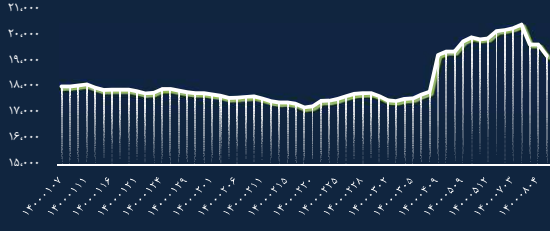


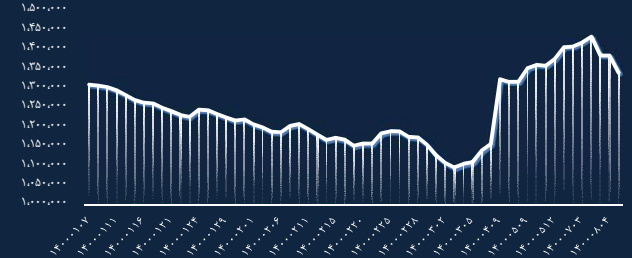
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۱۰

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۲۳۶	۱,۳۴۰,۱۲۱	
۱۰,۷۴۱,۷۲۲.۱۲۸ B	۵۳,۵۶۶,۲۴۵.۳۱۲ B	ارزش بازار
(-۲۲۵)	(-۱۷,۰۰۹)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۱.۲)	(-۱)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۱۹,۳۷۶.۹۷۰ B	۲۹,۴۱۵.۱۹۳ B	ارزش معاملات

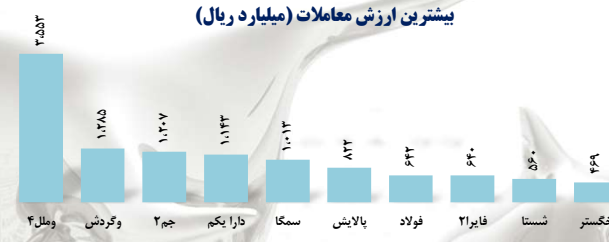
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



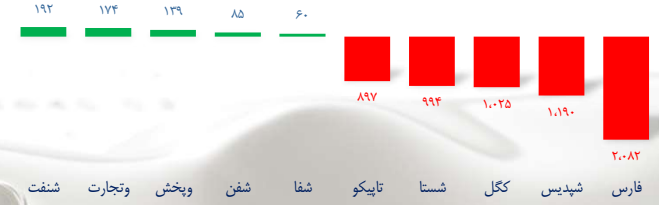
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



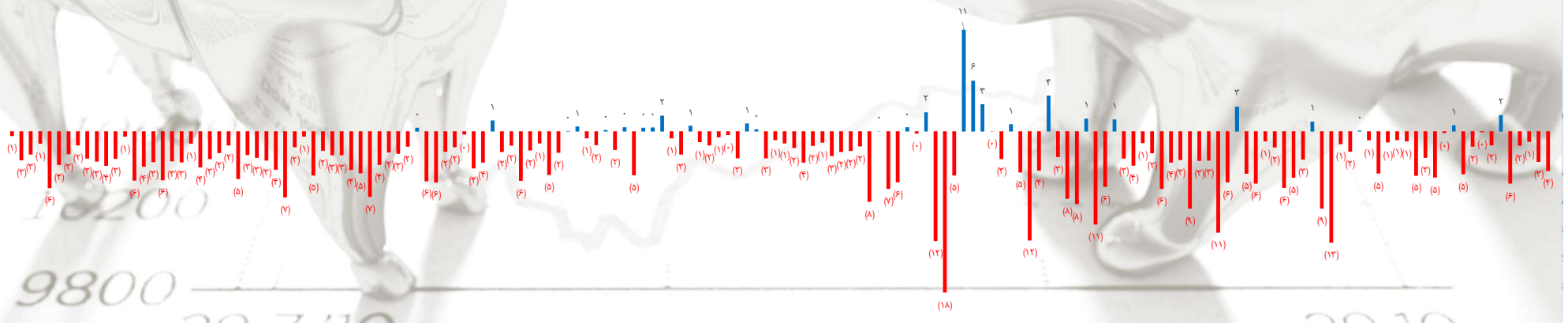
درصد فروش حقیقی‌ها

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

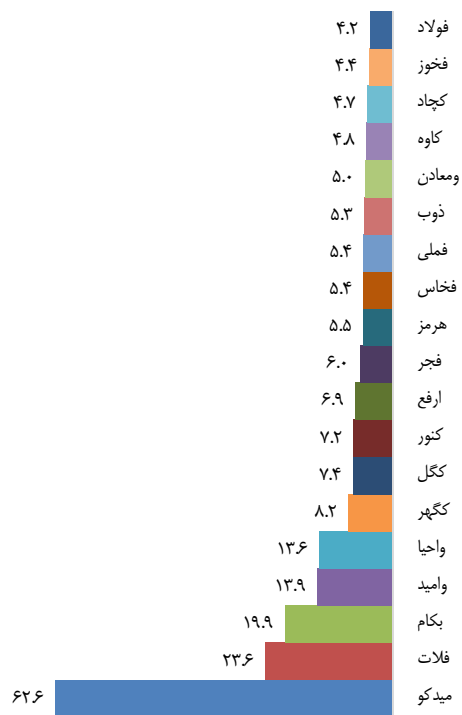
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



درصد خرید حقیقی‌ها



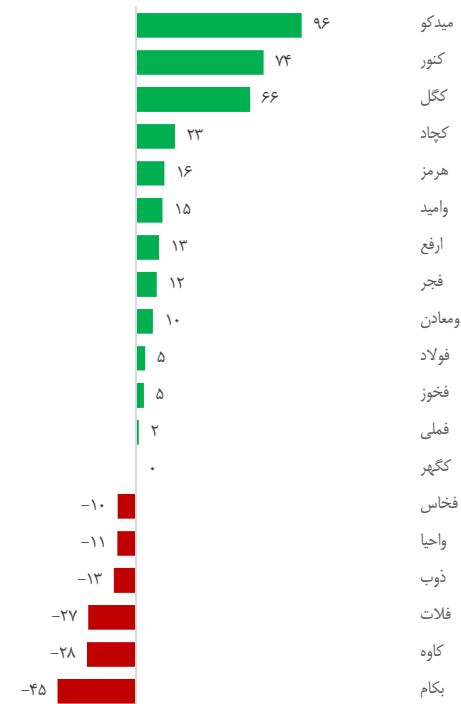
P/E تحلیلی



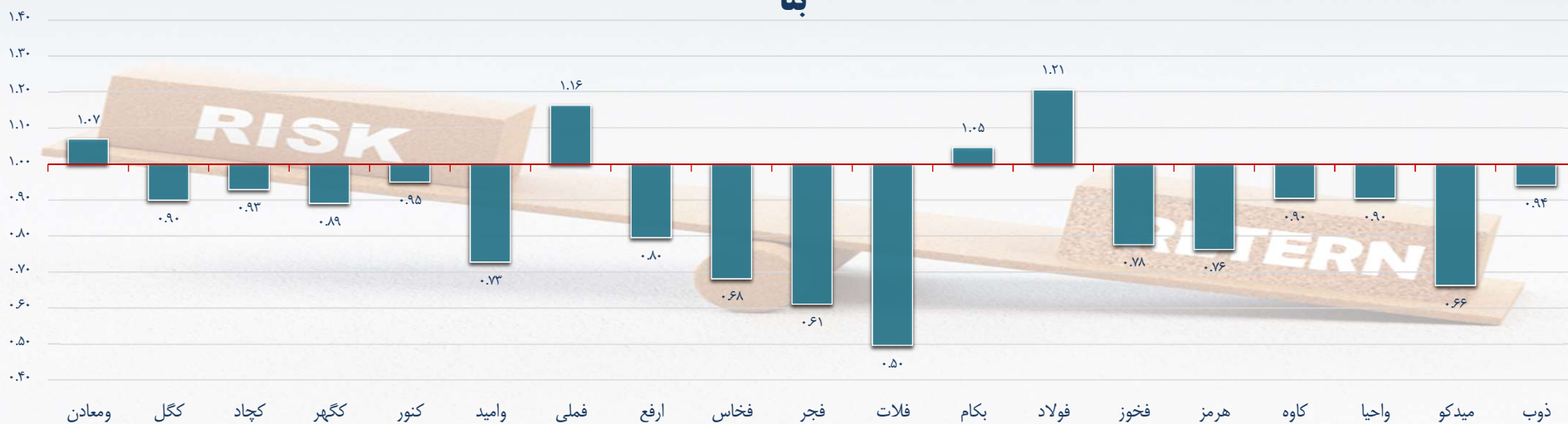
عملکرد معاملات سهام پرتوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا

نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه معادن و فلزات	۲۲,۰۰۲,۷۲۳	۲۰۶,۲۶۳	۹,۳۷۰	(۰.۶)	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۳,۱۰۴,۵۶۵	۷۰,۹۶۹	۲۳,۱۲۰	(۱.۷)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۶۸۹,۶۴۲	۷۲,۱۹۲	۲۶,۹۱۰	(۰.۴)	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۶۱۶,۹۳۹	۲۷,۴۳۷	۴۶,۰۴۱	(۱.۱)	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۱,۴۹۱,۱۹۵	۲۷,۰۱۵	۱۸,۳۵۰	(۰.۵)	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۱,۹۲۴,۸۳۸	۲۵,۵۴۵	۱۳,۲۲۰	(۰.۱)	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده		۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۴۵۸
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۷۰۷,۲۹۱	۲۴,۷۰۰	۱۴,۷۶۰	(۱.۱)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۳۶۲,۴۳۶	۸,۲۱۳	۲۳,۷۴۰	(۰.۴)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۴۳۱,۸۶۶	۳۲,۹۱۵	۲۲,۹۹۰	(۰.۸)	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۶۶۳,۲۶۴	۷,۴۴۷	۱۱,۲۹۷	(۲.۳)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۱۶,۱۲,۱۴۹	۱۹,۶۴۴	۱,۶۹۲	(۴.۰)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۶۳,۷۱۲,۷۵۰	۶۴۱,۷۴۰	۱۰,۰۷۰	(۰.۳)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۹,۰۵۸,۳۱۰	۵۶,۵۲۸	۶,۳۵۰	(۱.۶)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۲۴۷,۷۸۱	۳۵,۶۶۰	۱۶,۲۴۳	(۱.۱)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۸,۹۰۱,۱۲۸	۱۳۰,۲۳۰	۱۴,۶۳۰	(۰.۲)	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۳۹۴,۸۱۷	۵۱,۴۸۵	۱۳۰,۴۵۴	(۲.۹)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۳,۵۷۴,۰۵۹	۱۶۳,۷۳۵	۴۵,۸۱۰	(۰.۱)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۹,۰۴۱,۸۹۶	۱۰۰,۵۹۳	۳,۴۶۴	(۳.۳)	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

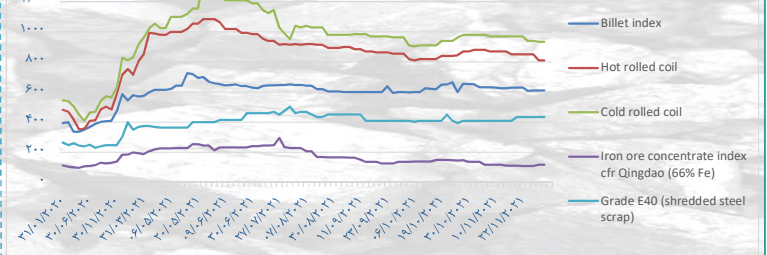
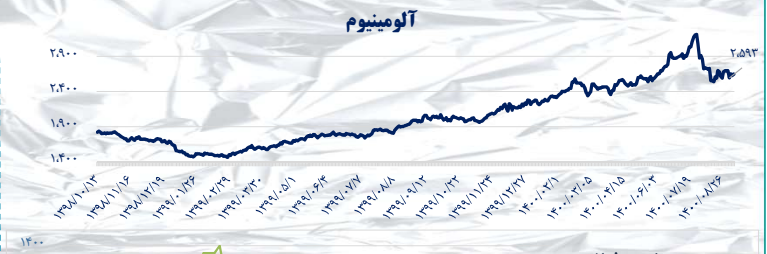
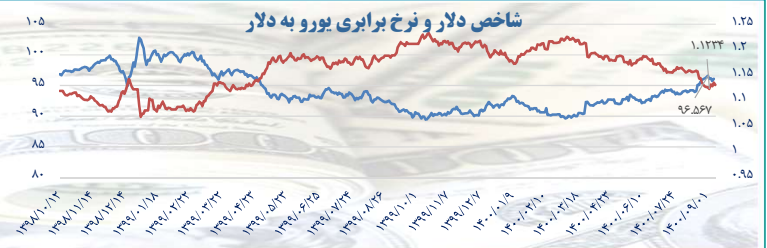
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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%)	۶۱.۵-۸۸.۷	(۱)
	lumps (62.5%-63.5%)	۹۶.۳-۹۷.۳	(۱)
برزیل	finer (61%-65%)	۳۷.۵-۸۹	۰.۵
	lumps (62%)	۸۱.۲	(۰.۵)
هند	finer (55%-62%)	۲۱.۳-۶۶.۸	(۰.۵-۰.۲)
	pellets (64.0%)	۱۲۰	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۴-۶۸	-
	concentrates (65.0%-67.0%)	۸۵.۲-۹۳.۸	-
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۸۴.۴-۸۵.۹	-
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۱۳.۵-۱۳۶	-

بر اساس گزارش SMM، جمعا ۵۴ کشتی حمل بار از ۲۲ تا ۲۹ نوامبر به بنادر اصلی چین وارد شده اند. تخمین زده می شود میزان ورود محموله ها به ۸.۲۴ میلیون تن برسد که نسبت به هفته قبل ۳.۵۸ میلیون تن و نسبت به مدت مشابه سال قبل ۶.۳۹ میلیون تن کاهش یافته است.

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	

• افزایش سرمایه شرکت از مبلغ ۴۵ هزار میلیارد ریال به ۶۰ هزار میلیارد ریال از محل مطالبات و آورده نقدی در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۰۸ در مرجع ثبت شرکت‌ها به ثبت رسیده است.

کدال

میدکو

• شرکت سرمایه‌گذاری و توسعه گل‌گهر از زیرمجموعه‌های شرکت معدنی و صنعتی گل‌گهر در دوره منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ توانست سود خالص ۵,۲۲۶ میلیارد ریال محقق کند که نسبت به دوره مشابه سال گذشته ۲ درصد کاهش داشته است.

کدال

کگل

رشد قیمت انرژی در اروپا باعث شده تا شرکت‌های بیشتری اقدام به تعطیلی خطوط تولید خود کنند. شرکت فروگلوب که تولیدکننده فروآلیاژ در اروپا است، اعلام کرد که خطوط تولید خود را بدلیل رشد قیمت‌ها، متوقف می‌کند. چند هفته قبل، تعطیلی خطوط تولید نیراستار بلژیک عامل جهش ۲۰٪ قیمت روی جهانی شد.

اخبار روز

وزارت انرژی عربستان روز یکشنبه (۲۸ نوامبر) یک یادداشت تفاهم با شرکت صنایع پایه عربستان سعودی؛ سابیک، برای کمک به توسعه پروژه‌های انرژی تجدیدپذیر این شرکت امضا کرد.

اخبار روز

طبق اعلام سایت بدهی آمریکا، تا پایان ماه نوامبر، ایرلند بیشترین نسبت بدهی خارجی به تولید ناخالص داخلی را در جهان داشته است؛ به گونه‌ای که این کشور اکنون بیشتر از هشت برابر اندازه اقتصاد خود بدهی خارجی دارد.

اخبار روز

پلتس پرمیوم زغال استرالیا را با ۵۰ سنت کاهش ۳۱۵,۵۰ دلار فوب استرالیا اعلام کرد و زغال تحویل CFR چین را در ۲۹ نوامبر با ۵ دلار افت ۳۸۱ دلار گزارش کرد.

اخبار روز

نیپون استیل در کارخانجات ورق‌سازی تایپند سرمایه‌گذاری نموده است و قصد دارد شرایط جدیدی در تولید ورق در تایپند ایجاد کند.

اخبار روز

تحولات تجارت کالایی بدون نفت خام ایران طی ۸ ماهه نخست ۱۴۰۰:

رشد ۳۸ درصدی ارزش واردات نسبت به مدت مشابه سال قبل

رشد ۴۲ درصدی ارزش صادرات بدون نفت خام نسبت به مدت مشابه سال قبل

کاهش حدود ۲۴ درصدی ارزش صادرات بدون نفت خام در آبان ۱۴۰۰ نسبت به ماه قبل

کاهش حدود ۸ درصدی ارزش واردات طی در مهر ۱۴۰۰ نسبت به ماه قبل

اخبار روز