



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۲۰

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۲۰ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، فولاد، شستا، فملی، کگل و پارس با افزایش ۳۰۷۷۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۸۴,۵۹۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۰۰ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۱۰۰ هزار میلیارد ریال از کل ارزش معاملات در روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام، حق تقدم و صندوق های قابل معامله سهامی می باشد. در روز جاری ۵۰ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

دلار به عنوان یکی از محرک های بازار سرمایه در روز جاری تا نزدیکی کانال ۲۶ هزار واحد پیش رفته است و این برای سهامداران می تواند خبر مهمی باشد. شاخص کل نیز به محدوده ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد نزدیک شده است و اکثر فعالان بازار سرمایه به این محدوده شاخص کل حساسیت بالایی نشان خواهند داد. به نظر می رسد در محدوده های ذکر شده در شاخص کل شاهد فشار عرضه در اکثر نمادها باشیم اما اگر نرخ دلار به روند صعودی خود ادامه دهد، شاخص کل نیز می تواند با همراهی گروه فلزات و شیمیایی به راحتی از این محدوده عبور کند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۶۳,۹۴۹ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۶۴۴، 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 ۷۲۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۸/۲۴ با ۲۱,۴۱٪ سود است.

| شرح   | ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ | ۱۴۰۰/۰۵/۲۰ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۵۰,۸۴۴     | ۶۳,۹۴۹     | ۲۶٪        |



## گروه‌های مؤثر

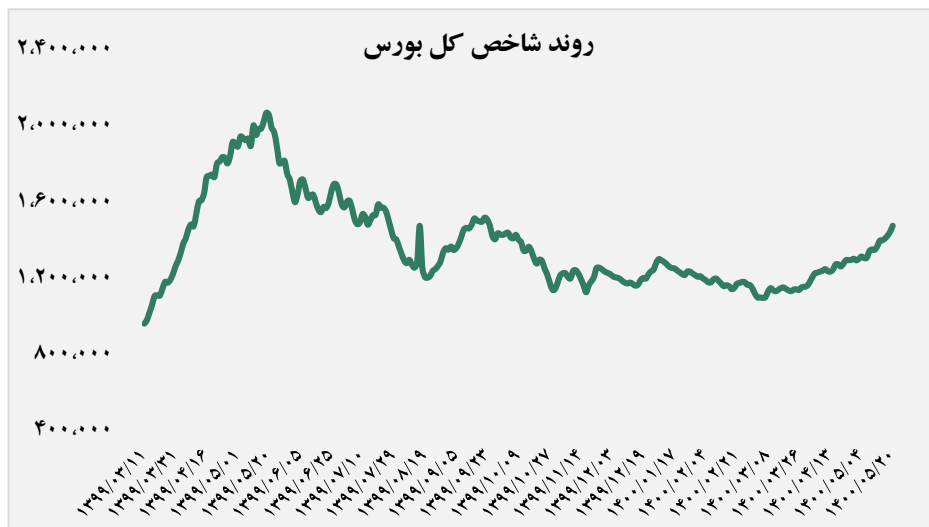
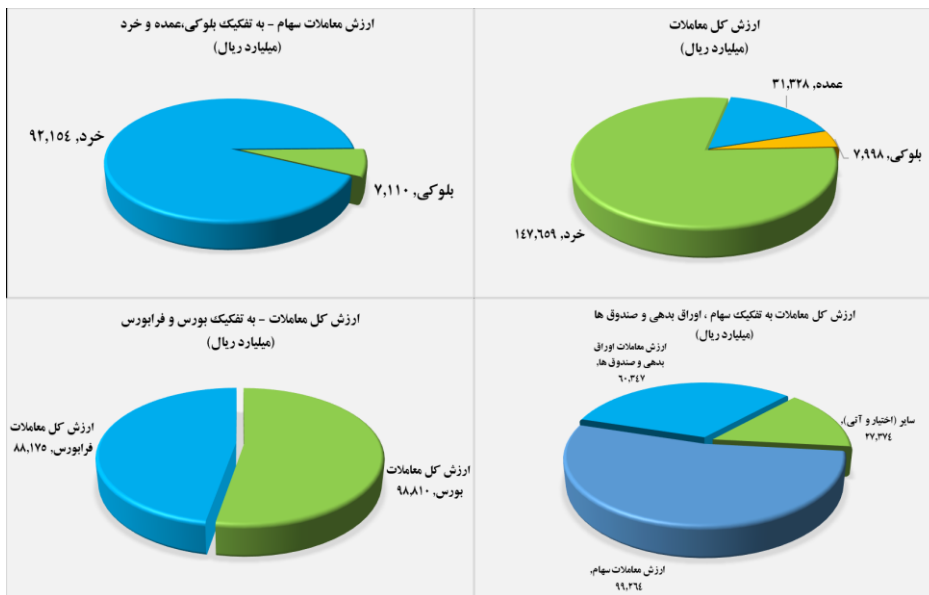
در گروه فلزات اساسی، فولاد خوزستان در ۱۲ ماهه ۹۹، ۲۳۳ تومان به ازای هر سهم سود ساخته بود. در اولین فصل سال مالی جدید سود ۷۵ تومانی را روانه کدال کرده است که نسبت به فصل قبل کاهش ۵ درصدی دارد. متوسط فروش فصلی سال گذشته برابر ۷,۶۰۰ میلیارد بوده که در فصل اول سال جاری فروش شرکت برابر ۱۱ هزار میلیارد تومان است. این فولادساز در سال مالی ۹۹، ۱۱,۰۰۰ میلیارد تومان سود عملیاتی شناسایی کرده بود که در فصل اول ۱۴۰۰ این عدد ۴,۱۳۸ میلیارد تومان است. سود عملیاتی سه ماهه رشد ۲۰۶ درصدی نسبت به فصل اول ۹۹ دارد. حاشیه سود شرکت در ۱۲ ماهه ۹۹، ۴۰ درصد بوده است و در فصل ابتدایی ۴۵ درصد گزارش شده است.

