تحولات بازارهای مالی در روز سه شنبه مورخ ۱۷ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۲

تحولات بازار سرمایه

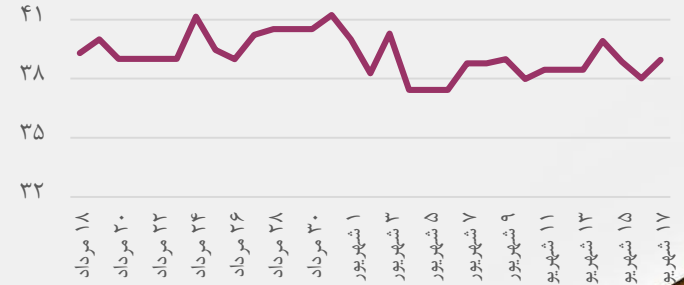
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۷ شهریورماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت همراه شد، اما هم‌زمان خالص ورود پول حقیقی کاهش و نرخ بهره بدون ریسک افزایش یافت. این ترکیب نشان می‌دهد که اگرچه حجم فعالیت در بازار بدهی بیشتر شده، اما افزایش ارزش معاملات الزاماً به معنای تقویت تقاضای سرمایه‌گذاران حقیقی نبوده و بخشی از منابع همچنان به سمت بازار سهام در حال حرکت بوده است؛ به‌ویژه اینکه در همین روز ورود پول حقیقی به سهام و خروج از صندوق‌های درآمد ثابت گزارش شد. از سوی دیگر، افزایش نرخ بهره بدون ریسک نشان‌دهنده بالا رفتن بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران و افزایش هزینه فرصت سرمایه‌گذاری در سهام است که می‌تواند بر جذابیت بازار سهام تاثیر منفی بگذارد.

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)
۱۳۱۷.۰۴	۳۸.۹۵	روز جاری (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۰.۰۰۹	۶۰.۱۵۷
۱۳۱۶.۶۳	۳۸.۰۲	روز گذشته (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۰.۱۶	۲۳.۷۸۶
+۰.۰۳	+۰.۹۳	تغییرات (درصد)	-۹۴.۵	+۱۵۲.۹

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

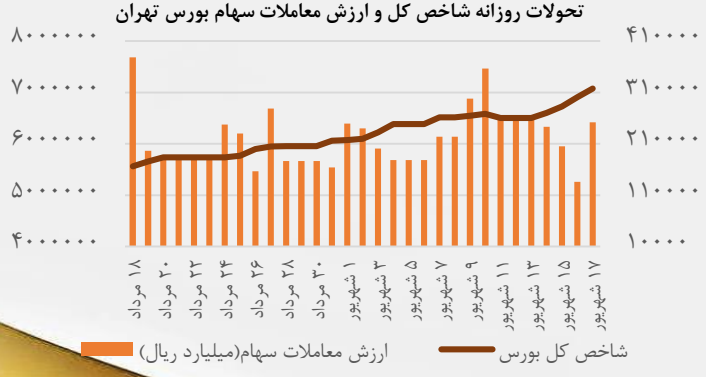
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۵۴,۶۶۱	۸۷.۰۷	۲۵۱,۹۸۶	۱,۹۳۶,۶۴۳	۱,۱۷۸,۰۷۹	۷,۰۷۴,۹۴۵	روز جاری (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)
۵۳,۶۰۵	۳۶.۰۱	۱۳۶,۰۸۹	۱,۹۰۲,۴۵۴	۱,۱۵۰,۵۵۸	۶,۹۰۷,۶۱۷	روز گذشته (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)
+۱.۹۷	+۱۴۱.۸	+۸۵.۲	+۱.۸۰	+۲.۳۹	+۲.۴۲	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

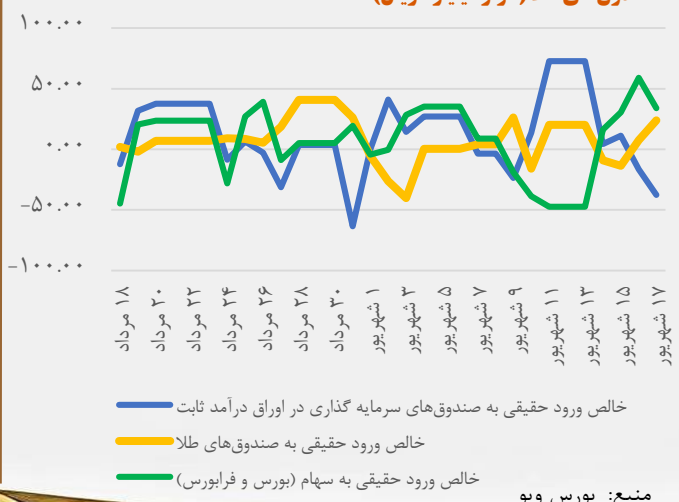
در روز معاملاتی جاری (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران به روند صعودی خود ادامه داد و شاخص کل با رشد ۲.۴۲ درصدی برای نخستین‌بار از مرز ۷ میلیون واحد عبور کرد. شاخص هم‌وزن نیز ۱.۸ درصد افزایش یافت که نشان‌دهنده فراگیری نسبی رشد در بازار بود. هم‌زمان، ورود حدود ۳.۴ همت پول حقیقی و افزایش ارزش معاملات، مهم‌ترین پشتوانه این صعود بودند.

در مجموع، معاملات این روز بیانگر تقویت مومنتوم صعودی و افزایش ریسک‌پذیری سرمایه‌گذاران بود. با این حال، عقب‌نشینی شاخص از سقف روزانه نشان داد که در سطوح بالای تاریخی، احتمال فروش و ذخیره‌سازی سود نیز در حال افزایش است. از این‌رو، تداوم ورود نقدینگی و حفظ ارزش معاملات بالا، برای تثبیت شاخص بالای کانال ۷ میلیون واحد اهمیت زیادی دارد.

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 (۱۷ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۴.۰۴ و ۲۳.۸ 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 ۳۷.۵۹ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) اتفاق افتاده است.

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 سه شنبه مورخ ۱۷ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۲

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 (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۰.۲۱۹	۶۲.۷۳۰	۲۲۶.۴۹۰	۱۶۱.۹۵۱	۲۲۸.۲۰۰
روز گذشته (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۴.۶۷۷	۶۱.۲۲۰	۲۲۰.۷۶۰	۱۶۱.۴۶۷	۲۲۲.۷۰۰
تغییرات (درصد)	+۲.۴۷	+۲.۴۷	+۲.۶۰	+۰.۳۰	+۲.۴۷

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۷ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۴۷ درصدی همراه شد و به سطح ۲۲۸ هزار و ۲۰۰ 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، قیمت دلار در بازار غیررسمی عمدتاً روندی صعودی داشت و در محدوده ۲۲۳ تا ۲۲۸ هزار تومان معامله شد. به‌طوری‌که گزارش‌ها قیمت پایانی را حدود ۲۲۸ هزار هزار تومان ثبت کردند. از منظر عوامل اثرگذار، تحریم‌های جدید آمریکا علیه بخش هوانوردی ایران، تداوم تنش‌های منطقه‌ای و ابهام در مسیر مذاکرات مهم‌ترین عوامل تقویت‌کننده تقاضای احتیاطی ارز بودند. در همین روز، اظهارات مقامات ایرانی درباره تداوم اختلافات با آمریکا و مشروط بودن بازگشت به وضعیت عادی به پایبندی طرف آمریکایی به تعهدات، چشم‌انداز روشنی از کاهش ریسک سیاسی ایجاد نکرد. در مقابل، افزایش عرضه ارز و فشار فروش در محدوده‌های بالاتر مانع از جهش شدیدتر دلار شد؛ به همین دلیل می‌توان رفتار روز جاری دلار غیررسمی را بیشتر صعودی همراه با نوسان و مقاومت قیمتی ارزیابی کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

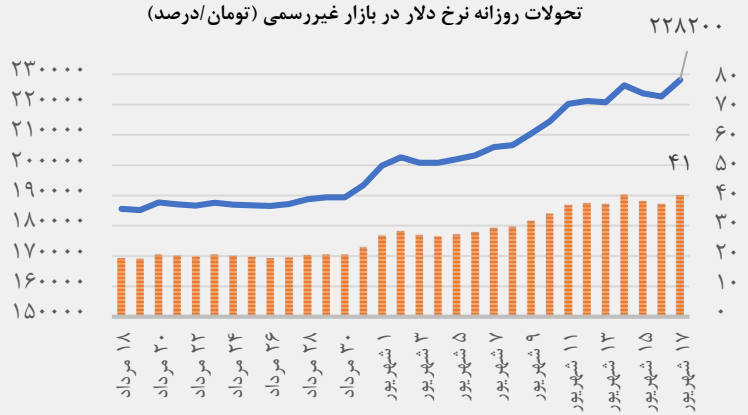
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۶۵.۵۹	۴.۳۵۰	۰.۵۰۱	۳.۱۰۱	۲۳۱.۶۸	۲۳.۶۲	۲۳۵
روز گذشته (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۱۷	۴.۴۰۵	۰.۴۹۲	۳.۰۹۰	۲۲۷.۸۰	۲۳.۰۶	۲۳۰.۰۱
تغییرات (درصد)	-۰.۸۶	-۱.۲۵	+۱.۸۹	+۰.۳۶	+۱.۷۱	+۲.۴۳	+۲.۱۷

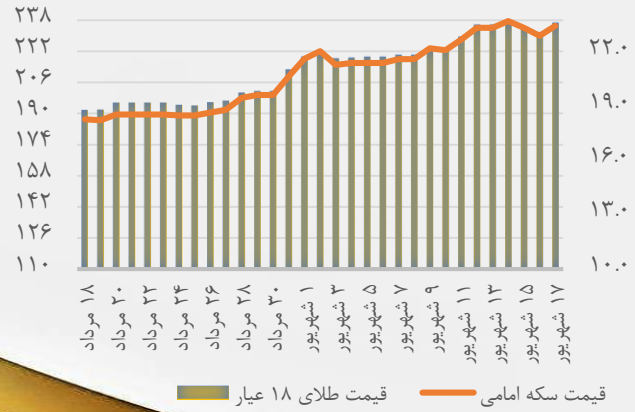
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۱۷ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار با وجود کاهش قیمت اونس جهانی طلا. در مجموع به ترتیب، حدود ۲.۱۷ و ۲.۴۳ درصد رشد را ثبت کردند. مهم‌ترین عامل این افزایش، افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی بوده است. به‌نحوی که اثر افزایش این نرخ بر اثر کاهش قیمت اونس جهانی طلا غلبه کرده و در مجموع منجر به افزایش قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا شده 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

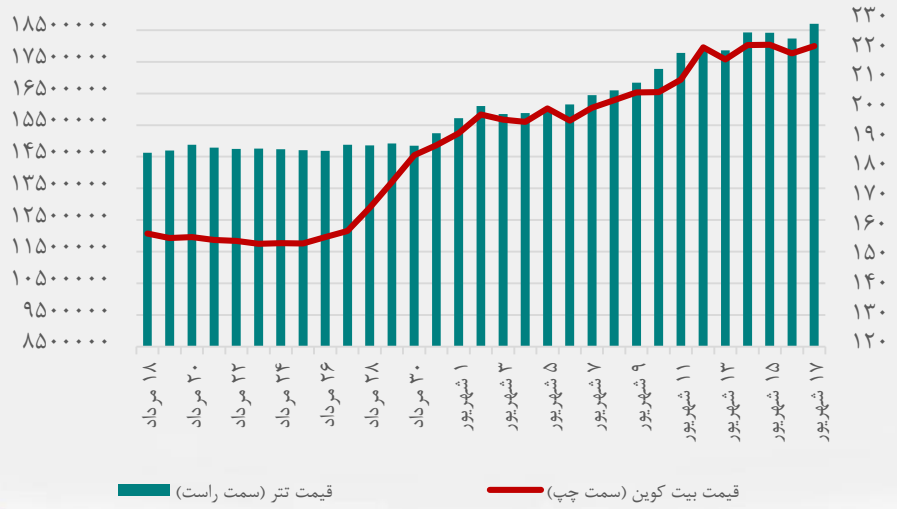
در روز جاری (۱۷ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با افزایش ۱.۳۱ و ۲.۱۳ درصدی همراه شدند. در روز جاری، بیت‌کوین در بازار جهانی با فشار فروش مواجه شد و قیمت آن در محدوده ۷۸.۵ هزار دلار قرار گرفت. گزارش‌ها کاهش حدود ۰.۹ درصدی را نشان می‌دهند. افزایش قیمت نفت و تشدید تنش‌های ژئوپلیتیکی در کنار افزایش انتظارات برای بالا ماندن نرخ بهره فدرال رزرو، فضای ریسک‌گریزی را در بازارهای جهانی تقویت کرد و قیمت آن را کاهش داد. با این حال، قیمت ریالی بیت‌کوین افزایش یافت. علت اصلی این واگرایی، رشد هم‌زمان نرخ دلار در بازار غیررسمی بود. درواقع، افت قیمت جهانی بیت‌کوین در این روز به اندازه‌ای نبود که اثر افزایش نرخ دلار بر ارزش ریالی آن را خنثی کند. در نتیجه، برای سرمایه‌گذار ایرانی بازده بیت‌کوین الزاماً تابع قیمت دلاری آن نیست و ترکیب قیمت جهانی بیت‌کوین و نرخ دلار داخلی تعیین‌کننده ارزش ریالی آن است. در مجموع، می‌توان گفت، قیمت بیت‌کوین در ۱۷ شهریور در بازار جهانی وارد فاز اصلاحی کوتاه‌مدت شد، اما افزایش نرخ دلار غیررسمی باعث شد این کاهش در بازار ایران به افزایش قیمت ریالی تبدیل شود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۱۹ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۸ هزار و ۹۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۱۷.۹۹۳	۵۶۹.۸	۲۲۸.۹۰۰
روز گذشته (۱۶ شهریور ۱۴۰۵)	۱۷.۷۶۱	۵۵۷.۹	۲۲۴.۰۰۰
تغییرات (درصد)	+۱.۳۱	+۲.۱۳	+۲.۱۹

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