

## "تحولات بازار سرمایه در یازده ماهه سال ۱۴۰۱"

- شاخص کل "بورس اوراق بهادار تهران" و "فرا بورس" در بهمن ماه سال ۱۴۰۱ به ترتیب با ۹/۲ و ۶/۸ درصد کاهش نسبت به ماه قبل ارقام ۱۵۳۳۳۶۶ و ۲۰۰۴۳ را ثبت نمودند. وجود شوک های منفی در بازار و نوسان قیمت دلار در بازار آزاد از عوامل ریزش بازار سرمایه در بهمن ماه به شمار می رود. "شاخص کل هم وزن بورس اوراق بهادار تهران" که وزن یکسانی به تمامی صنایع (نمادها) می دهد در بهمن ماه سال ۱۴۰۱ نسبت به ماه قبل از آن با کاهش ۹/۴ درصدی همراه گردید. شاخص مذکور در یازده ماهه منتهی به بهمن ماه سال ۱۴۰۱ نسبت به دوره مشابه سال ۱۴۰۰ با رشد ۴۶/۶ درصدی همراه بوده است. لازم به ذکر است که بازدهی بالاتر شاخص هم وزن در یازده ماهه سال ۱۴۰۱ نسبت به مدت مشابه سال ۱۴۰۰ (۴۶/۶ درصد) در مقایسه با بازدهی شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران در این دوره (۱۹/۶ درصد) نشان دهنده بهبود بازدهی صنایع کوچک در مقایسه با بازدهی صنایع بزرگ می باشد.
- ارزش بازار سهام "بورس اوراق بهادار تهران" و "فرا بورس" در بهمن ماه سال ۱۴۰۱ نسبت به ماه گذشته به ترتیب با کاهش ۹/۶ و ۵/۲ درصدی ارقام ۵۶۵۰۵/۸ و ۱۵۳۵۷/۹ هزار میلیارد ریال را ثبت نمودند که نسبت به یازده ماهه سال ۱۴۰۰ با افزایش ۹/۸ و ۱۸/۵ درصدی همراه بوده اند.
- ارزش بازار بدهی "بورس اوراق بهادار تهران" و "فرا بورس" در بهمن ماه سال ۱۴۰۱ به ترتیب با افزایش ۶/۸ و ۰/۳ درصدی نسبت به ماه گذشته ارقام ۵۵۸/۸ و ۴۲۶۶/۵ هزار میلیارد ریال را به خود اختصاص داده اند که نسبت به یازده ماهه سال ۱۴۰۰ به ترتیب با رشد ۶۷/۰ و ۱۹/۰ درصدی همراه بوده اند.
- "مانده اوراق بدهی" در بازار فرا بورس به تفکیک ماهیت ناشر دولتی، شهرداری ها و شرکتی حاکی از آن است که در یازده ماهه سال ۱۴۰۱ نسبت به مدت مشابه سال ۱۴۰۰ به ترتیب با رشد ۱/۴، ۹۴/۴ و ۱۳۲/۷ درصدی مواجه بوده است. در این دوره سهم اوراق دولتی ۷۰/۴ درصد، سهم اوراق شهرداری ها ۳/۱ درصد و سهم اوراق شرکتی ۲۶/۶ درصد بوده است.
- "مجموع ارزش معاملات سهام در بازار بورس اوراق بهادار تهران" در یازده ماهه سال ۱۴۰۱ نسبت به دوره مشابه سال ۱۴۰۰ با افزایش ۵/۴ درصدی به ۸۶۴۷/۱ هزار میلیارد ریال رسید. حجم معاملات سهام در این دوره نسبت به دوره مشابه سال قبل تر از آن نیز با رشد ۳۵/۶ درصدی به ۱۷۵۱/۱ میلیارد سهم رسید.
- "مجموع تامین مالی از طریق بازار سرمایه" طی یازده ماهه سال ۱۴۰۱، با ۲۹/۳ درصد کاهش نسبت به مدت مشابه سال ۱۴۰۰ از ۵۹۸۴/۳ هزار میلیارد ریال به ۴۲۳۱/۰ هزار میلیارد ریال رسید. کاهش ۹۶/۸ درصدی ردیف "افزایش سرمایه شرکت های سهامی عام؛ از محل مازاد تجدید ارزیابی (مجوزهای ارائه شده)" در زیر گروه "سرمایه ای" عمده ترین عامل در کاهش تامین مالی از طریق بازار سرمایه در یازده ماهه سال ۱۴۰۱ نسبت به دوره مشابه سال ۱۴۰۰ تلقی می گردد<sup>(۱)</sup>.

۱- مجموع تامین مالی از طریق بازار سرمایه مجموع دو گروه "سرمایه ای" و "انتشار انواع ابزارهای تامین مالی" می باشند. لازم به ذکر است گروه "سرمایه" شامل "تاسیس شرکت های سهامی عام"، "افزایش سرمایه شرکت های سهامی عام (مجوزهای ارائه شده)"، "افزایش سرمایه شرکت های سهامی عام، از محل تجدید ارزیابی (مجوزهای ارائه شده)" و "عرضه اولیه سهام شرکت ها در بورس و فرا بورس" می باشد.