



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۰ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، شستا، فارس، کگل، فملی، کچاد و وبملت با کاهش ۸,۶۰۲ واحد همراه شد و به سطح ۱,۱۸۵,۴۰۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با تغییر محسوسی همراه نبوده است. در روز جاری در بازار بورس و فرابورس تهران، همانند روزهای گذشته، فشار عرضه بیشتر از تقاضا بود و حجم معاملات نیز همانند روز گذشته به شدت کاهش پیدا کرده است.

شاخص کل از نظر تکنیکالی در حال تکمیل موج نزولی خود می‌باشد که از ۱,۲۶۸,۰۰۰ واحد شروع شده است و می‌تواند به کمتر از ۱ میلیون واحد نیز برسد. با توجه به محدودیت بیشتر دامنه نوسان در سمت فروش، اصلاح شاخص به صورت فرسایشی شده است و انتظار می‌رود تا سه الی چهار ماه آینده وضعیت بازار به حالت طبیعی برنگردد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۶۴,۳۱۹ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوس ۴۷ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۴۹۴ 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 اخزا۷۱۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۰۷ با ۲۲,۴۵٪ سود است.

| شرح   | ۱۳۹۹/۱۲/۰۹ | ۱۳۹۹/۱۲/۱۰ | درصد تغییر |
|---|------------|------------|------------|
| ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال) | ۴۳,۶۱۶     | ۶۴,۳۱۹     | ۴۷٪        |



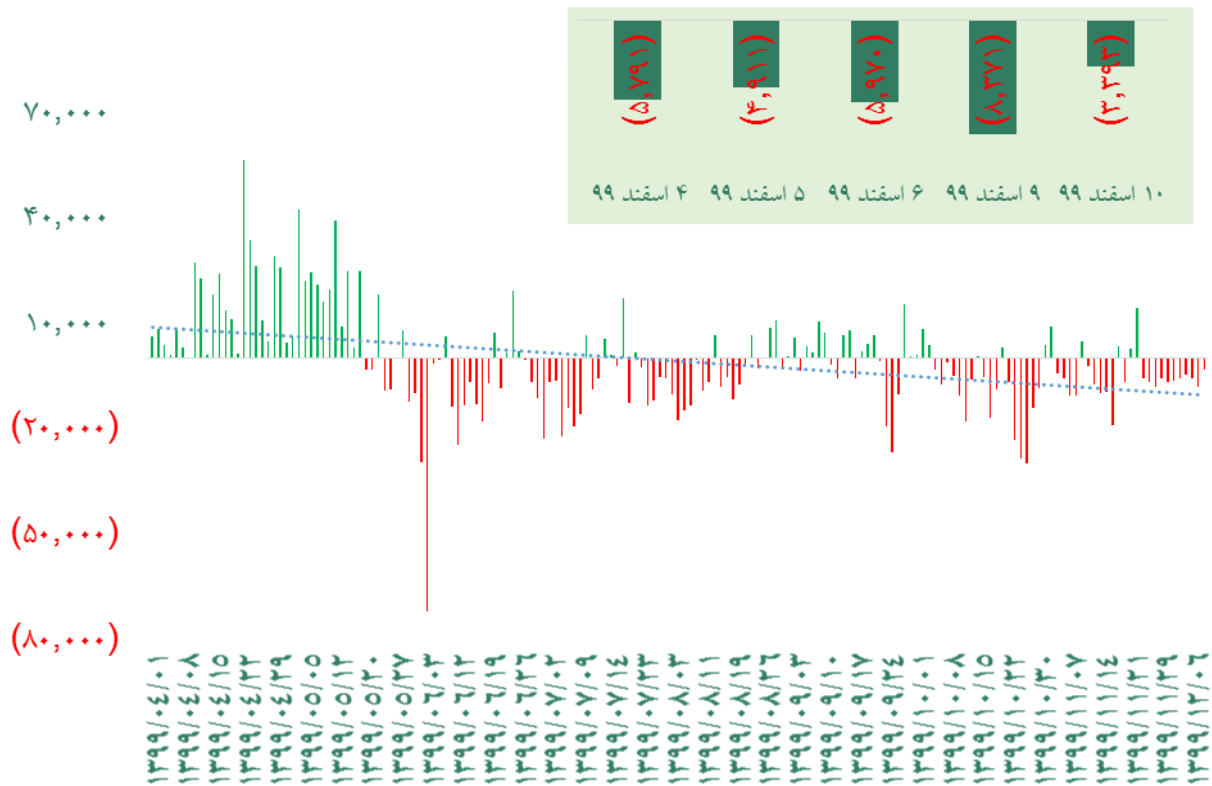
## گروه‌های مؤثر

در گروه فرآورده‌های نفتی، تولید محصول روانکار در شرکت نفت بهران در سال جاری به طور میانگین ماهانه ۳۶,۵ هزار متر مکعب بوده است. در دی ماه میزان تولید ۳۸ هزار متر مکعب و در بهمن ماه ۳۹ هزار متر مکعب گزارش شده است. میانگین مقدار فروش ماهانه روانکار در سال جاری ۳۶ هزار متر مکعب است. پس از افت فروش در آبان با ۲۸,۳ هزار متر مکعب، پس از آن فروش رو به افزایش بود و در بهمن ماه رقم ۴۱ هزار متر مکعب فروش روانکار را گزارش کرده است. شرکت نفت بهران در بهمن ماه ۷۴۱۰ میلیارد ریال فروش داشته که این رقم از لحاظ فروش ماهانه آن شرکت تاکنون بی سابقه بوده است. در سال جاری میانگین درآمد ماهانه ۴۴۷۰ میلیارد ریال است و رقم فروش در مجموع ۱۱ ماه به ۵۲۱۶۰ میلیارد ریال رسید که ۲۹ درصد بالاتر از کل سال گذشته است. نرخ فروش روانکار داخلی در بهمن ماه ۲۰۷۵۳۰ ریال در هر لیتر است که متوسط ماهانه در سال جاری ۱۴۸۶۷۰ ریال در هر لیتر می‌باشد.

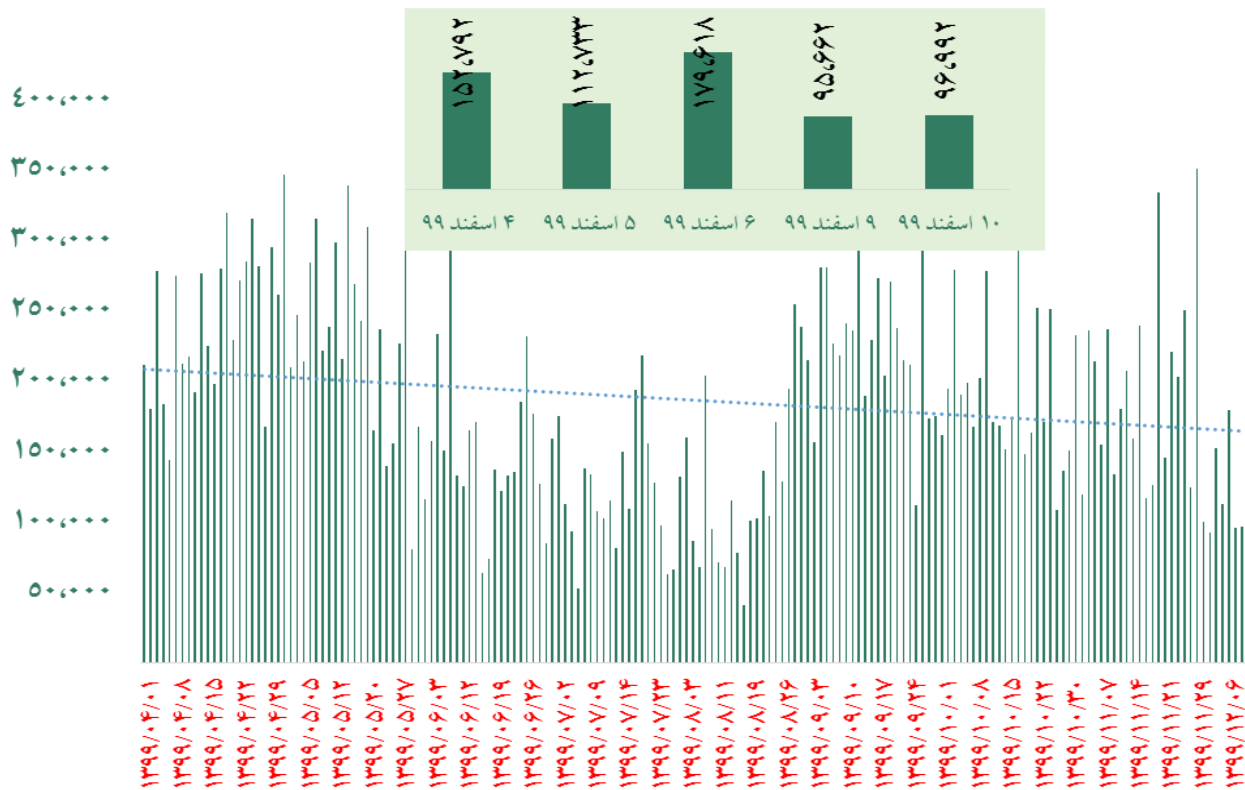
در گروه شیمیایی، شرکت پتروشیمی کرمانشاه، در دی و بهمن ماه به ترتیب ۱۲ هزار و ۵۲ هزار تن تولید کرده است. این شرکت که در سال جاری هر ماه به طور میانگین ۵۵ هزار تن فروش داشته، در دی ماه توانست فروش ۸۱ هزار تنی را داشته باشد و در بهمن ماه نیز فروش ۳۵ هزار تنی را ثبت کرده است. این اوره ساز در دی ماه ۳۸۹۰ میلیارد ریال و در بهمن ماه فروشی معادل ۱۳۲۰ میلیارد ریال را گزارش کرده است. نرخ فروش اوره کشاورزی در نیمه دوم سال با ۶۲ درصد رشد نسبت به نیمه اول برابر با ۳۶ هزار ریال در هر کیلو است. همچنین این شرکت در بهمن ماه فروش صادراتی نداشته است.

در گروه زغال سنگ، شرکت فرآوری زغال سنگ پرورده طبس در دی ماه ۲۲۵۶۱ تن و در بهمن ماه ۲۲۰۶۵ تن تولید را ثبت کرده است. مبلغ فروش این شرکت در دی ماه برابر با ۷۳۰ میلیارد ریال و در بهمن ماه نیز ۳۹۰ میلیارد ریال می‌باشد. شرکت در سال جاری بطور میانگین هر ماه فروش ۴۳۰ میلیارد ریالی را ثبت کرده و فروش ۱۱ ماهه خود را به ۴۷۲۰ میلیارد ریال افزایش داده است.

## ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

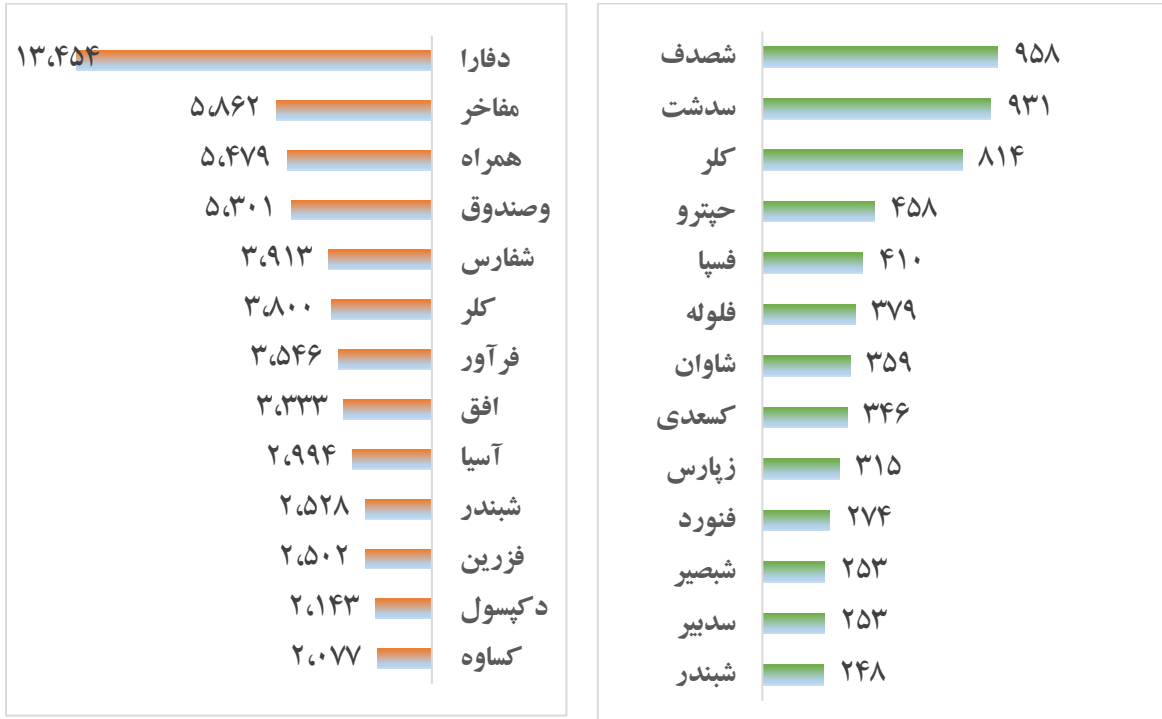


## روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





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

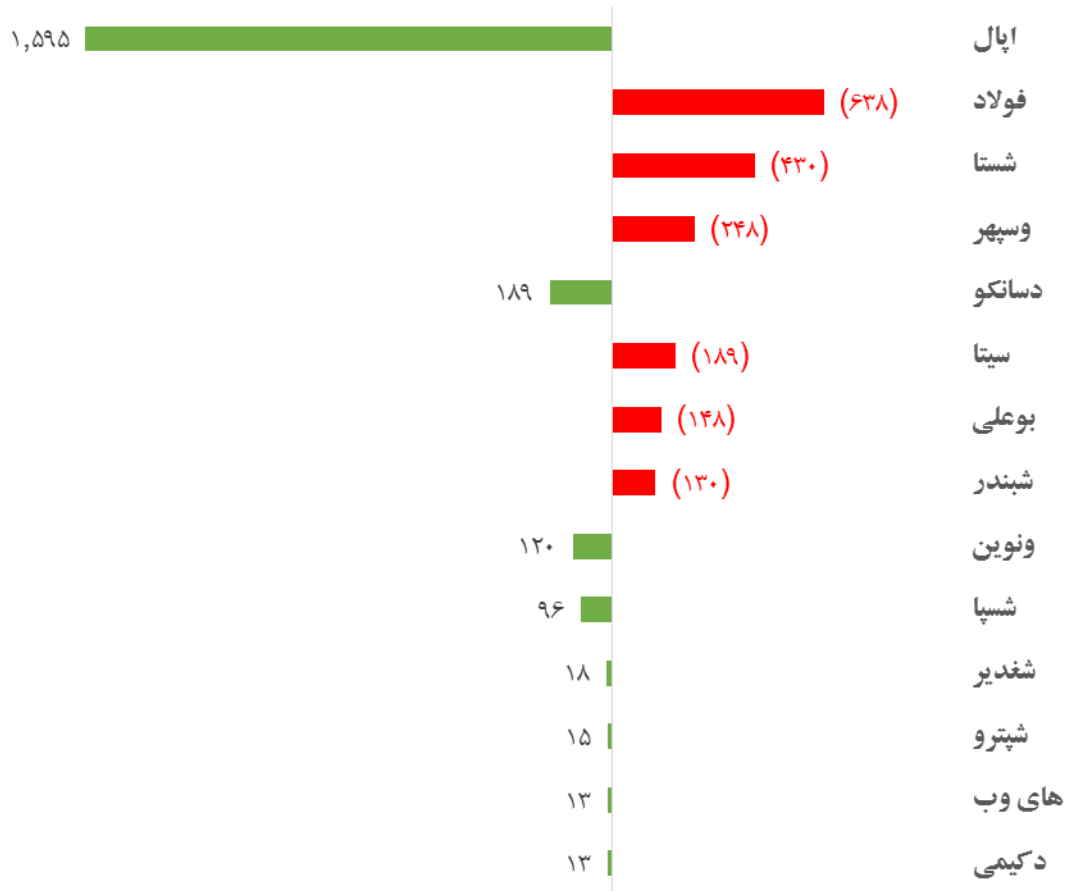


## پول هوشمند

| ردیف | ورود | ردیف | خروج   |
|------|------|------|--------|
| ۱    | اپال | ۱    | دلر    |
| ۲    | -    | ۲    | رتاپ   |
| ۳    | -    | ۳    | های وب |
| ۴    | -    | ۴    | ثامان  |
| ۵    | -    | ۵    | شسپا   |
| ۶    | -    | ۶    | کپشیر  |
| ۷    | -    | ۷    | -      |
| ۸    | -    | ۸    | -      |
| ۹    | -    | ۹    | -      |
| ۱۰   | -    | ۱۰   | -      |



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



## واچ لیست

| ردیف | نماد   | ردیف | نماد  |
|------|--------|------|-------|
| ۱    | کرمان  | ۱۱   | کرازی |
| ۲    | اپال   | ۱۲   | ششمال |
| ۳    | سصوفی  | ۱۳   | دلر   |
| ۴    | غپاک   | ۱۴   | شپترو |
| ۵    | شغدیر  | ۱۵   | سفارس |
| ۶    | گکوثر  | ۱۶   | فزرین |
| ۷    | شاوان  | ۱۷   | فوکا  |
| ۸    | بوعلی  | ۱۸   | زاگرس |
| ۹    | کزرغال | ۱۹   | وساخت |
| ۱۰   | شفا    | ۲۰   | غفارس |



## ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

| ردیف                    | صنعت                                       | مبلغ (میلیون ریال) |
|-------------------------|--|--------------------|
| ۱                       | استخراج کانه های فلزی                      | ۱,۲۸۵,۰۴۹          |
| ۲                       | مواد و محصولات دارویی                      | ۹۸,۹۱۷             |
| ۳                       | قند و شکر                                  | ۴۸۸                |
| ۴                       | ساخت محصولات فلزی                          | -۲۶۷               |
| ۵                       | فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه          | -۱,۸۳۹             |
| ۶                       | ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی             | -۴,۵۱۵             |
| ۷                       | اطلاعات و ارتباطات                         | ۱۱,۷۸۲             |
| ۸                       | استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف     | -۲,۸۷۱             |
| ۹                       | هتل و رستوران                              | -۴,۳۰۵             |
| ۱۰                      | محصولات کاغذی                              | -۶,۲۵۹             |
| ۱۱                      | حمل و نقل آبی                              | -۸,۵۳۸             |
| ۱۲                      | کاشی و سرامیک                              | -۱۱,۷۰۲            |
| ۱۳                      | مخابرات                                    | -۱۷,۶۱۶            |
| ۱۴                      | پیمانکاری صنعتی                            | -۱۸,۶۰۷            |
| ۱۵                      | دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش       | -۱۹,۳۱۴            |
| ۱۶                      | لاستیک و پلاستیک                           | -۱۹,۳۹۹            |
| ۱۷                      | محصولات چوبی                               | -۲۴,۳۶۷            |
| ۱۸                      | سایر واسطه گریهای مالی                     | -۲۵,۷۰۸            |
| ۱۹                      | سایر محصولات کانی غیر فلزی                 | -۲۶,۰۵۸            |
| ۲۰                      | ماشین آلات و تجهیزات                       | -۲۶,۷۸۵            |
| ۲۱                      | خودرو و ساخت قطعات                         | -۲۷,۱۲۰            |
| ۲۲                      | واسطه گری های مالی و پولی                  | -۴۳,۶۵۷            |
| ۲۳                      | خدمات فنی و مهندسی                         | -۴۴,۳۳۶            |
| ۲۴                      | عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم               | -۴۸,۱۱۰            |
| ۲۵                      | حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات            | -۴۸,۴۰۲            |
| ۲۶                      | زراعت و خدمات وابسته                       | -۵۲,۰۳۲            |
| ۲۷                      | بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی | -۶۳,۴۵۵            |
| ۲۸                      | استخراج زغال سنگ                           | -۶۳,۶۵۲            |
| ۲۹                      | ماشین آلات و دستگاه های برقی               | -۷۸,۷۸۳            |
| ۳۰                      | رایانه و فعالیت های وابسته به آن           | -۸۶,۷۶۷            |
| ۳۱                      | محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر   | -۸۹,۲۳۳            |
| ۳۲                      | بانکها و موسسات اعتباری                    | -۱۴۵,۹۲۲           |
| ۳۳                      | فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط      | -۱۵۸,۷۰۰           |
| ۳۴                      | انبوه سازی، املاک و مستغلات                | -۱۹۱,۳۶۲           |
| ۳۵                      | سیمان، آهک و گچ                            | -۳۷۳,۱۱۲           |
| ۳۶                      | سرمایه گذاریها                             | -۴۳۵,۶۵۵           |
| ۳۷                      | شرکتهای چند رشته ای صنعتی                  | -۴۹۷,۹۷۸           |
| ۳۸                      | فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای        | -۵۱۳,۷۴۴           |
| ۳۹                      | محصولات شیمیایی                            | -۷۴۲,۶۷۲           |
| ۴۰                      | فلزات اساسی                                | -۸۶۶,۲۰۹           |
| <b>جمع ورود نقدینگی</b> |  | <b>-۳,۳۹۲,۸۱۵</b>  |