

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۲۷

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 ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ 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.

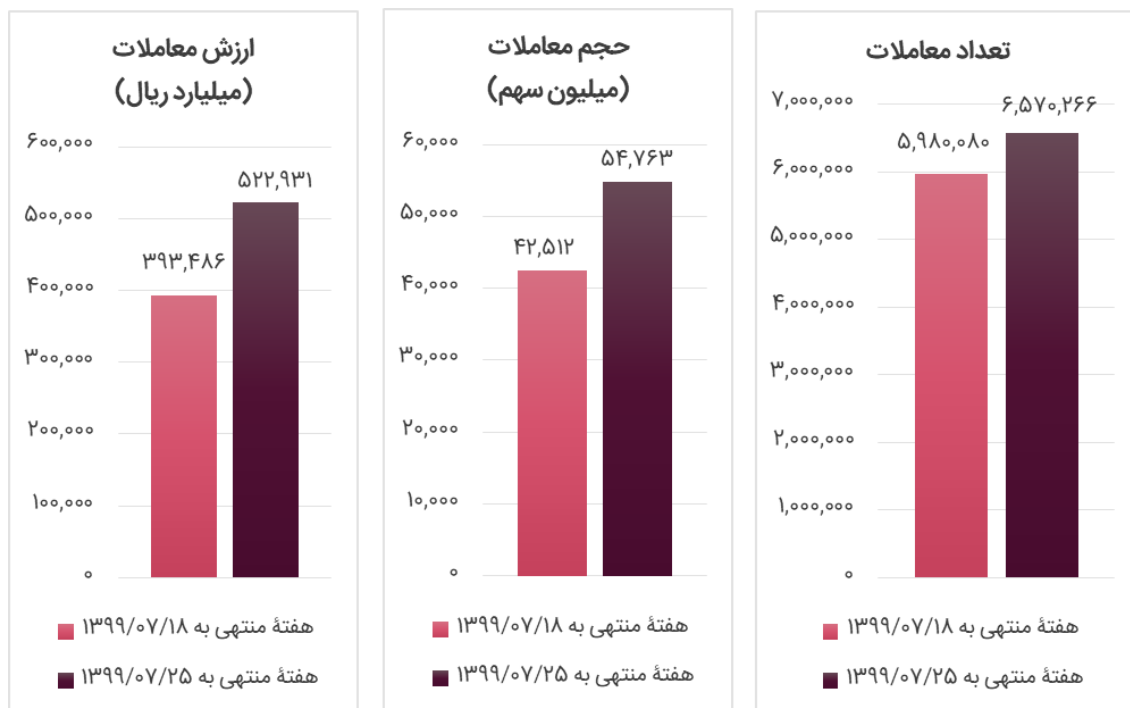
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ طی ۵ روز کاری، با ۲۰,۷۱۶ واحد افزایش، از ۱,۵۴۰,۷۰۰ به ۱,۵۶۱,۴۱۶ رسید. حجم معاملات ۱۰,۹۵۳ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۲۸ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۳۲ و ۹ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روزهای شنبه و یکشنبه به ترتیب افزایش ۱,۱۲۳ و ۵۵,۳۰۳ واحدی، در روز دوشنبه کاهش ۱۷,۶۱۸ واحدی، در روز سه‌شنبه افزایش ۱۶۸ واحدی و در روز چهارشنبه کاهش ۱۸,۲۶۰ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۹۳,۴۸۶	۷۸,۶۹۷	۵۲۲,۹۳۱	۱۰۴,۵۸۶
حجم معاملات (میلیون سهم)	۴۲,۵۱۲	۸,۵۰۲	۵۴,۷۶۳	۱۰,۹۵۳
تعداد معاملات	۵,۹۸۰,۰۸۰	۱,۱۹۶,۰۱۶	۶,۵۷۰,۲۶۶	۱,۳۱۴,۰۵۳
				میزان رشد
				۳۲/۸۹%
				۲۸/۸۱%
				۹/۸۶%

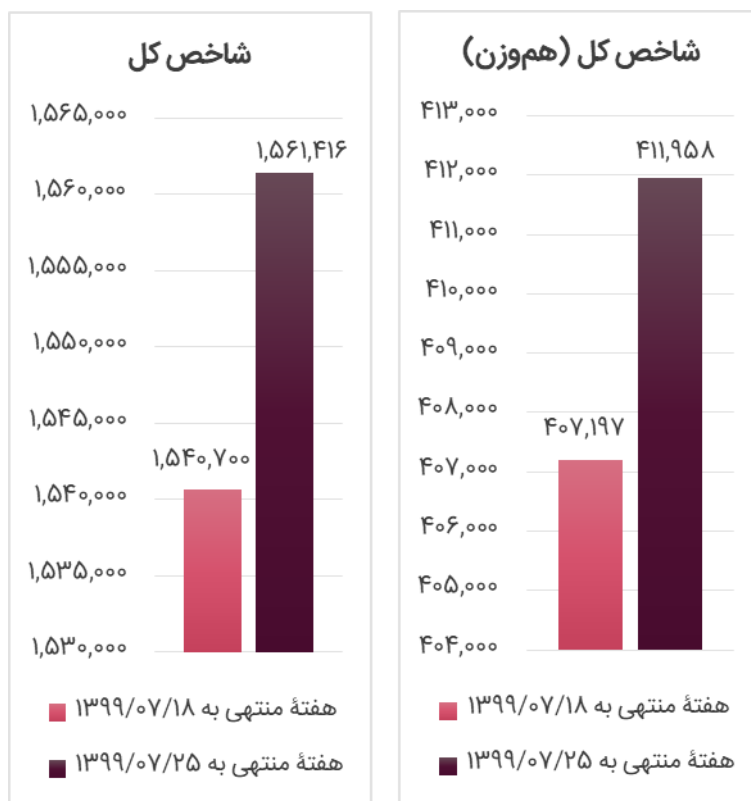
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸	عنوان
۱/۳%	۵۹,۰۷۹	۵۸,۳۲۹	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
	۱,۵۶۱,۴۱۶	۱,۵۴۰,۷۰۰	شاخص کل
	۴۰۸,۷۵۶	۴۰۳,۹۸۷	شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)
۱/۱۵%	۴۱۱,۹۵۸	۴۰۷,۱۹۷	شاخص کل (هموزن)
	۲۶۹,۹۰۳	۲۶۶,۸۱۰	شاخص قیمت (هموزن)

