



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

## گزارش روزانه تحلیل بازار



## تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۱۹ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای شینا، فولاد، شبندر، شتران، نوری، فارس و مبین با افزایش ۱۰,۲۶۲ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۱۰,۱۵۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۶۹ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش ۵۸ درصدی همراه بوده است. در حالیکه بسیاری از نمادهای کوچک با صف فروش به کار خود پایان دادند اما شاخص کل با توجه به افزایش تقاضا در نمادهای بزرگ در دو روز گذشته با افزایش همراه بوده است.

شاخص کل در حال تکمیل ریز موج‌های داخلی از شاخه F دیامتریک هست و می‌تواند تا محدوده ۱,۳۴۰,۰۰۰ واحد رشد کند. بعد از آن شاخص کل برای تکمیل موج G می‌تواند به صورت کوتاه ساخته شود و کف قبلی شاخص در محدوده ۱,۱۳۰,۰۰۰ واحد محفوظ بماند. همچنین در چند سال گذشته روند حرکتی شاخص کل با نفت همبستگی مثبتی داشته است. بنابراین انتظار می‌رود در چند روز گذشته شاخص کل بتواند به سمت ۱,۳۴۰,۰۰۰ واحد حرکت کند. به نظر می‌رسد بعضی از فعالین بازار با توجه به نوع حرکتی شاخص، قیمت بعضی نمادها به خصوص نمادهای شاخص ساز که رفتار حرکتی آنها شبیه شاخص کل می‌باشد، را مناسب برای خرید می‌دانند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۶۳,۹۴۲ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۷۹ درصدی داشته است. همچنین اوراق مابجه عام دولت با نماد اراد ۴۹۴ 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 اخزا ۹۰۸، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۳/۱۶ با ۲۲,۵٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۱۸	۱۳۹۹/۱۲/۱۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳۰۶,۷۳۱	۶۳,۹۴۲	-۷۹٪



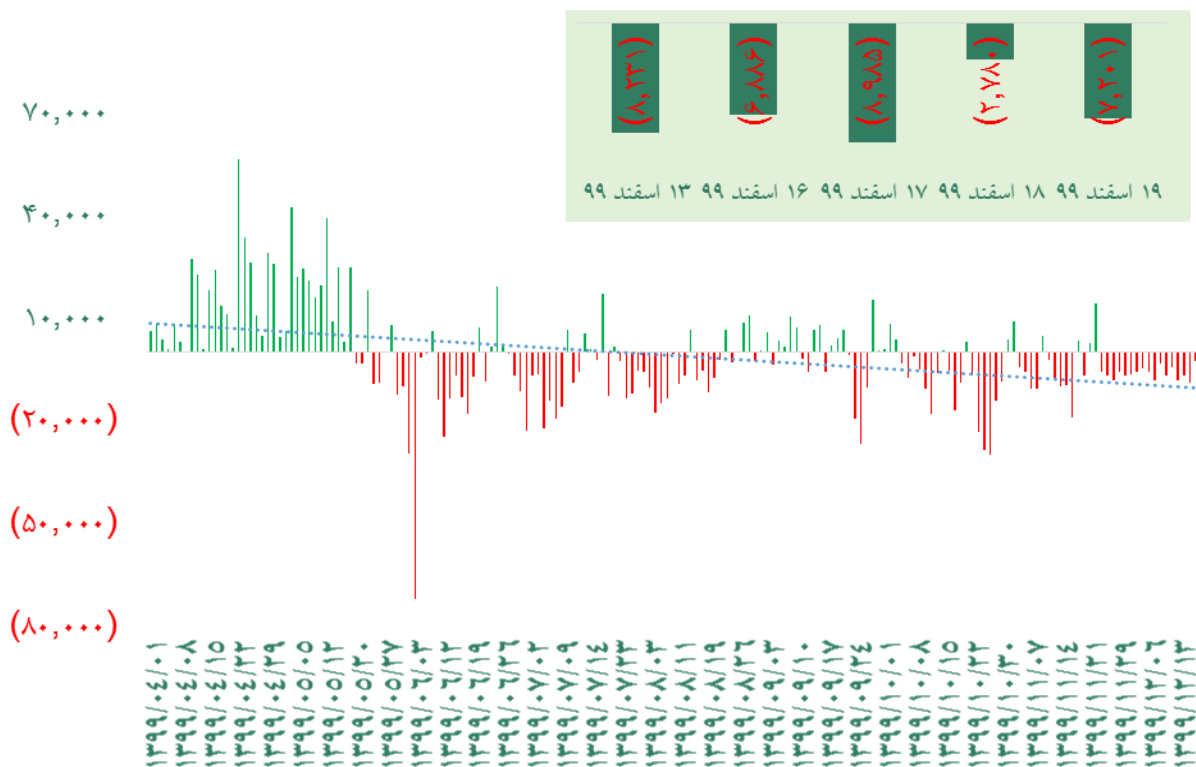
## گروه‌های مؤثر

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 را داشته و این در حالی است که امسال میانگین ماهانه ۳۷۰۰ میلیارد ریال فروخته است. میانگین فروش فصل بهار ۱۵۶۰، تابستان ۳۶۲۰ و پاییز ۵۲۴۰ میلیارد ریال بوده که در زمستان نیز تاکنون در سطح فصل پاییز عمل کرده است. میانگین نرخ فروش محصولات شرکت در سال جاری به طور میانگین ۳۸۶۰۰ ریال در هر کیلو بوده است. این نرخ در ماه بهمن ۶۴۷۷۰ ریال ثبت شد که نسبت به ماه دی ۵ درصد رشد را نشان می‌دهد.

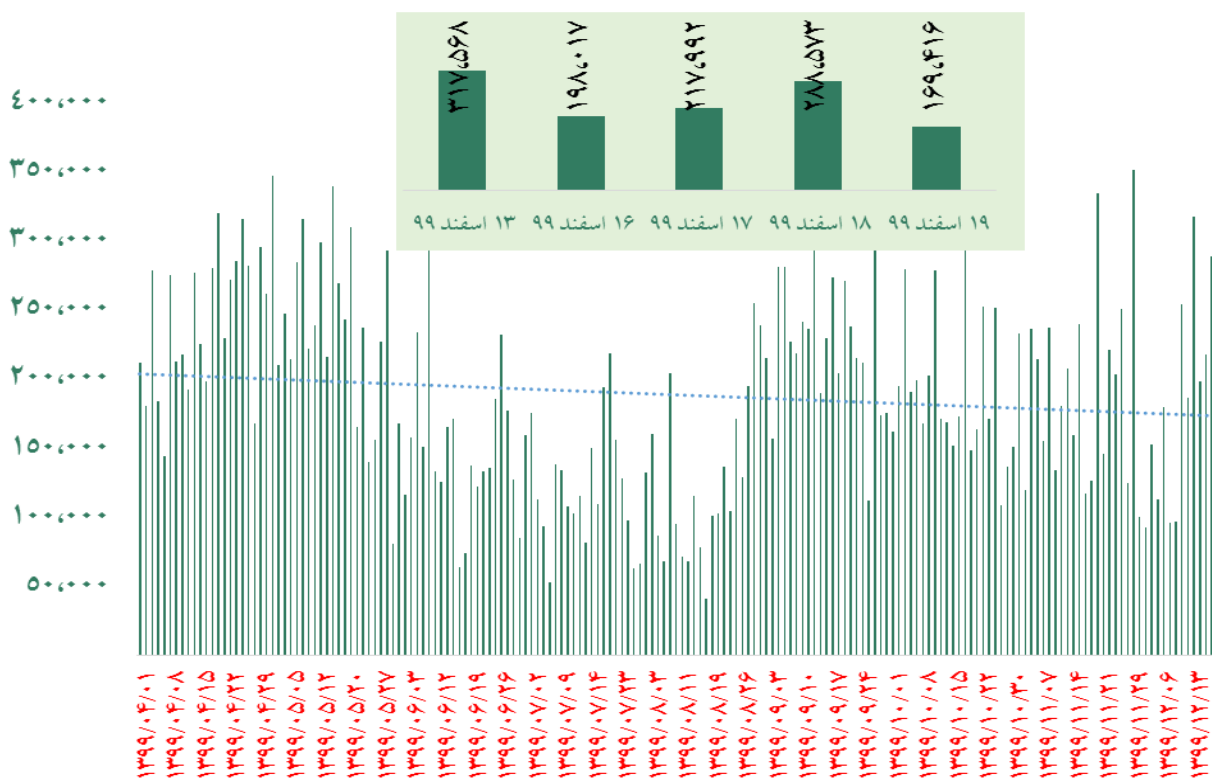
در گروه زراعت و خدمات وابسته، شرکت شیر و گوشت زاگرس شهرکرد، در سال گذشته به طور متوسط هر ماه ۱۰۰ میلیارد ریال فروش زده بود و در ۱۰ ماهه امسال متوسط فروش ماهانه ۱۳۰ میلیارد ریال و در بهمن فروش خوب ۱۹۰ میلیارد ریالی را ثبت کرده است. متوسط تولید شیر در آن شرکت در سال مالی گذشته، هر ماه ۳۰۶۳ تن بود که امسال به ۳۰۸۳ تن رسیده است و بهمن ماه ۳۰۴۸ تن تولید داشته است. شرکت شیر و گوشت زاگرس شهرکرد، تقریباً تمامی شیر تولیدی را به فروش می‌رساند. نرخ فروش شیر آن شرکت به طور متوسط در سال گذشته حدود ۲۶ هزار ریال در هر کیلو گزارش شده بود که متوسط نرخ فروش ماهانه سال مالی جاری ۳۹ هزار و ۷۶۰ ریال و نرخ فروش بهمن ماه ۴۷ هزار و ۹۵۰ ریال ثبت شده است.



## ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

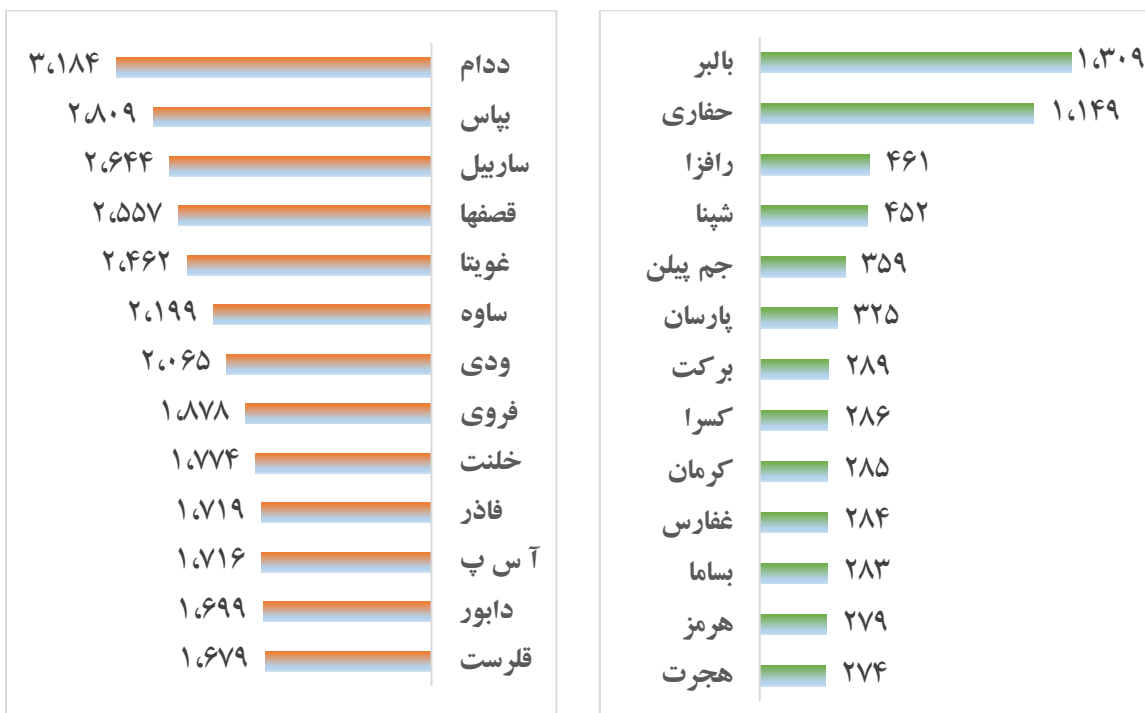


## روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

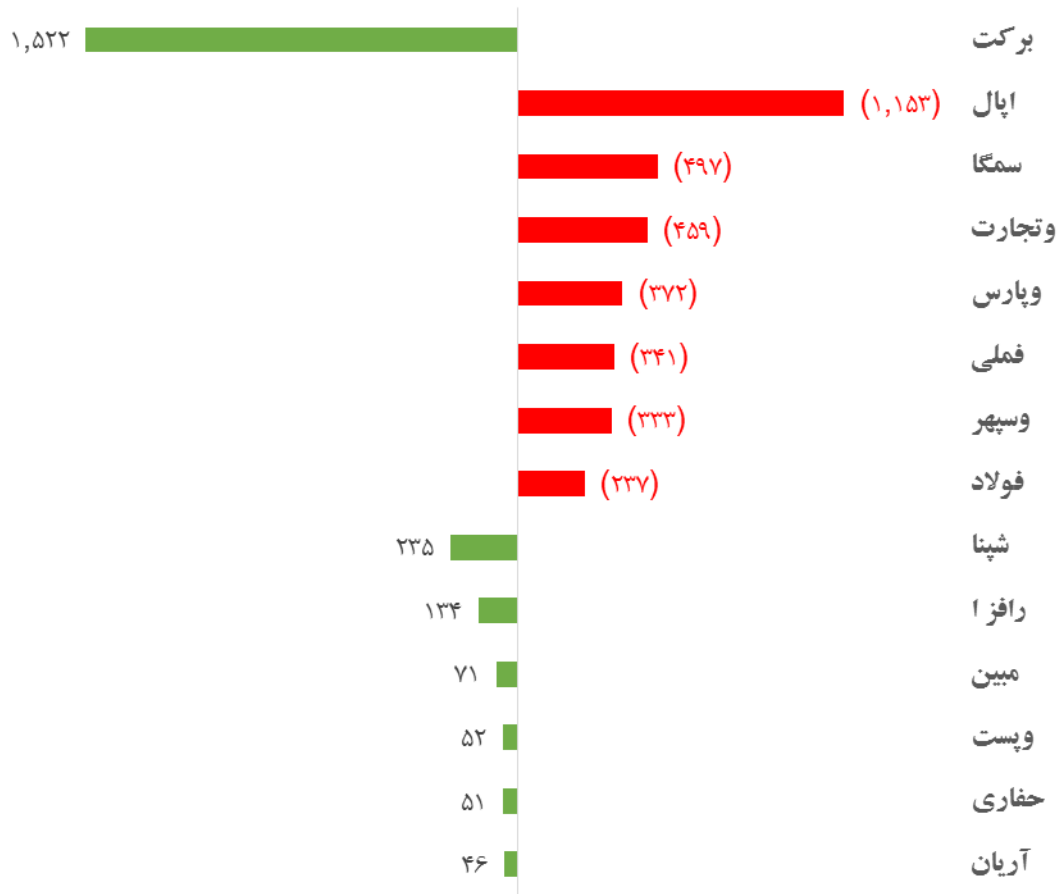


## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	شینا	۱	بترانس
۲	رافزا	۲	ونیکی
۳	-	۳	چکاپا
۴	-	۴	ورنا
۵	-	۵	زاگرس
۶	-	۶	حکشتی
۷	-	۷	شبهرن
۸	-	۸	کاما
۹	-	۹	شخارک
۱۰	-	۱۰	دی



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



## واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	ساراب
۲	کرمان	۱۲	شغدیر
۳	کزغال	۱۳	حریل
۴	جم بیلن	۱۴	وپست
۵	سمگا	۱۵	حریل
۶	غپاک	۱۶	وپست
۷	کرازی	۱۷	شیندر
۸	زاگرس	۱۸	اپال
۹	تایرا	۱۹	غفارس
۱۰	کاما	۲۰	ورازی



## ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	مواد و محصولات دارویی	۱,۰۷۵,۰۷۱
۲	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۴۰,۸۷۷
۳	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۲۴,۱۷۰
۴	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲,۳۹۰
۵	اطلاعات و ارتباطات	۲۲,۱۳۱
۶	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	۱۰,۲۴۹
۷	قند و شکر	۶,۴۶۵
۸	کاشی و سرامیک	۲,۷۱۶
۹	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۷۴۴
۱۰	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۹۰۱
۱۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۶,۵۹۷
۱۲	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۶,۸۷۰
۱۳	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۱۳,۶۱۷
۱۴	پیمانکاری صنعتی	-۱۹,۳۵۳
۱۵	زراعت و خدمات وابسته	-۲۰,۹۸۰
۱۶	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۳۰,۷۴۳
۱۷	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-۳۶,۰۰۶
۱۸	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۴۶,۳۵۰
۱۹	خدمات فنی و مهندسی	-۵۵,۷۳۷
۲۰	استخراج زغال سنگ	-۵۶,۷۴۹
۲۱	مخابرات	-۶۶,۰۹۳
۲۲	ساخت محصولات فلزی	-۸۰,۴۷۹
۲۳	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۹۷,۳۶۱
۲۴	لاستیک و پلاستیک	-۹۸,۰۲۹
۲۵	محصولات کاغذی	-۱۲۳,۰۶۴
۲۶	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۳۸,۵۴۱
۲۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۷۶,۷۶۱
۲۸	منسوجات	-۲۰۷,۴۱۳
۲۹	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۲۱۹,۱۲۴
۳۰	سیمان، آهک و گچ	-۲۴۳,۶۶۲
۳۱	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۲۴۴,۸۵۲
۳۲	خودرو و ساخت قطعات	-۲۶۱,۶۵۲
۳۳	ماشین آلات و تجهیزات	-۲۶۷,۰۱۷
۳۴	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۳۵۱,۴۶۹
۳۵	هتل و رستوران	-۵۲۹,۴۲۵
۳۶	سرمایه گذارها	-۵۴۵,۹۱۲
۳۷	محصولات شیمیایی	-۹۸۱,۰۰۲
۳۸	فلزات اساسی	-۱,۰۴۵,۲۴۸
۳۹	استخراج کانه های فلزی	-۱,۵۳۴,۶۲۶
۴۰	بانکها و موسسات اعتباری	-۱,۵۷۳,۱۶۵
<b>جمع ورود نقدینگی</b>		<b>-۷,۲۰۱,۳۱۵</b>