



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۱۲ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای کگل، فولاد، کچاد، شبندر، فخوز، اپال و پاکشو با افزایش ۴,۶۴۵ واحد همراه شد و به سطح ۱,۱۸۶,۲۸۶ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۸۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با کاهش ۲۷ درصدی همراه بوده است. در روز جاری در بازار بورس و فرابورس تهران، تعداد نمادهایی که در بازه قیمتی مثبت به کار خود پایان داده‌اند، نسبت به روزهای گذشته بیشتر شده بود و صف‌های فروش در بسیاری از نمادها برچیده شد. به نظر می‌رسد، الزام صندوق‌های با درآمد ثابت برای خرید سهام در چند روز آینده، باعث ایجاد تقاضای قوی‌تر نسبت به روزهای قبل در بازار سهام شود.

در چند روز گذشته به طور مستمر شاهد خروج پول توسط حقیقی‌ها در بازار سرمایه هستیم. با توجه به شرایط رکودی ایجاد شده، اعتماد فعالین بازار سرمایه هر روز به بازار بورس و فرابورس تهران کم رنگ‌تر می‌شود. همچنین در چند وقت اخیر شاهد ابطال معاملات در بعضی از نمادها توسط ناظر بورس و فرابورس هستیم. بسیاری از نمادها در ۶ ماه اخیر بیش از ۶۰ درصد نزول قیمتی را تجربه کرده‌اند اما در این مدت ناظر بازار، معاملات روزانه هیچ کدام از نمادها را به عنوان ظن دستکاری باطل نکرد، اما وقتی نمادی صف خرید می‌شود، به دفعات شاهد ابطال معاملات از طرف ناظر بازار به دلیل ظن دستکاری در معاملات هستیم و آن نماد متوقف می‌شود. این موضوع نیز باعث کاهش نقد شوندگی بیشتر بازار سرمایه شده است.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۱۵,۴۱۳ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۳۹ درصدی داشته است. همچنین اوراق مباحه عام دولت با نماد اراد ۳۵۴ 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 ۲۲,۳٪ سود است.

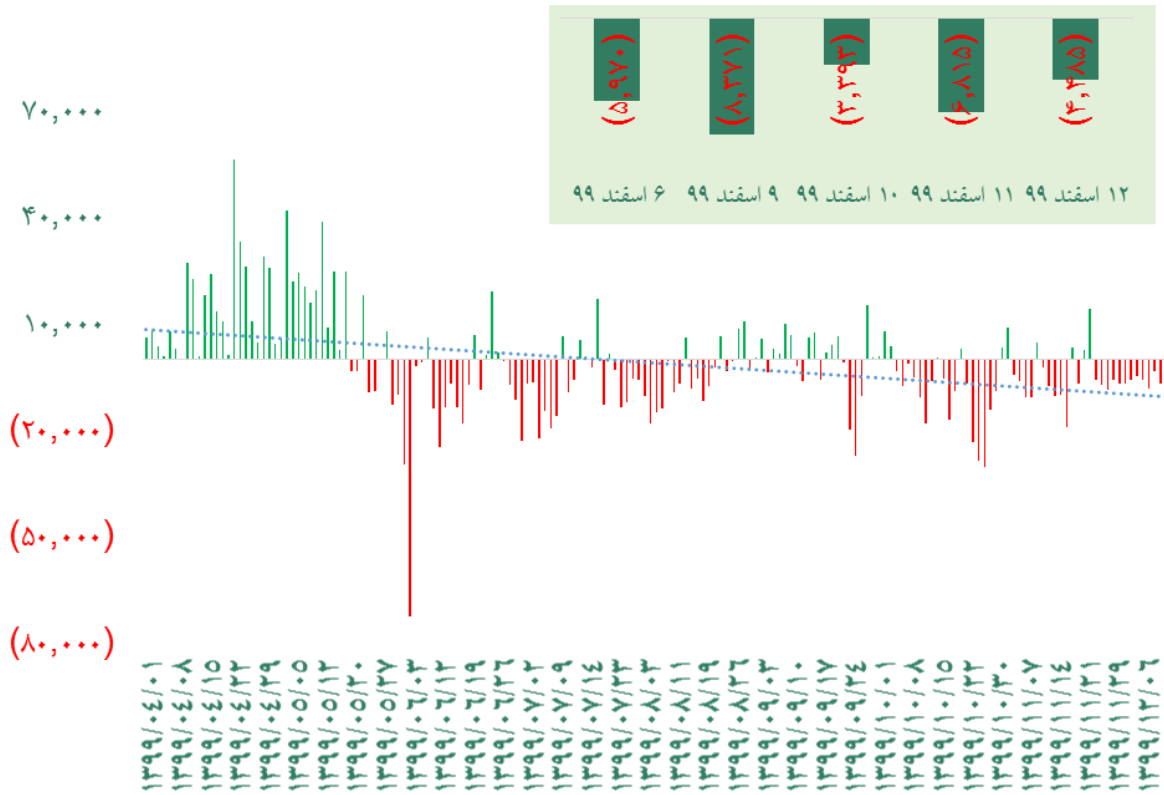
شرح	۱۳۹۹/۱۲/۱۱	۱۳۹۹/۱۲/۱۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۸۸,۴۹۲	۱۱۵,۴۱۳	-۳۹٪

گروه‌های مؤثر

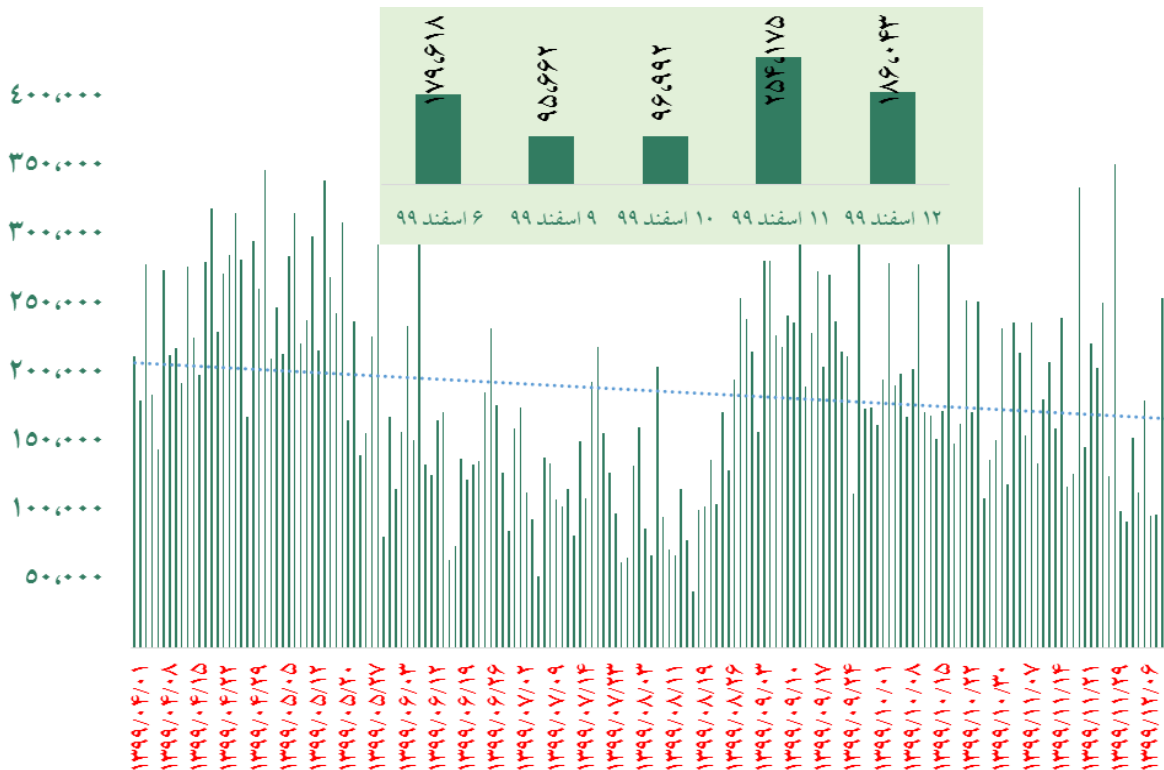
در گروه خودرویی، شرکت سایپا در بهمن ماه فروش ۱۹۵۶۰ میلیارد ریالی داشته و فروش ۱۱ ماهه را به ۱۲۹۱۶۰ میلیارد ریال رسانده است. میانگین فروش ماهیانه در سال جاری ۱۱۷۴۰ میلیارد ریال بوده و کل فروش سال مالی قبل ۱۳۷۵۲۰ میلیارد ریال است. این شرکت در بهمن ماه ۲۹۶۰۰ دستگاه خودرو تولید داشته در حالی که میانگین تولید ماهیانه سال جاری ۲۶۵۰۰ و در سال گذشته ۳۰۲۰۰ دستگاه بوده است. این خودروساز در بهمن ماه سال مالی جاری ۲۷ هزار دستگاه خودرو فروخته در حالیکه میانگین فروش ماهانه سال جاری ۲۳۵۰۰ و سال گذشته ۳۲۳۰۰ دستگاه بوده است. این شرکت در بهمن ماه به طور میانگین هر دستگاه خودرو را به قیمت ۷۲۰ میلیون ریال فروخته که میانگین نرخ فروش در سال جاری ۵۰۰ میلیون ریال و در سال گذشته ۳۶۰ میلیون ریال می باشد.

در گروه لاستیک، شرکت کویر تایر در بهمن ماه (ماه دوم سال مالی جدید) فروش ۱۳۶۰ میلیارد ریالی داشته که در دی ماه ۱۱۹۰ میلیارد ریال بوده است. شرکت کویر تایر در سال مالی گذشته به طور متوسط هر ماه ۲۴۸۴ تن تایر تولید کرده بود. این عدد در بهمن ماه در حدود ۲۳۰۰ تن و در دی ماه نیز ۲۴۰۰ تن بوده است. کویر تایر در سال مالی گذشته به طور متوسط هر ماه ۲۴۳۸ تن تایر فروخته بود. این عدد در بهمن ماه ۲۱۲۸ تن و در دی ماه نیز ۱۹۳۰ تن ثبت شده است. میانگین نرخ فروش تایر در سال مالی گذشته ۳۹۰ هزار ریال در هر کیلو بود و در بهمن نرخ فروش ۶۴۰ هزار ریال گزارش شده است که ۳ درصد نسبت به ماه قبل و حدود ۶۳ درصد نسبت به میانگین سال گذشته رشد داشته است.

ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

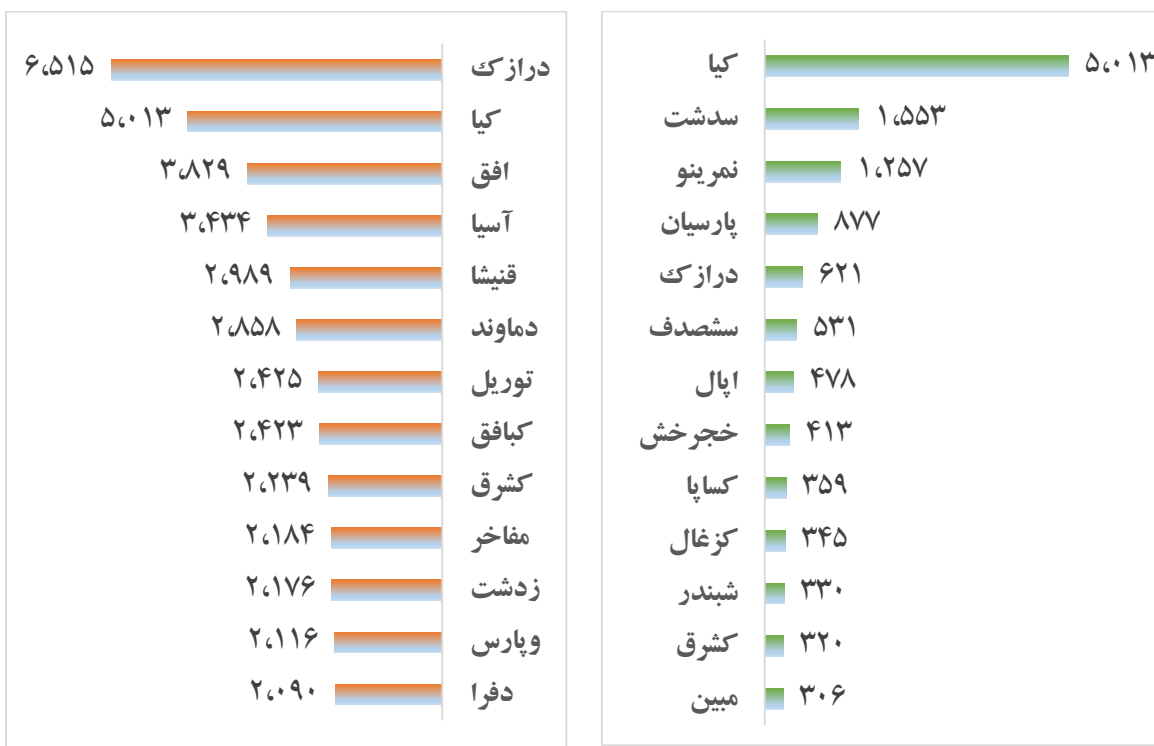


رشد ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

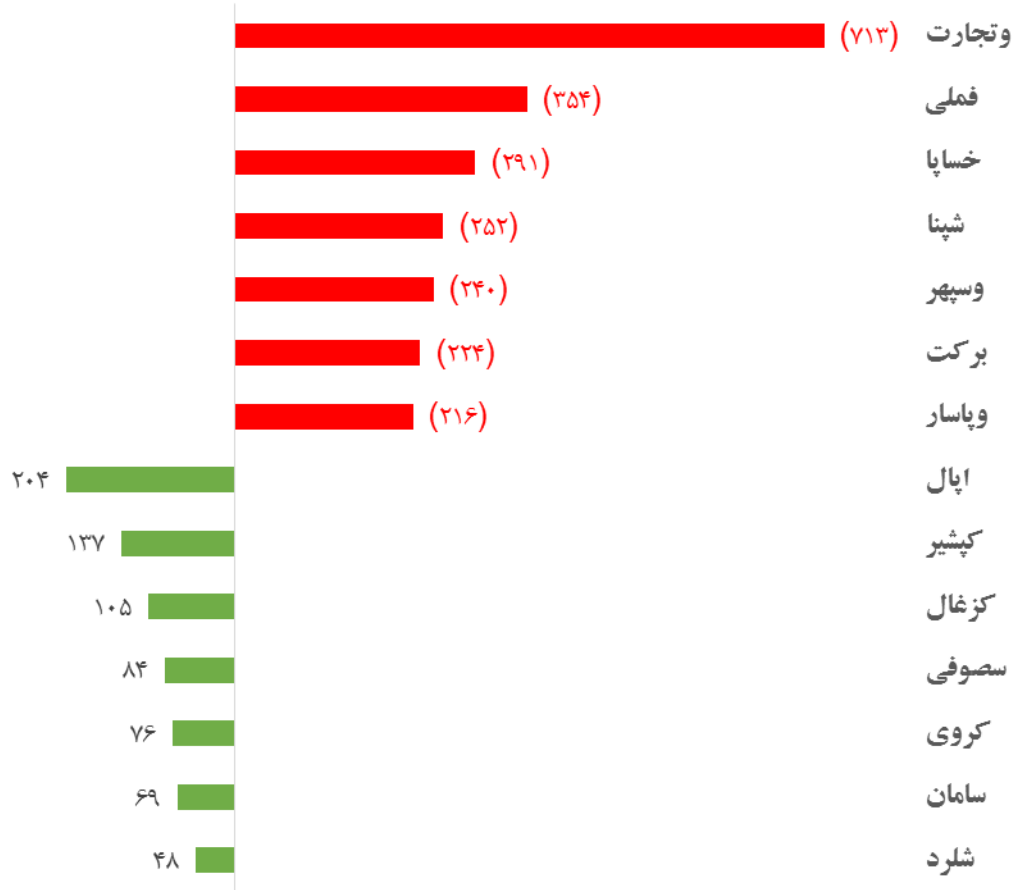


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
1	کزغال	1	وتوشه
2	برکت	2	ثامان
3	-	3	شیران
4	-	4	دی
5	-	5	دپارس
6	-	6	غیشهر
7	-	7	وسپه
8	-	8	-
9	-	9	-
10	-	10	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
1	کزغال	11	غفارس
2	برکت	12	وتوشه
3	کرمان	13	چفبیر
4	سیلام	14	کروی
5	سصوفی	15	غپاک
6	سشمال	16	شاوان
7	فزرین	17	ساراب
8	کرازی	18	سمازن
9	ستران	19	حریل
10	شغدیر	20	سشرق



ورود نقدینگی به تفکیک صنعتورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
1	استخراج کانه های فلزی	188,047
2	سایر محصولات کانی غیر فلزی	128,590
3	استخراج زغال سنگ	106,783
4	منسوجات	44,680
5	کاشی و سرامیک	1,988
6	ساخت محصولات فلزی	-609
7	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-1,825
8	ساخت دستگاهها و وسایل ارتباطی	-4,775
9	اطلاعات و ارتباطات	-17,426
10	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-4,942
11	لاستیک و پلاستیک	-6,963
12	محصولات کاغذی	-7,434
13	خرده فروشی، باستانهای وسایل نقلیه موتوری	-8,188
14	پیمانکاری صنعتی	-10,813
15	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-10,954
16	هتل و رستوران	-12,512
17	محصولات چوبی	-14,229
18	سایر واسطه گریهای مالی	-15,411
19	سیمان، آهک و گچ	-17,184
20	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-19,807
21	زراعت و خدمات وابسته	-22,607
22	ماشین آلات و دستگاههای برقی	-26,031
23	واسطه گری های مالی و پولی	-26,047
24	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-27,781
25	مخابرات	-31,603
26	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-33,219
27	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-46,603
28	قند و شکر	-51,205
29	خدمات فنی و مهندسی	-53,973
30	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-81,633
31	ماشین آلات و تجهیزات	-86,670
32	محصولات شیمیایی	-108,338
33	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-114,623
34	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-116,210
35	فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط	-159,917
36	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-197,394
37	سرمایه گذاریها	-326,359
38	مواد و محصولات دارویی	-361,269
39	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-425,446
40	خودرو و ساخت قطعات	-549,539
41	فلزات اساسی	-604,476
42	بانکها و موسسات اعتباری	-1,351,590
جمع ورود نقدینگی		-4,485,517