

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۱۹

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.
- ۱-۲- بازارگردانی انواع اوراق بدهی و سهام با استفاده از روش‌های نوین معاملات الگوریتمی مبنی بر حمایت اوراق بهادار ناشر.
- ۱-۳- سبذگردانی 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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ 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.

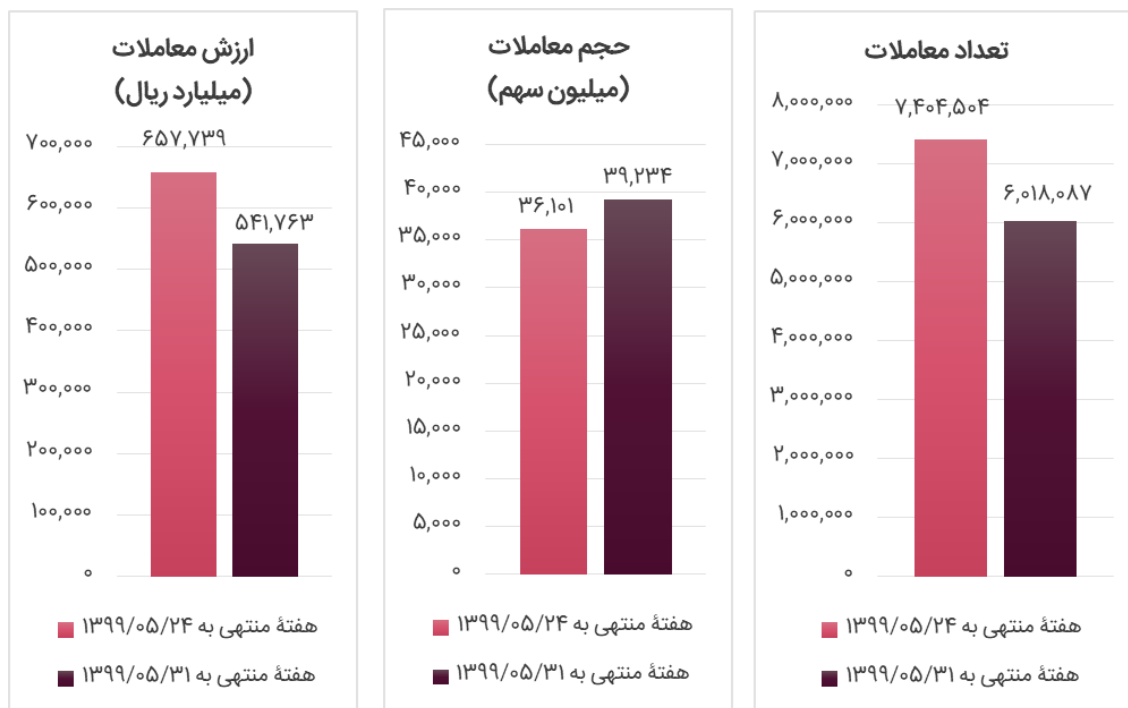
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ طی ۵ روز کاری، با ۲۱۸,۲۱۱ واحد کاهش، از ۱,۹۷۵,۴۴۰ به ۱,۷۵۷,۲۲۹ رسید. حجم معاملات ۷,۸۴۷ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۸ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۱۷ و ۱۸ درصد کاهش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روز شنبه و یکشنبه به ترتیب کاهش ۷۲,۱۷۲ و ۸۹,۷۰۲ واحدی، در روزهای دوشنبه و سه‌شنبه به ترتیب افزایش ۲,۱۸۹ و ۹,۵۹۸ واحدی و در روز چهارشنبه کاهش ۶۸,۱۲۴ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
	۵		۴		روزهای فعالیت
-۱۷/۶۳%	۱۰۸,۳۵۳	۵۴۱,۷۶۳	۱۶۴,۴۳۵	۶۵۷,۷۳۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۸/۶۷%	۷,۸۴۷	۳۹,۲۳۴	۹,۰۲۵	۳۶,۱۰۱	حجم معاملات (میلیون سهم)
-۱۸/۷۲%	۱,۲۰۳,۶۱۷	۶,۰۱۸,۰۸۷	۱,۸۵۱,۱۲۶	۷,۴۰۴,۵۰۴	تعداد معاملات

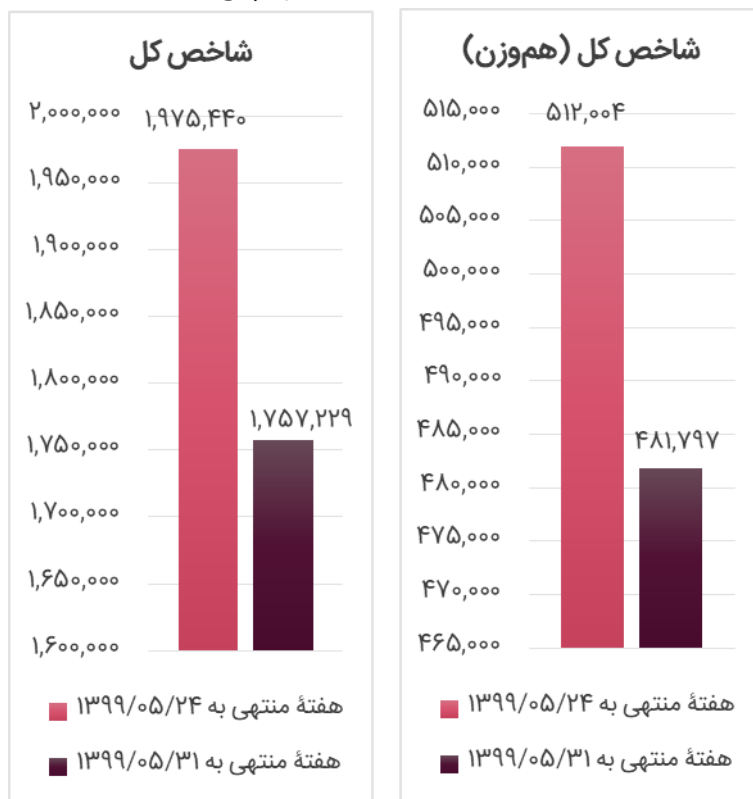
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	عنوان
-۱۱%	۶۵,۸۵۷	۷۳,۹۲۲	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
	۱,۷۵۷,۲۲۹	۱,۹۷۵,۴۴۰	شاخص کل
	۴۶۱,۴۶۴	۵۱۸,۹۴۳	شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)
-۵/۹%	۴۸۱,۷۹۷	۵۱۲,۰۰۴	شاخص کل (هموزن)
	۳۱۶,۱۰۶	۳۳۵,۹۹۸	شاخص قیمت (هموزن)

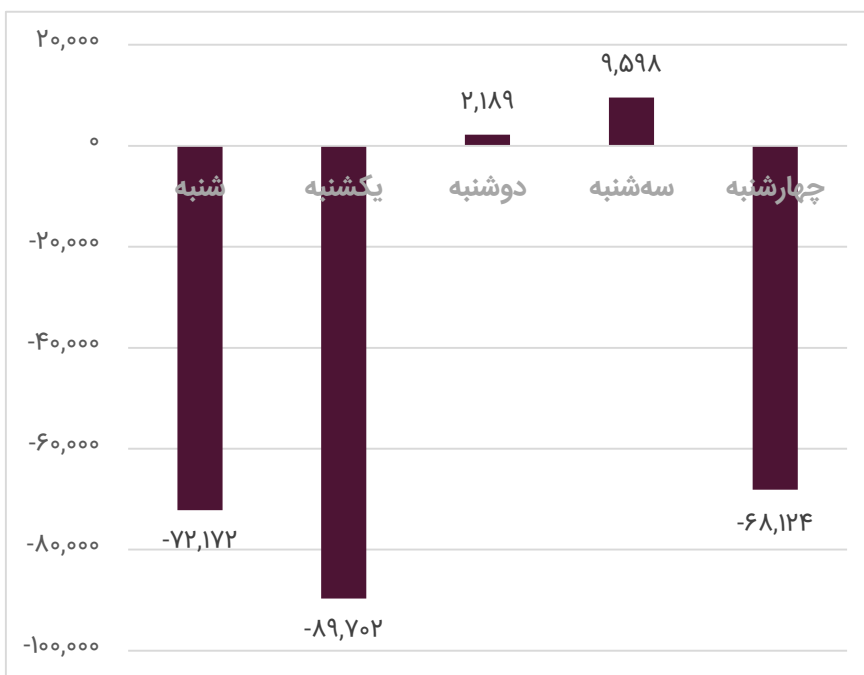
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن



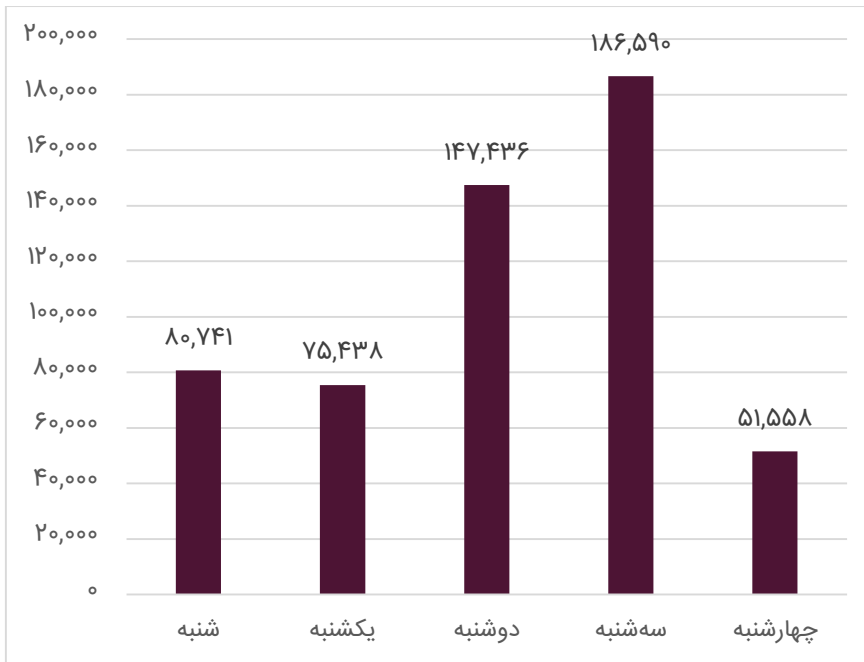
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۷۲,۱۷۲	-۳/۶۵%	۸۹۴,۰۶۹	۵,۵۴۶	۸۰,۷۴۱
یکشنبه	-۸۹,۷۰۲	-۴/۷۱%	۸۱۰,۴۵۴	۴,۵۴۰	۷۵,۴۳۸
دوشنبه	۲,۱۸۹	۰/۱۲%	۱,۴۹۵,۲۵۵	۱۳,۶۷۸	۱۴۷,۴۳۶
سه شنبه	۹,۵۹۸	۰/۵۲%	۲,۰۷۶,۰۳۰	۱۱,۴۱۴	۱۸۶,۵۹۰
چهارشنبه	-۶۸,۱۲۴	-۳/۷۳%	۷۴۲,۲۷۹	۴,۰۵۶	۵۱,۵۵۸

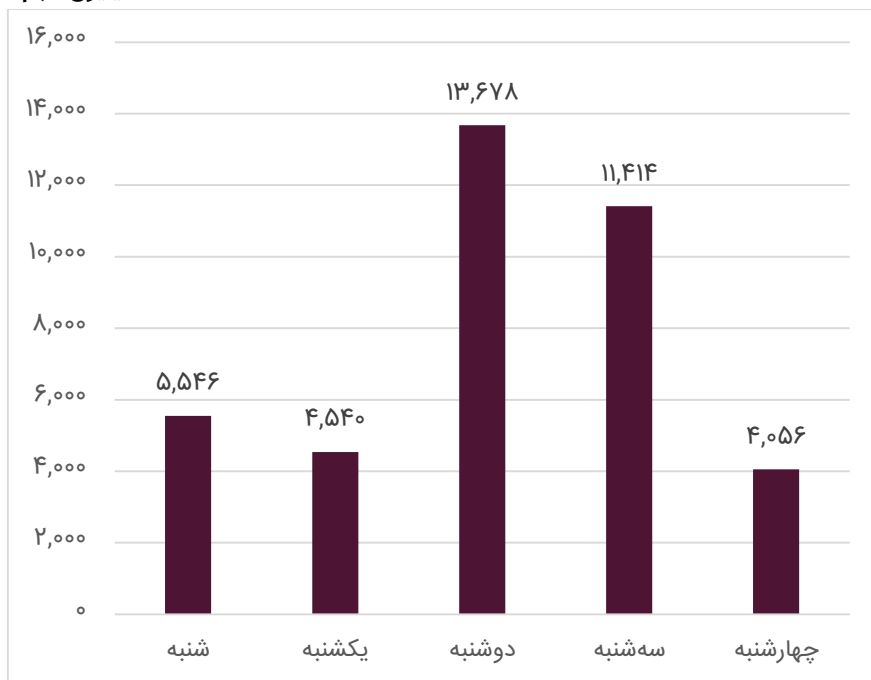
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ (میلیارد ریال)



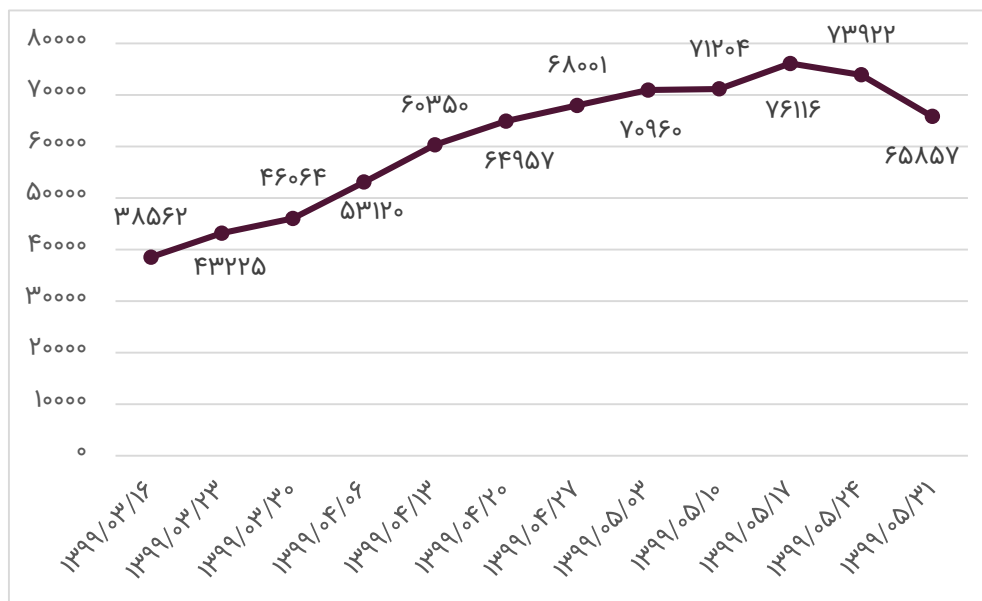
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

ارزش بازار (میلیارد ریال)	تاریخ
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
۶۵,۸۵۷	۱۳۹۹/۰۵/۳۱

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ (میلیارد ریال)



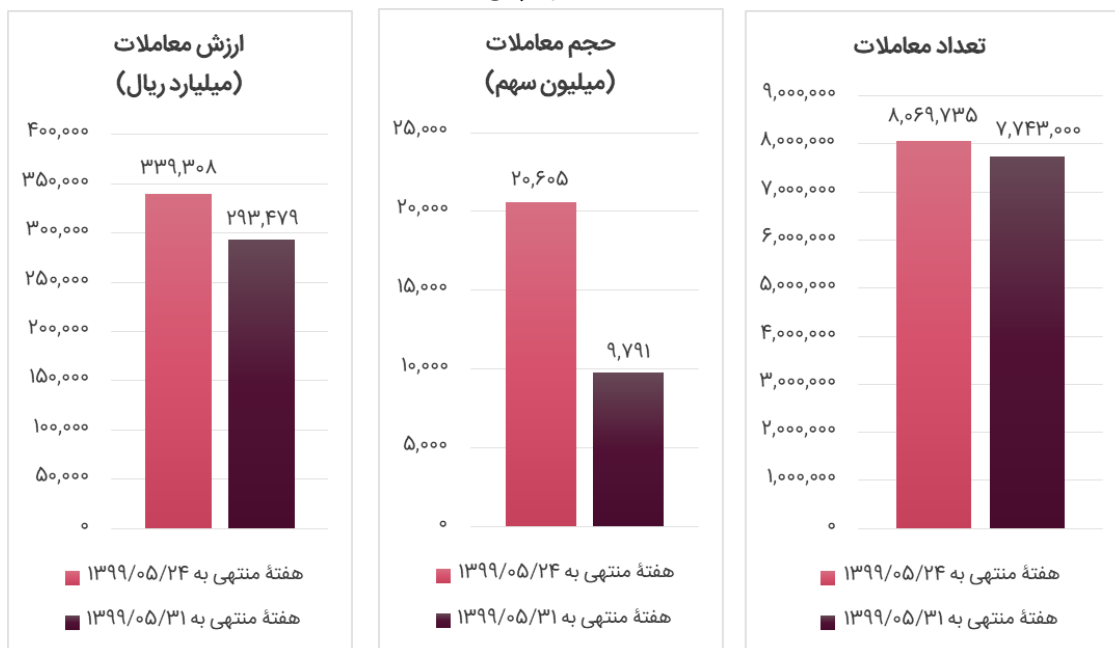
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ طی ۵ روز کاری، با ۱,۷۰۳ واحد افزایش، از ۲۰,۴۸۱ به عدد ۱۸,۷۷۸ رسید. حجم معاملات ۱,۹۵۸ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش ۵۲ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۱۳ و ۴ درصد کاهش داشته است.

جدول (۵): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۴		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۳۹,۳۰۸	۸۴,۸۲۷	۲۹۳,۴۷۹	۵۸,۶۹۶
حجم معاملات (میلیون سهم)	۲۰,۶۰۵	۵,۱۵۱	۹,۷۹۱	۱,۹۵۸
تعداد معاملات	۸,۰۶۹,۷۳۵	۲,۰۱۷,۴۳۴	۷,۷۴۳,۰۰۰	۱,۵۴۸,۶۰۰
				میزان رشد
				-۱۳/۵۰%
				-۵۲/۴۸%
				-۴/۰۴%

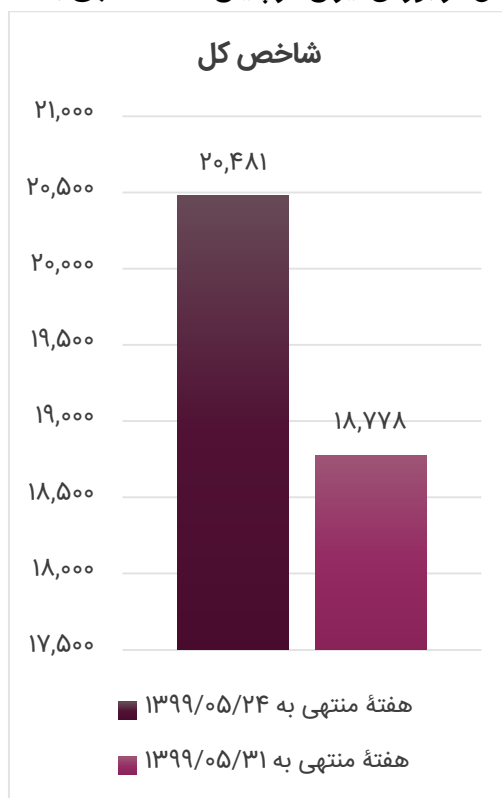
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن



جدول (۶): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۳,۳۳۰	۱۲,۲۲۳	-۸/۳۰%
شاخص کل	۲۰,۴۸۱	۱۸,۷۷۸	-۸/۳۱%

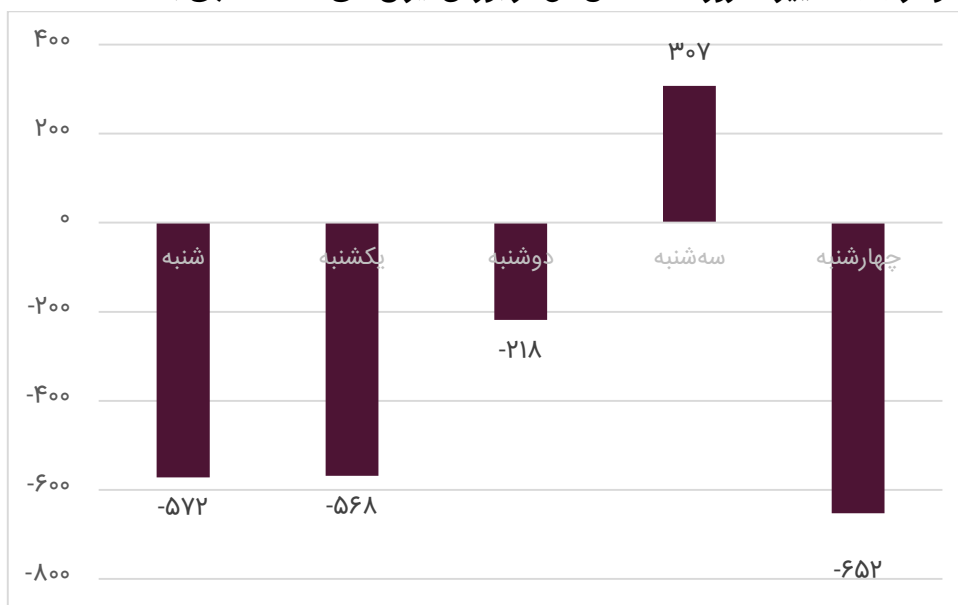
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن



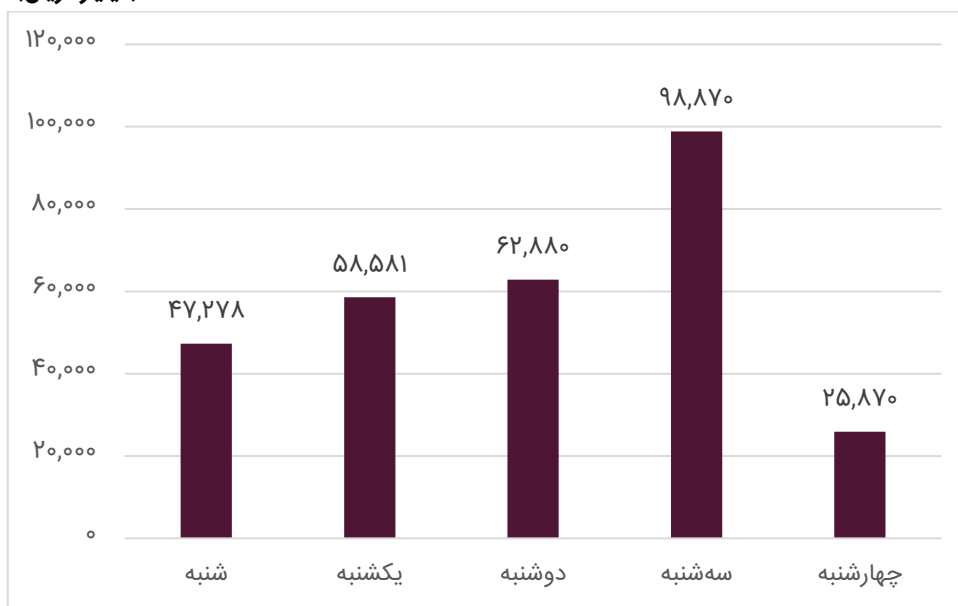
جدول (۷): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۵۷۲	-۲/۷۹%	۴۲۱,۲۱۷	۲,۱۴۱	۴۷,۲۷۸
یکشنبه	-۵۶۸	-۲/۸۵%	۳۲۸,۵۷۲	۱,۳۸۱	۵۸,۵۸۱
دوشنبه	-۲۱۸	-۱/۱۲%	۶۶۰,۰۴۳	۲,۶۸۹	۶۲,۸۸۰
سه شنبه	۳۰۷	۱/۶۰%	۷۷۶,۰۸۶	۲,۸۵۰	۹۸,۸۷۰
چهارشنبه	-۶۵۲	-۳/۳۵%	۵,۵۵۷,۰۸۲	۷۳۰	۲۵,۸۷۰

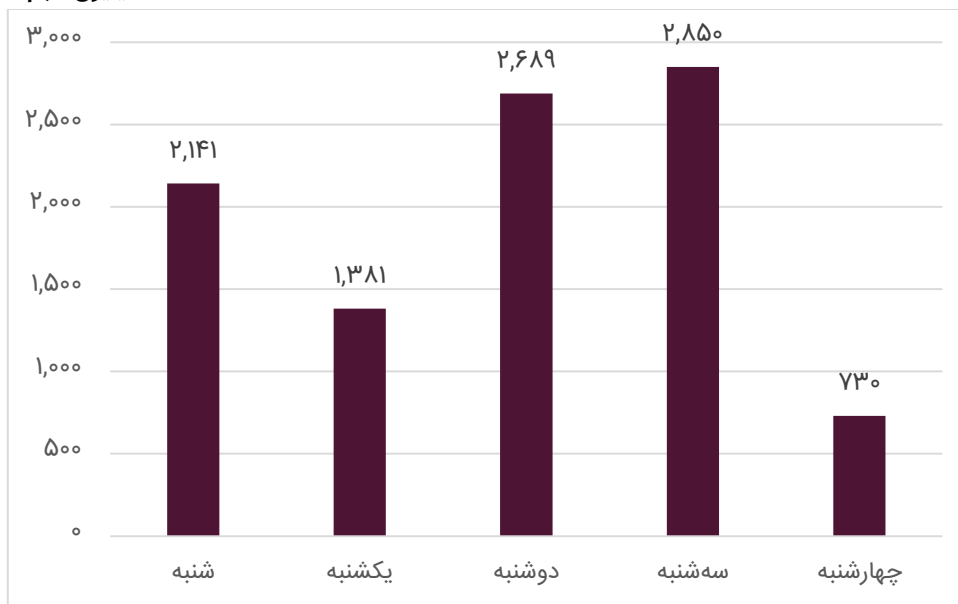
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ (میلیارد ریال)

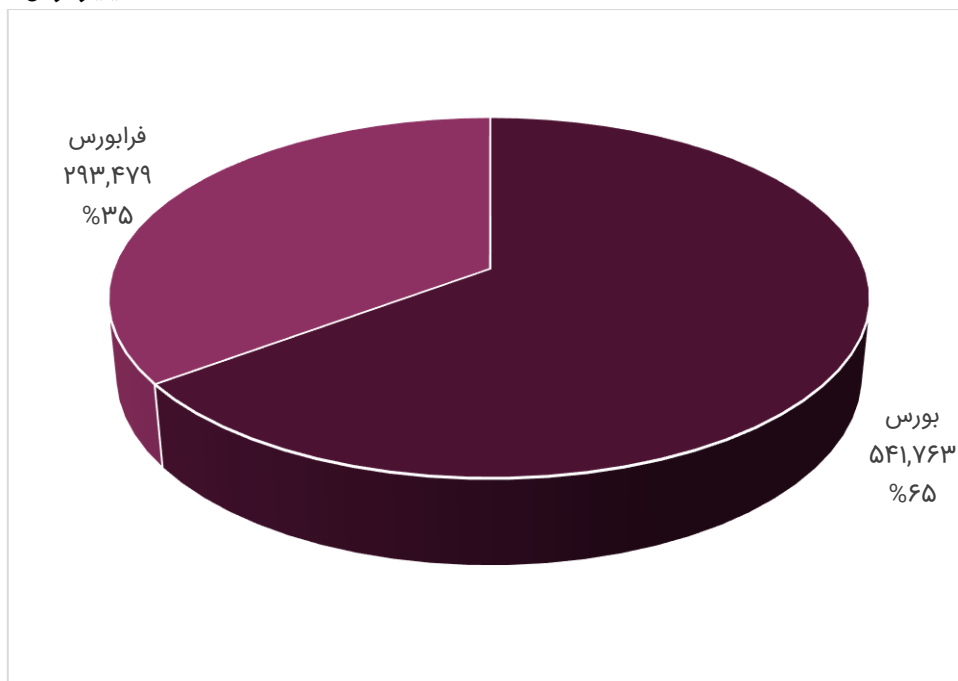


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

(میلیارد ریال)



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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱، 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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۱۹۰	۱,۴۳۷	۱,۶۴۶	۳۹
یکشنبه	۱۴۷	۶۷۳	۴,۴۵۹	۲۴۹
دوشنبه	۴۹۹	۴۳۳	۱۵,۶۸۹	۵۳۲
سه‌شنبه	۵۱۴	۳۵۷	۱۶,۴۰۰	۱۰,۵۱۳
چهارشنبه	۵۱۸	۷۰۱	۷,۴۰۳	۱,۱۵۶
پنجشنبه	۰	۱,۶۱۴	۰	۰

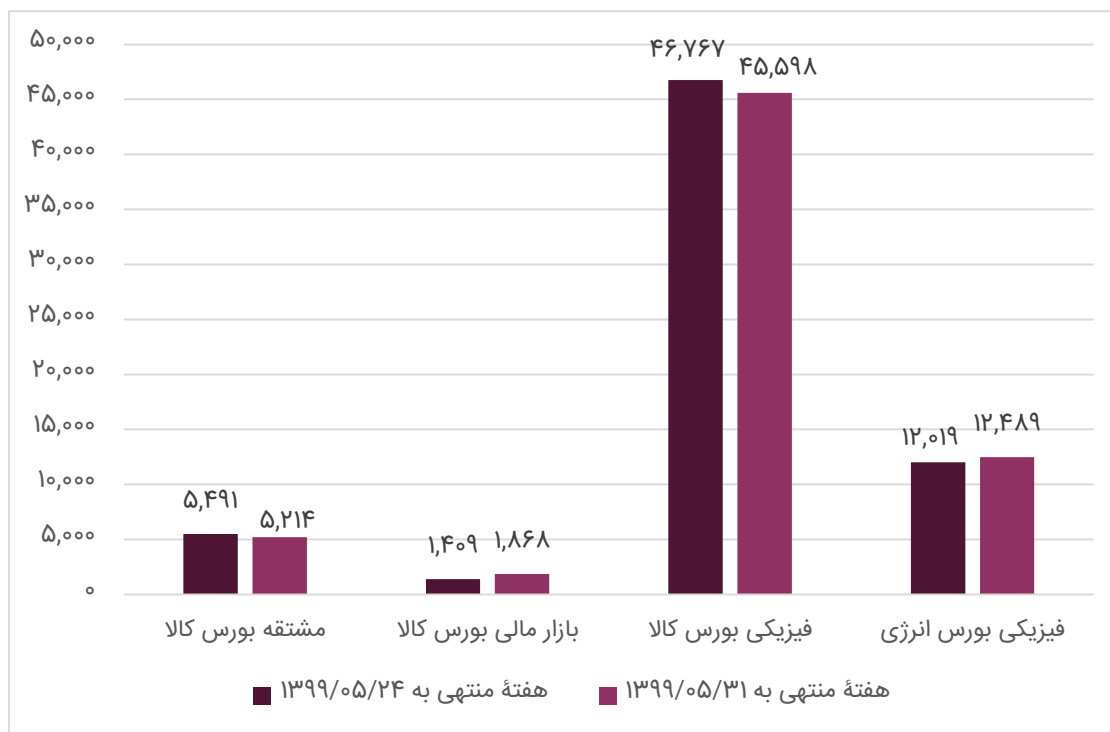
جدول (۹): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۵,۴۹۱	۵,۲۱۴	-۵/۰۳%
بازار مالی بورس کالا	۱,۴۰۹	۱,۸۶۸	۳۲/۶۳%
فیزیکی بورس کالا	۴۶,۷۶۷	۴۵,۵۹۸	-۲/۴۹%
فیزیکی بورس انرژی	۱۲,۰۱۹	۱۲,۴۸۹	۳/۹۱%

نمودار (۱۳): مقایسهٔ مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفتهٔ منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ با هفتهٔ قبل از آن

(میلیارد ریال)



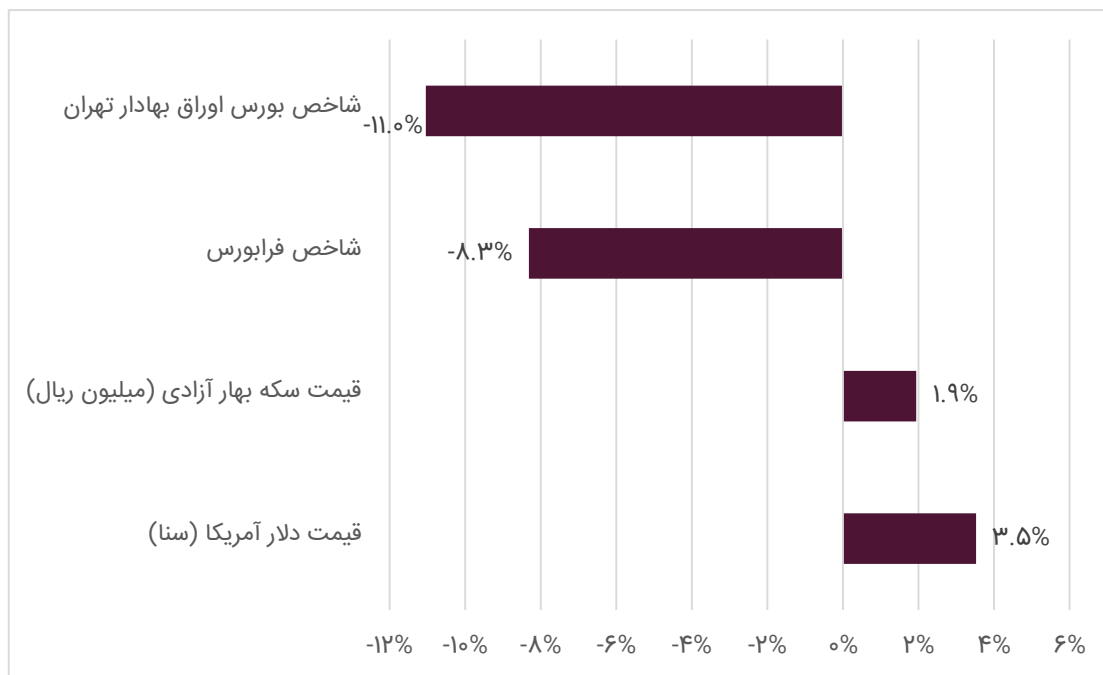
۱-۴-۱- مقایسهٔ عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفتهٔ منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۱۱ درصدی، بازدهی نامطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۸- درصدی، عملکرد نامطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکهٔ بهار آزادی بیش از ۱ درصد افزایش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، افزایش بیش از ۳ درصدی را ثبت نمود.

جدول (۱۰): مقایسهٔ بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفتهٔ منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

عنوان	هفتهٔ منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	هفتهٔ منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۹۷۵,۴۴۰	۱,۷۵۷,۲۲۹	-۱۱/۰۴%
شاخص فرابورس	۲۰,۴۸۱	۱۸,۷۷۸	-۸/۳۱%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۰۳	۱۰۵	۱/۹۴%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۱۵,۸۱۶	۲۲۳,۴۱۵	۳/۵۲%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ 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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۱): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

(ارقام برحسب دلار)

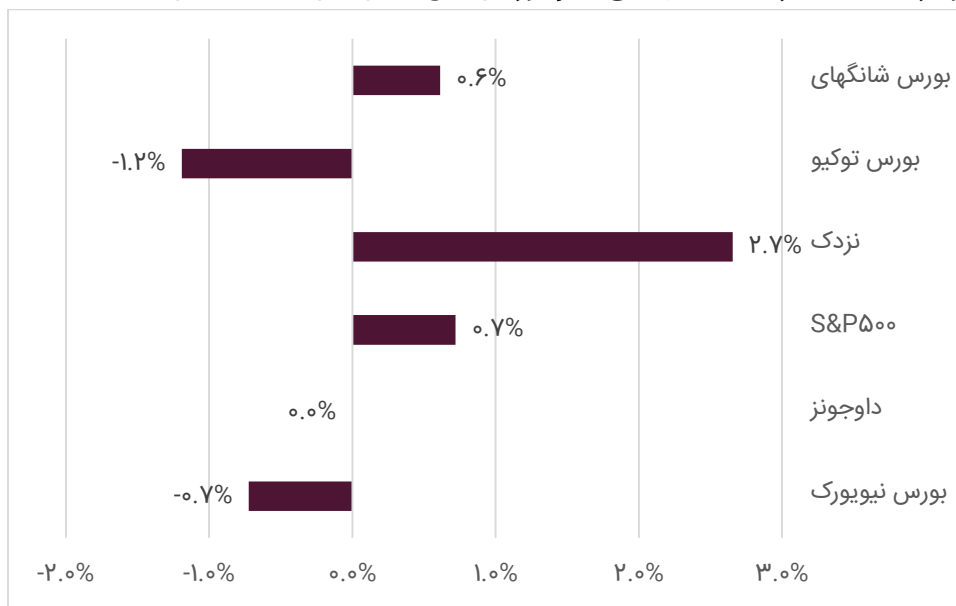
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۹۴۲	۱,۹۳۹	-۰/۱۲%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۳,۸۴	۴۳,۱۷	-۱/۵۲%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۴,۸۴	۴۴,۳۵	-۱/۰۹%

در جدول (۱۲)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بوری شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۲): تغییرات شاخص‌های مهم بوری بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۲,۹۰۳	۱۲,۸۰۹	-۰/۷۲%
داوجونز	۲۷,۹۳۱	۲۷,۹۳۰	۰/۰۰%
S&P ۵۰۰	۳,۳۷۳	۳,۳۹۷	۰/۷۲%
نزدک	۱۱,۰۱۹	۱۱,۳۱۲	۲/۶۵%
بورس توکیو	۱,۶۲۳	۱,۶۰۴	-۱/۱۷%
بورس شانگهای	۳,۳۶۰	۳,۳۸۱	۰/۶۲%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱



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 ۵/۶- درصد، صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان با ۳۸/۲ درصد و صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان با ۰/۳۶- 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
بذر امید آفرین

صندوق سرمایه گذاری قابل معامله بذر امید آفرین

بازده ماه گذشته
شاخص کل **-۵/۸%**
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۹)

بازده ماه گذشته واحد بذر

-۵/۶%

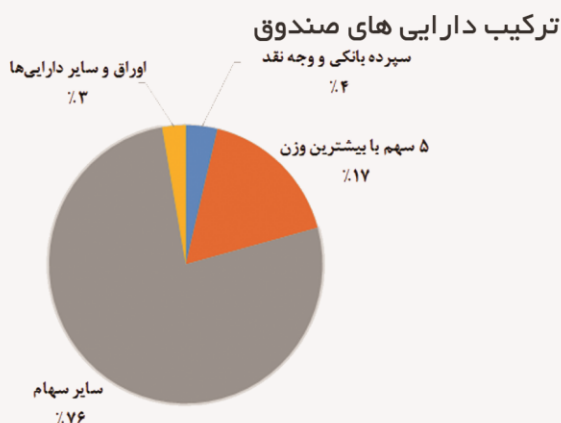
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۹)

بازده سالانه
واحد بذر **۳۹۹/۴%**

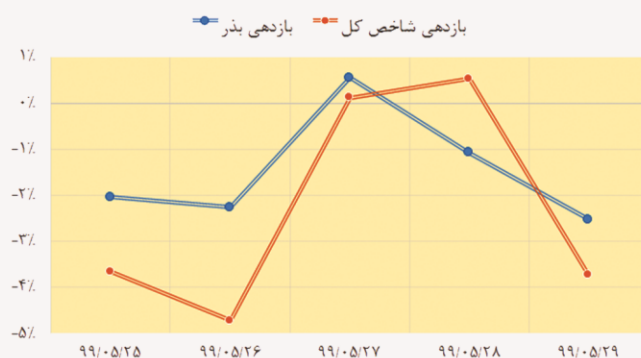
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۹)

مزیت‌های صندوق:

- مدیریت حرفه ای
- نقد شوندگی
- بازگردانی بر اساس 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



۱۳۹۹/۰۵/۲۹

تاریخ محاسبه NAV صندوق

۵۵,۱۲۶,۴۰۰

تعداد واحدهای سرمایه گذاری

۶۴۴,۸۷۳,۶۰۰

تعداد واحدهای باقی مانده

۷,۲۴۸,۵۸۴,۴۴۰,۹۷۰

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)

۱۳۲,۳۴۵

قیمت صدور هر واحد (ریال)

۱۳۱,۴۹۱

قیمت ابطال هر واحد (ریال)

۱۳۱,۴۹۱

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

بازارگردان

۱۳۹۸/۰۸/۱۶

تاریخ آغاز فعالیت

صندوق سرمایه گذاری قابل معامله (ETF)

نوع صندوق

صندوق سرمایه گذاری قابل معامله بذر امید آفرین

صندوق سرمایه گذاری بذر امید آفرین از جمله نهادهای مالی تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار است. این صندوق از نوع صندوق های سرمایه گذاری قابل معامله در سهام بوده و اکثر وجوه خود را صرف سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام می نماید. هدف این صندوق، دست یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط بورس اوراق بهادار تهران است. در صندوق سرمایه گذاری بذر امید آفرین تلاش می شود تا عملیات مدیریت پرتفوی با تحلیل و بررسی اقتصاد جهانی، اقتصاد ایران، صنایع مختلف و وضعیت شرکت ها و با استفاده از روشهای حرفه ای و رایج ارزش گذاری و تحلیل بازارهای مالی معتبر دنیا به انجام رسد. به کارگیری نرم افزار های مالی مناسب و ترکیب آن ها با روش های مزبور پایه محکم و ابزار مناسبی را برای حضور پر قدرت در بازار سرمایه فراهم خواهد کرد. مدیران سرمایه گذاری این صندوق به طور مستمر به بررسی بازار و شناسایی فرصتهای سرمایه گذاری مناسب اقدام می نمایند. بازارگردان این صندوق، شرکت تامین سرمایه امید (سهامی عام) است.



۰۲۱-۵۴۹۰۶



۰۲۱-۸۸۵۱۵۶۹۵



www.bazreomidfund.ir

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

بازده ماه گذشته واحد گنجینه

۳۸/۲%

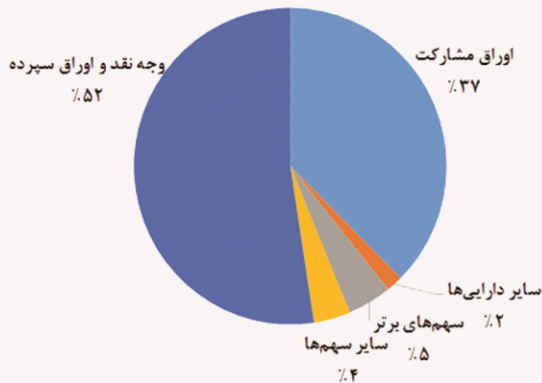
(سالانه شده منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۵)

بازده سالانه
واحد گنجینه
(منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۱۵)
۳۷/۱۴%

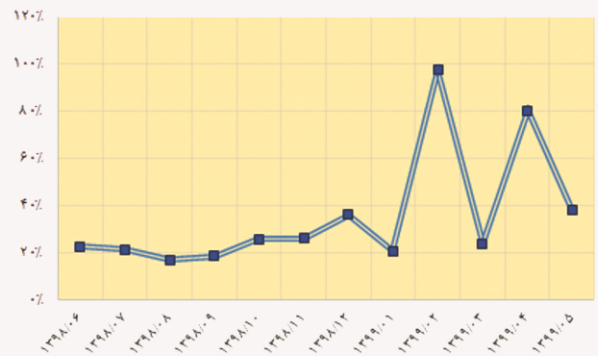
مزیت‌های صندوق:

- 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



۱۳۹۹/۰۵/۲۹	تاریخ محاسبه NAV صندوق	تأمین سرمایه امید	مدیر صندوق
۳۴,۳۴۰,۰۳۸	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	موسسه حسابرسی فریوران راهبرد	متولی صندوق
۱۵,۶۵۹,۹۶۲	تعداد واحدهای باقی مانده	موسسه حسابرسی بهراد مشار	حسابرس
۳۹,۴۷۰,۶۶۷,۰۲۴,۰۰۴	کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)	احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طیبی	مدیران سرمایه گذاری
۱,۱۵۰,۲۴۵	قیمت صدور هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	مدیر ثبت
۱,۱۴۹,۴۰۷	قیمت ابطال هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	ضامن نقدشوندگی
۱,۱۵۰,۰۹۹	قیمت آماری هر واحد (ریال)	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 مرفه 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 سرمایه گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان

بازده ماه گذشته
سپرده سکه طلا
-۱/۳%
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۹)

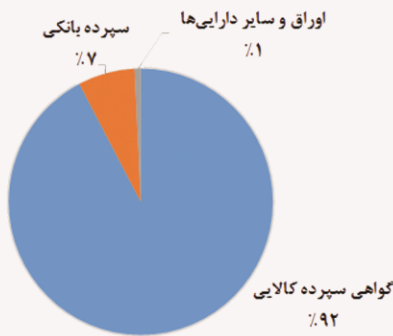
بازده ماه گذشته واحد زر
-۰/۳۶%
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۹)

بازده سالانه
واحد زر
۱۳۲/۰%
(متهی به ۱۳۹۹/۰۵/۲۹)

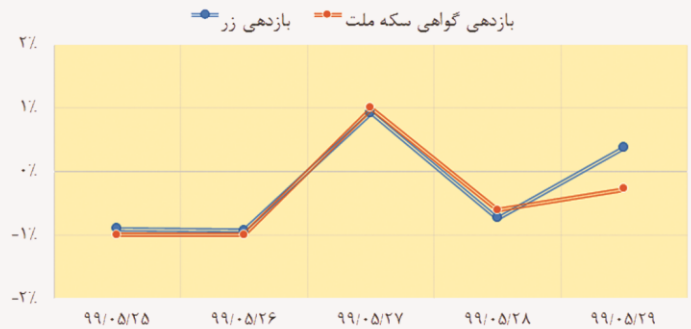
مزیت های صندوق:

ورود خروج و آسان	معافیت مالیات	شفافیت بالا	بازدهی بالا	امنیت بالا
وجود بازارگردان و نقدشوندگی بالا	امکان سرمایه گذاری 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



۱۳۹۹/۰۵/۲۹

تاریخ محاسبه NAV صندوق

۹۹,۹۷۵,۵۵۲

تعداد واحدهای سرمایه گذاری

۲۴,۴۴۸

تعداد واحدهای باقی مانده

۴,۸۷۶,۸۰۹,۲۸۴,۴۵۴

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)

۴۸,۸۱۶

قیمت صدور هر واحد (ریال)

۴۸,۷۸۱

قیمت ابطال هر واحد (ریال)

۴۸,۷۸۱

قیمت آماری هر واحد (ریال)

تأمین سرمایه امید

موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین

موسسه حسابرسی بهراد مشار

احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طیبی

تأمین سرمایه امید

۱۳۹۶/۰۸/۱۷

صندوق سرمایه گذاری قابل معامله (ETF)

مدیر صندوق

متولی صندوق

حسابرس

مدیران سرمایه گذاری

بازارگردان

تاریخ آغاز فعالیت

نوع صندوق

صندوق سکه طلای زرافشان امید ایرانیان

صندوق سرمایه گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان از جمله نهادهای مالی تحت نظارت سازمان بورس اوراق بهادار است. این صندوق، از انواع صندوق های سرمایه گذاری قابل معامله (کالایی) بوده و موضوع اصلی فعالیت آن سرمایه گذاری در اوراق بهادار مبتنی بر سکه طلا شامل گواهی سپرده کالایی، قراردادهای آتی کالا و قراردادهای اختیار معامله مبتنی بر کالا و همچنین سرمایه گذاری در اوراق مشارکت، صکوک، اوراق بهادار و سپرده گذاری نزد بانکها است. هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از اوراق بهادار مبتنی بر سکه طلا و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می گردد، سرمایه گذاران بیشترین بازدهی ممکن را به دست آورند. انباشته شدن سرمایه در صندوق مزیت های متعددی از جمله: تقسیم هزینه بکار گیری نیروهای متخصص بین کلیه سرمایه گذاران، انجام کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق توسط مدیر صندوق و امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع دارایی ها 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>	