تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۶ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۶

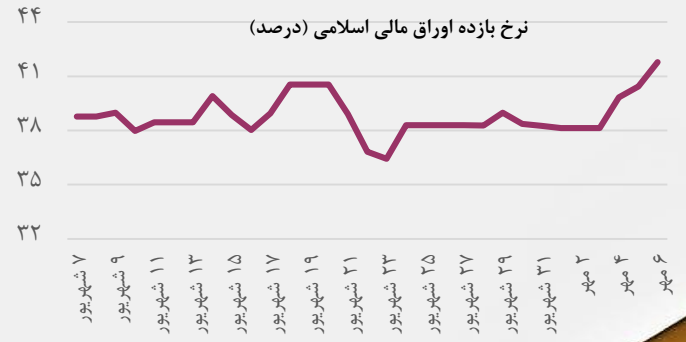
تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۶ مهرماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت کاهش یافت و هم‌زمان خروج پول حقیقی از این بازار ثبت شد. در مقابل، نرخ بهره بدون ریسک با افزایش قابل‌ملاحظه‌ای همراه شد و به حدود ۴۲ درصد رسید. سطحی که نشان‌دهنده تداوم فشار صعودی بر نرخ‌های بازده در بازار بدهی و افزایش هزینه فرصت سرمایه‌گذاری در بازار سهام است. با وجود رشد قابل‌توجه نرخ بهره بدون ریسک، در این روز بخشی از نقدینگی حقیقی از اوراق درآمد ثابت خارج شد که می‌تواند بیانگر انتقال منابع به سمت دارایی‌های ریسکی‌تر، به‌ویژه سهام، در شرایط صعودی بازار سهام 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)	
۱,۳۳۲.۷	۴۱.۷۸	-۱.۰۵	۴۸.۰۲۹	روز جاری (۶ مهر ۱۴۰۵)
۱۳۳۱.۴	۴۰.۴۴	۱.۳۳	۵۳۷.۷۳۲	روز گذشته (۵ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۱۰	+۱.۳۴	-۱۷۸.۸	-۹۱.۱	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

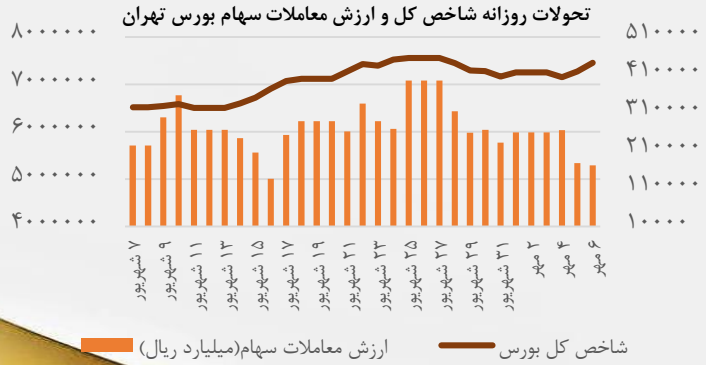
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
۶۰,۰۷۳	۴۵.۸۶	۱۷۱,۶۱۵	۲,۰۰۵,۱۶۹	۱,۲۳۳,۴۴۸	۷,۴۵۹,۳۳۸
۵۸,۷۵۵	۵۴.۱۴	۱۷۶,۹۰۶	۱,۹۶۱,۱۲۴	۱,۲۰۳,۰۰۸	۷,۲۷۴,۱۴۵
+۲.۲۴	-۱۵.۲	-۳	+۲.۲۵	+۲.۵۳	+۲.۵۵

روز جاری (۶ مهر ۱۴۰۵)
روز گذشته (۵ مهر ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

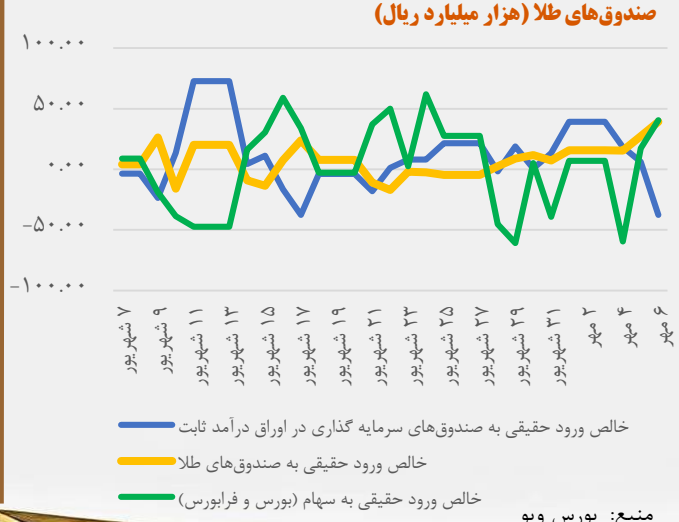
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۶ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران با بازگشت قدرتمند تقاضا همراه شد و شاخص کل با رشد حدود ۲.۶ درصدی به ۷ میلیون و ۴۵۹ هزار واحد رسید. شاخص هم‌وزن نیز حدود ۲.۳ درصد افزایش یافت و از مرز ۲ میلیون واحد عبور کرد؛ بنابراین، رشد بازار در این روز صرفاً متکی به نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز نبود و دامنه نسبتاً گسترده‌ای از نمادها را دربر گرفت. هم‌زمان، ورود قابل‌توجه نقدینگی حقیقی به بازار، نشان‌دهنده تقویت تقاضا و چرخش جریان نقدینگی به سمت سهام بود.

تقویت انتظارات تورمی و جهش نرخ دلار از مهم‌ترین عوامل حمایت‌کننده از تقاضای سهام، به‌ویژه در صنایع صادرات‌محور، بود. در مجموع، معاملات ۶ مهر نشان داد که پس از اصلاح روز قبل، تقاضا و ورود نقدینگی حقیقی به شکل محسوسی تقویت شده است. با این حال، استمرار ورود پول در روزهای بعد، برای ارزیابی پایداری این حرکت صعودی اهمیت خواهد داشت.



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 (۶ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۴۰.۴۹ و ۳۹.۱۳ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های طلا صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۳۷.۵ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) اتفاق افتاده 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 ۶ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۶

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 (۶ مهر ۱۴۰۵)	۲۴۶,۱۴۷	۶۷,۰۷۰	۲۴۱,۷۹۰	۱۷۲,۸۵۱	۲۴۴,۱۰۰
روز گذشته (۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۷,۲۶۶	۶۴,۶۵۰	۲۳۴,۰۱۰	۱۷۱,۷۴۰	۲۳۵,۰۰۰
تغییرات (درصد)	+۳.۷۴	+۳.۷۴	+۳.۳۲	+۰.۶۵	+۳.۸۷

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۶ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با جهش قابل ملاحظه ۳.۸۷ درصدی همراه شد و در سطح ۲۴۴ هزار و ۱۰۰ 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 جهش قابل‌ملاحظه‌ای همراه شد و به محدوده ۲۴۴ هزار تومان رسید و رکورد جدیدی ثبت کرد. این افزایش عمدتاً تحت تأثیر تشدید ریسک‌های سیاسی و نگرانی از محدودتر شدن منابع ارزی کشور شکل گرفت. در این میان، اسکات بسنت، وزیر خزانه‌داری آمریکا، بر تداوم فشار اقتصادی و عملیات «انزوای اقتصادی» علیه ایران تأکید کرد. وی در اظهارات روز گذشته خود مدعی شد که تنها حدود ۱۵ میلیون بشکه نفت ایران برای تحویل به چین باقی مانده و ایران احتمالاً ظرف دو هفته «چیزی برای مبادله نخواهد داشت». این اظهارات، انتظارات نسبت به تشدید فشارهای اقتصادی و محدودیت درآمدهای ارزی را تقویت کرد. در کنار عوامل سیاسی و نگرانی برای محدودیت منابع ارزی، متغیرهای بنیادی نیز زمینه افزایش قیمت را تقویت کردند. افزایش انتظارات تورمی و نگرانی نسبت به تداوم فشارهای تورمی، انگیزه نگهداری دلار به‌عنوان پوشش ریسک افت ارزش پول ملی را افزایش داده است. بنابراین، جهش دلار در این روز را می‌توان حاصل هم‌زمانی تشدید ریسک سیاسی و تحریمی با افزایش تقاضای احتیاطی و انتظارات تورمی دانست. عواملی که موجب شد، نرخ دلار در مدت کوتاهی از مرز روانی ۲۴۰ هزار تومان عبور کند.

تحولات بازار سکه و طلا

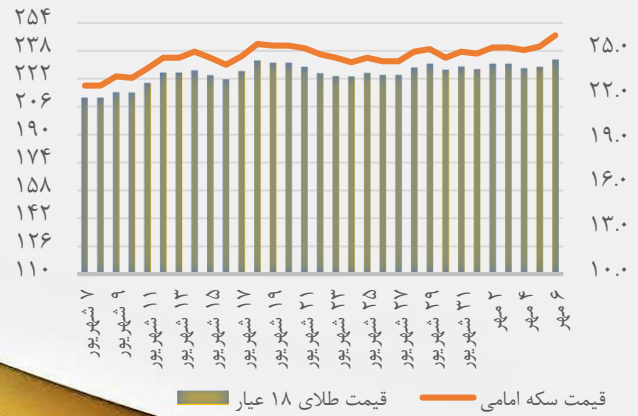
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۶ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۶۴	۴,۱۱۳	۰.۵۱۲	۳.۲۸۱	۲۴۴.۳۸	۲۴.۴۰	۲۴۶.۹۹
روز گذشته (۵ مهر ۱۴۰۵)	۶۳.۷۴	۴,۲۶۱	۰.۵۰۳	۳.۲۰۰	۲۳۸.۱۸	۲۳.۹۰	۲۴۰.۵۱
تغییرات (درصد)	-۴.۸۷	-۳.۴۶	+۱.۸۷	+۲.۵۳	+۲.۶۰	+۲.۰۹	+۲.۶۹

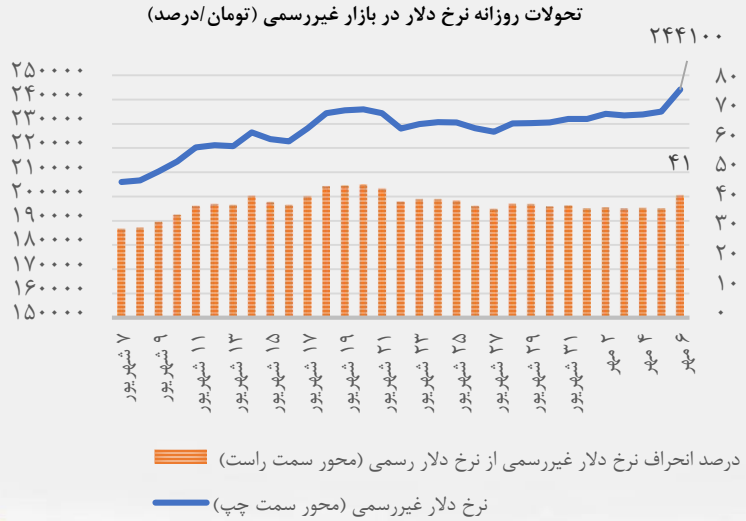
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Investing

در روز جاری (۶ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۲.۶۹ و ۲.۰۹ درصد افزایش را ثبت کردند. این افزایش عمدتا ناشی از غلبه اثر افزایشی قیمت دلار در بازار غیررسمی، تقویت انتظارات تورمی و افزایش تقاضای سفته‌بازی بر اثر کاهشی قیمت جهانی اونس طلا رخ داد.

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 (۶ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۱.۳ و ۲.۳۴ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی تحت فشار فروش قرار گرفت و تا حدود ۸۳.۵ هزار دلار عقب‌نشینی کرد. افزایش بازده اوراق خزانه‌داری آمریکا، تقویت دلار، رشد قیمت نفت و افزایش انتظارات نسبت به افزایش مجدد نرخ بهره فدرال رزرو، در کنار تشدید ریسک‌های ژئوپلیتیکی ناشی از تحولات ایران و آمریکا، فضای ریسک‌گریزی را تقویت کرد. در کنار عوامل کلان، شناسایی سود پس از رشد روزهای قبل و تسویه بخشی از موقعیت‌های اهرمی خرید نیز فشار فروش را تشدید کرد.

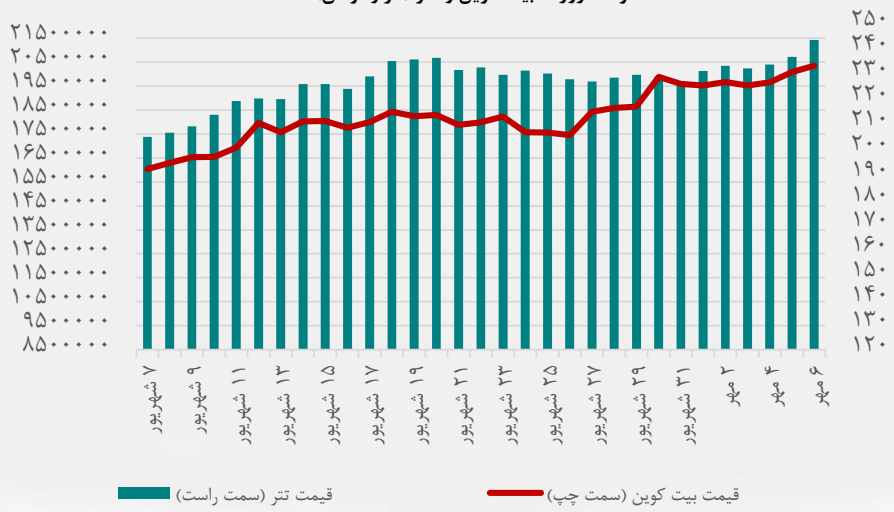
در بازار داخلی، با وجود افت قیمت جهانی، افزایش قیمت تتر، اثر کاهش قیمت بیت‌کوین به دلار را خنثی کرد. به‌طوری‌که، قیمت ریالی بیت‌کوین در گزارش پایان روز جاری، حدود ۱.۳ درصد افزایش یافت. بنابراین، رشد بیت‌کوین در بازار داخلی عمدتاً ناشی از افزایش نرخ تتر بود و نه رشد قیمت خود بیت‌کوین در بازار جهانی.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۸۷ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۴۳ هزار و ۵۵۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۶ مهر ۱۴۰۵)	۲۴۳,۵۵۰	۶۵۳.۵	۲۰,۳۴۵
روز گذشته (۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۳۶,۷۵۰	۶۳۸.۵	۲۰,۰۸۴
تغییرات (درصد)	+۲.۸۷	+۲.۳۴	+۱.۳۰

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی