



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

## گزارش روزانه تحلیل بازار



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۱۵ فروردین ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، فارس، شستا، کگل، کچاد و شپنا با کاهش ۱۳.۴۱۴ واحد همراه شد و به سطح ۱.۲۶۹.۵۳۴ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۱۶۸ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با افزایش ۲۲۹ درصدی همراه بوده است اما تنها ۱۷۷۰۰ میلیارد ریال از ارزش معاملات روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام و حق تقدم بوده است. در بازار امروز همانند روز گذشته، اکثر نمادها در اکثر گروه‌ها (شیمیایی، بانک، فرآورده‌های نفتی، فلزات اساسی و ...) با فشار عرضه مواجه بودند و با صف فروش به کار خود پایان دادند.

از لحاظ ارزشگذاری سهام و با توجه به نرخ بهره بانکی و نرخ جهانی محصولات، در حال حاضر بسیاری از سهام‌ها مخصوصاً از گروه‌های شیمیایی و فلزات اساسی زیر ارزش ذاتی در حال معامله هستند اما از طرفی دیگر از نظر تحلیل تکنیکال، نشانه‌ای از برگشت در اکثر سهام‌ها هنوز دیده نشده است و بسیاری از سرمایه‌گذاران در بازار سهام منتظر شفاف‌تر شدن موضوع برجام و تاثیر آن بر نرخ دلار هستند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۳۳.۷۱۰ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش محسوس ۱۵۳۵ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۶۶۴ 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 اخزا۸۰۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۹ با ۲۱.۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۱/۱۴	۱۴۰۰/۰۱/۱۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۸,۱۷۷	۱۳۳,۷۱۰	۱۵۳۵٪



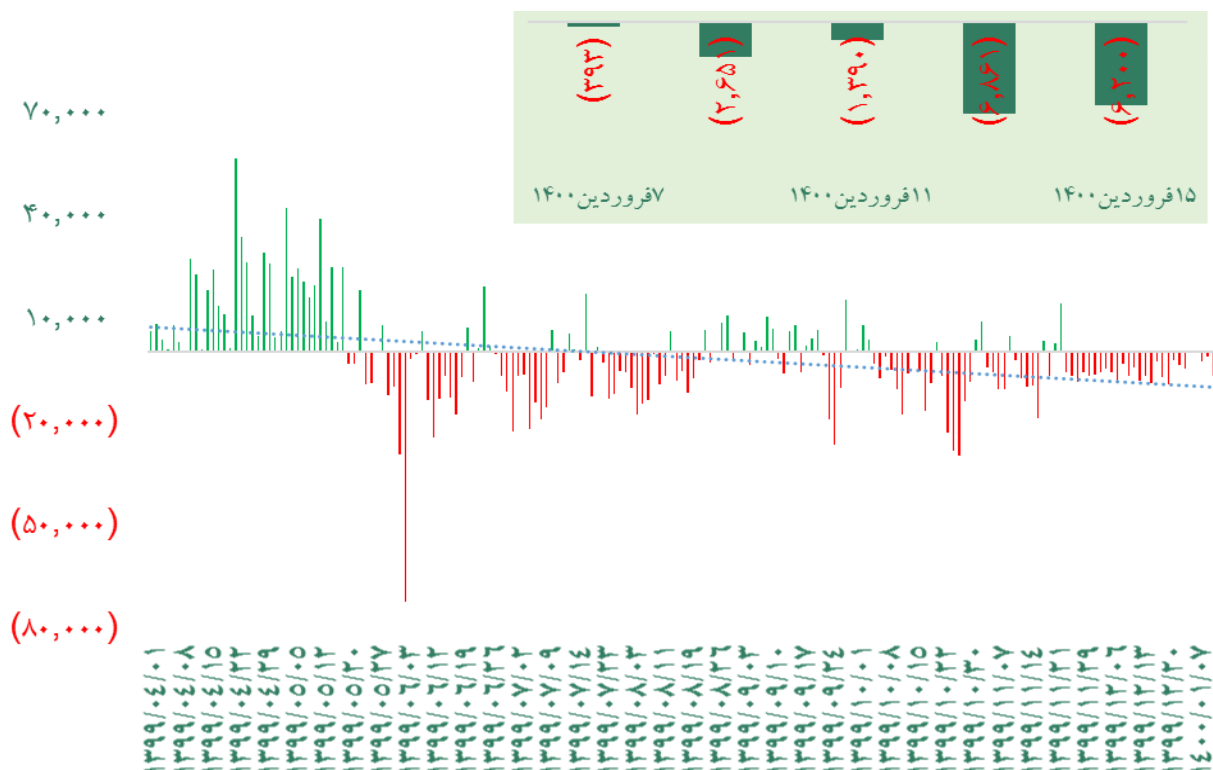
## گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت پتروشیمی جم در اسفند ماه، ۹۶ هزار تن اتیلن به عنوان محصول ابتدای خط تولید داشته است. میانگین تولید ماهانه در سال گذشته حدود ۱۰۰ هزار تن بوده است. فروش محصولات در اسفند ماه با ۱۸۰ هزار تن، بهترین فروش ماهانه آن شرکت در سال گذشته از لحاظ حجم محسوب می‌شود. شرکت پتروشیمی جم در سال ۹۹ به طور میانگین ماهانه ۱۵۷ هزار تن محصول فروخته است. در سال گذشته، فروش ماهانه این شرکت تا تیر ماه کمتر از ۱۰ هزار میلیارد ریال گزارش شد اما در بهمن ماه به فروش ۳۵۲۶۰ میلیارد ریالی رسید و در اسفند ماه نیز حدود ۳۲ هزار میلیارد ریال فروش را ثبت کرده است. میانگین نرخ فروش مجموع محصولات آن شرکت در اسفند ماه ۱۷۵۷۴۰ ریال به ازای هر کیلو بود و میانگین نرخ در فصل پاییز ۱۳۶۹۸۰ ریال و میانگین نرخ در نیمه نخست در سال ۹۹، ۷۴۸۲۰ ریال در هر کیلو بوده است.

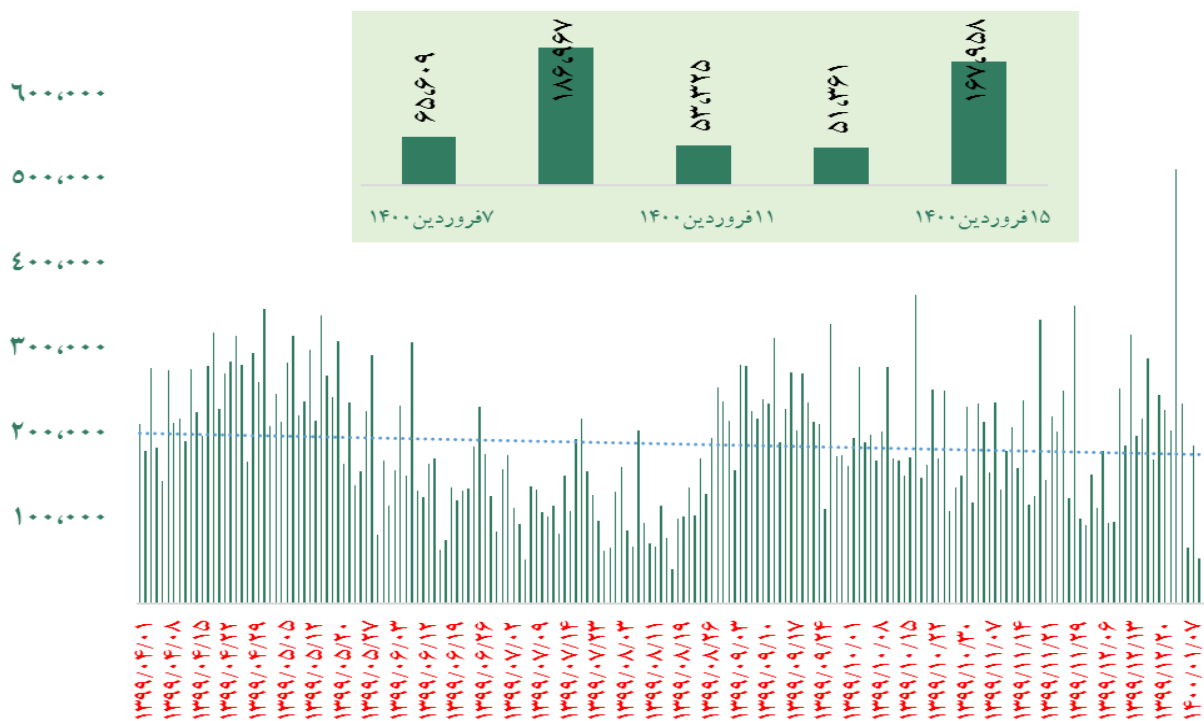
شرکت پتروشیمی نوری در سال مالی گذشته به طور متوسط برای هر ماه ۴۰۵ هزار تن تولید کرد و در اسفند ماه نیز ۴۰۰ هزار تن تولید داشت. تولید سال ۱۳۹۹ رشد ۱۲ درصدی نسبت به سال ۱۳۹۸ دارد. این شرکت در شش ماه ابتدای سال به طور متوسط فروش ۴۲۱ هزار تنی را داشت و در مهر ماه ۴۳۲ هزار تن محصول فروخت. در آبان ماه کمی از مقدار فروش کاسته و به ۲۷۱ هزار تن رسید و در آذر ماه ۴۰۰ هزار تن محصول فروخت. در دی و بهمن ماه نیز به ترتیب ۳۳۸ هزار و ۳۹۰ هزار تن مقدار فروش را ثبت کرده است. در اسفند نیز با فروش ۳۹۴ هزار تنی همراه بوده است. متوسط مبلغ فروش هر ماه در سال مالی گذشته در فصل بهار و تابستان به ترتیب ۱۰۸۷۰ و ۳۴۹۵۰ میلیارد ریال بود و در فصل پاییز مبلغ فروش به ۳۳ هزار میلیارد ریال رسید. در فصل زمستان نیز این شرکت با فروش ۴۶ هزار میلیارد ریالی همراه شد. نرخ فروش محصولات در حالی در ۹ ماه ابتدای سال گذشته به طور متوسط ۶۵ هزار ریال در هر کیلو بوده که در اسفند ماه به ۱۳۰ هزار ریال در هر کیلو رسیده است.



## ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

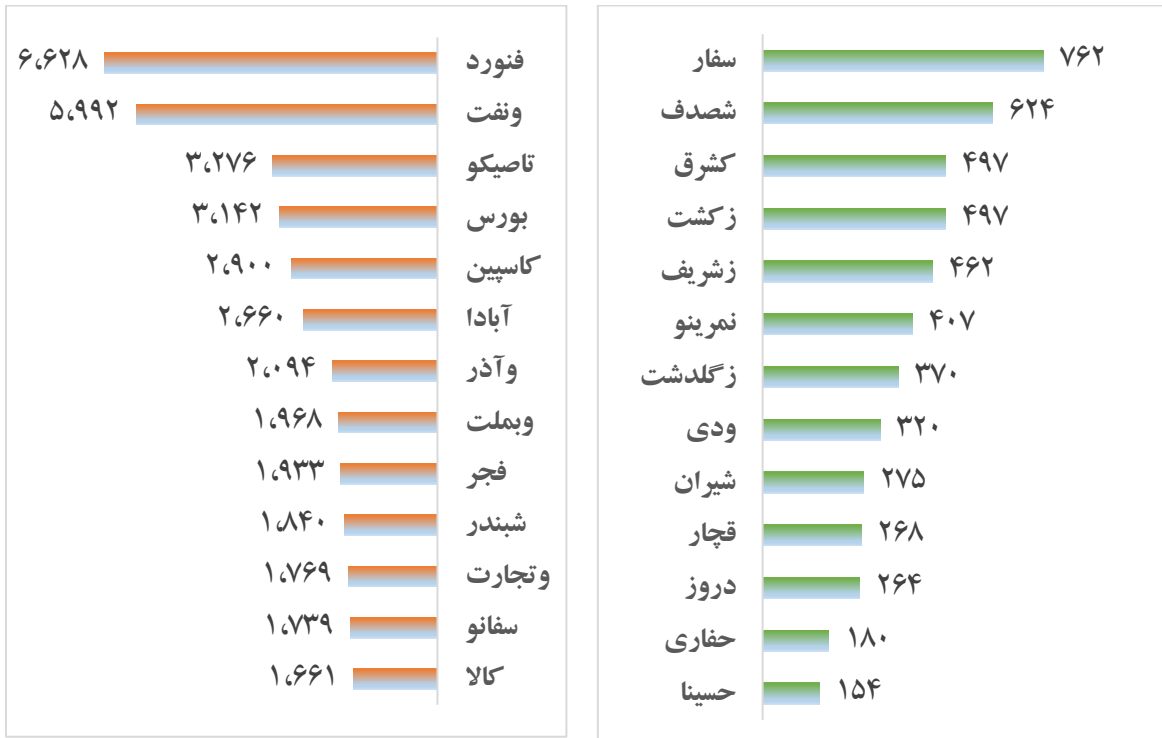


## روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





## بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

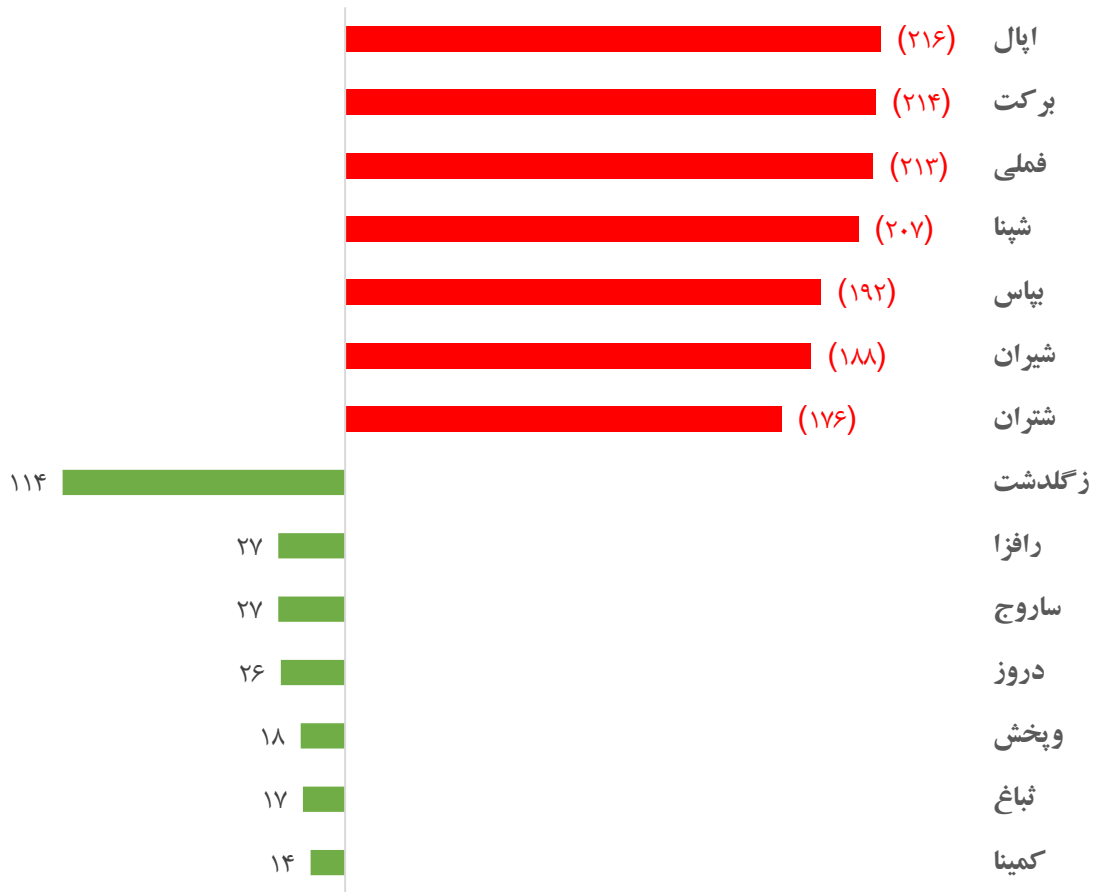


## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	زگلدشت	۱	رانفور
۲	-	۲	فباهنر
۳	-	۳	درازك
۴	-	۴	شيران
۵	-	۵	خديزل
۶	-	۶	وسبجان
۷	-	۷	لوتوس
۸	-	۸	-
۹	-	۹	-
۱۰	-	۱۰	-



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



## واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	برکت	۱۱	رانفور
۲	سیمرغ	۱۲	افق
۳	غپاک	۱۳	حتاید
۴	ثباغ	۱۴	شرانل
۵	سمایه	۱۵	شیران
۶	وساخت	۱۶	زاگرس
۷	غفارس	۱۷	بوعلی
۸	فباهنر	۱۸	شفا
۹	سدشت	۱۹	آریا
۱۰	کرازی	۲۰	ساروج



## ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	زراعت و خدمات وابسته	۵۴,۵۵۱
۲	اطلاعات و ارتباطات	-۵۴۷
۳	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۱,۹۳۱
۴	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۲,۸۶۲
۵	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۷۸۹
۶	استخراج سایر معادن	-۴,۲۹۸
۷	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۵,۳۲۲
۸	استخراج زغال سنگ	-۵,۵۸۸
۹	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۷,۰۲۳
۱۰	سایر واسطه گریهای مالی	-۷,۲۸۳
۱۱	محصولات کاغذی	-۷,۵۷۱
۱۲	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۸,۲۹۰
۱۳	حمل و نقل آبی	-۸,۴۰۰
۱۴	هتل و رستوران	-۱۳,۲۴۳
۱۵	واسطه گری های مالی و پولی	-۱۳,۶۹۵
۱۶	پیمانکاری صنعتی	-۱۹,۱۸۲
۱۷	محصولات چوبی	-۲۱,۷۲۳
۱۸	استخراج نفت گاز و خدمات جتبی جز اکتشاف	-۲۴,۱۷۴
۱۹	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۲۵,۲۲۷
۲۰	ماشین آلات و تجهیزات	-۲۷,۰۵۰
۲۱	ساخت محصولات فلزی	-۲۷,۶۰۵
۲۲	کاشی و سرامیک	-۳۳,۵۴۵
۲۳	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۳۳,۹۷۱
۲۴	لاستیک و پلاستیک	-۴۷,۱۹۴
۲۵	مخابرات	-۵۹,۶۴۸
۲۶	خدمات فنی و مهندسی	-۸۱,۱۷۳
۲۷	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۸۲,۸۷۲
۲۸	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۸۶,۶۲۸
۲۹	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۸۸,۸۹۴
۳۰	سیمان، آهک و گچ	-۹۳,۲۷۲
۳۱	خودرو و ساخت قطعات	-۱۱۹,۷۶۹
۳۲	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۱۲۵,۰۳۸
۳۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۱۵۲,۷۸۵
۳۴	مواد و محصولات دارویی	-۲۵۸,۳۲۵
۳۵	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۳۰۳,۸۵۸
۳۶	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۳۰۷,۱۶۷
۳۷	سرمایه گذاریها	-۳۵۹,۳۷۳
۳۸	بانکها و موسسات اعتباری	-۵۲۰,۶۰۵
۳۹	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۵۶۵,۵۰۷
۴۰	استخراج کانه های فلزی	-۵۷۲,۷۲۳
۴۱	فلزات اساسی	-۷۷۵,۴۸۸
۴۲	محصولات شیمیایی	-۱,۳۵۱,۶۴۱
	<b>جمع ورود نقدینگی</b>	<b>-۶,۲۰۰,۴۳۸</b>