



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۰۹

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۹ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای میدکو، فملی، فارس، فولاد، کگل و کچاد با افزایش ۳۴,۹۶۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۵۱,۴۶۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۸۲ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۶۷ 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 ۸۲ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. شاخص کل بعد از دو هفته در نهایت توانست با قدرت (کندل بزرگ) مقاومت محدوده ۱,۳۱۰,۰۰۰ واحد را بشکند. و اولین ناحیه مقاومتی بعدی مهم برای شاخص کل محدوده ۱,۴۷۰,۰۰۰ الی ۱,۵۳۰,۰۰۰ واحد می‌باشد. همچنین در چند روز گذشته شاهد افزایش نرخ دلار به بیش از ۲۶ هزار تومان در داخل کشور بودیم. نمودار قیمتی دلار نیز در محدوده ۲۶ الی ۲۶ هزار و سیصد تومان با مقاومت مهمی رو به رو است که در چند ماه گذشته، به دفعات قیمت با برخورد به این ناحیه شروع به اصلاح کرد. اگر محدوده ذکر شده در دلار شکسته شود، آنگاه شاهد افزایش بیشتر نرخ دلار در مرحله اول تا محدوده ۲۸ هزار تومان خواهیم بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳,۱۸۷ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق اسناد خزانه دولت با نماد اخزا ۹۰۸۲، 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 ۷۱۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۲۵ با ۲۲,۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۰۶	۱۴۰۰/۰۵/۰۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۸,۴۹۶	۳,۱۸۷	-۸۳٪



گروه‌های مؤثر

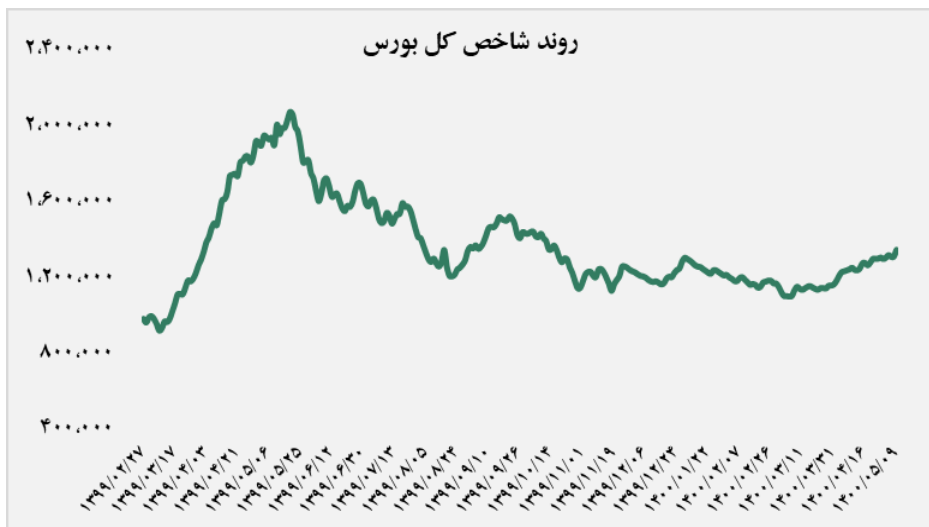
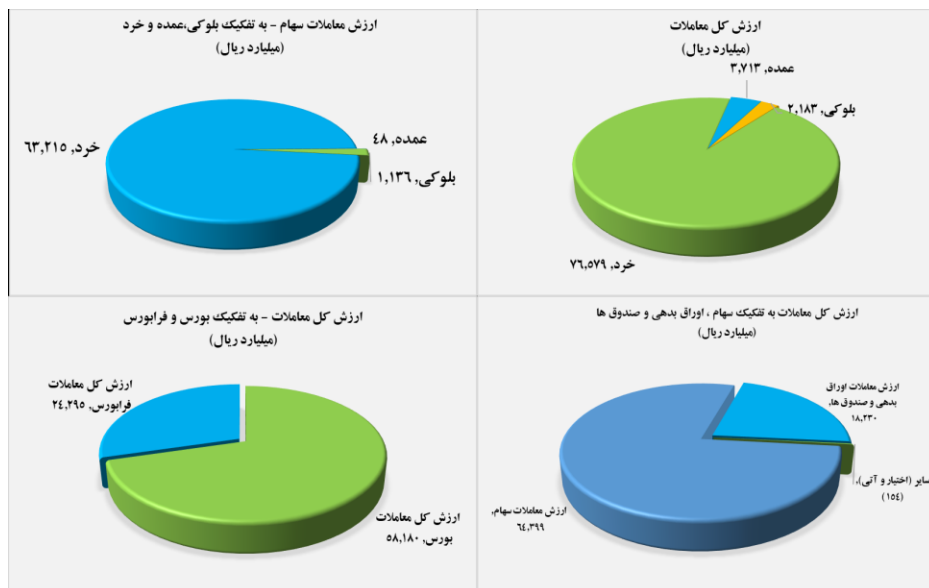
در گروه شیمیایی، پتروشیمی پردیس در سال مالی گذشته هر ماه ۱۴۳ هزار تن به طور متوسط آمونیاک تولید کرده است. در فصل اول تا سوم سال مالی ۱۴۰۰ متوسط تولید ماهانه بر اعداد ۱۷۵، ۱۶۱ و ۱۸۴ هزار تن استوار است و در تیر ۱۷۷ هزار تن تولید داشته است. مقدار فروش اوره داخلی شرکت در تیر ماه ۳۹ هزار تن (میانگین دورازده ماه گذشته ۹۲ هزار تن)، اوره صادراتی ۱۱۸ 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 بهار نیز به ترتیب از فروردین ۱,۶۰۰، ۱,۴۵۰ و ۱,۵۵۰ میلیارد تومان فروش گزارش کرد و در تیر افت کرده و برابر با ۱,۰۴۰ میلیارد تومان است. نرخ اوره صادراتی به صورت ریالی ۱۲ درصد بیشتر از ماه قبل و احتمالاً حدود ۳۰۸ دلار به فروش رسیده است. نرخ داخلی ۴,۶۰۰ تومان است.

در گروه فلزات اساسی، شرکت ملی سرب و روی ایران در سال گذشته ۴۴۳ تومان سود به ازای هر سهم ساخته است. در ۳ ماهه ابتدای سال ۹۹ سودی شناسایی نشده است. سود فصل دوم تا چهارم نیز به ترتیب ۵۰، ۱۸۹ و ۲۰۴ تومان به ازای هر سهم بوده است. در ۳ ماهه سال جاری شرکت موفق به شناسایی سود مناسب ۱۲۳ تومان به ازای هر سهم شده است. فروش شرکت در ۴ فصل سال ۹۹ به ترتیب از ابتدای سال ۱۸، ۸۴، ۲۰۵ و ۱۸۳ میلیارد تومان بوده است و در فصل اول سال ۱۴۰۰ فروش ۱۶۵ میلیارد تومان به ثبت رسیده است. شرکت در سال ۹۹ حاشیه سود ۳۸ درصدی داشته، حاشیه سود فصل اول سال ۱۴۰۰ نیز ۳۲ درصد گزارش شده است.

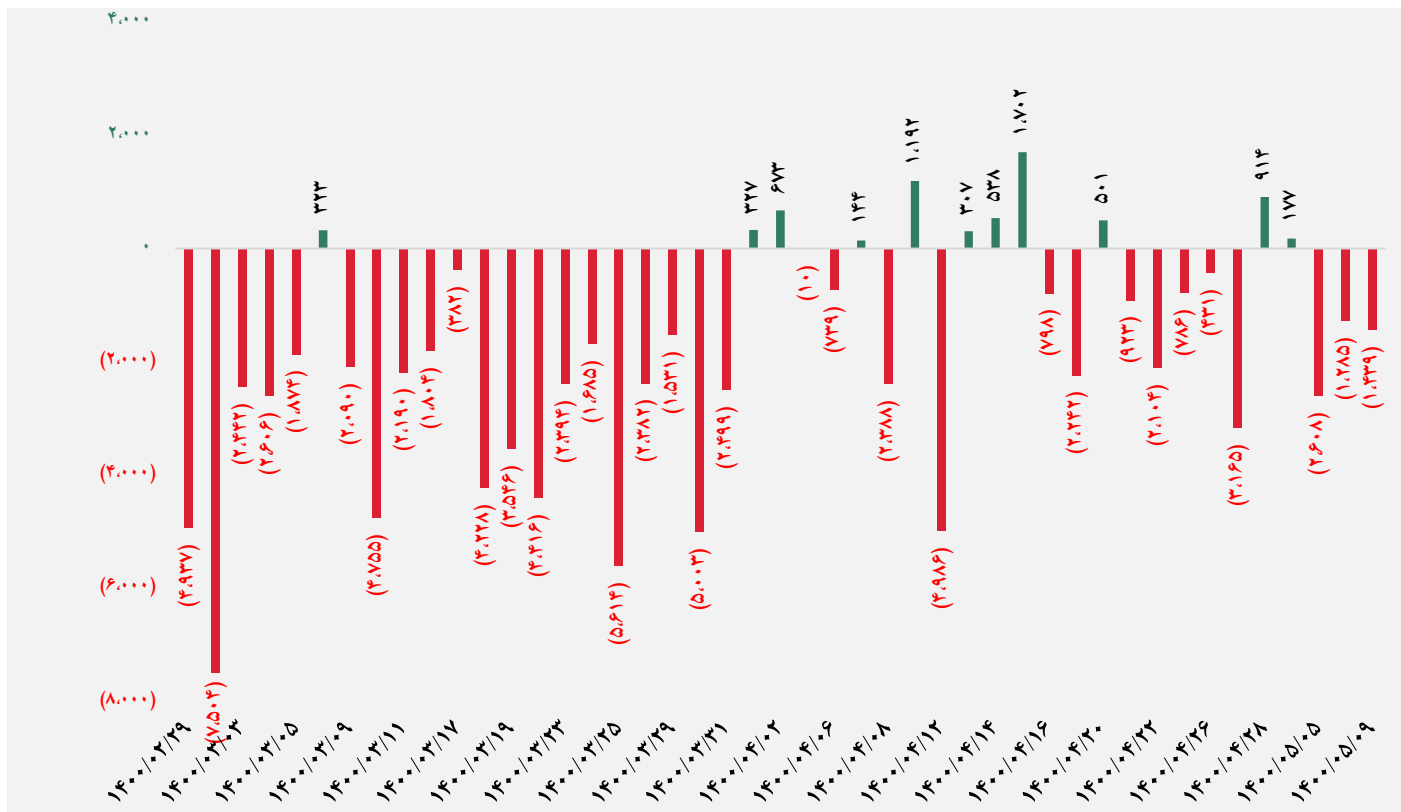
در گروه سیمان، شرکت سیمان ساوه در خرداد ماه تولیدی برابر با ۳۳۸ هزار تن را گزارش کرد و در تیر به دلیل محدودیت‌های اعمال شده بر روی برق نیز تولیدی برابر با ۲۰۹ هزار تن داشته است. ساوه که هر ماه بطور میانگین ۲۱۲ هزار تن فروش را گزارش کرده است. در خرداد ماه فروشی برابر با ۱۸۷ هزار تن داشت و در تیر نیز توانست فروش ۱۴۳ هزار تنی داشته باشد. مبلغ فروش سه ماهه ساوه برابر با ۲۶۷ میلیارد تومان بود که بطور میانگین شرکت هر ماه ۸۹ میلیارد تومان فروش داشته است. در خرداد شرکت با فروش ۷۸ میلیارد تومانی همراه بود و در تیر فروش ۷۰ میلیارد تومانی را به ثبت رسانده است. نرخ فروش هر کیلو سیمان خاکستری در خرداد ماه ۳,۵۵۱ ریال بوده که در تیر به ۴,۳۲۱ ریال تغییر پیدا کرده است.

تصویر کلی بازار

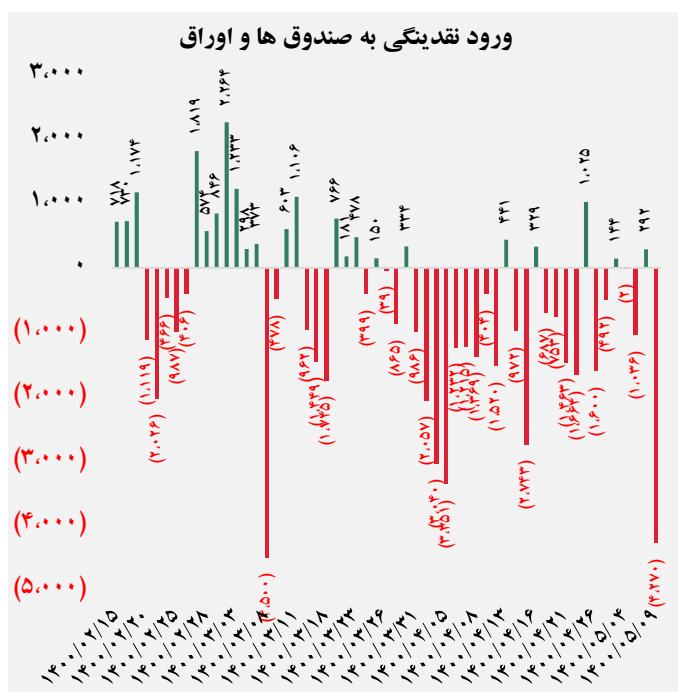
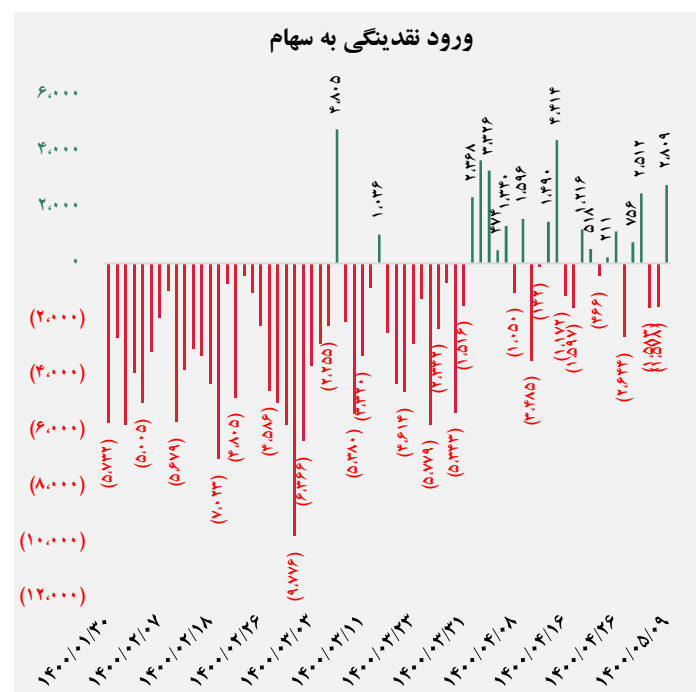
فرا بورس		بورس	
۱۹,۷۹۴	شاخص کل	۱,۳۵۱,۴۶۷	شاخص کل
۳۹۸	تغییر شاخص	۳۴,۹۶۲	تغییر شاخص
۱۰,۹۱۰,۰۷۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۴,۴۴۳,۵۳۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۴,۲۹۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۸,۱۸۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
پپاس		میدکو	
آریا		فملی	
کگهر		فارس	
زاگرس		فولاد	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
ومل		پاکشو	
غصینو		خودرو	
غویتا		وسکرشا	
ودی		همراه	



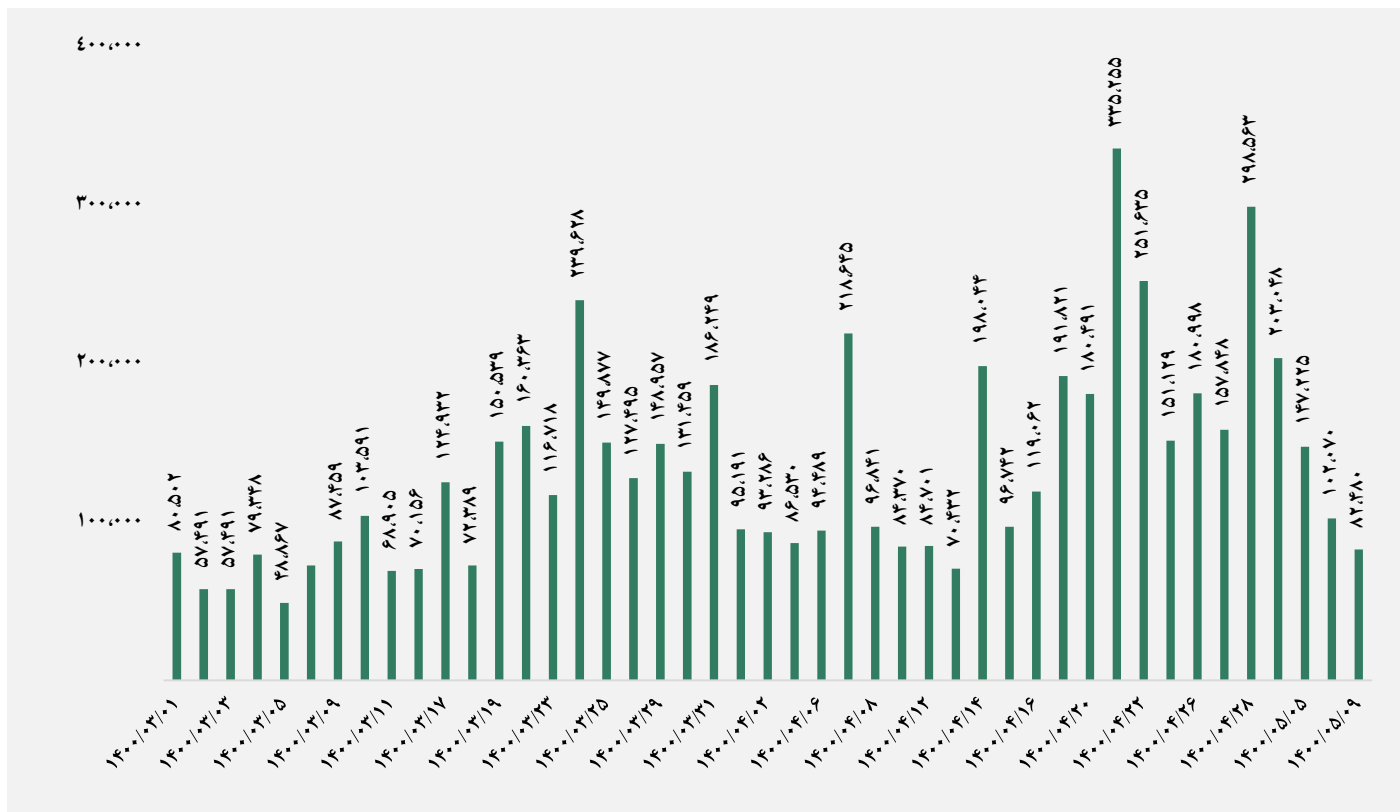
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



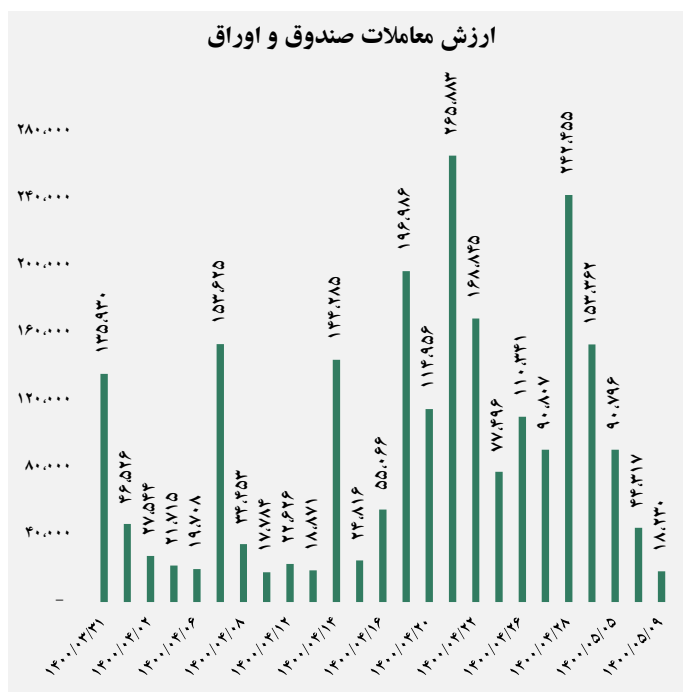
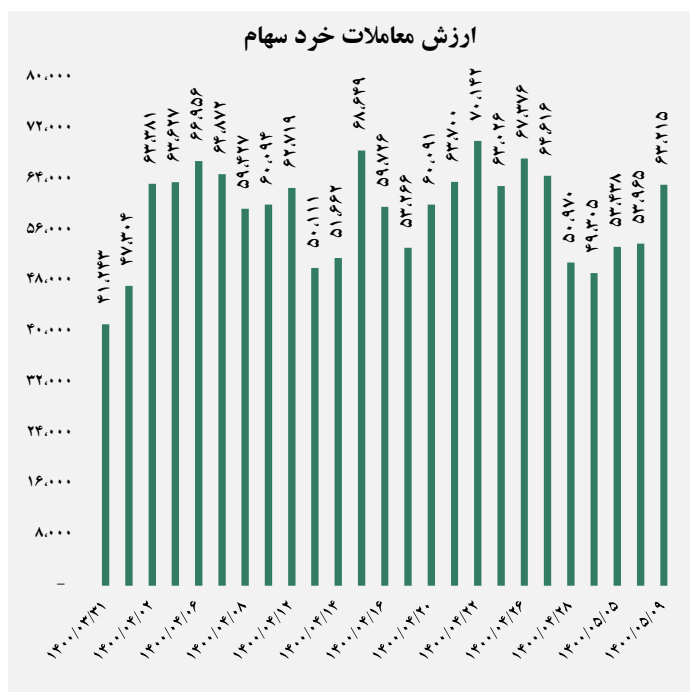
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

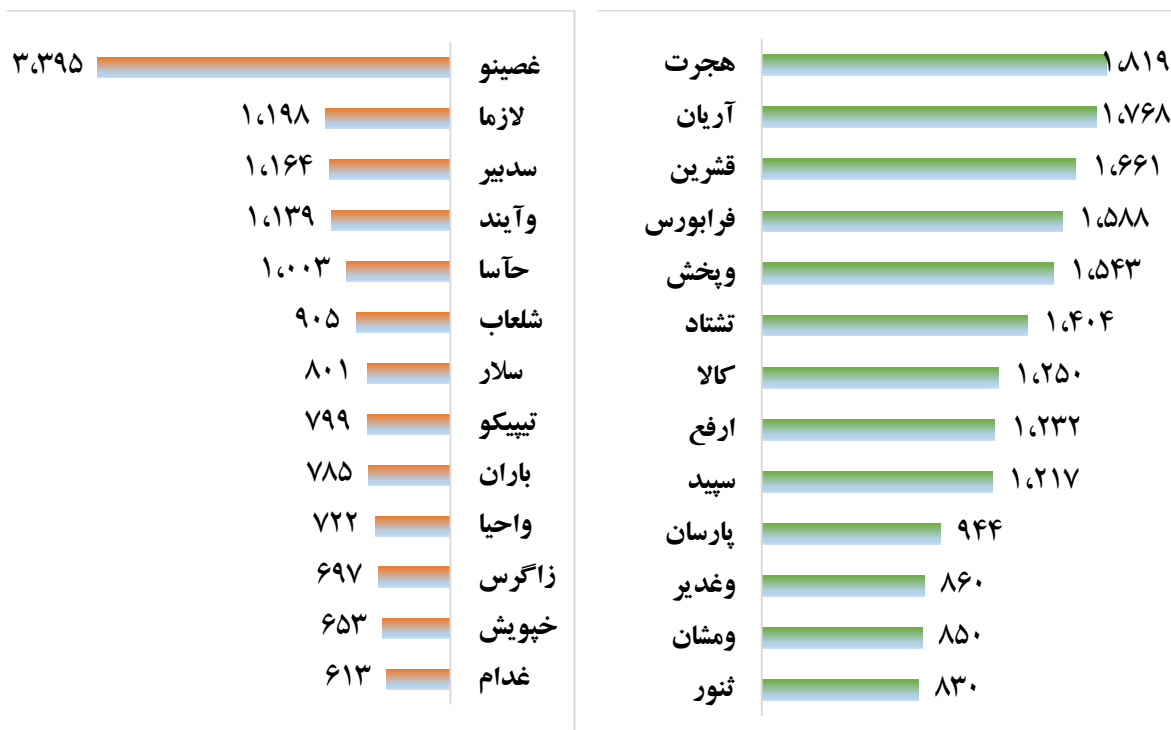


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





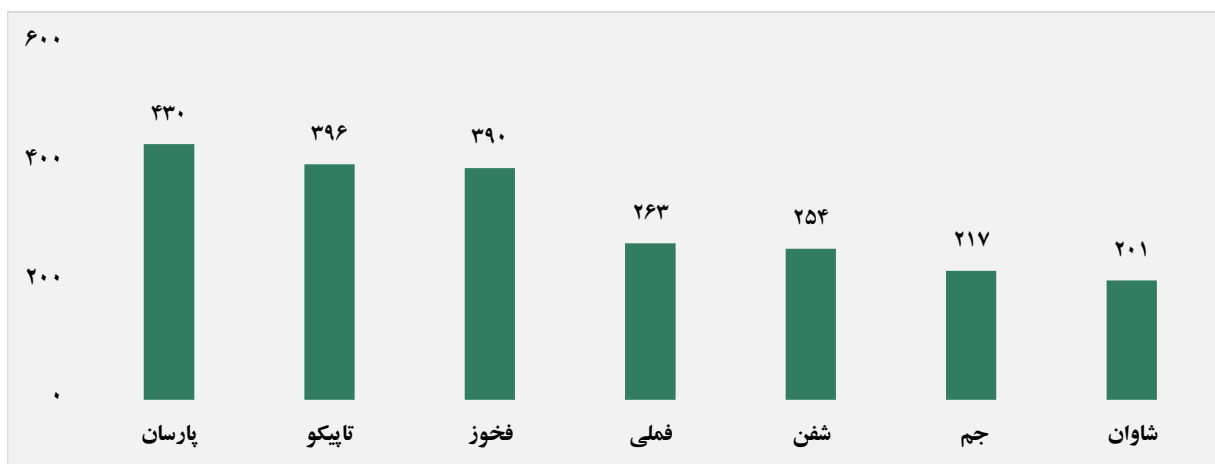
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



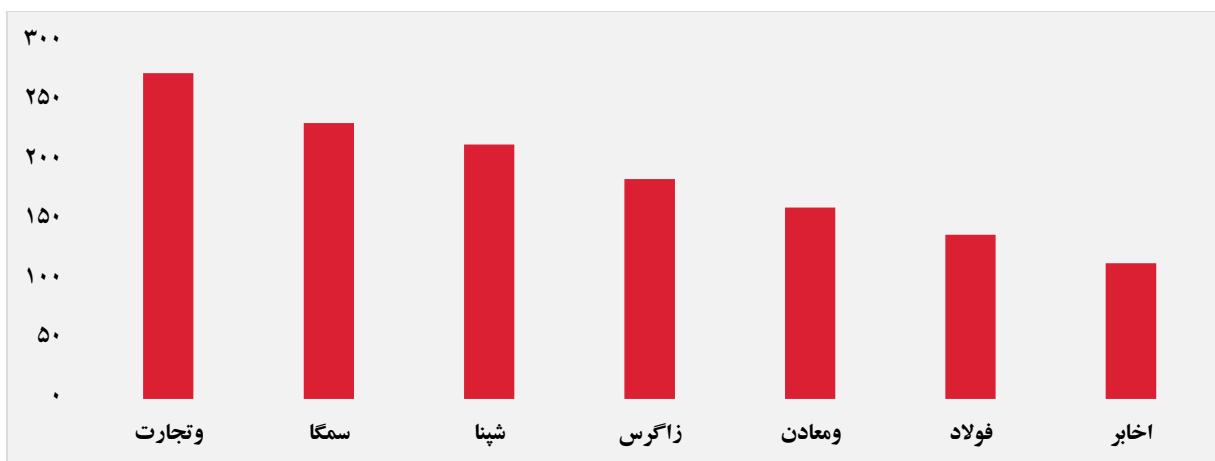
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	وپخش	۱	خاور
۲	ارفع	۲	خکاوه
۳	پارسان	۳	کسرا
۴	ثنور	۴	شزنگ
۵	البرز	۵	دروز
۶	وصندوق	۶	سخر
۷	پپاس	۷	شفا
۸	مادیرا	۸	قجام
۹	ومهان	۹	مداران
۱۰	وبانک	۱۰	سدور

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



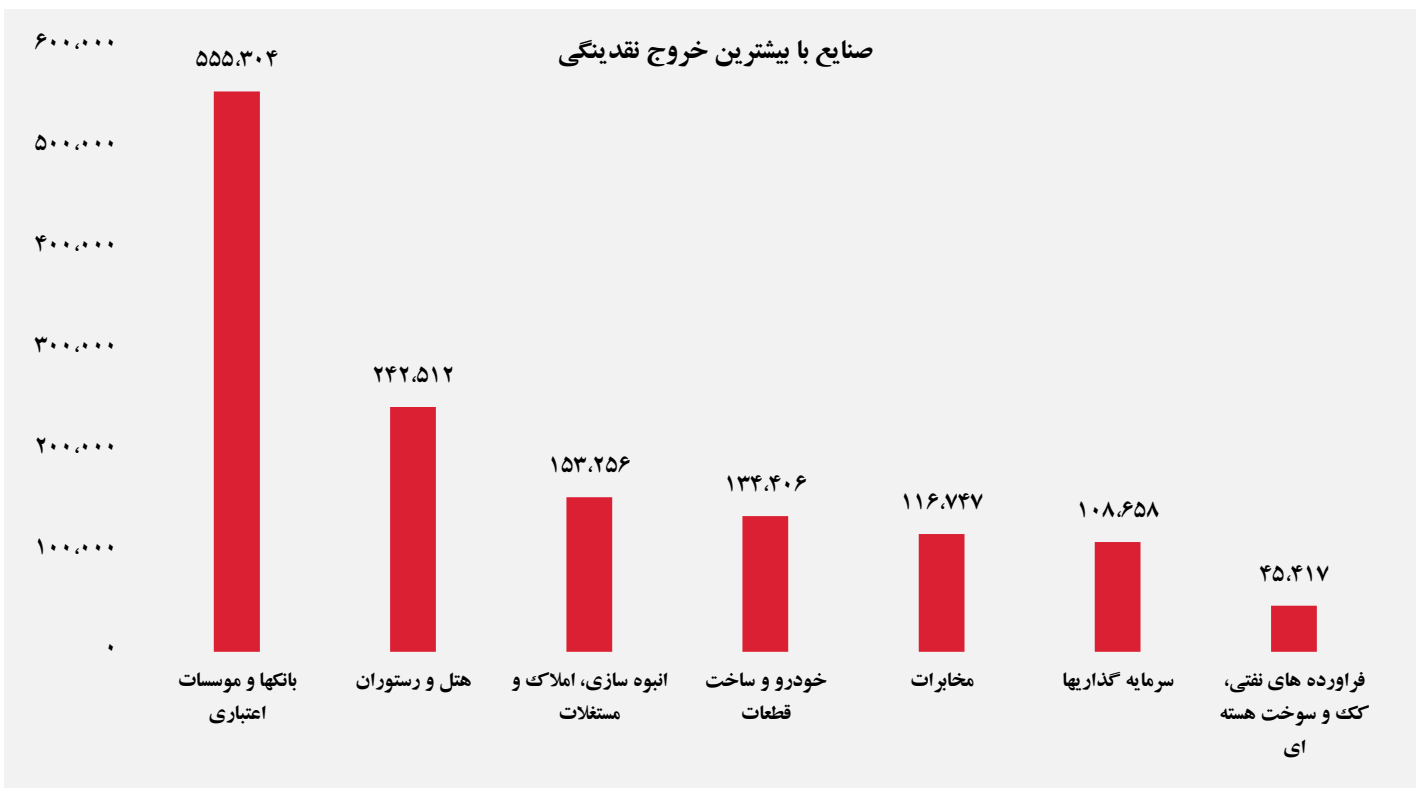
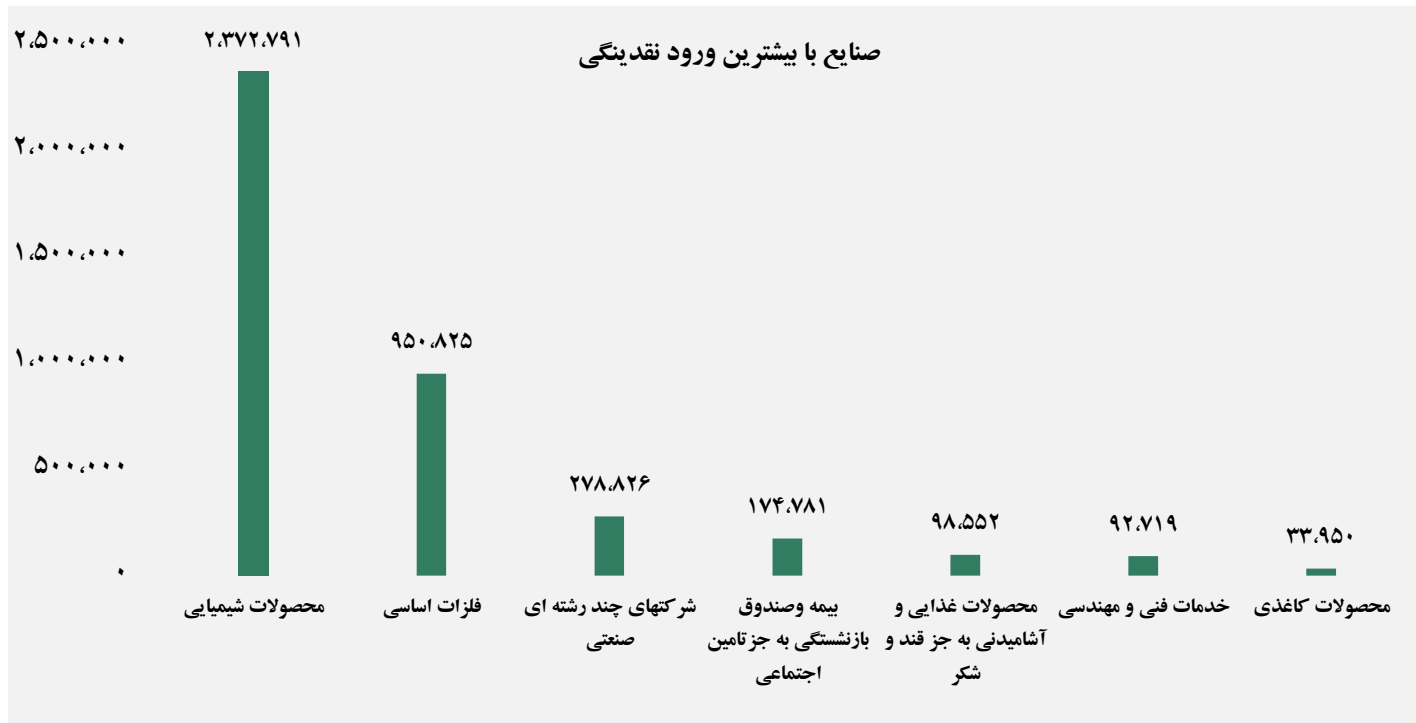
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	شاوان	۱۰	دلر
۲	فجر	۱۱	کزغال
۳	فرزین	۱۲	شپاکسا
۴	زاگرس	۱۳	خاور
۵	شغدیر	۱۴	ثنوسا
۶	کسرا	۱۵	غکورش
۷	برکت	۱۶	شراز
۸	بوعلی	۱۷	نوری
۹	جم بیلن	۱۸	سپید

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار