



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۱/۲۲

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

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۴۷)	۳,۸۳۰,۱۷۷	۳,۸۴۸,۴۰۵	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۰.۶۸)	۱,۴۹۹,۴۳۴	۱,۵۰۹,۶۷۲	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۷.۱۳	۴,۱۳۳	۳,۸۵۸	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۰.۴۸)	۹۶,۲۸۷	۹۶,۷۴۸	شاخص کل بازار بورس
(۱.۱۰)	۱۶,۷۶۳	۱۶,۹۵۰	شاخص هم وزن بازار بورس
(۰.۹۷)	۱,۰۶۴	۱,۰۷۴	شاخص کل بازار فرابورس
شخارک، ذوب			بازگشایی نماد های مهم و تاثیر گذار
غمارگ، بنیرو			توقف نمادهای مهم و تاثیر گذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۴۶۰ واحد افت داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۵.۶۴)	۳۳۷۴۷	زاگرس
۲.۸۷	۴۱۲۳۷	مارون
(۱.۲۴)	۷۹۳	ذوب
(۱.۰۱)	۵۷۰۶	شرانل
(۰.۸۵)	۱۲۹۵۵	شاون
(۰.۶۵)	۱۲۸۷۶	شراز
(۰.۵۲)	۲۲۲۴	میدکو

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۷۵.۸۷)	۲۴۱۹۸	شخارک
۶۶.۳۷	۱۷۷۶۶	همراه
(۵۴.۰۵)	۵۴۶۸	فارس
(۴۷.۱۴)	۲۸۷۰	فولاد
(۴۳.۲۰)	۱۱۰۱۷	جم
(۳۲.۵۸)	۱۱۲۷	وغدیر
۳۱.۱۶	۲۲۶۱	کچاد

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

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۸٪	۶۹۷,۹۷۳	۶۹۸,۵۴۳	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۲۴.۰۸٪	۱,۴۴۹	۱,۹۰۸	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۰.۸٪	۲۱.۷۴٪	۲۱.۹۲٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۱/۲۲

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص روز گذشته	شاخص روز جاری	درصد تغییرات	متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز	متوسط ارزش جاری معاملات (میلیون ریال)	درصد تغییرات
بورس و فرابورس	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۲۵	۲۳۲	۲۳۷	۲.۲٪	۱۰۸,۰۶۸,۶۵۲	۴۷۵,۲۲۳,۱۴۰	۳۳۹.۷٪
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۵,۳۳۶	۱۴,۸۲۷	-۳.۳٪	۲۱۵,۵۹۸,۸۳۰	۵۶۱,۳۳۶,۷۱۴	۱۶۰.۴٪
	وسایل ارتباطی	۲۱	۱,۵۱۵	۱,۴۴۴	-۴.۷٪	۷,۶۲۰,۳۶۷	۱۷,۰۲۲,۲۷۴	۱۲۳.۴٪
	فلزات اساسی	۲۶	۵۹,۶۹۵	۵۹,۳۷۵	-۰.۵٪	۲۸۱,۶۳۱,۸۴۷	۵۶۱,۹۷۱,۶۵۷	۹۹.۵٪
	استخراج کانه های فلزی	۵	۲۱,۴۸۸	۲۱,۵۷۲	۰.۴٪	۸۴,۵۱۹,۱۸۷	۱۲۷,۵۸۷,۰۳۱	۵۱.۰٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۳,۷۰۴	۳,۷۰۱	-۰.۱٪	۲۳,۷۲۲,۵۶۰	۲۷,۶۸۸,۶۹۴	۱۶.۷٪
	مخابرات	۹	۱,۱۰۷	۱,۱۲۰	۱.۲٪	۸,۵۶۳,۷۵۲	۹,۹۷۶,۹۸۸	۱۶.۵٪
	فرآورده های نفتی	۴۵	۳۵۳,۲۸۴	۳۵۰,۹۵۹	-۰.۷٪	۲۳۵,۳۷۶,۵۷۷	۲۶۶,۱۶۱,۶۰۲	۱۳.۱٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۴۲	۶,۳۲۱	۶,۲۶۰	-۱.۰٪	۳۳۷,۲۷۲,۷۴۲	۳۷۱,۲۱۵,۱۰۴	۱۰.۱٪
	سرمایه گذاریها	۸	۱,۹۷۲	۱,۹۴۱	-۱.۶٪	۵۲,۹۱۴,۳۰۶	۵۱,۹۰۱,۵۳۸	-۱.۹٪
	چندرشته ای صنعتی	۳	۹,۷۶۲	۹,۶۵۸	-۱.۱٪	۳۹,۶۶۵,۳۸۹	۳۲,۲۹۶,۳۳۸	-۱۸.۶٪
	رایانه	۷۵	۱۳,۴۲۷	۱۳,۴۰۲	-۰.۲٪	۴۱,۲۹۵,۷۹۹	۲۲,۹۳۸,۱۰۹	-۴۴.۵٪
	دارویی	۱۵	۸,۱۵۷	۸,۱۳۸	-۰.۲٪	۴۷,۱۲۴,۲۷۹	۱۶,۲۸۱,۰۱۰	-۶۵.۵٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۷	۴۹۲	۴۹۱	-۰.۲٪	۲۲۲,۵۱۸,۰۴۹	۷۵,۲۴۰,۱۳۹	-۶۶.۲٪
فنی و مهندسی	۴۰	۶۴۸	۶۴۸	۰.۰٪	۱۴,۸۷۱,۵۰۲	۳,۰۷۵,۸۴۹	-۷۹.۳٪	

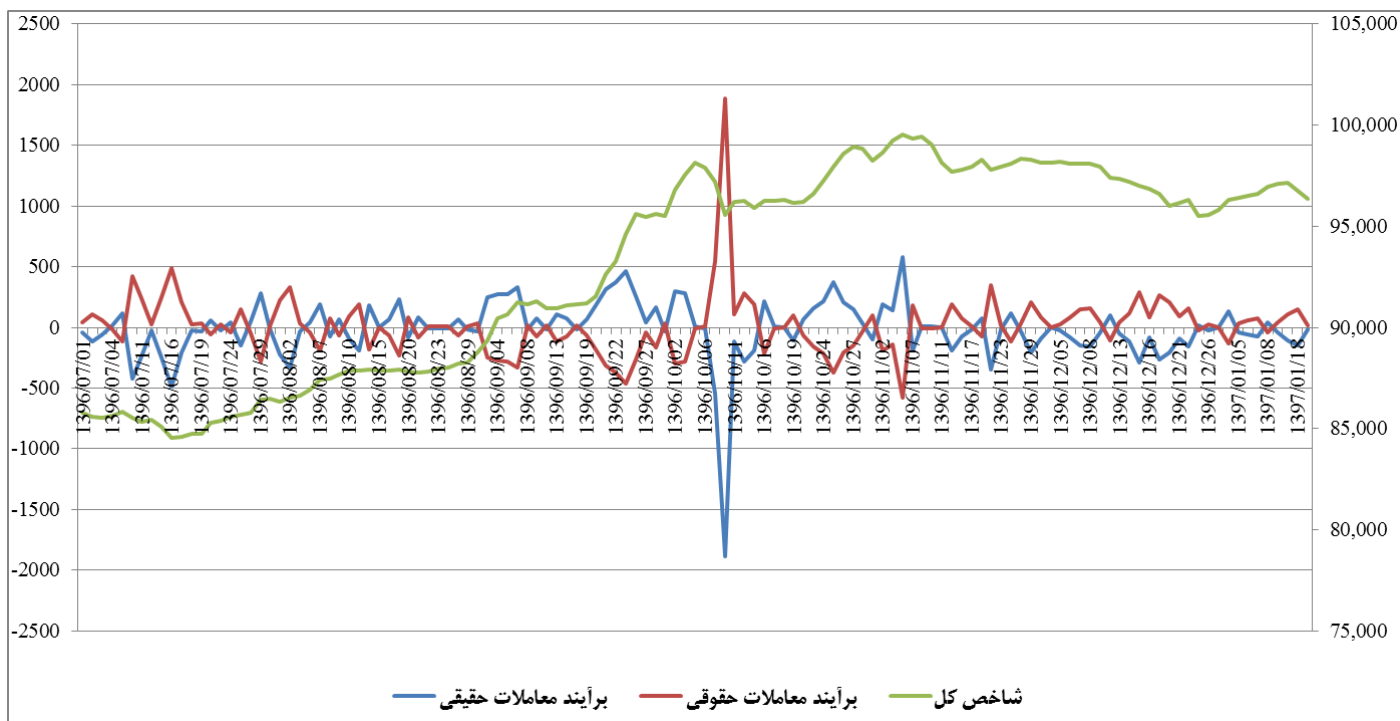
با توجه به جدول فوق، در صنایع عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم و خودرو و قطعات با توجه به افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز اخیر، ورود نقدینگی وجود داشته و در صنایع فنی و مهندسی و بانکی بیشترین خروج پول دیده می شود.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۲۲

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	۲۰,۶۳۲	۲۱,۵۷۲	۴.۵۶%	۲۶۰,۶۵۱	۲۸۰,۱۴۴	۷.۴۸%
	رایانه	۱۸	۱۲,۸۸۳	۱۳,۴۰۲	۴.۰۳%	۱۴۸,۱۸۹	۱۵۳,۷۶۸	۳.۷۶%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۲۷	۲۳۷	۴.۴۱%	۱۳۸,۷۸۴	۱۴۲,۲۹۷	۲.۶۰%
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۴۳,۰۰۲	۳۵۰,۹۵۹	۲.۳۳%	۳۷۲,۹۴۷	۳۸۱,۴۲۶	۲.۳۷%
	وسایل ارتباطی	۳۷	۱,۶۲۲	۱,۴۴۴	-۱۰.۹۷%	۱۳۴,۸۹۷	۱۳۶,۳۸۸	۱.۱۱%
	فلزات اساسی	۴۲	۵۸,۰۳۷	۵۹,۳۷۵	۲.۳۱%	۶۸۷,۷۵۰	۶۹۴,۵۶۳	۰.۹۹%
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۰	۴۸۷	۴۹۱	۰.۸۲%	۳۴۲,۶۸۱	۳۴۴,۸۱۲	۰.۶۲%
	شیمیایی و پتروشیمی	۲۵	۶,۳۳۰	۶,۲۶۰	-۰.۴۸%	۱,۱۹۴,۰۰۷	۱,۱۹۷,۳۳۸	۰.۳۷%
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۱	۳,۶۸۶	۳,۷۰۱	۰.۴۱%	۸۲,۲۳۷	۸۱,۹۱۲	-۰.۳۸%
	دارویی	۳	۸,۱۴۱	۸,۱۳۸	-۰.۰۴%	۱۳۴,۹۱۱	۱۳۴,۲۳۳	-۰.۵۰%
	سرمایه گذاریها	۸	۱,۹۹۲	۱,۹۴۱	-۲.۵۶%	۱۰۶,۱۴۳	۱۰۵,۲۵۳	-۰.۸۴%
	مخابرات	۹	۱,۱۲۸	۱,۱۲۰	-۰.۷۱%	۱۷۴,۱۳۴	۱۷۰,۵۵۴	-۲.۰۶%
	فنی و مهندسی	۵	۶۷۵	۶۴۸	-۴.۰۰%	۷۰,۵۳۹	۶۷,۷۱۸	-۴.۰۰%
	چندرشته ای صنعتی	۴۵	۹,۵۴۹	۹,۶۵۸	۱.۱۴%	۲۴۴,۵۷۱	۲۳۳,۵۶۸	-۴.۵۰%
خودرو و قطعات	۷۵	۱۵,۹۶۹	۱۴,۸۲۷	-۷.۱۵%	۱۵۴,۵۸۹	۱۴۴,۳۳۱	-۶.۶۴%	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های استخراج کانه های فلزی، رایانه و عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم 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.