

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۲۳

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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ 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.

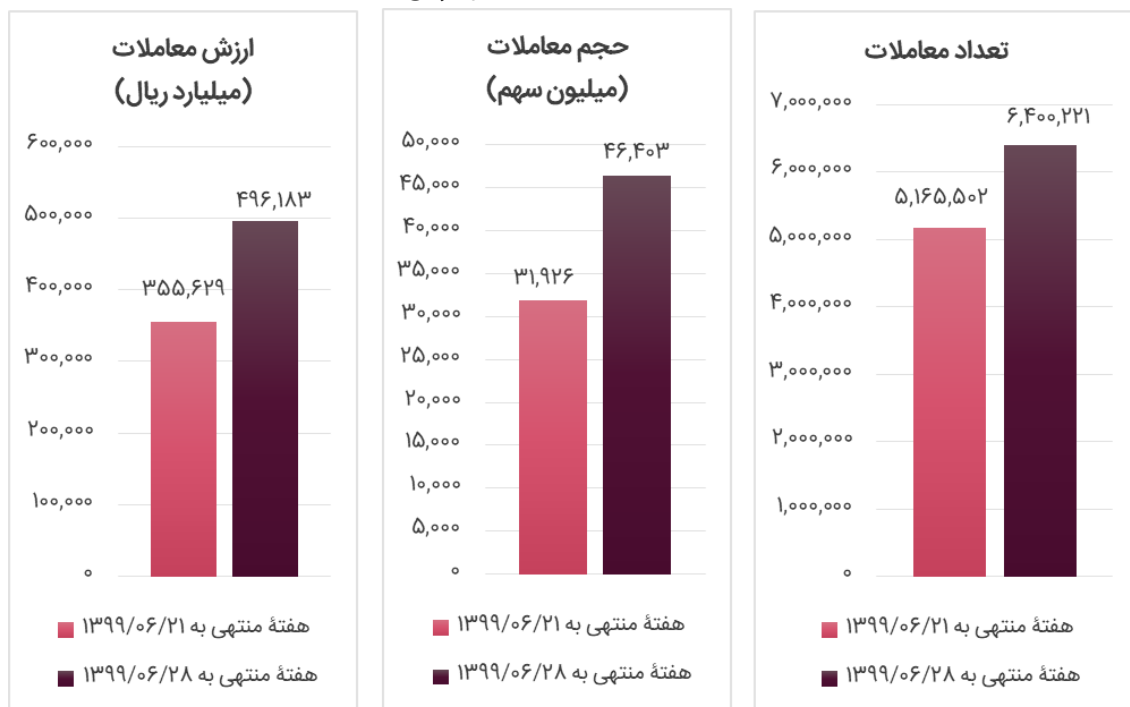
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ طی ۵ روز کاری، با ۱۴۷,۸۲۹ واحد افزایش، از ۱,۵۵۶,۲۸۰ به ۱,۷۰۴,۱۰۹ رسید. حجم معاملات ۹,۲۸۱ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۴۵ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۳۹ و ۲۳ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روز شنبه، افزایش ۲۷,۴۷۳ واحدی، در روز یکشنبه، کاهش ۵,۵۶۴، در روزهای دوشنبه، سه‌شنبه و چهارشنبه به ترتیب افزایش ۲۹,۳۹۷، ۵۷,۰۰۶ و ۳۹,۵۱۶ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۵		روزهای فعالیت
۳۹/۵۲%	۹۹,۲۳۷	۴۹۶,۱۸۳	۷۱,۱۲۶	۳۵۵,۶۲۹	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۴۵/۳۴%	۹,۲۸۱	۴۶,۴۰۳	۶,۳۸۵	۳۱,۹۲۶	حجم معاملات (میلیون سهم)
۲۳/۹۰%	۱,۲۸۰,۰۴۴	۶,۴۰۰,۲۲۱	۱,۰۳۳,۱۰۰	۵,۱۶۵,۵۰۲	تعداد معاملات

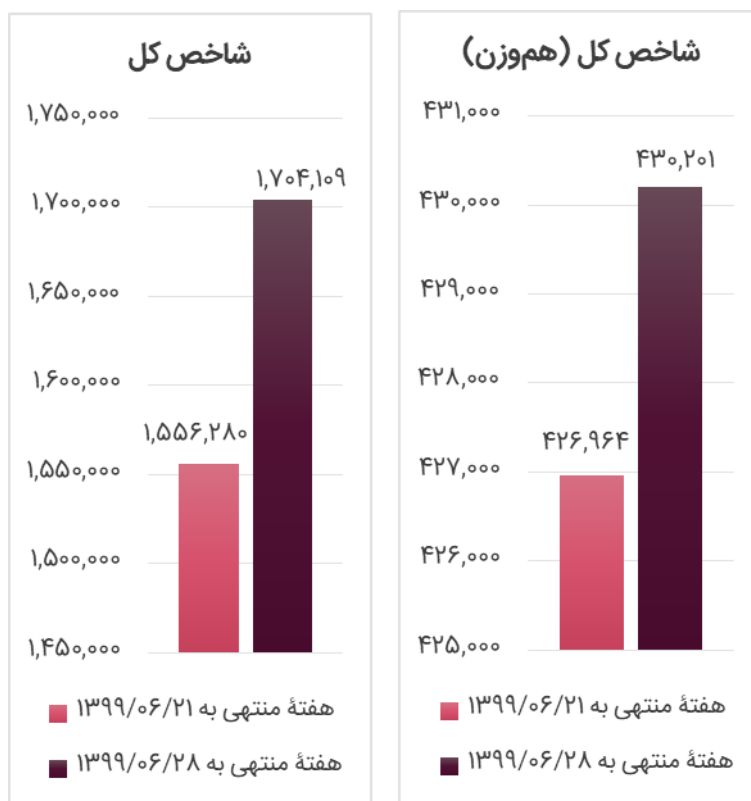
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	عنوان
۹/۵%	۶۳,۹۰۶	۵۸,۲۶۰	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
	۱,۷۰۴,۱۰۹	۱,۵۵۶,۲۸۰	شاخص کل
	۴۴۶,۹۳۶	۴۰۸,۱۷۶	شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)
۰/۷۵%	۴۳۰,۲۰۱	۴۲۶,۹۶۴	شاخص کل (هموزن)
	۲۸۱,۹۸۷	۲۷۹,۸۹۷	شاخص قیمت (هموزن)

