



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۵/۱۵

اطلاعات کلی بازار در پایان روز پانزدهم مرداد ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۴.۰۵	۵,۱۰۶,۷۲۴	۴,۹۰۸,۰۵۳	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۴.۹۵	۱,۷۹۰,۸۶۷	۱,۷۰۶,۳۲۹	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۲۴.۰۳	۱۹,۳۹۶	۱۵,۶۳۸	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۴.۰۵	۱۳۳,۶۴۶	۱۲۸,۴۴۸	شاخص کل بازار بورس
۰.۳۹	۱۸,۹۵۹	۱۸,۸۸۵	شاخص هم وزن بازار بورس
۳.۶۲	۱,۵۲۷	۱,۴۷۴	شاخص کل بازار فرابورس
وبصادر، شبندر، شهبهرن، و صندوق			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
زاگرس، شفن، کفرا			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۵۱۹۸ واحد رشد داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۱۹.۱۰	۵۴۳۴۹	مارون
۱۱.۶۲	۵۵۰۹۲	زاگرس
۴.۷۸	۱۶۵۶	ذوب
۴.۱۰	۳۱۱۳	هرمز
۲.۳۷	۲۹۰۲	میدکو
۲.۲۸	۶۶۳۶	ارفع
۲.۱۷	۹۰۲۵	دماوند

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۵۰۲.۴۷	۸۰۶۵	فارس
۴۸۷.۳۱	۷۷۶۵	فخاس
۴۳۹.۶۶	۴۸۵۱	فولاد
۳۱۷.۶۵	۱۰۶۶	وبصادر
۲۷۳.۲۲	۳۶۵۶	فملی
۲۷۰.۸۶	۳۶۲۲۹	پارس
۲۴۲.۱۳	۶۰۳۴	کگل

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز پانزدهم مرداد ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۴۳%	۷۲۰,۸۳۳	۷۲۳,۹۳۲	ارزش کل بازار بدهی
۱۳۵۰.۳۲%	۲,۹۱۵	۲۰۱	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۰.۴%	۲۸.۷۹%	۲۸.۹۰%	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۵/۱۵

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	دارویی	۴۲	۸,۰۵۹	۸,۰۳۸	-۰.۳%	۱۶۶,۰۴۸,۲۱۱	۱,۳۰۰,۴۷۰,۰۶۷	۶۸۳.۲%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۳۱۴	۳۴۰	۸.۳%	۱۷۰,۷۸۹,۳۲۴	۱,۰۳۹,۰۶۶,۶۱۸	۵۰۸.۴%
	شیمیایی	۳	۹,۳۰۰	۹,۷۴۱	۴.۷%	۱,۵۷۲,۳۷۲,۵۸۰	۴,۷۸۲,۸۹۱,۷۹۲	۲۰۴.۲%
	چندرشته ای صنعتی	۵	۱۴,۴۲۹	۱۴,۷۶۵	۲.۳%	۲۹۶,۵۵۲,۲۴۵	۸۹۱,۳۸۲,۷۰۲	۲۰۰.۶%
	فرآورده های نفتی	۲۶	۵۰۰,۶۲۷	۵۲۵,۲۹۴	۴.۹%	۵۸۵,۸۲۶,۳۷۴	۱,۶۷۹,۷۵۵,۲۴۸	۱۸۶.۷%
	فلزات اساسی	۷۵	۹۴,۳۵۷	۱۰۰,۶۷۰	۶.۷%	۱,۶۳۰,۶۵۵,۸۳۳	۴,۴۷۳,۸۰۲,۹۵۹	۱۷۴.۴%
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۳۷,۹۰۵	۳۹,۵۶۰	۴.۴%	۴۰۴,۱۱۰,۲۰۴	۱,۰۴۸,۸۹۷,۶۷۲	۱۵۹.۶%
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۵۰۶	۵۲۷	۴.۲%	۱۵۰,۱۲۴,۹۶۱	۳۷۳,۵۴۵,۹۱۵	۱۴۸.۸%
	سرمایه گذارها	۵۳	۲,۱۷۵	۲,۲۲۳	۲.۲%	۱۱۶,۰۵۸,۴۹۳	۱۹۰,۸۹۹,۳۷۱	۶۴.۵%
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۳۵۱	۳,۳۸۸	۱.۱%	۳۶,۷۲۴,۱۵۹	۴۶,۷۴۷,۷۵۹	۲۷.۳%
	وسایل ارتباطی	۹	۱,۵۳۱	۱,۴۷۹	-۳.۴%	۲۵,۳۴۲,۳۵۴	۳۲,۰۷۰,۷۸۳	۲۶.۶%
	خودرو و قطعات	۲۷	۱۴,۴۲۹	۱۴,۳۷۷	-۰.۴%	۲۷۳,۴۱۶,۸۳۵	۳۲۸,۰۰۸,۱۶۳	۲۰.۰%
	رایانه	۸	۱۳,۴۸۲	۱۳,۳۹۷	-۰.۶%	۸۱,۴۸۹,۸۷۳	۷۵,۹۳۵,۸۱۴	-۶.۸%
	مخابرات	۱۸	۱,۱۱۱	۱,۱۰۸	-۰.۳%	۴۲,۵۰۹,۸۸۰	۲۲,۲۹۴,۵۹۱	-۴۷.۶%
	فنی و مهندسی	۲۱	۶۵۵	۶۸۸	۵.۰%	۴۶,۷۴۲,۹۲۳	۲۱,۵۲۲,۶۸۸	-۵۴.۰%

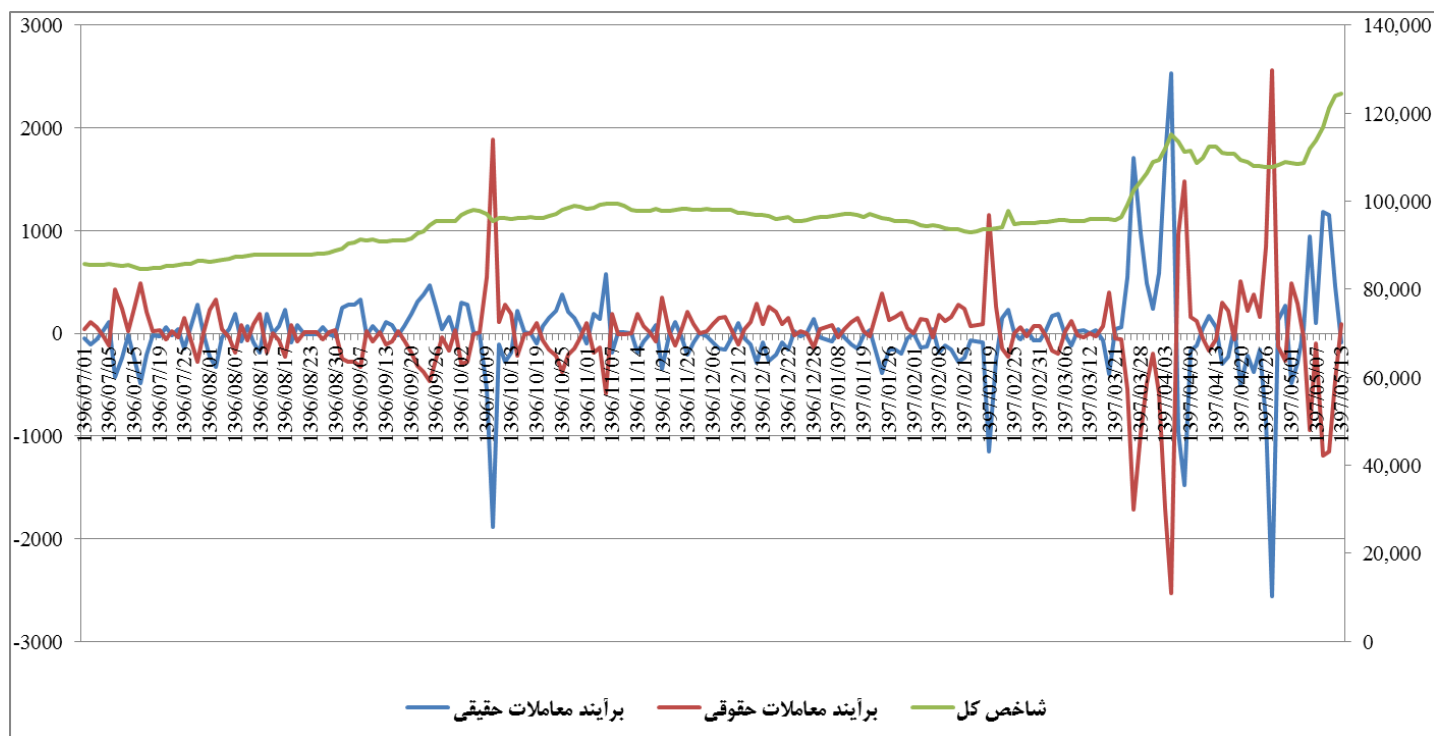
با توجه به جدول فوق، در صنایع دارویی، عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم و شیمیایی در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع فنی و مهندسی و مخابرات بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۱۵

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	۳۵۹,۳۴۶	۵۲۵,۲۹۴	۴۶.۱۸٪	۳۸۲,۲۴۰	۵۲۴,۱۳۳	۳۷.۱۲٪
	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۲۹,۱۱۲	۳۹,۵۶۰	۳۵.۸۹٪	۳۴۲,۳۹۱	۴۶۴,۲۸۴	۳۵.۶۳٪
	فلزات اساسی	۴۲	۷۳,۰۴۶	۱۰۰,۶۷۰	۳۷.۸۲٪	۸۲۹,۹۹۵	۱,۰۹۲,۴۱۷	۳۱.۶۲٪
	شیمیایی	۲۶	۷,۱۶۹	۹,۷۴۱	۳۵.۸۸٪	۱,۴۴۵,۸۶۳	۱,۸۸۶,۵۷۷	۳۰.۴۸٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۱,۰۹۶	۱۴,۷۶۵	۳۳.۰۷٪	۲۵۰,۱۰۶	۳۲۴,۲۸۸	۲۹.۶۶٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۲۵۲	۳۴۰	۳۴.۹۲٪	۱۳۳,۶۶۹	۱۶۸,۱۶۰	۲۵.۸۰٪
	فنی و مهندسی	۱۵	۶۰۲	۶۸۸	۱۴.۲۹٪	۶۲۹,۹۲۵	۶۹۷,۷۱۰	۱۰.۷۸٪
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۰۲۵	۲,۲۲۳	۹.۷۸٪	۱۰۲,۲۱۱	۱۰۹,۱۴۸	۶.۷۹٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۵۰۱	۵۲۷	۵.۱۹٪	۳۴۱,۳۵۶	۳۵۱,۷۶۴	۳.۰۵٪
	مخابرات	۳	۱,۱۴۱	۱,۱۰۸	-۲.۸۹٪	۱۳۸,۵۶۶	۱۳۷,۲۹۰	-۰.۹۲٪
	دارویی	۹	۸,۳۸۲	۸,۰۳۸	-۴.۱۰٪	۱۲۷,۸۱۹	۱۲۳,۸۴۵	-۳.۱۱٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۳,۵۶۷	۳,۳۸۸	-۵.۰۲٪	۷۷,۹۸۴	۷۴,۱۸۷	-۴.۸۷٪
	وسایل ارتباطی	۴۵	۱,۴۹۱	۱,۴۷۹	-۰.۸۰٪	۱۱۶,۷۸۴	۱۱۰,۷۲۵	-۵.۱۹٪
	رایانه	۲۵	۱۴,۱۵۳	۱۳,۳۹۷	-۵.۳۴٪	۱۶۳,۷۶۱	۱۵۵,۱۴۱	-۵.۲۶٪
خودرو و قطعات	۵	۱۵,۶۹۳	۱۴,۳۷۷	-۸.۳۹٪	۱۴۸,۲۶۸	۱۳۵,۳۳۷	-۸.۷۳٪	

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.