



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۱۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۸ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، پارس، فارس، فخوز، رمپنا و شستا با افزایش ۱۵۳۱۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۳۳,۱۷۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۵۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۷۰ 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 ۲۸ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

امروز بازار از مقاومت یک میلیون و ۴۱۰ هزار واحد نیز عبور کرد. به نظر می‌رسد مقاومت بعدی شاخص بر روی ۱,۵۵۰ میلیون واحد باشد. در ماه آینده، به دلیل شناسایی سود و سال مالی برخی از شرکت‌ها در بازار احتمال دارد، عرضه‌ها بیشتر شود و شاهد روند اصلاحی در بازار باشیم. احتمال عبور شاخص از مرز ۱,۵ میلیون واحد بر فرض پایین نیامدن دلار و فروش نفت زیاد است. اما باید توجه داشت که برای تحلیل دقیق، شرایط مختلفی را باید در نظر بگیریم که در حال حاضر روند بازار سرمایه با ابهامات سیاسی و اقتصادی زیادی در سطح داخلی و خارجی رو به رو است و اجازه تحلیل درست را نمی‌دهد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۵۲,۹۹۷ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش 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 ۸۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ با ۳۳,۱٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۱۷	۱۴۰۰/۰۵/۱۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۸۰,۴۳	۱۵۲,۹۹۷	۱۸۰,۲٪



گروه‌های مؤثر

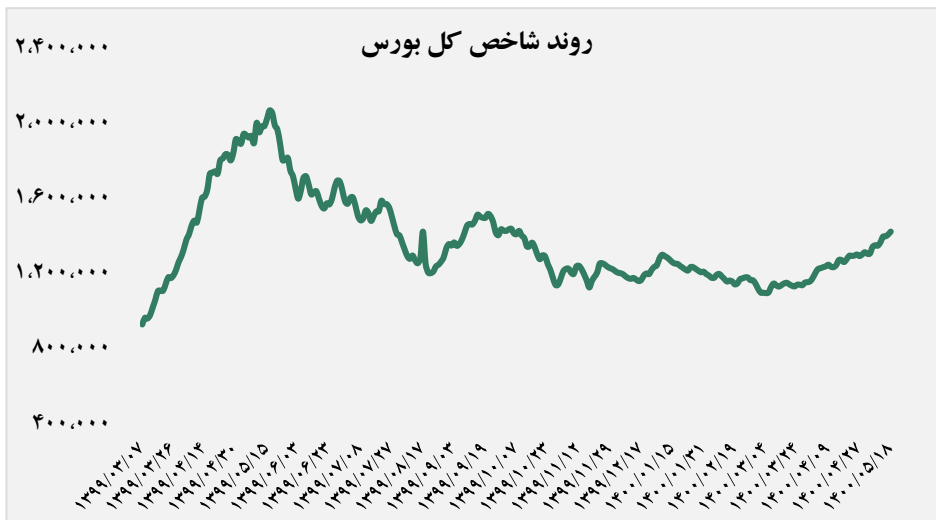
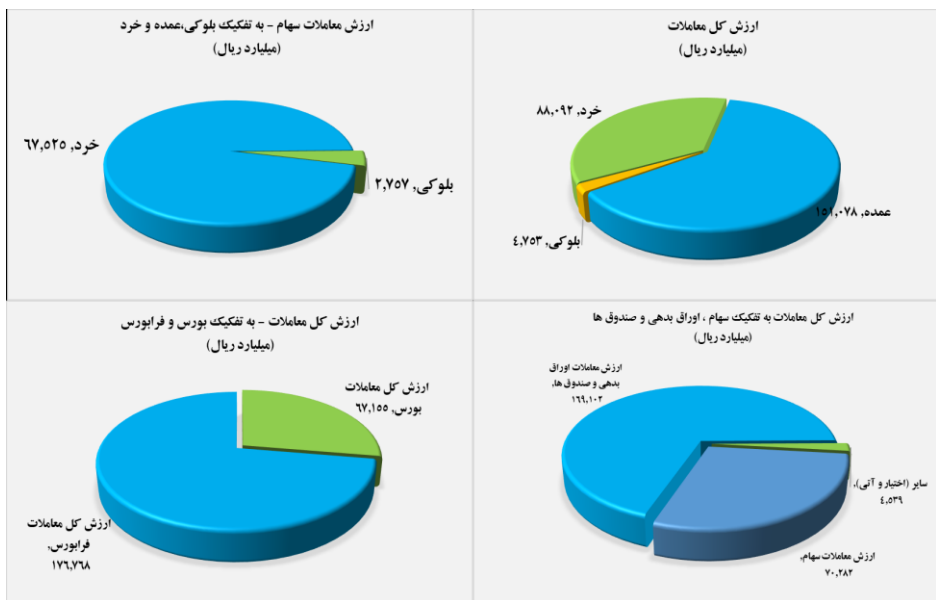
در گروه لاستیک، گروه لاستیک بارز در سه ماهه سال ۱۴۰۰ سود ۳۶ تومانی را به ازای هر سهم محقق کرده است که رشد ۱۳ درصدی نسبت به مدت مشابه سال گذشته دارد. ۱۲ ماهه سال گذشته ۲۶۵ تومان به ازای هر سهم سود ساخته بود. شرکت در فصل سوم و چهارم سال گذشته ۳۲ و ۱۳۲ تومان سود و در فصل دوم نیز ۷۵ تومان سود داشته است. در فصل چهارم سال مالی گذشته فروش ۱۲۰۰ میلیارد تومان، حاشیه سود ۱۹ درصد، سود عملیاتی ۱۸۷ میلیارد و سود خالص به کمک سود سرمایه گذاری ها ۳۳۴ میلیارد تومانی را داشته است. در فصل اول سال مالی ۱۴۰۰ فروش ۱,۱۵۴ میلیارد تومان، حاشیه سود ۱۳ درصد، سود عملیاتی ۱۲۶ میلیارد تومان و سود خالص ۹۰ میلیارد تومانی را داشته است. حاشیه سود و سود عملیاتی کل سال مالی ۹۹ برابر ۲۲ درصد و ۶۴۳ میلیارد تومان بوده است.

