



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۵ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فارس، شستا، خودرو، رمینا، وبملت، وغدیر و تجارت با کاهش ۲۷۱۹ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۱۱,۷۶۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۱۲ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با کاهش ۲۷ درصدی همراه شده است. فشار فروش بر کلیت بازار در روز جاری نسبت به روزهای گذشته کاهش یافته بود و بعضی نمادها علیرغم اینکه در زمان ابتدایی معاملات در بازه منفی شروع به کار کردند اما در انتهای زمان معاملاتی در بازه مثبت به کار خود پایان دادند.

در نشست روز گذشته صحن علنی مجلس شورای اسلامی در بررسی جزئیات لایحه بودجه ۱۴۰۰، نرخ سوخت صنایع از ۵۰ درصد به ۳۰ درصد گاز خوراک پتروشیمی‌ها تعیین شد. بنابراین با فرض میانگین گاز خوراک ۹ سنت برای سال آینده، افزایش هزینه سوخت برای سال آینده از حدود ۲۷۰ درصد رشد به حدود ۱۲۲ درصد کاهش پیدا کرده است که خبر خوبی برای کلیت بازار سرمایه می‌باشد. از طرف دیگر رشد قیمت کامودیتی‌ها بعد از تعطیلات سال نو در کشور چین همچنان ادامه دارد و مجموع این عوامل شرایط بازار امروز را نسبت به روزهای گذشته تغییر داده