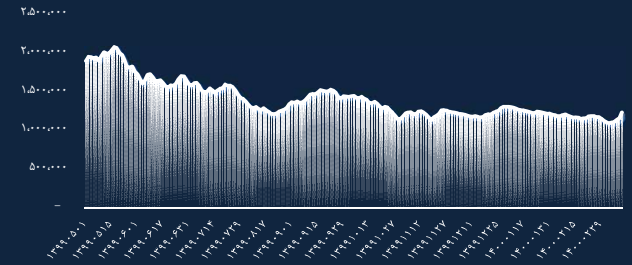
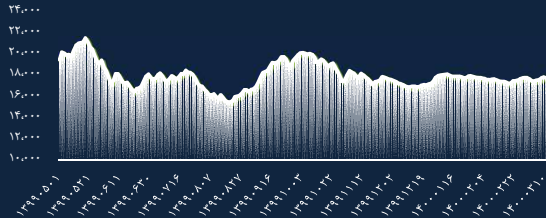


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



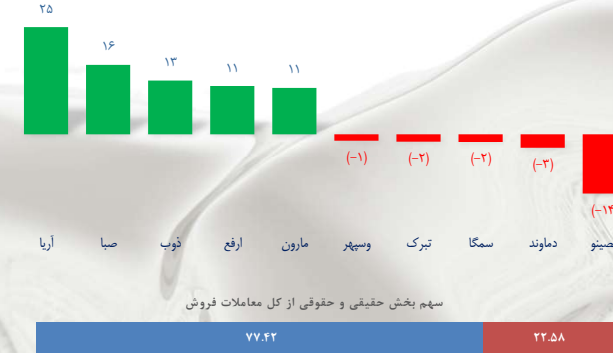
شاخص کل فرابورس



مقدار شاخص	بورس	فرابورس
۱۷,۷۶۸	۱,۲۳۲,۷۸۳	۱۷,۷۶۸
ارزش بازار	۴۹,۲۱۲,۸۹۴.۹۰۵ B	۱۱,۷۸۳,۵۹۵.۵۵۲ B
مقدار تغییر نسبت به روز گذشته	۲۰,۷۲۹	۱۵۲
درصد تغییر نسبت به روز گذشته	۱.۷۱	۰.۸۶
ارزش معاملات	۶۳,۶۶۵.۹۶۹ B	۲۲,۸۶۷.۹۹۲ B

بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)

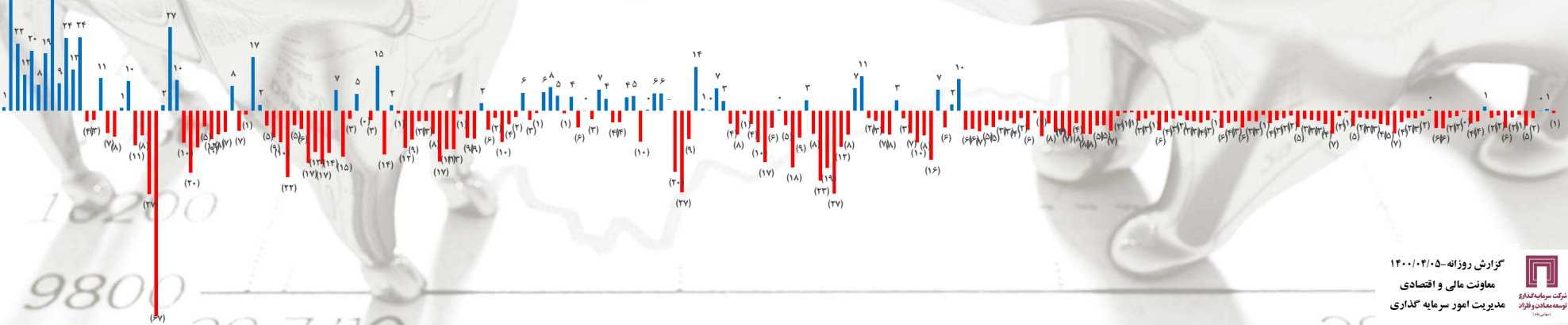
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



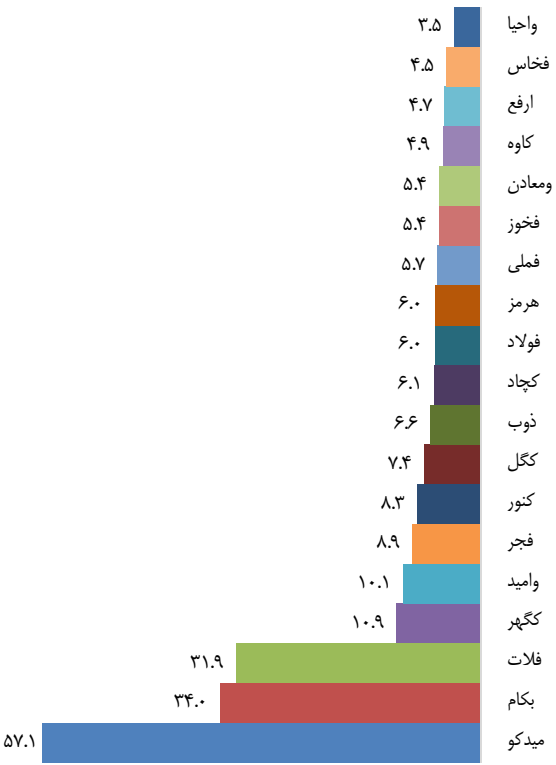
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



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



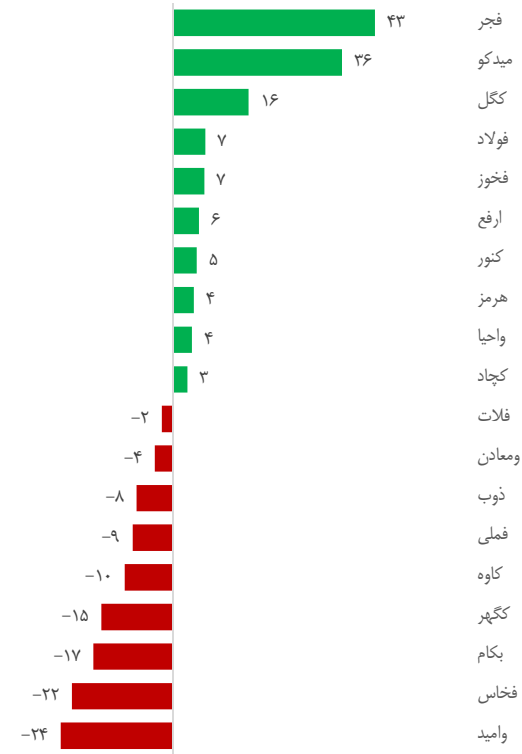
P/E تحلیلی



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

نام شرکت	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			
	۱۴۰۰	۱۳۹۹	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	حجم معاملات
توسعه معادن و فلزات	۱,۵۱۷	۸۸۱	۳.۶	۸,۹۵۰	۳۴۰,۷۴۱	۳۸,۰۵۲,۰۲۷
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۳۰۸	۱,۹۰۳	۰.۶	۱۷,۵۷۰	۱۲۲,۷۹۵	۶,۹۱۹,۶۵۹
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۷۸۵	۳,۰۸۰	۱.۸	۲۴,۹۱۰	۲۳۸,۱۵۳	۹,۵۶۱,۴۷۰
سنگ آهن گهرزمین	۳,۵۰۲	۱,۷۳۱	۰.۷	۳۹,۸۲۳	۲۷,۵۵۱	۶۷۴,۹۶۶
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۶,۳۱۶	۷,۴۳۸	۴.۸	۵۱,۶۰۰	۱۷۳,۳۳۸	۳,۳۵۹,۴۵۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	۲.۵	۹,۶۳۰	۹۲,۱۳۶	۹,۴۸۵,۱۸۲
ملی صنایع مس ایران	۲,۱۴۷	۱,۳۴۸	۰.۹	۱۲,۴۲۰	۱,۹۳۴,۱۲۳	۱۵۵,۷۵۱,۵۸۲
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۰۰۹	۲,۱۶۳	۴.۶	۱۴,۱۹۷	۱۲۲,۲۱۹	۸,۶۰۹,۰۶۹
فولاد خراسان	۴,۸۹۶	۱,۹۶۷	۱.۴	۲۲,۳۸۰	۲۹,۹۵۲	۱,۲۹۴,۰۹۳
فولاد امیرکبیرکاشان	۳,۳۲۸	۴,۷۳۶	۲.۴	۲۹,۴۹۰	۱۷۶,۱۶۶	۵,۹۷۴,۴۹۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(۰.۱)	۱۵,۲۰۴	۳۶۷	۲۴,۸۴۳
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۸۴	۱۰۳	(۴.۰)	۲,۸۵۶	۱۰۳,۷۸۰	۳۶,۳۳۶,۶۳۶
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	۲.۰	۱۰,۸۰۰	۱,۵۵۷,۴۲۶	۱۴۴,۲۲۰,۲۰۰
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۳۳۳	۳.۷	۱۶,۶۴۰	۴۹۴,۶۴۱	۲۹,۷۲۷,۰۰۸
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	۳.۹	۱۹,۸۷۰	۴۱۸,۰۶۶	۲۱,۰۳۶,۳۸۸
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	۰.۰	۱۵۱,۷۵۹	متوقف به دلیل افشای اطلاعات با اهمیت	
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۷۳۲	۶۶۰	۰.۳	۴۲,۴۱۶	۱۰۳,۵۰۶	۲,۴۳۸,۹۱۵
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	۳.۷	۳,۷۸۵	۱,۱۶۶,۸۲۸	۳۰۸,۳۴۸,۶۵۳

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

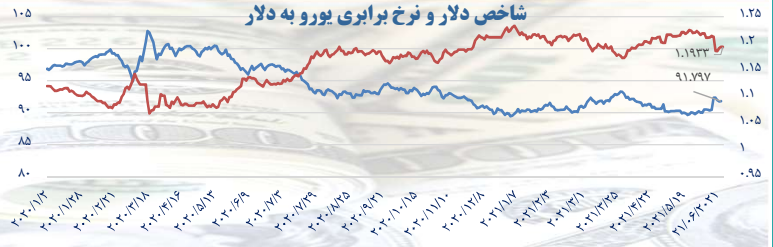
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

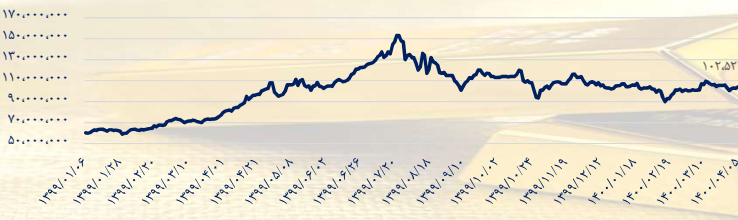
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



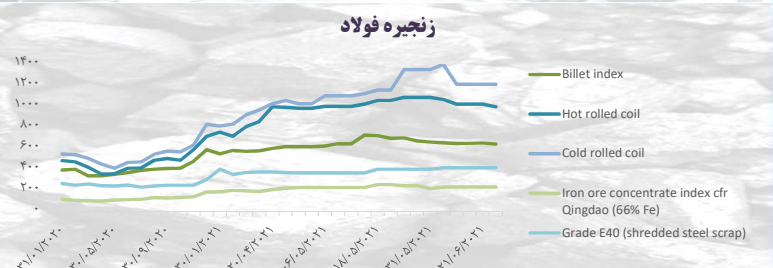
آلومینیوم



شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• شرکت مجتمع فولاد خراسان گزارش ماهانه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۳۱،۵۷۲ میلیارد ریال فروش محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۲۱۴ درصد رشد داشته است.

فخاس

کدال

• شرکت مجتمع فولاد خوزستان گزارش ماهانه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۱۰۹،۰۶۷ میلیارد ریال فروش محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۱۲۶ درصد رشد داشته است.

فخوز

کدال

• شرکت کک طیس از زیر مجموعه های شرکت سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات صورت های مالی حسابرسی شده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر کرده است این شرکت نتوانست سود محقق کند و از زیان خارج شود.

ومعادن

کدال

رئیس فدرال رزرو مینیاپولیس می گوید اقتصاد ایالات متحده در شروع یک ریکاوری بسیار قدرتمند قرار دارد. ما همچنان در یک گودال عمیق قرار داریم و ۷/۵ میلیون شغل همچنان از دست رفته است.



نماینده آمریکا در امور ایران می گوید "دولت این کشور آماده رفع تمامی تحریم های اعمال شده از سوی ترامپ برای بازگشت به برجام نیست."



۶ کشور از اعضای اتحادیه همکاری کشورهای شرق آسیا (آ س آن) شامل تایلند، فیلیپین، اندونزی، ویتنام، مالزی و سنگاپور در سال ۲۰۲۰ معادل ۷۰ میلیون تن فولاد مصرف نمودند که نسبت به سال ۲۰۱۹، کاهش ۱۲ درصدی داشته است.



پلنر در مطلبی می گوید "با نزدیکتر شدن به صدمین نشست حزب مرکزی در پکن طی ۲۹ ژوئن تا ۱ جولای، نرخ بهره برداری از کوره بلند های چین در حال کاهش است و با افت ۰/۹ درصد نسبت به هفته قبل به ۸۴/۹ رسیده است. از سوی دیگر، افت قیمت محصولات فولادی در چین موجب کاهش تولید فولادسازان برای جلوگیری از افزایش هزینه های سربار شده است و بسیاری از فولادسازان برنامه خود برای اورهال را اعلام کرده اند."



رئیس سازمان بورس می گوید "موضوع هفت موردی که در جلسه سران قوا تصویب شد، اکنون نیز در حال طی کردن مراحل اداری خود است. به طور مرتب در حال پیگیری بحث واریز مبلغ ۱۵۰ میلیون دلار هستیم تا بین صندوق توسعه ملی و بانک مرکزی هماهنگی لازم ایجاد شود."

