



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۳۱ مرداد ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای نوری، شتران، شپدیس، خودرو، اخبار و شپنا با افزایش ۱۵۵۵۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۵۱۵,۴۷۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۱۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۱۱۱ 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 ۵۳ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

با توجه به وضعیت سیاسی و اقتصادی در داخل کشور و منطقه نرخ دلار به ریال از محدوده ۲۷ هزار تومان نیز گذشته است. مهمترین محدوده‌های مقاومتی برای نرخ دلار ۲۹ هزار تومان و سقف بلند مدت آن در حوالی ۳۲ هزار تومان می‌باشد. کاهش نرخ دلار به کمتر از ۲۴ هزار تومان برای ماه‌های آینده نیز با توجه به شرایط موجود بعید به نظر می‌رسد. اما آنچه نمایان است، دولت جدید در حال حاضر توانایی کنترل نرخ برابری دلار به ریال را با توجه به تحریم‌های فعلی و شرایط موجود نداشته باشد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۷۴,۲۱۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۲۱۴، 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 ۲۱,۰۱٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۲۴	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۸۵.۹۷۸	۷۴.۲۱۶	-۶۰٪



## گروه‌های مؤثر

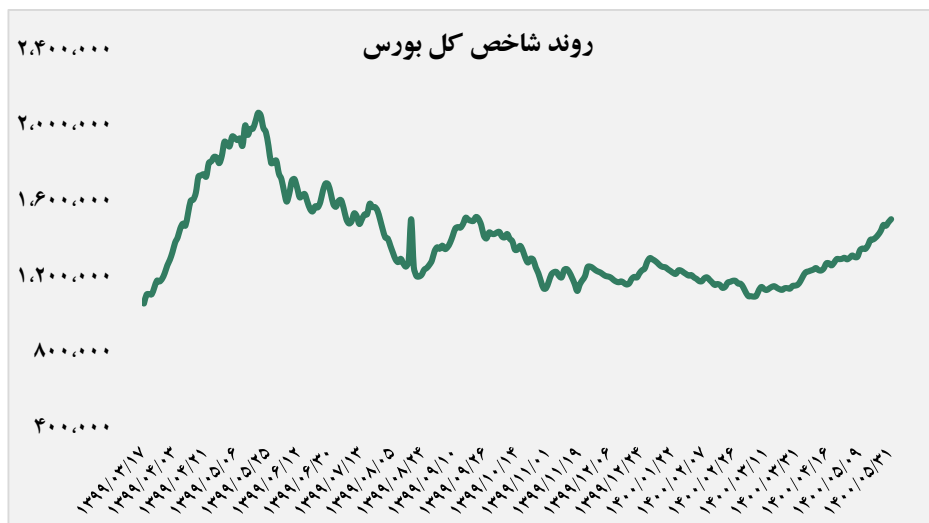
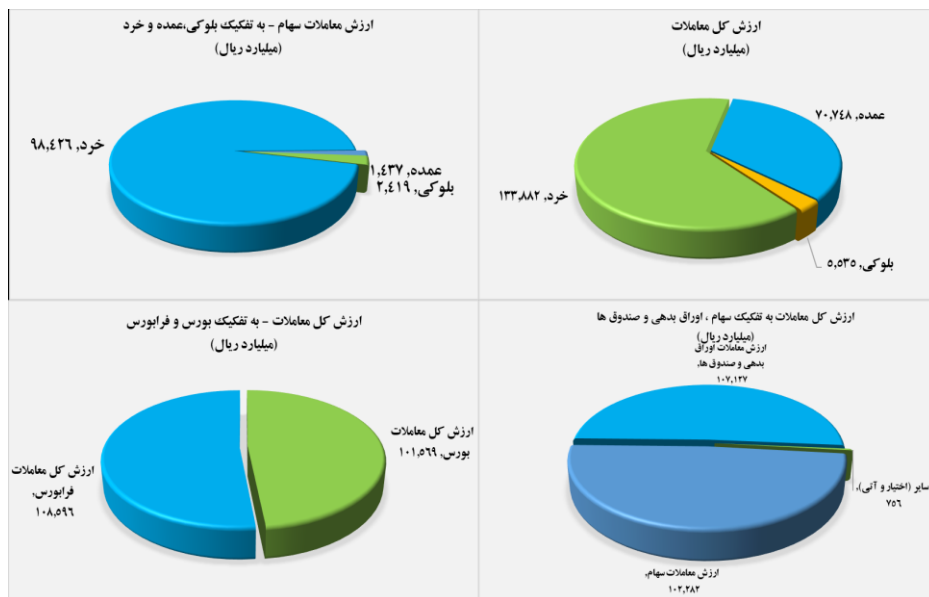
در گروه محصولات شوینده، گروه صنعتی پاکشو در تیر ماه فروش ۴۹۳ میلیارد تومانی را داشته است و جمع فروش ۴ ماهه به ۱,۴۰۹ میلیارد تومان رسیده است. کل فروش سال مالی قبل ۳,۶۸۰ میلیارد تومان بوده که میانگین ماهیانه ۳۰۷ میلیارد تومانی را داشته است. شرکت در این ماه ۲۷ هزار تن محصول تولید کرده در حالی که میانگین ماهیانه تولید سال قبل ۲۳ هزار تن و ۳ ماهه ۱۷,۶ هزار تن بوده است. فروش گروه صنعتی پاکشو در تیر ماه ۲۷ هزار تن بوده و میانگین فروش ماهیانه سال قبل ۲۲,۶ هزار تن و ۳ ماهه ۱۷ هزار تن بوده است. این شوینده در تیرماه هر کیلو محصول را به نرخ ۱۸,۰۰۰ تومان فروخته که ۶٪ پایینتر از ماه گذشته است. شرکت محصولات خود را در سال جاری با میانگین نرخ ۱۷,۸۸۴ و در سال گذشته با نرخ ۱۳,۵۵۰ تومان فروخته است.

