

عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی شرکت سرمایه گذاری در بازار بورس و مقایسه با اهم رقبا

تاریخ گزارش: ۹۶/۱۱/۱۱		عملکرد از ابتدای سال		آخرین تعداد سفارش		وضعیت سهام							نام شرکت	
پوشش ریالی بودجه (۹ ماهه)	بازده کل	رتبه نقدشوندگی	عرضه	تقاضا	P/E	EPS	میزان تاثیر بر شاخص	درصد تغییر	آخرین قیمت	قیمت پایانی	درصد از کل ارزش معاملات	ارزش معاملات		حجم معاملات
۴۰	۴۴.۲	۲۴	۱۴,۳۳۷	۲۲,۳۲۰	۷.۵	۲۴۲	(۳)	-۰.۲۲	۱,۸۱۸	۱,۸۰۳	۰.۱۷	۱۳,۰۶۷	۷,۲۴۵,۶۹۲	توسعه معادن و فلزات
۱۳۸	۸.۶	۳۳	۵۰,۸۶۵	۲۰,۰۰۰	۱۱.۰	۲۴۵	(۱)	-۰.۷۰	۲,۷۰۰	۲,۶۹۴	۰.۰۴	۲,۸۶۵	۱,۰۶۳,۹۶۶	توسعه معدنی و صنعتی صبانور
۲۱۰	۴۲.۱	۳۶	۳,۶۰۰	۱,۵۹۴	۵.۳	۴۲۵	(۲۵)	-۱.۴۵	۲,۲۲۰	۲,۲۴۵	۰.۲۰	۱۵,۶۷۲	۶,۹۸۲,۲۵۸	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید
۲۰۹	۳۱.۶	۴۱	۳,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۵.۷	۳۷۰	(۱۸)	-۰.۹۹	۲,۰۹۰	۲,۰۹۳	۰.۱۱	۸,۵۴۴	۴,۰۸۸,۱۳۹	معدنی و صنعتی چادرملو
۲۳۱ ریال شش ماهه	۴۹.۶	۲۷	۲۳,۷۷۰	۶,۴۰۰	۵.۳	۶۵۰	(۵۲)	-۱.۹۸	۳,۴۱۰	۳,۴۱۷	۰.۱۵	۱۱,۸۹۱	۳,۴۸۰,۰۹۳	معدنی و صنعتی گل گهر
۴۹۱	۱۰۹.۷	۲	۱۰۰	۴۶,۰۰۰	۵.۲	۵۴۶	(۴۳)	-۰.۸۰	۲,۸۴۹	۲,۸۵۵	۰.۶۳	۴۹,۱۳۸	۱۷,۲۰۹,۲۹۴	فولاد مبارکه اصفهان
۷۳۵	۵۲.۹	۳۰	۶۳,۲۸۱	۱۴,۸۴۵	۵.۷	۸۱۲	(۱۳)	-۰.۷۷	۴,۶۵۰	۴,۶۱۱	۰.۱۳	۱۰,۰۳۰	۲,۱۷۵,۱۵۲	فولاد خوزستان
۳۳۴	۱۵.۳	۴۹۷	۹۱۸	۱,۷۴۰	۱۷.۳	۳۴۷	-	-۰.۰۲	۵,۶۹۹	۵,۹۹۶	۰.۰۰	۹	۱,۵۱۸	فولاد امیرکبیرکاشان
۲۸۸	۵۹.۹	۱۸	۵,۰۰۰	۱۶,۵۲۰	۵.۹	۴۶۲	(۱۸.۱)	۱.۰۰	۲,۷۳۷	۲,۷۳۰	۰.۲۵	۱۹,۸۰۳	۷,۳۴۶,۷۱۴	ملی صنایع مس ایران
۱۲۱	(۲۱)	۴۲۶	۲,۰۰۰	۱,۰۰۰	۲۵.۳	۱۴۷	-	-۰.۰۵	۳,۷۰۰	۳,۷۲۶	۰.۰۰	۱۲۱	۳۳,۵۰۸	فولاد خراسان
-۳۹	۴۷.۵	۱۳۷	۳,۲۰۰	۱۱۰	۱۵.۶	۲۸۰	-	-۰.۴۶	۴,۴۲۵	۴,۳۵۶	۰.۱۶	۱۲,۷۷۰	۲,۹۳۱,۸۱۳	شرکت آهن و فولاد ارفع
-۱۲۰	۴.۶	۱۲۴	۵۰۰	۵,۴۵۶	۲۲.۶	۹۸	(۱)	-۳.۰۷	۲,۲۰۰	۲,۲۱۰	۰.۰۱	۷۰۳	۳۱۸,۱۳۸	کارخانجات تولیدی شهید قندی
۱۹۴ ریال زیان (۹ ماهه)	(۶)	۲۵۲	۱,۰۰۰	۳,۷۶۶	۱۰.۶-	۱۹۹-	-	۰.۷۱	۲,۱۲۸	۲,۱۱۶	۰.۰۰	۱۶۰	۷۵,۷۸۹	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان
-	(۲۴)	-	۸,۰۰۰	۰	۱۳.۱	۶۲	-	۰.۰	۸۲۵	۸۲۷	۰.۰۰	۰	۰	بانک سامان
(۴۲۴)	تغییرات مثبت / منفی	۹۸,۵۵۸	روز کاری گذشته برابر با:				۹۸,۱۳۴	در تاریخ گزارش برابر با:					۱- شاخص کل	
(۱۳۶)		۳۱,۴۸۶					۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)							
(۴۶۰)		۱۷,۵۱۸					۴- شاخص کل (هم وزن)							
(۳۵)		۱۳,۱۶۶					۵- شاخص قیمت (هم وزن)							
(۵۳۳)		۱۰۵,۹۲۱					۵- شاخص شناور آزاد							
۵		۱,۰۸۴					۶- شاخص فرابورس							



عملکرد بازار بورس و فرابورس در تاریخ گزارش

بیشترین تاثیر مثبت در شاخص		بیشترین تاثیر منفی در شاخص		حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیون سهم)		ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)		رتبه سر.معادن و فلزات در حجم معاملات		رتبه سر.معادن و فلزات در ارزش معاملات	
۱- شنف ۱۹.۴۹+	۲- تاپیکو ۱۴.۳+	۱- فارس ۵۸.۹۱-	۲- کگل ۵۱.۸۹-	۲۱۶	۱۲.۳۸۳	۲۲۴	۷.۸۱۰	۴۶	۱۶.۱۰۱	۶۸	۵۷۷
نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت		نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی		تعداد نماد با تغییرات مثبت		تعداد نماد با تغییرات منفی		تعداد نماد بدون تغییر		تعداد نمادهای متوقف	
سالار، کوز و شنف		دارابج، فساح و جهرمج		تعداد سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم)		ارزش سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال)		تغییرات ریالی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش		تغییرات درصدی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	

بیشترین ارزش معاملاتی سهام بازار امروز در سهام مربوط به نمادهای زاگرس ۲، کروی ۲ و کرماشاه ۲ به ترتیب به ارزش ۷۷۲، ۵۳۷ و ۲۶۵ میلیارد ریال معامله بوده که این سه حدود ۱۸.۴۱٪ از ارزش بازار امروز را تشکیل می‌دادند.

عملکرد بازارها و شاخص‌های جهانی در تاریخ گزارش

شاخص	مقدار (واحد)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته	کامودیتی	نرخ (دلار/بشکه) یا (دلار/تن)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
شاخص داوجونز	۲۶.۰۷۷	(۱.۳۷)	نفت برنت	۶۸.۱	۰.۱۲
شاخص S&P ۵۰۰	۲.۸۲۲	(۱.۰۹)	مس	۷.۱۴۱.۵	۰.۸۴
شاخص ترکیبی نزدک	۷.۴۰۲	(۰.۸۶)	روی	۳.۵۲۱.۸	۰.۴۶
شاخص نیکی ژاپن	۲۳.۰۹۸	(۰.۸۳)	آلومینیوم	۲.۲۲۷.۳	۰.۴۷
شاخص دلار	۸۹.۹	(۰.۳۱)	اونس طلا	۱.۳۴۳.۵	۰.۳۷

نرخ‌های جهانی بیلت فولاد و سنگ آهن

نوع بیلت	میانگین نرخ (دلار/تن)	درصد تغییر نسبت به هفته گذشته	کشور	مشخصات و شرایط فروش سنگ آهن	نرخ دلاری (\$) (تغییر)
CIS (فوب دریای سیاه)	۵۱۱	(۱.۷۳)	استرالیا	ریزدانه ۵۶.۷٪ تا ۶۲.۵٪ - فوب بندر دمپایر	۳۶-۶۹ (+۰.۵)
ترکیه (فوب)	۵۳۷.۵	(۰.۹۲)		درشت دانه ۶۲٪ و ۶۳٪	۷۷.۲-۷۹.۳ (+۰.۵)
هند (فوب)	۵۱۵	۰.۹۸		ریزدانه ۶۱٪ تا ۶۵٪ فوب بندر توپارو	۲۳.۲-۷۴.۷ (-۰.۳)
امارات (سی اف آر جبل علی)	۵۱۹.۵	(۰.۲۹)	برزیل	درشت دانه ۶۴٪ فوب بندر توپارو	۶۲.۴ (-)
مصر (سی اف آر)	۵۱۷.۵	(۰.۴۸)		گندله ۶۵٪ فوب بندر توپارو	۱۰۹.۷ (-۰.۵)
مسیر حمل سنگ آهن	نرخ (دلار)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته	هند	ریزدانه ۵۵٪ تا ۶۳٪ فوب بندر Chennai و Goa	۲۴-۶۰.۴ (-۰.۳)
برزیل به چین	۱۴.۸۰۹	(۰.۹)	روسیه	کنسانتره با عیار ۶۵٪ و ۶۶٪ فوب دریای سیاه	۷۶.۹-۷۸ (-۰.۵)
غرب استرالیا به چین	۶.۹۶۴	۰.۱		گندله با عیار ۶۳٪ و ۶۵٪ فوب دریای سیاه	۱۰۶-۱۱۱ (-۰.۵)
هند به چین	۱۰.۷	(۰.۹)	ایران	کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۷٪ - فوب بندر عباس	۷۹.۱-۸۲.۶ (-۰.۳)
آفریقا به چین	۱۱.۲	(۰.۹)		همانیت با عیار ۵۵٪ تا ۵۶٪/۶۱٪ - فوب بندر عباس	۲۴.۵-۲۸.۵ (-۰.۳)
ایران به چین	۱۵.۸	۰.۰		مگنتیت با عیار ۵۳٪ تا ۵۴٪/۶۱٪ - فوب بندر عباس	۲۵.۷-۴۲.۴ (-۰.۳)
موجودی انبار سنگ آهن	مقدار (هزار تن)	درصد تغییر نسبت به هفته گذشته	موجودی انبار سنگ آهن	مقدار (هزار تن)	درصد تغییر نسبت به هفته گذشته
موجودی کل انبارهای چین	۱۵۱.۶۹۰	(۰.۸)	موجودی انبار بندر Caofidian	۲۲۱۶۰	(۰.۳)



توجه: جدول زیر آمار معاملات روز قبل و امروز تا لحظه گرفتن خروجی گزارش از سایت بورس کالا و مربوط به گروه صنعتی بوده و اطلاعات معاملات جلسه معاملاتی بعد از ظهر تاریخ تهیه گزارش (امروز) آورده نشده است.

نام کالا	تولید کننده	نوع قرارداد	قیمت پایانی میانگین موزون (ریال)	حجم معامله (تن)	ارزش معامله (هزارریال)	تاریخ معامله	تاریخ تحویل
شمش آلیاژ ۳GOVAS	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۱۷,۶۶۵	۱,۱۵۰	۱۳۵,۳۱۴,۷۵۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
شمش طلا ۹۹۷	معدن زرشوران	نقدی	۱,۷۶۳,۲۶۰	۰	۱۷,۶۴۱,۴۱۶	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
شمش آلیاژ ۱۲ADC	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۱۱,۱۲۸	۱۱۰	۱۲,۲۲۴,۰۸۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
شمش روی ۹۹,۹۸	صنایع خالص سازان روی زنجان	نقدی	۱۶۲,۰۰۰	۵۰	۸,۱۰۰,۰۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
شمش p-۱۰۰۰ ۹۹,۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۰۸,۹۴۹	۶۰	۶,۵۳۶,۹۴۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
شمش p-۱۰۰۰ ۹۹,۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی (مچینگ)	۱۰۸,۹۴۹	۶۰	۶,۵۳۶,۹۴۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۱۹,۷۲۵	۱۰	۵,۱۹۷,۲۵۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۱۸,۰۰۱	۱۰	۵,۱۸۰,۰۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۱۵,۳۰۳	۱۰	۵,۱۵۳,۰۳۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۱۱,۹۳۲	۱۰	۵,۱۱۹,۳۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۰۶,۸۰۸	۱۰	۵,۰۶۸,۰۸۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۰۵,۹۳۶	۱۰	۵,۰۵۹,۳۶۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۵۰۳,۸۹۵	۱۰	۵,۰۳۸,۹۵۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۴۹۷,۹۹۷	۱۰	۴,۹۷۹,۹۷۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۴۹۰,۹۹۲	۱۰	۴,۹۰۹,۹۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۴۸۶,۰۷۹	۱۰	۴,۸۶۰,۷۹۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
سولفور مولیبدن	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۴۶۳,۶۵۵	۱۰	۴,۶۳۶,۵۵۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵
شمش آلیاژ ۱۷ADC	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۲۵,۲۹۱	۲۰	۲,۵۰۵,۸۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
بیلت ۸-۶۰۶۱	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۱۸,۹۳۳	۲۰	۲,۳۷۸,۶۶۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۱	۱۳۹۶/۱۱/۱۶
سیمان تپ ۵	سیمان خوزستان	نقدی	۱,۳۱۲	۱,۰۰۰	۱,۳۱۲,۰۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۱۵

امور اقتصادی و سرمایه گذاری

۱۳۹۶/۱۱/۱۱