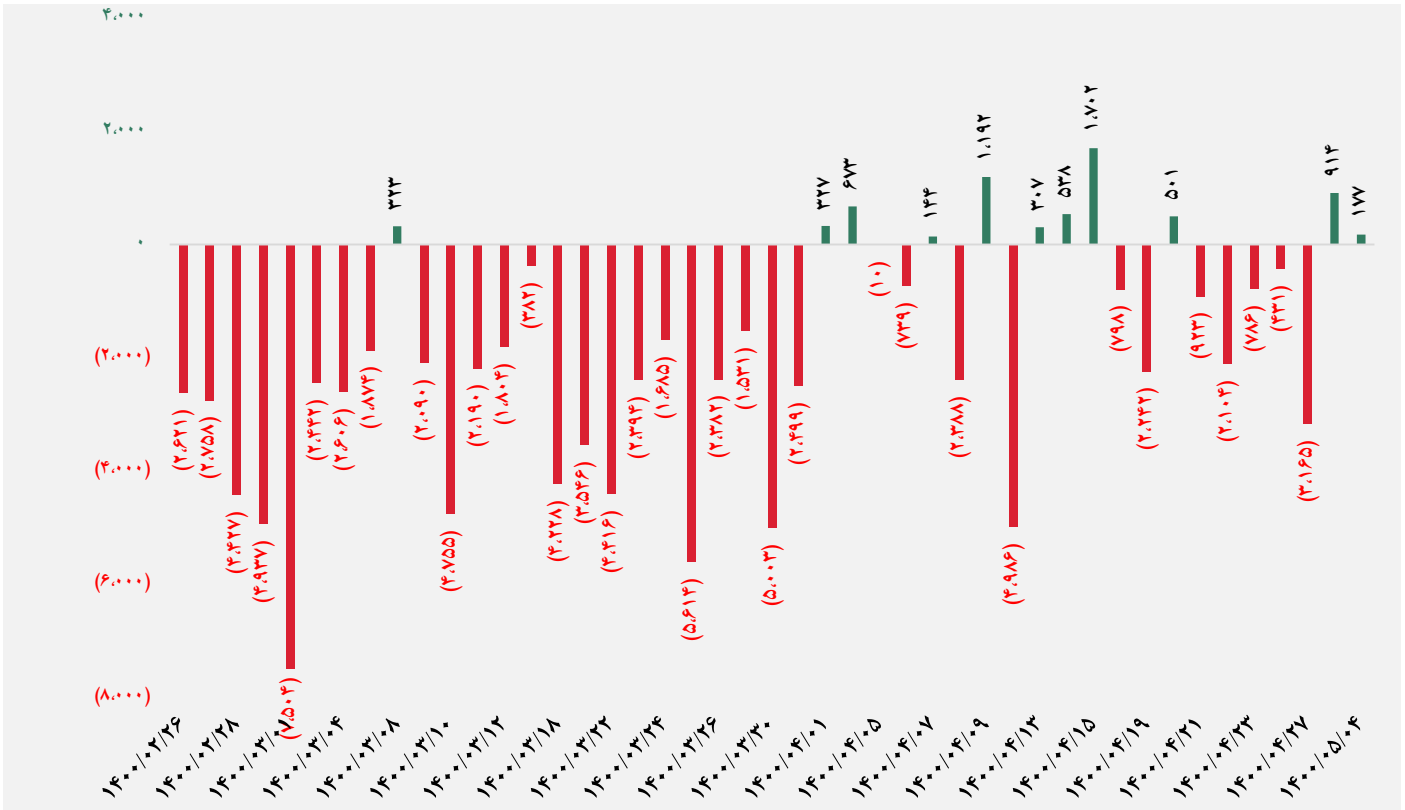
در گروه شیمیایی، شرکت دوده صنعتی پارس در سال ۹۹ و ۹۸ به طور متوسط هر ماه ۲,۱۱۲ و ۲,۱۸۷ تن دوده تولید داشت. در فروردین ۲,۰۵۷ تن تولید کرده بود و در اردیبهشت تولید بسیار خوب ۳,۱۷۰ تنی را داشته است. در خرداد تولید ۲,۴۲۶ تنی را گزارش کرده و ۲,۴۲۰ تن محصول نیز فروخته است. در فروردین و اردیبهشت ۲,۰۷۴ و ۳,۰۵۵ تن فروش داشت. در دوازده ماه گذشته به طور متوسط ۲,۲۲۶ تن فروش داشته است. شرکت در فروردین فروش ۴۶ میلیارد تومانی و در اردیبهشت فروش ۷۰ میلیارد تومانی را گزارش کرد. در خرداد ماه فروش خوب ۵۶ میلیارد تومانی را بدست آورده است. فروش سال ۹۹ برابر ۳۳۸ و سال ۹۸ برابر ۲۶۴ میلیارد تومان بوده است. نرخ فروش در خرداد ماه ۲۲۹,۳۶۴ ریال/کیلو بوده که تقریباً برابر با نرخ فروش در اردیبهشت ماه است.

