

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۳۴

شرکت تأمین سرمایه امید به عنوان یکی از بزرگترین نهادهای مالی فعال در بازار سرمایه کشور خدمات مالی و سرمایه‌گذاری متنوعی را به شرح زیر به اشخاص حقیقی و حقوقی ارائه می‌نماید.

۱- خدمات سرمایه‌گذاری و مدیریت دارایی

۱-۱- مدیریت صندوق‌های سرمایه‌گذاری: صندوق‌های سرمایه‌گذاری زیر تحت مدیریت تأمین سرمایه امید فعالیت می‌کنند.

- صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان: این صندوق مبتنی بر صدور و ابطال بوده و مناسب برای اشخاص با تمایل پذیرش ریسک کمتر و دریافت سود ماهانه است. اطلاعات این صندوق و صدور و ابطال واحدهای آن از طریق وبسایت صندوق به نشانی ganjinehomidfund.ir و شعب بانک سپه در دسترس است؛

- صندوق سرمایه‌گذاری سهامی قابل معامله بذر امیدآفرین: این صندوق با نماد معاملاتی «بذر» از طریق سیستم‌های معاملات آنلاین و کارگزاری‌ها قابل خرید و فروش است و مناسب برای اشخاصی است که با پذیرش ریسک بالاتر تمایل دارند در بازار سهام سرمایه‌گذاری نمایند. مدیر و بازارگردان این صندوق، شرکت تأمین سرمایه امید است. اطلاعات این صندوق در وبسایت آن به آدرس bazreomidfund.ir در دسترس است؛

- صندوق سرمایه‌گذاری طلای قابل معامله زرافشان امید ایرانیان: این صندوق با نماد معاملاتی «زر» از طریق سیستم‌های معاملات آنلاین و کارگزاری‌ها قابل خرید و فروش است و مناسب برای اشخاصی است که تمایل دارند بر روی طلا و ارز سرمایه‌گذاری نمایند. مدیر و بازارگردان این صندوق، شرکت تأمین سرمایه امید است. اطلاعات این صندوق در وبسایت آن به آدرس omidgoldfund.ir در دسترس است؛



- صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت قابل معامله آسمان امید: این صندوق با نماد معاملاتی «آسامید» از طریق سیستم‌های معاملات آنلاین و کارگزاری‌ها قابل خرید و فروش است و مناسب برای اشخاصی است که تمایل دارند ریسک کمتری بپذیرند. مدیر صندوق سبذگردان آسمان و بازارگردان آن شرکت تأمین سرمایه امید است. اطلاعات این صندوق در وبسایت آن به آدرس asemanomid.com در دسترس است؛

- صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی امید ایرانیان: این صندوق مختص بازارگردانی سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بازار سرمایه است و مطابق مقررات صرفاً در دسترس سهامداران عمده شرکت‌های پذیرفته شده است.

۲-۱- بازارگردانی انواع اوراق بدهی و سهام با استفاده از روش‌های نوین معاملات الگوریتمی مبنی بر حمایت اوراق بهادار ناشر.

۳-۱- سبذگردانی اختصاصی.

۲- خدمات تأمین مالی

۱-۲- خدمات مشاوره مالی شامل مشاوره افزایش سرمایه و عرضه سهام جدید در بورس، ارزشگذاری، مشاوره پذیرش، تدوین طرح کسب‌وکار و تهیه گزارش امکان‌سنجی.

۲-۲- تأمین مالی داخلی و بین‌المللی شامل مشاوره عرضه جهت معرفی انواع اوراق بهادار، بکارگیری بهترین روش تأمین مالی برای شرکت‌های متقاضی و پیگیری تحقق آن تا انتشار و فروش در بازار، برنامه‌ریزی جامع تأمین مالی و پذیرش تعهد پذیرهنویسی اوراق بهادار.

۳- مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شامل ارائه خدمات مشاوره مدیریت ریسک به سازمان‌ها و شرکت‌های متقاضی، طراحی ابزارهای مالی نوین و اجرای پروژه‌های غیرانتفاعی در راستای مسئولیت‌پذیری اجتماعی و ارتقای سواد و دانش مالی و بازار سرمایه در سطح کشور.



۱- بازارهای داخلی

در بخش نخست به بررسی عملکرد بازارهای داخلی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ می‌پردازیم. ابتدا شاخص‌ها و آمارهای معاملاتی بورس اوراق بهادار تهران، فرابورس ایران، بورس کالای ایران و بورس انرژی ایران مورد بررسی قرار می‌گیرد. سپس صنایع مختلف بورس اوراق بهادار تهران از نظر بازدهی هفتگی بررسی می‌گردند. در نهایت عملکرد بورس و فرابورس، با دو بازار موازی طلا و ارز، براساس قیمت سکه بهار آزادی و نرخ دلار آمریکا مورد مقایسه قرار می‌گیرد.

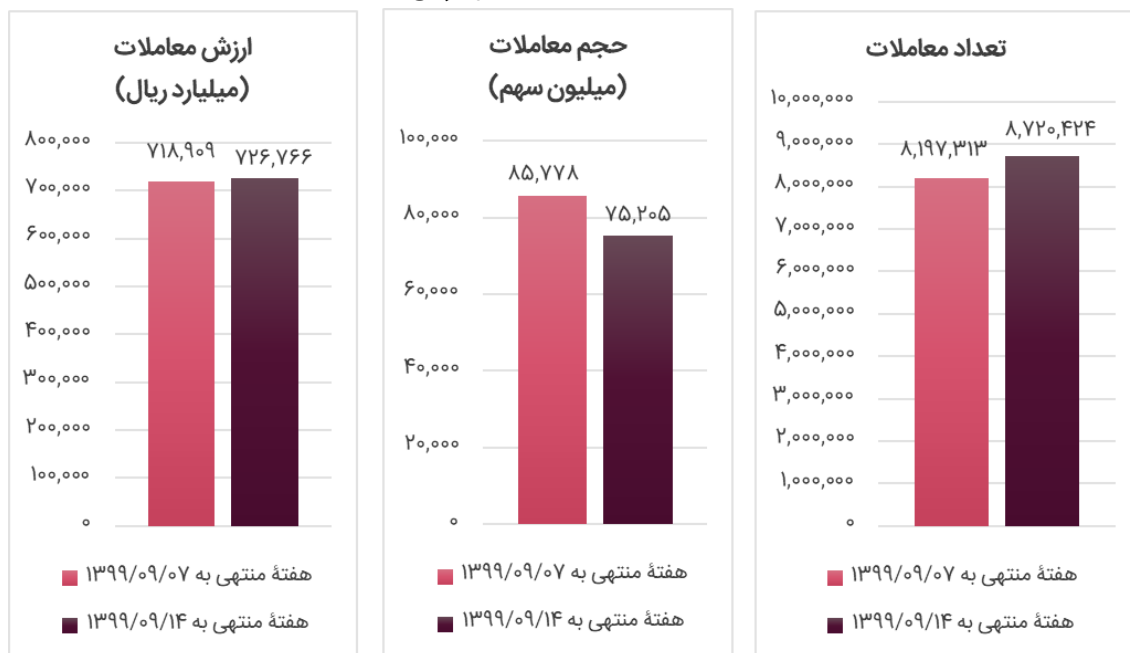
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ طی ۵ روز کاری، با ۱۰۳,۷۳۱ واحد افزایش، از ۱,۳۶۷,۲۴۹ به ۱,۴۷۰,۹۸۰ رسید. حجم معاملات ۱۵,۰۴۱ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش بیش از ۱۲ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۱ و ۶ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روزهای شنبه، یکشنبه، دوشنبه و سه‌شنبه به ترتیب افزایش ۲۳,۵۲۴، ۳۶,۵۰۵، ۳۸,۶۹۷ و ۷,۶۹۲ واحدی و در روز چهارشنبه کاهش ۲,۶۸۷ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۵		روزهای فعالیت
۱/۰۹%	۱۴۵,۳۵۳	۷۲۶,۷۶۶	۱۴۳,۷۸۲	۷۱۸,۹۰۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
-۱۲/۳۲%	۱۵,۰۴۱	۷۵,۲۰۵	۱۷,۱۵۶	۸۵,۷۷۸	حجم معاملات (میلیون سهم)
۶/۳۸%	۱,۷۴۴,۰۸۵	۸,۷۲۰,۴۲۴	۱,۶۳۹,۴۶۳	۸,۱۹۷,۳۱۳	تعداد معاملات

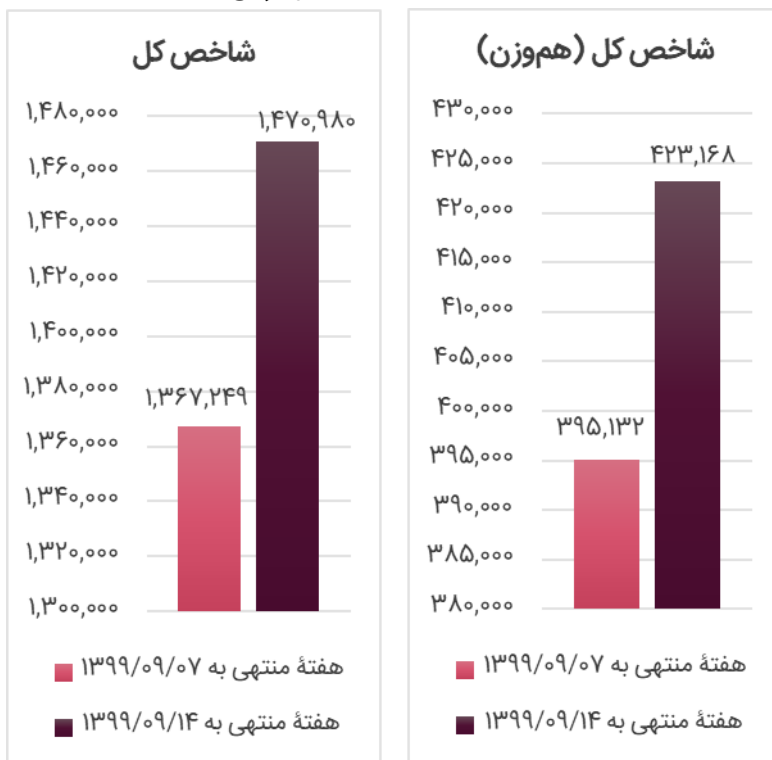
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	عنوان
۷/۶%	۵۸,۲۲۷	۵۳,۵۳۱	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
	۱,۴۷۰,۹۸۰	۱,۳۶۷,۲۴۹	شاخص کل
	۳۸۴,۶۸۹	۳۵۷,۵۶۲	شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)
۷/۱%	۴۲۳,۱۶۸	۳۹۵,۱۳۲	شاخص کل (هموزن)
	۲۷۷,۰۹۸	۲۵۸,۷۳۹	شاخص قیمت (هموزن)

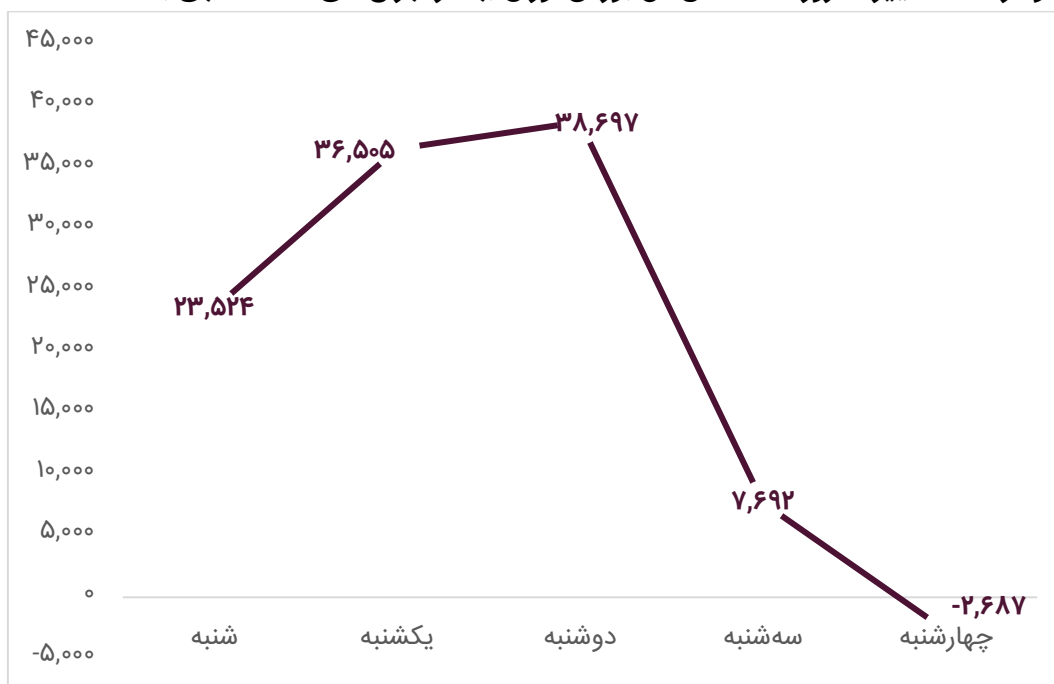
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن



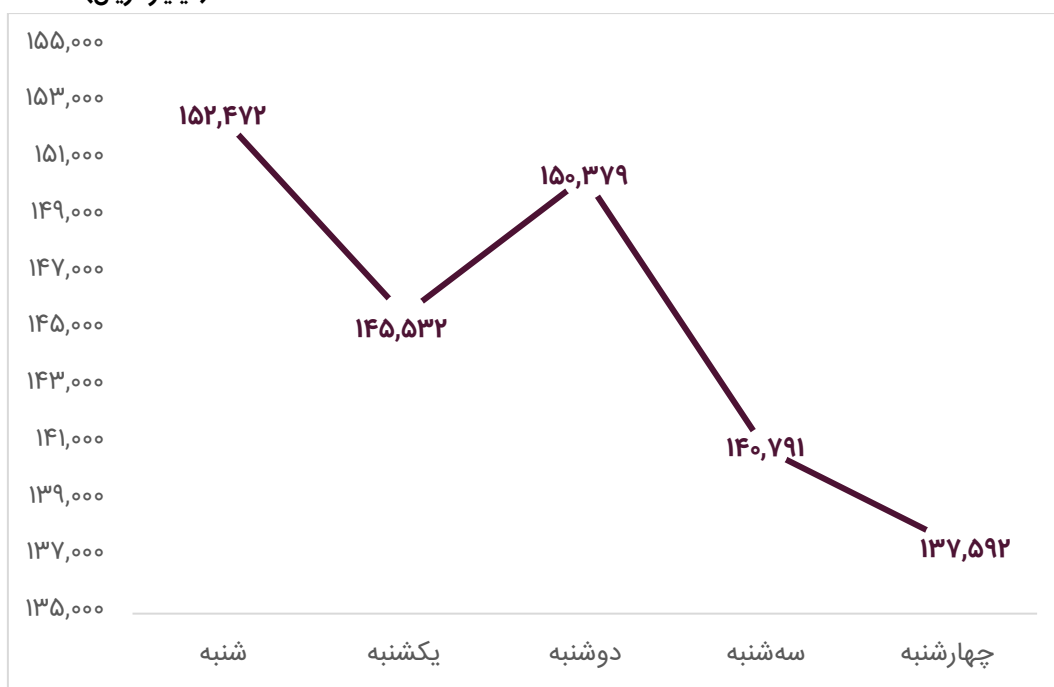
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۲۳,۵۲۴	۱/۷۲%	۱,۷۵۱,۱۳۰	۱۷,۷۸۸	۱۵۲,۴۷۲
یکشنبه	۳۶,۵۰۵	۲/۶۲%	۱,۶۵۸,۲۶۶	۱۵,۸۸۱	۱۴۵,۵۳۲
دوشنبه	۳۸,۶۹۷	۲/۷۱%	۱,۷۵۶,۱۴۸	۱۴,۶۹۳	۱۵۰,۳۷۹
سه شنبه	۷,۶۹۲	۰/۵۲%	۱,۷۶۱,۱۵۱	۱۲,۸۳۸	۱۴۰,۷۹۱
چهارشنبه	-۲,۶۸۷	-۰/۱۸%	۱,۷۹۳,۷۲۹	۱۴,۰۰۵	۱۳۷,۵۹۲

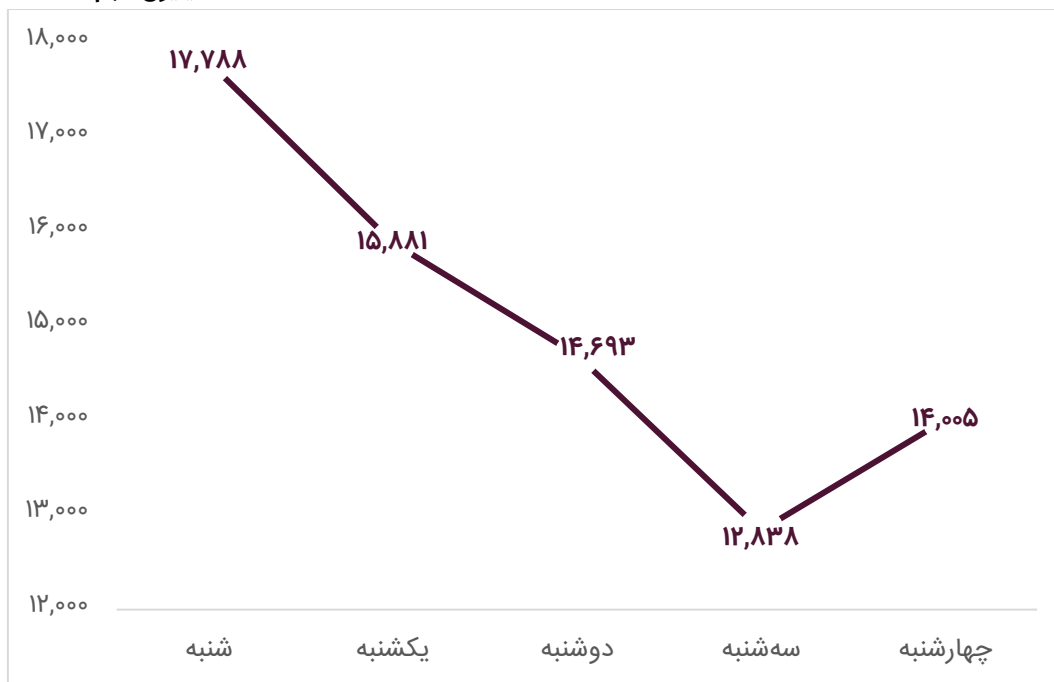
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ (میلیارد ریال)



