



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۷/۱۲

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

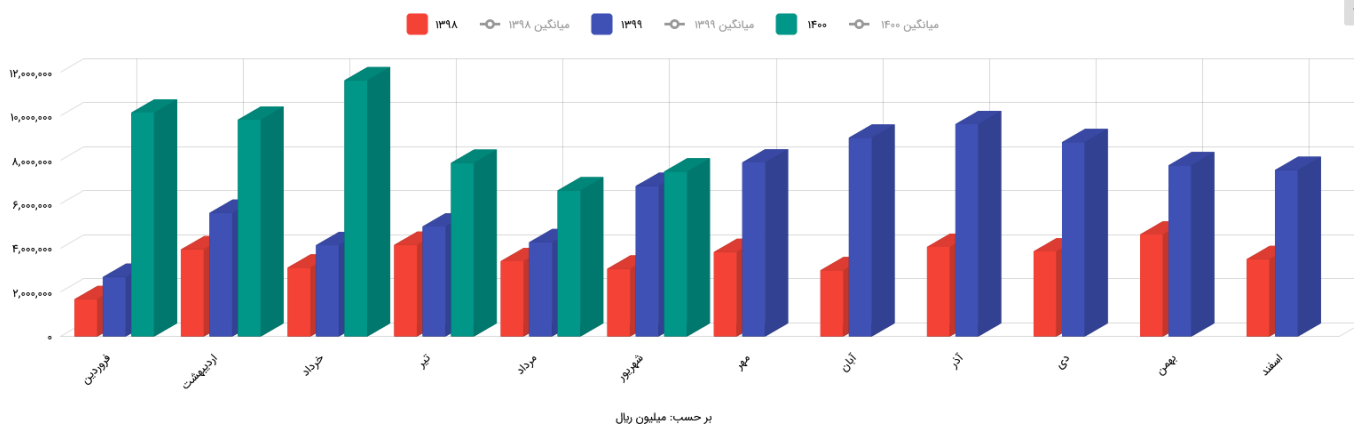
امروز دوشنبه ۱۲ مهر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، شینا، شبندر، شستا، خودرو و وبصادر با افزایش ۸,۰۳۶ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۸۴,۷۱۶ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۴۴۰ هزار میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته افزایش داشته است. مبلغ ۶۲ 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 ۱۴ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. با رشد قیمتی چند روز اخیر در نمادهای بزرگ در بازار سرمایه، شاهد افزایش شاخص کل به مرز ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد بودیم. قابل ذکر است روش فعلی محاسبه شاخص کل به طریقی انجام می شود که نمی توان فقط با تحلیل آن، اقدام به خرید و فروش سهام کرد. اما در کل شاخص کل تا موقعی که کمتر از سقف قبلی خود باشد و همچنین مجموع ارزش معاملات خرد در بازار بورس و فرابورس نیز کمتر از ۹۰ هزار میلیارد ریال باشد، نباید انتظار رشد دسته جمعی در اکثر نمادها داشت.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۹۰,۷۵۱ میلیارد ریال می باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۷۰۱، 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 ۸۲۱، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۹/۰۶ با ۲۳,۶٪ سود است.

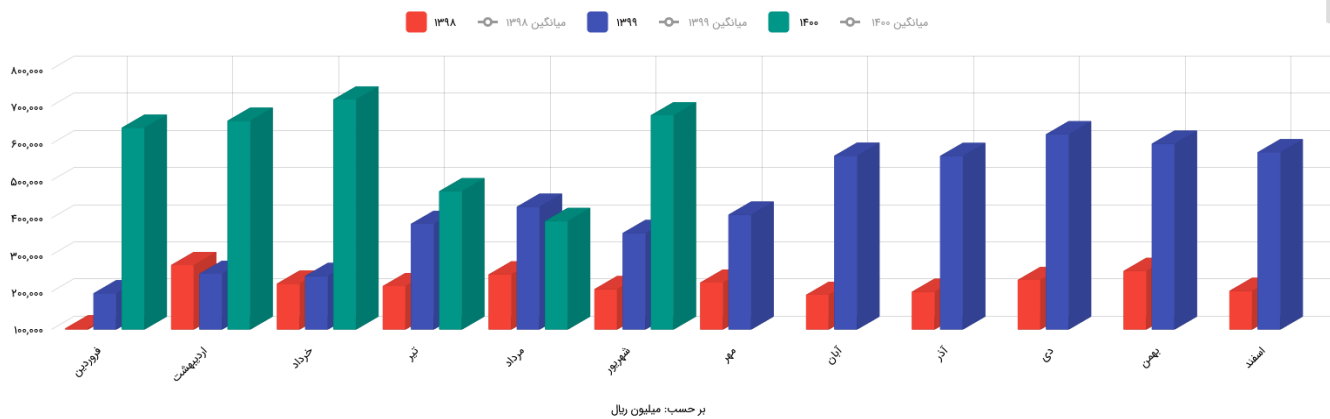
شرح	۱۴۰۰/۰۷/۱۱	۱۴۰۰/۰۷/۱۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۱۵,۳۶۴	۱۹۰,۷۵۱	-۱۳٪



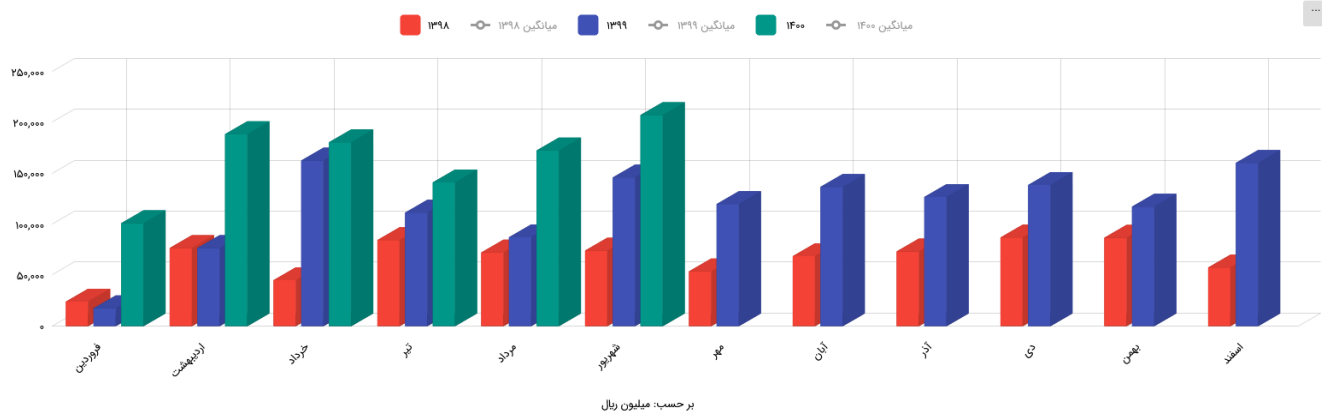
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه فولاد سپید فراب کویر (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



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



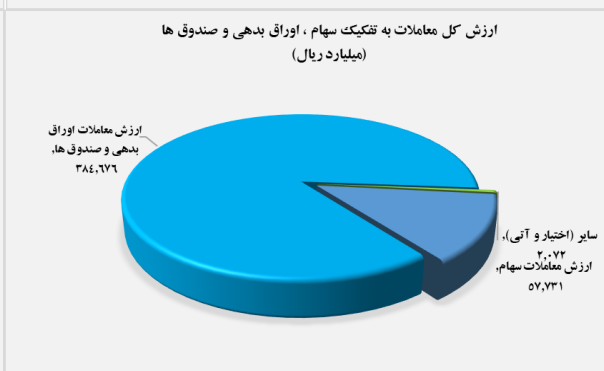
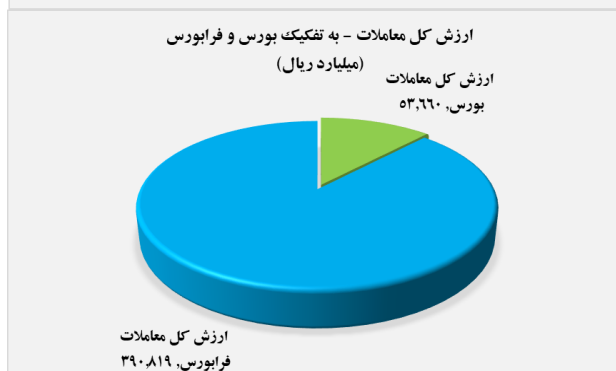
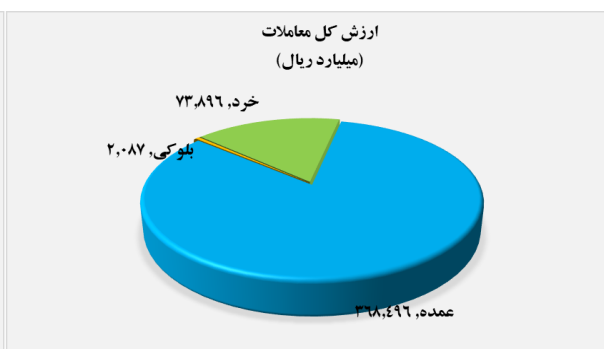
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه کاشی سعدی (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

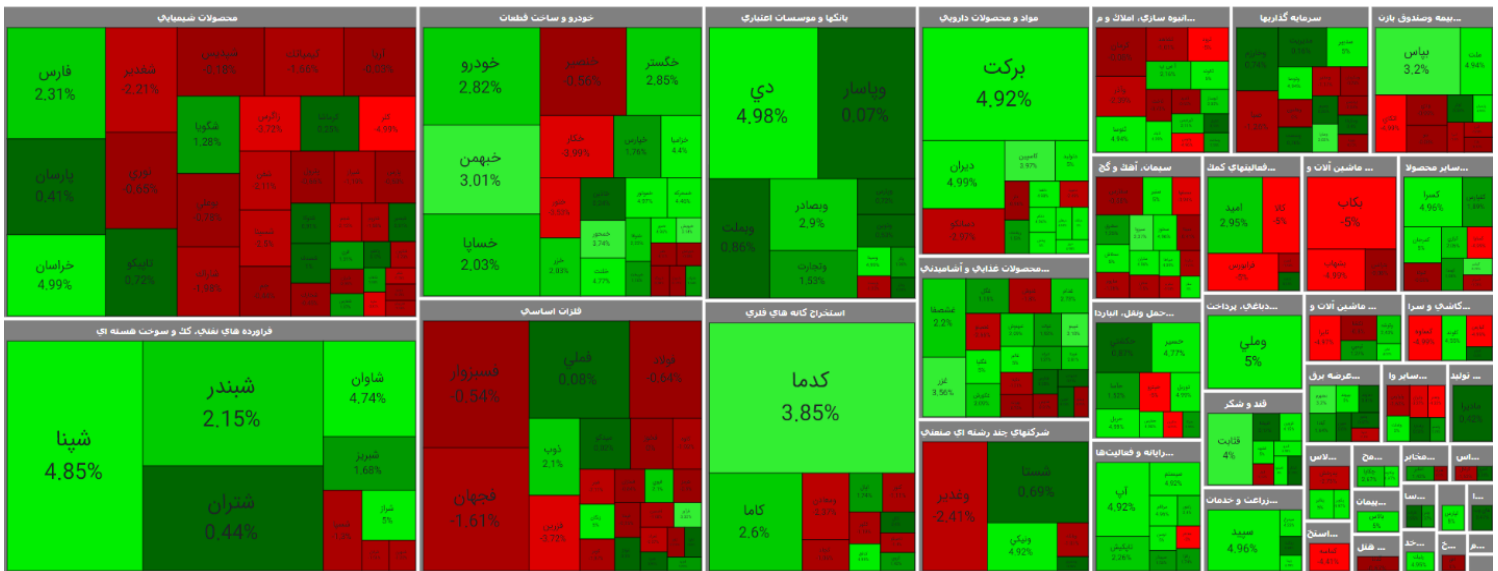
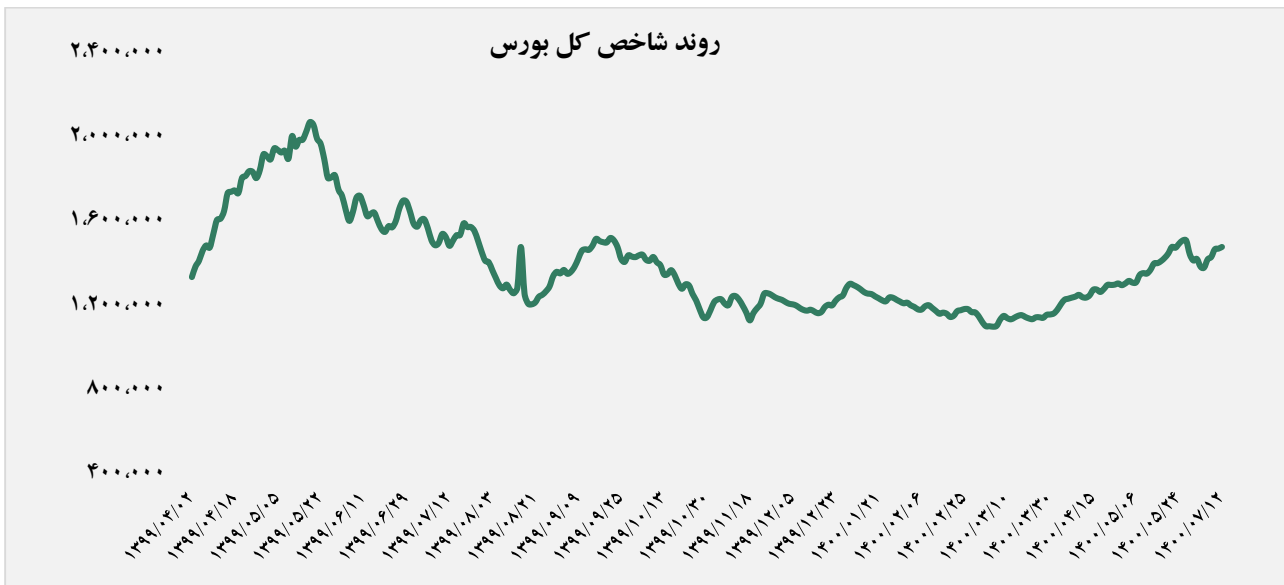


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

تصویر کلی بازار

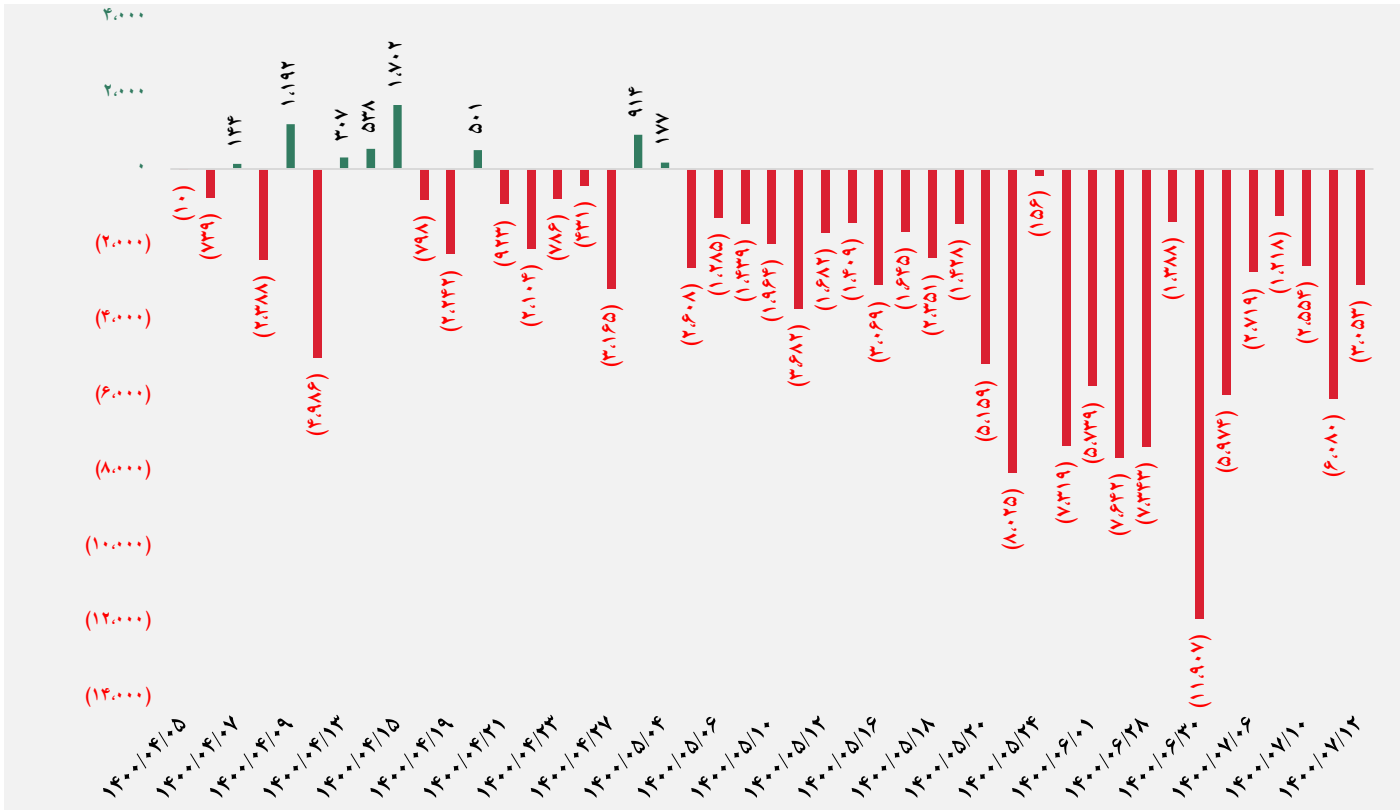
فرا بورس		بورس	
۲۱,۳۷۱	شاخص کل	۱,۴۸۴,۷۲۰	شاخص کل
۵۱	تغییر شاخص	۸,۰۴۰	تغییر شاخص
۱۵,۶۸۷,۲۰۶	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۹,۶۶۶,۸۷۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۳۹۰,۸۱۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۳,۶۶۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
پاس		فارس	
شاون		شپنا	
شگویا		شبندر	
دی		شستا	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
زاگرس		ومعادن	
کگهر		فولاد	
فرا بورس		کالا	
آریا		نوری	



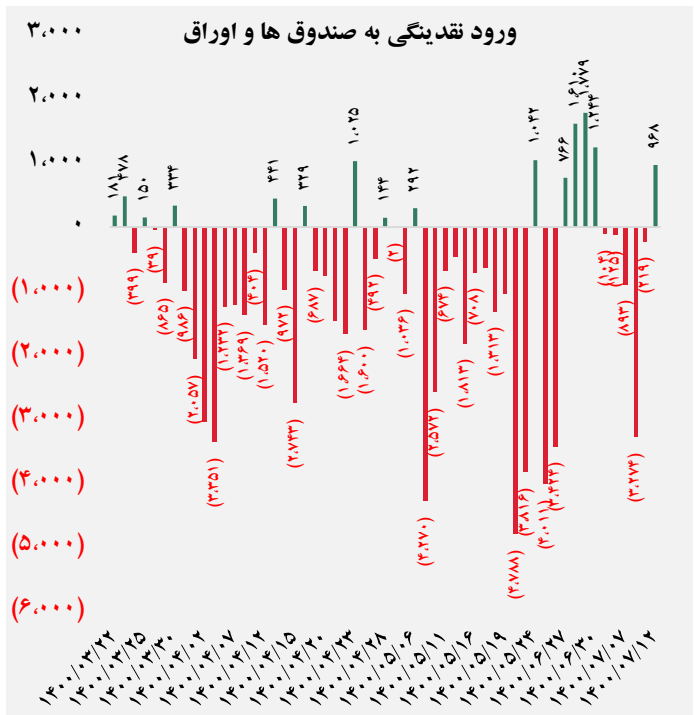
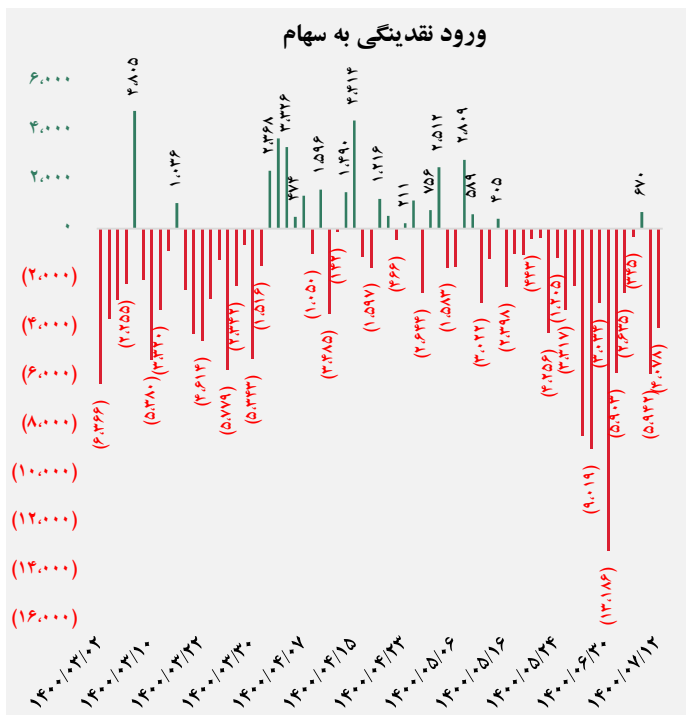


گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر

کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

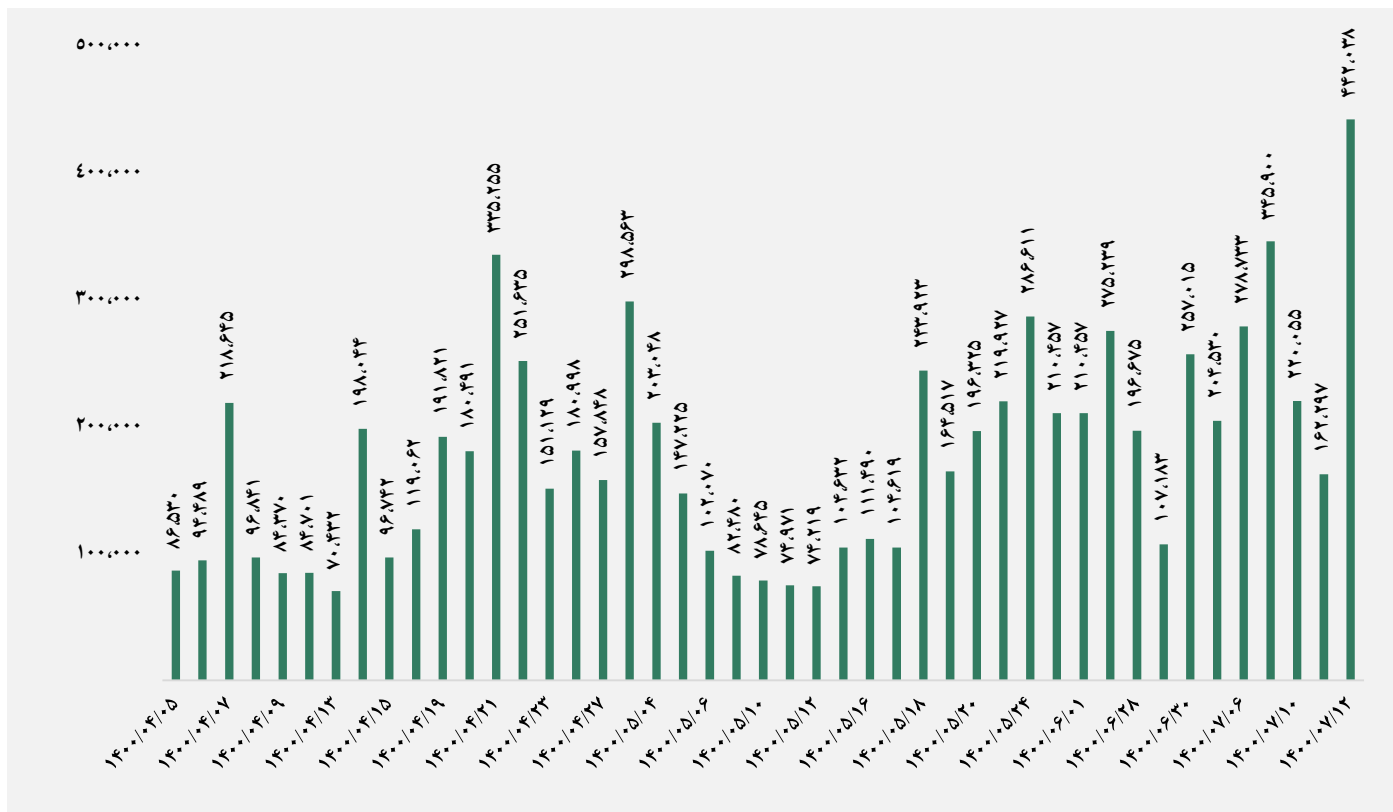


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

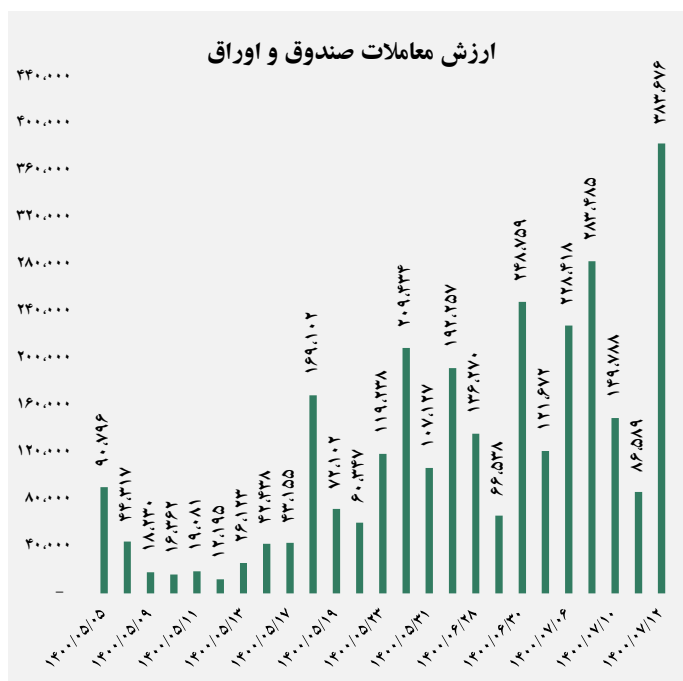
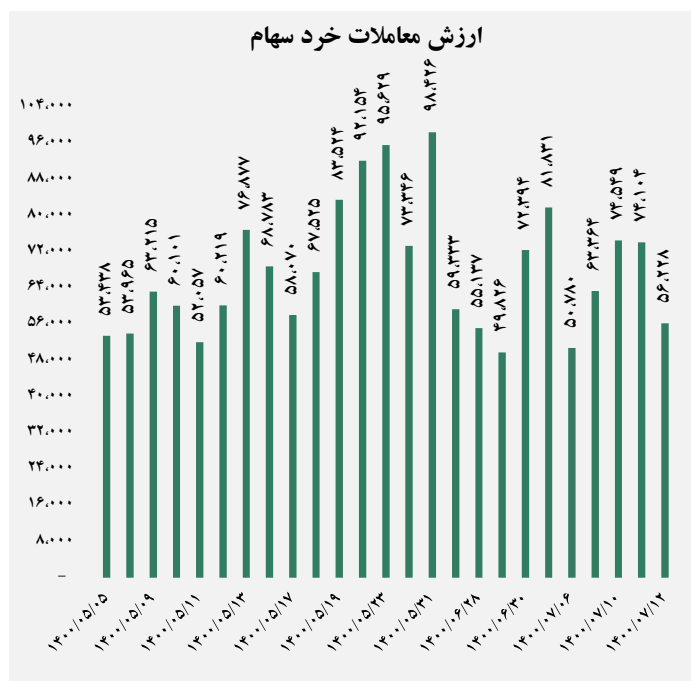


گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار

ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

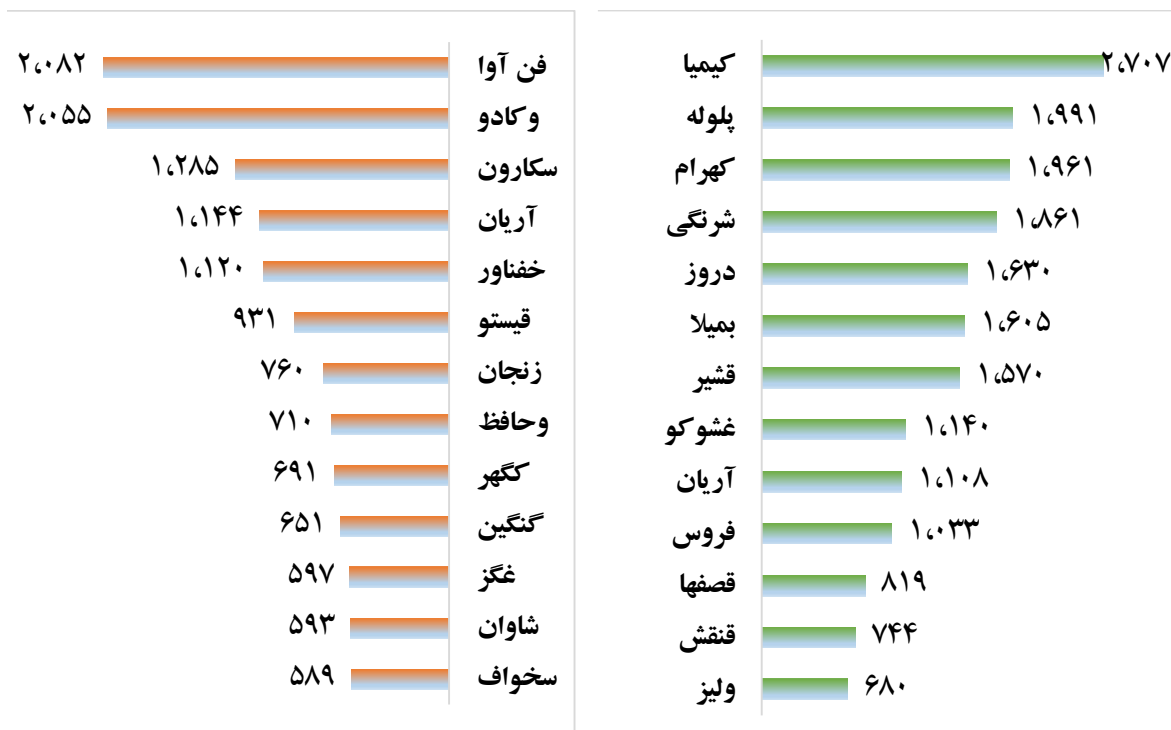


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





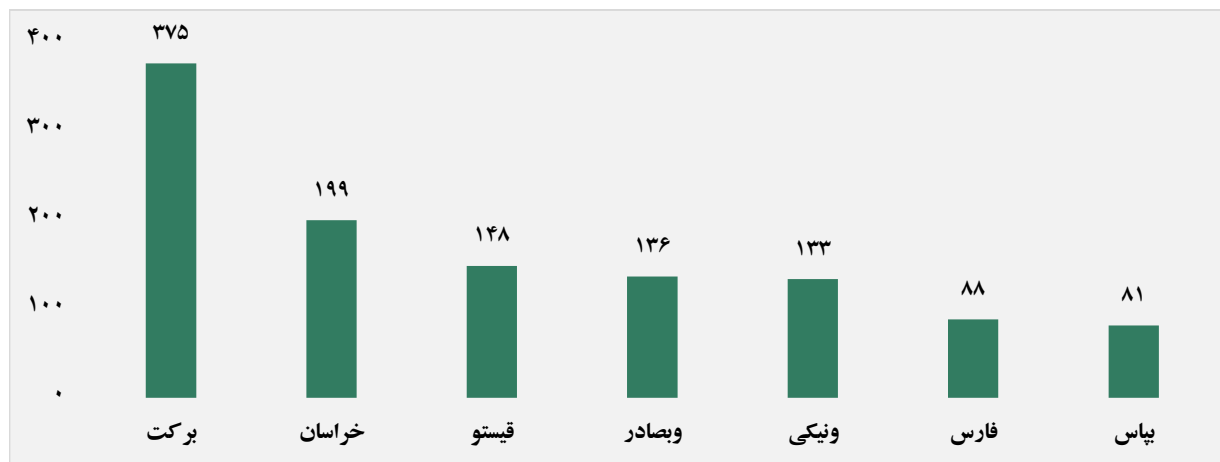
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



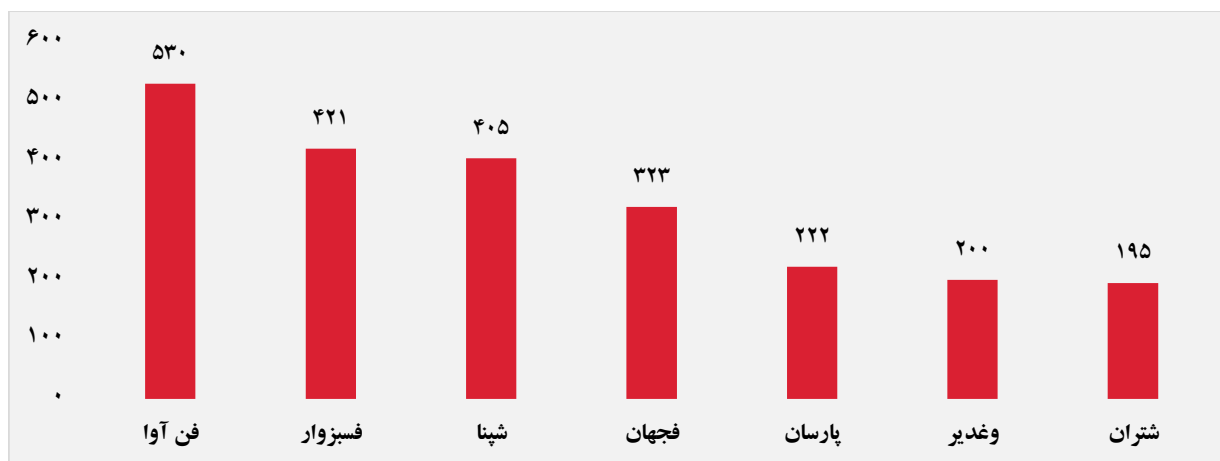
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	ونیکی	۱	وزمین
۲	قنقش	۲	خکار
۳	رنیک	۳	بایکا
۴	حبندر	۴	وحافظ
۵	شراز	۵	چپترو
۶	-	۶	-
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	شاوان	۱۰	برکت
۲	خنصیر	۱۱	دسانکو
۳	سپید	۱۲	کسرا
۴	شغدیر	۱۳	شراز
۵	خراسان	۱۴	تاپکیش
۶	کیمیاتک	۱۵	مدیریت
۷	فزرین	۱۶	زاگرس
۸	فسبزووار	۱۷	بوعلی



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

