

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

نام شرکت	وضعیت سهام											تاریخ گزارش: ۹۷/۰۱/۱۴		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	درصد از کل ارزش معاملات	قیمت پایانی	آخرین قیمت	درصد تغییر	میزان تاثیر بر شاخص	EPS	P/E	تقاضا	عرضه		آخرین تعداد سفارش	عملکرد از ابتدای سال
	پوشش ریالی بودجه (۹ ماهه)	رتبه نقدشوندگی	بازده کل ۹۷	رتبه نقدشوندگی	بازده کل ۹۷	پوشش ریالی بودجه (۹ ماهه)	رتبه نقدشوندگی	بازده کل ۹۷	رتبه نقدشوندگی	بازده کل ۹۷	پوشش ریالی بودجه (۹ ماهه)	رتبه نقدشوندگی	بازده کل ۹۷	پوشش ریالی بودجه (۹ ماهه)
توسعه معادن و فلزات	۱۰۸	۲۰۸	۰.۱۶	۱.۶۷۲	۱.۶۷۸	-۰.۲۴	(۳.۴)	۲۴۲	۶.۹	۱۵,۰۰۰	۴۲,۴۸۱	۲۲۶	(۰.۲)	۴۰
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۷۲۶	۸۰۸	۰.۵۷	۲,۹۱۷	۲,۹۵۸	۲.۸۲	۵.۹۱	۲۴۵	۱۱.۹	۱۰,۰۰۰	۴۳,۹۱۹	۳۰	۱۶.۰	۱۳۸
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۰۶	۶۲۰	۰.۰۴	۲,۳۸۱	۲,۳۸۰	۰.۰۴	۰.۸	۴۲۵	۵.۶	۳,۳۰۰	۱,۰۰۰	۶۰	۲.۱	۲۱۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۶۶۹	۷,۵۸۳	۰.۴۹	۲,۱۱۵	۲,۱۱۱	۰.۹۵	۱۶.۸۴	۳۷۰	۵.۷	۱۳,۶۷۰	۵,۰۰۰	۲۸	۲.۰	۲۰۹
معدنی و صنعتی گل گهر	۵۴	۵,۶۲۵	۰.۳۶	۳,۳۴۶	۳,۳۷۰	۰.۶۹	۲۰.۸	۶۵۰	۵.۱	۱۰,۰۰۰	۱۲,۴۸۹	۲۱۵	۴.۳	۲۳۱
فولاد مبارکه اصفهان	۸۳۶	۵۲,۲۵۴	۳.۳۷	۲,۹۹۴	۲,۹۸۵	۱.۶۳	۹۰.۵۰	۶۸۶	۴.۴	۶,۵۰۰	۹۹۰	۷	۴.۱	۴۹۱
فولاد خوزستان	۷۵۷	۱۸,۲۰۸	۱.۱۷	۵,۲۱۵	۵,۱۹۰	۲.۳۶	۴۳.۷	۸۱۲	۶.۴	۹,۵۰۰	۶,۴۰۲	۲۱	۷.۹۰	۷۳۵
فولاد امیرکبیرکاشان	۰	۰	۰.۰۰	۵,۹۷۰	۵,۶۷۴	-	-	۳۴۷	۱۷.۲	۰	۱۶,۰۷۷	-	-	۳۳۴
ملی صنایع مس ایران	۲۶۸	۹,۶۵۹	۰.۶۲	۲,۶۱۵	۲,۶۲۷	۰.۵۰	۱۹.۶	۴۶۲	۵.۷	۱۶,۵۲۰	۵,۰۰۰	۲۰	(۳)	۲۸۸
فولاد خراسان	۱۰۰,۰۰۰	۳۷۰	۰.۰۲	۳,۷۱۶	۳,۷۰۰	-۰.۰۳	-	۱۴۷	۲۵.۳	۱۰۰,۰۰۰	۲۱۱	۳۵۶	(۰.۰)	۱۲۱
شرکت آهن و فولاد ارفع	۶۲۱	۱۶,۶۱۵	۱.۰۷	۳,۸۴۶	۳,۸۵۳	۴.۸۰	-	۸۳۴	۴.۶	۲۵۰	۸,۰۰۰	۱۳۷	۸.۸	-۳۹
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۰	۰	۰.۰۰	۲,۰۸۱	۲,۰۴۲	-	-	۹۸	۲۱.۲	۲,۵۵۲,۹۰۶	۰	۱۲۴	-	-۱۲۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۰۰۱	۱۶۱	۰.۰۱	۲,۱۳۴	۲,۱۸۰	۳.۷۹	-	۱۹۹-	۱۰.۷-	۵,۰۰۰	۸,۰۰۰	۳۲۷	۳.۵۸	۱۹۴
بانک سامان	۰	۰	۰.۰۰	۸۲۷	۸۲۵	۰.۰	-	۶۲	۱۳.۱	۰	۸,۰۰۰	-	-	-
۱- شاخص کل	۱۴۷	۹۶,۹۳۹		۹۷,۰۸۶										
۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)	۴۷	۳۰,۷۳۹		۳۰,۷۸۶										
۴- شاخص کل (هم وزن)	۲۰.۷	۱۷,۳۲۴		۱۷,۳۴۴										
۵- شاخص قیمت (هم وزن)	۱۵	۱۲,۸۹۴		۱۲,۹۰۹										
۵- شاخص شناور آزاد	۲۴۰	۱۰۳,۷۴۸		۱۰۳,۹۸۹										
۶- شاخص فرابورس	۶.۲	۱,۱۰۷		۱,۱۱۳										

تغییرات مثبت / منفی

روز کاری گذشته برابر با:

در تاریخ گزارش برابر با:



عملکرد بازار بورس و فرابورس در تاریخ گزارش

بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	۱- فولاد +۹۰.۵	بیشترین تاثیر منفی در شاخص	۱- شبندر -۲۲.۵۵	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت	نتوس، کورز، نژاگرس، فسلیبر
	۲- فخوز +۴۳.۶۶		۲- پارسان -۱۸.۳۳	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی	گوهر ۲، طلا، کاذرخ، گلج
	۳- کگل +۲۰.۸۲		۳- شینا -۱۶.۰۹	تعداد سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم)	۳,۶۳۴
حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیون سهم)	۴۹۸	تعداد نماد با تغییرات مثبت	۲۴۶	ارزش سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال)	۶,۹۲۲
ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)	۱,۵۵۰	تعداد نماد با تغییرات منفی	۲۵۲	تغییرات حجمی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	(۲۱۶)
رتبه سر.معادن و فلزات در حجم معاملات	۵۹	تعداد نماد بدون تغییر	۴۶	تغییرات ریالی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	(۷۴۲)
رتبه سر.معادن و فلزات در ارزش معاملات	۹۹	تعداد نمادهای متوقف	۱۰	تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش	۵۴۴

بیشترین ارزش معاملاتی سهام بازار امروز در سهام مربوط به نمادهای شینا ۲، فولاد و کبوس ۲ به ترتیب به ارزش ۸۲، ۵۲ و ۳۲ میلیارد ریال معامله بوده که این سه حدود ۱۰.۷۵٪ 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	۲۳,۶۴۴	(۱.۹۰)	نفت برنت	۶۸.۲	۰.۹۶
شاخص S&P ۵۰۰	۲,۵۸۲	(۲.۲۳)	مس	۶,۸۰۹.۰	۱.۰۴
شاخص ترکیبی نزدک	۶,۸۷۰	(۲.۷۴)	روی	۳,۲۸۰.۳	۰.۰۵
شاخص نیکی ژاپن	۲۱,۲۹۲	(۰.۴۵)	آلومینیوم	۲,۰۲۷.۸	۱.۱۵
شاخص دلار	۸۹.۹	(۰.۱۰)	اونس طلا	۱,۳۲۷.۵	(۰.۲۹)

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)	۵۳۴	۲.۶۹	استرالیا	ریزدانه ۵۶.۷٪ تا ۶۲.۵٪ - فوب بندر دمپایر	۳۱.۷-۵۹.۹ (+۲)
	۵۸۵.۰	۱.۷۴		درشت دانه ۶۲٪ و ۶۳٪	۷۲-۷۴ (+۱.۸)
	۵۱۲.۵	۰.۰۰		ریزدانه ۶۱٪ تا ۶۵٪ فوب بندر توپارو	۳۹.۳-۶۸.۱ (+۱.۴)
امارات (سی اف آر جبل علی)	۵۵۰	۱.۸۵	برزیل	درشت دانه ۶۴٪ فوب بندر توپارو	۵۳.۷ (+۱.۳)
	۵۳۷.۵	۰.۹۴		گندله ۶۵٪ فوب بندر توپارو	۱۰۷.۷ (+۳)
	مسیر حمل سنگ آهن	نرخ (دلار)		درصد تغییر نسبت به روز گذشته	هند
گندله ۶۴٪ فوب بندر Chennai/Paradip			۱۰۰ (+۳)		
برزیل به چین			۱۴.۰۹۵		
	۵.۷۵۶	(۵.۹)	گندله با عیار ۶۳٪ و ۶۵٪ فوب دریای سیاه	۹۶.۸-۱۰۱.۸ (+۳)	
	هند به چین	۱۲.۳	۰.۰	ایران	کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۷٪ - فوب بندرعباس
۱۰.۶		(۵.۴)	همانیت با عیار ۵۶٪ تا ۶۱٪ - فوب بندرعباس		۱۶.۲-۲۶.۵ (+۲)
۱۸.۴		۵.۱	مگنتیت با عیار ۵۴٪ تا ۶۱٪ - فوب بندرعباس		۱۷.۴-۳۲.۸ (+۲)
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	۱۶۱,۳۱۰	۱.۲	موجودی انبار بندر Caofidian	۲۶۰۴۰	(۰.۱)



توجه: جدول زیر آمار معاملات گروه صنعتی از ابتدای سال ۹۷ تا زمان تهیه گزارش استخراج شده از سایت بورس کالا می باشد.

نام کالا	تولید کننده	نوع قرارداد	عرضه (تن)	قیمت پایه عرضه (ریال)	تقاضا (تن)	حجم معامله (تن)	عرضه کننده	کارگزار	قیمت پایانی میانگین موزون (ریال)
شمش p-۱۰۰۰ ۹۹٫۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی (مچینگ)	۰	۱۰۴٫۴۶۹	۱۲۰	۱۲۰	آلومینیوم ایران	ستاره جنوب	۱۰۴٫۴۶۹
شمش p-۱۰۰۰ ۹۹٫۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۲۰۰	۱۰۴٫۴۶۹	۱۲۰	۱۲۰	آلومینیوم ایران	بانک توسعه صادرات	۱۰۴٫۴۶۹
بیلت ۶۰۶۳-۷	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۱۰۰	۱۱۱٫۱۴۰	۴۰	۲۰	آلومینیوم ایران	ستاره جنوب	۱۱۱٫۱۴۰
شمش p-۱۰۰۰ ۹۹٫۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	نقدی	۳۲۰	۱۰۴٫۴۶۹	۲۰۰	۲۰۰	آلومینیوم ایران	ستاره جنوب	۱۰۴٫۴۶۹

امور اقتصادی و سرمایه گذاری

۱۳۹۷/۱/۱۴