



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۱/۲۱

اطلاعات کلی بازار در پایان روز بیست و یکم فروردین ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۳۹)	۳,۸۴۸,۴۰۵	۳,۸۶۳,۳۰۱	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۱.۴۴)	۱,۵۰۹,۶۷۲	۱,۵۳۱,۷۵۱	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۱۶.۹۸)	۳,۸۵۸	۴,۶۴۸	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۰.۳۸)	۹۶,۷۴۸	۹۷,۱۲۱	شاخص کل بازار بورس
۰.۱۷	۱۶,۹۵۰	۱۶,۹۲۰	شاخص هم وزن بازار بورس
(۲.۰۳)	۱,۰۷۴	۱,۰۹۷	شاخص کل بازار فرابورس
خاهن، بکام			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
شخارک، ذوب، رمپنا			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۳۷۲ واحد افت داشته است.

تاثیر در شاخص های بورس و فرابورس در پایان روز بیست و یکم فروردین ماه ۱۳۹۷

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۱۳.۸۲)	۴۰۸۱۴	مارون	(۱۵۶.۴۹)	۲۸۹۵	فولاد
(۷.۳۲)	۳۵۱۳۴	زاگرس	(۱۱۳.۱۹)	۱۱۱۹۶	جم
(۱.۹۱)	۱۸۷۱	هرمز	۸۶.۴۸	۴۳۷۹	شپنا
(۱.۰۹)	۷۱۸۳	خراسان	(۷۸.۴۳)	۲۶۸۰	فملی
۱.۰۲	۱۳۳۹۳	شاون	۷۳.۸۱	۴۷۱۴	مبین
۱.۰۲	۱۳۲۵۲	شراز	(۶۱.۵۹)	۵۵۱۱	فارس
(۰.۵۷)	۳۷۱۳	ارفع	(۵۵.۳۶)	۸۲۷۹	شپدیس

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز بیست و یکم فروردین ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۳.۱۵%	۶۹۸,۵۴۳	۶۷۷,۲۰۸	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
۳.۵۵%	۱,۹۰۸	۱,۸۴۲	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۰.۲%	۲۱.۹۲%	۲۱.۹۷%	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۱/۲۱

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص روز گذشته	شاخص روز جاری	درصد تغییرات	متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز	متوسط ارزش جاری معاملات جاری (میلیون ریال)	درصد تغییرات
بورس و فرابورس	استخراج کانه های فلزی	۵	۲۱,۹۱۸	۲۱,۴۸۸	-۲.۰%	۸۱,۶۰۹,۱۶۵	۲۰۷,۷۵۶,۰۴۱	۱۵۴.۶%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۲۵	۲۲۴	۲۳۲	۳.۶%	۸۱,۷۷۰,۲۳۵	۱۲۳,۶۸۰,۳۲۵	۵۱.۳%
	فلزات اساسی	۲۶	۶۱,۰۵۲	۵۹,۶۹۵	-۲.۲%	۲۶۸,۶۶۰,۵۰۶	۲۹۹,۷۷۸,۳۱۱	۱۱.۶%
	فرآورده های نفتی	۴۵	۳۴۵,۷۲۲	۳۵۳,۲۸۴	۲.۲%	۲۳۰,۲۸۰,۶۱۸	۲۳۴,۴۹۷,۷۰۷	۱.۸%
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۳,۷۰۱	۳,۷۰۴	۰.۱%	۲۴,۲۳۲,۴۲۷	۲۴,۲۷۰,۴۳۴	۰.۲%
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۴,۷۶۶	۱۵,۳۳۶	۳.۹%	۱۹۸,۵۰۴,۲۱۱	۱۸۸,۲۱۳,۹۱۷	-۵.۲%
	شیمیایی و پتروشیمی	۴۲	۶,۴۲۷	۶,۳۲۱	-۱.۶%	۳۴۱,۹۸۴,۹۳۰	۲۹۸,۴۵۶,۳۳۵	-۱۲.۷%
	سرمایه گذارها	۸	۱,۹۷۹	۱,۹۷۲	-۰.۴%	۵۵,۲۱۲,۲۵۰	۴۱,۶۱۵,۸۱۱	-۲۴.۶%
	وسایل ارتباطی	۲۱	۱,۵۲۲	۱,۵۱۵	-۰.۵%	۶,۶۹۲,۳۶۶	۴,۷۶۸,۵۳۰	-۲۸.۷%
	چندرشته ای صنعتی	۳	۹,۷۹۷	۹,۷۶۲	-۰.۴%	۳۹,۳۳۵,۳۴۸	۲۰,۹۴۲,۷۱۶	-۴۶.۸%
	رایانه	۷۵	۱۳,۴۴۴	۱۳,۴۲۷	-۰.۱%	۴۳,۲۶۱,۱۷۹	۲۲,۷۲۳,۰۳۲	-۴۷.۵%
	مخابرات	۹	۱,۱۰۹	۱,۱۰۷	-۰.۲%	۸,۲۵۸,۲۹۷	۳,۹۴۸,۵۰۲	-۵۲.۲%
	دارویی	۱۵	۸,۱۵۷	۸,۱۵۷	۰.۰%	۵۳,۰۳۵,۲۳۴	۲۲,۰۰۲,۰۲۹	-۵۸.۵%
	فنی و مهندسی	۴۰	۶۵۴	۶۴۸	-۰.۹%	۱۵,۰۳۹,۵۳۹	۵,۲۸۶,۹۱۰	-۶۴.۸%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۷	۴۹۲	۴۹۲	۰.۰%	۲۴۳,۶۷۶,۰۶۲	۷۹,۳۴۷,۲۳۰	-۶۷.۴%

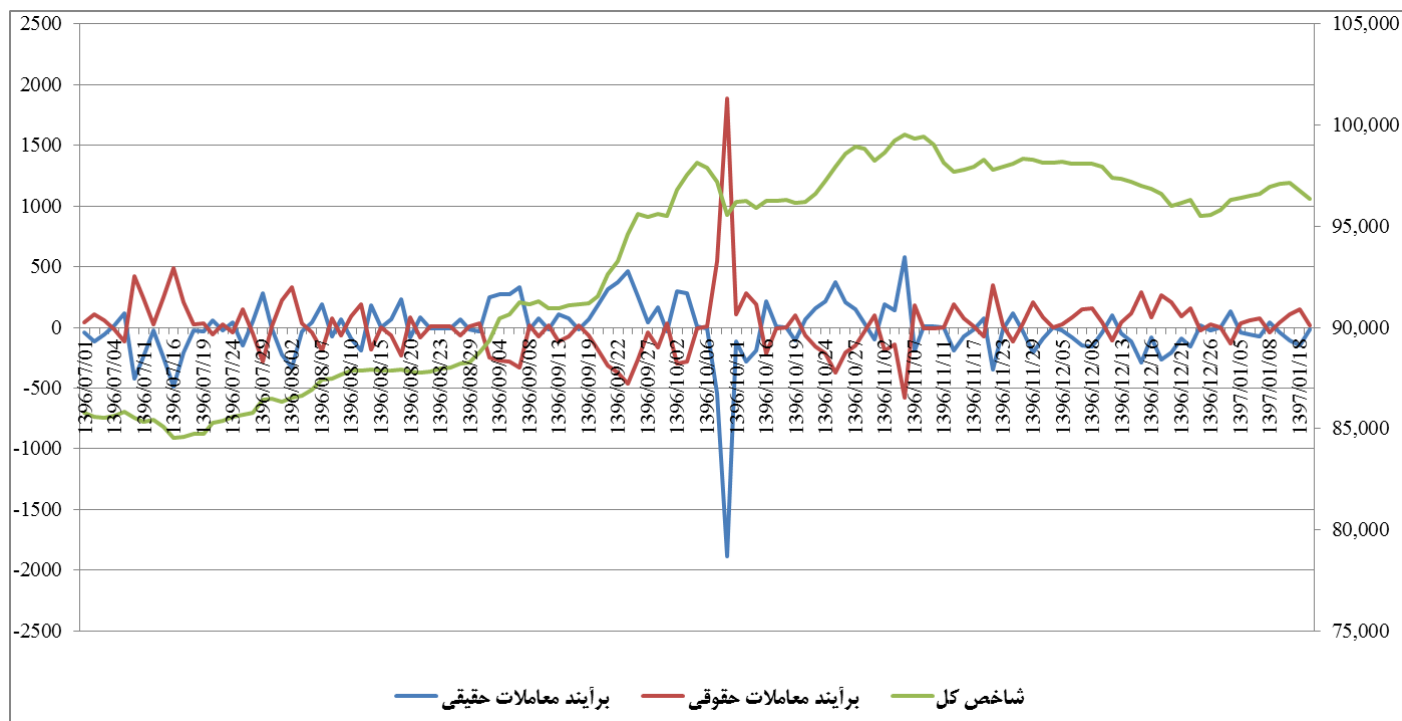
با توجه به جدول فوق، در صنایع استخراج کانه های فلزی و عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم، با توجه به افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز اخیر، ورود نقدینگی وجود داشته و در صنایع بانکی و فنی و مهندسی بیشترین خروج پول دیده می شود.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۲۱

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	استخراج کانه های فلزی	۲۶	۲۰,۷۴۲	۲۱,۴۸۸	۳.۶۰٪	۲۶۲,۰۵۰	۲۷۹,۰۸۰	۶.۵۰٪
	رایانه	۱۸	۱۲,۸۴۲	۱۳,۴۲۷	۴.۵۶٪	۱۴۷,۷۸۵	۱۵۴,۱۹۳	۴.۳۴٪
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۴۳,۹۴۱	۳۵۳,۲۸۴	۲.۷۳٪	۳۷۴,۲۰۹	۳۸۵,۲۴۸	۲.۹۵٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۰	۴۸۱	۴۹۲	۲.۲۹٪	۳۳۹,۵۷۱	۳۴۵,۱۵۴	۱.۶۴٪
	فلزات اساسی	۴۲	۵۸,۱۳۱	۵۹,۶۹۵	۲.۶۹٪	۶۸۸,۸۹۶	۶۹۸,۸۲۵	۱.۴۴٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۲۵	۶,۲۲۵	۶,۳۲۱	۱.۵۴٪	۱,۱۹۲,۶۱۲	۱,۲۰۸,۶۰۴	۱.۳۴٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۲۵	۲۳۲	۳.۱۱٪	۱۳۸,۲۷۳	۱۴۰,۰۹۲	۱.۳۳٪
	دارویی	۳	۸,۰۸۸	۸,۱۵۷	۰.۸۵٪	۱۳۳,۹۲۸	۱۳۴,۸۲۲	۰.۶۷٪
	وسایل ارتباطی	۲۷	۱,۵۴۷	۱,۵۱۵	-۲.۰۷٪	۱۳۴,۸۴۱	۱۳۵,۴۶۵	۰.۴۶٪
	سرمایه گذاریها	۸	۱,۹۹۶	۱,۹۷۲	-۱.۲۰٪	۱۰۶,۳۵۰	۱۰۶,۵۵۳	۰.۱۹٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۱	۳,۶۸۸	۳,۷۰۴	۰.۴۳٪	۸۲,۴۵۷	۸۲,۳۶۱	-۰.۱۲٪
	مخابرات	۹	۱,۱۲۳	۱,۱۰۷	-۱.۴۲٪	۱۷۲,۹۵۴	۱۶۷,۹۱۴	-۲.۹۱٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۵	۹,۵۰۰	۹,۷۶۲	۲.۷۶٪	۲۴۳,۴۲۴	۲۴۶,۰۴۲	۳.۰۳٪
	فنی و مهندسی	۵	۶۷۷	۶۴۸	-۴.۲۸٪	۷۰,۷۴۱	۶۷,۷۴۸	-۴.۳۳٪
	خودرو و قطعات	۷۵	۱۶,۲۴۳	۱۵,۳۳۶	-۵.۵۸٪	۱۵۷,۲۶۹	۱۴۹,۱۸۵	-۵.۱۴٪

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های استخراج کانه های فلزی، رایانه و فرآورده های نفتی 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 ۱۳۹۶ تا اواخر اسفند ماه، 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؛ اما همان طور که دیده می شود از اواخر اسفند ماه سال ۱۳۹۶، روند حرکتی شاخص کل با معاملات سهامداران حقوقی همسو شده و تا کنون نیز با آن همراه بوده است.