



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۱۳ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فارس، شستا، فولاد، شپنا، تاپیکو و خودرو با کاهش ۸,۳۰۰ واحد همراه شد و به سطح ۱,۱۷۷,۹۷۶ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۳۱۷ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با افزایش محسوس ۷۱ درصدی همراه بوده است. در روز جاری شرایط بازار فرابورس، بهتر از بازار بورس بوده است. بطوریکه در بازار فرابورس، تعداد نمادهایی که در بازه مثبت به کار خود پایان دادند، بسیار بیشتر از بازار بورس بوده است. به نظر می‌رسد با توجه به نیاز بعضی از حقوقی‌ها به پول در روزهای منتهی به پایان سال، فشار فروش بر سهام‌های شاخص ساز در روزهای باقیمانده ماه جاری، بیشتر از نمادهای کوچک باشد.

با توجه به تغییر دامنه نوسان، تکمیل شدن اصلاح زمانی شاخص کل، نیاز به زمان بیشتری دارد. اگر دامنه نوسان تغییر نمی‌کرد، با توجه به فشار فروشی که بر بازار حاکم است، تا به امروز شاخص کل به کف قبلی خود در حوالی ۱,۱۳۰,۰۰۰ واحد می‌رسید. اما در حال حاضر با توجه به شرایط وضع شده، اصلاح زمانی شاخص کل به مدت زمان بیشتری نیاز دارد. بنابراین به نظر نمی‌رسد بازار سرمایه حداقل تا دو ماه آینده با افزایش تقاضای قوی مواجه شود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲۶۰,۰۳۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش ۱۲۵ درصدی داشته است. همچنین اوراق مراحه عام دولت با نماد اراد۳۱۴ 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 ۲۲,۰۶٪ سود است.



درصد تغییر	۱۳۹۹/۱۲/۱۳	۱۳۹۹/۱۲/۱۲	شرح
۱۲۵%	۲۶۰,۰۳۱	۱۱۵,۴۱۳	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)

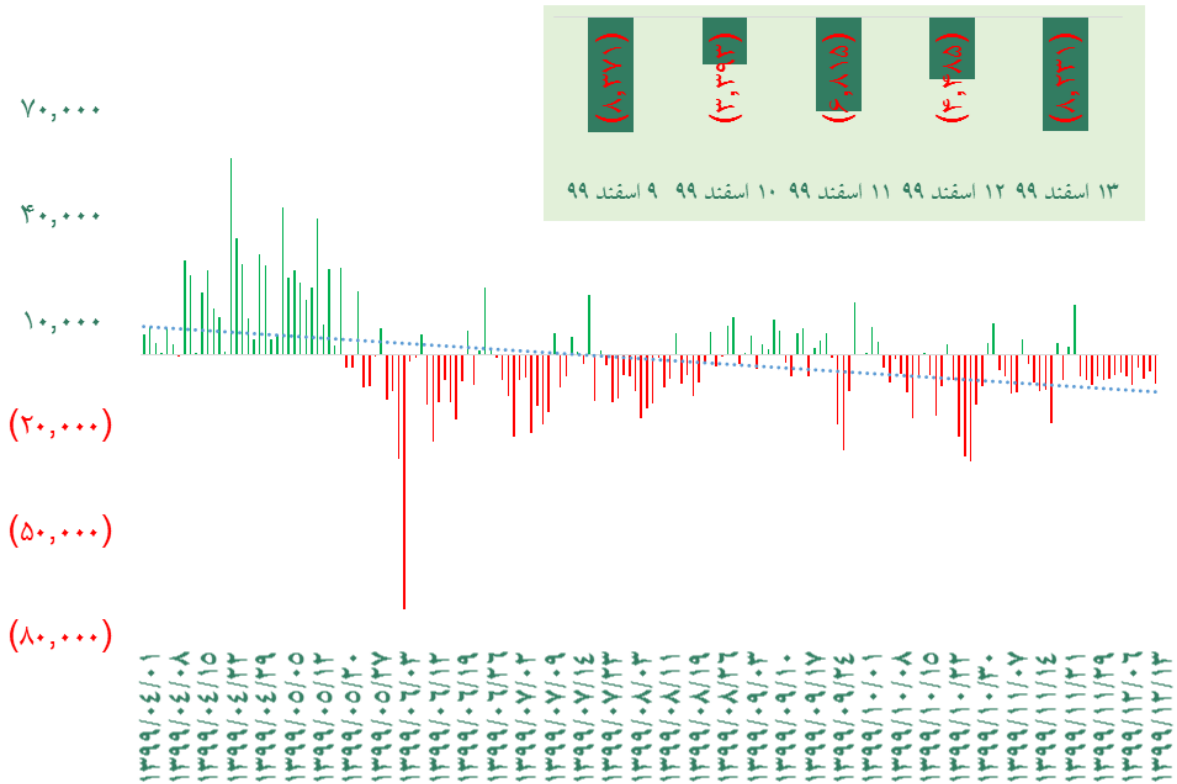
گروه‌های مؤثر

در گروه خودرویی، شرکت ایران خودرو در بهمن ماه توانست فروش ۴۵۴۷۰ میلیارد ریالی را به ثبت برساند که این رقم در مقایسه با میانگین فروش ماهانه سال مالی جاری افزایش ۴۰ درصدی را نشان می‌دهد. از مرداد ماه سال مالی جاری مبلغ فروش ماهانه به بالاتر از ۳۰ هزار میلیارد ریال رسید و فروش در بهمن ماه بعد از فروش ۶۰ هزار میلیاردی در آذر و ۴۹ هزار میلیارد ریالی در دی ماه، جزء بهترین فروش‌های ماهانه سال جاری به شمار می‌آید. این شرکت تولید ۴۳ هزار دستگاه خودرو را در بهمن ماه گزارش کرده است. میانگین تولید ماهانه امسال، ۳۸ هزار دستگاه است. در بهمن ماه، ۵۷ درصد از فروش شرکت از محل گروه پژو است. میانگین فروش ماهانه سال جاری برای گروه پژو ۲۷ هزار دستگاه و مبلغ ۲۲۲۸۰ میلیارد ریال می‌باشد. گروه دنا نیز با فروش ۸ هزار دستگاه و کسب ۱۲۵۰۰ میلیارد ریال، سهم ۲۷ درصدی از درآمد بهمن ماه شرکت ایران خودرو را تشکیل داده‌اند. متوسط نرخ فروش محصولات در ۱۰ ماه اول ۸۲۰ میلیون ریال بوده که همواره در حال رشد است. در بهمن ماه نرخ فروش به ۱۲۶۰ میلیارد ریال به ازای هر دستگاه رسید.

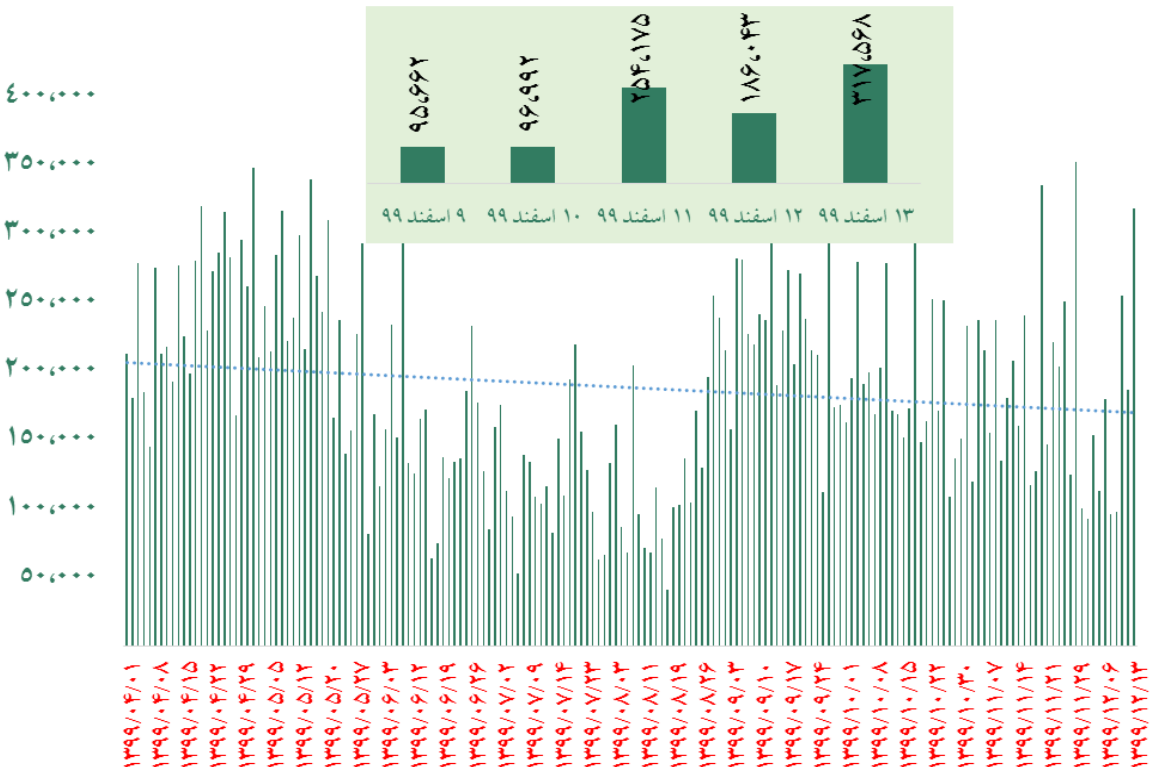
در گروه فلزات اساسی، شرکت آهن و فولاد ارفع در سه هفته اخیر ۴۷ هزار تن شمش در بورس کالا عرضه کرده است که تمام حجم عرضه شده، معامله شد. پس از نوسان قیمتی در ماه‌های اخیر، بازار فولاد وارد فاز تعادلی شده است. در این مدت به دنبال سفارشات عرضه، حجم‌ها و قیمت‌ها در سمت تقاضا، به طور معقول وارد سامانه شده که نشان می‌دهند، قیمت‌های پایه بورس کالا با شرایط واقعی بازار چندان اختلاف ندارد. اوج‌گیری قیمت محصولات فولادی در جهان، محرک بالا رفتن نرخ‌ها بوده و از طرفی انتظارات کاهشی برای نرخ دلار اجازه افزایش شدید به قیمت‌ها را نمی‌دهد.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



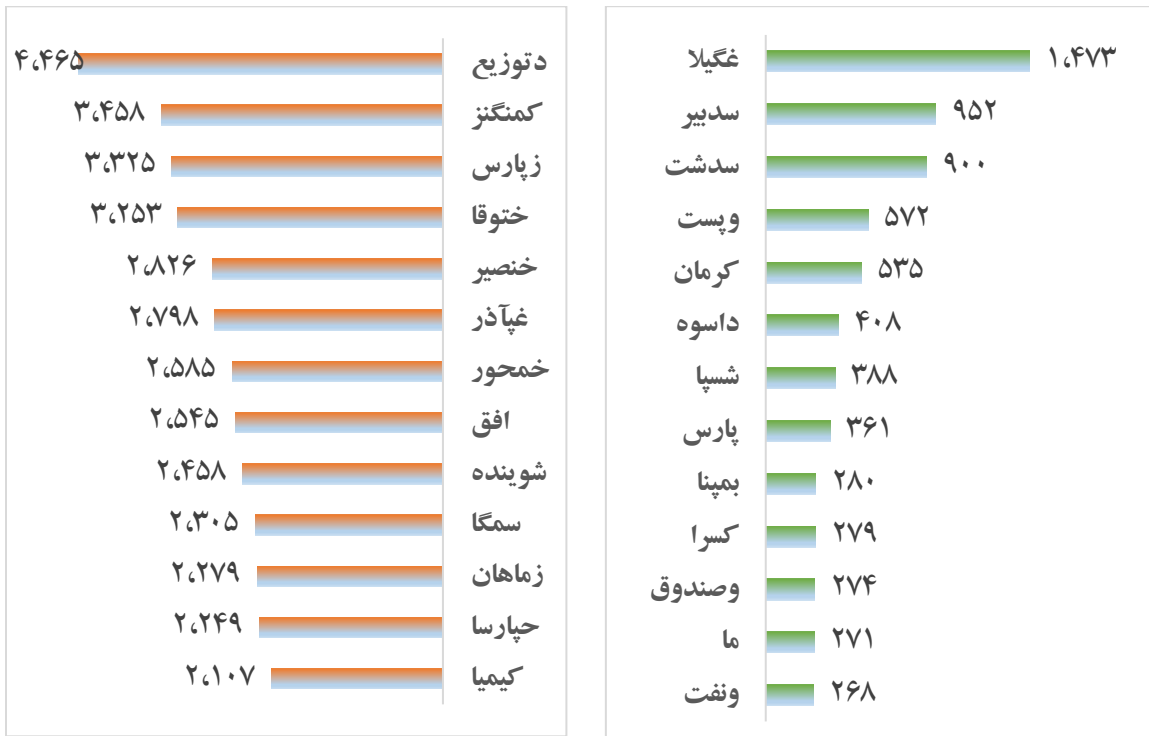
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

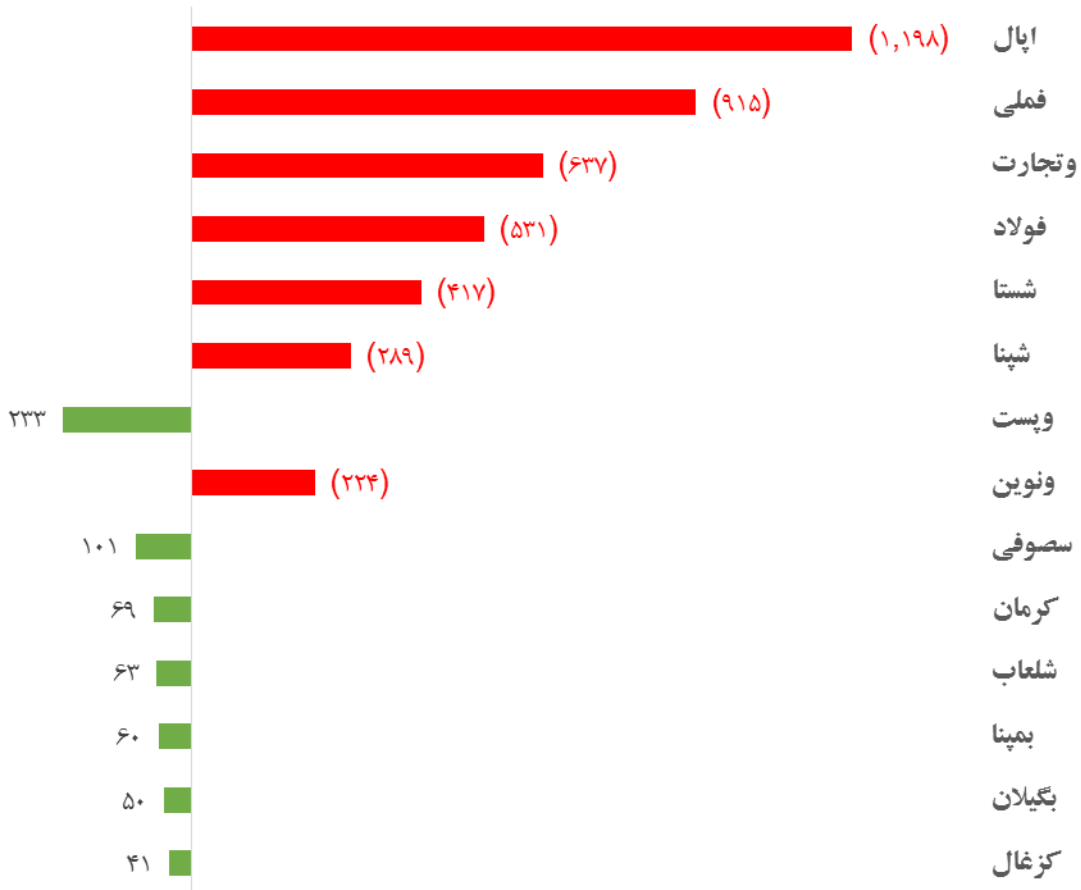


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	کزغال	۱	پپاس
۲	وېست	۲	وهور
۳	شسپا	۳	سصفها
۴	بجهرم	۴	بمپنا
۵	تملت	۵	دتماد
۶	آبادا	۶	سیلام
۷	اپال	۷	پارسپان
۸	بگیلان	۸	دماوند
۹	-	۹	سغرب
۱۰	-	۱۰	سبزوا



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کزغال	۱۱	شمال
۲	برکت	۱۲	غپاک
۳	سصوفی	۱۳	وساخت
۴	اپال	۱۴	آبادا
۵	کرمان	۱۵	تبرک
۶	سیلام	۱۶	پیوند
۷	شغدیر	۱۷	بوعلی
۸	دماوند	۱۸	سمازن
۹	خاهن	۱۹	فباهر
۱۰	وپیست	۲۰	وکبهن



ورود نقدینگی به تفکیک ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵۲,۲۳۲
۲	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴۲,۱۸۰
۳	استخراج زغال سنگ	۲۸,۰۹۹
۴	قند و شکر	۶,۶۵۳
۵	استخراج سایر معادن	۱۰
۶	محصولات کاغذی	-۲,۳۰۸
۷	ساخت محصولات فلزی	-۲,۴۹۱
۸	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۹۳۲
۹	اطلاعات و ارتباطات	-۲۵۵
۱۰	خرده فروشی، باستانهای وسایل نقلیه موتوری	-۲,۶۷۵
۱۱	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۲,۷۲۰
۱۲	لاستیک و پلاستیک	-۳,۰۷۶
۱۳	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۶,۱۶۸
۱۴	منسوجات	-۷,۳۸۳
۱۵	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۸,۰۴۲
۱۶	هتل و رستوران	-۱۰,۷۴۸
۱۷	پیمانکاری صنعتی	-۱۰,۹۰۴
۱۸	سایر واسطه گریهای مالی	-۱۳,۳۴۸
۱۹	خدمات فنی و مهندسی	-۱۷,۳۹۷
۲۰	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۲۱,۷۴۳
۲۱	محصولات چوبی	-۲۳,۶۱۰
۲۲	کاشی و سرامیک	-۲۴,۱۲۸
۲۳	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۳۱,۵۵۸
۲۴	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۳۴,۹۵۴
۲۵	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۳۸,۱۸۷
۲۶	زراعت و خدمات وابسته	-۴۷,۶۰۷
۲۷	ماشین آلات و تجهیزات	-۷۷,۴۷۳
۲۸	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	-۷۹,۵۹۳
۲۹	خودرو و ساخت قطعات	-۸۰,۵۱۳
۳۰	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	-۹۰,۴۸۳
۳۱	سیمان، آهک و گچ	-۹۷,۶۸۵
۳۲	مخابرات	-۱۱۷,۴۰۲
۳۳	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۱۴۵,۹۲۸
۳۴	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۲۲۹,۲۷۹
۳۵	مواد و محصولات دارویی	-۲۵۴,۹۶۱
۳۶	سرمایه گذارها	-۳۰۷,۱۳۶
۳۷	محصولات شیمیایی	-۳۲۵,۷۳۱
۳۸	شرکت‌های چند رشته ای صنعتی	-۵۶۴,۴۱۹
۳۹	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۶۶۸,۱۳۲
۴۰	بانکها و موسسات اعتباری	-۱,۲۲۱,۴۰۸
۴۱	استخراج کانه های فلزی	-۱,۴۰۵,۶۰۷
۴۲	فلزات اساسی	-۲,۴۸۱,۵۳۳
جمع ورود نقدینگی		-۸,۲۳۱,۳۵۳