

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۳۱

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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ 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.

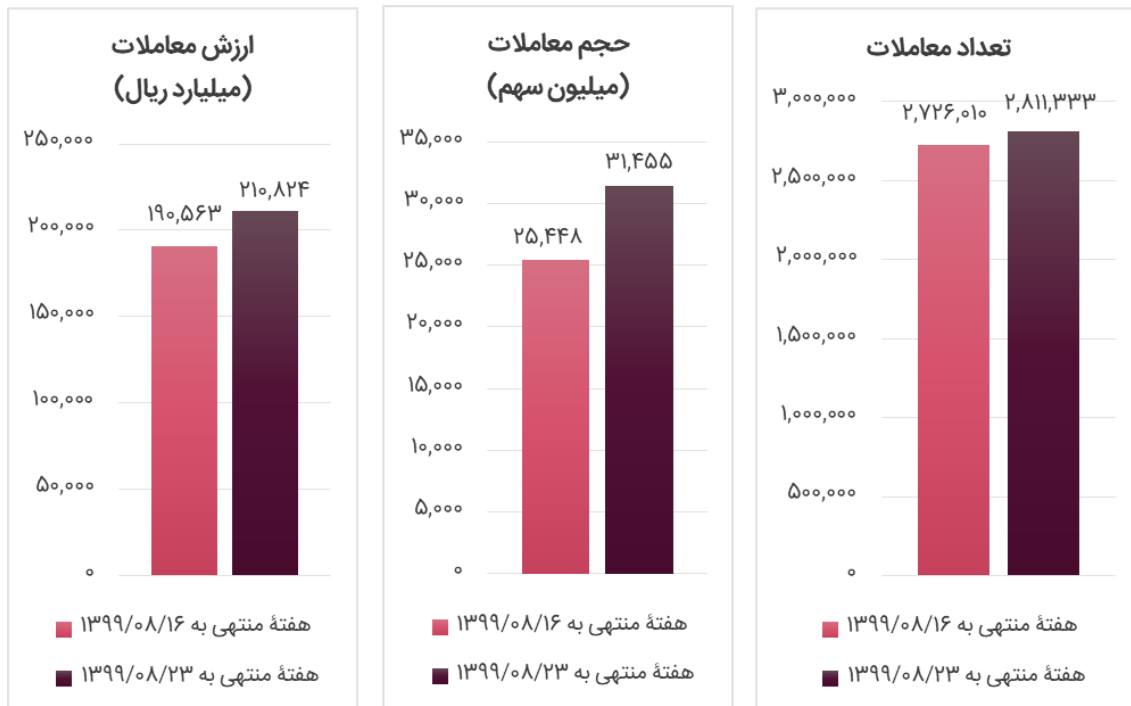
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ طی ۵ روز کاری، با ۶۹,۴۹۶ واحد کاهش، از ۱,۲۹۰,۵۷۱ به ۱,۲۲۱,۰۷۵ رسید. حجم معاملات ۶,۲۹۱ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۲۳ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۱۰ و ۳ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روزهای شنبه، یکشنبه، دوشنبه و سه‌شنبه به ترتیب کاهش ۲۷,۶۸۴، ۲۲,۳۶۳، ۲۵,۳۶۰ و ۳,۲۲۳ واحدی و در روز چهارشنبه افزایش ۹,۱۳۴ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۴		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۹۰,۵۶۳	۴۷,۶۴۱	۲۱۰,۸۲۴	۴۲,۱۶۵
حجم معاملات (میلیون سهم)	۲۵,۴۴۸	۶,۳۶۲	۳۱,۴۵۵	۶,۲۹۱
تعداد معاملات	۲,۷۲۶,۰۱۰	۶۸۱,۵۰۳	۲,۸۱۱,۳۳۳	۵۶۲,۲۶۷
				۱۰/۶۳%
				۲۳/۶۰%
				۳/۱۲%

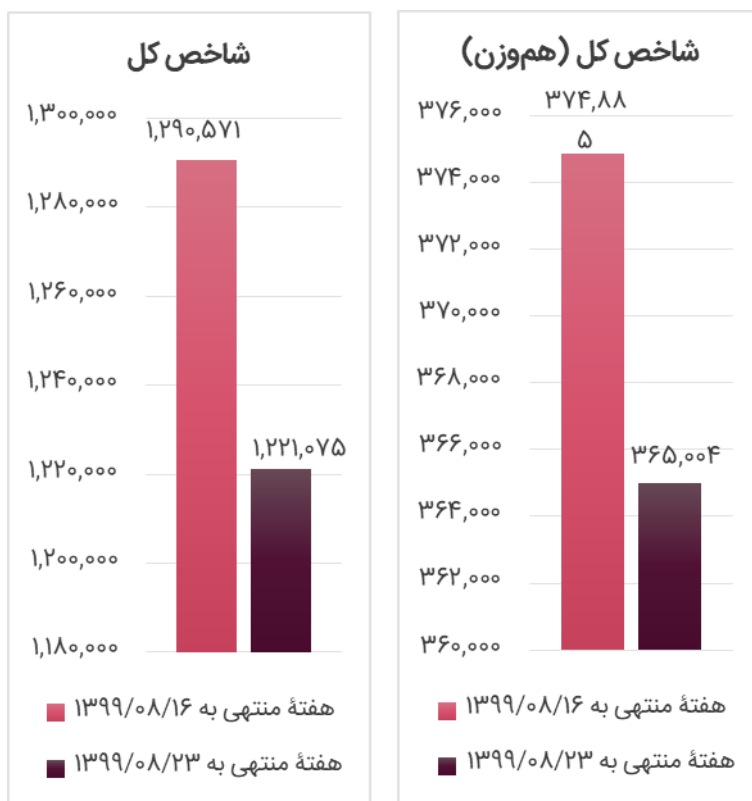
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۴۹,۰۵۳	۴۶,۴۱۱	-۵/۳۸%
شاخص کل	۱,۲۹۰,۵۷۱	۱,۲۲۱,۰۷۵	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۳۳۷,۵۱۹	۳۱۹,۳۴۱	
شاخص کل (هموزن)	۳۷۴,۸۸۵	۳۶۵,۰۰۴	-۲/۶۳%
شاخص قیمت (هموزن)	۲۴۵,۵۴۱	۲۳۹,۰۵۲	

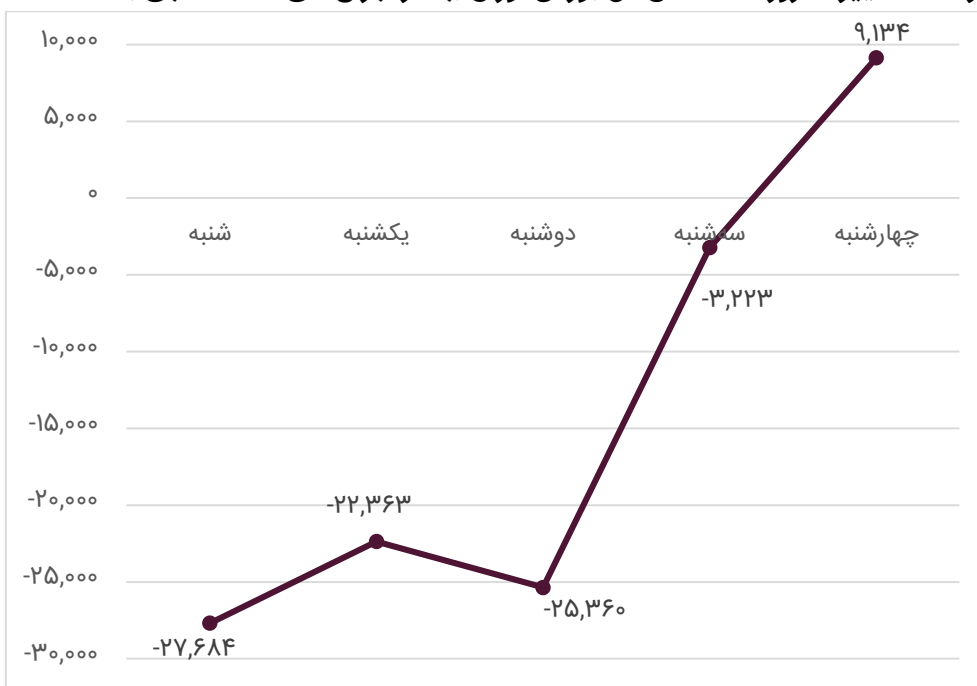
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن



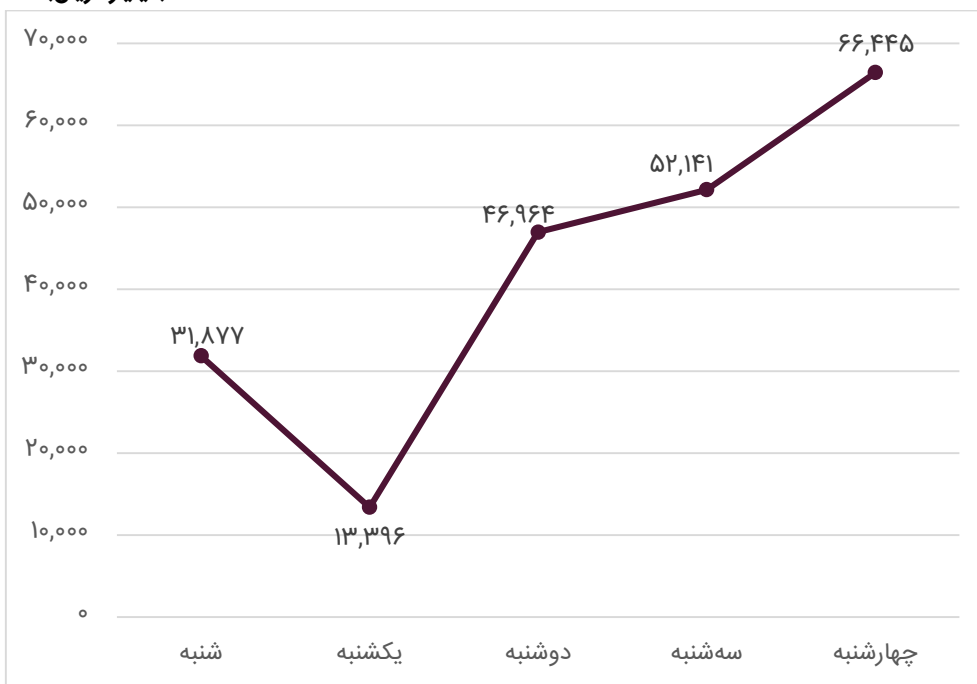
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۲۷,۶۸۴	-۲/۱۴%	۳۶۷,۰۰۱	۵,۵۹۸	۳۱,۸۷۷
یکشنبه	-۲۲,۳۶۳	-۱/۷۷%	۱۹۱,۷۱۶	۱,۱۷۰	۱۳,۳۹۶
دوشنبه	-۲۵,۳۶۰	-۲/۰۴%	۵۹۸,۷۳۷	۶,۷۹۷	۴۶,۹۶۴
سه شنبه	-۳,۲۲۳	-۰/۲۶%	۷۹۹,۸۵۹	۸,۵۲۲	۵۲,۱۴۱
چهارشنبه	۹,۱۳۴	۰/۷۵%	۸۵۴,۰۲۰	۹,۳۶۸	۶۶,۴۴۵

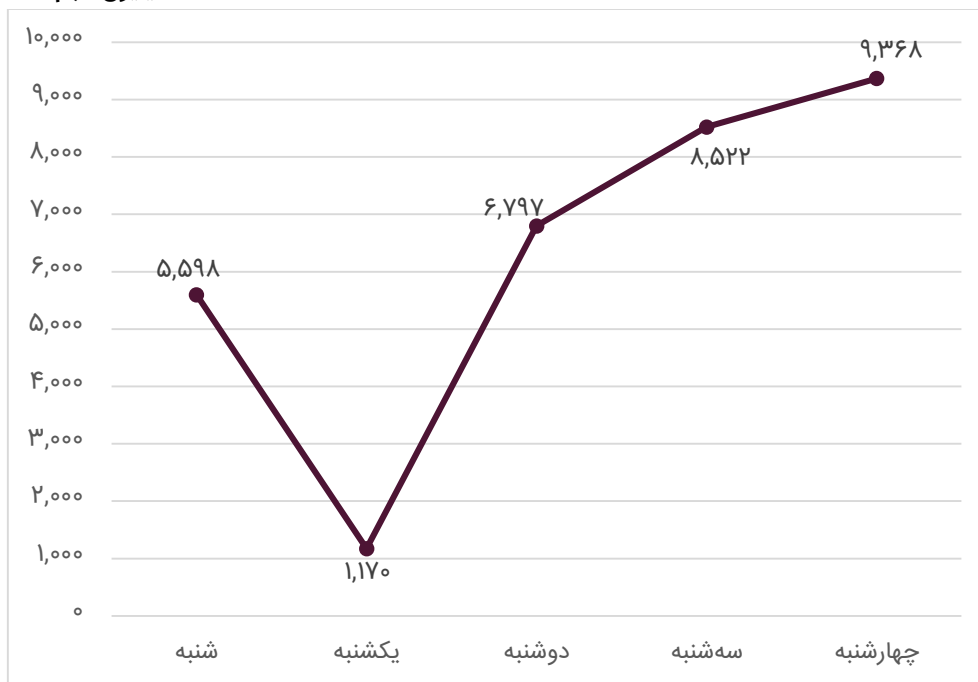
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ (میلیارد ریال)



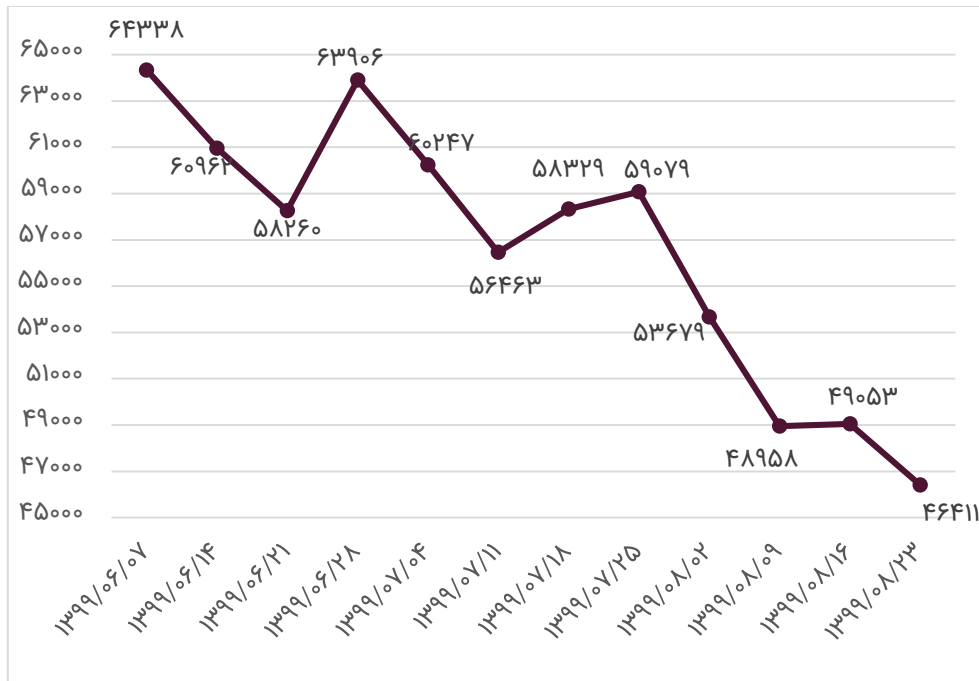
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۴۹,۰۵۳	۱۳۹۹/۰۸/۱۶
۴۶,۴۱۱	۱۳۹۹/۰۸/۲۳

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ (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 ۳,۰۹۱ و ۲,۱۴۵ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۳,۰۹۱
۲	محصولات چرمی	۱	۲,۱۴۵
۳	محصولات چوبی	۲	۳۱۹
۴	استخراج سایر معادن	۱	۱۰۵
۵	کاشی و سرامیک	۶	۷۹
۶	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۵۸
۷	قند و شکر	۱۴	۵۷
۸	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۵۶
۹	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۵۰
۱۰	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۴۹
۱۱	چاپ	۲	۴۷/۳

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱۲	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۱/۵
۱۳	محصولات فلزی	۹	۴۰/۹
۱۴	استخراج زغال سنگ	۱	۳۴/۰
۱۵	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۳۱/۶
۱۶	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۱۷	بیمه و بازنشستگی	۶	۲۹
۱۸	سیمان آهک گچ	۴۰	۲۶
۱۹	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۲۲/۵
۲۰	رایانه	۹	۲۲/۲
۲۱	فنی و مهندسی	۲	۲۲/۱
۲۲	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۰/۱
۲۳	کانی غیرفلزی	۱۵	۱۹/۹
۲۴	دستگاه‌های برقی	۱۱	۱۹/۵
۲۵	فرآورده‌های نفتی	۵۵	۱۹/۱
۲۶	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۱۹
۲۷	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۱۸/۲۸
۲۸	مخابرات	۲	۱۷/۹۴
۲۹	فلزات اساسی	۳۴	۱۷/۴
۳۰	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۷/۱
۳۱	دارویی	۳۱	۱۶/۵۹
۳۲	استخراج کانه‌های فلزی	۱۷	۱۴/۲۸
۳۳	خرده‌فروشی	۱	۱۳/۶۲
۳۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۲/۹
۳۵	شیمیایی	۴۵	۱۲/۷
۳۶	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۲/۶
۳۷	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۱۱/۹
۳۸	محصولات کاغذی	۳	۱۰
۳۹	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۶	۰
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۰
۴۱	منسوجات	۱۴	-۴۳

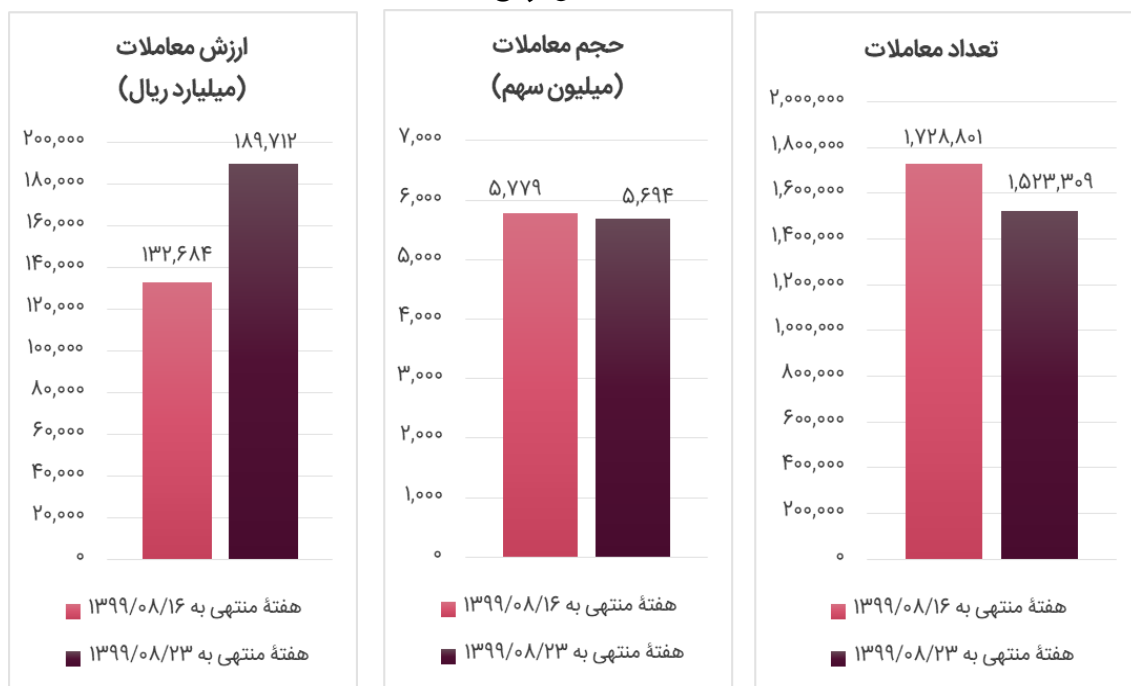
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ طی ۵ روز کاری، با ۵۷۰ واحد کاهش، از ۱۶,۱۶۵ به عدد ۱۵,۵۹۵ رسید. حجم معاملات ۱,۱۳۹ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش ۱ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۴۲ درصد افزایش و ۱۱ درصد کاهش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۴		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۳۲,۶۸۴	۳۳,۱۷۱	۱۸۹,۷۱۲	۳۷,۹۴۲
حجم معاملات (میلیون سهم)	۵,۷۷۹	۱,۴۴۵	۵,۶۹۴	۱,۱۳۹
تعداد معاملات	۱,۷۲۸,۸۰۱	۴۳۲,۲۰۰	۱,۵۲۳,۳۰۹	۳۰۴,۶۶۲
				میزان رشد
				۴۲/۹۸%
				-۱/۴۶%
				-۱۱/۸۸%

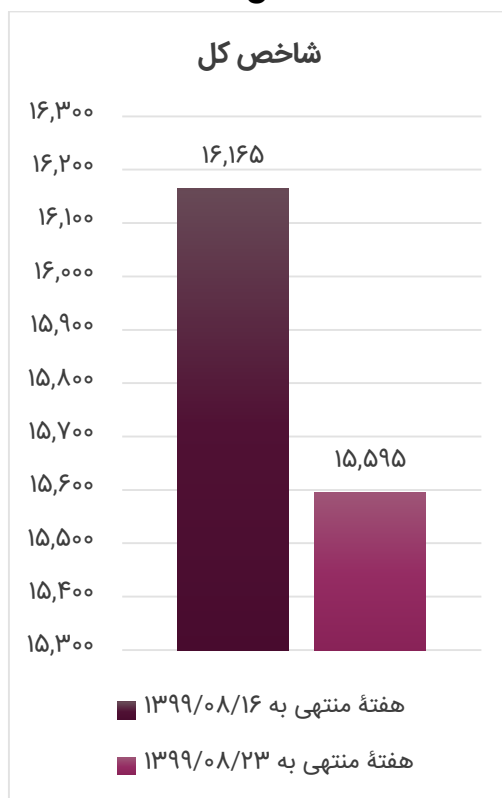
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۰,۹۹۵	۱۰,۶۰۷	-۳/۵۲%
شاخص کل	۱۶,۱۶۵	۱۵,۵۹۵	-۳/۵۲%

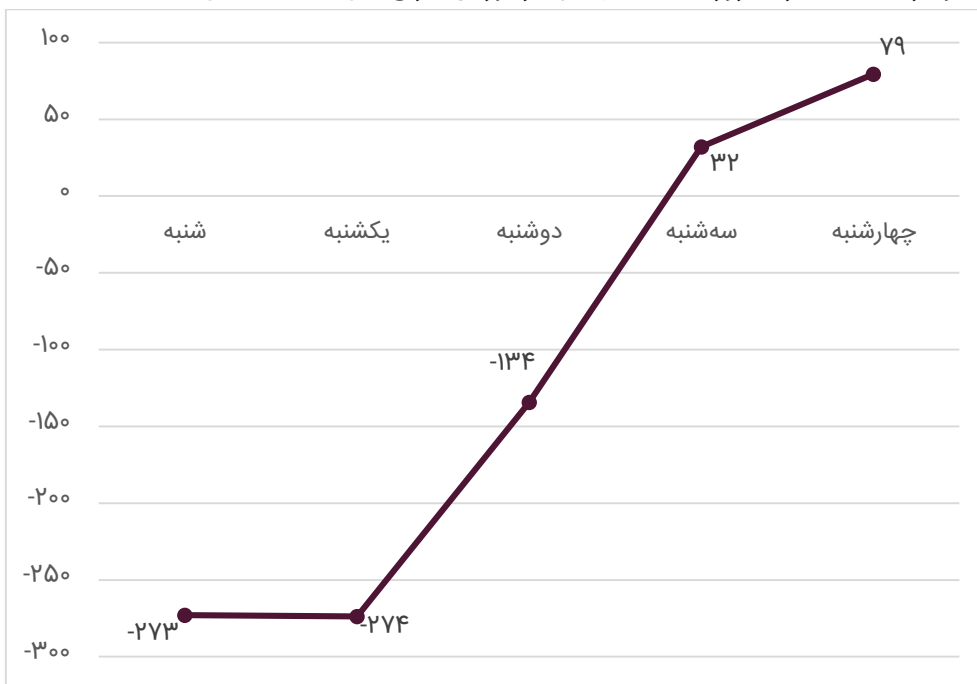
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن



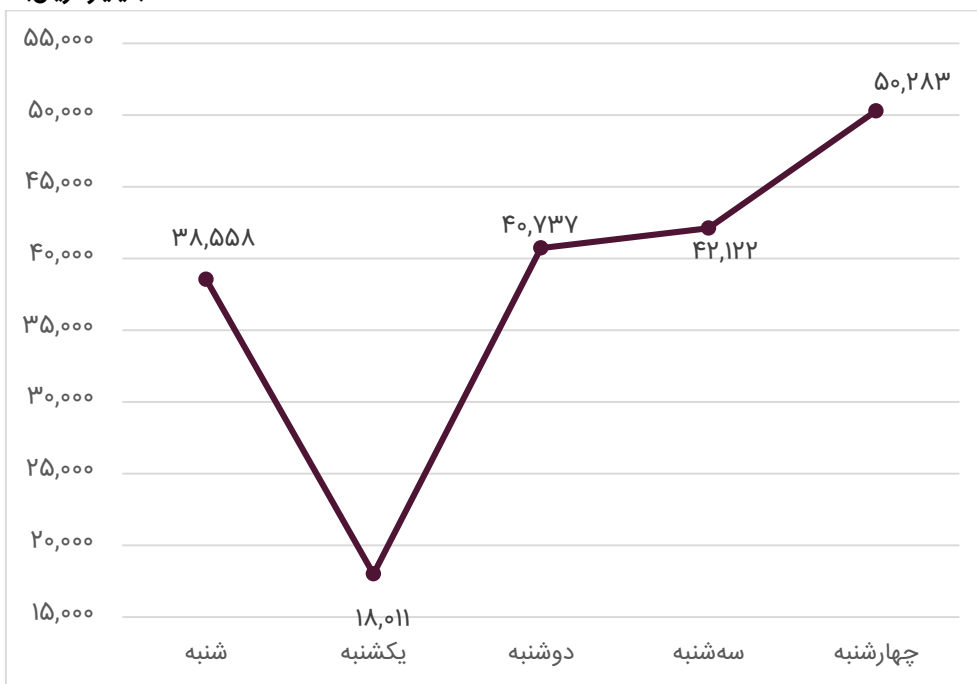
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۲۷۳	-۱/۶۸%	۲۰۶,۱۹۲	۹۶۴	۳۸,۵۵۸
یکشنبه	-۲۷۴	-۱/۷۲%	۱۶۴,۷۰۱	۸۳۹	۱۸,۰۱۱
دوشنبه	-۱۳۴	-۰/۸۶%	۳۱۰,۸۸۹	۱,۱۳۹	۴۰,۷۳۷
سه شنبه	۳۲	۰/۲۰%	۴۳۵,۶۴۲	۱,۳۱۵	۴۲,۱۲۲
چهارشنبه	۷۹	۰/۵۱%	۴۰۵,۸۸۵	۱,۴۳۸	۵۰,۲۸۳

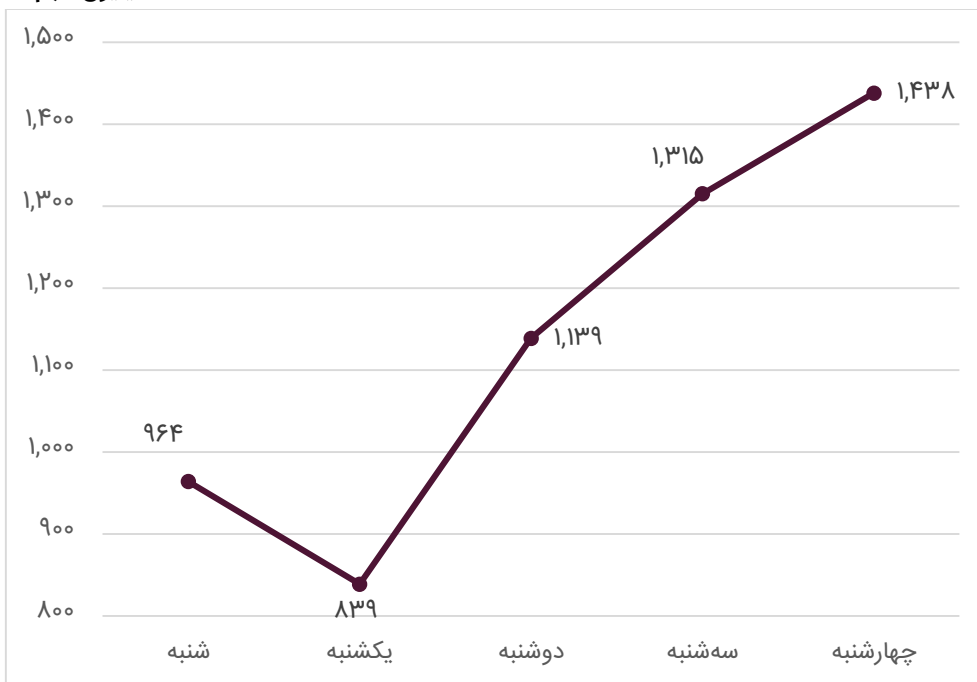
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ (میلیارد ریال)

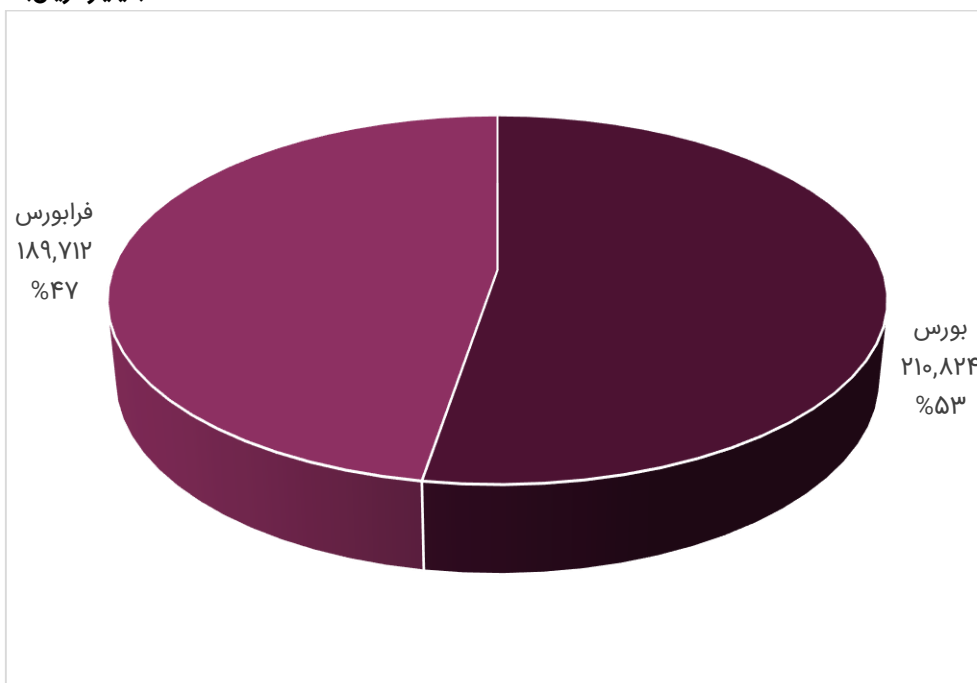


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

(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 ۲,۴۱۵ و ۱۵۷ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۴۱۵
۲	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۵۷
۳	محصولات فلزی	۸	۱۵۱
۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۱۳
۵	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۰۹,۸
۶	سایر حمل و نقل	۲	۸۶
۷	قند و شکر	۸	۷۶,۴
۸	رایانه	۸	۶۸
۹	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۲
۱۰	سیمان آهک گچ	۱۲	۵۷
۱۱	استخراج زغال سنگ	۳	۵۳
۱۲	فلزات اساسی	۲۴	۴۸
۱۳	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۵,۶
۱۴	خودرو و قطعات	۱۱	۴۲,۶
۱۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۹	۳۹
۱۶	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۳۷
۱۷	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۶,۶
۱۸	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۳۴,۱
۱۹	فرآورده‌های نفتی	۹	۳۲
۲۰	هتل و رستوران	۹	۲۷,۱۴
۲۱	فنی و مهندسی	۹	۲۶,۱
۲۲	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۲۵
۲۳	دارویی	۱۶	۲۱,۶
۲۴	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۱
۲۵	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۲۱
۲۶	شیمیایی	۴۳	۲۰,۸
۲۷	پیمانکاری صنعتی	۵	۱۸,۴
۲۸	عمده‌فروشی	۳	۱۴,۹

ردیف	صنعت	تعداد شرکتها	P/E موزون
۲۹	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۱/۰
۳۰	منسوجات	۷	۱۰/۸
۳۱	خرده‌فروشی	۲	۷/۲
۳۲	سرمایه گذاری‌ها	۴۴	۵/۱
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	-۱۳/۷
۳۷	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۱۸
۳۸	کاشی و سرامیک	۱۱	-۳۴
۳۹	وسایل ارتباطی	۲	-۱۱۵
۴۰	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	-۱۵۰
۴۱	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	-۳۸۸
۴۲	کانی غیرفلزی	۱۸	-۶۷۷

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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳، 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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

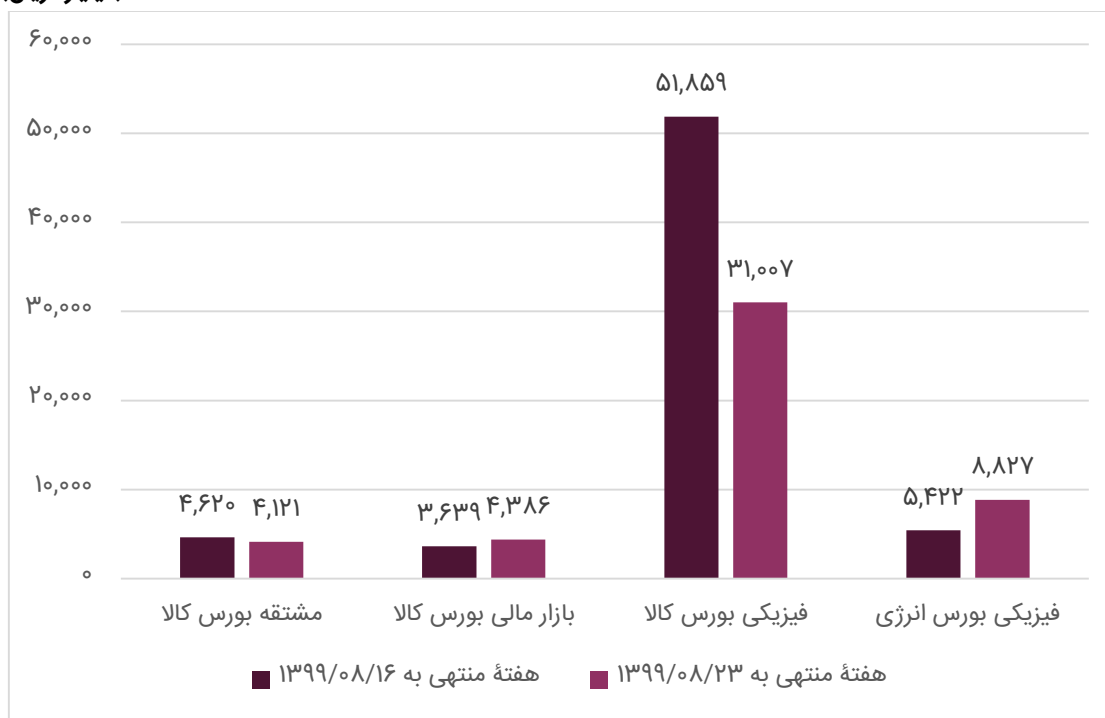
(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۲۴۴	۸۴۶	۵۳۳	۱۲
یکشنبه	۱,۰۳۴	۹۱۶	۲,۴۱۸	۲۵۳
دوشنبه	۹۸۷	۹۸۲	۵,۸۴۴	۷۸۲
سه‌شنبه	۱,۳۵۸	۴۷۳	۱۴,۶۷۷	۱,۶۷۵
چهارشنبه	۷۶۲	۴۳۰	۷,۵۳۴	۶,۱۰۶
پنجشنبه	۰	۴۷۶	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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۴,۶۲۰	۴,۱۲۱	-۱۰/۷۸%
بازار مالی بورس کالا	۳,۶۳۹	۴,۳۸۶	۲۰/۵۱%
فیزیکی بورس کالا	۵۱,۸۵۹	۳۱,۰۰۷	-۴۰/۲۰%
فیزیکی بورس انرژی	۵,۴۲۲	۸,۸۲۷	۶۲/۸۰%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



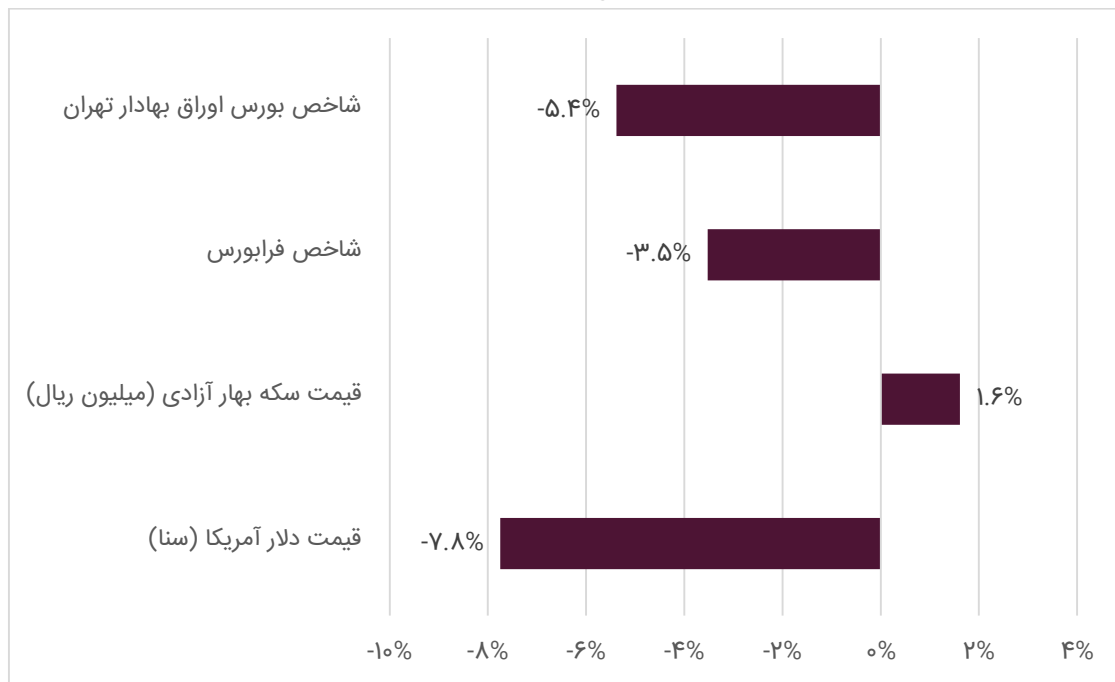
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۵ درصدی، بازدهی نامطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران نیز با بازدهی ۳- درصدی، عملکرد نامطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۱ درصد افزایش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، کاهش بیش از ۷ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۲۹۰,۵۷۱	۱,۲۲۱,۰۷۵	-۵/۳۸%
شاخص فرابورس	۱۶,۱۶۵	۱۵,۵۹۵	-۳/۵۲%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۲۳/۰	۱۲۵/۰	۱/۶۲%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۸۵,۳۷۳	۲۶۳,۲۵۳	-۷/۷۵%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

(ارقام برحسب دلار)

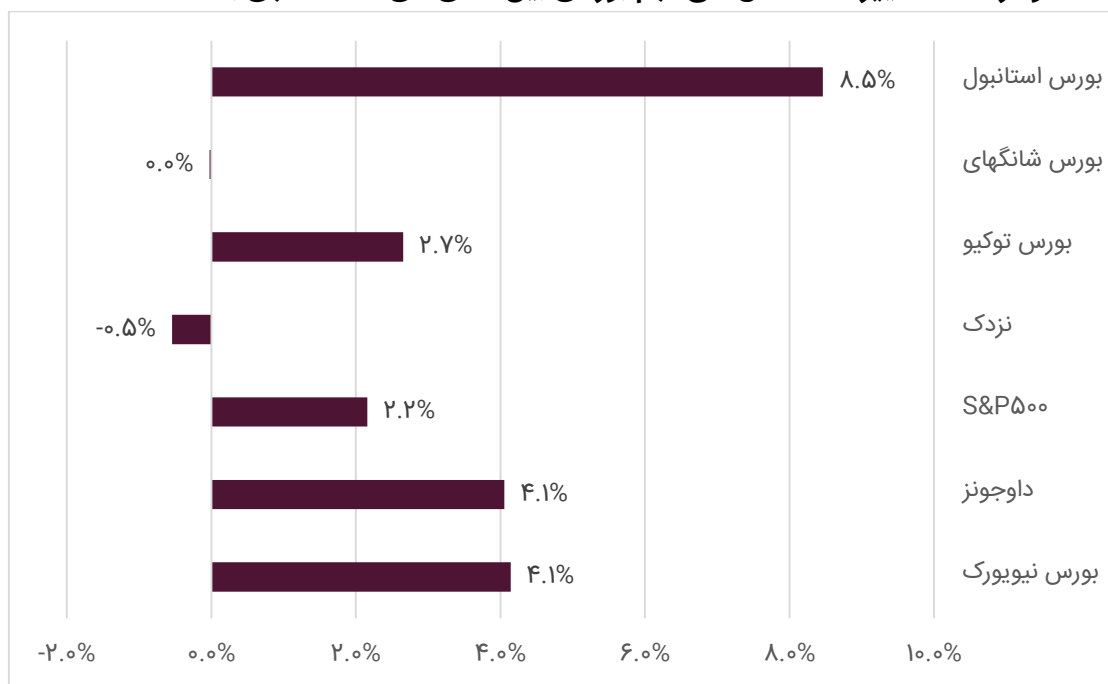
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۹۵۴	۱,۸۷۶	-۳/۹۷%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۳۷,۰۰۰	۴۰,۶۳۰	۹/۸۱%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۳۹,۶۰۰	۴۲,۷۸۰	۸/۰۳%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۲۳ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۱۶	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۳,۲۱۴	۱۳,۷۶۱	۴/۱۴%
داوجونز	۲۸,۳۳۱	۲۹,۴۸۰	۴/۰۵%
S&P ۵۰۰	۳,۵۰۹	۳,۵۸۵	۲/۱۵%
نزدک	۱۱,۸۹۴	۱۱,۸۲۹	-۰/۵۴%
بورس توکیو	۱,۶۵۹	۱,۷۰۳	۲/۶۵%
بورس شانگهای	۳,۳۱۱	۳,۳۱۰	-۰/۰۲%
بورس استانبول	۱,۱۹۱	۱,۲۹۱	۸/۴۵%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳



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