

عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۰

ریسک	بازدهی		P/E و EPS			وضعیت سهام				نام شرکت
	بازدهی ۹۹	بازدهی سال جاری تا امروز	P/E forward	EPS پیش بینی ۱۴۰۰	EPS پیش بینی ۱۳۹۹	درصد تغییر	قیمت پایانی	ارزش معاملات	حجم معاملات	
بنا										
۱.۰۸	۱۵۰.۷	-۱۶.۵	۶.۸	۱.۵۱۷	۱.۳۶۰	۰.۰	۱۱.۴۷۰	توقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده		توسعه معادن و فلزات
۰.۹۵	۱۹۱.۹	-۰.۴	۶.۱	۲,۲۰۸	۱.۶۴۳	(۱.۲)	۱۴.۶۴۰	۱۰۶,۴۰۸	۷,۲۷۳,۸۶۴	معدنی و صنعتی گل گهر
۰.۹۸	۲۵۰.۱	-۴.۹	۵.۶	۳,۷۸۵	۲.۹۸۵	(۱.۲)	۲۲.۹۹۰	۱۲۵,۸۵۷	۵,۴۷۳,۷۸۸	معدنی و صنعتی چادرملو
۰.۹۷	۲۱۵.۶	۱.۷	۱۳.۳	۳,۵۰۲	۱۷۳۱*	۰.۰	۴۷.۹۰۸	توقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی		سنگ آهن گهرزمین
۱.۰۴	۲۵۰.۹	-۵.۸	۶.۵	۶,۲۱۶	۷,۵۸۷	(۱.۳)	۴۶.۲۵۰	۴۰,۳۹۵	۸۷۷,۳۷۴	توسعه معدنی و صنعتی صباپور
۰.۷۳	۲۰۹.۰	-۲.۴	۱۳.۱	۹۴۹	۵۷۵	۰.۰	۱۲.۸۰۰	۸۷۵	۶۹,۷۲۴	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید
۱.۲۸	۲۸۲.۱	-۱۸.۱	۵.۰	۲,۱۷۴	۱,۴۰۰	(۰.۲)	۱۱,۱۴۰	۱۰,۳۱,۲۱۱	۹۲,۵۹۲,۷۰۲	ملی صنایع مس ایران
۰.۸۳	۱۶۳.۱	-۴.۹	۴.۵	۳,۰۰۹	۲,۴۹۶	۰.۳	۱۴,۸۸۱	۶۰,۴۶۷	۴,۰۶۱,۰۵۷	شرکت آهن و فولاد ارفع
۰.۶۸	۴۹.۱	-۲.۵	۶.۶	۴,۱۱۵	۲,۱۱۴	(۰.۲)	۲۷.۹۰۰	۱۰,۷۵۴	۳۹۲,۳۲۹	فولاد خراسان
۰.۵۴	۱۰۶.۶	-۷.۹	۴.۴	۱۱,۰۳۹	۱۱,۷۳۵	(۰.۵)	۵۷.۶۹۰	۱۲,۵۷۶	۲۲۱,۲۶۰	فولاد امیرکبیرکاشان
۰.۵۴	۹	۰.۷	۳۳	۴۷۵	۳۶۵	۰.۰	۱۵,۶۴۷	توقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی		گروه صنایع معادن فلات ایرانیان
۱.۱۴	(۲۹)	۱۴.۵	۲۶	۱۵۱	۶۳	(۰.۳)	۳.۹۵۰	۲,۳۴۶	۶۱۵,۷۹۱	کارخانجات تولیدی شهید قندی
۱.۲۷	۲۱۱.۴	-۱۳.۳	۴.۸	۲,۴۳۲	۱,۸۵۰	(۱.۴)	۱۲,۲۹۰	۱,۷۳۵,۴۸۳	۱۴۱,۱۷۱,۷۳۵	فولاد مبارکه اصفهان
۰.۸۳	۲۱۰.۵	-۷.۲	۴.۷	۲,۹۳۵	۲,۱۰۴	۰.۳	۱۴,۴۷۰	۲۳۸,۵۵۵	۱۶,۴۸۰,۵۲۲	فولاد خوزستان
۰.۸۵	۱۸۹.۰	-۰.۱	۵.۵	۲,۵۵۲	۲,۰۱۳	۰.۶	۱۴,۶۴۴	۵۷,۴۲۰	۳,۸۹۶,۲۵۱	فولاد هرمزگان جنوب
۰.۹۵	۲۵۸.۵	-۵.۵	۵.۲	۳,۸۱۴	۲,۵۳۲	۲.۶	۲۰.۹۵۰	۱۴۵,۶۳۳	۶,۹۵۱,۳۱۴	فولاد کاوه جنوب کیش
۰.۹۷	۶۹.۸	-۴.۳	۳.۲	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	(۲.۰)	۱۳۹,۶۲۲	۱۶۱,۱۸۶	۱,۱۵۴,۴۴۷	م. صنایع و معادن احیاء سیاهان
۰.۶۹	۵۲۰.۷	۳.۸	۴۳.۳	۷۳۲	۶۶۰	(۰.۰)	۳۲,۳۰۷	۶۱,۴۹۴	۱,۹۰۳,۷۲۴	هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه
۱.۰۰	۵۲.۹	-۱۱.۰	۶.۴	۵۷۴	۳۰۹	(۲.۰)	۳,۶۵۶	۱۰۰,۹۷۳	۲۷,۶۱۸,۵۶۱	سهامی ذوب آهن اصفهان
۵.۷۳	بازدهی سه ماه گذشته	-۶,۹۶	بازدهی یک ماه گذشته	-۰,۶۶	درصد تغییر نسبت به روز گذشته	۱,۲۱۶,۷۰۷	امروز	۱- شاخص کل		
۵,۴۲		-۷,۰۳		-۰,۶۶		۳۱۶,۵۶۲		۲- شاخص قیمت (وزنی ارزشی)		
۰,۳۱		-۱,۸۳		-۰,۱۷		۴۳۱,۷۵۰		۳- شاخص کل (هم وزن)		
-۰,۱۵		-۱,۹۱		-۰,۱۷		۲۸۱,۰۷۲		۴- شاخص قیمت (هم وزن)		
۲,۹۵		-۶,۰۲		-۰,۴۸		۱,۷۲۴,۲۴۰		۵- شاخص شناور آزاد		
۱,۴۲		-۱,۱۷		-۰,۲۳		۱۷,۷۸۰		۶- شاخص فرابورس		

← ضریب بتا، بر بازده های ماهانه سه سال اخیر محاسبه گردیده است.
 ← ارقام مربوط به بتا، ابتدای هر ماه به روز رسانی می گردد.

*سود واقعی هر سهم مطابق صورت های مالی حسابرسی شده با سرمایه ۲۵ هزار میلیارد ریال



عملکرد بازار بورس و فرابورس در تاریخ گزارش

فایرا . ساراب. وثنو ونیکی . اگ.۰۰۰۴۱۹. اگ.۰۰۴۱۹۲	نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد مثبت نمادهای معاملاتی با بیشترین درصد منفی	۱-فارس -۱۲۹۳ ۲- فولاد -۹۴۲ ۳- ونیکی -۴۶۸	بیشترین تاثیر منفی در شاخص	۱-فایرا +۲۰۴ ۲- کاوه +۱۹۵ ۳- وملت +۱۵۵		بیشترین تاثیر مثبت در شاخص
				حجم کل معاملات بورس و فرابورس (میلیون سهم)		
				ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (میلیارد ریال)		
۱۱۳,۰۰۵	حجم معاملات از ابتدای سال تاکنون (میلیون سهم)	۲۰۹	تعداد نماد با تغییرات مثبت	۴,۳۶۱	۱,۰۰۳,۱۵۲	
-۶۱,۰۶۱	تغییرات حجم معاملات از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	۳۸۲	تعداد نماد با تغییرات منفی	۴۴۰,۶۱۲		
-۳۹۳,۹۶۴	تغییرات ارزش معاملات از ابتدای سال نسبت به دوره مشابه سال پیش	۲۴۹	تعداد نماد بدون تغییر	۰		
۸۴۰	تعداد کل نمادهای معامله شده در تاریخ گزارش	۳۲	تعداد نمادهای متوقف	۰		

سه نماد سهام با بیشترین ارزش معاملات در بازار امروز عبارتند از: اگ.۰۰۴۱۹۲. شپنا. ۲. وملل ۲

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	۳۴,۲۰۰	۰.۵	نفت برنت	۶۶.۷۵	۳.۱۳
شاخص S&P ۵۰۰	۴,۱۸۵	۰.۴	مس	۹,۴۰۰	۲.۴۰
شاخص ترکیبی نزدک	۱۴,۰۵۲	۰.۱	روی	۲,۸۷۴	۰.۶۰
شاخص نیکی ژاپن	۲۹,۶۸۳	۰.۱	آلومینیوم	۲,۳۴۲	۰.۹۳
شاخص دلار	۹۱.۲	۰.۴	انس طلا	۱,۷۸۶	۰.۵۸

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)	۶۰۰	۳.۳	Iron ore pellet index cfr Qingdao (65% Fe)	۲۲۸.۹۸	۳.۲
Turkish Exports (fob main Turkish port)	۵۸۵-۵۹۰	(۱.۷)	Iron ore index (62% Fe)	۱۷۸.۴۱	۳.۱
Indian exports (fob main India port)	۵۹۰-۵۹۵	۷.۲	Iron ore index (65% Fe) Brazilian cfr Qingdao	۲۱۱.۱	۴.۲
UAE imports (cfr Jebel Ali)	۶۰۰-۶۱۰	۰.۰	Iron ore concentrate index cfr Qingdao (66% Fe)	۲۰۰.۰۶	۱.۱
Egypt imports (cfr main port)	۶۱۰-۶۲۵	۰.۸	Implied 62% Fe China port price index	۱۶۹.۳۸	۳.۸

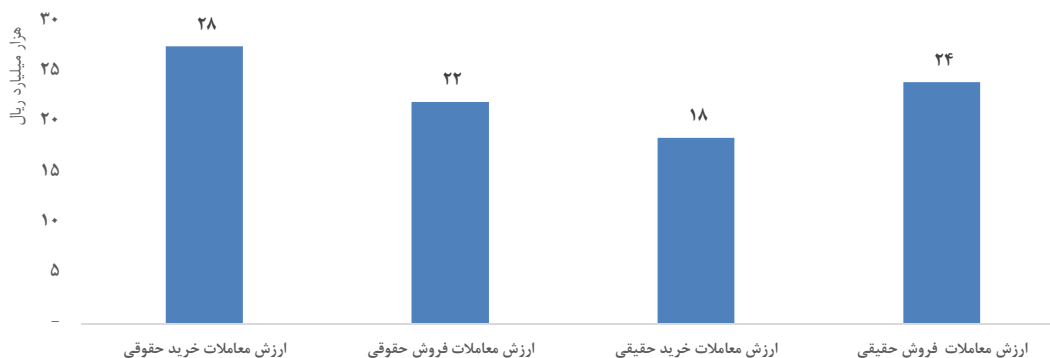
* داده های این قسمت مربوط به تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۲۸ می باشد.

آمار معاملات گروه صنعتی در بورس کالای ایران در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۰

نام کالا	تولید کننده	قیمت پایانی میانگین موزون	ارزش معامله (هزارریال)	بالاترین	عرضه (تن)	قیمت پایه عرضه	تقاضا (تن)	حجم معامله (تن)
ورق گرم HR	فولاد مبارکه اصفهان	۱۹۳,۴۱۶	۲۳,۲۱۱,۸۹۵,۱۹۰	۱۹۹,۹۹۹	۱۲۰,۰۱۰	۱۷۰,۴۵۷	۱۷۶,۳۳۰	۱۲۰,۰۱۰
ورق سرد B	فولاد مبارکه اصفهان	۲۲۵,۸۹۶	۳,۳۸۸,۴۳۷,۵۰۰	۲۳۰,۰۱۹	۱۵,۰۰۰	۲۰۵,۹۷۶	۱۶,۶۰۰	۱۵,۰۰۰
شمش ۱۰۰۰p-۹۹.۸	آلومینیوم ایران (ایرالکو)	۵۵۳,۷۹۱	۳۳,۲۲۷,۴۶۰	۵۵۳,۷۹۱	۶۰	۵۵۳,۷۹۱	۶۰	۶۰

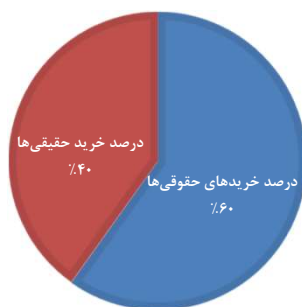
ارزش خرید و فروش معاملات حقیقی و حقوقی در بازار سرمایه

ارزش کل معاملات حقیقی و حقوقی



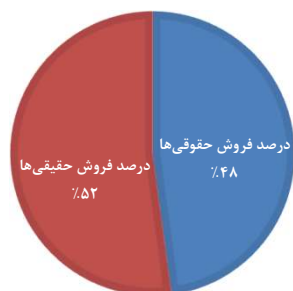
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

درصد خرید حقیقی‌ها (قرمز) | درصد خریدهای حقوقی‌ها (آبی)

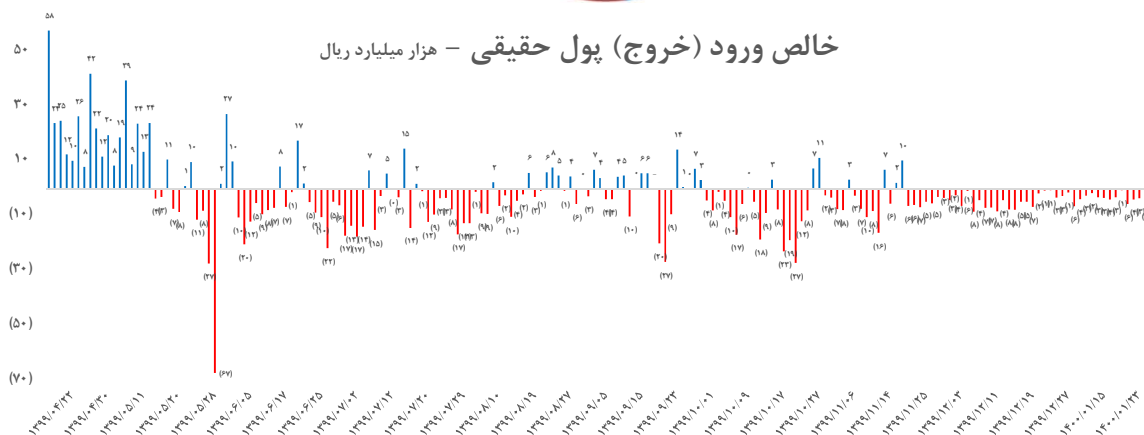


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

درصد فروش حقیقی‌ها (قرمز) | درصد فروش حقوقی‌ها (آبی)



خالص ورود (خروج) پول حقیقی - هزار میلیارد ریال



مروری بر بازار سرمایه

- شاخص کل بورس اوراق بهادار با ۸،۰۹۵ واحد کاهش و با ۰/۶۶ درصد منفی عدد ۱،۲۱۶،۷۰۷ واحد را تجربه کرد. بطوریکه ۴،۱۵۸ میلیون سهم به ارزش کل ۴۰،۳۶۹ میلیارد ریال مورد معامله قرار گرفت.
- شاخص فرابورس ایران نیز با ۴۰ واحد کاهش و با ۰/۲۳ درصد منفی عدد ۱۷،۷۸۰ واحد را تجربه کرد. بطوریکه در این بازار نیز ۱،۲۲۲ میلیون سهم به ارزش کل ۴۱۰،۰۹۶ میلیارد ریال مورد معامله قرار گرفت.

شایعات و شنیده‌ها

- نماد معاملاتی اخبار و بکام مشمول دستورالعمل رفع گره معاملاتی می باشند.

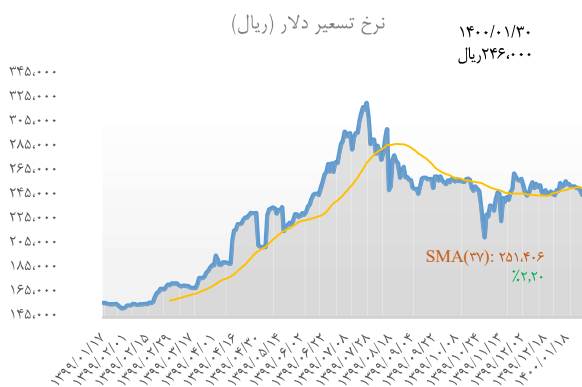
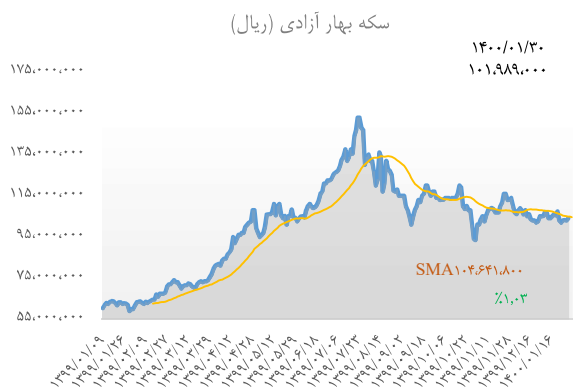
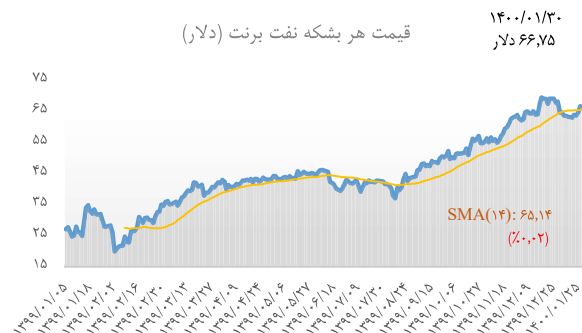
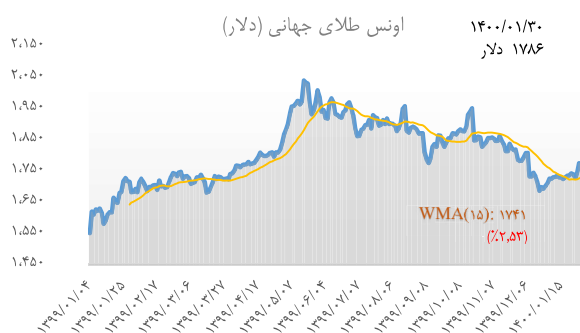
اخبار روز

- چین، بزرگ‌ترین مصرف‌کننده طلای جهان، به بانک‌های داخلی و بین‌المللی اجازه واردات مقادیر زیادی طلا را داده است.
- مؤسسه وودمکنزی اعلام کرد، ممکن است قیمت نفت در سال ۲۰۵۰ به ۱۰ دلار برای هر بشکه برسد.
- جیک سالیوان در مصاحبه با فاکس نیوز: گفت‌وگوها در وین سازنده بوده و تلاش‌های واقعی با چهار دائم دیگر شورای امنیت سازمان ملل و آلمان از یک سو و ایران از سوی دیگر در حال انجام است و تمامی موضوعات برداشته شدن تحریم‌ها و موضوع هسته‌ای بر روی میز قرار دارد.
- دبیرکل اتاق بازرگانی ایران و عراق می‌گوید: عراق معافیت‌هایی در زمینه بازگشت پول‌های بلوکه شده ایران دریافت کرده است و می‌تواند فارغ از تحریم‌ها بدهی‌های خود را به ایران پرداخت کند.
- دولت در سال ۹۹ از نقل و انتقال سهام در بورس ۱۷،۹۸۹ میلیارد تومان درآمد مالیاتی کسب کرده که این میزان نسبت به درآمد مالیاتی ۳،۳۱۴ میلیارد تومانی سال ۹۸ رشد ۴۴۳ درصدی را نشان می‌دهد.
- مدیرعامل فولاد مبارکه می‌گوید: توانستیم به تولید اسلب با عرض ۲۰۰۰ میلیمتر و ضخامت ۲۵۰ میلیمتر دست پیدا کنیم.

ارقام به تومان

نرخ	سکه	یورو			دلار		
		فروش	خرید	نرخ سنا	فروش	خرید	نرخ دلار نیما
۳,۸۸۵,۰۰۰	ربع سکه	۲۸,۴۷۵	۲۷,۹۱۱		۲۳,۵۲۶	۲۳,۰۸۲	
۶,۱۷۰,۰۰۰	نیم سکه				۲۳,۸۵۳	۲۳,۳۸۰	
۱۰,۳۱۷,۰۰۰	تمام امامی	EUR/USD: ۱.۲۰۳			۲۴,۶۰۰	۲۳,۶۰۰	
۱۰,۱۹۸,۹۰۰	بهار آزادی				۲۳,۸۵۳	۲۳,۳۸۰	

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



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