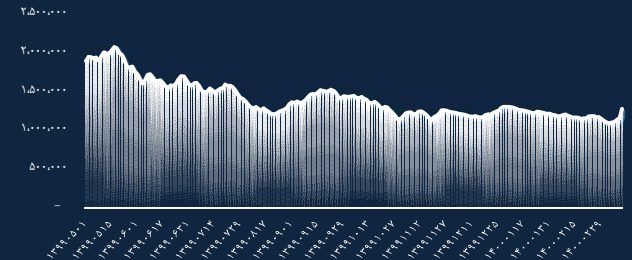
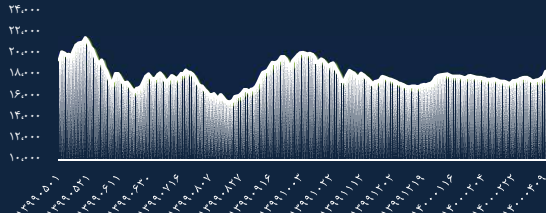


### شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

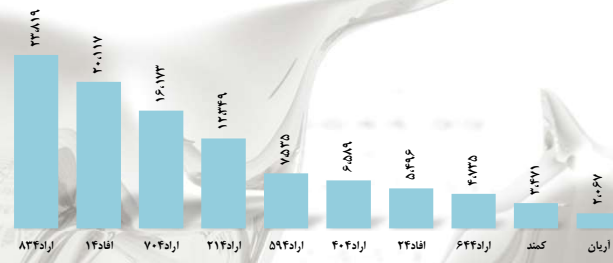


### شاخص کل فرابورس

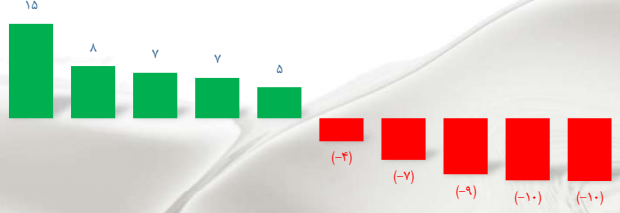


| فرابورس          | بورس             | مقدار شاخص                    |
|------------------|------------------|-------------------------------|
| ۱۸,۳۶۸           | ۱,۲۸۲,۰۱۸        | ۱۸,۳۶۸                        |
| ۱۲,۱۶۳,۶۶۸.۴۷۴ B | ۵۰,۳۸۲,۳۱۱.۲۲۲ B | ارزش بازار                    |
| ۲۷               | ۸۳۱              | مقدار تغییر نسبت به روز گذشته |
| ۰.۱۵             | ۰.۰۶             | درصد تغییر نسبت به روز گذشته  |
| ۱۴۱,۳۰۰,۰۰۰ B    | ۵۴,۸۴۴,۸۱۶ B     | ارزش معاملات                  |

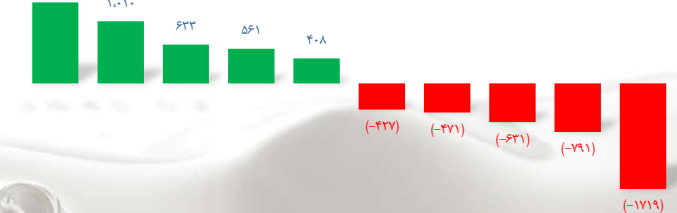
### بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



### بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



### بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



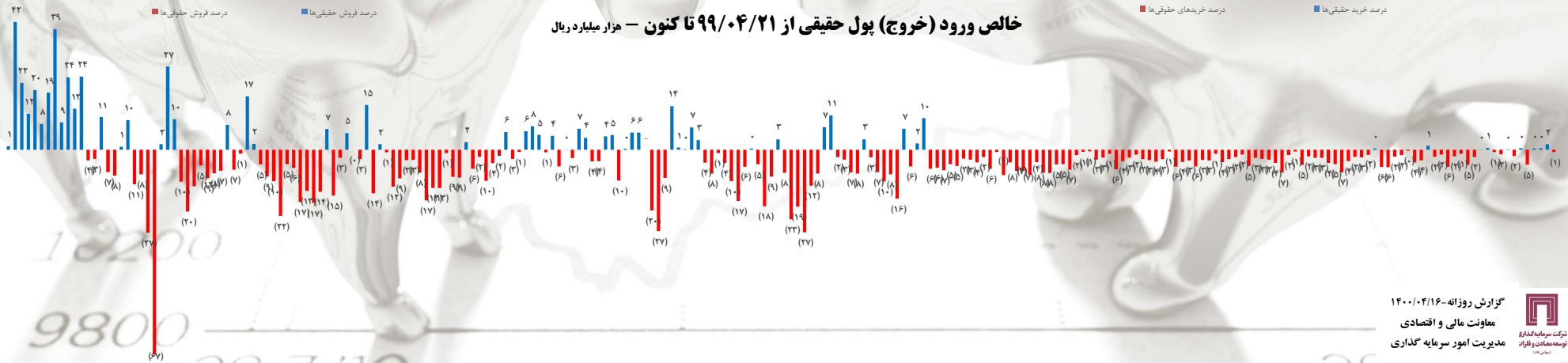
### سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



### سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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

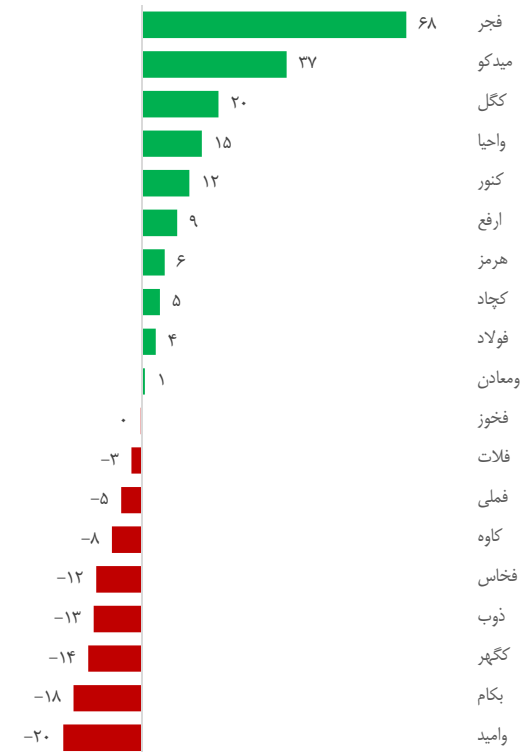


### P/E تحلیلی



| عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقا |   |             |              |        |              |              |
|---|---|-------------|--------------|--------|--------------|--------------|
| نام شرکت  | وضعیت سهام                              |             | EPS کارشناسی |        | نوسان روزانه | ارزش معاملات |
|   | حجم معاملات                             | قیمت پایانی | ۱۳۹۹         | ۱۴۰۰   |              |              |
| توسعه معادن و فلزات   | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | ۹,۳۸۰       | ۰.۰          | ۸۸۱    | ۱,۵۱۷        |              |
| معدنی و صنعتی گل گهر  | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | ۱۸,۱۰۰      | ۰.۰          | ۱,۹۰۳  | ۲,۵۲۳        |              |
| معدنی و صنعتی چادرملو   |   | ۹۹,۹۰۸      | ۱.۰          | ۳,۰۸۰  | ۳,۶۷۸        |              |
| سنگ آهن گهرزمین   |   | ۱۶,۹۹۱      | ۰.۰          | ۱,۷۳۱  | ۴,۹۱۶        |              |
| توسعه معدنی و صنعتی صابونر  |   | ۳۹,۸۰۸      | ۲.۰          | ۷,۴۳۸  | ۷,۴۰۰        |              |
| گروه مدیریت سرمایه گذاری امید   |   | ۳۸,۳۴۳      | (۰.۱)        | ۷۹۶    | ۹۴۹          |              |
| ملی صنایع مس ایران  |   | ۱,۹۸۴,۰۱۱   | ۰.۹          | ۱,۳۴۸  | ۲,۰۵۰        |              |
| شرکت آهن و فولاد ارفع   |   | ۳۵,۱۹۴      | (۰.۴)        | ۲,۱۶۳  | ۳,۷۳۹        |              |
| فولاد خراسان  | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | ۲۵,۲۰۰      | ۰.۰          | ۲,۰۵۷  | ۴,۹۴۳        |              |
| فولاد امیرکبیرکاشان   |   | ۱۶۳,۸۸۰     | ۰.۲          | ۴,۷۳۶  | ۴,۷۴۴        |              |
| گروه صنایع معادن فلات ایرانیان  |   | ۷           | ۰.۰          | ۳۶۵    | ۴۷۵          |              |
| کارخانجات تولیدی شهید قندی  |   | ۵۵,۶۲۱      | ۲.۲          | ۱.۰۳   | ۱.۰۷         |              |
| فولاد مبارکه اصفهان   |   | ۱,۲۱۶,۲۹۸   | (۲.۲)        | ۱,۲۵۸  | ۱,۷۳۵        |              |
| فولاد خوزستان   |   | ۳۹۰,۸۳۳     | (۳.۸)        | ۲,۲۳۳  | ۲,۹۳۵        |              |
| فولاد هرمزگان جنوب  |   | ۶۲,۸۶۴      | (۱.۵)        | ۲,۰۸۱  | ۲,۵۵۲        |              |
| فولاد کاوه جنوب کیش   |   | ۳۷۴,۴۹۵     | (۲.۵)        | ۲,۲۹۶  | ۳,۸۱۴        |              |
| م. صنایع و معادن احیاء سپاهان   |   | ۵۸,۲۴۶      | ۰.۲          | ۲۰,۸۷۰ | ۴۱,۶۱۰       |              |
| هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه  |   | ۷۱۹,۸۷۴     | ۰.۰          | ۶۶۰    | ۷۳۲          |              |
| سهامی ذوب آهن اصفهان  |   | ۳۴۲,۷۷۵     | (۳.۰)        | ۲۴۵    | ۵۷۴          |              |

### 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

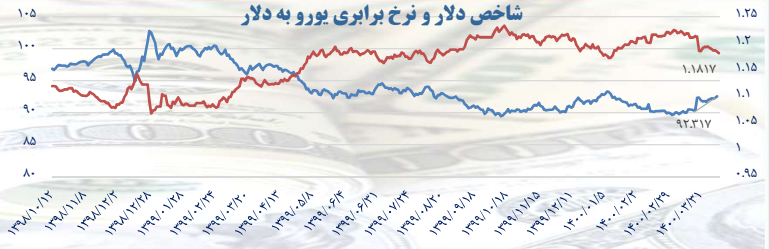
## آخرین نرخ کامودیتی ها

## داخلی

نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



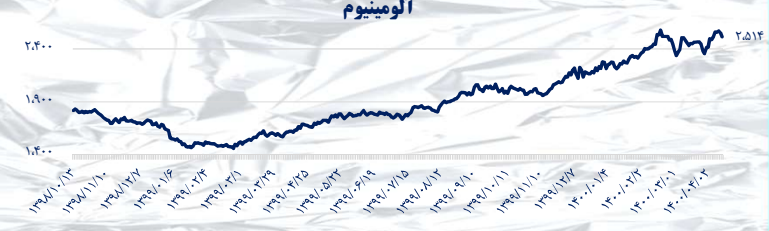
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



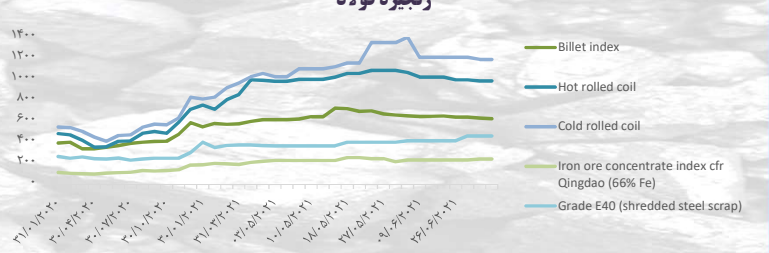
آلومینیوم



شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• شرکت آتیه فولاد نقش جهان از زیر مجموعه‌های فولاد مبارکه اصفهان صورت‌های مالی حسابرسی شده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ خود را منتشر نمود این شرکت توانست ۷،۱۸۰ میلیارد ریال سود خالص محقق کند.

فولاد

کدال

اخبار روز

رئیس کمیسیون اقتصادی مجلس می گوید "قیمت‌گذاری دستوری توسط وزارت نیرو، سرمایه‌گذاری در این حوزه را از بین برده است. نیروگاه‌های صنعت برق، بیش از ۳۰ هزار میلیارد تومان از دولت طلب دارند."

اخبار روز

میزان تولید مس شیلی در ماه می نسبت به ماه قبل افزایش یافت. اطلاعات کمیسیون مس شیلی Cochilco نشان می‌دهد که تولید مس شیلی در ماه می بالغ بر ۴۸۷ هزار و ۲۰۰ تن بوده است. این میزان تولید ۵/۶ درصد بیشتر از آوریل امسال است اما نسبت به ماه می سال گذشته ۱/۱ درصد کاهش داشته است.

اخبار روز

گروه BHP بزرگترین و پیشرفته‌ترین شرکت استخراج سنگ آهن طی گزارشی اعلام کرد که هفته گذشته، اولین محموله سنگ آهن خود از معدن جدید South Flank، واقع در غرب استرالیا را به چین ارسال کرده است.

اخبار روز

اختلاف قیمت اسلب و بیلت صادراتی روسیه به عدد معنی دار ۲۴۷ دلاری افزایش پیدا کرده است و این در حالی است که میانگین اختلاف نرخ این دو طی ۵ سال گذشته به طور متوسط حدوداً ۳۶ دلار بوده است. این اختلاف فاحش در نتیجه بحران کرونا و افت عرضه اسلب نسبت به تقاضای آن بوده است.