



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز دوشنبه ۱۱ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، شستا، خودرو، وغدیر، فارس، شپنا و پارسان با کاهش ۳,۹۴۴ واحد همراه شد و به سطح ۱,۱۸۱,۶۵۹ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۵۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با افزایش محسوس ۱۶۲ درصدی همراه بوده است. در روز جاری در بازار بورس و فرابورس تهران، شاهد تحرکات قیمتی در بعضی از نمادها در گروه‌های شیمیایی، فلزات و بانک بودیم.

در دو الی سه سال اخیر، اولین بار است که صندوق‌های سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت ملزم به سرمایه‌گذاری حداقل ۱۵ درصد از منابع خود در بازار سهام شده‌اند. بطوریکه در سال‌های اخیر در این نوع صندوق‌ها سقف سرمایه‌گذاری در بازار سهام در حدود ۱۵ درصد بوده است. بنابراین با توجه به الزام رعایت حداقلی مذکور، به نظر می‌رسد، در رزوه‌های آینده شاهد ورود پول‌های جدید به بازار بورس و فرابورس تهران خواهیم بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۸۸,۴۹۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوس ۱۹۳ 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 اخزا۹۰۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۶/۰۶ با ۲۲,۴۹٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۱۰	۱۳۹۹/۱۲/۱۱	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۶۴,۳۱۹	۱۸۸,۴۹۲	۱۹۳٪



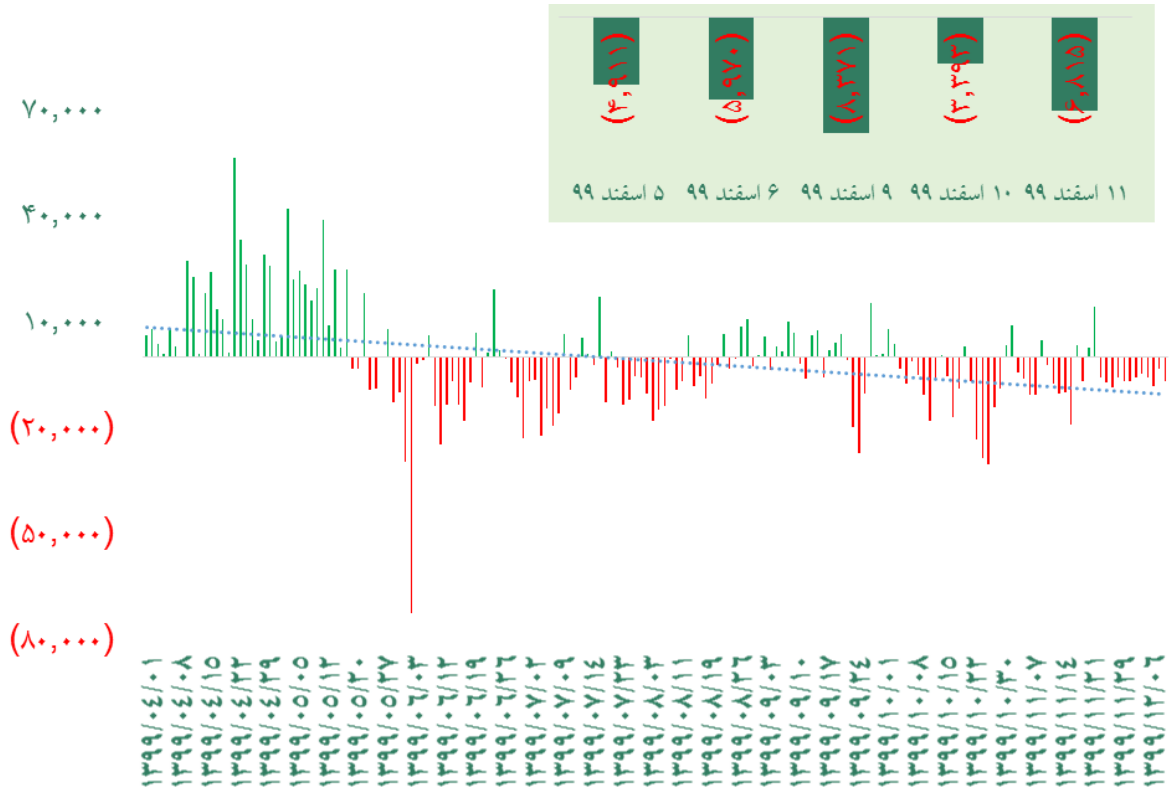
گروه‌های مؤثر

در گروه فرآورده‌های نفتی، شرکت نفت پاسارگاد در ۱۰ ماه اول سال مالی جاری به طور میانگین ۹۳ هزار تن تولید و فروش داشته است. در بهمن ماه مقدار تولید و فروش کاهش یافت و تولید ۸۲ هزار تنی و فروش ۷۶ هزار تنی را به ثبت رساند. این شرکت در بهمن ماه ۴۹۳۰ میلیارد ریال فروش انواع محصولات داشته است. این در حالی است که در سال جاری به طور میانگین ۳۷۰۰ میلیارد ریال فروش را به ثبت رساند. میانگین فروش فصل بهار ۱۵۶۰ میلیارد، تابستان ۳۶۲۰ میلیارد و فصل پاییز ۵۲۴۰ میلیارد ریال بود که در زمستان تاکنون در سطح فصل پاییز عمل کرده است. میانگین نرخ فروش محصولات شرکت نفت پاسارگاد در سال جاری به طور میانگین ۳۸,۶۰۰ ریال در هر کیلو بوده است. این نرخ در بهمن ماه ۶۴,۷۷۰ ریال در هر کیلو ثبت شد که نسبت به دی ماه ۵ درصد رشد را نشان می‌دهد.

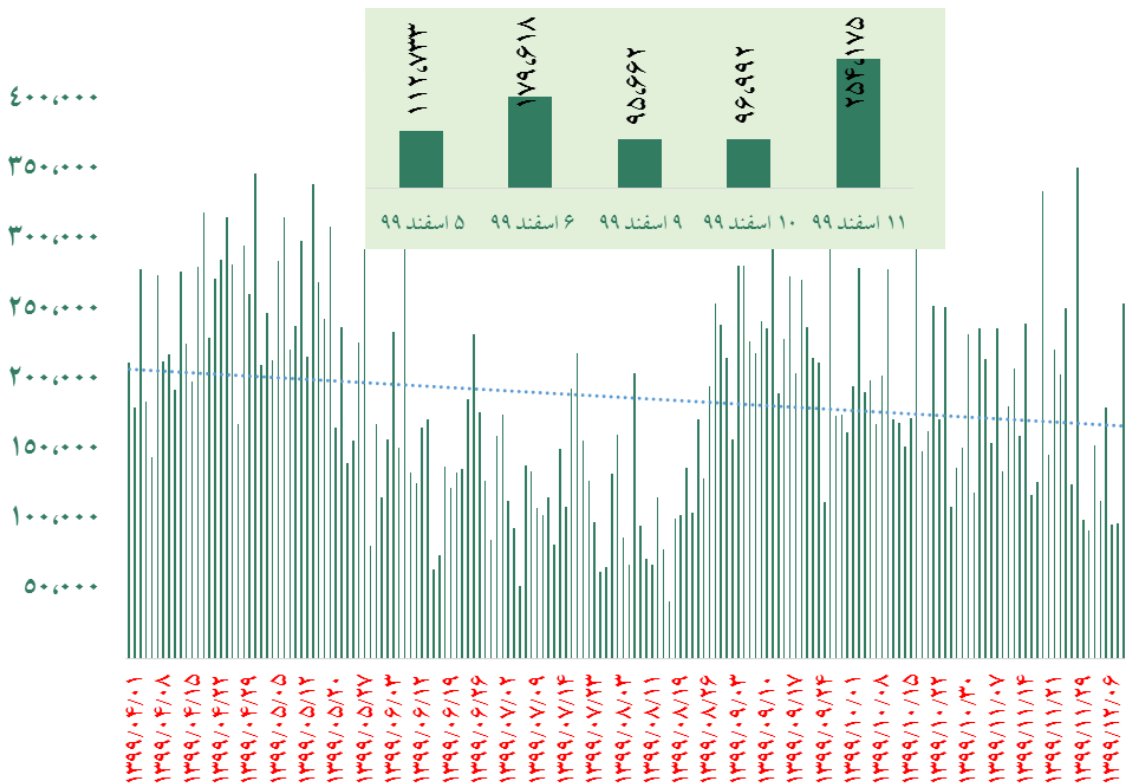
در گروه کانه‌های فلزی، شرکت سنگ آهن گهر زمین در بهمن ماه مشابه دی، ۱,۴ میلیون تن کلوخه و ۳۶۵ هزار تن کنسانتره تولید کرده است. متوسط تولید ماهانه سال مالی گذشته ۱,۳ میلیون تن کلوخه و ۳۷۴ هزار تن کنسانتره است. این تولید کننده سنگ آهن در بهمن ماه نیز یک میلیون تن کلوخه و ۳۱۸ هزار تن کنسانتره فروخته است. متوسط فروش ماهانه سال مالی گذشته برای محصول کلوخه و کنسانتره به ترتیب ۸۲۳ و ۳۲۳ هزار تن بوده است. این شرکت در آبان و آذر ماه درآمد ۱۳۹۴۰ و ۱۲۴۳۰ میلیارد ریالی داشته است. میانگین فروش ۱۲ ماه گذشته ۸۱۷۰ میلیارد ریال می‌باشد و فروش دی و بهمن ماه هم به ترتیب ۱۰۹۳۰ و ۱۷۸۱۰ میلیارد ریال گزارش شده است. نرخ فروش کنسانتره داخلی در بهمن ماه ۲۰۵۸۱ ریال به ازای هر کیلو و کلوخه ۸۰۳۷۰ ریال به ازای هر کیلو ثبت شده است. این شرکت در سال مالی گذشته، محصولات کنسانتره و کلوخه را با نرخ‌های ۱۱۸۵۸ و ۴۴۴۰ ریال به ازای هر کیلو به فروش رسانده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

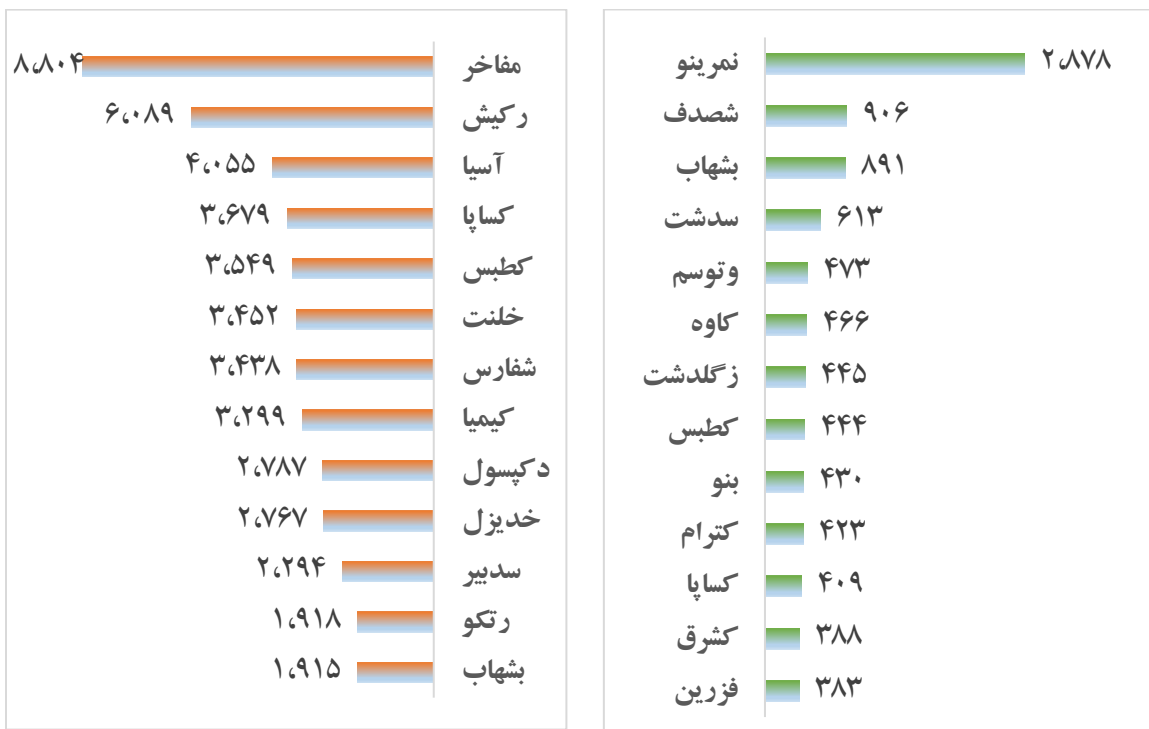


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	اپال	۱	همراه
۲	کزغال	۲	جم
۳	حریل	۳	دتماد
۴	فولاز	۴	وتجارت
۵	سصوفی	۵	دسانکو
۶	شبصیر	۶	-
۷	کاوه	۷	-
۸	وتوسم	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فزرین	۱۱	شاون
۲	کزغال	۱۲	چفبیر
۳	کرمان	۱۳	کاوه
۴	سصوفی	۱۴	غفارس
۵	غپاک	۱۵	فباهر
۶	شغدیر	۱۶	ستران
۷	اپال	۱۷	وسین
۸	سمازن	۱۸	وکبهن
۹	حریل	۱۹	حتاید
۱۰	ونفت	۲۰	زاگرس



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	۲,۰۲۱۵
۲	محصولات کاغذی	۱,۰۳۸۶
۳	منسوجات	۱,۰۲۴۸
۴	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۳۱۵
۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۹۱۷
۶	ساخت محصولات فلزی	-۱,۰۰۴۰
۷	ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی	-۳,۹۴۹
۸	اطلاعات و ارتباطات	۲۸۹
۹	واسطه گری های مالی و پولی	-۱,۰۸۷
۱۰	لاستیک و پلاستیک	-۲,۰۱۴۴
۱۱	حمل و نقل آبی	-۲,۵۵۹
۱۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۵,۲۵۷
۱۳	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۷,۳۴۷
۱۴	پیمانکاری صنعتی	-۱۱,۲۹۵
۱۵	قند و شکر	-۱۱,۷۲۶
۱۶	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۱۸,۶۱۴
۱۷	محصولات چوبی	-۲۰,۵۶۸
۱۸	سایر واسطه گری های مالی	-۲۲,۵۴۹
۱۹	هتل و رستوران	-۲۶,۳۵۸
۲۰	زراعت و خدمات وابسته	-۲۶,۳۸۰
۲۱	ماشین آلات و تجهیزات	-۲۸,۴۸۰
۲۲	مخابرات	-۴۱,۱۷۳
۲۳	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۴۵,۱۴۸
۲۴	ماشین آلات و دستگاه های برقی	-۶۸,۷۱۵
۲۵	استخراج زغال سنگ	-۹۸,۸۲۱
۲۶	سیمان، آهک و گچ	-۱۱۲,۷۴۹
۲۷	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۱۱۴,۴۹۹
۲۸	خدمات فنی و مهندسی	-۱۲۵,۴۹۲
۲۹	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۴۹,۵۶۶
۳۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۱۵۱,۵۵۲
۳۱	فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط	-۱۷۱,۸۳۰
۳۲	مواد و محصولات دارویی	-۲۴۴,۷۳۰
۳۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۳۱۳,۲۸۷
۳۴	محصولات شیمیایی	-۳۳۹,۹۴۸
۳۵	فلزات اساسی	-۳۴۶,۴۸۹
۳۶	خودرو و ساخت قطعات	-۳۸۱,۵۵۵
۳۷	استخراج کانه های فلزی	-۴۷۸,۵۰۳
۳۸	سرمایه گذاریها	-۴۸۵,۰۲۳
۳۹	شرکت های چند رشته ای صنعتی	-۵۴۰,۲۰۹
۴۰	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۱,۰۹۳,۰۷۵
۴۱	بانکها و موسسات اعتباری	-۱,۳۲۷,۷۶۳
جمع ورود نقدینگی		-۶,۸۱۴,۹۴۴