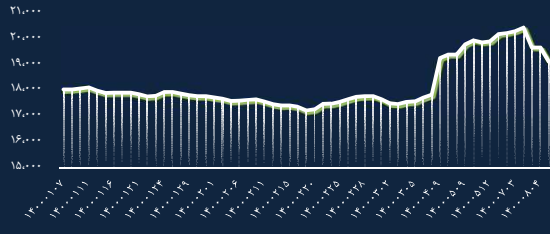


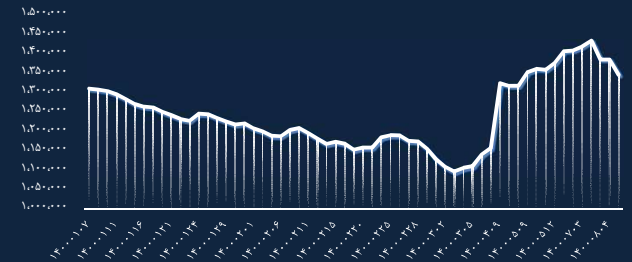
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۲۰

شاخص کل فرابورس

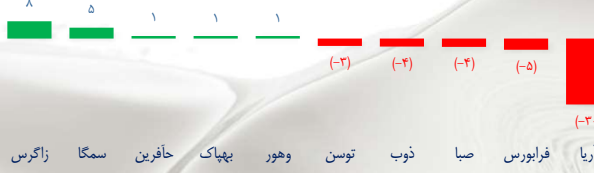


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۹,۱۲۱	۱,۳۴۴,۴۴۸	
۱۰,۶۷۵,۰۶۱.۱۰۶ B	۵۳,۷۳۷,۵۶۴.۸۸۳ B	ارزش بازار
(-۵۶)	(-۴,۹۴۱)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۳)	(-)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۲۸,۱۵۹.۶۲۵ B	۳۰,۸۲۰.۲۷۱ B	ارزش معاملات

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



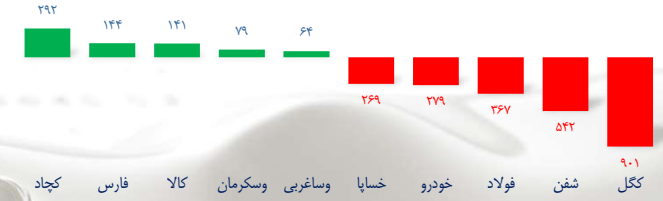
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

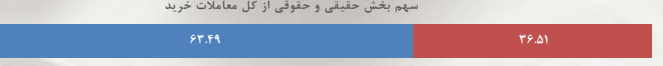


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



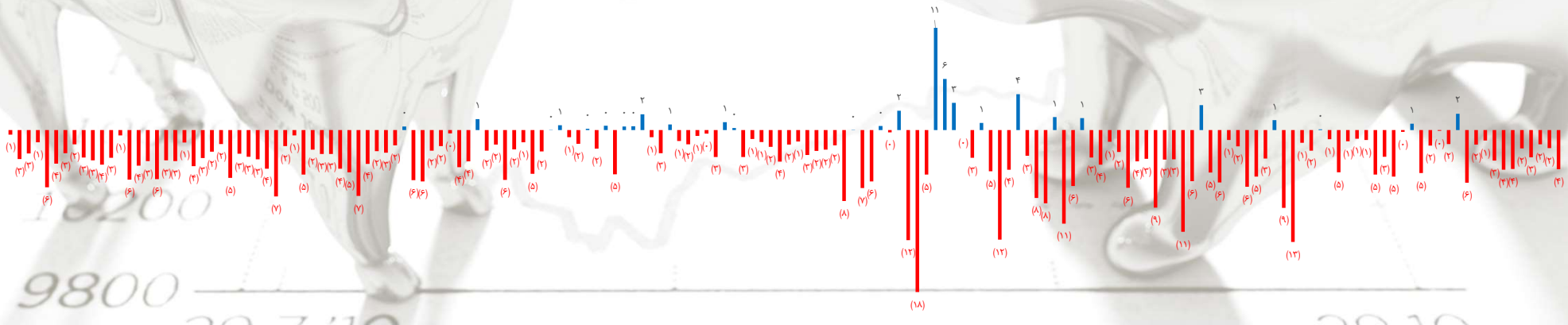
درصد فروش حقیقی‌ها (■) درصد فروش حقوقی‌ها (■)

