تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۳۰ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۶۱

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۳۰ شهریورماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت و تشدید خروج پول حقیقی، همزمان با افت نرخ بهره بدون ریسک، نشان‌دهنده کاهش تمایل سرمایه‌گذاران به نگهداری اوراق بدهی بود. کاهش نرخ بهره بدون ریسک به معنای پایین‌تر شدن بازدهی مورد انتظار این ابزارهاست و می‌تواند جذابیت آنها را در تصمیمات سرمایه‌گذاری کاهش دهد. ازاین‌رو، تشدید خروج پول حقیقی را می‌توان نشانه افزایش فروش و کاهش تمایل سرمایه‌گذاران به ماندن در بازار بدهی دانست.

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)
روز جاری (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۱,۳۲۵.۱	۳۸.۳۷	-۰.۲۱۷	۲۰۴,۴۴۶
روز گذشته (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۱,۳۲۵.۷	۳۸.۹۸	-۰.۰۰۶	۶۹۳,۹۵۵
تغییرات (درصد)	-۰.۰۵	-۰.۶۱	-۳۸۴۲.۷	-۷۰.۵

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

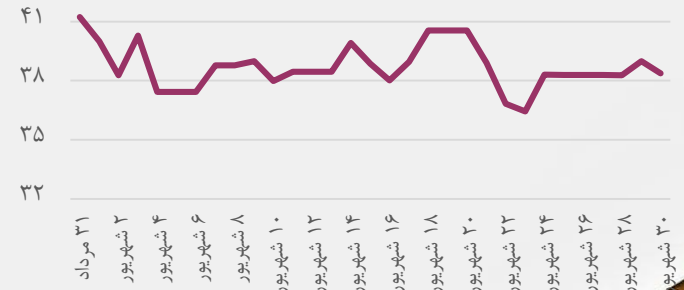
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

	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
روز جاری (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۵۶,۷۴۲	۷۵.۴۱	۲۶۵,۰۳۸	۱,۹۳۶,۹۳۲	۱,۲۰۵,۴۷۶	۷,۲۸۰,۴۳۰
روز گذشته (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۵۶,۶۳۵	۵۹.۶۴	۲۵۷,۱۸۰	۱,۹۴۶,۳۵۹	۱,۲۰۷,۶۴۱	۷,۲۹۱,۸۲۵
تغییرات (درصد)	+۰.۱۹	+۲۶.۴	+۳	-۰.۴۸	-۰.۱۸	-۰.۱۶

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

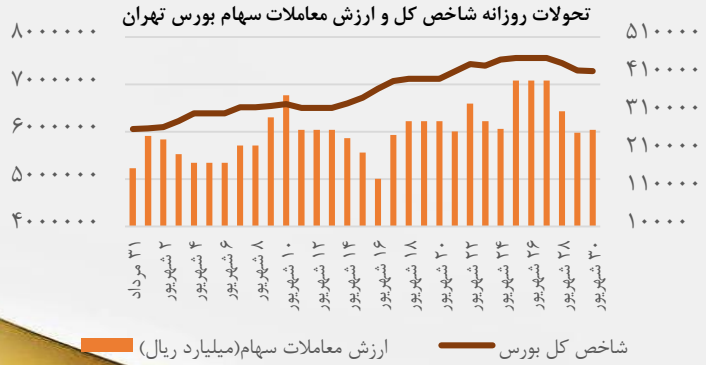
در روز معاملاتی جاری (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)، شاخص کل بورس تهران با کاهش ۰.۱۶ درصدی در محدوده ۷ میلیون و ۲۸۰ هزار واحد قرار گرفت و شاخص هم‌وزن نیز ۰.۴۸ درصد افت کرد. با وجود آنکه بازار در ابتدای معاملات با بهبود تقاضا همراه بود، اما افزایش عرضه در ادامه موجب شد، رشد اولیه شاخص‌ها تداوم نیابد. به نظر می‌رسد، بخشی از عرضه‌ها پس از رشد قابل‌توجه بازار در هفته‌های اخیر، ناشی از ذخیره‌سازی سود سرمایه‌گذاران بوده باشد. بااین‌حال، ورود پول حقیقی نشان داد که تقاضا همچنان در بازار فعال است. از سوی دیگر، رشد شاخص فرابورس نشان داد که معاملات در همه بخش‌های کل بازار سهام (بورس و فرابورس) یکدست نبوده است. رشد شاخص فرابورس در شرایطی رخ داد که خروج پول حقیقی از این بازار گزارش شد؛ بنابراین، این رشد را نمی‌توان ناشی از ورود نقدینگی جدید دانست و بیشتر تحت‌تأثیر عملکرد نمادهای شاخص‌ساز بازار بوده است.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

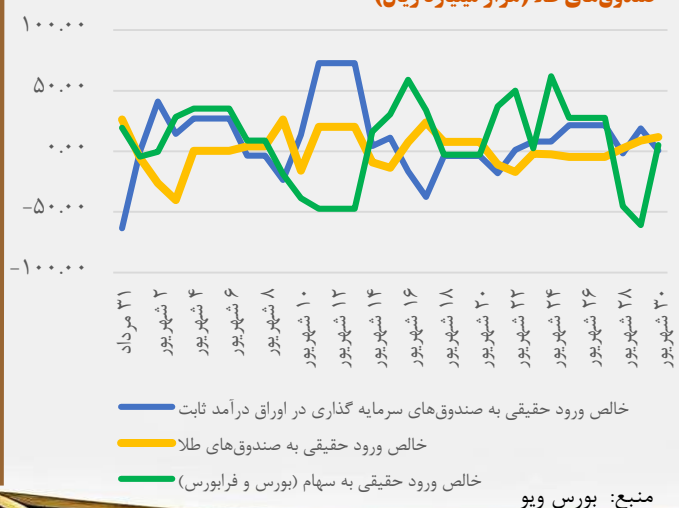


منبع: بورس ویو

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 (۳۰ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۵.۲۱، ۱۱.۸۱ و ۰.۷۴ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، 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 دوشنبه مورخ ۳۰ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۶۱

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 (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۲,۵۳۱	۶۳,۳۶۰	۲۳۰,۱۹۰	۱۶۷,۵۹۹	۲۳۰,۵۰۰
روز گذشته (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۲,۲۳۸	۶۳,۲۸۰	۲۲۹,۴۹۰	۱۶۶,۶۰۸	۲۳۰,۳۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۱۳	+۰.۱۳	+۰.۳۱	+۰.۵۹	+۰.۰۹

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۳۰ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، تقریبا ثابت و برابر با ۲۳۰ هزار و ۵۰۰ تومان بود. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۵۹ درصدی همراه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی همچنان مشابه روز گذشته، با وجود تداوم ابهامات سیاسی، تغییر محسوسی نداشت و در محدوده ۲۳۰ هزار تومان معامله 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 ۳۰ شهریور، بازار ارز در شرایطی از ثبات نسبی در سطوح بالای قیمتی قرار داشت.

تحولات بازار سکه و طلا

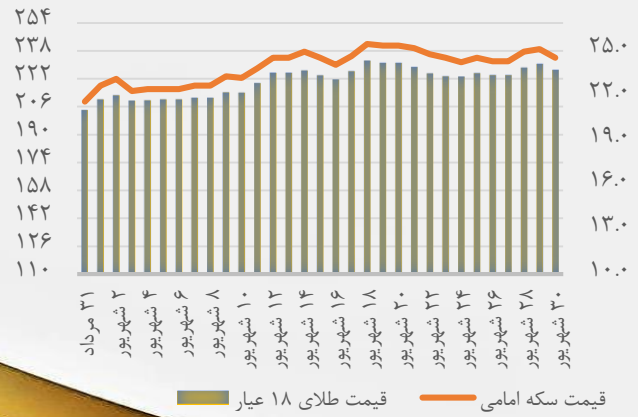
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۶۵	۴,۳۶۹	۰.۴۹۸	۳.۱۴۸	۲۳۴.۶۷	۲۳.۷۱	۲۳۳.۹۸
روز گذشته (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۶۶.۳۴	۴,۳۷۳	۰.۵۰۵	۳.۲۲۳	۲۳۹.۵۶	۲۴.۱۲	۲۳۹.۰۱
تغییرات (درصد)	+۰.۴۸	-۰.۰۹	-۱.۳۸	-۲.۳۲	-۲.۰۴	-۱.۷۳	-۲.۱۰

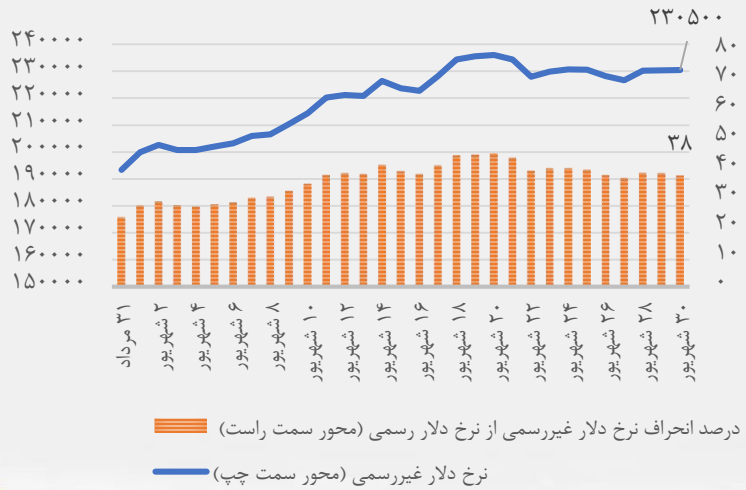
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۳۰ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۲.۱۰ و ۱.۷۳ درصد کاهش را ثبت کردند. در روز جاری، بازار طلا و سکه با وجود ثبات نسبی دلار و قیمت اونس جهانی طلا، کاهش یافتند. این کاهش را می‌توان بیشتر ناشی از ذخیره‌سازی سود پس از رشدهای اخیر بازار طلا و ارز دانست. به ویژه آنکه عامل جدید و قدرتمندی برای تحریک انتظارات سیاسی و تورمی در روز جاری مشاهده نشد.

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 (۳۰ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش قابل توجه ۶.۶۴ و ۵.۱۵ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت‌کوین در بازارهای جهانی با جهشی حدود ۶.۶۸ درصدی به محدوده ۸۶.۶۲ هزار دلار رسید و به بالاترین سطح هشت ماه اخیر صعود کرد. این رشد در شرایطی رخ داد که با وجود افزایش اخیر نرخ بهره فدرال رزرو و توقف پیشروی قانون شفافیت بازار دارایی‌های دیجیتال (Clarity Act)، فشار فروش ناشی از این عوامل تا حد زیادی جذب شده بود. در مقابل، ورود مجدد سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در کنار بهبود فضای ریسک‌پذیری در بازارهای جهانی، از تقاضای بیت‌کوین حمایت کرد. عامل مهم دیگر، بسته‌شدن اجباری موقعیت‌های فروش استقراضی بود. به‌طوری‌که بیش از ۶۰۰ میلیون دلار موقعیت فروش در بازار رمزارزها طی ۲۴ ساعت لیکویید شد. بسته‌شدن این موقعیت‌ها مستلزم خرید دارایی برای تسویه معاملات کوتاه‌مدت است و در نتیجه می‌تواند با ایجاد تقاضای اضافی، شتاب رشد قیمت را افزایش دهد. همچنین کاهش بازده اوراق خزانه‌داری آمریکا و افت قیمت نفت، فضای کلان مساعدتری برای دارایی‌های پرریسک ایجاد کرد. بنابراین، رشد بیت‌کوین در این روز را می‌توان حاصل ترکیب تقویت تقاضای نهادی، کاهش فشار ناشی از موقعیت‌های فروش و بهبود فضای ریسک‌پذیری در بازارهای جهانی دانست.

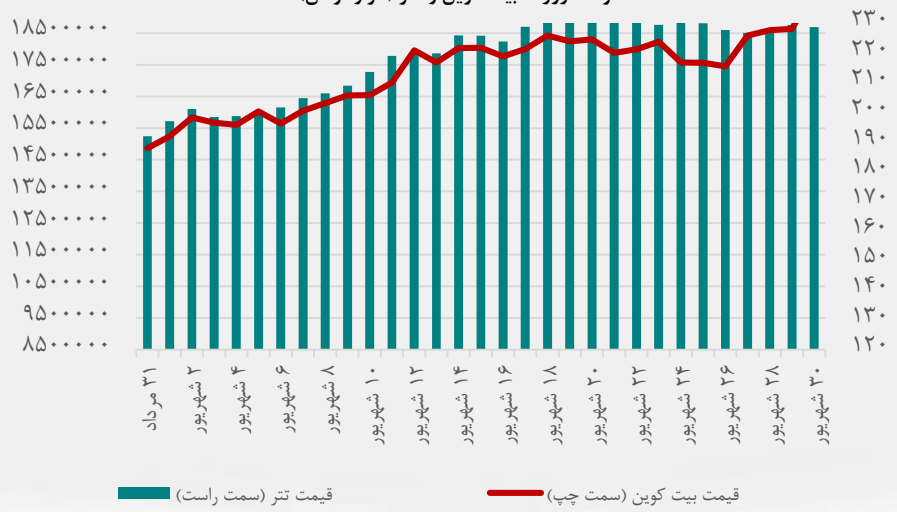
شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۳۵ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۸ هزار و ۸۰۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)

	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۸,۸۰۰	۶۳۵.۶	۱۹,۸۷۳
روز گذشته (۲۹ شهریور ۱۴۰۵)	۲۲۹,۶۰۰	۶۰۴.۴	۱۸,۶۳۵
تغییرات (درصد)	-۰.۳۵	+۵.۱۵	+۶.۶۴

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی