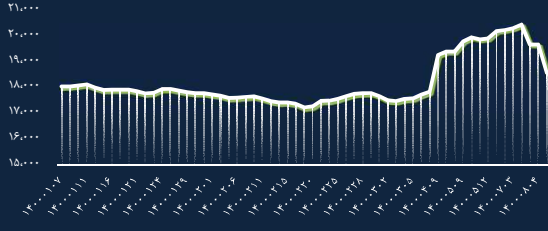


## خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۲۴

شاخص کل فرابورس



فرابورس

۱۸,۵۷۱

۱۰,۲۱۸,۹۷۰,۶۹۶ B

(-۲۰)

(-۰.۱)

۳۰,۰۱۳,۸۸۶ B

بورس

۱,۲۹۳,۲۱۷

۵۱,۶۹۰,۵۸۲,۹۶۷ B

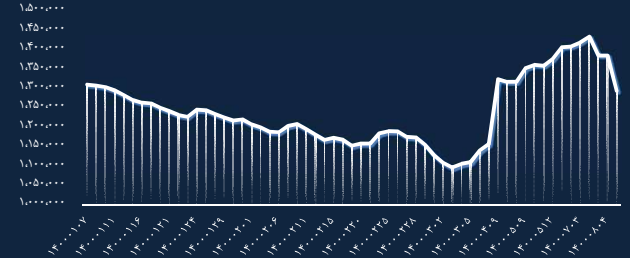
مقدار شاخص

مقدار تغییر نسبت به روز گذشته

درصد تغییر نسبت به روز گذشته

ارزش معاملات

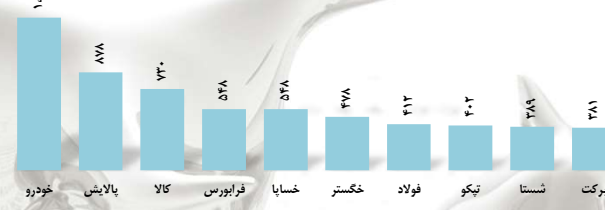
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



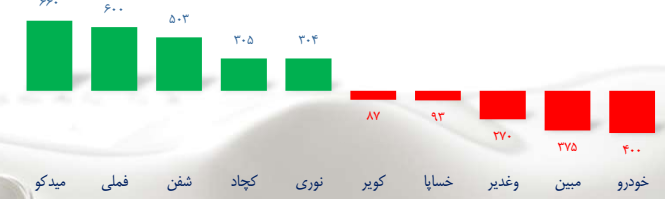
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



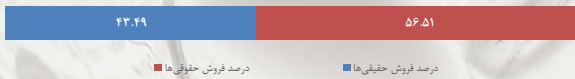
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

