



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۶/۲۸

www.sfg.ir - info@sfg.i

تحلیل روزانه بازار

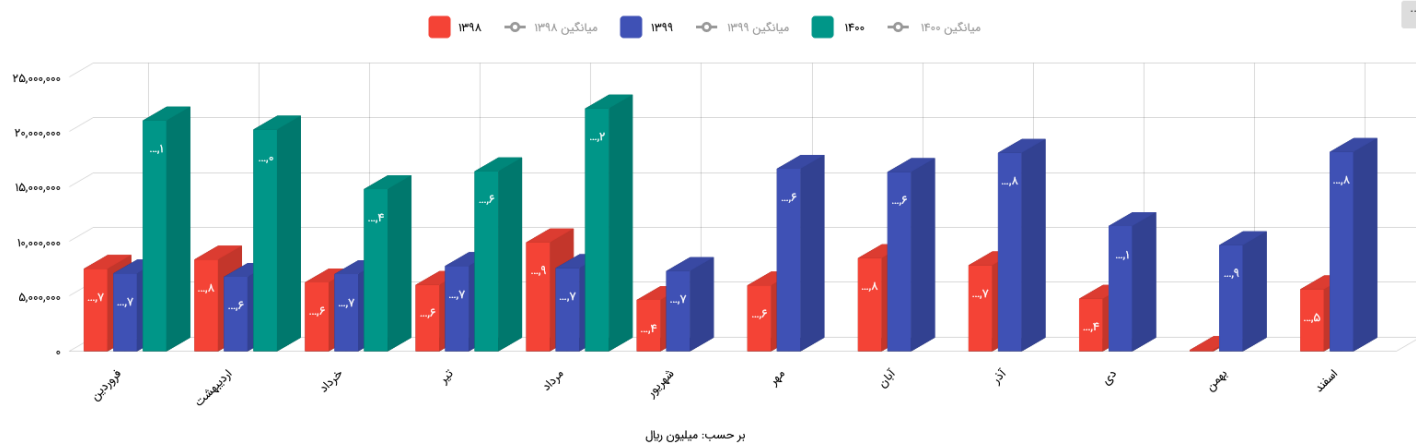
امروز یکشنبه ۲۸ شهریور ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، فولاد، فملی، کچاد، کگل و معادن با کاهش ۲۹,۷۴۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۲۰,۴۸۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۹۵ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۶۰ 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 ۳۱ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

در حال حاضر بازار سرمایه با ابهامات زیادی مواجه است. با توجه به عدم مشخص بودن سیاست های جدید بانک مرکزی (ابهام در نرخ بهره) در بازه زمانی کوتاه مدت می تواند به بازار سرمایه فشار وارد کند. از طرف دیگر شاخص کل در محدوده یک میلیون و ۴۲۰ هزار تا یک میلیون و ۴۰۰ هزار واحد یک محدوده حمایتی بسیار قوی را دارد. انتظار می رود با توجه به اینکه اکثر نمادها بر روی حمایت تکنیکالی خود قرار دارند، ریزش قیمتی بیشتری را در روزهای آینده شاهد نباشیم.

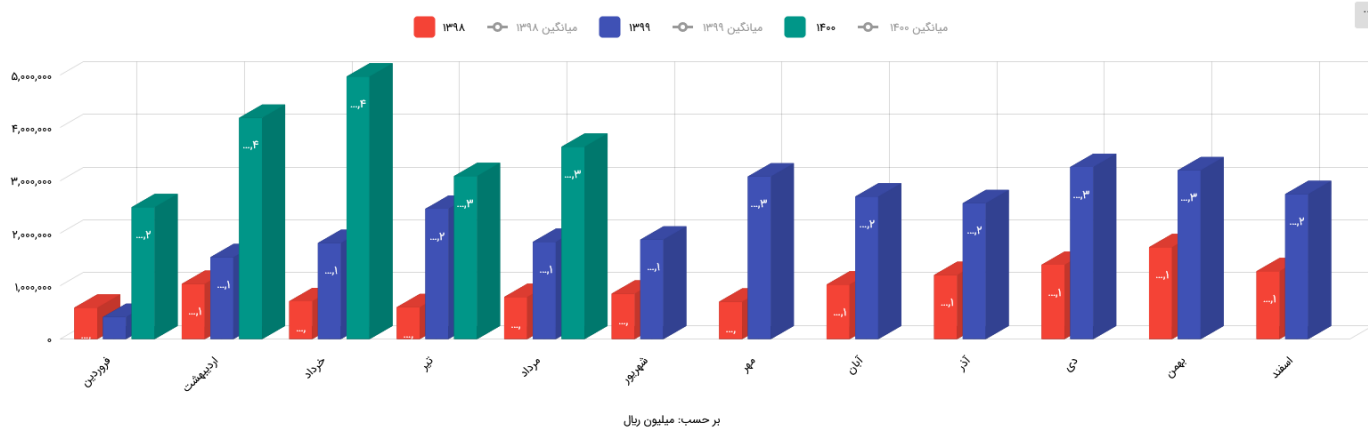
در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۲۱,۳۴۹ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۲۱۴، بیشترین ارزش معاملات را در بازار اوراق با درآمد ثابت به خود اختصاص داده است. در بین اوراق خزانه، بالاترین نرخ مؤثر بازده تا سررسید اخزاها نیز مربوط به نماد اخزا ۷۲۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۸/۲۴ با ۲۵,۶٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۶/۲۷	۱۴۰۰/۰۶/۲۸	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۵۴,۰۲۰	۱۲۱,۳۴۹	-۲۱٪

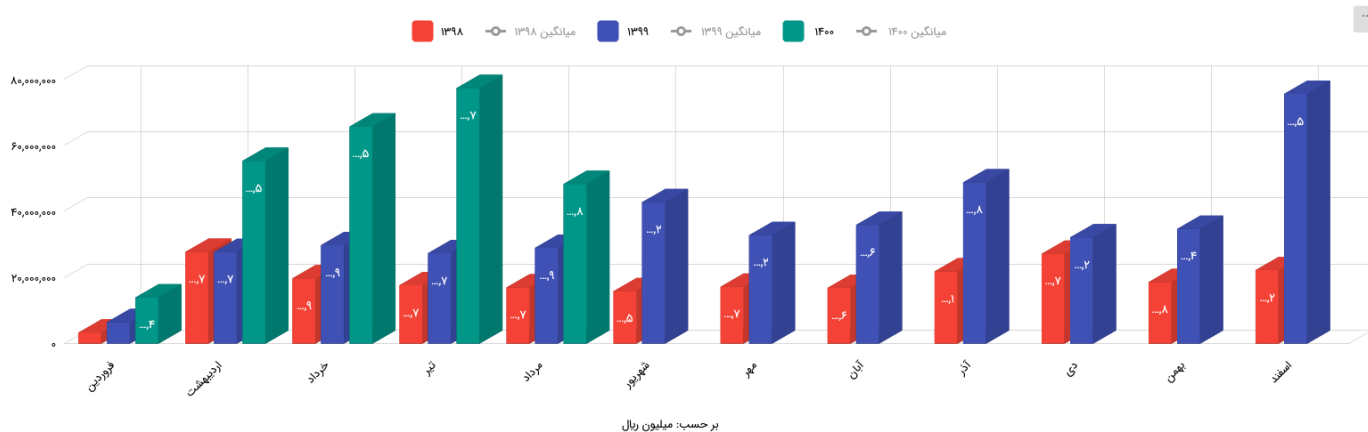
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه پتروشیمی زاگرس (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت فولاد امیرکبیر کاشان (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

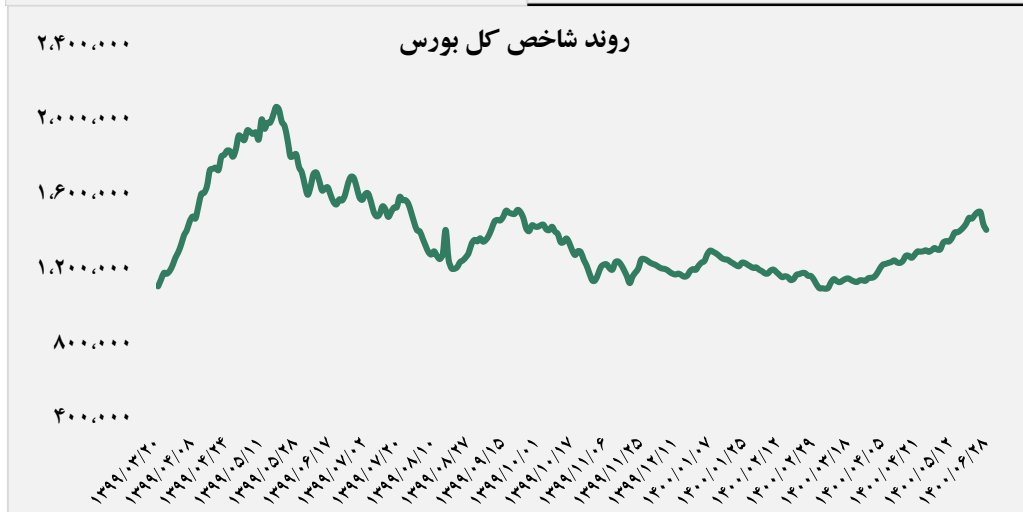
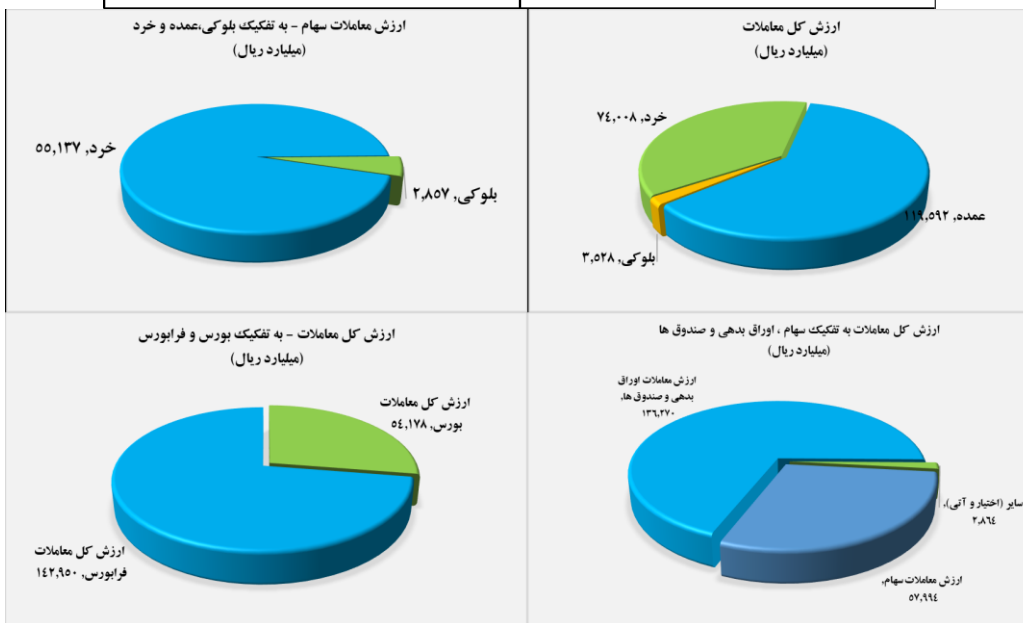


● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت ملی صنایع مس ایران (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

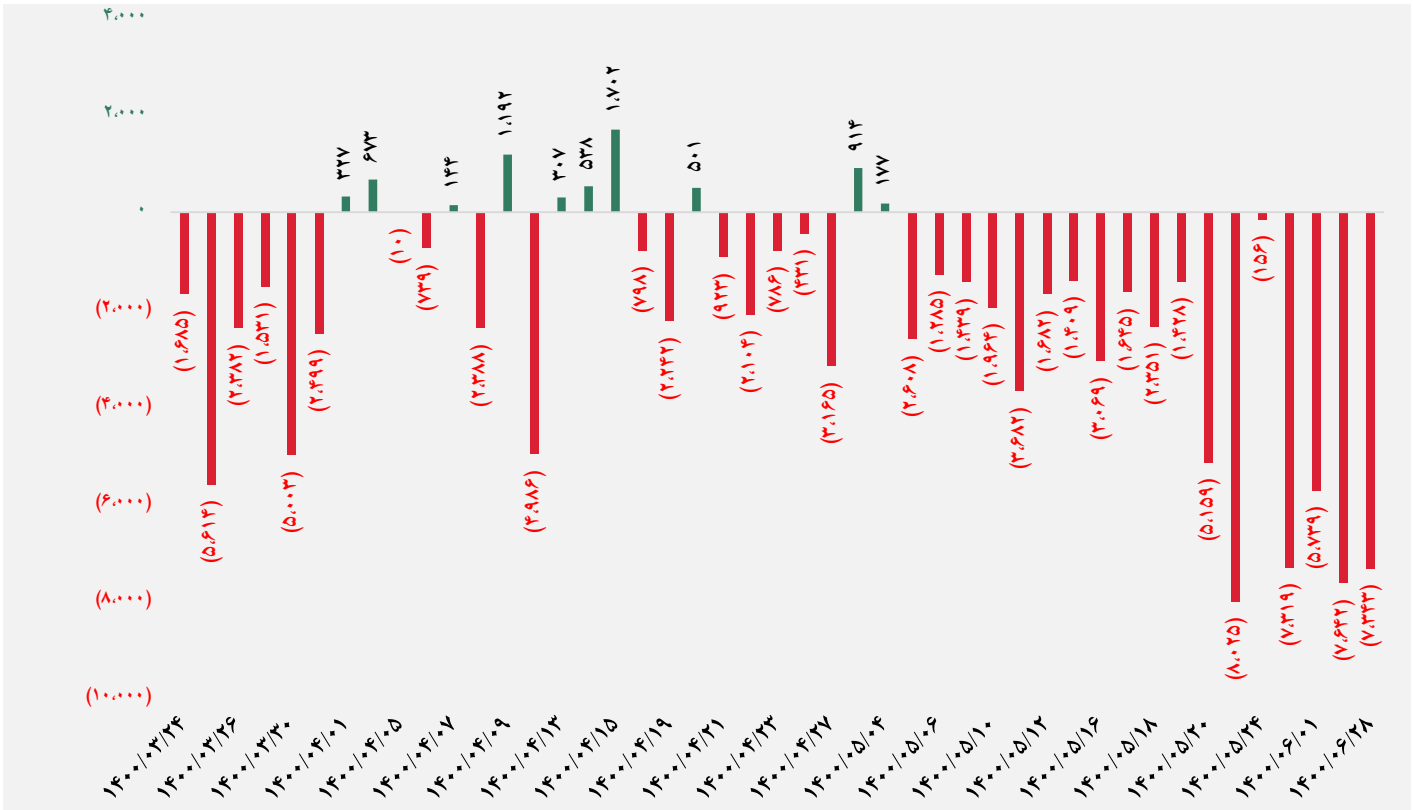


تصویر کلی بازار

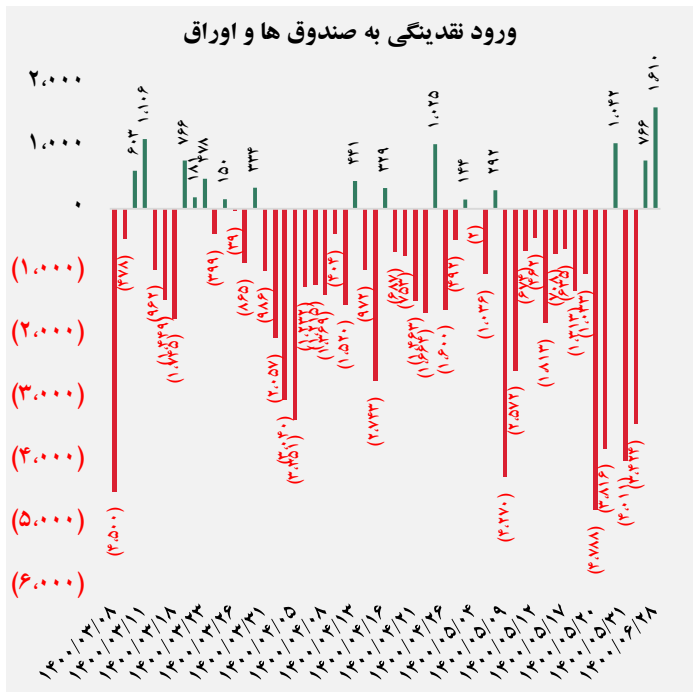
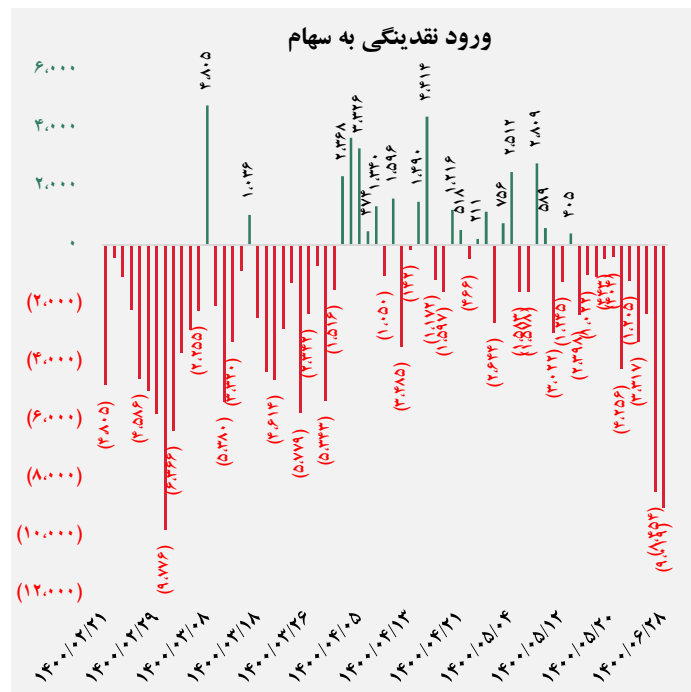
فرا بورس		بورس	
۲۱,۱۴۶	شاخص کل	۱,۴۲۰,۴۸۳	شاخص کل
(۳۲۱)	تغییر شاخص	(۲۹,۷۴۱)	تغییر شاخص
۱۵,۶۳۹,۹۸۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۷,۰۸۰,۳۳۹	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۴۲,۹۵۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۴,۱۷۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
فجهان		فسیزوار	
اتکای		دسبحا	
صبا		البرز	
توریل		کیمیاتک	
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
آریا		فارس	
بپاس		فولاد	
هرمز		فملی	
زاگرس		کچاد	



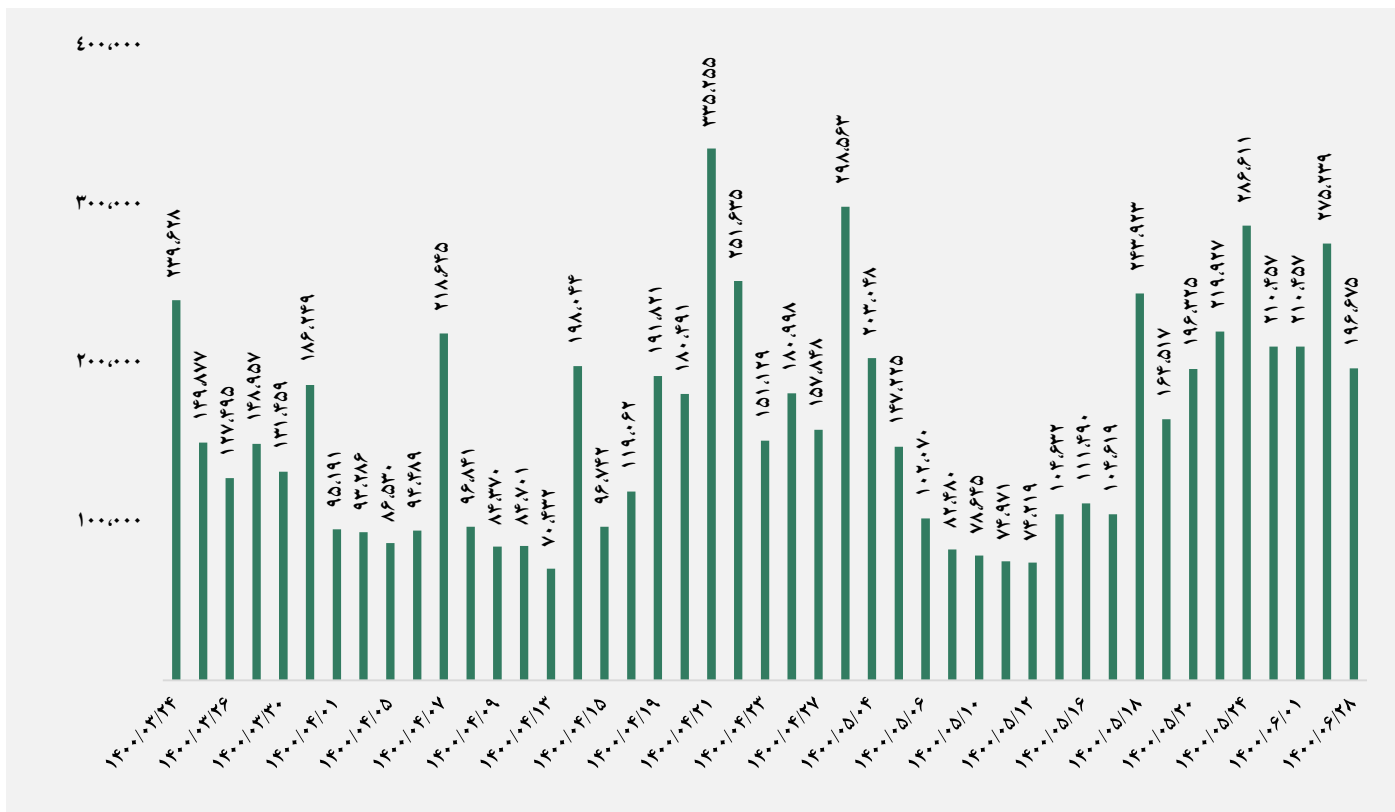
کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



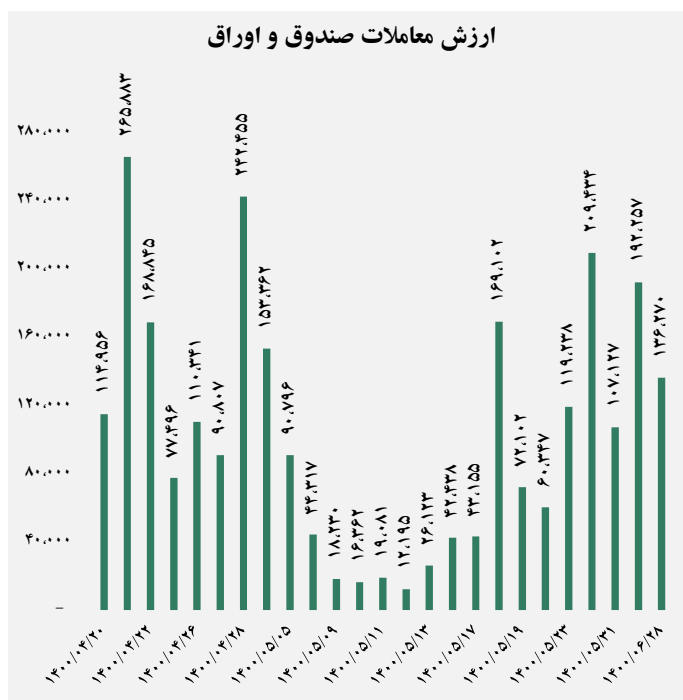
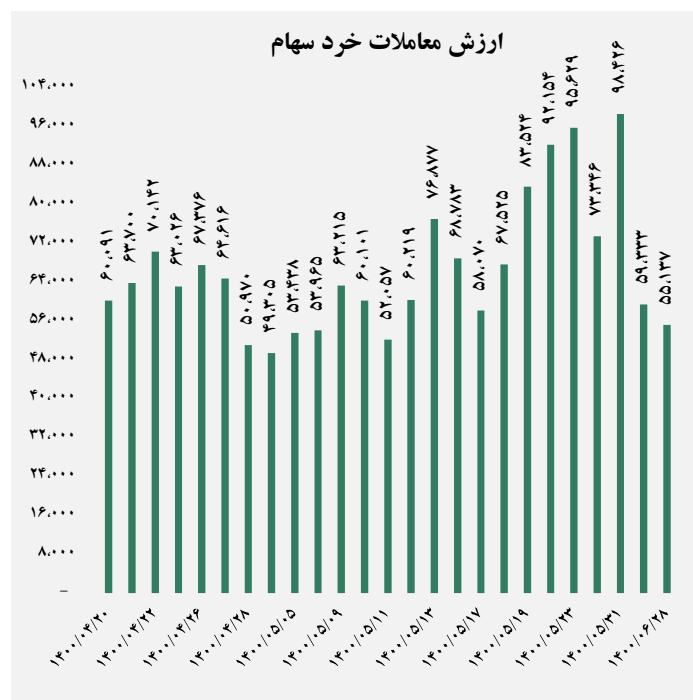
ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)



ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

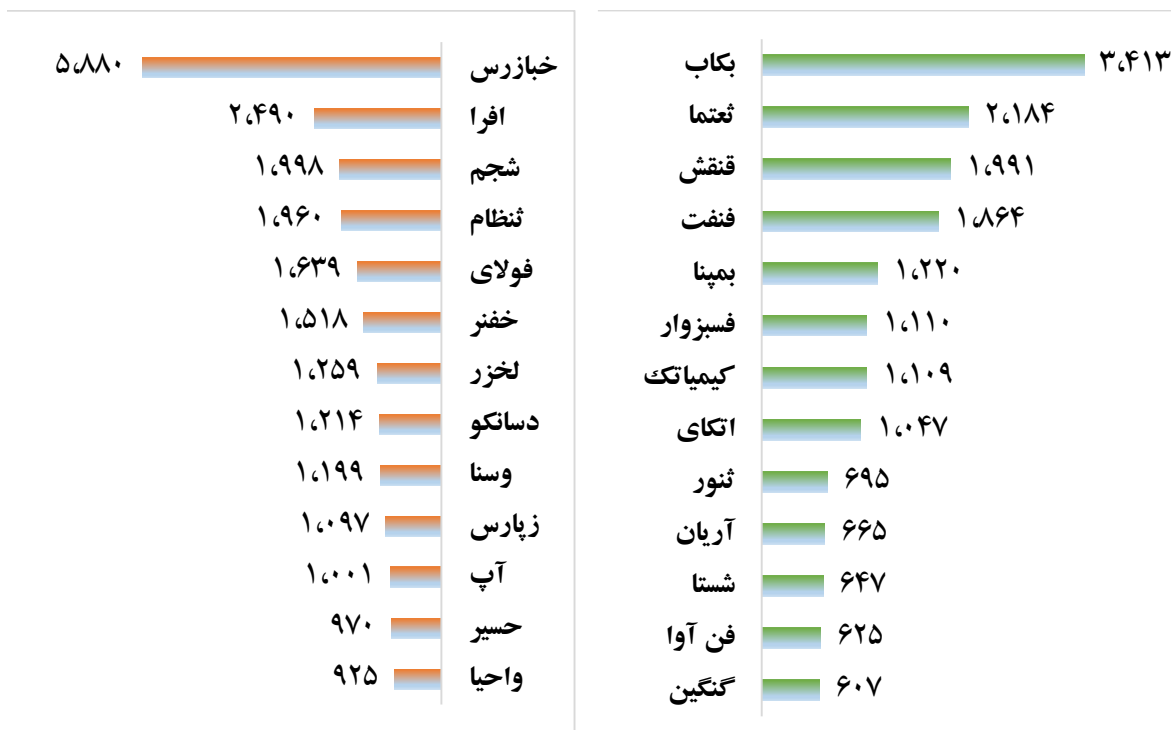


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





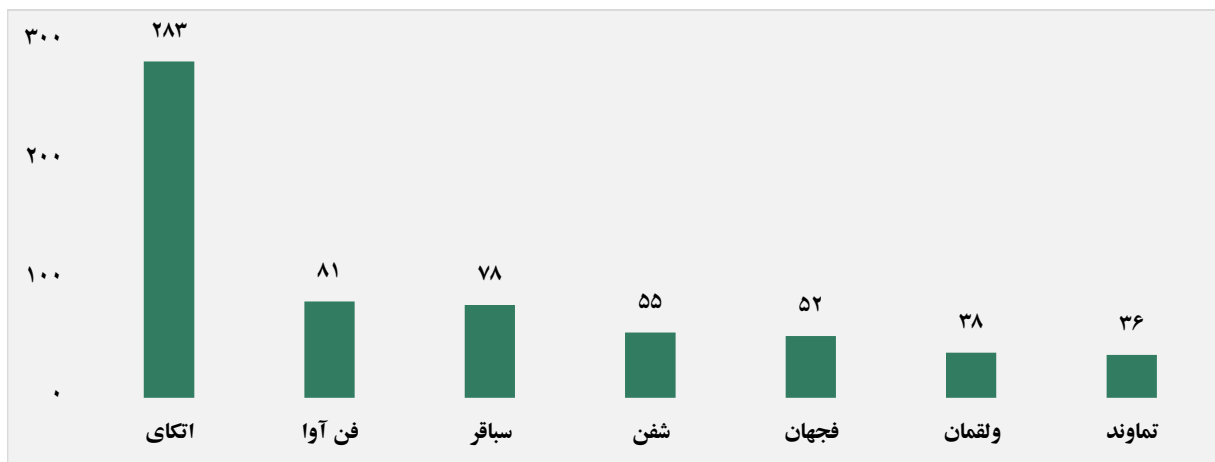
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



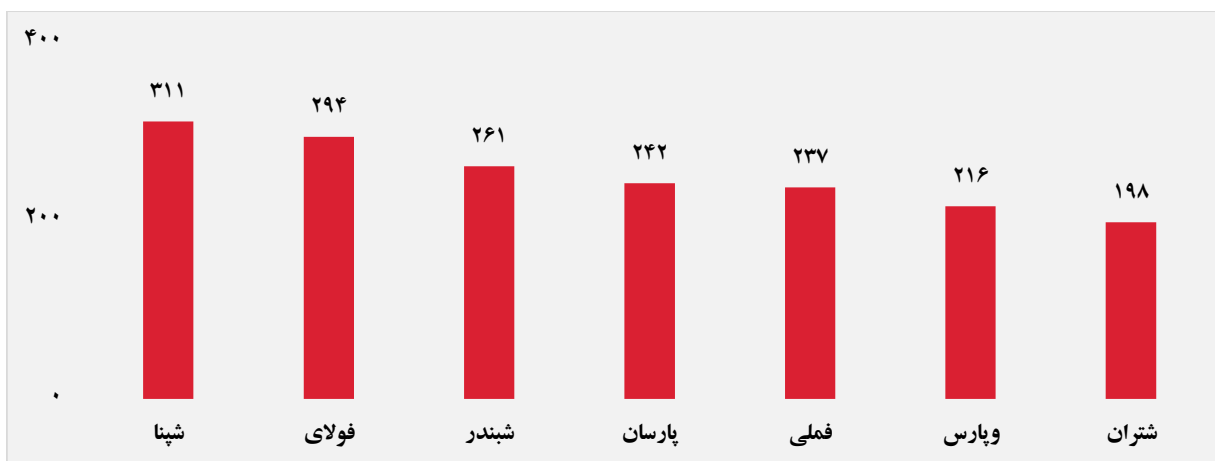
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	زنگان	۱	وٹخوز
۲	اتکای	۲	فمراد
۳	کی بی سی	۳	غبهنوش
۴	ولقمان	۴	فافزا
۵	بمپنا	۵	دشیمی
۶	فجوش	۶	ثپردیس
۷		۷	مداران
۸		۸	ثنظام
۹		۹	ویسا
۱۰		۱۰	وساغربی

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



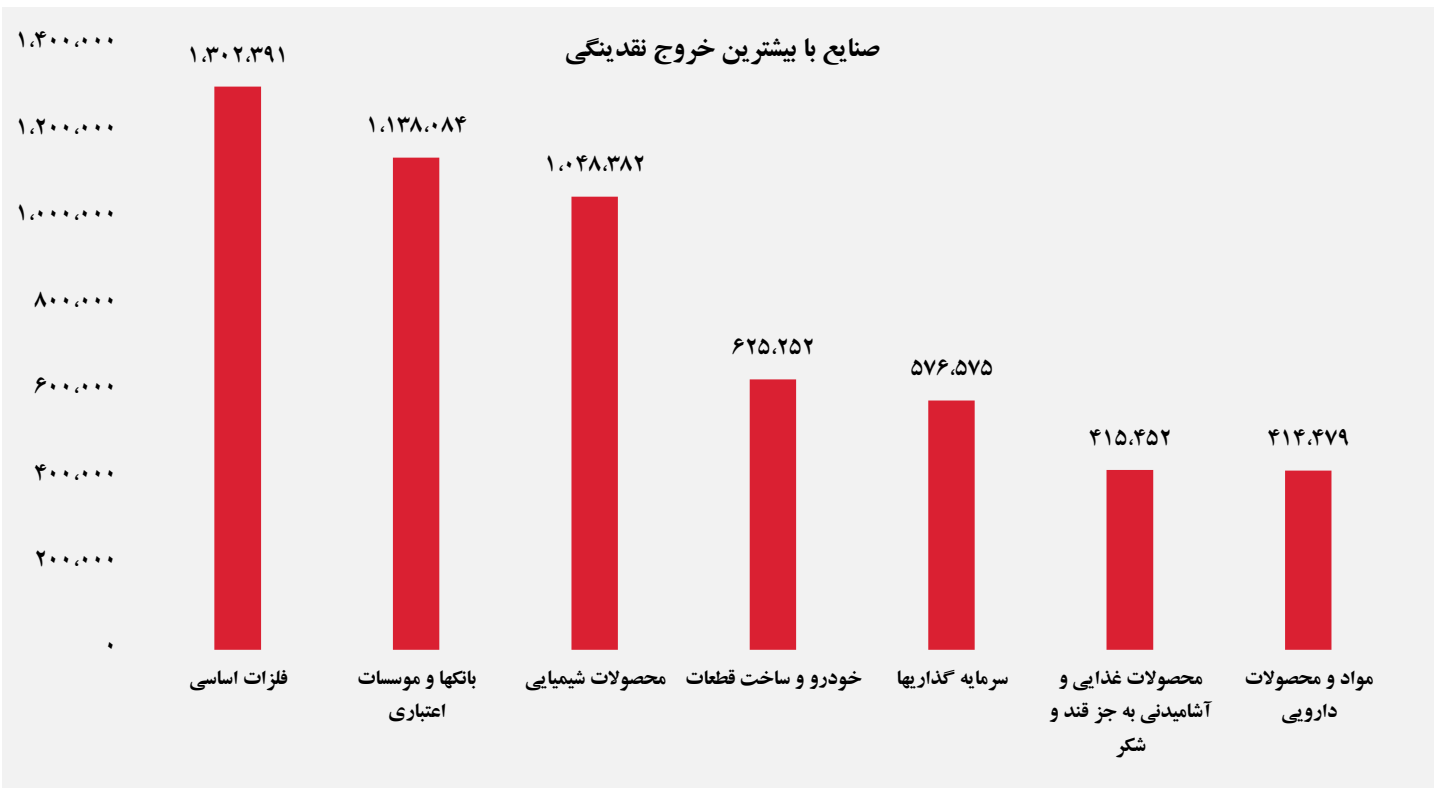
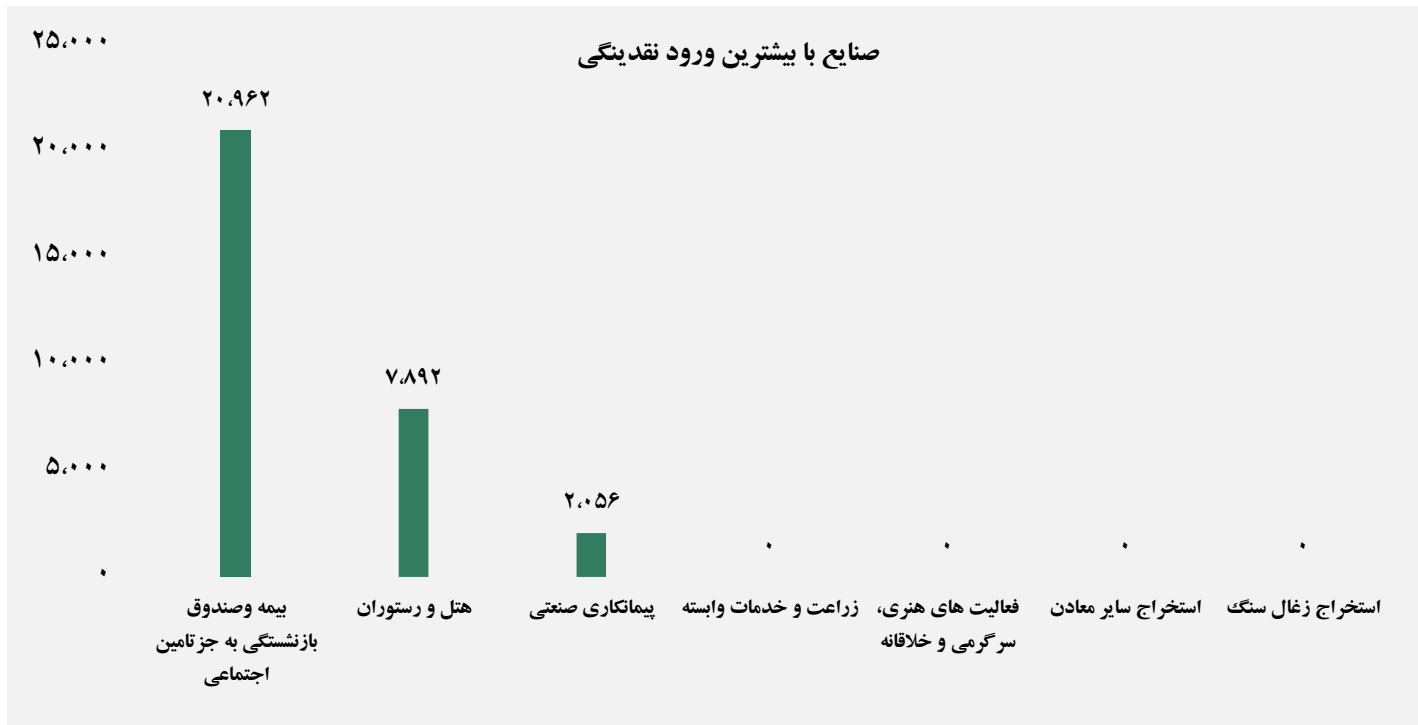
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	مدیریت	۱۰	خوساز
۲	سپید	۱۱	دتوزیع
۳	برکت	۱۲	تاپکیش
۴	کماسه	۱۳	ثپردیس
۵	سیمرغ	۱۴	توریل
۶	اتکای	۱۵	کسرا
۷	شغدیر	۱۶	وساخت
۸	کفپارس	۱۷	نفراس

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار