



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۷/۰۶

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

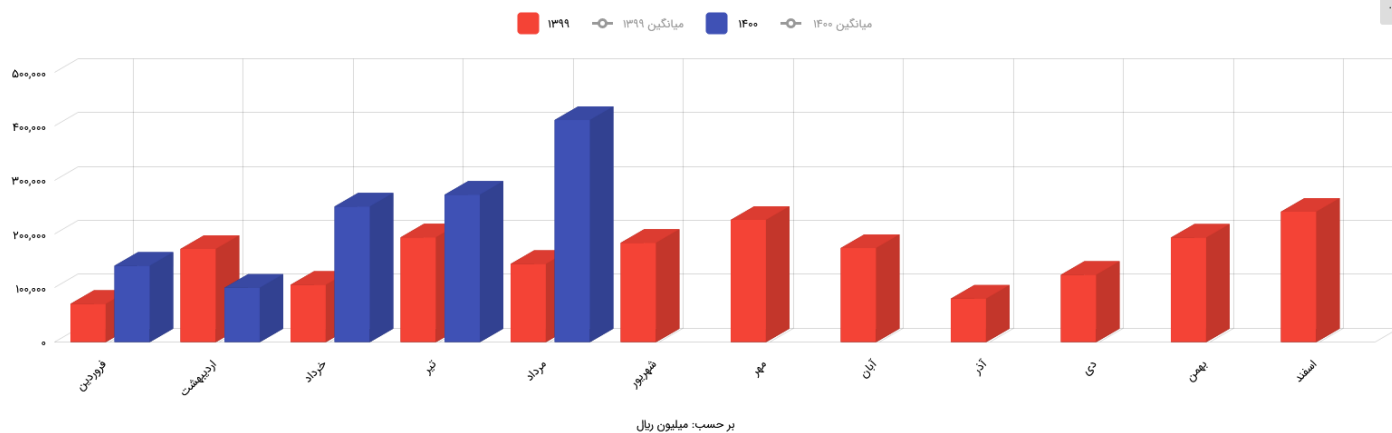
امروز سه‌شنبه ۶ مهر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای پارسان، شبندر، وغدیر، شیراز، شتران و سپدیس با افزایش ۷۳۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۲۵,۴۶۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۵۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۳ 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 ۳۴ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

شاخص کل در رشد قبلی خود از کف یک میلیون و نود هزار واحد یک گارد صعودی پر قدرت را به سمت هدف یک میلیون و ششصد تجربه کرد، اما با توجه به احتمال افت دلار در آن مقطع زمانی، موفق به عبور از محدوده مقاومتی خود نشده و موقتا وارد فاز اصلاحی شد. در حال حاضر شاخص کل در کف کانال نزولی خود قرار گرفته و این در حالیست که حمایت‌های کیجونسن و تنکانسن را از دست داده است. اما با توجه به عدم کاهش دلار، به نظر می‌رسد در روزهای آینده شاهد معاملات بهتری در بعضی از نمادها خواهیم بود.

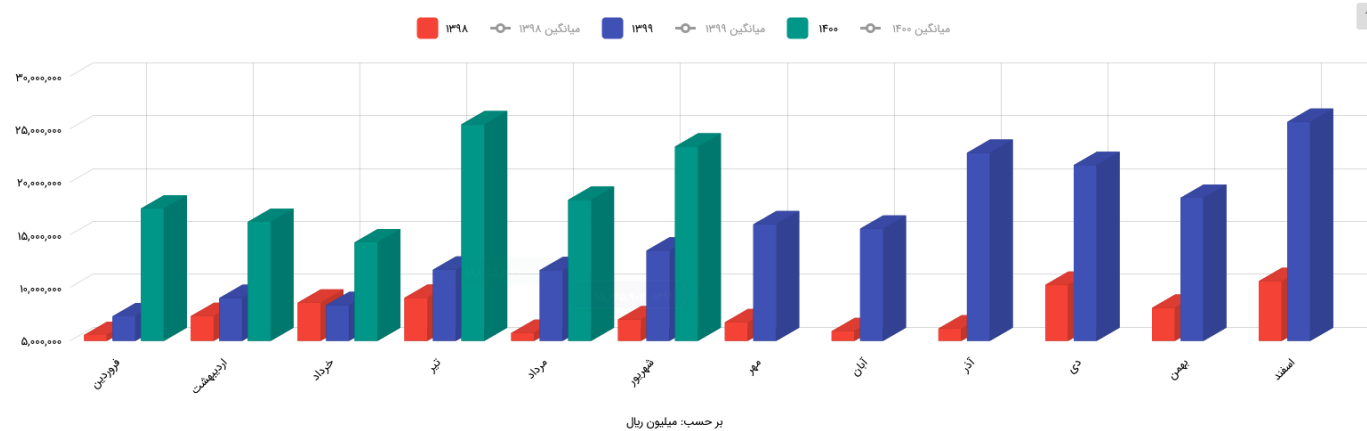
در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۹۰,۸۹۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۷۰۴، بیشترین ارزش معاملات را در بازار اوراق با درآمد ثابت به خود اختصاص داده است. در بین اوراق خزانه، بالاترین نرخ مؤثر بازده تا سررسید اخزاها نیز مربوط به نماد اخزا ۸۲۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۸/۰۶ با ۲۴,۱٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۷/۰۴	۱۴۰۰/۰۷/۰۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۷۷,۵۱۷	۹۰,۸۹۲	-۶۷٪

