



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۲ فروردین ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، فارس، کچاد، شستا، شپنا و تاپیکو با کاهش ۹۷۷۵ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۳۰,۹۲۰ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۳۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش ۸۰ درصدی همراه بوده است و مبلغ ۱۹,۷۰۰ میلیارد ریال از ارزش معاملات روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام و حق تقدم می‌باشد. بازار امروز همانند روزهای گذشته، بیشتر گروه‌ها و نمادها با فشار عرضه مواجه بودند و با صف فروش به کار خود پایان دادند.

بخش مهمی از بازار سرمایه به دلیل ابهام در نرخ واقعی ارز، ترجیح می‌دهند که حداقل تا قبل از تعیین شدن وضعیت سیاسی، در بازار سرمایه طرف خریدار حاضر نشوند و این موضوع را در کاهش حجم و ارزش معاملات در چند وقت اخیر به وضوح در حال مشاهده هستیم. اما موضوعی که به نظر مهم می‌رسد، عدم گرایش نرخ دلار به سمت پایین، حتی با توجه به اخبارهای مثبت سیاسی که در چند روز اخیر مخابره شده است. به نظر می‌آید با توجه به بودجه دولت، نرخ نفت و مقدار واقعی نفت قابل فروش توسط ایران، به این نتیجه می‌رسیم که نظراتی در مورد کاهش و تثبیت نرخ دلار به کمتر از ۲۲۰ هزار ریال بعد از توافقات جدید برجام، کارشناسی و علمی نمی‌باشد و با واقعیت‌های حال حاضر اقتصاد ایران همخوانی ندارد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۲,۹۵۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوس ۸۹ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۳۵۴ 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 ۷۱۳، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۵/۱۸ با ۲۲,۵٪ سود است.



شرح	۱۴۰۰/۰۱/۲۱	۱۴۰۰/۰۱/۲۲	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۲۷,۱۴۱	۲,۹۵۶	-۸۹٪

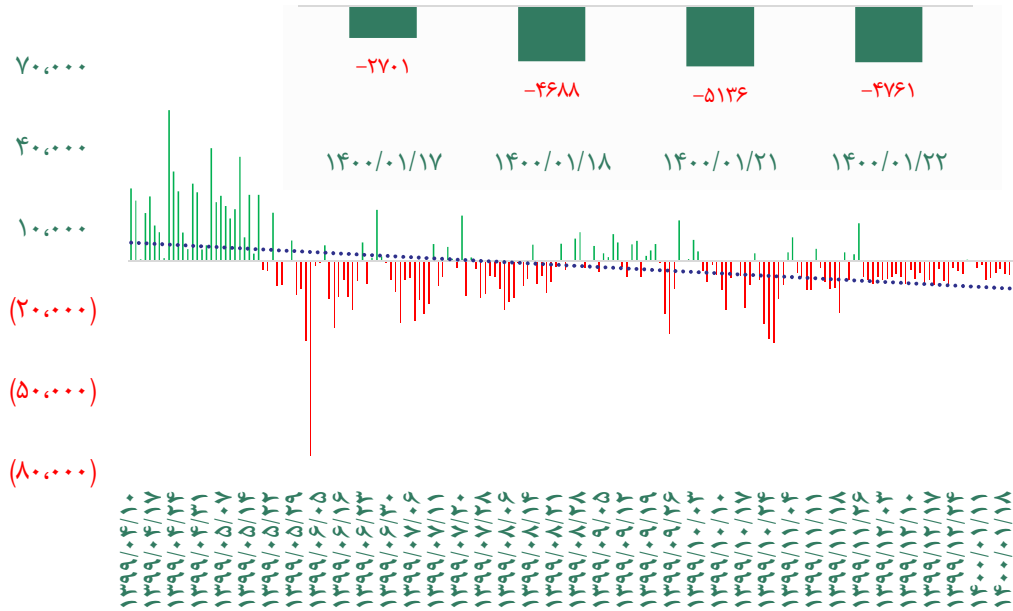
گروه‌های مؤثر

بازار خرید الیاف پلی اتیلن با توجه به تقاضای بهتر در صنایع پایین دستی، در هفته گذشته نسبت به هفته قبل بهتر ظاهر شد. نرخ نقدی داخل چین بین ۲۵ تا ۱۶۵ یوان رشد هفتگی داشته است. نسبت فروش به تولید کارخانه‌ها بین ۵۹ تا ۱۳۱ درصد گزارش شد که بالاتر از هفته‌های قبل است. پتروشیمی تندگویان انواع گرید بطری والیاف تولید را به فروش می‌رساند. این شرکت در ماه گذشته ۱۲,۴ هزار میلیارد ریال فروش محصولات را به ثبت رسانده است. میانگین نرخ فروش محصول گرید بطری در ۱۱ ماه ابتدایی سال مالی ۹۹، ۱۵۰،۵۷۳ ریال به ازای هر کیلو بود که در اسفند ماه موفق به فروش این محصول به نرخ ۲۵۰،۲۸۲ ریال به ازای هر کیلو شده است. میانگین مبلغ فروش ۱۱ ماهه سال مالی ۹۹، حدود ۸ هزار میلیارد ریال بوده که مبلغ فروش در اسفند ماه حدود ۵۰ درصد بیشتر از میانگین مبلغ فروش ۱۱ ماهه می باشد.

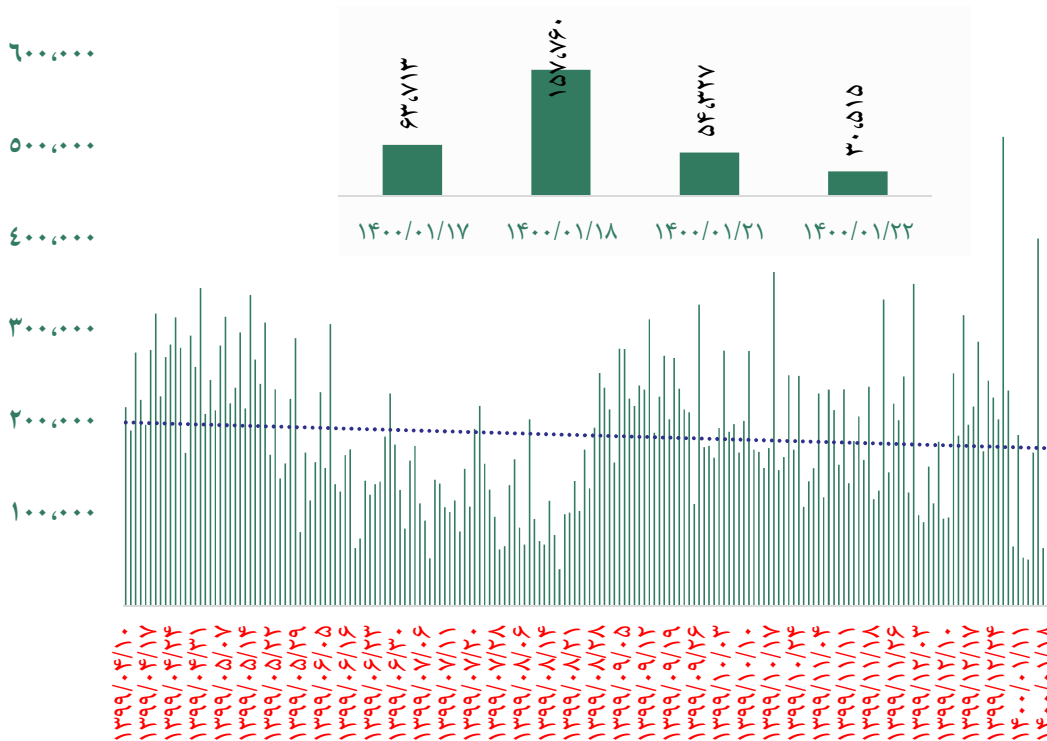
براساس گزارش انجمن جهانی فولاد در ماه مارس ۲۰۲۱، دولت چین چندین اقدام را اعمال کرد تا بتواند آلودگی هوا را کاهش دهد و در تاریخ ۱۹ مارس اعلام کرد که این محدودیت ها تا پایان سال ۲۰۲۱، برقرار خواهد بود. در دو ماه ابتدایی سال میلادی ۲۰۲۱، مصرف فولاد خام ۱۲,۲ درصد افزایش پیدا کرده و به ۱۶۸,۵ میلیون تن و تولید فولاد خام نیز با ۱۲,۹ درصد رشد به ۱۸۰ میلیون تن رسیده است. مقدار مصرف سالانه معادل ۱,۰۳۲ میلیون تن بوده در حالی که تولید فولاد خام سالانه چین تقریباً ۱ میلیون تن بوده است. واردات سنگ آهن در ۲ ماه ابتدایی در این کشور با ۲,۸ درصد رشد نسبت به مدت زمان مشابه سال گذشته به ۱۷۶,۶ میلیون تن رسید. متوسط قیمت سنگ آهن وارداتی کشور چین در دو ماه گذشته به طور قابل توجهی رشد داشته و به ۱۴۴ دلار رسید که بیشترین قیمت طی ۱۰ سال اخیر می باشد. شرکت‌های تولید کننده فولاد و سنگ آهن در داخل کشور در وضعیت خوبی به سر می‌برند. بطوریکه بلوم داخلی شرکت فولاد خوزستان در اسفند ماه بیش از ۱۰۵ میلیون ریال به ازای هر تن معامله شده است و گندله سنگ آهن نیز بیش از ۲۶ میلیون ریال به ازای هر تن توسط شرکت‌هایی مثل گل گهر به فروش رفته است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال) ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



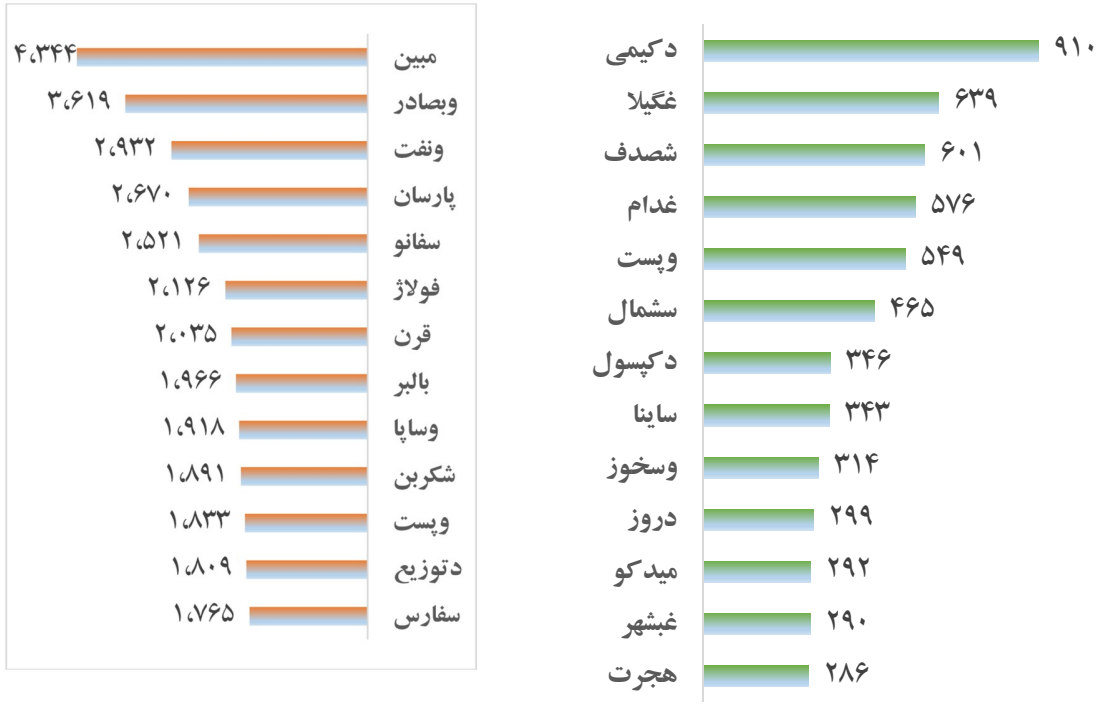
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گزارش روزانه گروه مالی شهر



بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)



پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	خزامیا	۱	کاما
۲	غپاک	۲	هېجرت
۳	فنورد	۳	دسبحان
۴	قپیرا	۴	پکویر
۵	سپیدار	۵	وخارزم
۶	-	۶	بکهنوج
۷	-	۷	مبین
۸	-	۸	کپارس
۹	-	۹	دسینا
۱۰	-	۱۰	پخس



بیشترین جذب تقدینگی (میلیارد ریال)



واج لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فنورد	۱۱	ساینا
۲	غپاک	۱۲	خزامیا
۳	فلوله	۱۳	غبشهر
۴	قچار	۱۴	دلتما
۵	سپیدار	۱۵	شکرین
۶	قپیرا	۱۶	سمازن
۷	فباهنرح	۱۷	نمرینو
۸	چخزر	۱۸	حتناید
۹	شفن	۱۹	رتکو
۱۰	زپارس	۲۰	بالاس



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۲۲,۶۲۴
۲	قند و شکر	۲,۸۵۷
۳	ساخت محصولات فلزی	-۲۶
۴	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۱۴۶
۵	واسطه‌گری های مالی و پولی	-۱,۲۶۶
۶	هتل و رستوران	-۳,۲۳۸
۷	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۵,۲۲۶
۸	محصولات کاغذی	-۵,۹۶۲
۹	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	-۶,۳۴۵
۱۰	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۶,۷۶۹
۱۱	سایر واسطه‌گریهای مالی	-۷,۱۲۱
۱۲	خدمات فنی و مهندسی	-۹,۹۱۱
۱۳	سایر محصولات کانی غیرفلزی	-۱۵,۳۶۳
۱۴	پیمانکاری صنعتی	-۱۷,۶۰۷
۱۵	لاستیک و پلاستیک	-۱۸,۸۱۱
۱۶	مخابرات	-۱۹,۶۵۰
۱۷	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۹,۸۷۰
۱۸	محصولات چوبی	-۲۲,۲۰۴
۱۹	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۲۷,۰۲۲
۲۰	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۲۸,۷۷۵
۲۱	زراعت و خدمات وابسته	-۵۲,۲۲۶
۲۲	خرده فروشی، باستاننای وسایل نقلیه موتوری	-۵۵,۵۳۹
۲۳	سیمان، آهک و گچ	-۶۷,۸۰۹
۲۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۷۱,۶۴۹
۲۵	خودرو و ساخت قطعات	-۸۷,۵۷۴
۲۶	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۹۴,۴۴۷
۲۷	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۱۲۵,۷۲۵
۲۸	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۶۰,۵۳۷
۲۹	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۱۸۵,۲۲۷
۳۰	سرمایه گذاریها	-۲۰۴,۷۱۸
۳۱	فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۳۶۶,۴۶۵
۳۲	فلزات اساسی	-۴۸۲,۰۶۵
۳۳	محصولات شیمیایی	-۶۳۱,۰۴۲
۳۴	استخراج کانه های فلزی	-۶۸۴,۰۵۶
۳۵	بانکها و موسسات اعتباری	-۱,۲۰۶,۱۵۴
۳۶	جمع	-۴,۷۲۵,۰۶۴