



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۱۲

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۱۲ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، میدکو، شستا، و معادن، وامید و پارس با افزایش ۱۷,۷۱۶ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۷۵,۶۱۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۵ 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 ۸۴ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

به نظر می‌رسد، مسائل سیاسی مانند عدم اطمینان نسبت به سیاست‌های دولت جدید و اتهامات برخی کشورها در مورد حمله به کشتی تجاری چند ملیتی در کنار افت اندک نرخ ارزهای خارجی از دلایل افزایش در عرضه‌های دیروز و امروز در بازار سرمایه بود. همچنین علی‌رغم گزارشات مالی میان دوره‌ای خوب شرکت‌ها، به نظر می‌آید، بازار تا مشخص شدن کابینه احتمالی دولت جدید و ارائه برنامه‌های آنها در ابهام خواهد بود اما در کل نوسانات در نرخ ارز و مسائل سیاسی می‌توانند روند کلی بازار سرمایه را مشخص کنند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۳,۵۹۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۶۴ 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 ۳۰,۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۱۱	۱۴۰۰/۰۵/۱۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳,۷۴۵	۳,۵۹۱	-۴٪



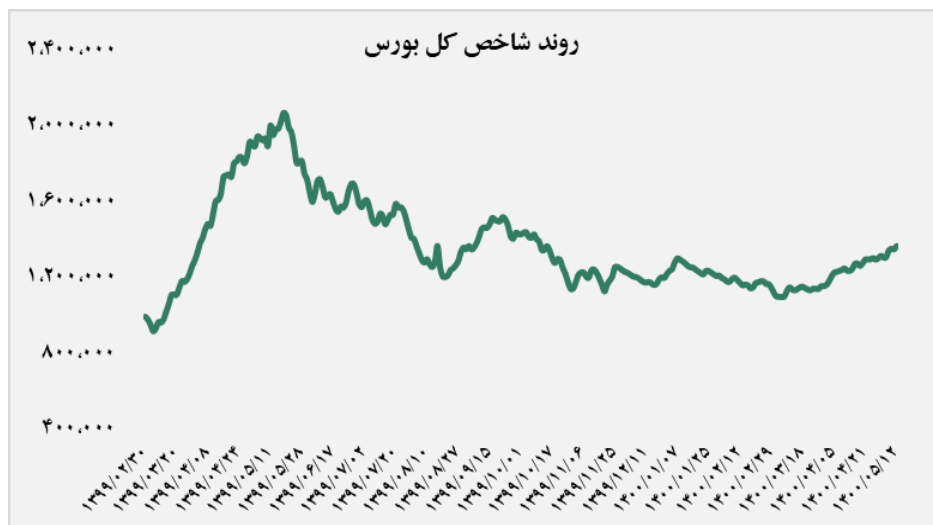
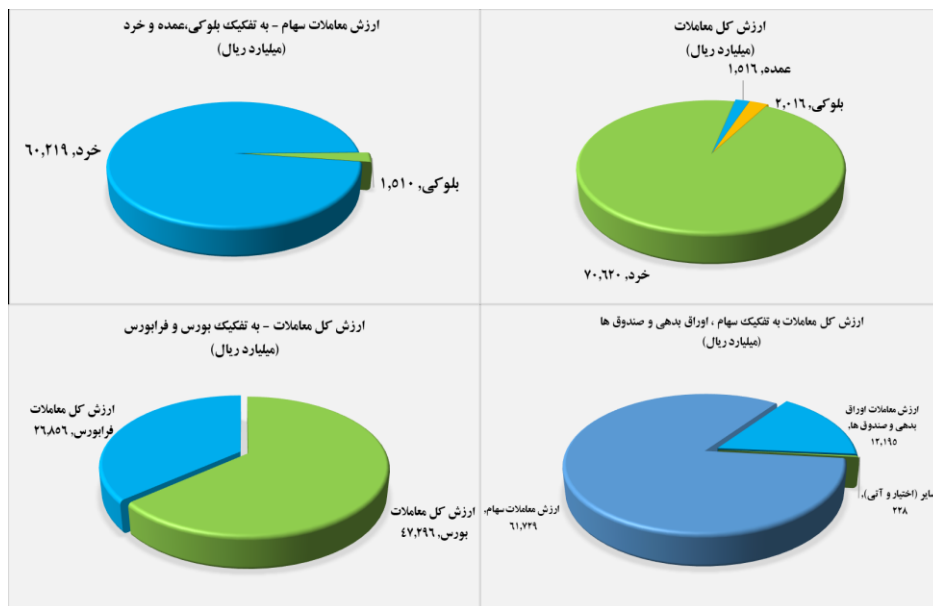
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی تندگویان در سال گذشته به طور متوسط ۴۴ هزار تن PTA به عنوان محصول ابتدای زنجیره تولید کرده است. در سه ماهه ابتدای سال میانگین تولید ۴۶ هزار تنی را داشت و در تیر ۳۵ هزار تن است. در سال ۹۹ متوسط فروش ماهانه ۵۱ هزار تنی را ثبت کرده و در سه ماهه سال جاری، متوسط ۵۱ هزار تنی و در تیر ۴۱ هزار تن فروش دارد. شرکت در حالی در فصل اول تا سوم ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۴۶۹، ۷۶۸، ۸۸۷ میلیارد تومان فروش داشته است. در سه ماه آخر سال گذشته عالی بوده و به ترتیب ۱،۰۴۵، ۱،۳۳۰ و ۱،۲۴۲ میلیارد تومان فروش گزارش کرد و در فروردین سال جاری با یک فروش خاص ۱،۵۷۴ میلیارد تومانی همراه بوده است و اردیبهشت و خرداد فروش ۱،۳۷۴ و ۱،۲۸۸ میلیارد تومانی را ثبت کرد و مبلغ فروش در تیر خیلی خاص نبوده و ۱،۰۶۸ میلیارد تومان است. نرخ فروش محصولات در حالی در سال ۹۹ به طور متوسط ۱۶،۰۰۰ تومان در هر کیلو بوده که در ماه های اخیر به لطف افزایش قیمت جهانی و رقابت های بورس کالا در حوالی ۲۵ هزار تومان است.

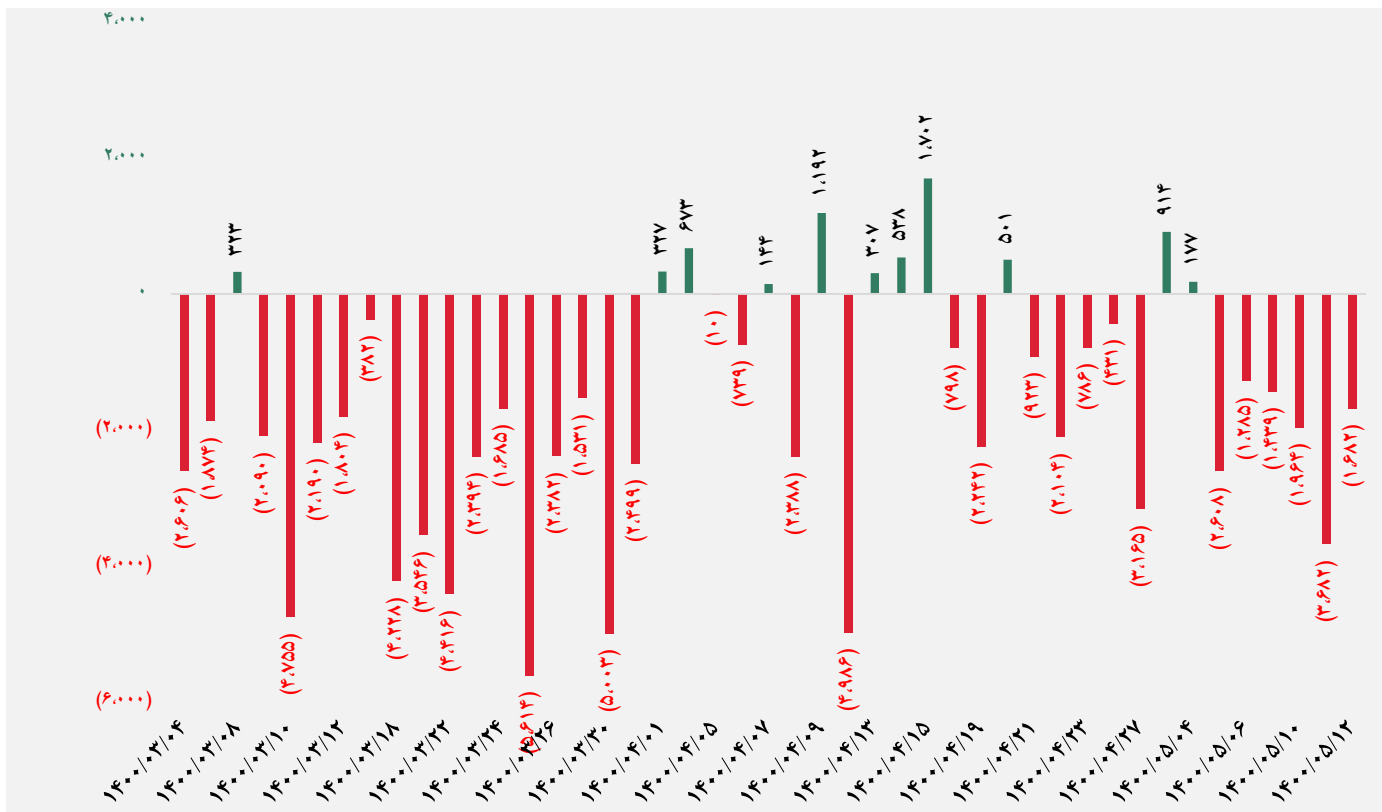
در گروه خرده فروشی، فروشگاههای زنجیره‌ای افق کوروش در بهار ۶۴ تومان سود به ازای هر سهم محقق کرده است. در زمستان ۱۰۱ تومان سود داشت و سال ۹۹ را با ۵۳۵ تومان سود به ازای هر سهم به پایان رساند بود. شرکت در بهار درآمد ۴،۸۳۲ میلیارد تومانی را داشته است که نسبت به فصل قبل ۳ درصد رشد داشته است. در سال ۹۹ با رشد ۶۷ درصدی نسبت به ۹۸، مبلغ فروش ۱۵،۲۵۹ میلیارد تومانی را به ثبت رسانده بود. در بهار حاشیه سود عملیاتی شرکت نسبت به چهار فصل قبل کمترین بوده است. شرکت در پنج فصل اخیر به ترتیب حاشیه سود عملیاتی‌های ۶،۸ و ۵،۹ و ۴،۵ و ۳،۸ درصدی را داشته و به طور میانگین در سال ۹۹ با حاشیه سود عملیاتی ۶،۴ درصدی کسب کار خود را انجام داده است. حاشیه سود عملیاتی ۹۸ برابر با ۵،۷ درصد و در سال ۹۷ در حدود ۶،۱ درصد بوده است. همچنین سود عملیاتی شرکت در بهار ۱۸۴ میلیارد تومان بود که ۱۲ درصد نسبت به فصل قبل افت داشته است. سود عملیاتی شرکت در سال ۹۹ در حدود ۹۷۰ میلیارد ثبت شده است.

تصویر کلی بازار

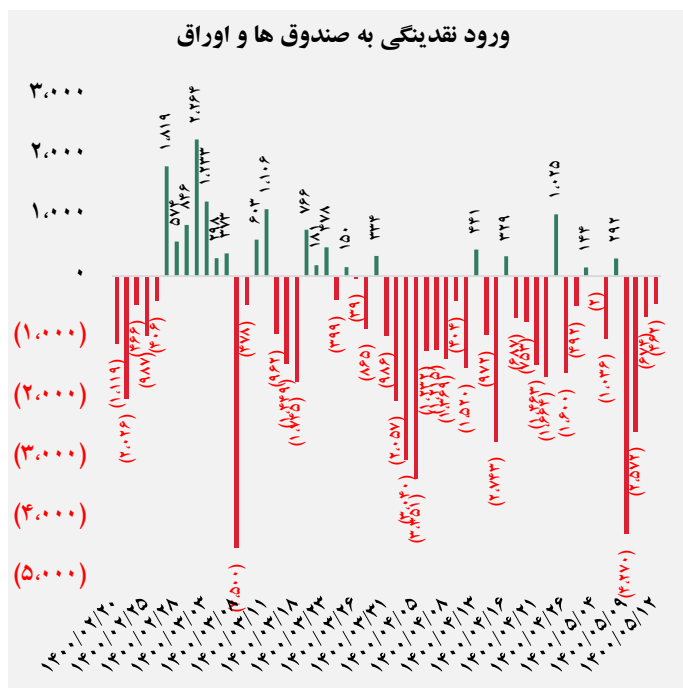
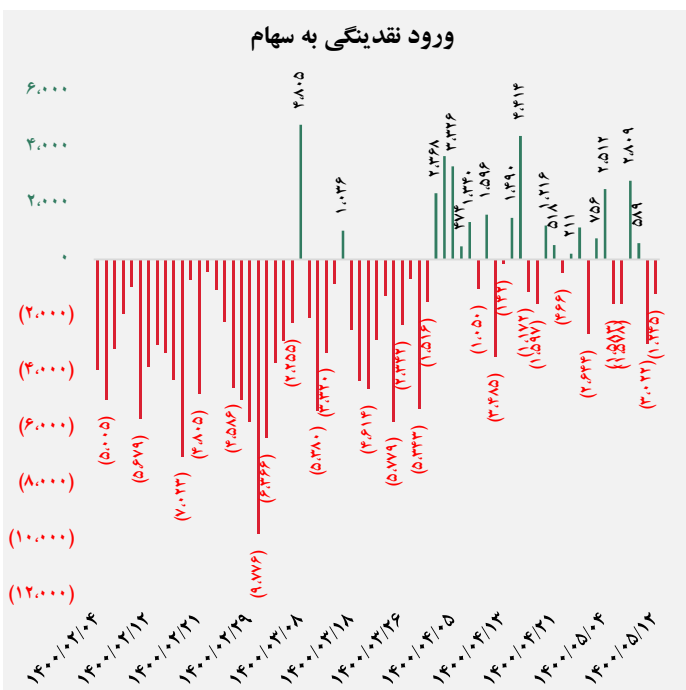
فرا بورس		بورس	
۱۹,۹۱۳	شاخص کل	۱,۳۷۵,۶۱۲	شاخص کل
۴۳	تغییر شاخص	۱۷,۷۱۶	تغییر شاخص
۱۰,۸۸۳,۹۰۱	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۵,۴۱۱,۴۰۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۶,۸۵۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۷,۳۹۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
	ذوب		فارس
	فرا بورس		میدکو
	شگویا		شستا
	شراز		ومعادن
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
	بیپاس		خودرو
	هرمز		ویپارس
	کوثر		خسارپا
	وهور		خبهمن



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

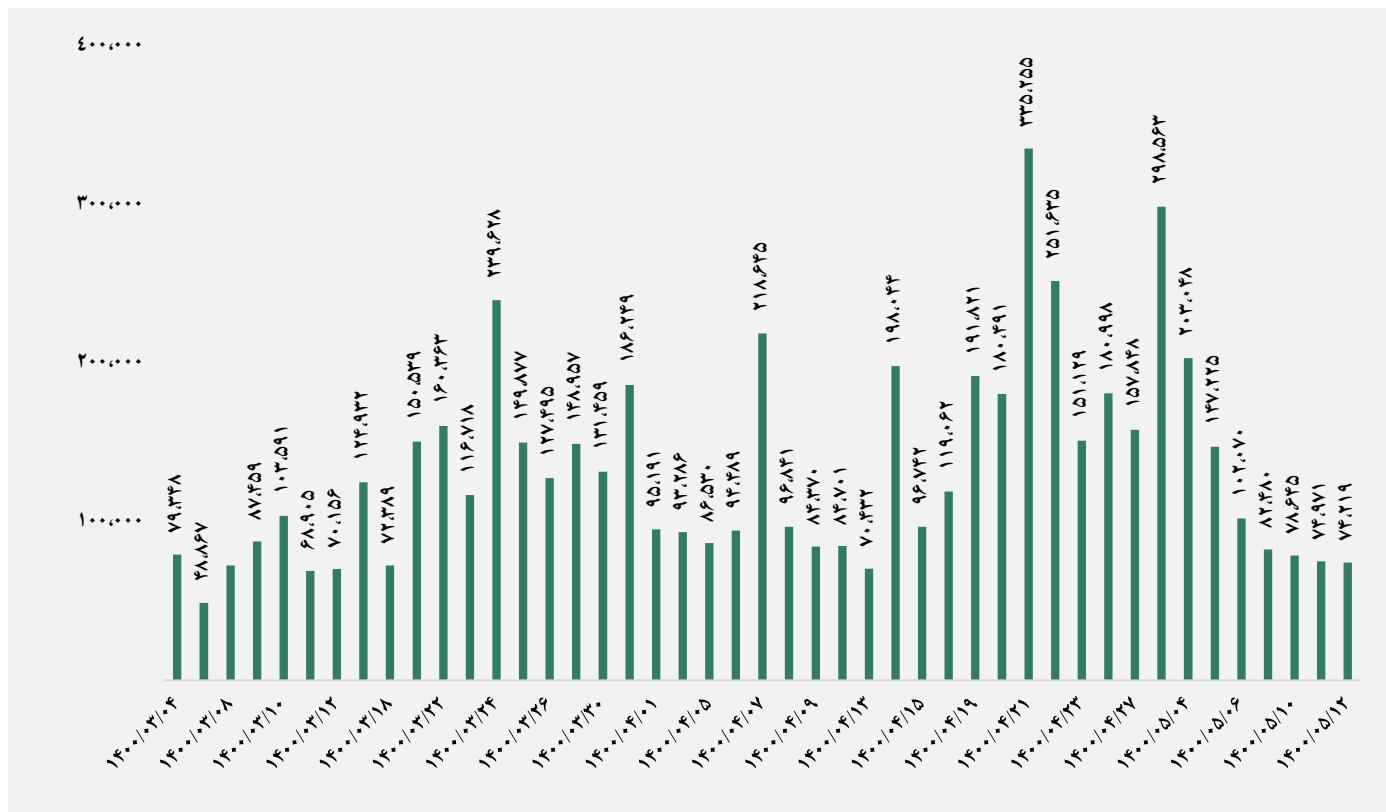


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

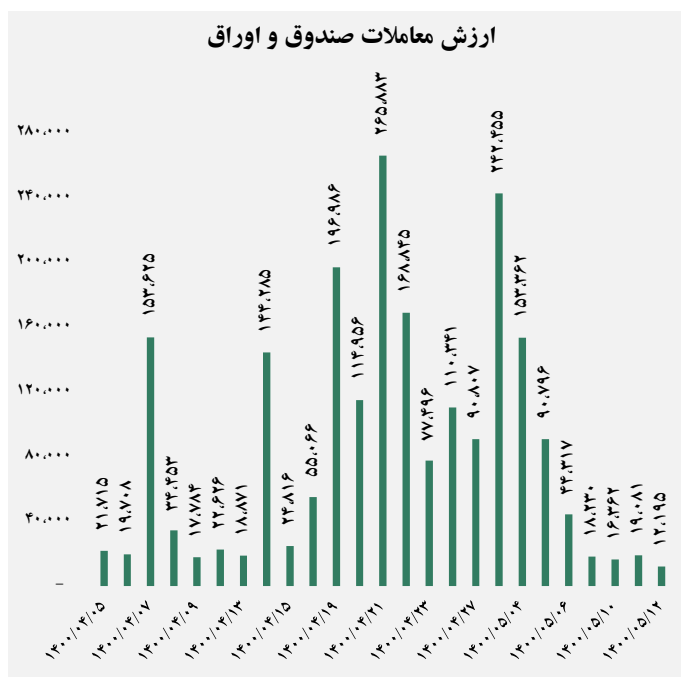
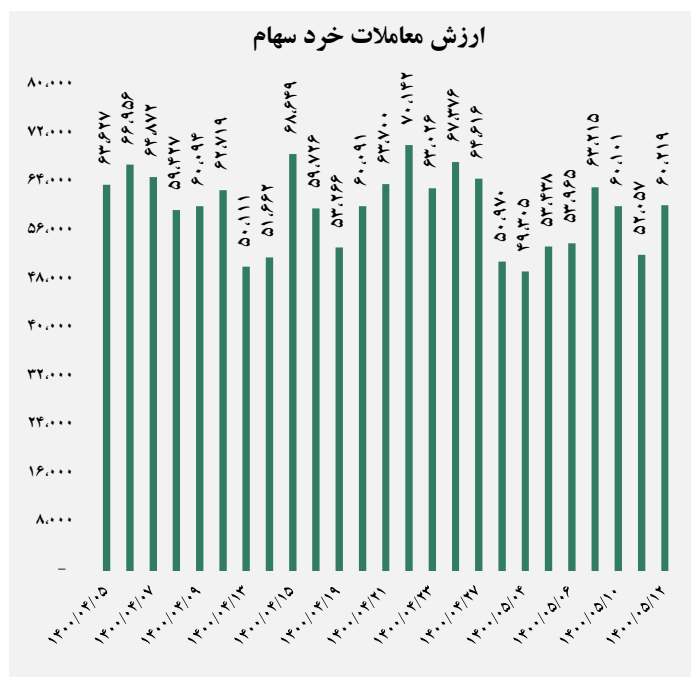




ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



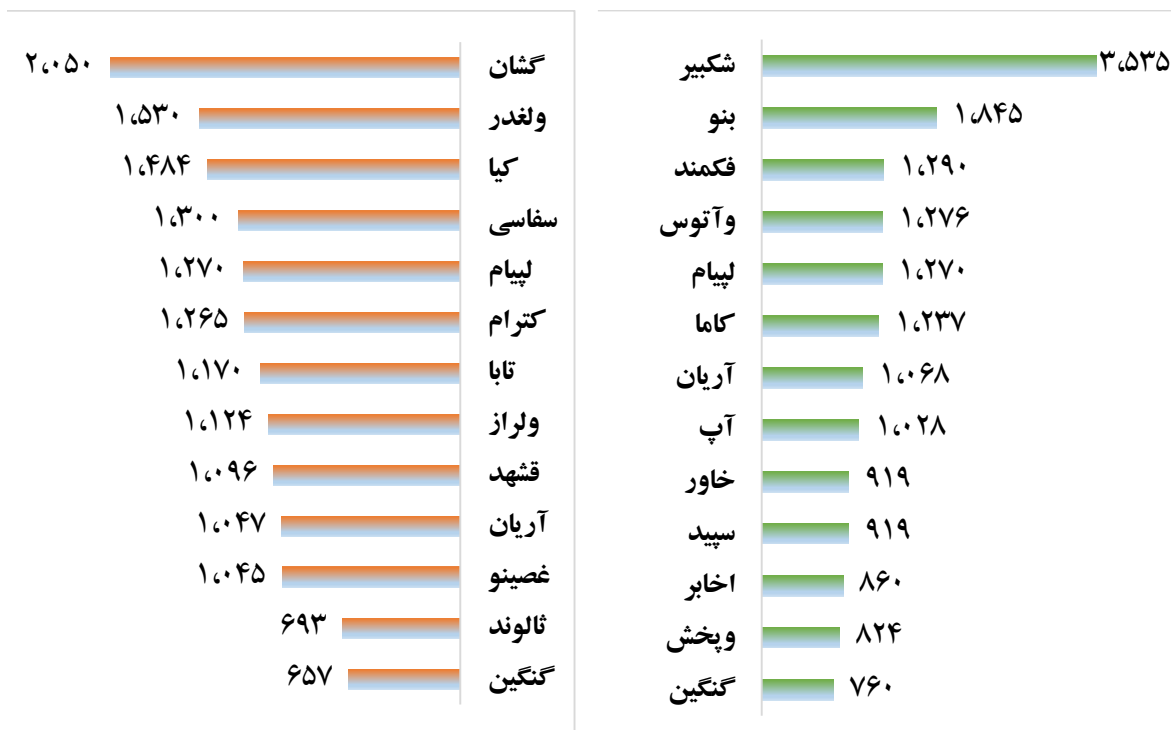
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



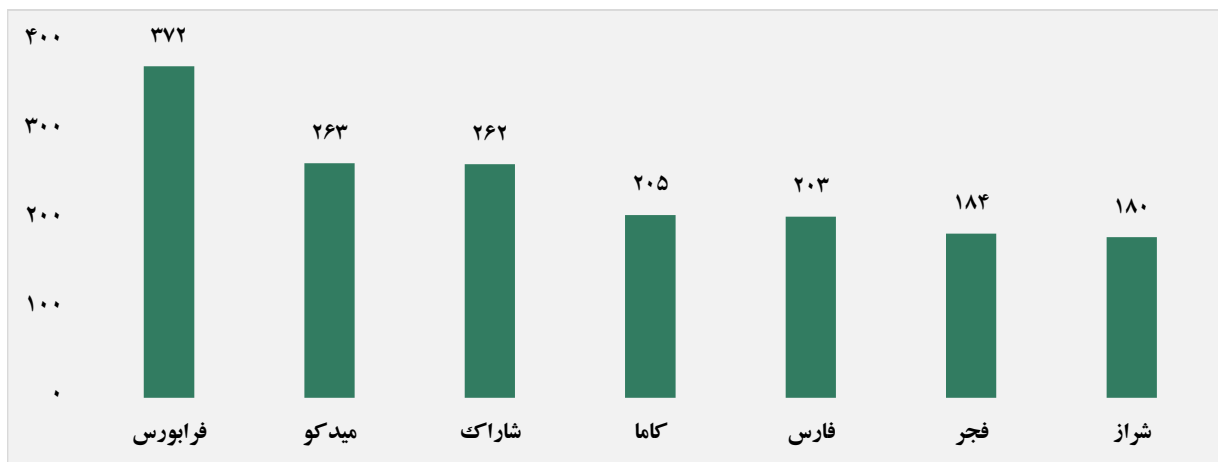
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



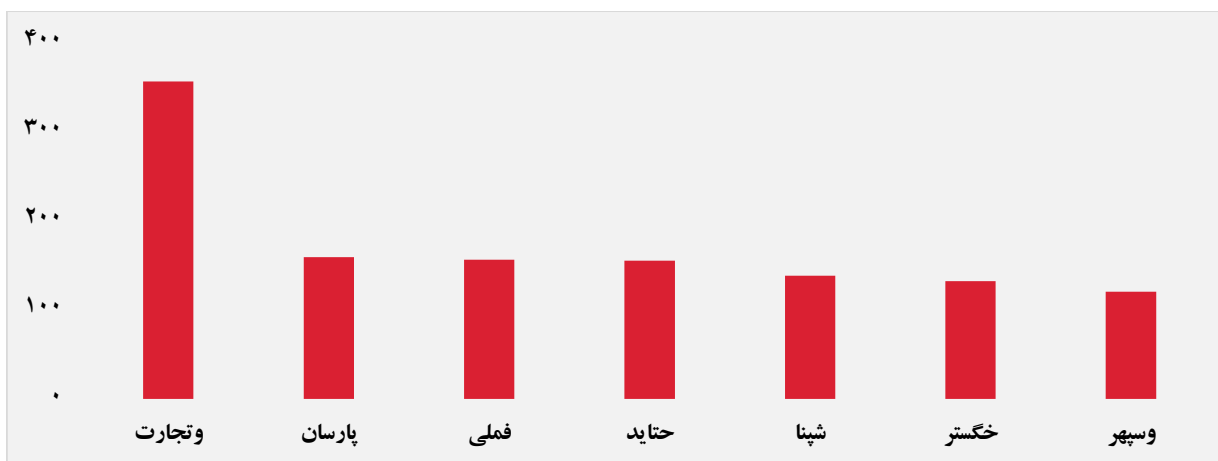
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شراز	۱	سکارون
۲	جم بیلن	۲	غگلیا
۳	پارس	۳	بالاس
۴	شیراز	۴	غنوش
۵	وآتوس	۵	هجرت
۶	وتوکا	۶	لپارس
۷	غشصفا	۷	قشیر
۸	دفارا	۸	سنیر
۹	سبزوا	۹	غمهرا
۱۰	دقاضی	۱۰	بمیلا

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



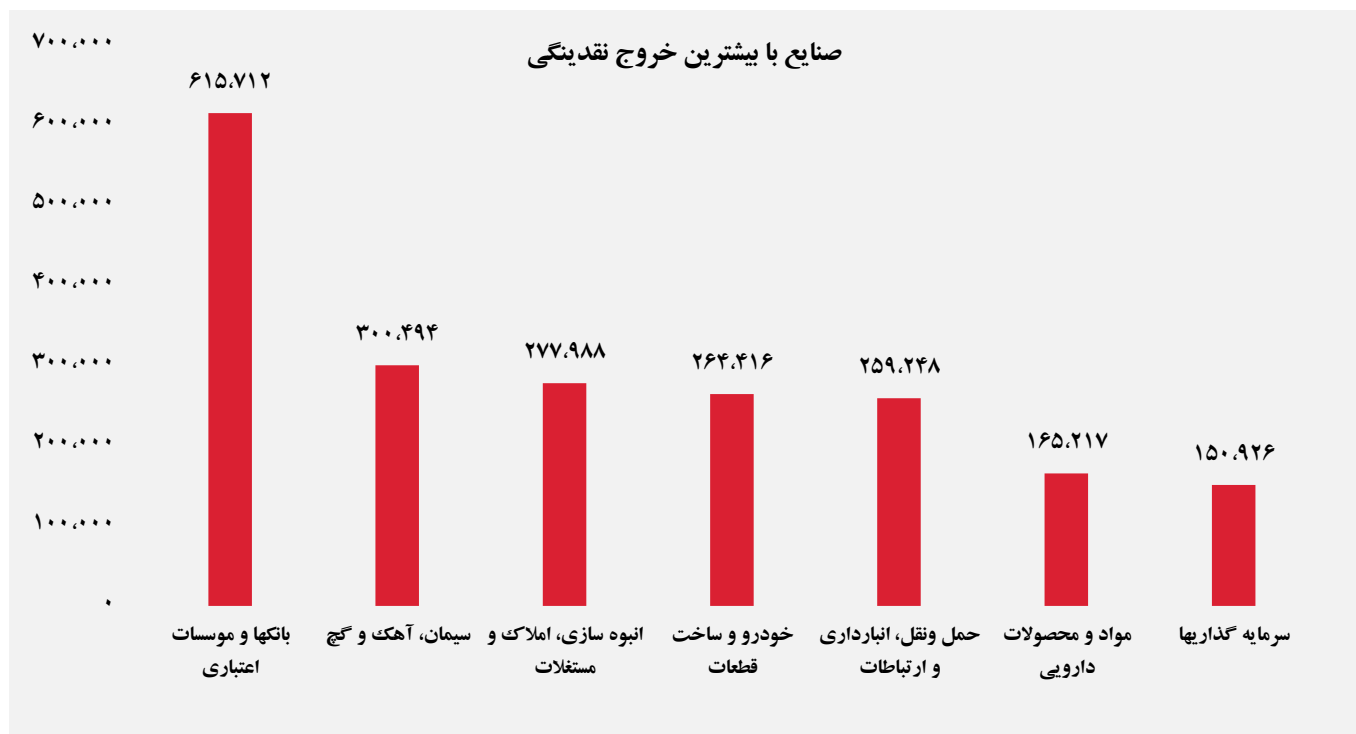
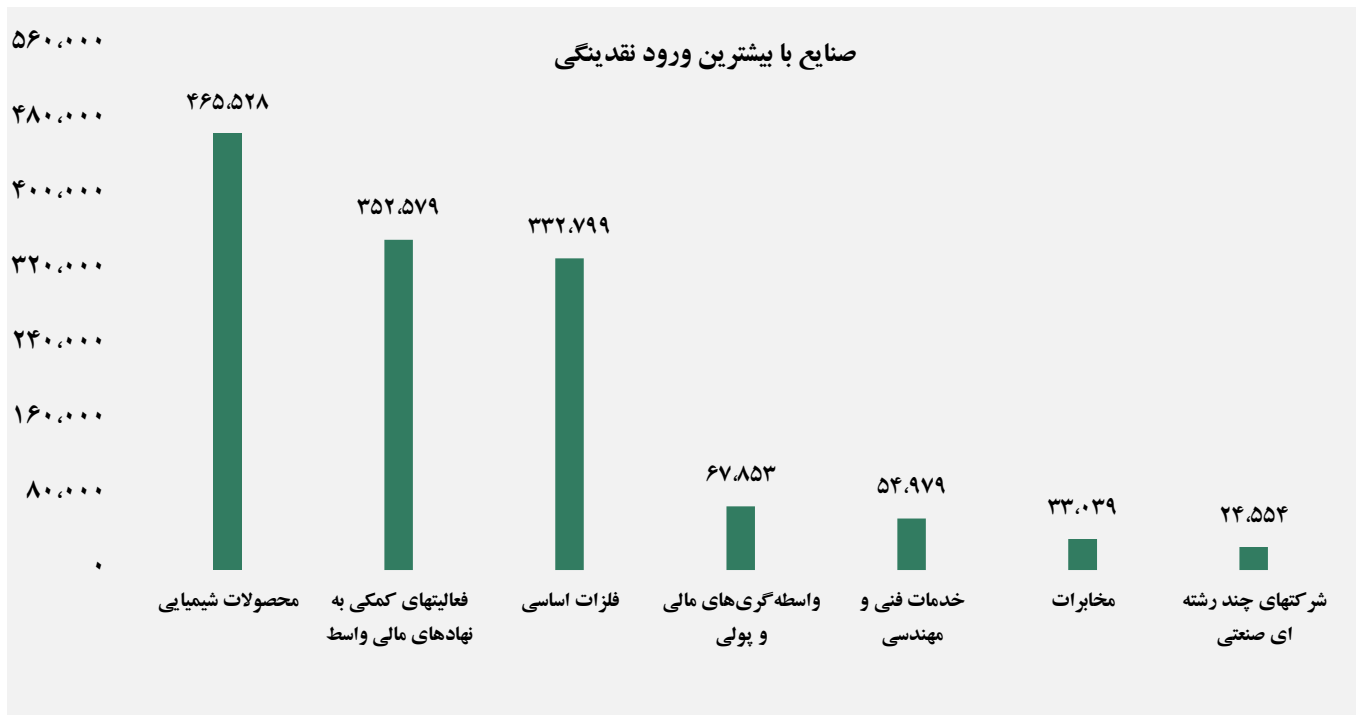
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ولصنم	۱۰	سبزوا
۲	شپترو	۱۱	خریخت
۳	شنتفت	۱۲	کیمیا
۴	سیلام	۱۳	فاما
۵	ثغرب	۱۴	وپترو
۶	غشان	۱۵	گکوثر
۷	شپدیس	۱۶	زفکا
۸	وآوا	۱۷	کخاک
۹	شرانل	۱۸	وتنو

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار