



بسم الله الرحمن الرحيم

گزارش روز بازار (۱۳۹۷/۰۷/۱۴)

نمای کلی بازار:

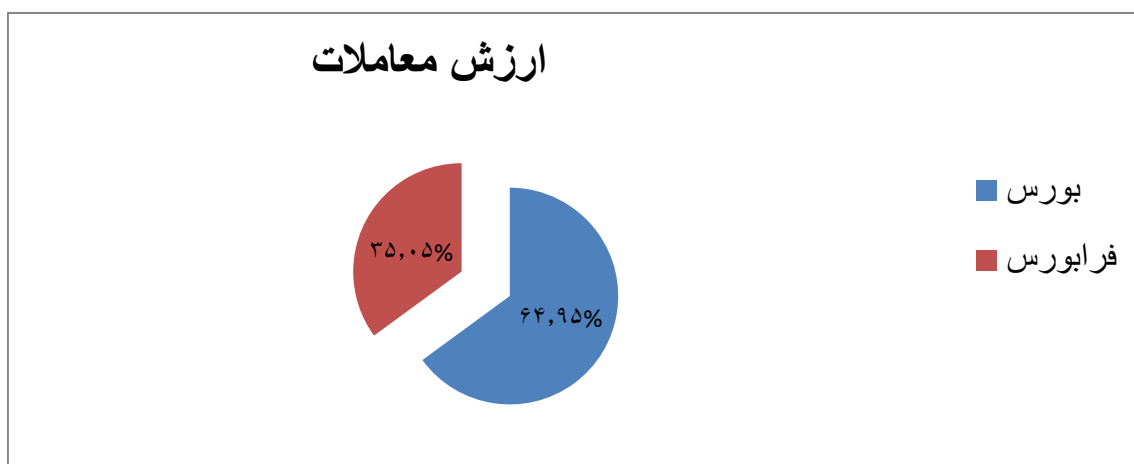
شاخص ها			
عنوان	واحد	تغییر نسبت به روز گذشته	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
شاخص کل	۱۸۴,۰۸۵	(۱,۴۷۴)	(۰,۷۹)
شاخص کل هم وزن	۳۱,۷۰۸	(۵۱۷)	(۱,۶۱)
فرا بورس	۲,۱۰۹	(۵)	(۰,۲۵)

حجم معاملات (میلیون سهم)			
بازار	حجم امروز	تغییر نسبت به روز گذشته	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
بورس اوراق بهادار تهران	۶,۱۰۱	۳۸۲	۶,۶۹
فرا بورس ایران	۱,۶۷۲	۳۷۷	۲۹,۱۵
جمع	۷,۷۷۳	۷۶۰	۱۰,۸۴

ارزش معاملات بورس (میلیارد تومان)			
نوع معامله	ارزش معاملات روز	تغییر نسبت به روز گذشته	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
معاملات عادی سهام در بورس	۱,۸۰۳	۹۷	۵,۶۹
معاملات عمده، بلوکی، اوراق مشارکت و صندوق سرمایه گذاری	۶۴	(۳۴)	(۳۴,۸۱)
جمع	۱,۸۶۸	۶۲	۳,۴۷

ارزش معاملات فرا بورس (میلیارد تومان)			
نوع معامله	ارزش معاملات روز	تغییر نسبت به روز گذشته	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
معاملات عادی سهام در فرا بورس	۴۹۴	۹۹	۲۵,۲۱
معاملات عمده، بلوکی	۳۸	۰,۲۳	۰,۶۱
اوراق با درآمد ثابت و اوراق تسهیلات مسکن	۴۷۵	۱۲۶	۳۶,۴۴
جمع	۱,۰۰۸	۲۲۶	۲۹,۰۳

ارزش معاملات بازارها (میلیارد تومان)		
بازار	ارزش معاملات	درصد
بورس اوراق بهادار تهران	۱,۸۶۸	۶۴,۹۵
فرا بورس ایران	۱,۰۰۸	۳۵,۰۵
کل	۲,۸۷۶	۱۰۰



معاملات عمده و بلوکی مهم در بازار فرا بورس			معاملات عمده و بلوکی مهم در بازار بورس		
ارزش تقریبی (میلیارد ریال)	نماد	نام اوراق	ارزش تقریبی (میلیارد ریال)	نماد	نام اوراق
۲۸۴	اعتماد	صندوق س. اعتماد آفرین پارسیان-د	۲۰۸	پارند	ص.س. پارند پایدار سپهر
۴۸	افرا	افرانت	۱۵۵	امین یکم	ص. درآمد ثابت امین یکم فردا
۲۶	ثروتم	ص.س. ثروت آفرین پارسیان-م	۱۳۶	کهمد۱	شیشه همدان
۱۴	اطلس	ص.س. توسعه اندوخته آینده-س	۱۰۳	کمند	ص.س. با درآمد ثابت کمند
۲	الماس	ص.س. امین تدبیرگران فردا-س	۳۳	صایتل ۹۰۲	صکوک اجاره رایتل ماهانه ۲۱%



کلیت بازار:

تغییر جهت ناگهانی بازار

بازار با پیشتازی گروه فراورد های نفتی و بانک شروع به کار کرد و در ابتدای بازار در اکثر گروه ها بهبود جو معاملات نسبت به روزهای پایانی هفته گذشته مشهود می باشد. افزایش نسبی عرضه در کلیت بازار پس از گذشت حدود ۱ ساعت از بازار مشهود بود. برخی نمادها که شروعی مثبت داشتند به محدوده منفی معاملات وارد شدند و صفوف خرید به خصوص در نمادهای پالایشگاهی نیز با عرضه روبرو شد. فشار فروش اکثر نمادهای بازار را با سرعت زیادی به سمت محدوده های منفی حرکت داد و در گروه های خودرو، انبوه سازی، فراورده های نفتی، محصولات شیمیایی، فلزات اساسی و دیگر گروه های بازار شاهد هیجان شدید فروش و تشکیل صفوف فروش بودیم. با توجه به وضعیت نموداری شاخص بیشتر از این حرکت منفی، رشد سنگین نمادها در ابتدای بازار غیر طبیعی بود و به نظر می رسد روند شکل گرفته تا حدود زیادی منطبق با سناریوی اصلاحی بازار باشد که البته در نمادهای با پشتوانه بنیادی چندان عمیق نیز نخواهد بود.

در فلزی ها معاملاتی منفی در اکثر نمادها برقرار شد و به جز نمادهای فنورد و فروش که مثبت داد و ستد شدند، بقیه نمادها افت قیمتی را تجربه نمودند. نماد ذوب نیز پس از بازگشایی با افت قیمتی و صف فروش سنگین روبرو شد.

در گروه محصولات شیمیایی نیز همسو با جو عمومی بازار شاهد بازگشت قیمتی بسیاری از نمادها در ابتدای بازار بودیم. زاگرس، شغدیر، تاپیکو، پارس، شپدیس، کرماش، شیراز، خراسان از نمادهای مود توجه بازار بودند و شاراک نیز متعادل و منفی داد و ستد میشد. این گروه نیز در ادامه و با افزایش فشار فروش در بازار، به جز نماد شغن و شپدیس که در نزدیکی صفر تابلو داد و ستد می شدند، بقیه نمادها با افت قیمت و فشار فروش روبرو شدند.

در گروه فراورده های نفتی شپنا، شبندر، شتران، شاون، شبریزو شنت از نمادهای مورد توجه در ابتدای بازار بودند. افزایش فشار فروش و عرضه صفوف خرید در این گروه شاهد رشد قیمتی مجدد نماد شپنا هستیم که بهبود جو گروه را به دنبال داشت. نوسان شدید در نماد شپنا را که مجدداً با افزایش تقاضای مناسب به صف خرید رسید شاهد بودیم هرچند مجدداً با افزایش عرضه این نماد نیز متعادل شد و حجم معاملات به بیش از ۱۰۰ میلیون سهم رسید.

در معدنی ها به جز نماد ومعدان بقیه نمادها با وسان منفی مواجه شدند.

در گروه عرضه برق، سیمان، انبوه سازی، کاشی و سرامیک، کانی غیرفلزی همه نمادها با افت مواجه شدند. در گروه خودرو و قطعات، علیرغم جو مثبت بازار در آغاز، از ابتدا شاهد معاملاتی منفی در اکثر نمادها بودیم. خزامیا تنها نماد



بسم الله الرحمن الرحيم

گزارش روز بازار (۱۳۹۷/۰۷/۱۴)

مثبت خودروساز بود و خادین، خفنر، خلنت و خدیزل در قطعه سازها مورد توجه بودند و که با افزایش عرضه تمامی این نمادها به محدوده منفی وارد شدند.

در گروه حمل و نقل نمادهای حسیر با صف خرید روبرو بود بقیه نمادها همسو با بازار با صف فروش همراه شدند. در گروه واسطه گری مالی نیز وضعیت متفاوتی با کلیت بازار نداشت و افت قیمت در تمامی نمادها صورت گرفت. در گروه بانک که امروز نیز مورد توجه می باشد معاملات اکثر نمادها در آغاز با رشد قیمت و صف خرید همراه بودند. دی، وبملت و تجارت در ابتدا با تقاضای سنگین خرید روبرو بودند و در ادامه و با افزایش عرضه این نمادها نیز به محدوده منفی رسیدند.

در گروه بیمه که مطابق با جو کلی بازار با فشار عرضه مواجه بودند، نماد بیاس و ما امروز مورد توجه بودند. در گروه قند و شکر تیز به جز دو نماد قشرین و قنابت و قشهد بقیه نمادها با صف فروش همراه بودند. در گروه ساخت محصولات فلزی همچنان فجام صف خرید بود و بقیه نمادهای با افت قیمتی همراه بودند. در چند رشته ای ها نماد وامید امروز نیز با رشد مواجه بود و صندوق و وبانک و وغدیر با افت مواجه بودند. در گروه رایانه، اطلاعات و ارتباطات تاپکیش، مورد توجه بود و بقیه نمادها افت قیمتی داشتند. در پایان معاملات روز جاری شاخص کل با بیشترین تاثیر از افت نمادهای فولاد، فملی، پارس، کچاد، با افت ۱۴۷۵ واحدی روبرو شد. رفتار هیجانی بازار و افت قیمتی سنگین نمادها از سقف تا کف مجاز قیمتی از رویدادهای جالب توجه روز جاری بود. لمس محدوده های مقاومتی سرسخت که با شایعاتی مبنی بر تغییر رویه خرید اعتباری در بازار سهام همراه شد عکس العمل شدیدی را در پی داشت که پس از تکذیب این شایعات نیز همچنان جو منفی بازار پابرجا بود.

افت امروز بازار در اکثر سهامی که صف خرید بودند و عرضه سهام تا صف فروش آن هم در یک زمان مشخص به وسیله معاملات الگوریتمی حالا به هر دلیل ، نشانه اصلاح بازار می باشد که در سهام با بنیاد قوی اصلاح به صورت زمانی خواهد بود و سهام غیر بنیادی افت بیشتری را تجربه خواهند نمود.

موضوع دیگر ثابت نبودن قیمت دلار و زمزمه ها مبنی بر کاهش آن نیز بی تاثیر نبود اما با توجه به اینکه قیمت ارز مسافرتی امروز ۱۱۸۰۰ اعلام شد و صف طولانی در صرافی ها برای ثبت نام تشکیل گردید می توان این قیمت را کف قیمت دلار در نظر گرفت با توجه به اینکه شرکت های دلار محور محصولات خود را با دلار نیمایی ۸۰۰۰ تومان تا ۱۰۰۰۰ تومان می فروختند به نظر نگرانی زیادی نباید داشت از طرفی بازارهای جهانی نیز افتی را شاهد نبودیم می توان نتیجه گرفت تنها یک اصلاح زمانی داریم .

پیشنهاد می گردد کسانی که اعتبار دارند اعتبار خود را تصفیه نموده و در موقع مناسب با اعتبار خرید نمایند.

اصلاح شاخص تا محدوده ۱۸۱،۰۰۰ واحد و در صورتی که جو فروش بیشتری ایجاد گردد تا ۱۷۵،۰۰۰ واحد خواهد بود .