

سالنامه

آماري بازار هاي مالي

rahavard365.com | ۱۳۹۹



بررسی

بازار سرمایه ایران



سالنامه آماری بازار سرمایه ایران

۱۳۹۹

صاحب امتیاز: شرکت پردازش اطلاعات مالی مبنا

گردآورندگان

سرپرست گروه تحقیق و توسعه

فریده تیموری

گروه محتوا

فریمه عزیز محمدی

مهبد توکلی

مهسا مقدم

طراح گرافیک

پویا مظاهری

سالنامه آماری بازار سرمایه ایران سال ۱۳۹۹ محصولی از گروه تحقیق و توسعه شرکت (پردازش اطلاعات مالی مبنا) است. این سالنامه با هدف افزایش آگاهی و اطلاعات کاربران از وضعیت بازارهای مالی جهانی و داخلی منتشر می‌شود. شرکت پردازش اطلاعات مالی مبنا بیش از دو دهه است که در زمینه تولید محصولات مرتبط با بازار سرمایه ایران فعالیت می‌کند. در این سال‌ها همواره یکی از اصلی‌ترین اهداف مبنا تولید و انتشار اطلاعات و تحلیل‌های دقیق و موثق از بازار سرمایه بوده است. ایده اولیه تأسیس مبنا از شناسایی یک نقطه ضعف بزرگ در بازار سرمایه به وجود آمد. این نقطه ضعف فقدان ابزارهایی برای تجزیه و تحلیل اطلاعات مالی بود. ابزارهایی که به فعالین بازار برای تصمیم‌گیری‌های سریع‌تر و بهینه‌تر کمک کند. مبنا کار خود را با تولید و عرضه نرم‌افزار ره‌آورد تحت سیستم عامل داس شروع کرد. نرم‌افزار ره‌آورد به مرور و با گسترش نیاز مخاطبان، تخصصی‌تر و گسترده‌تر شد و امروز تحت عنوان ره‌آورد ۳۶۵ یکی از مهمترین مراجع اطلاعات بنیادی و تحلیل تکنیکال بازار سرمایه است. همچنین مبنا در این سال‌ها محصولات دیگری را برای شرکتهای کارگزاری، سبدگردانی، صندوق‌های سرمایه‌گذاری و دیگر نهادهای فعال در بازار سرمایه تولید نموده است. مبنا در حال حاضر با ۹ محصول مختلف به بیش از ۱ میلیون کاربر حقیقی و حقوقی در حال ارائه خدمات می‌باشد.

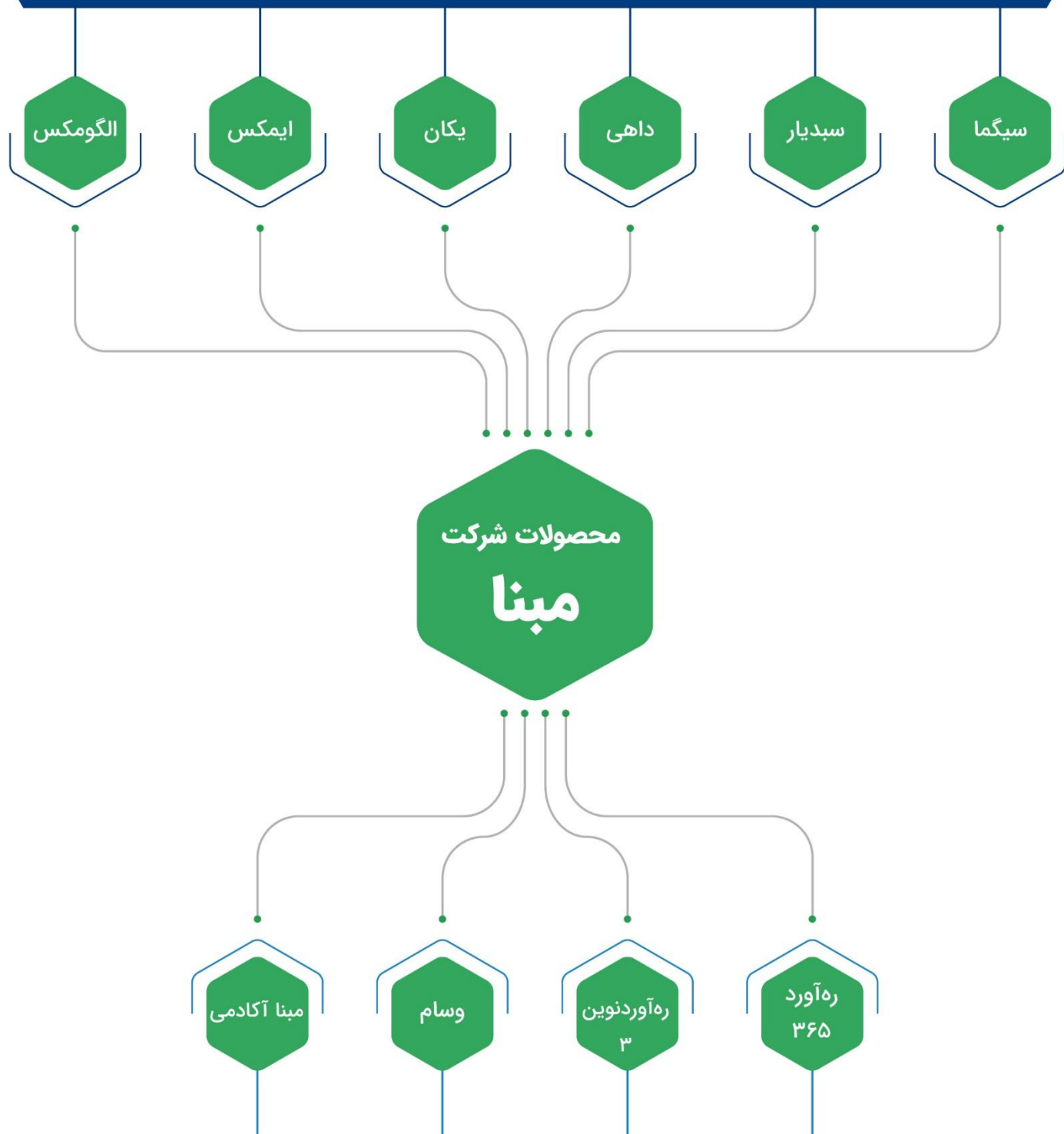
فهرست مطالب

۱.....	بازارهای مالی در یک نگاه - سال ۹۹.....
۲.....	مقایسه بازدهی بازار سرمایه ایران با بازارهای موازی.....
۲.....	روند ماهانه شاخص بورس.....
۲.....	روند ماهانه سکه طلا.....
۳.....	روند ماهانه دلار آمریکا.....
۳.....	روند ماهانه رمز ارز.....
۴.....	روند ماهانه قیمت مسکن.....
۴.....	روند ماهانه معاملات مسکن.....
۵.....	بازار سرمایه ایران.....
۵.....	بازار سرمایه در یک نگاه.....
۶.....	وقایع مهم سال ۹۹ و اثرات آن بر بازار بورس تهران.....
۷.....	شاخص های بازار بورس تهران.....
۹.....	ارزش بازار سهام ایران در سال ۹۹.....
۹.....	ارزش دلاری بازار سهام.....
۱۰.....	ورود و خروج حقیقی ها به بازار.....
۱۰.....	جدول بیشترین ورود و خروج حقیقی ها به شرکت های بازار در سال ۹۹.....
۱۱.....	ارزش معاملات بازار سهام.....
۱۱.....	ارزش دلاری معاملات بازار سهام (گردش مالی).....
۱۲.....	عرضه اولیه های بازار سرمایه در سال ۹۹.....
۱۳.....	صنایع در عرضه اولیه ها.....
۱۳.....	عرضه اولیه ها بر اساس میزان تخصیص.....
۱۴.....	افزایش سرمایه شرکت ها در سال ۹۹.....
۱۵.....	سودآوری شرکت های بازار سرمایه در سال ۹۹.....
۱۷.....	وضعیت پرداخت سود در سال ۹۹.....
۲۰.....	بازدهی شرکت ها و صنایع.....
۲۱.....	بازدهی صندوق ها و اوراق با درآمد ثابت.....
۲۱.....	آمار بسته شدن نمادهای معاملاتی در بازار سهام.....



شرکت
پردازش اطلاعات مالی
مینا

ویژه حقوقی ها



تمام کاربران (حقیقی ها و حقوقی ها)

ویژه حقوقی ها

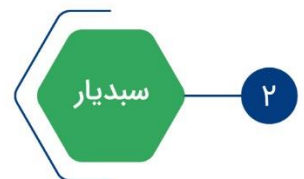
■ نرم‌افزار مدیریت دارایی داخل و خارج از بورس

همه امکانات لازم برای مدیریت دارایی شرکت‌های حقوقی در نرم‌افزار سیگما. سیگما از انواع مختلف دارایی پشتیبانی می‌کند و امکان محاسبه بازدهی و ریسک سبد را در اختیارتان قرار می‌دهد.



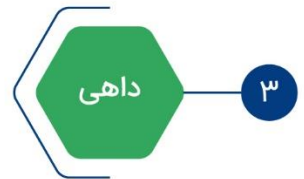
■ نرم‌افزار مدیریت سبذگردانی

سبذیار نرم‌افزار دقیق و پیشرفته مدیریت سبذگردانی مطابق با استانداردها و قوانین سازمان بورس و اوراق بهادار و سازگار با رویه‌های بازارهای مالی ایران. در حال حاضر سبذده شرکت معتبر، شامل شرکت‌های مشاوره سرمایه‌گذاری، سبذگردان، کارگزاری و تأمین سرمایه از این محصول استفاده می‌کنند.



■ نرم‌افزار معاملات الگوریتمی

داهی یک نرم‌افزار الگوریتم‌تریدینگ است که برای کمک به شرکت‌های حقوقی، به خصوص بازارگردان‌ها و سبذگردان‌ها، طراحی شده است. با داهی سرعت انجام تعهدات خود را به چند برابر افزایش دهید و با الگوریتم‌های هوشمند، کیفیت خدمات سبذگردانی و بازارگردانی خود را به شکل قابل ملاحظه‌ای ارتقاء بخشید.



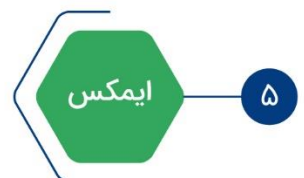
■ نرم‌افزار مدیریت صندوق‌های سرمایه‌گذاری

یکان برای شرکت‌هایی طراحی شده است که مدیریت صندوق‌های سرمایه‌گذاری را برعهده دارند. این نرم‌افزار با امکانات و تارنمای مدرن خود از همه انواع صندوق‌های سرمایه‌گذاری پشتیبانی می‌کند. در حال حاضر هفت صندوق سرمایه‌گذاری معتبر از آن استفاده می‌کنند.



■ سامانه معاملات برخط (OMS)

ایمکس سامانه‌ای معاملاتی برخط بورس است که از سال ۱۳۹۶ توسط شرکت مینا ارائه شده است. ایمکس هم از طریق وب و هم از طریق نرم‌افزار تحت ویندوز قابل دسترسی است. در حال حاضر کارگزاری‌های بهگزین و توسعه معاملات کیان جزو مشتریان این سرویس شرکت مینا هستند.



■ نرم‌افزار اجرای خودکار و بهینه عملیات بازارگردانی

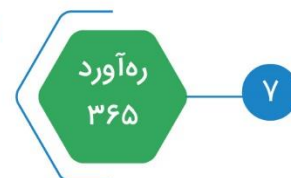
الگومکس یک ابزار نوین معاملاتی است با هدف اجرای خودکار و بهینه عملیات بازارگردانی. الگومکس کمکتان می‌کند تا به راحتی و همزمان، بازارگردانی چندین نماد را با بالاترین بازده و کمترین ریسک انجام دهید.



تمام کاربران (حقیقی ها و حقوقی ها)

■ بانک اطلاعات بازار سرمایه ایران، ابزار تحلیل تکنیکال و بنیادی

ره‌آورد ۳۶۵ مرجع کامل اطلاعات بازار سرمایه ایران است. اطلاع‌رسانی کامل، شبکه اجتماعی سهام و امکانات پیشرفته تحلیل تکنیکال و بنیادی تنها بخشی از امکانات ره‌آورد است.



■ نرم‌افزار تحلیل تکنیکی، بنیادی و مدیریت سبد دارایی

نرم‌افزار تحلیل تکنیکی، بنیادی و مدیریت سبد دارایی ره‌آورد نوین ۳ کامل‌ترین و باسابقه‌ترین نرم‌افزار تحلیل تکنیکی، بنیادی و مدیریت سبد دارایی با سابقه بیش از بیست سال است.



■ ۲۵ سال اطلاعات کامل بازار سرمایه ایران

وسام شامل ۲۵ سال اطلاعات مالی، معاملاتی و پردازش‌شده بازار سرمایه ایران است. شما می‌توانید از اطلاعات موجود در وسام در نرم‌افزارها و سایت‌های خود استفاده کنید.



■ آموزش بورس، نرم‌افزارهای مالی و روش‌های سرمایه‌گذاری

آموزش بورس، نرم‌افزارهای مالی و روش‌های سرمایه‌گذاری، برگزاری کلاس‌های آنلاین، کارگاه‌های آموزشی حضوری، همایش‌ها و وبینارها در جهت مهارت‌سازی برای افراد علاقمند به آموختن اصول سرمایه‌گذاری.





بررسی
بازار سرمایه ایران
۱۳۹۹

بازارهای مالی در یک نگاه - سال ۹۹

از مجموعه بازارهای مالی فعال در ایران که بطور معمول فرصت‌های سرمایه‌گذاری تلقی می‌شوند، می‌توان به بازار سرمایه شامل بازار سهام و اوراق با درآمد ثابت، انواع سپرده بانکی، بازار ارز به ویژه دلار آمریکا و بازار طلا اشاره کرد. اما بازار مسکن و مستغلات نیز همواره به عنوان یک فرصت سرمایه‌گذاری در کنار سایر بازارهای مالی مطرح بوده است. همچنین در سال‌های اخیر بازار رمزارزها که یک بازار نسبتاً نوظهور است در ایران نیز مورد توجه سرمایه‌گذاران قرار گرفته است. در ادامه جدولی از عملکرد یکساله ۷ فرصت پرمخاطب سرمایه‌گذاری در ایران، ارائه شده است.

برای نماینده‌های معرفی شده در هر بازار، قیمت‌های آغاز و پایان آن‌ها را در سال ۹۹، بیشترین و کمترین قیمتی که در این سال تجربه کرده‌اند و همچنین بازدهی شاخص‌هایشان را نیز ذکر کرده‌ایم.

با وجود اتفاقات گسترده‌ای که در سال ۹۹ در فضای داخلی و جهانی رقم خورد اما بازارهای مالی و فرصت‌های سرمایه‌گذاری بسیار فعالانه عمل کردند و بازدهی‌های بسیار متفاوتی نسبت به سال قبل ساختند.

ردیف	فرصت های سرمایه گذاری	قیمت در ابتدای سال ۹۹	قیمت انتهای سال ۹۹ (۱۵ اسفند)	بیشترین قیمت در سال ۹۹	کمترین قیمت در سال ۹۹	بازدهی سال ۹۹
۱	ارز (دلار آمریکا / تومان)	۱۴,۸۹۶	۲۴,۶۶۸	۳۱,۸۵۶	۱۴,۸۹۶	%۶۶
۲	سکه (سکه امامی / تومان)	۶,۰۲۰,۰۰۰	۱۰,۶۰۱,۹۰۰	۱۵,۵۰۰,۰۰۰	۵,۹۰۰,۰۰۰	%۷۶
۳	طلا (گرمی ۱۸ عیار / تومان)	۶۱۷,۸۰۰	۱,۰۶۲,۴۰۰	۱,۴۹۴,۴۰۰	۵۹۸,۹۰۰	%۷۲
۴	رمز ارز (بیت کوین / دلار)	۶,۲۱۹	۵۰,۹۵۱	۵۸,۱۲۱	۵,۹۳۵	%۷۱۹
۵	بازار سهام (شاخص بورس)	۵۰۸,۶۶۲	۱,۱۷۷,۹۱۶	۲,۱۰۳,۳۱۰	۵۰۸,۶۶۲	%۱۳۲
۶	سپرده بانکی (یکساله)	۱۸%	۱۸%	۱۸%	۱۸%	%۱۸
۷	مسکن (متر مربع / تومان)	۱۵,۶۵۸,۸۰۰	۲۸,۳۸۹,۱۰۰	۲۸,۳۸۹,۱۰۰	۱۵,۲۹۵,۹۰۰	%۸۱

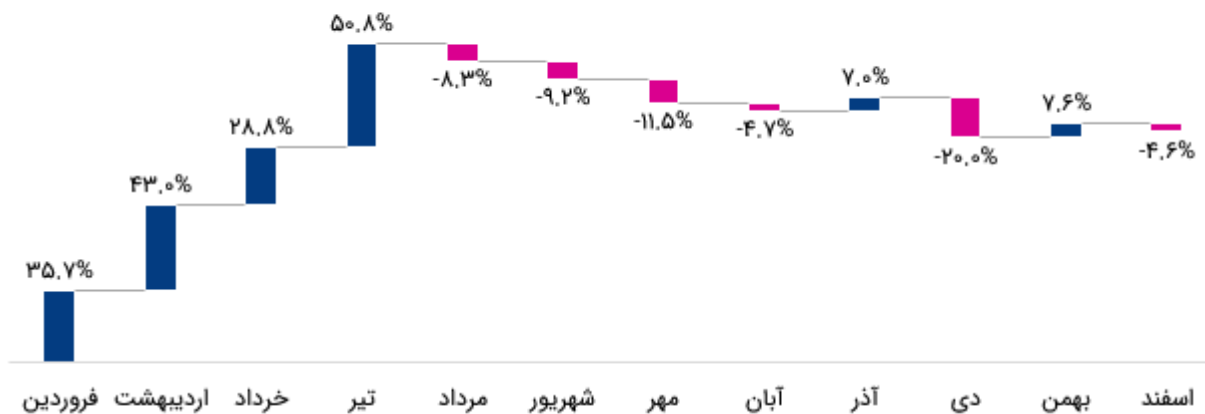
^۱ تمام اطلاعات سال ۹۹ منتهی به ۱۵ اسفند می‌باشد.

مقایسه بازدهی بازار سرمایه ایران با بازارهای موازی

روند ماهانه شاخص بورس

نمودار زیر، بازدهی ماهانه شاخص بورس در سال ۹۹ را نشان می‌دهد. در این بین تیر ماه با حدود ۵۰ درصد رشد بیشترین بازدهی ماه در سال ۹۹ را به ثبت رسانده است. همچنین شاخص از مرداد ماه وارد کانال نزولی شده و جز در آذر و بهمن ماه که رشد اندکی را تجربه کرده، سایر ماه‌ها همواره بازدهی منفی داشته است.

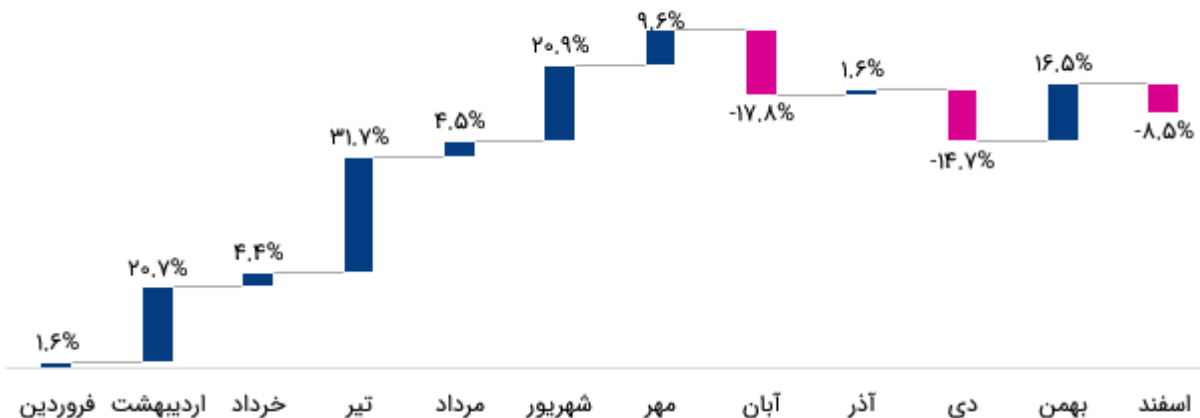
روند بازدهی ماهانه بورس سال ۹۹



روند ماهانه سکه طلا

نمودار بازدهی ماهانه سکه امامی به نمایندگی از بازار سکه ی طلا نیز در نیمه اول سال رشد مثبت و نسبتاً شارپی را تجربه کرده است. سکه امامی در تیر ماه سال ۹۹ با حدود ۳۲ درصد بازدهی از ابتدای سال بیشترین رشد قیمتی را به ثبت رساند. همچنین این کالای گرانبها بیشترین افت را در آبان ماه با ریزش حدود ۱۸ درصدی تجربه کرد. نکته قابل تامل در روند قیمتی سکه، رشد قیمتی در ماه‌های مرداد، شهریور و مهر است که بازار بورس روزهای قرمزی را تجربه می‌کرده است.

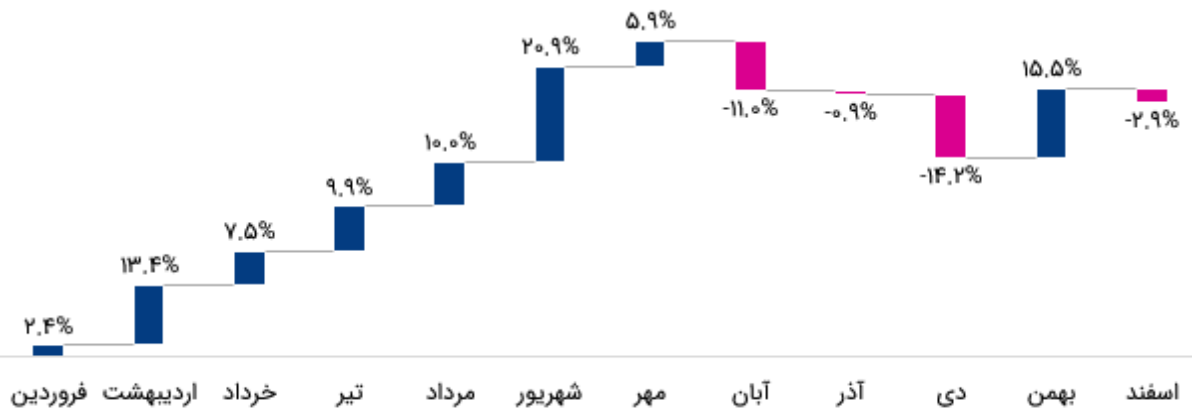
روند بازدهی ماهانه سکه امامی سال ۹۹



روند ماهانه دلار آمریکا

روند بازدهی ماهانه دلار آمریکا به نمایندگی از بازار ارز بسیار نزدیک به روند بازدهی ماهانه سکه طلا است. ضمن اینکه روند ماهانه دلار آمریکا نسبت به سکه طلا کمتر شارپ بوده و بیشترین بازدهی دلار آمریکا مربوط به شهریور ماه است که مصادف با اوایل سقوط شاخص بورس تهران است.

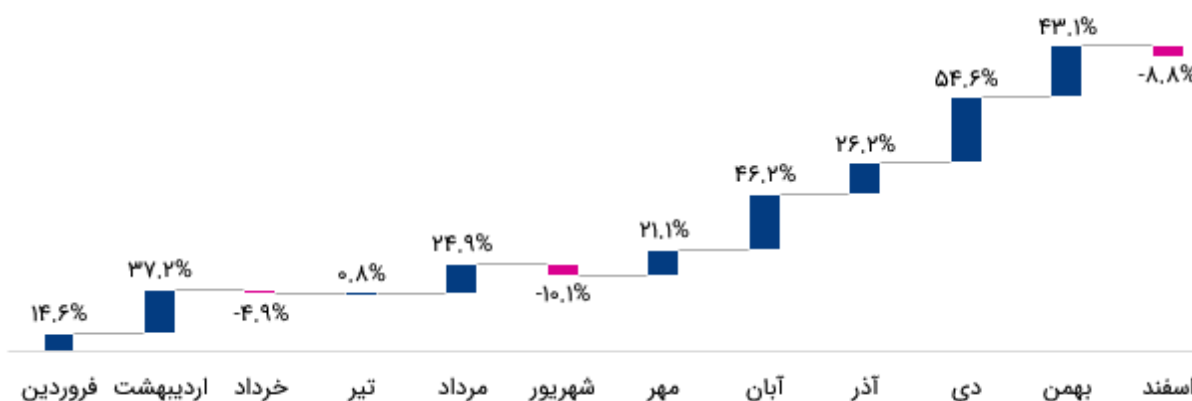
روند بازدهی ماهانه دلار آمریکا سال ۹۹



روند ماهانه رمز ارز

روند بازدهی ماهانه بیت کوین به عنوان نماینده رمزارزها نشان می‌دهد این بازار در نیمه دوم سال شمسی روندهای صعودی پرقدرتی را ثبت کرده‌است. البته با توجه به اینکه رمز ارزها اساساً متأثر از بازارهای جهانی هستند، ارتباط دقیقی نمی‌توان بین این بازار با سایر فرصت‌های سرمایه‌گذاری داخلی تعریف کرد. با این وجود رشدهای شارپی که در نیمه اول سال در بازار سهام ایران مشاهده شد، در نیمه دوم سال در بیت کوین و به طور کلی در بازار رمز ارزها به چشم می‌خورد. تحلیل مفصلی از بیت کوین در گزارش بازارهای جهانی که همراه با این گزارش منتشر شده، ارائه شده است.

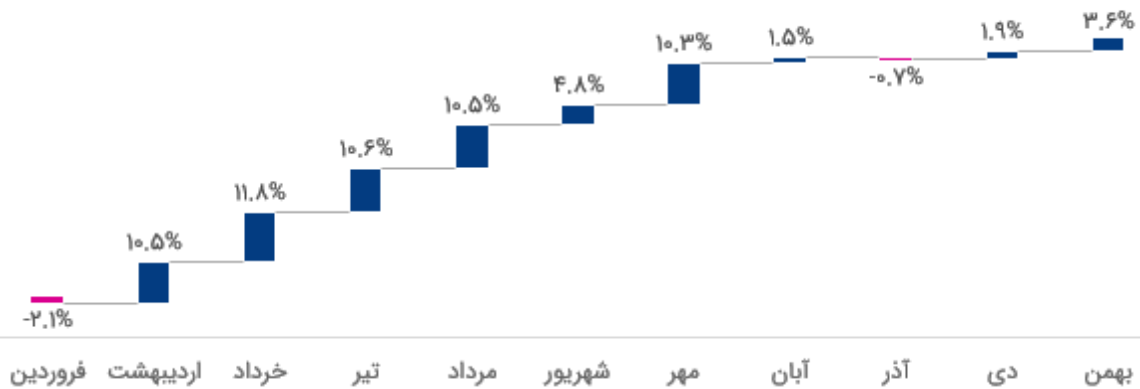
روند بازدهی ماهانه بیت کوین سال ۹۹



روند ماهانه قیمت مسکن

روند ماهانه متوسط قیمت فروش هر متر مربع مسکن در تهران تا پایان بهمن ماه در نمودار زیر ارائه شده است. همانطور که پیداست روند قیمت مسکن در تهران به نمایندگی از کشور، در مسیر صعودی قرار داشته است. البته با توجه به رکود بی سابقه در معاملات، این افزایش نمی‌تواند خیلی واقعی باشد و احتمالاً حاصل از چند معامله خاص و ثبت قیمت‌های صعودی باشد.

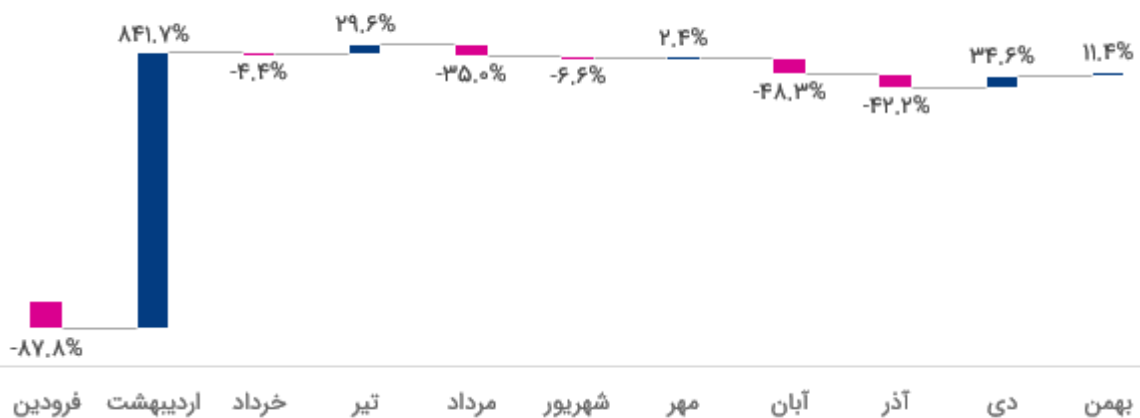
روند بازدهی ماهانه قیمت مسکن



روند ماهانه معاملات مسکن

روند تعداد معاملات مسکن در پایتخت نشان از رکود بی سابقه و آمار پایین معاملات از ماه خرداد تا پایان سال را دارد. این روند در طی سال نیز تقریباً کاهشی بوده و ادعای واقعی نبودن قیمت مسکن را تا حدودی می‌تواند اثبات نماید. در اردیبهشت ماه درحالی معاملات نسبت به فروردین ماه ۹۹ رشد ۸۴۰ درصدی را تجربه کرده‌است که نسبت به اردیبهشت ماه سال ۹۸ همچنان حدود ۶ درصد کمتر بوده است.

روند ماهانه تعداد معاملات مسکن



بازار سرمایه ایران

بازار سرمایه را می‌توان متشکل از دو بخش اصلی اوراق مالکیت (سهام) و اوراق مشارکت (اوراق با درآمد ثابت) تعریف کرد. نمودارهای تغییرات شاخص‌های بازار سهام در سال ۹۹، آمار کلی از بازدهی شرکت‌ها و صنایع و آمار ورود و خروج پول به بازار از جمله مواردی است که در این سالنامه به آن پرداخته شده است. در ادامه با نگاه دقیق تری وقایع سال ۹۹ و اثرات آن بر بازار بورس مورد بررسی قرار گرفته است. همچنین بر اساس معیارهایی چون بازدهی و سودآوری، برترین عملکردها بین شرکت‌های فعال در بازار معرفی می‌گردد.

بازار سرمایه در یک نگاه

بازار سرمایه ایران امسال سال پرتلاطم و متفاوتی را تجربه کرد. از طرفی همه‌گیری ویروس کووید ۱۹ و به دنبال آن بحران جهانی که منجر به چالش‌های فراوان شد، آسیب‌های جدی به اقتصاد تمام کشورهای دنیا وارد گشت. از سویی دیگر برنامه‌های داخلی کشور که با تبلیغات گسترده و تشویق عموم جامعه به سرمایه‌گذاری در بازار تخصصی سهام همراه بود، باعث شد این بازار فراز و فرودهای زیادی را به چشم ببیند.

ردیف	پارامترها	سال ۹۹ (تا پایان ۱۵ سفند)	سال ۹۸	تغییر ۹۹ نسبت به ۹۸
۱	ارزش بازار سهام	۶,۶۳۵ هزار میلیارد تومان	۲,۵۰۹ هزار میلیارد تومان	+۱۶۴٪
۲	گردش مالی بازار سهام (ارزش معاملات خرد)	۳,۵۵۵ هزار میلیارد تومان	۷۳۰ هزار میلیارد تومان	+۳۸۷٪
۳	بازدهی بازار سهام (حاصل از تغییر قیمت)	۱۶۴٪	۱۸۵٪	-۱۱٪
۴	تعداد عرضه‌های اولیه	۲۶	۲۳	+۱۳٪
۵	مجموع ورود پول حقیقی	۶۳/۷ هزار میلیارد تومان	۴۳/۳ هزار میلیارد تومان	+۴۷٪
۶	مجموع افزایش سرمایه‌ها	۱۲۴,۸۳۳ هزار میلیارد تومان	۱۰۱,۲۷۷ هزار میلیارد تومان	+۲۳٪
۷	مجموع سود تقسیمی شرکت‌ها	۲۱۸ هزار میلیارد تومان	۹۵ هزار میلیارد تومان	+۱۲۹٪

وقایع مهم سال ۹۹ و اثرات آن بر بازار بورس تهران

در ادامه وقایع مهم و مجموعه اتفاقات مرتبط به بازار سرمایه ایران در قالب جدولی ارائه شده است. این وقایع و سایر پارامترهای موثر دیگر (مانند میزان درک و دانش عمومی جامعه نسبت به بازار سرمایه و فرهنگ سرمایه گذاری) باعث مجموعه اثرات و رفتارهای جمعی شد که قطعاً نتایج آن در شاخص بورس تهران منعکس شده است.

ردیف	وقایع	برخی از اثرات مهم
۱	تبلیغات گسترده و مصاحبه‌های مسئولین در جهت جذب عموم مردم به بازار سرمایه (با وجود آمادگی ناکافی در بسترهای لازم)	<ul style="list-style-type: none"> ورود نقدینگی بالا به بازار سهام در زمان کوتاه (حدود ۵۰ هزار میلیارد تومان فقط در ۳ ماهه اول سال ۹۹ جذب نقدینگی اتفاق افتاده در حالی که این عدد در کل سال ۹۸ حدود ۳۰ هزار میلیارد تومان بوده است)
۲	عرضه با تخفیف صندوق‌های دولتی: <u>دارایکم و یالایش</u> آزادسازی سهام عدالت	<ul style="list-style-type: none"> ورود گسترده‌تر عموم مردم به بازار سرمایه بیش از دوبرابر شدن کدهای معاملاتی نسبت به سال قبل
۳	تبلیغات گسترده در فضاهای غیر تخصصی، آموزش ناکافی فرهنگ سرمایه‌گذاری، تلاش ناکافی جهت معرفی نهادهای واسط و متخصص بجای سرمایه‌گذاری مستقیم مردم در بازار سرمایه	<ul style="list-style-type: none"> تشدید رفتارهای دسته‌ای همچون خرید و فروش بدون تحلیل و در نظر گرفتن ارزش سهامها
۴	دستکاری و ایجاد فضای غیرمنصفانه در بازار: <u>دو نیمه کردن زمان بازار</u>	<ul style="list-style-type: none"> سمت و سو دادن به برخی سهام‌های بزرگ بازار که در نیمه دوم بازار معامله می‌شدند
۵	تغییرات گسترده و ضرب العجلی در قوانین بازار برای مثال ممنوع شدن <u>نوسان گیری روزانه</u> - <u>ممنوعیت معاملات الگوریتمی</u>	<ul style="list-style-type: none"> بی اعتمادی و سردرگمی سرمایه‌گذاران: تثبیت خروج پول حقیقی از بازار
۶	تغییر متغیرهای اقتصادی: نرخ سود بانکی، تغییر تورم انتظاری نوسان‌های شدید در بازارهای موازی: طلا و ارز	<ul style="list-style-type: none"> فرصت انگاری سرمایه‌گذاری در بازارهای موازی: خروج پول حقیقی
۷	نابسمانی‌های سیاسی و مصاحبه‌های تنش زا مانند: بحث قیمت‌گذاری فولاد توسط وزیر صمت	<ul style="list-style-type: none"> تشدید تنش به بازار و کاهش اعتماد به سازوکارهای تعریف شده قانونی
۸	ارائه راه حل‌های مقطعی برای عبور از بحران و رسیدن به تعادل در بازار سهام: افزایش سقف خرید سهام در صندوق‌های با درآمد ثابت از ۵ درصد به ۱۵ درصد و سپس ۲۰ درصد	<ul style="list-style-type: none"> صعودهای مقطعی بازار
۹	الزام به داشتن بازارگردان در همه نمادهای بازار سرمایه به عنوان راه حلی برای کمک به تعادلی کردن بازار سرمایه	<ul style="list-style-type: none"> با توجه به گستردگی عرضه‌ها و توان نابرابر بازارگردان و سایر سرمایه گذاران تاثیر مثبت ویژه‌ای نداشته است.

ردیف	وقایع	برخی از اثرات مهم
۱۰	تغییرات ریز ساختارهای بازار مانند: کاهش و نامتقارن کردن دامنه نوسان روزانه سهم	<ul style="list-style-type: none"> کاهش اساسی نقدشوندگی بازار و تشدید صف‌های فروش کاهش ارزش معاملات

شاخص های بازار بورس تهران

در ادامه روند شاخص‌های اصلی بازار سرمایه در سال ۹۹ ارائه می‌شود. اما سوالی که در ذهن بسیاری از سرمایه‌گذاران مطرح می‌شود این است که: در سال ۹۹ چه بر سر بورس تهران آمد؟ برای پاسخ به این سوال نیاز به بررسی مجموعه عوامل متعدد و پیچیده‌ای است که در فضای این سالنامه نمی‌گنجد اما با بررسی روند شاخص کل بورس، فرابورس و هم وزن و عوامل موثر بر تغییرات آن سعی بر ایجاد فضای تحلیلی برای مخاطب شده است.

روند شاخص بورس و فرابورس از ابتدای سال ۹۹ تا اواسط آذر هم جهت بوده به این معنی که صعود و نزول‌های همزمانی را تجربه کردند. پس از آن شاخص فرابورس از اواسط آذر تا هفته اول دی برخلاف شاخص بورس، صعود کوتاه مدتی را تجربه کرد (روزهای بهتر برای سهم‌های کوچکتر بازار) و مجدداً با شاخص بورس در یک جهت قرار گرفت.

روند نزول و افول شاخص‌ها با توجه به وقایعی که در سال ۹۹ رخ داد و بر بازار سرمایه تاثیرگذار بود، قابل تفسیر است.

با وجود گسترش و پاندمی جهانی ویروس کووید-۱۹، بازار سرمایه ایران به دلایل مختلف از جمله تبلیغات گسترده، تشویق عموم مردم و هدایت نقدینگی به سمت بازار بورس روند پر قدرت صعودی را تجربه کرد. شاخص بورس در ابتدای سال در محدوده‌ی ۵۰۸ هزار واحد قرار داشت و تا اواخر اردیبهشت در مسیر صعودی با شیب تند به حرکت خود ادامه داد و از ۱ میلیون واحد نیز عبور کرد (معادل ۱۰۰ درصد نسبت به ابتدای سال). پس از آن شاخص بورس و فرابورس چند روز روند کاهشی (کمتر از ۱۰ درصد) را تجربه کردند و سرانجام نقطه آغازین رشد شارپی بازار در اواسط خرداد ماه رقم خورد و شاخص بورس در طی ۲ ماه به محدوده ۲ میلیون ۷۰ هزار واحد رسید و افزایش بیش از ۳۰۰ درصد را نسبت به ابتدای سال ثبت کرد. رشد ۳۰۰ درصدی بازار از ابتدای سال تا ۲۰ مرداد ۹۹ درحالی رقم خورد که بازار سرمایه در سال ۹۸ (یکی از بهترین سال‌های بازار سرمایه)، توانسته بود حدود ۱۸۰ درصد افزایش را ثبت کند.

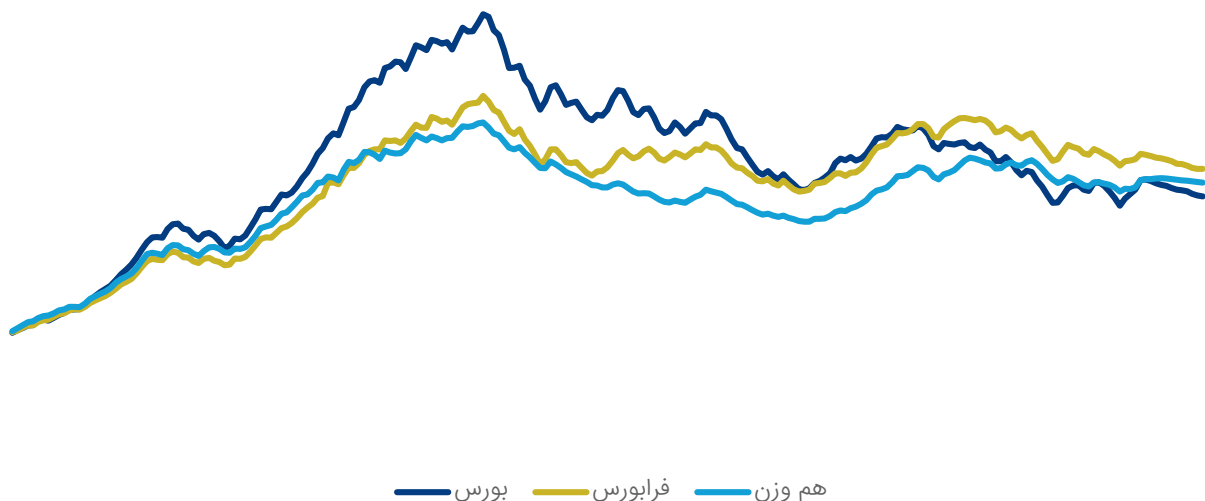
اما انتهای مرداد آغاز سقوط شاخص‌های بورس و فرابورس بود. روند نزولی پیوسته تا کاهش ۴۲ درصدی شاخص بورس در اواسط آبان ماه در حالی رقم خورد که شرکت‌های زیادی با سقوط بیش از ۷۰ درصدی مواجه شده بودند. با توجه به مجموعه وقایعی که منجر به حرکت‌های دسته‌ای عموم مردم در معاملات شده و رشد شارپی در کوتاه مدت را رقم زده بود، سازمان بورس مجموعه‌ای از اقدامات را با هدف کنترل ریزش‌های متوالی و سنگین بازار در دستورکار قرار داد و با تغییر در برخی از قوانین بازار مانند ممنوعیت نوسان‌گیری روزانه، افزایش سقف سهام در صندوق‌های با درآمد ثابت و از این دست تغییرات، سعی در کمک به ایجاد تعادل، در بازار را داشت. از اواخر آبان تا اواسط آذر شاخص بورس از محدوده ۱ میلیون و ۲۰۰ هزار واحد، رشدی با شیب ملایم تا ۳۰۰ هزار واحد را تجربه کرد و مجدداً در کانال نزولی قرار گرفت. با توجه به روند نزولی و عرضه‌های شدید، سازمان دامنه نوسان نامتقارن را در دستور کار قرار داد و این اقدام که در جهت کمک به بازار سرمایه طراحی شده بود نتیجه‌ای جز تشدید صف‌های عرضه و کاهش شدید ارزش معاملات و قفل شدن صف‌های فروش نداشت. بدین ترتیب در

پایان نیمه اسفند ۹۹ شاخص در محدوده ۱ میلیون و ۱۰۰ هزار واحد قرار دارد و نسبت به نقطه اوج خود حدود ۴۵ درصد سقوط کرده است. با این حال شاخص بورس نسبت به سال ۹۸ توانست حدود ۱۳۰ درصد و شاخص فرابورس حدود ۱۵۷ درصد رشد را به ثبت برساند.

شاخص هم‌وزن در مقایسه با شاخص بورس نشان می‌دهد به ترتیب در دور اول صعود امسال (۲ ماه ابتدای سال)، اختلاف کمی با این شاخص دارد و نشان از رشد یکپارچه و یکدست بازار دارد. در ادامه با شروع رشد شارپی بازار، شاخص هم‌وزن از شاخص بورس فاصله می‌گیرد که این امر حاکی از رشد بی‌مهابای سهم‌های شاخص‌ساز می‌باشد و بیان‌کننده‌ی این موضوع که سهم‌های کوچک بازار به سبزی سهم‌های بزرگ بازار نبودند.

از اواخر آذر در حالیکه مسیر شاخص فرابورس از شاخص بورس جدا شد و در مدار نسبتاً صعودی حرکت کرد، شاخص هم‌وزن نیز در روندی صعودی قرار گرفت. این رشد کوتاه‌مدت در شاخص هم‌وزن و فرابورس، حاصل رشد شرکت‌های کوچک بازار و ورود حقیقی‌ها به این دسته از سهم‌ها بود و در نهایت شاخص هم‌وزن در نیمه اسفند سال ۹۹ روی ۴۳۰ هزار واحد ایستاد و رشد ۱۴۰ درصدی نسبت به سال قبل را ثبت کرد.

روند شاخص بورس، فرابورس و هم‌وزن در سال ۹۹



ارزش بازار سهام ایران در سال ۹۹

ارزش بازار از محاسبه مجموع ارزش روز شرکت‌های فعال در بازار سرمایه بدست می‌آید. بنابراین با رشد و افت قیمت سهام، تعداد سهام شرکت‌ها (نقش افزایش سرمایه) و عرضه شرکت‌های جدید به بازار تحت عنوان عرضه اولیه ارتباط مستقیم دارد. در سال ۹۹ ارزش بازار بورس و فرابورس به صورتی که در نمودار ارائه شده تغییر کرده است. همانطور که مشاهده می‌کنید ارزش بازار از مرداد ماه در روند نزولی قرار گرفته است، به طوری که بیشترین ارزشی که بازار تجربه کرده، معادل بیش از ۷۰۰۰ هزار میلیارد تومان بوده است. در حال حاضر ارزش بازار بورس تهران کمتر از ۵۰۰۰ هزار میلیارد تومان قرار دارد و نسبت به سال قبل تنها حدود ۱۵۰ درصد رشد داشته است.

ارزش بازار در پایان هر ماه (هزار میلیارد تومان)



ارزش دلاری بازار سهام

در جدول زیر با توجه به تغییرات قیمت دلار آمریکا، ارزش بازار (بورس و فرابورس) را براساس قیمت دلار در انتهای سال ۹۹ محاسبه و در مقایسه با سال ۹۸ ارائه شده است. در حالی رشد ارزش ریالی بازار در سال ۹۹ و ۹۸ نزدیک به هم بوده که رشد ارزش دلاری سال ۹۹ کمتر از نصف رشد ارزش دلاری در سال قبل بوده است.

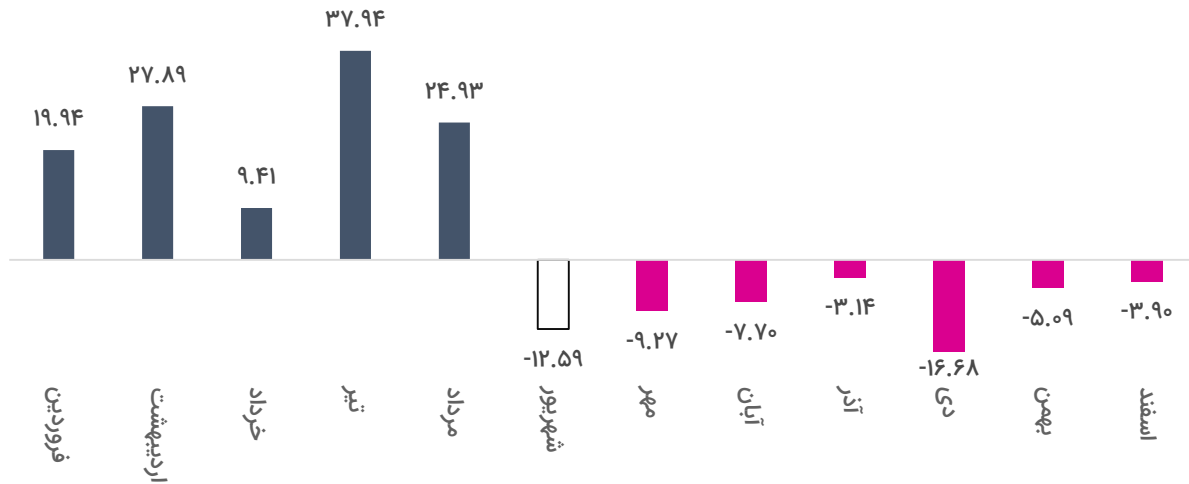
سال	قیمت دلار ابتدای سال (ریال)	ارزش بازار ابتدای سال (میلیون دلار)	قیمت دلار انتهای سال (ریال)	ارزش بازار انتهای سال (میلیون دلار)	تغییرات دلاری ارزش بازار
سال ۹۸	۱۲۹,۵۲۰	۶۷,۹۸۶	۱۴۸,۹۹۰	۱۶۸,۲۴۶	٪۱۴۷
سال ۹۹	۱۴۸,۹۶۰	۱۶۷,۵۰۸	۲۴۶,۶۱۰	۲۵۹,۳۵۸	٪۵۵

^۲ منتهی به ۱۵ اسفند

ورود و خروج حقیقی ها به بازار

در مجموع سال ۹۹ ورود پول افراد حقیقی در بازار برابر با ۶۲/۶۲ هزارمیلیارد تومان بوده است. اگرچه در نیمه‌ی اول سال این رقم برابر با ۱۰۷/۵ هزارمیلیارد تومان بوده اما در نیمه‌ی دوم سال افراد حقیقی ۴۶ هزارمیلیارد تومان خود را از بازار خارج کرده‌اند.

روند ورود-خروج حقیقی به بازار(هزار میلیارد تومان)



جدول بیشترین ورود و خروج حقیقی ها به شرکت های بازار در سال ۹۹

در این جدول شرکت‌هایی که بیشترین ورود و خروج پول از سمت حقیقی‌ها را تجربه کرده‌اند نمایش داده شده است. از بین ۱۰ شرکت با بیشترین ورود پول حقیقی، ۳ شرکت مربوط به صنعت فرآورده‌های نفتی و ۲ شرکت مربوط به فلزات اساسی است. همچنین ۶ شرکت از ۱۰ شرکتی که خروج سنگین پول حقیقی داشته‌اند از گروه بانکی‌ها بوده‌اند.

بیشترین میزان خروج نقدینگی افراد حقیقی از نمادهای بازار		بیشترین میزان ورود نقدینگی افراد حقیقی به نمادهای بازار	
مقدار (هزار میلیارد تومان)	شرکت	مقدار (هزار میلیارد تومان)	شرکت
-۲.۹۳۷۱۵۷۹۳	وپاسار	۶.۹۷۰۸۸۸	شپنا
-۲.۵۵۸۳۱۵۹۲۳	وتجارت	۵.۹۰۶۶۱۹	شستا
-۱.۷۵۰۹۸۸۰۴۹	وملل	۴.۴۷۹۲۱۷	شتران
-۱.۶۹۷۱۸۷۵۹۹	وآیند	۴.۱۷۲۴۶۹	فولاد
-۱.۲۳۰۳۶۰۲۴۷	بپاس	۳.۶۸۶۶۶۷	فملی
-۰.۹۸۶۱۳۳۳۱۲	میدکو	۲.۷۴۲۹۹۹	خگستر
-۰.۹۲۷۴۰۲۵۹۹	ومهان	۲.۴۵۷۶۱۴	شبندر
-۰.۷۱۴۱۰۸۶۱۳	آریان	۲.۳۲۱۸۵۸	سیتا

بیشترین میزان ورود نقدینگی افراد حقیقی به نمادهای بازار	بیشترین میزان خروج نقدینگی افراد حقیقی از نمادهای بازار
کاما ۲.۱۸۴۸۱۱	وشهر -۰.۷۰۸۱۴۴۲۱۶
برکت ۲.۱۷۸۲۵۷	واحیا -۰.۷۰۸۱۲۲۳۵۴

ارزش معاملات بازار سهام

معاملات خرد: تا نیمه‌ی اسفندماه سال ۱۳۹۹ ارزش معاملات خرد بازار بورس اوراق بهادار به مبلغ ۲۵۰۸/۸ هزارمیلیارد تومان رسیده و این رقم برای بازار فرابورس ایران برابر با ۱۰۴۵/۶ هزارمیلیارد تومان شده‌است. بنابراین ارزش کل معاملات خرد بازار سرمایه در سال ۹۹ برابر با ۳۵۵۴/۵ هزارمیلیارد تومان بوده است.

معاملات بلوکی: ارزش کل معاملات بلوکی بازار در این بازه‌ی زمانی برابر با ۱۸۸ هزارمیلیارد تومان برآورد شده است.

ارزش معاملات و ورود پول حقیقی: با بررسی کلی ارزش معاملات و ورود-خروج افراد حقیقی در طول سال می‌توان نتیجه گرفت که سال ۱۳۹۹، سال استقبال عمومی از بازار سرمایه بوده‌است اما با بررسی‌های دقیق‌تر و تقسیم سال به دو نیمه‌ی مساوی، اعداد و شواهد نشان‌دهنده‌ی ورود سنگین به بازار در اوایل سال و استقبال کم‌نظیر از آن می‌باشد و در نیمه‌ی دوم سال، خروج سنگین و به اصطلاح فرار حقیقی را از بازار رقم زده‌است.

استقبال عمومی فراوان بازار در نیمه‌ی اول سال را تنها با مشاهده ورود حقیقی در شش ماه به میزان ۱۰۷/۵ هزارمیلیارد تومان در مقایسه با ورود حقیقی در کل سال ۱۳۹۸ به میزان ۴۳/۴ هزارمیلیارد تومان، نتیجه گرفت. به طور میانگین نسبت ورود حقیقی به ارزش معاملات بورس، فرابورس و کل از ابتدای سال تا نیمه اسفندماه به ترتیب برابر با ۲/۵۴٪ و ۶٪ و ۱/۸٪ می‌باشد که این نسبت‌ها در سال ۱۳۹۸ به ترتیب برابر با ۱۰٪ و ۱۷٪ و ۶٪ بوده است. بنابراین اگر بخواهیم در مقایسه با سال ۱۳۹۸، میزان استقبال عمومی را به طور کلی بیان کنیم، نتیجه می‌گیریم با کاهش نسبی اقبال عمومی روبه‌رو شده‌ایم و در صورتیکه این روند در بازار سرمایه ادامه پیدا کند، میزان نقدینگی افراد حقیقی در بازار به شدت کاهش خواهد یافت.

ارزش دلاری معاملات بازار سهام (گردش مالی)

ارزش معاملات بازار سهام در سال ۹۹ را با توجه به تغییرات قیمت دلار آمریکا در جدول زیر مشاهده می‌کنید. همچنین برای درک بهتر ارقام، اطلاعات سال ۹۸ نیز ارائه شده‌است. با مقایسه گردش دلاری معاملات در این دو سال می‌توان دریافت که این رقم در سال ۹۹ حدود ۳ برابر شده است.

سال	میانگین قیمت دلار (ریال)	ارزش معاملات خرد (میلیارد دلار)
سال ۹۸	۱۲۸,۲۳۹	۵۳,۲
سال ۹۹	۲۲۷,۰۰۶	۱۵۶,۷

عرضه اولیه های بازار سرمایه در سال ۹۹

در سال ۹۹ مجموعاً ۲۷ شرکت برای اولین بار در بازار سرمایه عرضه شدند. از میان این ۲۷ عرضه، ۱ شرکت ویژه حقوقی ها و مابقی بصورت عمومی عرضه گردیده‌اند. آمار بازدهی اولیه این شرکت‌ها و میزان تخصیص یافته در^۳ روز عرضه به هر کد حقیقی در جدول زیر ارائه شده است.

ردیف	تاریخ عرضه ماه / روز	نماد	قیمت عرضه (ریال)	ارزش ریالی تخصیص به هر کد	بازدهی اولیه
۱	۲۰ / ۱	صبا	۱۲۰۰۰	۹,۷۴۴,۰۰۰	%۱۲۲
۲	۲۷ / ۱	شستا	۸۶۰۰	۳۱,۲۷۸,۲۰۰	%۹۰
۳	۱۰ / ۲	غگیلا	۱۲۵۰۷	۱۸۷,۶۰۵	%۴
۴	۳۱ / ۲	پیزد	۴۰۳۵۳	۵۶۴,۹۴۲	%۱۷
۵	۷ / ۳	آریا	۶۵۱۱۹	۳,۷۷۶,۹۰۲	%۵۱
۶	۷ / ۳	غزر	۳۹۷۵۰	۱,۳۱۱,۷۵۰	%۱۰۶
۷	۴ / ۴	ویویا	۴۱۰۰	۹۳۸,۹۰۰	%۳۲۷
۸	۱۱ / ۴	سیتا	۱۵۷۵۰	۴,۷۰۹,۲۵۰	%۳۹
۹	۱۸ / ۴	ولپارس	۳۲۰۰	۲۴۰,۰۰۰	%۱۵۶
۱۰	۲۴ / ۴	رافزا	۲۵۰۰۰	۱۵۰,۰۰۰	%۷۲
۱۱	۱ / ۵	آبادا	۱۵۵۰۰	۷۴۴,۰۰۰	%۱۱۵
۱۲	۷ / ۵	بگیلان	۲۴۰۰۰	۱,۲۲۴,۰۰۰	%۶۱
۱۳	۱۴ / ۵	شاروم	۶۳۰۰	۱۰۰,۸۰۰	%۲۶۲
۱۴	۱۵ / ۵	امین	۱۰۴۰۰	۱,۶۷۴,۴۰۰	%۶۳
۱۵	۲۱ / ۵	زملارد	۲۱۰۰۰	۱۶۸,۰۰۰	%۱۳۲
۱۶	۲۲ / ۵	ثبهساز	۲۲۰۰	۱,۴۷۴,۰۰۰	%۸۱
۱۷	۲۸ / ۵	گدنا	۶۰۰۰	۶۰,۰۰۰	%۶۹۲
۱۸	۱۱ / ۶	بپیوند	۱۸۵۰۰	۱,۴۴۳,۰۰۰	%۶۲
۱۹	۱۹ / ۶	ثامید	۱۷۵۰	۱,۴۸۰,۵۰۰	%۵۸
۲۰	۳۰ / ۶	وسپهر	۱۰۰۵۹	۱۱,۰۶۴,۹۰۰	%۶۰
۲۱	۱۱ / ۹	چخزر	۲۵۰۰۰	۱۷۵,۰۰۰	%۱۰۷
۲۲	۱۸ / ۹	وکبهن	۱۴۴۸۴	۸۱۱,۱۰۴	%۵۰

^۳ بازدهی اولیه به بازدهی سهم از روز عرضه تا اولین روز افت قیمت سهم اطلاق می‌شود.

ردیف	تاریخ عرضه ماه / روز	نماد	قیمت عرضه (ریال)	ارزش ریالی تخصیص به هر کد	بازدهی اولیه
۲۳	۱۹ / ۹	بوعلی	۴۱۴۳۰	۳,۲۳۱,۵۴۰	٪۶۳
۲۴	۱۷ / ۱۰	سپیدار	۳۹۸۰۰	۲۷۸,۶۰۰	٪۸۵
۲۵	۱۵ / ۱۱	کزغال	۲۰۴۷۷	۱,۲۲۸,۶۲۰	٪۵۲
۲۶	۶ / ۱۲	اپال	۱۲۴۲۰	۴,۹۶۸,۰۰۰	٪۳۰

صنایع در عرضه اولیه‌ها

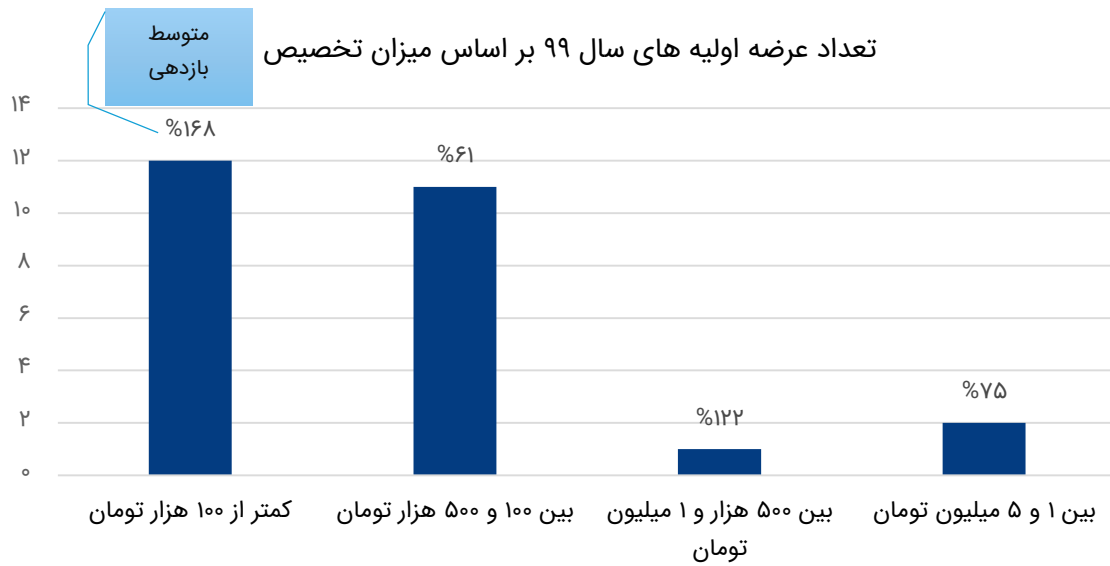
عرضه اولیه‌های سال ۹۹ از حیث پراکندگی در صنایع بازار به ۱۶ صنعت مختلف مربوط می‌شوند که بیشترین عرضه اولیه مربوط به صنعت سرمایه‌گذاری با ۴ عرضه و بعد از آن صنعت شیمیایی و صنعت یوتیلیتی با ۳ عرضه مشترکاً رتبه دوم را کسب کردند. نمودار زیر پراکندگی عرضه‌ها در بین صنایع را نشان می‌دهد.

نقشه تعداد عرضه‌های اولیه هر صنعت

سرمایه گذاری: ۴	یوتیلیتی (آب/برق/گاز): ۳	رایانه: ۲	چند رشته ای صنعتی: ۱	لاستیک و پلاستیک: ۱	سیمان: ۱	
			سایر واسطه گری مالی: ۱	زراعت: ۱	هتل و رستوران: ۱	
شیمیایی: ۳	غذایی بجز قند: ۲	املاک و مستغلات: ۲	ف.ک. به نهاد مالی واسطه: ۱	چوب: ۱	زغال سنگ: ۱	کانه های فلزی: ۱

عرضه اولیه‌ها بر اساس میزان تخصیص

بر اساس میزان تخصیص در روز عرضه به هر کد، دسته‌بندی زیر انجام شده است. در ۱۲ عرضه اولیه در سال ۹۹ به هر فرد کمتر از ۱۰۰ هزار تومان رسیده است بطوری که بازدهی این دسته از عرضه‌ها (کمتر از ۱۰۰ هزار تومان) به طور متوسط ۱۶۸ درصد بوده است. همانطور که در نمودار مشاهده می‌کنید در تخصیص بیشتر از ۱ میلیون تومان تنها ۲ عرضه با متوسط ۷۵ درصد بازدهی حضور داشته‌اند.



افزایش سرمایه شرکت ها در سال ۹۹

بیشترین درصد افزایش سرمایه سال ۱۳۹۹ مربوط به شرکت آذریت با میزان ۳۷۰۰ درصد است و در مقابل کمترین میزان افزایش سرمایه متعلق به شرکت سبحان انکولوژی با میزان ۱۱/۶۱ درصد می‌باشد.

بانک ملت با افزایش سرمایه‌ی ۳۱۴ درصدی به مبلغ ۱۵۷,۰۴۲,۸۶۲ میلیون ریال، بالاترین میزان ریالی افزایش سرمایه را داشته‌است و شرکت شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان با افزایش سرمایه‌ی ۴۰/۸۳ درصدی به مبلغ ۴۹,۰۰۰ میلیون ریال، کمترین میزان ریالی افزایش سرمایه را در سال ۹۹ رقم زده‌است.

۱۰ شرکت برتر از حیث درصد در افزایش سرمایه:

نام شرکت	درصد	حجم ریالی (میلیون ریال)
آذریت	۳,۷۰۰	۲۲۲,۰۰۰
هتل بین المللی پارسیان کوثر اصفهان	۳,۳۸۱.۲	۳,۷۱۹,۳۲۶.۵۷۵
ایران تایر	۳,۳۴۹.۸	۹,۵۹۶,۲۶۱
تولید برق ماهتاب کهنوج	۲,۴۳۵.۶	۱۵,۴۱۷,۴۹۶
صنعتی دریایی	۱,۶۴۸.۰۷	۲۴,۷۲۱,۰۵۷
مدیریت انرژی امید تابان هور	۱,۵۵۴.۴	۶۲,۱۷۶,۲۸۳
پارس سرام	۱,۵۳۵.۴	۹۲۱,۲۴۹
فرآورده نسوز پارس	۱,۵۱۹.۵۲	۱,۵۱۹,۵۱۹
سالمین	۱,۳۹۴.۶	۴,۱۸۴,۰۰۰
تلیسه نمونه	۱,۳۲۶.۸۴	۴,۶۴۳,۹۴۰

۱۰ شرکت برتر از حیث مبلغ افزایش سرمایه:

نام شرکت	درصد	حجم ریالی (میلیون ریال)
بانک ملت	۳۱۴	۱۵۷,۰۴۲,۸۶۲
صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۱۰۰	۱۴۳,۵۰۰,۰۰۰
ملی صنایع مس ایران	۹۷.۲	۹۸,۶۰۰,۰۰۰
مدیریت انرژی امید تابان هور	۱۵۵۴.۴	۶۲,۱۷۶,۲۸۳
ایران ترانسفو	۸۷۰.۷	۳۲,۶۵۲,۷۵۶
پالایش نفت تهران	۷۰.۴۵	۳۱,۰۰۰,۰۰۰
فولاد خوزستان	۱۶۲.۴۸	۳۰,۹۵۱,۳۰۳
سر. صبا تامین	۲۰۰	۳۰,۰۰۰,۰۰۰
گل گهر	۵۵	۲۶,۴۰۰,۰۰۰
پالایش نفت اصفهان	۴۹.۰۲	۲۵,۰۰۰,۰۰۰

سودآوری شرکت‌های بازار سرمایه در سال ۹۹

سودآوری شرکت‌ها به ازای هر سهم (EPS) شاخص مهمی از عملکرد بازار سرمایه است که نظر بسیاری از سرمایه‌گذاران را جلب می‌کند. در سال ۹۹ مجموع سود ساخته شده به ازای هر سهم بازار سرمایه (فقط شرکت‌هایی که سودآور بودند) برابر با ۹۴۶,۲۷۸ ریال می‌باشد که به صورت میانگین (بین همه شرکت‌ها شامل سودآور و زیان‌ده) هر شرکت ۱۴۳۰ ریال سود به ازای هر سهم ساخته است.

همچنین شرکت‌های فعال در بازار سرمایه توانسته‌اند در مجموع ۴,۸۲۹.۵۴۹ هزار میلیارد ریال سود بسازند. بیشترین سود ساخته شده به ازای هر سهم متعلق به شرکت پتروشیمی فن‌آوران برابر با ۷۰,۸۸۸ ریال است و کمترین مقدار متعلق به بانک سرمایه برابر با ۱۸,۴۵۳ ریال می‌باشد.

- بیشترین سود ساخته شده به ازای هر سهم (ریال)

شرکت	سود ساخته شده به ازای هر سهم
پتروشیمی فن‌آوران	۷۰,۸۸۸
پتروشیمی زاگرس	۲۲,۳۵۹
نورد قطعات فولادی	۱۷,۱۶۰
پترو گامرون	۱۵,۸۸۴
شیرین دارو	۱۳,۷۹۰
پتروشیمی پارس	۱۳,۵۲۸
رنگین	۱۲,۶۴۱

سود ساخته شده به ازای هر سهم	شرکت
۱۱,۶۸۲	گروه صنعتی و معدنی امیر
۱۱,۳۴۲	بازرسی مهندسی و صنعتی ایران
۱۰,۶۴۴	دشت مرغاب

• کمترین سود ساخته شده به ازای هر سهم (ریال)

سود ساخته شده به ازای هر سهم	شرکت
-۱۸,۴۵۳	بانک سرمایه
-۱۵,۲۸۹	بانک ایران زمین
-۱۰,۴۶۵	تجهیزات سدید
-۸,۲۸۰	جوش و اکسیژن
-۷,۱۱۲	کابل تک
-۴,۴۰۰	تولی پرس
-۴,۱۳۸	کف
-۳,۶۰۹	بانک آینده
-۳,۰۵۹	انرژی آذراب
-۲,۱۰۲	بانک شهر

در این بین بیشترین سود خالص ۱۲ ماهه متعلق به شرکت سر.تامین اجتماعی می‌باشد که این رقم برابر با ۲۶۹,۱۲۰ میلیارد ریال است و بیشترین زیان خالص ۱۲ ماهه توسط شرکت ایران خودرو به میزان ۸۷,۱۷۵ میلیارد ریال محقق شده است.

• بیشترین سود خالص ۱۲ ماهه و بیشترین زیان خالص ۱۲ ماهه (میلیارد ریال)

شرکت (بیشترین سود)	سود خالص ۱۲ ماهه	شرکت (بیشترین زیان)	زیان خالص ۱۲ ماهه
سر. تامین اجتماعی	۲۶۹,۱۲۰	ایران خودرو	-۸۷,۱۷۵
فولاد مبارکه اصفهان	۲۴۶,۶۲۰	بانک سرمایه	-۷۳,۸۱۲
صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۲۱۶,۵۴۲	بانک ایران زمین	-۶۱,۱۵۶
ملی صنایع مس ایران	۲۰۹,۱۱۱	بانک آینده	-۵۷,۷۴۴
گل گهر	۱۱۲,۸۳۶	بانک شهر	-۳۲,۷۳۴
چادرملو	۱۱۰,۴۰۱	سایپا	-۳۱,۱۸۴

شرکت (بیشترین سود)	سود خالص ۱۲ ماهه	شرکت (بیشترین زیان)	زیان خالص ۱۲ ماهه
پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان	۱۰۶,۵۹۰	ایران خودرو دیزل	-۷,۹۹۲
سر. صبا تامین	۹۳,۴۳۵	تولید برق ماهتاب کهنوج	-۴,۵۳۰
بانک ملت	۹۱,۷۵۱	پارس خودرو	-۳,۱۱۳
پتروشیمی مارون	۸۴,۷۶۸	هیکو	-۱,۲۲۶

وضعیت پرداخت سود در سال ۹۹

مجموع سود پرداخت شده به ازای هر سهم (DPS) کل بازار (فقط شرکت‌هایی که سود پرداخت کردند) در سال ۱۳۹۹ برابر با ۴۴۸,۲۲۳ ریال می‌باشد که به صورت میانگین بازار به ازای هر شرکت (شامل شرکت‌هایی که سود پرداخت کردند و نکردند) ۹۳۲ ریال سود پرداخت کرده است.

همچنین در سال ۹۹ در مجموع بازار سرمایه ۲,۱۸۲,۲۴۹ هزار میلیارد ریال سود پرداخت کرده است.

بیشترین سود پرداختی به ازای هر سهم متعلق به شرکت پتروشیمی فن‌آوران به میزان ۱۶,۵۰۰ ریال و کمترین سود پرداختی متعلق به شرکت چرخشگر با میزان ۱ ریال بوده است.

• بیشترین و کمترین سود پرداختی به ازای هر سهم (ریال)

شرکت (بیشترین)	بیشترین سود پرداختی به ازای هر سهم	۱۰ شرکت (کمترین)	کمترین سود پرداختی به ازای هر سهم
پتروشیمی فن‌آوران	۱۶,۵۰۰	چرخشگر	۱
پتروشیمی زاگرس	۱۱,۰۰۰	سر. ایران خودرو	۲
بازرسی مهندسی و صنعتی ایران	۱۰,۶۰۰	نیروگاهی چهارم	۲
پتروشیمی نوری	۱۰,۰۰۰	محور خودرو	۲
پتروشیمی پارس	۹,۵۰۰	سر. مسکن شمالغرب	۲
پلیمر آریا ساسول	۸,۷۴۰	سر. صنعت پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲
شیرین دارو	۸,۵۳۰	کارتن ایران	۳
داروپخش	۸,۵۰۰	پتروشیمی داراب	۳
پتروشیمی پردیس	۶,۸۰۰	مهندسی حمل و نقل پتروشیمی	۳
پارس دارو	۶,۴۴۰	پتروشیمی فسا	۳

بیشترین درصد پرداخت سود متعلق به شرکت سر. توس گستر به میزان ۱۶۱ درصد و کمترین درصد پرداخت سود متعلق به شرکت بیمه سینا به میزان ۳/۶ درصد می‌باشد.

• بیشترین درصد سود پرداختی

درصد سود پرداختی	شرکت
٪۱۶۱	سر. توس گستر
٪۱۵۷	کربن ایران
٪۱۴۰	پتروشیمی بوعلی سینا
٪۱۳۶	سیمان فارس نو
٪۱۳۶	سیمان خوزستان
٪۱۳۵	شیشه و گاز
٪۱۳۴	سیمان سفید نی ریز
٪۱۳۲	سیمان غرب
٪۱۲۹	صنعتی بارز
٪۱۲۵	توسعه و عمران امید

• کمترین درصد سود پرداختی

درصد سود پرداختی	شرکت
٪۴	بیمه سینا
٪۴	بانک قرض الحسنه رسالت
٪۵	بانک ملت
٪۶	توسعه بازرگانی آهن و فولاد میلاد
٪۷	دشت مرغاب
٪۷	کارتن ایران
٪۸	بانک سامان
٪۸	پتروشیمی شیراز
٪۸	پگاه آذربایجان
٪۹	سر. ساختمانی نظام مهندسی ایران

بیشترین مجموع پرداخت سود سهام با ۲۰۹,۷۰۰ میلیارد ریال متعلق به شرکت سر.صباتامین می‌باشد و کمترین مجموع پرداخت سود سهام را شرکت سر. صنعت پتروشیمی ساختمان خلیج فارس به میزان ۵ میلیون ریال رقم زده‌است.

• بیشترین سود پرداختی (میلیارد ریال)

مجموع سود پرداختی	شرکت
۲۰۹,۷۰۰	سر. صبا تامین
۹۹,۸۷۶	صنایع پتروشیمی خلیج فارس
۹۶,۰۰۰	سر. تامین اجتماعی
۹۰,۰۰۰	پتروشیمی نوری
۸۰,۱۲۶	پلیمر آریا ساسول
۶۶,۹۶۰	گل گهر
۵۷,۰۰۰	پتروشیمی پارس
۵۱,۳۴۵	سر. نفت و گاز تامین
۵۰,۶۲۵	گسترش نفت و گاز پارسیان
۵۰,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران

• کمترین مجموع سود پرداختی (میلیون ریال)

مجموع سود پرداختی	شرکت
۵	سر. صنعت پتروشیمی ساختمان خلیج فارس
۳۵۲.۰۶۱۲	کارگزاران پارس
۴۹۶	تابان نیرو سپاهان
۶۰۰	مهندسی حمل و نقل پتروشیمی
۸۴۱.۴۸۲	محور خودرو
۹۵۲.۰۹۴۷	چرخشگر
۱۱۰۰	صنعتی روان فن آور
۱۲۹۶.۶۲۳	نیرو سرمایه
۲۰۰۰	سر. مسکن زاینده رود
۲۴۰۰	سر. مسکن شمالغرب

بازدهی شرکت‌ها و صنایع

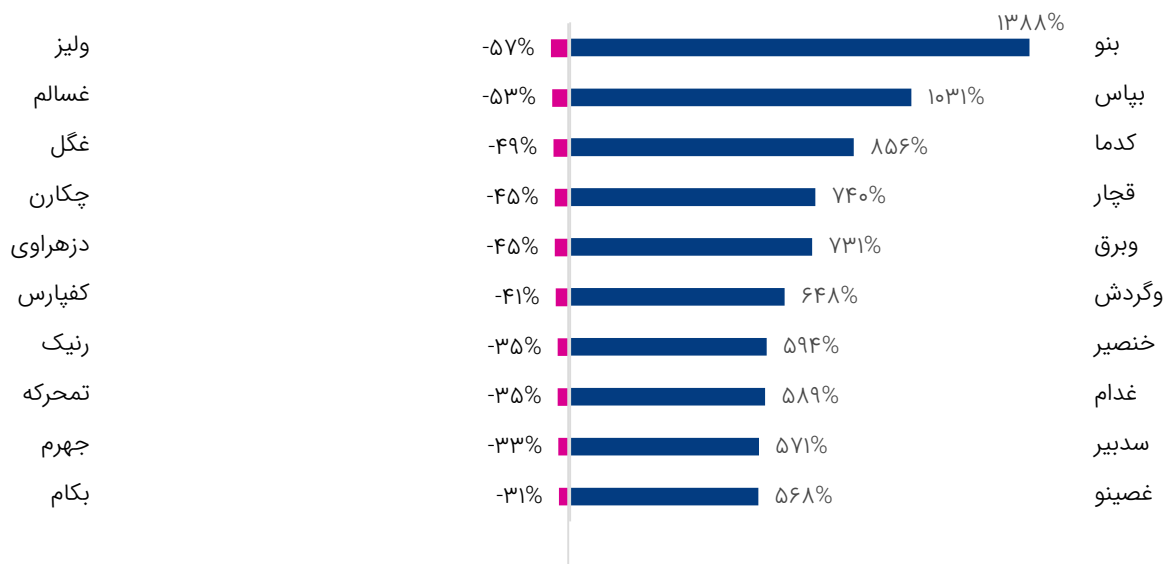
در ۱۲ ماهه اخیر تا نیمه اسفندماه ۹۹، ۷۴۶ شرکت در بازار بورس و فرابورس ایران فعال بوده‌اند. شاخص بورس و فرابورس و هم‌وزن در این مدت به ترتیب ۱۳۲٪ و ۱۵۸٪ و ۱۴۱٫۳٪ بازدهی مثبت داشته‌اند. وضعیت شرکت‌ها و صنایع در ۱۲ ماهه اخیر به ترتیب ذیل بوده است:

- ۵۸۷ شرکت بازدهی بالای ۱۵٪ (سود یکساله بدون ریسک) و ۲۳۱ شرکت بازدهی بیش از شاخص بورس داشته‌اند.
- تعداد ۶۳۹ شرکت (معادل ۸۶٪ از بازار) بازدهی مثبت داشته و بیشترین بازدهی مربوط به شرکت " بیمه تجارت نو" (۱۳۸۷٪)، " بیمه پاسارگاد" (۱۰۳۱٪) و " معدنی دماوند" (۸۵۶٪) بوده است.
- تعداد ۸۷ شرکت (معادل ۱۲٪ از بازار) بازدهی منفی داشته و بدترین بازدهی همراه با ضرر مربوط به شرکت " لیزینگ ایران" (-۵۷٪)، " سالمین" (-۵۳٪) و " گلوکوزان" (-۴۹٪) بوده است.
- صنایع " بیمه و بازنشستگی"، " فعالیت مهندسی، تجزیه، تحلیل و آزمایش فنی" و " محصولات چوبی" بالاترین بازدهی (بیش از ۱۷۰٪) را تجربه کرده‌اند، همچنین صنعت " محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری" با ۱۷٪- بازدهی منفی ضعیف‌ترین عملکرد را داشته است.

گزارش مفصلی از بازدهی شرکت‌ها و صنایع نیز در بخش بولتن سایت ره‌آورد ۳۶۵ در ابتدای هر ماه منتشر می‌شود.

نمودار ۱۰ شرکت با بیشترین بازدهی و ۱۰ شرکت با بدترین عملکرد نیز ارائه شده است.

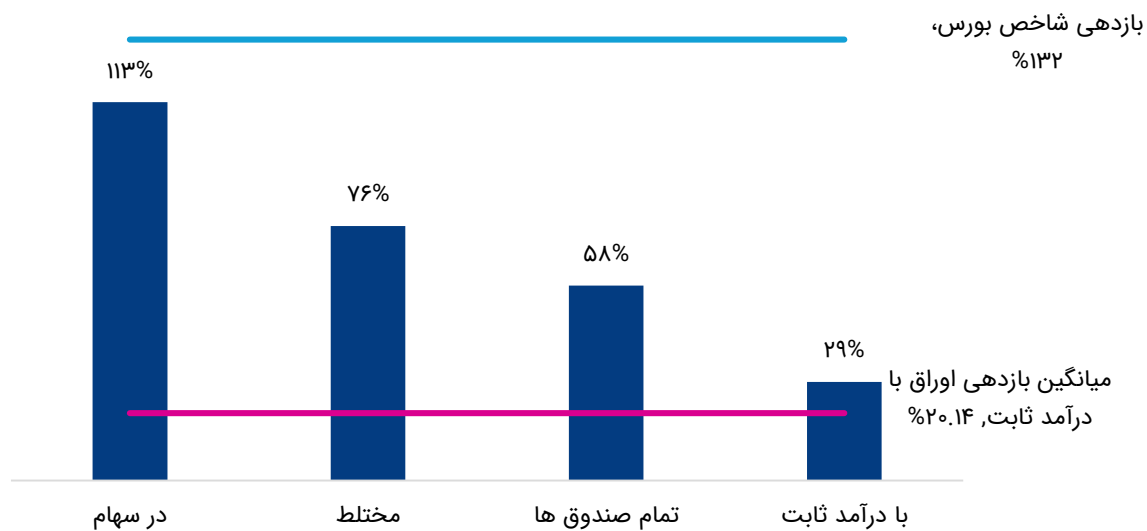
۱۰ شرکت با بیشترین بازدهی در سال ۹۹ ۱۰ شرکت کمترین بازدهی منفی در سال ۹۹



بازدهی صندوق‌ها و اوراق با درآمد ثابت

بازدهی سایر دارایی‌های مالی در بازار سرمایه در نمودار زیر ارائه شده است. یکی از گزینه‌های بسیار مناسب برای افراد علاقمند به سرمایه‌گذاری که تخصص کافی را ندارد، صندوق‌های سرمایه‌گذاری است. همانطور که مشاهده می‌کنید به طور متوسط صندوق‌های سهامی بازدهی بالایی و نزدیک به شاخص داشتند. صندوق‌های با درآمد ثابت نیز از متوسط اوراق با درآمد ثابت بازدهی بهتری داشتند. با توجه به بازدهی مطلوب صندوق‌ها و این موضوع که دارای مدیریت حرفه‌ای دارایی هستند، می‌توانند انتخاب کم‌ریسک‌تر و مطلوب‌تری برای افراد با دانش کمتر باشند.

بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری



آمار بسته شدن نمادهای معاملاتی در بازار سهام

حتماً تا به حال با بسته شدن نمادهای معاملاتی بازار سرمایه روبه‌رو شده‌اید و این امر می‌تواند متاثر از دلایل مختلفی برای سهم‌ها باشد، در این بخش گزارش خلاصه‌ای از تعداد دفعات بسته شدن نمادها را به تفکیک دلایل آن‌ها ارائه شده است.

همانطور که در جدول نشان داده شده ۷۱۲ مرتبه توقیفی حاصل شده است که در دسته‌های تعریف شده قرار نمی‌گرفتند. این تعداد بالای توقف به دلایل دیگر شاید نشان از کافی نبودن دسته‌های تعریف شده برای توقف نماد باشد. همچنین موضوع توقف‌های بدون دلیل از سمت ناظر یا اعمال رفتارهای سلیقه‌ای نیز جای بحث دارد.

تعداد	دلیل
۷۱۲	توقف به دلایل دیگر
۵۳۵	افشای اطلاعات با اهمیت
۳۶۰	نوسان قیمت بیش از ۵۰ درصد
۴۷۵	به دلیل مجمع عادی سالیانه

تعداد	دلیل
۲۱۰	به دلیل عدم کشف قیمت
۱۱۵	به دلیل مجمع عادی بطور فوق العاده
۱۰۶	به برگزاری مجمع فوق العاده (افزایش سرمایه)
۹۵	به دلیل برگزاری مجمع فوق العاده
۵۹	به دلیل عدم رعایت الزامات دستورالعمل اجرایی
۴۵	به دلیل مجمع فوق العاده (انتخاب هیئت مدیره)
۳۱	بررسی وضعیت اطلاعاتی ناشر
۲۳	به دلیل بررسی معاملات
۷	به دلیل توقف نماد اصلی
۱۰	به دلیل ابهام در ارائه اطلاعات
۱۰	به دلیل عدم رعایت الزامات دستور العمل پذیرش
۵	به دلیل رفع گره معاملاتی
۴	به دلیل عدم اظهار نظر حسابرس
۴	به دلیل اصلاح اساسنامه
۲	نوسان قیمت بیش از ۲۰ درصد
۲	به دلیل برگزاری مجمع عادی و فوق العاده
۱	انتقال به تابلوی زرد بازار پایه فرابورس
۱	به روز رسانی دارایی ها
۱	به دلیل عدم محاسبه صحیح دامنه نوسان
۱	به دلیل صدور رای بدوی ورشکستگی

Rahavard365.ocm

cbi.ir

tgju.org

آنچه مطالعه فرمودید محصولی از گروه تحقیق و توسعه شرکت (پردازش اطلاعات مالی مبنا) بود. این گزارش به صورت سالانه در اختیار علاقمندان قرار می‌گیرد. گزارش فوق در دو نسخه تهیه و تنظیم گشته است. نسخه‌ی اول شامل بررسی آمار و ارقام برخی از متغیرهای کلان اقتصاد جهانی، اهم کامودیتی‌ها، برابری ارزها و برخی رمز ارزها و نسخه‌ی دوم در بردارنده‌ی اطلاعات و وقایع بازار سرمایه ایران می‌باشد که به صورت چاپی و pdf تهیه شده‌اند. اطلاعات سالانه و تحلیل کلی برخی صنایع نیز به صورت یک گزارش جامع در فروردین ماه سال ۱۴۰۰، برای عموم کاربران بر بستر سایت ره آورد ۳۶۵ به آدرس rahavard365.com ارائه خواهد شد. گزارش دوره‌ای دیگری که به صورت منظم در هر ماه توسط گروه تحقیق و توسعه شرکت مبنا منتشر می‌شود، ماهنامه‌ی تخصصی بازار سرمایه نام دارد که شامل بررسی مفصل صنایع مختلف و سهام شرکت‌های منتخب می‌باشد. این گزارش به صورت ماهانه در اختیار علاقمندان قرار می‌گیرد که در سه شماره‌ی گذشته، صنایع پالایشی، فولاد و دارویی مورد بررسی قرار گرفته‌اند. صنایع و نمادها برای هر شماره‌ی ماهنامه، از طریق نظرسنجی در کانال تلگرام ره‌آورد ۳۶۵ انتخاب می‌شوند.