

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۳۵

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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ 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.

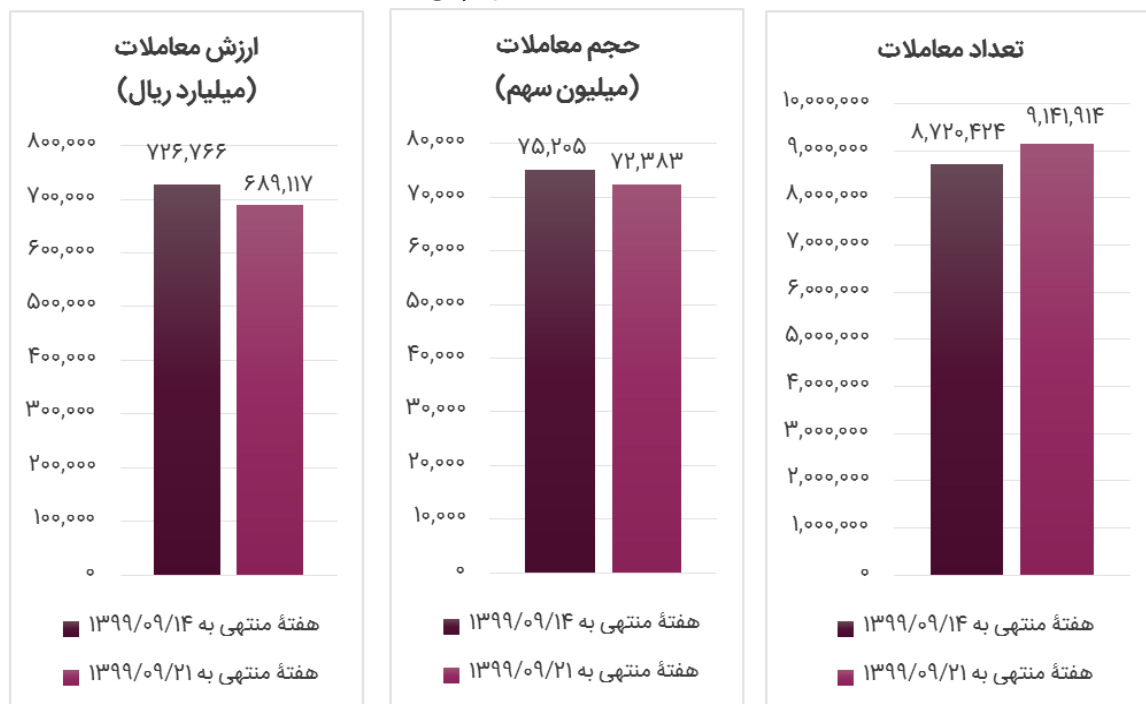
۱-۱- بورس اوراق بهادار تهران

شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ طی ۵ روز کاری، با ۳۵,۲۳۷ واحد افزایش، از ۱,۴۷۰,۹۸۰ به ۱,۵۰۶,۲۱۷ رسید. حجم معاملات ۱۴,۴۷۷ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از کاهش بیش از ۳ درصدی در بورس اوراق بهادار است؛ همچنین ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته به ترتیب بیش از ۵ درصد کاهش و ۴ درصد افزایش را از خود نشان داده‌اند. شاخص در روز شنبه، افزایش ۱۹,۶۹۷ واحدی، در روز یکشنبه، افزایش ۳۲,۴۳۲، در روز دوشنبه کاهش ۱۰,۲۱۷ واحدی، در روز سه‌شنبه کاهش ۵,۳۹۳ واحدی و در روز چهارشنبه کاهش ۱,۲۸۱ واحدی را ثبت نمود.

جدول (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴		عنوان
کل	میانگین	میزان رشد	کل	میانگین	
۵			۵		روزهای فعالیت
۶۸۹,۱۱۷	۱۳۷,۸۲۳	-۵/۱۸%	۷۲۶,۷۶۶	۱۴۵,۳۵۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۷۲,۳۸۳	۱۴,۴۷۷	-۳/۷۵%	۷۵,۲۰۵	۱۵,۰۴۱	حجم معاملات (میلیون سهم)
۹,۱۴۱,۹۱۴	۱,۸۲۸,۳۸۳	۴/۸۳%	۸,۷۲۰,۴۲۴	۱,۷۴۴,۰۸۵	تعداد معاملات

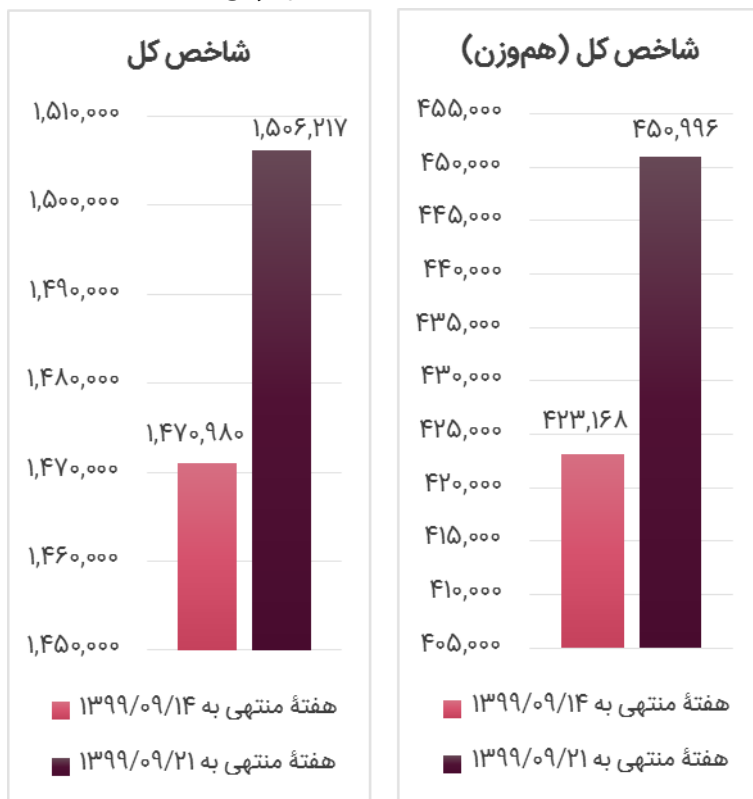
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۵۸,۲۲۷	۵۹,۶۱۷	۲/۳۸%
شاخص کل	۱,۴۷۰,۹۸۰	۱,۵۰۶,۲۱۷	۲/۳۹%
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۳۸۴,۶۸۹	۳۹۳,۸۹۴	۲/۳۹%
شاخص کل (هموزن)	۴۲۳,۱۶۸	۴۵۰,۹۹۶	۶/۵۷%
شاخص قیمت (هموزن)	۲۷۷,۰۹۸	۲۹۵,۲۸۳	۶/۵۶%

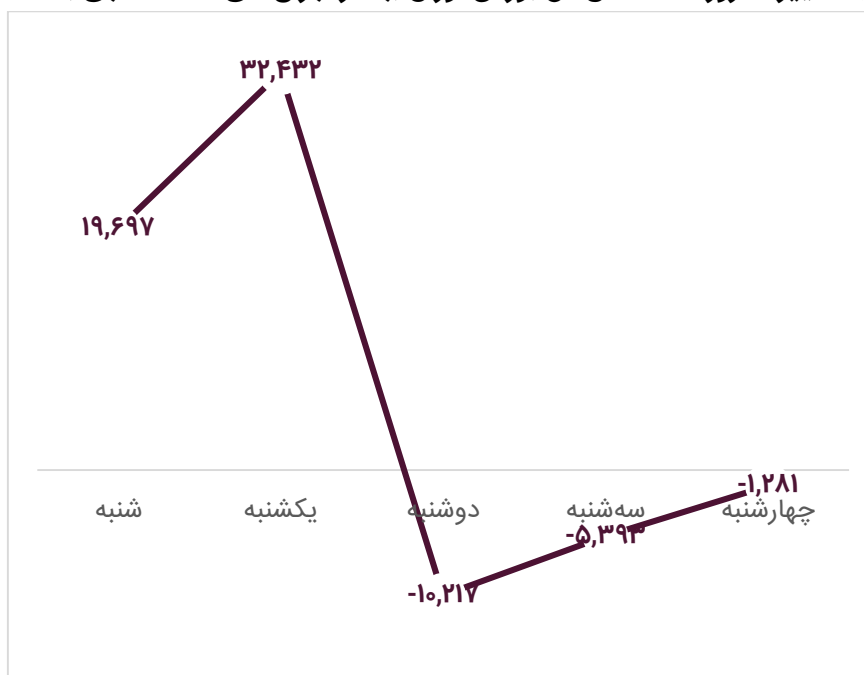
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن



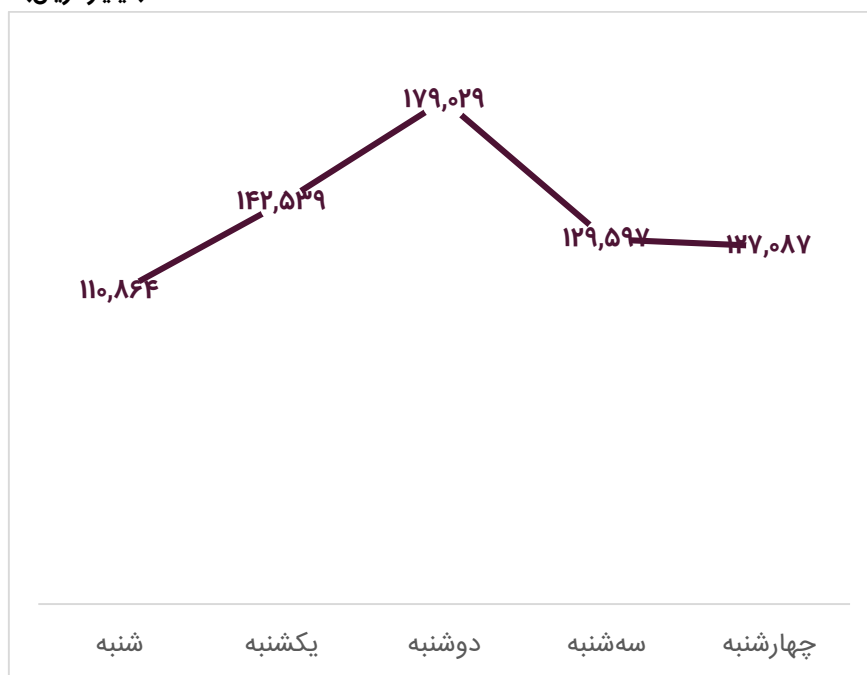
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۱۹,۶۹۷	۱/۳۳%	۱,۳۷۵,۷۶۰	۱۰,۸۷۹	۱۱۰,۸۶۴
یکشنبه	۳۲,۴۳۲	۲/۱۷%	۱,۷۳۷,۵۶۳	۱۲,۹۷۱	۱۴۲,۵۳۹
دوشنبه	-۱۰,۲۱۷	-۰/۶۷%	۲,۲۷۵,۸۰۹	۲۲,۱۰۰	۱۷۹,۰۲۹
سه شنبه	-۵,۳۹۳	-۰/۳۵%	۱,۹۲۹,۴۰۱	۱۴,۰۴۶	۱۲۹,۵۹۷
چهارشنبه	-۱,۲۸۱	-۰/۰۸%	۱,۸۲۳,۳۸۱	۱۲,۳۸۷	۱۲۷,۰۸۷

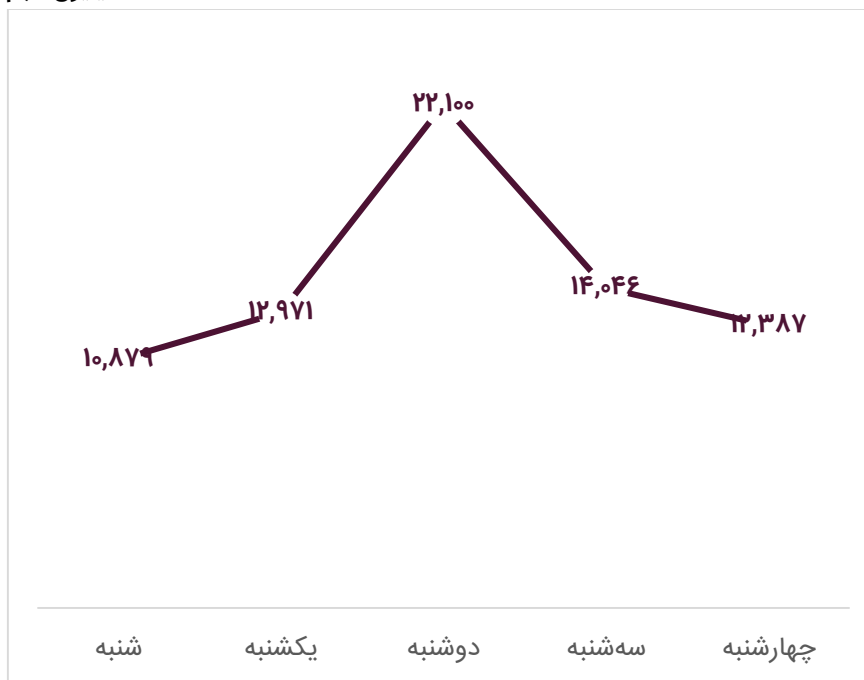
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (میلیارد ریال)



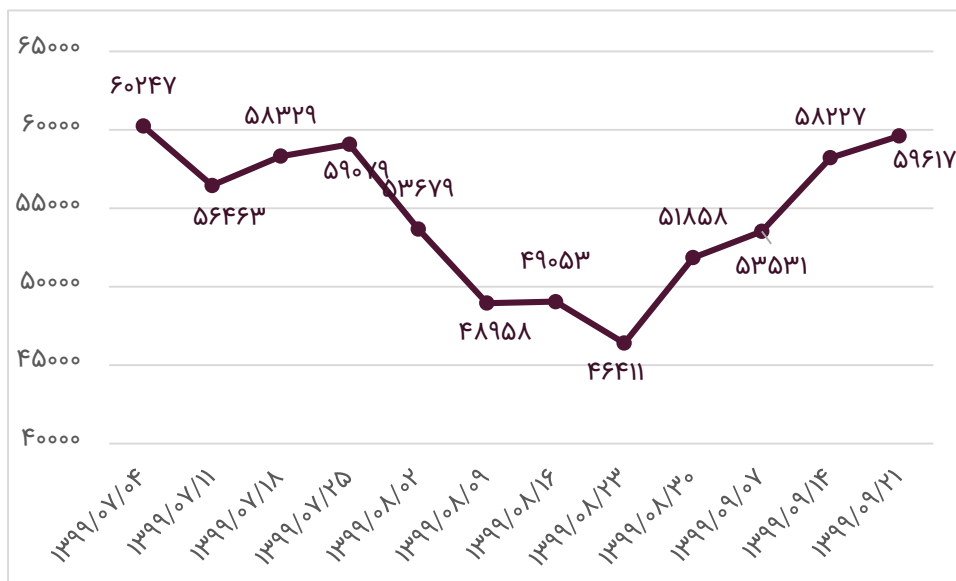
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۵۸,۲۲۷	۱۳۹۹/۰۹/۱۴
۵۹,۶۱۷	۱۳۹۹/۰۹/۲۱

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (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،۱۳۱ و ۲،۰۶۰ در مقایسه با سایر صنایع در بالاترین جایگاه قرار گرفته‌اند.

جدول (۵): نسبت P/E صنایع شرکت‌های بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	وسایل ارتباطی	۵	۳,۱۳۱
۲	محصولات چرمی	۱	۲,۰۶۰
۳	محصولات کاغذی	۳	۷۶۲
۴	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۱۵	۳۸۷
۵	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶	۳۸۶
۶	حمل‌ونقل انبارداری و ارتباطات	۵	۲۸۵
۷	کانی غیرفلزی	۱۵	۲۱۱
۸	بیمه و بازنشستگی	۶	۱۴۹
۹	استخراج کانه‌های فلزی	۱۷	۱۰۲
۱۰	کاشی و سرامیک	۶	۹۶
۱۱	استخراج سایر معادن	۱	۹۴
۱۲	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۶	۸۲
۱۳	قند و شکر	۱۴	۷۸
۱۴	فرآورده‌های نفتی	۵۶	۷۲
۱۵	غذایی بجز قند و شکر	۳۰	۶۷
۱۶	لاستیک و پلاستیک	۱۱	۶۴
۱۷	اطلاعات و ارتباطات	۲	۶۰
۱۸	محصولات فلزی	۹	۵۵
۱۹	استخراج زغال سنگ	۱	۴۹
۲۰	چاپ	۲	۴۴
۲۱	فلزات اساسی	۳۴	۴۲
۲۲	ماشین‌آلات و تجهیزات	۲۰	۳۹
۲۳	دستگاه‌های برقی	۱۱	۳۶
۲۴	رایانه	۹	۳۴
۲۵	زراعت و خدمات وابسته	۶	۳۳
۲۶	سیمان، آهک، گچ	۴۰	۳۲/۶
۲۷	ابزار پزشکی	۱	۳۱
۲۸	شیمیایی	۴۶	۳۰/۸
۲۹	دارویی	۳۱	۲۸
۳۰	مخابرات	۲	۲۵
۳۱	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹	۲۴/۹
۳۲	چندرشته‌ای صنعتی	۶	۱۸
۳۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵	۱۷



ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۳۴	استخراج نفت و گاز جز اکتشاف	۲	۱۶/۵
۳۵	خودرو و قطعات	۳۱	(۳۹)
۳۶	منسوجات	۱۴	(۴۳)
۳۷	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۱	(۱,۹۵۷)
۳۸	فنی و مهندسی	۲	(۴,۱۴۹)

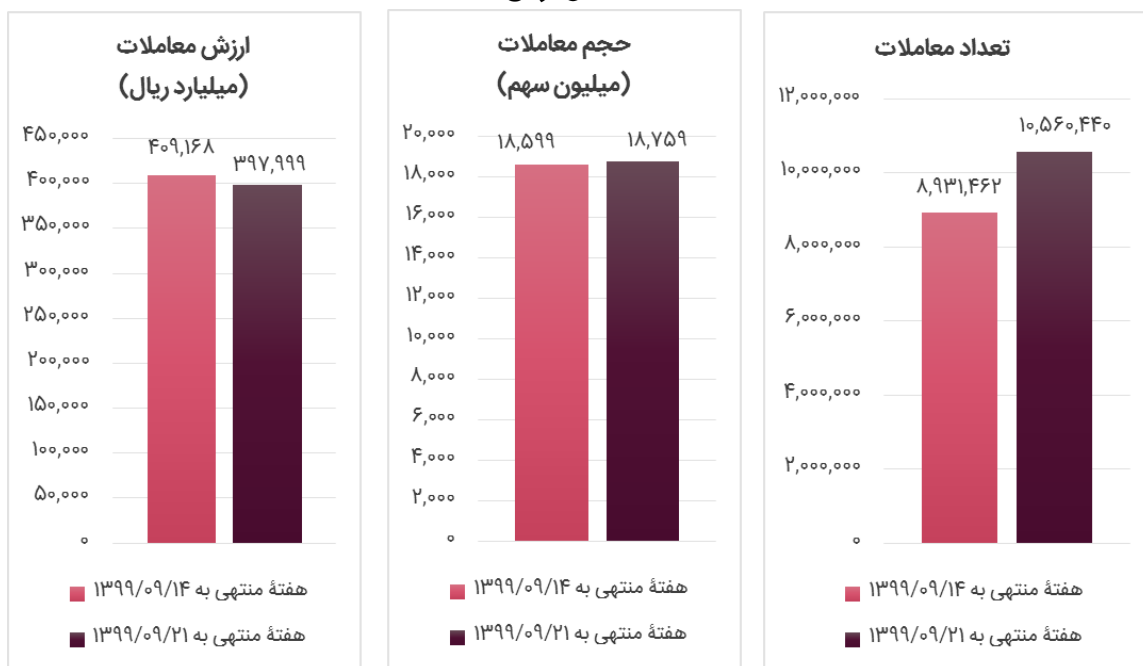
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ طی ۵ روز کاری، با ۹۶۶ واحد افزایش، از ۱۸,۴۶۶ به عدد ۱۹,۴۳۲ رسید. حجم معاملات ۳,۷۵۲ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش کمتر از ۱ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۲ درصد کاهش و ۱۸ درصد افزایش داشته است که درصد رشد متمایز تعداد معاملات به دلیل عرضه‌های اولیه سهام بوده است.

جدول (۶): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴		هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	
	کل	میانگین	کل	میانگین
روزهای فعالیت	۵		۵	
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۴۰۹,۱۶۸	۸۱,۸۳۴	۳۹۷,۹۹۹	۷۹,۶۰۰
حجم معاملات (میلیون سهم)	۱۸,۵۹۹	۳,۷۲۰	۱۸,۷۵۹	۳,۷۵۲
تعداد معاملات	۸,۹۳۱,۴۶۲	۱,۷۸۶,۲۹۲	۱۰,۵۶۰,۴۴۰	۲,۱۱۲,۰۸۸
				میزان رشد
				۲/۷۲٪
				۰/۸۵٪
				۱۸/۲۳٪

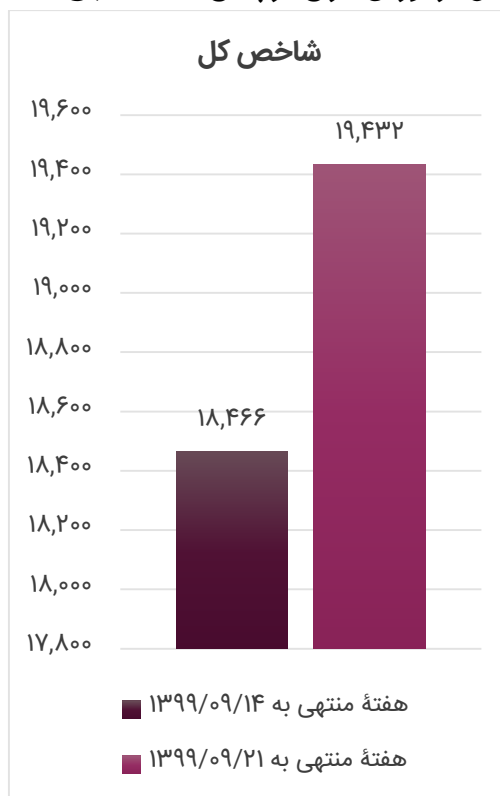
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن



جدول (۷): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۲,۵۶۱	۱۳,۲۲۱	۵/۲۵%
شاخص کل	۱۸,۴۶۶	۱۹,۴۳۲	۵/۲۳%

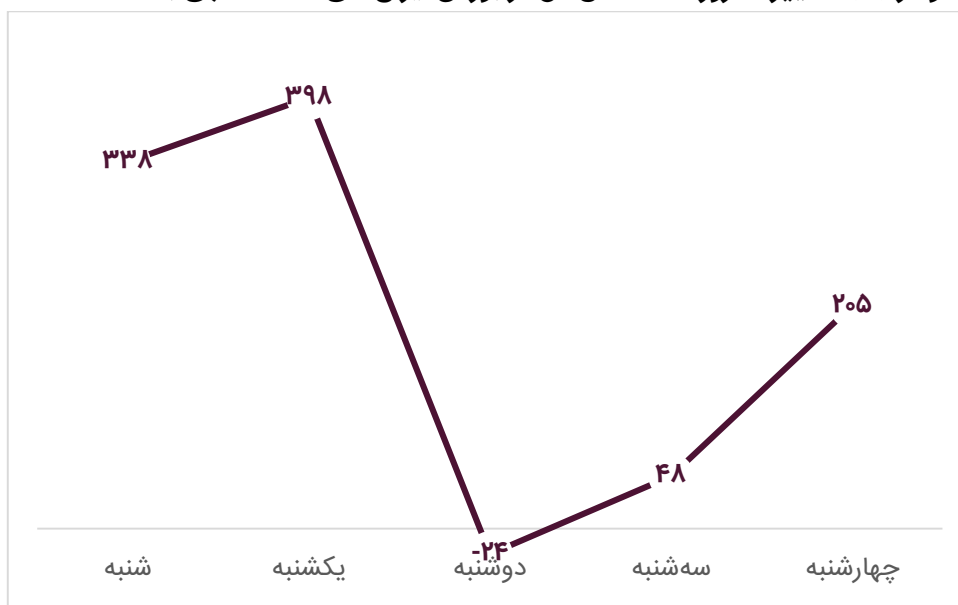
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن



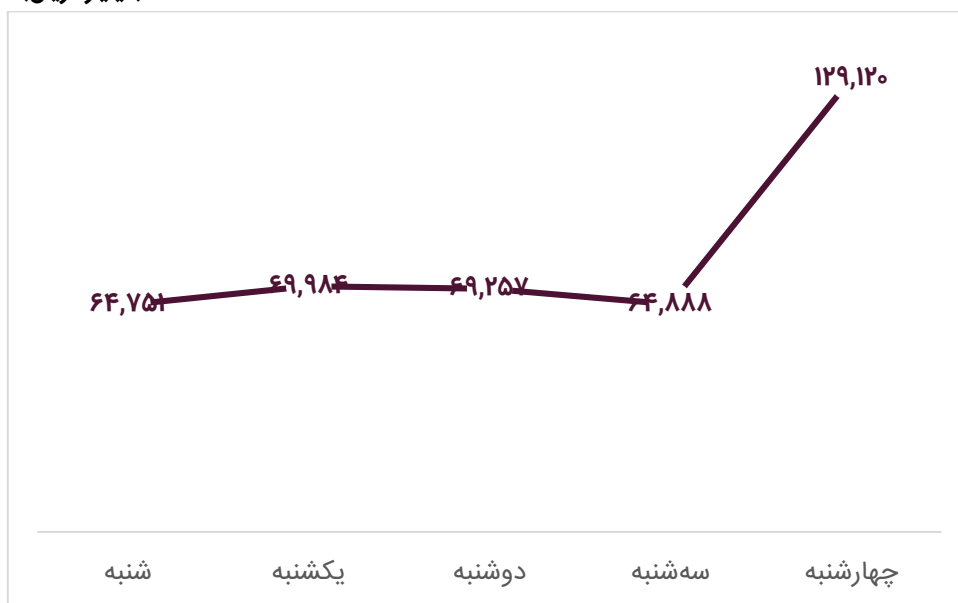
جدول (۸): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	۳۳۸	۱/۸۳%	۷۸۹,۲۸۲	۲,۹۷۲	۶۴,۷۵۱
یکشنبه	۳۹۸	۲/۱۱%	۱,۱۱۲,۴۱۵	۴,۳۹۹	۶۹,۹۸۴
دوشنبه	-۲۴	-۰/۱۲%	۱,۵۸۵,۷۸۵	۴,۲۵۲	۶۹,۲۵۷
سه شنبه	۴۸	۰/۲۵%	۱,۱۶۷,۳۰۶	۳,۱۱۷	۶۴,۸۸۸
چهارشنبه	۲۰۵	۱/۰۶%	۵,۹۰۵,۶۵۲	۴,۰۲۰	۱۳۹,۱۲۰

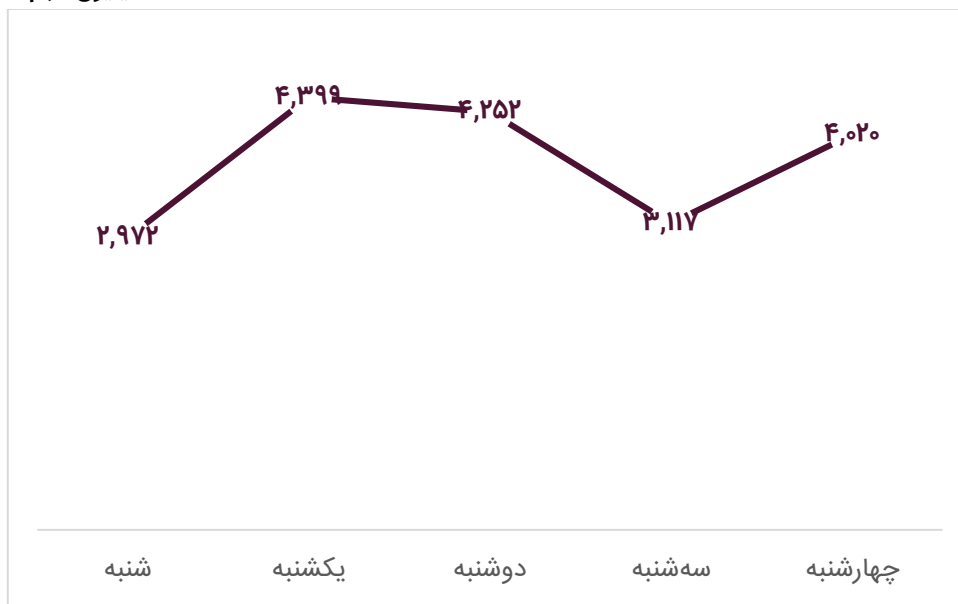
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱



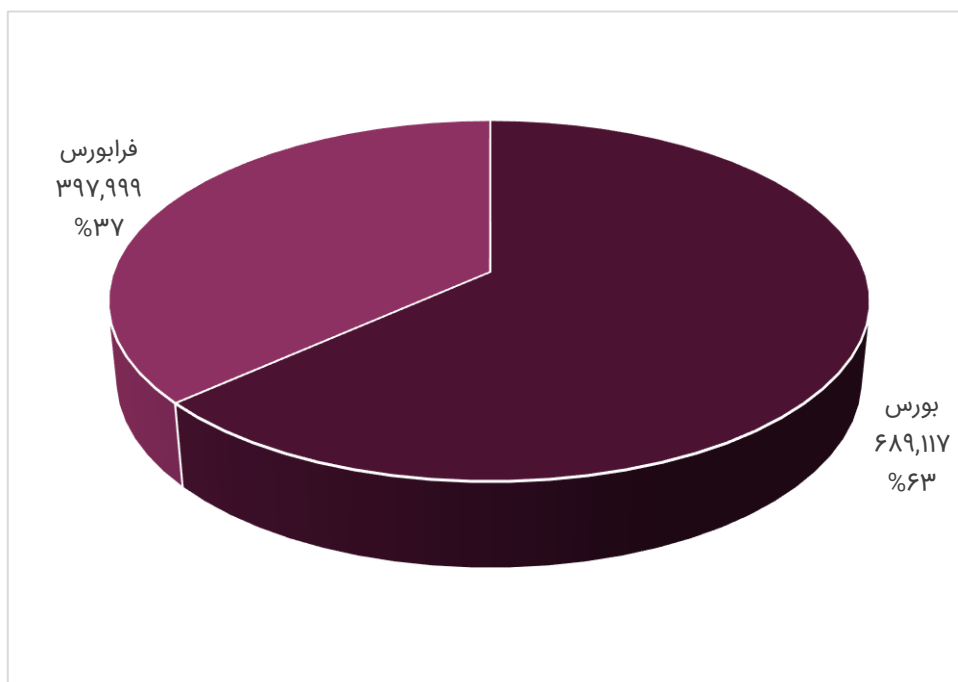
نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (میلیارد ریال)



نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ (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 ۳،۵۷۷ و ۲،۳۱۴ نسبت به سایر صنایع در جایگاه بالاتری قرار گرفته‌اند.

جدول (۹): نسبت P/E صنایع شرکت‌های فرابورس در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/E موزون
۱	دستگاه‌های برقی	۵	۳،۵۷۷
۲	منسوجات	۷	۲،۳۱۴
۳	پیمانکاری صنعتی	۵	۲،۲۸۴
۴	هتل و رستوران	۹	۱،۷۲۵
۵	استخراج کانه‌های فلزی	۸	۱،۴۵۸
۶	فنی و مهندسی	۹	۴۳۰
۷	انبوه‌سازی املاک و مستغلات	۳۲	۲۶۶
۸	محصولات چوبی	۴	۲۵۱
۹	محصولات فلزی	۸	۲۲۸
۱۰	بیمه و بازنشستگی	۲۱	۲۱۷
۱۱	استخراج نفت و گاز جز اکتشاف	۲	۱۷۹
۱۲	خرده‌فروشی	۲	۱۴۱
۱۳	غذایی بجز قند و شکر	۲۶	۱۳۷
۱۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۹	۱۲۰
۱۵	فلزات اساسی	۲۴	۱۱۲
۱۶	قند و شکر	۸	۱۰۷
۱۷	سایر حمل و نقل	۲	۱۰۳
۱۸	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۵	۹۷
۱۹	زراعت و خدمات وابسته	۱۹	۸۳
۲۰	رایانه	۸	۶۳
۲۱	لاستیک و پلاستیک	۵	۵۶
۲۲	استخراج زغال سنگ	۳	۵۵
۲۳	خودرو و قطعات	۱۱	۵۴
۲۴	اطلاعات و ارتباطات	۲	۵۰
۲۵	حمل و نقل انبارداری و ارتباطات	۱۹	۴۹
۲۶	فرآورده‌های نفتی	۹	۴۴
۲۷	سرمایه‌گذاری‌ها	۴۴	۳۹
۲۸	دارویی	۱۶	۳۷
۲۹	محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۳	۳۱
۳۰	شیمیایی	۴۲	۲۶



ردیف	صنعت	تعداد شرکت‌ها	P/Eموزون
۳۱	فعالیت‌های هنری، سرگرمی و خلاقانه	۱	۱۵
۳۲	تجارت عمده و خرده‌فروشی وسائط نقلیهٔ موتور	۱	۳
۳۳	محصولات کاغذی	۴	۰
۳۴	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۱۵	(۱۴)
۳۵	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۲۲	(۲۰)
۳۶	کاشی و سرامیک	۱۱	(۴۰)
۳۷	وسایل ارتباطی	۲	(۱۰۲)
۳۸	ماشین‌آلات و تجهیزات	۷	(۱۵۰)
۳۹	کانی غیر فلزی	۱۸	(۳۷۳)
۴۰	فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی	۱	(۳۸۸)
۴۱	سیمان، آهک، گچ	۱۲	(۵,۲۸۸)

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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱، 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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

(میلیارد ریال)

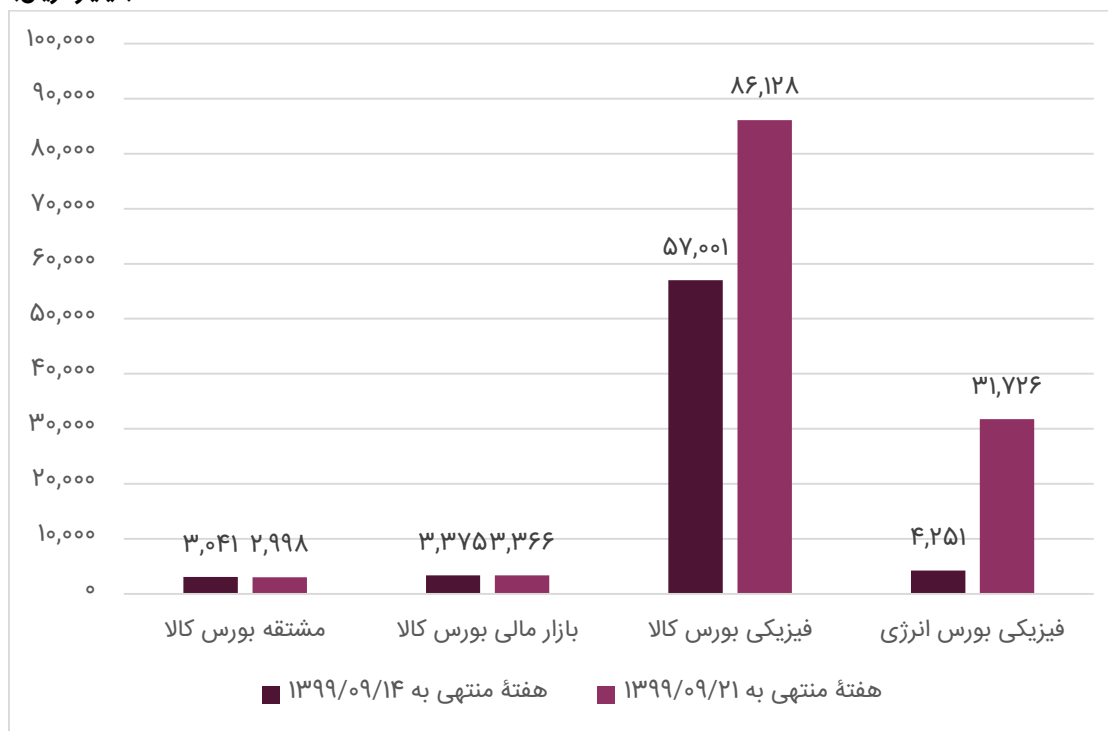
تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۸۴۳	۳۷۲	۱,۸۵۵	۹۶
یکشنبه	۷۵۶	۴۷۰	۷,۶۷۷	۲,۸۹۴
دوشنبه	۵۸۳	۳۷۴	۱۱,۱۱۱	۵۰۲
سه‌شنبه	۸۱۹	۹۳۰	۳۹,۹۰۴	۲۴,۹۲۲
چهارشنبه	۳۶۵	۶۰۳	۲۵,۵۸۲	۳,۳۱۱
پنجشنبه	۰	۲۴۹	۰	۰

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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن

(میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۳,۰۴۱	۲,۹۹۸	-۱/۴۰%
بازار مالی بورس کالا	۳,۳۷۵	۳,۳۶۶	-۰/۲۶%
فیزیکی بورس کالا	۵۷,۰۰۱	۸۶,۱۲۸	۵۱/۱۰%
فیزیکی بورس انرژی	۴,۲۵۱	۳,۷۲۶	۶۴۶/۳۵%

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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



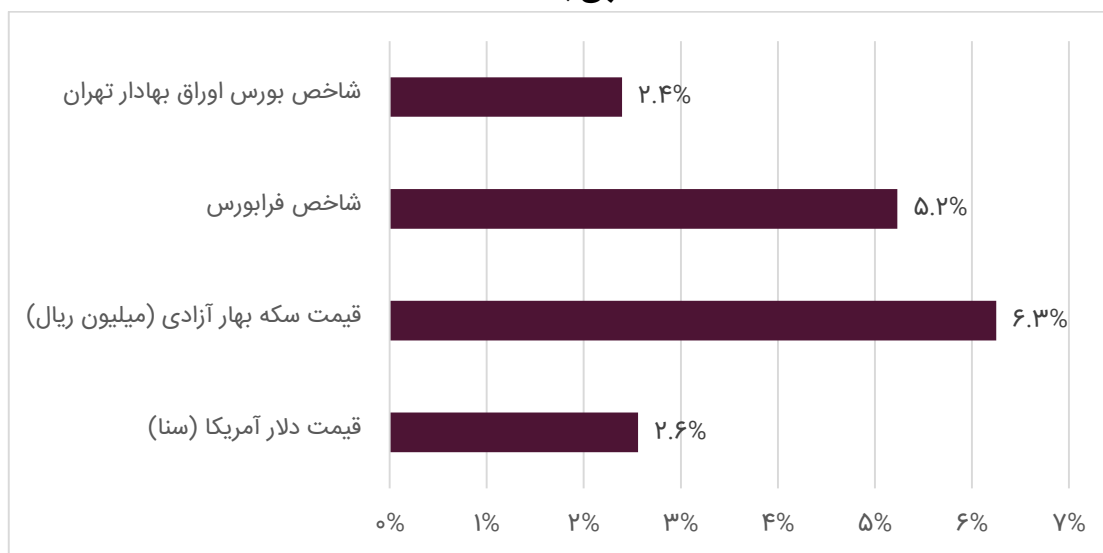
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱، بورس اوراق بهادار تهران با افزایش بیش از ۲ درصدی، بازدهی مطلوبی را از خود نشان داد. همچنین فرابورس ایران با بازدهی ۵ درصدی، عملکرد مطلوبی را ثبت نمود. در مدت مشابه، قیمت سکه بهار آزادی بیش از ۶ درصد افزایش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، افزایش 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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۴۷۰,۹۸۰	۱,۵۰۶,۲۱۷	۲/۳۹%
شاخص فرابورس	۱۸,۴۶۶	۱۹,۴۳۲	۵/۲۳%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۱۲/۰	۱۱۹/۰	۶/۲۵%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۴۸,۲۶۲	۲۵۴,۶۱۸	۲/۵۶%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱



۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ 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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۳): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

(ارقام برحسب دلار)

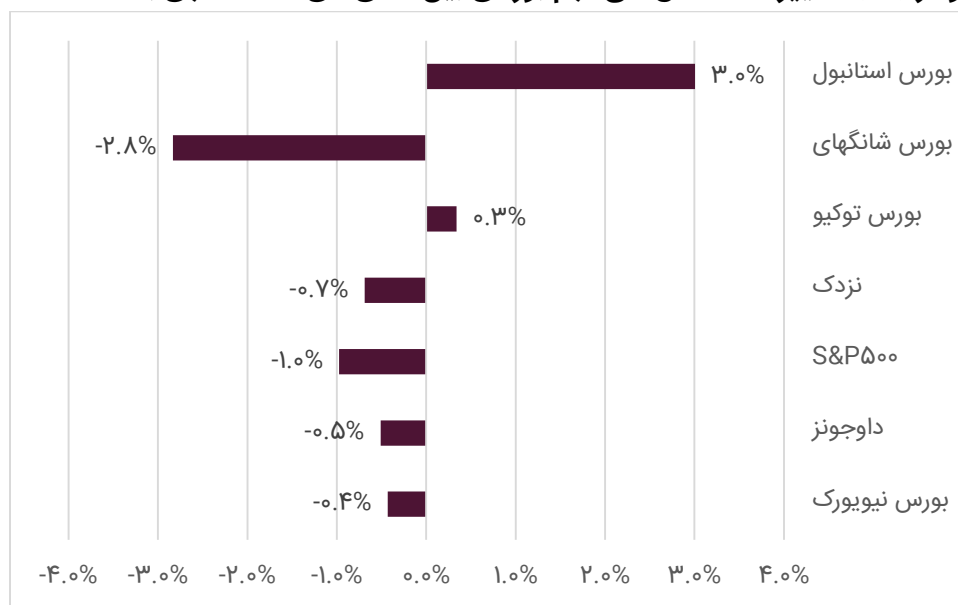
عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۳۶	۱,۸۳۹	۰/۱۶%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۴۶/۸۱	۴۷/۶۴	۱/۷۷%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۴۹/۲۵	۴۹/۹۷	۱/۴۶%

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 ۱۳۹۹/۰۹/۲۱ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۴): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۱۴	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۴,۴۱۷	۱۴,۳۵۵	-۰/۴۳%
داو جونز	۳۰,۲۱۸	۳۰,۰۶۴	-۰/۵۰%
S&P ۵۰۰	۳,۶۹۹	۳,۶۶۳	-۰/۹۷%
نزدک	۱۲,۴۶۴	۱۲,۳۷۸	-۰/۶۸%
بورس توکیو	۱,۷۷۶	۱,۷۸۲	۰/۳۳%
بورس شانگهای	۳,۴۴۵	۳,۳۴۷	-۲/۸۳%
بورس استانبول	۱,۳۳۱	۱,۳۷۱	۳/۰۰%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۲۱



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.

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