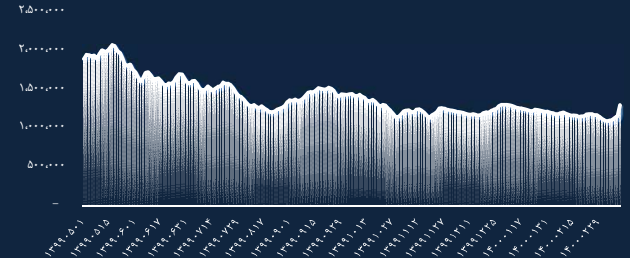
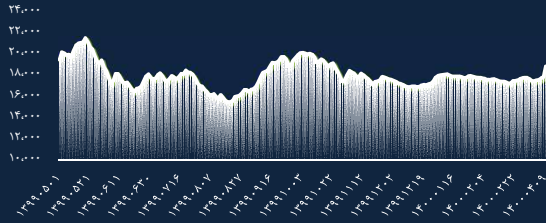


شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

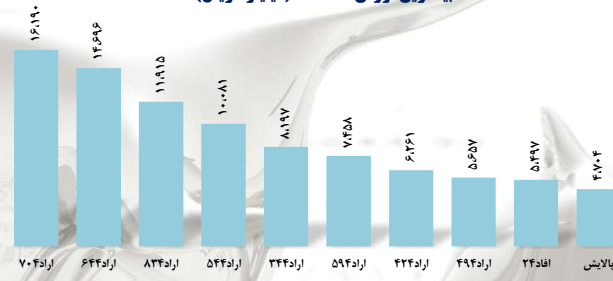


شاخص کل فرابورس

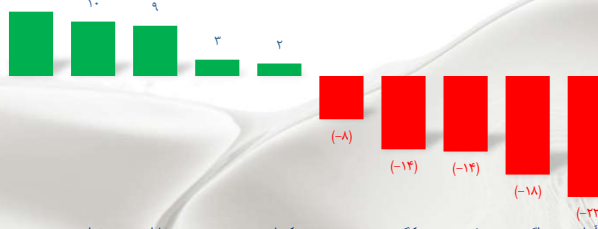


مقدار شاخص	بورس	فرابورس
مقدار شاخص	۱,۳۰۲,۸۵۷	۱۸,۸۴۵
ارزش بازار	۵۳,۰۶۹,۳۴۰.۳۳۳ B	۱۰,۴۲۶,۸۹۹.۷۱۱ B
مقدار تغییر نسبت به روز گذشته	(-۸,۳۸۴)	(-۱۴۲)
درصد تغییر نسبت به روز گذشته	(-۱)	(-۰.۷)
ارزش معاملات	۶۳,۵۲۶.۳۴۱ B	۱۰۲,۴۷۸.۱۴۳ B

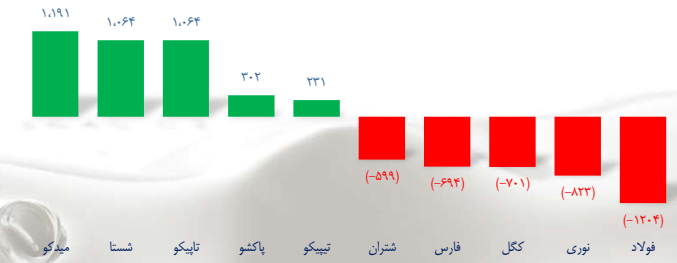
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



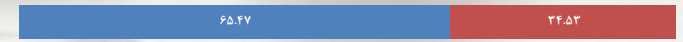
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



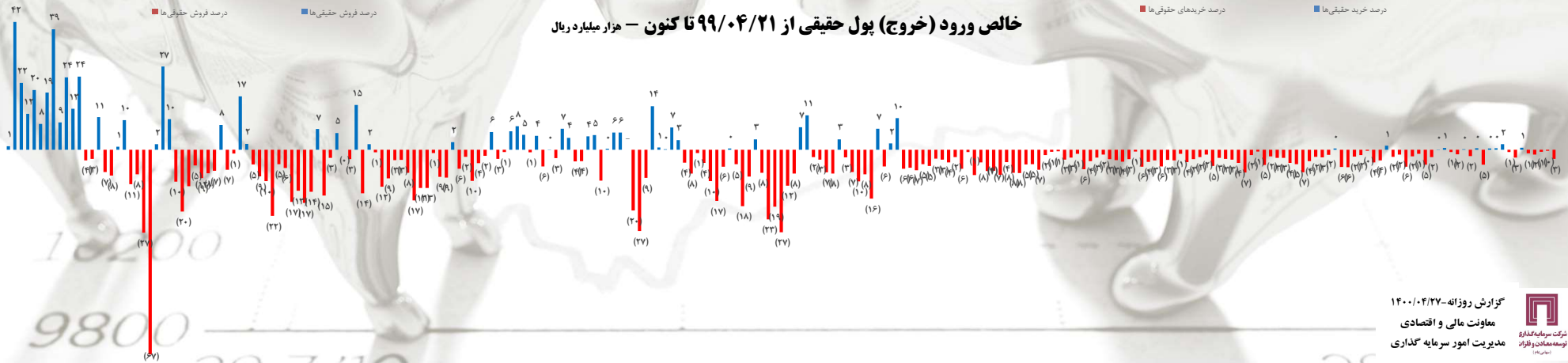
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



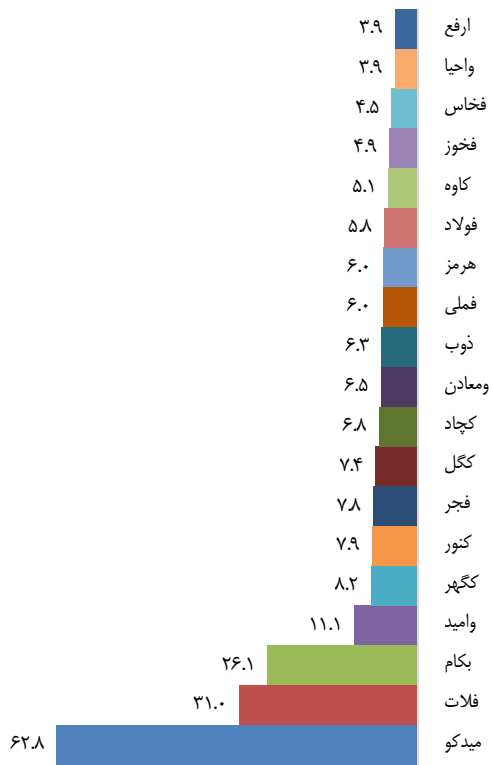
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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

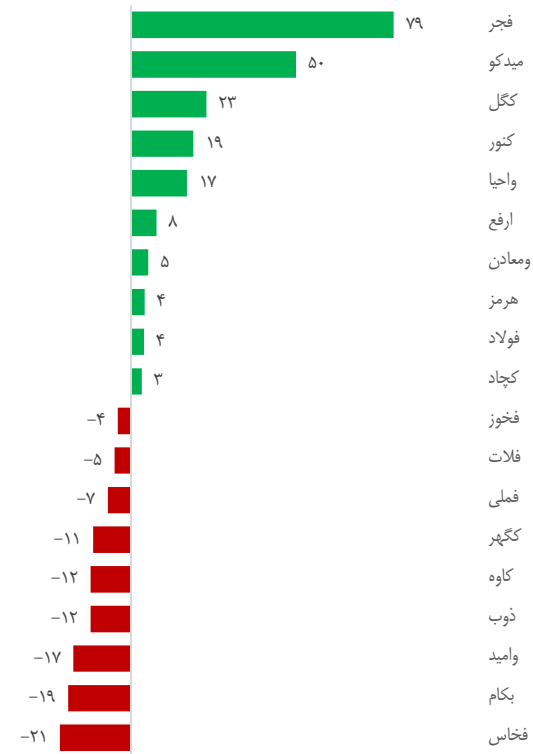


P/E تحلیلی



نام شرکت	عملکرد معاملات سهام پرتفوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا					
	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			نام شرکت
	۱۴۰۰	۱۳۹۹	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	
توسعه معادن و فلزات	۱,۵۱۷	۸۸۱	۰.۰	۹,۸۰۰	متوقف به دلیل بررسی وضعیت اطلاعاتی ناشر	
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۵۲۳	۱,۹۰۳	(۱.۵)	۱۸,۵۵۰	۱۱۲,۲۸۶	۶,۰۶۲,۱۰۴
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۶۷۸	۳,۰۸۰	(۰.۴)	۲۴,۹۴۰	۶۹,۷۱۰	۲,۸۰۱,۸۹۶
سنگ آهن گهرزمین	۴,۹۱۶	۱,۷۳۱	(۰.۸)	۴۱,۷۱۸	۳۶,۰۴۳	۸۷۹,۶۸۸
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۷,۴۰۰	۷,۴۳۸	۰.۰	۵۸,۳۱۰	متوقف به دلیل عدم رعایت ضوابط افشای اطلاعات	
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	(۰.۱)	۱۰,۵۰۰	۸,۶۱۰	۸۳۰,۰۸۱
ملی صنایع مس ایران	۲,۰۵۰	۱,۳۰۲	(۰.۸)	۱۲,۶۵۰	۱,۱۱۴,۷۷۳	۸۸,۱۰۶,۱۶۲
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۷۳۹	۲,۱۶۳	(۰.۲)	۱۴,۴۷۶	۲۴,۷۳۱	۱,۷۱۳,۸۰۸
فولاد خراسان	۴,۹۴۳	۲,۰۵۷	(۰.۹)	۲۲,۴۸۰	۱۸,۲۴۱	۸۴۲,۳۳۰
فولاد امیرکبیرکاشان	۴,۷۴۴	۴,۷۳۶	(۴.۷)	۳۶,۸۳۰	۳۲۰,۶۷۲	۸,۷۰۷,۷۱۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(۰.۰)	۱۴,۸۰۸	۱۴	۱,۰۰۰
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۰۷	۱۰۳	(۴.۷)	۲,۷۹۶	۵۹,۵۷۲	۲۱,۳۰۴,۴۲۰
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	(۱.۶)	۱۰,۴۹۰	۱,۰۱۰,۰۹۷	۹۶,۲۶۰,۱۴۲
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۲۳۳	(۲.۱)	۱۴,۹۷۰	۲۵۱,۷۰۰	۱۶,۸۱۵,۱۹۸
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۵۵۲	۲,۰۸۱	(۰.۶)	۱۵,۲۵۵	۳۶,۴۳۶	۲,۴۱۸,۴۷۱
فولاد کاوه جنوب کیش	۳,۸۱۴	۲,۲۹۶	(۱.۰)	۱۹,۶۸۰	۵۳,۸۱۳	۲,۷۸۳,۸۰۴
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	(۰.۱)	۱۷۰,۳۷۵	۱۲۱,۸۱۹	۷۱۵,۰۰۴
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۷۳۲	۶۶۰	۲.۴	۴۶,۵۵۰	۵۰۸,۳۹۵	۱۰,۹۲۱
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	(۱.۶)	۳,۶۰۷	۲۱۱,۲۸۰	۵۸,۵۶۸,۰۶۳

