

وضعیت بازار سرمایه در هفته منتهی به ۱۴۰۰/۶/۳۱

روز چهارشنبه ۳۱ شهریور ماه ارزش معاملات کل بازار به ۱۰،۶۲۹ میلیارد تومان بود. ارزش معاملات خرد نسبت به روزهای قبل رشد یافت و به حدود ۸،۲۰۰ میلیارد تومان رسید و ۷۷ درصد از کل معاملات را در بر گرفت. همچنین حدود ۱۰ هزار میلیارد تومان اوراق دولتی در بازار فروخته شد.

ارزش صفوف خرید در ابتدای بازار حدود ۱،۸۰۰ میلیارد تومان بود که در پایان بازار به ۳۵۰ میلیارد تومان کاهش یافت. ارزش صفوف فروش از ۵۱۰ میلیارد تومان به حدود ۶۰۰ میلیارد تومان رسید.

در روز یاد شده گروه های فلزی، خودرو و قطعه ساز، فعالیت های کمکی مالی، شیمیایی و فرآورده های نفتی صدرنشین ارزش معاملات روز چهارشنبه بودند.

در یک ساعت پایانی بازار شاهد بهبود معاملات و افزایش تقاضا در گروه پالایشی بودیم، به نحوی که خریداران برای سهم های شپنا، شتران و شبندر به صف نشستند.

حقیقی ها تا توانستند سمگا، حآفرین، فسبزوا، شتران، کالا، شپنا، مفاخر و خزر خریدند و در مقابل فجهان، برکت، شبندر، فولاد، وپست، فملی، شستا، میدکو و خگستر را به حقوقی ها فروختند.

تراز پول حقیقی در صندوق های سرمایه گذاری با درآمد ثابت مثبت ۷۸ میلیارد تومان بود.

در یک ربع ابتدایی معاملات شاخص کل سبزپوش بود و تا ۱ میلیون و ۳۹۳ هزار واحد رشد کرد اما بعد از آن شرایط تغییر یافت و عرضه ها شدت گرفت. افزایش فروش ها موجب شد تا شاخص در سراسیمی قرار گرفته و تا ۱ میلیون و ۳۷۹ هزار واحد افت کند. اما از ساعت ۱۱ و ۵ دقیقه یکبار دیگر تقاضاها قدرت گرفتند و بازار رو به بالا حرکت کرد و موجب شد تا شاخص کل بخشی از افت خود را جبران کند.

در پایان معاملات چهارشنبه شاخص کل کمتر از ۵ هزار واحد معادل ۰،۳۵ درصد افت داشت و به محدوده ۱ میلیون و ۳۸۶ هزار واحد رسید. نمادهای پارس، شستا و فخوز بیشترین تاثیر منفی و شپنا، شتران، و صندوق و شبندر بیشترین تاثیر مثبت را بر شاخص داشتند. شاخص هم وزن هم با ریزش ۱،۴۳ درصدی بیش از ۶ هزار واحد دیگر اصلاح شد و در ارتفاع ۴۱۵ هزار واحد قرار گرفت. شاخص فرابورس نیز ۱۵۷ واحد کاهش داشت تا شهریور را در ارتفاع ۲۰،۵۶۴ واحدی به پایان برساند.

شاخص بورس در شهریورماه امسال در حالی با افت ۸،۵۲ درصد مواجه و در ارتفاع یک میلیون و ۳۸۶ هزار واحد متوقف شد که ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی با ۷۱.۳ درصد، دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش با ۴۵،۸ درصد، استخراج سایر معادن با ۲۵،۵ درصد، کاشی و سرامیک با ۵،۲ درصد و تامین آب، برق و گاز با ۳،۷ درصد بیشترین اثر مثبت و منسوجات با ۳۲،۳ درصد، محصولات چوبی با ۲۰،۷ درصد، انتشار،

چاپ و تکثیر با ۱۹,۶ درصد، اطلاعات و ارتباطات با ۱۹,۴ درصد و حمل و نقل با 18.9 درصد بیشترین اثر منفی را بر شاخص بورس در آخرین ماه تابستان امسال داشتند .

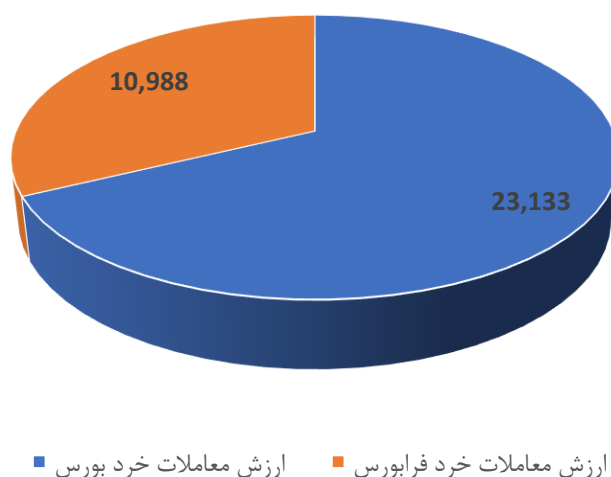
همچنین در ماهی که گذشت خودرو و ساخت قطعات با ۵۲۴۹۰ میلیون سهم، بانکها و موسسات اعتباری با ۲۳۲۹۲ میلیون سهم، سرمایه‌گذاری‌ها با ۱۷۴۶۵ میلیون سهم، فرآورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای با ۱۶۰۱۶ میلیون سهم، فلزات اساسی با ۸۵۷۸ میلیون سهم، محصولات شیمیایی با ۷۳۱۵ میلیون سهم، بیمه و صندوق‌های بازنشتی بجز تامین اجتماعی با ۷۲۸۹ میلیون سهم، ساخت محصولات فلزی با 7035 میلیون سهم، انبوه‌سازی، املاک و مستغلات با ۵۸۸۷ میلیون سهم و شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی با ۴۷۴۷ میلیون سهم بیشترین حجم معاملات ماهانه را به نام خود ثبت کردند.

وضعیت بازار در شهریور ماه- کلیه میالغ به میلیارد تومان است							
روز	اوراق دولتی	ارزش کل بازار	ارزش معاملات خرد	سهم حقیقی‌ها	سهم حقوقی‌ها	برایند ورود و خروج پول خرد	شاخص کل
1 شهریور	8,744	12,476	10,670	86%	14%	-130	1,515,886
2 شهریور	1,302	13,383	10,600	79%	21%	275	1,543,476
3 شهریور	3,096	14,609	11,930	82%	18%	60	1,550,120
6 شهریور	4,257	15,444	12,750	83%	17%	399	1,575,763
7 شهریور	6,378	19,291	17,390	90%	10%	-1,108	1,573,406
8 شهریور	17,535	13,897	12,526	90%	10%	-1,975	1,523,997
9 شهریور	17,161	18,161	13,990	77%	23%	-679	1,496,158
10 شهریور	11,292	14,987	9,600	64%	36%	731	1,520,686
13 شهریور	12,341	12,759	9,700	76%	24%	462	1,541,054
14 شهریور	1,540	11,250	9,600	85%	15%	268	1,537,270
15 شهریور	12,390	18,452	10,600	57%	43%	39	1,538,506
16 شهریور	5,700	16,063	8,500	53%	47%	-264	1,523,086
17 شهریور	5,000	22,845	7,100	31%	69%	-63	1,526,009
20 شهریور	7,762	19,965	7,500	38%	62%	-424	1,530,517
21 شهریور	7,574	18,800	6,300	34%	66%	-1,420	1,489,994
22 شهریور	15,230	24,090	6,800	28%	72%	-540	1,475,274
23 شهریور	11,271	14,592	6,000	41%	59%	310	1,496,955
24 شهریور	28,316	8,455	5,600	66%	34%	-434	1,488,294
27 شهریور	34,835	11,071	5,930	54%	46%	-840	1,450,221
28 شهریور	12,264	7,700	5,500	71%	29%	-900	1,420,484
29 شهریور	3,665	7,102	4,980	70%	30%	-300	1,427,758
30 شهریور	14,324	11,033	6,800	62%	38%	-1,060	1,391,219
31 شهریور	9,950	10,609	8,200	77%	23%	-605	1,386,450
مجموع	251,927	337,034	208,566	62%	38%	-8,198	-9%
							-5%

خلاصه اتفاقات بازار (شاخص‌ها)				
آخرین وضعیت شاخص‌ها	پایان معاملات روز قبل	پایان معاملات امروز	میزان تغییرات (واحد)	میزان تغییرات (درصد)
شاخص کل	۱,۳۹۱,۳۳۵	۱,۳۸۶,۴۰۱	۴,۸۳۴	-۰.۳۵%
شاخص هموزن	۴۲۱,۵۱۸	۴۱۵,۴۹۵	۶,۰۲۳	-۱.۴۳%
شاخص فرابورس	۲۰,۷۲۱	۲۰,۵۶۴	۱۵۷	-۰.۷۶%
نمادهای تأثیرگذار				
نمادهای موثر در رشد TEPiX	شپنا-شتران-وصندوق	نمادهای موثر در رشد IFX	آریا-سمگا-ومهان	
نمادهای موثر در افت TEPiX	پارس-شستا-فخوز-اخابر	نمادهای موثر در افت IFX	بپاس-فجهان-هرمز	
شاخص صنایع مثبت	فرآورده‌های نفتی-استخراج نفت-چندرشته‌ای-تامین آب‌برق، گاز-غذایی-شیمیایی			
شاخص صنایع منفی	اکثر صنایع			
روند شاخص	از ابتدا تا ۹:۳۰ صعودی / از ۹:۳۰ تا ۱۰:۵۵ نزولی / از ۱۰:۵۵ تا انتهای ساعت معاملات صعودی			
بازار P/E	۹			
بازار P/S	۳.۵			
نرخ ارز	۲۷,۵۴۰	ارزش دلاری کل بازار (میلیارد دلار)	۲۴۴	

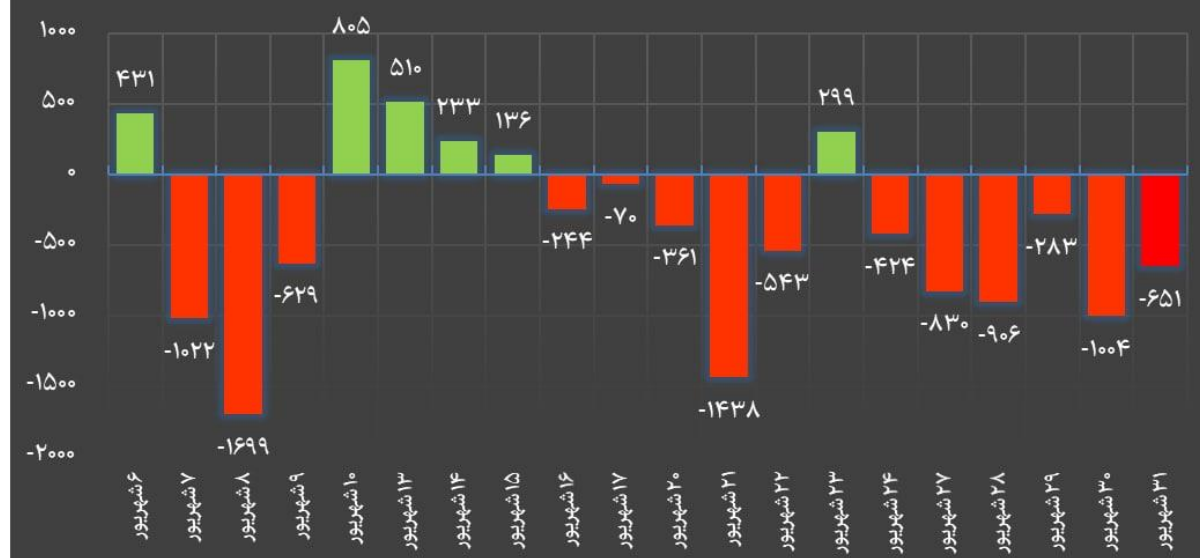
آمار معاملات	
ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (با در نظر گرفتن اوراق، صندوق‌ها و بلوک‌ها)	۱۴,۴۱۲
ارزش معاملات خرد بورس	۶,۱۶۹
ارزش معاملات خرد فرابورس	۲,۷۹۰
ارزش کل معاملات خرد (بدون بلوک‌ها، اوراق مشارکت و صندوق با درآمد ثابت)	۸,۹۵۹
ارزش کل معاملات معاملات بلوکی، اوراق و صندوق‌های درآمد ثابت	۵,۴۵۳
درصد تغییرات در ارزش معاملات نسبت به روز گذشته	
ارزش معاملات خرد روز کاری گذشته	۷,۶۸۶
درصد تغییرات	۱۷%
سهم بازار از ارزش معاملات ۴ نماد برتر	
فسبزوار-فجهان-کالا-پالایش	۲,۲۹۳
سهم ۴ نماد برتر از کل ارزش معاملات	۲۶%
(ورود/خروج) نقدینگی (میلیارد تومان)	(۶۵۱)

ارزش معاملات خرد بورس و فرابورس (میلیارد تومان)



برآیند ورود و خروج نقدینگی خرد در روز چهارشنبه منفی ۶۰۵ میلیارد تومان بود. بیشترین خروج پول از گروه های فلزی، شیمیایی، بانکی، دارویی و خودرو و قطعه ساز اتفاق افتاد. اما گروه های هتل و رستوران، فعالیت های کمکی مالی، حمل و نقل، فرآورده های نفتی و پیمانکاری صنعتی شاهد تزریق نقدینگی حقیقی بودند.

برآیند ورود و خروج پول حقیقی در یک ماه اخیر (میلیارد تومان)



تغییرات بازارهای جهانی در هفته منتهی به ۱۴۰۰/۷/۰۲

درصد تغییرات	تاریخ		واحد	نام محصول
	۱۴۰۰/۷/۰۲	۱۴۰۰/۶/۲۷		
3.64%	\$ 78.05	\$75.31	بشکه/دلار	نفت برنت
-0.28%	\$1.750	\$ 1.755	مئقال/دلار	طلا
-۰.۸۷%	\$ ۲,۱۶۵	\$ 2.184	تن/دلار	سرب
۸.۸۲%	\$ ۱۱۱	\$ ۱۰۲	تن/دلار	سنگ آهن
۱,۴۷%	\$ ۳,۱۱۳	\$ ۳,۰۶۸	تن/دلار	روی
۱,۸۴%	\$ ۲,۹۲۶	\$ ۲,۸۷۳	تن/دلار	آلمینیوم
۵,۶۴%	\$ ۳۵۶	\$ ۳۳۷	تن/دلار	متانول
۱,۰۰%	\$ ۹,۳۵۷	\$ ۹,۲۶۴	تن/دلار	مس
۰,۰۰%	\$ ۶۰۰	\$ ۶۰۰	تن/دلار	بیلت
۲۰,۳۳%	\$ ۵۸۰	\$ ۴۸۲	تن/دلار	اوره