تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۲۳ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۶

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۳ شهریورماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با کاهش هم‌زمان ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت، کاهش خالص ورود پول حقیقی و افت جزئی نرخ بهره بدون ریسک همراه شد. کاهش ارزش معاملات و تضعیف ورود پول حقیقی نشان می‌دهد که تقاضا و فعالیت سرمایه‌گذاران در این بازار نسبت به روز قبل کاهش یافته است. در عین حال، افت جزئی نرخ بهره بدون ریسک بیانگر کاهش محدود بازده مورد انتظار ابزارهای کم‌ریسک بود. مجموع این سه تحول نشان می‌دهد که در این روز، جذابیت نسبی بازار اوراق درآمد ثابت اندکی کاهش یافته و بخشی از نقدینگی در حال جابه‌جایی میان بازارهای مالی بوده است.

بازار بدهی				
شاخص کل صکوک فرابورس	نرخ بهره بدون ریسک (درصد)	خالص ورود حقیقی به اوراق درآمد ثابت (هزار میلیارد ریال)	ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت (غیربلوکی) (میلیارد ریال)	
۱۳۲۰.۹	۳۶.۴۳	۱.۸۳	۲۱,۷۷۲	روز جاری (۲۳ شهریور ۱۴۰۵)
۱۳۱۹.۱	۳۶.۸۳	۹.۵۱	۸۵,۳۸۶	روز گذشته (۲۲ شهریور ۱۴۰۵)
+۰.۱۳	-۰.۴۰	-۸۰.۷	-۷۴.۵	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

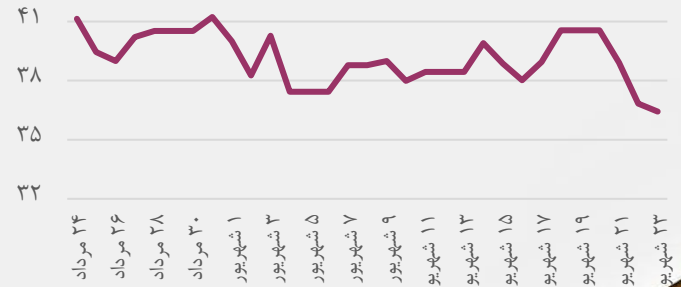
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۵۷,۲۲۹	۶۷.۵۱	۲۸۷,۹۲۸	۱,۹۹۴,۱۴۵	۱,۲۳۱,۰۸۱	۷,۳۹۳,۲۴۷	روز جاری (۲۳ شهریور ۱۴۰۵)
۵۷,۲۵۳	۹۲.۳۶	۳۳۴,۶۶۳	۲,۰۰۲,۶۶۱	۱,۲۳۷,۴۴۲	۷,۴۳۱,۴۵۱	روز گذشته (۲۲ شهریور ۱۴۰۵)
-۰.۰۴	-۲۶.۹	-۱۴	-۰.۴۳	-۰.۵۱	-۰.۵۱	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

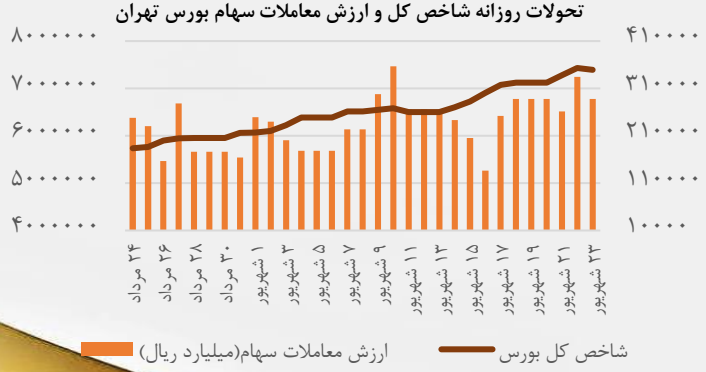
در روز معاملاتی جاری (۲۳ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از رشد قابل‌توجه روزهای اخیر وارد فاز اصلاحی شد. به‌طوری‌که شاخص کل با کاهش ۰.۵۱ درصدی به ۷ میلیون و ۳۹۳ هزار واحد رسید و شاخص هم‌وزن نیز با افت ۰،۴۳ درصدی مواجه شد. این افت هم‌زمان نشان‌دهنده افزایش فشار فروش در بخش قابل‌توجهی از بازار بود. در این روز، انتشار خبر تعویق نشست منطقه‌ای عمان درباره ترتیبات مرتبط با تنگه هرمز و افزایش ابهامات پیرامون تحولات سیاسی، بر رفتار معامله‌گران اثر گذاشت و موجب افزایش احتیاط و تشدید عرضه سهام شد. در مجموع، معاملات این روز بیشتر بیانگر اصلاح کوتاه‌مدت قیمت‌ها، ذخیره‌سازی سود و افزایش احتیاط سرمایه‌گذاران در واکنش به ریسک‌های سیاسی بود و با توجه به سطح بالای ارزش معاملات، نمی‌توان این افت را به‌تنهایی نشانه تغییر روند بازار تلقی کرد.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

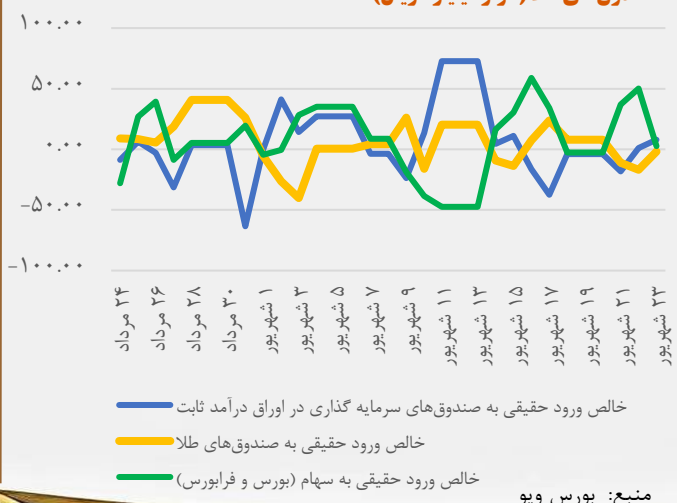


منبع: بورس ویو

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 (۲۳ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۲.۵۶ و ۷.۹۹ 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) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۱.۹۴ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا صورت گرفته 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 دوشنبه مورخ ۲۳ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۶

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 (۲۳ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۱,۸۳۴	۶۳,۱۷۰	۲۲۷,۷۹۰	۱۶۴,۳۹۵	۲۲۹,۹۰۰
روز گذشته (۲۲ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۰,۲۱۹	۶۲,۷۳۰	۲۲۶,۶۱۰	۱۶۳,۹۰۳	۲۲۸,۰۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۷۰	+۰.۷۰	+۰.۵۲	+۰.۳۰	+۰.۸۳

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۳ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۸۳ درصدی همراه شد و به سطح ۲۲۹ هزار و ۹۰۰ 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 کاهش روزهای قبل مجدداً وارد مسیر صعودی شد و به محدوده ۲۳۰ هزار تومان بازگشت. مهم‌ترین محرک این تغییر، افزایش نااطمینانی سیاسی پس از تعویق نشست ایران و کشورهای منطقه درباره ترتیبات تنگه هرمز در عمان بود. به‌ویژه آنکه سخنگوی وزارت امور خارجه ایران اعلام کرد این نشست به درخواست عربستان سعودی به تعویق افتاده است. این تحول بخشی از خوش‌بینی ایجادشده در بازار نسبت به کاهش تنش‌های منطقه‌ای را تعدیل کرد و با افزایش تقاضای احتیاطی ارز همراه شد.

از سوی دیگر، افزایش نرخ تتر در معاملات شبانه نیز به‌عنوان یک سیگنال افزایشی، انتظارات معامله‌گران بازار آزاد را تقویت کرد. در نتیجه، دلار توانست پس از اصلاح قبلی دوباره به کانال ۲۳۰ هزار تومان بازگردد. با این حال، این افزایش را باید در چارچوب نوسان ناشی از اخبار سیاسی و تغییر انتظارات ارزیابی کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

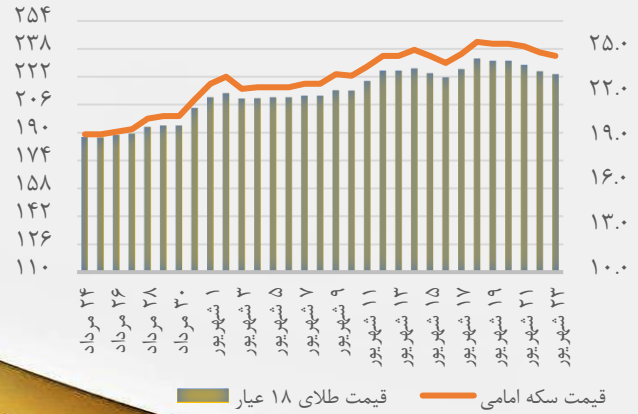
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۲۳ شهریور ۱۴۰۵)	۶۳.۳۸	۴,۲۹۴	۰.۴۹۹	۳.۱۰۱	۲۳۲.۳۹	۲۳.۲۸	۲۳۳.۹۹
روز گذشته (۲۲ شهریور ۱۴۰۵)	۶۳.۹۲	۴,۳۳۳	۰.۵۰۸	۳.۱۰۴	۲۳۲.۱۶	۲۳.۴۸	۲۳۶.۰۱
تغییرات (درصد)	-۰.۸۴	-۰.۸۹	-۱.۸۲	-۰.۱۲	+۰.۱۰	-۰.۸۲	-۰.۸۶

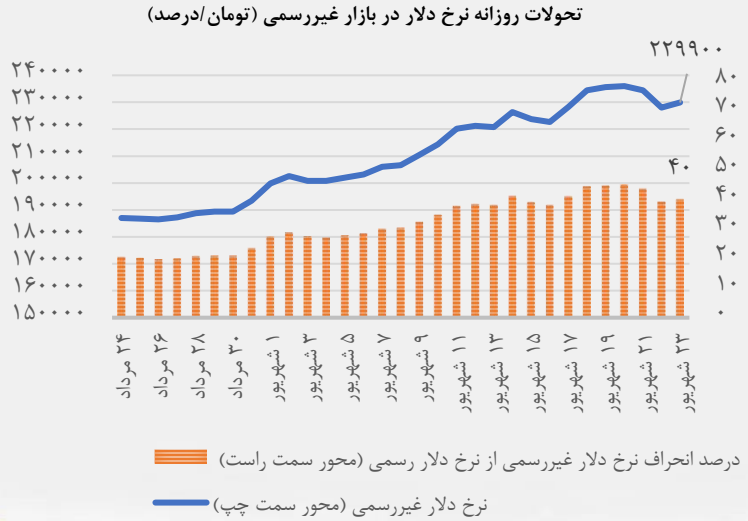
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۲۳ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۰.۸۶ و ۰.۸۲ درصد کاهش را ثبت کردند. این کاهش عمدتا ناشی از اثر غلبه کاهش قیمت اونس جهانی طلا بر اثر افزایشی قیمت دلار در بازار غیررسمی بود.

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

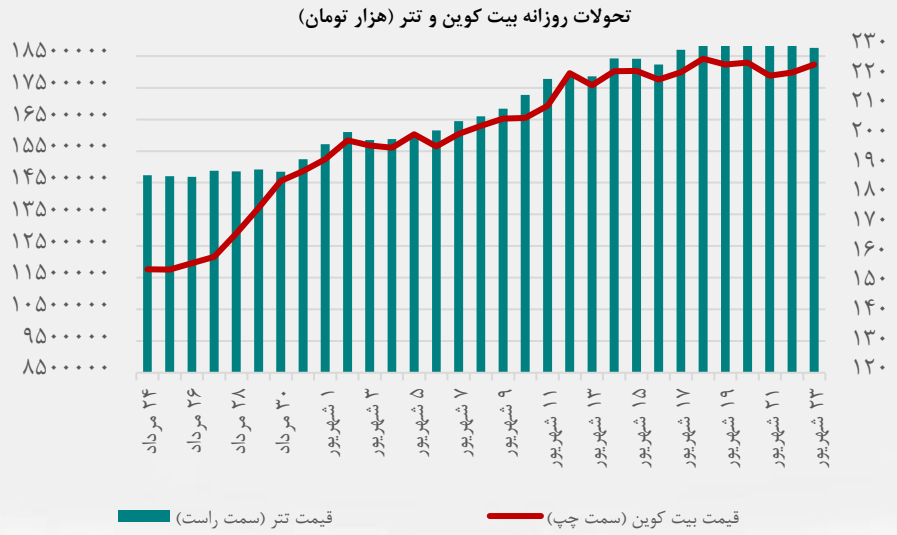
تحولات بازار ارزهای دیجیتال

در روز جاری (۲۳ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم با افزایش ۱.۳۸ و ۱.۷۸ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی روندی صعودی داشت و با رشد ۱.۶۷ درصدی به حدود ۷۸ هزار دلار رسید. این افزایش در شرایطی رخ داد که بازار رمزارزها همچنان تحت تأثیر دو نیروی متضاد قرار داشت. از یک‌سو، بازگشت تقاضای نهادی و تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین از قیمت حمایت و به بهبود انتظارات سرمایه‌گذاران نسبت به ادامه روند صعودی بازار کمک کرد. از سوی دیگر، افزایش انتظارات برای افزایش نرخ بهره فدرال رزرو و رشد بازده اوراق خزانه آمریکا، ریسک فشار بر دارایی‌های پرریسک از جمله بیت‌کوین را افزایش داد. در مجموع، بیت‌کوین در روز جاری توانست در برابر این فشارها مقاومت کرده و به محدوده ۷۸ هزار دلار بازگردد. گزارش‌های بازار نشان دادند که معامله‌گران همچنان در انتظار تصمیم فدرال رزرو و همچنین تحولات مربوط به رأی‌گیری سنای آمریکا درباره «قانون شفافیت بازار دارایی‌های دیجیتال (Clarity Act)» بودند.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۲۹ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۹ هزار و ۵۵۰ تومان تنزل کرد. لازم به ذکر است، قیمت تتر با وجود افزایش قابل‌توجه در معاملات شبانه تحت‌تأثیر افزایش نااطمینانی‌های سیاسی و تعویق نشست مرتبط با تنگه هرمز، در معاملات روزانه کاهش یافت. این افت محدود را می‌توان ناشی از تعدیل بخشی از رشد هیجانی شبانه و کاهش موقت تقاضای کوتاه‌مدت دانست. به‌ویژه آنکه دلار آزاد در همین روز افزایش جزئی داشت و بنابراین کاهش تتر بیشتر بیانگر اصلاح نوسان و تعدیل آن نسبت به دلار غیررسمی بود.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۳ شهریور ۱۴۰۵)	۱۸,۲۲۹	۵۹۳.۸	۲۲۹,۵۵۰
روز گذشته (۲۲ شهریور ۱۴۰۵)	۱۷,۹۸۲	۵۸۳.۴	۲۳۲,۵۵۰
تغییرات (درصد)	+۱.۳۸	+۱.۷۸	-۱.۲۹

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