



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز چهارشنبه ۲۰ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فملی، شستا، فولاد، شبندر، شپنا، خودرو و رمپنا با کاهش ۳,۳۶۴ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۰۶,۷۸۱ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۴۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش ۴۶ درصدی همراه بوده است. فشار عرضه در بازار امروز به نسبت چند روز گذشته بیشتر بوده است اما با تأثیر مثبت نمادهایی مانند کچاد، پارس و کگل، شاخص کل توانست در بالای ۱,۲۰۰,۰۰۰ واحد باقی بماند.

بسیاری از فعالین بازار معتقدند، دلیل اصلی منفی بودن بازار، به خاطر انتظارات کاهشی از نرخ دلار با توجه به موضوعات مطرح شده در مورد برجام می‌باشد. اما در گروه‌هایی مانند خودرو که حتی از کاهش نرخ دلار منتفع می‌شوند، اکثر نمادها در این گروه نیز در چند وقت گذشته با کاهش قیمتی محسوسی همراه بودند. بنابراین نمی‌توان کاهش قیمت در اکثر نمادها و گروه‌ها را فقط به انتظارات کاهشی نرخ دلار گره زد و شاید به دلیل اتفاقاتی که در چند ماه گذشته رخ داده است، اعتماد فعالین بازار سرمایه به این بازار بسیار کم رنگ تر از سال‌های گذشته شده است و به همین دلیل شاهد خروج روزانه پول حقیقی‌ها از این بازار هستیم.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۸۲,۰۰۷ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش ۱۸۵ درصدی داشته است. همچنین اوراق مابحه عام دولت با نماد اراد۸۳ 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 اخزا۹۰۸۱، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۶/۰۶ با ۲۲,۳٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۱۹	۱۳۹۹/۱۲/۲۰	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۶۳,۹۴۲	۱۸۲,۰۰۷	۱۸۵٪



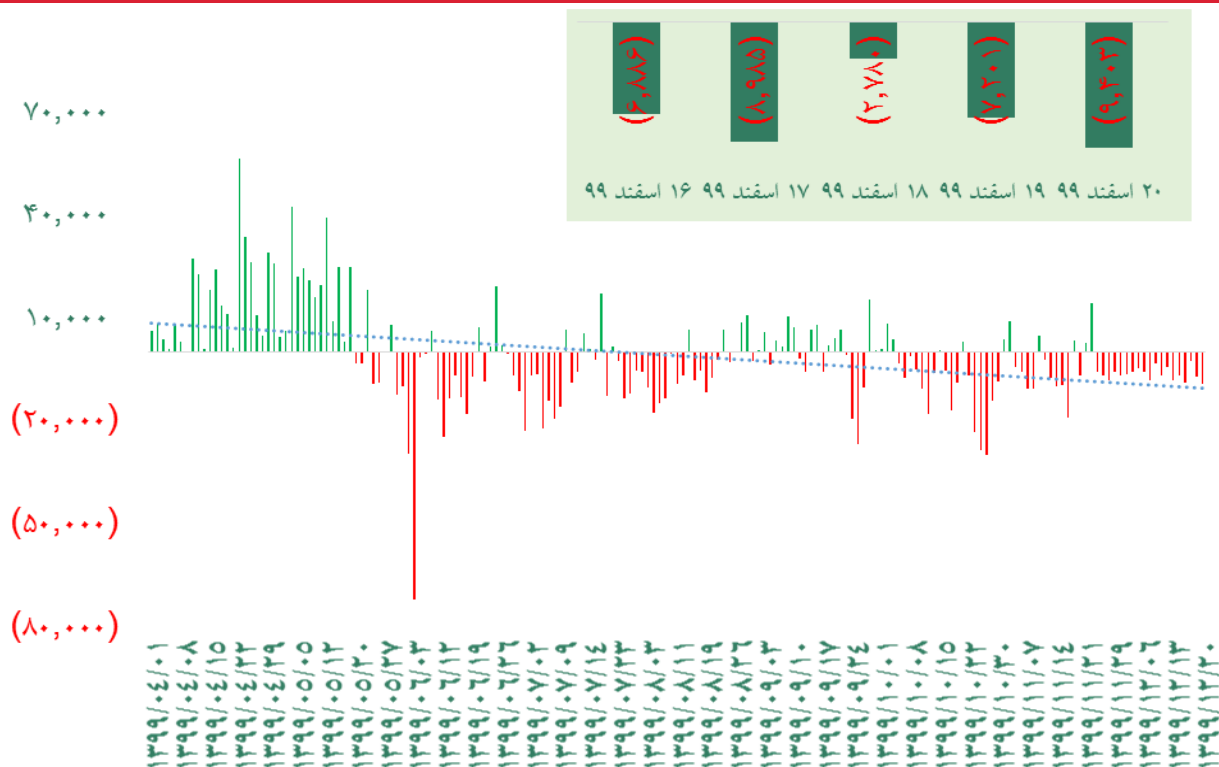
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت جم پیلن برای ۱۲ ماهه سال مالی جاری سود ۷۳۸۵ ریال به ازای هر سهم را برآورد کرده، در حالیکه سود ۹ ماهه به ازای هر سهم ۶۰۰۳ ریال بوده است. سود فصل اول تا سوم این شرکت به ترتیب ۱۳۴۲، ۲۳۱۷ و ۲۳۴۴ ریال به ازای هر سهم بوده و سود فصل چهارم ۱۳۸۲ ریال از طرف آن شرکت پیش بینی شده است. شرکت جم پیلن در ۱۰ ماهه ابتدای سال مالی جاری به طور متوسط هر ماه حدود ۵ هزار میلیارد ریال فروش داشته است. در بهمن ماه مبلغ فروش این شرکت حدود ۶ هزار و ۶۸۷ میلیارد ریال بوده که حدود ۳۴ درصد بیشتر از میانگین ۱۰ ماهه سال مالی جاری و ۲۷ درصد کمتر از دی ماه بوده است. از نظر مقداری نیز در بهمن ماه این شرکت موفق به فروش ۱۹۵۴۷ تن از انواع محصولات در داخل کشور و ۱۶۲۰ تن نیز محصول پلی پروپیلن را صادر کرده است. میانگین مقدار فروش داخلی و صادراتی به ترتیب در ۱۰ ماهه ابتدای سال حدود ۲۰ هزار تن و ۲۵۶ تن می‌باشد. میانگین نرخ فروش ۱۰ ماهه ابتدای سال مالی جاری برای محصول پلی پروپیلن حدود ۲۱۸ میلیون ریال در هر تن ثبت شد که در بهمن ماه نرخ فروش آن محصول به ۳۱۵ میلیون ریال در هر تن افزایش پیدا کرده است.

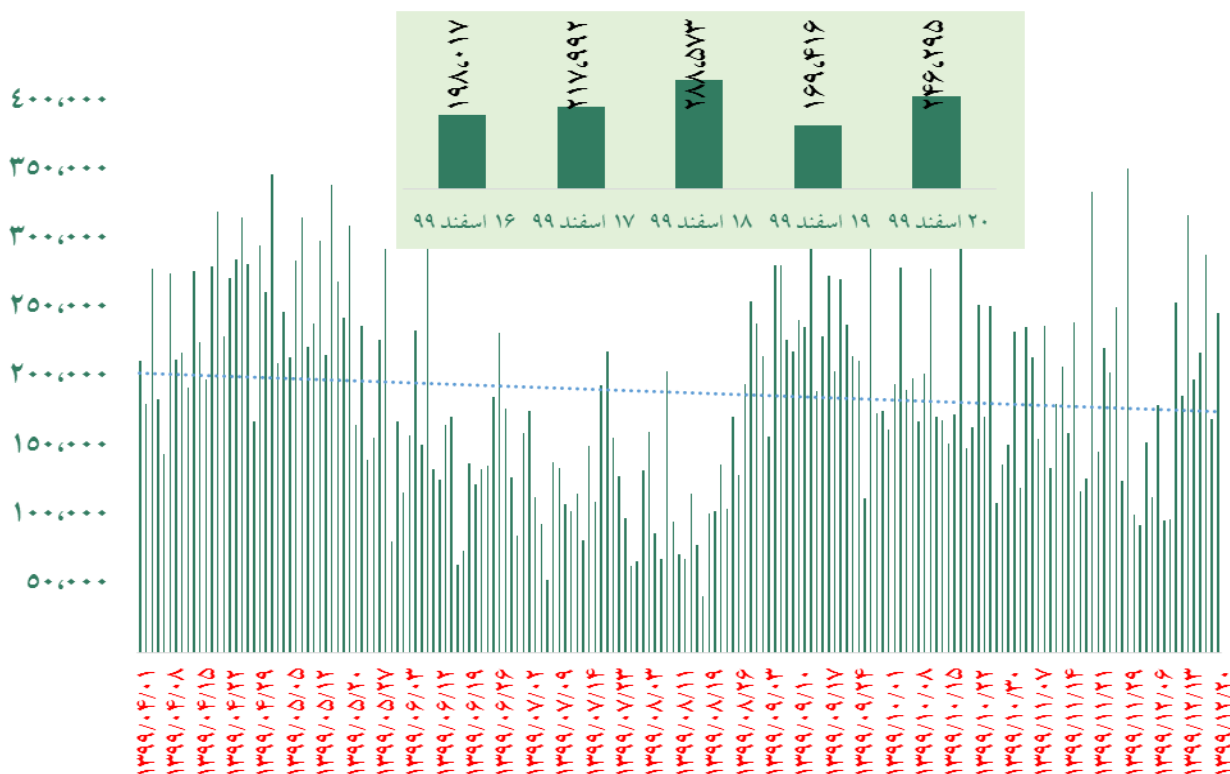
در گروه فلزات اساسی، شرکت غلتک سازان سپاهان، در ۹ ماهه سال مالی جاری ۲۰۰۴ ریال سود ساخته است و برای ۱۲ ماه سال مالی جاری نیز برآورد سودسازی ۲۶۰۱ ریالی را دارد. سود فصل‌های بهار تا پاییز به ترتیب ۴۰۰، ۷۸۷ و ۸۱۸ ریال گزارش شده و طبق گزارش پیش بینی سود منتشر شده، سود فصل پایانی ۵۹۶ ریال محاسبه می‌شود. در ۱۱ ماهه سال مالی جاری، این شرکت موفق به فروش ۱۲ هزار و ۳۹۰ میلیارد ریال از انواع محصولات خود شد که در ۱۲ ماهه سال مالی گذشته، مبلغ فروش ۵ هزار و ۶۵۶ میلیارد ریال ثبت شده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

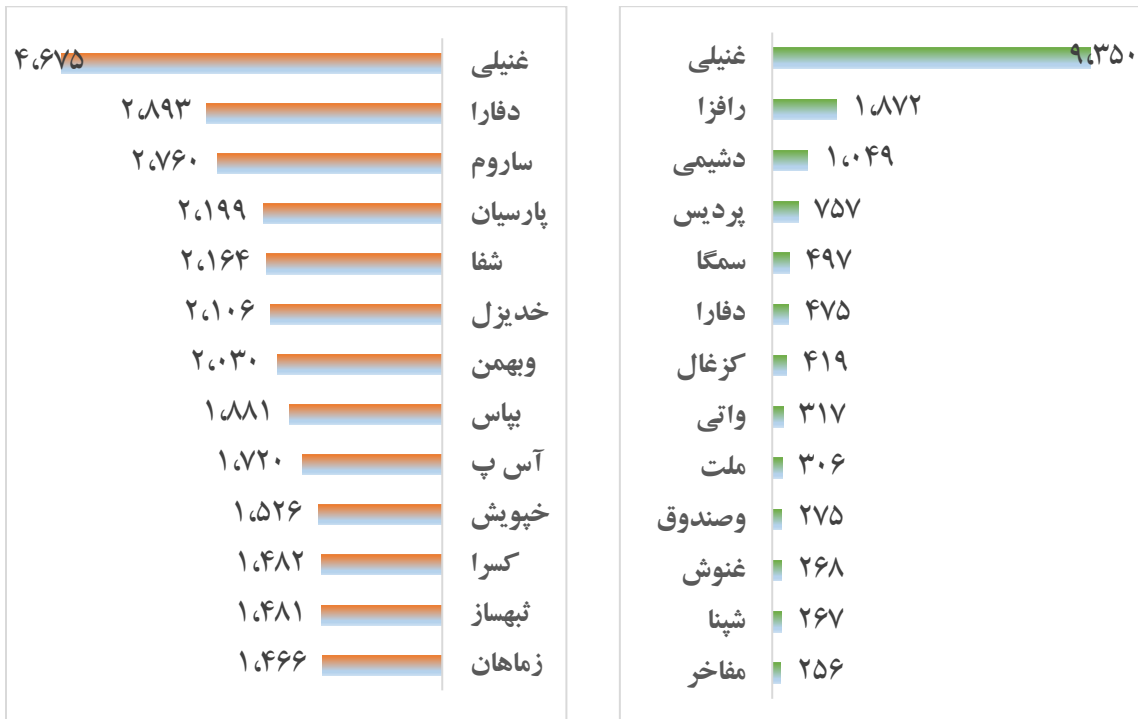


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

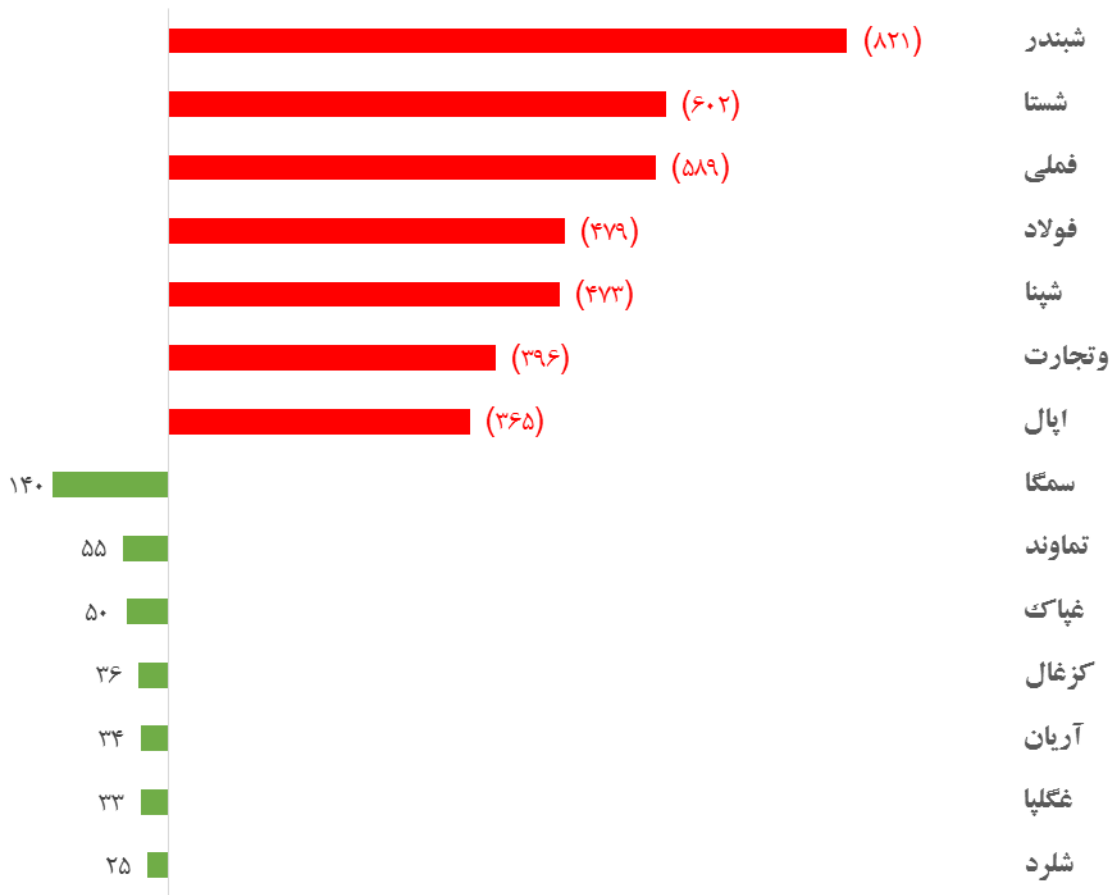


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	دعبيد	۱	غبشهر
۲	-	۲	غفارس
۳	-	۳	چکاپا
۴	-	۴	خبهمن
۵	-	۵	شيران
۶	-	۶	قنیشا
۷	-	۷	بالر
۸	-	۸	پتایر
۹	-	۹	دی
۱۰	-	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	وپست
۲	کزغال	۱۲	شبندر
۳	غپاک	۱۳	اپال
۴	کرازی	۱۴	خپهن
۵	سمگا	۱۵	زاگرس
۶	ساراب	۱۶	جم بیلن
۷	خودکفا	۱۷	شپهرن
۸	غگل	۱۸	شاون
۹	کرمان	۱۹	شغدیر
۱۰	شبریز	۲۰	خکرمان



ورود نقدینگی به ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	هتل و رستوران	۱۲۸.۷۶۸
۲	استخراج زغال سنگ	۳۳.۶۲۰
۳	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۱۶.۰۹۱
۴	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	۱۳.۵۶۵
۵	اطلاعات و ارتباطات	۲۱۵
۶	منسوجات	-۲۹
۷	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتوری	-۱۰.۰۹۷
۸	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳۱.۹۴
۹	قند و شکر	-۴.۵۲۱
۱۰	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۵.۲۱۷
۱۱	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۶.۷۰۳
۱۲	پیمانکاری صنعتی	-۸.۱۲۵
۱۳	سایر واسطه‌گری‌های مالی	-۱۳.۷۰۱
۱۴	کاشی و سرامیک	-۱۷.۳۵۳
۱۵	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۱۸.۶۶۲
۱۶	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۲۲.۰۸۱
۱۷	محصولات چوبی	-۲۲.۹۲۳
۱۸	زراعت و خدمات وابسته	-۲۷.۷۵۵
۱۹	ساخت محصولات فلزی	-۳۴.۹۶۳
۲۰	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۴۰.۸۱۹
۲۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۴۱.۵۰۳
۲۲	مخابرات	-۴۴.۵۵۸
۲۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۴۴.۵۹۷
۲۴	ماشین آلات و تجهیزات	-۴۹.۴۶۲
۲۵	لاستیک و پلاستیک	-۵۰.۳۶۹
۲۶	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۶۵.۸۹۰
۲۷	خدمات فنی و مهندسی	-۸۴.۷۲۱
۲۸	محصولات کاغذی	-۹۰.۹۴۱
۲۹	مواد و محصولات دارویی	-۹۵.۵۲۰
۳۰	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	-۹۷.۱۳۶
۳۱	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۱۲.۸۱۸
۳۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۶۴.۶۳۳
۳۳	خودرو و ساخت قطعات	-۱۸۵.۸۱۲
۳۴	سیمان، آهک و گچ	-۲۲۱.۶۰۸
۳۵	سرمایه‌گذاریها	-۲۷۷.۷۶۰
۳۶	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	-۶۴۴.۳۱۰
۳۷	استخراج کانه‌های فلزی	-۷۵۳.۴۰۵
۳۸	محصولات شیمیایی	-۹۳۵.۰۴۸
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۱.۴۵۳.۷۶۹
۴۰	فلزات اساسی	-۱.۹۳۴.۴۱۶
۴۱	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	-۲.۰۱۹.۷۳۵
	جمع ورود نقدینگی	-۹.۴۰۳.۶۶۵