



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۱۶ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، فارس، فولاد، شستا، شپنا، وبملت و وپاسار با کاهش ۸,۱۷۳ واحد همراه شد و به سطح ۱,۱۶۹,۷۴۳ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۹۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته معاملاتی با کاهش ۳۷ درصدی همراه بوده است. در روز جاری کلیت بازار با فشار فروش همراه بود، بطوریکه بسیاری از نمادها با صف فروش به کار خود پایان داده‌اند.

در نامه‌ای از طرف مدیر نظارت بر نهادهای مالی در روز جاری، صندوق‌های با درآمد ثابت موظف شدند به شکل خرد، سهام را از بازار خرید کرده و خرید سهام به صورت بلوک برای این نوع صندوق‌ها برای اجرای سقف روزانه ممنوع شده است. در چند وقت گذشته خبرها و اتفاقات مثبت از افزایش اعتبار مشتریان نزد کارگزاری‌ها گرفته تا قوانین جدید برای صندوق‌های با درآمد ثابت و همچنین افزایش نرخ کامودیتی‌ها به بازار سرمایه مخابره شده است اما واکنش بازار به همه این خبرها و اتفاقات، منفی بوده است. به نظر می‌رسد تا زمانیکه وضعیت نرخ دلار مشخص نشود، کلیت بازار سرمایه نیز با افزایش تقاضای محسوسی همراه نخواهد بود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۴۹,۲۹۱ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۴۳ درصدی داشته است. همچنین اوراق مباحه عام دولت با نماد اراد۶۴۴ 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 ۲۲,۲۸٪ سود است.



درصد تغییر	۱۳۹۹/۱۲/۱۶	۱۳۹۹/۱۲/۱۳	شرح
-۴۳%	۱۴۹,۲۹۱	۲۶۰,۰۳۱	ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)

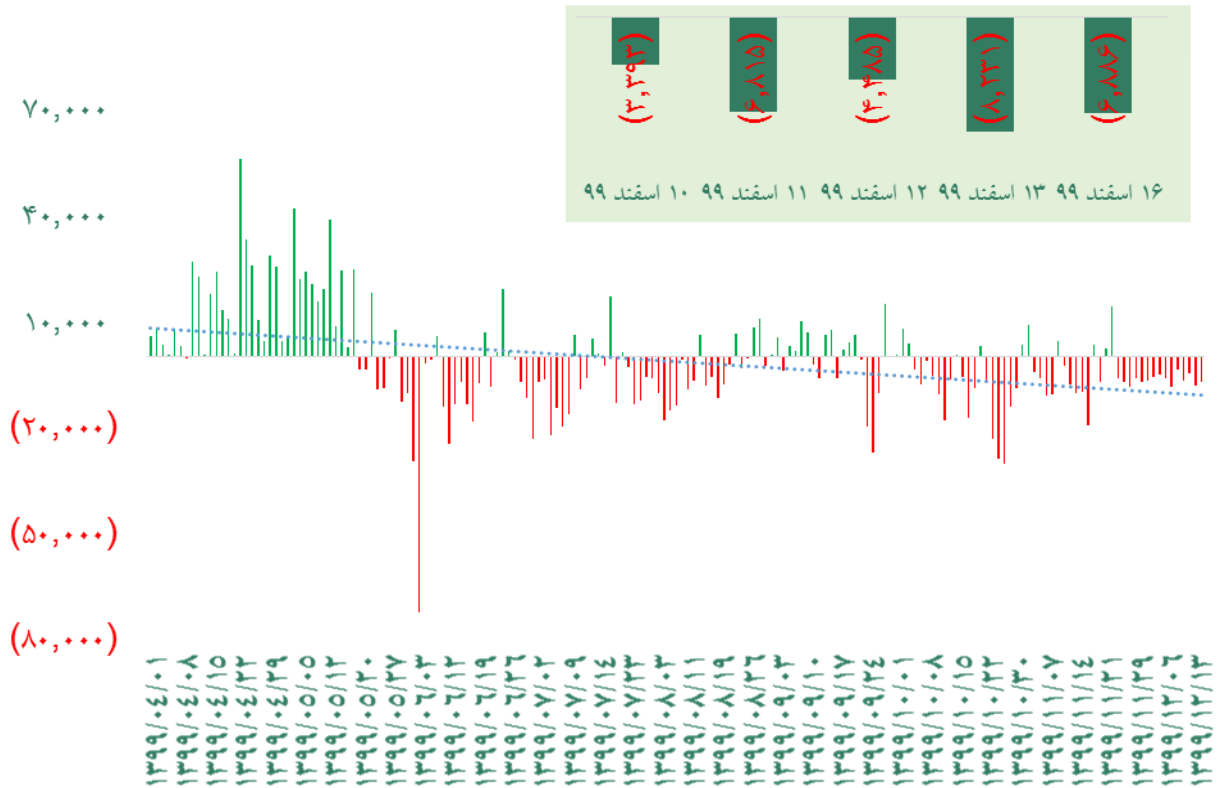
گروه‌های مؤثر

در گروه زغال سنگ، شرکت زغال سنگ پروده طبس در بهمن ماه سال مالی جاری موفق به فروش ۲,۰۸۱ میلیارد ریالی شده است. مبلغ فروش در بهمن حدود ۱۰۰ درصد بیشتر از میانگین ۱۰ ماه گذشته بود. از ابتدای سال مالی جاری تا پایان ماه گذشته، ۱۲,۶۸۵ میلیارد ریال فروش را به ثبت رسانده است که نسبت به مدت مشابه سال گذشته با رشد ۱۰۰ درصدی همراه بود. کل مبلغ فروش ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۸,۸۶۵ میلیارد ریال می باشد که فروش ۱۱ ماهه سال مالی جاری نیز حدود ۴۳ درصد بیشتر از ۱۲ ماهه سال مالی گذشته بیشتر می باشد. نرخ فروش محصول کنسانتره زغال سنگ شرکت زغال سنگ پروده طبس در بهمن ماه ۲۹,۸۸۴,۸۶۶ ریال ثبت شده است که نسبت به میانگین نرخ فروش ۱۰ ماه گذشته با رشد ۳۰ درصدی همراه شده است. نسبت نرخ زغال سنگ به شمش فولاد خوزستان در ماه گذشته حدود ۲۷,۶ درصد بود.

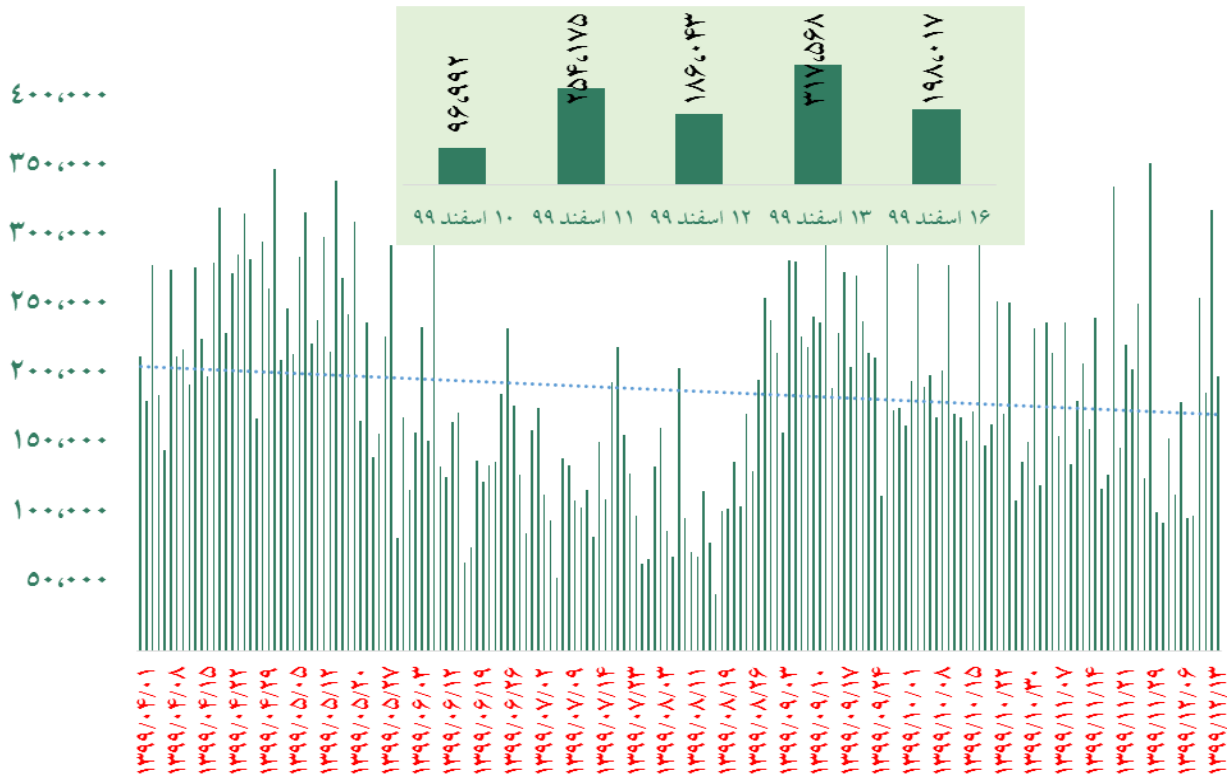
در گروه پتروشیمی، شرکت پتروشیمی جم در بهمن ماه ۱۰۱ هزار تن اتیلن تولید کرد که رقمی بالاتر از میانگین ماه‌های گذشته است. میانگین تولید ماهانه سال جاری، حدود ۱۰۰ هزار تن بوده و فروش محصولات در ماه بهمن ۱۷۲ هزار تن ثبت شده است. این شرکت در سال جاری به طور میانگین ماهانه ۱۵۵ هزار تن محصول فروخته است. فروش ریالی ماهانه این شرکت تا تیر ماه کمتر از ۱۰ هزار میلیارد ریال گزارش شد اما بعد از تیر ماه، فروش ریالی آن شرکت به رقم بیش از ۲۰ هزار میلیارد ریال رسیده است. میانگین نرخ فروش جمع محصولات شرکت در بهمن ماه با ۱۸۹,۲۳۰ ریال در هر کیلو رکورد جدیدی را به ثبت رسانده است. میانگین نرخ فروش در فصل پاییز نیز ۱۳۶,۹۸۰ ریال در هر کیلو بوده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

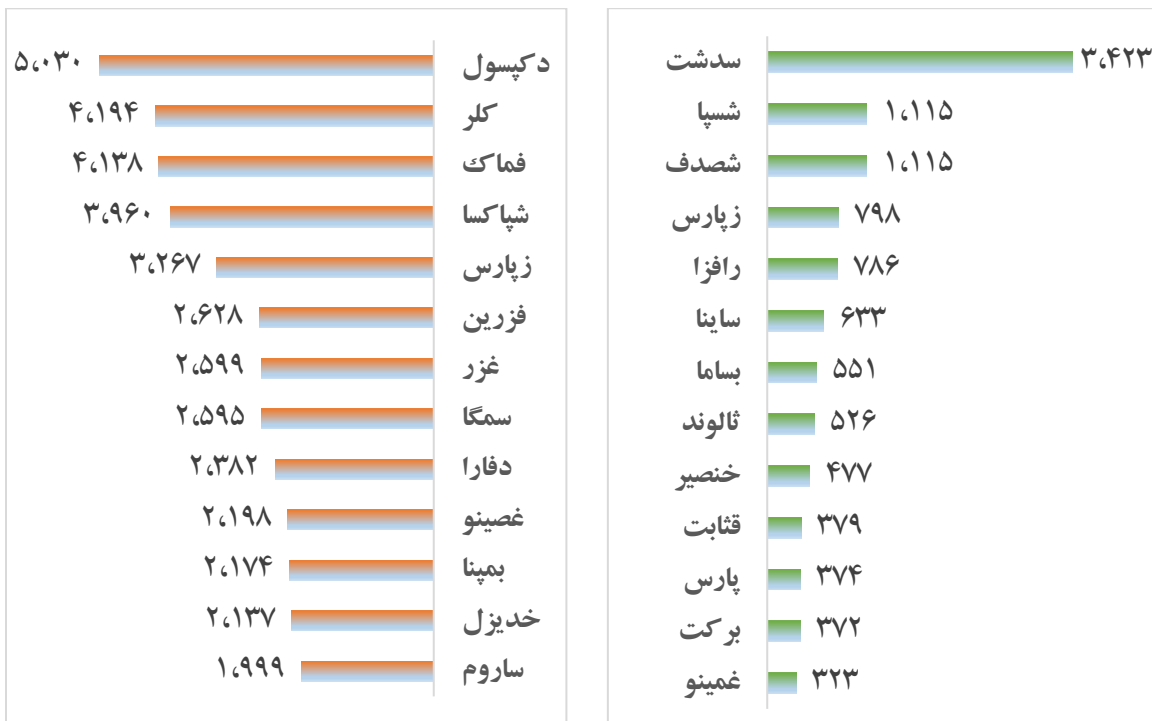


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

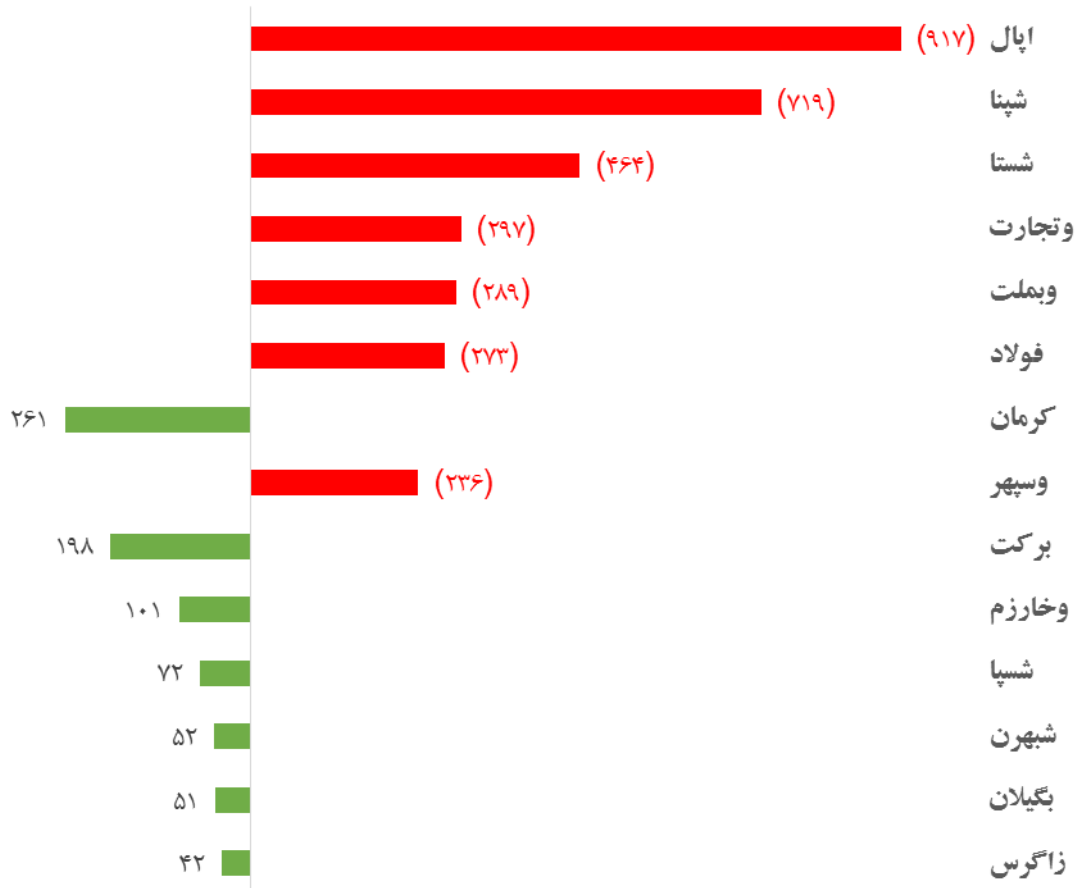


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شسپا	۱	بکهنوج
۲	رافزا	۲	بزاگرس
۳	ثامید	۳	کرمان
۴	پیوند	۴	دفرا
۵	بگیلان	۵	وهور
۶	آبادا	۶	پتایر
۷	-	۷	دی
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کرمان	۱۱	شمال
۲	کزغال	۱۲	تبرک
۳	برکت	۱۳	غپاک
۴	پردیس	۱۴	بگیلان
۵	آبادا	۱۵	اپال
۶	غفارس	۱۶	وکهمن
۷	وپست	۱۷	شپهرن
۸	پیوند	۱۸	شرانل
۹	وساخت	۱۹	وخارزم
۱۰	شغدیر	۲۰	بوعلی



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۳۵،۶۳۹
۲	مواد و محصولات دارویی	۶۰،۲۸۲
۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳،۹۹۲
۴	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۱۲،۳۶۲
۵	قند و شکر	۴،۷۶۰
۶	محصولات کاغذی	۳،۱۸۰
۷	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳،۹۲۶
۸	اطلاعات و ارتباطات	۸۰۵
۹	ساخت محصولات فلزی	-۱۰۶
۱۰	خدمات فنی و مهندسی	-۳۳۷
۱۱	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۹۹۴
۱۲	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱،۸۰۱
۱۳	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۶،۷۴۸
۱۴	پیمانکاری صنعتی	-۷،۳۹۴
۱۵	منسوجات	-۸،۹۷۹
۱۶	سایر واسطه گریهای مالی	-۱۴،۹۹۷
۱۷	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۵،۱۳۱
۱۸	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۱۷،۰۶۷
۱۹	محصولات چوبی	-۲۳،۳۸۸
۲۰	کاشی و سرامیک	-۲۶،۴۶۴
۲۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۳۶،۵۱۴
۲۲	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۴۳،۲۲۰
۲۳	لاستیک و پلاستیک	-۴۷،۷۹۰
۲۴	واسطه گری های مالی و پولی	-۴۹،۰۰۸
۲۵	مخابرات	-۵۳،۸۱۶
۲۶	خودرو و ساخت قطعات	-۷۰،۲۵۳
۲۷	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۷۸،۲۷۴
۲۸	زراعت و خدمات وابسته	-۸۰،۵۲۷
۲۹	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۹۱،۶۴۶
۳۰	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۰۹،۴۸۵
۳۱	هتل و رستوران	-۱۱۶،۴۶۹
۳۲	استخراج زغال سنگ	-۱۳۷،۳۳۱
۳۳	سرمايه گذاريها	-۱۹۲،۴۲۰
۳۴	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۲۴۳،۹۲۰
۳۵	سیمان، آهک و گچ	-۴۱۶،۴۶۳
۳۶	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۵۸۰،۶۵۲
۳۷	محصولات شیمیایی	-۶۴۳،۷۶۱
۳۸	فلزات اساسی	-۶۵۶،۳۶۳
۳۹	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۱،۰۲۹،۷۲۲
۴۰	استخراج کانه های فلزی	-۱،۱۹۲،۳۳۸
۴۱	بانکها و موسسات اعتباری	-۱،۲۶۰،۰۳۸
جمع ورود نقدینگی		-۶،۸۸۶،۳۲۹