



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۷/۱۹

[www.sfg.ir](http://www.sfg.ir) - [info@sfg.i](mailto:info@sfg.i)



## تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۹ مهر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شپدیس، فملی، فخوز، نوری، وغدیر و پارسان با افزایش ۱,۸۶۹ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۵۷,۴۸۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۶۰۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۴۷ 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 ۷ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است.

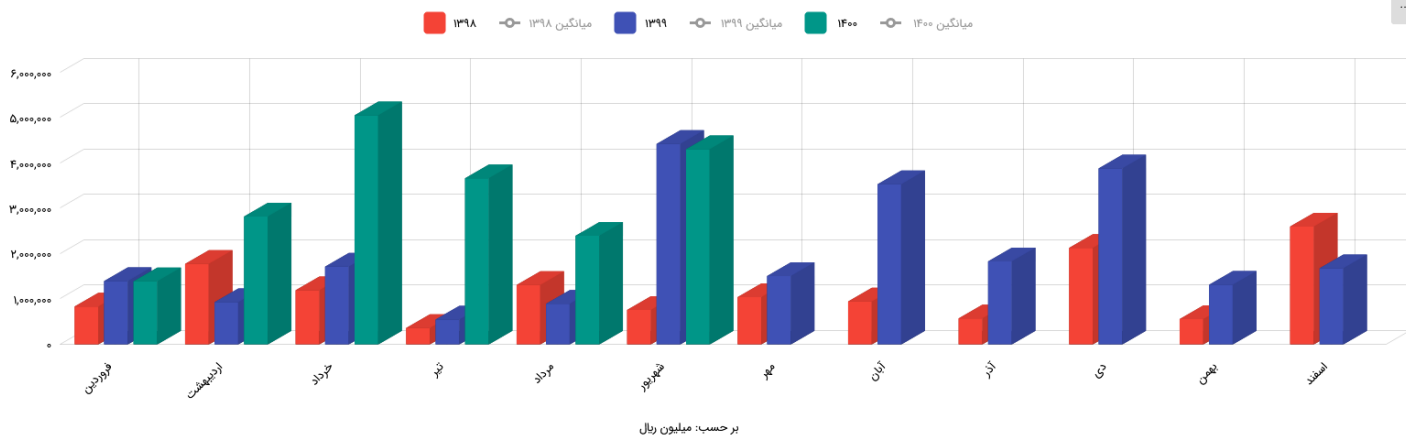
بررسی بازارهای جهانی حکایت از آن دارد که در اغلب محصولات به‌ویژه در حوزه صنایع پتروشیمی، پالایشی، معدنی، فلزی و محصولات شیمیایی قیمت‌ها مطلوب ارزیابی می‌شوند. از طرفی هلدینگ‌های این صنایع نیز در وضعیت بنیادی معقولی به سر می‌برند. حال به فصل مجامع شرکت‌های سرمایه‌گذاری و هلدینگ‌های همین صنایع نزدیک هستیم. به نظر می‌رسد روند کاهشی با توجه به وضعیت بنیادی شرکت‌ها و گزارش‌های ۶ ماهه مطلوبی که در انتظار بازار است، ادامه‌دار نخواهد بود و در روزهای آینده شاهد افزایش در سمت تقاضا بر روی تابلوی معاملاتی بورس و فرابورس خواهیم بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۶۴,۷۲۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۸۶۴ 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 ۲۷,۶٪ سود است.

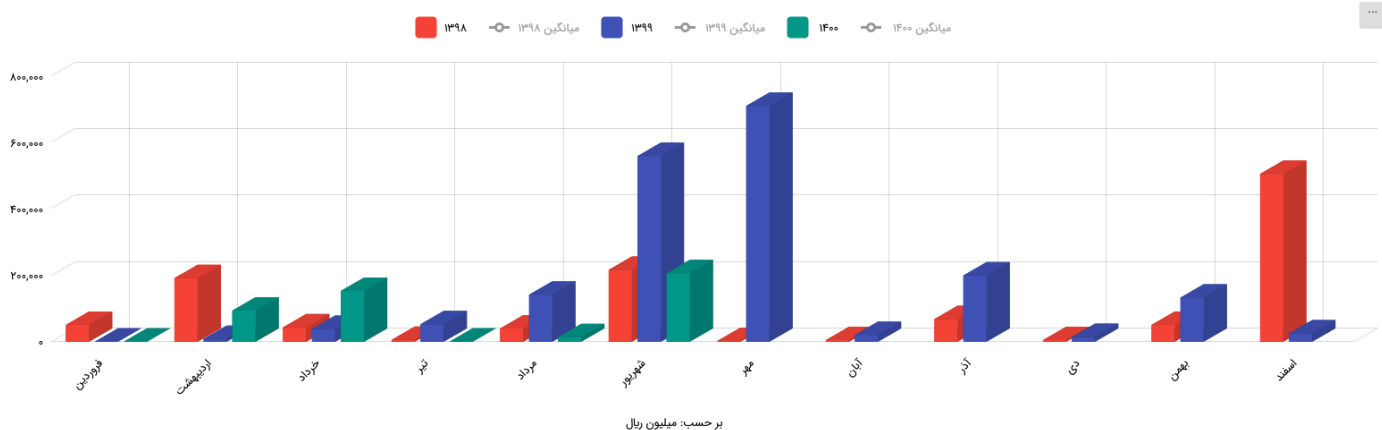
درصد تغییر	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	۱۴۰۰/۰۷/۱۸	شرح
۱۹۱٪	۲۶۴,۷۲۳	۹۰,۹۷۰	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)



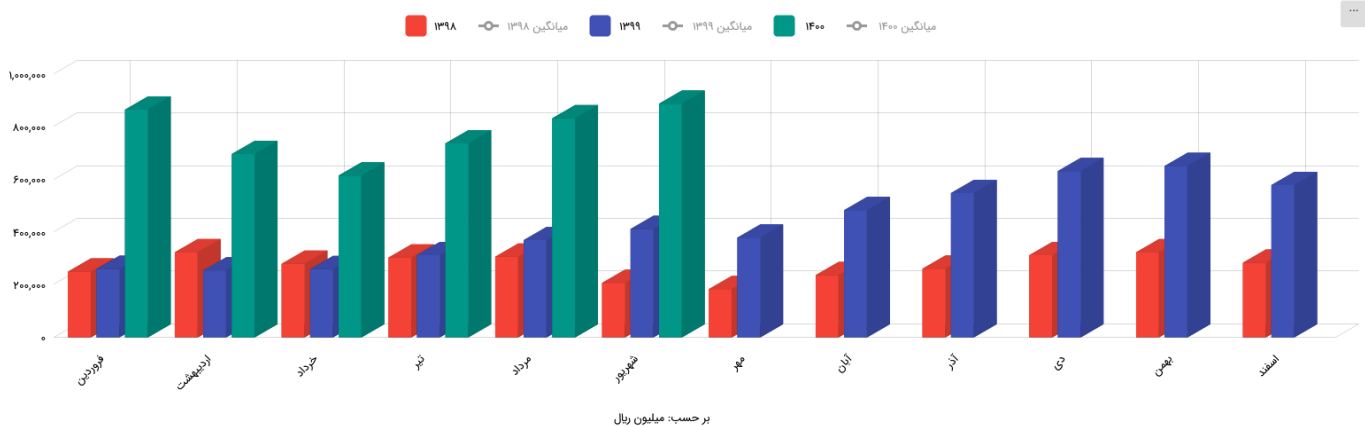
● عملکرد مبلغ فروش ماهانه پتروشیمی کرمانشاه (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



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

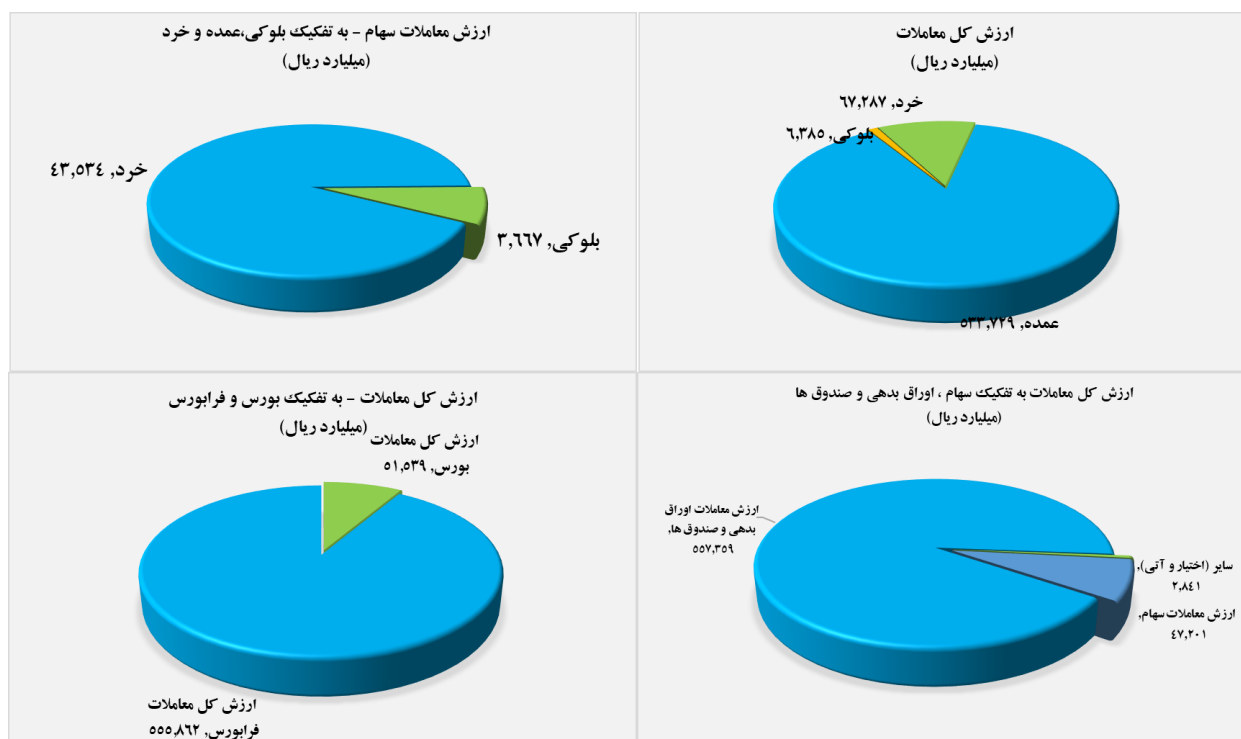


● عملکرد مبلغ فروش ماهانه شرکت صنعتی دوده فام (در ۶ ماه اخیر و مدت مشابه در سال‌های ۱۳۹۸ و ۱۳۹۹)



## تصویر کلی بازار

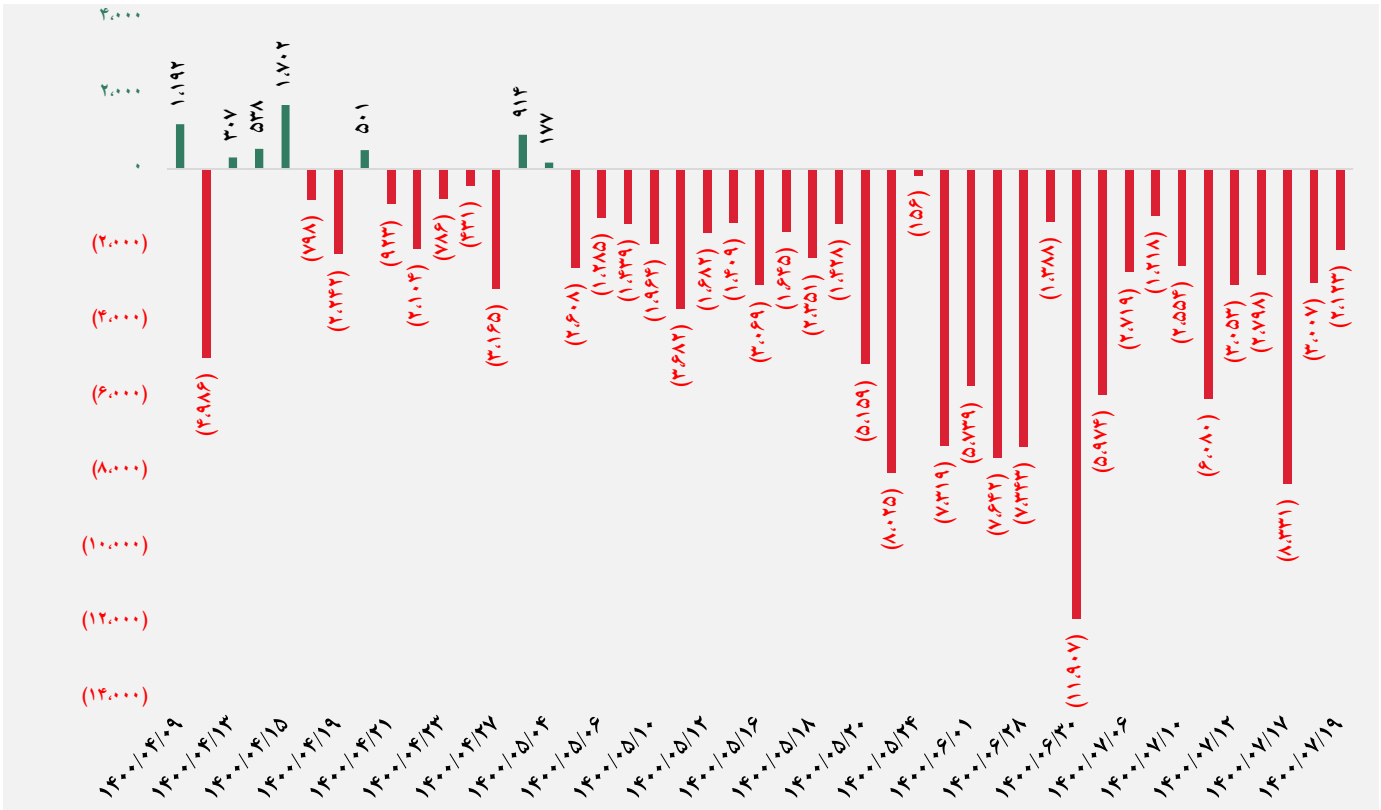
فرا بورس		بورس	
۲۰,۸۳۴	شاخص کل	۱,۴۵۷,۴۸۰	شاخص کل
۵۱	تغییر شاخص	۱,۸۶۹	تغییر شاخص
۱۵,۳۳۸,۶۹۴	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۸,۵۶۶,۰۰۲	ارزش بازار (میلیارد ریال)
۵۵۵,۸۶۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۱,۵۳۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
زاگرس		شپدیس	
آریا		فملی	
شاون		فخوز	
هرمز		نوری	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
غصینو		فارس	
فرا بورس		شبندر	
سمگا		شپنا	
ذوب		اخبار	



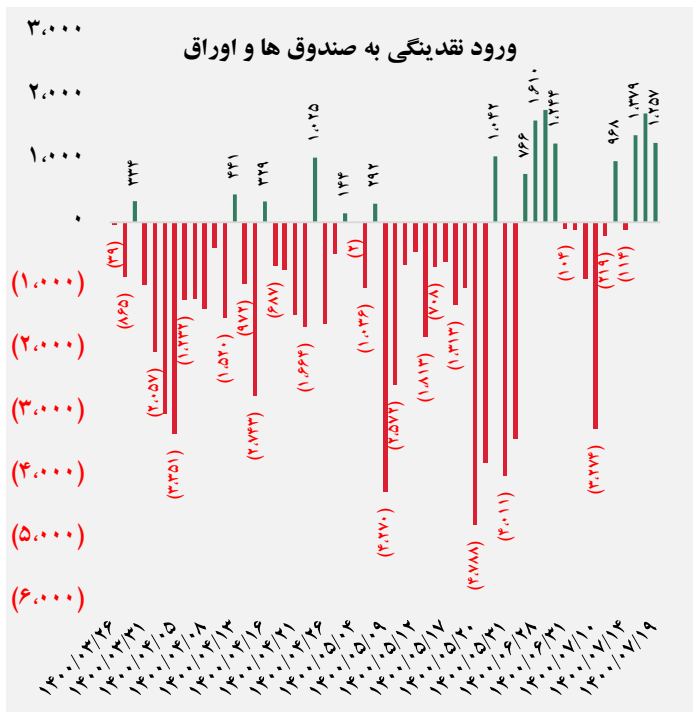
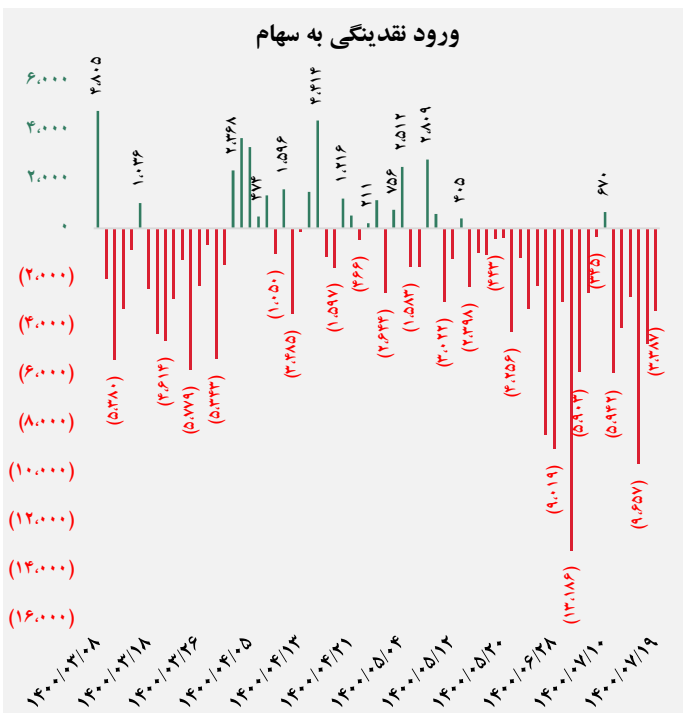




## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



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

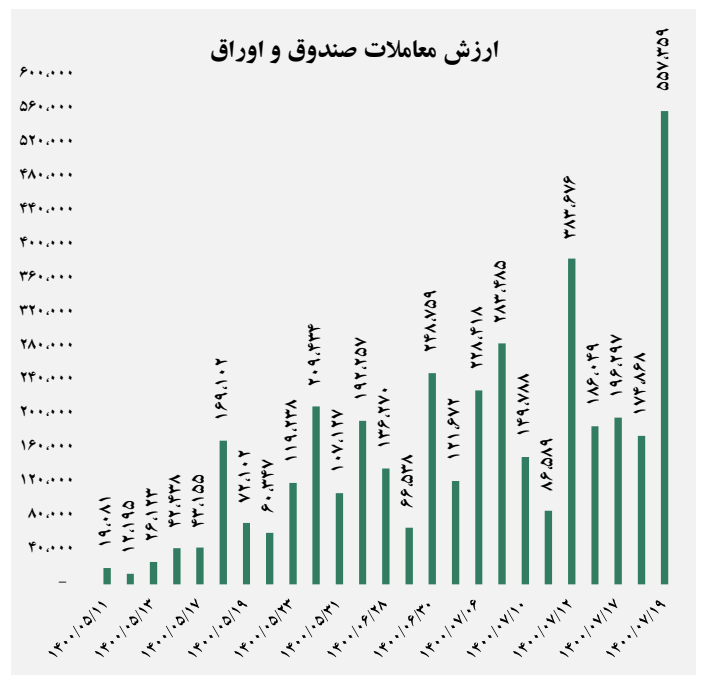
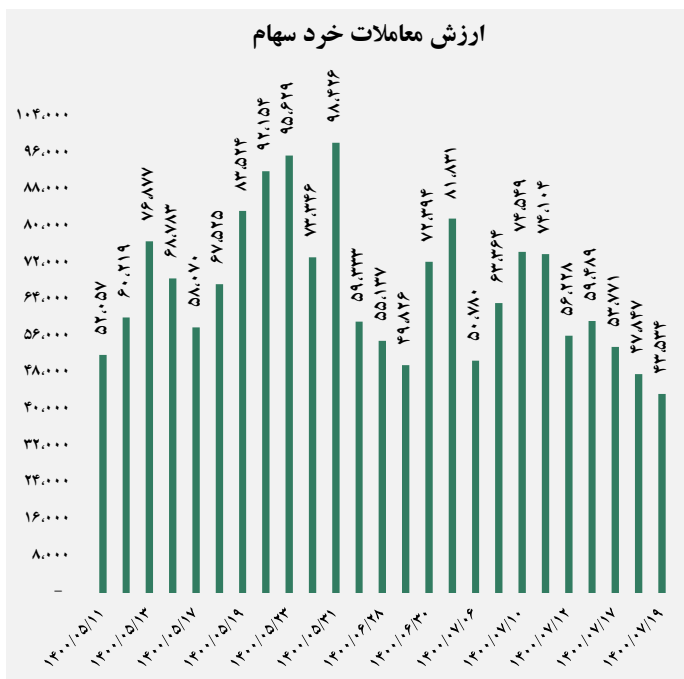




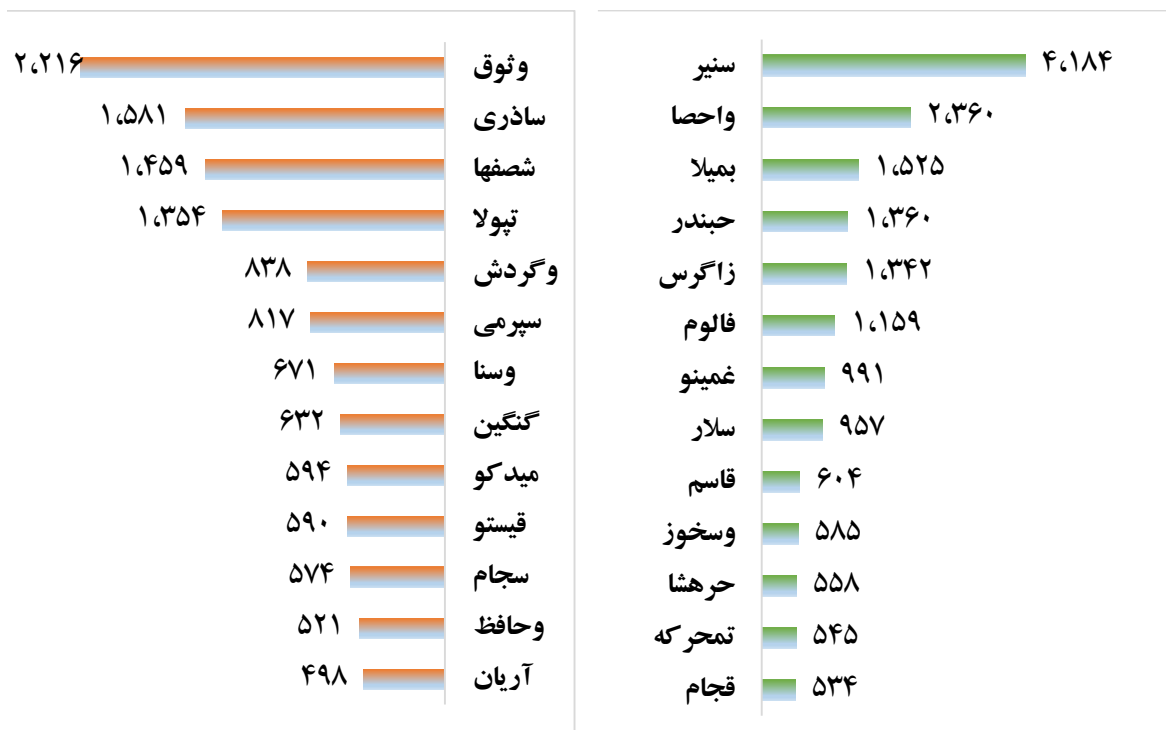
## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)



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



## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

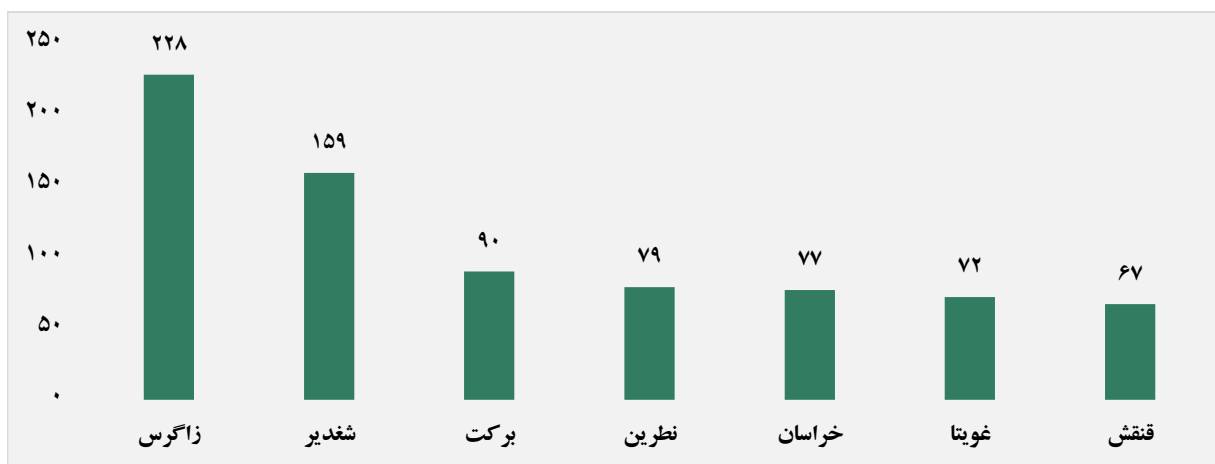


## پول هوشمند

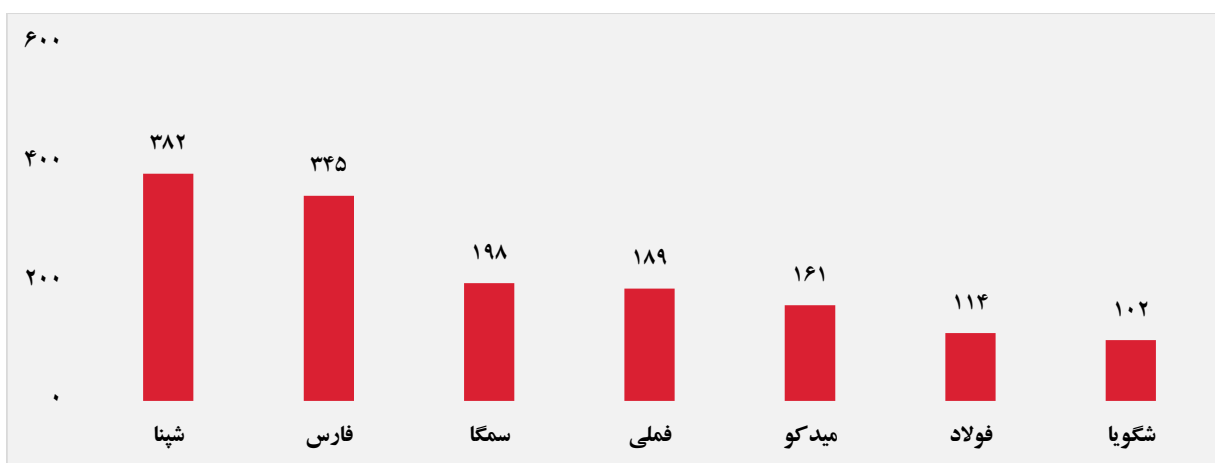
ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	غگیلا	۱	بخاور
۲	شرنگی	۲	سجام
۳	تمحرکه	۳	لکما
۴	-	۴	قیستو
۵	-	۵	بالاس
۶	-	۶	لوتوس
۷	-	۷	فینتا
۸	-	۸	دکوثر
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



### سهام با بیشترین ورود نقدینگی (میلیارد ریال)



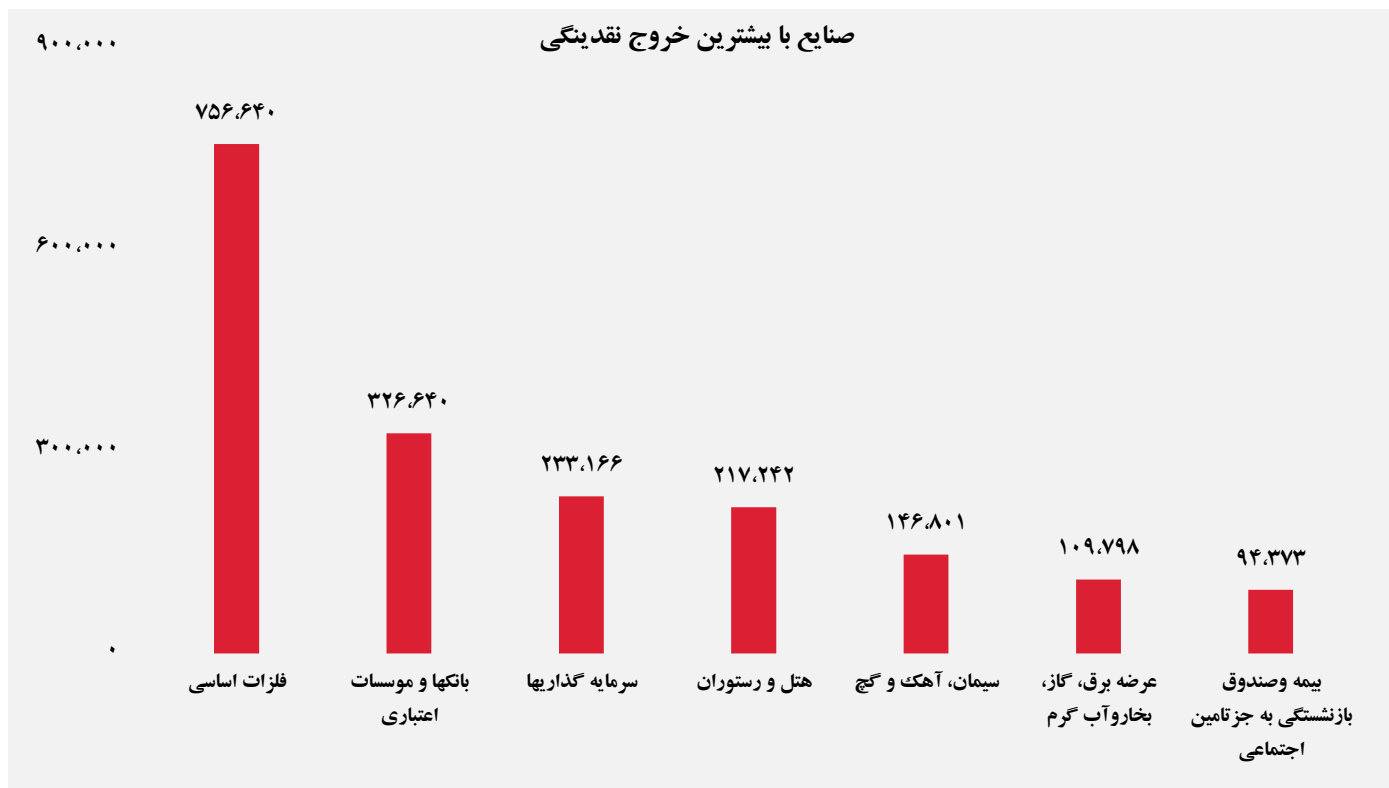
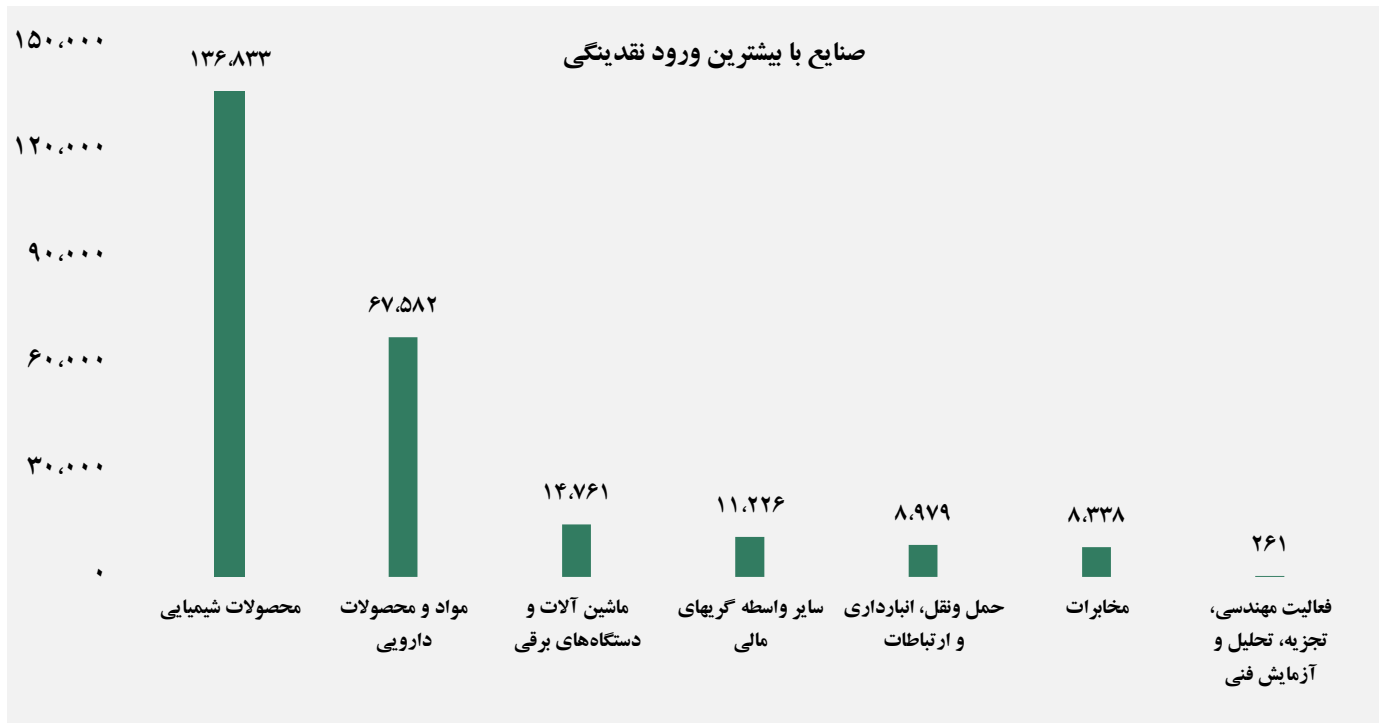
### سهام با بیشترین خروج نقدینگی (میلیارد ریال)



### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	شاوان	۱۰	خصیر
۲	شغدیر	۱۱	کیمیاتک
۳	خموتور	۱۲	فراپورس
۴	برکت	۱۳	خراسان
۵	زاگرس	۱۴	فسبزواری
۶	شراز	۱۵	دسانکو
۷	کالا	۱۶	سپید
۸	تفارس	۱۷	فزرین

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



گروه مالی شهر گزارش روزانه تحلیل بازار