

# گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۲۸

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](http://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](http://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](http://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](http://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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ 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.

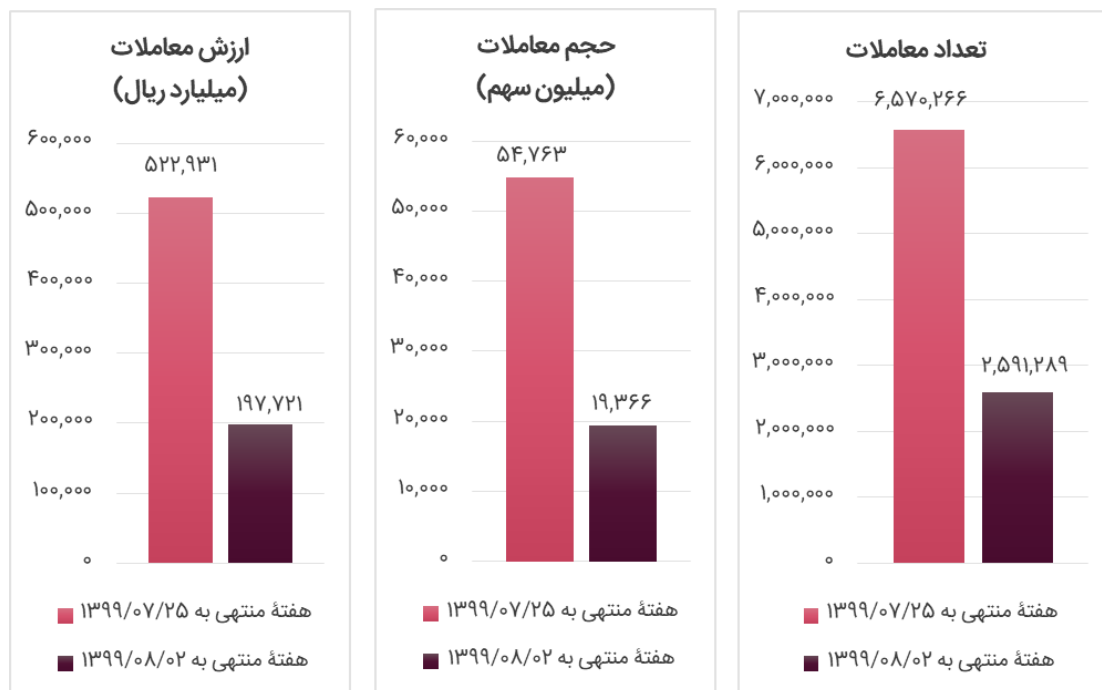
### ۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ طی ۴ روز کاری، با ۱۴۹,۰۶۱ واحد کاهش، از ۱,۵۶۱,۴۱۶ به ۱,۴۱۲,۳۵۵ رسید. حجم معاملات ۴,۸۴۲ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش بیش از ۶۴ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۶۲ و ۶۰ درصد کاهش را از خود نشان داده‌اند. شاخص کل در روزهای یکشنبه، دوشنبه، سه‌شنبه و چهارشنبه به ترتیب کاهش ۴۷,۱۴۴، ۵۱,۹۸۹، ۴۲,۹۷۸ و ۶,۹۵۱ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵		۴	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۲۲,۹۳۱	۱۰۴,۵۸۶	۱۹۷,۷۲۱	۴۹,۴۳۰
حجم معاملات (میلیون سهم)	۵۴,۷۶۳	۱۰,۹۵۳	۱۹,۳۶۶	۴,۸۴۲
تعداد معاملات	۶,۵۷۰,۲۶۶	۱,۳۱۴,۰۵۳	۲,۵۹۱,۲۸۹	۶۴۷,۸۲۲
				-۶۲/۱۸%
				-۶۴/۶۳%
				-۶۰/۵۶%

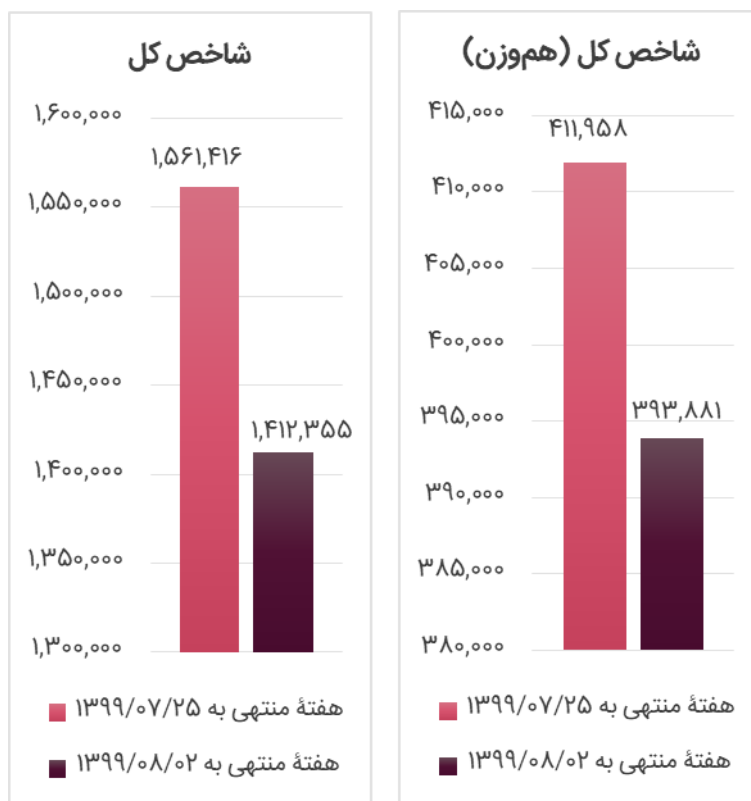
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۵۹,۰۷۹	۵۳,۶۷۹	-۹/۵%
شاخص کل	۱,۵۶۱,۴۱۶	۱,۴۱۲,۳۵۵	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۴۰۸,۷۵۶	۳۶۹,۳۸۰	
شاخص کل (هموزن)	۴۱۱,۹۵۸	۳۹۳,۸۸۱	-۴/۴%
شاخص قیمت (هموزن)	۲۶۹,۹۰۳	۲۵۸,۰۲۶	

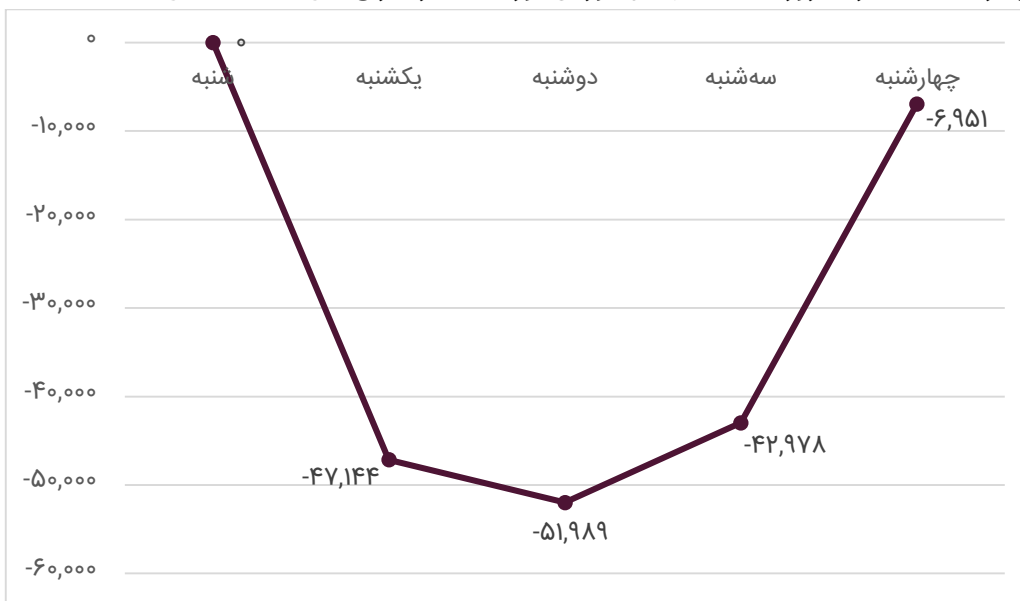
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن



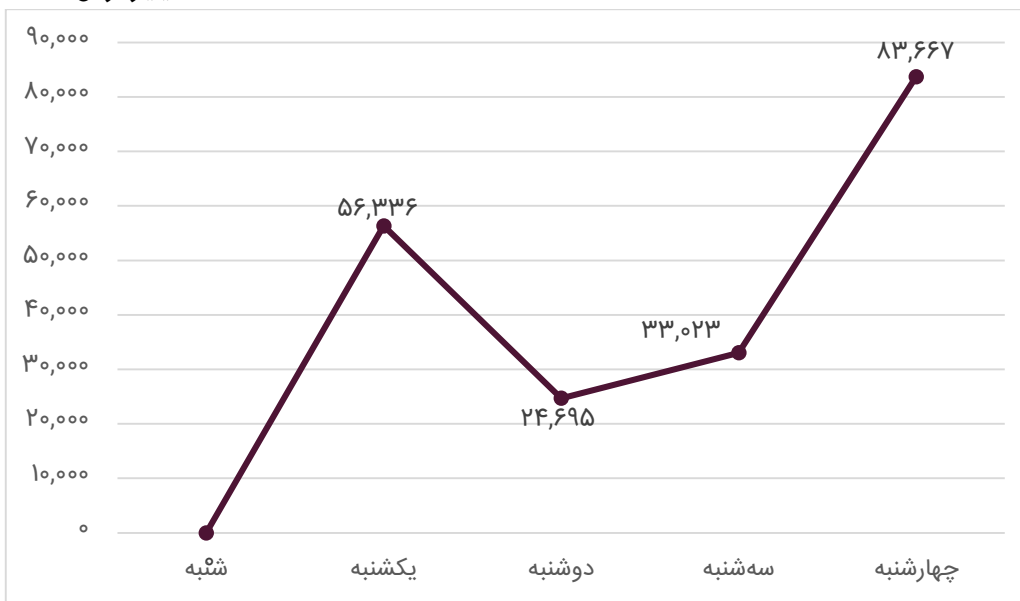
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
تعطیل					
شنبه					
یکشنبه	-۴۷,۱۴۴	-۳/۰۱%	۷۰۹,۷۷۸	۳,۸۶۲	۵۶,۳۳۶
دوشنبه	-۵۱,۹۸۹	-۳/۴۳%	۲۶۱,۰۹۱	۱,۵۷۰	۲۴,۶۹۵
سه شنبه	-۴۲,۹۷۸	-۲/۹۳%	۵۱۲,۶۴۱	۳,۵۳۳	۳۳,۰۲۳
چهارشنبه	-۶,۹۵۱	-۰/۴۸%	۱,۱۰۷,۷۷۹	۱۰,۴۰۰	۸۳,۶۶۷

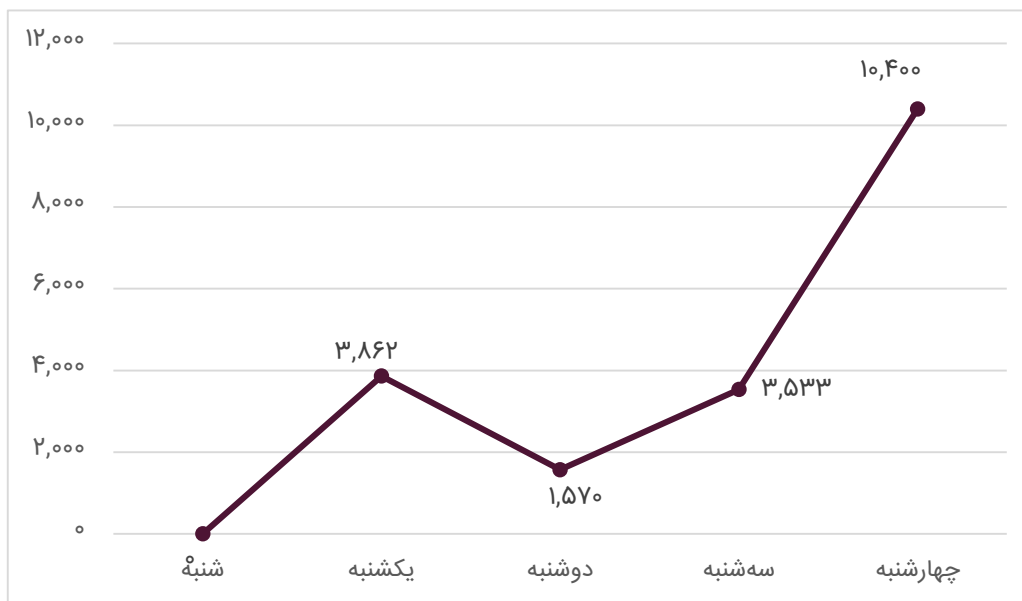
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ (میلیارد ریال)



نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ (میلیون سهم)

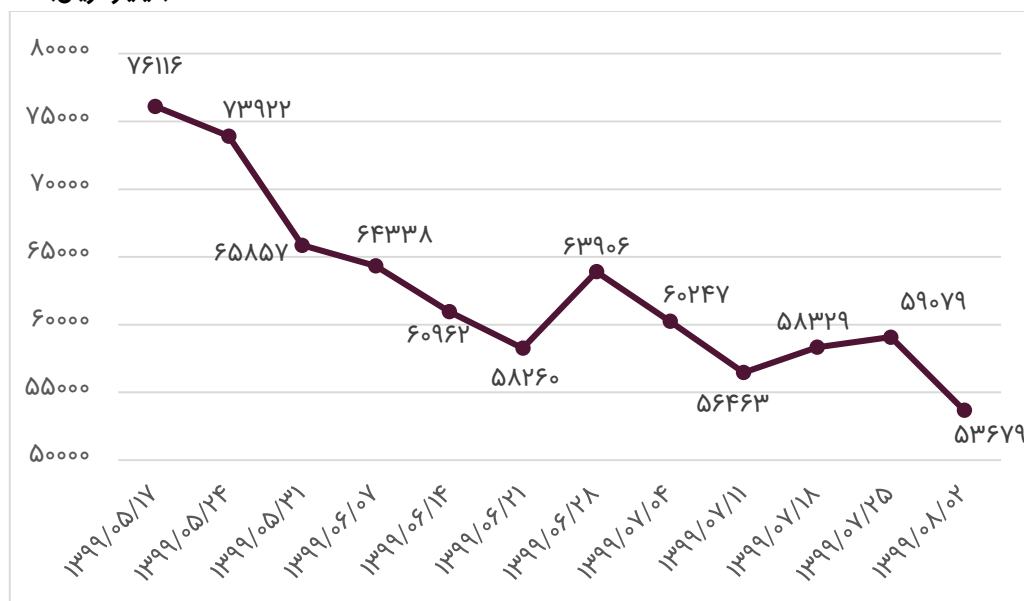


جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۵۳,۶۷۹	۱۳۹۹/۰۸/۰۲



نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ (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 ۶,۳۳۳ و ۲,۲۴۱ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۶,۳۳۳
۲	محصولات چرمی	۱	۲,۲۴۱
۳	محصولات چوبی	۱	۵۰۵
۴	استخراج سایر معادن	۱	۱۱۲
۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۷۷
۶	کاشی و سرامیک	۶	۷۱
۷	قند و شکر	۱۴	۶۲
۸	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۵۶
۹	اطلاعات و ارتباطات	۲	۵۴
۱۰	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۵۳
۱۱	چاپ	۲	۴۷
۱۲	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۴۵
۱۳	محصولات فلزی	۹	۴۴/۷

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱۴	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۳۴/۶
۱۵	بیمه و بازنشستگی	۶	۳۳/۹
۱۶	استخراج زغال سنگ	۱	۳۲
۱۷	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۱۸	سیمان آهک گچ	۴۰	۲۸
۱۹	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۲۷/۶
۲۰	فنی و مهندسی	۲	۲۶/۳
۲۱	فرآورده‌های نفتی	۵۳	۲۶/۲
۲۲	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۴/۴
۲۳	مخابرات	۲	۲۴/۲
۲۴	دستگاه‌های برقی	۱۱	۲۳/۶
۲۵	رایانه	۹	۲۲/۷
۲۶	کانی غیرفلزی	۱۵	۲۲
۲۷	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۲۱/۶۳
۲۸	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۲۱/۰۴
۲۹	فلزات اساسی	۳۴	۲۱/۰
۳۰	شیمیایی	۴۵	۱۹/۲
۳۱	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۱۸/۶۲
۳۲	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۸/۴۸
۳۳	دارویی	۳۱	۱۸/۳۰
۳۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب‌گرم	۱۵	۱۶
۳۵	استخراج کانه‌های فلزی	۱۷	۱۵
۳۶	خرده‌فروشی	۱	۱۴
۳۷	محصولات کاغذی	۳	۱۳/۵
۳۸	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۳
۳۹	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۶	۰
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۳
۴۱	منسوجات	۱۴	-۴۳

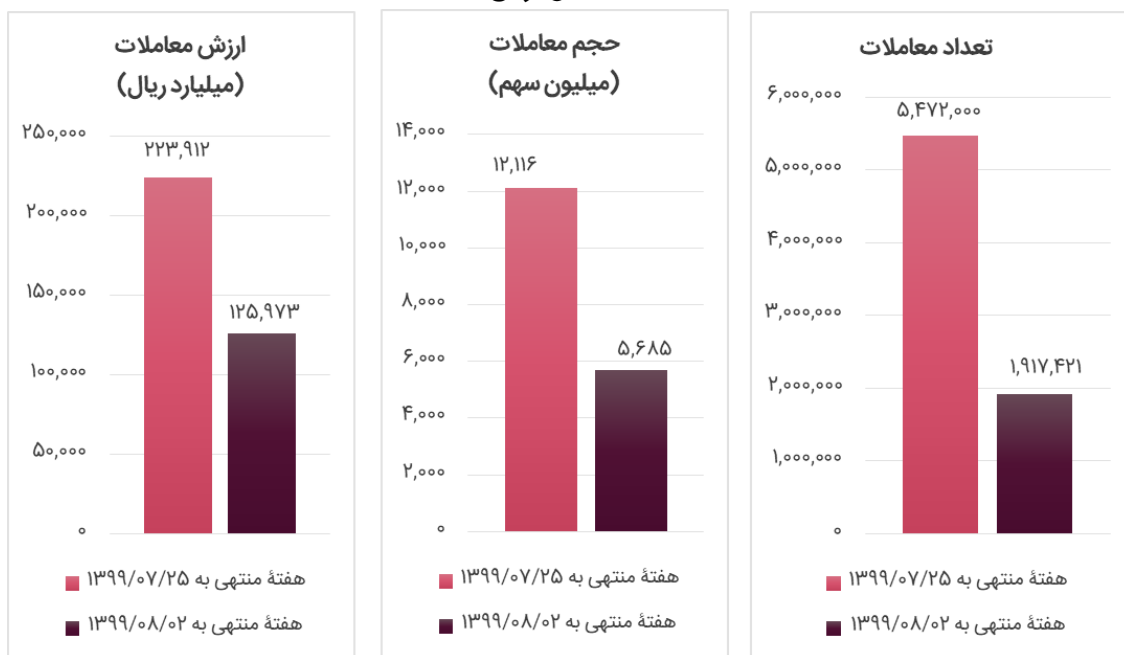
## ۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ طی ۴ روز کاری، با ۱,۱۰۵ واحد کاهش، از ۱۸,۰۷۵ به عدد ۱۶,۹۷۰ رسید. حجم معاملات ۱,۴۲۱ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش ۵۳ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۴۳ و ۶۴ درصد کاهش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۴			۵		روزهای فعالیت
-۴۳/۷۴%	۳۱,۴۹۳	۱۲۵,۹۷۳	۴۴,۷۸۲	۲۲۳,۹۱۲	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
-۵۳/۰۷%	۱,۴۲۱	۵,۶۸۵	۲,۴۲۳	۱۲,۱۱۶	حجم معاملات (میلیون سهم)
-۶۴/۹۵%	۴۷۹,۳۵۵	۱,۹۱۷,۴۲۱	۱,۰۹۴,۴۰۰	۵,۴۷۲,۰۰۰	تعداد معاملات

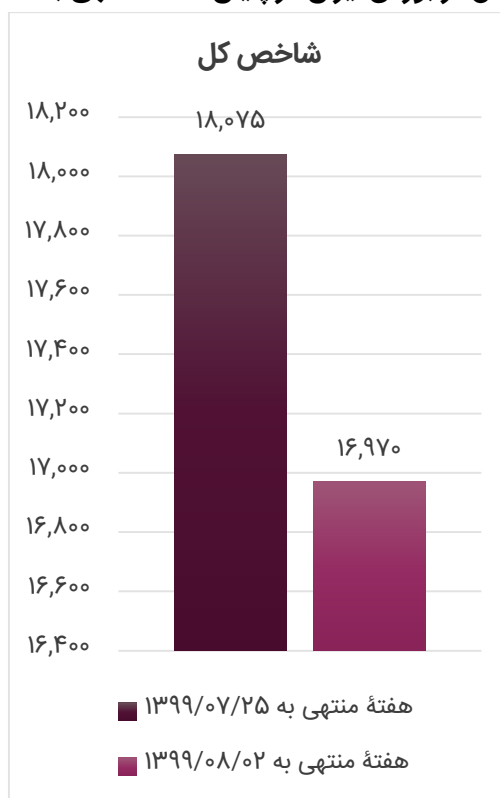
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۲,۱۱۱	۱۱,۳۷۱	-۶/۱۱%
شاخص کل	۱۸,۰۷۵	۱۶,۹۷۰	

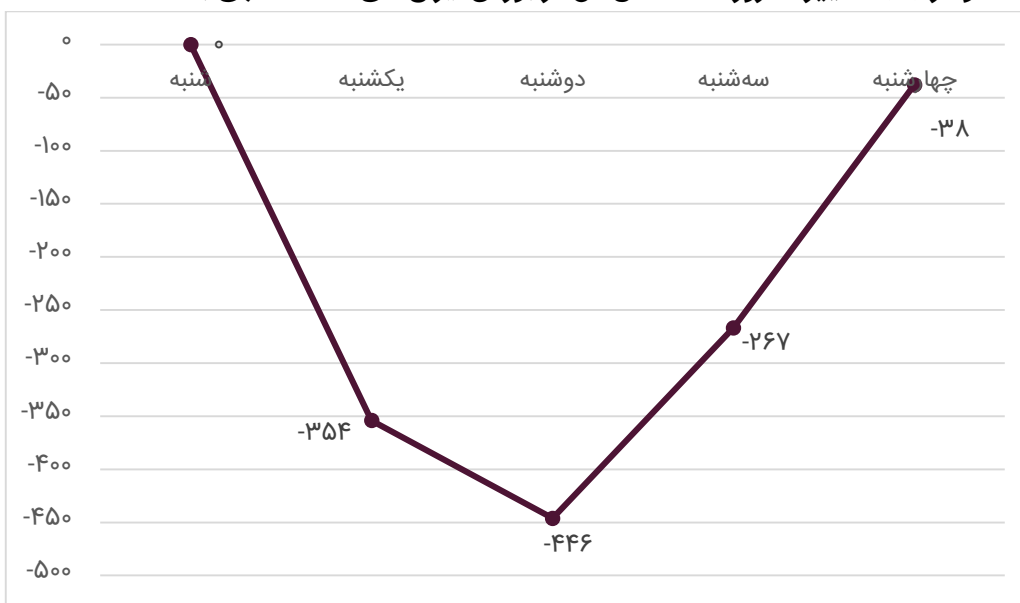
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن



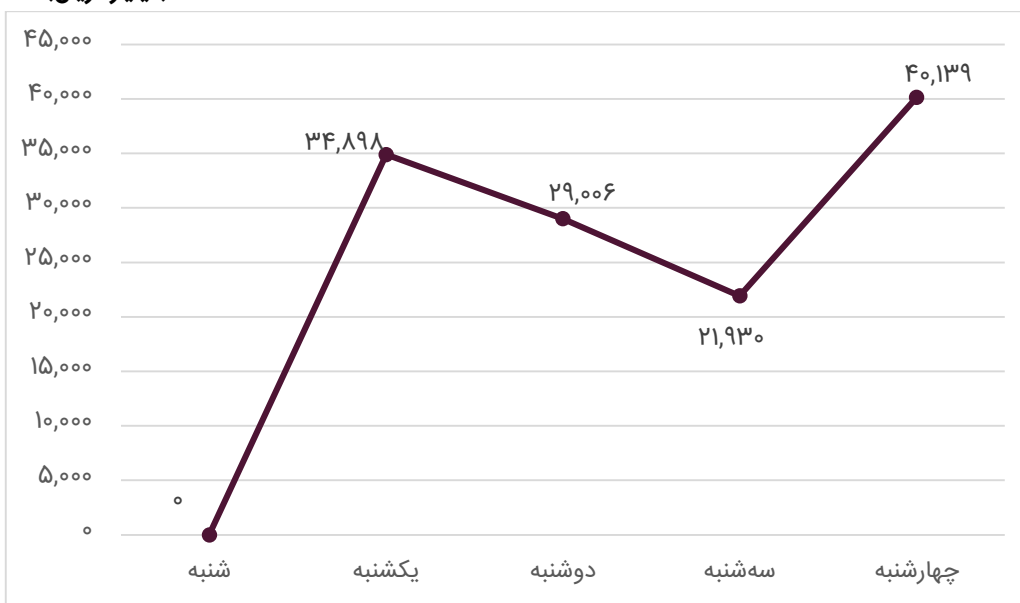
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
تعطیل					
شنبه					
یکشنبه	-۳۵۴	-۱/۹۵%	۵۹۴,۳۵۴	۱,۵۷۸	۳۴,۸۹۸
دوشنبه	-۴۴۶	-۲/۵۱%	۲۸۳,۶۶۶	۹۷۲	۲۹,۰۰۶
سه شنبه	-۲۶۷	-۱/۵۴%	۴۵۵,۱۵۸	۱,۱۷۳	۲۱,۹۳۰
چهارشنبه	-۳۸	-۰/۲۲%	۵۸۴,۲۴۳	۱,۹۶۲	۴۰,۱۳۹

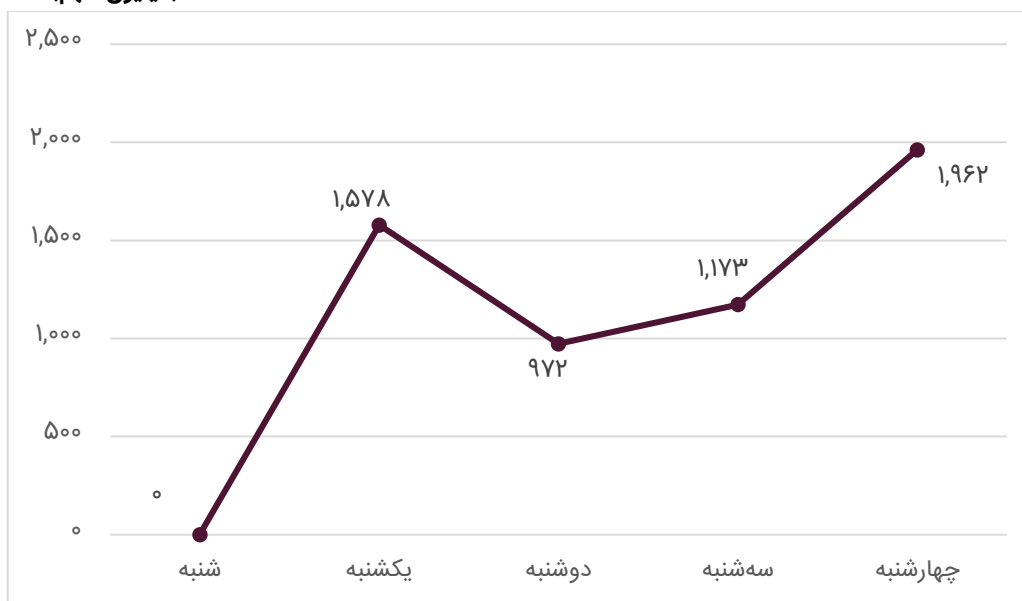
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ (میلیارد ریال)

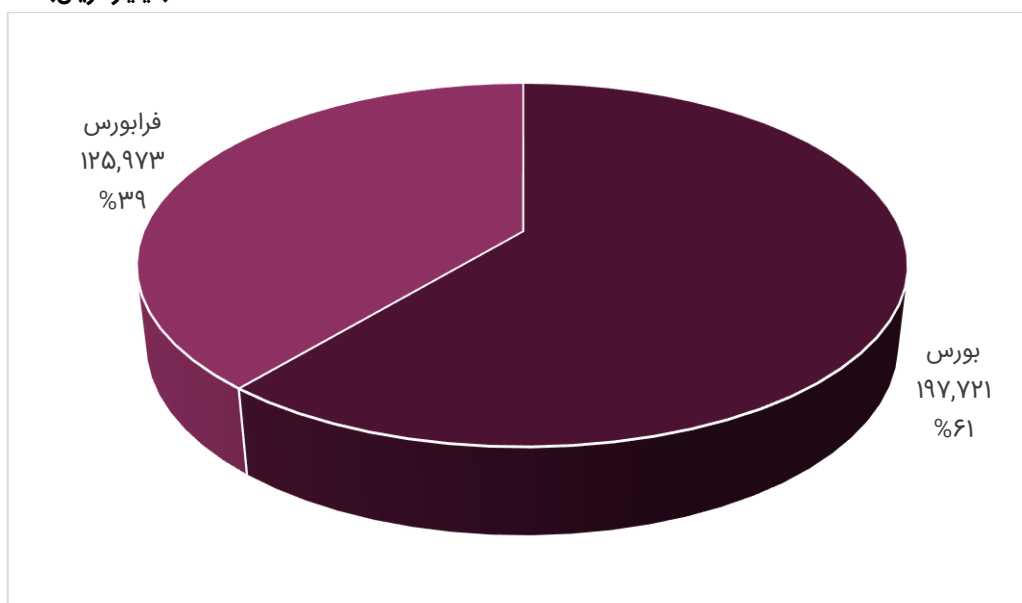


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

(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 «محصولات فلزی» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۲،۵۵۳ و ۲۰۷ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲،۵۵۳
۲	محصولات فلزی	۸	۲۰۷
۳	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۴۹
۴	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۱۹
۵	عرضه برق، گاز، بخار و آب‌گرم	۱۹	۱۱۸/۶
۶	سایر حمل و نقل	۲	۸۷
۷	قند و شکر	۸	۷۸/۲
۸	رایانه	۷	۷۴
۹	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۳
۱۰	سیمان آهک گچ	۱۲	۵۶
۱۱	استخراج زغال سنگ	۳	۵۴
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	۲	۵۱
۱۳	فلزات اساسی	۲۴	۴۹/۴
۱۴	خودرو و قطعات	۱۱	۴۹/۱
۱۵	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۴۵
۱۶	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۴۳
۱۷	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۴۰/۸
۱۸	فرآورده‌های نفتی	۹	۳۸/۲
۱۹	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۸
۲۰	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۳/۴۷
۲۱	هتل و رستوران	۹	۳۰
۲۲	فنی و مهندسی	۹	۲۹
۲۳	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۲۷
۲۴	دارویی	۱۶	۲۵
۲۵	شیمیایی	۴۳	۲۳
۲۶	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۱/۸
۲۷	پیمانکاری صنعتی	۵	۱۹
۲۸	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۳

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۲۹	عمدهفروشی	۳	۱۲
۳۰	منسوجات	۷	۱۰/۹
۳۱	خردهفروشی	۲	۷/۴
۳۲	سرمایه گذاریها	۴۴	۶/۱
۳۳	تجارت عمده و خردهفروشی وسائط نقلیه موتور	۱	۳/۴
۳۴	محصولات چوبی	۴	۰
۳۵	محصولات کاغذی	۴	-۰/۴
۳۶	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۵	-۱۵/۷
۳۷	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۱۸
۳۸	کاشی و سرامیک	۱۱	-۳۲
۳۹	وسایل ارتباطی	۲	-۱۱۸
۴۰	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	-۱۵۰
۴۱	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	-۳۸۸
۴۲	کانی غیرفلزی	۱۸	-۶۸۳

### 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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲، 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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

(میلیارد ریال)

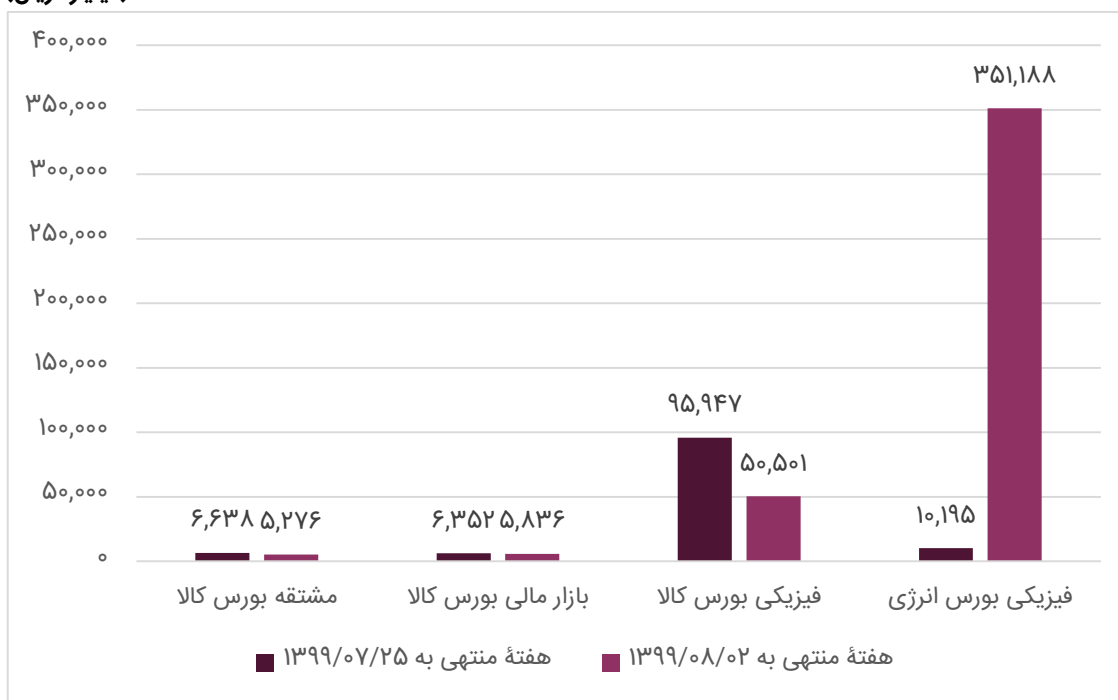
تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	تعطیل			
یکشنبه	۱,۸۸۱	۱,۲۵۴	۵,۲۵۵	۷۹۰
دوشنبه	۱,۵۸۰	۱,۲۶۰	۱۲,۹۳۵	۴۱۵
سه‌شنبه	۱,۰۲۵	۱,۳۲۷	۱۹,۵۹۸	۲,۳۲۴
چهارشنبه	۱,۳۵۰	۱,۴۳۵	۱۲,۷۱۳	۳۴۷,۶۵۹



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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۶,۶۳۸	۵,۲۷۶	-۲۰/۵۱%
بازار مالی بورس کالا	۶,۳۵۲	۵,۸۳۶	-۸/۱۲%
فیزیکی بورس کالا	۹۵,۹۴۷	۵۰,۵۰۱	-۴۷/۳۶%
فیزیکی بورس انرژی	۱۰,۱۹۵	۳۵۱,۱۸۸	۳,۴/۴۶%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



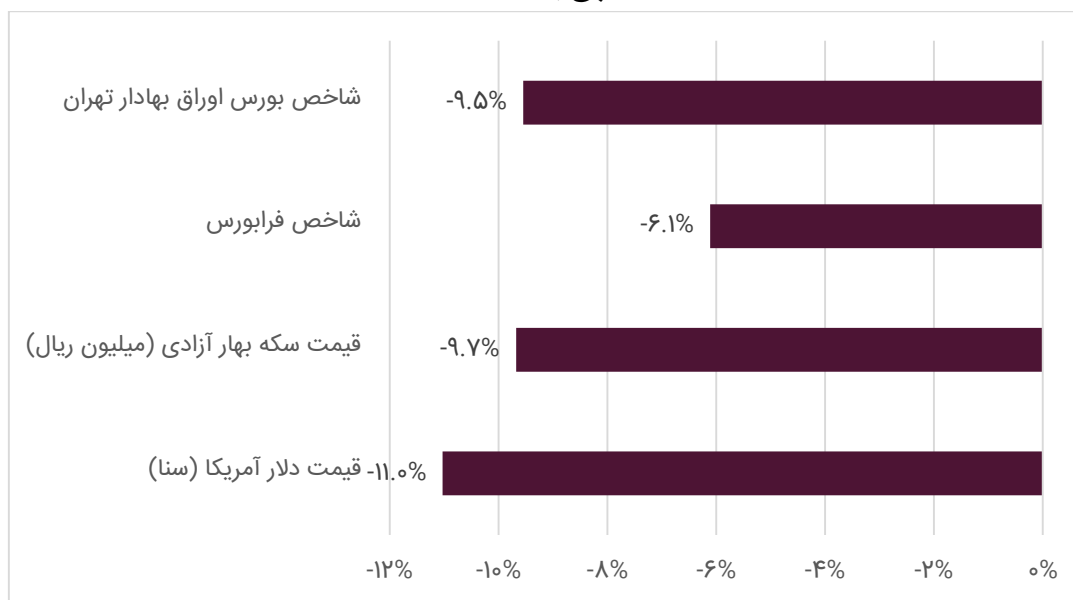
#### ۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۹ درصدی، بازدهی نامطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۶- درصدی، عملکرد نامطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۹ درصد کاهش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، کاهش بیش از ۱۱ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۵۶۱,۴۱۶	۱,۴۱۲,۳۵۵	-۹/۵۴%
شاخص فرابورس	۱۸,۰۷۵	۱۶,۹۷۰	-۶/۱۱%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۵۵	۱۴۰	-۹/۶۷%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۳۰۵,۵۲۹	۲۷۱,۸۳۶	-۱۱/۰۲%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲



## ۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

(ارقام برحسب دلار)

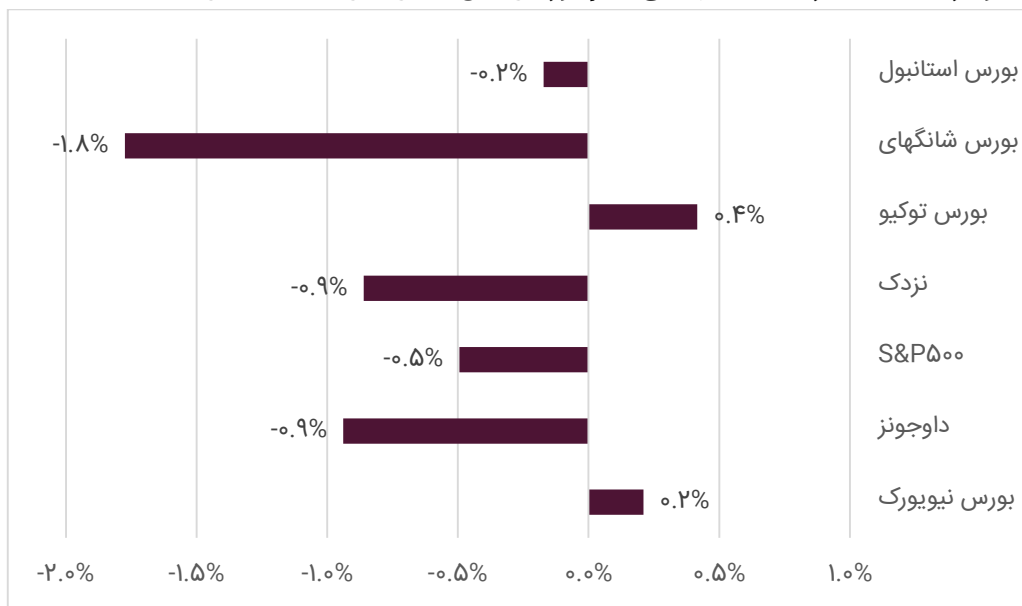
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۹۹	۱,۹۰۳	۰/۱۸%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۰,۲۸	۳۹,۵۰	-۱/۹۳%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۲,۹۳	۴۱,۷۷	-۲/۷۰%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۲ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۲۵	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۳,۱۷۲	۱۳,۲۰۰	۰/۲۰%
داوجونز	۲۸,۶۰۴	۲۸,۳۳۶	-۰/۹۳%
S&P ۵۰۰	۳,۴۸۳	۳,۴۶۵	-۰/۴۹%
نزدک	۱۱,۶۴۹	۱۱,۵۴۸	-۰/۸۶%
بورس توکیو	۱,۶۱۹	۱,۶۲۵	۰/۴۱%
بورس شانگهای	۳,۳۳۷	۳,۲۷۸	-۱/۷۷%
بورس استانبول	۱,۱۹۳	۱,۱۹۱	-۰/۱۷%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲



## 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><b>مجتبی رستمی نوروزآباد</b>                      دکتری مدیریت مالی                      m.rostaminoroozabad@yahoo.com</p>	
<p><b>محمدحسین بادامی</b>                      فوق لیسانس مهندسی مالی                      hobadami@gmail.com</p>	
<p><b>محمدرضا صادقی‌نسب</b>                      فوق لیسانس علوم اقتصادی                      sadeghinassab.mr@gmail.com</p>	