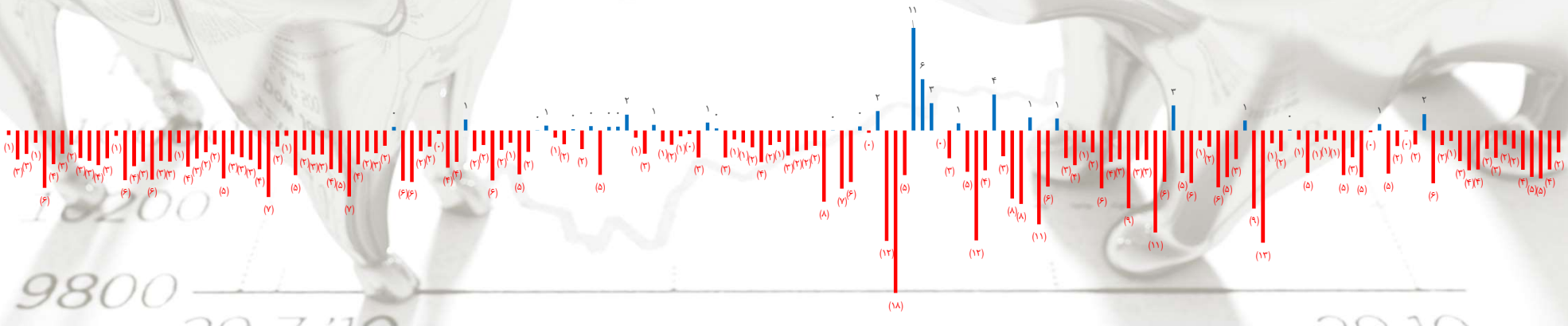


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

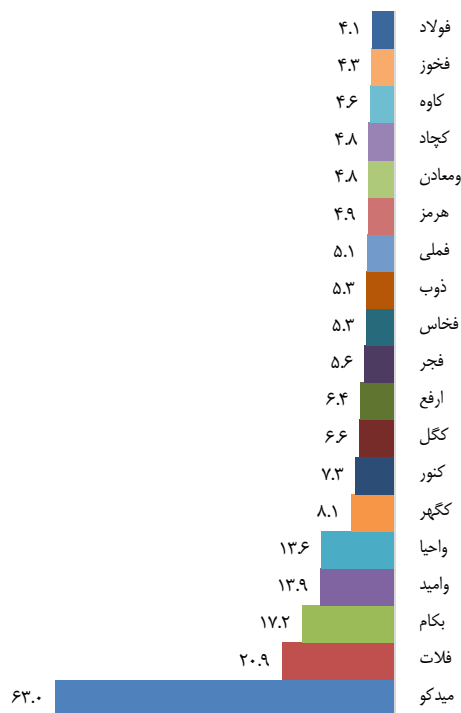


خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۱۴۰۰/۰۱/۰۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال

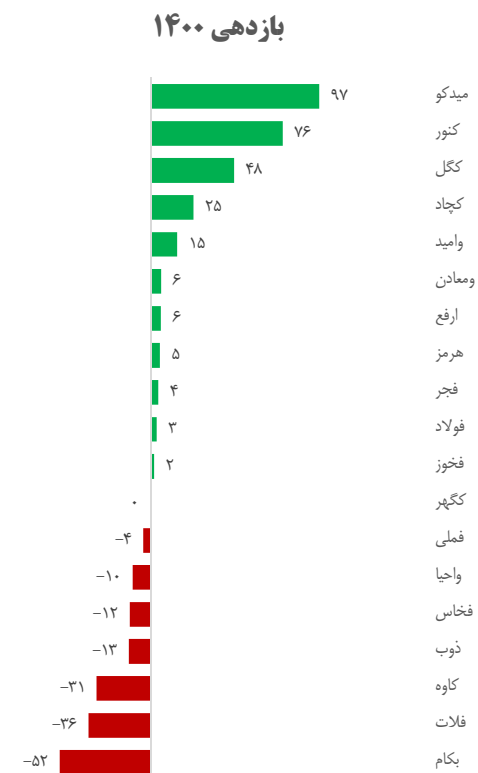
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



