



**گروه مالی شهر**  
SHAHR FINANCIAL GROUP

# گزارش روزانه تحلیل بازار

معاونت سرمایه گذاری و توسعه

۱۴۰۰/۰۷/۲۰

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



## تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۲۰ مهر ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، شستا، فولاد، فملی، کگل و شپنا با کاهش ۳۸,۷۷۲ واحدی همراه شد و به سطح ۱,۴۱۸,۷۲۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۵۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته کاهش داشته است. مبلغ ۵۸ 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 ۳۷ درصد از کل ارزش معاملات سهام مربوط به معاملات خرد بوده است. مهم‌ترین عامل پیش روی بازار، انتشار گزارش‌های شش ماهه شرکت‌ها است و انتظار گزارش‌های قابل توجه از شرکت‌های پتروشیمی، پالایشگاهی، سنگ آهنی و سیمانی در بازار وجود دارد. این گزارش‌ها اگر بهتر از پیش‌بینی‌ها باشند بازار واکنش بهتری خواهد داشت. در گروه پالایشگاهی به انتشار گزارش‌های شش ماهه و سه ماهه نزدیک شدیم و این عامل نیز جریان مثبتی را می‌تواند در بازار ایجاد می‌کند. همچنین اگر قیمت‌های جهانی کاهش‌ی باشند، روند بازار ریزشی خواهد ماند. اما بعید است افت قیمت در کامودیتی‌ها وجود داشته باشد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۵,۵۷۲ 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 ۷۲۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۸/۲۴ با ۲۳,۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	۱۴۰۰/۰۷/۲۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۶۴,۷۲۳	۴۵,۵۷۲	-۸۳٪



## عملکرد ماهانه

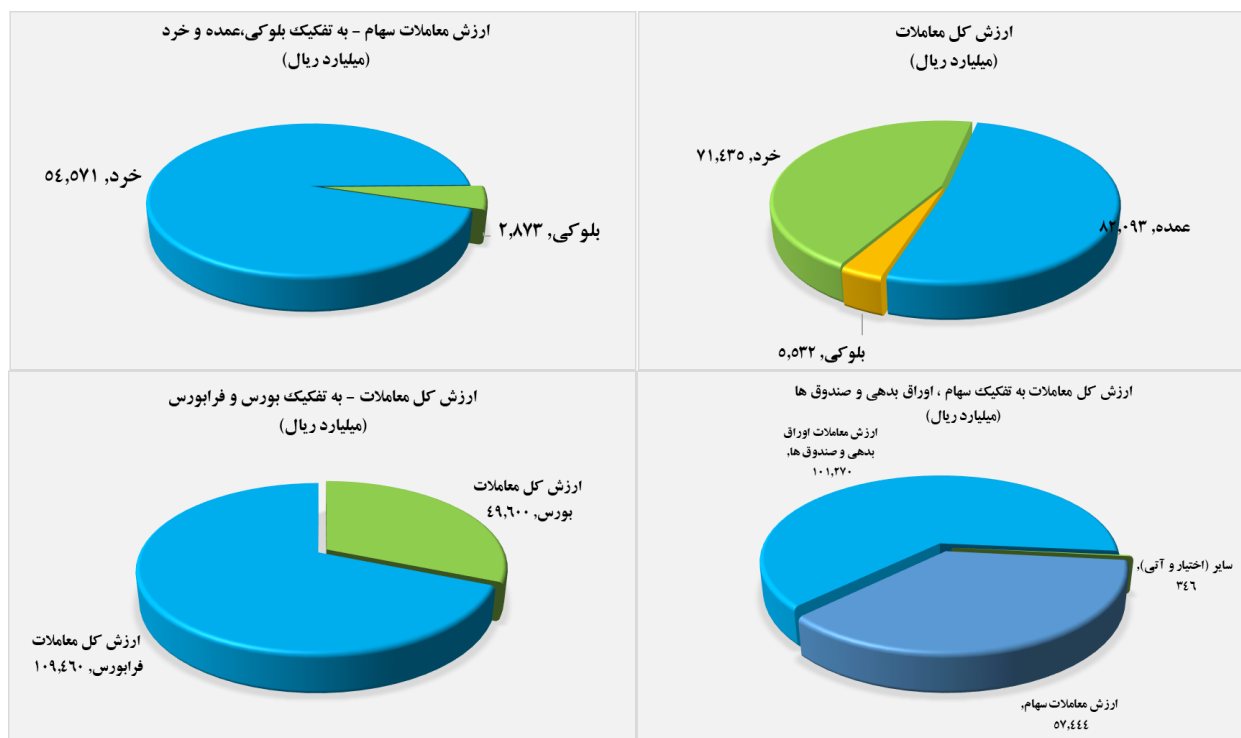
سال مالی شرکت گروه صنایع کاغذ پارس منتهی به آبان است. این شرکت در سال مالی ۹۹ به طور متوسط هر ماه ۴،۹۳۲ تن تولید داشته است. شرکت در شهریورماه ۵،۰۸۴ تن و در نه ماه گذشته به طور متوسط ۵،۱۵۹ تن تولید داشته است. این تولیدکننده محصولات کاغذی در شهریور ۵،۴۳۹ تن و در ۹ ماه گذشته به طور متوسط ۵،۲۲۴ تن فروش ثبت کرده است. متوسط فروش در سال مالی قبل ۵،۰۸۷ تن ثبت شده است. شرکت سال مالی گذشته خود را با متوسط فروش ۴۳ میلیارد تومان به پایان رساند. شهریور ماه فروش ۸۹ میلیارد تومان و متوسط فروش آذر تا مرداد ۸۱ میلیارد تومان گزارش شده است. نرخ فروش کاغذ در شهریور ۲۱۹،۰۲۲ ریال به ازای هر کیلو و متوسط نرخ آذر تا مرداد ۱۷۴،۹۵۷ ریال به ازای هر کیلو بوده است. متوسط نرخ فروش ۱۲ ماه سال قبل ۱۰۶،۷۱۳ ریال به ازای هر کیلو گزارش شده است.

شرکت پتروشیمی تندگویان در ۵ ماه ابتدایی سال به طور متوسط ۴۳،۴ هزار تن PTA به عنوان محصول ابتدای زنجیره تولید کرده است. این میانگین در سال گذشته ۴۴،۳ هزار تن بوده و تولید در شهریور ۴۶،۲ هزار تن ثبت شد. متوسط فروش ماهانه امسال تا مرداد ۴۷ هزار تن بوده و در شهریور یک رقم خوب از خود بر جای گذاشت و ۵۷ هزار تن محصول فروخت. سهم در شهریور ۱۶۰۲ میلیارد تومان فروش داشت و رکورد جدید فروش ماهانه از خود بر جای گذاشت. رکورد قبلی در فروردین امسال با ۱۵۷۴ میلیارد رقم خورده بود. میانگین درآمد ماهانه امسال ۱۲۷۱ میلیارد تومان بود که با احتساب شهریور به ۱۳۲۶ میلیارد تومان ارتقا یافته است. نرخ فروش محصولات در شهریور ۲۸ هزار تومان به ازای هر کیلو گرم محصول ثبت شده و ۶ درصد رشد ماهانه را نشان می دهد. شرکت نرخ ماهانه ۲۹ هزار تومانی را در اردیبهشت ثبت کرده و بعد از آن نتوانسته به آن رقم برسد.



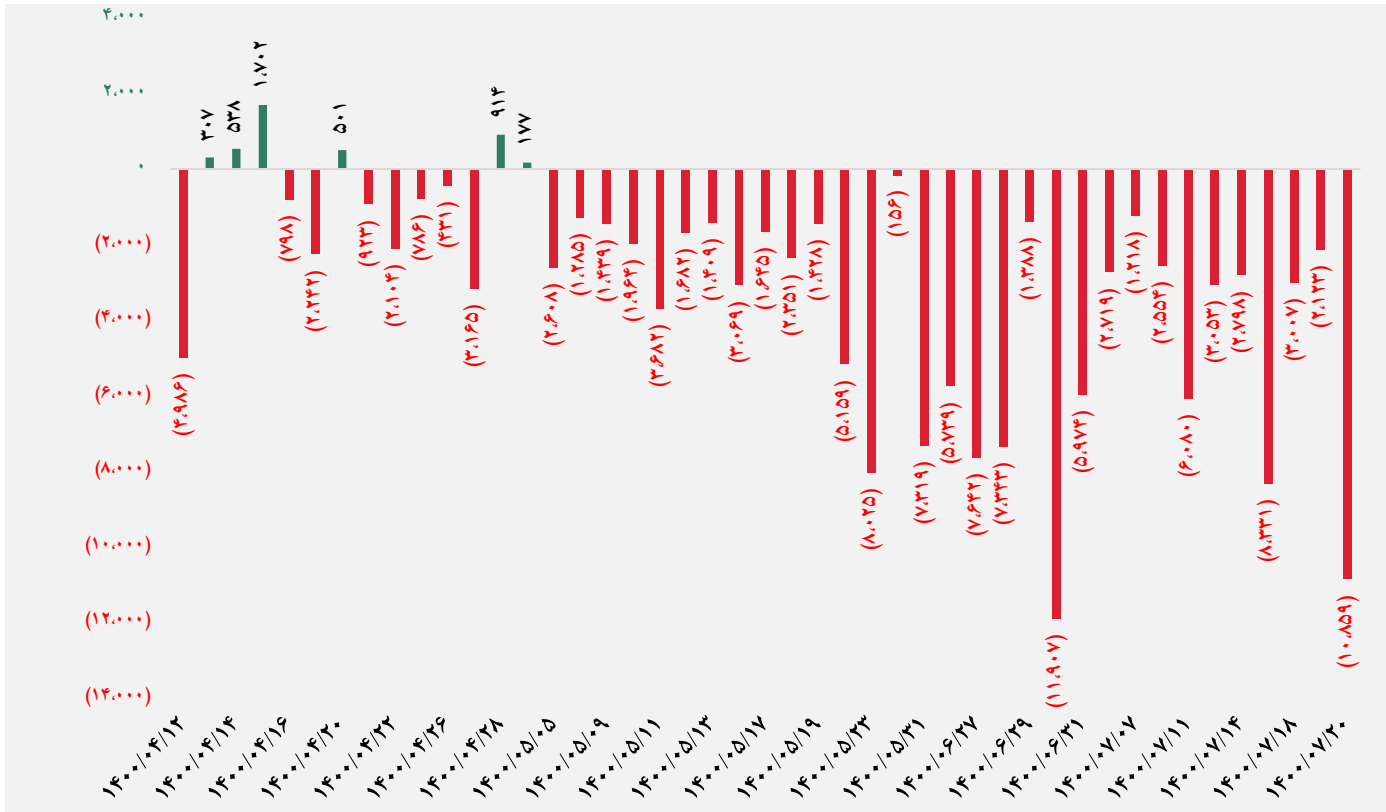
## تصویر کلی بازار

بورس		فرا بورس	
شاخص کل	۱,۴۱۸,۷۲۱	شاخص کل	۲۰,۴۸۴
تغییر شاخص	(۳۸,۷۷۲)	تغییر شاخص	(۳۵۰)
ارزش بازار (میلیارد ریال)	۵۷,۰۰۴,۲۰۳	ارزش بازار (میلیارد ریال)	۱۱,۴۳۷,۹۵۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۹,۶۰۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۰۹,۴۶۰
بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	
فایرا		زاگرس	
چکاپا		فجهان	
خنصیر		شکام	
دروز		بساما	
بیشترین تاثیر منفی در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص	
فارس		آریا	
شستا		صبا	
فولاد		شگویا	
فملی		ذوب	

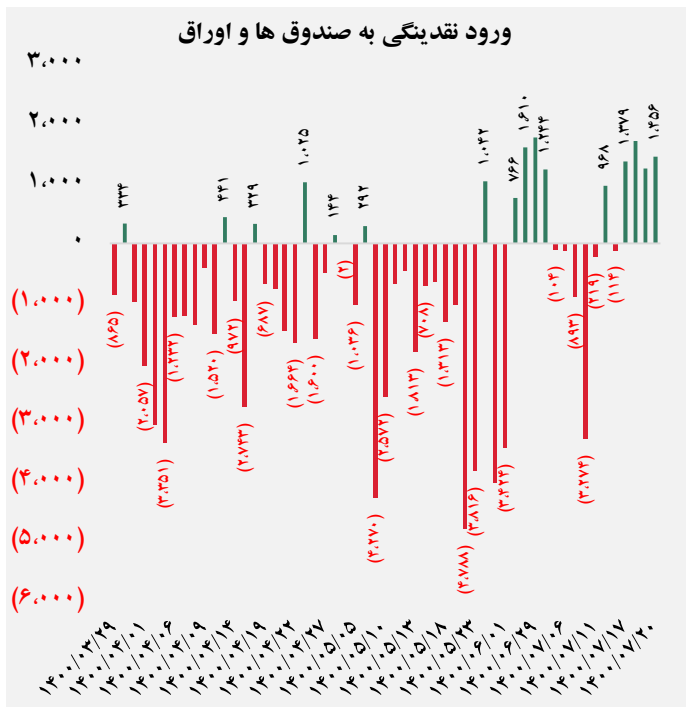
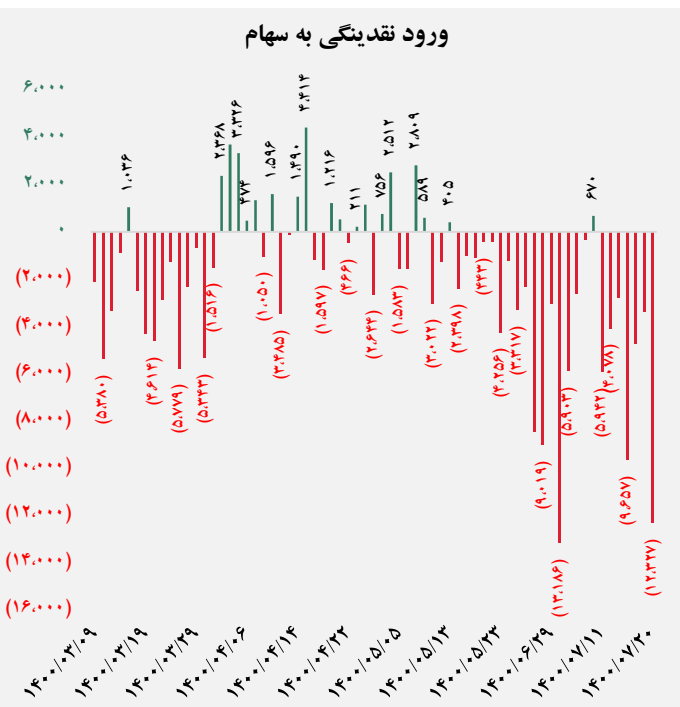




## کل ورود نقدینگی حقیقی ها (خروج) (میلیارد ریال)

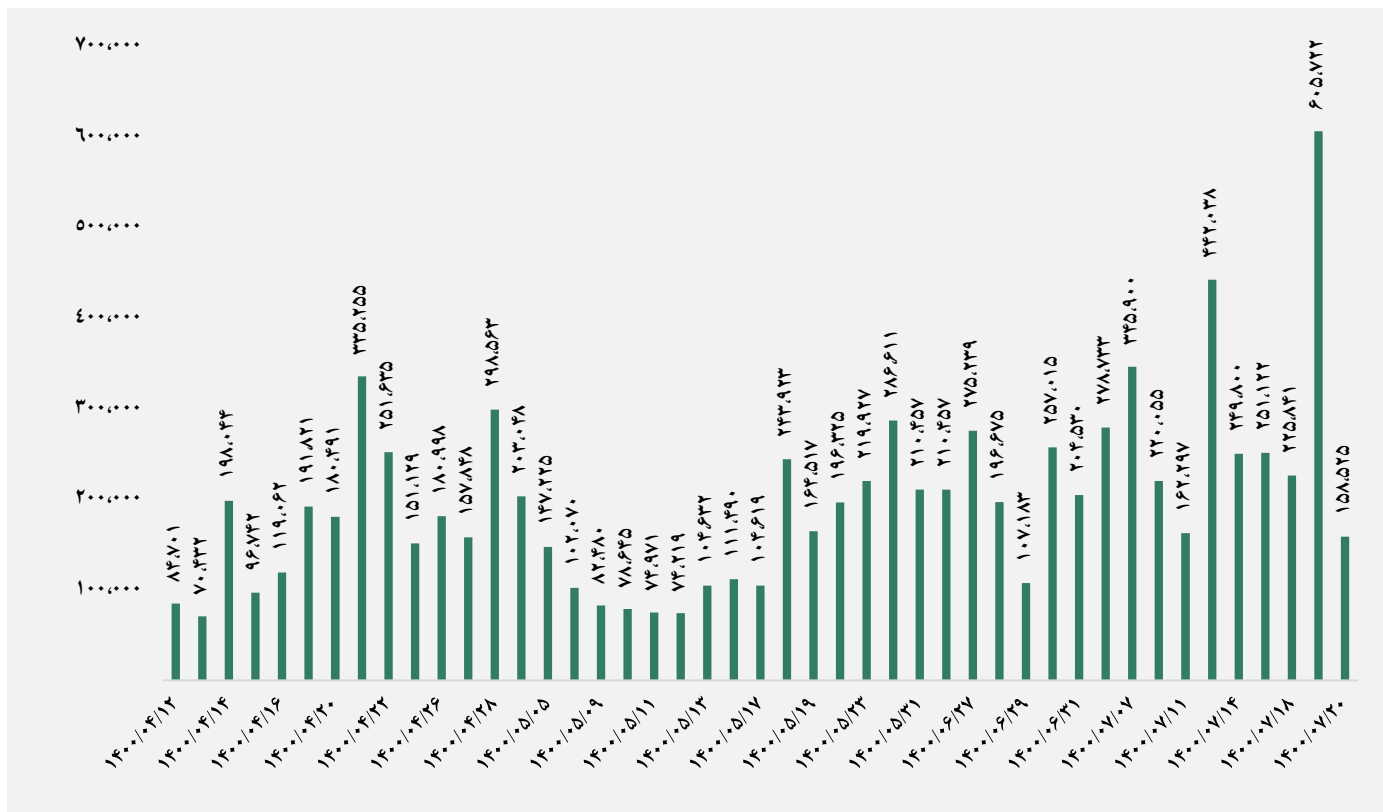


## ورود نقدینگی حقیقی ها به تفکیک سهام و اوراق (میلیارد ریال)

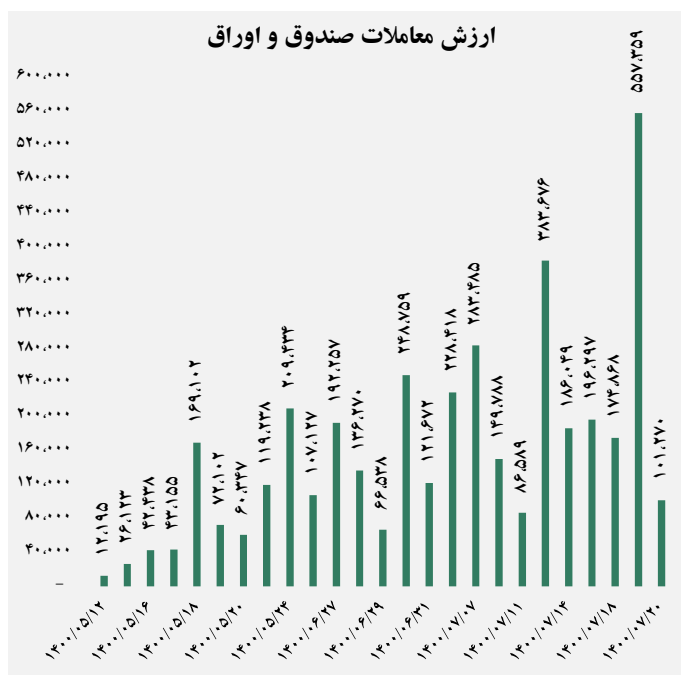
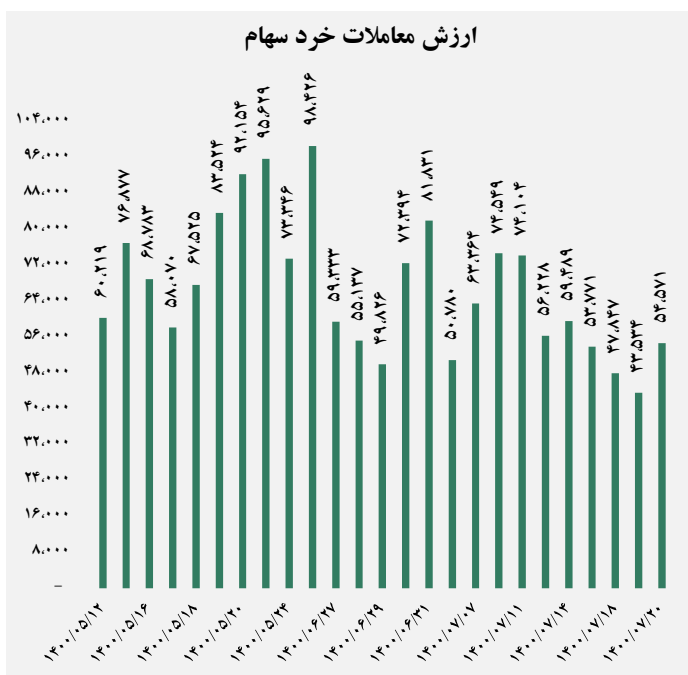




## ارزش معاملات کل (میلیارد ریال)

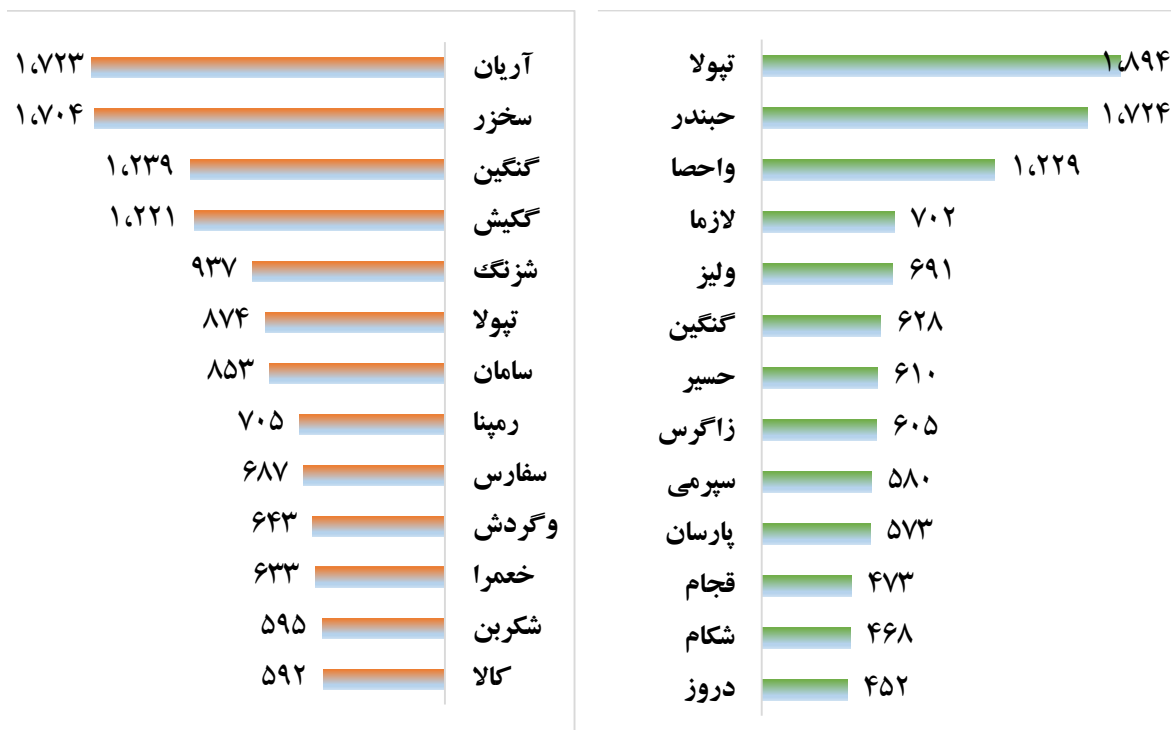


## ارزش معاملات به تفکیک معاملات خرد و صندوق ها (میلیارد ریال)





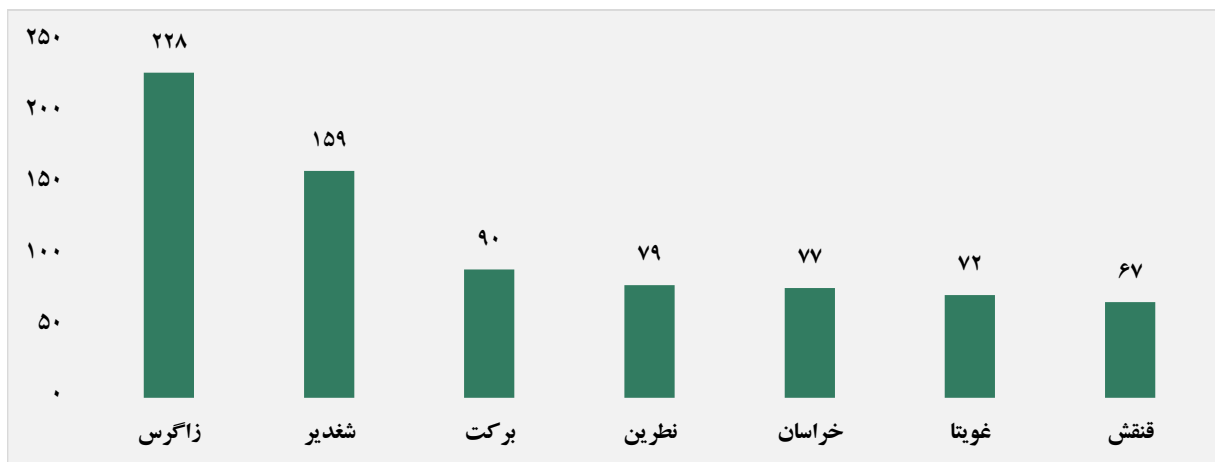
## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



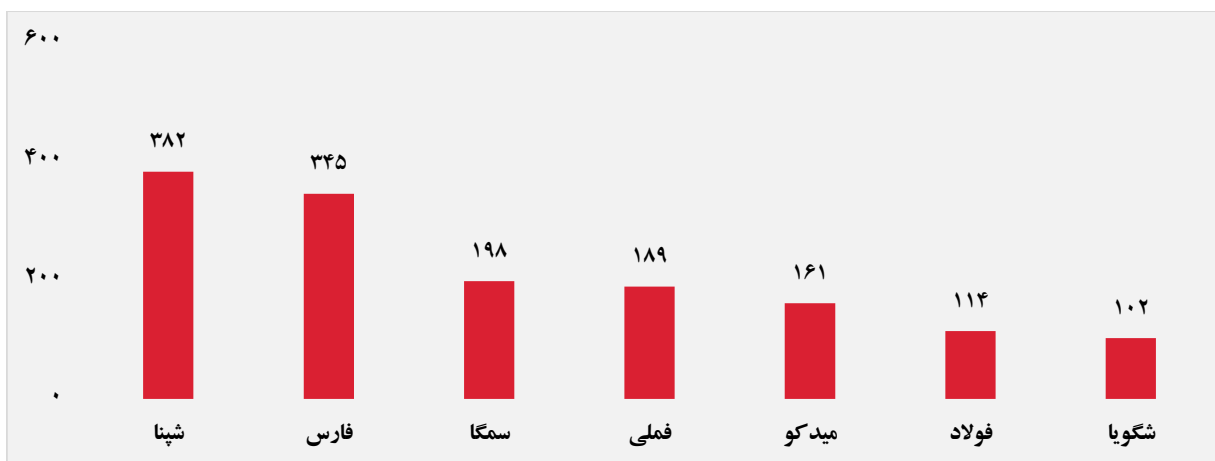
## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شکام	۱	آریان
۲	چکاپا	۲	وسپه
۳	کرمانشاه	۳	کالا
۴	حگردش	۴	سنیر
۵	توسن	۵	ولبهن
۶	سلار	۶	سبجنو
۷	-	۷	وگستر
۸	-	۸	سیستم
۹	-	۹	خچرخش
۱۰	-	۱۰	غشو کو

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



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



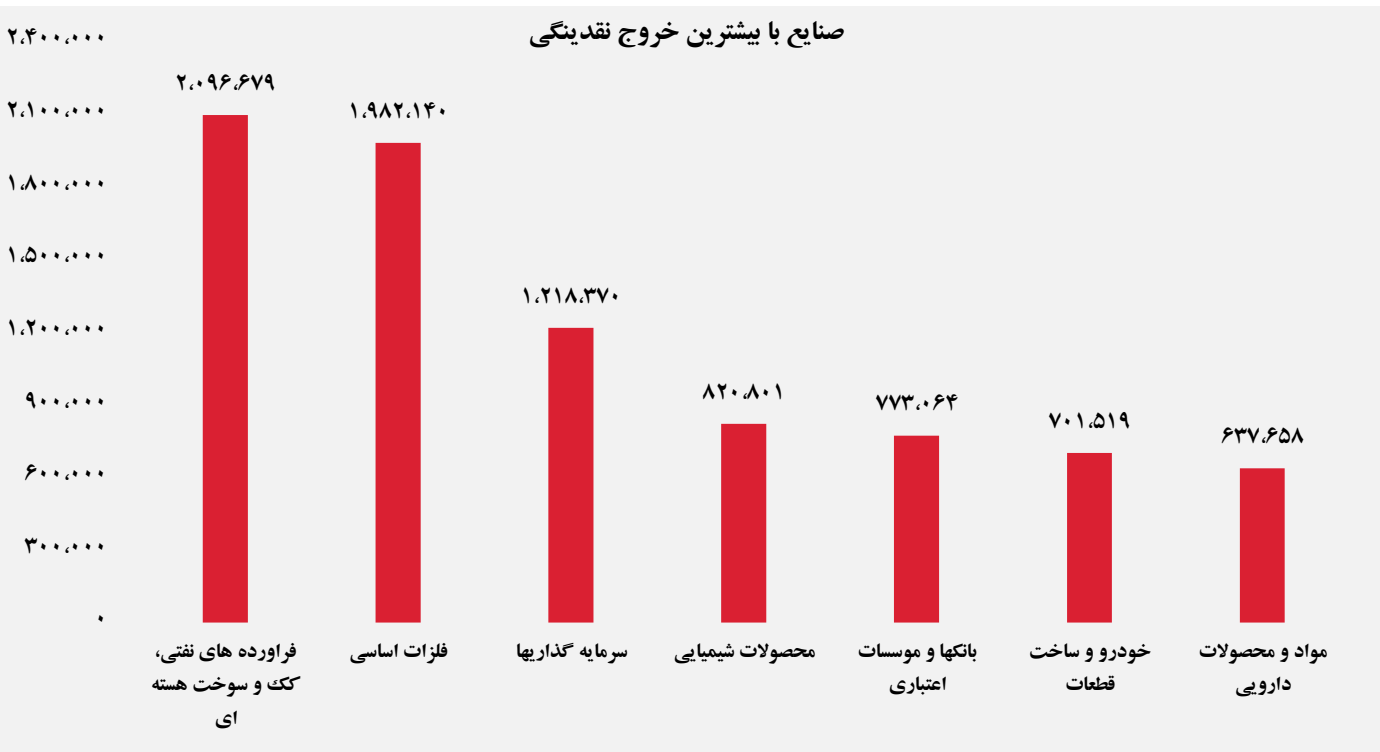
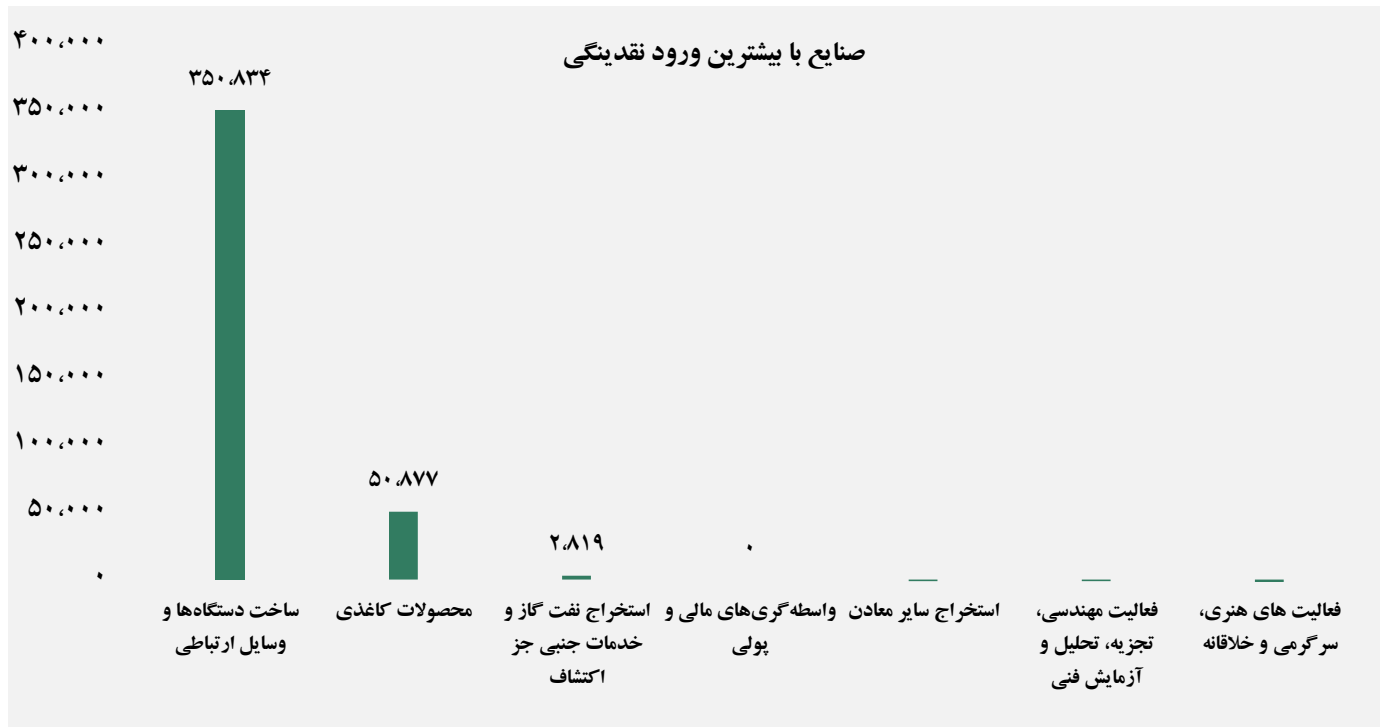
### واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	زاگرس	۱۰	برکت
۲	شاوان	۱۱	سپید
۳	خنصیر	۱۲	کیمیاتک
۴	شغدیر	۱۳	مدیریت
۵	شراز	۱۴	ثنور
۶	غمینو	۱۵	کالا
۷	فسیزوار	۱۶	خراسان
۸	توسن	۱۷	دسانکو





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



گزارش روزانه تحلیل بازار گروه مالی شهر