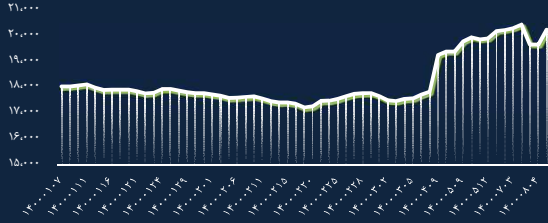
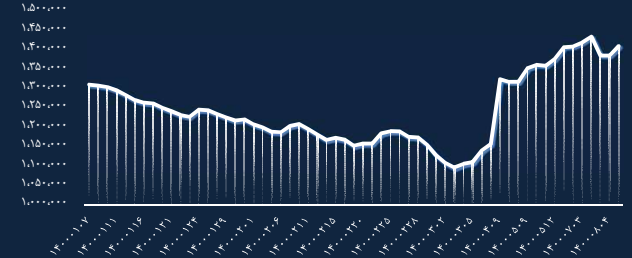


خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۸/۲۵

شاخص کل فرابورس



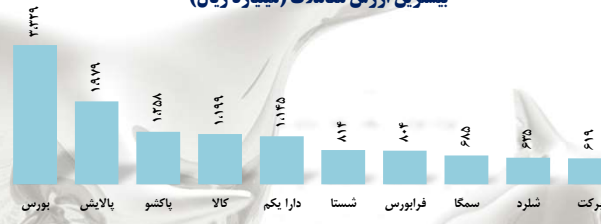
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



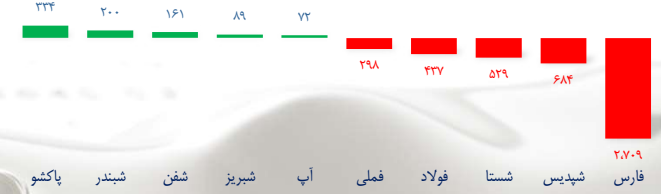
فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۲۰,۲۵۳	۱,۴۰۸,۵۸۳	
۱۱,۳۰۹,۸۶۹.۵۱۰ B	۵۶,۲۸۹,۱۴۸.۶۵۰ B	ارزش بازار
(-۳۵)	(-۷,۷۱۶)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۲)	(-۱)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۱۰۸,۶۸۴.۲۶۷ B	۴۵,۶۳۹.۰۷۱ B	ارزش معاملات

بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)

بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

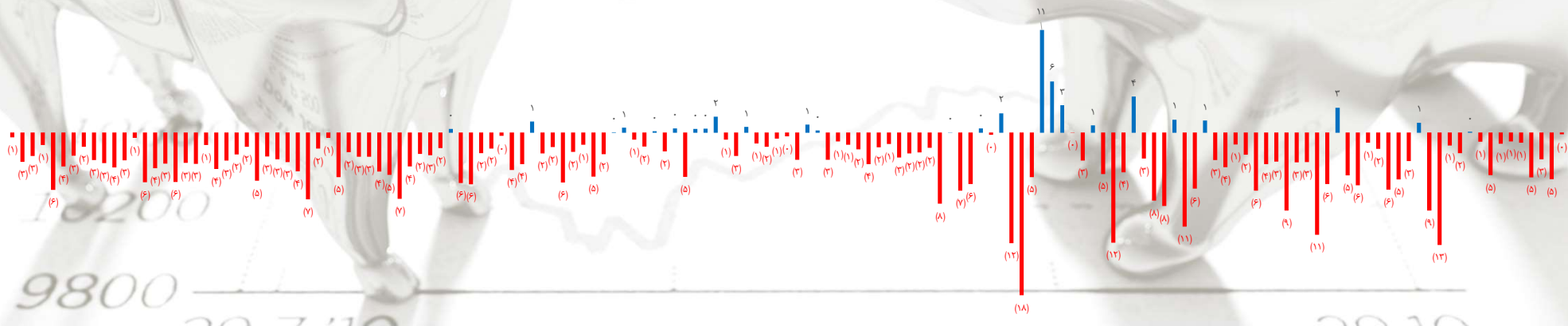


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

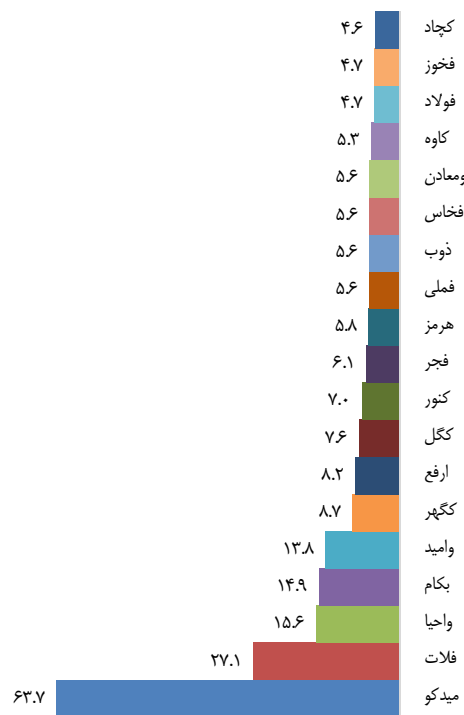


خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۱۴۰۰/۰۱/۰۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال

سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

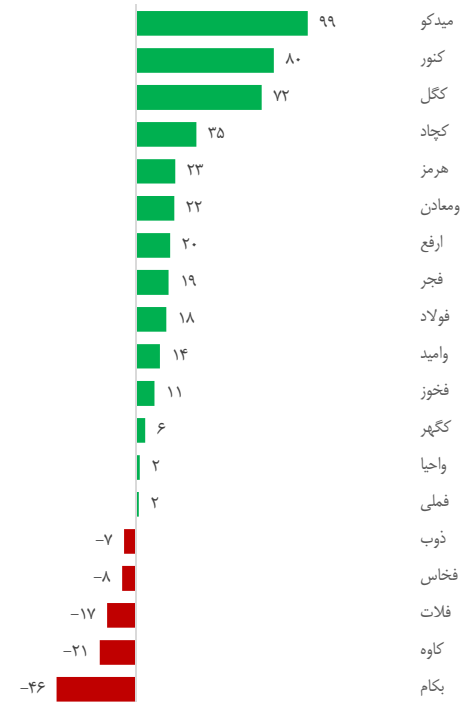


P/E تحلیلی

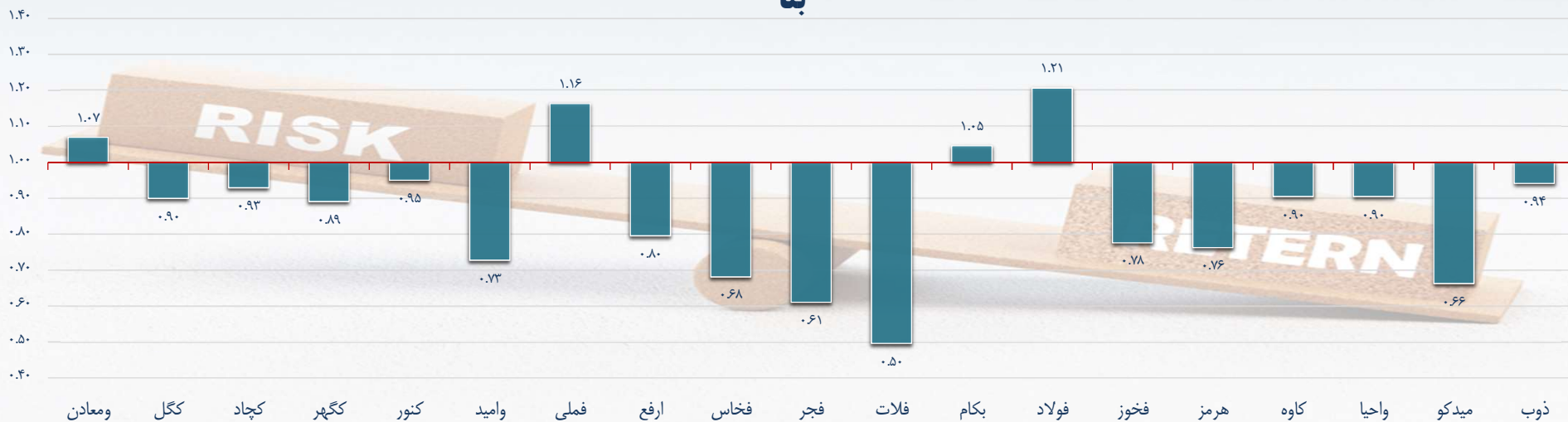


عملکرد معاملات سهام پرتوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا						
نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه معادن و فلزات	۵۶۷۱۵۰۱	۵۹,۱۲۷	۱۰,۴۱۰	۰.۱	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۴۸۶۴,۰۸۳	۱۱۶,۹۰۰	۲۴,۰۳۰	۰.۰	۱,۹۰۳	۳,۱۷۸
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۵۹۲,۵۱۳	۷۶,۶۱۹	۲۹,۶۴۰	(۰.۶)	۳,۰۸۰	۶,۳۹۳
سنگ آهن گهرزمین	۱,۷۹۷,۴۴۸	۸۷,۰۹۶	۴۸,۴۱۰	۰.۳	۱,۷۳۱	۵,۳۷۳
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۴۵۶۶۶۰	۸,۵۷۰	۱۸,۹۹۰	(۰.۱)	۷,۴۳۸	۲,۷۱۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۳,۰۸۰,۵۴۱	۴۰,۳۶۵	۱۳,۰۶۰	۰.۰	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۲۶,۲۳۴,۳۹۱	۳۴۸,۴۱۵	۱۳,۲۸۰	(۰.۵)	۱,۳۰۲	۲,۳۶۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۶۴۷,۹۸۶	۲۵,۶۳۹	۱۵,۶۰۰	(۰.۱)	۲,۱۶۳	۱,۹۰۰
فولاد خراسان	۲۵۰,۲۰۹	۵,۹۴۲	۲۴,۴۳۰	(۰.۲)	۲,۰۵۷	۴,۳۹۷
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۵۵۰,۸۸۵	۳۷,۸۴۸	۲۴,۴۰۰	(۰.۵)	۴,۷۳۶	۳,۹۷۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۷۳۸,۵۰۷	۹,۵۷۸	۱۲,۹۶۴	۰.۹	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۷۶۰۰,۹۹۳	۱۴,۰۶۹	۱,۸۵۱	(۰.۶)	۱۰۳	۱۳۴