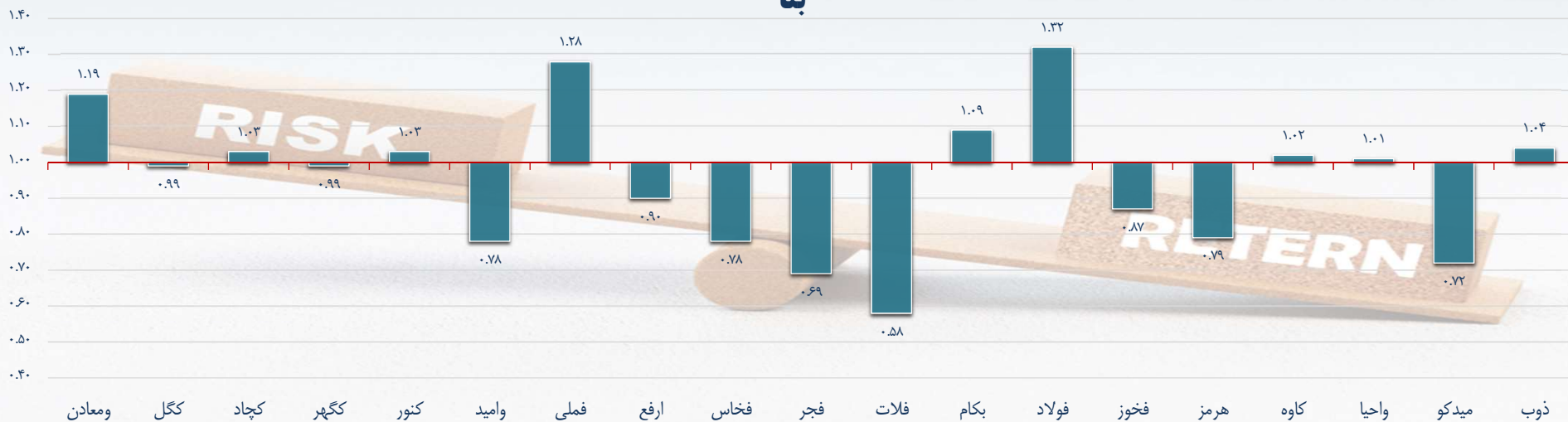
P/E تحلیلی



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	۹,۷۲۶,۶۴۹	۸۸,۰۱۰	۹,۰۴۰	۰.۳	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۲,۳۶۱,۴۳۲	۴۸,۷۹۲	۲۰,۶۲۰	۰.۲	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۸۱۷,۹۱۵	۷۷,۴۵۱	۲۷,۲۶۰	۰.۸	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۵۲۵,۵۶۴	۲۳,۸۲۹	۴۵,۷۰۹	(۰.۲)	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صبانور	۹۲۸,۸۹۰	۱۷,۳۰۶	۱۸,۶۱۰	۰.۱	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۲,۱۷۳,۸۳۹	۲۸,۶۴۹	۱۳,۱۹۰	(۰.۱)	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۳۶,۲۳۶,۴۲۹	۲۲۷,۷۵۰	۶,۲۵۰	۱.۰	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳,۳۷۶,۴۲۶	۴۶,۲۱۲	۱۳,۷۸۲	(۱.۶)	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۳۳۰,۶۳۷	۷,۵۶۹	۲۳,۲۹۰	(۰.۱)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۶۴۳,۳۰۷	۳۵,۱۹۷	۲۱,۴۲۰	(۱.۶)	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلآت ایرانیان	۱۵۰,۶۳۹	۱,۵۰۲	۱۰,۰۱۵	(۰.۱)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۶,۴۸۴,۹۶۶	۹,۵۱۶	۱,۴۶۳	۰.۷	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۴۱,۷۵۵,۹۰۱	۴۱۲,۱۳۰	۹,۸۱۰	۰.۲	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۶,۷۸۱,۶۸۱	۴۱,۹۵۵	۶,۱۸۰	۰.۰	۲,۳۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۲,۸۷۱,۶۲۳	۴۱,۷۸۳	۱۴,۶۷۳	(۰.۵)	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۳,۷۷۷,۹۳۱	۵۲,۹۳۲	۱۴,۰۱۰	۰.۰	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	۶,۰۲۲,۱۷۱	۲۷۷,۸۶۶	۴۶,۱۴۰	۱.۰	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	متوقف به دلیل انتقال به بورس تهران		۳,۴۶۳	۰.۰	۳۴۵	۶۵۹



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

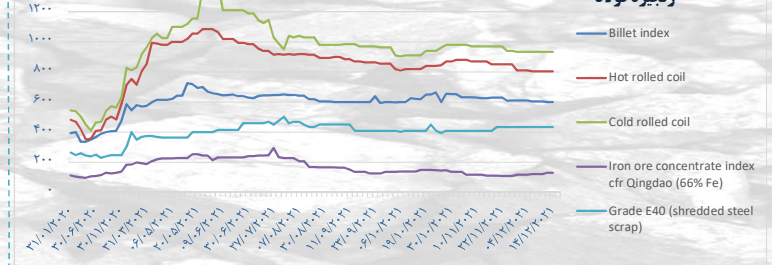
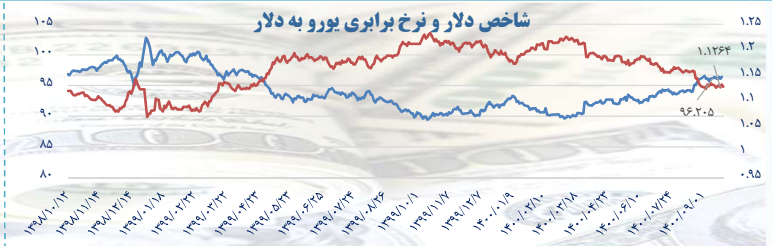
این جداول نشان می دهد که می توان در یک سطح معین از ریسک سهامی که بازده ای بیشتری دارد را انتخاب نمود و یا بالعکس در یک سطح معین از بازده، سهامی

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%)	۷۰.۷-۹۶.۷	(۲-۳)
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۰۸.۵-۱۰۹.۵	(۳)
برزیل	finer (61%-65%)	۴۸-۱۰۰.۲	(۲)
	lumps (62%)	۹۷	(۳)
هند	finer (55%-62%)	۲۷.۱-۷۳.۳	(۱-۳)
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۰-۷۲.۵	(۳)
	concentrates (65.0%-67.0%)	۹۲.۲-۹۹.۸	(۱)
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۹۱.۴-۹۵.۹	(۱)
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۰۹.۵-۱۳۱	(۲)

تولید روزانه فولاد خام طی دوره اول تا دهم دسامبر کاهش یافت زیرا نرخ تولید روزانه ۲,۳۶ میلیون تن به طور میانگین ثبت شده که پایین ترین سطح از ژانویه ۲۰۱۸ می باشد که به دلیل کاهش تقاضای زمستانی رقم خورده است.

ضریب بهره برداری از ظرفیت کوره بلندهای چین در هفته گذشته به رقم ۷۴٪ نزول کرده که نشان از افت شدید تولید فولاد این کشور داشته و مرتبط با سیاست های دولت در محدود کردن سقف تولید فولاد این کشور در زمستان و سال ۲۰۲۱ دارد.

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



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. افزایش قیمت های انرژی دولت ها را ناچار کرده است از یارانه و تخفیف های مالیاتی برای حمایت از مصرف کنندگان در برابر قبوض بالا استفاده کنند و درخواست بعضی از کشورها برای ایجاد یک سیستم خرید مشترک گاز در اتحادیه اروپا را به دنبال داشته است.



تولید فولاد خام چین در ماه نوامبر با ۲/۲۷۰ میلیون تن کاهش نسبت به ماه اکتبر به ۶۹/۳۱ میلیون تن رسید. این عدد در مقایسه با مدت مشابه سال قبل ۲۲ درصد افت را نشان می دهد. بدین ترتیب چین در ۱۱ ماهه سال ۲۰۲۱ بالغ بر ۹۴۴/۸۵ میلیون تن فولاد تولید نموده است. این بدان معناست که اگر چینی ها در دسامبر بیش از ۱۲۰ میلیون تن فولاد هم داشته باشند باز هم از تولید سال ۲۰۲۰ فراتر نخواهند رفت که همین موضوع عامل تقویت بهای سنگ آهن در هفته های گذشته بوده است.



دولت شهری تانگشان در پاسخ به دستورالعمل های اداره هواشناسی استان هبی رتبه بندی عملکرد چندین تاسیسات این منطقه را ارتقا داد. این تاسیسات شامل کارخانه های فولاد و واحدهای کک سازی می شود که رتبه بندی آنها از D به C در ۱۵ دسامبر ارتقا یافتند.



پلتس پرمیوم زغال استرالیا را بدون تغییر ۳۴۱ دلار در هر تن فوب استرالیا اعلام کرد و زغال تحویل CFR چین را نیز بدون تغییر ۳۴۷ دلار در هر تن در ۱۳ دسامبر گزارش کرد. چشم انداز بازار برای مواد خام نیز با بهبود حاشیه سود و خوش بینی بازار نسبت به تقاضای فولاد در سال ۲۰۲۲ بهبود یافته است که ممکن است در کوتاه مدت منجر به فعالیت های ذخیره سازی مجدد در میان مصرف کنندگان نهایی شود.



به گزارش اخبارفلزات، کاهش تقاضای مس توسط چین یکی از دلایل مهم برای کاهش قیمت این فلز ارزشمند صنعتی است. چین بزرگ ترین مصرف کننده مس در دنیاست، اما پیش بینی می شود با توجه به اوج گیری دوباره ویروس همه گیر کرونا فعالیت های ساختمانی و زیرساختی در این کشور کاهش یابد و به دنبال آن بستر برای افت تقاضا فراهم شود.



معاون امور صنایع وزارت صنعت، معدن و تجارت با بیان اینکه ۱۳ هزار واحد تولیدی و صنعتی راکد در کشور وجود دارد، گفت: موانع پیش روی دو هزار واحد تولیدی راکد در سطح کشور تا پایان امسال برطرف و این واحدها به چرخه تولید باز می گردند.