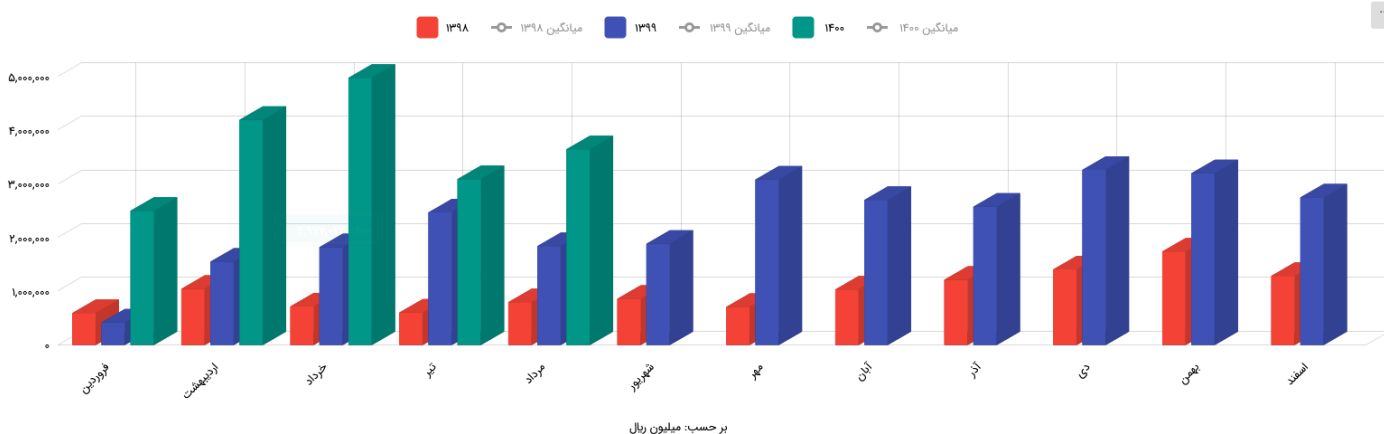
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت پتروشیمی شیراز (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سالهای ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت پتروشیمی آریا (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سالهای ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

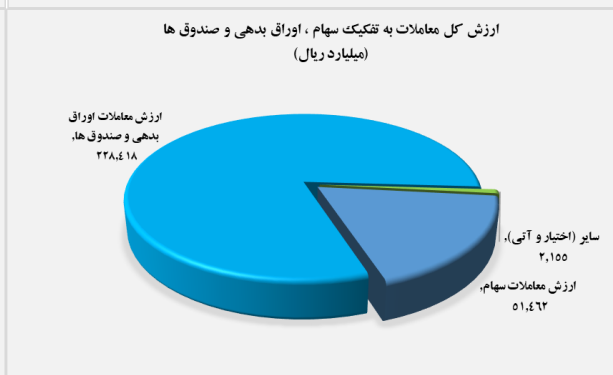
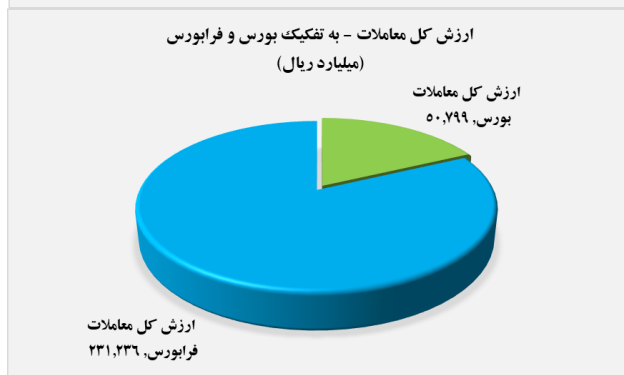
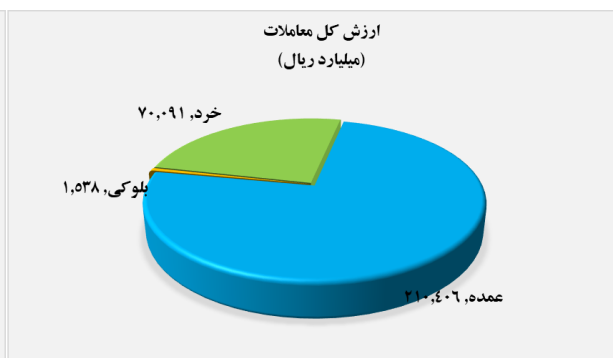


● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت فولاد امیر کبیر کاشان (در ۵ ماه اخیر و مدت مشابه در سالهای ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

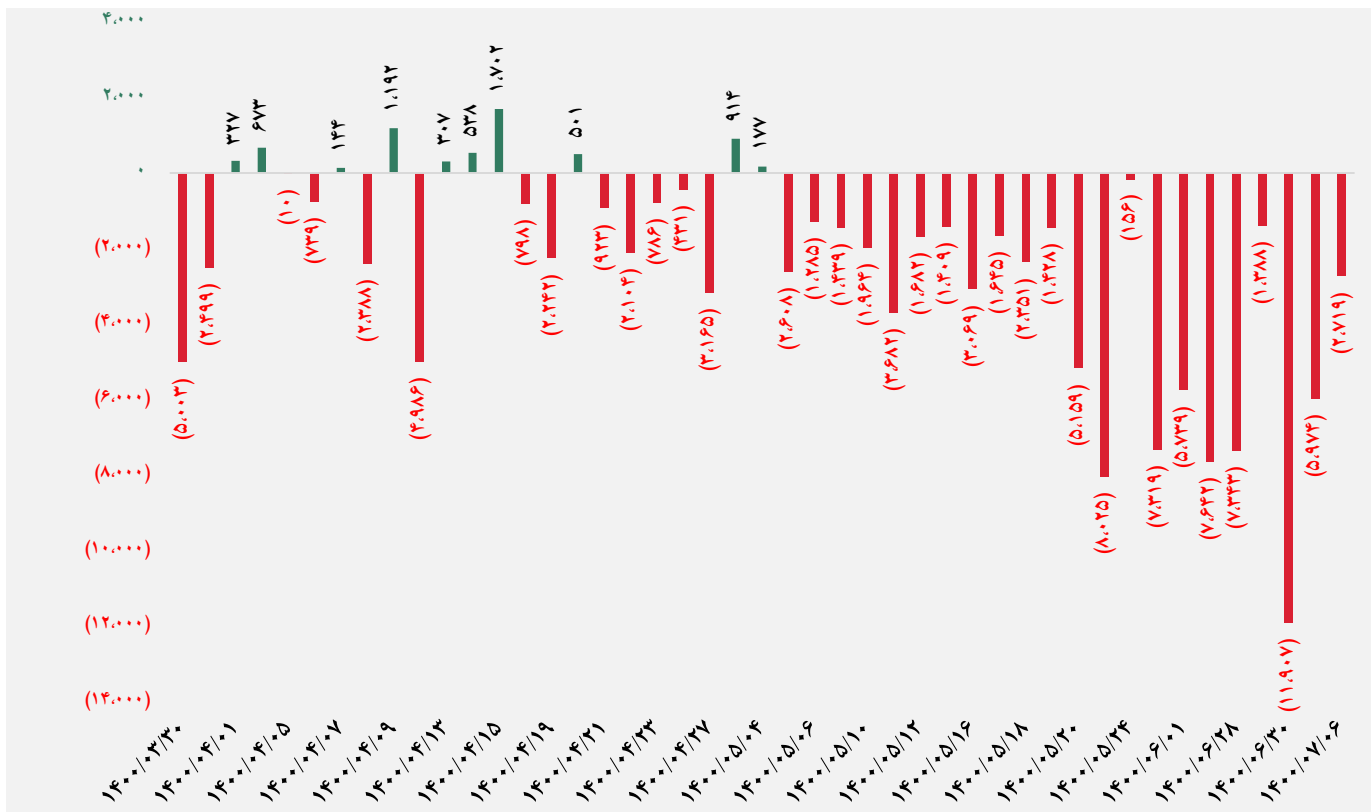


تصویر کلی بازار

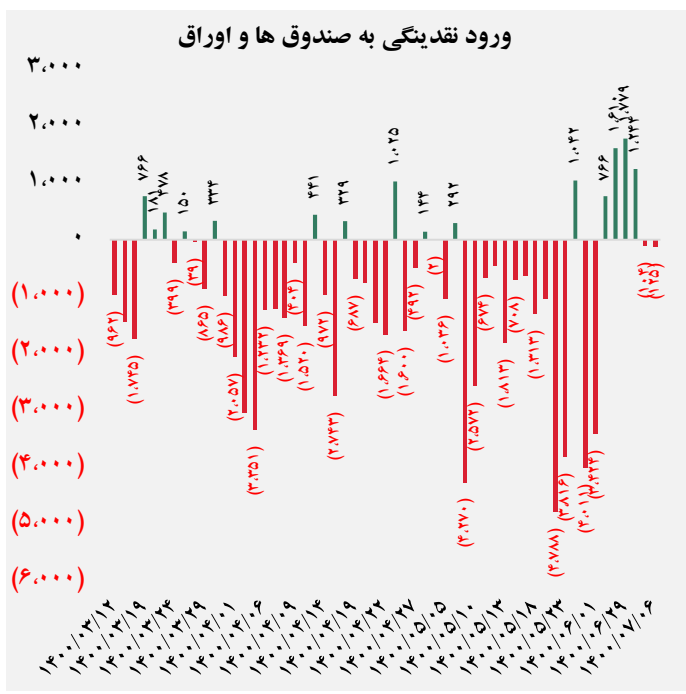
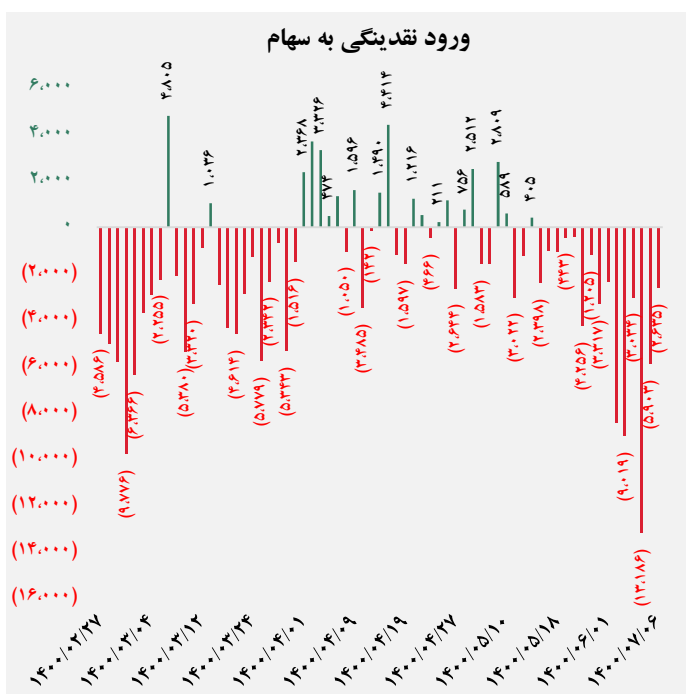
فرا بورس		بورس	
۲۰,۸۵۹	شاخص کل	۱,۴۲۵,۴۴۰	شاخص کل
۵۳	تغییر شاخص	۷۰۸	تغییر شاخص
۱۵,۳۵۰,۰۴۰	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۷,۲۷۹,۹۵۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۲۳۱,۲۳۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۰,۷۹۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
آریا		پارسان	
زاگرس		شبندر	
شگویا		وغدیر	
غصینو		شیراز	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
پپاس		فولاد	
صبا		رمپنا	
وسپهر		فخوز	
فرا بورس		فارس	



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

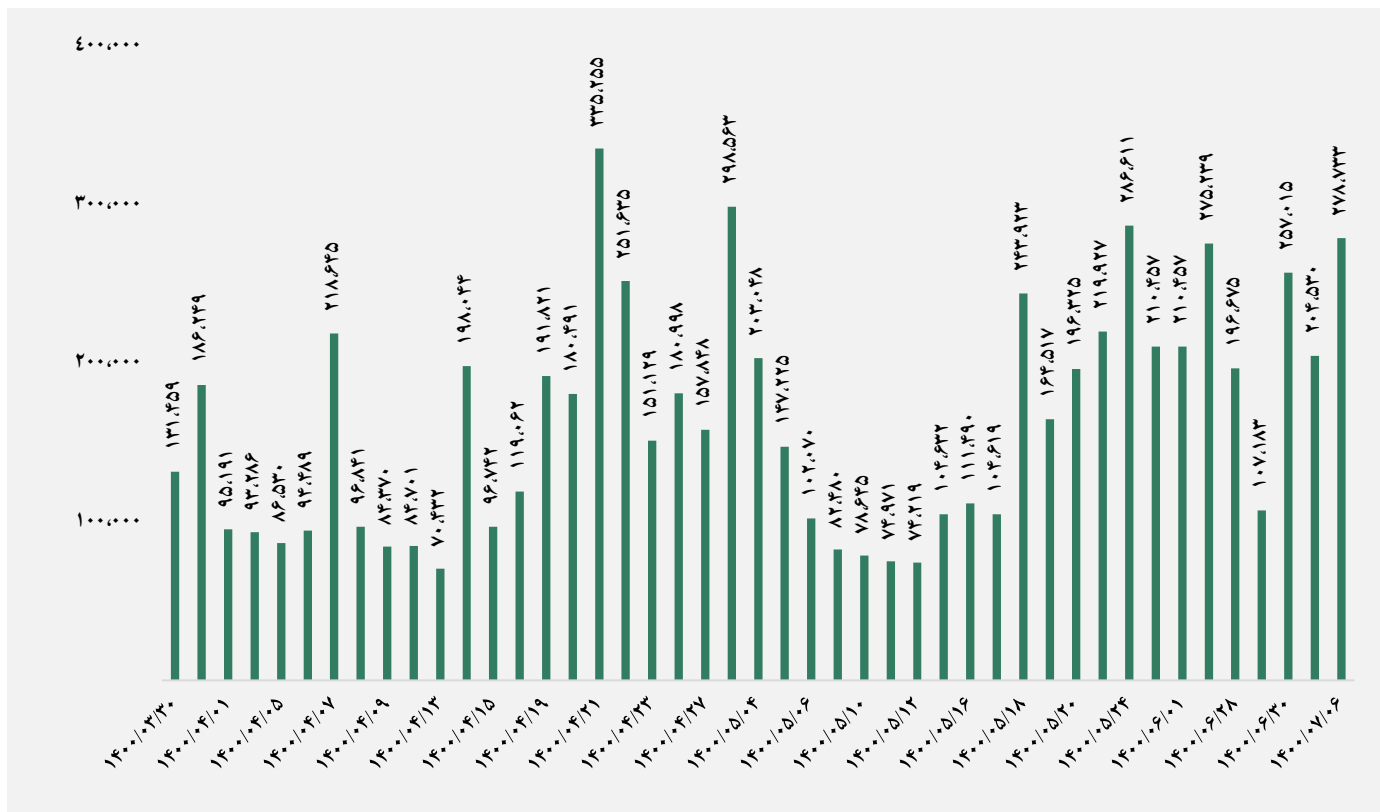


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

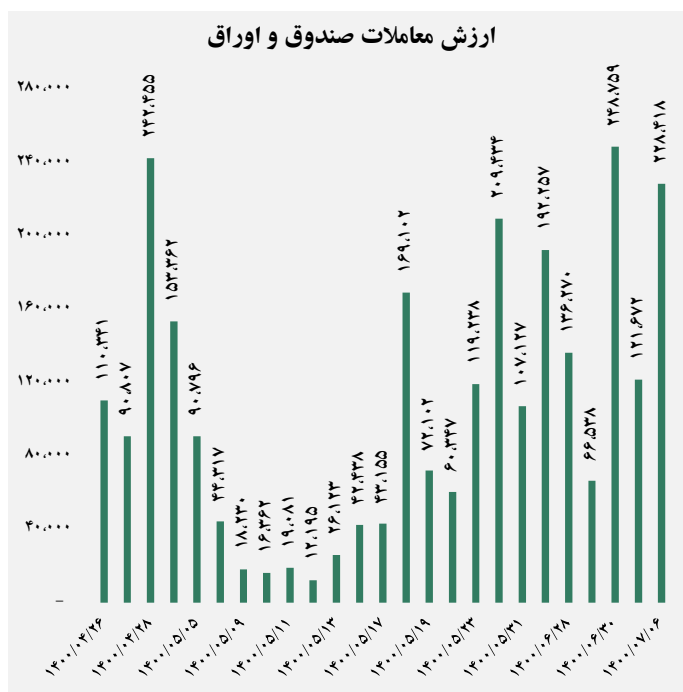
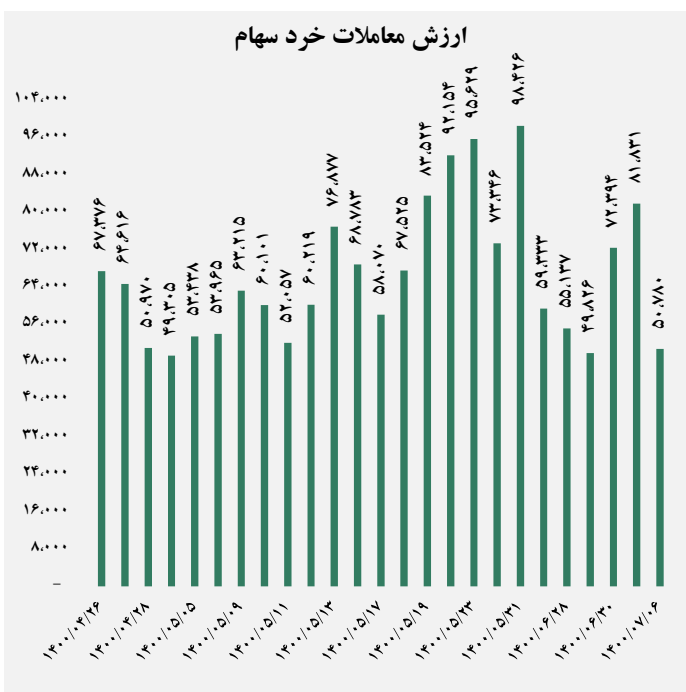


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

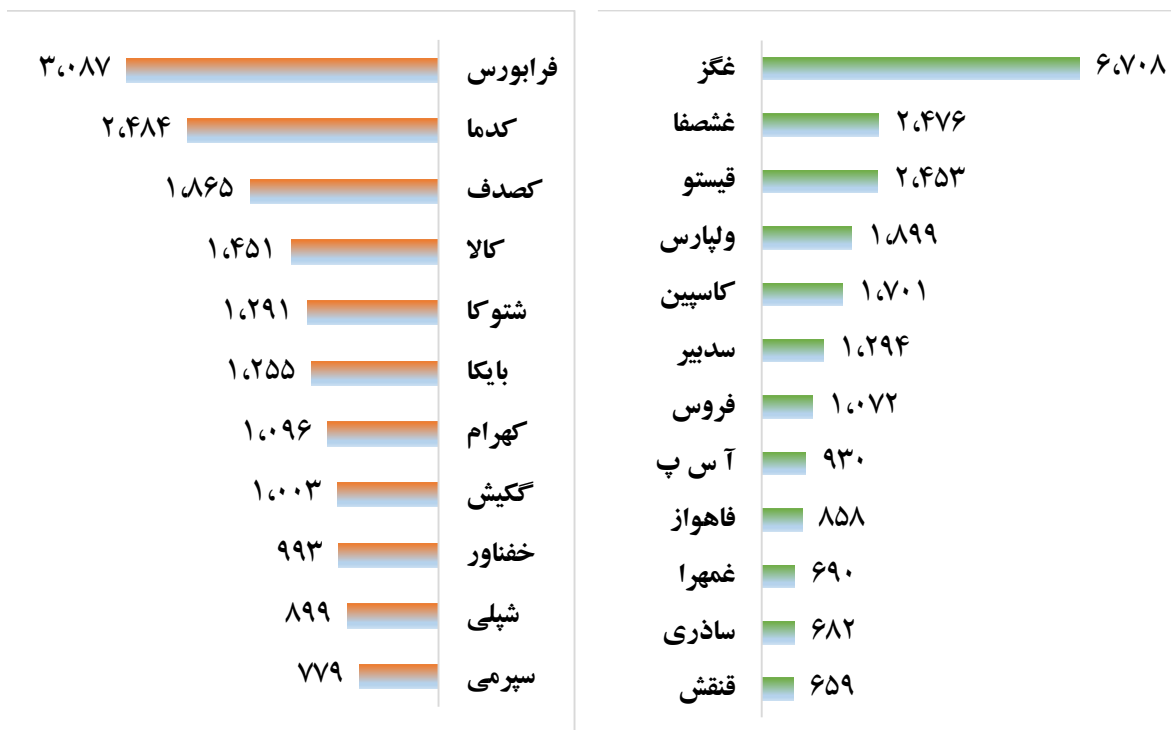
ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



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



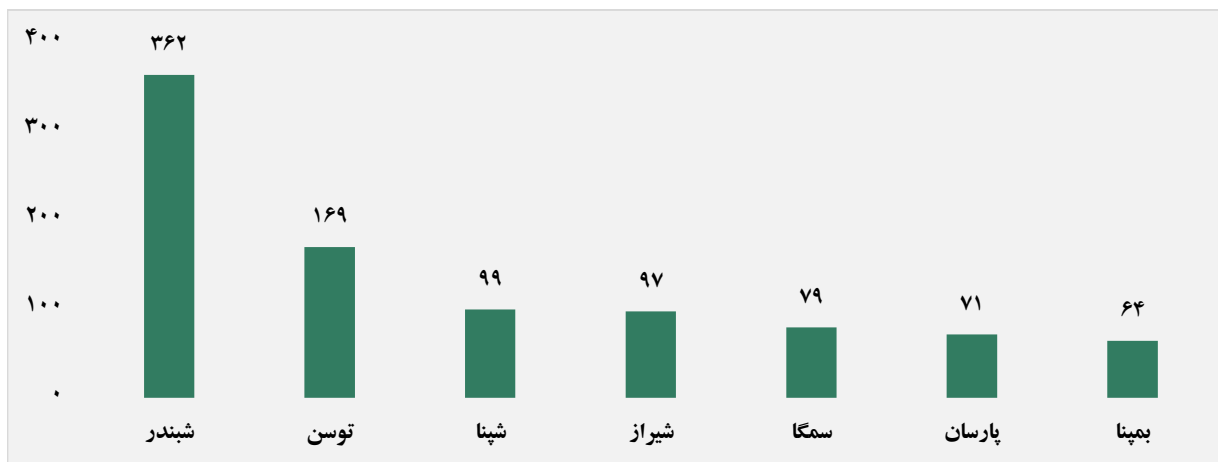
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



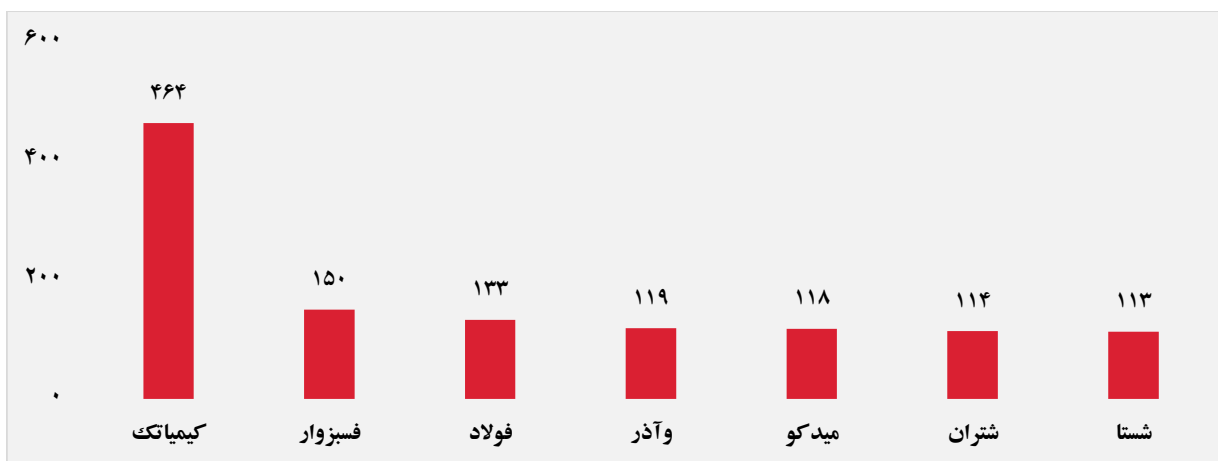
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	توسن	۱	فنزری
۲	سغرب	۲	فن آوا
۳	بجهرم	۳	شپلی
۴	گپارس	۴	خمحور
۵	فنف	۵	ثوسا
۶	تپکو	۶	زقیام
۷	-	۷	-
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



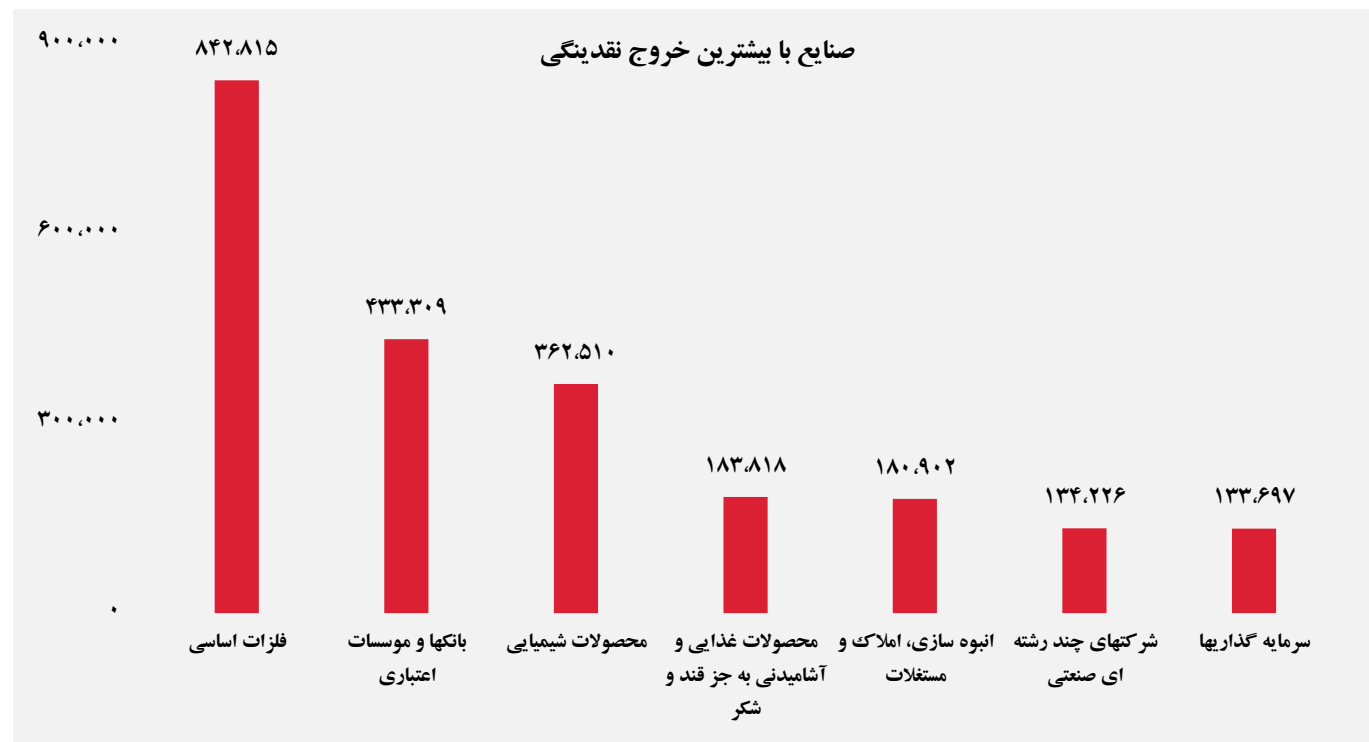
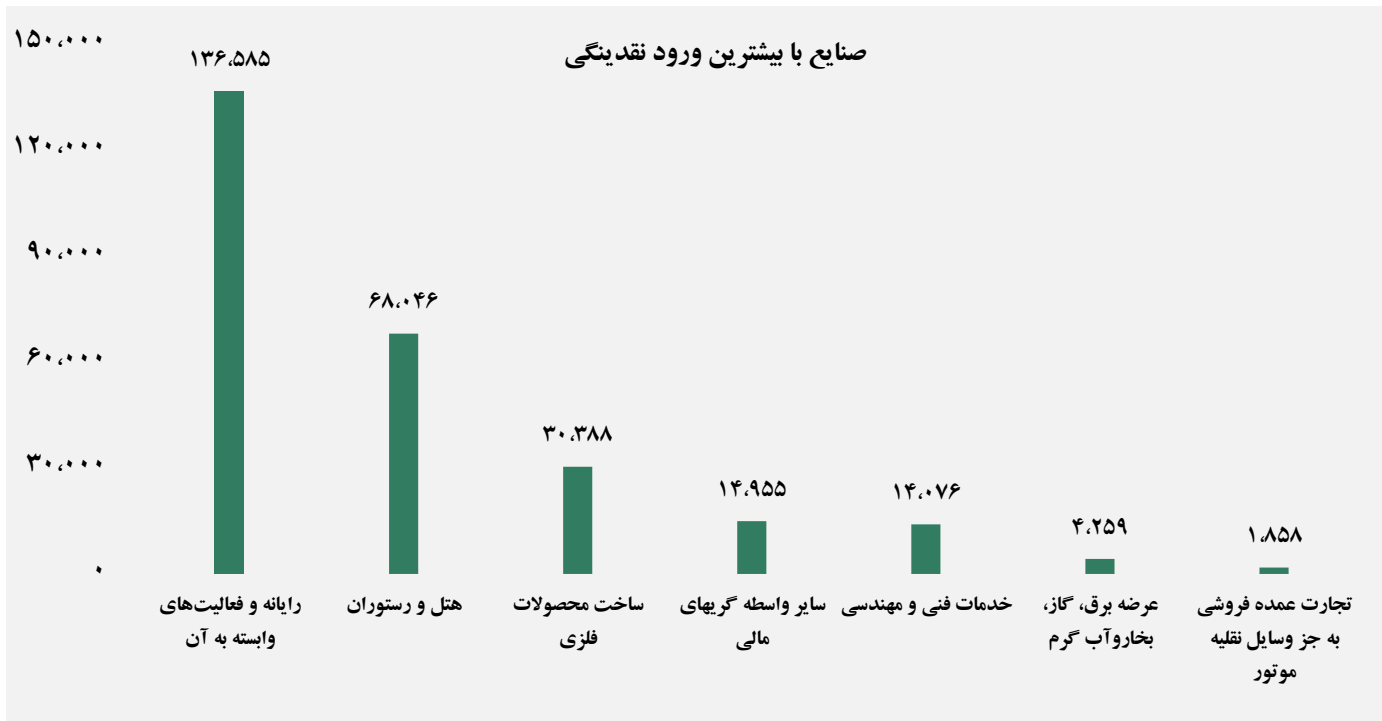
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کیمیاتک	۱۰	سپید
۲	خنصیر	۱۱	کماسه
۳	تاپکیش	۱۲	خفتر
۴	فسیزوار	۱۳	اتکای
۵	شغدیر	۱۴	خموتور
۶	توسن	۱۵	برکت
۷	آپ	۱۶	زفکا
۸	مدیریت	۱۷	کفپارس

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار