



سازمان بورس و اوراق بهادار
Securities & Exchange Organization

گزارش آماری

فروردین ماه ۱۳۹۷

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 - حسن حکیمیان - سامان ابراهیم پور - زهره گیوی

همکاران سایر بخش‌ها:

محمد مهدی مؤمن زاده (اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بهادار بدهی)

سیاوش پرویز نژاد (اداره امور نهادهای مالی)

محمد رضا عالمی، مهدی زمانی سبزی و توحید کاظمی (اداره امور بورس‌ها)

تاریخ گزارش: فروردین ماه ۱۳۹۷

۵.....	نگاهی به بازار سرمایه در فروردین ماه ۱۳۹۷
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.....	تعداد نمادها
۲۵.....	آمار عرضه اولیه
۲۵.....	سرمایه گذاران خارجی
۲۶.....	شاخص های بازار سرمایه
۲۷.....	اینفوگرافیک شاخص
۲۸.....	مقایسه شاخص کل با شاخص های کشورهای در حال توسعه و اسلامی
۲۹.....	مقایسه معاملات سرمایه گذاران حقیقی و حقوقی در بورس و فرا بورس
۳۰.....	آمار معاملات حقیقی و حقوقی در سهام
۳۱.....	آمار معاملات حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی
۳۲.....	ارزش و حجم معاملات به تفکیک خرید و فروش حقیقی و حقوقی در بورس و فرا بورس
۳۳.....	ارزش معاملات حقیقی و حقوقی به تفکیک نوع اوراق بهادار
۳۴.....	لیست نمادهای متوقف
۳۷.....	عملکرد سرمایه گذاران در بازار سرمایه به صورت منطقه ای
۳۷.....	نسبت حجم معاملات به تفکیک معاملات برخط و غیر برخط
۳۷.....	حجم معاملات به تفکیک مناطق

آمار تأمین مالی.....	۴۰
مانده اوراق بدهی منتشره.....	۴۱
سررسید اوراق بدهی منتشره.....	۴۱
بازار سرمایه و بازارهای موازی.....	۴۴
مروری بر نرخ‌های جهانی کالای اساسی و تغییرات شاخص‌ها.....	۴۵
نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی و تأثیر آن‌ها بر بازار سرمایه.....	۴۶
بورس تهران.....	۴۶
فرابورس ایران.....	۴۸
مدل آماری بررسی تأثیر بازارهای موازی بر شاخص کل بورس.....	۵۱
شاخص‌های مورد بررسی.....	۵۱
همبستگی بین متغیرها.....	۵۲
روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها بر شاخص کل.....	۵۳
مصوبات کمیته‌های تخصصی.....	۵۴

نگاهی به بازار سرمایه در فروردین ماه ۱۳۹۷

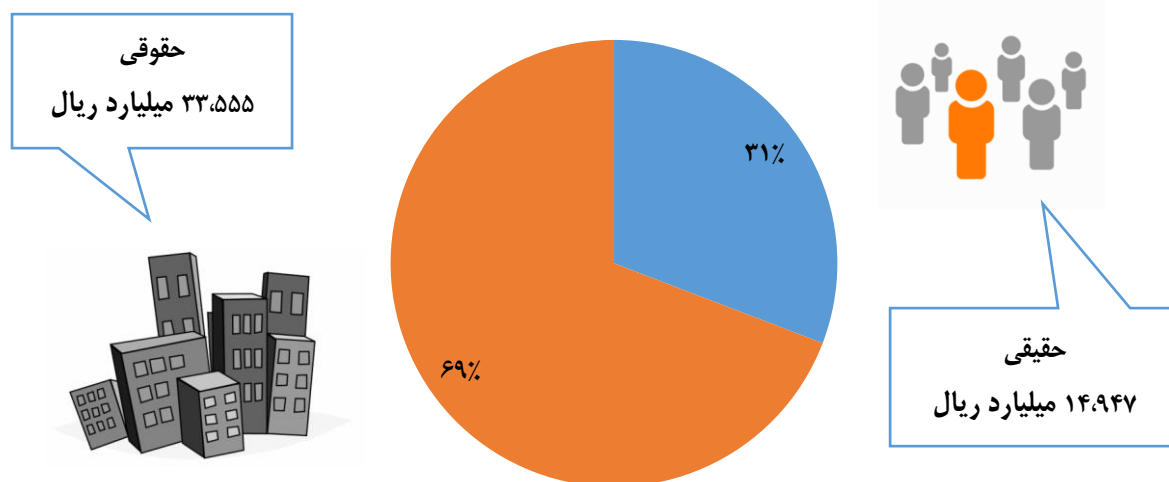
ارزش بازار بورس تهران و فرابورس ایران

میلیارد ریال					
درصد تغییرات		ارزش بازار			نوع بورس
نسبت به ماه قبل	نسبت به پایان سال ۹۵	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۷/۰۱/۳۱	
-۰.۶۲٪	۱۷.۹۸٪	۳,۲۲۰,۰۴۶	۳,۸۲۲,۸۵۷	۳,۷۹۹,۰۳۰	بورس تهران
۲.۱۶٪	۴۳.۴۸٪	۱,۰۴۳,۶۴۳	۱,۴۶۵,۷۴۹	۱,۴۹۷,۴۲۰	فرابورس ایران
۰.۱۵٪	۲۴.۲۲٪	۴,۲۶۳,۶۸۹	۵,۲۸۸,۶۰۶	۵,۲۹۶,۴۵۱	مجموع بورس و فرابورس

شاخص‌های بازار سرمایه

درصد تغییرات		تاریخ			نام شاخص
نسبت به ماه قبل	نسبت به پایان سال ۹۵	۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۷/۰۱/۳۱	
-۰.۸۰٪	۲۳.۶۹٪	۷۷,۲۳۰	۹۶,۲۹۰	۹۵,۵۲۴	شاخص کل
-۳.۱۰٪	۶.۴۴٪	۱۵,۷۲۳	۱۷,۲۷۱	۱۶,۷۳۵	شاخص کل (هم وزن)
-۰.۸۴٪	۱۲.۸۷٪	۲۶,۸۲۶	۳۰,۵۳۴	۳۰,۲۷۹	شاخص قیمت
-۳.۲۰٪	۰.۵۴٪	۱۲,۳۷۷	۱۲,۸۵۵	۱۲,۴۴۴	شاخص قیمت (هم وزن)
-۰.۴۹٪	۳۷.۹۰٪	۳,۰۹۸	۴,۲۹۳	۴,۲۷۲	شاخص ۳۰ شرکت بزرگ
-۰.۶۲٪	۲۹.۴۳٪	۶۶,۱۰۰	۸۶,۰۸۲	۸۵,۵۵۲	شاخص صنعت
-۰.۱۵٪	۳۲.۷۸٪	۳,۰۳۵	۴,۰۳۶	۴,۰۳۰	شاخص ۵۰ شرکت فعال‌تر
-۳.۰۱٪	۲۱.۶۰٪	۸۷۵	۱,۰۹۷	۱,۰۶۴	شاخص کل فرابورس

معاملات حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس



حجم و ارزش معاملات

تاریخ			درصد تغییرات	
بورس	نوع	فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل
بورس تهران	حجم معامله - هزار سهم	۹،۷۹۱،۶۰۱	۴۷،۸۳۵،۵۰۲	-۷۹.۵۳٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۰،۹۳۴	۹۴،۸۸۱	-۷۷.۹۴٪
فرا بورس ایران	حجم معامله - هزار سهم	۲،۶۱۱،۱۹۰	۱۲،۹۲۹،۹۰۴	-۷۹.۸۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۷،۵۶۸	۱۴۴،۰۸۳	-۸۰.۸۷٪
بورس کالا	حجم معامله - تن	۱،۴۹۳،۰۲۰	۲،۵۲۴،۷۳۲	-۴۰.۸۶٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳۳،۶۹۶	۵۲،۴۴۴	-۳۵.۷۵٪
بورس انرژی	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵،۰۴۲	۱۴،۳۶۰	-۶۴.۸۹٪
مجموع ارزش معاملات بورس ها		۸۷،۲۴۰	۳۰۵،۷۶۸	-۷۱.۴۷٪

مانده اوراق بدهی منتشره

میلیارد ریال				
نوع اوراق	پایان فروردین ماه ۹۷	درصد از کل	پایان سال ۹۶	درصد از کل
مشارکت	۱۶۰,۱۱۹	۲۲,۴۴٪	۱۶۰,۱۱۹	۲۲,۳۱٪
اجاره	۴۹,۰۰۰	۶,۸۷٪	۴۹,۰۰۰	۶,۸۳٪
سلف	۵۰,۰۰۰	۰,۷۰٪	۵۰,۰۰۰	۰,۷۰٪
مراجعه	۵۷,۳۸۰	۸,۰۴٪	۵۷,۳۸۰	۸,۰۰٪
اسناد خزانه اسلامی	۲۶۰,۰۰۰	۳۶,۴۳٪	۲۶۰,۰۰۰	۳۶,۲۳٪
منفعت	۵۰,۰۰۰	۷,۰۱٪	۵۰,۰۰۰	۶,۹۷٪
معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری ها و دولت	۳۵,۹۹۵	۵,۰۴٪	۳۵,۹۹۵	۵,۰۲٪
جمع اوراق بهادار دولتی و شهرداری ها	۶۱۷,۴۹۴	۸۶,۵۳٪	۶۱۷,۴۹۴	۸۶,۰۵٪
انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی	۹۶,۱۲۱	۱۳,۴۷٪	۱۰۰,۱۲۱	۱۳,۹۵٪
جمع کل بازار اوراق بدهی	۷۱۳,۶۱۵	۱۰۰,۰۰٪	۷۱۷,۶۱۵	۱۰۰,۰۰٪

انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی

میلیارد ریال			
نوع بازار	عنوان	عملکرد فروردین ماه ۱۳۹۷	عملکرد ۹۶
انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	انتشار اوراق بهادار بدهی با مجوز سازمان بورس	۰	۴۷,۵۹۰
	انتشار اوراق سلف موازی استاندارد	۰	۱۹,۷۰۰
	اوراق مشارکت دولت، شهرداری ها و بانکها	۰	۱۱۱,۶۱۹
	گواهی سپرده سرمایه گذاری عام و خاص	۰	۰
	اوراق اجاره دولتی	۰	۲۱۵۰۰
	اوراق مراجعه دولتی	۰	۳۷,۳۸۰
	اوراق منفعت دولتی	۰	۵۰,۰۰۰
	اسناد خزانه اسلامی	۰	۳۴۸,۲۳۴
	امتیاز تسهیلات مسکن	۴۴۰	۱۲,۷۵۲
	جمع	۴۴۰	۶۴۸,۷۷۵

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 به تفکیک مناطق
- ✓ ارزش صندوق‌های سرمایه‌گذاری
- ✓ آمار تأمین مالی

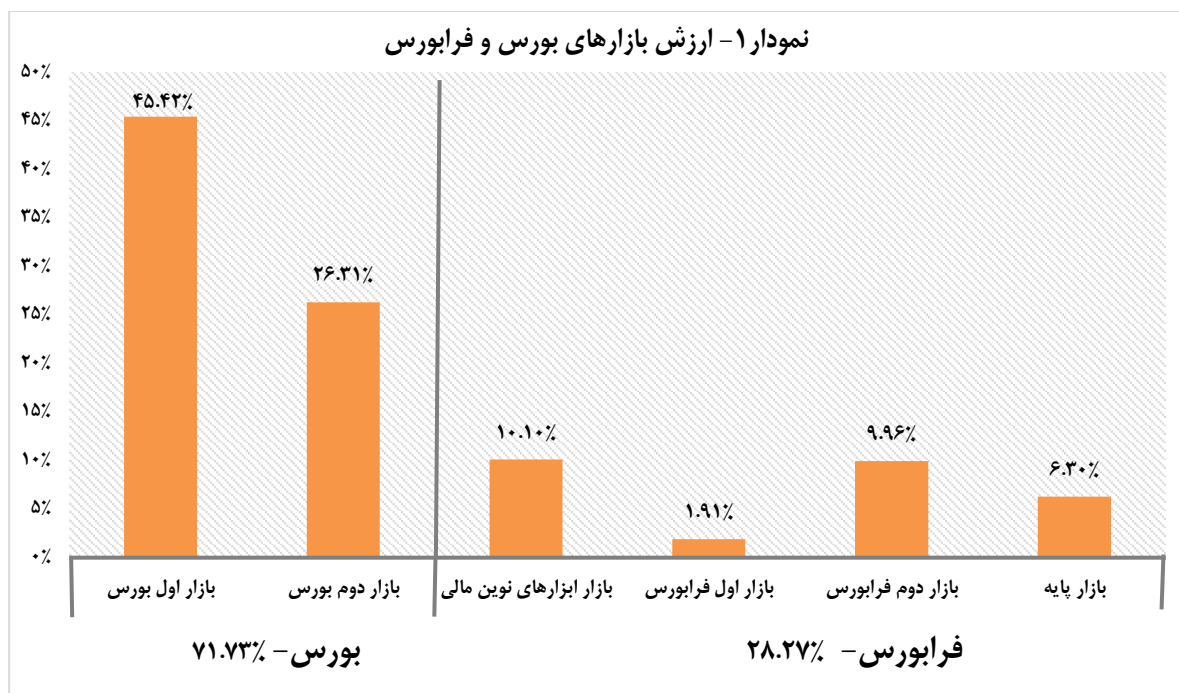
ارزش کل بازار به تفکیک بازارها

در جدول زیر، ارزش کل سهام بازار بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران به تفکیک بازارها در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و انتهای سال ۱۳۹۵ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

نوع بازار		ارزش بازار			درصد تغییرات	
بورس تهران	بازار اول	۱۳۹۷/۰۱/۳۱	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به پایان سال ۹۵
	بازار دوم	۱،۳۹۳،۳۲۰	۱،۴۰۶،۰۲۳	۱،۱۴۴،۷۲۴	-۰.۹۰٪	۲۱.۷۲٪
	مجموع	۳،۷۹۹،۰۳۰	۳،۸۲۲،۸۵۷	۳،۲۲۰،۰۴۶	-۰.۶۲٪	۱۷.۹۸٪
	بازار ابزارهای نوین مالی	۵۳۴،۹۹۲	۴۸۲،۵۵۴	۲۲۱،۷۸۰	۱۰.۸۷٪	۱۴۱.۲۳٪
	بازار اول	۱۰۱،۳۶۰	۱۰۳،۹۴۹	۹۷،۶۹۵	-۲.۴۹٪	۳.۷۵٪
فرابورس ایران	بازار دوم	۵۲۷،۳۱۹	۵۴۳،۶۹۶	۴۴۹،۳۳۰	-۳.۰۱٪	۱۷.۳۶٪
	بازار پایه	۳۳۳،۷۴۹	۳۳۵،۵۵۰	۲۷۴،۸۳۸	-۰.۵۴٪	۲۱.۴۳٪
	مجموع	۱،۴۹۷،۴۲۰	۱،۴۶۵،۷۴۹	۱،۰۴۳،۶۴۳	۲.۱۶٪	۴۳.۴۸٪
	مجموع کل	۵،۲۹۶،۴۵۱	۵،۲۸۸،۶۰۶	۴،۲۶۳،۶۸۹	+۰.۱۵٪	۲۴.۲۳٪
	مجموع کل	۵،۲۹۶،۴۵۱	۵،۲۸۸،۶۰۶	۴،۲۶۳،۶۸۹	+۰.۱۵٪	۲۴.۲۳٪

درصد ارزش بازارهای مختلف بورس و فرابورس در فروردین ماه ۱۳۹۷ در نمودار (۱) نمایش داده شده است.



ارزش بازارها به تفکیک صنایع

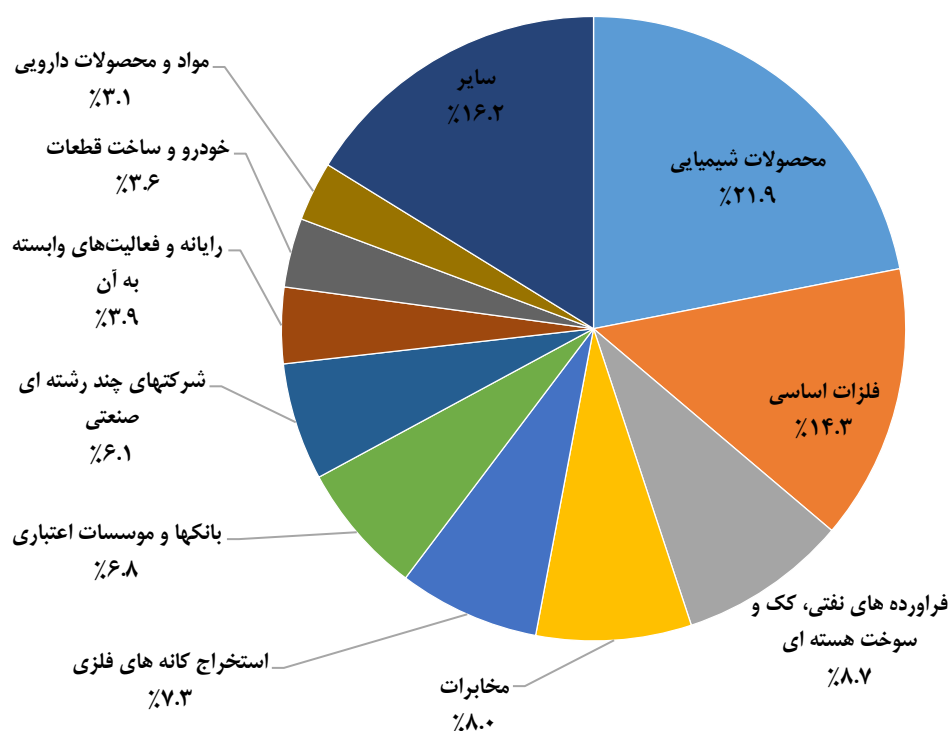
بورس اوراق بهادار تهران

در جدول زیر ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش بازار در بورس اوراق بهادار تهران در تاریخ ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

۱۳۹۵/۱۲/۲۸		۱۳۹۶/۱۲/۲۹		۱۳۹۷/۰۱/۳۱		نام نوع صنعت
درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	
۲۰.۶۴٪	۶۶۴,۴۷۲	۲۲.۰۵٪	۸۴۲,۸۴۵	۲۱.۹۲٪	۸۳۲,۷۰۷	محصولات شیمیایی
۱۰.۳۰٪	۳۳۱,۵۵۷	۱۴.۲۱٪	۵۴۳,۴۰۶	۱۴.۲۶٪	۵۴۱,۸۴۷	فلزات اساسی
۶.۶۱٪	۲۱۲,۸۰۱	۸.۶۲٪	۳۲۹,۶۹۷	۸.۷۵٪	۳۳۲,۳۲۳	فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای
۸.۸۵٪	۲۸۵,۰۶۴	۸.۰۲٪	۳۰۶,۷۵۴	۸.۰۴٪	۳۰۵,۵۳۷	مخابرات
۵.۷۱٪	۱۸۳,۸۱۰	۶.۸۱٪	۲۶۰,۲۱۷	۷.۳۲٪	۲۷۷,۹۱۹	استخراج کانه‌های فلزی
۹.۷۹٪	۳۱۵,۱۷۶	۶.۹۰٪	۲۶۳,۶۴۲	۶.۸۳٪	۲۵۹,۳۶۰	بانک‌ها و موسسات اعتباری
۶.۴۵٪	۲۰۷,۶۳۲	۶.۱۷٪	۲۳۵,۸۳۵	۶.۰۸٪	۲۳۱,۱۶۹	شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی
۲.۸۵٪	۹۱,۹۰۵	۳.۸۱٪	۱۴۵,۷۵۳	۳.۹۴٪	۱۴۹,۷۳۰	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن
۴.۸۴٪	۱۵۵,۹۲۷	۳.۹۲٪	۱۴۹,۸۴۰	۳.۵۸٪	۱۳۵,۸۳۷	خودرو و ساخت قطعات
۴.۳۹٪	۱۴۱,۵۰۷	۳.۱۵٪	۱۲۰,۲۹۹	۳.۰۸٪	۱۱۷,۰۸۶	مواد و محصولات دارویی
۸۰.۴۳٪	۲,۵۸۹,۸۵۱	۸۳.۶۶٪	۳,۱۹۸,۲۸۷	۸۳.۸۰٪	۳,۱۸۳,۵۱۶	مجموع
۱۹.۵۷٪	۶۳۰,۱۹۵	۱۶.۳۴٪	۶۲۴,۵۶۹	۱۶.۲۰٪	۶۱۵,۵۱۵	سایر
۱۰۰٪	۳,۲۲۰,۰۴۶	۱۰۰٪	۳,۸۲۲,۸۵۷	۱۰۰٪	۳,۷۹۹,۰۳۰	مجموع کل

نمودار ۲- ارزش صنایع بورسی



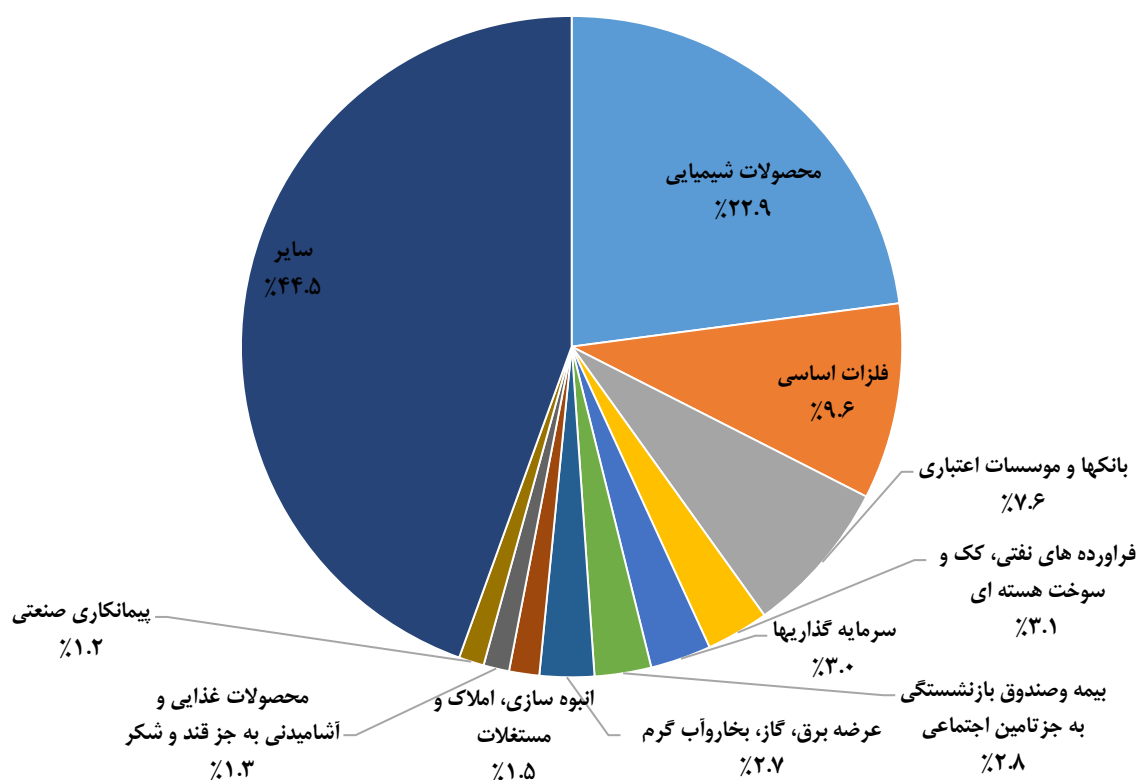
فراپورس ایران

در جدول زیر ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش بازار در فراپورس ایران در تاریخ ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ نشان داده شده است.

میلیارد ریال

۱۳۹۵/۱۲/۲۸		۱۳۹۶/۱۲/۲۹		۱۳۹۷/۰۱/۳۱		نام نوع صنعت
درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	درصد از کل	ارزش بازار	
۲۳.۲۱٪	۲۴۲,۱۹۱	۲۴.۰۰٪	۳۵۱,۷۲۹	۲۲.۹۰٪	۳۴۲,۹۷۰	محصولات شیمیایی
۱۱.۷۷٪	۱۲۲,۸۲۶	۱۰.۲۱٪	۱۴۹,۶۰۵	۹.۵۹٪	۱۴۳,۵۴۳	فلزات اساسی
۱۱.۰۸٪	۱۱۵,۶۴۱	۷.۷۸٪	۱۱۴,۰۹۹	۷.۶۰٪	۱۱۳,۸۵۳	بانکها و موسسات اعتباری
۴.۴۵٪	۴۶,۴۳۳	۳.۲۰٪	۴۶,۹۷۲	۳.۰۶٪	۴۵,۸۱۷	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای
۳.۵۵٪	۳۷,۰۶۷	۲.۷۲٪	۳۹,۸۱۹	۲.۹۷٪	۴۴,۵۰۰	سرمایه گذاریها
۳.۴۸٪	۳۶,۲۹۱	۲.۶۵٪	۳۸,۸۶۹	۲.۷۷٪	۴۱,۴۹۱	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی
۴.۱۱٪	۴۲,۹۱۹	۲.۶۸٪	۳۹,۲۵۵	۲.۶۷٪	۳۹,۹۵۲	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم
۲.۰۷٪	۲۱,۵۷۷	۱.۶۲٪	۲۳,۶۹۲	۱.۴۷٪	۲۲,۰۸۵	انبوه سازی، املاک و مستغلات
۱.۶۵٪	۱۷,۱۷۰	۱.۳۵٪	۱۹,۷۲۹	۱.۲۶٪	۱۸,۸۱۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر
۰.۸۸٪	۹,۲۱۳	۱.۵۲٪	۲۲,۲۴۴	۱.۲۳٪	۱۸,۴۶۰	پیمانکاری صنعتی
۶۶.۲۴٪	۶۹۱,۳۲۷	۵۷.۷۲٪	۸۴۶,۰۱۴	۵۵.۵۳٪	۸۳۱,۴۸۴	مجموع
۳۳.۷۶٪	۳۵۲,۳۱۶	۴۲.۲۸٪	۶۱۹,۷۳۶	۴۴.۴۷٪	۶۶۵,۹۳۷	سایر
۱۰۰٪	۱,۰۴۳,۶۴۳	۱۰۰٪	۱,۴۶۵,۷۴۹	۱۰۰٪	۱,۴۹۷,۴۲۰	مجموع کل

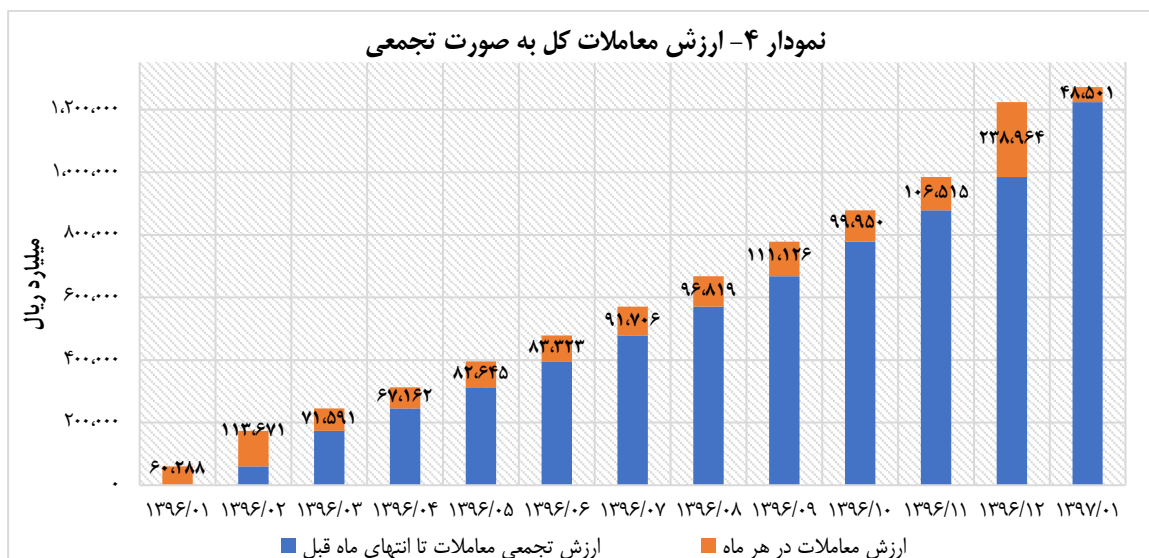
نمودار ۳- ارزش صنایع فراپورس ایران



آمار معاملات

ارزش تجمعی معاملات بورس و فرابورس

در نمودار (۴) ارزش معاملات در کلیه بازارها از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ به صورت تجمعی آورده شده است. قسمت نارنجی رنگ، ارزش معاملات انجام شده در هر ماه را نشان می‌دهد و قسمت آبی رنگ نشان‌دهنده ارزش تجمعی معاملات انجام شده تا انتهای ماه قبل است.



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

حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک نوع بخشی بازار در فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و در فروردین ماه ۱۳۹۶ در جدول زیر نشان داده شده است.

نوع بازار	تاریخ		درصد تغییرات	
	فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل / نسبت به ماه مشابه سال قبل
عمده	تعداد معامله	۱	۶۳	۷
	حجم معامله - هزار سهم	۲۵,۰۰۰	۲۶,۸۳۷,۲۷۵	۶۲۷,۸۲۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۹۴	۳۸,۸۱۹	۲,۲۰۵
بلوک	تعداد معامله	۷۸۵	۲۶۰۹	۳۷۶
	حجم معامله - هزار سهم	۱,۲۳۴,۷۴۳	۵,۹۸۰,۶۸۶	۱,۶۴۹,۰۶۰
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۳,۶۱۶	۱۶,۵۶۰	۷,۸۷۶
نرمال	تعداد معامله	۷۱۹,۹۰۷	۱,۴۸۷,۸۸۴	۱,۲۵۱,۳۵۹
	حجم معامله - هزار سهم	۸,۵۳۱,۸۵۸	۱۵,۰۱۷,۵۴۰	۱۴,۲۰۰,۸۵۱
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۷,۲۲۴	۳۹,۵۰۱	۲۷,۴۵۸
مجموع	تعداد معامله	۷۲۰,۶۹۳	۱,۴۹۰,۵۵۶	۱,۲۵۱,۶۴۲
	حجم معامله - هزار سهم	۹,۷۹۱,۶۰۱	۴۷,۸۳۵,۵۰۲	۱۶,۴۷۷,۷۳۱
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۰,۹۳۴	۹۴,۸۸۱	۳۷,۵۳۸
میانگین روزانه	تعداد معامله	۴۸,۰۴۶	۷۸,۴۵۰	۷۳,۶۲۶
	حجم معامله - هزار سهم	۶۵۲,۷۷۳	۲,۵۱۷,۶۵۸	۹۶۹,۲۷۸
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۳۹۶	۴,۹۹۴	۲,۲۰۸

حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک نوع بازار در فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و در فروردین ماه ۱۳۹۶ در جدول زیر نشان داده شده است.

نوع بازار		تاریخ		درصد تغییرات	
فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل	
حجم معامله - هزار سهم	بازار اوراق بدهی	۲,۴۷۰	۱۲,۵۳۰	۴,۱۵۵	-۴۰.۵۵%
	بازار اوراق مشتقه	۵	۱۲۰	۳۲۷,۳۸۳	-۱۰۰.۰۰%
	بازار اول	۶,۸۰۶,۷۰۳	۱۷,۲۰۷,۲۱۷	۹,۰۰۳,۲۴۲	-۲۴.۴۰%
	بازار دوم	۲,۷۹۵,۳۰۱	۲۹,۹۹۴,۷۰۹	۷,۰۶۹,۹۱۵	-۶۰.۴۶%
	بازار ETF	۱۸۷,۱۲۲	۶۲۰,۹۲۶	۷۳,۰۳۶	-۶۹.۸۶%
ارزش معامله - میلیارد ریال	بازار اوراق بدهی	۲,۴۸۱	۱۲,۵۷۰	۴,۲۴۰	-۴۱.۴۹%
	بازار اوراق مشتقه	۰.۵۸	۲.۱۳	۰.۹۱	-۳۶.۲۶%
	بازار اول	۱۱,۲۲۶	۳۳,۴۲۸	۱۷,۳۹۸	-۳۵.۴۷%
	بازار دوم	۵,۴۹۲	۴۴,۴۱۱	۱۵,۳۹۷	-۶۴.۳۳%
	بازار ETF	۱۷۳۴	۴۴۷۱	۵۰۲	-۶۱.۲۲%
تعداد معامله	بازار اوراق بدهی	۱,۸۸۳	۳,۴۵۳	۱,۱۵۹	-۴۵.۴۷%
	بازار اوراق مشتقه	۷۵	۶۰	۱۰۵	-۲۸.۵۷%
	بازار اول	۳۳۷,۲۰۴	۵۱۶,۸۳۴	۵۶۷,۲۶۵	-۴۰.۵۶%
	بازار دوم	۳۷۳,۰۷۶	۹۵۱,۹۶۷	۶۸۰,۸۵۲	-۴۵.۲۰%
	بازار ETF	۸,۴۵۵	۱۸,۲۴۲	۲,۲۶۱	-۵۳.۶۵%
مجموع	حجم معامله - هزار سهم	۹,۷۹۱,۶۰۱	۴۷,۸۳۵,۵۰۲	۱۶,۴۷۷,۷۳۱	-۴۰.۵۸%
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۰,۹۳۴	۹۴,۸۸۱	۳۷,۵۳۸	-۴۴.۲۳%
	تعداد معامله	۷۲۰,۶۹۳	۱,۴۹۰,۵۵۶	۱,۲۵۱,۶۴۲	-۴۲.۴۲%
میانگین روزانه	حجم معامله - هزار سهم	۶۵۲,۷۷۳	۲,۵۱۷,۶۵۸	۹۶۹,۲۷۸	-۳۲.۶۵%
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۳۹۶	۴,۹۹۴	۲,۲۰۸	-۳۶.۸۰%
	تعداد معامله	۴۸,۰۴۶	۷۸,۴۵۰	۷۳,۶۲۶	-۳۴.۷۴%

- ✓ ارزش معاملات در بخش بازار نرمال نسبت به ماه قبل ۵۶,۴۰ درصد کاهش یافته است. همچنین حجم و تعداد معاملات در این بازار نیز به ترتیب با کاهش ۴۳,۱۹ و ۵۱,۶۲ درصدی همراه بوده است.
- ✓ در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷، ارزش معاملات در بورس اوراق بهادار تهران با ۷۷,۹۴ درصد کاهش نسبت به ارزش معاملات اسفندماه ۱۳۹۶ به ۲۰,۹۳۴ میلیارد ریال رسید.
- ✓ حجم معاملات در بازار اول بورس اوراق بهادار تهران در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ با کاهش ۴۰,۴۴ درصدی همراه بوده است. همچنین در پایان این ماه حجم معاملات در بازار دوم بورس اوراق بهادار تهران با ۹۰,۶۸ درصد کاهش نسبت به ماه قبل به ۲,۷۹۵,۳۰۱ هزار سهم رسیده است.
- ✓ ارزش و حجم معاملات در بازار اوراق بدهی در بورس اوراق بهادار تهران نسبت به اسفندماه ۹۶ کاهش داشته است. به طوری که حجم و ارزش معاملات در این بازار به ترتیب ۸۰,۲۹ و ۸۰,۲۶ درصد کاهش را نشان می‌دهند.

حجم، ارزش و تعداد معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک نوع اوراق در فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و در فروردین ماه ۱۳۹۶ در جدول زیر نشان داده شده است.

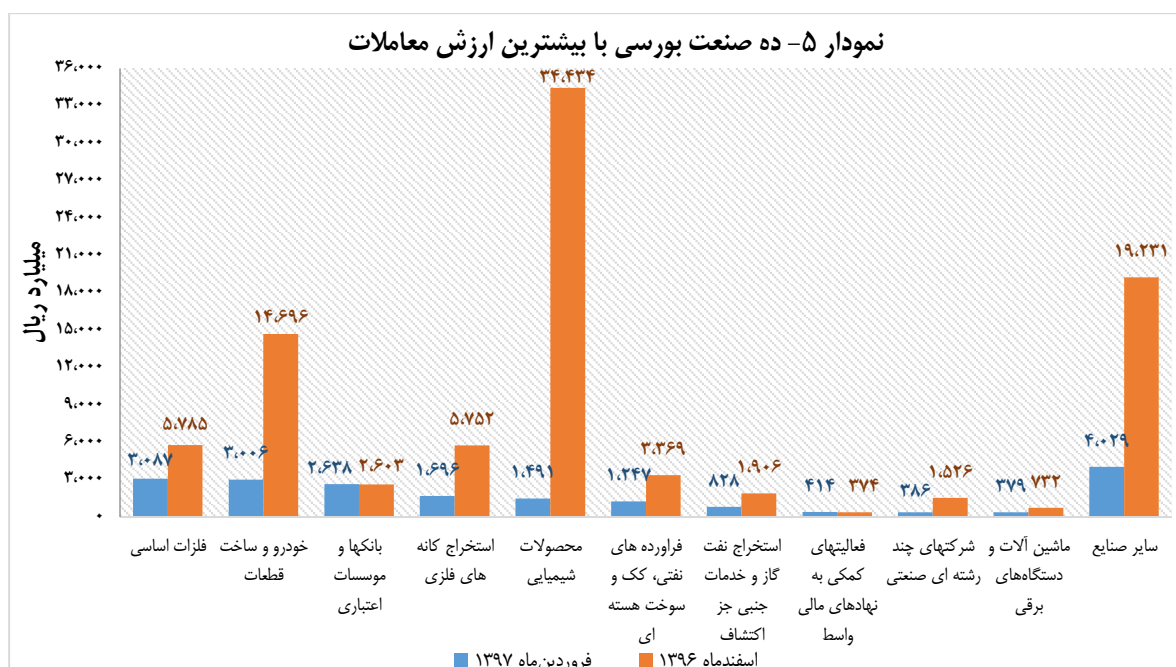
نوع اوراق بهادار		تاریخ			درصد تغییرات	
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل
سهام	تعداد معامله	۷۱۰،۲۸۰	۱،۴۶۸،۸۰۱	۱،۲۴۸،۱۱۷	-۵۱،۶۴٪	-۴۳،۰۹٪
	حجم معامله - هزار سهم	۹،۶۰۲،۰۰۵	۴۷،۲۰۱،۹۲۶	۱۶،۰۷۳،۱۵۷	-۷۹،۶۶٪	-۴۰،۲۶٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۶،۷۱۸	۷۷،۸۳۸	۳۲،۷۹۶	-۷۸،۵۲٪	-۴۹،۰۲٪
اوراق بدهی	تعداد معامله	۱،۸۸۳	۳،۴۵۳	۱،۱۵۹	-۴۵،۴۷٪	۶۲،۴۷٪
	حجم معامله - هزار سهم	۲،۴۷۰	۱۲،۵۳۰	۴،۱۵۵	-۸۰،۲۹٪	-۴۰،۵۵٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲،۴۸۱	۱۲،۵۷۰	۴،۲۴۰	-۸۰،۲۶٪	-۴۱،۴۹٪
مشتقات	تعداد معامله	۷۵	۶۰	۱۰۵	۲۵،۰۰٪	-۲۸،۵۷٪
	حجم معامله - هزار سهم	۵	۱۲۰	۳۲۷،۳۸۳	-۹۶،۱۴٪	-۱۰۰،۰۰٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۰،۶	۲،۱	۱	-۷۲،۸۹٪	-۳۶،۲۶٪
ETFs	تعداد معامله	۸،۴۵۵	۱۸،۳۴۲	۲،۲۶۱	-۵۳،۶۵٪	۲۷۳،۹۵٪
	حجم معامله - هزار سهم	۱۸۷،۱۲۲	۶۲۰،۹۲۶	۷۳،۰۳۶	-۶۹،۸۶٪	۱۵۶،۲۱٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱،۷۳۴	۴،۴۷۱	۵۰۲	-۶۱،۲۲٪	۲۴۵،۵۴٪
مجموع	تعداد معامله	۷۲۰،۶۹۳	۱،۴۹۰،۵۵۶	۱،۲۵۱،۶۴۲	-۵۱،۶۵٪	-۴۲،۴۲٪
	حجم معامله - هزار سهم	۹،۷۹۱،۶۰۱	۴۷،۸۳۵،۵۰۲	۱۶،۴۷۷،۷۳۱	-۷۹،۵۳٪	-۴۰،۵۸٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۰،۹۳۴	۹۴،۸۸۱	۳۷،۵۳۸	-۷۷،۹۴٪	-۴۴،۲۳٪
میانگین روزانه	تعداد معامله	۴۸،۰۴۶	۷۸،۴۵۰	۷۳،۶۲۶	-۳۸،۷۶٪	-۳۴،۷۴٪
	حجم معامله - هزار سهم	۶۵۲،۷۷۳	۲،۵۱۷،۶۵۸	۹۶۹،۲۷۸	-۷۴،۰۷٪	-۳۲،۶۵٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱،۳۹۶	۴،۹۹۴	۲،۲۰۸	-۷۲،۰۵٪	-۳۶،۸۰٪

- ✓ ارزش معاملات سهام در فروردین ماه ۹۷، ۸۰ درصد از کل ارزش معاملات در انواع اوراق بهادار را در بورس اوراق بهادار به خود اختصاص داده است.
- ✓ حجم و ارزش معاملات در سهام، نسبت به اسفندماه ۹۶ کاهش داشته اند. به طوری که ارزش معاملات ۷۸،۵۲ درصد و حجم معاملات ۷۹،۴۴ درصد کاهش داشته اند، همچنین تعداد معاملات نیز ۵۱،۶۴ درصد نسبت به اسفندماه ۹۶ کاهش داشته است.
- ✓ در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷، ارزش، حجم و تعداد معاملات در صندوق های سرمایه گذاری قابل معامله در بورس (ETFs) با کاهش قابل توجهی نسبت به اسفندماه ۹۶ همراه بوده است. این در حالی است که در مقایسه با فروردین ماه ۹۶، شاهد رشد چشمگیر ارزش، حجم و تعداد معاملات در صندوق های سرمایه گذاری قابل معامله در بورس (ETFs) هستیم.
- ✓ در پایان فروردین ماه ۹۷ در آمار معاملات اوراق مشتقه شاهد کاهش حجم و ارزش معاملات این نوع از اوراق هستیم. در پایان معاملات این ماه حجم معاملات اوراق مشتقه با ۹۴،۱۴ درصد کاهش به ۵ هزار سهم رسید.

ارزش معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع برای ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

میلیارد ریال

ردیف	نام صنعت	تاریخ			درصد تغییرات		نسبت گردش معاملات
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل	
۱	فلزات اساسی	۳۰،۸۷	۵،۷۸۵	۲،۳۴۳	-۴۶،۶۴٪	۳۱،۷۳٪	۰،۰۱
۲	خودرو و ساخت قطعات	۳،۰۰۶	۱۴،۶۹۶	۵،۵۲۲	-۷۹،۵۵٪	-۴۵،۵۷٪	۰،۰۲
۳	بانکها و موسسات اعتباری	۲،۶۳۸	۲،۶۰۳	۷۴۵	۱،۳۴٪	۲۵۴،۲۹٪	۰،۰۱
۴	استخراج کانه های فلزی	۱،۶۹۶	۵،۷۵۲	۷۶۱	-۷۰،۵۲٪	۱۲۲،۸۹٪	۰،۰۱
۵	محصولات شیمیایی	۱،۴۹۱	۳۴،۴۳۴	۳،۸۱۳	-۹۵،۶۷٪	-۶۰،۹۰٪	۰،۰۰
۶	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱،۲۴۷	۳،۳۶۹	۱،۳۴۳	-۶۲،۹۸٪	-۷،۱۷٪	۰،۰۰
۷	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۸۲۸	۱،۹۰۶	۳۰۷۹	-۵۶،۵۴٪	-۷۳،۱۰٪	۰،۱۹
۸	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۴۱۴	۳۷۴	۶۶	۱۰،۶۵٪	۵۳۱،۲۱٪	۰،۰۳
۹	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۳۸۶	۱،۵۲۶	۸۵۲	-۷۴،۷۲٪	-۵۴،۷۰٪	۰،۰۰
۱۰	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۳۷۹	۷۳۲	۵۱۹	-۴۸،۳۰٪	-۲۷،۰۸٪	۰،۰۱
	مجموع	۱۵،۱۷۱	۷۱،۱۷۹	۱۹،۰۴۳	-۷۸،۶۹٪	-۲۰،۳۳٪	۰،۰۱



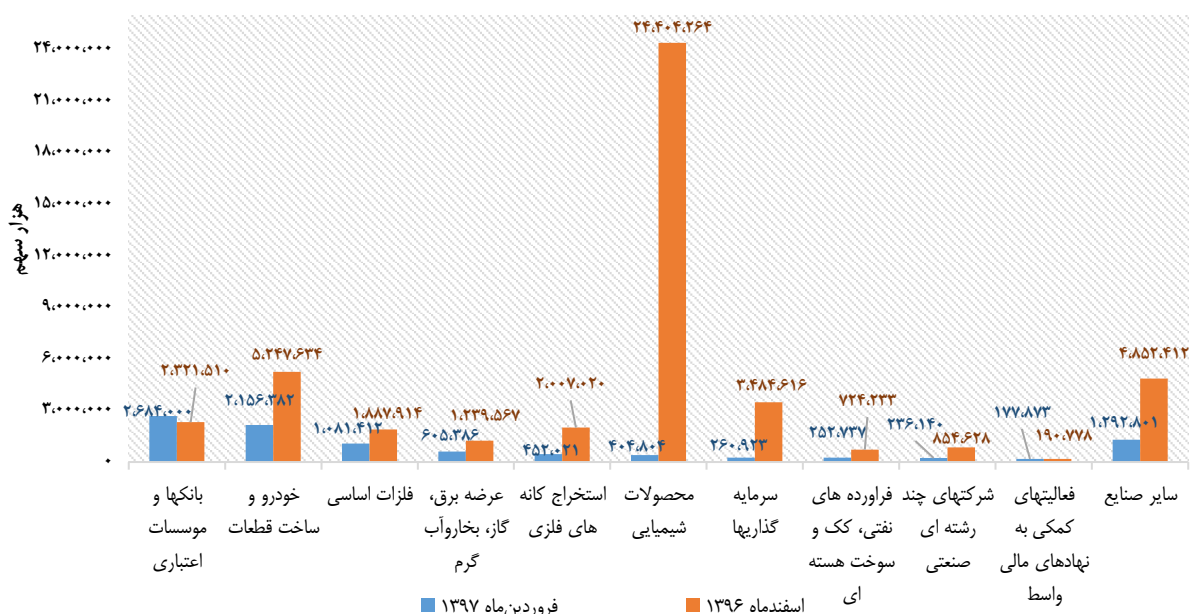
- ✓ به طور کلی ارزش معاملات در ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات در بورس اوراق بهادار تهران نسبت به اسفندماه ۹۶، ۷۸،۷ درصد کاهش یافته است.
- ✓ گروه خودرو و سافت قطعات با کاهش ۸۰ درصدی در ارزش معاملات، در جایگاه دوم بین صنایع با بیشترین ارزش معاملات در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ قرار گرفته است.

حجم معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع برای ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

هزار سهم

ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات		نسبت حجم معاملات
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل	
۱	بانکها و موسسات اعتباری	۲۶۸۴,۰۰۰	۲,۳۳۱,۵۱۰	۱۵۶۱٪	۲۶۹,۱۵٪	۰,۲۷
۲	خودرو و ساخت قطعات	۲,۱۵۶,۳۸۲	۵,۲۴۷,۶۳۴	-۵۸,۹۱٪	-۴۳,۴۸٪	۰,۲۲
۳	فلزات اساسی	۱,۰۸۱,۴۱۲	۱,۸۸۷,۹۱۴	-۴۲,۷۲٪	۱۰,۷۴٪	۰,۱۱
۴	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۶۰۵,۳۸۶	۱,۲۳۹,۵۶۷	-۵۱,۱۶٪	۱۷۰,۳۵۰٪	۰,۰۶
۵	استخراج کانه های فلزی	۴۵۲,۰۲۱	۲,۰۰۷,۰۲۰	-۷۷,۴۸٪	۴۰,۰۹٪	۰,۰۵
۶	محصولات شیمیایی	۴۰۴,۸۰۴	۲۴,۴۰۴,۲۶۴	-۹۸,۳۴٪	-۷۸,۹۵٪	۰,۰۴
۷	سرمایه گذاریها	۲۶۰,۹۲۳	۳,۴۸۴,۶۱۶	-۹۲,۵۱٪	-۷۳,۵۳٪	۰,۰۳
۸	فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲۵۲,۷۳۷	۷۲۴,۲۳۳	-۶۵,۱۰٪	-۴۰,۶۶٪	۰,۰۳
۹	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۲۳۶,۱۴۰	۸۵۴,۶۲۸	-۷۲,۳۷٪	-۶۰,۱۰٪	۰,۰۲
۱۰	فعالیتهای کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۷۷,۸۷۳	۱۹۰,۷۷۸	-۶,۷۶٪	۱۱۶۵,۵۵٪	۰,۰۲
	مجموع	۸,۳۱۱,۶۷۷	۴۲,۳۶۲,۱۶۴	-۸۰,۳۸٪	-۱۵,۳۲٪	۰,۸۵

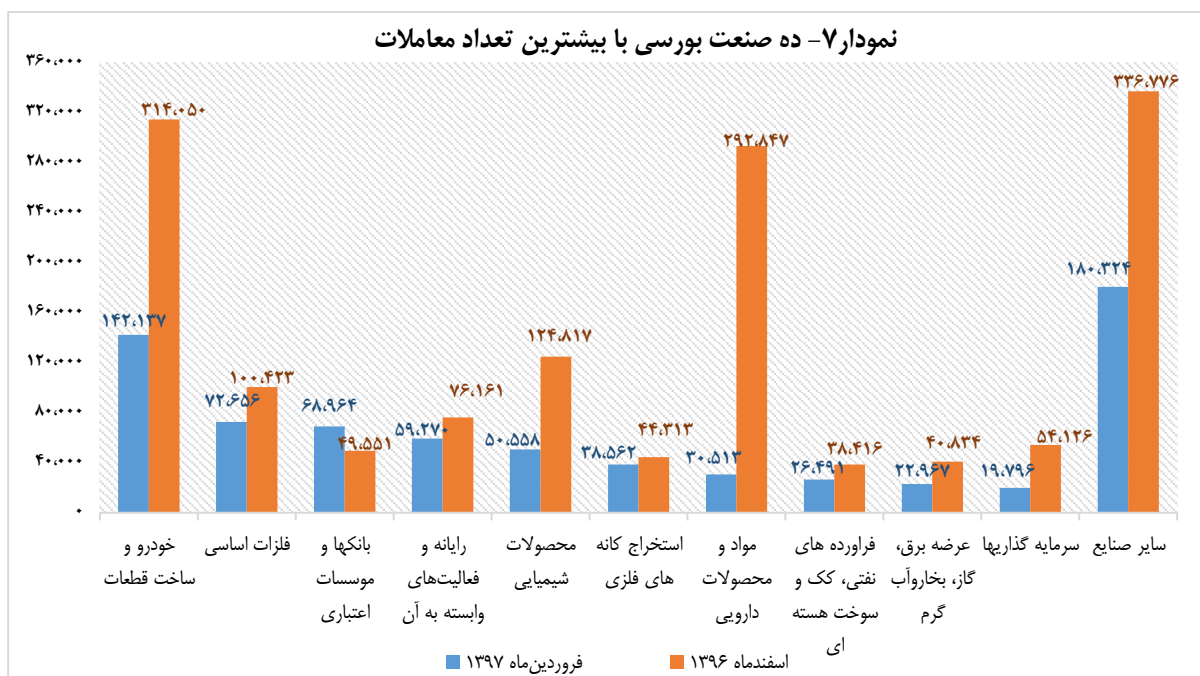
نمودار ۶- ده صنعت بورسی با بیشترین حجم معاملات



- ✓ گروه بانکها و مؤسسات اعتباری، در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ با افزایش ۱۵,۶۱ درصدی نسبت به اسفندماه ۹۶ در حجم معاملات، در جایگاه نخست قرار گرفته است.
- ✓ مجموع حجم معاملات در ده صنعت اول در بورس اوراق بهادار تهران، ۸۵ درصد از کل حجم معاملات در بورس اوراق بهادار تهران در فروردین ماه ۹۷ را به خود اختصاص داده اند.

تعداد معاملات در بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع برای ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

ردیف	نام صنعت	تاریخ			درصد تغییرات		متوسط تعداد معامله در هر شرکت
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به مشابه سال قبل	
۱	خودرو و ساخت قطعات	۱۴۲,۱۳۷	۳۱۴,۰۵۰	۲۸۷,۵۳۰	-۵۴.۷۴٪	-۵۰.۵۷٪	۴,۷۳۸
۲	فلزات اساسی	۷۲,۶۵۶	۱۰۰,۴۲۳	۸۵,۱۳۱	-۲۷.۶۵٪	-۱۴.۶۵٪	۳,۶۳۳
۳	بانکها و موسسات اعتباری	۶۸,۹۶۴	۴۹,۵۵۱	۳۴,۲۴۷	۳۹.۱۸٪	۱۰۱.۳۷٪	۶,۲۶۹
۴	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۵۹,۲۷۰	۷۶,۱۶۱	۳۵,۴۵۰	-۲۲.۱۸٪	۶۷.۱۹٪	۷,۴۰۹
۵	محصولات شیمیایی	۵۰,۵۵۸	۱۲۴,۸۱۷	۱۳۷,۴۵۱	-۵۹.۴۹٪	-۶۳.۲۲٪	۱,۸۷۳
۶	استخراج کانه های فلزی	۳۸,۵۶۲	۴۴,۳۱۳	۴۴,۲۳۰	-۱۲.۹۸٪	-۱۲.۸۱٪	۴,۲۸۵
۷	مواد و محصولات دارویی	۳۰,۵۱۳	۲۹۲,۸۴۷	۲۲,۵۲۱	-۸۹.۵۸٪	۳۵.۴۹٪	۱,۰۵۲
۸	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲۶,۴۹۱	۳۸,۴۱۶	۵۴,۳۹۶	-۳۱.۰۴٪	-۵۱.۳۰٪	۳,۳۱۱
۹	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۲۲,۹۶۷	۴۰,۸۳۴	۲۵,۳۷	-۴۳.۷۶٪	۸۰.۵۲۸٪	۷,۶۵۶
۱۰	سرمایه گذاریها	۱۹,۷۹۶	۵۴,۱۲۶	۶۵,۷۸۳	-۶۳.۴۳٪	-۶۹.۹۱٪	۱,۲۳۷
	مجموع	۵۳۱,۹۱۴	۱,۱۳۵,۵۳۸	۷۶۹,۲۷۶	-۵۳.۱۶٪	-۳۰.۸۶٪	۳,۳۰۴



- ✓ به طور کلی تعداد معاملات در ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران نسبت به اسفندماه ۹۶، ۵۳,۱۶ درصد کاهش یافته است.
- ✓ در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ گروه خودرو و سافت قطعات با وجود کاهش ۵۴,۷۴ درصدی در تعداد معاملات، در جایگاه نخست در بین ده صنعت با بیشترین تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران قرار گرفته 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 فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و فروردین ماه ۱۳۹۶ در جدول زیر نشان داده شده است.

نوع بازار		تاریخ			درصد تغییرات	
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل
		۱۳۹۷	۱۳۹۶	۱۳۹۶	قبل	مشابه سال قبل
عمده	تعداد معامله	۳۴	۱۲۹	۲۸	-۷۳.۶۴٪	۲۱.۴۳٪
	حجم معامله - هزار سهم	۱۵,۳۸۵	۶,۸۶۹,۹۰۷	۶۶,۸۰۴	-۹۹.۷۸٪	-۷۶.۹۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۷,۴۷۹	۱۳,۰۸۱	۱۶۷	-۴۲.۸۳٪	۴۳۷۵.۱۷٪
بلوک	تعداد معامله	۱۳۹	۹۹۵	۱۱۵	-۸۶.۰۳٪	۲۰.۸۷٪
	حجم معامله - هزار سهم	۶۷,۱۲۴	۵۴۰,۸۹۲	۳۰,۲۶۵۰	-۸۷.۵۹٪	-۷۷.۸۲٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲,۷۲۰	۱۱,۷۱۳	۸,۵۸۷	-۷۶.۷۸٪	-۶۸.۳۳٪
نرمال	تعداد معامله	۴۶۳,۸۰۵	۷۱۰,۴۶۰	۶۲۶,۲۷۴	-۳۴.۷۲٪	-۲۵.۹۴٪
	حجم معامله - هزار سهم	۲,۵۲۸,۶۸۱	۵,۵۱۹,۱۰۵	۶,۱۰۳,۷۳۵	-۵۴.۱۸٪	-۵۸.۵۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۷,۳۶۹	۱۱۹,۲۸۹	۱۸,۴۸۶	-۸۵.۴۴٪	-۶۰.۴٪
مجموع	تعداد معامله	۴۶۳,۹۷۸	۷۱۱,۵۸۴	۶۲۶,۴۱۷	-۳۴.۸۰٪	-۲۵.۹۳٪
	حجم معامله - هزار سهم	۲,۶۱۱,۱۹۰	۱۲,۹۲۹,۹۰۴	۶,۴۷۳,۱۸۹	-۷۹.۸۱٪	-۵۹.۶۶٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۷,۵۶۸	۱۴۴,۰۸۳	۲۷,۲۴۰	-۸۰.۸۷٪	۱.۲۰٪
میانگین روزانه	تعداد معامله	۳۰,۹۳۲	۳۷,۴۵۲	۳۶,۸۴۸	-۱۷.۴۱٪	-۱۶.۰۶٪
	حجم معامله - هزار سهم	۱۷۴,۰۷۹	۶۸۰,۵۲۱	۳۸۰,۷۷۶	-۷۴.۴۲٪	-۵۴.۲۸٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۸۳۸	۷,۵۸۳	۱,۶۰۲	-۷۵.۷۶٪	۱۴.۷۰٪

- ✓ ارزش معاملات بخش نرمال در پایان فروردین ماه ۹۷ با مدود ۸۵ درصد کاهش نسبت به ماه قبل، به ۱۷,۳۶۹ میلیارد ریال رسید. همچنین حجم معاملات نرمال در پایان فروردین ماه ۹۷ با مدود ۵۴ درصد کاهش نسبت به ماه قبل همراه بوده است.
- ✓ حجم معاملات بلوک با کاهش ۸۸ درصدی در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷، به ۶۷,۱۲۴ هزار سهم رسید.
- ✓ در مجموع ارزش و حجم معاملات در کلیه بخش‌های بازار در فرابورس ایران، به ترتیب ۸۰,۸۷ درصد و ۷۹,۸۱ درصد کاهش را نسبت به اسفندماه ۹۶ نشان می‌دهند.
- ✓ به طور کلی مدود ۶۳ درصد از کل ارزش معاملات در تمامی بخش‌های فرابورس، مربوط به ارزش معاملات نرمال می‌باشد. مدود ۱۰ درصد مربوط به ارزش معاملات بلوک و بقیه یعنی مدود ۲۷ درصد نیز مربوط به ارزش معاملات عمده است.

حجم، ارزش و تعداد معاملات در فرابورس ایران به تفکیک نوع بازار در فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و فروردین ماه ۱۳۹۶ در جدول زیر نشان داده شده است.

	نام بازار	تاریخ			درصد تغییرات	
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل
حجم معامله - هزار سهم	بازار ابزارهای نوین مالی	۹۳,۶۴۰	۴۳,۵۰۲۷	۸۳,۷۹۹	-۷۸.۴۷٪	۱۱.۷۴٪
	بازار اول	۲۳,۵۶۵۲	۱,۷۴۳,۹۷۳	۷۲۲,۲۱۱	-۸۶.۴۹٪	-۶۷.۳۷٪
	بازار دوم	۱,۱۲۲,۱۵۰	۷,۹۹۷,۶۴۵	۲,۵۴۳,۸۶۷	-۸۵.۹۷٪	-۵۵.۸۹٪
	بازار پایه	۱,۱۵۹,۲۸۱	۲,۷۴۱,۰۰۰	۳,۱۲۲,۱۳۸	-۵۷.۷۱٪	-۶۲.۸۷٪
	شرکت های کوچک و متوسط	۴۶۷	۱۲,۲۵۷,۷۷۷	۱۱۷۳,۸	-۹۶.۱۹٪	-۶۰.۲۱٪
ارزش معامله - میلیارد ریال	بازار ابزارهای نوین مالی	۲۲,۶۹۰	۱۲۷,۳۴۸	۱۴,۸۷۳	-۸۲.۱۸٪	۵۲.۵۶٪
	بازار اول	۴۶۱	۳,۹۵۹	۱,۵۸۴	-۸۸.۳۶٪	-۷۰.۹۱٪
	بازار دوم	۲,۷۰۸	۹,۷۱۳	۶,۱۸۱	-۷۲.۱۲٪	-۵۶.۱۸٪
	بازار پایه	۱,۷۰۷	۳,۰۰۸	۴,۵۸۶	-۴۳.۲۶٪	-۶۲.۷۸٪
	شرکت های کوچک و متوسط	۱۰۱	۵۲,۷۷	۱۶,۱۶	-۹۸.۰۸٪	-۹۳.۷۴٪
تعداد معامله	بازار ابزارهای نوین مالی	۷۸,۰۶۸	۱۲۹,۱۳۲	۶۱,۶۲۶	-۳۹.۵۴٪	۲۶.۶۸٪
	بازار اول	۲۹,۴۶۹	۴۵,۴۱۷	۸۳,۹۳۸	-۳۵.۱۱٪	-۶۴.۸۹٪
	بازار دوم	۲۱۰,۰۲۶	۲۹۲,۹۴۲	۲۶۴,۸۷۵	-۲۸.۳۰٪	-۲۰.۷۱٪
	بازار پایه	۱۴۶,۴۰۲	۲۴۳,۸۲۴	۲۱۵,۹۱۹	-۳۹.۹۶٪	-۳۲.۲۰٪
	شرکت های کوچک و متوسط	۱۳	۲۶۸	۵۸	-۹۵.۱۵٪	-۷۷.۵۹٪
مجموع	حجم معامله - هزار سهم	۲,۶۱۱,۱۹۰	۱۲,۹۲۹,۹۰۴	۶,۴۷۳,۱۸۹	-۷۹.۸۱٪	-۵۹.۶۶٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۷,۵۶۸	۱۴۴,۰۸۳	۲۷,۲۴۰	-۸۰.۸۷٪	۱.۲۰٪
	تعداد معامله	۴۶۳,۹۷۸	۷۱۱,۵۸۴	۶۲۶,۴۱۷	-۳۴.۸۰٪	-۲۵.۹۳٪
میانگین روزانه	حجم معامله - هزار سهم	۱۷۴,۰۷۹	۶۸۰,۵۲۱	۳۸۰,۷۷۶	-۷۴.۴۲٪	-۵۴.۲۸٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱,۸۳۸	۷,۵۸۳	۱,۶۰۲	-۷۵.۷۶٪	۱۴.۷۰٪
	تعداد معامله	۳۰,۹۳۲	۳۷,۴۵۲	۳۶,۸۴۸	-۱۷.۴۱٪	-۱۶.۰۶٪

- ✓ در فروردین ماه ۱۳۹۷ ارزش معاملات در همه بازارها با کاهش همراه بوده است. همچنین میانگین ارزش معاملات روزانه با ۷۵,۷۶ درصد کاهش از ۷,۵۸۳ میلیارد ریال به ۱,۸۳۸ میلیارد ریال رسیده است.
- ✓ حجم و تعداد معاملات نیز همانند ارزش معاملات در همه بازارها نسبت به ماه گذشته کاهش داشته اند. همچنین حجم و تعداد معاملات در میانگین روزانه به ترتیب ۷۴,۴۲ و ۱۷,۴۱ درصد نسبت به میانگین روزانه اسفندماه ۹۶ کاهش داشته اند.

حجم، ارزش و تعداد معاملات در فرابورس ایران به تفکیک نوع اوراق در فروردین ماه ۱۳۹۷، اسفندماه ۱۳۹۶ و فروردین ماه ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

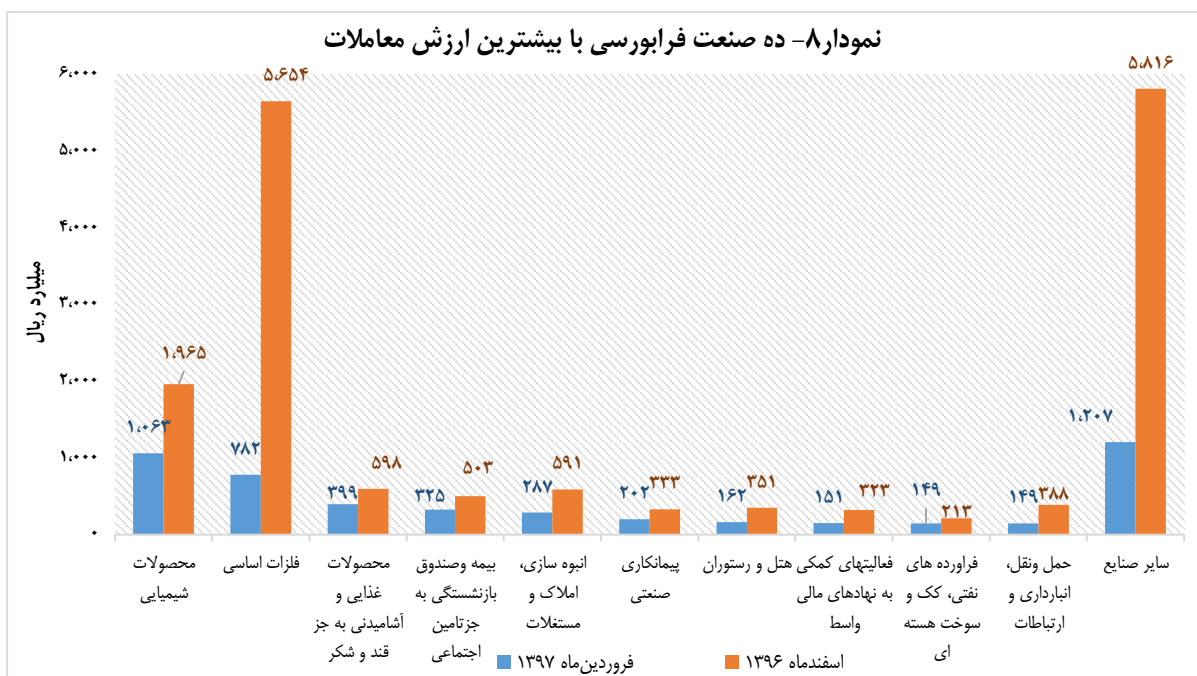
نوع اوراق بهادار	تاریخ			درصد تغییرات	
	فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل
سهام	تعداد معامله	۴۴۵،۷۸۱	۶۷۹،۳۱۷	۶۱۰،۶۲۵	-۳۴،۳۸٪
	حجم معامله -هزار سهم	۲،۵۱۸،۲۵۷	۱۲،۴۹۶،۰۷۰	۶،۳۸۹،۹۶۲	-۶۰،۵۹٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۵،۳۱۷	۱۷،۵۴۰	۱۲،۷۷۱	-۵۸،۳۷٪
اوراق بدهی	تعداد معامله	۱۱،۹۸۷	۲۱،۲۳۶	۹،۸۷۹	-۴۳،۵۵٪
	حجم معامله -هزار سهم	۲۳،۵۰۳	۱۲۹،۷۰۵	۱۳،۸۳۵	-۸۱،۸۸٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۱،۱۷۲	۱۲۳،۴۷۱	۱۳،۴۸۶	-۸۲،۸۵٪
ETFs	تعداد معامله	۶،۲۱۰	۱۱،۰۳۰	۵،۹۱۲	-۴۳،۷۰٪
	حجم معامله -هزار سهم	۶۹،۴۳۰	۳۰۴،۱۲۸	۶۹،۳۹۳	-۷۷،۱۷٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱۰،۷۹	۳۰،۷۰	۹،۸۲	-۶۴،۸۴٪
مجموع	تعداد معامله	۴۶۳،۹۷۸	۷۱۱،۵۸۳	۶۲۶،۴۱۶	-۳۴،۸۰٪
	حجم معامله -هزار سهم	۲،۶۱۱،۱۹۰	۱۲،۹۲۹،۹۰۳	۶،۴۷۳،۱۸۹	-۵۹،۶۶٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۲۷،۵۶۸	۱۴۴،۰۸۱	۲۷،۲۴۰	-۸۰،۸۷٪
میانگین روزانه	تعداد معامله	۳۰،۹۳۲	۳۷،۴۵۲	۳۶،۸۴۸	-۱۶،۰۶٪
	حجم معامله -هزار سهم	۱۷۴،۰۷۹	۶۸۰،۵۲۱	۳۸۰،۷۷۶	-۷۴،۴۲٪
	ارزش معامله - میلیارد ریال	۱،۸۳۸	۷،۵۸۳	۱،۶۰۲	-۷۵،۷۶٪

- ✓ ارزش معاملات سهام در فروردین ماه ۹۷، ۱۹ درصد از کل ارزش معاملات در انواع اوراق بهادار در فرابورس ایران را به خود اختصاص داده است. این در حالی است که ارزش معاملات اوراق بدهی، ۷۷ درصد از کل ارزش معاملات در انواع اوراق بهادار در فرابورس ایران را به خود اختصاص داده است.
- ✓ ارزش، حجم و تعداد معاملات در سهام نسبت به اسفندماه ۹۶ کاهش داشته است. به طوری که ارزش معاملات ۶۹،۶۹ درصد، حجم معاملات ۷۹،۸۵ درصد و تعداد معاملات ۳۴،۳۸ درصد کاهش یافته اند.
- ✓ ارزش، حجم و تعداد معاملات در اوراق بدهی در فروردین ماه ۹۷ با رشد قابل توجهی در مقایسه با فروردین ماه ۹۶ همراه بوده است.

ارزش معاملات در فرابورس ایران به تفکیک صنایع، برای ۱۰ صنعت با بیشترین ارزش معاملات در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

میلیارد ریال

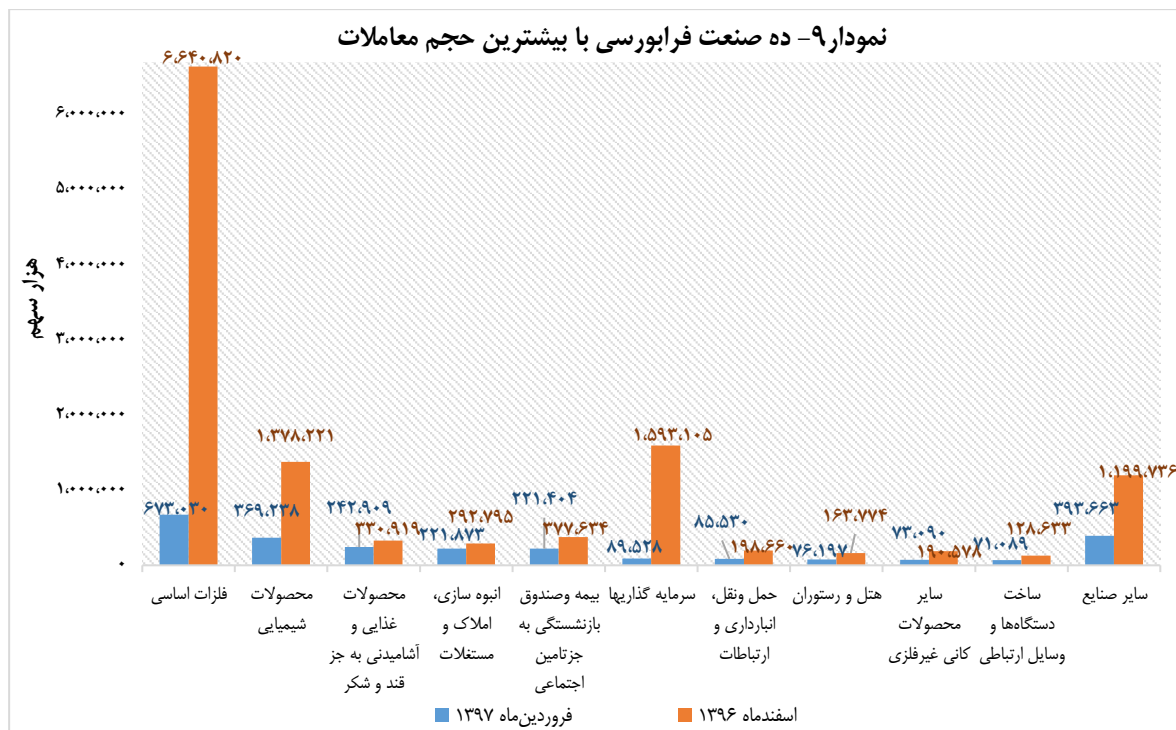
ردیف	نام صنعت	تاریخ			درصد تغییرات		نسبت گردش معاملات
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه سال قبل	
۱	محصولات شیمیایی	۱,۰۶۳	۱,۹۶۵	۹۰۱	-۴۵.۹۱٪	۱۱۷.۹۳٪	۰.۰۰
۲	فلزات اساسی	۷۸۲	۵,۶۵۴	۲,۰۳۰	-۸۶.۱۶٪	۱۷۸.۵۵٪	۰.۰۱
۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۳۹۹	۵۹۸	۱,۲۰۹	-۳۳.۲۸٪	-۵۰.۵۱٪	۰.۰۲
۴	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۳۲۵	۵۰۳	۱۵۰	-۳۵.۲۵٪	۲۳۵.۵۵٪	۰.۰۱
۵	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۸۷	۵۹۱	۱,۰۶۰	-۵۱.۳۵٪	-۴۴.۲۲٪	۰.۰۱
۶	پیمانکاری صنعتی	۲۰۲	۳۳۳	۱,۲۱۴	-۳۹.۱۳٪	-۷۲.۶۱٪	۰.۰۱
۷	هتل و رستوران	۱۶۲	۳۵۱	۳۲۴	-۵۳.۸۵٪	۸.۲۰٪	۰.۰۲
۸	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۵۱	۳۲۳	۵۲	-۵۳.۳۴٪	۵۱۶.۲۴٪	۰.۰۱
۹	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۴۹	۲۱۳	۵۱۱	-۲۹.۹۱٪	-۵۸.۳۸٪	۰.۰۰
۱۰	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۴۹	۳۸۸	۹۵۹	-۶۱.۶۳٪	-۵۹.۵۵٪	۰.۰۱
	مجموع	۳,۶۷۰	۱۰,۹۱۷	۸,۴۱۱	-۶۶.۳۸٪	-۵۶.۳۷٪	۰.۰۱



- ✓ گروه فلزات اساسی در فرابورس ایران که در پایان اسفندماه ۹۶ در رتبه اول صنایع با بیشترین ارزش معاملات قرار گرفته بود، در پایان فروردین ماه ۹۷ با کاهش ۸۶ درصدی در ارزش معاملات، در رتبه دوم صنایع فرابورسی قرار گرفته است.
- ✓ مجموع ارزش معاملات در ده صنعت با بیشترین ارزش معاملات در فرابورس ایران، ۶۶,۳۸ درصد نسبت به ماه قبل کاهش داشته است.

حجم معاملات در فرابورس ایران به تفکیک صنایع، برای ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

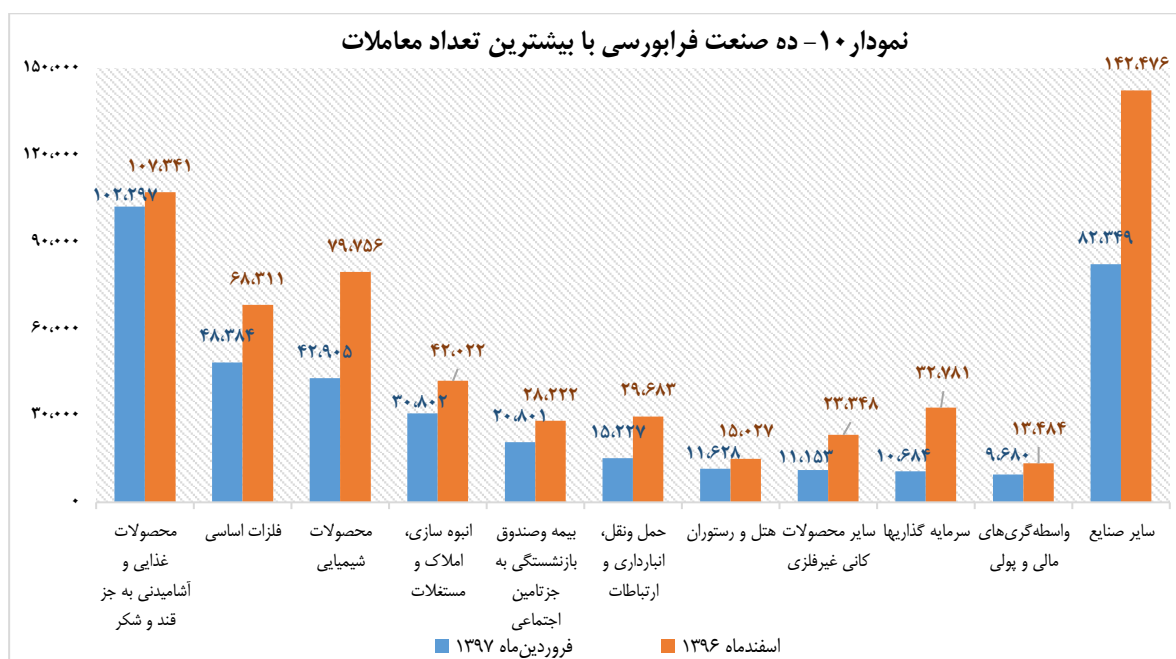
ردیف	نام صنعت	تاریخ		درصد تغییرات		نسبت حجم معاملات
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل سال قبل	
۱	فلزات اساسی	۶۷۳,۰۳۰	۶۶۴۰,۸۲۰	۲,۲۰۸,۳۸۵	-۸۹,۸۷٪	-۶۹,۵۲٪
۲	محصولات شیمیایی	۳۶۹,۲۳۸	۱,۳۷۸,۲۲۱	۲۲۳,۱۵۲	-۷۳,۲۱٪	۶۵,۴۶٪
۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۲۴۲,۹۰۹	۳۳۰,۹۱۹	۲۳۲,۷۲۵	-۲۶,۶۰٪	۴,۳۸٪
۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۲۱,۸۷۳	۲۹۲,۷۹۵	۴۶۵,۷۹۳	-۲۴,۲۲٪	-۵۲,۳۷٪
۵	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۲۲۱,۴۰۴	۳۷۷,۶۳۴	۱۳۲,۴۴۲	-۴۱,۳۷٪	۶۷,۱۷٪
۶	سرمایه گذاریها	۸۹,۵۲۸	۱,۵۹۳,۱۰۵	۱۴۳,۶۲۳	-۹۴,۳۸٪	-۳۷,۶۶٪
۷	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۸۵,۵۳۰	۱۹۸,۶۶۰	۴۱۴,۱۹۲	-۵۶,۹۵٪	-۷۹,۳۵٪
۸	هتل و رستوران	۷۶,۱۹۷	۱۶۳,۷۷۴	۱۹۱,۲۶۸	-۵۳,۴۷٪	-۶۰,۱۶٪
۹	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۷۳,۰۹۰	۱۹۰,۵۷۸	۵۲۵,۷۷	-۶۱,۶۵٪	۳۹,۰۱٪
۱۰	ساخت دستگاهها و وسایل ارتباطی	۷۱,۰۸۹	۱۲۸,۶۳۳	۷۷۸,۸۰۹	-۴۴,۷۴٪	-۹۰,۸۷٪
	مجموع	۲,۱۲۳,۸۸۷	۱۱,۲۹۵,۱۴۱	۴,۸۴۲,۹۶۶	-۸۱,۲۰٪	-۵۶,۱۴٪



- ✓ گروه فلزات اساسی با وجود کاهش ۹۰ درصدی حجم معاملات نسبت به اسفندماه ۹۶، همچنان در جایگاه نخست ده صنعت با بیشترین حجم معاملات در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ قرار گرفته است.
- ✓ حجم معاملات در پایان فروردین ماه ۹۷ در بازار فرابورس ایران در ۱۰ صنعت با بیشترین حجم معاملات، ۸۱,۲۰ درصد نسبت به اسفندماه ۹۶ کاهش داشته است.

تعداد معاملات در فرابورس ایران به تفکیک صنایع، برای ۱۰ صنعت با بیشترین تعداد معاملات در انتهای فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

ردیف	نام صنعت	تاریخ	درصد تغییرات	متوسط تعداد معامله در هر شرکت		
		فروردین ماه ۱۳۹۷	اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین- ماه ۱۳۹۶	نسبت به ماه قبل	نسبت به مشابه سال قبل
۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۰۲,۲۹۷	۱۰۷,۳۴۱	۵۱,۱۲۵	۴۷,۰٪	۱۰۹,۹۶٪
۲	فلزات اساسی	۴۸,۳۸۴	۶۸,۳۱۱	۱۲۵,۹۰۱	۲۹,۱۷٪	۴۵,۷۴٪
۳	محصولات شیمیایی	۴۲,۹۰۵	۷۹,۷۵۶	۳۴,۲۰۱	۴۶,۲۰٪	۱۳۳,۲۰٪
۴	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳۰,۸۰۲	۴۲,۰۲۲	۴۶,۸۴۱	۲۶,۷۰٪	۱۰,۲۹٪
۵	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۲۰,۸۰۱	۲۸,۲۲۲	۵,۳۸۰	۲۶,۳۰٪	۴۲۴,۵۷٪
۶	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۵,۲۲۷	۲۹,۶۸۳	۴۳,۲۰۳	۴۸,۷۰٪	۳۱,۲۹٪
۷	هتل و رستوران	۱۱,۶۲۸	۱۵,۰۲۷	۲۳,۶۶۳	۲۲,۶۲٪	۳۶,۵۰٪
۸	سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱۱,۱۵۳	۲۳,۳۴۸	۸,۷۲۳	۵۲,۲۳٪	۱۶۷,۶۶٪
۹	سرمایه گذاریها	۱۰,۶۸۴	۳۲,۷۸۱	۱۲,۰۸۵	۶۷,۴۱٪	۱۷۱,۲۵٪
۱۰	واسطه‌گری‌های مالی و پولی	۹,۶۸۰	۱۳,۴۸۴	۶,۹۴۶	۲۸,۲۱٪	۹۴,۱۳٪
	مجموع	۳۰۳,۵۶۱	۴۳۹,۹۷۵	۳۵۸,۰۶۸	۳۱,۰۰٪	۱۵,۲۲٪



- ✓ در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ در فرابورس ایران، گروه محصولات غذایی و آشامیدنی بیشترین تعداد معامله را در بین صنایع فرابورسی به خود اختصاص داده است.
- ✓ متوسط تعداد معامله در هر شرکت در مجموع ده صنعت با بیشترین تعداد معاملات در فروردین ماه ۹۷، تعداد ۱۹۳۴ معامله به ازای هر شرکت بوده است.

آمار معاملات در بورس کالا

حجم و ارزش معاملات در بورس کالا به ترتیب در سال ۱۳۹۵، سال ۱۳۹۶ و از ابتدای سال ۱۳۹۷ تا پایان فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

بازار معاملات آتی بورس کالا		سال ۹۵		سال ۹۶		انباشته از ابتدای سال ۹۷ تا انتهای فروردین ماه ۹۷	
حجم معاملات (قرارداد تعداد)	ارزش معاملات (ریال میلیارد)	حجم معاملات (قرارداد تعداد)	ارزش معاملات (ریال میلیارد)	حجم معاملات (قرارداد تعداد)	ارزش معاملات (ریال میلیارد)	حجم معاملات (قرارداد تعداد)	ارزش معاملات (ریال میلیارد)
قرارداد آتی	۳,۲۰۲,۲۴۲	۳۹۰,۳۴۱	۴,۲۴۶,۹۱۳	۶۵۷,۹۸۷	۷۳۲,۱۷۳	۱۴۲,۵۶۶	
قرارداد اختیار معامله	۴۲,۸۵۲	۵۰۴	۴۱,۷۷۱	۸	۴۰۰	۱	
سلف موازی استاندارد	۷,۱۰۶	۵۲,۰۲۲	۲۵,۴۳۴,۹۰۰	۱۰,۰۴۶	۲۴,۹۶۰	۳۳	
صندوق های کالایی	-	-	۹۶,۸۲۰,۱۲۴	۱,۰۰۶	۷۱,۹۲۸,۵۰۰	۹۴۴	
گواهی سپرده کالایی	۴۵۳	۳,۴۳۷	۴۹۹,۵۹۳,۰۱۴	۵,۰۰۲	۱۳۹,۸۲۴	۱۹۷	
مجموع	-	۴۴۶,۲۰۴	-	۶۷۴,۰۴۹	-	۱۴۳,۷۴۰	

حجم و ارزش معاملات در بورس کالا به تفکیک گروه های محصولات به ترتیب در سال ۱۳۹۵، سال ۱۳۹۶ و از ابتدای سال ۱۳۹۷ تا پایان فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

گروه کالا		سال ۹۵		سال ۹۶		انباشته از ابتدای سال ۹۷ تا انتهای فروردین ماه ۹۷	
حجم معاملات (تن)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات (تن)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات (تن)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات (تن)	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
گروه کالاهای کشاورزی	۲,۵۱۰,۱۱۴	۲۸,۱۱۳	۲,۹۶۹,۸۲۹	۳۳,۰۹۰	۱۵۴,۷۸۵	۱,۸۲۷	
گروه کالاهای فلزی	۹,۳۹۳,۰۳۵	۱۵۶,۷۹۶	۸,۷۶۰,۲۸۶	۲۰۴,۹۸۳	۲۰۱,۴۵۹	۷,۵۸۶	
گروه محصولات نفتی و پتروشیمی	۱۳,۴۵۶,۹۰۶	۱۸۴,۶۱۶	۱۴,۷۶۱,۸۱۱	۲۵۶,۳۴۷	۱,۱۳۱,۰۱۲	۲۴,۰۵۰	
بازار فرعی	۱۱۴,۹۱۴	۱,۴۸۳	۱۷۰,۵۳۱	۴,۳۷۷	۵,۷۶۴	۲۳۳	
کل بازار	۲۵,۴۷۴,۹۶۹	۳۷۱,۰۰۸	۲۶,۶۶۲,۴۵۷	۴۹۸,۷۹۷	۱,۴۹۳,۰۲۰	۳۳,۶۹۶	

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 ۱۳۹۵، سال ۱۳۹۶ و همچنین از ابتدای سال ۱۳۹۷ تا پایان فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

بازار		سال ۹۵		سال ۹۶		انباشته از ابتدای سال ۹۷ تا انتهای فروردین ماه ۹۷	
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)
بازار فیزیکی	تن	۱,۹۱۲,۱۵۲	۲۳,۲۰۴	۲,۶۷۷,۹۲۸	۴۴,۹۶۶	۱۳۷,۲۷۷	۳,۰۷۹
بازار مشتقه (تابلو)	برق	۷۶۴,۴۱۳	۴,۱۵۸	۶۳۲,۴۱۸,۵۸۵	۳,۷۹۵	۳۷۱,۵۰۰	۴۶
سلف موازی استاندارد)	سلف بلندمدت	۴,۹۳۶,۹۰۹	۱۴,۹۴۳	۸,۰۴۴,۰۰۳	۲۵,۳۶۴	۵۴۲,۲۷۶	۱,۹۱۷
مجموع	-	۴۲,۳۰۵	-	۷۴,۱۲۵	-	۵۰۴۲	-

۱- طی اطلاعیه شرکت بورس انرژی از تاریخ ۹۶/۰۴/۱۰ واحد دارایی پایه از مگا وات به کیلو وات تغییر یافته و تغییر تعداد قرارداد از شش رقم به نه رقم به منظور تعدیل اثر این تغییر می باشد.

۲- منظور کیلو وات در هر ساعت می باشد که نشان دهنده حجم کیلو وات در ساعت معامله شده طی قراردادهای بند ۱ می باشد.

منبع: اداره امور بورس و بازارها

تعداد نمادها

تعداد نمادهای پذیرفته شده در بازارهای مختلف در پایان فروردین ماه ۱۳۹۷ و تغییرات آن نسبت به ماه قبل در جدول زیر نشان داده شده است.

اسفندماه ۱۳۹۶	فروردین ماه ۱۳۹۷	
تعداد نمادها	تعداد نمادها	نام بازار
۳۲۶	۳۲۶	بورس اوراق بهادار تهران
۹۶	۹۶	فرابورس ایران
۱۶۱	۱۶۲	بازار پایه فرابورس ایران

آمار عرضه اولیه

در جدول زیر اطلاعات عرضه های اولیه صورت گرفته در فروردین ماه ۱۳۹۷ در بازارهای مختلف ارائه شده است.

نام بورس	نام نوع صنعت	نام نوع اوراق بهادار	نام نوع بازار	کد فارسی نماد	نام شرکت	سرمایه ثبت شده اوراق بهادار	تاریخ عرضه
فرابورس ایران	سرمایه گذاری ها	سهام عادی بازار پایه	بازار پایه	وآداک	صنعت و تجارت آداک	۸۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۹۷/۰۱/۰۶

سرمایه گذاران خارجی

ارزش سبد سرمایه گذاران خارجی شامل سرمایه گذاران خارجی حقیقی و حقوقی در پایان فروردین ماه ۱۳۹۷ در جدول زیر نشان داده شده است.

نوع سهامدار	ارزش سبد (میلیارد ریال)	ارزش سبد (میلیارد ریال)	درصد رشد ارزش سبد
حقیقی	۳۴۲	۳۳۲	۳٪
حقوقی	۱۴۹۰۲	۱۸۶۳۸	-۲۰٪
مجموع	۱۵۲۴۳	۱۸۹۷۰	-۱۹,۶٪

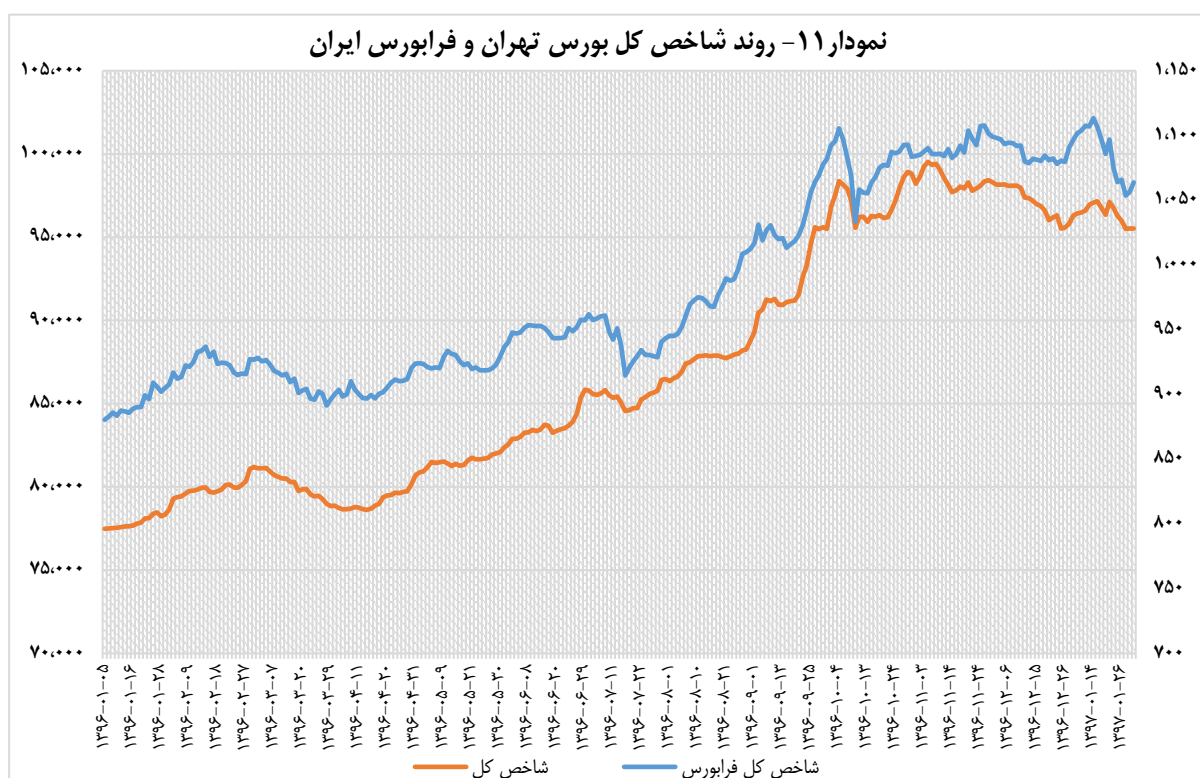
منبع: حوزه ریاست

شاخص‌های بازار سرمایه

شاخص‌های بازار سرمایه شامل شاخص‌های بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ و تغییرات آن نسبت به ماه قبل و همچنین پایان اسفند ۱۳۹۵ در جدول زیر نشان داده شده است.

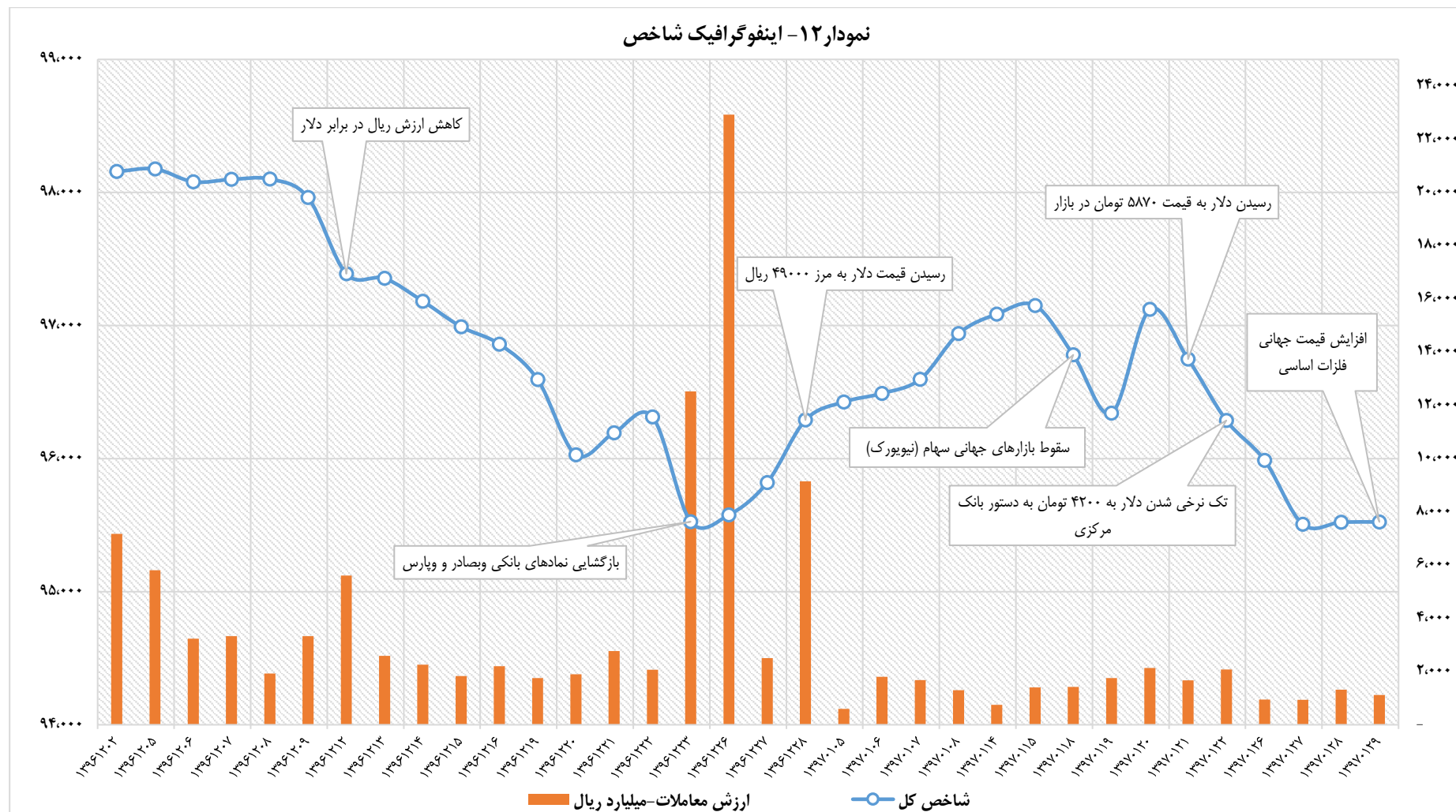
نام بورس	نام شاخص	تاریخ	درصد تغییرات	نسبت به ابتدای سال ۹۶	نسبت به ماه قبل
		۱۳۹۵/۱۲/۲۸	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۷/۰۱/۳۱	
بورس اوراق بهادار تهران	شاخص کل بورس تهران	۷۷,۲۳۰	۹۶,۲۹۰	۹۵,۵۲۴	-۰.۸۰٪
	شاخص کل (هم وزن)	۱۵,۷۲۳	۱۷,۲۷۱	۱۶,۷۳۵	-۳.۱۱٪
	شاخص قیمت	۲۶,۸۲۶	۳۰,۵۳۴	۳۰,۲۷۹	-۰.۸۳٪
	شاخص قیمت (هم وزن)	۱۲,۳۷۷	۱۲,۸۵۵	۱۲,۴۴۴	-۳.۲۰٪
	شاخص ۳۰ شرکت بزرگ	۳,۰۹۸	۴,۲۹۳	۴,۲۷۲	-۰.۴۹٪
	شاخص صنعت	۶۶,۱۰۰	۸۶,۰۸۲	۸۵,۵۵۲	-۰.۶۲٪
	شاخص ۵۰ شرکت فعال‌تر	۳,۰۳۵	۴,۰۳۶	۴,۰۳۰	-۰.۱۶٪
فرابورس ایران	شاخص کل فرابورس	۸۷۵	۱,۰۹۷	۱,۰۶۴	-۲.۹۹٪

روند شاخص کل بورس و فرابورس در بازه زمانی ۱۳۹۶/۰۱/۰۵ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ در نمودار (۱۱) نشان داده شده است.



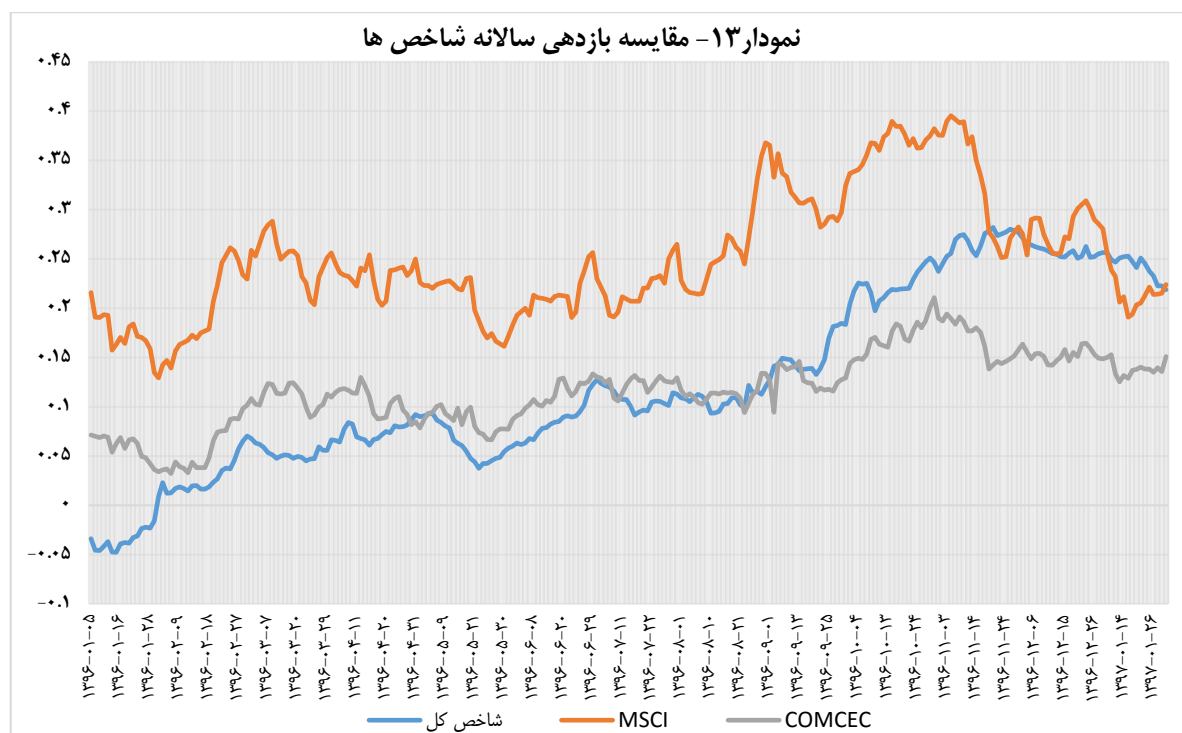
اینفوگرافیک شاخص

نمودار اینفوگرافیک شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی ۱۳۹۶/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ 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 فروردین‌ماه سال ۱۳۹۶ نمایش داده شده است. همان‌گونه که مشاهده می‌شود طی ده ماه منتهی به فروردین ۱۳۹۷، بازدهی سالانه شاخص کل تقریباً مشابه با بازده سالانه شاخص شریعت COMCEC و پایین‌تر از بازدهی MSCI کشورهای در حال توسعه حرکت می‌کند. همچنین شاخص MSCI در طی سه ماه اخیر با افت شدید مواجه بوده است به طوری که مقدار این شاخص برای اولین بار در طول سال اخیر به مقداری کمتر از شاخص کل کاهش یافته است.

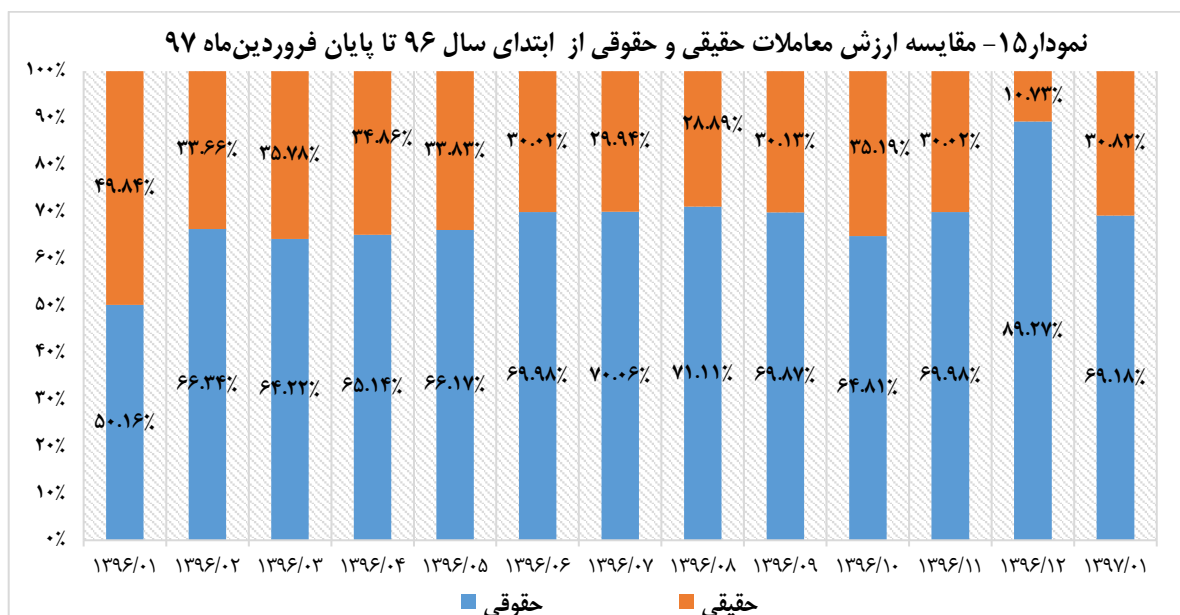


مقایسه معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس

در جدول زیر آمار معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان فروردین‌ماه ۱۳۹۷ نمایش داده شده است.

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان فروردین‌ماه ۱۳۹۷				
ماه	حقوقی	درصد از کل	حقیقی	درصد از کل
۱۳۹۶/۰۱	۳۰,۲۴۳	۵۰.۱۶٪	۳۰,۰۴۶	۴۹.۸۴٪
۱۳۹۶/۰۲	۸۲,۰۶۴	۶۶.۶٪	۴۱,۱۲۳	۳۳.۴٪
۱۳۹۶/۰۳	۴۵,۹۷۵	۶۴.۲۱٪	۲۵,۶۱۷	۳۵.۷۸٪
۱۳۹۶/۰۴	۴۳,۷۵۲	۶۵.۱۴٪	۲۳,۴۱۰	۳۴.۸۶٪
۱۳۹۶/۰۵	۵۴,۶۸۲	۶۶.۱۷٪	۲۷,۹۶۳	۳۳.۸۳٪
۱۳۹۶/۰۶	۵۸,۳۰۷	۶۹.۹۸٪	۲۵,۰۱۶	۳۰.۰۲٪
۱۳۹۶/۰۷	۶۴,۲۴۸	۷۰.۰۶٪	۲۷,۴۵۸	۲۹.۹۴٪
۱۳۹۶/۰۸	۶۸,۸۵۲	۷۱.۱۱٪	۲۷,۹۶۷	۲۸.۸۹٪
۱۳۹۶/۰۹	۷۷,۶۴۴	۶۹.۸۷٪	۳۳,۴۸۲	۳۰.۱۳٪
۱۳۹۶/۱۰	۶۴,۷۸۲	۶۴.۸۱٪	۳۵,۱۶۸	۳۵.۱۹٪
۱۳۹۶/۱۱	۷۴,۵۳۹	۶۹.۹۸٪	۳۱,۹۷۶	۳۰.۰۲٪
۱۳۹۶/۱۲	۲۱۳,۳۳۳	۸۹.۲۷٪	۲۵,۶۳۱	۱۰.۷۳٪
۱۳۹۷/۰۱	۳۳,۵۵۵	۶۹.۱۸٪	۱۴,۹۴۷	۳۰.۸۲٪



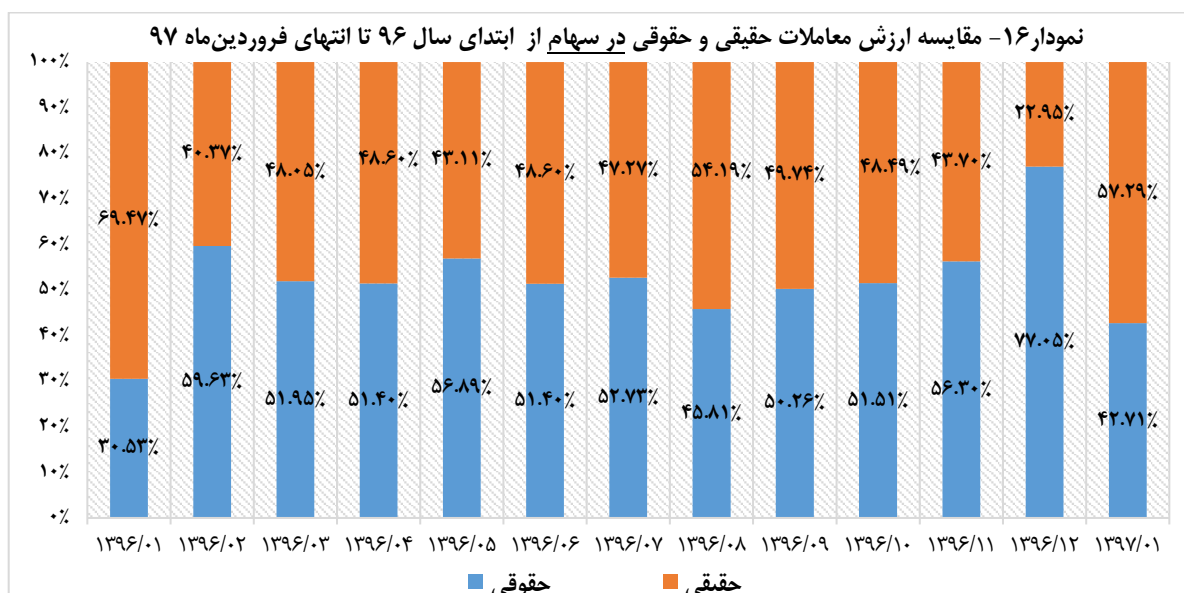
- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقوقی از کل ارزش معاملات انجام‌شده در فروردین‌ماه ۹۷، با ۸۴ درصد کاهش نسبت به اسفندماه ۹۶ به ۳۳,۵۵۵ میلیارد ریال رسید.
- ✓ نسبت ارزش معاملات اشخاص حقیقی در پایان فروردین‌ماه ۹۷ با افزایش ۲۰,۱ درصدی نسبت به ماه قبل همراه بوده است. این در حالی است که ارزش معاملات اشخاص حقیقی نیز در پایان این ماه ۴۱,۷ درصد کاهش داشته است.

آمار معاملات حقیقی و حقوقی در سهام

در جدول زیر آمار معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در سهام از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان فروردین‌ماه ۱۳۹۷ آورده شده است.

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی در سهام از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان فروردین‌ماه ۱۳۹۷				
ماه	حقوقی	درصد از کل	حقیقی	درصد از کل
۱۳۹۶/۰۱	۱۲,۷۰۹	۳۰.۵۳٪	۲۸,۹۲۱	۶۹.۴۷٪
۱۳۹۶/۰۲	۵۴,۱۱۲	۵۹.۶۳٪	۳۶,۶۲۷	۴۰.۳۷٪
۱۳۹۶/۰۳	۲۵,۸۳۹	۵۱.۹۵٪	۲۳,۸۹۶	۴۸.۰۵٪
۱۳۹۶/۰۴	۲۳,۲۷۱	۵۱.۴۰٪	۲۲,۰۰۰	۴۸.۶۰٪
۱۳۹۶/۰۵	۳۴,۶۱۱	۵۶.۸۹٪	۲۶,۲۳۰	۴۳.۱۱٪
۱۳۹۶/۰۶	۲۴,۱۰۵	۵۱.۴۰٪	۲۲,۷۹۷	۴۸.۶۰٪
۱۳۹۶/۰۷	۲۷,۸۶۸	۵۲.۷۳٪	۲۴,۹۸۶	۴۷.۲۷٪
۱۳۹۶/۰۸	۲۱,۶۶۴	۴۵.۸۱٪	۲۵,۶۲۸	۵۴.۱۹٪
۱۳۹۶/۰۹	۳۱,۱۸۸	۵۰.۲۶٪	۳۰,۸۵۹	۴۹.۷۴٪
۱۳۹۶/۱۰	۳۴,۲۰۷	۵۱.۵۱٪	۳۲,۲۰۶	۴۸.۴۹٪
۱۳۹۶/۱۱	۳۷,۸۵۴	۵۶.۳۰٪	۲۹,۳۸۲	۴۳.۷۰٪
۱۳۹۶/۱۲	۷۳,۴۸۸	۷۷.۰۵٪	۲۱,۸۹۲	۲۲.۹۵٪
۱۳۹۷/۰۱	۹,۴۱۲	۴۲.۷۱٪	۱۲,۶۲۳	۵۷.۲۹٪



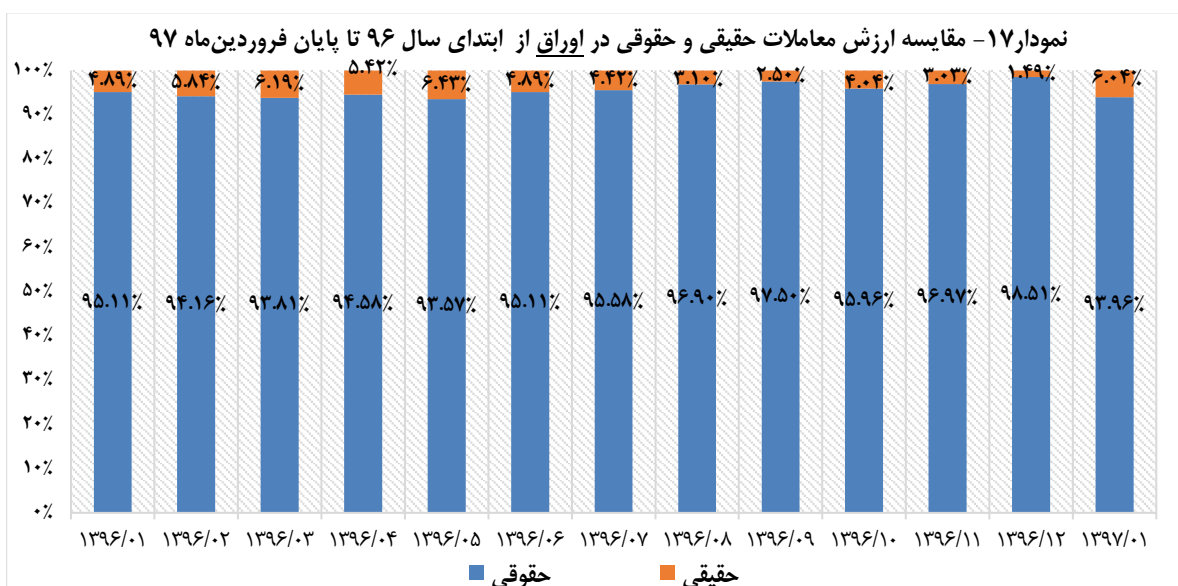
- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقوقی در سهام در فروردین‌ماه ۹۷ با کاهش ۸۷ درصدی نسبت به اسفندماه ۹۶ به ۹,۴۱۲ میلیارد ریال رسید.
- ✓ این در حالی است که ارزش معاملات اشخاص حقیقی در سهام در پایان فروردین‌ماه ۹۷، ۴۲,۳ درصد کاهش داشته است.
- ✓ سهم نسبت ارزش معاملات اشخاص حقیقی در سهام در پایان معاملات فروردین‌ماه ۹۷ با ۳۴,۴ درصد افزایش نسبت به ماه قبل، به ۵۷,۲۹ درصد از کل معاملات سهام افزایش یافت.

آمار معاملات حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی

در جدول زیر آمار معاملات سرمایه‌گذاران حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان فروردین‌ماه ۱۳۹۷ آورده شده است.

میلیارد ریال

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان فروردین‌ماه ۹۷				
ماه	حقوقی	درصد از کل	حقیقی	درصد از کل
۱۳۹۶/۰۱	۱۶,۳۶۷	۹۵.۱۱٪	۸۴۱	۴.۸۹٪
۱۳۹۶/۰۲	۲۰,۲۷۹	۹۴.۱۶٪	۱,۲۵۸	۵.۸۴٪
۱۳۹۶/۰۳	۱۸,۹۷۵	۹۳.۸۱٪	۱,۲۵۳	۶.۱۹٪
۱۳۹۶/۰۴	۱۹,۰۰۰	۹۴.۵۸٪	۱,۰۸۸	۵.۴۲٪
۱۳۹۶/۰۵	۱۸,۵۳۶	۹۳.۵۷٪	۱,۲۷۴	۶.۴۳٪
۱۳۹۶/۰۶	۳۰,۴۸۴	۹۵.۱۱٪	۱,۵۶۸	۴.۸۹٪
۱۳۹۶/۰۷	۳۳,۴۵۹	۹۵.۵۸٪	۱,۵۴۸	۴.۴۲٪
۱۳۹۶/۰۸	۴۴,۲۳۶	۹۶.۹۰٪	۱,۴۱۳	۳.۱۰٪
۱۳۹۶/۰۹	۴۳,۶۰۰	۹۷.۵۰٪	۱,۱۱۹	۲.۵۰٪
۱۳۹۶/۱۰	۲۶,۵۹۰	۹۵.۹۶٪	۱,۱۱۹	۴.۰۴٪
۱۳۹۶/۱۱	۳۲,۱۰۳	۹۶.۹۷٪	۱,۰۰۴	۳.۰۳٪
۱۳۹۶/۱۲	۱۳۴,۰۱۹	۹۸.۵۱٪	۲,۰۲۲	۱.۴۹٪
۱۳۹۷/۰۱	۲۲,۲۲۴	۹۳.۹۶٪	۱,۴۲۹	۶.۰۴٪



- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقوقی در اوراق بدهی در فروردین‌ماه ۹۷، ۸۳,۴ درصد نسبت به ماه قبل کاهش داشته است. به طوری که ارزش معاملات اشخاص حقوقی در اوراق بدهی از ۱۳۴,۰۱۹ میلیارد ریال در پایان اسفندماه ۹۶ به ۲۲,۲۲۴ میلیارد ریال در پایان فروردین‌ماه ۹۷ کاهش یافته است.
- ✓ ارزش معاملات اشخاص حقیقی در اوراق بدهی در پایان معاملات فروردین‌ماه ۹۷، ۲۹,۳ درصد نسبت به ماه قبل کاهش داشته و ۱,۴۲۹ میلیارد ریال می‌باشد.

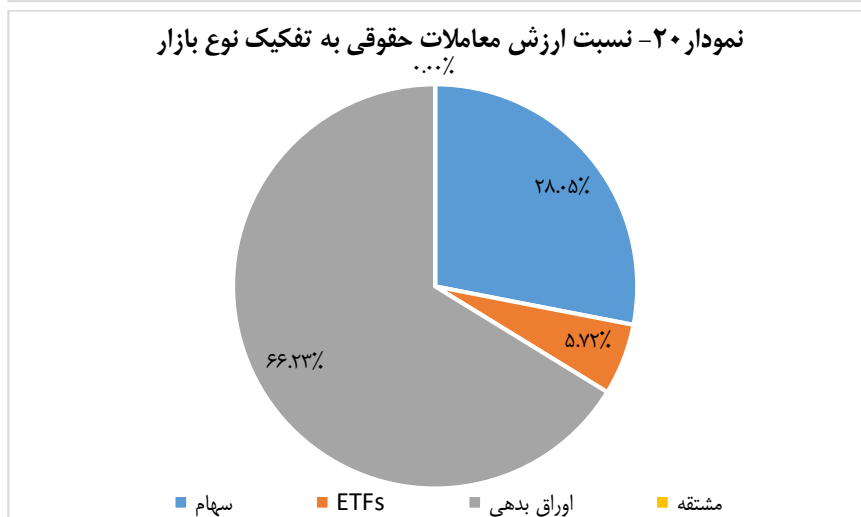
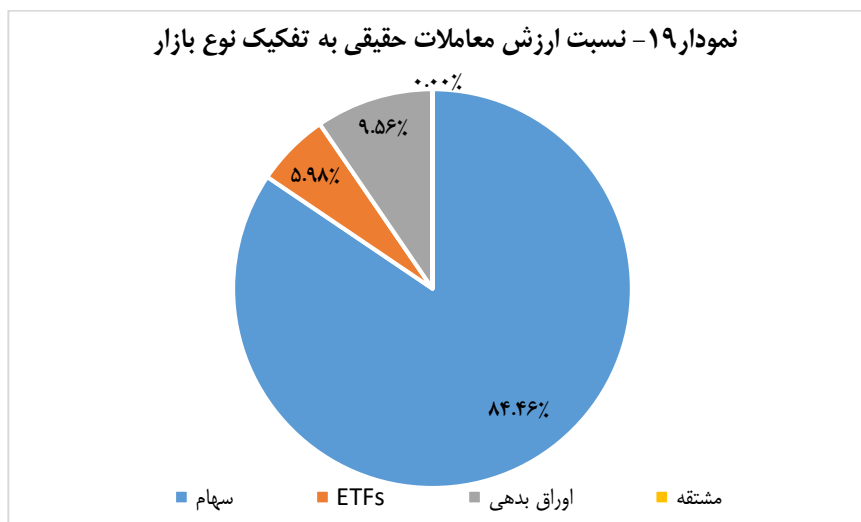
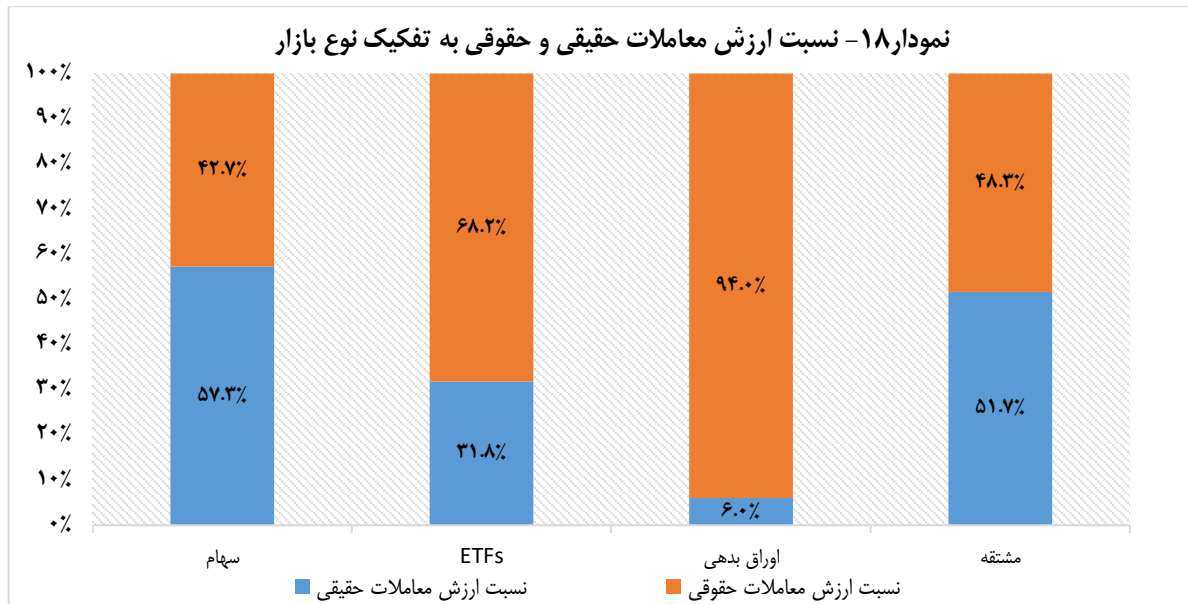
ارزش و حجم معاملات به تفکیک خرید و فروش حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس

در جدول زیر ارزش و حجم معاملات به تفکیک خرید و فروش حقیقی و حقوقی در بورس و فرابورس در فروردین ماه ۱۳۹۷ و اسفندماه ۱۳۹۶ آورده شده است.

تغییر نسبت به ماه گذشته	فروردین ماه ۹۷	اسفندماه ۹۶		
-۷۷.۹۴٪	۲۰,۹۳۴	۹۴,۸۸۱	ارزش معامله - بورس (میلیارد ریال)	بورس اوراق بهادار تهران
-۸۴.۰۱٪	۱۲,۵۵۳	۷۸,۴۸۶	ارزش خرید - حقوقی - بورس (میلیارد ریال)	
-۴۸.۸۸٪	۸,۳۸۱	۱۶,۳۹۵	ارزش خرید - حقیقی - بورس (میلیارد ریال)	
-۸۶.۳۶٪	۱۰,۶۲۰	۷۷,۸۷۷	ارزش فروش - حقوقی - بورس (میلیارد ریال)	
-۳۹.۳۴٪	۱۰,۳۱۴	۱۷,۰۰۴	ارزش فروش - حقیقی - بورس (میلیارد ریال)	
-۷۹.۵۳٪	۹,۷۹۲	۴۷,۸۳۶	حجم معامله - بورس (میلیون سهم)	
-۸۶.۹۳٪	۴,۸۴۰	۳۷,۰۲۶	حجم خرید - حقوقی - بورس (میلیون سهم)	
-۵۴.۱۹٪	۴,۹۵۲	۱۰,۸۱۰	حجم خرید - حقیقی - بورس (میلیون سهم)	
-۹۱.۳۵٪	۳,۲۱۶	۳۷,۱۶۹	حجم فروش - حقوقی - بورس (میلیون سهم)	
-۳۸.۳۶٪	۶,۵۷۵	۱۰,۶۶۶	حجم فروش - حقیقی - بورس (میلیون سهم)	
تغییر نسبت به ماه گذشته	فروردین ماه ۹۷	اسفندماه ۹۶		
-۸۰.۸۷٪	۲۷,۵۶۸	۱۴۴,۰۸۳	ارزش معامله - فرابورس (میلیارد ریال)	فرابورس ایران
-۸۳.۵۳٪	۲۲,۱۹۰	۱۳۴,۷۴۸	ارزش خرید - حقوقی - فرابورس (میلیارد ریال)	
-۴۲.۳۸٪	۵,۳۷۸	۹,۳۳۴	ارزش خرید - حقیقی - فرابورس (میلیارد ریال)	
-۸۳.۹۶٪	۲۱,۷۴۷	۱۳۵,۵۵۵	ارزش فروش - حقوقی - فرابورس (میلیارد ریال)	
-۳۱.۷۴٪	۵,۸۲۱	۸,۵۲۸	ارزش فروش - حقیقی - فرابورس (میلیارد ریال)	
-۷۹.۸۱٪	۲,۶۱۱	۱۲,۹۳۰	حجم معامله - فرابورس (میلیون سهم)	
-۹۲.۷۰٪	۶۶۴	۹,۰۹۲	حجم خرید - حقوقی - فرابورس (میلیون سهم)	
-۴۹.۲۶٪	۱,۹۴۷	۳,۸۳۷	حجم خرید - حقیقی - فرابورس (میلیون سهم)	
-۹۴.۰۳٪	۵۶۲	۹,۴۱۸	حجم فروش - حقوقی - فرابورس (میلیون سهم)	
-۴۱.۶۶٪	۲,۰۴۹	۳,۵۱۲	حجم فروش - حقیقی - فرابورس (میلیون سهم)	

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 فروردین ماه ۱۳۹۷ نشان داده شده است.



لیست نمادهای متوقف

در جدول زیر لیست ۱۸ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران و ۳ نماد متوقف شده در فرابورس ایران در فروردین ماه ۱۳۹۷ 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	استخراج کانه های فلزی	معادن منگنز ایران	کمنگنز	تغییرات بیش از ۲۰ درصدی قیمت سهام	۱
	خودرو و ساخت قطعات	آهنگری تراکتورسازی ایران	خاهن	برگزاری مجمع عمومی عادی	۳
	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	ایران ارقام	مرقام	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۲
	ساخت دستگاه‌ها و وسایل ارتباطی	پارس الکترونیک	لپارس	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب	۲
	سرمایه گذاریها	سرمایه گذاری صنعت بیمه	وبیمه	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۱
	سیمان، آهک و گچ	سیمان کردستان	سکرد	برگزاری مجمع عمومی	۶
	فلزات اساسی	کالسیمین	فاسمین	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب	۱
	قند و شکر	فرآورده‌های غذایی و قندپیرانشهر	قپیرا	برگزاری مجمع عمومی عادی	۴
	قند و شکر	قند شیرین خراسان	قشرین	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۴
	کاشی و سرامیک	تولیدی کاشی تکسرام	کترام	تغییرات بیش از ۲۰ درصدی قیمت سهام	۱
	لاستیک و پلاستیک	درخشان تهران	پدرخش	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب و نوسان قیمت بیش از ۲۰ درصد طی ۵ روز معاملاتی	۳
	لاستیک و پلاستیک	صنایع لاستیکی سهند	پسهند	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب	۱
	ماشین آلات و تجهیزات	تکنوتار	تکنو	تغییرات بیش از ۲۰ درصدی قیمت سهام	۱
	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	نیروترانس	بنیرو	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب	۱
	محصولات چوبی	فیبر ایران	چفیبیر	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۱
	محصولات شیمیایی	پتروشیمی خارک	شخارک	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۱
	محصولات شیمیایی	پتروشیمی فناوران	شفن	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۱
	محصولات کاغذی	صنایع کاغذسازی کاوه	چکاوه	تغییرات بیش از ۲۰ درصدی قیمت سهام	۱
فرابورس ایران	اطلاعات و ارتباطات	آتیه داده پرداز	اپرداز	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۱
	رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	افران	افرا	نوسان قیمت بیش از ۲۰ درصد طی ۵ روز	۱
	فلزات اساسی	سهامی ذوب آهن اصفهان	ذوب	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب	۱

در جدول زیر لیست ۲۱ نماد متوقف شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در فروردین ماه ۱۳۹۷ که در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده‌اند به همراه علت توقف آن‌ها ارائه شده است.

بورس	صنعت	شرکت	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
بورس اوراق بهادار تهران	خودرو و ساخت قطعات	سرمایه‌گذاری رنا(هلدینگ	ورنا	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۲۹
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	فرآورده‌های نسوز پارس	کفپارس	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۷/۱/۲۷
	سایر واسطه گریهای مالی	واسپاری ملت	ولملت	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۲۹
	سرمایه گذاریها	سرمایه گذاری آتیه دماوند	واتی	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۷/۱/۲۷
	سرمایه گذاریها	سرمایه‌گذاری ملی ایران	ونیکی	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۷/۱/۲۸
	سیمان، آهک و گچ	سیمان هگمتان	سپهگمت	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۷/۱/۲۶
	ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	صنایع جوشکاب‌یزد	بکاب	برگزاری مجمع عمومی فوق العاده	۹۷/۱/۲۹
	محصولات شیمیایی	مدیریت صنعت شوینده ت.ص. بهشهر	شوینده	برگزاری مجمع عمومی	۹۷/۱/۲۸
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	خوراک دام پارس	غدام	برگزاری مجمع عمومی	۹۷/۱/۲۷
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	صنعتی بهشهر	غیشهر	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۲۸
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	کشت و صنعت پیاذر	غازر	عدم افشای به موقع اطلاعات با اهمیت	۹۷/۱/۱۵
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	مارگارین	غمارگ	برگزاری مجمع عمومی	۹۷/۱/۲۲
	منسوجات	نساجی بروجرد	نبروج	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۷/۱/۲۰
	بانکها و موسسات اعتباری	بانک صادرات ایران	وبصادر	تغییرات بیش از ۲۰ درصدی قیمت سهام،	۹۷/۱/۵
	خودرو و ساخت قطعات	ایرکا پارت صنعت	خکار	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف و ب	۹۷/۱/۵
	سایر محصولات کانی غیرفلزی	فرآورده های نسوز ایران	کفرا	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۵
	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	وبانک	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۵
	محصولات شیمیایی	سرمایه‌گذاری صنایع پتروشیمی	وپترو	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۵
فرابورس ایران	انبوه سازی، املاک و مستغلات	س. توسعه و عمران استان کرمان	کرمان	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۲۷
	انبوه سازی، املاک و مستغلات	شرکت سرمایه گذاری مسکن شمالغرب	ثغرب	افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف	۹۷/۱/۲۹
	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	صنعتی بهپاک	بهپاک	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۷/۱/۲۷

در جدول زیر لیست ۵ نماد در بورس اوراق بهادار تهران و ۸ نماد در فرابورس ایران که قبل از فروردین ماه ۱۳۹۷ متوقف شده و در پایان این ماه نیز همچنان متوقف بوده‌اند به همراه علت توقف آن‌ها ارائه شده است.

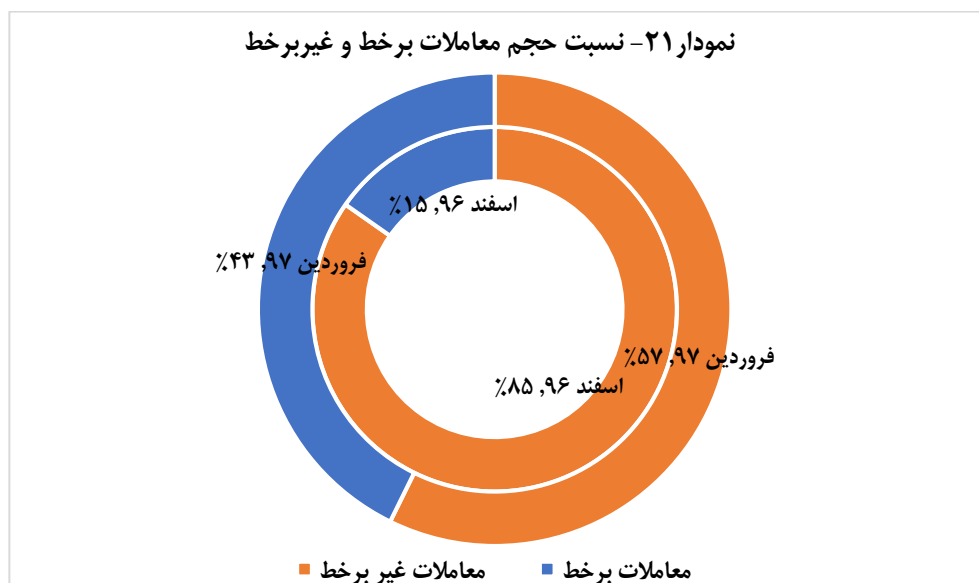
بورس	صنعت	شرکت	نماد	علت توقف	تاریخ توقف
بورس اوراق بهادار تهران	ابزار پزشکی، اپتیک و اندازه‌گیری	کنتورسازی ایران	آکتور	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۶/۱۳
	اطلاعات و ارتباطات	داده گستر عصر نوین-های وب	های وب	ابهام نسبت به شفافیت اطلاعات	۹۶/۹/۲۲
	بانکها و موسسات اعتباری	بانک پاسارگاد	وپاسار	ابهام در ارائه اطلاعات	۹۵/۹/۲
	ساخت محصولات فلزی	صنایع آذراب	فاذر	تعدیل پیش بینی درآمد هر سهم	۹۶/۴/۳
	سرمایه گذاریها	سرمایه گذاری ملت	وملت	بررسی وضعیت شفافیت اطلاعاتی ناشر	۹۶/۱۲/۲۱
فرابورس ایران	بانکها و موسسات اعتباری	اعتباری ملل	وملل	برگزاری مجمع عمومی عادی	۹۶/۴/۲۷
	بانکها و موسسات اعتباری	بانک دی	دی	برگزاری مجامع عمومی عادی	۹۶/۶/۲۵
	بانکها و موسسات اعتباری	بانک سرمایه	سمایه	عدم ارائه اطلاعات	۹۵/۸/۳
	بانکها و موسسات اعتباری	بانک گردشگری	وگردش	تعدیل با اهمیت پیش بینی درآمد هر سهم سال مالی ۱۳۹۵	۹۵/۵/۲۵
	بانکها و موسسات اعتباری	شرکت اعتباری کوثر مرکزی	وکوثر	ابهام در اطلاعات	۹۵/۱۱/۲۶
	خودرو و ساخت قطعات	مهندسی صنعتی روان فن آور	خفناور	عدم رعایت ماده ۳۹ دستورالعمل پذیرش، عرضه و نقل و انتقال اوراق بهادار در فرابورس ایران	۹۶/۱۲/۱۳
	سرمایه گذاریها	سرمایه گذاری مس سرچشمه	سرچشمه	عدم افشای بموقع اطلاعات با اهمیت	۹۶/۱۲/۲۷
	سیمان، آهک و گچ	سیمان لار سبزوار	سبزوا	افشای اطلاعات با اهمیت گروه ب	۹۶/۱۱/۸

- ✓ در فروردین ماه ۱۳۹۷، در بین نمادهای بورسی و فرابورسی ۵۷ نماد به علت‌های مختلف بسته بوده‌اند که در انتهای ماه ۲۱ نماد معادل ۳۷ درصد نمادهای متوقف بازگشایی شده‌اند.
- ✓ از میان ۳۶ نماد باقی‌مانده، ۱۲ نماد به علت برگزاری مجمع، ۱۲ نماد به علت افشای اطلاعات با اهمیت گروه الف یا ب، ۸ نماد به علت ابهام در ارائه اطلاعات، ۲ نماد به علت تعدیل پیش‌بینی درآمد، یک نماد به علت عدم رعایت ماده ۳ دستورالعمل پذیرش و یک نماد به علت نوسان قیمت بیش از ۲۰ درصد توقف شده‌اند.
- ✓ در مجموع، از میان نمادهای متوقف باقی‌مانده در پایان فروردین ماه ۱۳۹۷، ۱۲ مورد معادل ۳۳ درصد نمادهای متوقف، به درخواست شرکت پذیرفته شده در بورس و فرابورس صورت گرفته است.

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 فروردین‌ماه ۱۳۹۷ و اسفندماه ۱۳۹۶ نشان داده شده است.



حجم معاملات به تفکیک مناطق

به طور کلی ۶۳ درصد از حجم معاملات خرید و فروش در استان‌های کشور در کلیه انواع اوراق بهادار در بورس و فرابورس در فروردین‌ماه ۱۳۹۷، مربوط به معاملات اشخاص حقیقی و ۳۷ درصد مربوط به معاملات اشخاص حقوقی می‌باشد. در جدول زیر پنج استان با بیش‌ترین حجم معاملات خرید و فروش اشخاص حقوقی در فروردین‌ماه ۱۳۹۷ نمایش داده شده است.

هزار سهم

بیشترین حجم خرید و فروش اشخاص حقوقی		تاریخ			درصد تغییرات		
		۱۳۹۷/۰۱/۳۱	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه در سال قبل	نسبت به کل حجم فروردین‌ماه ۹۷
۱	تهران	۴۰٬۸۱۶۸۶	۲۱٬۴۲۸۶۶۰	۵۸۰۱۰٬۸۲	-۸۰٫۹۵٪	-۲۹٫۶۴٪	۸۷٫۹۵٪
۲	آذربایجان شرقی	۳۴٬۷۷۸	۲۸٬۵۱۵	۱۲۱٬۵۰۵	۲۱٫۹۶٪	-۷۱٫۳۸٪	۰٫۷۵٪
۳	زنجان	۳۲٬۰۰۷	۱٬۲۵۴	۱٬۹۳۵	۲۴۵۲٫۳۹٪	۱۵۵۴٫۱۱٪	۰٫۶۹٪
۴	گیلان	۳۰٬۴۵۷	۸۷٬۷۲۷	۱۱۲٬۴۴۵	-۶۵٫۲۸٪	-۷۲٫۹۱٪	۰٫۶۶٪
۵	همدان	۲۹٬۴۳۲	۳۸٬۲۰۴	۶٬۷۳۰	-۲۲٫۹۶٪	۳۳۷٫۳۳٪	۰٫۶۳٪
مجموع ۵ استان		۴۰٬۲۰۸٬۳۶۰	۲۱٬۵۸۴٬۳۶۰	۶۰٬۴۳۶۹۷	-۸۰٫۵۰٪	-۳۰٫۳۷٪	۹۰٫۶۸٪
سایر استان‌ها		۱۲۷٬۳۱۲	۲۳٬۸۹۱٬۵۴۳	۴۲۴٬۸۴۸	-۹۹٫۴۷٪	-۷۰٫۰۳٪	۲٫۷۴٪
معاملات برخط		۳۰۵٬۴۶۳	۸۷۶٬۵۶۵	۲۹۸٬۶۳۵	-۶۵٫۱۵٪	۲٫۲۹٪	۶٫۵۸٪
مجموع		۴۰۶۴۱٬۱۳۵	۴۶٬۳۵۲٬۴۶۸	۶۰۷۶۷٬۱۸۰	-۸۹٫۹۹٪	-۳۱٫۴۲٪	۱۰۰٫۰۰٪

در جدول زیر پنج استان با بیشترین حجم معاملات خرید و فروش اشخاص حقیقی در فروردین ماه ۱۳۹۷ نمایش داده شده است.

هزار سهم

بیشترین حجم خرید و فروش <u>اشخاص حقیقی</u>	تاریخ			درصد تغییرات		
	۱۳۹۷/۰۱/۳۱	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۵/۱۲/۲۹	نسبت به ماه قبل	نسبت به ماه مشابه در سال قبل	نسبت به کل حجم فروردین ماه ۹۷
۱ تهران	۱,۵۱۸,۲۰۶	۳,۵۲۸,۵۴۹	۴,۰۲۵,۹۵۸	-۵۶.۹۷٪	-۶۲.۲۹٪	۱۹.۵۶٪
۲ اصفهان	۳۴۶,۲۱۹	۴۶۳,۹۸۰	۵۵۷,۰۴۶	-۴۶.۹۳٪	-۵۵.۸۰٪	۳.۱۷٪
۳ خراسان رضوی	۱۳۴,۵۲۵	۳۰۹,۲۴۵	۴۰۹,۵۳۵	-۵۶.۵۰٪	-۶۷.۱۵٪	۱.۷۳٪
۴ البرز	۱۰۸,۴۴۲	۱۹۳,۱۹۷	۲۷۴,۶۷۲	-۴۳.۸۷٪	-۶۰.۵۲٪	۱.۴۰٪
۵ آذربایجان شرقی	۱۰۷,۱۳۷	۲۰۴,۳۱۵	۲۳۸,۱۷۳	-۴۷.۵۶٪	-۵۵.۰۲٪	۱.۳۸٪
مجموع ۵ استان	۲,۱۱۴,۵۲۹	۴,۶۹۹,۲۸۶	۵,۵۰۵,۳۸۴	-۵۵.۰۰٪	-۶۱.۵۹٪	۲۷.۲۴٪
سایر استان ها	۶۵۴,۰۴۱	۱,۳۱۷,۲۴۵	۱,۷۹۶,۳۹۰	-۵۰.۳۵٪	-۶۳.۵۹٪	۸.۴۳٪
معاملات برخلاف	۴,۹۹۳,۰۸۶	۸,۳۹۶,۴۰۷	۸,۸۸۱,۹۶۶	-۴۰.۵۳٪	-۴۳.۷۸٪	۶۴.۳۳٪
مجموع	۷,۷۶۱,۶۵۶	۱۴,۴۱۲,۹۳۸	۱۶,۱۸۳,۷۴۰	-۴۶.۱۵٪	-۵۲.۰۴٪	۱۰۰.۰۰٪

در نمودار (۲۲) حجم و ارزش معاملات اشخاص حقیقی در استان های کشور بجز استان تهران، در کلیه انواع اوراق بهادار در بورس و فرابورس در فروردین ماه ۱۳۹۷ نشان داده شده است.

لازم به ذکر است که حدود ۶۴,۳ درصد از کل حجم معاملات مربوط به معاملات برخلاف می باشد که این تعداد در نمودار صفحه بعد نشان داده نشده است. همچنین استان تهران به تنهایی حدود ۱۹,۶ 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 استان ها را نشان می دهد.

نمودار ۲۲- حجم و ارزش معاملات اشخاص حقیقی در فروردین ماه ۹۷ به تفکیک مناطق غیر از تهران

اصفهان	البرز	زنجان	فارس	قم	کرمانشاه
	108,442,470				
	آذربایجان شرقی	76,986,219	52,048,844	47,131,488	44,274,542
		مازندران	همدان	آذربایجان غربی	مرکزی
			30,715,453		
		گیلان		23,872,137	16,145,582
246,219,303		43,711,483		خوزستان	کردستان
		هرمزگان	26,898,689		لرستان
خراسان رضوی	107,136,750		اردبیل		
	یزد			15,679,867	15,353,754
		38,472,575	26,708,777	سمنان	12,085...
		قزوین	کرمان	11,850,491	...
				سیستان و بلوچستان	4,...
134,525,252	91,622,682	31,139,416	25,891,291	9,270,494	گلستان

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 از ابتدای سال ۹۷ تا ۳۱ فروردین ماه ۹۷	عملکرد ۹۶
بازار اولیه و ثانویه	تأسیس شرکت‌های سهامی عام	۰	۸۵۰
	افزایش سرمایه شرکت‌های سهامی عام (مجوزهای ارائه شده)	۱,۹۴۶	۱۷۳,۷۰۴
	انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	۴۴۰	۶۴۸,۷۷۵
	عرضه اولیه سهام شرکت‌ها در بورس و فرابورس	۰	۵,۱۹۵
جمع تأمین مالی بازار اولیه و ثانویه		۲,۳۸۶	۸۲۸,۵۲۴
نهادهای مالی	افزایش ارزش صندوق‌ها نسبت به ابتدای سال	۹۳,۸۴۴	۱۷۵,۲۱۴
	سایر نهادهای مالی*	۰	۱۰,۵۷۱
جمع تأمین مالی نهادهای مالی		۹۳,۸۴۴	۱۸۵,۷۸۵
جمع کل		۹۶,۲۳۰	۱,۰۱۴,۳۰۹

*: تأمین مالی سایر نهادهای مالی شامل تأسیس و افزایش سرمایه سایر نهادهای مالی شامل شرکت‌های سبدگردان، مشاور سرمایه‌گذاری، تأمین سرمایه و پردازش اطلاعات مالی می‌باشد.

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 فروردین ماه ۱۳۹۷	عملکرد ۹۶
انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	انتشار اوراق بهادار بدهی با مجوز سازمان بورس	۰	۴۷,۵۹۰
	انتشار اوراق سلف موازی استاندارد	۰	۱۹,۷۰۰
	اوراق مشارکت دولت، شهرداری ها و بانکها	۰	۱۱۱,۶۱۹
	گواهی سپرده سرمایه گذاری عام و خاص	۰	۰
	اوراق اجاره دولتی	۰	۲۱۵۰۰
	اوراق مرابحه دولتی	۰	۳۷,۳۸۰
	اوراق منفعت دولتی	۰	۵۰,۰۰۰
	اسناد خزانه اسلامی	۰	۳۴۸,۲۳۴
	امتیاز تسهیلات مسکن	۴۴۰	۱۲,۷۵۲
جمع		۴۴۰	۶۴۸,۷۷۵

*: اوراق بهادار بدهی شامل اوراق مشارکت، اجاره، مرابحه، رهنی و سفارش ساخت 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.

****: در سال ۹۵ مبلغ ۲۰,۰۰۰ میلیارد ریال اوراق اجاره دولت برای تسویه بدهی‌های وزارت آموزش و پرورش و مبلغ ۱,۵۰۰ میلیارد ریال اوراق اجاره دولت برای تسویه بدهی‌های وزارت علوم، تحقیقات و فناوری نیز منتشر و به طلبکاران وزارتخانه‌های مذکور واگذار گردیده، که به دلیل عدم شروع معاملات ثانویه آن در آمار لحاظ نگردیده 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 فروردین ماه ۱۳۹۷ و در انتهای سال ۱۳۹۶ در جدول زیر نمایش داده شده است.
میلیارد ریال

نوع اوراق	پایان فروردین ماه ۹۷	درصد از کل	پایان سال ۹۶	درصد از کل
مشارکت	۱۶۰،۱۱۹	۲۲،۴۴٪	۱۶۰،۱۱۹	۲۲،۳۱٪
اجاره	۴۹،۰۰۰	۶،۸۷٪	۴۹،۰۰۰	۶،۸۳٪
سلف	۵،۰۰۰	۰،۷۰٪	۵،۰۰۰	۰،۷۰٪
مراجعه	۵۷،۳۸۰	۸،۰۴٪	۵۷،۳۸۰	۸،۰۰٪
اسناد خزانه اسلامی	۲۶۰،۰۰۰	۳۶،۴۳٪	۲۶۰،۰۰۰	۳۶،۲۳٪
منفعت	۵۰،۰۰۰	۷،۰۱٪	۵۰،۰۰۰	۶،۹۷٪
معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری ها و دولت	۳۵،۹۹۵	۵،۰۴٪	۳۵،۹۹۵	۵،۰۲٪
جمع اوراق بهادار دولتی و شهرداری ها	۶۱۷،۴۹۴	۸۶،۵۳٪	۶۱۷،۴۹۴	۸۶،۰۵٪
انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی	۹۶،۱۲۱	۱۳،۴۷٪	۱۰۰،۱۲۱	۱۳،۹۵٪
جمع کل بازار اوراق بدهی	۷۱۳،۶۱۵	۱۰۰،۰۰٪	۷۱۷،۶۱۵	۱۰۰،۰۰٪

منبع: اداره نظارت بر انتشار و ثبت اوراق بدهی

سررسید اوراق بدهی منتشره

در جدول زیر لیست اوراق بدهی که در فروردین ماه ۱۳۹۷ سررسید شده اند، 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
اوراق مشارکت نفت و گاز پرشیا	اوراق مشارکت	پرشیا	شرکت توسعه نفت و گاز پرشیا (سهامی خاص)	غیر دولتی	فرابورس ایران	۲،۰۰۰،۰۰۰	۹۳/۰۲/۰۳	۹۷/۰۱/۲۳
اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪	اوراق مشارکت	ومدکو ۲	هلدینگ توسعه معادن و صنایع معدنی خاورمیانه (سهامی عام)	غیر دولتی	فرابورس ایران	۲،۰۰۰،۰۰۰	۹۳/۰۲/۱۰	۹۷/۰۱/۲۵
مجموع						۴،۰۰۰،۰۰۰		

در جدول زیر لیست اوراق بدهی که در اردیبهشت ماه ۱۳۹۷ سررسید خواهند شد، نشان داده شده است.

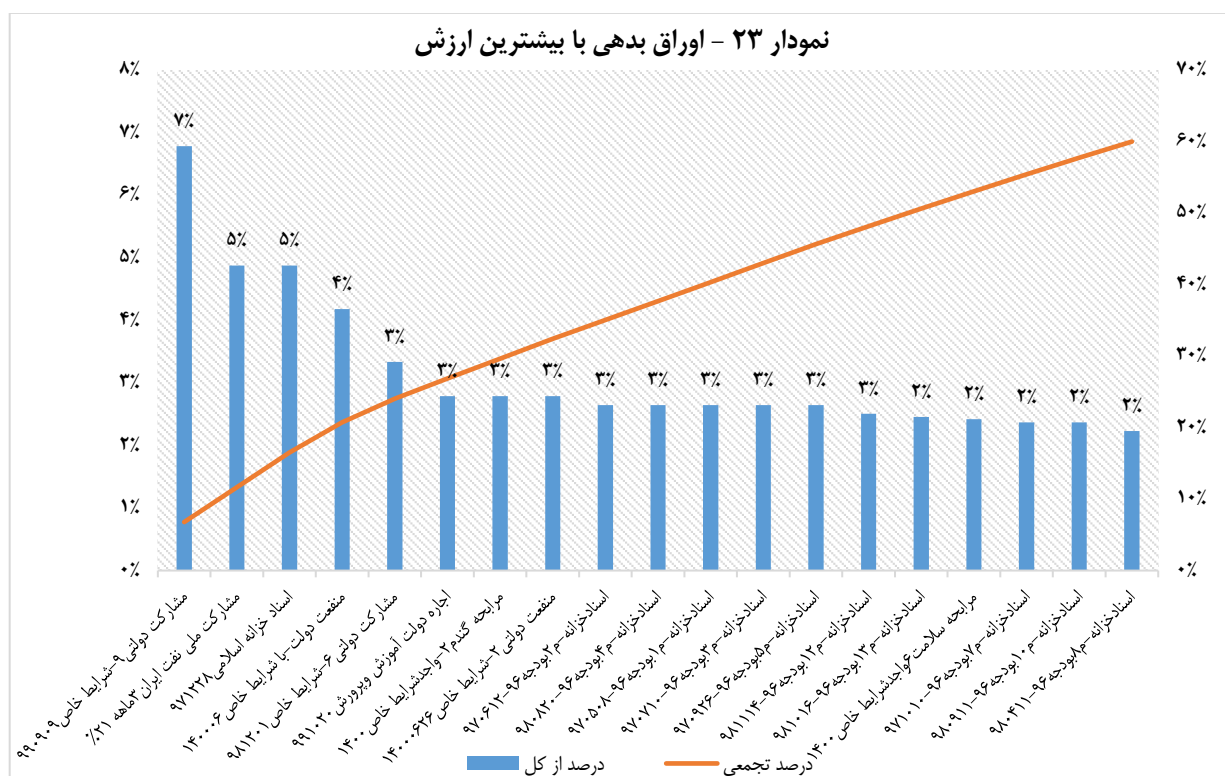
نام اوراق	نوع اوراق	نماد	نام ناشر/بانی	ماهیت ناشر	بورس منتشره کننده اوراق	مبلغ کل اوراق منتشره (میلیون ریال)	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید
اوراق اجاره قاندهبصر ۳ ماهه ۲۰٪	اوراق اجاره	صبصیر	پتروشیمی قاندهبصر	غیر دولتی	فرابورس ایران	۵۰۰،۰۰۰	۹۳/۰۳/۱۰	۹۷/۰۲/۲۸

در جدول زیر لیست ۲۰ اوراق بدهی که بیش از ۶۰ درصد کل اوراق بدهی باقی مانده را تشکیل می‌دهند 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 دولتی-۹-شرایط خاص ۹۹۰۹۰۹	اوراق مشارکت	اشاد ۹	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۴۸۶۸۸.۹۵۲
مشارکت ملی نفت ایران ۳ ماهه ۲۱٪	اوراق مشارکت	مپارس ۷۱۲	شرکت ملی نفت ایران	دولتی	بورس اوراق بهادار تهران	۳۵.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸	اسناد خزانه اسلامی	سخاب ۷	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۳۵.۰۰۰.۰۰۰
منفعت دولت-با شرایط خاص ۱۴۰۰۰۶	اوراق منفعت	افاد ۱	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۳۰.۰۰۰.۰۰۰
مشارکت دولتی-۶-شرایط خاص ۹۸۱۲۰۱	اوراق مشارکت	اشاد ۶	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۲۳.۹۵۳.۲۸۹
اجاره دولت آموزش و پرورش ۹۹۱۰۲۰	اوراق اجاره	اجاد ۳	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۲۰.۰۰۰.۰۰۰
مربحه گندم-۲-واجد شرایط خاص ۱۴۰۰	اوراق مربحه	گندم ۲	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۲۰.۰۰۰.۰۰۰
منفعت دولتی-۲-شرایط خاص ۱۴۰۰۰۶۲۶	اوراق منفعت	افاد ۲	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۲۰.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۲ بودجه ۹۶-۹۷۰۶۱۲	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۰۲	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۹.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۴ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۰۴	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۹.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۱ بودجه ۹۶-۹۷۰۵۰۸	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۰۱	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۹.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۳ بودجه ۹۶-۹۷۰۷۱۰	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۰۳	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۹.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۵ بودجه ۹۶-۹۷۰۹۲۶	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۰۵	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۹.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۱۲ بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۱۲	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۸.۰۰۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۱۳ بودجه ۹۶-۹۸۱۰۱۶	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۱۳	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۷.۶۲۵.۹۷۰
مربحه سلامت عواجد شرایط خاص ۱۴۰۰	اوراق مربحه	سلامت ۶	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۷.۳۸۰.۰۰۰
اسناد خزانه-م-۷ بودجه ۹۶-۹۷۱۰۱۰	اسناد خزانه اسلامی	اخزا ۶۰۷	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۷.۰۰۰.۰۰۰

اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۶-	اسناد خزانه اسلامی	۶۱۰	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۷,۰۰۰,۰۰۰
۹۸۰۹۱۱						
اسناد خزانه-م ۸ بودجه ۹۶-	اسناد خزانه اسلامی	۶۰۸	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۱۶,۰۰۰,۰۰۰
۹۸۰۴۱۱						
مشارکت دولتی-۹ شرایط خاص ۹۹۰۹۰۹	اوراق مشارکت	۹	وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت ج. ا. ا.	دولتی	فرابورس ایران	۴۸,۶۸۸,۹۵۲
۹۹۰۹۰۹						
مجموع						۴۳۰,۶۴۸,۲۱۱
سایر اوراق بدهی						۲۸۲,۹۶۷,۲۶۶
مجموع کل						۷۱۳,۶۱۵,۴۷۷

نمودار (۲۳) درصد ارزش هر یک از ۲۰ 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.



✓ در فروردین ماه ۱۳۹۷، ۲ مورد از اوراق بدهی به ارزش مجموعاً ۴۰۰۰ میلیارد ریال سررسید شد.

✓ مانده اوراق بدهی منتشره در پایان فروردین ماه ۹۷ به ۷۱۳,۶۱۵ میلیارد ریال رسید که در مقایسه با پایان اسفند ماه ۹۶، ۰,۵۵ درصد کاهش داشته است.

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 آماری بررسی تأثیر بازارهای**

موازی بر شاخص کل بورس

شاخص‌های مورد بررسی

بازدهی روزانه شاخص‌ها

همبستگی بین متغیرها

روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن -

ها 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 پایان سال ۹۵	یک ماه	۹۵/۱۲/۲۸	۹۶/۱۲/۲۹	۹۷/۰۱/۳۱	واحد	
۴۰.۵۸٪	۹.۶۰٪	۴۹.۳۶	۶۳.۳۱	۶۹.۳۹	بشکه	نفت (دلار)
۱۲.۵۸٪	-۱۲.۰۰٪	۳۷.۳۰۷	۴۷.۷۲۶	۴۲.۰۰۰		دلار (ریال)
۱۶.۳۳٪	-۵.۴۵٪	۴۴۷	۵۵۰	۵۲۰	تن	فولاد (دلار)
-۲۳.۸۹٪	-۱.۰۱٪	۹۰	۶۹.۲	۶۸.۵	تن	سنگ آهن (دلار)
۱۵.۱۵٪	۲.۷۵٪	۸۱.۲	۹۱	۹۳.۵	تن	زغال سنگ (دلار)
۱۷.۲۳٪	۲.۶۲٪	۵,۸۸۶.۳۰	۶,۷۲۴.۰۳	۶,۹۰۰.۴۰	تن	مس (دلار)
۱۳.۴۱٪	۰.۳۱٪	۲,۸۵۷	۳,۲۳۰	۳,۲۴۰	تن	روی (دلار)
۳۰.۷۸٪	۱۹.۶۰٪	۱,۹۰۴	۲,۰۸۲	۲,۴۹۰	تن	آلومینیوم (دلار)
۲۶.۶۵٪	۱۹.۱۵٪	۳۳۴	۳۵۵	۴۲۳	تن	متانول (دلار)
۱۷.۶۵٪	-۱.۱۴٪	۲۲۱	۲۶۳	۲۶۰	تن	اوره (دلار)
-۳۴.۹۷٪	-۸.۴۹٪	۱۷.۹	۱۲.۷۲	۱۱.۶۴	پوند	شکر (سنت)
از پایان سال ۹۵	یک ماه	مقدار شاخص				
۲۳.۶۹٪	-۰.۸۰٪	۷۷.۲۳۰	۹۶.۲۹۰	۹۵.۵۲۴		شاخص کل بورس
۶.۴۴٪	-۳.۱۱٪	۱۵.۷۲۳	۱۷.۲۷۱	۱۶.۷۳۵		شاخص کل (هم وزن)
۲۱.۶۰٪	-۲.۹۷٪	۸۷۵	۱,۰۹۷	۱,۰۶۴		شاخص فرابورس

- ✓ قیمت نفت خام پس از افزایش ۰,۶۷ درصدی قیمت در پایان اسفندماه ۹۶ و رسیدن به قیمت ۶۳,۳۱ دلار در هر بشکه، در پایان فروردین‌ماه ۹۷ با رشد ۹,۶ درصدی، به قیمت ۶۹,۳۹ دلار در هر بشکه رسید. این در حالی است که قیمت نفت خام نسبت به ابتدای سال ۱۳۹۶ رشد ۴۰,۶ درصدی را نشان می‌دهد.
- ✓ دلار در ادامه روند صعودی خود طی چند ماه اخیر، در فروردین‌ماه ۹۷ به قیمت‌های بیش از ۶۰,۰۰۰ ریال نیز رسید اما در اوایل دهه سوم فروردین‌ماه ۹۷ و با مصوبه دولت، قیمت دلار به صورت تک نرخی و با قیمت ۴۲,۰۰۰ ریال تعیین شد.
- ✓ قیمت جهانی سنگ آهن پس از کاهش ۱۱,۳ درصدی در پایان اسفندماه ۹۶ و رسیدن به قیمت ۶۹,۲ دلار در هر تن، در پایان فروردین‌ماه ۹۷ نیز با افت ۱ درصدی به قیمت ۶۸,۵ دلار در هر تن رسید.
- ✓ قیمت جهانی متانول در پایان فروردین‌ماه ۹۷، با ۱۹,۲ درصد افزایش نسبت به پایان اسفندماه ۹۶ به قیمت ۴۲۳ دلار در هر تن رسید.
- ✓ در پایان فروردین‌ماه ۹۷ شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران با ۰,۸ درصد کاهش به ۹۵,۵۲۴ واحد رسید. همچنین شاخص فرابورس ایران در پایان فروردین‌ماه ۹۷ با ۳ کاهش به ۱,۰۶۴ واحد 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 پذیرفته‌شده 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 ۹۶ 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 به‌روز 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 واسه‌گیری‌های 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- واسطه‌گیری‌های مالی و پولی |
| ۵- خدمات فنی و مهندسی | ۱۰- فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط |

۳- مجموعاً ۲۲۹ شرکت بورسی و ۴۳ شرکت فرابورسی مورد بررسی و تحلیل قرار گرفته‌اند.

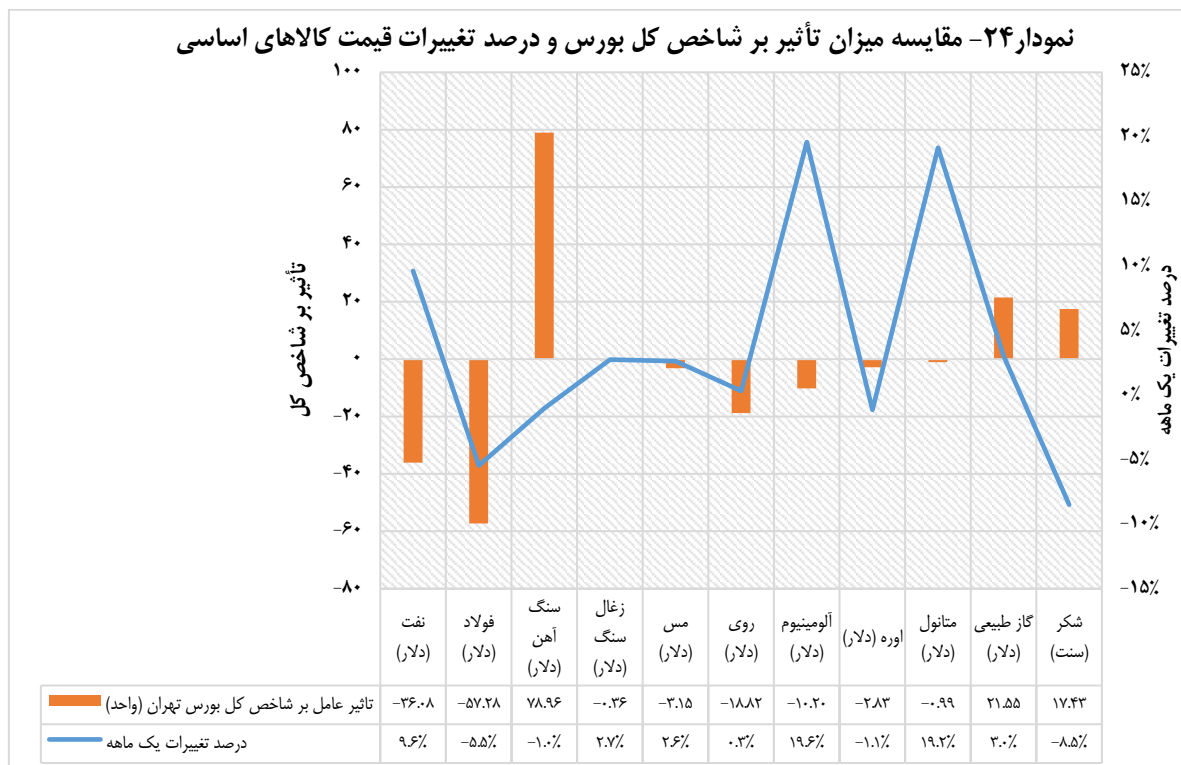
بورس تهران

در جدول صفحه بعد، تغییرات نرخ‌های جهانی کالاهای اساسی در بازه زمانی یک ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ و تأثیر هر یک از آن‌ها بر شرکت‌های بورسی متأثر از آن عامل نمایش داده شده است. همان‌طور 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 فروردین ماه ۱۳۹۷					تغییرات نرخ های جهانی کالاهای اساسی				
ردیف	عامل بازار	واحد	۹۷/۰۱/۳۱	۹۶/۱۲/۲۹	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	۶۹.۳۹	۶۳.۳۱	۹.۶%	۴۰	۹۳.۶%	۹۵.۴%	-۳۶.۰۸
۲	فولاد (دلار)	تن	۵۲۰	۵۵۰	-۵.۵%	۳۸	۳۲.۸%	۳۷.۶%	-۵۷.۲۸
۳	سنگ آهن (دلار)	تن	۶۸.۵	۶۹.۲	-۱.۰%	۳۲	۴.۷%	۳۱.۱%	۷۸.۹۶
۴	زغال سنگ (دلار)	تن	۹۳.۵	۹۱	۲.۷%	۲	۲۱.۱%	۷.۱%	-۰.۳۶
۵	مس (دلار)	تن	۶۹۰۰.۴	۶۷۲۴.۰۳	۲.۶%	۷	۷۷.۳%	۳۰.۰%	-۳.۱۵
۶	روی (دلار)	تن	۳۲۴۰	۳۲۳۰	۰.۳%	۶	۴۶.۹%	۵.۹%	-۱۸.۸۲
۷	آلومینیوم (دلار)	تن	۲۴۹۰	۲۰۸۲	۱۹.۶%	۵	۶۰.۰%	۲۱.۳%	-۱۰.۲۰
۸	اوره (دلار)	تن	۲۶۰	۲۶۳	-۱.۱%	۳	۸۴.۱%	۰.۰%	-۲.۸۳
۹	متانول (دلار)	تن	۴۲۳	۳۵۵	۱۹.۲%	۵	۴۵.۳%	۰.۸%	-۰.۹۹
۱۰	گاز طبیعی (دلار)	MMBtu	۲.۷۴	۲.۶۶	۳.۰%	۶	۱۷.۳%	۲۷.۳%	۲۱.۵۵
۱۱	شکر (سنت)	پوند	۱۱.۶۴	۱۲.۷۲	-۸.۵%	۱۸	۳۴.۸%	۸.۲%	۱۷.۴۳
مجموع تأثیر بر شاخص کالاهای اساسی									-۱۱.۸
مجموع تأثیر بر شاخص ۲۲۹ شرکت مورد بررسی									-۱۰۷.۲
مجموع تأثیر بر شاخص ۳۲۶ شرکت بورسی									-۷۶۳.۳

بر اساس جدول فوق قیمت نفت در یک ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ با ۹,۶ درصد افزایش به ۶۹,۴ دلار در هر بشکه رسید که با بررسی به عمل آمده نفت به طور مستقیم در فروش و بهای تمام شده ۴۰ شرکت بورسی تأثیر داشته است که سهم این عامل از مجموع فروش و بهای تمام شده این ۴۰ شرکت به ترتیب حدود ۹۳,۶ و ۹۵,۴ درصد می باشد، همانطور که مشاهده می شود با وجود افزایش ۹,۶ درصدی قیمت نفت، شاهد تأثیر منفی ۳۶ واحدی نفت در مجموع این ۴۰ شرکت هستیم. در مورد فولاد با توجه به نسبت های عامل فولاد از مجموع فروش و بهای تمام شده ۳۸ شرکت مربوطه، شاهد آن هستیم که با کاهش ۵,۵ درصدی قیمت جهانی فولاد، مجموع تأثیر بر شاخص این ۳۸ شرکت بورسی ۵۷,۳ واحد منفی 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 ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ و تأثیر هر یک از آنها بر شرکت‌های فرا بورسی متأثر از آن عامل نمایش داده شده است.

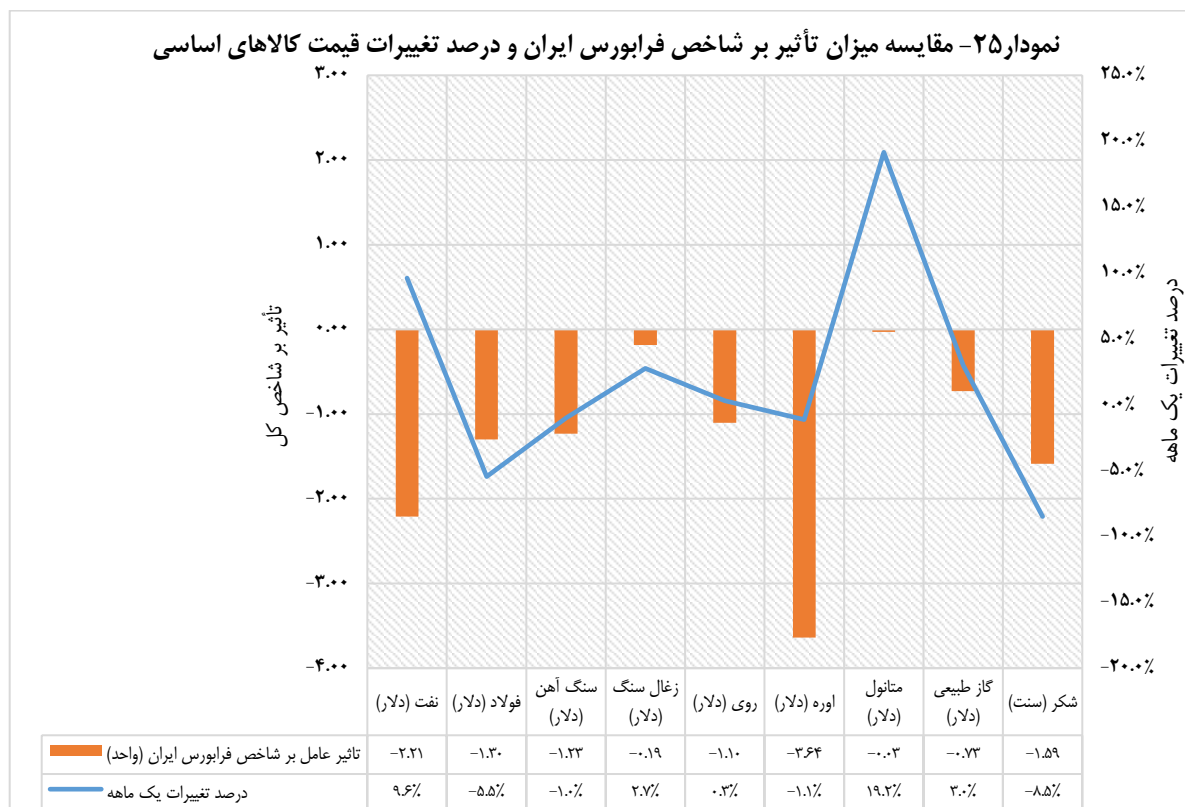
همان‌طور که مشاهده می‌شود، تقریباً در اغلب کالاهای مورد بررسی، مجموع تأثیر بر شاخص آن کالا در شرکت‌های مربوط به آن عامل در جهت تغییرات نرخهای جهانی آن کالا و با توجه به نسبت‌های فروش و بهای تمام‌شده مربوط به هر کالا به کل فروش و بهای تمام‌شده شرکت‌های مربوطه می‌باشد.

به عنوان مثال قیمت نفت در بازه یک ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱، ۹.۶ درصد رشد داشته است که این تغییر در ۶ شرکت فرا بورس ایران که به طور مستقیم نفت در فروش و یا بهای تمام‌شده آنها موثر است، موجب تأثیر منفی مجموعاً ۲,۲ واحدی این شرکت‌ها ناشی از کاهش قیمت نفت شده است.

تأثیر بر شاخص مربوط به کالاهای اساسی در فروردین ماه ۱۳۹۷					تغییرات نرخ های جهانی کالاهای اساسی				
ردیف	عامل بازار	واحد	۹۷/۰۱/۳۱	۹۶/۱۲/۲۹	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 فرابورس ایران (واحد)
۱	نفت (دلار)	بشکه	۶۹.۳۹	۶۳.۳۱	۹.۶%	۶	۷۳.۹%	۶۵.۰%	-۲.۲۱
۲	فولاد (دلار)	تن	۵۲۰	۵۵۰	-۵.۵%	۴	۷۸.۰%	۵۸.۰%	-۱.۳۰
۳	سنگ آهن (دلار)	تن	۶۸.۵	۶۹.۲	-۱.۰%	۳	۰.۰%	۲۶.۶%	-۱.۲۳
۴	زغال سنگ (دلار)	تن	۹۳.۵	۹۱	۲.۷%	۳	۲۰.۰%	۱۱.۸%	-۰.۱۹
۵	روی (دلار)	تن	۳۳۴۰	۳۳۳۰	۰.۳%	۳	۸۸.۲%	۵.۵%	-۱.۱۰
۶	اوره (دلار)	تن	۲۶۰	۲۶۳	-۱.۱%	۱	۷۷.۸%	۰.۰%	-۳.۶۴
۷	متانول (دلار)	تن	۴۲۳	۳۵۵	۱۹.۲%	۱	۹۸.۲%	۰.۰%	-۰.۰۳
۸	گاز طبیعی (دلار)	MMBtu	۲.۷۴	۲.۶۶	۳.۰%	۱	۰.۰%	۲۷.۷%	-۰.۷۳
۹	شکر (سنت)	پوند	۱۱.۶۴	۱۲.۷۲	-۸.۵%	۶	۲۷.۶%	۲۰.۱%	-۱.۵۹
مجموع تأثیر بر شاخص کالاهای اساسی					-۱۲.۰				
مجموع تأثیر بر شاخص ۴۳ شرکت مورد بررسی در فرابورس					-۲۳.۷				
مجموع تأثیر بر شاخص ۹۶ شرکت فرابورسی					-۳۲.۹				

- ✓ با کاهش ۱,۱ درصدی نرخ جهانی اوره و با توجه به نسبت های فروش و بهای تمام شده متانول از کل فروش و بهای تمام شده ا شرکت مربوط به آن، این تغییر منجر به تأثیر منفی ۳,۶ واحدی اوره بر شاخص فرابورس شده است.
- ✓ از طرفی با کاهش ۵,۵ درصدی قیمت جهانی فولاد و رسیدن به قیمت ۵۲۰ دلار در هر تن، شاهد تأثیر آن بر شاخص فرابورس ایران به میزان منفی ۱,۳ واحد در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ هستیم.

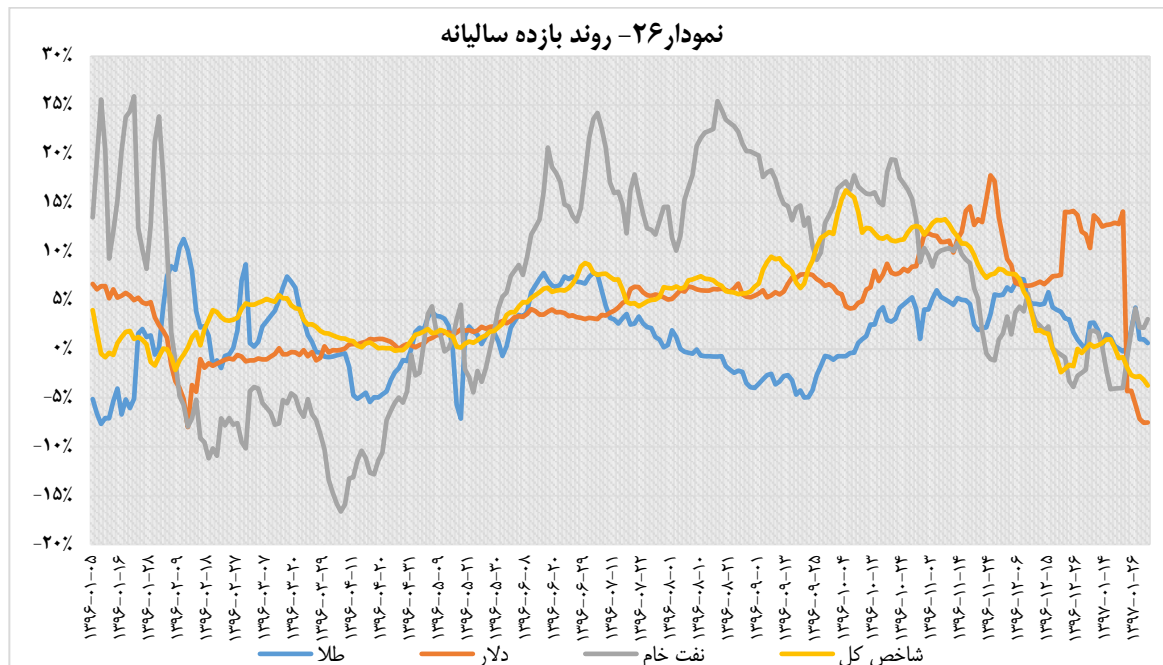
در نمودار (۲۵) میزان تأثیر بر شاخص فرابورس ایران برای هر یک از کالاهای اساسی مورد بررسی به همراه میزان تغییرات نرخ‌های جهانی این کالاها نشان داده شده است.



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 ۱۳۹۶/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ نشان داده شده است. روند بازدهی شاخص کل و نفت قابل توجه است.



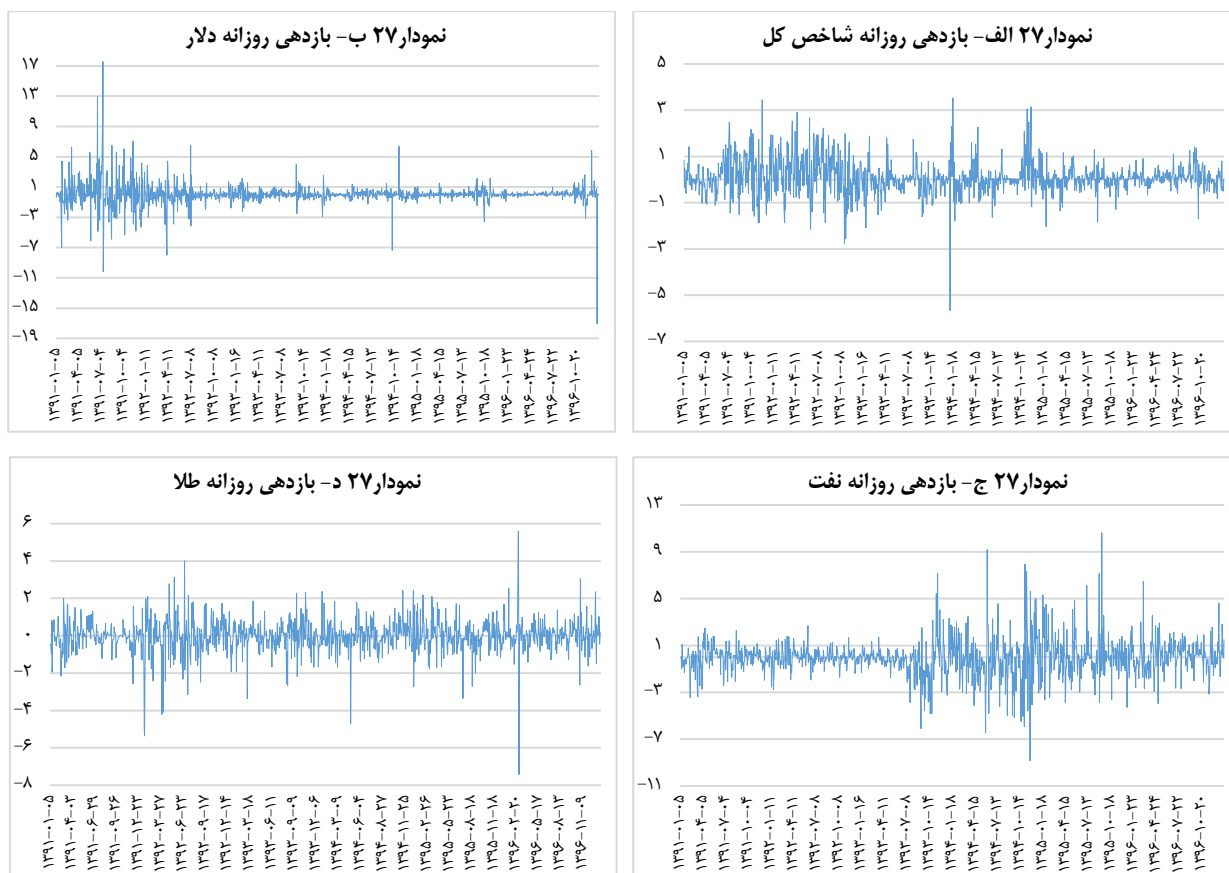
شاخص های مورد بررسی

در جدول زیر خلاصه آمار توصیفی بازدهی روزانه (درصدی) شاخص کل، قیمت دلار، طلا و نفت در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ نمایش داده شده است.

شاخص کل	دلار	طلا	نفت	
۰.۰۹	۰.۰۵	-۰.۰۲	-۰.۰۴	میانگین
۰.۰۳	۰.۰۱	-۰.۰۰۳	-۰.۰۳	میانه
۳.۵۳	۱۷.۵۶	۵.۵۸	۱۰.۶۳	بیشینه
-۵.۶۷	-۱۷.۰۸	-۷.۴۳	-۸.۸۵	کمینه
۰.۷۰	۱.۴۴	۰.۸۱	۱.۴۸	انحراف معیار
۰.۲۵	۰.۶۷	-۰.۹۳	۰.۴۸	چولگی
۸.۶۲	۴۳.۶۷	۱۴.۳۵	۱۰.۴۰	کشیدگی
۱۹۴۶۶	۹۸۱۲۵.۳	۸۰۸۰.۴	۳۳۹۸.۸	آزمون Jurque-Bera
۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	P-Value J-B
۱۴۶۴	۱۴۶۴	۱۴۶۴	۱۴۶۴	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 جارك-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 ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ نشان داده شده است.



همبستگی بین متغیرها

ضریب همبستگی بین بازده روزانه چهار متغیر مورد بررسی در بازه زمانی ۱۳۹۱/۰۱/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ 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	۰.۰۲۷	۰.۰۰۹	۰.۰۲۵	۱
طلا	۰.۰۲۴	۰.۰۲۵	۱	
دلار	-۰.۰۳۲	۱		
شاخص کل	۱			

روابط بلندمدت بین متغیرها و تأثیر آن‌ها بر شاخص کل

بررسی روابط هم‌انباشتگی

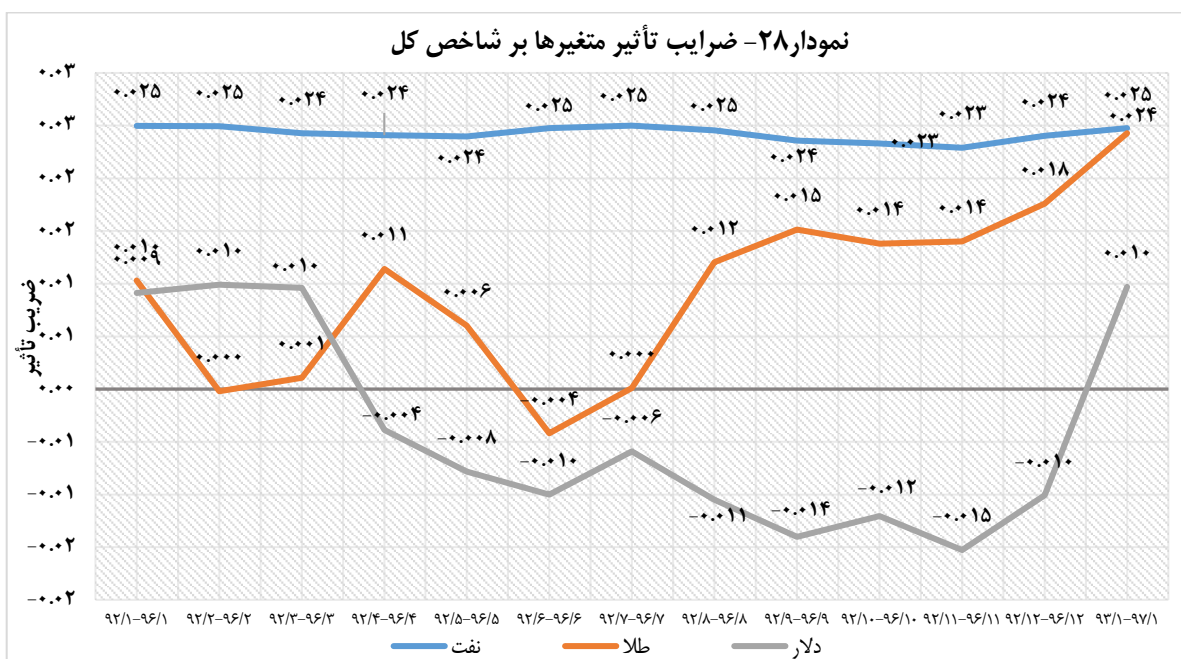
هم‌انباشتگی، عبارت است از مطالعه ثبات روابط بلندمدت بین متغیرهای سری زمانی ناماناً^۶. اندیشه هم‌انباشتگی، در واقع رهیافتی برای حل مشکل رگرسیون‌های کاذب، در سری‌های زمانی است. به منظور بررسی وجود روابط هم‌انباشتگی بین شاخص کل (متغیر وابسته) و قیمت نفت، دلار و طلا (متغیرهای مستقل) از آزمون هم‌انباشتگی 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 ۱۳۹۳/۰۱/۳۱ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ را نشان می‌دهد.

$$TRI = 0.299*TRI(-1) + 0.025*OPEC(-1) + 0.024*GOLD(-1) + 0.010*DOLLAR(-1) + 0.018$$

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 در بازه زمانی یک سال اخیر نشان داده شده است.



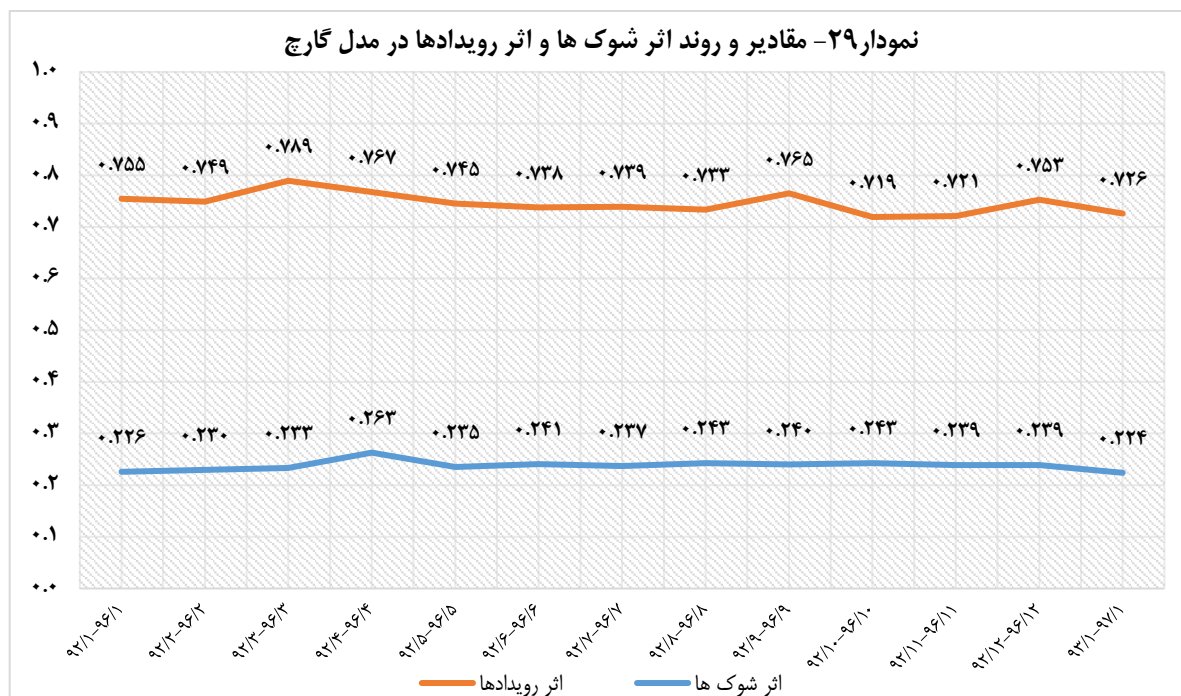
^۶ یک سری زمانی ناماناً است هرگاه دارای روند باشد و یا واریانس آن به صورت خوشه‌ای تغییر کند.

با توجه به روند ضرایب مشاهده می‌شود که در طی دوره یک ساله اخیر، تغییرات نفت اثر بیشتری بر تغییرات شاخص کل نسبت به دلار و طلا داشته است و میزان این تأثیر همواره روند یکنواختی داشته است. از طرفی روند تأثیر قیمت دلار بر تغییرات شاخص قابل توجه بوده و طی سه ماه اخیر با روند صعودی چشمگیری همراه بوده 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 ۱۳۹۳/۰۱/۳۱ تا ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ را نشان می‌دهد.

$$\text{VARIANCE} = 0.014 + 0.224 * \text{RESID}(-1)^2 + 0.726 * \text{VARIANCE}(-1)$$

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 بازه زمانی یک سال اخیر 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 هیئت‌وزیران به عنوان یکی از کمیته‌های تخصصی هیئت‌مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار تشکیل شد، هدف اصلی این کمیته بررسی و کارشناسی دستورالعمل‌ها و تدوین مقررات جهت تصویب در هیئت‌مدیره سازمان است.

همچنین به استناد بند (۱۳) ماده (۷) قانون بازار اوراق بهادار و همچنین تشکیلات مصوب ۱۳۸۵/۰۹/۰۸ هیئت‌مخترم وزیران در خصوص تشکیل کمیته‌های تخصصی هیئت‌مدیره، 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 تصویب‌شده توسط هیئت‌مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار ارائه شده است.



❖ عناوین مورد بررسی در این بخش

- ✓ مصوبات هیئت‌مدیره
- ✓ عناوین مقررات در دست بررسی در کمیته تدوین مقررات
- ✓ عناوین در دست بررسی کمیته فقهی

عناوین مقررات در دست بررسی در کمیته تدوین مقررات	
اساسنامه صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله سهام عدالت	۱

عناوین مقررات در دست بررسی در کمیته فقهی	
بررسی ابعاد فقهی ارزشهای رمزگذاری شده (با تأکید بر بیت کوین)	۱
امکان سنجی استفاده از دو قرارداد اختیار معامله تبعی در ضمن معامله سهام	۲

- ✓ در فروردین ماه ۱۳۹۷، ارزش بازار سهام در بورس تهران و فرابورس ایران به مقدار ۵,۲۹۶,۱۴۵۱ میلیارد ریال رسید که نسبت به ماه قبل ۰,۱۵ درصد افزایش داشته است.
- ✓ حجم معاملات در بازار اول بورس اوراق بهادار تهران در پایان معاملات فروردین ماه ۹۷ با کاهش ۶۰,۴۴ درصدی همراه بوده است. همچنین در پایان این ماه حجم معاملات در بازار دوم بورس اوراق بهادار تهران با ۹۰,۶۸ درصد کاهش نسبت به ماه قبل به ۲,۷۹۵,۳۰۱ هزار سهم رسیده است.
- ✓ شفافصهای کل بورس تهران و فرابورس ایران در پایان فروردین ماه ۹۷ به ترتیب برابر ۹۵,۵۲۴ و ۱۰۶۴ وامد هستند که به ترتیب ۰,۸- و ۳- درصد تغییر را نسبت به ماه قبل نشان می‌دهند.
- ✓ ارزش معاملات اشخاص مقوقی از کل ارزش معاملات انجام شده در فروردین ماه ۹۷، با ۸۴ درصد کاهش نسبت به اسفندماه ۹۶ به ۳۳,۵۵۵ میلیارد ریال رسید. این در حالی است که ارزش معاملات اشخاص مقیق نیز در پایان این ماه ۴۱,۷ درصد کاهش داشته است.
- ✓ در فروردین ماه ۱۳۹۷، ۲ مورد از اوراق بدهی مجموعاً به ارزش ۴۰۰۰ میلیارد ریال سررسید شد. مانده اوراق بدهی منتشره در پایان فروردین ماه ۹۷ به ۷۱۳,۶۱۵ میلیارد ریال رسید که در مقایسه با پایان اسفندماه ۹۶، ۰,۵۵ درصد کاهش داشته است.
- ✓ قیمت نفت خام پس از افزایش ۰,۶۷ درصدی قیمت در پایان اسفندماه ۹۶ و رسیدن به قیمت ۶۳,۳۱ دلار در هر بشکه، در پایان فروردین ماه ۹۷ با رشد ۹,۶ درصدی، به قیمت ۶۹,۳۹ دلار در هر بشکه رسید. این در حالی است که قیمت نفت خام نسبت به ابتدای سال ۱۳۹۶ رشد ۴۰,۶ درصدی را نشان می‌دهد.



نسخه الکترونیکی گزارش را می‌توانید با اسکن کد QR فوق دریافت نمایید.