



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۲۲

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۲۳ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، فملی، رمینا، کچاد، فولاد و نوری با کاهش ۳۷۹۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۸۰,۸۳۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۶۱ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۱۰۳ 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 ۶۴ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. دلار به عنوان یکی از محرک های اصلی بازار سرمایه در دو روز گذشته تا حوالی ۲۶,۷۰۰ تومان پیش رفته است و در حال تثبیت در بالاتر از محدوده مقاومتی ۲۶ هزار تومانی می باشد. اگرچه افزایش دلار برای بازار سرمایه می تواند عامل محرک قوی تلقی گردد اما برای کلیت اقتصاد و جامعه بسیار مضر است و به نظر می رسد در ماه های آینده باید شاهد جهش تورم در کشور همانند دو سال گذشته باشیم. در بازار سرمایه با توجه به وضعیت ذکر شده، گروه های دلار محور مانند شیمیایی و فلزات اساسی نیز گروه های پیشرو به شمار می آیند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۹۳,۴۷۹ میلیارد ریال می باشد 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 ۷۲۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۸/۲۴ با ۲۱,۰۵٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۲۰	۱۴۰۰/۰۵/۲۳	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۶۳,۹۴۹	۹۳,۴۷۹	٪۴۶



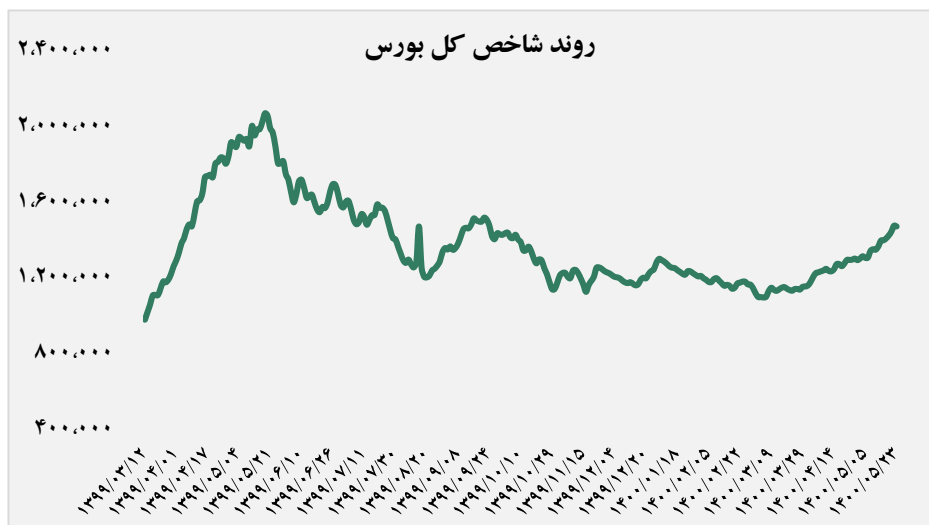
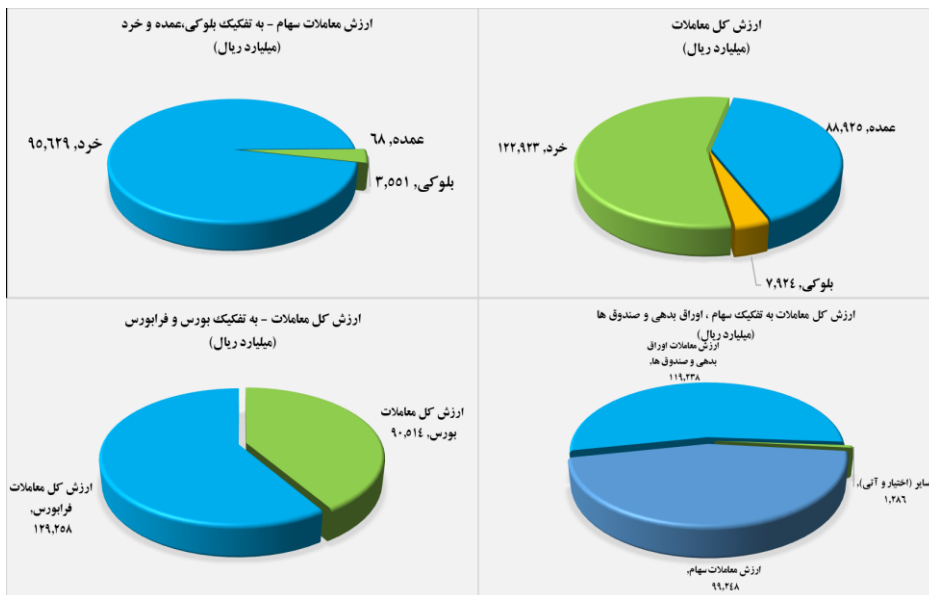
گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، متوسط تولید ماهانه شمش آهن و فولاد ارفع در سال ۹۹، ۶۸ هزار تن بوده و در فصل بهار سال جاری میانگین تولید عالی ۷۷ هزار تنی ثبت شد. در تیر ماه با توجه به کاهش سطح فعالیت، ۳۲ هزار تن شمش تولید داشت. ارفع در سال گذشته به طور میانگین ۶۷ هزار تن شمش در هر ماه به فروش رسانده که این رقم در فروردین ماه ۳۱، اردیبهشت ۴۶ و خرداد ۶۰ هزار تن گزارش شد. اما در تیر ماه، از موجودی انبار خود استفاده کرد و ۱۱۰ هزار تن شمش، شامل ۵۳ هزار تن داخلی و ۵۷ هزار تن صادراتی به فروش رساند که رکورد فروش مقداری ماهانه شرکت می‌باشد. مبلغ درآمد ماهانه ارفع در سال گذشته رشد خوبی را داشت و در اسفند عدد مناسب ۱،۱۲۶ میلیارد تومانی را ثبت کرد. در فصل بهار میانگین مبلغ ۵۵۷ میلیارد تومانی را ثبت کرد. در تیر ماه اما با ۱۴۰۸ میلیارد تومان فروش، رکورد اسفند ماه را ۲۵ درصد ارتقا داد. نرخ فروش شمش متوسط سال گذشته ۸،۵۲۵ تومان در هر کیلو ثبت شد. در بهار میانگین نرخ فروش ۱۱،۸۴۹ تومان به ازای هر کیلوگرم محصول بوده و نرخ فروش شمش در تیر ماه ۱۲،۶۴۸ تومان ثبت شد.

در گروه شیمیایی، متوسط تولید ۱۲ ماهه پتروشیمی زاگرس در سال ۹۹، ۲۵۱ هزار تن بوده است. در سه ماه اخیر متوسط تولید ۲۶۲ هزار و تیر ۲۴۵ هزار تن است. در سال ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۲۵۳ هزار تن فروش داشت. سال مالی جاری را با فروش عالی ۲۹۵ و ۳۰۵ هزار تنی شروع کرد و خرداد نیز ۲۲۷ هزار تن فروخت و در تیر ۲۳۱ هزار فروش دارد. متوسط نرخ فروش شرکت در سال ۹۹ در حدود ۱۶۶ دلار بوده است. در اسفند حوالی ۲۹۴ دلار صادر کرده است. در فروردین و اردیبهشت اعداد عالی ۳۱۴ و ۳۰۵ دلاری را دارد و خرداد هم ۳۲۱ دلار است و تیرماه ۳۳۳ دلار می‌باشد. متوسط فروش ماهانه فصل اول و دوم در سال ۹۹، ۷۰۰ و ۷۵۸ میلیارد تومان و در فصل سوم متوسط فروش ۱،۷۰۰ میلیارد تومان بود. در فصل انتهایی متوسط فروش ۱،۳۰۰ میلیارد تومان ثبت شده است. اما در فصل اول سال جاری، متوسط مبلغ فروش ماهانه ۱،۸۰۰ میلیارد و در تیر ماه ۱،۶۴۲ میلیارد تومان می‌باشد.

تصویر کلی بازار

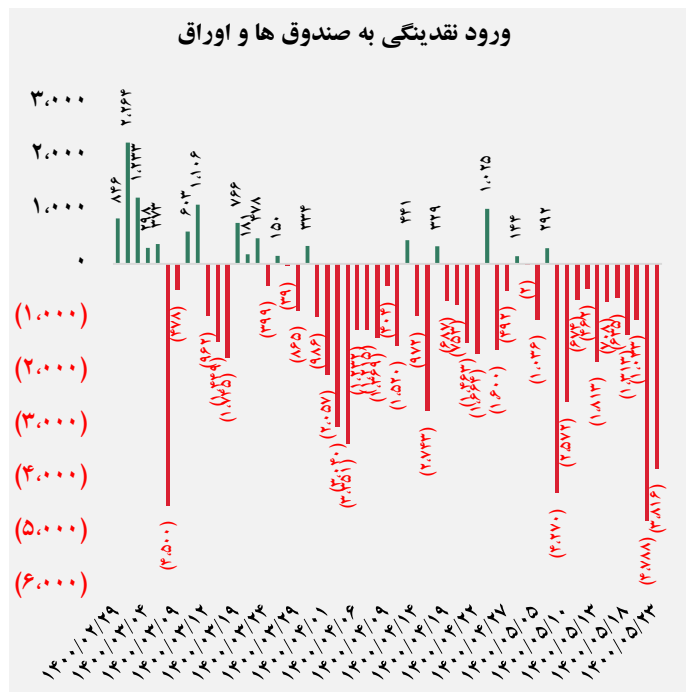
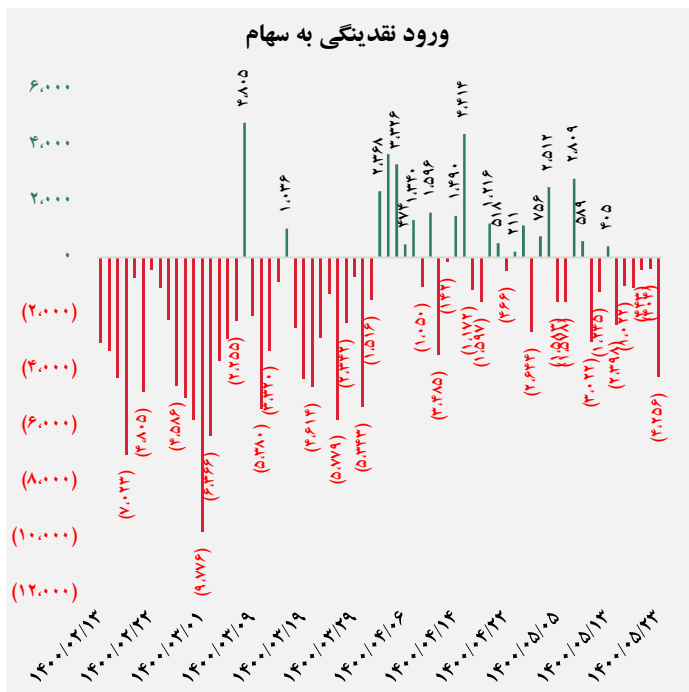
فرا بورس		بورس	
۲۱,۳۰۶	شاخص کل	۱,۴۸۰,۸۳۰	شاخص کل
۹۴	تغییر شاخص	(۳,۷۹۷)	تغییر شاخص
۱۱,۶۵۲,۲۲۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۹,۴۳۹,۱۶۸	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۲۹,۲۵۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۹۰,۵۱۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
مارون		پارس	
کگهر		شتران	
هرمز		خودرو	
غصینو		وبملت	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
زاگرس		فارس	
آریا		فملی	
شگویا		رمپنا	
شاون		کچاد	



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

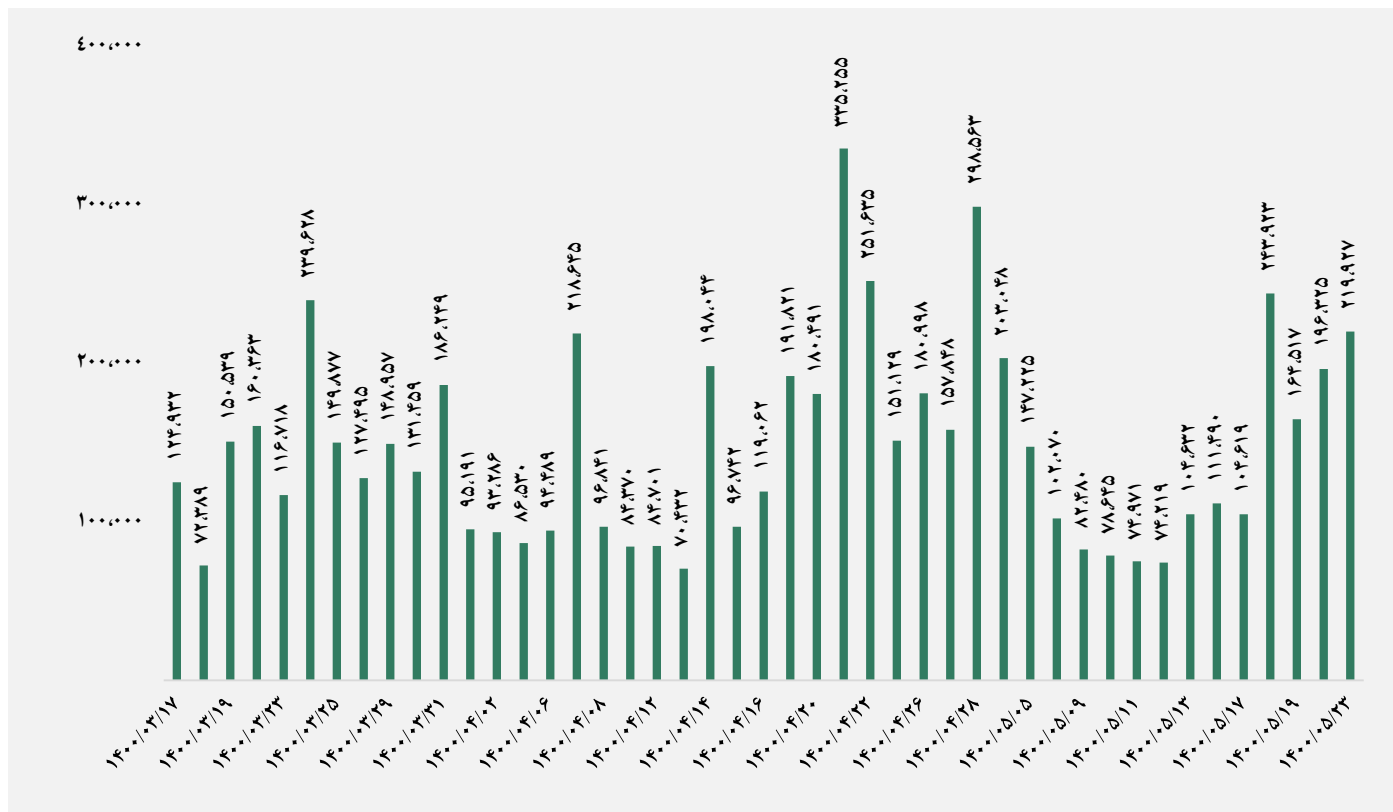


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

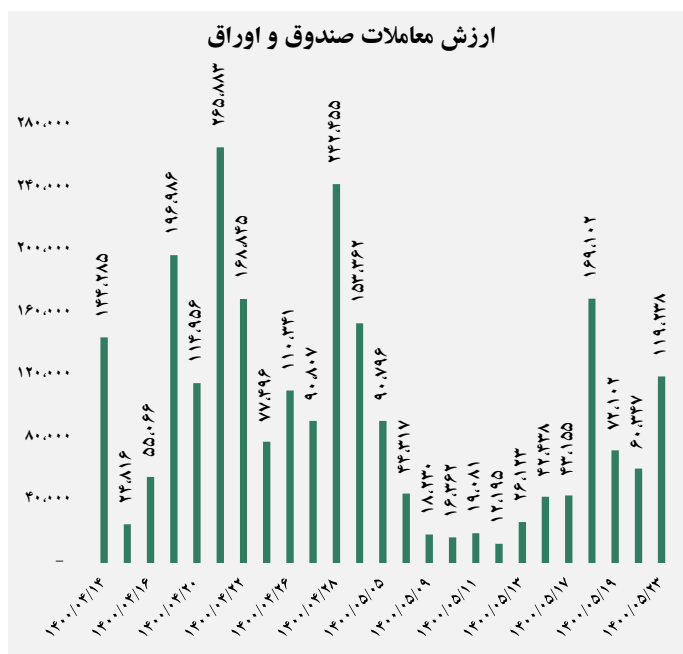
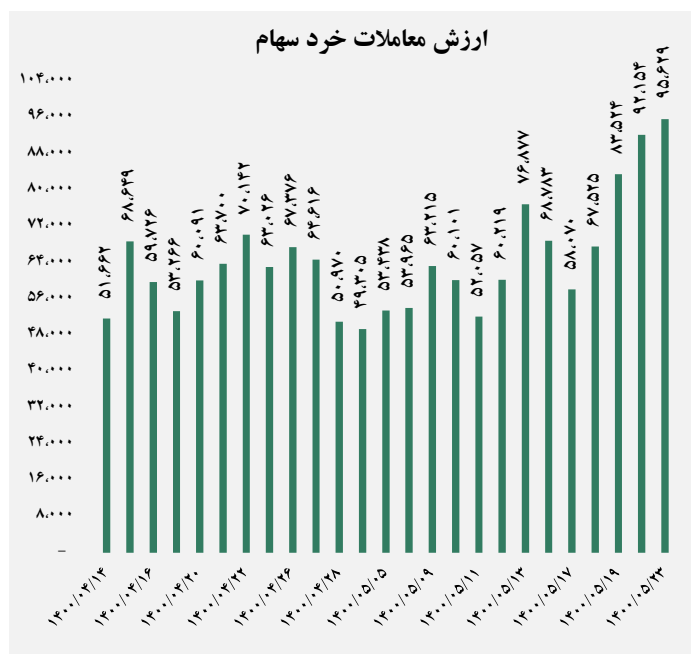


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

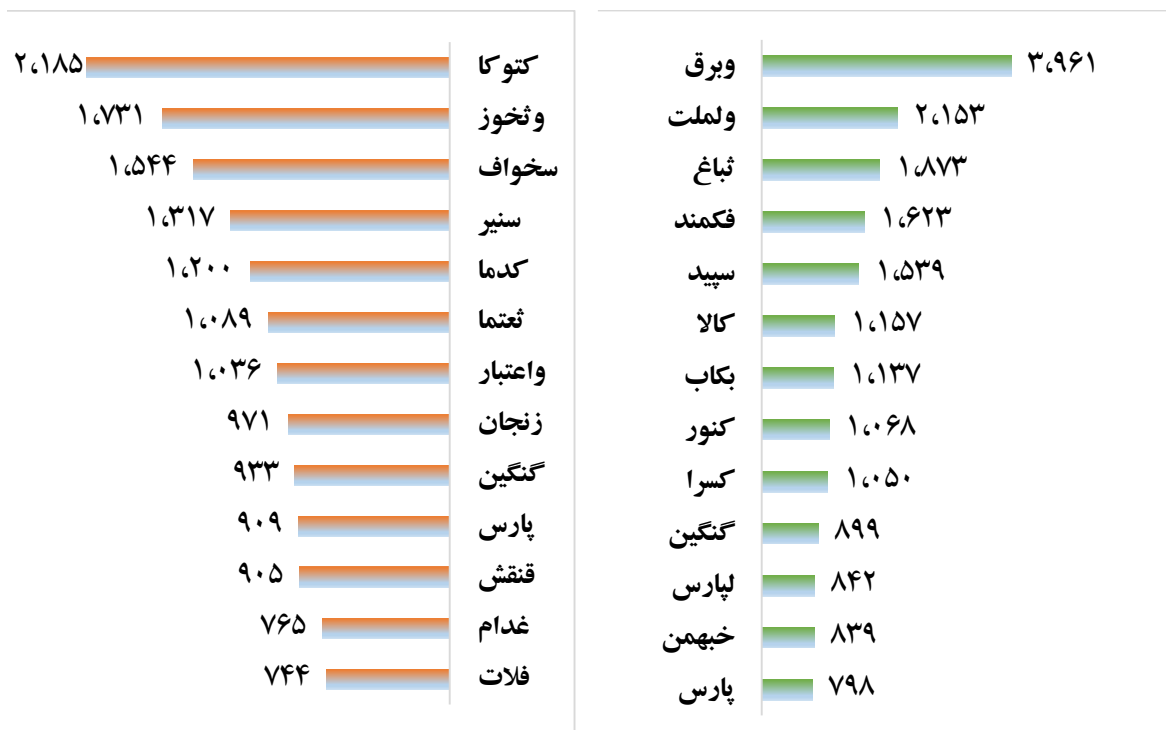
ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



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



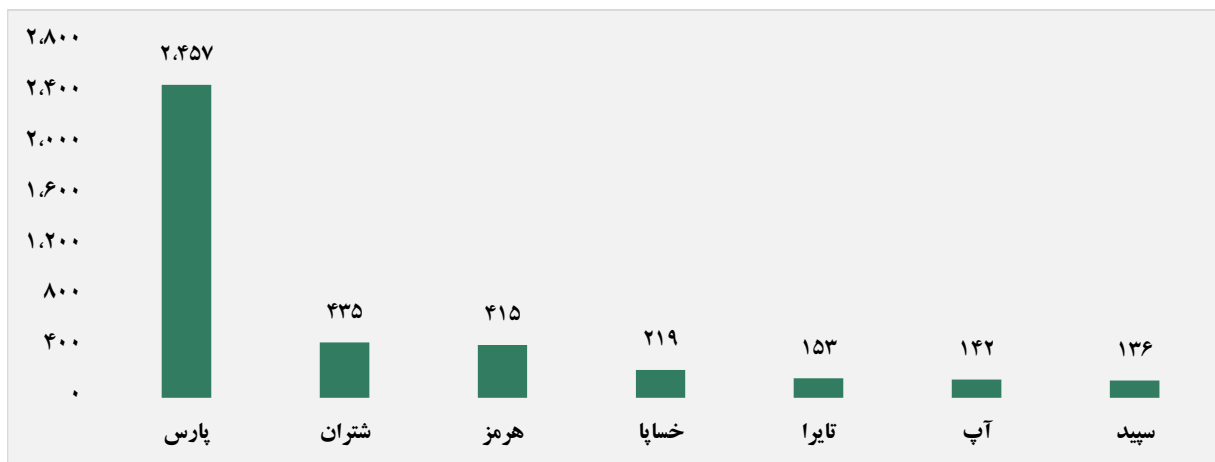
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



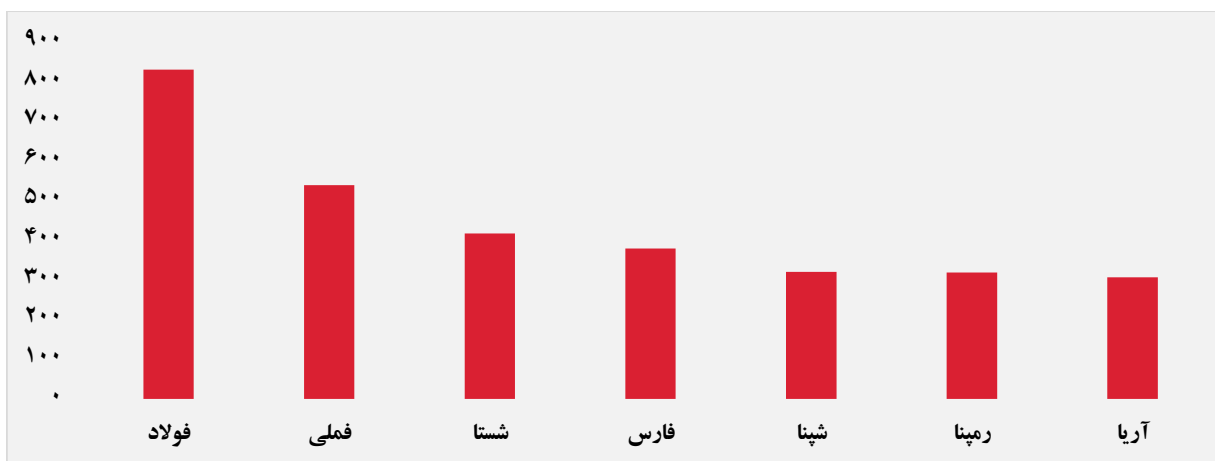
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	خساپا	۱	سامان
۲	تایرا	۲	دی
۳	وتوصا	۳	شپترو
۴	شکربن	۴	گشان
۵	ئفارس	۵	لکما
۶	ورنا	۶	لازما
۷	بموتو	۷	وسرمد
۸	دقاضی	۸	قلرست
۹	بترانس	۹	ئثور
۱۰	خزامیا	۱۰	وسزنجان

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



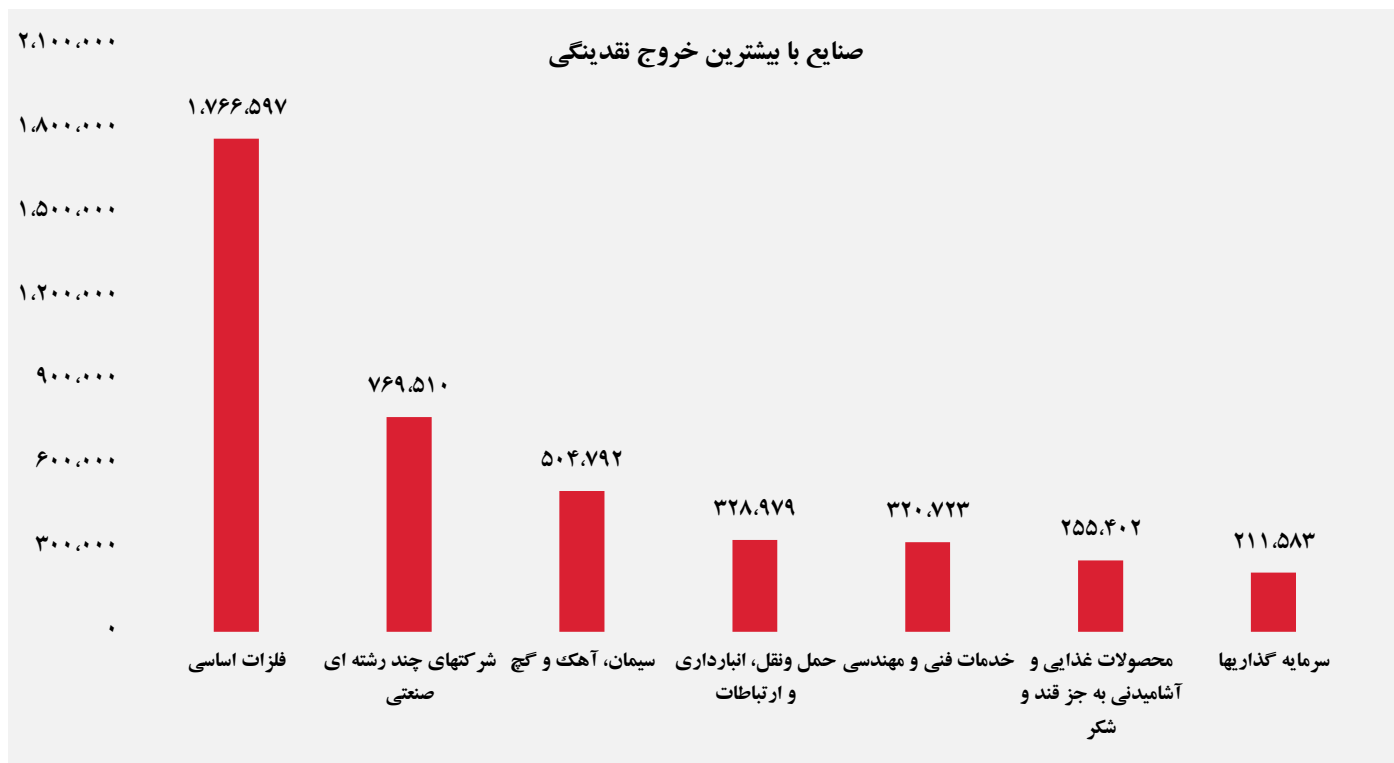
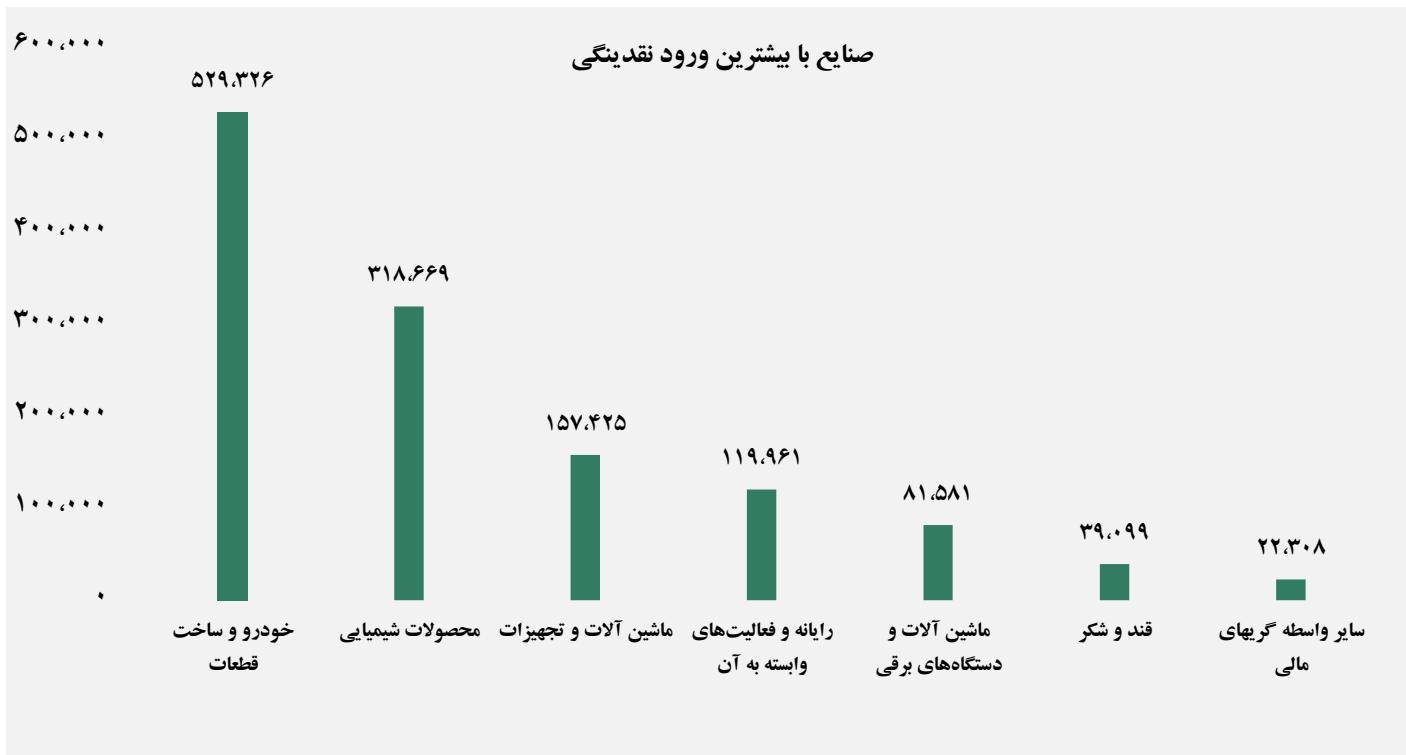
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	پارس	۱۰	شاوان
۲	غدیس	۱۱	شغدیر
۳	غفارس	۱۲	گشان
۴	فجر	۱۳	وساخت
۵	سپید	۱۴	سصوفی
۶	پرکت	۱۵	شپلی
۷	نفارس	۱۶	شراز
۸	خنصیر	۱۷	ونفت
۹	آپ	۱۸	کبافق

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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر