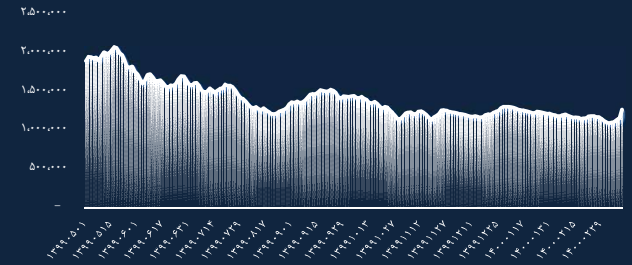
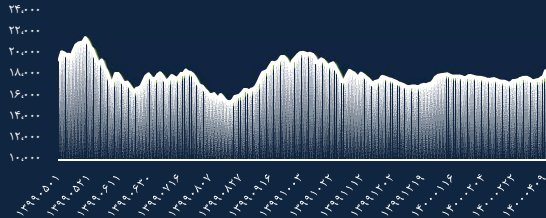


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

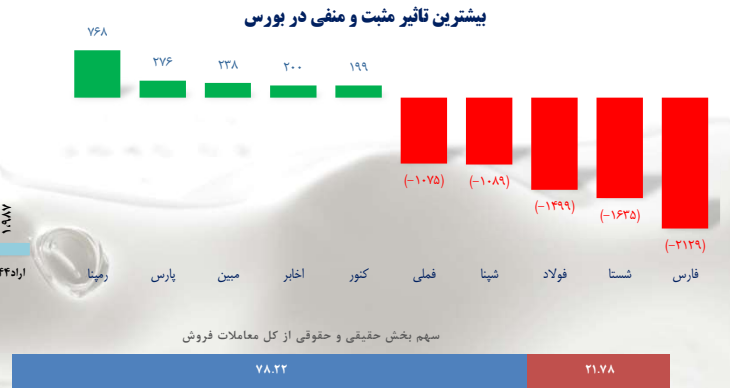
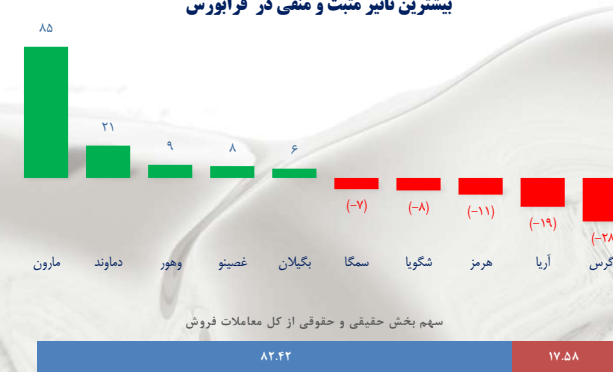


شاخص کل فرابورس

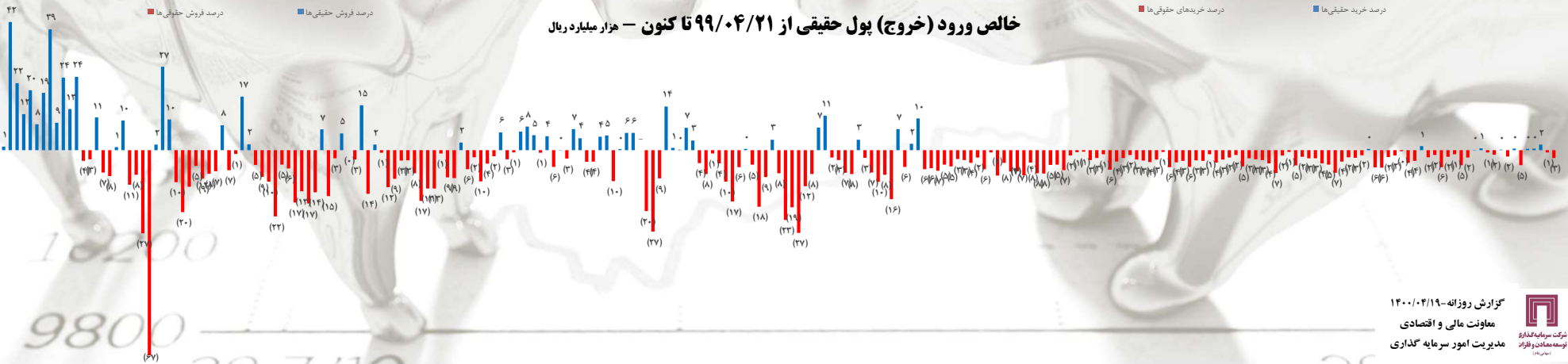


| مقدار شاخص | بورس | فرابورس |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| ۱۸,۴۲۶ | ۱,۲۷۰,۷۳۰ | ۱۸,۴۲۶ |
| ارزش بازار | ۴۹,۵۲۹,۳۰۷.۲۲۸ B | ۱۲,۱۴۵,۰۳۹.۰۹۸ B |
| مقدار تغییر نسبت به روز گذشته | (-۱۱,۳۰۶) | ۵۸ |
| درصد تغییر نسبت به روز گذشته | (-۱) | ۰.۳۲ |
| ارزش معاملات | ۴۳,۹۸۷.۷۴۹ B | ۱۴۷,۸۳۴.۴۰۹ B |

بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



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

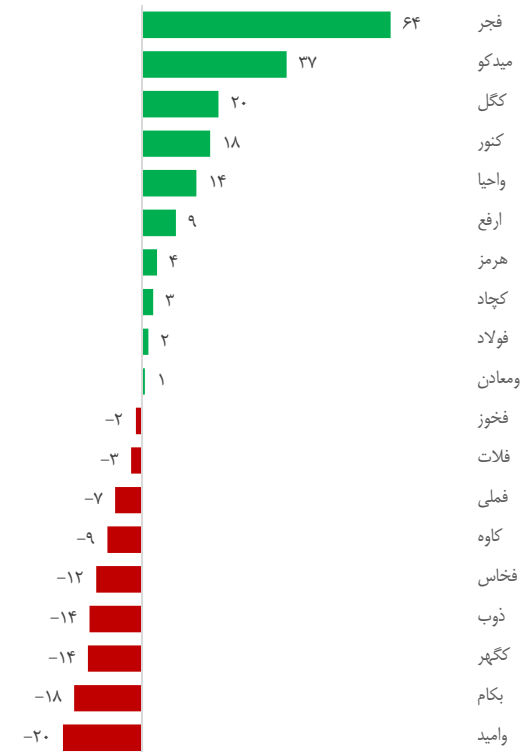


P/E تحلیلی



| عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقا | | | | | | | | |
|---|---|---------|--------------|--------|--------------|--------------|-------------|-------------|
| نام شرکت | وضعیت سهام | | EPS کارشناسی | | نوسان روزانه | ارزش معاملات | حجم معاملات | قیمت پایانی |
| | ۱۴۰۰ | ۱۳۹۹ | ۱۴۰۰ | ۱۳۹۹ | | | | |
| توسعه معادن و فلزات | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | ۹,۳۸۰ | ۰.۰ | ۸۸۱ | ۰.۰ | ۱,۵۱۷ | | |
| معدنی و صنعتی گل گهر | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | ۱۸,۱۰۰ | ۰.۰ | ۱,۹۰۳ | ۰.۰ | ۲,۵۲۳ | | |
| معدنی و صنعتی چادرملو | ۶۶,۶۹۴,۴۲۲ | ۱۶۵,۸۹۸ | ۲۴,۸۷۰ | ۳,۰۸۰ | (۱.۶) | ۳,۶۷۸ | | |
| سنگ آهن گهرزمین | ۳۵۸,۳۶۷ | ۱۴,۴۸۸ | ۴۰,۵۰۹ | ۱,۷۳۱ | (۰.۰) | ۴,۹۱۶ | | |
| توسعه معدنی و صنعتی صابونر | ۴,۸۵۷,۲۸۷ | ۲۸۰,۳۵۱ | ۵۷,۷۲۰ | ۷,۴۳۸ | ۴.۸ | ۷,۴۰۰ | | |
| گروه مدیریت سرمایه گذاری امید | ۱,۱۹۴,۶۱۱ | ۱۱,۹۱۹ | ۱۰,۱۱۰ | ۷۹۶ | (۰.۱) | ۹۴۹ | | |
| ملی صنایع مس ایران | ۶۶,۹۵۲,۷۵۴ | ۸۴۷,۶۱۲ | ۱۲,۶۶۰ | ۱,۳۴۸ | (۱.۶) | ۲,۰۵۰ | | |
| شرکت آهن و فولاد ارفع | ۱,۹۵۲,۷۴۸ | ۲۸,۴۱۲ | ۱۴,۶۱۸ | ۲,۱۶۳ | (۰.۴) | ۳,۷۳۹ | | |
| فولاد خراسان | متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی سالیانه | ۲۵,۲۰۰ | ۰.۰ | ۲,۰۵۷ | ۰.۰ | ۴,۹۴۳ | | |
| فولاد امیرکبیرکاشان | ۳,۰۹۷,۷۲۷ | ۱۰۴,۵۹۴ | ۳۳,۷۶۰ | ۴,۷۳۶ | (۲.۴) | ۴,۷۴۴ | | |
| گروه صنایع معادن فلات ایرانیان | ۷,۱۰۰ | ۱۰۴ | ۱۵,۱۳۹ | ۳۶۵ | (۰.۰) | ۴۷۵ | | |
| کارخانجات تولیدی شهید قندی | ۱۷,۸۶۲,۷۷۵ | ۵۰,۸۰۲ | ۲,۸۴۴ | ۱۰۳ | ۰.۲ | ۱۰۷ | | |
| فولاد مبارکه اصفهان | ۸۸,۱۵۶,۴۹۴ | ۹۰۴,۸۵۰ | ۱۰,۲۶۰ | ۱,۲۵۸ | (۱.۹) | ۱,۷۳۵ | | |
| فولاد خوزستان | ۹,۱۹۶,۹۷۳ | ۱۴۱,۰۵۸ | ۱۵,۳۴۰ | ۲,۲۳۳ | (۱.۳) | ۲,۹۳۵ | | |
| فولاد هرمزگان جنوب | ۴,۹۸۰,۱۵۱ | ۷۴,۹۹۳ | ۱۵,۲۱۷ | ۲,۰۸۱ | (۱.۸) | ۲,۵۵۲ | | |
| فولاد کاوه جنوب کیش | ۷,۶۹۲,۴۲۱ | ۱۵۵,۳۳۸ | ۲۰,۱۹۰ | ۲,۲۹۶ | (۱.۲) | ۳,۸۱۴ | | |
| م. صنایع و معادن احیاء سپاهان | ۳۷۱,۷۸۱ | ۶۱,۷۶۶ | ۱۶۶,۲۹۱ | ۲۰,۸۷۰ | (۱.۲) | ۴۱,۶۱۰ | | |
| هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه | متوقف به دلیل افشای اطلاعات با اهمیت | ۴۲,۷۱۰ | ۰.۰ | ۶۶۰ | ۰.۰ | ۷۳۲ | | |
| سهامی ذوب آهن اصفهان | ۶۹,۰۳۳,۲۹۵ | ۲۴۴,۸۳۹ | ۳,۵۴۷ | ۲۴۵ | (۱.۳) | 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

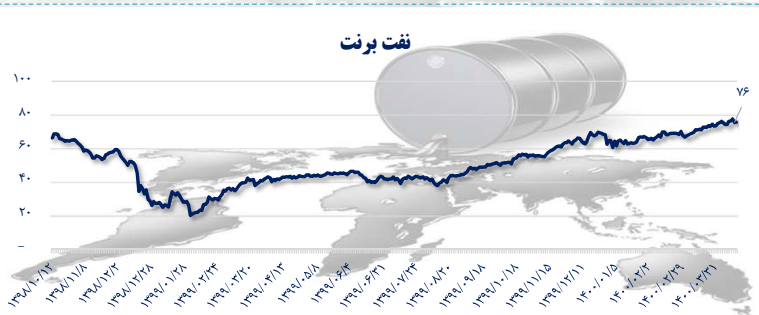
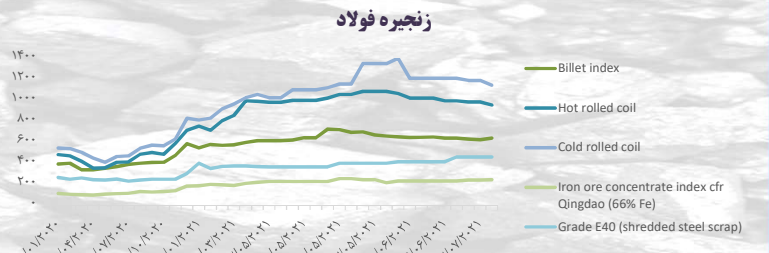
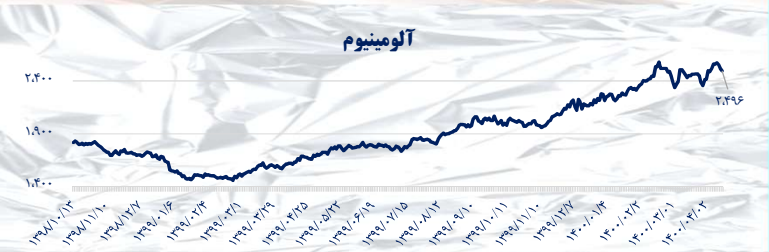
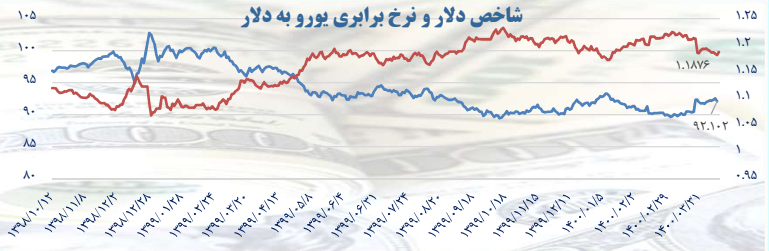
این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده،

سهامی که ریسک کمتری دارد را انتخاب کرد.

داخلی


آخرین نرخ کامودیتی ها

جهانی




• مجمع عمومی عادی سالیانه شرکت روز پنجشنبه مورخ ۱۴۰۰/۰۴/۱۷ برگزار گردید که در این مجمع ۱،۴۰۰ ریال سود نقدی تقسیم شد.

فخاس




• مجمع عمومی عادی سالیانه شرکت برای دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۰/۰۴/۲۹ در استان تهران برگزار می‌گردد.

فملی



• شرکت صورت‌های مالی حسابرسی نشده منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ را منتشر نمود این شرکت توانست ۵۸۷،۳۹۸ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۱۸۶ درصد رشد داشته است.

فولاد



در گزارش سیاست‌های پولی شش ماهه ابتدایی فدرال رزرو آمده است که "انتظارات تورمی در محدوده ای کاملاً منطبق با هدف بلند مدت قرار دارد. ریسک‌های صعودی چشم انداز تورمی کوتاه مدت افزایش پیدا کرده است. با گذر شرایط فوق العاده، عرضه و تقاضا باید به تعادل نزدیک شوند و بر این اساس انتظار می رود تورم به طور گسترده‌ای نزول کند."



قیمت زغال سنگ در چین به شدت در حال صعود است. کیوان جعفری طهرانی می‌گوید "پشت افزایش قیمت زغال کک شو، کمبود شدید عرضه ناشی از توقف گسترده فعالیت های معدنکاری زغال سنگ در معادن اصلی تولید این کشور از اواخر ژوئن تا اوایل جولای، قرار دارد."



در روزهای اخیر فولاد سازان ترکیه موفق به عقد قراردادهای خرید آهن قراضه در نرخهای ۴۹۵ و ۴۹۶ دلار برای گرید ۲۰_۸۰ شدند. (نرخ قراضه همبستگی بالایی با شمش CIS دارد)



نماینده ویژه آمریکا در امور ایران می‌گوید حتی اگر مذاکرات هسته‌ای با ایران هم به نتیجه نرسد، آمریکا همچنان مسئله آزادی زندانیان خود را به صورت جدی پیگیری خواهد کرد. زندانیان آمریکایی که در ایران هستند باید بدون هیچ پیش شرطی آزاد شوند.



تجارت ایران با افغانستان در مرز دوغارون و ماهیرود به دلیل نفوذ طالبان به حالت تعلیق درآمده است. نیروهای طالبان، گمرک اسلام‌قلعه در مرز هرات با ایران را در اختیار گرفته اند.

