

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

نام شرکت	وضعیت سهام											تاریخ گزارش: ۹۷/۰۲/۱۱		
	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
													رتبه نقدشوندگی	بازده کل ۹۷
توسعه معادن و فلزات	۹,۷۷۲,۴۷۷	۱۶,۱۲۵	۰.۵۴	۱,۶۵۰	۱,۶۰۰	-۰.۳۶	(۵.۲)	۲۴۲	۶.۸	۶۰,۳۶۴	۳۹,۱۴۰	۸۱	۰.۳۶	۴۰
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۵۵۲,۲۶۵	۱,۴۴۲	۰.۰۵	۲,۶۲۲	۲,۶۰۳	-۰.۳۴	(۰.۷)	۲۴۵	۱۰.۷	۱۹,۲۶۴	۲,۱۰۷	۶۲	۶.۱۰	۱۳۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۲۱۲,۶۴۸	۴۸۷	۰.۰۲	۲,۳۲۵	۲,۲۹۰	-۰.۰۹	(۱.۵)	۴۲۵	۵.۵	۳,۰۰۰	۳,۳۹۳	۷۳	۰.۷۷	۲۱۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۱۸۹,۶۹۰	۶,۹۵۸	۰.۲۳	۲,۱۸۲	۲,۱۷۰	-۰.۰۵	(۰.۹)	۳۷۰	۵.۹	۱۵,۲۳۸	۴۸,۳۱۹	۱۵	۵.۰۳	۲۰۹
معدنی و صنعتی گل گهر	۴,۷۲۶,۱۸۲	۱۵,۳۹۶	۰.۵۱	۳,۲۵۸	۳,۲۵۰	-۰.۱۸	(۵)	۶۵۰	۵.۰	۵۰۰	۱۰۰,۰۰۰	۷۹	۰.۹۴	۲۳۱ ریال شش ماهه
فولاد مبارکه اصفهان	۹,۲۸۹,۸۰۶	۲۵,۵۷۴	۰.۸۵	۲,۷۵۳	۲,۷۷۹	۰.۳۳	۱۷.۱	۶۸۶	۴.۰	۶,۵۰۰	۹۹۰	۳۱	(۰.۷)	۴۹۱
فولاد خوزستان	۹۴۷,۵۲۰	۴,۸۵۷	۰.۱۶	۵,۱۵۹	۵,۱۴۲	-۰.۶۲	(۱۲)	۸۱۲	۶.۴	۱۳,۰۰۰	۱,۶۱۰	۷۴	۸.۸۱	۷۳۵
فولاد امیرکبیرکاشان	۰	۰	۰.۰۰	۵,۹۶۹	۵,۶۷۱	-	-	۳۴۷	۱۷.۲	۰	۲۱,۵۸۶	۵۴۳	(۰.۰۳)	۳۳۴
ملی صنایع مس ایران	۴,۴۴۱,۷۳۹	۱۱,۱۸۷	۰.۳۷	۲,۵۱۹	۲,۵۱۰	۰.۱۶	(۶.۱)	۴۶۲	۵.۵	۱۶,۵۲۰	۵,۰۰۰	۵	(۴.۶)	۲۸۱
فولاد خراسان	۰	۰	۰.۰۰	۳,۷۱۱	۳,۷۰۰	-	-	۱۴۷	۲۵.۲	۲,۴۴۱	۱۴۰	۴۲۱	(۰.۲)	۱۲۱
شرکت آهن و فولاد ارفع	۴۴۴,۱۶۵	۱,۵۵۰	۰.۰۵	۳,۴۸۹	۳,۴۹۰	-۰.۲۰	-	۸۳۴	۴.۲	۲۵۰	۸,۰۰۰	۱۳۷	۰.۴۸	-۳۹
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۳۹,۳۷۱	۲۶۵	۰.۰۱	۱,۹۰۹	۱,۸۷۵	-۰.۲۶	-	۱۱۷	۱۶.۳	۱,۱۰۰	۰	۱۲۴	(۸.۳)	-۱۲۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۵۳,۱۷۵	۰	۰.۰۰	۱,۳۰۷	۱,۳۲۰	-۴.۴۶	-	۱۲۱	۱۰.۸	۰	۲,۰۰۰	۳۰۴	(۱.۳)	۱۹۴ ریال زیان (۹ ماهه)
بانک سامان	۰	۰	۰.۰۰	۱,۳۳۳	۰	۰.۰	-	۶۳	۲۱.۲	۰	۸,۰۰۰	-	-	-
شاخص کل	۹۳,۶۱۲													۲۵
۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)	۲۹,۴۱۹													۸
۴- شاخص کل (هم وزن)	۱۶,۶۱۰													(۳)
۵- شاخص قیمت (هم وزن)	۱۲,۳۳۴													(۲)
۵- شاخص شناور آزاد	۹۹,۴۵۵													۱۱
۶- شاخص فرابورس	۱,۰۵۷													۴.۶

روز کاری گذشته برابر با:

در تاریخ گزارش برابر با:

تغییرات مثبت / منفی



## عملکرد بازار بورس و فرابورس در تاریخ گزارش

بیشترین تاثیر مثبت در شاخص	۱- آپ +۲۳.۴۸	بیشترین تاثیر منفی در شاخص	۱- رانفور -۱۵.۴۸	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت	کیسونج، وسدید، تشتاد
	۲- شبندر +۲۲.۰۴		۲- صندوق -۱۳.۰۱	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی	شپاسح، وگردش، فلاتح
	۳- فولاد +۱۷.۱۱		۳- فخوز -۱۱.۷۴	تعداد سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم)	۱۷,۴۱۴
حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیون سهم)	۱,۰۸۲	تعداد نماد با تغییرات مثبت	۲۷۰	ارزش سهام معامله شده از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال)	۳۹,۱۹۶
ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)	۲,۹۹۶	تعداد نماد با تغییرات منفی	۲۵۷	تغییرات حجمی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	(۱۸,۰۴۵)
رتبه سرمایه‌های و فلزات در حجم معاملات	۳۱	تعداد نماد بدون تغییر	۵۰	تغییرات ریالی از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	(۳۵,۸۲۸)
رتبه سرمایه‌های و فلزات در ارزش معاملات	۵۳	تعداد نمادهای متوقف	۱۶	تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش	۵۷۷

بیشترین ارزش معاملاتی سهام بازار امروز در سهام مربوط به نمادهای آسیا۴، شیریز و شپنا به ترتیب به ارزش ۸۳۲، ۹۰ و ۴۶ میلیارد ریال معامله بوده که این سه حدود ۳۲.۳۴٪ از ارزش بازار امروز را تشکیل می‌داند.

## 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	۲۴,۴۴۹	(۰.۰۶)	نفت برنت	۷۴.۱۴	(۰.۷۵)
شاخص S&P ۵۰۰	۲,۶۷۰	۰.۰۱	مس	۶,۷۸۰.۰	(۰.۵۹)
شاخص ترکیبی نزدک	۷,۱۲۹	(۰.۲۵)	روی	۳,۱۰۶.۰	(۰.۵۶)
شاخص نیکی ژاپن	۲۲,۲۷۸	۰.۸۶	آلومینیوم	۲,۲۵۰.۸	۰.۰۷
شاخص دلار	۹۱.۹۹	۰.۳۹	اونس طلا	۱,۳۰۹.۷	(۰.۴۳)

## 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)	۵۱۰	(۱.۳۵)	استرالیا	ریزدانه ۵۶.۷٪ تا ۶۲.۵٪ - فوب بندر دمپایر	(۱.۵) -۶۰.۲ تا ۳۱.۸
	۵۳۵.۰	(۱.۸۳)		درشت دانه ۶۲٪ و ۶۳٪	(۱.۸) -۷۰.۶ تا ۶۸
	۵۰۷.۵	۰.۰۰		ریزدانه ۶۱٪ تا ۶۵٪ فوب بندر توپارو	(۱.۵) -۷۲.۶ تا ۴۰.۹
امارات (سی اف آر جبل علی) مصر (سی اف آر)	۵۲۷.۵	۰.۰۰	برزیل	درشت دانه ۶۴٪ فوب بندر توپارو	(۱.۵) -۴۲.۴
	۵۲۷.۵	(۰.۷۵)		گندله ۶۵٪ فوب بندر توپارو	(۱.۵) -۱۱۲.۷
مسیر حمل سنگ آهن	نرخ (دلار)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته	هند	ریزدانه ۵۵٪ تا ۶۳٪ فوب بندر Chennai و Goa	(۱.۸) -۴۷.۱ تا ۱۵.۴
				گندله ۶۴٪ فوب بندر Chennai/Paradip	(۱.۵) -۱۰۲.۲
				کنسانتره با عیار ۶۵٪ و ۶۶٪ فوب دریای سیاه	(۱.۵) -۶۹.۷ تا ۶۸.۶
برزیل به چین غرب استرالیا به چین	۱۸.۰۵۵	۰.۲	روسیه	گندله با عیار ۶۳٪ و ۶۵٪ فوب دریای سیاه	(۱.۵) -۱۰۳.۲ تا ۹۷.۲
هند به چین آفریقا به چین ایران به چین	۱۲.۶	(۱.۶)	ایران	کنسانتره با عیار ۶۵٪ تا ۶۷٪ - فوب بندر عباس	(۱.۸) -۶۹.۵ تا ۶۶
	۱۳.۴	۲.۳		همانیت با عیار ۵۵٪/۵۶٪ تا ۶۱٪/۶۲٪ - فوب بندر عباس	(۱.۳) -۲۴.۹ تا ۱۵.۶
	۱۹.۸	۰.۰		مگنتیت با عیار ۵۳٪/۵۴٪ تا ۶۱٪/۶۲٪ - فوب بندر عباس	(۱.۳) -۳۰.۹ تا ۱۶.۷
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	۱۵۷,۸۸۲	(۰.۲)	موجودی انبار بندر Caofidian	۲۴۷۹۰	(۱.۰)



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	قیمت پایانی میانگین موزون	ارزش معامله (هزارریال)	حجم معامله (تن)
ورق سرد B	فولاد مبارکه اصفهان	سلف (مچینگ)	۲۹،۱۰۶	۳۰۵،۳۲۱،۹۴۰	۱۰،۴۹۰
ورق گرم C	فولاد مبارکه اصفهان	سلف (مچینگ)	۲۶،۷۶۷	۱۲۴،۱۱۸،۵۷۹	۴،۶۳۷
سبد میلگرد مخلوط	ذوب آهن اصفهان	سلف	۲۷،۴۷۹	۲۵،۶۹۲،۸۶۵	۹۳۵
آهن اسفنجی	فولاد سیرجان ایرانیان	نقدی	۱۱،۸۸۹	۵۹،۴۴۲،۵۰۰	۵،۰۰۰
سبد میلگرد مخلوط	نورد فولاد صنعتی و ساختمانی یزد	نقدی	۲۳،۸۰۰	۲۱،۱۳۴،۴۰۰	۸۸۸
تختال C	فولاد خوزستان	سلف	۲۲،۸۰۰	۲۹۶،۴۰۰،۰۰۰	۱۳،۰۰۰
ورق گرم B	فولاد مبارکه اصفهان	سلف (مچینگ)	۲۷،۴۶۸	۳۲۹،۹۴۵،۶۱۶	۱۲،۰۱۲
سیمان تیپ ۱	سیمان اصفهان	نقدی (مچینگ)	۱،۳۱۴	۱،۳۱۴،۰۰۰	۱،۰۰۰

امور اقتصادی و سرمایه گذاری

۱۳۹۷/۰۲/۱۱