

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۳۳

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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ 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.

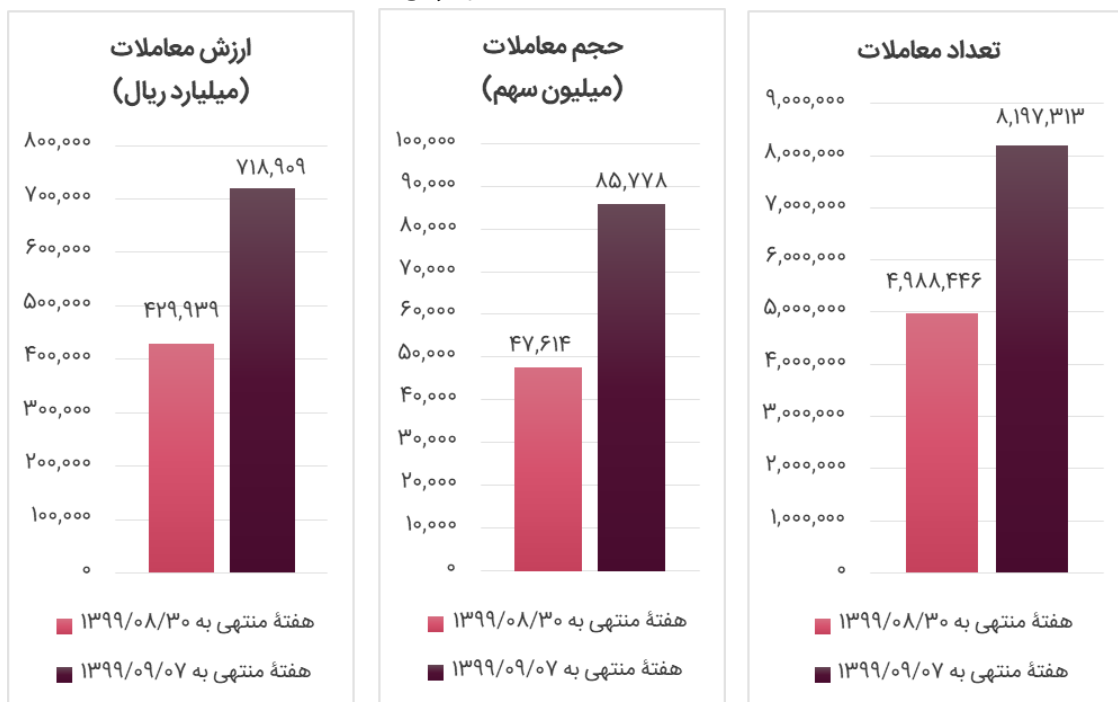
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ طی ۵ روز کاری، با ۲۱,۹۴۷ واحد افزایش، از ۱,۳۴۵,۳۰۱ به ۱,۳۶۷,۲۴۹ رسید. حجم معاملات ۱۷,۱۵۶ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش بیش از ۸۰ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۶۷ و ۶۴ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روز شنبه، افزایش ۲۱,۲۳۴ واحدی، در روز یکشنبه، کاهش ۷,۶۸۸، در روز دوشنبه افزایش ۱۶,۶۹۴ واحدی، در روز سه‌شنبه کاهش ۱۸,۴۳۳ واحدی و در روز چهارشنبه افزایش ۱۰,۱۴۰ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۲۹,۹۳۹	۸۵,۹۸۸	۷۱۸,۹۰۹	۱۴۳,۷۸۲
حجم معاملات (میلیون سهم)	۴۷,۶۱۴	۹,۵۲۳	۸۵,۷۷۸	۱۷,۱۵۶
تعداد معاملات	۴,۹۸۸,۴۴۶	۹۹۷,۶۸۹	۸,۱۹۷,۳۱۳	۱,۶۳۹,۴۶۳
				۶۷/۲۱%
				۸۰/۱۵%
				۶۴/۳۲%

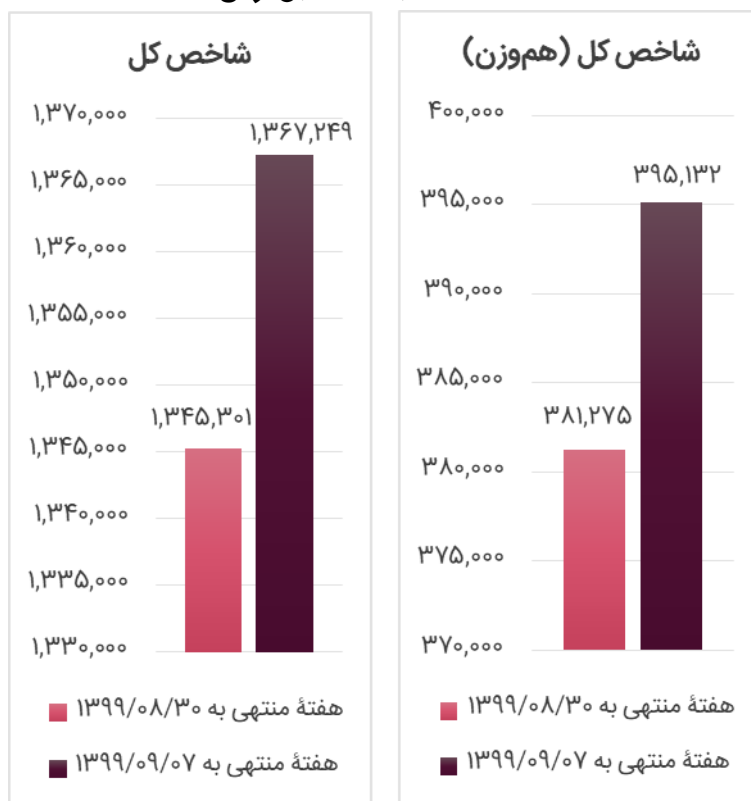
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن

میزان رشد (درصد)	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	عنوان
۱/۶%	۵۳,۵۳۱	۵۱,۸۵۸	ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)
	۱,۳۶۷,۲۴۹	۱,۳۴۵,۳۰۱	شاخص کل
	۳۵۷,۵۶۲	۳۵۱,۸۲۸	شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)
۳/۶%	۳۹۵,۱۳۲	۳۸۱,۲۷۵	شاخص کل (هموزن)
	۲۵۸,۷۳۹	۲۴۹,۷۰۲	شاخص قیمت (هموزن)

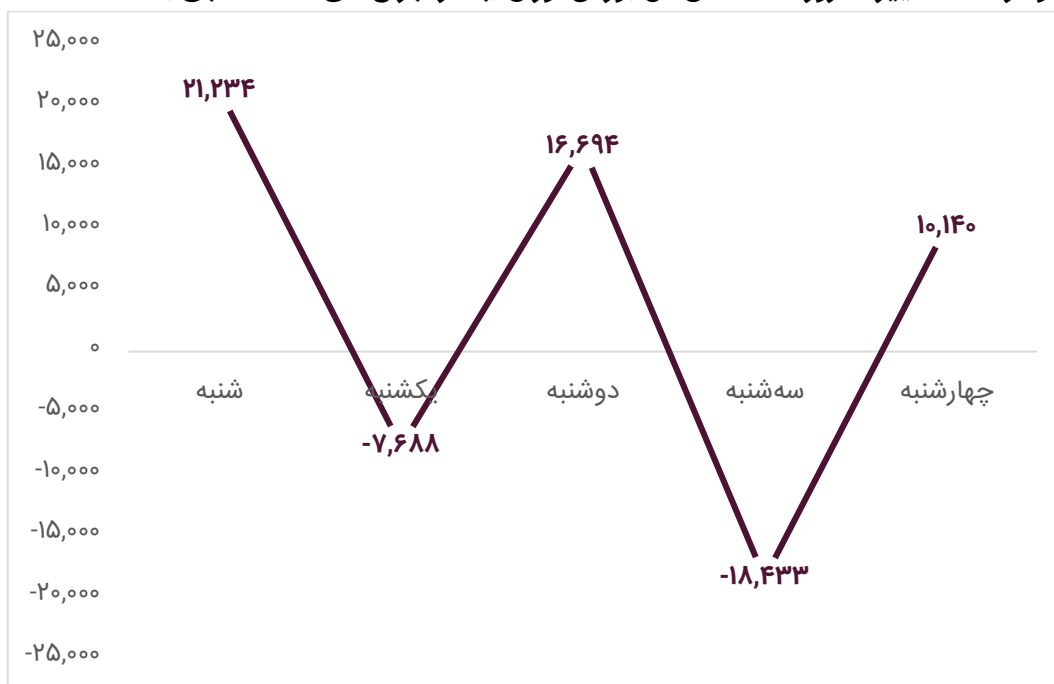
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن



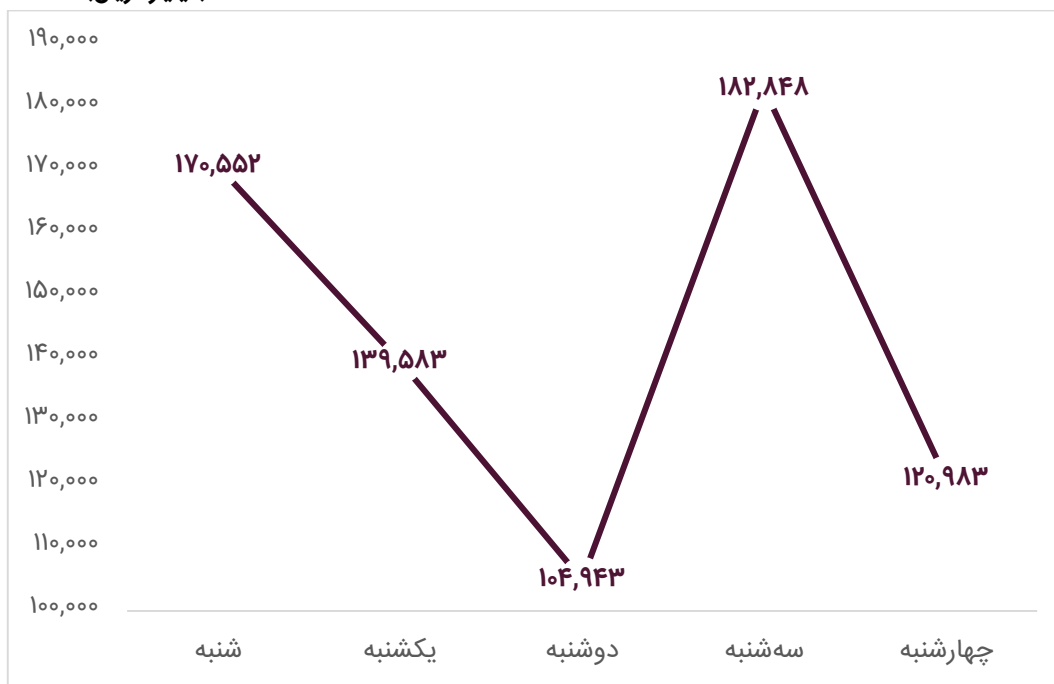
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۲۱,۲۳۴	۱/۵۷%	۱,۸۹۲,۰۳۳	۲۰,۱۱۷	۱۷۰,۵۵۲
یکشنبه	-۷,۶۸۸	-۰/۵۶%	۱,۴۸۸,۵۳۲	۱۷,۲۲۰	۱۳۹,۵۸۳
دوشنبه	۱۶,۶۹۴	۱/۲۲%	۱,۳۶۷,۶۸۹	۱۱,۳۵۴	۱۰۴,۹۴۳
سه شنبه	-۱۸,۴۳۳	-۱/۳۴%	۱,۸۵۹,۵۵۳	۲۲,۴۸۹	۱۸۲,۸۴۸
چهارشنبه	۱۰,۱۴۰	۰/۷۴%	۱,۵۸۹,۵۰۶	۱۴,۵۹۸	۱۲۰,۹۸۳

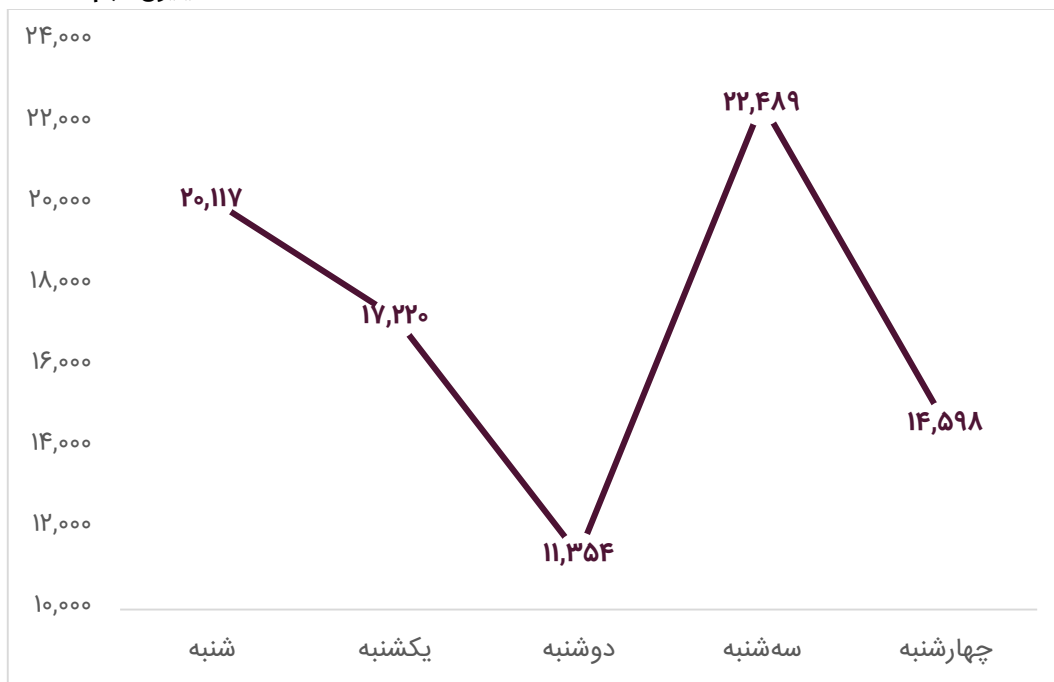
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ (میلیارد ریال)



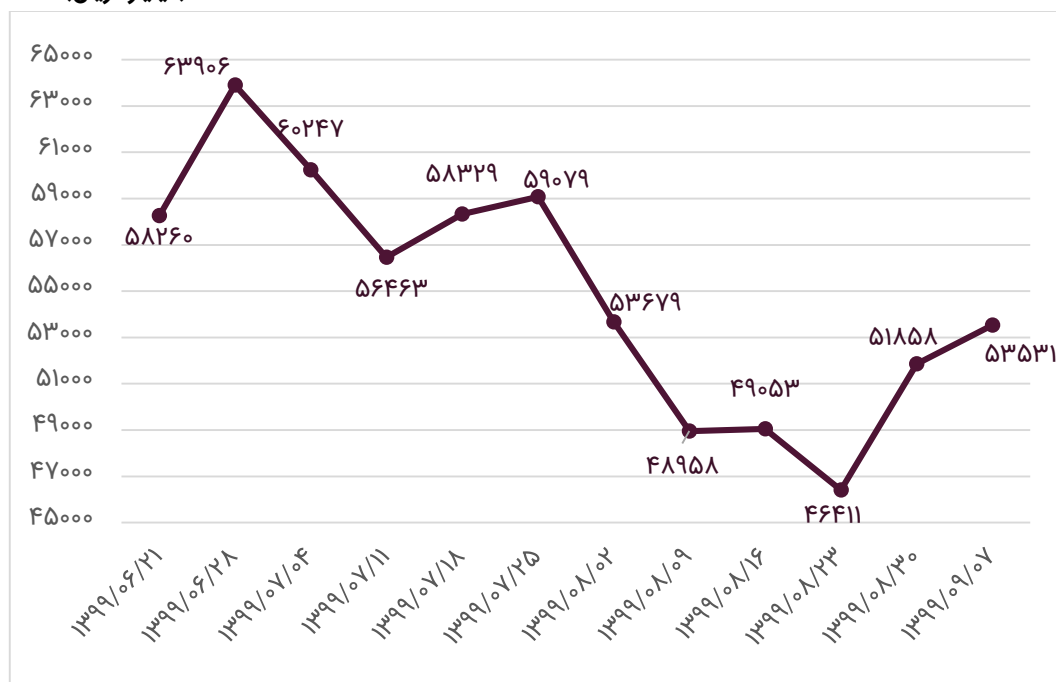
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۵۳,۵۳۱	۱۳۹۹/۰۹/۰۷

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ (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 ۲,۶۰۴ و ۱,۷۶۰ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۲,۶۰۴
۲	محصولات چرمی	۱	۱,۷۶۰
۳	محصولات کاغذی	۳	۷۳۴
۴	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۳۴۲
۵	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۲۴۹
۶	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۵	۲۴۵
۷	کانی غیرفلزی	۱۵	۱۷۲
۸	استخراج کانه‌های فلزی	۱۷	۹۶
۹	استخراج سایر معادن	۱	۹۴
۱۰	بیمه و بازنشستگی	۶	۸۳
۱۱	کاشی و سرامیک	۶	۸۱

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱۲	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۶	۷۷
۱۳	قند و شکر	۱۴	۷۱
۱۴	فرآورده‌های نفتی	۵۶	۷۰
۱۵	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۵۹
۱۶	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۵۷
۱۷	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۹
۱۸	محصولات فلزی	۹	۴۵
۱۹	چاپ	۲	۴۱
۲۰	استخراج زغال سنگ	۱	۳۸
۲۱	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۳۵
۲۲	دستگاه‌های برقی	۱۱	۳۴
۲۳	رایانه	۹	۳۲
۲۴	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۲۵	سیمان آهک گچ	۴۰	۲۹
۲۶	شیمیایی	۴۶	۲۷
۲۷	زراعت و خدمات وابسته	۶	۲۵/۳
۲۸	دارویی	۳۱	۲۴/۹
۲۹	فلزات اساسی	۳۴	۲۳
۳۰	مخابرات	۲	۲۲
۳۱	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۱۹
۳۲	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۸
۳۳	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۵/۹
۳۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۵/۵
۳۵	خودرو و قطعات	۳۱	(۳۶)
۳۶	منسوجات	۱۴	(۴۳)
۳۷	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	(۱,۸۹۶)
۳۸	فنی و مهندسی	۲	(۳,۶۱۵)

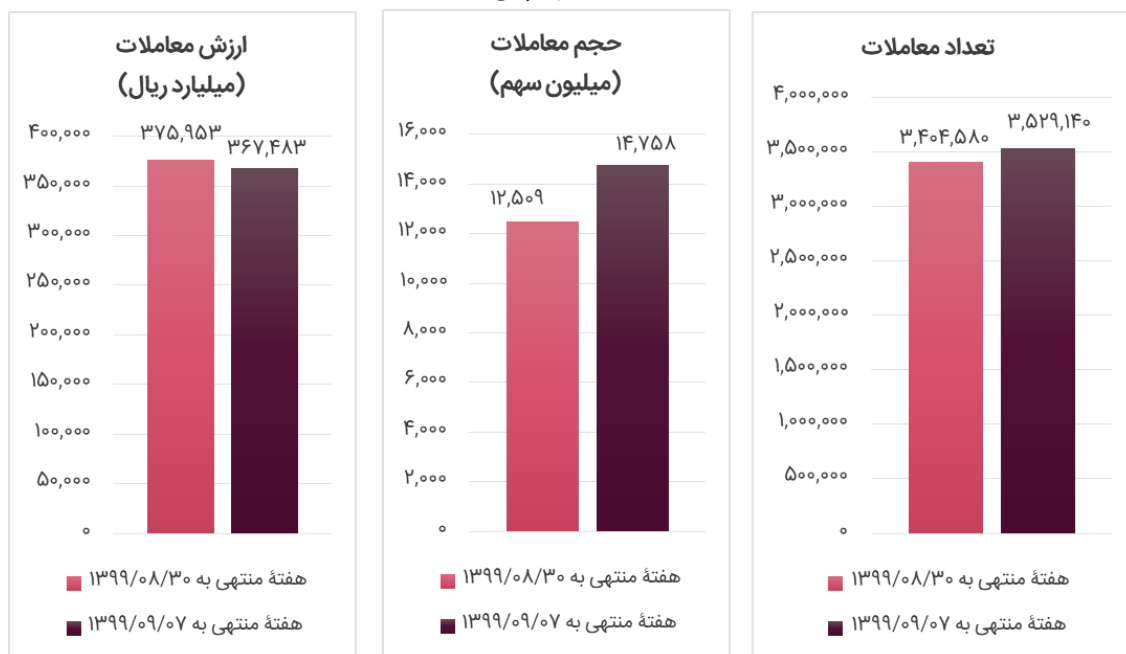
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ طی ۵ روز کاری، با ۳۰۴ واحد افزایش، از ۱۶,۶۴۷ به عدد ۱۶,۹۵۱ رسید. حجم معاملات ۲,۹۵۲ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۱۷ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۲ درصد کاهش و ۳ درصد افزایش داشته است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۷۵,۹۵۳	۷۵,۱۹۱	۳۶۷,۴۸۳	۷۳,۴۹۷
حجم معاملات (میلیون سهم)	۱۲,۵۰۹	۲,۵۰۲	۱۴,۷۵۸	۲,۹۵۲
تعداد معاملات	۳,۴۰۴,۵۸۰	۶۸۰,۹۱۶	۳,۵۲۹,۱۴۰	۷۰۵,۸۲۸
				میزان رشد
				-۲/۲۵%
				۱۷/۹۷%
				۳/۶۵%

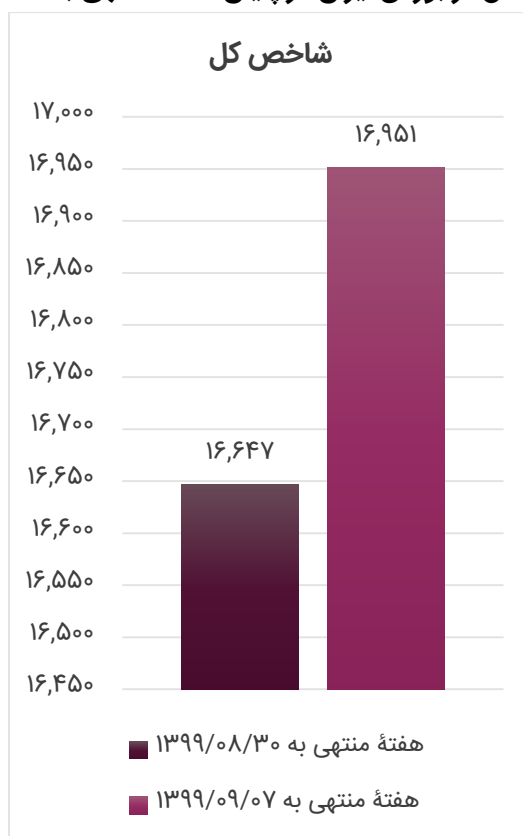
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۱,۳۲۳	۱۱,۵۳۰	۱/۸۲%
شاخص کل	۱۶,۶۴۷	۱۶,۹۵۱	۱/۸۲%

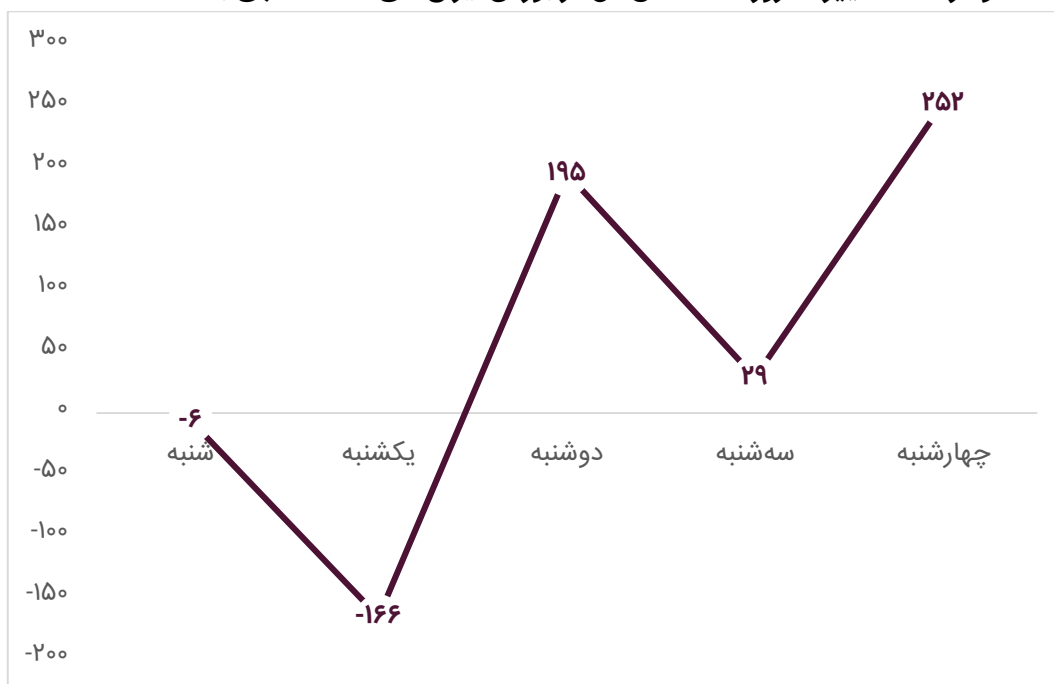
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن



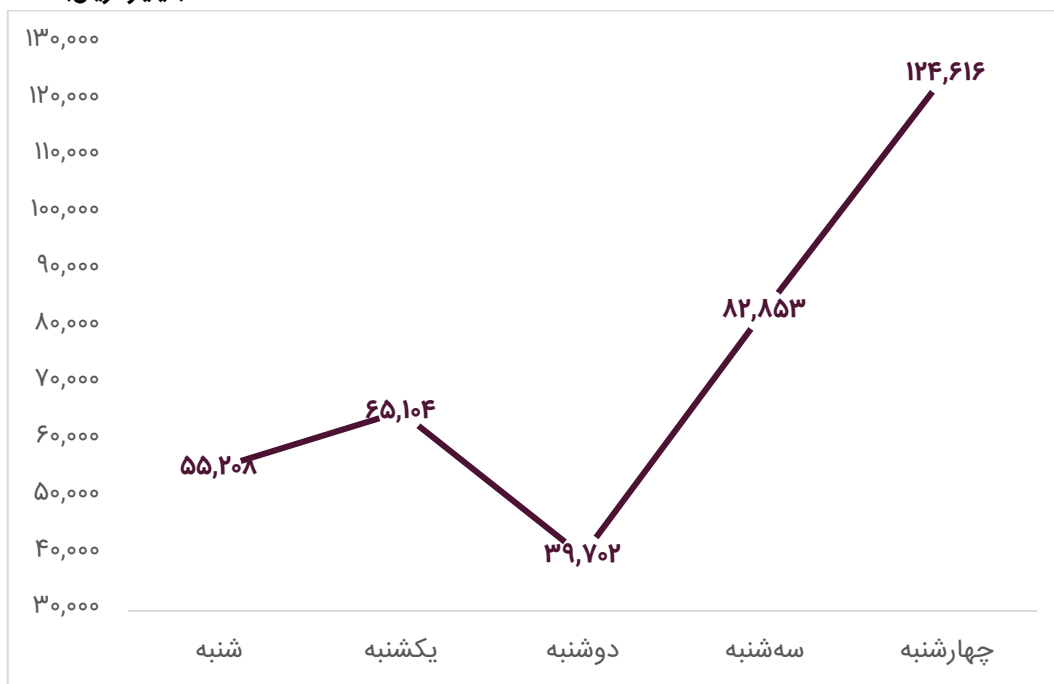
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۶	-۰/۰۳%	۸۰۷,۲۹۱	۳,۵۳۸	۵۵,۲۰۸
یکشنبه	-۱۶۶	-۰/۹۹%	۵۷۴,۹۶۱	۲,۳۶۵	۶۵,۱۰۴
دوشنبه	۱۹۵	۱/۱۸%	۶۵۸,۴۷۸	۲,۴۹۴	۳۹,۷۰۲
سه‌شنبه	۲۹	۰/۱۷%	۸۱۷,۱۹۰	۳,۵۹۵	۸۲,۸۵۳
چهارشنبه	۲۵۲	۱/۵۰%	۶۷۱,۲۲۰	۲,۷۶۶	۱۲۴,۶۱۶

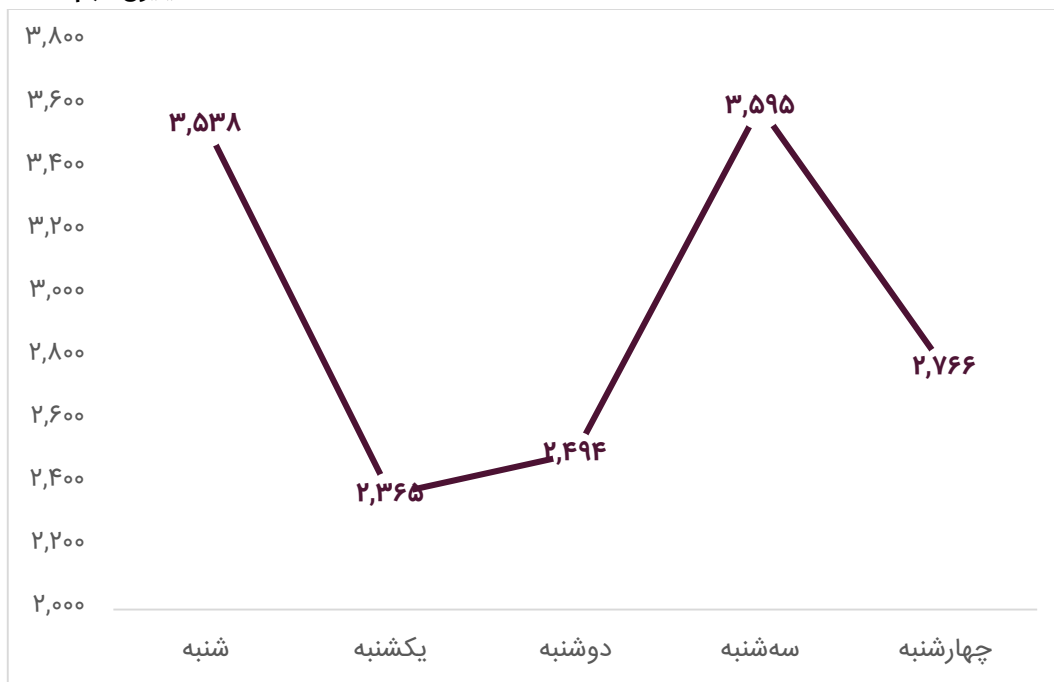
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ (میلیارد ریال)

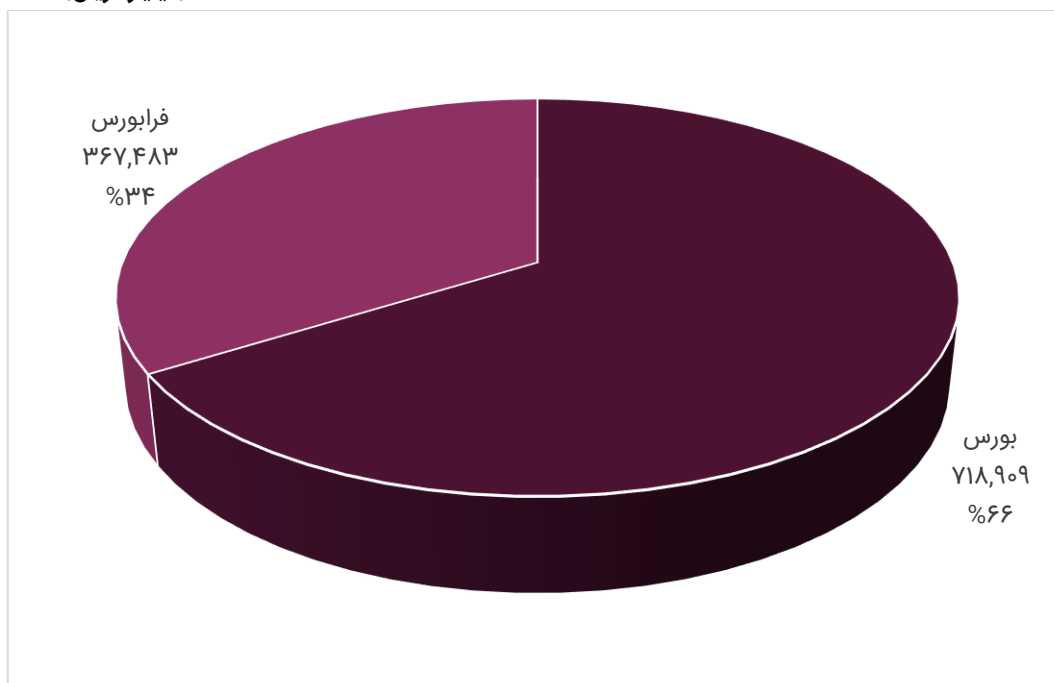


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

(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 «منسوجات» به ترتیب با نسبت قیمت به درآمد ۲,۷۱۱ و ۲,۱۰۶ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۲,۷۱۲
۲	منسوجات	۷	۲,۱۰۶
۳	پیمانکاری صنعتی	۵	۲,۰۸۴
۴	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۱,۳۳۷
۵	فنی و مهندسی	۹	۳۷۳
۶	کانی غیرفلزی	۱۸	۲۳۲
۷	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۲۳۱
۸	محصولات فلزی	۸	۲۲۹
۹	بیمه و بازنشستگی	۲۰	۱۷۷
۱۰	استخراج نفت گاز جز اکتشاف	۲	۱۴۴
۱۱	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۰۹
۱۲	خرده‌فروشی	۲	۱۰۷
۱۳	فلزات اساسی	۲۴	۱۰۶
۱۴	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۹۱
۱۵	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۸۲
۱۶	سایر حمل و نقل	۲	۸۲
۱۷	قند و شکر	۸	۷۸
۱۸	رایانه	۸	۶۵
۱۹	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۶۱
۲۰	لاستیک و پلاستیک	۵	۵۸
۲۱	استخراج زغال سنگ	۳	۵۰
۲۲	خودرو و قطعات	۱۱	۴۸
۲۳	اطلاعات و ارتباطات	۲	۴۳
۲۴	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۹	۴۲
۲۵	هتل و رستوران	۹	۳۹
۲۶	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۴	۳۸
۲۷	فرآورده‌های نفتی	۹	۳۶
۲۸	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۱

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۲۹	دارویی	۱۶	۲۸
۳۰	شیمیایی	۴۲	۲۲
۳۱	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۱
۳۲	تجارت عمده و خرده‌فروشی وسائط نقلیه موتور	۱	۳
۳۳	محصولات چوبی	۴	۰
۳۴	محصولات کاغذی	۴	۰
۳۵	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۵	(۱۳)
۳۶	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	(۱۸)
۳۷	کاشی و سرامیک	۱۱	(۳۶)
۳۸	وسایل ارتباطی	۲	(۱۰۷)
۳۹	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	(۱۵۰)
۴۰	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	(۳۸۸)
۴۱	سیمان آهک گچ	۱۲	(۵,۰۲۰)

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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷، 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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

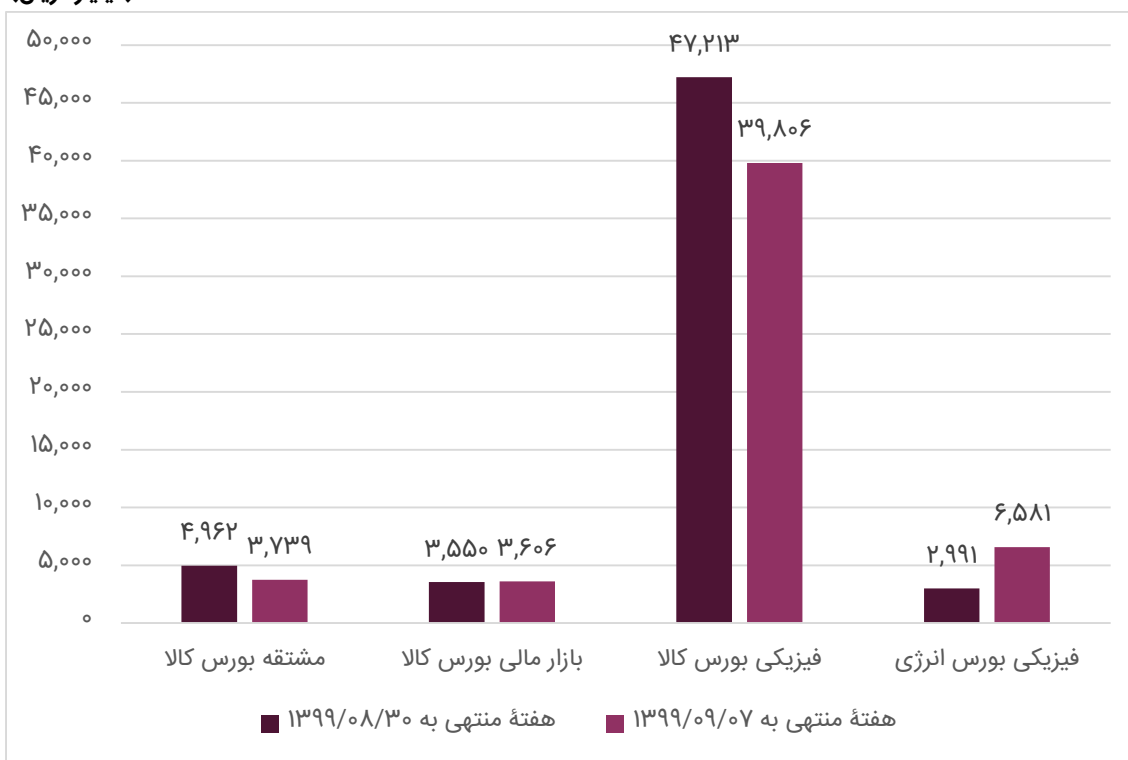
(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۵۱۳	۵۸۰	۴۹	۱,۱۰۸
یکشنبه	۱,۰۰۳	۹۱۳	۱۳	۳۲۰
دوشنبه	۷۰۴	۶۹۱	۱۱,۲۰۳	۴۶۸
سه‌شنبه	۶۹۱	۶۵۱	۱۴,۷۵۸	۳,۱۴۳
چهارشنبه	۶۹۵	۴۴۲	۱۳,۷۸۲	۱,۵۴۲
پنجشنبه	۰	۴۶۲	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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۴,۹۶۲	۳,۷۳۹	-۲۴/۶۵%
بازار مالی بورس کالا	۳,۵۵۰	۳,۶۰۶	۱/۵۷%
فیزیکی بورس کالا	۴۷,۲۱۳	۳۹,۸۰۶	-۱۵/۶۸%
فیزیکی بورس انرژی	۲,۹۹۱	۶,۵۸۱	۱۲۰%

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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



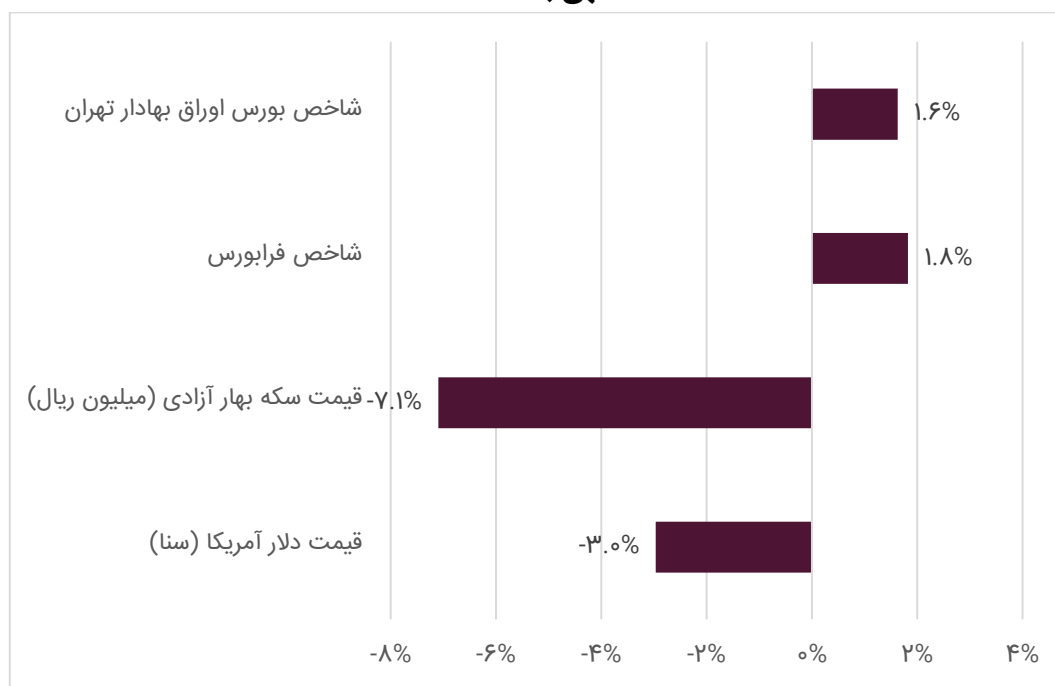
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷، شاخص کل بورس اوراق بهادار و شاخص کل فرابورس ایران هر یک با افزایش بیش از ۱ درصدی، نسبت به بازارهای موازی بازدهی مطلوبی را از خود نشان دادند. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۷ درصد کاهش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، کاهش بیش از ۲ 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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۳۴۵,۳۰۱	۱,۳۶۷,۲۴۹	۱/۶۳%
شاخص فرابورس	۱۶,۶۴۷	۱۶,۹۵۱	۱/۸۲%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۱۳/۰	۱۰۵/۰	-۷/۰۹%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۴۸,۹۵۲	۲۴۱,۵۶۹	-۲/۹۶%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ 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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

(ارقام برحسب دلار)

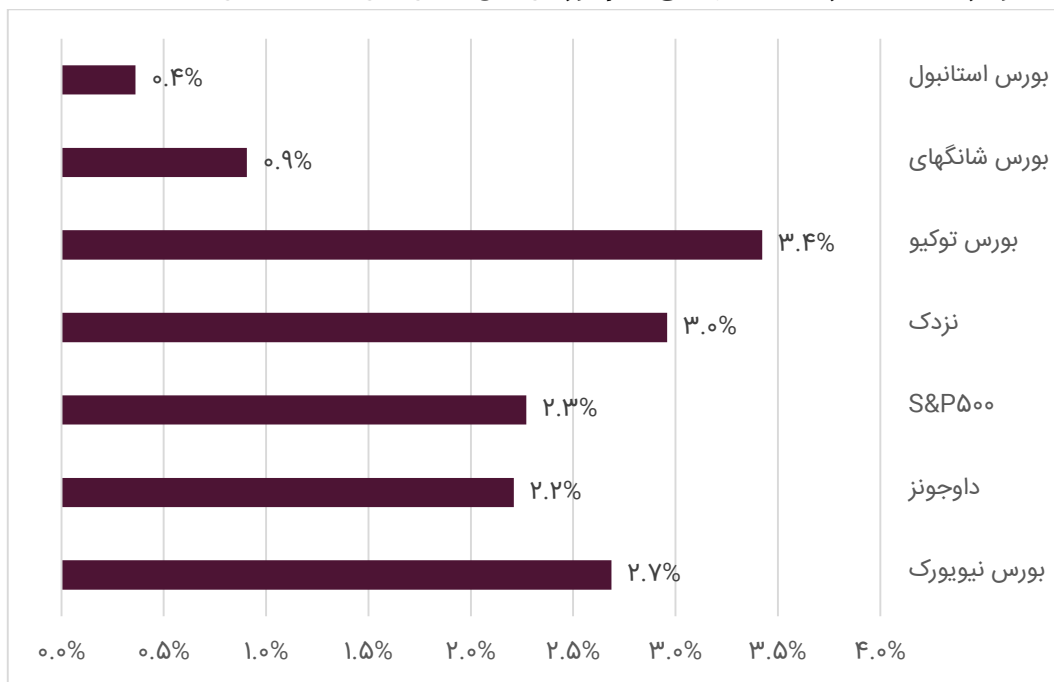
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۷۳	۱,۷۸۸	-۴/۵۳%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۲/۱۳	۴۵/۸۱	۸/۷۳%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۴/۹۶	۴۸/۱۸	۷/۱۶%

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 ۱۳۹۹/۰۹/۰۷ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بوری بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۳,۸۲۷	۱۴,۱۹۹	۲/۶۸%
داوجونز	۲۹,۲۶۳	۲۹,۹۱۰	۲/۲۱%
S&P ۵۰۰	۳,۵۵۸	۳,۶۳۸	۲/۲۷%
نزدک	۱۱,۸۵۵	۱۲,۲۰۶	۲/۹۵%
بورس توکیو	۱,۷۲۷	۱,۷۸۷	۳/۴۲%
بورس شانگهای	۳,۳۷۸	۳,۴۰۸	۰/۹۰%
بورس استانبول	۱,۳۲۴	۱,۳۲۹	۰/۳۶%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۰۷



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>محمد رضا صادقی نسب فوق لیسانس علوم اقتصادی sadeghinasab.mr@gmail.com</p>	
<p>محمد حسین بادامی فوق لیسانس مهندسی مالی hobadami@gmail.com</p>	