در گروه فلزات اساسی، شرکت ذوب آهن اصفهان در سال گذشته ۲۵۷ ریال به ازای هر سهم سود ساخته است. شرکت در اولین فصل سال جاری نیز ۱۷۸ ریال سود گزارش کرده است. فروش شرکت سال گذشته برابر ۲۰,۰۴۲ میلیارد تومان گزارش شد که در سه ماهه توانسته فروش ۷,۵۸۵ میلیارد تومانی را بسازد که نسبت به فصل گذشته رشد ۱۲ درصدی داشته است. این تولید کننده در سال مالی ۹۹، ۲,۱۷۶، ۹۹ میلیارد تومان سود عملیاتی شناسایی کرد که این مبلغ در سه ماهه برابر با ۱,۵۵۷، ۱ میلیارد تومان بوده و نسبت به فصل گذشته رشد ۲۵۰ درصدی را تجربه کرده است. حاشیه سود شرکت در سال ۹۹ برابر با ۱۸ درصد بوده است و در بهار حاشیه سود ۲۹ درصدی داشته است.

در گروه فعالیتهای کمکی به نهادهای مالی واسط، شرکت بورس در تیر ماه درآمد ماهانه ۵۵ میلیارد تومانی را گزارش کرده است. شرکت در فروردین و اردیبهشت به ترتیب ۲۸ و ۳۹ میلیارد تومان درآمد داشت. میانگین درآمد ماهانه سال ۹۹، ۱۱۶ و میانگین سال ۹۸، ۳۱ میلیارد تومان بوده است. شرکت فرابورس در همین گروه نیز در تیر ماه ۲۴ میلیارد تومان درآمد گزارش کرده است. شرکت در فروردین و اردیبهشت به ترتیب ۹ و ۱۵ میلیارد تومان درآمد گزارش کرده بود. میانگین درآمد ماهانه سال ۹۹، ۴۹ و میانگین سال ۹۸، ۱۷ میلیارد تومان بوده است.

