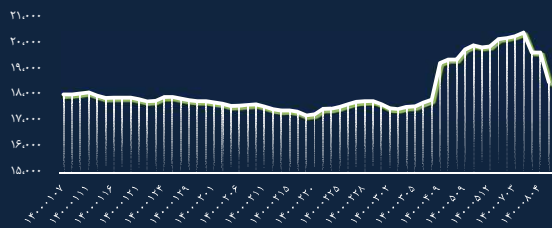


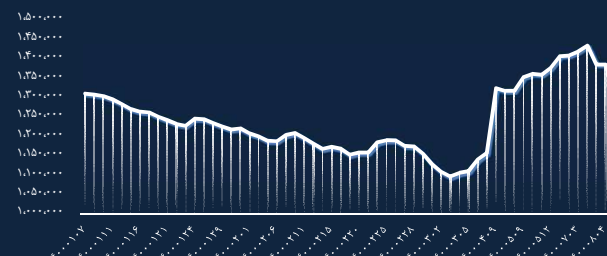
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

شاخص کل فرابورس



فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۸,۵۲۴	۱,۳۱۸,۴۶۷	
۱۰,۱۹۳,۱۸۶.۶۲۵ B	۵۲,۶۹۴,۹۶۱.۸۳۵ B	ارزش بازار
۸۴	۱۶,۹۲۵	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۰.۴۵	۱.۳۰	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۳۷,۹۸۱.۷۸۲ B	۳۴,۹۲۸.۴۴۲ B	ارزش معاملات

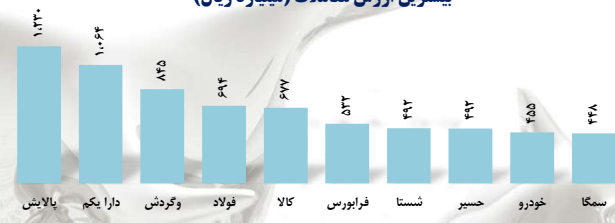
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



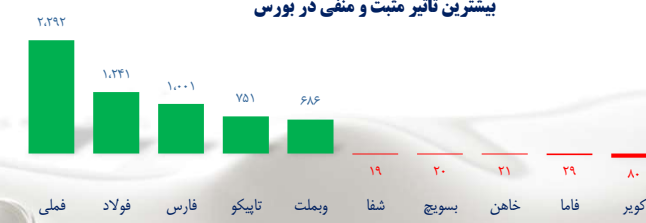
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



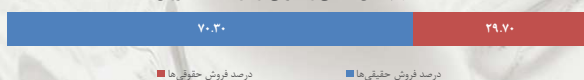
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

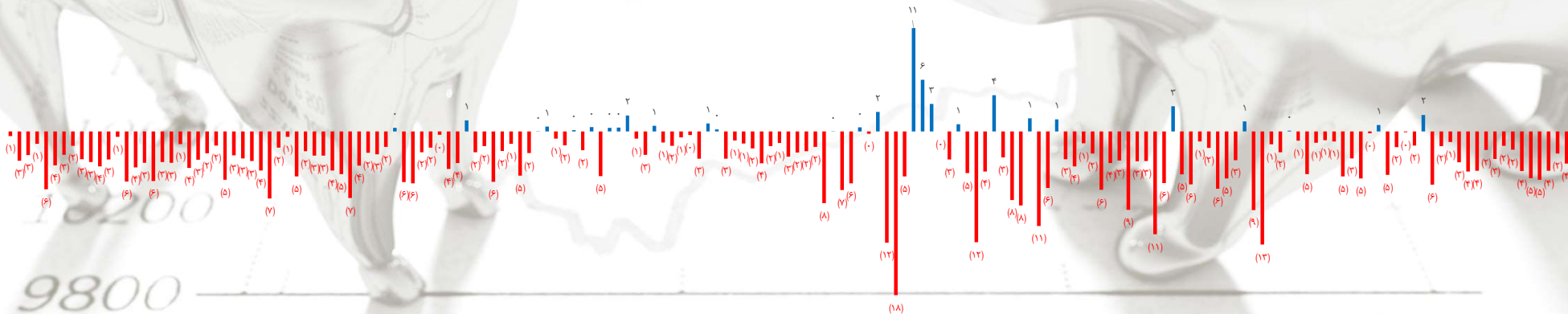
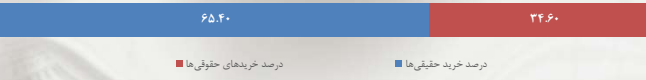


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش

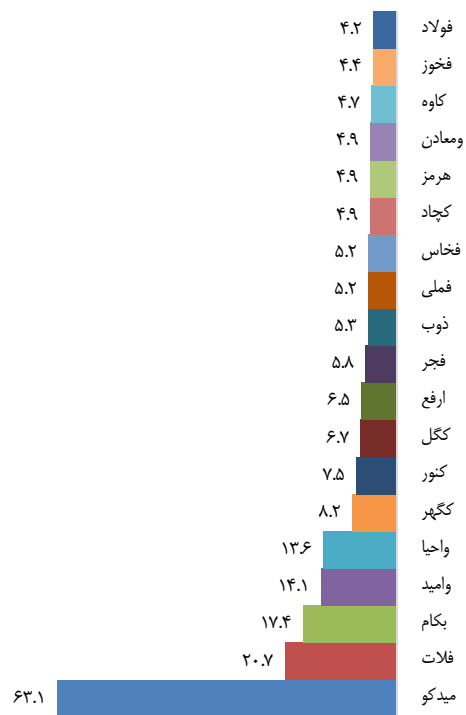


خالص ورود (خروج) پول حقیقی از ۱۴۰۰/۰۱/۰۱ تا کنون - هزار میلیارد ریال

سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

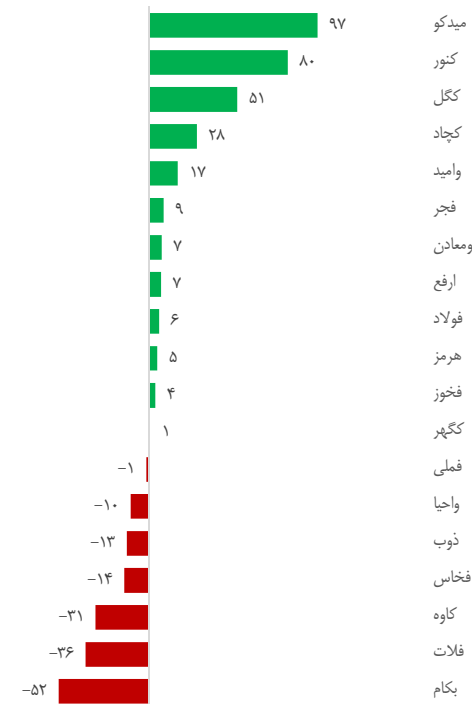


P/E تحلیلی



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	۶,۱۵۱,۱۵۲	۵۷,۱۴۸	۹,۱۶۰	۱.۳	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۱,۸۶۴,۴۴۲	۳۹,۳۶۹	۲۱,۰۴۰	-۰.۲	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۲,۴۵۵,۹۰۱	۶۹,۱۲۶	۲۸,۰۲۰	-۰.۸	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۱,۵۶۹,۹۳۴	۷۲,۸۰۹	۴۶,۱۱۲	-۰.۹	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۷۵۱,۱۶۳	۱۴,۳۳۴	۱۹,۰۴۰	-۰.۱	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۳,۴۷۹,۲۷۹	۴۶,۶۱۰	۱۳,۳۶۰	-۰.۲	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۵۸,۶۳۷,۹۳۲	۳۷۷,۷۲۶	۶,۴۴۰	۳.۷	۱,۳۰۲	۱,۳۲۹
شرکت آهن و فولاد ارفع	۲,۸۱۷,۷۹۸	۴۰,۶۹۷	۱۳,۹۴۰	۲.۲	۲,۱۶۳	۲,۱۴۷
فولاد خراسان	۱۰۱,۲۲۳	۲,۲۴۴	۲۲,۷۵۰	(۰.۰)	۲,۰۵۷	۴,۳۸۲
فولاد امیرکبیر کاشان	۱,۳۲۴,۶۷۴	۲۹,۵۲۵	۲۲,۲۹۰	۴.۳	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلآت ایرانیان	۱۶۹,۴۰۴	۱,۶۵۴	۹,۹۲۷	(۰.۳)	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۵,۴۳۷,۱۱۳	۸۱,۰۲	۱,۴۷۹	-۰.۹	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۶۸,۵۳۶,۹۹۶	۶۹۳,۷۹۳	۱۰,۱۲۰	۱.۷	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۶,۴۹۴,۹۹۸	۴۱,۳۳۶	۶,۲۹۰	-۰.۵	۲,۳۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۳,۱۷۶,۵۲۷	۴۶,۸۷۴	۱۴,۶۱۵	-۰.۶	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۹,۵۱۰,۴۷۹	۱۳۴,۳۹۱	۱۴,۱۲۰	۲.۴	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	۳,۳۳۸,۶۵۵	۱۵۴,۱۸۰	۴۶,۱۸۰	-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

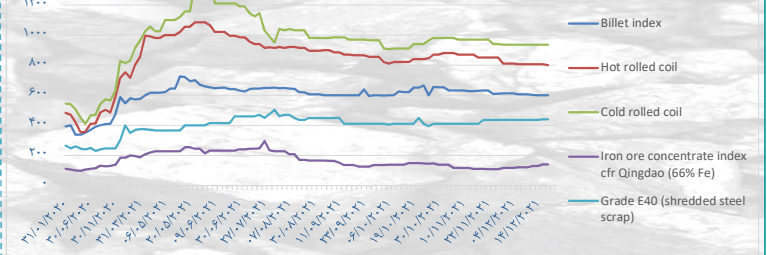
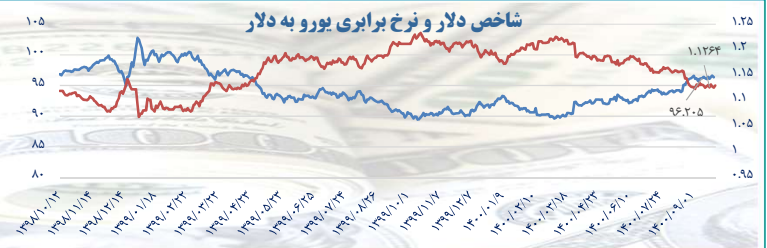
با توجه به بازده مازاد منفی سهام در این بازه نسبت شارپ قابلیت اندازه گیری ندارد

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%)	۸۷.۲-۱۱۳.۷	۳.۵-۴
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۲۶-۱۲۷	۵.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۶۵-۱۱۹.۲	۴-۴.۵
	lumps (62%)	۱۱۴	۵.۵
هند	finer (55%-62%)	۳۳.۳-۸۶.۲	۳-۴
	pellets (64.0%)	۱۲۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۳۰-۸۷.۸	۵
	concentrates (65.0%-67.0%)	۱۱۳.۷-۱۲۱.۳	۶
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۱۰۹.۴-۱۱۲.۹	۵
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۲۰.۵-۱۴۴	۴

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

• اطلاعات و صورت‌های مالی میان‌دوره‌ای حسابرسی شده منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ شرکت فولاد متیل از زیر مجموعه های فولاد مبارکه منتشر شده است که شرکت توانست در این دوره ۱،۵۵۶ میلیارد ریال سود خالص محقق کند که نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۳۹۲ درصد رشد داشته است.

کدال

فولاد

کل سرمایه گذاری چین در توسعه املاک و مستغلات در بین ماه های ژانویه تا نوامبر سال جاری به بیش از ۱/۳۷ تریلیون یوان رسید. این عدد ۶ درصد بیشتر از مدت مشابه سال قبل است و ۱۳/۲ درصد بیشتر از مدت مشابه سال ۲۰۱۹ می باشد.

اخبار روز

با قطع گاز ارسالی روسیه به اروپا از سمت خط انتقال گاز Mallnow، قیمت گاز اروپا صعودی شده و به ۱۴۷ دلار بر مگاوات رسیده که بالاترین سطح تاریخ است.

اخبار روز

تحلیل های بانک سیتی نشان می دهد که بازار جهانی روی در سه ماهه اول سال ۲۰۲۲ با کسری عرضه ۱۰۰ هزار تنی مواجه خواهد شد و احتمال دارد که این مقدار به دو برابر تا پایان شش ماهه اول برسد. با توجه به احتمال بسته شدن واحدهای ذوب در اروپا، این بانک عقیده دارد که این منطقه با کاهش تولید ۶۶۰ هزار تنی سالانه روبرو خواهد شد که حدود ۱۶۵ هزار تن آن مربوط به سه ماهه اول سال می باشد. همچنین با توجه به افت تولید ۳۰۰ هزار تنی سالانه در دیگر نقاط و به تناسب آن در شش ماهه اول سال، بازار جهانی فلز روی با کسری تقریبی ۲۶۰ هزار تنی مواجه خواهد شد.

اخبار روز

در راستای اجرای توافق وزارت صمت و وزارت نیرو در زمینه ایجاد ظرفیت جدید نیروگاهی توسط شرکت های صنعتی و معدنی، نخستین تفاهم نامه با ارزش تقریبی ۷۹ میلیون یورو بین شرکت سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات و گروه مپنا برای تکمیل فاز دوم نیروگاه سمنان به امضا رسید.

اخبار روز

مدیرعامل شرکت احیا استیل فولاد بافت اعلام کرد: میزان تولید آهن اسفنجی در هشت ماه منتهی به پایان آبان ماه امسال به ۶۸۶ هزار و ۵۱۲ تن رسید که در مقایسه با مدت مشابه سال گذشته ۷۰۳۲ تن افزایش داشت.

اخبار روز