



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۰۵

[www.sfg.ir](http://www.sfg.ir) - [info@sfg.i](mailto:info@sfg.i)



## تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۵ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای کگل، فولاد، شستا، شینا، شتران و تاپیکو با کاهش ۸,۴۰۱ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۱۴,۹۵۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۴۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۶ 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 ۳۰ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. در روز جاری فشار فروش بیشتری را در بازار سهام نسبت به روز گذشته شاهد بودیم. بسیاری از نمادها نیز بعد از مجمع عادی سالیانه با کاهش قیمتی بیش از ۵ درصد به تابلوی معاملاتی بورس و فرابورس بازگشته‌اند. در یک ماه اخیر بسیاری از نمادها با رشد بیش از ۲۰ درصدی همراه بوده‌اند و به نظر می‌رسد این کاهش در قیمت سهام با توجه به رشد اخیر در کنار تغییر در کابینه دولت، مقطعی باشد و از اواسط هفته آینده، بازار سهام مجدد به روند صعودی خود برگردد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۶۶,۱۸۳ میلیارد ریال می‌باشد 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 ۲۱,۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۰۴	۱۴۰۰/۰۵/۰۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۲۷,۳۵۸	۶۶,۱۸۳	-۴۸٪



## گروه‌های مؤثر

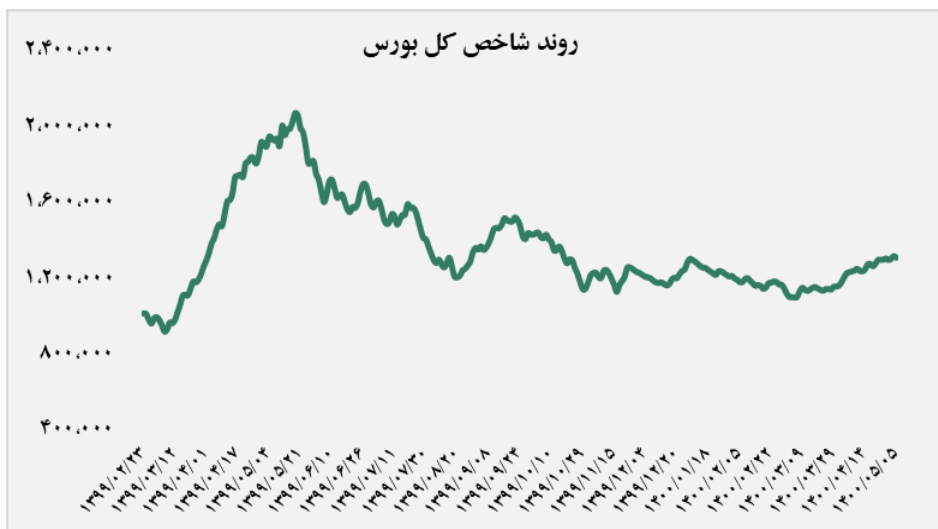
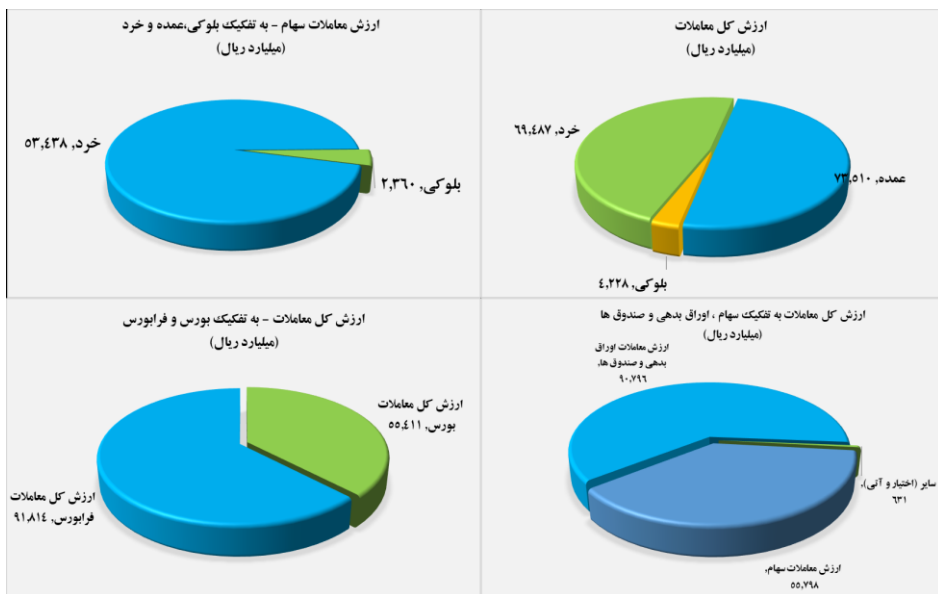
در گروه شیمیایی، متوسط تولید اتیلن و سی تری پلاس پتروشیمی آریا ساسول در سال مالی ۹۹ برابر ۹۳ هزار تن بوده است که این عدد در چهار ماهه سال جاری برابر ۹۲ هزار تن برای هر ماه است. متوسط فروش ماهانه سال ۹۹ آریا ۹۲ هزار تن انواع محصول بوده است که سهم صادرات ۵۸ هزار تن ثبت شده است. در سه ماهه به طور متوسط برای هر ماه فروش ۷۷ هزار تنی را داشت که در تیرماه عدد عالی ۱۲۰ هزار تنی را گزارش کرده است. آریاساسول در نیمه ابتدایی سال ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۱,۰۰۰ میلیارد تومان فروش زده بود که در نیمه دوم به متوسط ماهانه ۲,۰۰۰ میلیارد تومان رسیده بود. در فروردین و اردیبهشت هم مبلغ فروش شرکت بر عدد ۱,۷۵۴ و ۱,۶۲۶ میلیارد تومان استوار است، خرداد خیلی خاص نبود و ۱,۴۳۳ میلیارد تومانی را داشت و در تیر رکورد فروش ۲,۵۵۰ میلیارد تومانی را دارد. متوسط نرخ پلی اتیلن آریاساسول در سال ۹۹ برابر ۱۹,۳۰۰ تومان برای هر کیلو بوده که در سه ماهه برابر ۲۴,۸۰۰ تومان بوده است که در تیر برابر ۲۲,۸۰۰ تومان است.

در گروه زغال سنگ، شرکت زغال سنگ پروده طبس در تیرماه ۲۹,۲۳۲ تن تولید داشته است. متوسط تولید فصل اول ۳۳,۶۲۶ تن بوده است. متوسط تولید ۱۲ ماه سال مالی گذشته ۵۱,۳۴۷ تن بوده است. بدلیل اورهال تولید شرکت در ماه مورد گزارش افت داشته است. درآمد تیرماه ۱۱۶ میلیارد تومان و فصل اول متوسط فروش ۱۲۷ میلیارد تومان بوده است. متوسط فروش سال قبل ۱۱۹ میلیارد تومان بود. کزغال این ماه فروش با نرخ ۳۷,۳۶۵ ریال به ازای هر کیلو انجام داده است. متوسط نرخ فرودین تا خرداد ۳۳,۷۶۴ ریال بوده است. فروش‌های فروردین تا اسفند ۹۹ به طور متوسط با نرخ ۲۴,۲۳۹ ریال به ازای هر کیلو انجام شده است.

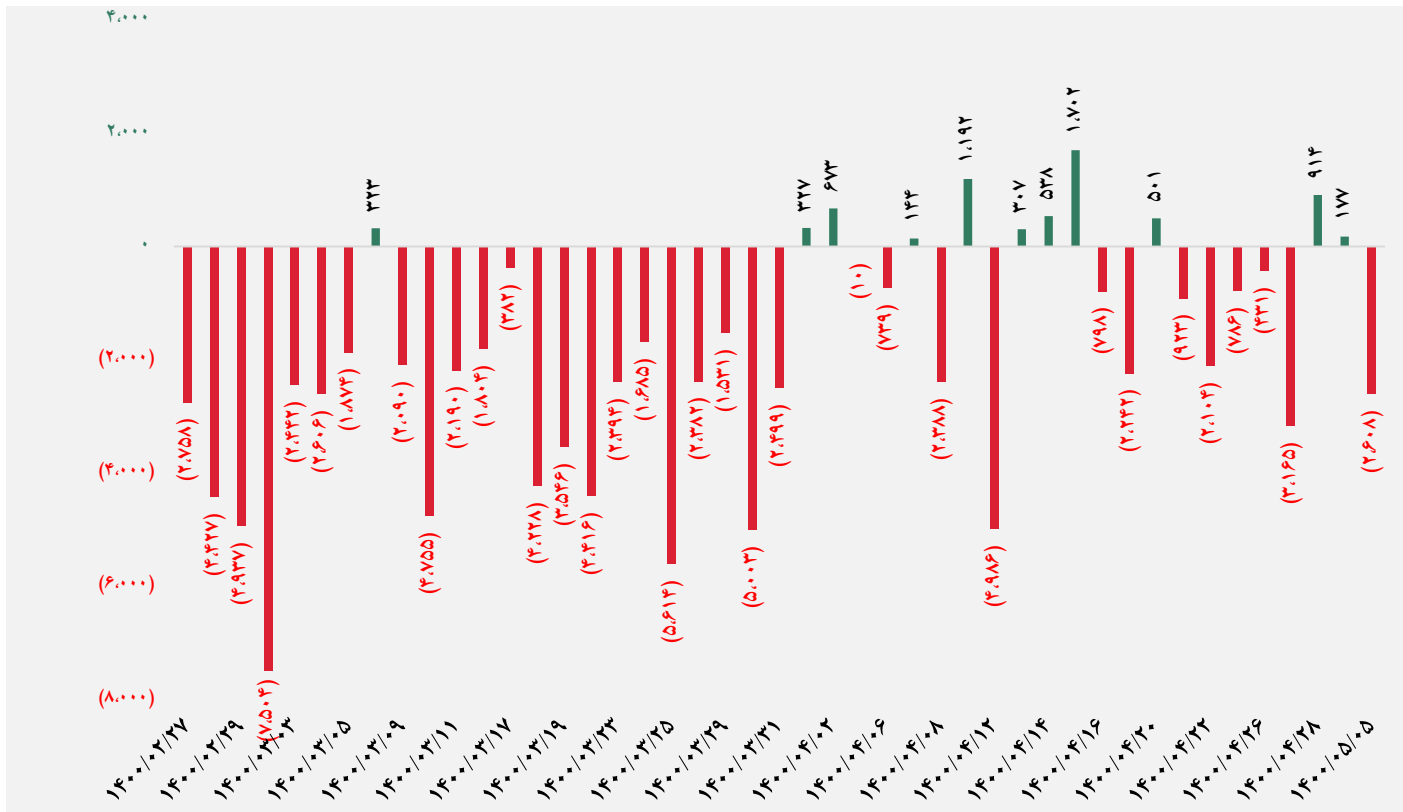
در گروه کاشی و سرامیک، شرکت کاشی پارس در فصل بهار سال جاری در حالی به ازای هر سهم ۱,۵۴۸ ریال سود محقق کرده که این عدد در ۴ فصل گذشته به ترتیب ۳۹۸، ۲۳۳۵، ۳۳۶۵ و ۲,۲۰۷ ریال بوده است. در بهار فروش ۷۶ میلیارد تومانی گزارش کرده که ۱۴ درصد نسبت به فصل قبل افت نشان می‌دهد. فروش کل سال ۹۹ در حدود ۳۰۱ میلیارد تومان بوده است که نسبت به مدت مشابه سال قبل ۱۲۲٪ رشد کرده بود. حاشیه سود ناخالص بهار ۳۵ درصد می‌باشد. در حالیکه در سال ۹۹ حاشیه سود ناخالص فصل بهار ۲۸ درصد بود. شرکت در بهار با حاشیه سود عملیاتی ۳۰٪ به سود عملیاتی ۲۳ میلیارد تومانی رسیده است.

## تصویر کلی بازار

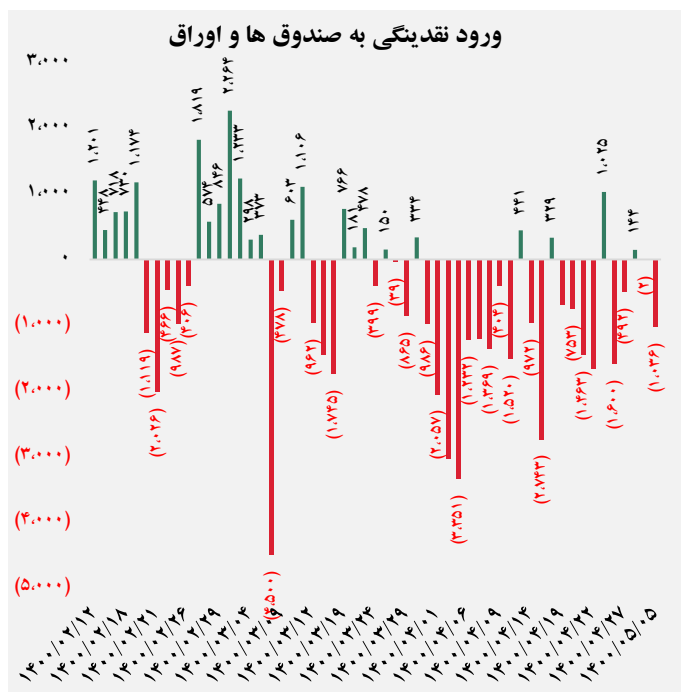
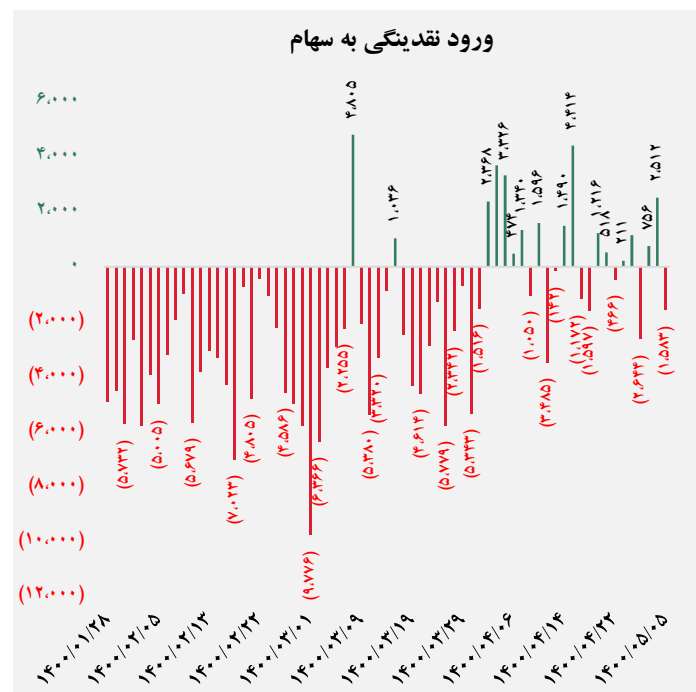
فرا بورس		بورس	
۱۹,۳۱۹	شاخص کل	۱,۳۱۴,۹۵۳	شاخص کل
(۴۸)	تغییر شاخص	(۸,۴۰۱)	تغییر شاخص
۱۰,۶۰۲,۰۶۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۳,۰۷۵,۴۰۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۹۱,۸۱۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۵,۴۱۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
کگل		کگل	
پپاس		کچاد	
ذوب		وامید	
زاگرس		ومعادن	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
هرمز		فولاد	
غصینو		شستا	
سدبیر		شپنا	
شصدف		شتران	



## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)

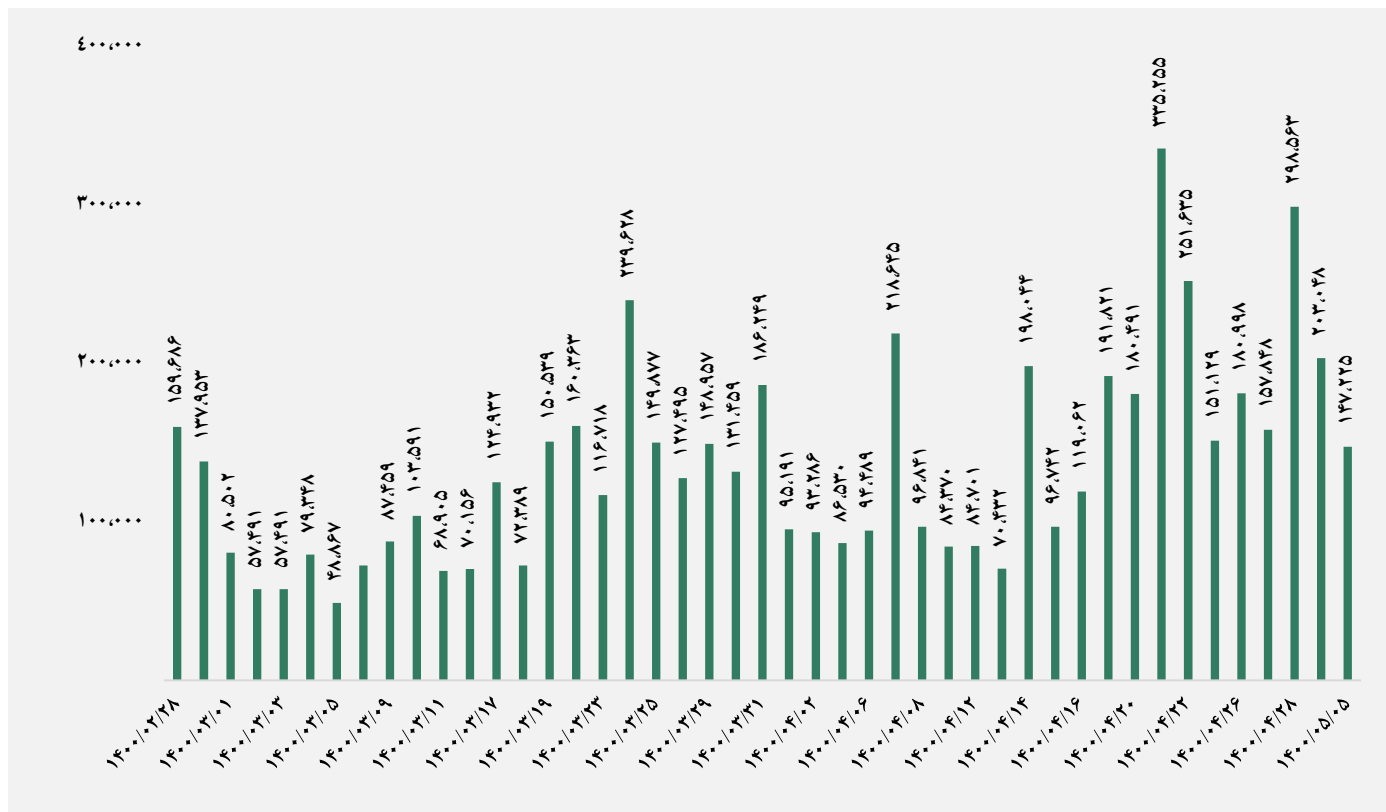


## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)

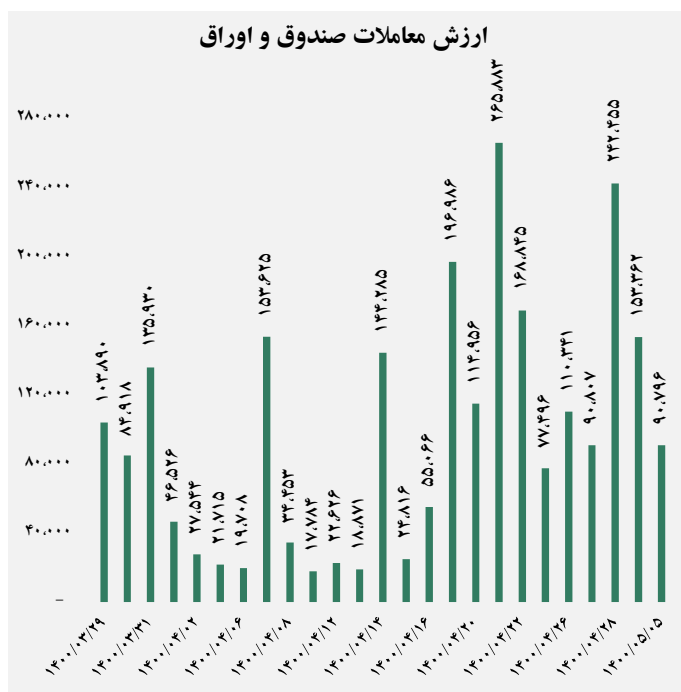
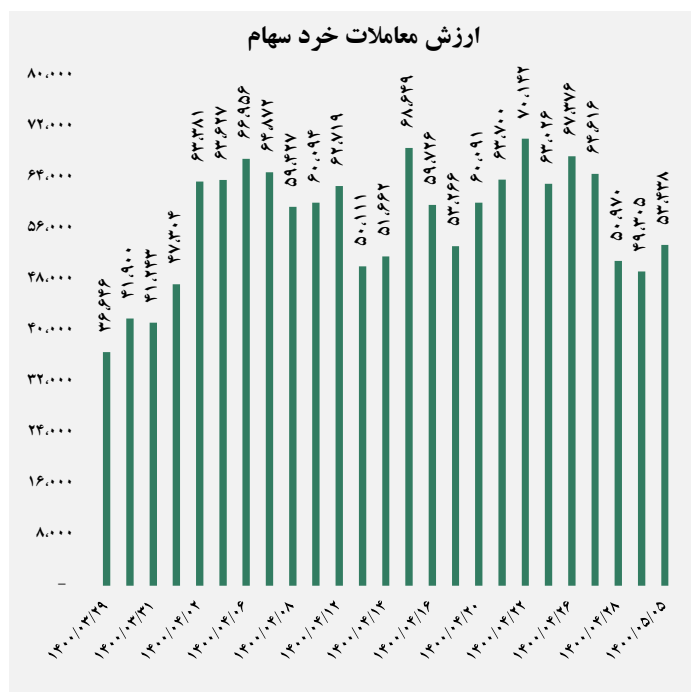


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

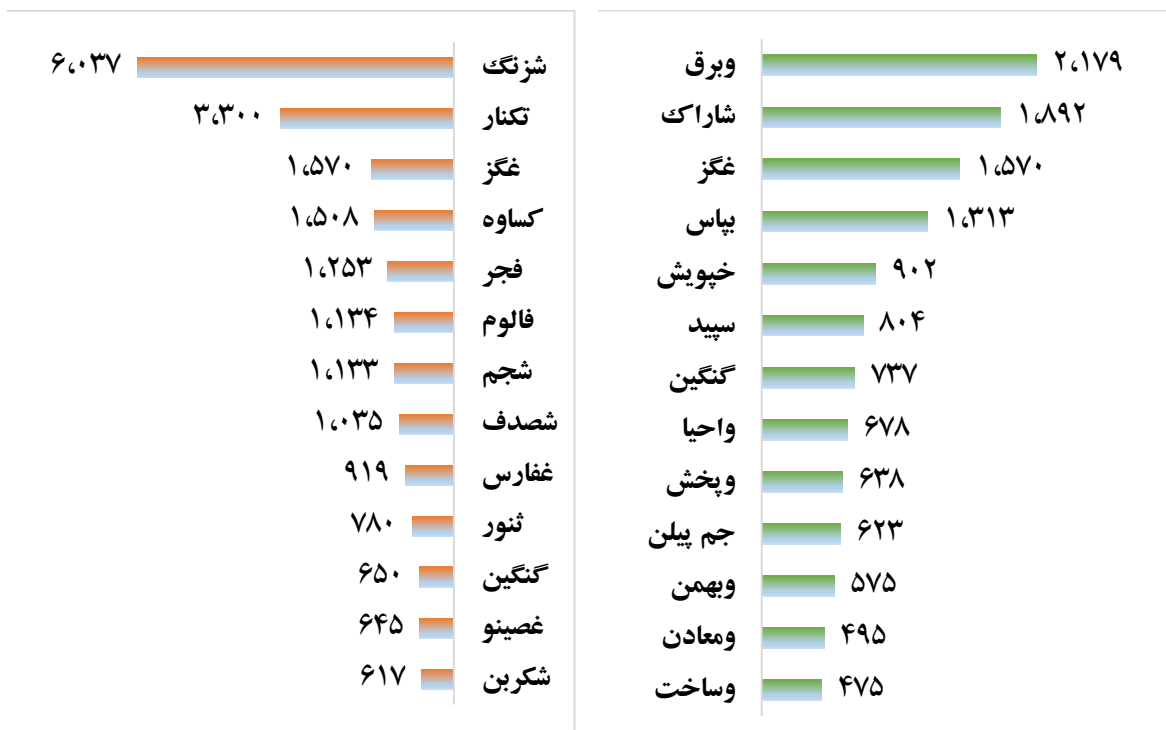


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





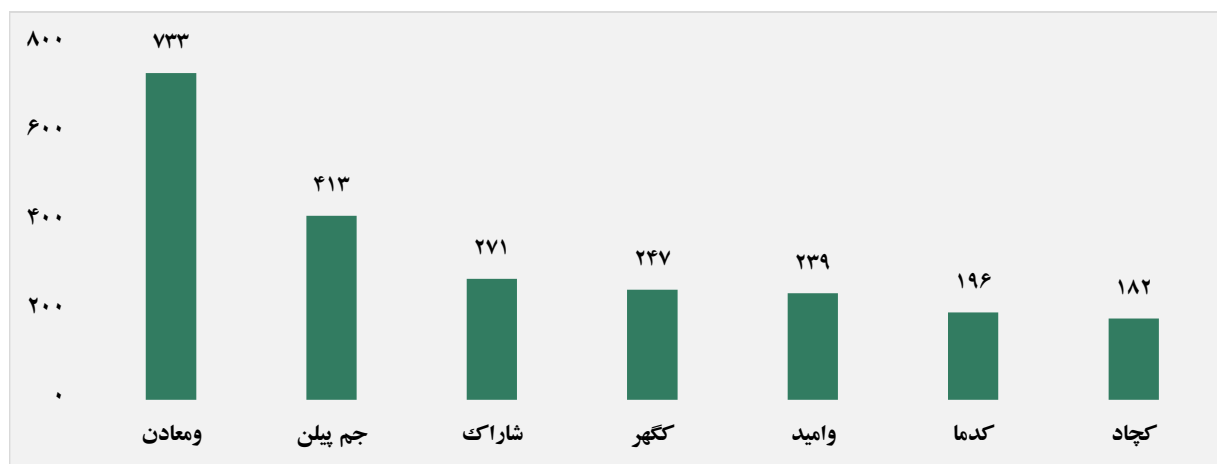
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



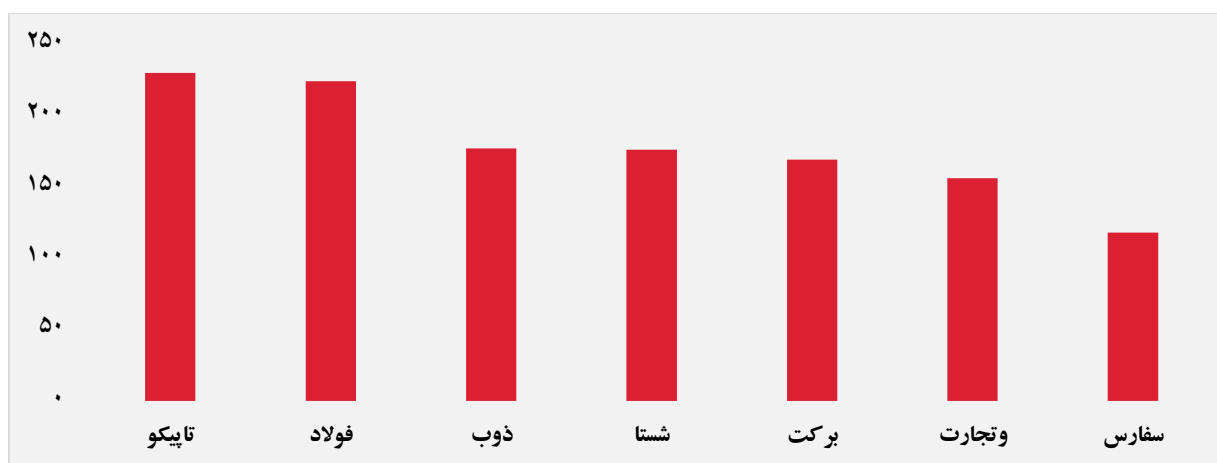
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	زملارد	۱	غمهرا
۲	وئوق	۲	سوخاش
۳	بوعلی	۳	شبصیر
۴	درازک	۴	ثامان
۵	کگاز	۵	خرینگ
۶	غشصفا	۶	غنوش
۷	دفرا	۷	فروی
۸	خپویش	۸	کلوند
۹	شاراک	۹	چپارسا
۱۰	ومعادن	۱۰	خزر

### سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



### سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)

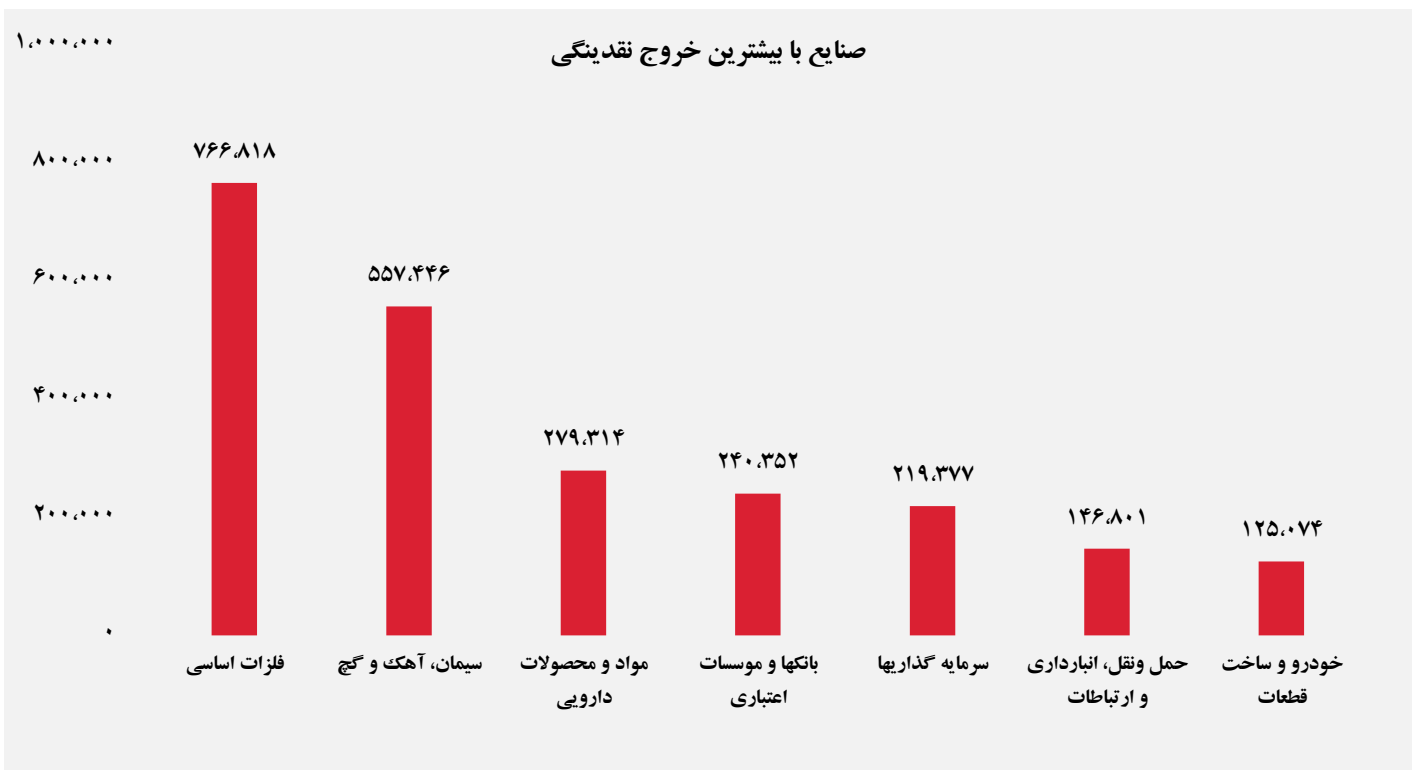
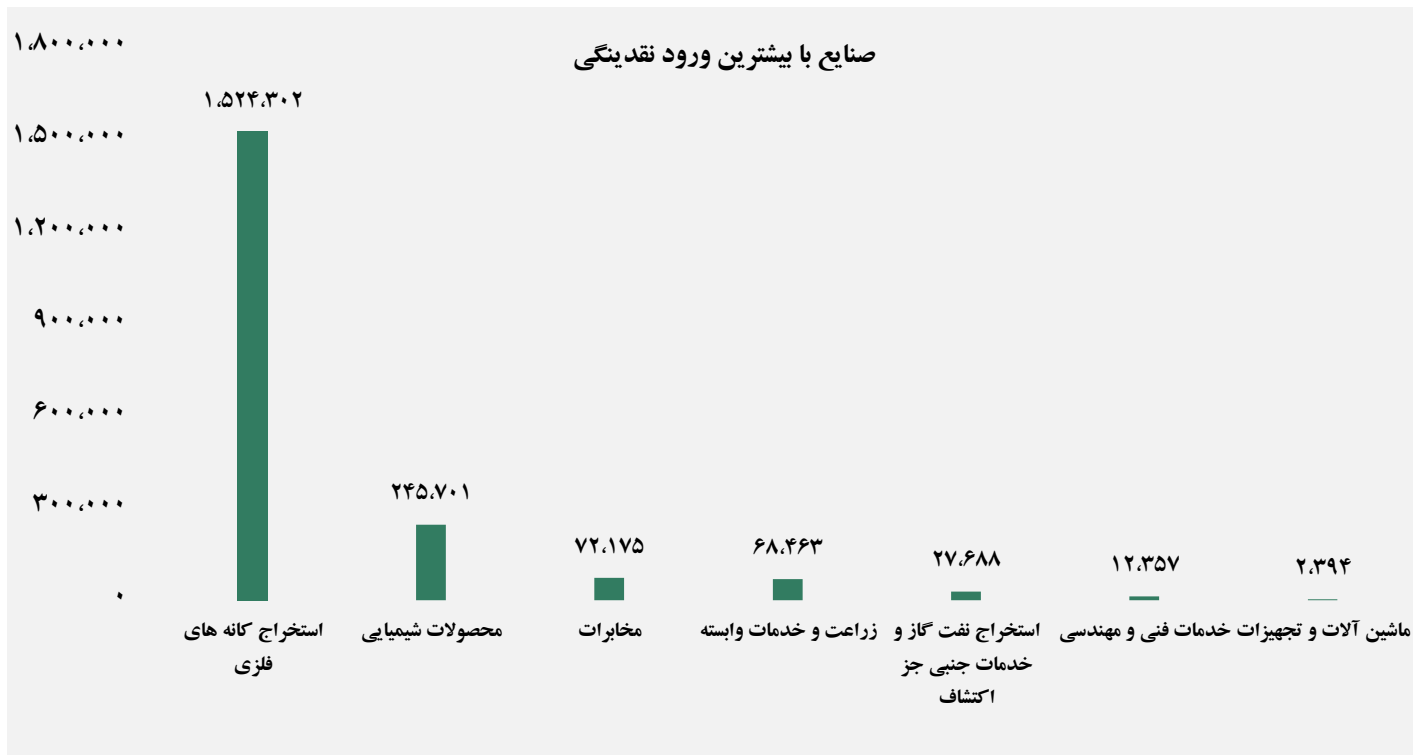


### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	جم پیلن	۱۰	شرانل
۲	شغدیر	۱۱	نوری
۳	شاوان	۱۲	کاما
۴	برکت	۱۳	کبافق
۵	بوعلی	۱۴	سپید
۶	خکاوه	۱۵	زفکا
۷	سیمرخ	۱۶	میهن
۸	غکورش	۱۷	های وب
۹	سصوفی	۱۸	غگل



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار