

گزارش هفتگی بازار سرمایه

منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶



تأمین سرمایه امید

مدیریت ریسک و مهندسی مالی

شماره ۴۰



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 با درآمد ثابت امید انصار:** 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 omidansarfund.com 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 این صندوق، شرکت تأمین سرمایه امید است. اطلاعات این صندوق در وبسایت آن به آدرس bazreomidfund.ir در دسترس است؛

- **صندوق سرمایه‌گذاری سهامی مشترک نوید انصار:** مدیریت دارایی‌های این صندوق عمدتاً شامل سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس می‌شود 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 parsgostarfund.com 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 مشترک گنجینه مهر:** این صندوق از نوع مختلط است و ترکیب دارایی آن به گونه‌ای است که منابع صندوق همزمان در بازار سهام و اوراق با درآمد ثابت مانند سپرده بانکی، اوراق مشارکت و ... به نسبت نزدیک به یکدیگر سرمایه‌گذاری می‌شوند. به همین دلیل سرمایه‌گذاری در این صندوق نسبت به صندوق‌های سرمایه‌گذاری سهامی دارای ریسک کمتر و نسبت به صندوق‌های سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت دارای بازدهی بیشتری خواهد بود. اطلاعات این صندوق در وبسایت آن به آدرس ganjinehfund.meibourse.com 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

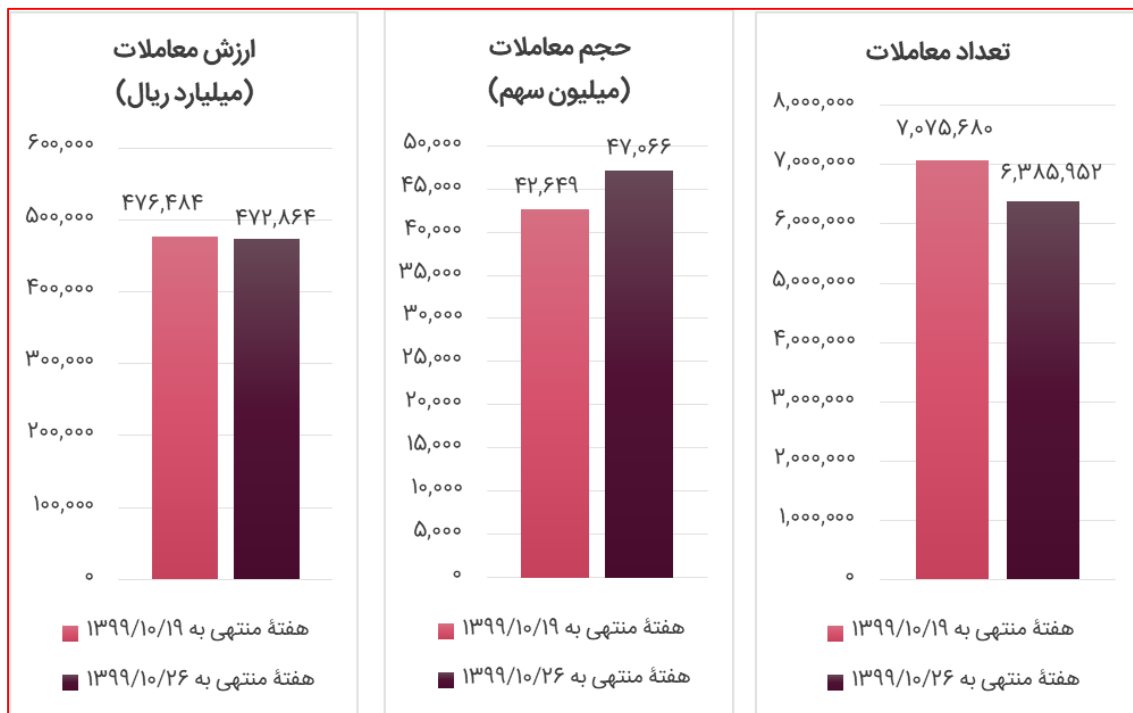


آن تا انتشار و فروش در بازار، برنامه‌ریزی جامع تأمین مالی و پذیرش تعهد پذیرهنویسی اوراق بهادار.

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.

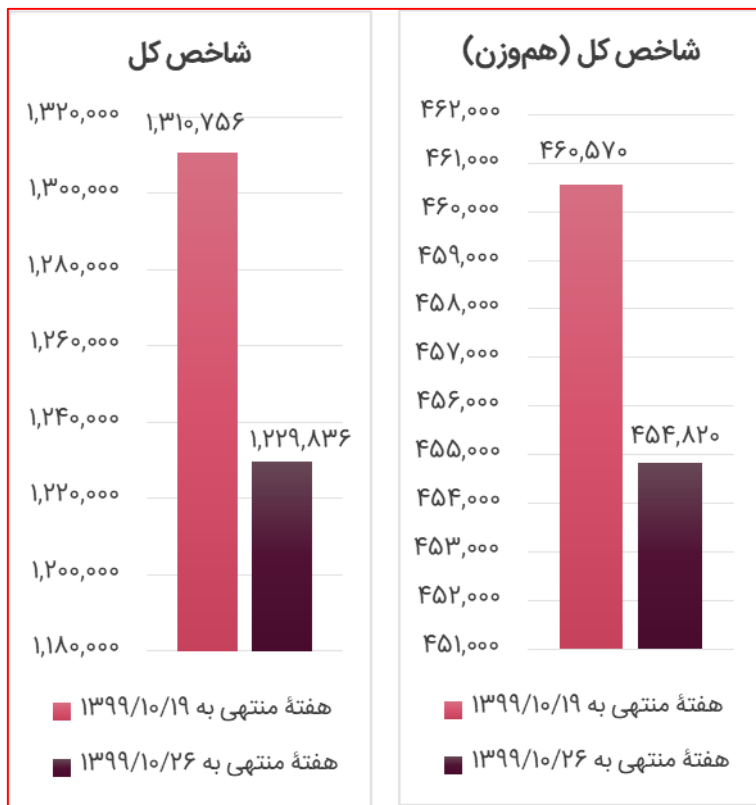
نمودار (۱): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن



جدول (۲): مقایسه شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۵۱,۹۸۲	۴۸,۹۶۳	-۶/۲%
شاخص کل	۱,۳۱۰,۷۵۶	۱,۲۲۹,۸۳۶	
شاخص قیمت (ارزشی-وزنی)	۳۴۲,۵۲۰	۳۲۱,۳۵۲	
شاخص کل (هموزن)	۴۶۰,۵۷۰	۴۵۴,۸۲۰	-۱/۳%
شاخص قیمت (هموزن)	۳۰۱,۴۷۹	۲۹۷,۶۰۷	

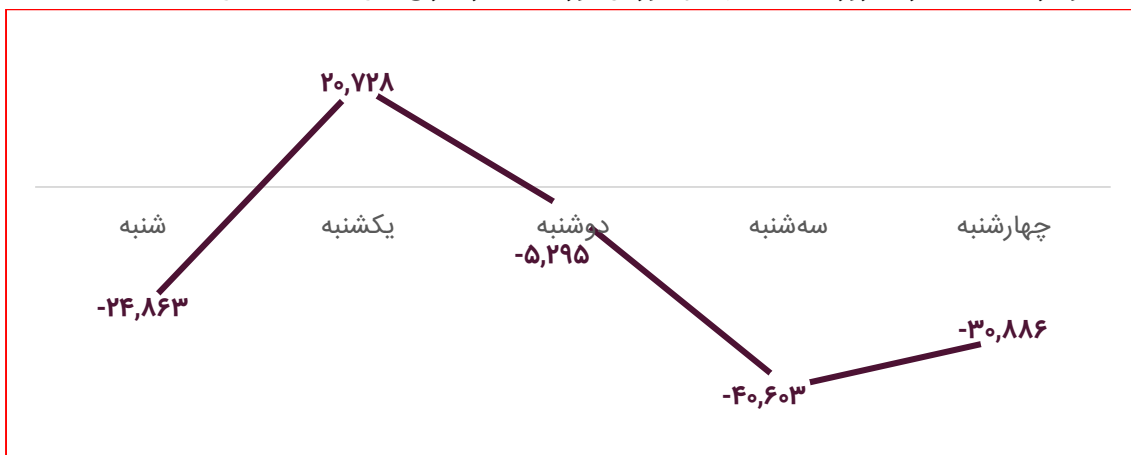
نمودار (۲): مقایسه شاخص کل و شاخص کل هموزن بورس اوراق بهادار تهران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن



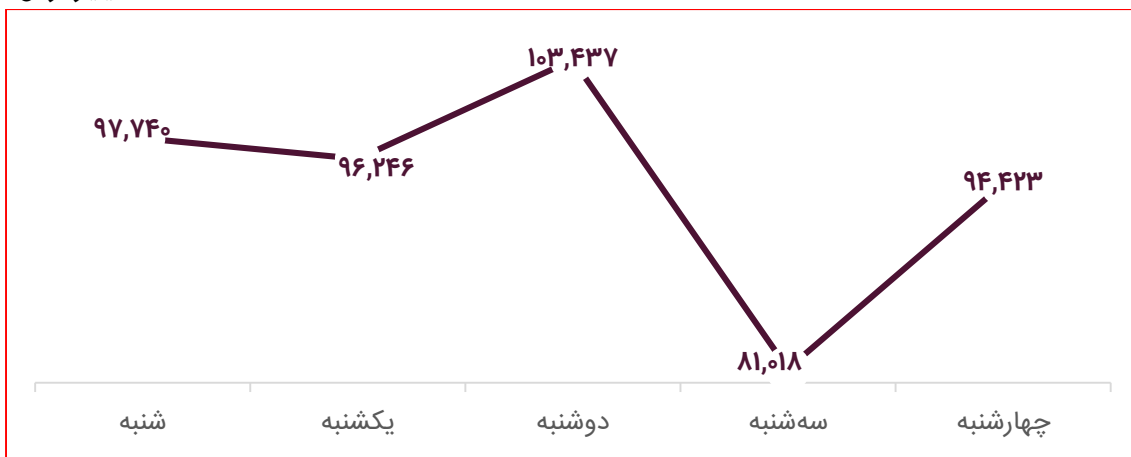
جدول (۳): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۲۴,۸۶۳	-۱/۸۹%	۱,۳۵۲,۷۶۰	۱۰,۶۳۰	۹۷,۷۴۰
یکشنبه	۲۰,۷۲۸	۱/۶۱%	۱,۴۱۹,۶۰۴	۹,۰۵۶	۹۶,۲۴۶
دوشنبه	-۵,۲۹۵	-۰/۴۰%	۱,۳۶۹,۹۸۹	۹,۹۱۲	۱۰۳,۴۳۷
سه شنبه	-۴۰,۶۰۳	-۳/۱۲%	۱,۰۲۲,۷۴۰	۷,۰۳۶	۸۱,۰۱۸
چهارشنبه	-۳۰,۸۸۶	-۲/۴۴%	۱,۲۲۰,۸۵۹	۱۰,۴۳۱	۹۴,۴۲۳

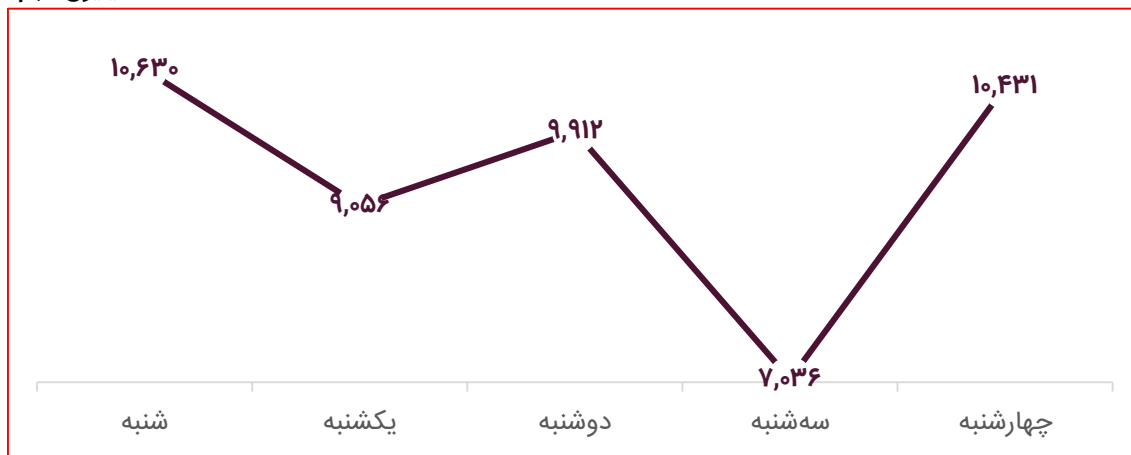
نمودار (۳): تغییرات روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶



نمودار (۴): ارزش معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ (میلیارد ریال)



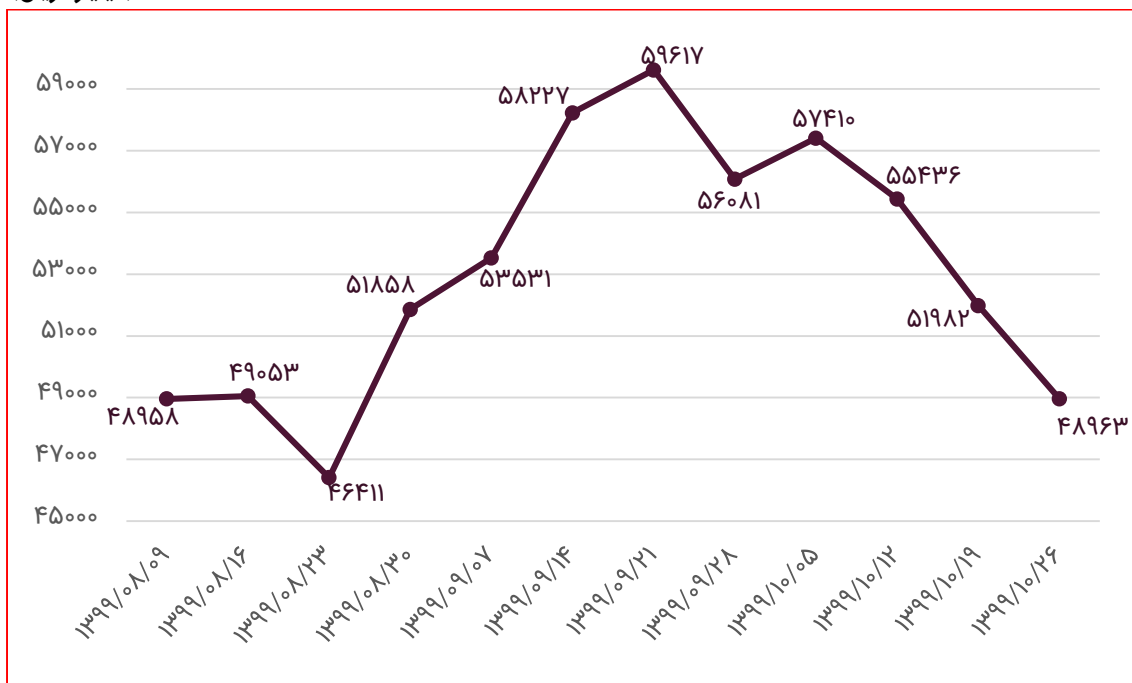
نمودار (۵): حجم معاملات روزانه بورس اوراق بهادار تهران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ (میلیون سهم)



جدول (۴): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ (میلیارد ریال)

ارزش بازار	تاریخ
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
۵۶,۰۸۱	۱۳۹۹/۰۹/۲۸
۵۷,۴۱۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۵
۵۵,۴۳۶	۱۳۹۹/۱۰/۱۲
۵۱,۹۸۲	۱۳۹۹/۱۰/۱۹
۴۸,۹۶۳	۱۳۹۹/۱۰/۲۶

نمودار (۶): تغییرات هفتگی ارزش کل بورس اوراق بهادار طی ۳ ماه اخیر منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ (میلیارد ریال)



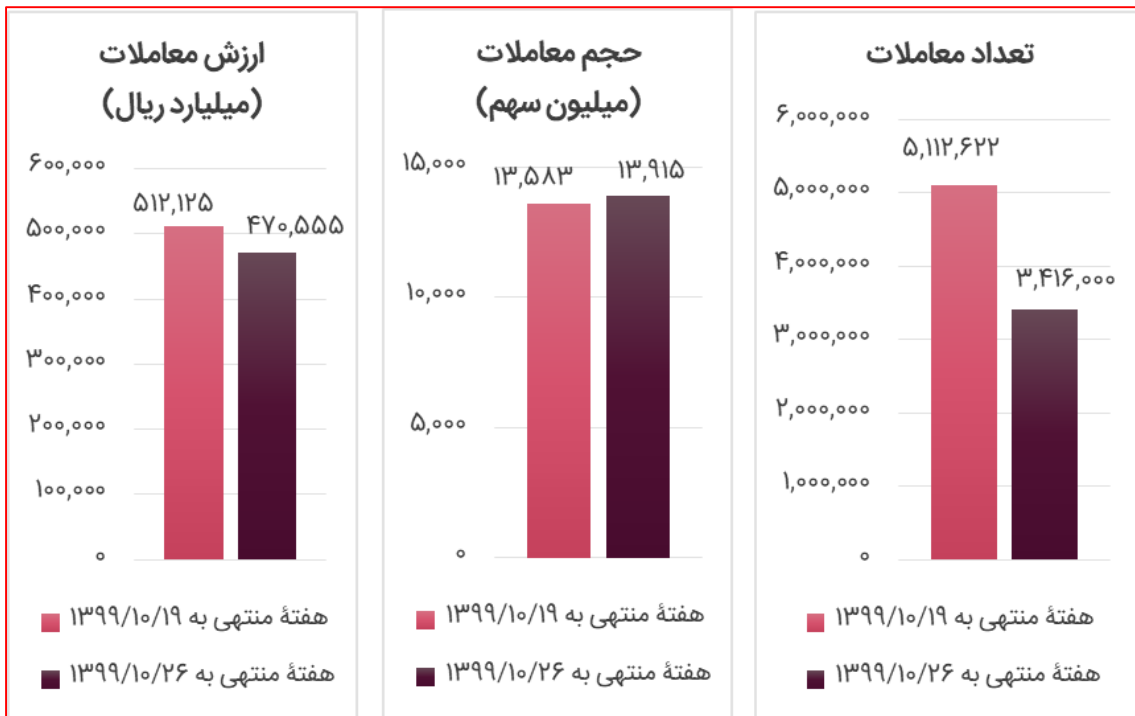
۱-۲- فرابورس ایران

شاخص کل فرابورس در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ طی ۵ روز کاری، با ۷۵۶ واحد کاهش، از ۱۹,۰۷۶ به عدد ۱۸,۳۲۰ رسید. متوسط حجم معاملات روزانه ۲,۷۸۳ میلیون سهم در طی این هفته، حاکی از افزایش ۲ درصدی است. ارزش معاملات و تعداد معاملات انجام گرفته، به ترتیب ۸ و ۳۳ درصد کاهش داشته است.

جدول (۵): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن

هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶			هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹		عنوان
میزان رشد	میانگین	کل	میانگین	کل	
۵			۵		روزهای فعالیت
-۸/۱۱%	۹۴,۱۱۱	۴۷۰,۵۵۵	۱۰۲,۴۲۵	۵۱۲,۱۲۵	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۲/۴۴%	۲,۷۸۳	۱۳,۹۱۵	۲,۷۱۷	۱۳,۵۸۳	حجم معاملات (میلیون سهم)
-۳۳/۱۸%	۶۸۳,۲۰۰	۳,۴۱۶,۰۰۰	۱,۰۲۲,۵۲۴	۵,۱۱۲,۶۲۲	تعداد معاملات

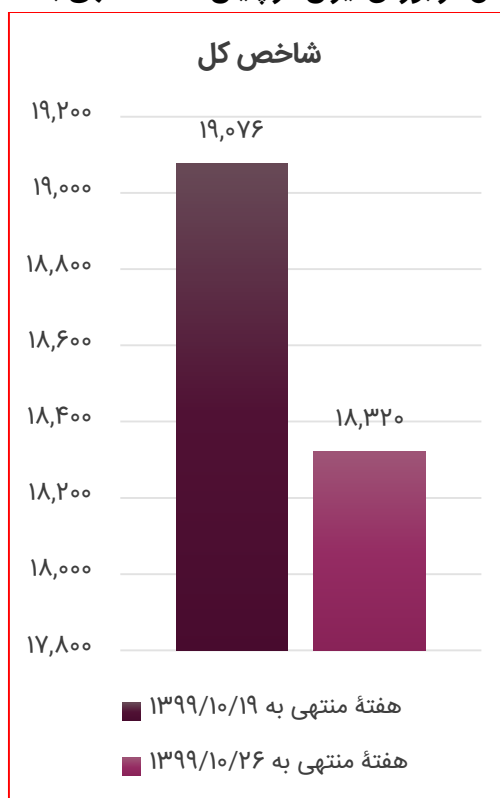
نمودار (۷): مقایسه تعداد، ارزش و حجم معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن



جدول (۶): مقایسه شاخص کل و ارزش بازار اول و دوم فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶	میزان رشد (درصد)
ارزش بازار (هزار میلیارد ریال)	۱۳,۰۱۶	۱۲,۵۰۸	-۳/۹۰%
شاخص کل	۱۹,۰۷۶	۱۸,۳۲۰	-۳/۹۶%

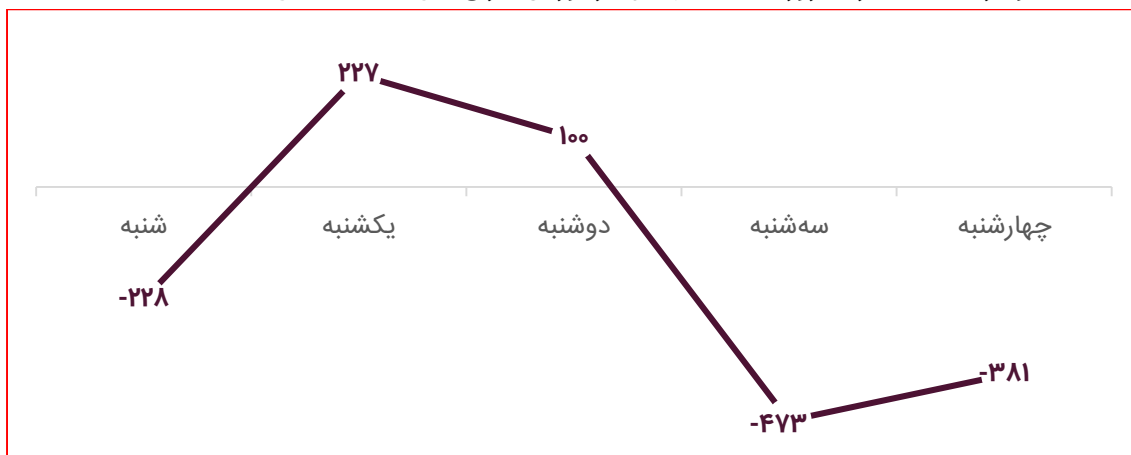
نمودار (۸): مقایسه شاخص کل فرابورس ایران در پایان هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن



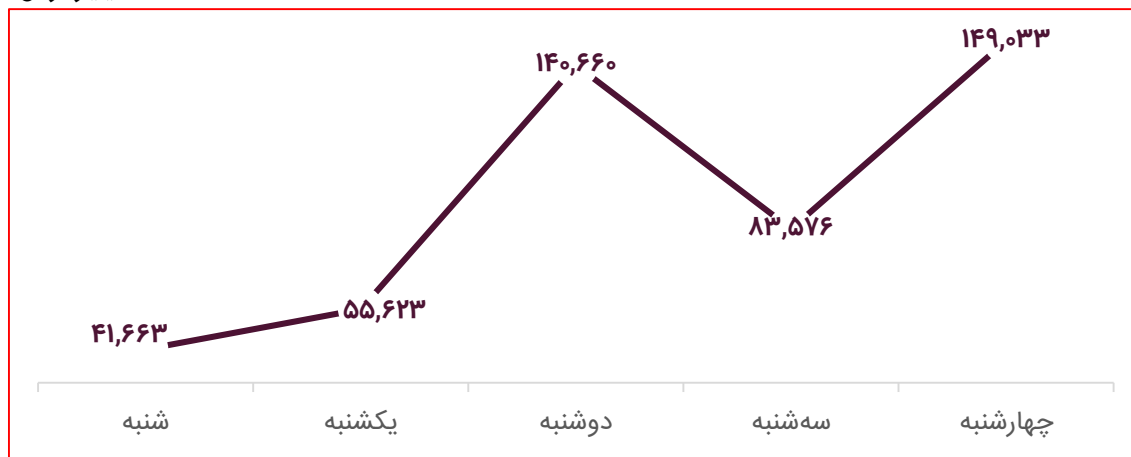
جدول (۷): تغییرات روزانه شاخص، تعداد، حجم و ارزش معاملات فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

روز هفته	تغییر شاخص	درصد تغییر	تعداد معاملات	حجم معاملات (میلیون سهم)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
شنبه	-۲۲۸	-۱/۱۹%	۵۵۸,۰۰۰	۲,۲۰۳	۴۱,۶۶۳
یکشنبه	۲۲۷	۱/۲۰%	۷۳۱,۰۰۰	۲,۹۵۴	۵۵,۶۲۳
دوشنبه	۱۰۰	۰/۵۲%	۷۶۶,۰۰۰	۳,۲۸۸	۱۴۰,۶۶۰
سه شنبه	-۴۷۳	-۲/۴۶%	۷۶۱,۰۰۰	۳,۱۰۷	۸۳,۵۷۶
چهارشنبه	-۳۸۱	-۲/۰۳%	۶۰۰,۰۰۰	۲,۳۶۳	۱۴۹,۰۳۳

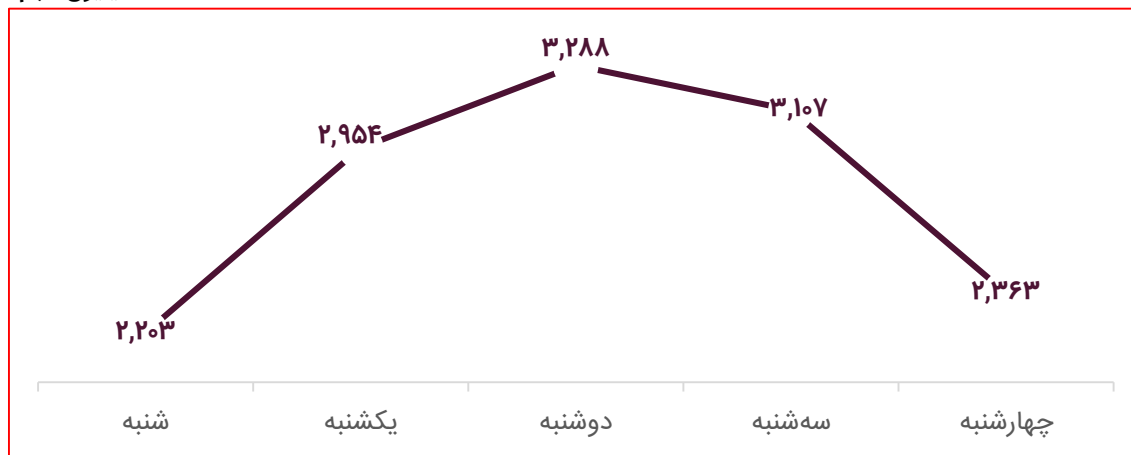
نمودار (۹): تغییرات روزانه شاخص کل فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶



نمودار (۱۰): ارزش معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ (میلیارد ریال)

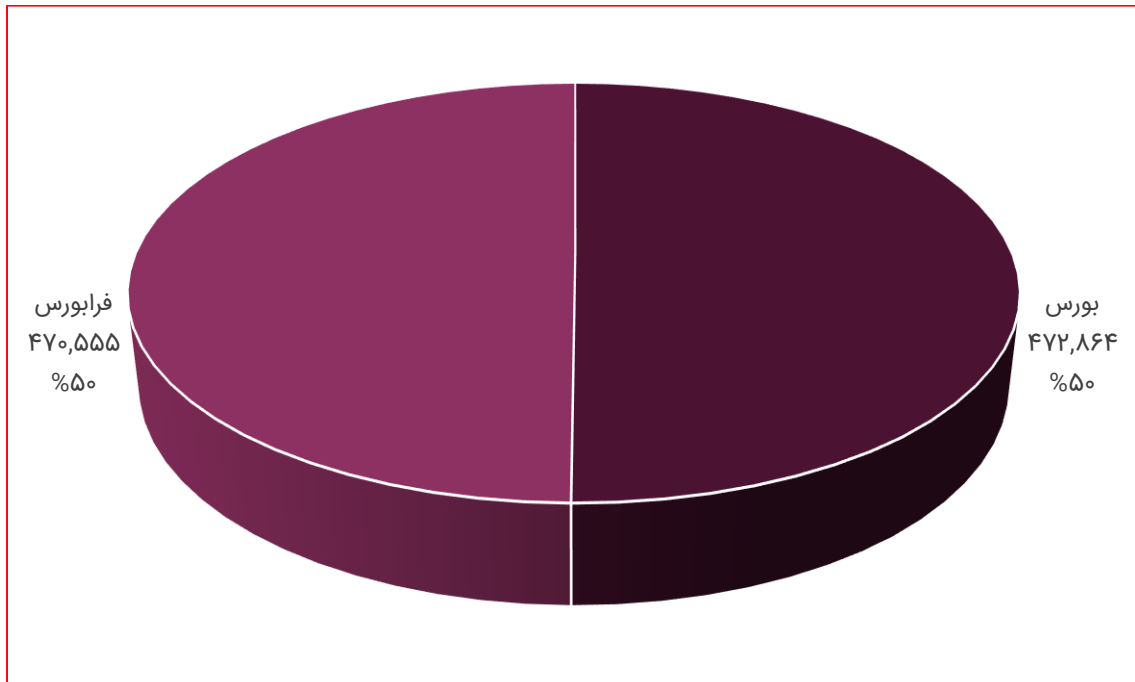


نمودار (۱۱): حجم معاملات روزانه فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ (میلیون سهم)



نمودار (۱۲): مقایسه ارزش کل معاملات بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

(میلیارد ریال)



۳-۱- بورس کالا و انرژی

در جدول (۸)، 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 (۹) مجموع کل ارزش معاملات هریک از بازارهای فوق طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶، با هفته قبل از آن مورد مقایسه قرار گرفته است.

جدول (۸): آمار روزانه ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

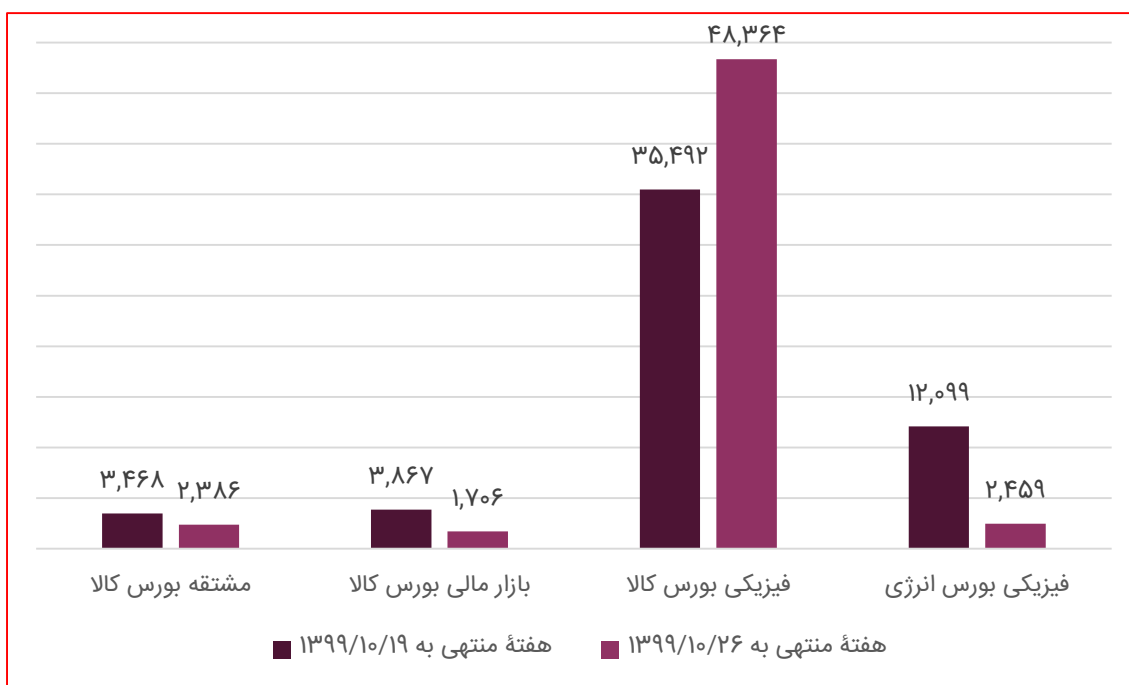
(میلیارد ریال)

تاریخ	بازار مالی بورس کالا	مشتقه بورس کالا	فیزیکی بورس کالا	فیزیکی بورس انرژی
شنبه	۳۴۰	۳۶۸	۳,۰۹۶	۱۳۳
یکشنبه	۳۸۱	۵۸۷	۴,۴۳۱	۴۹۲
دوشنبه	۳۱۶	۵۷۹	۱۵,۴۶۹	۹۵۵
سه‌شنبه	۱۸۸	۳۷۹	۱۳,۸۵۰	۸۰۹
چهارشنبه	۴۸۲	۴۷۳	۱۱,۵۱۷	۷۰

جدول (۹): مقایسه مجموع ارزش معاملات فیزیکی، مشتقه و بازار مالی در بورس کالای ایران و معاملات فیزیکی بورس انرژی ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)

تاریخ	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶	درصد تغییر
مشتقه بورس کالا	۳,۴۶۸	۲,۳۸۶	-۳۱/۲۱%
بازار مالی بورس کالا	۳,۸۶۷	۱,۷۰۶	-۵۵/۸۸%
فیزیکی بورس کالا	۳۵,۴۹۲	۴۸,۳۶۴	۳۶/۲۶%
فیزیکی بورس انرژی	۱۲,۰۹۹	۲,۴۵۹	-۷۹/۶۷%

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 ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ با هفته قبل از آن (میلیارد ریال)



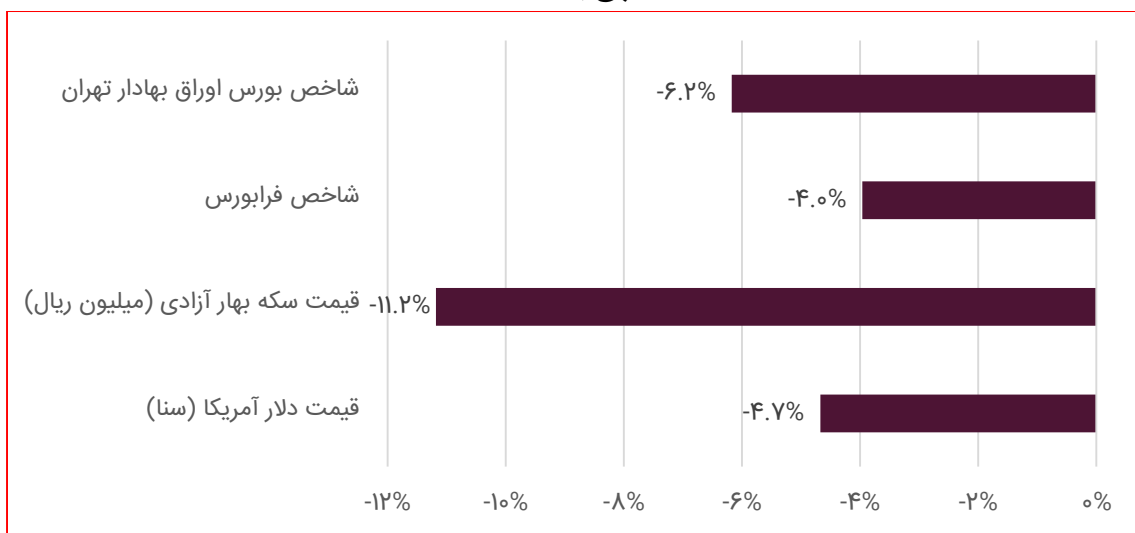
۴-۱- مقایسه عملکرد بازار سرمایه با بازارهای موازی

طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶، بورس اوراق بهادار تهران با کاهش بیش از ۶ 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 ۱۱ درصد کاهش داشت و همچنین نرخ دلار آمریکا (براساس نرخ سنا)، کاهش بیش از ۴ درصدی را ثبت نمود.

جدول (۱۰): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶	درصد تغییرات
شاخص بورس اوراق بهادار تهران	۱,۳۱۰,۷۵۶	۱,۲۲۹,۸۳۶	-۶/۱۷%
شاخص فرابورس	۱۹,۰۷۶	۱۸,۳۲۰	-۳/۹۶%
قیمت سکه بهار آزادی (میلیون ریال)	۱۱۶/۰	۱۰۳/۰	-۱۱/۱۸%
قیمت دلار آمریکا (سنا)	۲۵۳,۴۲۹	۲۴۱,۵۸۸	-۴/۶۷%

نمودار (۱۴): مقایسه بازدهی بازارهای طلا و ارز با بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶





۲- بازارهای بین‌المللی

در بخش ۲، به طور مختصر تغییرات قیمت‌ها و شاخص‌های با اهمیت بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ مورد بررسی قرار می‌گیرد. در جدول (۱۱) میزان تغییرات قیمت جهانی طلا، قیمت هر بشکه نفت برنت و قیمت هر بشکه نفت سنگین ایران طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۱): تغییرات قیمت جهانی طلا و نفت طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

(ارقام برحسب دلار)

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶	درصد تغییرات
قیمت جهانی طلا (هر اونس)	۱,۸۴۷	۱,۸۲۶	-۱/۱۰%
قیمت نفت سنگین ایران (هر بشکه)	۵۲,۸۹	۵۰,۹۹	-۳/۵۹%
قیمت نفت برنت (هر بشکه)	۵۵,۹۹	۵۵,۱۰	-۱/۵۸%

در جدول (۱۲)، میزان تغییرات شاخص‌های مهم بین‌المللی بورس شامل بورس نیویورک، داوجونز، S&P۵۰۰، نزدک، بورس استانبول، بورس توکیو و بورس شانگهای طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶ مورد بررسی قرار گرفته است.

جدول (۱۲): تغییرات شاخص‌های مهم بورس بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

عنوان	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۱۹	هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶	درصد تغییرات
بورس نیویورک	۱۴,۹۶۷	۱۴,۸۹۴	-۰/۴۸%
داوجونز	۳۱,۰۹۸	۳۰,۸۱۴	-۰/۹۱%
S&P ۵۰۰	۳,۸۲۵	۳,۷۶۸	-۱/۴۸%
نزدک	۱۳,۲۰۲	۱۲,۹۹۹	-۱/۵۴%
بورس توکیو	۱,۸۵۵	۱,۸۵۷	۰/۰۸%
بورس شانگهای	۳,۵۷۰	۳,۵۶۶	-۰/۱۰%
بورس استانبول	۱,۵۴۱	۱,۵۲۴	-۱/۰۷%

نمودار (۱۵): تغییرات شاخص‌های مهم بورسی بین‌المللی طی هفته منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۲۶

