

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

تاریخ گزارش: ۹۶/۱۱/۰۴		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	۴۵.۹	۱۱	۳۰,۰۰۰	۱,۰۰۰	۹.۷	۱۸۸	(۱۸)	۱.۳۲	۱,۸۰۰	۱,۸۱۸	۰.۲۷	۱۴,۶۸۹	۸,۰۷۹,۳۷۰	توسعه معادن و فلزات
۱۳۸	۱۵.۲	۳۰	۱۷,۵۰۰	۸,۹۰۰	۱۱.۵	۲۴۵	(۱)	-۰.۴۲	۲,۸۱۹	۲,۸۲۸	۰.۱۱	۵,۸۶۹	۲,۰۷۴,۹۹۵	توسعه معدنی و صنعتی صبانور
۲۱۰	۴۰.۲	۳۸	۵۱۴,۷۳۵	۱۰,۰۰۰	۵.۲	۴۲۵	۱۸.۱	۱.۰۹	۲,۲۱۷	۲,۲۱۶	۰.۶۲	۳۳,۸۷۳	۱۵,۲۸۲,۵۵۵	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید
۲۰۹	۳۳.۰	۳۷	۲۰,۰۰۰	۴,۷۰۰	۵.۹	۳۷۰	(۳)	-۰.۱۸	۲,۱۴۰	۲,۱۷۹	۰.۳۱	۱۶,۷۹۹	۷,۷۰۸,۶۹۰	معدنی و صنعتی چادرملو
۲۳۱ ریال شش ماهه	۵۳.۹	۱۳	۴,۶۵۰	۶,۵۰۰	۷.۶	۴۷۴	۱۷.۳	۰.۶۴	۳,۵۸۷	۳,۶۱۱	۰.۳۳	۱۸,۰۲۸	۴,۹۹۲,۹۸۰	معدنی و صنعتی گل گهر
۴۹۱	۱۱۸.۸	۳	۲۲,۵۰۰	۱۰۸,۸۵۸	۵.۵	۵۴۶	۲۴.۵	۰.۴۴	۲,۹۵۰	۲,۹۹۸	۲.۱۰	۱۱۵,۲۶۲	۳۸,۴۴۷,۶۷۰	فولاد مبارکه اصفهان
۷۳۵	۵۶.۷	۲۵	۷,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۵.۹	۸۱۲	۰.۴	۰.۰۲	۴,۷۳۲	۴,۷۸۳	۱.۲۸	۷۰,۴۹۰	۱۴,۷۳۷,۴۶۳	فولاد خوزستان
۳۳۴	۱۶.۸	۵۰۲	۶۵,۷۳۰	۰	۱۷.۵	۳۴۷	-	-۰.۰۵	۵,۷۶۷	۶,۰۶۷	۰.۰۰	۱۹	۳,۲۱۰	فولاد امیرکبیرکاشان
۲۸۸	۵۸.۴	۶۴	۵,۰۰۰	۱۶,۵۲۰	۵.۹	۴۶۲	(۴۶.۷)	۱.۰۰	۲,۷۳۷	۲,۷۳۰	۱.۲۶	۶۹,۱۷۰	۲۵,۶۳۸,۸۸۵	ملی صنایع مس ایران
۱۲۱	(۲۰)	۴۲۸	۱۸,۱۱۲	۱,۳۶۴	۲۵.۴	۱۴۷	-	-	۳,۷۳۰	۳,۷۳۲	۰.۰۰	۱۳۸	۳۷,۳۷۱	فولاد خراسان
-۳۹	۴۷.۴	۱۳۷	۸,۶۷۰	۱۱,۶۴۰	۱۶.۳	۲۸۰	-	۳.۱۳	۴,۶۲۵	۴,۵۵۲	۰.۵۴	۲۹,۶۰۸	۶,۵۰۴,۸۳۸	شرکت آهن و فولاد ارفع
-۱۲۰	۸.۸	۱۲۴	۲,۵۰۰	۳۵۹,۴۱۹	۲۲.۲	۹۸	۱.۵	۴.۶۷	۲,۱۸۰	۲,۱۷۴	۰.۰۶	۳,۵۰۸	۱,۶۱۳,۹۳۵	کارخانجات تولیدی شهید قندی
۱۹۴ ریال زیان (۹ ماهه)	(۳)	۱۹۸	۳,۰۰۰	۱۳,۵۶۰	۱۰.۹-	۱۹۹-	-	۴.۳۸	۲,۱۳۲	۲,۱۶۹	۰.۰۱	۷۲۲	۳۳۲,۷۲۳	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان
-	(۲۴)	-	۸,۰۰۰	۰	۱۳.۱	۶۲	-	۰.۰	۸۲۵	۸۲۷	۰.۰۰	۰	۰	بانک سامان
۲۹۷	تغییرات مثبت / منفی	۹۹,۲۲۵	روزکاری گذشته برابر با:				۹۹,۵۲۲	در تاریخ گزارش برابر با:					۱- شاخص کل	
۹۳		۳۱,۷۰۱					۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)							
۷۴.۵		۱۷,۴۳۹					۴- شاخص کل (هم وزن)							
۴۶		۱۳,۱۱۷					۵- شاخص قیمت (هم وزن)							
۱۰۲		۱۰۶,۷۳۸					۵- شاخص شناور آزاد							
۳		۱,۰۸۸					۶- شاخص فرابورس							



عملکرد بازار بورس و فرابورس در تاریخ گزارش

بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	۱-فارس	+۱۱۵.۳۹	بیشترین تاثیر منفی در شاخص	۱-فلمی	-۴۶.۶۶	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت	شمال، نتوس و نژاگرس	
	۲-وعدیر	+۵۰.۵۷		۲-وبملت	-۲۸.۸۵		نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی	غیوان، ولراز، شکبیر
	۳-جم	+۴۰.۹۴		۳-خودرو	-۲۲.۶۴		تعداد سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم)	۲۵۷.۸۵۶
حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیون سهم)	۱.۶۱۰	تعداد نماد با تغییرات مثبت	۲۹۵	ارزش سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال)	۶۳۴.۱۳۲			
ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)	۵.۴۹۳	تعداد نماد با تغییرات منفی	۲۴۰	تغییرات حجمی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	(۱۳,۰۲۸)			
رتبه سر.معادن و فلزات در حجم معاملات	۴۴	تعداد نماد بدون تغییر	۳۰	تغییرات ریالی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	۵,۲۵۰			
رتبه سر.معادن و فلزات در ارزش معاملات	۷۶	تعداد نمادهای متوقف	۲۹	تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش	۵۶۵			

بیشترین ارزش معاملاتی سهام بازار امروز در سهام مربوط به نمادهای فارس، فارس ۲ و کرماشاه ۲ به ترتیب به ارزش ۳۵۳,۸۲۱ و ۱۲۵ میلیارد ریال معامله بوده که این سه حدود ۲۳.۶۴٪ 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	۲۶,۲۱۱	(۰.۰۱)	نفت برنت	۶۹.۸	(۰.۱۳)
شاخص S&P ۵۰۰	۲,۸۳۹	۰.۲۲	مس	۶,۹۹۳.۵	۱.۳۱
شاخص ترکیبی نزدک	۷,۴۶۰	۰.۷۱	روی	۳,۴۰۳.۰	(۰.۱۹)
شاخص نیکی ژاپن	۲۳,۹۴۱	(۰.۷۶)	آلومینیوم	۲,۲۲۸.۵	۰.۰۹
شاخص دلار	۸۹.۷	(۰.۴۹)	اونس طلا	۱,۳۴۹.۹	۰.۶۲

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) ترکیه (فوب) هند (فوب) امارات (سی اف آر جبل علی) مصر (سی اف آر)	۵۲۰	۱.۱۷	استرالیا	ریزدانه ۵۶.۷٪ تا ۶۲.۵٪ - فوب بندر دمپایر	(-۱.۵) ۳۴-۶۸
	۵۴۲.۵	(۰.۹۱)		درشت دانه ۶۲٪ و ۶۳٪	(-۱.۵) ۷۴.۷-۷۷.۳
	۵۱۰	(۰.۹۷)	برزیل	ریزدانه ۶۱٪ تا ۶۵٪ فوب بندر توپارو	(-۲.۵) ۴۴.۳-۷۲.۳
	۵۲۱	(۱.۰۴)		درشت دانه ۶۴٪ فوب بندر توپارو	(-۱.۵) ۵۹.۴
	۵۲۰	(۴.۱۵)		گندله ۶۵٪ فوب بندر توپارو	(-) ۱۱۰
مسیر حمل سنگ آهن	نرخ (دلار)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته	هند	ریزدانه ۵۵٪ تا ۶۳٪ فوب بندر Chennai و Goa	(-۲) ۱۶.۸-۵۹.۳
			روسیه	کنسانتره با عیار ۶۵٪ و ۶۶٪ فوب دریای سیاه	(-۰.۵) ۷۵.۴-۷۶.۳
	گندله با عیار ۶۳٪ و ۶۵٪ فوب دریای سیاه	(-۲.۲) ۱۰۶.۵-۱۱۰			
	ایران	کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۷٪ - فوب بندر عباس	(-۰.۵) ۷۹.۴-۸۲.۴		
		همانیت با عیار ۵۵/۵۶٪ تا ۶۱/۶۲٪ - فوب بندر عباس	(-۲) ۲۴.۷-۳۸.۴		
		مگنتیت با عیار ۵۳/۵۴٪ تا ۶۱/۶۲٪ - فوب بندر عباس	(-۲) ۲۵.۲-۴۲.۹		
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	۱۵۲,۸۸۰	۱.۴	موجودی انبار بندر Caofidian	۲۲۲۳۰	۴.۱



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 ۱۰۰۰ p-۹۹.۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۰۵.۹۴۰	۱۰۰۰	۱۰۵۹۴۰۲۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۰۹
شمش ۱۰۰۰ p-۹۹.۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۰۵.۳۹۳	۷۴۰	۷۷۹۹۰۸۲۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱۳۹۶/۱۱/۰۸
بیلت ۷-۶۰۶۳	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۱۲.۱۲۸	۵۰۰	۵۶۰۶۴۰۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۰۹
شمش ۱۰۰۰ p-۹۹.۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی (مچینگ)	۱۰۵.۳۹۳	۲۶۰	۲۷۴۰۲۱۸۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱۳۹۶/۱۱/۰۸
شمش طلا ۹۹۹	طلای موته	نقدی	۱.۷۷۵.۰۰۰	۰.۰۱	۱۷۷۵۰۰۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۰۹
شمش طلا ۹۹۷	معدن زرشوران	نقدی	۱.۷۷۵.۶۴۰	۰.۰۰۹	۱۵۹۸۷۸۶۲.۵۶	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱۳۹۶/۱۱/۰۸
بیلت ۷-۶۰۶۳	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۱۲.۱۲۸	۲۰	۲۲۴۲۵۶۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱۳۹۶/۱۱/۰۸
شمش طلا ۹۹۸	معدن زرشوران	نقدی	۱.۷۸۵.۴۳۹	۰.۰۰۱	۱۷۸۵۴۳۹	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱۳۹۶/۱۱/۰۸
سیمان تیپ ۱	سیمان اصفهان	نقدی	۱.۳۱۴	۱۱۰۰	۱۴۴۵۴۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۱۰
سیمان تیپ ۲	سیمان شرق	نقدی (مچینگ)	۱.۱۷۵	۱۰۰۰	۱۱۷۵۰۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	۱۳۹۶/۱۱/۰۳
سیمان تیپ ۲	سیمان شرق	نقدی (مچینگ)	۱.۱۷۵	۱۰۰۰	۱۱۷۵۰۰۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱۳۹۶/۱۱/۰۳

امور اقتصادی و سرمایه گذاری

۱۳۹۶/۱۱/۰۴