



گروه مالی شهر
SHAHR FINANCIAL GROUP

گزارش روزانه تحلیل بازار



تحلیل روزانه بازار

امروز شنبه ۲۵ بهمن ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فارس، فولاد، فملی، شستا، تاپیکو، شپنا و وغدیر با افزایش ۴۷۷۸۷ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۶۲,۲۰۲ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۲۱ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با افزایش ۵۱ درصدی همراه شده است. همچنین با توجه به اعمال دامنه نوسان جدید در بازار امروز، شاهد افزایش تقاضا در اکثر گروه‌ها و نمادها بودیم و بسیاری از نمادها با صف خرید به کار خود پایان دادند.

سیاوش و کیلی مدیر روابط عمومی سازمان بورس در مورد دامنه نوسان جدید گفتند تا اطلاع ثانوی این تغییر پابرجا است و تاریخ دقیقی را برای بازگشت دامنه نوسان به حالت معمول ذکر نکردند.

از نظر تحلیل نموداری، شاخص کل بعد از عبور از ۱,۲۶۸,۰۰۰ واحد، توانایی تشکیل الگوی کف دو قلو با هدف ۱,۳۸۰,۰۰۰ واحد را دارد. برای تأیید تشکیل الگوی ذکر شده نیاز است تا شاخص کل بتواند سقف قبلی خود در ۱,۲۶۸,۰۰۰ واحد را پس بگیرد. اما این روند کوتاه مدت صعودی نمی‌تواند پایان روند اصلاحی در شاخص کل به شمار آید و فقط یک روند اصلاحی کوتاه مدت به نظر می‌رسد.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۲۸۲۸ میلیارد ریال بود که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش ۳۸۵ درصدی داشته است. همچنین اوراق مرابحه عام دولت با نماد اراد۵۴۴ 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 اخزا۷۱۶، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۰۷ با ۲۸,۹٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۱/۲۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۵	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۸,۸۳۴	۴۲,۸۲۸	۳۸۵٪



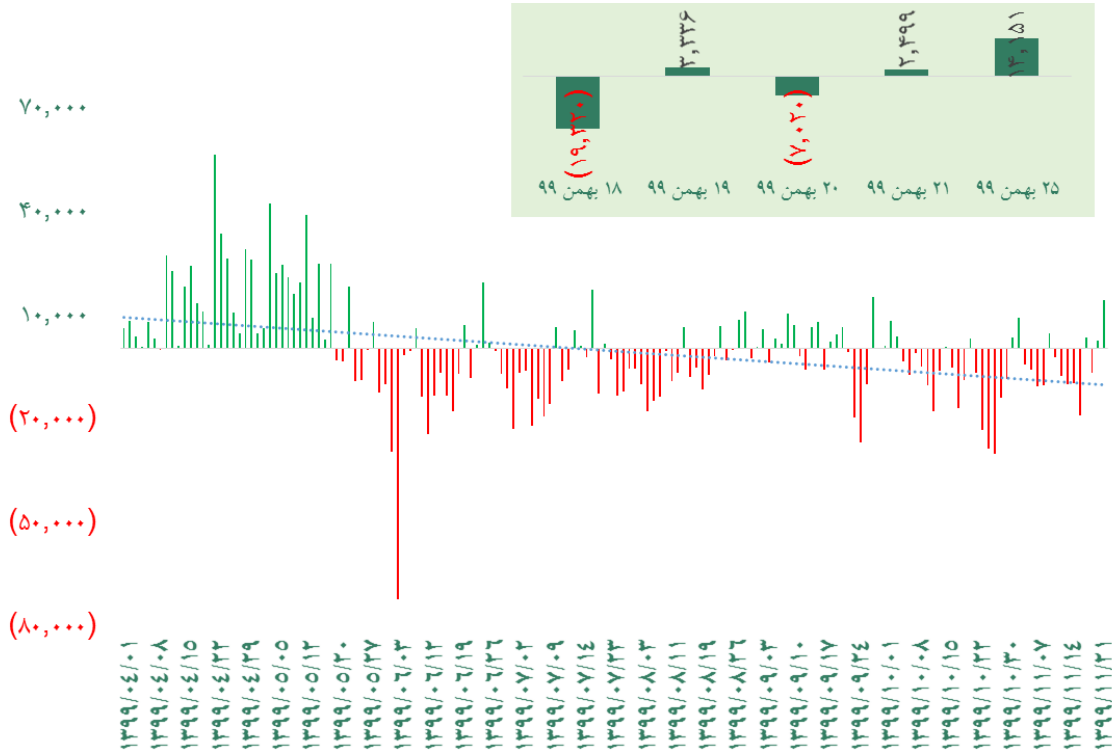
گروه‌های مؤثر

در گروه شیمیایی، علی‌رغم کاهش قیمت متانول در هفته گذشته اما با توجه به افزایش نرخ نفت، انتظار می‌رود نرخ متانول در بازارهای بین‌المللی همچنان رو به افزایش باشد. در شرکت‌های داخلی نیز شرکت پتروشیمی زاگرس در ابتدای سال جاری نرخ متانول را حدود ۱۹۷ دلار در هر تن به فروش رساند اما در ماه گذشته نرخ متانول به حدود ۲۹۰ دلار در هر تن معامله شده است و حدود ۴۷ درصد رشد نسبت به ابتدای سال نشان می‌دهد.

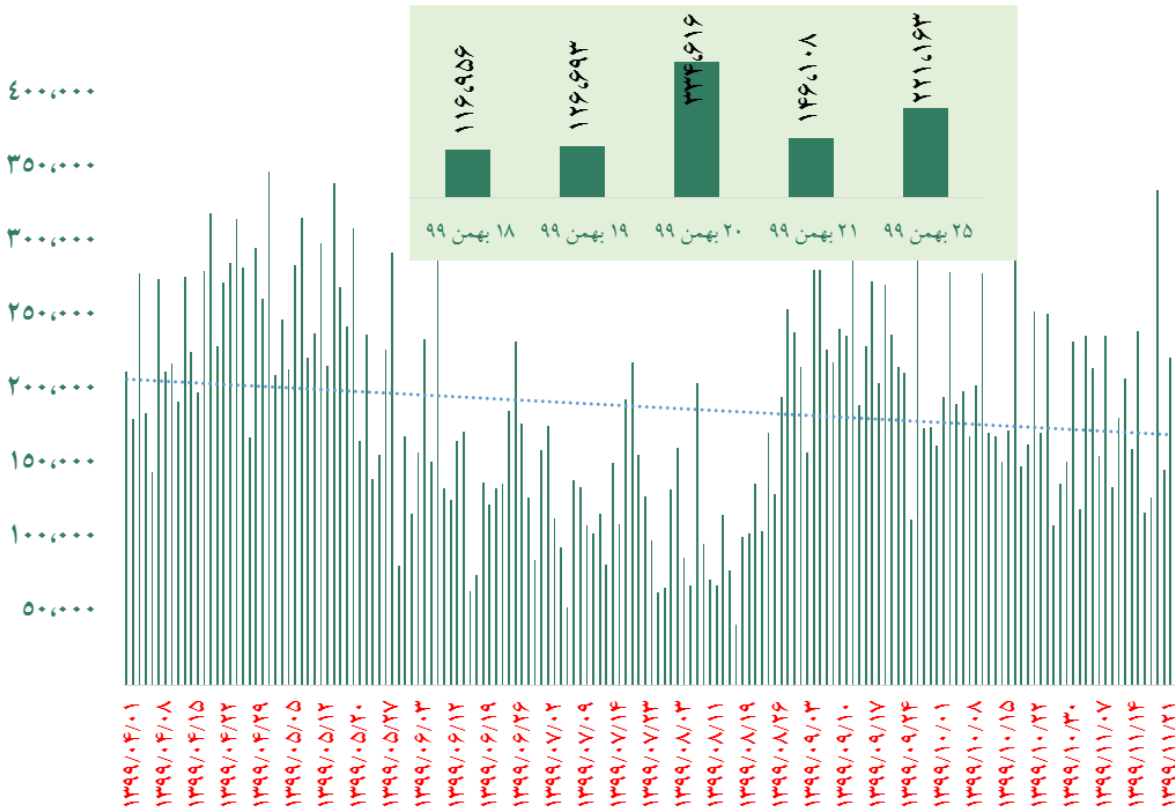
از ابتدای ماه جاری تاکنون حدود ۲ هزار تن محصول پلی‌اتیلن سنگین توسط شرکت پتروشیمی اراک در بورس کالا عرضه شده است. قیمت این محصول از ۱۲۰۸۴۱ ریال به ۲۵۸,۹۵۵ ریال به ازای هر کیلو افزایش پیدا کرده است. حدود ۱۷ درصد از مبلغ کل فروش شرکت پتروشیمی اراک را محصول پلی‌اتیلن سنگین تشکیل می‌دهد.

بر اساس اطلاعات ارائه شده در گزارش فعالیت ماهانه (دی) شرکت پتروشیمی آریا، طی دوره ۱۰ ماهه سال جاری در حدود ۳۷ درصد از فروش به صورت داخلی بوده است که از این محل ۲۶ درصد از درآمد شرکت محقق شده است. در حالی که در طی دوره مشابه سهم فروش داخلی ۳۶ درصد و سهم درآمدی آن ۳۰ درصد بوده است که طی سال جاری با افزایش تقاضای داخلی، سهم آن با افزایش یک درصدی همراه شده است. در حالی که با افزایش بیشتر نرخ فروش محصولات صادراتی، سهم درآمدی آن ۴ درصد کاهش را تجربه کرده است. همچنین مقدار تولیدات شرکت طی یک ماهه دی، ۱۶۰,۷ هزار تن بوده است که در مقایسه با میانگین ۹ ماهه سال جاری، افزایش ۲ درصدی داشته است.

ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

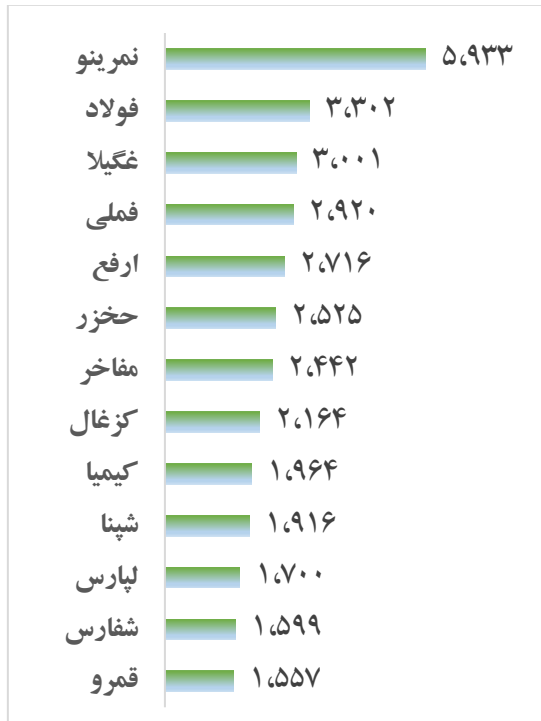
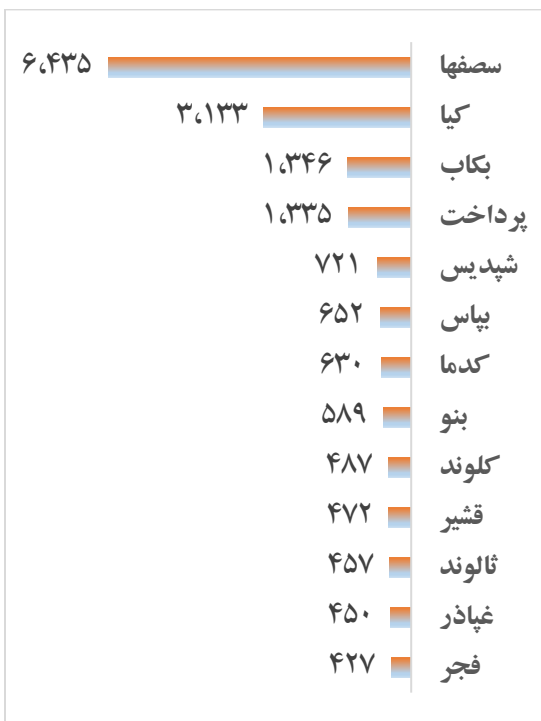


روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





بالاترين قدرت خريد و فروش حقيقي (مليون ريال)



پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	فخوز	۱	كساوه
۲	تاصيکو	۲	داسوه
۳	هرمز	۳	فلامی
۴	رمپنا	۴	اميد
۵	شيراز	۵	زنگان
۶	وسپه	۶	وتوس
۷	وبانك	۷	غشاذر
۸	فخاس	۸	-
۹	حفاری	۹	-
۱۰	غزر	۱۰	-



بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



واچ لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	کرمان	۱۱	ثنوسا
۲	چفبیر	۱۲	ثشاهد
۳	خمتور	۱۳	وسین
۴	برکت	۱۴	تاپکیش
۵	کرازی	۱۵	کسرا
۶	وتوس	۱۶	کاما
۷	بنو	۱۷	وساخت
۸	کبافق	۱۸	قاسم
۹	فباهنر	۱۹	ثفارس
۱۰	سصوفی	۲۰	غزر



ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	فلزات اساسی	۲,۹۶۶,۳۵۸
۲	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱,۵۶۴,۷۵۲
۳	استخراج کانه های فلزی	۱,۵۱۰,۲۱۶
۴	خودرو و ساخت قطعات	۱,۰۲۴,۲۹۶
۵	محصولات شیمیایی	۱,۰۱۱,۷۹۱
۶	قند و شکر	۸۵۲,۱۸۶
۷	مواد و محصولات دارویی	۷۸۹,۳۴۰
۸	سیمان، آهک و گچ	۷۰۶,۷۸۳
۹	سرمایه گذاریها	۶۲۵,۷۷۹
۱۰	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۵۰۲,۵۷۸
۱۱	ساخت دستگاهها و وسایل ارتباطی	۶۸۰,۵
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	-۴,۹۷۰
۱۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۳۵۰,۲۹۳
۱۴	بانکها و موسسات اعتباری	۳۴۷,۱۸۱
۱۵	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۳۴۴,۶۱۷
۱۶	سایر محصولات کانی غیر فلزی	۲۰۹,۸۸۱
۱۷	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱۹۰,۶۰۷
۱۸	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۷۷,۶۳۳
۱۹	خدمات فنی و مهندسی	۱۷۴,۵۲۹
۲۰	محصولات چوبی	۱۶۳,۵۸۶
۲۱	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۳۹,۲۱۰
۲۲	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۱۵,۰۵۴
۲۳	ماشین آلات و تجهیزات	۱۰۳,۰۳۲
۲۴	هتل و رستوران	۷۸,۳۳۷
۲۵	لاستیک و پلاستیک	۷۵,۵۳۷
۲۶	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۶۴,۸۳۸
۲۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۶۱,۴۶۲
۲۸	سایر واسطه گریهای مالی	۵۵,۸۵۱
۲۹	محصولات کاغذی	۳۵,۶۱۸
۳۰	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	۳۴,۰۷۶
۳۱	زراعت و خدمات وابسته	۳۲,۵۹۸
۳۲	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۲۶,۷۷۹
۳۳	ساخت محصولات فلزی	۲۵,۹۰۰
۳۴	استخراج زغال سنگ	۲۳,۹۳۵
۳۵	مخابرات	۱۹,۴۶۸
۳۶	پیمانکاری صنعتی	۱۲,۳۳۵
۳۷	انتشار، چاپ و تکثیر	۷,۶۳۵
۳۸	استخراج سایر معادن	۶,۱۵۶
۳۹	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۶,۱۱۱
۴۰	حمل و نقل آبی	۲,۲۶۵
۴۱	منسوجات	-۱,۹۴۶
۴۲	کاشی و سرامیک	-۲۲,۴۲۵
۴۳	واسطه گری های مالی و پولی	-۵۷,۶۶۹
	جمع ورود نقدینگی	۱۴,۱۵۱,۲۴۷