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

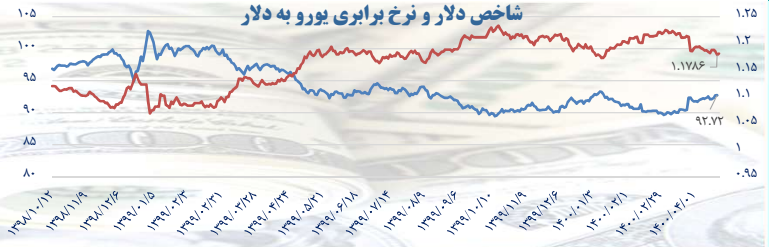
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

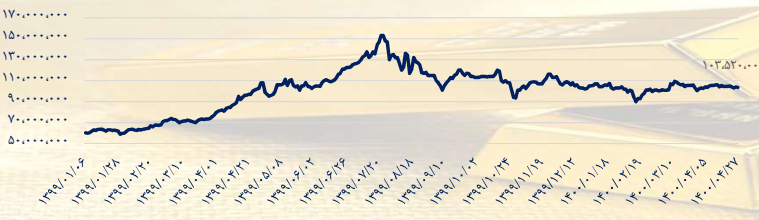
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برابری یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



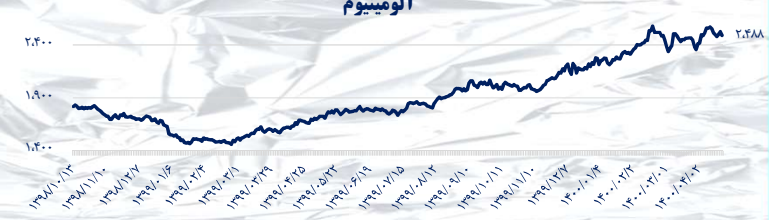
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



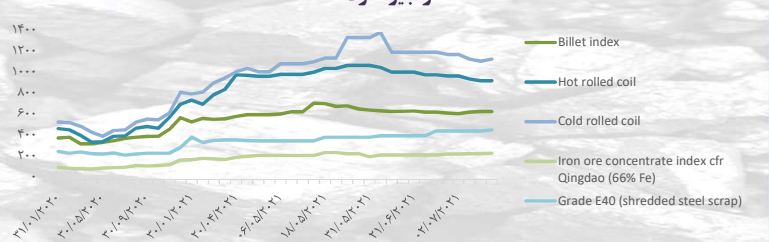
آلومینیوم



شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



• به منظور ابهام در اطلاعات با اهمیت منتشر شده توسط ناشر، نماد معاملاتی شرکت حداکثر به مدت ۲ روز کاری متوقف می‌گردد.

کنور



داده‌های رسمی نشان داد که تورم منطقه یورو که در ماه‌های ابتدایی ۲۰۲۱ در حال شتاب گرفتن بود در ماه ژوئن افت کرده، در حالی که مازاد تجاری این منطقه در ماه می با کاهش صادرات مواجه بوده است.



اقتصاددانان پیش‌بینی کرده‌اند که صادرات ژاپن تحت تأثیر رشد تقاضای جهانی برای کالاهای بخش ماشین‌آلات و تکنولوژی، در ماه ژوئن ۴۶/۲ درصد نسبت به سال قبل جهش خواهد کرد که این چهارمین رشد ماهانه متوالی دو رقمی آن خواهد بود.



فعالیت‌های وارداتی برای مس کاتد در چین با توجه به بهبود فرصت آربیتراژ بین لندن و بازارهای آتی شانگهای، افزایش پیدا کرده است. موجودی مس در شانگهای برای هشتمین هفته متوالی کاهش پیدا کرد.



منابع بلوکه شده ایران که احتمالاً قرار است با تمدید ۹۰ روزه معافیت از تحریم آزاد شود، به گفته برخی منابع آگاه حدود ۱۵ میلیارد دلار است.

