



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۶/۱۲/۱۹

اطلاعات کلی بازار در پایان روز نوزدهم اسفند ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۱۶)	۳,۸۵۲,۵۹۹	۳,۸۵۸,۹۱۴	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۰.۱۹)	۱,۳۸۴,۶۴۰	۱,۳۸۷,۲۵۵	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۴۳.۱۰)	۱۰,۷۸۷	۱۸,۹۵۸	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۰.۲۷)	۹۶,۵۹۵	۹۶,۸۶۰	شاخص کل بازار بورس
(۰.۴۰)	۱۷,۲۴۳	۱۷,۳۱۲	شاخص هم وزن بازار بورس
۰.۳۸	۱,۰۸۴	۱,۰۸۰	شاخص کل بازار فرابورس
خودرو، ارفع			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
وهور، دامین، شسم			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۲۶۵ واحد کاهش داشته است.

تاثیر در شاخص های بورس و فرابورس در پایان روز نوزدهم اسفند ماه ۱۳۹۶

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۳.۵۲	۳۸۵۲	ارفع
۳.۳۷	۴۱۴۲۴	مارون
(۱.۷۲)	۸۳۶	ذوب
(۰.۷۸)	۱۳۸۵۸	شاون
۰.۶۱	۸۱۴۸	دماوند
۰.۳۷	۳۶۲۸	بساما
۰.۳۱	۳۹۹۴	خدیزل

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۴۹.۱۲)	۴۲۷۶	شپنا
(۳۹.۴۷)	۲۸۵۰	فولاد
(۲۹.۷۴)	۷۰۰۰	شبندر
(۲۹.۴۴)	۲۲۸۳	پارسان
(۲۷.۳۷)	۵۲۶۲	بفجر
(۲۶.۴۷)	۴۰۱۶	شتران
۲۳.۴۱	۲۴۵۱۸	شخارک

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز نوزدهم اسفند ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۰۵٪	۵۷۶,۱۲۸	۵۷۶,۴۴۴	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۳۱.۹۵٪	۸,۷۹۰	۱۲,۹۱۷	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۲.۶٪	۲۱.۶۱٪	۲۱.۰۷٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

همان طور که دیده می شود در بازار بدهی امروز ارزش کل معاملات بیش از ۳۱ درصد افت داشته است.

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۶/۱۲/۱۹

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	دارویی	۲۷	۸,۰۵۶	۸,۰۴۵	-۰.۱٪	۶۱,۸۲۵,۴۶۳	۲۵۷,۲۸۸,۴۸۸	۳۱۶.۲٪
	فلزات اساسی	۴۲	۵۸,۶۰۵	۵۸,۲۹۱	-۰.۵٪	۲۹۶,۲۲۶,۱۰۷	۲۹۹,۸۳۵,۶۴۲	۱.۲٪
	سرمایه گذارها	۵	۲,۰۴۶	۲,۰۳۸	-۰.۴٪	۱۲۱,۵۲۸,۳۵۸	۱۱۵,۵۴۰,۳۲۴	-۴.۹٪
	رایانه	۴۵	۱۲,۶۷۷	۱۲,۶۷۲	۰.۰٪	۳۵,۵۷۳,۷۲۲	۲۷,۶۷۰,۲۶۹	-۲۲.۲٪
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۶,۵۸۱	۱۶,۴۸۷	-۰.۶٪	۳۱۶,۳۶۰,۰۶۰	۲۴۲,۸۷۰,۴۳۳	-۲۳.۲٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۳۵	۱,۱۳۴	-۰.۱٪	۵,۸۷۴,۴۶۳	۴,۰۹۳,۴۹۴	-۳۰.۳٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۶	۳,۶۴۳	۳,۶۴۸	۰.۱٪	۳۰,۱۰۹,۲۸۳	۱۷,۹۹۴,۶۱۳	-۴۰.۲٪
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۴۶,۷۴۵	۳۴۲,۳۹۸	-۱.۳٪	۳۲۶,۶۰۶,۳۶۹	۱۸۱,۴۰۲,۶۸۷	-۴۴.۵٪
	استخراج کانه های فلزی	۹	۲۰,۷۵۱	۲۰,۶۹۳	-۰.۳٪	۱۶۲,۸۸۲,۱۸۵	۸۷,۰۵۱,۳۲۵	-۴۶.۶٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۳	۶,۲۲۸	۶,۲۳۰	۰.۰٪	۳۲۸,۸۰۳,۸۳۲	۱۶۸,۲۲۱,۱۰۳	-۴۸.۸٪
	فنی و مهندسی	۸	۶۸۴	۶۸۵	۰.۱٪	۹,۸۹۸,۶۶۰	۴,۱۹۹,۱۱۳	-۵۷.۶٪
	چندرشته ای صنعتی	۲۱	۹,۶۲۵	۹,۶۲۴	۰.۰٪	۸۴,۴۱۶,۷۲۰	۲۶,۱۰۳,۸۹۰	-۶۹.۱٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۵	۲۲۸	۲۲۷	-۰.۴٪	۱۷۵,۸۲۶,۹۸۷	۱۸,۳۳۵,۰۸۷	-۸۹.۶٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸	۵۴۴	۵۴۴	۰.۰٪	۱۲۲,۷۵۹,۳۸۲	۱۰,۱۲۹,۵۹۰	-۹۱.۷٪
وسایل ارتباطی	۴۰	۱,۵۳۴	۱,۵۰۲	-۲.۱٪	۲۲۷,۷۵۸,۷۰۶	۱۰,۵۷۱,۱۴۳	-۹۵.۴٪	

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران

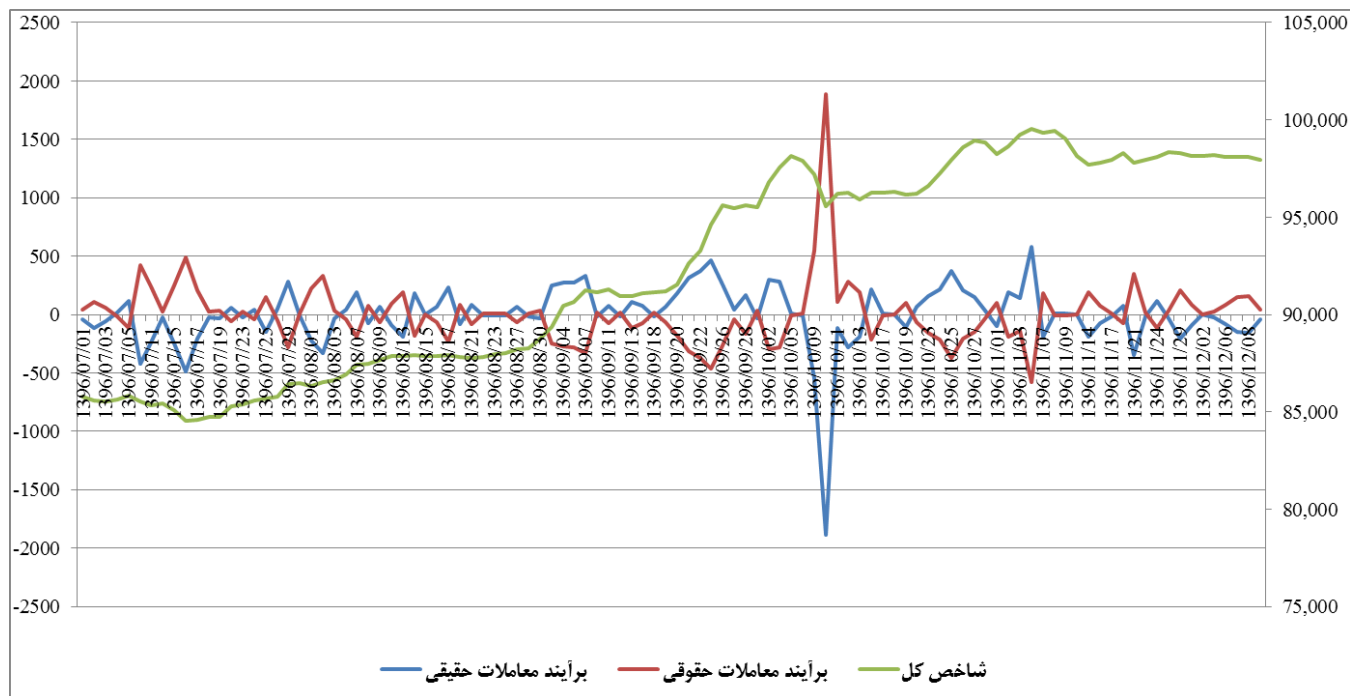
با توجه به جدول فوق، در صنایع دارویی و فلزات اساسی با توجه به افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز اخیر، ورود نقدینگی وجود داشته و در سایر صنایع خروج پول دیده می شود.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۱۹

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	مخابرات	۲۵	۱,۱۲۰	۱,۱۳۴	۱.۲۵%	۱۶۸,۳۶۵	۱۷۴,۱۵۴	۳.۴۴%
	دارویی	۱۵	۸,۲۶۸	۸,۰۴۵	-۲.۷۰%	۱۳۲,۸۷۷	۱۳۳,۷۰۹	۰.۶۳%
	رایانه	۴۲	۱۲,۶۰۲	۱۲,۶۷۲	۰.۵۶%	۱۴۵,۷۸۸	۱۴۵,۹۴۰	۰.۱۰%
	استخراج کانه های فلزی	۲۷	۲۰,۶۹۰	۲۰,۶۹۳	۰.۰۱%	۲۶۱,۵۲۶	۲۶۱,۴۷۶	-۰.۰۲%
	حمل و نقل و انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۶۳۱	۳,۶۴۸	۰.۴۷%	۸۱,۷۲۷	۸۱,۴۴۳	-۰.۳۵%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۶	۵۴۸	۵۴۴	-۰.۷۳%	۳۸۴,۱۳۸	۳۸۱,۵۱۱	-۰.۶۸%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۲۹	۲۲۷	-۰.۸۷%	۱۴۲,۲۴۷	۱۴۰,۴۸۳	-۱.۲۴%
	چند رشته ای صنعتی	۱۸	۹,۷۵۶	۹,۶۲۴	-۱.۳۵%	۲۴۹,۹۸۶	۲۴۶,۵۱۱	-۱.۳۹%
	شیمیایی و پتروشیمی	۷۵	۶,۳۶۱	۶,۲۳۰	-۲.۰۶%	۱,۲۱۰,۸۰۳	۱,۱۹۳,۶۳۳	-۱.۴۲%
	سرمایه گذاریها	۲۱	۲,۰۱۷	۲,۰۳۸	۱.۰۴%	۱۱۱,۱۴۸	۱۰۹,۴۷۵	-۱.۵۰%
	وسایل ارتباطی	۳	۱,۸۰۶	۱,۵۰۲	-۱۶.۸۳%	۱۳۸,۷۳۳	۱۳۶,۵۴۹	-۱.۵۷%
	فلزات اساسی	۴۵	۵۹,۷۵۶	۵۸,۲۹۱	-۲.۴۵%	۷۰۶,۷۳۳	۶۹۱,۷۵۷	-۲.۱۲%
	خودرو و قطعات	۸	۱۶,۹۰۲	۱۶,۴۸۷	-۲.۴۶%	۱۶۳,۶۰۱	۱۵۹,۷۱۶	-۲.۳۷%
	فنی و مهندسی	۹	۷۰۲	۶۸۵	-۲.۴۲%	۷۳,۳۸۹	۷۱,۶۱۷	-۲.۴۱%
	فرآورده های نفتی	۵	۳۶۲,۱۶۴	۳۴۲,۳۹۸	-۵.۴۶%	۳۹۵,۹۰۶	۳۷۳,۸۱۰	-۵.۵۸%

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های مخابرات، دارویی 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.