



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۶/۱۹

اطلاعات کلی بازار در پایان روز نوزدهم شهریور ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۳.۴۲	۵,۶۰۹,۵۲۲	۵,۴۲۴,۱۵۷	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۹.۳۱)	۱,۸۴۰,۷۷۵	۲,۰۲۹,۷۳۱	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۲۷.۷۶	۱۶,۲۸۵	۱۲,۷۴۷	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۳.۲۵	۱۴۶,۹۹۹	۱۴۲,۲۳۴	شاخص کل بازار بورس
۲.۹۸	۲۴,۱۳۴	۲۳,۴۳۷	شاخص هم وزن بازار بورس
۲.۶۵	۱,۶۸۶	۱,۶۴۳	شاخص کل بازار فرابورس
شپنا، شتران، شاون، شیریز، سراز، فابهنر، خبهمن، سمگا			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
کرمان، قشیر، قثابت، پخش، شلعاب			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۴۷۶۴ واحد رشد داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۶.۷۰	۵۲۶۱۱	مارون	۴۵۱.۳۶	۴۹۰.۳	فولاد
۶.۴۴	۲۲۰۷	ذوب	۲۴۶.۸۰	۵۶۶۵	کگل
۵.۵۲	۳۱۸۹۱	سراز	۲۲۹.۲۱	۴۰۹۶	فملی
۵.۰۷	۳۹۲۳	هرمز	۱۹۲.۴۶	۱۱۶۳۵	شبندر
۴.۴۴	۲۵۳۲۲	شاون	۱۸۲.۶۴	۶۶۶۸	شپنا
۳.۰۷	۲۷۹۳	میدکو	۱۷۲.۷۳	۱۷۱۷	تاپیکو
۱.۹۵	۳۳۲۱	سمگا	۱۷۲.۷۰	۵۲۲۹	شتران

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز نوزدهم شهریور ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۰۵٪	۷۵۷,۷۷۱	۷۵۸,۱۷۸	ارزش کل بازار بدهی
۹۶.۳۳٪	۲۹۲	۱۴۹	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۱.۱٪	۲۷.۱۰٪	۲۶.۸۱٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۶/۱۹

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	۱۴,۴۱۵	۱۵,۰۵۸	۴.۵٪	۲۳۰,۲۰۵,۹۶۴	۸۵۶,۰۱۹,۸۲۶	۲۷۱.۸٪
	مخابرات	۱۸	۱,۱۹۲	۱,۲۱۹	۲.۳٪	۹,۱۸۰,۴۷۵	۲۸,۲۹۲,۳۰۴	۲۰۸.۲٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۳۶۰	۳۷۴	۳.۹٪	۱۴۹,۴۸۶,۳۱۶	۳۳۲,۸۶۹,۹۴۲	۱۲۲.۷٪
	رایانه	۸	۱۵,۸۲۲	۱۶,۰۳۵	۱.۳٪	۹۲,۷۸۵,۱۳۹	۱۹۵,۳۸۷,۱۵۷	۱۱۰.۶٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۳۸,۱۵۰	۳۹,۹۹۳	۴.۸٪	۳۴۶,۴۳۴,۹۱۰	۷۲۶,۷۱۷,۶۱۵	۱۰۹.۸٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۲,۶۳۶	۲,۷۳۷	۳.۸٪	۲۵۲,۹۵۱,۹۹۹	۵۰۲,۸۰۲,۷۰۸	۹۸.۸٪
	فنی و مهندسی	۲۱	۹۱۸	۹۶۲	۴.۸٪	۱۹۳,۷۳۰,۷۷۴	۳۱۲,۲۸۷,۰۲۳	۶۱.۲٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۶۰,۵۱۴	۶۳,۰۵۱۸	۵.۰٪	۸۴۶,۴۳۹,۷۱۶	۱,۳۵۵,۵۳۳,۷۹۸	۶۰.۱٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۱۸,۷۳۳	۱۸,۹۷۸	۱.۳٪	۵۳۷,۷۳۸,۳۶۵	۷۷۳,۴۰۷,۸۳۹	۴۳.۸٪
	شیمیایی	۳	۹,۷۲۰	۹,۹۹۸	۲.۹٪	۱,۵۶۲,۷۴۷,۷۱۸	۲,۲۳۹,۸۳۴,۵۶۶	۴۳.۳٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۰۵,۳۸۶	۱۰۹,۵۲۱	۳.۹٪	۱,۶۰۵,۵۰۵,۲۱۹	۲,۲۷۴,۰۴۵,۰۵۷	۴۱.۶٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۸۰۸	۳,۷۹۰	-۰.۵٪	۱۱۹,۸۵۰,۰۹۴	۱۵۳,۳۳۶,۰۹۷	۲۷.۹٪
	دارویی	۴۲	۹,۲۲۸	۹,۳۷۹	۱.۶٪	۱۱۹,۵۹۱,۵۵۷	۱۳۰,۸۴۰,۵۵۹	۹.۴٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۵۸۳	۵۹۷	۲.۴٪	۵۶۹,۵۲۵,۷۸۷	۴۰۲,۱۸۵,۳۸۰	-۲۹.۴٪
وسایل ارتباطی	۹	۲,۰۱۲	۲,۰۱۲	۰.۰٪	۲۵۴,۱۰۳,۸۶۱	۱۰۳,۲۱۲,۳۷۸	-۵۹.۴٪	

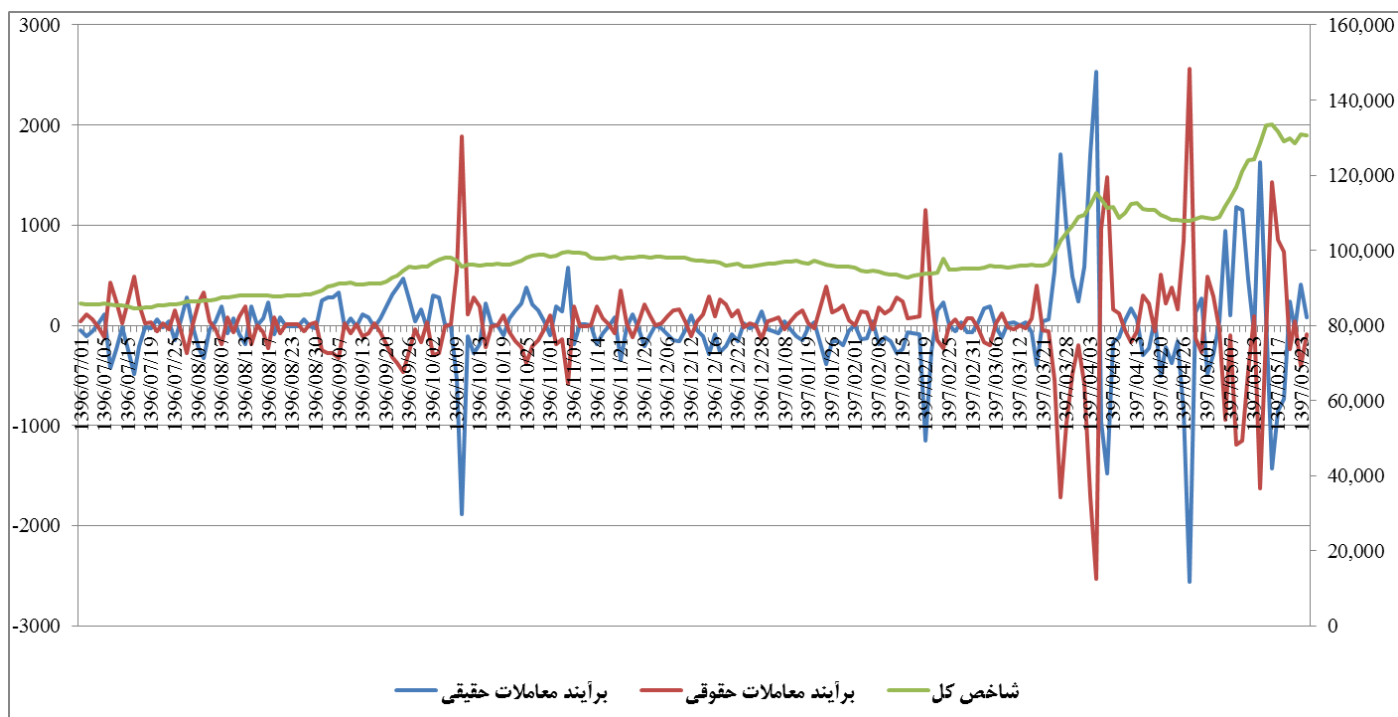
با توجه به جدول فوق، در صنایع چند رشته ای صنعتی و مخابرات، در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع وسایل ارتباطی و بانکها بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۱۹

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	۷۷۱	۹۶۲	۲۴.۷۷٪	۷۸,۲۱۶	۹۷,۶۸۵	۲۴.۸۹٪
	فرآورده های نفتی	۱۸	۵۲۰,۹۷۴	۶۳۰,۵۱۸	۲۱.۰۳٪	۵۳۴,۳۰۸	۶۴۵,۸۸۹	۲۰.۸۸٪
	خودرو و قطعات	۵	۱۵,۹۷۸	۱۸,۹۷۸	۱۸.۷۸٪	۱۵۸,۰۸۱	۱۸۸,۴۷۹	۱۹.۲۳٪
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۳۳۹	۲,۷۳۷	۱۷.۰۲٪	۱۱۴,۴۶۶	۱۳۳,۲۰۸	۱۶.۳۷٪
	دارویی	۹	۸,۱۱۷	۹,۳۷۹	۱۵.۵۵٪	۱۲۶,۱۱۴	۱۴۶,۷۳۳	۱۶.۳۴٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۳,۳۸۹	۳,۷۹۰	۱۱.۸۳٪	۷۴,۷۹۸	۸۵,۶۵۱	۱۴.۵۱٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۵۳۰	۵۹۷	۱۲.۶۴٪	۳۵۳,۰۴۳	۳۸۹,۸۷۵	۱۰.۴۳٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۳۶۰	۳۷۴	۳.۸۹٪	۱۷۲,۶۶۴	۱۸۴,۵۴۶	۶.۸۸٪
	وسایل ارتباطی	۴۵	۱,۶۹۴	۲,۰۱۲	۱۸.۷۷٪	۱۱۶,۰۶۹	۱۲۲,۹۷۶	۵.۹۵٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۴,۲۶۴	۱۵,۰۵۸	۵.۵۷٪	۳۱۳,۳۴۹	۳۳۰,۷۴۲	۵.۵۵٪
	فلزات اساسی	۴۲	۱۰۷,۸۱۰	۱۰۹,۵۲۱	۱.۵۹٪	۱,۱۶۴,۳۴۷	۱,۲۰۹,۱۱۹	۳.۸۵٪
	شیمیایی	۲۶	۹,۶۲۰	۹,۹۹۸	۳.۹۳٪	۱,۸۵۸,۸۲۳	۱,۹۲۸,۰۲۳	۳.۷۲٪
	رایانه	۲۵	۱۵,۵۷۶	۱۶,۰۳۵	۲.۹۵٪	۱۸۰,۰۶۳	۱۸۵,۹۳۷	۳.۲۶٪
	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۳۹,۲۳۲	۳۹,۹۹۳	۱.۹۴٪	۴۶۰,۶۹۰	۴۷۰,۰۹۹	۲.۰۴٪
مخابرات	۳	۱,۱۹۴	۱,۲۱۹	۲.۰۹٪	۱۵۱,۱۹۰	۱۵۱,۱۲۳	-۰.۰۴٪	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های فنی و مهندسی و فرآورده های نفتی 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.