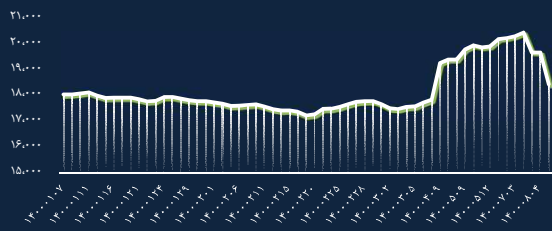


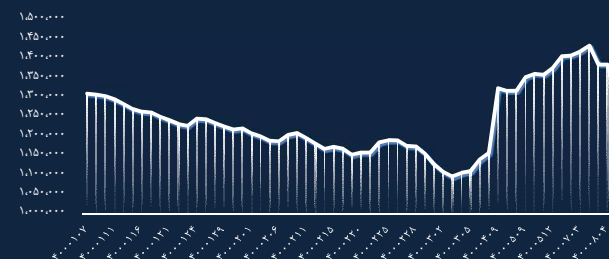
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۲۹

شاخص کل فرابورس

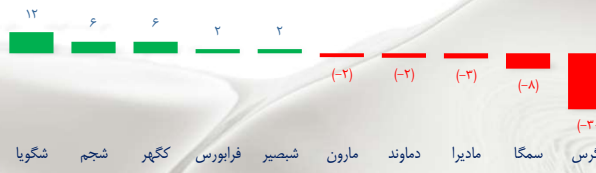


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۸,۴۴۰	۱,۳۰۱,۵۱۷	
۱۰,۱۴۷,۰۴۲.۳۹۵ B	۵۲,۰۲۲,۶۰۷.۶۰۸ B	ارزش بازار
(-۹)	۹,۸۴۱	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
(-۰.۰)	۰.۷۶	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۱,۲۱۷,۱۳۷.۴۷۲ B	۳۶,۲۹۲.۳۸۳ B	ارزش معاملات

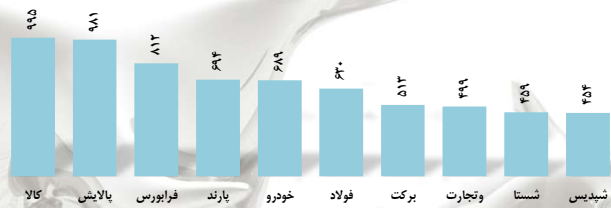
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



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



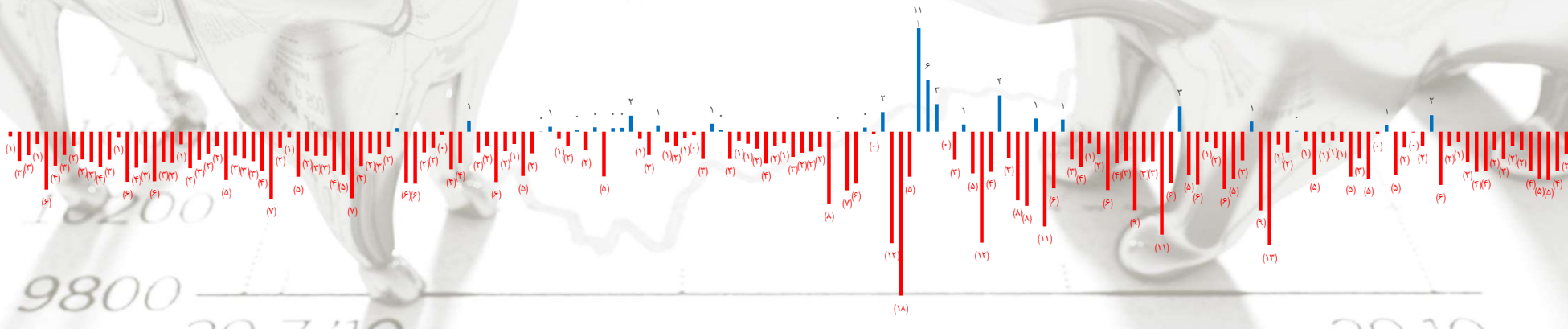
درصد فروش حقیقی‌ها (سبز) | درصد فروش حقوقی‌ها (قرمز)

