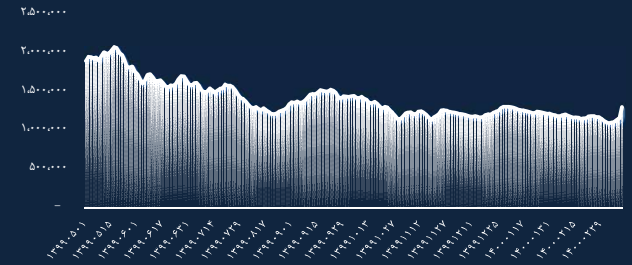
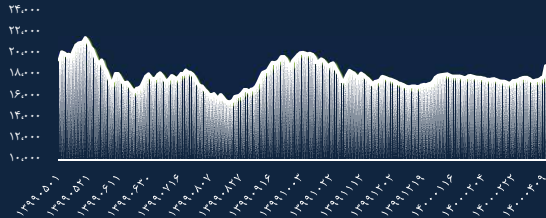


### شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

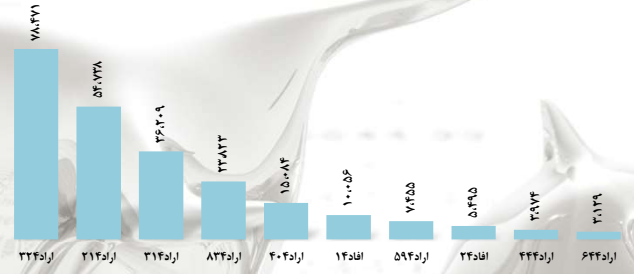


### شاخص کل فرابورس



مقدار شاخص	بورس	فرابورس
ارزش بازار	۱,۳۰۴,۳۳۲	۱۸,۸۸۱
مقدار تغییر نسبت به روز گذشته	۵۱,۴۵۹,۷۱۹.۸۱۹ B	۱۰,۴۵۴,۳۲۱.۹۸۶ B
درصد تغییر نسبت به روز گذشته	۱۹,۰۷۶	۲۶۲
ارزش معاملات	۵۸,۷۹۶.۲۷۴ B	۲۷۶,۲۳۵.۲۶۷ B

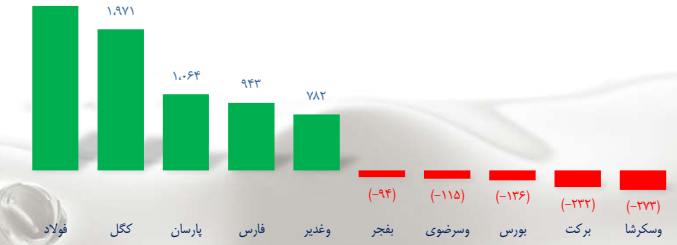
### بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



### بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



### بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



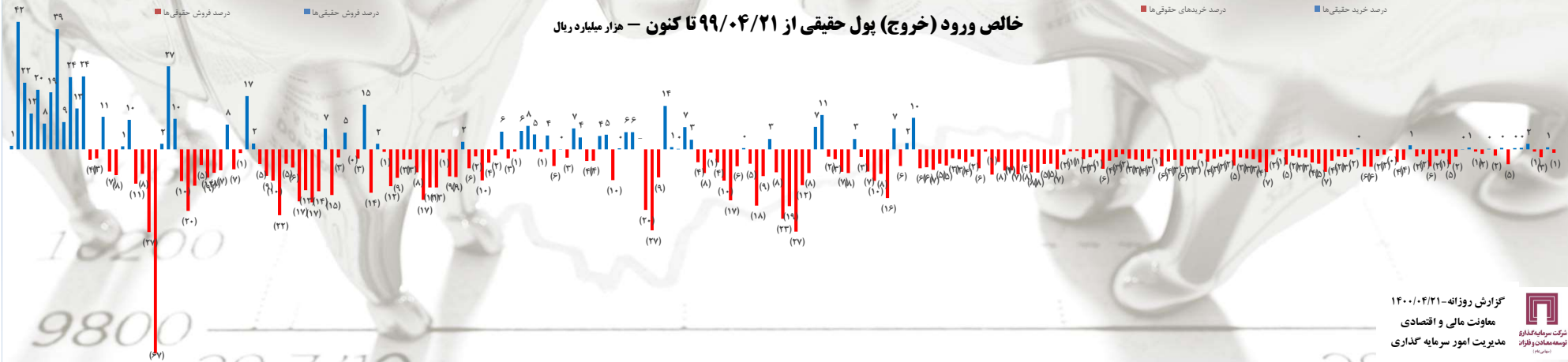
### سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



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



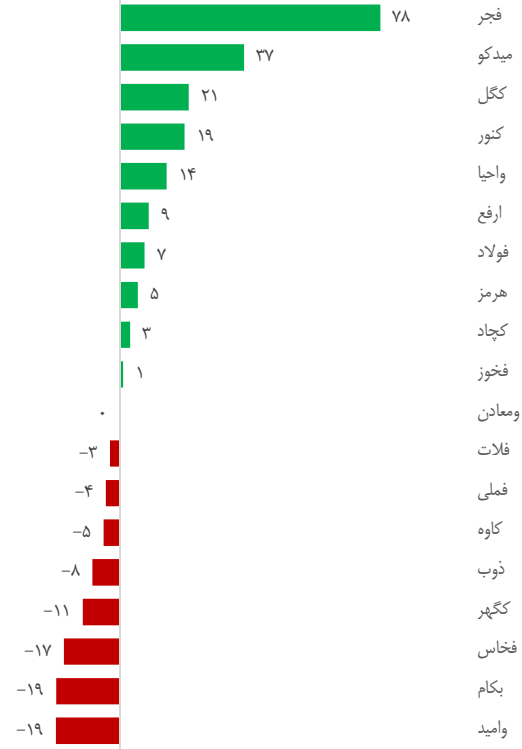
### P/E تحلیلی



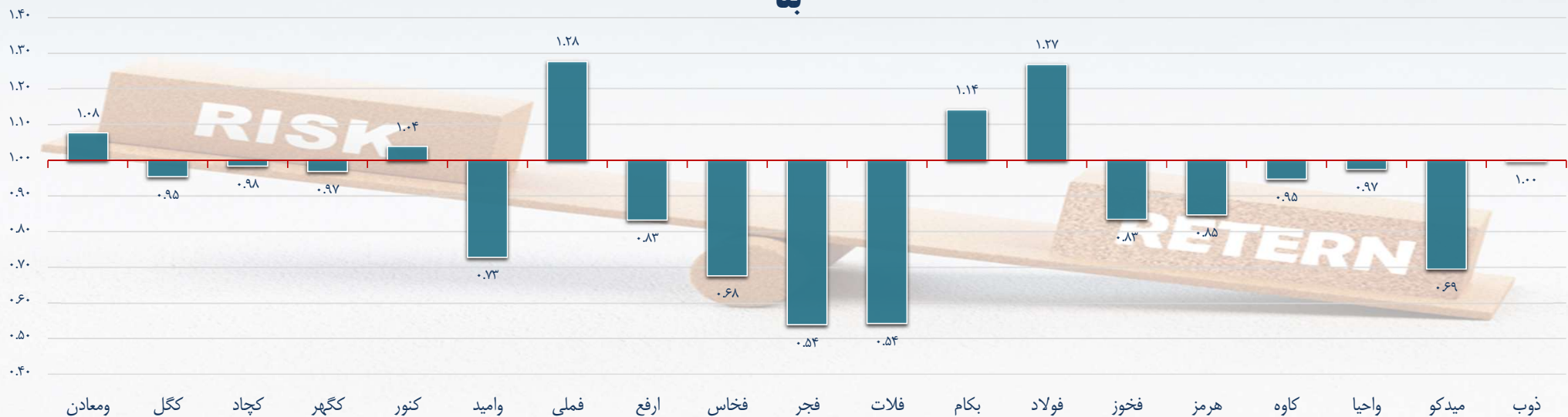
### عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا

نام شرکت	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			نام شرکت
	۱۴۰۰	۱۳۹۹	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	
توسعه معادن و فلزات	۱,۵۱۷	۸۸۱	۳.۵	۹,۳۰۰	۲۲۵,۵۹۸	۲۴,۴۴۵,۸۴۷
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۵۲۳	۱,۹۰۳	۴.۵	۱۸,۲۵۰	۳۴۰,۱۱۱	۱۸,۶۳۵,۰۷۳
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۶۷۸	۳,۰۸۰	-۰.۴	۲۴,۹۰۰	۲۱۴,۵۷۶	۸,۶۱۸,۹۴۹
سنگ آهن گهرزمین	۴,۹۱۶	۱,۷۳۱	۱.۸	۴۱,۸۰۷	۴۸,۲۳۳	۱,۱۲۰,۴۹۴
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۷,۴۰۰	۷,۴۳۸	۱.۰	۵۸,۶۲۰	۶۹,۶۸۸	۱,۱۸۸,۱۷۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	-۰.۶	۱۰,۲۵۰	۳۰,۶۱۵	۲,۹۳۹,۱۴۸
ملی صنایع مس ایران	۲,۰۵۰	۱,۳۰۲	۱.۱	۱۳,۰۲۰	۱,۳۸۳,۱۰۲	۱۰۶,۳۰۸,۷۶۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۷۳۹	۲,۱۶۳	-	۱۴,۶۱۸	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عادی بطور فوق العاده	
فولاد خراسان	۴,۹۴۳	۲,۰۵۷	(-۰.۴)	۲۳,۷۶۰	۱۳,۹۷۵	۶۰۲,۱۸۵
فولاد امیرکبیرکاشان	۴,۷۴۴	۴,۷۳۶	۴.۹	۳۶,۶۷۰	۲۵۰,۲۵۰	۶,۸۲۳,۵۸۵
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(-۰.۲)	۱۵,۱۰۶	۵۷۵	۳۹,۱۷۰
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۰۷	۱۰۳	(-۰.۳)	۲,۷۸۶	۵۰,۱۹۳	۱۸,۰۱۳,۴۹۵
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	۲.۹	۱۰,۸۵۰	۱,۶۹۵,۵۴۰	۱۵۶,۲۱۶,۷۸۰
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۳۳۳	۱.۶	۱۵,۷۴۰	۱۷۹,۳۵۸	۱۱,۳۸۸,۵۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۵۵۲	۲,۰۸۱	-۰.۸	۱۵,۴۴۳	۸۰,۱۷۶	۵,۱۷۱,۷۰۴
فولاد کاوه جنوب کیش	۳,۸۱۴	۲,۲۹۶	۲.۶	۲۱,۰۸۰	۳۴۷,۵۹۷	۱۶,۴۹۰,۵۰۱
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	۰.۰	۱۶۶,۲۹۱	متوقف به دلیل افشای اطلاعات با اهمیت	
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۷۳۲	۶۶۰	۰.۰	۴۲,۷۱۰	متوقف به دلیل افشای اطلاعات با اهمیت	
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	۱.۸	۳,۷۶۵	۷۰۲,۰۹۱	۱۸۶,۴۵۷,۷۸۶

### 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

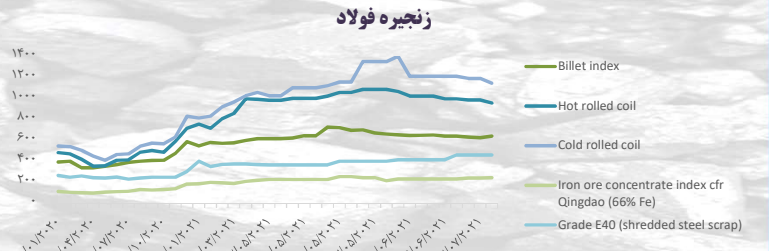
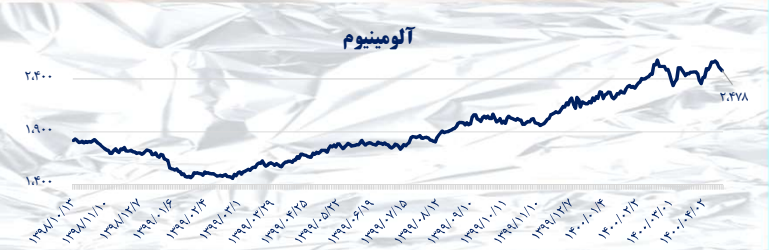
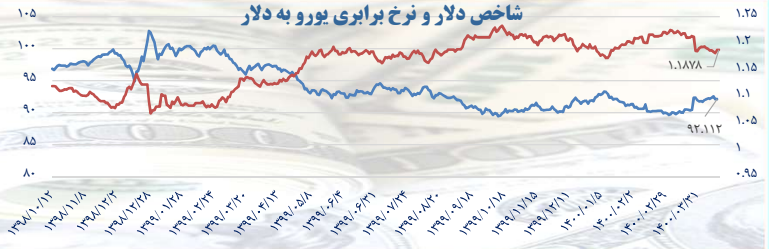
این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده،

سهامی که ریسک کمتری دارد را انتخاب کرد.

## داخلی

## آخرین نرخ کامودیتی ها

## جهانی





• درخواست شرکت مبنی بر تمدید سه ماهه مهلت مجوز خرید سهام خزانه تا تعداد ۲۵۰ میلیون سهم از تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۱۴ لغایت ۱۴۰۰/۰۷/۱۴ با دوره نگهداری حداکثر ۲ سال مورد موافقت هیئت مدیره سازمان قرار گرفت.

فخوز

کدال

اداره اطلاعات انرژی آمریکا (EIA) پیش‌بینی کرد که عرضه جهانی نفت خام در ماه‌های آینده از مصرف این کالای راهبردی فراتر می‌رود. این نهاد می‌گوید "انتظار داریم افزایش تولید سبب کاهش برداشت مداوم از ذخیره‌سازی‌های جهانی نفت شود که در بیشتر سال گذشته اتفاق افتاده است و قیمت‌ها در سطح کنونی حفظ شوند."

اخبار روز

سخت‌گویی صنعت برق می‌گوید "برق از سه کشور ترکمنستان، جمهوری آذربایجان و ارمنستان به میزان حداقل ۴۰۰ تا حداکثر ۶۵۰ مگاوات وارد می‌شود. صادرات برق به غیر از حدود ۵۰ مگاواتی که به افغانستان انجام می‌شود، قطع است. با پایداری شرایط تامین برق به تدریج کارخانه‌های فولاد و سیمان رفع محدودیت می‌شوند."

اخبار روز

انجمن فولاد پیشنهاد داده که حلقه‌های مختلف زنجیره فولاد (به جز ذوب و فولادسازی) مشابه سایر صنایع امکان فعالیت و تولید داشته باشند و به واحدهای ذوب و فولادسازی نیز حداقل در زمان غیر از اوج بار مثل ساعات شب، اجازه فعالیت داده شود. (در تولید آهن اسفنجی برق زیادی مصرف می‌شود و در تبدیل آهن اسفنجی به شمش، گاز بسیار مصرف می‌شود. تولید کنسانتره، گندله و تولید اسلب به ورق، انرژی اندکی نیاز دارد).

اخبار روز

مدیر محصولات سرد شرکت فولاد مبارکه از بومی‌سازی روغن نورد با تکنولوژی پیشرفته و روز دنیا در ناحیه نورد سرد این شرکت خبر داد.

اخبار روز