



کارگزاری بانک صادرات ایران

گزارش روزانه بازار سهام در تاریخ

۱۳۹۶/۱۰/۱۸

اطلاعات کلی بازار در پایان روز هجدهم دی ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
(۹۰.۸۸)	۳۵۰,۸۵۰	۳,۸۴۷,۰۶۱	ارزش بازار بورس (میلیارد ریال)
۰.۰۹	۱,۲۴۶,۲۸۲	۱,۲۴۵,۱۶۳	ارزش بازار فرابورس (میلیارد ریال)
۵۰.۸۷	۴,۴۴۵	۲,۹۴۶	ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)
۰.۱۰	۹۶,۳۳۳	۹۶,۲۳۵	شاخص کل بازار بورس
۰.۴۱	۱۷,۳۷۷	۱۷,۳۰۶	شاخص هم وزن بازار بورس
۰.۶۴	۱,۰۷۵	۱,۰۶۸	شاخص کل بازار فرابورس
کتوکا، کاذر، دتولید			بازگشایی نماد های مهم و تاثیرگذار
پارسان، فرآور			توقف نمادهای مهم و تاثیرگذار

همانگونه که از جدول فوق برمی آید، امروز شاخص کل ۹۸,۰۶ واحد نسبت به روز قبل افت رشد داشته است.

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

تاثیر در شاخص فرابورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۲.۷۵	۲۳۲۷	میدکو
۲.۱۲	۲۱۳۶	هرمز
(۰.۶۹)	۳۱۱۹۸	زاگرس
۰.۶۷	۸۸۵	ذوب
۰.۵۹	۵۵۵۱	سرچشمه
(۰.۴۲)	۳۱۱۰	شپاس
۰.۴۱	۴۳۹۲	ارفع

تاثیر در شاخص بورس		
تاثیر	قیمت پایانی	نماد
۲۸.۷۷	۱۱۳۵	وبملت
۲۱.۰۱	۲۵۰۰	فملی
۲۰.۰۱	۵۶۸۲	فارس
۱۷.۲۶	۷۵۰۹	رمپنا
۱۷.۲۳	۱۸۳۶۲	پرداخت
۱۲.۱۰	۲۵۹۷	شاراک
(۱۱.۴۱)	۲۴۶۲	پارسان

اطلاعات کلی بازار بدهی در پایان روز هجدهم دی ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	امروز	روز گذشته	
۰.۲۶٪	۴۵۳,۲۰۴	۴۵۲,۰۳۱	ارزش بازار بدهی (میلیارد ریال)
۲۸۳.۵۵٪	۱,۵۸۹	۴۱۴	ارزش کل معاملات بازار بدهی (میلیارد ریال)
۱.۷٪	۱۶.۰٪	۱۵.۸٪	متوسط نرخ بازده مورد انتظار (YTM)

بازار بدهی طی معاملات امروز با متوسط نرخ بازده مورد انتظار ۱۶ درصد و با ۱۵۸۹ میلیارد ریال ارزش معامله رشد قابل توجهی در ارزش معاملات نسبت به روز گذشته خود داشت.

تغییرات بین صنایع منتخب در روز ۱۳۹۶/۱۰/۱۸

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	وسایل ارتباطی	۴۰	۲,۰۶۷	۲,۰۵۹	-۰.۴٪	۲۴,۹۵۶,۸۵۱	۶۴,۰۵۲,۶۷۴	۱۵۶.۷٪
	فلزات اساسی	۴۲	۵۷,۵۹۴	۵۷,۶۷۱	۰.۱٪	۷۳۷,۷۷۰,۵۱۲	۱,۱۰۲,۱۴۱,۲۷۴	۴۹.۴٪
	شیمیایی و پتروشیمی	۳	۵,۹۸۳	۵,۹۹۶	۰.۲٪	۳۸۱,۰۵۸,۴۴۴	۴۲۴,۹۳۱,۶۴۹	۱۱.۵٪
	سرمایه گذاریها	۵	۲,۰۵۰	۲,۰۵۵	۰.۲٪	۵۵,۸۶۳,۲۸۸	۳۸,۸۰۳,۶۳۷	-۳۰.۵٪
	بانکها و موسسات اعتباری	۱۸	۵۸۲	۵۸۴	۰.۳٪	۳۵,۴۲۷,۶۷۸	۲۱,۱۱۰,۹۰۱	-۴۰.۴٪
	فرآورده های نفتی	۱۵	۳۵۰,۴۵۷	۳۴۹,۴۹۸	-۰.۳٪	۲۸۲,۰۱۷,۷۲۴	۱۶۰,۱۱۰,۵۱۹	-۴۳.۲٪
	رایانه	۴۵	۱۱,۹۲۶	۱۲,۰۳۹	۰.۹٪	۵۷,۱۶۵,۴۰۶	۲۸,۸۷۳,۳۰۹	-۴۹.۵٪
	خودرو و قطعات	۵۳	۱۶,۸۱۰	۱۶,۷۵۸	-۰.۳٪	۲۲۰,۱۹۲,۶۵۴	۹۹,۹۴۴,۹۱۲	-۵۴.۶٪
	استخراج کانه های فلزی	۹	۱۹,۵۲۷	۱۹,۵۰۲	-۰.۱٪	۴۳۱,۵۵۵,۷۷۸	۱۸۷,۶۳۴,۵۱۷	-۵۶.۵٪
	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۲۶	۳,۸۲۲	۳,۸۱۳	-۰.۲٪	۳۶,۰۶۱,۲۳۵	۱۵,۳۳۲,۱۵۴	-۵۷.۵٪
	دارویی	۲۷	۸,۶۵۸	۸,۶۵۶	۰.۰٪	۷۴,۳۶۷,۸۰۴	۲۸,۱۲۸,۹۷۶	-۶۲.۲٪
	فنی و مهندسی	۸	۷۲۶	۷۳۳	۱.۰٪	۳۳,۱۳۲,۴۶۸	۱۰,۱۴۹,۰۲۴	-۶۹.۴٪
	مخابرات	۲۵	۱,۱۰۴	۱,۱۰۴	۰.۰٪	۱۳,۵۶۲,۰۱۱	۳,۷۸۴,۲۶۱	-۷۲.۱٪
	چندرشته ای صنعتی	۲۱	۹,۳۲۳	۹,۳۰۹	-۰.۲٪	۴۷,۰۷۰,۵۳۳	۹,۳۹۱,۲۸۱	-۸۰.۰٪
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۵	۲۴۲	۲۴۲	۰.۰٪	۷۰,۸۴۱,۰۵۰	۸,۰۳۹,۰۴۲	-۸۸.۷٪

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران

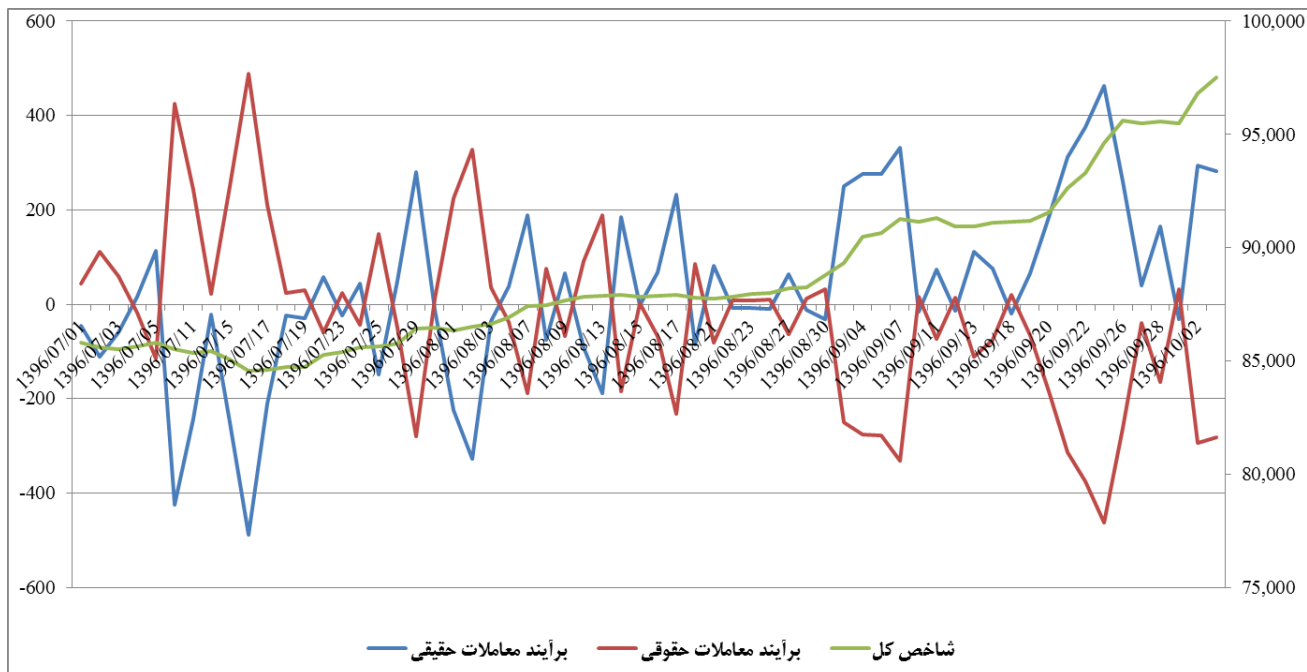
با توجه به جدول فوق، در گروه های وسایل ارتباطی، فلزات اساسی و شیمیایی و پتروشیمی بیشترین رشد در متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به متوسط چهارده روز اخیر، مشاهده می شود و سایر صنایع کاهش متوسط ارزش معاملات روز جاری نسبت به میانگین ۱۴ روز اخیر داشته اند.

وضعیت صنایع منتخب در ۱۴ روز منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۱۸

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	شیمیایی و پتروشیمی	۷۵	۵,۷۱۴	۵,۹۹۶	۴.۹۴%	۱,۱۱۲,۱۶۱	۱,۱۵۵,۷۶۱	۳.۹۲%
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۳	۲۲۷	۲۴۲	۶.۶۱%	۱۴۳,۳۰۸	۱۴۸,۵۴۶	۳.۶۶%
	فرآورده های نفتی	۵	۳۴۰,۴۹۲	۳۴۹,۴۹۸	۲.۶۴%	۳۷۴,۵۵۰	۳۸۲,۲۹۵	۲.۰۷%
	فلزات اساسی	۴۵	۵۶,۹۴۱	۵۷,۶۷۱	۱.۲۸%	۶۷۹,۰۲۳	۶۸۹,۲۰۳	۱.۵۰%
	چند رشته ای صنعتی	۱۸	۹,۱۸۸	۹,۳۰۹	۱.۳۳%	۲۳۵,۴۲۳	۲۳۸,۴۴۴	۱.۲۸%
	استخراج کانه های فلزی	۲۷	۱۹,۳۱۸	۱۹,۵۰۲	۰.۹۵%	۲۴۴,۱۷۱	۲۴۶,۴۴۶	۰.۹۳%
	مخابرات	۲۵	۱,۱۰۵	۱,۱۰۴	-۰.۰۹%	۱۶۴,۰۰۶	۱۶۴,۱۱۲	۰.۰۶%
	رایانه	۴۲	۱۲,۰۴۸	۱۲,۰۳۹	-۰.۰۷%	۱۳۸,۳۳۷	۱۳۸,۲۳۹	-۰.۰۷%
	بانکها و موسسات اعتباری	۲۶	۵۸۳	۵۸۴	۰.۱۷%	۴۰۴,۹۷۸	۴۰۴,۳۱۳	-۰.۱۶%
	وسایل ارتباطی	۳	۲,۱۸۷	۲,۰۵۹	-۵.۸۵%	۱۳۹,۱۶۹	۱۳۸,۷۷۴	-۰.۲۸%
	سرمایه گذارها	۲۱	۲,۱۲۲	۲,۰۵۵	-۳.۱۶%	۱۱۳,۶۵۳	۱۱۱,۷۲۸	-۱.۶۹%
	حمل و نقل و انبارداری و ارتباطات	۴۰	۳,۹۵۹	۳,۸۱۳	-۳.۶۹%	۸۱,۴۲۴	۸۴,۹۴۳	۳.۹۴%
	دارویی	۱۵	۸,۹۲۶	۸,۶۵۶	-۳.۰۲%	۱۴۳,۰۳۵	۱۳۷,۴۰۰	-۳.۹۴%
	فنی و مهندسی	۹	۷۸۷	۷۳۳	-۶.۸۶%	۸۲,۱۷۶	۷۶,۶۳۵	-۶.۷۴%
خودرو و قطعات	۸	۱۸,۱۰۲	۱۶,۷۵۸	-۷.۴۲%	۱۷۴,۵۹۱	۱۶۲,۱۱۰	-۷.۱۵%	

باتوجه به جدول فوق در می یابیم که بیشترین تغییرات در ارزش بازاری در گروه های شیمیایی و پتروشیمی 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 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.