

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۲۵

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 ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ 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.

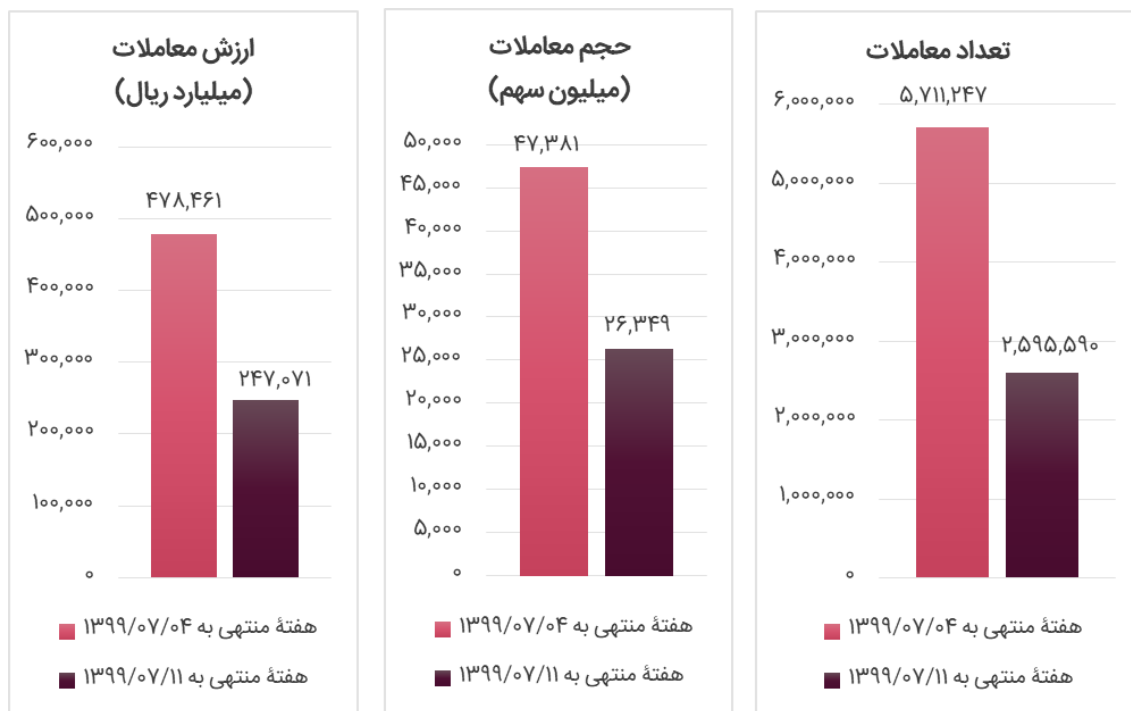
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ طی ۵ روز کاری، با ۱۰۸,۱۵۶ واحد کاهش، از ۱,۶۱۱,۵۸۳ به ۱,۵۰۳,۴۲۷ رسید. حجم معاملات ۵,۲۷۰ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش بیش از ۴۴ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۴۸ و ۵۴ درصد کاهش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روز شنبه، افزایش ۳,۹۴۹ واحدی، در روزهای یکشنبه، دوشنبه و سه‌شنبه به ترتیب کاهش ۴۴,۶۴۳، ۵۴,۹۵۸، ۲۲,۹۹۰ واحدی و در روز چهارشنبه افزایش ۱۰,۴۸۷ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵	۵	۵	۵
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۷۸,۴۶۱	۹۵,۶۹۲	۲۴۷,۰۷۱	۴۹,۴۱۴
حجم معاملات (میلیون سهم)	۴۷,۳۸۱	۹,۴۷۶	۲۶,۳۴۹	۵,۲۷۰
تعداد معاملات	۵,۷۱۱,۲۴۷	۱,۱۴۲,۲۴۹	۲,۵۹۵,۵۹۰	۵۱۹,۱۱۸
				میزان رشد
				۴۸/۳۶%
				۴۴/۳۸%
				۵۴/۵۵%

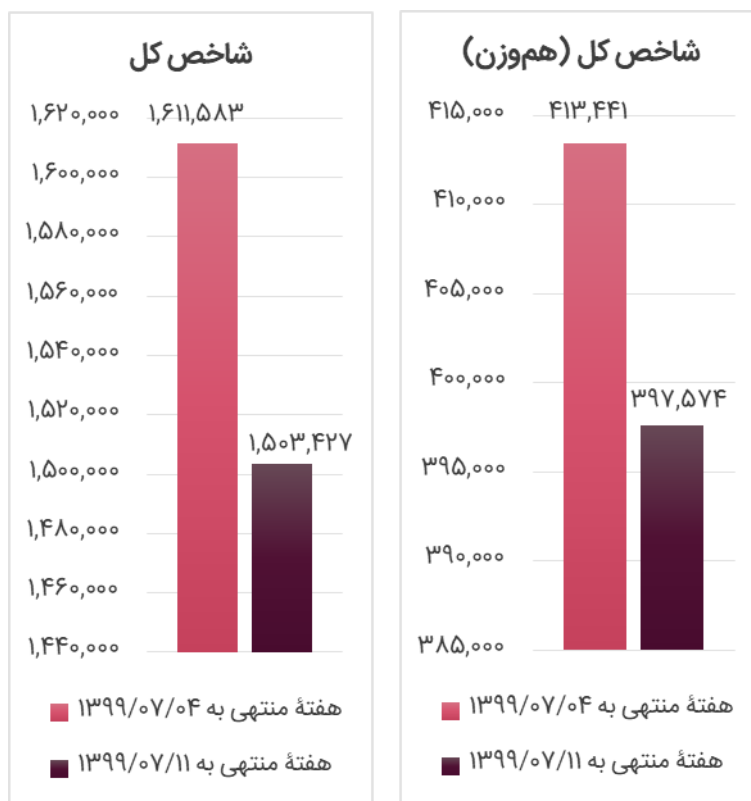
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۶۰,۲۴۷	۵۶,۴۶۳	-۶/۷%
شاخص کل	۱,۶۱۱,۵۸۳	۱,۵۰۳,۴۲۷	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۴۲۲,۶۰۴	۳۹۴,۲۴۳	
شاخص کل (هموزن)	۴۱۳,۴۴۱	۳۹۷,۵۷۴	-۳/۸۳%
شاخص قیمت (هموزن)	۲۷۰,۹۲۱	۲۶۰,۵۲۴	

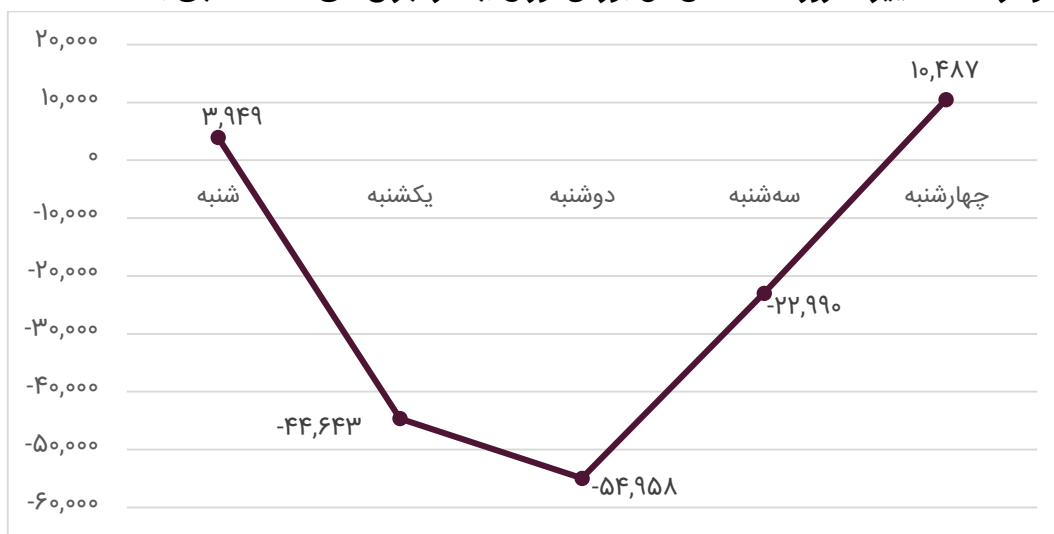
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن



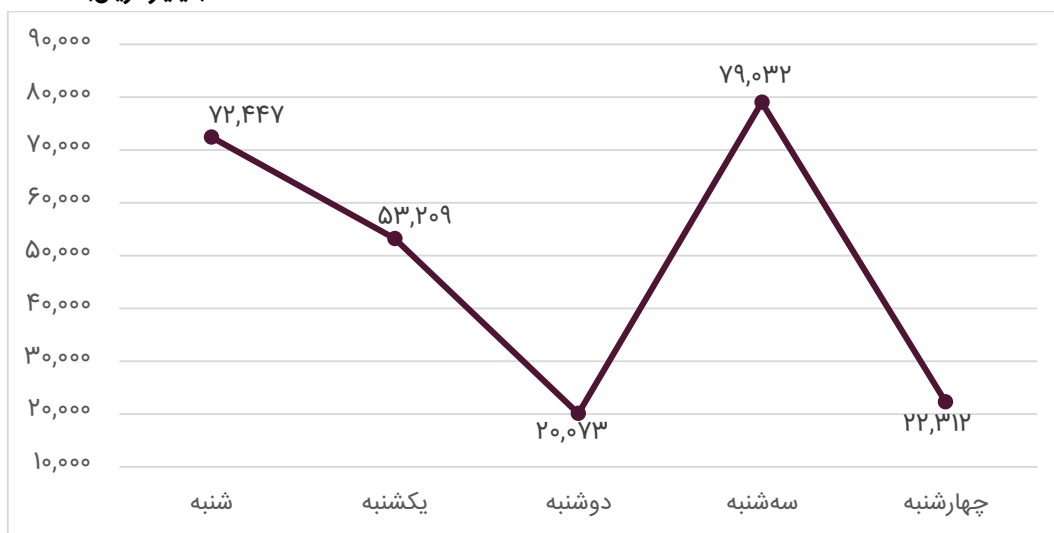
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۳,۹۴۹	۰/۲۴%	۱,۰۵۸,۴۱۵	۶,۶۹۲	۷۲,۴۴۷
یکشنبه	-۴۴,۶۴۳	-۲/۷۶%	۴۵۱,۰۱۴	۶,۴۹۰	۵۳,۲۰۹
دوشنبه	-۵۴,۹۵۸	-۳/۴۹%	۱۷۱,۰۲۵	۱,۴۶۷	۲۰,۰۷۳
سه شنبه	-۲۲,۹۹۰	-۱/۵۱%	۹۱۲,۰۶۳	۹,۱۶۶	۷۹,۰۳۲
چهارشنبه	۱۰,۴۸۷	۰/۷۰%	۳,۰۷۳	۲,۵۳۴	۲۲,۳۱۲

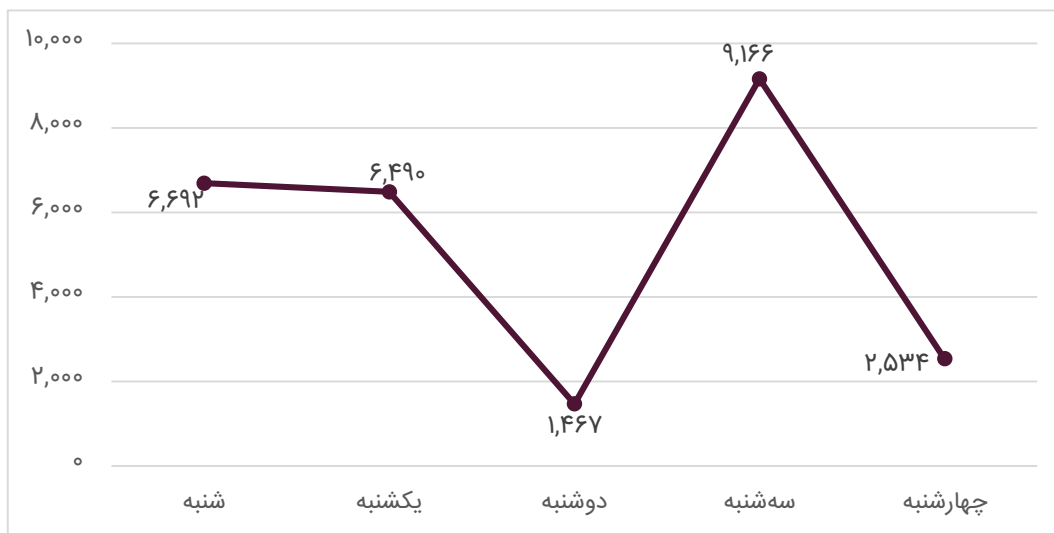
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ (میلیارد ریال)



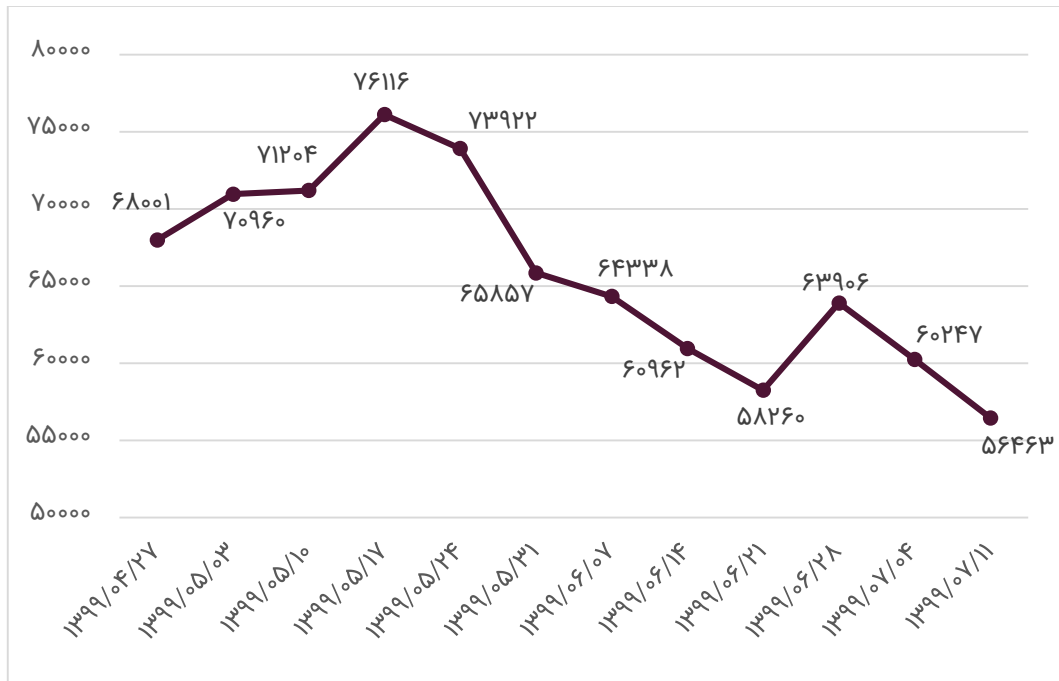
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۶۰,۲۴۷	۱۳۹۹/۰۷/۰۴
۵۶,۴۶۳	۱۳۹۹/۰۷/۱۱

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ (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 ۶،۸۴۱ و ۲،۹۲۹ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۶،۸۴۱
۲	محصولات چرمی	۱	۲،۹۲۹
۳	محصولات چوبی	۱	۵۱۲
۴	استخراج سایر معادن	۱	۱۲۷
۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۱۰۳
۶	کاشی و سرامیک	۶	۸۰
۷	قند و شکر	۱۴	۶۷
۸	اطلاعات و ارتباطات	۲	۵۸
۹	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۵۶
۱۰	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۴۹
۱۱	چاپ	۲	۴۸

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۱۲	فنی و مهندسی	۲	۴۸
۱۳	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۴۵
۱۴	محصولات فلزی	۹	۴۵
۱۵	استخراج زغال سنگ	۱	۳۷
۱۶	ماشین آلات و تجهیزات	۲۰	۳۷
۱۷	بیمه و بازنشستگی	۶	۳۲
۱۸	فرآورده های نفتی	۵۰	۳۲
۱۹	چندرشته ای صنعتی	۶	۳۱
۲۰	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۲۱	سیمان، آهک و گچ	۴۰	۲۹
۲۲	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۲۸
۲۳	دستگاه های برقی	۱۱	۲۶
۲۴	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۵
۲۵	فلزات اساسی	۳۴	۲۵
۲۶	کانی غیر فلزی	۱۵	۲۴
۲۷	مخابرات	۲	۲۴
۲۸	شیمیایی	۴۵	۲۳
۲۹	انبوه سازی املاک و مستغلات	۱۵	۲۲
۳۰	رایانه	۹	۲۱
۳۱	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۲۱
۳۲	واسطه گیری های مالی و پولی	۹	۲۰
۳۳	استخراج کانه های فلزی	۱۶	۱۹
۳۴	دارویی	۳۱	۱۸
۳۵	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۷
۳۶	محصولات کاغذی	۳	۱۶
۳۷	خرده فروشی	۱	۱۵
۳۸	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۱
۳۹	سرمایه گذاری ها	۴۵	۰
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۰
۴۱	منسوجات	۱۵	-۳۴۲

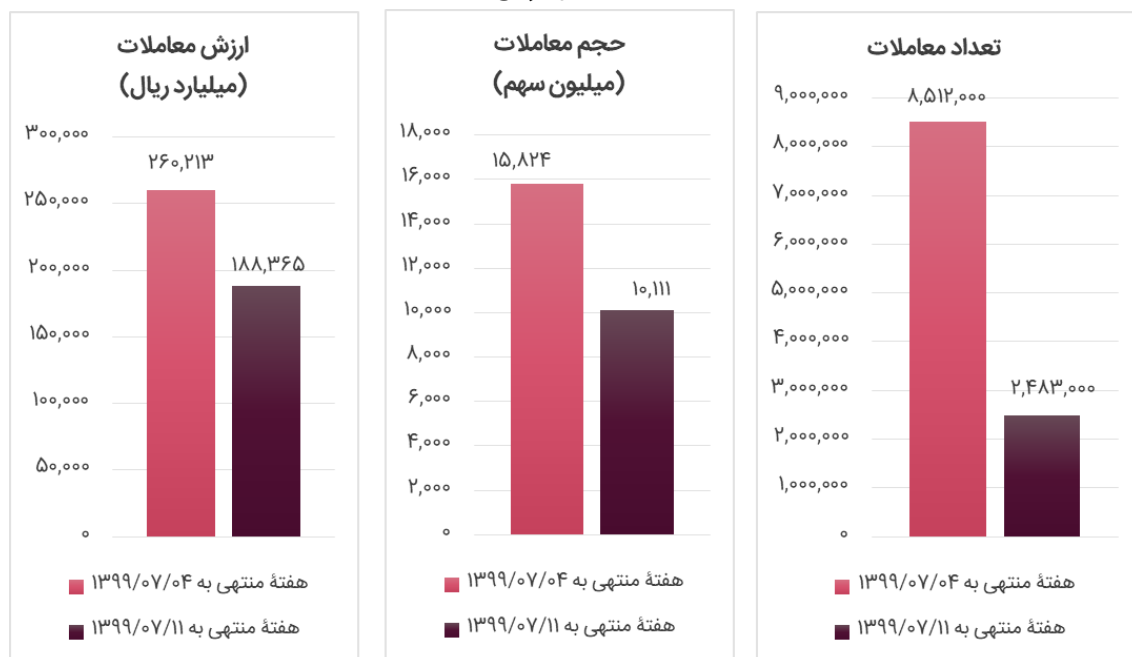
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ طی ۵ روز کاری، با ۳۵۹ واحد کاهش، از ۱۸,۰۳۵ به عدد ۱۷,۶۷۶ رسید. حجم معاملات ۲,۰۲۲ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش ۳۶ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۲۷ و ۷۰ درصد کاهش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۵		روزهای فعالیت
-۲۷/۶۱%	۳۷,۶۷۳	۱۸۸,۳۶۵	۵۲,۰۴۳	۲۶۰,۲۱۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
-۳۶/۱۰%	۲,۰۲۲	۱۰,۱۱۱	۳,۱۶۵	۱۵,۸۲۴	حجم معاملات (میلیون سهم)
-۷۰/۸۲%	۴۹۶,۶۰۰	۲,۴۸۳,۰۰۰	۱,۷۰۲,۴۰۰	۸,۵۱۲,۰۰۰	تعداد معاملات

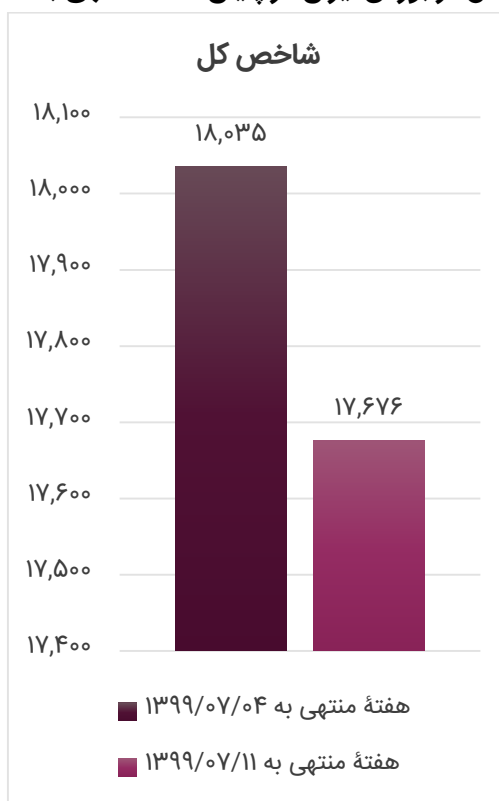
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۱,۷۸۳	۱۱,۸۴۳	۰/۵۰%
شاخص کل	۱۸,۰۳۵	۱۷,۶۷۶	-۱/۹۹%

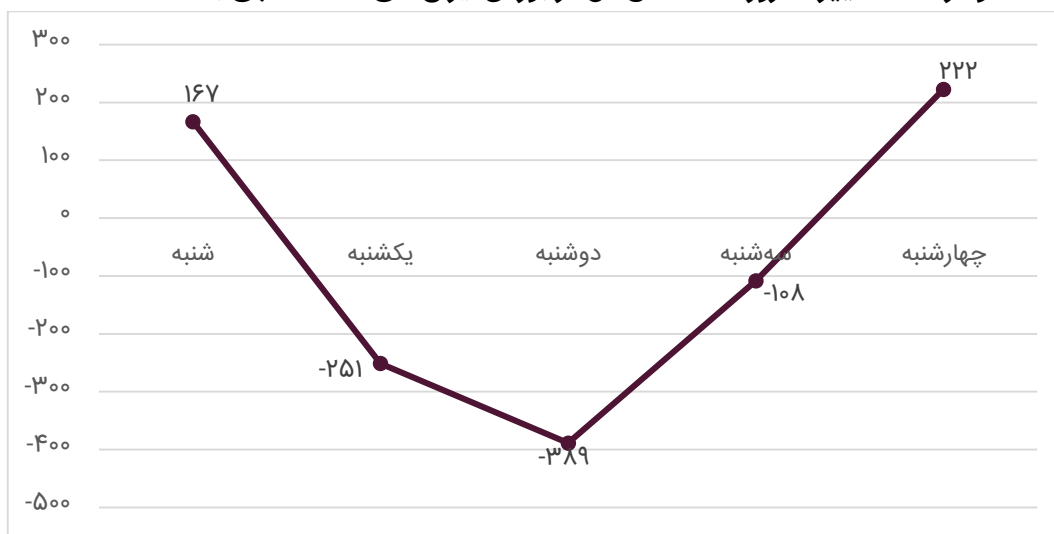
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن



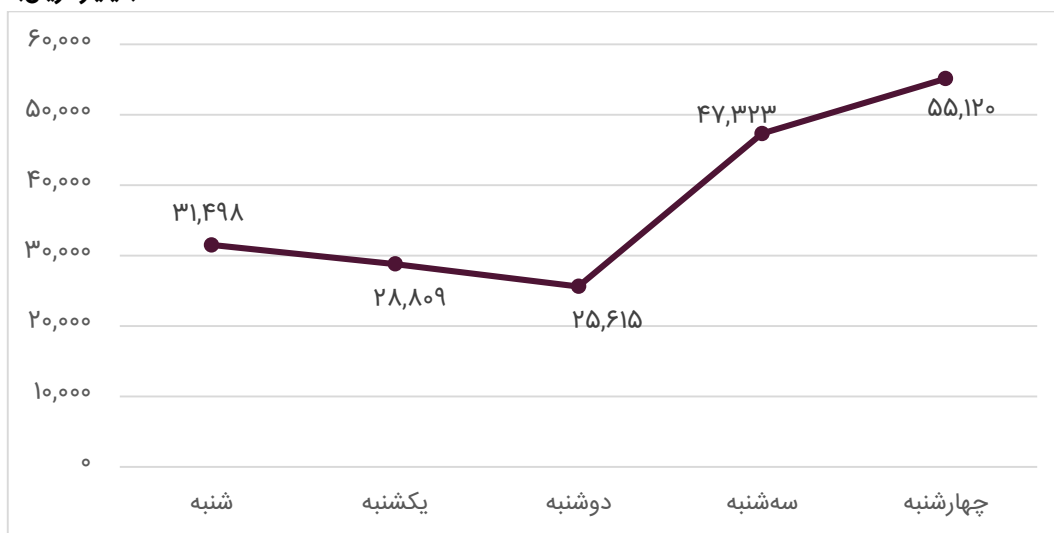
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۱۶۷	۰/۹۲%	۳۷۶,۷۵۴	۱,۴۷۴	۳۱,۴۹۸
یکشنبه	-۲۵۱	-۱/۳۸%	۳۳۹,۹۲۸	۱,۲۴۷	۲۸,۸۰۹
دوشنبه	-۳۸۹	-۲/۱۶%	۵۲۹,۲۵۵	۱,۲۷۴	۲۵,۶۱۵
سه شنبه	-۱۰۸	-۰/۶۱%	۷۲۵,۱۹۰	۲,۲۷۶	۴۷,۳۲۳
چهارشنبه	۲۲۲	۱/۲۷%	۵۱۱,۸۷۳	۳,۸۴۰	۵۵,۱۲۰

نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

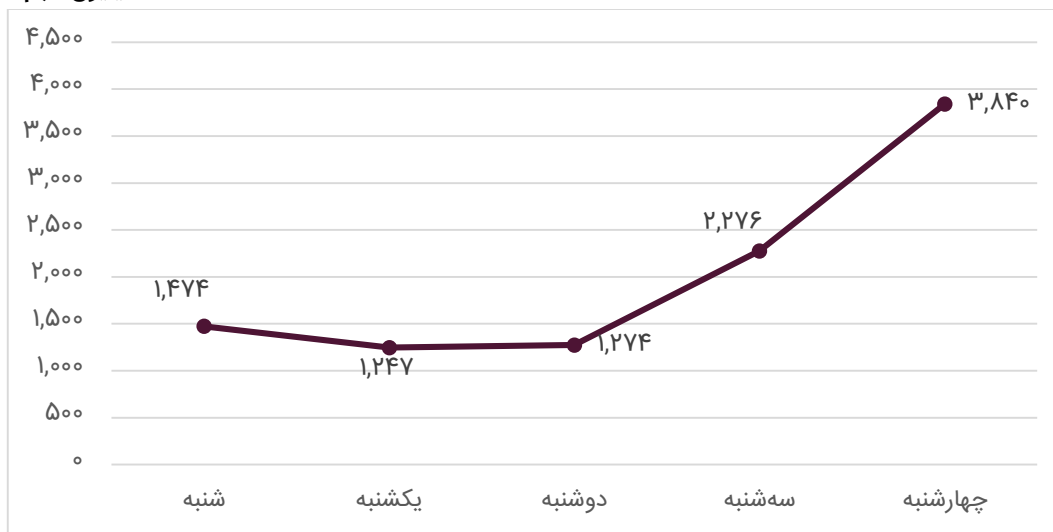


نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ (میلیارد ریال)



نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

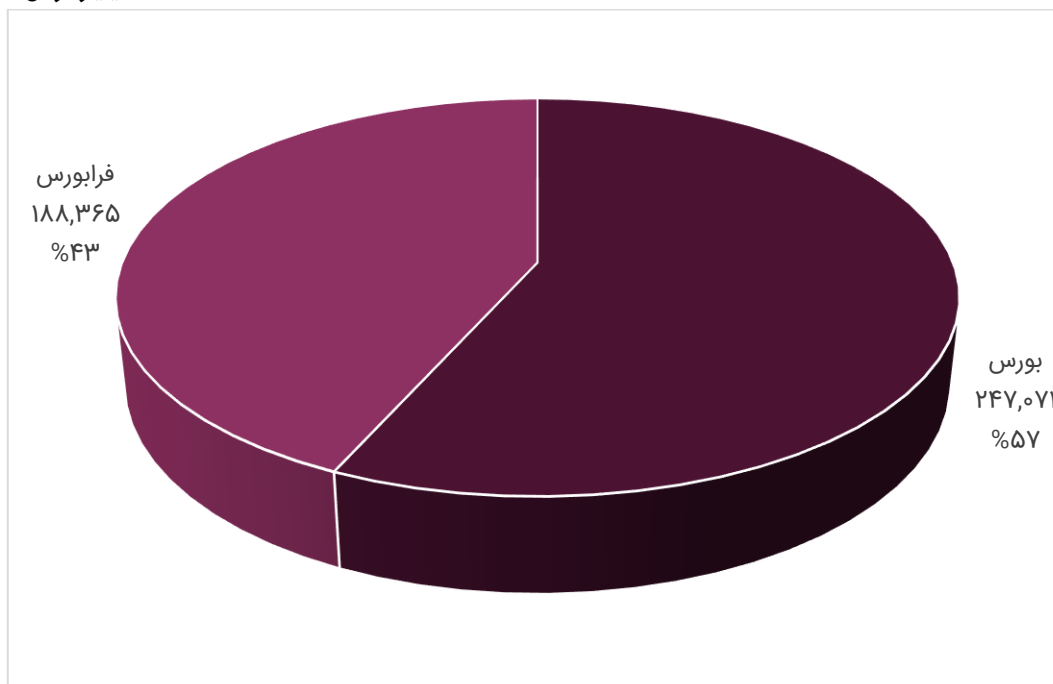
(میلیون سهم)



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

۱۳۹۹/۰۷/۱۱

(میلیارد ریال)



در جدول (۹) نسبت قیمت به درآمد (P/E) صنایع فعال در فرابورس، به همراه تعداد شرکت‌های هر یک از صنایع قابل مشاهده است. صنایع «دستگاه‌های برقی» و «کانی غیرفلزی» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۲,۶۴۶ و ۴۲۴ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۶۴۶
۲	کانی غیرفلزی	۱۸	۴۲۴
۳	هتل و رستوران	۹	۲۴۵
۴	محصولات فلزی	۸	۲۱۲
۵	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۶۰
۶	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۲۴
۷	عرضه برق، گاز، بخار و آب‌گرم	۱۹	۱۱۹
۸	سایر حمل و نقل	۲	۹۸
۹	رایانه	۷	۷۷
۱۰	قند و شکر	۸	۷۵
۱۱	سیمان، آهک و گچ	۱۲	۷۴
۱۲	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۵
۱۳	استخراج زغال‌سنگ	۳	۵۲
۱۴	فلزات اساسی	۲۴	۵۱
۱۵	خودرو و قطعات	۱۱	۵۰
۱۶	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۴۴
۱۷	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۴۲
۱۸	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۱
۱۹	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۳۹
۲۰	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۷
۲۱	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۷
۲۲	فرآورده‌های نفتی	۹	۳۶
۲۳	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۳۳
۲۴	فنی و مهندسی	۹	۳۱
۲۵	شیمیایی	۴۳	۲۵/۳
۲۶	دارویی	۱۶	۲۵/۲
۲۷	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۴/۷

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۲۸	پیمانکاری صنعتی	۵	۲۲
۲۹	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۴
۳۰	منسوجات	۶	۱۲
۳۱	عمده‌فروشی	۳	۱۱
۳۲	خرده‌فروشی	۲	۹
۳۳	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۴	۷
۳۴	تجارت عمده و خرده‌فروشی وسائط نقلیه موتور	۱	۳
۳۵	محصولات چوبی	۴	۰/۱
۳۶	محصولات کاغذی	۴	-۰/۴
۳۷	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۵	-۱۳
۳۸	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۲۰
۳۹	کاشی و سرامیک	۱۱	-۳۰
۴۰	وسایل ارتباطی	۲	-۱۲۵
۴۱	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	-۱۵۰
۴۲	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	-۳۸۸

۱-۳- بورس کالا و انرژی

در جدول (۱۰)، ارزش معاملات روزانه بازارهای فیزیکی بورس کالای ایران و بورس انرژی ایران، و همچنین ارزش معاملات بازار مشتقه و بازار مالی بورس کالای ایران مورد بررسی قرار می‌گیرد. لازم به ذکر است ارزش معاملات بازار مشتقه شامل آمار معاملات آتی و معاملات اختیار معامله است. همچنین در جدول (۱۱) مجموع کل ارزش معاملات هریک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱، 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 ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

(میلیارد ریال)

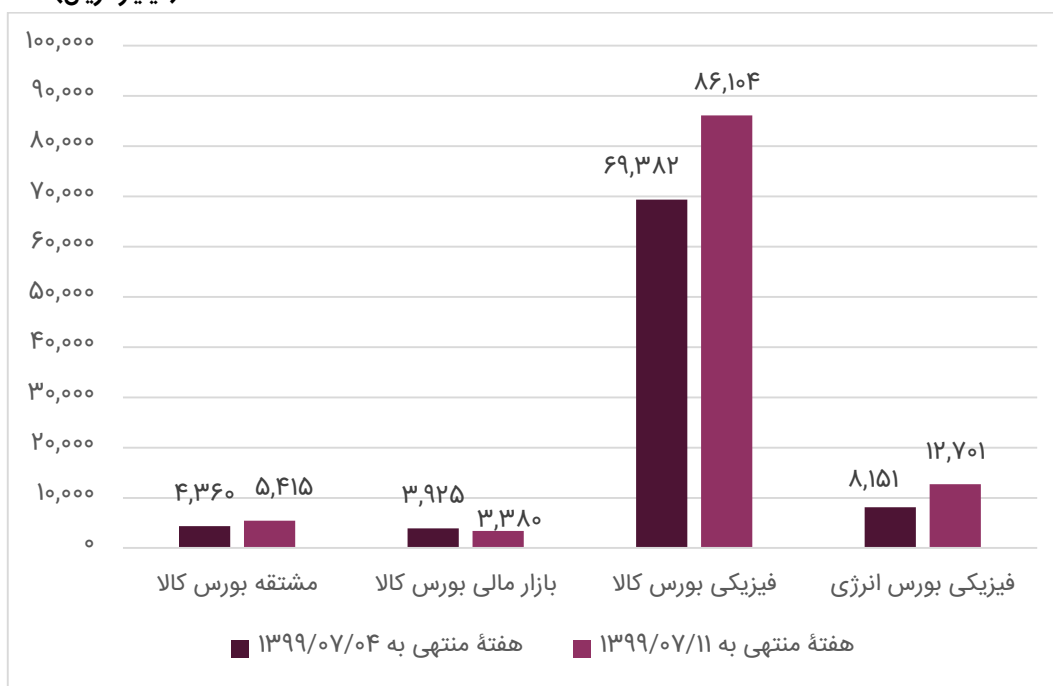
تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۷۰۰	۶۸۳	۱,۸۹۸	۶۶۷
یکشنبه	۴۱۵	۹۱۹	۱۴,۴۶۲	۷۲۱
دوشنبه	۵۹۳	۸۰۵	۲۱,۷۲۳	۶۳۴
سه‌شنبه	۶۰۱	۱,۲۱۲	۳۳,۸۱۶	۸,۸۹۱
چهارشنبه	۱,۰۷۰	۸۱۳	۱۴,۲۰۵	۱,۷۸۸
پنجشنبه	۰	۹۸۳	۰	۰

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 ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۴,۳۶۰	۵,۴۱۵	۲۴/۱۹%
بازار مالی بورس کالا	۳,۹۲۵	۳,۳۸۰	-۱۳/۸۸%
فیزیکی بورس کالا	۶۹,۳۸۲	۸۶,۱۰۴	۲۴/۱۰%
فیزیکی بورس انرژی	۸,۱۵۱	۱۲,۷۰۱	۵۵/۸۲%

نمودار (۱۳): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



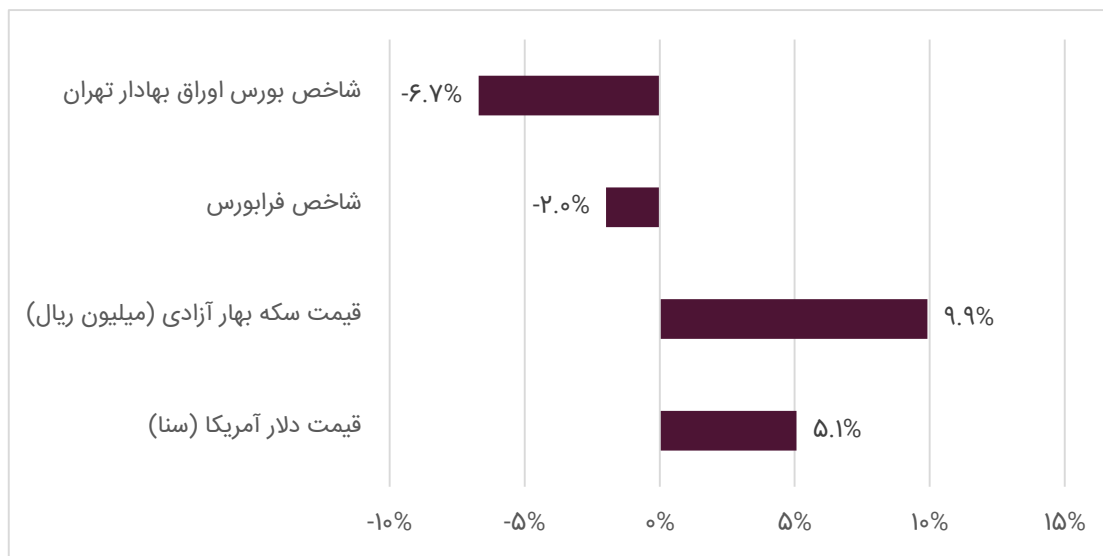
۱-۴ مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۶ درصدی، بازدهی نامطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی -۱ درصدی، عملکرد ضعیفی 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 ۵ 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 ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۶۱۱,۵۸۳	۱,۵۰۳,۴۲۷	-۶/۷۱%
شاخص فرابورس	۱۸,۰۳۵	۱۷,۶۷۶	-۱/۹۹%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۲۶	۱۳۸,۵	۹/۹۲%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۷۰,۲۳۹	۲۸۳,۹۱۹	۵/۰۶%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ 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 ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

(ارقام برحسب دلار)

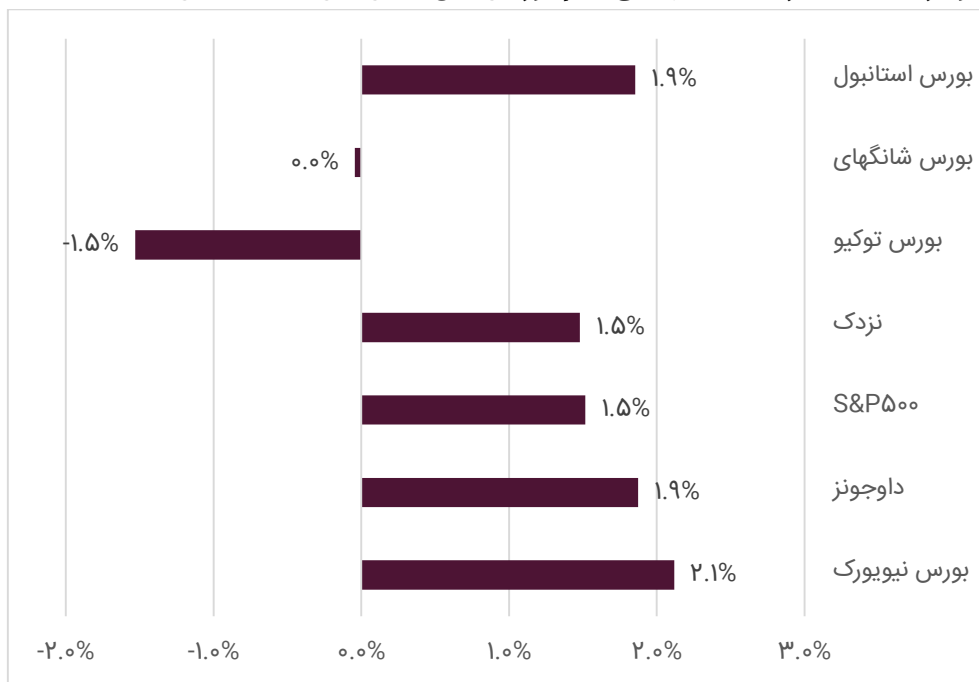
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۶۲	۱,۹۰۱	۲/۰۸%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۳۹,۷۵	۳۷,۲۹	-۶/۱۸%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۱,۹۲	۳۹,۲۷	-۶/۳۲%

در جدول (۱۴)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بورس شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس استانبول، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۰۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۲,۴۸۵	۱۲,۷۵۰	۲/۱۱%
داوجونز	۲۷,۱۷۴	۲۷,۶۸۳	۱/۸۷%
S&P ۵۰۰	۳,۲۹۸	۳,۳۴۸	۱/۵۱%
نزدک	۱۰,۹۱۴	۱۱,۰۷۵	۱/۴۷%
بورس توکیو	۱,۶۳۴	۱,۶۰۹	-۱/۵۳%
بورس شانگهای	۳,۲۱۹	۳,۲۱۸	-۰/۰۴%
بورس استانبول	۱,۱۲۴	۱,۱۴۵	۱/۸۵%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۱



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 m.rostaminoroozabad@yahoo.com</p>	
<p>محمدحسین بادامی فوق لیسانس مهندسی مالی hobadami@gmail.com</p>	
<p>محمدرضا صادقی‌نسب فوق لیسانس علوم اقتصادی sadeghinasab.mr@gmail.com</p>	