

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

تاریخ گزارش: ۹۶/۱۰/۰۵	عملکرد از ابتدای سال		آخرین تعداد سفارش		وضعیت سهام								نام شرکت	
	پوشش ریالی بودجه (۶ 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
۴۰	۴۸.۰۳	۹	۲,۵۰۰	۵۹,۶۰۲	۹.۹	۱۸۸	(۶۴)	۰.۴	۱,۸۵۵	۱,۸۵۲	۰.۸۹	۳۸,۷۱۸	۲۰,۹۰۴,۴۷۷	توسعه معادن و فلزات
۱۰۴	۲۱.۸۴	۳۸	۱۰,۰۰۰	۱,۵۰۰	۱۲.۴	۲۴۵	(۸)	۰.۱	۳,۰۲۰	۳,۰۳۲	۰.۴۸	۲۰,۶۹۲	۶,۸۲۵,۳۶۷	توسعه معدنی و صنعتی صبانور
۲۱۰	۳۹.۸	۴۷	۳,۶۲۰	۱,۰۰۰	۵.۲	۴۲۵	(۲)	۲.۹	۲,۱۸۰	۲,۲۰۴	۰.۲۲	۹,۴۴۰	۴,۲۸۴,۱۷۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید
۱۱۶	۲۷.۹	۱۰	۳۴,۳۲۳	۱,۰۰۰	۹.۱	۲۳۱	(۳۸)	۰.۲	۲,۰۹۶	۲,۱۰۴	۰.۳۲	۱۴,۰۴۲	۶,۶۷۲,۴۹۶	معدنی و صنعتی چادرملو
۲۳۱	۵۰.۲	۱۱	۱,۹۲۳	۲۹,۶۴۵	۷.۲	۴۷۴	(۳۱)	۲.۵	۳,۴۵۳	۳,۴۳۴	۰.۸۸	۳۸,۱۷۳	۱۱,۱۱۵,۴۸۸	معدنی و صنعتی گل گهر
۲۹۸	۱۲۵.۵	۲	۱۲۱,۸۵۲	۱,۶۱۷	۵.۶	۵۴۶	(۳۰)	۲.۷	۳,۰۹۰	۳,۰۷۷	۲.۷۲	۱۱۷,۸۸۹	۳۸,۳۰۷,۰۶۷	فولاد مبارکه اصفهان
۴۲۰	۵۷.۹	۶۰	۲۹,۰۳۳	۵,۰۰۰	۵.۹	۸۱۲	(۲۶)	۰.۷-	۴,۷۹۰	۴,۷۷۶	۰.۳۴	۱۴,۸۶۶	۳,۱۱۲,۸۸۵	فولاد خوزستان
۲۰۶	۱۸.۴	۴۸۵	۳,۳۹۷	۸۰۰	۱۷.۸	۳۴۷	۰.۰	۰.۱-	۵,۹۹۵	۶,۱۵۹	۰.۰۰	۲۵	۴,۲۰۰	فولاد امیرکبیر کاشان
۱۸۳	۴۹.۲	۸۴	۵,۶۸۰	۵۰۰	۹.۷	۲۵۴	(۱۰۴)	۰.۰	۲,۴۶۰	۲,۴۶۵	۰.۷۸	۳۳,۶۵۰	۱۳,۶۵۲,۰۸۷	ملی صنایع مس ایران
۶۱	(۱۹.۶)	۳۸۱	۲,۰۰۰	۳۰۰	۲۵.۷	۱۴۷	۰.۰	۰.۰	۳,۷۰۰	۳,۷۷۲	۰.۰۰	۱۱	۳,۰۰۰	فولاد خراسان
-۴۱	۴۵.۶	۱۰۷	۲۵,۰۰۰	۶,۰۰۰	۹.۱	۴۷۱	۰.۰	۸.۴-	۴,۳۰۰	۴,۲۹۹	۰.۱۳	۵,۴۹۰	۱,۲۷۷,۱۴۸	شرکت آهن و فولاد ارفع
-۳۹	۲.۶۳	۱۱۸	۶,۸۵۰	۳,۴۲۳	۲۲.۱	۹۸	۰.۰	۱.۲-	۲,۱۶۶	۲,۱۶۹	۰.۰۲	۱,۰۰۳	۴۶۲,۳۶۷	کارخانجات تولیدی شهید قندی
۱۹۴ ریال زیان (۹ ماهه)	۷.۰	۱۳۲	۶,۲۰۰	۵,۰۰۰	-	-	-	۰.۳	۲,۴۰۰	۲,۴۰۹	۰.۰۱	۳۰۶	۵۵,۲۱۲	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان
-	۲۴.۱۳	-	۸,۰۰۰	۰	۱۳.۱	۶۳	-	۰.۰	۸۲۵	۸۲۷	۰.۰۰	۰	۰	بانک سامان
(۲۰۷)	تغییرات مثبت / منفی	۹۸,۳۵۸	روزکاری گذشته برابر با:				۹۸,۱۵۱	در تاریخ گزارش برابر با:						۱- شاخص کل
(۶۶)		۳۱,۵۲۴					۳۱,۴۵۸							۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)
(۵۸)		۱۷,۹۹۳					۱۷,۹۳۴							۴- شاخص کل (هم وزن)
(۴۴)		۱۳,۵۶۷					۱۳,۵۲۳							۵- شاخص قیمت (هم وزن)
(۶۵۴)		۱۰۶,۴۳۸					۱۰۵,۷۸۵							۵- شاخص شناور آزاد
۱		۱,۰۹۶					۱,۰۹۷							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-فملی ۱۰۳.۵-	۲-ومعادن ۶۴.۳۳-					۳-شبندر ۶۰.۳۸-
	۱-فارس ۳۲۷.۵+	۲-تاپیکو ۱۰۵.۹۵+					۳-وغدیر ۱۹.۸+
ولانا، ولراز و واحیا	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت	تعداد سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم)	۲۲۷,۵۷۳	۵۵۲,۷۶۶			
فسا، غادر و لخانه	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی	ارزش سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال)					
		تغییرات حجمی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش		(۱۸,۹۲۶)			
		تغییرات ریالی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش		(۳۱,۰۲۹)			
		تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش	۳۳	۵۱۷			

بیشترین ارزش معاملاتی سهام بازار امروز در سهام مربوط به نمادهای فارس، امید و فاراک به ترتیب به ارزش ۲۹۷، ۲۷۲ و ۱۷۴ میلیارد ریال معامله بوده که این سه حدود ۱۷.۱۳٪ از ارزش بازار امروز را تشکیل می دادند.

عملکرد بازارها و شاخص های 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	۲۴,۷۵۴	(۰.۱۱)	نفت برنت	۶۴.۶	(۰.۲۳)
شاخص S&P ۵۰۰	۲,۶۸۳	(۰.۰۵)	مس	۷,۱۳۵.۵	۰.۰۰
شاخص ترکیبی نزدک	۶,۹۶۰	(۰.۰۸)	روی	۳,۲۶۶.۳	۰.۰۰
شاخص نیکی ژاپن	۲۲,۸۹۳	(۰.۲۰)	آلومینیوم	۲,۱۹۱.۰	۰.۰۰
شاخص دلار	۹۳.۳۲	۰.۰۸	اونس طلا	۱,۲۷۷.۹	۰.۲۲

نرخ های 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)	۴۹۵	۴	استرالیا	ریزدانه ۵۶.۷٪ تا ۶۲.۵٪ - فوب بندر دمپایر	۳۳.۴-۶۵.۶ (-۰.۴)
ترکیه(فوب)	۵۲۵	۰		درشت دانه ۶۲٪ و ۶۳٪	۷۱.۶-۷۵.۱ (-۰.۴)
هند(فوب)	۴۹۷.۵	۴.۷۳		ریزدانه ۶۱٪ تا ۶۵٪ - فوب بندر توبارو	۲۶.۵-۶۹.۹ (-۰.۴)
امارات(سی اف آر جبل علی)	۴۹۷.۵	۲.۰۵	برزیل	درشت دانه ۶۴٪ - فوب بندر توبارو	۵۸.۵ (-۰.۴)
مصر(سی اف آر)	۵۲۵	۳.۴۵		گندله ۶۵٪ - فوب بندر توبارو	۱۰۸.۷ (-۰.۴)
مسیر حمل سنگ آهن	نرخ(دلار)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته	هند	ریزدانه ۵۵٪ تا ۶۳٪ - فوب بندر Chennai و Goa	۱۹.۲-۶۰.۳ (-۰.۴)
برزیل به چین	۱۷۰.۲۳	(۸.۹)	روسیه	کنسانتره با عیار ۶۵٪ و ۶۶٪ - فوب دریای سیاه	۷۰.۲-۷۱.۲ (-۰.۴)
غرب استرالیا به چین	۷	(۲۸.۳)		گندله با عیار ۶۳٪ و ۶۵٪ - فوب دریای سیاه	۱۰۸.۳-۱۱۱.۸ (-۰.۴)
هند به چین	۱۰.۲	(۱.۰)		کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۷٪ - فوب بندرعباس	۷۴.۳-۷۷.۳ (-۰.۴)
آفریقا به چین	۱۳.۳	(۱۰.۷)	ایران	هماتیت با عیار ۵۶/۵۵٪ تا ۶۱/۶۲٪ - فوب بندرعباس	۲۵.۶-۳۹.۳ (-۰.۴)
ایران به چین	۱۶	۰.۰		مگنتیت با عیار ۵۴/۵۳٪ تا ۶۱/۶۲٪ - فوب بندرعباس	۲۵.۴-۴۳.۱ (-۰.۴)
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	۱۴۴,۲۸۰	۱.۷	موجودی انبار بندر Caofidian	۲۱۴۶۰	۳.۶



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 بلوم SP5(150*150)	فولاد خوزستان	سلف (مچینگ)	۱۹,۸۰۰	۱۵۰۰۰	۲۹۷۰۰۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
مس مفتول	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۲۹۹,۹۹۵	۳۶۰	۱۰۷۹۹۸۲۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۱۰
سبد مس کاتد	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی	۲۹۲,۰۳۱	۲۶۶۰	۷۷۶۸۰۲۴۶۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۱۰
سبد میلگرد ۱۲ تا ۳۲ - ۳A	تولیدی فولاد سپید فراب کویر	سلف	۲۱,۰۰۰	۲۲۰۰	۴۶۲۰۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۳۰
مس مفتول	گیل راد شمال	نقدی (مچینگ)	۳۰۰,۵۴۵	۲۰	۶۰۱۰۹۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۱۰
ورق سرد B	فولاد مبارکه اصفهان	سلف (مچینگ)	۲۷,۹۷۷	۱۵۴۹	۴۳۳۳۶۳۷۳	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۲/۲۹
ورق گرم C	فولاد مبارکه اصفهان	سلف (مچینگ)	۲۳,۵۰۰	۴۶۶۰	۱۰۹۵۱۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
ورق گرم B	فولاد مبارکه اصفهان	سلف (مچینگ)	۲۵,۶۶۳	۴۷۹۸	۱۲۳۱۳۱۰۷۴	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
سبد میلگرد ۱۲ تا ۳۲ - ۳A	ذوب آهن اصفهان	سلف	۲۱,۹۴۹	۲۰۰۰	۴۳۸۹۸۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
سبد میلگرد ۱۲ تا ۳۲ - ۳A	ذوب آهن اصفهان	سلف	۲۱,۷۶۶	۵۰۰۰	۱۰۸۸۳۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
تیر آهن ۱۴ تا ۱۸	ذوب آهن اصفهان	سلف	۲۵,۵۵۸	۲۰۰۰	۵۱۱۱۶۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۰/۳۰
سبد مس کاتد	شرکت ملی صنایع مس ایران	نقدی (مچینگ)	۲۹۲,۰۳۱	۳۴۰	۹۹۲۹۰۵۴۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۱۰
تیر آهن ۱۴ تا ۱۸	ذوب آهن اصفهان	سلف	۲۵,۲۵۰	۵۰۰۰	۱۲۶۲۵۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
مس مفتول	صنایع تولیدی دنیای مس کاشان	نقدی	۳۰۰,۵۴۵	۱۴۰	۴۲۰۷۶۳۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۱۰
شمش بلوم SP5(150*150)	فولاد خوزستان	سلف	۱۹,۸۰۰	۹۰۰۰	۱۷۸۲۰۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
مس مفتول	گیل راد شمال	نقدی	۳۰۰,۵۴۵	۲۰	۶۰۱۰۹۰۰	۱۳۹۶/۱۰/۰۵	۱۳۹۶/۱۰/۱۰