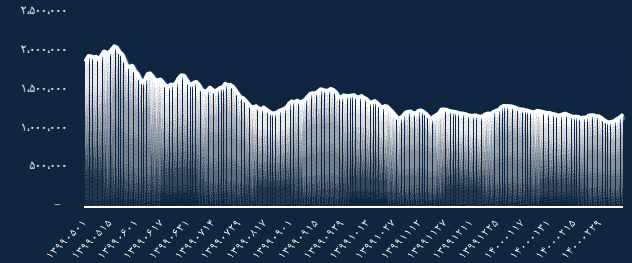
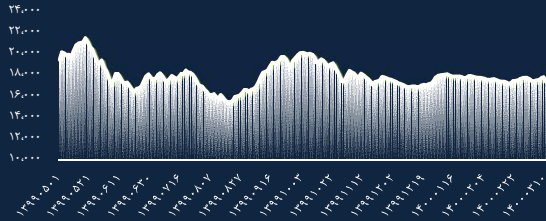


### شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

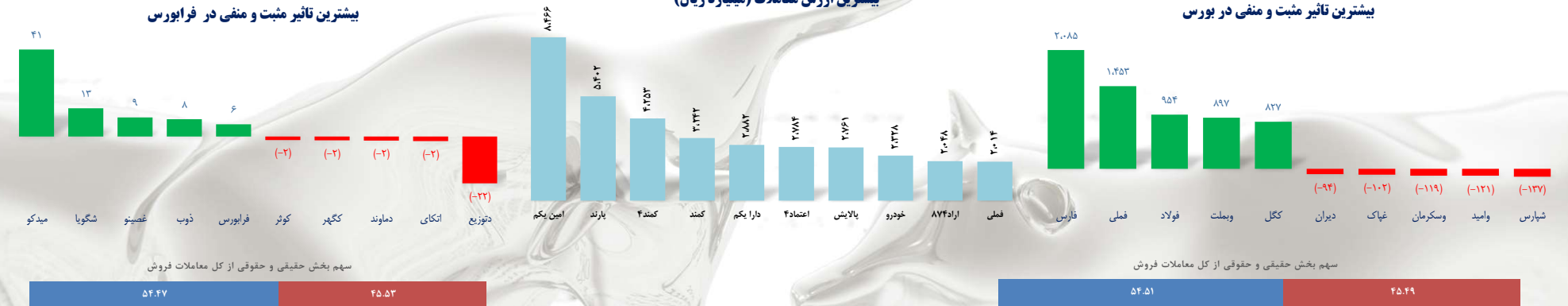


### شاخص کل فرابورس

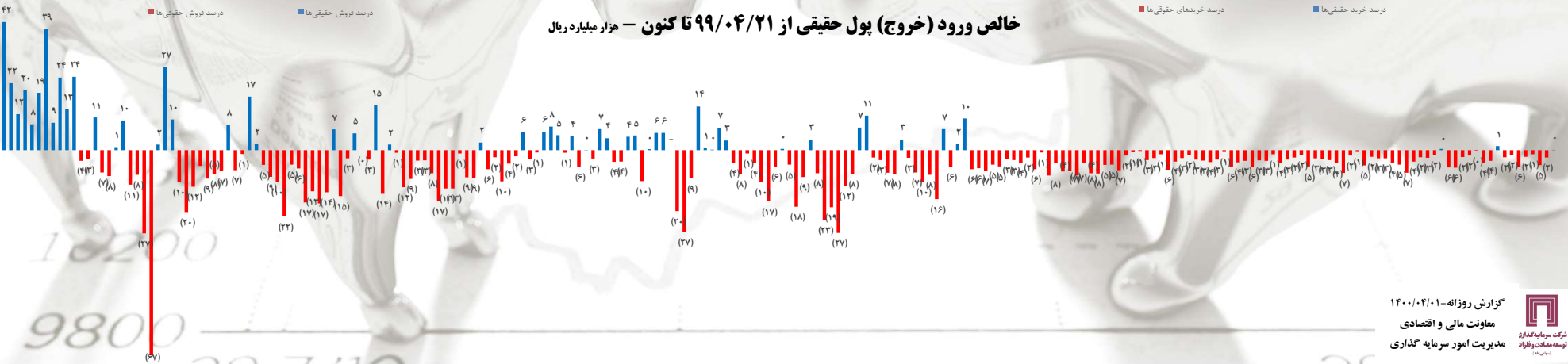


مقدار شاخص	بورس	فرابورس
مقدار شاخص	۱,۱۸۶,۸۹۵	۱۷,۴۲۸
ارزش بازار	۴۷,۳۶۴,۹۹۴.۲۳۶ B	۱۱,۵۵۲,۷۸۶.۴۹۲ B
مقدار تغییر نسبت به روز گذشته	۱۸,۲۳۱	۱۰۹
درصد تغییر نسبت به روز گذشته	۱.۵۶	۰.۶۳
ارزش معاملات	۷۲,۷۹۱.۲۴۳ B	۲۲,۴۰۰.۳۶۷ B

### بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



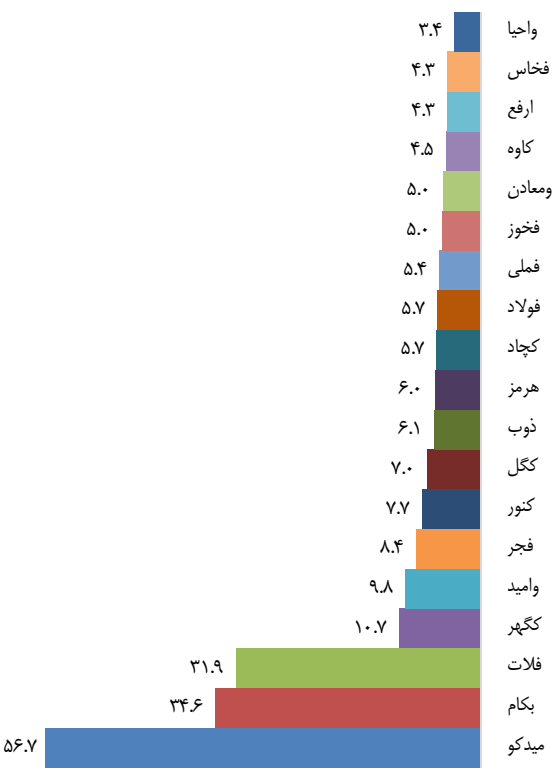
### خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۹۹/۰۴/۲۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال



گزارش روزانه - ۱۴۰۰/۰۴/۰۱  
 معاونت مالی و اقتصادی  
 مدیریت امور سرمایه گذاری



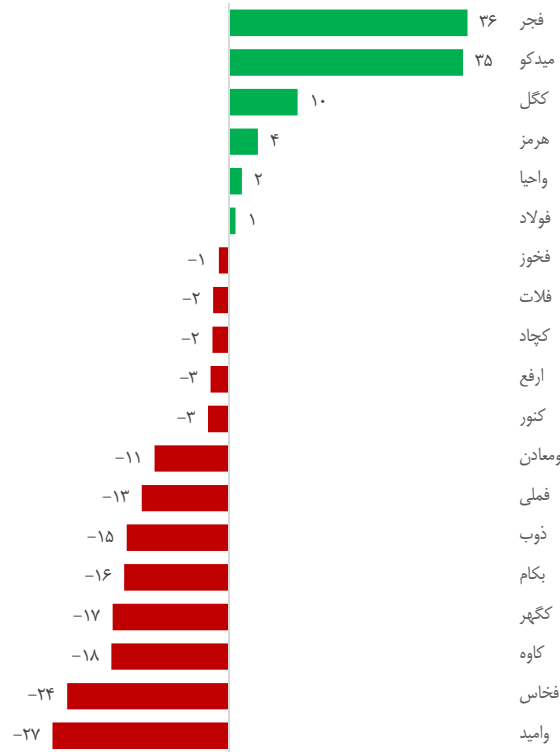
### P/E تحلیلی



### عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا

نام شرکت	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			
	۱۴۰۰	۱۳۹۹	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	حجم معاملات
توسعه معادن و فلزات	۱,۵۱۷	۸۸۱	۳.۰	۸,۲۸۰	۲۱۸,۴۲۶	۲۶,۳۷۸,۳۳۷
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۲۰۸	۱,۸۹۳	۲.۰	۱۶,۶۹۰	۱۱۶,۷۹۸	۶,۹۸۹,۲۳۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۷۸۵	۳,۰۸۰	(۰.۰)	۲۳,۵۹۰	۱۰۳,۸۵۰	۴,۴۰۲,۳۱۷
سنگ آهن گهرزمین	۳,۵۰۲	۱,۷۳۱	(۰.۱)	۳۸,۸۷۵	۱۵,۲۵۷	۳۹۵,۷۳۶
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۶,۲۱۶	۷,۴۳۸	-۰.۴	۴۷,۵۸۰	۲۰,۹۵۲	۴۳۷,۷۱۶
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	(۰.۵)	۹,۳۴۰	۶۲,۴۷۰	۶,۷۲۰,۳۴۵
ملی صنایع مس ایران	۲,۱۴۷	۱,۳۴۸	۲.۵	۱۱,۸۳۰	۲,۰۱۴,۴۳۷	۱۷۰,۳۵۳,۲۱۰
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۰۰۹	۲,۱۶۳	-۰.۴	۱۳,۰۸۵	۶۸,۲۹۹	۵,۲۱۹,۵۶۹
فولاد خراسان	۴,۸۹۶	۱,۹۶۷	(۰.۳)	۲۱,۶۶۰	۸,۵۷۴	۴۰۷,۳۹۲
فولاد امیرکبیرکاشان	۳,۳۲۸	۴,۷۳۶	(۰.۹)	۲۷,۹۶۰	۱۴۲,۶۴۱	۵,۱۰۰,۸۳۵
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(۰.۰)	۱۵,۲۳۳	۱۸	۱,۲۳۰
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۸۴	۱۰۳	۴.۳	۲,۹۰۷	۴۹,۱۳۶	۱۶,۹۰۲,۷۹۳
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	۱.۳	۱۰,۲۱۰	۹۹۶,۰۶۵	۹۷,۵۳۵,۳۱۶
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۲۳۳	-۰.۷	۱۵,۳۷۰	۳۰۲,۶۱۹	۱۹,۶۹۱,۶۶۱
