



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۷/۱۰

اطلاعات کلی بازار در پایان روز دهم مهر ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۳.۷۰)	۷,۱۸۰,۹۷۷	۷,۴۵۷,۰۲۶	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۳.۱۲)	۲,۳۹۸,۷۷۸	۲,۴۷۵,۹۴۰	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۲۶.۰۵)	۲۱,۷۱۰	۲۹,۳۵۶	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۳.۶۹)	۱۸۸,۲۵۹	۱۹۵,۴۸۰	شاخص کل بازار بورس
(۲.۸۲)	۳۳,۰۵۰	۳۴,۰۰۷	شاخص هم وزن بازار بورس
(۳.۳۷)	۲,۱۶۶	۲,۲۴۱	شاخص کل بازار فرابورس
شبندر، تاپیکو، شاون، شنفت، شراز، بمپنا، صندوق، وبملت			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
دماوند، فاذر، ونوین			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۷۲۲۰ واحد افت داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۲۴.۷۴)	۶۴۰۱۳	مارون	(۶۲۵.۲۶)	۶۲۱۴	فولاد
(۱۳.۹۱)	۶۰۰۸۹	زاگرس	(۵۲۳.۴۷)	۲۳۱۵	تاپیکو
۹.۳۹	۱۸۰۷۹	بمپنا	(۵۱۶.۲۷)	۱۳۳۲۳	شبندر
(۶.۵۹)	۲۹۱۷۲	شاون	(۳۸۶.۰۱)	۸۰۸۱	کگل
(۶.۳۹)	۴۶۵۸	هرمز	(۳۷۴.۳۷)	۴۵۳۹	فملی
(۶.۲۸)	۳۳۲۰۶	شراز	(۳۱۳.۰۲)	۳۹۳۳۳	پارس
(۳.۵۷)	۳۵۱۰	میدکو	۲۷۵.۲۷	۲۲۷۴	وبملت

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز دهم مهر ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۶۸٪	۷۹۹,۵۴۱	۸۰۵,۰۱۵	ارزش کل بازار بدهی ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال) متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)
۹۰.۱۱٪	۳,۷۵۹	۱,۹۷۷	
-۳.۶٪	۲۸.۹۷٪	۳۰.۰۴٪	

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۷/۱۰

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	۸۱۵	۸۴۰	۳.۱٪	۱,۴۸۸,۵۴۲,۴۸۴	۴,۸۴۹,۰۶۹,۳۴۶	۲۲۵.۸٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۶۱,۰۲۲	۵۸,۴۰۴	-۴.۳٪	۶۸۵,۸۹۰,۰۹۰	۱,۳۵۰,۲۰۷,۰۹۶	۹۶.۹٪
	مخابرات	۱۸	۱,۶۲۳	۱,۵۵۰	-۴.۵٪	۶۴,۳۰۸,۷۸۴	۸۳,۰۹۲,۶۷۹	۲۹.۲٪
	چندرشته ای صنعتی	۵	۲۰,۰۵۸	۱۹,۲۷۶	-۳.۹٪	۶۹۵,۴۷۲,۷۸۴	۸۹۴,۰۹۵,۹۳۱	۲۸.۶٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۸۷۱,۰۹۶	۸۲۲,۲۷۸	-۵.۶٪	۱,۷۴۳,۸۲۴,۱۶۵	۲,۰۶۳,۲۹۸,۲۱۸	۱۸.۳٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۵۳۲	۵۰۷	-۴.۷٪	۵۰۹,۰۷۱,۷۴۱	۳۹۱,۶۵۵,۵۹۴	-۲۳.۱٪
	وسایل ارتباطی	۹	۳,۱۳۴	۲,۹۷۸	-۵.۰٪	۱۲۴,۶۲۴,۶۱۶	۹۰,۳۸۴,۷۷۴	-۲۷.۵٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۳۷,۰۵۰	۱۳۰,۷۲۸	-۴.۶٪	۲,۳۹۰,۳۷۰,۶۳۳	۱,۶۱۸,۴۶۱,۰۶۲	-۳۲.۳٪
	سرمایه گذارها	۵۳	۳,۸۳۴	۳,۷۱۱	-۳.۲٪	۷۸۵,۹۹۷,۳۶۹	۴۱۷,۱۹۴,۲۱۵	-۴۶.۹٪
	شیمیایی	۳	۱۲,۵۲۸	۱۲,۰۴۲	-۳.۹٪	۳,۵۵۶,۵۱۵,۰۱۰	۱,۸۷۳,۱۸۸,۲۹۰	-۴۷.۳٪
	دارویی	۴۲	۱۳,۶۷۲	۱۳,۳۳۴	-۲.۵٪	۳۳۱,۷۲۲,۵۳۷	۱۳۲,۳۳۰,۵۶۴	-۶۰.۱٪
	رایانه	۸	۲۰,۰۱۰	۱۹,۱۴۰	-۴.۳٪	۲۳۶,۷۹۴,۲۳۰	۹۳,۰۲۵,۷۶۲	-۶۰.۷٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۲۵,۵۷۹	۲۴,۸۰۶	-۳.۰٪	۱,۲۱۵,۶۰۷,۳۹۳	۳۹۹,۹۸۶,۶۲۷	-۶۷.۱٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۵,۶۳۷	۵,۳۶۰	-۴.۹٪	۳۲۴,۹۸۶,۶۷۶	۹۸,۸۶۵,۴۵۵	-۶۹.۶٪
فنی و مهندسی	۲۱	۱,۲۱۱	۱,۲۱۰	-۰.۱٪	۱۹۰,۳۶۶,۵۵۲	۲۱,۸۵۷,۳۲۱	-۸۸.۵٪	

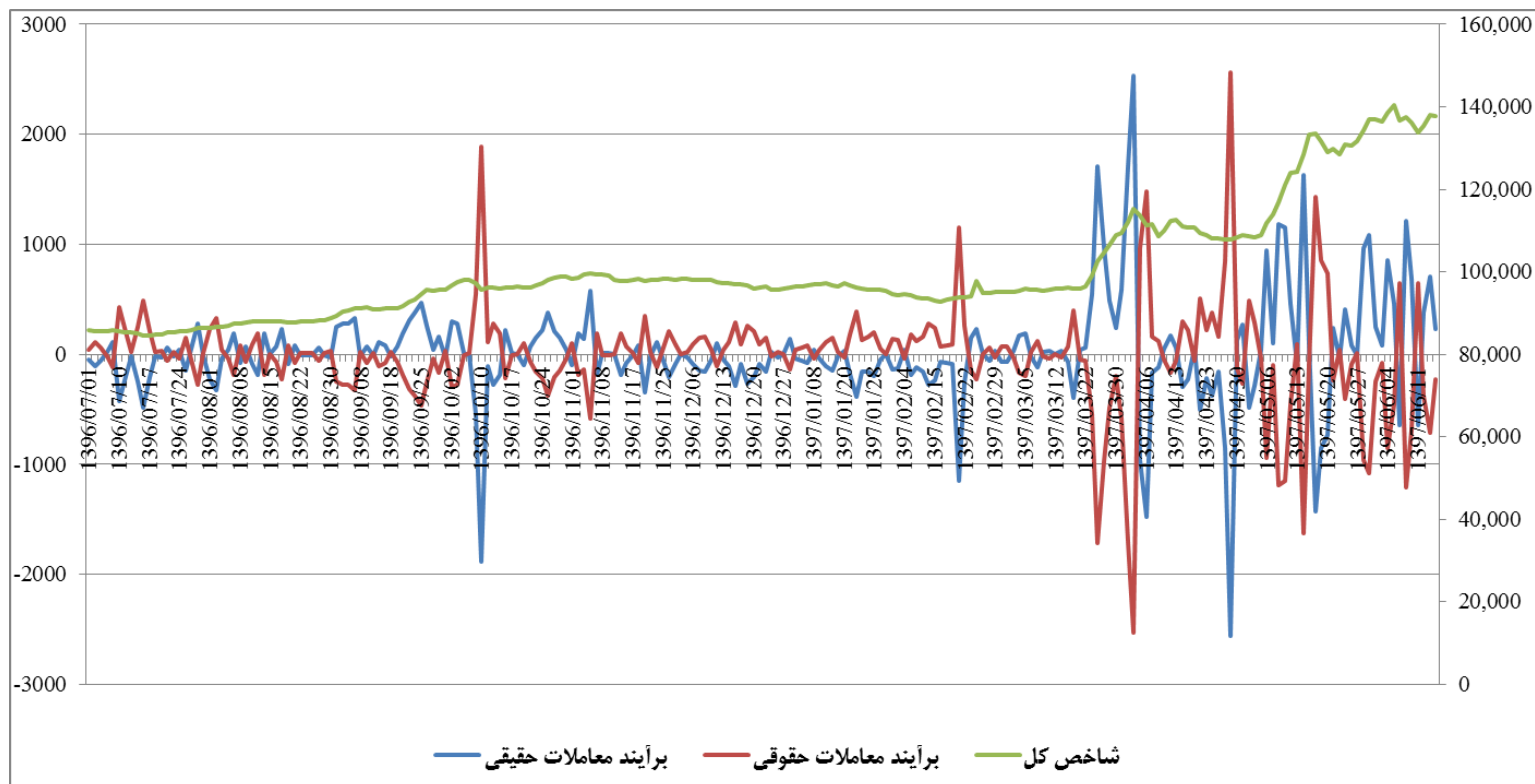
با توجه به جدول فوق، در صنایع بانکی و استخراج کانه های فلزی، در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع فنی و مهندسی و حمل و نقل و انبارداری بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۱۰

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	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۳,۸۳۰	۵,۳۶۰	۳۹.۹۵%	۸۶,۹۱۴	۱۱۹,۷۳۲	۳۷.۷۶%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۳۹۰	۵۰۷	۳۰.۰۰%	۱۹۱,۳۳۷	۲۵۶,۳۲۰	۳۳.۹۶%
	دارویی	۹	۹,۶۵۰	۱۳,۳۳۴	۳۸.۱۸%	۱۵۰,۹۵۹	۲۰۰,۸۶۶	۳۳.۰۶%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۶۲۹	۸۴۰	۳۳.۵۵%	۴۰۶,۹۲۵	۵۴۰,۸۷۸	۳۲.۹۲%
	خودرو و قطعات	۵	۱۹,۴۴۲	۲۴,۸۰۶	۲۷.۵۹%	۱۹۴,۳۴۷	۲۵۳,۷۳۰	۳۰.۵۵%
	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۴۴,۷۶۹	۵۸,۴۰۴	۳۰.۴۶%	۵۲۶,۳۹۳	۶۸۶,۲۱۶	۳۰.۳۹%
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۸۴۶	۳,۷۱۱	۳۰.۳۹%	۱۳۸,۳۷۸	۱۷۶,۶۴۲	۲۷.۶۵%
	وسایل ارتباطی	۴۵	۲,۳۲۶	۲,۹۷۸	۲۸.۰۳%	۱۳۴,۷۶۴	۱۶۹,۱۹۳	۲۵.۵۵%
	فرآورده های نفتی	۱۸	۶۴۶,۲۰۰	۸۲۲,۲۷۸	۲۷.۲۵%	۶۶۲,۱۲۱	۸۲۸,۹۷۵	۲۵.۲۰%
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۵,۹۷۸	۱۹,۲۷۶	۲۰.۶۴%	۳۵۰,۹۶۷	۴۲۳,۳۸۱	۲۰.۶۳%
	رایانه	۲۵	۱۶,۱۰۵	۱۹,۱۴۰	۱۸.۸۵%	۱۸۷,۳۱۱	۲۲۳,۳۲۹	۱۹.۲۳%
	مخابرات	۳	۱,۲۸۶	۱,۵۵۰	۲۰.۵۳%	۱۵۴,۴۵۴	۱۸۰,۲۹۸	۱۶.۷۳%
	فنی و مهندسی	۱۵	۱,۰۳۹	۱,۲۱۰	۱۶.۴۶%	۱۰۵,۴۴۶	۱۲۳,۰۴۰	۱۶.۶۹%
	شیمیایی	۲۶	۱۰,۴۳۱	۱۲,۰۴۲	۱۵.۴۴%	۲,۰۰۹,۹۴۱	۲,۳۱۷,۰۷۶	۱۵.۲۸%
فلزات اساسی	۴۲	۱۱۸,۲۸۸	۱۳۰,۷۲۸	۱۰.۵۲%	۱,۳۰۸,۲۶۲	۱,۵۰۴,۲۷۵	۱۴.۹۸%	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های حمل و نقل انبارداری و ارتباطات و عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم 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.