بود. در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۶۴۸۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۹۴ درصدی داشته است. همچنین اوراق مابجه عام دولت با نماد اراد۷۰۴ 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 اخزا۷۱۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۸ با ۲۰,۹٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۰۴	۱۳۹۹/۱۲/۰۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۱۰,۹۹۵	۶,۴۸۶	-۹۴٪



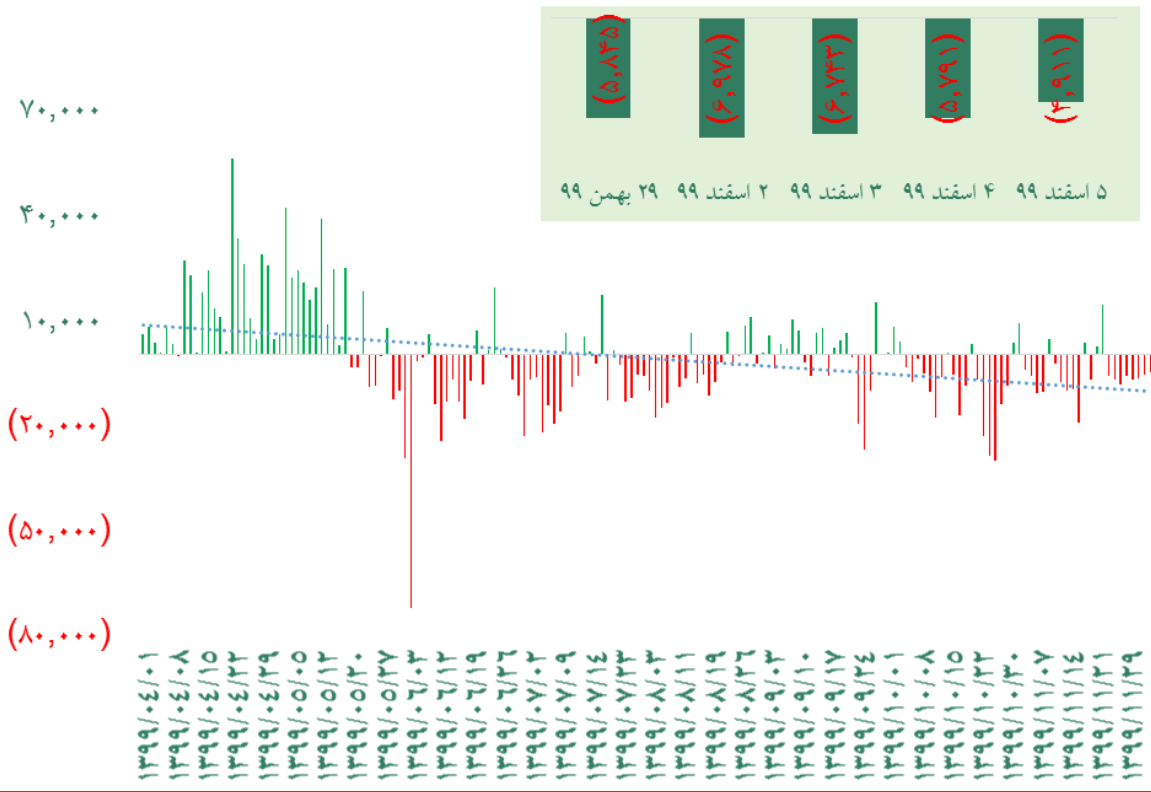
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی شرکت پتروشیمی پردیس، در سال مالی گذشته، هر ماه به طور متوسط ۱۴۳ هزار تن آمونیاک تولید کرد. در سه ماهه ابتدای سال مالی جاری متوسط تولید ماهانه ۱۷۵ هزار تن بوده است. در دی ماه به دلیل افت گاز تولید به ۱۳۵ هزار تن کاهش داشت اما در بهمن ماه مقدار تولید با رشد محسوس به ۱۸۰ هزار تن رسید. مقدار فروش اوره داخلی شرکت در بهمن ماه ۱۴۵ هزار تن بود. بطوریکه میانگین مقدار فروش ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۹۹ هزار تن است. مقدار فروش اوره صادراتی در بهمن ماه نیز ۶۰ هزار تن می باشد. مبلغ فروش ماهانه شرکت در فصل پاییز به ترتیب از مهرماه ۱۶۸۵۰، ۱۲۷۸۰ و ۱۶۹۵۰ میلیارد ریال ثبت شده است. در دی ماه با وجود فروش از موجودی‌ها مبلغ فروش ۱۲ هزار میلیارد ریال بود و مبلغ فروش در بهمن ماه نیز به ۸۸۰۰ میلیارد ریال کاهش پیدا کرده است. نرخ اوره صادراتی به صورت ریالی ۶ درصد کمتر از ماه قبل است و احتمالاً حدود ۲۱۵ الی ۲۲۰ دلار در هر تن به فروش رسیده است. نرخ داخلی اوره نیز ۳۶۰۰۰ هزار به ازای هر کیلو به فروش رفته است.

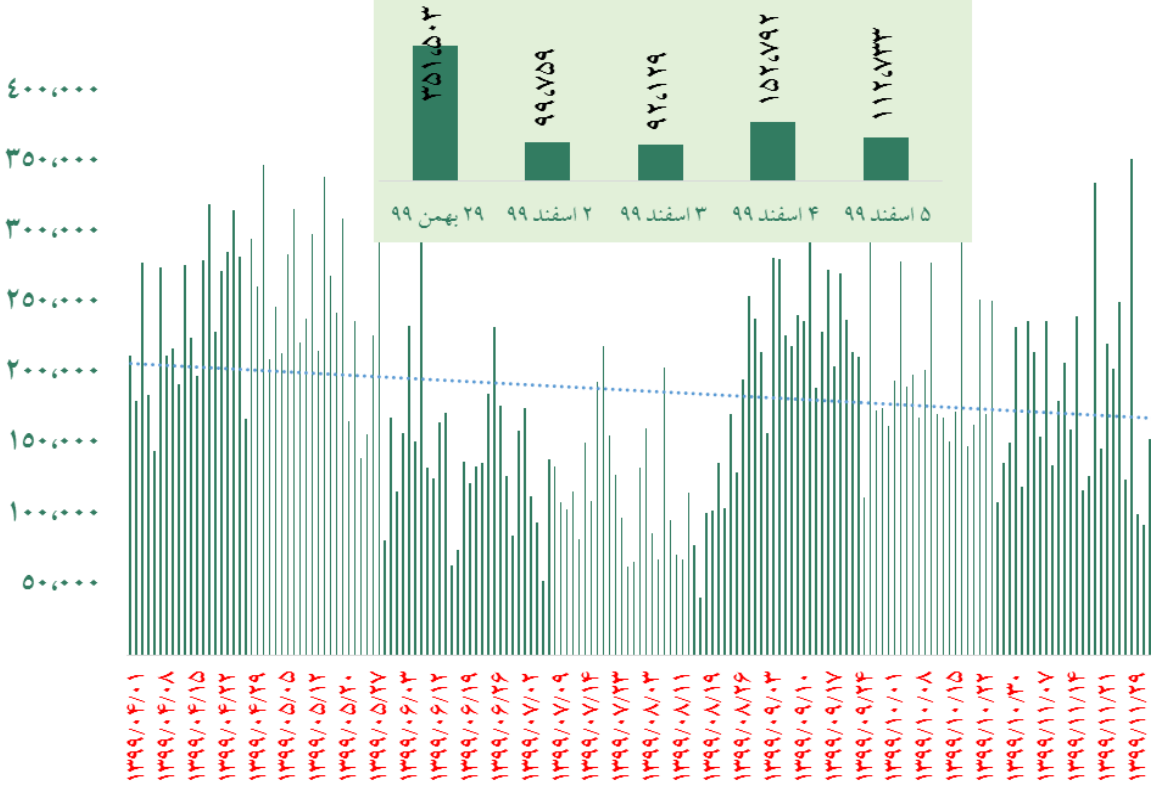
در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد هرمزگان جنوب در فصل اول تا سوم سال جاری به طور متوسط هر ماه فروش ۵۵۷۰، ۸۷۱۰ و ۱۱۳۰۰ میلیارد ریالی را روانه کدال کرده بود و در دی و بهمن ماه فروش شرکت با رشد مناسب به حدود ۱۶۰۰۰ میلیارد ریال رسید. این شرکت در سال مالی گذشته، به طور متوسط هر ماه ۱۲۰ هزار تن اسلب تولید کرد و متوسط تولید شش ماه ابتدای سال ۱۱۴ هزار تن و در فصل پاییز ۱۳۶ هزار تن ثبت شده است. در دی ماه با وجود قطعی گاز، آن شرکت توانست به تولید ۱۴۰ هزار تن دست یابد و در بهمن نیز مقدار تولید به ۱۴۲ هزار تن رسید. موجودی اول سال شرکت حدود ۹۶ هزار تن اسلب بوده است. در ۹ ماهه فروش ۹۹۳ هزار تنی را داشته و با فروش ۱۴۱ هزار تن در دی ماه و ۱۳۰ هزار تن در بهمن ماه موجودی آخر دوره شرکت به ۲۱۲ هزار تن رسیده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



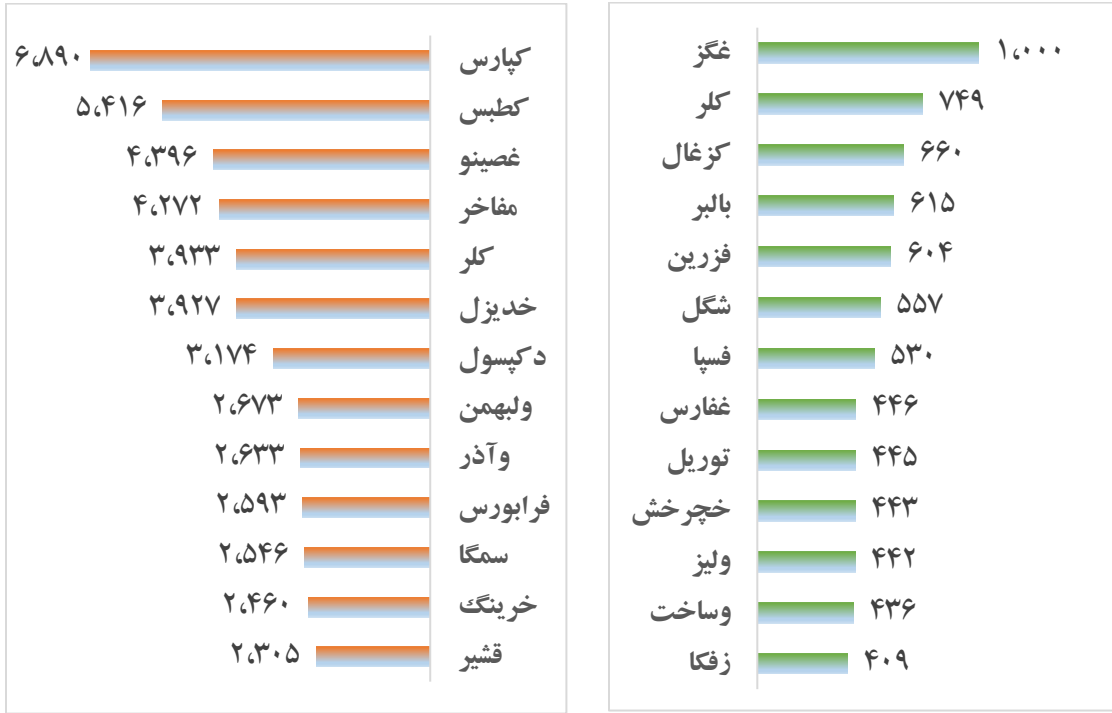
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

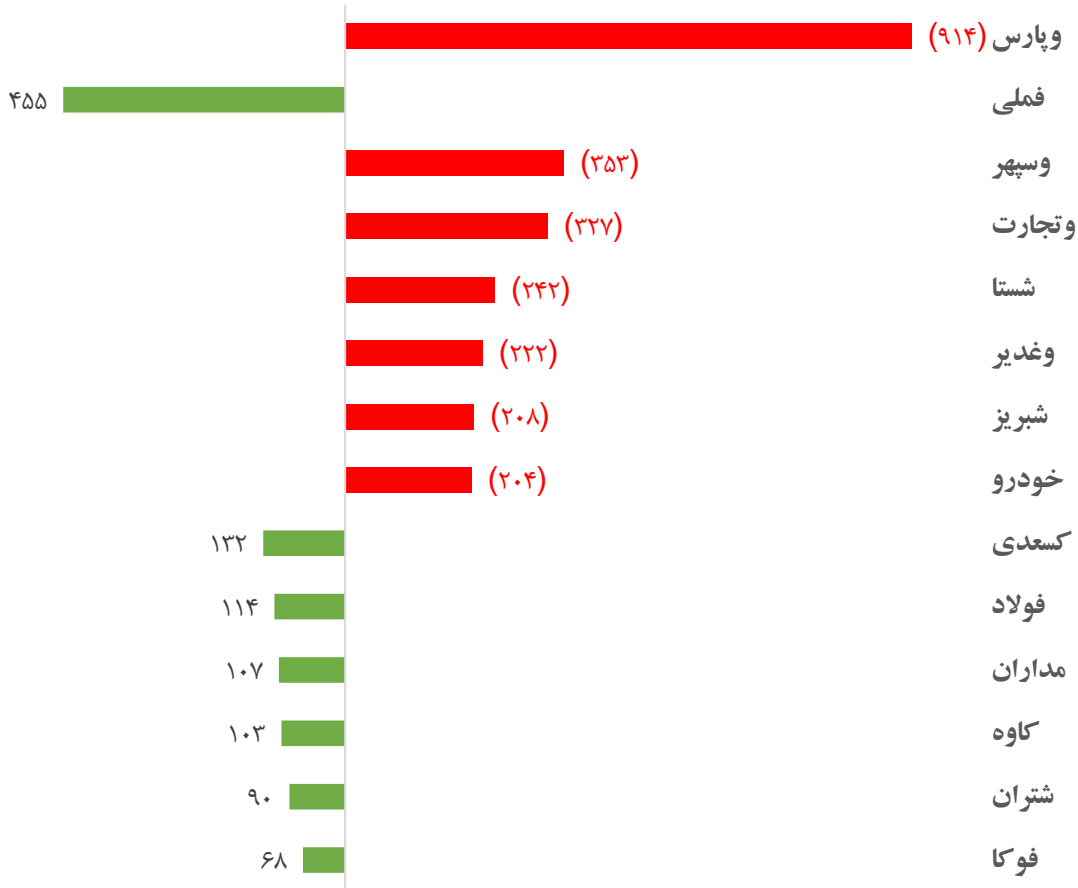


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شصدف	۱	دی
۲	مداران	۲	ویبخش
۳	زفکا	۳	خکار
۴	فملی	۴	کفپارس
۵	زماهان	۵	غشاذر
۶	فلوله	۶	-
۷	کاوه	۷	-
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فرزین	۱۱	شغدیر
۲	ششمال	۱۲	تشرق
۳	کزغال	۱۳	زفکا
۴	غشاذر	۱۴	سصوفی
۵	شبریز	۱۵	امید
۶	غپاک	۱۶	کرازلی
۷	کسرا	۱۷	شبندر
۸	کفپارس	۱۸	فباهر
۹	زماهان	۱۹	ونفت
۱۰	وسین	۲۰	وتوس



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	فلزات اساسی	۲۷۷,۲۹۴
۲	کاشی و سرامیک	۹۸,۵۶۲
۳	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۵۸,۶۰۲
۴	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۵۶,۳۹۴
۵	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۵۴,۴۸۷
۶	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳۲,۶۵۸
۷	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۳۳۵
۸	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۲,۱۲۵
۹	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۲,۵۸۴
۱۰	منسوجات	-۶,۲۶۶
۱۱	حمل و نقل آبی	-۸,۸۴۹
۱۲	مخابرات	-۹,۱۸۵
۱۳	محصولات کاغذی	-۱۳,۵۲۹
۱۴	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۱۸,۴۸۵
۱۵	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۲۵,۹۵۰
۱۶	قند و شکر	-۳۲,۳۸۱
۱۷	استخراج زغال سنگ	-۳۳,۱۳۹
۱۸	هتل و رستوران	-۳۵,۳۹۳
۱۹	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۳۸,۸۵۷
۲۰	لاستیک و پلاستیک	-۴۵,۳۹۹
۲۱	ماشین آلات و تجهیزات	-۴۶,۷۱۸
۲۲	ساخت محصولات فلزی	-۴۸,۰۷۷
۲۳	سایر واسطه‌گریهای مالی	-۶۰,۱۴۱
۲۴	خدمات فنی و مهندسی	-۶۳,۳۵۰
۲۵	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۶۳,۸۸۴
۲۶	زراعت و خدمات وابسته	-۷۸,۱۲۱
۲۷	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	-۹۳,۷۰۶
۲۸	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۱۱۰,۹۷۵
۲۹	سیمان، آهک و گچ	-۱۲۱,۹۹۰
۳۰	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۵۶,۶۳۰
۳۱	مواد و محصولات دارویی	-۱۶۵,۶۰۸
۳۲	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	-۱۹۲,۴۸۱
۳۳	استخراج کانه‌های فلزی	-۲۰۲,۱۵۳
۳۴	خودرو و ساخت قطعات	-۳۲۲,۷۸۲
۳۵	فعالیت‌های کمکی به نهاد‌های مالی واسط	-۳۴۰,۸۳۲
۳۶	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	-۵۰۱,۷۶۲
۳۷	سرمایه‌گذاریها	-۵۱۴,۸۸۷
۳۸	محصولات شیمیایی	-۶۱۲,۲۲۳
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۱,۵۲۱,۷۱۹
جمع ورود نقدینگی		-۴,۹۱۱,۸۴۹