



سازمان بورس و اوراق بهادار
Securities & Exchange Organization

گزارش آماری

اسفندماه ۱۳۹۵

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



سازمان بورس و اوراق بهادار
مرکز پژوهش، توسعه و مطالعات اسلامی
گروه آمار و تحلیل ریسک

عنوان: گزارش آماری بازار سرمایه

تهیه کنندگان:

زانیار احمدی (سرپرست) – حسن حکیمیان – زهره گیوی

همکاران سایر بخش‌ها:

محمدمهدی مؤمن‌زاده (اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بهادار بدهی)

سیاوش پرویزنژاد (اداره امور نهادهای مالی)

تاریخ گزارش: اسفندماه ۱۳۹۵

۵.....	نگاهی به بازار سرمایه در اسفندماه 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.....	فرا بورس ایران
۱۲.....	آمار معاملات
۱۲.....	ارزش تجمعی معاملات بورس و فرا بورس
۱۲.....	آمار معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک بخش، بازار، نوع اوراق و صنایع
۱۸.....	آمار معاملات در فرا بورس ایران به تفکیک بخش، بازار، صنایع و نوع اوراق
۲۴.....	آمار معاملات در بورس کالا
۲۴.....	آمار معاملات در بورس انرژی
۲۵.....	سرمایه‌گذاران خارجی
۲۵.....	تعداد نمادها
۲۶.....	شاخص‌های بازار سرمایه
۲۷.....	اینفوگرافیک شاخص
۲۸.....	مقایسه شاخص کل با شاخص‌های کشورهای در حال توسعه و اسلامی
۲۹.....	نسبت P/E بازار
۳۰.....	مقایسه معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در بورس و فرا بورس
۳۱.....	آمار معاملات حقیقی و حقوقی در سهام
۳۲.....	آمار معاملات حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی
۳۳.....	ارزش معاملات حقیقی و حقوقی به تفکیک نوع اوراق بهادار
۳۴.....	لیست نمادهای متوقف
۳۷.....	عملکرد سرمایه‌گذاران در بازار سرمایه به صورت منطقه‌ای
۳۷.....	نسبت حجم معاملات به تفکیک معاملات برخط و غیربرخط
۳۷.....	حجم معاملات در اسفندماه ۹۵ به تفکیک مناطق
۴۰.....	ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری به تفکیک انواع صندوق‌ها
۴۱.....	آمار تأمین مالی

مانده اوراق بدهی منتشره.....	۴۲
سررسید اوراق بدهی منتشره.....	۴۲
بازار سرمایه و بازارهای موازی.....	۴۵
مروری بر نرخ‌های جهانی کالای اساسی و تغییرات شاخص‌ها.....	۴۶
نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی و تأثیر آن‌ها بر بازار سرمایه.....	۴۷
بورس تهران.....	۴۷
فرا بورس ایران.....	۴۹
مدل آماری بررسی تأثیر بازارهای موازی بر شاخص کل بورس.....	۵۲
شاخص‌های مورد بررسی.....	۵۲
همبستگی بین متغیرها.....	۵۳
روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها بر شاخص کل.....	۵۴
مدیریت پیگیری تخلفات.....	۵۶
تخلفات بر اساس واحد گزارش‌دهنده.....	۵۷
تخلفات بر اساس نوع متخلف.....	۵۸
مصوبات کمیته‌های تخصصی.....	۵۹

نگاهی به بازار سرمایه در اسفندماه ۱۳۹۵

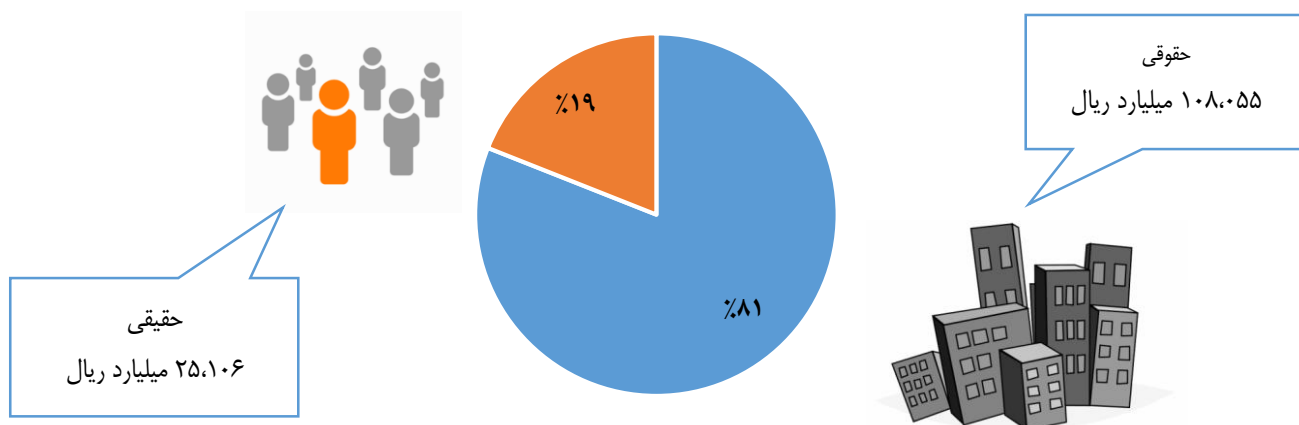
ارزش بازار بورس تهران و فرابورس ایران

میلیارد ریال					
درصد تغییرات		ارزش بازار			نوع بورس
نسبت به ابتدای سال ۹۵	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	
-۶.۹۸٪	-۱.۰۷٪	۳,۴۶۱,۷۷۴	۳,۲۵۴,۹۱۹	۳,۲۲۰,۰۴۶	بورس تهران
۷.۹۹٪	۴.۵۳٪	۹۶۶,۴۲۳	۹۹۸,۴۳۹	۱,۰۴۳,۶۴۳	فرابورس ایران
-۳.۷۳٪	۰.۲۴٪	۴,۴۲۸,۱۹۷	۴,۲۵۳,۳۵۸	۴,۲۶۳,۶۸۹	مجموع بورس و فرابورس

شاخص‌های بازار سرمایه

درصد تغییرات		تاریخ			نام شاخص
نسبت به ابتدای سال	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	
-۳.۷۳٪	-۰.۴۸٪	۸۰,۲۱۹	۷۷,۵۹۹	۷۷,۲۳۰	شاخص کل
۱۷.۷۱٪	۰.۴۶٪	۱۳,۳۵۷	۱۵,۶۵۱	۱۵,۷۲۳	شاخص کل (هم وزن)
-۱۲.۰۸٪	-۱.۱۰٪	۳۰,۵۱۱	۲۷,۱۲۴	۲۶,۸۲۶	شاخص قیمت
۱۰.۴۹٪	-۰.۱۳٪	۱۱,۲۰۲	۱۲,۳۹۳	۱۲,۳۷۷	شاخص قیمت (هم وزن)
-۸.۳۷٪	-۱.۳۴٪	۳,۳۸۱	۳,۱۴۰	۳,۰۹۸	شاخص ۳۰ شرکت بزرگ
-۱.۳۳٪	-۰.۳۹٪	۶۶,۹۹۴	۶۶,۳۵۷	۶۶,۱۰۰	شاخص صنعت
-۶.۷۳٪	-۰.۸۵٪	۳,۲۵۴	۳,۰۶۱	۳,۰۳۵	شاخص ۵۰ شرکت فعال‌تر
۸.۵۶٪	۲.۵۸٪	۸۰۶	۸۵۳	۸۷۵	شاخص کل فرابورس

معاملات حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس



حجم و ارزش معاملات

تاریخ		درصد تغییرات		
بورس	نوع	اسفندماه ۱۳۹۵	بهمن ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
بورس تهران	حجم معامله - هزار سهم	۳۵,۹۸۱,۸۹۰	۲۰,۲۶۷,۳۹۲	۷۷.۵۴٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۸۱,۱۵۳	۴۴,۹۸۸	۸۰.۳۹٪
فرابورس ایران	حجم معامله - هزار سهم	۷,۲۳۵,۱۴۶	۴,۴۷۱,۳۷۷	۶۱.۸۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵۲,۰۰۸	۶۶,۲۸۵	-۲۱.۵۴٪
بورس کالا	حجم معامله - تن	۲,۲۶۰,۰۴۹	۱,۷۹۲,۴۴۹	۲۶.۰۹٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۵,۵۳۸	۳۲,۷۴۵	۸.۵۳٪
بورس انرژی	حجم معامله - (تن - مگاوات)	۱,۵۱۵,۲۹۰	۴۵۶,۳۴۴	۳۳۲.۰۵٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۶,۲۳۸	۴,۲۱۳	۴۸.۰۷٪
مجموع ارزش معاملات بورس ها		۱۷۴,۹۳۷	۱۴۸,۲۳۱	۱۸.۰۳٪

مانده اوراق بدهی منتشره در اسفندماه ۱۳۹۵

میلیارد ریال				
نوع اوراق	پایان اسفندماه ۹۵	درصد از کل	پایان سال ۹۴	درصد از کل
مشارکت	۵۰,۰۰۰	۱۵.۰۴٪	۵۰,۰۰۰	۲۸.۲۸٪
اجاره	۴۹,۰۰۰	۱۴.۷۴٪	۵۰,۰۰۰	۲۸.۳٪
سلف	۰	۰	۰	۰٪
مربحه	۲۰,۰۰۰	۶.۰۱٪	۰	۰٪
اسناد خزانه اسلامی	۷۵,۰۰۰	۲۲.۵۵٪	۴۰,۰۰۰	۲۲.۶۲٪
معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری ها و دولت	۴۷,۹۹۵	۱۴.۴۳٪	۲۶,۳۹۵	۱۴.۹۳٪
جمع اوراق بهادار دولتی	۲۴۱,۹۹۵	۷۲.۷۷٪	۱۲۱,۳۹۵	۶۸.۶۶٪
انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی	۹۰,۵۳۳	۲۷.۲۳٪	۵۵,۴۲۰	۳۱.۳۴٪
جمع کل بازار اوراق بدهی	۳۳۲,۵۲۸	۱۰۰٪	۱۷۶,۸۱۵	۱۰۰٪

انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی

میلیارد ریال			
نوع بازار	عنوان	عملکرد ۱۲ ماهه ۱۳۹۵	عملکرد ۹۴
انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	انتشار اوراق بهادار بدهی با مجوز سازمان بورس	۱۶,۵۹۸	۹,۶۷۵
	انتشار اوراق سلف موازی استاندارد	۳۷,۹۸۹	۱۰,۸۲۷
	اوراق مشارکت دولت، شهرداری ها و بانک ها	۲۴,۰۰۰	۱۳,۴۹۲
	گواهی سپرده سرمایه گذاری عام و خاص	۳۱,۰۰۰	۰
	اوراق مشارکت شرکت ملی نفت	۰	۵۰,۰۰۰
	اوراق اجاره دولتی	۲۲,۵۰۰	۵,۰۰۰
	اوراق مربحه دولتی	۲۰,۰۰۰	۰
	اسناد خزانه اسلامی	۱۳۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
	امتیاز تسهیلات مسکن	۱۰,۲۹۳	۹,۰۲۰
	جمع	۲۹۲,۳۸۰	۱۴۸,۰۱۴

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 جداولی که فاقد منبع هستند از پایگاه آمار و اطلاعات سازمان بورس اوراق بهادار 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
 - ارزش تجمعی معاملات بورس و فرابورس
 - 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
- ✓ تعداد نمادها
 - آمار عرضه اولیه
- ✓ 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

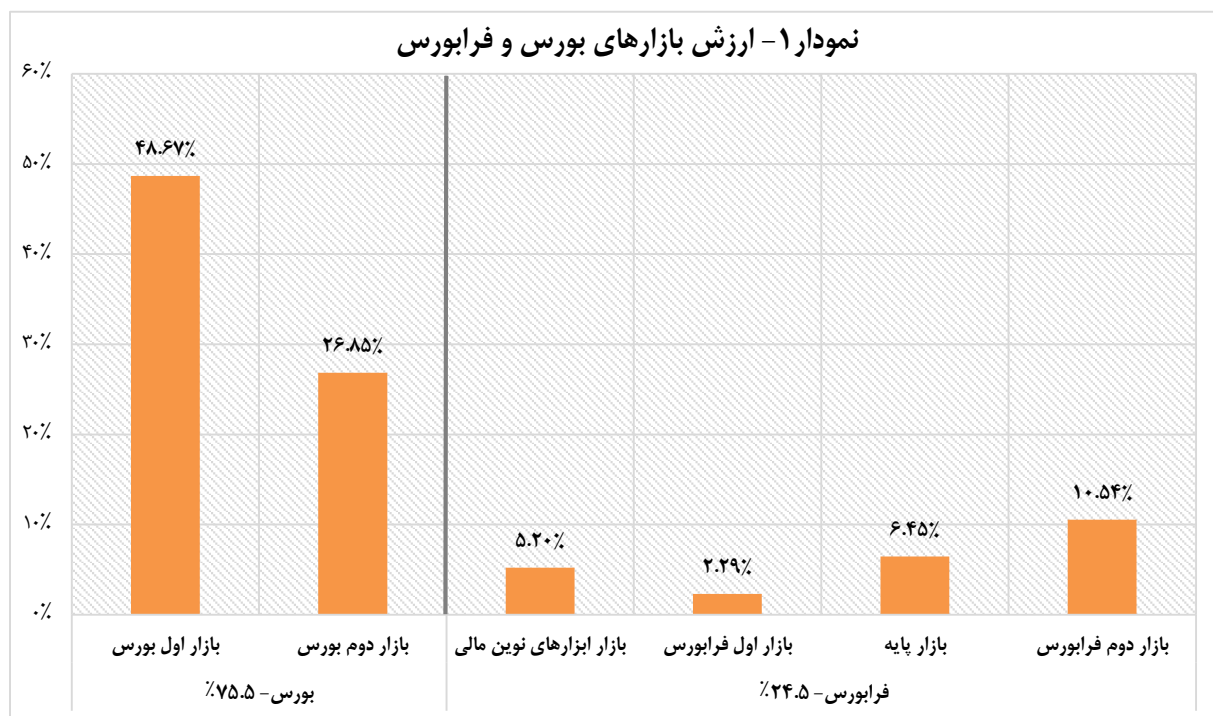
ارزش کل بازار به تفکیک بازارها

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

میلیارد ریال

نوع بازار		ارزش بازار			درصد تغییرات	
بورس تهران	بازار اول	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ابتدای سال ۹۵
	بازار دوم	۱،۱۴۴،۷۲۴	۱،۱۳۰،۵۳۹	۱،۱۵۸،۰۵۴	۱.۲۵٪	-۱.۱۵٪
	مجموع	۳،۲۲۰،۰۴۶	۳،۲۵۴،۹۱۹	۳،۴۶۱،۷۷۴	-۱.۰۷٪	-۶.۹۸٪
	فرابورس ایران	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ابتدای سال ۹۵
	بازار ابزارهای نوین مالی	۲۲۱،۷۸۰	۲۰۷،۹۲۲	۱۱۲،۳۰۳	۶۶۷٪	۹۷.۴۸٪
فرابورس ایران	بازار اول	۹۷،۶۹۵	۹۰،۹۰۰	۱۱۷،۸۰۹	۷.۴۷٪	-۱۷.۰۷٪
	بازار دوم	۴۴۹،۳۳۰	۴۴۲،۶۳۱	۴۶۹،۳۹۱	۱.۵۱٪	-۴.۳۷٪
	بازار پایه	۲۷۴،۸۳۸	۲۵۶،۹۸۵	۲۶۶،۹۱۹	۶.۹۵٪	۲.۹۷٪
	مجموع	۱،۰۴۳،۶۴۳	۹۹۸،۴۳۹	۹۶۶،۴۲۳	۴.۵۳٪	۷.۹۹٪
	مجموع کل	۴،۲۶۳،۶۸۹	۴،۲۵۳،۳۵۸	۴،۴۲۸،۱۹۷	۰.۲۴٪	-۳.۷۲٪

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



ارزش بازارها به تفکیک صنایع

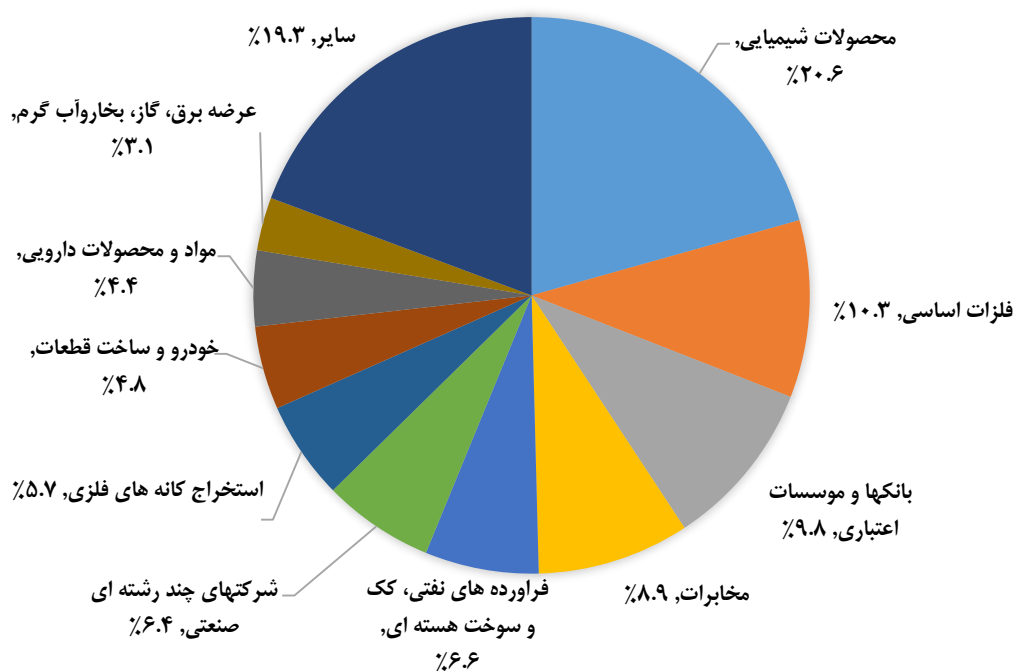
بورس اوراق بهادار تهران

در جدول زیر ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش بازار در بورس اوراق بهادار تهران در تاریخ ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

۱۳۹۴/۱۲/۲۹		۱۳۹۵/۱۱/۳۰		۱۳۹۵/۱۲/۲۸		نام نوع صنعت
درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	
۲۱.۹٪	۷۵۹.۷۳۹	۲۰.۴٪	۶۶۲.۴۹۶	۲۰.۶٪	۶۶۴.۴۷۲	محصولات شیمیایی
۷.۷٪	۲۶۵.۵۷۷	۱۰.۵٪	۳۴۱.۸۷۴	۱۰.۳٪	۳۳۱.۵۵۷	فلزات اساسی
۱۲.۱٪	۴۱۷.۳۶۵	۱۰.۰٪	۳۲۵.۴۹۷	۹.۸٪	۳۱۵.۱۷۶	بانکها و مؤسسات اعتباری
۸.۳٪	۲۸۷.۰۵۴	۸.۴٪	۲۷۴.۷۸۰	۸.۹٪	۲۸۵.۰۶۴	مخابرات
۵.۹٪	۲۰۳.۰۱۸	۶.۳٪	۲۰۵.۶۲۶	۶.۶٪	۲۱۲.۸۰۱	فراوردههای نفتی، کک و سوخت هسته‌ای
۷.۵٪	۲۵۸.۲۱۱	۶.۶٪	۲۱۴.۵۸۹	۶.۴٪	۲۰۷.۶۳۲	شرکتهای چند رشته‌ای صنعتی
۴.۴٪	۱۵۲.۰۷۶	۵.۸٪	۱۸۷.۶۳۹	۵.۷٪	۱۸۳.۸۱۰	استخراج کانه های فلزی
۶.۹٪	۲۳۷.۳۹۶	۵.۱٪	۱۶۶.۱۱۳	۴.۸٪	۱۵۵.۹۲۷	خودرو و ساخت قطعات
۳.۷٪	۱۲۷.۷۷۷	۴.۳٪	۱۳۸.۷۲۸	۴.۴٪	۱۴۱.۵۰۷	مواد و محصولات دارویی
۲.۸٪	۹۵.۵۴۱	۲.۹٪	۹۴.۶۱۳	۳.۱٪	۹۹.۵۳۱	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم
۸۱٪	۲,۸۰۳,۶۵۵	۸۰.۲٪	۲,۶۱۱,۹۵۴	۸۰.۷٪	۲,۵۹۷,۴۷۸	مجموع
۱۹٪	۶۵۸,۱۲۰	۱۹.۸٪	۶۴۲,۹۶۵	۱۹.۳٪	۶۲۲,۵۶۸	سایر
۱۰۰٪	۳,۴۶۱,۷۷۴	۱۰۰٪	۳,۲۵۴,۹۱۹	۱۰۰٪	۳,۲۲۰,۰۴۶	مجموع کل

نمودار ۲- ارزش صنایع بورسی



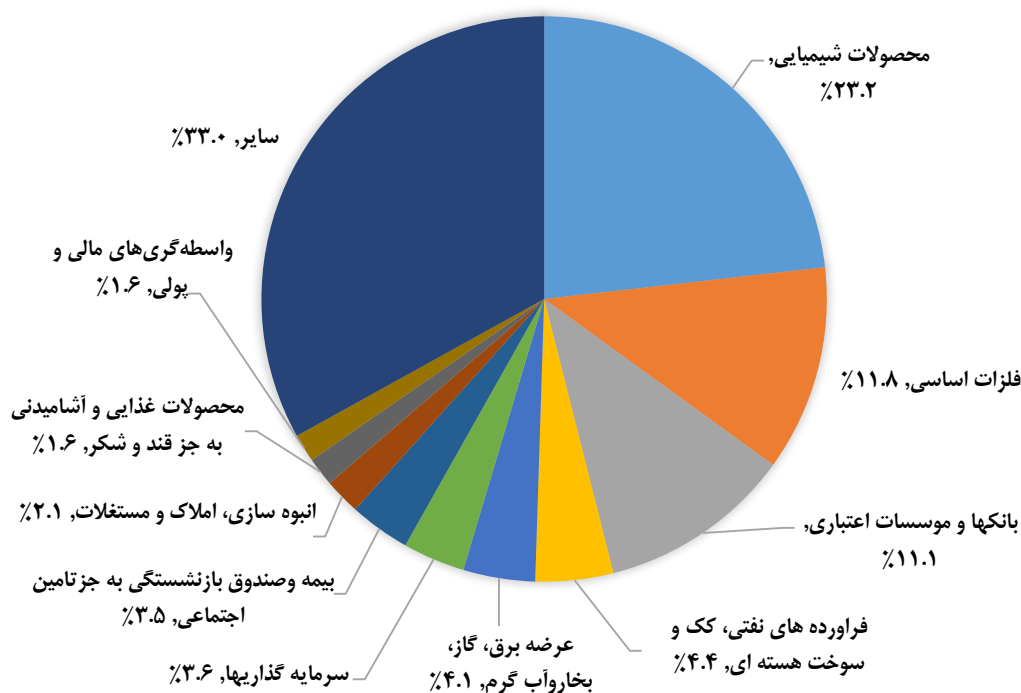
فراپورس ایران

در جدول زیر ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش بازار در فراپورس ایران در تاریخ ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ 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	۲۴۲،۱۹۱	۲۳.۲٪	۲۴۰،۹۷۰	۲۴.۱٪	۲۵۷،۹۷۹	۲۶.۷٪
فلزات اساسی	۱۲۲،۸۲۶	۱۱.۸٪	۱۱۴،۳۳۹	۱۱.۵٪	۱۱۵،۰۷۷	۱۱.۹٪
بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۱۵،۶۴۱	۱۱.۱٪	۱۱۱،۴۴۱	۱۱.۲٪	۱۳۱،۸۳۲	۱۳.۶٪
فراوردههای نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۴۶،۴۳۳	۴.۴٪	۴۲،۷۵۳	۴.۳٪	۷۷،۵۸۶	۸.۰٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۴۲،۹۱۹	۴.۱٪	۴۲،۲۲۹	۴.۲٪	۴۷،۶۷۴	۴.۹٪
سرمایه‌گذاری‌ها	۳۷،۰۶۷	۳.۶٪	۳۴،۲۴۳	۳.۴٪	۳۴،۵۰۰	۳.۶٪
بیمه و صندوق بازنشتی به جز تامین اجتماعی	۳۶،۲۹۱	۳.۵٪	۳۵،۶۸۱	۳.۶٪	۳۲،۲۴۷	۳.۳٪
انبوه‌سازی، املاک و مستغلات	۲۱،۵۷۷	۲.۱٪	۲۱،۴۴۱	۲.۱٪	۲۲،۴۴۹	۲.۳٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۷،۱۷۰	۱.۶٪	۱۷،۱۵۹	۱.۷٪	۱۲،۶۰۲	۱.۳٪
واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۱۶،۷۰۱	۱.۶٪	۱۵،۷۹۶	۱.۶٪	۱۴،۱۱۰	۱.۵٪
مجموع	۶۹۸،۸۱۵	۶۷٪	۶۷۶،۰۵۲	۶۷.۷٪	۷۴۶،۰۵۶	۷۷.۲٪
سایر	۳۴۴،۸۲۸	۳۳٪	۳۲۲،۳۸۷	۳۲.۳٪	۲۲۰،۳۶۷	۲۲.۸٪
مجموع کل	۱،۰۴۳،۶۴۳	۱۰۰٪	۹۹۸،۴۳۹	۱۰۰٪	۹۶۶،۴۲۳	۱۰۰٪

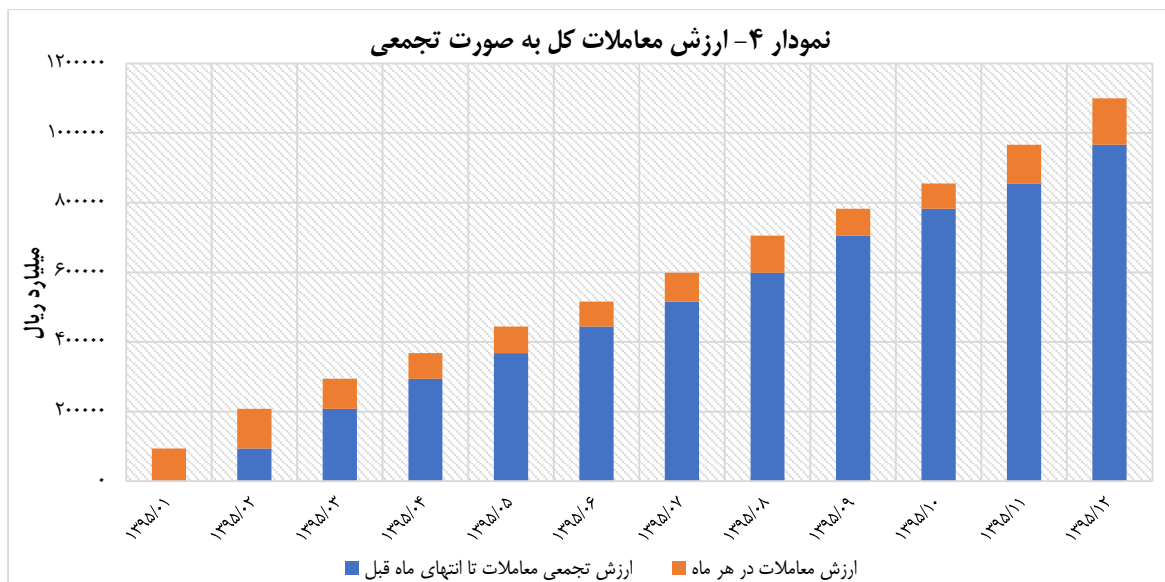
نمودار ۳- ارزش صنایع فراپورس ایران



آمار معاملات

ارزش تجمعی معاملات بورس و فرابورس

در نمودار (۴) ارزش معاملات در کلیه بازارها از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا انتهای اسفندماه ۱۳۹۵ به صورت تجمعی آورده شده است. قسمت نارنجی رنگ، ارزش معاملات انجام شده در هر ماه را نشان می دهد و قسمت آبی رنگ نشان دهنده ارزش تجمعی معاملات انجام شده تا انتهای ماه قبل است.



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

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

نوع بازار	تاریخ	درصد تغییرات	
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمن ماه ۱۳۹۵
عمده	تعداد معامله	۳۵	۰
	حجم معامله - هزار سهم	۹۰,۹۳,۷۷۱	۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۰,۲۰۸	۰
بلوک	تعداد معامله	۳۴۹	۴۵۹
	حجم معامله - هزار سهم	۸,۷۶۲,۹۸۵	۳,۹۷۶,۷۷۶
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۴,۶۱۳	۱۴,۰۵۷
نرمال	تعداد معامله	۱۰,۴۷,۱۱۳	۱۰,۲۰,۳۲۱
	حجم معامله - هزار سهم	۱۸,۱۲۵,۱۳۴	۱۶,۲۹۰,۶۱۶
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۶,۳۳۲	۳۰,۹۳۰
مجموع	تعداد معامله	۱۰,۴۷,۴۹۷	۱۰,۲۰,۳۶۹
	حجم معامله - هزار سهم	۳۵,۹۸۱,۸۹۰	۲۰,۲۶۷,۳۹۲
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۸۱,۱۵۳	۴۴,۹۸۸
میانگین روزانه	تعداد معامله	۵۲,۳۷۵	۵۷,۳۱۸
	حجم معامله - هزار سهم	۱۰,۷۹۹,۰۹۵	۹۶۵,۱۱۴
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴,۰۵۸	۲,۱۴۲

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

نوع بازار	تاریخ	درصد تغییرات	
		بهمن ماه ۱۳۹۵	نسبت به ماه قبل
حجم معامله - هزار سهم	بازار اوراق بدهی	۴,۳۳۴	-۴۱,۸۷٪
	بازار اوراق مشتقه	۳,۰۳۷,۷۰۵	۸۲۱۷,۴۹٪
	بازار اول	۱۹,۸۲۹,۸۵۶	۸۲,۸۷٪
	بازار دوم	۱۲,۹۷۷,۷۹۸	۴۰,۵۹٪
	بازار ETF	۱۴۲,۲۰۷	-۴,۵۰٪
ارزش معامله - میلیارد ریال	بازار اوراق بدهی	۴,۳۳۵	-۴۱,۷۹٪
	بازار اوراق مشتقه	۴	۱۳,۴۸٪
	بازار اول	۵۳,۳۳۲	۱۹۴,۲۸٪
	بازار دوم	۲۲,۴۸۷	۲۱,۵۰٪
	بازار ETF	۱,۰۹۶	۱۶,۴۸٪
تعداد معامله	بازار اوراق بدهی	۲,۴۷۸	-۱۴,۳۷٪
	بازار اوراق مشتقه	۱۵۴	-۷۶,۸۴٪
	بازار اول	۵۰,۸۰۱,۸۱۱	-۱۱,۹۳٪
	بازار دوم	۵۳۱,۴۵۵	-۱۴,۱۲٪
	بازار ETF	۵,۲۳۹	۲۳,۹۱٪
مجموع	حجم معامله - هزار سهم	۳۵,۹۸۱,۸۹۰	۷۷,۵۴٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۸۱,۱۵۳	۸۰,۳۹٪
	تعداد معامله	۱,۰۴۷,۴۹۷	-۱۲,۹۷٪
میانگین روزانه	حجم معامله - هزار سهم	۱,۷۹۹,۰۹۵	۸۶,۴۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴,۰۵۸	۸۹,۴۱٪
	تعداد معامله	۵۲,۳۷۵	-۸,۶۲٪

✓ در ادامه روند رو به رشد حجم معاملات در بازار اوراق مشتقه در بهمن ماه، در اسفندماه ۹۵ نیز با انجام معاملات اختیار فرید و فروش سهام شرکت ملی صنایع مس ایران، شرکت فولاد مبارکه اصفهان و شرکت ایران خودرو و همچنین معاملات اوراق اختیار فروش تبعی شرکت پتروشیمی جم "جم ۵۱۲"، اوراق اختیار فروش تبعی شرکت سرمایه گذاری نفت و گاز پتروشیمی تأمین "هیپکو ۶۰۶" و عرضه اوراق اختیار فروش تبعی سهام شرکت مخابرات ایران "هفاب ۶۱۳" شاهد رشد چشمگیر حجم معاملات در این بازار می باشیم.

✓ حجم معاملات در بازار اول و دوم بورس اوراق بهادار تهران در اسفندماه ۹۵، به ترتیب ۸۲,۹ و ۴۰,۶ درصد افزایش داشته است به طوری که در بازار اول بورس اوراق بهادار تهران حجم معاملات در پایان اسفندماه ۹۵ به ۱۹,۸۲۹,۸۵۶ هزار سهم رسید.

✓ ارزش معاملات در تمامی بازارهای بورس اوراق بهادار تهران بجز بازار اوراق بدهی در اسفندماه ۹۵ افزایش داشته است.

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

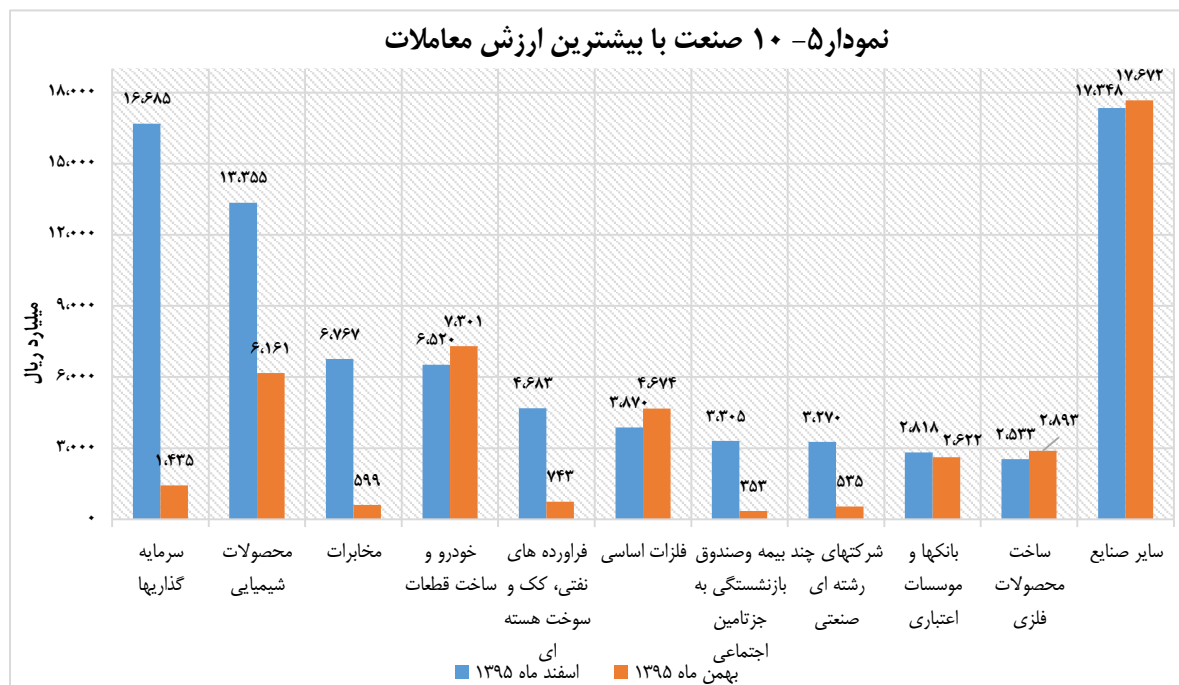
نوع اوراق بهادار	تاریخ		درصد تغیی برات نسبت به ماه قبل
	اسفندماه ۱۳۹۵	بهمن ماه ۱۳۹۵	
اوراق صکوک	تعداد معامله	۱,۷۱۸	۱,۸۰۰
	حجم معامله - هزار سهم	۸۸۰	۲,۸۳۹
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۸۸۳	۲,۸۷۶
اوراق مشارکت	تعداد معامله	۵۲۳	۶۲۱
	حجم معامله - هزار سهم	۳,۳۹۰	۴,۵۱۳
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳,۳۹۹	۴,۴۸۵
اوراق گواهی سپرده	تعداد معامله	۲۳۷	۴۷۳
	حجم معامله - هزار سهم	۵۳	۸۶
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵۳	۸۶
اختیار خرید	تعداد معامله	۶۴	۱۶۴
	حجم معامله - هزار سهم	۰.۴۷	۴
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱	۳
اختیار فروش	تعداد معامله	۱	۸
	حجم معامله - هزار سهم	۰.۰۸	۰.۱۸
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۰.۰۴	۰.۱۴
اختیار فروش تبعی	تعداد معامله	۸۹	۴۹۳
	حجم معامله - هزار سهم	۳,۰۲۷,۷۰۴	۳۶,۳۹۷
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳.۰۳	۰.۳۲
حق تقدم بورس	تعداد معامله	۲۵,۷۹۴	۹۹,۴۳۸
	حجم معامله - هزار سهم	۴,۱۷۵,۲۴۱	۴۶,۲۷,۳۳۷
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵۱۳	۱,۰۴۱
سهام عادی بورس	تعداد معامله	۱,۰۱۳,۸۴۲	۱,۰۹۶,۴۵۲
	حجم معامله - هزار سهم	۲۸,۶۳۲,۴۱۳	۱۵,۴۴۷,۳۰۴
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۷۵,۲۰۵	۳۵,۵۵۶
صندوق سرمایه گذاری (ETF)	تعداد معامله	۵,۲۲۹	۴,۲۲۰
	حجم معامله - هزار سهم	۱۴۲,۲۰۷	۱۴۸,۹۱۲
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۰۹۶	۹۴۱
مجموع	تعداد معامله	۱,۰۴۷,۴۹۷	۱,۲۰۳,۶۶۹
	حجم معامله - هزار سهم	۳۵,۹۸۱,۸۹۰	۲۰,۲۶۷,۳۹۲
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۸۱,۱۵۳	۴۴,۹۸۸
میانگین روزانه	تعداد معامله	۵۲,۳۷۵	۵۷,۳۱۸
	حجم معامله - هزار سهم	۱,۷۹۹,۰۹۵	۹۶۵,۱۱۴
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴,۰۵۸	۲,۱۴۲

- ✓ حجم، ارزش و تعداد معاملات در تمامی انواع اوراق بازار بدهی شامل اوراق صکوک، مشارکت و گواهی سپرده در اسفندماه ۹۵ با کاهش همراه بوده است.
- ✓ در اسفندماه ۹۵ شاهد رشد چشمگیر حجم و ارزش معاملات سهام عادی بورس در مقایسه با بهمن ماه ۹۵ هستیم.
- ✓ در اسفندماه ۹۵، مجموع و میانگین روزانه حجم و ارزش معاملات در کلیه بازارهای بورس اوراق بهادار تهران با رشد چشمگیری همراه بوده اند. مجموع حجم و ارزش معاملات در این ماه به ترتیب ۷۷,۵ و ۸۰,۴ درصد رشد داشته اند.

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

میلیارد ریال

ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمنماه ۱۳۹۵	
۱	سرمایه‌گذاری‌ها	۱۶,۶۸۵	۱,۴۳۵	۱۰۶۲.۷۹٪
۲	محصولات شیمیایی	۱۳,۳۵۵	۶,۱۶۱	۱۱۶.۷۶٪
۳	مخابرات	۶,۷۶۷	۵۹۹	۱۰۳۰.۶۲٪
۴	خودرو و ساخت قطعات	۶,۵۲۰	۷,۳۰۱	-۱۰.۷۰٪
۵	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۴,۶۸۳	۷۴۳	۵۳۰.۲۹٪
۶	فلزات اساسی	۳,۸۷۰	۴,۶۷۴	-۱۷.۲۰٪
۷	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۳,۳۰۵	۳۵۳	۸۳۵.۳۴٪
۸	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	۳,۲۷۰	۵۳۵	۵۱۱.۵۴٪
۹	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۲,۸۱۸	۲,۶۲۲	۷.۴۹٪
۱۰	ساخت محصولات فلزی	۲,۵۳۳	۲,۸۹۳	-۱۲.۴۵٪
مجموع		۶۳,۸۰۵	۲۷,۳۱۶	۱۳۳.۵۹٪

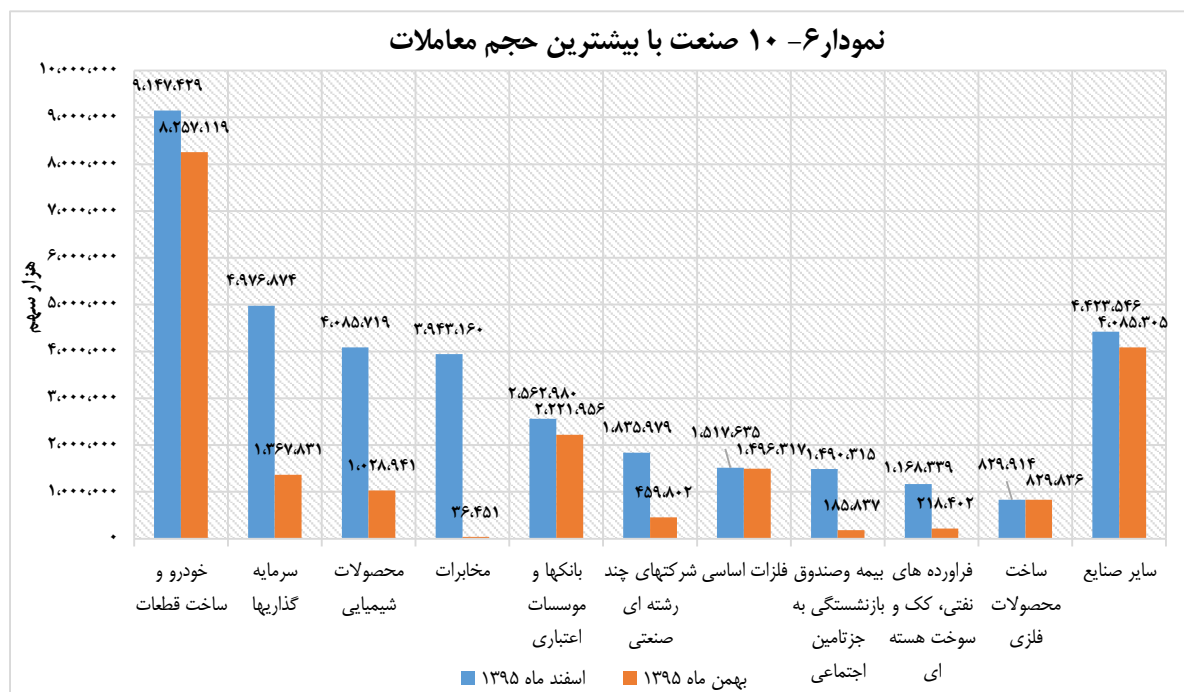


- ✓ به طور کلی ارزش معاملات در ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات نسبت به بهمن‌ماه ۹۵، ۱۳۳٫۶ درصد رشد داشته است.
- ✓ ارزش معاملات در گروه سرمایه‌گذاری با افزایش ۱۰۶۲ درصد نسبت به ماه قبل در رتبه نخست صنایع با بیشترین ارزش معاملات قرار گرفت. این در حالی است که این گروه در بهمن‌ماه ۹۵ رتبه نهم را به خود اختصاص داده بود.
- ✓ در گروه مخابرات شاهد رشد چشمگیر ۱۰۳۰ درصدی ارزش معاملات در اسفندماه ۹۵ بوده‌ایم.

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

هزار سهم

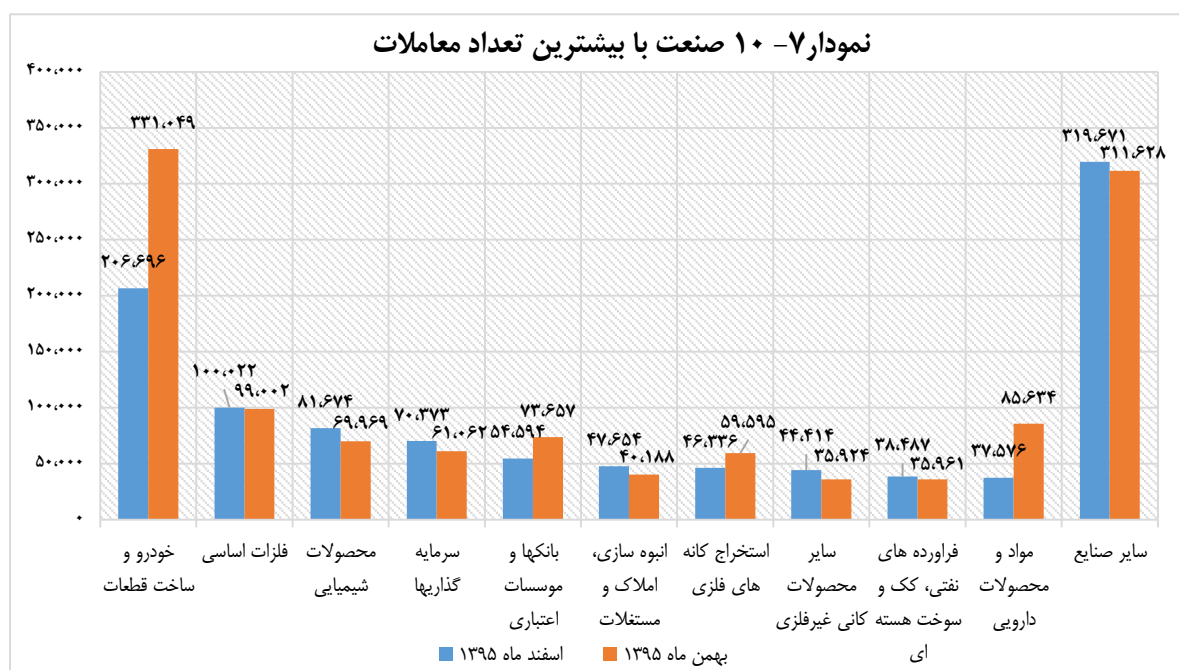
ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات نسبت به ماه قبل
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمنماه ۱۳۹۵	
۱	خودرو و ساخت قطعات	۹,۱۴۷,۴۲۹	۸,۲۵۷,۱۱۹	۱۰,۷۸٪
۲	سرمایه‌گذاری‌ها	۴,۹۷۶,۸۷۴	۱,۳۶۷,۸۳۱	۲۶۳,۸۵٪
۳	محصولات شیمیایی	۴,۰۸۵,۷۱۹	۱,۰۲۸,۹۴۱	۲۹۷,۰۸٪
۴	مخابرات	۳,۹۴۳,۱۶۰	۳۶,۴۵۱	۱۰,۷۱۷,۸۰٪
۵	بانک‌ها و مؤسسات اعتباری	۲,۵۶۲,۹۸۰	۲,۲۲۱,۹۵۶	۱۵,۳۵٪
۶	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	۱,۸۳۵,۹۷۹	۴۵۹,۸۰۲	۲۹۹,۳۰٪
۷	فلزات اساسی	۱,۵۱۷,۶۳۵	۱,۴۹۶,۳۱۷	۱,۴۲٪
۸	بیمه و صندوق بازنشتی به جز تامین اجتماعی	۱,۴۹۰,۳۱۵	۱۸۵,۸۳۷	۷۰۱,۹۵٪
۹	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۱,۱۶۸,۳۳۹	۲۱۸,۴۰۲	۴۳۴,۹۵٪
۱۰	ساخت محصولات فلزی	۸۲۹,۹۱۴	۸۲۹,۸۳۶	۰,۰۱٪
مجموع		۳۱,۵۵۸,۳۴۴	۱۶,۱۰۲,۴۹۲	۹۵,۹۸٪



- ✓ گروه خودرو و ساخت قطعات که در بهمن‌ماه ۹۵ بیشترین حجم معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران را به خود اختصاص داده بود، در اسفندماه ۹۵ نیز با بیشترین حجم معاملات در جایگاه نخست قرار گرفته است.
- ✓ حجم معاملات در گروه مخابرات، محصولات شیمیایی و سرمایه‌گذاری‌ها در اسفندماه ۹۵ با رشد بسیار بالایی نسبت به بهمن‌ماه ۹۵ همراه بوده است.

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

ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمن ماه ۱۳۹۵	
۱	خودرو و ساخت قطعات	۲۰۶,۶۹۶	۳۳۱,۰۴۹	-۳۷.۵۶٪
۲	فلزات اساسی	۱۰۰,۰۲۲	۹۹,۰۰۲	۱.۰۳٪
۳	محصولات شیمیایی	۸۱,۶۷۴	۶۹,۹۶۹	۱۶.۷۳٪
۴	سرمایه گذاری ها	۷۰,۳۷۳	۶۱,۰۶۲	۱۵.۲۵٪
۵	بانک ها و مؤسسات اعتباری	۵۴,۵۹۴	۷۳,۶۵۷	-۲۵.۸۸٪
۶	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۴۷,۶۵۴	۴۰,۱۸۸	۱۸.۵۸٪
۷	استخراج کانه های فلزی	۴۶,۳۳۶	۵۹,۵۹۵	-۲۲.۲۵٪
۸	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۴۴,۴۱۴	۳۵,۹۲۴	۲۳.۶۳٪
۹	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳۸,۴۸۷	۳۵,۹۶۱	۷.۰۲٪
۱۰	مواد و محصولات دارویی	۳۷,۵۷۶	۸۵,۶۳۴	-۵۶.۱۲٪
مجموع		۷۲۷,۸۲۶	۸۹۲,۰۴۱	-۱۸.۴۱٪



- ✓ گروه خودرو و سافت قطعات علی رغم کاهش ۳۷,۶ درصدی تعداد معاملات، همچون بهمن ماه ۹۵، بیشترین تعداد معاملات در اسفندماه ۹۵ را به خود اختصاص داده است.
- ✓ تعداد معاملات در گروه خودرو و سافت قطعات به تنهایی حدود ۲۰ درصد از کل تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران در اسفندماه ۹۵ را به خود اختصاص داده است.
- ✓ مجموع تعداد معاملات در ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در اسفندماه ۹۵، ۱۸,۴ درصد نسبت به بهمن ماه ۹۵ کاهش داشته است.

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

حجم، ارزش و تعداد معاملات در فرابورس ایران به تفکیک بخش بازار در بهمن و اسفندماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

نوع بازار	تاریخ	درصد تغییرات	
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمنماه ۱۳۹۵ نسبت به ماه قبل
عمده	تعداد معامله	۲۳	۲۱ ۹.۵٪
	حجم معامله - هزار سهم	۳,۰۹۴,۰۲۵	۷۰۸,۴۲۱ ۳۳۶.۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۹,۰۳۷	۱,۸۵۲ ۳۸۷.۹٪
بلوک	تعداد معامله	۳۰۶	۲۰۱ ۵۲.۲٪
	حجم معامله - هزار سهم	۶۳۴,۴۹۸	۲۹۲,۸۱۱ ۱۱۶.۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۹,۹۷۸	۴,۵۳۹ ۱۱۹.۸٪
نرمال	تعداد معامله	۴۳۵,۹۱۵	۷۳۳,۸۴۹ -۴۰.۶٪
	حجم معامله - هزار سهم	۳,۵۰۶,۶۲۳	۳,۴۷۰,۱۴۵ ۱.۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۲,۹۹۳	۵۹,۸۹۴ -۴۴.۹٪
مجموع	تعداد معامله	۴۳۶,۲۴۴	۷۳۴,۰۷۱ -۴۰.۶٪
	حجم معامله - هزار سهم	۷,۲۳۵,۱۴۶	۴,۴۷۱,۳۷۷ ۶۱.۸٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵۲,۰۰۸	۶۶,۲۸۵ -۲۱.۵٪
میانگین روزانه	تعداد معامله	۲۱,۸۱۲	۳۴,۹۵۶ -۳۷.۶٪
	حجم معامله - هزار سهم	۳۶۱,۷۵۷	۲۱۲,۹۲۳ ۶۹.۹٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲,۶۰۰	۳,۱۵۶ -۱۷.۶٪

- ✓ ارزش معاملات بخش نرمال در اسفندماه ۹۵ با ۴۴,۹ درصد کاهش نسبت به ماه قبل، به ۳۲,۹۹۳ میلیارد ریال رسید.
- ✓ در اسفندماه ۹۵ آمار معاملات بلوک، بر خلاف بهمنماه ۹۵ با افزایش چشمگیری همراه بوده است. به طوری که در این ماه حجم معاملات بلوک با ۱۱۶,۷ درصد افزایش به ۶۳۴,۴۹۸ هزار سهم در پایان اسفندماه ۹۵ رسید. همچنین ارزش معاملات بلوک با ۱۱۹,۸ درصد افزایش به ۹,۹۷۸ میلیارد ریال رسید.
- ✓ در مجموع ارزش و تعداد معاملات در کلیه بخش‌های بازار در فرابورس ایران، به ترتیب ۲۱,۵ و ۴۰,۶ درصد نسبت به بهمنماه ۹۵ کاهش داشته است و حجم معاملات در این ماه ۶۱,۸ درصد رشد را نشان می‌دهد.
- ✓ از مجموع ارزش معاملات در کلیه بخش‌های بازار فرابورس ایران، ۶۳,۴ درصد مربوط به ارزش معاملات نرمال، ۱۹,۲ درصد مربوط به ارزش معاملات بلوک و ۱۷,۴ درصد سهم ارزش معاملات عمده از کل ارزش معاملات در اسفندماه ۹۵ می‌باشد.

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

نام بازار	تاریخ	درصد تغییرات	
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمن ماه ۱۳۹۵
حجم معامله - هزار سهم	بازار ابزارهای نوین مالی	۱۵۰,۳۲۵	۲۰۲,۱۶۱
	بازار اول	۱,۵۱۴,۹۰۱	۵۶۵,۹۸۵
	بازار دوم	۲,۲۳۵,۷۶۰	۱,۶۷۱,۲۱۸
	بازار سوم	۳,۳۳۰,۲۸۶	۲,۰۳۰,۹۲۶
	شرکت های کوچک و متوسط	۳,۸۷۴	۱,۰۸۸
ارزش معامله - میلیارد ریال	بازار ابزارهای نوین مالی	۳۲,۷۹۰	۵۰,۵۱۷
	بازار اول	۳,۲۶۷	۹۷۶
	بازار دوم	۱۱,۴۷۴	۹,۸۰۸
	بازار سوم	۴,۴۰۶	۴,۹۲۷
	شرکت های کوچک و متوسط	۷۰	۵۷
تعداد معامله	بازار ابزارهای نوین مالی	۹۶,۱۴۵	۱۰۱,۱۸۶
	بازار اول	۷۳,۱۷۹	۶۵,۳۳۲
	بازار دوم	۲۳۲,۷۵۲	۵۵۴,۶۶۴
	بازار سوم	۳۳,۹۸۶	۱۲۸,۰۳
	شرکت های کوچک و متوسط	۱۸۲	۸۶
مجموع	حجم معامله - هزار سهم	۷,۲۳۵,۱۴۶	۴,۴۷۱,۳۷۷
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵۲,۰۰۸	۶۶,۲۸۵
	تعداد معامله	۴۳۶,۲۴۴	۷۳۴,۰۷۱
میانگین روزانه	حجم معامله - هزار سهم	۳۶۱,۷۵۷	۲۱۲,۹۲۳
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲,۶۰۰	۳,۱۵۶
	تعداد معامله	۲۱,۸۱۲	۳۴,۹۵۶

- ✓ در اسفندماه ۹۵ حجم، ارزش و تعداد معاملات در بازار ابزارهای نوین مالی در فرابورس ایران کاهش داشته است. ارزش معاملات در این بازار با ۱۷,۷۲۷ میلیارد ریال کاهش به ۳۲,۷۹۰ میلیارد ریال در اسفندماه ۹۵ رسید.
- ✓ حجم معاملات در بازار اول فرابورس ۱۶۷,۷ درصد نسبت به بهمن ماه ۹۵ افزایش داشته است. حجم معاملات در بازار دوم فرابورس نیز ۳۳,۸ درصد افزایش نسبت به ماه قبل را نشان می دهد.
- ✓ در مجموع حجم معاملات در کلیه بازارهای فرابورس ایران، رشد چشمگیر ۶۱,۸ درصدی را نسبت به بهمن ماه ۹۵ نشان می دهد. میانگین روزانه حجم معاملات نیز با رشد ۶۹,۹ درصدی در اسفندماه ۹۵ همراه بوده است.
- ✓ ارزش معاملات در کلیه بازارهای فرابورس ایران با ۲۱,۵ درصد کاهش نسبت به ماه قبل به ۵۲,۰۰۸ میلیارد ریال در اسفندماه ۹۵ رسید.

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

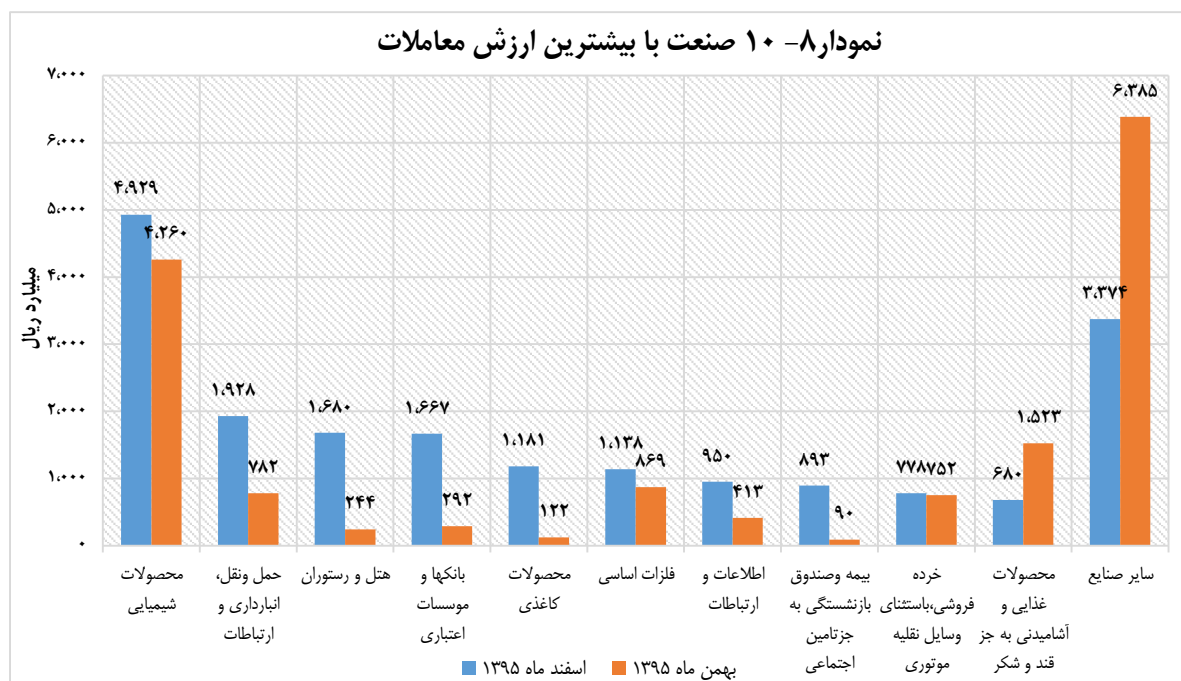
نوع اوراق بهادار	تاریخ		درصد تغییرات
	اسفندماه ۱۳۹۵	بهمن ماه ۱۳۹۵	
اوراق فرابورس	تعداد معامله	۱۷۶۰۰	۱۷،۵۵۵
	حجم معامله - هزار سهم	۳۲،۱۰۴	۴۸،۴۸۹
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۰،۷۹۷	۴۷،۳۱۸
سهام عادی فرابورس	تعداد معامله	۳۶۷،۱۵۲	۶۸۸،۵۸۲
	حجم معامله - هزار سهم	۳،۴۱۹،۳۰۹	۲۰،۸۳،۹۷۹
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۵،۰۹۴	۱۱،۷۴۱
صندوق سرمایه گذاری	تعداد معامله	۵،۸۹۲	۴،۸۷۰
	حجم معامله - هزار سهم	۱۱۷،۲۱۴	۱۵۲،۲۸۲
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱،۲۳۱	۲،۱۳۸
حق تقدم فرابورس	تعداد معامله	۱۱،۴۳۲	۱۰،۱۷۵
	حجم معامله - هزار سهم	۳۳۲،۳۵۹	۱۵۴،۶۱۴
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴۰۹	۱۰۴
شرکت های کوچک و متوسط	تعداد معامله	۱۸۲	۸۶
	حجم معامله - هزار سهم	۳،۸۷۴	۱۰،۸۸
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۷۰	۵۷
حق تقدم بازار پایه	تعداد معامله	۱۰،۷۰۱	۱۱۲
	حجم معامله - هزار سهم	۶۸۵،۰۵۰	۱۱۸،۰۳۱
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۰	۴
سهام عادی بازار پایه	تعداد معامله	۲۳،۲۸۵	۱۲،۶۹۱
	حجم معامله - هزار سهم	۲،۶۴۵،۲۳۶	۱،۹۱۲،۸۹۵
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۴،۳۹۶	۴،۹۲۳
مجموع	تعداد معامله	۴۳۶،۲۴۴	۷۳۴،۰۷۱
	حجم معامله - هزار سهم	۷،۲۳۵،۱۴۶	۴،۴۷۱،۳۷۷
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵۲،۰۰۸	۶۶،۲۸۵
میانگین روزانه	تعداد معامله	۲۱،۸۱۲	۳۴،۹۵۶
	حجم معامله - هزار سهم	۳۶۱،۷۵۷	۲۱۲،۹۲۳
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲،۶۰۰	۳،۱۵۶

- ✓ ارزش معاملات اوراق فرابورسی در اسفندماه ۹۵، ۱۶،۵۲۱ میلیارد ریال، معادل ۳۴،۹ درصد، نسبت به بهمن ماه ۹۵ کاهش یافته است. حجم معاملات اوراق فرابورسی نیز در این ماه ۳۳،۸ درصد کاهش داشته است.
- ✓ حجم و ارزش معاملات سهام عادی فرابورس در اسفندماه ۹۵ نسبت به ماه قبل افزایش داشته است. به طوری که حجم معاملات سهام عادی فرابورس مدود ۶۴،۱ درصد نسبت به ماه قبل رشد داشته است.
- ✓ آمار معاملات حق تقدم فرابورسی، حق تقدم بازار پایه و شرکت های کوچک و متوسط در اسفندماه ۹۵ رشد چشمگیری نسبت به بهمن ماه ۹۵ داشته اند.

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

میلیارد ریال

ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمنماه ۱۳۹۵	
۱	محصولات شیمیایی	۴,۹۲۹	۴,۲۶۰	۱۵.۷۱٪
۲	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱,۹۲۸	۷۸۲	۱۴۶.۴۵٪
۳	هتل و رستوران	۱,۶۸۰	۲۴۴	۵۸۸.۳۴٪
۴	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱,۶۶۷	۲۹۲	۴۷۱.۷۵٪
۵	محصولات کاغذی	۱,۱۸۱	۱۲۲	۸۶۸۸۹٪
۶	فلزات اساسی	۱,۱۳۸	۸۶۹	۳۰.۹۸٪
۷	اطلاعات و ارتباطات	۹۵۰	۴۱۳	۱۳۰.۱۱٪
۸	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۸۹۳	۹۰	۸۸۷.۴۱٪
۹	خرده فروشی، به استثنای وسایل نقلیه موتوری	۷۷۸	۷۵۲	۳.۴۶٪
۱۰	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۶۸۰	۱,۵۲۳	-۵۵.۳۵٪
مجموع		۱۵,۸۲۳	۹,۳۴۷	۶۹.۲۹٪



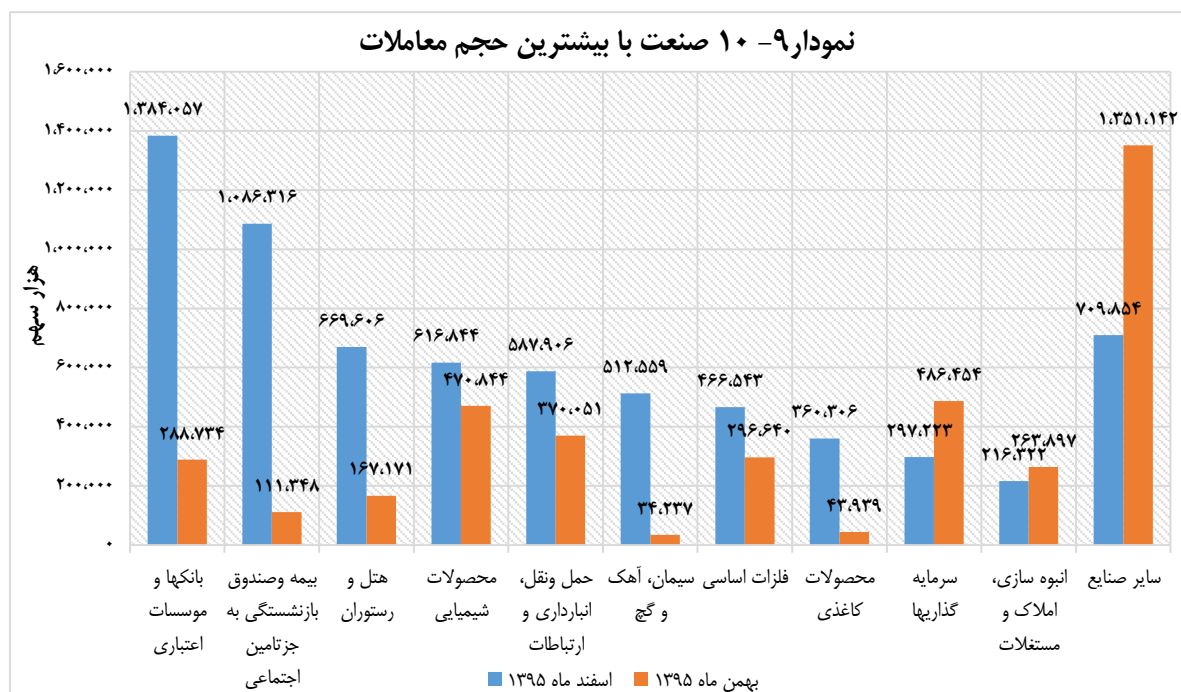
✓ گروه حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات در اسفندماه ۹۵ با ۱۴۶,۴ درصد افزایش در ارزش معاملات نسبت به بهمنماه ۹۵، در رتبه دوم صنایع با بیشترین ارزش معاملات قرار گرفته است.

✓ در ادامه رشد چشمگیر ارزش معاملات در گروه محصولات شیمیایی در بهمنماه ۹۵، در اسفندماه نیز شاهد رشد ۱۵,۷ درصدی ارزش معاملات این گروه در فرابورس ایران هستیم.

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

هزار سهم

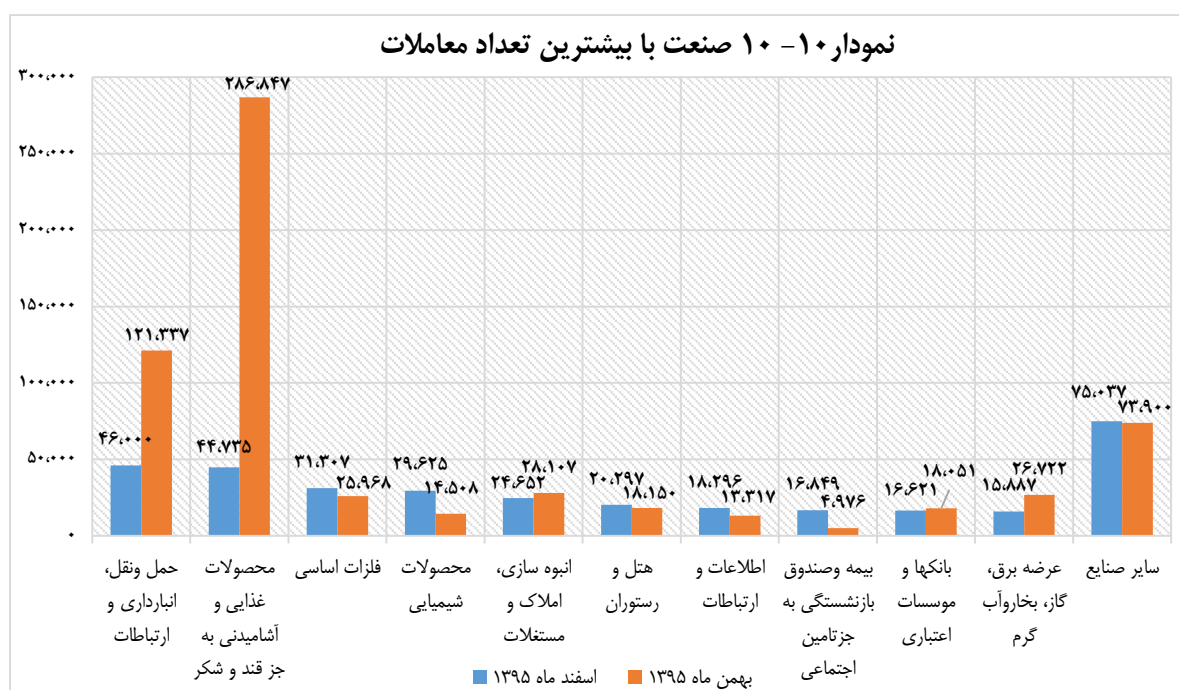
ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات نسبت به ماه قبل
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمنماه ۱۳۹۵	
۱	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱,۳۸۴,۰۵۷	۲۸۸,۷۳۴	۳۷۹,۳۵٪
۲	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۱,۰۸۶,۳۱۶	۱۱۱,۳۴۸	۸۷۵,۶۱٪
۳	هتل و رستوران	۶۶۹,۶۰۶	۱۶۷,۱۷۱	۳۰۰,۵۵٪
۴	محصولات شیمیایی	۶۱۶,۸۴۴	۴۷۰,۸۴۴	۳۱,۰۱٪
۵	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۵۸۷,۹۰۶	۳۷۰,۰۵۱	۵۸,۸۷٪
۶	سیمان، آهک و گچ	۵۱۲,۵۵۹	۳۴,۲۳۷	۱۳۹۷,۰۸٪
۷	فلزات اساسی	۴۶۶,۵۴۳	۲۹۶,۶۴۰	۵۷,۲۸٪
۸	محصولات کاغذی	۳۶۰,۳۰۶	۴۳,۹۳۹	۷۲۰,۰۲٪
۹	سرمایه گذاریها	۲۹۷,۲۲۳	۴۸۶,۴۵۴	-۳۸,۹۰٪
۱۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۱۶,۳۲۲	۲۶۳,۸۹۷	-۱۸,۰۳٪
مجموع		۶,۱۹۷,۶۸۱	۲,۵۳۳,۳۱۵	۱۴۴,۶۵٪



- ✓ در معاملات اسفندماه ۹۵ و همراه با بازگشایی تعدادی از نمادها در گروه بانکها و مؤسسات اعتباری، حجم معاملات این گروه ۳۷۹,۴ درصد افزایش داشته است.
- ✓ حجم معاملات در بازار فرابورس ایران در گروه بیمه و صندوق بازنشستگی بجز تأمین اجتماعی با رشد ۸۷۵,۶ درصدی در اسفندماه ۹۵ همراه بوده است.

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

ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات
		اسفندماه ۱۳۹۵	بهمنماه ۱۳۹۵	
۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۴۶,۰۰۰	۱۲۱,۳۳۷	-۶۲.۰۹٪
۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۴۴,۷۳۵	۲۸۶,۸۴۷	-۸۴.۴۰٪
۳	فلزات اساسی	۳۱,۳۰۷	۲۵,۹۶۸	۲۰.۵۶٪
۴	محصولات شیمیایی	۲۹,۶۲۵	۱۴,۵۰۸	۱۰۴.۲۰٪
۵	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۴,۶۵۲	۲۸,۱۰۷	-۱۲.۲۹٪
۶	هتل و رستوران	۲۰,۲۹۷	۱۸,۱۵۰	۱۱.۸۳٪
۷	اطلاعات و ارتباطات	۱۸,۲۹۶	۱۳,۳۱۷	۳۷.۳۹٪
۸	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۱۶,۸۴۹	۴,۹۷۶	۲۳۸.۶۱٪
۹	بانکها و مؤسسات اعتباری	۱۶,۶۲۱	۱۸,۰۵۱	-۷.۹۲٪
۱۰	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۵,۸۸۷	۲۶,۷۲۲	-۴۰.۵۵٪
	مجموع	۲۶۴,۲۶۹	۵۵۷,۹۸۳	-۵۲.۶۴٪



- ✓ در معاملات اسفندماه ۹۵ در فرابورس ایران، در گروه محصولات شیمیایی و گروه بیمه و صندوق بازنشستگی بجز تأمین اجتماعی شاهد رشد به ترتیب ۱۰۴ و ۲۳۹ درصدی در تعداد معاملات در مقایسه با ماه قبل هستیم.
- ✓ در مجموع تعداد معاملات در ده صنعت با بیشترین تعداد معاملات در اسفندماه ۹۵، ۵۲,۶ درصد نسبت به بهمنماه 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 اسفندماه ۹۵ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان بهمن ماه ۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

بازار		سال ۹۴		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا انتهای اسفندماه ۹۵		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا انتهای بهمن ماه ۹۵		درصد تغییرات یک ماهه	
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	۳،۲۰۲،۲۴۲	۳۹۰،۲۴۱	۲،۹۶۵،۴۶۴	۳۵۸،۵۶۱	۷،۹۸٪	۸،۸۴٪		

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 اسفندماه ۹۵ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان بهمن ماه ۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

گروه کالا		سال ۹۴		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا انتهای اسفندماه ۹۵		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا انتهای بهمن ماه ۹۵		درصد تغییرات یک ماهه	
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	۲،۵۱۰،۱۱۴	۲۸،۱۱۳	۲،۳۰۷،۲۱۸	۲۶،۱۳۹	۸،۷۹٪	۷،۵۵٪		
۹،۸۳۱،۰۴۵	۱۲۸،۴۲۳	۹،۳۹۳،۰۳۵	۱۵۶،۷۹۶	۸،۷۳۴،۵۴۹	۱۴۲،۸۳۳	۷،۵۴٪	۹،۷۸٪		
۱۲،۵۵۳،۷۱۴	۱۵۸،۵۵۸	۱۳،۴۵۶،۹۰۶	۱۸۴،۶۱۶	۱۲،۰۷۲،۱۴۶	۱۶۵،۱۶۴	۱۱،۴۷٪	۱۱،۷۸٪		
۲۶،۶۵۱	۱۹۴	۱۱۴،۹۱۴	۱،۴۸۳	۱۰۱،۰۰۶	۱،۳۳۵	۱۳،۷۷٪	۱۱،۰۸٪		
۲۳،۱۷۵،۰۹۹	۲۹۶،۵۷۰	۲۵،۴۷۴،۹۶۹	۳۷۱،۰۰۸	۲۳،۲۱۴،۹۲۰	۳۳۵،۴۷۰	۹،۷۴٪	۱۰،۵۹٪		

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 اسفندماه ۹۵ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان بهمن ماه ۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

بازار		سال ۹۴		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا انتهای اسفندماه ۹۵		انباشته از ابتدای سال ۹۵ تا انتهای بهمن ماه ۹۵		درصد تغییرات یک ماهه	
واحد	حجم معاملات	ارزش معاملات	حجم 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)
تن	۱۹،۷۴،۵۸۶	۱۹،۷۲۷	۱،۹۱۲،۱۵۲	۲۳،۲۰۴	۱،۷۶۴،۲۵۸	۸،۳۸٪	۱۰،۳۹٪		
برق MW	۸۹۵،۳۲۰	۷،۳۱۰	۷۶۴،۴۱۳	۴،۱۵۸	۷۵۳،۲۷۶	۱،۴۸٪	۴،۲۶٪		
تن	۱۸۸،۲۰۸	۱،۹۸۹	۴،۹۳۶،۹۰۹	۱۴،۹۴۳	۳،۵۸۰،۶۵۰	۳۷،۸۸٪	۳۵،۱۲٪		
مجموع	۳،۰۵۸،۱۱۴	۲۹،۰۲۶	۷،۶۱۳،۴۷۴	۴۲،۳۰۵	۶،۰۹۸،۱۸۴	۲۴،۸۵٪	۱۷،۳۰٪		

منبع: اداره امور بورس و بازارها

سرمایه‌گذاران خارجی

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

اسفندماه ۱۳۹۵		بهمن‌ماه ۱۳۹۵			
نوع سهامدار	تعداد کدها	ارزش سبد (میلیارد ریال)	تعداد کدها	ارزش سبد (میلیارد ریال)	درصد رشد ارزش سبد
حقیقی	۵۴۶	۳۳۵	۵۳۹	۳۳۵	۰,۰٪
حقوقی	۲۶۷	۱۲۲۰۳	۲۵۱	۱۱۶۶۵	۴,۶٪
مجموع	۸۱۳	۱۲۵۳۸	۷۹۰	۱۲۰۰۰	۴,۵٪

منبع: حوزه ریاست

تعداد نمادها

تعداد نمادهای پذیرفته‌شده در بازارهای مختلف در پایان اسفندماه ۱۳۹۵ و تغییرات آن نسبت به ماه قبل در جدول زیر نشان داده شده است.

اسفندماه ۱۳۹۵		بهمن‌ماه ۱۳۹۵
نام بازار	تعداد نمادها	تعداد نمادها
بورس اوراق بهادار تهران	۳۲۵	۳۲۶
فرا بورس ایران	۸۷	۸۷
بازار پایه فرا بورس ایران	۱۵۲	۱۵۲

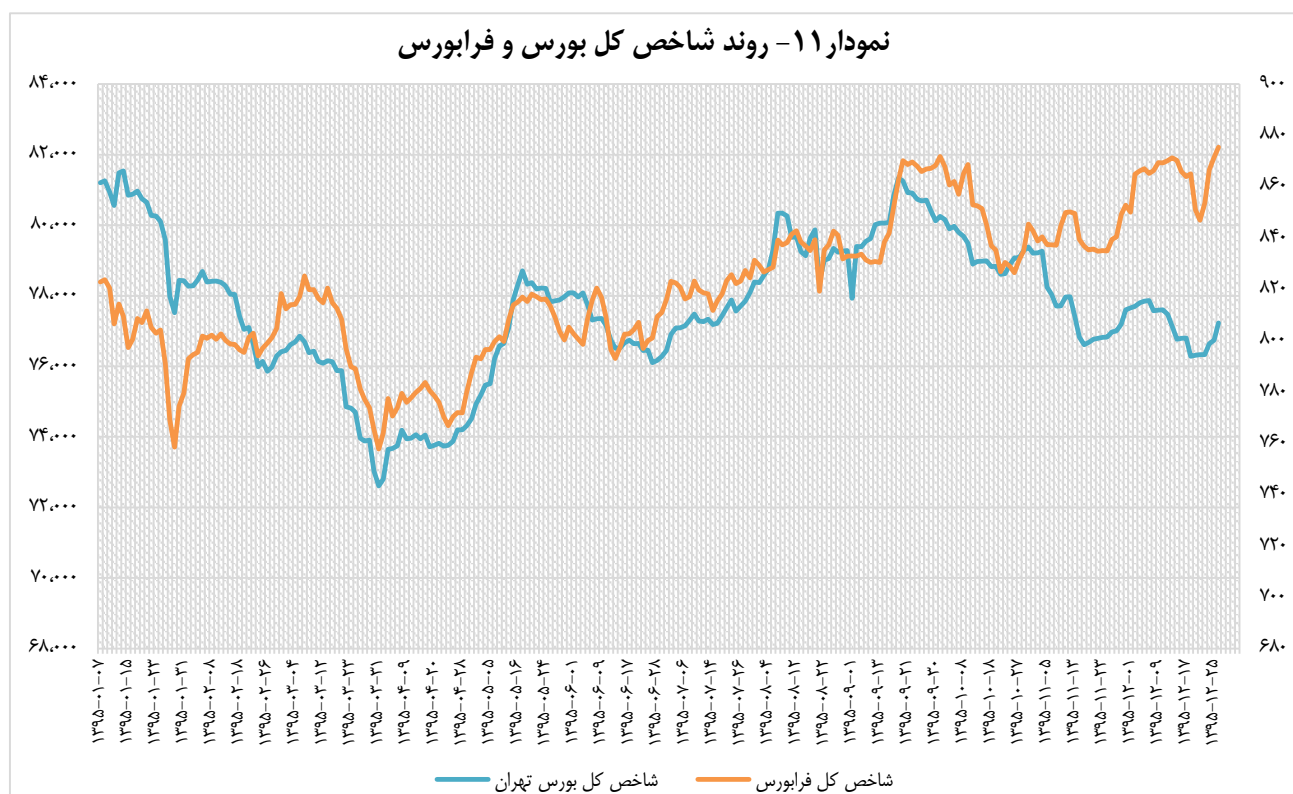
* نماد کاصفا در اسفندماه ۹۵ از بازار بورس به بازار پایه فرا بورس منتقل شده است.

شاخص‌های بازار سرمایه

شاخص‌های بازار سرمایه شامل شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ و تغییرات آن نسبت به ماه قبل و همچنین پایان اسفند ۱۳۹۴ در جدول زیر نشان داده شده است.

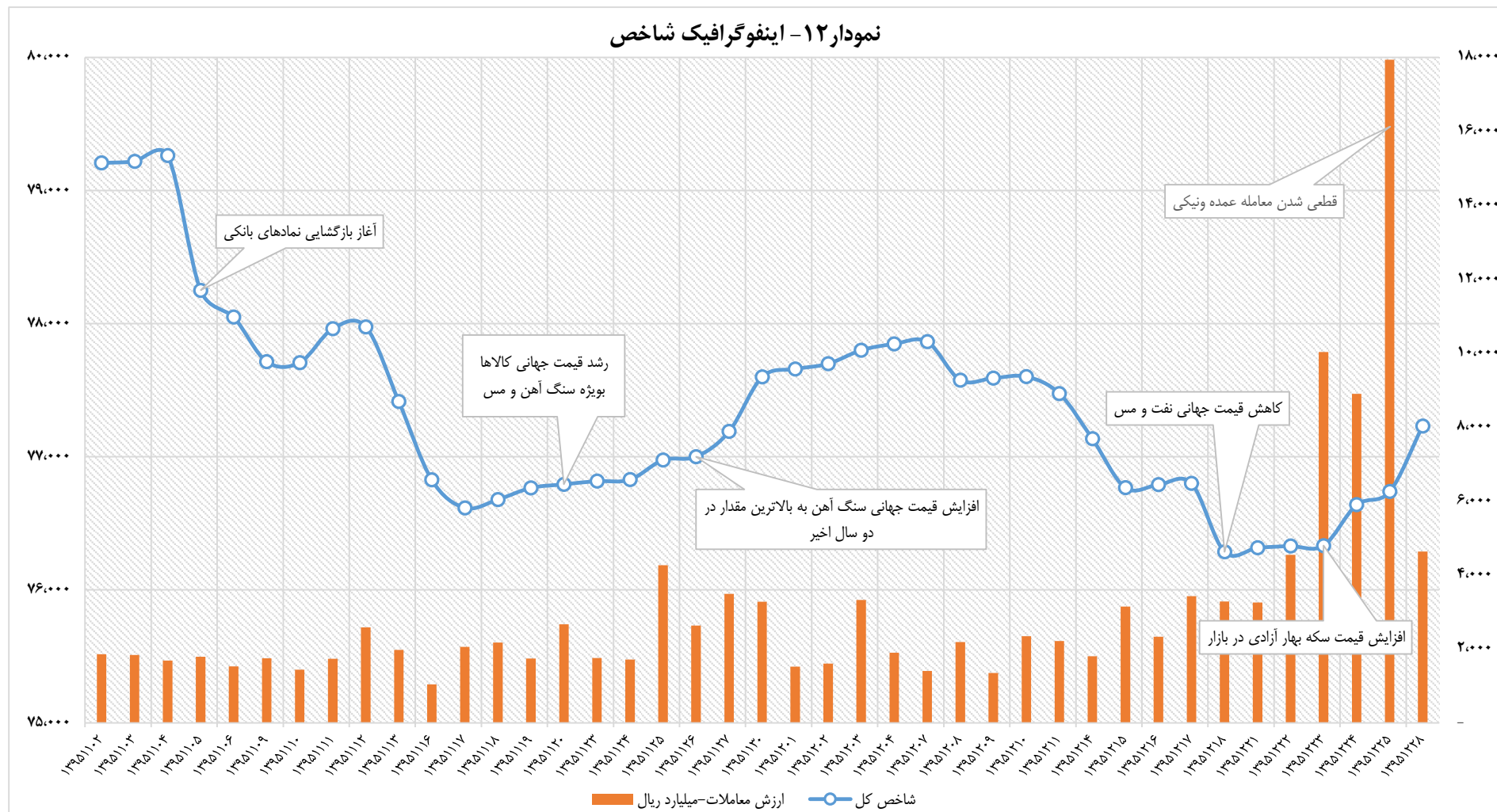
نام بورس	نام شاخص	تاریخ			درصد تغییرات	
		۱۳۹۴/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	نسبت به ماه قبل	نسبت به ابتدای سال
بورس اوراق بهادار تهران	شاخص کل بورس تهران	۸۰,۲۱۹	۷۷,۵۹۹	۷۷,۲۳۰	-۰.۴۸٪	-۳.۷۳٪
	شاخص کل (هم وزن)	۱۳,۳۵۷	۱۵,۶۵۱	۱۵,۷۲۳	۰.۴۶٪	۱۷.۷۱٪
	شاخص قیمت	۳۰,۵۱۱	۲۷,۱۲۴	۲۶,۸۲۶	-۱.۱۰٪	-۱۲.۰۸٪
	شاخص قیمت (هم وزن)	۱۱,۲۰۲	۱۲,۳۹۳	۱۲,۳۷۷	-۰.۱۳٪	۱۰.۴۹٪
	شاخص ۳۰ شرکت بزرگ	۳,۳۸۱	۳,۱۴۰	۳,۰۹۸	-۱.۳۳٪	-۸.۳۷٪
	شاخص صنعت	۶۶,۹۹۴	۶۶,۳۵۷	۶۶,۱۰۰	-۰.۳۹٪	-۱.۳۳٪
	شاخص ۵۰ شرکت فعال‌تر	۳,۲۵۴	۳,۰۶۱	۳,۰۳۵	-۰.۸۵٪	-۶.۷۵٪
فرابورس ایران	شاخص کل فرابورس	۸۰۶	۸۵۳	۸۷۵	۲.۵۸٪	۸.۵۶٪

روند شاخص کل بورس و فرابورس در بازه زمانی ۱۳۹۵/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ در نمودار (۱۱) نشان داده شده است.



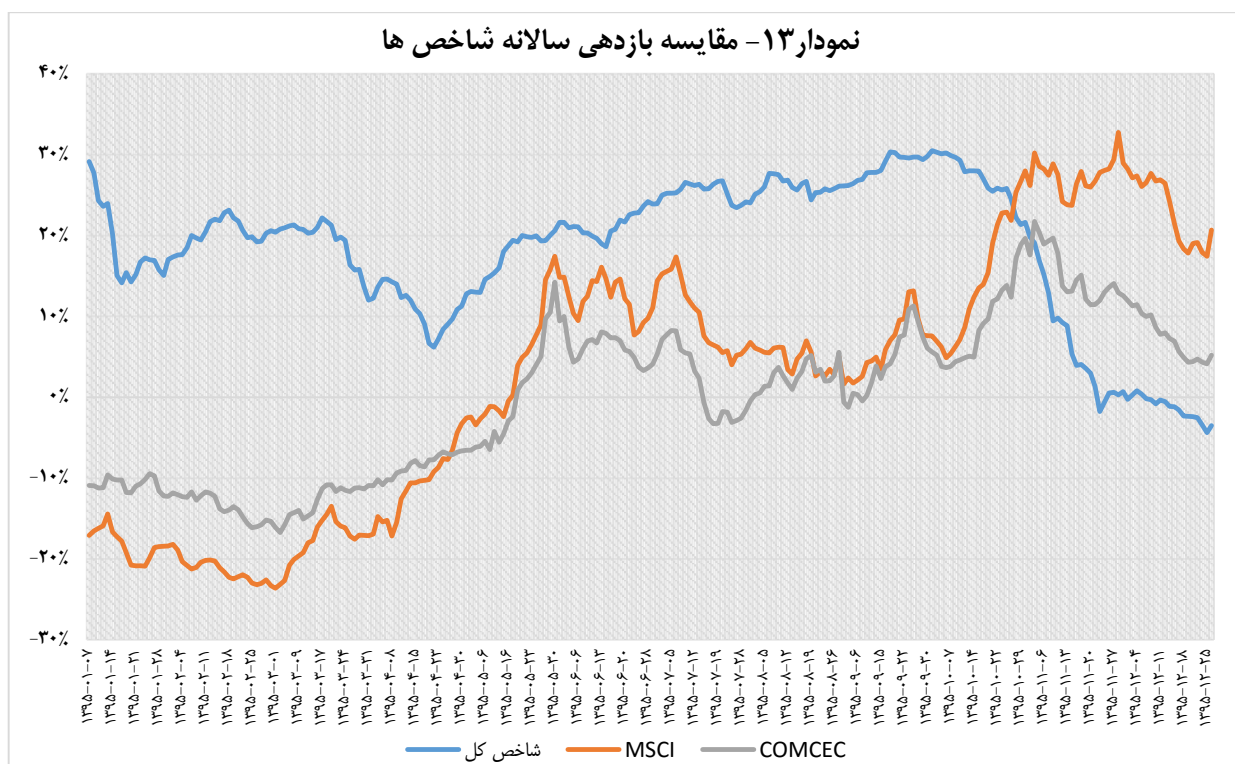
اینفوگرافیک شاخص

نمودار اینفوگرافیک شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی ۱۳۹۵/۱۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ در زیر نشان داده شده است.



مقایسه شاخص کل با شاخص‌های کشورهای در حال توسعه و اسلامی

در نمودار (۱۳) بازدهی سالانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران و بازدهی شاخص‌های MSCI^۱ کشورهای در حال توسعه و شریعت COMCEC^۲ از ابتدای سال ۱۳۹۵ نمایش داده شده است. همان‌گونه که مشاهده می‌شود بجز دو ماه پایانی سال ۱۳۹۵، بازدهی سالانه شاخص کل در بقیه 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 پانوشته^۳ قابل مشاهده است. فهرست کشورهای اسلامی مشمول در شاخص شریعت COMCEC در لینک قید شده در پانوشته^۴ قابل مشاهده است.



✓ همان‌طور که در نمودار مشاهده می‌شود، طی سه ماه اخیر شاهد کاهش بازدهی سالانه شاخص کل و افزایش بازدهی سالانه شاخص‌های MSCI کشورهای در حال توسعه و شاخص شریعت COMCEC نسبت به شاخص کل هستیم.

^۱ Morgan Stanley Capital International

^۲ Committee for Commercial and Economic Cooperation

^۳ <https://www.msci.com/emerging-markets>

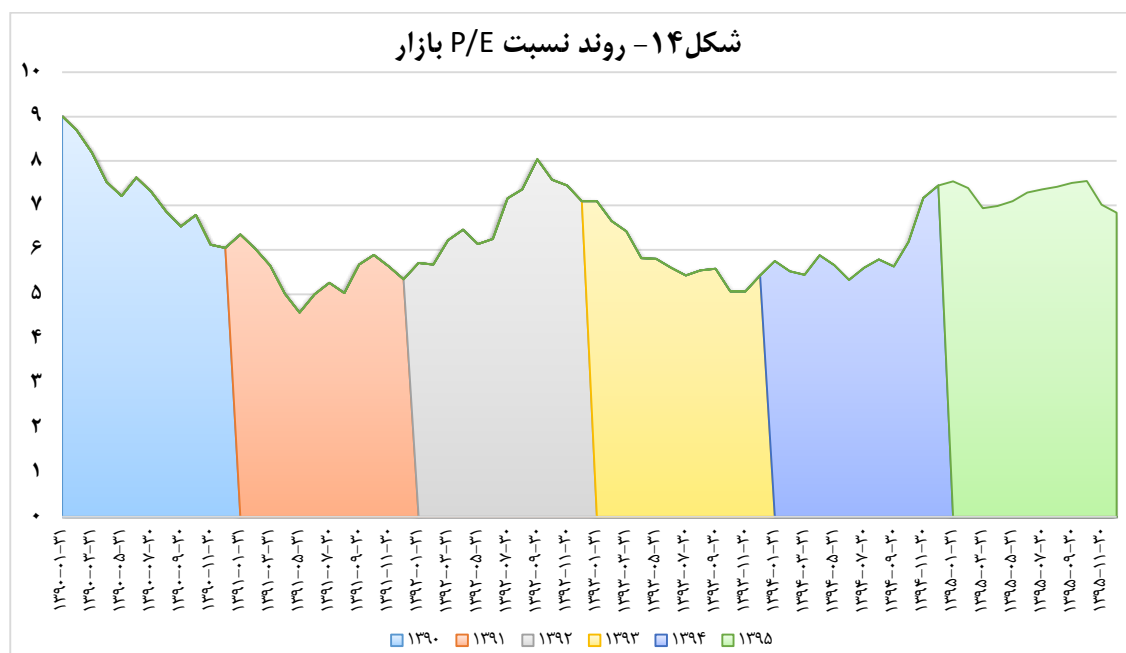
^۴ <https://eu.spindices.com/indices/equity/sp-oic-comcec-50-shariah>

نسبت P/E بازار

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

تاریخ انتهای ماه (بیشترین P/E)	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹
کل بازار	۶.۸۴	۷.۰۲	۷.۴۵
منسوجات	۷۲.۱۲	۵۳.۵۹	۹۴.۲۸
دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۶۴.۴۱	۶۳.۹۶	۷.۹۳
استخراج سایر معادن	۵۴.۴۲	۵۴.۳۸	۱۸.۱۹
محصولات چوبی	۴۳.۳۵	—	۳۰.۲۱۷
محصولات کاغذی	۳۰.۳۶	۷۶.۲۷	۸.۹۹
حمل‌ونقل، انبارداری و ارتباطات	۲۰.۱۶	۲۰.۴۵	۳۳.۴۴
فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶.۲۹	۱۶.۹۳	—
تاریخ انتهای ماه (کمترین P/E)	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۴/۱۲/۲۹
سایر محصولات کانی غیرفلزی	۶.۳۴	۶.۲۰	۸.۴۵
سایر واسطه‌گری‌های مالی	۶.۲۴	۵.۷۳	۸.۵۹
محصولات شیمیایی	۵.۸۴	۵.۸۱	۵.۹۴
شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	۵.۲۵	۵.۱۲	۴.۹۵
تأمین برق، گاز، بخار و آب گرم	۴.۹۳	۴.۷۴	۵.۲۷
مخابرات	۴.۸۸	۴.۷۱	۵.۳۲
وسایل اندازه‌گیری، پزشکی و اپتیک	۱.۸۶	۱.۸۶	۲.۹

در نمودار (۱۴) روند تغییرات نسبت P/E ماهیانه بازار از ابتدای سال ۱۳۹۰ تا انتهای اسفندماه 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 اسفندماه ۱۳۹۵ نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی از ابتدای سال تا انتهای اسفندماه 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٪
۱۳۹۵/۱۰	۵۰,۷۸۱	۶۹,۴۱٪	۲۲,۳۸۳	۳۰,۵۹٪
۱۳۹۵/۱۱	۸۰,۸۷۰	۷۲,۶۸٪	۳۰,۴۰۳	۲۷,۳۲٪
۱۳۹۵/۱۲	۱۰۸,۰۵۵	۸۱,۱۵٪	۲۵,۱۰۶	۱۸,۸۵٪



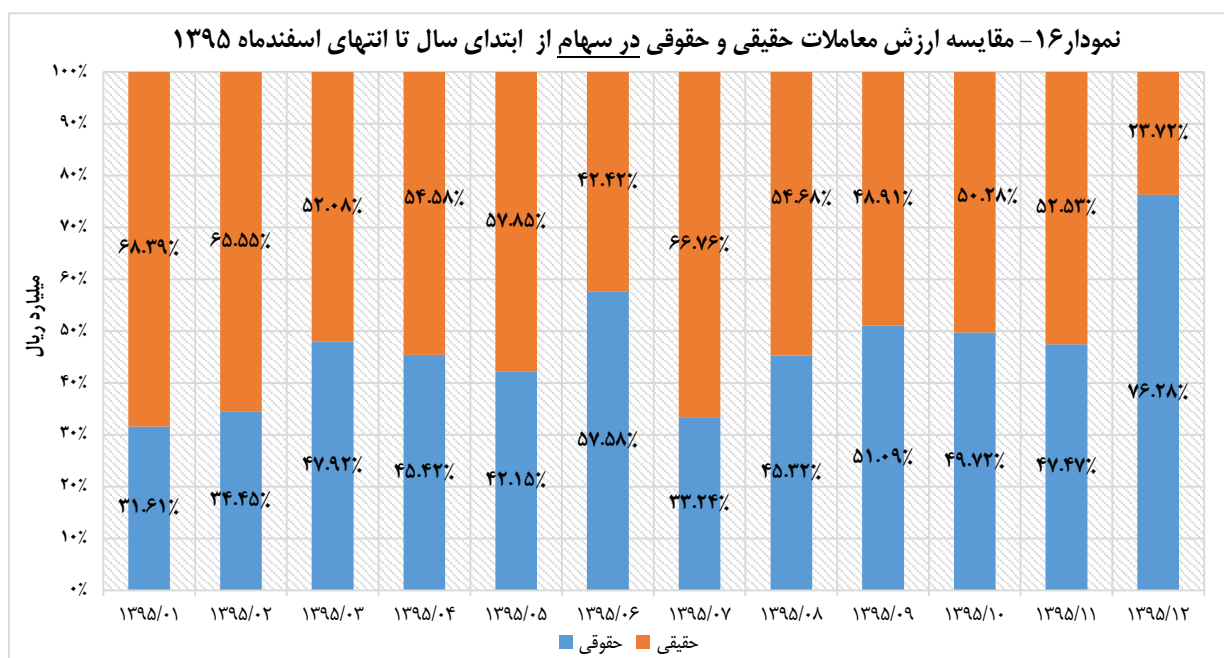
- ✓ طی شش ماه افیر شاهد افزایش نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی از کل ارزش معاملات انجام شده بودیم. به طوری که نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی از ۵۸,۶۴ درصد در مهرماه ۹۵ به ۸۱,۱۵ درصد در اسفندماه ۹۵ افزایش یافته است.
- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقیقی بعد از کاهش در سه ماهه آبان تا دی‌ماه ۹۵، در ادامه افزایش بهمن‌ماه، در اسفندماه ۹۵ نیز با افزایش ۳۳ درصدی نسبت به ماه قبل همراه بوده است.

آمار معاملات حقیقی و حقوقی در سهام

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

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی در سهام از ابتدای سال تا انتهای اسفندماه 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٪
۱۳۹۵/۱۰	۲۰,۶۶۲	۴۹,۷۲٪	۲۰,۸۹۸	۵۰,۲۸٪
۱۳۹۵/۱۱	۲۵,۳۳۳	۴۷,۴۷٪	۲۸,۰۳۵	۵۲,۵۳٪
۱۳۹۵/۱۲	۷۲,۹۴۱	۷۶,۲۸٪	۲۲,۶۸۷	۲۳,۷۲٪



✓ میانگین نسبت ارزش معاملات اشخاص حقیقی در سهام طی دوازده ماهه سال ۱۳۹۵، ۵۳ درصد و میانگین نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی در سهام طی این مدت ۴۷ درصد می‌باشد.

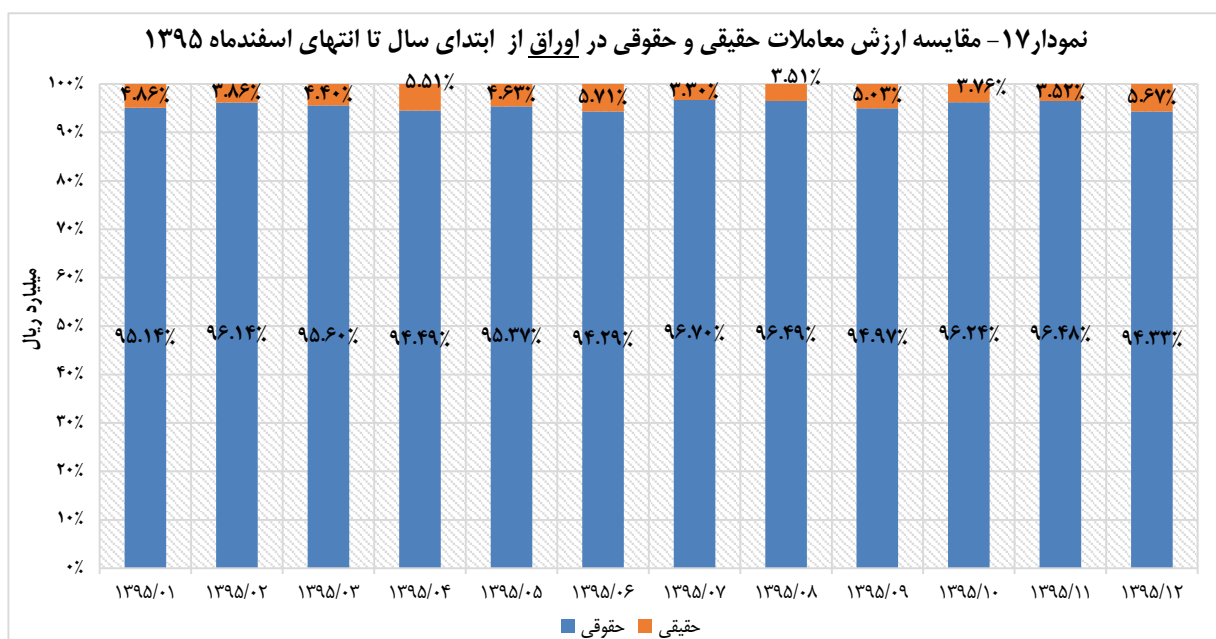
✓ ارزش معاملات اشخاص حقوقی در سهام در اسفندماه ۹۵ با رشد ۸۸ درصدی نسبت به ماه قبل به ۷۲,۹۴۱ میلیارد ریال رسید. این در حالی است که ارزش معاملات اشخاص حقیقی در سهام در اسفندماه ۱۹ درصد کاهش داشته است.

آمار معاملات حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی

در جدول زیر آمار معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی از ابتدای سال ۱۳۹۵ تا پایان اسفندماه ۱۳۹۵ آورده شده است.

میلیارد ریال

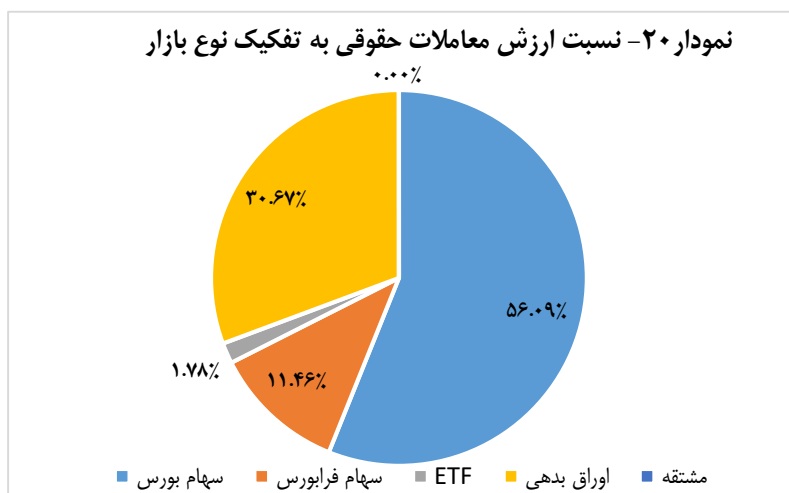
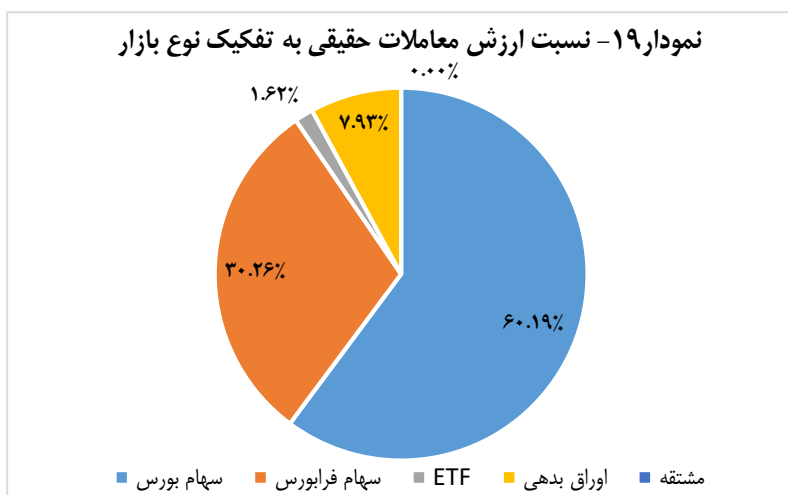
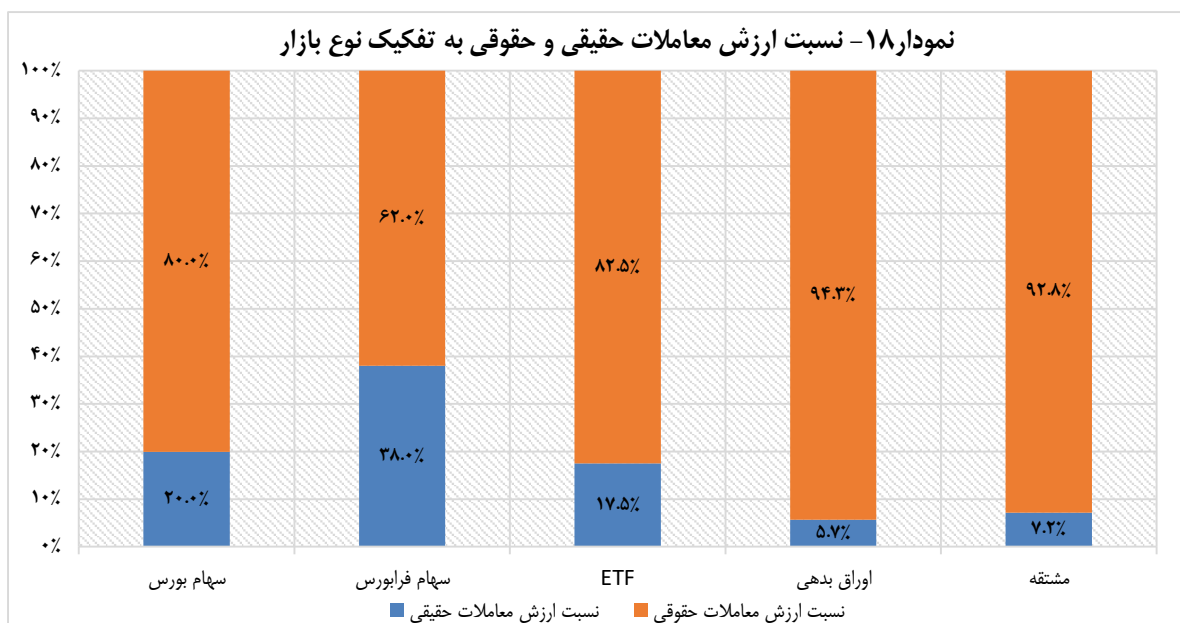
مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی در اوراق از ابتدای سال تا انتهای اسفندماه ۱۳۹۵				
ماه	حقوقی	درصد از کل	حقیقی	درصد از کل
۱۳۹۵/۰۱	۱۶,۹۰۲	۹۵.۱۴٪	۸۶۴	۴.۸۶٪
۱۳۹۵/۰۲	۳۸,۵۰۱	۹۶.۱۴٪	۱,۵۴۵	۳.۸۶٪
۱۳۹۵/۰۳	۲۲,۱۳۹	۹۵.۶۰٪	۱,۰۲۰	۴.۴۰٪
۱۳۹۵/۰۴	۱۵,۹۴۳	۹۴.۴۹٪	۹۳۰	۵.۵۱٪
۱۳۹۵/۰۵	۱۹,۸۶۶	۹۵.۳۷٪	۹۶۵	۴.۶۳٪
۱۳۹۵/۰۶	۱۸,۲۶۳	۹۴.۲۹٪	۱,۱۰۶	۵.۷۱٪
۱۳۹۵/۰۷	۳۱,۱۴۱	۹۶.۷۰٪	۱,۰۶۳	۳.۳۰٪
۱۳۹۵/۰۸	۳۴,۹۴۴	۹۶.۴۹٪	۱,۲۷۲	۳.۵۱٪
۱۳۹۵/۰۹	۲۴,۸۸۸	۹۴.۹۷٪	۱,۳۱۷	۵.۰۳٪
۱۳۹۵/۱۰	۲۸,۳۲۳	۹۶.۲۴٪	۱,۱۰۸	۳.۷۶٪
۱۳۹۵/۱۱	۵۲,۸۳۶	۹۶.۴۸٪	۱,۹۳۰	۳.۵۲٪
۱۳۹۵/۱۲	۳۳,۱۴۰	۹۴.۳۳٪	۱,۹۹۲	۵.۶۷٪



- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقوقی در اوراق بدهی در اسفندماه ۹۵، ۳۸ درصد نسبت به ماه قبل کاهش داشته است. به طوری که ارزش معاملات اشخاص حقوقی در اوراق بدهی از ۵۲,۸۳۶ میلیارد ریال در بهمن‌ماه ۹۵ به ۳۳,۱۴۰ میلیارد ریال در اسفندماه ۹۵ کاهش یافته است.
- ✓ نسبت ارزش معاملات اشخاص حقوقی در اوراق بدهی در اسفندماه با ۲,۱۵ درصد افزایش نسبت به ماه قبل همراه بوده است.

ارزش معاملات حقیقی و حقوقی به تفکیک نوع اوراق بهادار

در نمودار (۱۸) ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی به تفکیک نوع اوراق بهادار در اسفندماه ۱۳۹۵ نشان داده شده است.



لیست نمادهای متوقف

در جدول زیر لیست ۳۹ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در اسفندماه 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 شرکت	نماد	علت توقف	تعداد روزهای توقف
بورس اوراق بهادار تهران	بیمه و صندوق بازنشتی به جز تأمین اجتماعی	بیمه پارسیان	پارسیان	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۱۰
	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	حمل و نقل بین‌المللی خلیج فارس	حافرس	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۵
	خودرو و ساخت قطعات	الکترونیک خودرو شرق	خشرق	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱
	خودرو و ساخت قطعات	سایپاآذین	خاذین	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده	۴
	خودرو و ساخت قطعات	سرمایه‌گذاری رناله‌لدینگ	ورنا	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۵
	خودرو و ساخت قطعات	محورسازان ایران خودرو	خوساز	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۵
	زراعت و خدمات وابسته	کشاورزی و دامپروری مگسال	زمگسا	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۳
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	سایپاشیشه	کسپا	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۳
	سایر واسطه‌گری‌های مالی	لیزینگ صنعت و معدن	ولصنم	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۹
	سرمایه‌گذاری‌ها	سرمایه‌گذاری صنعت و معدن	وصنعت	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه – عمومی فوق‌العاده	۵
	سرمایه‌گذاری‌ها	سرمایه‌گذاری سپه	وسپه	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۳
	سرمایه‌گذاری‌ها	سرمایه‌گذاری بهمن	وبهمن	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۳
	سرمایه‌گذاری‌ها	سرمایه‌گذاری توسعه ملی	وتوسم	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۶
	سیمان، آهک و گچ	سیمان شمال	شمال	مجمع عمومی عادی سالیانه	۶
	سیمان، آهک و گچ	سیمان ارومیه	ساروم	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۵
	سیمان، آهک و گچ	سیمان مازندران	سمازن	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۹
	سیمان، آهک و گچ	سیمان هگمتان	سپگمت	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۴
	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	سرمایه‌گذاری غدیر (هلدینگ)	وغدیر	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۳
	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	پالایش نفت اصفهان	شپنا	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۱
	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	پالایش نفت بندرعباس	شیندر	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۲
	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	پالایش نفت تهران	شتران	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۹
	قند و شکر	قند ثابت خراسان	قثابت	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۷
	لاستیک و پلاستیک	درخشان تهران	پدرخش	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق‌العاده	۳
	لاستیک و پلاستیک	کوبیر تایر	پکوبیر	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه – عمومی فوق‌العاده	۱۱
	ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی	کابل البرز	بالبر	برگزاری مجمع عمومی فوق‌العاده	۸
	ماشین‌آلات و دستگاه‌های برقی	لامپ پارس شهاب	بشهاب	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۵
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	پارس مینو	غپینو	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۷
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	دشت مرغاب	غدشت	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۴
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	صنعتی بهشهر	غبشهر	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۴
	محصولات کاغذی	کارتن ایران	چکارن	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۶
	منسوجات	نساجی بروجرد	نبروج	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۵
	مواد و محصولات دارویی	داروسازی فارابی	دفارا	تعدیل پیش‌بینی درآمد هر سهم	۱۰
	مواد و محصولات دارویی	دارویی لقمان	دلقما	اعلام پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۱۵
فرابورس ایران	حمل و نقل آبی	کشتیرانی دریای خزر	خحزر	اطلاعات دریافتی مبنی بر تعدیل در بودجه سال مالی ۹۶	۸
	سرمایه‌گذاری‌ها	سرمایه‌گذاری توسعه گوهران امید	گوهران	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۴
	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	مدیریت انرژی امید تابان هور	وهور	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۵
	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	پالایش نفت لاوان	شاوان	اطلاعات دریافتی مبنی بر تغییر بااهمیت پیش‌بینی سال مالی ۹۶	۱۳
	قند و شکر	فراورده‌های غذایی و قند چهارمحال	قچار	اطلاعات دریافتی مبنی بر اولین پیش‌بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۶
	محصولات کاغذی	گروه صنایع کاغذ پارس	چکاپا	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۵

در جدول زیر لیست ۲۰ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در اسفندماه ۱۳۹۵ که در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده‌اند به همراه علت توقف آن‌ها ارائه شده است.

بورس	صنعت	نام شرکت	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
بورس اوراق بهادار تهران	استخراج کانه های فلزی	توسعه معادن و فلزات	ومعادن	جهت برگزاری مجمع عمومی فوق العاده به منظور تصمیم گیری در خصوص افزایش سرمایه	۹۵/۱۲/۲۴
	انبوه سازی، املاک و مستغلات	سرمایه گذاری مسکن	ثمسکن	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه به منظور تصویب صورت های مالی	۹۵/۱۲/۲۲
	خودرو و ساخت قطعات	ایران خودرو دیزل	خاور	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۱۲/۲۸
	خودرو و ساخت قطعات	کمک فنر ایندامین	خککمک	اعلام پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۹۵/۱۲/۰۱
	سرمایه گذاری ها	سرمایه گذاری آتیه دماوند	واتی	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه به منظور تصویب صورت های مالی	۹۵/۱۲/۲۴
	سرمایه گذاری ها	سرمایه گذاری نور کوثر ایرانیان	وسکاب	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه به منظور تصویب صورت های مالی	۹۵/۱۲/۲۲
	سرمایه گذاری ها	سرمایه گذاری نیرو	ونیرو	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۱۲/۰۷
	سیمان، آهک و گچ	سیمان دورود	سدور	اعلام پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۹۵/۱۲/۲۳
	سیمان، آهک و گچ	سیمان تهران	ستران	اعلام پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۹۵/۱۲/۰۱
	فلزات اساسی	سرمایه گذاری توکافولاد (هلدینگ)	وتوکا	برگزاری مجمع عمومی فوق العاده به منظور تصمیم گیری در خصوص اصلاح اساسنامه	۹۵/۱۲/۲۴
	فلزات اساسی	فولاد آلیاژی ایران	فولاز	برگزاری مجمع عمومی فوق العاده به منظور تصویب صورت های مالی	۹۵/۱۲/۲۱
	قند و شکر	قند شیرین خراسان	قشرین	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق العاده به منظور تصویب صورت های مالی	۹۵/۱۲/۱۷
	قند و شکر	قند نقش جهان	قنقش	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۱۲/۰۲
	ماشین آلات و دستگاه های برقی	ایران ترانسفو	بترانس	برگزاری مجمع عمومی فوق العاده به منظور تصمیم گیری در خصوص افزایش سرمایه	۹۵/۱۲/۲۴
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	خوراک دام پارس	غدام	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۱۲/۲۸
	مواد و محصولات دارویی	داروسازی زاگرس فارمد پارس	ددام	اعلام پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۹۵/۱۲/۲۱
فرابورس ایران	اطلاعات و ارتباطات	آتیه داده پرداز	اپرداز	اطلاعات دریافتی مبنی بر ابهام در اطلاعات	۹۵/۱۲/۲۸
	بیمه و صندوق بازنشتی به جز تامین اجتماعی	بیمه اتکایی ایرانیان	اتکای	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه صاحبان سهام	۹۵/۱۲/۲۳
	فلزات اساسی	زرین معدن آسیا	فزرین	اطلاعات دریافتی مبنی بر تعدیل در پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۱۲/۲۴
	قند و شکر	قند شیروان قوچان و بجنورد	قشیر	اطلاعات دریافتی مبنی بر وقوع تغییرات با اهمیت طبق اطلاعات اولین پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۱۳۹۶	۹۵/۱۲/۰۲

- ✓ در اسفندماه ۱۳۹۵، در بین نمادهای بورسی و فرابورسی ۸۶ نماد به علت های مختلف بسته بوده‌اند که در انتهای ماه ۳۹ نماد بازگشایی شده‌اند.
- ✓ از میان ۴۷ نماد باقی مانده، ۱۶ نماد به علت ابهام در ارائه اطلاعات، ۱۸ نماد به علت تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم و ۱۳ نماد به علت برگزاری مجمع، متوقف شده‌اند.
- ✓ در کل، از میان نمادهای متوقف باقی مانده، ۳۱ مورد به درخواست شرکت پذیرفته شده در بورس و فرابورس صورت گرفته است.

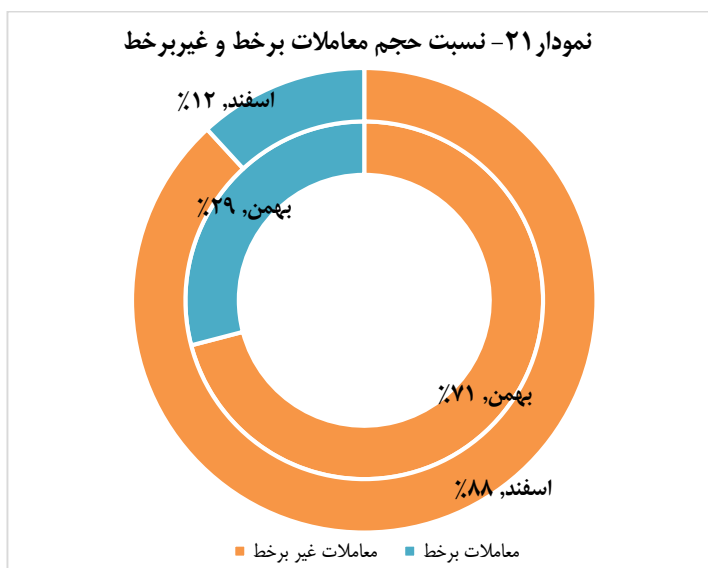
در جدول زیر لیست ۱۹ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران و ۸ نماد متوقف شده در فرابورس ایران که قبل از اسفندماه ۱۳۹۵ متوقف شده و در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده اند به همراه علت توقف آن ها ارائه شده است.

بورس	صنعت	نام شرکت	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
بورس اوراق بهادار تهران	ابزار پزشکی، اپتیکی و اندازه گیری	کنتور سازی ایران	آکتور	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۰۶/۱۳
	استخراج زغال سنگ	ذغال سنگ نگین طبس	کطبس	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۰۹/۲۲
	استخراج کانه های فلزی	معدنی دماوند	کدما	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۱۱/۰۲
	بانک ها و مؤسسات اعتباری	بانک پاسارگاد	وپاسار	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۰۹/۰۲
	بانک ها و مؤسسات اعتباری	بانک صادرات ایران	وبصادر	برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه	۹۵/۰۴/۲۹
	بانک ها و مؤسسات اعتباری	بانک پارسیان	وپارس	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۰۸/۱۵
	خودرو و ساخت قطعات	سازه پوش	خپوش	برگزاری مجامع عمومی عادی به طور فوق العاده - عمومی فوق العاده	۹۵/۰۹/۱۳
	ساخت دستگاه ها و وسایل ارتباطی	پارس الکترونیک	لپارس	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۱۱/۲۶
	سیمان، آهک و گچ	سیمان صوفیان	صصوفی	اعلام پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۹۶	۹۵/۱۱/۳۰
	سیمان، آهک و گچ	سیمان کارون	سکارون	برگزاری مجمع عمومی عادی به طور فوق العاده	۹۵/۰۸/۰۴
	فلزات اساسی	آلومینیوم ایران	فایرا	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۴/۰۸/۰۳
	کاشی و سرامیک	چینی ایران	کچینی	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۰۸/۱۰
	کاشی و سرامیک	کاشی نیلو	کنیلو	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۴/۱۰/۲۸
	کاشی و سرامیک	کاشی و سرامیک حافظ	کحافظ	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۰۸/۲۹
	محصولات شیمیایی	پارس پامچال	شپمچا	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۱۰/۲۹
	محصولات شیمیایی	تولید مواد اولیه الیاف مصنوعی	شمواد	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۵/۰۵/۱۳
	محصولات شیمیایی	دوده صنعتی پارس	شدوص	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۰۸/۰۱
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	به نوش ایران	غبه نوش	برگزاری مجمع عمومی فوق العاده	۹۵/۱۱/۰۵
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	کشت و صنعت پیادر	غازر	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۱۱/۰۳
فرابورس ایران	بانک ها و مؤسسات اعتباری	بانک ایران زمین	وزمین	دریافت اطلاعات با اهمیت	۹۴/۰۲/۲۷
	بانک ها و مؤسسات اعتباری	بانک سرمایه	سمایه	عدم ارائه اطلاعات	۹۵/۰۸/۰۳
	بانک ها و مؤسسات اعتباری	بانک گردشگری	وگردش	اطلاعات دریافتی مبنی بر تعدیل با اهمیت پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۱۳۹۵	۹۵/۰۵/۲۵
	بانک ها و مؤسسات اعتباری	شرکت اعتباری کوثر مرکزی	وکوثر	اطلاعات دریافتی مبنی بر ابهام در اطلاعات ارائه شده	۹۵/۱۱/۲۶
	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	بیمه میهن	میهن	اطلاعات دریافتی مبنی بر تعدیل با اهمیت پیش بینی عملکرد سال مالی ۱۳۹۵	۹۵/۱۱/۱۲
	سایر محصولات کانی غیر فلزی	شرکت مواد ویژه لیا	شلیا	اطلاعات دریافتی مبنی بر ابهام در اطلاعات	۹۵/۱۱/۰۵
	فلزات اساسی	سهامی ذوب آهن اصفهان	ذوب	اطلاعات دریافتی مبنی بر ابهام در اطلاعات و پیش بینی شرکت مذکور	۹۵/۱۰/۲۵
	فلزات اساسی	صنایع فولاد آلیاژی یزد	فولای	اطلاعات دریافتی مبنی بر تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۱۳۹۵	۹۵/۱۱/۱۲

عملکرد سرمایه‌گذاران در بازار سرمایه به صورت منطقه‌ای

نسبت حجم معاملات به تفکیک معاملات برخط و غیر برخط

در نمودار (۲۱) نسبت حجم معاملات خرید و فروش به تفکیک معاملات برخط و غیر برخط در بهمن و اسفندماه ۱۳۹۵ نشان داده شده است.



حجم معاملات در اسفندماه ۹۵ به تفکیک مناطق

به طور کلی ۷۷ درصد از حجم معاملات خرید و فروش در استان‌های کشور در کلیه انواع اوراق بهادار در بورس و فرابورس در اسفندماه ۱۳۹۵، مربوط به معاملات اشخاص حقوقی و ۲۳ درصد مربوط به معاملات اشخاص حقیقی می‌باشد. در جدول زیر پنج استان با بیش‌ترین حجم معاملات خرید و فروش اشخاص حقوقی در اسفندماه ۱۳۹۵ نمایش داده شده است.

هزار سهم

درصد تغیری‌رات		تاریخ		بیش‌ترین حجم خرید و فروش اشخاص حقوقی	
نسبت به کل حجم اسفندماه ۹۵	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۱۲/۲۸		
۹۰.۲۳٪	۲۴۵.۱۴٪	۸,۷۲۳,۸۰۱	۳۰,۱۰۹,۰۴۴	تهران	۱
۵.۳۲٪	۱۴۹۵.۶٪	۱۱۱,۱۵۵	۱,۷۷۳,۵۶۹	هرمزگان	۲
۰.۹۱٪	۴۶۵.۳٪	۵۳,۶۱۹	۳۰۳,۱۰۶	البرز	۳
۰.۵۹٪	۵۰۱.۶٪	۳۲,۸۵۷	۱۹۷,۶۷۳	اصفهان	۴
۰.۵۸٪	۱۲۶.۰٪	۸۶,۱۳۰	۱۹۴,۶۳۷	آذربایجان شرقی	۵
۹۷.۶۳٪	۲۶۱.۷٪	۹,۰۰۷,۵۶۲	۳۲,۵۷۸,۰۲۸	مجموع ۵ استان	
۱.۱۵٪	۱۲.۷٪	۳۴۰,۳۸۰	۳۸۳,۴۵۲	سایر استان‌ها	
۱.۲۲٪	۰.۱٪	۴۰۵,۵۷۹	۴۰۶,۰۹۰	معاملات برخط	
۱۰۰٪	۲۴۲.۱٪	۹,۷۵۳,۵۲۰	۳۳,۳۶۷,۵۷۱	مجموع	

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

هزار سهم

درصد تغیی رات		تاریخ		بیشترین حجم خرید و فروش <u>اشخاص حقیقی</u>	
نسبت به کل حجم اسفندماه ۹۵	نسبت به ماه قبل	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۱۲/۲۸		
۳۴.۳۲٪	-۳۹.۶۱٪	۵,۵۹۷,۹۷۵	۳,۳۸۰,۷۵۵	تهران	۱
۲.۹۹٪	-۲۴.۶٪	۳۹۰,۲۳۱	۲۹۴,۱۸۳	اصفهان	۲
۲.۱۹٪	-۲۵.۲٪	۲۸۸,۷۲۰	۲۱۶,۰۷۷	خراسان رضوی	۳
۱.۷۰٪	-۱۸.۸٪	۲۰۶,۶۲۴	۱۶۷,۸۵۲	البرز	۴
۱.۳۱٪	-۳۴.۰٪	۱۹۵,۲۸۶	۱۲۸,۹۷۶	آذربایجان شرقی	۵
۴۲.۵۲٪	-۳۷.۲٪	۶,۶۷۸,۸۳۶	۴,۱۸۷,۸۴۳	مجموع ۵ استان	
۹.۶۹٪	-۳۷.۴٪	۱,۵۲۴,۹۷۵	۹۵۴,۵۶۷	سایر استانها	
۴۷.۷۹٪	-۳۰.۶٪	۶,۷۸۱,۴۳۸	۴,۷۰۷,۰۵۵	معاملات برخط	
۱۰۰٪	-۳۴.۳٪	۱۴,۹۸۵,۲۴۹	۹,۸۴۹,۴۶۵	مجموع	

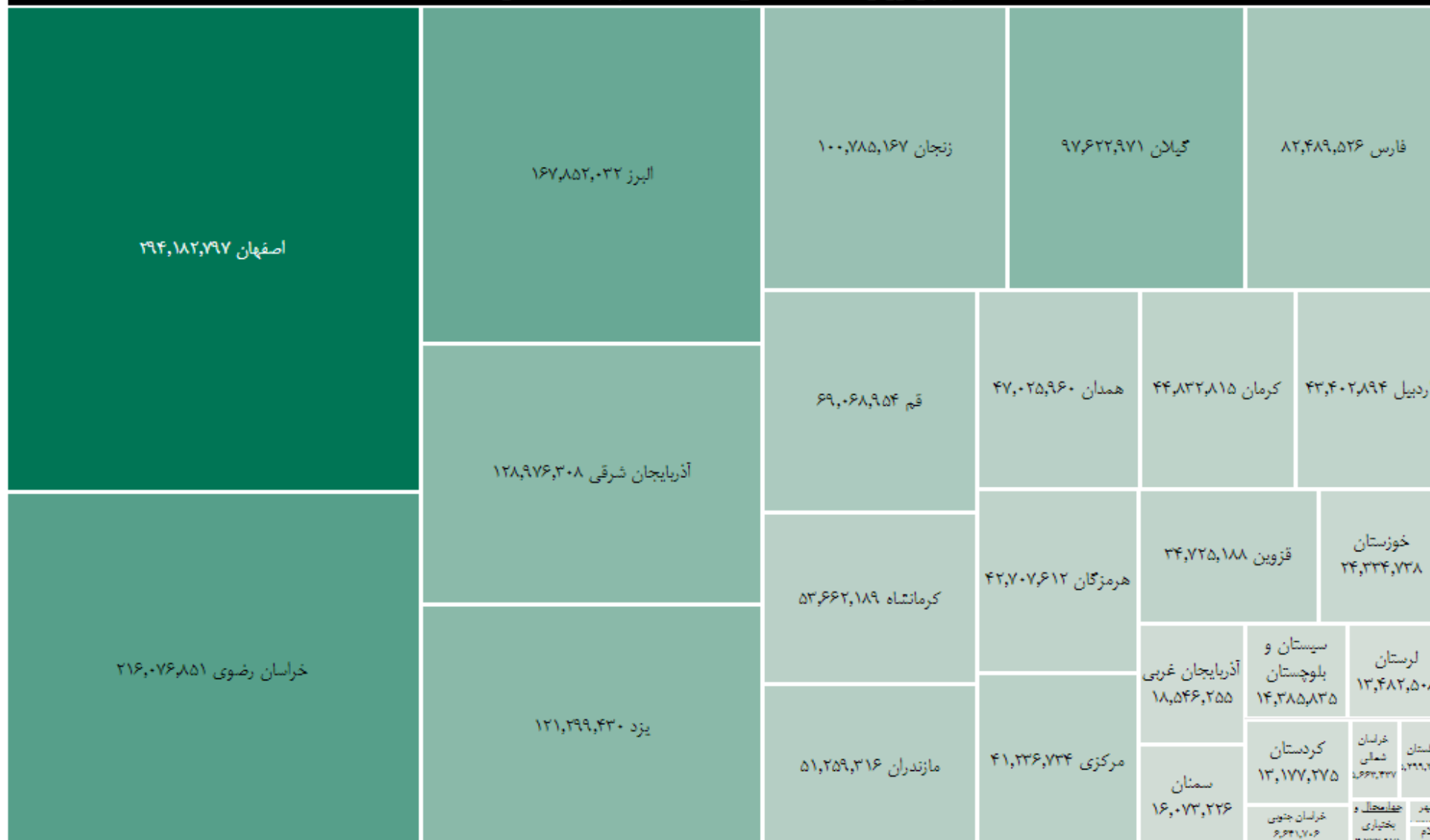
در نمودار (۲۲) حجم و ارزش معاملات اشخاص حقیقی در استانهای کشور بجز استان تهران، در کلیه انواع اوراق بهادار در بورس و فرابورس در اسفندماه ۱۳۹۵ نشان داده شده است.

لازم به ذکر است که حدود ۴۷,۸ درصد از کل حجم معاملات مربوط به معاملات برخط می باشد که این تعداد در نمودار صفحه بعد نشان داده نشده است. همچنین استان تهران به تنهایی حدود ۳۴,۳ درصد از کل حجم معاملات اشخاص حقیقی را به خود اختصاص داده است.

📊 در نمودار صفحه بعد اندازه هر قسمت، بیانگر حجم معاملات و شدت رنگ، میزان ارزش معاملات در استانها را نشان می دهد.

نمودار ۲۲- حجم و ارزش معاملات اشخاص حقیقی به تفکیک مناطق غیر از تهران

حجم و ارزش معاملات حقیقی اسفند ماه ۹۵ به تفکیک استان ها



ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری به تفکیک انواع صندوق‌ها

در جدول زیر مقایسه عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری در سال ۱۳۹۴ و یازده ماهه نخست سال ۱۳۹۵ آورده شده است.
 ** لازم به توضیح است که صندوق‌های سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی در این گزارش در نظر گرفته نمی‌شوند.

ارزش (میلیارد ریال)	ارزش به تفکیک حقیقی و حقوقی (میلیارد ریال)								فروش (میلیارد ریال)		ارزش سهام (میلیارد ریال)	
	حقیقی				حقوقی							
نوع صندوق سرمایه‌گذاری	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان سال ۹۴
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱,۲۸۸,۳۸۶	۶۰۴,۹۷۹	۱,۲۲۳,۹۶۷	۵۶۱,۷۱۱	۶۴,۴۱۹	۴۳,۲۶۸	۳۰,۶۳۹	۱۰,۱۶۴	۱۴,۷۳۳	۲,۲۷۸	۲۱,۸۲۵	۹,۸۶۸
مختلط	۹,۶۵۸	۱,۲۴۵	۸,۴۰۲	۱۵۵	۱,۲۵۶	۱,۰۹۱	۲,۱۷۲	۱,۴۸۶	۱,۴۴۸	۱,۲۷۰	۱,۳۴۲	۸۱۷
سهام	۱۷,۱۳۹	۲۰,۱۶۳	۳,۲۵۶	۵۶۵۹	۱۳,۸۸۳	۱۴,۵۰۳	۱۵,۴۵۴	۱۷,۳۳۹	۱۵,۲۶۳	۱۳,۰۵۴	۱۵,۳۳۱	۱۸,۰۶۸
کل	۱۳,۳۱۵,۱۸۲	۶۲۶,۳۸۶	۱۰,۲۳۶,۳۷۱	۵۶۷,۵۲۵	۷۸,۹۱۱	۵۸,۸۶۲	۴۸,۲۶۶	۲۸,۹۸۹	۳۱,۴۳۴	۱۶۶۰۲	۳۸,۴۹۸	۲۸,۷۵۳

منبع: اداره امور نهادهای مالی

در جدول زیر عملکرد بهمن‌ماه ۱۳۹۵ با دی‌ماه ۱۳۹۵ مقایسه شده است.

نوع صندوق سرمایه‌گذاری	تعداد		تعداد سرمایه‌گذار در بهمن‌ماه ۱۳۹۵			تعداد سرمایه‌گذار در دی‌ماه ۱۳۹۵		
	پایان بهمن‌ماه ۱۳۹۵	پایان دی‌ماه ۱۳۹۵	حقیقی	حقوقی	جمع	حقیقی	حقوقی	جمع
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۵۸	۵۸	۱,۷۴۰,۲۱۲	۳,۵۲۲	۱,۷۴۳,۷۳۴	۱,۶۳۴,۶۹۷	۳,۵۳۶	۱,۶۳۸,۲۳۳
مختلط	۱۷	۱۶	۱۳,۴۱۹	۱۵۳	۱۳,۵۷۲	۱۳,۴۰۵	۱۵۱	۱۳,۵۵۶
سهام	۹۸	۹۸	۱۰,۹۱۲	۵۵۶	۱۱,۴۶۸	۱۱,۱۷۱	۴۵۱	۱۱,۶۲۲
کل	۱۷۳	۱۷۲	۱,۷۶۴,۵۴۳	۴,۲۳۱	۱,۷۶۸,۷۷۴	۱,۶۵۹,۲۷۳	۴,۱۳۸	۱,۶۶۳,۴۱۱

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 ۱۲ ماهه ۱۳۹۵	عملکرد ۹۴
بازار اولیه و ثانویه	تأسیس شرکتهای سهامی عام	۵,۵۰۰	۳,۷۰۰
	افزایش سرمایه شرکتهای سهامی عام (مجوزهای ارائه شده)*	۲۲۶,۱۷۳	۳۱۱,۲۶۲
	انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	۲۹۲,۳۸۰	۱۴۸,۰۱۴
	عرضه اولیه سهام شرکتهای در بورس و فرابورس	۳,۵۹۳	۱۰,۴۰۸
	جمع تأمین مالی بازار اولیه و ثانویه	۵۲۷,۶۴۶	۴۷۳,۳۸۴
نهادهای مالی	افزایش ارزش صندوقها نسبت به ابتدای سال	۶۸۲,۷۱۳	۵۵۶,۴۵۶
	سایر نهادهای مالی**	۱۰,۰۹۵	۴,۳۲۹
	جمع تأمین مالی نهادهای مالی	۶۹۲,۸۰۸	۵۶۰,۷۸۵
	جمع کل	۱,۲۲۰,۴۵۴	۱,۰۳۴,۱۶۹

*: مبلغ ثبت شده افزایش سرمایه شرکتهای سهامی عام، در سال ۹۵ مبلغ ۲۸۹,۱۸۳ میلیارد ریال بوده است.

** : تأمین مالی سایر نهادهای مالی شامل تأسیس و افزایش سرمایه سایر نهادهای مالی شامل شرکتهای سبدگردان، مشاور سرمایه گذاری، تأمین سرمایه و پردازش اطلاعات مالی بوده است. اطلاعات سالهای ۸۸ و ۸۹ صرفاً برای تأسیس ارائه شده 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 ۱۲ ماهه ۱۳۹۵	عملکرد ۹۴
انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	انتشار اوراق بهادار بدهی با مجوز سازمان بورس*	۱۶,۵۹۸	۹,۶۷۵
	انتشار اوراق سلف موازی استاندارد	۳۷,۹۸۹	۱۰,۸۲۷
	اوراق مشارکت دولت، شهرداریها و بانکها**	۲۴,۰۰۰	۱۳,۴۹۲
	گواهی سپرده سرمایه گذاری عام و خاص***	۳۱,۰۰۰	۰
	اوراق مشارکت شرکت ملی نفت	۰	۵۰,۰۰۰
	اوراق اجاره دولتی	۲۲,۵۰۰	۵,۰۰۰
	اوراق مرابحه دولتی	۲۰,۰۰۰	۰
	اسناد خزانه اسلامی	۱۳۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
	امتیاز تسهیلات مسکن***	۱۰,۲۹۳	۹,۰۲۰
	جمع	۲۹۲,۳۸۰	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 سرمایه گذاری عام و خاص مربوط به آغاز معاملات ثانویه اوراق مذکور از طریق بورس و فرابورس می باشد 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 اسفندماه ۱۳۹۵ و همچنین در انتهای سال ۱۳۹۴ در جدول زیر نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

نوع اوراق	پایان اسفندماه	درصد از کل	پایان سال ۹۴	درصد از کل
مشارکت	۵۰,۰۰۰	۱۵.۰۴٪	۵۰,۰۰۰	۲۸.۲۸٪
اجاره	۴۹,۰۰۰	۱۴.۷۴٪	۵,۰۰۰	۲.۸۳٪
سلف	۰	۰	۰	۰٪
مراجعه	۲۰,۰۰۰	۶.۰۱٪	۰	۰٪
اسناد خزانه اسلامی	۷۵,۰۰۰	۲۲.۵۵٪	۴۰,۰۰۰	۲۲.۶۲٪
معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری‌ها و دولت	۴۷,۹۹۵	۱۴.۴۳٪	۲۶,۳۹۵	۱۴.۹۳٪
جمع اوراق بهادار دولتی	۲۴۱,۹۹۵	۷۲.۷۷٪	۱۲۱,۳۹۵	۶۸.۶۶٪
انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی	۹۰,۵۳۳	۲۷.۲۳٪	۵۵,۴۲۰	۳۱.۳۴٪
جمع کل بازار اوراق بدهی	۳۳۲,۵۲۸	۱۰۰٪	۱۷۶,۸۱۵	۱۰۰٪

منبع: اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بدهی

سررسید اوراق بدهی منتشره

در جدول زیر لیست اوراق بدهی که در اسفندماه ۱۳۹۵ سررسید شده‌اند، نشان داده شده است.

نام اوراق	نوع اوراق	نماد	نام ناشر/بانی	ماهیت ناشر	بورس منتشره کننده اوراق	مبلغ کل اوراق منتشره (میلیون ریال)	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید
مشارکت شیراز سه ماهه ۲۰ درصد	اوراق مشارکت	مراز ۱	شهرداری شیراز	شهرداری	فرابورس ایران	۱,۸۰۰,۰۰۰	۹۲/۱/۲۷	۹۵/۱۲/۲۲
سلف موازی برق مهاباد گستر ۹۵۱	اوراق سلف موازی استاندارد	سماه ۹۵۱	گروه آراین مهاباد گستر	غیر دولتی	بورس انرژی	۲۰۰,۰۰۰	۹۴/۱۲/۰۱	۹۵/۱۲/۰۱
گواهی سپرده عام گردشگری ۹۵۱۲۰۱	گواهی سپرده	گردش ۹۵	بانک گردشگری	غیر دولتی	فرابورس ایران	۳,۰۰۰,۰۰۰	۹۵/۰۱/۱۶	۹۵/۱۲/۰۱
گواهی سپرده عام گردشگری ۹۵۱۲۱۵	گواهی سپرده	گردش ۹۵۲	بانک گردشگری	غیر دولتی	فرابورس ایران	۲,۰۰۰,۰۰۰	۹۵/۰۱/۲۴	۹۵/۱۲/۱۵
سلف تیرآهن ۱۴ ذوب‌آهن مرحله اول	اوراق سلف موازی استاندارد	عذوب ۱	شرکت ذوب‌آهن (سهامی عام)	غیر دولتی	بورس کالا	۱,۵۰۰,۰۰۰	۹۴/۱۲/۱۷	۹۵/۱۲/۱۷
اوراق سلف موازی استاندارد گندم	اوراق سلف موازی استاندارد	عگندم	شرکت بازرگانی دولتی ایران	دولتی	بورس کالا	۲۶,۵۰۰,۰۰۰	۹۵/۰۶/۱۷	۹۵/۱۲/۱۷
گواهی س.ل.رایان سایپا، ۳ماه ۲۲٪	گواهی سپرده	رایان ۵۱۲	شرکت لیزینگ رایان سایپا (سهامی عام)	غیر دولتی	بورس اوراق بهادار تهران	۵۰۰,۰۰۰	۹۳/۰۶/۲۵	۹۵/۱۲/۲۴
سلف اوره پتروشیمی پردیس ۱	اوراق سلف موازی استاندارد	عپردیس ۱	شرکت پتروشیمی پردیس (سهامی عام)	غیر دولتی	بورس کالا	۱,۵۰۰,۰۰۰	۹۴/۱۲/۲۴	۹۵/۱۲/۲۴
اسناد خزانه اسلامی ۹۵۱۲۲۵	اسناد خزانه اسلامی	اخز ۶	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج.ا.ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۵/۰۴/۱۳	۹۵/۱۲/۲۵
مشارکت قائم ذرفول سه ماهه ۲۰٪	اوراق مشارکت	دزفول	شهرداری دزفول	شهرداری	فرابورس ایران	۶۰۰,۰۰۰	۹۲/۰۴/۰۱	۹۵/۱۲/۲۷
مجموع						۴۷,۶۰۰,۰۰۰		

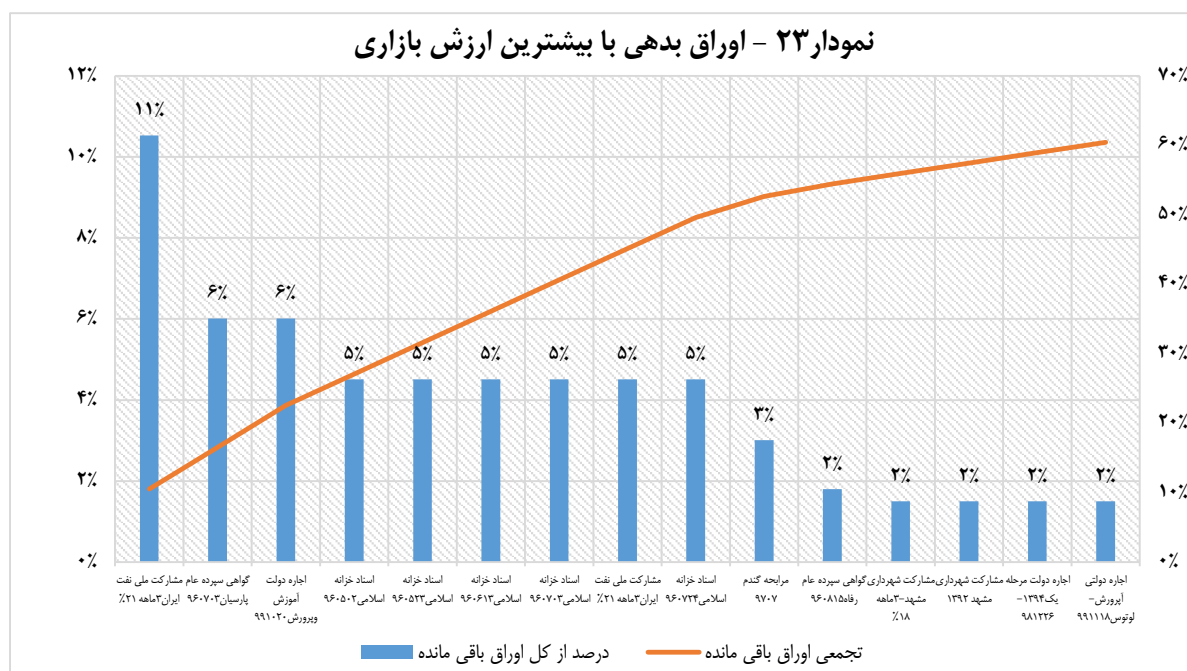
در جدول زیر لیست اوراق بدهی که در فروردین ماه ۱۳۹۶ سررسید خواهند شد، نشان داده شده است.

نام اوراق	نوع اوراق	نماد	نام ناشر/بانی	ماهیت ناشر	بورس منتشره کننده اوراق	مبلغ کل اوراق منتشره (میلیون ریال)	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید
اجاره رایان سه ماهه ۲۰ درصد	اوراق اجاره	صایان ۱	لیزینگ رایان سایپا (سهامی عام)	غیر دولتی	فرا بورس ایران	۲۲۷,۸۶۵	۹۲/۰۳/۰۵	۹۶/۰۱/۲۸

در جدول زیر لیست ۱۵ اوراق بدهی که بیش از ۶۰ درصد کل اوراق بدهی باقی مانده را تشکیل می دهند نشان داده شده است.

نام اوراق	نوع اوراق	نماد	نام ناشر/بانی	ماهیت ناشر	بورس منتشره کننده اوراق	مبلغ کل اوراق منتشره (میلیون ریال)
مشارکت ملی نفت ایران ۳ماهه ۲۱٪	اوراق مشارکت	مپارس ۷۱۲	شرکت ملی نفت ایران	دولتی	بورس اوراق بهادار تهران	۳۵,۰۰۰,۰۰۰
گواهی سپرده عام پارسیان ۹۶۰۷۰۳	گواهی سپرده	پارس ۹۶۰۷	بانک پارسیان (سهامی عام)	غیر دولتی	فرا بورس ایران	۲۰,۰۰۰,۰۰۰
اجاره دولت آموزش و پرورش ۹۹۱۰۲۰	اوراق اجاره	اجاد ۳	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۲۰,۰۰۰,۰۰۰
اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۵۰۲	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۷	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۱۵,۰۰۰,۰۰۰
اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۵۲۳	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۸	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۱۵,۰۰۰,۰۰۰
اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۶۱۳	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۹	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۱۵,۰۰۰,۰۰۰
اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۷۰۳	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۱۰	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۱۵,۰۰۰,۰۰۰
مشارکت ملی نفت ایران ۳ماهه ۲۱٪	اوراق مشارکت	مغرب ۹۷۱۲	شرکت ملی نفت ایران	دولتی	بورس اوراق بهادار تهران	۱۵,۰۰۰,۰۰۰
اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۷۲۴	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۱۱	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۱۵,۰۰۰,۰۰۰
مربحه گندم ۹۷۰۷	اوراق مربحه	گندم ۹۷۰۷	شرکت مادر تخصصی بازرگانی دولتی ایران	دولتی	فرا بورس ایران	۱۰,۰۰۰,۰۰۰
گواهی سپرده عام رفاه ۹۶۰۸۱۵	گواهی سپرده	رفاه ۹۶	بانک رفاه کارگران	غیر دولتی	فرا بورس ایران	۶,۰۰۰,۰۰۰
مشارکت شهرداری مشهد-۳ماهه ۱۸٪	اوراق مشارکت	مشهد ۶۱۲	شهرداری مشهد	شهرداری	بورس اوراق بهادار تهران	۵,۰۰۰,۰۰۰
مشارکت شهرداری مشهد ۱۳۹۲	اوراق مشارکت	مشهد ۹۶۱۲	شهرداری مشهد	شهرداری	فرا بورس ایران	۵,۰۰۰,۰۰۰
اجاره دولت مرحله یک ۱۳۹۴-۹۸۱۳۲۶	اوراق اجاره	اجاد ۱	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرا بورس ایران	۵,۰۰۰,۰۰۰
مجموع						
۲۰۱,۰۰۰,۰۰۰						
سایر اوراق بدهی						
۱۳۱,۵۲۸,۰۰۰						
مجموع کل						
۳۳۲,۵۲۸,۰۰۰						

نمودار (۲۳) درصد ارزش هر یک از ۱۵ اوراق بدهی که بیش از ۶۰ درصد کل اوراق بدهی باقی مانده را تشکیل می دهند، به صورت جداگانه و تجمعی نشان داده شده است.



- ✓ مانده اوراق بدهی منتشره در پایان اسفندماه ۱۳۹۵، ۱۲٫۱ درصد نسبت به مانده اوراق بدهی در پایان بهمن ماه ۱۳۹۵ کاهش یافته است.
- ✓ در فروردین ماه ۱۳۹۵، تنها یک اوراق بدهی منتشره سررسید خواهند شد که ارزش آن ۲۲۷٫۸۶۵ میلیون ریال می باشد.
- ✓ اوراق مشارکت ملی نفت ایران با نماد "مپارس ۷۱۲" به تنهایی ۱۱ درصد از کل اوراق باقی مانده را به خود اختصاص داده است. بعد از این اوراق، اوراق گواهی سپرده عام پارسیان با نماد "پارس ۹۶۰۷" و اوراق اجاره دولتی آموزش و پرورش با نماد "اجادس" هر کدام به تنهایی ۶ درصد از کل اوراق باقی مانده را تشکیل می دهند.

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

✓ **مروری بر نرخ‌های جهانی کالای**

اساسی و تغییرات شاخص‌ها

✓ **نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی و**

تأثیر آن‌ها بر بازار سرمایه

بورس تهران

فرا بورس ایران

✓ **مدل آماري 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

مروری بر 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	۹۵/۱۱/۳۰	۹۵/۱۲/۲۸	واحد	
۴۳.۱٪	-۷.۱٪	۳۴.۵۰	۵۳.۱۴	۴۹.۳۶	بشکه	نفت (دلار)
۹.۰٪	-۱.۸٪	۳۴.۲۳۰.۰	۳۷.۹۷۳	۳۷.۳۰۷		دلار (ریال)
۳۳.۴٪	۷.۷٪	۳۳۵.۰	۴۱۵	۴۴۷	تن	فولاد (دلار)
۷۱.۴٪	-۱.۶٪	۵۲.۵	۹۱.۵	۹۰.۰	تن	سنگ آهن (دلار)
۵۷.۳٪	۱.۵٪	۵۱.۶	۸۰.۰	۸۱.۲	تن	زغال سنگ (دلار)
۱۹.۵٪	-۱.۵٪	۴.۹۲۷.۳	۵.۹۷۴.۵	۵.۸۸۶.۳	تن	مس (دلار)
۶۱.۰٪	۰.۲٪	۱.۷۷۵	۲.۸۵۱	۲.۸۵۷	تن	روی (دلار)
۲۴.۹٪	۱.۱٪	۱.۵۲۴	۱.۸۸۴	۱.۹۰۴	تن	آلومینیوم (دلار)
۵۹.۰٪	-۱۲.۱٪	۲۱۰	۳۸۰	۳۳۴	تن	متانول (دلار)
۲۶.۳٪	-۱۳.۳٪	۱۷۵	۲۵۵	۲۲۱	تن	اوره (دلار)
۱۵.۷٪	-۱۱.۹٪	۱۵.۵	۲۰.۳	۱۷.۹	پوند	شکر (سنت)
از ابتدای سال	یک ماه	مقدار شاخص				
-۳.۷٪	-۰.۴٪	۸۰.۲۱۹	۷۷.۵۵۹	۷۷.۲۳۰		شاخص کل بورس
۱۷.۷٪	۰.۵٪	۱۳.۳۵۷	۱۵.۶۵۱	۱۵.۷۲۳		شاخص کل (هم وزن)
۸.۶٪	۲.۶٪	۸۰.۶	۸۵.۳	۸۷.۵		شاخص فرابورس

- ✓ قیمت نفت خام پس از طی کردن روند صعودی و رسیدن به قیمت ۵۱,۹۹ دلار در پایان آذرماه ۹۵، در پایان بهمن‌ماه ۹۵ نیز شاهد رشد ۳,۳ درصدی قیمت نفت خام و رسیدن آن به قیمت ۵۳,۱۴ دلار در هر بشکه بودیم اما در پایان اسفندماه ۹۵ قیمت هر بشکه نفت خام با ۷,۱ درصد کاهش به ۴۹,۳۶ دلار در هر بشکه رسید.
- ✓ دلار نیز پس از طی کردن روند صعودی فود و عبور از قیمت ۴۰,۰۰۰ ریال در آذرماه ۹۵، در پایان اسفندماه ۹۵ با ۸.۱ درصد کاهش نسبت به بهمن‌ماه ۹۵، به جایگاه قیمت ۳۷,۳۰۷ ریال رسید.
- ✓ در پایان اسفندماه ۹۵ در اغلب کالاهای اساسی به جز زغال سنگ، فولاد و آلومینیوم، شاهد کاهش قیمت بوده‌ایم. در این ماه قیمت فولاد و زغال سنگ با به ترتیب ۷,۷ و ۱,۵ درصد رشد همراه بوده‌اند.
- ✓ قیمت جهانی متانول با کاهش ۱۲,۱ درصدی در اسفندماه ۹۵، به قیمت ۳۳۴ دلار در هر تن در پایان این ماه رسید.

نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی و تأثیر آن‌ها بر بازار سرمایه

در این قسمت به بررسی تأثیر تغییرات نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی و میزان تأثیر آن‌ها بر شاخص کل بورس و فرابورس با توجه به مقادیر فروش و بهای تمام‌شده شرکت‌های حاضر در بورس تهران و فرابورس ایران پرداخته خواهد شد. در واقع این تحلیل نمایانگر این مهم خواهد بود که تغییرات در نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی، تا چه میزان و در چه جهتی بر شرکت‌های پذیرفته شده بورسی و فرابورسی و نهایتاً شاخص‌های بازار سرمایه تأثیرگذار خواهند بود. در این تحلیل به شناسایی کالاهای اساسی که به طور مستقیم در فروش و یا بهای تمام‌شده شرکت‌های بورسی و فرابورسی تأثیر داشته، پرداخته شده است. تعداد شرکت‌های بورسی ۳۲۶ و تعداد شرکت‌های فرابورسی ۸۷ شرکت بوده و فرضیه‌های زیر صورت گرفته است.

- ۱- به منظور بررسی سهم هر یک از کالاهای اساسی در فروش و بهای تمام‌شده شرکت‌ها، از اطلاعات صورت‌های مالی حسابرسی شده شش ماهه شرکت‌ها استفاده شده است و در دوره حسابرسی بعدی مقادیر به روز خواهند شد.
- ۲- از گروه‌های مطرح‌شده ذیل و تمامی شرکت‌ها در گروه‌های مختلف بورسی و فرابورسی که ماهیت سرمایه‌گذاری و هلدینگ دارند، چشم‌پوشی شده است.

- | | |
|---|--|
| ۱- انبوه‌سازی، املاک و مستغلات | ۶- سایر واسه‌گری‌های مالی |
| ۲- بانک‌ها و مؤسسات اعتباری | ۷- سرمایه‌گذاری‌ها |
| ۳- بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی | ۸- شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی |
| ۴- حمل‌ونقل، انبارداری و ارتباطات | ۹- واسطه‌گری‌های مالی و پولی |
| ۵- خدمات فنی و مهندسی | ۱۰- فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط |

- ۳- مجموعاً ۲۳۱ شرکت بورسی و ۳۹ شرکت فرابورسی مورد بررسی و تحلیل قرار گرفته‌اند.

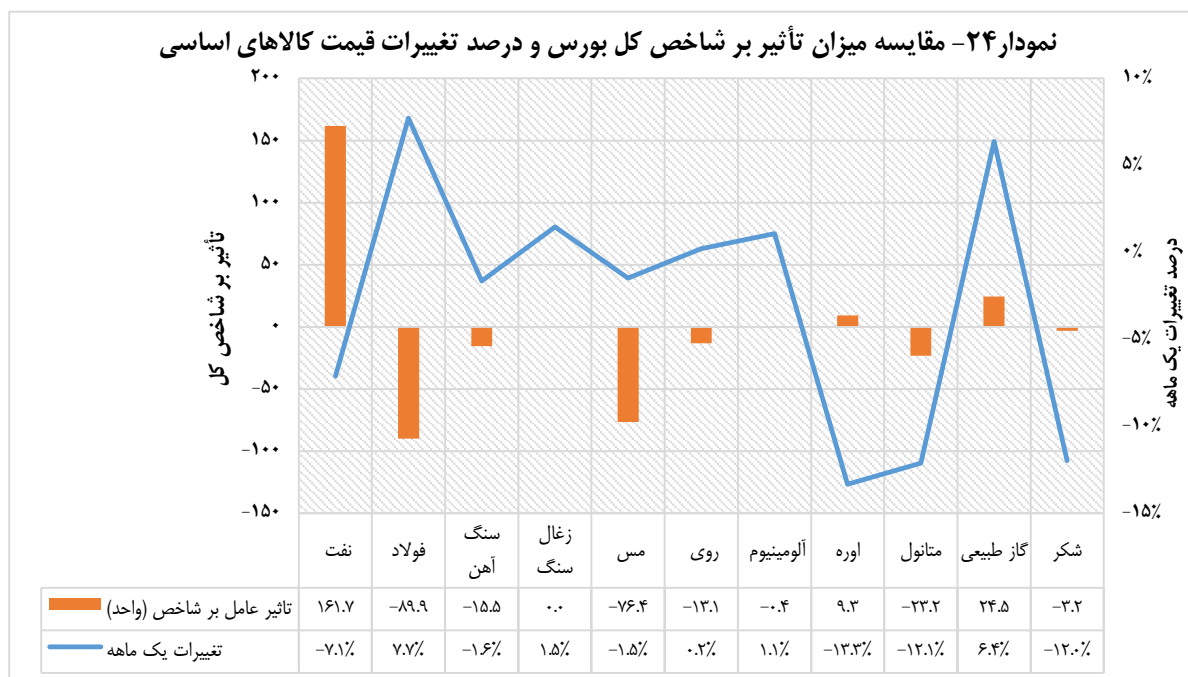
بورس تهران

در جدول صفحه بعد، تغییرات نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی در بازه زمانی یک ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ و تأثیر هر یک از آن‌ها بر شرکت‌های بورسی متأثر از آن عامل نمایش داده شده است. همان طور که مشاهده می‌شود تقریباً در اغلب کالاهای مورد بررسی، مجموع تأثیر بر شاخص آن کالا در شرکت‌های مربوط به آن عامل در جهت تغییرات نرخ‌های جهانی آن کالا و با توجه به نسبت‌های فروش و بهای تمام‌شده مربوط به هر کالا به کل فروش و بهای تمام‌شده شرکت‌های مربوطه می‌باشد.

تأثیر بر شاخص مربوط به کالاهای اساسی در اسفند ماه ۱۳۹۵					تغییرات نرخ های جهانی کالاهای اساسی				
ردیف	عامل بازار	واحد	۹۵/۱۲/۲۸	۹۵/۱۱/۳۰	درصد تغییرات یک ماهه	تعداد شرکت ها	نسبت فروش وابسته به عامل بازار به کل فروش شرکت های مربوطه	نسبت بهای تمام شده وابسته به عامل بازار به کل بهای تمام شده شرکت های مربوطه	تأثیر عامل بر شاخص کل بورس تهران (واحد)
۱	نفت (دلار)	بشکه	۴۹.۳۶	۵۳.۱۴	-۷.۱%	۴۰	۹۳.۶%	۹۵.۴%	۶۱.۷
۲	فولاد (دلار)	تن	۴۴۷	۴۱۵	۷.۷%	۳۷	۳۲.۸%	۳۷.۶%	-۸۹.۹
۳	سنگ آهن (دلار)	تن	۹۰	۹۱.۵	-۱.۶%	۳۲	۴.۷%	۳۱.۱%	-۱۵.۵
۴	زغال سنگ (دلار)	تن	۸۱.۱۷	۸۰	۱.۵%	۲	۲۱.۱%	۷.۱%	۰.۰
۵	مس (دلار)	تن	۵,۸۸۶.۳۰	۵,۹۷۴.۴	-۱.۵%	۷	۷۷.۳%	۳۰.۰%	-۷۶.۴
۶	روی (دلار)	تن	۲۸۵۷	۲۸۵۱	۰.۲%	۶	۴۶.۹%	۵.۹%	-۱۳.۱
۷	آلومینیوم (دلار)	تن	۱۹۰.۴	۱۸۸۳.۷	۱.۱%	۵	۶۰.۰%	۲۱.۳%	-۰.۴
۸	اوره (دلار)	تن	۲۲۱	۲۵۵	-۱۳.۳%	۳	۸۴.۱%	۰.۰%	۹.۳
۹	متانول (دلار)	تن	۳۳۴	۳۸۰	-۱۲.۱%	۵	۴۵.۳%	۰.۸%	-۲۳.۲
۱۰	گاز طبیعی (دلار)	MMBtu	۳	۲.۸۲	۶.۴%	۶	۱۷.۳%	۲۷.۳%	۲۴.۵
۱۱	شکر (سنت)	پوند	۱۷.۸۷	۲۰.۳	-۱۲.۰%	۱۸	۳۴.۸%	۸.۲%	-۳.۲
مجموع تأثیر بر شاخص کالاهای اساسی									-۲۶.۰
مجموع تأثیر بر شاخص ۲۳۱ شرکت مورد بررسی									۸۳.۹
مجموع تأثیر بر شاخص ۳۲۶ شرکت بورسی									-۳۶۸.۲

بر اساس جدول فوق قیمت جهانی مس در یک ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ با ۱,۵ درصد کاهش به ۵,۸۸۶,۳ دلار در هر تن رسید که با بررسی به عمل آمده مس به طور مستقیم در فروش و بهای تمام شده هفت شرکت بورسی تأثیر داشته است و از آنجایی که سهم این عامل از مجموع فروش و بهای تمام شده این هفت شرکت به ترتیب حدود ۷۷ و ۳۰ درصد می باشد، بنابراین انتظار می رود با کاهش قیمت جهانی مس و در نظر گرفتن نسبت های عامل از فروش و بهای تمام شده، شاهد تأثیر منفی در این هفت شرکت باشیم که تأثیر منفی ۷۶,۴ واحدی مس در مجموع این هفت شرکت موید این موضوع است. بر خلاف مس، در فولاد با توجه به نسبت های عامل فولاد از مجموع فروش و بهای تمام شده ۳۷ شرکت مربوطه، شاهد آن هستیم که با وجود افزایش ۷,۷ درصد قیمت جهانی فولاد، مجموع تأثیر بر شاخص این ۳۷ شرکت بورسی منفی ۸۹,۹ واحد بوده است.

در نمودار (۲۴) میزان تأثیر بر شاخص کل بورس برای هر یک از کالاهای اساسی مورد بررسی به همراه میزان تغییرات نرخ‌های جهانی این کالاها نشان داده شده است.



فرا بورس ایران

در جدول صفحه بعد، تغییرات نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی در بازه زمانی یک ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ و تأثیر هر یک از آن‌ها بر شرکت‌های فرا بورسی متأثر از آن عامل نمایش داده شده است.

همان طور که مشاهده می‌شود، تقریباً در اغلب کالاهای مورد بررسی، مجموع تأثیر بر شاخص آن کالا در شرکت‌های مربوط به آن عامل در جهت تغییرات نرخ‌های جهانی آن کالا و با توجه به نسبت‌های فروش و بهای تمام‌شده مربوط به هر کالا به کل فروش و بهای تمام‌شده شرکت‌های مربوطه می‌باشد.

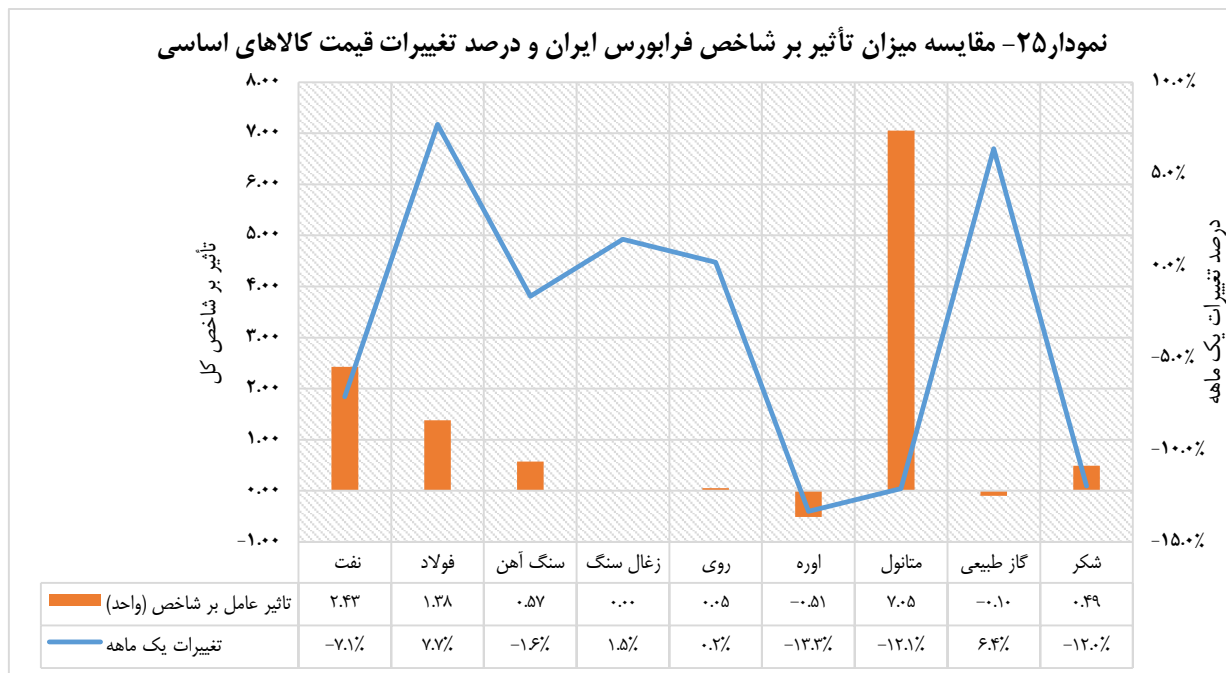
به عنوان مثال قیمت جهانی فولاد در بازه یک ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۸، ۷,۷ درصد رشد داشته است که این تغییر در ۴ شرکت فرا بورس ایران که به طور مستقیم فولاد در فروش و یا بهای تمام‌شده آن‌ها موثر است، موجب تأثیر مثبت مجموعاً ۱,۳۸ واحدی این شرکت‌ها ناشی از افزایش قیمت جهانی فولاد شده است.

تغییرات نرخ های جهانی کالاهای اساسی					تاثیر بر شاخص مربوط به کالاهای اساسی در اسفند ماه ۱۳۹۵				
ردیف	عامل بازار	واحد	۹۵/۱۲/۲۸	۹۵/۱۱/۳۰	درصد تغییرات یک ماهه	تعداد شرکت ها	نسبت فروش وابسته به عامل بازار به کل فروش شرکت های مربوطه	نسبت بهای تمام شده وابسته به عامل بازار به کل بهای تمام شده شرکت های مربوطه	تاثیر عامل بر شاخص فرابورس ایران (واحد)
۱	نفت (دلار)	بشکه	۴۹.۳۶	۵۳.۱۴	-۷.۱٪	۶	۷۳.۹٪	۶۵.۰٪	۲.۴۳
۲	فولاد (دلار)	تن	۴۴۷	۴۱۵	۷.۷٪	۴	۷۸.۰٪	۵.۸٪	۱.۳۸
۳	سنگ آهن (دلار)	تن	۹۰	۹۱.۵	-۱.۶٪	۳	۰.۰٪	۲۶.۶٪	۰.۵۷
۴	زغال سنگ (دلار)	تن	۸۱.۱۷	۸۰	۱.۵٪	۳	۲.۰٪	۱۱.۸٪	۰.۰۰
۵	روی (دلار)	تن	۲۸۵۷	۲۸۵۱	۰.۲٪	۳	۸۸.۲٪	۵.۵٪	۰.۰۵
۶	اوره (دلار)	تن	۲۲۱	۲۵۵	-۱۳.۳٪	۱	۷۷.۸٪	۰.۰٪	-۰.۵۱
۷	متانول (دلار)	تن	۳۳۴	۳۸۰	-۱۲.۱٪	۱	۹۸.۲٪	۰.۰٪	۷.۰۵
۸	گاز طبیعی (دلار)	MMBtu	۳	۲.۸۲	۶.۴٪	۱	۰.۰٪	۲۷.۷٪	-۰.۱۰
۹	شکر (سنت)	پوند	۱۷.۸۷	۲۰.۳	-۱۲.۰٪	۶	۲۷.۶٪	۲۰.۱٪	۰.۴۹
					مجموع تاثیر بر شاخص کالاهای اساسی				
					۱۱.۴				
					مجموع تاثیر بر شاخص ۳۹ شرکت مورد بررسی در فرابورس				
					۶.۸				
					مجموع تاثیر بر شاخص ۸۷ شرکت فرابورسی				
					۲۲.۶				

✓ رشد ۷,۷ درصدی نرخ جهانی فولاد با توجه به نسبت های فروش و بهای تمام شده فولاد از کل فروش و بهای تمام شده ۴ شرکت مربوط به آن، منجر به تأثیر مثبت ۱,۳۸ واحدی فولاد بر شاخص فرابورس شده است.

✓ با کاهش ۱۳,۳ درصدی قیمت جهانی اوره و رسیدن به قیمت ۲۲۱ دلار در هر تن، شاهد تأثیر آن بر شاخص فرابورس ایران و به میزان ۰,۵۱- واحد در پایان اسفندماه ۹۵ بوده ایم. قیمت جهانی متانول نیز در پایان این ماه با ۱۲,۱ درصد کاهش به ۳۳۴ دلار در هر تن رسید که در پی آن شاهد تأثیر مثبت ۷,۰۵ واحدی بر شاخص فرابورس ایران بوده ایم.

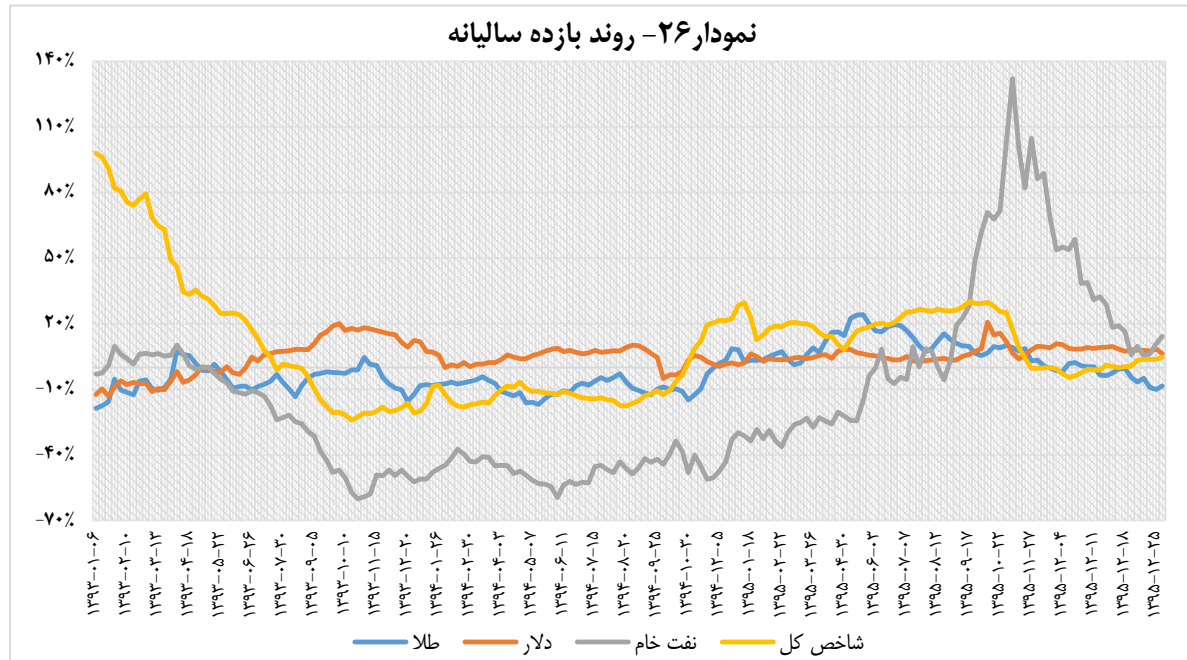
در نمودار (۲۵) میزان تأثیر بر شاخص فرابورس ایران برای هر یک از کالاهای اساسی مورد بررسی به همراه میزان تغییرات نرخ‌های جهانی این کالاها نشان داده شده است.



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.^۵

در نمودار (۲۶) روند بازدهی سالانه چهار شاخص مورد بررسی در بازه زمانی ۱۳۹۳/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ نشان داده شده است. روند بازدهی شاخص کل و نفت قابل توجه است.



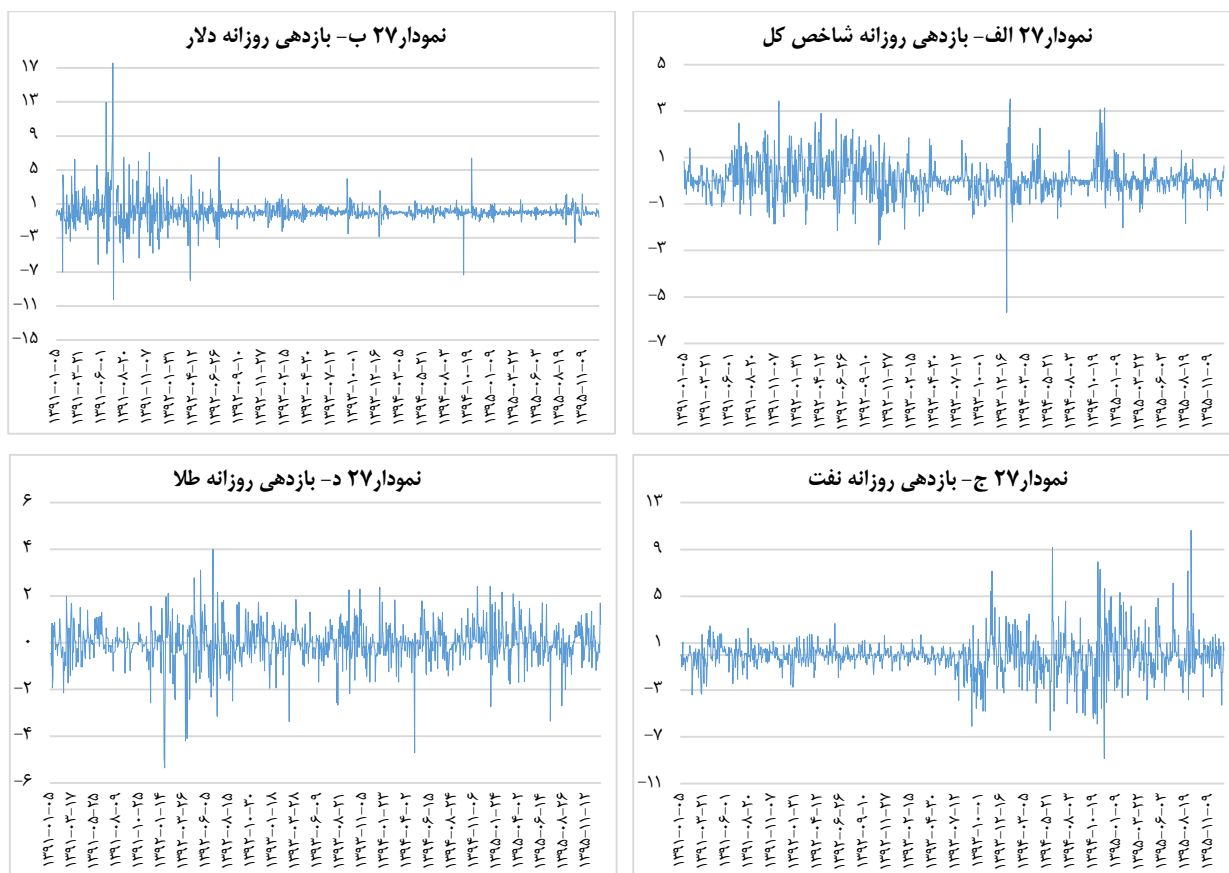
شاخص های مورد بررسی

در جدول زیر خلاصه آمار توصیفی بازدهی روزانه (درصدی) شاخص کل، قیمت دلار، طلا و نفت در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ نمایش داده شده است.

نفت	طلا	دلار	شاخص کل	
-۰.۰۷	-۰.۰۳	۰.۰۶	۰.۰۹	میانگین
-۰.۰۵	-۰.۰۱	۰.۰۰	۰.۰۲	میانه
۱۰.۶۳	۴.۰۱	۱۷.۵۶	۳.۵۳	بیشینه
-۸.۸۵	-۵.۳۵	-۱۰.۲۲	-۵.۶۷	کمینه
۱.۵۲	۰.۸۰	۱.۵۰	۰.۷۵	انحراف معیار
۰.۵۰	-۰.۸۶	۱.۹۹	۰.۲۴	چولگی
۱۰.۶۲	۹.۵۶	۳۱۶۶	۷.۷۵	کشیدگی
۲۹۷۳.۱	۲۳۱۲.۳	۴۲۱۵۳۶	۱۱۴۶۶	آزمون Jurque-Bera
۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	P-Value J-B
۱۲۰.۸	۱۲۰.۸	۱۲۰.۸	۱۲۰.۸	تعداد مشاهدات

^۵ جهت کسب اطلاعات بیشتر به گزارش تفصیلی "بررسی تأثیر بازده بازارهای موازی بر بازده شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران" در تارنمای مرکز پژوهش، توسعه و مطالعات اسلامی سازمان بورس و اوراق بهادار تهران مراجعه نمایید.

نتایج استفاده از آزمون جاک-برا نشان می‌دهد بازدهی روزانه هیچ‌یک از متغیرهای مورد بررسی توزیع نرمال ندارند. در نمودار (۲۷-الف تا د) بازدهی روزانه شاخص کل، قیمت نفت، طلا و دلار در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ نشان داده شده است.



همبستگی بین متغیرها

ضریب همبستگی بین بازده روزانه چهار متغیر مورد بررسی در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ در جدول زیر نشان داده شده است. همان طور 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	۰.۰۲۴	۰.۰۳۱	۰.۰۴۸	۱
طلا	۰.۰۱۷	۰.۰۳۲	۱	
دلار	-۰.۰۴۱	۱		
شاخص کل	۱			

روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها بر شاخص کل

بررسی روابط هم‌انباشتگی

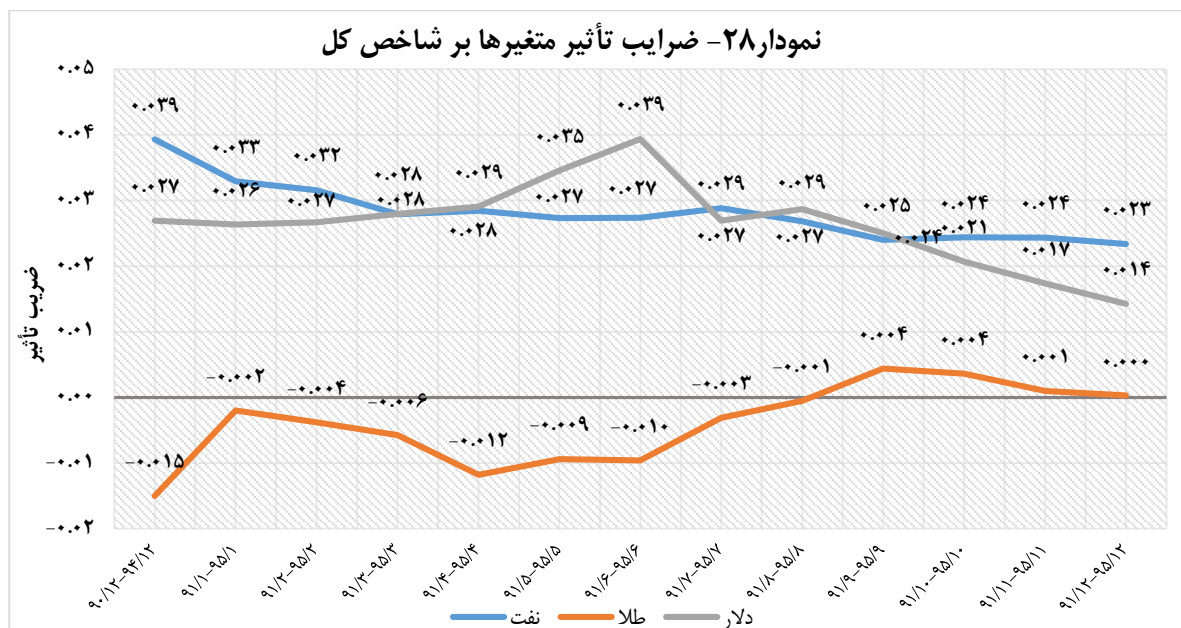
هم‌انباشتگی، عبارت است از مطالعه ثبات روابط بلندمدت بین متغیرهای سری زمانی ناماناً^۶ اندیشه هم‌انباشتگی، در واقع رهیافتی برای حل مشکل رگرسیون‌های کاذب، در سری‌های زمانی است. به منظور بررسی وجود روابط هم‌انباشتگی بین شاخص کل (متغیر وابسته) و قیمت نفت، دلار و طلا (متغیرهای مستقل) از آزمون هم‌انباشتگی یوهانسون (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 ۱۳۹۱/۱۲/۲۸ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ را نشان می‌دهد.

$$TRI = 0.333*TRI(-1) + 0.0233*OPEC(-1) - 0.0003*GOLD(-1) + 0.0142*DOLLAR(-1) + 0.0502$$

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 (۲۸) مقدار و روند ضرایب تأثیر هر یک از متغیرهای مورد بررسی بر تغییرات شاخص کل طی دوازده ماه سال ۱۳۹۵ نشان داده شده است.



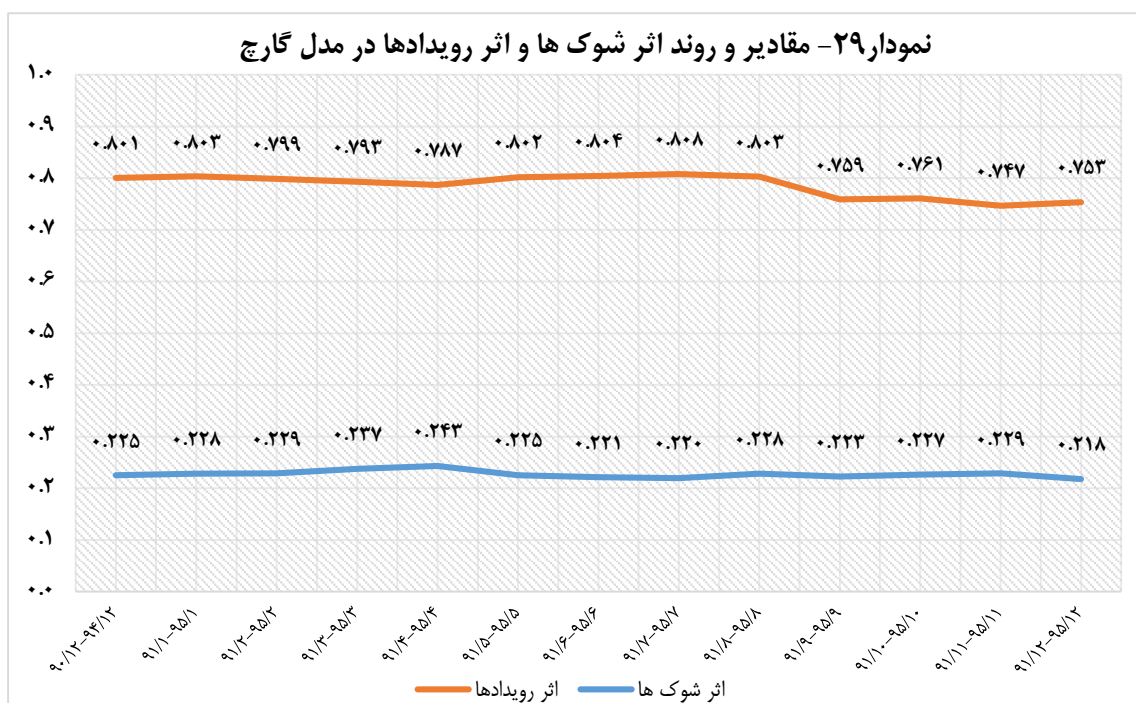
^۶ یک سری زمانی ناماناً است هرگاه دارای روند باشد و یا واریانس آن به صورت خوشه‌ای تغییر کند.

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. همچنین طی پنج ماه اخیر، ضریب تأثیر دلار بر شاخص کل روند کاهشی را نشان می‌دهد. 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 ۱۳۹۱/۱۲/۲۸ تا ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ را نشان می‌دهد.

$$\text{VARIANCE} = 0.019 + 0.2178 * \text{RESID}(-1)^2 + 0.7533 * \text{VARIANCE}(-1)$$

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 (۲۹) مقادیر و روند اثر شوک‌ها و اثر رویدادها در مدل گارچ در طی دوازده ماه سال ۱۳۹۵ نمایش داده شده است. هر زمان اثر شوک‌ها کاهش می‌یابد اثر رویدادهای گذشته بیشتر می‌شود.



مدیریت پیگیری تخلفات

مقدمه

این مدیریت یکی از مدیریت‌های زیرمجموعه معاونت حقوقی است که اجرای سیاست‌های سازمان بورس و اوراق بهادار در زمینه رسیدگی به تخلفات و نیز وظیفه بررسی و رسیدگی به شکایات واصله از طریق سامانه الکترونیک شکایات را بر عهده دارد.

وظایف محوله بر عهده این مدیریت و اجرای صحیح آن، ضامن سلامت و امنیت خاطر سرمایه‌گذاران داخلی و خارجی حوزه بازار سرمایه بوده و در واقع بخش وسیعی از نقش نظارتی سازمان، از طریق اعمال ضمانت اجراهای موجود در قوانین و مقررات بازار سرمایه، توسط این مدیریت به سرانجام می‌رسد. اقدامات مدیریت پیگیری تخلفات، در دو بخش کلی پیگیری شکایات حوزه بازار سرمایه و رسیدگی به تخلفات اشخاص تحت نظارت سازمان صورت می‌پذیرد.



❖ عناوین مورد بررسی در این بخش

✓ تخلفات بر اساس واحد گزارش‌دهنده

واحدهای داخل سازمان

واحدهای خارج از سازمان

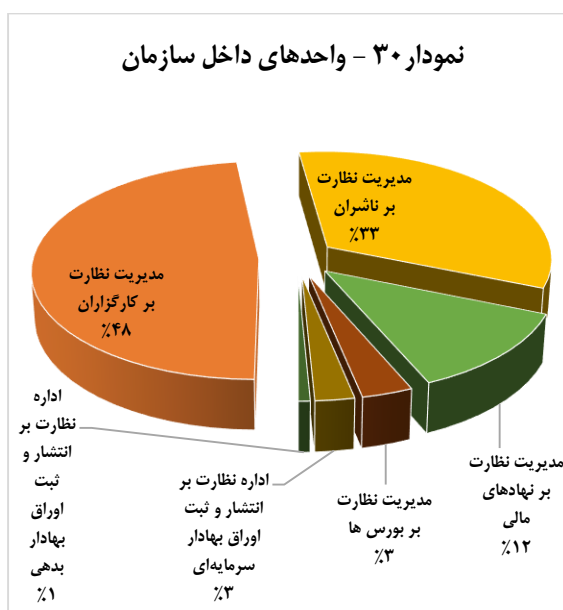
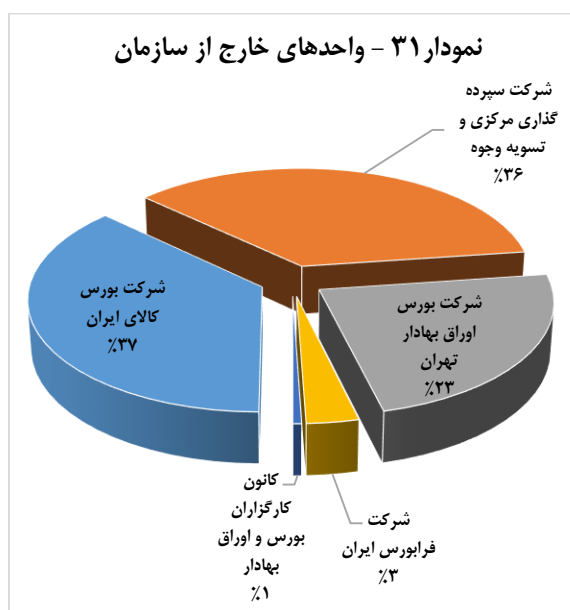
✓ تخلفات بر اساس نوع متخلف

آمار تخلفات در دوازده ماهه ۱۳۹۵

تخلفات بر اساس واحد گزارش دهنده

تعداد گزارش	واحد گزارش دهنده
واحدهای داخل سازمان (۳۹۸ گزارش)	
۱۹۱	مدیریت نظارت بر کارگزاران
۱۳۲	مدیریت نظارت بر ناشران
۴۹	مدیریت نظارت بر نهادهای مالی
۱۳	مدیریت نظارت بر بورس ها
۱۰	اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بهادار سرمایه ای
۳	اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بهادار بدهی
واحدهای خارج از سازمان (۱۸۴ گزارش)	
۶۸	شرکت بورس کالای ایران
۶۶	شرکت سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه
۴۳	شرکت بورس اوراق بهادار تهران
۶	شرکت فرابورس ایران
۱	کانون کارگزاران بورس و اوراق بهادار
۵۸۲	جمع کل

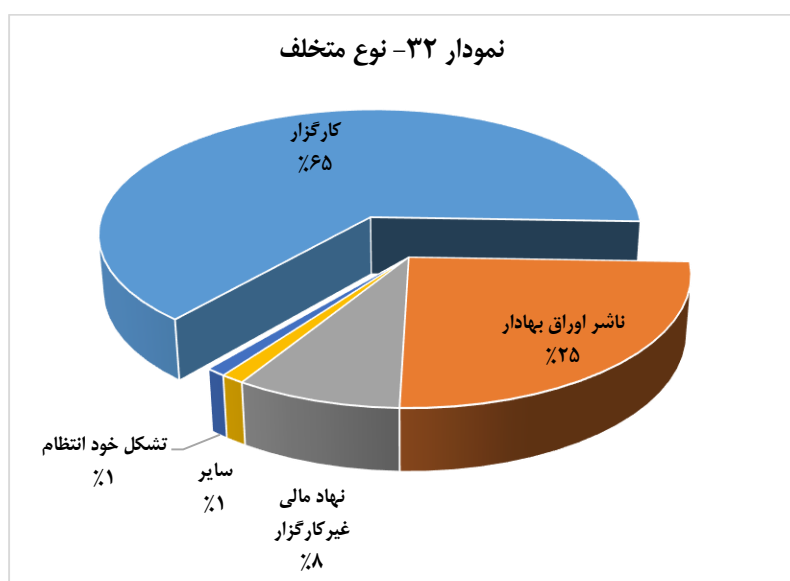
منبع: مدیریت پیگیری تخلفات



تخلفات بر اساس نوع متخلف

متخلف	تعداد
کارگزار	۳۷۵
ناشر اوراق بهادار	۱۴۵
نهاد مالی غیر کارگزار	۴۹
تشکل خود انتظام	۶
سایر	۷
جمع کل	۵۸۲

منبع: مدیریت پیگیری تخلفات



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
اصلاح دستورالعمل ثبت، نگهداری و گزارش دهی اسناد، مدارک و اطلاعات توسط اشخاص تحت نظارت	۹۵/۱۱/۱۲	هیئت مدیره
مصوبه در خصوص تأیید تغییر ترکیب سهامداری نهادهای مالی (سهامی خاص)	۹۵/۱۱/۱۲	هیئت مدیره
اصلاح دستورالعمل تأسیس و فعالیت سبدگردانی	۹۵/۱۱/۱۲	هیئت مدیره
اصلاح دستورالعمل تأسیس و فعالیت مشاور سرمایه گذاری	۹۵/۱۱/۱۲	هیئت مدیره
اصلاح دستورالعمل تأسیس و فعالیت پردازش اطلاعات مالی	۹۵/۱۱/۱۲	هیئت مدیره
اصلاح دستورالعمل تعریف و اعطای گواهینامه های حرفه ای بازار اوراق بهادار	۹۵/۱۱/۱۲	هیئت مدیره
اصلاح مصوبه در خصوص سقف حق عضویت سالانه اعضای کانون کارگزاران	۹۵/۱۲/۴	هیئت مدیره
مصوبه در خصوص سقف مجموع خالص بدهی شرکت های کارگزاری به شرکت سپرده گذاری مرکزی بابت معاملات اوراق بهادار	۹۵/۱۲/۱۰	هیئت مدیره
حفظ قدرت خرید در اسناد خزانه اسلامی	۹۵/۱۰/۱۵	کمیته فقهی
صندوق های سرمایه گذاری تک سهم و گواهی سپرده سهم	۹۵/۱۱/۲۷	کمیته فقهی

عناوین مقررات در دست بررسی در کمیته تدوین مقررات	
اصلاح مقررات بورس انرژی	۱
اصلاح مواردی از مقررات ثبت سفارش کالا، پذیرش و معاملات بورس کالا	۲
دستورالعمل انتشار اوراق خرید دین	۳

عناوین در دست بررسی کمیته فقهی	
اوراق جعاله در فرض قرار گرفتن حق بهره برداری به عنوان جُل	۱

- ✓ در اسفندماه ۱۳۹۵، ارزش بازار سهام در بورس تهران و فرابورس ایران به مقدار ۴,۲۶۳,۶۸۹ میلیارد ریال رسید که نسبت به ماه قبل ۰,۲۴ درصد رشد داشته است.
- ✓ در این مدت ارزش معاملات در کل بورس ها (بورس تهران، فرابورس ایران، کالا و انرژی) ۱۷۴,۹۳۷ میلیارد ریال بوده است که نسبت به ماه گذشته ۱۸,۰۲ درصد افزایش یافته است.
- ✓ حجم و ارزش معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران در اسفندماه ۹۵، به ترتیب ۷۷,۵ و ۸۰,۳۹ درصد نسبت به بهمنماه ۹۵ افزایش یافته است. این در حالی است که تعداد معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران ۱۲,۹۷ در این ماه کاهش داشته است.
- ✓ شاخص های کل بورس تهران و فرابورس ایران در پایان اسفندماه ۹۵ به ترتیب برابر ۷۷,۲۳۰ و ۸۷۵ وامد هستند که به ترتیب ۰,۴۸ درصد کاهش و ۲,۵۸ درصد افزایش را نسبت به ماه قبل نشان می دهند.
- ✓ طی شش ماه اخیر شاهد افزایش نسبت ارزش معاملات اشخاص مقوقی از کل ارزش معاملات انجام شده بوده ایم. به طوری که نسبت ارزش معاملات اشخاص مقوقی از ۵۸,۶۴ درصد در مهرماه ۹۵ به ۸۱,۱۵ درصد در پایان اسفندماه ۹۵ افزایش یافته است.
- ✓ قیمت جهانی مس در یک ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۸ با ۱,۵ درصد کاهش به ۵۸۸۶,۳ دلار در هر تن رسید به با بررسی به عمل آمده این کاهش باعث ایجاد تأثیر منفی ۷۶,۴ وامدی بر شاخص، ناشی از تأثیر قیمت جهانی مس بر شرکت های بورسی متأثر از آن بوده است.