



نگاهی بر وضعیت بازار سرمایه در آبان ماه ۱۳۹۶

معاونت بررسی های اقتصادی
اتاق بازرگانی، صنایع، معادن و کشاورزی تهران

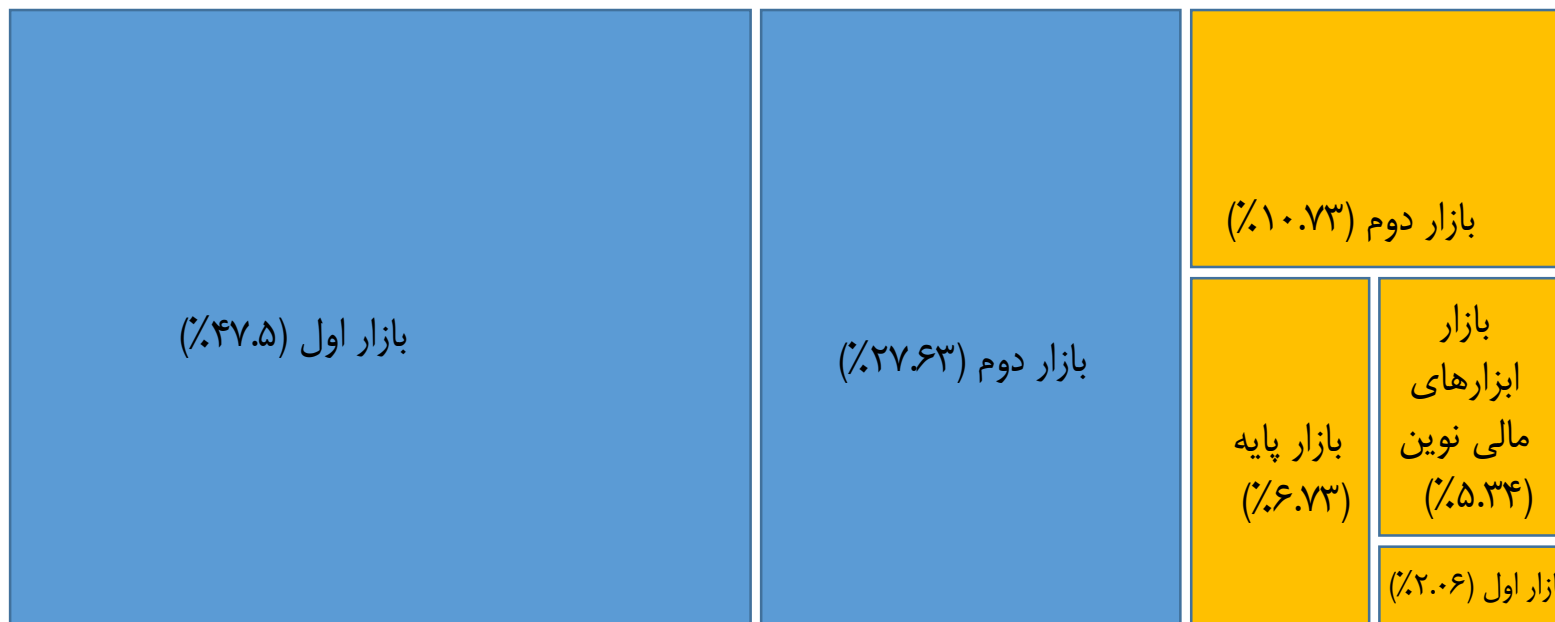




تصویری از بازارهای بورس و فرابورس

سهام ارزش بازارهای مختلف بورس و فرابورس در آبان ماه ۱۳۹۶

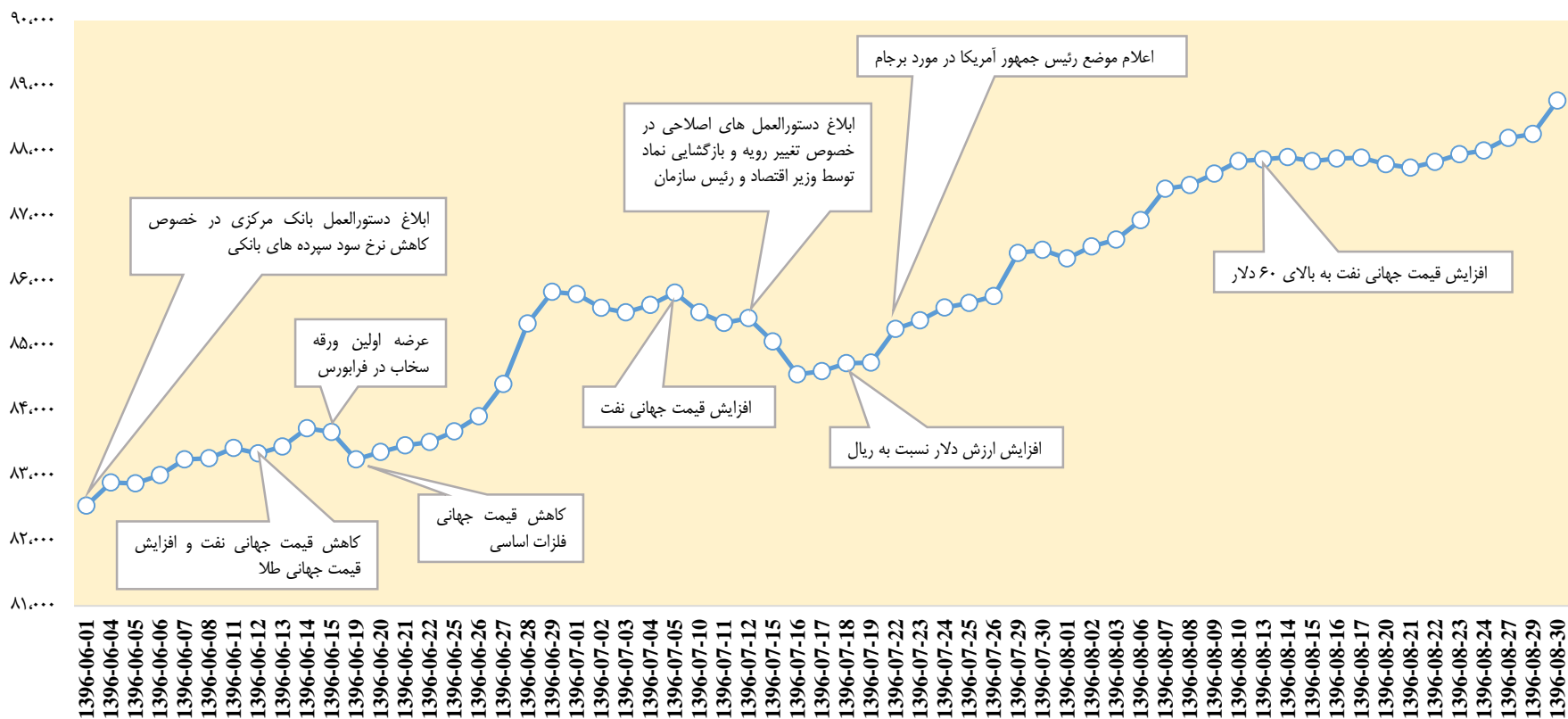
■ بورس اوراق بهادار تهران ■ فرابورس ایران





اینفوگرافیک شاخص بورس

رشد شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران از ابتدای شهریور تا انتهای آبان ۱۳۹۶





ارزش بازارهای بورس و فرابورس به تفکیک نوع بازار

ارزش بازار بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران به تفکیک انواع بازارها در انتهای آبان ۱۳۹۶

نوع بازار	ارزش بازار (هزار میلیارد تومان)	درصد تغییرات
بورس تهران	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	نسبت به پایان سال ۱۳۹۵
بازار اول	۲۲۴	۷.۹۱%
بازار دوم	۱۳۰	۱۳.۷۹%
مجموع	۳۵۴	۱۰%
فرابورس ایران	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	نسبت به پایان سال ۱۳۹۵
بازار ابزارهای نوین مالی	۲۵	۱۳.۴۴%
بازار اول	۱۰	-۰.۵۲%
بازار دوم	۵۱	۱۲.۵۹%
بازار پایه	۳۲	۱۵.۴۷%
مجموع	۱۱۷	۱۲.۳۰%
مجموع کل	۴۷۱	۱۰.۵۶%

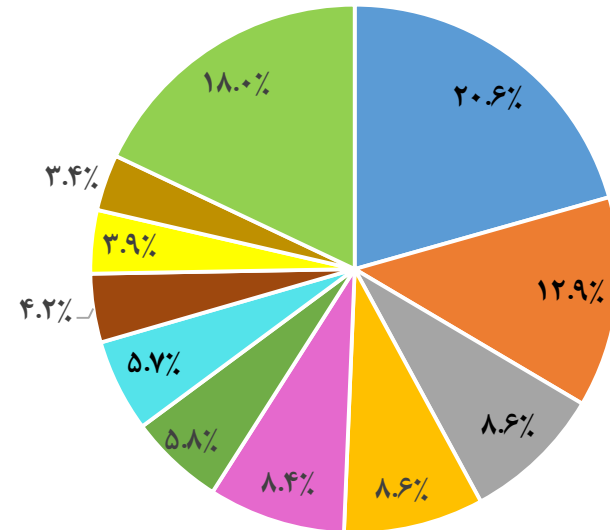
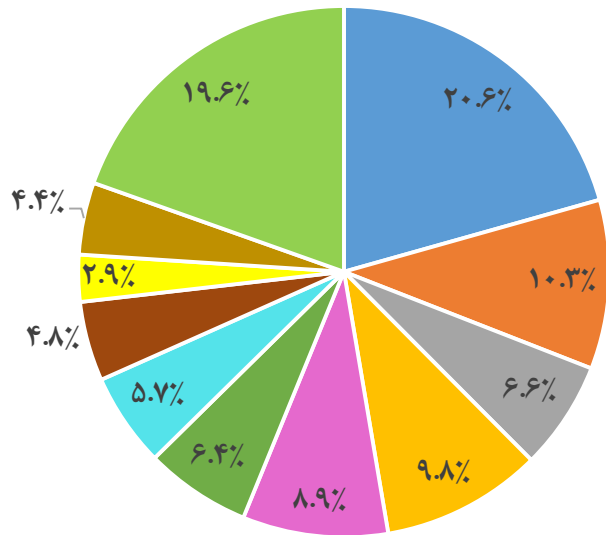


ارزش بازار بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک صنایع

سهم صنایع از ارزش بازار بورس اوراق بهادار تهران

پایان سال ۱۳۹۵

پایان آبان ۱۳۹۶



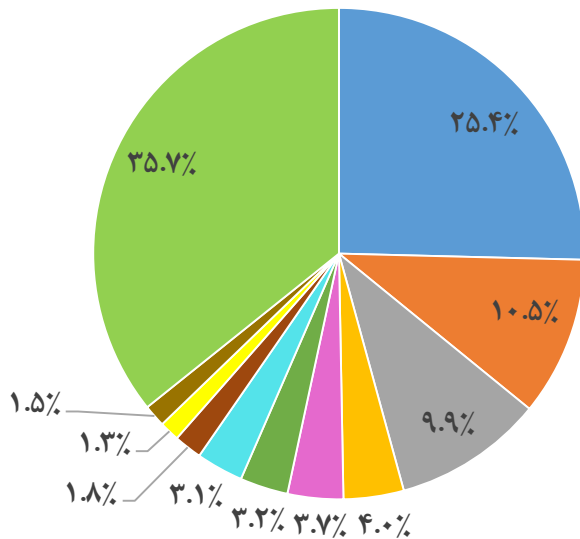
- محصولات شیمیایی
- فلزات اساسی
- بانکها و موسسات اعتباری
- شرکتهای چند رشته ای صنعتی
- مخابرات
- استخراج کانه های فلزی
- رایانه و فعالیت های وابسته به آن
- سایر
- فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای
- خودرو و ساخت قطعات
- مواد و محصولات دارویی

- محصولات شیمیایی
- فلزات اساسی
- بانکها و موسسات اعتباری
- شرکتهای چند رشته ای صنعتی
- مخابرات
- استخراج کانه های فلزی
- رایانه و فعالیت های وابسته به آن
- سایر
- فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای
- خودرو و ساخت قطعات
- مواد و محصولات دارویی

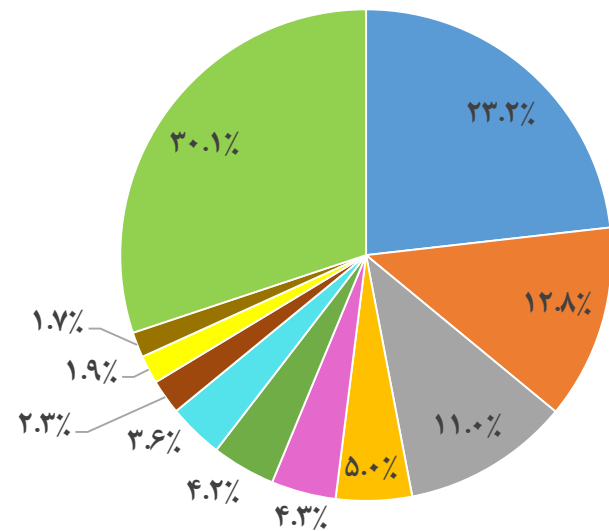
ارزش بازار فرابورس ایران به تفکیک صنایع

سهم صنایع از ارزش بازار فرابورس ایران

پایان سال ۱۳۹۵



پایان آبان ۱۳۹۶



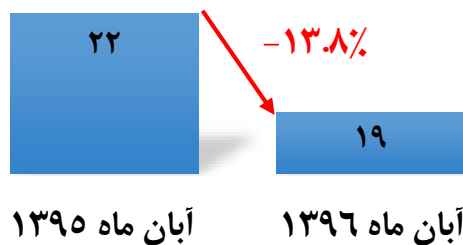
- | | | | |
|--|--|--|--|
| ■ محصولات شیمیایی | ■ فلزات اساسی | ■ محصولات شیمیایی | ■ فلزات اساسی |
| ■ بانکها و موسسات اعتباری | ■ فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای | ■ بانکها و موسسات اعتباری | ■ فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای |
| ■ عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم | ■ سرمایه گذاریها | ■ عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم | ■ سرمایه گذاریها |
| ■ بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی | ■ انبوه سازی، املاک و مستغلات | ■ بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی | ■ انبوه سازی، املاک و مستغلات |
| ■ مواد و محصولات دارویی | ■ محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر | ■ مواد و محصولات دارویی | ■ محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر |
| ■ سایر | | ■ سایر | |



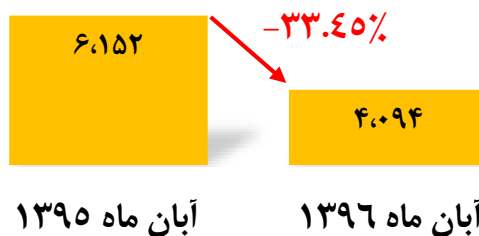
حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس تهران

مجموع حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران در آبان ماه ۱۳۹۶

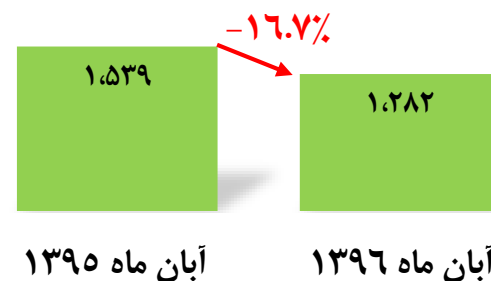
حجم معامله - میلیارد سهم



ارزش معامله - میلیارد تومان

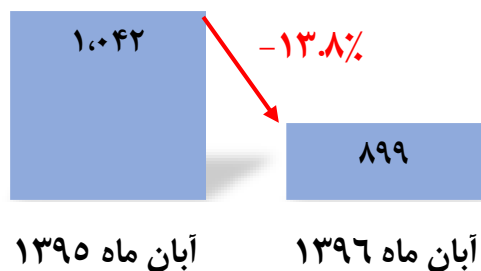


تعداد معامله - هزار عدد

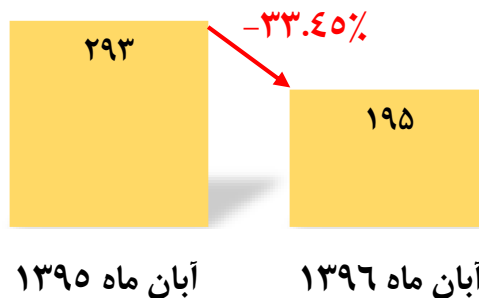


میانگین روزانه حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران در آبان ماه ۱۳۹۶

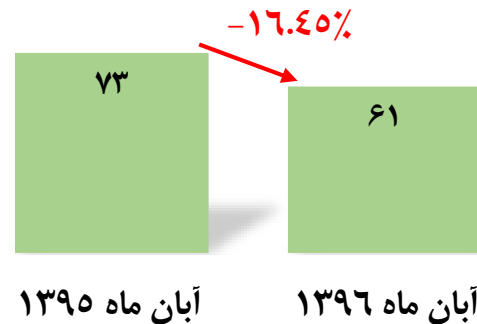
حجم معامله - میلیون سهم



ارزش معامله - میلیارد تومان



تعداد معامله - هزار عدد





حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس تهران

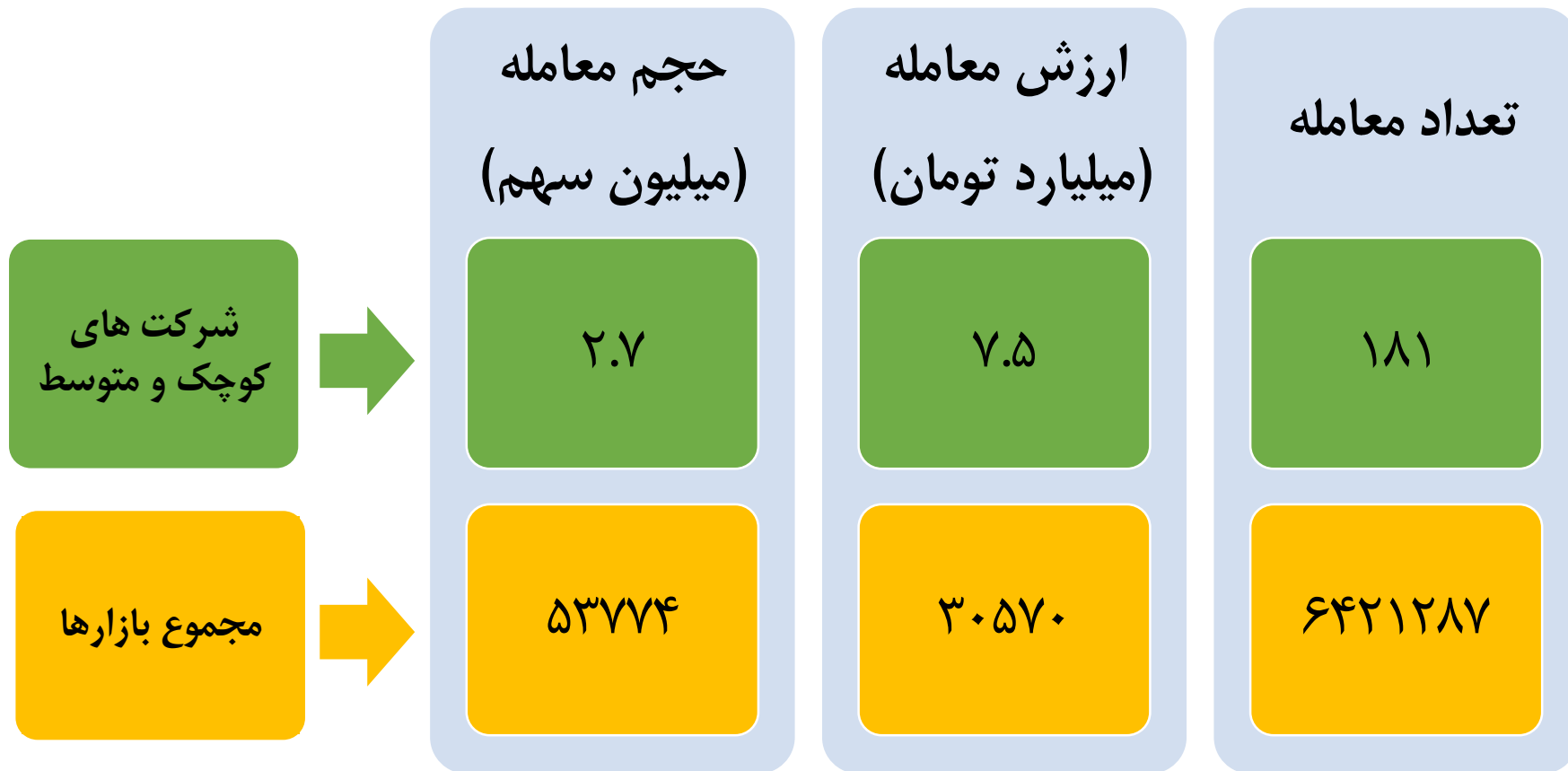
حجم، ارزش و تعداد معاملات در بورس اوراق بهادار تهران به تفکیک نوع بازار در آبان ماه ۱۳۹۶

درصد تغییرات	تاریخ	نوع بازار	
نسبت به ماه مشابه سال قبل	آبان ماه ۱۳۹۶		
-۵۵.۲۶٪	۵.۵	بازار اوراق بدهی	حجم معامله - میلیون سهم
۳۳۸۱۰.۷۹.۹۰٪	۲۴۰۲.۱	بازار اوراق مشتقه	
-۳۴.۸۸٪	۹۴۱۹.۷	بازار اول	
-۷.۳۵٪	۶۸۴۰.۵	بازار دوم	
۵۷۱.۳۳٪	۲۰۲.۱	بازار ETF	
-۵۵.۴۰٪	۵۵۹.۶	بازار اوراق بدهی	ارزش معامله - میلیارد تومان
۴۸۲۹۱.۰۹٪	۵.۶	بازار اوراق مشتقه	
-۳۰.۸۰٪	۱۹۶۵.۰	بازار اول	
-۲۹.۵۹٪	۱۴۲۶.۶	بازار دوم	
۳۳۴.۰۶٪	۱۳۷.۴	بازار ETF	
-۲۷.۲۷٪	۱,۶۸۸	بازار اوراق بدهی	تعداد معامله
۸۷۸.۹۵٪	۱۸۶	بازار اوراق مشتقه	
-۳۳.۳۹٪	۴۹۲,۲۱۰	بازار اول	
-۲۰.۰۳٪	۷۷۹,۷۶۰	بازار دوم	
۴۰۱.۳۶٪	۷,۷۶۶	بازار ETF	



حجم، ارزش و تعداد معاملات در فرابورس ایران

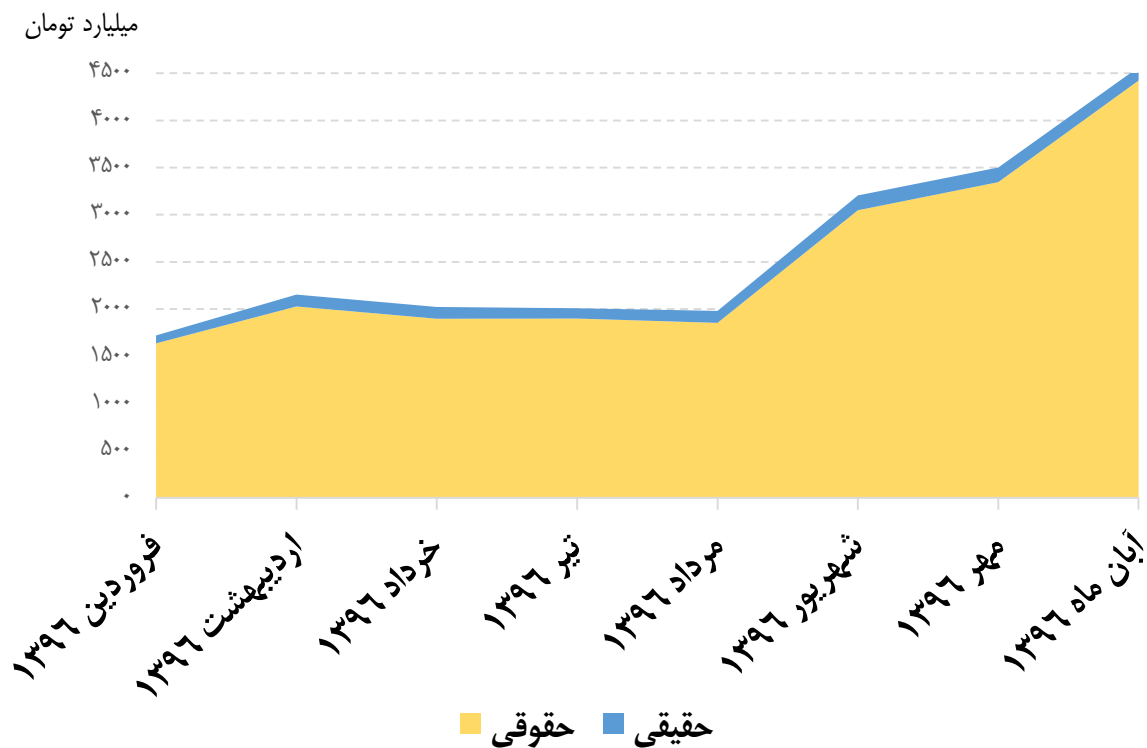
حجم، ارزش و تعداد معاملات در فرابورس ایران به تفکیک نوع بازار در هشت ماهه ۱۳۹۶





معاملات اوراق بدهی در بورس و فرابورس

مقایسه ارزش معاملات اشخاص حقیقی و حقوقی در اوراق بدهی
از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان آبان ماه ۱۳۹۶

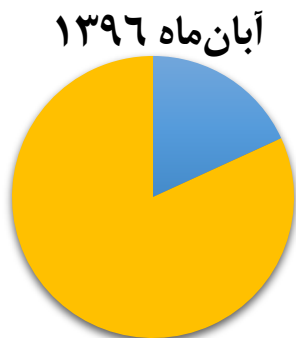




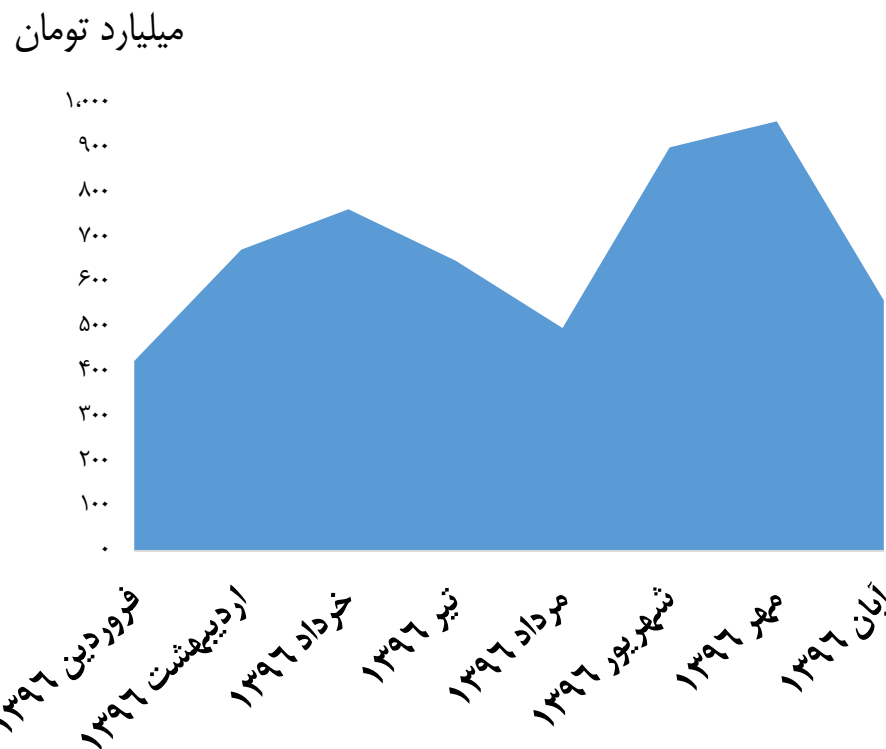
معاملات اوراق بدهی در بورس تهران

سهام اوراق صکوک و مشارکت از اوراق بدهی

ارزش معاملات اوراق بدهی در بورس اوراق بهادار تهران



■ اوراق صکوک ■ اوراق مشارکت

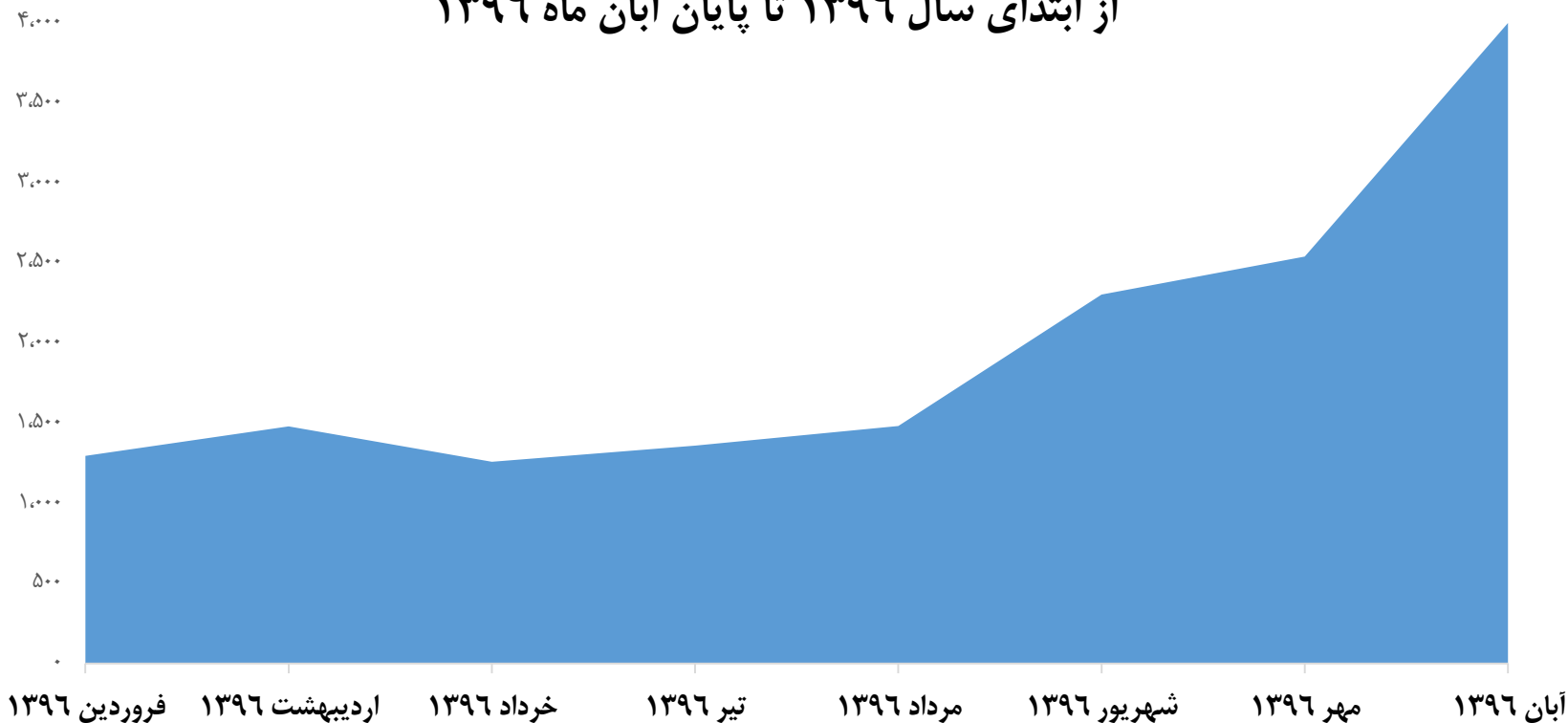




معاملات اوراق بدهی در فرابورس ایران

ارزش معاملات اوراق بدهی در فرابورس
از ابتدای سال ۱۳۹۶ تا پایان آبان ماه ۱۳۹۶

میلیارد تومان





آمار تامین مالی

ارزش تامین مالی صورت گرفته در بازارهای اولیه، ثانویه و همچنین نهادهای مالی (میلیارد تومان)

عملکرد ۱۳۹۵	عملکرد از ابتدای سال تا ۳۰ آبان ۱۳۹۶	عنوان	نوع بازار
۵۵۰	۸۵	تأسیس شرکتهای سهامی عام	بازار اولیه و ثانویه
۱۷،۵۵۲	۱۰،۹۴۶	افزایش سرمایه شرکتهای سهامی عام - سایر روش ها به جز تجدید ارزیابی - (مجوزهای ارائه شده)	
۵،۰۶۵	۰	افزایش سرمایه شرکتهای سهامی عام - از محل مازاد تجدید ارزیابی - (مجوزهای ارائه شده)	
۲۹،۲۳۸	۱۹،۰۴۴	انتشار انواع ابزارهای تأمین مالی	
۳۵۹	۳۲۹	عرضه اولیه سهام شرکتهای در بورس و فرابورس	
۵۲،۷۶۵	۳۰،۴۰۳	جمع تأمین مالی بازار اولیه و ثانویه	
۶۸،۲۷۱	۲۷،۱۸۶	افزایش ارزش صندوقها نسبت به ابتدای سال	نهادهای مالی
۱،۰۱۰	۷۴۰	سایر نهادهای مالی *	
۶۹،۲۸۱	۲۷،۹۲۶	جمع تأمین مالی نهادهای مالی	
۱۲۲،۰۴۵	۵۸،۳۲۹	جمع کل	

*تأمین مالی سایر نهادهای مالی شامل تاسیس و افزایش سرمایه سایر نهادهای مالی شامل شرکتهای سبذگردان، مشاور سرمایه گذاری، تأمین سرمایه و پردازش اطلاعات مالی می باشد.



مانده اوراق بدهی منتشره

مانده اوراق بدهی منتشره در انتهای آبان ماه ۱۳۹۶ و در انتهای سال ۱۳۹۵ (میلیارد تومان)

نوع اوراق	پایان آبان ماه ۱۳۹۶	درصد از کل	پایان سال ۱۳۹۵	درصد از کل
مشارکت	۵,۰۰۰	۱۴.۱۹%	۵,۰۰۰	۱۵.۰۴%
اجاره	۴,۹۰۰	۱۳.۹۱%	۴,۹۰۰	۱۴.۷۴%
سلف	۰	۰.۰۰%	-	۰.۰۰%
مراجعه	۴,۰۰۰	۵.۶۸%	۲,۰۰۰	۶.۰۱%
اسناد خزانه اسلامی	۱۱,۵۹۳	۳۴.۹۷%	۷,۵۰۰	۲۲.۵۵%
معاملات ثانویه اوراق مشارکت شهرداری ها و دولت	۴,۹۵۰	۱۴.۰۵%	۴,۸۰۰	۱۴.۴۳%
جمع اوراق بهادار دولتی و شهرداری ها	۳۰,۴۴۳	۸۲.۷۹%	۲۴,۲۰۰	۷۲.۷۷%
انتشار و معامله ثانویه اوراق بهادار شرکتی	۵,۱۴۳	۱۷.۲۱%	۹,۰۵۳	۲۷.۲۳%
جمع کل بازار اوراق بدهی	۳۵,۵۸۵	۱۰۰%	۳۳,۲۵۳	۱۰۰%



ملاحظات

- ❖ طی هفت ماهه نخست سال ۱۳۹۶، سهم بازار سرمایه از تامین مالی کشور (۳۶۰.۵ هزار میلیارد تومان غیر از تامین مالی خارجی) معادل ۱۳ درصد بوده است.
- ❖ طی هشت ماهه ۱۳۹۶ در مجموع ۵۸.۳ هزار میلیارد تومان تامین مالی از طریق بازار سرمایه صورت گرفته که در مقایسه با رقم ۸۶.۱ هزار میلیارد تومان مدت مشابه ۱۳۹۵، از ۳۲ درصد کاهش برخوردار بوده است.
- ❖ به طور کلی از اواسط مهر ماه سال جاری تا پایان آبان، شاخص کل بورس کشور در مسیر افزایشی قرار گرفته است که این امر را می توان ناشی از عواملی از جمله استمرار پای بندی بانکها به اعمال نرخ های سود بانکی، رشد نرخ ارز و تاثیر مثبت آن بر بنگاه های صادراتی، رشد قیمت مواد معدنی و پایه در بازارهای جهانی و صادراتی، اعلام موضع رئیس جمهور آمریکا در مورد برجام، افزایش قیمت جهانی نفت بالای ۶۰ دلار دانست.
- ❖ در هشت ماهه منتهی به آبان سال ۱۳۹۶، سهم برخی صنایع از جمله فلزات اساسی از ارزش بازار بورس نسبت به مدت مشابه سال ۱۳۹۵ افزایش یافته است. سهم فلزات اساسی از ۱۰.۳ درصد به ۱۲.۹ درصد در هشت ماهه امسال رسیده که به نظر می رسد این افزایش متاثر از افزایش قیمت جهانی فلزات (بخصوص فولاد) باشد.



منبع

• سازمان بورس و اوراق بهادار

تهیه شده توسط فروغ کریمی امیرکیاسر
آذرماه ۱۳۹۶