



گروه مالی شهر  
SHAHR FINANCIAL GROUP

## گزارش روزانه تحلیل بازار



## تحلیل روزانه بازار

امروز یکشنبه ۲۶ بهمن ۱۳۹۹، در بازار سرمایه، شاخص کل متأثر از صعود در نمادهای فملی، فولاد، شبندر، شپنا، خساپا، فخاس و ومعادن با افزایش ۲۰۸۴ واحد همراه شد و به سطح ۱,۲۶۴,۳۳۷ واحد برگشت. ارزش معاملات بورس و فرابورس تهران در روز جاری حدود ۲۰۳ هزار میلیارد ریال می‌باشد که نسبت به روز گذشته با کاهش ۸ درصدی همراه شده است. در ابتدای زمان معاملاتی روز جاری، شاهد افزایش تقاضا در اکثر گروه‌ها و نمادها بودیم اما هر چه از زمان بازار می‌گذشت فشار فروش نیز بیشتر می‌شد. بطوریکه در انتهای زمان معاملات نیز بسیاری از نمادها برعکس روز گذشته با صف فروش به کار خود پایان دادند.

شاخص کل در نقطه حساسی قرار دارد و برای رشد بیشتر نیاز به عبور پر قدرت از محدوده ۱,۲۶۸,۰۰۰ واحد را دارد. به نظر می‌رسد تغییر دامنه نوسان علی‌رغم اینکه ریسک به پاداش معامله در بازار بورس و فرابورس تهران را به نفع خریدار تغییر داده است اما با فشار فروش اندک، به دلیل کاهش در دامنه منفی، منجر به صف فروش در نمادها مخصوصاً نمادهای کوچک می‌شود.

در بازار اوراق با درآمد ثابت که همان‌طور در جدول زیر مشخص است، ارزش معاملات ۴۷۲۶۹ میلیارد ریال بود که نسبت به روز معاملاتی گذشته، افزایش ۱۰ درصدی داشته است. همچنین اوراق مابجه عام دولت با نماد اراد۷۴ 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 اخزا۸۰۵، تاریخ سررسید ۱۴۰۰/۰۴/۲۲ با ۲۲,۶٪ سود است.

شرح	۱۳۹۹/۱۱/۲۵	۱۳۹۹/۱۱/۲۶	درصد تغییر
ارزش معاملات اوراق با درآمد ثابت (میلیارد ریال)	۴۲,۸۲۸	۴۷,۲۶۹	۱۰٪

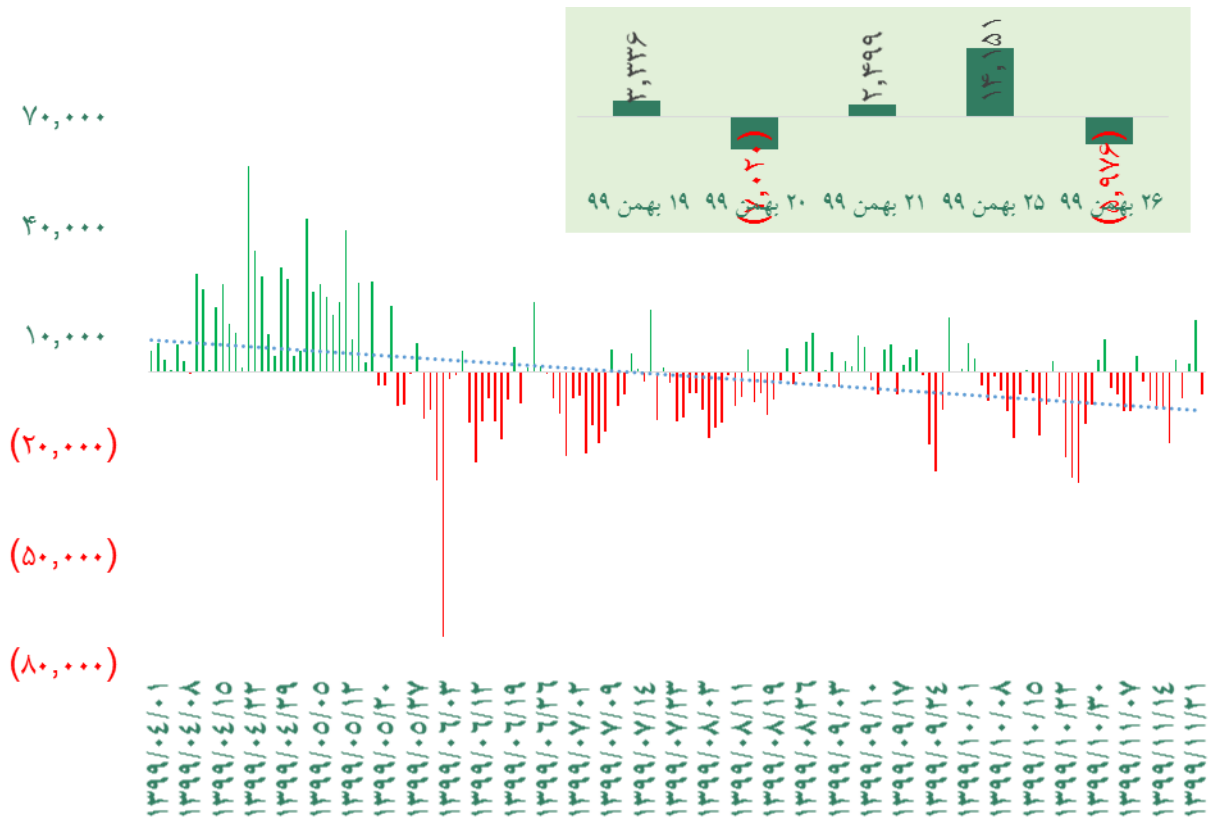


## گروه‌های مؤثر

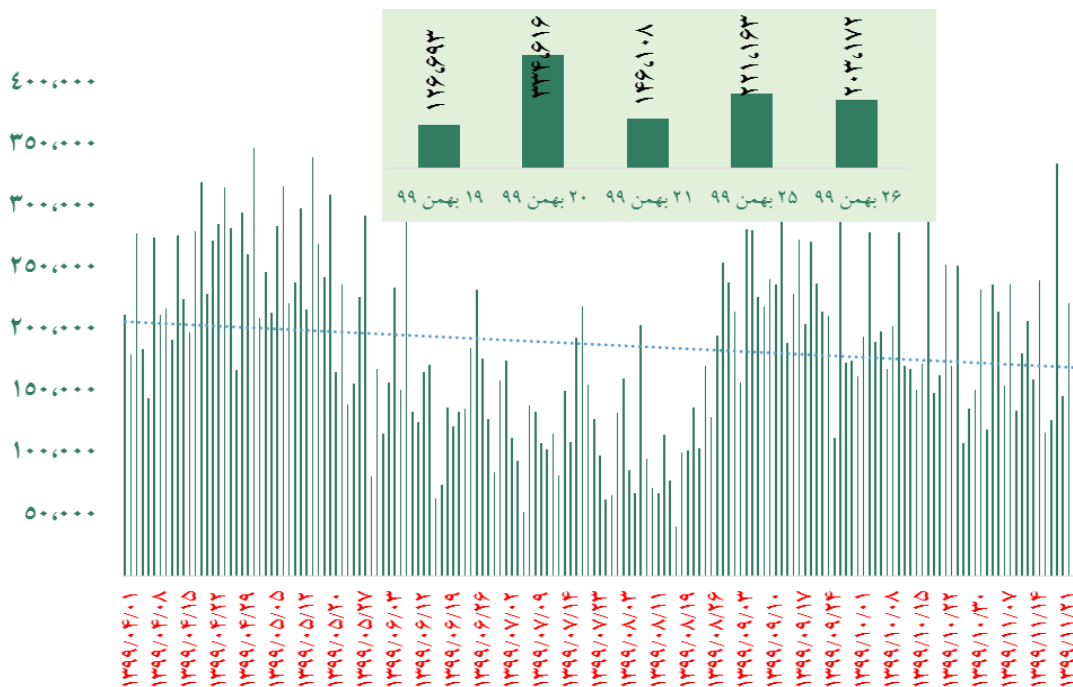
در گروه شیمیایی، پتروشیمی زاگرس در دی ماه سال جاری محصول متانول خود را به قیمت ۷۳،۳۰۴،۴۵۶ ریال به ازای هر تن به فروش رسانده است که با میانگین نرخ دلار ۲۵۲ هزار ریال، نرخ متانول ۲۹۱ دلار به ازای هر تن بوده است. با توجه به تحلیل حساسیت سود هر سهم، با تغییر ۱۰ دلار در نرخ متانول، سود هر سهم شرکت پتروشیمی زاگرس حدود ۸ درصد تغییر می‌کند. بنابراین با دلار حدود ۲۳۰ هزار ریال و با متانول ۲۹۰ دلار در هر تن، احتمالاً شرکت پتروشیمی زاگرس در سال ۱۴۰۰ بتواند حوالی ۳۲ هزار ریال سود به ازای هر سهم محقق سازد.

در روز جاری در بورس کالا شمش روی شرکت کالسیمین به قیمت ۶۰۴،۱۰۵ ریال به ازای هر کیلو معامله شده است. در دی ماه نیز آن شرکت محصول شمش روی را به قیمت ۷۱۰ میلیون ریال در هر تن صادر کرده است. نرخ جهانی روی نیز در چند هفته گذشته با رشد مناسبی همراه بوده است و توانسته در محدوده ۲،۸۰۰ دلار در هر تن تثبیت گردد. شرکت فاسمین در ۱۰ ماهه ابتدای سال جاری موفق به فروش حدود ۱۴ هزار میلیارد ریال از انواع محصولات شده است که نسبت به مدت مشابه سال گذشته، با رشد حدود ۱۹۸ درصد همراه بود. همچنین این شرکت در ۹ ماهه ابتدای سال، ۱۴۸۹ ریال سود به ازای هر سهم محقق ساخته است که نسبت به دوره مشابه سال گذشته با رشد حدود ۲۴۸ درصدی همراه بوده است. با توجه به قیمت‌های سرب و روی جهانی و موجودی محصولات در شرکت کالسیمین، سود حوالی ۲۷۰۰ ریال به ازای هر سهم برای ۱۲ ماهه سال مالی جاری توسط آن شرکت پیش‌بینی شده است.

### ورود نقدینگی حقیقی ها (میلیارد ریال)

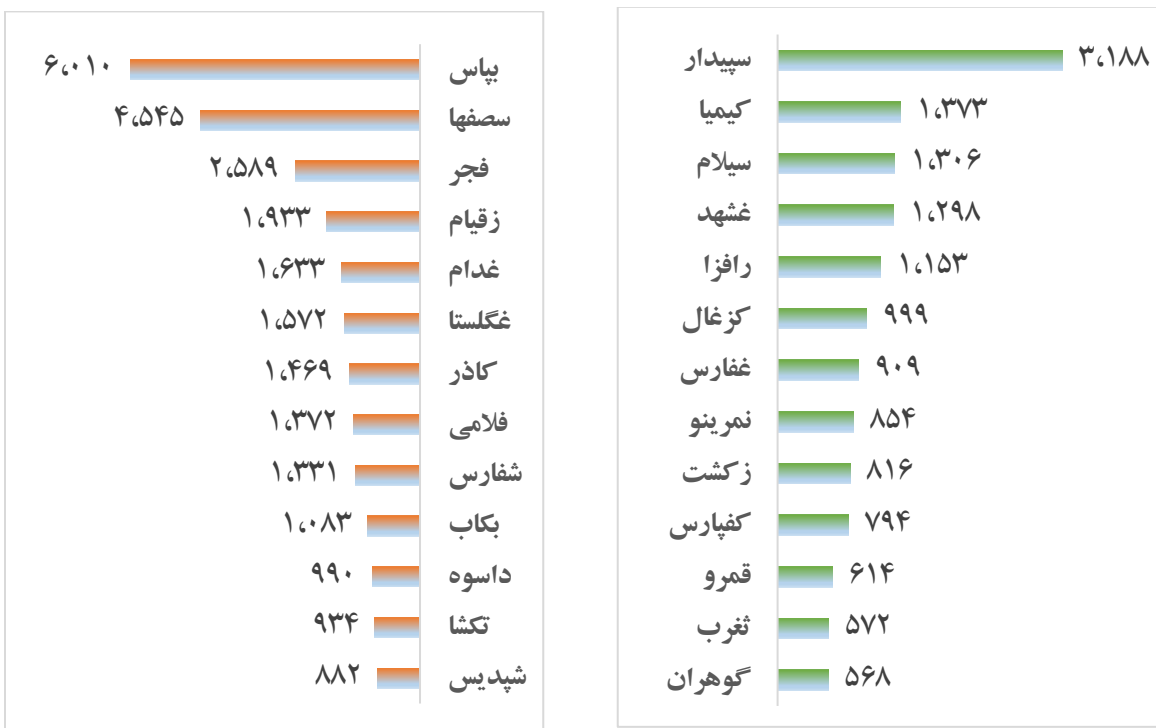


### روند ارزش معاملات (میلیارد ریال)





## بالاترین قدرت خرید و فروش حقیقی (میلیون ریال)

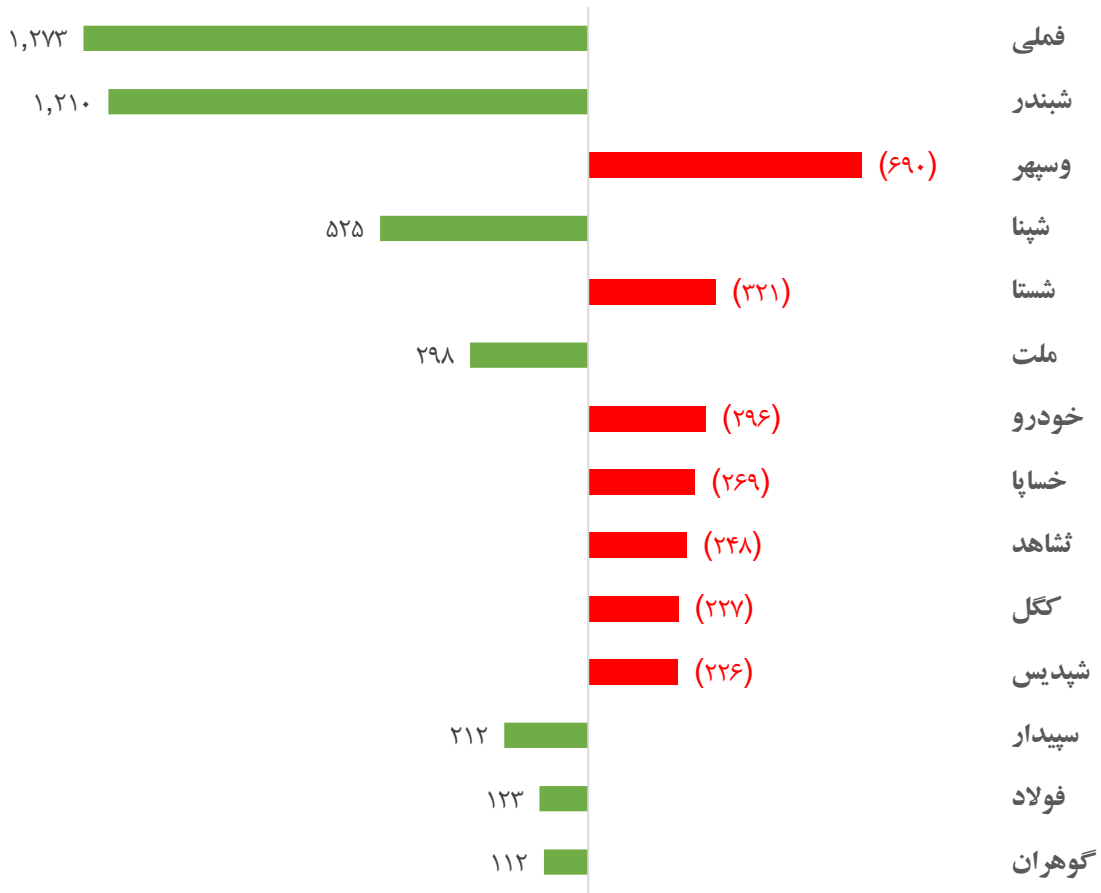


## پول هوشمند

ردیف	ورود	ردیف	خروج
۱	سپیدار	۱	سارییل
۲	رافزا	۲	کپشیر
۳	شصدف	۳	وتوصا
۴	گدنا	۴	فولاد
۵	بمپنا	۵	سنیر
۶	غدیس	۶	وتوس
۷	شبندر	۷	غشاذر
۸	فخاس	۸	کاوه
۹	وساپا	۹	ثالوند
۱۰	گوهران	۱۰	بشهاب



## بیشترین جذب نقدینگی (میلیارد ریال)



## واج لیست

ردیف	نماد	ردیف	نماد
۱	فزرین	۱۱	برکت
۲	کرمان	۱۲	شاهد
۳	غپاک	۱۳	کسرا
۴	کالا	۱۴	شبندر
۵	ملت	۱۵	کبافق
۶	غدیس	۱۶	ویست
۷	فراپورس	۱۷	چکارن
۸	حریل	۱۸	فاسمین
۹	چفبیر	۱۹	فباهنر
۱۰	وآوا	۲۰	خزامیا



## ورود نقدینگی به تفکیک صنعت

ردیف	صنعت	مبلغ (میلیون ریال)
۱	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱,۳۵۰,۰۰۲
۲	فلزات اساسی	۵۷۲,۶۴۵
۳	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۱۵۶,۲۱۱
۴	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۱۰۸,۳۸۷
۵	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۹۰,۰۲۸
۶	استخراج زغال سنگ	۶۳,۸۸۴
۷	سایر محصولات کانی غیر فلزی	۵۷,۲۲۵
۸	حمل و نقل آبی	۳۴,۳۸۹
۹	محصولات چوبی	۲۳,۶۳۵
۱۰	واسطه گری های مالی و پولی	۱۰,۳۰۴
۱۱	ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی	۳,۶۱۵
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	-۱۵,۹۲۳
۱۳	هتل و رستوران	-۵,۲۷۹
۱۴	استخراج سایر معادن	-۷,۰۸۲
۱۵	فعالیت های هنری، سرگرمی و خلاقانه	-۷,۸۰۵
۱۶	انتشار، چاپ و تکثیر	-۸,۷۵۷
۱۷	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	-۹,۰۲۷
۱۸	ساخت محصولات فلزی	-۱۰,۴۸۹
۱۹	ماشین آلات و تجهیزات	-۱۴,۰۶۰
۲۰	تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	-۱۵,۰۱۸
۲۱	منسوجات	-۱۵,۴۷۴
۲۲	زراعت و خدمات وابسته	-۲۴,۸۶۷
۲۳	پیمانکاری صنعتی	-۲۴,۹۴۸
۲۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	-۲۶,۰۷۱
۲۵	محصولات کاغذی	-۳۳,۷۴۸
۲۶	خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	-۳۵,۹۸۲
۲۷	سایر واسطه گری های مالی	-۳۹,۸۳۳
۲۸	لاستیک و پلاستیک	-۵۳,۱۱۷
۲۹	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	-۵۴,۹۵۲
۳۰	مخابرات	-۶۱,۸۱۰
۳۱	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	-۸۳,۴۷۷
۳۲	فعالیت های کمکی به نهاد های مالی واسط	-۱۰۰,۱۷۸
۳۳	قند و شکر	-۱۰۵,۰۹۰
۳۴	خدمات فنی و مهندسی	-۱۱۲,۲۰۴
۳۵	کاشی و سرامیک	-۱۵۰,۳۰۸
۳۶	سیمان، آهک و گچ	-۳۴۰,۸۱۶
۳۷	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	-۳۵۷,۱۴۱
۳۸	شرکت های چند رشته ای صنعتی	-۵۰۵,۹۰۶
۳۹	استخراج کانه های فلزی	-۵۲۸,۵۶۷
۴۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	-۶۴۵,۷۲۷
۴۱	مواد و محصولات دارویی	-۷۰۳,۵۲۲
۴۲	سرمایه گذاریها	-۷۲۴,۵۷۶
۴۳	خودرو و ساخت قطعات	-۹۳۹,۹۳۸
	<b>جمع ورود نقدینگی</b>	<b>-۵,۹۷۶,۳۶۸</b>