



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۵/۱۶

اطلاعات کلی بازار در پایان روز شانزدهم مرداد ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۰۵)	۵,۱۰۴,۳۳۲	۵,۱۰۶,۷۲۴	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۰.۰۶	۱,۷۹۱,۹۱۷	۱,۷۹۰,۸۶۷	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۲۹.۳۹)	۱۳,۶۹۴	۱۹,۳۹۶	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۰.۱۹	۱۳۳,۵۸۴	۱۳۳,۳۲۸	شاخص کل بازار بورس
۰.۰۴	۱۸,۹۵۰	۱۸,۹۴۳	شاخص هم وزن بازار بورس
۰.۳۲	۱,۵۳۲	۱,۵۲۷	شاخص کل بازار فرابورس
شبریز، رمپنا			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
پارسان، ومعادن، جم، شیران			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۲۵۶ واحد رشد داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۵.۱۸)	۳۷۸۴	میدکو
۴.۴۸	۵۴۹۵۶	مارون
۳.۹۹	۳۲۵۷	هرمز
۳.۶۱	۱۷۱۵	ذوب
(۱.۸۸)	۶۳۸۲	ارفع
۱.۲۹	۱۷۵۹۰	شاون
(۱.۱۰)	۴۶۱۸	سرچشمه

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۱۳۸.۱۸	۳۷۴۴	فملی
۱۱۰.۲۳	۳۸۷۵	پارسان
(۹۷.۳۵)	۳۳۳۳	رمپنا
۸۳.۹۱	۱۴۶۳۵	همراه
۷۸.۸۳	۱۱۸۴۰	شپدیس
(۷۴.۵۹)	۳۳۳۱	وامید
(۷۱.۶۰)	۵۹۵۸	کگل

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز شانزدهم مرداد ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۱۸٪	۷۲۲,۱۰۱	۷۲۰,۸۳۳	ارزش کل بازار بدهی ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال) متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)
-۸۰.۳۷٪	۵۷۲	۲,۹۱۵	
۵.۵٪	۳۰.۳۷٪	۲۸.۷۹٪	

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۶/۰۵/۱۳۹۷

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	۳۴۰	۳۴۶	۱.۸٪	۲۱۱,۷۰۶,۸۵۰	۶۱۸,۲۰۲,۶۴۴	۱۹۲.۰٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۵۲۵,۲۹۴	۵۲۱,۹۲۵	-۰.۶٪	۶۷۸,۱۶۲,۷۸۴	۱,۵۰۰,۵۵۲,۳۳۳	۱۲۱.۳٪
	فنی و مهندسی	۲۱	۶۸۸	۶۵۱	-۵.۴٪	۵۳,۱۳۵,۳۹۱	۱۰۶,۶۰۳,۷۱۶	۱۰۰.۶٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۰۰,۶۷۰	۱۰۱,۲۵۴	۰.۶٪	۱,۸۳۲,۲۵۶,۰۸۳	۳,۲۴۸,۰۴۴,۵۰۵	۷۷.۳٪
	شیمیایی	۳	۹,۷۴۱	۹,۷۸۶	۰.۵٪	۱,۶۸۷,۲۱۵,۳۷۲	۲,۹۳۰,۷۷۷,۴۸۸	۷۳.۷٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۱۴,۳۷۷	۱۴,۷۹۷	۲.۹٪	۲۷۴,۲۸۰,۱۷۹	۴۳۶,۴۶۲,۰۱۳	۵۹.۱٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۳۹,۵۶۰	۳۹,۴۴۲	-۰.۳٪	۴۴۳,۳۷۴,۹۰۴	۷۰۲,۶۶۴,۸۳۳	۵۸.۵٪
	رایانه	۸	۱۳,۳۹۷	۱۳,۳۶۲	-۰.۳٪	۸۸,۹۹۰,۰۹۴	۱۳۷,۹۹۵,۸۹۸	۵۵.۱٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۵۲۷	۵۱۴	-۲.۵٪	۱۲۵,۲۹۰,۵۱۷	۱۶۸,۵۹۰,۷۲۲	۳۴.۶٪
	چندرشته ای صنعتی	۵	۱۴,۷۶۵	۱۴,۴۳۶	-۲.۲٪	۳۲۰,۷۱۴,۵۰۱	۳۸۹,۲۰۶,۴۰۹	۲۱.۴٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۲,۲۲۳	۲,۱۹۵	-۱.۳٪	۱۲۳,۵۶۱,۸۲۸	۱۲۵,۶۱۰,۱۹۷	۱.۷٪
	مخابرات	۱۸	۱,۱۰۸	۱,۱۲۰	۱.۱٪	۴۳,۵۶۷,۷۴۴	۳۱,۰۳۷,۳۰۶	-۲۸.۸٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۳۸۸	۳,۴۰۸	۰.۶٪	۳۷,۶۰۳,۴۳۹	۲۴,۳۵۸,۸۹۷	-۳۵.۲٪
	وسایل ارتباطی	۹	۱,۴۷۹	۱,۴۲۸	-۳.۴٪	۲۵,۳۹۳,۳۶۶	۱۵,۱۹۴,۲۸۶	-۴۰.۲٪
دارویی	۴۲	۸,۰۳۸	۸,۰۹۰	۰.۶٪	۱۶۶,۱۹۷,۶۹۷	۵۳,۳۰۶,۳۱۲	-۶۷.۹٪	

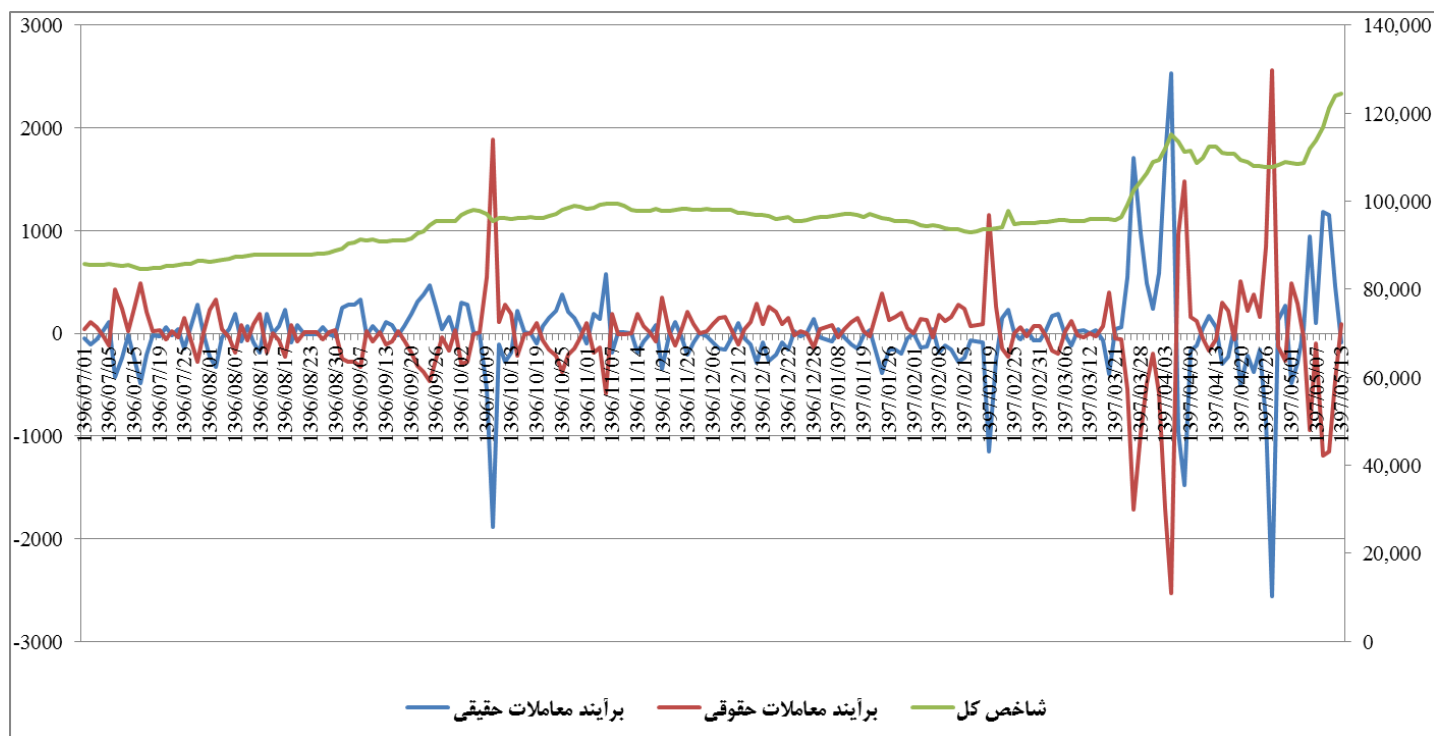
با توجه به جدول فوق، در صنایع عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم و فرآورده های نفتی در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و دارویی و وسایل ارتباطی بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۱۶

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص 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	۳۵۸,۸۲۰	۵۲۱,۹۲۵	۴۵.۴۶%	۳۸۱,۵۶۱	۵۲۳,۲۹۰	۳۷.۱۴%
	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۲۹,۵۲۴	۳۹,۴۴۲	۳۳.۵۹%	۳۴۶,۷۲۸	۴۶۲,۹۱۸	۳۳.۵۱%
	فلزات اساسی	۴۲	۷۲,۵۹۸	۱۰۱,۲۵۴	۳۹.۴۷%	۸۲۴,۷۹۲	۱,۰۹۷,۵۷۸	۳۳.۰۷%
	شیمیایی	۲۶	۷,۱۸۲	۹,۷۸۶	۳۶.۲۶%	۱,۴۴۹,۷۱۳	۱,۸۹۳,۵۰۴	۳۰.۶۱%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۲۵۲	۳۴۶	۳۷.۳۰%	۱۳۳,۴۹۲	۱۶۹,۴۴۹	۲۶.۹۴%
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۱,۰۹۴	۱۴,۴۳۶	۳۰.۱۲%	۲۵۰,۱۰۰	۳۱۷,۱۰۹	۲۶.۷۹%
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۰۱۹	۲,۱۹۵	۸.۷۳%	۱۰۱,۹۵۵	۱۰۸,۰۲۵	۵.۹۵%
	فنی و مهندسی	۱۵	۶۰۲	۶۵۱	۸.۱۴%	۶۲,۸۹۰	۶۵,۹۴۱	۴.۸۵%
	مخابرات	۳	۱,۱۳۰	۱,۱۲۰	-۰.۸۸%	۱۳۸,۵۹۵	۱۴۰,۴۹۶	۱.۳۷%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۵۰۵	۵۱۴	۱.۷۸%	۳۴۳,۸۳۹	۳۴۵,۲۴۰	۰.۴۱%
	دارویی	۹	۱,۴۷۳	۸,۰۹۰	۴۴۹.۲۲%	۱۲۷,۱۸۰	۱۲۴,۴۳۳	-۲.۱۶%
	وسایل ارتباطی	۴۵	۱,۴۷۳	۱,۴۲۸	-۳.۰۵%	۱۱۴,۳۰۲	۱۱۰,۰۱۵	-۳.۷۵%
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۳,۵۶۶	۳,۴۰۸	-۴.۴۳%	۷۷,۲۷۳	۷۴,۲۱۳	-۳.۹۶%
	رایانه	۲۵	۱۴,۰۹۰	۱۳,۳۶۲	-۵.۱۷%	۱۶۳,۰۵۹	۱۵۴,۶۸۹	-۵.۱۳%
خودرو و قطعات	۵	۱۵,۶۸۱	۱۴,۷۹۷	-۵.۶۴%	۱۴۸,۶۴۳	۱۳۹,۱۷۴	-۶.۳۷%	

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.