



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۴ اسفند ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، کچاد، کگل، خودرو، پارسان، وبملت و ومعادن با افزایش ۱۵,۷۶۳ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۴۵,۱۴۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۰۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش ۱۱ درصدی همراه بوده است. افزایش تقاضا مخصوصاً در نمادهای بزرگ در گروه‌های خودرویی، بانکی و استخراج کانه‌های فلزی در بازار امروز به نسبت چند روز گذشته بیشتر بوده است. اما بسیاری از نمادهای کوچک همچنان مثل روزهای معاملاتی گذشته با صف فروش به کار خود پایان دادند.

در دو روز گذشته، شاخص کل به کمک نمادهای شاخص ساز با رشد حدود ۳۷ هزار واحدی همراه شد و شاخص کل از روند نزولی خود خارج شده است و در چند روز آینده می‌تواند به بالای ۱,۳۰۰,۰۰۰ واحد نیز برسد اما این حرکت در شاخص کل تا موقعی که کمتر از ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد باشد (سقف میان مدتی قبلی)، به منزله شروع یک روند صعودی قوی نیست و شاخص کل هنوز روند اصلاحی خود را به طور کامل تکمیل نکرده است و می‌تواند بعد از این رشد دوباره حالت اصلاحی به خود بگیرد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۲۵,۶۳۰ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش ۱ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اخزا۲۱ 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 اخزا۸۲۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۰۸/۰۶ با ۲۳,۲٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۲/۲۳	۱۳۹۹/۱۲/۲۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۲۶,۳۰۹	۱۲۵,۶۳۰	-۱٪



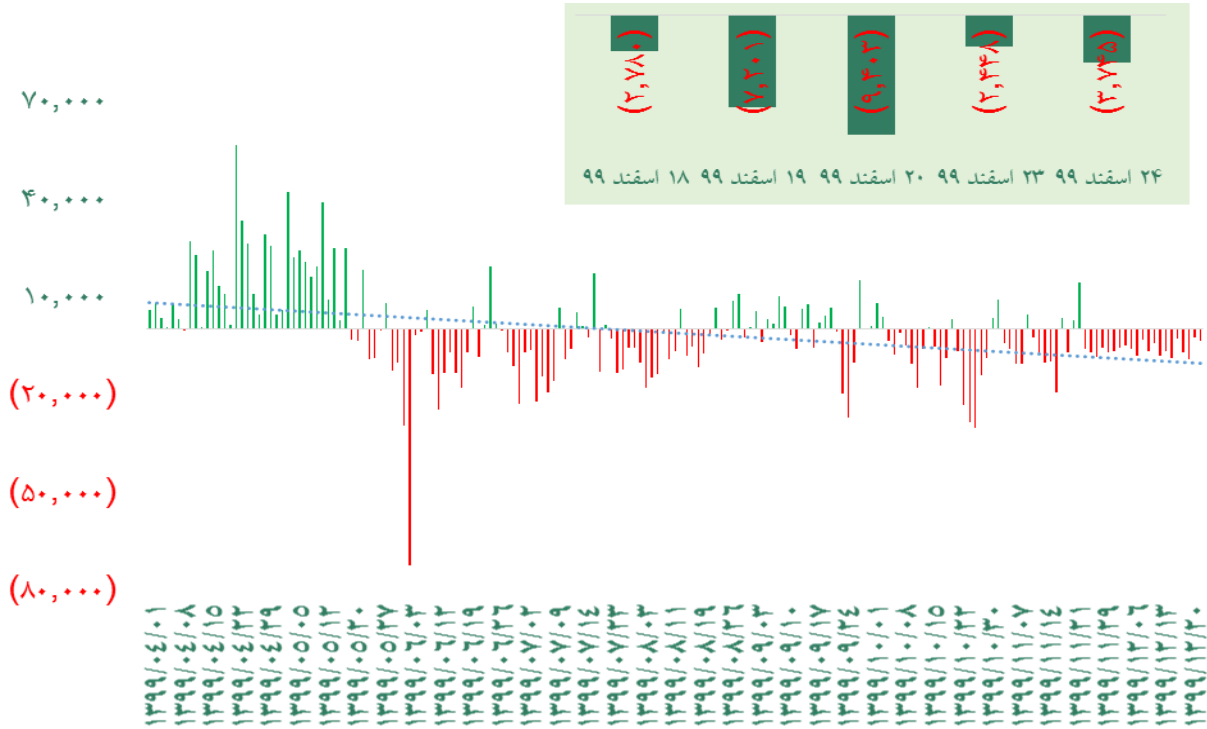
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، در دو روز گذشته سهام شرکت‌های اوره ساز با افزایش تقاضا در بازار سرمایه همراه بودند. بنابر داده‌های (ICIS)، محصول اوره فوب ایران در هفته اخیر با نرخ ۲۶۵ دلار در هر تن معامله شده است. همچنین نرخ اوره فوب خلیج فارس افزایش حدود ۱۷ دلاری در هر تن داشته و به ۳۶۶ دلار رسیده است. از طرفی نرخ اوره فوب بالتیک در هفته اخیر ۳۵۳ دلار بوده که افزایش ۳ دلاری را نسبت به هفته قبل داشته است. به طور متوسط، اگر نرخ دلار در بهمن ماه سال جاری را به طور میانگین، نرخ نیمایی (۲۳۴ هزار ریال) در نظر بگیریم، آن وقت اکثر شرکت‌های اوره‌ای، محصول اوره صادراتی را حوالی ۲۱۵ دلار در هر تن به فروش رساندند که در حال حاضر با رشد بااهمیتی همراه شده است.

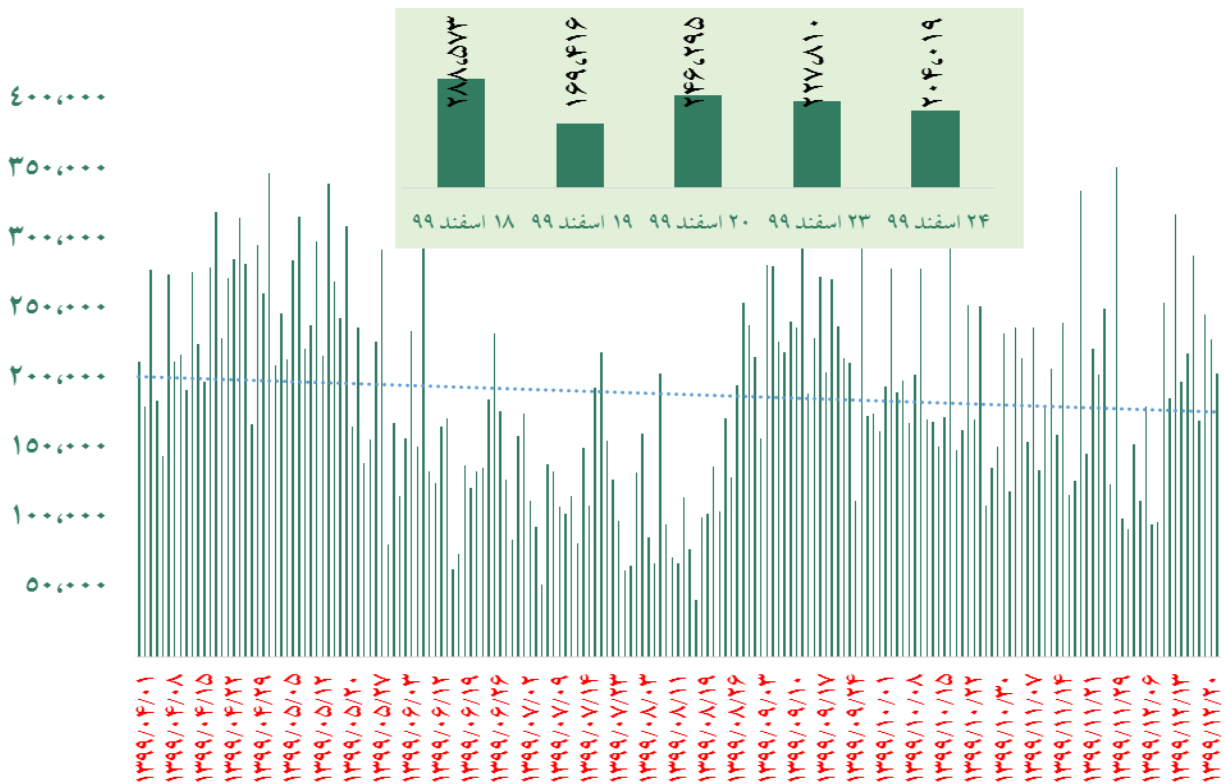
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع شیمیایی ایران، در ابتدای سال جاری با کاهش قیمت نفت، ماده اولیه مصرفی این شرکت کاهش ۳۵ الی ۵۰ درصدی همراه بوده است ولی به دلیل تقاضای مناسب برای محصول نهایی تولیدی این شرکت، حاشیه سود فروش LAB به اوج چند سال اخیر خود رسیده است که سبب شد که اسپرد دلاری ۷۶۶ دلار (۷۰ درصد) به طور متوسط ثبت شود. در بهمن ماه اسپرد دلاری به ۸۳۳ دلار ثبت شده که همچنان وضعیت مطلوب عملیاتی محصول ذکر شده را نشان می‌دهد. قابل ذکر است که در اسفند قیمت‌های منطقه ICIS برای فوب خلیج فارس بروز رسانی نشده است اما قیمت در چین و هند به حدود ۱۵۰۰ دلار در هر تن رسیده است که نوید بخش سودآوری مناسب برای این محصول خواهد بود.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



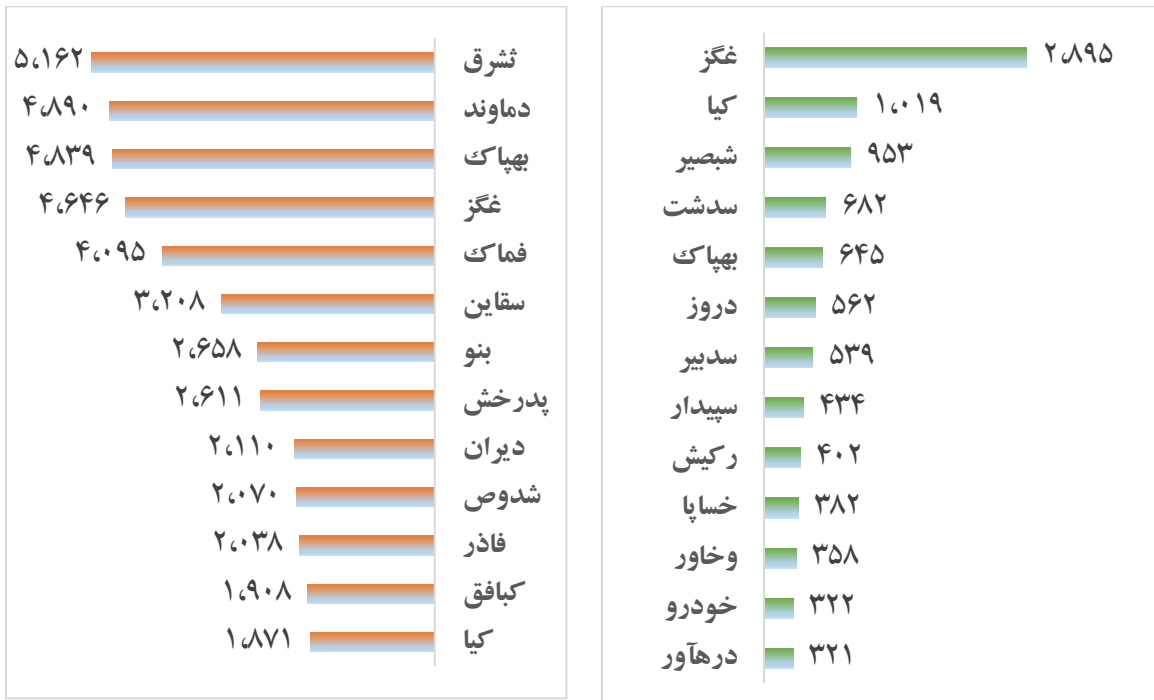
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گروه مالی شهر گزارش روزانه



بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

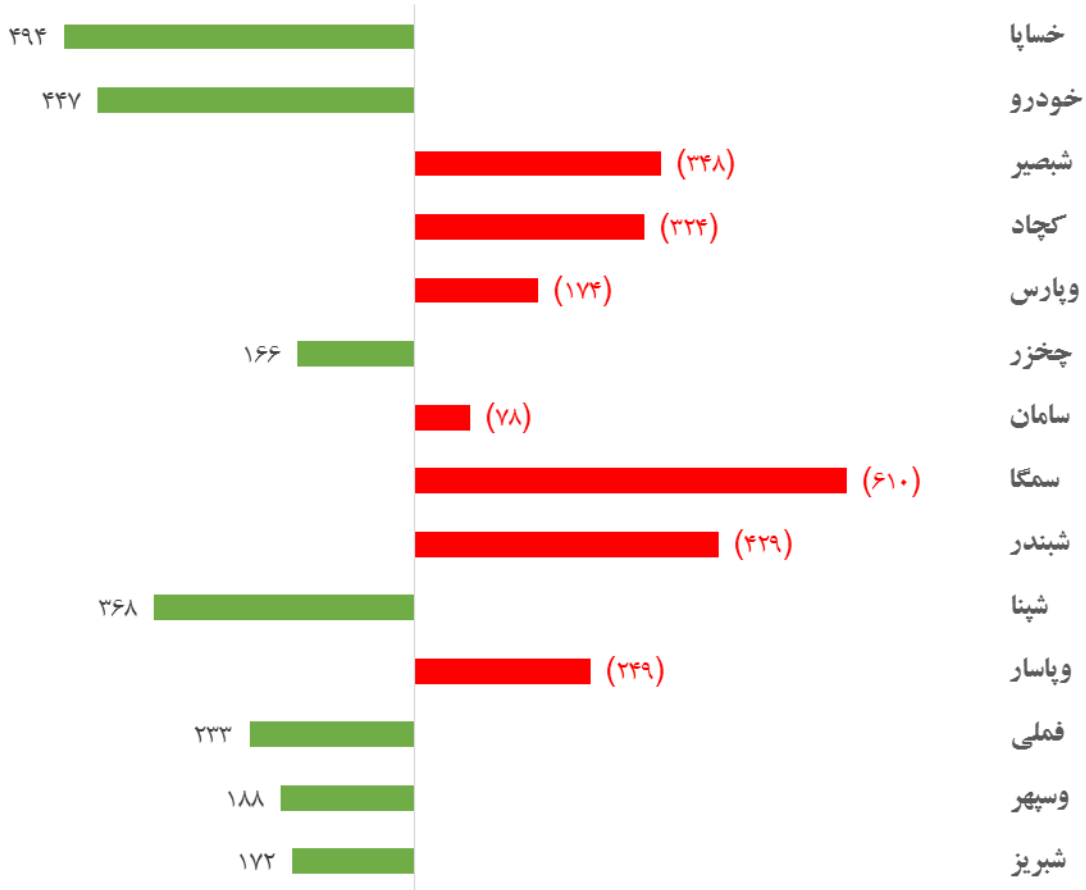


پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	سپیدار	۱	افق
۲	چخزر	۲	بكهنج
۳	كزغال	۳	زشریف
۴	فولاژ	۴	خدیزل
۵	وصندوق	۵	شسپا
۶	خساپا	۶	خاهن
۷	خودرو	۷	افق
۸	فارس	۸	وهور
۹	ناخت	۹	كیمیا
۱۰	شبعير	۱۰	دی



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کرغال	۱۱	خاهن
۲	کیمیا	۱۲	افق
۳	غپاک	۱۳	جم بیلن
۴	سمگا	۱۴	حریل
۵	برکت	۱۵	زاگرس
۶	شاوان	۱۶	ختوقا
۷	خزامیا	۱۷	کاما
۸	کرازی	۱۸	شغدیر
۹	سیلام	۱۹	بنو
۱۰	اپال	۲۰	سامان



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	خودرو و ساخت قطعات	۸۵۰,۸۹۱
۲	محصولات چوبی	۱۶۵,۷۷۷
۳	استخراج کانه های فلزی	۱۰۹,۵۳۰
۴	مخابرات	۴۹,۶۳۳
۵	واسطه گری های مالی و پولی	۴۹,۵۹۸
۶	استخراج زغال سنگ	۴۳,۷۸۰
۷	ماشین آلات و تجهیزات	۳۲,۹۴۳
۸	مواد و محصولات دارویی	۲۶,۶۲۳
۹	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۱۳,۹۱۵
۱۰	ساخت محصولات فلزی	۴,۵۶۹
۱۱	پیمانکاری صنعتی	۴,۲۷۵
۱۲	کاشی و سرامیک	۱,۲۰۸
۱۳	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۲,۰۴۸
۱۴	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۲,۲۸۵
۱۵	ساخت دستگاهها و وسایل ارتباطی	-۳,۸۷۷
۱۶	قند و شکر	-۵,۶۱۶
۱۷	ماشین آلات و دستگاههای برقی	-۹,۶۵۵
۱۸	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۱۱,۵۱۴
۱۹	اطلاعات و ارتباطات	-۱۲,۴۲۵
۲۰	خدمات فنی و مهندسی	-۱۸,۶۸۶
۲۱	سایر واسطه گریهای مالی	-۳۰,۵۴۷
۲۲	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۴۴,۹۹۹
۲۳	محصولات کاغذی	-۴۵,۷۷۵
۲۴	لاستیک و پلاستیک	-۶۲,۶۶۳
۲۵	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۶۳,۲۹۷
۲۶	زراعت و خدمات وابسته	-۷۱,۶۳۰
۲۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۷۹,۷۱۹
۲۸	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۸۳,۵۰۴
۲۹	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۸۷,۸۶۷
۳۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۹۶,۵۱۰
۳۱	سیمان، آهک و گچ	-۱۴۶,۹۹۹
۳۲	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۱۷۹,۸۹۷
۳۳	محصولات شیمیایی	-۲۱۷,۴۷۶
۳۴	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۳۲۷,۴۱۷
۳۵	بانکها و موسسات اعتباری	-۳۴۳,۶۴۶
۳۶	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۳۸۵,۷۹۱
۳۷	سرمایه گذاریها	-۴۵۳,۶۱۷
۳۸	فلزات اساسی	-۶۰۹,۵۹۷
۳۹	هتل و رستوران	-۶۳۱,۰۷۰
۴۰	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۱,۰۶۹,۷۵۹
	جمع ورود نقدینگی	-۳,۷۴۵,۱۴۴