



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۶/۱۰

اطلاعات کلی بازار در پایان روز دهم شهریور ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۹۹)	۵,۱۹۲,۶۲۳	۵,۲۴۴,۶۰۴	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۰.۰۴	۱,۸۲۰,۹۶۸	۱,۸۲۰,۳۰۵	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۲۷.۲۸)	۸,۸۹۶	۱۲,۲۳۳	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۰.۹۹)	۱۳۶,۱۱۰	۱۳۷,۴۷۲	شاخص کل بازار بورس
۱.۴۳	۲۱,۶۶۰	۲۱,۳۵۵	شاخص هم وزن بازار بورس
(۰.۶۹)	۱,۵۴۵	۱,۵۵۶	شاخص کل بازار فرابورس
زنگان، سپاه، کیمیا، وتوکا			بازگشایی نماد های مهم و تاثیر گذار
ولسپا، کمنگنز			توقف نمادهای مهم و تاثیر گذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۱۳۶۲ واحد افت داشته است.

تاثیر در شاخص های بورس و فرابورس در پایان روز دهم شهریور ماه ۱۳۹۷

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۴.۰۷)	۳۴۲۰	هرمز	(۱۸۰.۸۶)	۴۵۳۲	فولاد
(۳.۷۱)	۵۱۲۸۹	زاگرس	(۱۳۵.۲۵)	۳۸۷۷	فملی
(۲.۷۶)	۱۸۹۴	ذوب	(۱۳۱.۰۶)	۷۶۸۰	فارس
(۱.۸۱)	۱۹۱۱۱	شاون	(۱۰۶.۳۲)	۹۰۸۰	فخوز
(۱.۰۴)	۴۶۰۰	شپاس	(۱۰۵.۸۴)	۳۳۹۱۷	پارس
۱.۰۰	۲۸۷۷	حنزر	(۱۰۲.۳۷)	۹۵۶۹	شبندر
(۰.۹۸)	۲۳۱۱۰	شراز	(۹۱.۲۲)	۵۳۴۳	شپنا

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز دهم شهریور ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۳۸٪	۷۵۸,۰۴۵	۷۵۵,۱۹۸	ارزش کل بازار بدهی
-۳۷.۹۵٪	۷۴۴	۱,۲۰۰	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۵.۹٪	۲۷.۴۷٪	۲۹.۱۹٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۶/۱۰

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	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۵۵۵	۵۶۹	۲.۵٪	۳۴۲,۳۱۳,۴۱۵	۱,۷۱۵,۴۱۶,۹۷۲	۴۰.۱٪
	دارویی	۴۲	۸,۷۷۷	۹,۱۰۱	۳.۷٪	۷۵,۶۴۳,۵۰۸	۱۸۲,۱۱۵,۵۹۶	۱۴۰.۸٪
	وسایل ارتباطی	۹	۱,۷۸۸	۱,۸۰۸	۱.۱٪	۴۱,۵۳۵,۳۴۹	۸۸,۸۵۴,۷۲۰	۱۱۳.۹٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۴۷۱	۳,۶۱۸	۴.۲٪	۷۴,۱۰۷,۴۱۵	۱۴۳,۱۱۰,۹۷۲	۹۳.۱٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۲,۴۵۳	۲,۴۶۴	۰.۴٪	۱۷۷,۴۹۳,۲۹۹	۲۰۱,۶۰۹,۹۶۲	۱۳.۶٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۱۷,۲۳۲	۱۶,۶۲۳	-۳.۵٪	۳۸۹,۳۲۵,۵۲۲	۳۸۳,۱۵۷,۵۷۸	-۱.۶٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۳۸,۱۸۶	۳۷,۶۶۵	-۱.۴٪	۳۳۷,۳۵۳,۱۲۱	۳۲۰,۶۷۱,۷۳۸	-۴.۹٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۵۳۹,۴۰۲	۵۲۲,۹۳۴	-۳.۱٪	۷۷۴,۶۳۴,۳۴۱	۶۰۹,۰۸۵,۴۸۳	-۲۱.۴٪
	شیمیایی	۳	۹,۴۸۱	۹,۳۷۴	-۱.۱٪	۱,۴۱۷,۷۲۸,۰۵۳	۹۶۳,۴۲۷,۸۱۷	-۳۲.۰٪
	مخابرات	۱۸	۱,۲۰۴	۱,۲۰۶	۰.۲٪	۱۱,۵۱۳,۵۷۰	۶,۵۶۹,۳۸۱	-۴۲.۹٪
	رایانه	۸	۱۵,۱۷۲	۱۵,۲۲۰	۰.۳٪	۸۷,۴۲۱,۹۵۴	۴۸,۸۴۳,۹۳۴	-۴۴.۱٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۰۵,۰۵۸	۱۰۳,۰۴۳	-۱.۹٪	۲,۰۶۶,۴۱۸,۰۶۳	۱,۱۳۰,۹۴۸,۲۶۱	-۴۵.۳٪
	فنی و مهندسی	۲۱	۸۷۳	۸۴۴	-۳.۳٪	۱۵۱,۷۰۹,۸۴۷	۷۰,۲۳۴,۴۳۲	-۵۳.۷٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۳۶۱	۳۵۳	-۲.۲٪	۱۷۹,۳۳۸,۰۵۷	۸۱,۱۷۶,۵۰۲	-۵۴.۷٪
	چندرشته ای صنعتی	۵	۱۴,۱۴۲	۱۳,۷۶۵	-۲.۷٪	۲۰۵,۴۴۱,۴۸۸	۸۶,۶۴۱,۲۵۸	-۵۷.۸٪

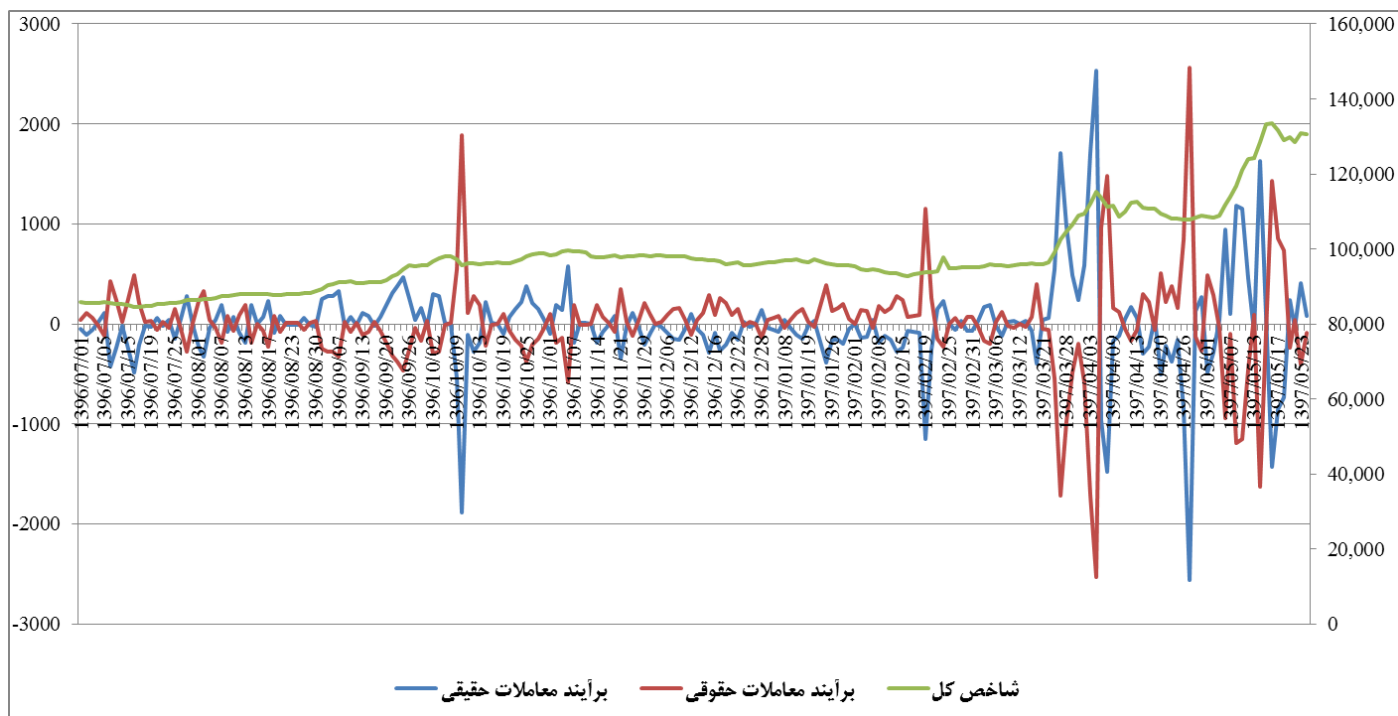
با توجه به جدول فوق، در صنایع بانکی و دارویی، در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع چند رشته ای صنعتی و عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۱۰

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	فنی و مهندسی	۱۵	۶۴۷	۸۴۴	۳۰.۴۵٪	۶۵,۵۵۹	۸۵,۵۸۴	۳۰.۵۵٪
	دارویی	۹	۸,۰۹۰	۹,۱۰۱	۱۲.۵۰٪	۱۲۴,۴۴۷	۱۴۱,۶۹۲	۱۳.۸۶٪
	خودرو و قطعات	۵	۱۵,۳۸۸	۱۶,۶۲۳	۸.۰۳٪	۱۴۷,۰۹۶	۱۶۴,۶۰۴	۱۱.۹۰٪
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۱۷۰	۲,۴۶۴	۱۳.۵۵٪	۱۰۶,۹۳۱	۱۱۹,۳۳۹	۱۱.۶۰٪
	رایانه	۲۵	۱۳,۹۶۵	۱۵,۲۲۰	۸.۹۹٪	۱۶۱,۶۱۰	۱۷۶,۲۵۴	۹.۰۶٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۳۲۴	۳۵۳	۸.۹۵٪	۱۵۹,۹۸۱	۱۷۴,۲۷۸	۸.۹۴٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۳,۴۷۴	۳,۶۱۸	۴.۱۵٪	۷۵,۶۳۷	۸۱,۷۲۸	۸.۰۵٪
	وسایل ارتباطی	۴۵	۱,۶۳۳	۱,۸۰۸	۱۰.۷۳٪	۱۰۹,۵۲۰	۱۱۷,۶۶۴	۷.۴۴٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۵۲۳	۵۶۹	۸.۸۰٪	۳۴۹,۹۱۹	۳۷۴,۲۸۰	۶.۹۶٪
	فرآورده های نفتی	۱۸	۴۹۸,۴۷۰	۵۲۲,۹۳۴	۴.۹۱٪	۵۰۳,۶۰۹	۵۳۳,۰۳۴	۵.۸۴٪
	مخابرات	۳	۱,۱۳۵	۱,۲۰۶	۶.۲۶٪	۱۴۴,۵۶۶	۱۵۲,۱۰۲	۵.۲۱٪
	فلزات اساسی	۴۲	۹۹,۸۲۱	۱۰۳,۰۴۳	۳.۲۳٪	۱,۰۸۳,۷۲۷	۱,۱۱۸,۷۸۲	۳.۲۳٪
	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۳۶,۸۹۴	۳۷,۶۶۵	۲.۰۹٪	۴۳۳,۱۶۲	۴۴۲,۶۵۵	۲.۱۹٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۳,۵۶۵	۱۳,۷۶۵	۱.۴۷٪	۲۹۷,۹۷۴	۳۰۲,۳۸۵	۱.۴۸٪
	شیمیایی	۲۶	۹,۲۸۶	۹,۳۷۴	۰.۹۵٪	۱,۸۰۰,۲۵۹	۱,۸۰۴,۶۵۳	۰.۲۴٪

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های فنی و مهندسی و دارویی 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 و در سه ماهه اول سال ۹۷، روند حرکتی شاخص کل با معاملات سهامداران حقوقی همسو شده است اما از اوایل تابستان بازهم شاهد همسویی شاخص با معاملات حقیقی ها هستیم.