



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۵/۱۴

اطلاعات کلی بازار در پایان روز چهاردهم مرداد ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۳.۲۸	۴,۹۰۸,۰۵۳	۴,۷۵۱,۹۹۷	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۱.۹۳	۱,۷۰۶,۳۲۹	۱,۶۷۴,۰۲۸	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۱۵۲.۴۲	۱۵,۶۳۸	۶,۱۹۵	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۳.۲۹	۱۲۸,۴۴۸	۱۲۴,۳۵۴	شاخص کل بازار بورس
۰.۵۳	۱۸,۸۸۵	۱۸,۷۸۵	شاخص هم وزن بازار بورس
۳.۸۷	۱,۴۷۴	۱,۴۱۹	شاخص کل بازار فرابورس
شراز، خبهمن			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
شبریز، شبندر، و صندوق، مبین			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۴۰۹۴ واحد رشد داشته است.

تاثیر در شاخص های بورس و فرابورس در پایان روز چهاردهم مرداد ماه ۱۳۹۷

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۱۷.۷۲	۵۱۷۶۱	مارون
۱۱.۰۵	۵۲۴۶۹	زاگرس
۵.۰۴	۲۸۴۸	میدکو
۴.۴۷	۱۵۷۸	ذوب
۳.۵۴	۲۹۶۵	هرمز
۳.۲۲	۱۸۲۸۵	شراز
۲.۱۰	۶۳۲۷	ارفع

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۴۷۶.۲۷	۷۶۸۱	فارس
۴۲۳.۹۳	۴۶۲۷	فولاد
۲۵۴.۳۶	۳۴۸۲	فملی
۲۵۴.۳۶	۳۴۵۰۴	پارس
۲۴۸.۷۱	۵۷۷۷	کگل
۱۸۱.۲۳	۳۵۹۲	پارسان
۱۷۹.۱۵	۱۸۴۶	تاپیکو

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز چهاردهم مرداد ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۲۲٪	۷۳۳,۹۳۳	۷۳۵,۵۴۴	ارزش کل بازار بدهی
-۹۳.۹۲٪	۲۰۱	۳,۳۰۸	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۵.۱٪	۲۸.۹٪	۲۷.۵۱٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۵/۱۴

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص روز گذشته	شاخص روز جاری	درصد تغییرات	متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز	متوسط ارزش معاملات جاری (میلیون ریال)	درصد تغییرات
بورس و فرابورس	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۲۹۹	۳۱۴	۵.۰٪	۹۷,۵۵۴,۵۲۶	۳۵۴,۸۵۳,۱۴۶	۲۶۳.۷٪
	شیمیایی	۳	۸,۸۷۵	۹,۳۰۰	۴.۸٪	۱,۲۸۶,۸۸۶,۳۴۸	۳,۶۵۸,۸۳۹,۲۳۹	۱۸۴.۳٪
	فلزات اساسی	۷۵	۹۰,۳۳۳	۹۴,۳۵۷	۴.۵٪	۱,۳۲۹,۵۷۸,۷۴۵	۳,۷۲۲,۹۵۹,۶۱۲	۱۸۰.۰٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۳۶,۲۶۸	۳۷,۹۰۵	۴.۵٪	۳۳۴,۸۰۵,۸۲۵	۹۰۸,۰۳۷,۳۵۶	۱۷۱.۲٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۴۸۰,۰۶۰	۵۰۰,۶۲۷	۴.۳٪	۴۷۱,۳۲۱,۲۹۲	۱,۰۱۸,۱۷۹,۸۶۳	۱۱۶.۰٪
	چندرشته ای صنعتی	۵	۲۹۹	۳۱۴	۵.۰٪	۲۳۸,۲۵۳,۰۸۶	۴۷۳,۰۵۱,۷۲۷	۹۸.۶٪
	فنی و مهندسی	۲۱	۶۲۶	۶۵۵	۴.۶٪	۴۶,۴۰۱,۳۶۰	۹۱,۷۲۵,۷۶۲	۹۷.۷٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۳۵۶	۳,۳۵۱	-۰.۱٪	۳۴,۳۴۶,۶۰۲	۵۶,۲۹۸,۳۳۲	۶۳.۹٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۱۴,۳۶۱	۱۴,۴۲۹	۰.۵٪	۲۷۳,۵۸۷,۳۵۶	۳۷۷,۰۸۴,۲۶۲	۳۷.۸٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۲,۱۲۲	۲,۱۷۵	۲.۵٪	۱۰۶,۵۰۰,۱۱۰	۱۴۲,۴۵۵,۴۵۷	۳۳.۸٪
	دارویی	۴۲	۸,۰۸۵	۸,۰۵۹	-۰.۳٪	۷۴,۵۸۷,۹۱۲	۸۴,۵۵۷,۱۸۳	۱۳.۴٪
	وسایل ارتباطی	۹	۱,۵۵۰	۱,۵۳۱	-۱.۲٪	۲۳,۲۹۳,۰۵۰	۲۵,۱۳۰,۷۱۳	۷.۹٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۵۰۷	۵۰۶	-۰.۲٪	۱۶۱,۹۱۲,۱۳۹	۱۵۵,۶۹۱,۵۶۸	-۳.۸٪
	رایانه	۸	۱۳,۵۳۲	۱۳,۴۸۲	-۰.۴٪	۷۹,۵۶۱,۱۳۸	۶۲,۷۴۳,۱۴۳	-۲۱.۱٪
مخابرات	۱۸	۱,۱۱۲	۱,۱۱۱	-۰.۱٪	۴۱,۷۷۲,۹۷۶	۱۴,۵۳۳,۶۶۷	-۶۵.۲٪	

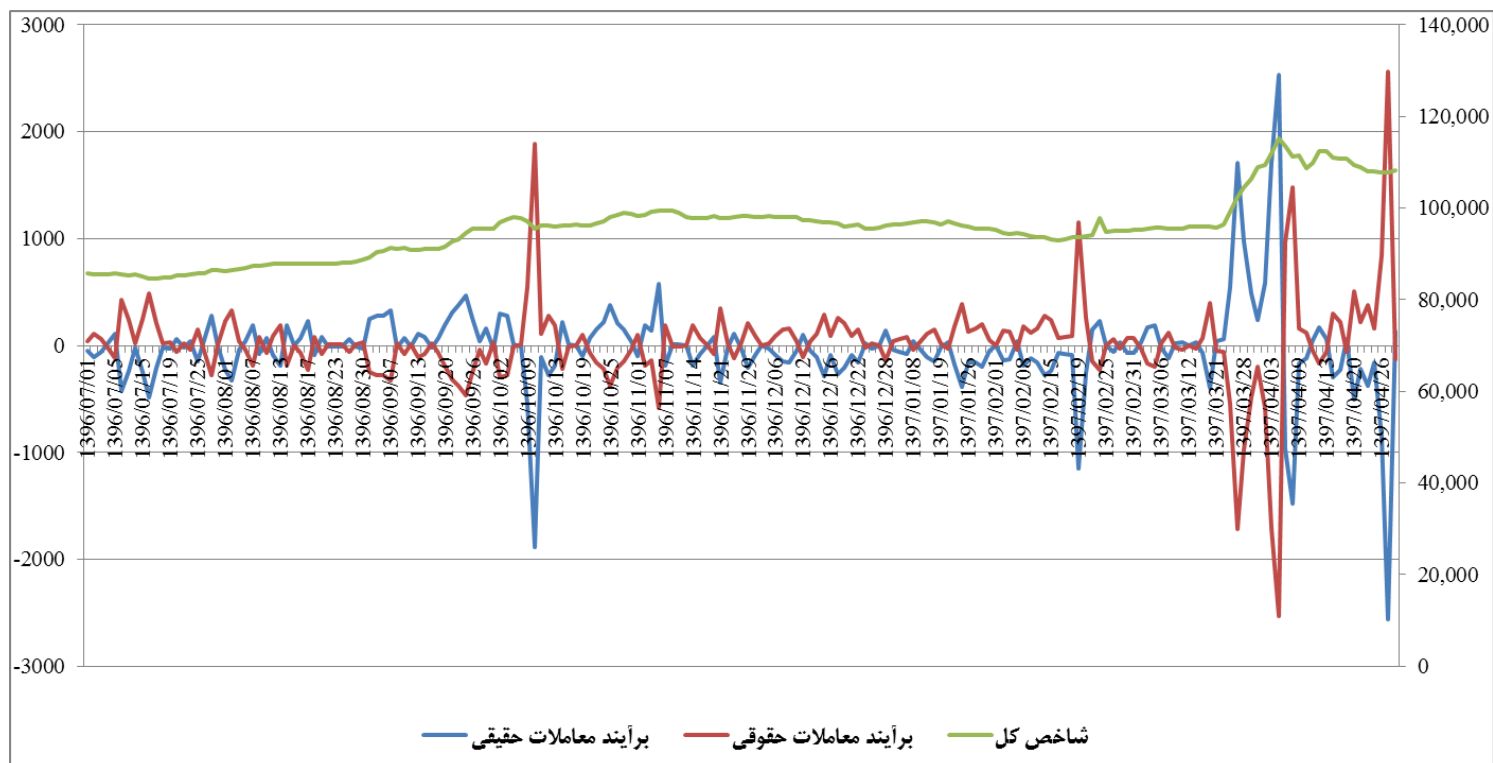
با توجه به جدول فوق، در صنایع عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم و شیمیایی در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع مخابرات و رایانه ای بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۱۴

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	فرآورده های نفتی	۱۸	۳۶۰,۳۱۲	۵۰۰,۶۲۷	۳۸.۹۴%	۳۸۳,۲۳۸	۴۹۹,۵۱۶	۳۰.۳۴%
	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۲۹,۵۹۰	۳۷,۹۰۵	۲۸.۱۰%	۳۴۸,۰۲۰	۴۴۵,۰۱۸	۲۷.۸۷%
	شیمیایی	۲۶	۷,۱۴۹	۹,۳۰۰	۳۰.۰۹%	۱,۴۴۴,۶۷۵	۱,۸۰۲,۳۴۴	۲۴.۷۵%
	فلزات اساسی	۴۲	۷۳,۶۷۲	۹۴,۳۵۷	۲۸.۰۸%	۸۳۶,۳۸۶	۱,۰۳۰,۰۸۷	۲۳.۱۶%
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۱,۲۰۷	۳۱۴	-۹۷.۲۰%	۲۵۲,۶۴۰	۳۰۷,۹۰۶	۲۱.۸۸%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۲۶۰	۳۱۴	۲۰.۷۷%	۱۳۷,۲۷۴	۱۵۷,۳۹۰	۱۴.۶۵%
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۰۳۵	۲,۱۷۵	۶.۸۸%	۱۰۲,۴۲۷	۱۰۷,۳۴۰	۴.۸۰%
	فنی و مهندسی	۱۵	۶۱۳	۶۵۵	۶.۸۵%	۶۴,۰۵۶	۶۶,۴۰۹	۳.۶۷%
	مخابرات	۳	۱,۱۳۱	۱,۱۱۱	-۱.۷۷%	۱۳۷,۰۵۰	۱۳۷,۳۶۶	۰.۲۳%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۵۰۰	۵۰۶	۱.۲۰%	۳۴۱,۲۴۴	۳۴۰,۵۵۵	-۰.۲۰%
	دارویی	۹	۸,۳۷۳	۸,۰۵۹	-۳.۷۵%	۱۲۸,۲۹۵	۱۲۳,۷۳۰	-۳.۵۶%
	وسایل ارتباطی	۴۵	۱,۵۲۳	۱,۵۳۱	۰.۵۳%	۱۱۵,۹۸۴	۱۱۱,۲۹۰	-۴.۰۵%
	رایانه	۲۵	۱۴,۱۸۷	۱۳,۴۸۲	-۴.۹۷%	۱۶۴,۱۷۲	۱۵۶,۲۲۶	-۴.۸۴%
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات خودرو و قطعات	۷۵	۳,۵۶۶	۳,۳۵۱	-۶.۰۳%	۷۸,۱۰۱	۷۳,۶۳۸	-۵.۷۱%
		۵	۱۵,۵۳۳	۱۴,۴۲۹	-۷.۱۱%	۱۴۶,۸۷۱	۱۳۵,۹۸۹	-۷.۴۱%

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های فرآورده های نفتی و استخراج کانه های فلزی 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 است؛ در ادامه نیز از نیمه دوم اردیبهشت ماه حرکت شاخص با معاملات حقیقی های بازار همراه شده است.