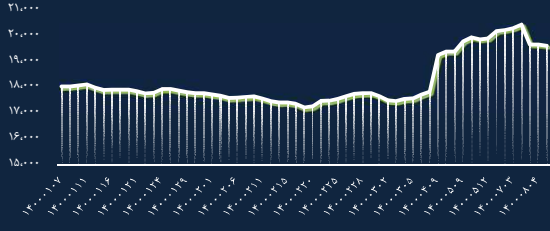


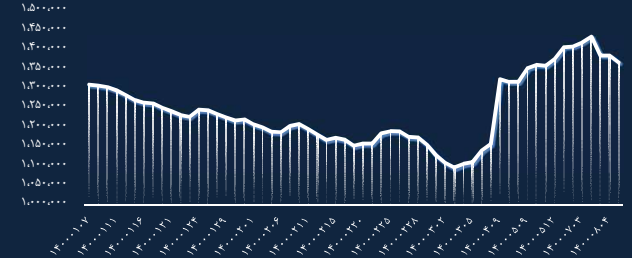
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۰۶

شاخص کل فرابورس

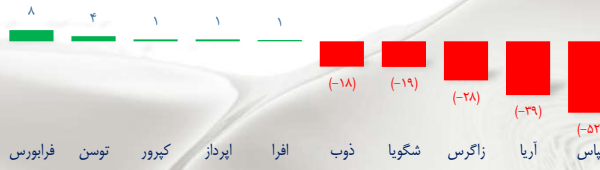


| فرابورس | بورس | مقدار شاخص |
|------------------|------------------|-------------------------------|
| ۱۹,۶۲۶ | ۱,۳۶۶,۶۶۴ | |
| ۱۰,۹۶۰,۵۰۵.۶۳۱ B | ۵۴,۶۱۲,۷۴۷.۶۷۹ B | ارزش بازار |
| (-۳۴۲) | (-۲۷,۴۴۲) | مقدار تغییر نسبت به روز گذشته |
| (-۱.۷) | (-۲) | درصد تغییر نسبت به روز گذشته |
| ۱۵۷,۴۱۲.۱۶۸ B | ۳۶,۴۵۹.۵۴۰ B | ارزش معاملات |

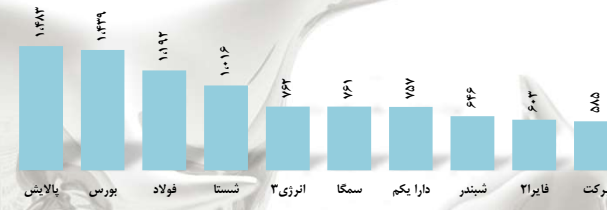
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



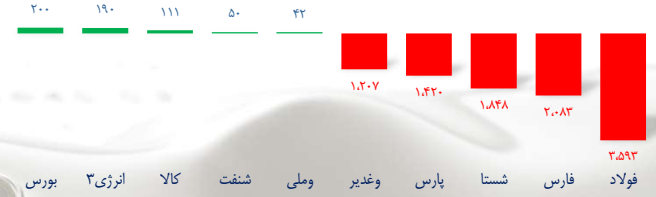
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

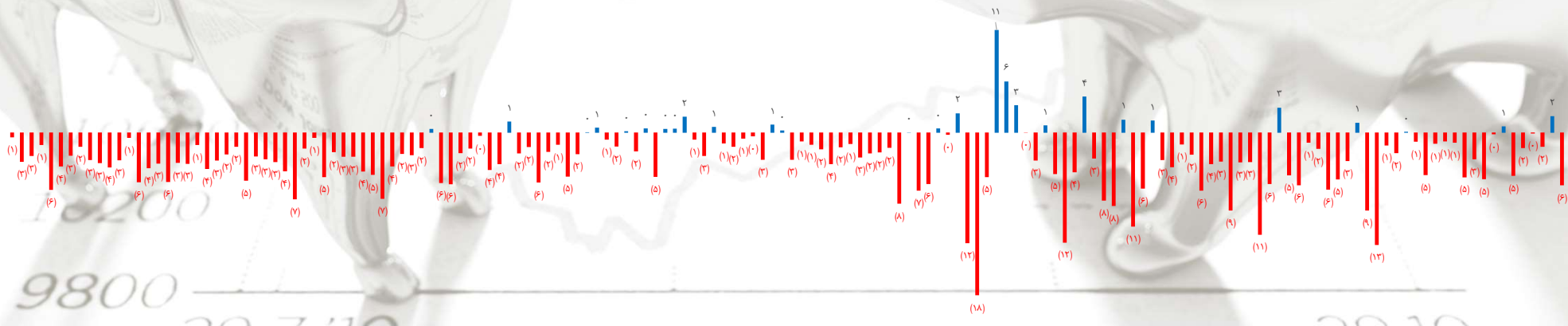
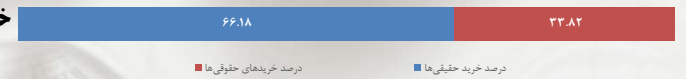


سهام بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

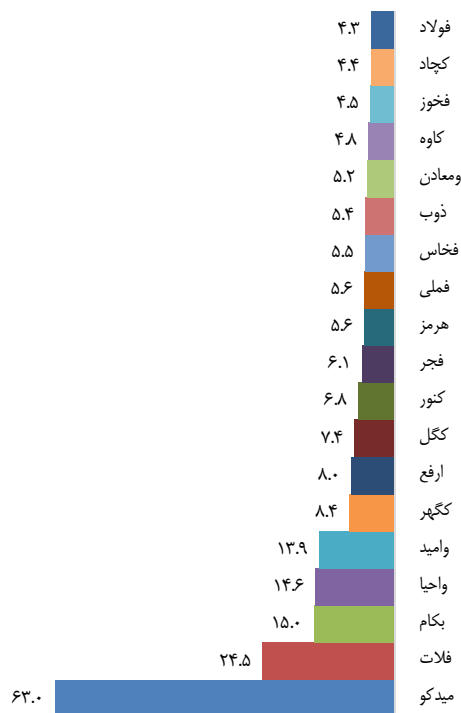


خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۱۴۰۰/۰۱/۰۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال

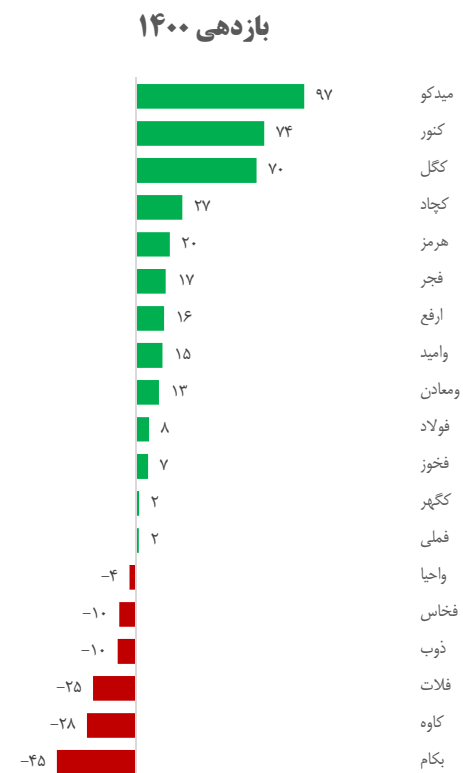
سهام بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



P/E تحلیلی



| 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 |
| توسعه معادن و فلزات | ۹,۰۰۱,۲۳۱ | ۸۶,۳۰۸ | ۹,۶۰ | (۲.۵) | ۱,۱۲۵ | ۱,۸۷۵ |
| معدنی و صنعتی گل گهر | ۱,۴۶۸,۹۲۷ | ۳۴,۰۹۲ | ۲۳,۶۲۰ | (۰.۷) | ۱,۹۰۳ | ۳,۱۷۸ |
| معدنی و صنعتی چادرملو | ۲,۵۸۴,۶۲۶ | ۷۱,۰۶۵ | ۲۷,۸۴۰ | (۱.۹) | ۳,۰۸۰ | ۶,۳۹۳ |
| سنگ آهن گهرزمین | ۳۶۸,۴۱۷ | ۱۶,۶۴۳ | ۴۶,۷۷۷ | (۰.۶) | ۱,۷۳۱ | ۵,۳۷۳ |
| توسعه معدنی و صنعتی صیانور | ۱,۰۲۳,۵۱۴ | ۱۸,۸۱۲ | ۱۸,۴۰۰ | ۰.۰ | ۷,۴۳۸ | ۲,۷۱۱ |
| گروه مدیریت سرمایه گذاری امید | ۱,۴۶۸,۳۵۳ | ۱۹,۲۲۹ | ۱۳,۲۲۰ | (۰.۲) | ۷۹۶ | ۹۴۹ |
| ملی صنایع مس ایران | ۲,۱۸۸,۵۲۴ | ۳۲,۳۷۳ | ۱۳,۲۹۰ | ۰.۰ | ۱,۳۰۲ | ۲,۳۶۳ |
| شرکت آهن و فولاد ارفع | ۲,۱۸۸,۵۲۴ | ۳۲,۳۷۳ | ۱۵,۱۳۴ | (۱.۹) | ۲,۱۶۳ | ۱,۹۰۰ |
| فولاد خراسان | ۲۴۹,۷۸۶ | ۵,۷۱۶ | ۲۳,۹۷۰ | (۰.۳) | ۲,۰۵۷ | ۴,۳۹۷ |
| فولاد امیرکبیر کاشان | ۱,۹۵۳,۱۶۸ | ۴۷,۰۵۲ | ۲۴,۰۹۰ | (۰.۷) | ۴,۷۳۶ | ۳,۹۷۰ |
| گروه صنایع معادن فلزات ایرانیان | ۶۵۱,۱۴۷ | ۷,۵۸۳ | ۱۱,۷۱۷ | (۲.۱) | ۳۶۵ | ۴۷۵ |
| کارخانجات تولیدی شهید قندی | ۱۴۶,۰۸۰,۳۳ | ۲۷,۱۳۹ | ۱,۸۵۸ | (۴.۴) | ۱۰۳ | ۱۳۴ |
| فولاد مبارکه اصفهان | ۱۱۶,۰۰۶,۲۹۱ | ۱,۱۹۲,۰۵۱ | ۱۰,۲۸۰ | (۴.۶) | ۱,۲۵۸ | ۲,۳۸۸ |
| فولاد خوزستان | ۷,۳۳۲,۸۴۸ | ۴۶,۷۳۲ | ۶,۴۹۰ | (۱.۱) | ۲,۲۳۳ | ۱,۴۳۶ |
| فولاد هرمزگان جنوب | ۳,۶۸۷,۴۲۹ | ۶۰,۳۰۵ | ۱۶,۶۸۳ | (۲.۱) | ۲,۰۸۱ | ۲,۹۶۶ |
| فولاد کاوه جنوب کیش | ۵,۵۹۷,۲۹۰ | ۸۱,۶۴۹ | ۱۴,۶۲۰ | (۳.۴) | ۲,۳۹۶ | ۳,۰۲۷ |
| م. صنایع و معادن احیاء سپاهان | ۴۰۵,۸۰۲ | ۵۷,۰۵۷ | ۱۴,۶۰۳ | (۱.۵) | ۵,۱۹۱ | ۹,۴۹۹ |
| هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه | ۵,۵۱۴,۷۵۵ | ۲۵۴,۴۰۶ | ۴۶,۱۳۰ | (۰.۲) | ۶۶۰ | ۷۳۲ |
| سهامی ذوب آهن اصفهان | ۶۵۵,۰۱,۱۹۷ | ۳۳۲,۸۷۷ | ۳,۵۵۵ | (۴.۵) | 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

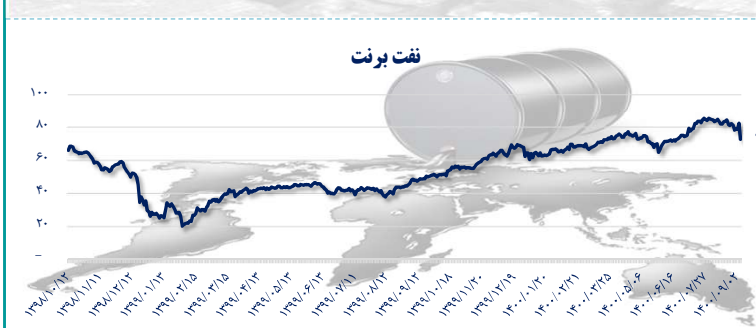
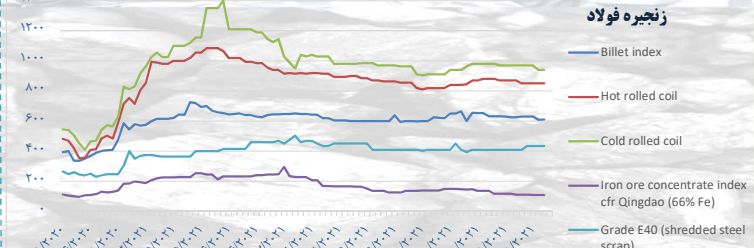
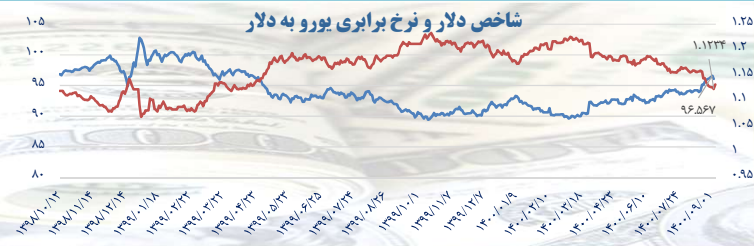
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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

به نظر می رسد قیمت سنگ آهن از این هفته با توجه به انتظار از سرگیری فعالیت کوره‌های بلند در کارخانه های فولاد چین در میان بهبود حاشیه سود فولاد، دوباره جهش یابد.

