تحولات بازارهای مالی در روز یکشنبه مورخ ۱۵ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۰

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۵ شهریورماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت کاهش یافت و هم‌زمان خروج پول حقیقی از این بازار ثبت شد. این وضعیت نشان‌دهنده افزایش فشار فروش برای دارایی‌های کم‌ریسک و حرکت بخشی از نقدینگی به سمت بازار سهام است. در واقع، هم‌زمانی کاهش ارزش معاملات و خروج پول از اوراق با رشد قدرتمند بورس و افزایش ورود نقدینگی به سهام، از شکل‌گیری چرخش پرتفوی سرمایه‌گذاران به سمت دارایی‌های پرریسک‌تر حکایت دارد. از سوی دیگر، کاهش نرخ بهره بدون ریسک نیز با پایین آوردن نرخ بازده مورد انتظار از سرمایه‌گذاری‌های کم‌ریسک، می‌تواند جذابیت نسبی سهام را افزایش داده و به تداوم تقاضا در بازار سهام کمک کند.

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)	۱۳۱۵.۰۹	۳۸.۸۶	-۰.۲۸	۹۸.۹۳۰
روز گذشته (معاملاتی)	۱۳۱۲.۷۷	۳۹.۹۱	۰.۱۹	۱۴۸.۸۹۸
تغییرات (درصد)	+۰.۱۸	-۱.۰۵	-۲۴۳	-۳۳.۶

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

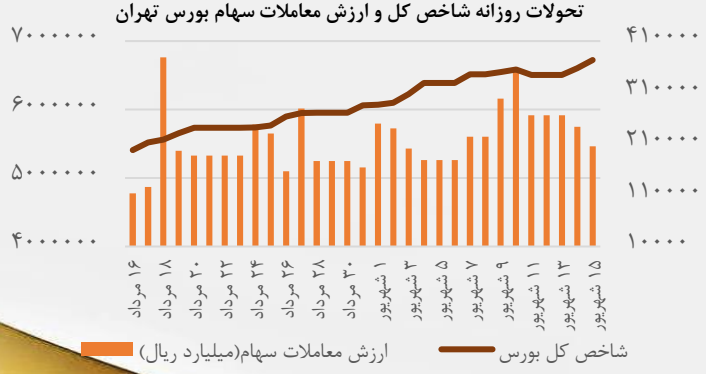
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
۵۲,۳۰۴	۷۸.۷۴	۲۰۵,۲۳۴	۱,۸۵۴,۴۵۰	۱,۱۱۹,۹۰۴	۶,۷۲۳,۵۷۶
۵۱,۴۱۰	۱۰۶.۱	۲۴۲,۹۰۸	۱,۸۲۱,۸۹۱	۱,۱۰۰,۰۸۰	۶,۶۰۱,۲۹۹
+۱.۷۴	-۲۵.۸	-۱۵.۵	+۱.۷۹	+۱.۸۰	+۱.۸۵

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

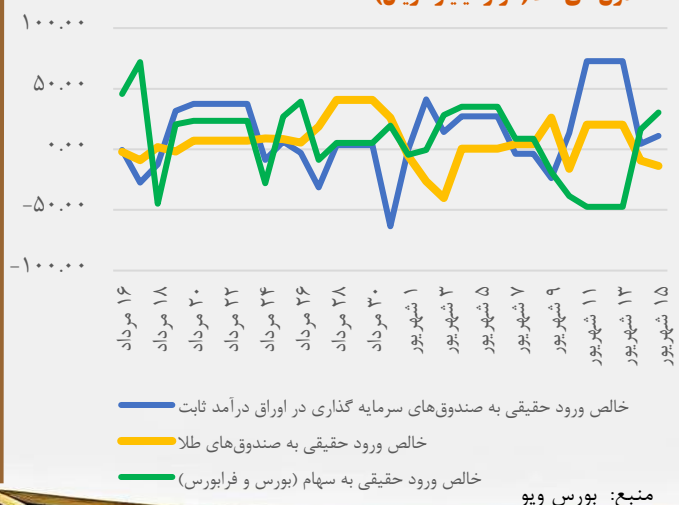
در روز معاملاتی جاری (۱۵ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران با تقویت محسوس تقاضا و رشد فراگیر شاخص‌ها همراه شد. شاخص کل با افزایش ۱.۸۵ درصدی وارد کانال ۶.۷ میلیون واحد شد و شاخص هم‌وزن نیز ۱.۷۹ درصد افزایش یافت؛ به‌گونه‌ای که حدود ۸۹ درصد نمادها در محدوده مثبت معامله شدند. همچنین ورود حدود ۳ همت پول حقیقی به سهام، بیانگر بهبود محسوس تقاضای سرمایه‌گذاران حقیقی بود.

این رشد عمدتاً تحت تأثیر افزایش نرخ دلار، تشدید انتظارات تورمی و چرخش بخشی از نقدینگی از بازارهای موازی مانند سکه و طلا به سمت سهام شکل گرفت. در این میان، گروه‌های معدنی، پتروشیمی، دارویی و پالایشی بیشترین جذب نقدینگی حقیقی را داشتند. از این‌رو، اگرچه معاملات روز جاری، نشانه‌ای از تقویت مومنتوم صعودی بورس بود، اما پایداری این روند همچنان به تداوم ورود نقدینگی، سطح ارزش معاملات و روند نرخ دلار وابسته است.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



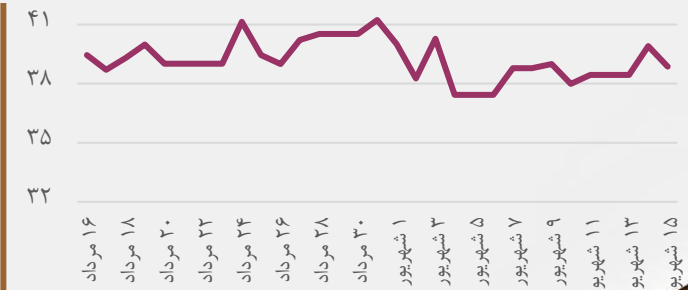
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



لازم به توجه است که در روز معاملاتی جاری (۱۵ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۰.۴۳ و ۱۱.۱۸ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۱۳.۶۳ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.

منبع: بورس ویو

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 یکشنبه مورخ ۱۵ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۰

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)	۲۲۵.۵۵۸	۶۱.۴۶۰	۲۲۳.۹۹۰	۱۶۱.۴۶۷	۲۲۳.۷۰۰
روز گذشته (معاملاتی)	۲۲۷.۷۹۷	۶۲.۰۷۰	۲۲۴.۳۱۰	۱۶۰.۵۰۲	۲۲۶.۴۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۹۸	-۰.۹۸	-۰.۱۴	+۰.۶۰	-۱.۱۹

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز معاملاتی جاری (۱۵ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۹۹ درصدی همراه شد و به سطح ۲۲۳ هزار و ۷۰۰ تومان رسید. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۶ درصدی همراه شد.

در روز معاملاتی جاری، دلار در ادامه روند صعودی روزهای قبل با افزایش قابل‌توجه تقاضا همراه شد و در ابتدای معاملات تا محدوده ۲۲۶ هزار تومان پیش رفت. با این حال، در ادامه بازار با افزایش عرضه و مقاومت در محدوده‌های بالاتر، عقب‌نشینی کرد و در محدوده ۲۲۳ تا ۲۲۴ هزار تومان قرار گرفت. این کاهش عمدتاً تحت تأثیر افزایش عرضه و مداخله بازارساز، کاهش تقاضای هیجانی پس از رشد قابل‌توجه روزهای گذشته و ذخیره‌سازی سود معامله‌گران در سطوح بالای قیمتی رخ داد. همچنین، تداوم رایزنی‌های دیپلماتیک منطقه‌ای برای کاهش تنش و احتمال ایجاد مسیر مذاکره، در کوتاه‌مدت از شدت تقاضای احتیاطی در بازار دلار غیررسمی کاست. با این حال، تداوم ریسک‌های سیاسی و انتظارات تورمی نشان می‌دهد که کاهش نرخ در این روز را باید بیشتر اصلاح کوتاه‌مدت قیمت پس از یک دوره صعودی دانست تا تغییر پایدار در روند بازار ارز.

تحولات بازار سکه و طلا

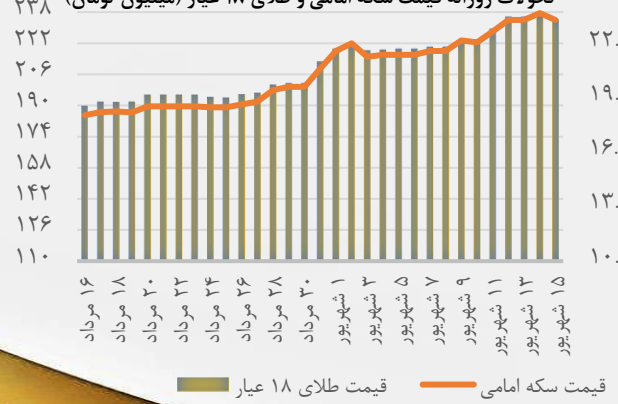
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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	۰.۴۹۳	۳.۰۹۰	۲۳۱.۱۰	۲۳.۳۵	۲۳۳.۹۹
روز گذشته (معاملاتی)	۶۶.۲۱	۴.۴۳۰	۰.۵۰۲	۳.۱۲۰	۲۳۲.۹۷	۲۳.۶۷	۲۳۷.۵۰
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۱.۸۰	-۰.۹۷	-۰.۸۰	-۱.۳۶	-۱.۴۸

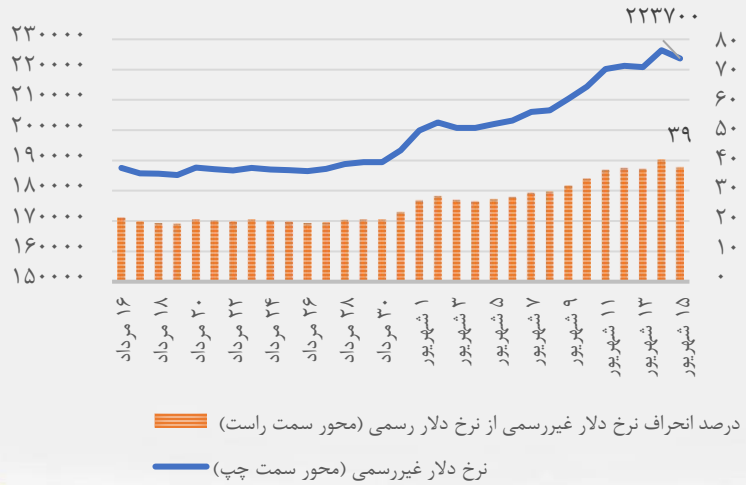
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز معاملاتی جاری (۱۵ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب با کاهش ۱.۴۸ و ۱.۳۶ درصدی همراه شدند. این کاهش در شرایطی رخ داد که اونس جهانی طلا در تعطیلات پایان هفته بازارهای جهانی تغییر محسوسی نداشت. از این‌رو، مهم‌ترین محرک بازار داخلی، اصلاح نرخ دلار و کاهش تقاضای هیجانی پس از رشد قابل‌توجه روزهای گذشته بود. در این میان، اقدام بانک مرکزی برای مدیریت بازار طلا و کاهش فشار تقاضای سرمایه‌ای نیز بر انتظارات بازار اثرگذار بود؛ به‌ویژه آنکه بانک مرکزی در ۱۵ شهریور اعلام کرد، برای نخستین‌بار از ۱۸ شهریور، ۱۰۰ هزار قطعه سکه تمام بهار آزادی را در قالب اوراق سلف موازی استاندارد تمام سکه و با سررسید سه‌ماهه از طریق بورس کالا عرضه خواهد کرد. این سیاست با فراهم‌کردن یک ابزار مالی جایگزین برای سرمایه‌گذاری در سکه، می‌تواند بخشی از تقاضای سرمایه‌ای را از بازار فیزیکی به بازار مالی منتقل کرده و از فشار تقاضا و شکل‌گیری حباب قیمتی در بازار سکه بکاهد.

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



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



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

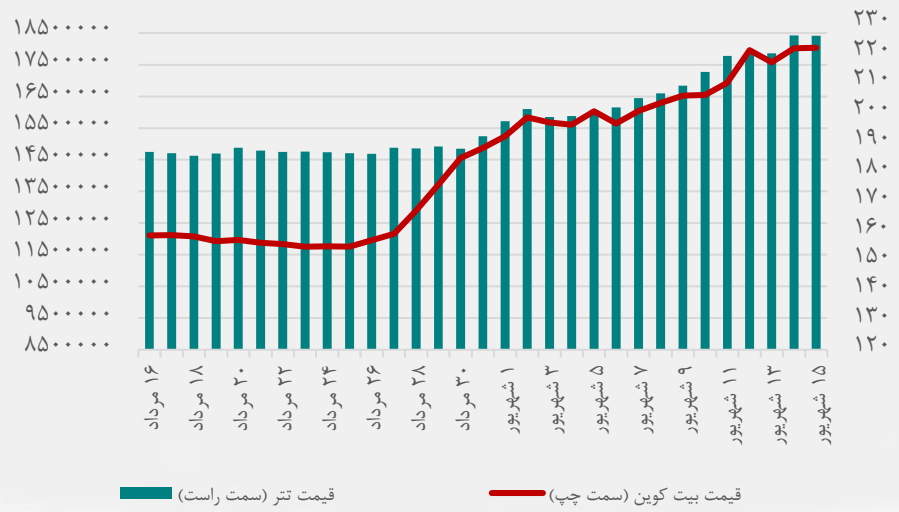
در روز معاملاتی جاری (۱۵ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با افزایش محدود ۰.۰۶ و ۰.۵۳ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت کوین با نوسانات محدود و افزایش جزئی در محدوده ۸۰ هزار دلار معامله شد. مهم‌ترین عامل حمایت‌کننده از قیمت، تداوم تقاضای نهادی و ورود پول به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین بود. در مقابل، انتشار گزارش اشتغال قوی آمریکا و افزایش احتمال افزایش نرخ بهره فدرال‌رزرو در نشست سپتامبر، مانعی برای رشد بیشتر این رمزارز محسوب شد. در مجموع، تقابل میان فشار ناشی از افزایش احتمال نرخ بهره و حمایت ناشی از تقاضای نهادی، موجب شد بیت‌کوین در ۱۵ شهریور عمدتاً در محدوده ۸۰ هزار دلار تثبیت شود و تغییرات قیمتی محدودی را تجربه کند.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، تقریبا ثابت و برابر با ۲۲۵ هزار و ۸۵۰ تومان بود.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری(معاملاتی)	۱۸.۰۳۵	۵۶۳.۰	۲۲۵.۸۵۰
روز گذشته(معاملاتی)	۱۸.۰۲۳	۵۶۰.۰	۲۲۵.۹۵۰
تغییرات (درصد)	+۰.۰۶	+۰.۵۳	-۰.۰۴

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