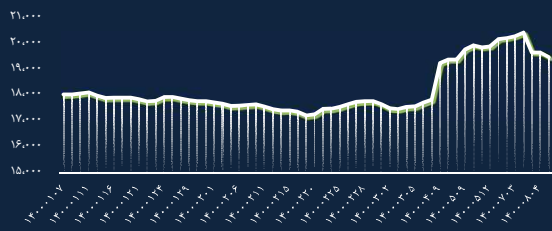


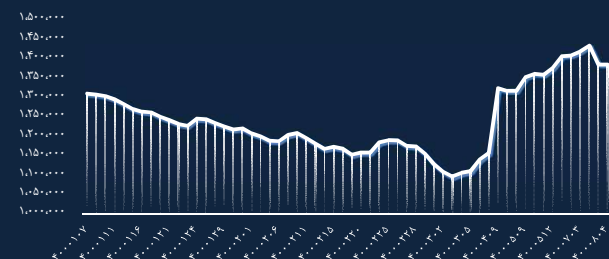
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۰۷

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۴۹۴	۱,۳۶۸,۰۱۳	
۱۰,۸۸۵,۸۳۷.۱۶۹ B	۵۴,۶۸۰,۴۴۷.۲۳۱ B	ارزش بازار
(-۱۳۲)	۱,۳۰۰	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۷)	۰.۱۰	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۱۹,۵۶۶.۵۲۶ B	۳۶,۶۳۴.۲۱۹ B	ارزش معاملات

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



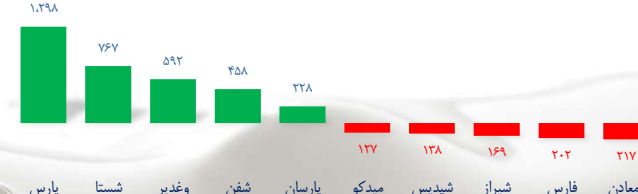
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



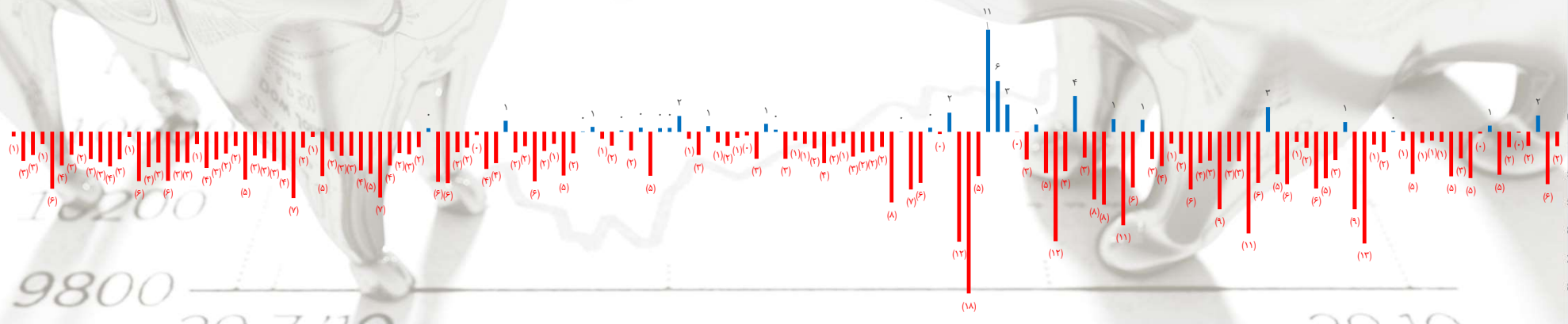
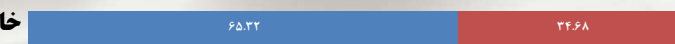
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



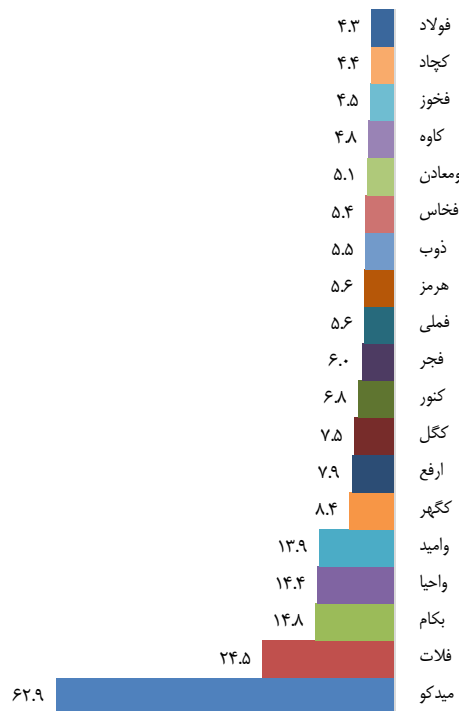
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



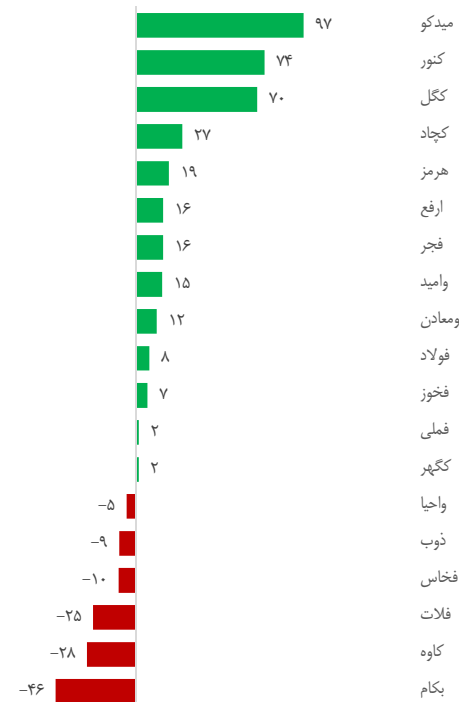
P/E تحلیلی



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

نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه معادن و فلزات	۱۲,۴۸۹,۳۹۹	۱۱۹,۳۴۲	۹,۵۶۰	(۱.۱)	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۳,۹۰۲,۱۹۷	۹۲,۴۹۱	۲۳,۶۸۰	۰.۳	۱,۹۰۳	۳,۱۷۸
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۱۲۰,۴۸۰	۵۹,۱۶۱	۲۷,۸۷۰	۰.۱	۳,۰۸۰	۶,۳۹۳
سنگ آهن گهرزمین	۴۰۰,۰۵۱	۱۸,۴۵۸	۴۶,۶۷۷	(۰.۲)	۱,۷۳۱	۵,۳۷۳
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۱,۲۶۱,۷۸۲	۲۳,۳۲۹	۱۸,۴۲۰	۰.۱	۷,۴۳۸	۲,۷۱۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۵,۴۳۳,۶۱۱	۷۱,۷۶۱	۱۳,۲۱۰	(۰.۱)	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده		۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۳۶۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۰۰۸,۳۱۸	۱۴,۹۱۶	۱۵,۰۶۲	(۰.۵)	۲,۱۶۳	۱,۹۰۰
فولاد خراسان	۲۴۵,۰۴۳	۵,۶۷۳	۲۳,۹۲۰	(۰.۲)	۲,۰۵۷	۴,۳۹۷
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۳۱۲,۰۲۴	۳۱,۱۶۲	۲۳,۷۵۰	(۱.۴)	۴,۷۳۶	۳,۹۷۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۲۶۴,۲۹۰	۳,۰۹۸	۱۱,۷۱۹	۰.۰	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۰,۵۵۱,۳۴۳	۱۹,۳۱۸	۱,۸۳۱	(۱.۵)	۱۰۳	۱۲۴
فولاد مبارکه اصفهان	۷۳,۲۶۸,۴۸۳	۷۵۴,۷۵۲	۱۰,۳۰۰	۰.۲	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۹,۷۰۱,۹۱۶	۶۲,۷۵۶	۶,۴۸۰	(۰.۲)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲۰,۳۶۶,۵۳	۳۳,۴۴۷	۱۶,۶۰۸	(۰.۵)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۴,۸۰۹,۷۱۸	۷,۰۳۴۳	۱۴,۶۲۰	۰.۰	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۳۷۹,۹۱۶	۵۲,۴۴۱	۱۳,۱۶۱	(۱.۷)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۶,۲۳۵,۵۷۸	۲۸۶,۶۱۷	۴۶,۰۴۰	(۰.۲)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۳۴,۱۲۰,۵۸۲	۱۲۲,۵۵۷	۳,۵۹۲	۱.۰	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	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

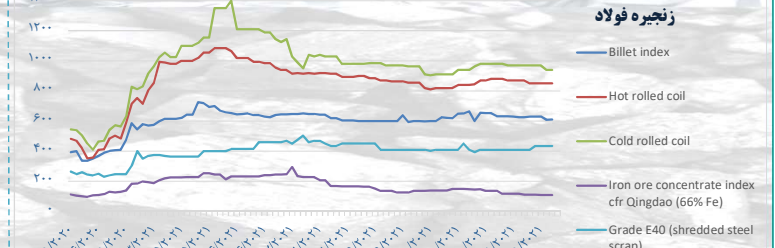
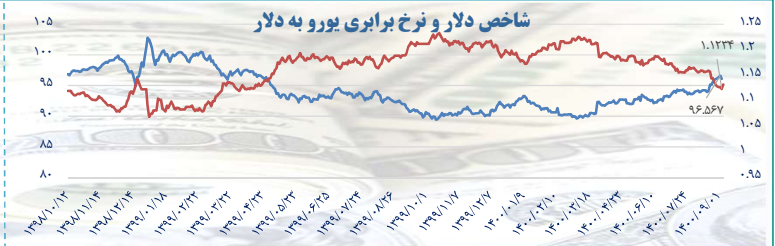
این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده، سهامی

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%)	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	-

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

*داده‌های این قسمت مربوط به تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۰۶ می باشد.

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۳۷،۱۶۵ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۲٪ بیشتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۲۹۱،۶۲۸ میلیارد ریال است.

کچاد

کدال

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۳۰،۵۴۶ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۱۰٪ بیشتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۲۲۲،۷۵۶ میلیارد ریال است.

ذوب

کدال

• در حال حاضر برنامه‌ای جهت اعمال محدودیت در مصرف گاز به شرکت ابلاغ نشده است؛ ولی چنانچه محدودیتی مشابه سال گذشته اعمال گردد، پیش بینی می‌شود تولید فولاد خام حداقل به میزان ۵۰۰،۰۰۰ تن کاهش یابد. لازم به ذکر است با برنامه ریزی انجام شده و در صورت کاهش یا توقف احتمالی تولید، مقادیر تولید محصولات نهایی (شامل کلاف گرم و سرد) با کاهش قابل توجهی مواجه نمی‌شود و در صورت لزوم کسری فولادخام مورد نیاز از محل ذخیره استراتژیک شرکت و یا واردات جبران خواهد شد.

فولاد

کدال

در حالی که چشم انداز تولید سنگ آهن وله در سال جاری ۳۱۵ تا ۳۳۵ میلیون تن می‌باشد، این شرکت قصد دارد چشم انداز سال ۲۰۲۲ را بین ۳۳۰ تا ۳۵۰ میلیون تن برنامه ریزی نماید. مجمع عمومی وله روز ۲۹ نوامبر در نیویورک برگزار خواهد شد و این موضوع به همراه مواردی مانند بودجه سالانه و سایر موضوعات تصمیم گیری خواهد شد.

اخبار روز

در پی بالا رفتن قیمت برق و انرژی در اروپا بویژه فرانسه، شرکت فولادسازی آسکوال در جهت مدیریت هزینه های خود طی توافقی با ساراستیل آلمان قصد جابجا کردن کارگاه تولید ریل خود از منطقه آیانژ به آلمان را داشت که با حمایت دولت این کشور و قراردادن این این شرکت در سبد حمایتی قیمت ها این انتقال منتفی شد.

اخبار روز

شرکت فولاد نیپون استیل ژاپن رسماً تصمیم گرفت تا ۱۹ میلیارد ین (معادل ۱۶۷/۶ میلیون دلار) سرمایه گذاری اضافی در منطقه Setouchi Works Hirohata انجام دهد تا ظرفیت تولید ورق های فولادی الکتریکی خود را بهبود بخشیده و تقویت کند.

اخبار روز

بررسی ها نشان می دهد که در بین ۵ محصول اصلی فولادی، موجودی میلگرد و مفتول به ترتیب ۵/۴ درصد و ۳/۱ درصد افت هفتگی داشتند درحالی که موجودی نورد گرم، نورد سرد و ورق به ترتیب با ۱/۷ درصد، ۱/۵ درصد و ۲/۸ درصد افزایش همراه شدند.

اخبار روز

بسته به میزان سردی هوا میزان مصرف گاز در فاز اول ۲۲٪، در فاز دوم ۴۳٪ و در فاز سوم ۶۵٪ نیازمند کاهش خواهد بود. شرکت فولاد خوزستان به دلیل گرمای هوا در این منطقه از محدودیت مصرف گاز معاف خواهد بود. فولاد مبارکه هم در فاز اول معاف از محدودیت مصرف گاز خواهد بود ولی در فاز دوم و سوم محدودیت ۶۲٪ دارد که میتواند تا ۵۰٪ تولید فولاد این شرکت را کاهش دهد. اولویت کاهش مصرف گاز با تولیدکنندگان آهن اسفنجی است که تاثیر مستقیم بر تولید فولاد خواهد گذاشت.

اخبار روز

تجارت کالایی ایران با اتحادیه اروپا طی نه ماهه نخست ۲۰۲۱ با افزایش حدود ۲ درصدی در مقایسه با مدت مشابه سال قبل به حدود ۳/۴ میلیارد یورو رسید که ۵۵۴ میلیون یورو (حدود ۱۹ درصد) آن را صادرات، و ۲/۷ میلیارد یورو (حدود ۸۱ درصد) آن را نیز واردات تشکیل داده است.

اخبار روز