

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۱۸

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 سب‌گردان 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.
- ۱-۲- بازارگردانی انواع اوراق بدهی و سهام با استفاده از روش‌های نوین معاملات الگوریتمی مبنی بر حمایت اوراق بهادار ناشر.
- ۱-۳- سب‌گردانی اختصاصی.

۲- خدمات تأمین مالی

- ۲-۱- 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 ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ 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.

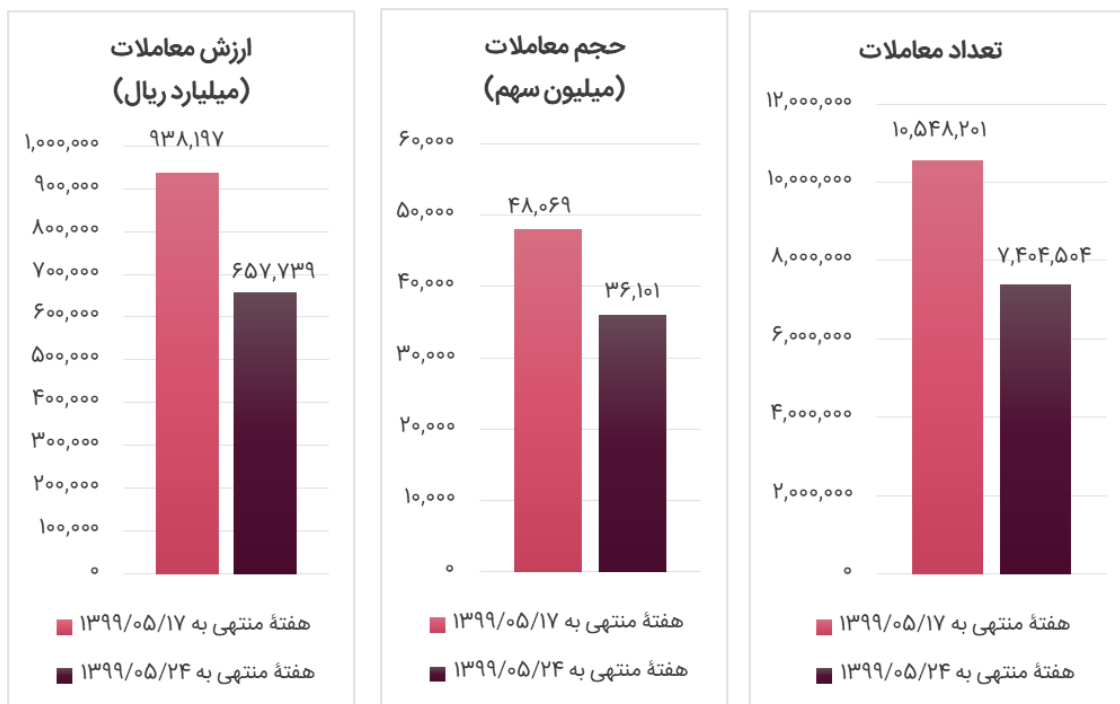
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ طی ۴ روز کاری، با ۵۸,۷۵۳ واحد کاهش، از ۲,۰۳۴,۱۹۳ به ۱,۹۷۵,۴۴۰ رسید. حجم معاملات ۹,۰۲۵ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش بیش از ۲۴ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته هر کدام بیش از ۲۹ درصد کاهش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روز یکشنبه، افزایش ۴۴,۳۵۴ واحدی اما در روز دوشنبه، سه‌شنبه و چهارشنبه به ترتیب کاهش ۱۳,۴۳۳، ۶۵,۲۷۱ و ۲۴,۴۰۴ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۴			۵		روزهای فعالیت
-۲۹/۸۹%	۱۶۴,۴۳۵	۶۵۷,۷۳۹	۱۸۷,۶۳۹	۹۳۸,۱۹۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
-۲۴/۸۹%	۹,۰۲۵	۳۶,۱۰۱	۹,۶۱۴	۴۸,۰۶۹	حجم معاملات (میلیون سهم)
-۲۹/۸۰%	۱,۸۵۱,۱۲۶	۷,۴۰۴,۵۰۴	۲,۱۰۹,۶۴۰	۱۰,۵۴۸,۲۰۱	تعداد معاملات

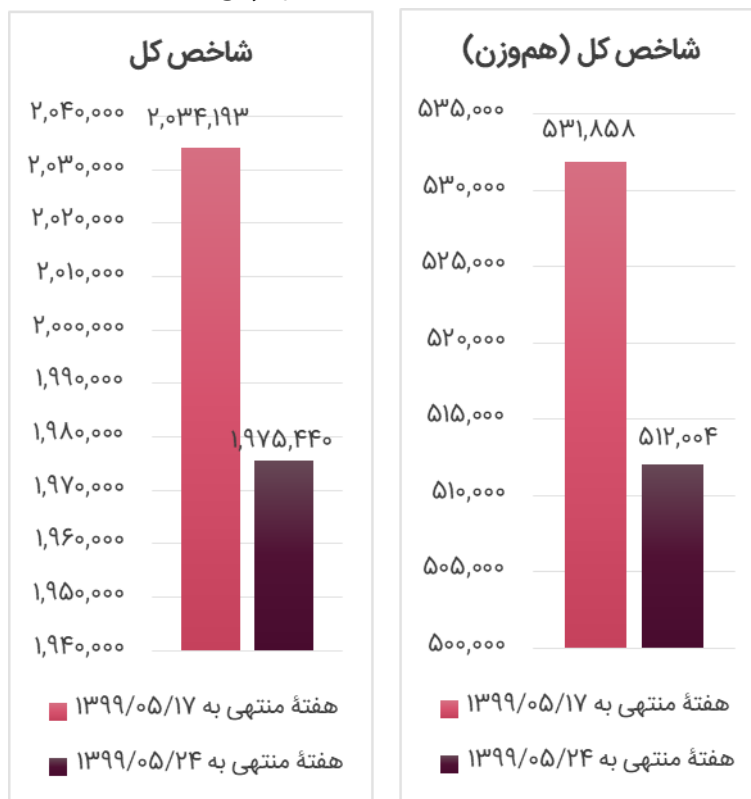
شکل (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۷۶,۱۱۶	۷۳,۹۲۲	-۲/۸۸%
شاخص کل	۲,۰۳۴,۱۹۳	۱,۹۷۵,۴۴۰	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۵۳۴,۳۷۸	۵۱۸,۹۴۳	
شاخص کل (هموزن)	۵۳۱,۸۵۸	۵۱۲,۰۰۴	-۳/۷۳%
شاخص قیمت (هموزن)	۳۴۹,۰۲۷	۳۳۵,۹۹۸	

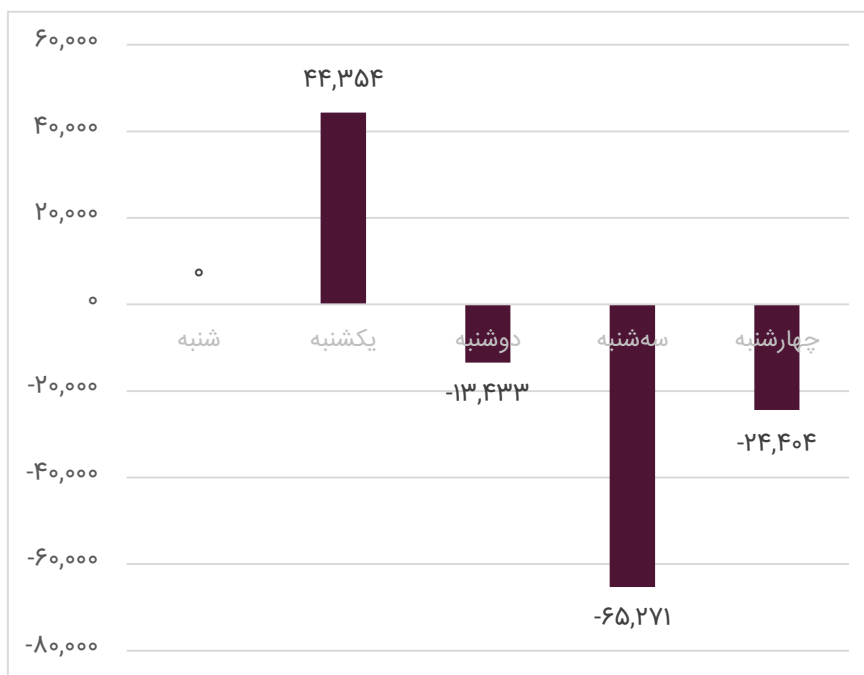
شکل (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن



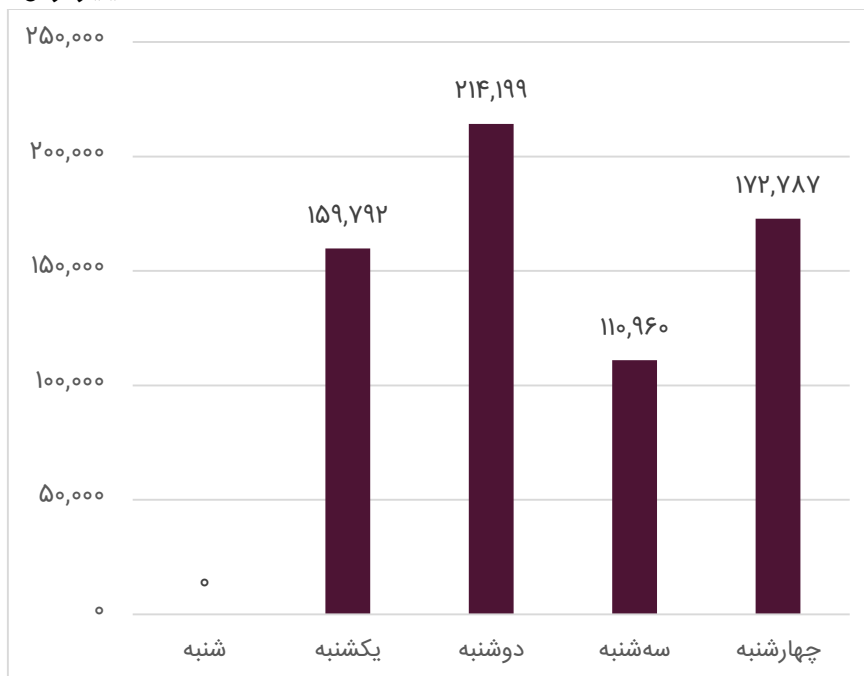
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	تعطیل				
یکشنبه	۴۴,۳۵۴	۲/۱۸%	۱,۷۹۹,۰۵۵	۷,۸۱۱	۱۵۹,۷۹۲
دوشنبه	-۱۳,۴۳۳	-۰/۶۴%	۱,۹۹۷,۸۰۱	۱۱,۵۳۹	۲۱۴,۱۹۹
سه شنبه	-۶۵,۲۷۱	-۳/۱۶%	۱,۰۸۴,۶۰۱	۶,۳۷۴	۱۱۰,۹۶۰
چهارشنبه	-۲۴,۴۰۴	-۱/۲۲%	۲,۵۲۳,۰۴۷	۱۰,۳۷۶	۱۷۲,۷۸۷

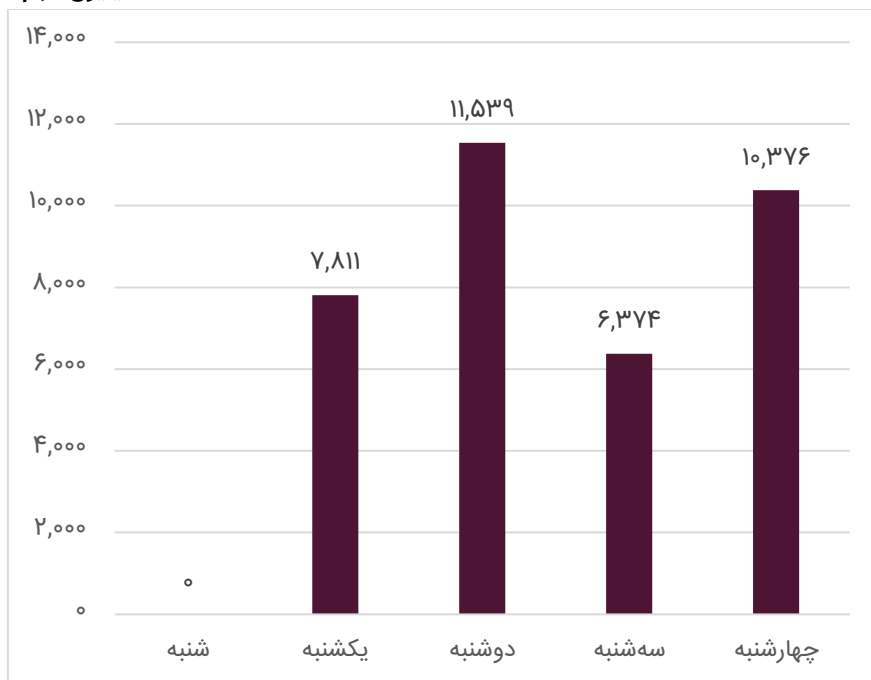
شکل (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴



شکل (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ (میلیارد ریال)



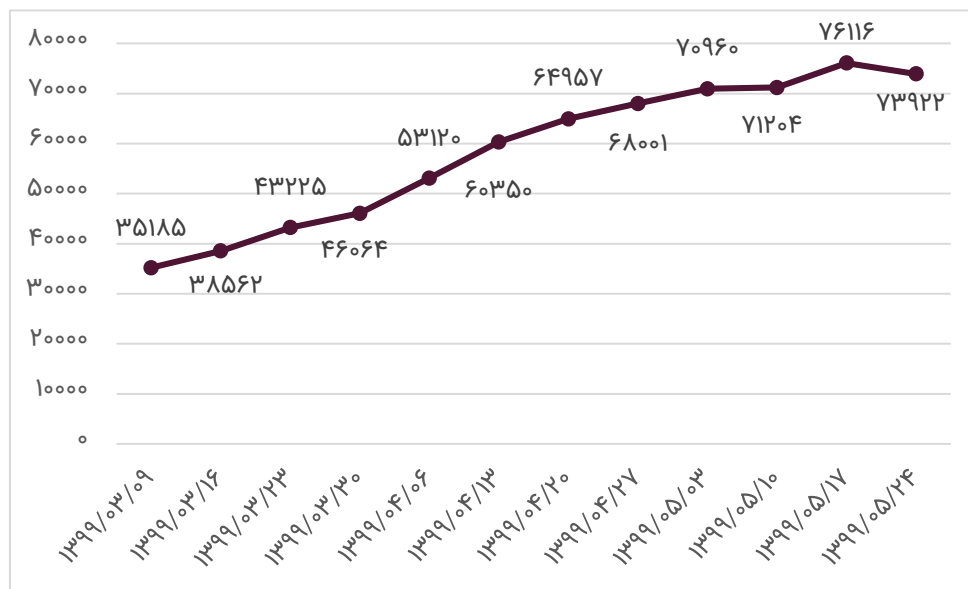
شکل (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
۳۵,۱۸۵	۱۳۹۹/۰۳/۰۹
۳۸,۵۶۲	۱۳۹۹/۰۳/۱۶
۴۳,۲۲۵	۱۳۹۹/۰۳/۲۳
۴۶,۰۶۴	۱۳۹۹/۰۳/۳۰
۵۳,۱۲۰	۱۳۹۹/۰۴/۰۶
۶۰,۳۵۰	۱۳۹۹/۰۴/۱۳
۶۴,۹۵۷	۱۳۹۹/۰۴/۲۰
۶۸,۰۰۱	۱۳۹۹/۰۴/۲۷
۷۰,۹۶۰	۱۳۹۹/۰۵/۰۳
۷۱,۲۰۴	۱۳۹۹/۰۵/۱۰
۷۶,۱۱۶	۱۳۹۹/۰۵/۱۷
۷۳,۹۲۲	۱۳۹۹/۰۵/۲۴

شکل (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بازار بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ (میلیارد ریال)



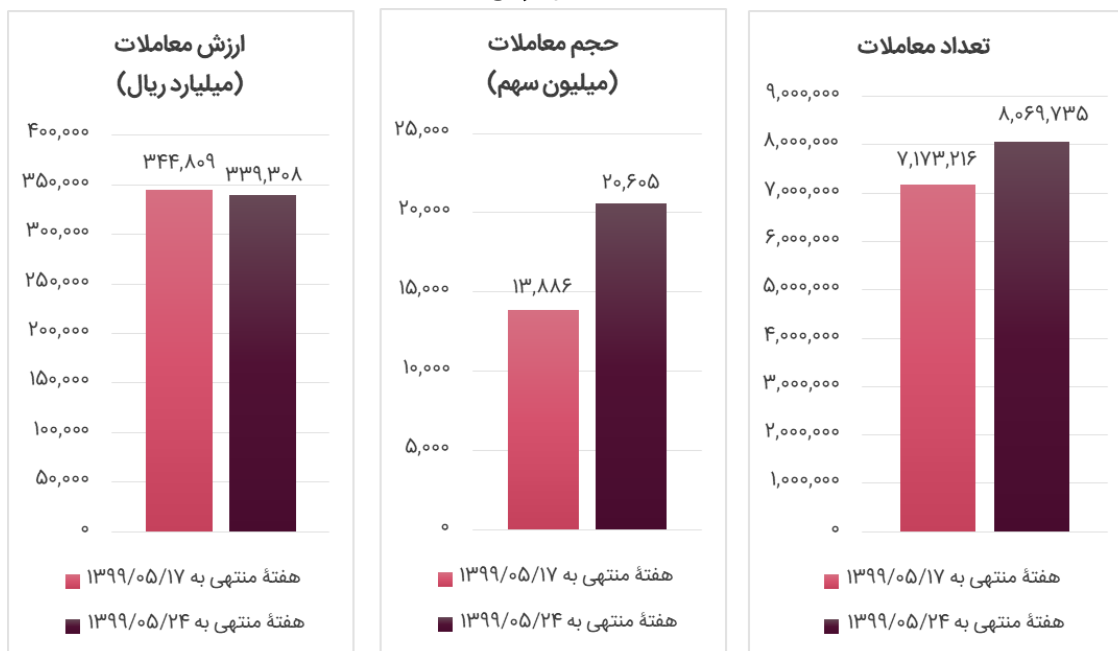
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ طی ۴ روز کاری، با ۶۴۲ واحد کاهش، از ۲۱,۱۲۳ به عدد ۲۰,۴۸۱ رسید. حجم معاملات ۵,۱۵۱ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۴۸ درصدی است. ارزش و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۱ درصد کاهش و ۱۲ درصد افزایش داشته است.

جدول (۵): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۴			۵		روزهای فعالیت
-۱/۵۹%	۸۴,۸۲۷	۳۳۹,۳۰۸	۶۸,۹۶۲	۳۴۴,۸۰۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۴۸/۳۸%	۵,۱۵۱	۲۰,۶۰۵	۲,۷۷۷	۱۳,۸۸۶	حجم معاملات (میلیون سهم)
۱۲/۴۹%	۲,۰۱۷,۴۳۴	۸,۰۶۹,۷۳۵	۱,۴۳۴,۶۴۳	۷,۱۷۳,۲۱۶	تعداد معاملات

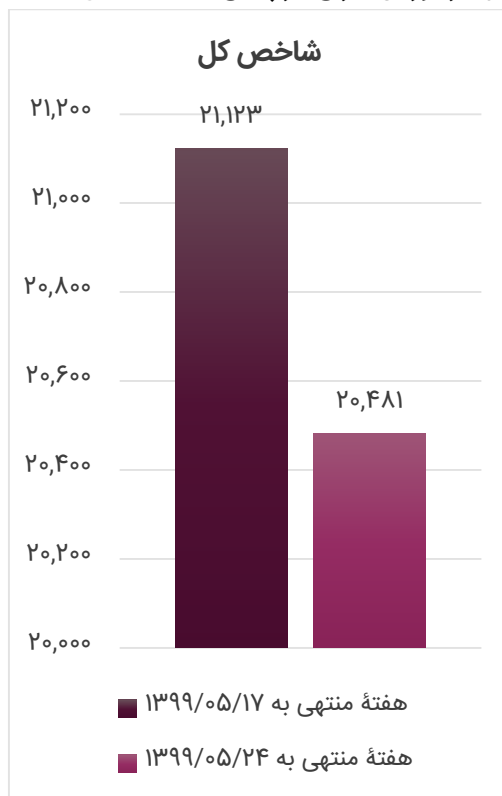
شکل (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن



جدول (۶): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷	عنوان
-۲/۹۶%	۱۳,۳۳۰	۱۳,۷۳۷	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
-۳/۰۳%	۲۰,۴۸۱	۲۱,۱۲۳	شاخص کل

شکل (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن



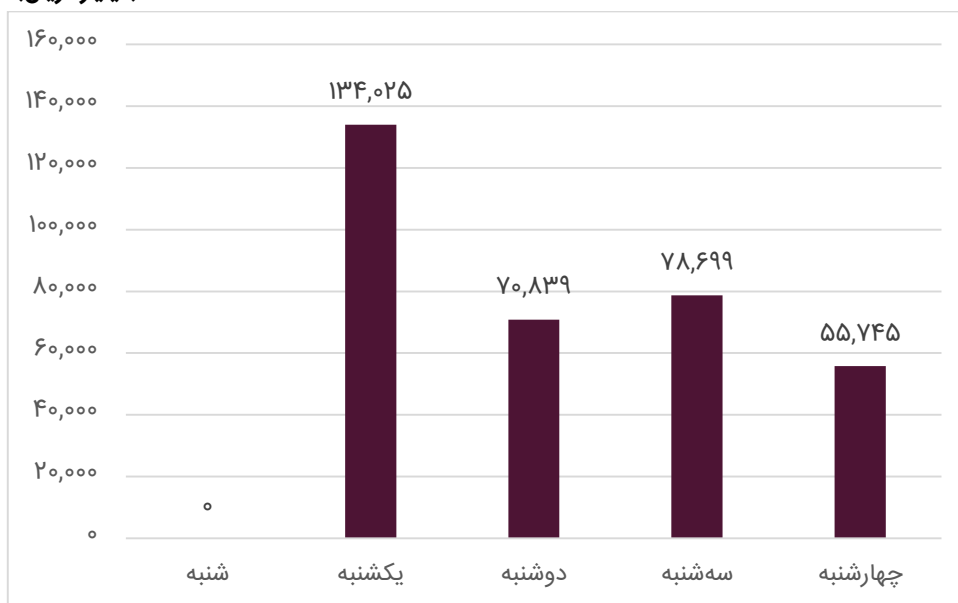
جدول (۷): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	تعطیل				
یکشنبه	۴۱۳	۱/۹۵%	۸۵۱,۵۹۳	۱۳,۸۵۱	۱۳۴,۰۲۵
دوشنبه	-۳۵۸	-۱/۶۶%	۶۸۹,۶۰۹	۲,۶۵۰	۷۰,۸۳۹
سه شنبه	-۵۲۳	-۲/۴۶%	۴۵۱,۶۵۰	۱,۷۰۷	۷۸,۶۹۹
چهارشنبه	-۱۷۴	-۰/۸۴%	۶,۰۷۶,۸۸۳	۲,۳۹۷	۵۵,۷۴۵

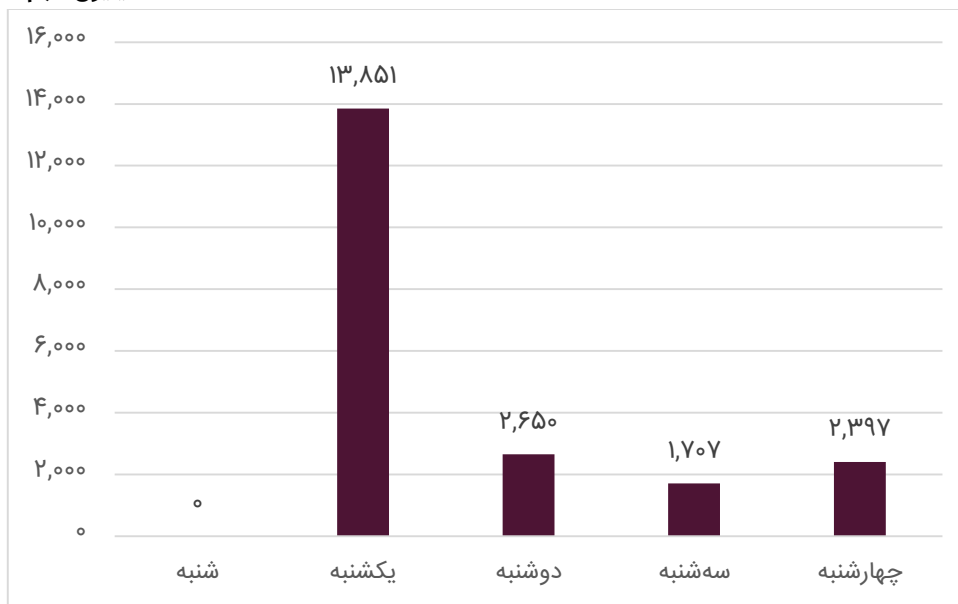
شکل (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴



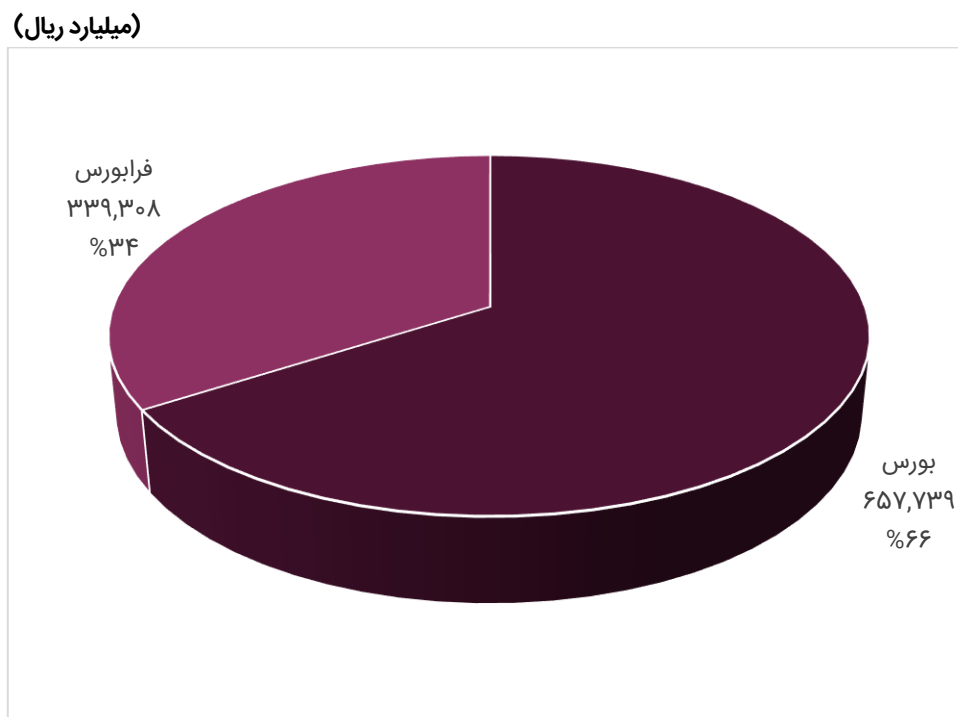
شکل (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ (میلیارد ریال)



شکل (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ (میلیون سهم)



شکل (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴



۱-۳- بورس کالا و انرژی

در جدول (۸)، 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 (۹) مجموع کل ارزش معاملات هر یک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴، با هفته قبل از آن مورد مقایسه قرار گرفته است.

جدول (۸): آمار روزانه ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴

(میلیارد ریال)

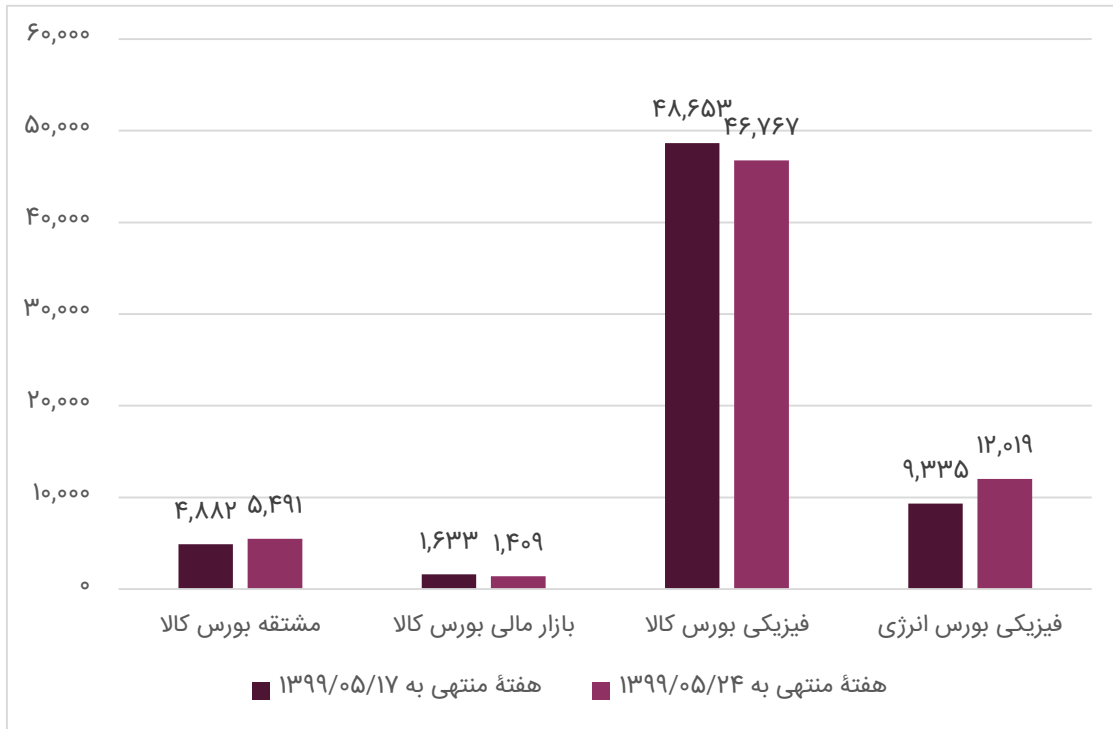
تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	تعطیل			
یکشنبه	۳۱۳	۱,۲۱۸	۷۲۵	۰
دوشنبه	۱۶۷	۱,۱۴۲	۲۰,۸۵۹	۳,۶۵۱
سه‌شنبه	۷۵۹	۱,۲۹۳	۱۷,۶۷۶	۷,۷۹۱
چهارشنبه	۱۷۰	۸۱۸	۷,۵۰۷	۵۷۷
پنجشنبه	۰	۱,۰۲۰	۰	۰

جدول (۹): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۴,۸۸۲	۵,۴۹۱	۱۲/۴۵%
بازار مالی بورس کالا	۱,۶۳۳	۱,۴۰۹	-۱۳/۷۲%
فیزیکی بورس کالا	۴۸,۶۵۳	۴۶,۷۶۷	-۳/۸۷%
فیزیکی بورس انرژی	۹,۳۳۵	۱۲,۰۱۹	۲۸/۷۴%

شکل (۱۳): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



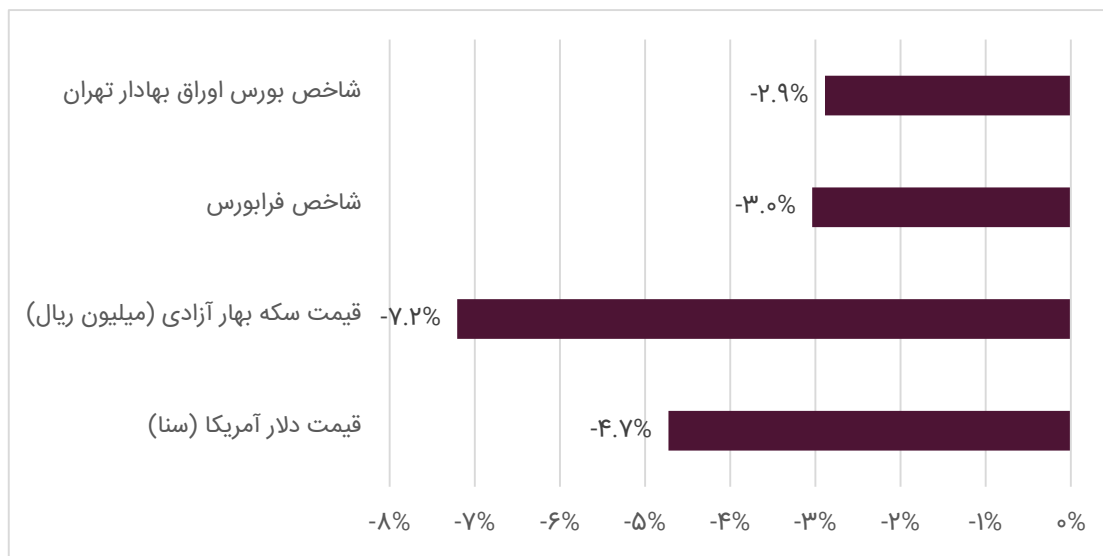
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۲ درصدی، بازدهی متوسطی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۳- درصدی، عملکرد متوسطی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۷ درصد و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، بیش از ۴ درصد کاهش را ثبت نمود.

جدول (۱۰): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۲,۰۳۴,۱۹۳	۱,۹۷۵,۴۴۰	-۲/۸۸%
شاخص فرابورس	۲۱,۱۲۳	۲۰,۴۸۱	-۳/۰۳%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۱۱	۱۰۳	-۷/۲۰%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۲۶,۵۲۴	۲۱۵,۸۱۶	-۴/۷۲%

شکل (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ مورد بررسی قرار می‌گیرد. در جدول (۱۱) میزان تغییرات قیمت جهانی طلا، قیمت هر بشکه نفت برنت و قیمت هر بشکه نفت سنگین ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۱): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴

(ارقام برحسب دلار)

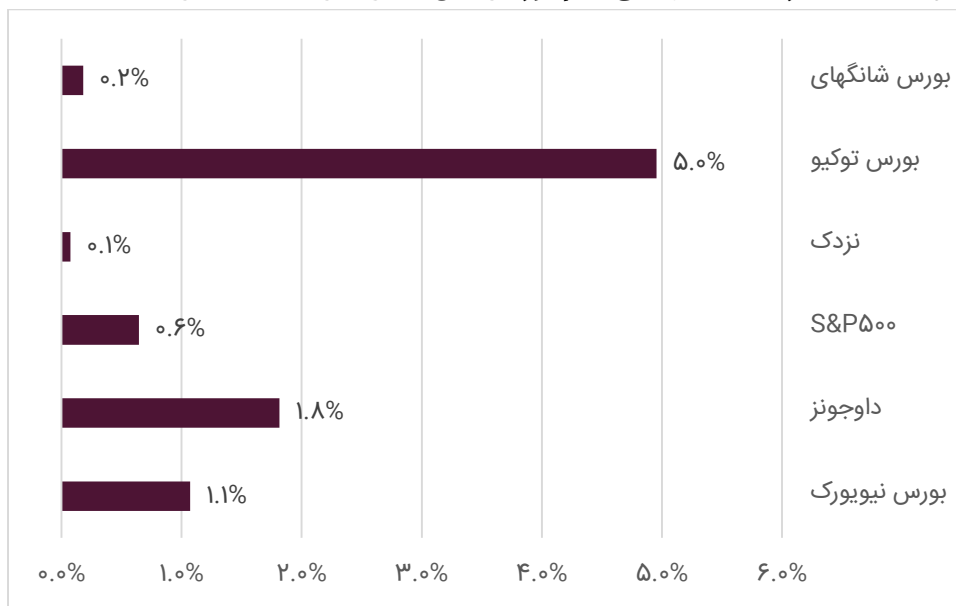
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۲,۰۳۶	۱,۹۴۲	-۴/۶۲%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۴,۶۱	۴۳,۸۴	-۱/۷۲%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۴,۵۸	۴۴,۸۴	۰/۵۸%

در جدول (۱۲)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بورس شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۲): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۲,۷۶۶	۱۲,۹۰۳	۱/۰۷%
داوجونز	۲۷,۴۳۳	۲۷,۹۳۱	۱/۸۱%
S&P ۵۰۰	۳,۳۵۱	۳,۳۷۳	۰/۶۴%
نزدک	۱۱,۰۱۱	۱۱,۰۱۹	۰/۰۷%
بورس توکیو	۱,۵۴۷	۱,۶۲۳	۴/۹۵%
بورس شانگهای	۳,۳۵۴	۳,۳۶۰	۰/۱۸%

شکل (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴



۳- صندوق‌های سرمایه‌گذاری شرکت تأمین سرمایه امید

در حال حاضر شرکت تأمین سرمایه امید مدیریت صندوق‌های متنوع و جذاب سرمایه‌گذاری را در راستای جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و سرمایه‌گذاری آن وجوه در سبدهای مختلف اوراق بهادار انجام می‌دهد. سه صندوق سرمایه‌گذاری با نام‌های صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله بذر امید آفرین، صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان و صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان تحت مدیریت شرکت تأمین سرمایه امید فعالیت می‌نمایند. صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله بذر امید آفرین با ۶/۴ درصد، صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان با ۳۸/۲ درصد و صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان با ۵/۶ درصد بازدهی در ماه گذشته، فضای ایده‌آلی را برای سرمایه‌گذاری جهت کسب سود مناسب و مطمئن، برای علاقمندان به بازار سرمایه فراهم نموده است.

در ادامه، گزارش هفتگی صندوق‌های سرمایه‌گذاری تحت مدیریت شرکت تأمین سرمایه امید در قالب سه اینفوگراف معرفی می‌شوند که به ترتیب در خصوص صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله بذر امید آفرین، صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان و صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان، اطلاعاتی نظیر بازدهی ماهانه، بازدهی سالانه، مزایا، ترکیب دارایی، خالص ارزش دارایی‌ها، قیمت صدور و ابطال، و سایر مشخصات را ارائه می‌نمایند.



صندوق سرمایه‌گذاری
بذرامید آفرین

صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله بذر امید آفرین

بازده ماه گذشته
شاخص کل
۸/۹%
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۲)

بازده ماه گذشته واحد بذر

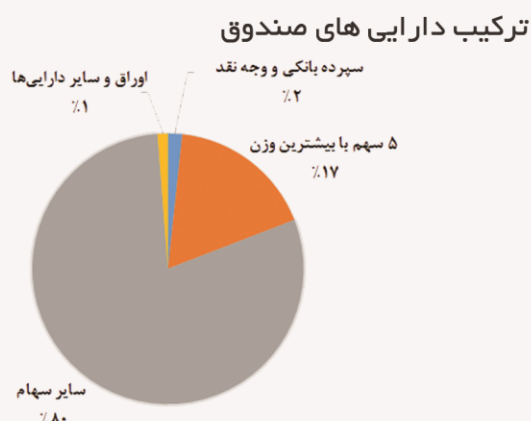
۶/۴%

(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۲)

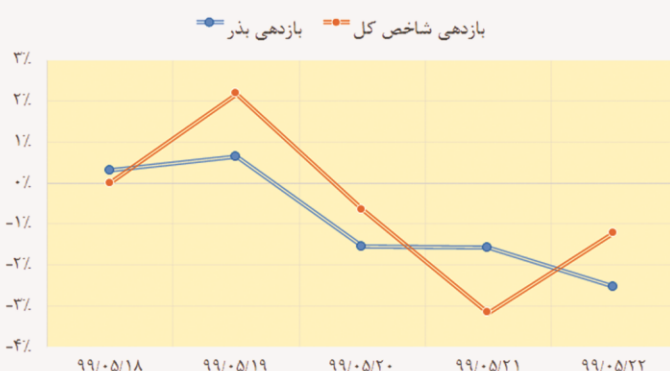
بازده سالانه
واحد بذر
۴۳۸/۱%
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۲)

مزیت‌های صندوق:

- مدیریت حرفه ای
- نقد شوندگی
- بازگردانی براساس NAV صدور و ابطال صندوق
- متنوع سازی و کاهش ریسک
- صرفه جویی در مقیاس
- شفافیت و نظارت
- سهولت سرمایه گذاری



مقایسه بازده روزانه صندوق با شاخص کل طی هفته اخیر



۱۳۹۹/۰۵/۲۲

تاریخ محاسبه NAV صندوق

۵۵,۱۲۶,۴۰۰

تعداد واحدهای سرمایه گذاری

۶۴۴,۸۷۳,۶۰۰

تعداد واحدهای باقی مانده

۷,۷۹۵,۹۶۱,۰۴۹,۶۲۳

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)

۱۴۲,۳۸۶

قیمت صدور هر واحد (ریال)

۱۴۱,۴۲۰

قیمت ابطال هر واحد (ریال)

۱۴۱,۴۲۰

قیمت آماری هر واحد (ریال)

مدیر صندوق

تأمین سرمایه امید

متولی صندوق

موسسه حسابرسی فریوران راهبرد

حسابرس

موسسه حسابرسی بهراد مشار

مدیران سرمایه گذاری

احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طبیبی

بازارگردان

تأمین سرمایه امید

تاریخ آغاز فعالیت

۱۳۹۸/۰۸/۱۶

نوع صندوق

صندوق سرمایه گذاری قابل معامله (ETF)

صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله بذر امید آفرین

صندوق سرمایه‌گذاری بذر امید آفرین از جمله نهادهای مالی تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار است. این صندوق از نوع صندوق های سرمایه‌گذاری قابل معامله در سهام بوده و اکثر وجوه خود را صرف سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام می‌نماید. هدف این صندوق، دست‌یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط بورس اوراق بهادار تهران است. در صندوق سرمایه‌گذاری بذر امید آفرین تلاش می‌شود تا عملیات مدیریت پرتفوی با تحلیل و بررسی اقتصاد جهانی، اقتصاد ایران، صنایع مختلف و وضعیت شرکت‌ها و با استفاده از روشهای حرفه‌ای و رایج ارزش‌گذاری و تحلیل بازارهای مالی معتبر دنیا به انجام رسد. به کارگیری نرم افزارهای مالی مناسب و ترکیب آن‌ها با روش‌های مزبور پایه محکم و ابزار مناسبی را برای حضور پر قدرت در بازار سرمایه فراهم خواهد کرد. مدیران سرمایه‌گذاری این صندوق به طور مستمر به بررسی بازار و شناسایی فرصت‌های سرمایه‌گذاری مناسب اقدام می‌نمایند. بازارگردان این صندوق، شرکت تأمین سرمایه امید (سهامی عام) است.



۰۲۱-۵۴۹۰۶



۰۲۱-۸۸۵۱۵۶۹۵



www.bazreomidfund.ir



صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان

متوسط بازده سالانه
سپرده بانکی و اوراق
بهادار با درآمد ثابت **۱۷%**

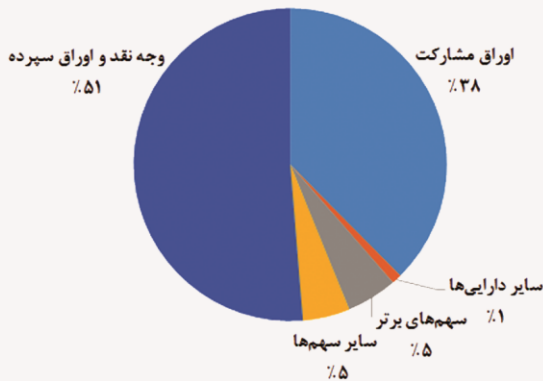
بازده ماه گذشته واحد گنجینه
۳۸/۲%
(سالانه شده منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۵)

بازده سالانه
واحد گنجینه
(منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۵) **۳۷/۸۴%**

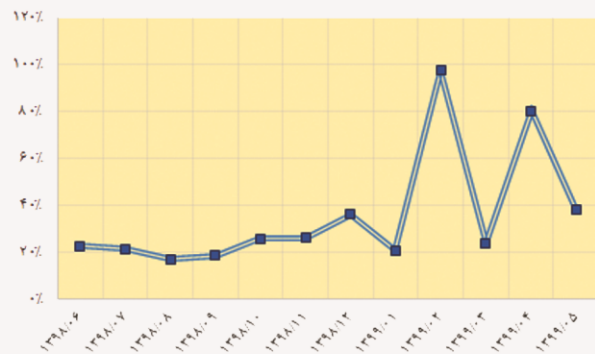
مزیت‌های صندوق:

- شفافیت و نظارت
- نقد شوندگی
- مدیریت حرفه ای
- صرفه جویی در مقیاس
- متنوع سازی و کاهش ریسک
- سهولت سرمایه گذاری

ترکیب دارایی‌های صندوق



بازده ماهانه صندوق منتهی به ۱۵ ام هر ماه



۱۳۹۹/۰۵/۲۲

تاریخ محاسبه NAV صندوق

۳۳,۶۳۴,۶۷۰

تعداد واحدهای سرمایه گذاری

۱۶,۳۶۵,۳۳۰

تعداد واحدهای باقی مانده

۳۸,۹۵۴,۴۱۳,۸۸۷,۴۱۸

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)

۱,۱۵۹,۰۰۴

قیمت صدور هر واحد (ریال)

۱,۱۵۸,۱۶۳

قیمت ابطال هر واحد (ریال)

۱,۱۵۷,۸۴۵

قیمت آماری هر واحد (ریال)

تأمین سرمایه امید

مدیر صندوق

موسسه حسابرسی فریوران راهبرد

متولی صندوق

موسسه حسابرسی بهراد مشار

حسابرس

احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طیبی

مدیران سرمایه گذاری

تأمین سرمایه امید

مدیر ثبت

تأمین سرمایه امید

ضامن نقدشوندگی

۱۳۹۸/۰۳/۳۰

تاریخ آغاز فعالیت

با درآمد ثابت

نوع صندوق

صندوق گنجینه امید ایرانیان

صندوق سرمایه گذاری گنجینه امید ایرانیان از جمله نهادهای مالی تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار است. این صندوق، از نوع صندوق های سرمایه گذاری با درآمد ثابت بوده و موضوع اصلی فعالیت آن سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده ها و گواهی های سپرده بانکی، سهام و حق تقدم سهام بوده و در کنار آن فعالیت فرعی صندوق مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. ضامن نقد شوندگی صندوق نیز شرکت تأمین سرمایه امیدبه شماره ثبت ۴۱۸۲۲۹ است.



۰۲۱-۵۴۹۰۶



۰۲۱-۸۸۵۱۵۶۹۵



www.ganjinehomidfund.ir



صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه
سکه طلای زرافشان امید ایرانیان

صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان

بازده ماه گذشته
سپرده سکه طلا

۶/۲%

(متممی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۲)

بازده ماه گذشته واحد زر

۵/۶%

(متممی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۲)

۱۳۱/۶%

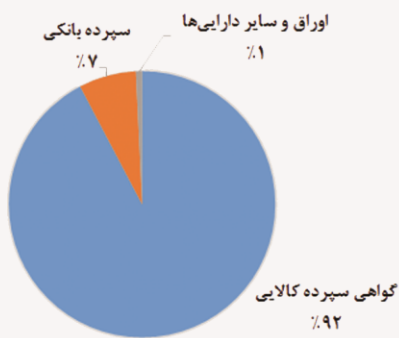
بازده سالانه
واحد زر

(متممی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۲)

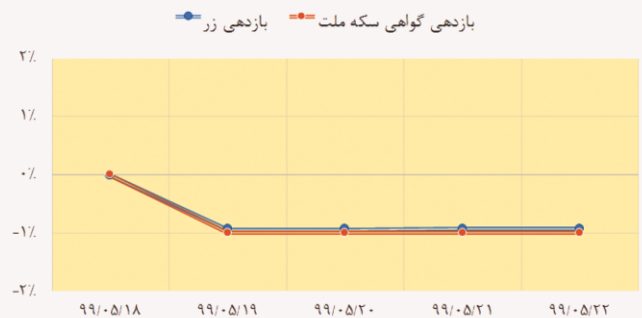
مزیت های صندوق:

ورود خروج و آسان	معافیت مالیات	شفافیت بالا	بازدهی بالا	امنیت بالا
وجود بازارگردان و نقدشوندگی بالا	امکان سرمایه‌گذاری با مبالغ کم	هزینه و کارمزد معاملاتی کم	مدیریت فعال و حرفه ای	جلوگیری از پولشویی

ترکیب دارایی‌های صندوق



مقایسه بازده روزانه صندوق با بازدهی شاخص سکه طی هفته گذشته



توجه: به دلیل اعمال دامنه نوسان ۱٪ روی گواهی سکه تمام بهار توسط بورس کالا، نمودار بازدهی گواهی سکه، خطی است و با توجه به اینکه این گواهی، بیش از ۹۰٪ از دارایی‌های صندوق را تشکیل می‌دهد، نمودار بازدهی صندوق نیز طی هفته جاری تقریباً خطی شده است

۱۳۹۹/۰۵/۲۲	تاریخ محاسبه NAV صندوق	تأمین سرمایه امید	مدیر صندوق
۹۹,۹۷۵,۵۵۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین	متولی صندوق
۲۴,۴۴۸	تعداد واحدهای باقی مانده	موسسه حسابرسی بهراد مشار	حسابرس
۴,۹۳۹,۶۳۵,۸۱۸,۲۵۹	کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)	احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طیبی	مدیران سرمایه‌گذاری
۴۹,۴۴۵	قیمت صدور هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	بازارگردان
۴۹,۴۰۹	قیمت ابطال هر واحد (ریال)	۱۳۹۶/۰۸/۱۷	تاریخ آغاز فعالیت
۴۹,۴۰۹	قیمت آماری هر واحد (ریال)	صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله (ETF)	نوع صندوق

صندوق سکه طلای زرافشان امید ایرانیان

صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان از جمله نهادهای مالی تحت نظارت سازمان بورس اوراق بهادار است. این صندوق، از انواع صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله (کالایی) بوده و موضوع اصلی فعالیت آن سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار مبتنی بر سکه طلا شامل گواهی سپرده کالایی، قراردادهای آتی کالا و قراردادهای اختیار معامله مبتنی بر کالا و همچنین سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت، سکو، اوراق بهادار و سپرده‌گذاری نزد بانکها است. هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از اوراق بهادار مبتنی بر سکه طلا و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌گردد، سرمایه‌گذاران بیشترین بازدهی ممکن را به دست آورند. انباشته شدن سرمایه در صندوق مزیت‌های متعددی از جمله: تقسیم هزینه بکارگیری نیروهای متخصص بین کلیه سرمایه‌گذاران، انجام کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق توسط مدیر صندوق و امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع دارایی‌ها و در نهایت کاهش ریسک را در بردارد. بازارگردان صندوق مزبور شرکت تامین سرمایه امید (سهامی عام) است.



۰۲۱-۵۴۹۰۶



۰۲۱-۸۸۵۱۵۶۹۵



www.omidgoldfund.ir

ارتباط با ما

این گزارش توسط واحد 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>مجتبی رستمی نوروزآباد دکتری مدیریت مالی (داخلی ۳۲۷) m.rostaminoroozabad@yahoo.com</p>	
<p>محمدحسین بادامی فوق لیسانس مهندسی مالی (داخلی ۳۴۶) hobadami@gmail.com</p>	
<p>محمدرضا صادقی‌نسب فوق لیسانس علوم اقتصادی (داخلی ۳۴۴) sadeghinasab.mr@gmail.com</p>	