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۵۵۲	۲,۰۸۱	-۰.۰	۱۵,۳۰۹	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی عادی	
فولاد کاوه جنوب کیش	۳,۸۱۴	۲,۱۳۵	۱.۱	۱۸,۲۷۰	۱۳۰,۰۷۹	۷,۱۱۸,۶۲۴
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	۱.۰	۱۴۸,۷۹۲	۱۰۴,۷۶۰	۷۰۴,۰۷۰
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۷۳۲	۶۶۰	۱.۴	۴۲,۰۹۶	۹۲,۳۳۷	۲,۱۸۳,۱۳۹
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	۲.۶	۳,۴۷۷	۴۲۰,۴۸۰	۱۲۰,۹۴۳,۳۴۳

### بازدهی ۱۴۰۰



### بتا



## ارزیابی بازده و ریسک سهام معدنی و فلزی از ابتدای سال ۱۴۰۰ تا کنون ❁

Std❁❁	Excess Return (Ri-Rf)❁❁	Ri	سهام	طبقه بندی
۰.۰۶۷	-۰.۳۴	-۰.۳۲	سهامی ذوب آهن اصفهان	Ri-Rf(-۰.۳۴,-۰.۲۵)
۰.۰۶۲	-۰.۳۲	-۰.۲۹	توسعه معادن و فلزات	
۰.۱۱۷	-۰.۲۳	-۰.۲۰	فولاد مبارکه اصفهان	Ri-Rf(-۰.۲۵,-۰.۱۶)
۰.۰۹۲	-۰.۲۱	-۰.۱۸	معدنی و صنعتی چادرملو	
۰.۰۷۳	-۰.۱۸	-۰.۱۵	شرکت آهن و فولاد ارفع	
۰.۰۵۲	-۰.۱۷	-۰.۱۴	معدنی و صنعتی گل گهر	
۰.۱۲۳	-۰.۱۷	-۰.۱۴	فولاد کاوه جنوب کیش	
۰.۱۴۸	-۰.۱۷	-۰.۱۴	ملی صنایع مس ایران	Ri-Rf(-۰.۱۶,-۰.۰۷)
۰.۰۵۰	-۰.۱۳	-۰.۱۱	سنگ آهن گهر زمین	
۰.۱۱۵	-۰.۱۳	-۰.۱۱	فولاد امیر کبیر کاشان	
۰.۱۳۳	-۰.۱۳	-۰.۱۰	فولاد خوزستان	Ri-Rf(-۰.۱۶,-۰.۰۷)
۰.۰۳۳	-۰.۱۲	-۰.۱۰	فولاد خراسان	
۰.۰۰۹	-۰.۰۸	-۰.۰۵	گروه مدیریت سرمایه‌گذاری امید	Ri-Rf(-۰.۰۷,-۰.۰۱۴)
۰.۰۹۹	-۰.۰۷	-۰.۰۴	م. صنایع و معادن احیا سپاهان	
۰.۰۷۵	-۰.۰۶	-۰.۰۳	توسعه معدنی و صنعتی صبا نور	
۰.۰۸۳	-۰.۰۳	۰.۰۰	فولاد هرمزگان جنوب	
۰.۰۲۹	-۰.۰۲	۰.۰۰	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	Ri-Rf(۰.۰۱۴,۰.۰۱۴)
۰.۰۲۰	۰.۰۳	۰.۰۵	هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	
۰.۰۷۴	۰.۱۰	۰.۱۳	کارخانجات تولیدی شهید قندی	

Std	Excess Return (Ri-Rf)	Ri	سهام	طبقه بندی	سطح
۰.۰۱	-۰.۰۸	-۰.۰۵	گروه مدیریت سرمایه‌گذاری امید	Std(۰.۰۰۹,۰.۰۵۵)	Low Risk
۰.۰۲	۰.۰۳	۰.۰۵	هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه		
۰.۰۳	-۰.۰۲	۰.۰۰	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان		
۰.۰۳	-۰.۱۲	-۰.۱۰	فولاد خراسان		
۰.۰۵	-۰.۱۳	-۰.۱۱	سنگ آهن گهر زمین		
۰.۰۵	-۰.۱۷	-۰.۰۳	معدنی و صنعتی گل گهر	Std(۰.۱۲۵,۰.۱۰۲)	Moderate Risk
۰.۰۶	-۰.۳۲	-۰.۱۴	توسعه معادن و فلزات		
۰.۰۷	-۰.۳۴	-۰.۲۹	سهامی ذوب آهن اصفهان		
۰.۰۷	-۰.۱۸	-۰.۳۲	شرکت آهن و فولاد ارفع		
۰.۰۷	۰.۱۰	-۰.۱۵	کارخانجات تولیدی شهید قندی		
۰.۰۷	-۰.۰۶	۰.۱۳	توسعه معدنی و صنعتی صبا نور		
۰.۰۸	-۰.۰۳	۰.۰۰	فولاد هرمزگان جنوب	Std(۰.۱۰۲,۰.۱۴۸)	High Risk
۰.۰۹	-۰.۲۱	-۰.۱۴	معدنی و صنعتی چادرملو		
۰.۱۰	-۰.۰۷	-۰.۱۸	م. صنایع و معادن احیا سپاهان		
۰.۱۲	-۰.۱۳	-۰.۰۴	فولاد امیر کبیر کاشان		
۰.۱۲	-۰.۲۳	-۰.۱۱	فولاد مبارکه اصفهان		
۰.۱۲	-۰.۱۷	-۰.۲۰	فولاد کاوه جنوب کیش	Std(۰.۱۰۲,۰.۱۴۸)	High Risk
۰.۱۳	-۰.۱۳	-۰.۱۰	فولاد خوزستان		
۰.۱۵	-۰.۱۷	-۰.۱۴	ملی صنایع مس ایران		

❁ داده ها به صورت هفتگی بروز رسانی می گردد.

❁❁ اختلاف بازده هر سهم با بازده بدون ریسک از ابتدای سال تا کنون را نشان می دهد

❁❁❁ Standard deviation انحراف معیار بازده یک سهم را طی دوره مذکور نشان می دهد

با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده،

سهامی که ریسک کمتری دارد را انتخاب کرد.

## جهانی

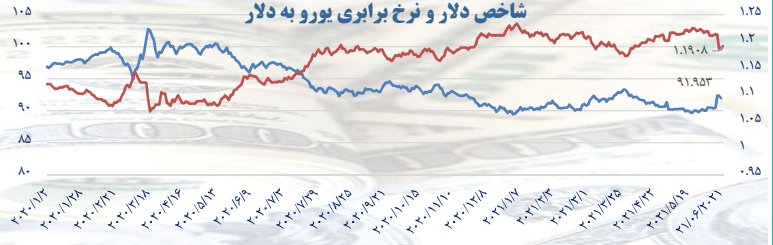
## آخرین نرخ کامودیتی ها

## داخلی

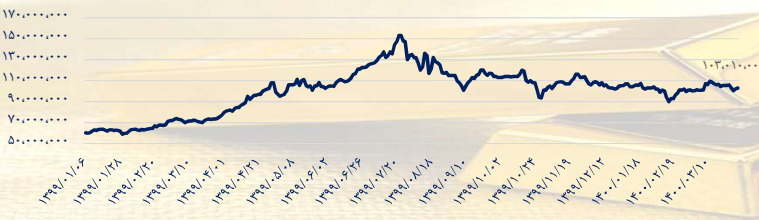
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



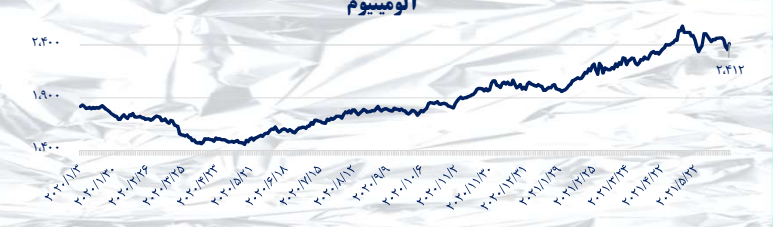
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



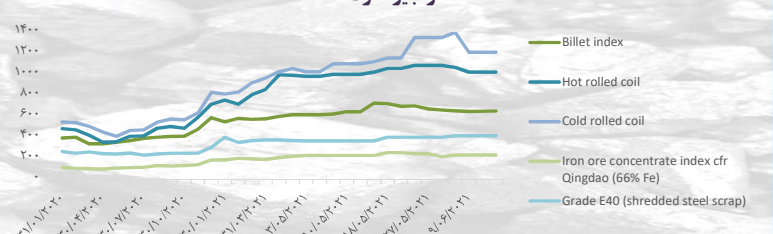
آلومینیوم



شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• مجمع عمومی عادی سالیانه شرکت برای دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ روز پنجشنبه در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۱۷ در استان خراسان رضوی برگزار می‌گردد.

فخاس



سخنگوی وزارت خارجه آمریکا می‌گوید "توافق هسته‌ای با ایران، امری ضروری است، اما اگر بخواهیم به مسائل موشکی ایران بپردازیم، کافی نبوده و برای رفع سایر اختلافات باید چاره‌ای دیگر اندیشید."



رئیس فدرال رزرو نیویورک می‌گوید "اقتصاد به اندازه کافی بهبود پیدا نکرده است تا محرک‌ها را کنار بگذاریم. اقتصاد با سرعتی زیاد در حال بهبودی است و سریعتر از انتظارات بازگشت داشته است به طوریکه چشم انداز میان مدت بسیار مثبت است. پیش بینی می‌کنم تولید ناخالص داخلی امسال تا ۷٪ رشد داشته باشد. عوامل زیادی که مسئول پایین نگه داشتن نرخ‌های بهره جهانی در سطوح پایین هستند احتمالاً پس از پاندمی نیز ادامه داشته باشند. در حال حاضر نرخ‌های بهره پایین یک مشکل نیستند."



پرس‌تی‌وی می‌گوید "آمریکا در ازای تعلیق ۱۲۰ روزه تحریم‌های برجامی خواستار مذاکرات در مورد منطقه شده است."



موسسه فیچ از پتانسیل رشد بالای هشت درصدی اقتصاد ایران در صورت احیای برجام خبر داد. این موسسه می‌گوید "پیش بینی می‌کنیم که رشد اقتصادی ایران در سال جاری ۴/۳ درصد و در سال آینده ۸/۲ درصد باشد، با این شرط که دولت بایده به توافق هسته‌ای بازگردد."



جدیدترین آمار از وضعیت بازار مسکن شهر تهران حاکی از آن است که نرخ‌های پیشنهادی در خردادماه نسبت به اردیبهشت ماه ۸ درصد کاهش یافته و افت قیمت در مناطق شمالی، بیشتر بوده است.