تصویر کلی بازار

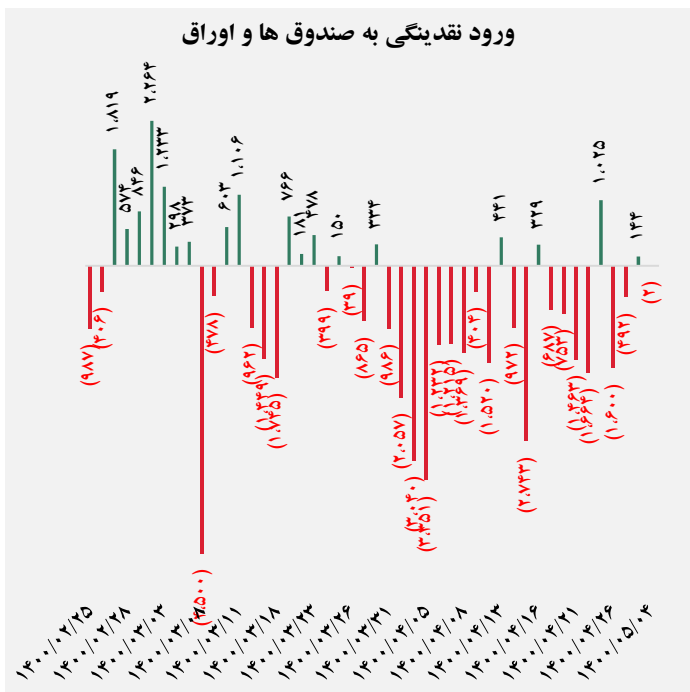
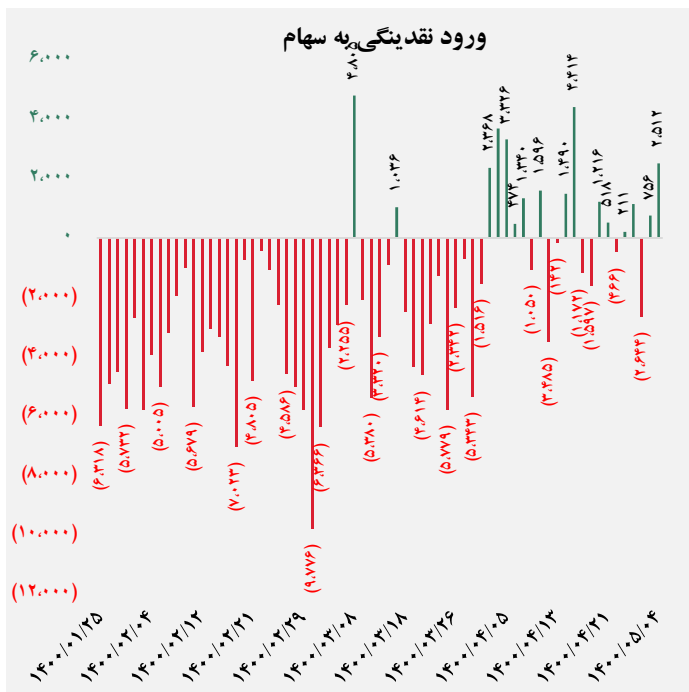
فرا بورس		بورس	
۱۹,۳۶۷	شاخص کل	۱,۳۲۳,۴۲۰	شاخص کل
۲۱۸	تغییر شاخص	۱۲,۱۱۳	تغییر شاخص
۱۰,۶۵۲,۷۲۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۳,۷۶۷,۹۶۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۴۷,۴۶۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۵,۵۷۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
بیاس		گگل	
زاگرس		فولاد	
گگهر		کچاد	
مارون		وامید	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
غصینو		وسر ضوی	
صبا		شستا	
قجارج		تاپیکو	
کوثر		کاوه	



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

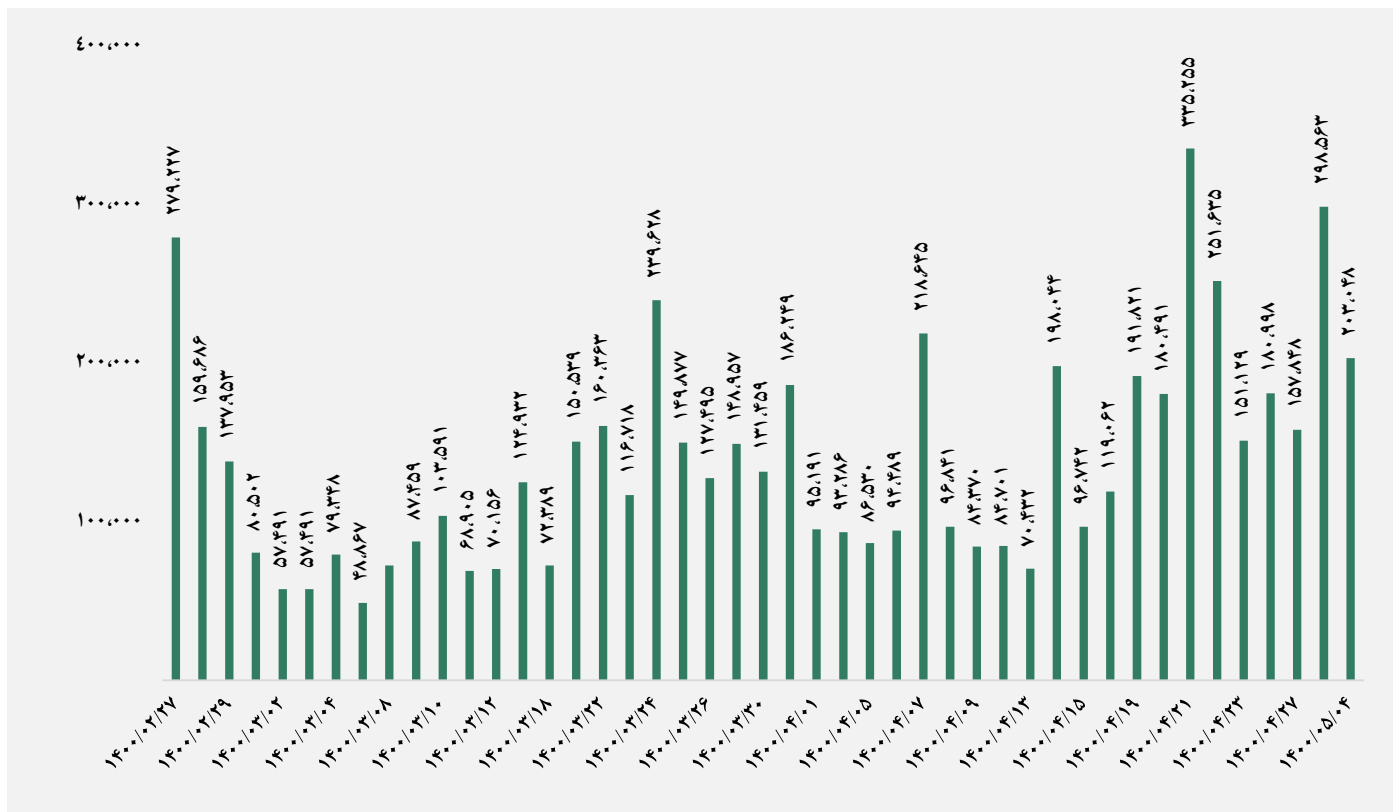


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

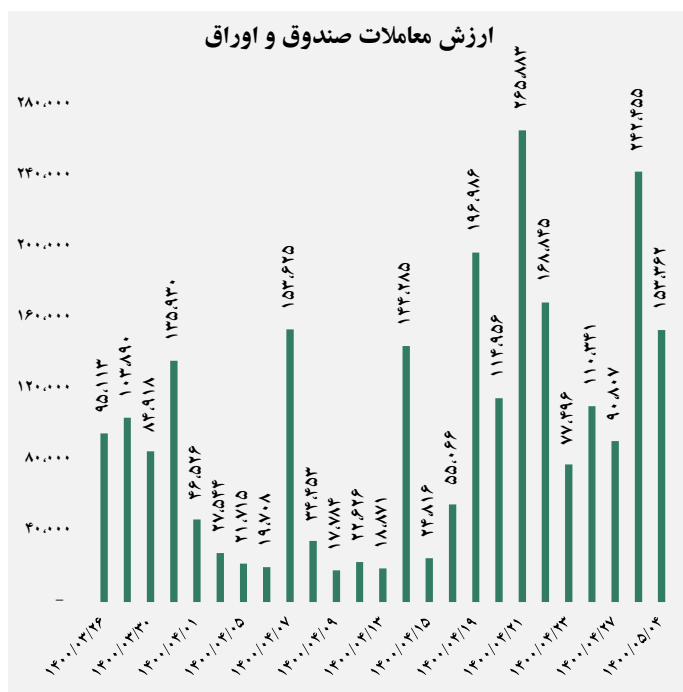
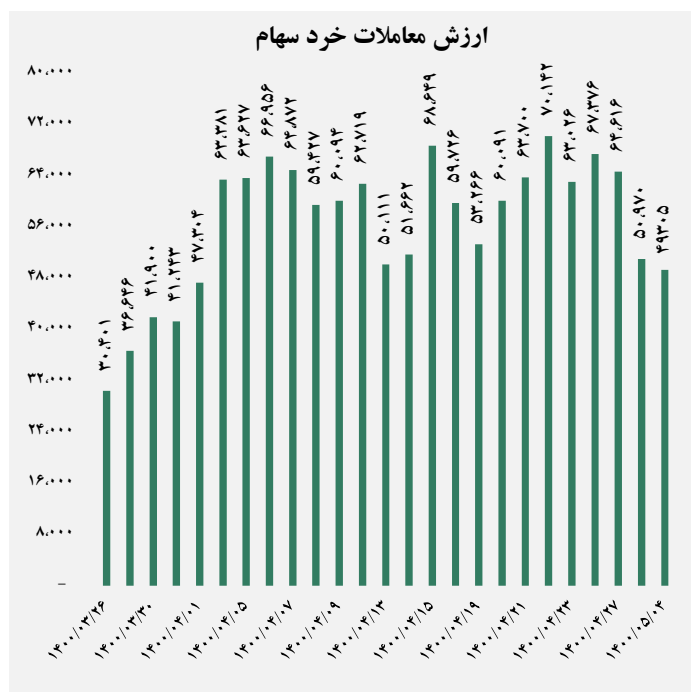


