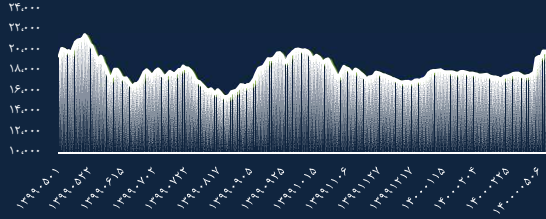


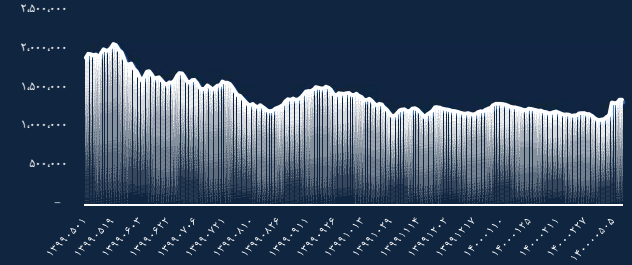
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۵/۱۲

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل فرابورس



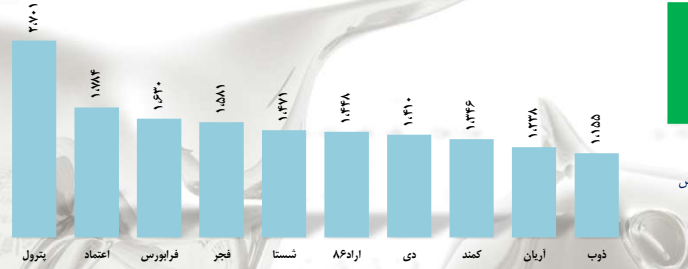
فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۳۸۱,۴۲۹	۱,۳۷۵,۶۱۲	۳۰.۵۲۴B
۳۰,۶۱۲.۴۵۱B	۵۵,۴۱۱,۴۰۹.۴۵۷B	۱۷,۷۱۶
#VALUE!	۱.۳۰	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۴۷,۲۹۶.۴۴۵B		درصد تغییر نسبت به روز گذشته
اعتبار و توقف نماد معاملاتی (تسه ۸۰۵)		ارزش معاملات



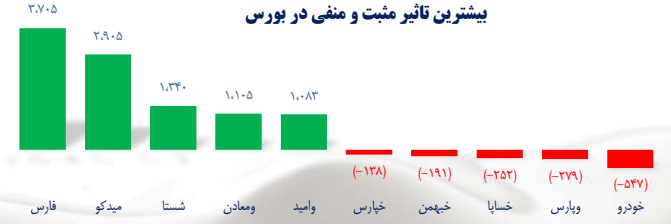
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



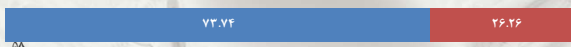
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



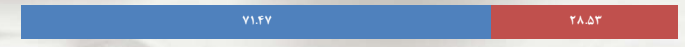
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



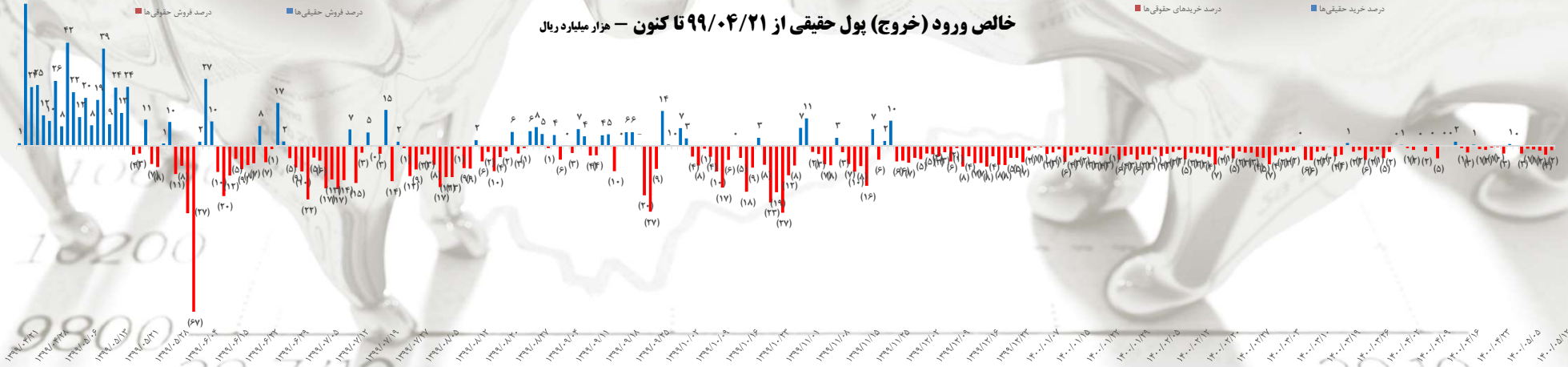
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



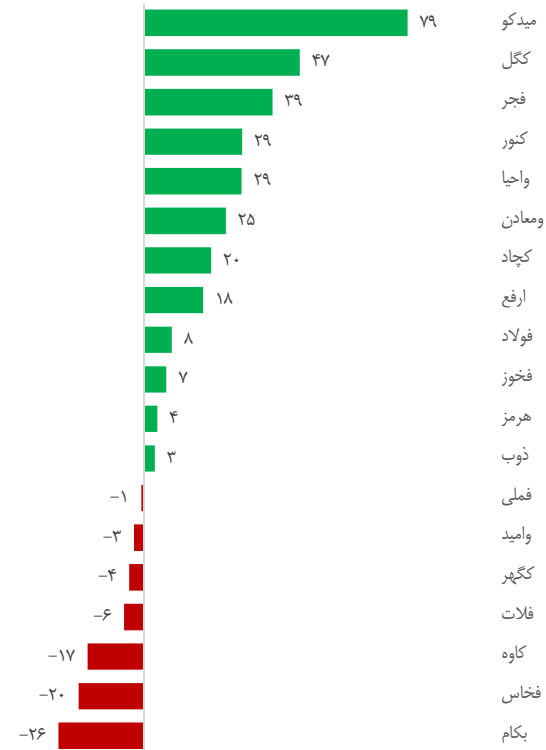
P/E تحلیلی



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

نام شرکت	EPS کارشناسی		وضعیت سهام			
	۱۴۰۰	۱۳۹۹	نوسان روزانه	قیمت پایانی	ارزش معاملات	حجم معاملات
توسعه معادن و فلزات	۱,۵۱۷	۸۸۱	۴.۸	۱۱,۶۱۰	۸۴۹,۴۴۹	۷۳,۱۳۹,۸۳۶
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۵۲۳	۱,۹۰۳	۰.۸	۲۲,۲۲۰	۲۱۰,۱۸۴	۹,۴۵۹,۷۶۶
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۶۷۸	۳,۰۸۰	۲.۷	۲۹,۰۶۰	۲۰۹,۵۹۲	۷,۲۱۱,۵۹۴
سنگ آهن گهرزمین	۴,۹۱۶	۱,۷۳۱	۰.۲	۴۴,۹۹۶	۲۶۶,۷۲۱	۵,۹۲۷,۶۸۹
توسعه معدنی و صنعتی صابونر	۷,۴۰۰	۷,۴۳۸	۰.۰	۶۳,۵۸۰	متوقف - برگزاری مجمع عمومی	
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۹۴۹	۷۹۶	۳.۸	۱۲,۳۲۰	۲۱۱,۰۶۱	۱۷,۱۲۹,۸۲۲
ملی صنایع مس ایران	۲,۰۵۰	۱,۳۰۲	۱.۴	۱۳,۴۹۰	۸۳۳,۳۳۰	۶۱,۷۷۵,۰۷۵
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۷۳۹	۲,۱۶۳	۰.۲	۱۵,۸۳۹	۴۵,۹۲۷	۲,۸۹۶,۵۹۹
فولاد خراسان	۴,۹۴۳	۲,۰۵۷	۱.۰	۲۲,۹۶۰	۴۱,۲۶۰	۱,۷۶۸,۷۵۴
فولاد امیرکبیرکاشان	۴,۷۴۴	۴,۷۳۶	(۱.۹)	۲۸,۵۲۰	۱,۵۸۱,۲۱۹	۵۵,۴۴۹,۵۲۹
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۷۵	۳۶۵	(۰.۰)	۱۴,۶۴۶	۲۸	۱,۹۳۶
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۰۷	۱۰۳	۲.۹	۲,۵۶۱	۵۳,۳۸۴	۲۰,۸۴۸,۷۳۹
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۷۳۵	۱,۲۵۸	-	۱۰,۹۵۰	متوقف - برگزاری مجمع عمومی	
فولاد خوزستان	۲,۹۳۵	۲,۲۳۳	۱.۸	۱۶,۶۵۰	۵۵۸,۸۹۴	۳۳,۵۷۴,۲۰۳
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۵۵۲	۲,۰۸۱	(۱.۲)	۱۵,۲۴۰	۸۹,۶۹۰	۵,۹۱۲,۳۸۱
فولاد کاوه جنوب کیش	۳,۸۱۴	۲,۲۹۶	(۰.۳)	۱۸,۴۰۰	۱۹۸,۰۳۵	۱۰,۷۶۱,۷۱۵
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۱,۶۱۰	۲۰,۸۷۰	۲.۶	۱۸۸,۷۲۷	۵۱۲,۶۲۲	۲,۷۱۶,۰۵۸
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۷۳۲	۶۶۰	۴.۹	۴۱,۹۹۰	۳۳۶,۵۹۱	۸۰,۱۵,۶۲۳
سهامی ذوب آهن اصفهان	۵۷۴	۲۴۵	۴.۵	۴,۲۴۱	۱,۱۵۵,۳۳۹	۲۷۲,۳۹۷,۵۳۴

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		
۰.۰۹	-۰.۲۱	-۰.۱۴	معدنی و صنعتی چادرملو	Std(۰.۱۰۲,۰.۱۴۸)	High Risk
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		
۰.۱۳	-۰.۱۳	-۰.۱۰	فولاد خوزستان	Std(۰.۱۰۲,۰.۱۴۸)	High Risk
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

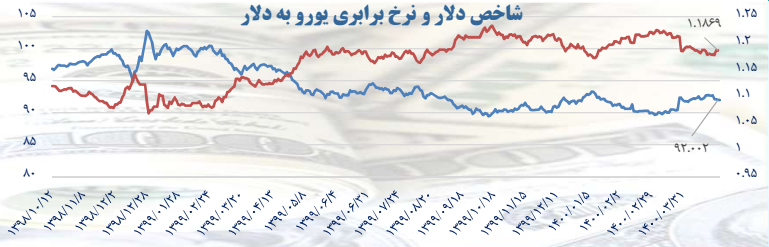
آخرین نرخ کامودیتی ها

داخلی

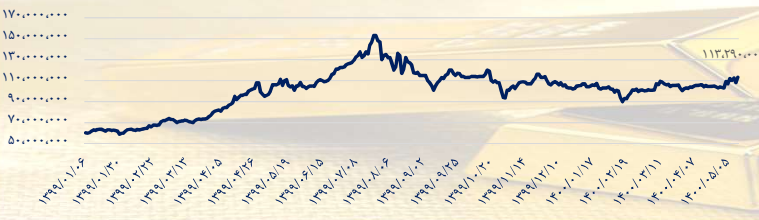
نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برای یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



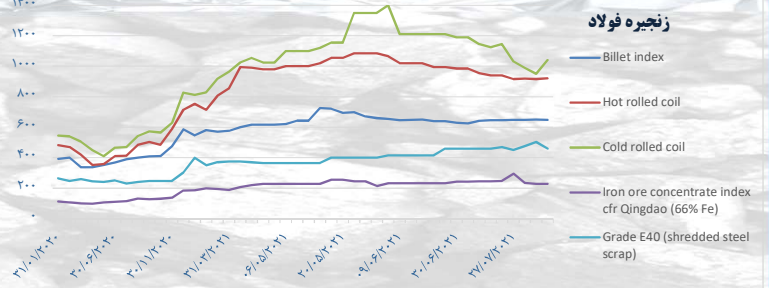
آلومینیوم



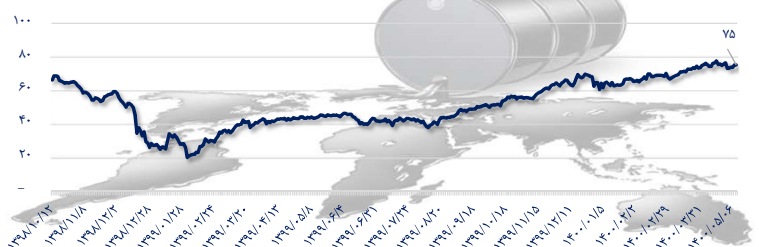
شمش فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



آگهی های کدال

▪ فولاد: در مجمع عمومی عادی سالیانه خود ۴۰۰ ریال سود تقسیم نمود که معادل ۳۰/۶٪ سود هر سهم است.

اخبار روز:

- شاخص قیمت زغالسنگ در بازار داخلی چین Shanxi دیروز یک پرواز ۱۲/۸٪ داشت و به ۴۱۲ دلار در هر تن رسید که بالاترین سطح تاریخ است. بروز سیل و بدی آب و هوا مانع حمل زغالسنگ شده و وضعیت عرضه را بدتر از گذشته کرده است. تقاضا از سمت واحدهای کک سازی بالا گزارش شده و مارجین آنها فعلا مطلوب است. واردات از استرالیا نیز فعلا محدود بوده که بر التهاب بازار افزوده است.
- از مجموع ۷۴ شرکت بورسی فعال در زنجیره معدن و صنایع معدنی، ۴۷ شرکت شاهد افت فروش ماه به ماه بوده‌اند که علیرغم رشد دلار رخ داده است. فروش ۷۴ شرکت زنجیره معدن و صنایع معدنی بورسی در تیرماه ۱۴۰۰ به ۴۵ هزار میلیارد تومان رسیده که با وجود رشد ۱۱۲٪ سالانه، کاهش ۱۸٪- نسبت به خردادماه داشته که معادل ۱۰ هزار میلیارد تومان و یا ۴۵۰ میلیون دلار است. در ماه گذشته، عرضه به بازار عمدتا از محل موجودی انبارها بوده که عملا خالی شده است. لذا انتظار می‌رود در صورت تداوم محدودیت برق، عملکرد مرداد ۱۴۰۰ با افت بیشتری نسبت به تیرماه مواجه شود و شوک‌های قیمتی به بازار را افزایش دهد که بعضا تا پایان سال و پس از اتصال برق باقی خواهد ماند.
- آمار گمرک ایران نشان می‌دهد که در خردادماه ۱۴۰۰ به میزان ۳۹ میلیون دلار صادرات آهن اسفنجی از کشور صورت گرفته (حدود ۲۰۱ هزار تن) که بالاترین سطح تاریخ است. انتظار می‌رود با تشدید بحران کمبود برق در تیرماه و مرداد، شاهد روند افزایشی خروج آهن اسفنجی از کشور باشیم. اما افزایش عوارض صادرات این محصول از سوی دولت از ۱۰٪ به ۳۵٪ می‌تواند بعنوان عامل محدودکننده صادرات و توقف خط تولید واحدهای احیا تفسیر شود.
- امروز پس از ۴۰ روز عدم عرضه شمش فولادی در بورس کالا شاهد معامله بیش از ۹۷ هزار تن تن بیلت و بلوم فولادی SP5 با متوسط قیمت ۱۳،۸۰۰ تومان در هر کیلو بودیم. امروز هر کیلو شمش فخوز با قیمت ۱۴،۲۶۱ تومان معامله شد که نسبت به آخرین معامله در اول تیرماه، رشد ۸٪+ داشته است:

آمار معاملات بورس کالا روی شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5

نام کالا	تولید کننده	حجم معامله (تن)	قیمت (ریال/کیلو)	ارزش معامله (هزار ریال)
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	آهن و فولاد ارفع	۱۵،۰۰۰	۱۴۴،۸۹۵	۲،۱۷۳،۴۲۴،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	فولاد خوزستان	۱۵،۰۰۰	۱۴۲،۶۰۹	۲،۱۳۹،۱۲۹،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	جهان فولاد سیرجان	۱۵،۰۰۰	۱۳۲،۵۴۳	۱،۹۸۸،۱۴۴،۷۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	فولاد کاوه جنوب کیش	۱۲،۰۰۰	۱۳۵،۶۵۳	۱،۶۲۷،۸۳۶،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	فولاد سیرجان ایرانیان	۸،۵۰۰	۱۳۵،۱۴۴	۱،۱۴۸،۷۲۴،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد	۸،۰۰۰	۱۳۵،۶۵۳	۱،۰۸۵،۲۲۴،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	فولاد کاوه جنوب کیش	۸،۰۰۰	۱۳۵،۶۵۳	۱،۰۸۵،۲۲۴،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	فولاد سیرجان ایرانیان	۶،۵۰۰	۱۳۵،۱۴۴	۸۷۸،۴۳۶،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	مجتمع صنعتی ذوب آهن پاسارگاد	۴،۰۰۰	۱۳۵،۶۵۳	۵۴۲،۶۱۲،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	شرکت فولاد زرند ایرانیان	۲،۰۰۰	۱۴۳،۰۰۹	۲۸۶،۰۱۸،۰۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	مجتمع ذوب آهن و نورد کرمان	۱،۰۰۰	۱۴۰،۳۳۵	۱۴۰،۳۳۴،۸۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	فولاد کویر دامغان	۸۰۰	۱۴۴،۴۲۶	۱۱۵،۵۴۱،۰۲۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	گسترش خدمات آتیه اندیشان سپهر شرق	۵۰۰	۱۴۶،۲۳۰	۷۳،۱۱۴،۸۲۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	غلتنک سازان سپاهان	۵۰۰	۱۴۴،۳۶۹	۷۲،۱۸۴،۵۰۰
شمش بلوم (۱۵۰*۱۵۰) SP5	پردیس صنعت زنده رود	۵۰۰	۱۴۴،۲۰۴	۷۲،۱۰۱،۹۰۰
جمع		۹۷،۳۰۰	۱۳۸،۰۰۷	۱۳،۴۲۸،۰۴۸،۷۴۰