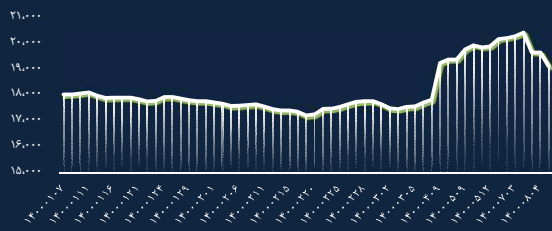


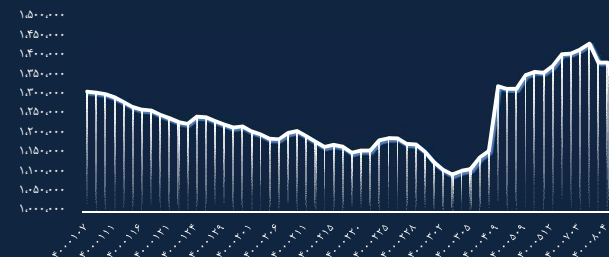
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۳/۰۹/۱۴۰۰

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۱۳۵	۱,۳۳۴,۷۳۵	
۱۰,۶۸۵,۵۵۱.۷۳۱ B	۵۳,۳۵۴,۲۲۰.۸۶۱ B	ارزش بازار
(-۰.۱)	(-۵,۳۲۸)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۵)	(-۰)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۱۶,۵۳۴.۸۱۵ B	۳۲,۷۱۲.۰۳۳ B	ارزش معاملات

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



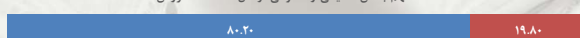
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



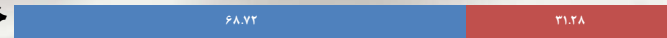
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



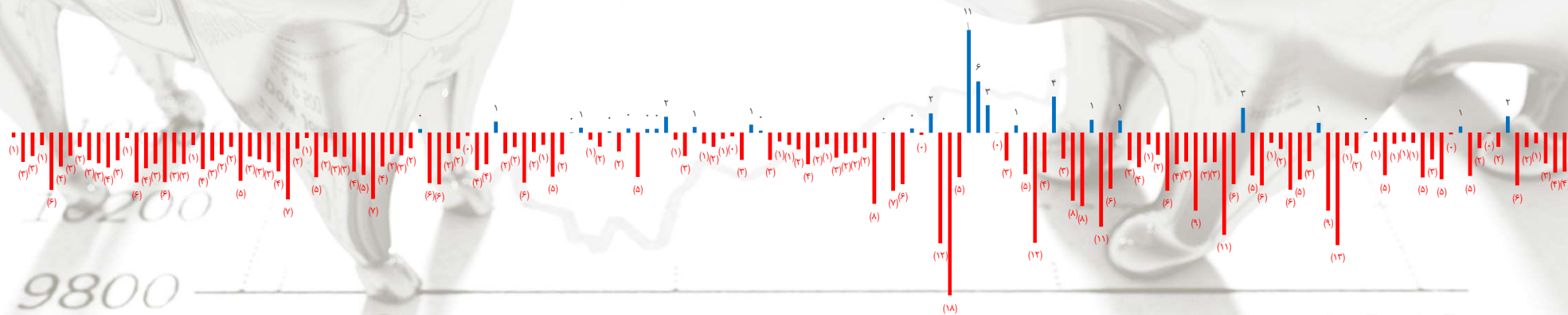
درصد فروش حقیقی‌ها

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

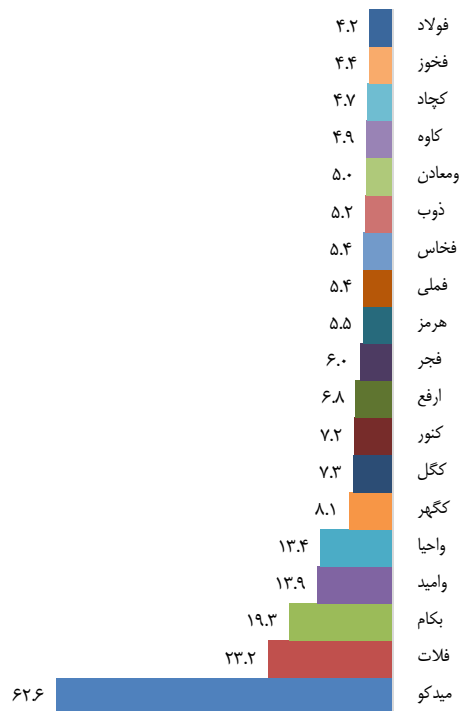
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



درصد خریدهای حقوقی‌ها

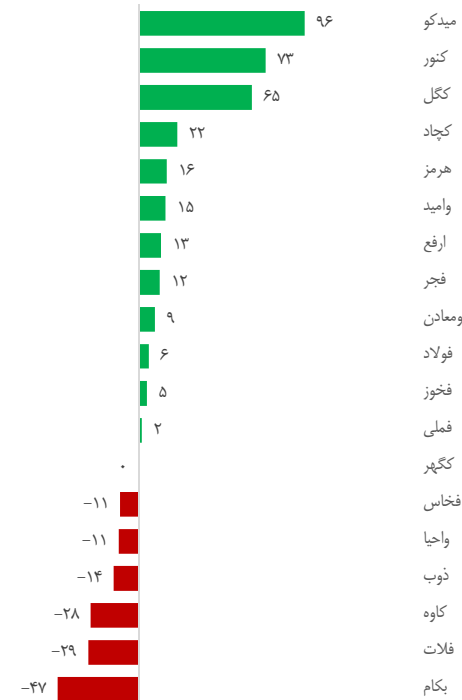


P/E تحلیلی



عملکرد معاملات سهام پرتقوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا						
نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه معادن و فلزات	۷,۸۹۶,۰۵۹	۷۳,۲۱۸	۹,۳۱۰	(۰.۶)	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۳,۰۰۷,۷۴۳	۶۸,۸۹۷	۲۳,۰۰۰	(۰.۵)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۷۶۳,۷۵۱	۷۴,۰۱۱	۲۶,۸۳۰	(۰.۳)	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۵۹۴,۴۳۰	۲۶,۷۲۳	۴۵,۷۹۴	(۰.۵)	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۶۳۰,۳۶۳	۱۱,۲۵۲	۱۸,۲۹۰	(۰.۳)	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۵۴۲,۱۹۶	۷,۱۷۵	۱۳,۲۲۰	۰.۰	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۰	۰	۱۳,۲۹۰	۰.۰	۱,۳۰۲	۲,۴۵۸
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۴۸۲,۷۵۸	۲۱,۵۰۶	۱۴,۶۸۱	(۰.۵)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۳۱۹,۷۹۷	۷,۲۸۷	۲۳,۶۷۰	(۰.۳)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۴۵۹,۳۳۴	۳۳,۵۴۳	۲۲,۹۹۰	۰.۰	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۵۹۹,۳۱۴	۶,۵۷۴	۱۱,۰۷۵	(۲.۰)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۸,۰۴۶,۷۵۴	۱۳,۱۵۰	۱,۶۴۰	(۳.۱)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۶۱,۸۲۷,۱۳۹	۶۲۴,۴۰۹	۱۰,۱۰۰	۰.۳	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۶,۹۵۶,۲۵۹	۴۴,۰۸۶	۶,۳۵۰	۰.۰	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۳,۰۲۹,۷۳۱	۴۸,۷۹۰	۱۶,۱۸۶	(۰.۴)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۹,۹۹۳,۱۴۹	۱۴۷,۲۴۲	۱۴,۷۳۰	۰.۷	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۳۶۳,۰۴۱	۴۶,۷۸۸	۱۲۹,۰۲۴	(۱.۱)	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۳,۹۵۳,۱۱۶	۱۸۱,۰۲۵	۴۵,۷۹۰	(۰.۰)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۳۶,۷۵۱,۳۱۶	۱۲۴,۷۶۰	۳,۳۹۵	(۲.۰)	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

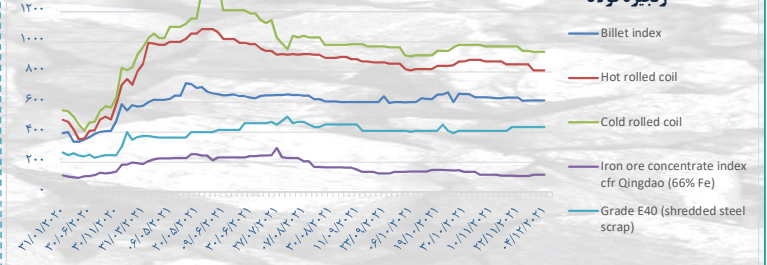
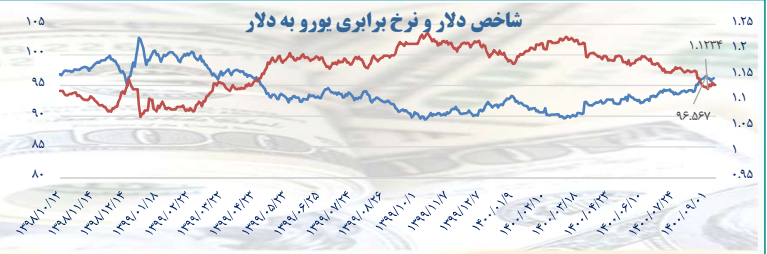
این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده، سهامی

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%)	۶۱-۸۷.۷	(۲-۲.۵)
	lumps (62.5%-63.5%)	۹۶.۳-۹۷.۳	(۳)
برزیل	finer (61%-65%)	۳۶-۸۷.۵	(۴)
	lumps (62%)	۸۱.۲	(۳)
هند	finer (55%-62%)	۲۰.۱-۶۴.۸	(۲.۵)
	pellets (64.0%)	۱۲۰	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۵-۶۶	(۲-۳)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۸۳.۲-۹۲.۸	(۲-۱)
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۸۲.۴-۸۶.۹	(۲)
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۵.۵-۱۲۷	(۳-۴)

برخی فعالان تجاری انتظار دارند که به دلیل موجودی بالای سنگ آهن ۴۵ بندر چین، قیمت‌ها بیشتر اصلاح شود چرا که به علت حاشیه سود محدود فولاد، کارخانه‌ها برای خرید بیشتر عجله‌ای ندارند.

از اول دسامبر ۱۰ کارخانه در قطب اصلی فولادسازی چین در تانگشان رتبه بندی عملکرد آلایندگی خود را از D به C ارتقا دادند که بازتابی از پیشرفت‌های اخیر 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	

• پیشنهاد هیات مدیره به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه ۱۱۳ درصدی (از ۱۵ هزار میلیارد ریال به ۳۲ هزار میلیارد ریال) از محل سود انباشته به منظور تامین بخشی از منابع مورد نیاز نیاز جهت تکمیل طرح توسعه.

کاوه

کدال

• اطلاعات و صورت‌های مالی تلفیقی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ حسابرسی شده شرکت منتشر شده است، شرکت توانست ۱۵،۴۳۲ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به دوره مشابه سال گذشته ۵۹ درصد افزایش داشته است.

کنور

کدال

انجمن آهن و فولاد چین CISA در پستی که در ۳۰ نوامبر به اشتراک گذاشت اعلام کرد: طی ماه های ژانویه تا اکتبر، کشورهای ASEAN به عنوان برترین خریدار محصولات فولادی چین، در حجم ۱۶/۸ میلیون تن باقی ماندند که ۱۶/۴ درصد رشد نسبت به مدت مشابه سال قبل داشته و سهم ۲۹/۲ درصدی از کل صادرات فولاد در این دوره را به خود اختصاص داده اند.

اخبار روز

مس برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن با افزایش ۱/۰۳ درصدی در قیمت ۹،۴۶۹ دلار در هر تن بسته شد. انتظار می رود مس در محدوده ۹،۴۰۰ تا ۹،۵۰۰ دلار در هر تن معامله شود. آلومینیوم برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن در ۲،۶۱۳ دلار در هر تن بسته شد که ۱/۳۲ درصد کاهش داشت. سرب برای تحویل سه ماهه در LME به ۲،۲۴۴ دلار در هر تن رسید که ۱/۷۹ درصد کاهش را نشان می دهد. روی برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن با ۰/۱۳ درصد کاهش به ۳،۱۵۶ دلار در هر تن رسید. انتظار می رود روی در محدوده ۳،۱۵۰ تا ۳،۲۰۰ دلار در هر تن حرکت کند.

اخبار روز

پلتس پرمیوم زغال استرالیا را بدون تغییر ۳۱۵/۵۰ دلار در هر تن فوب استرالیا اعلام کرد و زغال تحویل CFR چین را با ۸ دلار کاهش در ۲ دسامبر ۳۶۳ دلار در هر تن چین گزارش نمود.

اخبار روز

موسسه MEPS پیش بینی تولید فولاد ضد زنگ جهانی خود را به ۵۶/۸ میلیون تن در سال ۲۰۲۱ ارتقا داده است. کاهش سرعت تولید چین با فعالیت های قوی تر از حد انتظار در سایر نقاط جهان به ویژه اندونزی جبران خواهد شد.

اخبار روز

گینه بزرگترین تولید کننده بوکسیت در جهان است و همچنین دارای ذخایر زیادی از سنگ آهن می باشد. Doumbouya، که رهبری کودتا و سرنگونی رئیس جمهور سابق را بر عهده داشت، تمام قراردادهای معدنی این کشور را اصلاح کرد و این نشان می دهد که گینه مشتاق است بخشی را که همواره رگ حیاتی اقتصادش بوده، بازسازی نماید.

اخبار روز

بر اساس گزارش بانک مرکزی، حجم نقدینگی در پایان مهرماه سال ۱۴۰۰ به حدود ۴،۲۲۷/۵ هزار میلیارد تومان رسیده که نسبت به پایان سال ۱۳۹۹ معادل ۲۱/۶ درصد رشد یافته است. نرخ رشد نقدینگی در دوازده ماهه منتهی به مهرماه ۱۴۰۰ به ۴۲/۸ درصد رسید. این آمار نشان می دهد حجم نقدینگی در پایان مهرماه نسبت به پایان شهریور حدود ۴ درصد رشد کرده است.

اخبار روز