تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۱۶ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۱

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۶ شهریورماه ۱۴۰۵، در بازار اوراق بدهی با وجود کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت، افزایش ورود پول حقیقی و هم‌زمان کاهش نرخ بهره بدون ریسک اتفاق افتاد. این ترکیب نشان می‌دهد فشار تقاضا در بازار اوراق بیشتر شده و قیمت اوراق تقویت شده است؛ در نتیجه بازدهی مؤثر آنها کاهش یافته است. از سوی دیگر، کاهش نرخ بدون ریسک، جذابیت نسبی اوراق را در مقایسه با سهام کمتر کرده و می‌تواند یکی از عوامل مؤثر بر چرخش نقدینگی از دارایی‌های کم‌ریسک به سمت بازار سهام باشد؛ موضوعی که با ورود پول حقیقی به بورس در همین روز نیز هم‌جهت بوده است.

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)
۱۳۱۶.۶۳	۳۸.۰۲	۰.۱۶	۲۳.۷۸۶
۱۳۱۵.۰۹	۳۸.۸۶	-۰.۲۸	۹۸.۹۳۰
+۰.۱۲	-۰.۸۴	+۱۵۷.۵	-۷۶

روز جاری (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)
روز گذشته (۱۵ شهریور ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

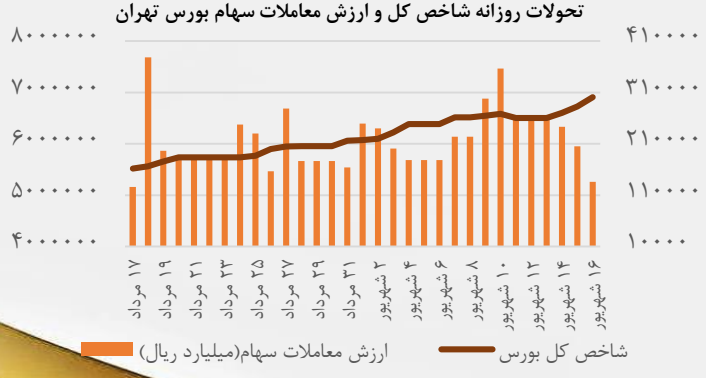
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
۵۳,۶۰۵	۳۶.۰۱	۱۳۶,۰۸۹	۱,۹۰۲,۴۵۴	۱,۱۵۰,۵۵۸	۶,۹۰۷,۶۱۷
۵۲,۳۰۴	۷۸.۷۴	۲۰۵,۲۳۴	۱,۸۵۴,۴۵۰	۱,۱۱۹,۹۰۴	۶,۷۲۳,۵۷۶
+۲.۴۹	-۵۴.۳	-۳۳.۷	+۲.۵۹	+۲.۷۴	+۲.۷۴

روز جاری (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)
روز گذشته (۱۵ شهریور ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

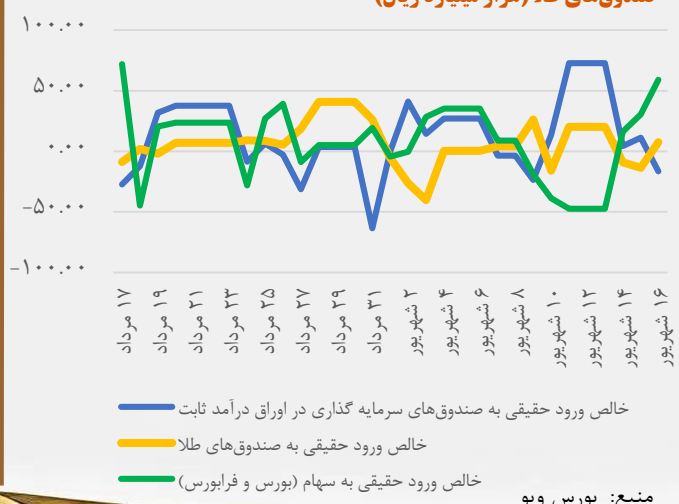
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران با رشد قدرتمندی همراه شد. شاخص کل ۲.۷۴ درصد و شاخص هم‌وزن ۲.۵۹ درصد افزایش یافت و حدود ۵.۹ همت پول حقیقی وارد بازار شد. مهم‌ترین عامل این صعود، تقویت تقاضا و افزایش ریسک‌پذیری سرمایه‌گذاران بود که با حرکت بخشی از نقدینگی از صندوق‌های درآمد ثابت به سمت سهام همراه شد. از سوی دیگر، انتظارات تورمی و جذابیت سهام شرکت‌های صادرات‌محور و کامودیتی‌محور، به‌ویژه پتروشیمی‌ها، فلزی‌ها و پالایشی‌ها، از تقاضا حمایت کرد. بیشترین ورود پول حقیقی نیز به همین گروه‌ها اختصاص داشت. در کنار این عوامل، رشد فراگیر بازار و مثبت بودن حدود ۹۷ تا ۹۹ درصد نمادها منجر به چشم‌انداز مثبت برای سرمایه‌گذاران و جذابیت بازار سهام شد. در مجموع، ترکیب ورود نقدینگی و انتظارات تورمی موجب شد، شاخص کل به محدوده ۶.۹ میلیون واحد برسد و در آستانه کانال ۷ میلیون واحدی قرار گیرد.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



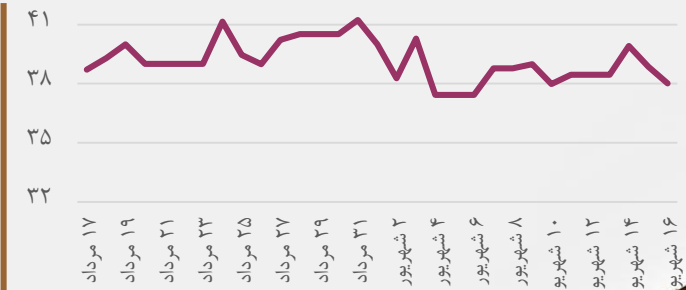
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۱۶ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۵۸.۹ و ۷.۵ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های طلا صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۱۶.۳۷ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) 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 دوشنبه مورخ ۱۶ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۱

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 (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۴,۶۷۷	۶۱,۲۲۰	۲۲۰,۷۶۰	۱۶۱,۴۶۷	۲۲۲,۷۰۰
روز گذشته (۱۵ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۵,۵۵۸	۶۱,۴۶۰	۲۲۳,۹۹۰	۱۶۰,۹۸۴	۲۲۳,۷۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۳۹	-۰.۳۹	-۱.۴۴	+۰.۳	-۰.۴۵

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۶ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۴۵ درصدی همراه شد و به سطح ۲۲۲ هزار و ۷۰۰ تومان رسید. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۳ درصدی همراه شد.

در روز جاری، دلار در بازار غیررسمی در مجموع با کاهش محدودی همراه بود و در پایان معاملات حوالی ۲۲۳ هزار تومان قرار گرفت. این افت را می‌توان عمدتاً اصلاحی و ناشی از تخلیه بخشی از هیجان خرید روزهای قبل دانست. کاهش نرخ در شرایطی رخ داد که دلار در روزهای پیشین تا محدوده ۲۲۶ هزار تومان صعود کرده بود. از این‌رو، با نزدیک‌شدن قیمت به سطوح بالاتر، بخشی از معامله‌گران اقدام به ذخیره‌سازی سود کردند. از سوی دیگر، سیگنال‌های سیاسی و دیپلماتیک مثبت و افزایش عرضه ارز از سوی سیاست‌گذار نیز به کاهش تقاضای احتیاطی کمک کرد. با این حال، تداوم ریسک‌های سیاسی و انتظارات تورمی باعث شد کاهش قیمت محدود بماند و دلار همچنان در سطوح بالای قیمتی معامله شود.

تحولات بازار سکه و طلا

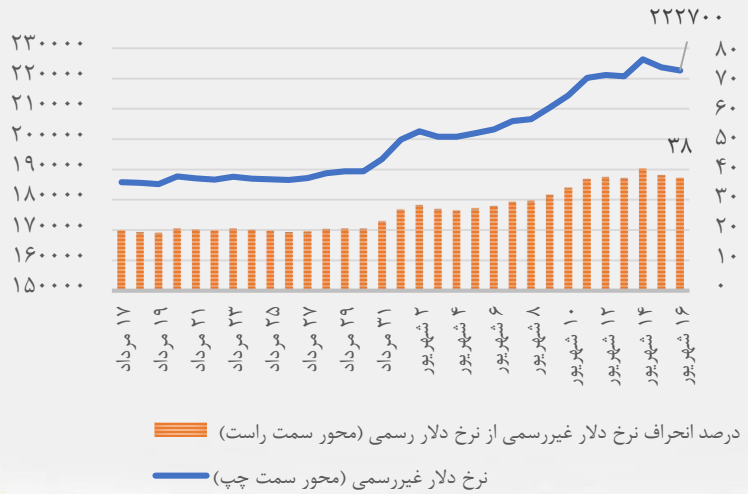
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۱۷	۴,۴۰۵	۰.۴۹۲	۳.۰۹۰	۲۲۷.۸۰	۲۳.۰۶	۲۳۰.۰۱
روز گذشته (۱۵ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۲۱	۴,۴۳۰	۰.۴۹۳	۳.۰۹۰	۲۳۱.۱۰	۲۳.۳۵	۲۳۳.۹۹
تغییرات (درصد)	-۰.۰۸	-۰.۵۷	-۰.۲۷	۰.۰	-۱.۴۳	-۱.۲۵	-۱.۷۰

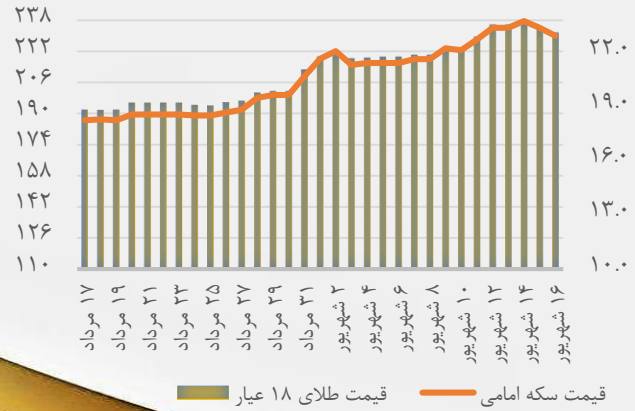
در روز جاری (۱۶ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۱.۷ و ۱.۲۵ درصد کاهش یافتند. مهم‌ترین عامل این افت، کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی در کنار کاهش قیمت اونس جهانی طلا بوده است.

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

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

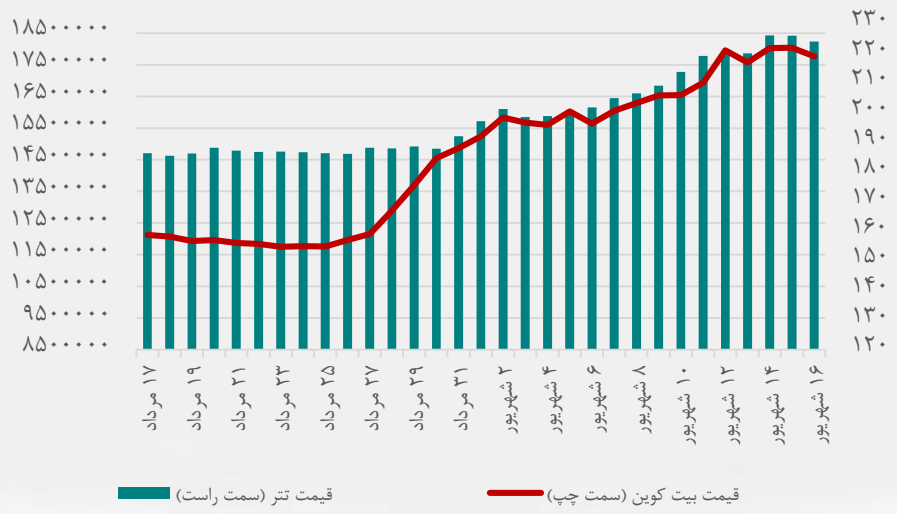
در روز جاری (۱۶ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با کاهش ۱.۵۲ و ۰.۹ درصدی همراه شدند. بیت‌کوین در این روز عمدتاً نوسانی و نزولی بود و در محدوده ۷۸ تا ۸۰ هزار دلار معامله شد. این درحالی است که بیت‌کوین در روزهای قبل تا بالای ۸۰ هزار دلار صعود کرده بود، اما پس از انتشار گزارش اشتغال قوی آمریکا، بخشی از خود را پس داد. مهم‌ترین فشار بر قیمت بیت‌کوین از افزایش احتمال سیاست پولی انقباضی‌تر فدرال رزرو ناشی شد. ایجاد ۱۶۲ هزار شغل در آمریکا در ماه اوت، بسیار بالاتر از انتظارات، احتمال افزایش نرخ بهره در نشست ۱۶ سپتامبر را به حدود ۶۰ درصد رساند و موجب افزایش بازده اوراق خزانه و تقویت دلار شد. از سوی دیگر، تشدید تنش‌های آمریکا و ایران و افزایش قیمت نفت نیز با بالا بردن نگرانی‌های تورمی، فشار مضاعفی بر بازار رمزارز وارد کرد. با این حال، تداوم ورود پول به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین و تقاضای نهادی مانع از افت شدیدتر قیمت شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۸۲ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۴ هزار تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۴,۰۰۰	۵۵۷.۹	۱۷.۷۶۱
روز گذشته (۱۵ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۵,۸۵۰	۵۶۳.۰	۱۸.۰۳۵
تغییرات (درصد)	-۰.۸۲	-۰.۹۰	-۱.۵۲

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی