



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۶/۱۸

اطلاعات کلی بازار در پایان روز هجدهم شهریور ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۱.۸۵	۵,۴۲۴,۱۵۷	۵,۳۲۵,۷۸۶	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۷.۵۴	۲,۰۲۹,۷۳۱	۱,۸۸۷,۴۷۰	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۸۲.۹۶)	۱۲,۷۴۷	۷۴,۸۰۹	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۱.۸۷	۱۴۲,۲۳۴	۱۳۹,۶۲۹	شاخص کل بازار بورس
۲.۸۰	۲۳,۴۳۷	۲۲,۷۹۸	شاخص هم وزن بازار بورس
۱.۷۲	۱,۶۴۳	۱,۶۱۵	شاخص کل بازار فرابورس
مرقام، شکرین، خازین، کماسه، ونیکی			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
شپنا، شاون، شیریز، شراز، فیهنر، خیهمن، سمگا، زمگسا			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۲۶۰۵ واحد رشد داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۶.۱۳	۲۱۰۲	ذوب	۱۸۱.۲۶	۱۱۱۰۲	شبندر
۴.۶۵	۲۷۲۳	میدکو	۱۶۷.۷۹	۷۷۷۵	فارس
۳.۱۱	۵۱۷۰۴	مارون	۱۵۱.۱۷	۳۴۳۰۰	پارس
۲.۶۲	۲۸۹۸۲	شراز	۱۴۷.۵۹	۴۲۳۱	پارسان
۲.۳۳	۲۳۲۲۲	شاون	۱۲۲.۷۰	۱۶۸۷	وغدیر
۱.۷۵	۵۴۰۴۶	زاگرس	۱۱۲.۷۴	۴۵۷۰	رمپنا
۱.۵۵	۱۰۵۵۹	خراسان	۱۰۰.۶۸	۱۵۱۸۶	شپدیس

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز هجدهم شهریور ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۰۲٪	۷۵۸,۱۷۸	۷۵۸,۰۱۸	ارزش کل بازار بدهی
-۸۱.۳۸٪	۱۴۹	۷۹۸	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۰.۲٪	۲۶.۸۱٪	۲۶.۷۵٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۶/۱۸

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	چندرشته ای صنعتی	۵	۱۳,۹۳۰	۱۴,۴۱۵	۳.۵٪	۲۰۷,۰۸۰,۴۲۸	۵۰۶,۲۴۸,۳۱۳	۱۴۴.۵٪
	شیمیایی	۳	۹,۴۸۵	۹,۷۲۰	۲.۵٪	۱,۵۱۴,۱۵۶,۹۶۸	۲,۷۶۳,۵۵۸,۳۰۱	۸۲.۵٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۳۵۲	۳۶۰	۲.۳٪	۱۴۱,۸۰۲,۶۳۷	۲۴۲,۱۴۴,۷۱۸	۷۰.۸٪
	رایانه	۸	۱۵,۶۶۹	۱۵,۸۲۲	۱.۰٪	۸۵,۲۳۶,۷۶۰	۱۴۳,۳۴۳,۰۱۹	۶۸.۲٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۱۸,۱۹۶	۱۸,۷۳۳	۳.۰٪	۵۰۱,۹۹۹,۵۵۳	۸۰۸,۸۴۴,۸۲۰	۶۱.۱٪
	دارویی	۴۲	۹,۱۱۱	۹,۲۲۸	۱.۳٪	۱۱۲,۶۲۱,۵۳۶	۱۷۲,۹۰۹,۳۳۵	۵۳.۵٪
	فنی و مهندسی	۲۱	۸۷۵	۹۱۸	۴.۹٪	۱۷۷,۶۲۱,۹۰۱	۲۶۹,۳۵۸,۱۴۰	۵۱.۶٪
	مخابرات	۱۸	۱,۱۹۶	۱,۱۹۲	-۰.۳٪	۸,۲۲۵,۶۷۳	۱۱,۷۶۳,۸۵۵	۴۳.۰٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۲,۵۴۵	۲,۶۳۶	۳.۶٪	۲۲۹,۵۹۴,۴۸۳	۲۹۴,۱۰۱,۰۷۷	۲۸.۱٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۶۵۸	۳,۸۰۸	۴.۱٪	۱۱۱,۹۶۶,۶۷۶	۱۲۶,۵۵۱,۴۱۰	۱۳.۰٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۵۷۲	۵۸۳	۱.۹٪	۵۴۱,۵۰۰,۲۶۹	۵۹۵,۹۵۰,۷۷۹	۱۰.۱٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۳۷,۸۶۹	۳۸,۱۵۰	۰.۷٪	۳۵۴,۶۱۴,۴۱۶	۳۶۱,۵۳۹,۹۱۷	۲.۰٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۰۵,۱۸۸	۱۰۵,۳۸۶	۰.۲٪	۱,۷۵۳,۷۳۵,۱۹۸	۱,۳۴۹,۰۷۰,۱۴۱	-۲۳.۱٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۵۸۴,۹۶۳	۶۰۰,۵۱۴	۲.۷٪	۸۱۵,۶۳۶,۸۳۵	۴۲۷,۵۸۱,۰۰۳	-۴۷.۶٪
وسایل ارتباطی	۹	۱,۹۱۶	۲,۰۱۲	۵.۰٪	۲۵۰,۱۳۳,۷۹۰	۶۲,۹۲۷,۰۷۷	-۷۴.۸٪	

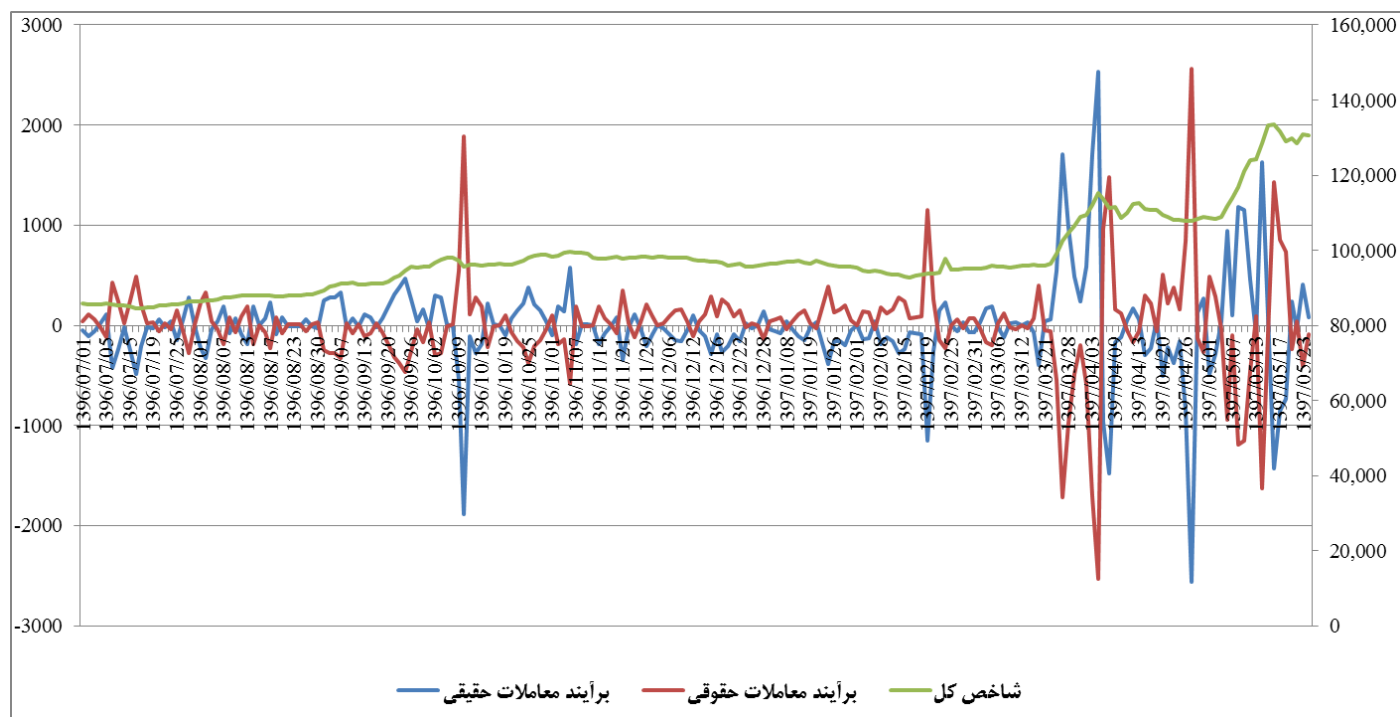
با توجه به جدول فوق، در صنایع چند رشته ای صنعتی و شیمیایی، در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع وسایل ارتباطی و فرآورده های نفتی بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۱۸

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	فنی و مهندسی	۱۵	۷۳۵	۹۱۸	۲۴.۹۰٪	۷۴,۵۴۸	۹۳,۱۷۸	۲۴.۹۹٪
	خودرو و قطعات	۵	۱۵,۴۰۰	۱۸,۷۳۳	۲۱.۶۴٪	۱۵۲,۷۰۵	۱۸۵,۰۹۸	۲۱.۲۱٪
	فرآورده های نفتی	۱۸	۵۰۶,۸۲۷	۶۰۰,۵۱۴	۱۸.۴۹٪	۵۱۹,۲۴۶	۶۱۳,۰۹۸	۱۸.۰۷٪
	دارویی	۹	۸,۰۸۷	۹,۲۲۸	۱۴.۱۱٪	۱۲۴,۹۷۰	۱۴۴,۰۵۱	۱۵.۲۷٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۳,۳۷۸	۳,۸۰۸	۱۲.۷۳٪	۷۴,۵۳۲	۸۵,۶۳۹	۱۴.۹۰٪
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۲۸۰	۲,۶۳۶	۱۵.۶۹٪	۱۱۲,۰۶۹	۱۲۸,۵۱۷	۱۴.۶۸٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۵۳۰	۵۸۳	۱۰.۰۰٪	۳۵۳,۰۶۹	۳۸۲,۰۴۲	۸.۲۱٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۳۵۱	۳۶۰	۲.۵۶٪	۱۶۹,۷۱۰	۱۷۸,۱۳۴	۵.۳۲٪
	وسایل ارتباطی	۴۵	۱,۷۱۴	۲,۰۱۲	۱۷.۳۹٪	۱۱۶,۱۷۹	۱۱۷,۶۱۰	۱.۳۳٪
	شیمیایی	۲۶	۹,۷۰۷	۹,۷۲۰	۰.۱۳٪	۱,۸۱۳,۲۷۴	۱,۸۱۷,۷۷۸	۰.۲۴٪
	رایانه	۲۵	۱۵,۸۹۳	۱۵,۸۲۲	-۰.۴۵٪	۱۸۳,۴۲۵	۱۸۳,۴۹۹	۰.۰۴٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۴,۵۴۹	۱۴,۴۱۵	-۰.۹۲٪	۳۱۹,۵۸۰	۳۱۶,۶۱۴	-۰.۹۳٪
	فلزات اساسی	۴۲	۱۰۸,۷۴۴	۱۰۵,۳۸۶	-۳.۰۹٪	۱,۱۷۴,۸۸۴	۱,۱۵۷,۶۸۹	-۱.۴۶٪
	مخابرات	۳	۱,۲۰۵	۱,۱۹۲	-۱.۰۸٪	۱۵۳,۴۰۸	۱۴۹,۹۸۱	-۲.۲۳٪
استخراج کانه های فلزی	۵۳	۳۹,۳۷۰	۳۸,۱۵۰	-۳.۱۰٪	۴۶۲,۳۱۴	۴۴۸,۲۰۲	-۳.۰۵٪	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های فنی و مهندسی و خودرویی دیده می شود.

نمودار تغییرات مالکیت سهامداری و جهت شاخص



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.