تحولات بازارهای مالی در روز یکشنبه مورخ ۵ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۵

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۵ مهرماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت افزایش یافت، اما همزمان خالص ورود پول حقیقی کاهش پیدا کرد و نرخ بهره بدون ریسک افزایش یافت. این وضعیت نشان می‌دهد افزایش ارزش معاملات بیشتر به معنای افزایش گردش معاملات بوده و به تقویت تقاضای حقیقی منجر نشده است. از سوی دیگر، رشد نرخ بهره بدون ریسک، بازدهی دارایی‌های کم‌ریسک را بالاتر برده و در نتیجه هزینه فرصت سرمایه‌گذاری در دارایی‌های پرریسک، از جمله سهام، افزایش یافته است. موضوعی که می‌تواند در کوتاه‌مدت بر ترکیب جریان نقدینگی میان بازار بدهی و سهام اثرگذار باشد.

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)
۱۳۳۱.۴	۴۰.۴۴	۱.۳۳	۵۳۷.۷۳۲
۱,۳۳۱.۴	۳۹.۸۴	۳.۷۱	۶۷.۹۴۵
۰.۰	+۰.۶۰	-۶۴.۱	+۶۹۱.۴

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
۵۸,۷۵۵	۵۴.۱۴	۱۷۶,۹۰۶	۱,۹۶۱,۱۲۴	۱,۲۰۳,۰۰۸	۷,۲۷۴,۱۴۵
۵۷,۶۵۹	۶۷.۸۳	۲۶۴,۲۷۷	۱,۹۲۹,۶۸۹	۱,۱۸۲,۹۸۷	۷,۱۵۳,۰۹۰
+۱.۹۰	-۲۰.۲	-۳۳	+۱.۶۳	+۱.۶۹	+۱.۶۹

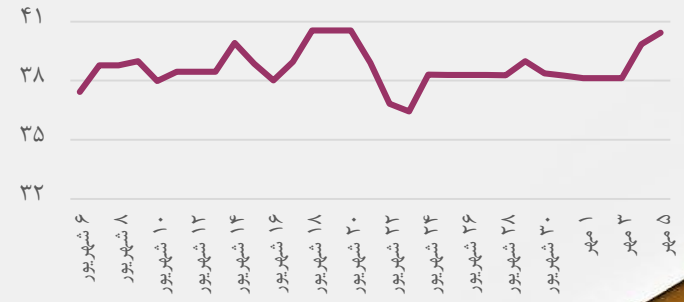
روز جاری (۵ مهر ۱۴۰۵)
روز گذشته (۴ مهر ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۵ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از افت روز گذشته، با بازگشت تقاضا مواجه شد و شاخص کل با رشد ۱.۶۹ درصدی، به ۷ میلیون و ۲۷۴ هزار واحد رسید. شاخص هم‌وزن نیز حدود ۱.۶ درصد افزایش یافت که بیانگر فراگیر بودن تقاضا و محدود نبودن رشد بازار به نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بود.

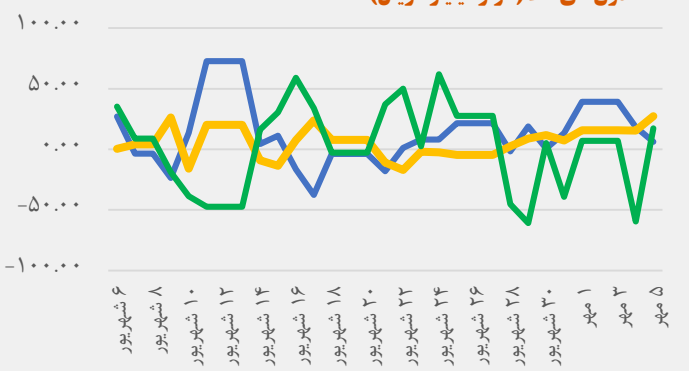
در این روز، ورود نقدینگی حقیقی به سهام نیز تقویت شد. این رفتار در کنار رشد همزمان شاخص‌های کل و هم‌وزن، نشان‌دهنده افزایش تمایل سرمایه‌گذاران به پذیرش ریسک و بازگشت بخشی از تقاضای حقیقی به بازار سهام بود. با این حال، ارزش معاملات کاهش یافت که هنوز برای تأیید تداوم یک روند صعودی پایدار کافی به نظر نمی‌رسید. ازاین‌رو، رشد ۵ مهر را می‌توان در وهله نخست حرکت بازگشتی بازار پس از اصلاح روز قبل دانست و استمرار ورود پول حقیقی و افزایش ارزش معاملات در روزهای آتی را شرط مهم تثبیت این روند ارزیابی کرد.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

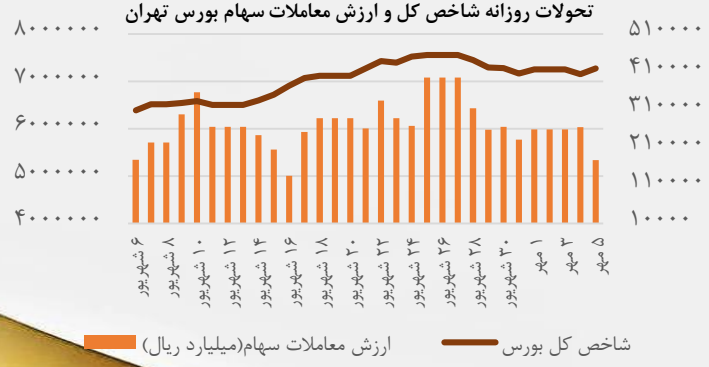
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۵ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۷.۴۰، ۶.۰۸ و ۲۷.۳۸ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، 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 یکشنبه مورخ ۵ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۵

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 (۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۷,۲۶۶	۶۴,۶۵۰	۲۳۴,۰۱۰	۱۷۱,۷۴۰	۲۳۵,۰۰۰
روز گذشته (۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۶,۰۵۴	۶۴,۳۲۰	۲۳۱,۷۹۰	۱۷۰,۶۲۷	۲۳۳,۸۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۵۱	+۰.۵۱	+۰.۹۶	+۰.۶۵	+۰.۵۱

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش محدود ۰.۵۱ درصدی همراه شد و در سطح ۲۳۵ هزار تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری نیز با افزایش ۰.۶۵ درصدی مواجه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی با افزایش محدود همراه شد و در محدوده ۲۳۴ تا ۲۳۵ هزار تومان معامله شد. مهم‌ترین عامل اثرگذار بر بازار دلار غیررسمی، تداوم ابهام در چشم‌انداز مذاکرات ایران و آمریکا و تحولات مرتبط با تنگه هرمز بود. به‌گونه‌ای که از یک‌سو بحث توافق مرحله‌ای و بازگشایی تنگه هرمز از شکل‌گیری جهش شدید قیمت جلوگیری کرد و از سوی دیگر، رد پیشنهاد تهران از سوی واشنگتن و تداوم اختلافات بر سر تحریم‌ها و نحوه بازگشایی تنگه، مانع از تقویت انتظارات کاهشی شد.

در سمت عوامل تعدیل‌کننده نیز، اقدامات بانک مرکزی برای تقویت عرضه ارز مورد توجه بازار بود. طبق اعلام دستیار ارزی رئیس‌کل بانک مرکزی در روز قبل، اصلاح سیاست‌های ارزی موجب بهبود بازگشت ارز صادراتی و حتی ایجاد مازاد عرضه ارز در سامانه‌های بانک مرکزی شده و امکان بازگشت اسکناس نیز فراهم شده است. به گفته وی، بیش از ۱.۵ میلیارد دلار از این مسیر به کشور بازگشته است. همچنین رئیس کل بانک مرکزی نیز پیش‌تر اعلام کرده بود که بیش از ۱۰ میلیارد دلار از ارزهای تراستی‌ها بازگشته و برای تأمین ارز واردات تخصیص یافته است.

تحولات بازار سکه و طلا

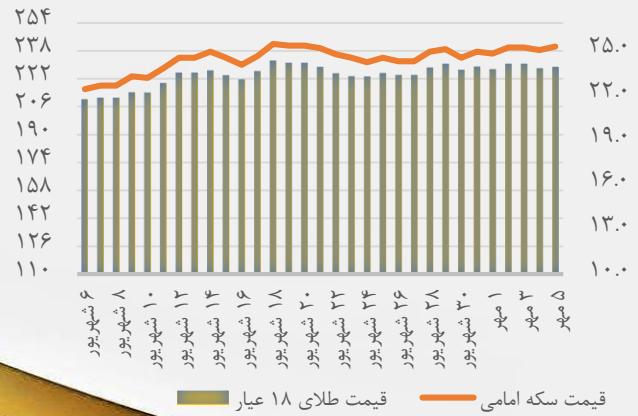
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۵ مهر ۱۴۰۵)	۶۳.۷۴	۴,۲۶۱	۰.۵۰۳	۳.۲۰۰	۲۳۸.۱۸	۲۳.۹۰	۲۴۰.۵۱
روز گذشته (۴ مهر ۱۴۰۵)	۶۴.۳۱	۴,۲۸۷	۰.۵۰۲	۳.۱۸۴	۲۳۷.۱۰	۲۳.۸۳	۲۳۸.۴۹
تغییرات (درصد)	-۰.۸۷	-۰.۶۲	+۰.۰۸	+۰.۴۹	+۰.۴۶	+۰.۳۰	+۰.۸۴

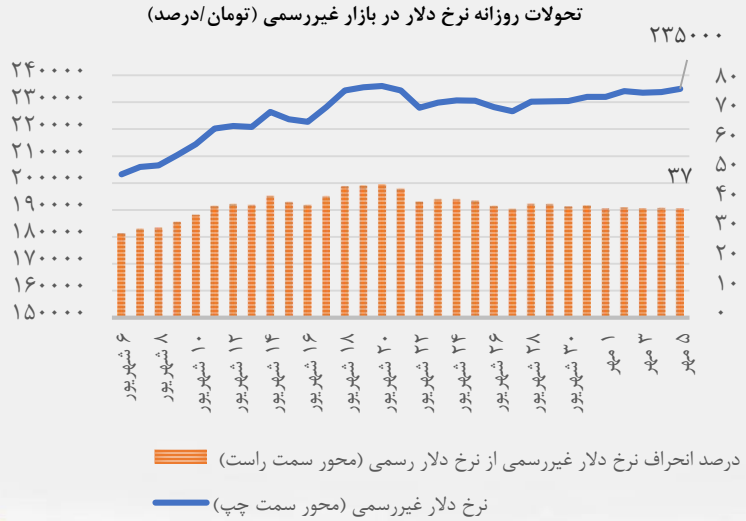
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۰.۸۴ و ۰.۳ درصد افزایش را ثبت کردند. این افزایش محدود عمدتا متاثر از اثر غالب افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی در کنار ابهامات سیاسی، با وجود کاهش قیمت جهانی اونس طلا بوده است.

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

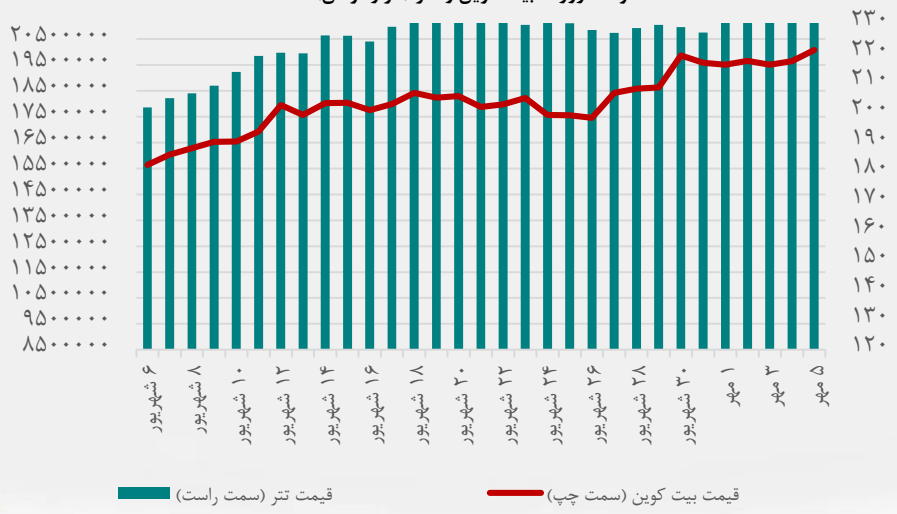
در روز جاری (۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۲.۲۱ و ۱.۷۹ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی با افزایش جزئی همراه شد و در محدوده ۸۴ هزار دلار قرار گرفت. تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین، از عوامل حمایت‌کننده قیمت بود. با این حال، رد پیشنهاد ایران برای بازگشایی تنگه هرمز از سوی ترامپ در روز قبل، بر نااطمینانی‌های ژئوپلیتیکی افزود و در کنار افزایش بازده اوراق خزانه‌داری آمریکا، از شتاب رشد قیمت بیت‌کوین کاست. در بازار داخلی، افزایش قیمت تتر موجب شد، قیمت ریالی بیت‌کوین بیش از میزان رشد دلاری آن افزایش یابد. بنابراین، رشد ارزش ریالی این دارایی در ۵ مهر، علاوه بر افزایش جزئی قیمت جهانی بیت‌کوین، از افزایش قیمت تتر نیز متأثر بود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۱.۳۱ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۳۶ هزار و ۷۵۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۶,۷۵۰	۶۳۸.۵	۲۰,۰۸۴
روز گذشته (۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۳,۷۰۰	۶۲۷.۳	۱۹,۶۵۰
تغییرات (درصد)	+۱.۳۱	+۱.۷۹	+۲.۲۱

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