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

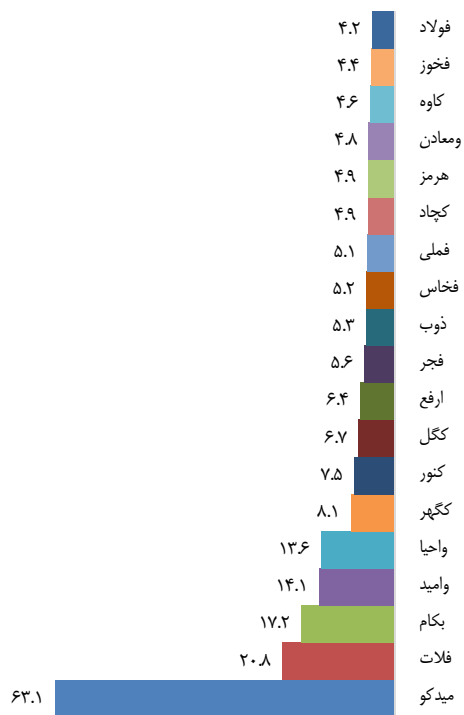
سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید



درصد خرید حقیقی‌ها (سبز) | درصد خریدهای حقوقی‌ها (قرمز)

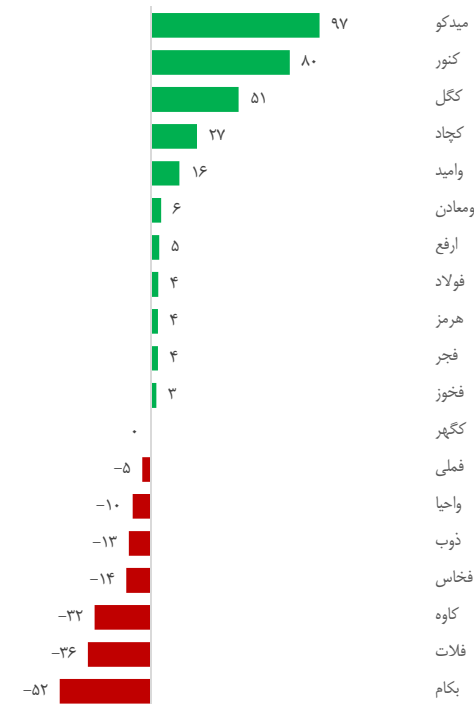


P/E تحلیلی



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	۱۰,۹۲۱,۳۹۷	۹۸,۸۳۰	۹۰,۴۰	-۰.۶	۱,۱۲۵	۱,۸۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۶,۹۰۹,۲۵۸	۱۴۵,۰۸۰	۲۱,۰۰۰	۱.۰	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۶,۲۹۲,۵۹۶	۱۷۴,۹۵۳	۲۷,۸۰۰	۱.۱	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۲,۲۰۳,۳۳۹	۱۰۰,۷۸۸	۴۵,۷۱۷	-۰.۳	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۲,۳۶۷,۸۱۷	۴۵,۴۹۰	۱۹,۰۳۰	-۰.۹	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶,۴۸۲,۲۴۷	۸۶,۹۰۱	۱۳,۳۴۰	۱.۱	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۴۹,۸۱۲,۵۷۷	۳۰۹,۳۷۲	۶,۳۱۰	-۰.۸	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۱,۴۹۹,۰۳۷	۲۰,۴۷۲	۱۳,۶۳۸	-۰.۱	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱,۰۸۷,۹۴۴	۲۴,۳۳۰	۲۲,۷۶۰	(-۰.۶)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۳,۴۱۷,۱۸۵	۷۳,۰۱۲	۲۱,۳۷۰	۴.۰	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلزات ایرانیان	۱۹۲,۴۸۷	۱,۸۸۱	۹,۹۶۱	(-۰.۵)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۶,۹۴۴,۳۸۹	۱۰,۱۵۵	۱,۴۶۶	(-۰.۵)	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۶۳,۲۶۹,۹۶۲	۶۲۹,۵۹۱	۹,۹۵۰	۲.۶	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۹,۳۰۸,۸۴۲	۵۸,۵۹۷	۶,۲۶۰	-۰.۶	۲,۲۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۳,۷۰۵,۷۳۵	۵۳,۹۷۴	۱۴,۵۲۶	-۰.۲	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۷,۰۴۰,۹۲۶	۹۷,۰۷۲	۱۳,۷۹۰	-۰.۶	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده	۱۹۹,۳۳۵	۱۳۰,۵۸۶	-۰.۰	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۴,۳۱۶,۵۸۵	۱۹۹,۳۳۵	۴۶,۱۸۰	-۰.۱	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	متوقف به دلیل انتقال به بورس تهران	۳,۴۶۳	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

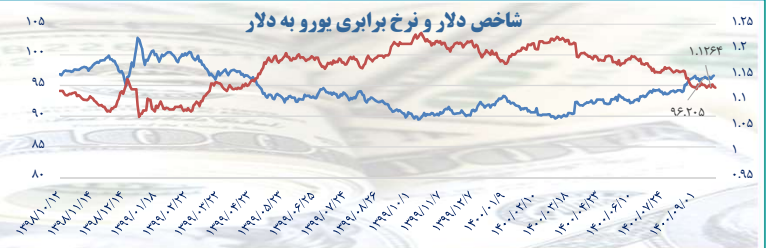
آخرین نرخ کامودیتی ها

جهانی

نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برابری یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



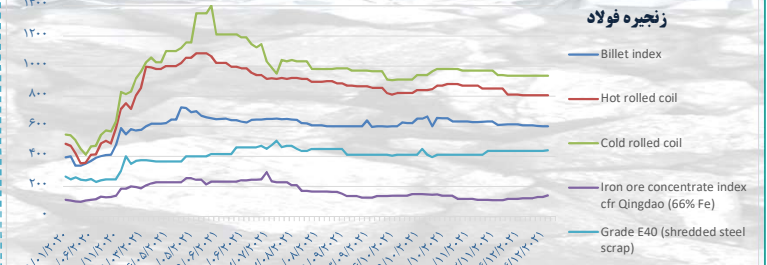
آلومینیوم



شمی فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



قیمت زنجیره سنگ آهن و موجودی بنادر چین

بر اساس گزارش اداره ملی آمار چین، تولید فولاد خام چین طی ماه های ژانویه تا نوامبر کاهش شدیدی را نسبت به مدت مشابه سال قبل به ثبت رساند و با ۲٫۶ درصد کاهش به ۹۴۶٫۳۶ میلیون تن رسید. این افت تولید سریع تر از کاهش ۰٫۷ درصدی ثبت شده در طول دوره ژانویه تا اکتبر است. تولید در ماه نوامبر نیز با ۲۲ درصد افت نسبت به نوامبر سال قبل به ۶۹٫۳۱ میلیون تن رسید.

میانگین ضریب بهره برداری از ظرفیت ۷۶۸ کوره بلند در میان ۲۴۷ کارخانه فولاد چین، در طول ۹ تا ۱۶ دسامبر با ۰٫۱۶ درصد افزایش به ۷۴٫۲۸ درصد رسیده است.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۸۳.۷-۱۰۹.۷	۴
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۲۰.۵-۱۲۱.۵	۳.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۶۱-۱۱۴.۷	۴
	lumps (62%)	۱۰.۸	۳
هند	finer (55%-62%)	۳۰.۳-۸۲.۲	۱.۲-۳.۲
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۲۵-۸۲.۸	۳-۴
	concentrates (65.0%-67.0%)	۱۰۷.۷-۱۱۵.۳	۵
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۱۰۴.۴-۱۰۷.۹	۳-۴
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۱۶.۵-۱۴۰	۳

موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	موجودی	تغییر هفتگی	ظرفیت
Qingdao	۲۳,۴۰۰	۸۰	۲۱,۰۰۰
Tianjin	۱۱,۰۸۰	-۱۲۰	۱۵,۵۰۰
Caofeidian	۱۵,۸۰۰	۴۰۰	۲۳,۰۰۰
Total	۱۵۶,۱۰۰	۱,۶۰۰	۲۳۶,۲۰۰

• اطلاعات و صورت‌های مالی میان‌دوره‌ای تلفیقی حسابرسی نشده
منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ شرکت منتشر شده است که شرکت
توانست در این دوره ۱۵۴۰۰۶۲ میلیارد ریال سود خالص محقق
کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۱۲۷ درصد رشد داشته
است.

کگل

کدال

• سود عملیاتی شرکت در دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
نسبت به مدت مشابه قبل به میزان ۸۷ درصد افزایش داشته است
که عمدتاً ناشی از افزایش ۸۹ درصدی درآمد که ناشی از: ۱-
افزایش نرخ فروش محصولات نسبت به مدت مشابه قبل و افزایش
حجم فروش صادراتی بوده است. ۲-افزایش ۱۶۰ درصدی سایر
درآمدهای عملیاتی نسبت به مدت مشابه قبل که عمدتاً ناشی از
افزایش حجم و نرخ فروش ضایعات تولیدی بوده است.

فخاس

کدال

اداره ملی آمار چین در اطلاعیه ۱۵ دسامبر، با ذکر چند نشانه مثبت از جمله تولید محصولات صنعتی و کشاورزی بیشتر، بازار اشتغال
عمدتاً ثابت و افزایش ملایم در شاخص قیمت مصرف کننده تاکید کرد که اقتصاد داخلی چین تا ماه نوامبر روند بهبود را حفظ کرده و
با توسعه با کیفیت بالا همراه با افزایش انعطاف پذیری همراه بوده است. در ماه نوامبر، شرکت‌های صنعتی بزرگ این کشور ارزش افزوده
خود را ۳,۸ درصد افزایش دادند که بالاتر از ۳,۵ درصد رشد ماه اکتبر است.

اخبار روز

موسسه MEPS پیش‌بینی تولید سالانه فولاد خام خود را برای سال ۲۰۲۱ به یک میلیارد و ۹۴۰ میلیون تن کاهش داده است. با این
وجود، این رقم یک اوج گیری جدید برای فولادسازی جهانی است و نشان دهنده رشد سالانه ۳/۴ درصدی است.

اخبار روز

ریوتینتو در اختلاف با دولت مغولستان بر سر پروژه مشترک مس Oyu Tolgoi تصمیم گرفته است که فعالیت خود را متوقف کند. ریو
پیشنهاد داده است که برای پوشش ۳۴ درصد از سرمایه گذاری خود، از ۲/۳ میلیارد دلار بدهی به مغولستان چشم پوشی نماید.

اخبار روز

از ابتدای سال ۱۴۰۰ تا آذرماه این سال، سهم کل تجارت ایران بالغ بر ۶۳ میلیارد دلار بوده است که از این میزان ۵۲ درصد سهم تجارت
با همسایگان و ۴۸ درصد سهم تجارت با سایر کشورهای جهان بوده است. در این بین، ارزش دلاری سهم تجارت خارجی ایران در هشت
ماه نخست امسال با کشورهای همسایه با رشد حدود ۱۰ میلیارد دلار نسبت به مدت مشابه سال قبل به ۳۳ میلیارد دلار رسیده است.

اخبار روز

میزان آب تولیدی تا پایان آبان ۱۴۰۰ حدود ۶ میلیارد متر مکعب بوده که نسبت به مدت زمان مشابه سال قبل با افزایش ۳/۳ درصدی
همراه بوده است. از این مقدار ۳/۵ میلیارد مترمکعب را آب های زیرزمینی و ۲/۴ میلیارد مترمکعب را نیز آب های سطحی تشکیل داده
است. آب های زیرزمینی و سطحی تا پایان آبان ۱۴۰۰ نسبت به مدت مشابه سال قبل به ترتیب با افزایش ۷/۵ درصدی و کاهش ۲/۴
درصدی همراه بوده اند.

اخبار روز