



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۷/۱۱

اطلاعات کلی بازار در پایان روز یازدهم مهر ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۱.۴۳)	۷,۰۷۸,۰۹۹	۷,۱۸۰,۹۷۷	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۲.۸۰)	۲,۳۳۱,۵۲۹	۲,۳۹۸,۷۷۸	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۱۹.۱۴	۲۵,۸۶۶	۲۱,۷۱۰	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۱.۴۳)	۱۸۵,۵۵۹	۱۸۸,۲۵۹	شاخص کل بازار بورس
(۲.۴۹)	۳۲,۲۲۶	۳۳,۰۵۰	شاخص هم وزن بازار بورس
(۲.۳۴)	۲,۱۱۵	۲,۱۶۶	شاخص کل بازار فرابورس
خودرو، کروی، کبافق، رمپنا، فاراک			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
سختش، ما			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همان گونه که در جدول فوق مشاهده می شود، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۲۷۰۰ واحد افت داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۱۸.۴۶)	۶۱۴۹۹	مارون	(۳۱۱.۴۵)	۴۳۴۱	فملی
(۶.۱۱)	۴۴۳۶	هرمز	۲۳۴.۰۶	۸۳۲۹	کگل
(۴.۰۵)	۳۴۳۸	میدکو	(۲۱۱.۵۳)	۲۲۱۶	تاپیکو
(۲.۶۷)	۷۳۲۵	ارفع	(۲۰۳.۸۶)	۴۵۴۶	پارسان
(۲.۲۶)	۵۱۱۷	سمگا	(۲۰۱.۹۷)	۳۸۰۴۹	پارس
(۲.۱۵)	۳۲۰۶۴	شراز	(۱۹۸.۸۱)	۱۰۲۵۲	فخوز
(۱.۸۹)	۵۹۶۵۹	زاگرس	(۱۹۸.۲۰)	۲۵۸۹	اخابر

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز یازدهم مهر ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۲.۱۱٪	۷۸۲,۶۹۳	۷۹۹,۵۴۱	ارزش کل بازار بدهی ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال) متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)
-۵۵.۳۵٪	۱,۶۷۹	۳,۷۵۹	
-۳.۲٪	۲۸.۰۴٪	۲۸.۹۷٪	

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۷/۱۱

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	۸۴۰	۸۶۱	۲.۵٪	۱,۷۷۱,۳۵۹,۴۲۹	۴,۳۲۹,۹۹۰,۹۰۸	۱۴۴.۴٪
	وسایل ارتباطی	۹	۲,۹۷۸	۲,۹۲۴	-۱.۸٪	۱۴۲,۶۴۱,۴۳۹	۳۱۲,۷۳۰,۷۰۶	۱۱۹.۲٪
	رایانه	۸	۱۹,۱۴۰	۱۸,۲۷۶	-۴.۵٪	۲۵۹,۲۶۳,۷۱۶	۴۲۴,۲۱۶,۹۹۱	۶۳.۶٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۸۲۲,۲۷۸	۸۲۷,۴۵۷	۰.۶٪	۱,۸۵۶,۶۱۲,۳۲۸	۲,۹۶۱,۹۹۹,۸۰۲	۵۹.۵٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۵۸,۴۰۴	۵۹,۱۹۵	۱.۴٪	۶۹۵,۹۶۰,۵۹۶	۹۴۲,۶۵۹,۵۹۱	۳۵.۴٪
	فنی و مهندسی	۲۱	۱,۲۱۰	۱,۲۰۹	-۰.۱٪	۲۰۶,۲۱۸,۹۴۸	۲۶۴,۱۶۸,۸۰۷	۲۸.۱٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۲۴,۸۰۶	۲۳,۳۳۱	-۵.۹٪	۱,۲۵۰,۴۱۴,۲۹۹	۱,۳۲۸,۱۱۷,۴۹۶	۶.۲٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۳۰,۷۲۸	۱۲۷,۶۰۲	-۲.۴٪	۲,۳۸۰,۳۹۸,۷۴۹	۲,۴۷۸,۹۴۰,۳۳۴	۴.۱٪
	چندرشته ای صنعتی	۵	۱۹,۲۷۶	۱۹,۱۸۵	-۰.۵٪	۷۱۱,۰۲۸,۷۳۱	۷۲۲,۵۰۲,۴۰۱	۱.۶٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۵۰۷	۴۹۰	-۳.۴٪	۵۲۰,۳۰۷,۴۱۵	۴۹۰,۷۹۹,۱۲۷	-۵.۷٪
	شیمیایی	۳	۱۲,۰۴۲	۱۱,۴۸۸	-۴.۶٪	۳,۵۷۲,۱۸۲,۴۷۳	۳,۳۴۰,۰۰۴,۴۵۴	-۶.۵٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۳,۷۱۱	۳,۵۸۰	-۳.۵٪	۸۰۷,۰۶۵,۱۳۰	۷۱۳,۹۶۹,۵۲۷	-۱۱.۵٪
	دارویی	۴۲	۱۳,۳۳۴	۱۳,۰۰۵	-۲.۵٪	۳۳۳,۵۱۰,۶۴۹	۱۷۹,۷۴۲,۲۲۵	-۴۶.۱٪
	مخابرات	۱۸	۱,۵۵۰	۱,۴۹۵	-۳.۵٪	۶۳,۴۴۸,۵۰۷	۳۲,۶۳۹,۳۶۷	-۴۸.۶٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۵,۳۶۰	۵,۱۰۰	-۴.۹٪	۳۲۰,۳۳۸,۷۸۴	۷۲,۸۷۷,۵۵۴	-۷۷.۲٪

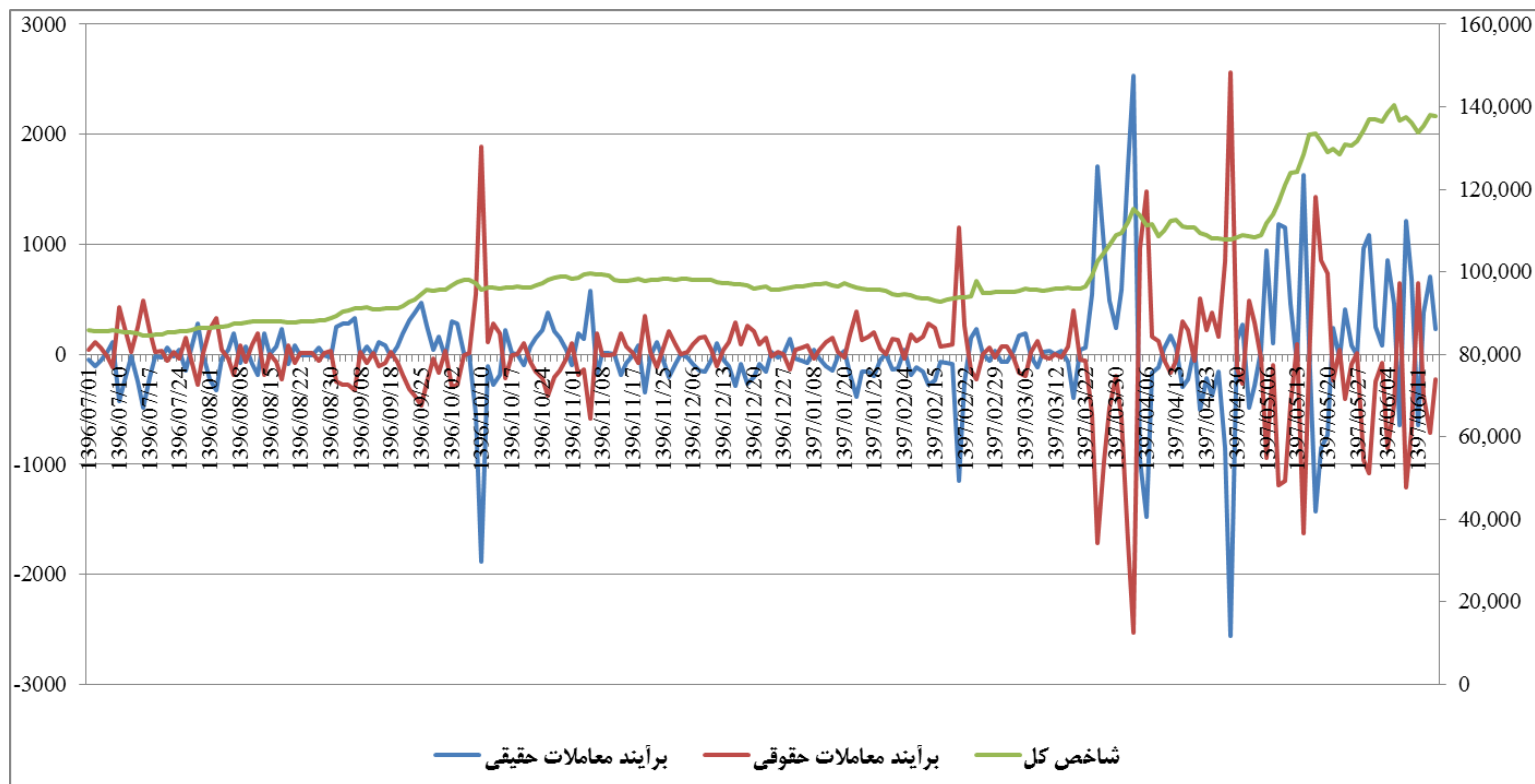
با توجه به جدول فوق، در صنایع بانکی و وسایل ارتباطی، در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع حمل و نقل انبارداری و ارتباطات و مخابرات بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۱۱

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	استخراج کانه های فلزی	۵۳	۴۴,۷۰۴	۵۹,۱۹۵	۳۲.۴۲٪	۵۲۵,۵۵۲	۶۹۵,۳۸۲	۳۲.۳۱٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۶۴۶	۸۶۱	۳۳.۲۸٪	۴۱۶,۲۲۶	۵۵۰,۶۹۳	۳۲.۳۱٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۴,۰۰۳	۵,۱۰۰	۲۷.۴۰٪	۹۰,۴۵۳	۱۱۴,۴۸۵	۲۶.۵۷٪
	دارویی	۹	۹,۹۱۴	۱۳,۰۰۵	۳۱.۱۸٪	۱۵۵,۰۷۹	۱۹۵,۷۷۸	۲۶.۲۴٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۴۰۵	۴۹۰	۲۰.۹۹٪	۱۹۸,۲۰۸	۲۴۹,۴۷۴	۲۵.۸۶٪
	فرآورده های نفتی	۱۸	۶۴۶,۱۳۸	۸۲۷,۴۵۷	۲۸.۰۶٪	۶۶۰,۷۹۳	۸۳۱,۵۴۰	۲۵.۸۴٪
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۸۶۸	۳,۵۸۰	۲۴.۸۳٪	۱۴۰,۵۹۲	۱۷۰,۰۵۷	۲۰.۹۶٪
	خودرو و قطعات	۵	۲۰,۲۴۰	۲۳,۳۳۱	۱۵.۲۷٪	۲۰۲,۷۸۳	۲۳۸,۸۳۸	۱۷.۷۸٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۶,۵۳۵	۱۹,۱۸۵	۱۶.۰۳٪	۳۶۳,۱۸۳	۴۲۱,۴۰۹	۱۶.۰۳٪
	وسایل ارتباطی	۴۵	۲,۳۳۴	۲,۹۲۴	۲۵.۲۸٪	۱۴۱,۳۸۸	۱۶۱,۴۱۴	۱۴.۱۶٪
	فلزات اساسی	۴۲	۱۱۵,۹۸۵	۱۲۷,۶۰۲	۱۰.۰۲٪	۱,۲۹۴,۰۵۱	۱,۴۶۷,۲۰۰	۱۳.۳۸٪
	فنی و مهندسی	۱۵	۱,۰۸۸	۱,۲۰۹	۱۱.۱۲٪	۱۱۰,۴۵۴	۱۲۲,۸۵۳	۱۱.۲۲٪
	رایانه	۲۵	۱۶,۵۱۶	۱۸,۲۷۶	۱۰.۶۶٪	۱۹۲,۱۹۵	۲۱۳,۶۰۲	۱۱.۱۴٪
	شیمیایی	۲۶	۱۰,۸۷۴	۱۱,۴۸۸	۵.۶۵٪	۲,۰۹۱,۸۷۳	۲,۲۷۳,۲۴۲	۸.۶۷٪
مخابرات	۳	۱,۳۴۷	۱,۴۹۵	۱۰.۹۹٪	۱۶۱,۶۲۶	۱۷۵,۶۱۳	۸.۶۵٪	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های استخراج کانه های فلزی و بانکها 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 باز هم شاهد همسویی شاخص با معاملات حقیقی ها هستیم.