



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز سه‌شنبه ۲۴ فروردین ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فولاد، شستا، فملی، تاپیکو، کچاد، فخوز و شپنا با افزایش ۱۸۴۵۸ واحد همراه شد و به سطح ۱.۲۴۴.۶۱۶ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۷۴ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش محسوسی همراه بوده است. حدود مبلغ ۵۰ هزار میلیارد ریال از ارزش معاملات روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام و حق تقدم می‌باشد که بیش از ۶۵ درصد از ارزش معاملات را شامل می‌شود. در بازار امروز بعد از هفته‌ها شاهد صف‌های خرید در بعضی از نمادهای بزرگ مانند شستا و فخوز بودیم اما همچنان فشار فروش در بازار مشهود بود که به نظر امری طبیعی می‌باشد.

شاخص کل از اوایل مرداد ماه تا اواخر دی ماه سال گذشته بیش از ۴۶ درصد ریزش داشته است که در نوع خود در چند سال گذشته، این نوع ریزش بی‌سابقه بوده است. در ۸ ماه گذشته شاخص کل در حال تکمیل موج نزولی خود بوده و بعد از تکمیل موج دیامتریکی F در اواخر بهمن ماه سال گذشته، شروع به ساخت آخرین موج اصلاحی خود در شاخه G اقدام کرد که در دو سناریو خوشبینانه و بدبینانه می‌توان آخرین موج اصلاحی شاخص را بررسی کرد. سناریو خوشبینانه، تکمیل موج G در چند روز گذشته و شروع دوره صعود می‌باشد و سناریو بدبینانه نیز عدم اتمام موج G می‌باشد و افزایش شاخص کل در روزهای آینده را فقط یک اصلاح کوتاه مدتی به سمت بالا می‌توان در نظر گرفت. در هر دو سناریو، در صورت تکمیل شدن موج نزولی، شاخص کل می‌تواند به سمت اهداف ۱.۵۰۰.۰۰۰ الی ۱.۶۰۰.۰۰۰ واحدی حرکت کند.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۱۲.۱۶۵ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مابحه عام دولت با نماد اراد ۴۰۴ 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 ۹۰۴، تاریخ سررسید ۱۴۰۲/۱۰/۲۵ با ۲۱.۷٪ سود است.



شرح	۱۴۰۰/۰۱/۲۳	۱۴۰۰/۰۱/۲۴	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۳۹۹,۴۵۷	۱۲,۱۶۵	-۹۷%

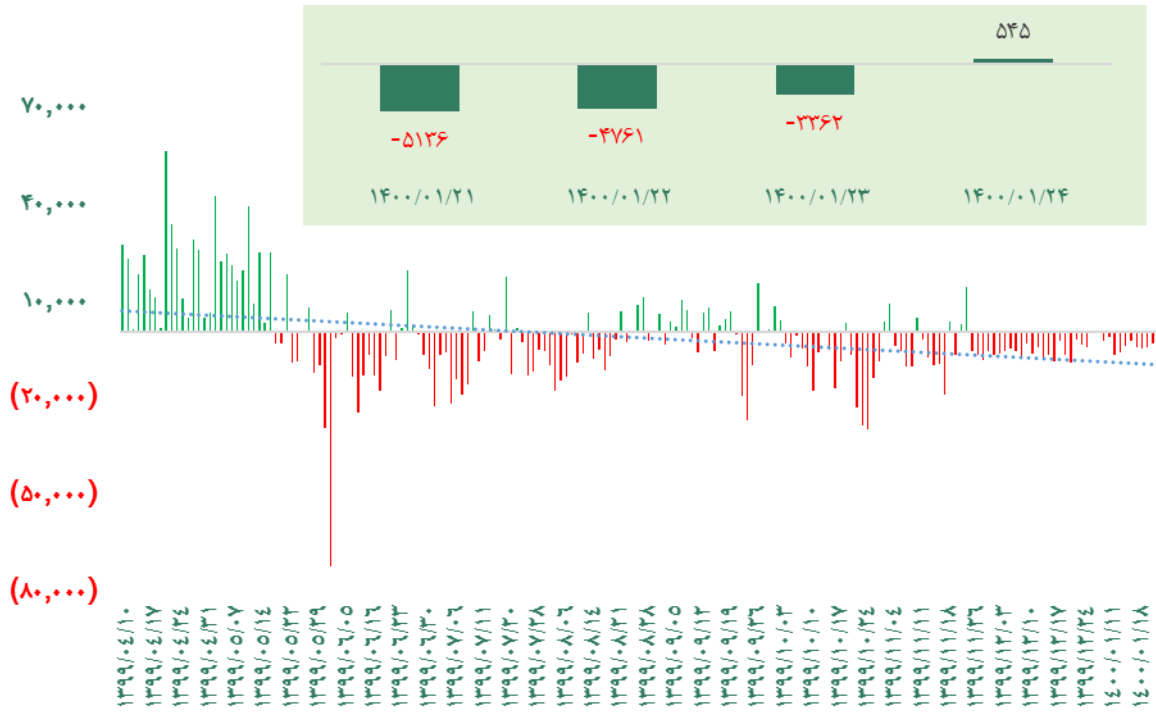
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، شرکت پتروشیمی تندگویان در دو هفته اخیر مجموعاً ۱۹ هزار تن محصول پت گریدهای مختلف را در بورس کالا عرضه کرده که تقاضای ۳۲ هزار تنی به دنبال داشت و تمامی مقادیر عرضه شده در قیمت‌های بالاتر از قیمت پایه معامله شد. مقدار عرضه شده در حد متوسط چند وقت اخیر بوده است. قیمت پلی اتیلن ترفتلات در بازه مرداد ماه تا آبان ماه سال مالی گذشته در حالت رکود در کف قیمتی به سر می‌برد اما تغییرات قیمت ارز در داخل عامل رشد قیمت ریالی این محصول بود. اما پس از رشد قیمت پت جهانی و شروع روند صعودی از قیمت‌های ۶۵۰ دلار به حدود ۱۰۰۰ دلار در هر تن برای گرید بطری، این بار در سایه ثبات نرخ دلار، معاملات محصول پت روند صعودی خود را حفظ کرده است. میانگین قیمت معامله پت گرید بطری ۸۲۱ که در زمستان ۲۷۳ هزار ریال به ازای هر کیلو بوده، در فرودین ماه تاکنون این محصول با نرخ میانگین ۳۱۲ هزار ریال به ازای هر کیلو معامله شده است.

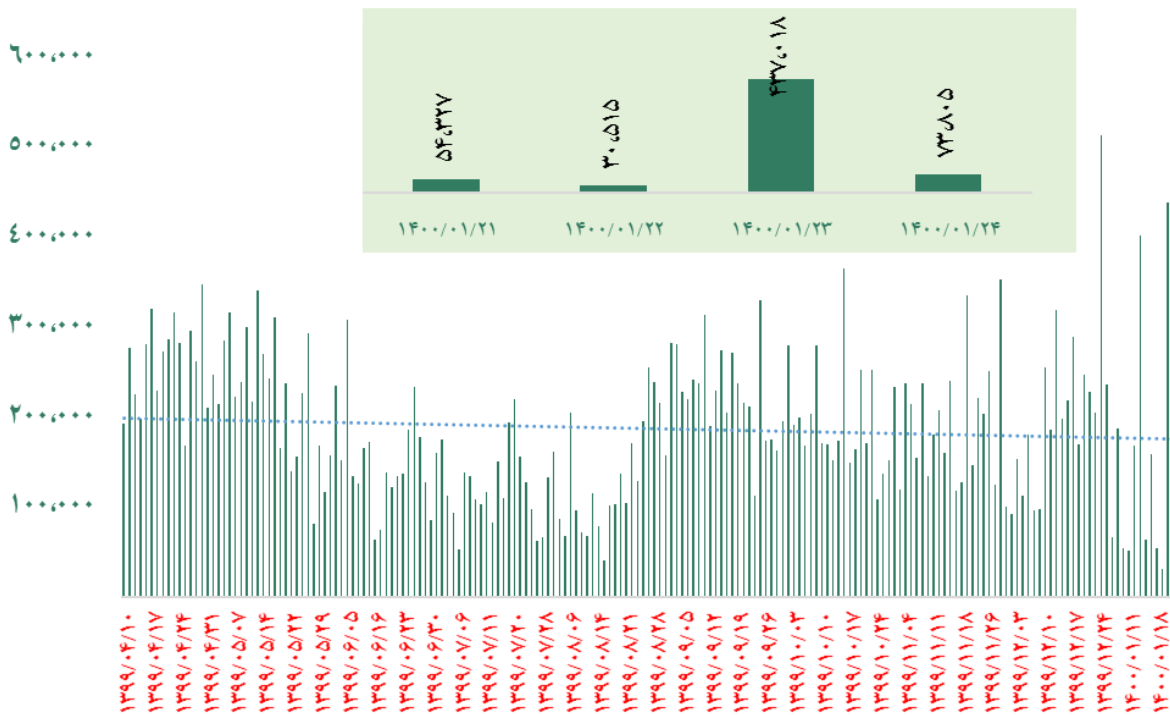
در گروه سیمان، شرکت سیمان کرمان در اسفند ماه ۹۳ هزار تن تولید سیمان داشته است. میانگین تولید سیمان در سال مالی جاری (سال مالی شرکت آذر ماه می باشد) به ۸۵ هزار تن رسیده که این عدد در سال مالی گذشته، ۹۴ هزار تن گزارش شده است. مقدار فروش سیمان در اسفند ماه ۹۰ هزار تن گزارش شد. این شرکت در سال مالی جاری به طور متوسط هر ماه ۸۴ هزار تن فروش داشته و این عدد برای سال مالی قبل ۹۳ هزار تن بوده است. درآمد فروش شرکت در اسفند ماه ۲۶۰ میلیارد ریال می باشد. این شرکت در سال مالی گذشته ۲۷۳۰ میلیارد ریال فروش داشته است. میانگین نرخ فروش سیمان شرکت در اسفند ماه ۲۹۱۱ ریال بر کیلوگرم بود. متوسط نرخ فروش سیمان در سال مالی گذشته نیز ۲۳۸۵ ریال در هر کیلو بوده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

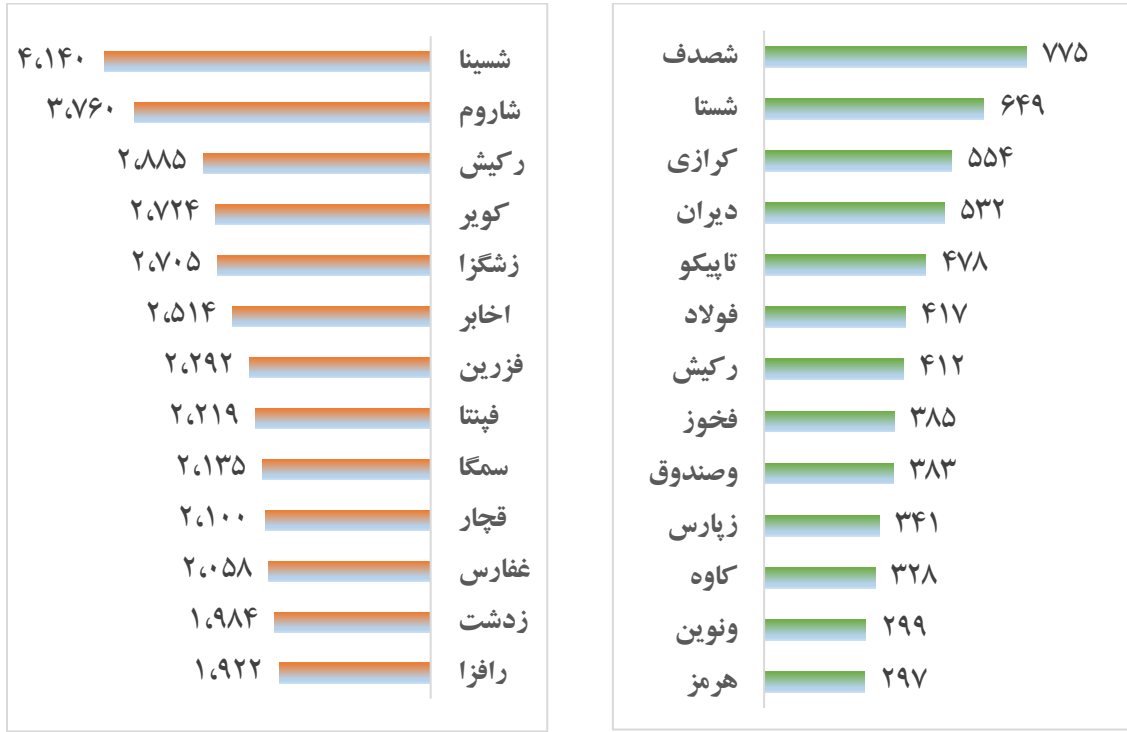


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

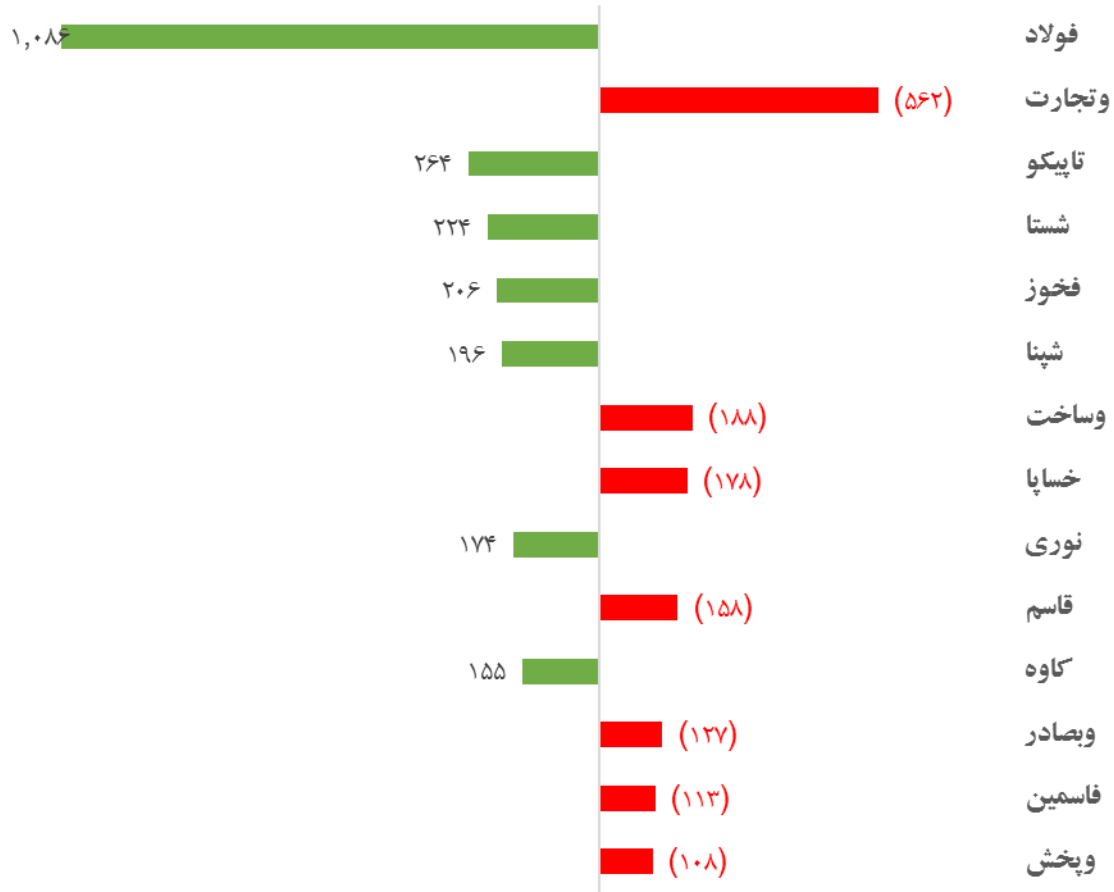


پول هوشمند

خروج	ردیف	ورود	ردیف
رکیش	۱	شصدف	۱
کویر	۲	دکپسول	۲
فیتتا	۳	وغدیر	۳
سخزر	۴	فولاد	۴
غمارگ	۵	تاپیکو	۵
دابور	۶	سمازن	۶
وپخش	۷	وسینا	۷
قاسم	۸	سپ	۸
شاملا	۹	سرود	۹
ورنا	۱۰	بخاور	۱۰



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	غپاک	۱۱	رنیک
۲	وساخت	۱۲	افق
۳	سمازن	۱۳	نوری
۴	برکت	۱۴	غگل
۵	خزامیا	۱۵	دسبحان
۶	قاسم	۱۶	سصوفی
۷	کرازی	۱۷	زاگرس
۸	غشهر	۱۸	کروی
۹	حتاید	۱۹	آریا
۱۰	کالا	۲۰	ثباغ



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	فلزات اساسی	۱,۳۸۳,۳۹۸
۲	محصولات شیمیایی	۸۲۴,۱۹۲
۳	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۳۴۷,۹۱۹
۴	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳۱۰,۷۵۹
۵	واسطه گری های مالی و پولی	۹۵,۵۹۷
۶	سایر محصولات کانی غیر فلزی	۳۷,۳۲۶
۷	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۲۴,۴۹۰
۸	استخراج نفت گاز و خدمات جنسی جز اکتشاف	۷,۳۵۵
۹	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۲,۶۸۸
۱۰	هتل و رستوران	۱,۶۵۳
۱۱	محصولات کاغذی	-۱,۲۹۹
۱۲	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۱,۳۶۶
۱۳	زراعت و خدمات وابسته	-۱,۵۲۴
۱۴	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	-۱,۵۵۸
۱۵	پیمانکاری صنعتی	-۱,۷۷۰
۱۶	قند و شکر	-۱,۸۲۶
۱۷	سیمان، آهک و گچ	-۲,۶۴۰
۱۸	مخابرات	-۵,۷۷۲
۱۹	سرمایه گذاریها	-۹,۸۴۳
۲۰	استخراج سایر معادن	-۱۰,۶۳۴
۲۱	لاستیک و پلاستیک	-۱۰,۷۶۹
۲۲	خدمات فنی و مهندسی	-۱۰,۸۶۲
۲۳	ساخت محصولات فلزی	-۱۶,۱۷۲
۲۴	ماشین آلات و تجهیزات	-۲۰,۱۲۶
۲۵	سایر واسطه گریهای مالی	-۲۱,۵۳۶
۲۶	تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	-۳۲,۸۶۳
۲۷	استخراج زغال سنگ	-۳۲,۸۷۰
۲۸	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	-۵۵,۲۵۳
۲۹	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۵۹,۴۷۷
۳۰	خودرو و ساخت قطعات	-۷۵,۲۶۶
۳۱	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۷۹,۸۶۹
۳۲	استخراج کانه های فلزی	-۸۳,۹۴۸
۳۳	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۱۸,۷۹۳
۳۴	اطلاعات و ارتباطات	-۱۵۰,۹۶۳
۳۵	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۱۸۷,۱۵۲
۳۶	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۲۱۱,۵۹۹
۳۷	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۲۳۸,۴۰۳
۳۸	مواد و محصولات دارویی	-۲۸۱,۰۵۴
۳۹	بانکها و موسسات اعتباری	-۷۶۵,۲۰۹
جمع ورود نقدینگی		۵۴۴,۹۶۱