



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۱۶

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۱۶ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، وبملت، وتجارت، وبصادر، خسپا و پاکشو با افزایش ۱۷۱۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۰۷,۷۵۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۱۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۷۴ 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 ۶۷ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

شاخص کل در هفته گذشته با توجه به رشد دلار با رشد مناسبی همراه بود. بطوریکه این شاخص از ۱,۳۱۷,۰۰۰ تا بیش از ۱,۴۰۰,۰۰۰ واحد نیز رشد کرد. همچنین نرخ دلار نیز در هفته گذشته از حوالی ۲۵,۴۰۰ تومان تا ۲۷ هزار تومان رشد داشت، اگرچه در پایان هفته نرخ دلار در حوالی ۲۶ هزار تومان به کار خود پایان داد. امروز نیز قیمت دلار به کمتر از ۲۵,۵۰۰ تومان رسیده است. به نظر می‌رسد نرخ دلار در حوالی ۲۶ هزار تومان با مقاومت سنگینی روبه رو است و به تنش سیاسی و یا اقتصادی قوی نیاز دارد تا بتواند از محدوده ذکر شده عبور کند. اما اگر نرخ دلار از محدوده ۲۶ الی ۲۷ هزار تومان فراتر رود، با شتاب بیشتری به رشد خود ادامه خواهد داد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۸,۲۰۸ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش 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 ۷۱۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۲۵ با ۲۵,۷٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۱۳	۱۴۰۰/۰۵/۱۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳,۸۹۴	۲۸,۲۰۸	۶۲۴٪



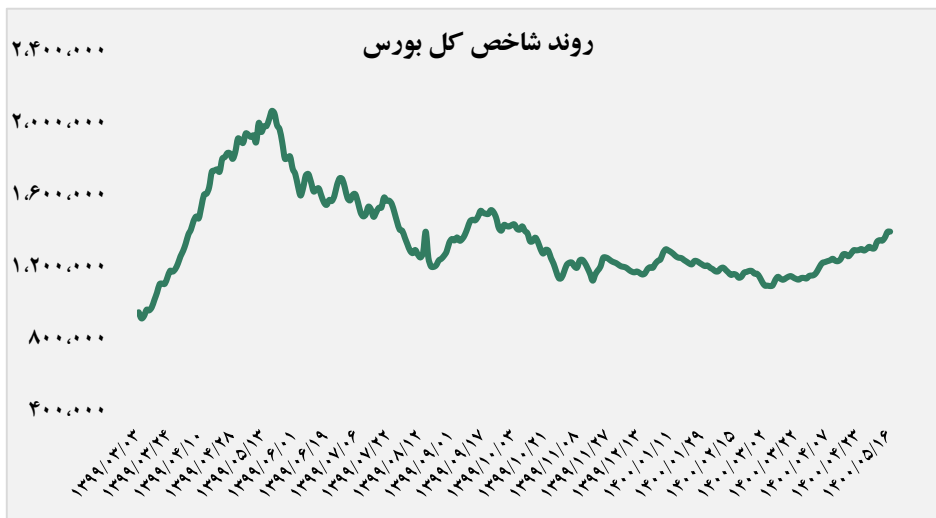
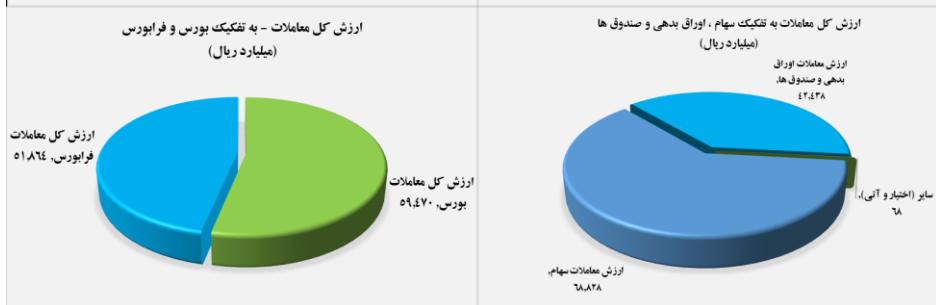
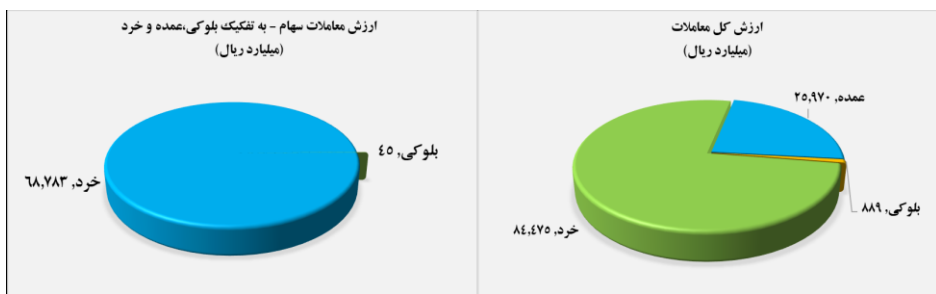
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی شیراز در ۱۲ ماهه ۹۹، ۶۰۷ تومان به ازای هر سهم سود ساخته بود. در اولین فصل سال مالی جدید سود ۱۲۸ تومانی را روانه کدال کرده است که نسبت به فصل قبل کاهش ۴ درصدی دارد. متوسط فروش فصلی سال گذشته برابر ۱,۸۰۰ میلیارد تومان بوده که در فصل اول سال جاری فروش شرکت برابر ۱,۷۰۰ میلیارد تومان است. این تولید کننده اوره در سال مالی ۹۹، ۳,۸۰۰ میلیارد تومان سود عملیاتی شناسایی کرده بود که در فصل اول ۱۴۰۰ این عدد ۸۶۹ میلیارد تومان است. سود عملیاتی سه ماهه رشد ۲۰ درصدی نسبت به فصل اول ۹۹ دارد. حاشیه سود شرکت در ۱۲ ماهه ۹۹، ۵۸ درصد بوده است و در فصل ابتدایی سال جاری ۵۷ درصد گزارش شده است. با قیمت‌های فعلی اوره گزارش های پیشرو درخشان تر خواهد بود و احتمالاً شاهد سود بیش از ۱۰۰۰ تومانی در ۱۲ ماهه شرکت باشیم.

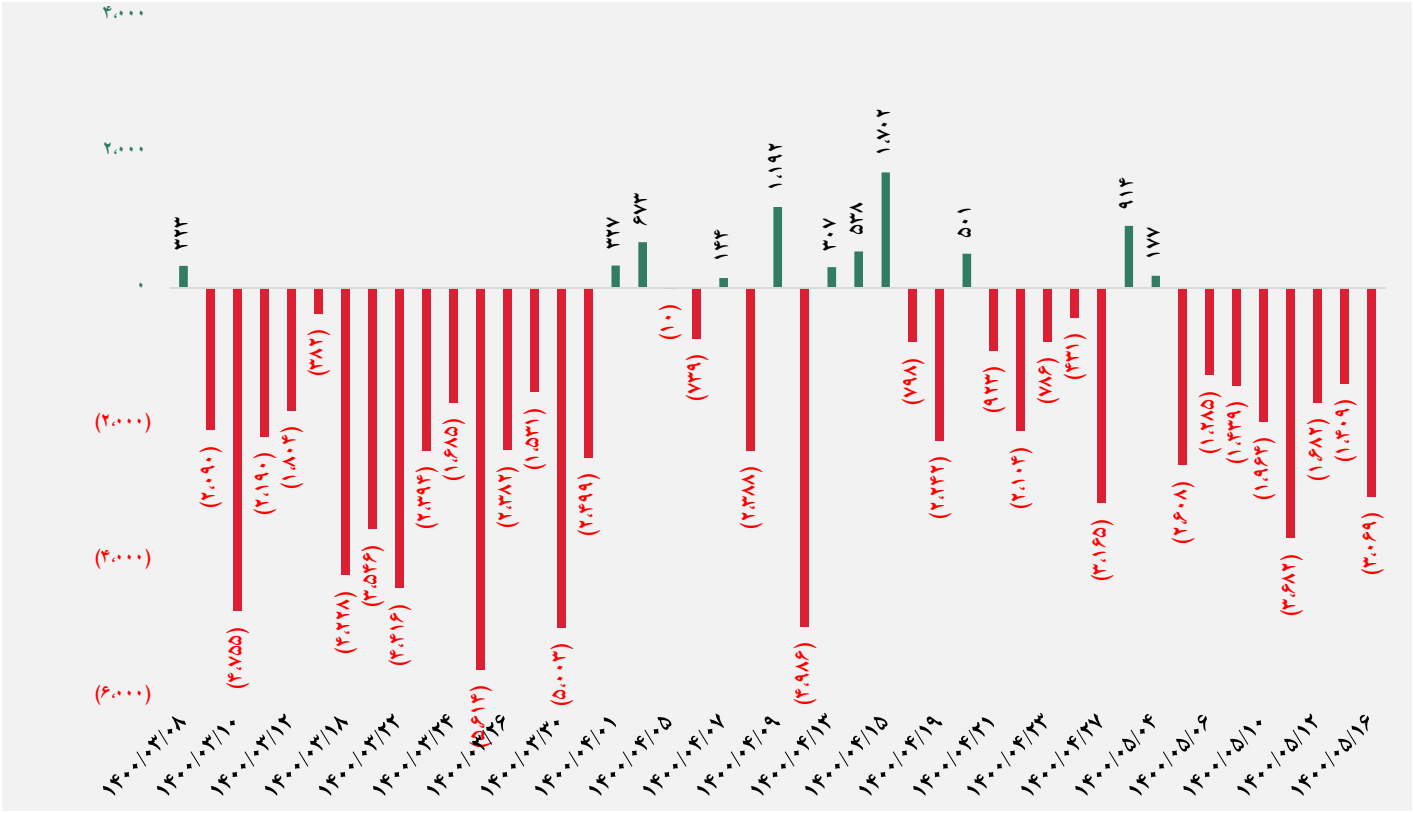
در همین گروه، پتروشیمی سازند، بهار سال جاری را با سود خالص ۱,۶۴۰ میلیارد تومانی (۲۰۳) تومانی به ازای هر سهم، که رشد ۴۲۲ درصدی نسبت به مدت مشابه سال ۹۹ داشته است به پایان رساند. سهم در ۱۲ ماهه سال ۹۹ سود ۴۲۵ تومانی را ثبت کرده بود. فروش شرکت در بهار سال جاری ۴,۳۰۰ میلیارد تومان بوده که ۲۹ و ۵ درصد بیشتر از بهار و زمستان سال قبل است. حاشیه سود ۴۵ درصد گزارش شده که این عدد در زمستان ۴۱ و در بهار سال قبل ۲۳ درصد بوده است. سود عملیاتی ۱۲ ماهه ۹۹ شرکت ۳,۵۰۰ میلیارد تومان است که در فصول اول تا چهارم به ترتیب ۳۱۱، ۵۰۶، ۱,۲۴۵ و ۱,۵۰۰ میلیارد تومان بوده است. سال ۱۴۰۰ را با سود عملیاتی ۱,۷۰۰ میلیارد تومانی آغاز کرده است. در حال حاضر نسبت قیمت به درآمد گذشته نگر سهم به ۶,۳ واحد رسیده است. قیمت سهام این شرکت در یک ماه گذشته با رشد مناسبی همراه بوده است و در حال حاضر حوالی ۳,۷۰۰ تومان می باشد.

تصویر کلی بازار

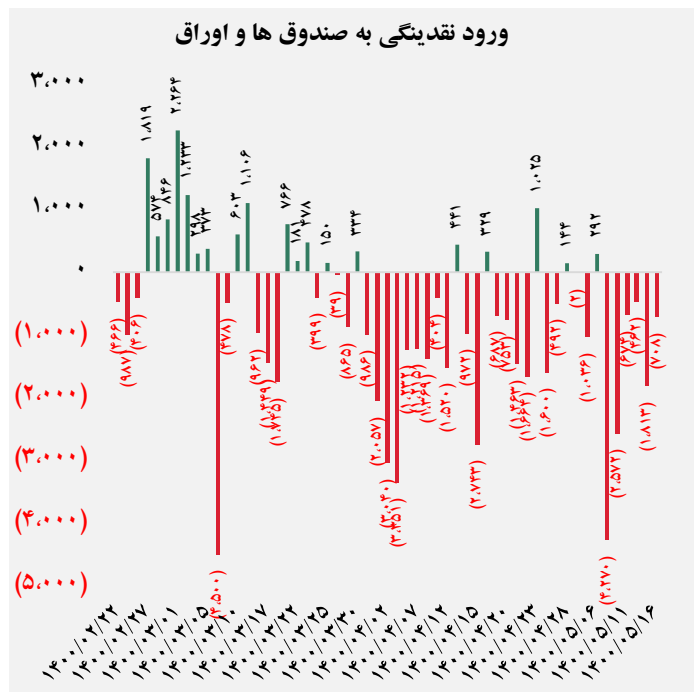
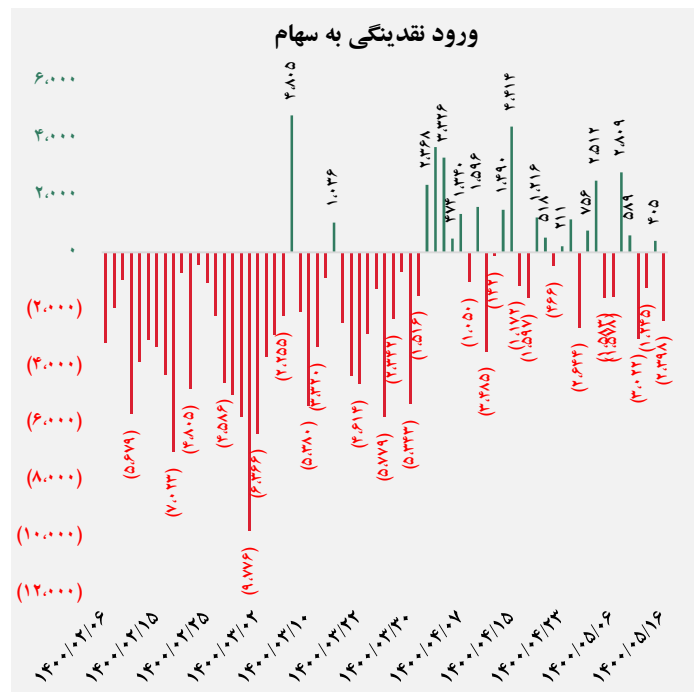
فرا بورس		بورس	
۲۰,۲۴۰	شاخص کل	۱,۴۰۷,۷۵۸	شاخص کل
۴۷	تغییر شاخص	۱,۷۱۸	تغییر شاخص
۱۱,۰۴۸,۴۴۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۶,۵۸۳,۹۵۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۵۱,۸۶۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۹,۴۷۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
کگلر		فارس	
مارون		وبملت	
فرا بورس		وتجارت	
پاس		ویصادر	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
زاگرس		پارسان	
غصینو		فخوز	
شگوبا		فملی	
آریا		میدکو	



کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



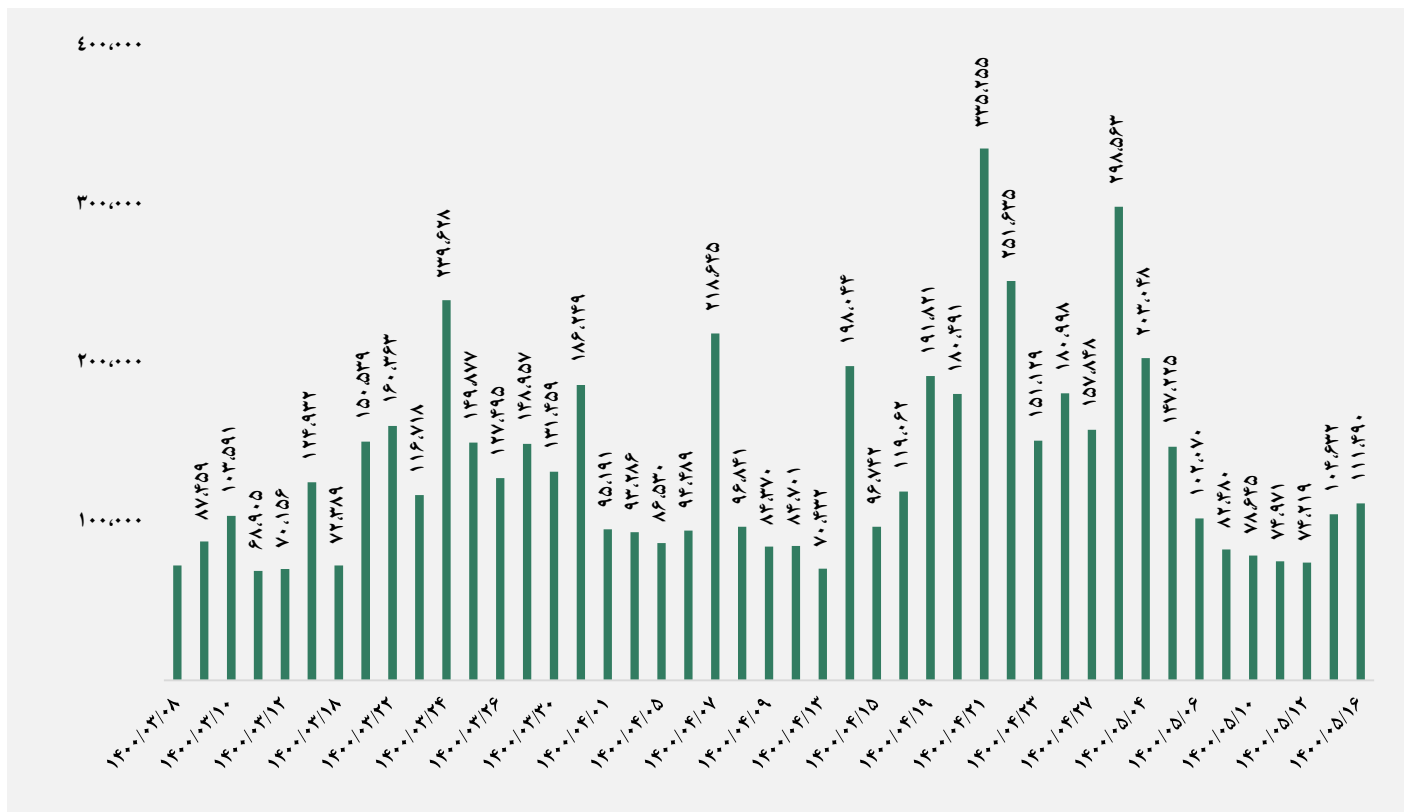
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



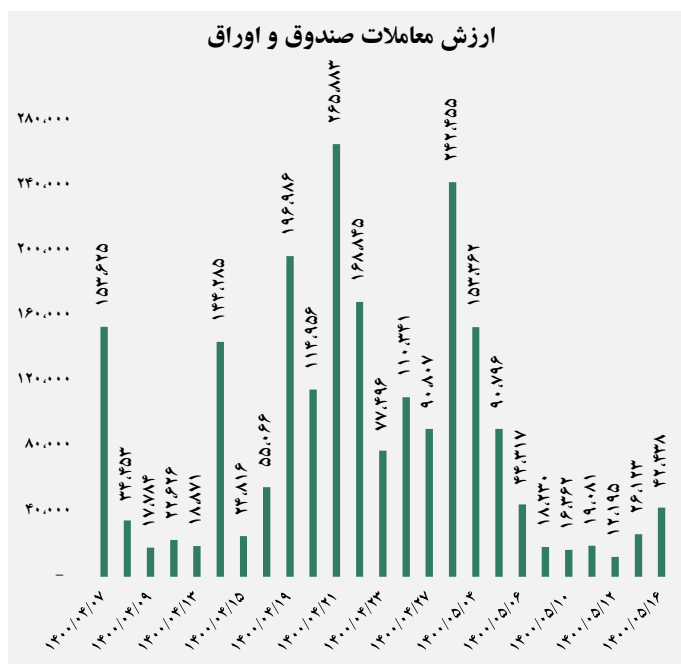
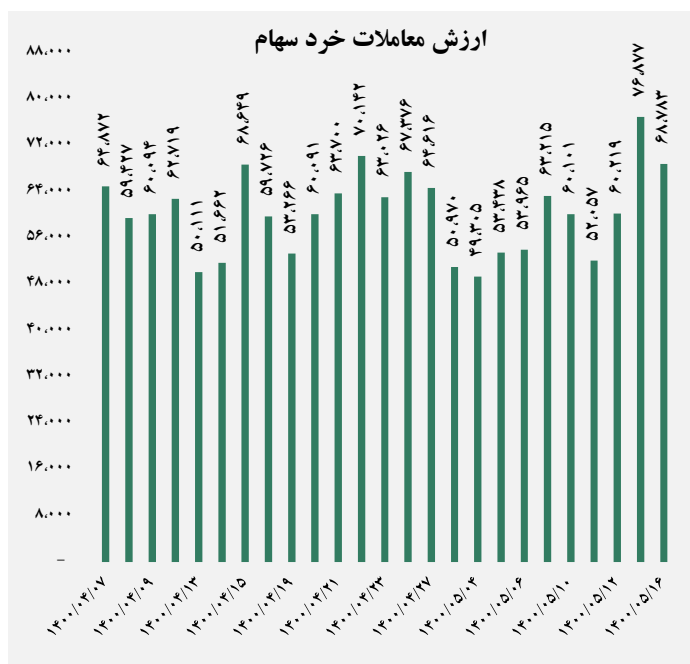
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