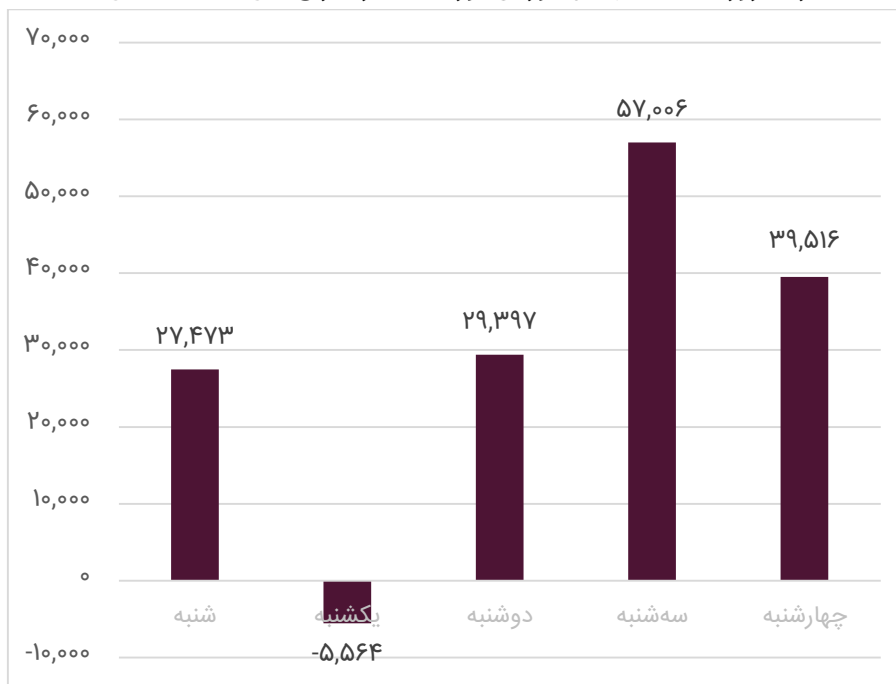
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن



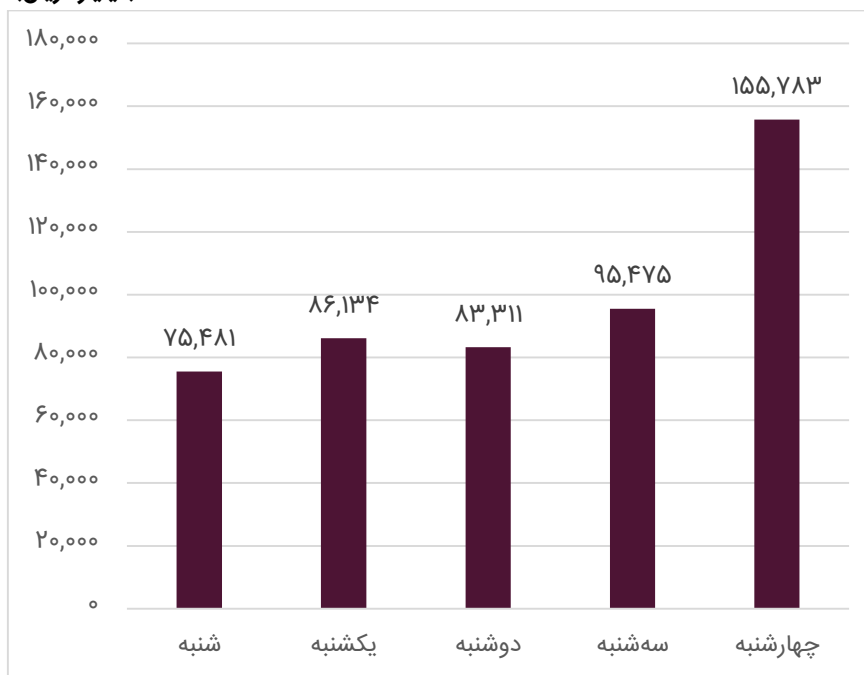
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۲۷,۴۷۳	۱/۷۶%	۱,۰۳۶,۵۱۵	۵,۴۲۴	۷۵,۴۸۱
یکشنبه	-۵,۵۶۴	-۰/۳۵%	۱,۰۴۱,۷۵۵	۸,۶۳۴	۸۶,۱۳۴
دوشنبه	۲۹,۳۹۷	۱/۸۶%	۱,۱۹۶,۸۹۰	۷,۲۸۸	۸۳,۳۱۱
سه شنبه	۵۷,۰۰۶	۳/۵۴%	۱,۱۷۵,۰۴۱	۸,۵۱۱	۹۵,۴۷۵
چهارشنبه	۳۹,۵۱۶	۲/۳۷%	۱,۹۵۰,۰۲۰	۱۶,۵۴۶	۱۵۵,۷۸۳

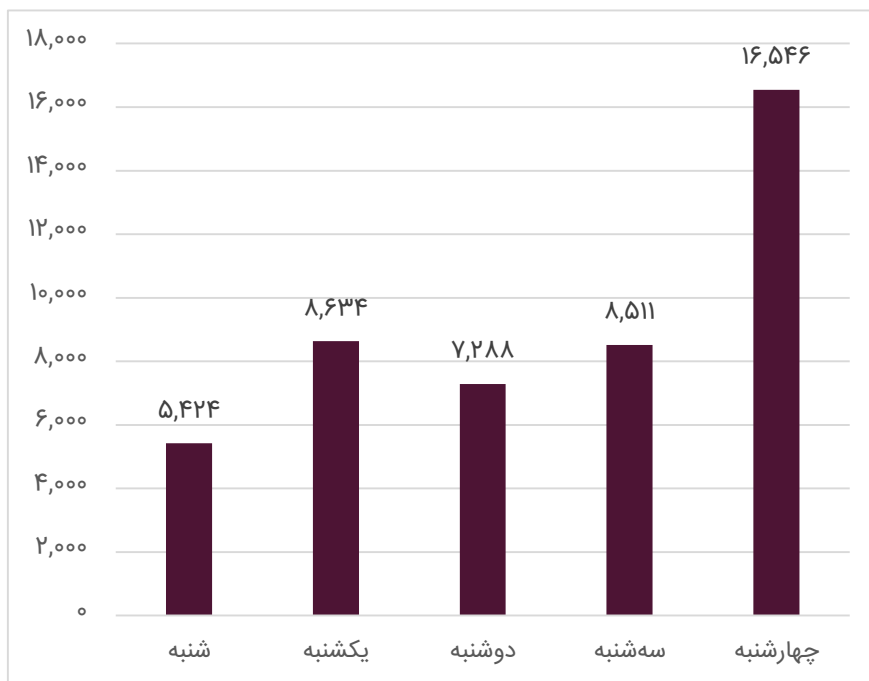
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ (میلیارد ریال)



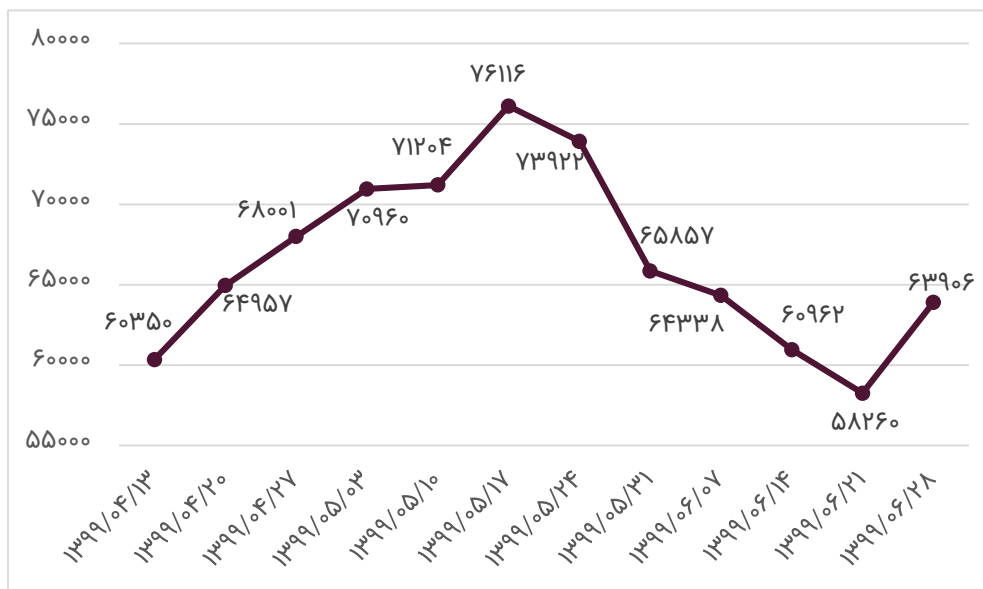
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۶۳,۹۰۶	۱۳۹۹/۰۶/۲۸

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ (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 ۷,۰۲۰ و ۳,۳۴۶ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۷,۰۲۰
۲	محصولات چرمی	۱	۳,۳۴۶
۳	محصولات چوبی	۱	۵۲۵
۴	استخراج سایر معادن	۱	۱۳۶
۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۱۰۵
۶	قند و شکر	۱۴	۸۲
۷	کاشی و سرامیک	۶	۷۸
۸	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۶۰
۹	اطلاعات و ارتباطات	۲	۵۸
۱۰	فنی و مهندسی	۲	۵۷
۱۱	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۵۱
۱۲	محصولات فلزی	۹	۵۰
۱۳	چاپ	۲	۴۹

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۱۴	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۴۶
۱۵	فرآورده‌های نفتی	۵۰	۴۴
۱۶	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۴۰
۱۷	کانی غیرفلزی	۱۵	۳۸
۱۸	استخراج زغال سنگ	۱	۳۸
۱۹	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۳۸
۲۰	بیمه و بازنشستگی	۶	۳۶
۲۱	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۳۴
۲۲	مخابرات	۲	۳۴
۲۳	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۳۲
۲۴	سیمان، آهک و گچ	۴۰	۳۲
۲۵	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۲۶	فلزات اساسی	۳۴	۳۰
۲۷	دستگاه‌های برقی	۱۱	۲۹
۲۸	زراعت و خدمات وابسته	۵	۲۸
۲۹	رایانه	۹	۲۵
۳۰	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۲۴
۳۱	شیمیایی	۴۵	۲۴
۳۲	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۲۴
۳۳	محصولات کاغذی	۳	۲۱
۳۴	استخراج کانه‌های فلزی	۱۶	۲۰
۳۵	دارویی	۳۱	۲۰
۳۶	عرضه برق، گاز، بخار و آب‌گرم	۱۵	۱۹
۳۷	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۵
۳۸	خرده‌فروشی	۱	۱۴
۳۹	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۵	۱
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۷
۴۱	منسوجات	۱۵	-۳۵۲

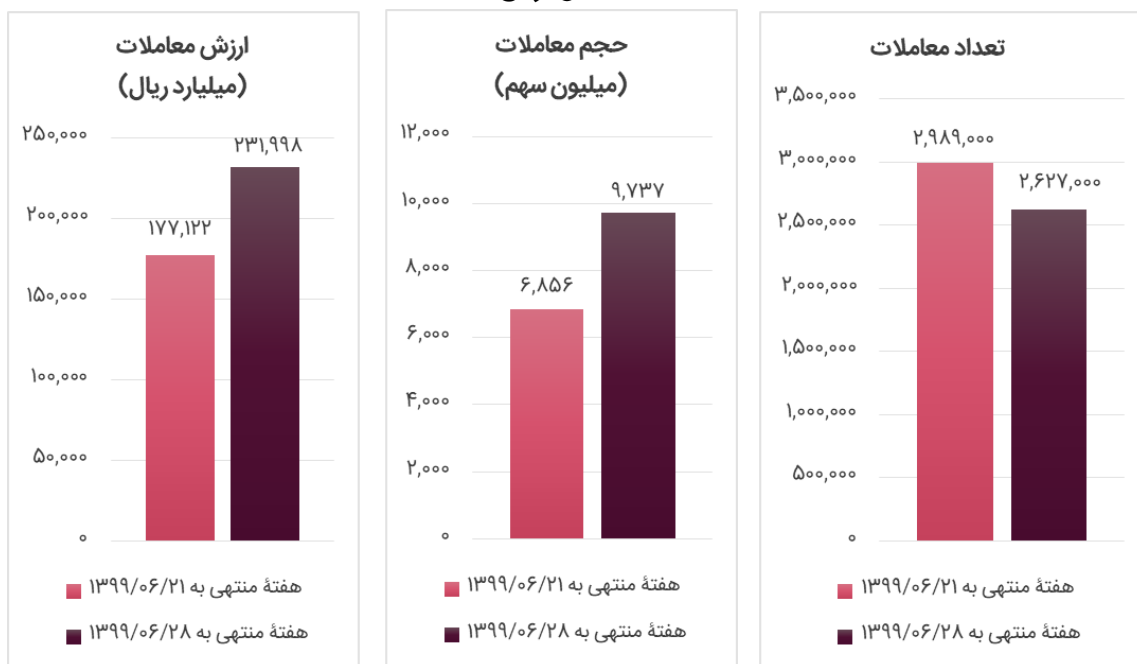
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ طی ۵ روز کاری، با ۱,۴۳۱ واحد افزایش، از ۱۶,۴۹۰ به عدد ۱۷,۹۲۱ رسید. حجم معاملات ۱,۹۴۷ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۴۲ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۳۰ درصد افزایش و ۱۲ درصد کاهش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۵		روزهای فعالیت
۳۰/۹۸%	۴۶,۴۰۰	۲۳۱,۹۹۸	۳۵,۴۲۴	۱۷۷,۱۲۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۴۲/۰۱%	۱,۹۴۷	۹,۷۳۷	۱,۳۷۱	۶,۸۵۶	حجم معاملات (میلیون سهم)
-۱۲/۱۱%	۵۲۵,۴۰۰	۲,۶۲۷,۰۰۰	۵۹۷,۸۰۰	۲,۹۸۹,۰۰۰	تعداد معاملات

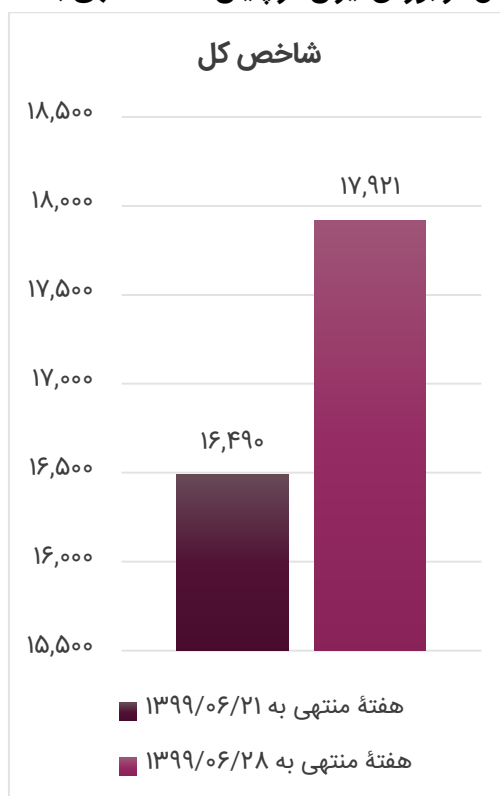
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۰,۷۴۴	۱۱,۷۰۷	۸/۹۶%
شاخص کل	۱۶,۴۹۰	۱۷,۹۲۱	۸/۶۷%

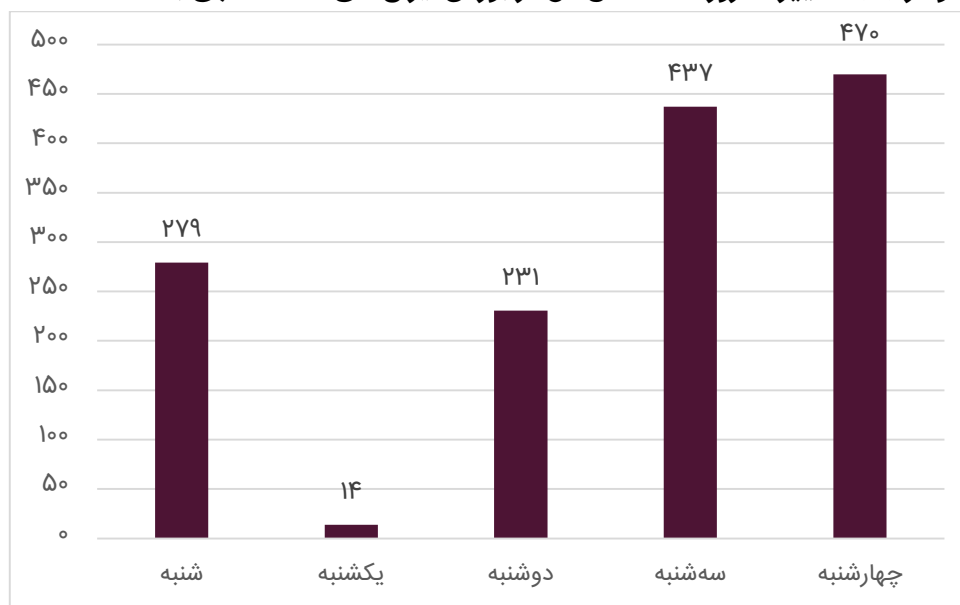
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن



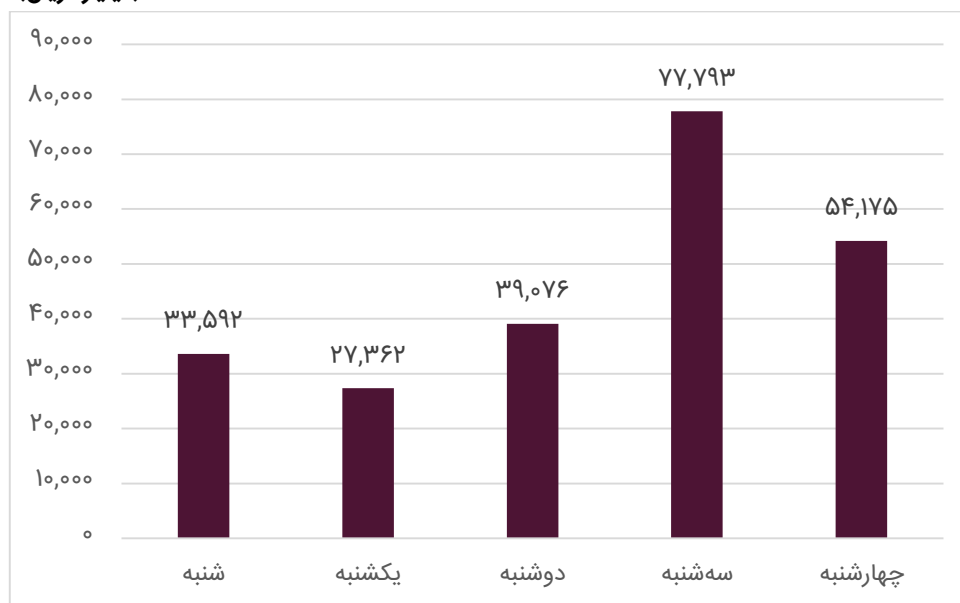
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۲۷۹	۱/۶۹%	۴۸۷,۲۲۱	۱,۷۳۴	۳۳,۵۹۲
یکشنبه	۱۴	۰/۰۸%	۳۳۳,۴۲۸	۱,۴۴۷	۲۷,۳۶۲
دوشنبه	۲۳۱	۱/۳۷%	۵۱۶,۵۶۹	۱,۷۳۰	۳۹,۰۷۶
سه شنبه	۴۳۷	۲/۵۶%	۵۶۰,۶۱۲	۲,۳۸۶	۷۷,۷۹۳
چهارشنبه	۴۷۰	۲/۶۹%	۷۲۹,۱۷۰	۲,۴۴۱	۵۴,۱۷۵

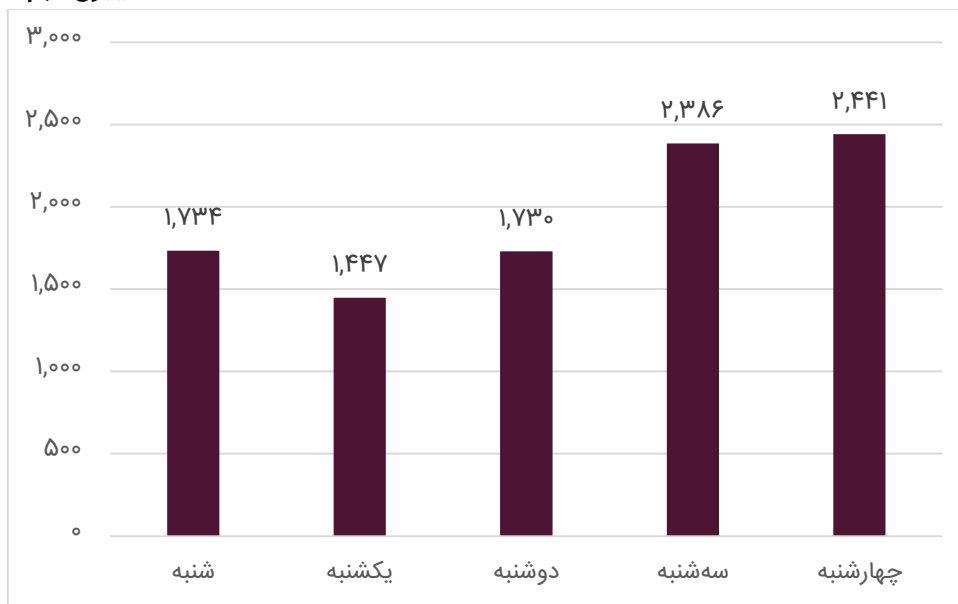
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸



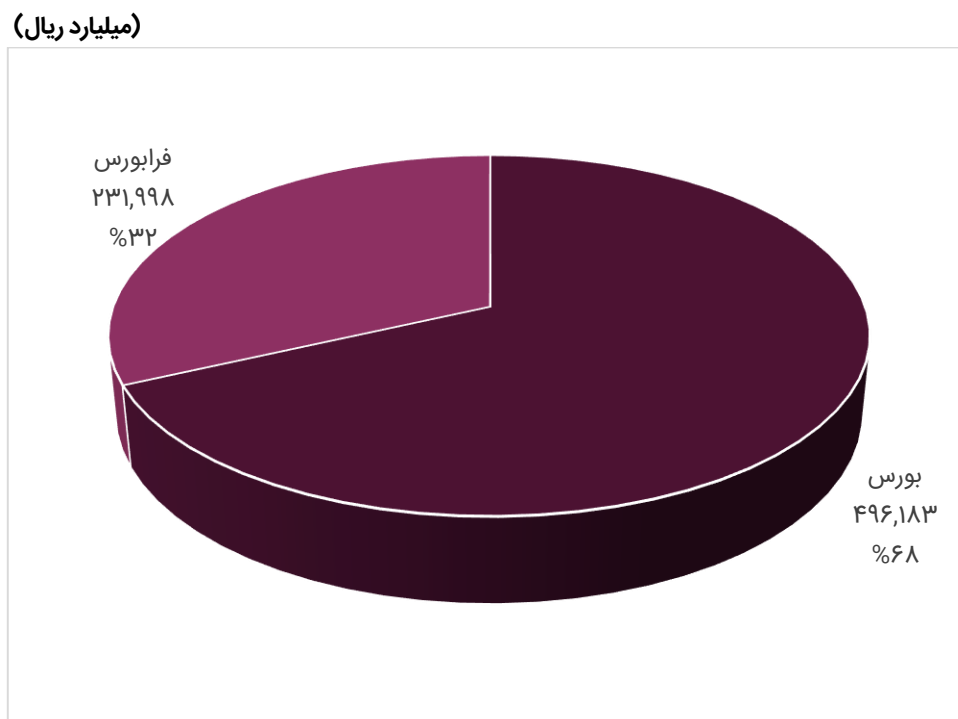
نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ (میلیارد ریال)



نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸



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 «کانی‌غیرفلزی» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۲,۶۹۰ و ۳۸۴ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۶۹۰
۲	کانی غیرفلزی	۱۸	۳۸۴
۳	هتل و رستوران	۹	۲۵۱
۴	محصولات فلزی	۸	۲۰۴
۵	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۳۰
۶	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۳۰
۷	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۱۰
۸	سایر حمل و نقل	۲	۹۹
۹	رایانه	۷	۷۹
۱۰	سیمان، آهک و گچ	۱۲	۷۷
۱۱	قند و شکر	۸	۷۱
۱۲	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۶
۱۳	استخراج زغال سنگ	۳	۵۴
۱۴	فلزات اساسی	۲۴	۵۴
۱۵	خودرو و قطعات	۱۱	۵۲
۱۶	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۴۷
۱۷	فرآورده‌های نفتی	۹	۴۴
۱۸	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۳
۱۹	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۴۲
۲۰	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۴۰
۲۱	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۴۰
۲۲	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۷
۲۳	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۳۴
۲۴	فنی و مهندسی	۹	۳۳
۲۵	عمده‌فروشی	۳	۳۱
۲۶	دارویی	۱۶	۲۷
۲۷	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۶
۲۸	شیمیایی	۴۳	۲۴

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۲۹	پیمانکاری صنعتی	۵	۲۴
۳۰	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۵
۳۱	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۴	۱۳
۳۲	منسوجات	۶	۱۲
۳۳	خرده‌فروشی	۲	۹
۳۴	تجارت عمده و خرده‌فروشی وسائط نقلیه‌موتور	۱	۳
۳۵	محصولات چوبی	۴	۰
۳۶	محصولات کاغذی	۴	۰
۳۷	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۵	-۱۳
۳۸	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۲۱
۳۹	کاشی و سرامیک	۱۱	-۲۹
۴۰	وسایل ارتباطی	۲	-۱۲۸
۴۱	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	-۱۵۱
۴۲	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	-۳۸۸

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 هر یک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸، 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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۵۱۳	۶۸۳	۱,۲۴۲	۶,۹۱۸
یکشنبه	۶۷۸	۸۰۶	۹,۹۰۷	۱۲
دوشنبه	۷۸۶	۶۷۲	۱۹,۶۳۱	۱,۳۲۵
سه‌شنبه	۷۷۰	۱,۰۹۰	۲۰,۴۱۶	۳,۲۵۹
چهارشنبه	۶۲۴	۹۳۶	۱۰,۶۸۸	۱,۶۷۸
پنجشنبه	۰	۵۳۹	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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۳,۴۶۲	۴,۷۲۶	۳۶/۵۱%
بازار مالی بورس کالا	۳,۸۵۸	۳,۳۷۱	-۱۲/۶۱%
فیزیکی بورس کالا	۱,۶۶۰,۳۰۶	۸۸۸,۶۹۷	-۴۶/۴۷%
فیزیکی بورس انرژی	۶,۵۰۴	۱۳,۱۹۲	۱۲/۸۲%

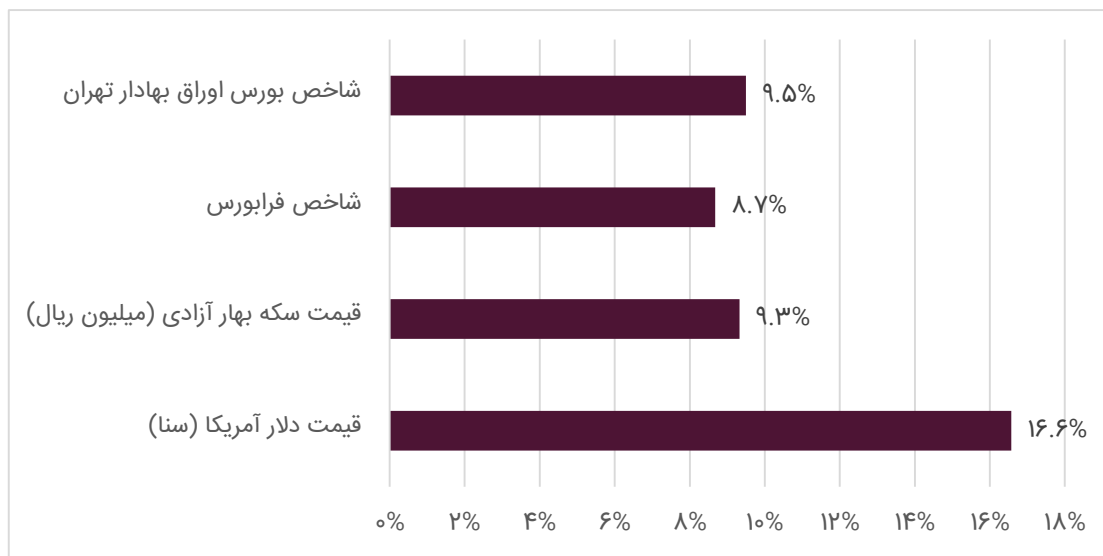
۱-۴- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸، بورس اوراق بهادار تهران با افزایش بیش از ۹ درصدی، بازدهی مطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۸ درصدی، عملکرد مطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۹ درصد افزایش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، افزایش بیش از ۱۶ درصدی را ثبت نمود.

جدول (۱۲): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۵۵۶,۲۸۰	۱,۷۰۴,۱۰۹	۹/۴۹%
شاخص فرابورس	۱۶,۴۹۰	۱۷,۹۲۱	۸/۶۷%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۱۲/۵	۱۲۳	۹/۳۲%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۲۷,۱۹۸	۲۶۴,۸۴۵	۱۶/۵۷%

نمودار (۱۳): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ 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 ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

(ارقام برحسب دلار)

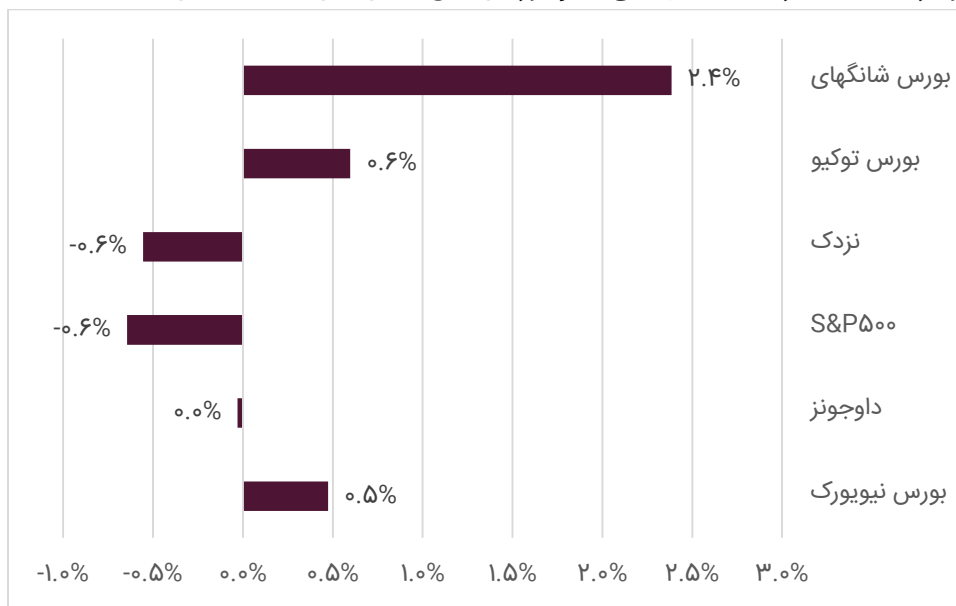
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۹۴۲	۱,۹۵۱	۰/۴۵%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۳۷,۷۰	۴۱,۰۵	۸/۸۸%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۳۹,۸۳	۴۳,۱۵	۸/۳۳%

در جدول (۱۴)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بوری شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بوری بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۱	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۲,۷۷۳	۱۲,۸۳۴	۰/۴۷%
داوجونز	۲۷,۶۶۶	۲۷,۶۵۷	-۰/۰۲%
S&P ۵۰۰	۳,۳۴۱	۳,۳۱۹	-۰/۶۴%
نزدک	۱۰,۸۵۴	۱۰,۷۹۳	-۰/۵۵%
بورس توکیو	۱,۶۳۷	۱,۶۴۶	۰/۵۹%
بورس شانگهای	۳,۲۶۰	۳,۳۳۸	۲/۳۸%

نمودار (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۸



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 ۸/۴- درصد، صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت گنجینه امید ایرانیان با ۹/۵ درصد و صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه سکه طلای زرافشان امید ایرانیان با ۱۲/۵ 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 **-۶/۰%**
(متهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

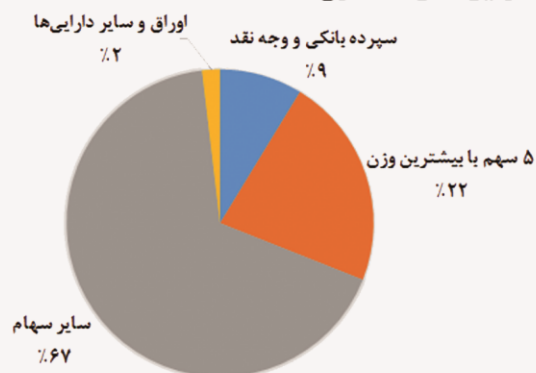
بازده ماه گذشته واحد بذر
-۸/۴%
(متهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

بازده سالانه
واحد بذر **۳۷۱/۷%**
(متهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

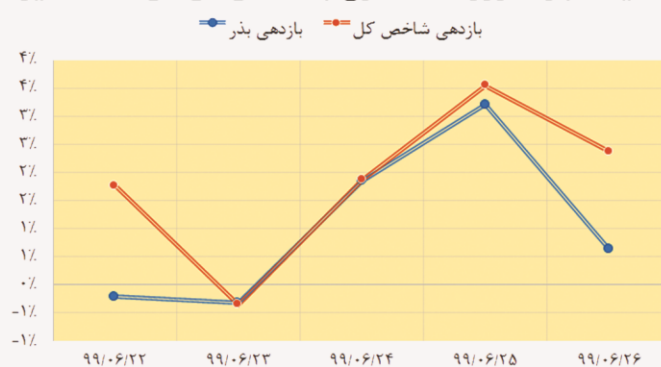
مزیت‌های صندوق:

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

ترکیب دارایی‌های صندوق



مقایسه بازده روزانه صندوق با شاخص کل طی هفته اخیر



۱۳۹۹/۰۶/۲۶

تاریخ محاسبه NAV صندوق

۴۷,۳۷۶,۴۰۰

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری

۶۵۲,۶۲۳,۶۰۰

تعداد واحدهای باقی مانده

۵,۸۸۳,۸۵۲,۵۱۳,۷۱۲

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)

۱۲۴,۹۶۹

قیمت صدور هر واحد (ریال)

۱۲۴,۱۹۴

قیمت ابطال هر واحد (ریال)

۱۲۴,۱۹۴

قیمت آماري 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 به طور مستمر به بررسی بازار و شناسایی فرصت‌های سرمایه‌گذاری مناسب اقدام می‌نمایند. بازارگردان این صندوق، شرکت تامین سرمایه امید (سهامی عام) است.



۰۲۱-۵۴۹۰۶



۰۲۱-۸۸۵۱۵۶۹۵



www.bazreamidfund.ir

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

بازده ماه گذشته واحد گنجینه

۹/۵%

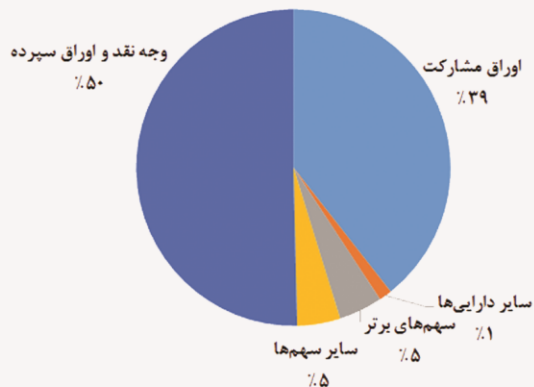
(سالانه شده منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

بازده سالانه
واحد گنجینه
(منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۱۵)
۳۵/۳%

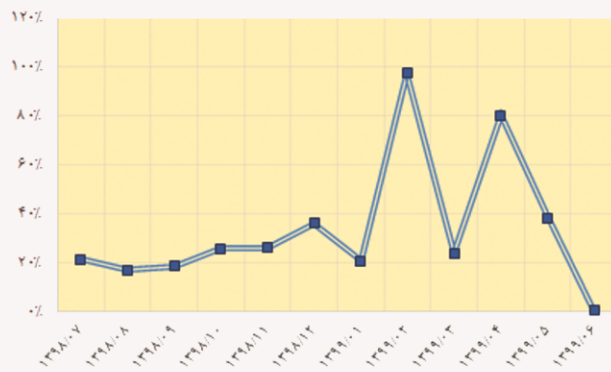
مزیت‌های صندوق:

- 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



۱۳۹۹/۰۶/۲۶	تاریخ محاسبه NAV صندوق
۳۳,۳۹۶,۳۵۳	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱۶,۶۰۳,۶۴۷	تعداد واحدهای باقی مانده
۳۸,۱۵۴,۴۴۶,۸۰۸,۵۱۸	کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)
۱,۱۴۳,۲۰۶	قیمت صدور هر واحد (ریال)
۱,۱۴۲,۴۷۳	قیمت ابطال هر واحد (ریال)
۱,۱۴۶,۴۷۱	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	مدیر ثبت
تأمین سرمایه امید	ضامن نقدشوندگی
۱۳۹۸/۰۳/۳۰	تاریخ آغاز فعالیت
با درآمد ثابت	نوع صندوق

صندوق گنجینه امید ایرانیان

صندوق 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 ملاحظه 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 نقد شوندگی صندوق نیز شرکت تأمین سرمایه امید به 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
(متممی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

۱۲/۶%

بازده ماه گذشته واحد زر

۱۲/۵%

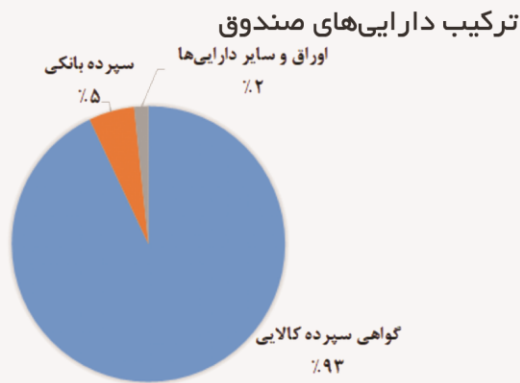
(متممی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

۱۶۸/۶%

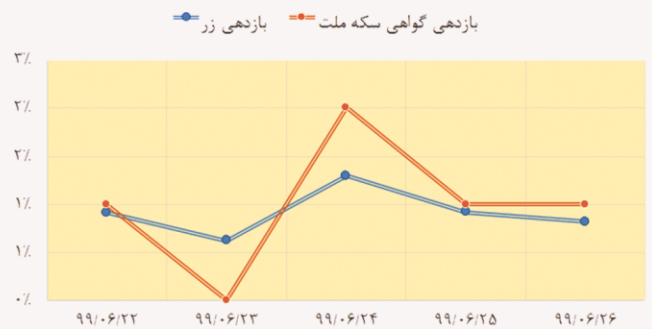
بازده سالانه
واحد زر
(متممی به ۱۳۹۹/۰۶/۲۶)

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 کار مزد معاملاتی کم	امکان سرمایه گذاری با مبالغ کم	وجود بازارگردان و نقدشوندگی بالا



مقایسه بازده روزانه صندوق با بازدهی شاخص سکه طی هفته گذشته



۱۳۹۹/۰۶/۲۶	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
۵,۴۵۵,۰۹۴,۸۳۰,۲۰۱	کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال)	احسان عسکری فیروزجانی، عبدالله دریابر، احسان طیبی	مدیران سرمایه گذاری
۵۴,۶۰۵	قیمت صدور هر واحد (ریال)	تأمین سرمایه امید	بازارگردان
۵۴,۵۶۵	قیمت ابطال هر واحد (ریال)	۱۳۹۶/۰۸/۱۷	تاریخ آغاز فعالیت
۵۴,۵۶۵	قیمت آماری هر واحد (ریال)	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله (ETF)	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، منکوک، 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.



۰۲۱-۵۴۹۰۰۶



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>	