تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۴ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۴

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۴ مهرماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات و رشد خالص ورود پول حقیقی همراه شد. هم‌زمان، نرخ بهره بدون ریسک نیز افزایش یافت که با بالا بردن بازدهی مورد انتظار سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت، جذابیت نسبی این بازار را تقویت کرد. در این شرایط، افزایش ورود نقدینگی حقیقی در کنار رشد ارزش معاملات نشان‌دهنده تقویت تقاضا برای اوراق بدهی و تمایل بیشتر سرمایه‌گذاران به استفاده از فرصت‌های بازدهی با ریسک پایین‌تر 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)
روز جاری (۴ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۳۱.۴	۳۹.۸۴	۳.۷۱	۶۷,۹۴۵
روز گذشته (۱ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۲۶.۶	۳۸.۱۳	-۰.۰۷	۱۵,۰۵۰
تغییرات (درصد)	+۰.۳۶	+۱.۷۱	+۵۶۶۲.۶	+۳۵۱.۵

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

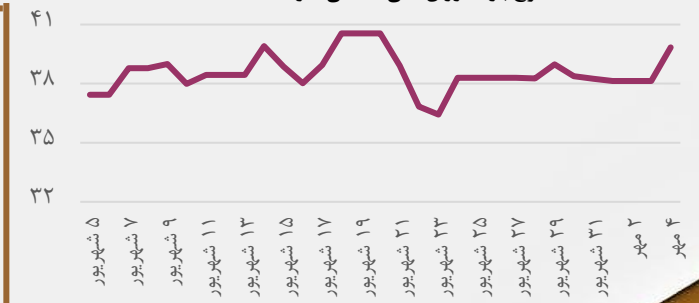
	فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
	شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی- ارزشی)	شاخص کل
روز جاری (۴ مهر ۱۴۰۵)	۵۷,۶۵۹	۶۷.۸۳	۲۶۴,۲۷۷	۱,۹۲۹,۶۸۹	۱,۱۸۲,۹۸۷	۷,۱۵۳,۰۹۰
روز گذشته (۱ مهر ۱۴۰۵)	۵۷,۶۱۲	۶۳.۵۰	۲۵۸,۸۰۶	۱,۹۳۹,۰۲۰	۱,۲۰۰,۱۷۹	۷,۲۵۷,۰۴۳
تغییرات (درصد)	+۰.۰۸	+۶.۸	+۲	-۰.۴۸	-۱.۴۳	-۱.۴۳

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۴ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران تحت تأثیر افزایش عرضه و خروج نقدینگی حقیقی با افت همراه شد. شاخص کل ۱.۴۳ درصد و شاخص هم‌وزن ۰.۴۸ درصد کاهش یافت که افت بیشتر شاخص کل، بیانگر فشار فروش بالاتر در سهام بزرگ و شاخص‌ساز بود. این روند در ادامه اصلاح بازار پس از رشدهای اخیر رخ داد. خروج حدود ۵.۵ همت پول حقیقی از بازار سهام بورس، افزایش شناسایی سود و کاهش ریسک‌پذیری معامله‌گران را نشان داد. با این حال، ارزش معاملات افزایش یافت و کاهش فشار فروش در نیمه دوم معاملات، از فعال بودن تقاضا در سطوح پایین‌تر حکایت داشت. در مجموع، معاملات این روز بیشتر نشان‌دهنده تداوم فاز اصلاحی پس از رشد پرشتاب اخیر بود و جهت جریان نقدینگی حقیقی و تحولات سیاسی و ارزی، همچنان عوامل مهم تعیین‌کننده روند کوتاه‌مدت بازار هستند.

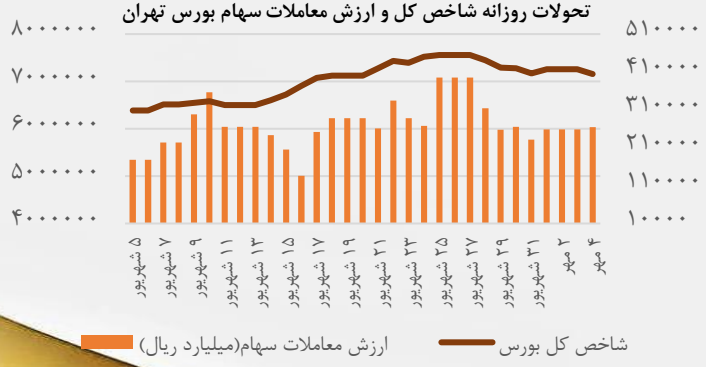
شایان ذکر است، در روز جاری شاخص کل فرابورس تقریبا ثابت و در سطح ۵۷ هزار و ۶۵۹ واحد قرار گرفت.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

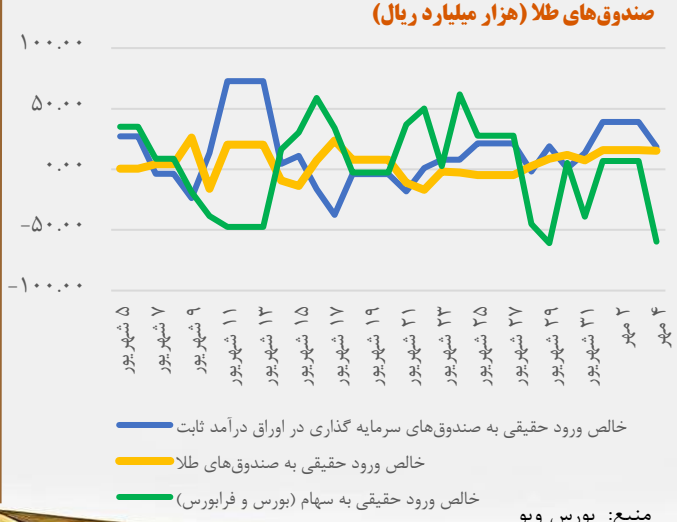


منبع: بورس ویو

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 (۴ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۵۹.۶۲ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۱۸.۴۳ و ۱۵.۳۷ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و 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 شنبه مورخ ۴ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۴

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 (۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۶,۰۵۴	۶۴,۳۲۰	۲۳۱,۷۹۰	۱۷۰,۶۲۷	۲۳۳,۸۰۰
روز گذشته (۳ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۵,۵۴۱	۶۴,۱۸۰	۲۳۱,۵۹۰	۱۷۰,۶۲۷	۲۳۳,۵۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۲۲	+۰.۲۲	+۰.۰۹	۰.۰	+۰.۱۳

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۴ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، تقریبا ثابت و در سطح ۲۳۳ هزار و ۸۰۰ تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری ثابت بود.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی در مجموع تقریباً ثابت ماند و در محدوده ۲۳۴ هزار تومان قرار گرفت. در این روز، تحولات دیپلماتیک در نیویورک همچنان مهم‌ترین عامل اثرگذار بر انتظارات بازار ارز بود. در جریان مذاکرات غیرمستقیم ایران و آمریکا، موضوع توافق مرحله‌ای برای پایان درگیری‌ها، رفع محاصره دریایی و بازگشایی تنگه هرمز مطرح شد. به‌گونه‌ای که بر اساس پیشنهاد ایران، در صورت تحقق شروط موردنظر تهران، روند توقف درگیری‌ها آغاز و تنگه هرمز پس از هفت روز بازگشایی می‌شد. با این حال، اختلاف دو طرف بر سر شروط توافق و اظهارات متناقض مقامات آمریکایی و ایرانی، از شکل‌گیری انتظارات کاهشی پایدار جلوگیری کرد. در مجموع، ثبات تقریبی قیمت دلار در بازار غیررسمی را می‌توان حاصل تقابل سیگنال‌های کاهشی ناشی از احتمال توافق مرحله‌ای و بازگشایی هرمز با ریسک‌های افزایشی ناشی از تداوم ابهام در مذاکرات دانست.

تحولات بازار سکه و طلا

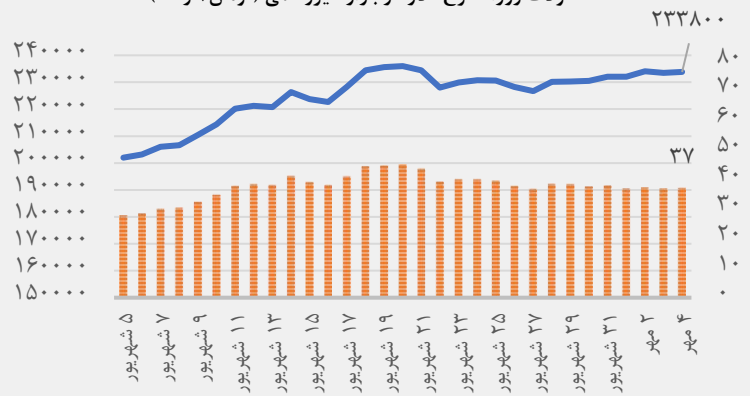
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۴ مهر ۱۴۰۵)	۶۴.۳۱	۴,۲۸۷	۰.۵۰۲	۳.۱۸۴	۲۳۷.۱۰	۲۳.۸۳	۲۳۸.۴۹
روز گذشته (۲ مهر ۱۴۰۵)	۶۴.۳۱	۴,۲۸۷	۰.۴۹۵	۳.۱۵۴	۲۳۴.۵۵	۲۴.۱۲	۲۴۰.۰۱
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۱.۵۴	+۰.۹۴	+۱.۰۹	-۱.۲۲	-۰.۶۳

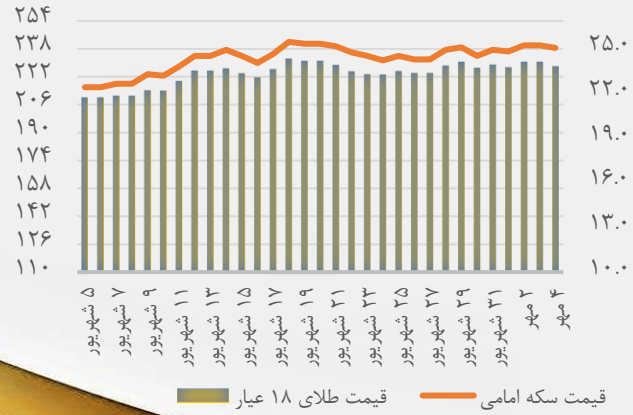
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۴ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۰.۶۳ و ۱.۲۲ درصد کاهش را ثبت کردند. با وجود ثبات تقریبی قیمت دلار در بازار غیر رسمی و ثبات قیمت اونس جهانی طلا در تعطیلات آخر هفته بازارهای جهانی، این افرایش محدود ناشی از شناسایی سود پس از رشدهای اخیر و تعدیل انتظارات سیاسی بوده است.

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

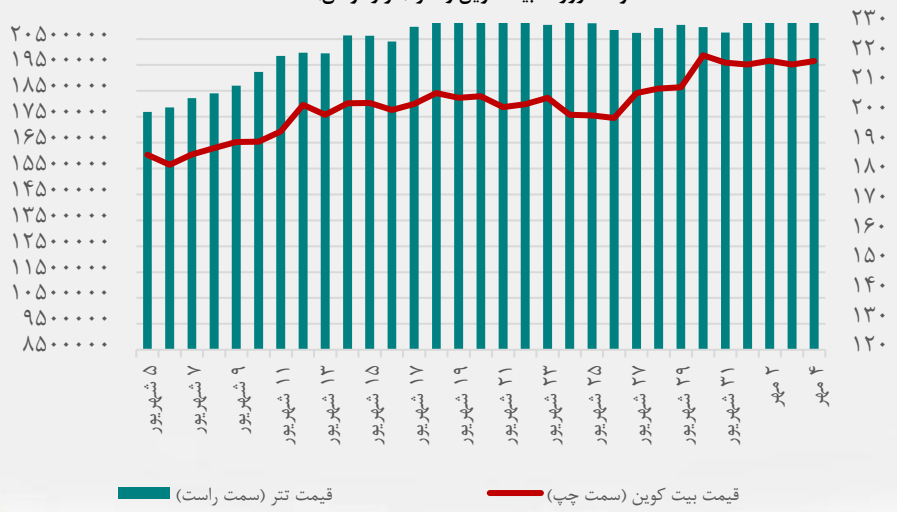
در روز جاری (۴ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۶۸ و ۰.۳ درصدی همراه شدند. در روز جاری، قیمت بیت‌کوین با نوسان محدود در محدوده ۸۴ هزار دلار قرار گرفت. اگرچه فاصله گرفتن قیمت از سقف ۸۷ هزار دلار در روزهای اخیر، بیانگر تداوم شناسایی سود پس از رشد اخیر بود، اما تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت کوین، از پایداری نسبی تقاضا و جلوگیری از تشدید فشار فروش حمایت کرد. همچنین، کاهش سهم بیت‌کوین از بازار رمزارزها به زیر ۶۰ درصد (معادل ۵۸.۵ درصد) براساس گزارش Tradingview، نشان‌دهنده انتقال بخشی از نقدینگی به سایر رمزارزها بود. در مجموع، معاملات ۴ مهر، بیانگر تثبیت قیمت بیت‌کوین پس از اصلاح اخیر، همراه با تداوم حمایت جریان سرمایه نهادی بود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۶۵ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۳۳ هزار و ۷۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۴ مهر ۱۴۰۵)	۱۹,۶۵۰	۶۲۷.۳	۲۳۳,۷۰۰
روز گذشته (۳ مهر ۱۴۰۵)	۱۹,۵۱۷	۶۲۵.۴	۲۳۲,۲۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۶۸	+۰.۳۰	+۰.۶۵

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی