



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۷/۰۷/۱۵

اطلاعات کلی بازار در پایان روز پانزدهم مهر ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۴.۱۶)	۶,۷۲۹,۴۱۲	۷,۰۲۱,۸۶۵	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۲.۹۹)	۲,۲۶۰,۶۹۵	۲,۳۳۰,۴۸۴	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۶.۳۶)	۲۶,۹۳۲	۲۸,۷۶۳	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۴.۱۶)	۱۷۶,۴۱۹	۱۸۴,۰۸۵	شاخص کل بازار بورس
(۲.۸۵)	۳۰,۸۰۶	۳۱,۷۰۹	شاخص هم وزن بازار بورس
(۴.۲۲)	۲,۰۲۰	۲,۱۰۹	شاخص کل بازار فرابورس
فارس، کسرا			بازگشایی نماد های مهم و تاثیر گذار
شاراک، شپترو			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 ۷۶۶۵ واحد افت داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۱۷.۷۱)	۵۸۵۴۳	مارون	(۱۲۳۳.۴۶)	۸۷۳۸	فارس
(۱۲.۳۶)	۵۷۷۳۳	زاگرس	(۵۲۱.۰۴)	۵۷۳۱	فولاد
(۱۱.۸۶)	۳۶۹۱	ذوب	(۳۴۴.۴۸)	۷۸۴۳	کگل
(۹.۱۳)	۳۳۵۴	میدکو	(۲۹۸.۸۶)	۴۰۱۵	فملی
(۶.۰۵)	۴۱۶۳	هرمز	(۲۳۴.۶۹)	۳۵۷۹۴	پارس
(۳.۰۲)	۱۱۳۱۱	دماوند	(۲۲۲.۹۷)	۴۲۸۳	پارسان
(۲.۹۷)	۳۰۱۱۵	شراز	(۲۲۰.۰۷)	۲۰۹۳	تاپیکو

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز پانزدهم مهر ماه ۱۳۹۷

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۰۳٪	۷۸۱,۰۰۵	۷۸۰,۷۴۳	ارزش کل بازار بدهی ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال) متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)
-۲۱.۵۵٪	۱,۳۸۳	۱,۷۶۴	
-۴.۹٪	۲۶.۴۱٪	۲۷.۷۷٪	

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۷/۰۷/۱۵

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	استخراج کانه های فلزی	۲۵	۵۸,۷۸۳	۵۶,۴۰۰	-۴.۱٪	۸۰۶,۸۷۳,۶۰۹	۱,۵۴۳,۰۹۸,۷۷۲	۹۱.۲٪
	فرآورده های نفتی	۲۶	۸۳۸,۴۳۱	۸۰۸,۹۲۰	-۳.۵٪	۲,۲۴۳,۳۰۱,۲۴۰	۴,۱۸۵,۴۹۳,۲۷۹	۸۶.۶٪
	فلزات اساسی	۷۵	۱۲۴,۹۴۲	۱۱۹,۵۴۸	-۴.۳٪	۲,۵۲۰,۲۹۹,۶۳۲	۴,۳۸۱,۴۰۹,۲۶۳	۷۳.۸٪
	چندرشته ای صنعتی	۵	۱۹,۱۸۵	۱۸,۵۴۱	-۳.۴٪	۷۸۶,۴۱۶,۷۵۱	۹۷۷,۱۵۶,۵۹۰	۲۴.۳٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۴۵	۸۶۹	۸۴۱	-۳.۲٪	۱,۹۹۴,۵۰۵,۵۶۹	۲,۴۴۶,۱۴۵,۲۳۶	۲۲.۶٪
	وسایل ارتباطی	۹	۲,۸۸۰	۲,۷۴۰	-۴.۹٪	۱۵۲,۵۲۵,۴۰۰	۱۷۹,۲۰۲,۰۹۳	۱۷.۵٪
	شیمیایی	۳	۱۱,۷۸۴	۱۱,۱۱۵	-۵.۷٪	۳,۱۷۱,۸۳۲,۶۴۲	۲,۶۰۶,۶۸۰,۳۱۷	-۱۷.۸٪
	مخابرات	۱۸	۱,۴۹۳	۱,۴۲۳	-۴.۷٪	۶۴,۹۶۷,۶۳۵	۵۰,۵۶۰,۱۲۲	-۲۲.۲٪
	سرمایه گذاریها	۵۳	۳,۴۹۷	۳,۳۶۶	-۳.۷٪	۸۱۰,۱۰۴,۴۶۳	۵۰۰,۹۰۹,۵۱۷	-۳۸.۲٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۴۰	۴,۹۹۶	۴,۷۵۴	-۴.۸٪	۳۳۳,۸۳۲,۷۴۰	۱۹۷,۴۰۰,۹۳۴	-۴۰.۹٪
	رایانه	۸	۱۷,۹۰۰	۱۷,۲۲۸	-۳.۸٪	۲۶۶,۰۹۲,۸۵۰	۱۴۲,۶۶۶,۵۱۱	-۴۶.۴٪
	خودرو و قطعات	۲۷	۲۲,۸۸۰	۲۱,۹۵۰	-۴.۱٪	۱,۲۱۱,۲۱۷,۰۸۸	۵۶۷,۲۴۳,۷۳۸	-۵۳.۲٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۴۷۵	۴۵۴	-۴.۴٪	۴۷۶,۹۸۹,۵۹۰	۱۳۳,۲۱۰,۳۳۵	-۷۲.۱٪
	دارویی	۴۲	۱۲,۷۸۸	۱۲,۴۹۹	-۲.۳٪	۳۴۰,۵۵۹,۴۹۷	۶۰,۲۵۵,۹۱۳	-۸۲.۳٪
فنی و مهندسی	۲۱	۱,۱۹۵	۱,۱۹۴	-۰.۱٪	۲۰۳,۰۵۱,۷۴۴	۳۰,۳۶۹,۰۲۸	-۸۵.۰٪	

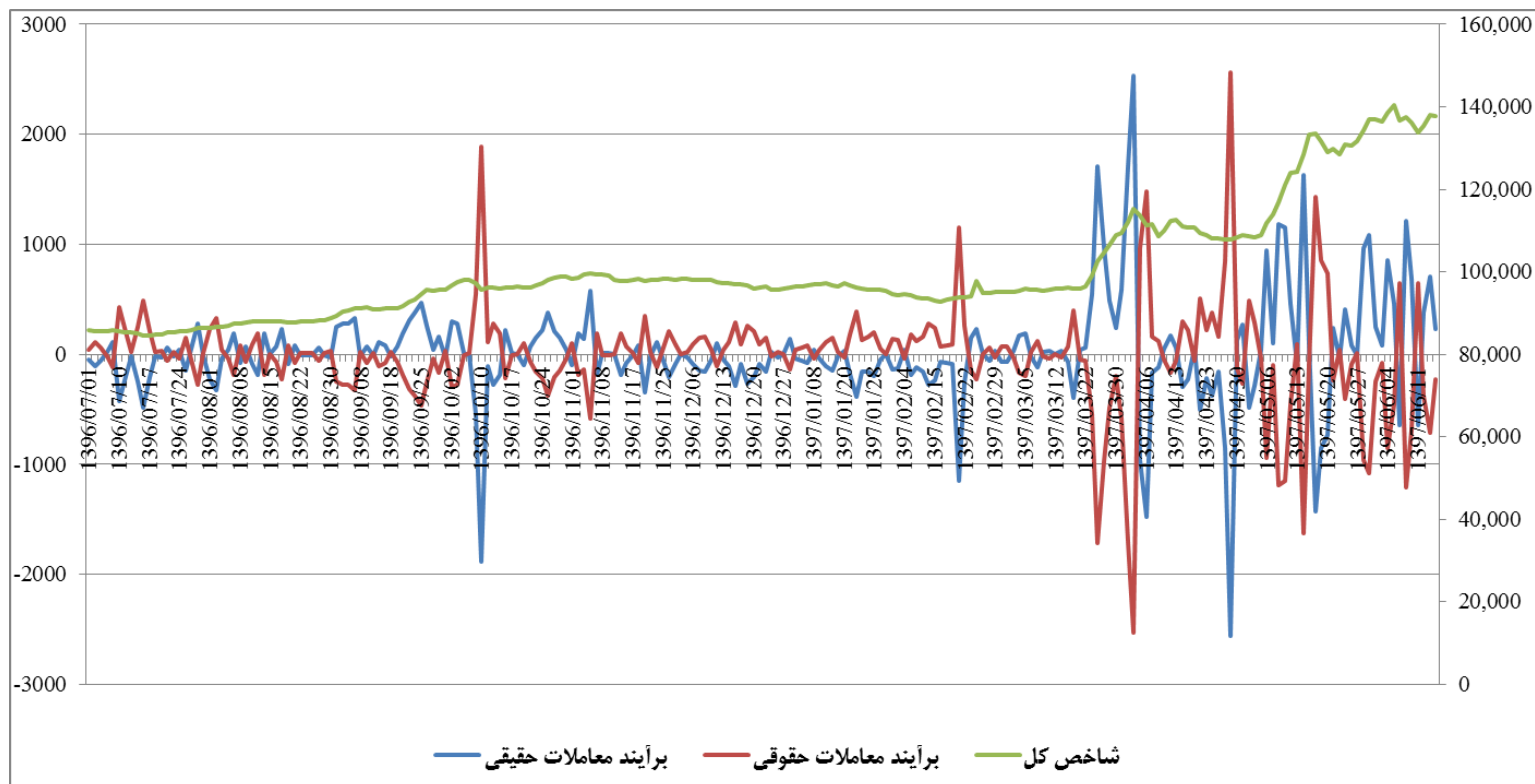
با توجه به جدول فوق، در صنایع استخراج کانه های فلزی و فرآورده های نفتی، در پی افزایش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به ۱۴ روز اخیر، بیشترین ورود نقدینگی دیده می شود و در صنایع فنی و مهندسی و دارویی بیشترین خروج پول وجود داشته است.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۱۵

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	۴۴,۳۲۱	۵۶,۴۰۰	۲۷.۲۵٪	۵۲۱,۱۱۷	۶۶۲,۴۴۵	۲۷.۱۲٪
	فرآورده های نفتی	۱۸	۶۴۳,۳۰۲	۸۰۸,۹۲۰	۲۵.۷۴٪	۶۵۵,۶۰۳	۸۰۹,۸۱۰	۲۳.۵۲٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۱	۶۷۳	۸۴۱	۲۴.۹۶٪	۴۳۷,۶۳۶	۵۳۸,۱۶۲	۲۲.۹۷٪
	دارویی	۹	۱۰,۴۸۶	۱۲,۴۹۹	۱۹.۲۰٪	۱۶۰,۲۲۰	۱۸۷,۹۵۹	۱۷.۳۱٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۷۵	۴,۰۳۱	۴,۷۵۴	۱۷.۹۴٪	۹۱,۴۵۹	۱۰۶,۵۵۶	۱۶.۵۱٪
	سرمایه گذاریها	۲۷	۲,۸۹۸	۳,۳۶۶	۱۶.۱۵٪	۱۴۲,۳۹۷	۱۶۱,۱۴۵	۱۳.۱۷٪
	چندرشته ای صنعتی	۴۰	۱۶,۵۱۲	۱۸,۵۴۱	۱۲.۲۹٪	۳۶۲,۶۹۷	۴۰۷,۲۷۴	۱۲.۲۹٪
	فلزات اساسی	۴۲	۱۱۲,۳۴۰	۱۱۹,۵۴۸	۶.۴۲٪	۱,۲۵۹,۷۱۴	۱,۳۸۶,۴۷۰	۱۰.۰۶٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۸	۴۳۰	۴۵۴	۵.۵۸٪	۲۰۹,۸۴۱	۲۳۰,۷۲۰	۹.۹۵٪
	فنی و مهندسی	۱۵	۱,۰۹۶	۱,۱۹۴	۸.۹۴٪	۱۱۱,۳۷۵	۱۲۱,۱۳۱	۸.۷۶٪
	وسایل ارتباطی	۴۵	۲,۳۶۹	۲,۷۴۰	۱۵.۶۶٪	۱۴۰,۸۲۱	۱۵۰,۸۲۵	۷.۱۰٪
	خودرو و قطعات	۵	۲۱,۴۷۹	۲۱,۹۵۰	۲.۱۹٪	۲۱۴,۹۴۸	۲۲۸,۶۶۴	۶.۳۸٪
	رایانه	۲۵	۱۶,۲۹۷	۱۷,۲۲۸	۵.۷۱٪	۱۸۹,۷۹۵	۲۰۱,۵۲۷	۶.۱۸٪
	مخابرات	۳	۱,۳۵۶	۱,۴۲۳	۴.۹۴٪	۱۶۴,۳۲۳	۱۶۹,۹۰۱	۳.۳۹٪
شیمیایی	۲۶	۱۰,۷۶۶	۱۱,۱۱۵	۳.۲۴٪	۲,۰۹۱,۸۱۹	۲,۱۴۴,۰۶۰	۲.۵۰٪	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات مثبت در ارزش بازاری در گروه های استخراج کانه های فلزی و فرآورده های نفتی 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.