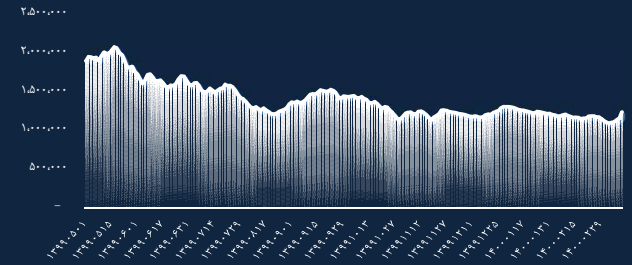
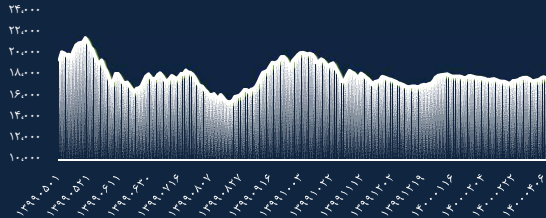


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

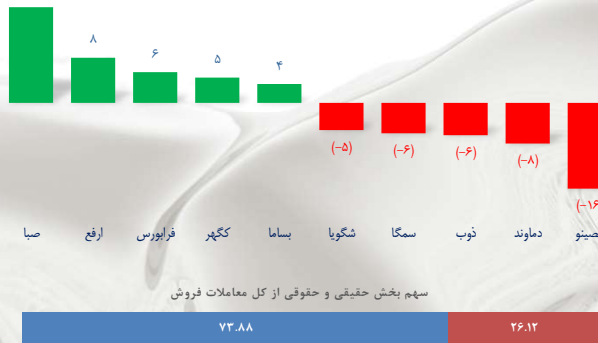


شاخص کل فرابورس

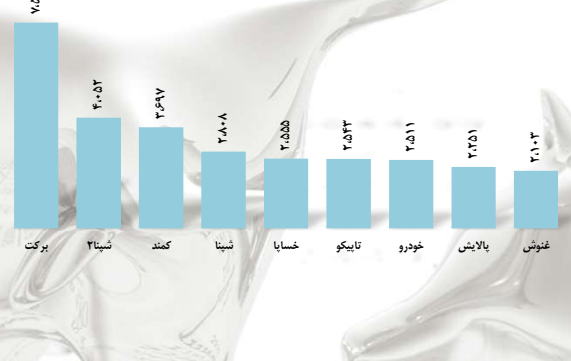


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۷,۷۶۸	۱,۲۳۸,۴۸۶	ارزش بازار
۱۱,۷۶۸,۲۹۷.۲۸۸ B	۴۹,۳۹۹,۶۳۱.۴۳۱ B	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-)	۴,۷۴۷	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۰)	۰.۳۸	ارزش معاملات
۲۱,۵۷۳.۰۸۵ B	۷۲,۹۱۶.۰۹۷ B	

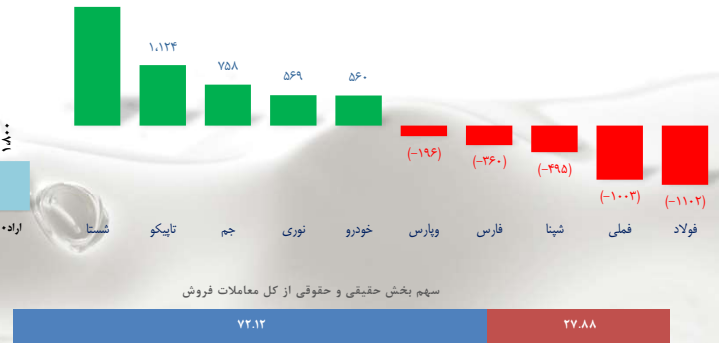
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



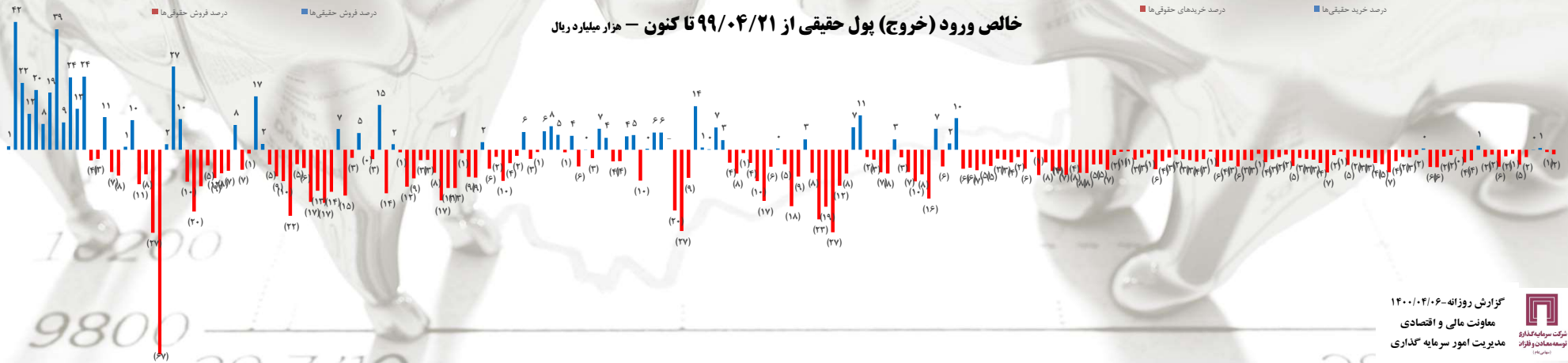
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



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



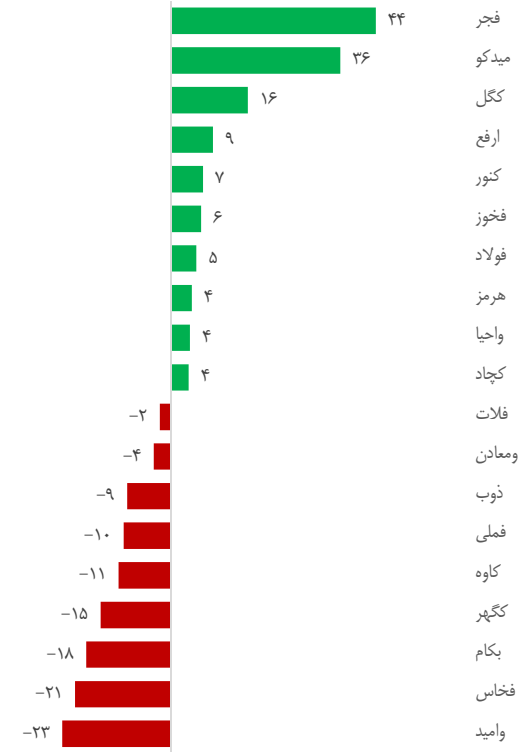
P/E تحلیلی



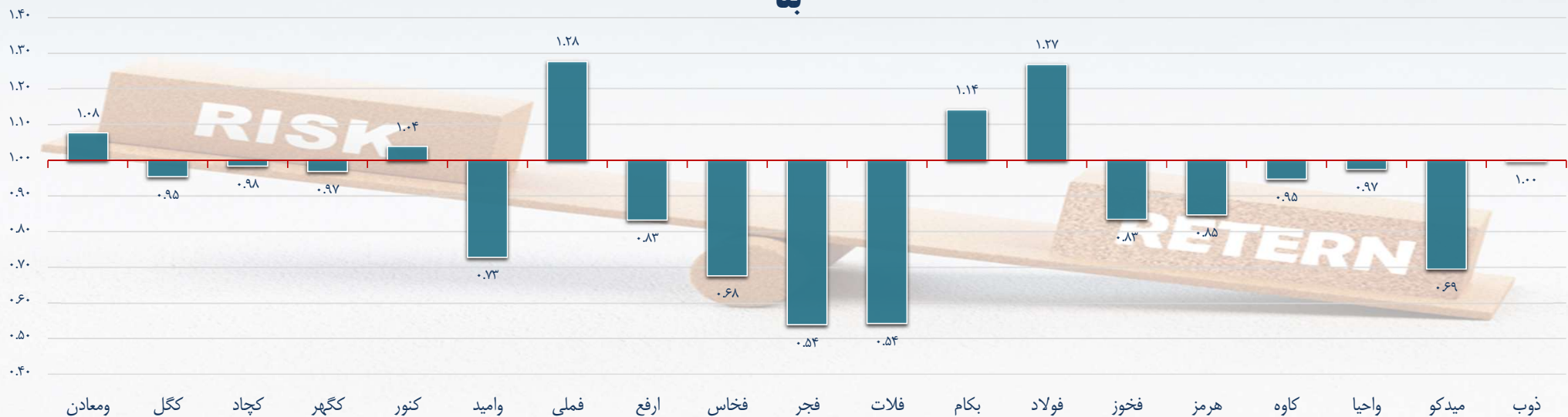
عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا

نام شرکت	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			
	۱۴۰۰	۱۳۹۹	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	حجم معاملات
توسعه معادن و فلزات	۱,۵۱۷	۸۸۱	۰.۲	۸,۹۷۰	۳۴۵,۵۱۷	۲۷,۳۸۲,۸۶۲
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۳۰۸	۱,۹۰۳	۰.۲	۱۷,۶۱۰	۱۱۶,۵۷۹	۶۶,۱۸,۹۱۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۷۸۵	۳,۰۸۰	۰.۷	۲۵,۰۹۰	۱۲۳,۹۹۹	۴,۹۴۱,۹۸۰
سنگ آهن گهرزمین	۳,۵۰۲	۱,۷۳۱	۰.۳	۳۹,۹۴۸	۱۳,۷۳۹	۳۳۵,۴۸۸
توسعه معدنی و صنعتی صابنور	۶,۳۱۶	۷,۴۳۸	۱.۷	۵۲,۴۵۰	۵۳,۰۳۷	۱,۰۰۸,۵۵۶
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	۱.۰	۹,۷۳۰	۳۶,۶۸۵	۳,۶۷۵,۸۰۳
ملی صنایع مس ایران	۲,۱۴۷	۱,۳۴۸	(۱.۶)	۱۲,۲۲۰	۱,۱۴۸,۳۷۳	۹۳,۹۳۷,۷۲۲
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۰۰۹	۲,۱۶۳	۳.۳	۱۴,۶۶۰	۶۹,۱۵۶	۴,۷۱۴,۵۹۲
فولاد خراسان	۴,۸۹۶	۱,۹۶۷	۱.۴	۲۲,۶۹۰	۳۲,۱۲۴	۱,۳۲۲,۰۹۷
فولاد امیرکبیرکاشان	۳,۳۲۸	۴,۷۳۶	۰.۴	۲۹,۶۲۰	۱۱۷,۵۵۲	۳,۹۶۸,۲۴۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(۰.۰)	۱۵,۲۰۳	۱۵	۱,۰۰۰
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۸۴	۱۰۳	(۱.۳)	۲,۸۱۹	۶۴,۴۳۲	۲۲,۸۵۴,۱۰۹
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	(۱.۴)	۱۰,۶۵۰	۸۰۸,۵۷۱	۷۵,۹۱۱,۱۶۹
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۳۳۳	(۰.۲)	۱۶,۶۱۰	۳۱۴,۱۹۰	۱۸,۹۱۱,۱۱۸
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)	۱۹,۶۶۰	۲۴۵,۶۱۸	۱۲,۴۹۴,۷۹۵
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	۰.۱	۴۲,۴۳۸	۸۵,۶۶۱	۲,۰۱۸,۰۶۹
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	(۱.۷)	۳,۷۲۰	۴۱۸,۸۶۶	۱۱۲,۶۰۰,۹۲۴

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		
۰.۰۹	-۰.۲۱	-۰.۱۴	معدنی و صنعتی چادرملو	Std(۰.۱۰۲,۰.۱۴۸)	High Risk
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		
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

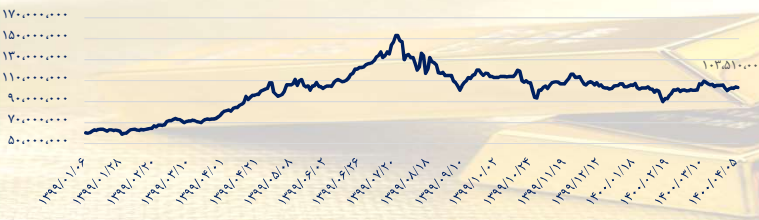
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



سکه (ریال)



کاند فملی



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



شمش فولاد خوزستان (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



اونس



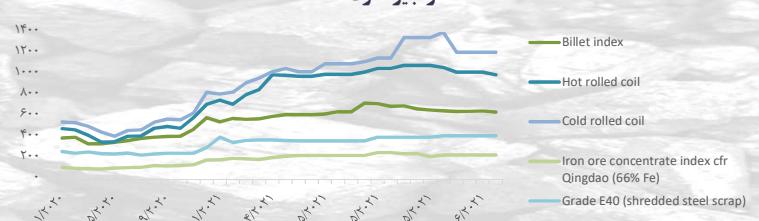
کاند



آلومینیوم



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• شرکت سنگ و آهن فولاد سنگان از زیر مجموعه‌های شرکت فولاد مبارکه اصفهان صورت‌های مالی حسابرسی شده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر کرده است این شرکت نتوانست سود محقق کند و از زیان خارج شود.

فولاد

کدال

• شرکت آهن و فولاد ارفع گزارش ماهانه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست در سه ماهه امسال ۱۶،۷۳۰ میلیارد ریال فروش محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۵۲ درصد رشد داشته است.

ارفع

کدال

چین تصمیم گرفته برای کنترل قیمت، بخشی از ذخائر استراتژیک مواد معدنی خود را در بازار عرضه کند. چین ۲۰،۰۰۰ تن مس، ۳۰،۰۰۰ تن روی و ۵۰،۰۰۰ تن آلومینیوم را ۵-۶ جولای حراج عمومی خواهد کرد.



سنگ آهن ۶۲ درصد چین به مرز ۲۱۹ دلار هر تن رسیده که علت آن تصمیمات دولت های دیگر در خصوص عوارض و مالیات بر صادرات است. پیش‌بینی Fitch کاهش مصرف سنگ آهن در نیمه دوم سال است اما روند قیمت ها هنوز هم افزایشی است.



گزارش فصلی اقتصاد ایران زمستان ۱۳۹۹ منتشر شد که بر این اساس رشد اقتصادی بدون نفت ۳/۳ درصد، نرخ تورم ۳۶/۴ درصد و حجم نقدینگی ۳،۴۷۶ هزار میلیارد تومان بوده که نسبت به پایان سال ۱۳۹۸، ۴۰/۶ درصد رشد داشته است.



رئیس کمیسیون اقتصادی مجلس می گوید "پیش‌بینی می‌شود در بودجه ۱۴۰۰ چیزی بین ۳۵۰ تا ۴۰۰ هزار میلیارد تومان کسری بودجه داشته باشیم. به عبارتی یک سوم بودجه عمومی کشور کسری بودجه ماست."

