

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

| تاریخ گزارش: ۹۷/۰۱/۲۲        |                        | عملکرد از ابتدای سال |                          | آخرین تعداد سفارش |       | وضعیت سهام |                        |                          |               |                |                            |                 | نام شرکت                  |                                |
|------------------------------|------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------|-------|------------|------------------------|--------------------------|---------------|----------------|----------------------------|-----------------|---------------------------|--------------------------------|
| پوشش ریالی<br>بودجه (۹ ماهه) | بازده کل<br>۹۷         | رتبه<br>نقدشوندگی    | عرضه                     | تقاضا             | P/E   | EPS        | میزان تاثیر<br>بر شاخص | درصد<br>تغییر            | آخرین<br>قیمت | قیمت<br>پایانی | درصد از کل<br>ارزش معاملات | ارزش<br>معاملات |                           | حجم<br>معاملات                 |
| ۴۰                           | (۲.۰)                  | ۹۹                   | ۹۹,۰۳۶                   | ۲۰,۰۰۰            | ۶.۸   | ۲۴۲        | (۲.۶)                  | -۰.۱۸                    | ۱,۶۰۰         | ۱,۶۴۳          | ۰.۰۵                       | ۲,۰۴۳           | ۱,۲۵۱,۹۰۷                 | توسعه معادن و فلزات            |
| ۱۳۸                          | ۵.۹۴                   | ۴۷                   | ۵,۱۶۷                    | ۲,۹۰۰             | ۱۱.۱  | ۲۴۵        | (۳.۴)                  | -۱.۶۷                    | ۲,۶۹۰         | ۲,۷۱۱          | ۰.۰۸                       | ۳,۳۴۰           | ۱,۲۳۲,۰۷۱                 | توسعه معدنی و صنعتی صبانور     |
| ۲۱۰                          | ۳.۶۰                   | ۳۷                   | ۳۹,۲۹۸                   | ۴,۳۱۰             | ۵.۷   | ۴۲۵        | (۱۱)                   | -۰.۵۸                    | ۲,۳۵۰         | ۲,۴۱۶          | ۰.۰۴                       | ۱,۷۵۶           | ۷۴۷,۲۲۶                   | گروه مدیریت سرمایه گذاری امید  |
| ۲۰۹                          | ۹.۰۶                   | ۴۲                   | ۱۰۰,۰۰۰                  | ۱,۰۰۰             | ۶.۱   | ۳۷۰        | ۳۱.۱۶                  | ۱.۶۶                     | ۲,۲۵۰         | ۲,۲۶۱          | ۱.۶۱                       | ۶۶,۶۵۶          | ۲۹,۴۷۴,۵۹۳                | معدنی و صنعتی چادرملو          |
| ۲۳۱                          | ۲.۵۰                   | ۹۷                   | ۳,۰۰۰                    | ۲,۸۰۰             | ۵.۲   | ۶۵۰        | ۹.۹۶                   | ۰.۳۳                     | ۳,۳۵۷         | ۳,۳۷۳          | ۰.۳۹                       | ۱۶,۲۱۰          | ۴,۸۰۵,۳۵۰                 | معدنی و صنعتی گل گهر           |
| ۴۹۱                          | (۰.۲)                  | ۲۵                   | ۹۹۰                      | ۶,۵۰۰             | ۴.۲   | ۶۸۶        | (۴۷.۱)                 | -۰.۸۶                    | ۲,۸۶۰         | ۲,۸۷۰          | ۱.۴۳                       | ۵۹,۱۸۵          | ۲۰,۶۲۵,۰۷۵                | فولاد مبارکه اصفهان            |
| ۷۳۵                          | ۹.۴۵                   | ۷۱                   | ۱۰,۰۰۰                   | ۱۵,۸۹۲            | ۶.۵   | ۸۱۲        | (۱۴)                   | -۰.۷۳                    | ۵,۳۹۷         | ۵,۲۸۵          | ۰.۶۰                       | ۲۴,۸۸۶          | ۴,۷۰۸,۶۶۱                 | فولاد خوزستان                  |
| ۳۳۴                          | (۰.۰)                  | ۵۲۳                  | ۱۵,۷۸۲                   | ۰                 | ۱۷.۲  | ۳۴۷        | -                      | -                        | ۵,۶۷۲         | ۵,۹۶۹          | ۰.۰۰                       | ۰               | ۰                         | فولاد امیرکبیرکاشان            |
| ۲۸۸                          | ۱.۲۰                   | ۲۰                   | ۵,۰۰۰                    | ۱۶,۵۲۰            | ۵.۷   | ۴۶۲        | ۱۹.۶۱                  | -۱.۹۸                    | ۲,۶۲۷         | ۲,۶۲۷          | ۰.۶۹                       | ۲۸,۵۸۰          | ۱۰,۶۱۱,۹۰۲                | ملی صنایع مس ایران             |
| ۱۲۱                          | (۰.۰۳)                 | ۴۲۵                  | ۹۹۶                      | ۱۸,۵۴۵            | ۲۵.۳  | ۱۴۷        | -                      | -                        | ۰             | ۳,۷۱۶          | ۰.۰۰                       | ۱۰۰             | ۲۷,۰۱۰                    | فولاد خراسان                   |
| -۳۹                          | ۲.۸۶                   | ۱۳۷                  | ۸,۰۰۰                    | ۲۵۰               | ۴.۴   | ۸۳۴        | -                      | -۲.۰۷                    | ۰             | ۳,۶۳۶          | ۰.۰۳                       | ۱,۴۱۴           | ۳۸۸,۹۵۵                   | شرکت آهن و فولاد ارفع          |
| -۱۲۰                         | ۱.۸۷                   | ۱۲۴                  | ۰                        | ۱,۱۰۰             | ۱۸.۱- | ۱۱۷-       | ۱.۲۷                   | ۴.۱۳                     | ۲,۱۰۰         | ۲,۱۲۰          | ۰.۰۸                       | ۳,۱۰۸           | ۱,۴۶۵,۹۷۷                 | کارخانجات تولیدی شهید قندی     |
| ۱۹۴                          | (۶.۴)                  | ۲۷۳                  | ۴۰,۶۸۳                   | ۱۷,۸۹۵            | ۹.۷-  | ۱۹۹-       | -                      | -۳.۲۰                    | ۲,۰۴۵         | ۱,۹۳۷          | ۰.۰۱                       | ۲۹۳             | ۱۵۱,۱۶۰                   | گروه صنایع معادن فلات ایرانیان |
| -                            | -                      | -                    | ۸,۰۰۰                    | ۰                 | ۲۱.۲  | ۶۲         | -                      | ۰.۰                      | ۰             | ۱,۳۳۳          | ۰.۰۰                       | ۰               | ۰                         | بانک سامان                     |
| ۸۳۴                          | تغییرات<br>مثبت / منفی | ۹۶,۲۸۷               | روز کاری گذشته برابر با: |                   |       |            | ۹۷,۱۲۱                 | در تاریخ گزارش برابر با: |               |                |                            |                 | ۰                         | شاخص کل                        |
| ۲۶۴                          |                        | ۳۰,۵۳۳               |                          |                   |       |            | ۳۰,۷۹۷                 |                          |               |                |                            |                 | ۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی) |                                |
| ۱۵۶.۹                        |                        | ۱۶,۷۶۳               |                          |                   |       |            | ۱۶,۹۲۰                 |                          |               |                |                            |                 | ۴- شاخص کل (هم وزن)       |                                |
| ۱۱۷                          |                        | ۱۲,۴۷۷               |                          |                   |       |            | ۱۲,۵۹۳                 |                          |               |                |                            |                 | ۵- شاخص قیمت (هم وزن)     |                                |
| ۱,۰۶۴                        |                        | ۱۰۲,۳۲۳              |                          |                   |       |            | ۱۰۲,۳۸۷                |                          |               |                |                            |                 | ۵- شاخص شناور آزاد        |                                |
| ۳۲.۶                         |                        | ۱,۰۶۴                |                          |                   |       |            | ۱,۰۹۷                  |                          |               |                |                            |                 | ۶- شاخص فرابورس           |                                |



## عملکرد بازار بورس و فرابورس در تاریخ گزارش

| بیشترین تاثیر مثبت در شاخص                    | ۱- همراه | +۶۶.۳۷                     | بیشترین تاثیر منفی در شاخص | ۱- شخارک   | -۷۵.۸۷  | نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت | ومعادنج، فبیرا، وایرا                                   |                      |
|---|----------|----------------------------|----------------------------|--|---------|---------------------------------------|---|----------------------|
|   | ۲- کچاد  | +۳۱.۱۶                     |                            | ۲- فارس  | -۵۴.۰۵  |                                       | نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی                   | سپرمی، وتعاون و کصدف |
|   | ۳- مبین  | +۳۰.۸۱                     |                            | ۳- فولاد   | -۴۷.۱۴  |                                       | تعداد سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم) | ۹.۷۴۶                |
| حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیون سهم)    | ۱.۲۷۴    | تعداد نماد با تغییرات مثبت | ۱۶۰                        | ارزش سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال) | ۲۰.۷۴۰  |                                       |   |                      |
| ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال) | ۴.۱۳۳    | تعداد نماد با تغییرات منفی | ۴۱۹                        | تغییرات حجمی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش    | (۱.۴۲۹) |                                       |   |                      |
| رتبه سرمایه‌معدن و فلزات در حجم معاملات       | ۱۳۹      | تعداد نماد بدون تغییر      | ۳۲                         | تغییرات ریالی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش   | (۱.۳۹۳) |                                       |   |                      |
| رتبه سرمایه‌معدن و فلزات در ارزش معاملات      | ۲۰۶      | تعداد نمادهای متوقف        | ۱۳                         | تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش               | ۶۱۱     |                                       |   |                      |

بیشترین ارزش معاملاتی سهام بازار امروز در سهام مربوط به نمادهای فولاد۲، فملی ۲ و زاگرس به ترتیب به ارزش ۱۴۳، ۱۴۳ و ۹۰ میلیارد ریال معامله بوده که این سه حدود ۹.۱۲٪ 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     | ۲۴,۴۰۸       | ۱.۷۹                         | نفت برنت  | ۷۰.۹۷                        | (۰.۰۷)                       |
| شاخص S&P ۵۰۰     | ۲,۶۵۷        | ۱.۶۷                         | مس        | ۶,۹۴۶.۰                      | (۰.۳۴)                       |
| شاخص ترکیبی نزدک | ۷,۰۹۴        | ۲.۰۷                         | روی       | ۳,۲۴۲.۳                      | (۰.۲۵)                       |
| شاخص نیکی ژاپن   | ۲۱,۶۸۷       | (۰.۴۹)                       | آلومینیوم | ۲,۲۵۵.۸                      | ۱.۴۲                         |
| شاخص دلار        | ۸۹.۵         | (۰.۱۱)                       | اونس طلا  | ۱,۳۴۳.۴                      | ۰.۲۸                         |

## نرخ‌های جهانی بیلت فولاد (به علت مشکلات سیستمی بروز نمی‌باشد) 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)<br>ترکیه (فوب)<br>هند (فوب)<br>امارات (سی اف آر جبل علی)<br>مصر (سی اف آر) | ۵۳۴                   | ۲.۶۹  | استرالیا                    | ریزدانه ۵۶.۷٪ تا ۶۲.۵٪ - فوب بندر دمپایر  | ۳۲-۶۱.۶ (+۲.۵)                |       |       |  |   |
|   | ۵۸۵.۰                 | ۱.۷۴  |                             | درشت دانه ۶۲٪ و ۶۳٪                       | ۶۹.۷۳.۲ (+۲)                  |       |       |  |   |
|   | ۵۱۲.۵                 | ۰.۰۰  |                             | ریزدانه ۶۱٪ تا ۶۵٪ فوب بندر توپارو        | ۴۱.۶-۷۱.۲ (+۲)                |       |       |  |   |
|   | ۵۵۰                   | ۱.۸۵  |                             | درشت دانه ۶۴٪ فوب بندر توپارو             | ۴۳.۴ (+۱.۵)                   |       |       |  |   |
|   | ۵۳۷.۵                 | ۰.۹۴  |                             | گندله ۶۵٪ فوب بندر توپارو                 | ۱۱۱.۷ (+۲)                    |       |       |  |   |
| مسیر حمل سنگ آهن  | نرخ (دلار)            | درصد تغییر نسبت به روز گذشته                  | هند                         | ریزدانه ۵۵٪ تا ۶۳٪ فوب بندر Chennai و Goa | ۱۳.۲-۴۹ (+۱.۵)                |       |       |  |   |
|   |                       |   |                             | گندله ۶۴٪ فوب بندر Chennai/Paradip        | ۱۰۱ (+۱.۵)                    |       |       |  |   |
|   |                       |   |                             | برزیل به چین                              | ۱۳.۸۰۷                        | (۹.۱) | روسیه | کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۶٪ فوب دریای سیاه | ۶۷.۷-۶۸.۸ (+۱.۵)                            |
|   |                       |   |                             |   | ۵.۹۲۷                         | ۳.۰   |       | گندله با عیار ۶۳٪ و ۶۵٪ فوب دریای سیاه     | ۹۶.۳-۱۰۲.۳ (+۲)                             |
|   |                       |   |                             |   | ۱۲.۱                          | (۱.۶) |       | ایران                                      | کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۷٪ - فوب بندر عباس |
| ۱۰.۲  | (۳.۸)                 | همانیت با عیار ۵۶٪ تا ۵۵٪/۶۱٪ - فوب بندر عباس | ۱۵.۲-۲۵.۱ (+۱.۵)            |   |                               |       |       |  |   |
| ۱۸.۴  | (۷.۱)                 | مگنتیت با عیار ۵۴٪ تا ۵۳٪/۶۱٪ - فوب بندر عباس | ۱۶.۳-۳۱.۶ (+۱.۵)            |   |                               |       |       |  |   |
| 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 طی دو روز کاری اخیر (استخراج شده از سایت بورس کالا) می باشد:

| نام کالا              | تولید کننده       | نوع قرارداد | بالاترین  | عرضه (تن) | قیمت پایه عرضه | تقاضا (تن) | حجم معامله (تن) | عرضه کننده                    | کارگزار     | قیمت پایانی میانگین موزون |
|-----------------------|-------------------|-------------|-----------|-----------|----------------|------------|-----------------|-------------------------------|-------------|---------------------------|
| شمش بلوم SP5(150*150) | فولاد خوزستان     | سلف         | ۲۳.۲۵۹    | ۱۸.۰۰۰    | ۲۳.۲۵۹         | ۱۸.۰۰۰     | ۱۸.۰۰۰          | فولاد خوزستان                 | ستاره جنوب  | ۲۳.۲۵۹                    |
| تختال C               | فولاد خوزستان     | سلف         | ۲۳.۹۸۱    | ۲۰.۰۰۰    | ۲۳.۲۵۹         | ۴۱.۳۰۰     | ۲۰.۰۰۰          | فولاد خوزستان                 | ستاره جنوب  | ۲۳.۸۶۴                    |
| سیمان تیپ ۱           | سیمان اصفهان      | نقدی        | ۱.۳۱۴     | ۲.۰۰۰     | ۱.۳۱۴          | ۱.۰۰۰      | ۱.۰۰۰           | شرکت سیمان اصفهان             | مبین سرمایه | ۱.۳۱۴                     |
| آهن اسفنجی            | جهان فولاد سیرجان | نقدی        | ۱۲.۹۲۵    | ۵.۰۰۰     | ۱۱.۷۵۰         | ۲۶.۰۰۰     | ۵.۰۰۰           | مجتمع جهان فولاد سیرجان       | ارگ هومن    | ۱۲.۹۲۵                    |
| شمش طلا ۹۹۹           | طلای موته         | نقدی        | ۲.۰۴۵.۰۰۰ | ۰/۰۱      | ۲.۲۰۰.۰۰۰      | ۰/۰۳       | ۰/۰۱            | تهیه و تولید مواد معدنی ایران | سی ولکس     | ۲.۰۴۵.۰۰۰                 |

امور اقتصادی و سرمایه گذاری

۱۳۹۷/۱/۲۲