



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۶/۱۱/۱۴

اطلاعات کلی بازار در پایان روز چهاردهم بهمن ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۰.۴۲)	۳,۸۹۸,۳۷۸	۳,۹۱۴,۹۶۷	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۸.۲۸	۱,۴۲۷,۲۸۳	۱,۳۱۸,۱۴۰	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۱۷.۷۵)	۶,۴۲۳	۷,۸۰۹	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
(۰.۴۲)	۹۷,۷۱۹	۹۸,۱۳۴	شاخص کل بازار بورس
(۰.۱۳)	۱۷,۴۴۹	۱۷,۴۷۲	شاخص هم وزن بازار بورس
(۰.۶۱)	۱,۰۸۳	۱,۰۹۰	شاخص کل بازار فرابورس
وهور، زشگزا			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
زنگان، وصنعت			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۴۱۴ واحد افت داشته است.

تاثیر در شاخص های بورس و فرابورس در پایان روز چهاردهم بهمن ماه ۱۳۹۶

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۵.۷۹)	۴۰۰۷۱	مارون
۰.۷۷	۴۵۰۹	ارفع
۰.۶۸	۲۴۰۴	میدکو
(۰.۴۸)	۱۹۳۹	هرمز
۰.۴۲	۱۳۳۸	وهور
۰.۳۸	۷۱۸۱	خراسان
(۰.۳۳)	۱۴۳۷۴	شاون

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
(۱۱۲.۸۰)	۲۷۹۵	فولاد
(۸۰.۲۱)	۵۵۹۲	فارس
(۴۸.۱۳)	۲۶۶۴	فملی
(۳۰.۶۸)	۲۷۰۵	خودرو
(۲۴.۵۴)	۷۶۴۳	شبریز
۲۴.۰۶	۳۴۴۹	کگل
(۲۲.۰۶)	۴۵۸۲	شپنا

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز چهاردهم بهمن ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۰۸٪	۵۰۳,۳۵۹	۵۰۳,۷۶۵	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۳۲.۲۷٪	۴۴۳	۶۵۴	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۵.۷٪	۱۶.۸۲٪	۱۵.۹۲٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

با توجه به جدول فوق متوسط نرخ بازده موردانتظار بازار بدهی امروز نسبت به روز قبل بیش از ۵ درصد رشد داشت.

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۶/۱۱/۱۴

بازار	صنعت	تعداد شرکت	شاخص روز گذشته	شاخص روز جاری	درصد تغییرات	متوسط ارزش معاملات ۱۴ روز	متوسط ارزش معاملات جاری (میلیارد ریال)	درصد تغییرات
بورس و فرابورس	استخراج کانه های فلزی	۹	۲۰,۳۴۱	۲۰,۴۷۸	۰.۷٪	۳۶۴,۰۰۸,۶۲۲	۹۵۳,۳۸۴,۶۸۹	۱۶۱.۹٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۶	۳,۶۸۴	۳,۶۶۶	-۰.۵٪	۳۴,۱۵۸,۸۹۴	۳۲,۵۹۵,۰۱۳	-۴.۶٪
	دارویی	۲۷	۸,۵۹۷	۸,۵۸۰	-۰.۲٪	۸۴,۱۶۲,۵۰۱	۷۸,۳۱۵,۸۲۷	-۶.۹٪
	رایانه	۴۵	۱۲,۵۰۸	۱۲,۴۵۳	-۰.۴٪	۴۰,۸۹۳,۰۴۵	۳۵,۲۲۶,۴۸۷	-۱۳.۹٪
	فلزات اساسی	۴۲	۵۸,۸۵۲	۵۸,۰۱۱	-۱.۴٪	۶۶۷,۶۰۹,۰۳۸	۵۲۵,۳۱۷,۳۹۳	-۲۱.۳٪
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۶,۲۲۳	۱۵,۹۹۰	-۱.۴٪	۲۱۴,۱۵۸,۶۱۶	۱۵۶,۶۸۰,۷۴۹	-۲۶.۸٪
	چندرشته ای صنعتی	۲۱	۹,۷۷۸	۹,۷۹۹	۰.۲٪	۹۱,۸۵۰,۹۰۵	۶۴,۹۲۶,۵۰۸	-۲۹.۳٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۳	۶,۳۱۰	۶,۲۷۷	-۰.۵٪	۶۱۸,۴۳۳,۶۵۸	۳۸۴,۳۷۸,۶۳۵	-۳۷.۸٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۲۶	۱,۱۲۵	-۰.۱٪	۶,۱۷۹,۳۷۰	۳,۶۰۲,۹۷۲	-۴۱.۷٪
	سرمایه گذاریها	۵	۲,۰۵۰	۲,۰۴۹	۰.۰٪	۵۵,۰۲۹,۵۴۳	۳۰,۲۱۳,۶۸۰	-۴۵.۱٪
	فنی و مهندسی	۸	۷۲۲	۷۲۹	۱.۰٪	۳۰,۹۰۶,۲۶۶	۱۳,۰۳۹,۲۲۳	-۵۷.۸٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸	۵۶۹	۵۶۹	۰.۰٪	۳۴,۷۱۴,۲۷۲	۱۳,۰۶۰,۹۶۳	-۶۲.۴٪
	وسایل ارتباطی	۴۰	۱,۸۳۰	۱,۸۲۹	-۰.۱٪	۴۲,۹۲۹,۸۵۱	۱۳,۹۶۸,۱۵۱	-۶۷.۵٪
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۵۶,۵۷۱	۳۵۳,۳۱۳	-۰.۹٪	۸۶۶,۲۷۳,۴۱۳	۱۴۶,۵۰۲,۹۴۵	-۸۳.۱٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۵	۲۳۹	۲۳۸	-۰.۴٪	۷۵,۲۸۸,۱۸۷	۱۱,۶۷۱,۹۸۲	-۸۴.۵٪

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران

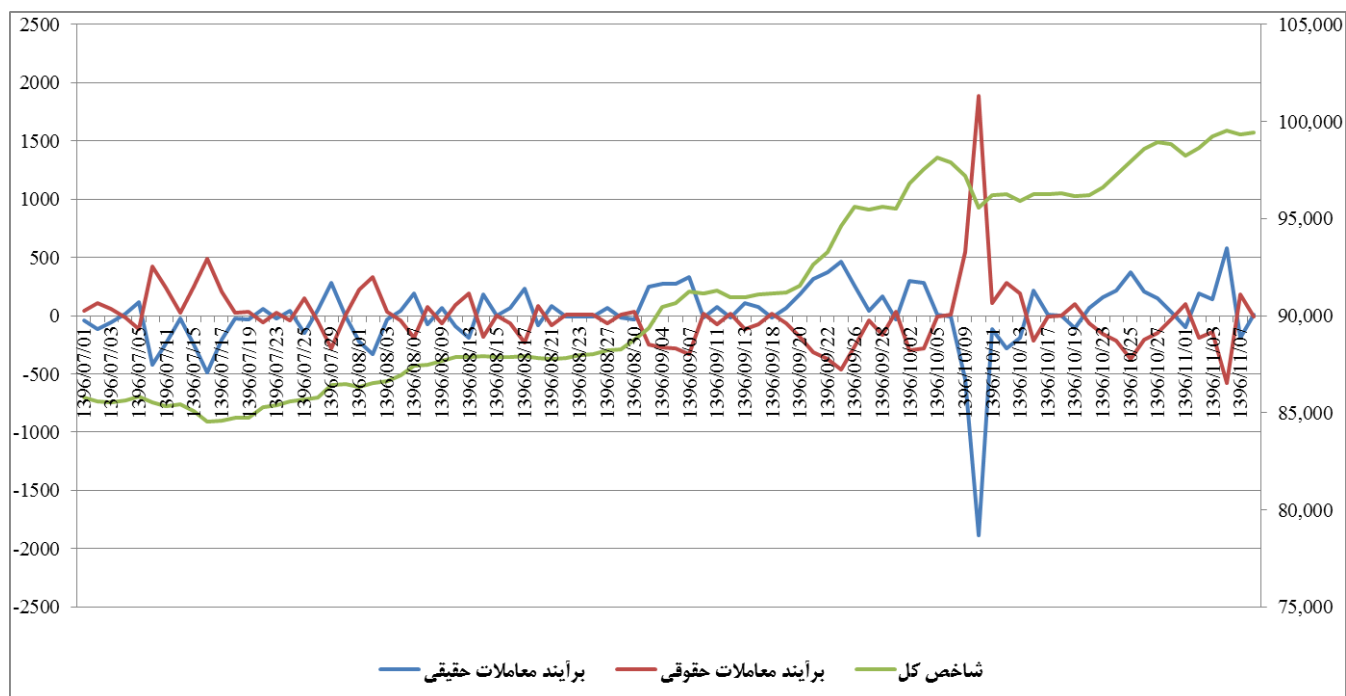
با توجه به جدول فوق، بنا بر رشد ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط معاملات ۱۴ روز اخیر، در صنعت استخراج کانه های فلزی، ورود نقدینگی وجود داشته است و سایر صنایع خروج پول دیده می شود.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۱۴

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	چند رشته ای صنعتی	۱۸	۹,۴۱۵	۹,۷۹۹	۴.۰۸٪	۲۴۱,۲۲۳	۲۵۱,۰۶۳	۴.۰۷٪
	رایانه	۴۲	۱۲,۲۶۶	۱۲,۴۵۳	۱.۵۲٪	۱۴۰,۵۳۹	۱۴۳,۷۹۹	۲.۳۳٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۱۵	۱,۱۲۵	۰.۹۰٪	۱۶۷,۵۶۸	۱۷۰,۴۱۹	۱.۷۰٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۷۵	۶,۲۳۳	۶,۲۷۷	۰.۷۱٪	۱,۱۹۵,۸۰۸	۱,۱۹۴,۸۶۹	-۰.۰۸٪
	سرمایه گذاریها	۲۱	۲,۰۴۵	۲,۰۴۹	۰.۲۰٪	۱۱۲,۶۳۲	۱۱۲,۴۳۲	-۰.۱۸٪
	وسایل ارتباطی	۳	۱,۹۰۷	۱,۸۲۹	-۴.۰۹٪	۱۳۸,۴۷۸	۱۳۸,۲۰۹	-۰.۱۹٪
	فنی و مهندسی	۹	۷۳۲	۷۲۹	-۰.۴۱٪	۷۶,۵۶۷	۷۶,۲۱۹	-۰.۴۵٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۳۷	۲۳۸	۰.۴۲٪	۱۴۵,۲۵۴	۱۴۴,۴۴۸	-۰.۵۶٪
	دارویی	۱۵	۸,۶۷۴	۸,۵۸۰	-۱.۰۸٪	۱۳۸,۰۷۲	۱۳۶,۹۴۴	-۰.۸۲٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۶	۵۷۷	۵۶۹	-۱.۳۹٪	۴۰۰,۷۹۶	۳۹۶,۰۳۸	-۱.۱۹٪
	فلزات اساسی	۴۵	۵۹,۵۱۹	۵۸,۰۱۱	-۲.۵۳٪	۶۹۹,۳۹۰	۶۸۹,۵۴۴	-۱.۴۱٪
	استخراج کانه های فلزی	۲۷	۲۰,۷۹۵	۲۰,۴۷۸	-۱.۵۲٪	۲۶۲,۷۵۶	۲۵۸,۸۵۴	-۱.۴۸٪
	فرآورده های نفتی	۵	۳۶۰,۶۳۹	۳۵۳,۳۱۳	-۲.۰۳٪	۳۹۴,۷۲۳	۳۸۶,۷۶۴	-۲.۰۲٪
	حمل و نقل و انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۷۶۲	۳,۶۶۶	-۲.۵۵٪	۸۴,۱۱۸	۸۲,۰۳۲	-۲.۴۸٪
خودرو و قطعات	۸	۱۶,۵۳۹	۱۵,۹۹۰	-۳.۳۳٪	۱۵۹,۹۷۶	۱۵۴,۶۸۲	-۳.۳۱٪	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات در ارزش بازاری در گروه های چند رشته ای صنعتی و رایانه 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 جاری، 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.