



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۷/۱۸

www.sfg.ir - info@sfg.i



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۸ مهر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فولاد، همراه، شپدیس، شستا و رمپنا با کاهش ۱۰,۴۲۰ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۵۵,۶۱۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۲۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۲ 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 ۲۳ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

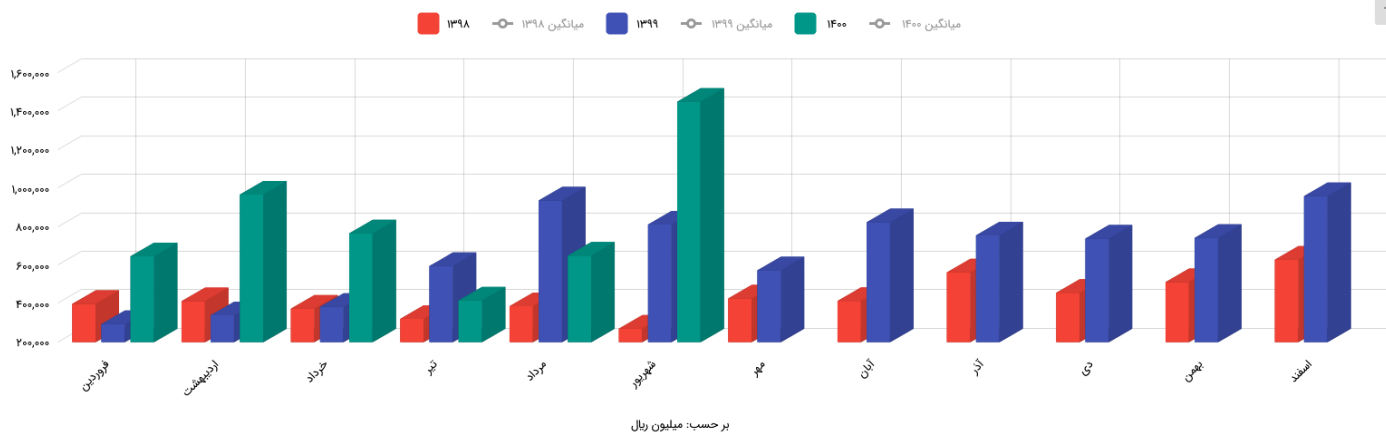
با نگاهی به شاخص کل و شاخص هم وزن در ۱۰ روز گذشته و با توجه به شکل گرفتن یک روند مثبت در این دو شاخص که در حال حاضر در حال اصلاح است، می‌توان انتظار داشت که در روزهای آینده دوباره بازار به روند صعودی خود برگردد و سیگنال تایید در شاخص کل نیز به معنای رشد حداقل ۲ درصدی به همراه حجم معاملات بیشتر نسبت به میانگین ۱۰ روز گذشته می‌باشد. در صورت اتفاق سیگنال تایید، شاخص کل می‌تواند به سمت محدوده مقاومتی ۱,۶۰۰,۰۰۰ واحد حرکت نماید. در صورتی که حجم معاملات بازار بیشتر از میانگین ۱۰ روز گذشته نباشد، احتمال رنج بودن حرکت شاخص تقویت می‌شود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۹۰,۹۷۰ 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 ۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۳/۰۴/۱۸ با ۲۳,۶٪ سود است.

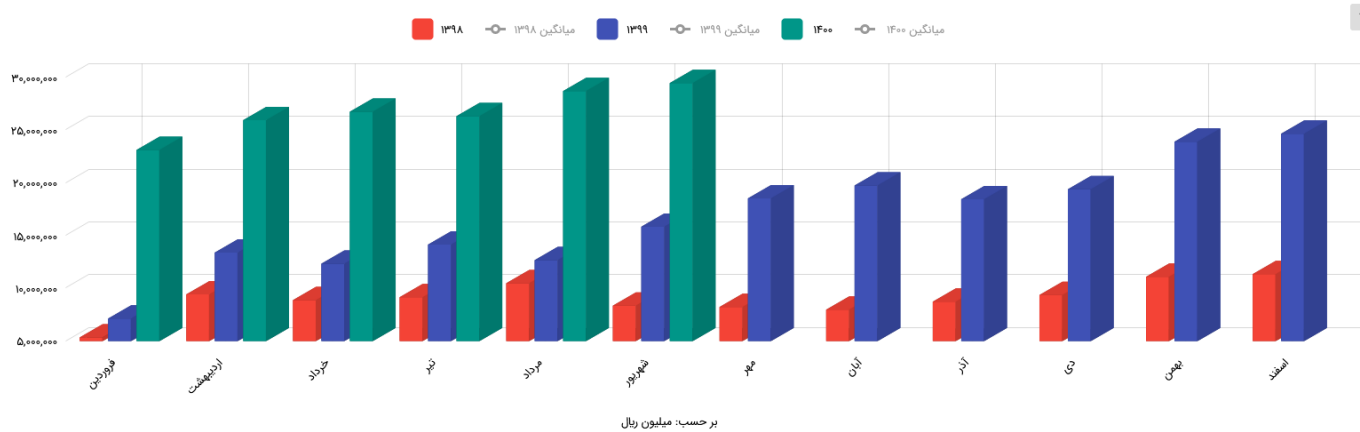
درصد تغییر	۱۴۰۰/۰۷/۱۸	۱۴۰۰/۰۷/۱۷	شرح
۵٪	۹۰,۹۷۰	۸۶,۲۵۵	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)



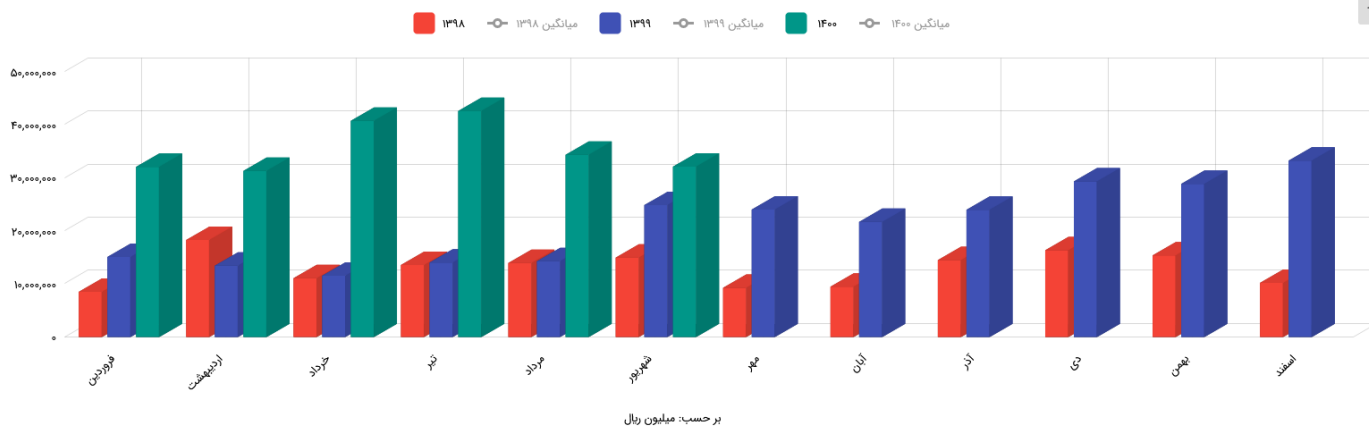
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه سیمان خوزستان (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سالهای ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت ذوب آهن اصفهان (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سالهای ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



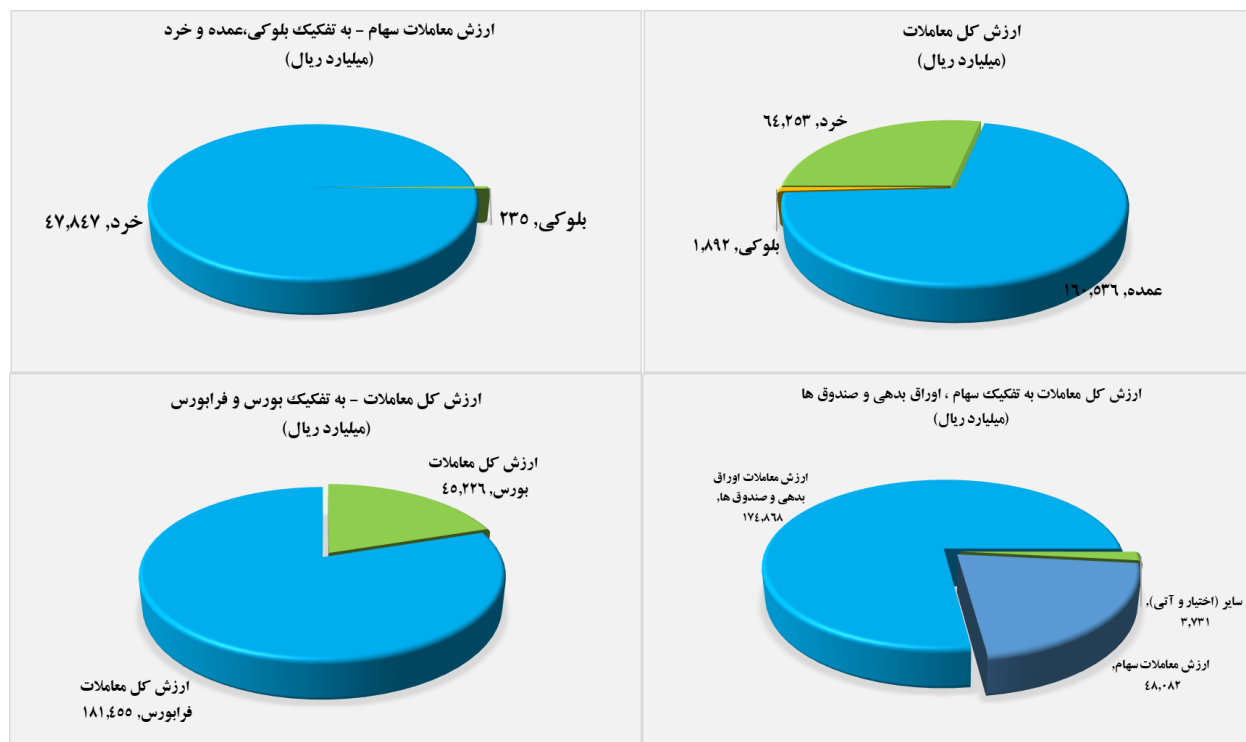
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه پتروشیمی پارس (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سالهای ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)

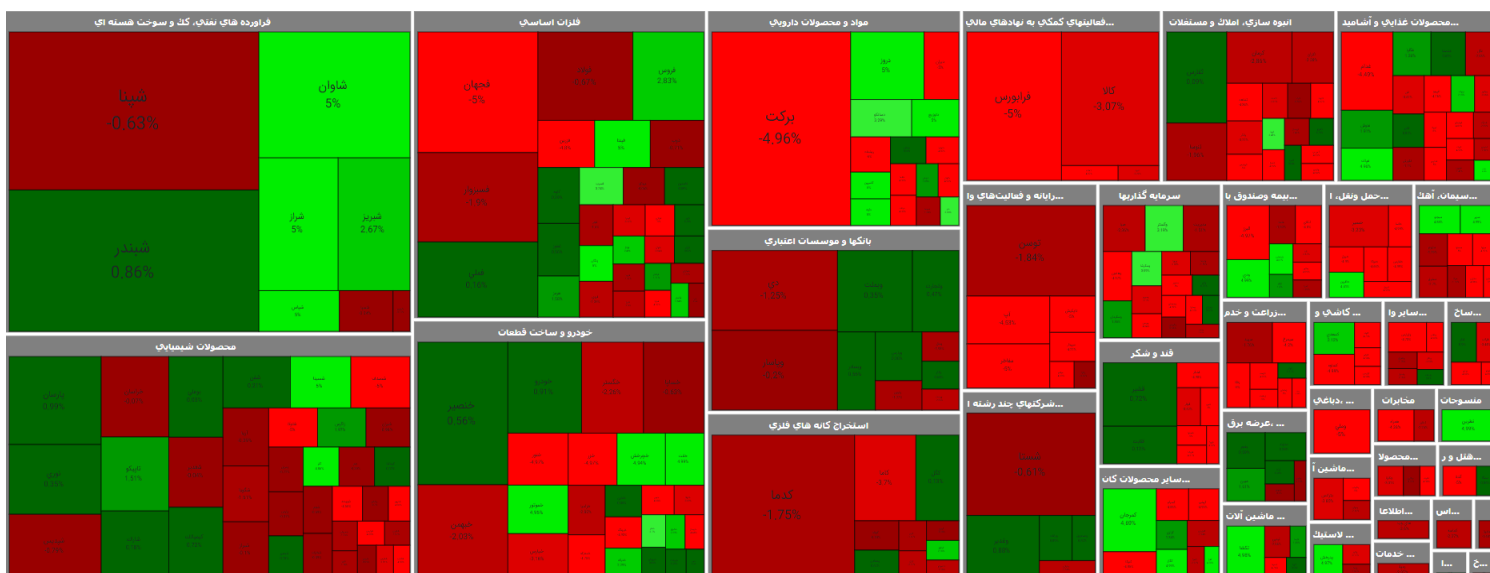
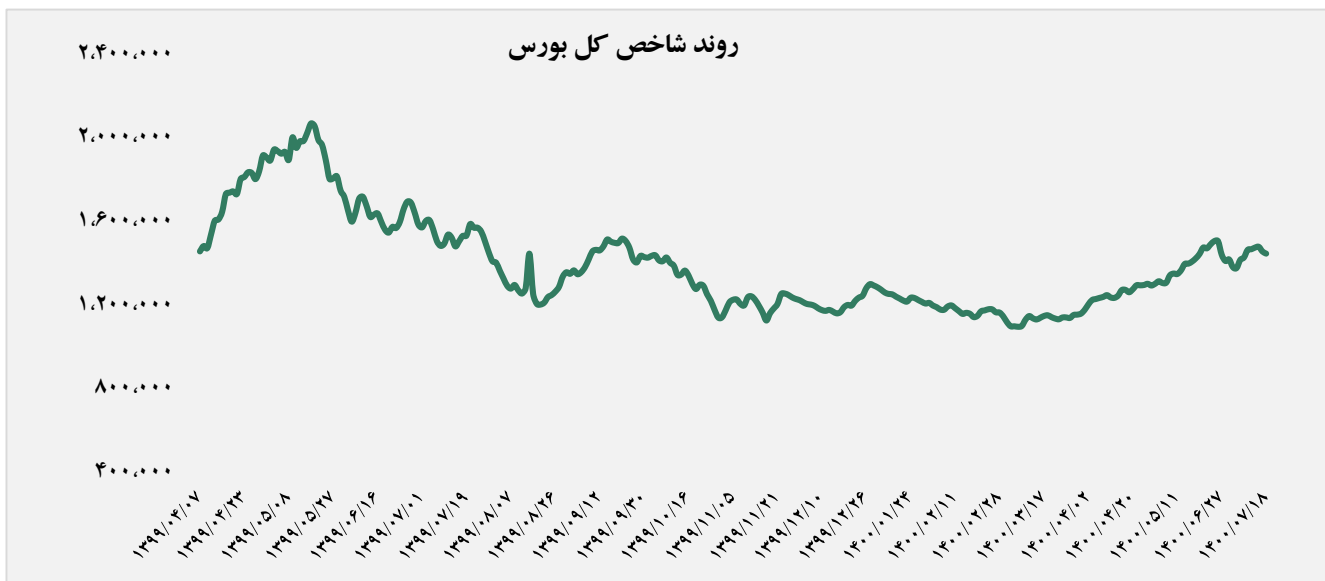




تصویر کلی بازار

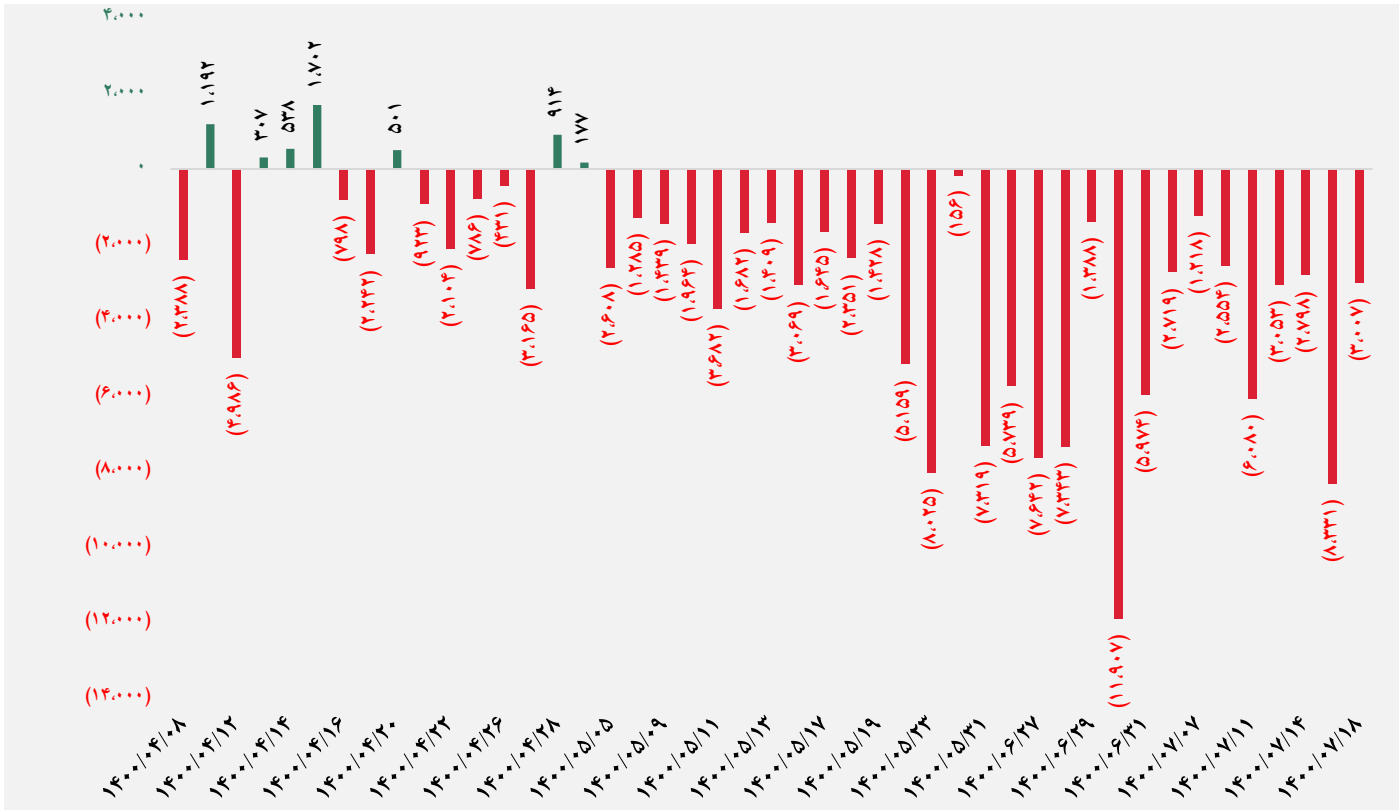
فرا بورس		بورس	
۲۰,۷۸۲	شاخص کل	۱,۴۵۵,۶۱۰	شاخص کل
(۱۹۷)	تغییر شاخص	(۱۰,۴۲۰)	تغییر شاخص
۱۵,۳۰۵,۸۸۵	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۸,۴۹۰,۱۹۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۱۸۱,۴۵۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۵,۲۲۶	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
شراز		تاپیکو	
شاون		پارسان	
شپاس		شبریز	
زاگرس		مبین	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
آریا		فملی	
پپاس		فولاد	
فجهان		همراه	
فرا بورس		شپدیس	



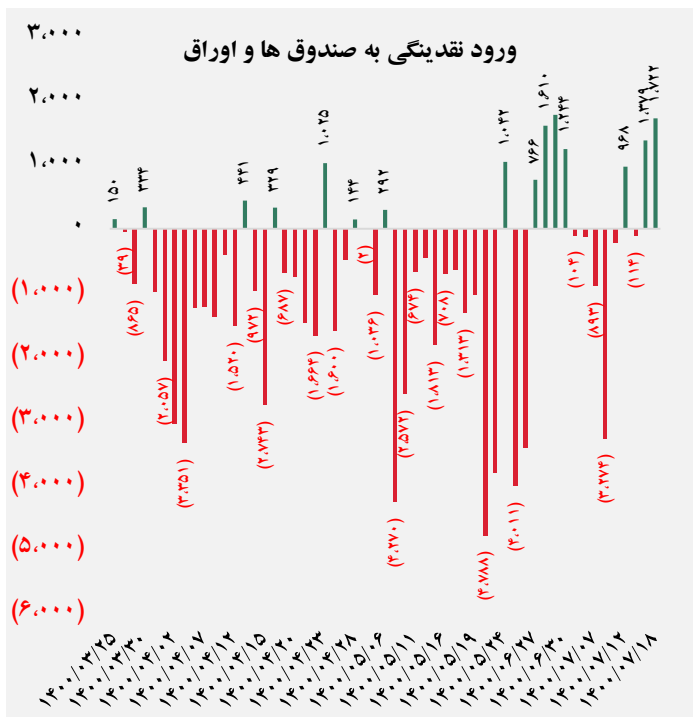
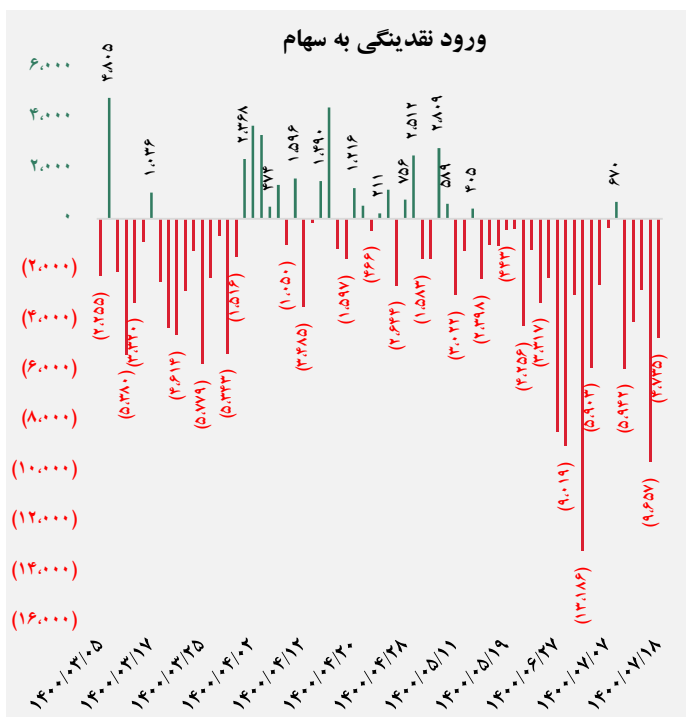




کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

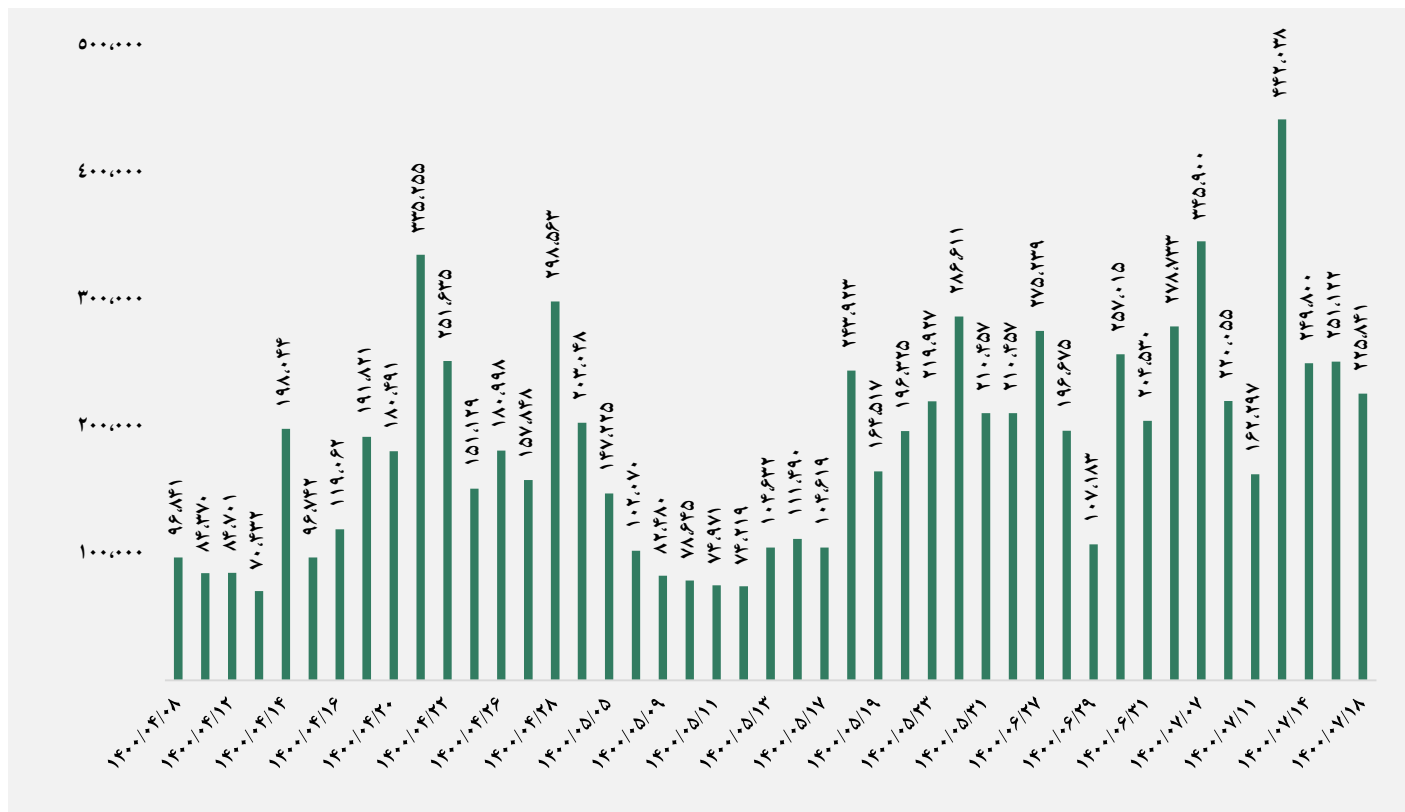


ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

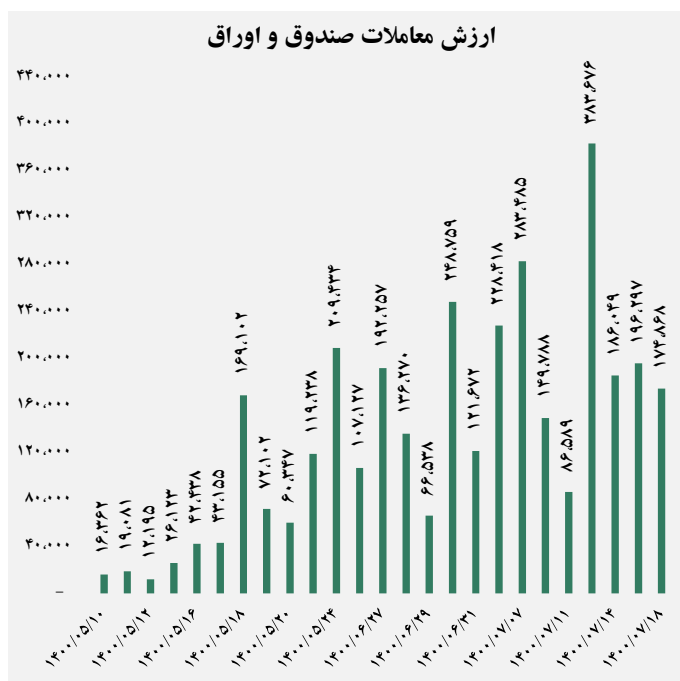
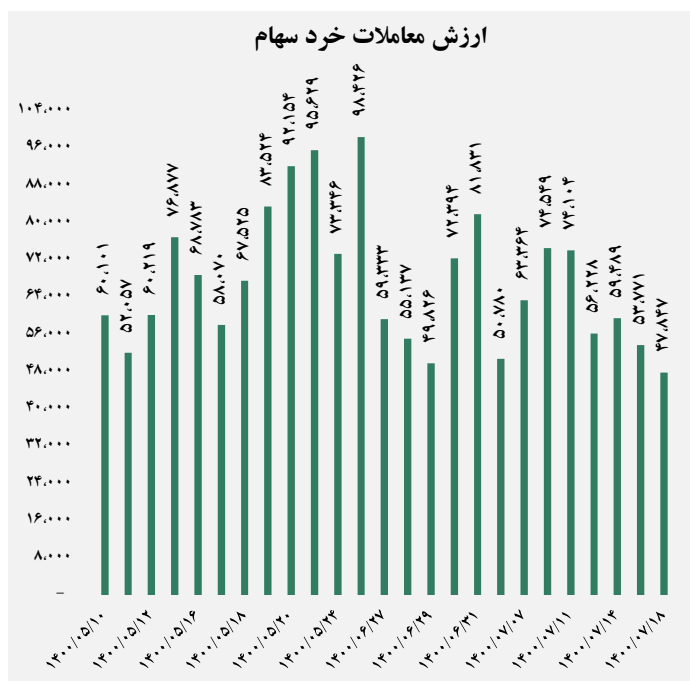




ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

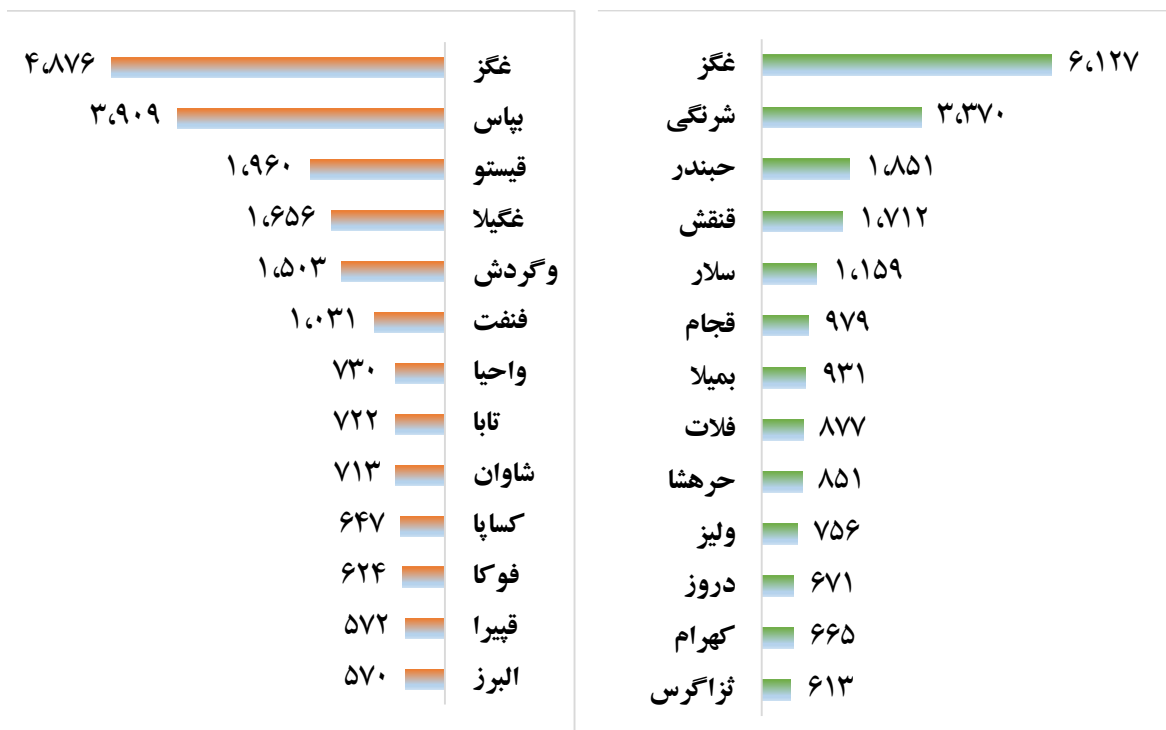


ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





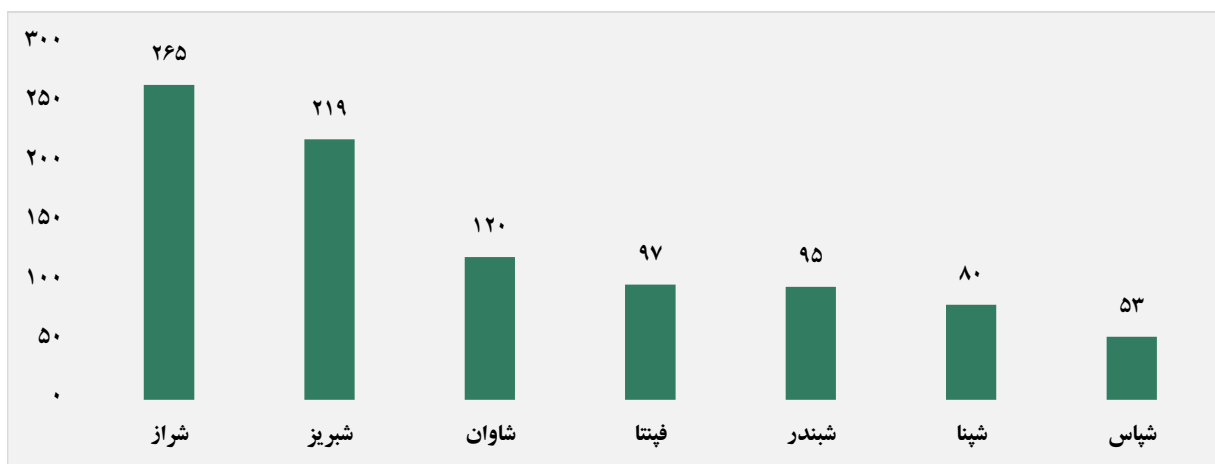
بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



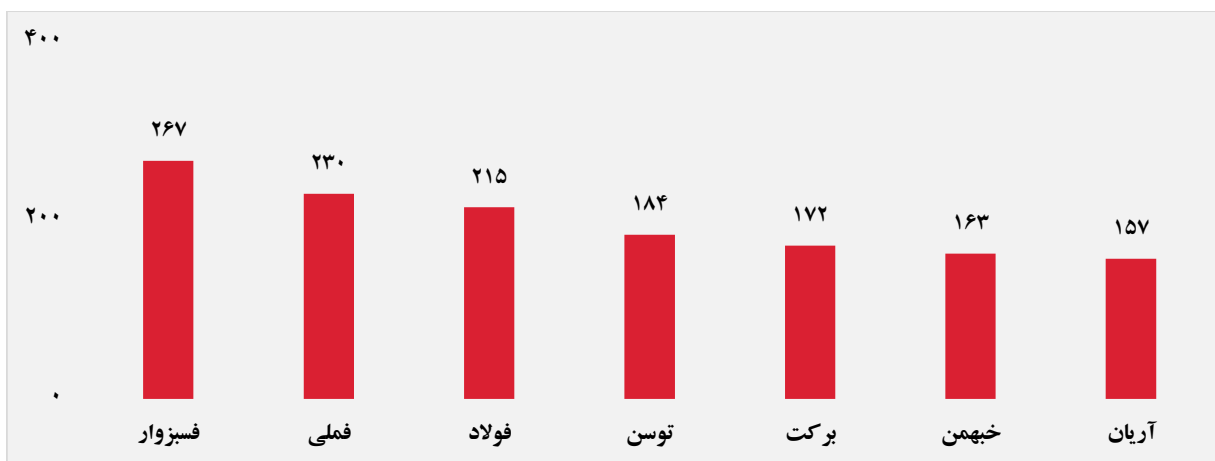
پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	فپنتا	۱	کدما
۲	کاسپین	۲	مفاخر
۳	تپکو	۳	کالا
۴	-	۴	قمرو
۵	-	۵	شوینده
۶	-	۶	زفکا
۷	-	۷	شپلی
۸	-	۸	بخاور
۹	-	۹	البرز
۱۰	-	۱۰	سجام

سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



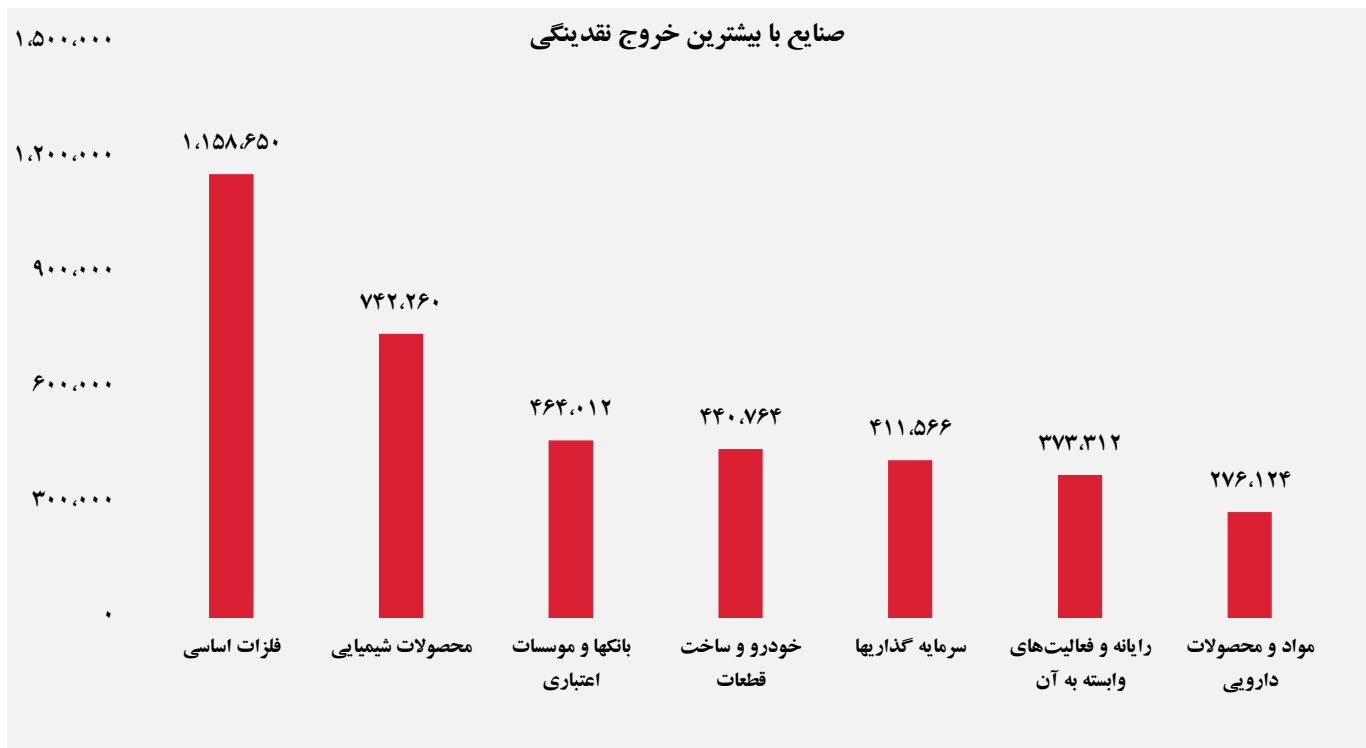
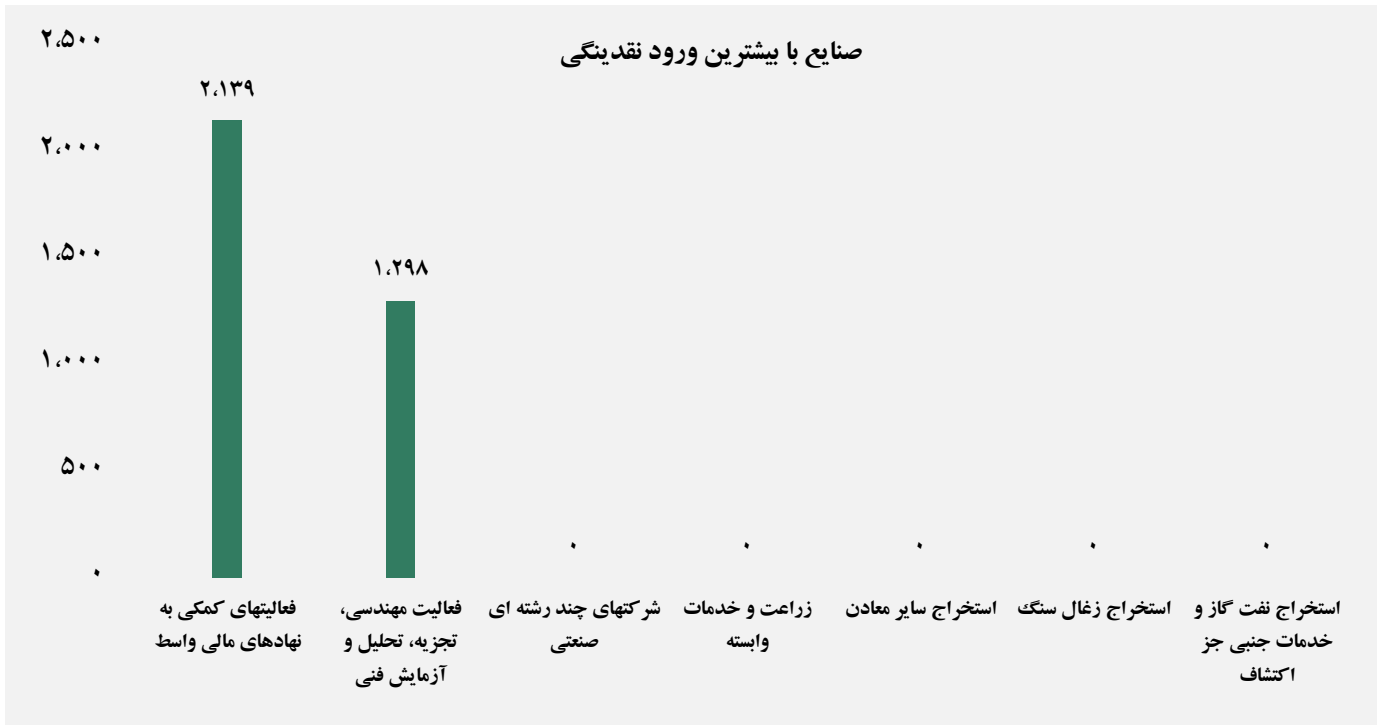
سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	شاون	۱۰	کالا
۲	خنصیر	۱۱	ثور
۳	شراز	۱۲	فسبزوار
۴	توسن	۱۳	کیمیاتک
۵	برکت	۱۴	فزرین
۶	ثفارس	۱۵	سپید
۷	خراسان	۱۶	فراپورس
۸	شغدیر	۱۷	خمتور

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار