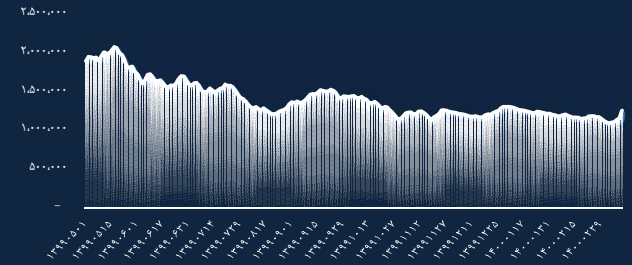
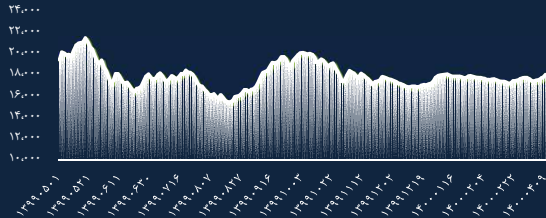


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

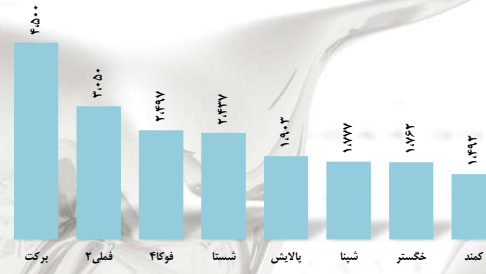


شاخص کل فرابورس

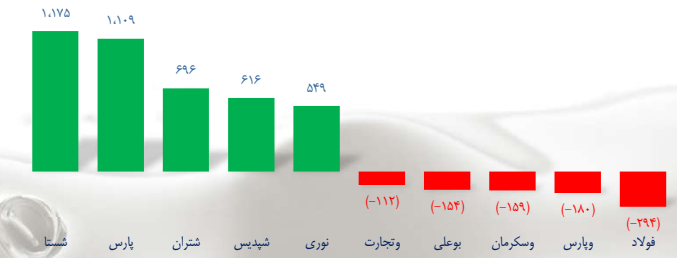


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۸,۰۸۸	۱,۲۵۶,۹۲۱	
۱۱,۹۷۹,۸۱۹.۸۱۶B	۵۰,۱۰۹,۰۲۰.۸۲۱B	ارزش بازار
۱۲۴	۸,۴۰۵	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۰.۶۹	۰.۶۷	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۲۶,۱۱۸.۱۵۳B	۵۸,۴۴۹.۶۰۴B	ارزش معاملات

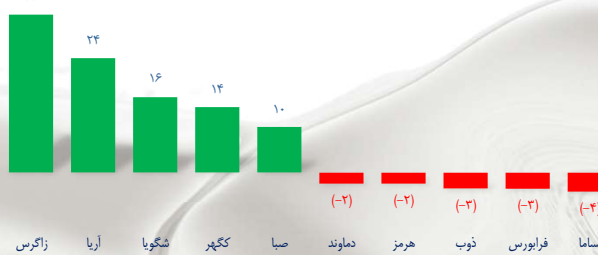
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



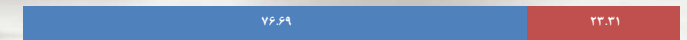
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



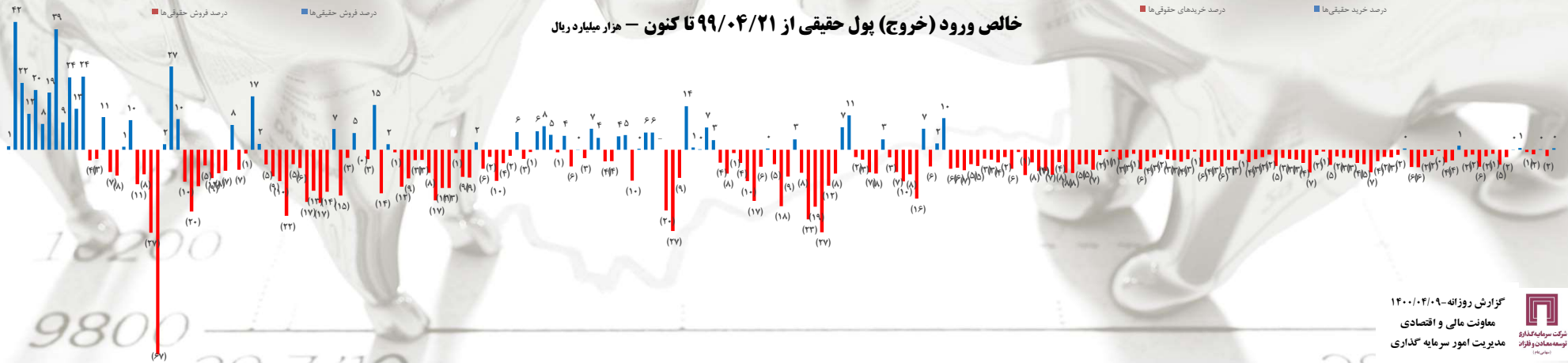
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



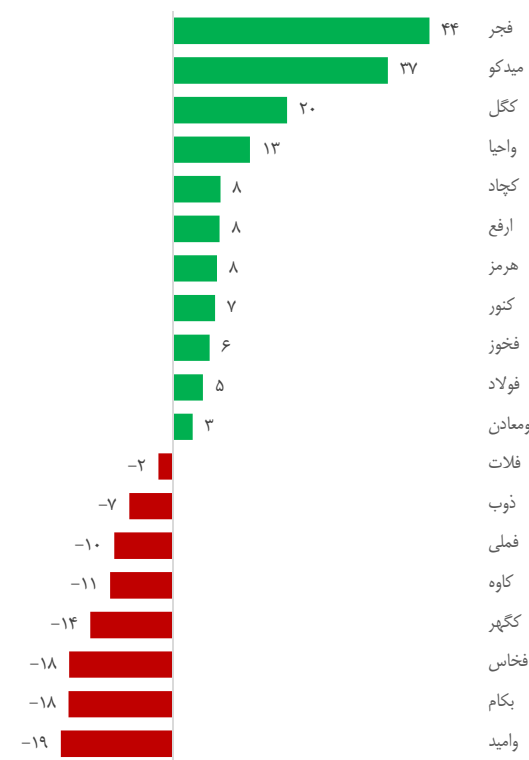
P/E تحلیلی



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

نام شرکت	وضعیت سهام		EPS کارشناسی		نوسان روزانه	ارزش معاملات	حجم معاملات	قیمت پایانی
	ارزش معاملات	حجم معاملات	۱۳۹۹	۱۴۰۰				
توسعه معادن و فلزات	۵۸۸,۱۸۷	۶۱,۰۲۷,۸۴۰	۰.۲	۹.۶۴۰	۰.۲	۱,۵۱۷	۸۸۱	۱۳۹۹
معدنی و صنعتی گل گهر	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه	۱۸,۱۰۰	۰.۰	۲۶,۱۷۰	۰.۰	۲,۳۰۸	۱,۹۰۳	۱۳۹۹
معدنی و صنعتی چادرملو	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه	۲۶,۱۷۰	۰.۰	۲۶,۱۷۰	۰.۰	۳,۷۸۵	۳,۰۸۰	۱۳۹۹
سنگ آهن گهرزمین	۲۹,۵۷۵	۷۱۰,۸۶۰	۰.۹	۴۰,۴۲۰	۰.۹	۳,۵۰۲	۱,۷۳۱	۱۳۹۹
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۳۷,۴۴۰	۷۱۱,۲۷۹	(۰.۱)	۵۲,۶۸۰	(۰.۱)	۶,۳۱۶	۷,۴۳۸	۱۳۹۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۷۳,۳۶۸	۷,۱۲۶,۸۷۵	۰.۵	۱۰,۲۶۰	۰.۵	۹۴۹	۷۹۶	۱۳۹۹
ملی صنایع مس ایران	۷۵۸,۰۲۹	۶۱,۹۳۴,۴۴۰	۰.۰	۱۲,۲۴۰	۰.۰	۲,۱۴۷	۱,۳۴۸	۱۳۹۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳۳,۰۷۸	۲,۲۰۴,۸۲۹	۰.۱	۱۴,۵۳۶	۰.۱	۳,۷۳۹	۲,۱۶۳	۱۳۹۹
فولاد خراسان	۲۸,۸۸۱	۱,۱۸۵,۸۳۷	۱.۳	۲۳,۵۲۰	۱.۳	۴,۸۹۶	۲,۰۵۷	۱۳۹۹
فولاد امیرکبیرکاشان	۸۶,۸۷۵	۲,۹۲۹,۶۸۶	(۱.۱)	۲۹,۶۵۰	(۱.۱)	۳,۳۲۸	۴,۷۳۶	۱۳۹۹
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۲۹	۱,۹۷۵	(۰.۰)	۱۵,۲۰۲	(۰.۰)	۴۷۵	۳۶۵	۱۳۹۹
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۴۸,۹۹۹	۱۷,۳۰۲,۷۵۲	۱.۱	۲,۸۳۲	۱.۱	۸۴	۱۰۳	۱۳۹۹
فولاد مبارکه اصفهان	۵۰۶,۰۴۷	۴۷,۶۲۵,۳۷۷	(۰.۴)	۱۰,۶۳۰	(۰.۴)	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	۱۳۹۹
فولاد خوزستان	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه	۱۶,۵۹۰	۰.۰	۱۶,۵۹۰	۰.۰	۲,۹۳۵	۲,۳۳۳	۱۳۹۹
فولاد هرمزگان جنوب	۵۶,۶۴۴	۳,۶۰۷,۱۷۵	(۰.۴)	۱۵,۷۷۸	(۰.۴)	۲,۵۵۲	۲,۰۸۱	۱۳۹۹
فولاد کاوه جنوب کیش	۱۵۲,۱۶۴	۷,۶۸۸,۳۶۰	(۱.۰)	۱۹,۷۹۰	(۱.۰)	۳,۸۱۴	۲,۲۹۶	۱۳۹۹
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۱۲۲,۰۹۹	۷۳۸,۵۳۱	۲.۹	۱۶۵,۳۲۶	۲.۹	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	۱۳۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۳۲۹,۳۸۰	۷,۷۲۴,۹۳۷	۰.۱	۴۲,۶۳۹	۰.۱	۷۳۲	۶۶۰	۱۳۹۹
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۴۲,۱۶۱	۶۳,۷۱۶,۰۶۲	(۰.۹)	۳,۸۰۱	(۰.۹)	۵۷۴	۲۴۵	۱۳۹۹

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

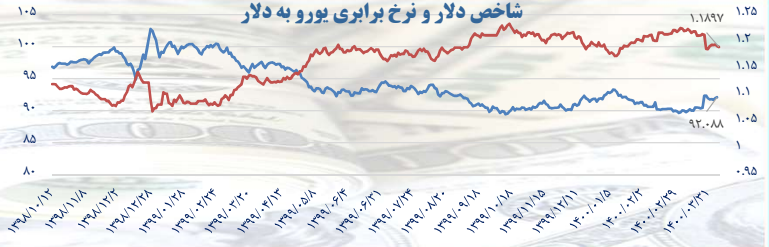
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

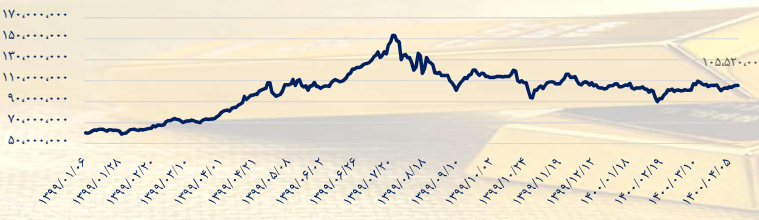
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



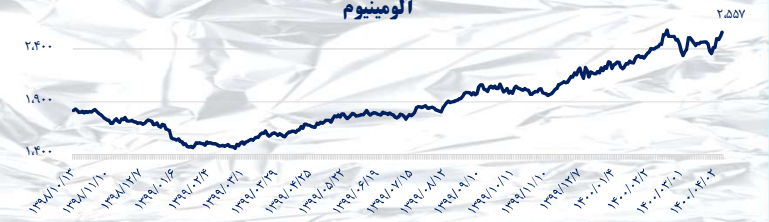
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



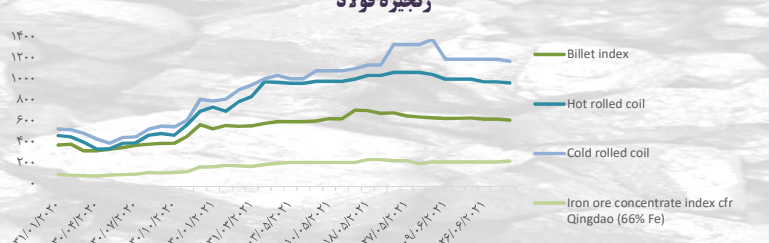
آلومینیوم



شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• شرکت فولاد کاوه جنوب کیش
صورت‌های مالی تلفیقی حسابرسی شده
منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر
کرده است این شرکت توانست ۳۴،۴۲۸
میلیارد ریال سود خالص محقق کند که
نسبت به مدت مشابه سال گذشته با ۲۵۳
درصد رشد همراه بوده است.

کاوه

کدال

• شرکت گروه توسعه فراگیر فولاد خوزستان
صورت‌های مالی حسابرسی شده منتهی به
۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر کرده است
این شرکت توانست ۴،۵۰۷ میلیارد ریال
سود خالص محقق کند.

فخوز

کدال

جدیدترین پیش بینی اوپک در مورد تقاضا برای نفت خام نشان می‌دهد، اگر سطح تولید تغییر نکند، عرضه اوپک ۱/۵ میلیون بشکه در روز در ماه آگوست کمتر از تقاضای مورد انتظار خواهد بود. این کمبود در سه ماهه چهارم به ۲/۲ میلیون بشکه در روز افزایش خواهد یافت.



وزیر خارجه آمریکا در اظهاراتی تازه درباره وضعیت مذاکرات در وین به منظور احیای برجام گفت هنوز برخی اختلافات اساسی باقی است.



وزیران خارجه آمریکا و عربستان در دیداری درباره تقویت هماهنگی بین دو کشور برای توقف آنچه حمایت ایران از جنبش انصارالله یمن دانسته شده است بحث و تبادل نظر کردند.



مدیرعامل و معادن از کنور بازدید کرد. در این سفر، معادن باباعلی و گلالی با ظرفیت استخراج سالیانه ۹۰۰ هزار تن، کارخانه کنسانتره با ظرفیت تولید سالیانه ۶۰۰ هزار تن، کارخانه گندله سازی با ظرفیت تولید سالیانه ۵۵۰ هزار تن و محل احداث کارخانه کنسانتره گلالی مورد ارزیابی و بازدید قرار گرفت.