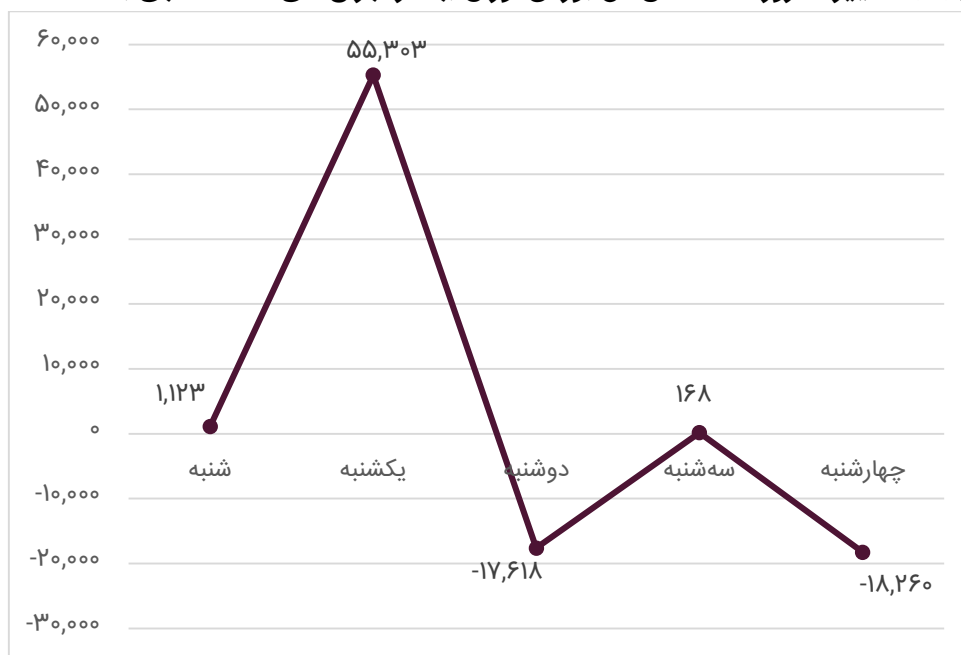
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن



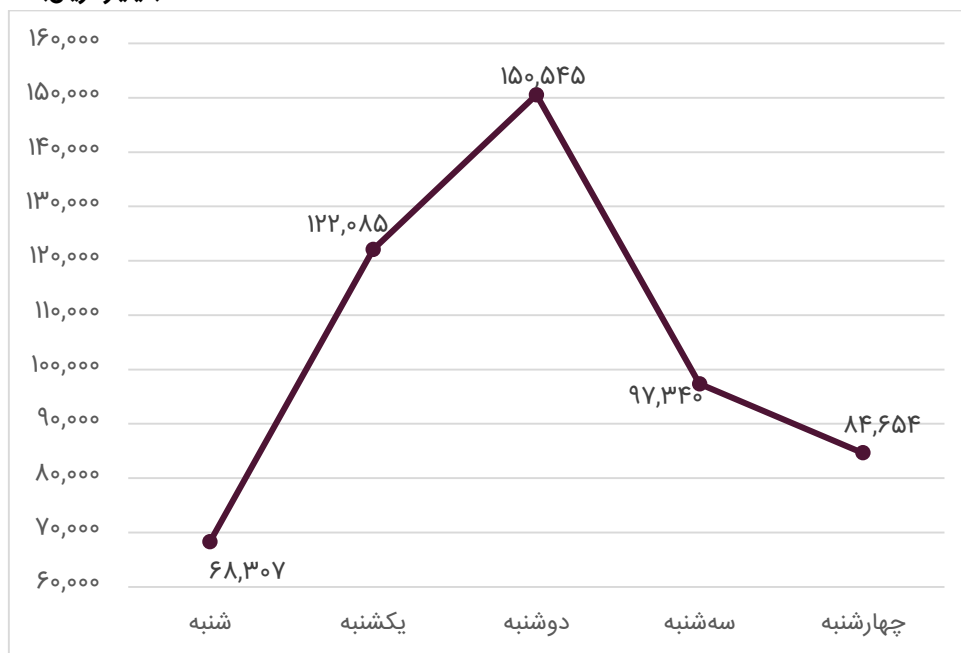
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۱,۱۲۳	۰/۰۷%	۱,۱۲۸,۷۲۱	۶,۶۶۴	۶۸,۳۰۷
یکشنبه	۵۵,۳۰۳	۳/۵۸%	۱,۴۳۶,۵۸۱	۱۲,۰۴۸	۱۲۲,۰۸۵
دوشنبه	-۱۷,۶۱۸	-۱/۱۰%	۱,۵۶۶,۴۰۵	۱۸,۹۰۳	۱۵۰,۵۴۵
سه شنبه	۱۶۸	۰/۰۱%	۱,۳۱۵,۰۲۸	۱۰,۹۱۲	۹۷,۳۴۰
چهارشنبه	-۱۸,۲۶۰	-۱/۱۵%	۱,۱۲۳,۵۳۱	۶,۲۳۶	۸۴,۶۵۴

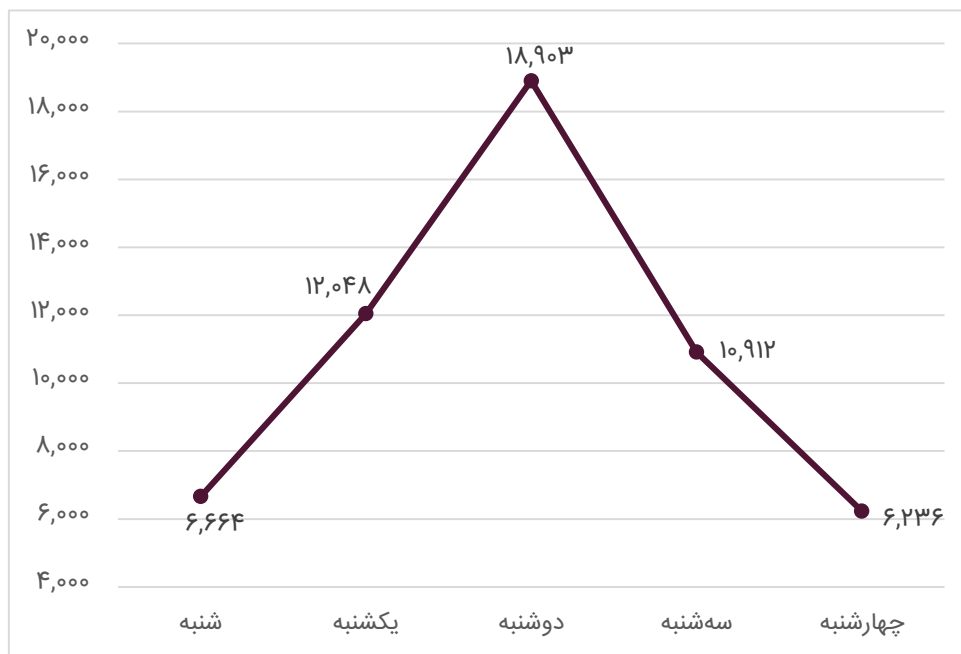
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (میلیارد ریال)



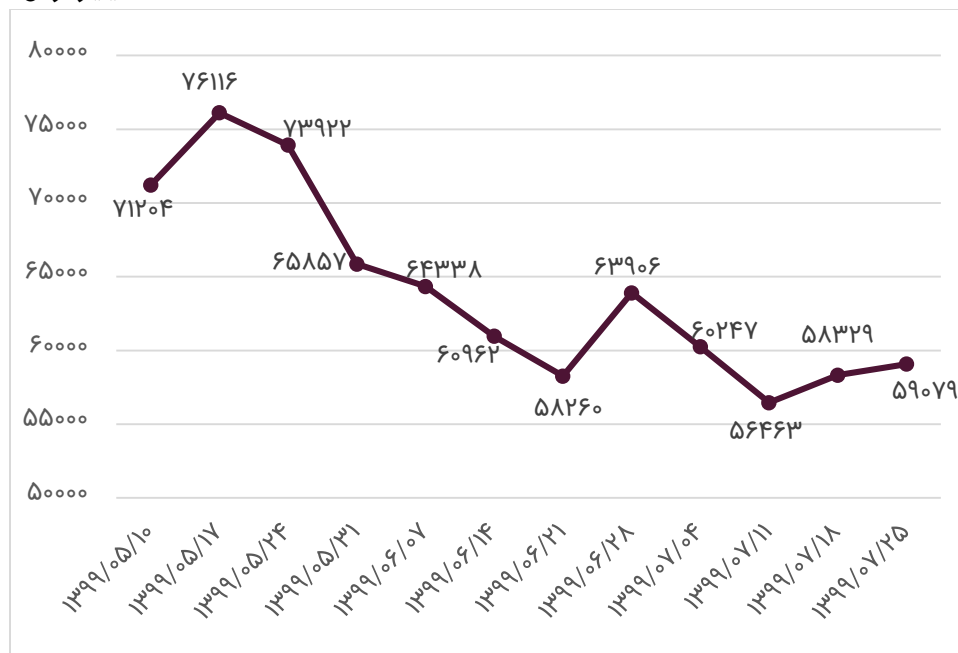
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۵۸,۳۲۹	۱۳۹۹/۰۷/۱۸
۵۹,۰۷۹	۱۳۹۹/۰۷/۲۵

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (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 ۶,۳۹۶ و ۲,۳۱۰ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۶,۳۹۶
۲	محصولات چرمی	۱	۲,۳۱۰
۳	محصولات چوبی	۱	۵۰۵
۴	استخراج سایر معادن	۱	۱۱۴
۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۹۳
۶	کاشی و سرامیک	۶	۷۰
۷	قند و شکر	۱۴	۶۵
۸	اطلاعات و ارتباطات	۲	۶۱
۹	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۵۷
۱۰	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۵۲
۱۱	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۴۸
۱۲	چاپ	۲	۴۷

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۱۳	محصولات فلزی	۹	۴۶
۱۴	ماشین آلات و تجهیزات	۲۰	۳۷/۵
۱۵	بیمه و بازنشستگی	۶	۳۶/۴
۱۶	استخراج زغال سنگ	۱	۳۴
۱۷	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۳۲
۱۸	فنی و مهندسی	۲	۳۱
۱۹	فرآورده های نفتی	۵۳	۳۰/۹
۲۰	ابزار پزشکی	۱	۳۰/۸
۲۱	سیمان آهک گچ	۴۰	۲۹/۵
۲۲	مخابرات	۲	۲۸/۶
۲۳	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۶/۸
۲۴	دستگاه های برقی	۱۱	۲۵/۸
۲۵	رایانه	۹	۲۴/۶
۲۶	فلزات اساسی	۳۴	۲۴
۲۷	انبوه سازی املاک و مستغلات	۱۵	۲۳/۴۲
۲۸	کانی غیر فلزی	۱۵	۲۳/۳۹
۲۹	شیمیایی	۴۵	۲۳/۱
۳۰	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۲۲/۹
۳۱	چندرشته ای صنعتی	۶	۱۹/۶۹
۳۲	دارویی	۳۱	۱۹/۶۵
۳۳	واسطه گیری های مالی و پولی	۹	۱۹/۵۶
۳۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۸
۳۵	استخراج کانه های فلزی	۱۷	۱۷
۳۶	محصولات کاغذی	۳	۱۶
۳۷	خرده فروشی	۱	۱۴
۳۸	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۳
۳۹	سرمایه گذاری ها	۴۵	۰
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۶
۴۱	منسوجات	۱۴	-۴۴

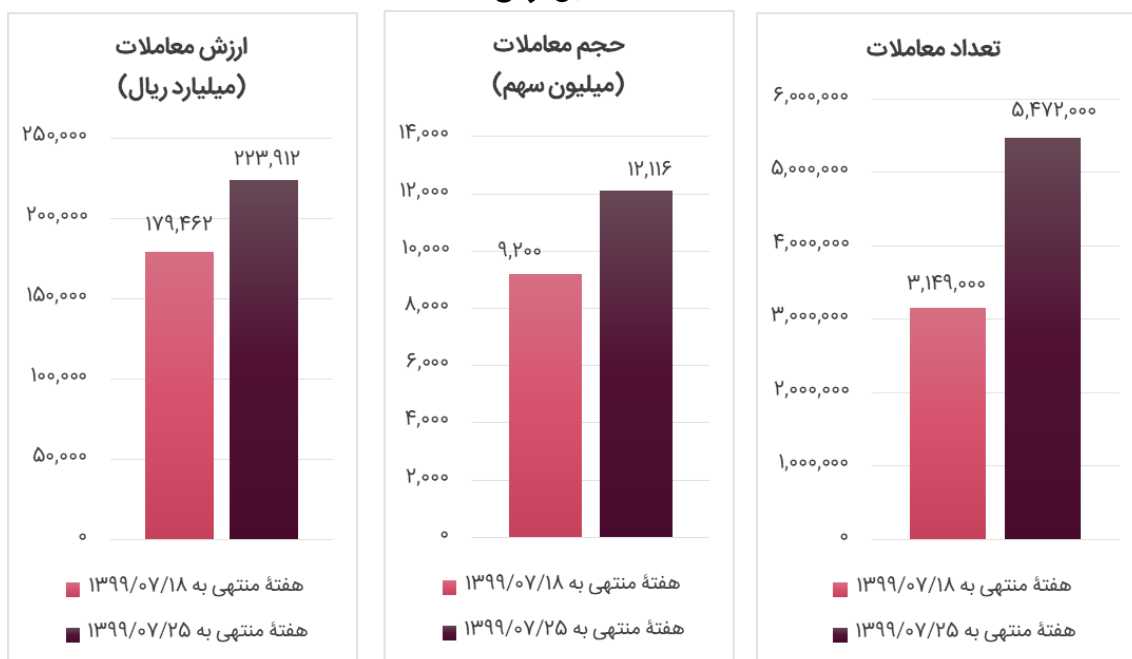
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ طی ۵ روز کاری، با ۷۹ واحد کاهش، از ۱۸,۱۵۴ به عدد ۱۸,۰۷۵ رسید. حجم معاملات ۲,۴۲۳ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۳۱ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۲۴ و ۷۳ درصد افزایش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۷۹,۴۶۲	۳۵,۸۹۲	۲۲۳,۹۱۲	۴۴,۷۸۲
حجم معاملات (میلیون سهم)	۹,۲۰۰	۱,۸۴۰	۱۲,۱۱۶	۲,۴۲۳
تعداد معاملات	۳,۱۴۹,۰۰۰	۶۲۹,۸۰۰	۵,۴۷۲,۰۰۰	۱,۰۹۴,۴۰۰

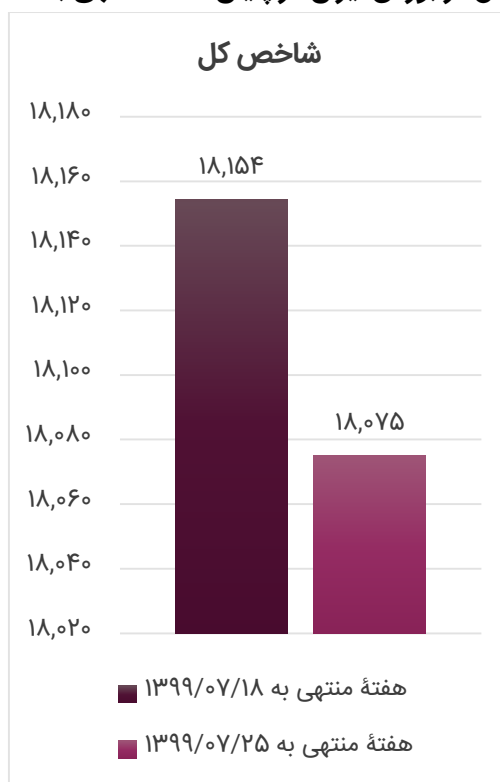
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۲,۱۶۴	۱۲,۱۱۱	-۰/۴۳%
شاخص کل	۱۸,۱۵۴	۱۸,۰۷۵	-۰/۴۳%

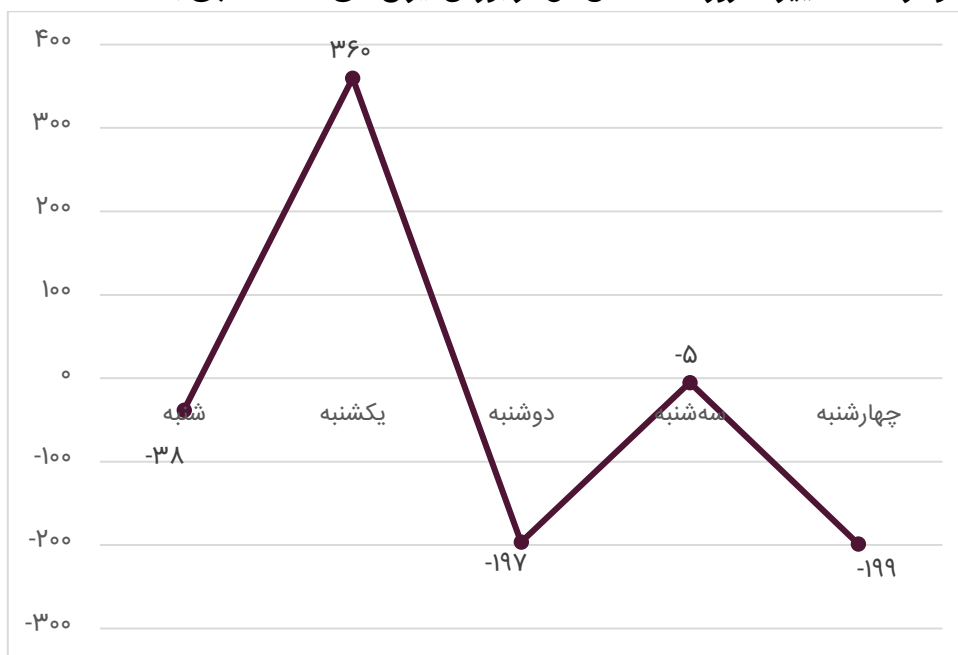
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن



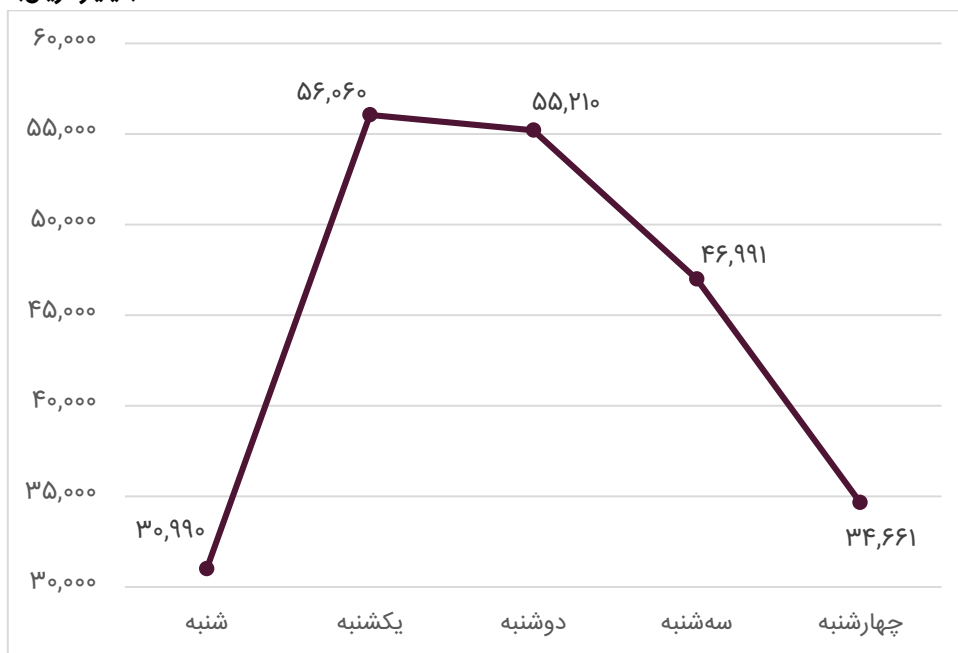
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۳۸	-۰/۲۱%	۷۹۳,۹۱۸	۱,۷۱۲	۳۰,۹۹۰
یکشنبه	۳۶۰	۱/۹۸%	۱,۴۸۸,۴۲۷	۳,۱۲۴	۵۶,۰۶۰
دوشنبه	-۱۹۷	-۱/۰۶%	۱,۳۹۲,۲۳۳	۳,۰۴۵	۵۵,۲۱۰
سه شنبه	-۵	-۰/۰۲%	۱,۰۴۳,۷۴۲	۲,۳۲۱	۴۶,۹۹۱
چهارشنبه	-۱۹۹	-۱/۰۸%	۷۵۳,۶۸۰	۱,۹۱۴	۳۴,۶۶۱

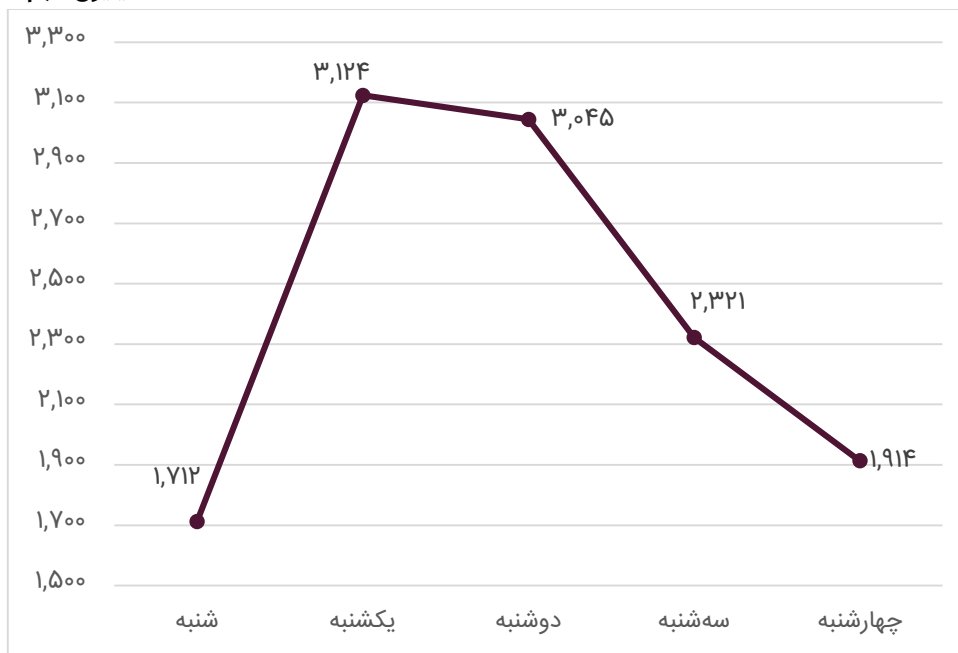
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵



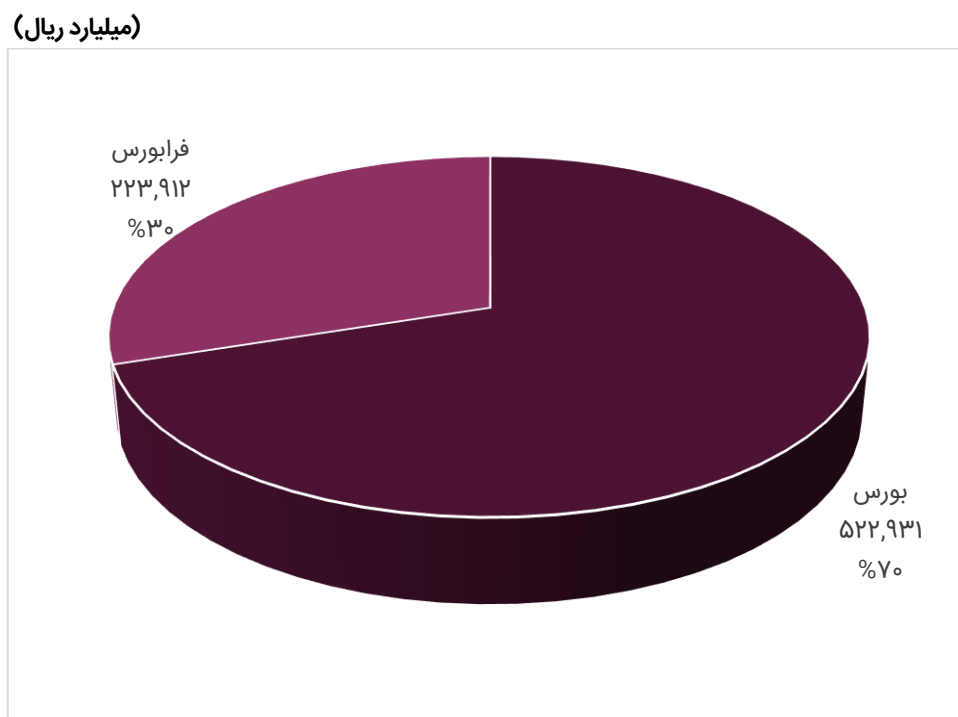
نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (میلیارد ریال)



نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵



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 ۲,۵۷۴ و ۳۸۷ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۵۷۴
۲	کانی غیرفلزی	۱۸	۳۸۷
۳	هتل و رستوران	۹	۲۵۷
۴	محصولات فلزی	۸	۲۰۷
۵	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۶۰
۶	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۲۴
۷	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۲۲/۴
۸	سایر حمل و نقل	۲	۸۸
۹	قند و شکر	۸	۸۰
۱۰	رایانه	۷	۷۶
۱۱	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۳
۱۲	سیمان آهک گچ	۱۲	۵۸
۱۳	فلزات اساسی	۲۴	۵۳
۱۴	استخراج زغال سنگ	۳	۵۲
۱۵	خودرو و قطعات	۱۱	۵۱
۱۶	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۴۷
۱۷	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۷/۳
۱۸	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۴۴/۹
۱۹	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۴۲
۲۰	فرآورده‌های نفتی	۹	۴۱/۹۸
۲۱	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۹/۵
۲۲	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۷
۲۳	فنی و مهندسی	۹	۳۰
۲۴	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۲۷
۲۵	دارویی	۱۶	۲۶
۲۶	شیمیایی	۴۳	۲۴/۰
۲۷	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۲/۸
۲۸	پیمانکاری صنعتی	۵	۱۹

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۲۹	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۳
۳۰	عمده فروشی	۳	۱۲/۱
۳۱	منسوجات	۷	۱۰/۹
۳۲	خرده‌فروشی	۲	۷/۵
۳۳	سرمایه گذاری‌ها	۴۴	۶/۶
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	-۱۵
۳۸	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۱۸
۳۹	کاشی و سرامیک	۱۱	-۳۱
۴۰	وسایل ارتباطی	۲	-۱۱۹
۴۱	ماشین آلات 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 هر یک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵، با هفته قبل از آن مورد مقایسه قرار گرفته است.

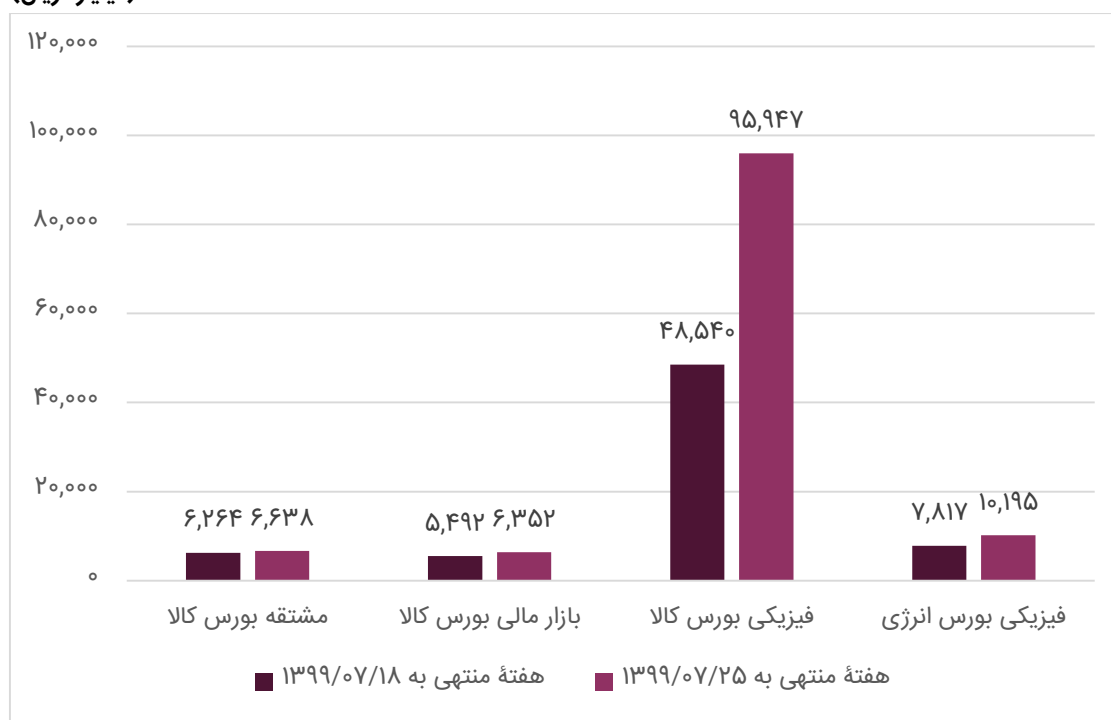
جدول (۱۰): آمار روزانه ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ (میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۷۱۷	۱,۴۱۹	۷۶۲	۴۰۶
یکشنبه	۱,۷۷۸	۹۷۴	۱۳,۸۸۱	۳۹۲
دوشنبه	۱,۳۲۸	۷۷۹	۱۷,۴۵۲	۱,۰۲۷
سه‌شنبه	۱,۳۴۱	۶۲۶	۵۰,۴۷۴	۳,۹۷۹
چهارشنبه	۱,۱۸۹	۱,۵۴۵	۱۳,۳۷۸	۴,۳۹۱
پنجشنبه	۰	۱,۲۹۵	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 ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۶,۲۶۴	۶,۶۳۸	۵/۹۷%
بازار مالی بورس کالا	۵,۴۹۲	۶,۳۵۲	۱۵/۶۶%
فیزیکی بورس کالا	۴۸,۵۴۰	۹۵,۹۴۷	۹۷/۶۶%
فیزیکی بورس انرژی	۷,۸۱۷	۱۰,۱۹۵	۳۰/۴۱%

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 ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



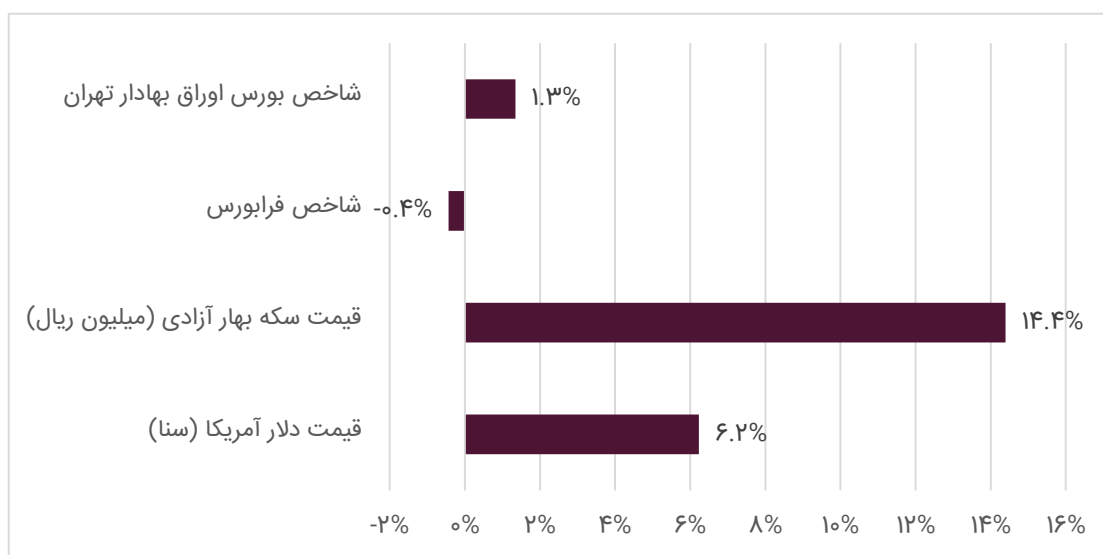
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵، بورس اوراق بهادار تهران با افزایش بیش از ۱ درصدی، بازدهی متوسطی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی کوچکتر از صفر، عملکرد ضعیفی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۱۴ درصد افزایش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، افزایش بیش از ۶ 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 ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۵۴۰,۷۰۰	۱,۵۶۱,۴۱۶	۱/۳۴%
شاخص فرابورس	۱۸,۱۵۴	۱۸,۰۷۵	-۰/۴۳%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۳۵/۵	۱۵۵	۱۴/۳۹%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۸۷,۶۰۳	۳۰۵,۵۲۹	۶/۲۳%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ 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 ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

(ارقام برحسب دلار)

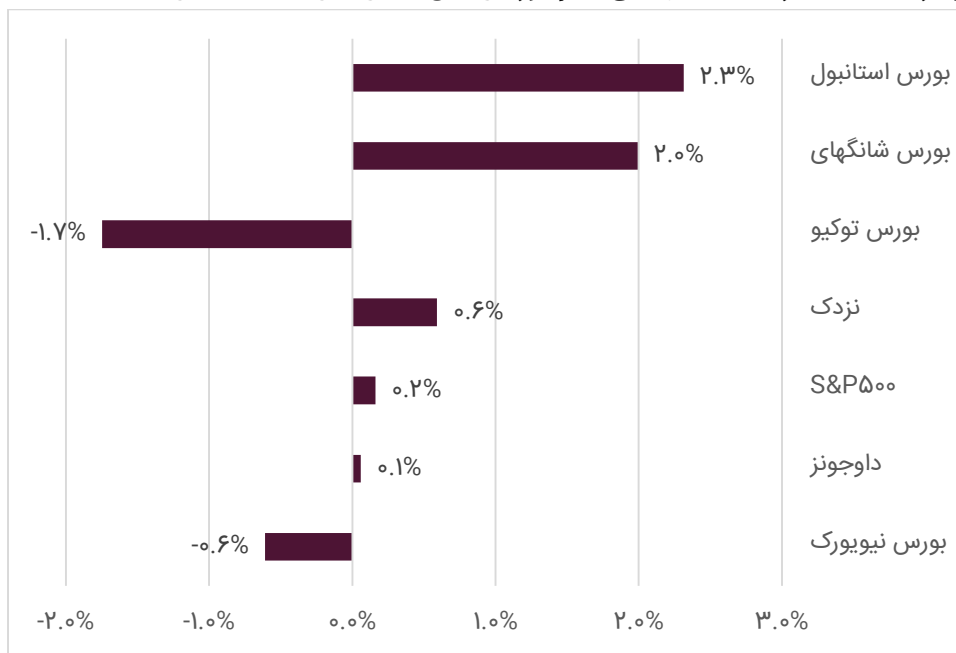
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۸۸	۱,۸۹۹	۰/۵۹%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۰/۵۸	۴۰/۲۸	-۰/۷۳%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۲/۸۵	۴۲/۹۳	۰/۱۸%

در جدول (۱۴)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بوری شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس استانبول، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بوری بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۱۸	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۳,۲۵۳	۱۳,۱۷۲	-۰/۶۰%
داوجونز	۲۸,۵۸۷	۲۸,۶۰۴	۰/۰۵%
S&P ۵۰۰	۳,۴۷۷	۳,۴۸۳	۰/۱۶%
نزدک	۱۱,۵۸۰	۱۱,۶۴۹	۰/۵۹%
بورس توکیو	۱,۶۴۷	۱,۶۱۹	-۱/۷۴%
بورس شانگهای	۳,۲۷۲	۳,۳۳۷	۱/۹۹%
بورس استانبول	۱,۱۶۶	۱,۱۹۳	۲/۳۱%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵



ارتباط با ما

این گزارش توسط 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>	