تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۱۴ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۴۹

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۴ شهریورماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات، کاهش خالص ورود پول حقیقی و افزایش نرخ بهره بدون ریسک همراه بوده است. این ترکیب نشان می‌دهد که اگرچه فعالیت و گردش نقدینگی در بازار اوراق افزایش یافته، اما جذابیت آن برای سرمایه‌گذاران حقیقی در مقایسه با روز قبل کاهش پیدا کرده است. از طرف دیگر، افزایش نرخ بهره بدون ریسک به معنای بالاتر رفتن بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران از دارایی‌های کم‌ریسک است و می‌تواند در صورت تداوم، هزینه تأمین مالی و نرخ تنزیل جریان‌های نقدی را افزایش داده و از جذابیت نسبی بازار سهام بکاهد.

بازار بدهی	شاخص کل صکوک	نرخ بهره بدون ریسک (درصد)	خالص ورود حقیقی به اوراق درآمد ثابت (هزار میلیارد ریال)	ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت (غیربلوکی) (میلیارد ریال)
روز جاری (معاملاتی)	۱۳۱۲.۷۷	۳۹.۹۱	۰.۱۹	۱۴۸.۸۹۸
روز گذشته (معاملاتی)	۱۳۱۱.۹۷	۳۸.۴۵	۰.۲۶	۴۷.۷۸۲
تغییرات (درصد)	+۰.۰۶	+۱.۴۶	-۲۴.۱	+۲۱۱.۶

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

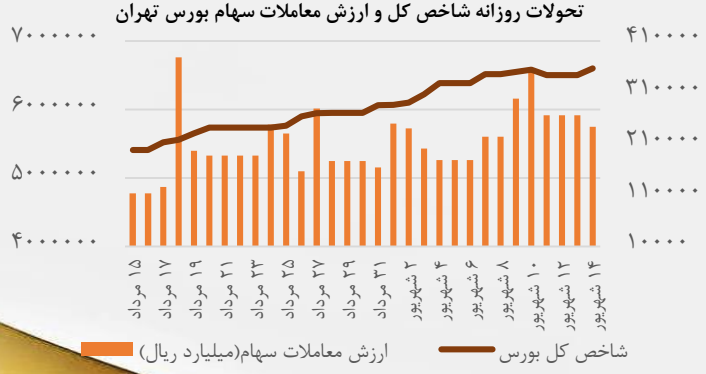
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
۵۱,۴۱۰	۱۰۶.۱	۲۴۲,۹۰۸	۱,۸۲۱,۸۹۱	۱,۱۰۰,۰۸۰	۶,۶۰۱,۲۹۹
۵۰,۸۳۴	۱۰۷.۲	۲۶۵,۳۹۰	۱,۷۹۸,۷۵۶	۱,۰۸۳,۸۶۸	۶,۵۰۴,۰۱۰
+۱.۱۳	-۱	-۸.۵	+۱.۲۹	+۱.۵۰	+۱.۵۰

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

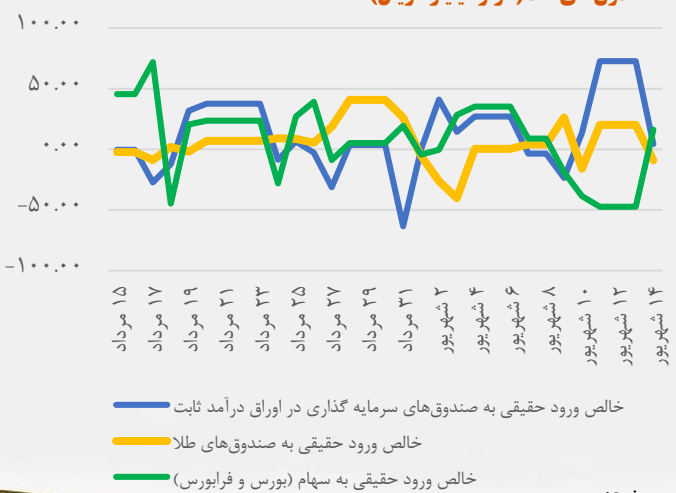
در روز معاملاتی جاری (۱۴ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران با بازگشت محسوس تقاضا همراه شد و شاخص کل با رشد حدود ۹۷ هزار واحدی، معادل ۱.۵ درصد، مجدداً به کانال ۶.۶ میلیون واحد وارد شد. شاخص هم‌وزن نیز حدود ۱.۳ درصد افزایش یافت که نشان‌دهنده گسترده بودن نسبی تقاضا در بازار بود. همچنین، پس از ۵ روز خروج متوالی، جریان پول حقیقی به سمت سهام بازگشت و افزایش تعداد صف‌های خرید، قدرت گرفتن سمت تقاضا را تأیید کرد.

این بهبود عمدتاً تحت تأثیر افزایش نرخ دلار و تقویت انتظارات تورمی شکل گرفت. رشد نرخ دلار از منظر افزایش ارزش ریالی درآمد و دارایی شرکت‌های صادرات‌محور، به‌ویژه صنایع کالایی، پتروشیمی و فلزی، محرک مثبتی برای بورس محسوب شد. در مقابل، تداوم ریسک‌های سیاسی و احتمال ذخیره‌سازی سود در سطوح بالای قیمتی همچنان از مهم‌ترین عوامل محدودکننده تداوم رشد بازار هستند.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



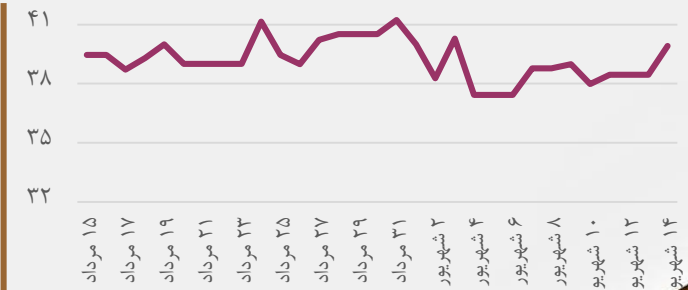
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق در آمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز معاملاتی جاری (۱۴ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۶.۳۲ و ۴.۴۲ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۹.۲۲ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

وزارت امور اقتصادی و دارایی، معاونت امور بانکی، بیمه و شرکت‌های دولتی، مرکز ملی تامین مالی

نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی

تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۱۴ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۴۹

تحولات بازار ارز

تحولات نرخ‌های دلار

قیمت (تومان)	نرخ دلار براساس درهم	نرخ حواله درهم	نرخ دلار هرات	نرخ حواله مرکز مبادله	نرخ دلار غیررسمی
روز جاری (معاملاتی)	۲۲۷,۷۹۷	۶۲,۰۷۰	۲۲۴,۳۱۰	۱۶۰,۵۰۲	۲۲۶,۴۰۰
روز گذشته (معاملاتی)	۲۲۲,۸۴۲	۶۰,۷۲۰	۲۱۹,۸۱۰	۱۶۰,۰۲۲	۲۲۰,۸۰۰
تغییرات (درصد)	+۲.۲۲	+۲.۲۲	+۲.۰۵	+۰.۳۰	+۲.۵۴

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز معاملاتی جاری (۱۴ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۵۴ درصدی همراه شد و به سطح ۲۲۶ هزار و ۴۰۰ تومان رسید. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۳ درصدی همراه شد.

در روز معاملاتی جاری، تصویر بازار دلار غیررسمی کاملاً صعودی بود. دلار در بازار غیررسمی در محدوده ۲۲۳ تا ۲۲۷ هزار تومان معامله شد و نسبت به پایان هفته قبل افزایش حدود ۶ هزار تومانی داشت. مهم‌ترین عامل این رشد، درگیری‌های نظامی در آب‌های منطقه، فشارهای تحریمی و افزایش نااطمینانی نسبت به چشم‌انداز روابط ایران و آمریکا بود. در فضای خبری روزهای اخیر، همزمانی فشار تحریم‌ها با ابهام در مسیر مذاکرات، انتظارات فعالان بازار را به سمت تقاضای احتیاطی ارز سوق داده است. اخبار اخیر نیز از تداوم فشارهای تحریمی و هزینه‌های اقتصادی ناشی از شرایط موجود حکایت دارند. افزایش همزمان قیمت طلا و سکه نیز نشان می‌دهد که بخشی از نقدینگی به سمت دارایی‌های پوشش‌دهنده ریسک تورم و کاهش ارزش پول ملی حرکت کرده است و لذا از این منظر نیز منجر به افزایش انتظارات افزایشی در بازار دلار غیررسمی شده است.

تحولات بازار سکه و طلا

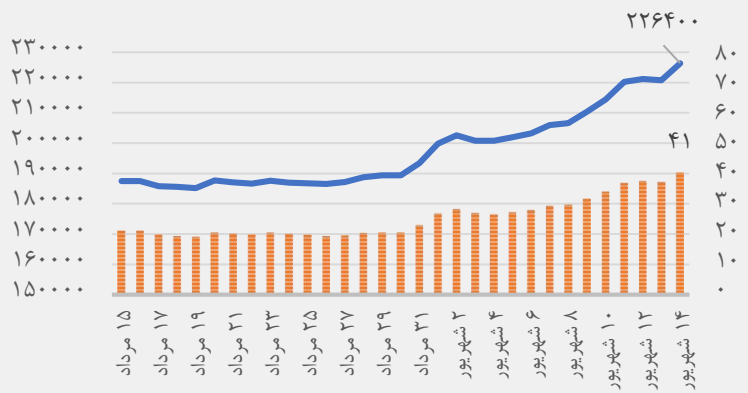
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

قیمت (میلیون تومان / دلار)	اونس جهانی نقره (دلار)	اونس جهانی طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (معاملاتی)	۶۶.۲۱	۴,۴۳۰	۰.۵۰۲	۳,۱۲۰	۲۳۲,۹۷	۲۳,۶۷	۲۳۷,۵۰
روز گذشته (معاملاتی)	۶۶.۲۱	۴,۴۳۰	۰.۴۸۷	۳,۰۱۶	۲۲۵,۰۳	۲۳,۵۲	۲۳۴,۰۱
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۳.۰۴	+۳.۴۷	+۳.۵۳	+۰.۶۶	+۱.۴۹

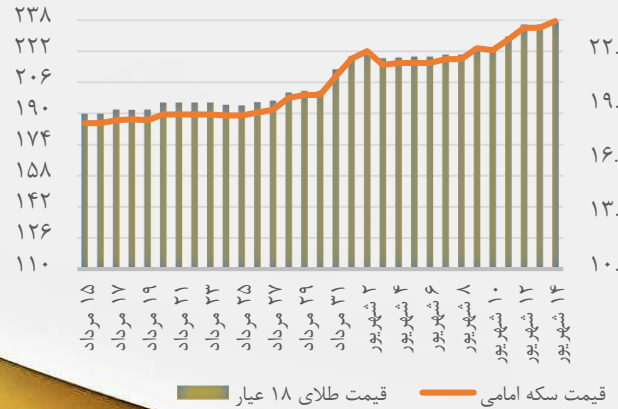
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز معاملاتی جاری (۱۴ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار با وجود ثبات قیمت اونس جهانی طلا. به ترتیب، حدود ۱.۴۹ و ۰.۶۶ درصد رشد را ثبت کردند. مهم‌ترین عامل این افزایش، رشد قیمت دلار در بازار غیررسمی بوده است.

تحولات روزانه نرخ دلار در بازار غیررسمی (تومان/درصد)



تحولات روزانه قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار (میلیون تومان)



وزارت امور اقتصادی و دارایی، معاونت امور بانکی، بیمه و شرکت‌های دولتی، مرکز ملی تامین مالی
نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی

تحولات بازار ارزهای دیجیتال

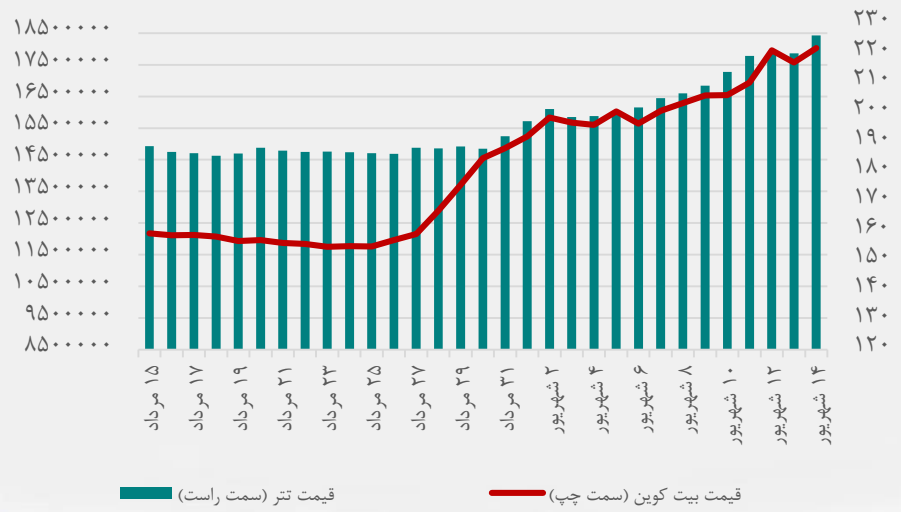
در روز معاملاتی جاری (۱۴ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با افزایش ۲.۵۶ و ۳.۶۷ درصدی همراه شدند. در روز جاری (برابر با ۵ سپتامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی در محدوده ۸۰ هزار دلار نوسان داشت و پس از صعود تا بالای ۸۲ هزار دلار، تحت فشار فروش قرار گرفت. مهم‌ترین عامل اثرگذار بر قیمت بیت‌کوین در این مقطع، چشم‌انداز سیاست پولی فدرال رزرو بود. اظهارات کریستوفر والر، عضو فدرال رزرو، در ۳ سپتامبر (۱۲ شهریورماه)، پیرامون امکان ثابت ماندن نرخ بهره در صورت بهبود تورم، انتظارات برای سیاست پولی انبساطی‌تر را تقویت کرد و همین موضوع به رشد دارایی‌های پرریسک، از جمله بیت‌کوین، کمک کرد. با این حال، انتشار گزارش اشتغال قوی‌تر از انتظار آمریکا در ۴ سپتامبر با افزایش احتمال تداوم نرخ‌های بهره بالا، موجب عقب‌نشینی بیت‌کوین از محدوده ۸۲ هزار دلار شد. از سوی دیگر، تشدید درگیری‌های آمریکا و ایران و افزایش ریسک ژئوپلیتیکی نیز فضای بازارهای جهانی را محتاط‌تر کرد. در ۵ سپتامبر (۱۴ شهریور)، درگیری میان نیروهای آمریکا و ایران در آب‌های منطقه و حمله آمریکا به سه نفتکش ایرانی، نگرانی درباره عرضه انرژی و افزایش قیمت نفت را تشدید کرد. افزایش قیمت نفت و احتمال تقویت تورم جهانی می‌تواند دست فدرال رزرو را برای کاهش نرخ بهره محدود کند. درنتیجه، این عامل از منظر سیاست پولی، در کوتاه‌مدت برای بیت‌کوین یک ریسک منفی محسوب می‌شود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۷۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۵ هزار و ۹۵۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری(معاملاتی)	۱۸.۰۲۳	۵۶۰.۰	۲۲۵,۹۵۰
روز گذشته(معاملاتی)	۱۷.۵۷۳	۵۴۰.۲	۲۱۹,۹۵۰
تغییرات (درصد)	+۲.۵۶	+۳.۶۷	+۲.۷۳

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



وزارت امور اقتصادی و دارایی، معاونت امور بانکی، بیمه و شرکت‌های دولتی، مرکز ملی تامین مالی
نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی