



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۶/۱۱/۱۸

اطلاعات کلی بازار در پایان روز هجدهم بهمن ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۴۹	۳,۹۲۴,۵۲۷	۳,۹۰۵,۵۸۳	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
(۷.۱۲)	۱,۳۴۶,۵۳۶	۱,۴۴۹,۸۲۸	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
(۱۸.۱۶)	۴,۹۱۷	۶,۰۰۸	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۰.۴۰	۹۸,۳۱۷	۹۷,۹۲۸	شاخص کل بازار بورس
۰.۱۷	۱۷,۶۰۹	۱۷,۵۷۹	شاخص هم وزن بازار بورس
۱.۵۹	۱,۱۰۴	۱,۰۸۶	شاخص کل بازار فرابورس
زاگرس، ونفت			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
خودرو، قلرست			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل بورس نسبت به روز قبل بیش از ۳۸۹ واحد رشد داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس			تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد	تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۱۰.۵۰	۴۱۹۴۴	مارون	۱۷۶.۵۸	۲۹۶۲	فولاد
۴.۶۳	۳۴۰۷۷	زاگرس	۴۲.۸۷	۱۵۷۸	تاپیکو
۰.۶۶	۵۹۹۰	سرچشمه	۳۲.۴۶	۲۴۲۹	پارسان
۰.۴۴	۲۴۲۲	میدکو	۳۰.۰۶	۲۷۳۹	فملی
۰.۲۸	۲۸۲۸	بساما	۲۸.۵۵	۱۳۲۶	پترول
۰.۲۴	۱۴۳۳۱	شراز	(۲۳.۹۲)	۴۶۴۴	مبین
۰.۲۱	۹۰۲۴	حسینا	۲۲.۱۱	۴۶۹۸	فخوز

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز هجدهم بهمن ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
-۰.۱۹٪	۵۲۴,۱۸۰	۵۲۵,۱۶۶	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۵۰.۶۷٪	۷۱۲	۱,۴۴۴	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
-۲.۹٪	۱۶.۷۹٪	۱۷.۳۰٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

با توجه به جدول فوق ارزش کل معاملات بازار بدهی امروز نسبت به روز قبل بیش از ۵۰ درصد افت داشت.

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۶/۱۱/۱۸

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	سرمایه گذارینها	۵	۲,۰۳۹	۲,۰۳۶	-۰.۱٪	۵۸,۹۳۲,۳۴۱	۱۸۲,۰۱۳,۰۱۹	۲۰۸.۹٪
	فلزات اساسی	۴۲	۵۸,۹۵۱	۵۹,۹۹۶	۱.۸٪	۶۶۹,۷۳۸,۸۸۴	۱,۹۷۶,۶۶۹,۴۳۹	۱۹۵.۱٪
	فنی و مهندسی	۸	۷۳۱	۷۲۷	-۰.۵٪	۲۷,۳۳۷,۴۸۲	۳۳,۳۰۷,۳۲۳	۲۱.۸٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸	۵۵۶	۵۵۶	۰.۰٪	۲۷,۶۶۴,۸۲۳	۳۱,۹۱۹,۳۰۸	۱۵.۴٪
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۶,۵۵۳	۱۶,۶۳۰	۰.۵٪	۲۱۷,۸۰۱,۰۰۵	۲۳۰,۲۶۹,۱۰۳	۵.۷٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۵	۲۳۵	۲۳۳	-۰.۹٪	۸۲,۵۹۶,۸۴۵	۷۷,۰۳۷,۳۱۷	-۶.۷٪
	رایانه	۴۵	۱۲,۵۱۵	۱۲,۵۹۶	۰.۶٪	۴۳,۵۶۹,۷۴۰	۳۶,۱۱۳,۱۹۶	-۱۷.۱٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۳	۶,۲۹۵	۶,۳۳۴	۰.۶٪	۵۰۷,۶۸۴,۲۶۸	۴۰۹,۶۱۷,۱۰۲	-۱۹.۳٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۶	۳,۶۴۶	۳,۶۴۸	۰.۱٪	۳۱,۸۵۵,۷۲۵	۲۴,۱۴۹,۰۱۲	-۲۴.۲٪
	چندرشته ای صنعتی	۲۱	۹,۸۸۳	۹,۸۴۶	-۰.۴٪	۴۸,۷۹۵,۵۸۹	۲۱,۹۱۶,۹۳۹	-۵۵.۱٪
	وسایل ارتباطی	۴۰	۱,۷۱۷	۱,۷۵۵	۲.۲٪	۴۳,۶۴۲,۰۴۰	۱۵,۷۷۳,۰۰۴	-۶۳.۹٪
	دارویی	۲۷	۸,۵۲۳	۸,۵۱۴	-۰.۱٪	۷۴,۷۸۵,۲۹۶	۲۲,۴۸۸,۹۲۸	-۶۹.۹٪
	استخراج کانه های فلزی	۹	۲۰,۱۱۰	۲۰,۲۰۵	۰.۵٪	۲۸۸,۱۶۷,۲۲۲	۸۴,۵۷۷,۴۴۱	-۷۰.۶٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۲۱	۱,۱۲۰	-۰.۱٪	۶,۲۵۶,۵۹۳	۱,۲۲۲,۴۴۵	-۸۰.۵٪
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۵۶,۷۳۰	۳۵۷,۲۴۳	۰.۱٪	۴۹۳,۳۵۶,۸۳۶	۸۷,۳۳۸,۳۹۸	-۸۲.۳٪

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران

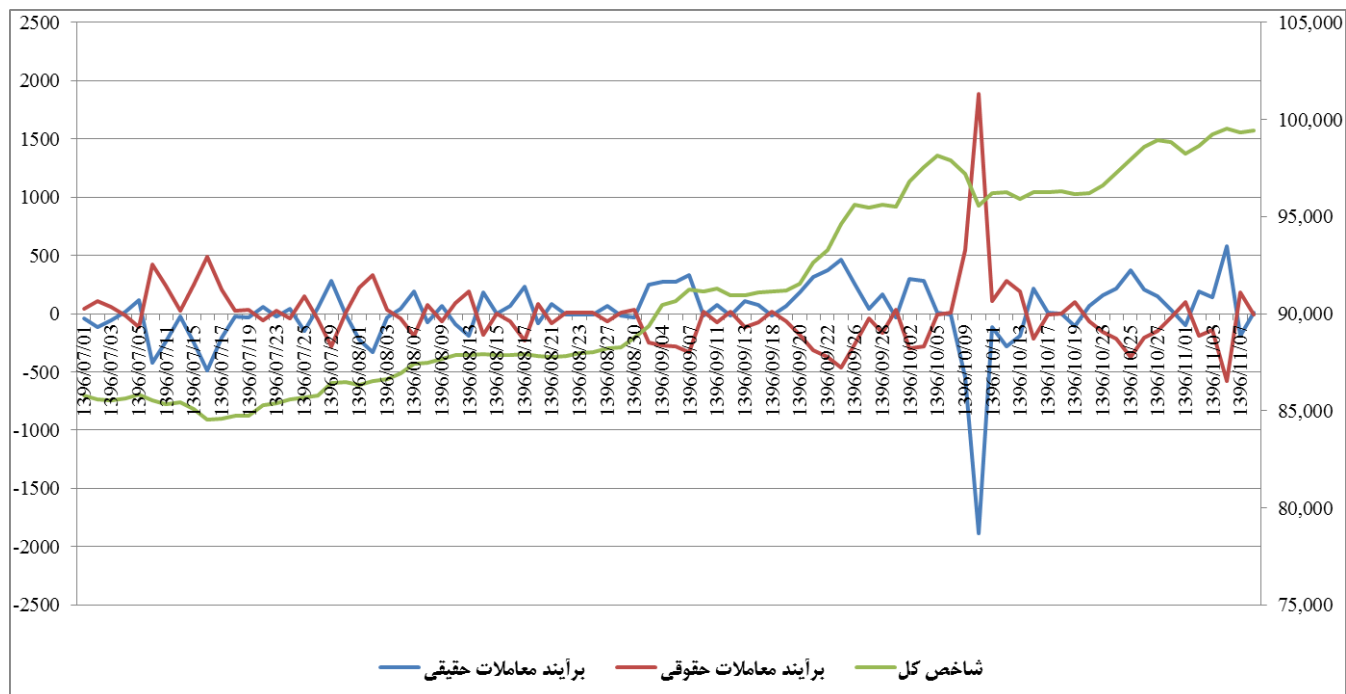
با توجه به جدول فوق، بنا بر رشد ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط معاملات ۱۴ روز اخیر، در صنایع سرمایه گذاری و فلزات اساسی، ورود نقدینگی وجود داشته است و در صنایع فرآورده های نفتی و مخابرات خروج پول دیده می شود.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۱۸

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	رایانه	۴۲	۱۲,۲۷۳	۱۲,۵۹۶	۲.۶۳%	۱۴۱,۵۸۷	۱۴۵,۵۲۹	۲.۷۸%
	فلزات اساسی	۴۵	۵۹,۳۱۸	۵۹,۹۹۶	۱.۱۴%	۷۰۰,۸۲۴	۷۰۷,۶۸۸	۰.۹۸%
	خودرو و قطعات	۸	۱۶,۵۵۲	۱۶,۶۳۰	۰.۴۷%	۱۵۹,۸۰۶	۱۶۰,۴۳۶	۰.۳۹%
	مخابرات	۲۵	۱,۱۲۱	۱,۱۲۰	-۰.۰۹%	۱۶۸,۸۶۴	۱۶۹,۵۲۶	۰.۳۹%
	شیمیایی و پتروشیمی	۷۵	۶,۴۱۶	۶,۳۳۴	-۱.۲۸%	۱,۲۱۸,۰۰۸	۱,۲۱۵,۹۲۴	-۰.۱۷%
	وسایل ارتباطی	۳	۱,۸۷۹	۱,۷۵۵	-۶.۶۰%	۱۳۸,۷۱۷	۱۳۷,۷۲۲	-۰.۷۲%
	فنی و مهندسی	۹	۷۳۴	۷۲۷	-۰.۹۵%	۷۶,۶۶۶	۷۵,۹۳۳	-۰.۹۶%
	سرمایه گذاریها	۲۱	۲,۰۶۴	۲,۰۳۶	-۱.۳۶%	۱۱۳,۴۱۱	۱۱۲,۰۰۳	-۱.۲۴%
	فرآورده های نفتی	۵	۳۶۵,۱۴۹	۳۵۷,۲۴۳	-۲.۱۷%	۳۹۹,۵۹۳	۳۹۲,۲۰۳	-۱.۸۵%
	دارویی	۱۵	۸,۶۹۶	۸,۵۱۴	-۲.۰۹%	۱۳۸,۶۶۸	۱۳۶,۱۰۱	-۱.۸۵%
	حمل و نقل و انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۷۱۹	۳,۶۴۸	-۱.۹۱%	۸۳,۵۳۲	۸۱,۹۳۴	-۱.۹۱%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۶	۵۶۹	۵۵۶	-۲.۲۸%	۳۹۶,۵۲۱	۳۸۸,۰۷۲	-۲.۱۳%
	چند رشته ای صنعتی	۱۸	۱۰,۰۶۰	۹,۸۴۶	-۲.۱۳%	۲۵۷,۷۴۸	۲۵۲,۲۰۸	-۲.۱۵%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۳۸	۲۳۳	-۲.۱۰%	۱۴۴,۷۹۴	۱۴۱,۲۲۰	-۲.۴۷%
	استخراج کانه های فلزی	۲۷	۲۱,۰۲۴	۲۰,۲۰۵	-۳.۹۰%	۲۶۵,۶۸۶	۲۵۵,۴۲۲	-۳.۸۶%

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات در ارزش بازاری در گروه های رایانه و فلزات اساسی 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.