

عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سر. توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا در تاریخ ۹۹/۱۰/۲۲

نقدشوندگی و بازدهی			وضعیت سهام											نام شرکت	
بازدهی ۹۸	بازدهی ۹۹ تا امروز	رتبه نقدشوندگی	P/E _{forward}	P/E _{t/m}	EPS پیش بینی ۹۹	EPS شش ماهه اول ۹۹	EPS ۹۸	میزان تاثیر بر شاخص	درصد تغییر	آخرین قیمت	قیمت پایانی	درصد از کل ارزش معاملات	ارزش معاملات		حجم معاملات
۹۲.۰	۱۱۵.۲	۵۳۰	۱۱	۱۵	۱.۰۹۵	۱۲۵	۶۹۶	(۲۴۸)	(۲)	۱۱.۴۹۰	۱۱.۷۱۰	۰.۰۷	۱۷۲.۲۴۱	۱۴.۷۱۰.۰۰۴	توسعه معادن و فلزات
۸۰.۲	۱۶۱.۵	۲۹	۱۱	۱۳	۱.۵۶۵	۵۲۰	۱۳۶۱	(۹۳)	(۰)	۱۷.۵۰۰	۱۷.۹۲۰	۰.۰۶	۱۵۴.۷۳۷	۸.۶۳۳.۰۶۶	معدنی و صنعتی گل گهر
۱۰۰.۱	۱۹۲.۴	۲۸	۹	۱۸	۲.۲۰۸	۷۷۸	۱۱۳۷	۱۵۳	۱	۱۹.۸۰۰	۲۰.۰۸۰	۰.۰۷	۱۸۷.۸۵۱	۹.۳۵۳.۶۷۷	معدنی و صنعتی چادرملو
۲۴۳.۵	۲۰۵.۳	۲۳۴	۳۲	۴۶	۱.۵۴۴	۱۸۹۳*	۱۸۶۰	(۱۲)	(۱)	۴۷.۶۰۰	۴۸.۶۶۶	۰.۰۳	۸۳.۱۵۳	۱.۷۱۲.۰۹۴	سنگ آهن گهرزمین
۱۹۳.۵	۲۱۶.۹	۲۳۶	۹	۱۱	۴.۸۴۷	۳.۲۸۷	۱۵۶۷	(۵۳)	(۲)	۴۳.۵۷۰	۴۴.۲۲۰	۰.۰۳	۷۵.۰۲۱	۱.۶۹۶.۳۶۱	توسعه معدنی و صنعتی صباتور
۱۷۷.۷	۲۴۱.۴	۱۶۸	۲۲	۲۷	۱.۸۶۱	۱۵۵۱**	۷۹۵	۴۵	۰	۴۰.۵۵۰	۴۰.۶۱۰	۰.۰۶	۱۴۶.۵۱۷	۳.۶۰۸.۱۲۶	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید
۱۴۲.۶	۲۳۶.۸	۳۶۵	۳۱	۳۳	۱.۳۰۹	۱.۰۰۸	۱۱۹۹	(۲.۳۱۱)	(۴)	۲۷.۶۵۰	۲۷.۷۲۰	۰.۸۵	۲.۱۴۳.۷۰۱	۱۷۸.۹۹۶.۵۰۱	ملی صنایع مس ایران
۶۸.۳	۱۳۳.۳	۳۹	۷	۹	۱.۹۳۴	۱.۰۲۶	۱۱۶۵	۹	۴	۱۳.۸۵۰	۱۴.۰۶۲	۰.۰۸	۱۸۹.۴۹۲	۱۳.۴۷۵.۰۴۵	شرکت آهن و فولاد ارفع
۱۹۴.۲	۵۳.۸	۳۴۳	۱۵	۲۳	۱.۸۵۸	۸۰۹	۸۴۶	۰	-	۲۷.۵۵۰	۲۸.۳۴۰	متوقف به دلیل ابهام در اطلاعات با اهمیت		فولاد خراسان	
۱۹۹.۴	۱۰۵.۱	۱۶۱	۶	۱۲	۹.۹۲۹	۴.۲۴۰	۲۱۱۱	۲۰	۲	۶۰.۳۸۰	۶۲۱۳۰	۰	۱۴۳.۰۵۹	۲۳.۰۲۰.۶۶۸	فولاد امیرکبیرکاشان
۱۹۱.۹	۱۱.۷	۱۶۷	۱۲۷	۱۵۳	۱۲۵	۱۰۰****	۴۲	۰	۱	۱۶.۱۷۱	۱۵.۹۲۴	۰.۰۰	۱۰.۱۹۹	۶۳.۰۶۸۳	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان
۱۸۳۸.۷	(۷)	۱۳	۶۰	۱۲۶	۷۵	۲۳	۵۰۵	۰	۰	۴.۶۱۰	۴.۵۰۰	۰.۱۵	۳۷۹.۷۰۸	۸۴.۴۳۰.۷۸۲	کارخانجات تولیدی شهید قندی
۱۱۹.۹	۱۶۱.۷	۲	۱۱	۱۵	۱.۱۰۲	۴۸۳	۷۰۸	۴۷۲	۱	۱۲.۹۲۰	۱۱.۸۷۰	۰.۳۸	۹۷۱.۵۷۵	۸۱.۸۴۳.۳۶۹	فولاد مبارکه اصفهان
۷۶.۸	۱۸۷.۹	۳۴۸	۵	۱۰	۳.۱۹۶	۱.۷۷۵	۱۷۵۳	(۵۶۵)	(۳)	۱۴.۱۶۰	۱۴.۴۵۰	۰.۰۶	۱۵۲.۱۰۵	۱۰.۵۳۹.۷۹۹	فولاد خوزستان
۵۹.۲	۱۸۱.۶	۳۱	۸	۱۳	۱.۷۵۳	۸۴۷	۶۰۰	۲۲	۴	۱۴.۰۰۰	۱۴.۲۸۰	۰.۱۵	۳۸۱.۴۴۶	۲۶.۷۱۲.۰۳۴	فولاد هرمزگان جنوب
۱۲۵.۰	۲۰۸.۳	۲۴	۱۲	۱۸	۱.۶۲۷	۸۰۱	۶۴۸	(۵۳)	(۱)	۱۸.۵۰۰	۱۹.۰۳۰	۰.۱۲	۳۱۲.۰۹۱	۱۶.۳۹۸.۰۹۸	فولاد کاوه جنوب کیش
۲۴۱.۴	۱۱۹.۲	۶۴۳	۹	۵۲	۲۰.۸۷۰	-۳۶***	۳۸۳۳	۰	-	۱۹۰.۳۳۲	۱۹۰.۳۳۲	متوقف به دلیل بررسی وضعیت اطلاعاتی ناشر		م. صنایع و معادن احیاء سیاهان	
۹۸.۵	۵۱۵.۳	۵۰	۴۳	۱۰۱	۷۱۷	-۳	۳۰۳	۰	۱	۳۰.۸۵۱	۳۰.۸۴۱	۰.۱۷	۴۲۷.۵۱۱	۱۳.۸۶۱.۹۱۵	هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه
۸۳.۴	۷۶.۵	۱۹۵	۹	۳۳	۵۰۰	۸۹	۱۲۲	۲۰	۵	۴.۵۵۱	۴.۵۳۸	۰.۵۹	۱.۴۷۷.۱۷۱	۳۱۱.۵۰۶.۹۹۶	ذوب آهن اصفهان
-۰.۴۱	درصد تغییر	-۵.۳۶۲	مقدار تغییر	۱.۳۰۶.۶۲۱	دیروز	۱.۳۰۱.۲۵۸	امروز	شاخص کل	-۰.۴۱	۳۴۱.۴۲۳	۳۴۰۰۰۲۲	۳- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)			
۰.۵۸		۲.۷۱۲							۴۶۶.۶۵۲	۴۶۹.۳۶۵	۴- شاخص کل (هم وزن)				
۰.۵۸		۱.۷۷۵							۳۰۵.۴۰۲	۳۰۷.۱۷۷			۵- شاخص قیمت (هم وزن)		
-۰.۴۵		-۸.۳۸۰							۱.۸۶۰.۸۸۳	۱.۸۵۲.۵۰۲				۵- شاخص شناور آزاد	
۰.۵۲		۹۹							۱۹.۰۷۵	۱۹.۱۷۴					۶- شاخص فرابورس

**برای دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

**برای دوره نه ماهه منتهی به ۹۹/۰۷/۳۰

***برای دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

****برای دوره سه ماهه اول سال ۹۹

*****برای دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱



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)	
	۱- شستا +۱۸۴۸	۱- فملی -۲۳۱۰	تعداد نماد با تغییرات مثبت	۱۳,۷۵۳
	۲- بترانس +۵۹۴	۲- خودرو -۷۵۷	تعداد نماد با تغییرات منفی	۲۵۲,۴۱۹
۳- حکشتی +۵۱۴	۳- شپنا -۵۷۲	تعداد نماد بدون تغییر	۱۵۳	
حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)	ارزش معاملات از ابتدای سال تاکنون (میلیارد ریال)	تعداد نمادهای متوقف	۲۴۷	رتبه سر.معادن و فلزات در حجم معاملات
۲۲,۲۰۹,۲۵۴	۴۰۹	تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش	۴۹	رتبه سر.معادن و فلزات در ارزش معاملات
ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)	تغییرات حجم معاملات از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش			
۱,۳۳۶,۱۶۰	۴۱۸			
رتبه سر.معادن و فلزات در حجم معاملات	تغییرات ارزش معاملات از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش			
۲۷,۶۱۵,۴۲۳	۴۲			
رتبه سر.معادن و فلزات در ارزش معاملات	تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش			
۸۶۹	۴۹			

سه نماد سهام با بیشترین ارزش معاملات در بازار امروز عبارتند از: **شستا**، **شپنا**، و **تجارت**

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	۳۱,۰۹۷	۰.۲	نفت برنت	۵۵	(۱.۴)
شاخص S&P ۵۰۰	۳,۸۲۴	۰.۶	مس	۸,۰۰۹	(۰.۹)
شاخص ترکیبی نزدک	۱۳,۲۰۱	۱.۰	روی	۲,۷۹۶	(۰.۱)
شاخص نیکی ژاپن	۲۸,۱۳۹	۲.۴	آلومینیوم	۲,۰۰۸	(۰.۴)
شاخص دلار	۹۰	۰.۳	اونس طلا	۱,۸۵۰	۰.۱

نرخ های جهانی بیلت فولاد و سنگ آهن*

نوع بیلت	میانگین نرخ (دلار/تن)	درصد تغییر نسبت به هفته گذشته	نوع سنگ آهن	میانگین نرخ (دلار/تن)	درصد تغییر نسبت به هفته گذشته
CIS exports index (fob Black Sea port)	۶۰۵	۰.۲	Iron ore pellet index cfr Qingdao (65% Fe)	۲۱۵.۱۱	۰.۶
Turkish Exports (fob main Turkish port)	۶۱۰-۶۱۵	۱.۲	Iron ore index (62% Fe)	۱۶۸.۷۲	۵.۶
Indian exports (fob main India port)	۵۳۰-۵۳۵	۰.۰	Iron ore index (65% Fe) Brazilian cfr Qingdao	۱۸۶.۴	۷.۸
UAE imports (cfr Jebel Ali)	۶۰۰-۶۱۰	۱.۷	Iron ore concentrate index cfr Qingdao (66% Fe)	۱۷۷.۱۲	(۳.۷)
Egypt imports (cfr main port)	۵۹۰-۶۲۰	۳.۴	Implied 62% Fe China port price index	۱۶۵.۰۶	۵.۲

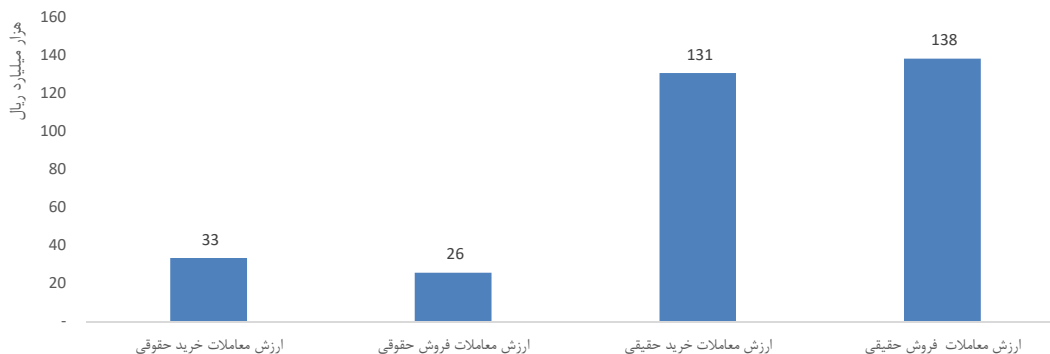
* داده های این قسمت مربوط به تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۲۰ می باشد.

آمار معاملات گروه صنعتی در بورس کالای ایران در تاریخ ۹۹/۱۰/۲۲

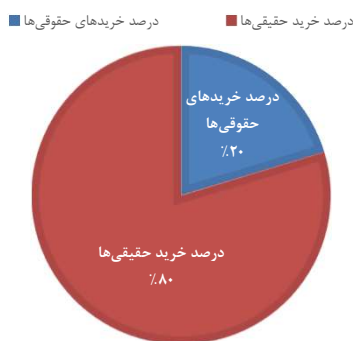
نام کالا	تولید کننده	قیمت پایانی میانگین موزون	ارزش معامله (هزارریال)	بالاترین	عرضه (تن)	قیمت پایه عرضه	تقاضا (تن)	حجم معامله (تن)
ورق گرم C	فولاد مبارکه اصفهان	۱۷۷,۶۱۴	۴,۴۳۵,۰۱۵,۶۴۰	۱۷۸,۸۹۹	۲۴,۹۷۰	۱۵۴,۶۴۳	۴۰,۵۹۰	۲۴,۹۷۰
ورق رنگی	فولاد مبارکه اصفهان	۲۳۹,۶۹۳	۴۷۹,۳۸۶,۷۵۰	۲۴۲,۸۸۹	۲,۰۰۰	۲۳۲,۳۱۰	۲,۱۰۰	۲,۰۰۰
ورق قلع اندود	فولاد مبارکه اصفهان	۲۰۸,۱۸۹	۴۰۵,۹۶۸,۵۵۰	۲۰۸,۱۸۹	۳,۵۰۰	۲۰۸,۱۸۹	۲,۱۵۰	۱,۹۵۰
ورق گرم B	مجتمع فولاد گیلان	۱۵۴,۶۴۳	۳۰۹,۲۸۶,۰۰۰	۱۵۴,۶۴۳	۲,۰۰۰	۱۵۴,۶۴۳	۲,۰۰۰	۲,۰۰۰
ورق گرم B	مجتمع فولاد گیلان	۱۵۴,۶۴۳	۲۳۱,۹۶۴,۵۰۰	۱۵۴,۶۴۳	۳,۵۰۰	۱۵۴,۶۴۳	۱,۵۰۰	۱,۵۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) ۵SP	گروه صنعتی پارس بوتیل یزد	۱۱۷,۱۶۶	۱۲۸,۸۸۲,۶۰۰	۱۱۷,۱۶۶	۱,۱۰۰	۱۱۷,۱۶۶	۱,۱۰۰	۱,۱۰۰
ورق گرم	نورد و تولید قطعات فولادی	۱۴۵,۹۹۸	۲۹,۱۹۹,۶۰۰	۱۴۵,۹۹۸	۲۰۰	۱۴۵,۹۹۸	۲۰۰	۲۰۰

ارزش خرید و فروش معاملات حقیقی و حقوقی در بازار سرمایه

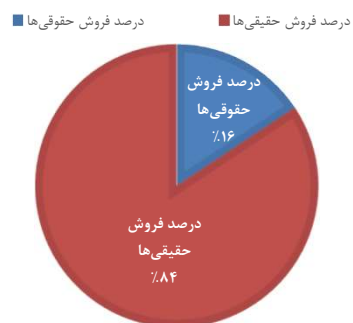
ارزش کل معاملات حقیقی و حقوقی



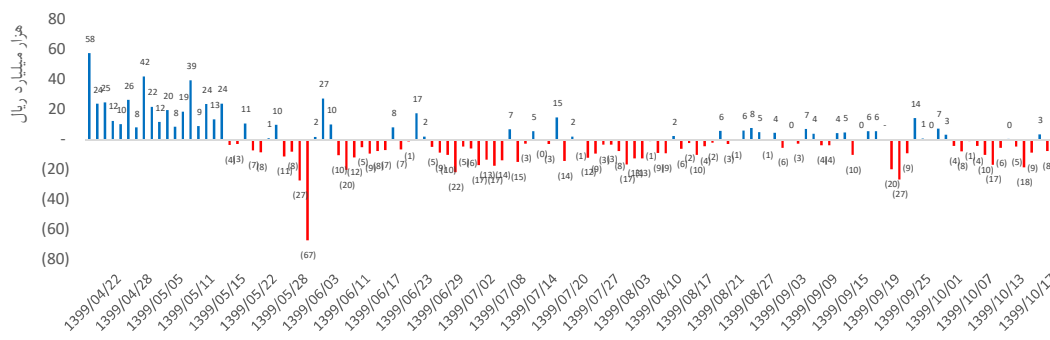
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



خالص ورود (خروج) پول حقیقی



مروری بر بازار سرمایه

- شاخص کل بورس اوراق بهادار با ۵,۳۶۲ واحد منفی و با ۰/۴۱ درصد کاهش عدد ۱,۳۰۱,۲۵۸ واحد را تجربه کرد. بطوریکه ۱۰,۴۶۱ میلیون سهم به ارزش کل ۱۱۱,۶۰۸ میلیارد ریال مورد معامله قرار گرفت.
- شاخص فرابورس ایران نیز با ۹۹ واحد مثبت و با ۰/۵۲ درصد افزایش عدد ۱۹,۱۷۴ واحد را تجربه کرد. بطوریکه در این بازار نیز ۳,۲۹۲ میلیون سهم به ارزش کل ۱۴۰,۸۳۵ میلیارد ریال مورد معامله قرار گرفت.

شایعات و شنیده‌ها

- وزارت خزانه داری آمریکا در نظر دارد تا دارندگان ارزهای دیجیتال همانند بیت‌کوین را مجبور به افشای دارایی‌های خود به شبکه مقابله با جرائم مالی این کشور کند.
- طرح توسعه فولادسازی مجتمع فولاد سفیددشت، شامل کوره قوس الکتریکی، کوره پاتیلی و ماشین ریخته‌گری اسلب، در حال حاضر ۸۶/۴ درصد پیشرفت فیزیکی دارد و اوایل سال ۱۴۰۰ به بهره برداری می‌رسد.

مروری بر اطلاعیه‌های کدال

- دی: به استناد ماده ۱۲ مکرر دستورالعمل اجرایی نحوه انجام معاملات در فرابورس ایران به اطلاع می‌رساند با توجه به ابهامات موجود در اطلاعات با اهمیت منتشر شده توسط ناشر، نماد معاملاتی حداکثر به مدت ۲ روز کاری متوقف می‌گردد.

اخبار روز

- اقتصاددانان بانک جهانی، پیش‌بینی سال ۲۰۲۰ خود را در خصوص تولید ناخالص داخلی جهانی از منفی ۵/۲ درصد به منفی ۴/۳ درصد کاهش دادند تا علائم اولیه بهبود را نشان دهند، در همین حال چشم‌انداز آنها برای سال ۲۰۲۱، به دلیل طولانی شدن اثرات بیماری همه‌گیر، بدتر شده است.
- کسری تراز تجاری آمریکا در ماه نوامبر با رشد ۵ میلیارد دلاری به ۶۸/۱ میلیارد دلار افزایش یافت که از انتظار ۶۵/۲ میلیارد دلاری بازار بدتر است.
- تقاضای سوخت هند در ماه دسامبر به بالاترین سطح در ۱۱ ماه گذشته رسید. مصرف سوخت هند در ماه دسامبر سال ۲۰۲۰، برای چهارمین ماه پیاپی افزایش یافت. زیرا فعالیت اقتصادی و تقاضای حمل و نقل در پسا کرونا بهبود یافته است.
- بررسی آمار تجارت خارجی در دوره ۹ ماهه امسال، گویای صادرات ۸۰ هزار تن کاتد و قطعات کاتد مس به ارزش ۵۱۲ میلیون دلار است.
- میزان تولید شمش آلومینیوم در ۹ ماهه امسال به رقم ۳۰۸ هزار تن رسید که در مقایسه با مدت مشابه پارسال، افزایش ۵۱/۲ درصدی را نشان می‌دهد.

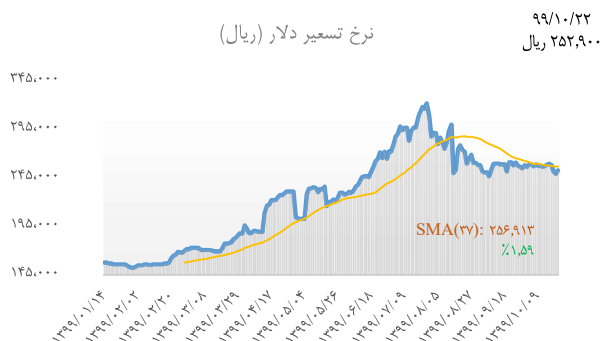
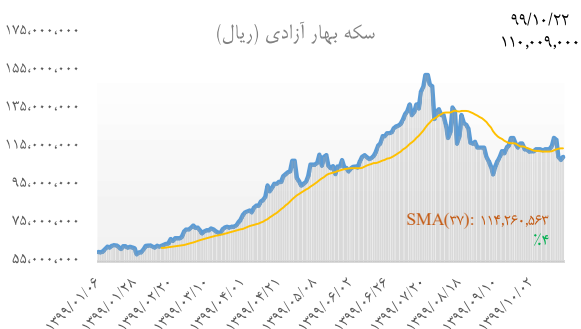
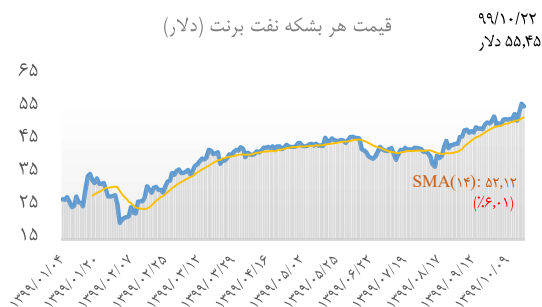
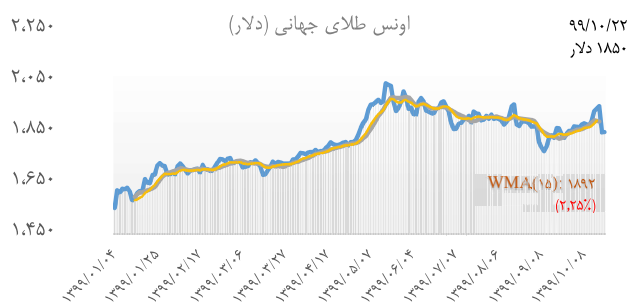
- احسان خاندوزی، عضو کمیسیون اقتصادی مجلس درباره قیمت‌گذاری فولاد عنوان کرد: طرح مجلس برای تنظیم بازار فولاد، فردا یا پس فردا در دستور صحن مجلس قرار می‌گیرد و نگاه مجلس در این باره، عرضه کامل و صد درصدی فولاد در بورس کالا است که به هر میزان مازاد وجود داشت، صادر شود. اما در خصوص قیمت، موضع مجلس تعیین قیمت نیست بلکه کشف قیمت، براساس عرضه و تقاضاست که امیدواریم وزیر صمت هم ایده‌های خود در خصوص قیمت را تغییر دهد و از روش فعلی دست بردارد.

نرخ‌های دلار و سکه مورخ ۱۳۹۹/۱۰/۲۲

ارقام به تومان

نرخ	سکه	یورو			دلار		
		فروش	خرید	نرخ سنا	فروش	خرید	نرخ دلار نیما
۴,۱۲۰,۰۰۰	ربع سکه	۳۰,۳۵۰	۲۹۴,۵۰۰		۲۵,۴۳۱	۲۵,۱۳۱	
۶,۱۴۰,۰۰۰	نیم سکه				۲۴,۹۵۰	۲۴,۰۵۰	
۱۱,۲۹۹,۰۰۰	تمام امامی	EUR/USD: ۱,۲۱۹			۲۵,۲۹۰	۲۴,۲۹۰	
۱۱,۰۰۰,۹۰۰	بهار آزادی				۲۴,۸۵۰	۲۳,۹۵۰	

روند نرخ دلار / اونس / نفت / سکه از ابتدای سال تا کنون



SMA(n): میانگین متحرک n روزه
تفاوت میانگین متحرک n روزه با قیمت امروز