



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۲ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، شستا، فولاد، تاپیکو، وغدیر و وبملت با کاهش ۵۵۹۶ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۳۲,۷۶۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۰۰ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با کاهش محسوس ۶۳ درصدی همراه شده است. علی‌رغم افزایش قیمت کامودیتی‌ها در چند روز گذشته اما در روز جاری در بازار بورس و فرابورس تهران همانند روزهای معاملاتی گذشته شاهد فشار عرضه از طرف فروشنده‌ها بودیم. بطوریکه بسیاری از نمادها در گروه فلزات اساسی، شیمیایی و فرآورده‌های نفتی با صف فروش به کار خود پایان دادند.

شاخص کل بورس از نظر تکنیکال در حال ساخت آخرین موج اصلاحی خود می‌باشد. بطوریکه این موج اصلاحی می‌تواند تا حوالی ۱,۰۰۰,۰۰۰ الی ۱,۱۰۰,۰۰۰ واحد ادامه داشته باشد. بسیاری از نمادهای بزرگ مانند فملی، فخور و وبملت نیز نموداری مانند شاخص کل دارند و در حال ساختن آخرین ریز موج اصلاحی خود می‌باشند. از لحاظ بنیادی نیز در بحث نرخ دلار مقداری ابهام وجود دارد و با توجه به افزایش مقداری نفت ایران در بازارهای جهانی و موضوع برگشت آمریکا به برجام، امیدواری به کاهش نرخ دلار در بین فعالان بازار سرمایه بیشتر شده است و می‌تواند در کوتاه مدت موجب فشار بیشتر عرضه در بازار سرمایه گردد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۲,۶۹۶ میلیارد ریال بود که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۹۰ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۵۴۴ 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 اخزا۹۰۵، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۲/۱۸ با ۲۲,۲٪ سود است.

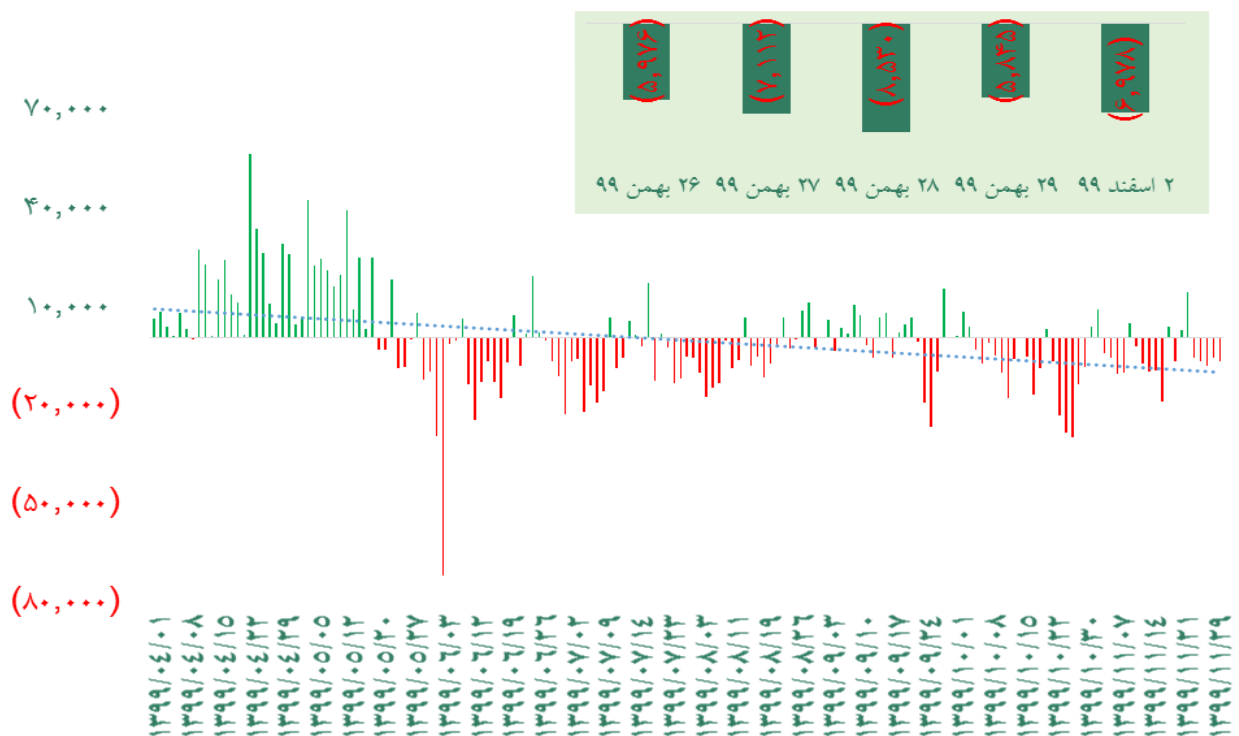
شرح	۱۳۹۹/۱۱/۲۹	۱۳۹۹/۱۲/۰۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۲۱,۴۰۰	۲۲,۶۹۶	-۹۰٪



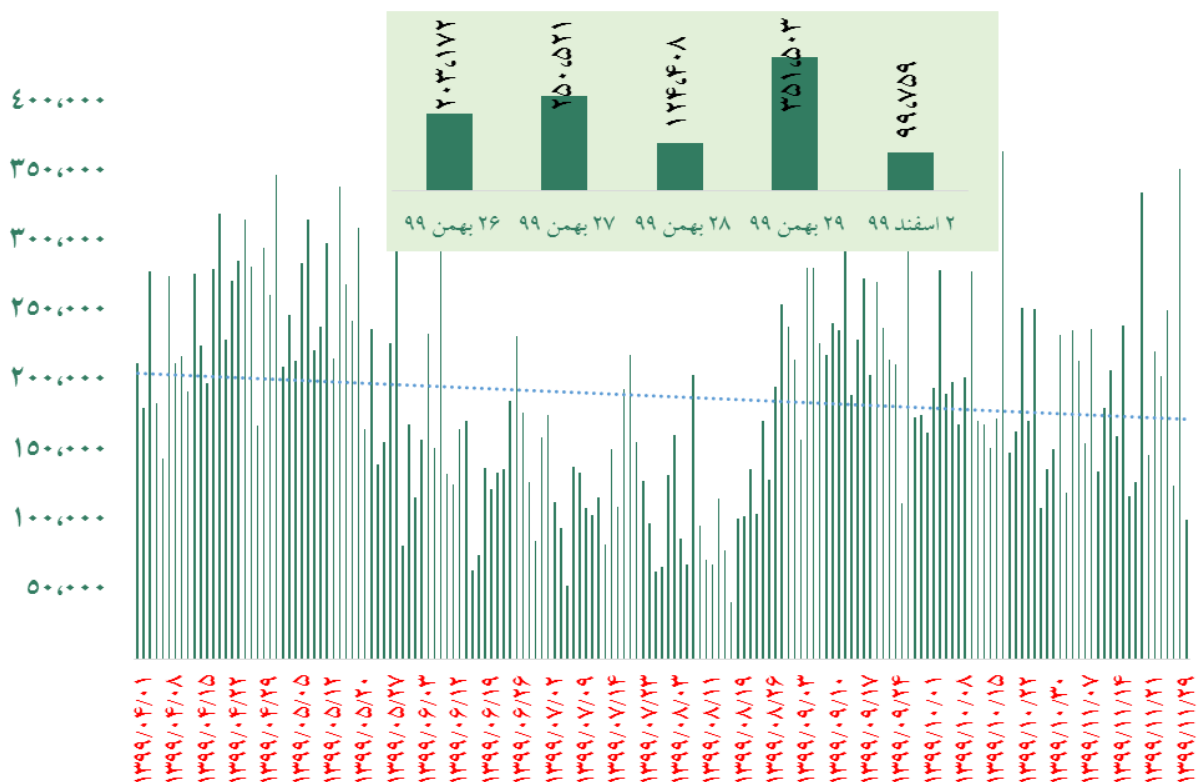
گروه‌های مؤثر

در گروه محصولات کانی غیر فلزی، تولید محصولات شرکت کارخانجات تولیدی شیشه رازی در دی ماه برابر با ۵,۵۴۴ تن از انواع دارویی و غیر دارویی بوده و در بهمن نیز تولید ۵۵۷۰ تن انواع محصولات را داشته است. میانگین تولید ماهانه شرکت در سال جاری برابر ۵۵۹۶ تن است. فروش مقداری این شرکت نیز در دی ماه برابر با ۵۱۶۱ تن بوده و در بهمن نیز فروش ۶۵۵۳ تنی را گزارش کرده و میانگین فروش ماهانه خود را به ۶۲۱۶ تن رسانده است. میانگین مبلغ فروش ماهانه شرکت کارخانجات تولیدی شیشه رازی در سال مالی جاری برابر با ۳۸۰ میلیارد ریال بود و فروش شرکت در دی ماه برابر با ۳۶۰ میلیارد ریال بود که در بهمن ماه نیز توانسته فروش ۴۴۰ میلیارد ریالی را ثبت کند. نرخ‌های فروش محصولات دارویی نسبت به میانگین سال جاری افزایش ۱۴ درصدی داشته و محصولات غیر دارویی نسبت به ماه گذشته افت ۲ درصدی داشته و به ترتیب برابر با ۸۳,۶۸۰ و ۶۱۱۴۹ ریال به ازای هر کیلو است. شرکت پتروشیمی غدیر در بهمن ماه در بورس کالا با فروش ۱۹۴۰ میلیارد ریالی همراه بوده است. این در حالی است که میانگین فروش ۱۰ ماهه ابتدای سال مالی جاری ۹۷۰ میلیارد ریال و فروش ماه قبل ۹۶۰ میلیارد ریال بوده است. میزان صادرات شرکت پتروشیمی غدیر در بهمن ماه در پیش بینی گزارش کدال ماه جاری مؤثر است اما با توجه به فروش مناسب این شرکت در بورس کالا، گزارشی قابل توجه برای بهمن ماه برای آن شرکت را انتظار داریم.

ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

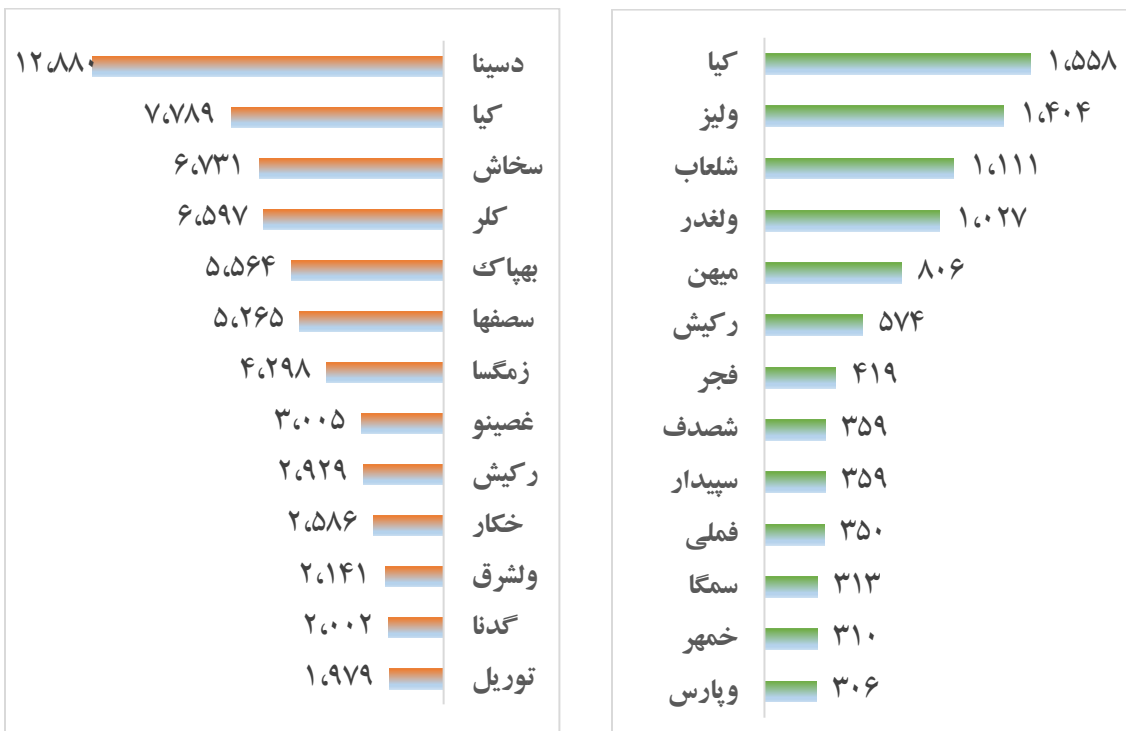


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

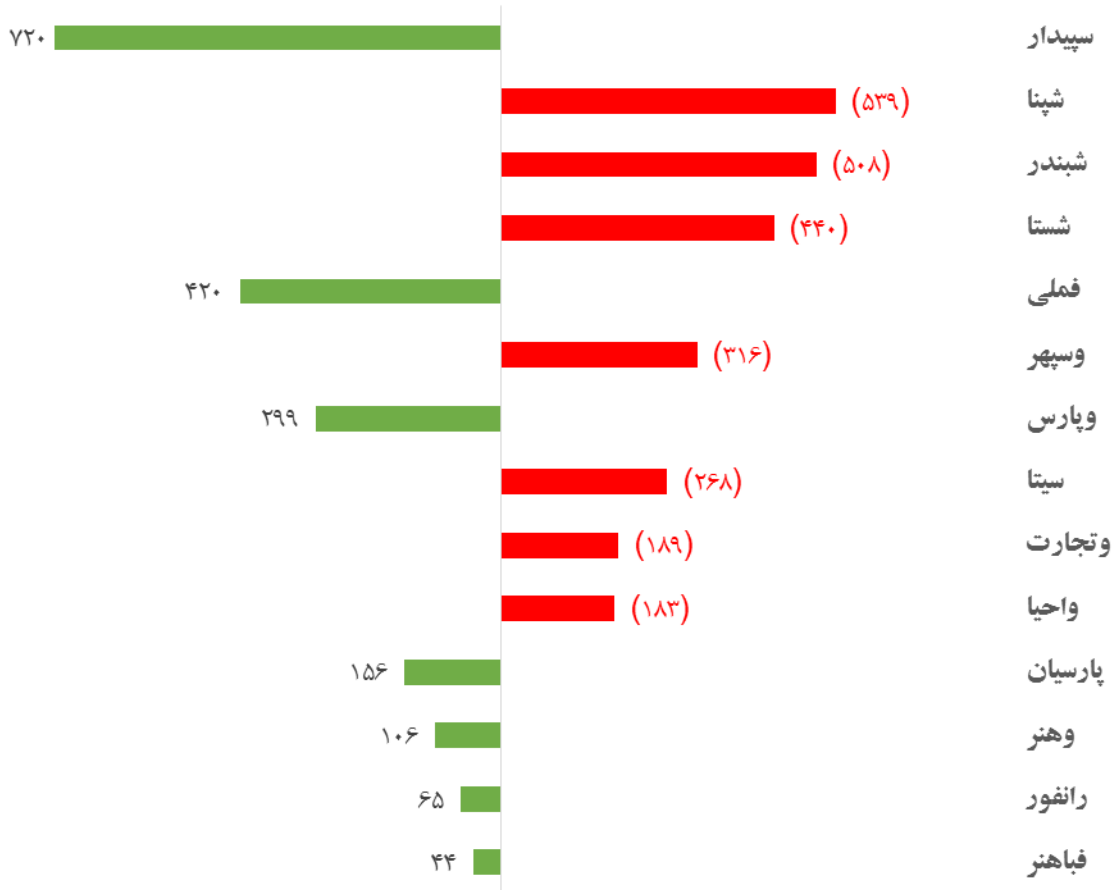


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	خمهر	۱	خراسان
۲	فملی	۲	چپترو
۳	سپیدار	۳	سبجنو
۴	-	۴	درهاور
۵	-	۵	غشان
۶	-	۶	سفار
۷	-	۷	نظرین
۸	-	۸	تلیسه
۹	-	۹	واعتبار
۱۰	-	۱۰	غچین



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	زماهان	۱۱	سفارس
۲	وسین	۱۲	کرمان
۳	وساخت	۱۳	کیمیا
۴	ثشرق	۱۴	ستران
۵	فباهنر	۱۵	ونفت
۶	غچپاک	۱۶	زکوثر
۷	حتاید	۱۷	ولپارس
۸	کرازی	۱۸	سبزوا
۹	دماوند	۱۹	پارسیان
۱۰	غشان	۲۰	بوعلی



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۶۸۸.۷۲۱
۲	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱۰۶.۵۰۲
۳	سایر واسطه‌گریهای مالی	۴۱۸.۲۹
۴	ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی	۱۵۳.۳۵۱
۵	مخابرات	۹.۷۶۴
۶	استخراج سایر معادن	۳.۲۱۸
۷	متنوجات	۲۰.۸۹
۸	انتشار، چاپ و تکثیر	۰
۹	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۸۱۵
۱۰	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۲.۲۶۴
۱۱	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۹.۷۷۵
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	-۱۷.۹۴۶
۱۳	حمل و نقل آبی	-۱۱.۷۶۵
۱۴	پیمانکاری صنعتی	-۱۴.۴۸۴
۱۵	محصولات چوبی	-۲۵.۱۹۲
۱۶	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۲۷.۳۴۰
۱۷	هتل و رستوران	-۳۱.۴۵۵
۱۸	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتور	-۳۳.۶۰۳
۱۹	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۳۷.۳۱۲
۲۰	کاشی و سرامیک	-۳۹.۴۹۷
۲۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۴۲.۳۳۳
۲۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۴۶.۴۴۴
۲۳	خدمات فنی و مهندسی	-۴۸.۵۵۰
۲۴	قند و شکر	-۴۹.۲۲۵
۲۵	استخراج زغال سنگ	-۴۹.۵۵۵
۲۶	محصولات کاغذی	-۵۰.۵۸۸
۲۷	ماشین‌آلات و تجهیزات	-۸۲.۱۸۸
۲۸	لاستیک و پلاستیک	-۹۶.۳۱۱
۲۹	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۰۱.۱۳۷
۳۰	ساخت محصولات فلزی	-۱۰۱.۸۶۰
۳۱	زراعت و خدمات وابسته	-۱۱۳.۲۱۶
۳۲	خودرو و ساخت قطعات	-۱۱۹.۱۲۹
۳۳	بانکها و موسسات اعتباری	-۱۷۴.۵۴۰
۳۴	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	-۱۷۷.۷۳۹
۳۵	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	-۱۹۲.۸۰۰
۳۶	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۱۹۹.۵۱۷
۳۷	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۲۳۷.۶۲۷
۳۸	مواد و محصولات دارویی	-۳۱۴.۷۱۸
۳۹	استخراج کانه‌های فلزی	-۳۸۱.۹۵۲
۴۰	سیمان، آهک و گچ	-۴۵۶.۷۹۷
۴۱	سرمایه‌گذاریها	-۵۹۲.۳۱۲
۴۲	فلزات اساسی	-۵۹۵.۶۰۷
۴۳	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	-۶۹۴.۴۵۶
جمع ورود نقدینگی		-۶,۹۷۸,۶۵۳