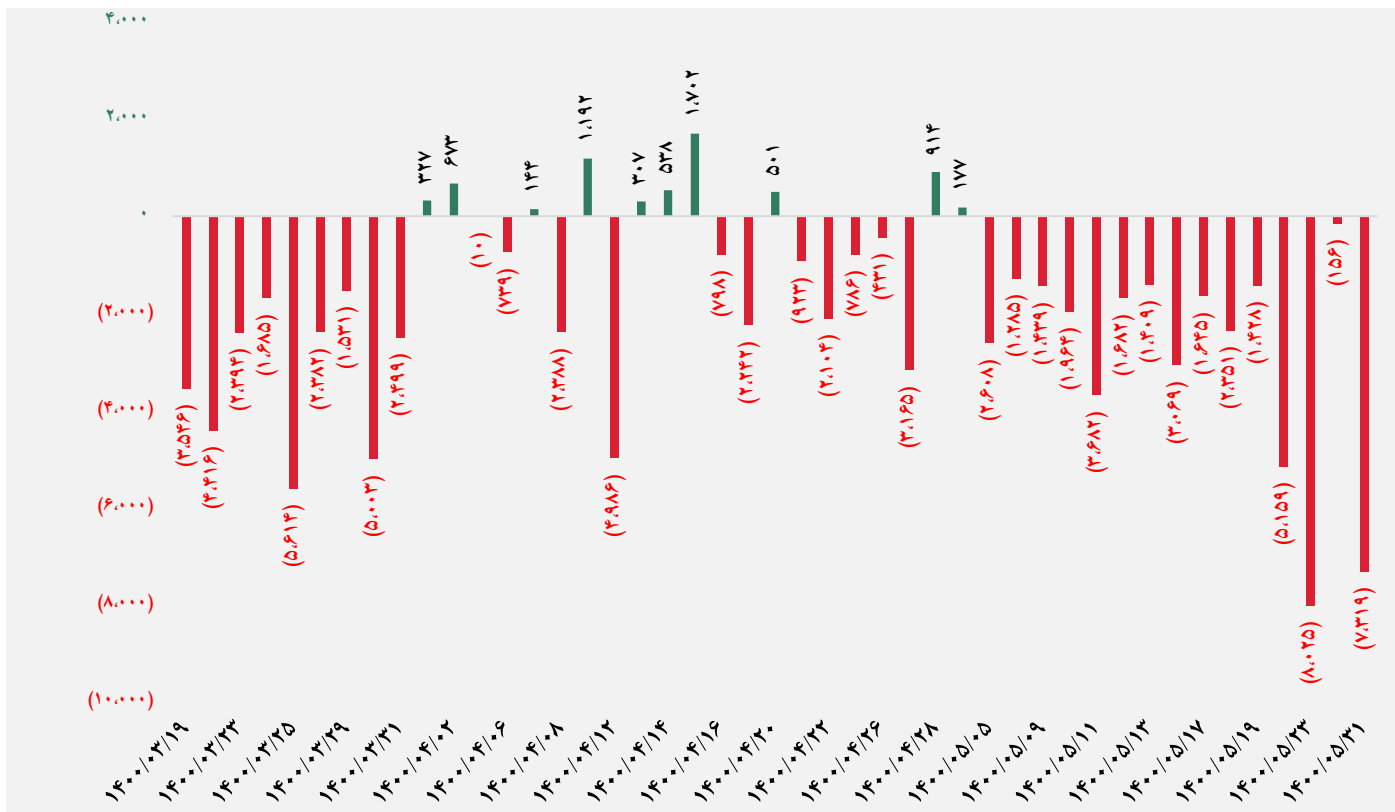
## تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۲۱,۸۷۶	شاخص کل	۱,۵۱۵,۴۸۲	شاخص کل
۳۱۸	تغییر شاخص	۱۵,۵۵۸	تغییر شاخص
۱۱,۹۴۳,۷۸۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۶۰,۸۶۶,۱۰۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۰۸,۵۹۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۰۱,۵۶۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
مازون		نوری	
آریا		شتران	
زاگرس		شپدیس	
صبا		خودرو	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
بپاس		شستا	
کگهر		میدکو	
ذوب		وسر ضوی	
ارفع		تپیکو	

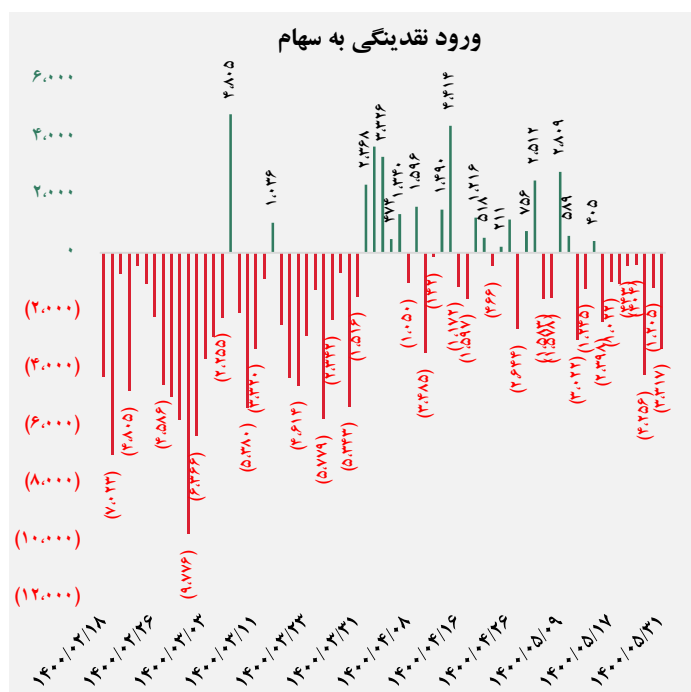


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

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

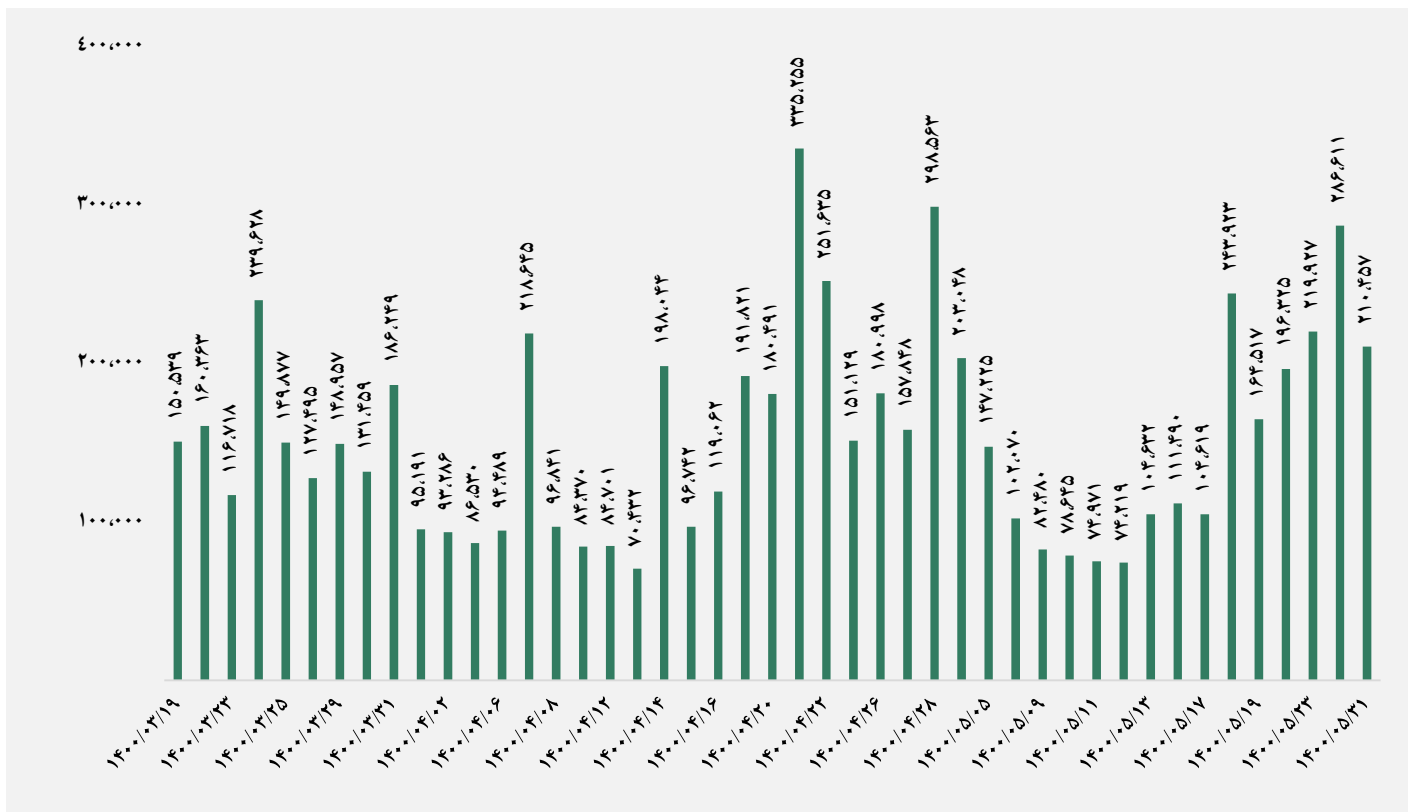


## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

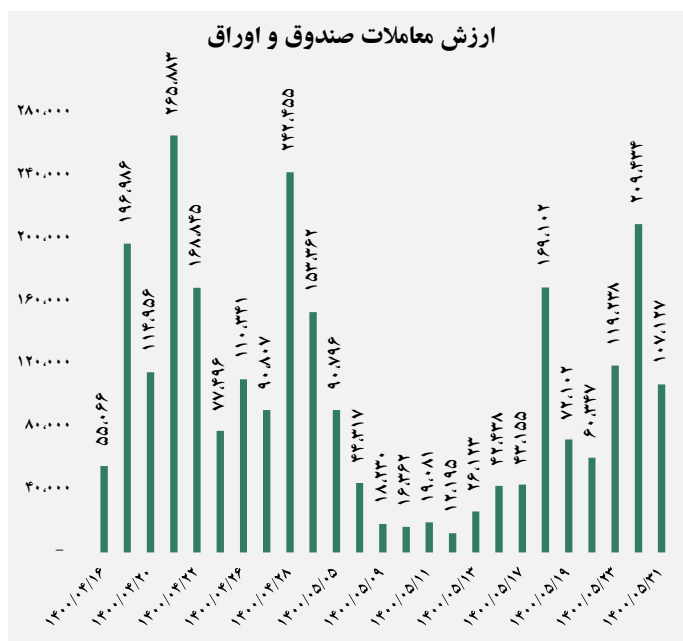
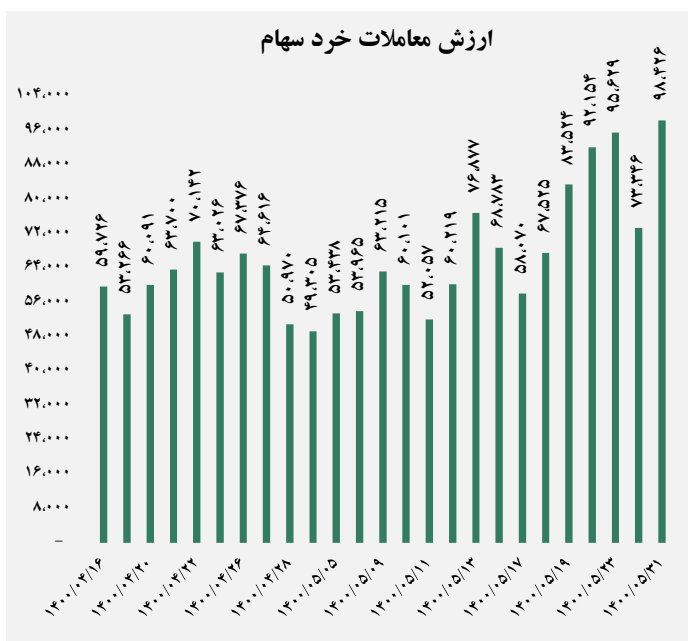


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

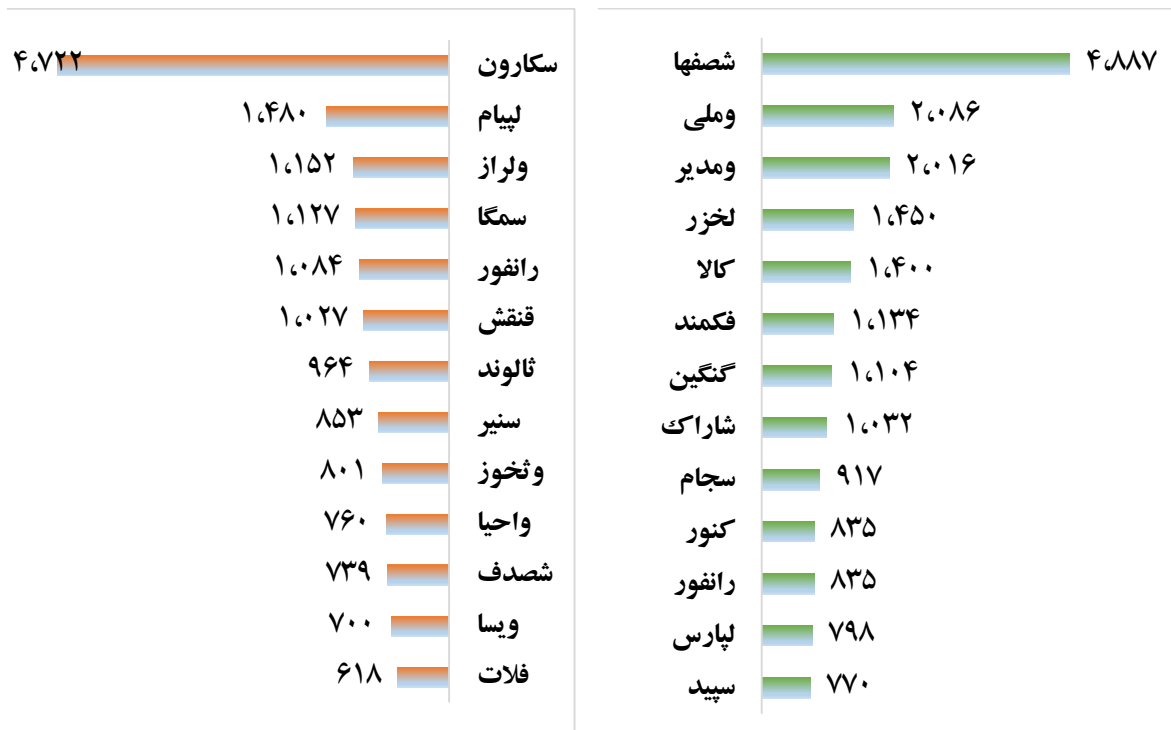


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





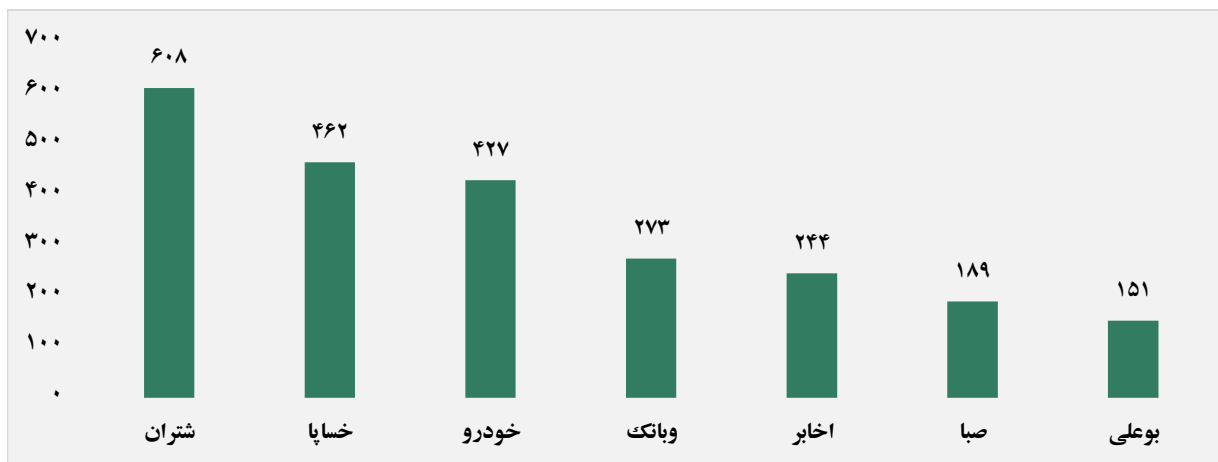
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



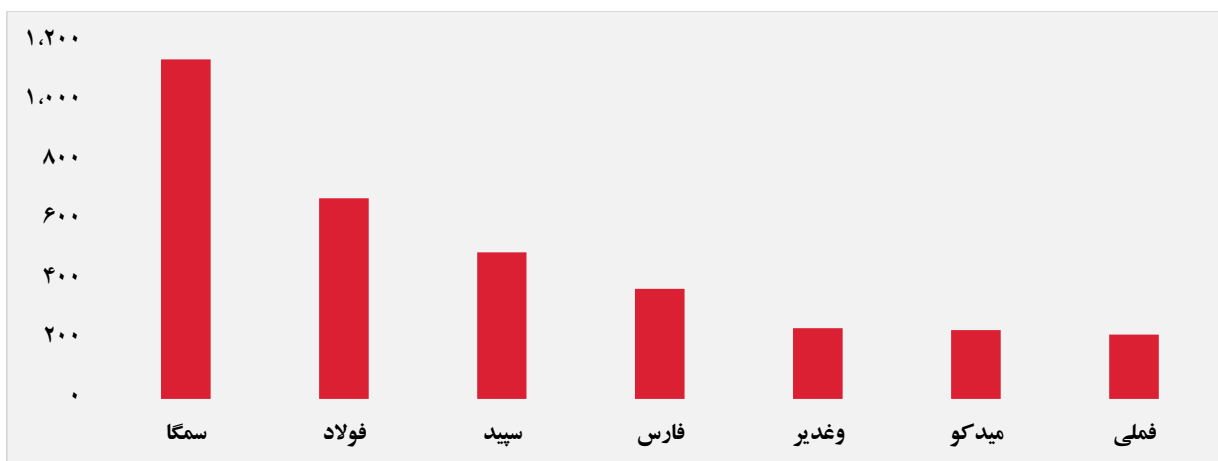
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	خودرو	۱	سمگا
۲	ویانک	۲	فخوز
۳	اخابر	۳	واحیا
۴	صبا	۴	تپیکو
۵	اپال	۵	وسرضوی
۶	بفجر	۶	فاسمین
۷	زاگرس	۷	دفارا
۸	ثباغ	۸	وحکمت
۹	دلر	۹	شبهرن
۱۰	شصفها	۱۰	غفارس

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



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



### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	سپید	۱۰	غفارس
۲	سمگا	۱۱	خصیر
۳	برکت	۱۲	بوعلی
۴	غدیس	۱۳	آپ
۵	شاوان	۱۴	خفتر
۶	زاگرس	۱۵	پارس
۷	دلر	۱۶	کسرا
۸	نوری	۱۷	وساخت
۹	شغدیر	۱۸	سیمرخ





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

