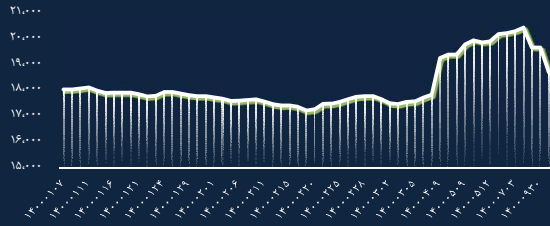


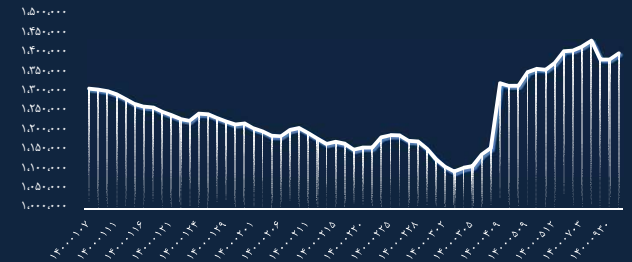
خلاصه وقایع بورس اوراق بهادار تهران در ۱۴۰۰/۱۰/۰۶

شاخص کل فرابورس

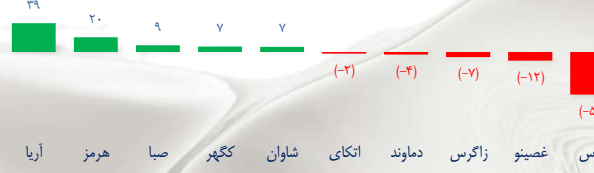


فرابورس	بورس	مقدار شاخص
۱۸,۷۲۰	۱,۴۰۰,۲۹۱	
۱۰,۳۰۱,۱۰۱,۴۹۶ B	۵۵,۹۷۱,۱۵۹,۳۵۱ B	ارزش بازار
۶۲	۱۶,۳۰۲	مقدار تغییر نسبت به روز گذشته
۰.۳۳	۱.۱۸	درصد تغییر نسبت به روز گذشته
۱,۳۲۱,۹۶۲,۶۱۲ B	۴۱,۹۱۲,۴۹۳ B	ارزش معاملات

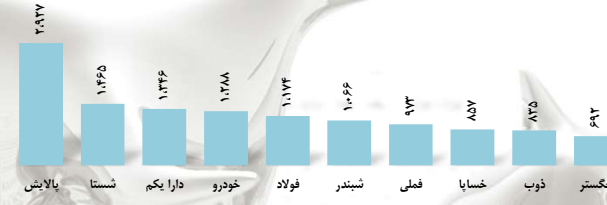
شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران



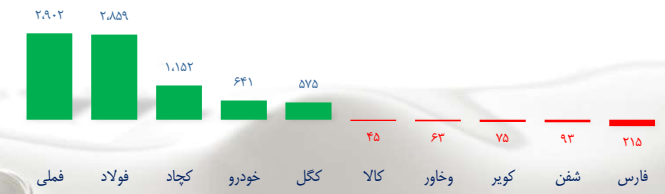
بیشترین تأثیر مثبت و منفی در فرابورس



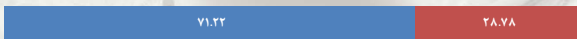
بیشترین ارزش معاملات (میلیارد ریال)



بیشترین تأثیر مثبت و منفی در بورس

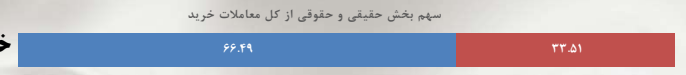


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات فروش



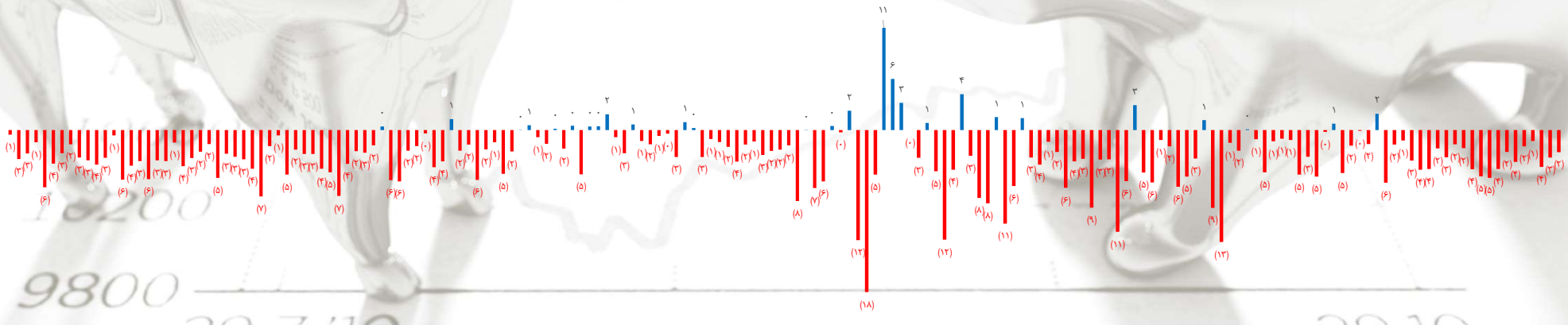
درصد فروش حقیقی‌ها (■) درصد فروش حقوقی‌ها (■)

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

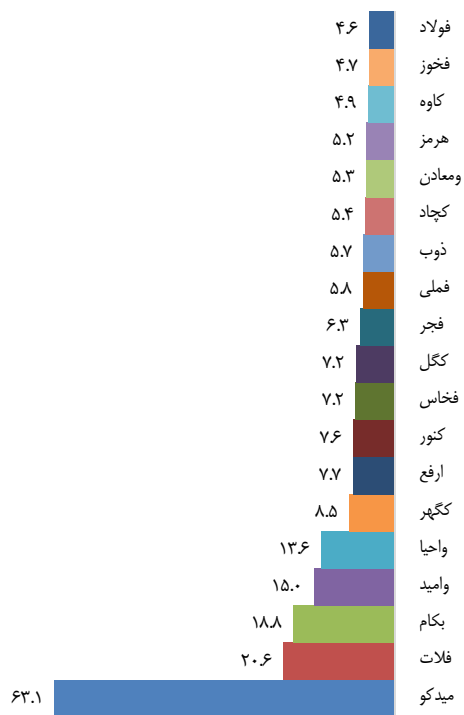


سهم بخش حقیقی و حقوقی از کل معاملات خرید

درصد خرید حقیقی‌ها (■) درصد خریدهای حقوقی‌ها (■)



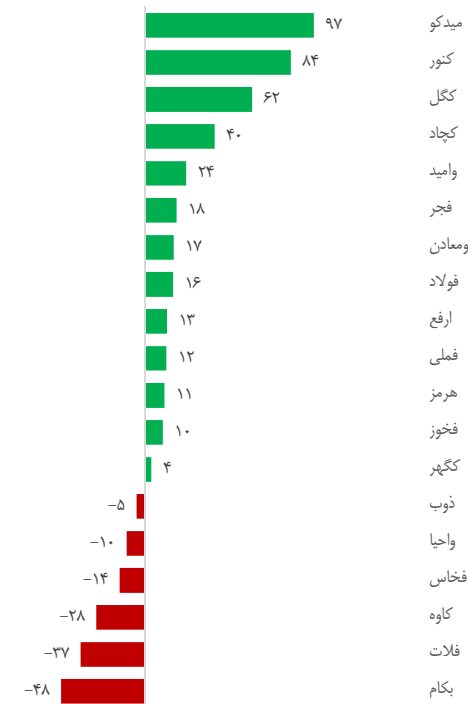
P/E تحلیلی



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	۸,۵۸۱,۶۵۹	۸۵,۷۶۴	۹,۹۴۰	۱.۰	۱,۱۲۵	۱,۱۷۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۴,۶۲۲,۶۵۴	۱۰۴,۴۰۱	۲۲,۵۴۰	۱.۰	۱,۹۰۳	۳,۱۴۰
معدنی و صنعتی چادرملو	۳,۹۹۸,۱۴۵	۱۲۳,۲۵۰	۳۰,۷۹۰	۲.۸	۳,۰۸۰	۵,۶۷۵
سنگ آهن گهرزمین	۵۱۰,۰۳۲	۲۴,۶۲۴	۴۷,۶۳۸	۰.۳	۱,۷۳۱	۵,۴۶۱
توسعه معدنی و صنعتی صیانور	۱,۴۴۳,۶۶۰	۲۸,۲۰۲	۱۹,۴۶۰	۰.۲	۷,۴۳۸	۲,۵۴۹
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۴,۶۸۰,۲۰۷	۶۶,۸۸۸	۱۴,۱۹۰	۰.۸	۷۹۶	۹۴۹
ملی صنایع مس ایران	۱۳۲,۵۸۵,۲۶۴	۹۷۲,۹۰۹	۷,۳۴۰	۴.۱	۱,۳۰۲	۱,۲۶۶
شرکت آهن و فولاد ارفع	۴,۰۵۶,۰۵۰	۵۹,۶۴۷	۱۴,۶۸۰	۱.۰	۲,۱۶۳	۱,۸۹۶
فولاد خراسان	۳۳۲,۹۱۲	۷,۳۰۳	۲۲,۶۸۰	(۰.۰)	۲,۰۵۷	۳,۱۴۶
فولاد امیرکبیر کاشان	۲,۴۶۱,۱۱۵	۵۹,۷۳۰	۲۴,۲۷۰	۲.۷	۴,۷۳۶	۳,۸۳۶
گروه صنایع معادن فلزات ایرانیان	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده	۹,۸۵۱	۹,۸۵۱	۰.۰	۳۶۵	۴۷۵
کارخانجات تولیدی شهید قندی	۶,۴۸۷,۴۲۵	۱۰,۳۹۳	۱,۵۹۶	۰.۶	۱۰۳	۸۵
فولاد مبارکه اصفهان	۱۰,۵۸۱,۹۴۷	۱,۱۷۴,۳۰۸	۱۱,۱۰۰	۳.۶	۱,۲۵۸	۲,۳۸۸
فولاد خوزستان	۹,۵۷۷,۴۰۰	۶۴,۵۲۶	۶,۷۰۰	۰.۸	۲,۳۳۳	۱,۴۳۶
فولاد هرمزگان جنوب	۵,۳۲۷,۰۹۲	۸۳,۹۷۸	۱۵,۵۴۱	۲.۹	۲,۰۸۱	۲,۹۶۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۷,۵۶۰,۱۳۶	۱۱۱,۰۳۴	۱۴,۶۹۰	۰.۸	۲,۳۹۶	۳,۰۲۷
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	متوقف به دلیل برگزاری مجمع عمومی فوق العاده	۱۳۰,۵۸۶	۱۳۰,۵۸۶	۰.۰	۵,۱۹۱	۹,۴۹۹
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۵,۱۷۰,۸۹۲	۲۳۸,۸۹۲	۴۶,۲۰۰	۰.۰	۶۶۰	۷۳۲
سهامی ذوب آهن اصفهان	۲۲۰,۹۴۰,۰۵۵	۸۳۵,۲۶۹	۳,۷۸۱	۴.۴	۲۴۵	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	Std (۰.۱۰۲,-۰.۱۴۸)	High Risk
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		
۰.۱۲	-۰.۲۳	-۰.۱۱	فولاد مبارکه اصفهان	Std (۰.۱۰۲,-۰.۱۴۸)	High Risk
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

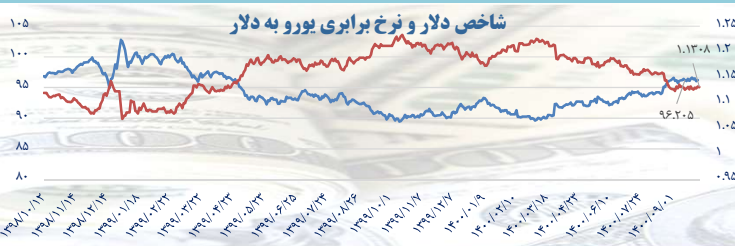
آخرین نرخ کامودیتی ها

جهانی

نرخ تسعیر دلار در بازار آزاد (ریال)



شاخص دلار و نرخ برابری یورو به دلار



سکه (ریال)



اونس



کاند فملی



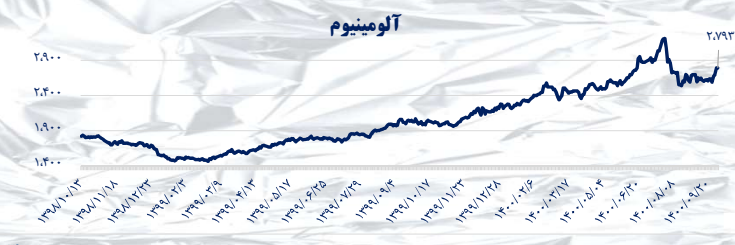
کاند



آلومینیوم ایرالکو (ریال)



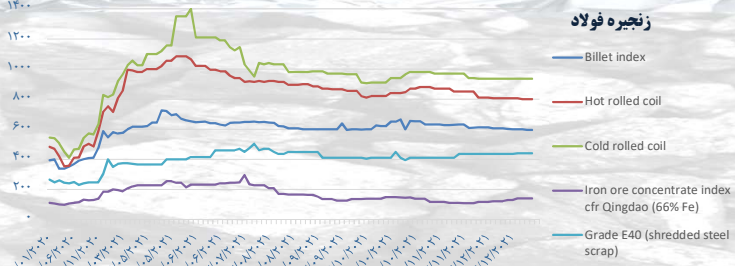
آلومینیوم



شمی فولاد خوزستان (ریال)



زنجیره فولاد



نفت برنت



بیت کوین



قیمت زنجیره سنگ آهن و موجودی بنادر چین

وزارت اکولوژی و محیط زیست چین MEE در بیانیه ای مطبوعاتی در تاریخ ۲۳ دسامبر شایعات مبنی بر اعمال محدودیت های گسترده برای فولادسازان پیش از المپیک ۲۰۲۲ پکن را تکذیب کرد. این وزارتخانه اعلام کرد که به استان های پکن و همی و همچنین مناطق اطراف دستور داده شده تا بهترین تلاش خود را برای تضمین و اطمینان از رشد سالم توسعه اقتصاد ملی در طول بازی های زمستانی و پارالمپیک ۲۰۲۲ انجام دهند.

قیمت زنجیره سنگ آهن			
کشور	نوع سنگ آهن	قیمت (FOB)	میزان تغییر (دلار)
استرالیا	finer (57%-63%)	۸۷.۷-۱۱۸	۱.۵-۴
	lumps (62.5%-63.5%)	۱۲۸.۵-۱۲۹.۵	۳.۵
برزیل	finer (61%-65%)	۷۲-۱۲۶.۲	۴
	lumps (62%)	۱۱۸	۴
هند	finer (55%-62%)	۳۳.۳-۹۰.۷	۲-۲.۵
	pellets (64.0%)	۱۳۱	-
ایران	finer (54%-62%)	۳۰-۹۱.۸	۱-۲
	concentrates (65.0%-67.0%)	۱۱۷.۷-۱۲۴.۳	۲-۳
روسیه	concentrates (65.0%-66%)	۱۱۳.۴-۱۱۶.۹	۳
	pellets (63.0%-65.0%)	۱۲۱.۵-۱۴۵	-

موجودی سنگ آهن بنادر چین (هزار تن)	موجودی	تغییر هفتگی	ظرفیت
بنادر	Qingdao	۲۳,۱۲۰	۲۱,۰۰۰
	Tianjin	۱۱,۷۰۰	۱۵,۵۰۰
	Caofeidian	۱۴,۹۵۰	۲۳,۰۰۰
	Total	۱۵۵,۲۵۰	۲۳۶,۲۰۰

• شرکت گزارش عملکرد آذرماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۱۶،۶۴۰ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۹ ماهه خود ۱۳٪ بیشتر است. مجموع فروش ۹ ماهه شرکت ۱۳۲،۴۶۶ میلیارد ریال است.

کدال

کاهه

• شرکت گزارش عملکرد آذرماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۲،۷۰۰ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۹ ماهه خود ۱۸٪ بیشتر است. مجموع فروش ۹ ماهه شرکت ۲۰،۵۷۷ میلیارد ریال است.

کدال

کنور

• شرکت گزارش عملکرد آذرماه خود را ارائه داد و در این ماه به فروش ۱۳۵،۲۹۲ میلیارد ریالی دست پیدا کرده، که نسبت به میانگین ۹ ماهه خود ۱۶٪ افزایش داشته است. مجموع فروش ۹ ماهه شرکت ۱،۰۴۹ هزار میلیارد ریال است.

کدال

فولاد



میزان صادرات چین به اتحادیه اروپا طی ۲۰ سال اخیر از حدود ۴۵ میلیارد دلار در سال ۲۰۰۱ به ۴۶۴ میلیارد دلار در سال ۲۰۲۰ رسیده که حکایت از رشد ۱۰ برابری در این مدت است.



طی ۲۰ سال اخیر رقم صادرات کالایی آمریکا به اتحادیه اروپا از ۱۶۸ میلیارد دلار در سال ۲۰۰۰ به ۳۳۶ میلیارد دلار در سال ۲۰۱۹ رسیده است که نشان از رشد دوبرابری دارد. در همین مدت میزان صادرات اتحادیه اروپا به آمریکا هم از ۲۲۷ میلیارد دلار در سال ۲۰۰۰ به ۵۱۵ میلیارد دلار در سال ۲۰۱۹ و ۱۴۵ میلیارد دلار در سال ۲۰۲۰ رسیده است.



پیش‌بینی می‌شود رشد اقتصادی واقعی منطقه منا در سال ۲۰۲۲، حدود ۵،۲ درصد و در سال ۲۰۲۳، حدود ۴،۶ درصد باشد. پیش‌بینی مزبور بر اساس فروض اصلی یعنی استمرار واکسیناسیون کووید-۱۹ در سرتاسر منطقه (البته با سرعت‌های متفاوت)، افزایش قیمت انرژی و رشد تولید نفت در راستای سهمیه‌های اوپک پلاس است.



انتظار می‌رود عرضه‌های بالاتر و تقاضای پایین‌تر عامل کاهش قیمت مس در سال آینده باشد. انتظار رشد کندتر تقاضا در چین و افزایش عرضه ناشی از فعالیت‌هایی مانند معدن Quellaveco آنگلو امریکن در پرو احتمالاً قیمت‌ها را در سال آینده پایین نگه می‌دارد.



در هفته گذشته، میانگین قیمت بیلت صادراتی ایران، ۵۴۱ دلار به ازای هر تن بود که نسبت به هفته پیش از آن، کاهش ۴ دلاری یا ۰/۷ درصدی را نشان می‌دهد. قیمت میانگین اسلب صادراتی ایران نیز در هفته گذشته ۵۶۸ دلار به ازای هر تن بود که نسبت به هفته پیش از آن، کاهش ۲ دلاری یا ۰/۳ درصدی را نشان می‌دهد.