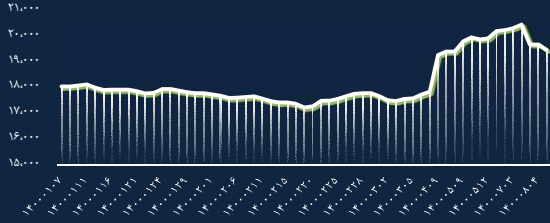


خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۰۹

شاخص کل فرابورس



فرابورس

۱۹,۴۶۰

۱۰,۸۶۷,۰۹۵.۱۵۷ B

(-۴۴)

(-۰.۲)

۲۳,۰۶۵.۹۳۴ B

بورس

۱,۳۵۷,۰۹۳

۵۴,۲۴۲,۹۵۷.۳۹۶ B

(-۶,۸۴۶)

(-۱)

۳۴,۲۶۱.۵۹۸ B

مقدار شاخص

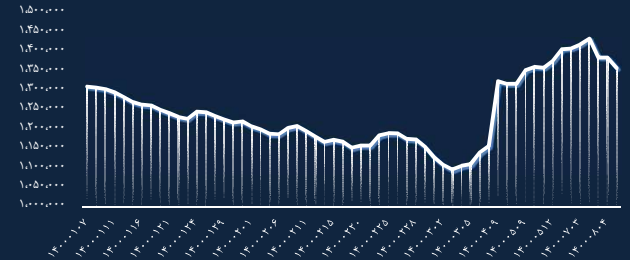
ارزش بازار

مقدار تغییر نسبت به روز گذشته

درصد تغییر نسبت به روز گذشته

ارزش معاملات

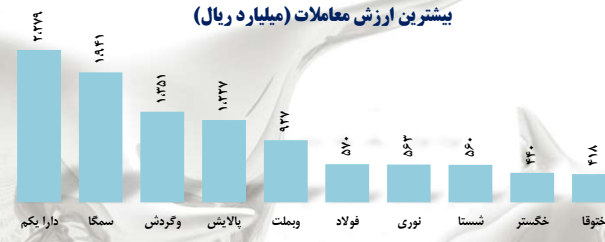
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



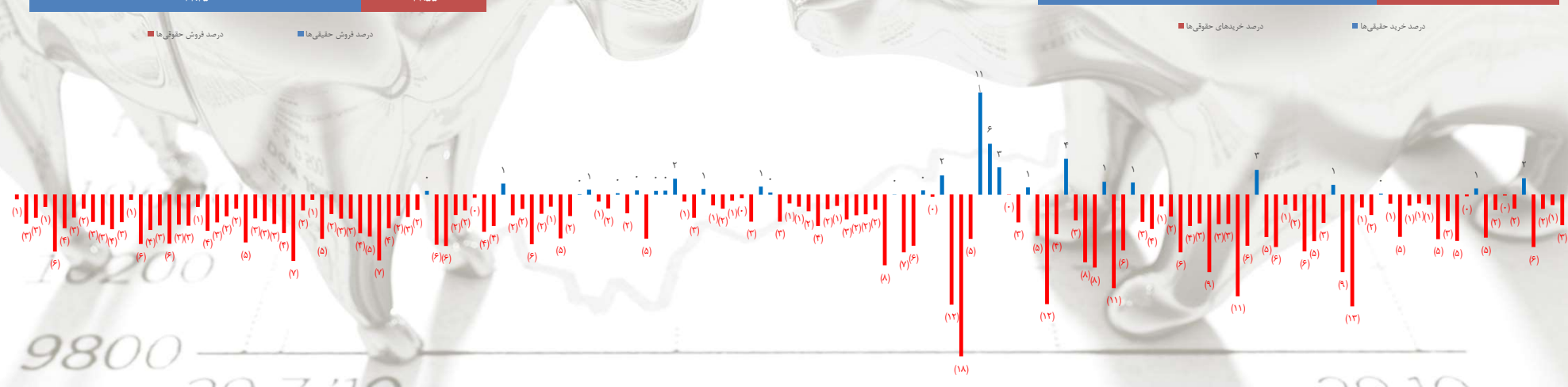
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



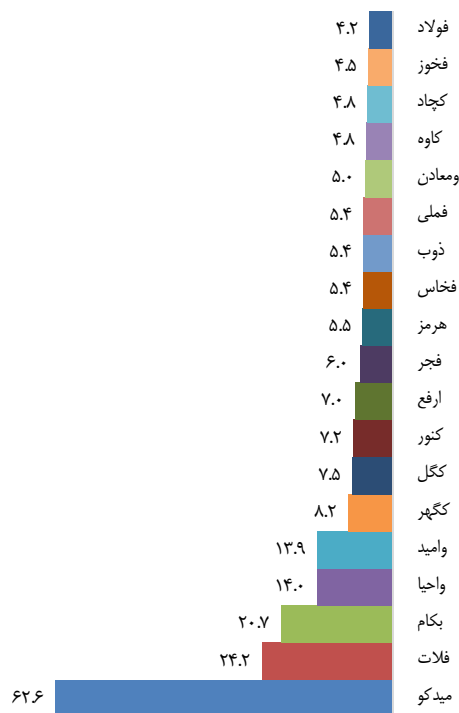
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



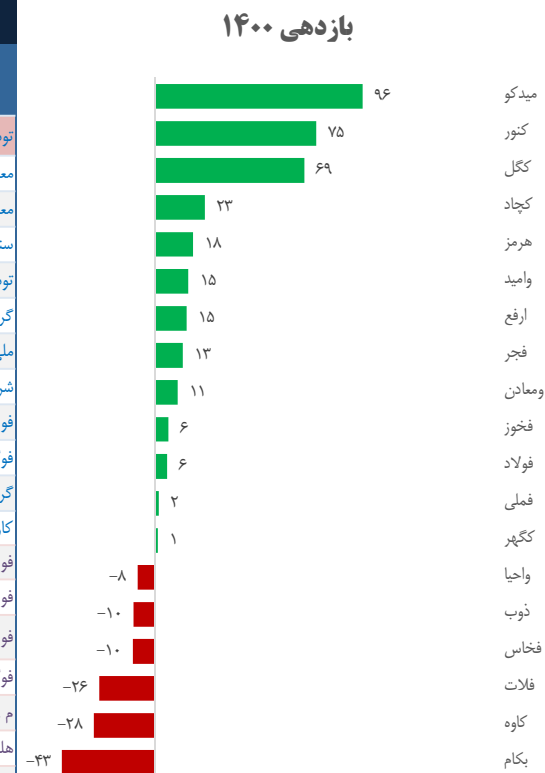
خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۱۴۰۰/۰۱/۰۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال



P/E تحلیلی



عملکرد معاملات سهام پرتقوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا						
نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		توسعه معادن و فلزات
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	
توسعه معادن و فلزات	۲۷,۲۳۶,۳۹۲	۲۵۶,۸۲۵	۹,۴۳۰	(۰.۷)	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۴,۱۸۵,۷۳۲	۹۸,۴۷۹	۲۳,۵۳۰	(۰.۰)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۱,۹۱۵,۷۹۳	۵۱,۷۹۲	۲۷,۰۳۰	۰.۰	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۱۴۶,۹۹۲	۶,۷۱۲	۴۶,۵۴۱	(۰.۱)	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۱,۶۸۵,۴۴۴	۳۱,۱۴۹	۱۸,۴۵۰	۰.۱	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۱,۸۵۱,۲۹۷	۲۴,۵۸۳	۱۳,۲۳۰	۰.۱	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	موقوف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده	۱۳,۲۹۰	۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۴۵۸
شرکت آهن و فولاد ارفع	۹۴۰,۸۷۰	۱۳,۸۲۶	۱۴,۹۲۲	(۰.۴)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱۹۱,۹۱۰	۴,۳۶۷	۲۳,۸۴۰	(۰.۳)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۲۹۷,۸۵۳	۳۰,۰۸۴	۲۳,۱۸۰	(۱.۵)	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۴۰۴,۶۲۹	۴,۶۴۴	۱۱,۵۶۶	(۰.۷)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۷,۲۹۳,۸۲۵	۱۲,۸۴۶	۱,۷۶۳	(۲.۰)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۵۶,۳۷۹,۵۷۹	۵۶۹,۵۰۸	۱۰,۱۰۰	(۱.۲)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۵,۴۳۴,۸۲۳	۳۴,۷۵۸	۶,۴۵۰	(۰.۳)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۰۳۲,۸۴۰	۳۲,۶۷۸	۱۶,۴۲۱	(۰.۹)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۳,۴۳۰,۶۴۶	۵۰,۱۴۰	۱۴,۶۶۰	(۰.۴)	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۵۸۶,۳۱۲	۷۸,۷۴۳	۱۳۴,۳۰۲	(۲.۱)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۱,۳۱۷,۳۰۰	۶۰,۳۰۸	۴۵,۸۴۰	(۰.۳)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۴,۰۲۲,۱۵۹	۸۶,۰۱۵	۳,۵۸۱	(۰.۴)	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				
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			Std (۰.۱۰۲,-۰.۱۴۸)	High Risk
۰.۱۲	-۰.۲۳	-۰.۱۱	فولاد مبارکه اصفهان				
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

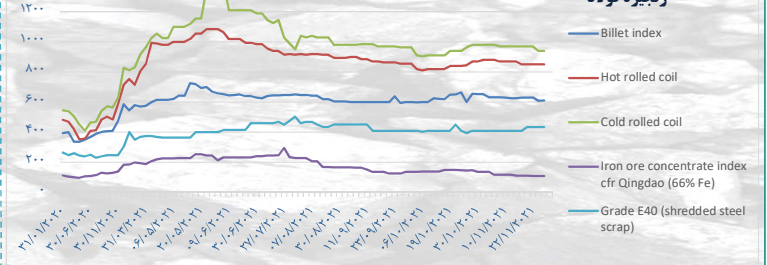
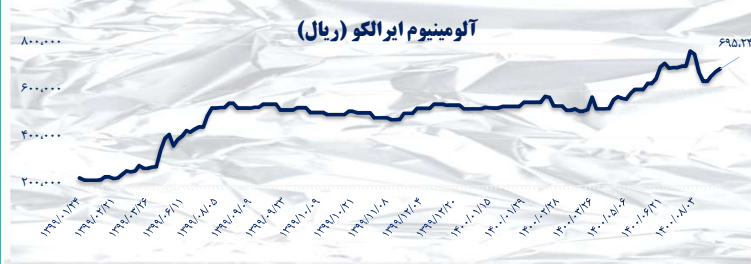
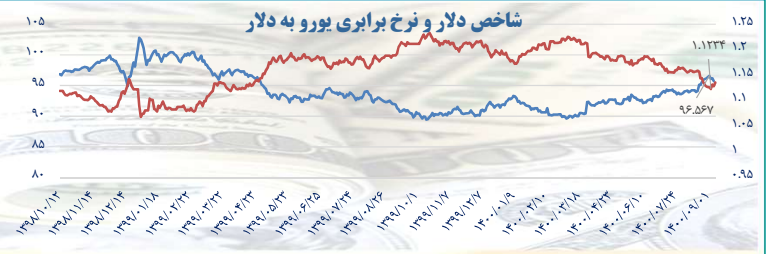
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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%)	۶۳.۵-۸۹.۷	۷-۶.۵
	lumps (62.5%-63.5%)	۹۸.۳-۹۹.۳	۷
برزیل	finer (61%-65%)	۳۸.۵-۸۹.۵	۶
	lumps (62%)	۸۲.۷	۶
هند	finer (55%-62%)	۲۱.۸-۶۷	۴-۶.۵
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۴-۶۸	۶
	concentrates (65.0%-67.0%)	۸۵.۲-۹۳.۸	۴-۳
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۸۴.۴-۸۵.۹	۶
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۱۳.۵-۱۳۶	-

حمل محموله های سنگ آهن از استرالیا به چین ۷,۳ درصد کاهش هفتگی داشته است. در این میان صادرات Rio Tinto و FMG به چین به ترتیب ۱۵,۳ درصد و ۳۳,۴ درصد کاهش داشته ولی صادرات BHP افزایش ۶,۰ درصدی داشته است. روند صادرات برزیل نیز کاهش است و در کل جهان ۱,۷ درصد کاهش هفتگی داشته است. در این میان صادرات Vale با ۰,۳ درصد افزایش و CSN با ۱۰۰ درصد کاهش همراه بوده است.

با توجه به کاهش تقاضا برای گندله های عیار بالا تحت حاشیه سود پایین کارخانه های فولاد، پرمیوم گندله از اوایل نوامبر به کاهش خود ادامه داد. در روز جمعه ۲۶ نوامبر پرمیوم گندله های ۶۵٪ و ۶۴٪ به ترتیب با کاهش ۱۶,۷۰ دلاری به ۴۸,۷۵ دلار و کاهش ۱۰,۰۵ دلاری به ۳۸,۳۵ دلار رسیدند.

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	

• گزارش حسابرِس و بازرِس قانونی نسبت به گزارش توجیهی هیئت مدیره در خصوص افزایش سرمایه شرکت از ۵۵ هزار میلیارد ریال به ۲۰۰ هزار میلیارد ریال از محل مطالبات حال شده سهامداران و آورده نقدی، سود انباشته در کدال قرار گرفت.

کچاد

کدال

مرکز مطالعاتی «بارکلیز» پیش‌بینی کرد متوسط قیمت نفت در سال ۲۰۲۲ میلادی سه دلار نسبت به برآوردهای قبلی افزایش خواهد یافت که دلیل آن نرخ پایین‌تر رشد عرضه نفت به بازار جهانی و افزایش تقاضا به دنبال ازسرگیری فعالیت‌های اقتصادی در اغلب کشورهای دنیاست. بر مبنای این گزارش، متوسط قیمت هر بشکه نفت برنت در سال بعد به ۸۰ دلار می‌رسد درحالی‌که متوسط قیمت هر بشکه نفت وست تگزاس برابر با ۷۷ دلار خواهد بود.

اخبار روز

اکنونمیست، تورم در سراسر جهان در حال افزایش است و افزایش قیمت‌ها اکنون از اهداف بانک‌های مرکزی فراتر رفته‌اند. اگرچه سیاستگذاران آنجا مدت‌هاست که به دنبال ایجاد تورم بوده‌اند، اما قیمت‌های مصرف‌کننده همچنان از تکان خوردن خودداری می‌کنند، و در ماه سپتامبر، تنها ۰/۲ درصد نسبت به سال قبل افزایش یافت و تورم، بدون احتساب قیمت مواد غذایی تازه و انرژی، در واقع ۰/۵ درصد در مدت مشابه کاهش یافت.

اخبار روز

بر اساس آخرین اطلاعات صندوق بین‌المللی پول در میان ۱۸۹ اقتصاد جهان، فقط ۱۲ کشور دارای نرخ ارز دوگانه هستند که شامل کشورهای ارمنستان، باهاما، برونئی، اریتره، غنا، عراق، قرقیزستان، مالدیو، ساؤتومه و پرنسیپ، سودان جنوبی، سوریه و ایران هستند.

اخبار روز

در چین، گمانه زنی‌های گسترده‌ای در مورد برنامه‌هایی برای کاهش تولید در مقیاس بزرگ در آستانه بازی‌های المپیک زمستانی ۲۰۲۲ وجود دارد. بر اساس گزارش‌ها، برخی کارخانه‌های فولاد در شهر تانگشان ممکن است تولید را برای دو ماه از اواسط ژانویه متوقف کنند. با این حال، برای برآورد اثر آن بر بازار باید منتظر ماند، چراکه بسیاری از کارخانه‌های فولاد قبلاً تولید خود را محدود کرده بودند.

اخبار روز

روسیه عوارض جدیدی را بر صادرات قراضه‌های آهنی وضع نمود. با اینکه انتظار بازار تعرفه‌های بالاتری برای صادرات قراضه بود، دولت روسیه عوارض ثابت قبلی را به ۵ درصد تغییر داد، به شرطی که کمتر از ۱۰۰ یورو نباشد.

اخبار روز

شرکت Fortescue Metals سامانه جدیدی را برای ارائه قیمت‌های سنگ آهن خود با استفاده از برنامه‌هایی که قابلیت اجرای حراج بر روی سیستم دیجیتال را دارند، آزمایش خواهد کرد. این سامانه امسال بازارهای لیتیوم را شگفت‌زده کرد و به شرکت Pilbara Minerals این امکان را داد تا محصول خود را با بیش از دو برابر قیمت معیار به فروش برساند.

اخبار روز