تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۲۱ شهریور ۱۴۰۵ - شماره ۵۴

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۱ شهریورماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی در شرایطی متفاوت از بازار سهام قرار گرفت. در بازار اوراق بدهی، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت افزایش یافت، اما هم‌زمان خروج پول حقیقی اتفاق افتاد. این خروج نقدینگی در کنار ورود قابل‌توجه پول حقیقی به سهام، نشان می‌دهد بخشی از سرمایه‌گذاران در حال انتقال منابع از دارایی‌های کم‌ریسک‌تر به بازار سهام بوده‌اند.

از سوی دیگر، نرخ بهره بدون ریسک کاهش یافت که در صورت تداوم، از منظر ارزش‌گذاری سهام عامل حمایتی محسوب می‌شود. زیرا کاهش بازده مورد انتظار دارایی‌های بدون ریسک، فاصله بازدهی مورد انتظار سهام با اوراق را کاهش داده و جذابیت نسبی بازار سهام را افزایش می‌دهد.

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)	
۳۸.۹۱	-۰.۰۱	۳۲۹,۲۷۰	روز جاری (۲۱ شهریور ۱۴۰۵)
۴۰.۵۵	۶۴.۹	۷۰,۹۸۵	روز گذشته (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)
-۱.۶۴	-۱۰۰	+۳۶۳.۹	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

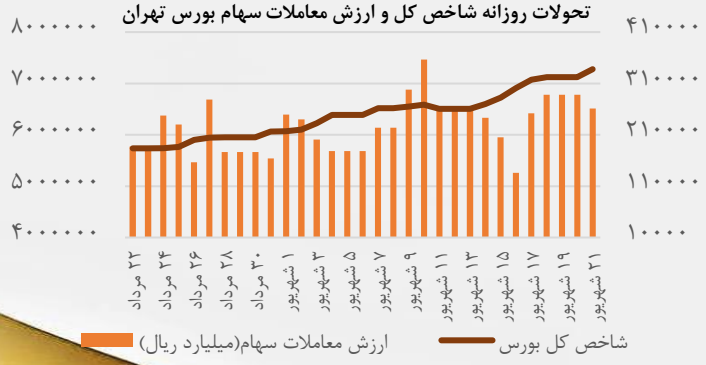
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۵۶,۲۸۲	۷۳.۰۷	۲۶۱,۳۱۰	۱,۹۷۲,۵۸۶	۱,۲۱۱,۸۲۱	۷,۲۷۷,۵۸۷	روز جاری (۲۱ شهریور ۱۴۰۵)
۵۵,۲۲۰	۸۷.۸۴	۲۸۸,۱۱۲	۱,۹۴۲,۳۱۹	۱,۱۸۵,۹۶۴	۷,۱۲۲,۲۹۷	روز گذشته (۱۸ شهریور ۱۴۰۵)
+۱.۹۲	-۱۶.۸	-۹.۳	+۱.۵۶	+۲.۱۸	+۲.۱۸	تغییرات (درصد)

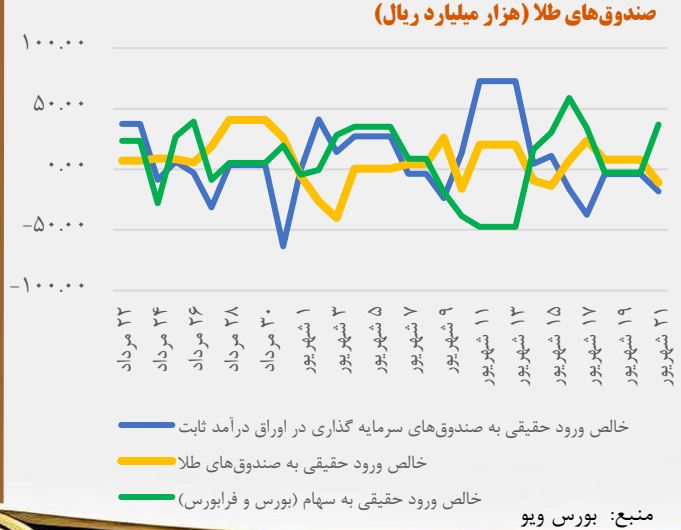
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۲۱ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران روند صعودی قدرتمندی را ادامه داد و شاخص کل با رشد معادل ۲.۱۸ درصد به ۷ میلیون و ۲۷۷ هزار واحد رسید. شاخص هم‌وزن نیز حدود ۱.۵۶ درصد افزایش یافت و مثبت بودن حدود ۸۹ درصد نمادها نشان داد که رشد بازار نسبتاً فراگیر بوده است. مهم‌ترین ویژگی معاملات این روز، تقویت تقاضای حقیقی بود. به‌طوری‌که حدود ۳.۷ همت پول حقیقی وارد بازار شد. تداوم ورود نقدینگی در کنار رشد هم‌زمان شاخص کل و هم‌وزن، نشان‌دهنده افزایش تقاضا و بهبود فضای معاملاتی بورس است. در شکل‌گیری این روند، افزایش نرخ دلار، انتظارات تورمی و چشم‌انداز بهبود سودآوری شرکت‌ها، به‌ویژه صنایع صادرات‌محور، از عوامل مهم بودند. در کنار آن، رشد قیمت جهانی نفت نیز به تقویت انتظارات نسبت به برخی صنایع کالایی و پالایشی کمک کرد. هرچند ریسک‌های سیاسی همچنان مهم‌ترین عامل عدم‌قطعیت بازار محسوب می‌شوند.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



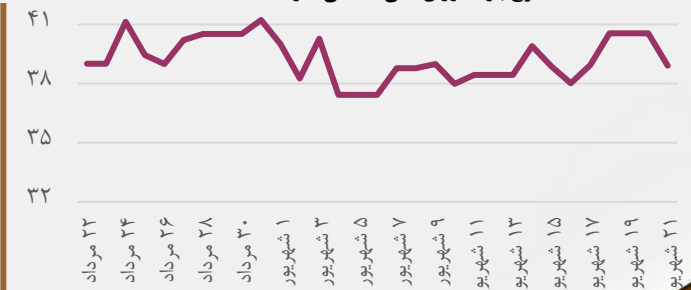
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۲۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۷.۰۶ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۱۸.۱۱ و ۱۱ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و 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 ۲۱ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۴

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 (۲۱ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۶,۴۵۸	۶۴,۴۳۰	۲۳۰,۳۹۰	۱۶۳,۴۱۳	۲۳۴,۴۰۰
روز گذشته (۲۰ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۸,۲۹۳	۶۴,۹۳۰	۲۳۳,۹۹۰	۱۶۲,۹۲۴	۲۳۶,۰۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۷۷	-۰.۷۷	-۱.۵۴	+۰.۳۰	-۰.۶۸

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۶۸ 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 پس از ثبت سطوح تاریخی در روزهای قبل، وارد فاز نوسانی و اصلاح محدود شد. نرخ دلار در ابتدای معاملات حدود ۲۳۶ هزار تومان بود و در طول روز عمدتاً در محدوده ۲۳۴ تا ۲۳۶ هزار تومان نوسان کرد. از منظر عوامل اثرگذار، بازار دلار غیررسمی همچنان تحت تأثیر ریسک‌های سیاسی، تحریم‌های جدید و محدودیت‌های تجاری و ارزی قرار داشت. در روزهای پیش از آن نیز تشدید فشارهای اقتصادی آمریکا و محدود شدن برخی مسیرهای تجاری و مالی، فشار بر ریال را افزایش داده بود. در مقابل، اظهارات رئیس کل بانک مرکزی درباره برخورداری کشور از منابع ارزی و آمادگی برای عرضه ارز، در کوتاه‌مدت از شدت تقاضای احتیاطی کاست و به عقب‌نشینی محدود نرخ دلار کمک کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

تحولات بازار سکه، طلا و نقره

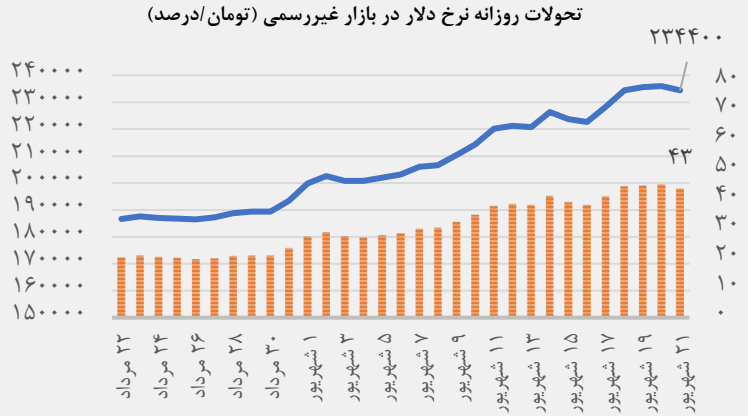
	قیمت (میلیون تومان/ دلار)						
	اونس جهانی نقره (دلار)	اونس جهانی طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۲۱ شهریور ۱۴۰۵)	۶۴.۴۸	۴,۳۴۹	۰.۵۱۵	۳.۱۷۹	۲۳۷.۱۶	۲۳.۹۲	۲۳۹.۵
روز گذشته* (۱۹ شهریور ۱۴۰۵)	۶۴.۴۸	۴,۳۴۹	۰.۵۱۷	۳.۱۸۷	۲۳۷.۹۴	۲۴.۱۸	۲۴۱.۰۱
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۰.۴۹	-۰.۲۵	-۰.۳۳	-۱.۰۹	-۰.۶۳

*: لازم به ذکر است، روز گذشته معاملاتی قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا و نقره در بورس روز ۱۸ شهریورماه بوده است.

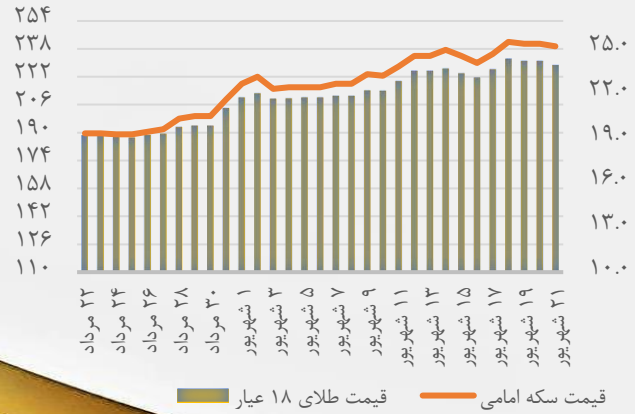
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۲۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۰.۶۳ و ۱.۰۹ درصد کاهش را ثبت کردند. مهم‌ترین عامل این کاهش، افت قیمت دلار در بازار غیررسمی در شرایط ثبات 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

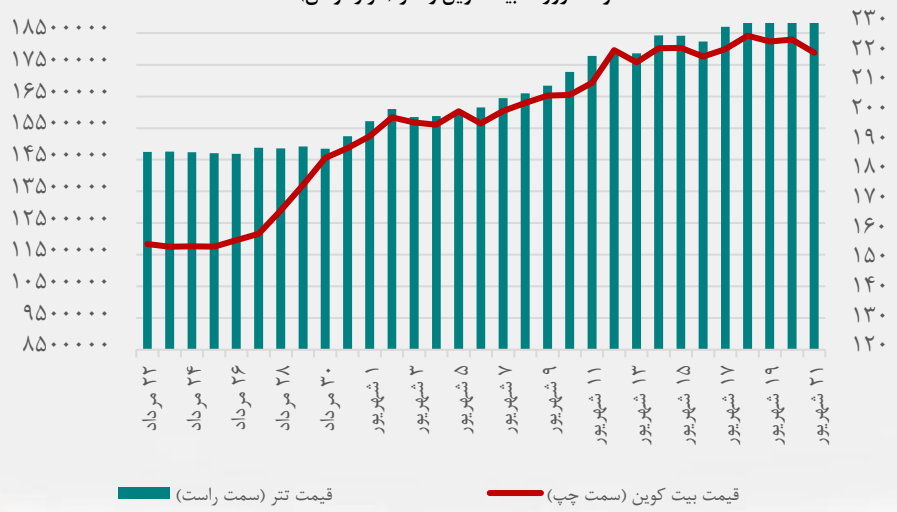
در روز جاری (۲۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با کاهش ۲.۲۹ و ۲.۷۶ درصدی همراه شدند. در روز جاری، بیت کوین پس از افت از سقف بالای ۸۰ هزار دلار در ابتدای سپتامبر (اواخر مردادماه)، در محدوده ۷۷ هزار دلار قرار گرفت. مهم‌ترین عامل فشار بر بیت‌کوین در این روز، افزایش انتظارات برای سیاست پولی انقباضی فدرال رزرو بود. انتشار تورم اوت آمریکا و افزایش تورم ماهانه هسته به ۰.۳ درصد، احتمال افزایش نرخ بهره در نشست ۱۶ سپتامبر را به حدود ۸۳ درصد رساند و در نتیجه، افزایش بازده اوراق خزانه و تقویت جذابیت دارایی‌های دلاری، فشار مضاعفی بر دارایی‌های پرریسک از جمله بیت‌کوین وارد کرد. از سوی دیگر، خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین نیز مانع شکل‌گیری موج صعودی جدید شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۲.۰۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۳۱ هزار و ۵۵۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۲۱ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۱,۵۵۰	۵۸۴.۱	۱۷,۸۷۹
روز گذشته (۲۰ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۶,۳۵۰	۶۰۰.۷	۱۸,۲۹۷
تغییرات (درصد)	-۲.۰۳	-۲.۷۶	-۲.۲۹

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی