



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۶ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای شپنا، شستا، وغدیر، و پاسار، فارس، وبملت و شتران با کاهش ۵,۹۱۵ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۰۵,۷۲۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۸۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با افزایش ۶۰ درصدی همراه شده است. علی‌رغم اینکه در روز گذشته در بازار بورس و فرابورس، بسیاری از نمادها در بازه مثبت به کار خود پایان داده بودند اما در بازار امروز از ابتدای زمان معاملات، فشار فروش را در کلیت بازار شاهد بودیم و در پایان زمان معاملاتی نیز بسیاری از نمادها با صف فروش بسته شدند.

بسیاری از ابهامات در مورد بودجه سال آینده برای بازار سرمایه برطرف شده است و افزایش نرخ سوخت صنایع تولیدی در سال ۱۴۰۰، اثر کمتر از ۵ درصدی بر سود خالص متوسط شرکت‌ها خواهد گذاشت. همچنین اکثر تحلیلگران بین‌المللی قیمت کامودیتی‌ها را همچنان صعودی می‌دانند و این موضوع می‌تواند پتانسیل نهفته‌ای برای شرکت‌های ایرانی باشد که در صنایع فولاد، سنگ آهن، زغال سنگ، پتروشیمی و پالایشگاهی فعالیت دارند. به نظر می‌رسد مهمترین ابهام باقی مانده برای بازار سرمایه ایران، نرخ دلار برای سال آینده می‌باشد که در صورت تثبیت نرخ دلار، شرایط بازار سرمایه به مراتب بهتر از وضعیت فعلی خواهد شد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱۲,۰۶۴ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوس ۱۶۲۸ 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 اخزا۹۱۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۸/۰۷ با ۲۲٪ سود است.



درصد تغییر	۱۳۹۹/۱۲/۰۶	۱۳۹۹/۱۲/۰۵	شرح
۱۶۲۸٪	۱۱۲,۰۶۴	۶,۴۸۶	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)

گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی شرکت پتروشیمی غدیر، در دی ماه موفق به تولید ۱۱,۳۶۲ تن محصول شده بود که در بهمن ماه مقدار تولید برابر با ۱۱,۶۷۷ تن گزارش شده است. قابل ذکر است، میانگین تولید ماهانه شرکت ۹,۸۵۵ تن می‌باشد. مقدار فروش آن شرکت در دی ماه برابر با ۶۴۶۱ تن بوده که در بهمن ماه با فروش ۱۲,۵۴۹ تن به میانگین فروش ماهانه ۹۳۶۷ تنی رسیده است. نرخ فروش محصول PVC نسبت به ماه گذشته ۱۰ درصد کاهش داشته و برابر با ۲۸۴,۴۸۶ ریال به ازای هر کیلو است و آن شرکت توانسته در بهمن ماه ۳,۵۷۰ میلیارد ریال فروش گزارش کند. میانگین فروش ماهانه شرکت مبلغ ۱,۸۵۰ میلیارد ریال است.

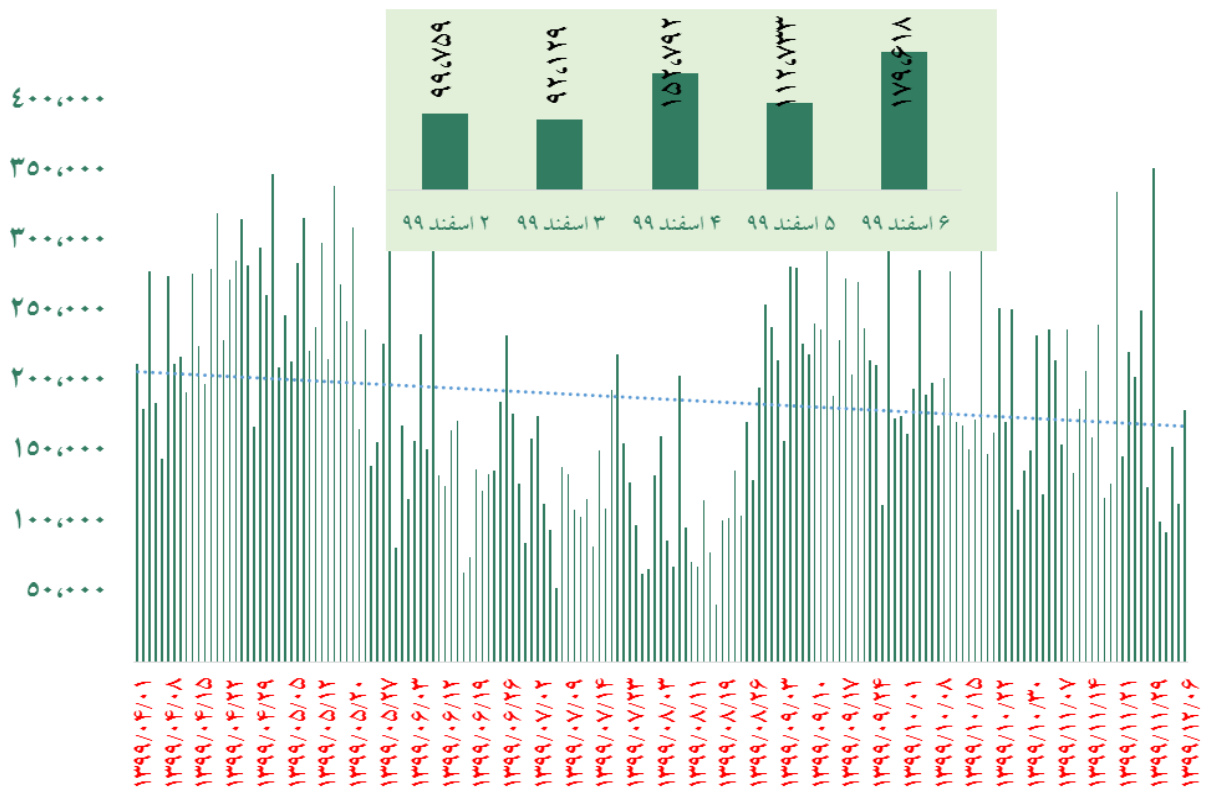
در گروه فلزات اساسی، شرکت ذوب آهن در دی ماه ۱۷۴ هزار تن تولید داشته و در بهمن ماه نیز تولید ۲۰۴ هزار تنی را ثبت کرده است. فروش مقداری آن شرکت در دی ماه برابر با ۱۶۷ هزار تن بود و در بهمن ماه نیز فروش ۱۸۴ هزار تنی را گزارش کرده و میانگین فروش شرکت در هر ماه به ۱۸۷ هزار تن رسیده است. مبلغ فروش این فولادساز در ماه‌های آذر و دی به ترتیب برابر با ۱۸,۴۶۰ و ۱۹,۴۱۰ میلیارد ریال بود که در بهمن ماه فروش ۲۳,۹۰۶ میلیارد ریالی را ثبت کرده است. مبلغ فروش آن شرکت در ۱۱ ماه گذشته به ۱۷۵,۷۵۰ میلیارد ریال می‌باشد. نرخ فروش تیرآهن نسبت به ماه گذشته کاهش ۴ درصدی داشته و به ۱۱۴,۹۵۸ ریال به ازای هر کیلو رسید و نرخ فروش شمش با ۸ درصد افزایش نسبت به ماه گذشته برابر با ۱۰۹,۱۵۳ ریال در هر کیلو است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



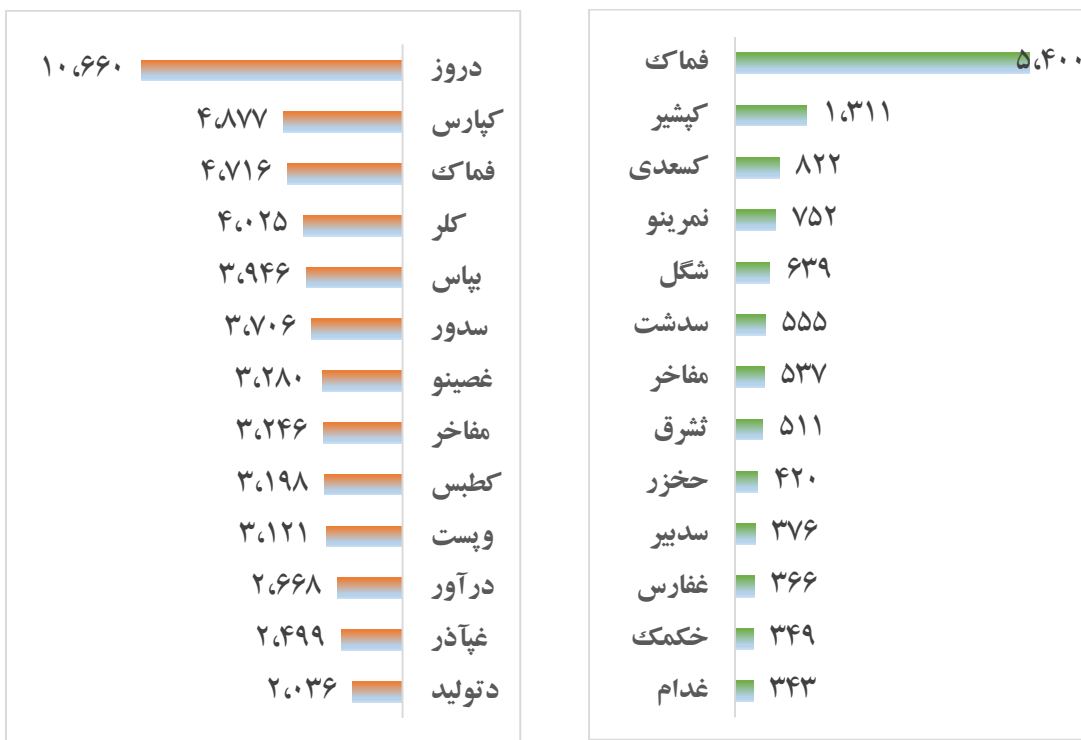
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

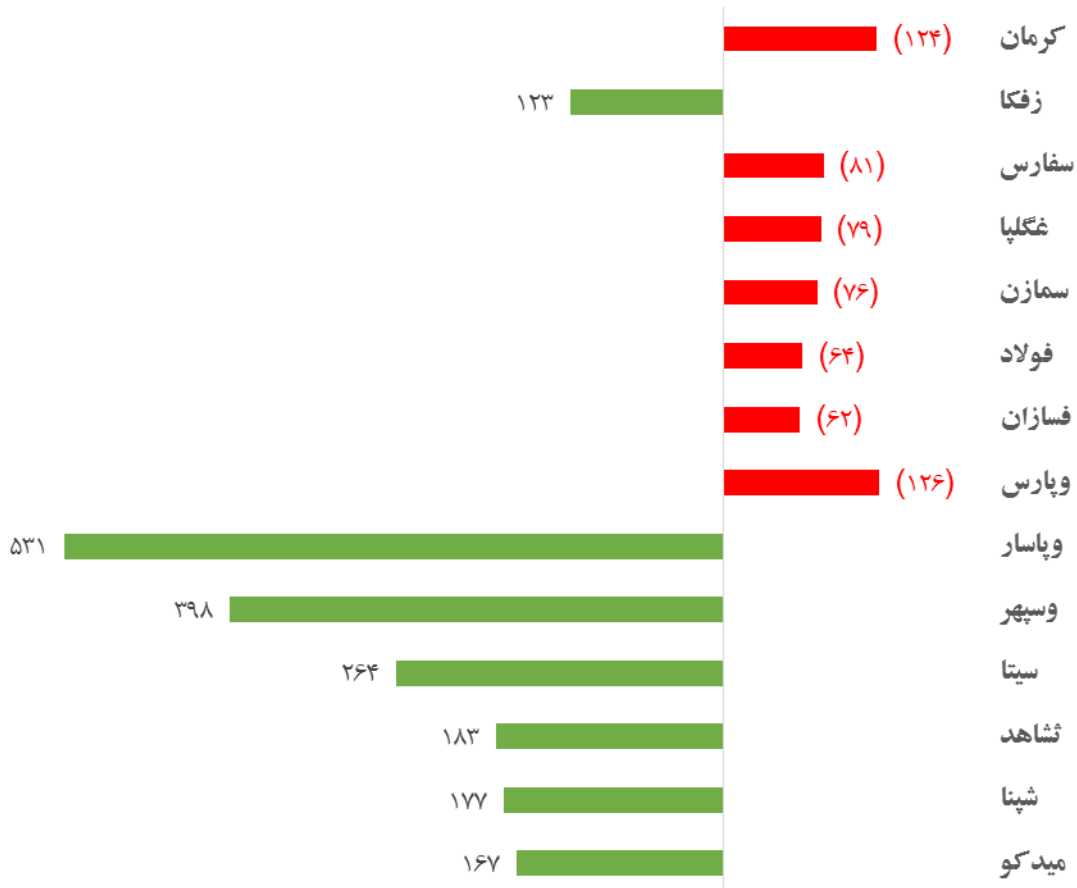


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
1	رافزا	1	دی
2	فسازان	2	تپیکو
3	سصوفی	3	امید
4	غفارس	4	شاون
5	سمازن	5	غالبر
6	-	6	شمال
7	-	7	-
8	-	8	-
9	-	9	-
10	-	10	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
1	کرمان	11	غپاک
2	فرزین	12	شاوان
3	کیمیا	13	میهن
4	ششمال	14	وساخت
5	غفارس	15	ثشاهد
6	سصوفی	16	ثشرق
7	زفکا	17	کرازی
8	سمازن	18	اعتلا
9	زماهان	19	وسین
10	شغدیر	20	بوعلی



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
1	زراعت و خدمات وابسته	45,133
2	سایر محصولات کانی غیر فلزی	19,336
3	پیمانکاری صنعتی	17,843
4	قند و شکر	14,162
5	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	340
7	استخراج سایر معادن	-1,353
8	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-1,748
9	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-6,274
10	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-5,513
11	اطلاعات و ارتباطات	-36,835
12	خرده فروشی، باستان‌شناسی وسایل نقلیه موتوری	-6,548
13	منسوجات	-6,683
14	ساخت محصولات فلزی	-7,405
15	حمل و نقل آبی	-8,597
16	ماشین آلات و تجهیزات	-8,904
17	هتل و رستوران	-11,566
18	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-14,912
19	محصولات کاغذی	-15,348
20	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-17,366
21	استخراج زغال سنگ	-17,399
22	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-21,545
23	لاستیک و پلاستیک	-28,588
24	مخابرات	-29,859
25	استخراج کانه‌های فلزی	-34,435
26	خدمات فنی و مهندسی	-36,844
27	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	-41,264
28	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-44,237
29	خودرو و ساخت قطعات	-47,625
30	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	-69,167
31	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-71,765
32	کاشی و سرامیک	-80,543
33	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	-81,924
34	محصولات شیمیایی	-88,894
35	مواد و محصولات دارویی	-114,695
36	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-118,463
37	سیمان، آهک و گچ	-139,790
38	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	-209,430
39	فعالیت‌های کمکی به نهاد‌های مالی واسط	-212,727
40	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	-238,102
41	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	-427,461
42	سرمایه‌گذاریها	-535,798
43	فلزات اساسی	-925,822
44	بانکها و موسسات اعتباری	-2,301,791
جمع ورود نقدینگی		-5,970,406