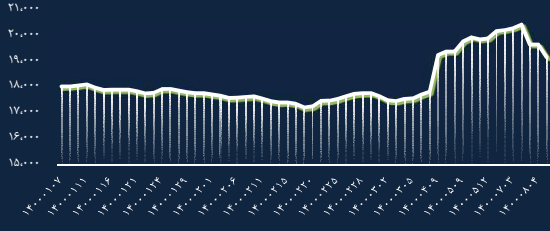


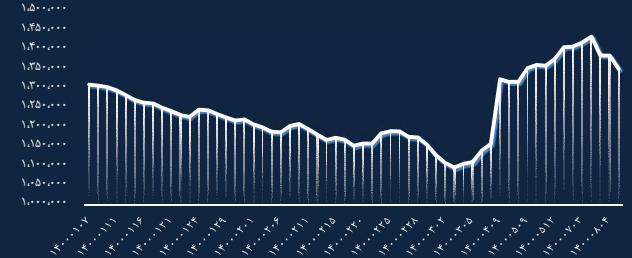
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۱۷

شاخص کل فرابورس

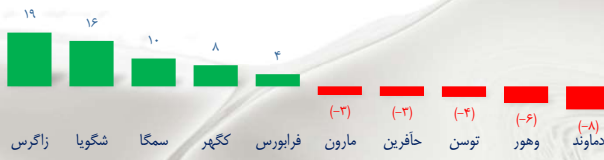


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۱۷۷	۱,۳۴۹,۳۶۵	
۱۰,۷۰۶,۲۰۹,۷۲۸ B	۵۳,۹۳۵,۶۷۸,۶۵۵ B	ارزش بازار
۷۳	۱۱,۳۴۹	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۰.۳۸	۰.۸۵	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۳۵,۱۳۶,۵۵۴ B	۳۸,۱۴۸,۶۳۸ B	ارزش معاملات

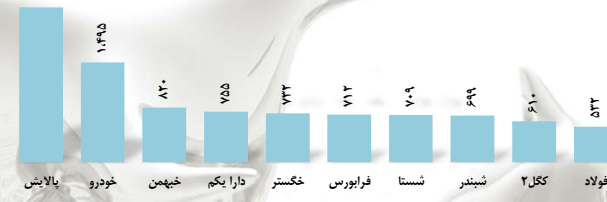
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



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



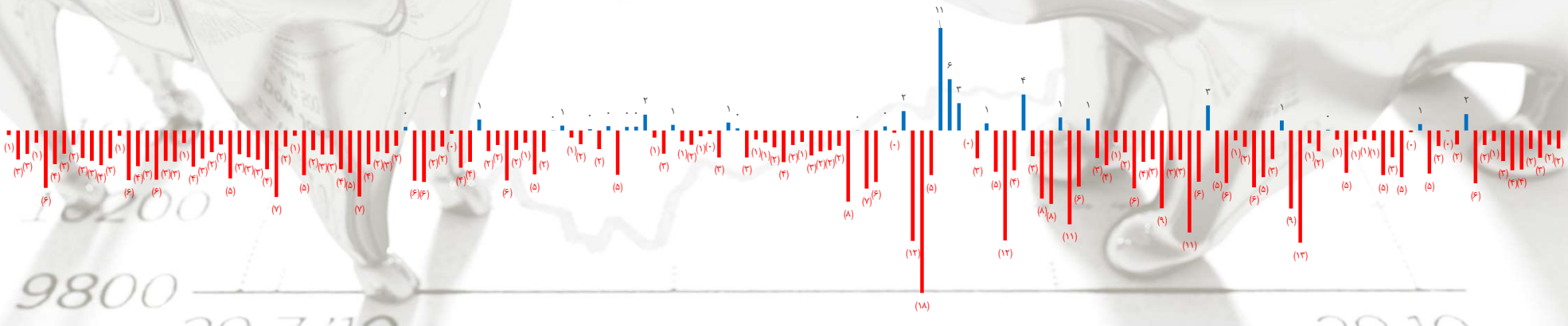
درصد فروش حقیقی‌ها | درصد فروش حقوقی‌ها

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

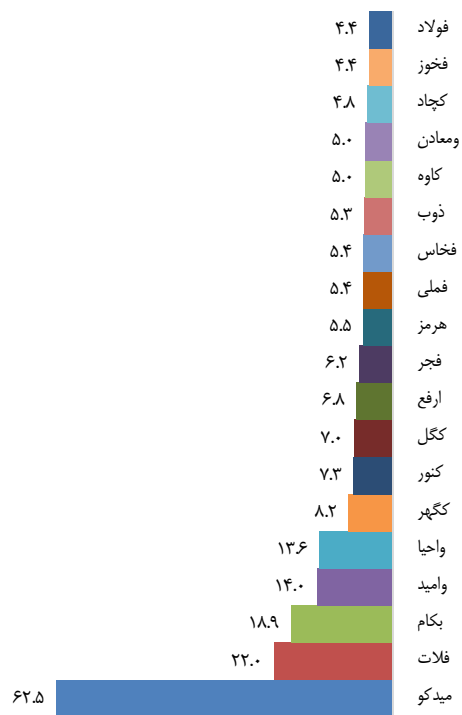
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



درصد خرید حقیقی‌ها | درصد خریدهای حقوقی‌ها

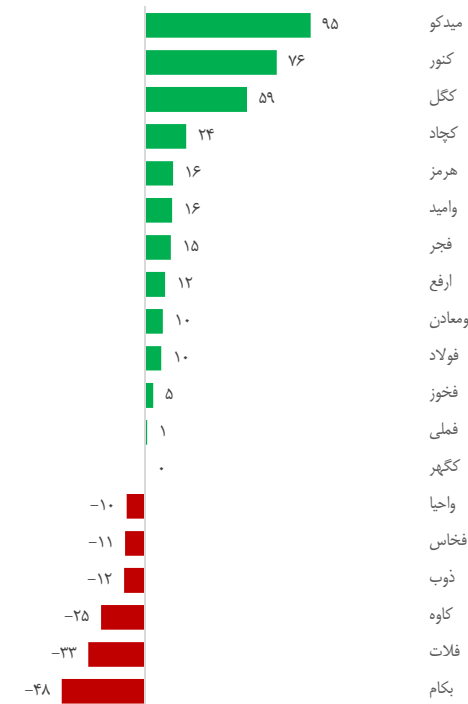


P/E تحلیلی



عملکرد معاملات سهام 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	۴,۸۸۱,۲۲۶	۴۶,۳۶۵	۹,۴۲۰	۰.۵	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۶۵۴,۳۲۲	۵۸,۰۱۹	۲۲,۱۳۰	(۱.۳)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۱,۳۶۵,۸۰۳	۳۷,۶۶۸	۲۷,۲۱۰	۰.۶	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۱,۲۸۷,۸۰۹	۵۹,۴۹۸	۴۶,۰۲۶	۰.۴	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۱,۱۱۵,۳۲۷	۲۰,۹۳۹	۱۸,۶۱۰	۰.۳	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۱,۱۹۸,۵۰۲	۱۵,۹۱۴	۱۳,۲۷۰	۰.۰	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۶۰۶,۰۱,۵۰۵	۴۰,۰۴۹۶	۶۶۱۰	۲.۵	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۹۲۸,۵۵۳	۱۳,۵۰۲	۱۴,۵۳۹	۰.۰	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۲۴۲,۷۴۸	۵,۴۷۹	۲۳,۵۲۰	(۰.۳)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۸۹۴,۳۴۳	۴۴,۷۱۰	۲۳,۶۰۰	۰.۵	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلزات ایرانیان	۴۵۸,۹۷۶	۴,۸۱۶	۱۰,۵۲۶	(۰.۳)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۸,۴۹۶,۳۵۸	۱۳,۶۲۲	۱,۶۰۳	۰.۶	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۵۰,۸۷۵,۰۰۴	۵۳۲,۰۲۶	۱۰,۴۶۰	۲.۰	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۵,۴۶۰,۱۹۲	۳۴,۸۱۵	۶,۳۶۰	۰.۰	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۱,۵۶۶,۰۴۸	۲۵,۴۹۲	۱۶,۲۰۰	۰.۱	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۲,۸۰۴,۹۶۲	۴۳,۲۸۸	۱۵,۲۳۰	۱.۱	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	۸,۶۲۰,۴۹۱	۳۹۴,۳۹۲	۴۵,۷۵۰	۰.۰	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۴۹,۸۱۰,۲۱۷	۱۷۴,۰۹۵	۳,۴۹۵	۱.۰	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				
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

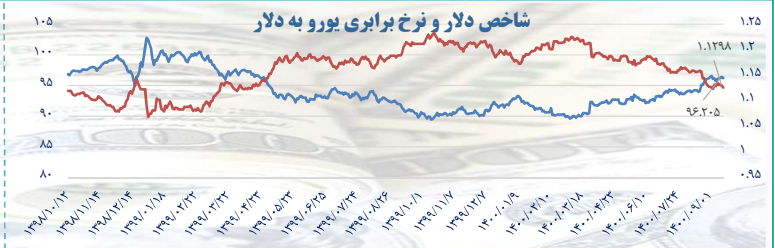
آخرین نرخ کامودیتی ها

جهانی

نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برابری یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کانه فملی



کانه



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



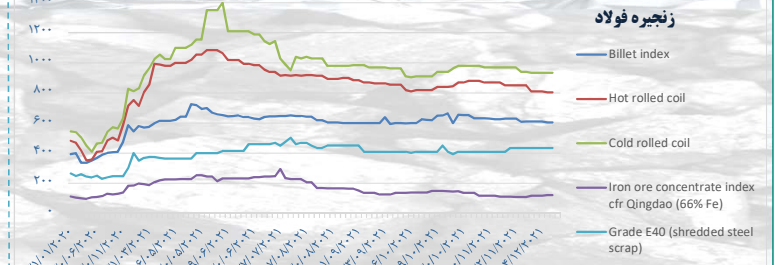
آلومینیوم



شمی فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



قیمت زنجیره سنگ آهن و موجودی بنادر چین

براساس داده های اخیر اداره کل گمرک چین (GAC)، صادرات محصولات نهایی فولاد چین در ماه نوامبر با کاهش ۰.۹ درصدی به ۴.۴ میلیون تن رسید. مجموع صادرات در ۱۱ ماهه اول سال جاری ۶۱.۹ میلیون تن گزارش شده که ۲۶.۷ درصد از مدت مشابه سال قبل بیشتر است. چین در ماه نوامبر ۱.۴ میلیون تن محصولات فولادی وارد کرد که ۲۶ درصد بالاتر از اکتبر است اما نسبت به نوامبر سال قبل ۲۳ درصد کمتر می باشد. واردات در ۱۱ ماهه اول سال جاری نیز درمقایسه با مدت مشابه سال قبل با ۲۹.۶ درصد افت به ۱۳.۳ میلیون تن رسید.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۶۹.۵-۹۷.۲	۵-۶.۵
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۰۹.۸-۱۱۰.۸	۹.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۴۵-۹۶.۵	۵
	lumps (62%)	۹۴.۲	۹
هند	finer (55%-62%)	۲۶.۶-۷۴.۸	۴.۵-۷
	pellets (64.0%)	۱۲۰	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۲.۵-۷۴.۵	۵
	concentrates (65.0%-67.0%)	۹۲.۲-۱۰۰.۸	۵
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۹۲.۴-۹۶.۹	۶
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۱۲.۵-۱۳۴	۵

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

• مجمع عمومی فوق العاده سهام شرکت در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۱۷ برگزار گردید که مجمع با افزایش سرمایه ۷۰۰ درصدی (از ۱ هزار میلیارد ریال به ۸ هزار میلیارد ریال) از سود انباشته موافقت نمود.

کدال

واحیا

• مهم‌ترین دلایل افزایش سود عملیاتی شرکت: افزایش در نرخ فروش محصولات شرکت که شامل افزایش در ضرایب فروش کنسانتره و گندله و نرخ فروش محصولات فولاد خوزستان به عنوان ملاک قیمت‌گذاری نرخ فروش محصولات این شرکت است.

کدال

کنور

وزارت صنعت، تجارت خارجی و خدمات برزیل اعلام کرد: برزیل در ماه نوامبر ۲۸/۹۹ میلیون تن سنگ آهن صادر کرد که ۶/۰۵ درصد افت ماهانه و ۰/۵۴ درصد کاهش سالانه داشته است. در همین دوره، ارزش صادرات حدود ۲/۶۳ میلیارد دلار آمریکا بود که نسبت به مدت مشابه سال قبل ۱/۳۳ درصد افزایش داشت.

اخبار روز

پس از اینکه بانک مرکزی چین نسبت ذخایر الزامی اکثر بانک‌ها RRR را حدود ۰/۵ درصد یا ۵۰ واحد با تاثیر از ۱۵ دسامبر کاهش داد، اعتماد بازار بالا رفت و ۱/۲ تریلیون یوان یا حدود ۱۸۸/۵ میلیارد دلار نقدینگی در سیستم بانکی آزاد شد. برخی فعالان تجاری معتقدند این کاهش به نفع شرکت‌های کوچک و متوسط و همچنین بازار املاک است و از تقاضای فولاد حمایت می‌کند.

اخبار روز

چین در حال بررسی تاسیس یک مرکز قیمت‌گذاری سنگ آهن برای تقویت نفوذ این کشور در بازار به عنوان بخشی از تلاش‌های گسترده‌اش برای تضمین عرضه و قیمت‌های پایدار در پی افزایش قیمت‌هاست که تأثیر قابل توجهی بر صنایع چین می‌گذارد.

اخبار روز

طبق پیش‌بینی موسسه برنامه‌ریزی و تحقیقات صنعت متالورژی چین در ماه مارس، بخش فولاد که سالانه حدود ۱۵ تا ۲۰ درصد از انتشار کربن کشور را به خود اختصاص می‌دهد، می‌تواند در سال ۲۰۲۵ به اوج انتشار برسد و سپس تا سال ۲۰۳۰ آن را تا ۳۰ درصد کاهش دهد.

اخبار روز

مس در بورس فلزات لندن برای تحویل سه ماهه با افت ۰/۲۸ درصدی به ۹،۵۵۰/۵ دلار در هر تن رسید. انتظار می‌رود مس در محدوده ۹،۵۰۰ تا ۹،۶۰۰ دلار در هر تن معامله شود. آلومینیوم برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن با ۱/۱۸ درصد افزایش در ۲،۶۲۴/۵ دلار در هر تن بسته شد. سرب برای تحویل سه ماهه در LME با ۰/۲۹ درصد کاهش به ۲۲۰۰ دلار رسید. روی هم برای تحویل سه ماهه در این بورس با ۱/۸۶ درصد افزایش، ۳،۲۳۲ دلار شد. انتظار می‌رود روی در محدوده ۳،۲۰۰ تا ۳،۲۵۰ دلار در هر تن حرکت کند.

اخبار روز

دولت امارات در راستای همسان‌سازی تعطیلات خود با سایر کشورهای جهان، از ابتدای ژانویه ۲۰۲۲ تعطیلات رسمی خود را به روزهای شنبه و یکشنبه منتقل خواهد نمود. این در حالیست که برخی مطلعان اعلام کرده‌اند که بخش دولتی در روز جمعه بصورت نیمه وقت فعالیت خواهد نمود و بخش خصوصی نیز یک ساعت برای نماز جمعه و نهار تعطیلی خواهد داشت و فعالیت‌ها از روز دوشنبه هر هفته از سر گرفته خواهند شد.

اخبار روز