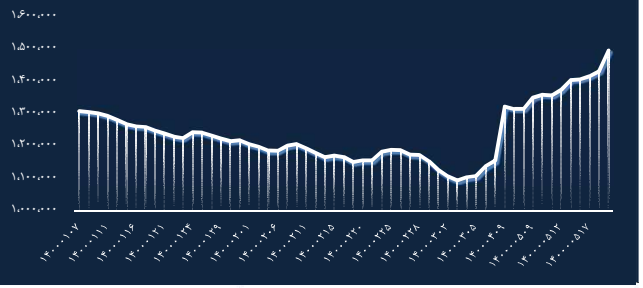
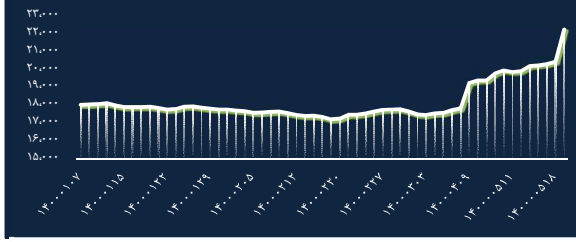
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۶/۲۳

	بورس	فرابورس
مقدار شاخص	۱,۴۹۶,۹۵۵	۲۲,۲۴۶
ارزش بازار	۶۰,۰۲۸,۱۳۰.۲۵۳ B	۱۲,۳۸۸,۷۴۴.۲۰۳ B
مقدار تغییر نسبت به روز گذشته	۲۱,۷۳۰	۱۱۶
درصد تغییر نسبت به روز گذشته	۱.۴۷	۰.۵۲
ارزش معاملات	۶۱,۴۵۷.۱۷۵ B	۱۶۵,۷۵۲.۱۶۳ B

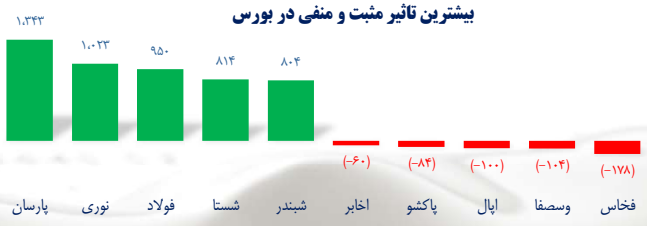
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



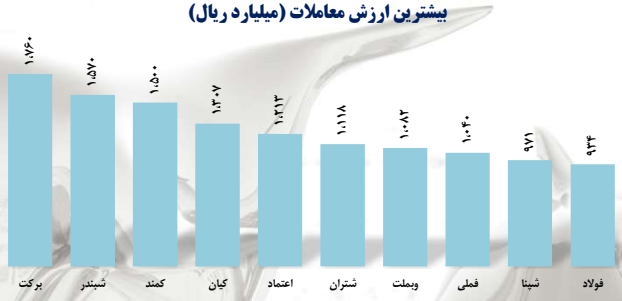
شاخص کل فرابورس



بیشترین تاثیر مثبت و منفی در بورس

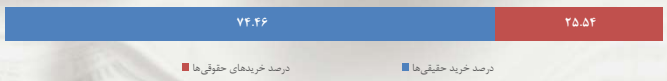


بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



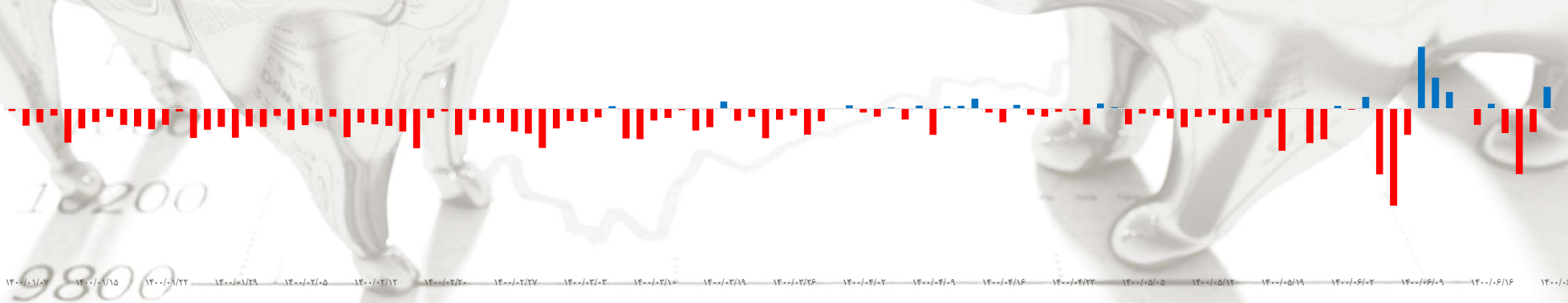
بیشترین تاثیر مثبت و منفی در فرابورس

سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

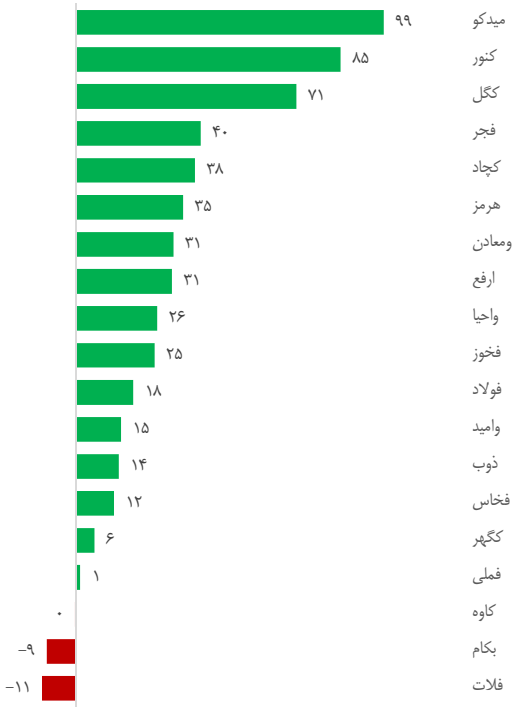
خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۹۹/۰۴/۲۱ تا کنون — هزار میلیارد ریال



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

نام شرکت	وضعیت سهام				EPS کارشناسی	
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه‌معادن‌وفلزات	۱۰,۲۱۵,۴۹۹	۱۱۴,۴۵۰	۱۱,۲۰۰	۲.۴	۱,۱۲۵	۱,۶۶۴
معدنی و صنعتی گل گهر	۵,۱۳۲,۳۶۲	۱۲۲,۳۷۳	۲۳,۸۴۰	۰.۸	۱,۹۰۳	۲,۵۲۳
معدنی‌وصنعتی‌چادرملو	۴,۴۸۸,۴۱۶	۱۳۶,۳۷۷	۳۰,۳۸۰	۱.۲	۳,۰۸۰	۳,۶۷۸
سنگ آهن گهرزمین	۵۱۸,۵۴۷	۲۵,۳۴۱	۴۸,۶۰۰	۰.۲	۱,۷۳۱	۴,۹۱۶
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۱۰,۷۶۴,۰۳۷	۲۱۰,۸۹۱	۱۹,۵۹۰	۲.۲	۷,۴۳۸	۱,۷۰۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۳,۶۸۹,۲۷۳	۴۸,۳۱۲	۱۳,۱۲۰	(۰.۱)	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۷۸,۷۲۶,۶۵۶	۱,۰۴۰,۳۹۱	۱۳,۲۲۰	۰.۷	۱,۳۰۲	۲,۰۵۰
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۸۱۴,۸۸۲	۶۵,۰۳۶	۱۷,۰۳۹	۰.۲	۲,۱۶۳	۳,۷۳۹
فولاد خراسان	۲,۲۳۸,۸۰۵	۶۶,۰۵۸	۲۹,۷۶۰	(۲.۰)	۲,۰۵۷	۴,۹۴۳
فولاد امیرکبیر کاشان	۷,۱۶۴,۶۳۱	۲۰۶,۱۷۹	۲۸,۷۸۰	۴.۸	۴,۷۳۶	۴,۷۴۴
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۸۵۴,۴۸۴	۱۱,۸۱۹	۱۳,۸۳۱	۲.۶	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۲,۷۰۹,۰۲۱	۳۹,۱۰۳	۳,۰۷۷	۱.۸	۱۰۳	۱۰۷
فولاد مبارکه اصفهان	۸۲,۶۳۸,۷۶۷	۹۳۴,۴۰۹	۱۱,۳۱۰	۱.۲	۱,۲۵۸	۱,۷۳۵
فولاد خوزستان	۱۱,۵۹۴,۷۵۱	۲۱۱,۳۹۱	۱۸,۲۳۰	۱.۷	۲,۲۳۳	۲,۹۳۵
فولاد هرمزگان جنوب	۱۳,۵۹۶,۹۹۳	۲۵۵,۱۲۴	۱۸,۷۶۳	۴.۳	۲,۰۸۱	۲,۵۵۲
فولاد کاوه جنوب کیش	۸,۴۳۸,۴۷۶	۱۷۰,۷۴۵	۲۰,۲۳۰	۲.۷	۲,۲۹۶	۳,۸۱۴
م .صنایع و معادن احیاء سپاهان	۶۴۹,۸۹۸	۱۱۹,۴۷۰	۱۸۳,۸۲۹	۲.۵	۲۰,۸۷۰	۴۱,۶۱۰
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۲,۹۶۳,۱۵۴	۱۳۸,۲۳۶	۴۶,۶۵۰	(۰.۰)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۱۱۶,۲۵۰,۷۸۰	۵۲۴,۵۲۸	۴,۵۱۲	۳.۸	۲۴۵	۵۷۴

بازدهی ۱۴۰۰



P/E تحلیلی

بتا

ارزیابی بازده و ریسک سهام معدنی و فلزی از ابتدای سال ۱۴۰۰ تا کنون❄

طبقه بندی	سهام	Ri	Excess Return (Ri-Rf)❄❄	Std❄❄❄
Ri-Rf (-۰.۳۴،-.۲۵)	سهامی ذوب آهن اصفهان	-۰.۳۲	-۰.۳۴	۰.۰۶۷
	توسعه معادن و فلزات	-۰.۲۹	-۰.۳۲	۰.۰۶۲
Ri-Rf (-۰.۲۵،-.۱۶)	فولاد مبارکه اصفهان	-۰.۲۰	-۰.۲۳	۰.۱۱۷
	معدنی و صنعتی چادرملو	-۰.۱۸	-۰.۲۱	۰.۰۹۲
	شرکت آهن و فولاد ارفع	-۰.۱۵	-۰.۱۸	۰.۰۷۳
	معدنی و صنعتی گل گهر	-۰.۱۴	-۰.۱۷	۰.۰۵۲
	فولاد کاوه جنوب کیش	-۰.۱۴	-۰.۱۷	۰.۱۲۳
	ملی صنایع مس ایران	-۰.۱۴	-۰.۱۷	۰.۱۴۸
Ri-Rf(-۰.۱۶،-۰.۰۷)	سنگ آهن گهر زمین	-۰.۱۱	-۰.۱۳	۰.۰۵۰
	فولاد امیر کبیر کاشان	-۰.۱۱	-۰.۱۳	۰.۱۱۵
	فولاد خوزستان	-۰.۱۰	-۰.۱۳	۰.۱۳۳
	فولاد خراسان	-۰.۱۰	-۰.۱۲	۰.۰۳۳
	گروه مدیریت سرمایه‌گذاری امید	-۰.۰۵	-۰.۰۸	۰.۰۰۹
Ri-Rf(-۰.۰۷،۰.۰۱۴)	م. صنایع و معادن احیا سپاهان	-۰.۰۴	-۰.۰۷	۰.۰۹۹
	توسعه معدنی و صنعتی صبا نور	-۰.۰۳	-۰.۰۶	۰.۰۷۵
	فولاد هرمزگان جنوب	۰.۰۰	-۰.۰۳	۰.۰۸۳
	گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۰.۰۰	-۰.۰۲	۰.۰۲۹
Ri-Rf(۰.۰۱۴،۰.۱۰۴)	هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۰.۰۵	۰.۰۳	۰.۰۲۰
	کارخانجات تولیدی شهید قندی	۰.۱۳	۰.۱۰	۰.۰۷۴

سطح	طبقه بندی	سهام	Ri	Excess Return (Ri-Rf)	Std
Low Risk	Std(۰.۰۰۹،۰.۰۵۵)	گروه مدیریت سرمایه‌گذاری امید	-۰.۰۵	-۰.۰۸	۰.۰۱
		هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۰.۰۵	۰.۰۳	۰.۰۲
		گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۰.۰۰	-۰.۰۲	۰.۰۳
		فولاد خراسان	-۰.۱۰	-۰.۱۲	۰.۰۳
		سنگ آهن گهر زمین	-۰.۱۱	-۰.۱۳	۰.۰۵
		معدنی و صنعتی گل گهر	-۰.۰۳	-۰.۱۷	۰.۰۵
Moderate Risk	Std(۰.۱۲۵،۰.۱۰۲)	توسعه معادن و فلزات	-۰.۱۴	-۰.۳۲	۰.۰۶
		سهامی ذوب آهن اصفهان	-۰.۲۹	-۰.۳۴	۰.۰۷
		شرکت آهن و فولاد ارفع	-۰.۳۲	-۰.۱۸	۰.۰۷
		کارخانجات تولیدی شهید قندی	-۰.۱۵	۰.۱۰	۰.۰۷
		توسعه معدنی و صنعتی صبا نور	۰.۱۳	-۰.۰۶	۰.۰۷
		فولاد هرمزگان جنوب	۰.۰۰	-۰.۰۳	۰.۰۸
		معدنی و صنعتی چادرملو	-۰.۱۴	-۰.۲۱	۰.۰۹
		م. صنایع و معادن احیا سپاهان	-۰.۱۸	-۰.۰۷	۰.۱۰
High Risk	Std(۰.۱۰۲،۰.۱۴۸)	فولاد امیر کبیر کاشان	-۰.۰۴	-۰.۱۳	۰.۱۲
		فولاد مبارکه اصفهان	-۰.۱۱	-۰.۲۳	۰.۱۲
		فولاد کاوه جنوب کیش	-۰.۲۰	-۰.۱۷	۰.۱۲
		فولاد خوزستان	-۰.۱۰	-۰.۱۳	۰.۱۳
		ملی صنایع مس ایران	-۰.۱۴	-۰.۱۷	۰.۱۵

❄ 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

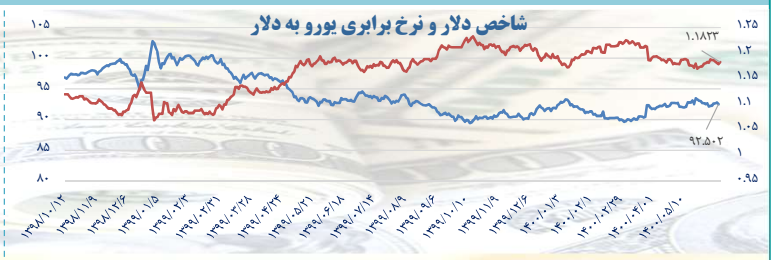
❄❄❄ Standard deviation انحراف معیار بازده یک سهم را طی دوره مذکور نشان می دهد

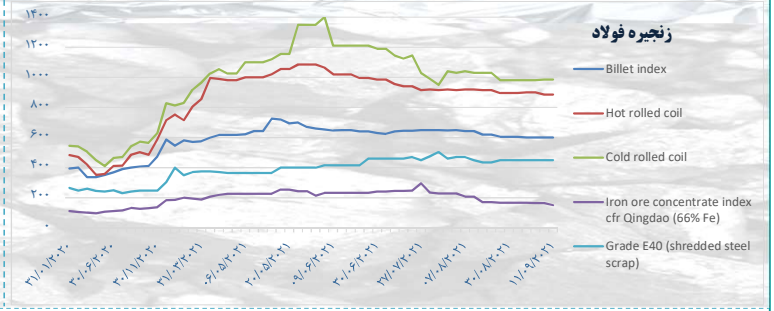
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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 بلعکس در یک سطح معین از بازده، سهامی که ریسک کمتری دارد را انتخاب کرد.

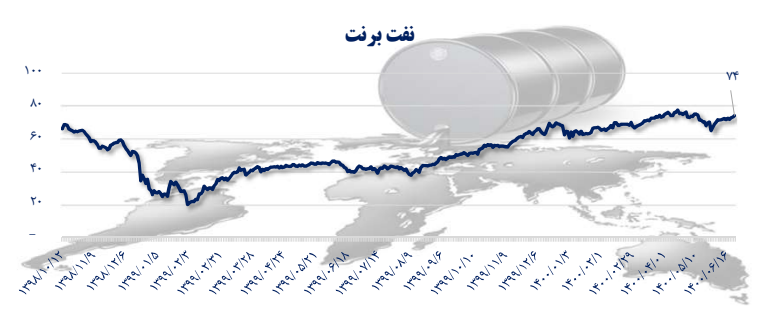
آخرین نرخ کامودیتی ها

جهانی





داخلی



قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	fines (57%-63%)	۸۸.۵ -۱۱۱.۳	(۲-)(۶-)
	lumps (62.5%-63%)	۱۱۶	۶-
برزیل	fines (61%-65%)	۱۱۶.۳-۵۹.۳	۶-
	lumps (62%)	۱۰۹	۶-
	pellets (65.0%)	۱۵۵	۶-
هند	fines (55%-62%)	۲۲.۲-۷۸.۲	(۲-)(۶-)
	pellets (64.0%)	۱۱۸	۶-
ایران	fines (54%-62%)	۳۵.۸-۸۰.۲	(۲-)(۶-)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۱۱۲.۲-۱۲۶.۸	۰
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۱۳۳.۴-۱۴۴.۹	۰
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۳۸.۵-۱۶۵	۰

موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)		موجودی	تغییر هفتگی	ظرفیت
بنادر	Qingdao	۲۰,۶۷۰	۵۶۰	۲۱,۰۰۰
	Tianjin	۱۰,۶۰۰	۱۰۰	۱۵,۵۰۰
	Caofeidian	۱۲,۳۰۰	-۳۵۰	۲۳,۰۰۰
	Total	۱۳۰,۶۱۰	-۷۵۰	۲۳۶,۲۰۰

S&P Global : مذاکرات قرارداد مقاطع تخت فولادی آمریکا برای سال ۲۰۲۲ به کندی پیش می رود چراکه کارخانه ها به دنبال فشار برای اخذ تخفیف های بیشتر هستند و مراکز خدماتی آمادگی تعهد به قیمت های بالاتر را ندارند.

یکی از بزرگترین شرکت های معدنی و فولادی جهان یعنی ArcelorMittal برنامه های بزرگی را برای توسعه دارایی های انرژی تجدیدپذیر در هند اعلام کرده است. این شرکت یک پارک خورشیدی ۴/۵ گیگاواتی در Rajasthan با ارزش سرمایه گذاری ۲/۶ میلیارد دلار پیشنهاد داده است. با این حال، گزارش های خبری به زمان توسعه این پروژه اشاره ای نکرده اند.

ماین نیوز: قیمت آلومینیوم در لندن برای نخستین بار طی ۱۳ سال اخیر روز دوشنبه به تنی ۳۰۰۰ دلار رسید. علت این افزایش قیمت، پیش‌بینی اختلال در عرضه آلومینیوم با وجود افزایش تقاضای آن اعلام شده است.

رئیس سازمان بورس و اوراق بهادار: در ماده ۱۸ قانون ابزارها که جزو قوانین مصوب مجلس است، به صراحت اعلام شده است که اگر کالایی وارد بورس کالا شد، دیگر در آن کالا نباید اجازه وضع هیچ نوع دخالتی اعم از قیمت‌گذاری، سهمیه‌بندی و منع صادراتی وجود داشته باشد. موضوع کاملا روشن است، کالاهایی که در بورس کالا عرضه می شوند، به هیچ عنوان امکان قیمت گذاری برای آنها وجود ندارد و ما هم چنین اجازه ای را به کسی نمی دهیم.