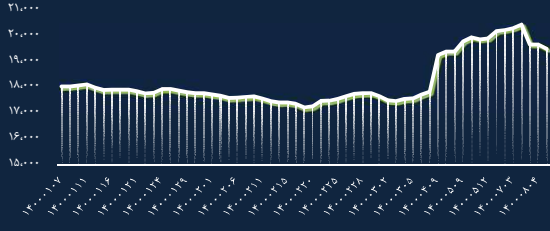


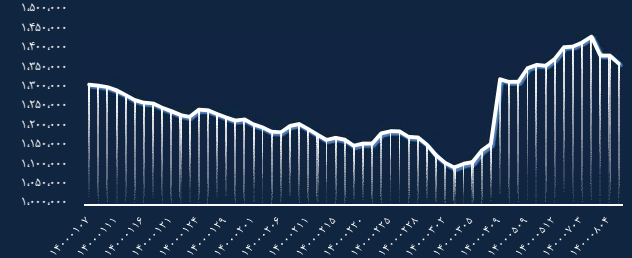
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۰۸

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۵۰۴	۱,۳۶۳,۸۲۲	
۱۰,۸۹۱,۳۷۷.۰۶۷ B	۵۴,۵۱۴,۵۱۱.۳۷۰ B	ارزش بازار
۱۰	(-۴,۱۸۳)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۰.۰۵	(-۰)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۶۸۱,۲۷۶.۳۷۸ B	۳۲,۲۱۰.۶۳۰ B	ارزش معاملات

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



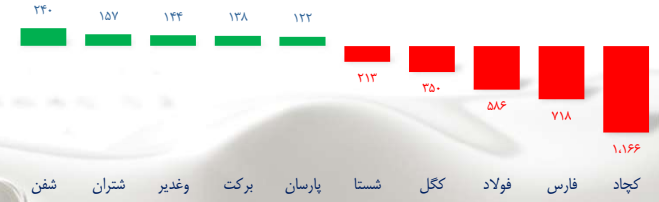
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



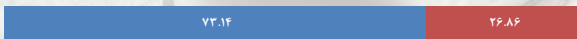
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



سهیم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



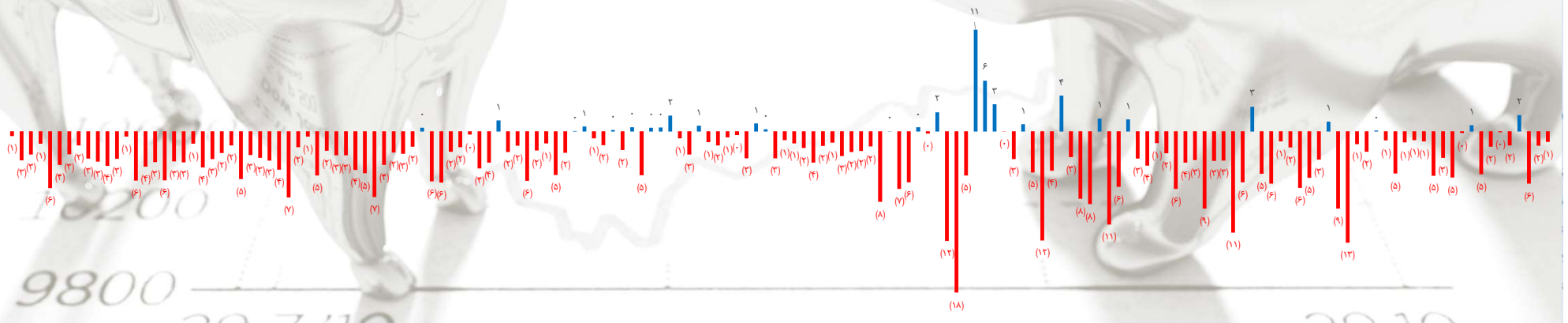
درصد فروش حقیقی‌ها | درصد فروش حقوقی‌ها

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

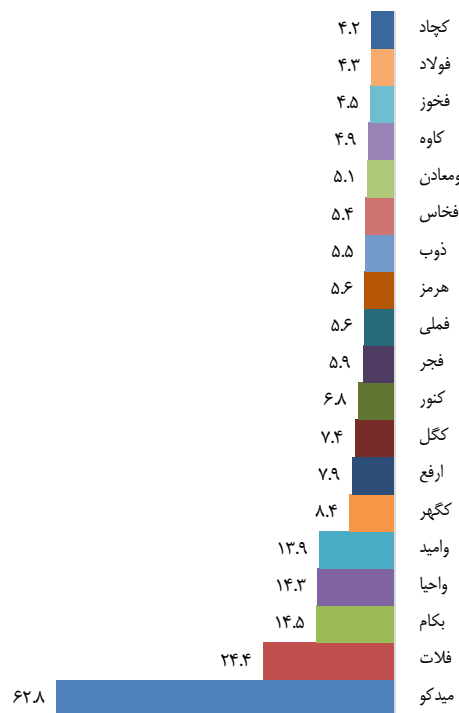
سهیم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



درصد خریدهای حقیقی‌ها | درصد خریدهای حقوقی‌ها



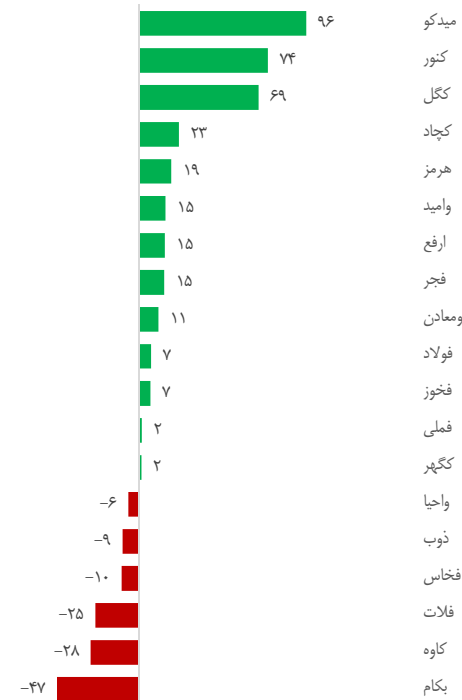
P/E تحلیلی



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	۱۲,۱۴۸,۳۳۷	۱۱۵,۴۱۳	۹۵.۰۰	(۰.۶)	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۵۸۸,۳۱۹	۶۰,۶۰۴	۲۳,۵۴۰	(۰.۶)	۱,۹۰۳	۳,۱۷۸
معدنی و صنعتی چادرملو	۵,۰۰۹,۱۰۰	۱۳۵,۳۷۹	۲۷,۰۳۰	(۳.۰)	۳,۰۸۰	۶,۳۹۳
سنگ آهن گهرزمین	۳۴۸,۲۵۴	۱۶,۰۴۶	۴۶,۵۹۵	(۰.۲)	۱,۷۳۱	۵,۳۷۳
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۳,۶۵۱,۱۶۶	۶۷,۲۸۵	۱۸,۴۳۰	۰.۱	۷,۴۳۸	۲,۷۱۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۲,۲۴۸,۷۲۸	۲۹,۸۲۴	۱۳,۲۲۰	۰.۱	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	موقوف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده		۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۳۶۳
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۱۵۰,۶۷۸	۱۶,۹۲۹	۱۴,۹۷۸	(۰.۶)	۲,۱۶۳	۱,۹۰۰
فولاد خراسان	۲۰۷,۷۰۱	۴,۱۴۸	۲۳,۸۹۰	(۰.۱)	۲,۰۵۷	۴,۳۹۷
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۱۱۶,۰۸۱	۲۶,۲۵۸	۲۳,۵۳۰	(۰.۹)	۴,۷۳۶	۳,۹۷۰
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۳۹,۳۷۵	۵,۰۹۱	۱۱,۶۴۹	(۰.۶)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۹,۴۵۲,۸۴۲	۱۷,۰۰۳	۱,۷۹۹	(۱.۸)	۱۰۳	۱۳۴
فولاد مبارکه اصفهان	۵۷,۱۹۹,۶۵۰	۵۸۴,۳۶۴	۱۰,۰۲۰	(۰.۸)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۵,۰۴۱,۴۶۳	۳۲,۴۲۲	۶,۴۷۰	(۰.۲)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۱,۶۹۶,۰۴۹	۲۷,۸۴۴	۱۶,۵۶۲	(۰.۳)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۱۰,۵۰۹,۲۳۶	۱۵۴,۶۵۱	۱۴,۷۲۰	۰.۷	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۶۵۱,۳۱۳	۸۹,۳۰۲	۱۳۷,۱۱۱	(۰.۸)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۱,۳۲۳,۵۰۸	۶۰,۷۴۰	۴۵,۹۷۰	(۰.۲)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۳۷,۰۷۷,۷۴۸	۱۳۳,۳۸۵	۳,۵۹۷	۰.۱	۳۴۵	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

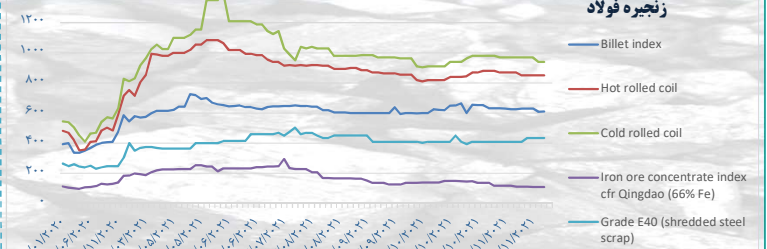
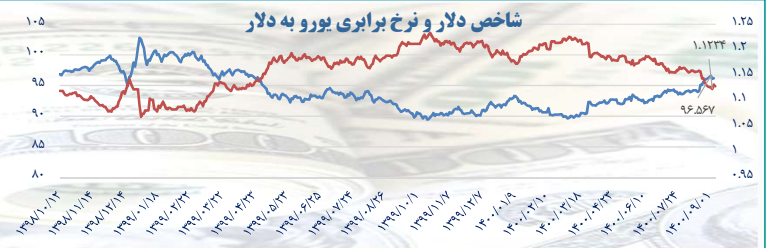
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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%)	۵۷.۵-۸۴.۲	(۴.۵-۵)
	lumps (62.5%-63.5%)	۹۲.۳-۹۳.۳	(۴.۵)
برزیل	finer (61%-65%)	۳۴.۵-۸۵.۵	(۴)
	lumps (62%)	۷۸.۷	(۴)
هند	finer (55%-62%)	۱۸.۸-۶۱.۵	(۲-۵)
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۸-۶۲	(۴)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۷۵.۲-۸۴.۸	-
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۷۹.۹-۷۸.۴	(۵)
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۱۳.۵-۱۳۶	-

ظرفیت	تغییر هفتگی	موجودی	موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	
۲۱,۰۰۰	۷۰۰	۲۳,۲۰۰	Qingdao	بنادر
۱۵,۵۰۰	-۲۷۰	۱۰,۸۵۰	Tianjin	
۲۳,۰۰۰	-۱۰۰	۱۵,۴۵۰	Caofeidian	
۲۳۶,۲۰۰	۱,۱۷۰	۱۵۱,۹۸۰	Total	

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۴۶،۲۵۸ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۸ ماهه خود ۱۴٪ بیشتر است. مجموع فروش ۸ ماهه شرکت ۳۲۵،۳۹۰ میلیارد ریال است.

کدال

کگل

• شرکت گزارش عملکرد آبان ماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۳۰،۸۴۴ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۱۱ ماهه خود ۷۳٪ بیشتر است. مجموع فروش ۱۱ ماهه شرکت ۱۹۶،۴۲۲ میلیارد ریال است.

کدال

کگهر

شرکت American Resources مجوز نهایی برای اولین تاسیسات تصفیه و جداسازی عناصر نادر خاکی و عناصر حیاتی در ایندیانا را دریافت کرد. تاسیسات مذکور که در حال حاضر در Noblesville ایندیانا در حال ساخت است اولین تاسیسات مقیاس تجاری در آمریکا خواهد بود که می تواند عناصر نادر خاکی و فلزات باتری را از بسیاری از مواد اولیه جدا و تصفیه نماید.

اخبار روز

پلتس پرمیوم زغال استرالیا را با ۵۰ سنت کاهش ۳۱۶ دلار فوب استرالیا و زغال تحویل CFR چین را در ۲۶ نوامبر با ۱۰ دلار کاهش ۳۸۶ دلار در هر تن اعلام کرد. خریداران به دلیل چشم انداز متفاوت بازار برای خرید مردد هستند.

اخبار روز

نصیر ضوئی، مدیر فروش و توسعه کسب و کار شرکت دانلیلی پرشیا در مقاله ای تاثیر تحریم ها بر صنعت و بازار فولاد ایران را مورد بررسی قرار داده است، نصیر ضوئی در بخشی از این مقاله نوشته است: یکی از دلایل زمین گیر نشدن صنعت فولاد ایران، وجود منابع سنگ آهن، انرژی ارزان قیمت و موقعیت جغرافیای مناسب می باشد در غیر اینصورت، صنعت فولاد کشور با مشکلات بدتری مواجه می شد. گلوگاه های زیادی در صنعت فولاد کشور در شرایط تحریم وجود دارد که در صورتیکه برای بعضی از این گلوگاه ها فکر اساسی نشود و شرایط تحریم بر صنعت فولاد کشور کماکان ادامه یابد، در طول زمان با مشکلات بسیار زیادی مواجه خواهیم شد.

اخبار روز

امیرعلی طاهرزاده مدیرعامل شرکت تهیه و تولید مواد معدنی ایران با اشاره به انجام بیش از ۴۰ هزار متر عملیات حفاری اکتشافی در بخش های پلی متال، سنگ آهن و زغال سنگ، رشد ۷ درصدی نسبت به برنامه را اعلام کرد.

اخبار روز

جواد اوجی وزیر نفت، از حدود دو ماه پیش مذاکره با ترکمنستان و آذربایجان در بحث تجارت گاز آغاز شد که در این سفر منجر به امضای قرارداد سوآپ سالانه ۱/۵ تا ۲ میلیارد مترمکعب گاز از ترکمنستان به سمت آذربایجان از مرز آستارا شد.

اخبار روز

نرخ تورم ۱۲ ماهه منتهی به آبان ۱۴۰۰ برای خانوارهای کشور به عدد ۴۴/۴ درصد رسید. بررسی استانی نرخ تورم نشان می دهد بیشترین نرخ مربوط به استان ایلام با ۵۲/۲ درصد تورم سالانه و کمترین آن مربوط به استان قم با ۴۰ درصد بوده است.

اخبار روز