فولاد مبارکه اصفهان	۴۶,۰۶۲,۸۷۹	۵۱۶,۸۰۱	۱۱,۳۲۰	(۰.۵)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۱۱,۶۳۳,۰۹۴	۷۷,۹۷۲	۶,۷۲۰	(۰.۴)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۳,۳۰۷,۰۵۰	۵۵,۸۷۱	۱۷,۱۰۷	(۱.۲)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۲,۴۳۶,۹۶۴	۳۹,۱۹۵	۱۶,۱۰۰	۰.۱	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۲۵۳,۸۸۷	۳۷,۸۵۹	۱۴۹,۲۹۱	(۰.۲)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۱,۸۳۳,۶۵۲	۸۵,۴۴۹	۴۶,۶۲۰	(۰.۱)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۳۰,۲۹۰,۸۷۳	۱۱۱,۹۷۲	۳,۶۹۷	(۰.۴)	۲۴۵	۶۵۹

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		
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		
۰.۰۲۰	۰.۰۳	۰.۰۵	هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	Ri-Rf (۰.۰۱۴,-۰.۰۱۴)	
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		
۰.۰۶	-۰.۳۲	-۰.۱۴	توسعه معادن و فلزات	Std (۰.۱۲۵,-۰.۱۰۲)	Moderate Risk
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		
۰.۱۰	-۰.۰۷	-۰.۱۸	م. صنایع و معادن احیا سپاهان	Std (۰.۱۰۲,-۰.۱۴۸)	High Risk
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		
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

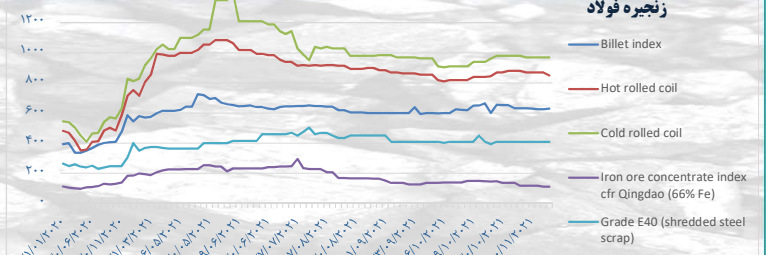
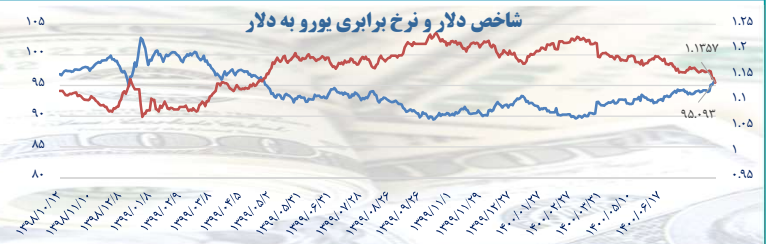
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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



قیمت زنجیره سنگ آهن و موجودی بنادر چین

اداره صنایع و فناوری اطلاعات و اکولوژی و محیط زیست استان هبی اطلاعیه مشترکی را در مورد برنامه چرخش تولید برای فصل گرمایش سال مالی ۲۰۲۱-۲۰۲۲ منتشر کردند. این طرح بین ۱۵ نوامبر و ۱۵ مارس سال آینده به قوت خود باقی خواهد ماند و در شهرهای شیجیازوانگ (Shijiazhuang)، تانگشان (Tangshan)، هاندان (Handan)، زینگتای (Xingtai)، کانگژو (Cangzhou)، سینجی (Xinji)، چنگده (Chengde)، ژانگجیاکو (Zhangjiakou) و کین هوان دائو (Qinhuangdao) اعمال می شود. این طرح ایجاب می کند که هر کارخانه اهداف کاهش تولید فولاد خام سالانه خود را تا ۳۱ دسامبر تکمیل کند و همچنین میزان انتشار گازهای گلخانه ای را بین اول ژانویه تا ۱۵ مارس به شدت کاهش دهد. تولید فولاد خام در طول دوره محدودیت نباید از ۳۰ درصد حد نرمال فراتر رود.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۵۰.۳-۷۶	(۰.۲-۰.۵)
	lumps (62.5%-63.5%)	۸۲-۸۳	(۰.۵)
برزیل	finer (61%-65%)	۲۹-۷۸.۸	(۰.۳-۰.۵)
	lumps (62%)	۷۱.۲	(۰.۳)
هند	finer (55%-62%)	۱۱.۵-۵۱.۵	(۰.۵)
	pellets (64.0%)	۱۱۳	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۳-۵۳.۵	(۰.۵)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۶۵.۲-۷۴.۸	-
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۶۹.۴-۷۰.۹	-
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۴.۵-۱۳۲	-

ظرفیت	تغییر هفتگی	موجودی	موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	
۲۱,۰۰۰	-۵۰۰	۲۲,۹۵۰	Qingdao	بنادر
۱۵,۵۰۰	۲۵۰	۱۰,۸۵۰	Tianjin	
۲۳,۰۰۰	-۱۰۰	۱۵,۲۸۰	Caofeidian	
۲۳۶,۲۰۰	۳,۳۶۰	۱۴۹,۷۱۰	Total	

• آمار تولید شرکت نسبت به ۷ ماهه دوره مشابه قبل کاهش یافته است که دلایل کاهش تولید به شرح ذیل است: در کارخانه کردستان به دلیل کمبود آب و قطعی برق سراسری، در کارخانه کنسانتره همدان کمبود خوراک و قطع برق سراسری، در کارخانه گندله اسد آباد به دلیل کمبود خوراک، تعمیرات دوره‌ای برنامه ریزی شده ۴۵ روزه و قطعی برق

کدان

کنور

• افزایش ۲۰۳ درصدی سود عملیاتی در دوره‌های مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ نسبت به دوره مشابه سال قبل عمدتاً به دلیل افزایش در نرخ فروش و مقدار فروش محصولات است.

کدال

کچاد



براساس گزارش Guosen Securities تولید زغال متالورژی چین با یک درصد افزایش سالانه در سال ۲۰۲۱ به ۴۸۹/۷۲ میلیون تن رسید. با این حال واردات زغال کک شو به دلیل ممنوعیت غیر رسمی واردات زغال کک شو استرالیا با ۲۹ درصد افت سالانه به ۵۱/۳ میلیون تن رسید.



پلتس پرمیوم زغال استرالیا را با ۵۰ سنت کاهش ۳۹۸/۵ دلار فوب استرالیا اعلام کرد و زغال تحویل CFR چین را در ۱۲ نوامبر با ۱۸ دلار افت ۵۱۲ دلار در هر تن گزارش داد.



طبق «سناریوی مرجع انیستیتو بین المللی آلومینیوم 2021 IAI»، قراضه آلومینیوم چین از ۱۱ میلیون تن در سال ۲۰۱۹ به ۴۰ میلیون تن تا سال ۲۰۵۰ افزایش خواهد یافت. حدود ۶۵ درصد از ضایعات موجود تا سال ۲۰۵۰ قراضه پس از مصرف خواهد بود که هم اکنون مقدار آن ۳۷ درصد است.



وزارت تجارت و صنعت مصر تعرفه های حفاظتی ۲۵ درصد و ۱۵ درصدی واردات میلگرد و شمش فولاد را لغو می کند. این اقدام در آوریل ۲۰۱۹ اعمال شد و تاریخ انقضای آن آوریل ۲۰۲۲ بوده است.



افزایش قابل توجه تولید و صادرات محصولات فولادی ترکیه در سال ۲۰۲۰ به خصوص در نیمه ی اول سال باعث افزایش واردات قراضه نیز گشته است. طی ژانویه-سپتامبر تولید فولاد خام در ترکیه با افزایش ۱۵٪ به ۲۹,۹ میلیون تن رسید.



گزارش معاونت بررسی‌های اقتصادی اتاق بازرگانی تهران از تغییرات شاخص بهای مصرف‌کننده در ماه سپتامبر ۲۰۲۱ نسبت به ماه مشابه سال ۲۰۲۰ نشان می‌دهد تورم ایران ۶ برابر تورم عراق، ۹/۴ برابر تورم پاکستان و ۲/۲ برابر تورم ترکیه شده است.