تحولات بازارهای مالی در روز سه شنبه مورخ ۳۱ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۶۲

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۳۱ شهریورماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت کاهش یافت، اما همزمان خالص ورود پول حقیقی به این بازار افزایش پیدا کرد. موضوعی که نشان می‌دهد، با وجود کاهش فعالیت معاملاتی، تمایل سرمایه‌گذاران حقیقی به نگهداری دارایی‌های کم‌ریسک‌تر تقویت شده است. از سوی دیگر، ثبات نسبی نرخ بهره بدون ریسک بیانگر آن است که در این روز تغییر محسوسی در بازده مورد انتظار اوراق ایجاد نشده است. در مجموع، هم‌زمانی افزایش ورود پول حقیقی با کاهش ارزش معاملات را می‌توان نشانه‌ای از تقویت تقاضا برای اوراق درآمد ثابت، در شرایط فشار فروش در بازار سهام دانست. به‌ویژه آنکه در همین روز بازار سهام با خروج قابل توجه پول حقیقی مواجه شد.

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)
۱,۳۲۶.۴	۳۸.۲۵	-۰.۰۹	۱۷۲,۹۹۰
۱,۳۲۵.۱	۳۸.۳۷	-۰.۲۲	۲۰۴,۴۴۶
+۰.۱۰	-۰.۱۲	+۶۰.۲	-۱۵.۴

روز جاری (۳۱ شهریور ۱۴۰۵)
روز گذشته (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)
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
۵۶,۷۸۶	۶۲.۹۸	۲۳۱,۰۱۶	۱,۹۲۲,۳۱۳	۱,۱۸۵,۳۵۵	۷,۱۶۷,۴۰۶
۵۶,۷۴۲	۷۵.۴۱	۲۶۵,۰۳۸	۱,۹۳۶,۹۳۲	۱,۲۰۵,۴۷۶	۷,۲۸۰,۴۳۰
+۰.۰۸	-۱۶.۵	-۱۳	-۰.۷۵	-۱.۶۷	-۱.۵۵

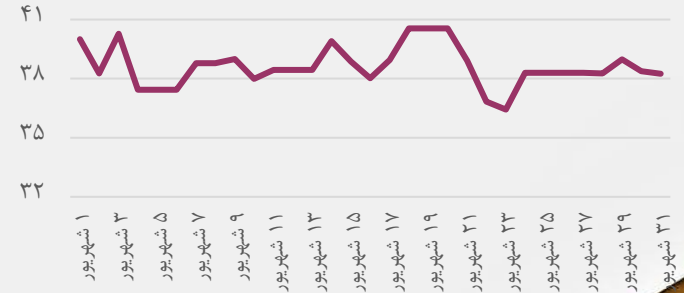
روز جاری (۳۱ شهریور ۱۴۰۵)
روز گذشته (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۳۱ شهریور ۱۴۰۵)، بورس تهران با تشدید فشار فروش مواجه شد و شاخص کل با افت ۱.۵۵ درصدی به ۷ میلیون و ۱۶۷ هزار واحد رسید. شاخص کل هم‌وزن نیز ۰.۷۶ درصد کاهش یافت. هم‌زمان، حدود ۴.۲ همت، پول حقیقی از بازار سهام بورس خارج شد و تعداد بالای نمادهای منفی نشان‌دهنده گستردگی عرضه در بازار بود.

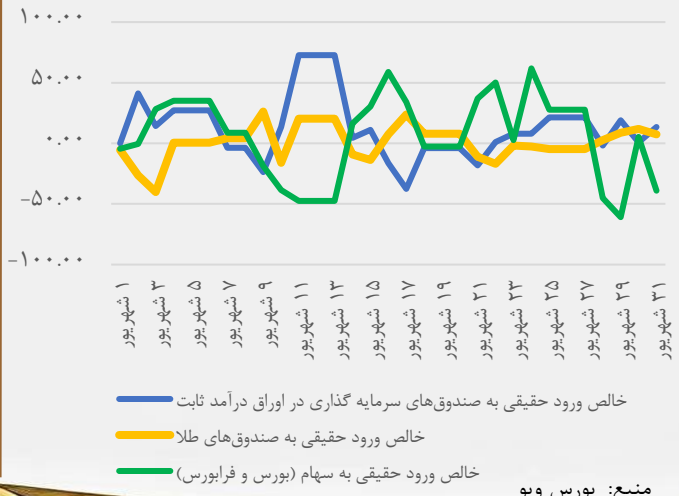
این روند در ادامه ضعف معاملات روزهای پایانی هفته شکل گرفت و فشار فروش در نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز، به‌ویژه فملی، فارس و گروه‌های پالایشی، نقش مهمی در افت شاخص داشت. ذخیره‌سازی سود پس از رشدهای اخیر، تداوم فضای اصلاحی بازار و خروج پول حقیقی از مهم‌ترین عوامل افت بازار بود. در مجموع، هم‌زمانی افت شاخص‌های اصلی سهام، گستردگی نمادهای منفی و خروج پول حقیقی نشان می‌دهد که بازار در این روز وارد مرحله‌ای از تعدیل قیمت‌ها و کاهش موقت تقاضا پس از رشدهای اخیر شده است.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

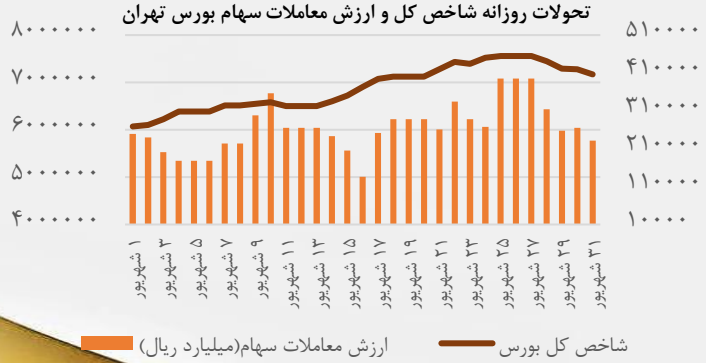
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۳۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۹.۱۲ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۱۳.۴۲ و ۷.۳۸ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و 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 سه شنبه مورخ ۳۱ شهریور ۱۴۰۵ – شماره ۶۲

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 (۳۱ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۴,۰۳۶	۶۳,۷۷۰	۲۳۰,۰۱۰	۱۶۸,۳۷۵	۲۳۲,۰۰۰
روز گذشته (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۲,۵۳۱	۶۳,۳۶۰	۲۳۰,۱۹۰	۱۶۷,۵۹۹	۲۳۰,۵۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۶۵	+۰.۶۵	−۰.۰۸	+۰.۴۶	+۰.۶۵

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۳۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۶۵ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۳۲ هزار تومان رسید. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری با افزایش ۰.۴۶ درصدی همراه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی در مسیر صعودی قرار گرفت. در این روز، بازار دلار غیررسمی در انتظار نتایج تحولات سیاسی در حاشیه مجمع عمومی سازمان ملل و مذاکرات ایران و آمریکا بود. از یک‌سو، اخبار مربوط به دیدار نمایندگان دو کشور و اظهارات ترامپ درباره «سازنده» بودن مذاکرات، سیگنال مثبتی برای بازار محسوب شد، اما از سوی دیگر، ابهامات موجود در مسیر مذاکرات و تحولات مربوط به تنگه هرمز مانع از شکل‌گیری خوش‌بینی پایدار شد. در همین شرایط، تهدید آمریکا به اعمال تحریم‌های ثانویه علیه شرکت‌ها و ارائه‌دهندگان خدمات به هواپیماهای ایرانی از ۲۳ سپتامبر ۲۰۲۶ (۱ مهرماه ۱۴۰۵) نیز به افزایش ریسک‌های اقتصادی دامن زد. این موضوع از منظر بازار ارز، با افزایش نگرانی درباره محدودیت‌های مبادلات خارجی و دسترسی به منابع ارزی، می‌تواند انتظارات احتیاطی و تقاضا برای ارز را تقویت کند. در مجموع، رفتار دلار در روز جاری، حاصل برهم‌کنش سیگنال‌های متضاد سیاسی و اقتصادی بود. اخبار مذاکرات از یک سو ظرفیت کاهش ریسک سیاسی را داشت و تهدید تحریم‌های ثانویه و ابهامات مرتبط با تنگه هرمز از سوی دیگر، ریسک‌های افزایشی را تقویت کرد. بنابراین، افزایش تقاضای احتیاطی ارز در این روز را می‌توان در چارچوب تداوم نااطمینانی سیاسی، تشدید فشارهای تحریمی و نگرانی نسبت به محدودیت‌های آتی جریان‌های ارزی تحلیل کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

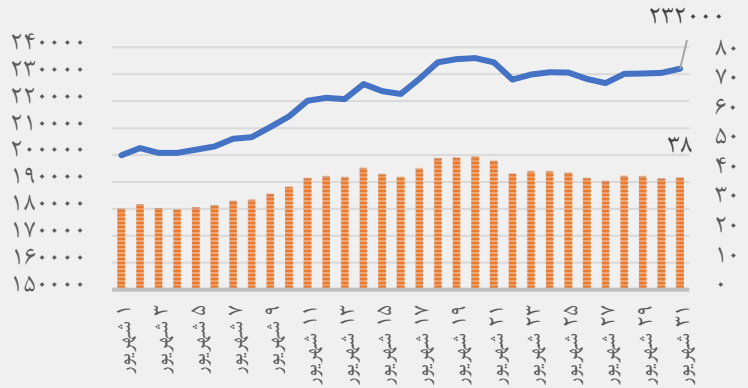
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	قیمت (میلیون تومان / دلار)						
	سکه امامی	طلای ۱۸ عیار	گواهی سپرده سکه	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده شمش نقره	اونس جهانی طلا (دلار)	اونس جهانی نقره (دلار)
روز جاری (۳۱ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۷.۴۹	۲۳.۹۴	۲۳۵.۸۸	۳.۱۸۷	۰.۵۰۱	۴,۳۶۴	۶۷.۴۱
روز گذشته (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۲۳۳.۹۸	۲۳.۷۱	۲۳۴.۶۷	۳.۱۴۸	۰.۴۹۸	۴,۳۴۴	۶۶.۰۵
تغییرات (درصد)	+۱.۵۰	+۰.۹۸	+۰.۵۱	+۱.۲۴	+۰.۵۵	+۰.۴۷	+۲.۰۵

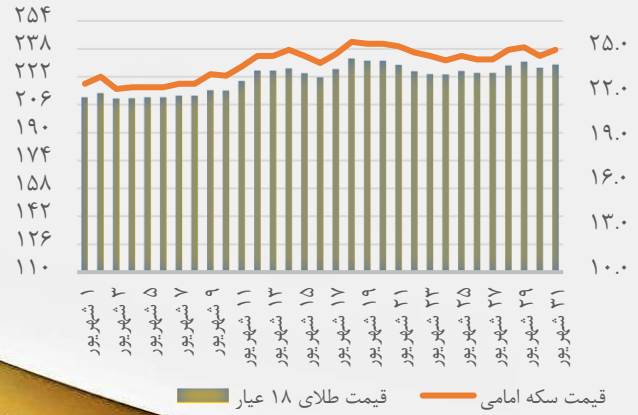
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۳۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۱.۵ و ۰.۹۸ درصد افزایش را ثبت کردند. این افزایش، عمدتا تحت تاثیر افزایش قیمت اونس جهانی طلا در کنار افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی به وقوع پیوست.

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

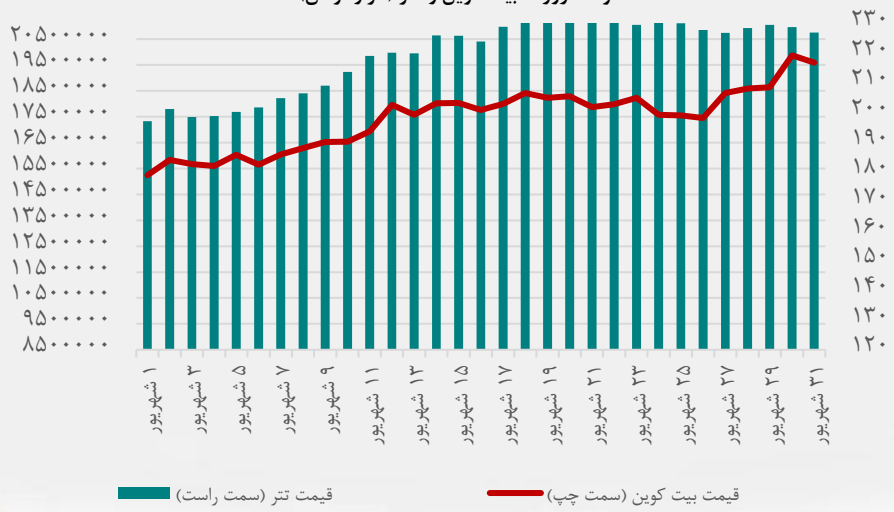
در روز جاری (۳۱ شهریورماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۱.۴۴ و ۱.۶۸ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت‌کوین در بازارهای جهانی با کاهش همراه شد و پس از صعود قابل توجه روز گذشته و ثبت سقف حدود ۸۶.۶۲ هزار دلار، با کاهش ۰.۵ درصدی به محدوده ۸۶.۲ هزار دلار عقب‌نشینی کرد. این افت محدود، عمدتاً در پی ذخیره‌سازی سود معامله‌گران و تعدیل موقعیت‌های اهرمی پس از رشد سریع قیمت رخ داد. در کنار آن، تداوم نرخ‌های بهره بالا و بازده قابل‌توجه اوراق خزانه آمریکا، همچنان از عوامل محدودکننده تقاضا برای دارایی‌های پرریسک و بدون بازدهی محسوب شد. در بازار ایران نیز کاهش قیمت بیت‌کوین، تحت تأثیر افت قیمت جهانی آن قرار گرفت و هم‌زمان، تغییرات کاهشی قیمت تتر، شدت این کاهش را در بازار ریالی بیشتر کرد. بنابراین، افت بیت‌کوین در این روز را می‌توان عمدتاً اصلاح پس از رشد سریع و ذخیره‌سازی سود در بازار جهانی دانست؛ هرچند تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت کوین نشان داد که تقاضای نهادی همچنان در بازار حضور دارد و کاهش این روز الزاماً به معنای تغییر بنیادین روند بازار نبود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۷۹ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۲۷ هزار تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۳۱ شهریور ۱۴۰۵)	۱۹,۵۸۷	۶۲۴.۹	۲۲۷,۰۰۰
روز گذشته (۳۰ شهریور ۱۴۰۵)	۱۹,۸۷۳	۶۳۵.۶	۲۲۸,۸۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۴۴	-۱.۶۸	-۰.۷۹

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