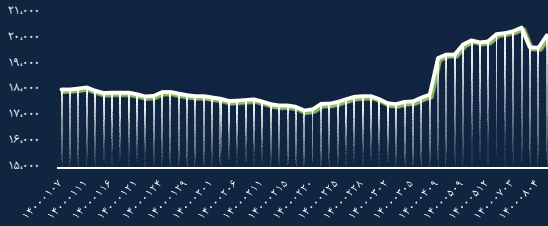


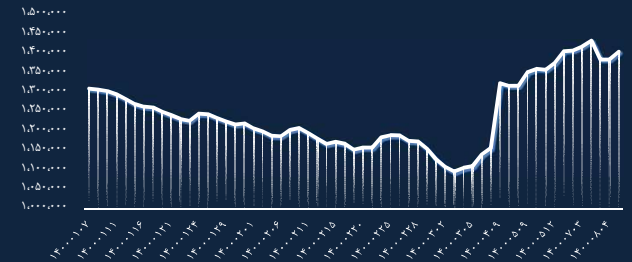
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۰۲

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۲۰,۱۵۰	۱,۴۰۴,۶۱۲	
۱۱,۲۵۲,۹۸۸.۵۷۳ B	۵۶,۱۲۶,۲۸۲.۹۲۰ B	ارزش بازار
(-۳۸)	(-۲,۵۲۲)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۲)	(-)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۳۰,۶۸۲,۶۲۳ B	۴۱,۳۲۵,۶۱۸ 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

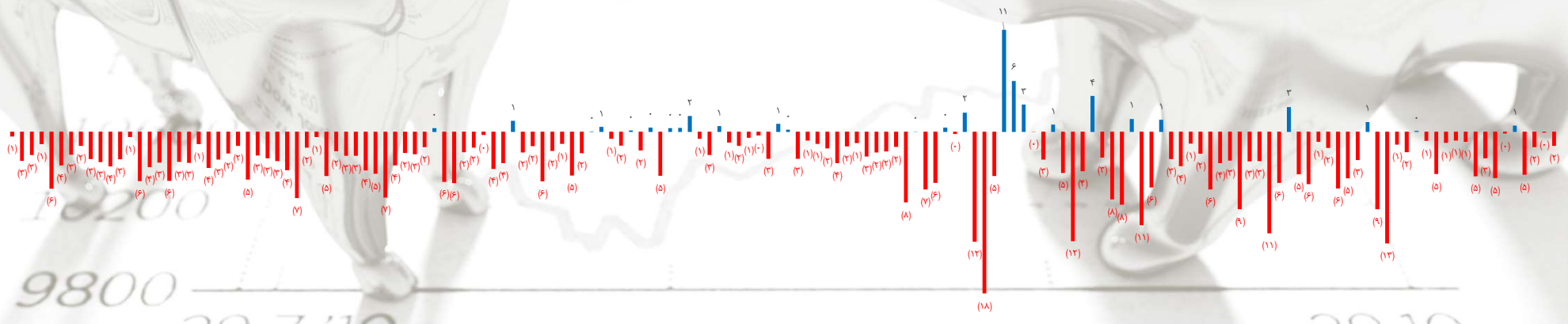
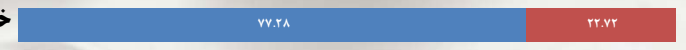


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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

سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

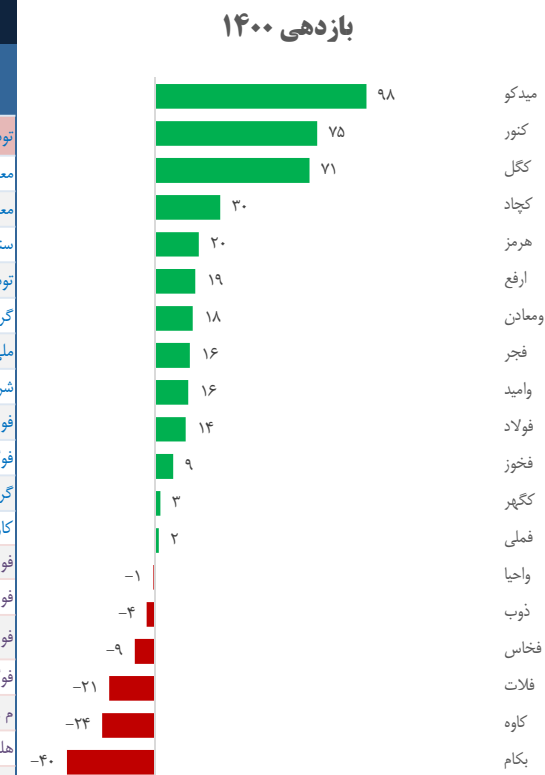


P/E تحلیلی



عملکرد معاملات سهام پرتوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقا

نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه معادن و فلزات	۷,۳۱۸,۲۰۱	۷۲,۲۸۱	۱۰,۰۲۰	۰.۰	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۸,۰۳۱,۵۸۵	۱۹۱,۶۳۹	۲۳,۸۶۰	۰.۱	۱,۹۰۳	۳,۱۷۸
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۳۰۹,۶۱۱	۶۶,۳۳۶	۲۸,۶۰۰	۰.۶	۳,۰۸۰	۶,۳۹۳
سنگ آهن گهرزمین	۴۶۳,۳۸۶	۲۱,۶۳۱	۴۷,۰۹۱	(۰.۲)	۱,۷۳۱	۵,۳۷۳
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۱,۳۲۵,۴۷۵	۲۴,۳۲۲	۱۸,۴۸۰	(۰.۳)	۷,۴۳۸	۲,۷۱۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۳,۷۹۷,۶۸۸	۵۰,۸۴۶	۱۳,۲۴۰	۰.۸	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۶۸۷,۱۴۷	۱۰,۵۲۹	۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۳۶۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۶۸۷,۱۴۷	۱۰,۵۲۹	۱۵,۴۴۹	(۰.۱)	۲,۱۶۳	۱,۹۰۰
فولاد خراسان	۲۲۱,۷۸۴	۵,۱۷۵	۲۴,۰۹۰	(۰.۲)	۲,۰۵۷	۴,۳۹۷
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۴۵۳,۰۳۱	۳۴,۶۷۵	۲۳,۸۶۰	(۲.۱)	۴,۷۳۶	۳,۹۷۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۳۴۸,۰۷۰	۴,۳۲۷	۱۲,۲۹۱	(۱.۰)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۴۸,۱۶۲,۲۷۷	۹۷,۵۷۲	۲,۰۲۶	۴.۵	۱۰۳	۱۲۴
فولاد مبارکه اصفهان	۳۹,۷۷۶,۵۰۶	۴۳۳,۹۵۹	۱۰,۹۱۰	(۲.۰)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۵,۱۸۰,۳۱۶	۳۴,۱۶۳	۶,۵۸۰	۰.۰	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۰۷۹,۶۰۶	۳۴,۶۰۳	۱۶,۷۷۷	(۰.۳)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۲۶۰,۵۶۰,۶	۳۹,۸۱۵	۱۵,۴۳۰	(۰.۸)	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۲۷۳,۲۹۲	۳۹,۶۵۱	۱۴۴,۸۲۶	۰.۴	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۱,۹۳۲,۰۷۹	۸۹,۳۵۸	۴۶,۲۵۰	۰.۰	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۴۵,۹۴۱,۶۲۱	۱۷۵,۶۱۵	۳,۸۲۳	(۰.۲)	۲۴۵	۶۵۹



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	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	Std (۰.۱۰۲,-۰.۱۴۸)	High Risk
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

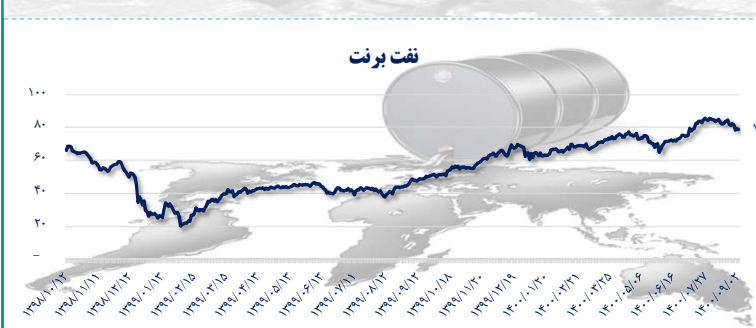
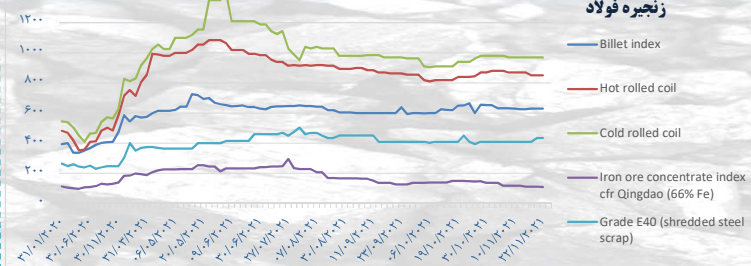
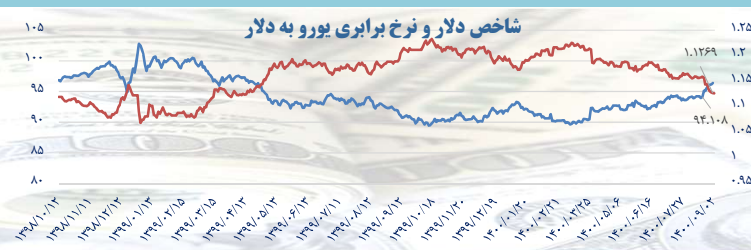
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۵۵.۸-۸۲.۶	۳.۵
	lumps (62.5%-63.5%)	۸۹.۳-۹۰.۳	۳.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۳۲.۵-۸۳.۳	۳.۵
	lumps (62%)	۷۶.۷	۳
هند	finer (55%-62%)	۱۸.۳-۶۱.۵	۲-۴
	pellets (64.0%)	۱۱۶	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۹-۶۱	۳
	concentrates (65.0%-67.0%)	۷۰.۲-۷۹.۸	-
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۷۲.۴-۷۳.۹	-
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۳.۵-۱۲۷	-

حمل محموله های سنگ آهن از استرالیا به چین ۱۸.۶ درصد افزایش هفتگی داشته است. در این میان صادرات Rio Tinto و FMG به چین به ترتیب ۳۹.۹ درصد و ۲۴.۰ درصد افزایش داشته ولی صادرات BHP کاهش ۱۵.۴ درصدی داشته است. روند صادرات برزیل نیز افزایشی است و در کل جهان ۲۴.۸ درصد افزایش هفتگی داشته است. در این میان صادرات Vale با ۳۳.۰ درصد افزایش و CSN با ۱۸.۰ درصد کاهش همراه بوده است.

براساس آخرین گزارش ماهانه انجمن آهن و فولاد چین CISA که در ۱۹ نوامبر منتشر شد، انتظار می رود قیمت فولاد چین در دوره آتی پس از کاهش قابل توجه در ماه اکتبر، ثابت بماند چراکه با نزدیک شدن به زمستان، عرضه و تقاضا ضعیف می باشد.

موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	موجودی	تغییر هفتگی	ظرفیت
Qingdao	۲۲,۵۰۰	-۴۵۰	۲۱,۰۰۰
Tianjin	۱۱,۱۲۰	۲۷۰	۱۵,۵۰۰
Caofeidian	۱۵,۵۵۰	۲۷۰	۲۳,۰۰۰
Total	۱۵۰,۸۱۰	۱,۱۰۰	۲۳۶,۲۰۰

• مجمع عمومی فوق العاده شرکت روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۰/۰۹/۱۷ در استان اصفهان برگزار می‌گردد. شرکت برنامه افزایش سرمایه از یک هزار میلیارد ریال به ۸ هزار میلیارد ریال را در برنامه دارد.

واحیا

کدان

براساس گزارش‌های منتشر شده، واحدهای بزرگ بخش معدن و صنایع معدنی کشور از ابتدای امسال تا پایان مهرماه ۲۹ میلیون و ۹۵۰ هزار و ۲۲۹ تن کنسانتره سنگ آهن تولید کردند، آماری که حاکی از رشد ۴ درصدی در مقایسه با مدت مشابه سال ۱۳۹۹ است.



پلتس پرمیوم زغال استرالیا را با ۲ دلار افت ۳۶۴ دلار فوب استرالیا و زغال تحویل CFR چین را در ۱۹ نوامبر با ۲۶ دلار کاهش ۴۴۰ دلار اعلام کرد. نتایج خریدهای اخیر منجر به دیدگاه‌های متفاوتی در بازار شد چرا که فعالان تجاری در تلاش هستند سمت و سوی بازار را ارزیابی و تحلیل کنند، درحالی که برخی فعالان بازار انتظار دسترسی محدود به محموله‌های استرالیا و عرضه محدود زغال کانادا برای محموله‌های ماه دسامبر را به دلیل اختلالات آب و هوایی مانند سیل‌های شدید در کانادا را دارند.



شهر Handan در استان هبی واقع در شمال چین محدودیت‌های جدیدی را برای کارخانه‌های فولاد در این منطقه از ۱۸ نوامبر تا ۳۱ دسامبر صادر کرد. این محدودیت‌ها در تلاش برای رسیدن به اهداف نهایی کاهش تولید فولاد خام وضع شده است. کارخانه‌ها با گرید A می‌توانند برنامه‌های تولید فعلی شان را ادامه دهند، در حالی که کارخانه‌ها با گرید B و B منفی باید تولید کوره‌های بلند خود را حدود ۳۰ درصد کم کنند و کارخانه‌ها با گرید C نیز باید ۵۰ درصد از تولید خود را کاهش دهند.



مس برای تحویل سه ماهه در بورس فلرات لندن با ۰/۲۱ درصد افزایش در ۹،۶۷۱/۵ دلار در هر تن بسته شد. انتظار می‌رود مس بین ۹،۶۳۰ تا ۹،۷۳۰ دلار در هر تن معامله شود. آلومینیوم در بورس فلرات لندن با ۰/۴۵ درصد افزایش به ۲،۶۹۵ دلار در هر تن رسید. سرب نیز برای تحویل سه ماهه در بورس فلرات لندن با ۱/۲۶ درصد افزایش در رقم ۲،۲۴۸/۵ دلار در هر تن بسته شد. روی هم برای تحویل سه ماهه در LME بالغ بر ۳/۹۷ درصد افزایش یافت و به ۳،۳۵۶ دلار در هر تن رسید. انتظار می‌رود روی در محدوده ۳،۳۱۰ تا ۳،۳۷۰ دلار در هر تن حرکت کند.



شرکت Samarco معدنکار سنگ آهن برزیلی که یک سرمایه‌گذاری مشترک میان Vale و BHP است و در نتیجه شکست سد باطله در نوامبر ۲۰۱۵ (دقیقا ۶ سال پیش) مجبور به توقف فعالیت در معدن سنگ آهن و گندله‌سازی ۳۰ میلیون تنی خود شده بود، در حال حاضر به ۵۴ درصد سطح تولید خود قبل از حادثه رسیده است.



تحت فشار هزینه‌ها، شرکت‌های الکترونی گرافیتی تمایلی به فروش ندارند. در صورت ادامه افزایش قیمت مواد اولیه، انتظار می‌رود قیمت الکترونی گرافیتی در بازار به رشد مداوم ادامه دهد.

