

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۲۹

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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ 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.

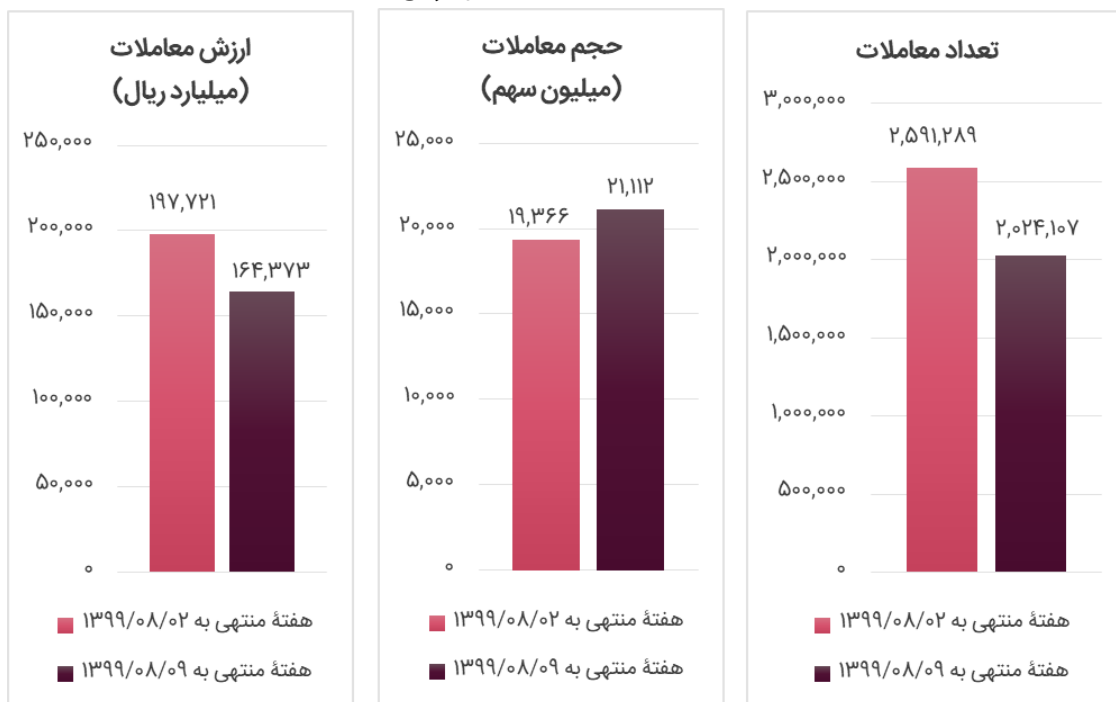
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ طی ۴ روز کاری، با ۱۲۴,۰۲۴ واحد کاهش، از ۱,۴۱۲,۳۵۵ به ۱,۲۸۸,۳۳۱ رسید. حجم معاملات ۵,۲۷۸ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۹ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۱۶ و ۲۱ درصد کاهش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روزهای شنبه، دوشنبه، سه‌شنبه و چهارشنبه به ترتیب کاهش ۳۸,۲۹۷، ۳۷,۴۷۰، ۳۴,۵۵۹ و ۱۳,۶۹۸ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۴		۴	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۹۷,۷۲۱	۴۹,۴۳۰	۱۶۴,۳۷۳	۴۱,۰۹۳
حجم معاملات (میلیون سهم)	۱۹,۳۶۶	۴,۸۴۲	۲۱,۱۱۲	۵,۲۷۸
تعداد معاملات	۲,۵۹۱,۲۸۹	۶۴۷,۸۲۲	۲,۰۲۴,۱۰۷	۵۰۶,۰۲۷

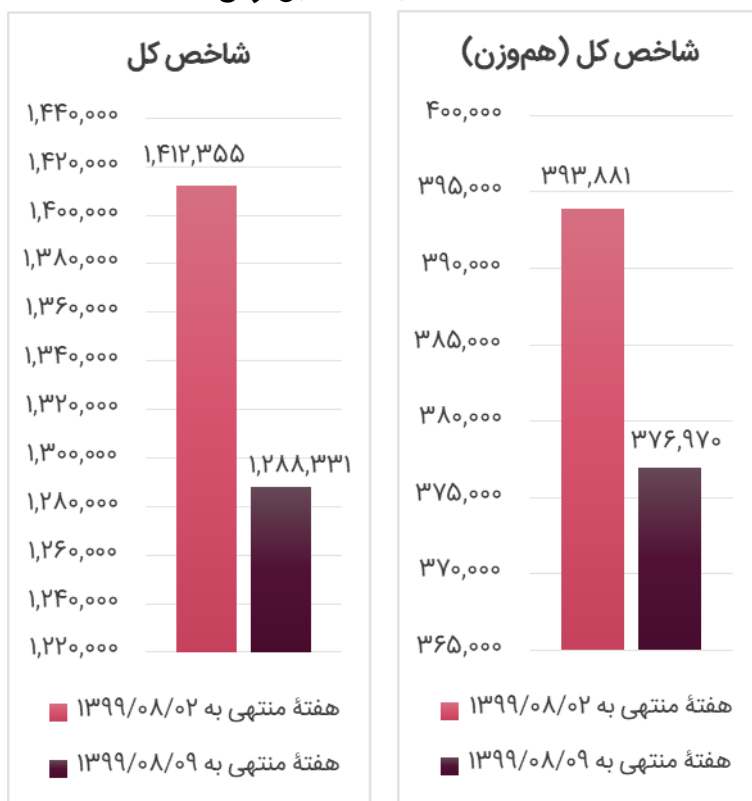
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۵۳,۶۷۹	۴۸,۹۵۸	-۸/۸%
شاخص کل	۱,۴۱۲,۳۵۵	۱,۲۸۸,۳۳۱	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۳۶۹,۳۸۰	۳۳۶,۹۳۳	
شاخص کل (هموزن)	۳۹۳,۸۸۱	۳۷۶,۹۷۰	-۴/۳%
شاخص قیمت (هموزن)	۲۵۸,۰۲۶	۲۴۶,۹۰۷	

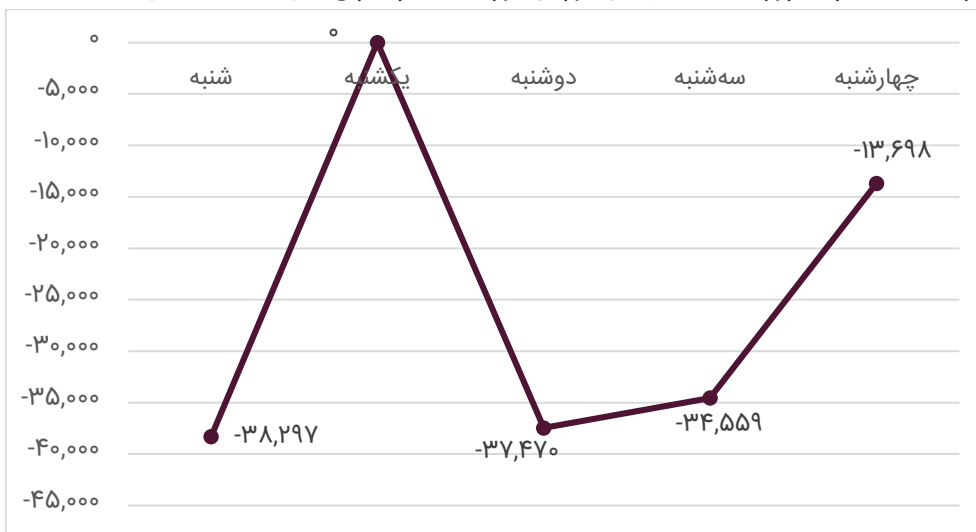
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن



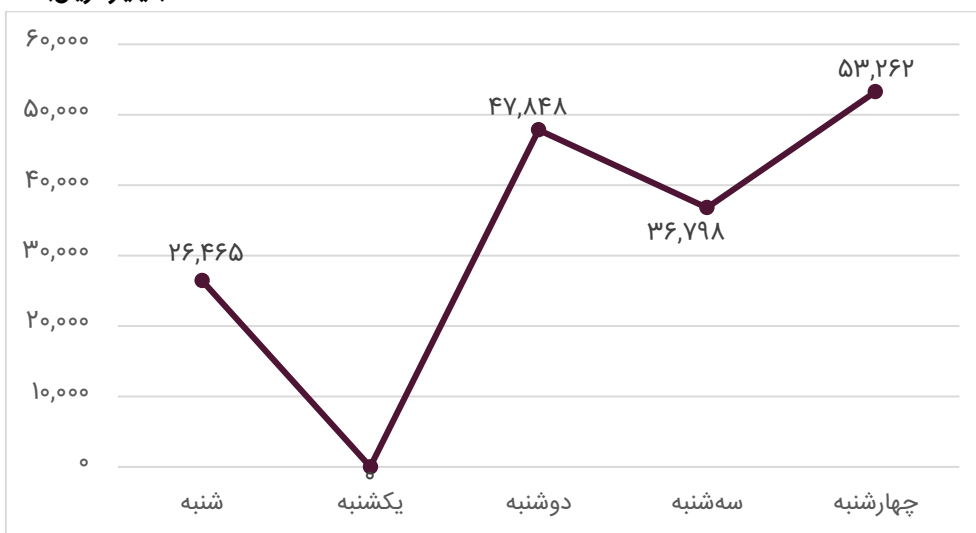
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۳۸,۲۹۷	-۲/۷۱%	۲۸۹,۲۴۷	۲,۷۲۳	۲۶,۴۶۵
یکشنبه	تعطیل				
دوشنبه	-۳۷,۴۷۰	-۲/۷۲%	۵۶۶,۱۴۴	۶,۲۴۳	۴۷,۸۴۸
سه شنبه	-۳۴,۵۵۹	-۲/۵۸%	۴۷۹,۴۸۶	۵,۴۸۸	۳۶,۷۹۸
چهارشنبه	-۱۳,۶۹۸	-۱/۰۵%	۶۸۹,۲۳۰	۶,۶۵۸	۵۳,۲۶۲

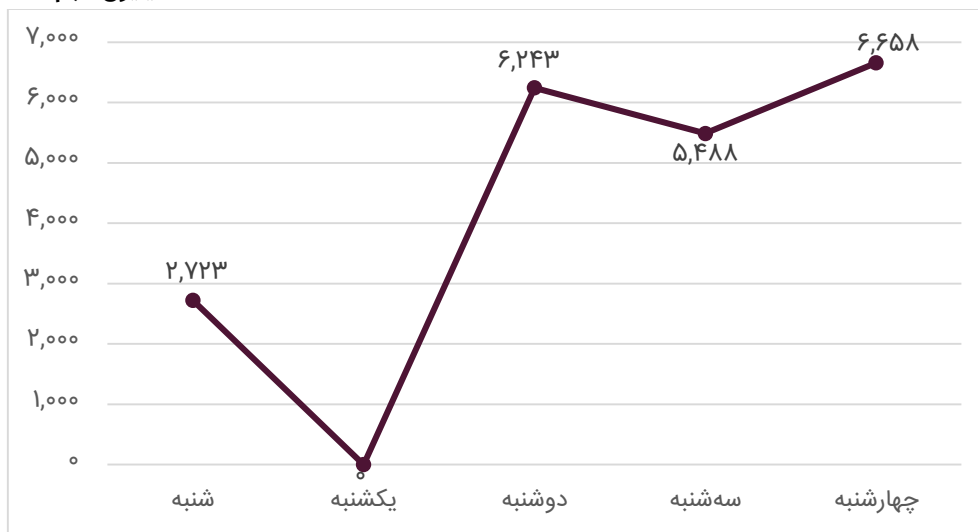
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ (میلیارد ریال)



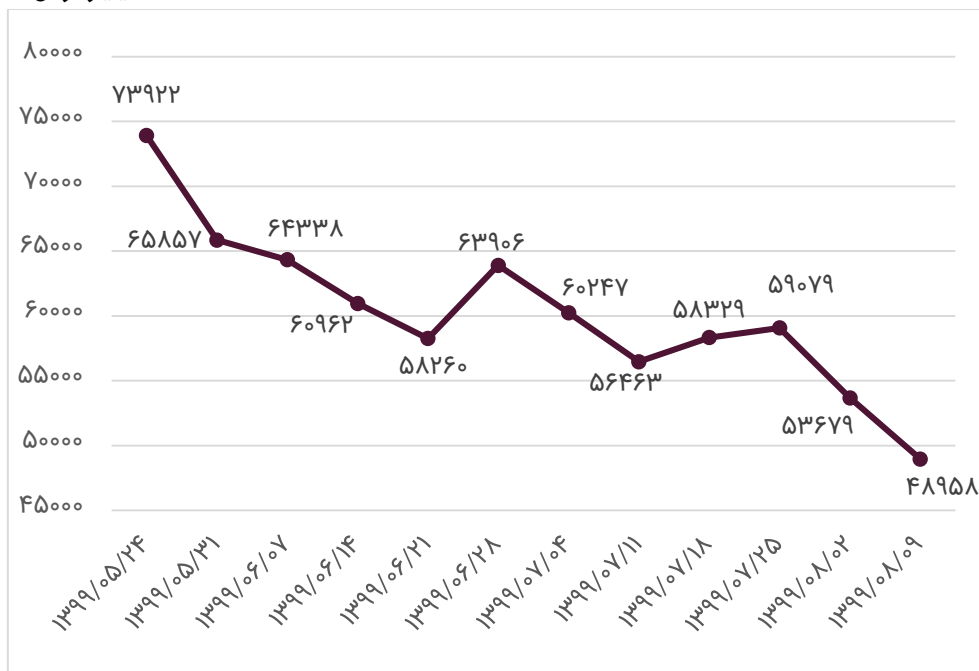
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۴۸,۹۵۸	۱۳۹۹/۰۸/۰۹

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ (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 ۶,۳۲۴ و ۲,۲۳۳ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۶,۳۲۴
۲	محصولات چرمی	۱	۲,۲۳۳
۳	محصولات چوبی	۱	۴۸۷
۴	استخراج سایر معادن	۱	۱۱۰
۵	کاشی و سرامیک	۶	۶۹
۶	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۶۹
۷	قند و شکر	۱۴	۶۲
۸	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۵۴
۹	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۵۳
۱۰	چاپ	۲	۴۷
۱۱	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۴۵/۴

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۵
۱۳	محصولات فلزی	۹	۴۳/۶
۱۴	ماشین آلات و تجهیزات	۲۰	۳۳/۸
۱۵	بیمه و بازنشستگی	۶	۳۱/۱
۱۶	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۱۷	استخراج زغال سنگ	۱	۳۰
۱۸	سیمان آهک گچ	۴۰	۲۷
۱۹	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۲۴/۴
۲۰	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۲/۵
۲۱	فنی و مهندسی	۲	۲۲/۴
۲۲	دستگاه‌های برقی	۱۱	۲۲/۳
۲۳	رایانه	۹	۲۲/۱
۲۴	فرآورده‌های نفتی	۵۳	۲۱/۷
۲۵	مخابرات	۲	۲۰/۳
۲۶	کانی غیرفلزی	۱۵	۲۰
۲۷	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۱۹/۸۰
۲۸	فلزات اساسی	۳۴	۱۸/۲۲
۲۹	شیمیایی	۴۵	۱۷/۹
۳۰	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۱۷/۸
۳۱	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۷/۳۶
۳۲	دارویی	۳۱	۱۷/۱۴
۳۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۴/۱۹
۳۴	استخراج کانه های فلزی	۱۷	۱۴/۱
۳۵	خرده‌فروشی	۱	۱۳/۹
۳۶	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۱۳/۵
۳۷	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۲/۶
۳۸	محصولات کاغذی	۳	۱۲
۳۹	سرمایه گذاری‌ها	۴۶	۰
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۱
۴۱	منسوجات	۱۴	-۴۳

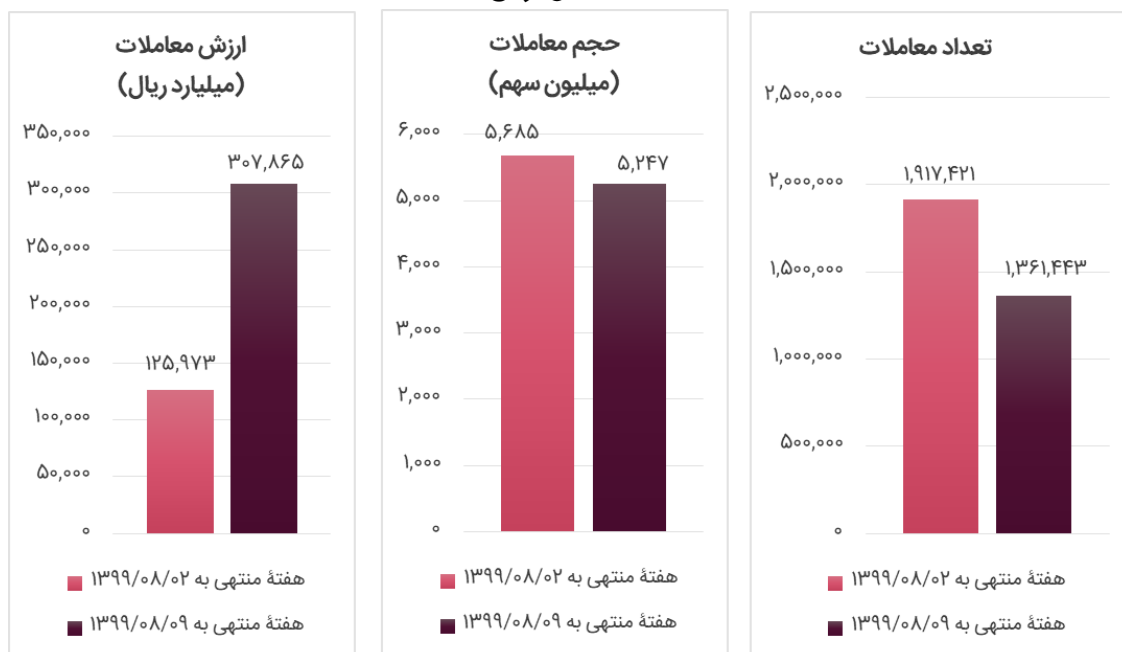
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ طی ۴ روز کاری، با ۸۴۵ واحد کاهش، از ۱۶,۹۷۰ به عدد ۱۶,۱۲۵ رسید. حجم معاملات ۱,۳۱۲ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش ۷ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۱۴۴ درصد افزایش و ۲۸ درصد کاهش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۴		۴	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۲۵,۹۷۳	۳۱,۴۹۳	۳۰۷,۸۶۵	۷۶,۹۶۶
حجم معاملات (میلیون سهم)	۵,۶۸۵	۱,۴۲۱	۵,۲۴۷	۱,۳۱۲
تعداد معاملات	۱,۹۱۷,۴۲۱	۴۷۹,۳۵۵	۱,۳۶۱,۴۴۳	۳۴۰,۳۶۱
				میزان رشد
				۱۴۴/۳۸%
				-۷/۷۰%
				-۲۸/۹۹%

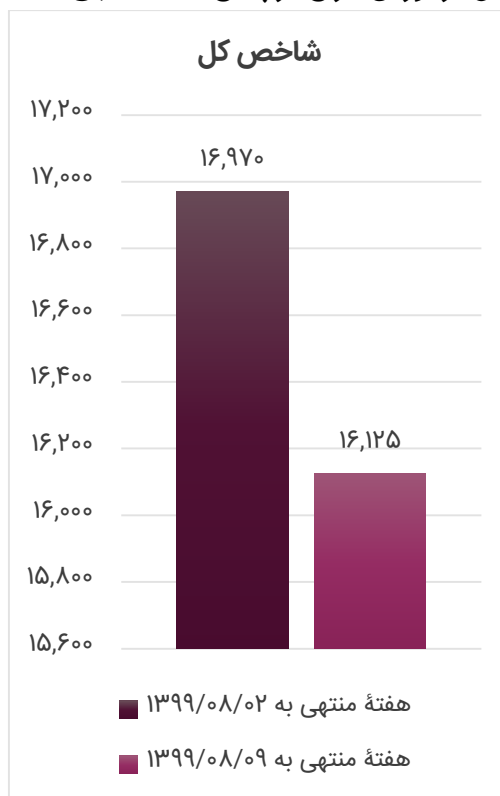
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۱,۳۷۱	۱۰,۸۰۴	-۴/۹۸%
شاخص کل	۱۶,۹۷۰	۱۶,۱۲۵	-۴/۹۸%

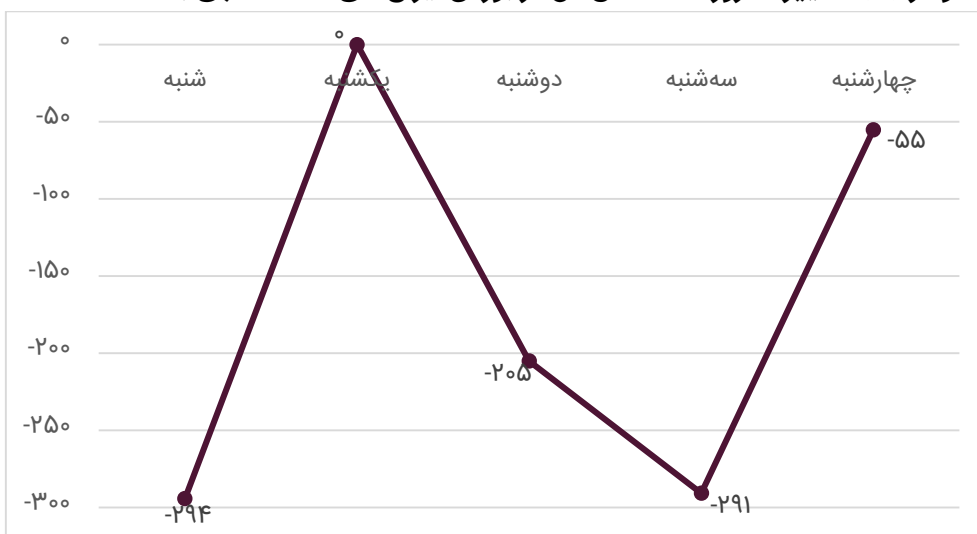
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن



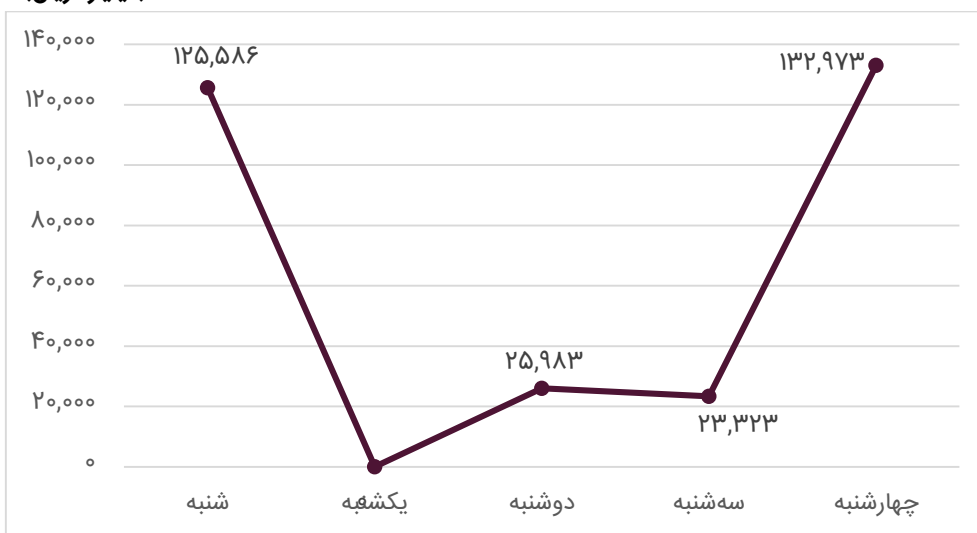
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۲۹۴	-۱/۷۳%	۲۲۹,۸۱۱	۹۱۰	۱۲۵,۵۸۶
یکشنبه	تعطیل				
دوشنبه	-۲۰۵	-۱/۲۲%	۳۷۰,۴۸۲	۱,۳۹۰	۲۵,۹۸۳
سه شنبه	-۲۹۱	-۱/۷۶%	۳۳۸,۴۱۳	۱,۱۹۵	۲۳,۳۲۳
چهارشنبه	-۵۵	-۰/۳۴%	۴۲۲,۷۳۷	۱,۷۵۱	۱۳۲,۹۷۳

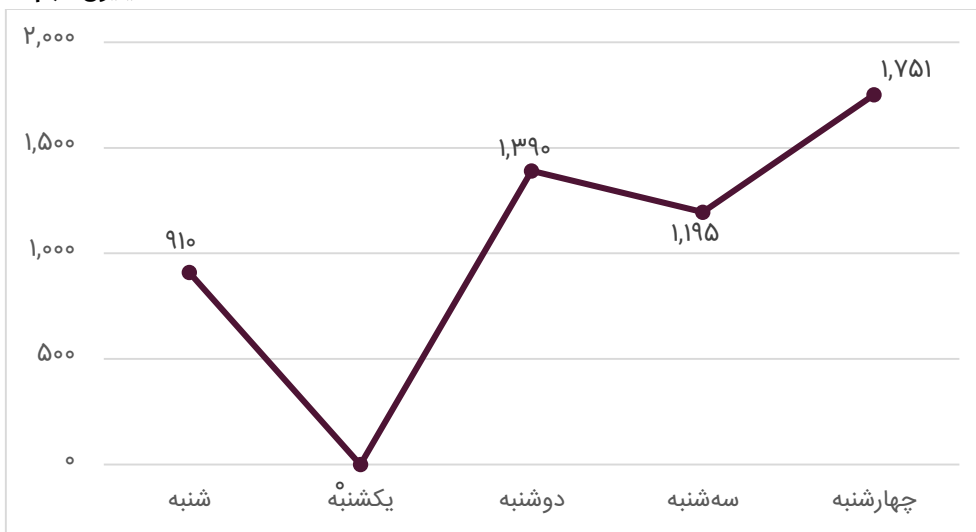
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ (میلیارد ریال)

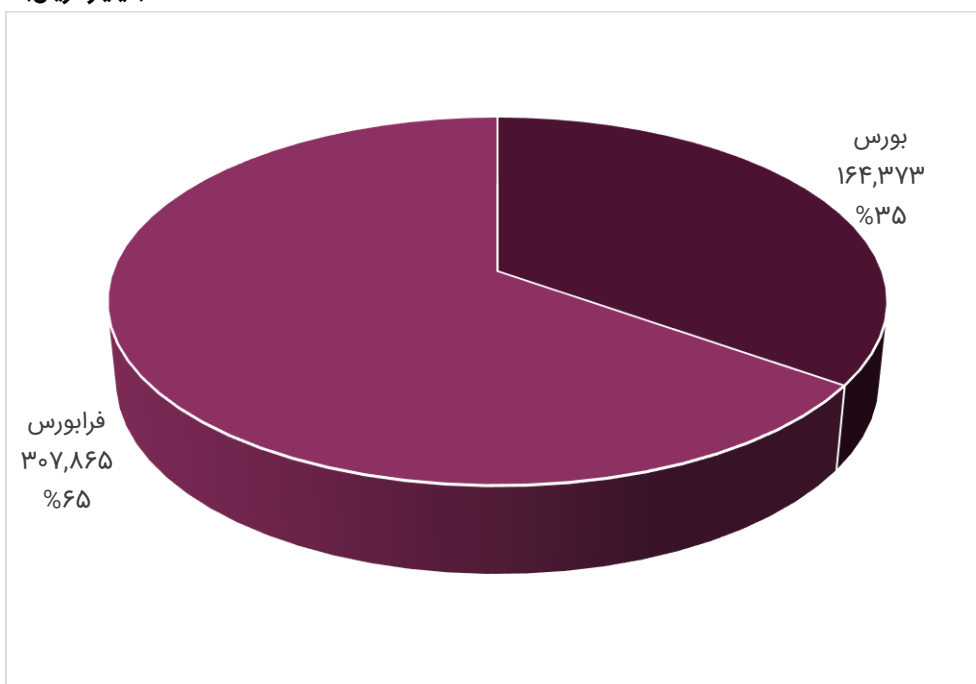


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

(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 «استخراج نفت گاز جز اکتشاف» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۲,۵۵۰ و ۱۵۸ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۵۵۰
۲	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۵۸
۳	محصولات فلزی	۸	۱۵۱
۴	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۱۷
۵	عرضه برق، گاز، بخار و آب‌گرم	۱۹	۱۱۶/۳
۶	سایر حمل و نقل	۲	۸۶
۷	قند و شکر	۸	۷۶/۷
۸	رایانه	۷	۷۴
۹	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۳
۱۰	سیمان آهک گچ	۱۲	۵۵
۱۱	استخراج زغال‌سنگ	۳	۵۳
۱۲	فلزات اساسی	۲۴	۴۸
۱۳	خودرو و قطعات	۱۱	۴۷/۵
۱۴	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۴/۶
۱۵	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۴۱
۱۶	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۴۰
۱۷	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۸	۳۹/۸
۱۸	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۷/۴
۱۹	فرآورده‌های نفتی	۹	۳۶
۲۰	فنی و مهندسی	۹	۳۰/۹۷
۲۱	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۲۹/۱
۲۲	هتل و رستوران	۹	۲۸
۲۳	دارویی	۱۶	۲۴/۳
۲۴	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۲۴
۲۵	شیمیایی	۴۳	۲۱
۲۶	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۰/۷
۲۷	پیمانکاری صنعتی	۵	۱۸/۷
۲۸	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۲

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۲۹	عمدهفروشی	۳	۱۱/۷
۳۰	منسوجات	۷	۱۰/۸
۳۱	خردهفروشی	۲	۷/۴
۳۲	سرمایه گذاریها	۴۴	۵/۶
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	-۱۴/۹
۳۷	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۱۸
۳۸	کاشی و سرامیک	۱۱	-۳۲
۳۹	وسایل ارتباطی	۲	-۱۱۷
۴۰	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	-۱۵۰
۴۱	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	-۳۸۸
۴۲	کانی غیرفلزی	۱۸	-۶۷۸

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 هریک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹، 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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۸۱۲	۷۷۸	۱,۹۲۱	۳۱۱
یکشنبه	تعطیل			
دوشنبه	۷۶۶	۹۱۷	۵,۵۵۴	۳۳۴
سه‌شنبه	۹۶۱	۹۳۲	۳۲,۱۵۱	۱,۰۴۹
چهارشنبه	۱,۰۱۱	۹۷۷	۱۲,۵۶۸	۲,۵۱۴
پنجشنبه	۰	۱,۱۷۷	۰	۰

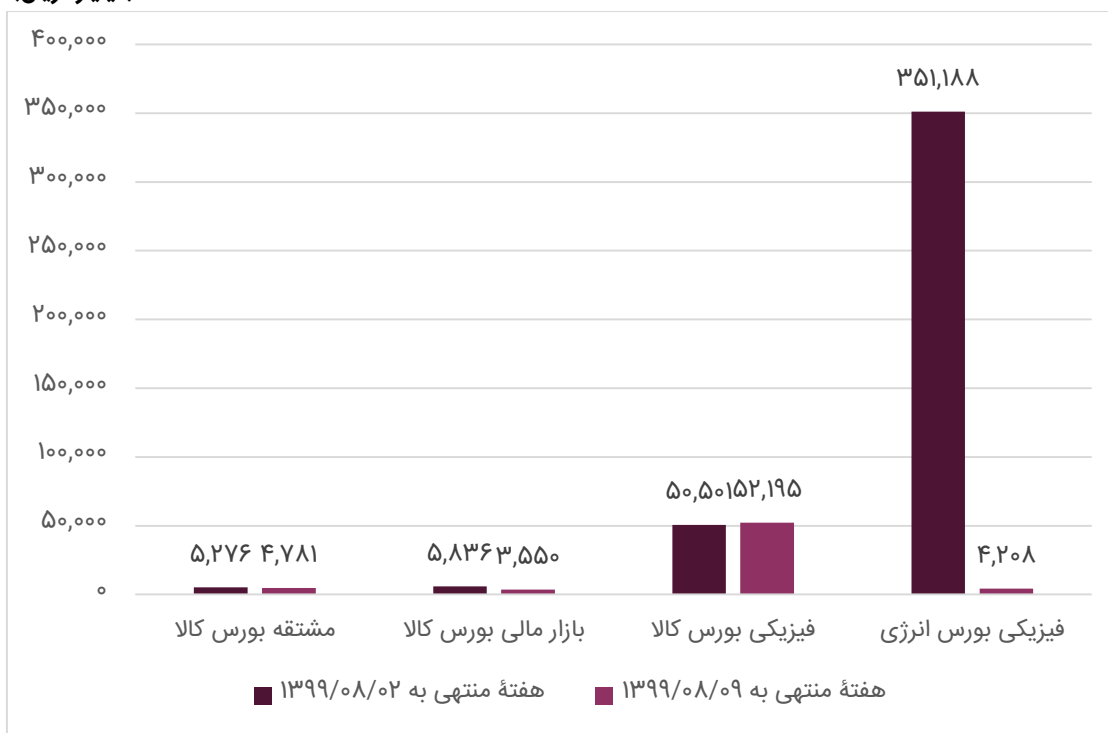
جدول (۱۱): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۵,۲۷۶	۴,۷۸۱	-۹/۳۸%
بازار مالی بورس کالا	۵,۸۳۶	۳,۵۵۰	-۳۹/۱۷%
فیزیکی بورس کالا	۵۰,۵۰۱	۵۲,۱۹۵	۳/۳۵%
فیزیکی بورس انرژی	۳۵۱,۱۸۸	۴,۲۰۸	-۹۸/۸۰%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)



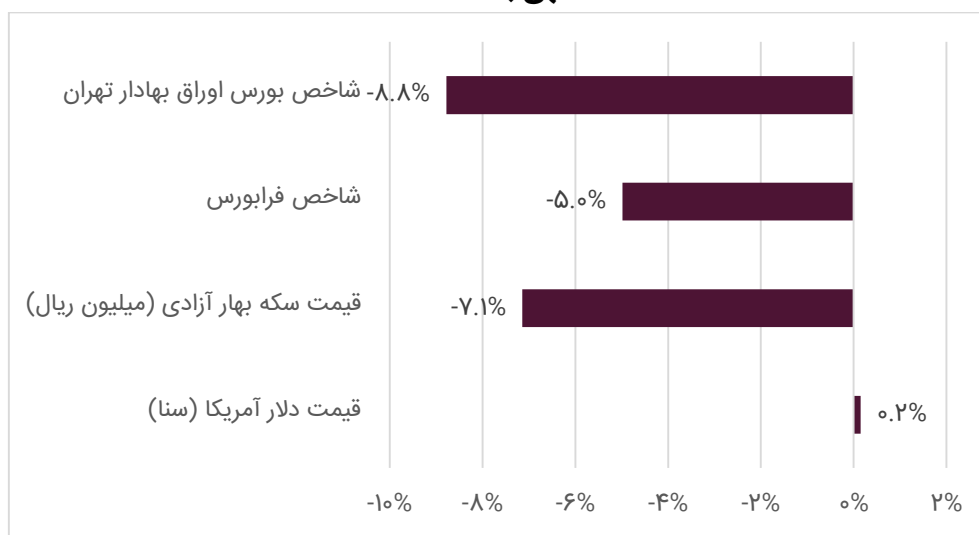
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۸ درصدی، بازدهی نامطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۴- درصدی، عملکرد نامطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۷ درصد کاهش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، تقریباً نسبت به هفته گذشته بدون تغییر باقی ماند.

جدول (۱۲): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۴۱۲,۳۵۵	۱,۲۸۸,۳۳۱	-۸/۷۸%
شاخص فرابورس	۱۶,۹۷۰	۱۶,۱۲۵	-۴/۹۸%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۴۰	۱۳۰	-۷/۱۴%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۷۱,۸۳۶	۲۷۲,۲۴۵	۰/۱۵%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

(ارقام برحسب دلار)

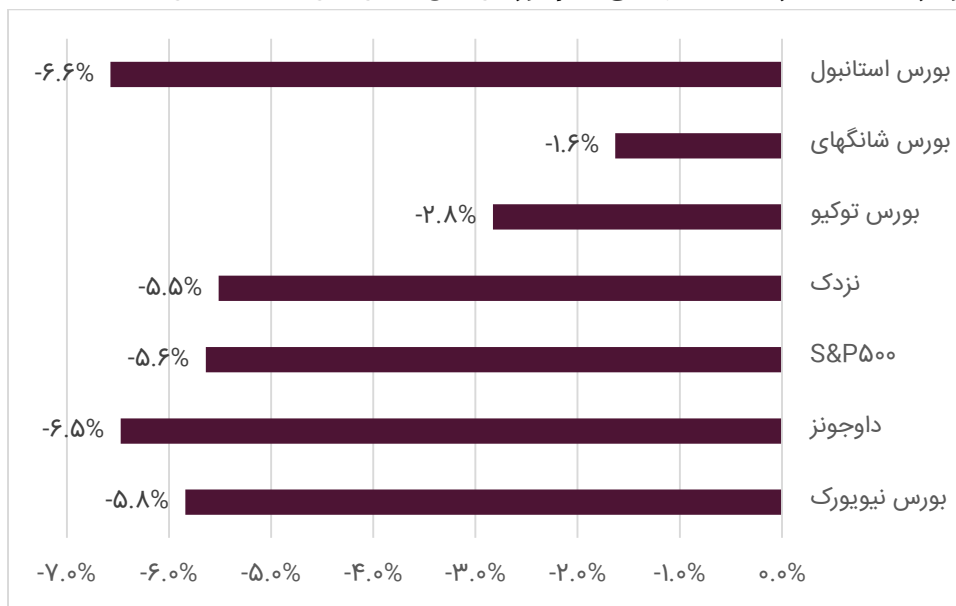
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۹۰۳	۱,۸۷۹	-۱/۲۵%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۳۹,۵۰	۳۴,۷۹	-۱۱/۹۲%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۱,۷۷	۳۷,۴۶	-۱۰/۳۱%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۰۹ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۲	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۳,۲۰۰	۱۲,۴۲۹	-۵/۸۳%
داوجونز	۲۸,۳۳۶	۲۶,۵۰۲	-۶/۴۷%
S&P ۵۰۰	۳,۴۶۵	۳,۲۷۰	-۵/۶۳%
نزدک	۱۱,۵۴۸	۱۰,۹۱۲	-۵/۵۱%
بورس توکیو	۱,۶۲۵	۱,۵۷۹	-۲/۸۲%
بورس شانگهای	۳,۲۷۸	۳,۲۲۵	-۱/۶۳%
بورس استانبول	۱,۱۹۱	۱,۱۱۲	-۶/۵۷%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۰۹



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 sadeghinassab.mr@gmail.com</p>	