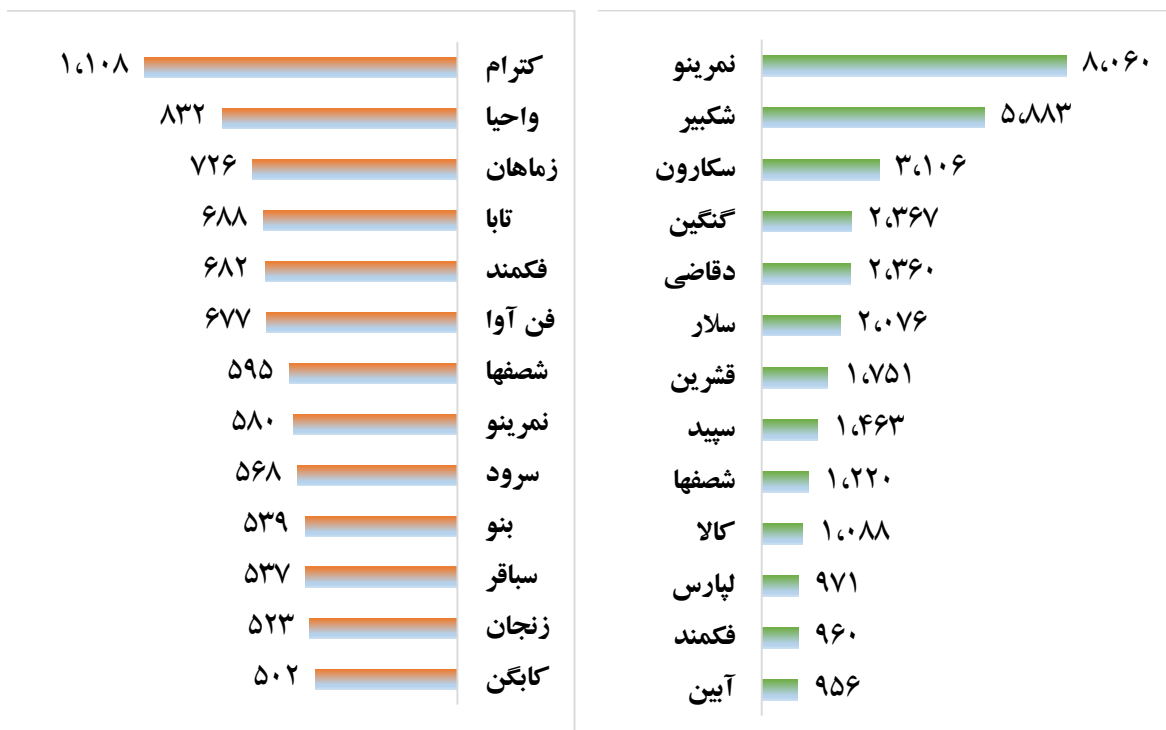


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



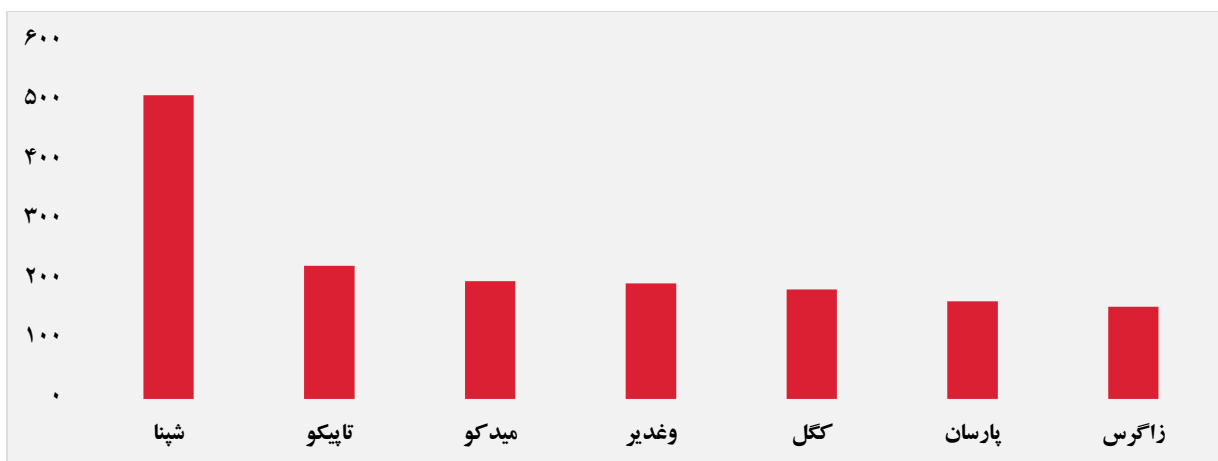
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	های وب	۱	شپترو
۲	سپید	۲	فایرا
۳	تیمپی	۳	پلاست
۴	شکیر	۴	تکنار
۵	شصفها	۵	وملت
۶	ومدیر	۶	چپترو
۷	فوکا	۷	کترام
۸	فاهواز	۸	دحاوی
۹	لکما	۹	گکیش
۱۰	ساروج	۱۰	تپکو

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



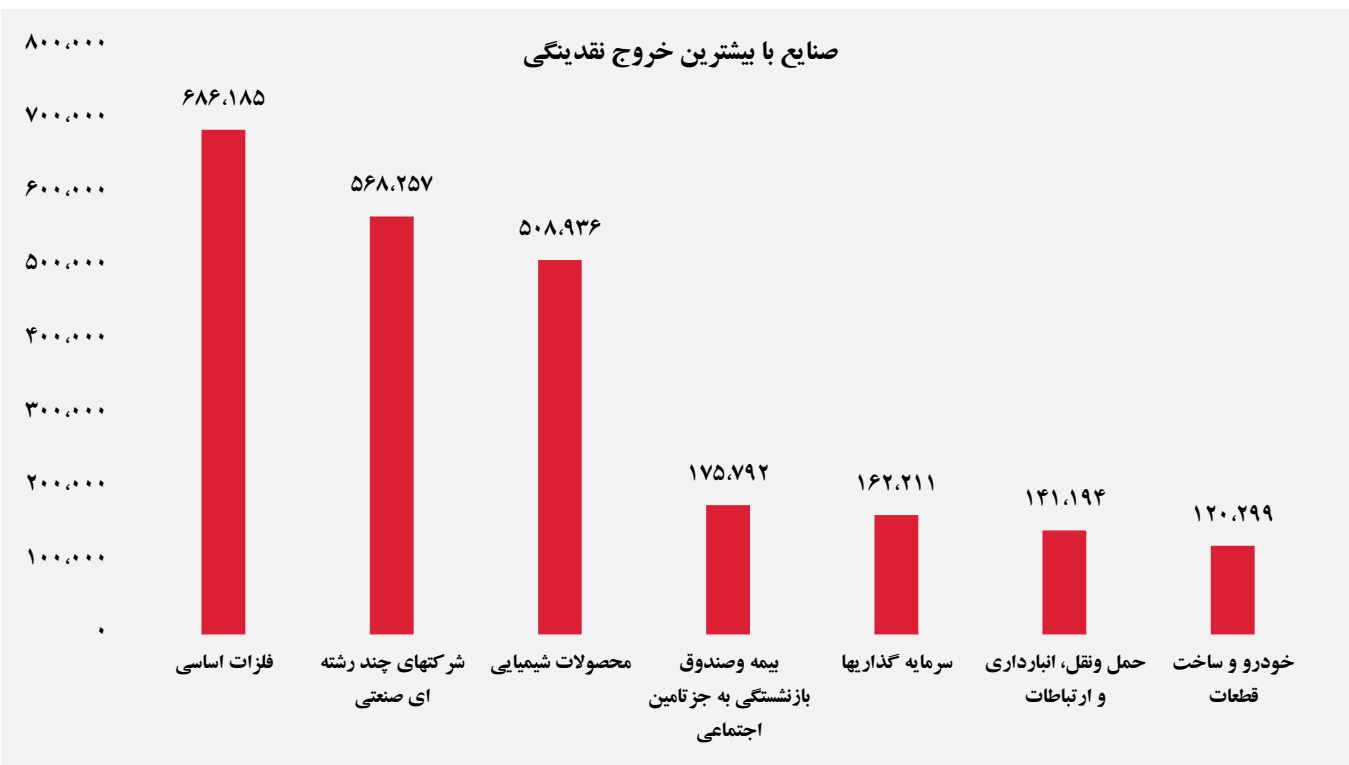
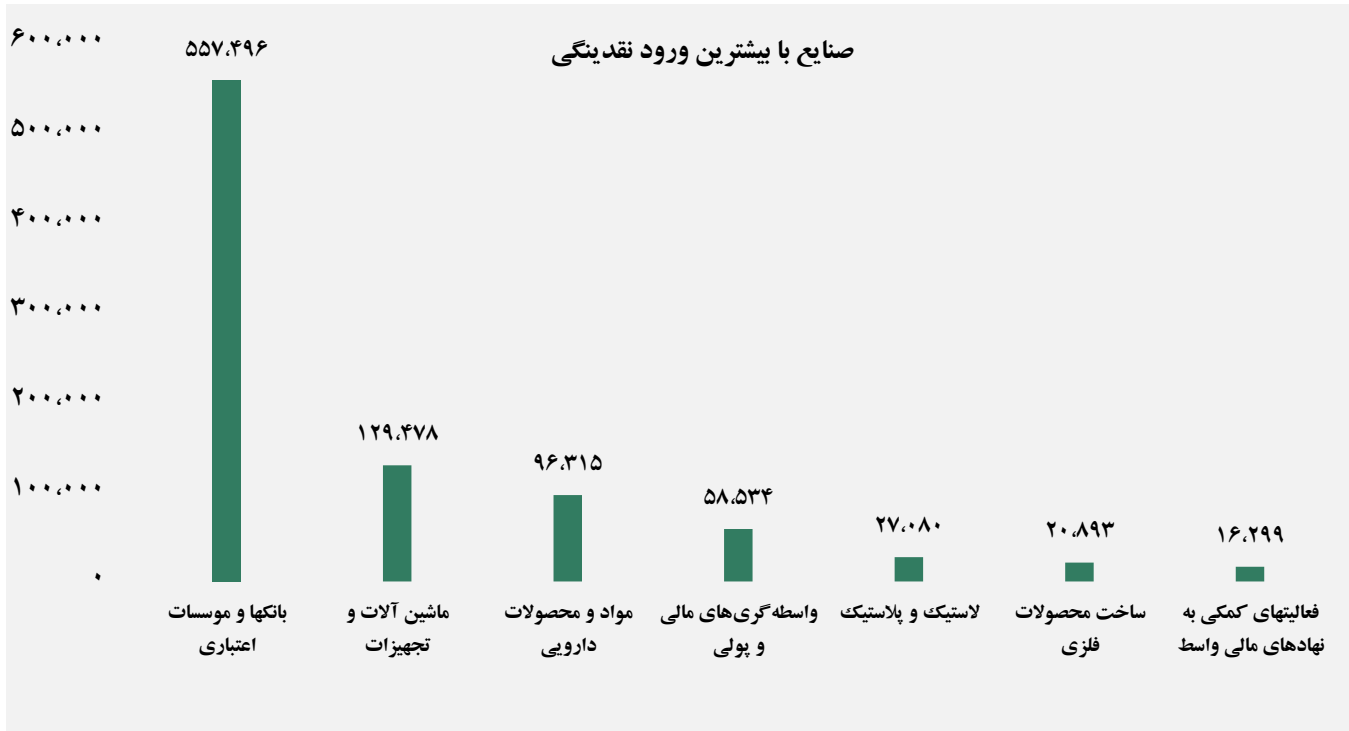
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	سپید	۱۰	های وب
۲	برکت	۱۱	بوعلی
۳	شغدیر	۱۲	غکورش
۴	فزرین	۱۳	نوری
۵	فجر	۱۴	غدیس
۶	تشرق	۱۵	شاراک
۷	شاون	۱۶	دفارا
۸	زاگرس	۱۷	کزغال
۹	شپلی	۱۸	غوینا

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار