



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۶/۳۰

www.sfg.ir - info@sfg.i

تحلیل روزانه بازار

امروز سه شنبه ۳۰ شهریور ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، شستا، کگل، کچاد، فملی و پارسان با کاهش ۳۶,۵۳۵ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۳۹۱,۲۳۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۲۷ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۷۴ 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 ۳۳ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

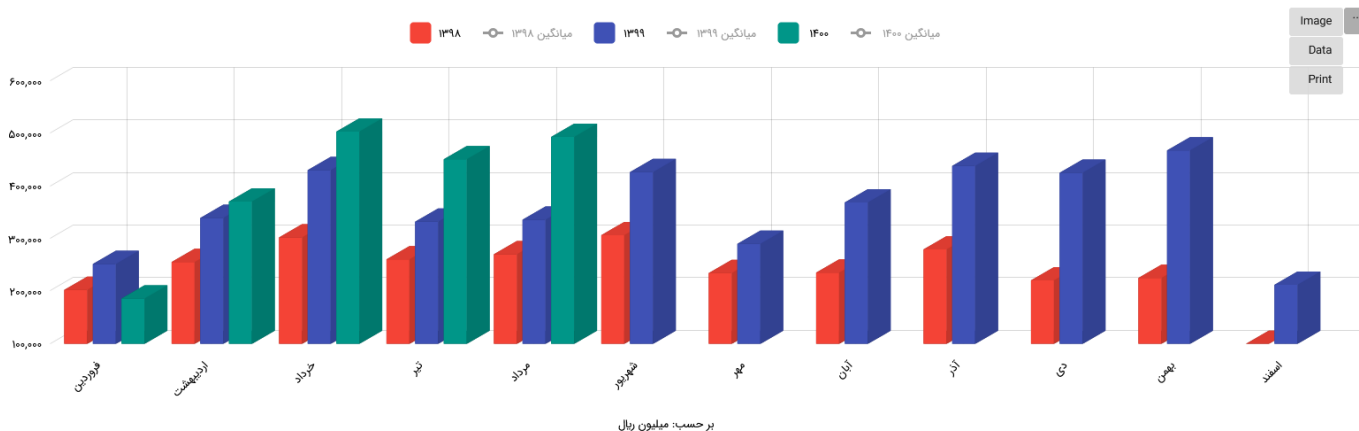
شاخص کل در چند ماه گذشته با تعداد معدودی از شرکت های بزرگ رشد کرد و اما در حال حاضر اکثر نمادها با منفی کامل باعث ریزش شاخص کل شده اند. از نظر تکنیکال، شاخص کل به محدوده ۳۸,۲ درصد فیبوناچی ریتریسمنت خود رسیده و علاوه بر این نیز به محدوده حمایتی از نظر اندیکاتور ایچیمیکو رسیده است. به نظر می رسد بازار در روزهای آینده بهتر معامله شود و شاهد صف های فروش سنگین در روزهای آینده در بازار سرمایه نخواهیم بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱۰,۲۴۷ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۳۴، 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 ۷۲۱، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۷/۲۸ با ۲۴,۲٪ سود است.

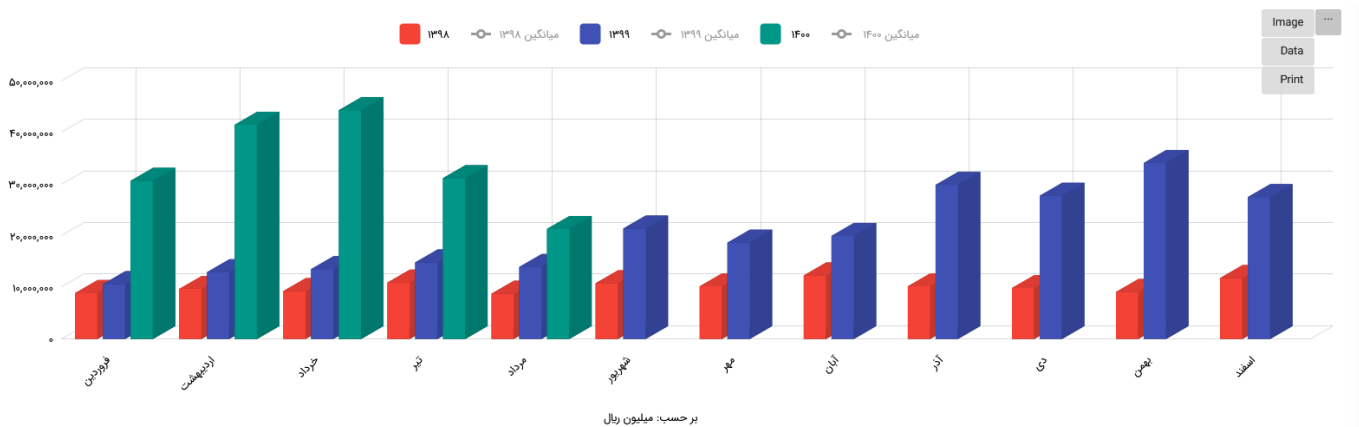
شرح	۱۴۰۰/۰۶/۲۹	۱۴۰۰/۰۶/۳۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳۵,۳۴۶	۱۱۰,۲۴۷	۲۱۰٪



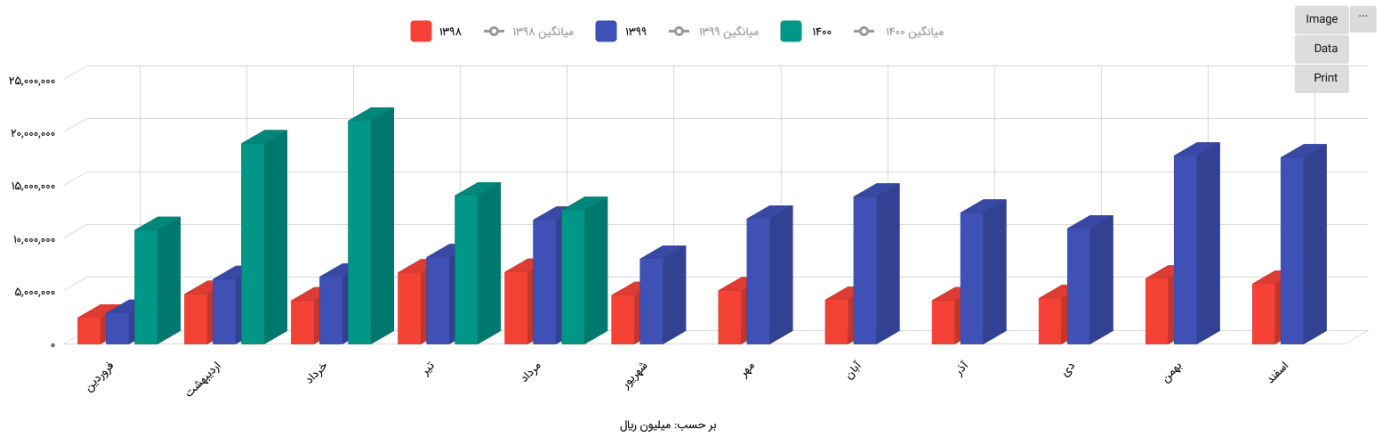
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت پارس دارو (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت معدنی گل گهر (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

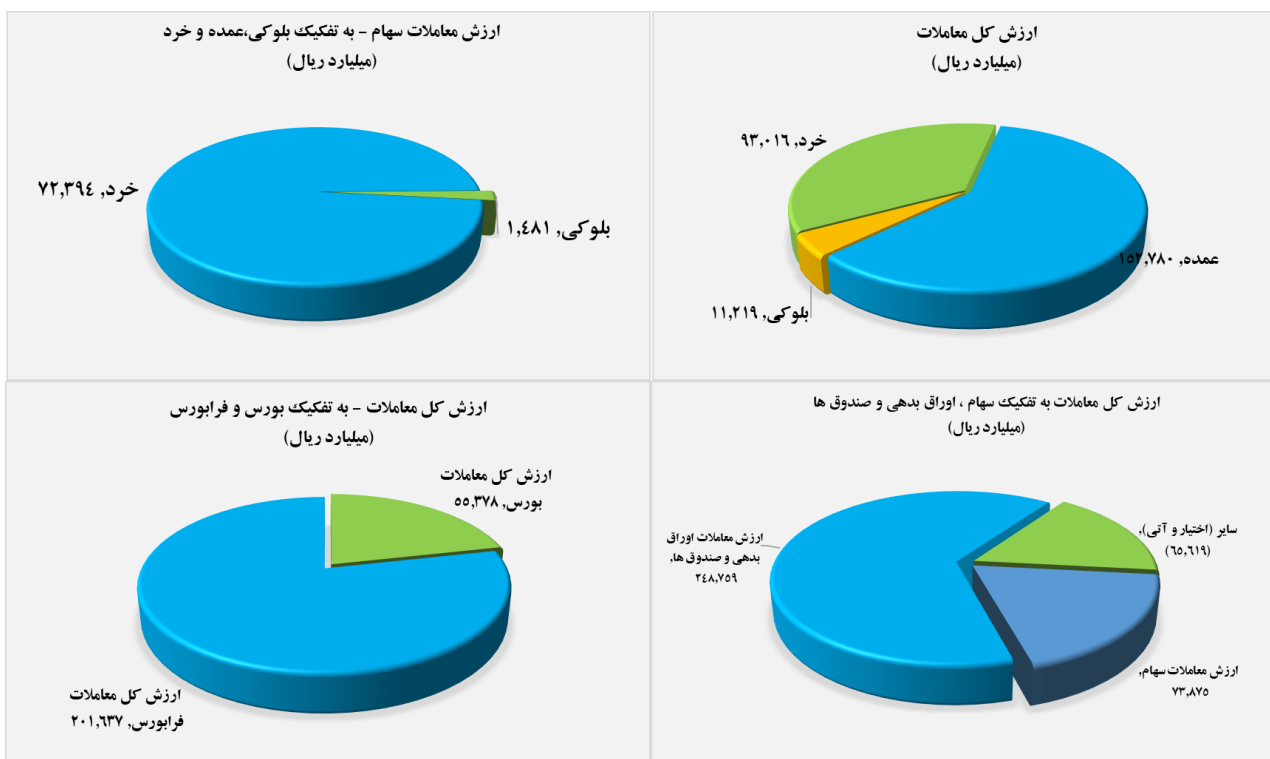


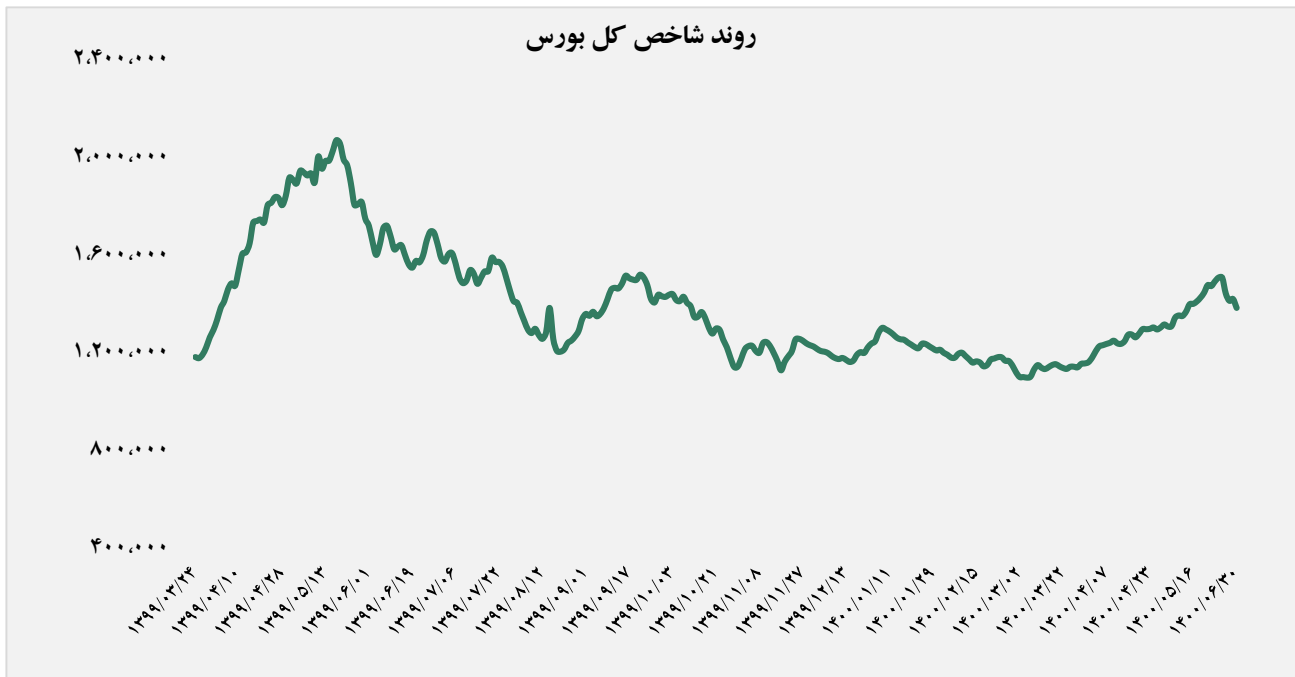
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت سنگ آهن گهر زمین (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



تصویر کلی بازار

فرا بورس		بورس	
۲۰,۷۲۱	شاخص کل	۱,۳۹۱,۲۱۹	شاخص کل
(۴۴۴)	تغییر شاخص	(۳۶,۵۵۳)	تغییر شاخص
۱۵,۳۴۰,۹۰۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۵,۹۰۵,۴۱۷	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۰۱,۶۳۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۵,۳۷۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تأثیر مثبت در شاخص		بیشترین تأثیر مثبت در شاخص	
فرا بورس		فسوزار	
و سپهر		کیمیاتک	
فجهان		امین	
بمپنا		میدکو	
بیشترین تأثیر منفی در شاخص		بیشترین تأثیر منفی در شاخص	
آریا		فولاد	
زاگرس		شستا	
کگهر		کگل	
هرمز		کچاد	

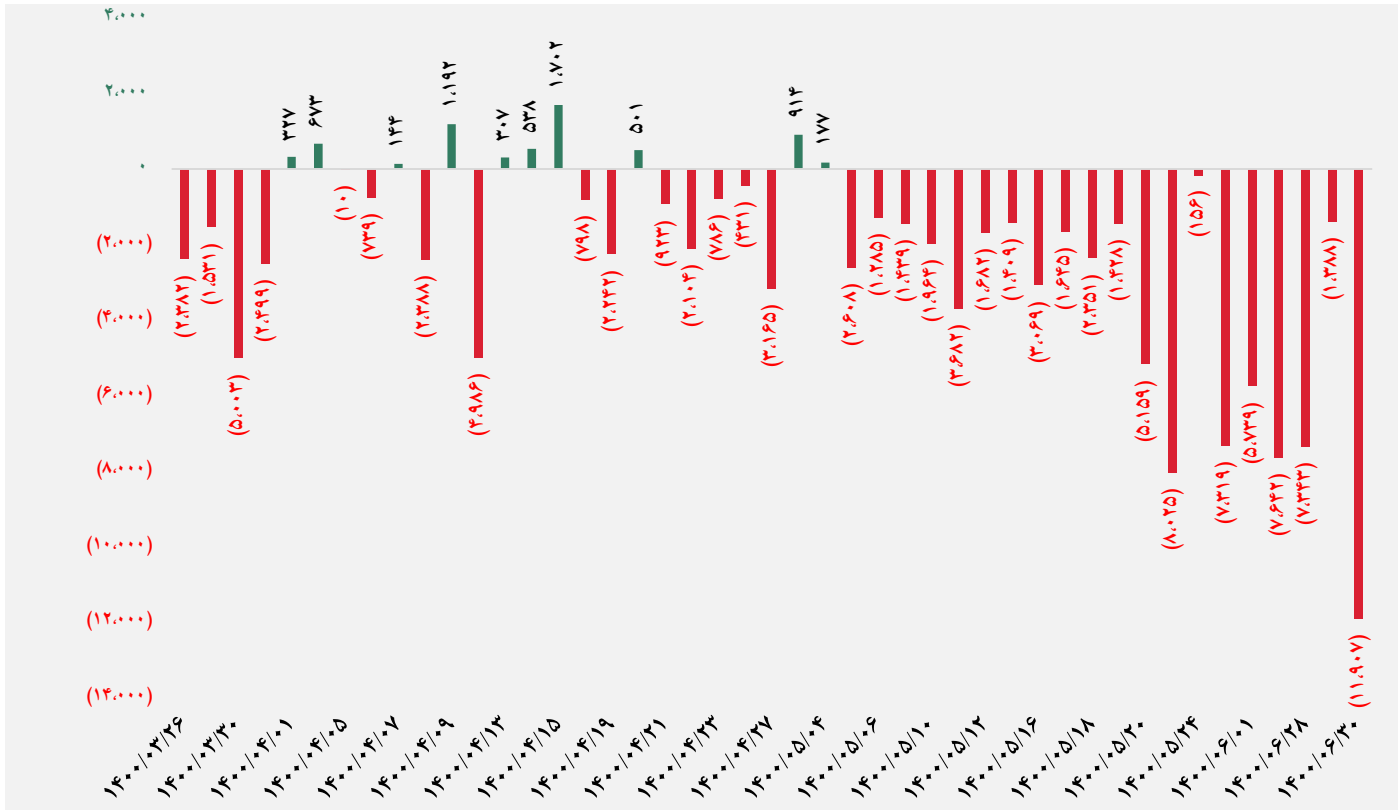




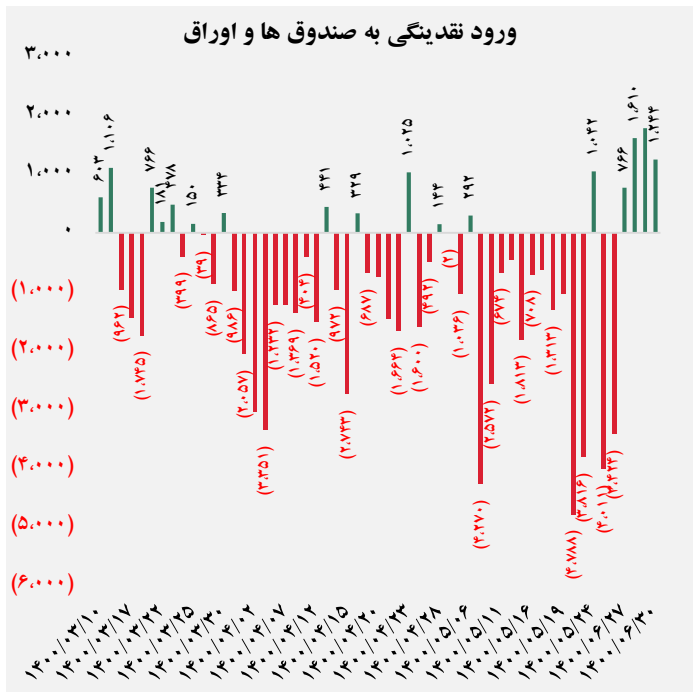
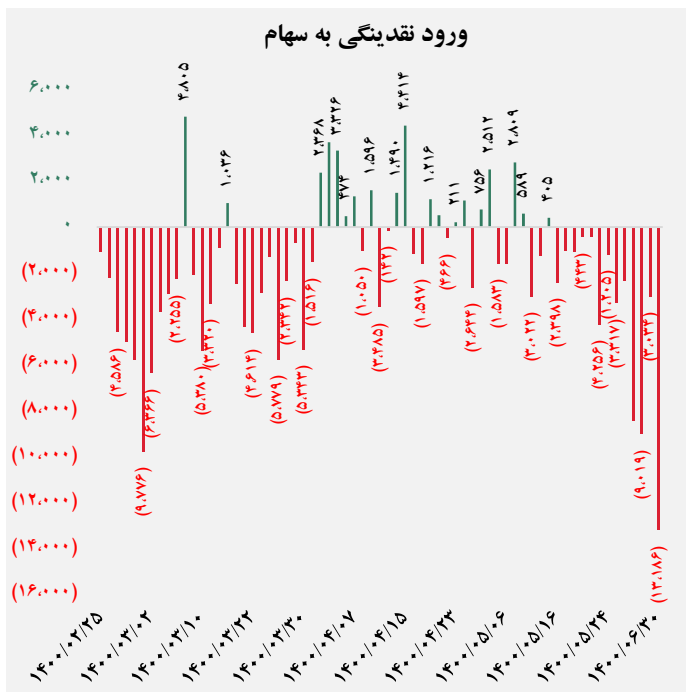
فقران اساسي	محصولات سيميپاي	فراورده هاي بني، كت و سوجت هسه اي	فناينهاي كميكي به نهادهاي م	ساخت دستگاها و وسايل ار	بزرگنكهاي جند رسته اي	استخراج كانه هاي فلز
فجهان 1.32%	تامين -0.55%	تامين 3.24%	فرايندگري -2.64%	تامين 0.14%	شستا -3.93%	تامين -4.94%
فولاد -3.05%	تامين -3.81%	تامين -2.5%	فرايندگري 5%	تامين 0.14%	تامين -4.23%	تامين -4.94%
فهلبي -2.35%	تامين -3.81%	تامين -3.76%	فرايندگري 5%	تامين 0.14%	تامين -4.23%	تامين -4.94%
فولاد -3.05%	تامين -3.81%	تامين -3.76%	فرايندگري 5%	تامين 0.14%	تامين -4.23%	تامين -4.94%
فولاد -3.05%	تامين -3.81%	تامين -3.76%	فرايندگري 5%	تامين 0.14%	تامين -4.23%	تامين -4.94%

گزارش روزانه تحليل بازار گروه مالي شهر

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

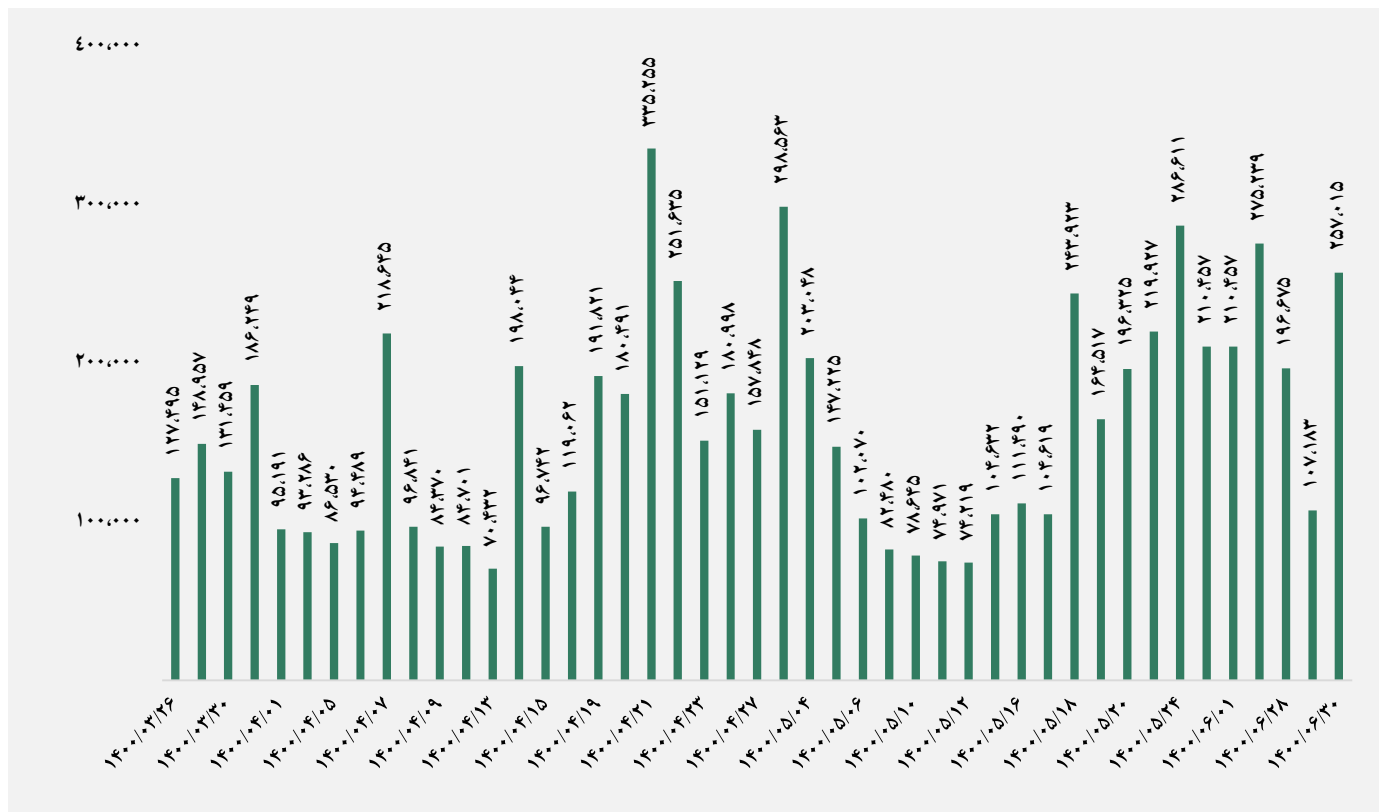


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

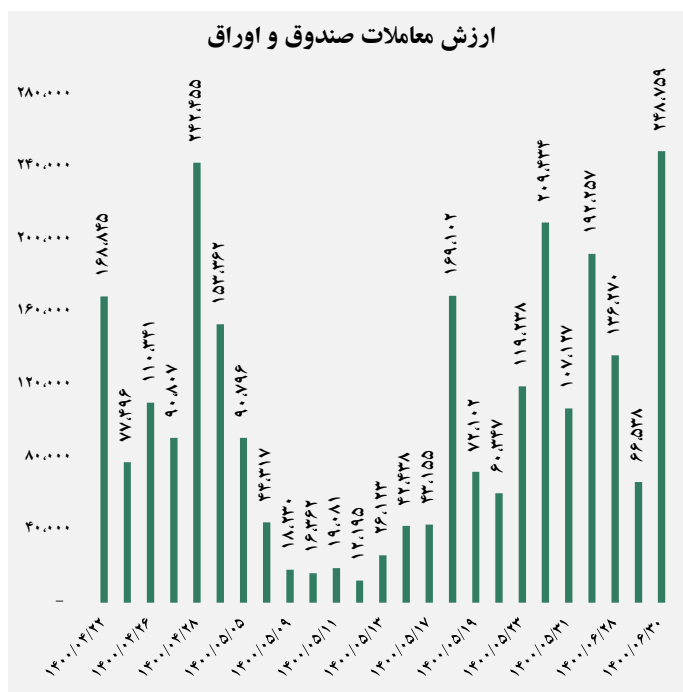
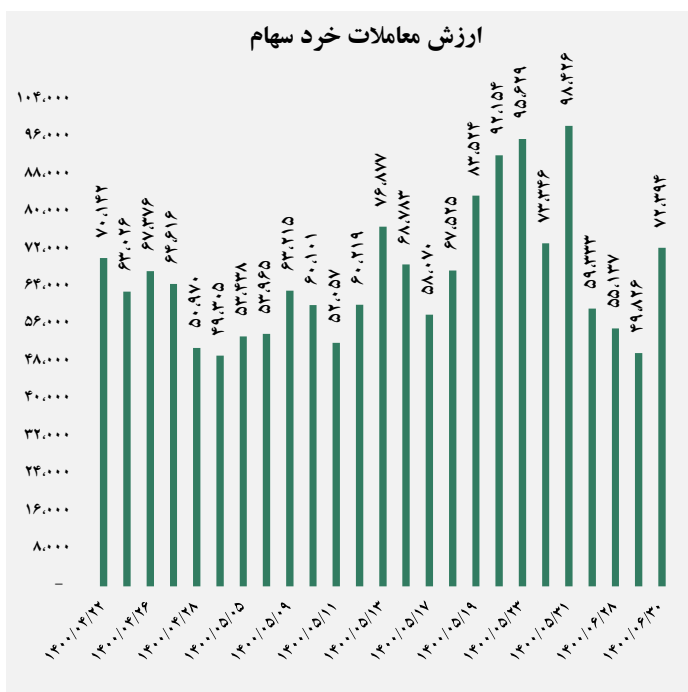


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

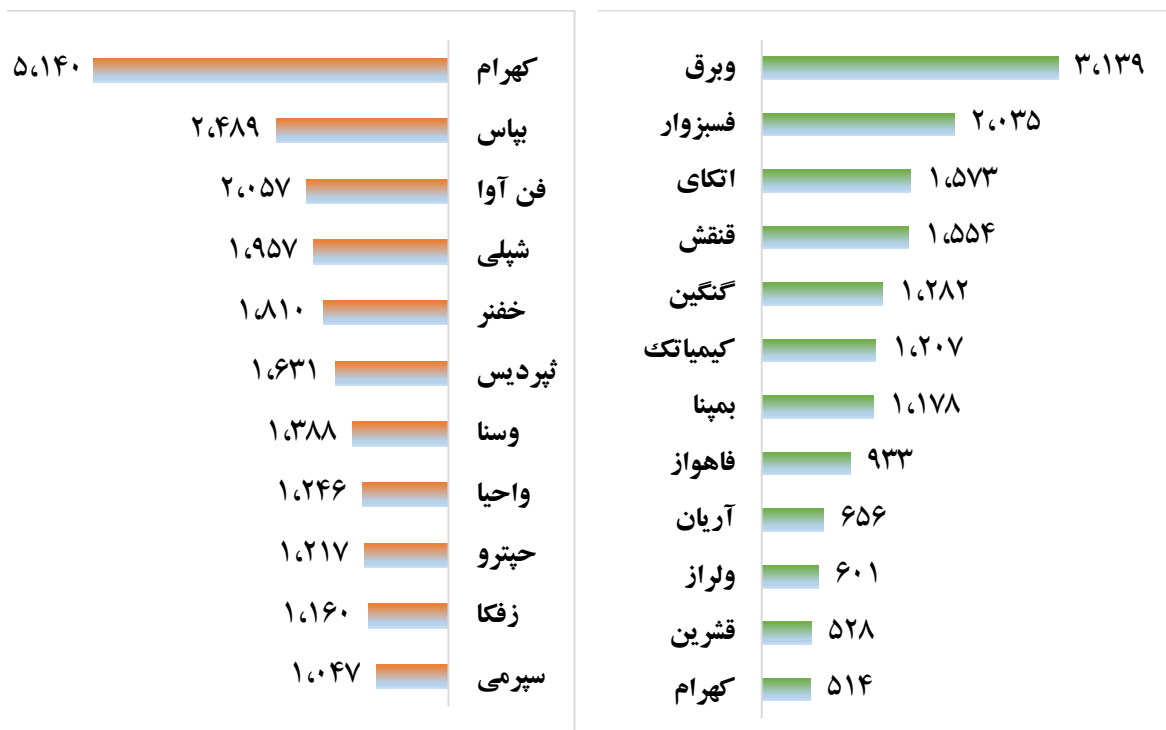
ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



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



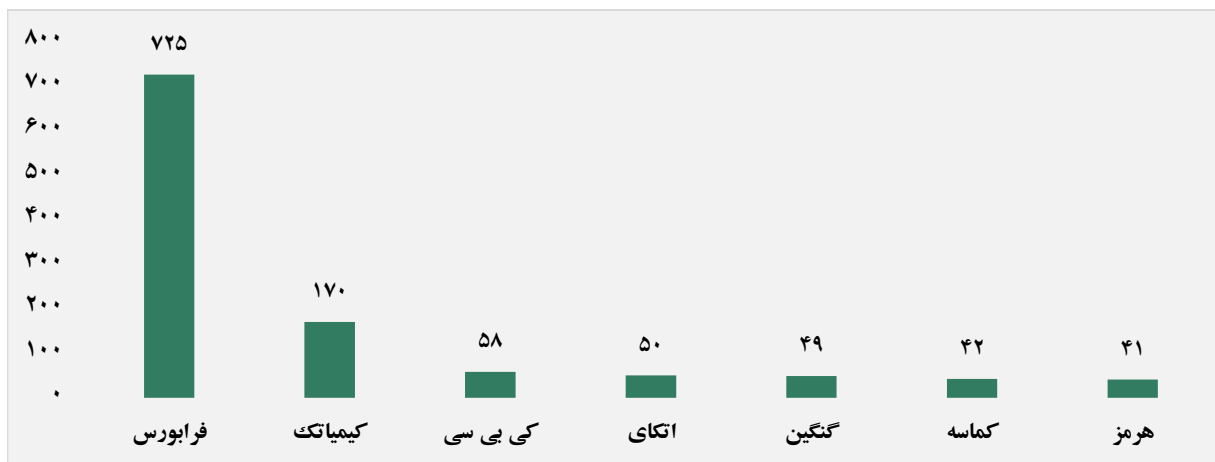
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



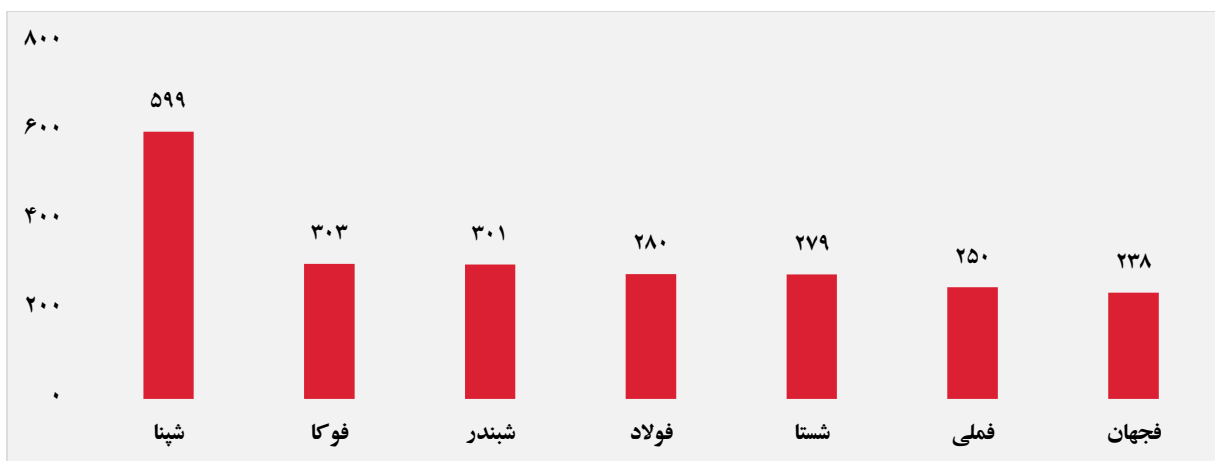
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	قنقش	۱	بکاب
۲	فجهان	۲	شسینا
۳	وسپهر	۳	کمرجان
۴	بمپنا	۴	خلنت
۵	-	۵	خپویش
۶	-	۶	ثنوسا
۷	-	۷	غگزر
۸	-	۸	دسانکو
۹	-	۹	واحیا
۱۰	-	۱۰	ساروم

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



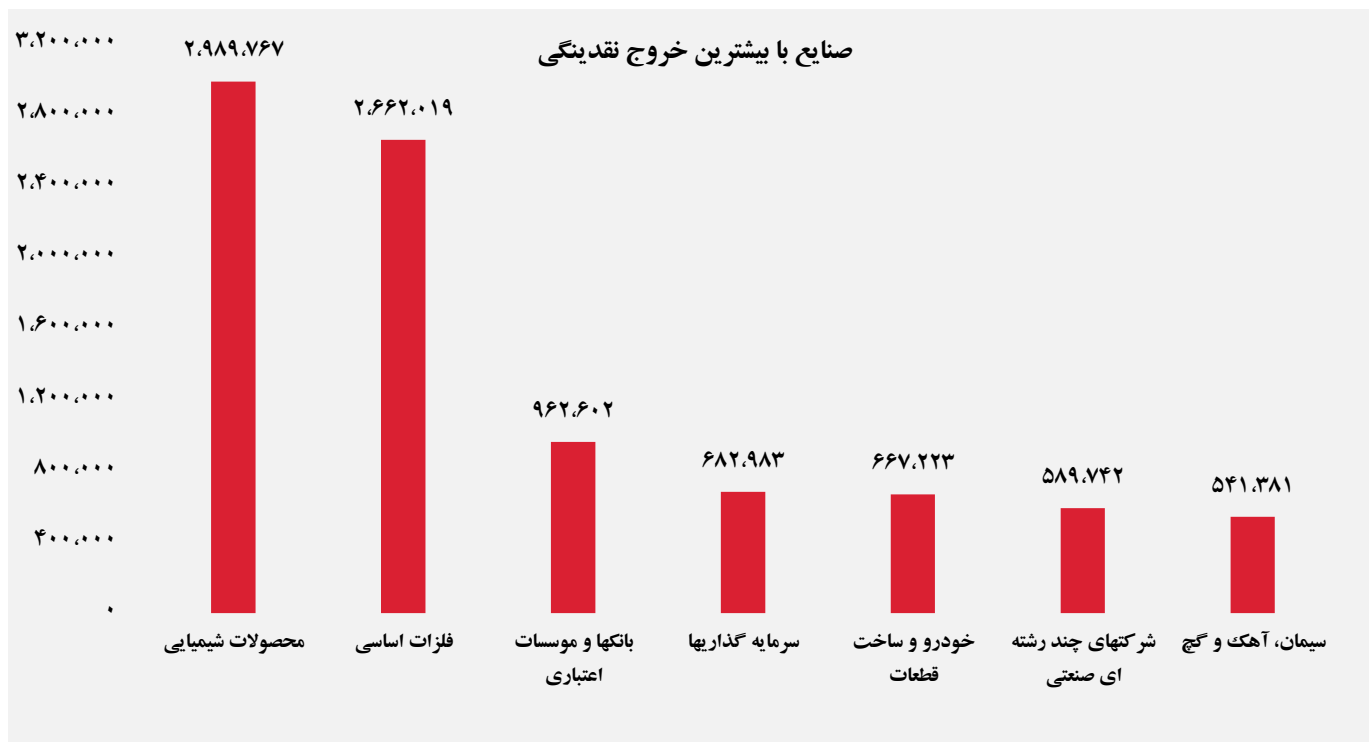
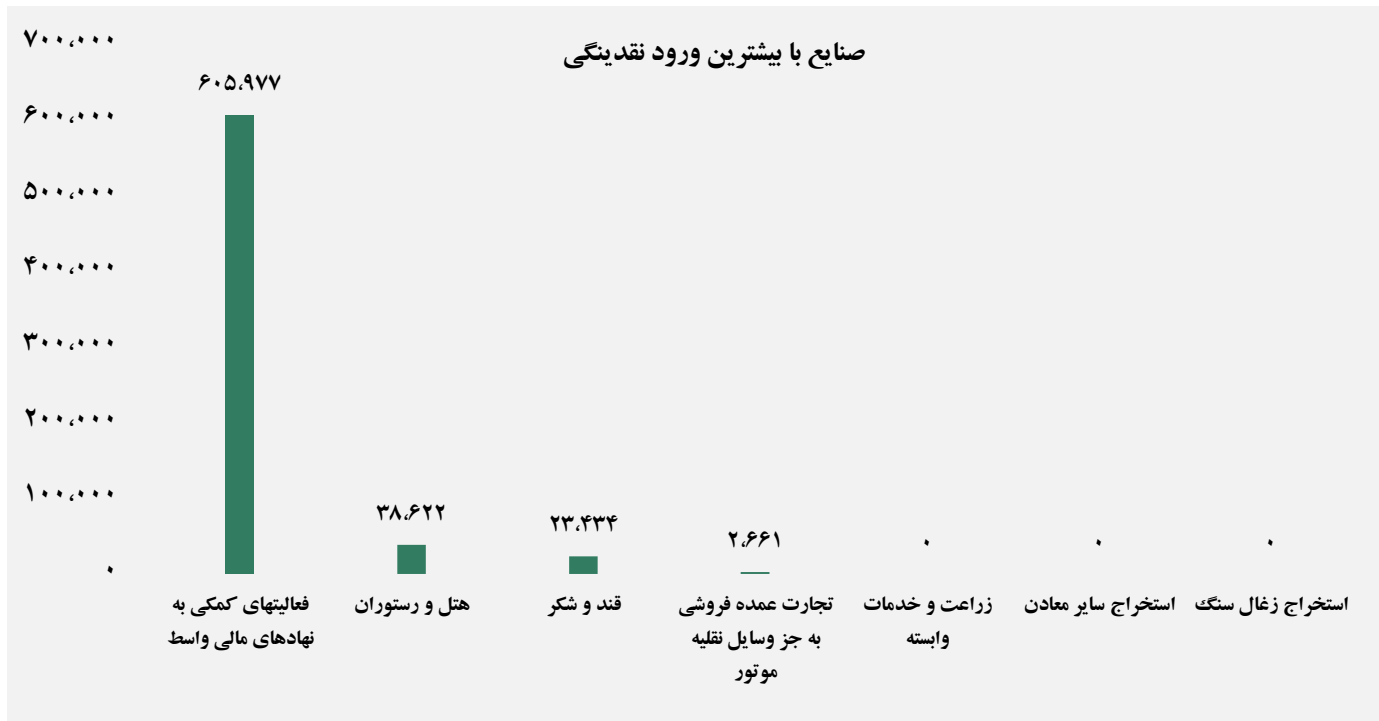
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	خنصیر	۱۰	فجهان
۲	دسانکو	۱۱	خریخت
۳	فراپورس	۱۲	کیمیاتک
۴	سپید	۱۳	ثنور
۵	کماسه	۱۴	دلر
۶	خموتور	۱۵	وهامون
۷	شغدیر	۱۶	فاما
۸	برکت	۱۷	سیلام

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار