



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۷/۱۱

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

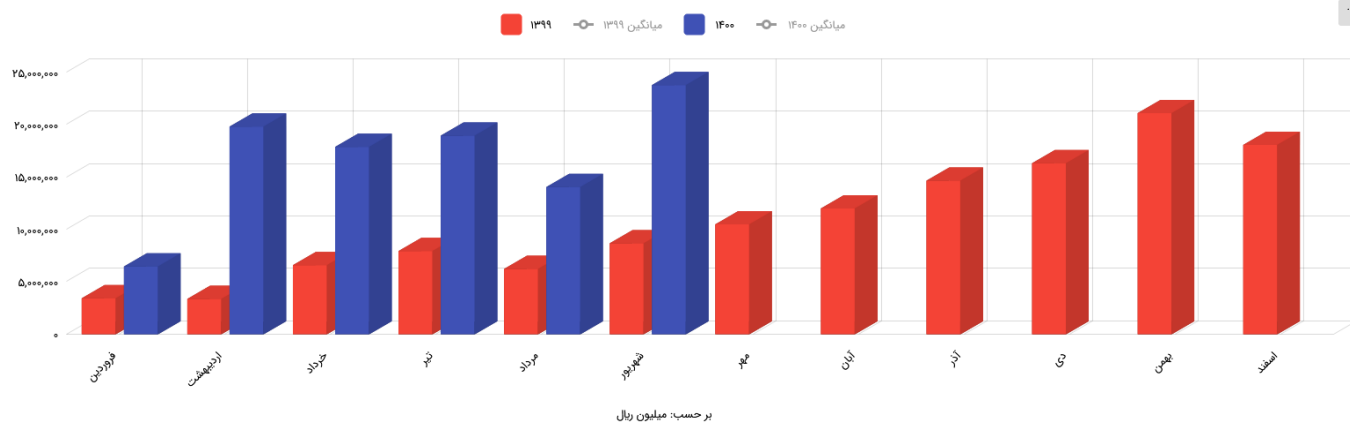
امروز یکشنبه ۱۱ مهر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، تاپیکو، و معادن، پارسان، شپدیس و کچاد با افزایش ۳,۲۱۳ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۷۶,۶۸۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۵۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۷۹ 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 ۵۱ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

اغلب گزارش‌های فعالیت ماهانه، بسته به نوع شرکت‌ها (خدماتی، تجاری و تولیدی) در برخی صنایع، با ارائه اطلاعات جذاب از مقادیر تولید، فروش، نرخ، مبلغ فروش و درآمدزایی مطلوب نیمه اول سال جاری، نگاه تحلیل‌گران و فعالان بازار سرمایه را به سمت پیش‌بینی صورت‌های مالی میان دوره‌ای ایده‌آل و تداوم عملکرد مطلوب این صنایع در نیمه دوم سال جاری جلب کرده است. با ثبت این گزارشات و در راستای آن سطوح مناسب قیمت‌های جهانی و وضعیت قیمت دلار در شرایط تورمی، بهبود تقاضا در بازار سرمایه در نیمه دوم سال جاری در برخی صنایع را انتظار می‌رود. در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۱۵,۳۶۴ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش 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.

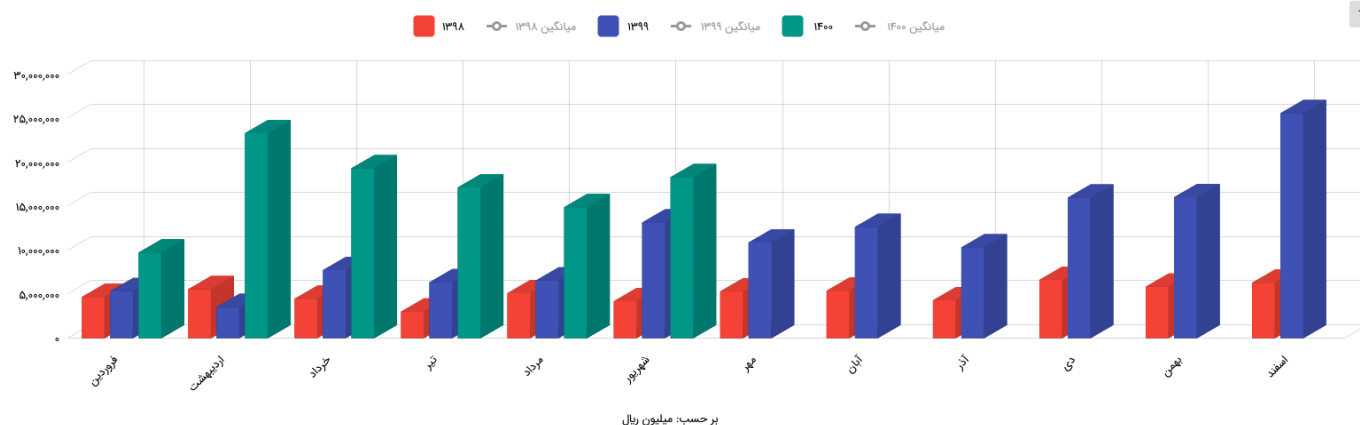
شرح	۱۴۰۰/۰۷/۱۰	۱۴۰۰/۰۷/۱۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۸۹,۲۵۱	۲۱۵,۳۶۴	۱۴٪



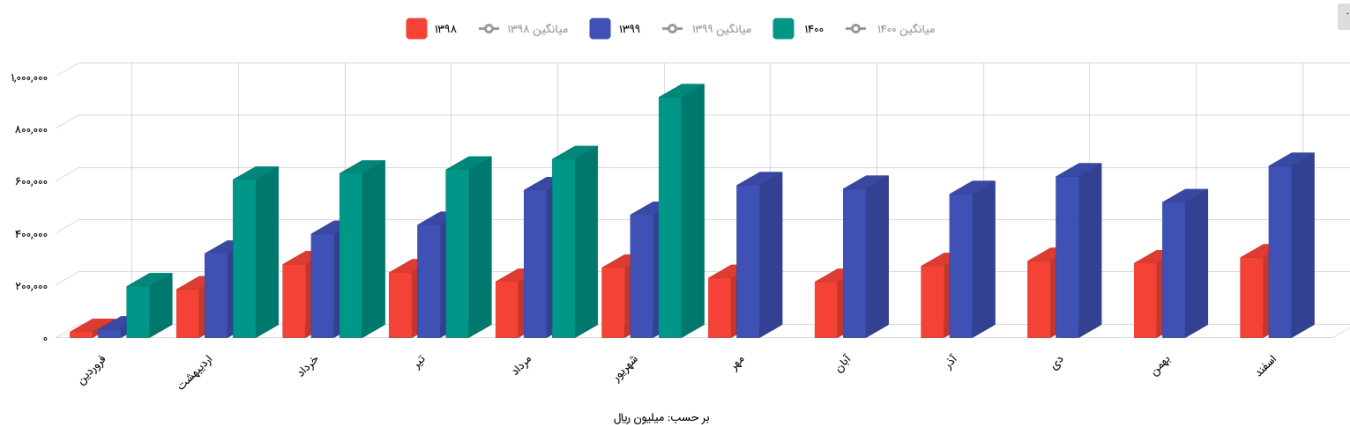
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه پتروشیمی بوعلی (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



● عملکرد مبلغ فروش ماهانه فولاد هرمزگان جنوب (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

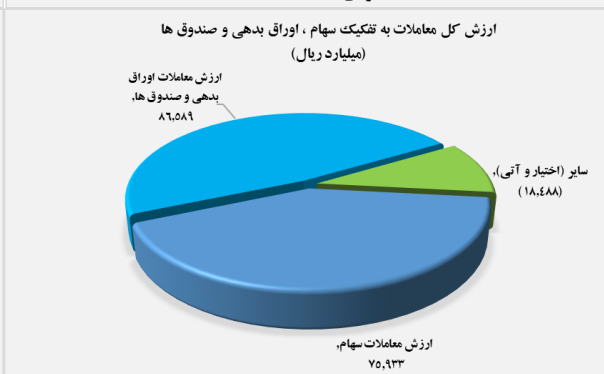
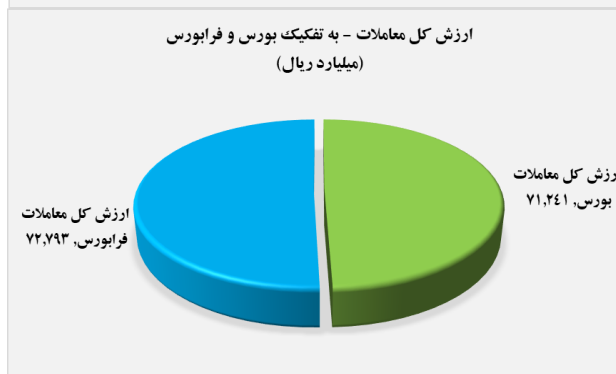


● عملکرد مبلغ فروش ماهانه کاشی سینا (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

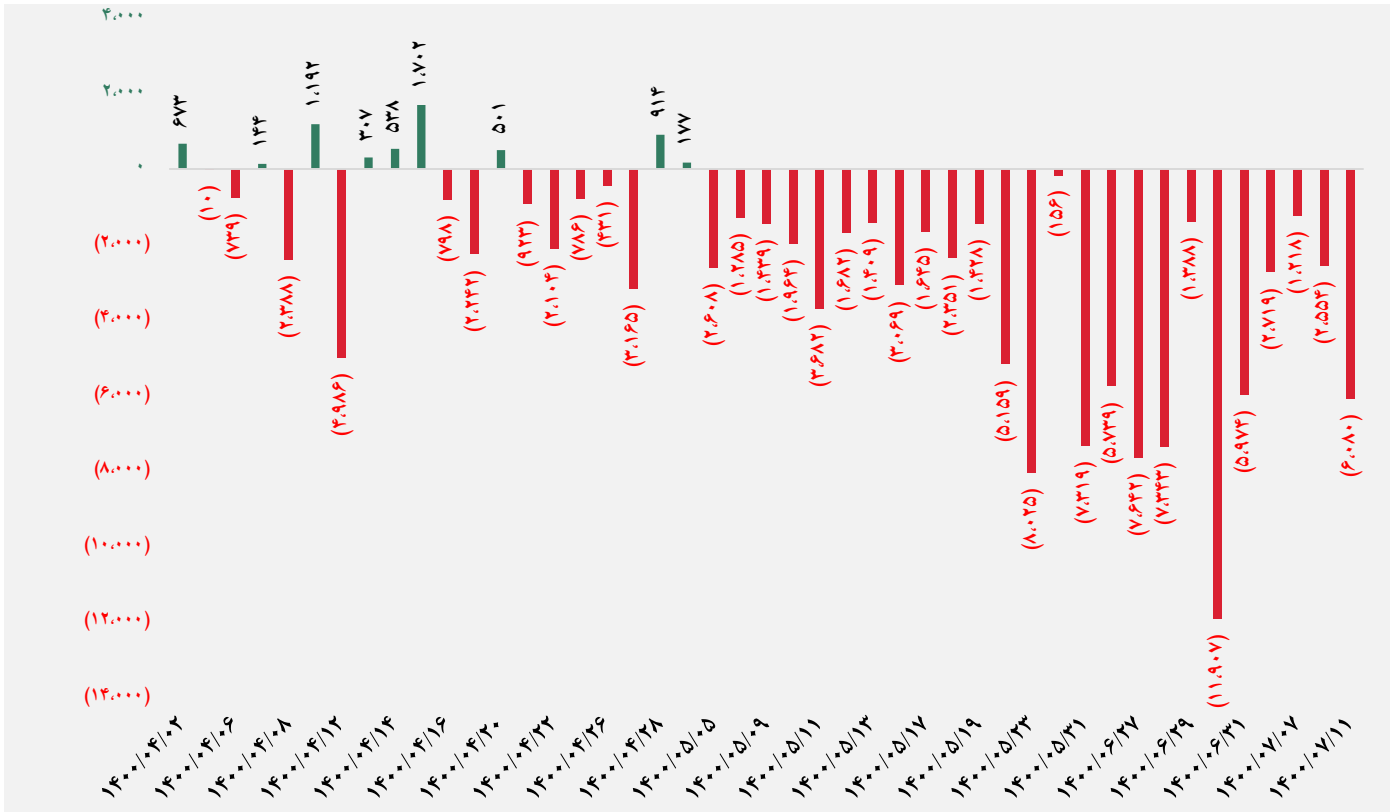


تصویر کلی بازار

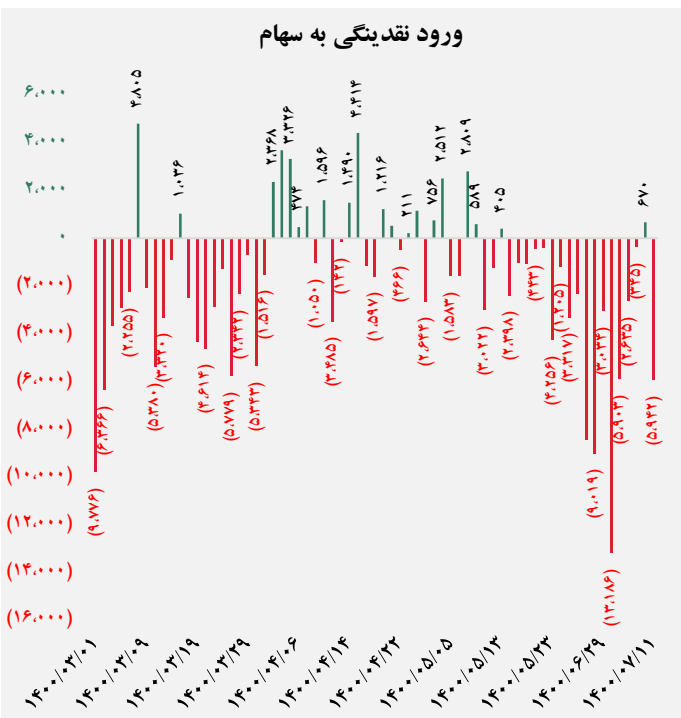
فرا بورس		بورس	
۲۱,۳۲۰	شاخص کل	۱,۴۷۶,۶۸۹	شاخص کل
۱۸	تغییر شاخص	۳,۲۱۳	تغییر شاخص
۱۵,۶۴۵,۲۸۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵,۹۳۴,۴۴۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۷۲,۷۹۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۷۱,۲۴۱	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
	پاس		فارس
	زاگرس		تاپیکو
	شاون		ومعادن
	شرانل		پارسان
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
	شگویا		فملی
	آریا		فولاد
	هرمز		شپنا
	صبا		شتران



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

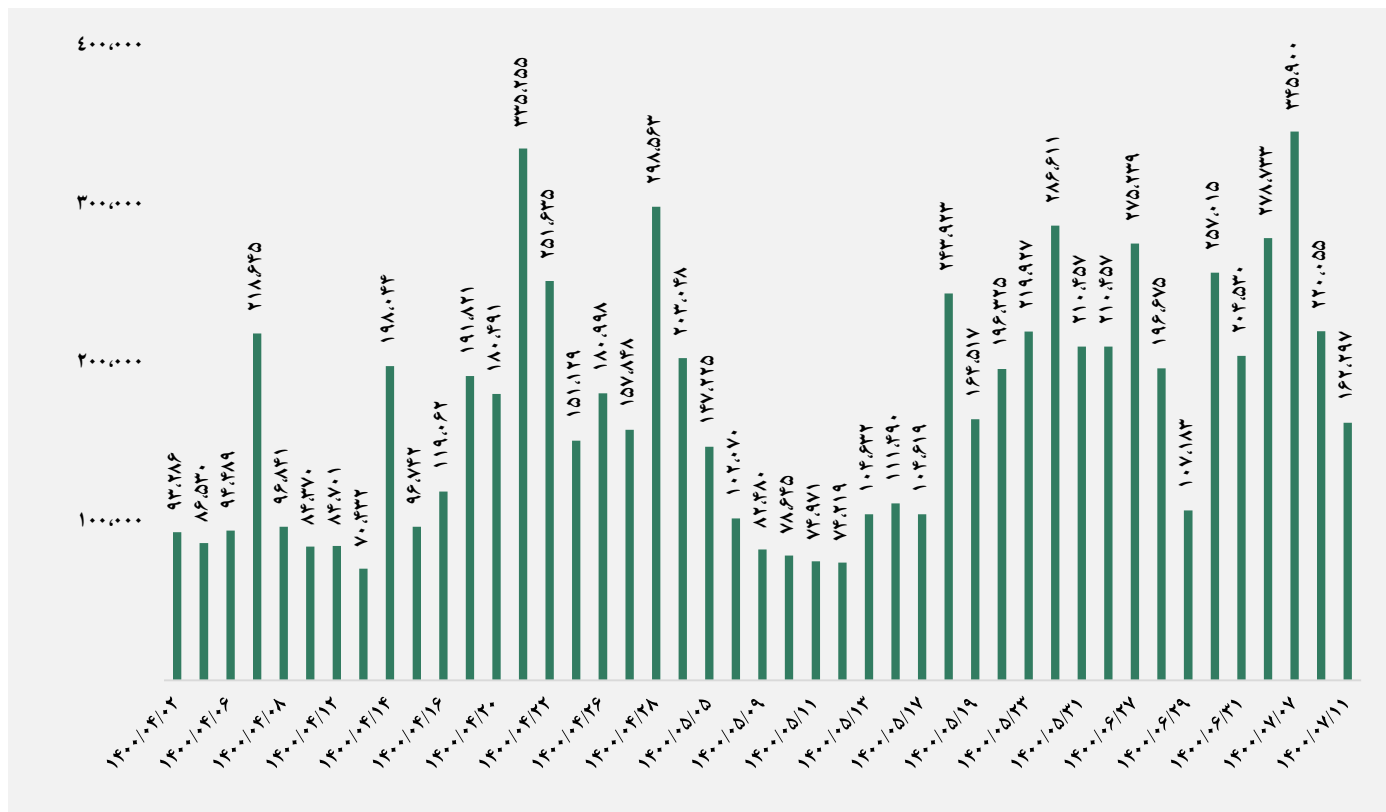


ورود (خروج) نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

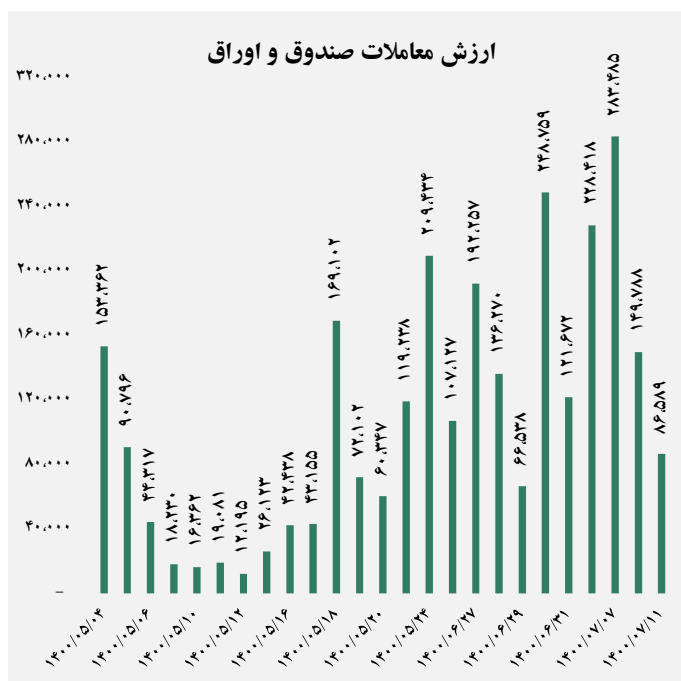
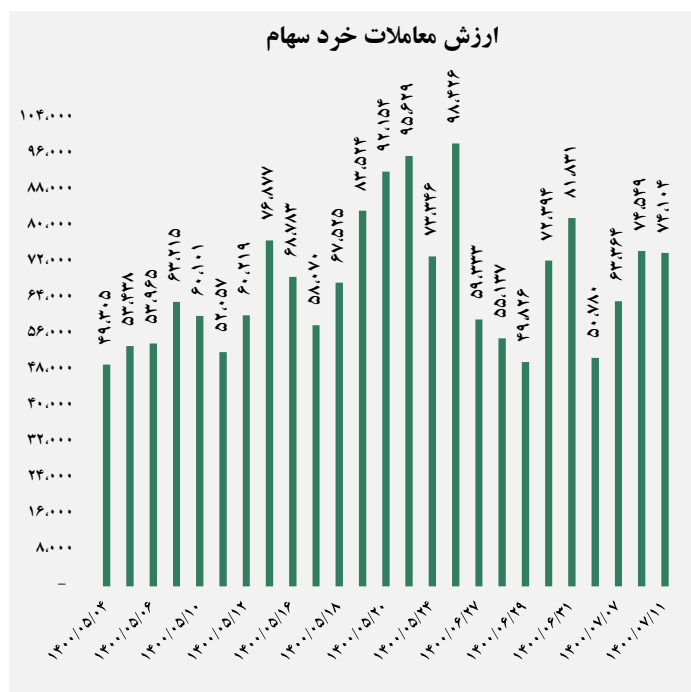




ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



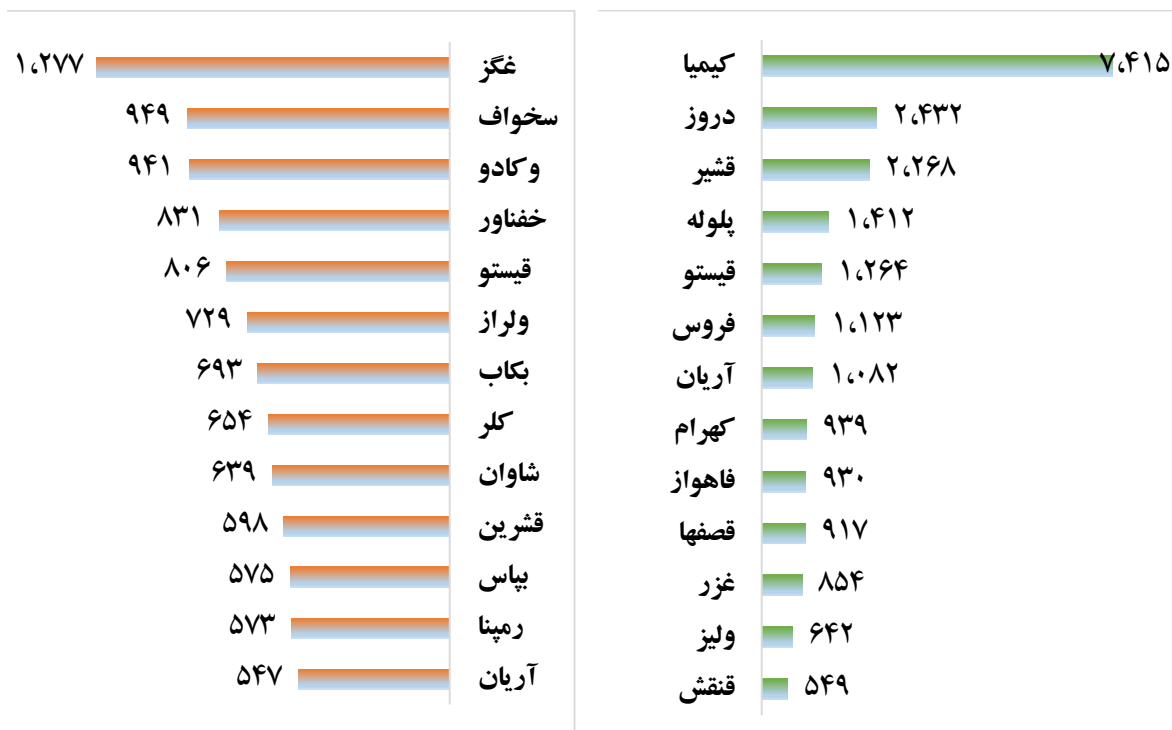
ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار



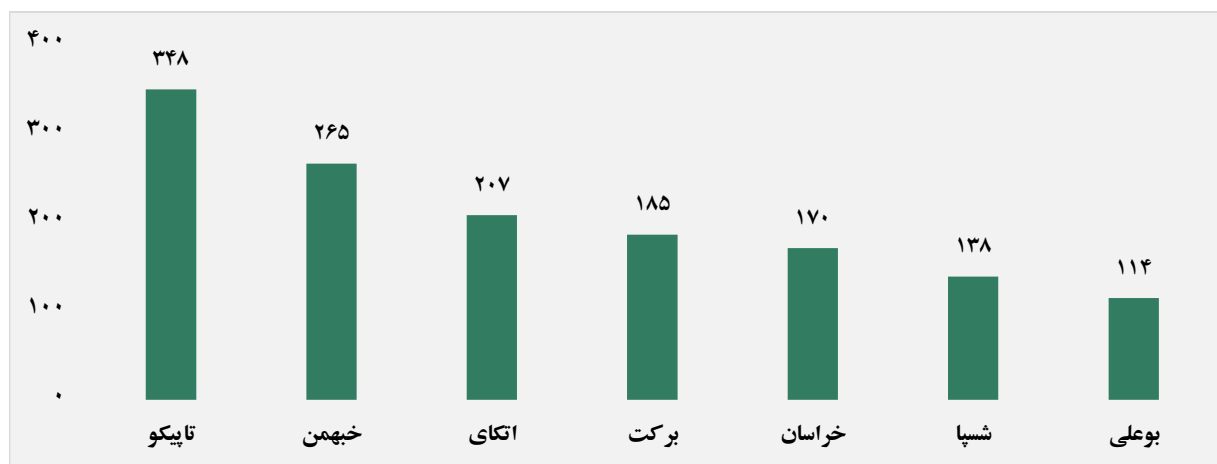
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



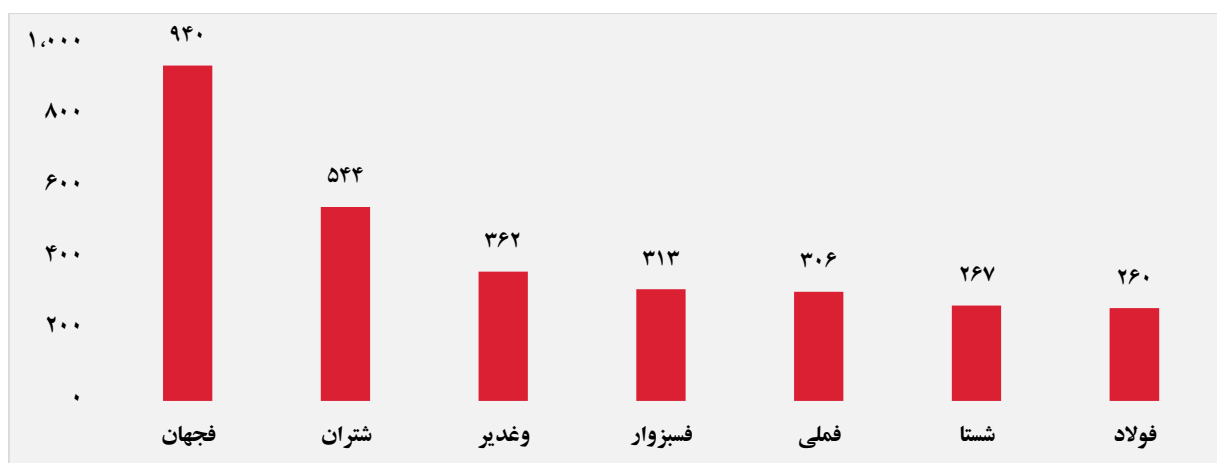
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	بوعلی	۱	بالاس
۲	قیستو	۲	کالا
۳	قترت	۳	فراپورس
۴	غشصفا	۴	کرمانشاه
۵	قزوین	۵	آپ
۶	خاذین	۶	کمینا
۷	وتوشه	۷	بایکا
۸	تپکو	۸	کیسون
۹	خبهن	۹	سایرا
۱۰	سیستم	۱۰	زفکا

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



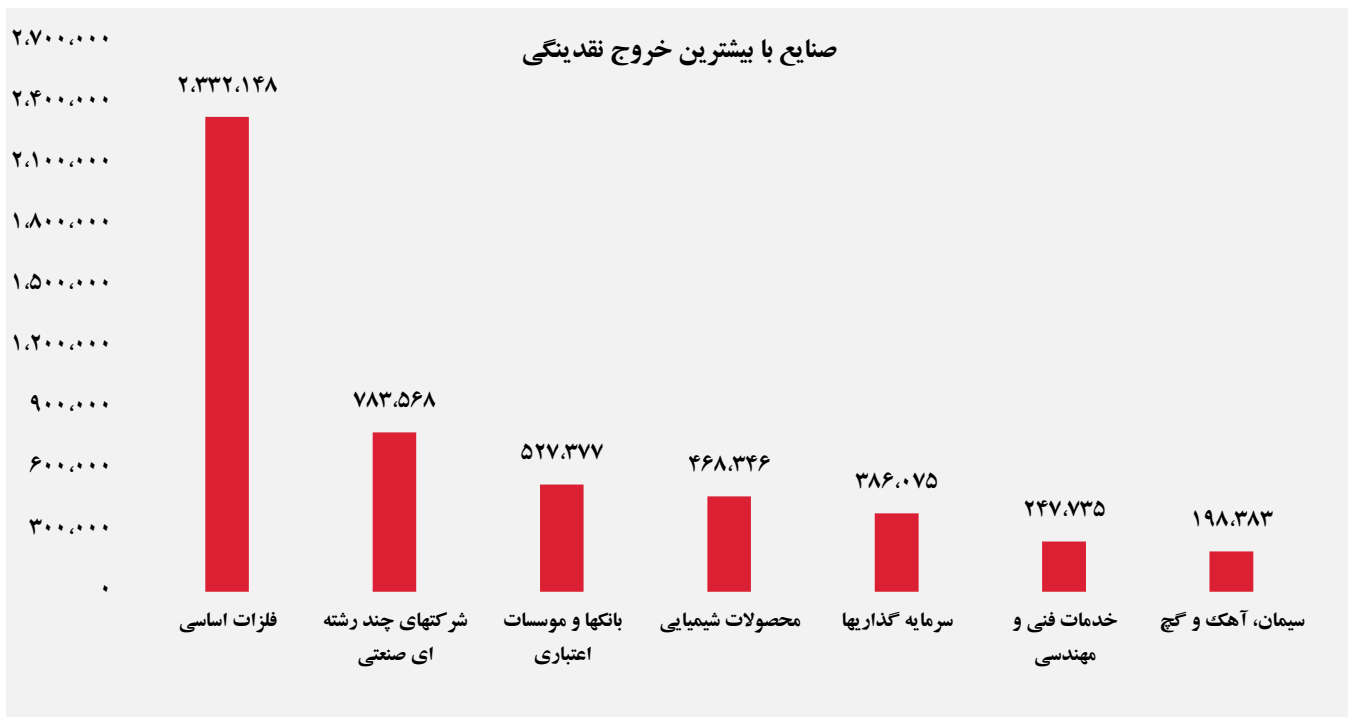
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	شغدیر	۱۰	بوعلی
۲	شاوان	۱۱	زاگرس
۳	کیمیاتک	۱۲	فسبزوار
۴	کالا	۱۳	سپید
۵	خنصیر	۱۴	تاپکیش
۶	خراسان	۱۵	مدیریت
۷	فراپورس	۱۶	فرزین
۸	برکت	۱۷	شپدیس

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار