

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۲۲



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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ 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.

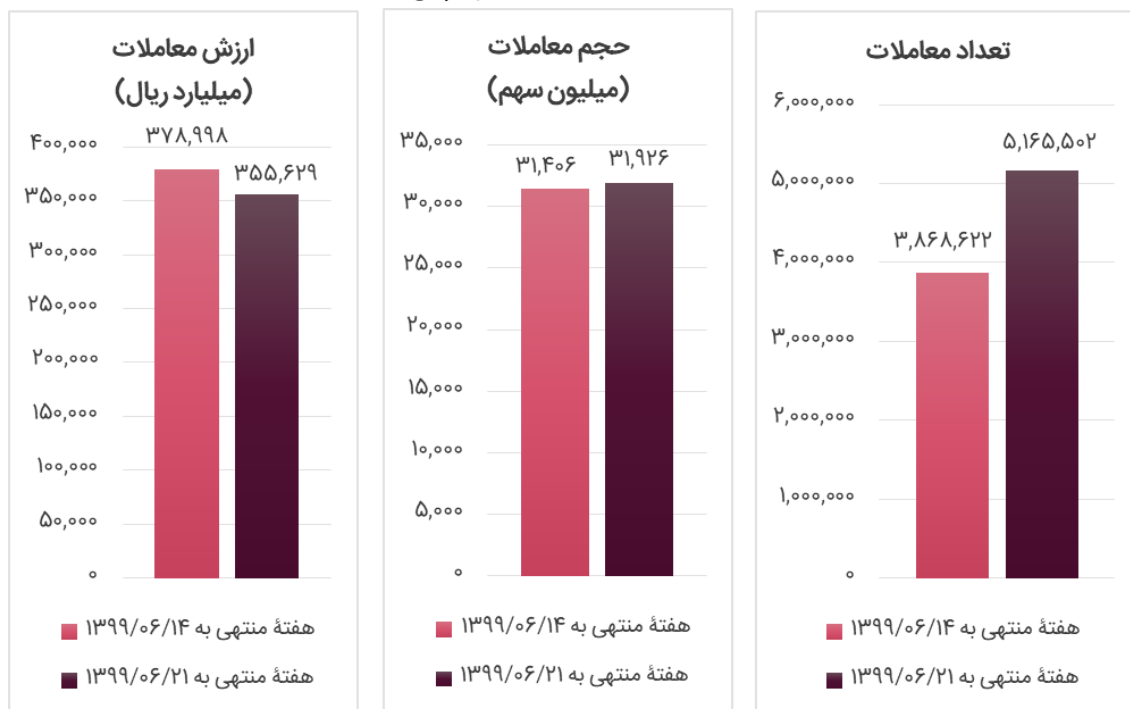
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ طی ۵ روز کاری، با ۷۵,۶۶۱ واحد کاهش، از ۱,۶۳۱,۹۴۱ به ۱,۵۵۶,۲۸۰ رسید. حجم معاملات ۶,۳۸۵ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۱ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۶ درصد کاهش و ۳۳ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روزهای شنبه و یکشنبه به ترتیب افزایش ۱۰,۰۶۶ و ۵,۷۷۴ واحدی و در روزهای دوشنبه، سه‌شنبه و چهارشنبه به ترتیب کاهش ۴۰,۵۸۷، ۳۷,۱۸۵ و ۱۳,۷۳۰ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۳		روزهای فعالیت
-۶/۱۶%	۷۱,۱۲۶	۳۵۵,۶۲۹	۱۲۶,۳۳۳	۳۷۸,۹۹۸	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱/۶۵%	۶,۳۸۵	۳۱,۹۲۶	۱۰,۴۶۹	۳۱,۴۰۶	حجم معاملات (میلیون سهم)
۳۳/۵۲%	۱,۰۳۳,۱۰۰	۵,۱۶۵,۵۰۲	۱,۲۸۹,۵۴۱	۳,۸۶۸,۶۲۲	تعداد معاملات

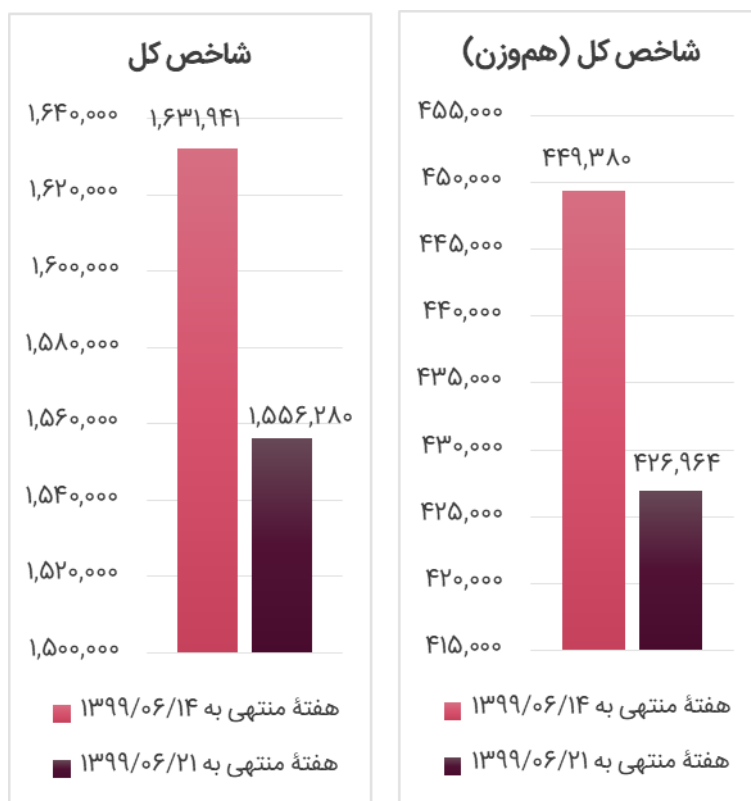
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴	عنوان
-۴/۶%	۵۸,۲۶۰	۶۰,۹۶۲	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
	۱,۵۵۶,۲۸۰	۱,۶۳۱,۹۴۱	شاخص کل
	۴۰۸,۱۷۶	۴۲۸,۰۷۲	شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)
-۵%	۴۲۶,۹۶۴	۴۴۹,۳۸۰	شاخص کل (هموزن)
	۲۷۹,۸۹۷	۲۹۴,۶۴۹	شاخص قیمت (هموزن)

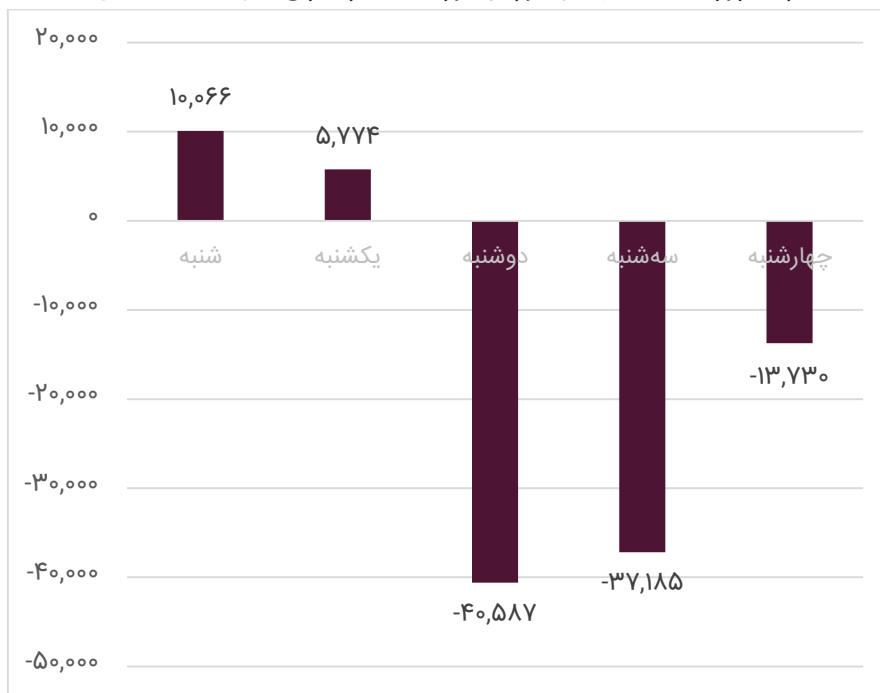
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن



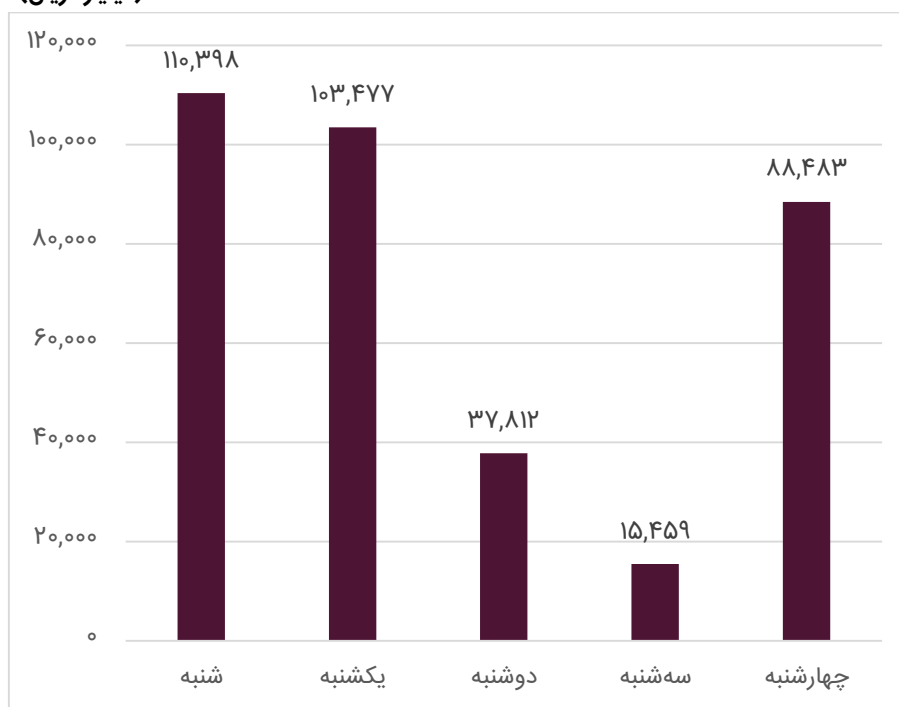
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۱۰,۰۶۶	۰/۶۱%	۱,۴۰۷,۷۱۶	۹,۷۲۲	۱۱۰,۳۹۸
یکشنبه	۵,۷۷۴	۰/۳۵%	۱,۲۹۷,۸۴۶	۹,۲۹۵	۱۰۳,۴۷۷
دوشنبه	-۴۰,۵۸۷	-۲/۴۶%	۵۹۷,۵۲۱	۴,۲۲۳	۳۷,۸۱۲
سه شنبه	-۳۷,۱۸۵	-۲/۳۱%	۱۹۴,۸۴۴	۹۶۳	۱۵,۴۵۹
چهارشنبه	-۱۳,۷۳۰	-۰/۸۷%	۱,۶۶۷,۵۷۵	۷,۷۲۴	۸۸,۴۸۳

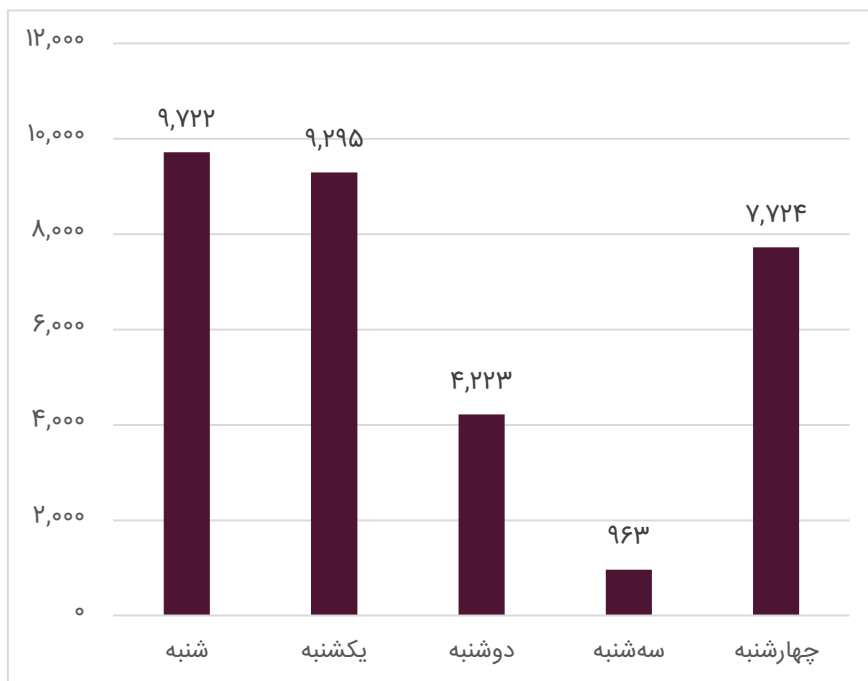
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ (میلیارد ریال)



نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ (میلیون سهم)

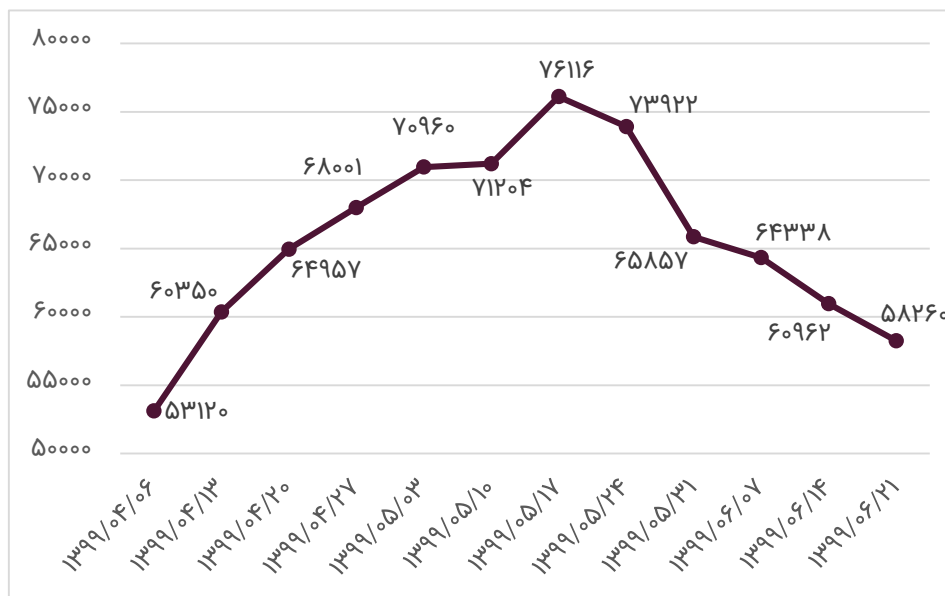


جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

(میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۶۴,۳۳۸	۱۳۹۹/۰۶/۰۷
۶۰,۹۶۲	۱۳۹۹/۰۶/۱۴
۵۸,۲۶۰	۱۳۹۹/۰۶/۲۱

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ (میلیارد ریال)



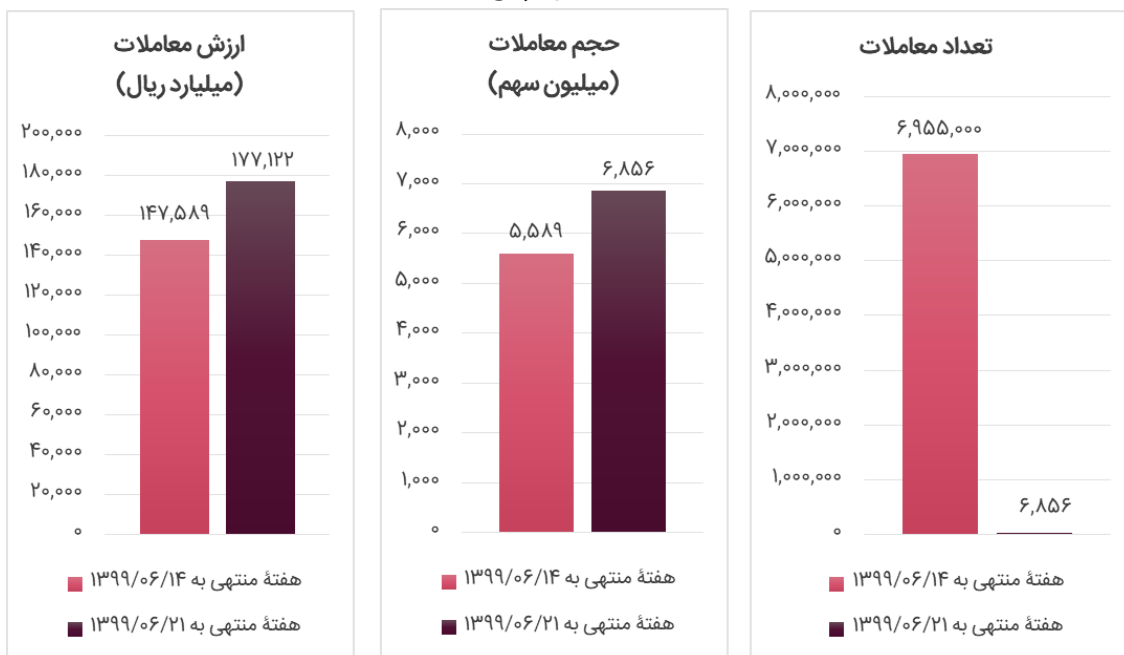
۲-۱- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ طی ۵ روز کاری، با ۸۶۷ واحد کاهش، از ۱۷,۳۵۷ به عدد ۱۶,۴۹۰ رسید. حجم معاملات ۱,۳۷۱ میلیون سهم در این هفته، حاکی از افزایش ۲۲ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۲۰ درصد افزایش و ۹۹ درصد کاهش داشته است.

جدول (۵): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱		میزان رشد
	کل	میانگین	کل	میانگین	
روزهای فعالیت	۳		۵		
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۴۷,۵۸۹	۴۹,۱۹۶	۱۷۷,۱۲۲	۳۵,۴۲۴	۲۰/۰۱%
حجم معاملات (میلیون سهم)	۵,۵۸۹	۱,۸۶۳	۶,۸۵۶	۱,۳۷۱	۲۲/۶۷%
تعداد معاملات	۶,۹۵۵,۰۰۰	۲,۳۱۸,۳۳۳	۶,۸۵۶	۱,۳۷۱	-۹۹/۹۰%

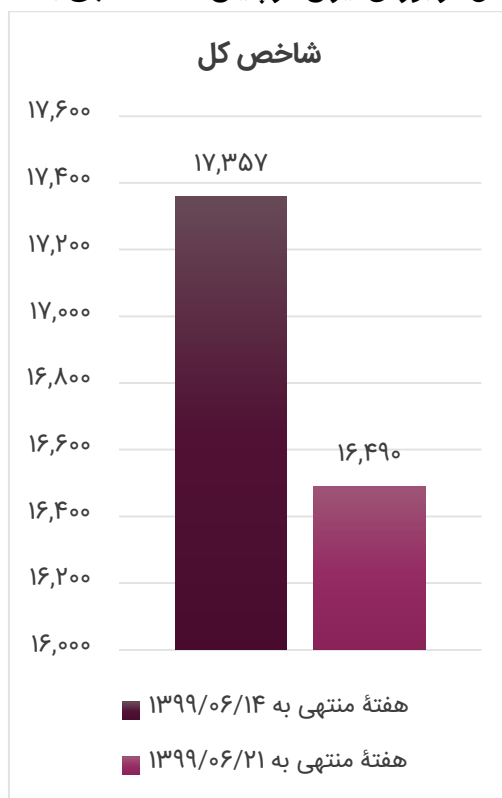
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن



جدول (۶): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۱,۳۲۸	۱۰,۷۴۴	-۵/۱۵%
شاخص کل	۱۷,۳۵۷	۱۶,۴۹۰	-۴/۹۹%

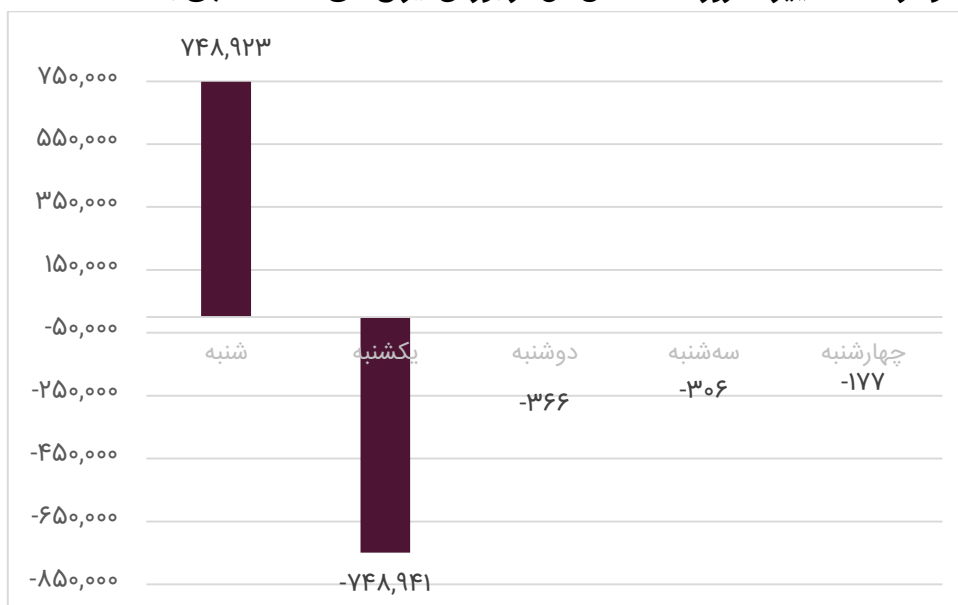
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن



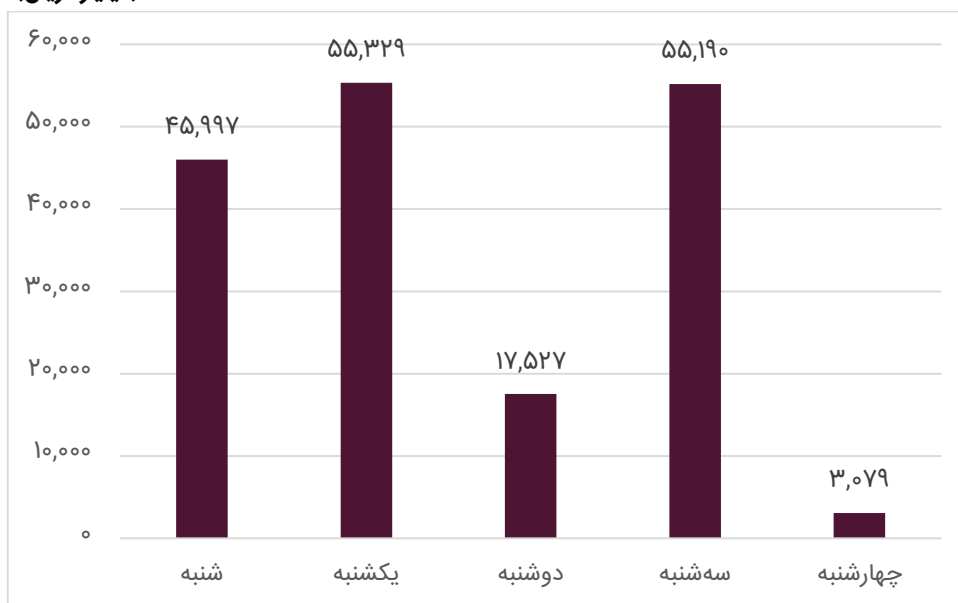
جدول (۷): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۷۴۸,۹۲۳	۴/۱/۴۷%	۲,۱۹۶	۲,۱۹۶	۴۵,۹۹۷
یکشنبه	-۷۴۸,۹۴۱	-۹۷/۷۳%	۱,۷۴۶	۱,۷۴۶	۵۵,۳۲۹
دوشنبه	-۳۶۶	-۲/۱۱%	۶۱۰	۶۱۰	۱۷,۵۲۷
سه شنبه	-۳۰۶	-۱/۸۰%	۶۲۵	۶۲۵	۵۵,۱۹۰
چهارشنبه	-۱۷۷	-۱/۰۶%	۱,۶۷۹	۱,۶۷۹	۳,۰۷۹

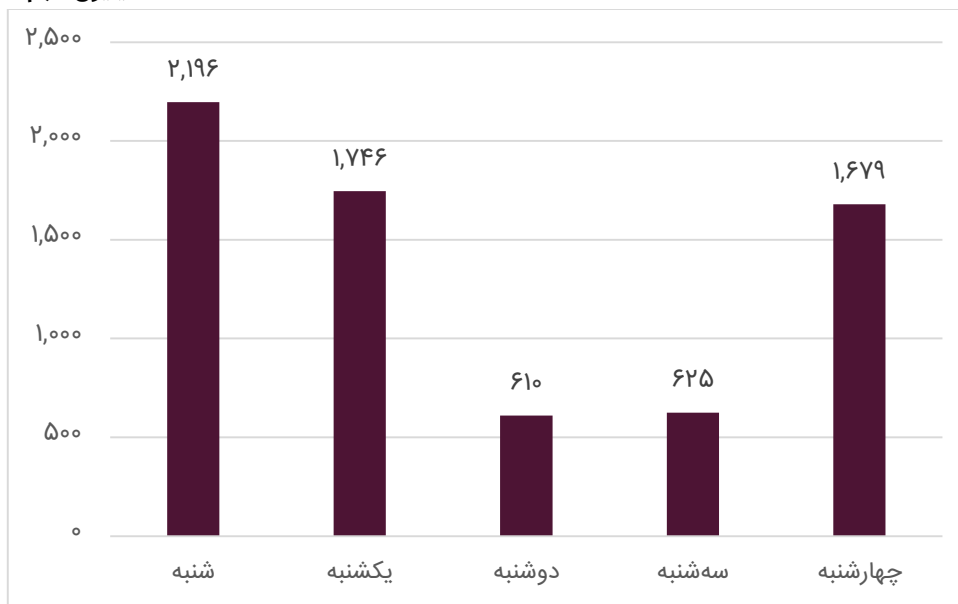
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱



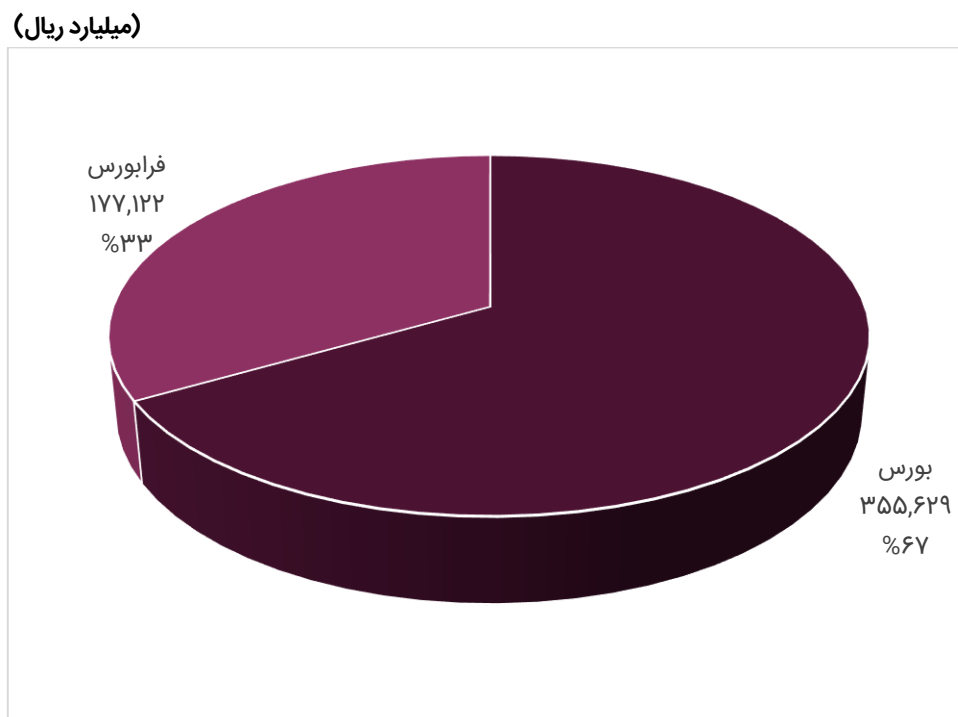
نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ (میلیارد ریال)



نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱



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 هریک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱، 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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۲۳۷	۳۸۰	۱۱,۴۰۶	۸۹۰
یکشنبه	۷۵۳	۳۶۶	۱۰,۰۱۲	۴۴۹
دوشنبه	۱,۳۲۷	۵۵۷	۲۴,۳۱۰	۶۱۲
سه‌شنبه	۸۳۳	۷۹۸	۲۰,۷۷۷	۲,۸۷۵
چهارشنبه	۷۰۸	۶۸۰	۱۰,۸۰۴	۱,۶۷۸
پنجشنبه	۰	۶۸۲	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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۱,۹۰۲	۳,۴۶۲	۸۱/۹۶%
بازار مالی بورس کالا	۱,۵۶۶	۳,۸۵۸	۱۴۶/۳۲%
فیزیکی بورس کالا	۴۷,۲۵۱	۹۲۳,۴۸۲	۱/۵/۴۴%
فیزیکی بورس انرژی	۳,۸۰۹	۶,۵۰۴	۷۰/۷۶%

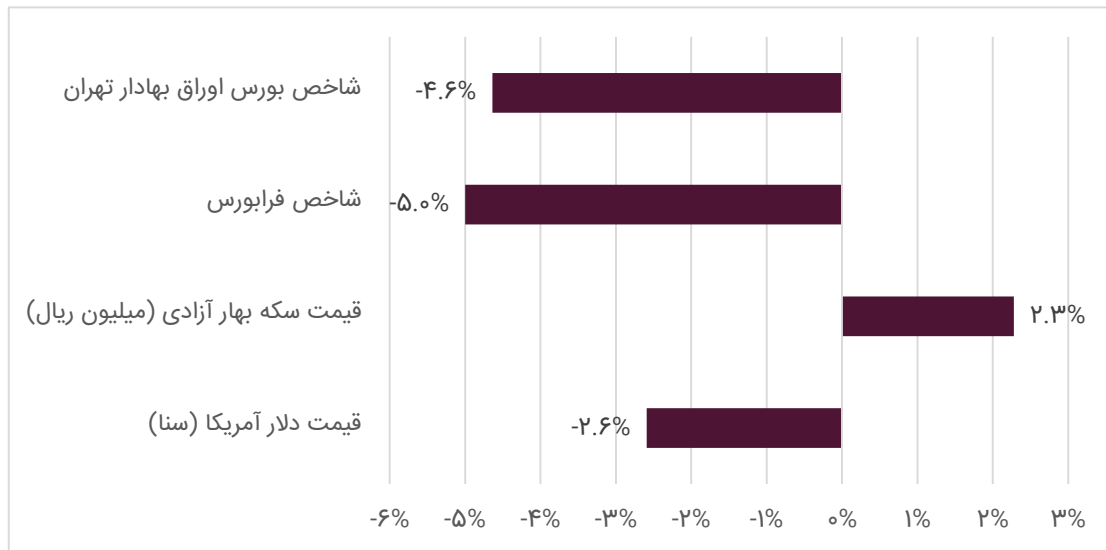
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۴ درصدی، بازدهی نامطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران نیز با بازدهی -۴ درصدی، عملکرد نامطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۲ درصد افزایش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، کاهش بیش از ۲ درصدی را ثبت نمود.

جدول (۱۰): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۶۳۱,۹۴۱	۱,۵۵۶,۲۸۰	-۴/۶۳%
شاخص فرابورس	۱۷,۳۵۷	۱۶,۴۹۰	-۴/۹۹%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۱۰	۱۱۲/۵	۲/۲۸%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۳۳,۲۳۹	۲۲۷,۱۹۸	-۲/۵۹%

نمودار (۱۳): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ 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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۱): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

(ارقام برحسب دلار)

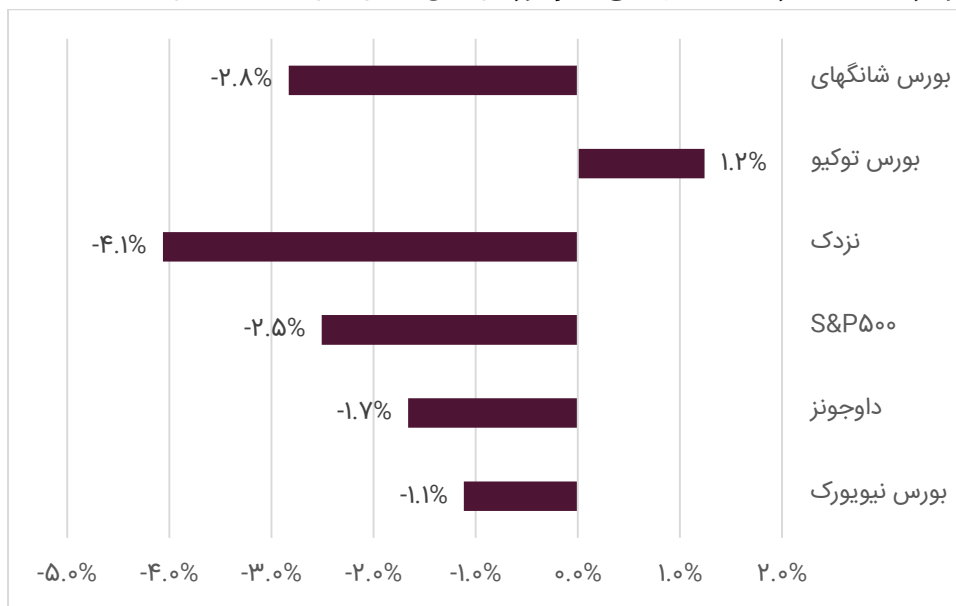
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۹۳۶	۱,۹۴۲	۰/۳۳%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۰,۵۲	۳۷,۷۰	-۶/۹۵%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۲,۶۶	۳۹,۸۳	-۶/۶۳%

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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۲): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۲,۹۱۷	۱۲,۷۷۳	-۱/۱۱%
داوجونز	۲۸,۱۳۳	۲۷,۶۶۶	-۱/۶۶%
S&P ۵۰۰	۳,۴۲۷	۳,۳۴۱	-۲/۵۰%
نزدک	۱۱,۳۱۳	۱۰,۸۵۴	-۴/۰۶%
بورس توکیو	۱,۶۱۷	۱,۶۳۷	۱/۲۳%
بورس شانگهای	۳,۳۵۵	۳,۲۶۰	-۲/۸۳%

نمودار (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱





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 ۲۱/۱۸- درصد، صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان با ۰/۵ درصد و صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان با ۲/۶۱ 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 سرمایه‌گذاری قابل معامله بذر امید آفرین

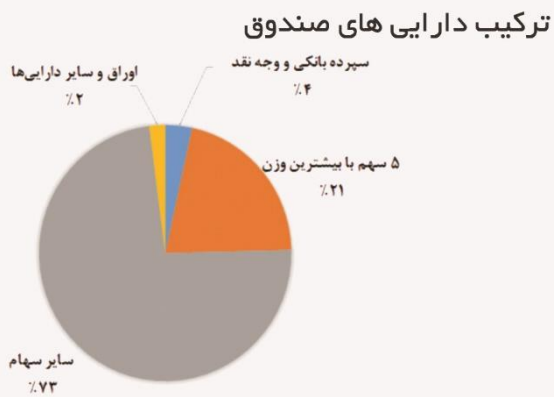
بازده ماه گذشته
شاخص کل
-۲۵/۱۳٪
(متتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۹)

بازده ماه گذشته واحد بذر
-۲۱/۱۸٪
(متتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۹)

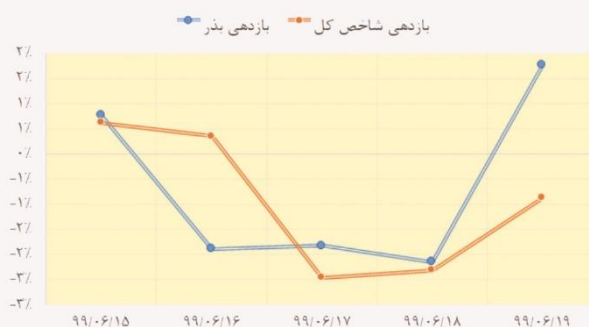
بازده سالانه
واحد بذر
۳۴۸/۳٪
(متتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۹)

مزیت‌های صندوق:

- مدیریت حرفه‌ای
- نقد شونگی
- بازارگردانی براساس NAV صدور و ابطال صندوق
- متنوع سازی و کاهش ریسک
- سهولت سرمایه‌گذاری
- شفافیت و نظارت
- صرفه جویی در مقیاس



مقایسه بازده روزانه صندوق با شاخص کل طی هفته اخیر



۱۳۹۹/۰۶/۱۹

تاریخ محاسبه NAV صندوق

۴۷,۳۷۶,۴۰۰

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری

۶۵۲,۶۲۳,۶۰۰

تعداد واحدهای باقی مانده

۵,۵۹۱,۷۳۱,۵۵۱,۶۹۶

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)

۱۱۸,۸۰۷

قیمت صدور هر واحد (ریال)

۱۱۸,۰۲۸

قیمت ابطال هر واحد (ریال)

۱۱۸,۰۲۸

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 سرمایه‌گذاری

تأمین سرمایه امید

بازارگردان

۱۳۹۸/۰۸/۱۶

تاریخ آغاز فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله (ETF)

نوع صندوق

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 صندوق‌های 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 به‌طور 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

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

بازده ماه گذشته واحد گنجینه

۰/۵%

(سالانه شده منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۵)

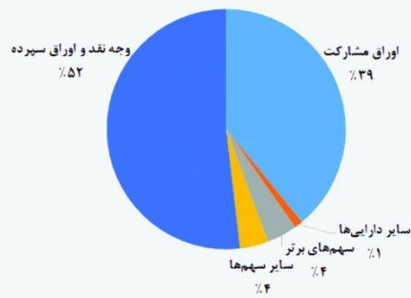
بازده سالانه واحد گنجینه **۳۵/۳%**

(منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۵)

مزیت‌های صندوق:

- شفافیت و نظارت
- نقد شوندگی
- مدیریت حرفه‌ای
- صرفه جویی در مقیاس
- متنوع سازی و کاهش ریسک
- سهولت سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی‌های صندوق



بازده ماهانه صندوق منتهی به ۱۵ ام هر ماه



1399/06/19	تاریخ محاسبه NAV صندوق	تأمین سرمایه امید	مدیر صندوق
333,666,746	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	موسسه حسابرسی فریوران راهبرد	متولی صندوق
16,333,254	تعداد واحدهای باقی مانده	موسسه حسابرسی بهراد مشار	حسابرس
38,023,507,532,378	کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)	احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابار، احسان طیبی	مدیران سرمایه‌گذاری
1,130,074	قیمت صدور هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	مدیر ثبت
1,129,408	قیمت ابطال هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	ضامن نقدشوندگی
1,128,333	قیمت آماری هر واحد (ریال)	1398/03/30	تاریخ آغاز فعالیت
		با درآمد ثابت	نوع صندوق

سندوق گنجینه امید ایرانیان

سندوق سرمایه‌گذاری گنجینه امید ایرانیان از جمله نهادهای مالی تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار است. این صندوق، از نوع صندوق‌های سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت بوده و موضوع اصلی فعالیت آن سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده‌ها و گواهی‌های 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، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها 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 جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. ضامن نقدشوندگی صندوق نیز شرکت تأمین سرمایه امیدبه شماره ثبت ۴۱۸۲۲۹ است.



۰۲۱-۵۴۹۰۶



۰۲۱-۸۸۵۱۵۶۹۵



www.ganjinehomidfund.ir



صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه
سکه ملای زرافشان امید ایرانیان

صندوق سرمایه گذاری پشتوانه سکه ملای زرافشان امید ایرانیان

بازده ماه گذشته
سپرده سکه طلا

۲/۹۲%

(متهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۹)

بازده ماه گذشته واحد زر

۲/۶۱%

(متهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۹)

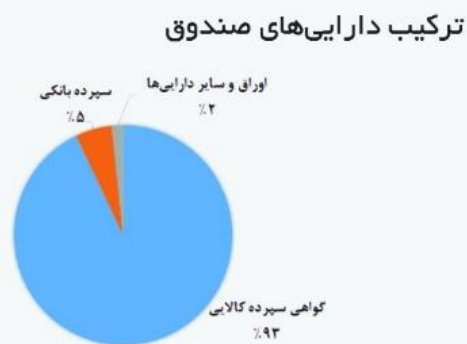
۱۴۵/۳%

بازده سالانه
واحد زر

(متهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۹)

مزیت های صندوق:

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



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 قلم، بیش از ۹۰٪ از دارایی‌های صندوق را تشکیل می‌دهد، نمودار بازدهی صندوق نیز طی هفته جاری تقریباً خطی شده است

۱۳۹۹/۰۶/۱۹	تاریخ محاسبه NAV صندوق	تأمین سرمایه امید	مدیر صندوق
۹۹,۹۷۵,۵۵۲	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین	متولی صندوق
۲۴,۴۴۸	تعداد واحدهای باقی مانده	موسسه حسابرسی بهراد مشار	حسابرس
۵,۲۱۲,۸۵۰,۰۰۷,۵۰۴	کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)	احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طیبی	مدیران سرمایه گذاری
۵۲,۱۸۰	قیمت صدور هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	بازارگردان
۵۲,۱۴۲	قیمت ابطال هر واحد (ریال)	۱۳۹۶/۰۸/۱۷	تاریخ آغاز فعالیت
۵۲,۱۴۲	قیمت آماری هر واحد (ریال)	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله (ETF)	نوع صندوق

صندوق سکه ملای زرافشان امید ایرانیان

صندوق سرمایه گذاری پشتوانه سکه ملای 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، مسکوک، 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>	