



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۶/۰۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱ شهریور ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای پترول، اخبر، شپدیس، اپال، وپارس و همراه با افزایش ۳۳۸ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۵۱۵,۸۸۶ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۱۳ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۱۰۷ 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 ۵۰ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

شاخص کل بورس در کانال ۱,۵ میلیونی در حال پیش روی است و به سقف مقاومت یک میلیون و ۵۴۰ هزار واحد نزدیک‌تر شد. پیش از این تحلیل گران تکنیکی دو سطح یک میلیون و ۵۰۰ هزار واحد و یک میلیون و ۵۴۰ هزار واحد را به عنوان دو سقف مقاومت مهم بازار معرفی می‌کردند. پس از صعود روز گذشته و جاری در شاخص و شکسته شدن قدرتمند سطح مقاومت یک میلیون و ۵۰۰ هزار، شاخص کل به فاصله ۲۵ هزار واحدی سقف مقاومت بعدی رسیده است؛ بنابراین به نظر می‌رسد شاخص دست کم تا رقم یک میلیون و ۵۴۰ هزار واحد بالا برود. در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۸۶,۸۲۸ 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 ۸۰۹، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۹/۲۳ با ۲۱,۹۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	۱۴۰۰/۰۶/۰۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۷۴,۲۱۶	۸۶,۸۲۸	۱۷٪

گروه‌های مؤثر



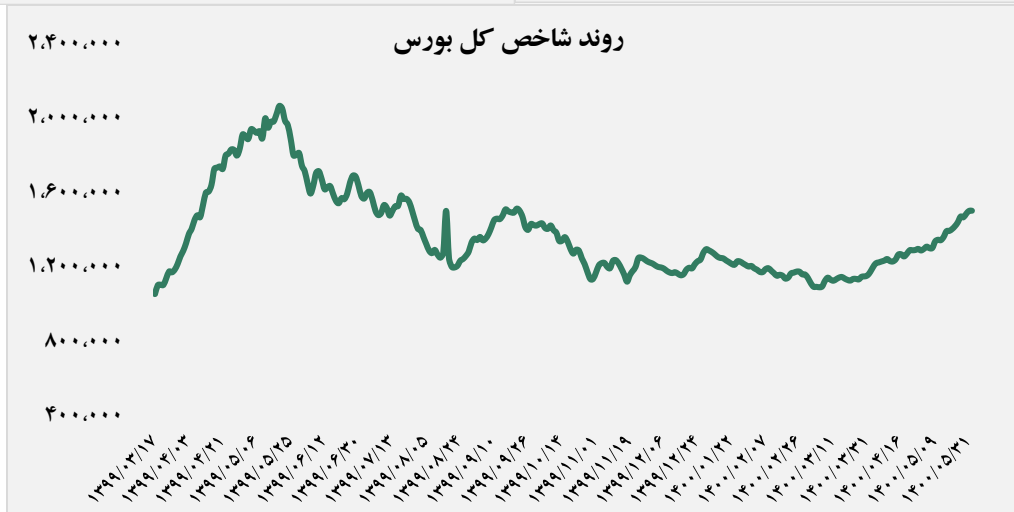
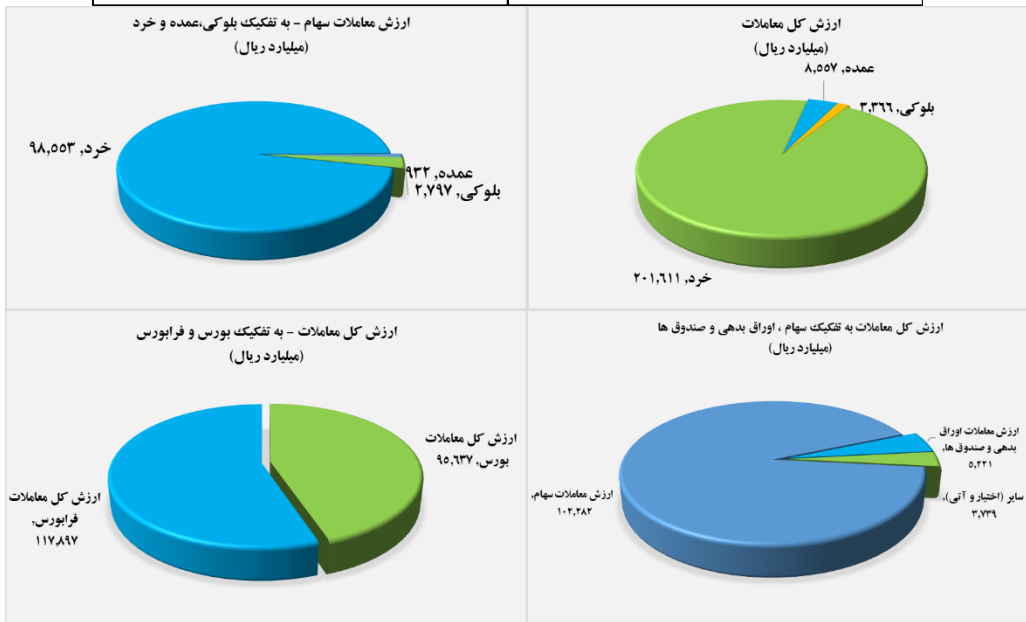
در گروه خودرو، سایپا در تیر ماه فروش ۳,۶۲۳ میلیارد تومانی داشته و جمع فروش ۴ ماهه را به ۱۰,۹۳۹ میلیارد تومان رسانده است. فروش کل سال مالی قبل ۱۶,۱۶۱ و میانگین ماهیانه ۱,۳۴۷ میلیارد تومان بوده است. شرکت در این ماه ۲۷,۶ هزار دستگاه خودرو تولید داشته در حالی که میانگین تولید ماهانه سال گذشته ۲۶,۴ هزار دستگاه و ۳ ماهه ۲۷,۲ هزار دستگاه بوده است. این خودروساز در تیر ماه ۳۸,۹ هزار دستگاه خودرو فروخته در حالی که میانگین فروش ماهانه سال گذشته ۲۴,۸ هزار دستگاه و ۳ ماهه ۲۶,۶ هزار دستگاه بوده است. شرکت در تیر ماه به طور میانگین هر دستگاه خودرو را به قیمت ۹۳,۴ میلیون تومان فروخته که میانگین این نرخ در سال گذشته ۵۴ میلیون تومان بوده و در ۴ ماهه ۹۲,۲ میلیون تومان شده است.

در گروه کانه‌های غیر فلزی، شرکت شیشه و گاز در تیر فروش ۲۷ میلیارد تومانی داشته است و میانگین ۳ ماهه ۲۴ میلیارد تومان بوده است. میانگین فروش ماهانه و مجموع فروش سال مالی قبل به ترتیب ۲۱ و ۲۵۲ میلیارد تومان بوده است. شرکت در این ماه ۱۶ میلیون عدد بطری تولید کرده و ۱۶ میلیون عدد فروش داشته است. میانگین تولید و فروش در ۳ ماه گذشته به ترتیب ۱۶,۶ و ۱۷,۴ میلیون عدد بوده است. میانگین تولید و فروش ماهیانه در سال مالی قبل هر دو ۱۸ میلیون عدد می‌باشد. نرخ فروش بطر سبک داخلی در این ماه ۱,۹۶۵ تومان به ازای هر عدد بوده و نرخ بطر صادراتی ۱,۳۲۸ تومان بوده است. شرکت در سال قبل بطر داخلی و صادراتی را به ترتیب با نرخ ۱,۰۶۰ و ۱,۲۴۱ تومان فروخته است. و در ۴ ماهه سال جاری نرخ بطر داخلی و صادراتی به ترتیب ۱,۵۸۶ و ۱,۳۳۲ بوده است.

در گروه لاستیک، پکویر در تیر ماه فروش ۱۱۹ میلیاردی داشته که میانگین ۶ ماه اول سال مالی ۱۶۱ میلیارد تومان بوده و جمع فروش ۷ ماهه را به ۱,۰۸۵ میلیارد تومان رسانده است. جمع فروش سال گذشته ۱,۱۳۱ میلیارد بوده است. کویر تایر در سال مالی گذشته به طور متوسط هر ماه ۲,۵۰۵ تن تایر تولید کرده بود. این عدد در تیر ماه در حدود ۲,۵۷۰ تن بوده و میانگین ۶ ماهه اول سال مالی ۲,۴۲۲ تن بوده است. پکویر در سال مالی گذشته به طور متوسط هر ماه ۲,۴۶۸ تن تایر فروخته بود. این عدد در تیر ماه ۱,۹۴۰ تن و میانگین ۶ ماهه اول سال ۲,۴۰۸ تن بوده است. میانگین نرخ فروش تایر در سال مالی گذشته ۳۹,۰۰۰ تومان به ازای هر کیلوگرم بوده است. در تیر نرخ فروش ۶۱,۵۴۰ تومان بوده که ۶٪ نسبت به ماه قبل افت داشته است. شرکت تایر را در ۷ ماهه سال جاری به نرخ ۶۶,۱۹۰ تومان به ازای هر کیلوگرم فروخته است.

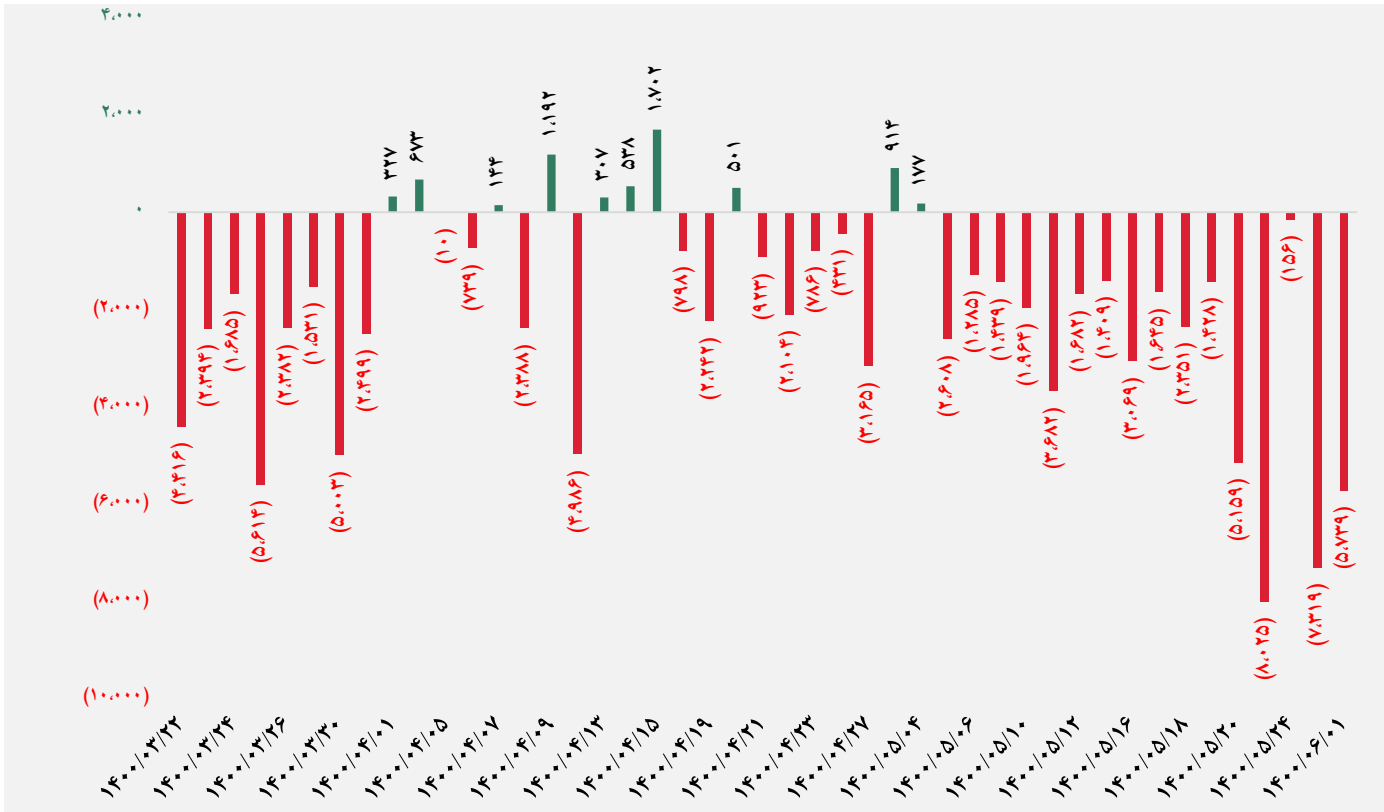
تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۲۱,۸۹۷	شاخص کل	۱,۵۱۵,۸۸۶	شاخص کل
۲۱	تغییر شاخص	۴۴۰	تغییر شاخص
۱۱,۹۵۴,۹۶۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۶۰,۸۸۱,۱۷۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۱۷,۸۹۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۹۵,۶۳۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
صبا		پترول	
وسپهر		شتران	
شگویا		اخابر	
زاگرس		شهیدیس	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
آریا		فارس	
بپاس		میدکو	
کگهر		فولاد	
ذوب		ومعادن	

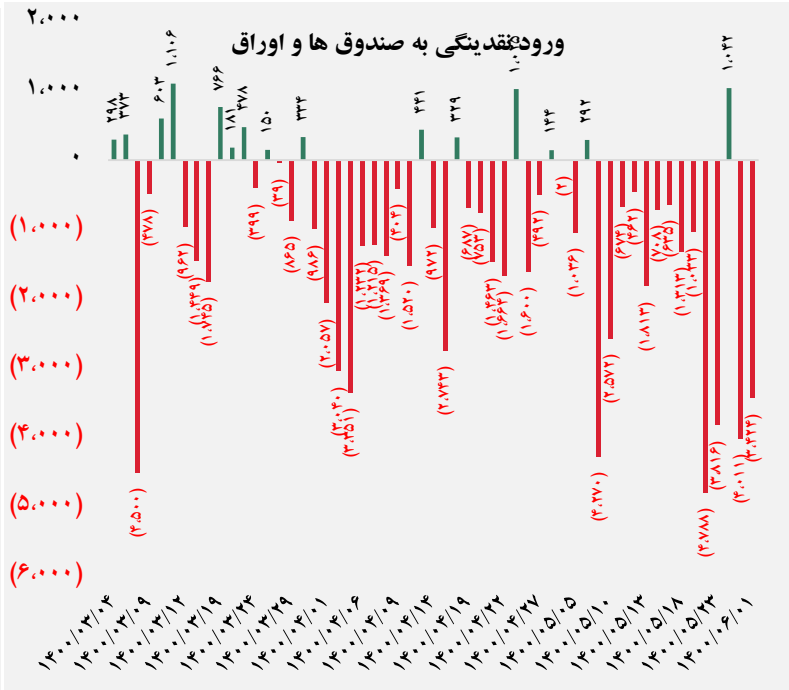
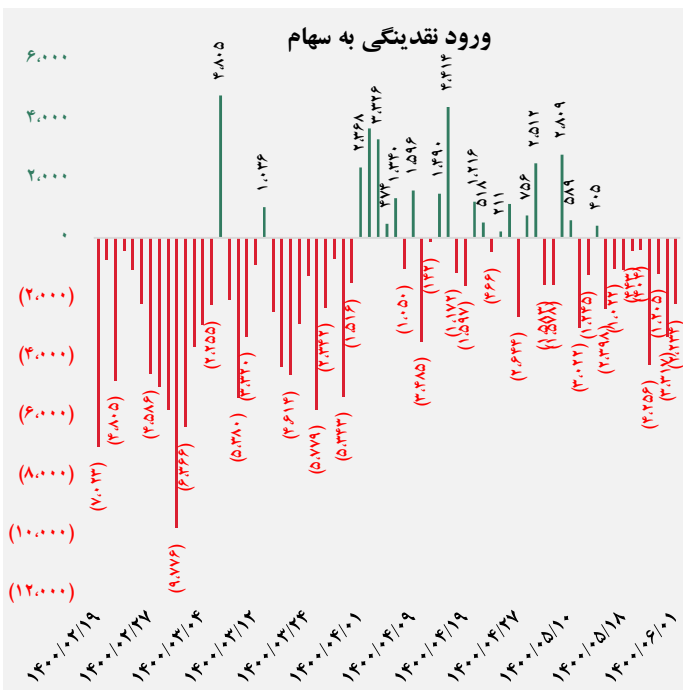




کل ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



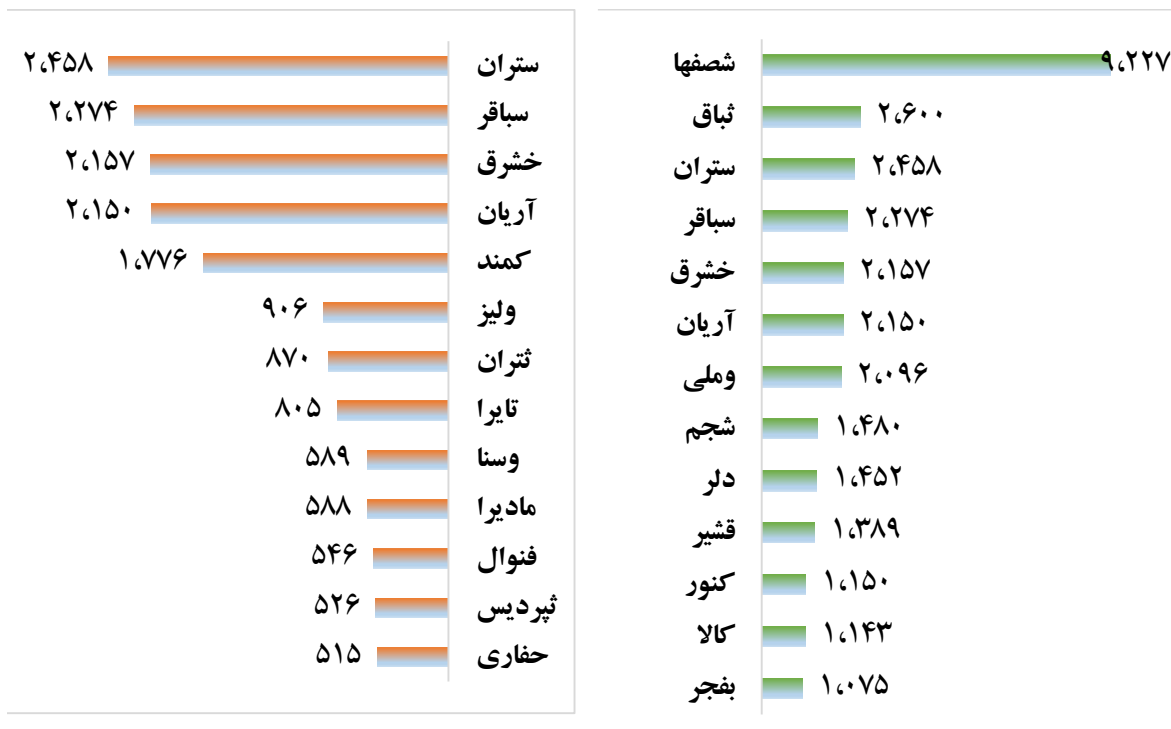
ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



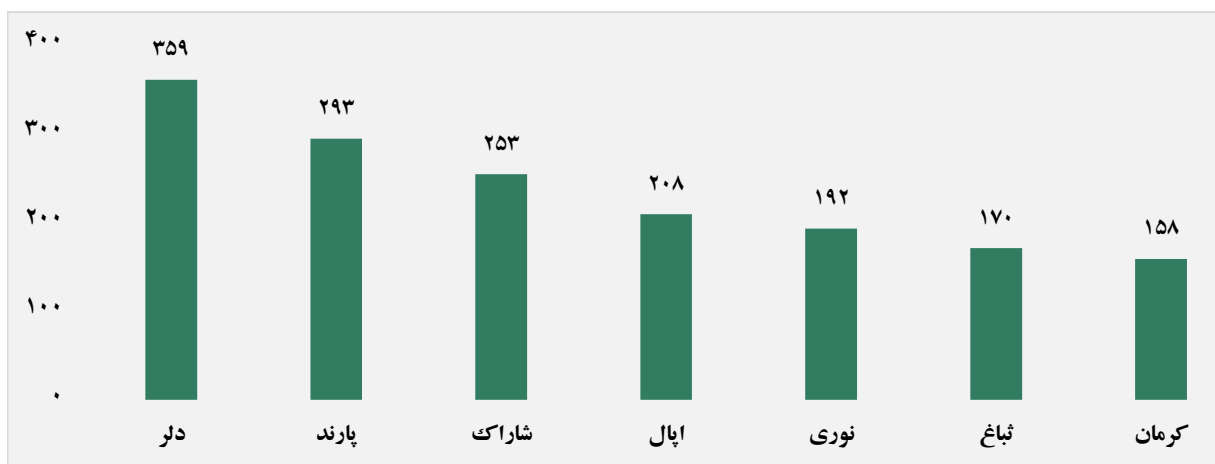
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



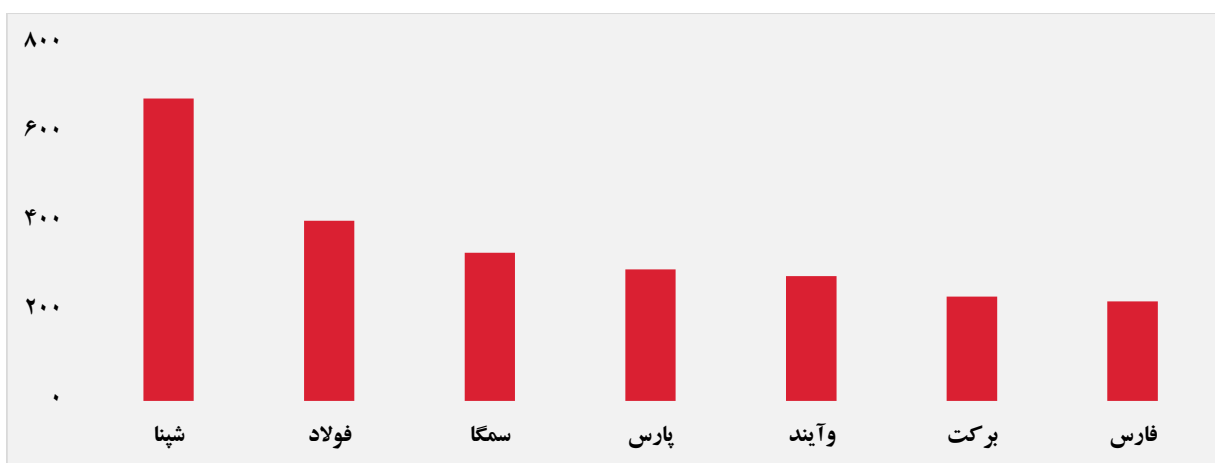
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شصفها	۱	دارا
۲	ثباق	۲	لپاس
۳	دلر	۳	گکیش
۴	بفجر	۴	کاوه
۵	تایرا	۵	غگلیا
۶	شفا	۶	دبالک
۷	دماوند	۷	شتران
۸	ثامان	۸	خساپا
۹	مادیرا	۹	فجم
۱۰	فنوال	۱۰	خلنت

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



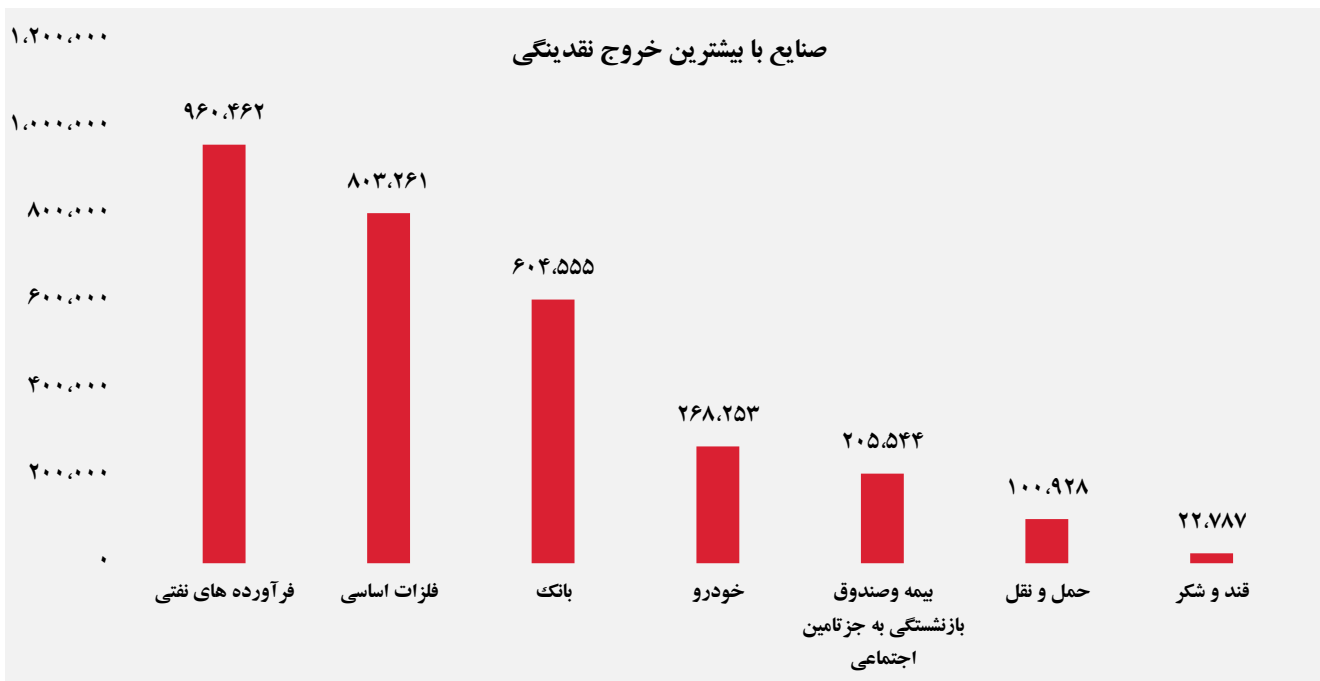
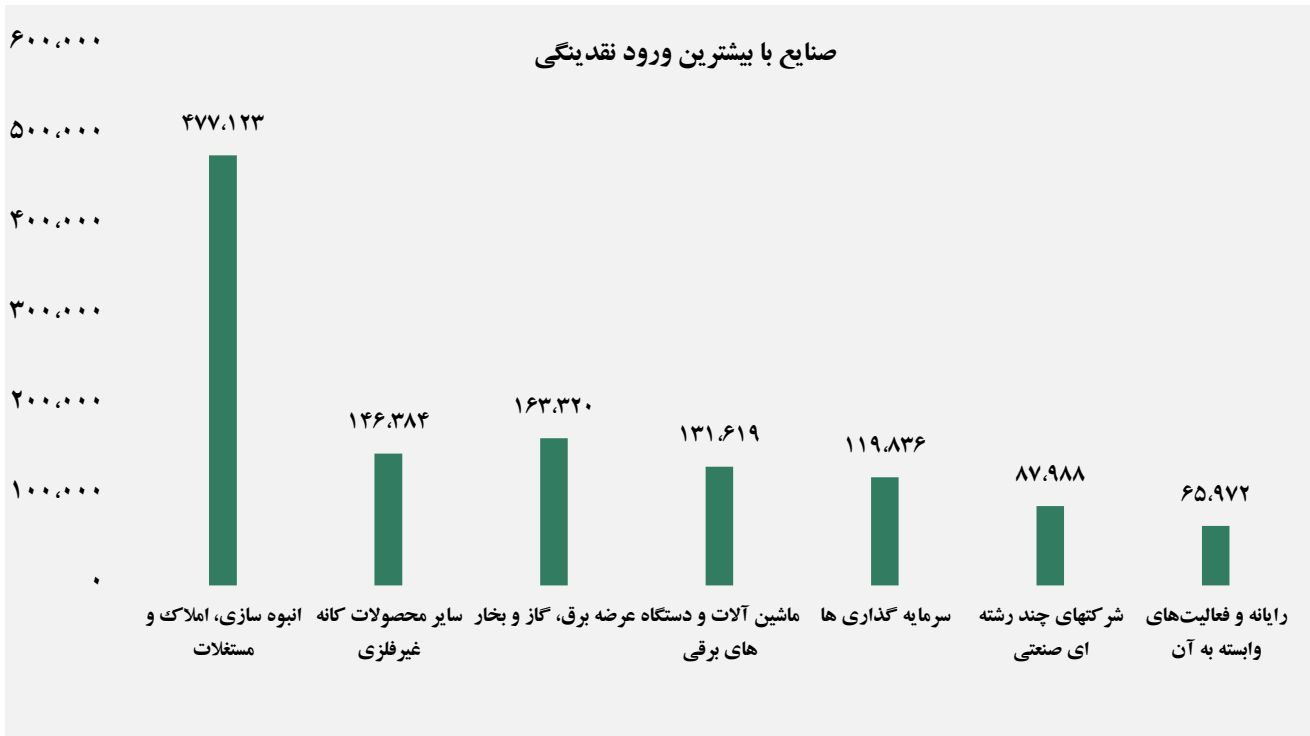
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	پالایش	۱۰	سمگا
۲	سپید	۱۱	فرزین
۳	برکت	۱۲	شاراك
۴	دلر	۱۳	سصوفی
۵	شغدیر	۱۴	غكورش
۶	غدیس	۱۵	خنصیر
۷	شاوان	۱۶	ثباغ
۸	كبافق	۱۷	فجر

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار