



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۲۳ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، کچاد، فولاد، فملی، شپنا، پارس و پارسان با افزایش ۲۲,۵۵۴ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۲۹,۴۳۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۲۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش ۷ درصدی همراه بوده است. افزایش تقاضا مخصوصاً در نمادهای بزرگ در بازار امروز به نسبت چند روز گذشته بیشتر بوده است. اما بسیاری از نمادها همچنان مثل روزهای معاملاتی گذشته با صف فروش به کار خود پایان دادند.

در روز جاری ارزش معاملات اوراق دولتی بیش از دو برابر ارزش معاملات خرد سهام و حق تقدم بود. به نظر می‌رسد، به فروش رساندن اوراق دولتی، دلیل اصلی نگه داشتن نرخ بهره بالای ۲۰ درصد باشد. بنابراین با توجه به خوشبینی به موضوعات برجامی و تعیین و تکلیف شدن وضعیت مطالبات ایران از سایر کشورها و همچنین انتخابات ریاست جمهوری پیش رو در خرداد ماه سال آینده، نرخ دلار در محدوده ۲۳ هزار الی ۲۵ هزار ریال ثابت نگه داشته شود. بنابراین بازار سهام با توجه به شرایط ذکر شده، توان افزایشی قوی در حال حاضر ندارد و نرخ بیش از ۲۰ درصد اوراق دولتی برای بسیاری از سرمایه‌گذاران جذاب به نظر می‌رسد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۲۶,۳۰۹ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۳۱ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۲۱۴ 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 اخزا۹۰۹، تاریخ سررسید ۱۶/۰۳/۱۴۰۲ با ۲۲,۸٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۲۰	۱۳۹۹/۱۲/۲۳	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۸۲,۰۰۷	۱۲۶,۳۰۹	-۳۱٪



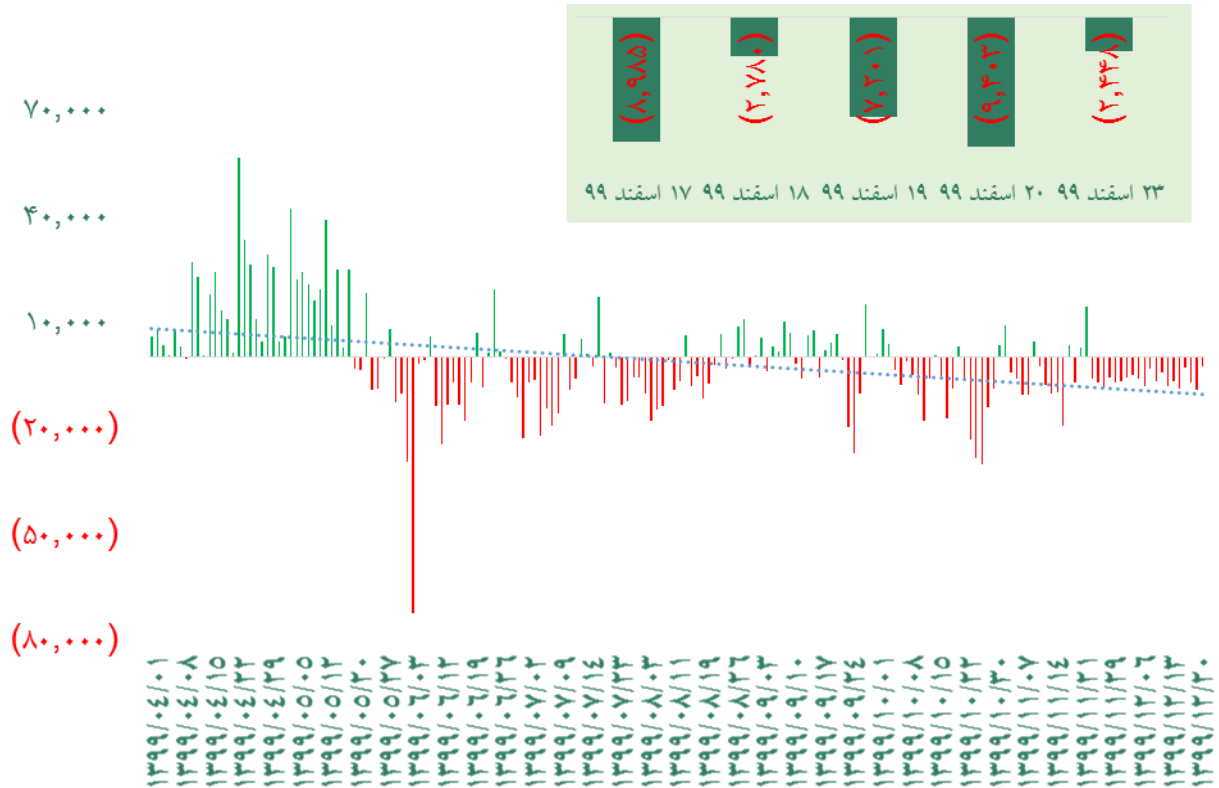
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت صنایع پتروشیمی تخت جمشید در بیست روز ابتدایی اسفند ماه ۲۲۷۸ تن استایرن بوتادین رابر تیره در بورس کالا عرضه کرده که از این مقدار ۲۰۱۶ تن در میانگین قیمتی ۴۱۰۵۶۱ ریال به ازای هر کیلو معامله شده است. حجم معاملات بهمن ماه ۲۱۳۷ تن با میانگین قیمتی ۳۶۶۲۱۱ ریال به ازای هر کیلو بوده است. روند قیمتی معاملات این محصول در یک سال اخیر صعودی بوده و بیشترین نرخ که معامله شده ۴۴۰۱۲۶ ریال به ازای هر کیلو بوده است.

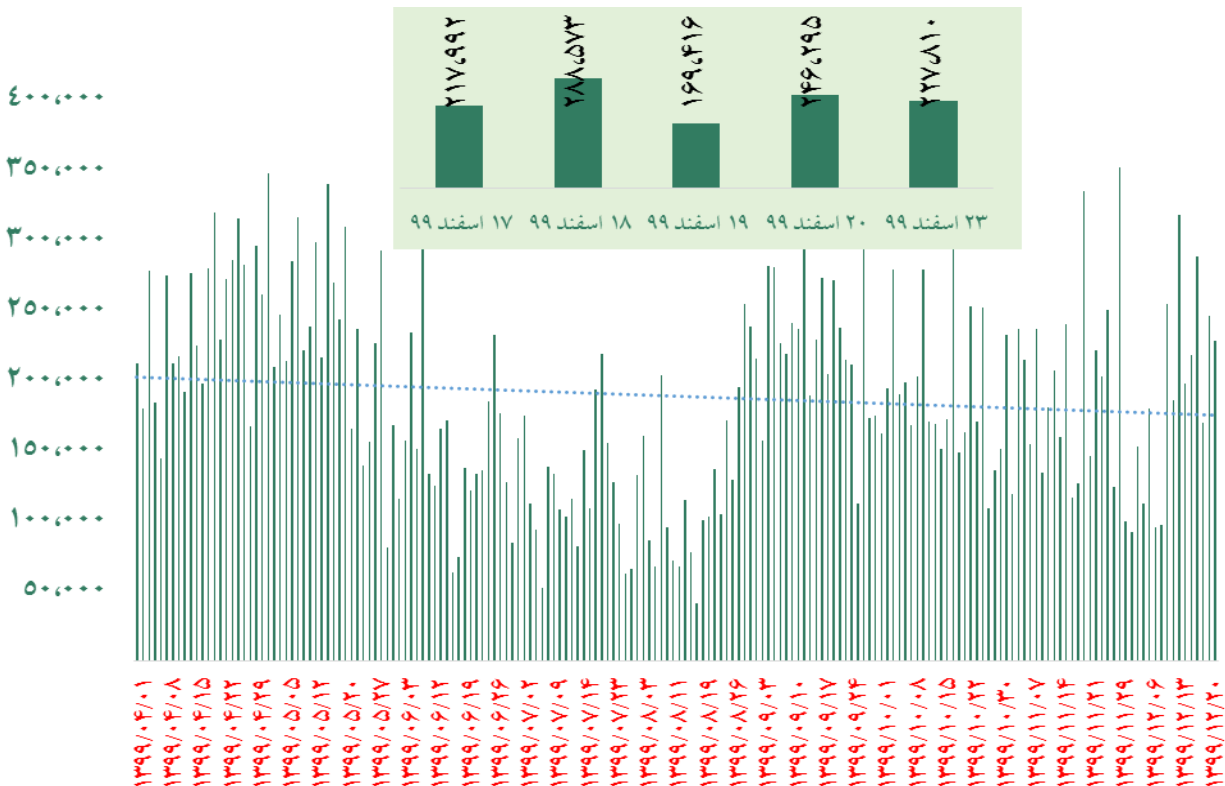
در شرکت پتروشیمی پارس، شاخص قیمت استحصال اتان که بیانگر LPG فروخته شده آن شرکت است، پس از افت در ابتدای سال در آذر ماه به بالای ۳۰۰ دلار رسیده و در هفته اخیر ۴۰۰ دلار را ثبت کرده است. شاخص قیمت استایرن مونومر شرکت پتروشیمی پارس اما بعد از شتاب صعودی که تا قبله ۱۳۵۸ دلار نیز فراتر رفته بود، در هفته اخیر قیمت ۱۳۳۹ دلار را ثبت کرد. استایرن مونومر محصول تولیدی پتروشیمی پارس و خوراک مصرفی شرکت پتروشیمی قائد بصیر می باشد.

شرکت آلومینیم ایران در بهمن ماه در مجموع ۸ هزار تن، دی ماه ۹۱۲۰ تن و در آذر ماه ۱۳ هزار تن شمش در بورس کالا عرضه کرده است. عرضه‌های ابتدایی ۲۰ روز اول در اسفند ماه ۶ هزار تن گزارش شده است. این محصول که در بازار داخلی ایران در ماه‌های ابتدایی سال در کف قیمتی خود معامله می‌شد، از تیر ماه سال جاری با رشد خوبی همراه بوده و بعد از پشت سر گذاشتن ثبات قیمتی از اواخر بهمن ماه مجدد از مرز ۵۰۰ هزار ریال در هر کیلو عبور و در آخرین معامله انجام شده در بورس کالا قیمت ۵۴۰ هزار ریال را ثبت نموده است.

ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

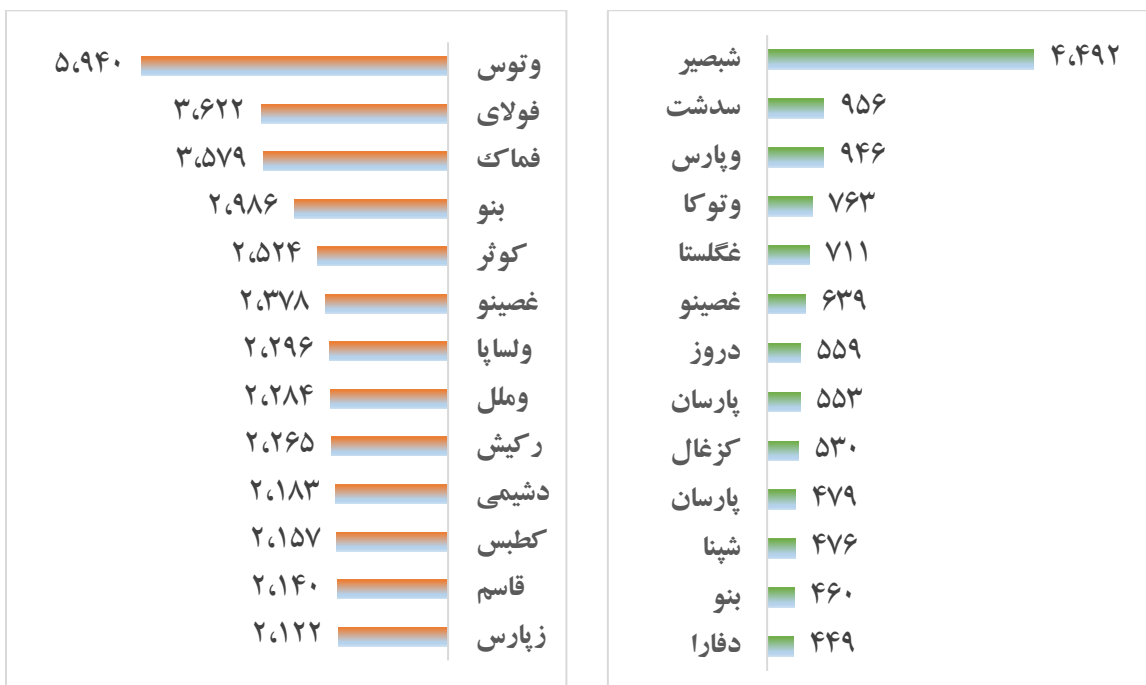


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

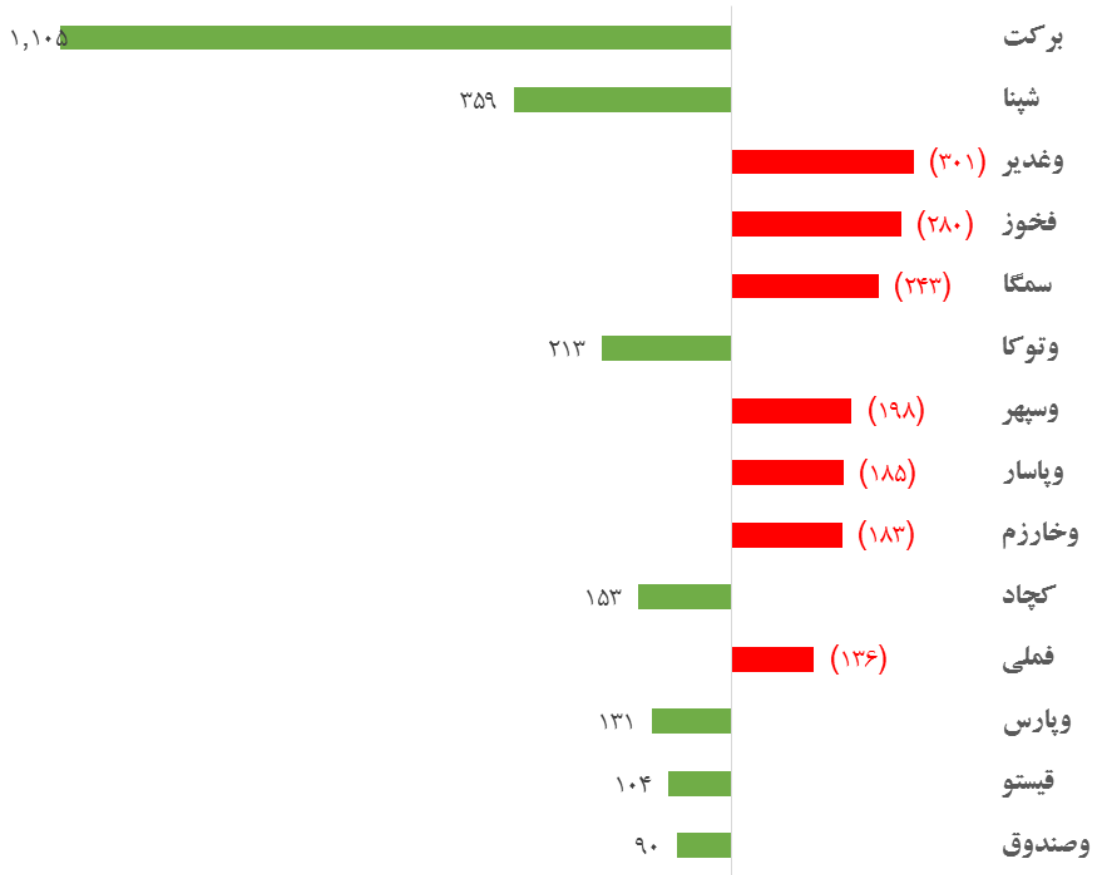


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	آریا	۱	شاملا
۲	فارس	۲	دسبحان
۳	ارفع	۳	چکاپا
۴	پارسان	۴	بمپنا
۵	کنور	۵	ساراب
۶	پارس	۶	وصنا
۷	کرماشا	۷	فخاس
۸	کچاد	۸	پتایر
۹	نوری	۹	دی
۱۰	وبملت	۱۰	سخوز



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	جوین
۲	کرازی	۱۲	افق
۳	غپاک	۱۳	خبهمن
۴	کرمان	۱۴	خودکفا
۵	سمگا	۱۵	ویست
۶	کزغال	۱۶	غفارس
۷	وتوکا	۱۷	زاگرس
۸	پردیس	۱۸	شپهرن
۹	ساراب	۱۹	کاما
۱۰	شغدیر	۲۰	جم بیلن



ورود نقدینگی ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	مواد و محصولات دارویی	۹۸۱،۰۲۴
۲	استخراج کانه های فلزی	۲۱۵،۶۸۴
۳	قند و شکر	۱۰۱،۵۰۶
۴	استخراج زغال سنگ	۶۵،۰۹۰
۵	واسطه گری های مالی و پولی	۳۰،۰۳۱
۶	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۷،۹۳۱
۷	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱۵،۱۲۱
۸	ساخت محصولات فلزی	۶۷۴
۹	حمل و نقل آبی	۲۹۰
۱۰	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۱،۳۰۰
۱۱	ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی	-۳،۸۸۶
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	-۳،۹۷۸
۱۳	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۴،۱۰۸
۱۴	کاشی و سرامیک	-۷،۴۴۰
۱۵	پیمانکاری صنعتی	-۸،۳۱۵
۱۶	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۱۵،۱۳۱
۱۷	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۲۰،۴۹۲
۱۸	ماشین آلات و دستگاه های برقی	-۲۱،۰۵۲
۱۹	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۲۲،۱۷۷
۲۰	محصولات چوبی	-۲۲،۷۰۷
۲۱	سایر واسطه گری های مالی	-۲۶،۴۰۱
۲۲	خدمات فنی و مهندسی	-۲۹،۲۹۴
۲۳	مخابرات	-۴۵،۹۰۱
۲۴	منسوجات	-۴۶،۵۴۶
۲۵	ماشین آلات و تجهیزات	-۵۵،۳۳۷
۲۶	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۶۵،۲۷۹
۲۷	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۶۶،۳۰۱
۲۸	لاستیک و پلاستیک	-۶۷،۶۹۱
۲۹	زراعت و خدمات وابسته	-۶۷،۷۴۸
۳۰	محصولات کاغذی	-۷۹،۴۹۶
۳۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۹۶،۹۷۹
۳۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۱۷،۷۸۵
۳۳	فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط	-۱۲۵،۴۳۳
۳۴	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۴۳،۰۰۰
۳۵	خودرو و ساخت قطعات	-۱۹۸،۵۹۱
۳۶	شرکت های چند رشته ای صنعتی	-۲۶۸،۲۶۳
۳۷	سیمان، آهک و گچ	-۲۷۵،۵۰۸
۳۸	هتل و رستوران	-۲۸۸،۰۶۱
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۳۵۳،۶۶۳
۴۰	محصولات شیمیایی	-۳۸۸،۴۲۵
۴۱	فلزات اساسی	-۴۳۹،۵۳۵
۴۲	سرمایه گذار یها	-۵۰۰،۰۴۳
جمع ورود نقدینگی		-۲،۴۴۸،۵۱۵