تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۱۱ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۹

تحولات بازار سرمایه

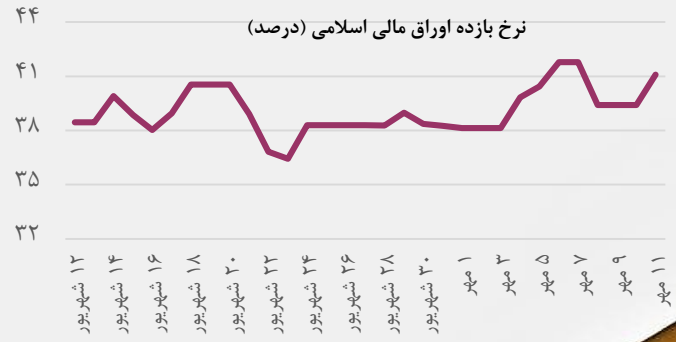
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۱ مهرماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات و کاهش خروج پول حقیقی همراه شد که نشان‌دهنده تقویت نسبی اقبال سرمایه‌گذاران برای ابزارهای درآمد ثابت بود. هم‌زمان، افزایش نرخ بهره بدون ریسک، جذابیت اوراق را برای سرمایه‌گذاران افزایش داد و در شرایطی که نرخ بازده اوراق خزانه اسلامی به سطوح بالای ۴۱ درصد رسیده است، رقابت بازار بدهی با سهام برای جذب نقدینگی تشدید شد. از این منظر، افزایش نرخ‌های بازدهی بدون ریسک می‌تواند ضمن حمایت از تقاضا در بازار بدهی، بخشی از نقدینگی را از دارایی‌های پرریسک‌تر به سمت اوراق سوق دهد و در کوتاه‌مدت به‌عنوان عاملی محدودکننده برای شتاب رشد بورس عمل کند.

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 (۱۱ مهر ۱۴۰۵)	۱.۳۳۶.۹	۴۱.۰۹	-۰.۵۰	۱۹۸.۰۹۶
روز گذشته (۸ مهر ۱۴۰۵)	۱.۳۳۶	۳۹.۴۱	-۰.۶۷	۳۱.۸۷۹
تغییرات (درصد)	+۰.۰۶	+۱.۶۸	+۲۵.۳	+۵۲۱.۴

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

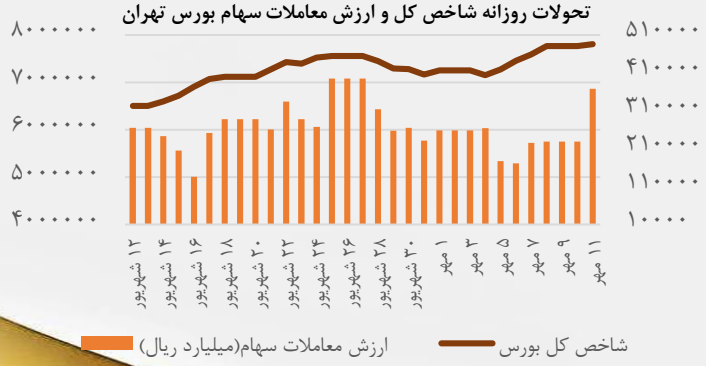
	فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
	شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
روز جاری (۱۱ مهر ۱۴۰۵)	۶۲.۰۴۶	۹۷.۴۲	۳۶۸.۲۶۲	۲.۰۶۸.۷۲۲	۱.۲۹۰.۸۲۹	۷.۸۰۸.۰۶۹
روز گذشته (۸ مهر ۱۴۰۵)	۶۱.۸۵۹	۶۸.۵۴	۲۲۹.۱۹۲	۲.۰۶۶.۶۸۷	۱.۲۸۳.۹۷۰	۷.۷۶۶.۵۳۱
تغییرات (درصد)	+۰.۳۰	+۴۲.۱	+۶۱	+۰.۱۰	+۰.۵۳	+۰.۵۳

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

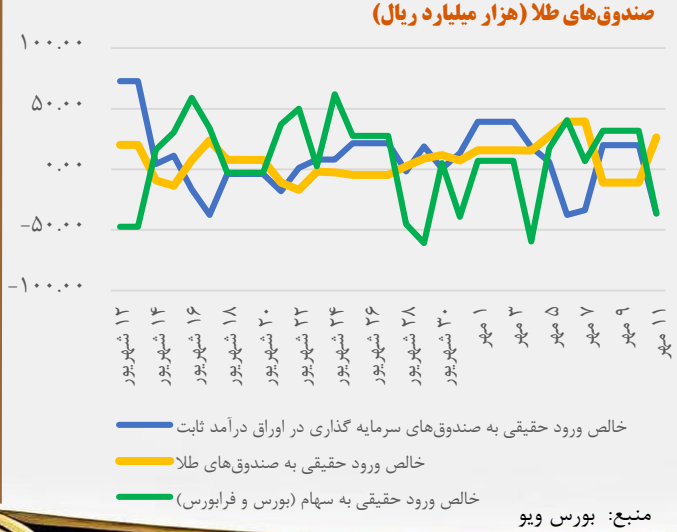
در روز معاملاتی جاری (۱۱ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران با وجود تداوم روند صعودی، نشانه‌هایی از افزایش عرضه و شناسایی سود را نشان داد. شاخص کل با رشد ۰.۵۳ درصدی به ۷ میلیون و ۸۰۸ هزار واحد رسید، اما شاخص هم‌وزن تنها ۰.۱ درصد افزایش یافت که بیانگر تمرکز رشد بر نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بود. هم‌زمان، خروج حدود ۳.۲ همت پول حقیقی از بازار سهام، در کنار رشد اولیه و عقب‌نشینی شاخص از سقف روزانه، نشان داد که پس از رشد پرشتاب هفته نخست مهر، بخشی از سرمایه‌گذاران در حال شناسایی سود و کاهش ریسک هستند.

در مجموع، رشد نرخ دلار و افزایش انتظارات تورمی همچنان از مهم‌ترین محرک‌های رشد اسمی بازار محسوب می‌شود، اما در سطوح فعلی، تداوم روند صعودی بورس به ورود نقدینگی جدید و بهبود شرایط سیاسی وابسته‌تر شده و احتمال نوسان و اصلاح کوتاه‌مدت افزایش یافته است.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



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



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۱۱ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۶.۱۷ و ۳۶.۶۲ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی به ترتیب از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۶.۱۶ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به 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 ۱۱ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۶۹

تحولات بازار ارز

تحولات نرخ‌های دلار

	قیمت (تومان)					
	نرخ دلار براساس درهم	نرخ حواله درهم	نرخ دلار هرات	نرخ سامانه الکترونیک ارز (ETS)	نرخ حواله مرکز مبادله	نرخ دلار غیررسمی
روز جاری (۱۱ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۱,۱۷۶	۷۳,۸۹۰	۲۶۳,۶۹۰	۲۴۶,۹۵۷	۱۷۵,۲۲۹	۲۶۸,۷۰۰
روز گذشته (۱۰ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۵,۵۲۵	۷۲,۳۵۰	۲۵۸,۴۹۰	۲۴۹,۰۲۸	۱۷۴,۷۰۴	۲۶۳,۲۰۰
تغییرات (درصد)	+۲.۱۳	+۲.۱۳	+۲.۰۱	-۰.۸۳	+۰.۳۰	+۲.۰۹

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۱ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۰۹ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۸ هزار و ۷۰۰ تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری نیز با افزایش ۰.۳ درصدی مواجه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی با تداوم روند صعودی روزهای قبل، مجددا افزایش یافت. این رشد در شرایطی رخ داد که همزمانی تشدید فشارهای تحریمی و تداوم محاصره دریایی، چشم‌انداز عرضه ارز و درآمدهای نفتی را تحت فشار قرار داده بود. همچنین، گزارش‌ها درباره کم‌رنگ بودن چشم‌انداز توافق میان ایران و آمریکا احتمال درگیری مجدد میان این دو کشور، ریسک‌های سیاسی و انتظارات منفی در بازار دلار غیررسمی را تقویت کرد. به‌گونه‌ای که با وجود اعلام بانک مرکزی برای عرضه تا ۲ میلیارد دلار از طریق بانک‌های دولتی، فشار تقاضا همچنان بر بازار غالب بود. بنابراین، افزایش نرخ دلار در این روز را می‌توان عمدتاً ناشی از تشدید ریسک‌های سیاسی همراه با افزایش تقاضای احتیاطی برای حفظ قدرت خرید دانست.

تحولات بازار سکه و طلا

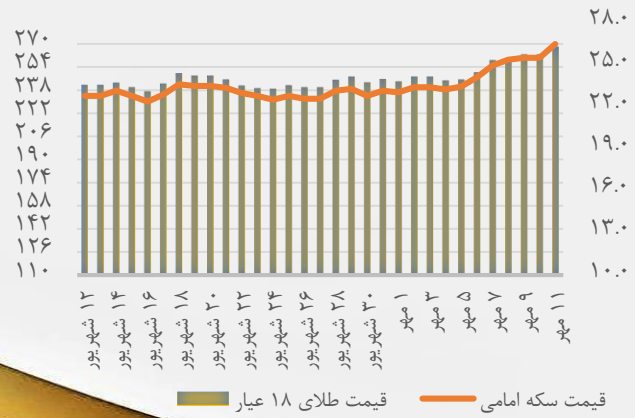
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	قیمت (میلیون تومان / دلار)						
	اونس نقره (دلار)	اونس طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۱۱ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۵۰	۴,۱۴۳	۰.۵۲۸	۳.۵۲۵	۲۶۸.۷۸	۲۶.۲۳	۲۶۹.۸۷
روز گذشته (۱۰ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۵۰	۴,۱۴۳	۰.۵۲۱	۳.۴۲۷	۲۵۸.۰۶	۲۵.۶۹	۲۶۰.۴۰
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۱.۳۵	+۲.۸۸	+۴.۱۵	+۲.۰۷	+۳.۶۴

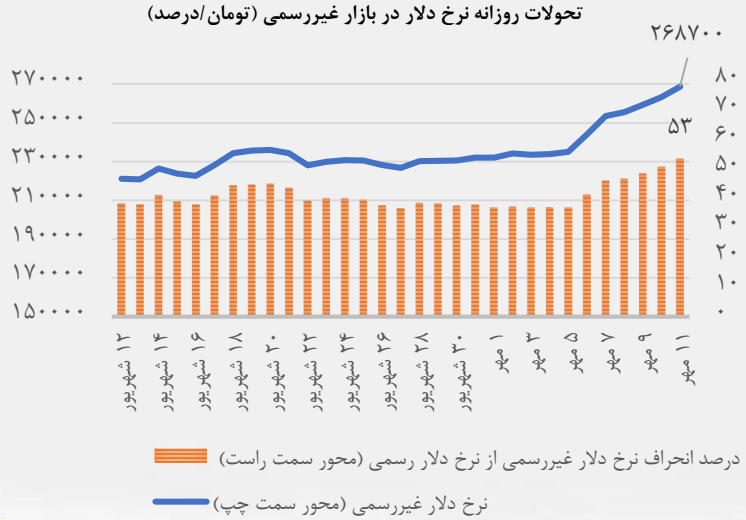
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۱ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب، حدود ۳.۶۴ و ۲.۰۷ درصد افزایش را ثبت کردند. این افزایش عمدتا ناشی از افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی، تقویت انتظارات تورمی و افزایش تقاضای سفته‌بازی در شرایط ثبات 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

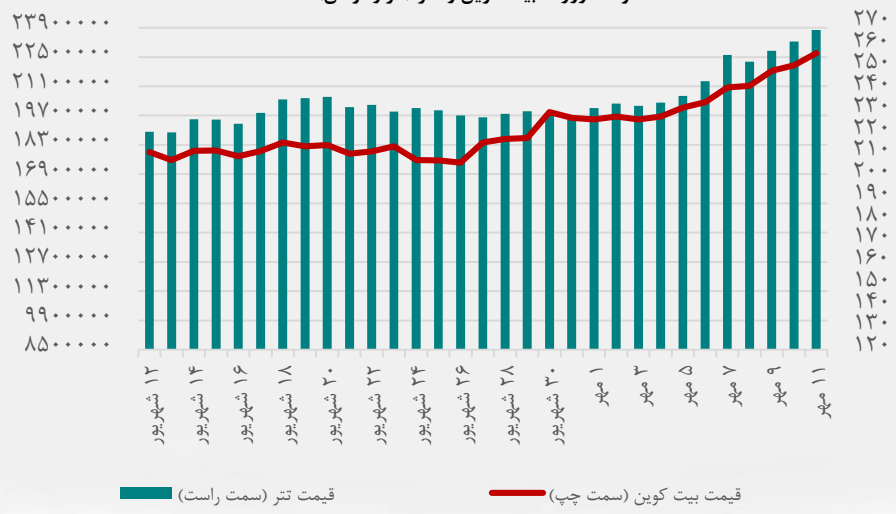
در روز جاری (۱۱ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۲.۶۲ و ۲.۷۹ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس پایگاه داده وبسایت Investing، با افزایش محدود ۰.۲۷ درصدی همراه شد و در محدوده ۸۴.۸ هزار دلار قرار گرفت. رشد اخیر بیت‌کوین تحت تأثیر انتشار آمار ضعیف‌تر از انتظار اشتغال آمریکا و کاهش احتمال افزایش نرخ بهره فدرال رزرو در ماه اکتبر، در کنار تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت کوین آمریکا، تقویت شده بود. با این حال، قرار گرفتن قیمت در نزدیکی مقاومت ۸۷ هزار دلار و همچنان بالا بودن بازده اوراق خزانه آمریکا، مانع از شتاب بیشتر رشد شد. در بازار ایران، قیمت ریالی بیت‌کوین افزایش بیشتری نسبت به بازار جهانی داشت که عمدتاً ناشی از رشد نرخ تتر بود. بنابراین، در این روز اثر افزایش نرخ داخلی تتر بر قیمت ریالی بیت‌کوین از اثر رشد محدود قیمت جهانی آن قوی‌تر بود و بخش مهمی از افزایش ارزش ریالی این رمزارز را توضیح می‌دهد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۰۲ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۷ هزار و ۵۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۱ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۶۷۹	۷۱۸.۱	۲۶۷,۰۵۰
روز گذشته (۱۰ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۱۰۰	۶۹۸.۶	۲۶۱,۷۵۰
تغییرات (درصد)	+۲.۶۲	+۲.۷۹	+۲.۰۲

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی