



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۶/۱۱/۱۱

اطلاعات کلی بازار در پایان روز یازدهم بهمن ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۴۳)	۳,۹۱۴,۹۶۷	۳,۹۳۱,۷۴۵	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۰.۱۲	۱,۳۱۸,۱۴۰	۱,۳۱۶,۵۱۱	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۱۵۹.۷۵	۷,۸۰۹	۳,۰۰۶	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۰.۴۳)	۹۸,۱۳۴	۹۸,۵۵۸	شاخص کل بازار بورس
(۰.۲۶)	۱۷,۴۷۲	۱۷,۵۱۸	شاخص هم وزن بازار بورس
۰.۵۰	۱,۰۹۰	۱,۰۸۴	شاخص کل بازار فرابورس
شنفت، سفارس، والبر، تاژن			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
ذوب، وهور، وگستر			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۴۲۴ واحد افت داشته است؛ همچنین ارزش کل معاملات امروز به کمک معاملات اوراق صکوک اجاره، رشد قابل ملاحظه ای داشت.

تاثیر در شاخص های بورس و فرابورس در پایان روز یازدهم بهمن ماه ۱۳۹۶

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۳.۰۷	۲۳۸۷	میدکو	(۵۸.۹۱)	۵۶۵۶	فارس
۱.۹۲	۴۰۹۳۳	مارون	(۵۱.۸۹)	۳۴۱۷	کگل
۱.۰۰	۳۲۷۰۱	زاگرس	(۴۷.۱۷)	۲۷۸۵	خودرو
(۰.۷۳)	۱۹۵۸	هرمز	(۴۳.۲۴)	۲۸۵۵	فولاد
۰.۳۰	۱۴۹۴	کوثر	(۲۴.۸۲)	۲۲۴۵	وامید
(۰.۲۹)	۱۴۵۴۴	شاون	(۲۳.۳۵)	۲۳۴۹	پارسان
۰.۲۵	۱۸۸۶	سمگا	(۲۰.۵۶)	۴۶۲۶	شپنا

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز یازدهم بهمن ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۰۴٪	۵۰۳,۷۶۵	۵۰۳,۵۶۴	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۹.۳۱٪	۶۵۴	۷۲۱	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۰.۸٪	۱۵.۹۲٪	۱۵.۸۰٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

با توجه به جدول فوق متوسط نرخ بازده موردانتظار بازار بدهی امروز نسبت به روز قبل ۰,۸ درصد رشد داشت.

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۶/۱۱/۱۱

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص روز گذشته	شاخص روز جاری	درصد تغییرات	متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز	متوسط ارزش معاملات جاری (میلیارد ریال)	درصد تغییرات
بورس و فرابورس	استخراج کانه های فلزی	۹	۹,۸۴۵	۲۰,۳۴۱	۱۰۶.۶٪	۳۰۹,۳۸۴,۴۳۷	۶۸۸,۵۰۳,۵۰۵	۱۲۲.۵٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۳	۶,۳۳۴	۶,۳۱۰	-۰.۴٪	۶۱۶,۷۸۶,۹۴۳	۱,۳۴۰,۳۱۰,۶۸۴	۱۱۷.۳٪
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۶,۵۵۶	۱۶,۲۲۳	-۲.۰٪	۲۱۷,۵۹۷,۰۰۳	۲۶۱,۳۷۸,۸۷۱	۲۰.۱٪
	سرمایه گذاریها	۵	۲,۰۶۱	۲,۰۵۰	-۰.۵٪	۵۶,۸۲۰,۵۶۳	۶۶,۰۷۶,۴۲۹	۱۶.۳٪
	دارویی	۲۷	۸,۶۲۲	۸,۵۹۷	-۰.۳٪	۸۰,۵۵۰,۸۸۵	۸۷,۵۲۸,۲۷۰	۸.۷٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۲۵	۱,۱۲۶	۰.۱٪	۶,۲۶۵,۰۱۵	۵,۹۳۸,۱۸۹	-۵.۲٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۶	۳,۶۹۱	۳,۶۸۴	-۰.۲٪	۳۵,۷۲۳,۰۵۹	۳۳,۱۴۳,۷۶۶	-۷.۲٪
	چندرشته ای صنعتی	۲۱	۹,۸۴۵	۹,۷۷۸	-۰.۷٪	۸۹,۲۲۵,۶۹۷	۷۶,۱۶۴,۰۵۴	-۱۴.۶٪
	وسایل ارتباطی	۴۰	۱,۸۳۵	۱,۸۳۰	-۰.۳٪	۴۹,۷۵۹,۷۷۲	۴۰,۶۳۶,۴۴۸	-۱۸.۳٪
	رایانه	۴۵	۱۲,۴۶۹	۱۲,۵۰۸	۰.۳٪	۶۰,۵۸۵,۰۹۰	۳۸,۲۷۲,۹۲۲	-۳۶.۸٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۵	۲۳۹	۲۳۹	۰.۰٪	۷۹,۰۹۰,۸۳۷	۴۹,۳۹۶,۸۹۷	-۳۷.۵٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸	۵۶۹	۵۶۹	۰.۰٪	۳۵,۴۱۶,۲۳۴	۱۸,۴۴۶,۳۱۱	-۴۷.۹٪
	فلزات اساسی	۴۲	۵۹,۲۵۳	۵۸,۸۵۲	-۰.۷٪	۶۶۴,۷۰۷,۸۷۵	۲۵۶,۶۹۶,۳۷۰	-۶۱.۴٪
	فنی و مهندسی	۸	۷۲۸	۷۲۲	-۰.۸٪	۴۰,۳۴۸,۱۳۱	۱۵,۴۹۷,۸۱۵	-۶۱.۶٪
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۵۷,۰۰۵	۳۵۶,۵۷۱	-۰.۱٪	۸۶۷,۰۴۹,۲۹۶	۱۹۲,۶۵۶,۱۴۶	-۷۷.۸٪

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران

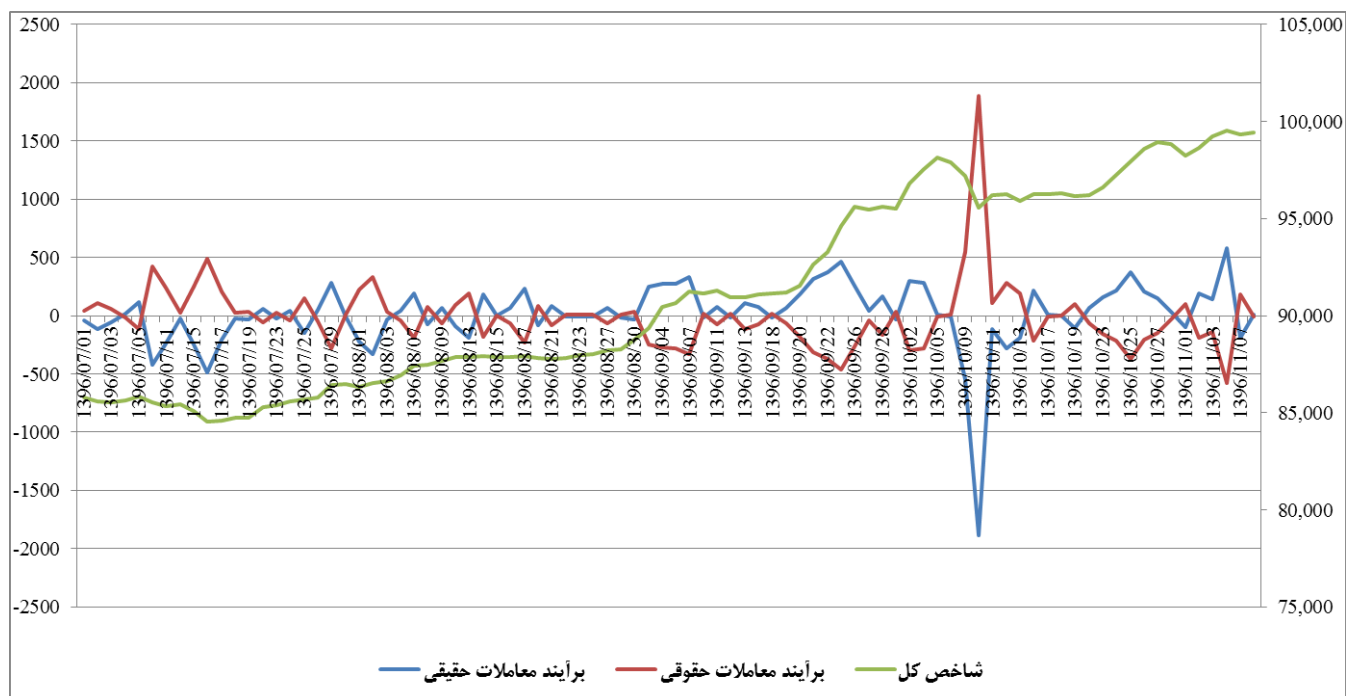
با توجه به جدول فوق، بنا بر رشد ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط معاملات ۱۴ روز اخیر، در صنایع استخراج کانه های فلزی و شیمیایی و پتروشیمی، ورود نقدینگی وجود داشته است و در صنعت فرآورده های نفتی خروج پول دیده می شود.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۱۱

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص ابتدای دوره	شاخص انتهای دوره	درصد تغییرات	ارزش بازاری ابتدای دوره	ارزش بازاری انتهای دوره	درصد تغییرات
بورس و فرابورس	چند رشته ای صنعتی	۱۸	۹,۳۹۶	۹,۷۷۸	۴.۰۷٪	۲۴۰,۷۱۴	۲۵۰,۵۱۳	۴.۰۷٪
	رایانه	۴۲	۱۲,۲۸۵	۱۲,۵۰۸	۱.۸۲٪	۱۴۰,۷۹۷	۱۴۴,۴۲۹	۲.۵۸٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۰۹	۱,۱۲۶	۱.۵۳٪	۱۶۶,۷۳۳	۱۷۰,۵۳۴	۲.۲۸٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۷۵	۶,۱۹۶	۶,۳۱۰	۱.۸۴٪	۱,۱۸۴,۹۷۴	۱,۲۰۲,۲۶۷	۱.۴۶٪
	وسایل ارتباطی	۳	۱,۹۰۹	۱,۸۳۰	-۴.۱۴٪	۱۳۷,۴۷۹	۱۳۸,۲۸۸	۰.۵۹٪
	فنی و مهندسی	۹	۷۲۵	۷۲۲	-۰.۴۱٪	۷۵,۷۷۰	۷۵,۵۴۴	-۰.۳۰٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۳۷	۲۳۹	۰.۸۴٪	۱۴۵,۲۲۵	۱۴۴,۳۶۴	-۰.۵۹٪
	دارویی	۱۵	۸,۶۷۲	۸,۵۹۷	-۰.۸۶٪	۱۳۸,۱۰۳	۱۳۷,۲۰۸	-۰.۶۵٪
	سرمایه گذارها	۲۱	۲,۰۶۰	۲,۰۵۰	-۰.۴۹٪	۱۱۳,۴۱۵	۱۱۲,۵۰۱	-۰.۸۱٪
	فلزات اساسی	۴۵	۶۰,۳۲۷	۵۸,۸۵۲	-۲.۴۵٪	۷۰۷,۸۲۷	۶۹۶,۸۳۷	-۱.۵۵٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۶	۵۸۳	۵۶۹	-۲.۴۰٪	۴۰۳,۸۱۷	۳۹۶,۰۸۰	-۱.۹۲٪
	حمل و نقل و انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۷۷۲	۳,۶۸۴	-۲.۳۳٪	۸۴,۲۱۴	۸۲,۵۱۷	-۲.۰۲٪
	فرآورده های نفتی	۵	۳۶۸,۰۳۱	۳۵۶,۵۷۱	-۳.۱۱٪	۴۰۲,۳۳۱	۳۹۰,۴۷۰	-۲.۹۵٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۷	۲۱,۲۶۴	۲۰,۳۴۱	-۴.۳۴٪	۲۶۸,۶۹۴	۲۵۷,۰۹۰	-۴.۳۲٪
خودرو و قطعات	۸	۱۷,۱۷۰	۱۶,۲۲۳	-۵.۵۲٪	۱۶۵,۷۷۷	۱۵۶,۹۳۱	-۵.۳۴٪	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات در ارزش بازاری در گروه های چند رشته ای صنعتی و رایانه دیده می شود.

نمودار تغییرات مالکیت سهامداری و جهت شاخص کل



همانطور که در نمودار بالا مشاهده می شود سه خط روند قرمز(روند خالص عملیات سرمایه گذاران حقوقی، خالص خرید حقوقی منهای خالص فروش حقوقی)، خط روند آبی(روند خالص عملیات سرمایه گذاران حقیقی، خالص خرید حقیقی منهای خالص فروش حقیقی) و خط روند سبز(خط روند شاخص کل بازار بورس) وجود دارد.

با توجه به نمودار فوق، می توان چنین استنباط نمود که از اوایل آبان ماه سال جاری، روند تغییرات شاخص کل همسو با معاملات سهامداران حقیقی حرکت کرده و همزمان با افزایش میزان خرید حقیقی، شاخص کل نیز صعودی بوده و با کاهش میزان خریدهای حقیقی ها، شاخص یا کاهش داشته و یا در حالت نسبتاً ثابتی باقی مانده است.