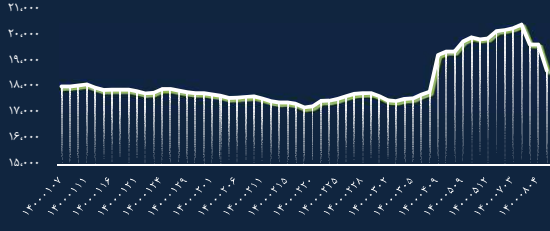


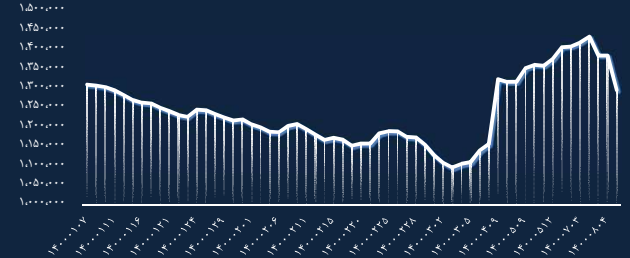
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۲۲

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۸,۶۶۴	۱,۲۹۵,۵۲۷	
۱۰,۴۶۱,۴۹۲.۵۰۹ B	۵۱,۷۷۹,۷۸۵.۳۴۵ B	ارزش بازار
(-۲۶۷)	(-۲۵,۲۴۹)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۱.۴)	(-۲)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۷۷۷,۳۸۷.۹۲۸ B	۳۸,۴۵۲.۲۴۰ B	ارزش معاملات

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



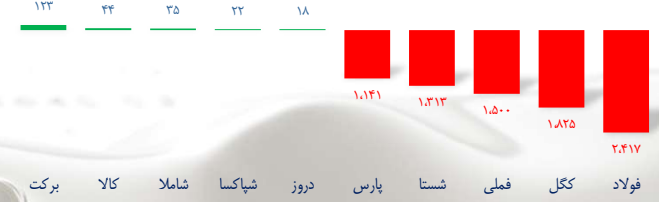
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



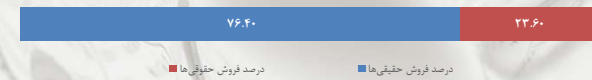
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

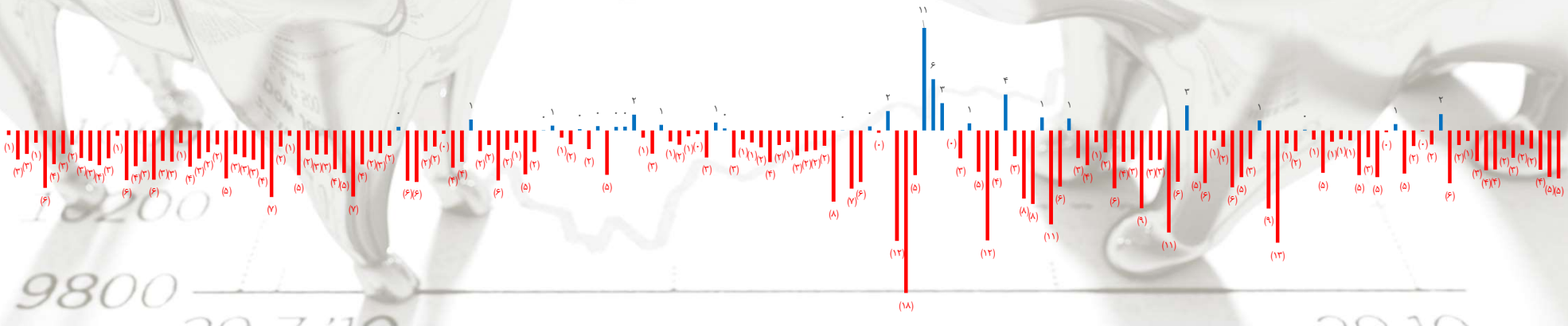


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

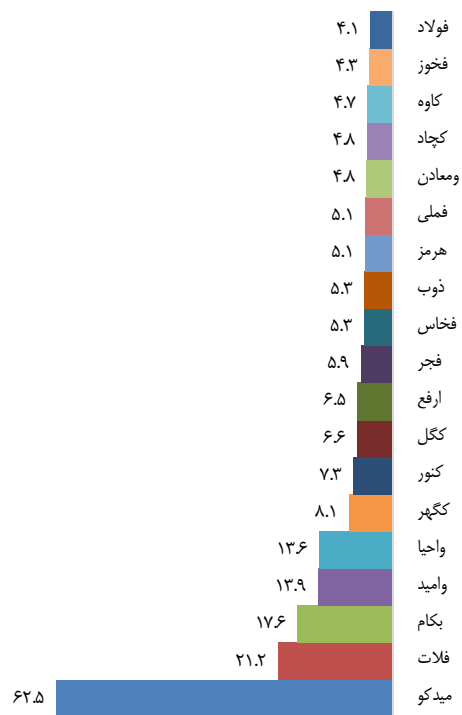


خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۱۴۰۰/۰۱/۰۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال

سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

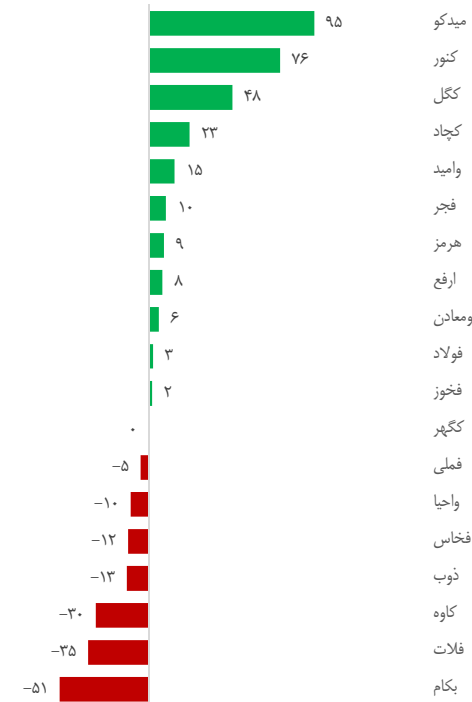


P/E تحلیلی



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	۱۹,۰۸۰,۰۶۹	۱۷۲,۲۶۵	۹,۰۳۰	(۳.۵)	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۴,۳۰۷,۴۲۵	۸۸,۱۴۴	۲۰,۶۵۰	(۳.۴)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۶,۰۳۷,۳۷۸	۱۶۳,۴۳۷	۲۷,۱۱۰	(۰.۴)	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۵۰۶,۹۹۰	۲۲,۷۹۶	۴۵,۸۱۲	(۰.۵)	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۲,۲۱۹,۶۹۵	۴۱,۱۵۱	۱۸,۵۷۰	(۰.۲)	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۱,۸۸۳,۵۷۴	۲۴,۱۲۱	۱۳,۱۶۰	(۰.۷)	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۶۳,۳۲۲,۸۵۴	۳۹۴,۱۰۴	۶,۲۲۰	(۲.۴)	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۲,۹۱۹,۲۲۲	۴۰,۲۸۴	۱۴,۰۴۷	(۲.۷)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۳۰۸,۳۵۹	۶,۹۲۴	۲۳,۳۴۰	(۰.۳)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۲,۰۷۰,۰۰۲	۴۶,۷۲۹	۲۲,۵۷۰	(۳.۴)	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلزات ایرانیان	۱۰,۳۷۱,۰۵۰	۱۲,۹۰۶	۱۰,۱۵۴	(۲.۹)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۱۰,۳۶۵,۸۴۸	۱۵,۳۵۴	۱,۴۹۶	(۴.۳)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۱۳۳,۷۷۴,۲۲۹	۱,۳۰۹,۳۴۴	۹,۷۹۰	(۳.۳)	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۱۰,۰۰۶,۹۶۴	۶۰,۶۵۹	۶,۱۸۰	(۲.۱)	۲,۳۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۷,۸۲۰,۹۸۸	۱۱۸,۶۰۸	۱۵,۱۶۵	(۴.۸)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۵,۷۴۹,۹۰۳	۸۱,۲۰۱	۱۴,۱۵۰	(۳.۹)	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	۵,۸۱۲,۰۰۲	۲۶۵,۷۲۷	۴۵,۷۲۰	(۰.۰)	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	متوقف به دلیل انتقال به بورس تهران		۳,۴۶۳	۰.۰	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				
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

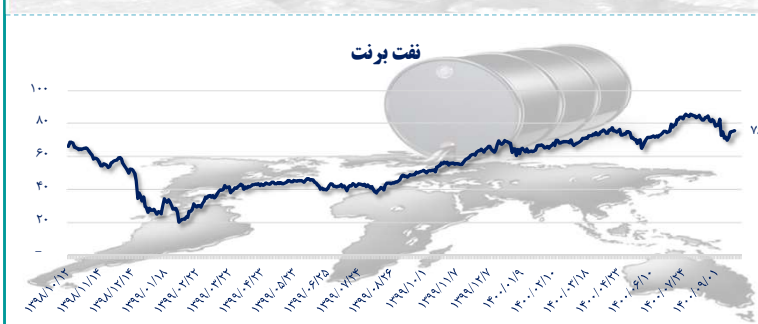
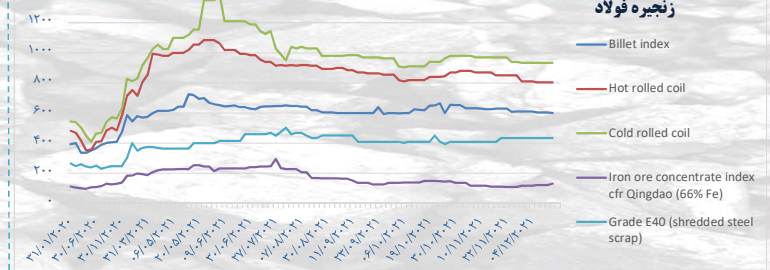
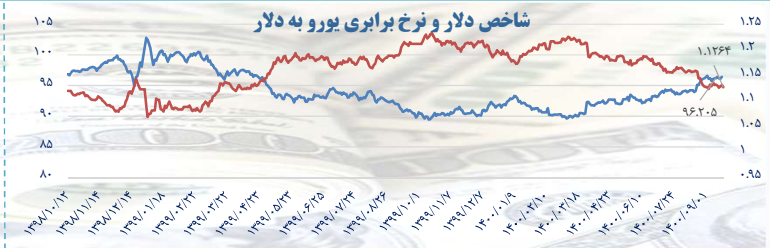
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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

آغاز سال نو چینی در روز سه شنبه اول فوریه (۱۲ بهمن) می باشد و چین از ۳۱ ژانویه (دوشنبه) تا ۶ فوریه (یکشنبه) به مدت یک هفته تعطیل است. اگر شرکت‌های چینی نقدینگی کافی داشته باشند پیش بینی می شود در حدود ۲ هفته کاری باقیمانده تا پایان دسامبر و همچنین در طول ماه ژانویه ۲۰۲۲ و زمانی که اعتبار بانکی به چرخه سالانه جدید وارد می شود، ذخیره سازی قبل از تعطیلات را انجام دهند که باعث می شود قیمت کامودیتی ها افزایش موقتی بیابند.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۶۴.۷-۹۱.۷	(۱-۱.۵)
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۰۴-۱۰۵	(۱.۵)
برزیل	finer (61%-65%)	۴۱-۹۳.۲	(۱-۲)
	lumps (62%)	۸۹	(۱.۵)
هند	finer (55%-62%)	۲۴.۱-۶۹.۳	(۰.۵-۱.۵)
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۱۹-۶۹.۵	(۱.۵-۲)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۹۰.۲-۹۷.۸	(۱-۲)
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۸۹.۴-۹۳.۹	(۲)
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۷.۵-۱۲۹	(۲)

موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	موجودی	تغییر هفتگی	ظرفیت
بنادر	Qingdao	۲۳,۳۲۰	۲۱,۰۰۰
	Tianjin	۱۱,۲۰۰	۱۵,۵۰۰
	Caofeidian	۱۵,۴۰۰	۲۳,۰۰۰
	Total	۱۵۴,۵۰۰	۲۳۶,۲۰۰



سرعت رشد تولیدات صنعتی جهان، اقتصادهای صنعتی، چین و کشورهای درحال توسعه (به جز چین) در فصل سوم ۲۰۲۱ نسبت به مدت مشابه سال قبل کاهش یافته است. تولیدات صنعتی کشورهای درحال توسعه و نوظهور در فصل سوم ۲۰۲۱ نسبت به فصل سوم ۲۰۲۰ افزایش ۶,۷ درصدی را تجربه کرده است. روند کاهشی رشد تولیدات صنعتی چین برای دومین فصل پیاپی در فصل سوم ۲۰۲۱ نیز استمرار یافته است.



مجمع جهانی اقتصاد در مطالعه اخیر خود، ضمن اشاره به لزوم درک عمیق تر از مجموعه قابلیت‌های سازمانی و جهت‌گیری‌های مورد نیاز برای بنگاه‌های کوچک و متوسط در راستای کمک به رشد مالی پایدار، تأثیر مثبت بر جامعه و محیط و دستیابی به سطوح بالایی از انعطاف‌پذیری و چابکی، به بررسی شیوه‌هایی که بنگاه‌های کوچک و متوسط را در موقعیت بهتری برای آمادگی در آینده قرار می‌دهد نیز پرداخته است.



بعد از رشد منفی شاخص تولید صنعتی در مهر ماه بعد از شانزده ماه رشد مثبت، در آبان ماه نیز شاخص تولید صنعتی شرکت‌های بورسی نسبت به مدت مشابه سال گذشته رشد منفی ۱,۱ درصدی را ثبت کرد. اگرچه رشد منفی تولید صنایع فلزات اساسی بیشترین سهم را در ماندگاری رشد منفی شاخص تولید صنعتی در آبان‌ماه داشته است، اما در مجموع از ۱۳ صنعت بورسی (کد ISIC دو رقمی) رشد تولید پنج صنعت دیگر نیز در دو ماه اخیر منفی بوده است که نشان‌دهنده این است که نامطلوب بودن وضعیت تولید محدود به یک صنعت نیست.



در صورت تصویب لایحه بودجه ۱۴۰۱ و افزایش قیمت گاز واحدهای آهن اسفنجی کشور به خوراک پتروشیمی (از ۷/۳ سنت دلار به ۲۲ سنت)، با توجه به ۳۷/۱ میلیون تن ظرفیت آهن اسفنجی کشور، هزینه سالیانه گاز این واحدها از ۶۸۷ میلیون دلار (۳۰ درصد خوراک) به ۲/۲۹ میلیارد دلار افزایش می‌یابد. در لایحه بودجه پیش‌بینی ۹۴ هزار میلیارد تومان درآمد از این محل شده که با تبدیل دلار ۲۳ هزار تومانی، رقم فوق ۵۲/۶ هزار میلیارد تومان بوده و الباقی ۴۱/۴ هزار میلیارد تومان باید از محل واحدهای پتروشیمی و پالایشی جبران شود.



مدیرعامل شرکت سرمایه‌گذاری توسعه معادن و فلزات با تأکید بر ضرورت تمرکز بر کل زنجیره معدن گفت: فعالیت و سرمایه‌گذاری شرکت در بخش‌های مختلف اکتشاف، بهره‌برداری، فراوری و بازرگانی در حوزه معدن و صنایع معدنی، علاوه بر ایجاد ترکیب پرتفوی مناسب، به تحقق اهداف اقتصادی کشور کمک می‌کند.



شرکت دانش بنیان نفت و گاز سرو، بعنوان پیشگام تولید کاتالیست در صنایع فولاد، پتروشیمی و پالایش کشور، بعنوان برگزیده صادرکننده نمونه ملی سال ۱۴۰۰ برگزیده شد.