تحولات بازارهای مالی در روز یکشنبه مورخ ۲۹ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۶۰

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۹ شهریورماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی در شرایطی قرار داشت که ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت افزایش یافت، اما هم‌زمان خروج پول حقیقی و افزایش نرخ بهره بدون ریسک مشاهده شد. این ترکیب نشان می‌دهد افزایش فعالیت معاملاتی در این بازار بیشتر در فضایی همراه با افزایش عرضه و جابه‌جایی نقدینگی رخ داده و رشد ارزش معاملات الزاماً به معنای تقویت تقاضای سرمایه‌گذاری حقیقی نبوده است.

همچنین، افزایش هم‌زمان نرخ بهره بدون ریسک و خروج پول حقیقی از اوراق می‌تواند نشان‌دهنده افزایش انتظارات بازدهی و ریسک در بازارهای مالی باشد. به‌گونه‌ای که سرمایه‌گذاران برای نگهداری اوراق، بازده بالاتری مطالبه می‌کنند.

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)	
۱۳۲۵.۷۳	۳۸.۹۸	-۰.۰۰۶	۶۹۳.۹۵۵	روز جاری (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)
۱۳۲۴.۸۷	۳۸.۲۷	۴.۰۷	۲۰۱.۷۶۶	روز گذشته (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)
+۰.۰۶	+۰.۷۱	-۱۰۰.۱	+۲۴۳.۹	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

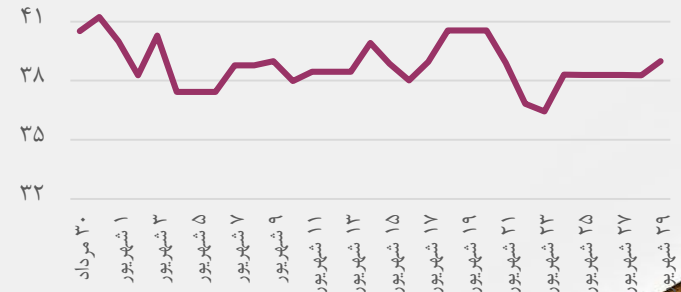
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۵۶,۶۳۵	۵۹.۶۴	۲۵۷,۱۸۰	۱,۹۴۶,۳۵۹	۱,۲۰۷,۶۴۱	۷,۲۹۱,۸۲۵	روز جاری (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)
۵۷,۵۶۷	۷۲.۴۰	۳۱۴,۱۸۲	۱,۹۸۶,۷۷۰	۱,۲۳۴,۰۴۳	۷,۴۴۸,۸۳۹	روز گذشته (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)
-۱.۶۲	-۱۷.۶	-۱۸	-۲.۰۳	-۲.۱۴	-۲.۱۱	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران با تشدید فشار فروش و ادامه روند اصلاحی روز قبل مواجه شد. شاخص کل با افت ۲.۱۱ درصدی به ۷ میلیون و ۲۹۱ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با کاهش حدود ۲ درصدی به ۱ میلیون و ۹۴۶ هزار واحد رسید. هم‌زمان شاخص فرابورس نیز حدود ۱.۶ درصد کاهش یافت. افت هم‌زمان شاخص کل و هم‌وزن بورس نشان می‌دهد که فشار فروش به طیف گسترده‌ای از نمادها سرایت کرده بود.

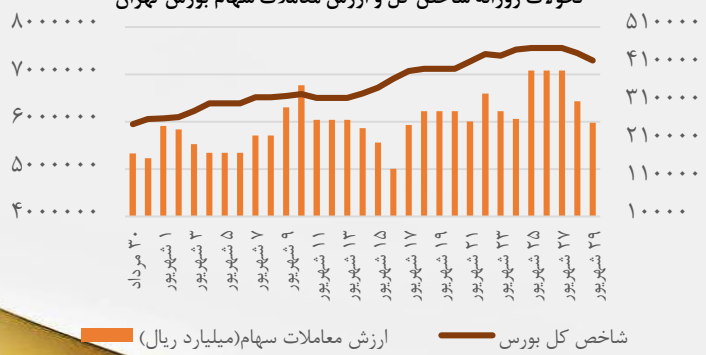
در جریان معاملات، ارزش معاملات کاهش یافت و خروج پول حقیقی حدود ۶.۱ همت ثبت شد. این وضعیت در شرایطی رخ داد که بازار در هفته قبل رشد قابل‌توجهی را تجربه کرده بود. ازاین‌رو، ذخیره‌سازی سود پس از رشد اخیر در کنار افزایش احتیاط و نااطمینانی معامله‌گران از عوامل مهم تشدید عرضه در این روز ارزیابی می‌شود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

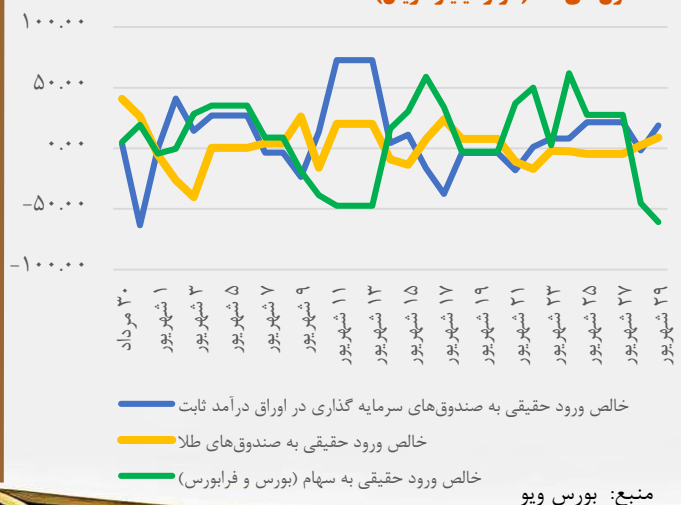


منبع: بورس ویو

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 (۲۹ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۶۰.۸۹ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۸.۷۵ و ۱۸.۸۹ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به صندوق‌های طلا و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) 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 یکشنبه مورخ ۲۹ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۶۰

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 (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۲,۲۳۸	۶۳,۲۸۰	۲۲۹,۴۹۰	۱۶۶,۶۰۸	۲۳۰,۳۰۰
روز گذشته (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۲,۲۳۸	۶۳,۲۸۰	۲۲۸,۰۹۰	۱۶۶,۳۷۷	۲۳۰,۲۰۰
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۰.۶۱	+۰.۱۴	+۰.۰۴

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۹ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، تقریبا ثابت و برابر با ۲۳۰ هزار و ۳۰۰ تومان بود. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۱۴ درصدی همراه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی با وجود تداوم ابهامات سیاسی، تغییر محسوسی نداشت و در محدوده ۲۳۰ هزار تومان تثبیت شد. در این روز، افزایش ریسک‌های سیاسی، ابهام در چشم‌انداز مذاکرات و نگرانی نسبت به تحولات منطقه‌ای، همچنان از عوامل حمایت‌کننده تقاضای احتیاطی ارز بودند. با این حال، این عوامل به دلیل نبود محرک جدید و قدرتمند، نتوانستند فشار قابل‌توجهی برای جهش نرخ دلار ایجاد کنند و بازار عمدتاً در محدوده ۲۳۰ هزار تومان باقی ماند. در مجموع، در ۲۹ شهریور، بازار ارز در شرایطی از ثبات نسبی در سطوح بالای قیمتی قرار داشت.

تحولات بازار سکه و طلا

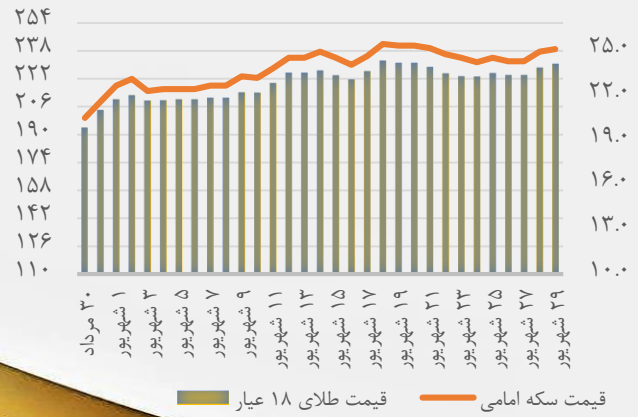
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۲۶	۴,۳۷۸	۰.۵۰۵	۳.۲۲۳	۲۳۹.۵۶	۲۴.۱۲	۲۳۹.۰۱
روز گذشته (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۲۶	۴,۳۷۸	۰.۴۹۷	۳.۱۶۸	۲۳۶.۱۶	۲۳.۸۸	۲۳۷.۴۸
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۱.۶۳	+۱.۷۴	+۱.۴۴	+۱.۰۳	+۰.۶۴

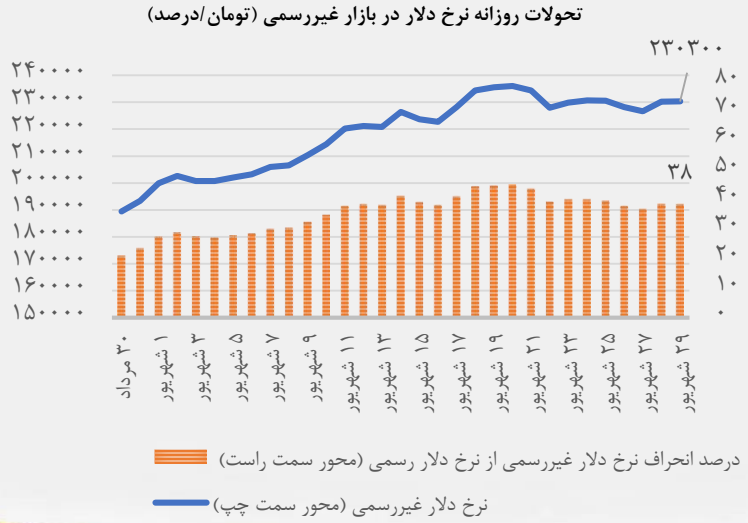
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۲۹ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۰.۶۴ و ۱.۰۳ درصد رشد را ثبت کردند. در روز جاری، بازار طلا و سکه با وجود ثبات نسبی دلار و اونس جهانی طلا، افزایش محدودی را تجربه کرد. این افزایش را می‌توان بیشتر ناشی از تقویت تقاضای احتیاطی و تعدیل قیمت‌های داخلی پس از افت‌های روزهای قبل دانست. در واقع، تشدید ابهامات سیاسی، جذابیت طلا و سکه به‌عنوان دارایی‌های امن را حفظ کرد. از این‌رو، رشد قیمت سکه بیش از آنکه ناشی از تغییر در ارزش ذاتی آن باشد، با افزایش حباب و افزایش تقاضا ارتباط داشت.

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 (۲۹ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۲۵ و ۰.۴۳ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی پس از رشد روزهای گذشته با اصلاح محدودی همراه شد و عمدتاً در محدوده ۸۰ تا ۸۱ هزار دلار معامله شد. بیت‌کوین که در روزهای قبل با افزایش قیمت مواجه بود، تحت تأثیر افزایش فشار فروش و ذخیره‌سازی سود بخشی از معامله‌گران عقب‌نشینی کرد. هم‌زمان، کاهش موقعیت‌های باز در بازار مشتقات، نشان‌دهنده تعدیل بخشی از اهرم‌های معاملاتی و کاهش فشار سفته‌بازی بود. از سوی دیگر، بازگشت جریان سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین و تثبیت قیمت بالای سطح ۸۰ هزار دلار، مانع از تشدید فشار فروش شد و نشان داد تقاضای نهادی همچنان در بازار حضور دارد.

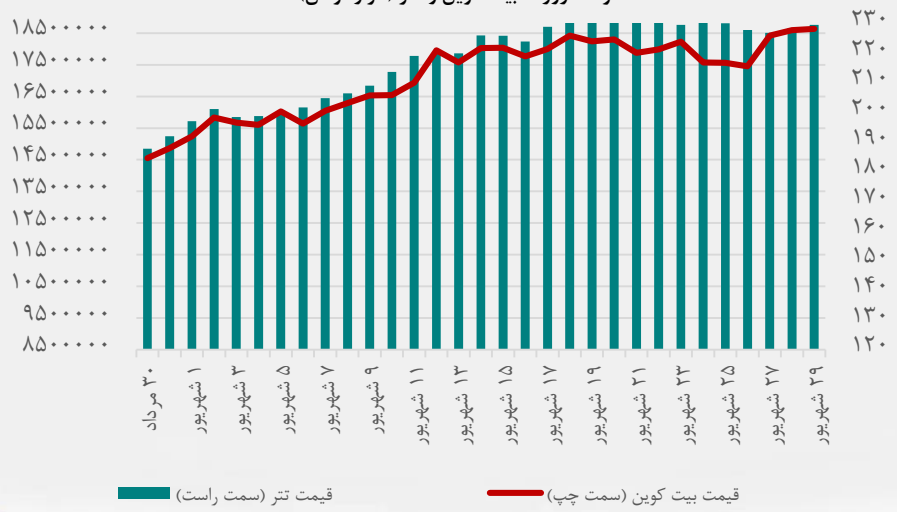
در بازار داخلی ایران، با وجود کاهش محدود قیمت جهانی بیت‌کوین، افزایش قیمت تتر موجب شد افت قیمت بیت‌کوین به ریال خنثی شود. از این رو، رفتار قیمت ریالی بیت‌کوین در این روز را باید حاصل برآیند دو عامل متفاوت، یعنی اصلاح محدود قیمت بیت‌کوین جهانی و افزایش تتر در بازار داخلی دانست.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۵۰ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۹ هزار و ۶۰۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۱۸,۶۳۵	۶۰۴.۴	۲۲۹,۶۰۰
روز گذشته (۲۸ شهریور ۱۴۰۵)	۱۸,۵۸۹	۶۰۱.۸	۲۲۸,۴۵۰
تغییرات (درصد)	+۰.۲۵	+۰.۴۳	+۰.۵۰

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