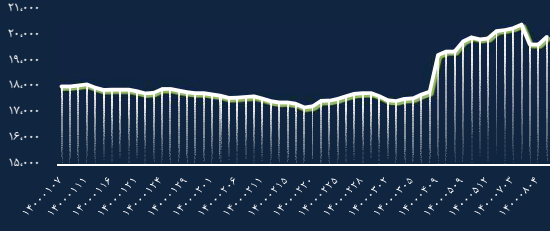


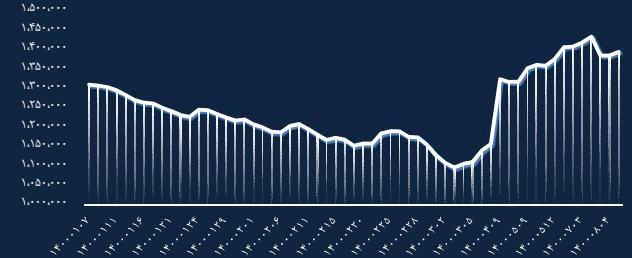
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۰۳

شاخص کل فرابورس

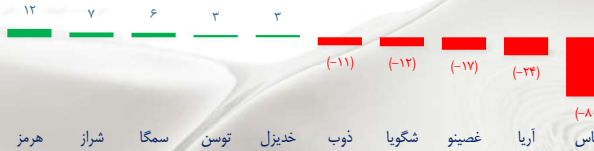


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۹۶۸	۱,۳۹۴,۱۰۵	
۱۱,۱۵۱,۵۰۱.۰۳۰ B	۵۵,۷۰۹,۳۷۳.۴۳۵ B	ارزش بازار
(-۱۸۲)	(-۱۰,۴۴۶)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۹)	(-۱)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۹۵,۳۶۳.۹۸۲ B	۳۴,۹۸۲.۳۱۹ B	ارزش معاملات

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



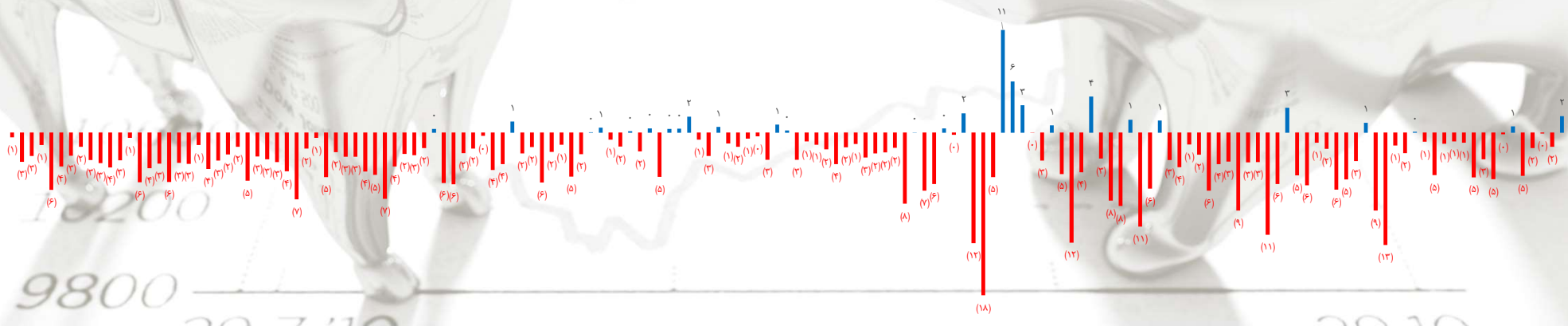
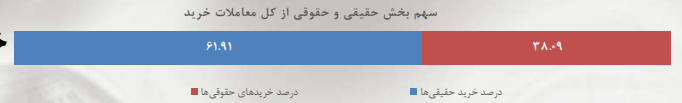
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



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		EPS کارشناسی
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	
توسعه معادن و فلزات	۹,۰۲۴,۰۰۲	۸۹,۲۶۰	۹,۹۲۰	(۱.۰)	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۱,۵۰۸,۵۱۷	۳۵,۶۴۲	۲۳,۷۹۰	(۰.۳)	۱,۹۰۳	۳,۱۷۸
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۴۳۴,۳۴۰	۹۷,۳۱۴	۲۸,۳۸۰	(۰.۸)	۳,۰۸۰	۶,۳۹۳
سنگ آهن گهرزمین	۱۸۶,۹۰۸	۸,۶۹۴	۴۷,۰۴۸	(۰.۱)	۱,۷۳۱	۵,۳۷۳
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۷۸۱,۱۲۳	۱۴,۰۵۱	۱۸,۴۰۰	(۰.۴)	۷,۴۳۸	۲,۷۱۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۷۹۱,۷۱۶	۱۰,۵۰۱	۱۳,۲۴۰	۰.۰	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۱۰,۹۳,۴۳۲	۱۶,۷۵۷	۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۳۶۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۰۹۳,۴۳۲	۱۶,۷۵۷	۱۵,۴۲۱	(۰.۲)	۲,۱۶۳	۱,۹۰۰
فولاد خراسان	۱۹۸,۳۶۴	۴,۵۹۱	۲۴,۰۴۰	(۰.۲)	۲,۰۵۷	۴,۳۹۷
فولاد امیرکبیر کاشان	۲,۶۷۴,۹۹۵	۶۴,۹۳۲	۲۴,۲۷۰	۱.۷	۴,۷۳۶	۳,۹۷۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۷۷۴,۳۵۳	۹,۲۶۶	۱۱,۹۷۰	(۲.۶)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۲۶۶,۹۸,۷۵۰	۵۱,۹۰۶	۱,۹۴۴	(۴.۱)	۱۰۳	۱۲۴
فولاد مبارکه اصفهان	۵۱,۸۷۸,۹۵۹	۵۵۸,۴۷۸	۱۰,۷۷۰	(۱.۳)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۱۰,۷۱۱,۴۴۹	۷۰,۱۵۳	۶,۵۶۰	(۰.۳)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۶,۰۵۵,۱۰۸	۱۰۳,۴۸۰	۱۷,۰۴۵	۱.۶	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۴,۶۴۳,۲۱۳	۶۹,۹۲۶	۱۵,۱۴۰	(۱.۹)	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۴۸۰,۶۲۷	۶۸,۵۹۳	۱۴۲,۷۱۵	(۱.۵)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۴,۴۸۵,۷۴۹	۲۰۷,۳۰۷	۴۶,۲۱۰	(۰.۱)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۴۲,۵۵۳,۳۲۳	۱۵۸,۳۹۴	۳,۷۲۲	(۲.۶)	۳۴۵	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

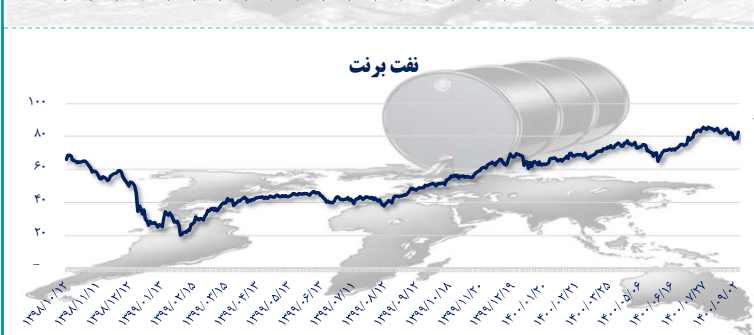
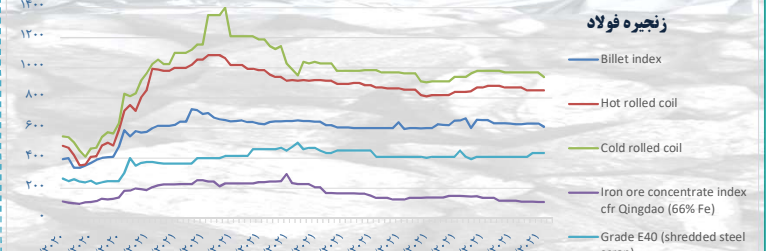
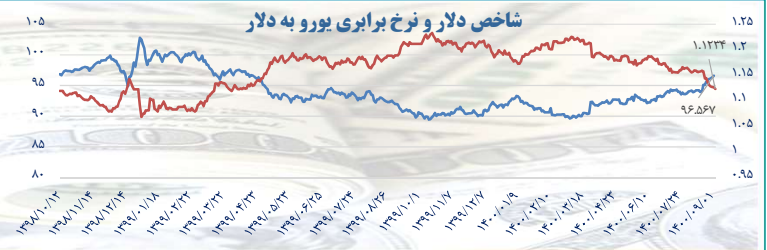
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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%)	۵۹.۳-۸۶.۲	۳.۵
	lumps (62.5%-63.5%)	۹۲.۸-۹۳.۸	۳.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۳۵.۵-۸۷	۴-۴.۷
	lumps (62%)	۷۹.۷	۴
هند	finer (55%-62%)	۲۰.۳-۶۴.۵	۲-۳
	pellets (64.0%)	۱۱۶	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۲-۶۵	۳-۴
	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	-

بر اساس گزارش انجمن جهانی فولاد در اکتبر ۲۰۲۱، میزان تولید فولاد در ۶۴ کشور و منطقه تولیدی فولاد، جمعاً ۱۴۵،۷ میلیون تن بوده است که در مقایسه با اکتبر سال ۲۰۲۰ کاهش ۱۰.۶ درصدی را نشان می دهد. از میان ۱۰ کشور اصلی تولیدکننده فولاد، افت تولید در چین با ۲۳،۳٪ کاهش و ایران با ۱۵،۳٪ کاهش در مقایسه با سال قبل بسیار قابل توجه می باشد. علت اصلی افت تولید در کشورمان را می توان به قطعی مکرر برق در کارخانه های تولید فولاد طی چند ماه گذشته دانست. علاوه بر این افت میزان تقاضای محصولات فولادی از دیگر عوامل موثر در روند نزولی تولید در کشور بوده است.

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 با افزایش سرمایه ۲۰۰ هزار میلیارد ریالی (۱۰۰ درصدی) از محل سود انباشته موافقت نمود.

کدان

فملی

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۷،۱۵۰ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۴٪ بیشتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۵۴،۶۶۲ میلیارد ریال است.

کدان

ارفع

اکنون میست انتظار دارد آمریکا در نیمه نخست ۲۰۲۲ برخی از تحریم‌های نفتی را بردارد، رویدادی که موجب حمایت از رشد اقتصادی ایران خواهد شد. در این گزارش تاکید شده که ایران نسبت به دیگر کشورهای تولیدکننده نفت منطقه، از اقتصاد متنوع‌تری برخوردار است اما در عین حال هنوز نفت و گاز، عمده درآمدهای بخش مالی و خارجی آن را تشکیل می‌دهد. تحریم‌های آمریکا، فعالیت‌های اقتصادی ایران (و به‌ویژه صادرات نفت) را محدود کرده است براساس پیش‌بینی این واحد، ایران حمایت کوتاه‌مدت خود از خانوارهای کم‌درآمد را افزایش خواهد داد و همزمان در آستانه افزایش صادرات هیدروکربن‌ها، ظرفیت‌های تولید نفت و گاز خود را نیز افزایش خواهد داد.

اخبار روز

نایب بولکل، رییس‌جمهور السالوادور از ساخت شهر ارزهای دیجیتال در این کشور خبر داده است. این شهر قرار است نزدیک به آتشفشان کانچانا در جنوب شرقی السالوادور ایجاد شود. السالوادور برنامه‌ریزی کرده برای تامین بودجه این شهر، یک میلیارد اوراق قرضه بیت‌کوین بفروشد.

اخبار روز

طی هفته‌های اخیر شاهد افت شدید قیمت کامودیتی‌ها مانند مس، فولاد، سنگ آهن، آلومینیوم، سرب، نیکل، قلع، فروآلیاژها و ... بوده ایم. قیمت‌ها در بازار فیوچرز به زیر قیمت بازار فیزیکی رسیده اند که نشان می‌دهد انتظار بازار برای آینده قیمت‌ها چندان روشن نیست. تنها استثنا در این روند، قیمت حامل‌های انرژی است که همچنان روندی صعودی دارد.

اخبار روز

ارزش لیر ترکیه در حال سقوط آزاد است. در معاملات سه شنبه شاهد افت ارزش به ۱۳/۴۶ بودیم که در ادامه ارزش اندکی تقویت شد. افت ارزش لیر ترکیه زمانی تشدید شد که بانک مرکزی این کشور بر خلاف انتظار بازار و روند صعودی تورم، اقدام به کاهش نرخ سپرده گذاری بانک‌ها نمود.

اخبار روز

تا سال ۲۰۵۰، روسیه قصد دارد بیش از ۳۳/۵ میلیون تن هیدروژن صادر کند و تا ۲۰ درصد از بازار جهانی هیدروژن را به خود اختصاص دهد. در نتیجه با صادرات هیدروژن، بالغ بر ۱۰۰ میلیارد دلار در سال درآمد برای روسیه به ارمغان خواهد آمد.

اخبار روز

طی هفت ماهه نخست ۱۴۰۰، صادرات کالای بدون نفت خام ایران به کشور سوریه حدود ۷۹/۶۵ هزارتن و به ارزش ۱۰۶/۲ میلیون دلار و در مقابل واردات کالایی ایران از این کشور ۱۹۵ هزارتن و به ارزش ۱۷/۶۸ میلیون دلار بوده است. در مقایسه با مدت مشابه سال قبل، مقدار صادرات ایران به سوریه طی مدت مزبور حدود ۲/۸ درصد کاهش و در مقابل ارزش صادرات ۴۲ درصد افزایش یافته است.

اخبار روز