تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۱۳ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۱

تحولات بازار سرمایه

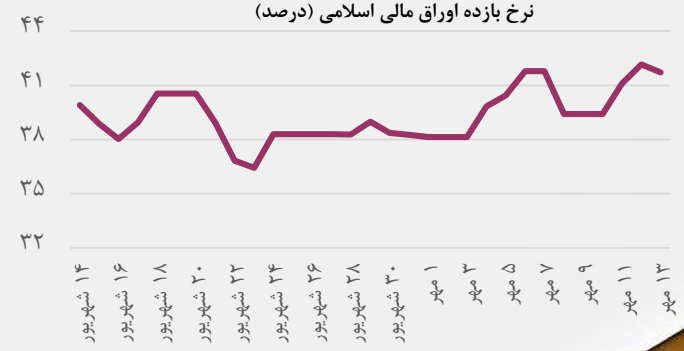
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۳ مهرماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت، افت نرخ بهره بدون ریسک و تشدید خروج پول حقیقی همراه شد. کاهش نرخ بازدهی اوراق در شرایطی که نرخ آن در روزهای گذشته در سطوح بالای ۴۰ درصد قرار داشت، می‌تواند بیانگر کاهش نسبی تقاضا برای دارایی‌های بدون ریسک و افزایش تمایل سرمایه‌گذاران به سایر بازارهای دارایی، از جمله سهام باشد. با این حال، تشدید خروج پول حقیقی از اوراق درآمد ثابت نشان می‌دهد که بخشی از سرمایه‌گذاران در حال کاهش موقعیت خود در این بازار هستند؛ موضوعی که در صورت تداوم می‌تواند به بهبود جریان نقدینگی به سمت بازار سهام کمک 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 (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۳۹.۱	۴۱.۷۲	-۱.۲۱	۱۵,۳۵۰
روز گذشته (۱۲ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۳۸.۱	۴۲.۱۶	-۰.۹۶	۵۷,۳۱۵
تغییرات (درصد)	+۰.۰۷	-۰.۴۴	-۲۶.۷	-۷۳.۲

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

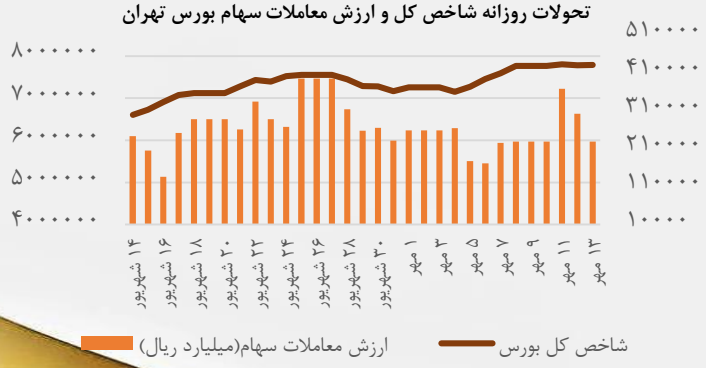
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۶۱,۹۲۲	۶۸.۲۲	۲۲۹,۱۵۳	۲,۰۶۵,۷۷۵	۱,۲۸۷,۸۲۶	۷,۷۸۹,۹۰۷	روز جاری (۱۳ مهر ۱۴۰۵)
۶۱,۷۹۶	۷۷.۷۸	۳۰۲,۰۰۶	۲,۰۶۳,۱۸۷	۱,۲۸۶,۷۱۴	۷,۷۸۳,۱۷۷	روز گذشته (۱۲ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۲۰	-۱۲.۳	-۲۴	+۰.۱۳	+۰.۰۹	+۰.۰۹	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

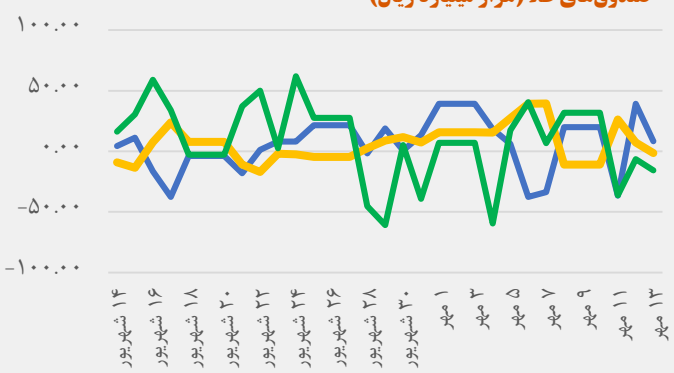
در روز معاملاتی جاری (۱۳ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از آغاز معاملات با فشار فروش، در ادامه با بهبود تقاضا مواجه شد و شاخص کل با رشد ۰.۰۹ درصدی در سطح ۷.۷۹ میلیون واحد قرار گرفت. شاخص هم‌وزن نیز ۰.۱۳ درصد افزایش یافت که بیانگر بهبود نسبی تقاضا در طیف گسترده‌تری از نمادها بود.

با این حال، خروج پول حقیقی و کاهش ارزش معاملات نسبت به روز قبل، نشان داد که سرمایه‌گذاران همچنان با احتیاط در حال معامله هستند. در مجموع، بازگشت تقاضا پس از افت ابتدای بازار، در کنار تداوم خروج نقدینگی حقیقی، حاکی از آن بود که بازار در سطوح بالای فعلی با شناسایی سود و نوسان مواجه است و برای تداوم روند صعودی، به ورود پایدار نقدینگی و افزایش قدرت تقاضا نیاز دارد.

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 (۱۳ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۵.۶۷ و ۱.۳۸ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی به ترتیب از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۸.۳۴ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) 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 دوشنبه مورخ ۱۳ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۱

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 (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۱,۸۷۴	۷۴,۰۸۰	۲۶۵,۳۱۰	۲۶۱,۹۱۹	۱۷۶,۲۸۲	۲۶۹,۵۰۰
روز گذشته (۱۲ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۱,۵۸۰	۷۴,۰۰۰	۲۶۵,۷۹۰	۲۵۷,۴۹۶	۱۷۵,۷۵۴	۲۶۹,۰۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۱۱	+۰.۱۱	-۰.۱۸	+۱.۷۲	+۰.۳۰	+۰.۱۹

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۳ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۱۹ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۹ هزار و ۵۰۰ 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 در محدوده ۲۶۸ تا ۲۷۱ هزار تومان معامله شد و در پایان معاملات نرخ آن حدود ۲۷۰ هزار تومان ثبت شد. محرک اصلی این رفتار، تداوم ریسک‌های سیاسی و محدودیت‌های منابع ارزی بود. در همین روز، اخبار مربوط به کاهش شدید صادرات نفت ایران، تداوم محدودیت‌های کشتیرانی و تحولات مرتبط با تنگه هرمز، انتظارات ارزی را تحت فشار قرار داد. این درحالی است که بانک مرکزی برای مهار تقاضای بازار غیررسمی، عرضه گسترده اسکناس را از روزهای گذشته آغاز کرده و در مرحله نخست یک میلیارد دلار و در مجموع تا دو میلیارد دلار عرضه را در دستور کار قرار داده است؛ همچنین امکان خرید تا سقف ۱۰ هزار دلار را برای افراد بالای ۱۸ سال فراهم کرده است. با این وجود، سیاست مذکور همچنان نتوانسته بر انتظارات صعودی بازار فائق آید. از این‌رو، افزایش نرخ دلار در روز جاری را می‌توان حاصل غلبه انتظارات ناشی از ریسک‌های سیاسی و محدودیت منابع ارزی بر اثر سیاست عرضه بانک مرکزی دانست؛ به‌گونه‌ای که اگرچه عرضه رسمی مانع از جهش شدیدتر نرخ شد، اما به دلیل تداوم نااطمینانی پیرامون درآمدهای ارزی و صادرات نفت، نتوانست فشار صعودی بازار غیررسمی را به‌طور کامل خنثی کند. در نتیجه، دلار در نزدیکی سقف‌های تاریخی خود باقی ماند.

تحولات بازار سکه و طلا

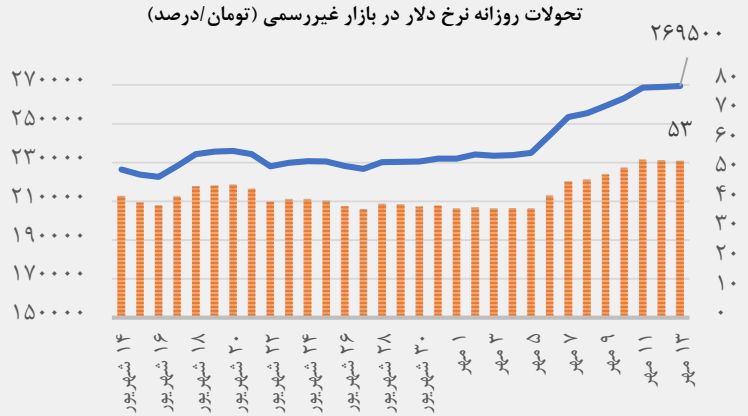
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۶۱.۰۹	۴,۱۴۱	۰.۵۳۵	۳.۵۴۷	۲۷۰.۱۷	۲۶.۵۵	۲۷۰.۹۳
روز گذشته (۱۲ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۵۰	۴,۱۴۳	۰.۵۲۸	۳.۵۳۷	۲۷۰.۵۴	۲۶.۳۳	۲۷۱.۰۸
تغییرات (درصد)	+۰.۹۶	-۰.۰۶	+۱.۲۵	+۰.۲۷	-۰.۱۴	+۰.۸۳	-۰.۰۵

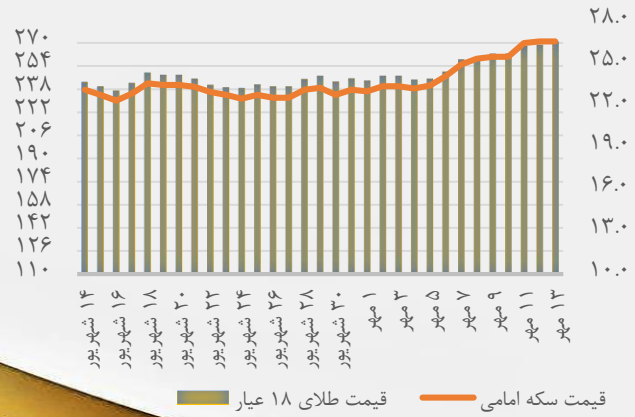
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۳ مهرماه ۱۴۰۵)، افزایش محدود دلار در بازار غیررسمی، در شرایط ثبات نسبی قیمت جهانی اونس طلا، از قیمت طلای ۱۸ عیار حمایت کرد و این دارایی با رشد ۰.۸۳ درصدی همراه شد. با این حال، قیمت سکه امامی تقریباً بدون تغییر باقی ماند که می‌توان آن را به محدود بودن تقاضای مؤثر در بازار سکه نسبت داد. در نتیجه، رشد نرخ دلار غیررسمی بیشتر در قیمت طلای ۱۸ عیار منعکس شد، اما ضعف نسبی تقاضای سکه مانع از انتقال کامل این افزایش به قیمت سکه شد.

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

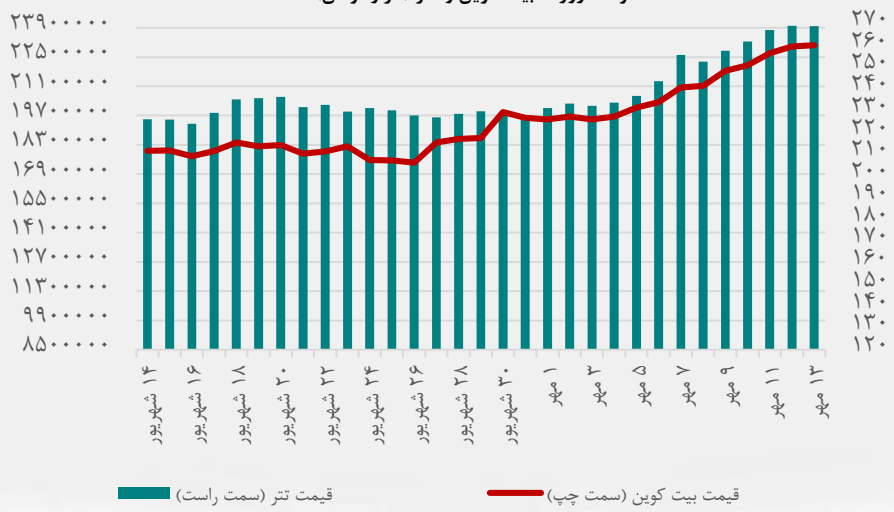
در روز جاری (۱۳ مهرماه ۱۴۰۵ برابر با ۵ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۲۸ و ۰.۲۸ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس پایگاه داده وبسایت Investing، تحت فشار فروش قرار گرفت و حدود ۰.۸۹ درصد کاهش یافت و به محدوده ۸۵.۷ هزار دلار رسید. مهم‌ترین عامل فشار بر قیمت، افزایش مجدد بازدهی اوراق خزانه آمریکا و کاهش تقاضای سرمایه‌گذاران عنوان شد؛ به‌طوری‌که با وجود کاهش انتظارات برای افزایش نرخ بهره فدرال رزرو، تقاضا برای بیت‌کوین همچنان ضعیف بود. همچنین گزارش‌ها از تضعیف جریان سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در همین مقطع حکایت داشت. اما در بازار داخلی ایران، قیمت ریالی بیت‌کوین افزایش محدودی داشت؛ این واگرایی در حالی رخ داد که قیمت تتر تقریباً باثبات بود. بنابراین، رشد محدود قیمت داخلی بیشتر ناشی از مقاومت نسبی قیمت تتر در سطوح بالای بازار و تبدیل کاهش محدود قیمت دلاری بیت‌کوین به نرخ ریالی بود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، تقریبا ثابت و برابر با ۲۶۸ هزار و ۸۰۰ تومان بود.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۲۳,۰۶۴	۷۲۹.۰	۲۶۸,۸۰۰
روز گذشته (۱۲ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۹۹۹	۷۲۶.۹	۲۶۸,۹۵۰
تغییرات (درصد)	+۰.۲۸	+۰.۲۸	−۰.۰۶

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی