تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۲۸ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۹

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۸ شهریورماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت و تقویت خالص ورود پول حقیقی همراه شد. رفتاری که در شرایط افت بازار سهام، نشان‌دهنده افزایش توجه بخشی از سرمایه‌گذاران به ابزارهای کم‌ریسک‌تر است.

از سوی دیگر، نرخ بهره بدون ریسک تقریباً بدون تغییر محسوسی باقی ماند. بنابراین افزایش تقاضا برای اوراق عمدتاً ناشی از تغییر سطح نرخ بازده نبود و بیشتر می‌توان آن را به افزایش تقاضا برای حفظ سرمایه و کاهش ریسک پرتفوی در فضای منفی بازار سهام نسبت داد.

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)	
۱۳۲۴.۸۷	۳۸.۲۷	۴.۰۷	۲۰۱,۷۶۶	روز جاری (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)
۱۳۲۴.۰۶	۳۸.۲۹	-۰.۱۸	۱۲۳,۴۲۶	روز گذشته (۲۵ شهریور ۱۴۰۵)
+۰.۰۶	-۰.۰۲	+۲۳۷۱.۴	+۶۳.۵	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

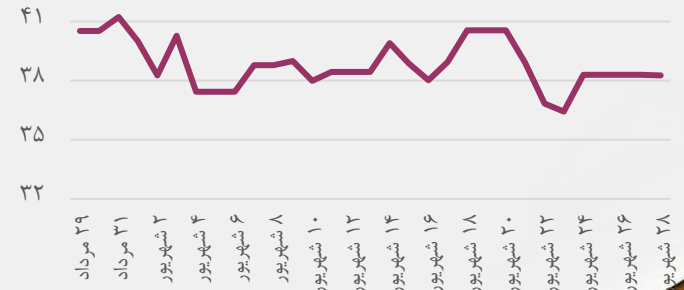
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۵۷,۵۶۷	۷۲.۴۰	۳۱۴,۱۸۲	۱,۹۸۶,۷۷۰	۱,۲۳۴,۰۴۳	۷,۴۴۸,۸۳۹	روز جاری (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)
۵۸,۱۹۴	۹۵.۹۰	۳۹۵,۵۸۴	۲,۰۱۶,۱۸۱	۱,۲۵۶,۴۲۹	۷,۵۵۷,۷۳۳	روز گذشته (۲۵ شهریور ۱۴۰۵)
-۱.۰۸	-۲۴.۵	-۲۱	-۱.۴۶	-۱.۷۸	-۱.۴۴	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

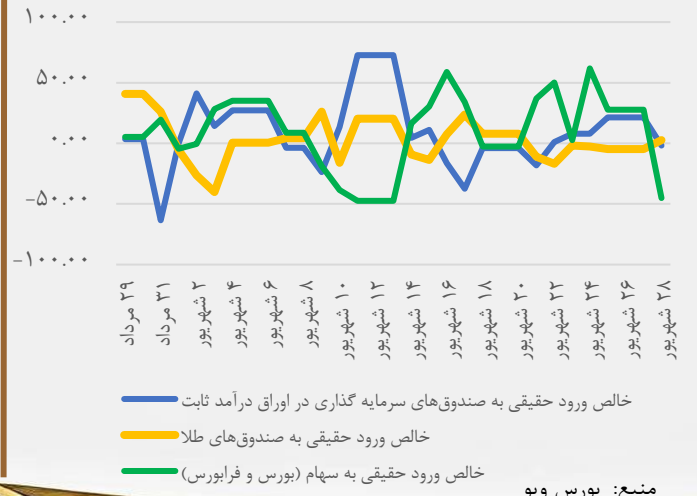
در روز معاملاتی جاری (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از شروعی مثبت و رشد حدود ۶۱ هزار واحدی شاخص کل، با تشدید عرضه‌ها تغییر مسیر داد و شاخص کل در پایان معاملات با کاهش معادل ۱.۴۴ درصدی در سطح ۷.۴۴۹ میلیون واحد قرار گرفت. شاخص هم‌وزن نیز ۱.۴۶ درصد افت کرد که نشان‌دهنده فراگیر بودن فشار فروش در میان نمادهای بازار بود. در سمت نقدینگی، حدود ۴.۵ همت پول حقیقی از بازار سهام خارج شد و تعداد نمادهای دارای صف فروش به بیش از ۵۰۰ نماد رسید. در مجموع، معاملات این روز بیانگر افزایش ریسک‌گریزی و چرخش موقت جریان معاملات به سمت فروش بود. هم‌زمانی افت گسترده سهام با افزایش تقاضا در برخی دارایی‌های طلا و ارز نیز نشان داد که در شرایط افزایش نااطمینانی، بخشی از سرمایه‌گذاران به سمت دارایی‌های پوشش‌دهنده ریسک متمایل شده‌اند.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

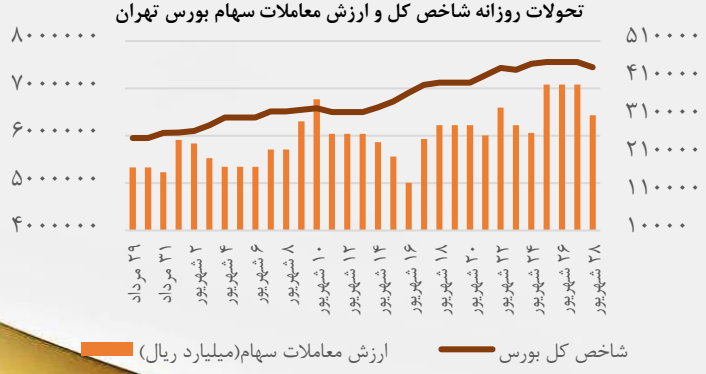
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۲۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۴۵.۱۹ و ۱.۸۳ 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) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۲.۶۳ 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 شنبه مورخ ۲۸ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۵۹

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 (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۲,۲۳۸	۶۳,۲۸۰	۲۲۸,۰۹۰	۱۶۶,۳۷۷	۲۳۰,۲۰۰
روز گذشته (۲۷ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۸,۷۱۴	۶۲,۳۲۰	۲۲۵,۰۱۰	۱۶۵,۸۷۹	۲۲۶,۷۰۰
تغییرات (درصد)	+۱.۵۴	+۱.۵۴	+۱.۳۷	+۰.۳۰	+۱.۵۴

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۱.۵۴ درصدی همراه شد و به سطح ۲۳۰ هزار و ۲۰۰ تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۳ درصدی همراه شد.

در روز جاری (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی با روندی صعودی همراه شد و بعد از افت روزهای پایانی هفته گذشته، به محدوده‌های بالاتر قیمتی بازگشت. رشد دلار در این روز در شرایطی اتفاق افتاد که فضای خبری کشور تحت تأثیر مجموعه‌ای از تحولات سیاسی و اقتصادی، انتظارات بازار ارز را تحت فشار قرار داد. از جمله مهم‌ترین اخبار روز، امضای قانون جدید آمریکا برای تشدید تحریم‌ها علیه روسیه و تمدید پنج‌ساله تحریم‌های موجود علیه ایران بود که بامداد ۲۸ شهریور منتشر شد، خبری که از منظر بازار ارز، استمرار محدودیت‌های خارجی و ریسک‌های مرتبط با دسترسی ایران به منابع ارزی و مبادلات مالی را برجسته کرد. در همین روز، ترکیه نیز مجوز فعالیت شعبه بانک ملت در استانبول را لغو کرد. انتشار این خبر در شرایط تشدید فشارهای مالی خارجی، بر فضای ریسک پیرامون روابط بانکی ایران اثرگذار بود. همچنین اخبار مربوط به مذاکرات ایران و آمریکا همچنان حاکی از اختلاف در مواضع طرفین بود و سیگنال روشنی از گشایش فوری ارائه نمی‌کرد. در مجموع، رشد دلار در روز جاری را می‌توان حاصل تشدید انتظارات احتیاطی در بازار ارز در پی تداوم فشارهای تحریمی، اخبار مرتبط با محدودیت‌های بانکی و ابهام در مسیر مذاکرات دانست.

تحولات بازار سکه و طلا

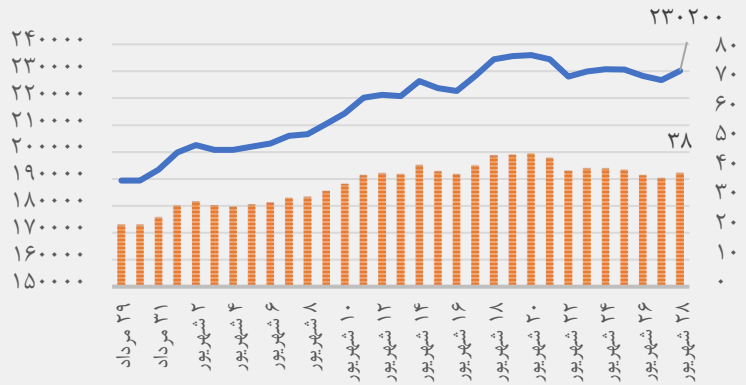
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۲۶	۴,۳۷۸	۰.۴۹۷	۳.۱۶۸	۲۳۶.۱۶	۲۳.۸۸	۲۳۷.۴۸
روز گذشته (۲۷ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۲۶	۴,۳۷۸	۰.۴۹۱	۳.۱۰۳	۲۳۰.۸۸	۲۳.۳۶	۲۳۱.۹۹
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۱.۲۱	+۲.۱۰	+۲.۲۹	+۲.۲۰	+۲.۳۷

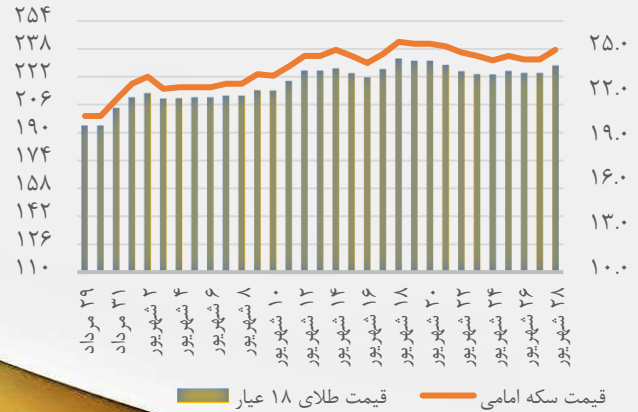
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۲۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۲.۳۷ و ۲.۲۰ درصد رشد را ثبت کردند. با وجود ثبات قیمت اونس جهانی طلا، لیکن رشد دارایی‌های مذکور عمدتا تحت تاثیر افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی و تشدید ریسک‌های سیاسی بود.

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

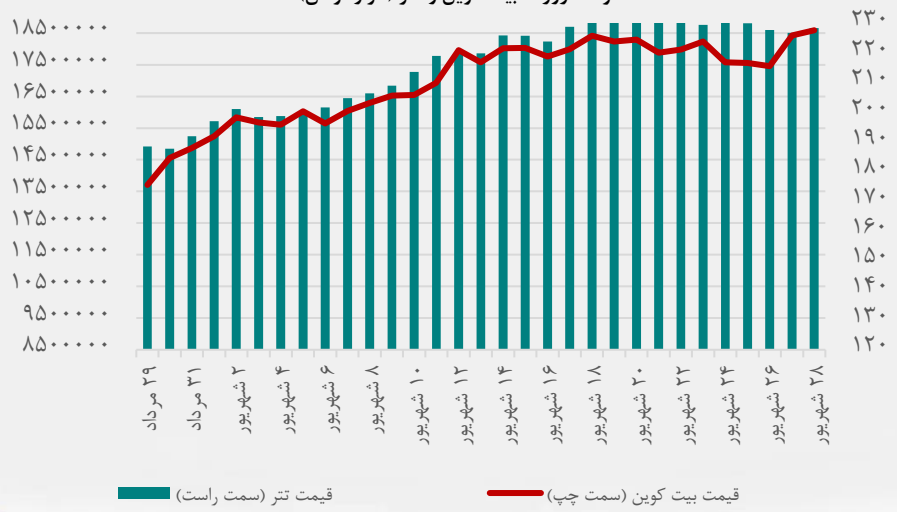
در روز جاری (۲۸ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۹۱ و ۰.۵۲ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی با رشد همراه شد و پس از حدود دو هفته بار دیگر به محدوده ۸۱ هزار دلار بازگشت. در اخبار روز جاری، بازگشت قیمت بیت‌کوین به بالای ۸۰ هزار دلار در حالی مورد توجه قرار گرفت که فدرال رزرو در ۲۵ شهریور نرخ بهره را ۲۵ واحد پایه افزایش داده و آن را به محدوده ۳.۷۵ تا ۴ درصد رسانده بود. با وجود این سیاست انقباضی، کاهش قیمت نفت و تعدیل نگرانی‌های تورمی به بهبود فضای ریسک‌پذیری کمک کرد و بخشی از فشار ناشی از افزایش نرخ بهره را خنثی کرد. گزارش‌های بازار همچنین از بازگشت سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین و افزایش تقاضا خبر دادند که به تقویت روند صعودی کمک کرد. از سوی دیگر، در حوزه مقرراتی، شکست پیشبرد «قانون شفافیت بازار دارایی‌های دیجیتال (Clarity Act)» در سنای آمریکا همچنان ابهام مقرراتی را حفظ کرده بود، اما در مقابل، خبرهای مربوط به اقدامات تسهیل گری و شفاف کننده مقرراتی SEC برای توکنایز معاملات سهام مبنی بر آنکه SEC در ۱۷ سپتامبر (۲۶ شهریورماه)، یک معافیت موقت و مشروط پنج‌ساله صادر کرد که به برخی پلتفرم‌های مجاز اجازه می‌دهد،سهام توکنیزه‌شده شرکت‌های بورسی آمریکا را روی بلاکچین و به‌صورت درون زنجیره‌ای معامله کنند. این اقدام بخشی از نگرانی‌های نظارتی بازار را کاهش داد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۶۸ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۸ هزار و ۴۵۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)	۱۸,۵۸۹	۶۰۱.۸	۲۲۸,۴۵۰
روز گذشته (۲۷ شهریور ۱۴۰۵)	۱۸,۴۲۱	۵۹۸.۷	۲۲۶,۹۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۹۱	+۰.۵۲	+۰.۶۸

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی