



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۴ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، شستا، فارس، کگل، تاپیکو، شبندر و معادن با کاهش ۸۱۱۳ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۱۴,۵۰۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۵۳ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با رشد ۶۶ درصدی همراه شده است. همانند روزهای گذشته، فشار فروش بر کلیت بازار حاکم بود و اکثر نمادها با صف فروش به کار خود پایان دادند.

یکی از مواردی که می‌تواند به رونق بازار سرمایه در کنار افزایش قیمت کامودیتی‌ها، کمک شایانی کند، درک واحد تحلیلگران و فعالین بازار در مورد پیش بینی نرخ دلار در ماه‌های آینده می‌باشد. با توجه به موضع‌گیری رئیس جمهور جدید آمریکا در موضوع برجام و رفع تحریم‌ها، انتظار می‌رود نرخ دلار در ماه‌های آینده در بازه قیمتی ۲۲۰ هزار الی ۲۶۰ هزار ریال در نوسان باشد. بنابراین به روزرسانی تحلیل بنیادی شرکتها برای پیش بینی سود سال آینده با میانگین نرخ دلار ۲۳۰ هزار ریال منطقی و محافظه کارانه می‌باشد و تا زمانی که کلیت بازار به این نتیجه نرسد، فشار فروش در بازار به افزایش تقاضا تبدیل نخواهد شد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱۰۹۹۵ میلیارد ریال بود که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش ۱۲۳ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۲۱۴ 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 اخزا۸۱۴، تاریخ سررسید ۱۴۰۱/۰۳/۱۸ با ۲۱,۹٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۰۳	۱۳۹۹/۱۲/۰۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۴۹,۷۹۱	۱۱۰,۹۹۵	۱۲۳٪

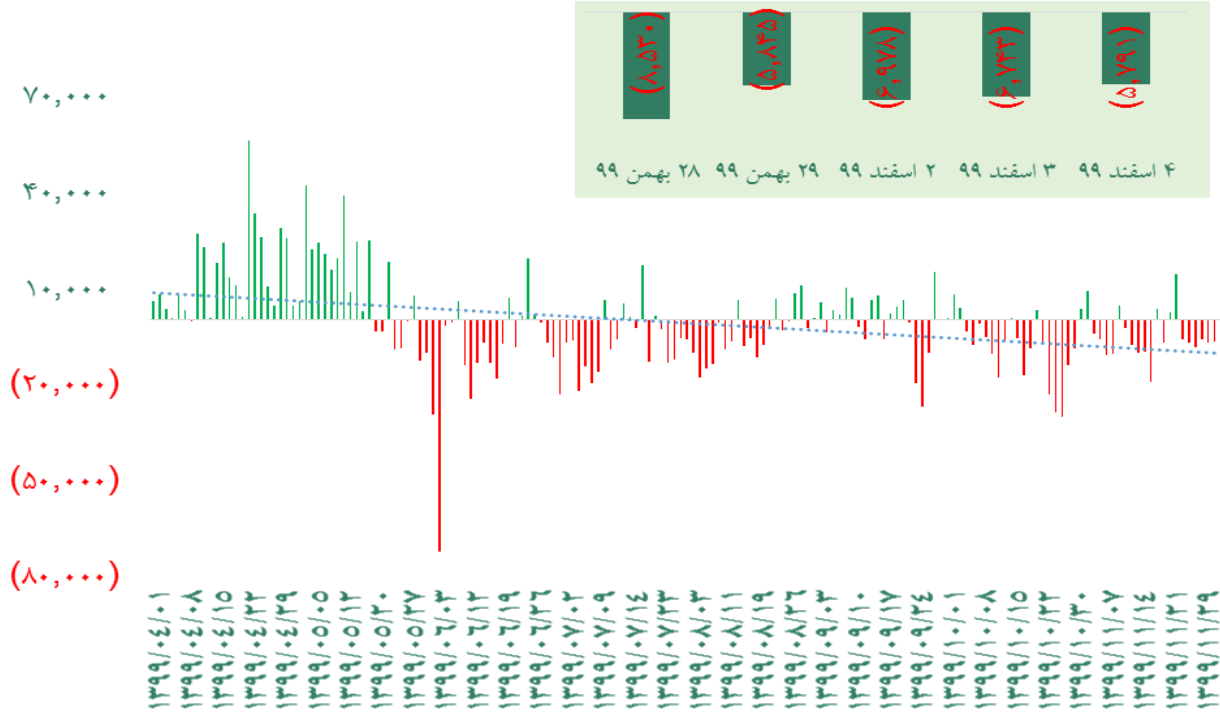


گروه‌های مؤثر

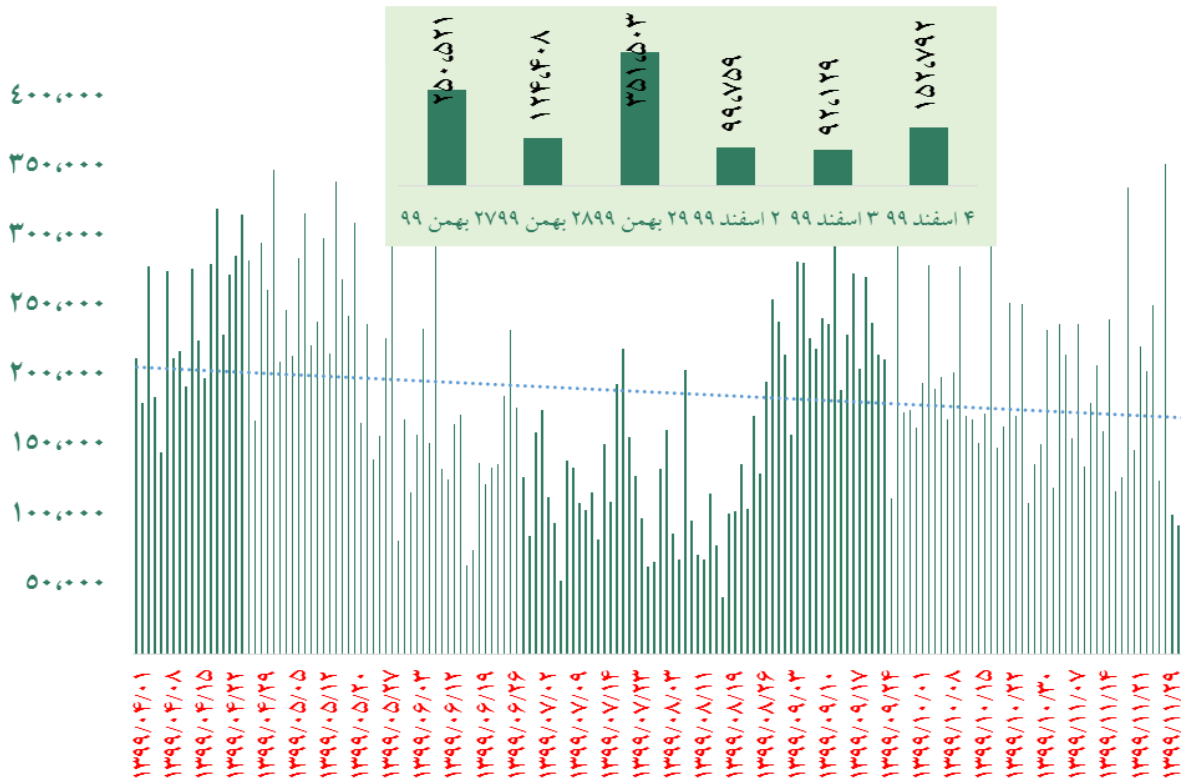
در گروه فلزات اساسی، شرکت آلومینیم ایران در سال جاری به طور میانگین هر ماه ۱۵ هزار تن و در بهمن ماه ۱۴,۶ هزار تن تولید گزارش کرده است. این شرکت آلومینیم ساز که در دی ماه فروشی برابر با ۱۶,۷ هزار تن داشت، در بهمن ماه فروش ۱۷,۱ هزار تنی را گزارش داده و میانگین فروش ماهانه خود در سال جاری را به ۱۵,۲ هزار تن رسانده است. میانگین مبلغ فروش ماهانه این شرکت در سال جاری برابر با ۵۷۳۰ میلیارد ریال بوده که در دی ماه به ۸۱۰۰ میلیارد ریال افزایش یافته است. در بهمن ماه نیز فروش ریالی ۸۴۸۰ میلیارد ریال را گزارش کرده است. نرخ فروش محصولات شرکت نسبت به ماه گذشته به طور متوسط افزایش ۲ درصدی داشته است.

شرکت پتروشیمی زاگرس، متوسط تولید ۷ ماهه اول شرکت ۲۶۵ هزار تن بوده که در آبان و آذر به ترتیب ۲۵۱ و ۲۵۷ هزار تن تولید داشته است. در دی ماه و بهمن به دلیل افت فشار گاز مقدار تولید به ۱۶۴ و ۲۲۴ هزار تن کاهش پیدا کرده است. فروش ۱۲ ماهه سال گذشته برابر با تولیدات بوده است. متوسط نرخ فروش شرکت در سال گذشته در حدود ۲۴۱ دلار بوده است. در شش ماهه ابتدای سال مالی جاری نرخ فروش متانول این شرکت ۱۶۹ دلار بود و در مهر ماه به ۲۰۶ دلار افزایش یافت و در آبان، آذر، دی و بهمن نیز به ترتیب ۲۴۰، ۲۴۹، ۲۹۸ و ۳۰۵ دلار در هر تن می باشد.

ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

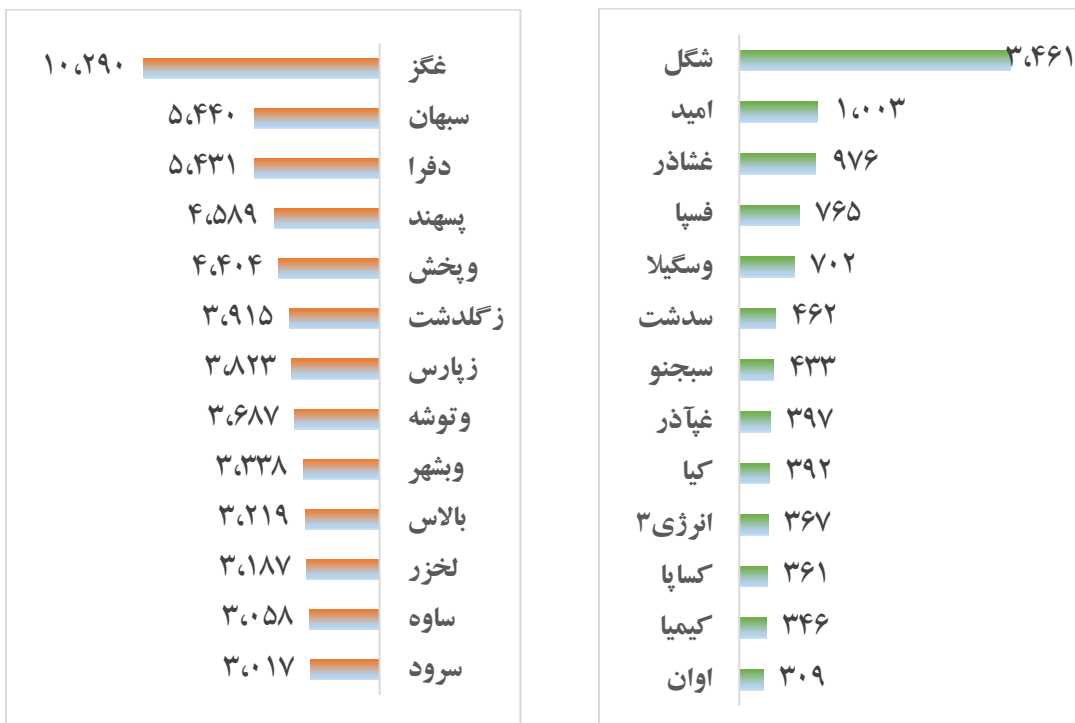


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

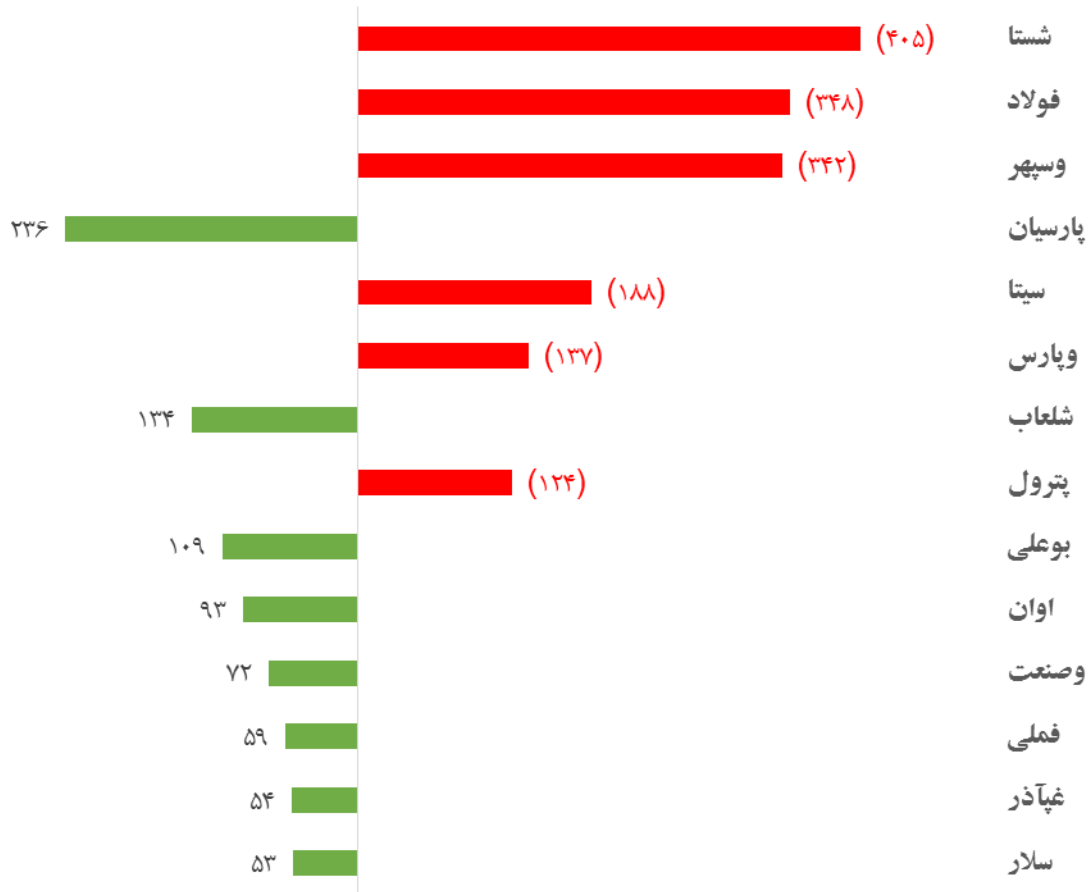


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	صنعت	۱	دی
۲	وتوس	۲	-
۳	اوان	۳	-
۴	-	۴	-
۵	-	۵	-
۶	-	۶	-
۷	-	۷	-
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

نماد	ردیف	نماد	ردیف
وساخت	۱۱	غپاک	۱
شغدیر	۱۲	ششمال	۲
سفارس	۱۳	تشرق	۳
سیستم	۱۴	پارسیان	۴
وآفری	۱۵	سهرمز	۵
وسنا	۱۶	فبهنر	۶
فاسمین	۱۷	وتوس	۷
تفارس	۱۸	بوعلی	۸
کروی	۱۹	وصنعت	۹
کرغال	۲۰	برکت	۱۰



ورود نق و ورود نقدینگی به تفکیک صنعتدینگی به

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۶۸،۴۹۸
۲	کاشی و سرامیک	۲۷،۳۹۴
۳	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱۰،۳۷۱
۴	استخراج سایر معادن	۲۲۰
۵	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۲،۶۸۴
۶	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۵،۹۱۴
۷	ساخت محصولات فلزی	-۷،۷۲۲
۸	هتل و رستوران	-۸،۴۱۸
۹	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۹،۶۷۲
۱۰	اطلاعات و ارتباطات	۹۲،۶۴۵
۱۱	پیمانکاری صنعتی	-۸،۴۹۰
۱۲	حمل و نقل آبی	-۸،۶۸۴
۱۳	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱۰،۸۳۴
۱۴	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۱۶،۶۱۴
۱۵	محصولات چوبی	-۲۴،۶۶۰
۱۶	محصولات کاغذی	-۲۶،۷۱۲
۱۷	خدمات فنی و مهندسی	-۲۷،۵۱۶
۱۸	سایر واسطه گریهای مالی	-۲۹،۹۳۶
۱۹	واسطه گری های مالی و پولی	-۳۵،۹۰۶
۲۰	قند و شکر	-۴۰،۰۷۲
۲۱	ماشین آلات و دستگاه های برقی	-۴۳،۶۸۸
۲۲	مخابرات	-۴۳،۹۰۲
۲۳	ماشین آلات و تجهیزات	-۴۸،۸۵۶
۲۴	استخراج زغال سنگ	-۴۹،۲۸۳
۲۵	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۵۷،۸۲۹
۲۶	لاستیک و پلاستیک	-۶۸،۴۸۱
۲۷	زراعت و خدمات وابسته	-۷۳،۷۱۴
۲۸	منسوجات	-۷۷،۵۰۱
۲۹	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۷۹،۷۷۶
۳۰	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۸۸،۵۸۹
۳۱	فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط	-۹۶،۱۱۵
۳۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۰۵،۲۶۵
۳۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۱۱۴،۹۵۱
۳۴	خودرو و ساخت قطعات	-۱۵۸،۴۵۶
۳۵	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۱۷۴،۴۸۹
۳۶	استخراج کانه های فلزی	-۲۷۹،۳۵۱
۳۷	مواد و محصولات دارویی	-۳۸۳،۷۶۴
۳۸	سیمان، آهک و گچ	-۳۹۶،۰۵۱
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۴۰۱،۸۸۵
۴۰	شرکت های چند رشته ای صنعتی	-۴۵۵،۰۱۲
۴۱	سرمایه گذارها	-۴۹۴،۱۰۰
جمع ورود نقدینگی		-۵،۷۹۱،۵۴۹