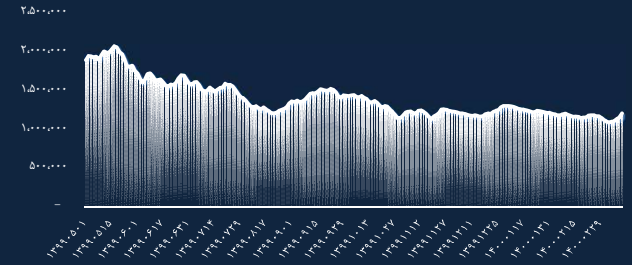
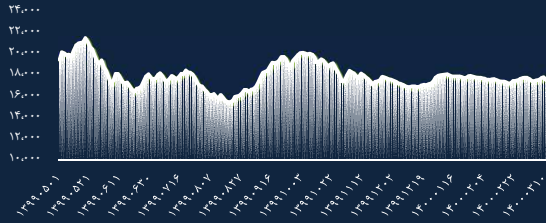


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

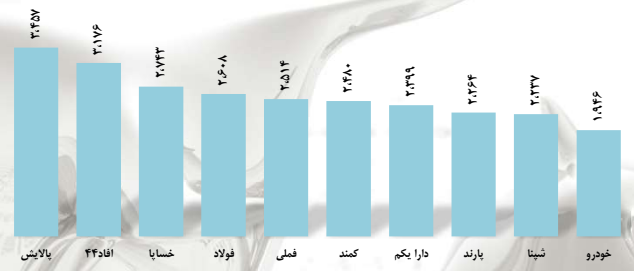


شاخص کل فرابورس



مقدار شاخص	بورس	فرابورس
۱۷,۶۱۶	۱,۲۱۳,۰۱۳	۱۱,۶۷۶,۹۶۶.۷۲۲ B
ارزش بازار	۴۸,۳۹۳,۰۲۰.۶۰۰ B	۲۶,۰۹۲
مقدار تغییر نسبت به روز گذشته	۲۰.۲۰	۱۰۰.۸
درصد تغییر نسبت به روز گذشته	۶۷,۸۱۰.۳۹۷ B	۲۵,۳۳۵.۸۴۳ B
ارزش معاملات		

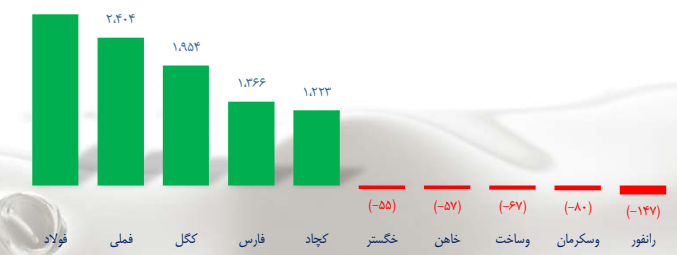
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



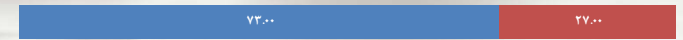
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



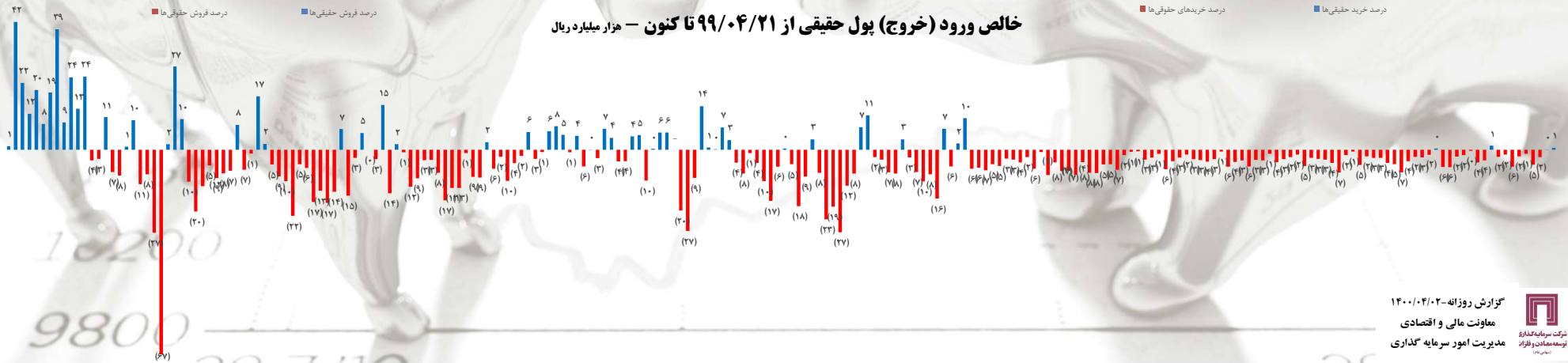
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



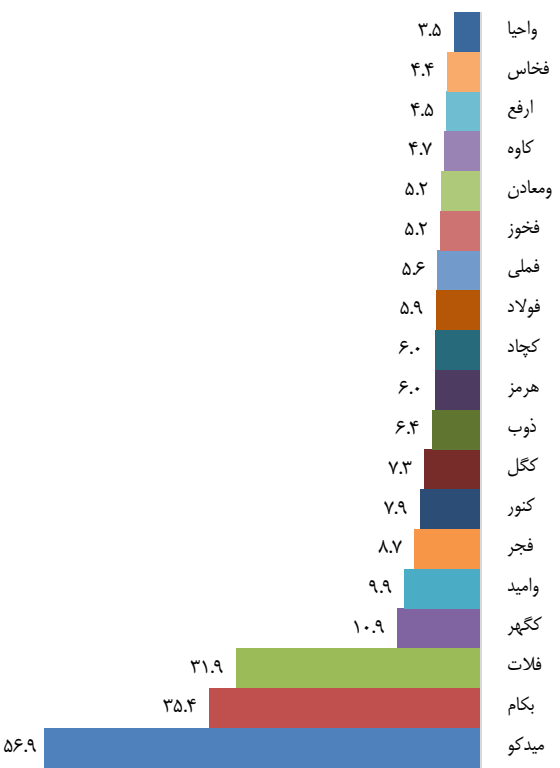
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



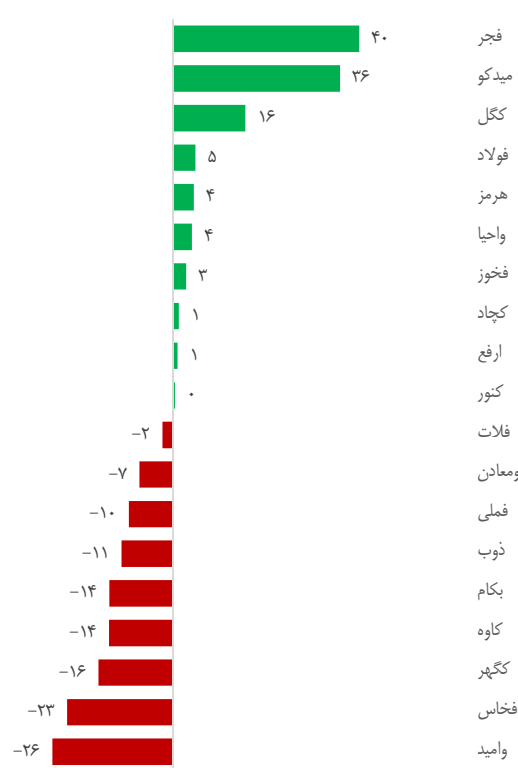
P/E تحلیلی



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	۴.۴	۸,۶۴۰	۴۲۶,۱۶۶	۴۹,۳۴۱,۳۳۰
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۳۰۸	۱,۹۰۳	۴.۷	۱۷,۴۷۰	۲۱۹,۸۴۸	۱۲,۵۸۷,۲۵۲
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۷۸۵	۳,۰۸۰	۳.۷	۲۴,۴۷۰	۲۱۱,۰۲۳	۸,۶۲۲,۷۹۲
سنگ آهن گهرزمین	۳,۵۰۲	۱,۷۳۱	۱.۷	۳۹,۵۳۹	۶۵,۹۳۹	۱,۶۴۳,۸۲۴
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۶,۳۱۶	۷,۴۳۸	۳.۵	۴۹,۲۶۰	۱۲۸,۴۶۹	۲۶۰۸,۱۹۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	۰.۶	۹,۴۰۰	۳۹,۶۴۷	۴,۱۵۷,۷۴۳
ملی صنایع مس ایران	۲,۱۴۷	۱,۳۴۸	۴.۱	۱۲,۳۱۰	۲,۵۱۴,۱۲۰	۲۰۴,۲۶۳,۵۱۴
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۰۰۹	۲,۱۶۳	۳.۷	۱۳,۵۷۵	۶۱,۸۰۵	۴,۵۴۳,۷۰۳
فولاد خراسان	۴,۸۹۶	۱,۹۶۷	۱.۹	۲۲,۰۷۰	۶۰,۴۶۵	۲,۷۰۵,۲۸۸
فولاد امیرکبیرکاشان	۳,۳۲۸	۴,۷۳۶	۳.۰	۲۸,۷۹۰	۲۰۵,۵۰۸	۷,۱۳۶,۹۷۴
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(۰.۰)	۱۵,۲۳۱	۲۵	۱,۷۱۷
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۸۴	۱۰۳	۲.۳	۲,۹۷۵	۶۶,۲۰۰	۲۲,۲۵۱,۱۹۲
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	۳.۷	۱۰,۵۹۰	۲۶۰۷,۶۷۵	۲۴۶,۲۳۲,۵۶۶
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۲۳۳	۴.۴	۱۶,۰۴۰	۴۳۰,۶۵۳	۲۶,۸۵۳,۰۱۰
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	۴.۷	۱۹,۱۲۰	۵۰۴,۶۶۳	۲۶,۴۰۰,۹۴۳
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	۲.۰	۱۵۱,۷۵۹	۸۱,۴۲۲	۵۲۶,۵۲۳
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۷۳۲	۶۶۰	۰.۴	۴۲,۲۷۲	۱۰۸,۸۶۳	۲,۵۷۳,۹۰۰
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	۵.۰	۳,۶۵۰	۵۴۶,۷۸۰	۱۴۹,۸۰۵,۶۵۸

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

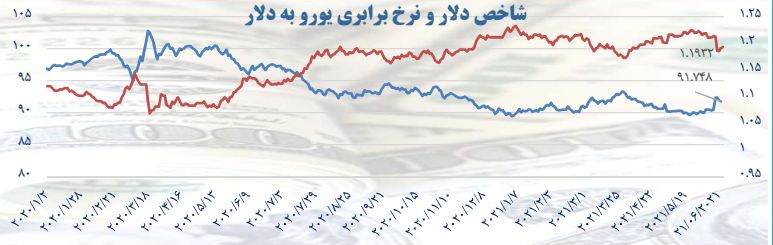
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

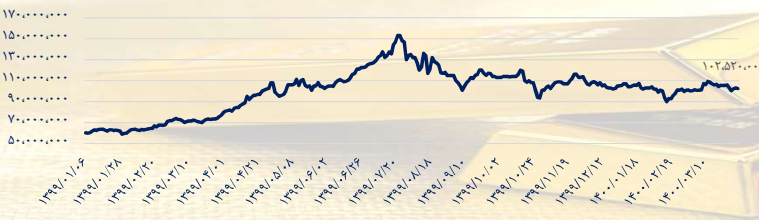
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



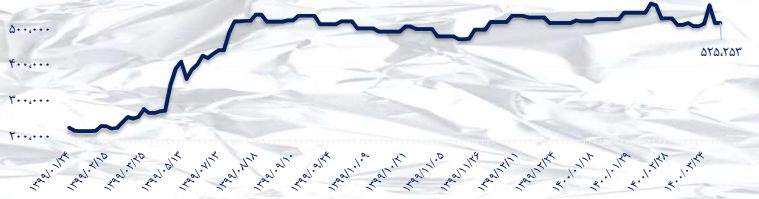
کاند فملی



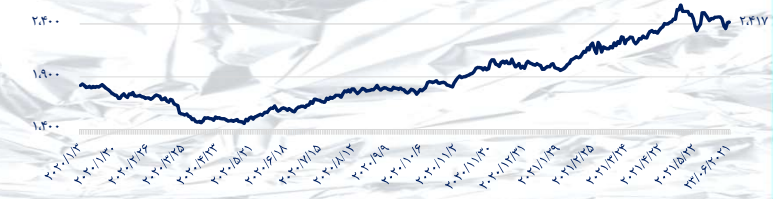
کاند



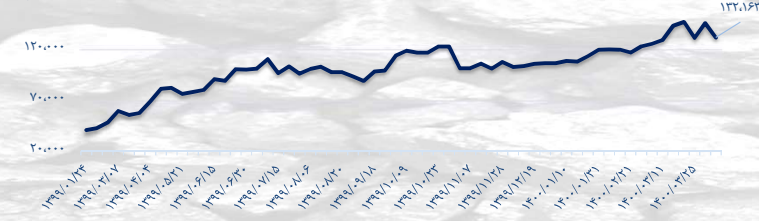
آلومینیوم ایرالکو (ریال)



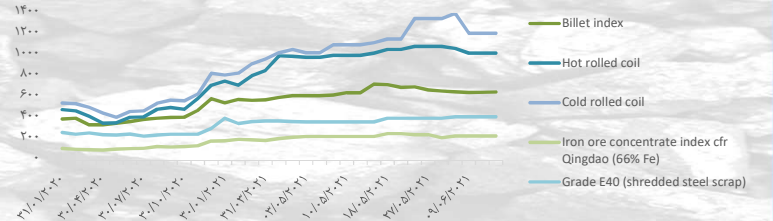
آلومینیوم



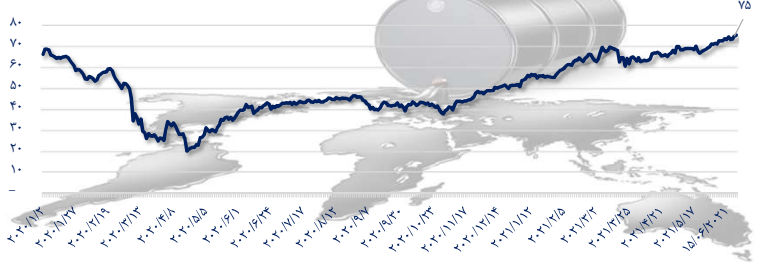
شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• شرکت فولاد امیر کبیر کاشان گزارش ماهانه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۱۱,۶۷۵ میلیارد ریال فروش محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۲۱۱ درصد رشد داشته است.

فجر

کدال

• شرکت ذوب آهن اصفهان صورت‌های مالی تلفیقی حسابرسی نشده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۱۵,۰۹۵ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به سال گذشته ۱۰۰ درصد رشد داشته است.

ذوب

کدال

• شرکت معدنی و صنعتی گل‌گهر صورت‌های مالی تلفیقی حسابرسی شده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۱۴۱,۶۰۳ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به سال گذشته ۱۱۶ درصد رشد داشته است.

کگل

کدال

موسسه Argu و S&P Global گزارش دادند: شرکت فولاد سبز Hybrit که یک سرمایه‌گذاری مشترک میان SSAB و LKAB و Vattenfall سوئد می باشد، اولین کارخانه آهن اسفنجی از طریق احیای هیدروژن در جهان را در مقیاس پایلوت ساختند. این شرکت‌ها این طرح را گامی قاطع در مسیر رسیدن به فولاد بدون کربن توصیف کرده اند.



پاول می گوید "فدرال رزرو نرخ های بهره را پیشگیرانه افزایش نخواهد داد. فدرال رزرو برای افزایش نرخ های بهره منتظر تورم واقعی خواهد بود. ممکن است کمی صبر لازم باشد تا بینیم چه اتفاقی به واقع در حال رخ دادن است.



رویترز میزان نفت ذخیره شده ایران روی خشکی و دریا را ۲۰۰ میلیون بشکه تخمین زد و نوشت ایران در صورت رفع تحریم‌ها می‌تواند به سرعت تولید نفت خود را از ۲/۱ میلیون بشکه فعلی به ۳/۶ میلیون بشکه در روز برساند.



دبیر انجمن صنفی کارفرمایان صنعت سیمان عرضه و ورود سیمان به بورس کالا را رخداد بسیار مثبتی برای این صنعت خواند و گفت "شاهد خروج کامل سیمان از شمول قیمت‌گذاری دستوری و تثبیت حرکت این صنعت در مسیر واقعی سازی قیمت‌ها خواهیم بود."



سید مصطفی علوی می گوید "با توجه به نیاز جدی کشور به محصولات فولاد مبارکه خواهان عدم اعمال محدودیت بر تأمین گاز این مجموعه هستیم."