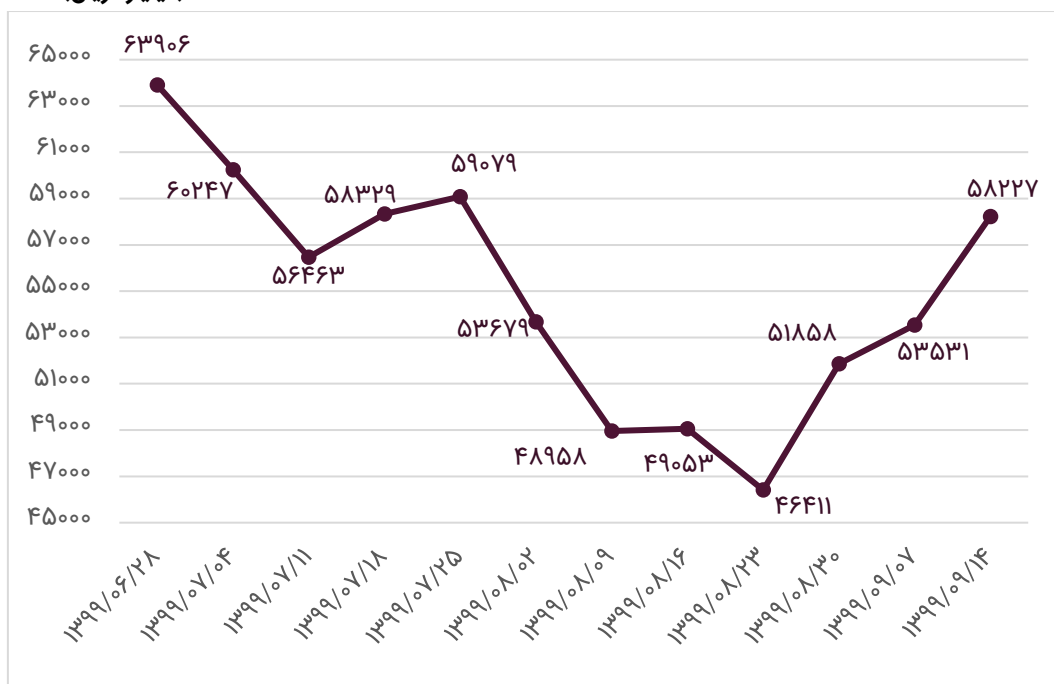
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
۶۳,۹۰۶	۱۳۹۹/۰۶/۲۸
۶۰,۲۴۷	۱۳۹۹/۰۷/۰۴
۵۶,۴۶۳	۱۳۹۹/۰۷/۱۱
۵۸,۳۲۹	۱۳۹۹/۰۷/۱۸
۵۹,۰۷۹	۱۳۹۹/۰۷/۲۵
۵۳,۶۷۹	۱۳۹۹/۰۸/۰۲
۴۸,۹۵۸	۱۳۹۹/۰۸/۰۹
۴۹,۰۵۳	۱۳۹۹/۰۸/۱۶
۴۶,۴۱۱	۱۳۹۹/۰۸/۲۳
۵۱,۸۵۸	۱۳۹۹/۰۸/۳۰
۵۳,۵۳۱	۱۳۹۹/۰۹/۰۷
۵۸,۲۲۷	۱۳۹۹/۰۹/۱۴

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ (میلیارد ریال)



در جدول (۵) نسبت قیمت به درآمد (P/E) صنایع فعال در بورس اوراق بهادار، به همراه تعداد شرکت‌های هر یک از صنایع قابل مشاهده است. صنایع «وسایل ارتباطی» و «محصولات چرمی» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۲,۷۷۰ و ۱,۸۲۷ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۲,۷۷۰
۲	محصولات چرمی	۱	۱,۸۲۷
۳	محصولات کاغذی	۳	۷۷۷
۴	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۳۶۵
۵	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۳۵۵
۶	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۲۷۵
۷	کانی غیرفلزی	۱۵	۱۸۵
۸	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۶	۱۱۲
۹	استخراج کانه‌های فلزی	۱۷	۱۰۲
۱۰	بیمه و بازنشستگی	۶	۹۵
۱۱	استخراج سایر معادن	۱	۹۴

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱۲	کاشی و سرامیک	۶	۸۵
۱۳	فرآورده‌های نفتی	۵۶	۷۴
۱۴	قند و شکر	۱۴	۷۳/۶
۱۵	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۶۴
۱۶	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۶۱
۱۷	اطلاعات و ارتباطات	۲	۵۸
۱۸	محصولات فلزی	۹	۵۱
۱۹	استخراج زغال سنگ	۱	۴۷
۲۰	چاپ	۲	۴۲
۲۱	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۳۷
۲۲	دستگاه‌های برقی	۱۱	۳۵
۲۳	رایانه	۹	۳۴
۲۴	شیمیایی	۴۶	۳۱
۲۵	ابزار پزشکی	۱	۳۰/۸
۲۶	سیمان آهک گچ	۴۰	۳۰/۴
۲۷	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۹
۲۸	دارویی	۳۱	۲۶
۲۹	مخابرات	۲	۲۵/۷
۳۰	فلزات اساسی	۳۴	۲۵
۳۱	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۲۳
۳۲	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۹
۳۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۷/۱
۳۴	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۷
۳۵	خودرو و قطعات	۳۱	(۳۷)
۳۶	منسوجات	۱۴	(۴۳)
۳۷	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	(۱,۹۵۴)
۳۸	فنی و مهندسی	۲	(۳,۶۸۳)

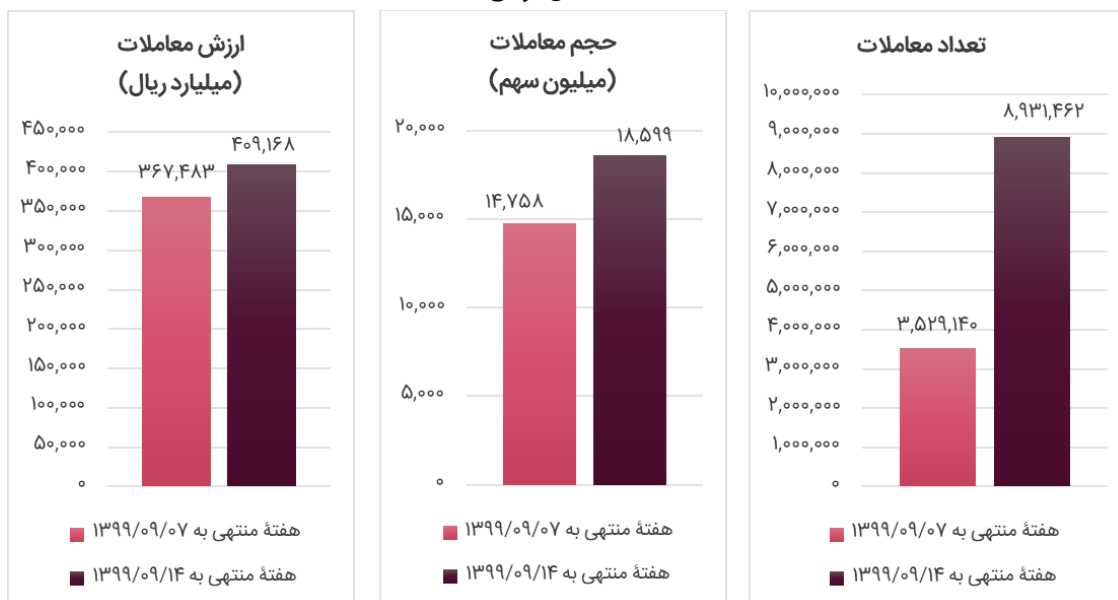
۲-۱- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ طی ۵ روز کاری، با ۱,۵۱۵ واحد افزایش، از ۱۶,۹۵۱ به عدد ۱۸,۴۶۶ رسید. حجم معاملات ۳,۷۲۰ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۲۶ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۱۱ و ۱۵۳ درصد افزایش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۵		روزهای فعالیت
۱۱/۳۴%	۸۱,۸۳۴	۴۰۹,۱۶۸	۷۳,۴۹۷	۳۶۷,۴۸۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۲۶/۰۲%	۳,۷۲۰	۱۸,۵۹۹	۲,۹۵۲	۱۴,۷۵۸	حجم معاملات (میلیون سهم)
۱۵۳/۰۷%	۱,۷۸۶,۲۹۲	۸,۹۳۱,۴۶۲	۷۰۵,۸۲۸	۳,۵۲۹,۱۴۰	تعداد معاملات

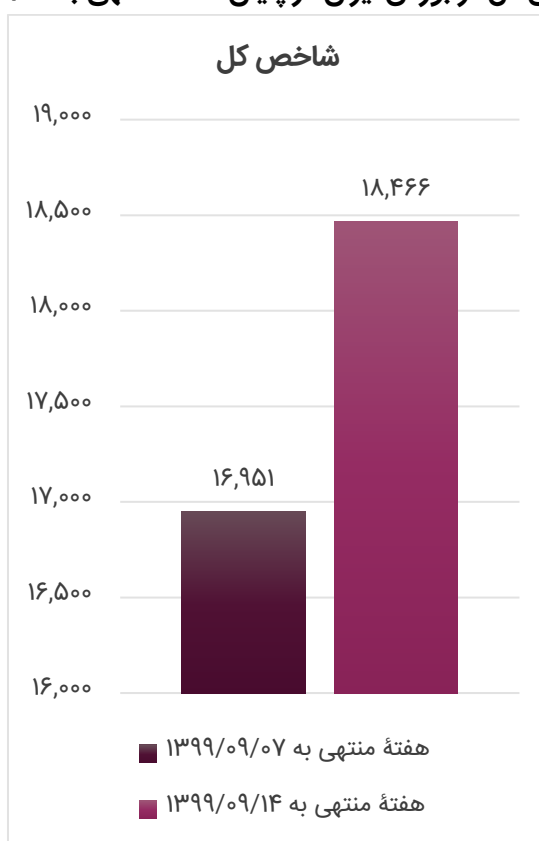
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۱,۵۳۰	۱۲,۵۶۱	۸/۹۴%
شاخص کل	۱۶,۹۵۱	۱۸,۴۶۶	۸/۹۳%

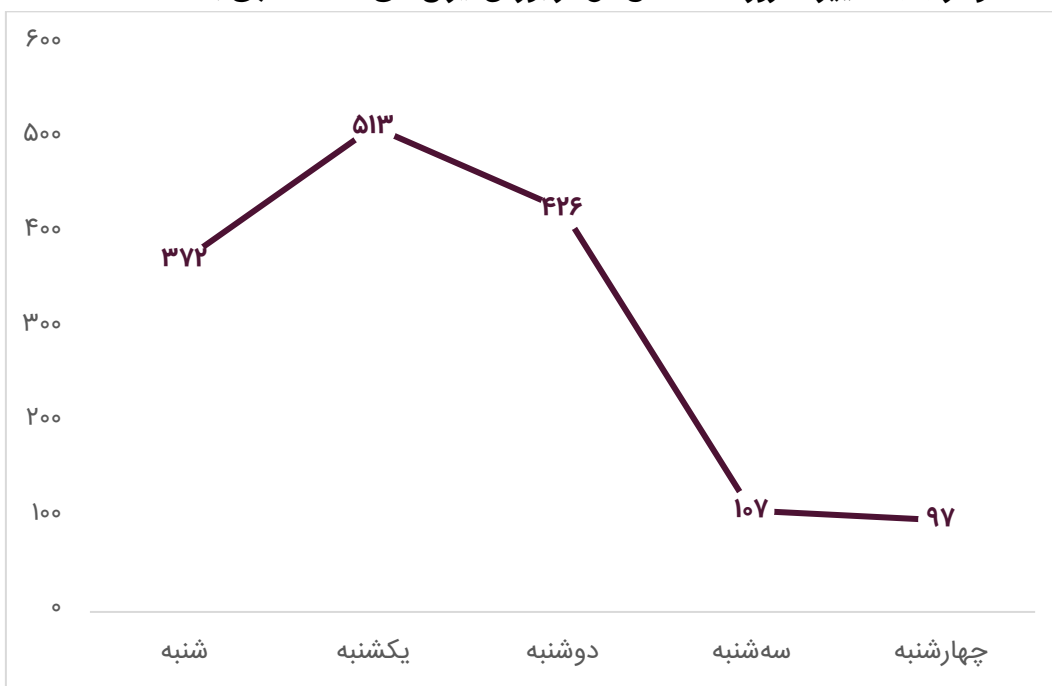
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن



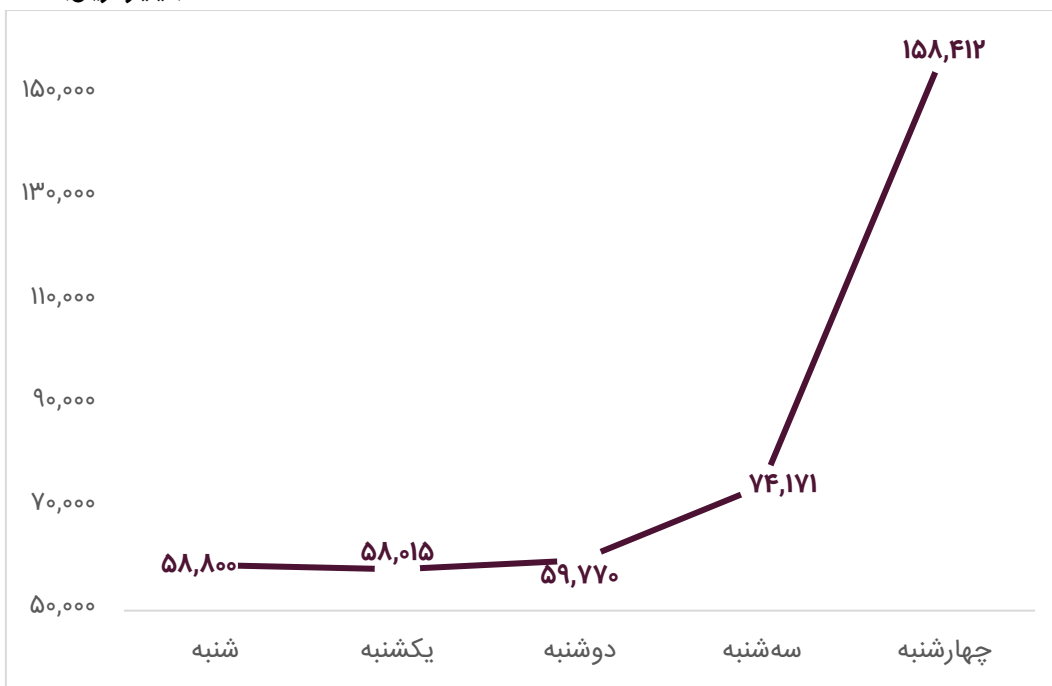
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۳۷۲	۲/۱۹%	۷۹۱,۶۲۷	۳,۶۳۶	۵۸,۸۰۰
یکشنبه	۵۱۳	۲/۹۶%	۸۰۶,۹۵۱	۳,۴۹۲	۵۸,۰۱۵
دوشنبه	۴۲۶	۲/۳۸%	۸۹۹,۸۶۰	۳,۱۹۷	۵۹,۷۷۰
سه شنبه	۱۰۷	۰/۵۸%	۱,۰۱۵,۰۵۴	۴,۱۷۵	۷۴,۱۷۱
چهارشنبه	۹۷	۰/۵۲%	۵,۴۱۷,۹۷۰	۴,۰۹۹	۱۵۸,۴۱۲

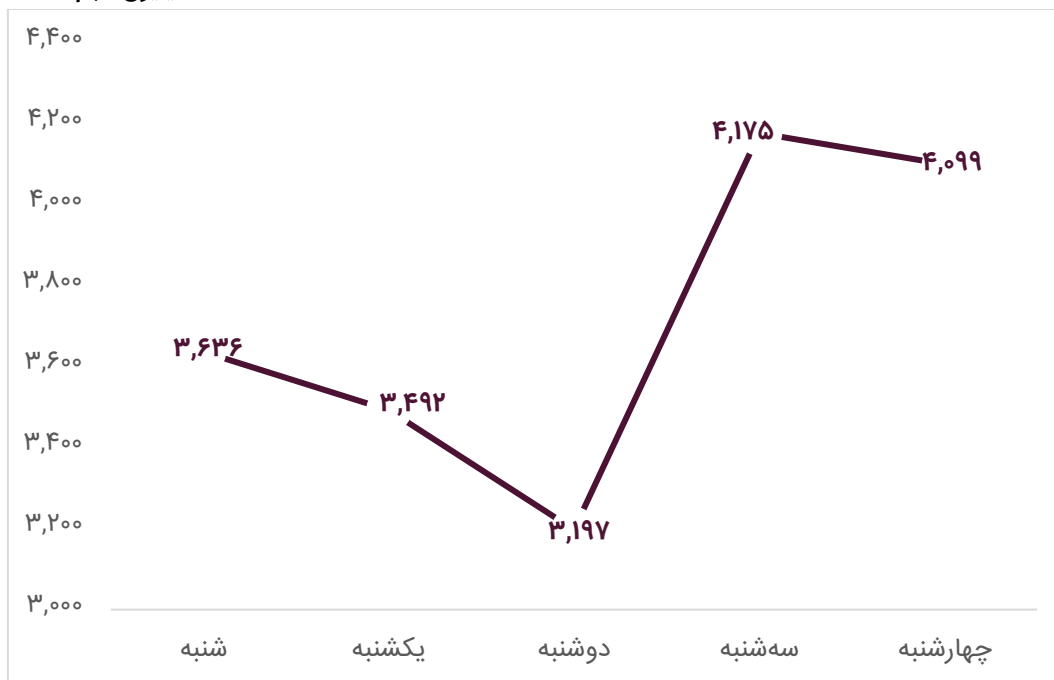
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ (میلیارد ریال)

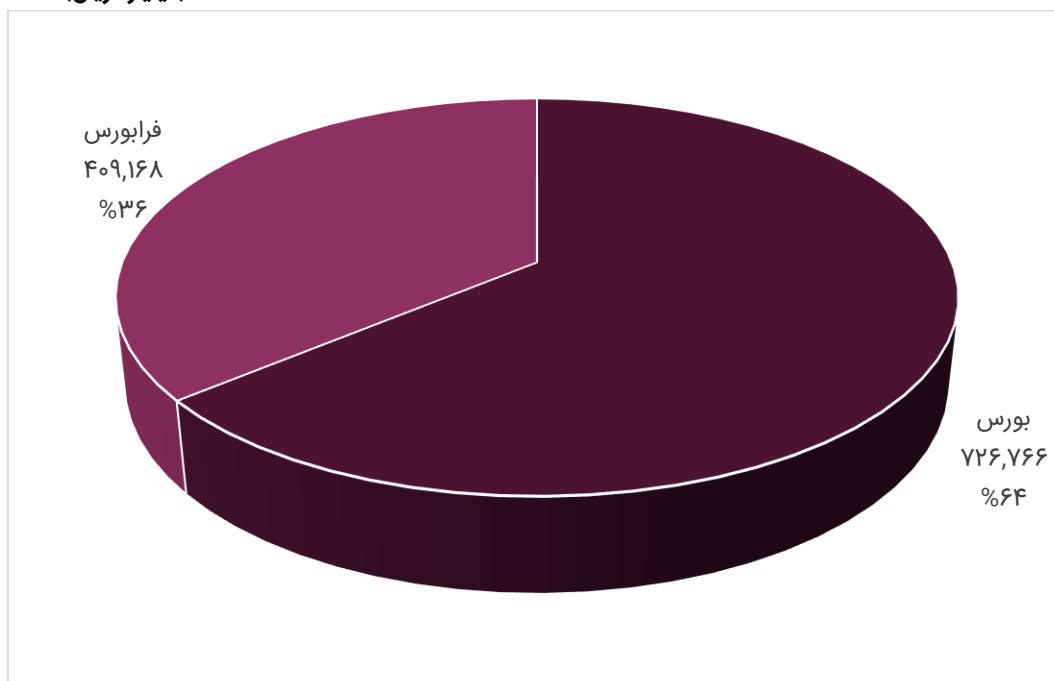


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

(میلیارد ریال)



در جدول (۹) نسبت قیمت به درآمد (P/E) صنایع فعال در فرابورس، به همراه تعداد شرکت‌های هر یک از صنایع قابل مشاهده است. صنایع «دستگاه‌های برقی» و «پیمانکاری صنعتی» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۳,۱۱۱ و ۲,۴۰۳ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۳,۱۱۱
۲	پیمانکاری صنعتی	۵	۲,۴۰۳
۳	منسوجات	۷	۲,۱۸۳
۴	هتل و رستوران	۹	۱,۵۸۴
۵	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۱,۳۷۹
۶	فنی و مهندسی	۹	۴۳۱
۷	کانی غیرفلزی	۱۸	۲۵۰
۸	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۲۴۶
۹	محصولات چوبی	۴	۲۳۹
۱۰	محصولات فلزی	۸	۲۲۸
۱۱	بیمه و بازنشستگی	۲۱	۲۰۲
۱۲	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۵۵
۱۳	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۱۲۳
۱۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۱۵
۱۵	خرده‌فروشی	۲	۱۱۴
۱۶	فلزات اساسی	۲۴	۱۱۰
۱۷	قند و شکر	۸	۹۶
۱۸	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۹۱
۱۹	سایر حمل و نقل	۲	۹۰
۲۰	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۷۹
۲۱	رایانه	۸	۶۴
۲۲	لاستیک و پلاستیک	۵	۵۶
۲۳	استخراج زغال سنگ	۳	۵۵
۲۴	خودرو و قطعات	۱۱	۵۰
۲۵	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۹٫۸
۲۶	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۹	۴۷
۲۷	سرمایه گذاری‌ها	۴۴	۴۱
۲۸	فرآورده‌های نفتی	۹	۴۰

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۲۹	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۱
۳۰	دارویی	۱۶	۳۰
۳۱	شیمیایی	۴۲	۲۴
۳۲	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۲
۳۳	تجارت عمده و خرده‌فروشی وسائط نقلیه موتور	۱	۳
۳۴	محصولات کاغذی	۴	۰
۳۵	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۵	(۱۴)
۳۶	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	(۲۰)
۳۷	کاشی و سرامیک	۱۱	(۳۸)
۳۸	وسایل ارتباطی	۲	(۱۰۲)
۳۹	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	(۱۵۰)
۴۰	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	(۳۸۸)
۴۱	سیمان آهک گچ	۱۲	(۵,۰۹۱)

۳-۱- بورس کالا و انرژی

در جدول (۱۰)، ارزش معاملات روزانه بازارهای فیزیکی بورس کالای ایران و بورس انرژی ایران، و همچنین ارزش معاملات بازار مشتقه و بازار مالی بورس کالای ایران مورد بررسی قرار می‌گیرد. لازم به ذکر است ارزش معاملات بازار مشتقه شامل آمار معاملات آتی و معاملات اختیار معامله است. همچنین در جدول (۱۱) مجموع کل ارزش معاملات هریک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴، با هفته قبل از آن مورد مقایسه قرار گرفته است.

جدول (۱۰): آمار روزانه ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

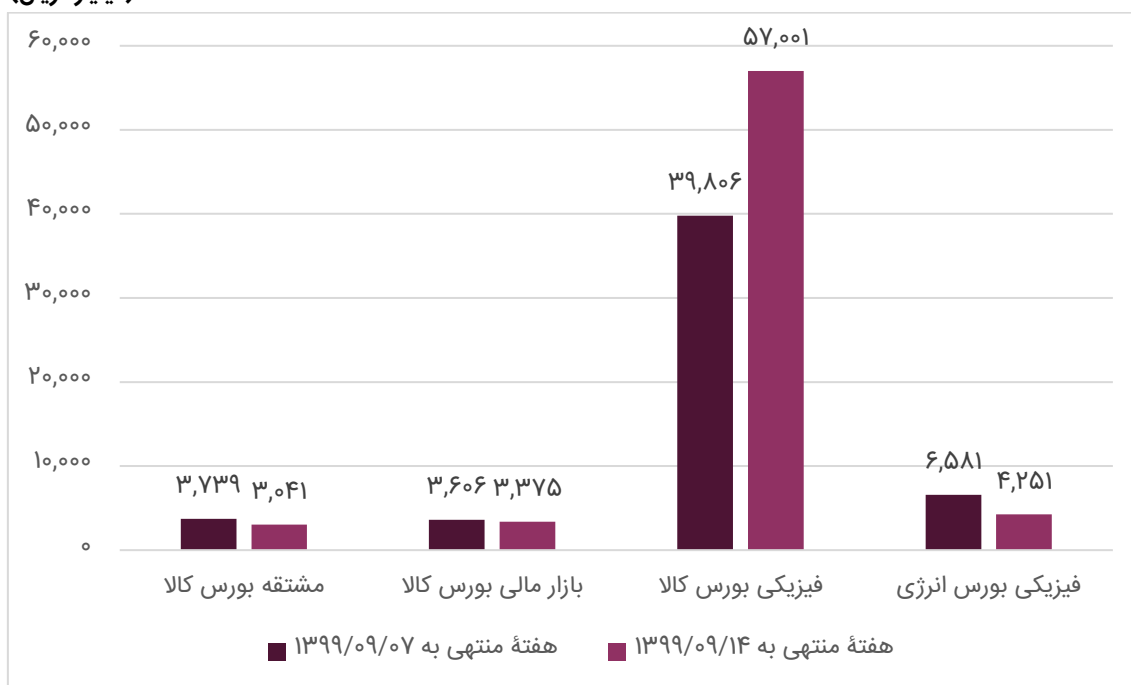
(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۴۵۵	۷۸۰	۶۰۹	۹۱۹
یکشنبه	۶۱۹	۴۸۷	۱۸۴	۱,۱۸۵
دوشنبه	۵۴۲	۴۸۱	۱۴,۸۷۷	۹۱۸
سه‌شنبه	۷۸۳	۴۸۱	۲۹,۸۵۲	۱۶۲
چهارشنبه	۹۷۶	۴۵۸	۱۱,۴۷۷	۱,۰۶۷
پنجشنبه	۰	۳۵۴	۰	۰

جدول (۱۱): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۳,۷۳۹	۳,۰۴۱	-۱۸/۶۶%
بازار مالی بورس کالا	۳,۶۰۶	۳,۳۷۵	-۶/۴۱%
فیزیکی بورس کالا	۳۹,۸۰۶	۵۷,۰۰۱	۴۳/۱۹%
فیزیکی بورس انرژی	۶,۵۸۱	۴,۲۵۱	-۳۵/۴۰%

نمودار (۱۳): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



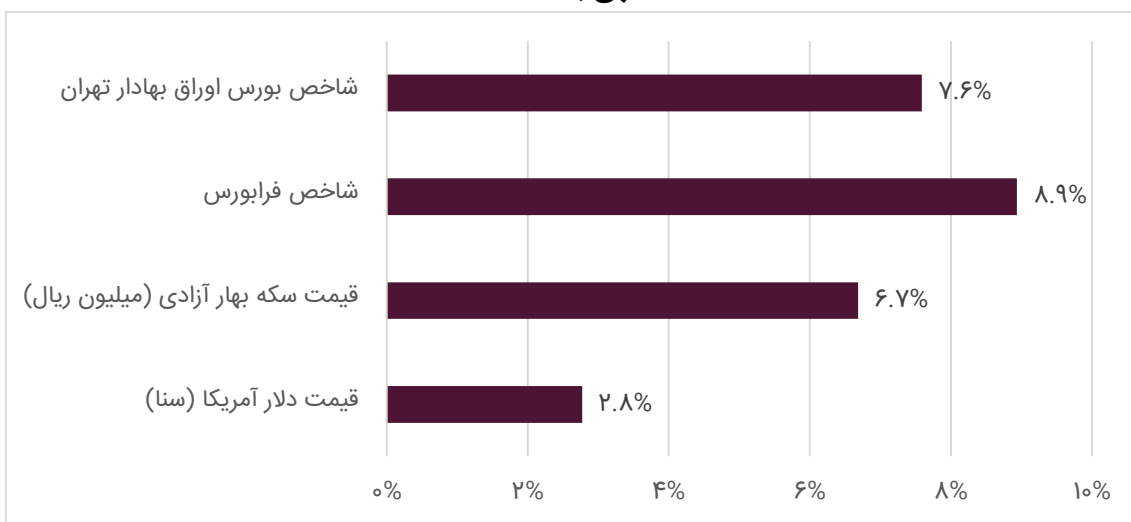
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴، بورس اوراق بهادار تهران با افزایش بیش از ۷ درصدی، بازدهی مطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی نزدیک به ۹ درصدی، عملکرد بسیار مطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۶ درصد و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، بیش از ۲ درصد افزایش را ثبت نمودند.

جدول (۱۲): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۳۶۷,۲۴۹	۱,۴۷۰,۹۸۰	۷/۵۸%
شاخص فرابورس	۴,۹۵۱	۱۸,۴۶۶	۸/۹۳%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۰۵/۰	۱۱۲/۰	۶/۶۸%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۴۱,۵۶۹	۲۴۸,۲۶۲	۲/۷۷%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ مورد بررسی قرار می‌گیرد. در جدول (۱۳) میزان تغییرات قیمت جهانی طلا، قیمت هر بشکه نفت برنت و قیمت هر بشکه نفت سنگین ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

(ارقام برحسب دلار)

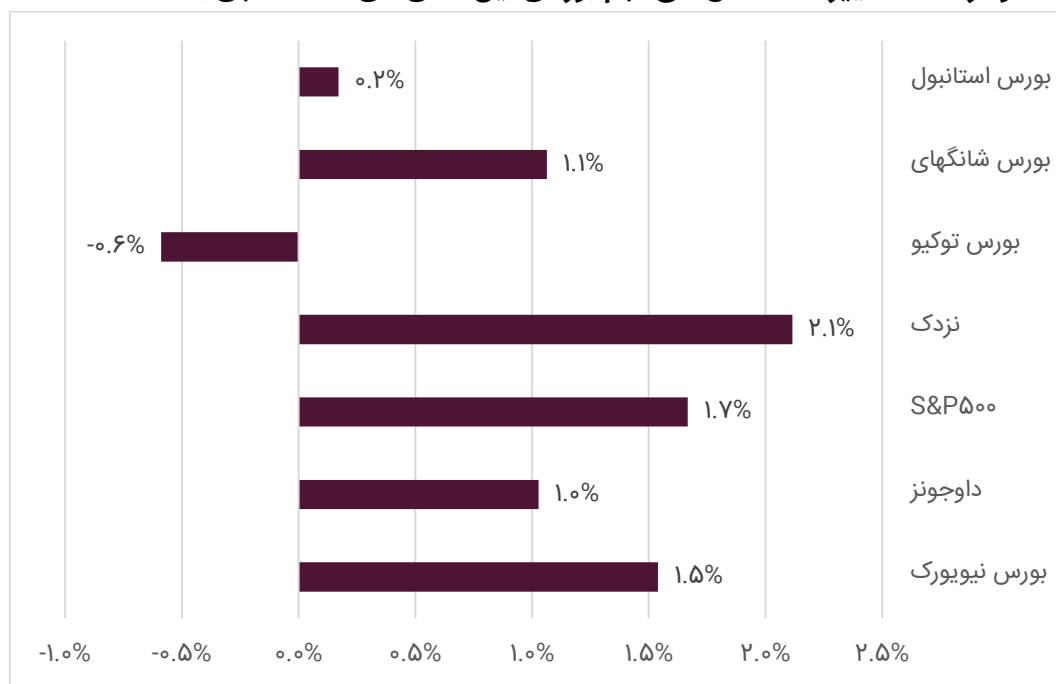
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۷۸۸	۱,۸۳۶	۲/۷۰%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۵,۸۱	۴۶,۸۱	۲/۱۸%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۸,۱۸	۴۹,۲۵	۲/۲۲%

در جدول (۱۴)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بورس شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس استانبول، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۴,۱۹۹	۱۴,۴۱۷	۱/۵۳%
داوجونز	۲۹,۹۱۰	۳۰,۲۱۸	۱/۰۲%
S&P ۵۰۰	۳,۶۳۸	۳,۶۹۹	۱/۶۶%
نزدک	۱۲,۲۰۶	۱۲,۴۶۴	۲/۱۱%
بورس توکیو	۱,۷۸۷	۱,۷۷۶	-۰/۵۸%
بورس شانگهای	۳,۴۰۸	۳,۴۴۵	۱/۰۶%
بورس استانبول	۱,۳۲۹	۱,۳۳۱	۰/۱۷%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴



ارتباط با ما

این گزارش توسط مدیریت ریسک و مهندسی مالی شرکت تأمین سرمایه امید تدوین شده است. ما در واحد مدیریت ریسک و مهندسی مالی شرکت تأمین سرمایه امید با بهره‌گیری از نیروهای متخصص و باتجربه در حوزه علوم مالی، اقتصاد و مدیریت، خدمات متنوعی را در حوزه‌های ذیل به مشتریان خود ارائه می‌دهیم. مشاوره در خصوص پیاده‌سازی مدیریت ریسک سازمانی (ERM) (شامل شناسایی ریسک‌ها؛ تحلیل، ارزیابی و اندازه‌گیری ریسک‌های شناسایی شده؛ اتخاذ و اجرای استراتژی‌های مدیریت ریسک‌های مختلف و سرانجام تبدیل این فرآیند به نرم‌افزار در قالب داشبورد ریسک بر مبنای اکسل یا وب) در سازمان‌های متقاضی و بر اساس آیین‌نامه‌های مربوطه از جمله آیین‌نامه حاکمیت شرکتی در شرکت‌های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران (تحت نظارت سازمان بورس)، بانک‌ها (تحت نظارت بانک مرکزی) و بیمه‌ها (تحت نظارت بیمه مرکزی در کشور)، طراحی ابزارهای نوین مالی، تحقیق و توسعه و ارائه خدمات پژوهشی در بازارهای مالی از جمله خدماتی ارزنده‌ای است که مفتخر به ارائه آنها هستیم.

<p>محمد رضا صادقی نسب فوق لیسانس علوم اقتصادی sadeghinasab.mr@gmail.com</p>	
<p>محمد حسین بادامی فوق لیسانس مهندسی مالی hobadami@gmail.com</p>	