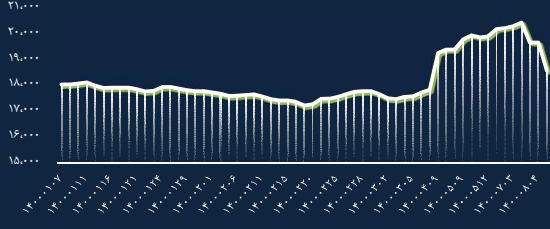


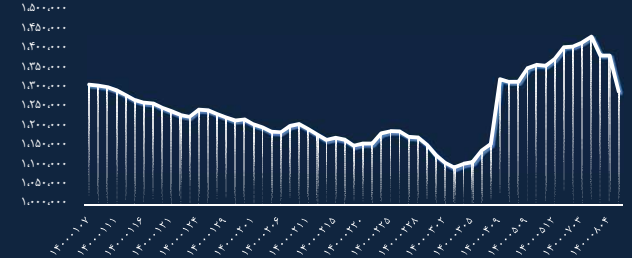
## خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۲۳

### شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۸,۵۹۱	۱,۲۹۱,۲۹۸	
۱۰,۲۰۸,۵۶۷.۴۴۸ B	۵۱,۶۳۲,۴۲۴.۲۰۱ B	ارزش بازار
(-۲۳)	(-۳,۷۵۲)	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۴)	(-)	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۹۲,۶۵۶.۵۹۴ B	۳۹,۹۲۰.۲۱۱ B	ارزش معاملات

### شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



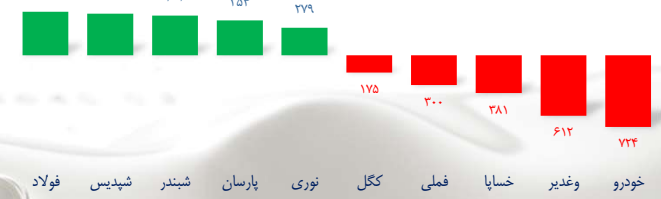
### بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



### بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



### بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس



سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



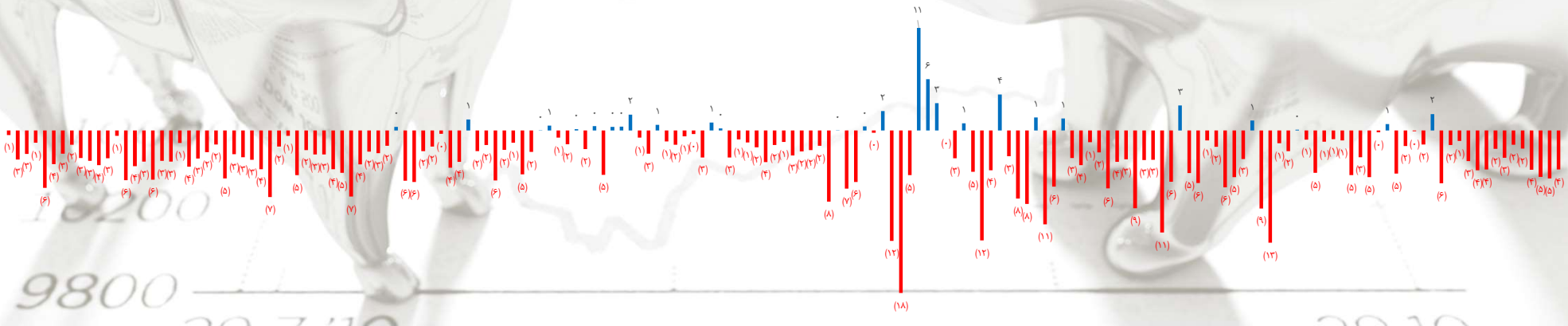
درصد فروش حقیقی‌ها

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

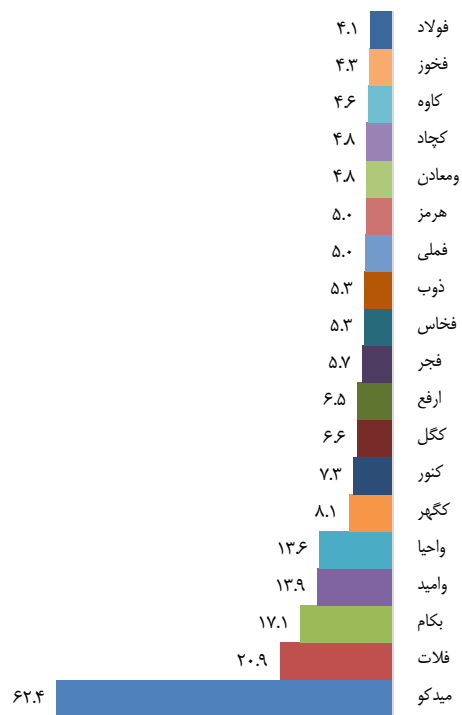


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

درصد خرید حقیقی‌ها



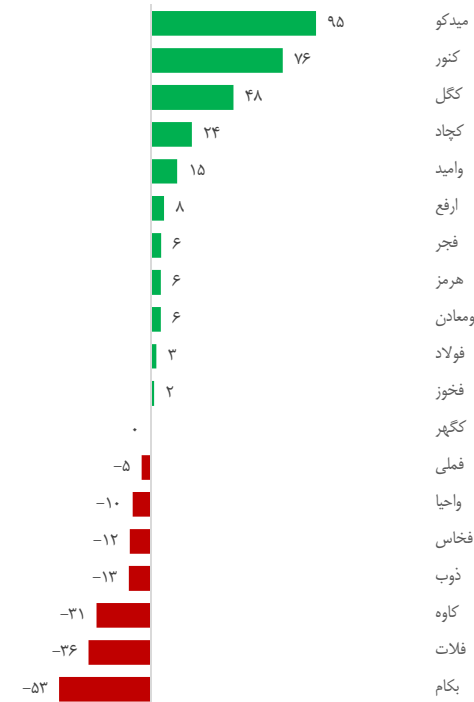
P/E تحلیلی



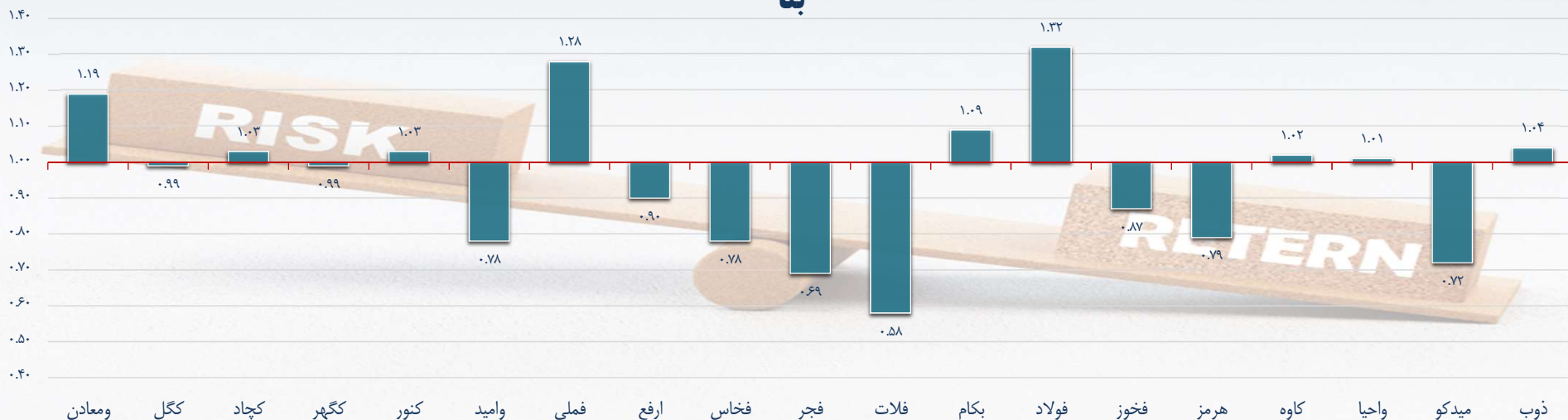
### عملکرد معاملات سهام پرتوی بورسی سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و مقایسه با اهم رقبا

نام شرکت	وضعیت سهام			EPS کارشناسی		
	حجم معاملات	ارزش معاملات	قیمت پایانی	نوسان روزانه	۱۳۹۹	۱۴۰۰
توسعه معادن و فلزات	۷,۶۹۲,۷۲۳	۶۹,۱۹۹	۹,۰۱۰	(۰.۲)	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۳,۹۵۲,۰۲۱	۸۱,۲۲۹	۲۰,۵۸۰	(۰.۳)	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۱,۶۸۶,۴۳۵	۴۵,۸۶۶	۲۷,۱۴۰	۰.۱	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۵۵۳,۶۹۲	۲۵,۳۴۱	۴۵,۸۰۲	(۰.۰)	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۱,۵۷۶,۳۴۷	۲۹,۴۴۷	۱۸,۶۰۰	۰.۲	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۲,۳۶۷,۰۲۰	۳۱,۴۷۱	۱۳,۲۰۰	۰.۳	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۵۳,۵۱۲,۵۱۶	۳۳۱,۴۷۳	۶,۱۹۰	(۰.۵)	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۰۷۹,۴۰۳	۴۳,۰۷۱	۱۴,۰۰۸	(۰.۳)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱۴۹,۶۳۳	۳,۳۹۴	۲۳,۳۲۰	(۰.۱)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۲,۵۳۵,۵۲۲	۵۵,۱۶۴	۲۱,۷۶۰	(۳.۶)	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلانت ایرانین	۴۳۰,۲۶۵	۴,۲۴۴	۱۰,۰۲۳	(۱.۳)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۹,۴۹۸,۶۸۵	۱۳,۸۰۳	۱,۴۵۳	(۲.۹)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۶۶,۹۴۷,۰۱۷	۶۵۹,۳۴۸	۹,۸۵۰	۰.۶	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۱۳,۱۴۳,۴۵۸	۸۱,۱۴۸	۶,۱۸۰	۰.۰	۲,۳۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۵,۳۳۵,۹۰۳	۷۷,۸۵۱	۱۴,۷۵۱	(۲.۷)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۴,۷۷۱,۶۰۴	۶۶,۶۴۹	۱۴,۰۱۰	(۱.۰)	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	۴,۱۲۸,۶۹۲	۱۸۸,۶۸۴	۴۵,۷۰۰	(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

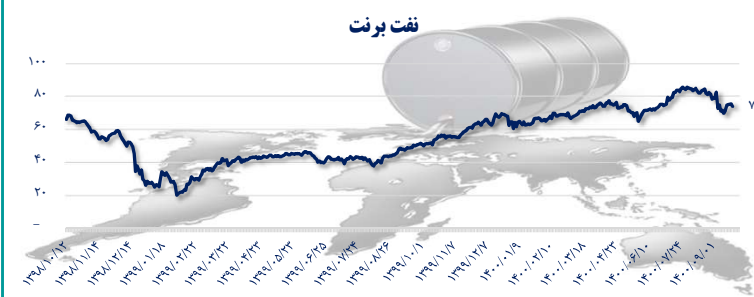
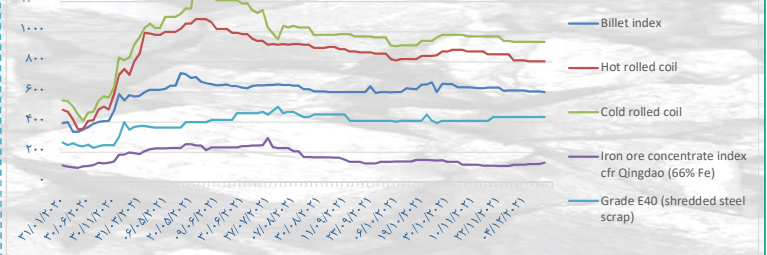
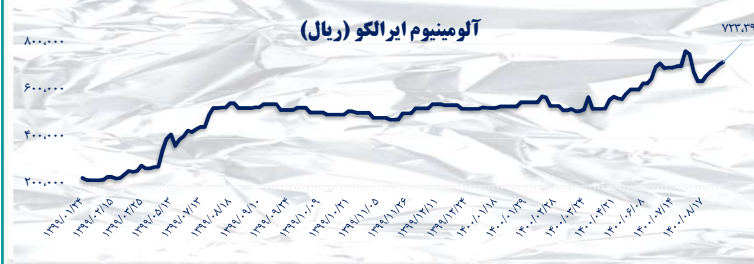
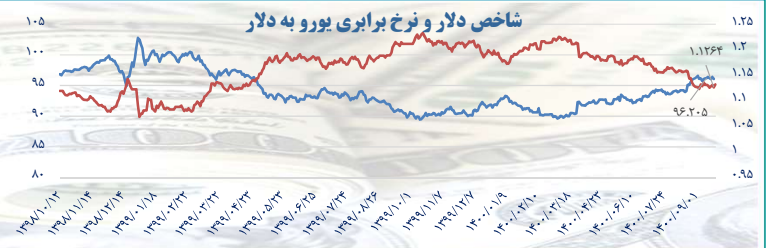
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۷۲.۷-۹۹.۷	۸
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۱۱.۵-۱۱۲.۵	۷.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۴۹-۱۰۱.۲	۶
	lumps (62%)	۹۶	۸
هند	finer (55%-62%)	۲۸.۱-۷۶.۳	۴-۷
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۳-۷۵.۵	۴-۶
	concentrates (65.0%-67.0%)	۹۳.۲-۱۰۰.۸	۳
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۹۲.۴-۹۶.۹	۳
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۱۱.۵-۱۳۳	۴

در حالیکه معاملات آتی سنگ آهن در بورس دالیان برای تحویل ژانویه در روز دوشنبه ۱۳ دسامبر با ۵.۷۳ درصد در هر تن افزایش در ۱۰۵.۹۳ دلار بسته شده، در بورس سنگاپور (SGX) این افزایش ۷.۲ درصد بود و قیمت حداقل ۱۰.۲۰ دلار بالاتر در ۱۱۶.۱۵ دلار بسته شد. بلومبرگ پیش بینی کرد احتمال افزایش قیمت سنگ آهن تا اواخر ماه دسامبر تا ۱۳۵ دلار محتمل است ولی بیشتر در محدوده ۱۱۷-۱۱۸ دلار بازی می کند.

موجودی سنگ آهن جهت بارگیری در ۳ بندر اصلی استرالیا شامل Dampier, Walcott, Hedland و ۴ بندر اصلی برزیل شامل PDM, Sepetibabay, Itaguai, Tubarao به ۱۰.۸۷ میلیون تن رسید که رشد ۳.۸۴ درصدی هفتگی داشته است.

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



قرار است سیاست گذاران پکن برای سال ۲۰۲۲ کاهش مالیات و کارمزدهای جدید و سرمایه گذاری در زیرساخت های اولیه را اجرا کنند و اعتماد بازار را بهبود بخشیده و ریسک های مالی را کاهش دهند.



به گفته اداره هواشناسی استرالیا، همانطور که برای نوامبر پیش بینی شده بود یک طوفان حاره ای La Niña در اقیانوس آرام در حال توسعه است. بسته به شدت این رویداد، این طوفان می تواند عواقب جدی برای زنجیره تامین فولاد داشته باشد.



قیمت های گاز در اروپا در ماه اکتبر بدنبال محدودیت عرضه و تقاضای بالا از سوی اقتصادهایی که در حال احیا از پاندمی کووید ۱۹ بودند، افزایش پیدا کرد. قیمت ها از اوج مذکور عقب نشینی کرده اند اما در هفته های اخیر به دلیل آب و هوای زمستانی سردتر و واردات کمتر از حد انتظار از روسیه، دوباره افزایش پیدا کرده اند.



سهام عراق از کل تجارت ترکیه با جهان در سال ۲۰۲۰ حدود ۹ درصد (۵ درصد صادرات و ۳/۹ درصد واردات) است. با وجود افت ۱۰/۲ درصدی صادرات ترکیه به عراق در سال ۲۰۲۰، واردات ترکیه از این کشور با افزایش قابل توجه و سه برابری همراه بود به نحوی که کسری تراز تجاری ۶/۵ میلیاردی عراق با ترکیه در سال ۲۰۱۹ به مازاد ۲۷ میلیون دلاری در سال ۲۰۲۰ تبدیل شد. سهم افغانستان و پاکستان از کل تجارت ترکیه با جهان در سال ۲۰۲۰ نسبت به ۲۰۱۹ (هم در صادرات و هم در واردات) تغییر چندانی نداشته است.



معاون توسعه معادن و صنایع معدنی شرکت سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات با تاکید بر توانمندی علمی، تخصصی این شرکت از برنامه های «ومعادن» در حوزه تامین ماشین آلات و توسعه فعالیت های اکتشافی خبر داد و گفت: با تامین ماشین آلات و تجهیزات مورد نیاز، آسیب ها و چالش های شرکت درحوزه اکتشاف به حداقل می رسد.



رئیس اداره امور معادن سازمان صنعت، معدن و تجارت خراسان شمالی گفت: امسال ۳۷۵ میلیارد و ۳۳۰ میلیون ریال در بخش معادن استان سرمایه گذاری شده است که این رقم نسبت به سال گذشته، سه برابر شده است.