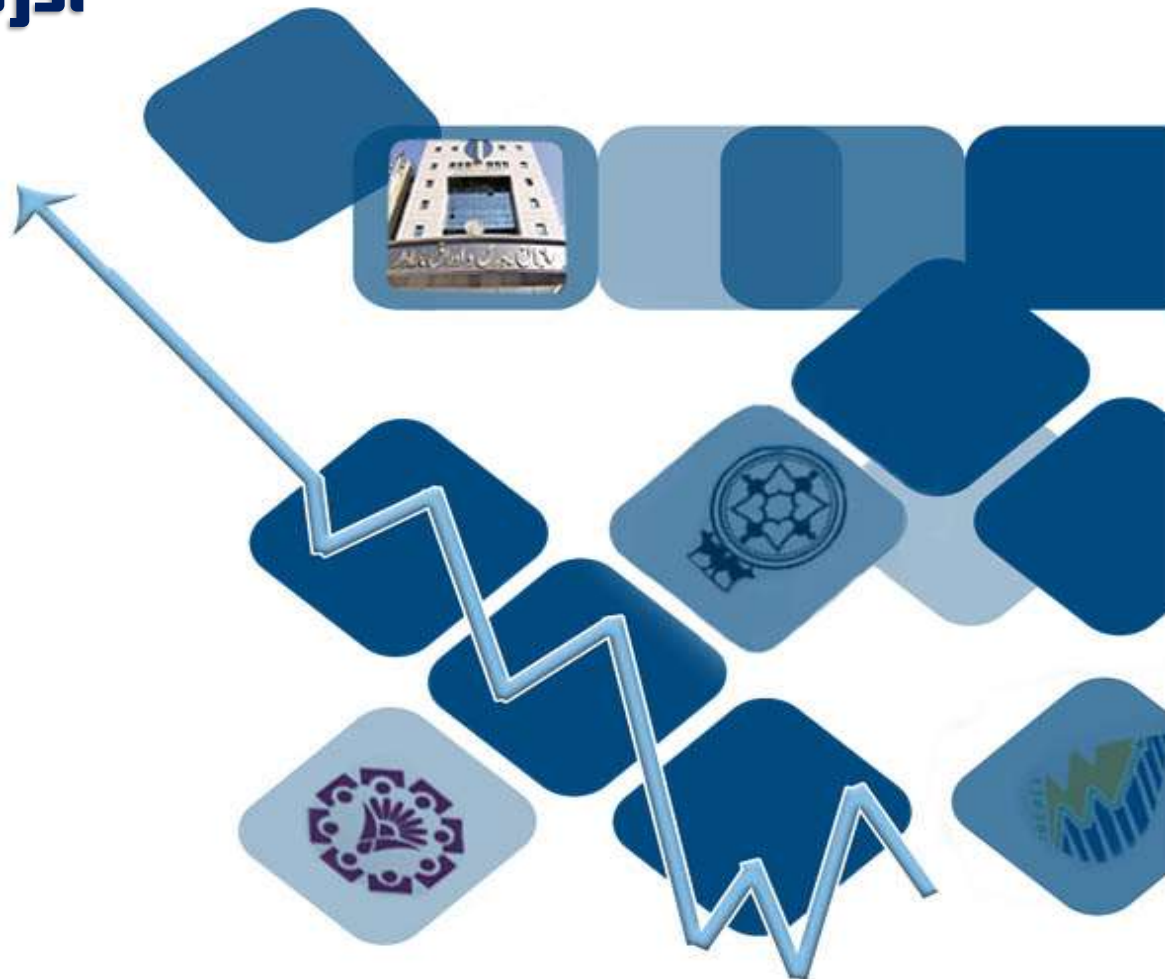




سازمان بورس و اوراق بهادار
SECURITIES & EXCHANGE ORGANIZATION

گزارش آماری آذرماه ۱۳۹۵



مرکز پژوهش، توسعه و مطالعات اسلامی

گروه آمار و تحلیل ریسک

بسم الله الرحمن الرحيم

سازمان بورس و اوراق بهادار

مرکز پژوهش، توسعه و مطالعات اسلامی - آذرماه ۱۳۹۵

تهیه کنندگان:

زانیار احمدی (سرپرست)

حسن حکیمیان

محمد احسان عامری

زهره گیوی

۵.....	نگاهی به بازار سرمایه در آذرماه ۱۳۹۵.....
۸.....	آمار و اطلاعات کلی.....
۹.....	ارزش کل بازار به تفکیک بازارها.....
۱۰.....	ارزش بازارها به تفکیک صنایع.....
۱۰.....	بورس اوراق بهادار تهران.....
۱۱.....	فرابورس ایران.....
۱۲.....	آمار معاملات.....
۱۲.....	آمار معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک بازار، نوع اوراق و صنایع.....
۱۷.....	آمار معاملات در فرابورس ایران به تفکیک بازار، صنایع و نوع اوراق.....
۲۲.....	آمار معاملات در بورس کالا.....
۲۲.....	آمار معاملات در بورس انرژی.....
۲۳.....	سرمایه‌گذاران خارجی.....
۲۳.....	شاخص‌های بازار سرمایه.....
۲۴.....	اینفوگرافیک شاخص.....
۲۵.....	مقایسه شاخص کل با شاخص‌های کشورهای در حال توسعه و اسلامی.....
۲۶.....	نسبت P/E بازار.....
۲۷.....	مقایسه معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس.....
۲۹.....	لیست نمادهای متوقف.....
۳۳.....	عملکرد سرمایه‌گذاران در بازار سرمایه به صورت منطقه‌ای.....
۳۳.....	نسبت حجم معاملات به تفکیک معاملات برخط و غیربرخط.....
۳۳.....	حجم معاملات در آذرماه ۹۵ به تفکیک مناطق.....
۳۵.....	ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری به تفکیک انواع صندوق‌ها.....
۳۶.....	آمار تأمین مالی.....
۳۷.....	مانده اوراق بدهی منتشره.....
۳۸.....	بازار سرمایه و بازارهای موازی.....
۳۹.....	نرخ‌های جهانی کالای اساسی و تغییرات شاخص‌ها.....
۴۰.....	مدل آماری بررسی تأثیر بازارهای موازی بر شاخص کل بورس.....

- شاخص‌های مورد بررسی ۴۰
- همبستگی بین متغیرها ۴۱
- روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها بر شاخص کل ۴۲
- مصوبات کمیته‌های تخصصی ۴۳

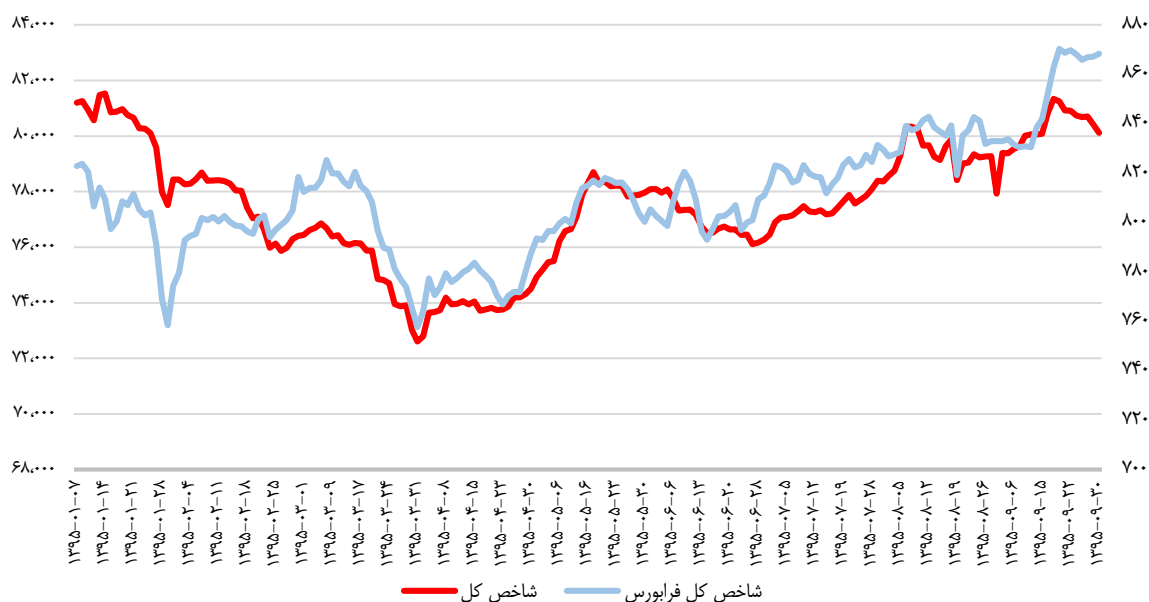
نگاهی به بازار سرمایه در آذرماه ۱۳۹۵

ارزش بازار بورس تهران و فرابورس ایران

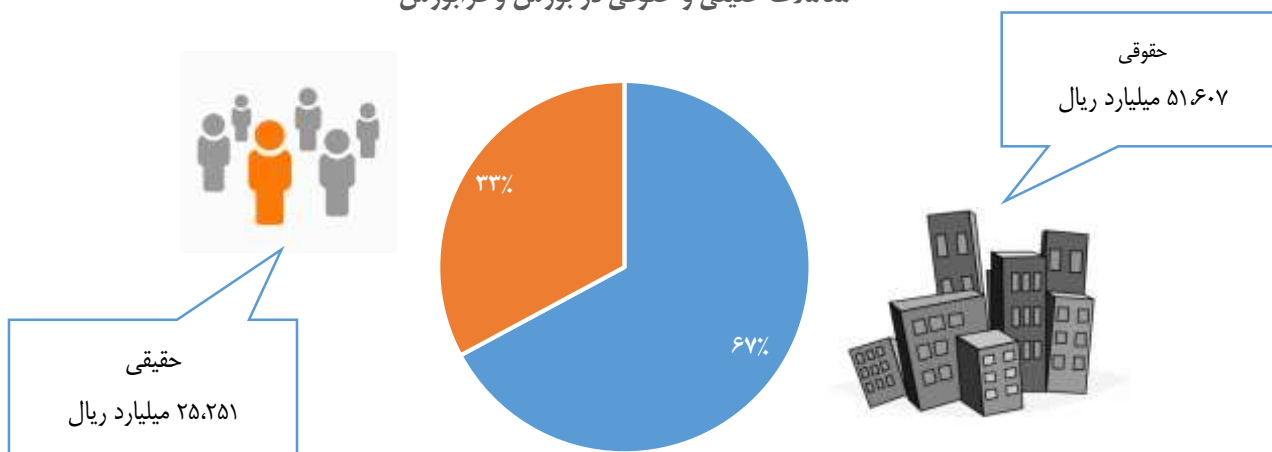
درصد تغییرات		ارزش بازار			نوع بورس
نسبت به ابتدای سال ۹۵	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	
-۲۸۳٪	۱.۴۰٪	۳,۴۶۱,۷۷۴	۳,۳۱۷,۶۵۵	۳,۳۶۳,۹۷۸	بورس تهران
۳۶۰٪	۳.۹۴٪	۹۶۶,۴۲۳	۹۶۳,۲۵۴	۱,۰۰۱,۲۰۳	فرابورس تهران
-۱.۴۲٪	۱.۹۷٪	۴,۴۲۸,۱۹۷	۴,۲۸۰,۹۰۹	۴,۳۶۵,۱۸۱	مجموع بورس و فرابورس

شاخص‌های بازار سرمایه

درصد تغییرات		تاریخ			نام شاخص
نسبت به ابتدای سال	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	
-۰.۱۲٪	۱.۰۶٪	۸۰,۲۱۹	۷۹,۲۷۹	۸۰,۱۲۳	شاخص کل
۱۷۶۹٪	-۱.۵۰٪	۱۳,۳۵۷	۱۵,۹۵۹	۱۵,۷۲۰	شاخص کل (هم وزن)
-۷۶۰٪	۰.۷۸٪	۳۰,۵۱۱	۲۷,۹۷۵	۲۸,۱۹۲	شاخص قیمت
۱۱.۷۱٪	-۱.۶۷٪	۱۱,۲۰۲	۱۲,۷۲۷	۱۲,۵۱۴	شاخص قیمت (هم وزن)
-۲۸۷٪	۱.۱۴٪	۳,۳۸۱	۳,۲۴۷	۳,۲۸۴	شاخص ۳۰ شرکت بزرگ
۰.۷۰٪	۱.۵۰٪	۶۶,۹۹۴	۶۶,۴۷۰	۶۷,۴۶۶	شاخص صنعت
-۲.۹۷٪	۱.۵۹٪	۳,۲۵۴	۳,۱۰۸	۳,۱۵۷	شاخص ۵۰ شرکت فعال‌تر
۷.۷۳٪	۴.۲۴٪	۸۰۶	۸۳۳	۸۶۸	شاخص کل فرابورس



معاملات حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس



حجم و ارزش معاملات

تاریخ		درصد تغییرات		
بورس	نوع	آذرماه ۱۳۹۵	آبان ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
بورس تهران	حجم معامله - هزار سهم	۱۵،۷۲۴،۱۱۹	۲۱،۸۹۱،۵۱۱	۲۸،۱۷٪ -
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴۰،۶۹۵	۶۱،۵۲۰	۳۳،۸۵٪ -
فرابورس ایران	حجم معامله - هزار سهم	۵،۹۴۷،۳۰۵	۶،۵۱۵،۷۰۱	۸،۷۲٪ -
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۶،۱۶۳	۴۴،۶۴۷	۱۹،۰۰٪ -
بورس کالا	حجم معامله - تن	۲،۳۵۷،۱۵۸	۲،۰۹۲،۱۲۹	۱۲،۶۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۷،۰۹۶	۳۳،۵۳۹	۱۰،۶۱٪
بورس انرژی	حجم معامله - (تن-مگاوات)	۶۱۷،۲۵۱	۱،۴۰۹،۸۸۲	۵۶،۲۲٪ -
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳،۴۸۲	۶،۸۱۷	۴۸،۹۲٪ -
مجموع ارزش معاملات بورس‌ها		۱۱۷،۴۳۶	۱۴۶،۵۲۳	۱۹،۸۵٪ -

مانده اوراق بدهی منتشره در آذرماه ۱۳۹۵

میلیارد ریال				
درصد از کل	پایان سال ۹۴	درصد از کل	پایان آذرماه ۹۵	نوع اوراق
۲۸.۲۸٪	۵۰,۰۰۰	۱۶.۸۵٪	۵۰,۰۰۰	مشارکت
۲.۸۳٪	۵,۰۰۰	۱.۶۹٪	۵,۰۰۰	اجاره
۰٪	۰	۸.۹۳٪	۲۶,۵۰۰	سلف
۰٪	۰	۳.۳۷٪	۱۰,۰۰۰	مراجعه
۲۲.۶۲٪	۴۰,۰۰۰	۲۳.۵۹٪	۷۰,۰۰۰	اسناد خزانه اسلامی
۱۴.۹۳٪	۲۶,۳۹۵	۱۴.۹۶٪	۴۴,۳۹۵	معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری ها و دولت
۶.۸۶٪	۱۲۱,۳۹۵	۶۹.۴۰٪	۲۰۵,۸۹۵	جمع اوراق بهادار دولتی
۳۱.۳۴٪	۵۵,۴۲۰	۳۰.۶۰٪	۹۰,۷۸۴	انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی
۱۰۰٪	۱۷۶,۸۱۵	۱۰۰٪	۲۹۶,۶۷۹	جمع کل بازار اوراق بدهی

انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی

میلیارد ریال			
عملکرد ۹۴	عملکرد ۹ ماهه ۹۵	عنوان	نوع بازار
۹,۶۷۵	۱۵,۰۹۸	انتشار اوراق بهادار بدهی با مجوز سازمان بورس	انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی
۱۰,۸۲۷	۳۴,۷۲۰	انتشار اوراق سلف موازی استاندارد	
۱۳,۴۹۲	۱۸,۰۰۰	اوراق مشارکت دولت، شهرداری ها و بانک ها	
۰	۲۵,۰۰۰	گواهی سپرده سرمایه گذاری عام و خاص	
۵۰,۰۰۰	۰	اوراق مشارکت شرکت ملی نفت	
۵,۰۰۰	۰	اوراق اجاره دولتی	
۰	۱۰,۰۰۰	اوراق مراجعه دولتی	
۵۰,۰۰۰	۹۰,۰۰۰	اسناد خزانه اسلامی	
۹,۰۲۰	۷,۶۱۵	امتیاز تسهیلات مسکن	
۱۴۸,۰۱۴	۲۰۰,۴۳۳	جمع	

آمار و اطلاعات کلی



مقدمه

در این قسمت کلیه آمار و اطلاعات بازار سرمایه ارائه خواهد شد. نخست ارزش کل بازارها به تفکیک بورس و فرابورس و همچنین ارزش صنایع به تفکیک بورس و فرابورس ارائه شده است.

پس از آن آمار معاملات بورس تهران، فرابورس ایران، بورس کالا و بورس انرژی به تفکیک ارزش، حجم و تعداد معاملات نمایش داده شده است. در ادامه این بخش شاخص‌های بازار سرمایه، اینفوگرافیک شاخص، مقایسه شاخص با شاخص MSCI کشورهای در حال توسعه و شاخص شریعت COMCEC مورد بررسی قرار گرفته‌اند.

نسبت P/E بازار، مقایسه معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس، لیست نمادهای متوقف، عملکرد سرمایه‌گذاران در بازار سرمایه به صورت منطقه‌ای، ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری به تفکیک انواع صندوق‌ها و در پایان این بخش آمار تأمین مالی در بازار سرمایه ارائه شده است.

* آمار جدولی که فاقد منبع هستند از پایگاه آمار و اطلاعات سازمان استخراج شده‌اند.

❖ شاخص‌های مورد بررسی در این بخش

✓ ارزش کل بازار به تفکیک بازارها

✓ ارزش بازار به تفکیک صنایع

بورس اوراق بهادار تهران

فرابورس ایران

✓ آمار معاملات

در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک

بازار، نوع اوراق و صنایع

در فرابورس ایران به تفکیک بازار، نوع اوراق

و صنایع

در بورس کالا

در بورس انرژی

✓ سرمایه‌گذاران خارجی

✓ شاخص‌های بازار سرمایه

✓ اینفوگرافیک شاخص

✓ مقایسه شاخص کل با شاخص

کشورهای در حال توسعه و اسلامی

✓ نسبت P/E بازار

✓ مقایسه معاملات سرمایه‌گذاران

حقیقی و حقوقی

✓ لیست نمادهای متوقف

✓ عملکرد سرمایه‌گذاران در بازار

سرمایه به صورت منطقه‌ای

نسبت حجم معاملات به تفکیک معاملات برخط

و غیربرخط

حجم معاملات در آذرماه ۹۵ به تفکیک مناطق

✓ ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری

✓ آمار تأمین مالی

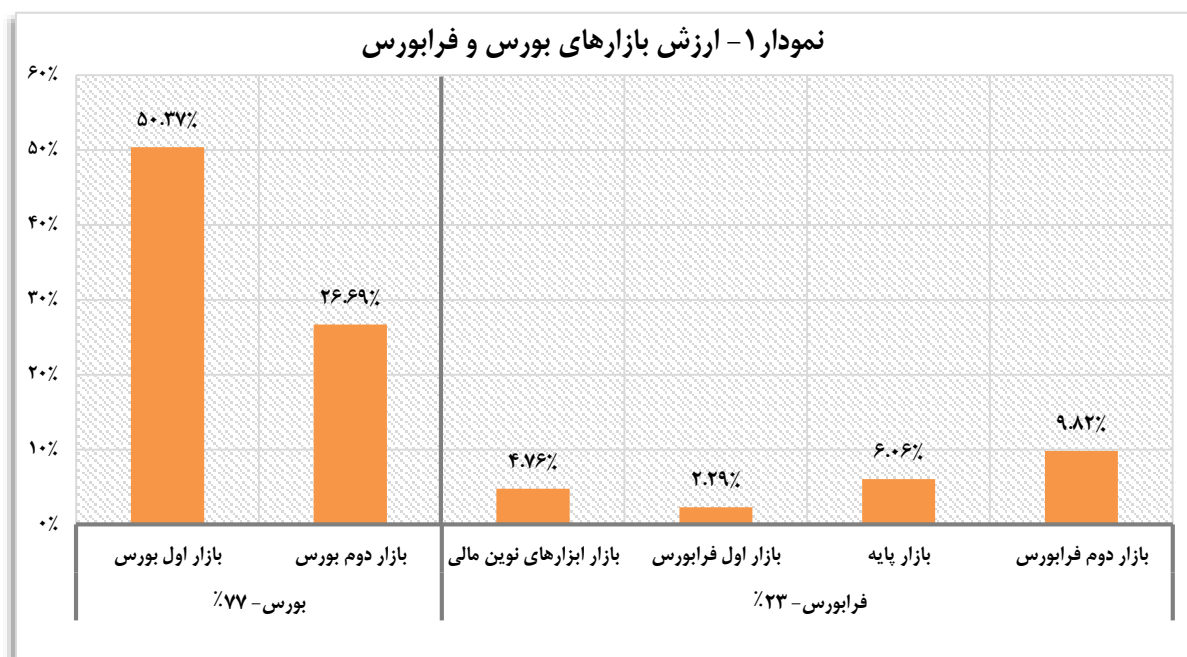
ارزش کل بازار به تفکیک بازارها

در جدول زیر، ارزش کل سهام بازار بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران به تفکیک بازارها در انتهای آذرماه ۱۳۹۵، آبان ماه ۱۳۹۵ و انتهای سال ۱۳۹۴ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

نوع بازار		ارزش بازار			درصد تغییرات
بورس تهران	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ابتدای سال ۹۵
بازار اول	۲,۱۹۸,۹۴۵	۲,۱۶۶,۵۶۴	۲,۳۰۳,۷۲۱	۱.۴۹٪	-۴.۵۵٪
بازار دوم	۱,۱۶۵,۰۳۲	۱,۱۵۱,۰۹۱	۱,۱۵۸,۰۵۴	۱.۲۱٪	-۰.۶۰٪
مجموع	۳,۳۶۳,۹۷۸	۳,۳۱۷,۶۵۵	۳,۴۶۱,۷۷۴	۱.۴۰٪	-۲.۸۳٪
فرابورس تهران	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ابتدای سال ۹۵
بازار ابزارهای نوین مالی	۲۰۷,۷۸۶	۱۹۸,۱۰۹	۱۱۲,۳۰۳	۴.۸۸٪	۸۵.۰۳٪
بازار اول	۹۹,۹۶۷	۱۰۳,۳۴۰	۱۱۷,۸۰۹	-۳.۲۶٪	-۱۵.۱۵٪
بازار دوم	۴۲۸,۷۰۴	۴۰۴,۳۰۱	۴۶۹,۳۹۱	۶.۰۴٪	-۸.۶۷٪
بازار پایه	۲۶۴,۷۴۶	۲۵۷,۵۰۴	۲۶۶,۹۱۹	۲.۸۱٪	-۰.۸۱٪
مجموع	۱,۰۰۱,۲۰۳	۹۶۳,۲۵۴	۹۶۶,۴۲۳	۳.۹۴٪	۳.۶۰٪
مجموع کل	۴,۳۶۵,۱۸۱	۴,۲۸۰,۹۰۹	۴,۴۲۸,۱۹۷	۱.۹۷٪	-۱.۴۲٪

درصد ارزش بازارهای مختلف بورس و فرابورس در آذرماه ۱۳۹۵ در نمودار (۱) نمایش داده شده است.



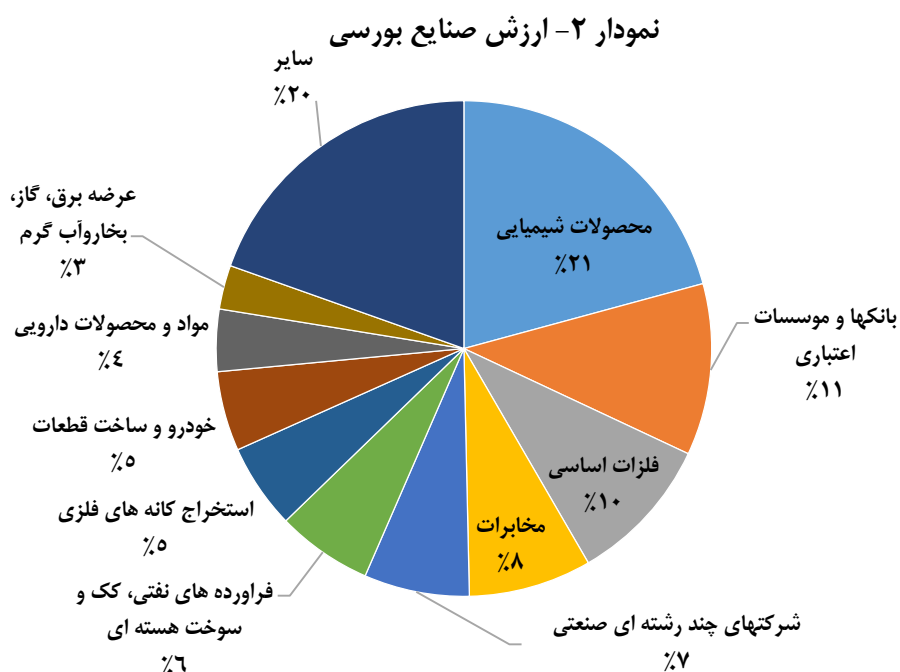
ارزش بازارها به تفکیک صنایع

بورس اوراق بهادار تهران

در جدول زیر ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش بازار در بورس اوراق بهادار تهران در تاریخ ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

۱۳۹۴/۱۲/۲۹		۱۳۹۵/۰۸/۳۰		۱۳۹۵/۰۹/۳۰		نام نوع صنعت
درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	
۲۱.۹۵٪	۷۵۹.۷۳۹	۲۰.۲۱٪	۶۷۰.۶۲۵	۲۰.۷۸٪	۶۹۸.۹۳۵	محصولات شیمیایی
۱۲.۰۶٪	۴۱۷.۳۶۵	۱۱.۵۰٪	۳۸۱.۶۲۰	۱۱.۲۰٪	۳۷۶.۷۳۹	بانکها و مؤسسات اعتباری
۷.۶۷٪	۲۶۵.۵۷۷	۹.۴۹٪	۳۱۴.۸۴۰	۹.۶۵٪	۳۲۴.۶۴۲	فلزات اساسی
۸.۲۹٪	۲۸۷.۰۵۴	۸.۲۰٪	۲۷۱.۹۱۲	۸.۰۲٪	۲۶۹.۸۲۸	مخابرات
۷.۴۶٪	۲۵۸.۲۱۱	۶.۳۶٪	۲۱۱.۱۳۹	۶.۸۸٪	۲۳۱.۴۰۳	شرکتهای چند رشتهای صنعتی
۵.۸۶٪	۲۰۳.۰۱۸	۶.۳۸٪	۲۱۱.۵۳۷	۶.۲۴٪	۲۰۹.۸۲۴	فراوردههای نفتی، کک و سوخت هسته‌ای
۴.۳۹٪	۱۵۲.۰۷۶	۵.۴۳٪	۱۸۰.۲۴۷	۵.۵۴٪	۱۸۶.۴۷۵	استخراج کانه‌های فلزی
۶.۸۵٪	۲۳۷.۲۹۶	۵.۱۸٪	۱۷۱.۷۵۲	۵.۲۰٪	۱۷۴.۹۱۸	خودرو و ساخت قطعات
۳.۶۹٪	۱۲۷.۷۷۷	۴.۰۲٪	۱۳۳.۴۵۴	۴.۰۵٪	۱۳۶.۳۷۱	مواد و محصولات دارویی
۲.۷۶٪	۹۵.۵۴۱	۲.۹۳٪	۹۷.۱۵۲	۲.۸۷٪	۹۶.۴۳۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم
۸۱٪	۲,۸۰۳,۶۵۵	۸۰٪	۲,۶۴۴,۲۷۷	۸۰٪	۲,۷۰۵,۵۶۵	مجموع
۱۹.۰۱٪	۶۵۸.۱۲۰	۲۰.۳۰٪	۶۷۳.۳۷۷	۱۹.۵۷٪	۶۵۸.۴۱۲	سایر
۱۰۰٪	۳,۴۶۱,۷۷۴	۱۰۰٪	۳,۳۱۷,۶۵۵	۱۰۰٪	۳,۳۶۳,۹۷۸	مجموع



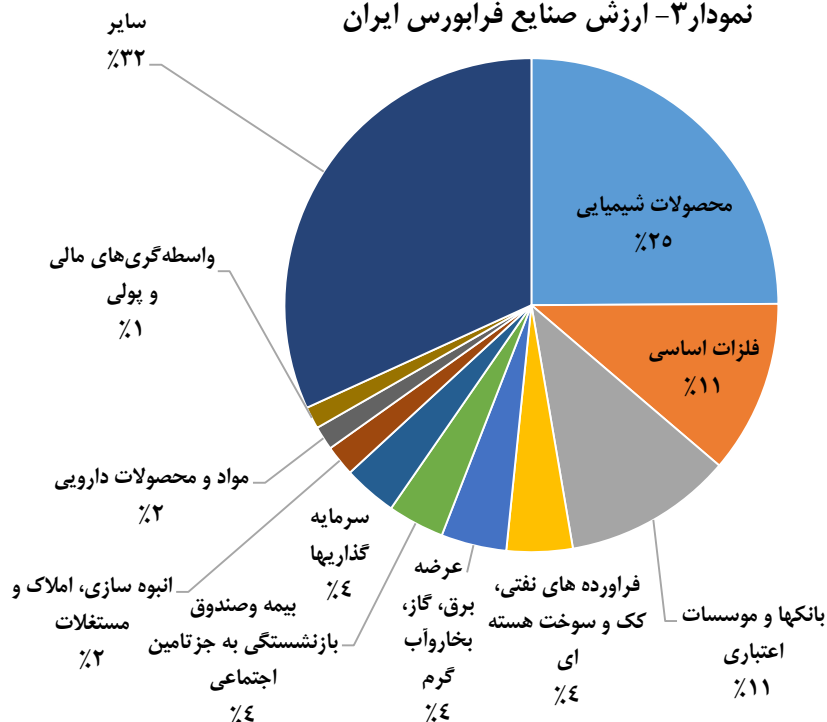
فرا بورس ایران

در جدول زیر ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش بازار در فرابورس ایران در تاریخ ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

نام نوع صنعت	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل
محصولات شیمیایی	۳۴۹,۴۶۱	۲۴.۹۲٪	۲۰۷,۵۲۹	۲۱.۵۴٪	۲۵۷,۹۷۹	۲۶.۶۹٪
فلزات اساسی	۱۱۳,۴۴۰	۱۱.۳۳٪	۱۱۷,۵۳۳	۱۲.۲۰٪	۱۱۵,۰۷۷	۱۱.۹۱٪
بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۱۰,۷۵۶	۱۱.۰۶٪	۱۱۱,۴۹۲	۱۱.۵۷٪	۱۳۱,۸۳۲	۱۳.۶۴٪
فراوردههای نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۴۳,۲۶۷	۴.۳۲٪	۴۴,۳۶۲	۴.۶۱٪	۷۷,۵۸۶	۸.۰۳٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۴۲,۸۹۷	۴.۲۸٪	۴۵,۶۳۱	۴.۷۴٪	۴۷,۶۷۴	۴.۹۳٪
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۳۷,۱۵۹	۳.۷۱٪	۳۷,۱۷۵	۳.۸۶٪	۳۲,۲۴۷	۳.۳۴٪
سرمایه‌گذاری‌ها	۳۵,۲۳۶	۳.۵۲٪	۳۲,۶۶۶	۳.۳۹٪	۳۴,۵۰۰	۳.۵۷٪
انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	۲۰,۲۴۵	۲.۰۲٪	۲۲,۶۰۹	۲.۳۵٪	۲۲,۴۴۹	۲.۳۲٪
مواد و محصولات دارویی	۱۵,۶۱۹	۱.۵۶٪	۱۶,۸۲۸	۱.۷۵٪	۱۱,۷۱۲	۱.۲۱٪
واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۱۴,۵۸۲	۱.۴۶٪	۱۴,۹۰۰	۱.۵۵٪	۱۴,۱۱۰	۱.۴۶٪
مجموع	۶۸۲,۶۶۰	۶۸.۱۸٪	۶۵۰,۷۲۴	۶۷.۵۵٪	۷۴۵,۱۶۶	۷۷.۱۱٪
سایر	۳۱۸,۵۴۳	۳۱.۸۲٪	۳۱۲,۵۳۱	۳۲.۴۵٪	۲۲۱,۲۵۷	۲۲.۸۹٪
مجموع	۱,۰۰۱,۲۰۳	۱۰۰٪	۹۶۳,۲۵۴	۱۰۰٪	۹۶۶,۴۲۳	۱۰۰٪

نمودار ۳- ارزش صنایع فرابورس ایران



آمار معاملات

آمار معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک بازار، نوع اوراق و صنایع

حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک نوع بازار در آبان و آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

نام نوع بازار		تاریخ		درصد تغییرات
		آذرماه ۱۳۹۵	آبان‌ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
حجم معامله - هزار سهم	بازار اوراق بدهی	۵,۴۷۶	۱۲,۳۶۲	-۵۵.۷۰٪
	بازار اوراق مشتقه	۲۸۸,۰۱۸	۷۱	۴۰۵۳۱۹٪
	بازار اول	۸,۲۱۷,۷۳۶	۱۴,۴۶۵,۵۳۶	-۴۳.۱۹٪
	بازار دوم	۶,۹۲۸,۳۷۴	۷,۳۸۳,۴۴۲	-۶.۱۶٪
	بازار ETF	۲۸۴,۵۱۵	۳۰,۱۰۰	۸۴۵٪
ارزش معامله - میلیارد ریال	بازار اوراق بدهی	۵,۵۵۰	۱۲,۵۴۷	-۵۵.۷۶٪
	بازار اوراق مشتقه	۴۵	۰.۱	۳۸۸۲۱٪
	بازار اول	۱۷,۲۲۹	۲۸,۳۹۵	-۳۹.۳۳٪
	بازار دوم	۱۶,۴۳۴	۲۰,۲۶۲	-۱۸.۸۹٪
	بازار ETF	۱,۴۳۷	۳۱۶	۳۵۴٪
تعداد معامله	بازار اوراق بدهی	۲,۴۰۰	۲,۳۲۱	۳.۴۰٪
	بازار اوراق مشتقه	۳۸۳	۱۹	۱۹۱۵٪
	بازار اول	۵۱۲,۷۰۶	۷۳۸,۹۹۷	-۳۰.۶۳٪
	بازار دوم	۴۸۶,۸۸۸	۷۹۵,۸۹۰	-۳۸.۸۲٪
	بازار ETF	۸,۱۲۳	۱,۵۴۹	۴۲۴٪
مجموع	حجم معامله - هزار سهم	۱۵,۷۲۴,۱۱۹	۲۱,۸۹۱,۵۱۱	-۲۸.۱۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴۰,۶۹۵	۶۱,۵۲۰	-۳۳.۸۵٪
	تعداد معامله	۱,۰۱۰,۵۰۰	۱,۵۳۸,۷۷۶	-۳۴.۳۳٪

- ✓ با آغاز معاملات قراردادهای اختیار معامله، حجم معامله، ارزش و تعداد معاملات در بازار اوراق مشتقه در آذرماه ۹۵ با رشد چشمگیری نسبت به آبان ماه ۹۵ همراه بوده است.
- ✓ حجم معاملات در بازار اوراق بدهی در آذرماه ۹۵ با کاهش ۵۵,۷ درصدی نسبت به آبان ماه همراه بوده است. حجم معاملات در بازار اول و دوم بورس نیز به ترتیب ۴۳,۱۹ و ۶,۱۶ درصد نسبت به آبان ماه ۹۵ کاهش داشته است.
- ✓ در مجموع حجم معاملات در بورس اوراق بهادار تهران در آذرماه ۹۵ با ۲۸,۱۷ درصد کاهش نسبت به آبان ماه ۹۵ روبرو بوده است.
- ✓ ارزش معاملات در بازار اول و دوم بورس اوراق بهادار تهران در آذرماه ۹۵ به ترتیب ۳۹,۳۳ و ۱۸,۸۹ درصد نسبت به ماه قبل کاهش داشته است. در مجموع نیز ارزش و تعداد معاملات در کلیه بازارهای بورس اوراق بهادار تهران به ترتیب ۳۳,۸۵ و ۳۴,۳۳ درصد کاهش نسبت به ماه قبل کاهش داشته است. علت این امر عرضه اوراق مرابحه سایپا در آبان ماه بود که ارزش و حجم معاملات را افزایش داد.

حجم، ارزش و تعداد معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک نوع اوراق در آبان و آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

نام نوع اوراق بهادار	تاریخ		درصد تغییرات
	آذرماه ۱۳۹۵	آبان ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
اوراق صکوک	تعداد معامله	۱,۱۸۷	۹۷۴
	حجم معامله - هزار سهم	۸۷۷	۲,۲۷۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۹۱۹	۲,۳۵۹
اوراق مشارکت	تعداد معامله	۶۶۵	۹۳۱
	حجم معامله - هزار سهم	۴,۴۶۲	۱۰,۰۳۵
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴,۴۹۴	۱۰,۱۳۰
اوراق گواهی سپرده	تعداد معامله	۵۴۸	۴۱۶
	حجم معامله - هزار سهم	۱۳۷	۵۷
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۳۷	۵۸
اختیار معامله	تعداد معامله	۳۳۶	۰
	حجم معامله - هزار سهم	۱۸	۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۱	۰
اختیار فروش تبعی	تعداد معامله	۴۷	۱۷
	حجم معامله - هزار سهم	۲۸۸,۰۰۰	۷۱
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۴,۸۲	۰,۰۰۰
قرارداد آتی سهام	تعداد معامله	۰	۲
	حجم معامله - هزار سهم	۰	۰,۰۰۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۰	۰,۱۱
حق تقدم بورس	تعداد معامله	۱۰,۶۶۲۰	۶۷,۳۱۸
	حجم معامله - هزار سهم	۲,۶۶۶,۰۱۱	۱,۳۳۲,۷۴۵
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۹۲۱	۶۵۸
سهام عادی بورس	تعداد معامله	۸۹۲,۹۷۴	۱,۴۶۷,۵۶۹
	حجم معامله - هزار سهم	۱۲,۴۸۰,۰۹۹	۲۰,۵۱۶,۳۳۳
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۲,۷۴۱	۴۷,۹۹۹
صندوق سرمایه گذاری (ETF)	تعداد معامله	۸,۱۲۳	۱,۵۴۹
	حجم معامله - هزار سهم	۲۸۴,۵۱۵	۳۰,۱۰۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۴۳۷	۳۱۶
	تعداد معامله	۱۰,۰۱۰,۵۰۰	۱,۵۳۸,۷۷۶
	حجم معامله - هزار سهم	۱۵,۷۲۴,۱۱۹	۲۱,۸۹۱,۵۱۱
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴۰,۶۹۵	۶۱,۵۲۰

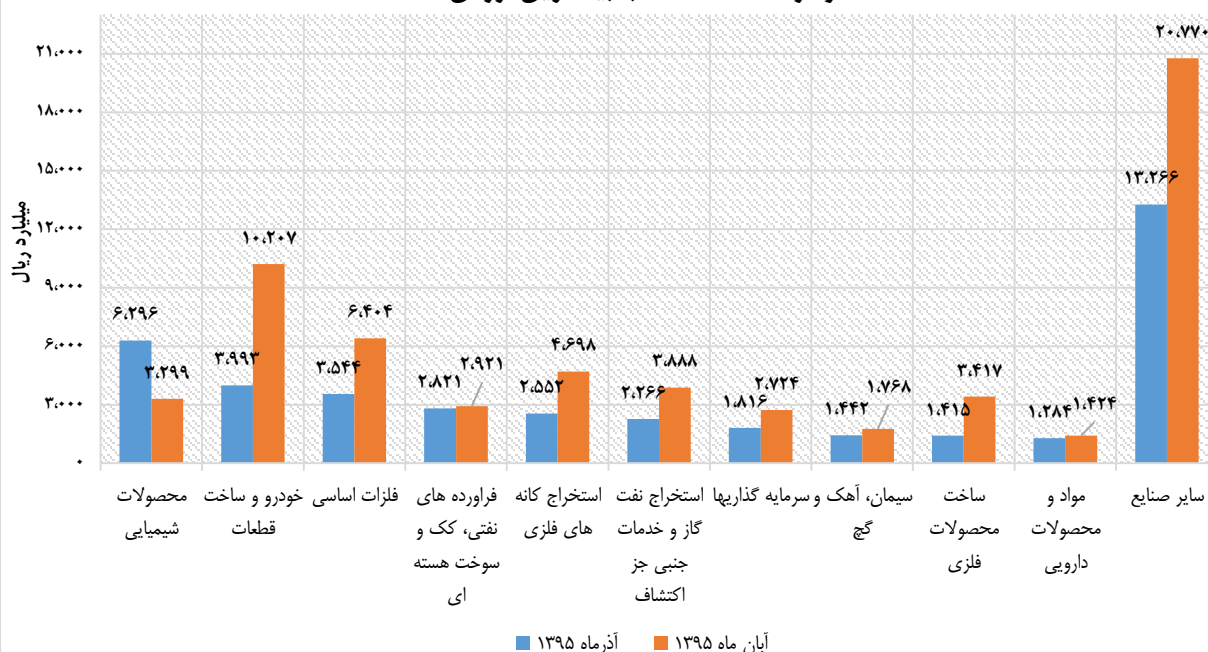
- ✓ حجم و ارزش معاملات اوراق مشارکت و صکوک در آذرماه ۹۵ نسبت به آبان ماه ۹۵ با کاهش همراه بوده است.
- ✓ از طرفی در آذرماه ۹۵ شاهد رشد چشمگیر آمار معاملات اوراق گواهی سپرده بوده ایم.
- ✓ آمار معاملات صندوق های سرمایه گذاری نیز در آذرماه ۹۵ با رشد بالایی همراه بوده است. به طوری که ارزش معاملات صندوق های سرمایه گذاری در آذرماه ۹۵ با ۳۵۴,۸ درصد رشد نسبت به ماه قبل همراه بوده است.

ارزش معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع برای ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

میلیارد ریال

ردیف	نام نوع صنعت	تاریخ	درصد تغییرات
		آذرماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
۱	محصولات شیمیایی	۶,۲۹۶	۹۰,۸۴٪
۲	خودرو و ساخت قطعات	۳,۹۹۳	-۶۰,۸۸٪
۳	فلزات اساسی	۳,۵۴۴	-۴۴,۶۵٪
۴	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۲,۸۲۱	-۳,۴۳٪
۵	استخراج کانه‌های فلزی	۲,۵۵۲	-۴۵,۶۷٪
۶	استخراج نفت گاز و خدمات جانبی جز اکتشاف	۲,۲۶۶	-۴۱,۷۲٪
۷	سرمایه‌گذاری‌ها	۱,۸۱۶	-۳۳,۳۴٪
۸	سیمان، آهک و گچ	۱,۴۴۲	-۱۸,۴۴٪
۹	ساخت محصولات فلزی	۱,۴۱۵	-۵۸,۶۰٪
۱۰	مواد و محصولات دارویی	۱,۲۸۴	-۹,۸۲٪
	مجموع	۲۷,۴۲۹	-۳۲,۶۹٪

نمودار ۴- ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات



✓ ارزش معاملات در گروه محصولات شیمیایی در آذرماه ۹۵ به رقم ۶,۲۹۶ میلیارد ریال رسید که نسبت به ماه قبل ۹۰,۸۴ درصد رشد داشته است.

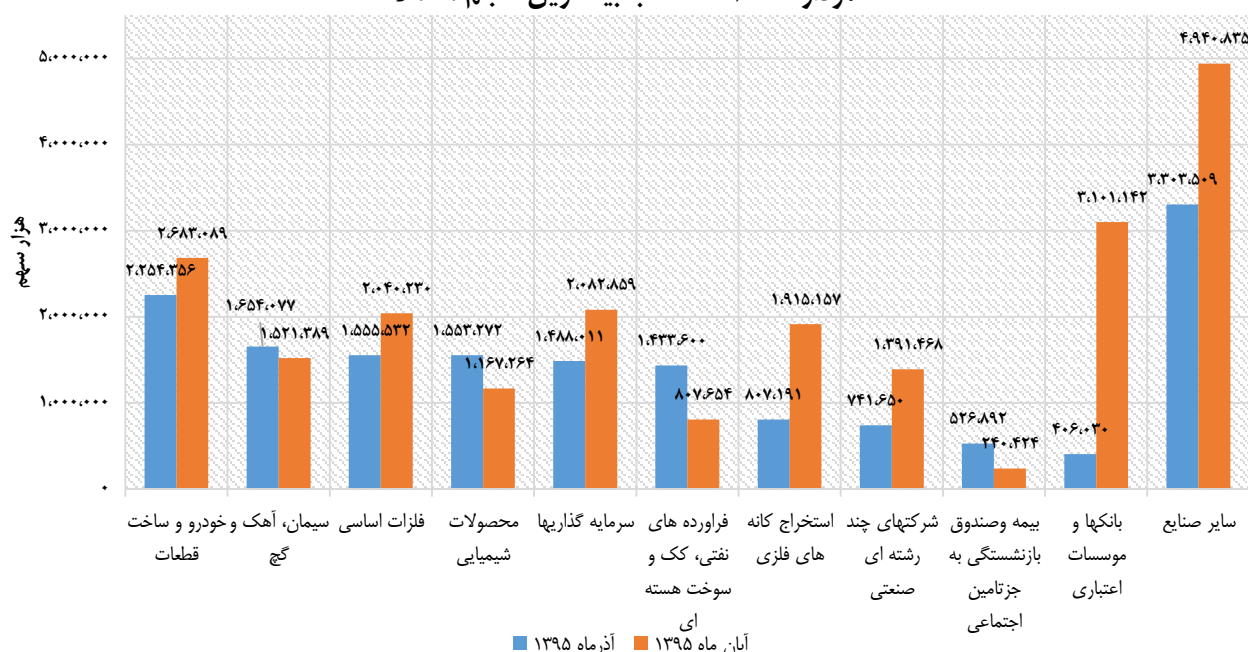
✓ در بین ده صنعت با بیشترین ارزش معاملات در آذرماه ۹۵، تنها گروه محصولات شیمیایی نسبت به ارزش معاملات فود در آبان ماه ۹۵ رشد داشته است و در بقیه گروه‌ها شاهد کاهش ارزش معاملات در آذرماه ۹۵ نسبت به آبان ماه ۹۵ هستیم.

حجم معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع برای ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

هزار سهم

ردیف	نام نوع صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		آذرماه ۱۳۹۵	آبانماه ۱۳۹۵	
۱	خودرو و ساخت قطعات	۲,۲۵۴,۳۵۶	۲,۶۸۳,۰۸۹	-۱۵.۹۸٪
۲	سیمان، آهک و گچ	۱,۶۵۴,۰۷۷	۱,۵۲۱,۳۸۹	۸.۷۲٪
۳	فلزات اساسی	۱,۵۵۵,۵۳۲	۲,۰۴۰,۲۳۰	-۲۳.۷۶٪
۴	محصولات شیمیایی	۱,۵۵۳,۲۷۲	۱,۱۶۷,۲۶۴	۳۳.۰۷٪
۵	سرمایه گذاری ها	۱,۴۸۸,۰۱۱	۲,۰۸۲,۸۵۹	-۲۸.۵۶٪
۶	فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱,۴۳۳,۶۰۰	۸۰۷,۶۵۴	۷۷.۵۰٪
۷	استخراج کانه های فلزی	۸۰۷,۱۹۱	۱,۹۱۵,۱۵۷	-۵۷.۸۵٪
۸	شرکت های چند رشته ای صنعتی	۷۴۱,۶۵۰	۱,۳۹۱,۴۶۸	-۴۶.۷۰٪
۹	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۵۲۶,۸۹۲	۲۴۰,۴۲۴	۱۱۹.۱۵٪
۱۰	بانک ها و مؤسسات اعتباری	۴۰۶,۰۳۰	۳,۱۰۱,۱۴۲	-۸۶.۹۱٪
مجموع		۱۲,۴۲۰,۶۱۰	۱۶,۹۵۰,۶۷۶	-۲۶.۷۲٪

نمودار ۵- ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات

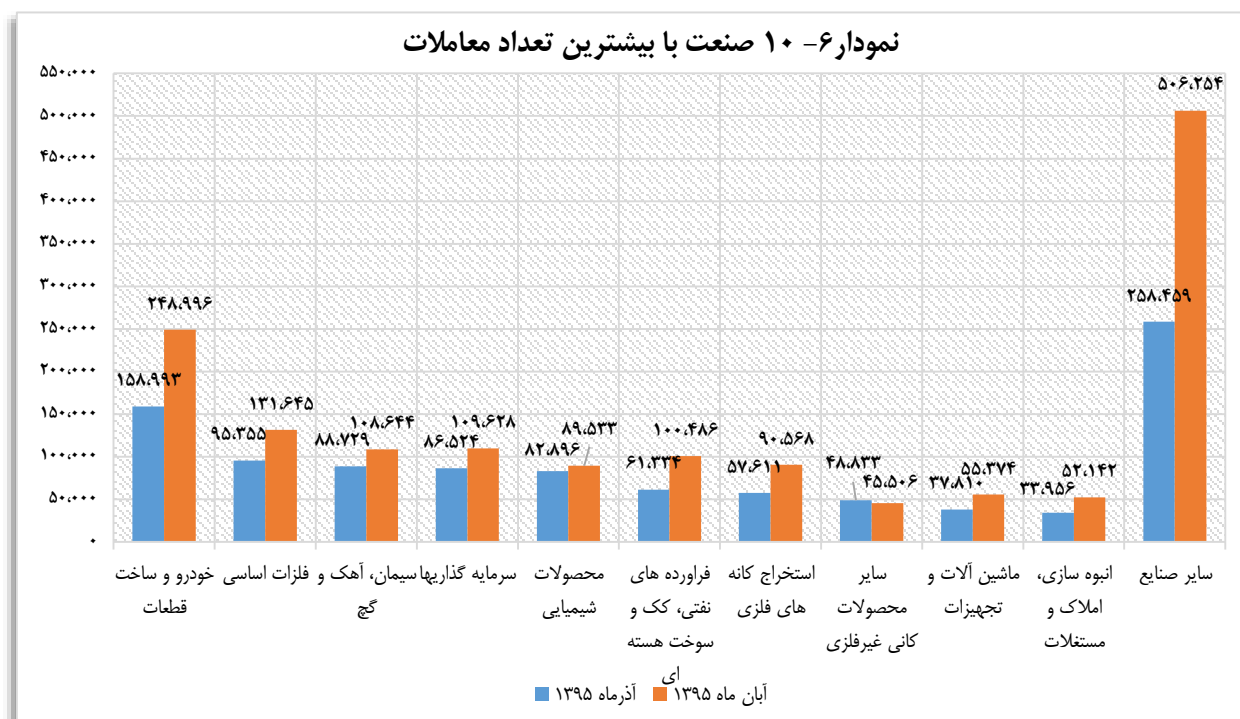


✓ گروه بانکها و مؤسسات اعتباری که در آبانماه ۹۵ بیشترین حجم معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران را به خود اختصاص داده بود، در آذرماه ۹۵ با کاهش ۸۶,۹۱ درصدی حجم معاملات در بین ده صنعت با بیشترین حجم معاملات در آذرماه ۹۵ در جایگاه دهم قرار گرفته است.

✓ حجم معاملات گروه های خودرو و سافت قطعات و فلزات اساسی نیز به ترتیب ۱۵,۹۸ و ۲۳,۷۶ درصد کاهش یافته است.

تعداد معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع برای ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

ردیف	نام نوع صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		آذرماه ۱۳۹۵	آبانماه ۱۳۹۵	
۱	خودرو و ساخت قطعات	۱۵۸,۹۹۳	۲۴۸,۹۹۶	-۳۶.۱۵٪
۲	فلزات اساسی	۹۵,۲۵۵	۱۳۱,۶۴۵	-۲۷.۵۷٪
۳	سیمان، آهک و گچ	۸۸,۷۲۹	۱۰۸,۶۴۴	-۱۸.۳۳٪
۴	سرمایه گذاری‌ها	۸۶,۵۲۴	۱۰۹,۶۲۸	-۲۱.۰۷٪
۵	محصولات شیمیایی	۸۲,۸۹۶	۸۹,۵۳۳	-۷.۴۱٪
۶	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۶۱,۳۳۴	۱۰۰,۴۸۶	-۳۸.۹۶٪
۷	استخراج کانه‌های فلزی	۵۷,۶۱۱	۹۰,۵۶۸	-۳۶.۳۹٪
۸	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۴۸,۸۳۳	۴۵,۵۰۶	۷.۳۱٪
۹	ماشین‌آلات و تجهیزات	۳۷,۸۱۰	۵۵,۳۷۴	-۳۱.۷۲٪
۱۰	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	۳۳,۹۵۶	۵۲,۱۴۲	-۳۴.۸۸٪
	مجموع	۷۵۲,۰۴۱	۱,۰۳۲,۵۲۲	-۲۷.۱۶٪



✓ مجموع تعداد معاملات در ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در آذرماه ۹۵، ۲۷،۱۶ درصد نسبت به ماه قبل کاهش یافته است.

✓ در بین ده صنعت با بیشترین تعداد معاملات در آذرماه ۹۵، تنها گروه سایر محصولات کانی غیرفلزی نسبت به ماه قبل فود افزایش داشته است و در بقیه گروه‌ها شاهد کاهش تعداد معاملات در آذرماه ۹۵ هستیم.

آمار معاملات در فرابورس ایران به تفکیک بازار، صنایع و نوع اوراق

حجم، ارزش و تعداد معاملات در فرابورس ایران به تفکیک نوع بازار در آبان و آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

نام نوع بازار		تاریخ	درصد تغییرات	
		آذرماه ۱۳۹۵	آبان‌ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
حجم معامله - هزار سهم	بازار ابزارهای نوین مالی	۱۰۵,۳۲۷	۱۳۷,۴۴۷	-۲۳.۳۷٪
	بازار اول	۱,۴۴۶,۱۴۳	۲,۵۵۶,۴۲۷	-۴۳.۴۳٪
	بازار دوم	۲,۲۸۳,۹۳۳	۲,۰۹۷,۵۷۲	۸.۸۸٪
	بازار سوم	۰	۱	-
	بازار پایه	۲,۱۱۱,۹۰۳	۱,۷۲۴,۲۵۳	۲۲.۴۸٪
ارزش معامله - میلیارد ریال	بازار ابزارهای نوین مالی	۲۲,۳۱۷	۲۵,۸۰۹	-۱۳.۵۳٪
	بازار اول	۳,۵۴۳	۷,۶۹۰	-۵۳.۹۳٪
	بازار دوم	۶,۳۲۹	۸,۲۱۸	-۲۲.۹۸٪
	بازار سوم	۰	۷	-
	بازار پایه	۳,۹۷۳	۲,۹۲۲	۳۵.۹۴٪
تعداد معامله	بازار ابزارهای نوین مالی	۶۸,۴۲۷	۷۱,۳۵۷	-۴.۱۱٪
	بازار اول	۵۷,۶۰۲	۹۱,۲۰۹	-۳۶.۸۵٪
	بازار دوم	۱۸۷,۹۹۴	۳۰۹,۸۳۰	-۳۹.۳۳٪
	بازار سوم	۰	۱	-
	بازار پایه	۱۱,۳۵۱	۱۳,۷۸۲	-۱۷.۶۴٪
مجموع	حجم معامله - هزار سهم	۵,۹۴۷,۳۰۵	۶,۵۱۵,۷۰۱	-۸.۷۲٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۶,۱۶۳	۴۴,۶۴۷	-۱۹.۰۰٪
	تعداد معامله	۳۲۵,۳۷۴	۴۸۶,۱۷۹	-۳۳.۰۸٪

- ✓ در آذرماه ۹۵ حجم معاملات در بازار ابزارهای نوین مالی در فرابورس ایران ۲۳,۳۷ درصد نسبت به آبان ماه ۹۵ کاهش داشته است. ارزش معاملات نیز در این بازار ۳,۴۹۲ میلیارد ریال نسبت به آبان ماه ۹۵ کاهش داشته است.
- ✓ حجم معاملات در بازار اول فرابورس ۴۳,۴۳ درصد نسبت به آبان ماه ۹۵ کاهش داشته است. این در حالی است که حجم معاملات در بازار دوم فرابورس ۸,۸۸ درصد افزایش نسبت به ماه قبل را نشان می‌دهد.
- ✓ در مجموع حجم معاملات در کلیه بازارهای فرابورس ایران، ۸,۷۲ درصد نسبت به آبان ماه ۹۵ کاهش داشته است.
- ✓ ارزش معاملات در کلیه بازارهای فرابورس ایران نیز ۸,۴۸۴ میلیارد ریال نسبت به ماه قبل کاهش داشته است.

حجم، ارزش و تعداد معاملات در بازار فرابورس ایران به تفکیک نوع اوراق در آبان و آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

نام نوع اوراق بهادار	تاریخ		درصد تغییرات	
	آذرماه ۱۳۹۵	آبان‌ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل	
اوراق فرابورس	تعداد معامله	۱۰,۷۳۸	۱۱,۱۸۳	۳۰۹۸٪
	حجم معامله -هزار سهم	۲۱,۸۴۳	۲۴,۸۳۶	۱۲۰۰۵٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۰,۶۵۵	۲۳,۶۷۰	۱۲۰۷۴٪
سهام عادی فرابورس	تعداد معامله	۲۹۱,۰۰۵	۴۵۲,۹۸۶	۳۵۰۷۶٪
	حجم معامله -هزار سهم	۳,۶۳۸,۶۵۷	۴,۶۱۷,۰۵۰	۲۱۰۱۹٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۰,۳۵۰	۱۶,۵۹۳	۳۷۶۳٪
صندوق سرمایه‌گذاری	تعداد معامله	۳,۵۶۵	۴,۲۹۳	۱۶۰۹۶٪
	حجم معامله -هزار سهم	۸۲,۶۱۱	۱۱۱,۶۸۳	۲۶۰۰۳٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۰۰۲	۱,۳۹۹	۲۸۰۴۲٪
حق تقدم فرابورس	تعداد معامله	۸,۷۱۵	۳,۹۳۴	۱۲۱۰۵۳٪
	حجم معامله -هزار سهم	۹۲,۲۹۱	۳۷,۸۷۸	۱۴۳۰۶۶٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۸۴	۵۶	۲۲۸۰۳۳٪
دارایی فکری	تعداد معامله	۰	۱	-
	حجم معامله -هزار سهم	۰	۱	-
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۰	۷	-
حق تقدم بازار پایه	تعداد معامله	۲۹۶	۶۴۸	۵۴۰۳۲٪
	حجم معامله -هزار سهم	۲۳۰,۰۲۲	۱۸۵,۶۴۳	۲۳۰۹۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۷	۷	۰۵۳٪
سهام عادی بازار پایه	تعداد معامله	۱۱۰,۵۵	۱۳,۱۳۴	۱۵۰۸۳٪
	حجم معامله -هزار سهم	۱,۸۸۱,۸۸۱	۱,۵۳۸,۶۱۰	۲۲۰۳۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳,۹۶۶	۲,۹۱۶	۳۶۰۰۲٪
	تعداد معامله	۳۲۵,۳۷۴	۴۸۶,۱۷۹	۳۳۰۰۸٪
	حجم معامله -هزار سهم	۵,۹۴۷,۳۰۵	۶,۵۱۵,۷۰۱	۸۰۷۲٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۶,۱۶۳	۴۴,۶۴۷	۱۹۰۰۰٪

✓ ارزش معاملات اوراق فرابورسی در آذرماه ۹۵، ۳۰۱۵ میلیارد ریال، معادل ۱۲,۷۴ درصد، نسبت به آبان ماه ۹۵ کاهش یافته است.

✓ تعداد، حجم و ارزش معاملات سهام عادی فرابورس در آذرماه ۹۵ نسبت به ماه قبل کاهش داشته است. به طوری که ارزش معاملات سهام عادی فرابورس ۳۷,۶۳ درصد معادل ۶۲۴۳ میلیارد ریال نسبت به ماه قبل کاهش داشته است.

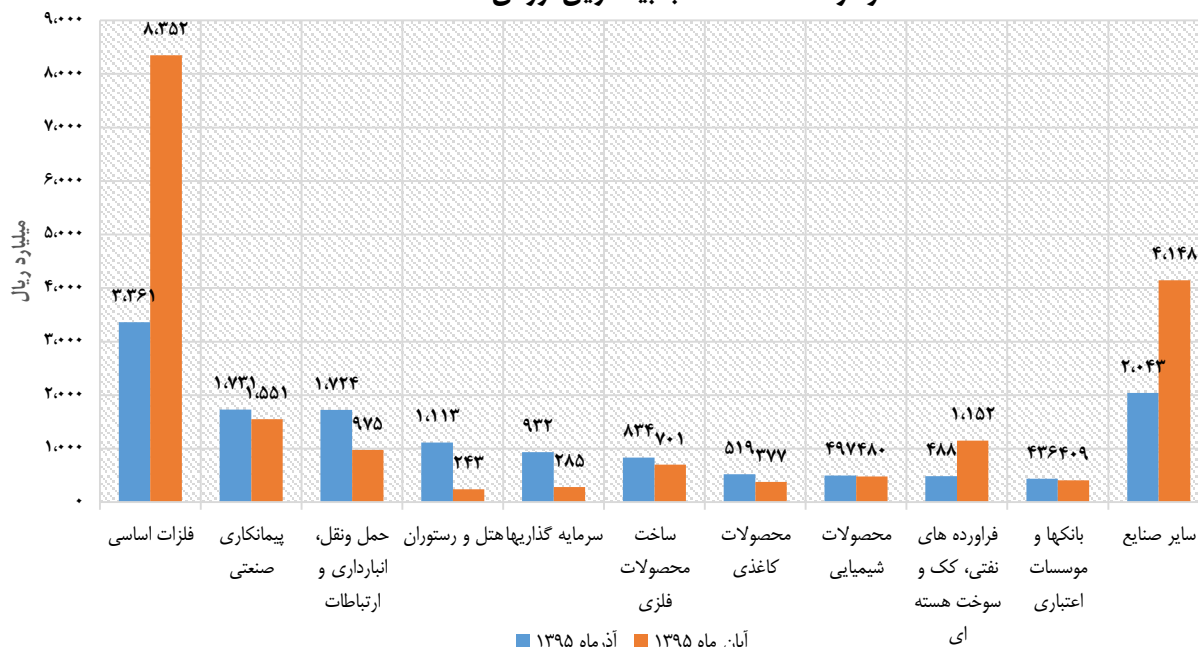
✓ آمار معاملات حق تقدم فرابورسی در آذرماه ۹۵ رشد چشمگیری نسبت به آبانماه ۹۵ داشته است. به طوری که ارزش آن ۲۲۸,۳۳ درصد و حجم معاملات آن ۱۴۳,۶۶ درصد رشد داشته است.

ارزش معاملات در بازار فرابورس ایران به تفکیک صنایع، برای ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

میلیارد ریال

ردیف	نام نوع صنعت	تاریخ		درصد تغییرات نسبت به ماه قبل
		آذرماه ۱۳۹۵	آبانماه ۱۳۹۵	
۱	فلزات اساسی	۳,۳۶۱	۸,۳۵۲	-۵۹.۷۶٪
۲	پیمانکاری صنعتی	۱,۷۳۱	۱,۵۵۱	۱۱.۵۸٪
۳	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱,۷۲۴	۹۷۵	۷۶.۸۷٪
۴	هتل و رستوران	۱,۱۱۳	۲۴۳	۳۵۷.۴۹٪
۵	سرمایه گذاری‌ها	۹۳۲	۲۸۵	۲۲۶.۸۷٪
۶	ساخت محصولات فلزی	۸۳۴	۷۰۱	۱۸.۹۶٪
۷	محصولات کاغذی	۵۱۹	۳۷۷	۳۷.۴۸٪
۸	محصولات شیمیایی	۴۹۷	۴۸۰	۳.۵۰٪
۹	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۴۸۸	۱,۱۵۲	-۵۷.۶۲٪
۱۰	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۴۳۶	۴۰۹	۶.۶۸٪
	مجموع	۱۱,۶۳۵	۱۴,۵۲۵	-۱۹.۹۰٪

نمودار ۷- ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات



✓ ارزش معاملات گروه فلزات اساسی در آذرماه ۹۵ با ۵۹,۷۶ درصد کاهش از ۸۳۵۲ میلیارد ریال در آبانماه ۹۵ به ۳۳۶۱ میلیارد ریال در آذرماه ۹۵ کاهش یافت.

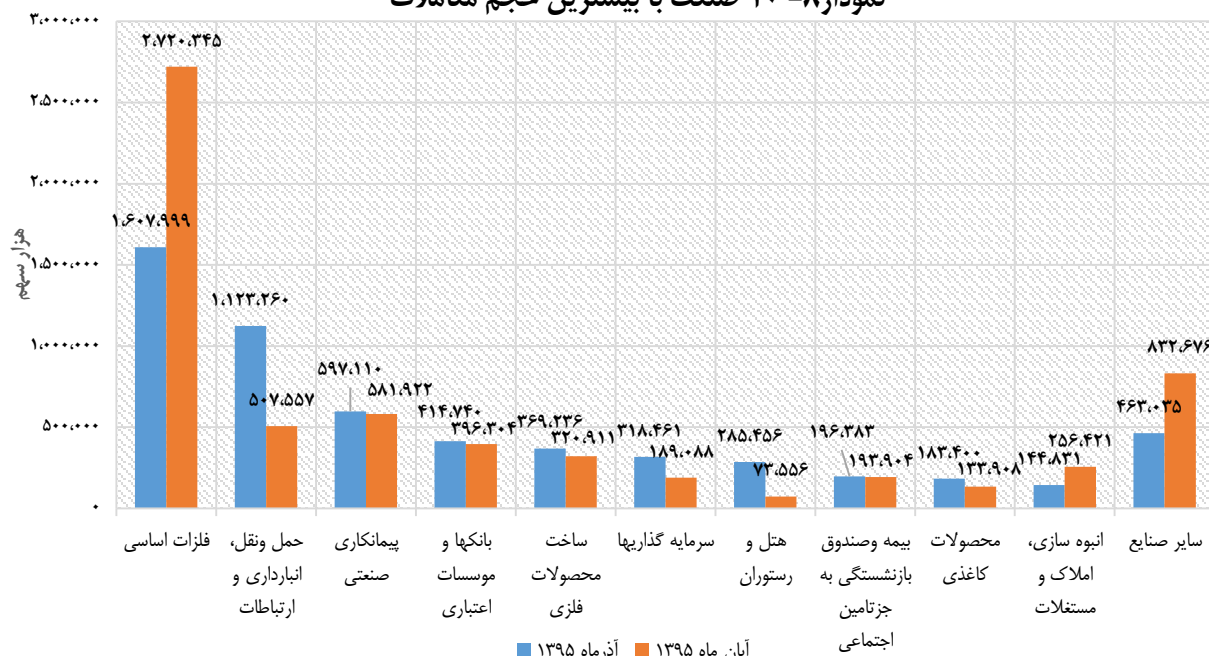
✓ گروه‌های سرمایه‌گذاری و هتل و رستوران نیز در آذرماه ۹۵ شاهد رشد چشمگیر ارزش معاملات در فرابورس ایران بوده‌اند.

حجم معاملات در بازار فرابورس ایران به تفکیک صنایع، برای ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

هزار سهم

ردیف	نام نوع صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		آذرماه ۱۳۹۵	آبانماه ۱۳۹۵	
۱	فلزات اساسی	۱۶۰۷،۹۹۹	۲،۷۲۰،۳۴۵	-۴۰،۸۹٪
۲	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱،۱۲۳،۲۶۰	۵۰۷،۵۵۷	۱۲۱،۳۱٪
۳	پیمانکاری صنعتی	۵۹۷،۱۱۰	۵۸۱،۹۲۲	۲،۶۱٪
۴	بانکها و مؤسسات اعتباری	۴۱۴،۷۴۰	۳۹۶،۳۰۴	۴،۶۵٪
۵	ساخت محصولات فلزی	۳۶۹،۲۳۶	۳۲۰،۹۱۱	۱۵،۰۶٪
۶	سرمایه گذاریها	۳۱۸،۴۶۱	۱۸۹،۰۸۸	۶۸،۴۲٪
۷	هتل و رستوران	۲۸۵،۴۵۶	۷۳،۵۵۶	۲۸۸،۰۸٪
۸	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۱۹۶،۳۸۳	۱۹۳،۹۰۴	۱،۲۸٪
۹	محصولات کاغذی	۱۸۳،۴۰۰	۱۳۳،۹۰۸	۳۶،۹۶٪
۱۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۴۴،۸۳۱	۲۵۶،۴۲۱	-۴۳،۵۲٪
مجموع		۵،۲۴۰،۸۷۸	۵،۳۷۳،۹۱۵	-۲،۴۸٪

نمودار ۸- ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات

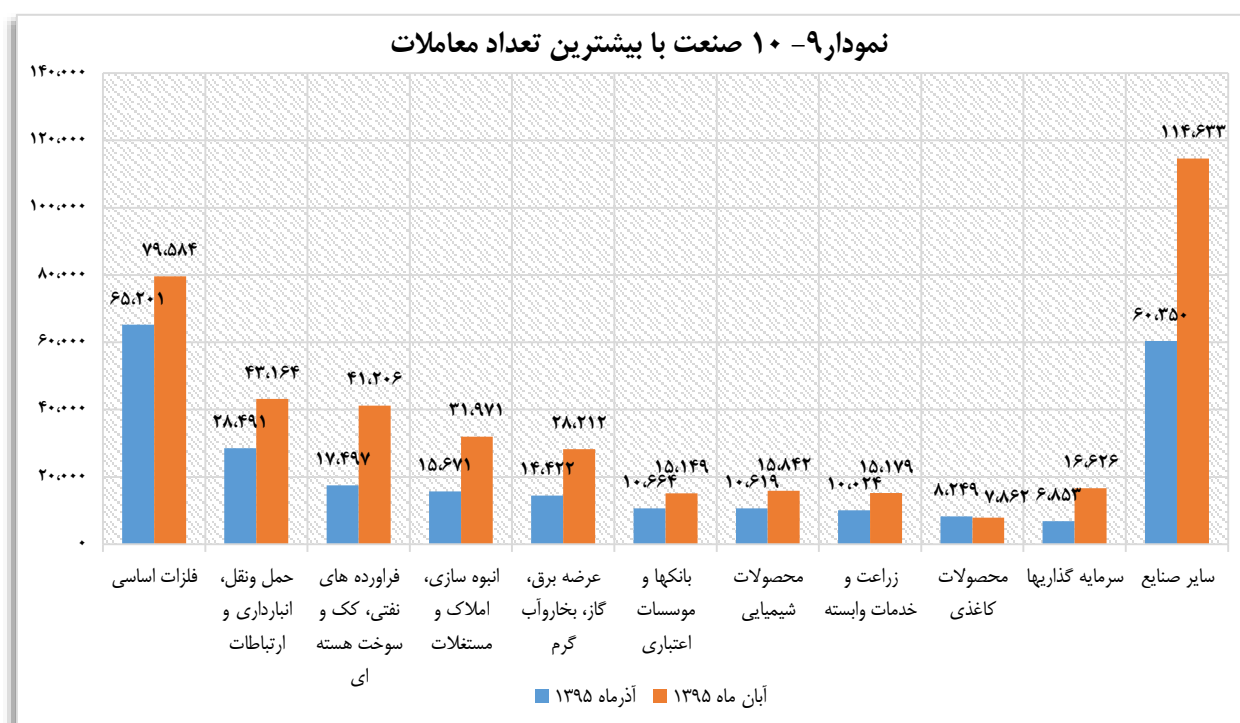


✓ در معاملات آذرماه ۹۵، حجم معاملات در گروه فلزات اساسی همراه با کاهش ارزش معاملات در این گروه، به میزان ۴۰،۸۹ درصد کاهش یافت.

✓ حجم معاملات در بازار فرابورس ایران در گروه حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات با رشد ۱۲۱،۳۱ درصدی در آذرماه ۹۵ همراه بوده است.

تعداد معاملات در بازار فرابورس ایران به تفکیک صنایع، برای ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

ردیف	نام نوع صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		آذرماه ۱۳۹۵	آبانماه ۱۳۹۵	
۱	فلزات اساسی	۶۵,۲۰۱	۷۹,۵۸۴	-۱۸.۰۷٪
۲	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۲۸,۴۹۱	۴۳,۱۶۴	-۳۳.۹۹٪
۳	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۷,۴۹۷	۴۱,۲۰۶	-۵۷.۵۴٪
۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۵,۶۷۱	۳۱,۹۷۱	-۵۰.۹۸٪
۵	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۴,۴۲۲	۲۸,۲۱۲	-۴۸.۸۸٪
۶	بانک ها و مؤسسات اعتباری	۱۰,۶۶۴	۱۵,۱۴۹	-۲۹.۶۱٪
۷	محصولات شیمیایی	۱۰,۶۱۹	۱۵,۸۴۲	-۳۲.۹۷٪
۸	زراعت و خدمات وابسته	۱۰,۰۲۴	۱۵,۱۷۹	-۳۳.۹۶٪
۹	محصولات کاغذی	۸,۲۴۹	۷,۸۶۲	۴.۹۲٪
۱۰	سرمایه گذاری ها	۶,۸۵۳	۱۶,۶۲۶	-۵۸.۷۸٪
مجموع		۱۸۷,۶۹۱	۲۹۴,۷۹۵	-۳۶.۳۳٪



- ✓ به جز گروه محصولات چوبی، در ۹ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در آذرماه ۹۵، شاهد کاهش تعداد معاملات در بازار فرابورس ایران هستیم.
- ✓ در مجموع تعداد معاملات در ده صنعت با بیشترین تعداد معاملات در آذرماه ۹۵، ۳۶,۳۳ درصد نسبت به آبانماه ۹۵ کاهش داشته است.

آمار معاملات در بورس کالا

حجم و ارزش معاملات آتی در بورس کالا به ترتیب در سال ۱۳۹۴، از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آذرماه ۹۵ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آبان ماه ۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

بازار		سال ۹۴		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا		درصد تغییرات یک ماهه	
		انتهای آذرماه ۹۵		انتهای آبان ماه ۹۵		انتهای آبان ماه ۹۵			
حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات
(تعداد قرارداد)	(میلیارد ریال)	(تعداد قرارداد)	(میلیارد ریال)	(تعداد قرارداد)	(میلیارد ریال)	(تعداد قرارداد)	(میلیارد ریال)	(تعداد قرارداد)	(میلیارد ریال)
۱۶۷۵،۱۶۹	۱۶۴،۶۲۲	۱،۷۶۲،۶۷۴	۱۹۹،۹۱۴	۱۶۲۵،۸۶۱	۱۸۳،۶۵۰	۸،۴۱٪	۸،۸۶٪		

منبع: اداره امور بورس و بازارها

حجم و ارزش معاملات در بورس کالا به تفکیک گروه‌های محصولات به ترتیب در سال ۱۳۹۴، از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آذرماه ۹۵ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آبان ماه ۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

گروه کالا		سال ۹۴		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا		درصد تغییرات یک ماهه	
		انتهای آذرماه ۹۵		انتهای آبان ماه ۹۵		انتهای آبان ماه ۹۵			
حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات
(تن)	(میلیارد ریال)	(تن)	(میلیارد ریال)	(تن)	(میلیارد ریال)	(تن)	(میلیارد ریال)	(تن)	(میلیارد ریال)
۷۶۳،۶۹۰	۹،۳۹۴	۱،۹۶۴،۴۱۹	۲۲،۳۵۰	۱،۷۴۱،۷۴۸	۲۰،۱۹۵	۱۲،۷۸٪	۱۰،۶۷٪		
۹،۸۳۱،۰۴۵	۱۲۸،۴۲۳	۷،۲۶۱،۹۰۹	۱۱۳،۸۵۹	۶،۵۳۸،۱۴۵	۹۹،۵۱۵	۱۱،۰۷٪	۱۴،۴۱٪		
۱۲،۵۵۳،۷۱۴	۱۵۸،۵۵۸	۹،۷۸۲،۶۳۰	۱۳۰،۲۳۳	۸،۳۷۶،۸۳۴	۱۰۹،۷۶۵	۱۶،۷۸٪	۱۸،۶۵٪		
۲۶،۶۵۱	۱۹۴	۶۳،۰۶۱	۹۶۶	۵۸،۱۳۵	۸۳۷	۸،۴۷٪	۱۵،۴۱٪		
۲۳،۱۷۵،۰۹۹	۲۹۶،۵۷۰	۱۹،۰۷۲،۰۱۹	۲۶۷،۴۰۸	۱۶،۷۱۴،۸۶۱	۲۳۰،۳۱۲	۱۴،۱۰٪	۱۶،۱۱٪		

منبع: اداره امور بورس و بازارها

آمار معاملات در بورس انرژی

حجم و ارزش معاملات در بورس انرژی به تفکیک بازار فیزیکی و بازار مشتقه محصولات به ترتیب در سال ۱۳۹۴، از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آذرماه ۹۵ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آبان ماه ۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

بازار		سال ۹۴		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا		درصد تغییرات یک ماهه	
		انتهای آذرماه ۹۵		انتهای آبان ماه ۹۵		انتهای آبان ماه ۹۵			
حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم معاملات	ارزش معاملات
(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)	(میلیارد ریال)
تن	۱،۹۷۴،۵۸۶	۱۹،۷۲۷	۱،۲۹۰،۶۲۸	۱۴،۲۰۳	۱،۱۴۵،۹۷۸	۱۲،۳۳۲	۱۲،۶۲٪	۱۵،۲۷٪	
MW	۸۹۵،۳۲۰	۷،۳۱۰	۵۵۰،۸۱۶	۲،۹۴۷	۴۴۲،۸۱۲	۲،۳۵۷	۲۴،۳۹٪	۲۵،۰۳٪	
تن	۱۸۸،۲۰۸	۱،۹۸۹	۳،۴۰۸،۱۳۸	۱۰،۳۷۹	۳۰،۴۳،۵۴۱	۹،۳۶۸	۱۱،۹۸٪	۱۰،۷۹٪	
مجموع	۳،۰۵۸،۱۱۴	۲۹،۰۲۶	۵،۲۴۹،۵۸۲	۲۷،۵۲۹	۴،۶۳۲،۳۳۱	۲۴،۰۴۷	۱۳،۳۲٪	۱۴،۴۸٪	

منبع: اداره امور بورس و بازارها

سرمایه‌گذاران خارجی

تعداد کدها و ارزش سبد سرمایه‌گذاران خارجی شامل سرمایه‌گذاران خارجی حقیقی و حقوقی در پایان آذرماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

تعداد کدها	ارزش سبد (میلیارد ریال)	
۵۲۶	۳۲۷	حقیقی
۲۲۶	۱۲,۰۰۱	حقوقی
۷۵۲	۱۲,۳۲۸	مجموع

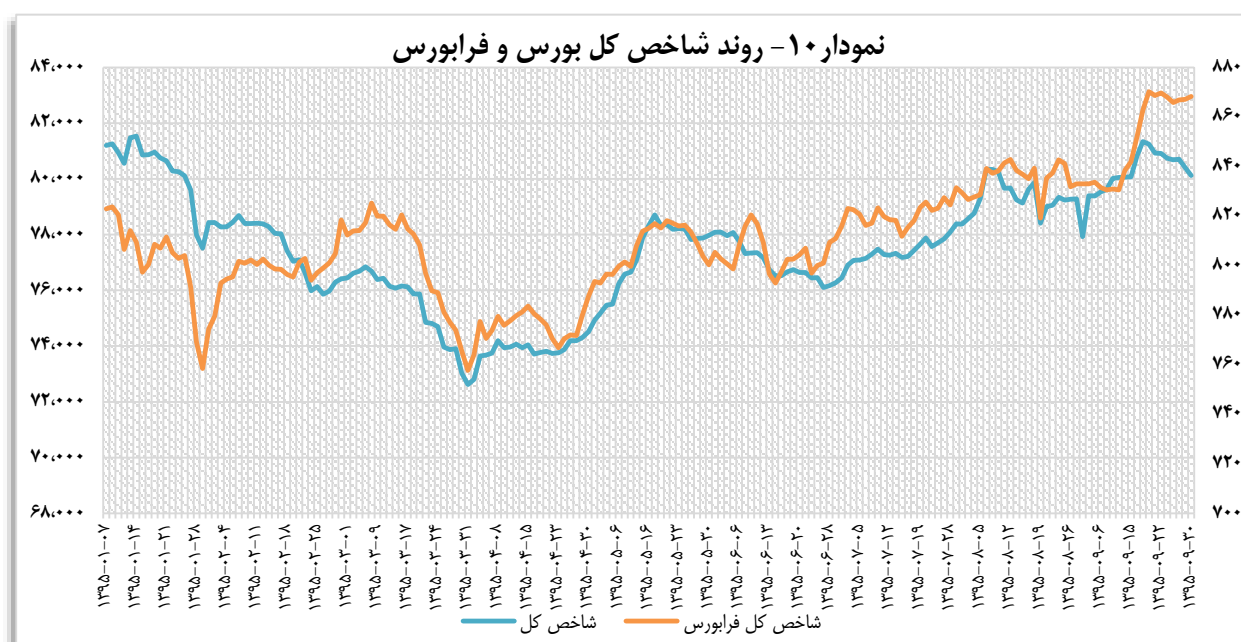
منبع: حوزه ریاست

شاخص‌های بازار سرمایه

شاخص‌های بازار سرمایه شامل شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ و تغییرات آن نسبت به ماه قبل و همچنین پایان اسفند ۱۳۹۴ در جدول زیر نشان داده شده است.

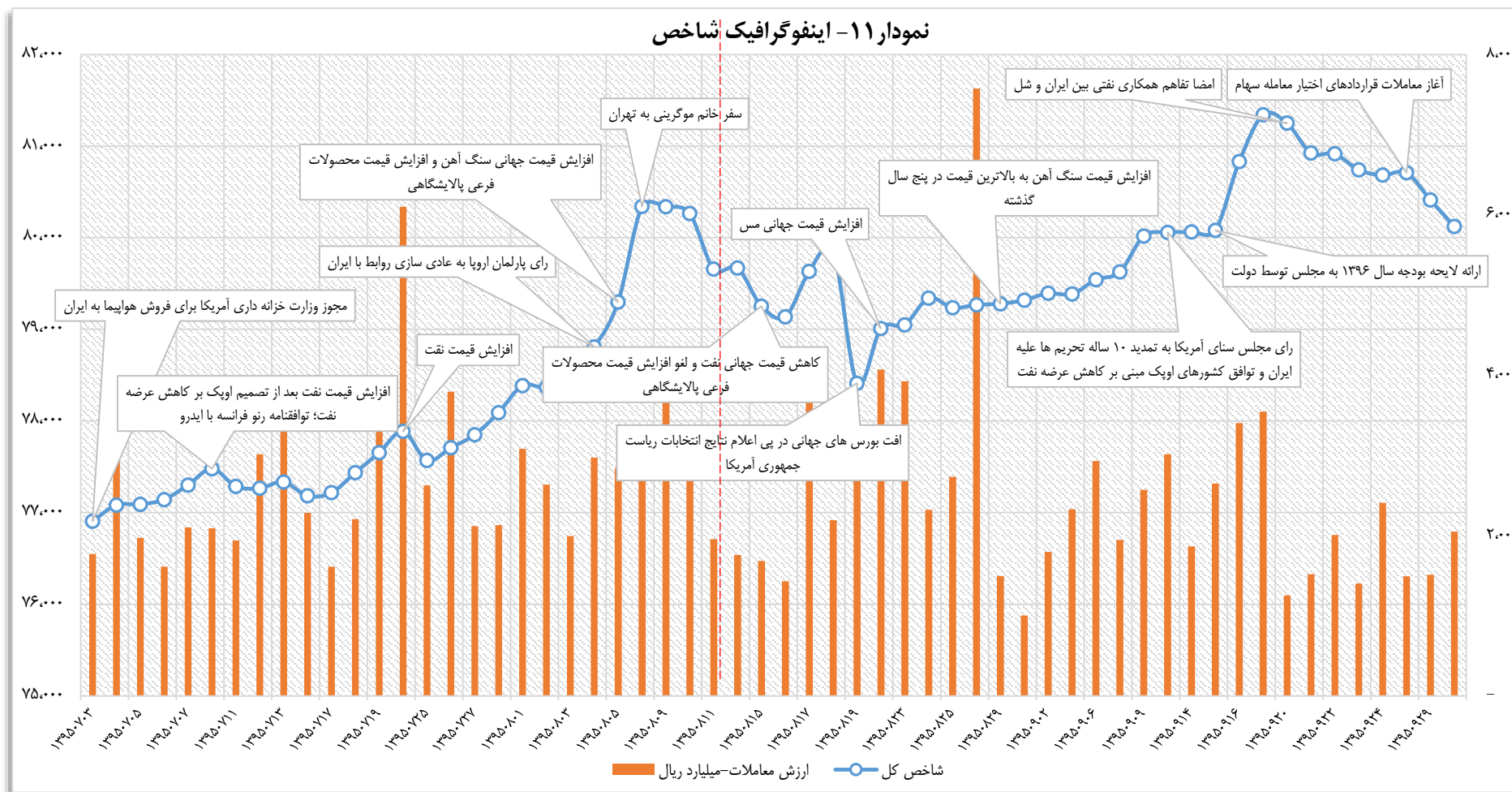
نام بورس	نام شاخص	تاریخ	درصد تغییرات	
		۱۳۹۴/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ابتدای سال
بورس اوراق بهادار تهران	شاخص کل بورس تهران	۸۰,۲۱۹	۱,۰۶٪	-۰,۱۲٪
	شاخص کل (هم وزن)	۱۵,۹۵۹	-۱,۵۰٪	۱۷,۷۰٪
	شاخص قیمت	۲۷,۹۷۵	۰,۷۸٪	-۷,۶۰٪
	شاخص قیمت (هم وزن)	۱۲,۷۳۷	-۱,۶۷٪	۱۱,۷۱٪
	شاخص ۳۰ شرکت بزرگ	۳,۲۴۷	۱,۱۵٪	-۲,۸۷٪
	شاخص صنعت	۶۶,۴۷۰	۱,۵۰٪	۰,۷۰٪
فرابورس ایران	شاخص ۵۰ شرکت فعال‌تر	۳,۱۰۸	۱,۶۰٪	-۲,۹۸٪
	شاخص کل فرابورس	۸۳۳	۴,۲۴٪	۷,۷۸٪

روند شاخص کل بورس و فرابورس در بازه زمانی ۱۳۹۵/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ در نمودار (۱۰) نشان داده شده است.



اینفوگرافیک شاخص

نمودار اینفوگرافیک شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی ۱۳۹۵/۰۶/۳۱ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ در زیر نشان داده شده است.

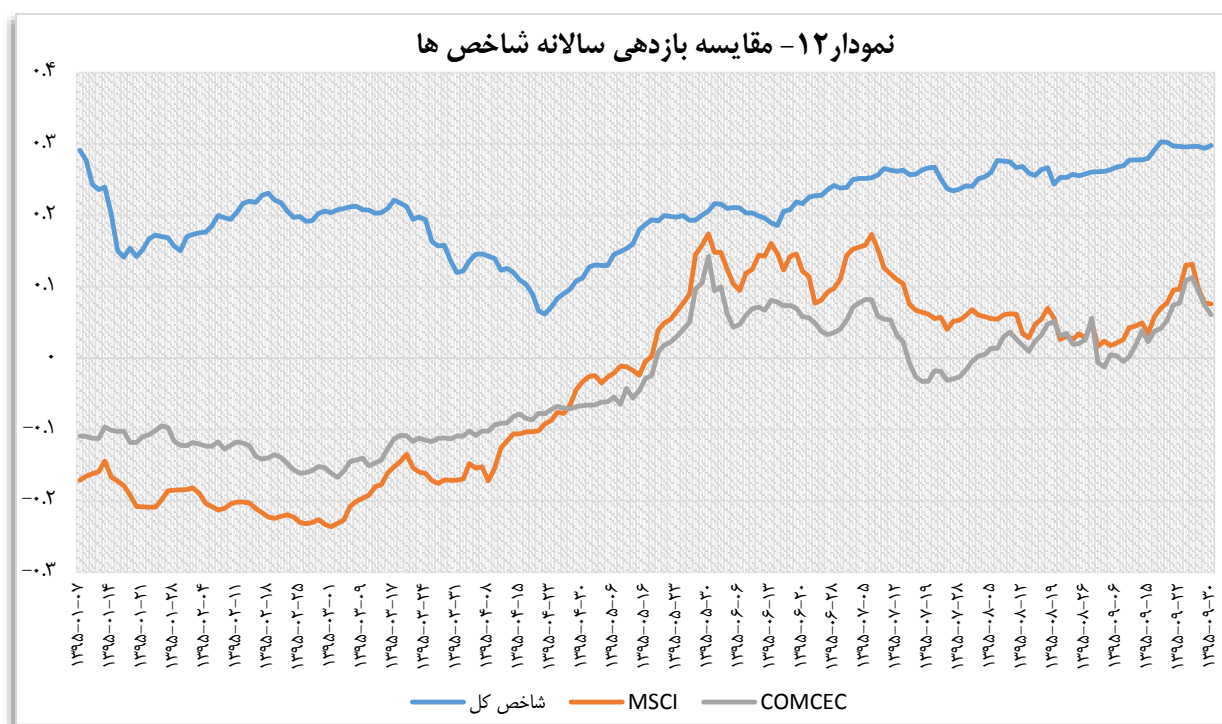


مقایسه شاخص کل با شاخص‌های کشورهای در حال توسعه و اسلامی

در نمودار (۱۲) بازدهی سالانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران و بازدهی شاخص‌های MSCI کشورهای در حال توسعه و شریعت COMCEC^۲ از ابتدای سال ۱۳۹۵ نمایش داده شده است. همان‌گونه که مشاهده می‌شود بازدهی سالانه شاخص کل در طول دوره همواره بیشتر از دو شاخص دیگر است.

شاخص MSCI کشورهای در حال توسعه شامل ۲۳ کشور در حال توسعه است که فهرست آن‌ها در لینک قید شده در پانویست^۳ قابل مشاهده است.

فهرست کشورهای اسلامی مشمول در شاخص شریعت COMCEC در لینک قید شده در پانویست^۴ قابل مشاهده است.



¹ Morgan Stanley Capital International

² Committee for Commercial and Economic Cooperation

³ <https://www.msci.com/emerging-markets>

⁴ <https://eu.spindices.com/indices/equity/sp-oic-comcec-50-shariah>

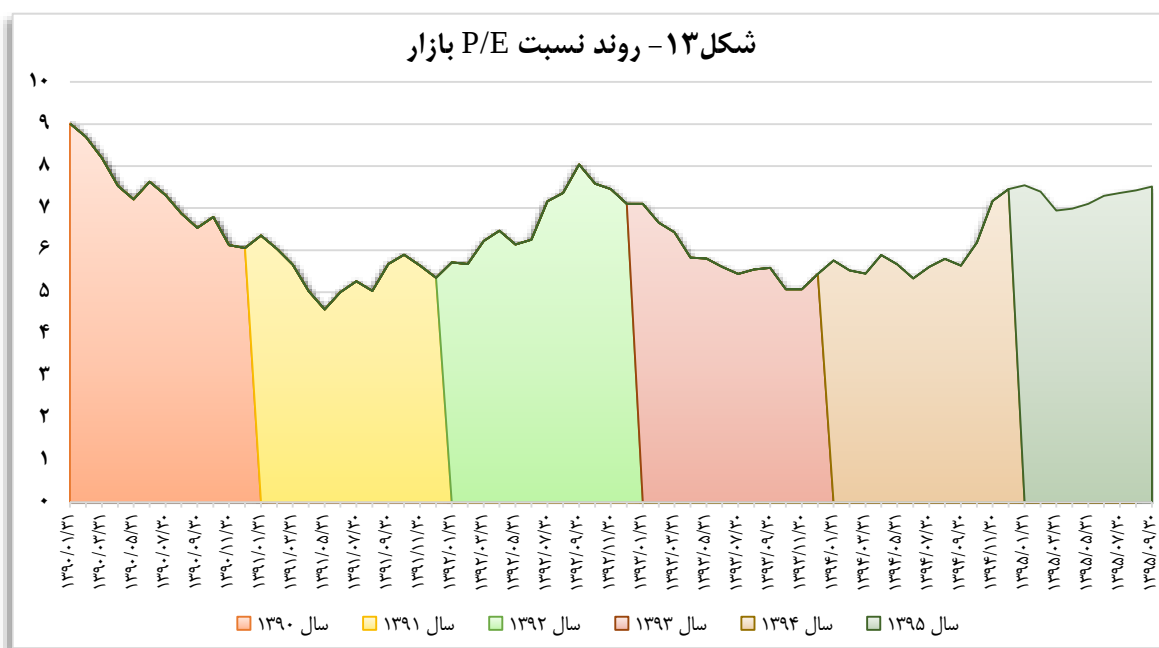
نسبت P/E بازار

در جدول زیر نسبت P/E کل بازار و پنج صنعت با بیشترین و کمترین نسبت P/E مشاهده می‌شود.

تاریخ انتهای ماه (بیشترین P/E)	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹
کل بازار	۷.۵۱	۷.۴۲	۷.۴۵
دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۳۵.۰۲	۳۱.۳۹	۷.۹۳
استخراج زغال سنگ	۳۵.۰۱	۳۸.۰۱	۲۰.۱۵
استخراج سایر معادن	۲۶.۲۲	۲۵.۳۷	۱۸.۱۹
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۹.۵۲	۲۱.۵۳	۳۳.۴۴
قند و شکر	۹.۰۱	۲۰.۷۷	۱۴.۷۱
تاریخ انتهای ماه (کمترین P/E)	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹
بانک‌ها، مؤسسات اعتباری و سایر نهادهای مالی	۵.۷۶	۵.۵۳	۶.۰۴
شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	۵.۵۲	۴.۸۱	۴.۹۵
تأمین برق، گاز، بخار و آب گرم	۵.۳۷	۵.۴	۵.۲۷
مخابرات	۴.۸۲	۵.۰۳	۵.۳۲
وسایل اندازه‌گیری، پزشکی و اپتیک	۱.۸۶	۱.۸۶	۲.۹

منبع: شرکت بورس تهران

در نمودار (۱۳) روند تغییرات نسبت P/E ماهیانه بازار از ابتدای سال ۱۳۹۰ تا انتهای آذرماه ۱۳۹۵ نمایش داده شده است.



مقایسه معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس

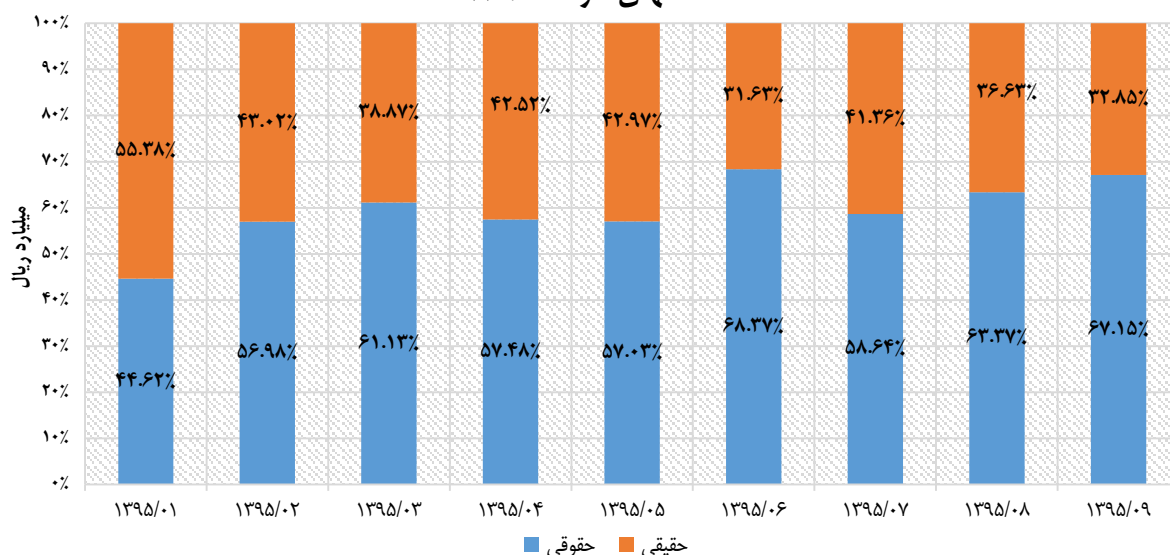
در جدول زیر آمار معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آذرماه ۱۳۹۵ نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی از ابتدای سال تا انتهای آذرماه ۱۳۹۵				
ماه	حقوقی	درصد از کل	حقیقی	درصد از کل
۱۳۹۵/۰۱	۴۱،۹۰۶	۴۴،۶۲٪	۵۲،۰۱۴	۵۵،۳۸٪
۱۳۹۵/۰۲	۶۵،۱۹۴	۵۶،۹۸٪	۴۹،۲۲۳	۴۳،۰۲٪
۱۳۹۵/۰۳	۵۲،۶۰۹	۶۱،۱۳٪	۳۳،۴۵۵	۳۸،۸۷٪
۱۳۹۵/۰۴	۴۲،۳۳۲	۵۷،۴۸٪	۳۱،۳۱۸	۴۲،۵۲٪
۱۳۹۵/۰۵	۴۳،۷۵۴	۵۷،۰۳٪	۳۲،۹۶۰	۴۲،۹۷٪
۱۳۹۵/۰۶	۴۸،۷۳۲	۶۸،۳۷٪	۲۲،۵۴۶	۳۱،۶۳٪
۱۳۹۵/۰۷	۴۸،۷۶۶	۵۸،۶۴٪	۳۴،۳۹۱	۴۱،۳۶٪
۱۳۹۵/۰۸	۶۷،۲۷۴	۶۳،۳۷٪	۳۸،۸۹۳	۳۶،۶۳٪
۱۳۹۵/۰۹	۵۱،۶۰۷	۶۷،۱۵٪	۲۵،۲۵۱	۳۲،۸۵٪

نمودار ۱۴ - مقایسه ارزش معاملات حقیقی و حقوقی از ابتدای سال تا

انتهای آذر ماه ۱۳۹۵



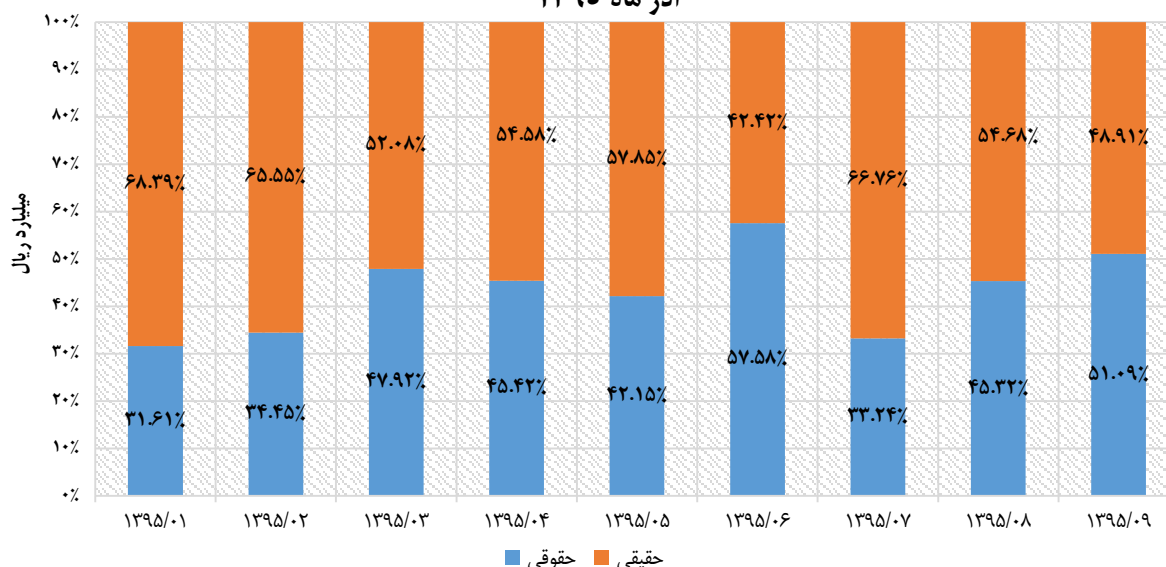
- ✓ طی سه ماه اخیر شاهد افزایش نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی از کل ارزش معاملات انجام شده بوده‌ایم. به طوری که نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی از ۵۸،۶۴ درصد در مهرماه ۹۵ به ۶۷،۱۵ درصد در آذرماه ۹۵ افزایش یافته است.
- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقیقی بعد از افزایش در سه ماهه شهریور تا آبان ۹۵، در آذرماه ۹۵ با کاهش ۳۵ درصدی همراه بوده است.

در جدول زیر آمار معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در سهام از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان آذرماه ۱۳۹۵ آورده شده است.

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی در سهام از ابتدای سال تا انتهای آذرماه ۱۳۹۵				
ماه	حقوقی	درصد از کل	حقیقی	درصد از کل
۱۳۹۵/۰۱	۲۳,۳۴۸	۳۱,۶۱٪	۵۰,۵۱۶	۶۸,۳۹٪
۱۳۹۵/۰۲	۲۴,۸۱۶	۳۴,۴۵٪	۴۷,۲۱۶	۶۵,۵۵٪
۱۳۹۵/۰۳	۲۹,۵۸۱	۴۷,۹۲٪	۳۲,۱۴۴	۵۲,۰۸٪
۱۳۹۵/۰۴	۲۵,۰۶۸	۴۵,۴۲٪	۳۰,۱۲۹	۵۴,۵۸٪
۱۳۹۵/۰۵	۲۳,۱۰۳	۴۲,۱۵٪	۳۱,۷۰۸	۵۷,۸۵٪
۱۳۹۵/۰۶	۲۸,۷۰۲	۵۷,۵۸٪	۲۱,۱۴۶	۴۲,۴۲٪
۱۳۹۵/۰۷	۱۶,۴۷۷	۳۳,۲۴٪	۳۳,۰۹۸	۶۶,۷۶٪
۱۳۹۵/۰۸	۳۰,۹۲۰	۴۵,۳۲٪	۳۷,۳۰۸	۵۴,۶۸٪
۱۳۹۵/۰۹	۲۴,۶۱۱	۵۱,۰۹٪	۲۳,۵۵۷	۴۸,۹۱٪

نمودار ۱۵- مقایسه ارزش معاملات حقیقی و حقوقی در سهام از ابتدای سال تا انتهای آذرماه ۱۳۹۵



- ✓ میانگین نسبت ارزش معاملات اشخاص حقیقی در سهام طی نه ماهه نخست سال ۹۵، ۵۷ درصد و میانگین نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی در سهام طی این مدت ۴۳ درصد می‌باشد.
- ✓ نسبت ارزش معاملات اشخاص حقیقی در سهام طی سه ماهه سوم سال ۹۵ از ۶۶,۷۶ درصد در مهرماه ۹۵ به ۴۸,۹۱ درصد در آذرماه ۹۵ کاهش یافته است.

لیست نمادهای متوقف

در جدول زیر لیست ۱۱ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران و ۶ نماد متوقف شده در فرابورس ایران در آذرماه ۱۳۹۵ که تا پایان این ماه نیز بازگشایی شده‌اند، به همراه علت توقف و تعداد روزهای توقف آن‌ها نمایش داده شده است.

بورس	صنعت	نام اوراق بهادار	نماد	علت توقف	تعداد روزهای توقف
بورس اوراق بهادار تهران	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	بیمه پارسیان	پارسیان	مجمع عمومی فوق العاده به منظور تصمیم‌گیری در خصوص افزایش سرمایه	۱۱
	انتشار، چاپ و تکثیر	افست	چافست	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۷
	ساخت محصولات فلزی	صنایع آذرآب	فاذر	ابهام در ارائه اطلاعات	۶
	فلزات اساسی	کالسیمین	فاسمین	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۵
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک خاورمیانه	وخابور	ابهام در ارائه اطلاعات	۴
	سیمان، آهک و گچ	سیمان سپاهان	سپاها	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه به منظور تصویب صورت‌های مالی	۴
	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	نفت سپاهان	شسپا	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق العاده به منظور انتخاب اعضای هیئت‌مدیره	۴
	استخراج کانه های فلزی	باما	کاما	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۳
	فلزات اساسی	فراوری مواد معدنی ایران	فراور	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۳
	فلزات اساسی	ملی سرب و روی ایران	فسرب	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۳
	مواد و محصولات دارویی	تولید مواد اولیه داروپخش	دتماد	بررسی بیشتر اطلاعات	۳
فرابورس ایران	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	شهرسازی و خانه‌سازی باغمیشه	ثباغ	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۷
	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	آ.س.پ	آ س پ	مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۶
	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	توسعه حمل و نقل ریلی پارسیان	حپارسا	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۶
	پیمانکاری صنعتی	مهندسی ساختمان تأسیسات راه آهن	بالاس	دریافت اطلاعات پیش‌بینی سود هر سهم سال مالی	۴
	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	ریل پردازسیر	حریل	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق العاده صاحبان سهام	۴
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	مدیریت انرژی امید تابان هور	وهور	اطلاعات دریافتی مبنی بر تعدیل با اهمیت پیش‌بینی سود سال مالی	۳

در جدول زیر لیست ۲۳ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران در آذرماه ۱۳۹۵ که در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده‌اند به همراه علت توقف آن‌ها ارائه شده است.

بورس	صنعت	نام اوراق بهادار	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
بورس اوراق بهادار تهران	استخراج زغال سنگ	ذغال سنگ نگین طبس	کطیس	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۲۲
	استخراج کانه های فلزی	توسعه معادن روی ایران	کروی	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۱۳
	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	عمران و توسعه فارس	ثفارس	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۳۰
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک پاسارگاد	وپاسار	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۲
	خودرو و ساخت قطعات	زامیاد	خزامیا	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۰۹
	خودرو و ساخت قطعات	سازه پویش	خپویش	برگزاری مجمع عمومی عادی فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۹/۱۳
	خودرو و ساخت قطعات	محورسازان ایران خودرو	خوساز	برگزاری مجمع عمومی عادی فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۹/۰۳
	ساخت محصولات فلزی	جام دارو	فجام	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده به منظور افزایش سرمایه	۱۳۹۵/۰۹/۲۴
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	فرآورده‌های نسوز آذر	کاذر	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۶
	سایر واسطه‌گری‌های مالی	لیزینگ خودرو غدیر	ولغدیر	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۱۵
	سیمان، آهک و گچ	سیمان مازندران	سمازن	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۲۱
	سیمان، آهک و گچ	صنایع سیمان دشتستان	سدشت	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۹/۰۶
	فرآورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	پالایش نفت بندرعباس	شبندر	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۲۰
	فلزات اساسی	آلومراد	فمراد	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۹
	لاستیک و پلاستیک	ایران یاساتایرورابر	پاسا	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۲
	ماشین‌آلات و تجهیزات	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۹
	ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی	موتوزن	بموتو	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۹/۰۳
	محصولات شیمیایی	پتروشیمی پردیس	شپدیس	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۹/۲۳
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	تولیدی مهرام	غمه‌را	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۹
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	کشت و صنعت پیادر	غاذر	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۲۱
	مواد و محصولات دارویی	داروسازی امین	دامین	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده به منظور افزایش سرمایه	۱۳۹۵/۰۹/۲۰
	مواد و محصولات دارویی	گروه دارویی سبحان	دسبحا	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده به منظور افزایش سرمایه	۱۳۹۵/۰۹/۲۲
	مواد و محصولات دارویی	لابراتوار داروسازی دکتر عبیدی	دعبید	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۱۶

در جدول زیر لیست ۶ نماد متوقف شده در فرابورس ایران در آذرماه ۱۳۹۵ که در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده‌اند به همراه علت توقف آن‌ها ارائه شده است.

بورس	صنعت	نام اوراق بهادار	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
فرابورس ایران	استخراج زغال سنگ	صنعتی و معدنی شمال شرق شاهرود	کشرق	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۲۳
	استخراج زغال سنگ	فرآوری زغال سنگ پروده طبس	کپرور	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۹/۲۳
	اطلاعات و ارتباطات	آتیه داده پرداز	اپرداز	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۰۷
	بیمه و صندوق بازنشتگی به جز تأمین اجتماعی	بیمه پاسارگاد	بپاس	برگزاری جلسه هیئت‌مدیره	۱۳۹۵/۰۹/۱۶
	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	افرانت	افرا	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۹/۲۱
	محصولات شیمیایی	پتروشیمی زاگرس	زاگرس	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۹/۲۳
	مواد و محصولات دارویی	داروسازی سبحان انکولوژی	دسانکو	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۹/۲۸
	هتل و رستوران	گروه سرمایه‌گذاری میراث فرهنگی	سمگا	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۲۲

- ✓ در آذر ماه ۱۳۹۵، در بین نمادهای بورسی و فرابورسی ۸۴ نماد به علت‌های مختلف بسته بوده‌اند که در انتهای ماه ۱۷ نماد بازگشایی شده‌اند.
- ✓ از میان ۶۷ نماد باقی‌مانده، ۲۱ نماد به علت ابهام در ارائه اطلاعات، ۲۰ نماد به علت تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم و ۲۶ نماد به علت برگزاری مجمع، متوقف شده‌اند.
- ✓ در کل، از میان نمادهای متوقف باقی‌مانده، ۴۶ مورد به درخواست شرکت پذیرفته شده در بورس و فرابورس صورت گرفته است.
- ✓ در مجموع در انتهای آذر ماه ۱۶٪ از نمادهای بورسی و فرابورسی متوقف بوده‌اند که در این میان ۵٪ به علت ابهام در ارائه اطلاعات بوده است و حدود ۱۱٪ به علت رویدادهای مختلف شرکتی رخ داده است.

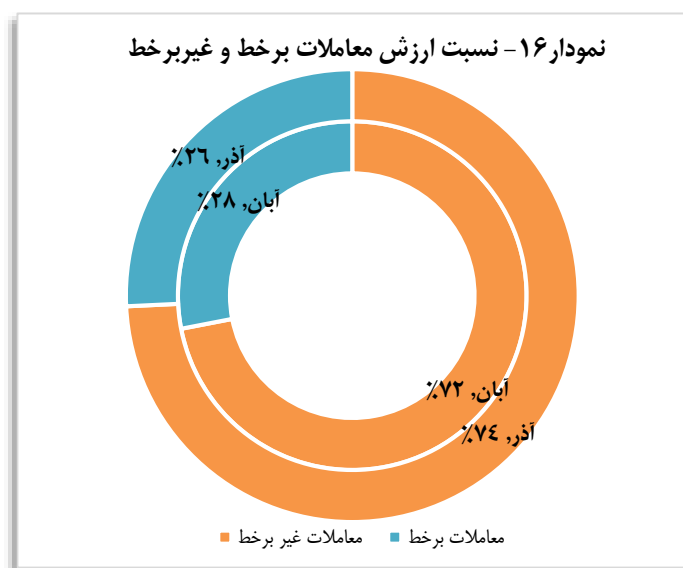
در جدول زیر لیست ۳۸ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار که قبل از آذرماه ۱۳۹۵ متوقف شده و در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده‌اند به همراه علت توقف آن‌ها ارائه شده است.

بورس	صنعت	نام اوراق بهادار	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
بورس	ابزار پزشکی، اپتیک و اندازه‌گیری	کنتورسازی ایران	آکتور	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۶/۱۳
	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	سرمایه‌گذاری ساختمان ایران	وساخت	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۲۹
	انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	نوسازی و ساختمان تهران	ثنوسا	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۲۹
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک تجارت	وتجارت	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۴/۲۹
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک صادرات ایران	وبصادر	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۴/۲۹
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک ملت	وبملت	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۴/۲۸
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک اقتصادنوین	ونوین	برگزاری مجامع عمومی فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۸/۲۴
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	بانک پارسیان	وپارس	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۱۵
	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	پست بانک ایران	وپست	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۶/۰۲
	خدمات فنی و مهندسی	گروه مپنا (سهامی عام)	رمپنا	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۴/۲۷
	خودرو و ساخت قطعات	آهن‌گری تراکتورسازی ایران	خاهن	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۱۰
	خودرو و ساخت قطعات	ایران خودرو دیزل	خاور	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۰۱
	خودرو و ساخت قطعات	تولیدمخورد خودرو	خمخور	مجمع عمومی فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۸/۲۹
	خودرو و ساخت قطعات	سایپا	خسایپا	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۸/۰۲
	خودرو و ساخت قطعات	سایپا دیزل	خکاوه	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۰۱
	خودرو و ساخت قطعات	فنر سازی خاور	خفتر	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۷/۲۸
	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	ایران ارقام	مرقام	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۶/۲۳
	ساخت محصولات فلزی	ماشین‌سازی اراک	فاراک	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۹/۰۱
	سایر محصولات کانی غیر فلزی	شیشه و گاز	کگاز	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۴/۲۹
	سایر واسطه‌گری‌های مالی	واسپاری ملت	ولملت	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۲۶
	سیمان، آهک و گچ	سیمان کارون	سکارون	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۱۳۹۵/۰۸/۰۴
	فلزات اساسی	آلومینیوم ایران	فایرا	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۴/۰۸/۰۳
	فلزات اساسی	سرمایه‌گذاری توکافولاد (هلدینگ)	وتوکا	بررسی بیشتر اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۲۶
	قند و شکر	قند لرستان	قنلرست	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۸/۲۵
	کاشی و سرامیک	چینی ایران	کچینی	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۱۰
	کاشی و سرامیک	کاشی اصفهان	کاصفا	مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۱۳۹۲/۰۹/۰۲
	کاشی و سرامیک	کاشی نیلو	کنیلو	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۴/۱۰/۲۸
	کاشی و سرامیک	کاشی و سرامیک حافظ	کحافظ	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۲۹
بورس	محصولات چوبی	فیبر ایران	چفیبیر	برگزاری جلسه هیئت‌مدیره	۱۳۹۵/۰۸/۱۸
	محصولات شیمیایی	پلی‌اکریل	شپلی	برگزاری مجامع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۱/۲۸
	محصولات شیمیایی	تولید مواد اولیه الیاف مصنوعی	شمواد	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۵/۱۳
	محصولات شیمیایی	دوده صنعتی پارس	شدوص	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۰۱
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	توسعه صنایع بهشهر (هلدینگ)	وبشهر	بررسی بیشتر اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۲۹
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	شیرپاستوریزه پگاه خراسان	غشان	ابهام در ارائه اطلاعات	۱۳۹۵/۰۸/۰۲
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	کشت و صنعت چین چین	غچین	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۱۳۹۵/۰۷/۲۷
	محصولات کاغذی	صنایع کاغذسازی کاوه	چکاوه	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۸/۲۵
	مواد و محصولات دارویی	داروپخش (هلدینگ)	وپخش	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده در خصوص افزایش سرمایه	۱۳۹۵/۰۹/۰۱
	مواد و محصولات دارویی	داروسازی زاگرس فارمد پارس	ددام	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۳۹۵/۰۷/۲۷

عملکرد سرمایه‌گذاران در بازار سرمایه به صورت منطقه‌ای

نسبت حجم معاملات به تفکیک معاملات برخط و غیر برخط

در نمودار (۱۶) نسبت حجم معاملات خرید و فروش به تفکیک معاملات برخط و غیر برخط در آبان و آذرماه ۱۳۹۵ نشان داده شده است.



حجم معاملات در آذرماه ۹۵ به تفکیک مناطق

به طور کلی ۴۸ درصد از حجم معاملات خرید و فروش در استان‌های کشور در کلیه انواع اوراق بهادار در بورس و فرابورس در آذرماه ۱۳۹۵، مربوط به معاملات اشخاص حقوقی و ۵۲ درصد مربوط به معاملات اشخاص حقیقی می‌باشد. در جدول زیر پنج استان با بیش‌ترین حجم معاملات خرید و فروش اشخاص حقوقی در آذرماه ۱۳۹۵ نمایش داده شده است.

هزار سهم

درصد تغییرات		تاریخ		بیش‌ترین حجم خرید و فروش اشخاص حقوقی	
نسبت به کل حجم آذرماه ۹۵	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۵/۰۹/۳۰		
۸۶.۵۰٪	-۲۳.۵٪	۱۱۸۱۷.۵۹۶	۹۰۴۴.۸۸۴	تهران	۱
۲۶.۲٪	۴۰.۳٪	۱۹۵.۴۷۳	۲۷۴.۱۸۷	هرمزگان	۲
۲۰.۲٪	۲۹.۱٪	۱۶۳.۳۲۹	۲۱۰.۸۰۶	گیلان	۳
۱.۲۳٪	۶۵.۱٪	۷۷.۸۵۵	۱۲۸.۵۲۱	خراسان رضوی	۴
۰.۹۷٪	۵۳۴.۷٪	۱۵.۹۵۰	۱۰۱.۲۳۹	فارس	۵
۹۳.۳۴٪	-۲۰.۵٪	۱۲.۲۷۰.۲۰۴	۹.۷۵۹.۶۲۹	مجموع ۵ استان	
۲.۳۰٪	-۲۵.۱٪	۳۲۰.۴۸۰	۲۳۹.۹۹۹	سایر استان‌ها	
۴.۳۷٪	۸.۵٪	۴۲۰.۹۹۵	۴۵۶.۶۱۰	معاملات برخط	
۱۰۰٪	-۱۹.۶٪	۱۳,۰۱۱,۶۷۹	۱۰,۴۵۶,۲۳۷	مجموع	

در جدول زیر پنج استان با بیشترین حجم معاملات خرید و فروش اشخاص حقیقی در آذرماه ۱۳۹۵ نمایش داده شده است.

تاریخ		درصد تغییرات	
بیشترین حجم خرید و فروش اشخاص حقیقی	۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	نسبت به ماه قبل نسبت به کل حجم آذرماه ۹۵
۱ تهران	۳,۷۲۶,۵۵۴	۴,۷۲۱,۸۸۸	-۲۱.۱٪
۲ اصفهان	۳۵۴,۱۴۷	۴۸۹,۹۴۳	-۲۷.۷٪
۳ گیلان	۲۶۳,۵۹۷	۲۱۲,۶۰۴	۲۴.۰٪
۴ خراسان رضوی	۲۵۴,۲۹۷	۳۳۸,۸۴۴	-۲۵.۰٪
۵ یزد	۱۶۶,۵۵۸	۱۹۲,۲۰۶	-۱۳.۳٪
مجموع ۵ استان	۴,۷۶۵,۱۵۴	۵,۹۵۵,۴۸۴	-۲۰.۰٪
سایر استانها	۱,۳۲۶,۱۸۷	۱,۸۹۴,۳۳۹	-۳۰.۰٪
معاملات برخط	۵,۱۲۳,۸۴۶	۷,۵۴۵,۷۰۹	-۳۲.۱٪
مجموع	۱۱,۲۱۵,۱۸۸	۱۵,۳۹۵,۵۳۲	-۲۷.۲٪

شکل ۱- حجم معاملات اشخاص حقیقی به تفکیک مناطق غیر از تهران

ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری به تفکیک انواع صندوق‌ها

در جدول زیر مقایسه عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری در سال ۱۳۹۳، ۱۳۹۴ و هشت‌ماهه نخست سال ۱۳۹۵ آورده شده است.

*** لازم به توضیح است که صندوق‌های سرمایه‌گذاری اختصاصی بازگردانی در این گزارش در نظر گرفته نمی‌شوند.

نوع صندوق سرمایه‌گذاری	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	تعداد	ارزش (میلیارد ریال)			تعداد سرمایه‌گذار			خرید (میلیارد ریال)			فروش (میلیارد ریال)			ارزش سهام (میلیارد ریال)		
				پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۵۳	۴۸	۳۴	۱۰۰۳۰۳۵۰	۶۰۴۰۹۷۹	۵۷۰۵۸۶	۱۰۳۸۰۲۹۷	۷۹۲۰۶۶۷	۱۴۶۰۸۸۲	۲۰۹۸۹	۱۰۷۶۳	۷۵۷	۲۵۰۱۵۵	۱۰۰۱۶۴	۱۰۶۳۳	۲۰۲۷۸	۲۰۲۵۷	۱۸۰۶۸
مختلط	۱۶	۱۵	۱۴	۸۰۷۷۷	۱۰۲۴۵	۵۴۲	۱۱۸۱۳	۷۰۷۱۱	۲۰۲۴۳	۱۳۷	۱۴۱	۱۰۳	۲۰۲۶۵	۱۰۴۸۶	۸۶۱	۱۰۲۷۰	۸۹۶	۸۱۷
سهام	۹۹	۹۴	۸۸	۱۸۰۵۲۱	۲۰۰۱۶۳	۱۲۰۰۰۳	۱۱۰۵۶۳	۱۴۰۴۶۶	۱۸۰۶۷۲	۴۲۱	۴۹۶	۴۵۷	۱۹۰۴۹۴	۱۷۰۳۳۹	۲۹۰۱۵۹	۱۸۰۰۸۵	۱۳۰۰۵۴	۱۸۰۰۶۸
کل	۱۶۸	۱۵۷	۱۳۶	۱۰۱۳۰۶۴۸	۶۲۶۰۳۸۶	۷۰۰۱۳۱	۱۰۴۰۳۶۷۳	۸۱۴۰۸۲۴	۱۶۷۰۷۹۷	۳۰۵۴۷	۲۰۴۰۰	۱۰۳۱۷	۴۶۰۹۱۴	۲۸۰۹۸۹	۳۱۶۵۳	۲۹۰۳۹۶	۱۶۶۰۲	۲۸۰۷۵۴

منبع: اداره امور نهادهای مالی

در جدول زیر عملکرد آبان‌ماه ۱۳۹۵ با مهرماه ۱۳۹۵ مقایسه شده است.

نوع صندوق سرمایه‌گذاری	پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان مهرماه ۱۳۹۵	ارزش (میلیارد ریال)		تعداد سرمایه‌گذار آبان ماه ۱۳۹۵		تعداد سرمایه‌گذار مهرماه ۱۳۹۵	
			پایان آبان ماه ۱۳۹۵	پایان مهرماه ۱۳۹۵	حقوقی	جمع	حقوقی	جمع
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۵۳	۵۳	۱۰۳۰۳۵۰	۱۰۱۲۰۳۱۷	۱۰۳۸۰۲۹۷	۱۰۳۸۳۰۲۸۶	۲۰۹۸۹	۱۰۲۵۲۰۴۹۲
مختلط	۱۶	۱۶	۸۰۷۷۷	۵۰۶۸	۱۱۸۱۳	۱۱۰۹۵۰	۱۳۷	۹۰۳۶۱
سهام	۹۹	۹۶	۱۸۰۵۲۱	۱۸۰۲۴۵	۱۱۰۵۶۳	۱۱۰۹۸۴	۴۲۱	۱۱۰۵۸۳
کل	۱۶۸	۱۶۵	۱۰۱۳۰۶۴۸	۱۰۰۳۵۶۳۰	۱۰۴۰۳۶۷۳	۱۰۴۰۷۰۲۲۰	۳۰۵۴۷	۱۰۲۷۳۰۴۳۶

منبع: اداره امور نهادهای مالی

در جدول زیر میانگین ساده بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری در آبان ماه نسبت به ماه و سال گذشته به شرح جدول زیر است.

بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری (%)		بازدهی بازار (%)	
نوع صندوق سرمایه‌گذاری	ماه گذشته	سال گذشته	ماه گذشته
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱.۴۶	۲۱.۶۸	۱.۵۲
صندوق مختلط	۱.۰۹	۳۰.۱۱	۲۶
در سهام	۰.۴۹	۳۵.۸۵	

منبع: اداره امور نهادهای مالی

آمار تأمین مالی

ارزش تأمین مالی صورت گرفته در بازارهای اولیه، ثانویه و همچنین نهادهای مالی در جدول زیر نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

نوع بازار	عنوان	عملکرد ۹ ماهه ۱۳۹۵	عملکرد ۹۴
بازار اولیه و ثانویه	تأسیس شرکت‌های سهامی عام	۵,۵۰۰	۳,۷۰۰
	افزایش سرمایه شرکت‌های سهامی عام (مجوزهای ارائه شده)	۱۵۳,۴۶۷	۳۱۱,۲۶۲
	انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	۲۰۰,۴۳۳	۱۴۸,۰۱۴
	عرضه اولیه سهام شرکت‌ها در بورس و فرابورس	۲,۳۰۹	۱۰,۴۰۸
	جمع تأمین مالی بازار اولیه و ثانویه	۳۶۱,۷۰۹	۴۷۳,۳۸۴
نهادهای مالی	افزایش ارزش صندوق‌ها نسبت به ابتدای سال	۶۱۹,۹۹۲	۵۵۶,۴۵۶
	سایر نهادهای مالی*	۹,۷۷۵	۴,۳۲۹
	جمع تأمین مالی نهادهای مالی	۶۲۹,۷۶۷	۵۶۰,۷۸۵
	جمع کل	۹۹۱,۴۷۶	۱,۰۳۴,۱۶۹

*: تأمین مالی سایر نهادهای مالی شامل تأسیس و افزایش سرمایه سایر نهادهای مالی شامل شرکت‌های سبد گردان، مشاور سرمایه‌گذاری، تأمین سرمایه و پردازش اطلاعات مالی بوده است.
منبع: اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بدهی

ارزش کل تأمین مالی صورت گرفته از طریق انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی در جدول زیر نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

نوع بازار	عنوان	عملکرد ۹ ماهه ۱۳۹۵	عملکرد ۹۴
انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	انتشار اوراق بهادار بدهی با مجوز سازمان بورس *	۱۵,۰۹۸	۹,۶۷۵
	انتشار اوراق سلف موازی استاندارد	۳۴,۷۲۰	۱۰,۸۲۷
	اوراق مشارکت دولت، شهرداری‌ها و بانک‌ها **	۱۸,۰۰۰	۱۳,۴۹۲
	گواهی سپرده سرمایه‌گذاری عام و خاص ***	۲۵,۰۰۰	۰
	اوراق مشارکت شرکت ملی نفت	۰	۵۰,۰۰۰
	اوراق اجاره دولتی	۰	۵,۰۰۰
	اوراق مرابحه دولتی	۱۰,۰۰۰	۰
	اسناد خزانه اسلامی	۹۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
	امتیاز تسهیلات مسکن ***	۷,۶۱۵	۹,۰۲۰
	جمع	۲۰۰,۴۳۳	۱۴۸,۰۱۴

*: اوراق بهادار بدهی شامل اوراق مشارکت، اجاره، مرابحه، سفارش ساخت و رهنی است که مجوز انتشار آن‌ها توسط سازمان بورس صادر شده است.

** :اطلاعات اوراق مشارکت دولت، شهرداری‌ها و بانک‌ها و گواهی سپرده سرمایه‌گذاری عام و خاص مربوط به آغاز معاملات ثانویه اوراق مذکور از طریق بورس و فرابورس می‌باشد که عرضه اولیه آن‌ها از طریق شبکه بانکی انجام شده است.

***: ارزش معاملات امتیاز تسهیلات مسکن به عنوان معیار تأمین مالی از این طریق در نظر گرفته شد.

منبع: اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بدهی

مانده اوراق بدهی منتشره

مانده اوراق بدهی منتشره در انتهای آذرماه ۱۳۹۵ و همچنین در انتهای سال ۱۳۹۴ در جدول زیر نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

نوع اوراق	پایان آذرماه	درصد از کل	پایان سال ۹۴	درصد از کل
مشارکت	۵۰,۰۰۰	۱۶.۸۵%	۵۰,۰۰۰	۲۸.۲۸%
اجاره	۵,۰۰۰	۱.۶۹%	۵,۰۰۰	۲.۸۳%
سلف	۲۶,۵۰۰	۸.۹۳%	۰	۰%
مرابحه	۱۰,۰۰۰	۳.۳۷%	۰	۰%
اسناد خزانه اسلامی	۷۰,۰۰۰	۲۳.۵۹%	۴۰,۰۰۰	۲۲.۶۲%
معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری‌ها و دولت	۴۴,۳۹۵	۱۴.۹۶%	۲۶,۳۹۵	۱۴.۹۳%
جمع اوراق بهادار دولتی	۲۰۵,۸۹۵	۶۹.۴۰%	۱۲۱,۳۹۵	۶۸.۶۶%
انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی	۹۰,۷۸۴	۳۰.۶۰%	۵۵,۴۲۰	۳۱.۳۴%
جمع کل بازار اوراق بدهی	۲۹۶,۶۷۹	۱۰۰%	۱۷۶,۸۱۵	۱۰۰%

منبع: اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بدهی

بازار سرمایه و بازارهای موازی

مقدمه

بازار سهام، ارز و طلا طی سالیان اخیر در تقابل با یکدیگر همواره نوسانات زیادی را به خود دیده‌اند و تلاش آن‌ها برای جذب و انتقال نقدینگی از یک بازار به بازاری دیگر در راستای تحقق بیش‌ترین رقم بازدهی، همواره افزایش نوسان قیمت‌ها را رقم زده است.

از طرف دیگر تأثیر قیمت نفت را نمی‌توان در بازار سهام کم جلوه داد؛ چرا که طی دو سال اخیر روند کاهش قیمت نفت نه تنها بر بورس تهران تأثیر گذاشته، بلکه بورس‌های کشورهای منطقه نیز که اقتصادشان نفتی بوده است، با ریزش سنگینی مواجه شده‌اند.

در تمامی کشورها، نفت همیشه به عنوان یکی از مهم‌ترین فاکتورهای اقتصاد کلان جهانی شناخته شده و با توجه به اهمیت و کاربردهای متفاوت این کالا در جهان امروز، نه تنها به عنوان یک عامل تعیین‌کننده اقتصادی و صنعتی، بلکه به عنوان یک عامل سیاسی و امنیتی نیز مطرح است.

در این بخش به بررسی نحوه و میزان تأثیر بازارهای موازی بر بازار سرمایه کشور و همچنین میزان تأثیر نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی موثر بر صنایع بورسی خواهیم پرداخت.



❖ شاخص‌های مورد بررسی در این بخش

✓ نرخ‌های جهانی کالای اساسی و

تغییرات شاخص‌ها

✓ مدل آماری بررسی تأثیر بازارهای

موازی بر شاخص کل بورس

شاخص‌های مورد بررسی

بازدهی روزانه شاخص‌ها

همبستگی بین متغیرها

روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها

بر شاخص کل

نرخ‌های جهانی کالای اساسی و تغییرات شاخص‌ها

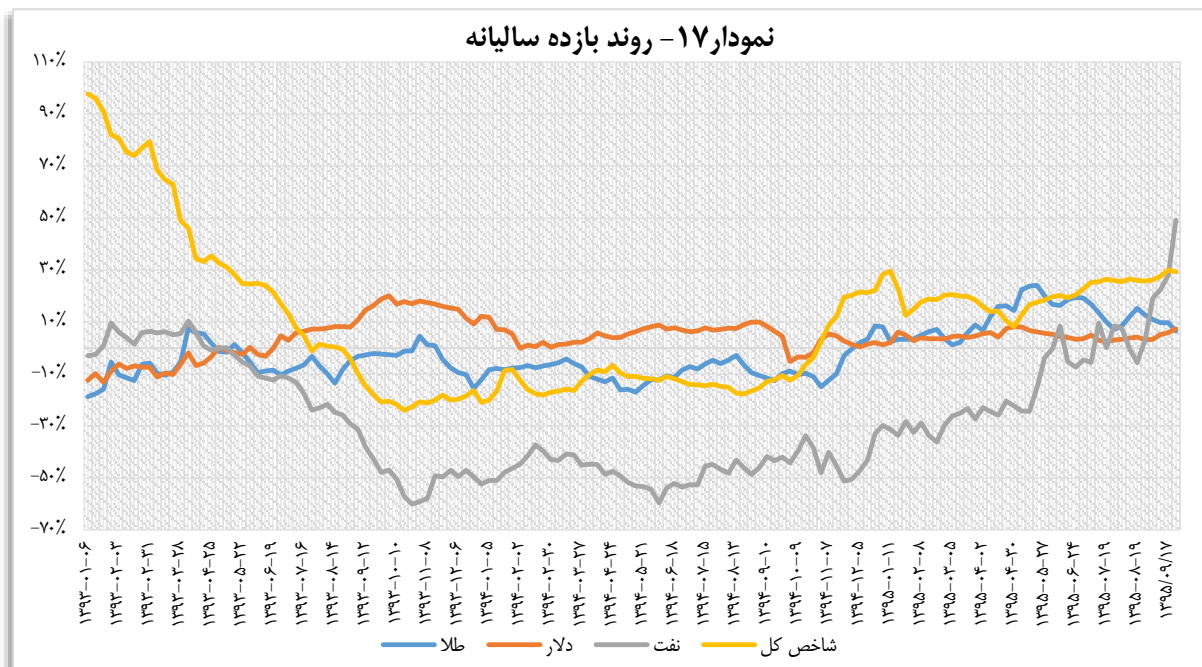
نرخ‌های جهانی کالای اساسی و تغییرات شاخص‌های بازار سرمایه و تغییرات آن‌ها در جدول زیر نشان داده شده است.

تغییرات قیمت (%)		قیمت			شرح	
از ابتدای سال	یک ماه	۹۴/۱۲/۲۹	۹۵/۰۸/۳۰	۹۵/۰۹/۳۰	واحد	
۵۰.۷٪	۲۱.۴٪	۳۴.۵۰	۴۲.۸۳	۵۱.۹۹	بشکه	نفت (دلار)
۱۴.۸٪	۷.۹٪	۳۴.۲۳۰	۳۶.۴۱۰	۳۹.۲۸۹		دلار (ریال)
۵۰.۵٪	۱۴.۵٪	۵۲.۵	۶۹	۷۹	تن	سنگ آهن (دلار)
۶۷.۱٪	-۱۸.۹٪	۵۱.۶	۱۰۶.۳	۸۶.۲	تن	زغال سنگ (دلار)
۱۱.۶٪	۰.۳٪	۴.۹۲۷.۳	۵.۴۸۵.۱	۵.۵۰۰.۵	تن	مس (دلار)
۴۸.۶٪	۳.۸٪	۱.۷۷۵	۲.۵۴۰	۲.۶۳۷	تن	روی (دلار)
۱۲.۹٪	۱.۶٪	۱.۵۲۴	۱.۶۹۴	۱.۷۲۱	تن	آلومینیوم (دلار)
۶۸.۶٪	۲۴.۲٪	۲۱۰	۲۸۵	۳۵۴	تن	متانول (دلار)
۳۳.۷٪	۰.۰٪	۱۷۵	۲۳۴	۲۳۴	تن	اوره (دلار)
۱۸.۲٪	-۹.۴٪	۱۵.۵	۲۰.۲	۱۸.۳	پوند	شکر (سنت)
از ابتدای سال	یک ماه	مقدار شاخص				
-۰.۱٪	۱.۱٪	۸۰.۲۱۹	۷۹.۲۷۹	۸۰.۱۲۳		شاخص کل بورس
۱۷.۷٪	-۱.۵٪	۱۳.۳۵۷	۱۵.۹۵۹	۱۵.۷۲۰		شاخص کل (هم وزن)
۷.۸٪	۴.۲٪	۸۰.۶	۸۳۳	۸۶۸		شاخص فرابورس

- ✓ قیمت نفت خام در ادامه روند صعودی خود در پایان آذرماه ۹۵ به ۵۱,۹۹ دلار در هر بشکه رسید. نفت خام در یک ماه اخیر رشد ۲۱,۴ درصدی را تجربه کرده است. یکی از علت‌های رشد قیمت نفت، توافق اعضای اوپک جهت کاهش عرضه نفت است.
- ✓ دلار نیز با ادامه روند صعودی خود، در طول ماه آذر از قیمت ۴۰,۰۰۰ ریال عبور کرد و در پایان آذرماه ۹۵ به جایگاه قیمت ۳۹,۲۸۹ رسید.
- ✓ زغال سنگ بعد از سپری کردن روند صعودی طی چند ماه اخیر، در پایان آذرماه ۹۵ به قیمت ۸۶,۲ دلار در هر تن رسید که نسبت به قیمت آبان‌ماه ۹۵، ۱۸,۹ درصد کاهش داشته است.

مدل آماری بررسی تأثیر بازارهای موازی بر شاخص کل بورس

در این قسمت مدل سازی آماری به منظور بررسی نحوه و میزان تأثیر متغیرهای قیمت نفت، قیمت طلا و قیمت دلار بر شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران صورت گرفته است. در نمودار (۱۷) روند بازدهی سالانه چهار شاخص مورد بررسی در بازه زمانی ۱۳۹۳/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ نشان داده شده است. روند بازدهی شاخص کل و نفت قابل توجه است.



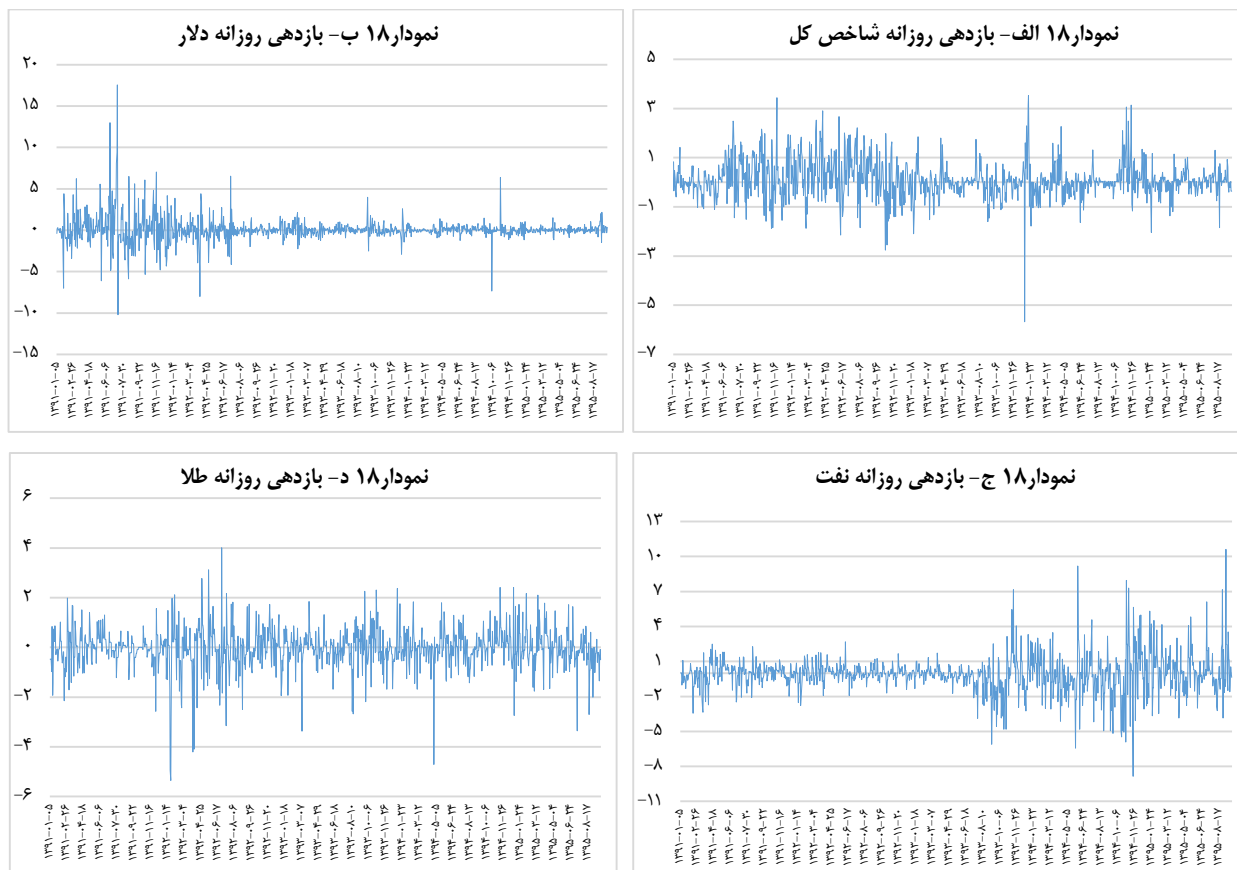
شاخص های مورد بررسی

در جدول زیر خلاصه آمار توصیفی بازدهی روزانه (درصدی) شاخص کل، قیمت دلار، طلا و نفت در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ نمایش داده شده است.

شاخص کل	دلار	طلا	نفت	
۰.۱۰	۰.۰۶	-۰.۰۴	-۰.۰۸	میانگین
۰.۰۳	۰.۰۰	-۰.۰۱	-۰.۰۶	میانه
۳.۵۳	۱۷.۵۶	۴.۰۱	۱۰.۶۳	بیشینه
-۵.۶۷	-۱۰.۲۲	-۵.۳۵	-۸.۸۵	کمینه
۰.۷۷	۱.۵۰	۰.۸۱	۱.۵۴	انحراف معیار
۰.۲۲	۱.۹۹	-۰.۸۷	۰.۵۳	چولگی
۷.۵۰	۳۱.۰۱	۹.۵۶	۱۰.۵۵	کشیدگی
۹۷۷.۹۲	۳۸۲۵۱.۷۹	۲۱۹۷.۳۶	۲۷۷۷.۳۶	آزمون Jurque-Bera
۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	P-Value J-B
۱۱۴۷	۱۱۴۷	۱۱۴۷	۱۱۴۷	تعداد مشاهدات

نتایج استفاده از آزمون جاک-برا نشان می دهد بازدهی روزانه هیچ یک از متغیرهای مورد بررسی توزیع نرمال ندارند.

در نمودار (۱۸-الف تا د) بازدهی روزانه شاخص کل، قیمت نفت، طلا و دلار در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ نشان داده شده است.



همبستگی بین متغیرها

ضریب همبستگی بین بازده روزانه چهار متغیر مورد بررسی در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ در جدول زیر نشان داده شده است. همان‌طور که مشاهده می‌شود، شاخص کل بیش‌ترین همبستگی مثبت را با قیمت نفت و بیش‌ترین همبستگی منفی را با قیمت دلار دارد.

ضرایب همبستگی	شاخص کل	دلار	طلا	نفت
نفت	۰.۰۲۶	۰.۰۳۲	۰.۰۵۰	۱
طلا	۰.۰۱۶	۰.۰۳۷	۱	
دلار	-۰.۰۴۲	۱		
شاخص کل	۱			

روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها بر شاخص کل

بررسی روابط هم‌انباشتگی

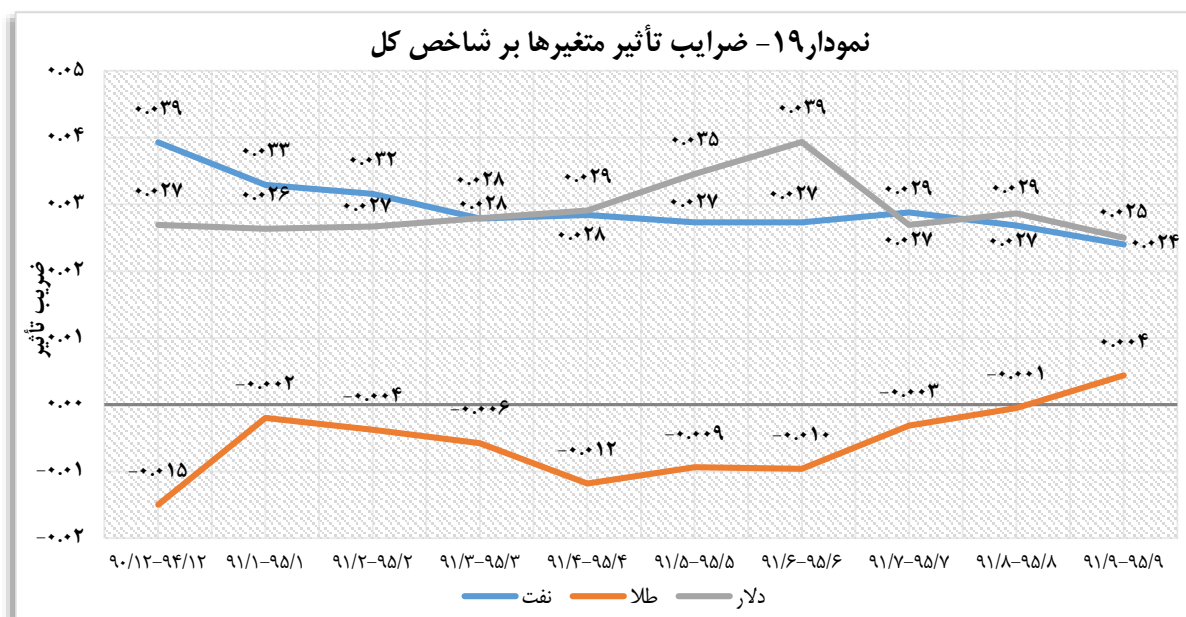
هم‌انباشتگی، عبارت است از مطالعه ثبات روابط بلندمدت بین متغیرهای سری زمانی نامانا^۵. اندیشه هم‌انباشتگی، در واقع رهیافتی برای حل مشکل رگرسیون‌های کاذب، در سری‌های زمانی است. به منظور بررسی وجود روابط هم‌انباشتگی بین شاخص کل (متغیر وابسته) و قیمت نفت، دلار و طلا (متغیرهای مستقل) از آزمون هم‌انباشتگی یوهانسون (Johansen Cointegration Test) استفاده شد، که نتایج حاکی از عدم وجود رابطه هم‌انباشتگی بین شاخص کل و متغیرهای قیمت نفت، دلار و طلا است.

خودرگرسیون برداری (VAR)

مدل خودرگرسیون برداری در واقع یک مدل سری زمانی برای بررسی روابط بین چند سری زمانی به صورت وقفه‌ای است. داده‌های مورد استفاده جهت برآورد پارامترهای این مدل، اطلاعات بازدهی روزانه متغیرهای مورد بررسی در یک دوره ثابت چهار ساله (با دوره تناوب اطلاعات یک ماهه) است. معیارهای اطلاعاتی آکائیک (AIC) و شوارتز (SC)، وقفه یک روزه را به عنوان مناسب‌ترین طول وقفه جهت تخمین مدل تخمین زدند. رابطه زیر ضرایب مدل خودرگرسیونی برداری برای بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۹/۳۰ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ را نشان می‌دهد.

$$TRI = 0.3153*TRI(-1) + 0.024*OPEC(-1) - 0.0044*GOLD(-1) + 0.025*DOLLAR(-1) + 0.0006$$

که در آن TRI، OPEC، GOLD و DOLLAR به ترتیب متغیرهای بازده روزانه برای شاخص کل، نفت اوپک، طلا و دلار هستند. همان‌گونه که مشاهده می‌شود تغییرات شاخص کل بیشتر به تغییرات خود در روز کاری قبل و بعد به دلار، نفت و طلا وابسته است. به منظور درک بهتر از روند تغییرات ضرایب متغیرها در طول زمان در نمودار (۱۹) مقدار و روند ضرایب تأثیر هر یک از متغیرهای مورد بررسی بر تغییرات شاخص کل طی نه ماهه نخست ۱۳۹۵ نشان داده شده است.



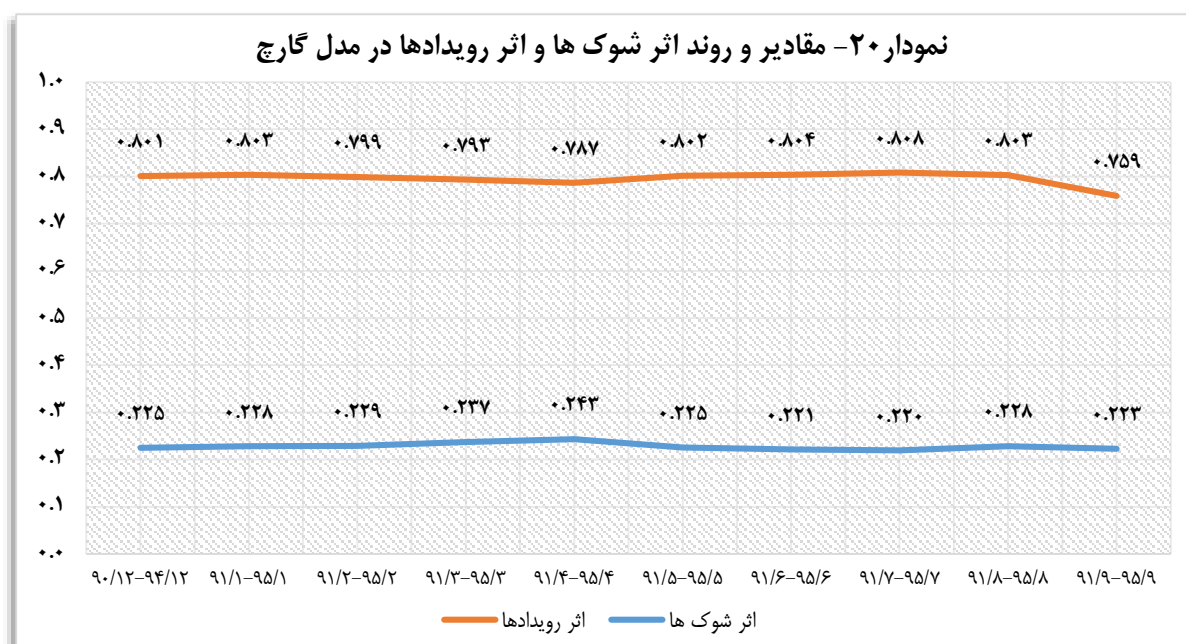
^۵ یک سری زمانی نامانا است هرگاه دارای روند باشد و یا واریانس آن به صورت خوشه‌ای تغییر کند.

با توجه به روند ضرایب مشاهده می‌شود در ابتدای دوره (اسفندماه ۹۴ و فروردین‌ماه ۹۵) تغییرات نفت اثر بیشتری بر تغییرات شاخص کل نسبت به دلار و طلا داشته است اما در طی ماه‌های مرداد و شهریور ۹۵ تأثیر دلار قابل ملاحظه‌تر است.

از طرفی با توجه به روند سری‌های پسماند مدل و وجود ناهمسانی واریانس در آن‌ها، از مدل گارچ (GARCH(1,1)) به منظور بررسی سری‌های پسماند استفاده شده است. رابطه زیر ضرایب مدل گارچ (۱,۱) برای بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۹/۳۰ تا ۱۳۹۵/۰۹/۳۰ را نشان می‌دهد.

$$\text{VARIANCE} = 0.000002 + 0.2226 * \text{RESID}(-1)^2 + 0.7586 * \text{VARIANCE}(-1)$$

که RESID و VARIANCE به ترتیب پسماندهای مدل خودرگرسیون و واریانس پسماندها هستند. این معادله نشان می‌دهد که تغییرات شاخص کل نسبت به رویدادهای گذشته بازار واکنش بیشتری نشان می‌دهد تا نسبت به اخبار و شوک‌های بازار. در نمودار (۲۰) مقادیر و روند اثر شوک‌ها و اثر رویدادها در مدل گارچ در طی نه ماهه نخست ۱۳۹۵ نمایش داده شده است. هر زمان اثر شوک‌ها کاهش می‌یابد اثر رویدادهای گذشته بیشتر می‌شود.



مصوبات کمیته‌های تخصصی

مقدمه

در سازمان بورس و اوراق بهادار کمیته‌های تخصصی با اهداف گوناگون مشغول به فعالیت هستند. دو کمیته تخصصی مهم، کمیته تدوین مقررات و کمیته فقهی هستند که در راستای اهداف مقرراتی و نظارت شرعی سازمان فعالیت می‌کنند.

کمیته تدوین مقررات، بر اساس اختیارات حاصل از ماده ۵ مصوبه مورخ ۱۳۸۵/۰۹/۰۸ هیئت وزیران به عنوان یکی از کمیته‌های تخصصی هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار تشکیل شد، هدف اصلی این کمیته بررسی و کارشناسی دستورالعمل‌ها و تدوین مقررات جهت تصویب در هیئت مدیره سازمان است.

همچنین به استناد بند (۱۳) ماده (۷) قانون بازار اوراق بهادار و همچنین تشکیلات مصوب ۱۳۸۵/۰۹/۰۸ هیئت محترم وزیران در خصوص تشکیل کمیته‌های تخصصی هیئت مدیره، دستورالعمل تشکیل و فعالیت کمیته تخصصی فقهی به تصویب رسید. هدف این کمیته نیز بررسی و بحث کارشناسی فقهی در خصوص ابزارها و سازوکارهای نوین در سازمان است. در ادامه آخرین مقررات و عناوین در دست بررسی این کمیته‌های تخصصی و همچنین عناوین تصویب شده توسط هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار ارائه شده است.



❖ عناوین مورد بررسی در این بخش

- ✓ مصوبات هیئت مدیره
- ✓ عناوین مقررات در دست بررسی در کمیته تدوین مقررات
- ✓ عناوین در دست بررسی کمیته فقهی

مقررات	تاریخ	نهاد تصویب کننده
اصلاحیه دستورالعمل اجرایی معاملات قرارداد اختیار معامله در شرکت بورس کالای ایران	۹۵/۰۹/۱۷	هیئت مدیره
اصلاحیه دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله سهام در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران	۹۵/۰۹/۱۷	هیئت مدیره
بررسی امکان انتشار اوراق مرابحه به منظور تأمین مالی دولت	۹۵/۰۹/۱۷	کمیته فقهی
انتشار اوراق اجاره و منفعت مبتنی بر سهام	۹۵/۰۹/۰۳	کمیته فقهی

عناوین مقررات در دست بررسی در کمیته تدوین مقررات	
اصلاح دستورالعمل نحوه انجام معاملات و کالتی اوراق بهادار	۱
دستورالعمل پذیره نویسی و عرضه اولیه اوراق بهادار در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران	۲

عناوین در دست بررسی کمیته فقهی	
اوراق گواهی سپرده مبتنی بر سهام	۱
اسناد خزانه در شرایط تمدید مدت سررسید	۲

- ✓ در آذرماه ۱۳۹۵، ارزش بازار سهام در بورس تهران و فرابورس ایران به مقدار ۴,۳۹۵,۱۸۱ میلیارد ریال رسید که نسبت به ماه قبل مدو ۲ درصد رشد داشته است.
- ✓ در این مدت ارزش معاملات در کل بورسها (بورس تهران، فرابورس ایران، کالا و انرژی) ۱۱۷,۴۳۶ میلیارد ریال بوده است که نسبت به ماه گذشته مدود ۲۰ درصد کاهش یافته است.
- ✓ شافصهای کل بورس تهران و فرابورس ایران به ترتیب برابر ۸۰,۱۲۳ و ۸۶۸ وامد هستند که به ترتیب ۱ و ۴ درصد نسبت به ماه قبل افزایش یافته‌اند.
- ✓ در مجموع در انتهای آذر ماه ۱۶٪ از نمادهای بورسی و فرابورسی متوقف بوده‌اند که در این میان ۵٪ به علت ابهام در ارائه اطلاعات بوده است و مدود ۱۱٪ به علت رویدادهای مختلف شرکتی رخ داده است.
- ✓ طی سه ماه اخیر شاهد افزایش نسبت ارزش معاملات اشفاص مقوقی از کل ارزش معاملات انجام شده بوده‌ایم. به طوری که نسبت ارزش معاملات اشفاص مقوقی از ۵۸,۶۴ درصد در مهرماه ۹۵ به ۶۷,۱۵ درصد در آذرماه ۹۵ افزایش یافته است.
- ✓ قیمت نفت خام در ادامه روند صعودی خود در پایان آذرماه ۹۵ به ۵۱,۹۹ دلار در هر بشکه رسید. نفت خام در یک ماه اخیر رشد ۲۱,۴ درصدی را تجربه کرده است. یکی از علت‌های رشد قیمت نفت، توافق اعضای اوپک جهت کاهش عرضه نفت است.



سازمان بورس و اوراق بهادار
SECURITIES & EXCHANGE ORGANIZATION

مرکز پژوهش، توسعه و مطالعات اسلامی
گروه آمار و تحلیل ریسک