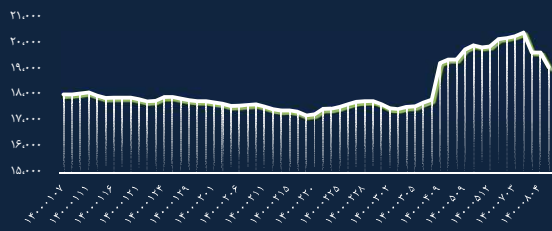


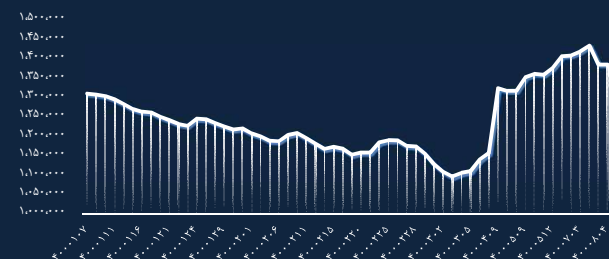
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۶/۰۹/۱۴۰۰

شاخص کل فرابورس

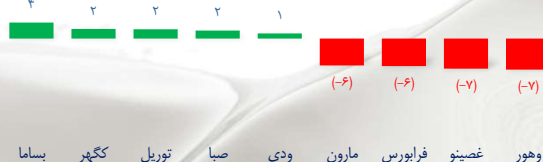


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۱۰۴	۱,۳۳۷,۶۲۰	
۱۰,۶۶۵,۳۹۰.۵۳۴ B	۵۳,۴۶۶,۲۸۰.۴۸۷ B	ارزش بازار
(-۷۸)	(-۴,۷۳۳)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۴)	(-۰)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۲۳,۹۵۴.۶۸۷ B	۳۴,۴۲۷.۳۱۹ B	ارزش معاملات

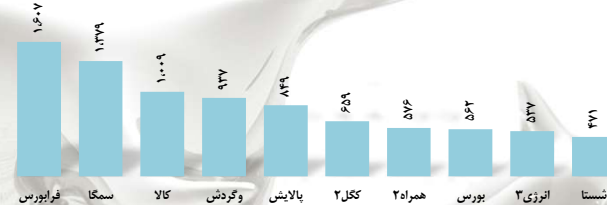
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

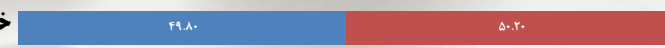


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



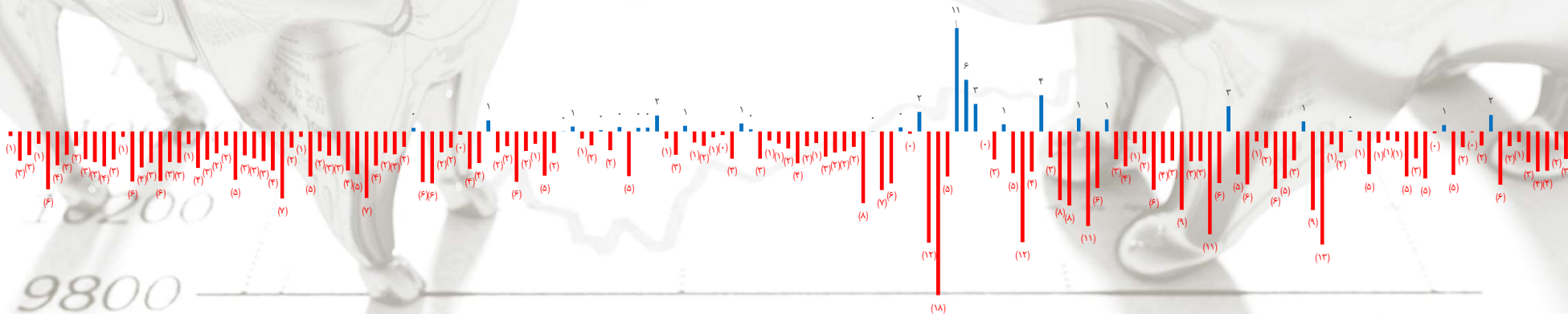
درصد فروش حقیقی‌ها | درصد فروش حقوقی‌ها

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

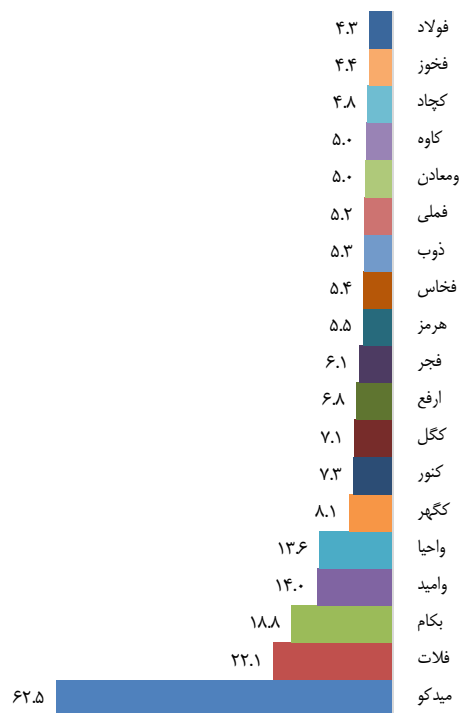


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

درصد خرید حقیقی‌ها | درصد خریدهای حقوقی‌ها

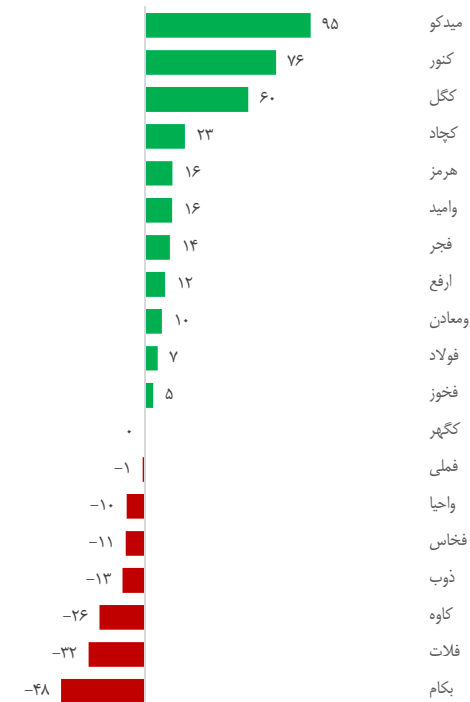


P/E تحلیلی



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	۷,۳۰۵,۱۲۷	۶۸,۶۷۹	۹,۳۷۰	۰.۴	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معذنی و صنعتی گل گهر	۳,۹۴۶,۳۷۴	۸۷,۰۹۷	۲۲,۲۵۰	(۲.۵)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معذنی و صنعتی چادرملو	۱,۹۷۹,۳۶۴	۵۳,۵۳۸	۲۷,۰۴۰	۰.۰	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۱,۰۰۶,۵۰۲	۴۶,۳۳۲	۴۵,۸۵۵	۰.۱	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معذنی و صنعتی صبانور	۱,۳۰۶,۹۰۷	۲۴,۲۳۴	۱۸,۵۶۰	۰.۰	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۲,۸۸۴,۳۰۹	۳۸,۳۱۲	۱۳,۲۷۰	۰.۱	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۷۰,۶۵۴,۷۱۸	۴۵۵,۶۶۲	۶,۴۵۰	(۰.۲)	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۲,۳۰۹,۶۹۲	۳۳,۲۸۲	۱۴,۵۳۹	(۰.۸)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱۴۳,۴۱۲	۳,۲۳۶	۲۳,۵۸۰	(۰.۲)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۹۰,۵۶۸۷	۲۱,۲۶۷	۲۳,۴۹۰	(۰.۶)	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلات ایرانیان	۲,۳۲۹,۷۲۴	۲۳,۵۴۸	۱۰,۵۶۱	(۰.۲)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۹,۴۵۷,۸۴۱	۱۵,۰۷۲	۱,۵۹۴	(۲.۰)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۳۶,۵۶۶,۱۸۲	۳۷۵,۰۹۹	۱۰,۲۶۰	(۰.۱)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۳,۴۳۹,۰۲۴	۲۱,۷۳۵	۶,۳۶۰	۰.۰	۲,۳۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۹۹۷,۲۰۰	۱۶,۰۸۸	۱۶,۱۷۹	(۰.۰)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۲,۴۷۱,۲۲۶	۳۷,۳۵۸	۱۵,۰۶۰	۰.۳	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده		۱۳۰,۵۸۶	۰.۰	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۸,۵۳۱,۹۵۸	۳۹,۰۳۳۴	۴۵,۷۵۰	(۰.۰)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۱,۴۸۵,۲۵۹	۷۴,۳۲۰	۳,۴۶۱	(۰.۴)	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

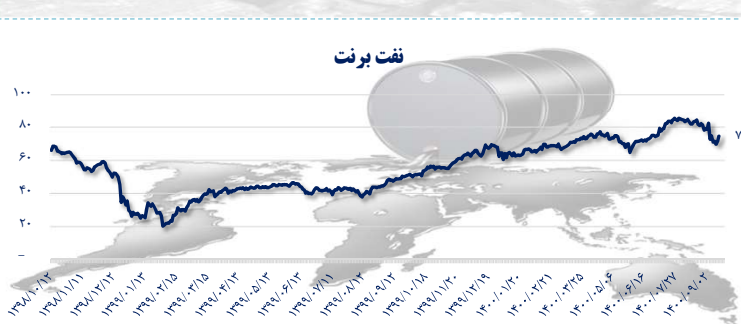
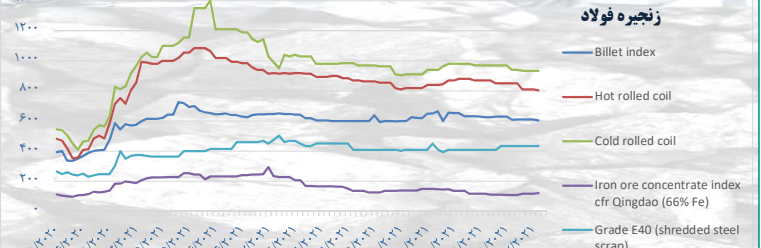
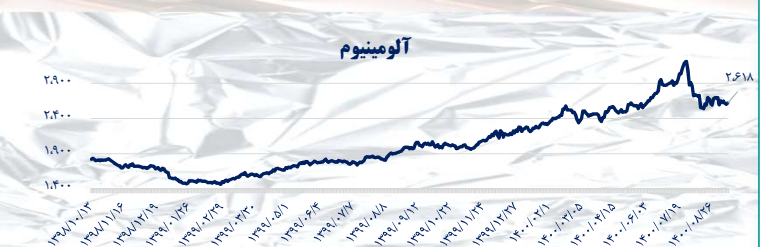
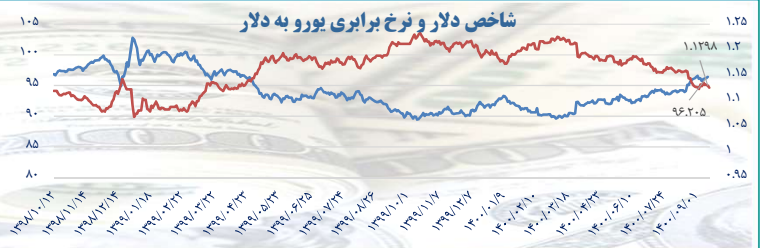
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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

تولید فولادسازان عضو انجمن آهن و فولاد چین طی ۱۰ روزه انتهایی ماه نوامبر روندی کاهشی داشته و نسبت به مدت مشابه ماه گذشته ۵/۱۸ درصد افت نموده است. این در حالیست که تولید چدن خام نسبت به ۱۰ روز میانی نوامبر رشد یافته که نشان از رشد فعالیت بیشتر کوره های بلند چین دارد.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۶۴.۵-۹۰.۷	۳-۲
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۰۰.۳-۱۰۱.۳	۳
برزیل	finer (61%-65%)	۴۰-۹۱.۵	۳-۴
	lumps (62%)	۸۵.۲	۳
هند	finer (55%-62%)	۲۲.۱-۶۷.۸	۱.۵-۲
	pellets (64.0%)	۱۲۰	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۷.۵-۶۹.۵	۲-۳
	concentrates (65.0%-67.0%)	۸۷.۲-۹۵.۸	۲-۳
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۸۶.۴-۹۰.۹	۳
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۷.۵-۱۲۹	۲

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

• اطلاعات و صورت‌های مالی تلفیقی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ حسابرسی شده شرکت منتشر شده است، شرکت توانست ۲۴۲،۷۹۱ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به دوره مشابه سال گذشته ۱۵۰ درصد افزایش داشته است.

فملی

کدال

• اطلاعات و صورت‌های مالی تلفیقی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ حسابرسی شده شرکت منتشر شده است، شرکت توانست ۲۱،۹۵۸ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به دوره مشابه سال گذشته ۲۹۸ درصد افزایش داشته است.

ذوب

کدال

• مهم‌ترین دلایل افزایش سود عملیاتی شرکت: افزایش ۱۰ درصدی تولید مذاب چدن نسبت به مدت مشابه، رشد نرخ فروش محصولات در مقایسه با بهای تمام شده تولید، افزایش ترکیب فروش محصولات با ارزش افزوده بالاتر مانند ریل به میزان ۶۹٪، کلاف به میزان ۵۹۳٪ و آرک تونلی به میزان ۱۳٪.

ذوب

کدال



پیش‌بینی‌های جدید کنفرانس توسعه و تجارت ملل متحد (آنکتاد) حکایت از آن دارد که ارزش تجارت کالا و خدمات در سال ۲۰۲۱ به رقم ۲۸ تریلیون دلار بالغ خواهد شد که افزایشی ۲۳ درصدی نسبت به ۲۰۲۰ و افزایشی ۱۱ درصدی نسبت به سطوح پیش از پاندمی کووید-۱۹ را نشان می‌دهد.



گلدمن ساچه روز شنبه چشم انداز خود را برای رشد اقتصادی آمریکا در سال ۲۰۲۲ به ۳/۸ درصد کاهش داد و دلیل آنرا خطرات و عدم اطمینان در مورد ظهور گونه جدید ویروس کرونا (اومیکرون) عنوان کرده است.



به گفته افراد مطلع، کمیسیون توسعه و اصلاحات ملی چین طرحی را برای تعیین نرخ معیار زغال سنگ حرارتی در ۷۰۰ یوان (۱۱۰ دلار) در هر تن برای قراردادهای بلندمدت تهیه و ترسیم کرده است که به قیمت‌ها اجازه می‌دهد تا در محدوده ۱۵۰ یوان در اصلاحات ماهانه افزایش یا کاهش یابد.



پلتیس پرمیوم زغال استرالیا را با ۲ دلار افزایش ۳۱۷/۵ دلار در هر تن اعلام کرد در حالی که زغال تحویل CFR چین را در ۳ دسامبر با ۵ دلار افت ۳۵۸ دلار در هر تن گزارش کرده است. این موضوع به دلیل بهبود حاشیه سود فولاد بوده که باعث شده مصرف‌کنندگان نهایی بیشتری در محموله‌های کوچکتر خرید کنند، اما شنیده شده که هنوز اکثر خریداران چینی در مورد خرید تردید دارند.



کل تجارت جهان طی نه ماهه نخست ۲۰۲۱ حدود ۲۱ هزارمیلیارد دلار بوده که ۱۶ هزار میلیارد دلار آن مربوط به تجارت کالا و ۴/۵ هزار میلیارد دلار آن نیز مربوط به تجارت خدمات بوده است.



طی نه ماهه نخست ۲۰۲۱، صادرات و واردات کالایی گروه ۲۰ (G-20) هر یک حدود ۱۲/۵ هزارمیلیارد دلار بوده که در مقایسه با نه ماهه نخست سال قبل به ترتیب از افزایش حدود ۲۹ درصدی و ۲۷ درصدی برخوردار بوده است.