



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۷ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، وغدیر، فخوز، شبندر، شپنا، فملی و وامید با افزایش ۵,۸۶۰ واحد همراه شد و به سطح ۱,۱۷۵,۵۸۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۱۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته معاملاتی با افزایش ۱۰ درصدی همراه بوده است.

یکی از تفاوت‌های اصلی بازار امروز با چند وقت گذشته در این بود که هر چه به زمان پایان معاملات نزدیکتر می‌شدیم، شاهد تقاضای بیشتر در بعضی از نمادها بودیم. همچنین در روز جاری شاهد افزایش تقاضا در بسیاری از نمادهای بنیادی در بعضی از گروه‌ها بودیم. به نظر می‌رسد بخش مهمی از افزایش تقاضا در نمادهای بنیادی که نسبت پی بر ای کمتر از ۶ دارند، احتمالاً از طرف صندوق‌های با درآمد ثابت باشد. به نظر می‌رسد این خریدها ادامه‌دار باشد و فردا شاهد تقاضای خرید بیشتری از طرف فعالین بازار مخصوصاً در نمادهایی که وضعیت بنیادی مطلوب دارند، باشیم.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۲۹,۰۶۹ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۱۴ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه 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 اخزا۹۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۳/۲۱ با ۲۲,۶٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۱۶	۱۳۹۹/۱۲/۱۷	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۴۹,۲۹۱	۱۲۹,۰۶۹	-۱۴٪



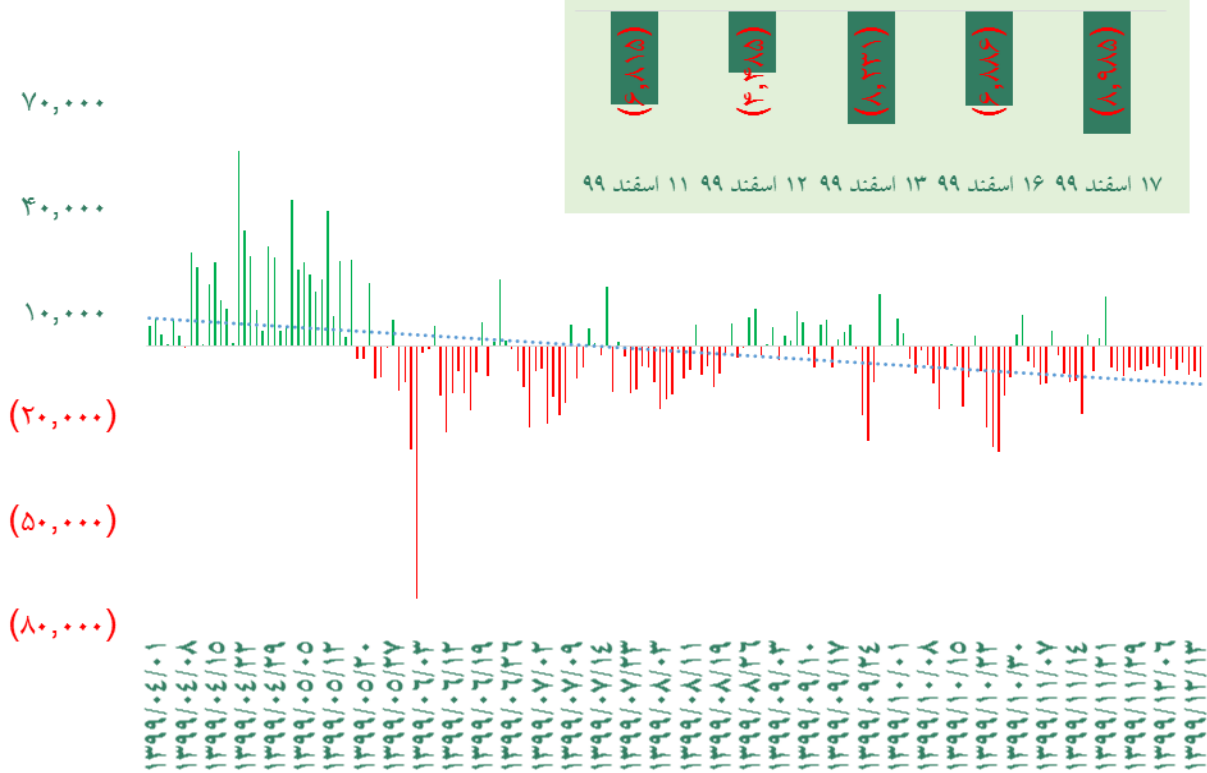
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، پتروشیمی پارس در دو ماه اخیر عملکرد خوبی داشته است. این شرکت در بهمن ماه سال مالی جاری موفق به فروش ۲۸,۸۹۹ میلیارد ریال شده است. مبلغ فروش در بهمن ماه حدود ۴۷ درصد بیشتر از میانگین ده ماه گذشته بود. شرکت پتروشیمی پارس از ابتدای سال مالی جاری تا پایان ماه گذشته، حدود ۲۲۵ هزار میلیارد ریال فروش را به ثبت رسانده است که نسبت به مدت مشابه سال گذشته با رشد ۵۳ درصدی همراه بود. کل مبلغ فروش ۱۲ ماهه سال مالی گذشته ۱۵۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که فروش ۱۱ ماهه سال مالی جاری نیز حدود ۴۶ درصد بیشتر از ۱۲ ماهه سال مالی گذشته می‌باشد. نرخ فروش محصول استایرن مونومر پتروشیمی پارس در بهمن ماه ۱۲۳,۳۷۶,۱۲۳ ریال در هر تن ثبت شده است که نسبت به میانگین نرخ فروش ۱۰ ماه گذشته با رشد ۷۶ درصدی همراه شده است. در دو هفته گذشته نرخ جهانی استایرن مونومر نزولی بود اما در چند روز گذشته مجدد به مدار صعودی برگشته است و در حدود ۱۳۰۰ دلار در هر تن می‌باشد. در بورس کالا نیز این محصول در محدوده ۲۰۰ هزار ریال در هر کیلو معامله شده است. همچنین این شرکت با توجه به افزایش قیمت پلیمرها در چند ماه گذشته، می‌تواند سود مناسبی را از محل شرکت زیرمجموعه خود (آریا ساسول) شناسایی کند.

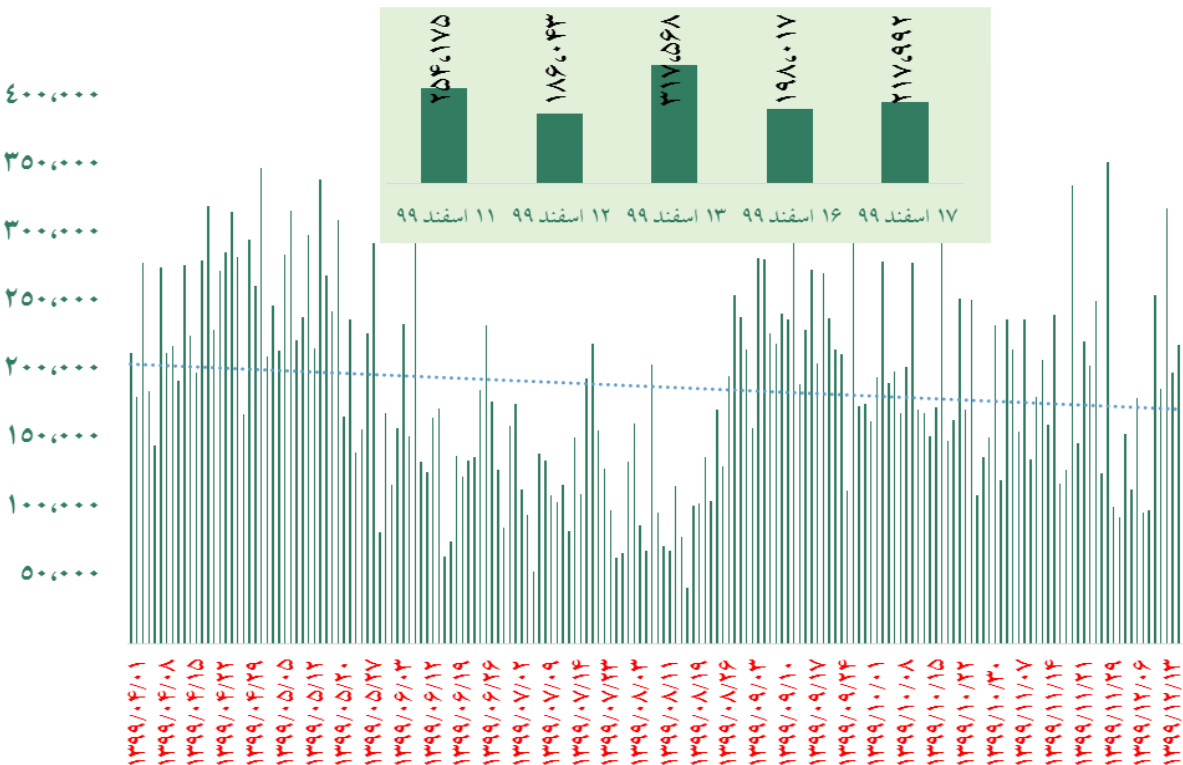
در گروه فلزات اساسی، شرکت فولاد کاوه جنوب در بهمن ماه ۱۵۷,۹۵۱ تن شمش بیلت تولید کرد که ۴۴ درصد بالاتر از میانگین ۱۰ ماه گذشته است. میانگین فروش ماهانه سال جاری، حدود ۱۲۵ هزار تن بوده و فروش محصولات در ماه بهمن ۱۶۰ هزار تن ثبت شده است. میانگین فروش ریالی ماهانه این شرکت در ۱۱ ماه گذشته حدود ۱۱ هزار میلیارد ریال بوده است. بطوریکه در بهمن ماه این شرکت توانسته به فروش ۱۸ هزار میلیارد ریالی دست یابد. میانگین نرخ فروش شمش بیلت صادراتی در سال مالی جاری، ۹۷,۵۵۰,۲۴۸ ریال در هر تن بود که در بهمن ماه این محصول به نرخ ۱۱۸,۴۵۳,۱۰۵ ریال در هر تن به فروش رفته است. شرکت فولاد کاوه جنوب در ۹ ماهه سال مالی جاری موفق به کسب ۱۶۶۹ ریال سود به ازای هر سهم شده است و انتظار می‌رود سود هر سهم در ۱۲ ماهه سال مالی جاری به بیش از ۲۱۰۰ ریال افزایش یابد.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

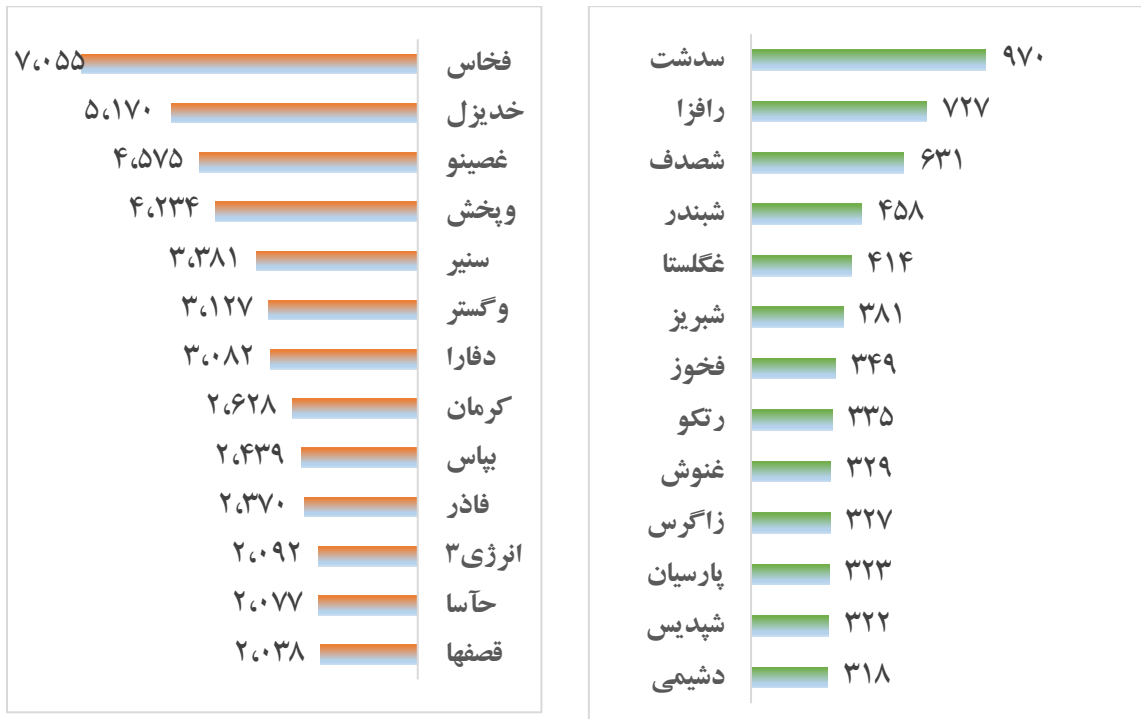


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

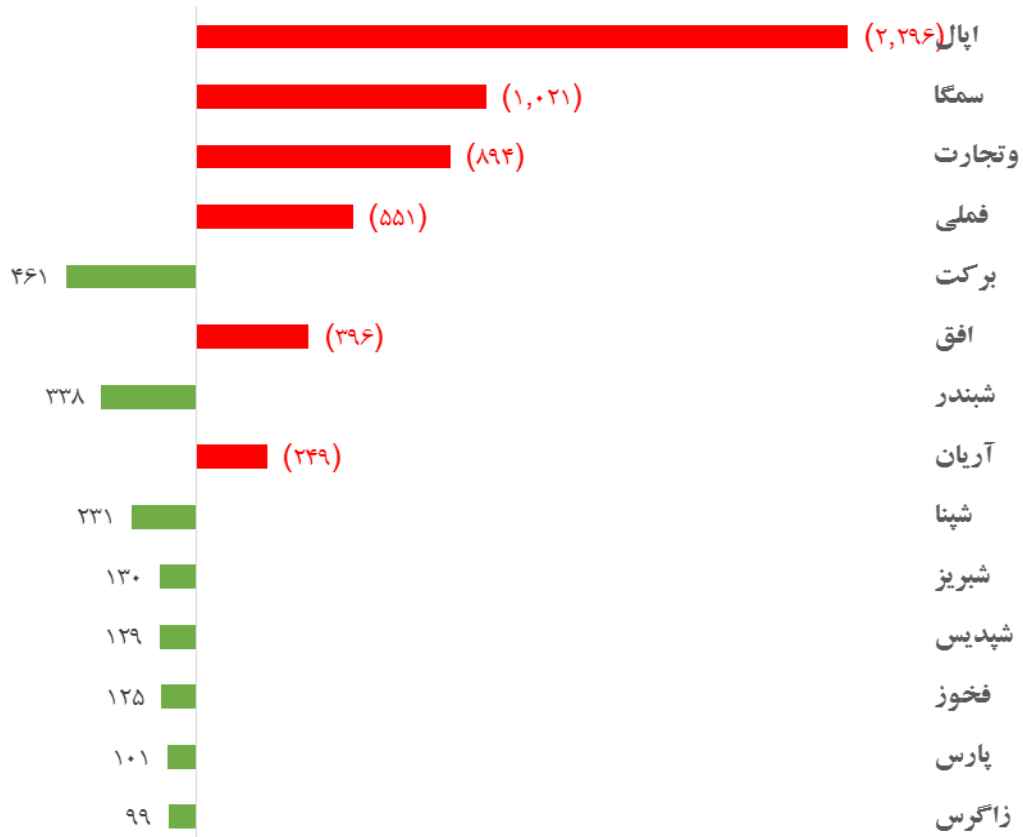


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	پارس	۱	چکاوہ
۲	فخوز	۲	فولاژ
۳	ونوین	۳	شسپا
۴	رافزا	۴	سغرب
۵	-	۵	ونیرو
۶	-	۶	پتایر
۷	-	۷	دی
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	شبریز
۲	گشان	۱۲	شاوان
۳	سمگا	۱۳	شغدیر
۴	کزغال	۱۴	وساخت
۵	غپاک	۱۵	فباهر
۶	اپال	۱۶	وسین
۷	افق	۱۷	شبندر
۸	شراز	۱۸	کرمان
۹	شپترو	۱۹	شپهرن
۱۰	زاگرس	۲۰	پیوند



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	مواد و محصولات دارویی	۳۰۹،۱۷۲
۲	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۸۲،۳۸۲
۳	محصولات شیمیایی	۲۰،۵۱۷
۴	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع باپوش	۸،۵۸۷
۵	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۶،۸۵۳
۶	قند و شکر	۳،۹۹۴
۷	ساخت دستگاهها و وسایل ارتباطی	-۳،۹۱۸
۸	اطلاعات و ارتباطات	۴۰۹
۹	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۹۹۴
۱۰	ساخت محصولات فلزی	-۱،۰۱۵
۱۱	محصولات کاغذی	-۱،۴۶۱
۱۲	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱،۷۹۴
۱۳	ماشین آلات و تجهیزات	-۶،۹۳۷
۱۴	واسطه گری های مالی و پولی	-۷،۹۹۸
۱۵	منسوجات	-۸،۴۴۳
۱۶	سایر واسطه گری های مالی	-۱۰،۱۸۸
۱۷	کاشی و سرامیک	-۱۷،۷۵۹
۱۸	محصولات چوبی	-۲۳،۱۷۱
۱۹	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۲۴،۷۹۹
۲۰	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۲۷،۳۱۸
۲۱	خدمات فنی و مهندسی	-۳۰،۹۱۷
۲۲	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۳۲،۳۵۵
۲۳	زراعت و خدمات وابسته	-۴۲،۸۲۴
۲۴	لاستیک و پلاستیک	-۴۳،۹۰۹
۲۵	مخابرات	-۴۴،۲۹۲
۲۶	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۴۶،۳۴۰
۲۷	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۴۷،۶۸۴
۲۸	ماشین آلات و دستگاه های برقی	-۷۴،۹۴۳
۲۹	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۸۸،۸۶۰
۳۰	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۹۱،۶۳۳
۳۱	استخراج زغال سنگ	-۱۵۲،۲۴۹
۳۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۵۶،۶۷۰
۳۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۲۷۲،۹۹۲
۳۴	خودرو و ساخت قطعات	-۳۶۰،۶۳۷
۳۵	سیمان، آهک و گچ	-۳۶۶،۱۷۳
۳۶	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۳۹۶،۱۶۵
۳۷	سرمایه گذاریها	-۶۰۰،۹۶۳
۳۸	هتل و رستوران	-۱،۰۰۹،۱۵۶
۳۹	فلزات اساسی	-۱،۳۵۷،۱۳۹
۴۰	بانکها و موسسات اعتباری	-۱،۵۹۸،۲۰۵
۴۱	استخراج کانه های فلزی	-۲،۴۶۶،۸۵۰
جمع ورود نقدینگی		-۸،۹۸۴،۹۳۷