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

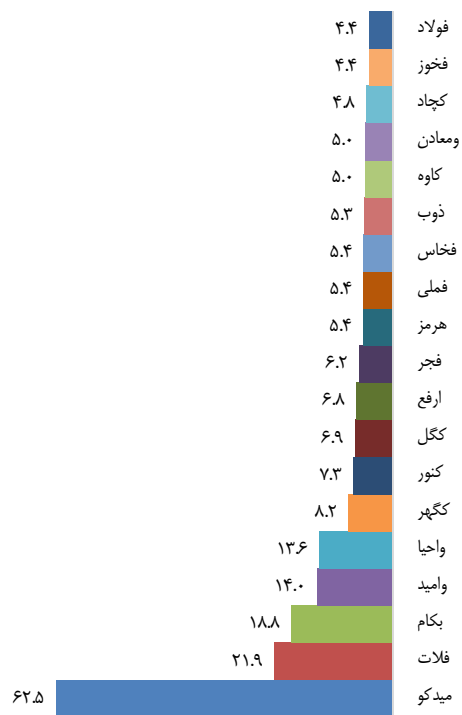


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

درصد خرید حقیقی‌ها (■) درصد خریدهای حقوقی‌ها (■)

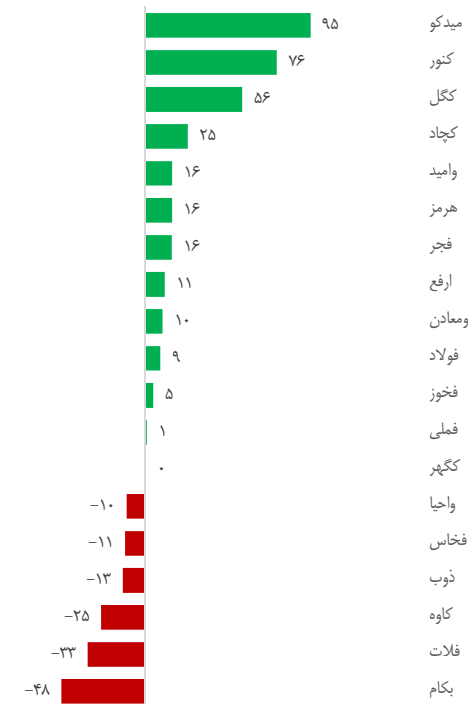


P/E تحلیلی



عملکرد معاملات سهام پرتفوی 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	۵,۷۷۲,۹۷۰	۵۴,۱۰۷	۹,۴۰۰	(۰.۲)	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۳,۳۱۰,۸۶۶	۷۱,۳۱۸	۲۱,۷۷۰	(۱.۶)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۴,۳۶۲,۳۳۴	۱۱۹,۶۲۸	۲۷,۴۲۰	-۰.۸	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۱,۰۵۱,۹۱۶	۴۸,۴۳۸	۴۶,۰۳۴	-۰.۰	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۳,۱۵۲,۴۹۲	۵۸,۷۰۲	۱۸,۶۲۰	-۰.۱	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۱,۲۴۲,۸۶۱	۱۶,۴۹۸	۱۳,۲۷۰	-۰.۰	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۳۹,۵۲۳,۱۴۷	۲۶۰,۶۸۹	۶۶۰۰	(۰.۲)	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۸۲۶,۴۱۱	۱۱,۸۶۵	۱۴,۵۰۸	(۰.۲)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱۳۱,۴۵۲	۲,۹۵۳	۲۳,۴۹۰	(۰.۱)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۱۳۲,۸۲۷	۲۶,۸۷۱	۲۳,۷۲۰	-۰.۵	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلزات ایرانیان	۲۶۹,۴۹۵	۲,۷۹۱	۱۰,۴۷۸	(۰.۵)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۴,۶۹۴,۷۹۳	۷,۴۸۱	۱,۵۹۸	(۰.۳)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۳۸,۹۰۲,۸۸۳	۴۰۵,۰۶۶	۱۰,۴۱۰	(۰.۵)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۲,۹۷۴,۷۶۷	۱۸,۹۰۵	۶,۳۶۰	-۰.۰	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۲۵۲,۳۵۷	۳۵,۹۸۳	۱۶,۱۳۲	(۰.۴)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۲,۷۴۸,۶۹۱	۴۱,۹۰۱	۱۵,۲۴۰	-۰.۱	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	۶,۵۸۲,۴۸۰	۳۰,۱,۳۲۲	۴۵,۷۶۰	-۰.۰	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۳۲,۰۰۱,۶۶۸	۱۱۰,۸۲۷	۳,۴۶۳	(۰.۹)	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

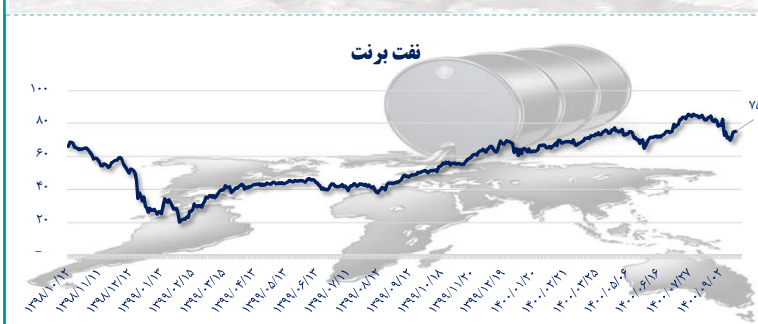
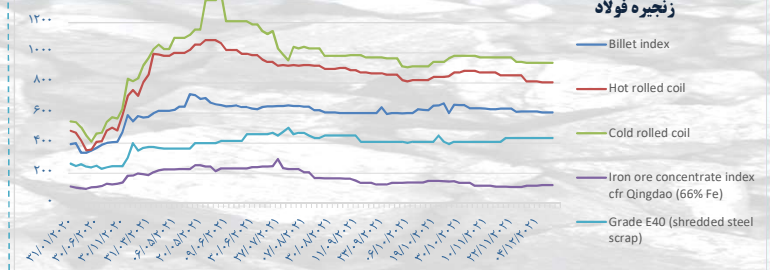
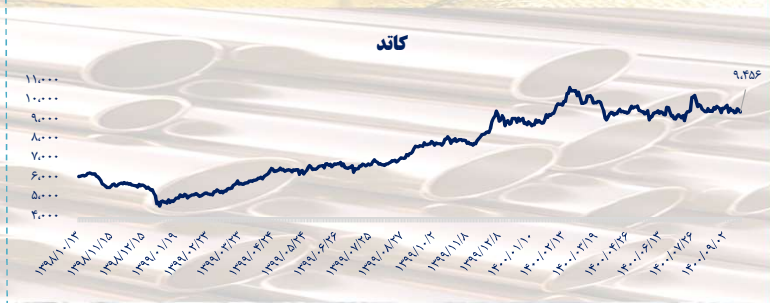
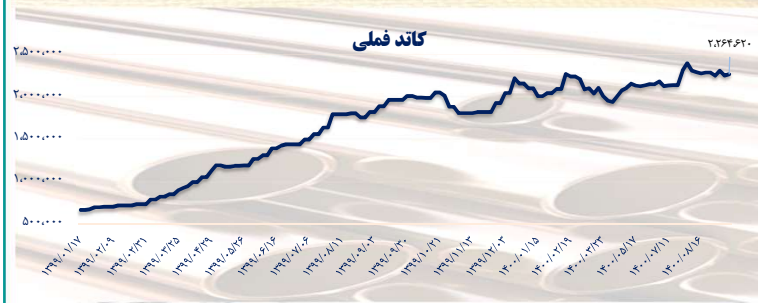
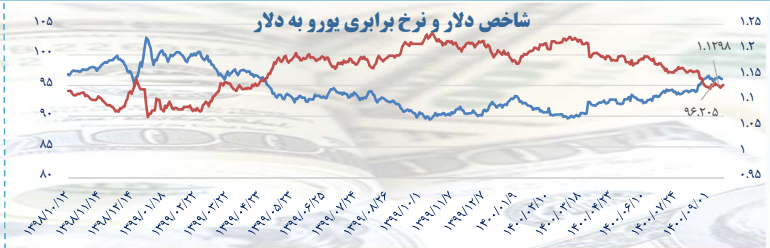
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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



قیمت زنجیره سنگ آهن و موجودی بنادر چین

بر اساس آخرین نسخه گزارش انجمن آهن و فولاد چین در ۷ دسامبر، طی ۲۱ تا ۳۰ نوامبر، تولید روزانه فولاد خام در میان کارخانه‌های عضو انجمن آهن و فولاد چین (CISA) با ۲۶ درصد یا ۴۵ هزار و ۹۰۰ تن در روز کاهش نسبت به دوره اواسط نوامبر به میانگین ۱,۷۲ میلیون تن در روز رسید. این انجمن گزارش داد، میانگین تولید کارخانه‌های عضو این انجمن طی ۱۰ روز پایانی ماه گذشته به پایین‌ترین سطح بیش از ۴,۵ سال اخیر رسید که عمدتاً به دلیل مجموعه محدودیت‌های تولید بر فولادسازان داخلی، به ویژه آنهایی که در شمال چین فعال هستند، می‌باشد. در نتیجه برای کل نوامبر، تولید روزانه فولاد خام در میان این کارخانه‌ها کاهش‌ی گزارش شده است.

براساس اطلاعات منتشر شده از سوی اداره کل گمرک چین در ۷ دسامبر، واردات سنگ آهن چین در بین ماه‌های ژانویه تا نوامبر با ۳,۲ درصد کاهش سالانه به ۱,۰۴ میلیارد تن رسید. میزان واردات ماه نوامبر ۱۰۵ میلیون تن گزارش شده است.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۶۵.۷-۹۳.۲	(۴)
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۰۵.۵-۱۰۶.۵	(۴.۵)
برزیل	finer (61%-65%)	۴۲-۹۵.۲	(۳-۲.۳)
	lumps (62%)	۹۰	(۴.۵)
هند	finer (55%-62%)	۲۴۶-۷۰.۸	(۲-۴)
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۰.۵-۷۱.۵	(۲-۳)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۹۱.۲-۹۹.۸	(۱)
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۹۱.۴-۹۵.۹	(۱)
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۹.۵-۱۳۱	(۴)

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

• گزارش توجیهی افزایش سرمایه شرکت (از ۱۰۰ هزار میلیارد ریال به ۳۰۰ هزار میلیارد ریال) جهت بررسی و اظهار نظر حسابرس و بازرسی قانونی شرکت به موسسه بهراد مشار ارائه گردید و در مرحله رسیدگی نهایی قرار دارد.

گگل

کدال

براساس اطلاعات منتشر شده در مورد دیدار اعضای دفتر سیاسی کمیته حزب کمونیست چین CPC در ۶ دسامبر، برای سال ۲۰۲۲ پکن همچنان ثبات در اقتصاد ملی را در اولویت قرار خواهد داد که پیش شرط هر گونه توسعه خواهد بود و این موضوع نیز باید در سیاست های کلان اقتصادی و سیاست پولی و سیاست مالی سختگیرانه حفظ شوند. این دفتر بالاترین نهاد تصمیم گیری CPC است و در جلسه روز دوشنبه بین اعضا آن به رهبری شی جین پینگ Xi Jinping موافقت شده بود تا برای سال آینده چین ایجاد ساختار جدید توسعه را تسریع کند، توسعه اقتصادی را از طریق نوآوری به حرکت درآورد و مدل های با کیفیت بالا را هدف قرار دهد.



مس برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن با کاهش ۱/۰۶ درصدی به ۹،۵۵۰/۵ دلار در هر تن رسید. انتظار می رود مس در محدوده ۹،۴۸۰ تا ۹،۵۵۰ دلار در هر تن معامله شود. آلومینیوم برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن با ۸ دلار یا ۰/۳ درصد افت در ۲،۶۲۷ دلار در هر تن بسته شد. سرب برای تحویل سه ماهه در LME با کاهش ۰/۴۴ درصدی در ۲،۲۸۰ دلار در هر تن بسته شد. روی اما برای تحویل سه ماهه در بورس فلزات لندن با ۰/۰۲ درصد افزایش به ۳،۳۱۹ دلار در هر تن رسید. انتظار می رود این فلز در محدوده ۳،۲۵۰ تا ۳،۳۰۰ دلار در هر تن حرکت کند.



پلتس پرمیوم زغال استرالیا را با ۲ دلار در هر تن افزایش ۳۴۱ دلار در هر تن فوب استرالیا اعلام کرد و زغال تحویل CFR چین را در ۹ دسامبر با ۳ دلار افت ۳۴۷ دلار در هر تن گزارش داد. این موضوع به دلیل بدی آب و هوا در استرالیا و کانادا بود که باعث تاخیر در حمل و نقل و افزایش بیشتر قیمت ها شد. با این حال برخی فعالان تجاری معتقدند تاخیرهای حمل و نقل با توجه به فصل آرام فولاد در چین قابل کنترل است.



شاخص بین المللی حقوق مالکیت در میان ۱۲۹ کشور جهان همه ساله اندازه گیری می شود تا بینشی جامع در مورد کشورهایی که حقوق مالکیت فیزیکی، حقوق مالکیت معنوی و محیط های قانونی آنها را اجرا می کنند، ارائه دهد. در منطقه غرب آسیا امارات متحده عربی با رتبه ۲۲ جهان بالاترین سطح حقوق مالکیت معنوی را دارد و ایران با رتبه ۱۱۴ جهان در پایین ترین جایگاه قرار دارد.



مرکز آمار ایران تصویر رشد اقتصاد ایران برای نیمه نخست سال جاری را به روز کرد: رشد اقتصادی برای ۶ ماهه ابتدایی سال جاری ۵/۹ درصد با نفت و ۴/۱ درصد بدون نفت. محاسبات این مرکز نشان می دهد: محصول ناخالص داخلی به قیمت ثابت سال ۱۳۹۰ در شش ماهه اول سال ۱۴۰۰ به رقم ۳۶۶ هزار میلیارد تومان با نفت و ۳۱۳ هزار میلیارد تومان بدون احتساب نفت رسیده است، در حالیکه رقم مذکور در مدت مشابه سال قبل با نفت ۳۴۵ هزار میلیارد تومان و بدون نفت ۳۰۱ هزار میلیارد تومان بوده است.



کل درآمد مالیاتی (بدون احتساب مالیات بر واردات) تحقق یافته طی هفت ماهه نخست ۱۴۰۰ حدود ۱۶۷ هزار میلیارد تومان بوده که این رقم حدود ۸۶ درصد از کل درآمدهای مالیاتی مشابه سال ۱۳۹۹ است. چنانچه روند تحقق درآمدهای مالیاتی در پنج ماه پایانی سال جاری نیز به همین صورت ادامه یابد، رقم درآمدهای مالیات تحقق یافته در پایان سال ۱۴۰۰ به حدود ۲۸۶ هزار میلیارد تومان خواهد رسید که نسبت به سال قبل، حدود ۴۸ درصد افزایش خواهد داد.