در گروه شیمیایی، پتروشیمی پارس بهار سال جاری را با سود خالص ۲,۸۰۰ میلیارد تومانی (۴۵۸ تومانی به ازای هر سهم)، که رشد ۵۰ درصدی نسبت به مدت مشابه سال ۹۹ داشته است، به پایان رساند. شرکت در ۱۲ ماهه سال ۹۹ سود ۲,۰۳۷ تومانی را ثبت کرده بود. فروش شرکت در بهار سال جاری ۱۰,۰۰۰ میلیارد تومان بوده که ۱۴۰ و ۵ درصد بیشتر از بهار و زمستان سال قبل است. حاشیه سود ۲۸ درصد گزارش شده که این عدد در زمستان ۲۴ و در بهار سال قبل ۲۳ درصد بوده است. سود عملیاتی ۱۲ ماهه ۹۹ شرکت ۱۰,۰۰۰ میلیارد تومان است که در فصول اول تا چهارم به ترتیب ۸۰۳، ۲,۲۰۰، ۲,۰۰۰ و ۵,۵۰۰ میلیارد تومان بوده است. سال ۱۴۰۰ را با سود عملیاتی ۲,۵۰۰ میلیارد تومانی آغاز کرده است.

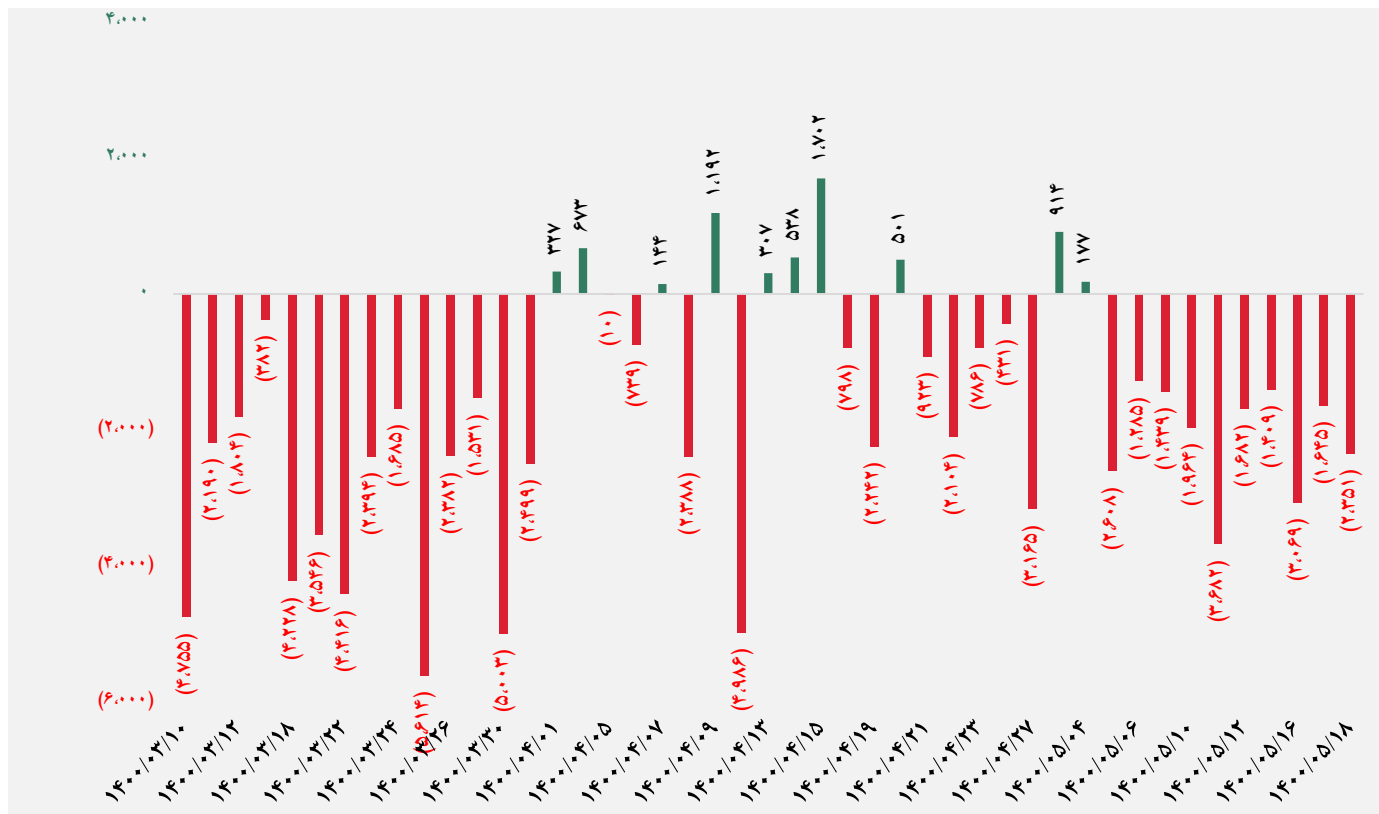
در گروه شوینده‌ها، پاکسان در سه ماهه دوم سال مالی ۱۴۰۰، زیان ۱۴ تومانی را به ازای هر سهم محقق کرده است. ۱۲ ماهه سال گذشته ۲۴۸ تومان به ازای هر سهم سود ساخته بود. سهم در فصل اول سال جاری ۳۵ تومان سود داشته است. در فصل چهارم اول سال مالی فروش ۵۲۶ میلیارد تومان، حاشیه سود ۱۳ درصد، سود عملیاتی ۵۵ میلیارد و سود خالص ۳۸ میلیارد تومانی را داشته است. در فصل دوم سال مالی ۱۴۰۰ فروش ۴۲۰ میلیارد تومان، حاشیه سود ۹ درصد، سود عملیاتی ۱۸ میلیارد و زیان خالص ۱۵ میلیارد تومانی را داشته است. حاشیه سود و سود عملیاتی کل سال مالی ۹۹ برابر ۲۵ درصد و ۳۵۵ میلیارد تومان بوده است.

تصویر کلی بازار

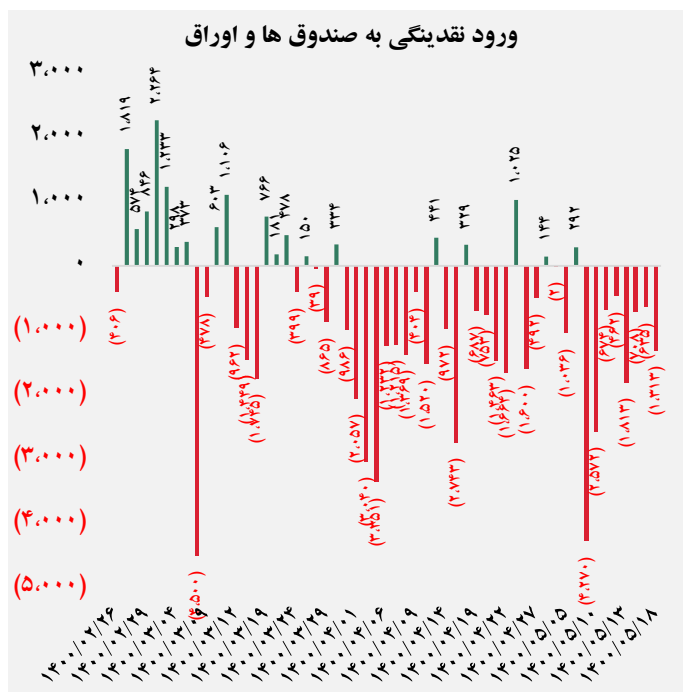
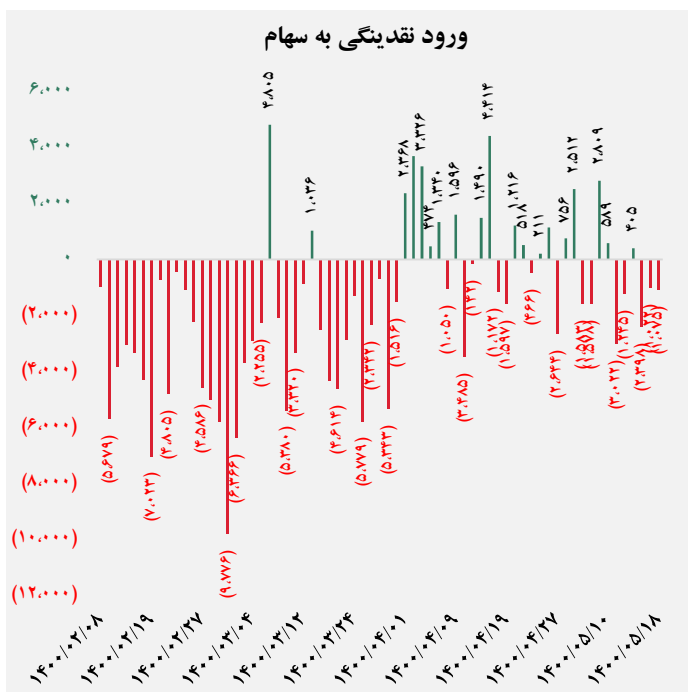
فرا بورس		بورس	
۲۰,۴۴۹	شاخص کل	۱,۴۳۳,۱۷۵	شاخص کل
۱۴۰	تغییر شاخص	۱۵,۳۱۴	تغییر شاخص
۱۱,۱۷۶,۱۱۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۷,۶۱۶,۰۲۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۷۶,۷۶۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۶۷,۱۵۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
هرمز		فولاد	
مارون		پارس	
فرا بورس		فارس	
شراز		فخوز	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
کگل		کچاد	
کوثر		کگل	
دی		وامید	
صبا		اپال	



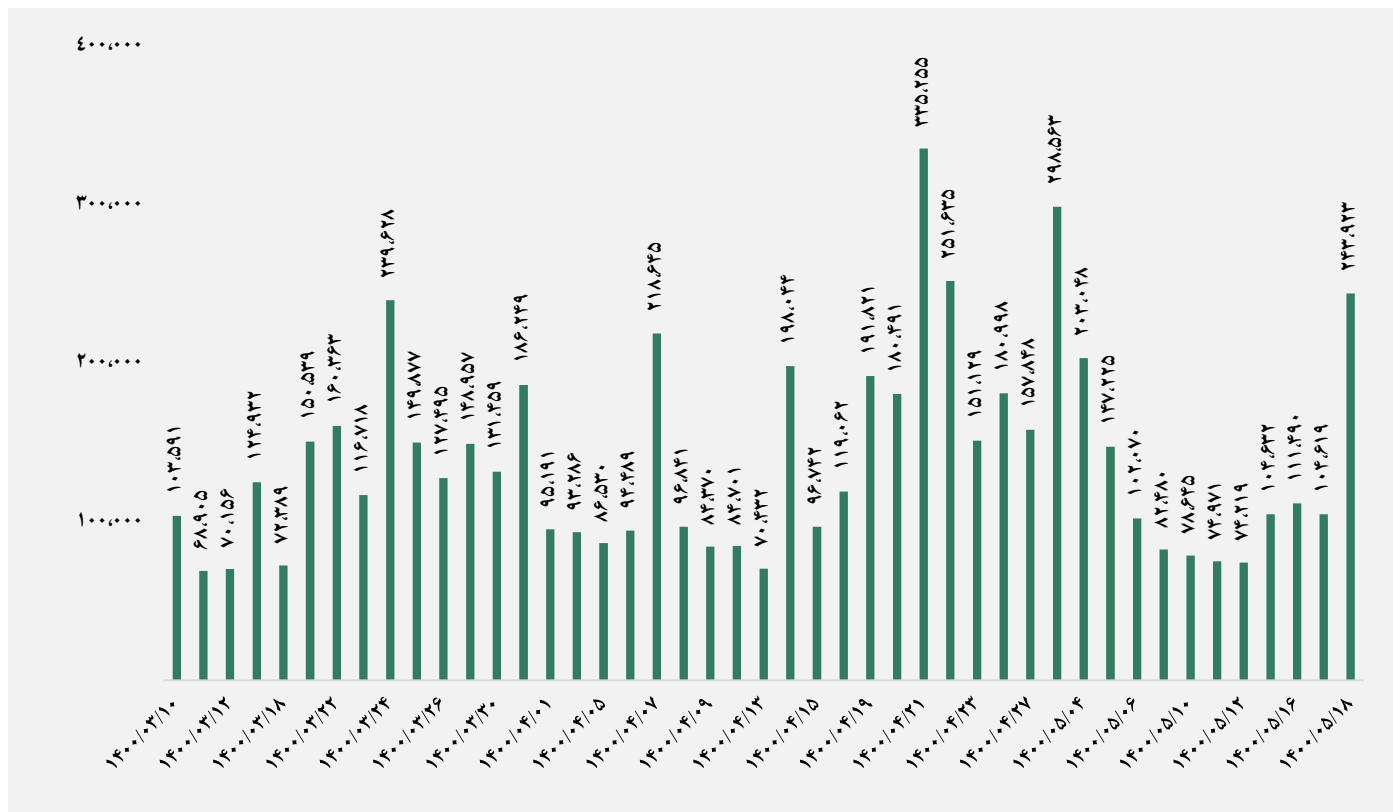
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلارد ریال)



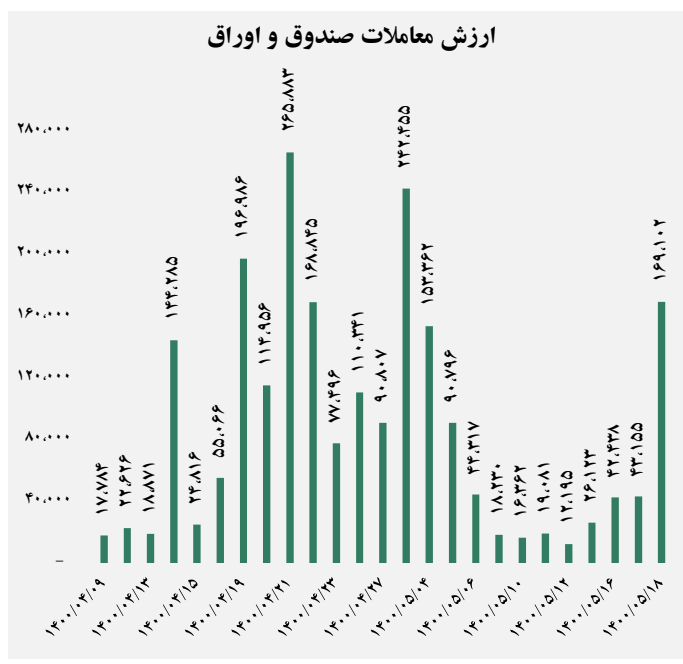
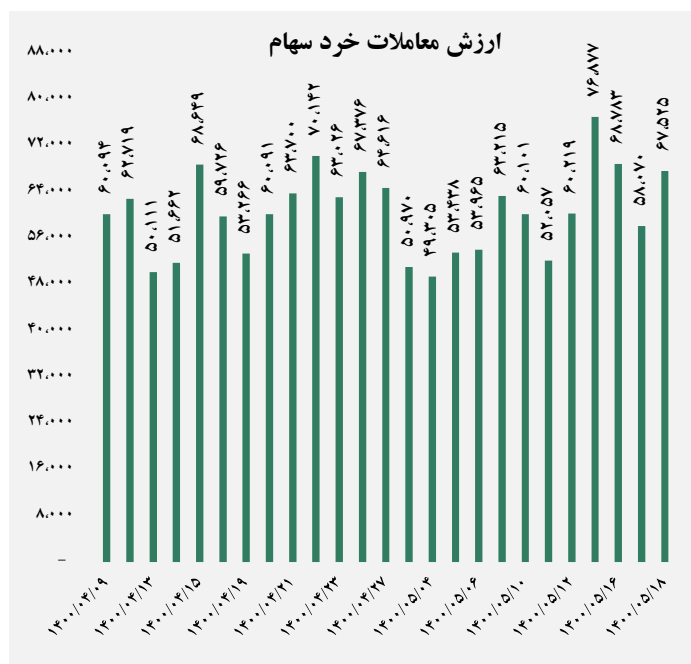
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

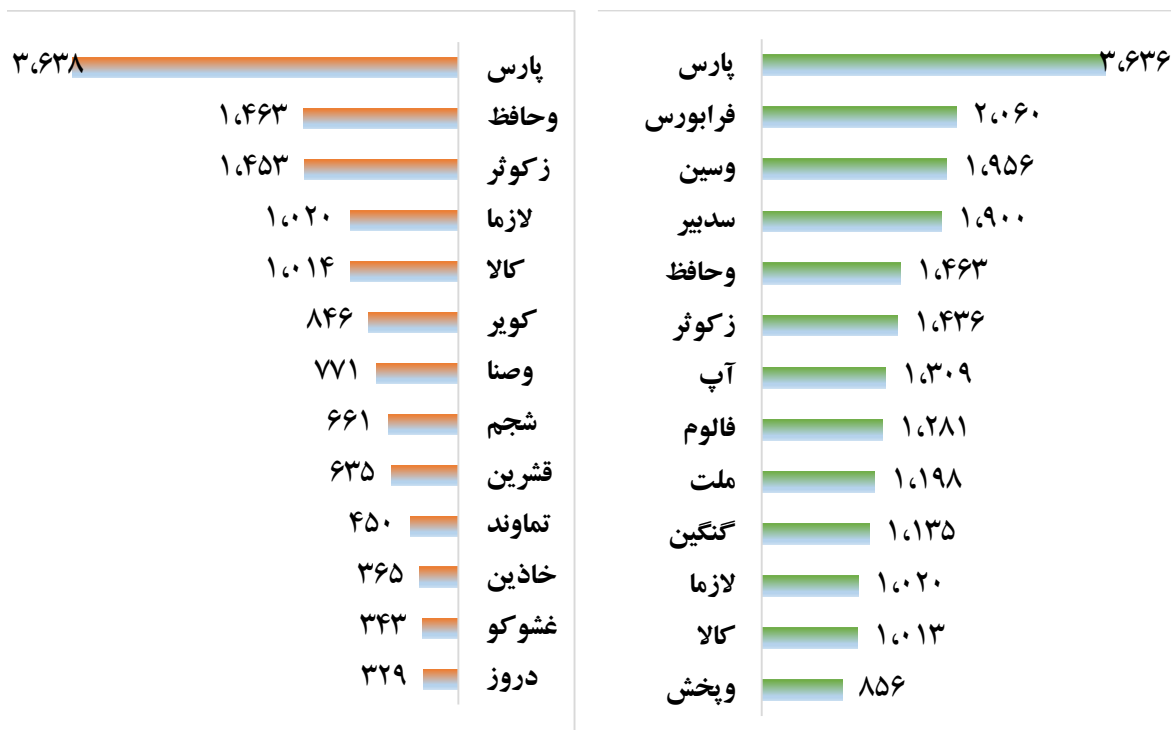


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





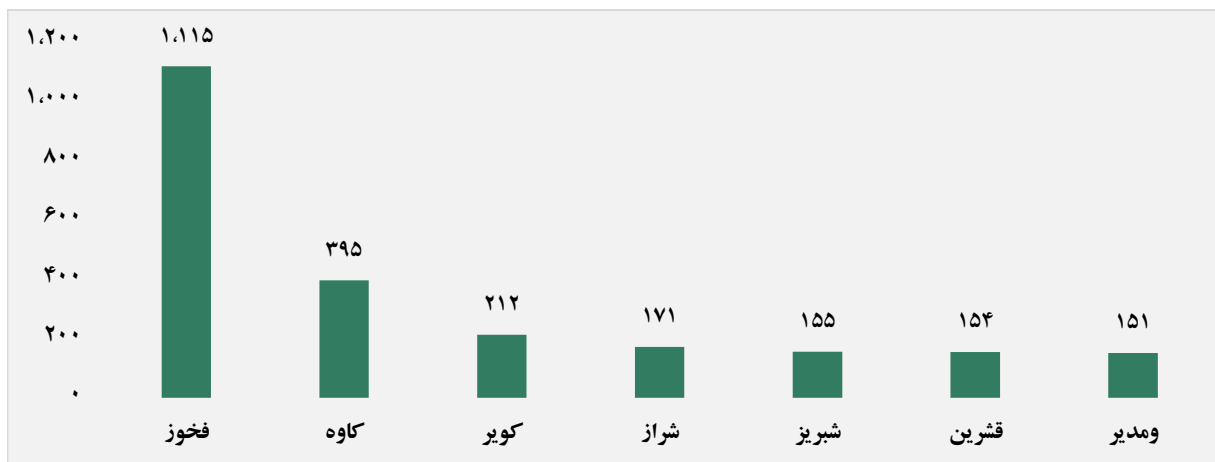
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



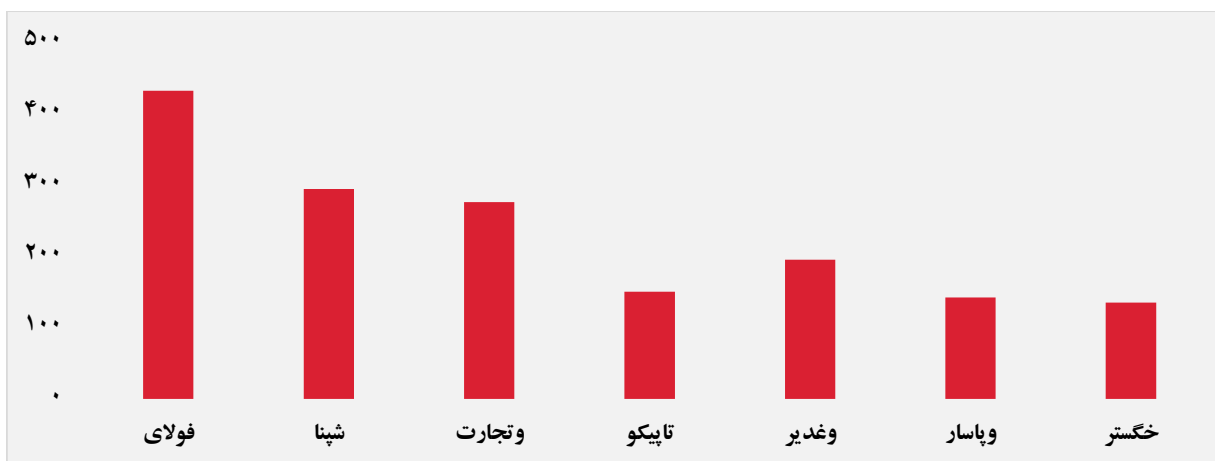
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	بکاب	۱	وامین
۲	غشوکو	۲	ثنام
۳	شاروم	۳	زنجان
۴	قشیر	۴	وملت
۵	ولیز	۵	ثالوند
۶	کپرور	۶	کدما
۷	کاوه	۷	سامان
۸	فخوز	۸	غدام
۹	کویر	۹	قشهد
۱۰	فایرا	۱۰	کوثر

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



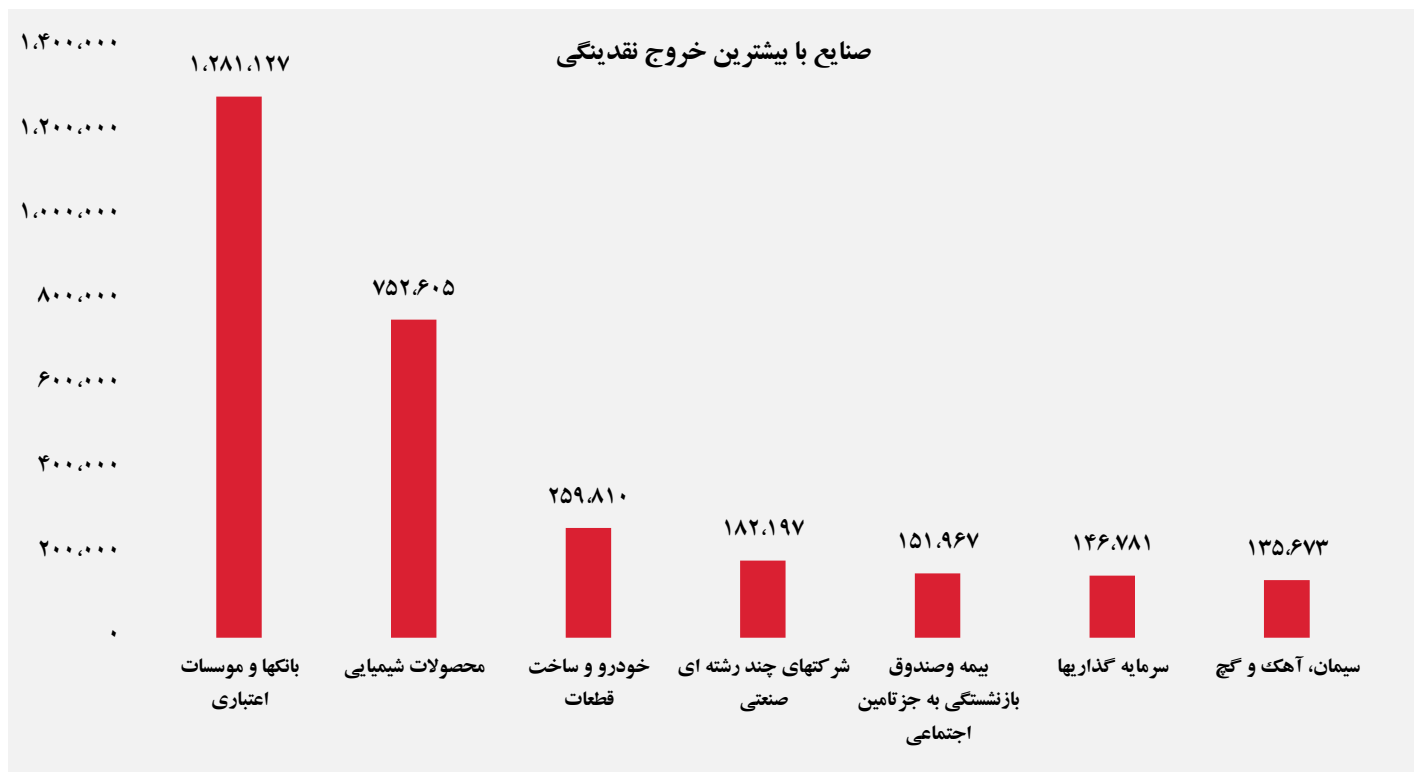
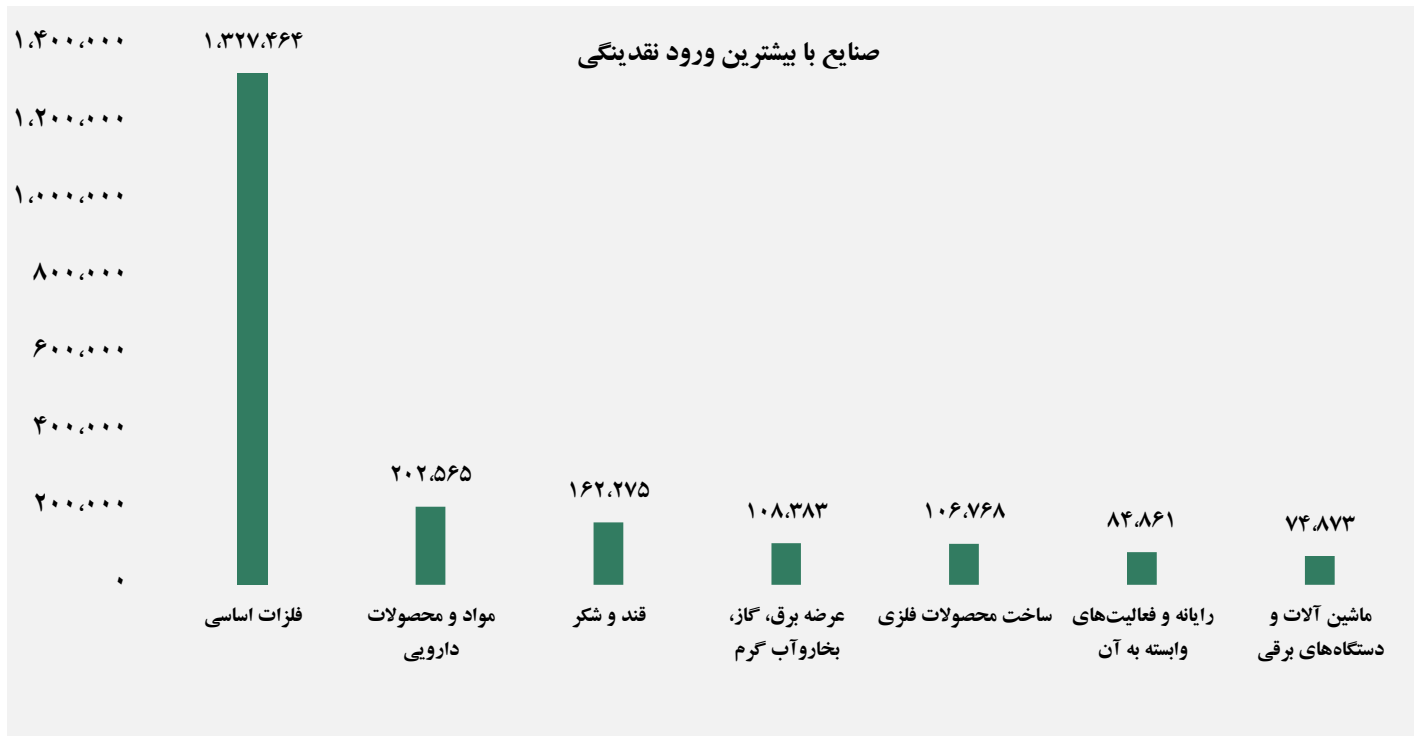
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	شراز	۱۰	سمازن
۲	خصیر	۱۱	بوعلی
۳	ثشرق	۱۲	ثنور
۴	شغدیر	۱۳	دتوزیع
۵	ستران	۱۴	ثنوسا
۶	پرکت	۱۵	ومدیر
۷	غفارس	۱۶	فزرین
۸	شاوان	۱۷	غدیس
۹	فجر	۱۸	سشرق

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار