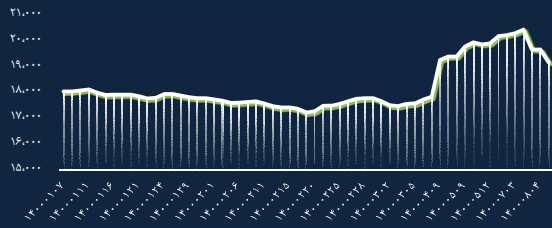


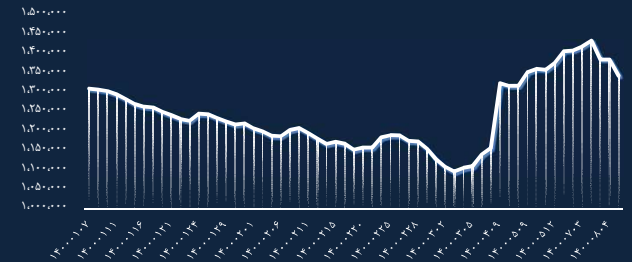
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۱۵

شاخص کل فرابورس

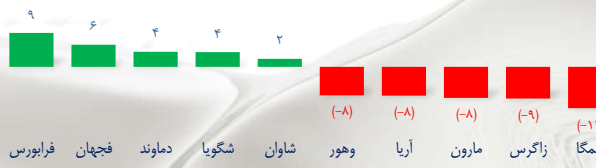


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۱۸۱	۱,۳۴۲,۳۳۷	
۱۰,۷۰۸,۸۰۱.۷۱۵ B	۵۳,۶۵۴,۲۴۷.۸۷۸ B	ارزش بازار
(-۲۸)	(-۸۶۵)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۱)	(-۰)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۴۸۰,۶۱۳.۵۳۳ B	۳۱,۷۰۹.۳۰۰ B	ارزش معاملات

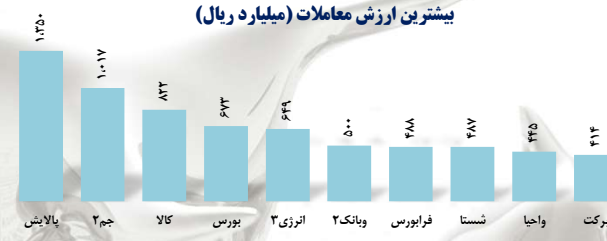
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



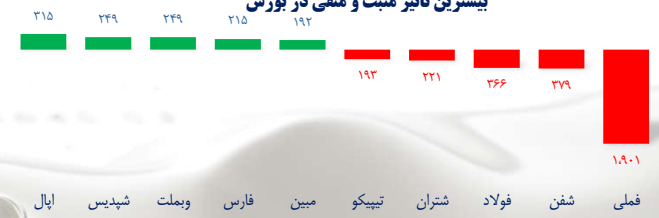
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



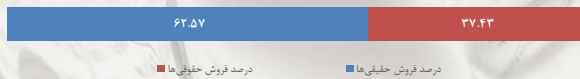
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



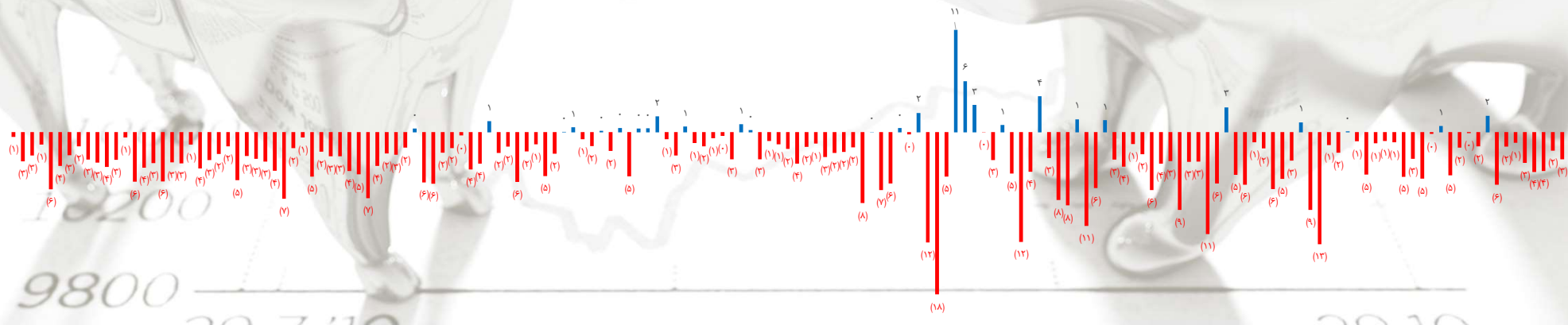
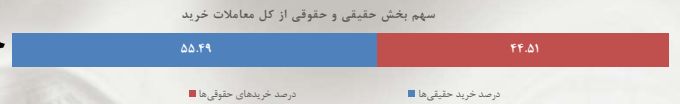
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



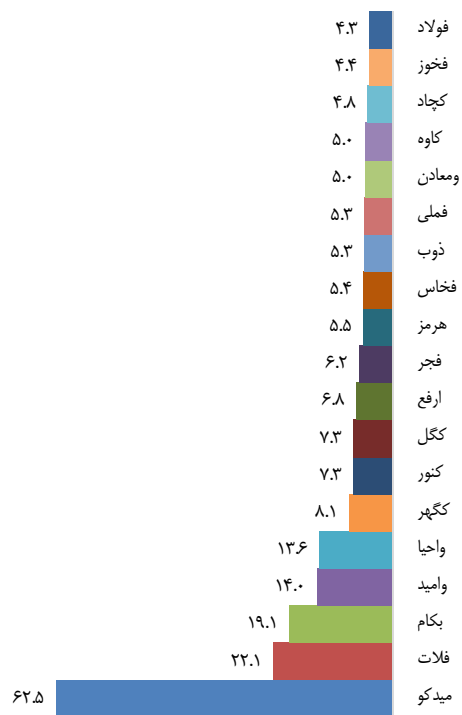
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



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



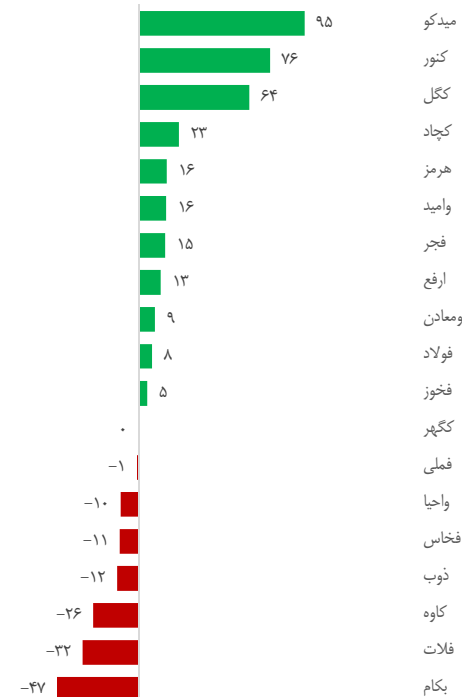
P/E تحلیلی



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	۴,۳۸۲,۳۸۴	۴۰,۸۵۰	۹,۳۲۰	۰.۰	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معذنی و صنعتی گل گهر	۱۱,۰۶۴,۷۰۸	۲۵,۲۵۰	۲۲,۸۲۰	(۰.۱)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معذنی و صنعتی چادرملو	۱,۱۱۸,۲۰۲	۳۰,۳۴۱	۲۷,۰۳۰	-۰.۲	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۲,۴۳۳,۴۴۹	۱۱۱,۴۶۷	۴۵,۸۰۶	۰.۰	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معذنی و صنعتی صبانور	۲,۳۶۸,۷۹۰	۴۴,۶۸۵	۱۸,۵۶۰	۱.۵	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۱,۱۵۴,۶۹۶	۱۵,۵۶۶	۱۳,۲۶۰	-۰.۲	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۵۴,۸۶۱,۴۴۱	۳۵۴,۳۰۸	۶,۴۶۰	(۲.۹)	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۴۶۷,۹۲۰	۲۱,۵۱۳	۱۴,۶۵۹	(۰.۰)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱۲۸,۹۰۳	۲,۹۰۲	۲۳,۶۲۰	(۰.۱)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۵۷۴,۷۱۲	۳۷,۲۳۱	۲۳,۶۴۰	-۰.۲	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۷۷۵,۳۱۸	۸,۱۷۶	۱۰,۵۷۷	(۲.۱)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۷,۴۲۱,۸۲۵	۱۲,۰۷۰	۱,۶۲۷	(۰.۳)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۳۸,۲۱۶,۲۶۶	۳۹۲,۶۶۳	۱۰,۲۷۰	(۰.۵)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۳,۶۱۲,۶۴۱	۲۲,۸۱۷	۶,۳۶۰	(۰.۲)	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۱,۱۴۰,۴۱۰	۱۸,۳۶۶	۱۶,۱۸۶	(۰.۱)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۶,۵۵۲,۶۷۴	۹۸,۴۲۲	۱۵,۰۲۰	۱.۱	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۳,۴۰۵,۸۱۵	۴۴۴,۷۵۲	۱۳۰,۵۸۶	-۰.۴	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معذنی خاورمیانه	۴,۸۶۴,۱۹۰	۲۲۲,۵۸۲	۴۵,۷۶۰	۰.۰	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۲,۲۸۸,۰۵۶	۷۷,۴۴۱	۳,۴۷۴	-۰.۲	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

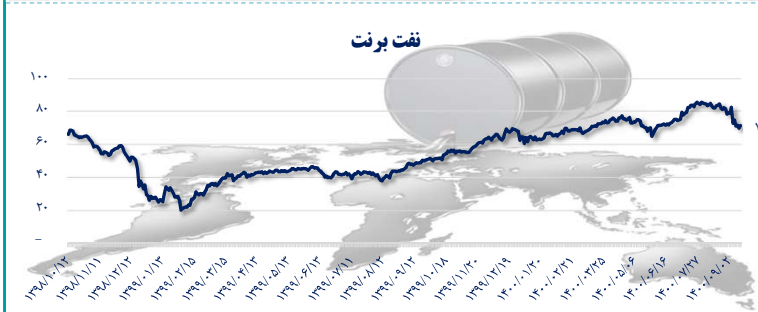
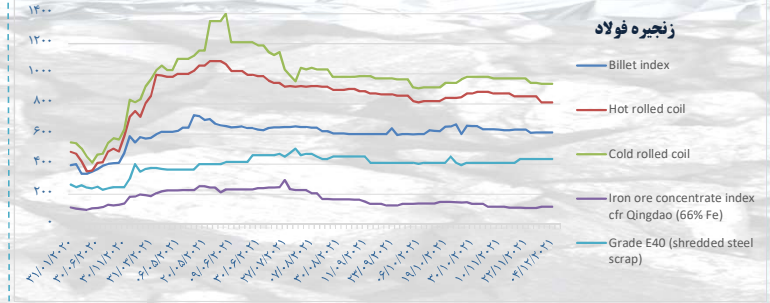
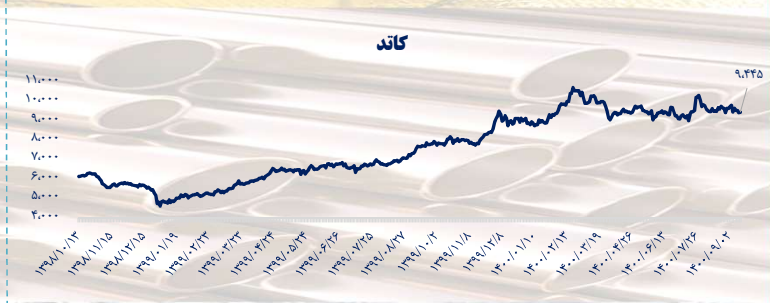
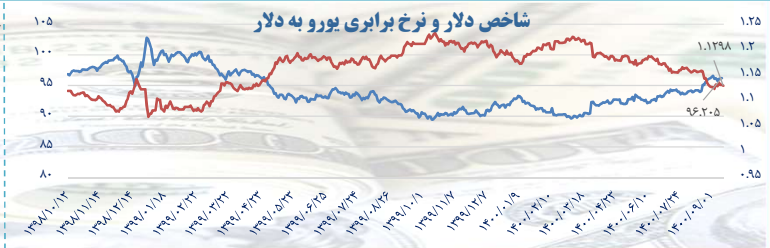
این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده، سهامی

که ریسک کمتری دارد را انتخاب کرد.

داخلی

آخرین نرخ کامودیتی ها

جهانی



قیمت زنجیره سنگ آهن و موجودی بنادر چین

شاخص حمل دریایی بالتیک پس از افت تا محدوده ۲۴۰۰ واحد، تحت تاثیر نگرانی ها از عواقب شیوع سویه اومیکرون و احتمال قرنطینه کشتی ها در بنادر و کاهش سرعت عملیات تخلیه و بارگیری روندی صعودی به خود گرفته است. البته هنوز برای اظهار نظر در خصوص آثار تجاری سویه جدید زود است.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۶۱.۵-۸۸.۷	۰.۵-۱
	lumps (62.5%-63.5%)	۹۷.۳-۹۸.۳	۱
برزیل	finer (61%-65%)	۶۷-۸۷.۵	۱
	lumps (62%)	۸۲.۲	۱
هند	finer (55%-62%)	۲۰.۶-۶۵.۸	۰.۵-۱
	pellets (64.0%)	۱۲۰	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۵.۵-۶۶.۵	۰.۵
	concentrates (65.0%-67.0%)	۸۴.۲-۹۳.۸	۱
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۸۳.۴-۸۷.۹	۱
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۵.۵-۱۲۷	-

ظرفیت	تغییر هفتگی	موجودی	موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	
۲۱,۰۰۰	۲۵۰	۲۳,۴۵۰	Qingdao	بنادر
۱۵,۵۰۰	-۴۵۰	۱۱,۳۰۰	Tianjin	
۲۳,۰۰۰	-۱۵۰	۱۵,۳۰۰	Caofeidian	
۲۳۶,۲۰۰	۲,۱۸۰	۱۵۴,۱۶۰	Total	

• اطلاعات و صورت‌های مالی تلفیقی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ حسابرسی شده شرکت منتشر شده است، شرکت توانست ۴۱،۶۱۳ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به دوره مشابه سال گذشته ۹۶ درصد افزایش داشته است.

کدال

هرمز

چین قصد دارد تا سال ۲۰۲۵ در حدود ۰.۴۵٪ از نیاز سنگ آهن خود را در داخل تامین نماید. این کشور هم اکنون در حدود ۰.۸۰٪ از نیاز سنگ آهن خود را از کشورهای استرالیا و برزیل وارد می‌کند که ابتکار عمل در تنظیم قیمت را به این دو کشور داده است.

اخبار روز

انتشار خبر ارسال لایحه ممنوعیت ارزهای دیجیتال به سنای آمریکا در کنار مشاهده ی اولین کیس مبتلا به اومیکرون در آمریکا باعث اصلاح سنگین بازار کریپتو و کاهش قیمت بیت کوین به پایین‌ترین سطح از ابتدای اکتبر امسال گردید.

اخبار روز

در طرح سنجش نگرش مردم ایران پیرامون وضعیت اقتصادی کشور با جامعه آماری شهروندان بالای ۱۸ سال کل کشور و تعداد نمونه ۱۶۱۲ که در آبان ۱۴۰۰ اجرا شد، ۳۶/۸ درصد گفته‌اند اگر پس‌اندازی داشته باشند ترجیح می‌دهند آن را در بخش زمین و مسکن سرمایه‌گذاری کنند. در بین گروه‌های سنی تمایل افراد بالای ۵۰ سال به سرمایه‌گذاری در بانک بیش از سایر گروه‌هاست. ۱۸ تا ۲۹ ساله‌ها بیش‌تر به اشتغال و کارآفرینی گرایش دارند و تمایل به سرمایه‌گذاری در زمین و مسکن در گروه سنی ۳۰ تا ۴۹ سال بیشتر است.

اخبار روز

از آغاز سال ۱۴۰۰ تا پایان مهر ماه بیش از ۳۱ میلیون تن انواع محصولات بخش معدن و صنایع معدنی به ارزش ۷ میلیارد ۵۹ میلیون دلار از کشور صادر شد. این میزان صادرات از نظر وزنی رشد ۹ درصدی داشته و از نظر ارزشی بیش از ۱۰۵ درصد افزایش نشان می‌دهد.

اخبار روز

در هفته گذشته، میانگین قیمت بیلت صادراتی ایران، ۵۶۵ دلار به ازای هر تن بود که نسبت به هفته پیش از آن، کاهش ۲۲/۵ دلاری یا ۳/۸ درصدی را نشان می‌دهد. قیمت میانگین اسلب صادراتی ایران نیز در هفته گذشته ۵۸۵ دلار به ازای هر تن بود که نسبت به هفته پیش از آن تغییری نشان نمی‌دهد.

اخبار روز

براساس تصمیم جدید وزارت صمت شبکه صادرات و واردات مواد معدنی بین ایران و سه کشور، قزاقستان، ونزوئلا و پاکستان شکل می‌گیرد. بر اساس این توافق در ازای صادرات به این کشورها مواد اولیه از جمله سنگ آهن وارد ایران خواهد شد.

اخبار روز