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

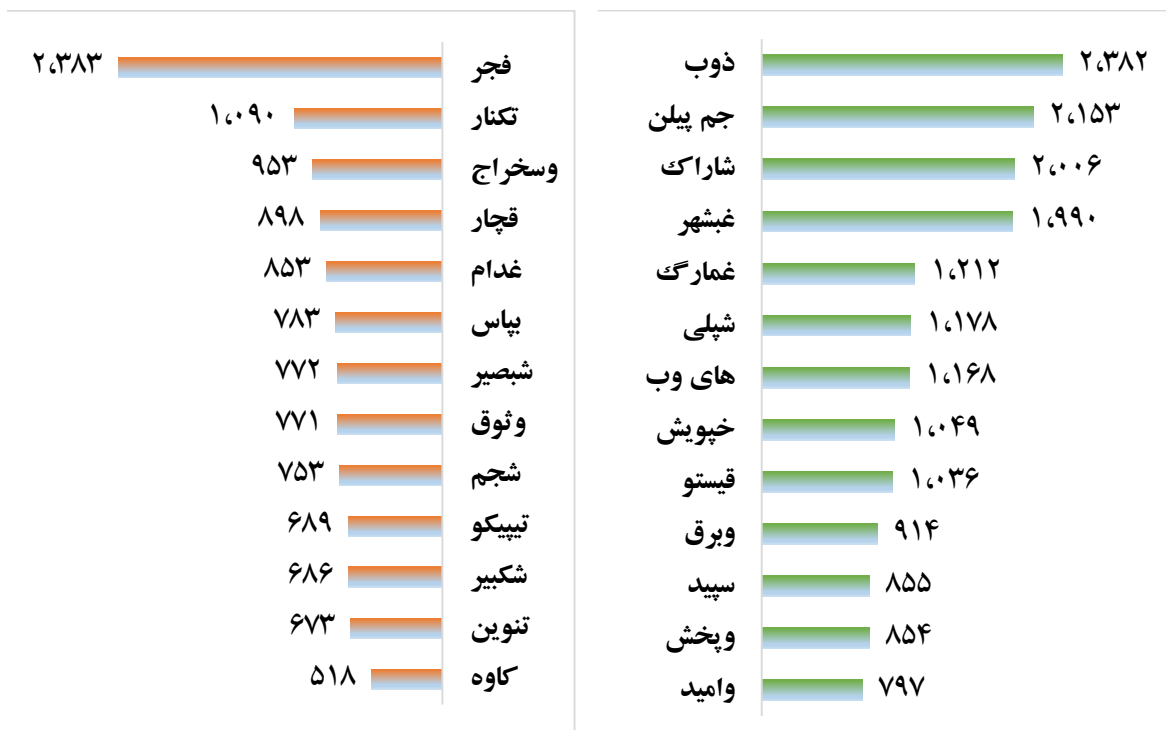


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





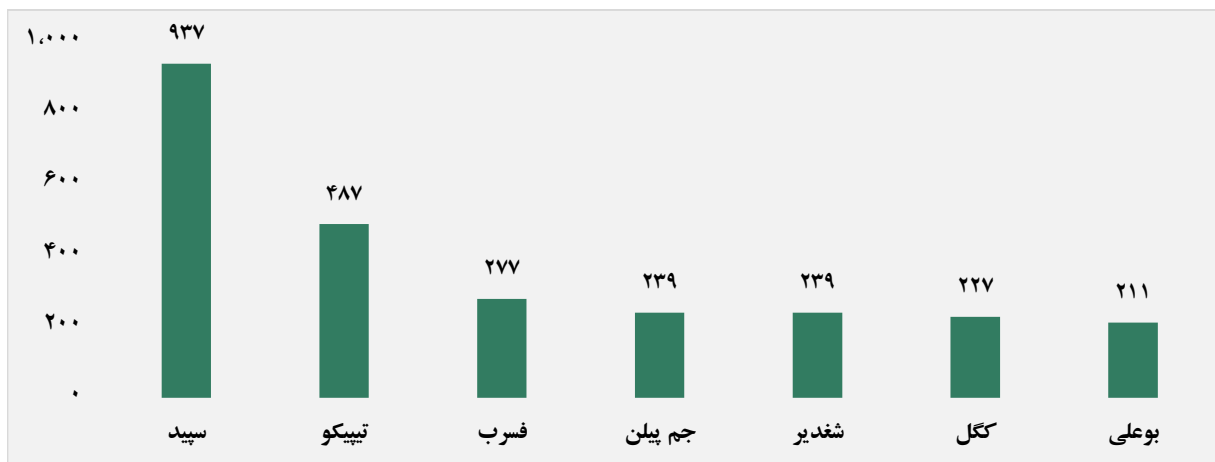
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



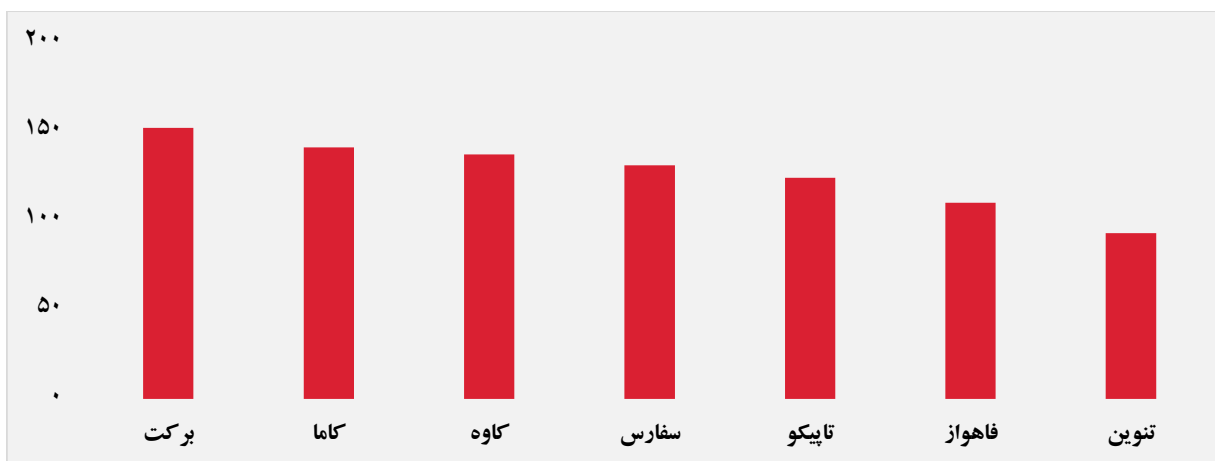
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	چخزر	۱	شزنگ
۲	سپید	۲	ثاصفا
۳	غگیلا	۳	وآذر
۴	تکشا	۴	سخاش
۵	غگورش	۵	سپهان
۶	قشرین	۶	مداران
۷	پیزد	۷	قنیشا
۸	بموتو	۸	سدور
۹	بوعلی	۹	چپارسا
۱۰	جم پیلن	۱۰	فنورد

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

نماد	ردیف	نماد	ردیف
تاپکیش	۱۰	سپید	۱
کاما	۱۱	شغدیر	۲
تپیکو	۱۲	غکورش	۳
سیمرخ	۱۳	ویپرو	۴
سصوفی	۱۴	برکت	۵
ولکار	۱۵	زاگرس	۶
غفارس	۱۶	بوعلی	۷
کالا	۱۷	شپاکسا	۸
شپدیس	۱۸	جم پیلن	۹

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

