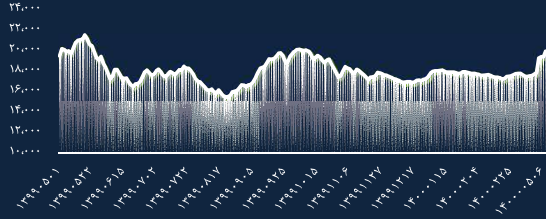


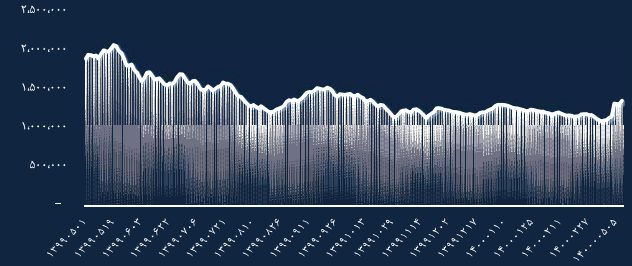
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۰/۰۵/۱۴۰۰

شاخص کل فرابورس

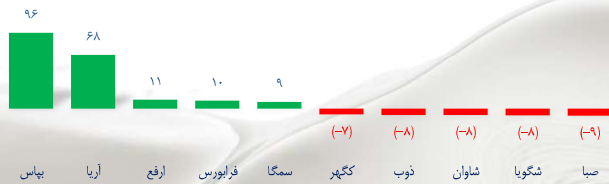


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۹۵۸	۱,۳۶۰,۲۸۱	
۱۱,۰۰۰,۳۰۲.۳۲۲ B	۵۴,۷۹۵,۷۰۷.۹۰۳ B	ارزش بازار
۱۶۴	۸,۷۸۱	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۰.۸۳	۰.۶۵	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۲۷,۱۹۹.۸۶۷ B	۶۲,۱۷۳.۵۶۱ B	ارزش معاملات

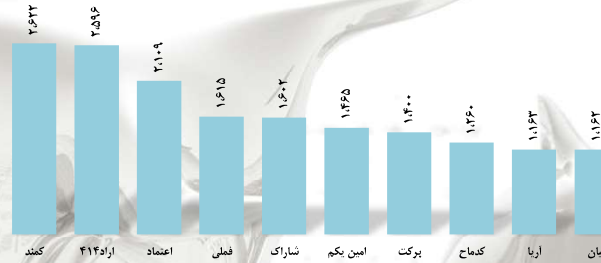
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



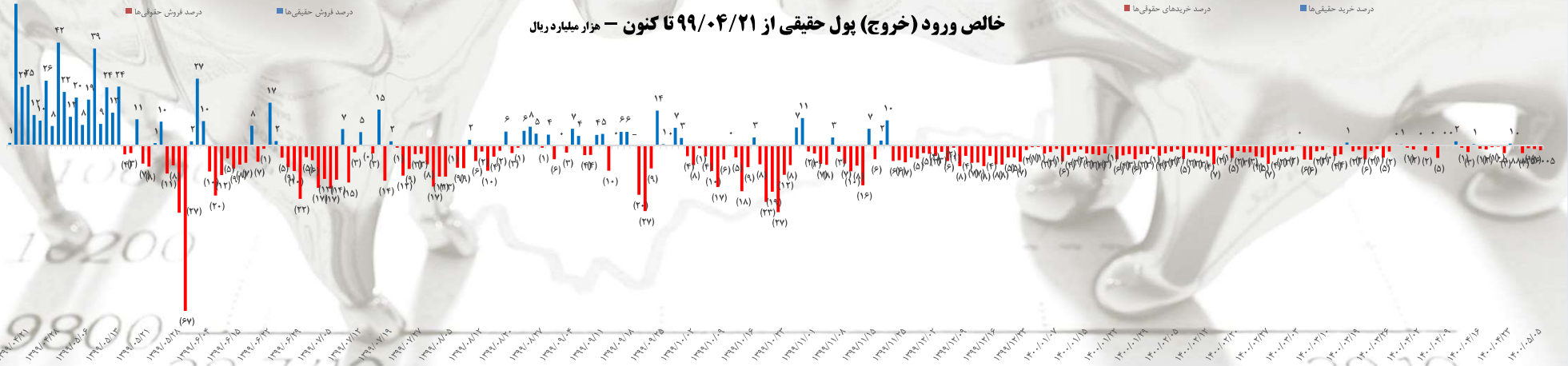
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



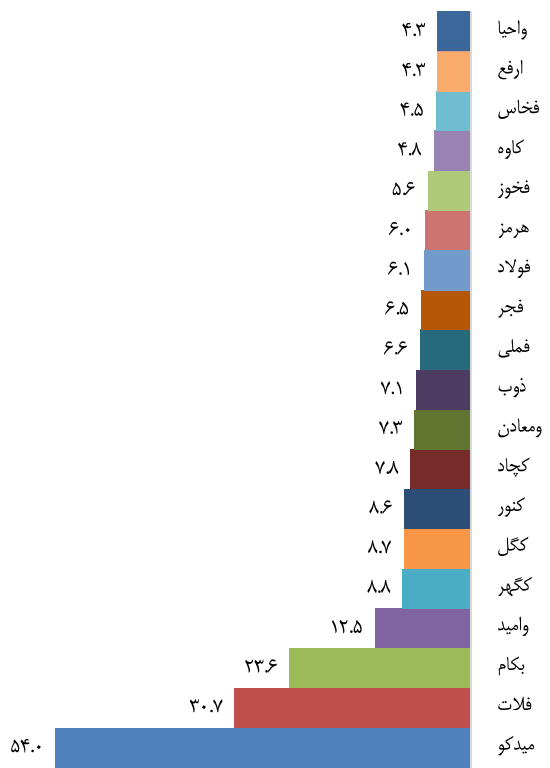
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



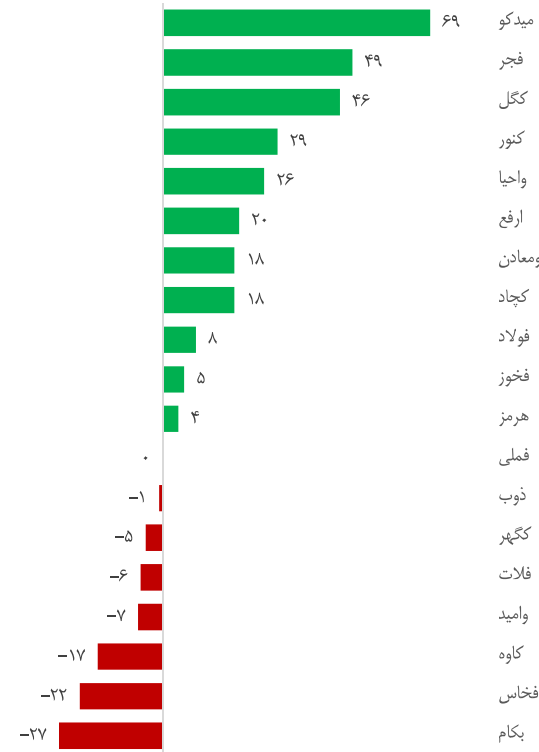
P/E تحلیلی



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

نام شرکت	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			
	۱۳۹۹	۱۴۰۰	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	حجم معاملات
توسعه معادن و فلزات	۸۸۱	۱,۵۱۷	۱.۳	۱۱,۰۳۰	۵۱۱,۱۳۶	۴۶,۳۶۱,۰۰۹
معدنی و صنعتی گل گهر	۱,۹۰۳	۲,۵۲۳	۰.۶	۲۲,۰۲۰	۳۳۹,۳۶۴	۱۵,۴۰۸,۶۹۸
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۰۸۰	۳,۶۷۸	(۰.۱)	۲۸,۶۱۰	۲۶۶,۴۰۲	۹,۳۰۹,۸۸۲
سنگ آهن گهرزمین	۱,۷۳۱	۴,۹۱۶	(۰.۴)	۴۴,۹۶۲	۹۱,۳۱۴	۲,۰۳۳,۵۱۰
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۷,۴۳۸	۷,۴۰۰	۲.۳	۶۳,۵۸۰	۲۱۴,۱۱۷	۳,۳۶۷,۹۰۵
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۷۹۶	۹۴۹	۰.۹	۱۱,۸۸۰	۹۶,۱۹۵	۸,۰۷۴,۲۲۳
ملی صنایع مس ایران	۱,۳۰۲	۲,۰۵۰	۰.۴	۱۳,۵۹۰	۱,۶۱۵,۰۹۴	۱۱۸,۸۵۸,۵۰۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۲,۱۶۳	۳,۷۳۹	۳.۶	۱۶,۰۸۰	۲۴۰,۷۳۳	۱۴,۹۷۰,۸۴۲
فولاد خراسان	۲,۰۵۷	۴,۹۴۳	۴.۶	۲۲,۴۴۰	۱۳۹,۲۴۵	۶,۳۰۵,۶۲۲
فولاد امیرکبیرکاشان	۴,۷۳۶	۴,۷۴۴	(۵.۰)	۳۰,۶۱۰	۶۹۱,۶۸۲	۲۲,۵۹۵,۸۳۷
گروه صنایع معادن فلات ایرانیا	۳۶۵	۴۷۵	(۰.۳)	۱۴,۶۶۵	۱,۰۸۵	۷۵,۹۹۶
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۰۳	۱۰۷	(۲.۱)	۲,۵۲۲	۴۴,۵۲۵	۱۷,۶۵۲,۰۴۱
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۲۵۸	۱,۷۳۵	-	۱۰,۹۵۰	متوقف - برگزاری مجمع عمومی عادی	
فولاد خوزستان	۲,۲۳۳	۲,۹۳۵	(۰.۳)	۱۶,۴۴۰	۲۶۲,۷۱۵	۱۵,۹۷۷,۶۳۸
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۰۸۱	۲,۵۵۲	(۰.۱)	۱۵,۲۳۱	۹۰,۳۰۱	۵,۹۲۴,۶۱۴
فولاد کاوه جنوب کیش	۲,۲۹۶	۳,۸۱۴	(۰.۴)	۱۸,۴۳۰	۲۳۶,۱۴۲	۱۲,۸۱۰,۰۵۹
م. صنایع و معادن احیاء سیاهان	۲۰,۸۷۰	۴۱,۶۱۰	۱.۶	۱۸۳,۹۵۶	۲۶۶,۰۱۵	۱,۴۴۶,۰۸۰
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۶۶۰	۷۳۲	۴.۷	۳۹,۵۶۰	۴۹۱,۷۳۱	۱۲,۴۲۸,۴۷۶
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۴۵	۵۷۴	(۱.۸)	۴۰,۶۳	۴۸۱,۶۶۴	۱۱۸,۵۵۲,۹۷۲

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 کوه 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(۰.۰۰۹۰,۰.۰۵۵)	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 کوه 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

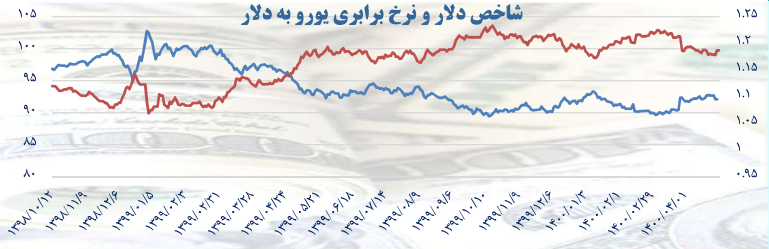
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



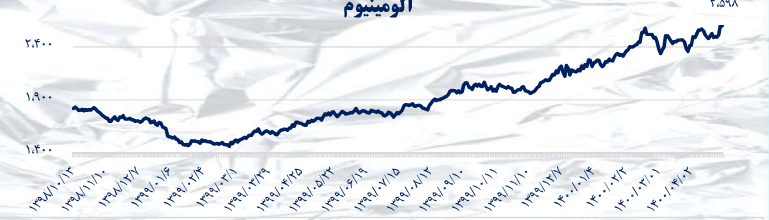
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



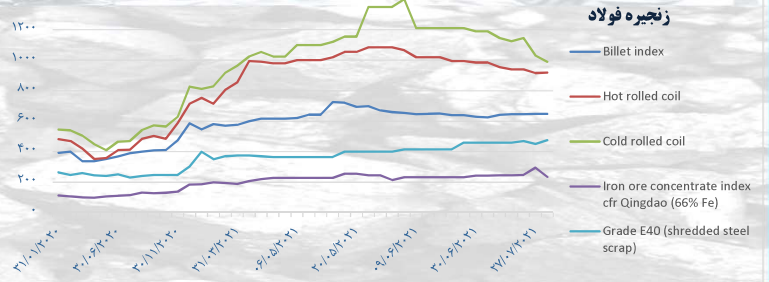
آلومینیوم



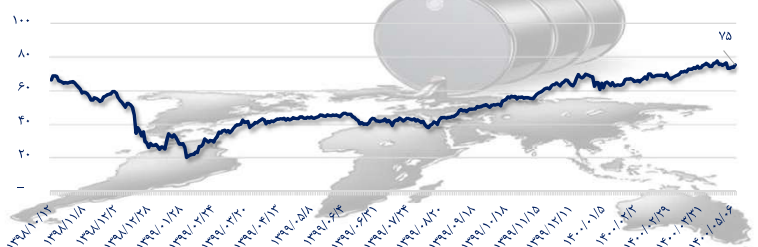
شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



آگهی های کدال

■ معادن بازار: مجمع صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه معادن و فلزات آرمان جهت تصمیم‌گیری در خصوص تصویب تغییرات در امیدنامه صندوق (هزینه‌های صندوق) در ۲۴ مرداد برگزار می‌شود.

اخبار روز:

- شاخص مدیران خرید PMI حوزه تولید چین برای ماه جولای رقم ۵۰/۴ را نشان می‌دهد که کمتر از ۵۰/۸ انتظار اقتصاددانان و ۵۰/۹ ماه قبل (ژوئن) بوده و برای چهارمین ماه متوالی نزولی است. این موضوع باعث خواهد شد تا بانک مرکزی چین سیاست‌های مقابله را رکود را افزایش داده و با افزایش وام دهی بانک‌ها (سیاست انبساطی) و توسعه طرح‌های مسکن و زیرساخت چین در این مسیر حرکت کند که خبر خوبی برای حوزه کامودیتی است.
- تامین جهانی مس به خطر افتاد: کارگران بزرگترین معدن مس جهان با رد پیشنهاد نهایی گروه بی‌اچی در خصوص دستمزد، به اعتصاب رای دادند که نگرانی‌هایی در خصوص تامین جهانی این فلز ارزشمند را برخواهد انگیخت. همین اتحادیه کارگری که اکنون خواستار سهم بزرگتری از درآمد مس است، بازار را در سال ۲۰۱۷ با توقف ۴۴ روزه کار بهم ریخت.
- وزیر صنعت و معدن و تجارت طی نامه ای به دولت، عوارض صادراتی مواد معدنی و محصولات فولادی را تا پایان سال ۱۴۰۰ پیشنهاد داد که عمدتاً با افزایش قابل ملاحظه همراه بود. برخی از اقلام پیشنهادی به شرح زیر است:

کالا	نرخ عوارض فعلی (درصد)	نرخ عوارض پیشنهادی (درصد)
سنگ آهن هماتیت	۲۵	۳۵
سنگ آهن مگنتیت ۶۰٪ به بالا	۲۵	۵۵
سنگ آهن مگنتیت ۴۰٪-۶۰٪	۲۵	۴۰
کنسانتره آهن	۲۵	۷۰
گندله آهن	۲۵	۴۵
آهن اسفنجی	۱۰	۳۵
محصولات تخت نورد شده	۰	۱۰

- تولید ۴۰ درصدی فولاد فقط با ۲ هزارمگاوات ساعت برق: انجمن تولیدکنندگان فولاد ایران طی نامه‌ای به وزیر صمت برنامه پیشنهادی خود برای تولید در زنجیره فولاد در شرایط اضطراری کمبود برق را ارائه داد. طبق این برنامه با اختصاص ۲ هزار مگاوات ساعتی که وزارتخانه‌های نیرو و صمت وعده تأمین آن را داده‌اند، تولید ۴۰ درصدی با اشتغال حدود ۹۰ درصدی در زنجیره فولاد برقرار خواهد شد. این پیشنهاد جهت تولید حداقلی و متوازن در زنجیره فولاد، برای رشته‌های مختلف این زنجیره به شرح زیر برنامه تولیدی ارائه داده است:

کنسانتره	تولیدمستمر با ۵۰ درصدتوان مصرفی
گندله	تولیدمستمر با ۵۰ درصدتوان مصرفی
آهن اسفنجی	تولیدمستمر با ۶۰ درصدتوان مصرفی
اسلب	تولیدمستمر با ۵۰ درصدتوان مصرفی
شمش به روش قوس الکتریکی	گروه A از بامدادروز جمعه تا ساعت ۱۱ روزدوشنبه
	گروه B از ساعت ۱۱ روزدوشنبه تا ساعت ۱۲ شب پنجشنبه
شمش به روش القایی	گروه A از بامدادروز جمعه تا ساعت ۱۱ روزدوشنبه
	گروه B از ساعت ۱۱ روزدوشنبه تا ساعت ۱۲ شب پنجشنبه
مقاطع تخت فولادی	تولید مستمر باتوان مصرفی
مقاطع طولیل فولادی	تولید باتوان مصرفی از ساعت ۱۱ شب تا ۱۱ صبح (روزهای شنبه تا چهارشنبه)
	تولید مستمر باتوان مصرفی در تمام ساعت شبانه روز (روزهای پنجشنبه و جمعه)