

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۳۲

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.

۲-۱- بازارگردانی انواع اوراق بدهی و سهام با استفاده از روش‌های نوین معاملات الگوریتمی مبنی بر حمایت اوراق بهادار ناشر.

۳-۱- سبذگردانی اختصاصی.

۲- خدمات تأمین مالی

۱-۲- خدمات مشاوره مالی شامل مشاوره افزایش سرمایه و عرضه سهام جدید در بورس، ارزشگذاری، مشاوره پذیرش، تدوین طرح کسب و کار 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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ 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.

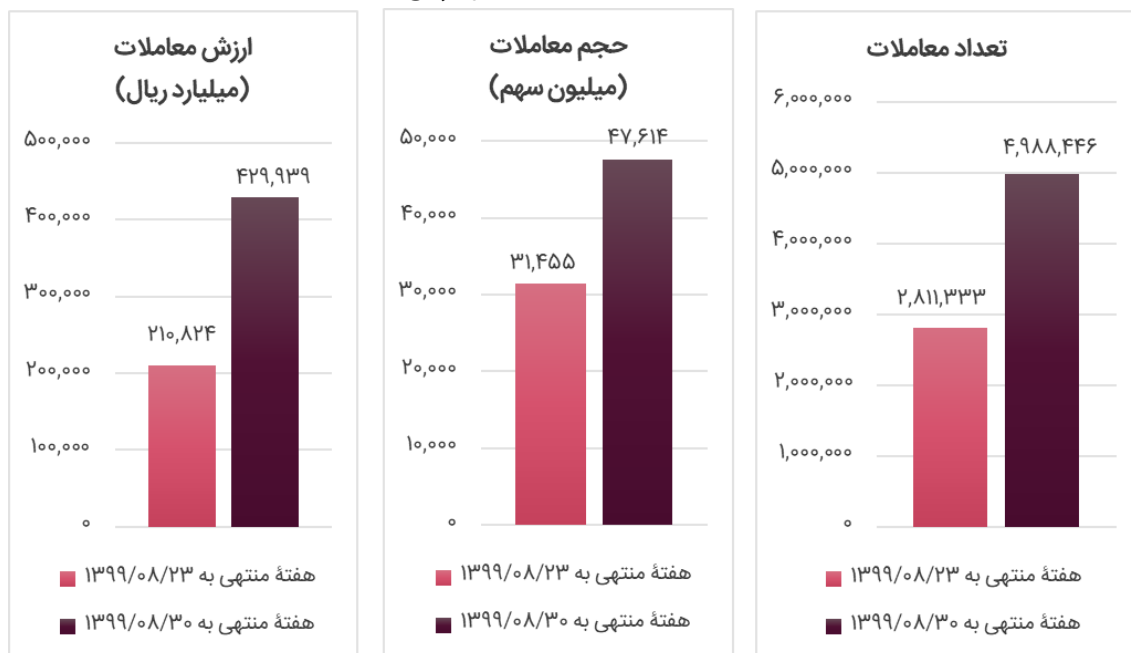
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ طی ۵ روز کاری، با ۱۲۴,۲۲۶ واحد افزایش، از ۱,۲۲۱,۰۷۵ به ۱,۳۴۵,۳۰۱ رسید. حجم معاملات ۹,۵۲۳ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۵۱ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۱۰۳ و ۷۷ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روزهای شنبه، یکشنبه، دوشنبه، سه‌شنبه و چهارشنبه به ترتیب افزایش ۲۶,۵۷۴، ۹,۷۰۸، ۱۶,۴۹۰، ۲۳,۱۰۰ و ۴۸,۳۵۴ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰		میزان رشد
	کل	میانگین	کل	میانگین	
روزهای فعالیت	۵		۵		
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۱۰,۸۲۴	۴۲,۱۶۵	۴۲۹,۹۳۹	۸۵,۹۸۸	۱۰۳/۹۳%
حجم معاملات (میلیون سهم)	۳۱,۴۵۵	۶,۲۹۱	۴۷,۶۱۴	۹,۵۲۳	۵۱/۳۷%
تعداد معاملات	۲,۸۱۱,۳۳۳	۵۶۲,۲۶۷	۴,۹۸۸,۴۴۶	۹۹۷,۶۸۹	۷۷/۴۴%

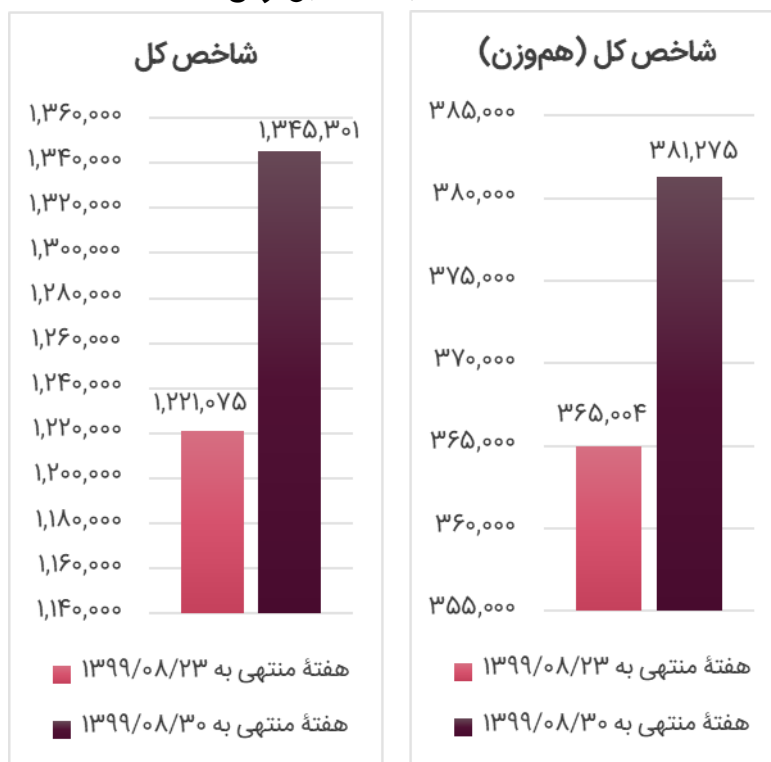
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۴۶,۴۱۱	۵۱,۸۵۸	۱۰/۱۷%
شاخص کل	۱,۲۲۱,۰۷۵	۱,۳۴۵,۳۰۱	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۳۱۹,۳۴۱	۳۵۱,۸۲۸	
شاخص کل (هموزن)	۳۶۵,۰۰۴	۳۸۱,۲۷۵	۴/۴۵%
شاخص قیمت (هموزن)	۲۳۹,۰۵۲	۲۴۹,۷۰۲	

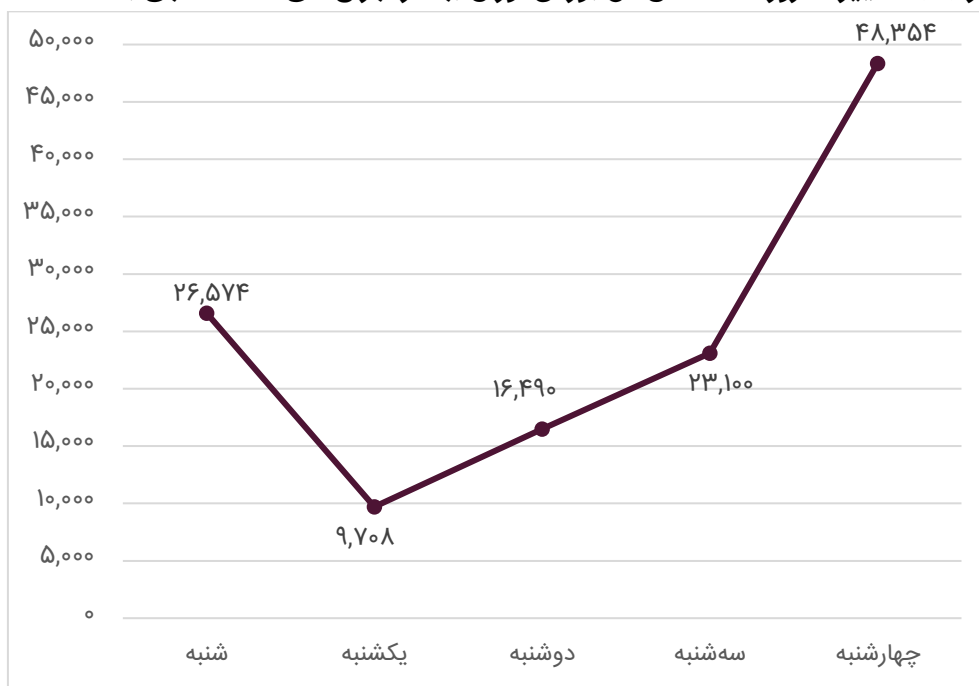
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن



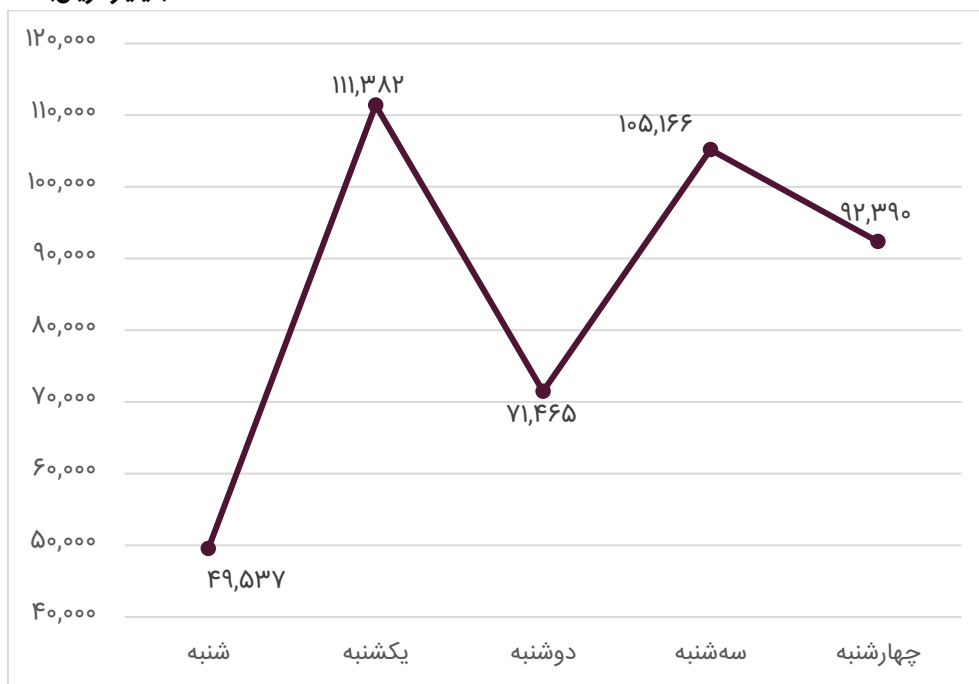
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۲۶,۵۷۴	۲/۱۷%	۶۴۰,۸۹۲	۴,۵۲۱	۴۹,۵۳۷
یکشنبه	۹,۷۰۸	۰/۷۷%	۱,۲۶۰,۳۸۸	۱۶,۶۳۵	۱۱۱,۳۸۲
دوشنبه	۱۶,۴۹۰	۱/۳۱%	۹۰۰,۵۹۴	۹,۱۹۳	۷۱,۴۶۵
سه شنبه	۲۳,۱۰۰	۱/۸۱%	۱,۰۷۸,۵۷۲	۹,۸۳۹	۱۰۵,۱۶۶
چهارشنبه	۴۸,۳۵۴	۳/۷۲%	۱,۱۰۸,۰۰۰	۷,۴۲۵	۹۲,۳۹۰

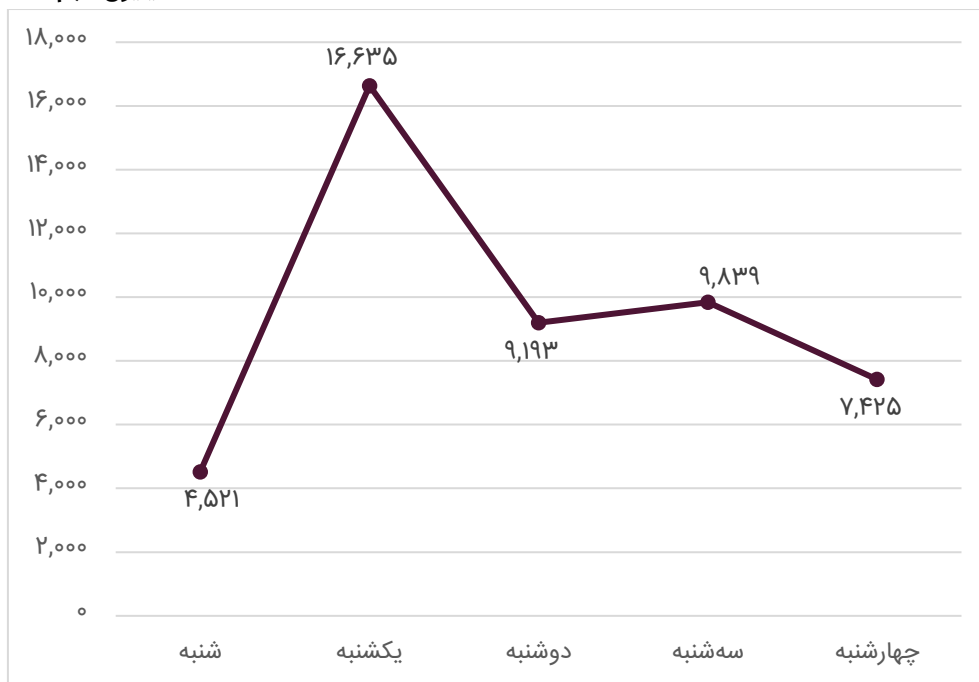
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (میلیارد ریال)



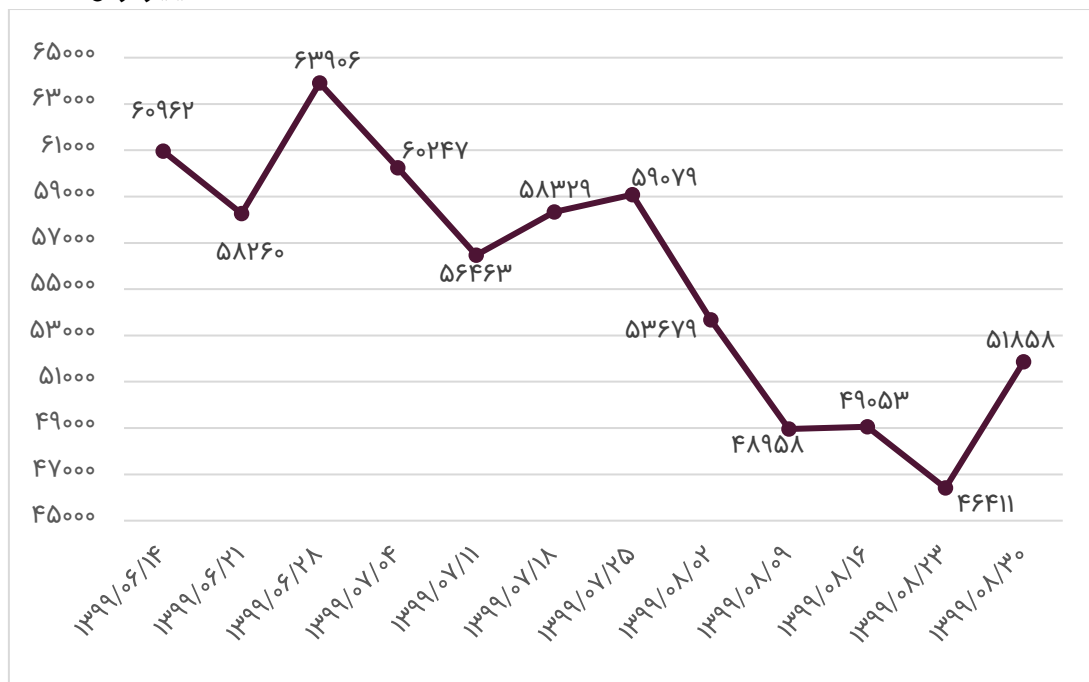
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۵۱,۸۵۸	۱۳۹۹/۰۸/۳۰

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (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 ۲,۵۴۰ و ۲,۰۴۷ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۲,۵۴۰
۲	محصولات چرمی	۱	۲,۰۴۷
۳	محصولات چوبی	۲	۳۰۳
۴	استخراج سایر معادن	۱	۹۸
۵	کاشی و سرامیک	۶	۸۰
۶	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۶۴
۷	سایر واسطه‌گری‌های مالی	۱	۶۰
۸	قند و شکر	۱۴	۵۹
۹	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۵۳
۱۰	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۷
۱۱	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۴۳/۳

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱۲	چاپ	۲	۴۳
۱۳	محصولات فلزی	۹	۴۰
۱۴	استخراج زغال سنگ	۱	۳۴
۱۵	بیمه و بازنشستگی	۶	۳۲/۴
۱۶	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۳۲
۱۷	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۱۸	سیمان آهک گچ	۴۰	۲۷
۱۹	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	۲۶/۴
۲۰	فنی و مهندسی	۲	۲۶/۱
۲۱	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۲/۸۳
۲۲	رایانه	۹	۲۲/۸۰
۲۳	فرآورده‌های نفتی	۵۵	۲۲/۵
۲۴	مخابرات	۲	۲۲/۰
۲۵	دستگاه‌های برقی	۱۱	۲۱/۲
۲۶	فلزات اساسی	۳۴	۲۱
۲۷	کانی غیرفلزی	۱۵	۲۰/۲۳
۲۸	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۲۰
۲۹	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۱۹
۳۰	دارویی	۳۱	۱۷
۳۱	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۶/۵
۳۲	استخراج کانه‌های فلزی	۱۷	۱۶
۳۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۴/۲
۳۴	خرده‌فروشی	۱	۱۴/۱
۳۵	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۳/۷
۳۶	شیمیایی	۴۶	۱۳/۵
۳۷	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۱۳
۳۸	محصولات کاغذی	۳	۱۱
۳۹	سرمایه گذاری‌ها	۴۶	۰
۴۰	خودرو و قطعات	۳۱	-۳۵
۴۱	منسوجات	۱۴	-۴۲

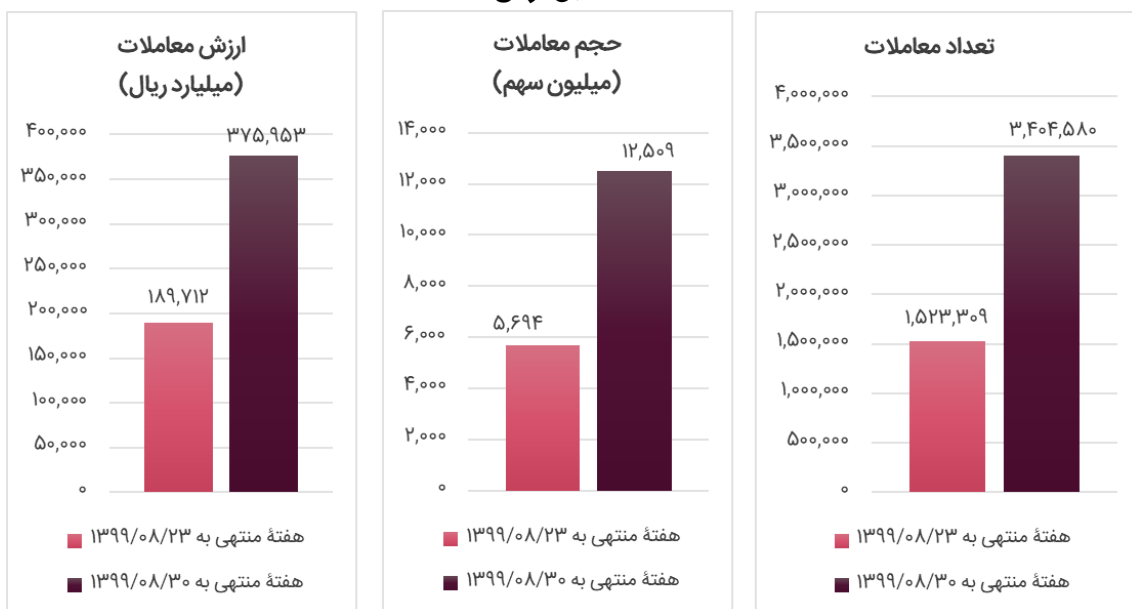
۲-۱- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ طی ۵ روز کاری، با ۱,۰۵۲ واحد افزایش، از ۱۵,۵۹۵ به عدد ۱۶,۶۴۷ رسید. حجم معاملات ۲,۵۰۲ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۱۱۹ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۹۸ و ۱۲۳ درصد افزایش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰		
	کل	میانگین	کل	میانگین	
روزهای فعالیت	۵	۵	۵	۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۸۹,۷۱۲	۳۷,۹۴۲	۳۷۵,۹۵۳	۷۵,۱۹۱	۹۸/۱۷%
حجم معاملات (میلیون سهم)	۵,۶۹۴	۱,۱۳۹	۱۲,۵۰۹	۲,۵۰۲	۱۱۹/۶۸%
تعداد معاملات	۱,۵۲۳,۳۰۹	۳۰۴,۶۶۲	۳,۴۰۴,۵۸۰	۶۸۰,۹۱۶	۱۲۳/۴۹%

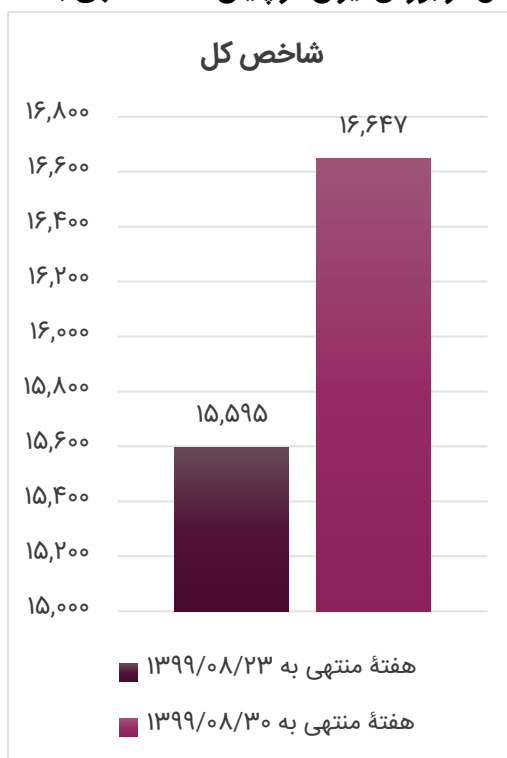
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۰,۶۰۷	۱۱,۳۲۳	۶/۷۵%
شاخص کل	۱۵,۵۹۵	۱۶,۶۴۷	۶/۷۴%

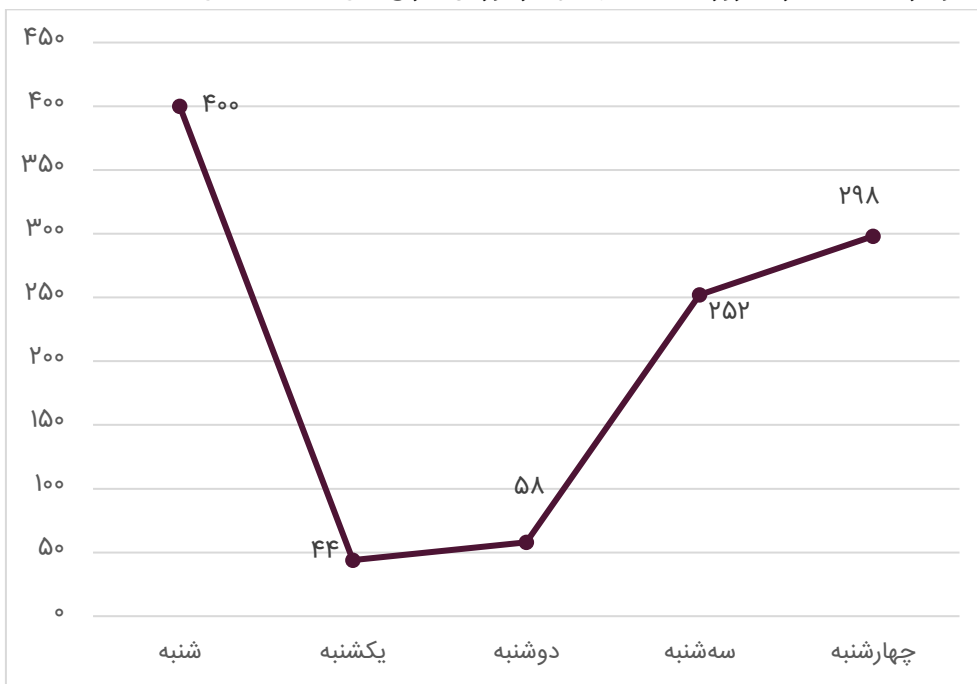
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن



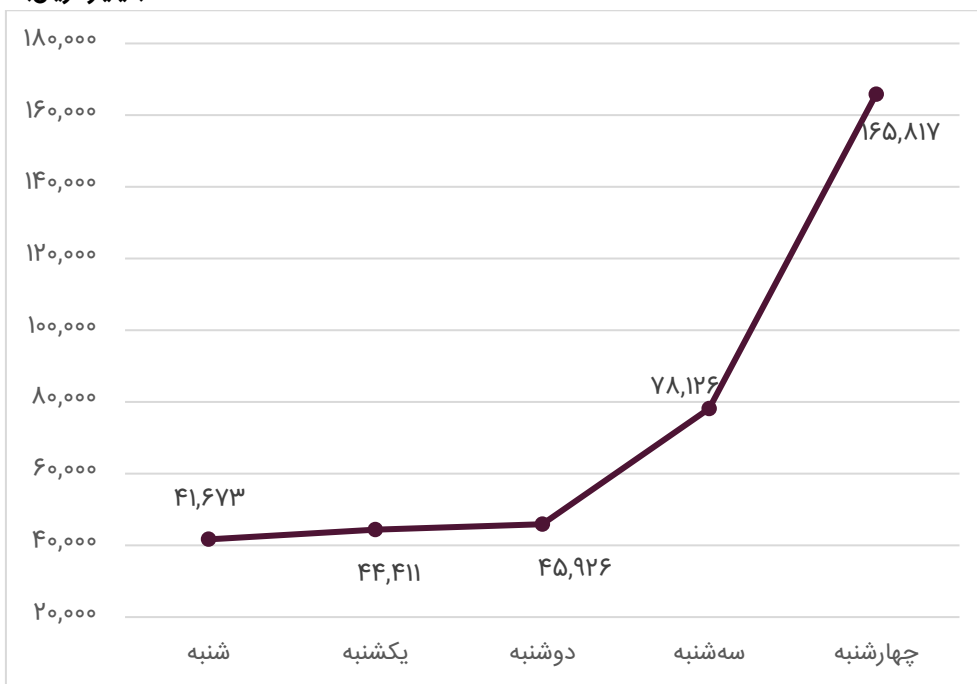
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۴۰۰	۲/۵۶%	۷۶۰,۱۵۶	۲,۲۱۰	۴۱,۶۷۳
یکشنبه	۴۴	۰/۲۷%	۶۳۰,۷۵۷	۲,۵۴۳	۴۴,۴۱۱
دوشنبه	۵۸	۰/۳۶%	۵۵۸,۵۸۰	۲,۱۸۹	۴۵,۹۲۶
سه شنبه	۲۵۲	۱/۵۶%	۶۸۶,۲۷۳	۲,۵۹۳	۷۸,۱۲۶
چهارشنبه	۲۹۸	۱/۸۲%	۷۶۸,۸۱۴	۲,۹۷۴	۱۶۵,۸۱۷

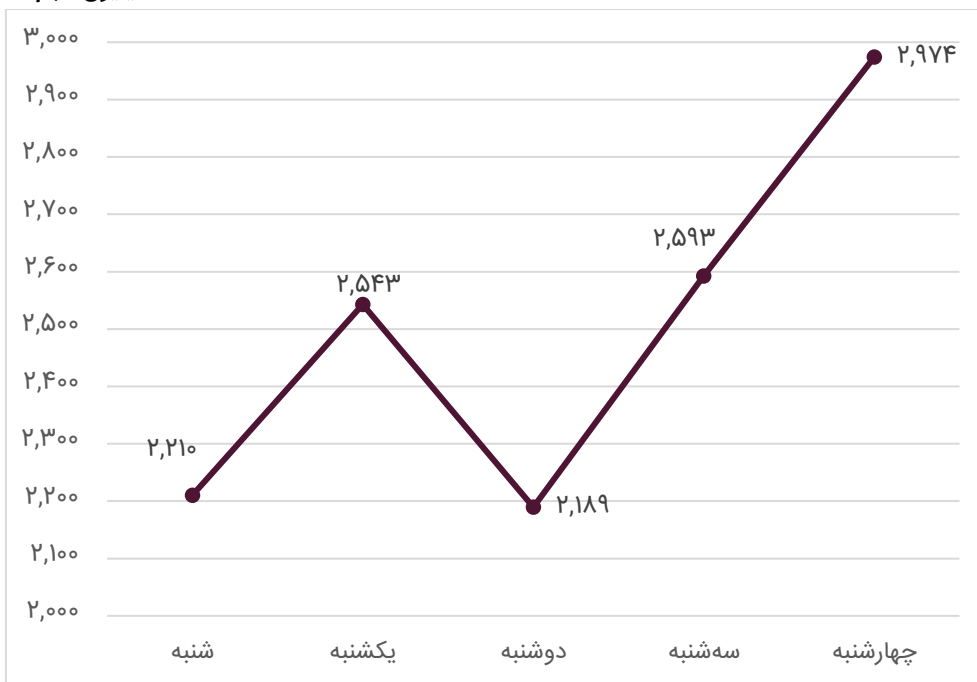
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (میلیارد ریال)

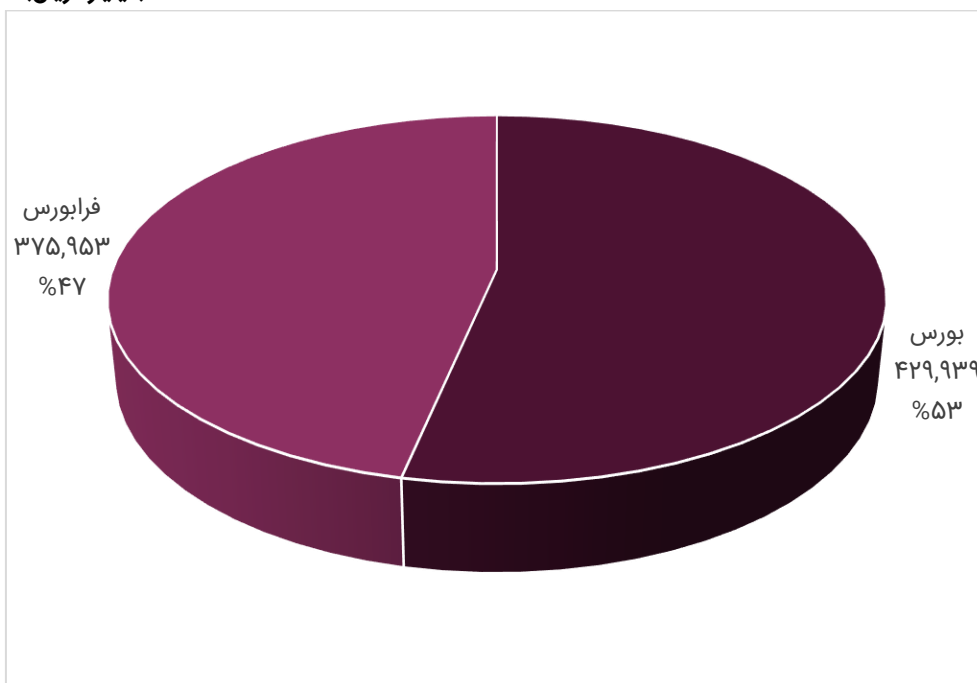


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

(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 ۲,۳۶۷ و ۱۵۰ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۳۶۷
۲	محصولات فلزی	۸	۱۵۰
۳	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۴۸
۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۱۹
۵	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۱۰۸
۶	سایر حمل و نقل	۲	۸۴
۷	قند و شکر	۸	۷۸
۸	رایانه	۸	۶۶
۹	لاستیک و پلاستیک	۵	۶۲
۱۰	سیمان آهک گچ	۱۲	۵۶
۱۱	فلزات اساسی	۲۴	۵۲
۱۲	استخراج زغال سنگ	۳	۵۰
۱۳	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۶/۴
۱۴	خودرو و قطعات	۱۱	۴۶/۱
۱۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۹	۴۱
۱۶	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۳۹
۱۷	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۳۸/۷
۱۸	فرآورده‌های نفتی	۹	۳۵
۱۹	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۳۲
۲۰	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۰
۲۱	هتل و رستوران	۹	۲۸/۴
۲۲	فنی و مهندسی	۹	۲۸/۳
۲۳	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۲۴
۲۴	شیمیایی	۴۲	۲۲
۲۵	دارویی	۱۶	۲۱/۸
۲۶	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۲۱/۶
۲۷	پیمانکاری صنعتی	۵	۱۷

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۲۸	عمده‌فروشی	۳	۱۶
۲۹	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۱
۳۰	منسوجات	۷	۱۰
۳۱	خرده‌فروشی	۲	۷
۳۲	سرمایه گذاری‌ها	۴۴	۶
۳۳	تجارت عمده و خرده‌فروشی وسائط نقلیه موتور	۱	۳
۳۴	محصولات چوبی	۴	۰
۳۵	محصولات کاغذی	۴	-۰/۴
۳۶	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۵	-۱۴
۳۷	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	-۱۹
۳۸	کاشی و سرامیک	۱۱	-۳۷
۳۹	وسایل ارتباطی	۲	-۱۱۱
۴۰	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	-۱۵۰
۴۱	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	-۳۸۸
۴۲	کانی غیرفلزی	۱۸	-۶۵۲

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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰، با هفته قبل از آن مورد مقایسه قرار گرفته است.

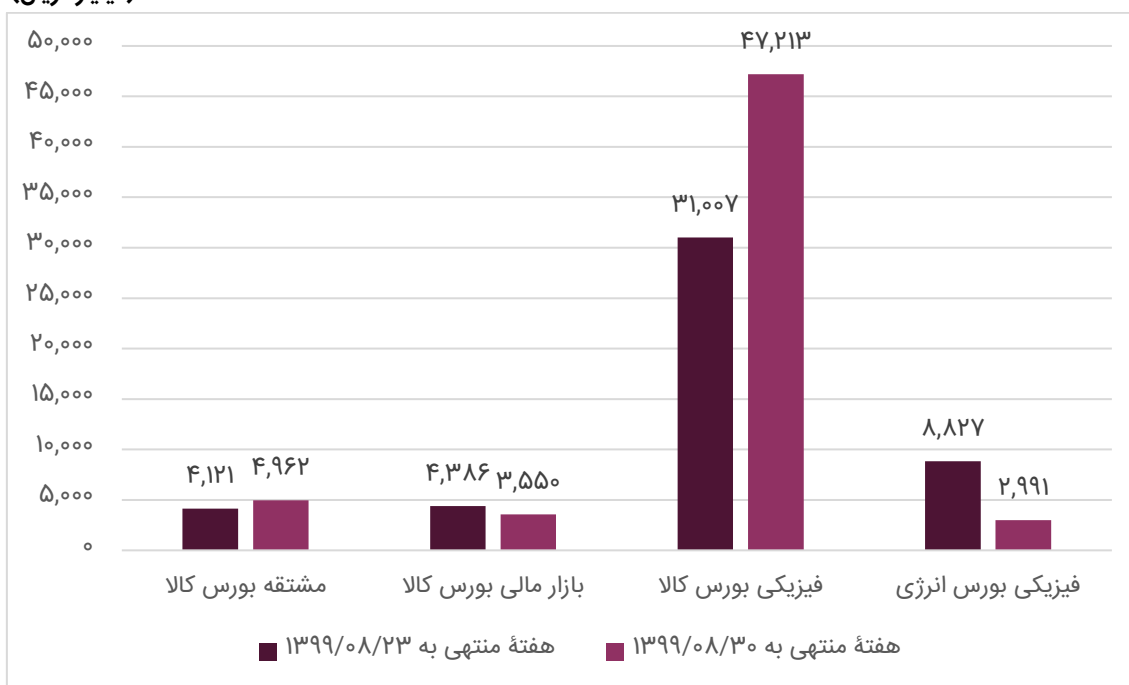
جدول (۱۰): آمار روزانه ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ (میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۶۳۹	۴۲۲	۳,۰۱۲	۸۲۱
یکشنبه	۵۳۸	۴۷۵	۸,۱۲۱	۵۷۶
دوشنبه	۸۷۴	۱,۱۱۱	۱۸,۱۹۸	۳۲۲
سه‌شنبه	۴۴۲	۱,۰۱۲	۱۳,۹۹۴	۶۱۵
چهارشنبه	۱,۰۵۸	۱,۳۵۰	۳,۸۸۷	۶۵۸
پنجشنبه	۰	۵۹۳	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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۴,۱۲۱	۴,۹۶۲	۲۰/۳۹%
بازار مالی بورس کالا	۴,۳۸۶	۳,۵۵۰	-۱۹/۰۴%
فیزیکی بورس کالا	۳۱,۰۰۷	۴۷,۲۱۳	۵۲/۲۶%
فیزیکی بورس انرژی	۸,۸۲۷	۲,۹۹۱	-۶۶/۱۱%

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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



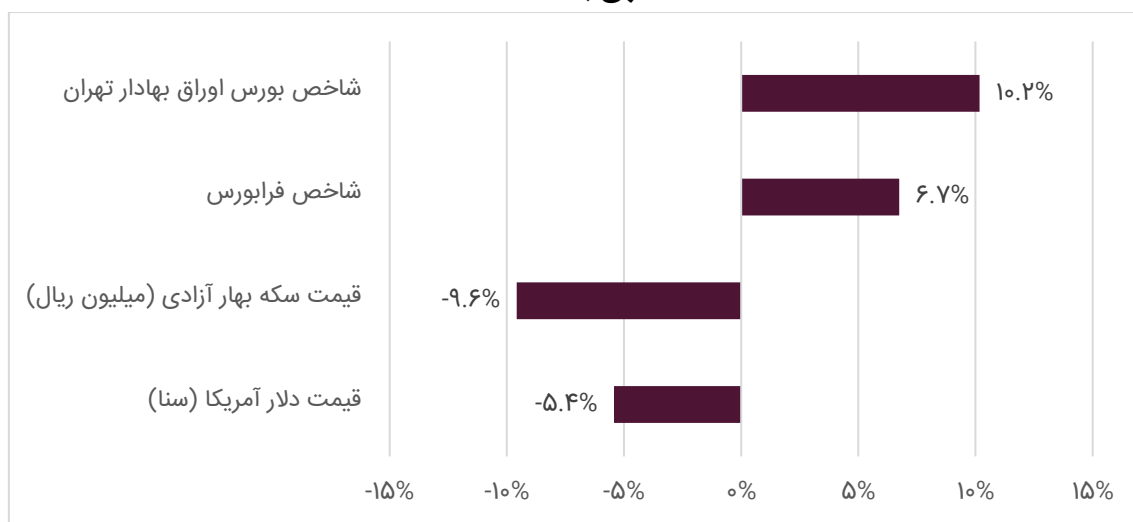
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰، بورس اوراق بهادار تهران با افزایش بیش از ۱۰ درصدی، بازدهی بسیار مطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۶ درصدی، عملکرد مطلوبی 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 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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۲۲۱,۰۷۵	۱,۳۴۵,۳۰۱	۱۰/۱۷%
شاخص فرابورس	۱۵,۵۹۵	۱۶,۶۴۷	۶/۷۴%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۲۵	۱۱۳	-۹/۵۸%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۶۳,۲۵۳	۲۴۸,۹۵۲	-۵/۴۳%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

(ارقام برحسب دلار)

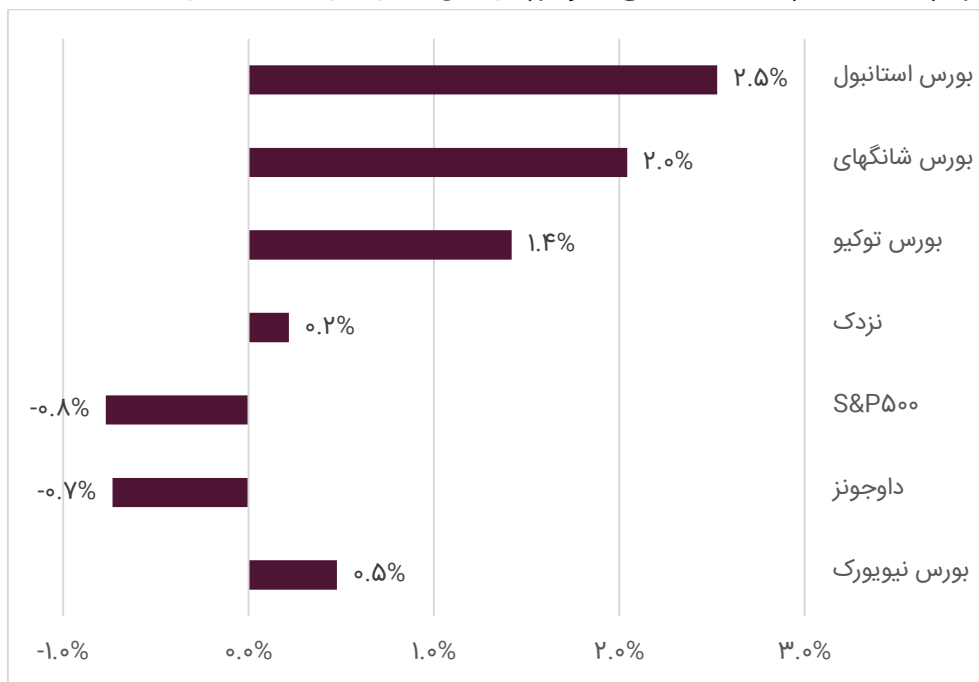
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۷۶	۱,۸۷۳	-۰/۱۷%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۰,۶۳	۴۲,۱۳	۳/۶۹%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۲,۷۸	۴۴,۹۶	۵/۰۹%

در جدول (۱۴)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بورس شامل بورس نیویورک، داو جونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس استانبول، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۲۳	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۳,۷۶۱	۱۳,۸۲۷	۰/۴۷%
داو جونز	۲۹,۴۸۰	۲۹,۲۶۳	-۰/۷۳%
S&P ۵۰۰	۳,۵۸۵	۳,۵۵۸	-۰/۷۷%
نزدک	۱۱,۸۲۹	۱۱,۸۵۵	۰/۲۱%
بورس توکیو	۱,۷۰۳	۱,۷۲۷	۱/۴۱%
بورس شانگهای	۳,۳۱۰	۳,۳۷۸	۲/۰۴%
بورس استانبول	۱,۲۹۱	۱,۳۲۴	۲/۵۲%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰



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.

محمدحسین بادامی فوق لیسانس مهندسی مالی hobadami@gmail.com	
محمد رضا صادقی نسب فوق لیسانس علوم اقتصادی sadeghinasab.mr@gmail.com	