تحولات بازارهای مالی در روز سه شنبه مورخ ۷ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۷

تحولات بازار سرمایه

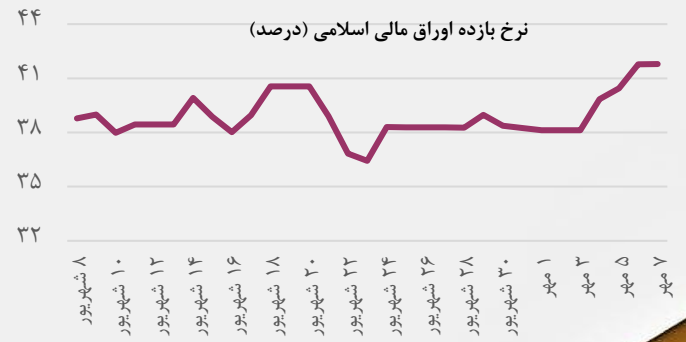
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۷ مهرماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت همراه شد، اما هم‌زمان خروج پول حقیقی شدت گرفت و نرخ بهره بدون‌ریسک تقریباً ثابت ماند. این ترکیب نشان می‌دهد افزایش ارزش معاملات الزاماً به معنای تقویت تقاضای سرمایه‌گذاران حقیقی نبوده و بخشی از افزایش گردش معاملات می‌تواند ناشی از جابه‌جایی و معاملات فعال‌تر میان سرمایه‌گذاران نهادی باشد. از سوی دیگر، ثبات نرخ بهره بدون‌ریسک در این روز، در کنار افزایش خروج پول حقیقی، نشان می‌دهد تغییر جریان نقدینگی بیشتر از آنکه ناشی از تغییر بازدهی اوراق باشد، تحت تأثیر افزایش جذابیت نسبی بازار سهام و انتقال بخشی از نقدینگی به دارایی‌های ریسک‌پذیرتر قرار داشته 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)	
۱,۳۳۳.۶	۴۱.۷۹		=۱.۴۹	۱۰۱,۵۵۳	روز جاری (۷ مهر ۱۴۰۵)
۱,۳۳۲.۷	۴۱.۷۸		-۱.۰۵	۴۸,۰۲۹	روز گذشته (۶ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۰۶	+۰.۰۱		-۴۲	+۱۱۱.۴	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران



منبع: بورس ویو

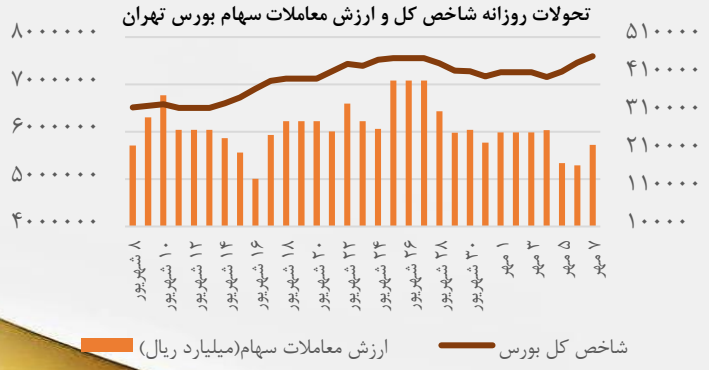
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۶۰,۷۲۰	۷۴.۳۶	۲۲۵,۱۹۹	۲,۰۳۰,۱۴۹	۱,۲۵۵,۶۱۷	۷,۵۹۴,۹۵۷	روز جاری (۷ مهر ۱۴۰۵)
۶۰,۰۷۳	۴۵.۸۶	۱۷۱,۶۱۵	۲,۰۰۵,۱۶۹	۱,۲۳۳,۴۴۸	۷,۴۵۹,۳۳۸	روز گذشته (۶ مهر ۱۴۰۵)
+۱.۰۸	+۶۲.۱	+۳۱	+۱.۲۵	+۱.۸۰	+۱.۸۲	تغییرات (درصد)

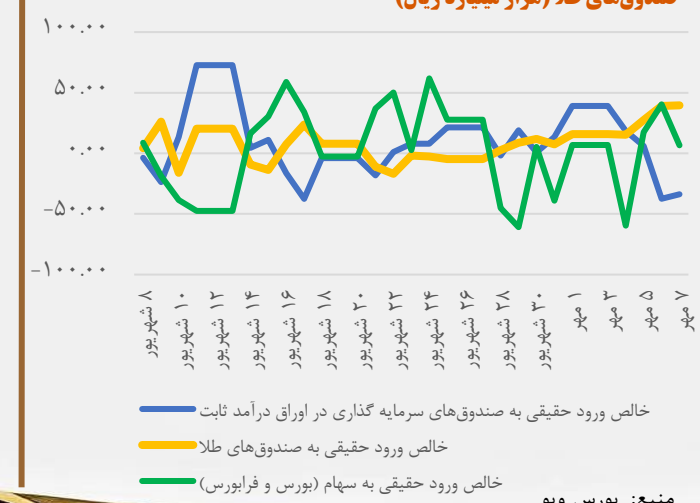
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۷ مهر ۱۴۰۵)، روند صعودی بورس تهران ادامه یافت و شاخص کل با رشد ۱.۸۲ درصدی به حدود ۷.۵۹ میلیون واحد رسید. شاخص هم‌وزن نیز حدود ۱.۲۵ درصد افزایش یافت که نشان‌دهنده تداوم تقاضا در بخش قابل‌توجهی از بازار بود. در این روز، افزایش ارزش معاملات و ورود نقدینگی حقیقی، از تقویت جریان تقاضا و افزایش مشارکت سرمایه‌گذاران حقیقی حکایت داشت.

تداوم رشد نرخ دلار، افزایش انتظارات تورمی و تقویت تقاضا در صنایع بزرگ و صادرات‌محور، به‌ویژه فلزات اساسی از مهم‌ترین عوامل حمایت‌کننده از بازار بود. بااین‌حال، نزدیک‌شدن شاخص به محدوده ۷.۶ میلیون واحد با افزایش عرضه و شناسایی سود همراه شد. بنابراین، اگرچه جریان نقدینگی همچنان از روند صعودی حمایت می‌کرد، رفتار بازار در این سطح و استمرار ورود پول حقیقی برای تداوم حرکت صعودی در روزهای آتی اهمیت بیشتری پیدا کرد.



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 (۷ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۶.۶۱ و ۳۹.۵۶ 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 ۳۳.۷۲ 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 سه شنبه مورخ ۷ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۷

تحولات بازار ارز

تحولات نرخ‌های دلار

قیمت (تومان)	نرخ دلار براساس درهم	نرخ حواله درهم	نرخ دلار هرات	نرخ اسکناس ETS مرکز مبادله*	نرخ حواله مرکز مبادله	نرخ دلار غیررسمی
روز جاری (۷ مهر ۱۴۰۵)	۲۵۵,۷۲۶	۶۹,۶۸۰	۲۵۰,۸۹۰	۲۳۰,۷۱۱	۱۷۳,۶۶۱	۲۵۳,۵۰۰
روز گذشته (۶ مهر ۱۴۰۵)	۲۴۶,۱۴۷	۶۷,۰۷۰	۲۴۱,۷۹۰	۲۲۶,۶۶۲	۱۷۲,۸۵۱	۲۴۴,۱۰۰
تغییرات (درصد)	+۳.۸۹	+۳.۸۹	+۳.۷۶	+۱.۷۹	+۰.۴۷	+۳.۸۵

*: نرخ ETS نرخ سامانه معاملات الکترونیک ارز مرکز مبادله ارز و طلای ایران است.

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۷ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۳.۸۵ درصدی همراه شد و در سطح ۲۵۳ هزار و ۵۰۰ تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله بازار ارز تجاری و اسکناس سامانه معاملات الکترونیک ارز (ETS) مرکز مبادله ارز و طلای ایران نیز با افزایش ۰.۴۷ و ۱.۷۹ درصدی مواجه شدند.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی با جهشی قابل‌توجه همراه شد و پس از عبور از مرز ۲۵۰ هزار تومان، در ادامه معاملات از ۲۵۳ هزار تومان نیز فراتر رفت. این افزایش در شرایطی رخ داد که بازار دلار غیررسمی تحت تأثیر تشدید ابهامات سیاسی قرار داشت. مهم‌ترین خبر روز، ادامه رایزنی‌های غیرمستقیم ایران و آمریکا درباره بازگشایی تنگه هرمز بود. وزیر امور خارجه ایران اعلام کرد که این کشور همچنان بر شروط خود برای بازگشایی تنگه هرمز تأکید دارد و منتظر پاسخ آمریکا از طریق قطر است. در مقابل، دونالد ترامپ در واکنش به خبرهایی پیرامون ارائه امتیازاتی به ایران، از جمله رفع تحریم‌ها و دسترسی به منابع مسدودشده، این موضوع را رد کرد و گفت آمریکا چنین پیشنهادی ارائه نکرده است. در چنین فضایی، افزایش فاصله مواضع دو طرف و نامشخص‌بودن چشم‌انداز توافق و رفع محدودیت‌های اقتصادی موجب تقویت تقاضای احتیاطی برای ارز و افزایش انتظارات نسبت به تداوم فشارهای ارزی شد. در نتیجه، دلار در این روز بیش از ۳ درصد افزایش یافت و رکورد جدیدی ثبت کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

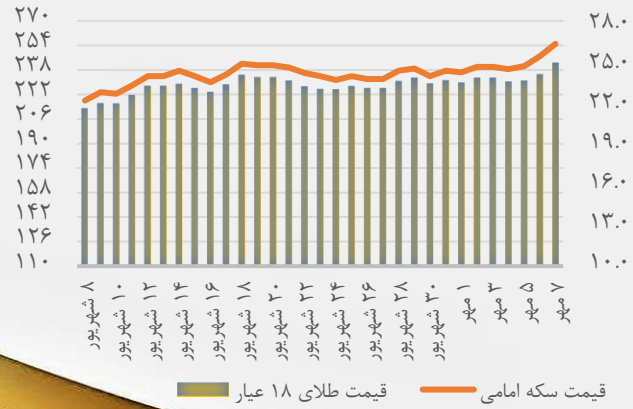
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۷ مهر ۱۴۰۵)	۶۱.۳۹	۴,۱۷۶	۰.۵۲۰	۳.۳۷۴	۲۵۲.۱۹	۲۵.۲۷	۲۵۵.۰۱
روز گذشته (۶ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۷۰	۴,۱۱۸	۰.۵۱۲	۳.۲۸۱	۲۴۴.۳۸	۲۴.۴۰	۲۴۶.۹۹
تغییرات (درصد)	+۱.۱۴	+۱.۴۱	+۱.۵۹	+۲.۸۴	+۳.۱۹	+۳.۵۴	+۳.۲۵

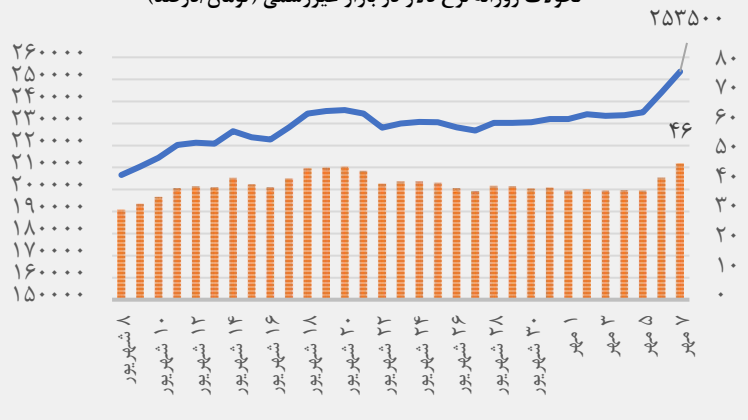
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۷ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۳.۲۵ و ۳.۵۴ درصد افزایش را ثبت کردند. این افزایش عمدتا ناشی از تداوم افزایش قابل توجه قیمت دلار در بازار غیررسمی در کنار افزایش قیمت اونس جهانی 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 (۷ مهرماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۹ سپتامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۳.۴۳ و ۳.۶۸ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی با افزایش جزئی ۰.۲۲ درصدی همراه شد و در سطح ۸۳.۷ هزار دلار قرار گرفت. در ابتدای معاملات، افزایش تقاضا قیمت را تا بالای ۸۴ هزار دلار رساند و ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین آمریکا نیز از قیمت حمایت کرد. بااین‌حال، افزایش مجدد بازده اوراق خزانه‌داری آمریکا و تقویت نگرانی‌ها درباره تورم و احتمال افزایش بیشتر نرخ بهره فدرال رزرو، مانع از تداوم رشد شد. همچنین کاهش حجم موقعیت‌های باز قراردادهای آتی بیت‌کوین به پایین‌ترین سطح سال نشان داد که اهرم بازار کاهش یافته است. در مجموع، حرکت بیت‌کوین در ۷ مهر بیشتر تثبیت و بازگشت محدود پس از افت روز قبل بود و با وجود حمایت صندوق‌های قابل معامله، فشار ناشی از نرخ‌های بهره بالا و تقویت دلار همچنان مانع از شکل‌گیری یک روند صعودی پرقدرت شد.

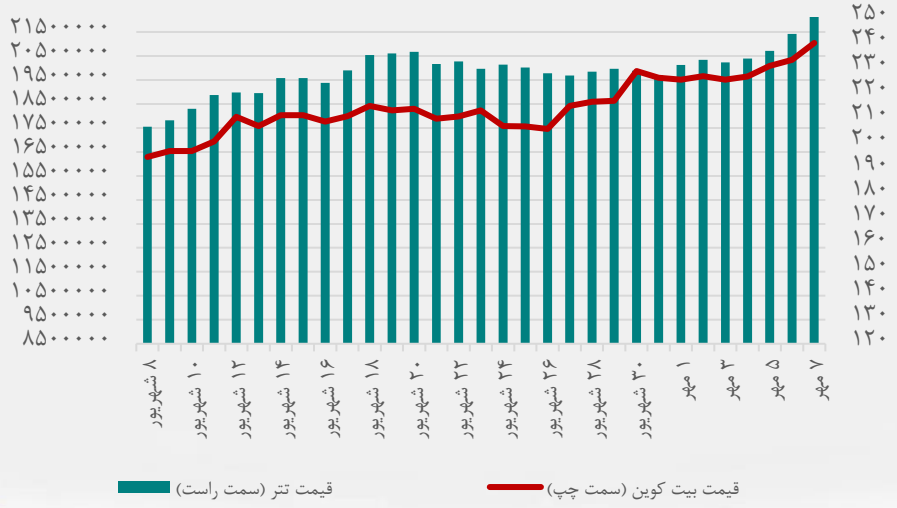
در بازار داخلی، رشد قیمت بیت‌کوین به ریال بیشتر بود. زیرا هم‌زمان با افزایش جزئی قیمت جهانی، نرخ تتر نیز افزایش یافت. بنابراین، اثر هم‌زمان افزایش محدود قیمت دلاری بیت‌کوین و جهش نرخ تتر باعث شد، ارزش ریالی بیت‌کوین با شدت بیشتری افزایش یابد و بازده آن برای سرمایه‌گذار ایرانی از تغییر قیمت جهانی بیت‌کوین بالاتر باشد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۴.۹۵ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۵۵ هزار و ۶۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۷ مهر ۱۴۰۵)	۲۱,۰۴۲	۶۷۷.۵	۲۵۵,۶۰۰
روز گذشته (۶ مهر ۱۴۰۵)	۲۰,۳۴۵	۶۵۳.۵	۲۴۳,۵۵۰
تغییرات (درصد)	+۳.۴۳	+۳.۶۸	+۴.۹۵

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی