تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۱۸ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۳

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۸ شهریورماه ۱۴۰۵، در بازار اوراق بدهی، همزمان با رشد ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت، نرخ بهره بدون ریسک نیز افزایش یافت و ورود قابل‌توجه پول حقیقی به این بازار ثبت شد. این هم‌زمانی نشان می‌دهد بخشی از نقدینگی به سمت کسب بازدهی با ریسک کم‌تر حرکت کرده است. از منظر تحلیلی، افزایش نرخ بهره بدون ریسک در کنار رشد ارزش معاملات اوراق، بیانگر تقویت جذابیت نسبی بازار بدهی است. موضوعی که می‌تواند در کوتاه‌مدت بخشی از منابع سرمایه‌گذاران را از بازار سهام به سمت ابزارهای کم‌ریسک‌تر سوق دهد.

بازار بدهی			
نرخ بهره بدون ریسک (درصد)	خالص ورود حقیقی به اوراق درآمد ثابت (هزار میلیارد ریال)	ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت (غیربلوکی) (میلیارد ریال)	
۴۰.۵۵	۶۴.۹	۷۰,۹۸۵	روز جاری (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)
۳۸.۹۵	۰.۰۰۹	۶۰,۱۵۷	روز گذشته (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)
+۱.۶۰	+۷۳۸.۰۳۸	+۱۸	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

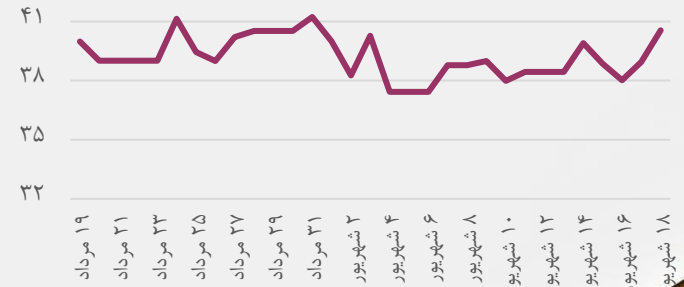
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۵۵,۲۲۰	۸۷.۸۴	۲۸۸,۱۱۲	۱,۹۴۲,۳۱۹	۱,۱۸۵,۹۶۴	۷,۱۲۲,۲۹۷	روز جاری (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)
۵۴,۶۶۱	۸۷.۰۷	۲۵۱,۹۸۶	۱,۹۳۶,۶۴۳	۱,۱۷۸,۰۷۹	۷,۰۷۴,۹۴۵	روز گذشته (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)
+۱.۰۲	+۰.۹	+۱۴.۳	+۰.۲۹	+۰.۶۷	+۰.۶۷	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

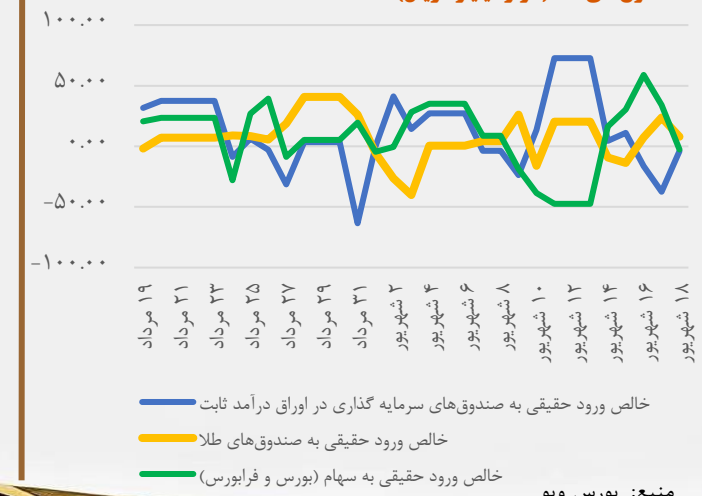
در روز معاملاتی جاری (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)، روند صعودی بورس تهران ادامه یافت، اما شتاب رشد نسبت به روزهای ابتدایی هفته کاهش پیدا کرد. شاخص کل با افزایش معادل ۰.۶۷ درصدی، به ۷ میلیون و ۱۲۲ هزار واحد رسید و شاخص هم‌وزن نیز ۰.۲۹ درصد افزایش یافت. با وجود رشد شاخص‌ها، خروج حدود ۰.۲۷ همت پول حقیقی نشان داد که بخشی از سرمایه‌گذاران در سطوح فعلی اقدام به ذخیره‌سازی سود کرده‌اند. در مقابل، ارزش معاملات در سطح بالایی قرار داشت و ورود نقدینگی به گروه‌های فلزی، فولادی و فرآورده‌های نفتی از تداوم تقاضا در نمادهای بزرگ و کالامحور حکایت داشت. هم‌زمان، تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های طلا و نقره نشان‌دهنده حفظ تقاضا برای دارایی‌های پوشش‌دهنده ریسک بود. در مجموع، معاملات این روز بیانگر ادامه روند صعودی بازار، اما با کاهش شتاب رشد و افزایش نسبی فشار عرضه و احتیاط سرمایه‌گذاران بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

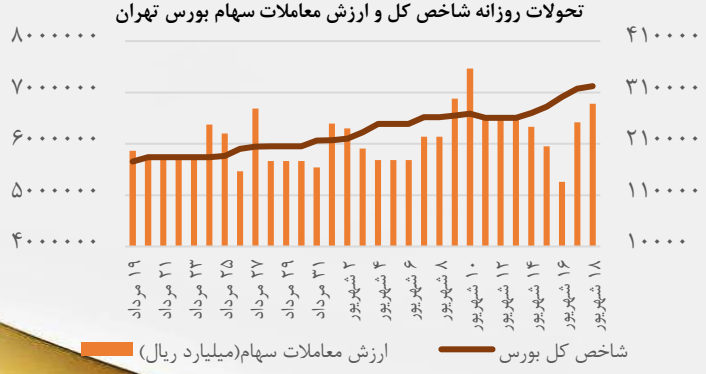
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۱۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۲.۶۶ و ۳.۹۱ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی به ترتیب از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۷.۸۱ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های طلا صورت گرفته است.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



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 چهارشنبه مورخ ۱۸ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۳

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 (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۶,۴۵۸	۶۴,۴۳۰	۲۳۲,۱۹۰	۱۶۲,۴۳۷	۲۳۴,۴۰۰
روز گذشته (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۰,۲۱۹	۶۲,۷۳۰	۲۲۶,۴۹۰	۱۶۱,۹۵۱	۲۲۸,۲۰۰
تغییرات (درصد)	+۲.۷۱	+۲.۷۱	+۲.۵۲	+۰.۳۰	+۲.۷۲

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۷۲ درصدی همراه شد و به سطح ۲۳۴ 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 جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی با افزایش قابل‌توجهی همراه شد و در جریان معاملات از مرز ۲۳۴ هزار تومان عبور کرد و رکورد جدیدی ثبت کرد. مهم‌ترین محرک این افزایش، تشدید نااطمینانی سیاسی و امنیتی بود. در روز جاری، خبرهایی درخصوص افزایش تنش میان ایران و آمریکا در منطقه، از جمله تبادل آتش در محدوده تنگه هرمز مخابره شد و هم‌زمان موضوع تحولات هسته‌ای ایران و مواضع آژانس بین‌المللی انرژی اتمی نیز در کانون اخبار قرار داشت. گزارش‌های رسانه‌ای از تصویب قطعنامه شورای حکام علیه ایران و افزایش نگرانی‌ها درباره پیامدهای این تحولات خبر دادند. این مجموعه اخبار، با افزایش ریسک ادراک‌شده، تقاضای احتیاطی برای ارز را تقویت کرد. از سوی دیگر، گزارش‌های رسانه‌ای نشان دادند که بانک مرکزی همچنان از طریق عرضه ارز و سیاست‌های ارزی در تلاش برای مدیریت بازار بود. با این حال، شدت انتظارات و تقاضای احتیاطی در بازار غیررسمی در این روز بر اثر سیاست‌های مداخله‌ای غلبه کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

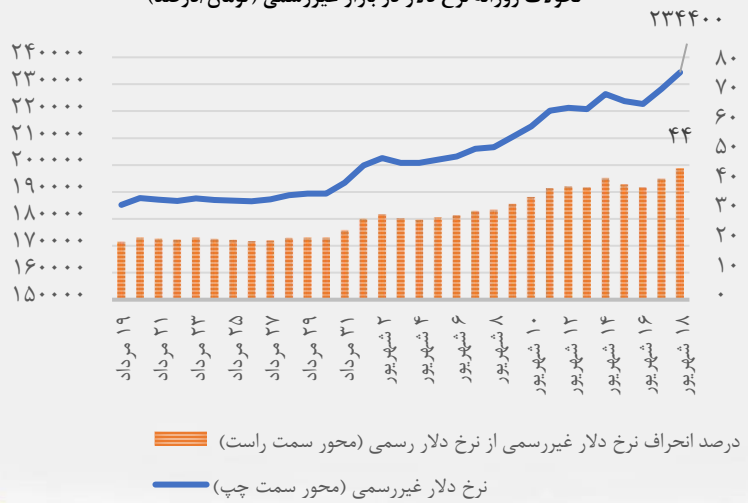
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	قیمت (میلیون تومان / دلار)						
	سکه امامی	طلای ۱۸ عیار	گواهی سپرده سکه	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده شمش نقره	اونس جهانی طلا (دلار)	اونس جهانی نقره (دلار)
روز جاری (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)	۲۴۲.۰۱	۲۴.۳۴	۲۳۷.۹۴	۳.۱۸۷	۰.۵۱۷	۴,۴۰۲	۶۷.۲۸
روز گذشته (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۵	۲۳.۶۲	۲۳۱.۶۸	۳.۱۰۱	۰.۵۰۱	۴,۳۵۶	۶۵.۷۷
تغییرات (درصد)	+۲.۹۹	+۳.۰۴	+۲.۷	+۲.۷۸	+۳.۲۴	+۱.۰۵	+۲.۳۱

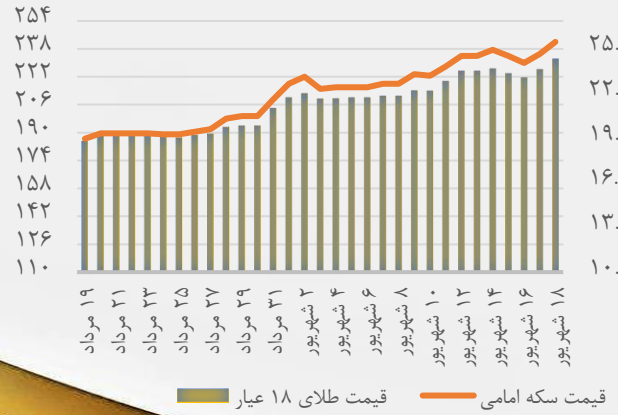
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۱۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۲.۹۹ و ۳.۰۴ درصد رشد را ثبت کردند. مهم‌ترین عامل این افزایش، جهش قیمت دلار در بازار غیررسمی در کنار افزایش قیمت اونس جهانی طلا 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

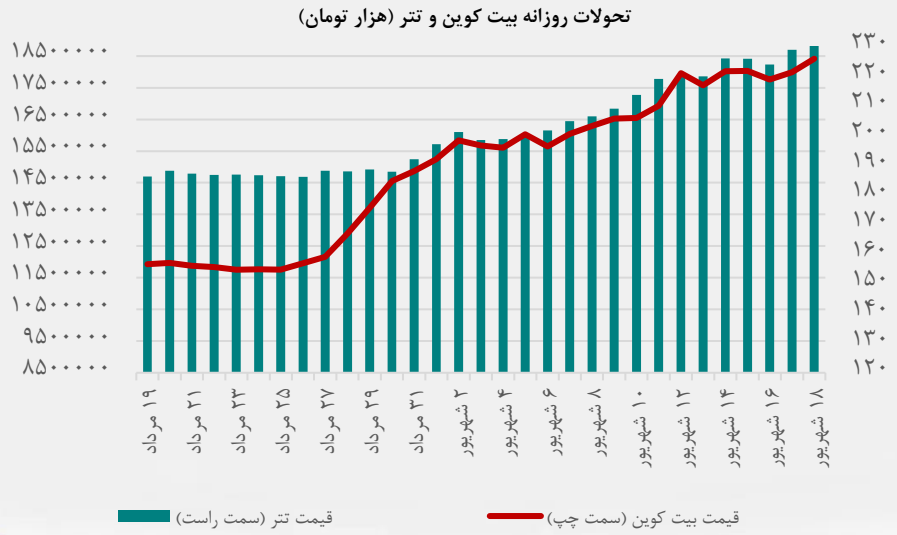
تحولات بازار ارزهای دیجیتال

در روز جاری (۱۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با افزایش ۲.۳۶ و ۱.۹۴ درصدی همراه شدند. در روز جاری، بیت‌کوین در بازار جهانی عمدتاً در محدوده ۷۸ هزار دلار نوسان کرد و همچنان برای بازگشت به سطح ۸۰ هزار دلار تلاش داشت. افزایش ریسک‌های ژئوپلیتیکی، رشد قیمت نفت و تقویت نگرانی‌ها درباره تداوم سیاست پولی سخت‌گیرانه فدرال رزرو از عوامل محدودکننده رشد بیت‌کوین بود. در مقابل، تداوم تقاضای نهادی و ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین از قیمت آن حمایت کرد. با این وجود، در بازار داخلی، بیت‌کوین بر مبنای ریال با رشد بیشتری همراه شد که علاوه بر تغییرات قیمت جهانی، تحت تأثیر افزایش قابل ملاحظه نرخ دلار در بازار غیررسمی قرار داشت. در مجموع، رشد ریالی بیت‌کوین در این روز از ترکیب نوسان قیمت جهانی رمزارز و افزایش نرخ ارز داخلی ناشی شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۷۱ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۳۵ هزار و ۱۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)	۱۸,۴۱۷	۵۸۰.۹	۲۳۵,۱۰۰
روز گذشته (۱۷ شهریور ۱۴۰۵)	۱۷,۹۹۳	۵۶۹.۸	۲۲۸,۹۰۰
تغییرات (درصد)	+۲.۳۶	+۱.۹۴	+۲.۷۱

منبع: نوسان پلاس



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