



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۶/۲۷

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۲۷ شهریور ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، کگل، فملی، کچاد، پارسان و معادن با کاهش ۳۷۱۰۷ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۵۱,۱۰۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۶۳ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۶۴ 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 ۲۴ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

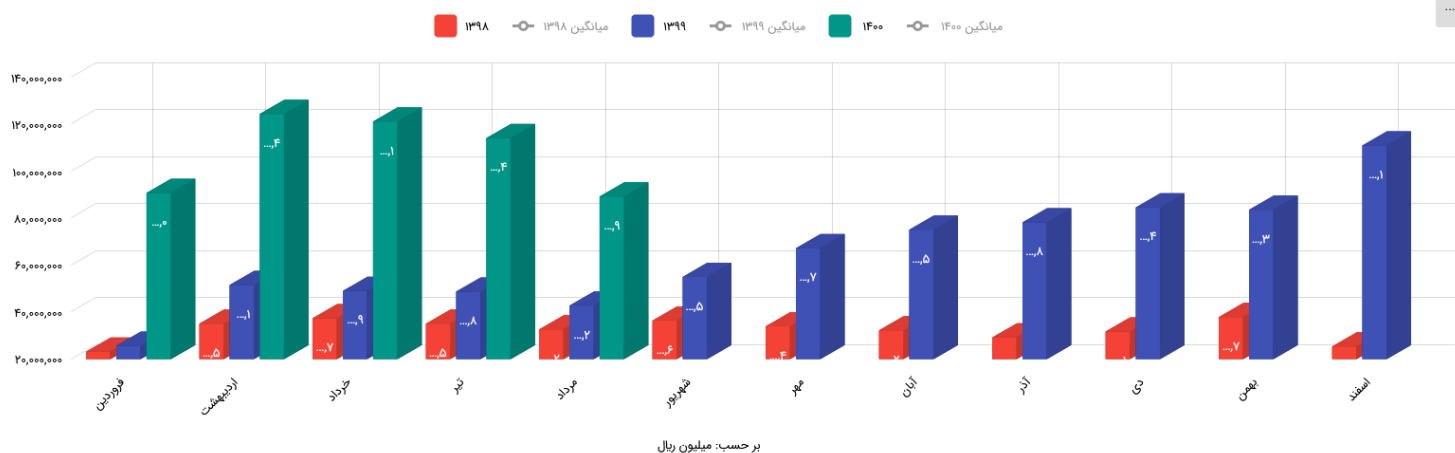
با توجه به کسری بودجه دولت، گمانه زنی ها بر سر افزایش نرخ حامل های انرژی و نرخ بهره مالکانه بسیار افزایش یافته است. بنابراین یکی از دلایل فشار فروش بازار سرمایه در روزهای اخیر می تواند همین موضوع باشد. همچنین طبق روال سال های گذشته، دو هفته آخر شهریور به خاطر پایان سال مالی بسیاری از کارگزاری ها در ۰۶/۳۱ و تسویه حساب کارگزاری ها با مشتریان، معمولاً به حجم فروش ها اضافه شده است. از طرفی دیگر بعضی از کارشناسان بازار سرمایه نظر مثبت به نشست بعدی گروه ۵+۱ در مورد برجام دارند و کاهش نرخ دلار به محدوده کمتر از ۲۵ هزار تومان را متصور هستند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۷۳,۰۷۱ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش 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 ۸۰۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۸/۱۷ با ۲۸,۸٪ سود است.

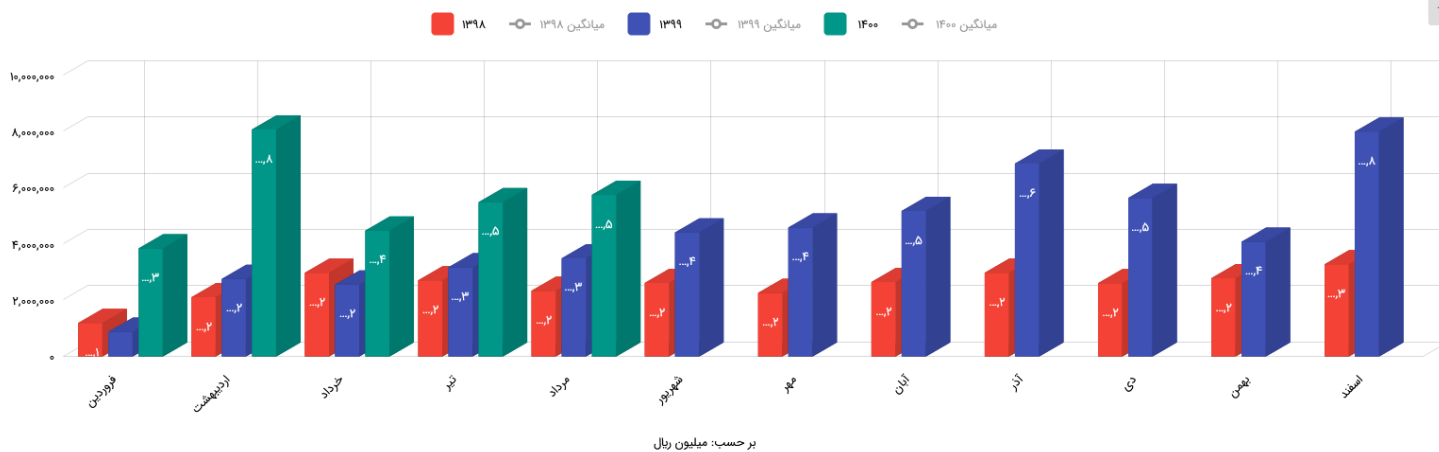
| شرح   | ۱۴۰۰/۰۶/۲۴ | ۱۴۰۰/۰۶/۲۷ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۱۵۴,۰۲۰    | ۱۷۳,۰۷۱    | ۱۲٪        |



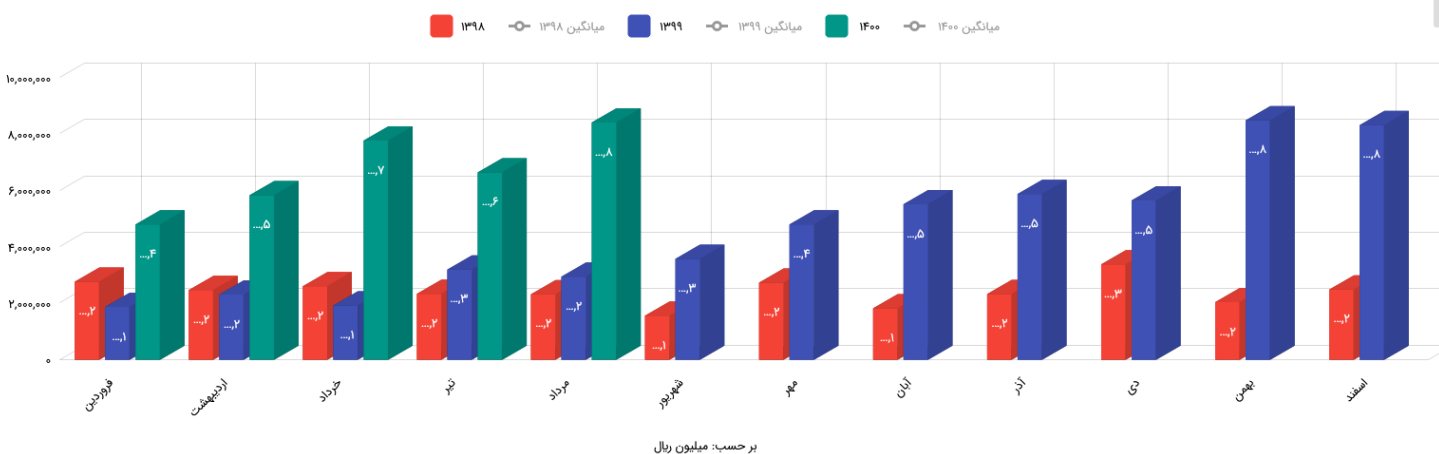
### ● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت فولاد مبارکه اصفهان (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



### ● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت نفت ایرانول (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



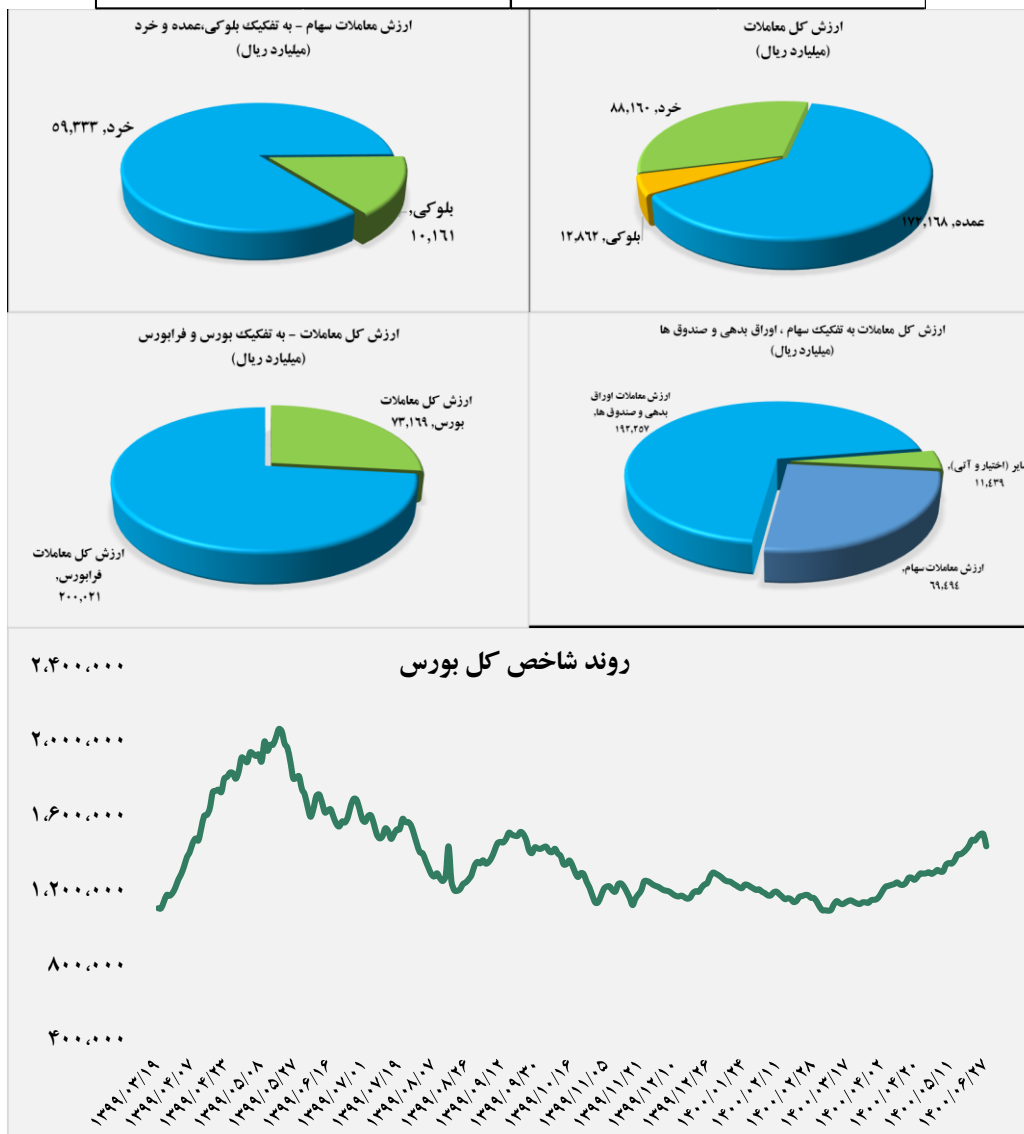
### ● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت پتروشیمی فناوران (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

## تصویر کلی بازار

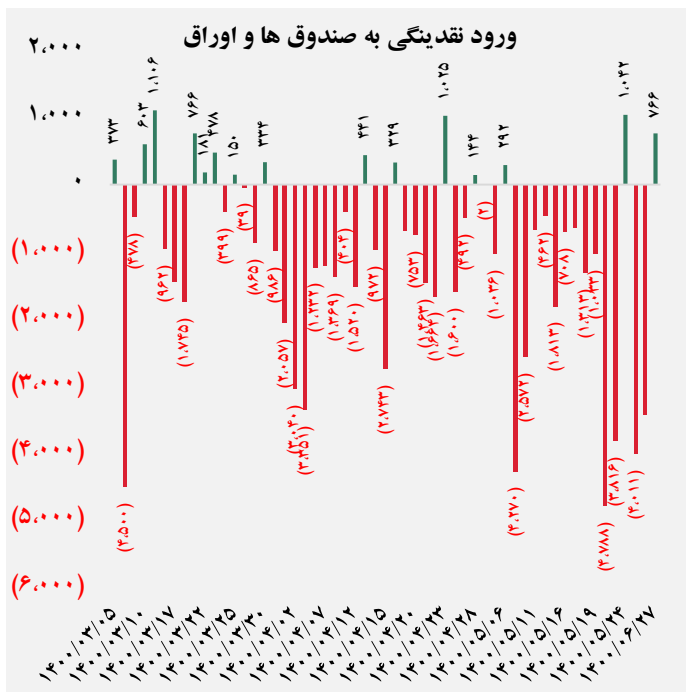
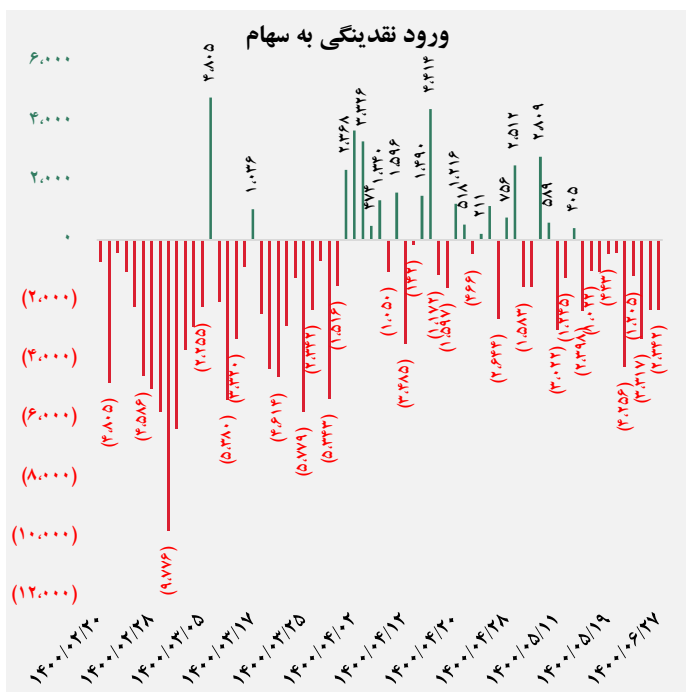
| فرا بورس                   |                             | بورس                       |                             |
|----------------------------|-----------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| ۲۱,۴۶۸                     | شاخص کل                     | ۱,۴۵۰,۲۲۱                  | شاخص کل                     |
| (۵۲۸)                      | تغییر شاخص                  | (۳۷,۹۹۱)                   | تغییر شاخص                  |
| ۱۵,۸۳۶,۱۹۴                 | ارزش بازار (میلیارد ریال)   | ۵۸,۲۷۵,۸۱۶                 | ارزش بازار (میلیارد ریال)   |
| ۲۰۰,۰۲۱                    | ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۷۳,۱۶۹                     | ارزش معاملات (میلیارد ریال) |
| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص |                             | بیشترین تاثیر مثبت در شاخص |                             |
| فجهان                      |                             | میدکو                      |                             |
| غصینو                      |                             | شستا                       |                             |
| دماوند                     |                             | تنوین                      |                             |
| بمینا                      |                             | فسزوار                     |                             |
| بیشترین تاثیر منفی در شاخص |                             | بیشترین تاثیر منفی در شاخص |                             |
| کگهر                       |                             | فولاد                      |                             |
| بپاس                       |                             | کگل                        |                             |
| آریا                       |                             | فملی                       |                             |
| زاگرس                      |                             | کچاد                       |                             |



## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

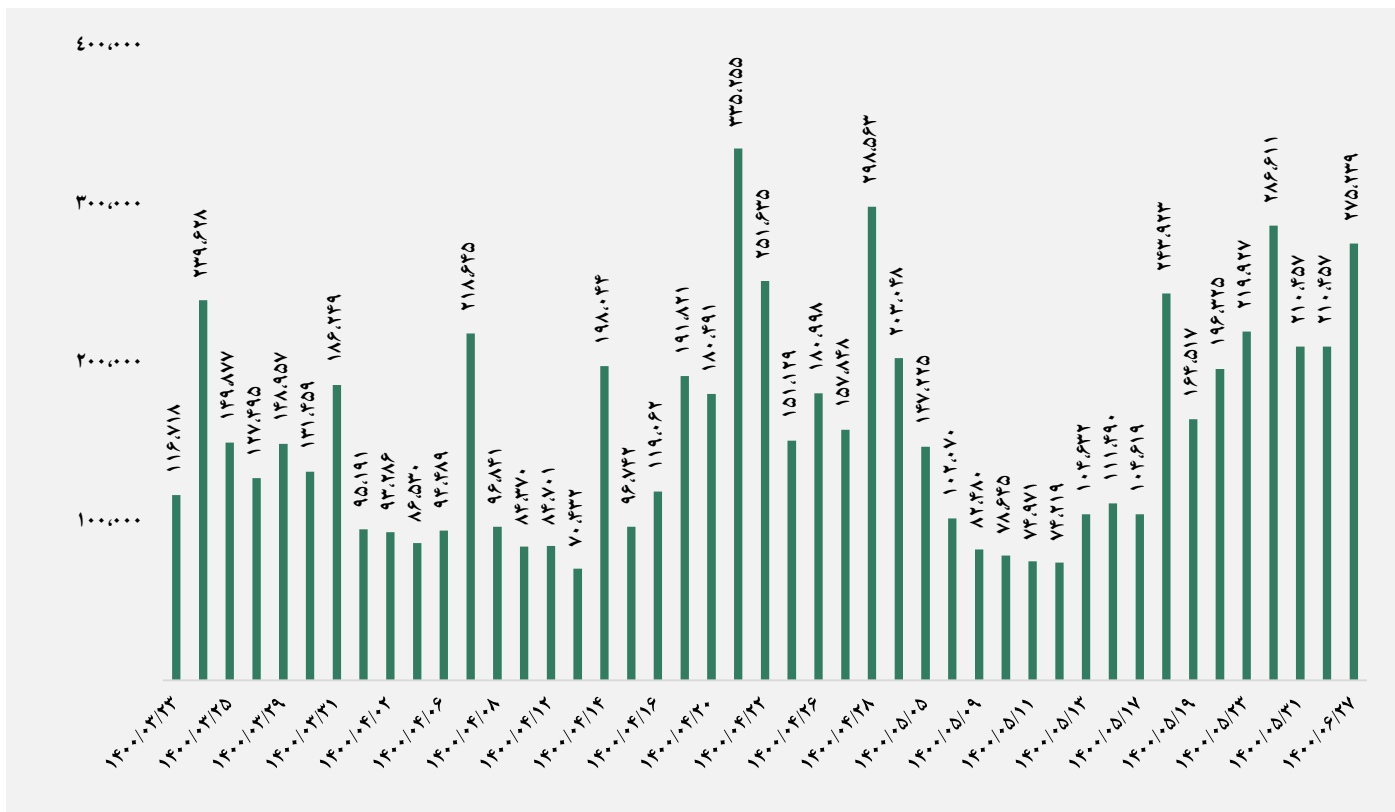


## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

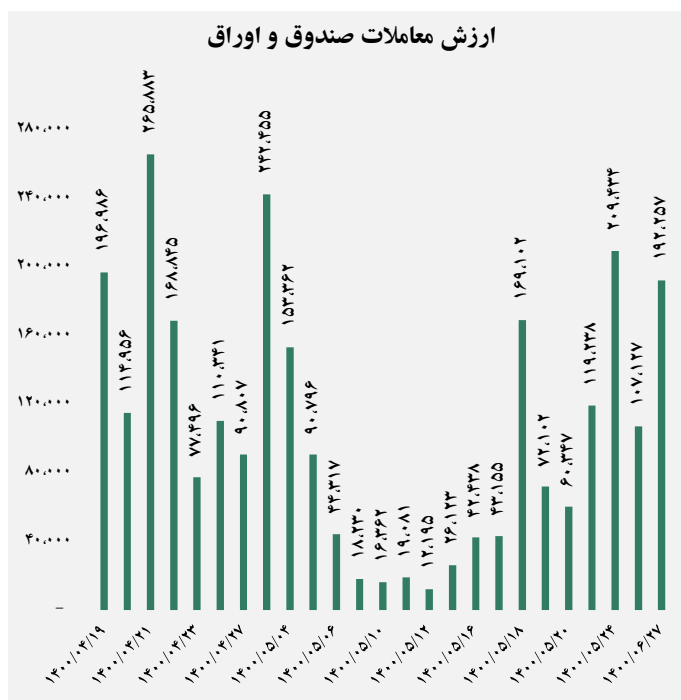
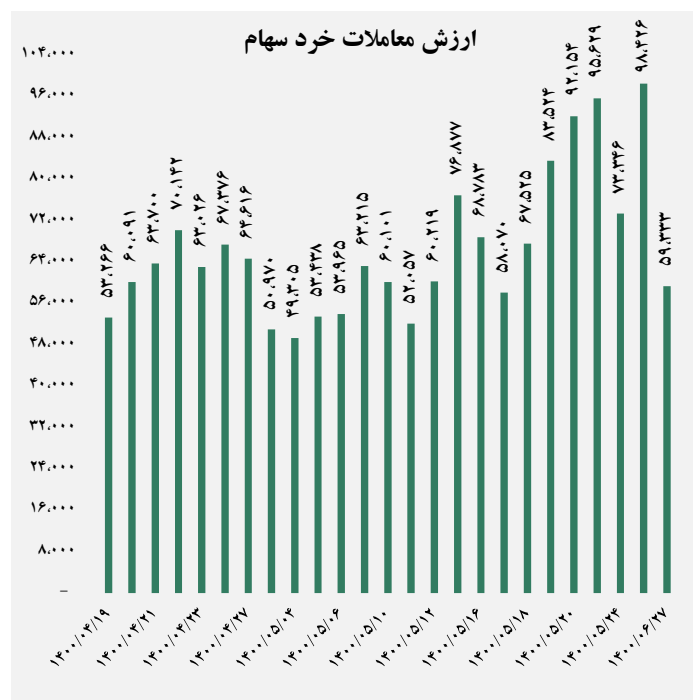


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

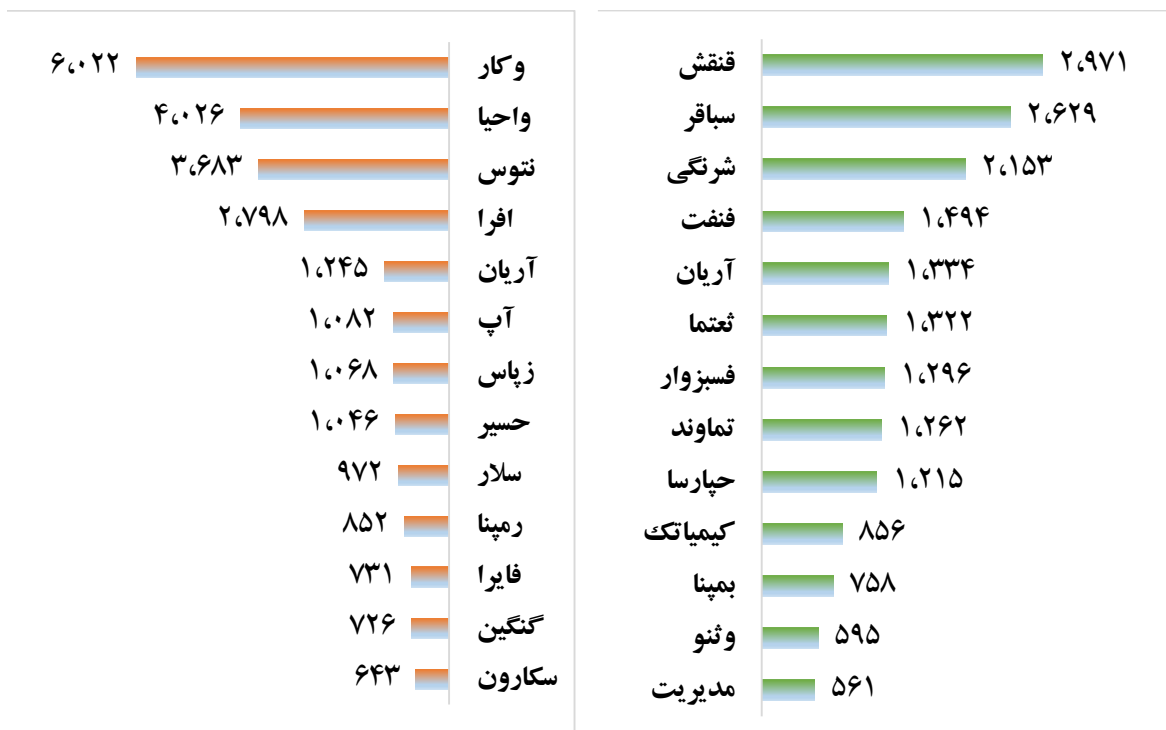


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





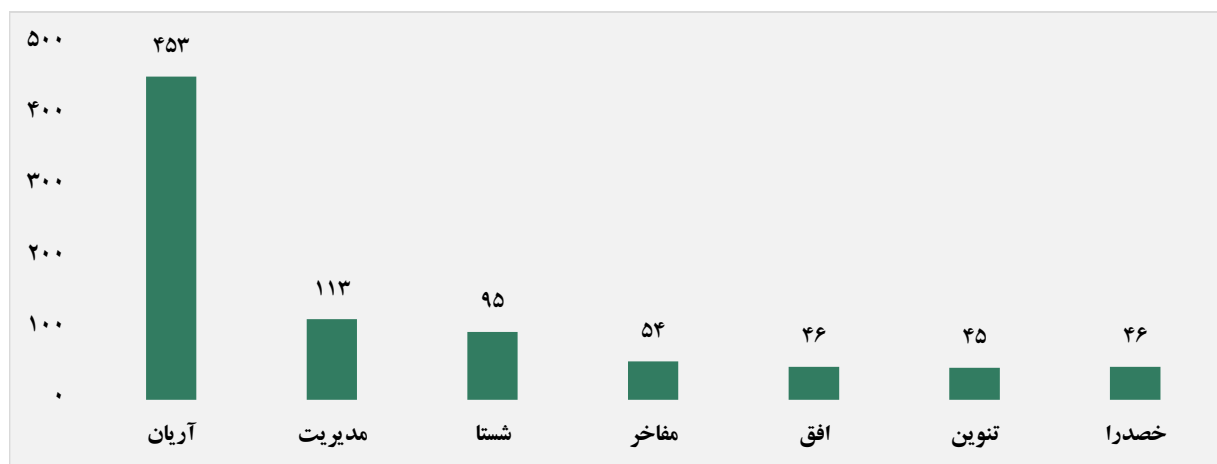
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



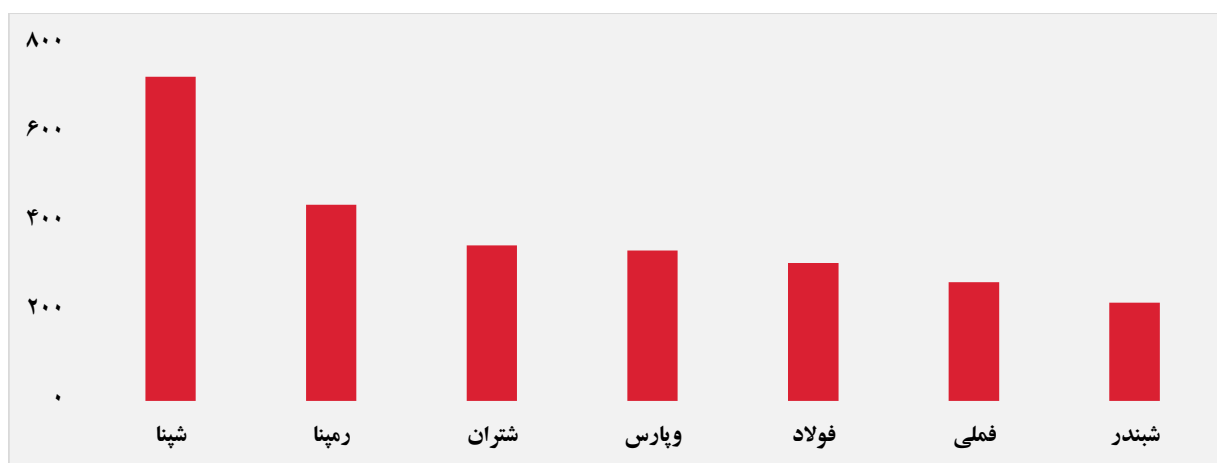
## پول هوشمند

| ردیف | ورود   | ردیف | خروج   |
|------|--------|------|--------|
| ۱    | مدیریت | ۱    | وخواور |
| ۲    | مفاخر  | ۲    | جم     |
| ۳    | دابور  | ۳    | ختور   |
| ۴    | شرنگی  | ۴    | فمراد  |
| ۵    | بمپنا  | ۵    | خفنر   |
| ۶    | خعمرا  | ۶    | پدرخش  |
| ۷    | خمتور  | ۷    | افق    |
| ۸    |        | ۸    |        |
| ۹    |        | ۹    |        |
| ۱۰   |        | ۱۰   |        |

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



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

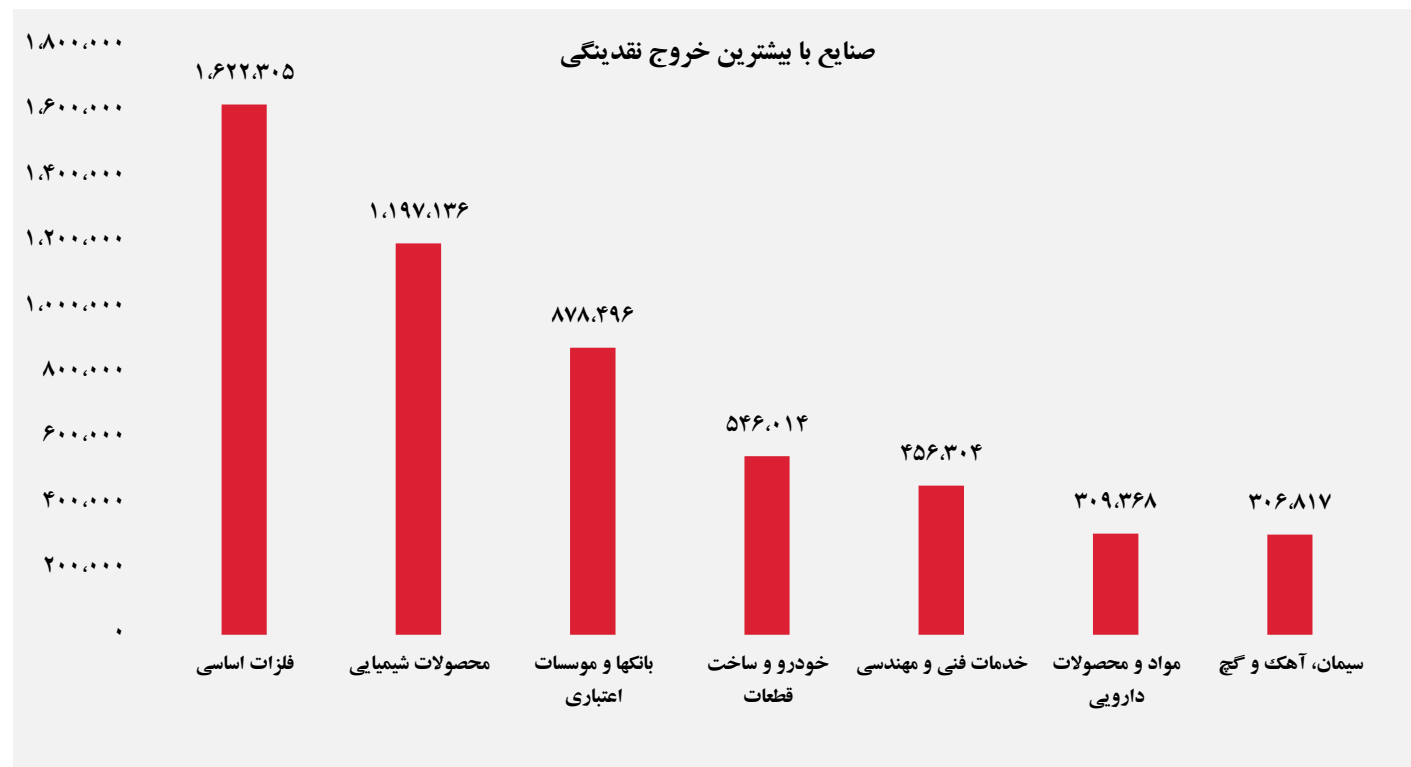
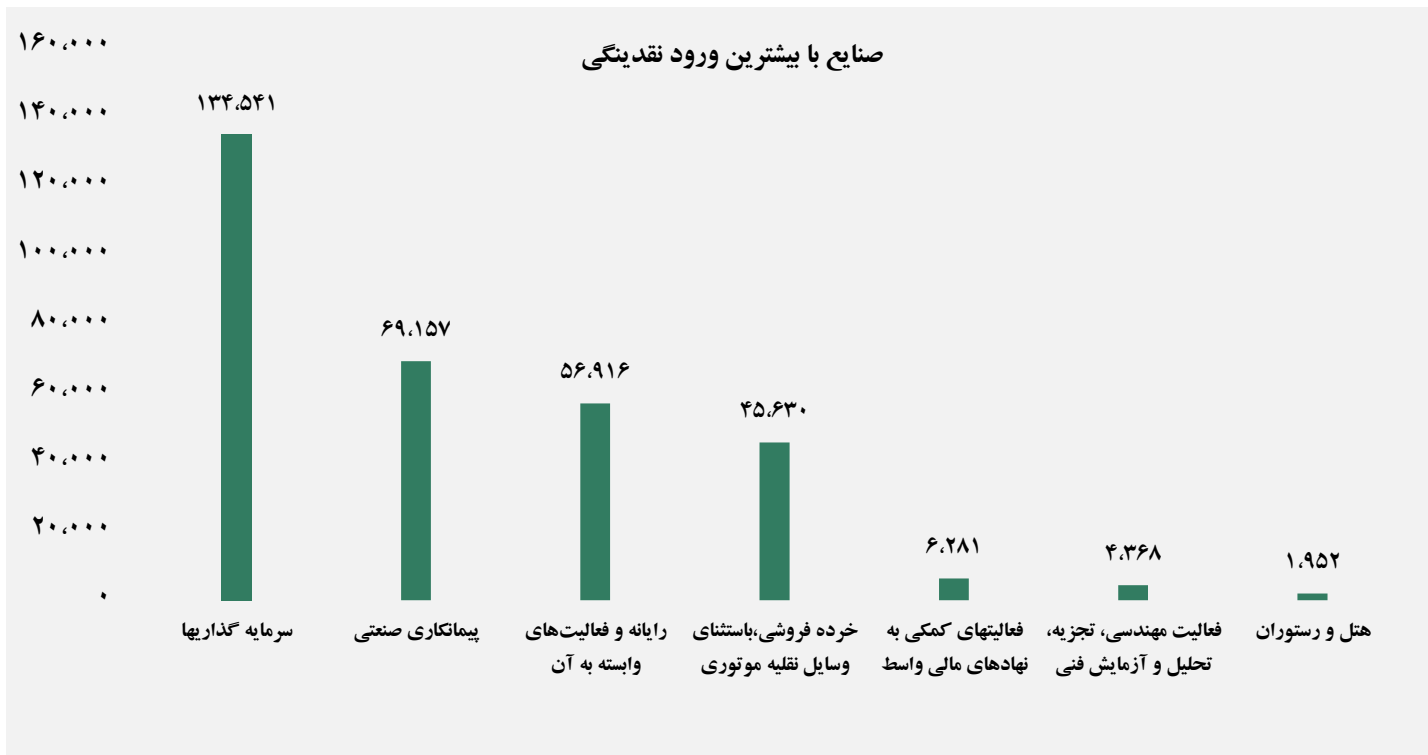


### واچ لیست

| ردیف | نماد   | ردیف | نماد   |
|------|--------|------|--------|
| ۱    | سپید   | ۱۰   | شاوان  |
| ۲    | مدیریت | ۱۱   | وپست   |
| ۳    | دلر    | ۱۲   | تپردیس |
| ۴    | تاپکیش | ۱۳   | ولپارس |
| ۵    | شغدیر  | ۱۴   | ثغرب   |
| ۶    | خفنر   | ۱۵   | ثفارس  |
| ۷    | زاگرس  | ۱۶   | توریل  |
| ۸    | برکت   | ۱۷   | سیمرغ  |



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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار