



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۱۰

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۰ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای میدکو، فارس، پارس، وغدیر، اخبار و وپارس با افزایش ۸,۷۸۶ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۶۰,۲۸۵ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۹ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۶۳ 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 ۸۰ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

در روز گذشته نرخ دلار به بیش از ۲۶,۵۰۰ تومان در بازار آزاد رسید اما با توجه به سطح مقاومتی مهم در محدوده ۲۶ هزار تومان، مجدداً شروع به اصلاح کرد و در حال حاضر نیز کمتر از ۲۶ هزار تومان در حال معامله می‌باشد. به نظر می‌رسد معامله گران و تحلیلگران بازار سرمایه در حال تغییر نگرش در مورد نرخ دلار هستند و کمتر فعال اقتصادی را می‌توان دید که در این روزها اشاره به کاهش دلار داشته باشد. بنابراین تا زمانی که دیدگاه نزولی برای نرخ برابری دلار به ریال شکل نگیرد، ریزشی برای بازار سرمایه نیز نمی‌توان تصور کرد و هر کاهشی را به عنوان اصلاح می‌توان در نظر گرفت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳,۷۰۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق اجاره انرژی پاسارگاد با نماد پاسار ۴۲، 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 ۲۵,۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۰۹	۱۴۰۰/۰۵/۱۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳,۱۸۷	۳,۷۰۶	۱۶٪



## گروه‌های مؤثر

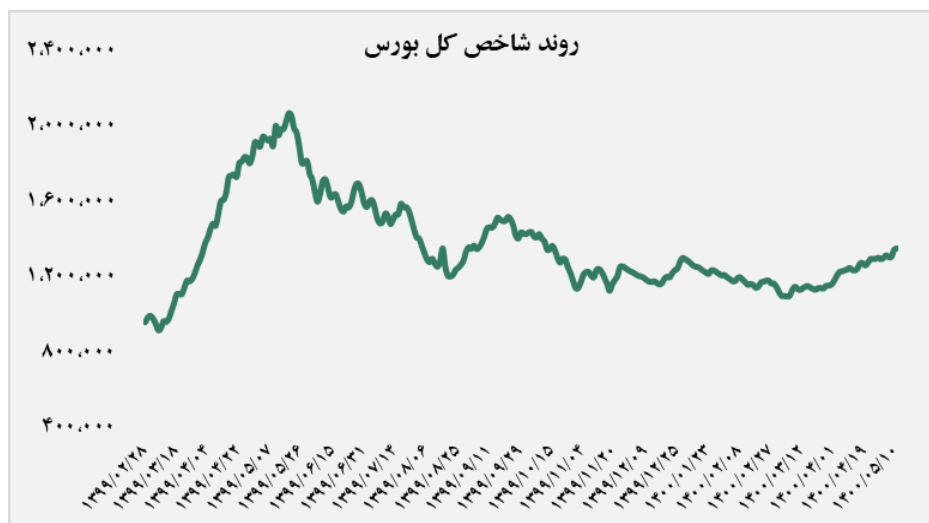
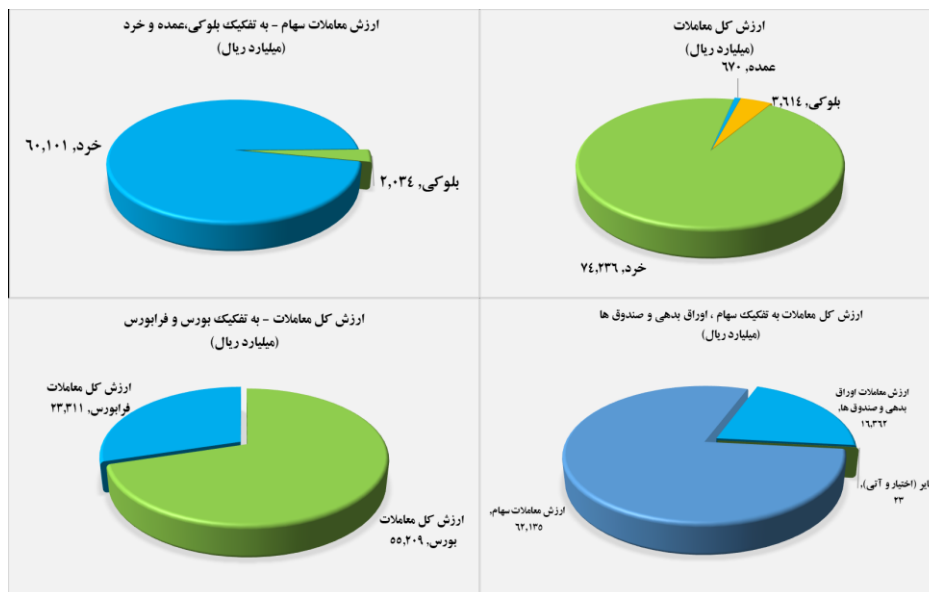
در گروه فلزات اساسی، فولاد هرمزگان در در فصل انتهایی سال مالی گذشته به طور متوسط هر ماه فروش ۱,۹۰۰ میلیارد تومانی را داشت. در فروردین فروش ۹۷۵ میلیارد تومانی را گزارش کرد و در اردیبهشت عدد ۲,۳۳۳ میلیارد تومانی و خرداد با فروش ۱,۹۳۴ میلیارد تومانی داشت. در تیر نیز با وجود محدودیت‌های برق، عدد خوب ۱,۷۱۴ میلیارد تومانی را ثبت کرده است. متوسط تولید در دو سال گذشته به طور متوسط هر ماه ۱۲۶ و ۱۲۱ هزار تن بوده است. در فروردین و اردیبهشت نیز تولید ۱۴۵ و ۱۳۱ هزار تن و در خرداد ۱۱۴ هزار تن است. و در تیر با کاهش تولید مواجه شده و ۷۱ هزار تن تولید کرده است. موجودی اول سال شرکت در سال ۱۴۰۰ برابر ۱۶۷ هزار تن بوده است که با فروش ۷۱ و ۱۶۱ هزار تنی دو ماه ابتدایی و ۱۳۱ هزار تنی خرداد در انتهای فصل ابتدایی ۹۹ به ۱۹۳ هزار تن رسید. در تیر شروع به فروش موجودی‌ها کرد و ۱۱۰ هزار تن فروش در تیر ماه ثبت شده است (موجودی تیر ۱۵۰ هزار تن). نرخ فروش اسلب فولاد هرمزگان در سال ۹۹ برابر ۹,۱۰۰ تومان برای هر کیلو بوده است که در سه ماهه ابتدایی ۱۴,۲۰۰ تومان و در تیر ۱۵,۶۰۰ تومان است.

در گروه فرآورده‌های نفتی، شرکت نفت ایرانول در سال ۹۸ و ۹۹ شرکت به ترتیب سودهای مناسب ۱۵۱ و ۵۳۴ تومان به ازای هر سهم ساخته است. در ۳ ماهه سال جاری شرکت ۱۷۱ تومان سود به ازای هر سهم شناسایی کرده است. فروش شرکت مجموعاً در فصل اول سال جاری ۱,۶۴۱ میلیارد تومان گزارش شده است. فروش ۴ فصل سال ۹۹ نیز به ترتیب از ابتدا ۶۲۱، ۱۱۰۹، ۱۶۶۴ و ۱۷۶۴ میلیارد تومان بوده است. حاشیه سود سال ۹۸ و ۹۹، ۱۷ و ۲۹ درصد بوده و در فصل ابتدایی سال جاری نیز شرکت حاشیه سود ۲۹ درصدی داشته است.

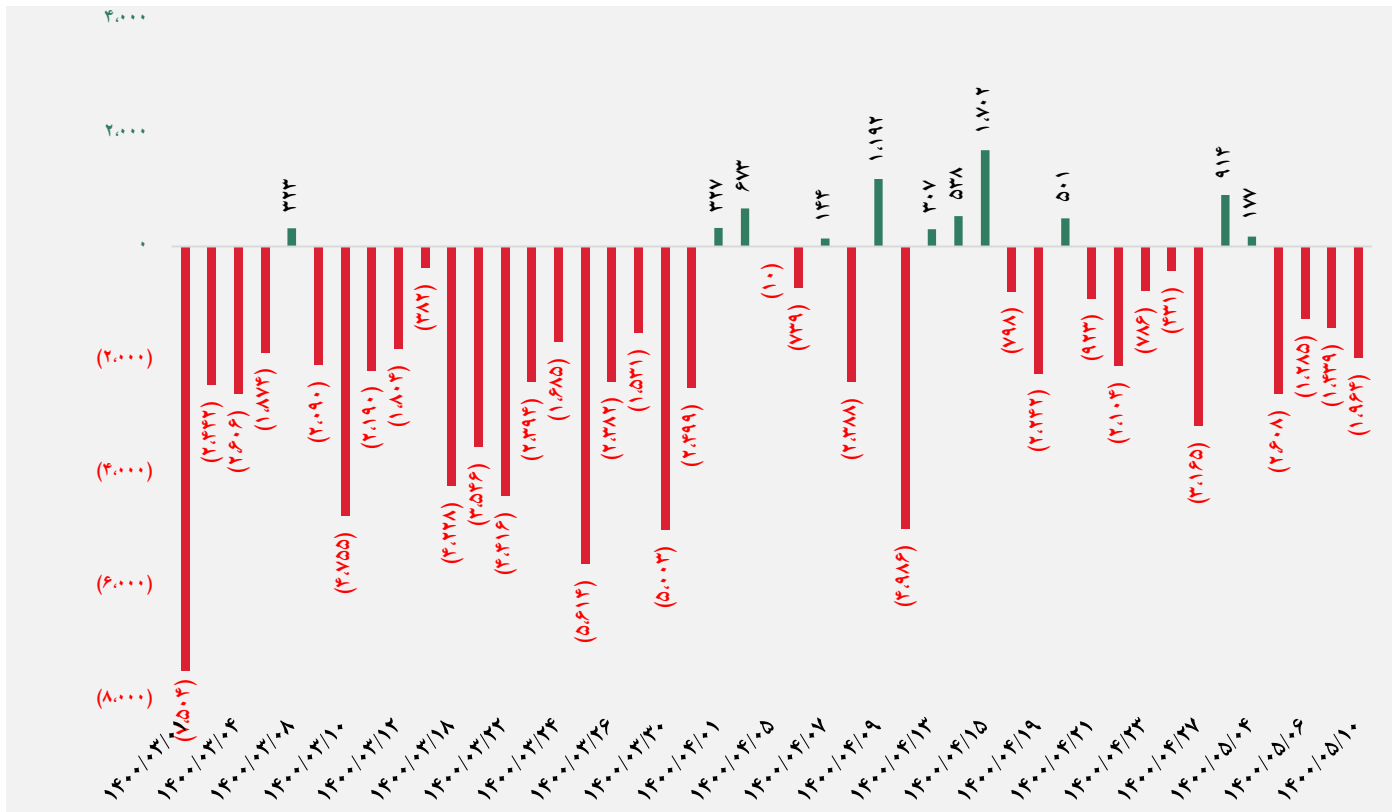
در گروه زراعت و خدمات وابسته، شرکت کشت و دام گل‌دشت نمونه اصفهان، در سال ۹۹ تولیدی برابر با ۴۶ هزار تن لبنیات و ۱,۸۸۴ راس دام بوده است که در خرداد ماه سال جاری برابر با ۴,۲۱۱ تن لبنیات و ۱۳۷ راس دام گزارش شد که این مقادیر در تیر به ۴,۱۳۳ تن لبنیات و ۱۵۱ راس دام رسیده است. این شرکت در سال گذشته ۴۵ هزار تن و ۱,۷۴۵ راس دام به مبلغ ۱۸۷ میلیارد تومان فروخته و در سال جاری فروش خرداد و تیر خود را ۴,۰۷۵ و ۳,۹۹۲ تن، هر کدام به مبالغ ۲۲ و ۲۱ میلیارد تومان گزارش کرده است. نرخ فروش شیر در خرداد ماه برابر با ۴۹,۶۸۰ ریال/کیلو بوده و در تیر به ۵۱,۳۰۶ ریال/کیلو رسیده است.

## تصویر کلی بازار

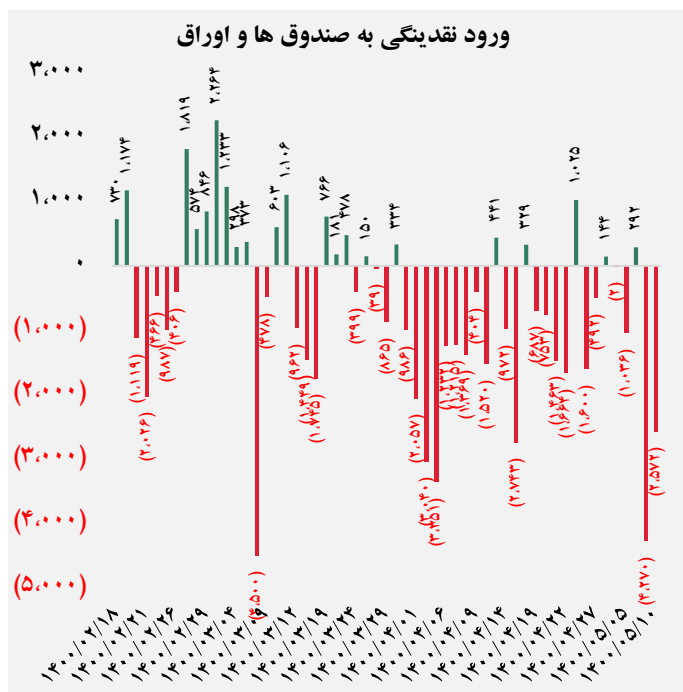
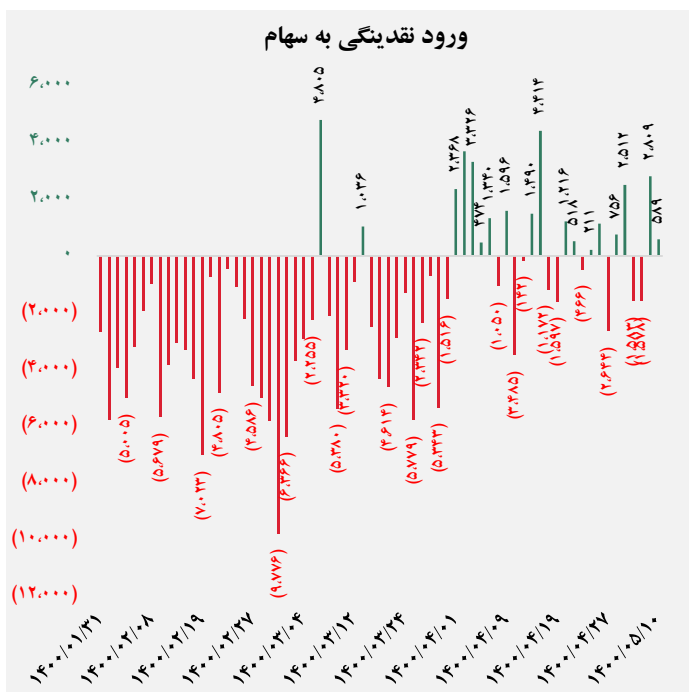
فرا بورس		بورس	
۱۹,۹۵۷	شاخص کل	۱,۳۶۰,۲۸۵	شاخص کل
۱۶۳	تغییر شاخص	۸,۷۸۶	تغییر شاخص
۱۱,۰۰۰,۳۰۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۴,۷۹۵,۸۷۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۳,۳۱۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۵,۲۰۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>	
پاس		میدکو	
آریا		فارس	
ارفع		پارس	
فرا بورس		وغدیر	
<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>	
صبا		شتران	
شگویا		وسرضوی	
شاون		وتجارت	
ذوب		شستا	



## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



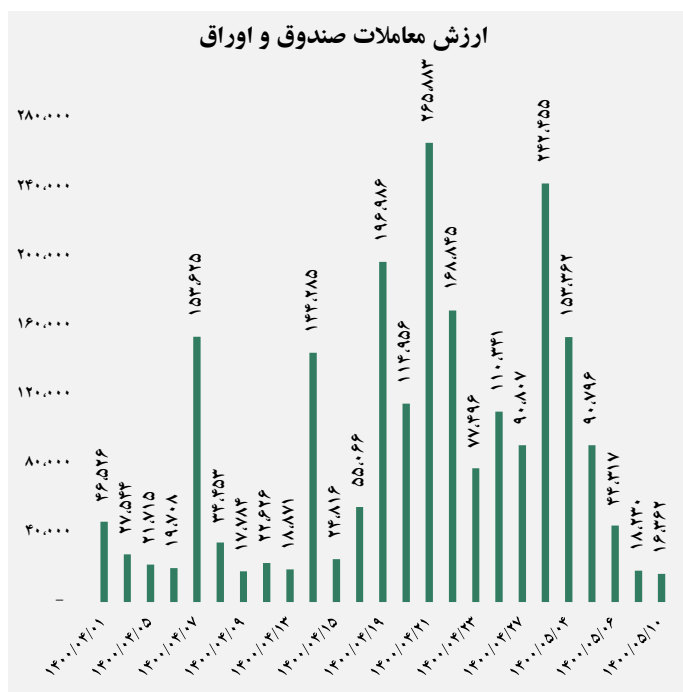
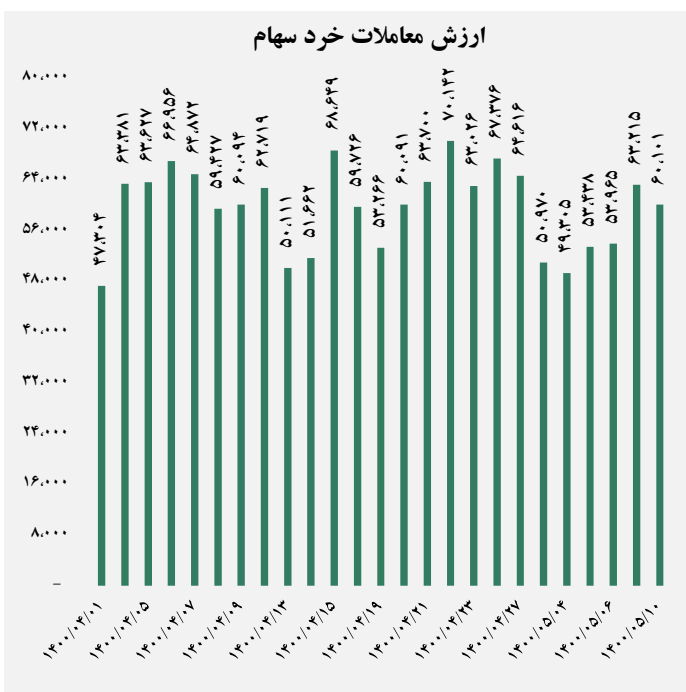
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

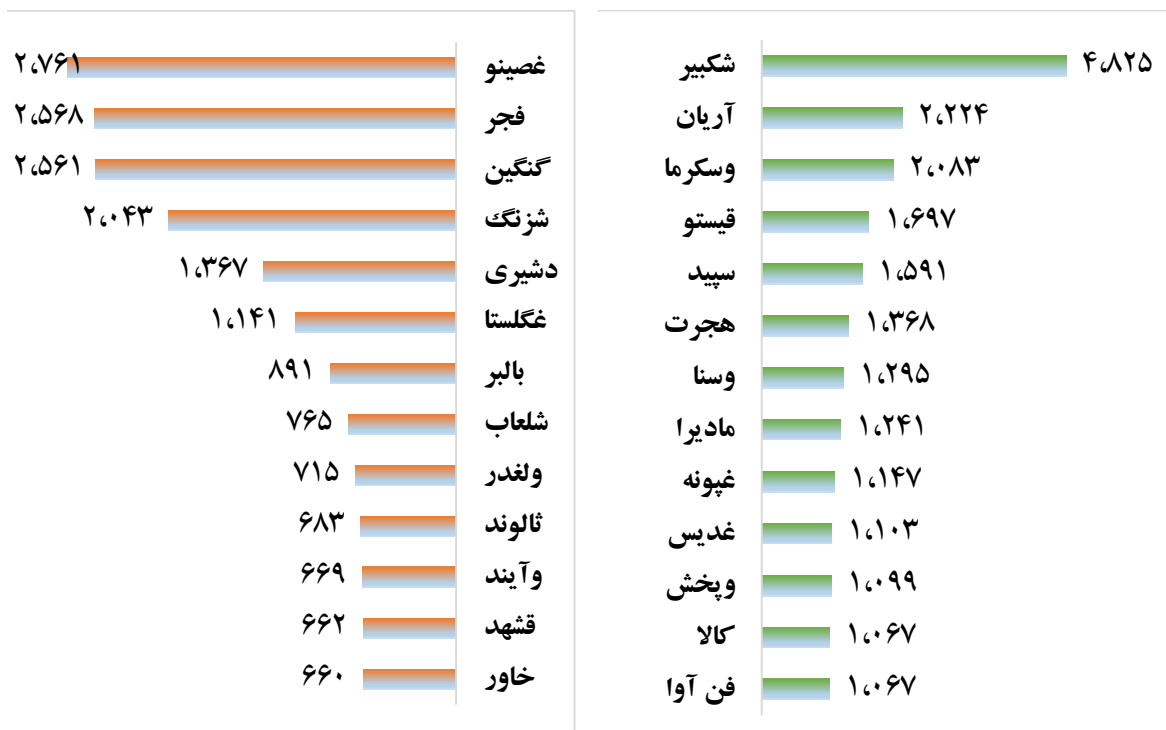


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





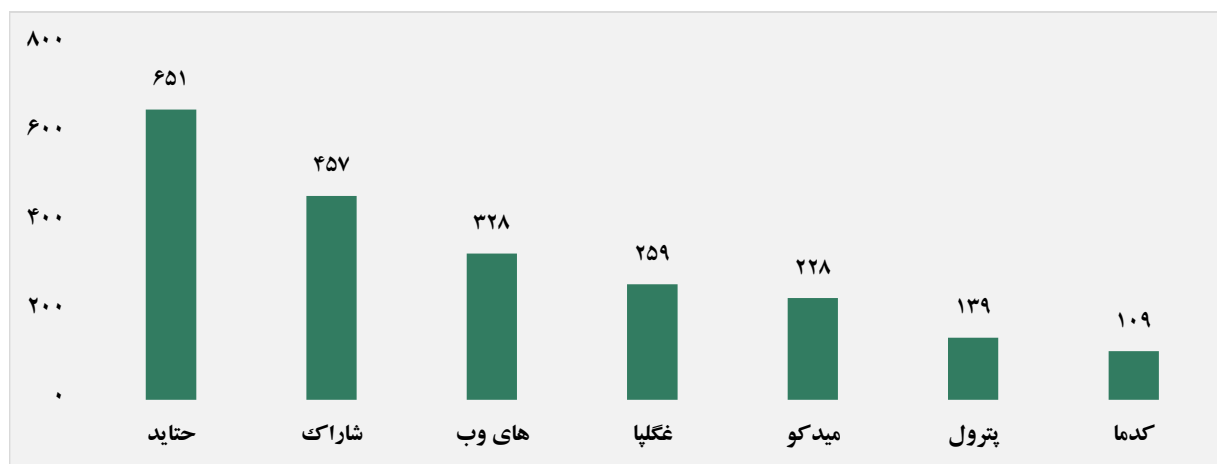
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



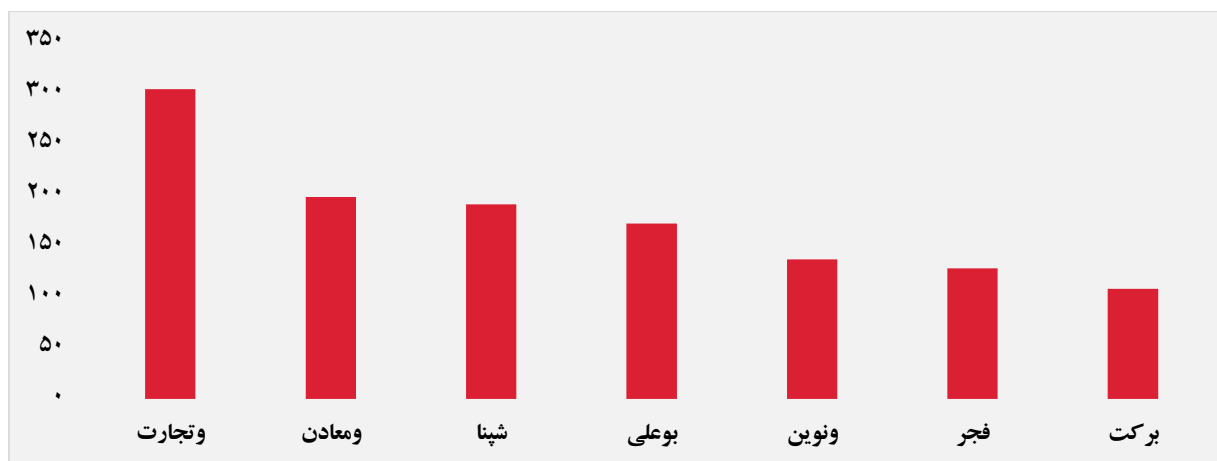
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	گدنا	۱	تکنار
۲	حتاید	۲	غازر
۳	غپآذر	۳	دلقما
۴	فن آوا	۴	ثرود
۵	کاذر	۵	فجر
۶	قشرین	۶	داسوه
۷	زپارس	۷	حآسا
۸	دیران	۸	دشیری
۹	های وب	۹	سقاین
۱۰	شکلر	۱۰	ساینا

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



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

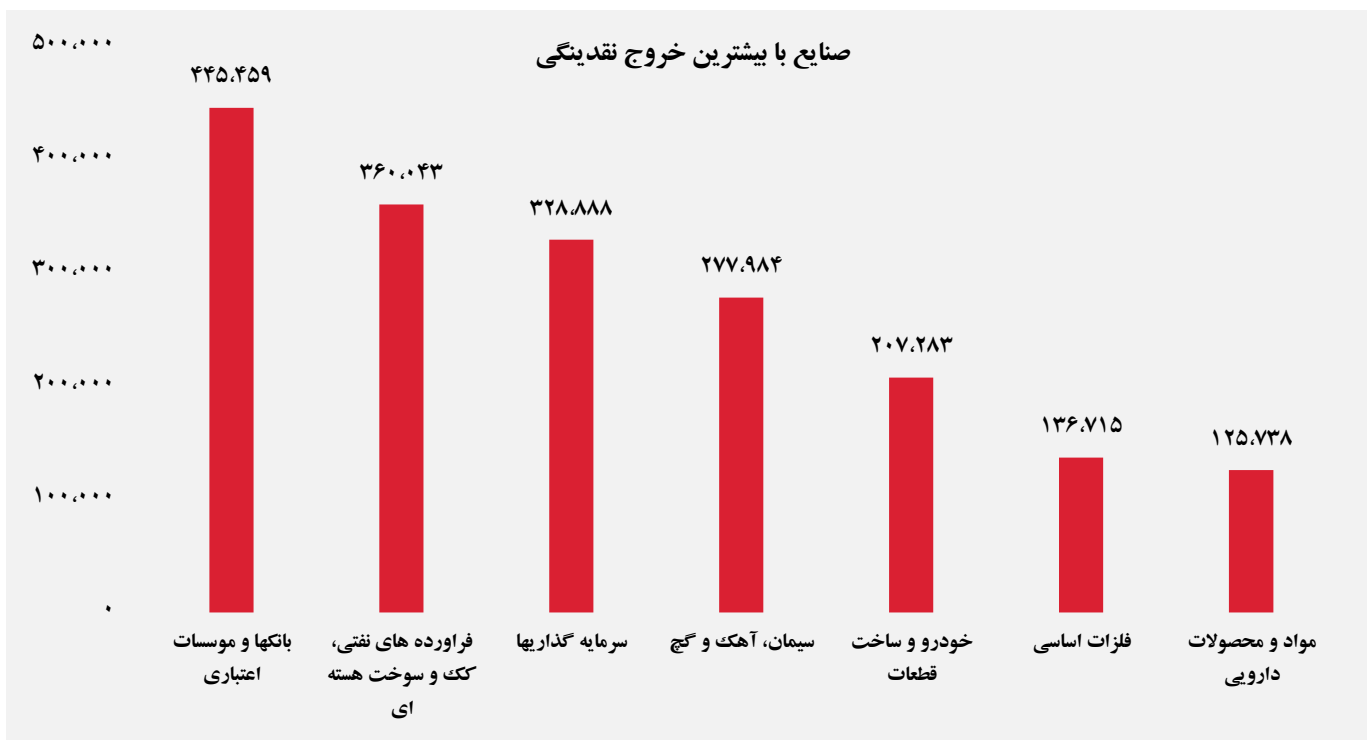
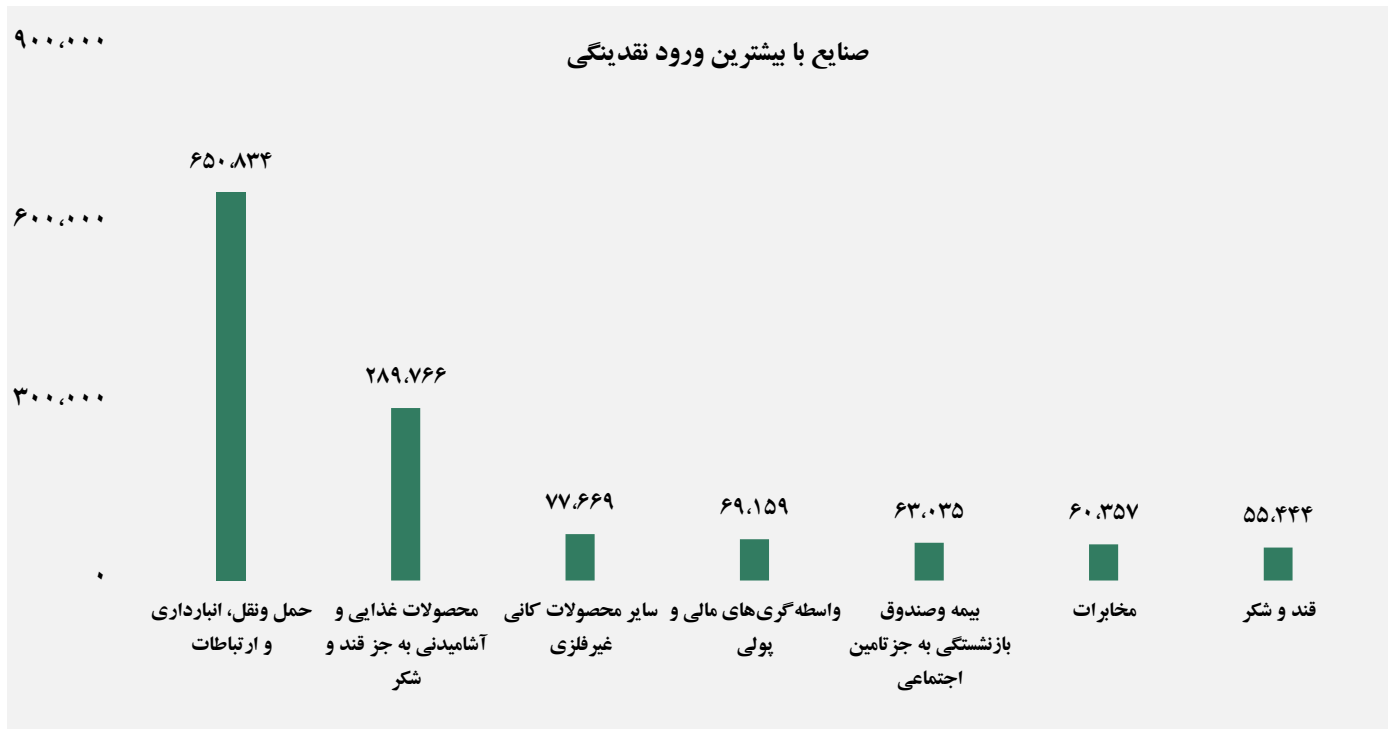


### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	حتاید	۱۰	آریا
۲	فجر	۱۱	فرزین
۳	برکت	۱۲	های وب
۴	شغدیر	۱۳	وساخت
۵	بوعلی	۱۴	کبافق
۶	شاراک	۱۵	نوری
۷	شاوان	۱۶	غفارس
۸	کسرا	۱۷	سپید
۹	ثنوسا	۱۸	ساراب



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار