



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۲۴

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۴ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شستا، فارس، شینا، کچاد، ومعادن و فولاد با افزایش ۱۹۱۹۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۸۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۸۲ 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 ۲۹ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

مهم‌ترین متغیرهای تاثیرگذار بر قیمت دلار در این روزها را می‌توان در چند مورد خلاصه کرد. ناآرامی‌ها در افغانستان و پیشروی طالبان در این کشور به عنوان یک عامل صعودی بر قیمت دلار عمل کرده است. عدم اطمینان نسبت به مذاکرات احیای برجام و سیاست‌های دولت جدید ایران در مورد روابط تجاری، کنترل نرخ ارز، تدابیر مربوط به کسری بودجه و تورم نیز روند قیمت دلار در میان مدت و بلند مدت را تحت تاثیر قرار خواهد داد. در کل روند قیمتی نرخ دلار نشان از ادامه دار بودن رشد در ماه‌های آینده دارد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۸۵,۹۷۸ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۳۱۴، 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 ۸۲۱، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۹/۰۶ با ۲۰,۹٪ سود است.

درصد تغییر	۱۴۰۰/۰۵/۲۴	۱۴۰۰/۰۵/۲۳	شرح
۹۹٪	۱۸۵,۹۷۸	۹۳,۴۷۹	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)



## گروه‌های مؤثر

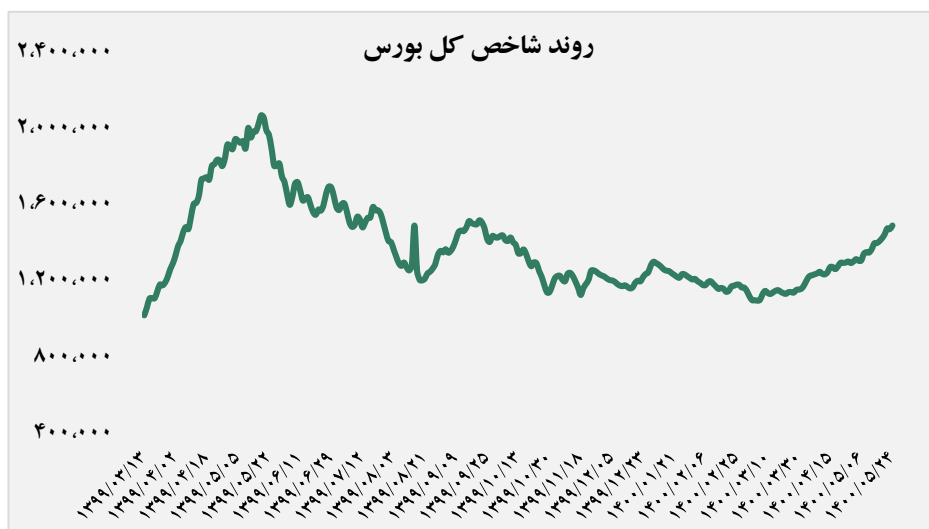
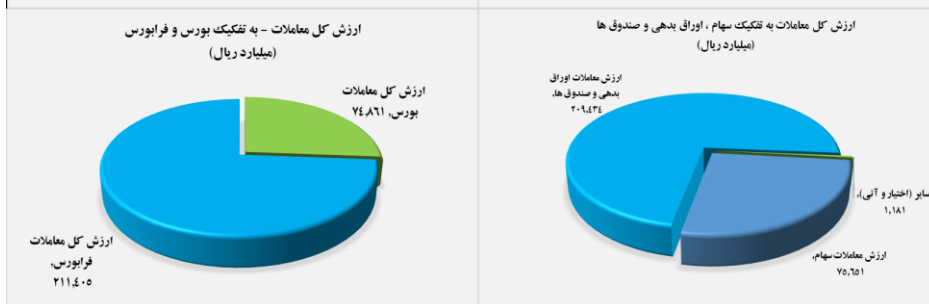
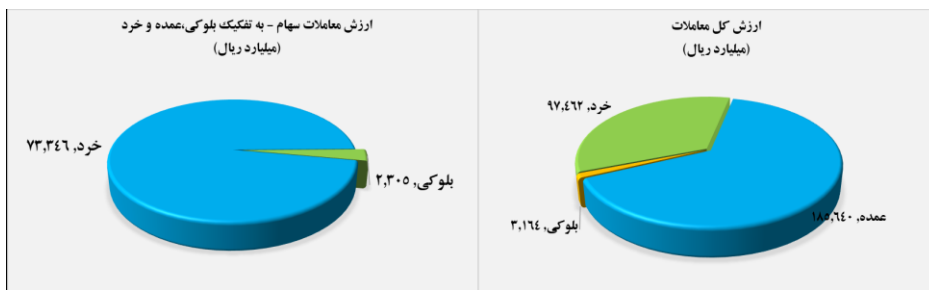
در گروه محصولات کاغذی، گروه صنایع کاغذ پارس سال مالی منتهی به آبان ماه دارد. این شرکت در سال مالی ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۴،۹۳۲ تن تولید داشته است. شرکت در تیر ۳،۵۲۰ تن و در هفت ماه گذشته به طور متوسط ۵،۵۷۲ تن تولید داشته است. این تولیدکننده محصولات کاغذی در تیر ۴،۲۳۳ تن و در ۷ ماه گذشته به طور متوسط ۵،۳۶۳ تن فروش ثبت کرده است. متوسط فروش در سال مالی قبل ۵،۰۸۷ تن ثبت شده است. شرکت سال مالی گذشته خود را با متوسط فروش ۴۳ میلیارد تومان به پایان رساند. فروش تیر ماه در حدود ماه قبل و ۷۲ میلیارد تومان بوده است. متوسط فروش آذر تا خرداد ۸۲ میلیارد تومان گزارش شده است. نرخ فروش کاغذ در خرداد ۱۹۲،۲۹۰ ریال به ازای هر کیلو و متوسط نرخ آذر تا خرداد ۱۷۱،۰۱۱ ریال به ازای هر کیلو بوده است. متوسط نرخ فروش ۱۲ ماه گذشته ۱۰۶،۷۱۳ ریال به ازای هر کیلو گزارش شده است.

در گروه زراعت، شرکت شیر و گوشت زاگرس شهرکرد در ۱۲ ماه سال مالی گذشته به طور متوسط هر ماه ۱۴ میلیارد تومان فروش داشته است، در تیرماه ۱۸ میلیارد تومان فروش داشته و متوسط فروش سه ماه گذشته ۱۹ میلیارد تومان بوده است. متوسط تولید شیر شرکت در سال ۹۹ هر ماه ۳،۰۷۲ تن بوده و تیرماه امسال ۳،۳۲۵ تن تولید داشته است. متوسط تولید سه ماه قبل ۳،۲۷۵ تن ثبت شده است. شرکت تقریباً تمامی شیر تولیدی را به فروش می‌رساند. نرخ فروش شیر شرکت به طور متوسط در سال ۹۹ حدود ۳،۸۱۴ تومان برای هر کیلو گزارش شده است. شرکت تیرماه شیر را با نرخ ۵۰،۵۴۷ ریال و فرودین و تا خرداد با نرخ متوسط ۴۸،۹۰۸ ریال به ازای هر کیلو فروخته است.

در گروه فلزات اساسی، شرکت ملی سرب و روی ایران در تیر ۱،۲۱۵ تن تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه سال ۹۸ و ۹۹ نیز به ترتیب ۱،۲۰۰ و ۱،۲۴۹ تن می‌باشد. این شرکت مانند سایر شرکت‌های سرب و روی فروش منظمی ندارد. در اردیبهشت ۱،۲۵۵ تن و در خرداد ۱،۳۸۷ تن شمش سرب و روی فروخته، فروش تیر ۵۲۴ تن گزارش شده است. میانگین فروش ماهانه شمش سرب و روی شرکت در سال ۹۹، ۹،۴۸۷ تن بوده است. موجودی انبار شمش روی و سرب شرکت در پایان تیر ماه به ترتیب در حدود ۱،۲۵۸ و ۷۳۰ تن می‌باشد. در تیر ۳۰ میلیارد تومان فروش ثبت شده، میانگین فروش سال ۹۹، ۴۹۱ میلیارد تومان و فروش خرداد و اردیبهشت سال جاری به ترتیب ۷۵ و ۶۶ میلیارد تومان بوده است. نرخ شمش سرب در خرداد ۴۹،۸۰۴ تومان و در تیر ۵۴،۲۸۳ تومان در هر کیلو گزارش شده است.

## تصویر کلی بازار

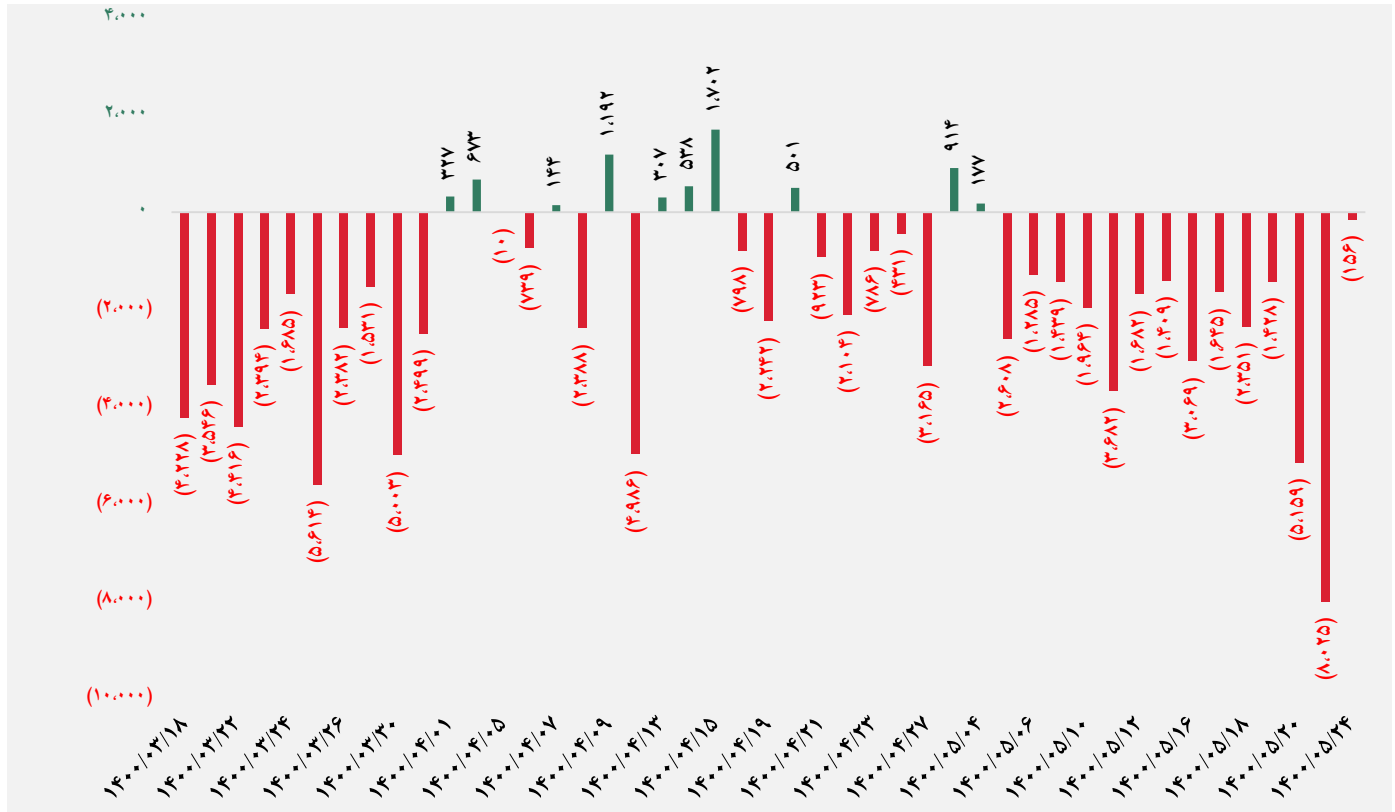
فرا بورس		بورس	
۲۱,۵۵۷	شاخص کل	۱,۵۰۰,۰۰۰	شاخص کل
۲۵۰	تغییر شاخص	۱۹,۱۹۷	تغییر شاخص
۱۱,۷۶۹,۶۹۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۶۰,۲۳۸,۶۰۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۱۱,۴۰۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۷۴,۸۶۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر مثبت در شاخص</b>	
کگلر		شستا	
آریا		فارس	
هرمز		شپنا	
زاگرس		کچاد	
<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>		<b>بیشترین تاثیر منفی در شاخص</b>	
دماوند		پارس	
دی		وسر ضوی	
مارون		برکت	
پساما		وسخوز	



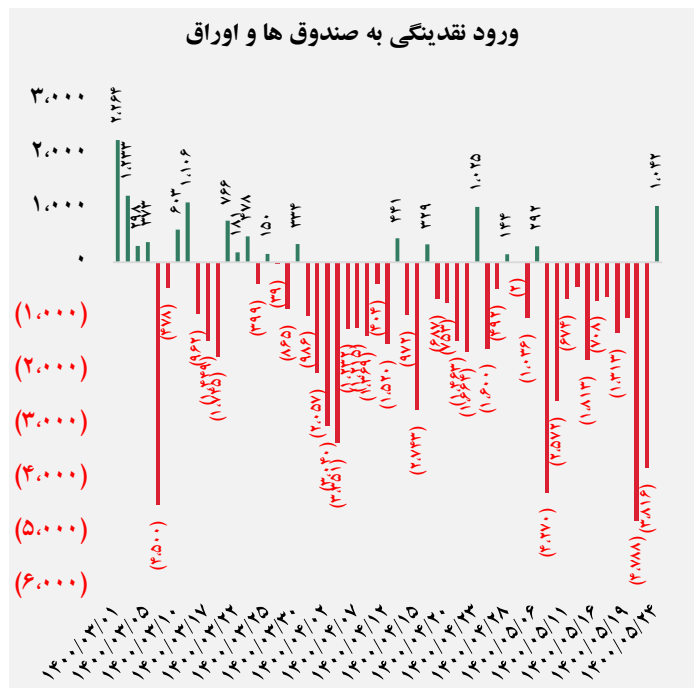
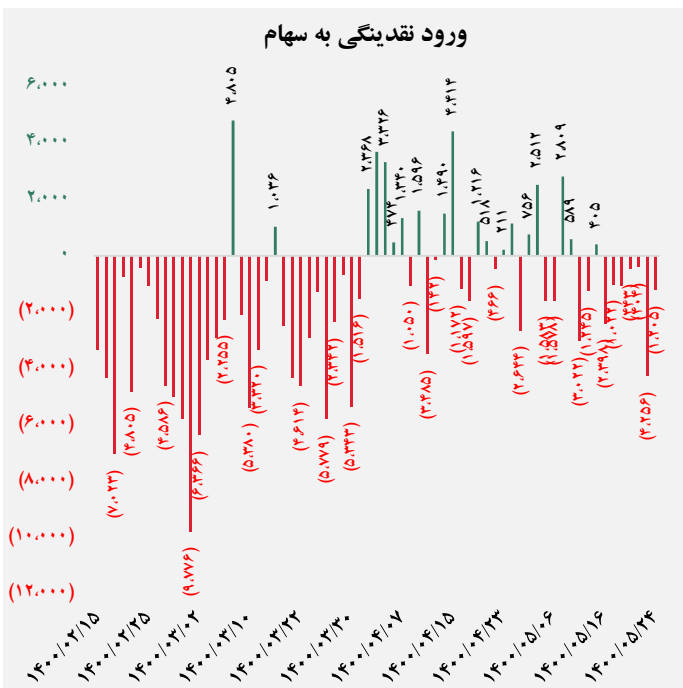
گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



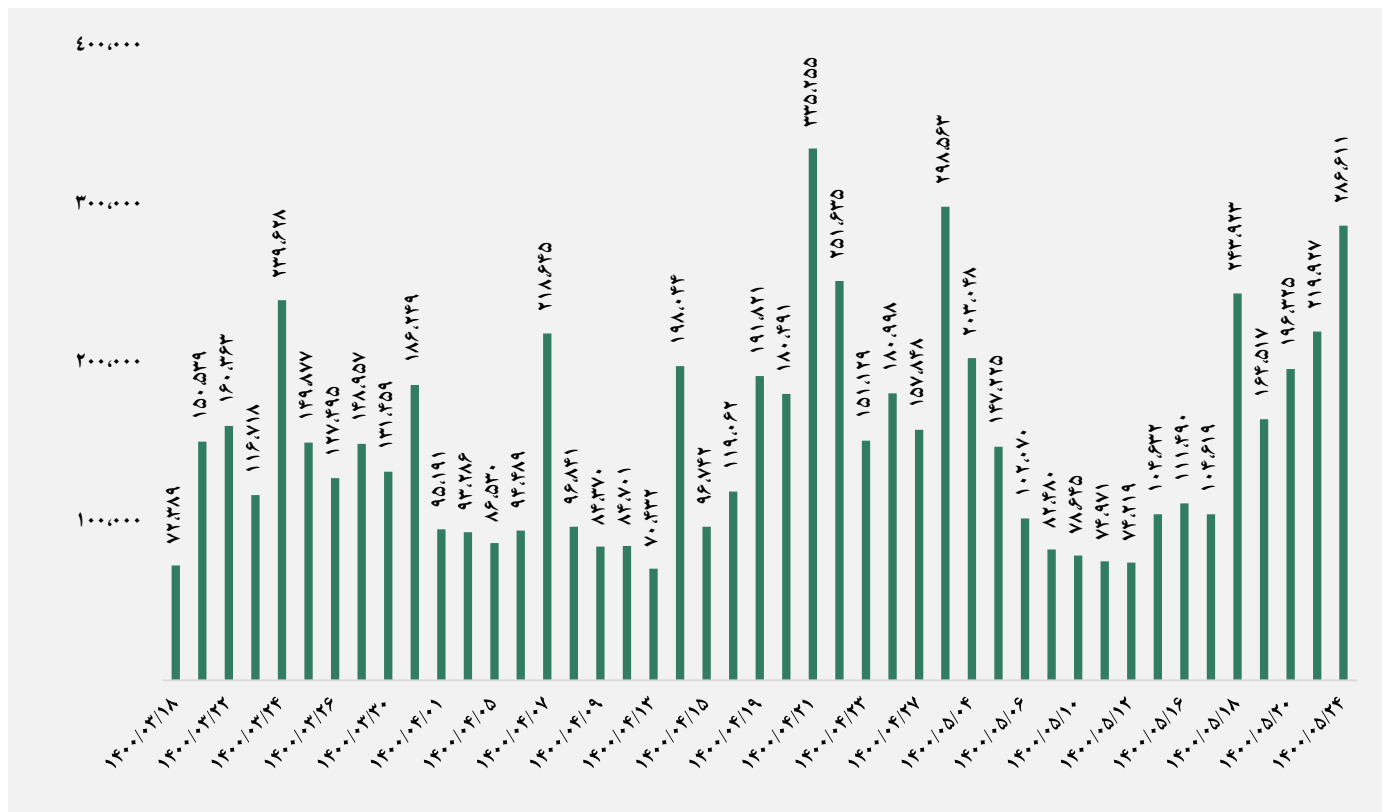
## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (خروج) (میلیارد ریال)



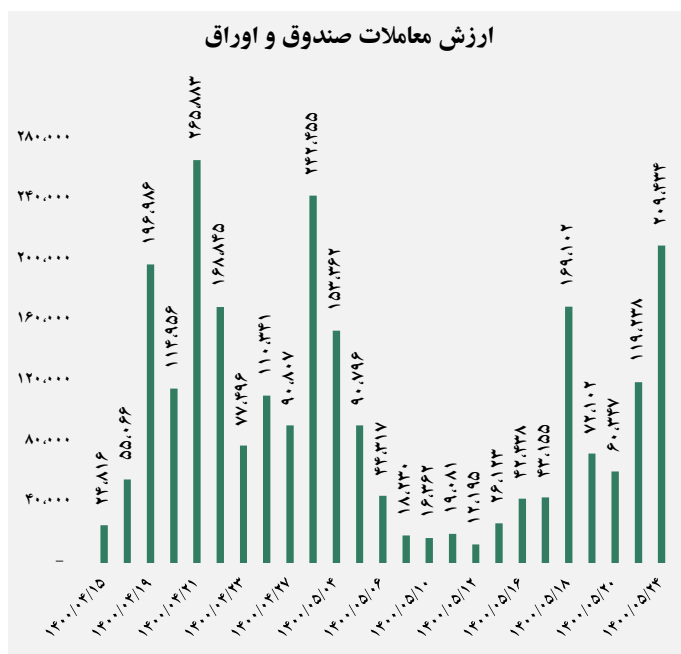
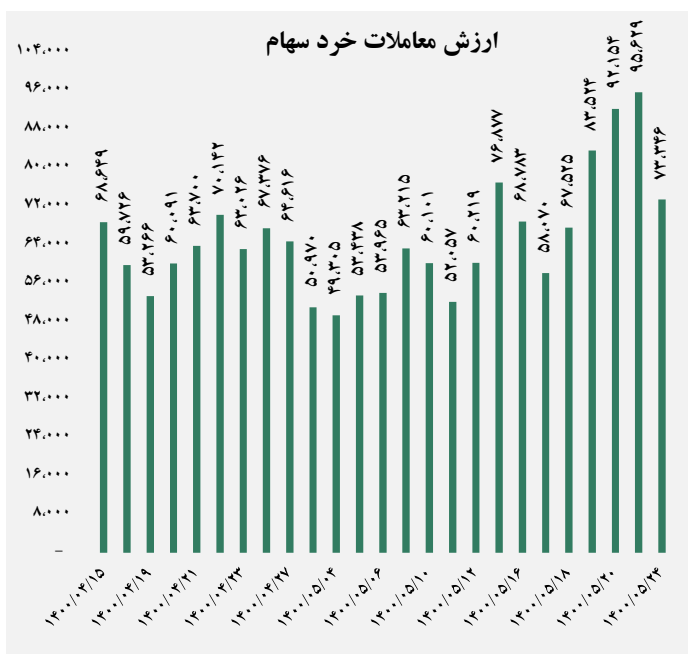
## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

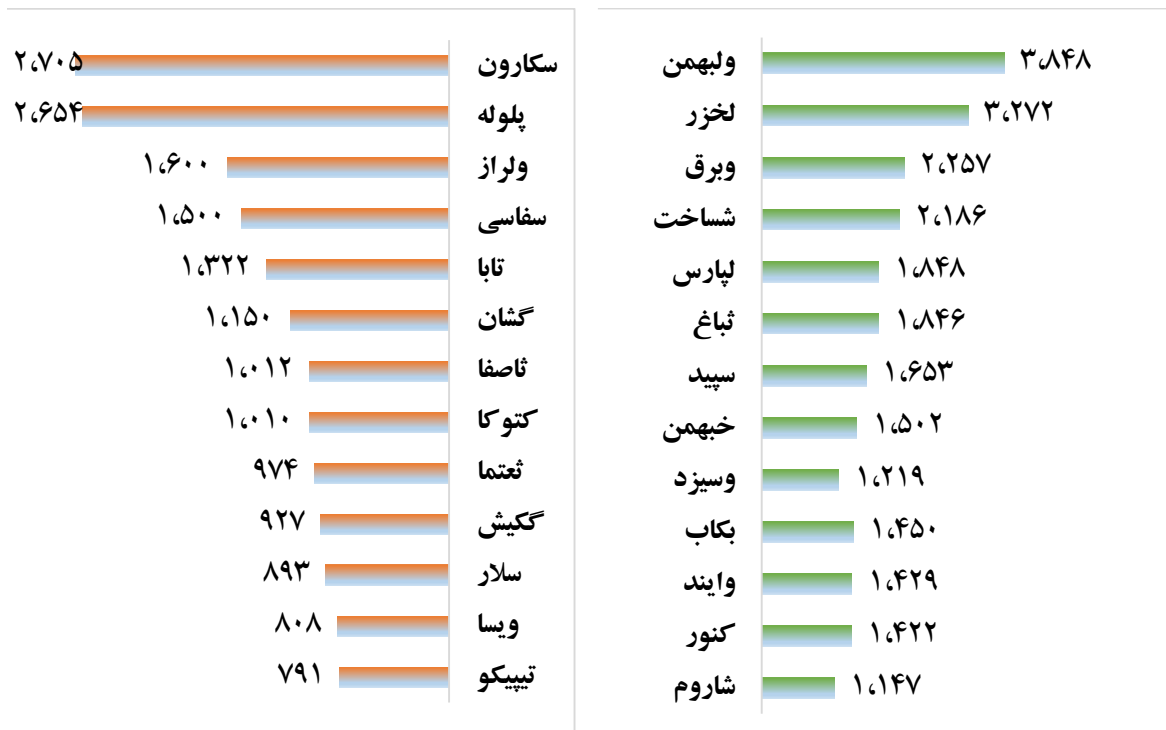


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





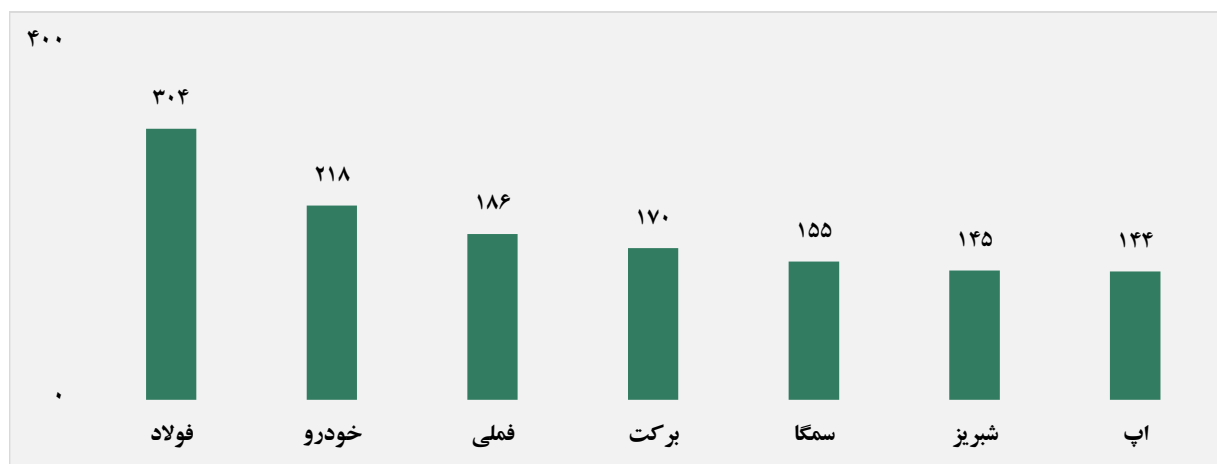
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



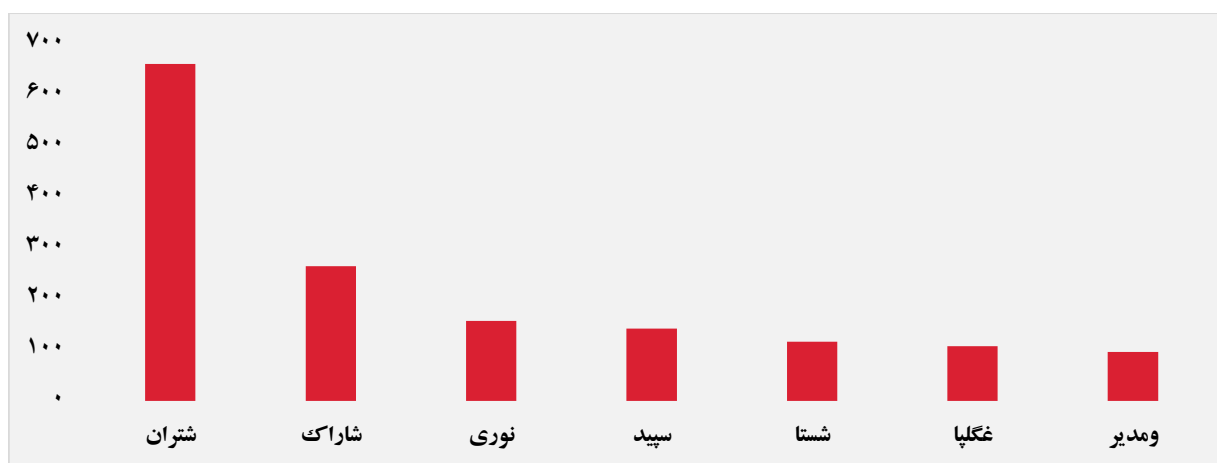
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شساخت	۱	غگکپا
۲	بکاب	۲	نتوس
۳	کمینا	۳	سامان
۴	پاکشو	۴	قشرین
۵	وآفری	۵	ولتجار
۶	سجام	۶	تکنار
۷	بفجر	۷	لازما
۸	شتران	۸	لابسا
۹	سیتا	۹	سفساسی
۱۰	خبازرس	۱۰	خرینگ

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



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



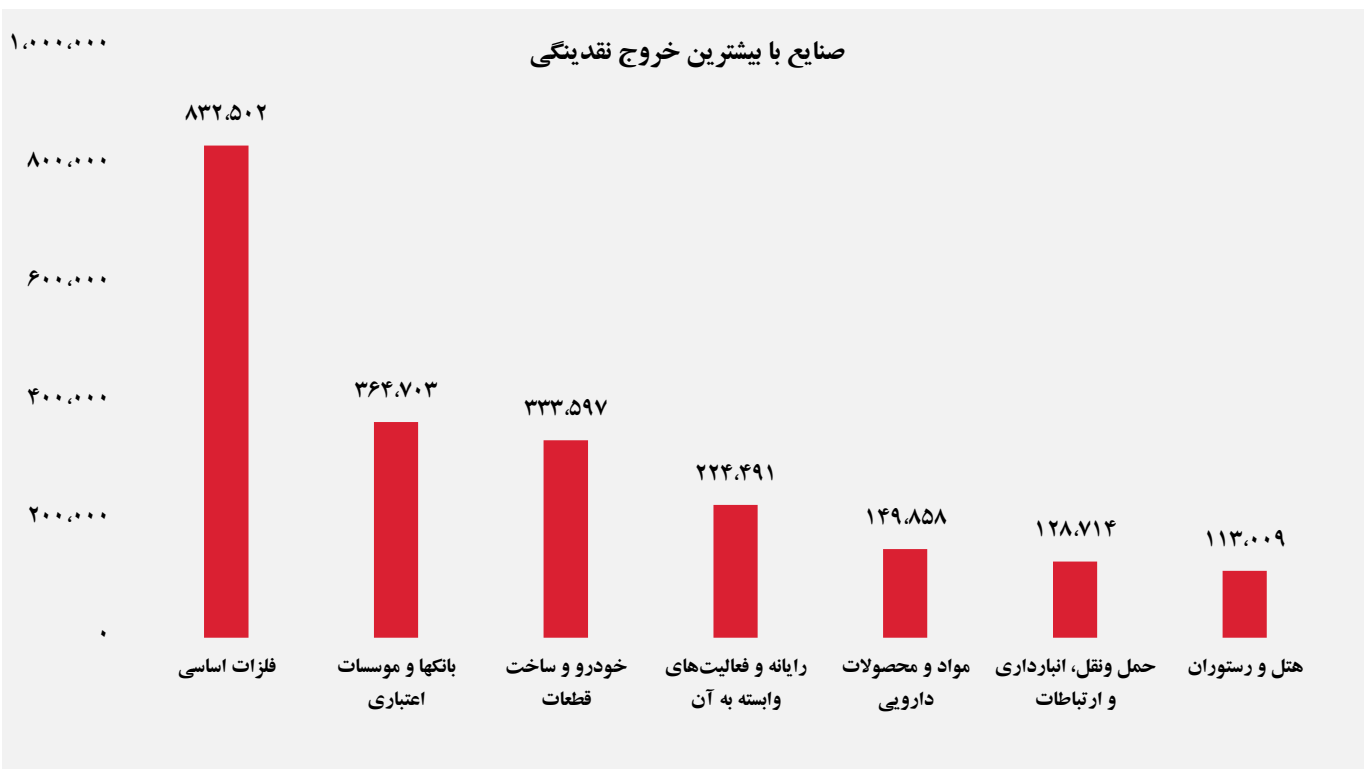
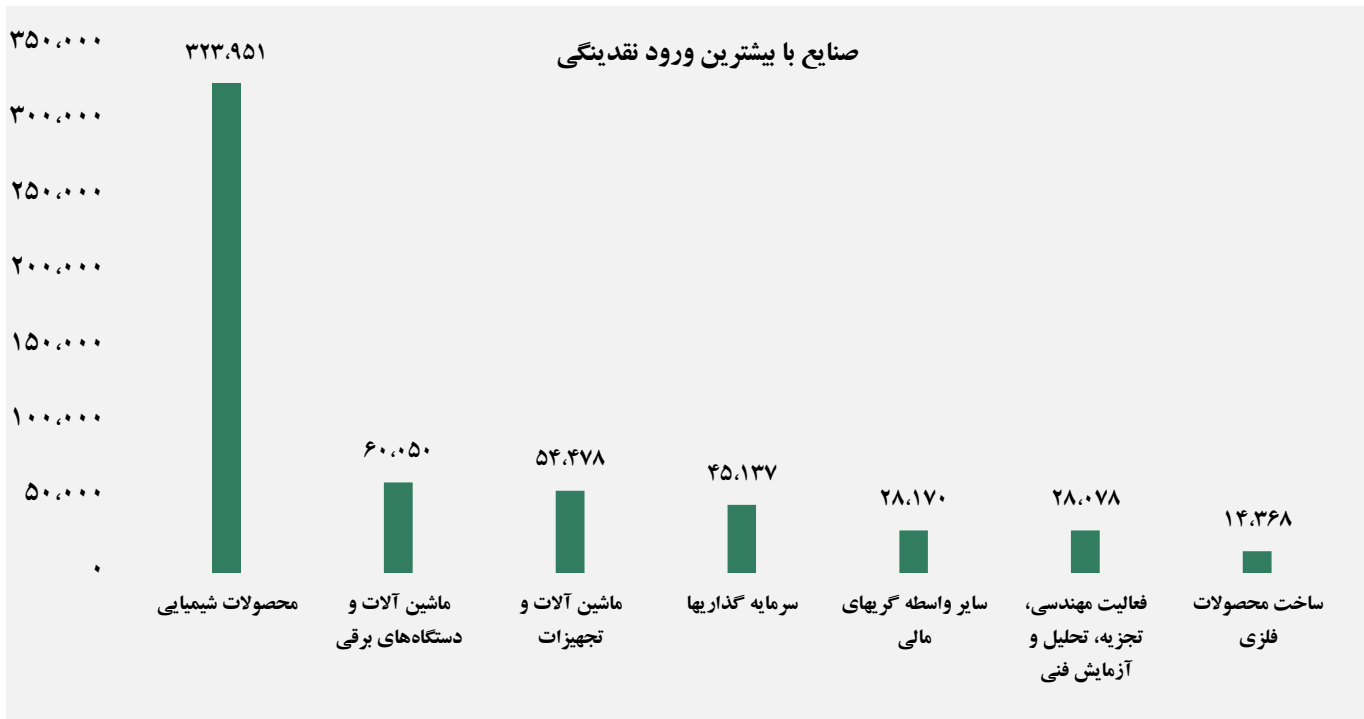
### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۰	ونفت
۲	غدیس	۱۱	پارس
۳	سپید	۱۲	آپ
۴	شاون	۱۳	شراز
۵	کسرا	۱۴	سیمرغ
۶	خنصیر	۱۵	ساراب
۷	شغدیر	۱۶	غفارس
۸	نفراس	۱۷	شپاکسا
۹	فجر	۱۸	سصوفی





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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر