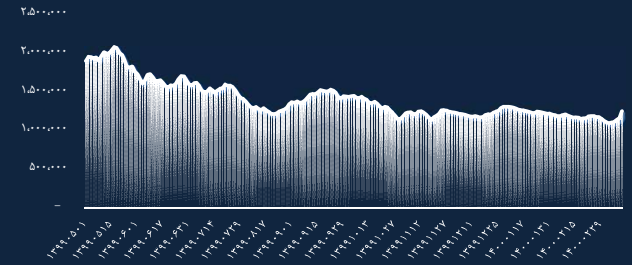
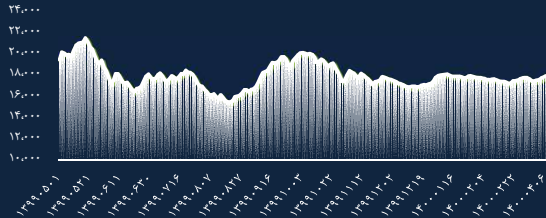


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

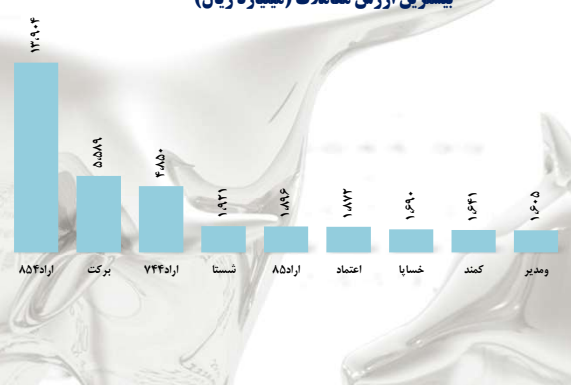
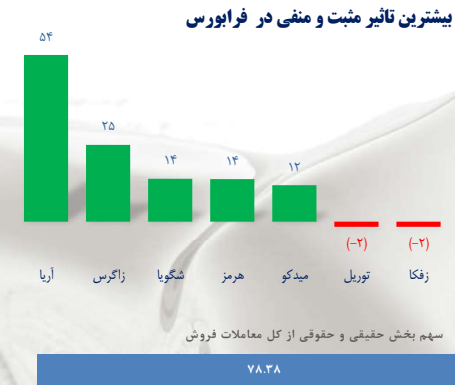


شاخص کل فرابورس

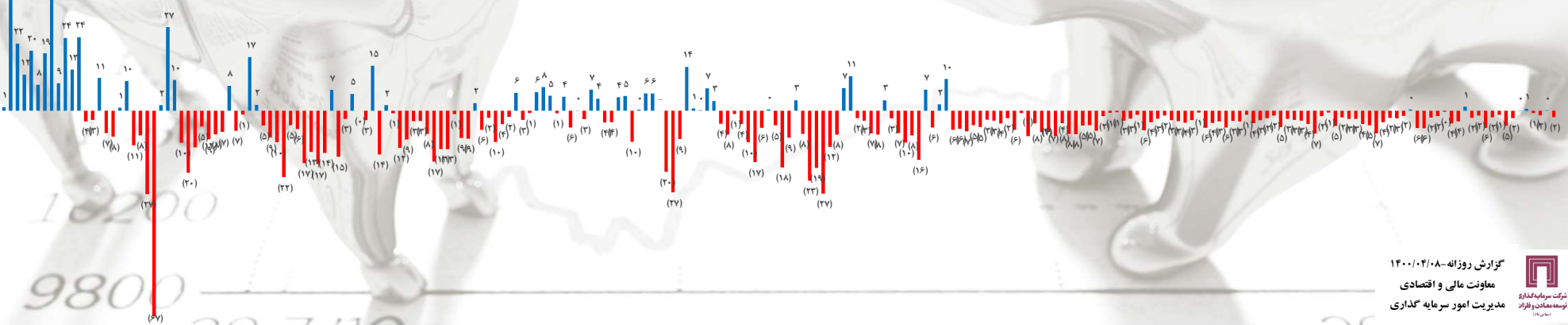


| مقدار شاخص | بورس | فرابورس |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| ارزش بازار | ۴۹,۷۷۵,۹۱۶.۲۲۲ B | ۱۱,۸۹۸,۰۲۵.۷۴۳ B |
| مقدار تغییر نسبت به روز گذشته | ۴,۷۲۸ | ۱۶۵ |
| درصد تغییر نسبت به روز گذشته | ۰.۳۸ | ۰.۹۳ |
| ارزش معاملات | ۵۶,۳۵۷.۸۵۲ B | ۲۲,۴۹۳.۴۵۶ B |

بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



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



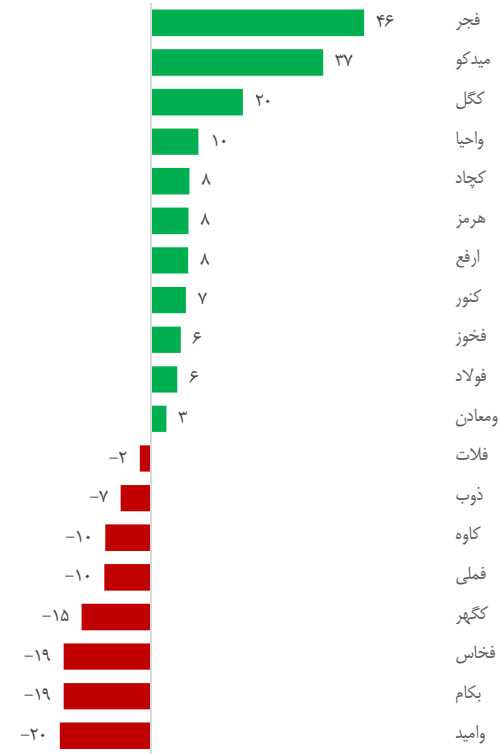
P/E تحلیلی



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 | ۴.۶ | ۹.۶۲۰ | ۹۳۳,۷۳۶ | ۹۶,۰۰۲,۵۰۰ |
| معدنی و صنعتی گل گهر | ۲,۳۰۸ | ۱,۹۰۳ | ۱.۷ | ۱۸,۱۰۰ | ۲۳۶,۸۷۱ | ۱۳,۰۹۰,۳۳۴ |
| معدنی و صنعتی چادرملو | ۳,۷۸۵ | ۳,۰۸۰ | -۰.۷ | ۲۶,۱۷۰ | ۳۹۷,۱۹۵ | ۱۵,۱۷۸,۰۹۸ |
| سنگ آهن گهرزمین | ۳,۵۰۲ | ۱,۷۳۱ | -۰.۳ | ۴۰,۰۵۸ | ۱۹,۳۷۲ | ۴۷۵,۳۲۶ |
| توسعه معدنی و صنعتی صابونر | ۶,۳۱۶ | ۷,۴۳۸ | ۱.۳ | ۵۲,۷۴۰ | ۳۷,۱۱۰ | ۶۹۷,۳۸۹ |
| گروه مدیریت سرمایه گذاری امید | ۹۴۹ | ۷۹۶ | ۴.۸ | ۱۰,۳۱۰ | ۳۰۷,۲۰۹ | ۳۰,۰۷۸,۷۱۳ |
| ملی صنایع مس ایران | ۲,۱۴۷ | ۱,۳۴۸ | -۰.۸ | ۱۲,۲۴۰ | ۹۸۸,۶۲۶ | ۸۰,۷۳۸,۱۵۸ |
| شرکت آهن و فولاد ارفع | ۳,۰۰۹ | ۲,۱۶۳ | (-۰.۳) | ۱۴,۵۲۵ | ۲۹,۵۴۳ | ۲,۰۴۱,۴۲۵ |
| فولاد خراسان | ۴,۸۹۶ | ۲,۰۵۷ | ۱.۳ | ۲۳,۲۲۰ | ۳۲,۱۰۶ | ۱,۳۴۱,۱۹۷ |
| فولاد امیرکبیرکاشان | ۳,۳۲۸ | ۴,۷۳۶ | -۰.۷ | ۲۹,۹۹۰ | ۵۴,۵۲۶ | ۱,۸۱۸,۴۰۸ |
| گروه صنایع معادن فلات ایرانیان | ۴۷۵ | ۳۶۵ | -۰.۰ | ۱۵,۲۰۳ | ۰ | ۰ |
| کارخانجات تولیدی شهید قندی | ۸۴ | ۱۰۳ | ۳.۴ | ۲۸,۰۰۰ | ۸۷,۰۶۶ | ۳۱,۱۰۰,۱۶۶ |
| فولاد مبارکه اصفهان | ۱,۷۳۵ | ۱,۲۵۸ | -۰.۶ | ۱۰,۶۷۰ | ۶۲۹,۶۴۸ | ۵۹,۰۲۱,۳۳۹ |
| فولاد خوزستان | ۲,۹۳۵ | ۲,۳۳۳ | -۰.۰ | ۱۶,۵۹۰ | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | |
| فولاد هرمزگان جنوب | ۲,۵۵۲ | ۲,۰۸۱ | ۲.۴ | ۱۵,۸۳۹ | ۲۰۷,۵۹۵ | ۱۳,۱۰۶,۴۱۴ |
| فولاد کاوه جنوب کیش | ۳,۸۱۴ | ۲,۱۳۵ | -۰.۴ | ۱۹,۹۸۰ | ۱۵۵,۸۲۵ | ۷۸,۰۰۴,۴۷۵ |
| م. صنایع و معادن احیاء سپاهان | ۴۱,۶۱۰ | ۲۰,۸۷۰ | ۲.۸ | ۱۶۰,۷۲۹ | ۲۰۵,۴۲۴ | ۱,۲۷۸,۰۷۴ |
| هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه | ۷۳۲ | ۶۶۰ | -۰.۴ | ۴۲,۶۱۶ | ۴۳۳,۴۸۲ | ۱۰,۱۷۱,۸۳۳ |
| سهامی ذوب آهن اصفهان | ۵۷۴ | ۲۴۵ | ۳.۱ | ۳,۸۳۷ | ۶۱۰,۷۱۹ | ۱۵۹,۱۷۰,۹۸۳ |

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

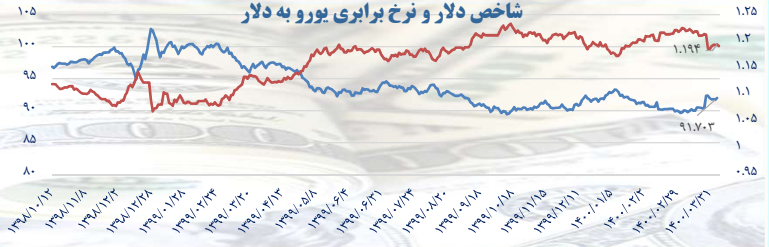
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

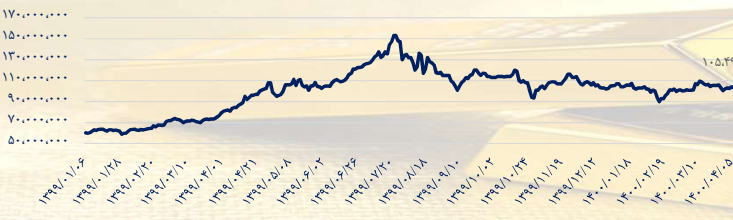
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



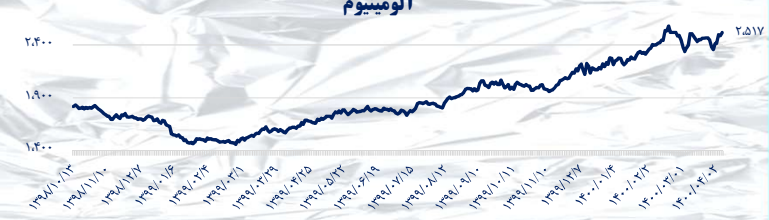
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



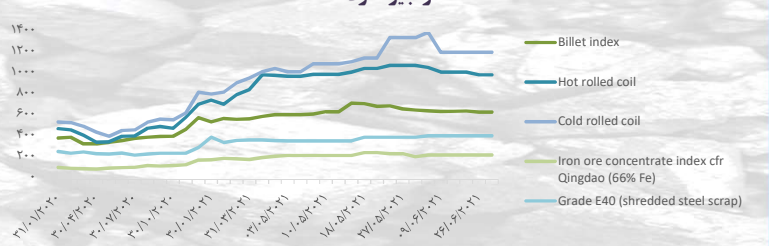
آلومینیوم



شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• شرکت سنگ آهن گهر زمین گزارش ماهانه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست در ۶ ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰، ۱۰۰،۷۴۹ میلیارد ریال فروش محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۲۱۷ درصد رشد داشته است.

کدال

• شرکت مجتمع فولاد خراسان صورت‌های مالی تلفیقی حسابرسی شده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۲۴،۴۷۸ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته با ۲۲۱ درصد رشد همراه بوده است.

کدال

• شرکت سرمایه‌گذاری و توسعه گل گهر از زیر مجموعه‌های شرکت معدنی و صنعتی گل گهر گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ خود را منتشر کرده است این شرکت توانست ۱،۸۳۶ میلیارد ریال سود محقق کند.

کدال



مبادلات تجاری ایران و چین در ۵ ماهه نخست سال جاری میلادی با افت ۱۴ درصدی نسبت به مدت مشابه سال قبل مواجه شد و به حدود ۵/۵ میلیارد دلار رسید. واردات چین از ایران در پنج ماه نخست سال جاری میلادی به ۲/۵ میلیارد دلار رسیده که این رقم با افت ۷ درصدی نسبت به مدت مشابه سال قبل مواجه شده است.



وزارت خارجه فرانسه خواستار ادامه همکاری ایران با آژانس بین‌المللی انرژی اتمی و فراهم کردن دسترسی کامل این نهاد به تأسیسات هسته‌ای ایران شد.



پلنرمی گوید "اخبار مرتبط با کاهش تولید فولاد در استانهای کلیدی چین باعث موج جدید رشد قیمت در معاملات شبانه بازار فیوچرز شده است. طبق اخبار پلنر، در صورت تحقق کامل توقف ها طی سه روز از ۲۸ ژوئن تا ۱ جولای، روزانه نزدیک به ۱۱۰ هزار تن از تولید فولاد تنها در منطقه تانگشان کاسته خواهد شد و مجموع افت تولید در چین طی سه روز ۴۳۵ هزار تن خواهد بود."



استیل پرایس می گوید "به دنبال کشف سه کیس کرونا دلتا در شهر پرت، مرکز استرالیای غربی از دیروز در اغلب مناطق این ایالت حالت فوق‌العاده اعلام شد. سرعت انتقال ویروس دلتا بسیار بیش از نمونه های قبلی است، با این حال به نظر نمی‌رسد بر روی عملیات استخراج و ارسال سنگ آهن تاثیر زیادی داشته باشد."



قائم مقام بانک مرکزی می گوید "از ابتدای سال جاری تاکنون روزانه به طور متوسط بیش از ۵ میلیون دلار و یک میلیون یورو در بازار متشکل معاملات ارزی معامله شده است."