میانگین ضریب بهره وری و استفاده از ظرفیت ها در ۷۶۸ کوره بلند (در ۲۴۷ کارخانه فولاد چین) طی دوره ۱۸ تا ۲۵ نوامبر با ۰٫۱۲ درصد کاهش به ۷۵٫۲۳ درصد رسید.

| قیمت زنجیره سنگ آهن | | | |
|---------------------|----------------------------|------------|--------------------|
| کشور | نوع سنگ آهن | قیمت (FOB) | میزان تغییر (دلار) |
| استرالیا | finer (57%-63%) | ۶۲-۸۹.۲ | (۳.۳-۲) |
| | lumps (62.5%-63.5%) | ۹۶.۸-۹۷.۸ | (۲) |
| برزیل | finer (61%-65%) | ۳۹.۵-۹۰.۵ | (۲-۲.۵) |
| | lumps (62%) | ۸۳.۷ | (۲) |
| هند | finer (55%-62%) | ۲۰.۸-۶۶.۵ | (۲-۳) |
| | pellets (64.0%) | ۱۲۱ | - |
| ایران | finer (54%-62%) | ۲۲-۶۶ | (۳) |
| | concentrates (65.0%-67.0%) | ۷۵.۲-۸۴.۸ | - |
| روسیه | concentrates (65.0%-66%) | ۸۳.۴-۸۴.۹ | - |
| | pellets (63.0%-65.0%) | ۱۱۳.۵-۱۳۶ | - |

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

کدان

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۷۴,۷۸۴ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۲۴٪ بیشتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۴۷۹,۰۲۷ میلیارد ریال است.

فملی

کدان

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۱۲۷,۰۶۶ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۱۱٪ بیشتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۹۱۴,۳۹۹ میلیارد ریال است.

فولاد

کدان

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۱۸۸ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۴۴٪ کمتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۲,۷۰۰ میلیارد ریال است.

بکام



براساس اطلاعات منتشر شده از سوی انجمن جهانی فولاد WSA که در ۲۳ نوامبر منتشر شد، در ماه اکتبر، سهم چین در تولید جهانی فولاد کمتر از نصف و حدود ۴۹/۱ درصد بود. این کاهش سهم ناشی از افت شدید تولید فولاد این کشور در ماه اکتبر بود چراکه این کشور در ماه مذکور افت ۲۳/۳ درصدی سالانه را به ثبت رسانده است.



موسسه فیچ انتظار دارد که متوسط قیمت سنگ آهن در سال ۲۰۲۲ حدود ۹۰ دلار در هر تن CFR چین باشد در حالی که پیش از این قیمت ۱۰۰ دلار در هر تن CFR را برای سال آینده برآورد کرده بود، این در حالی است که پیش بینی موسسه مذکور برای سال جاری در ۱۶۰ دلار CFR باقی مانده است.



چین با ۴۴ میلیون تن ذخایر و ۱۴۰ هزار تن تولید سالانه معدنی، در صدر فهرست برترین تولیدکنندگان و دارای ذخایر عناصر نادر خاکی قرار دارد. در حالی که ویتنام و برزیل به ترتیب با ۲۲ میلیون تن و ۲۱ میلیون تن دومین و سومین ذخایر بزرگ فلزات نادر خاکی را در جهان دارند.



اوپک پیش بینی می کند آزادسازی ذخایر نفت از سوی مصرف کنندگان بزرگ باعث افزایش قابل توجه مازاد عرضه جهانی در چند ماه آینده شود.



انجمن جهانی فولاد اعلام کرده که میزان تولید فولاد خام ایران در ماه اکتبر سال جاری میلادی ۲/۲ میلیون تن بوده که کاهش ۱۵,۳ درصدی را نسبت به ماه مشابه سال قبل نشان می دهد.



قیمت اسلب صادراتی ایران در هفته گذشته با کاهش شدید به پایین ترین میزان در ۱۰ ماه گذشته رسید. علت کاهش قیمت اسلب صادراتی ایران، روند نزولی در بازار اسلب و محصولات تخت فولادی، خصوصاً بازار شرق آسیا و چین است. سقف قیمت اسلب صادراتی ایران در ماه اردیبهشت سال جاری ۸۵۰ دلار به ازای هر تن بود. قیمت اسلب نسبت به سقف قیمت آن در سال جاری ۲۶۵ دلار به ازای هر تن، معادل ۳۱ درصد، کاهش یافته است.