



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۹ فروردین ۱۴۰۰، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از نزول در نمادهای فولاد، فملی، شستا، وپارس، فارس، کچاد و شپنا با کاهش ۹۰۰۴ واحدی همراه شد و به سطح ۱.۲۲۴.۷۷۸ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۶۶ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته با کاهش ۴۵ درصدی همراه بوده است. حدود مبلغ ۱۱ هزار میلیارد ریال از ارزش معاملات روز جاری مربوط به معاملات خرد سهام و حق تقدم می‌باشد که حدود ۱۶ درصد از ارزش کل معاملات را شامل می‌شود. در روز جاری همانند روزهای گذشته، فشار فروش حاکم بر بازار بود و اکثر نمادها با صف فروش به کار خود پایان دادند.

در حالیکه اعمال تغییرات بر روی دامنه نوسان در دو ماه گذشته به مثبت ۶ و منفی ۲، نه تنها باعث رونق در بازار سرمایه نشد، ریسک عدم نقد شوندگی را نیز به مجموع ریسک‌های این بازار اضافه نمود. اما با نتیجه‌ای که دامنه نوسان نامتقارن در طی حدود ۲ ماه گذشته از خود نشان داده است، در روز گذشته دستورات جدیدی بر روی دامنه نوسان از طرف سازمان بورس اخذ شده است که از اول اردیبهشت ماه به صورت دامنه نامتقارن مثبت ۶ و منفی ۳ تغییر خواهد کرد. این سوال مطرح می‌شود که علی‌رغم اثر منفی دامنه نامتقارن بر روی کلیت بازار سهام در دو ماه گذشته، چرا تغییراتی که نتیجه مثبتی برای بازار سرمایه نداشت، دوباره باید تکرار شود؟؟؟

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۱.۴۷۶ میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز معاملاتی گذشته، کاهش محسوسی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد ۴۹۴ 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 ۷۲۰، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۳/۲۴ با ۲۳.۹٪ سود است.

شرح	۱۴۰۰/۰۱/۲۸	۱۴۰۰/۰۱/۲۹	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۱۰۰,۸۲۲	۴۱,۴۷۶	-۵۹٪



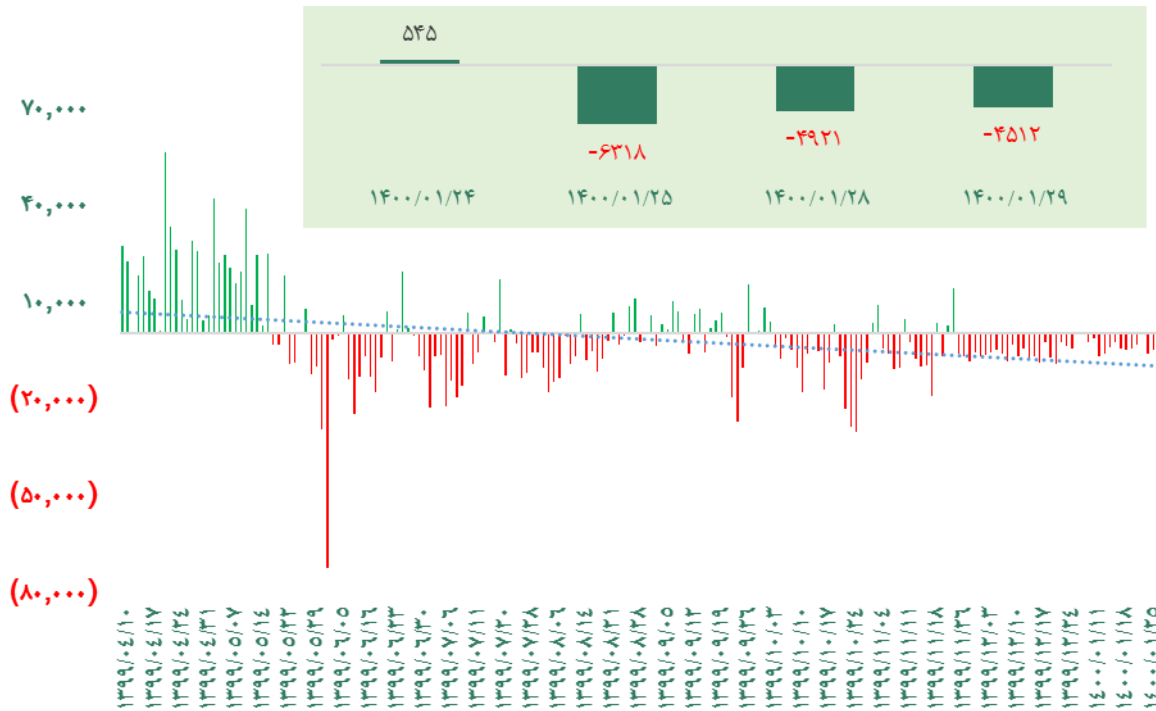
گروه‌های مؤثر

در گروه ذغال سنگ، شرکت ذغال سنگ طبس در سال مالی گذشته، به طور میانگین ماهانه ۲۰۱۷۰ تن تولید داشت. مقدار تولید در بهمن ماه ۲۴۴۰۰ تن و اسفند ۱۸۰۲۳ تن ذغال سنگ بود. در سال ۱۳۹۹، میانگین فروش ماهانه شرکت به ۲۰۳۸۷ تن رسیده که در بهمن و اسفند این شرکت توانسته به ترتیب ۲۳۷۶۸ و ۲۳۶۷۲ تن به فروش برساند. درآمد شرکت ذغال سنگ طبس در سه ماه بهار ماهانه ۵۷ میلیارد ریال بود اما در تابستان رشد قابل ملاحظه‌ای داشت و میانگین ۱۵۱ میلیارد ریالی را گزارش کرد. میانگین درآمد پاییز به ۱۸۷ میلیارد ریال رسید و در اسفند ماه با فروش ۲۰۰ میلیارد ریالی، میانگین درآمد ماهانه فصل زمستان به ۲۱۲ میلیارد ریال رسید. این شرکت در سال مالی گذشته به فروش ۱۸۵۰ میلیارد ریالی رسیده و نسبت به فروش ۸۵۰ میلیارد ریالی سال مالی ۹۸، ۱۱۷ درصد رشد داشته است. این موضوع عمدتاً به دلیل افزایش در نرخ فروش محصول بوده است. نرخ فروش ذغال سنگ در اسفند ماه به ۸.۵۵۰.۰۰۰ ریال در هر تن بوده است و نسبت به میانگین نرخ فروش ماهانه در شش ماه اول سال ۵۹ درصد رشد داشته است.

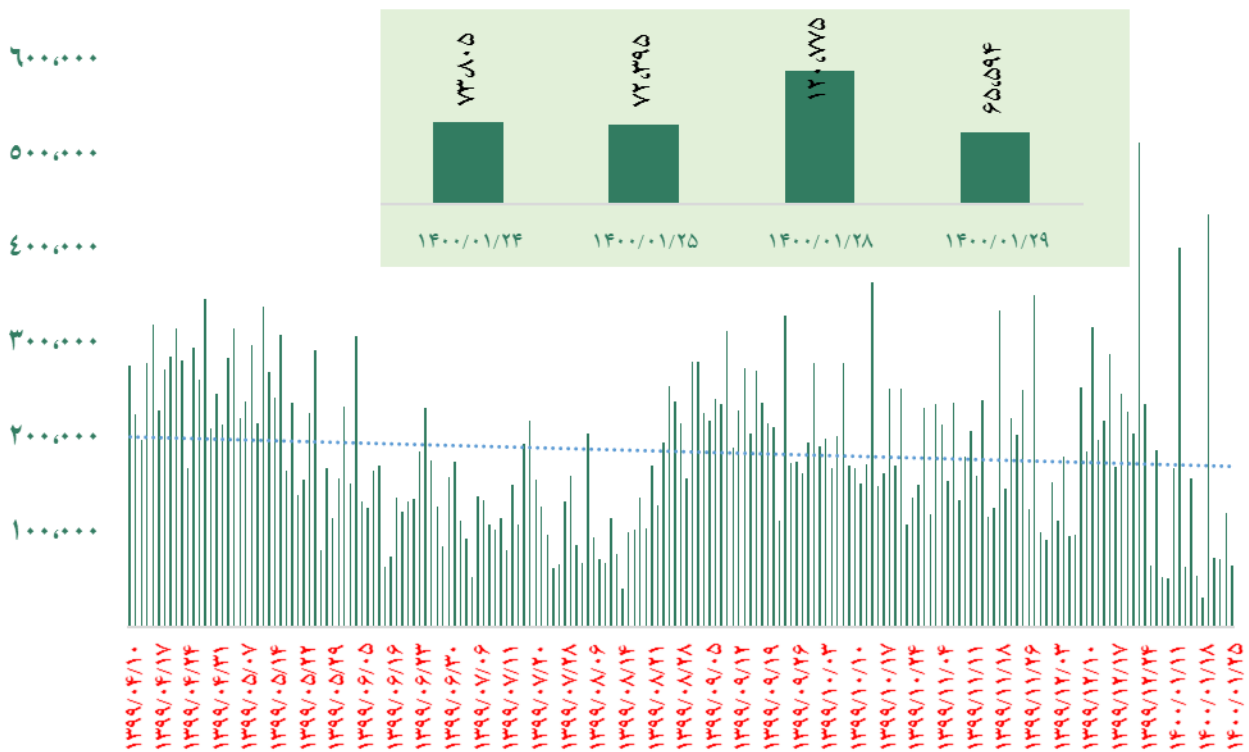
در گروه محصولات کاغذی، شرکت گروه صنایع کاغذ پارس، در سال مالی ۹۹، به طور متوسط هر ماه ۴۹۳۲ تن تولید داشته است. شرکت در اسفند ماه ۶۰۹۱ تن و در سه ماه گذشته به طور متوسط ۵۳۱۳ تن تولید را به ثبت رساند. این تولید کننده محصولات کاغذی در اسفند ماه ۶۰۷۵ تن، بهمن ۵۴۲۷ تن، دی ۵۵۷۵ و آذر ماه ۵۱۲۲ تن فروش داشته است. متوسط فروش در سال مالی ۹۸، ۵۰۸۷ تن ثبت شده است. این شرکت سال مالی گذشته خود را با متوسط فروش ۴۳۰ میلیارد ریالی به پایان رساند. در اسفند ماه فروش ۸۵۰ میلیارد ریالی و فروش‌های بهمن، دی و آذر به ترتیب ۷۷۰، ۸۱۰ و ۷۱۰ میلیارد ریال بوده است.



ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)



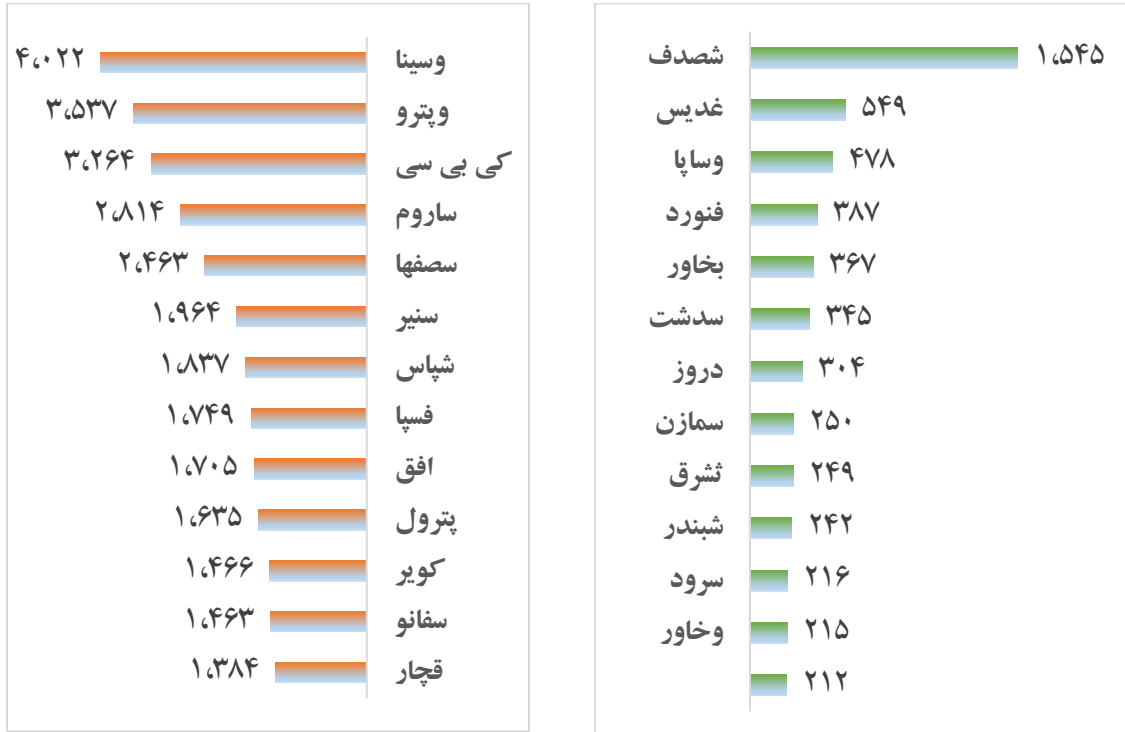
روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)



گزارش روزانه گروه مالی شهر



بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)

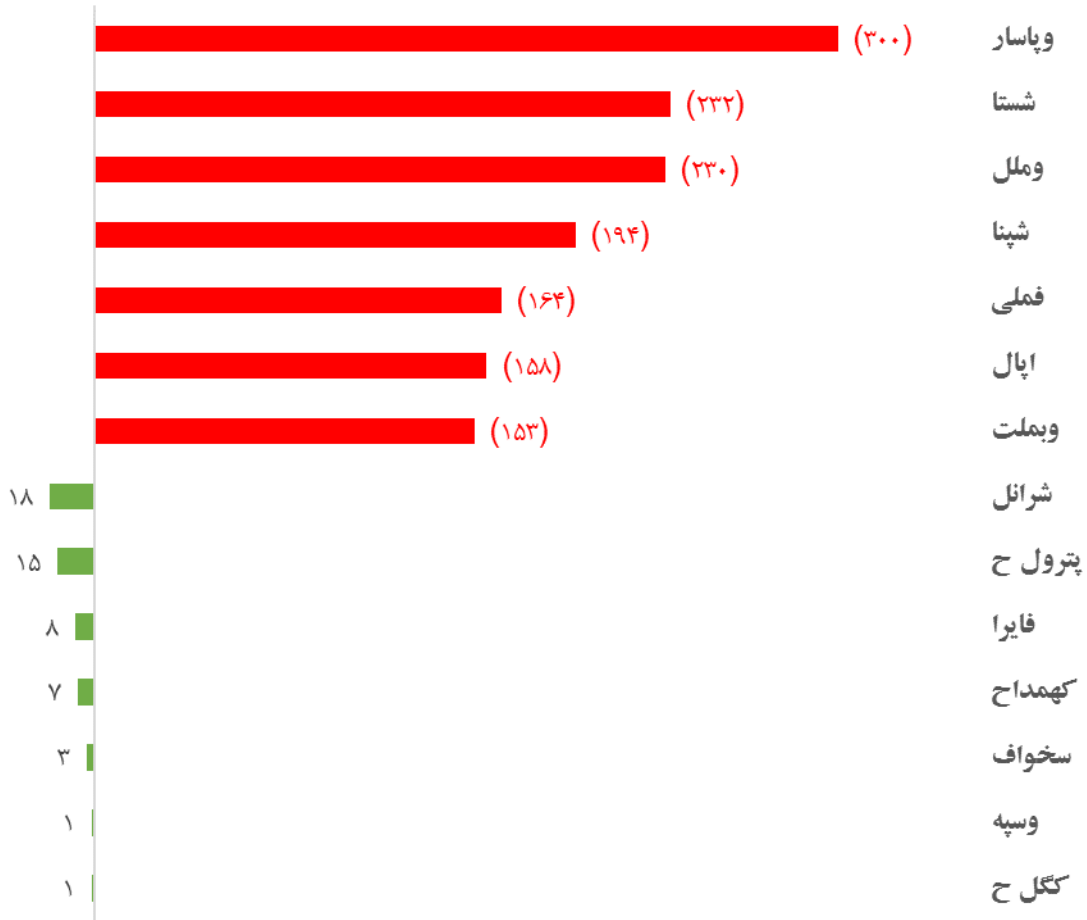


پول هوشمند

خروج	ردیف	ورود	ردیف
كوير	۱	-	۱
زفكا	۲	-	۲
سخزر	۳	-	۳
وسبحان	۴	-	۴
شبهرن	۵	-	۵
شيران	۶	-	۶
وصنعت	۷	-	۷
تاصيكو	۸	-	۸
اعتلا	۹	-	۹
-	۱۰	-	۱۰



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	ساراب	۱۱	شیران
۲	وساخت	۱۲	وصنعت
۳	سمازن	۱۳	کاوه
۴	اعتلا	۱۴	بخاور
۵	ورازی	۱۵	وثنو
۶	ونفت	۱۶	بوعلی
۷	ومل	۱۷	سیتا
۸	شرانل	۱۸	زاگرس
۹	پپاس	۱۹	نوری
۱۰	غپاک	۲۰	جم بیلن



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۱۳۹
۲	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	-۷۳۴
۳	قند و شکر	-۱,۷۰۵
۴	محصولات کاغذی	-۲,۶۵۶
۵	سایر محصولات کانی غیر فلزی	-۳,۴۰۱
۶	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	-۳,۷۳۴
۷	خودرو و ساخت قطعات	-۵,۶۷۵
۸	محصولات چوبی	-۵,۹۵۰
۹	لاستیک و پلاستیک	-۶,۴۷۱
۱۰	ساخت محصولات فلزی	-۶,۵۲۷
۱۱	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۶,۸۳۳
۱۲	استخراج زغال سنگ	-۶,۸۶۸
۱۳	خدمات فنی و مهندسی	-۷,۷۳۲
۱۴	زراعت و خدمات وابسته	-۱۱,۵۸۴
۱۵	مخابرات	-۱۲,۸۰۶
۱۶	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۸,۶۲۴
۱۷	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	-۲۱,۹۰۶
۱۸	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	-۲۵,۴۹۹
۱۹	مواد و محصولات دارویی	-۳۲,۹۲۷
۲۰	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۳۴,۴۵۹
۲۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۳۷,۱۷۹
۲۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۷۳,۶۹۸
۲۳	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	-۹۶,۷۶۲
۲۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۱۵۱,۹۵۵
۲۵	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	-۱۹۹,۴۴۳
۲۶	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	-۲۷۰,۳۰۴
۲۷	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	-۲۷۶,۵۳۶
۲۸	سرمایه گذاریها	-۲۸۰,۳۷۱
۲۹	سیمان، آهک و گچ	-۳۴۸,۷۶۰
۳۰	استخراج کانه های فلزی	-۳۷۸,۷۷۶
۳۱	فلزات اساسی	-۵۶۸,۷۸۶
۳۲	محصولات شیمیایی	-۷۳۵,۵۷۰
۳۳	بانکها و موسسات اعتباری	-۸۷۸,۱۴۹
جمع ورود نقدینگی		-۴,۵۱۲,۲۴۱