



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۳ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، شستا، کگل، فارس، کچاد و تاپیکو با کاهش ۱۰۰۵۱ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۲۲,۶۶۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۹۲ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با کاهش ۸ درصدی همراه شده است. در بازار سرمایه از ترس کاهش شدید دلار و کاهش انتظارات تورمی هر روز شاهد صف‌های فروش در اکثر نمادها هستیم. به نظر می‌رسد تا موقعی که وضعیت نرخ دلار مشخص نشود، شاهد افزایش تقاضا در کلیت بازار سرمایه نیز نخواهیم بود.

همچنین با توجه به دامنه نوسان قیمتی جدید (۲- الی ۶+)، اصلاح شاخص کل از لحاظ زمانی متفاوت تر از موج‌های اصلاحی قبلی خود خواهد بود. بطوریکه در روز جاری اکثر نمادهای بزرگ و کوچک با صف فروش مواجه بودند اما شاخص کل فقط با ۱۰ هزار واحد ریزش همراه شد. بسیاری از کارشناس‌ها تغییر در دامنه نوسان را دستکاری در کلیت بازار و عاملی منفی بر روی نقد شوندگی بازار می‌دانند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۹,۷۹۱ میلیارد ریال بود که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش ۱۱۹ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۴۰۴ 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 اخزا۷۲۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۳/۲۴ با ۲۲,۱٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۰۲	۱۳۹۹/۱۲/۰۳	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۲,۶۹۶	۴۹,۷۹۱	۱۱۹٪



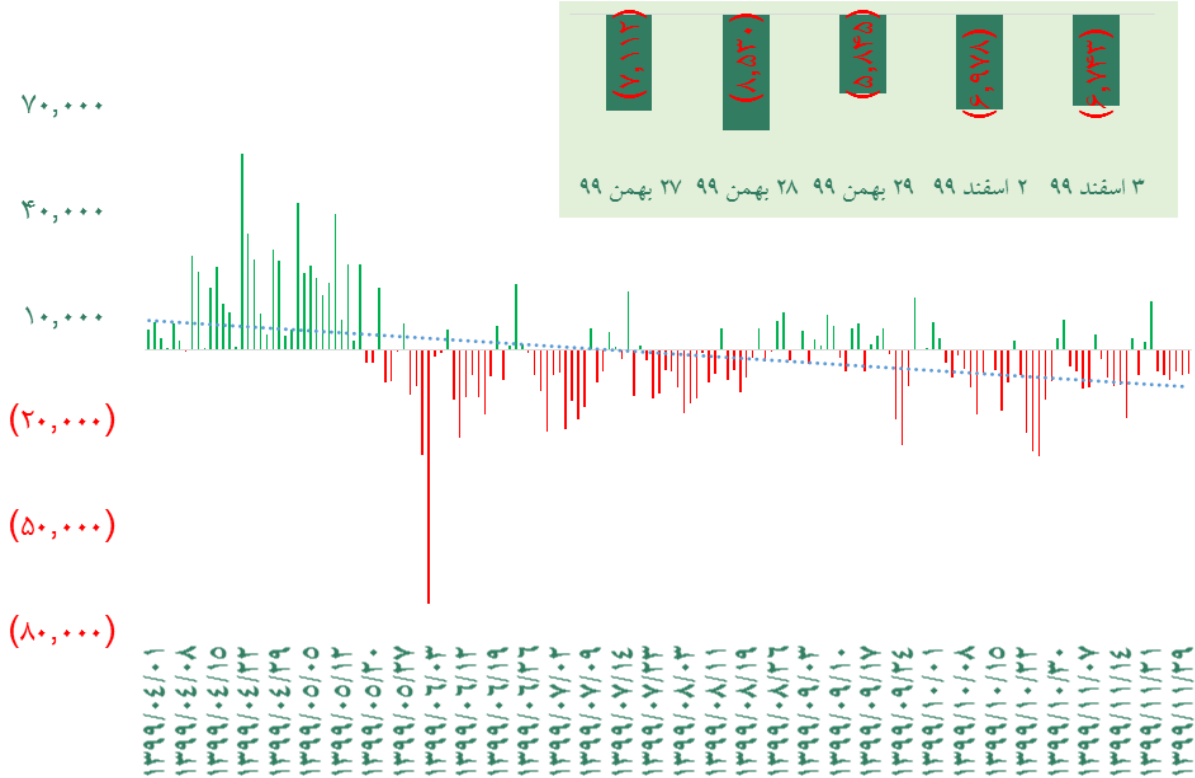
گروه‌های مؤثر

در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد امیر کبیر کاشان در بهمن ماه سال جاری، ۱۳۸۹۴ تن محصول گالوانیزه تولید کرده و میانگین تولید ۱۱ ماه ابتدای سال جاری ۱۲۹۶۵ تن بوده است. این شرکت در سال مالی گذشته مجموعاً ۱۴۸۷۴۲ تن تولید داشته است. فروش مقداری شرکت در ماه گذشته ۱۳۴۵۳ تن گزارش شده است. میانگین فروش ۱۱ ماه سال جاری ۱۳۳۸۷ تن می‌باشد. در ماه‌های دی و بهمن سال جاری مبلغ فروش ماهانه شرکت فولاد امیر کبیر کاشان به ترتیب ۳۲۶۰ و ۳۲۰۰ میلیارد ریال گزارش شده است. مبلغ کل فروش ۱۱ ماه گذشته ۲۴۸۰۰ میلیارد ریال و مبلغ فروش ۱۲ ماه سال مالی گذشته نیز ۱۱۹۵۰ میلیارد ریال می‌باشد. میانگین نرخ فروش محصول گالوانیزه در سال مالی گذشته، ۷۹,۱۶۶ ریال به ازای هر کیلو بوده و در ۹ ماهه امسال نرخ آن محصول به ۱۴۸۸۸۵ ریال به ازای هر کیلو رسیده است و در بهمن ماه نیز با نرخ ۲۲۶۴۶۳ ریال معامله شده است.

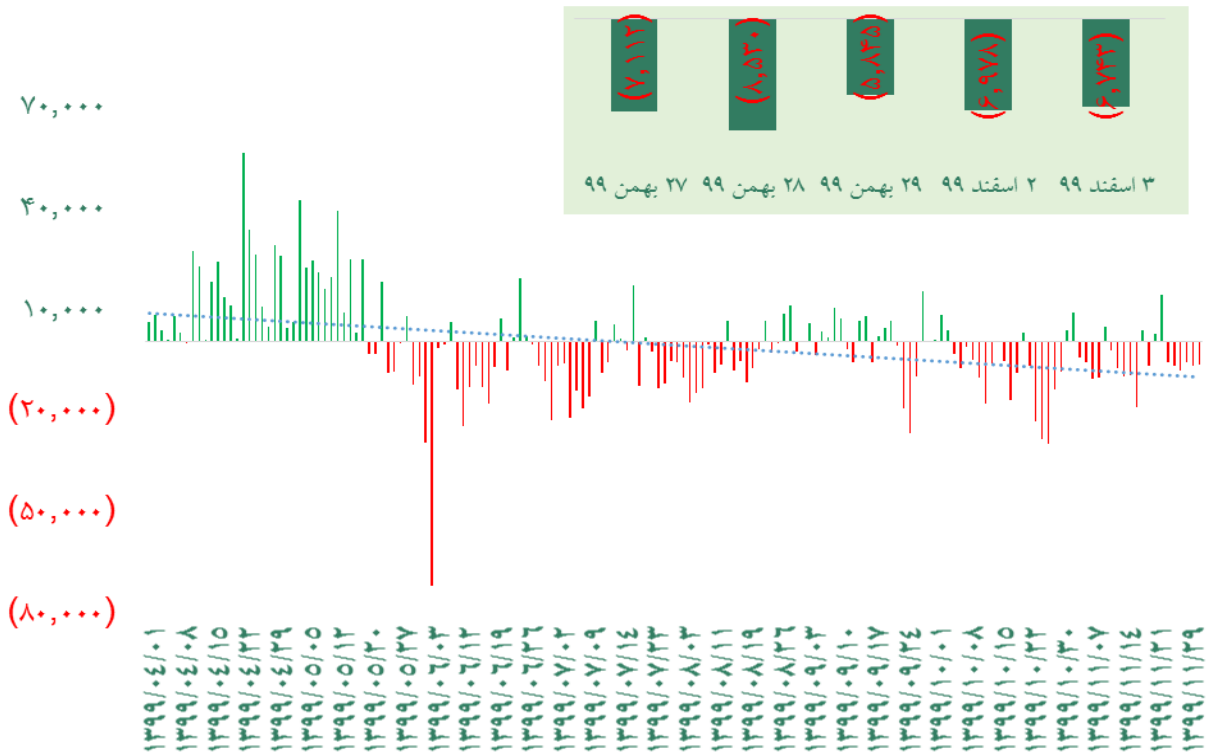
در گروه فرآورده‌های نفتی، شرکت پالایشگاه نفت تبریز در ۹ ماهه سال مالی جاری ۲۴۷۰ ریال سود به ازای هر سهم ساخته است. همچنین این شرکت در فصل اول و دوم به ترتیب ۵۶۰ و ۷۰۰ ریال سود به ازای هر سهم ثبت کرده است. سود هر سهم در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته، ۱۰۰۰ ریال بوده است. سود ۹ ماهه سال مالی جاری رشد ۷۰ درصدی نسبت به ۹ ماهه سال مالی گذشته دارد. در فصل اول فروش ریالی شرکت ۳۸۰۰۰ میلیارد ریال و در فصل دوم فروش ۷۶ هزار میلیارد ریالی را رقم زده است و در فصل سوم فروش شرکت به عدد مناسب ۱۰۰ هزار میلیارد ریال رسید. فروش ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۲۵۸ هزار میلیارد ریال و فروش ۹ ماهه سال مالی جاری برابر با ۲۱۵ هزار میلیارد ریال است. این شرکت در ۹ ماهه ابتدایی سال مالی جاری، ۳۱۳۰۰ میلیارد ریال سود عملیاتی شناسایی کرده که ۷۰ درصد بیشتر از مدت مشابه سال قبل است. در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته نیز این شرکت ۱۳ هزار میلیارد ریال سود عملیاتی گزارش کرده بود. حاشیه سود شرکت در ۹ ماهه سال مالی جاری ۱۱ درصد و در سال مالی گذشته ۸ درصد بوده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

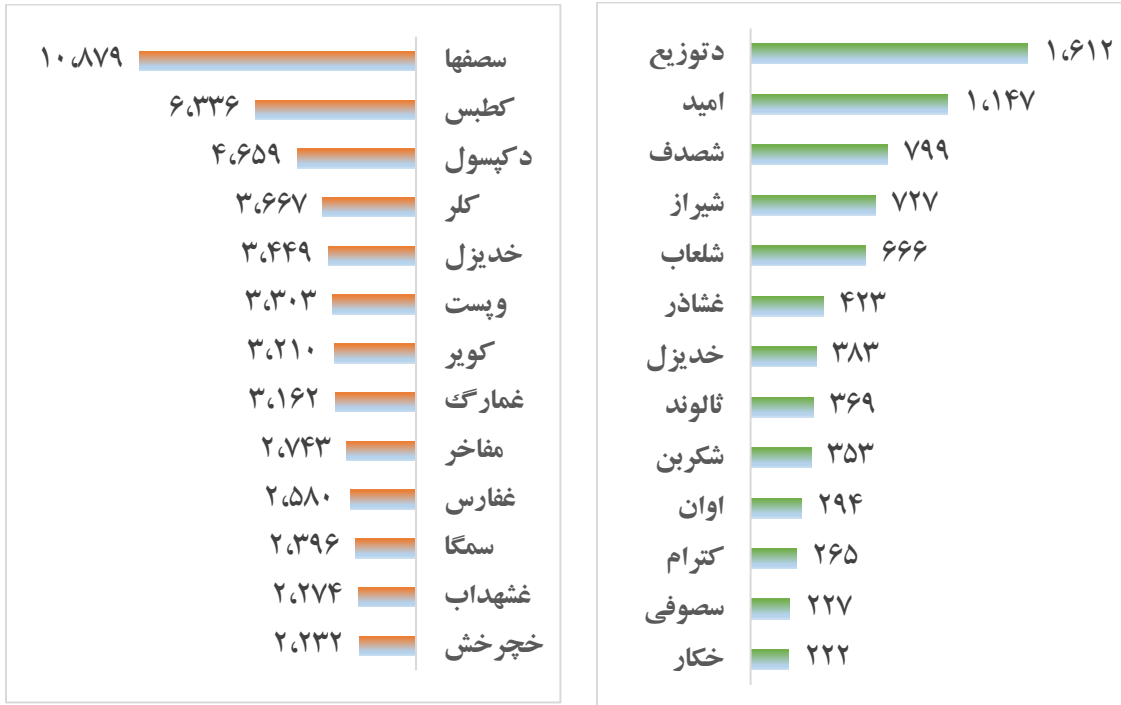


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)



پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	-	۱	بزاگرس
۲	-	۲	تکشا
۳	-	۳	چکاوه
۴	-	۴	میهن
۵	-	۵	وساخت
۶	-	۶	-
۷	-	۷	-
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

نماد	ردیف	نماد	ردیف
خکاوہ	۱۱	وساخت	۱
حتاید	۱۲	میهن	۲
تشرق	۱۳	غپاک	۳
وآفری	۱۴	ولپارس	۴
کیما	۱۵	شمال	۵
خکرمان	۱۶	سیستم	۶
سصوفی	۱۷	وسین	۷
وتوس	۱۸	زاگرس	۸
وسرمد	۱۹	بوعلی	۹
دتوزیع	۲۰	شاوان	۱۰



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	مخابرات	۶۰،۷۳۵
۲	سایر محصولات کانی غیر فلزی	۲۰،۶۸۸
۳	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱۱،۱۹۶
۴	استخراج سایر معادن	۰
۵	منسوجات	۰
۶	انتشار، چاپ و تکثیر	۰
۷	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۸۲۷
۸	پیمانکاری صنعتی	-۱۰،۰۹۲
۹	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۶،۱۲۴
۱۰	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۸،۳۷۲
۱۱	ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی	-۹،۷۱۶
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	-۴،۰۶۱
۱۳	حمل و نقل آبی	-۸،۷۱۵
۱۴	سایر واسطه گری های مالی	-۱۲،۷۳۸
۱۵	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۱۷،۰۸۴
۱۶	محصولات کاغذی	-۲۴،۱۷۲
۱۷	محصولات چوبی	-۲۴،۹۲۱
۱۸	ماشین آلات و دستگاه های برقی	-۳۴،۹۰۸
۱۹	هتل و رستوران	-۳۶،۵۷۴
۲۰	استخراج زغال سنگ	-۴۱،۳۱۵
۲۱	خودرو و ساخت قطعات	-۴۱،۶۷۱
۲۲	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۴۵،۲۱۰
۲۳	خدمات فنی و مهندسی	-۴۷،۰۰۸
۲۴	ساخت محصولات فلزی	-۴۸،۱۸۶
۲۵	لاستیک و پلاستیک	-۵۱،۶۲۴
۲۶	کاشی و سرامیک	-۶۳،۰۲۸
۲۷	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۷۴،۲۷۹
۲۸	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۷۹،۰۸۹
۲۹	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۸۰،۳۷۴
۳۰	قند و شکر	-۸۴،۲۹۵
۳۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۰۳،۱۱۵
۳۲	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۲۸،۴۶۸
۳۳	زراعت و خدمات وابسته	-۱۳۲،۶۲۸
۳۴	واسطه گری های مالی و پولی	-۱۵۸،۹۵۲
۳۵	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۱۵۹،۲۳۶
۳۶	مواد و محصولات دارویی	-۲۲۲،۰۲۰
۳۷	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۲۵۷،۲۳۴
۳۸	استخراج کانه های فلزی	-۳۰۴،۲۴۰
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۳۸۹،۴۵۷
۴۰	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۴۳۰،۱۶۸
۴۱	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۴۳۵،۳۲۱
۴۲	سرمایه گذارها	-۵۸۹،۵۵۹
۴۳	سیمان، آهک و گچ	-۶۵۶،۹۶۵
	جمع ورود نقدینگی	-۶،۷۴۳،۱۵۳