در گروه شیمیایی، شرکت جم پیلن از نظر مقداری فروش خوب ۳۰,۲۷۹ تنی در تیر داشته است. در خرداد فروش ۲۰,۵۲۲ تنی را گزارش کرده بود. شرکت در تیر ماه فروش عالی ۸۷۲ میلیارد تومانی داشته است. در خرداد ۶۵۴ میلیارد تومان محصول به فروش رسانده بود. فروش سال ۹۹، ۶,۵۸۰ میلیارد ثبت شد که این عدد در سال ۹۸ برابر با ۳,۳۲۴ میلیارد تومان بوده است. در تیر ۲۰,۱۴۵ تن محصول تولید کرد. این شرکت در دو ماه گذشته تولید ۲۶,۰۷۸ و ۲۸,۰۳۷ تن محصول را داشته است. میانگین تولید ماهانه سال ۹۹ و ۹۸ به ترتیب ۲۳,۹۵۹ و ۲۳,۲۰۳ تن می باشد. نرخ فروش شرکت در این ماه نیزافت داشت و ۲۸۷,۸۸۶ ریال/کیلو بوده است. نرخ در خرداد ۳۱۸,۶۳۰ ریال / کیلو بود.

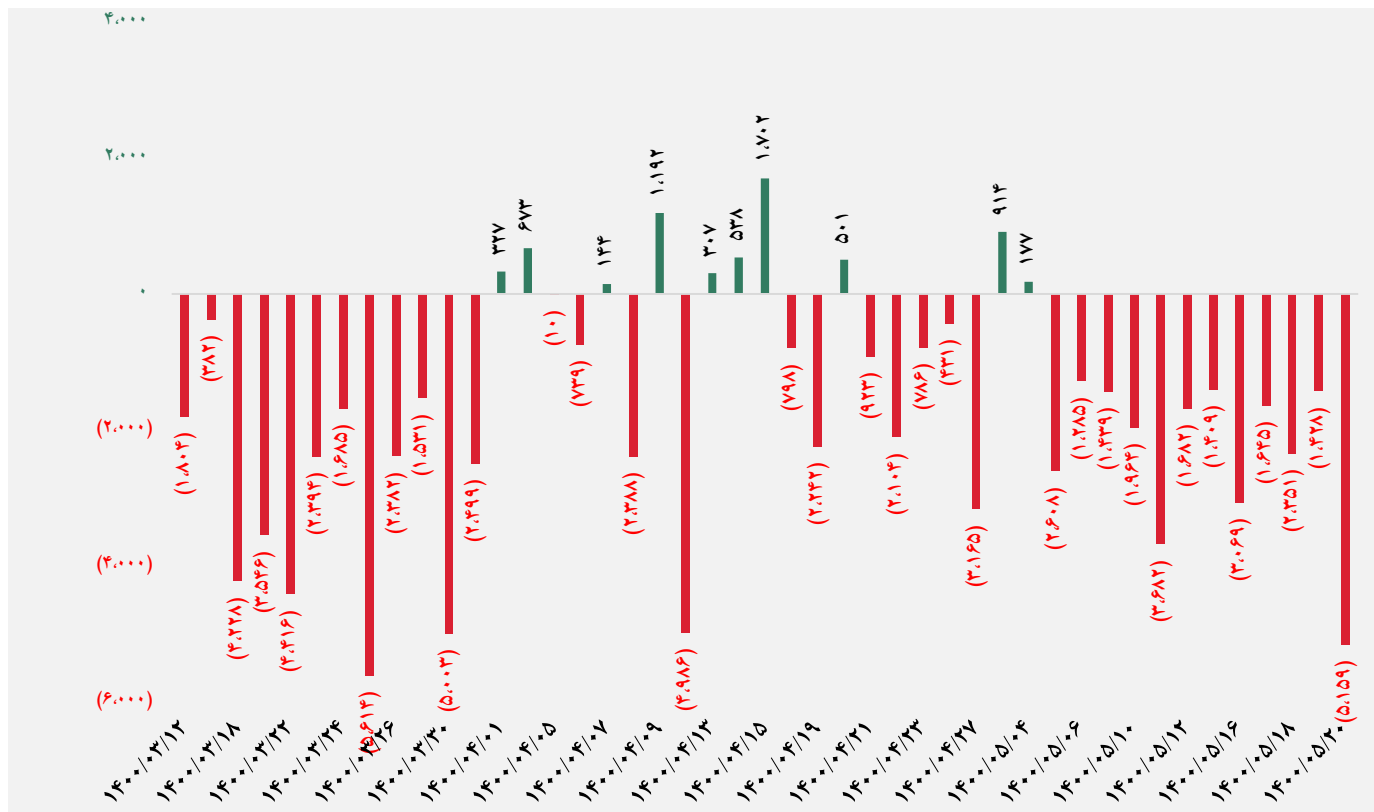
در همین گروه، پتروشیمی خارک در تیر تولیدات خوبی را به ثبت رساند. تولید متانول ۶۱,۴۲۸ تن گزارش شده و ۲۳,۴۷۱ تن LPG تولید کرده است. میانگین تولید سال ۹۹ هر یک از این دو محصول به ترتیب ۵۳,۰۹۴ و ۲۰,۳۲۱ تن بوده است. در تیر شرکت فروش عالی ۷۵,۴۹۶ تن متانول را به ثبت رسانده و در پایان ماه موجودی انبار این محصول به ۲۹,۴۴۶ تن رسیده است. مقدار فروش LPG در این ماه ۳۱,۸۶۲ تن گزارش شده است. شرکت در این ماه فروش ۱,۰۸۲ میلیارد تومانی را به ثبت رسانده است. میانگین فروش ماهانه سال ۹۹، ۵,۰۶۶ میلیارد تومان بوده و میانگین فروش ۳ ماه ابتدایی سال ۵۸۷ میلیارد تومان بوده است. نرخ فروش متانول در تیر ۷۳,۹۷۹ ریال در هر کیلو گزارش شده و در خرداد ۶۸,۹۵۱ ریال بوده است.

## تصویر کلی بازار

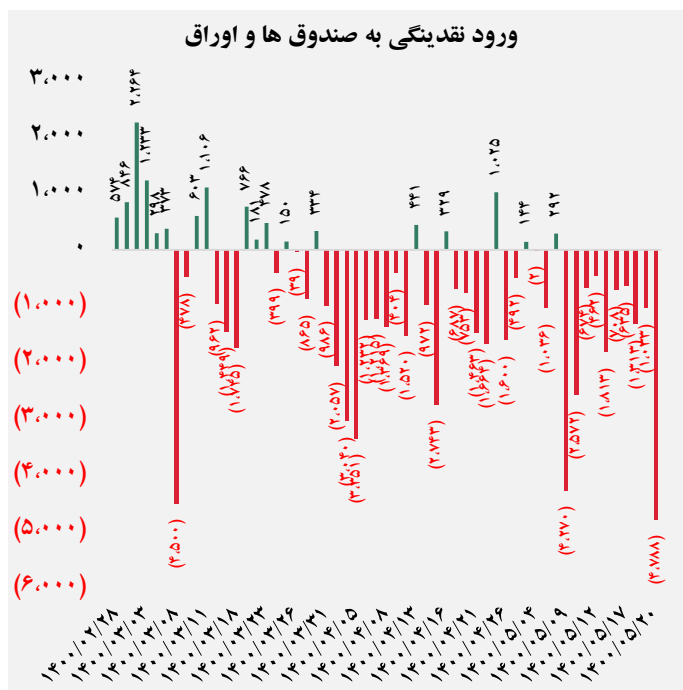
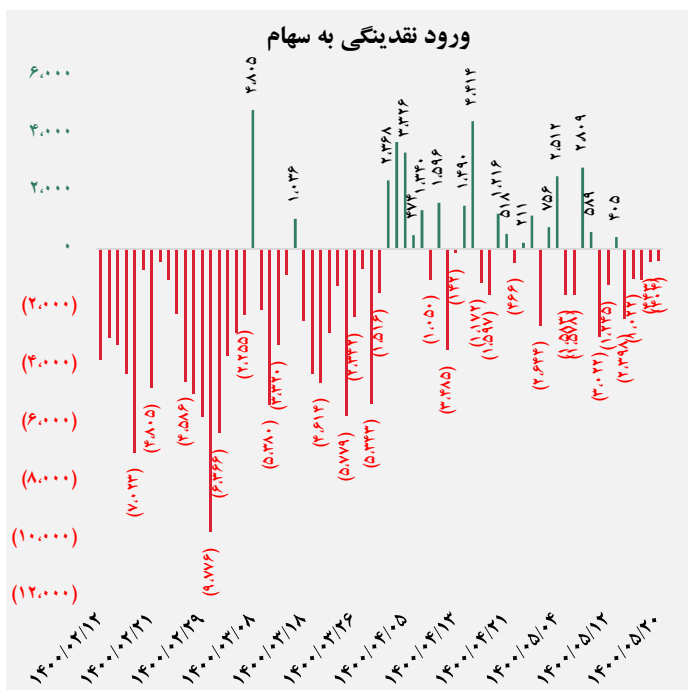
| فرا بورس                   |                             | بورس                       |                             |
|----------------------------|-----------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| ۲۱,۲۱۲                     | شاخص کل                     | ۱,۴۸۴,۵۹۰                  | شاخص کل                     |
| ۴۲۳                        | تغییر شاخص                  | ۳۰,۷۷۸                     | تغییر شاخص                  |
| ۱۱,۵۹۳,۳۲۸                 | ارزش بازار (میلیارد ریال)   | ۵۹,۶۱۵,۰۳۳                 | ارزش بازار (میلیارد ریال)   |
| ۸۸,۱۷۵                     | ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۹۸,۸۱۰                     | ارزش معاملات (میلیارد ریال) |
| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص |                             | بیشترین تاثیر مثبت در شاخص |                             |
| آریا                       |                             | فارس                       |                             |
| مارون                      |                             | فولاد                      |                             |
| کگهر                       |                             | شستا                       |                             |
| هرمز                       |                             | فملی                       |                             |
| بیشترین تاثیر منفی در شاخص |                             | بیشترین تاثیر منفی در شاخص |                             |
| زماهان                     |                             | پاکشو                      |                             |
| خدیزل                      |                             | اپال                       |                             |
| حخزر                       |                             | برکت                       |                             |
| پخش                        |                             | کدما                       |                             |



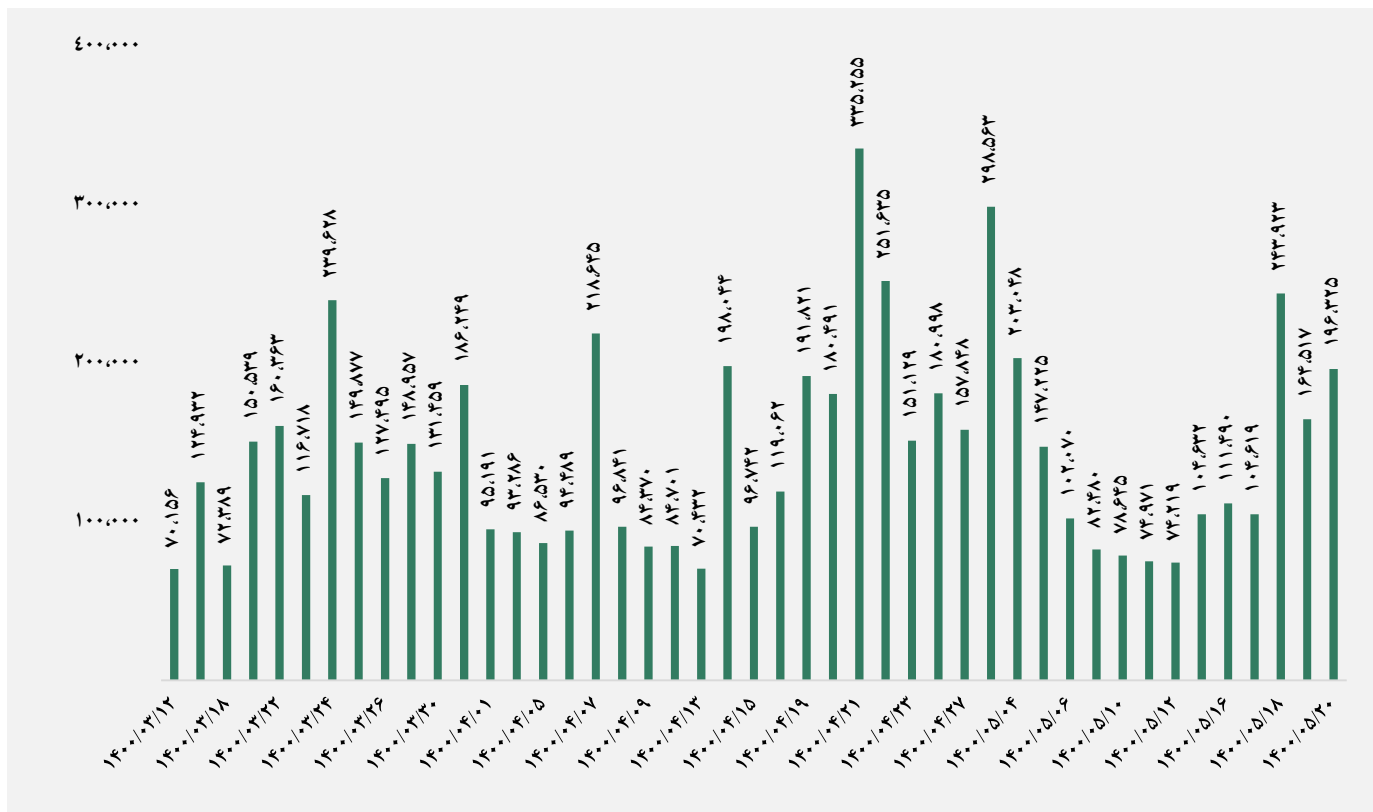
## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



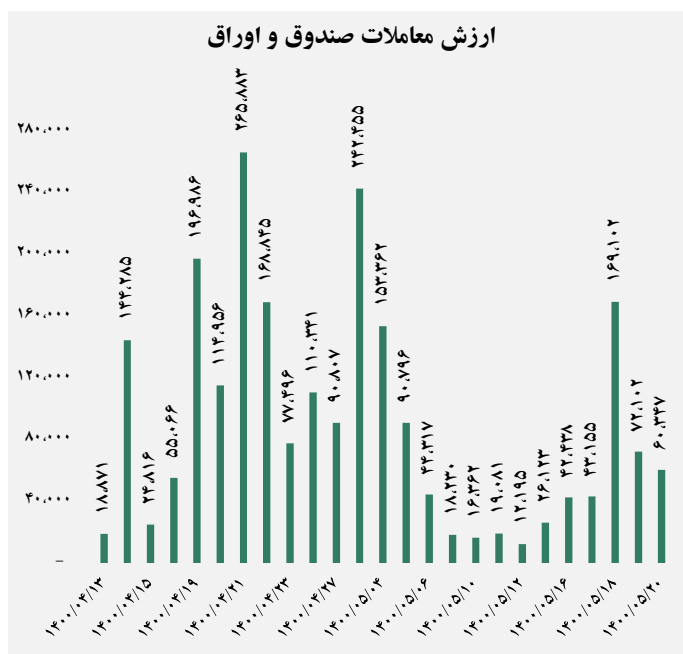
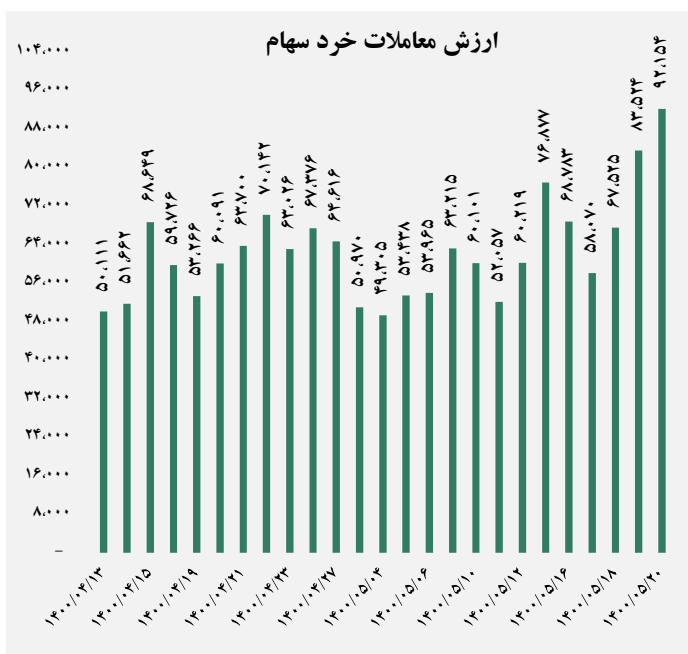
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

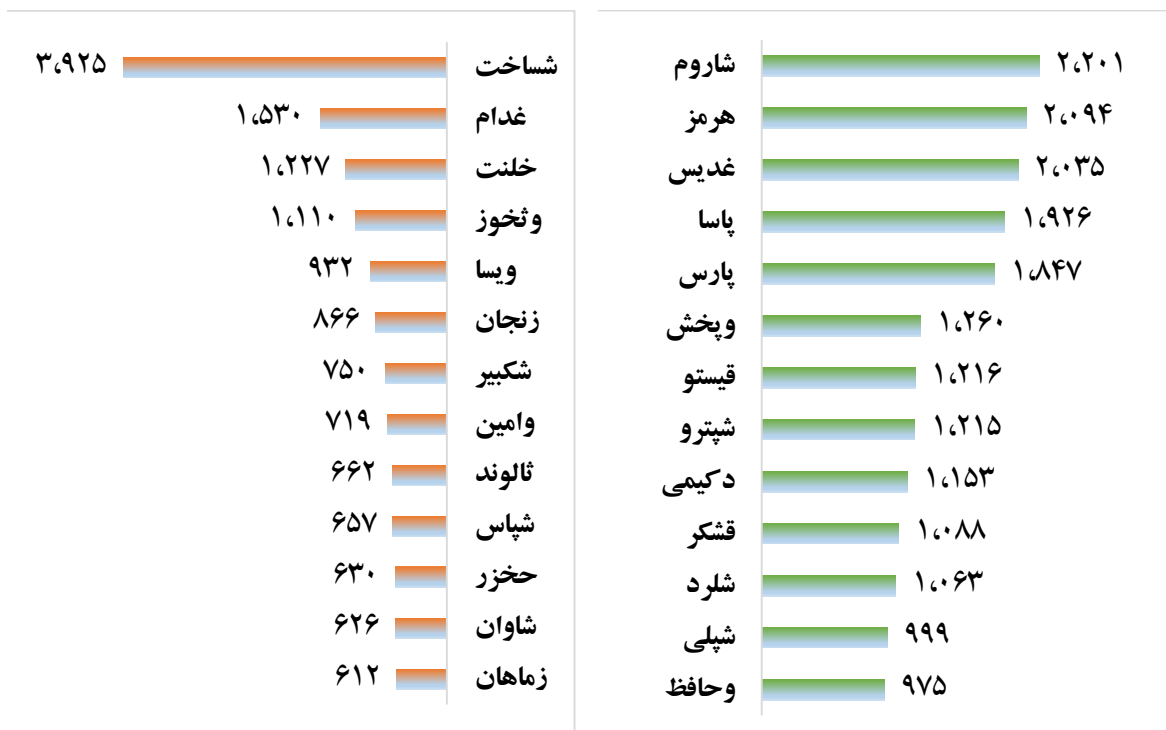


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





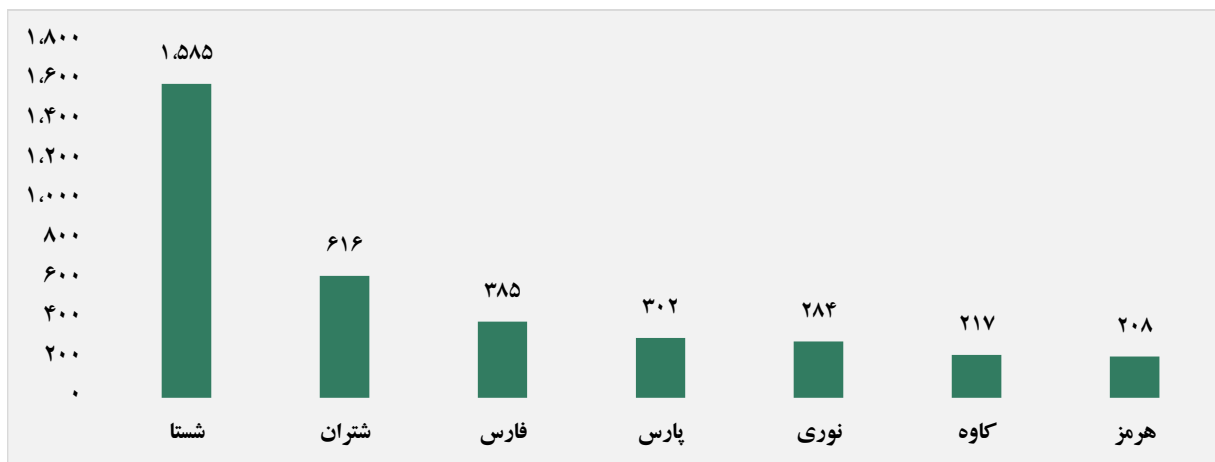
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



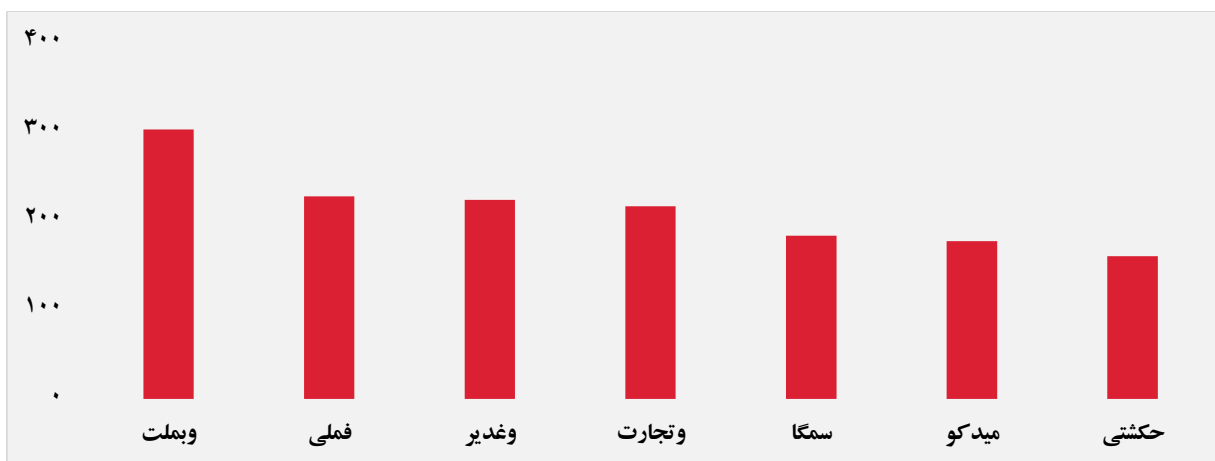
## پول هوشمند

| ردیف | ورود  | ردیف | خروج   |
|------|-------|------|--------|
| ۱    | واحصا | ۱    | وآذر   |
| ۲    | لابسا | ۲    | ولانا  |
| ۳    | دتماد | ۳    | قنیشا  |
| ۴    | غمارگ | ۴    | خبازرس |
| ۵    | شفا   | ۵    | قلرست  |
| ۶    | پارس  | ۶    | غفارس  |
| ۷    | وپویا | ۷    | دبالک  |
| ۸    | فاما  | ۸    | غدام   |
| ۹    | شستا  | ۹    | دشیمی  |
| ۱۰   | شپنا  | ۱۰   | خنصیر  |

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



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

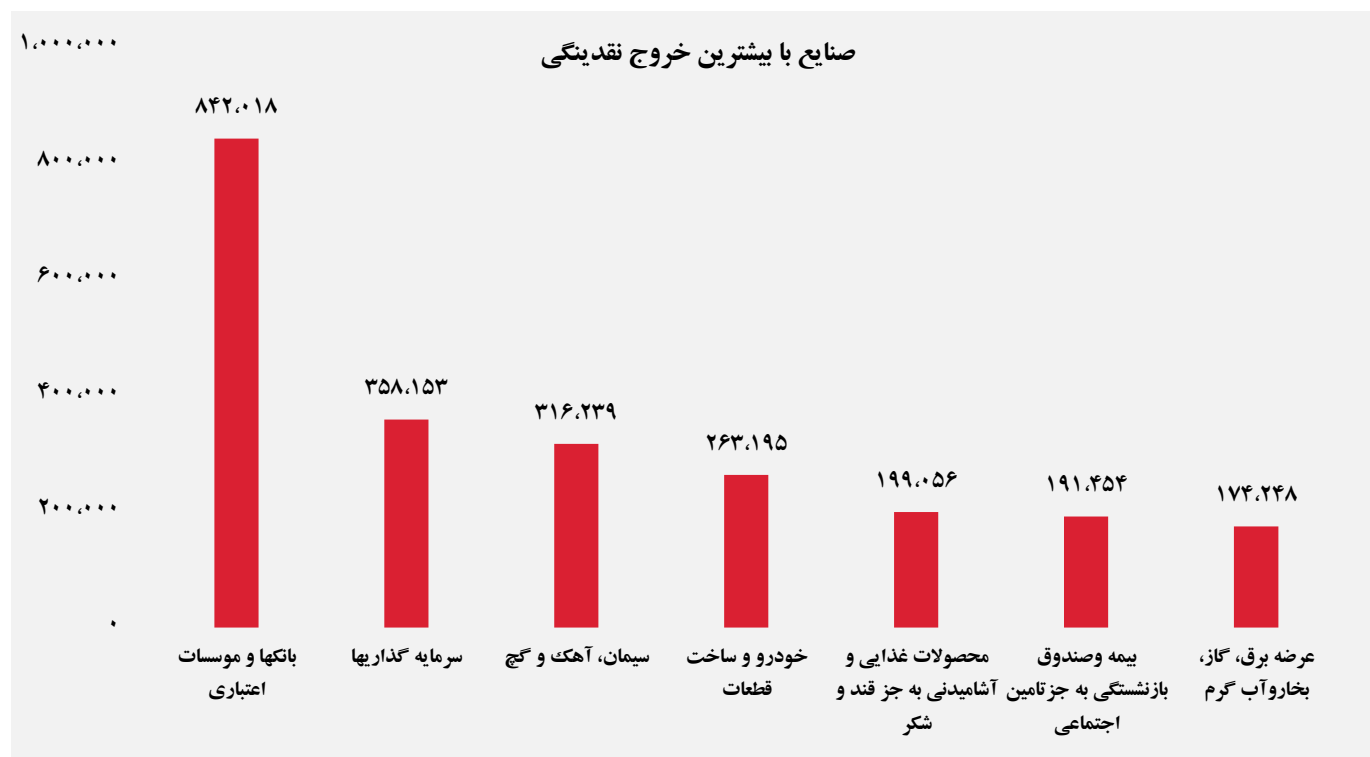
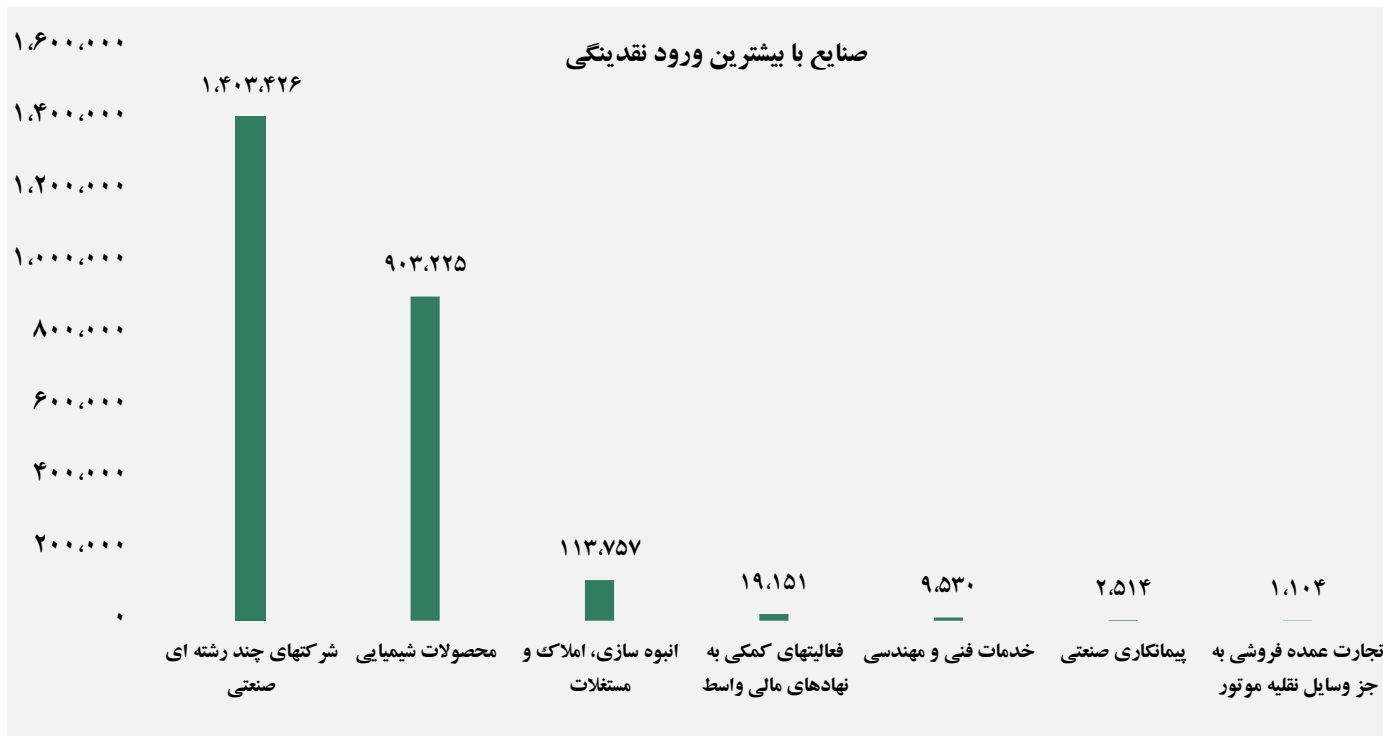


### واچ لیست

| ردیف | نماد  | ردیف | نماد   |
|------|-------|------|--------|
| ۱    | شاوان | ۱۰   | کیسون  |
| ۲    | غفارس | ۱۱   | فجر    |
| ۳    | برکت  | ۱۲   | زاگرس  |
| ۴    | وساخت | ۱۳   | آریا   |
| ۵    | سپید  | ۱۴   | حخزر   |
| ۶    | خصیر  | ۱۵   | سمگا   |
| ۷    | شراز  | ۱۶   | کیما   |
| ۸    | کزغال | ۱۷   | نوری   |
| ۹    | شغدیر | ۱۸   | دتوزیع |



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار