تحولات بازارهای مالی در روز سه شنبه مورخ ۱۴ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۲

تحولات بازار سرمایه

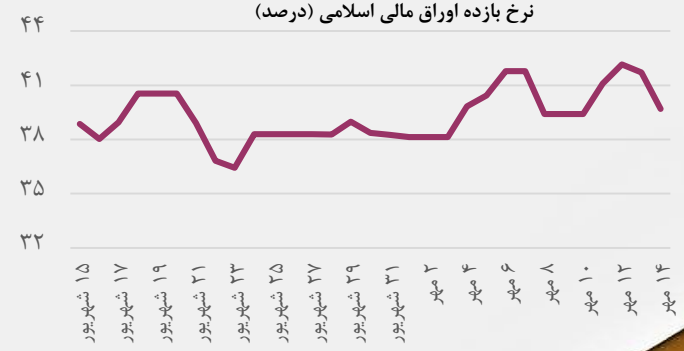
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۴ مهرماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی نیز هم‌زمان با تقویت معاملات بازار سهام، با افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت و ورود پول حقیقی همراه شد. این وضعیت، در کنار کاهش نرخ بهره بدون ریسک، نشان‌دهنده رشد قیمت اوراق و بهبود نسبی تقاضا در بازار بدهی است. از سوی دیگر، افت نرخ بهره بدون ریسک موجب کاهش جذابیت نسبی دارایی‌های کم‌ریسک و در مقابل، افزایش تمایل سرمایه‌گذاران به دارایی‌های ریسکی‌تر از جمله سهام شده است؛ بنابراین، هم‌زمانی رشد بورس، افزایش معاملات اوراق درآمد ثابت و ورود نقدینگی حقیقی، حاکی از بهبود عمومی جریان نقدینگی در بازار سرمایه در این روز 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)
روز جاری (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۰.۳	۳۹.۷۰	۰.۰۲	۱۶۱.۱۳۲
روز گذشته (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۳۹.۱	۴۱.۷۲	-۱.۲۱	۱۵.۳۵۰
تغییرات (درصد)	+۰.۱	-۲.۰۲	+۱۰۱.۷	+۹۴۹.۷

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

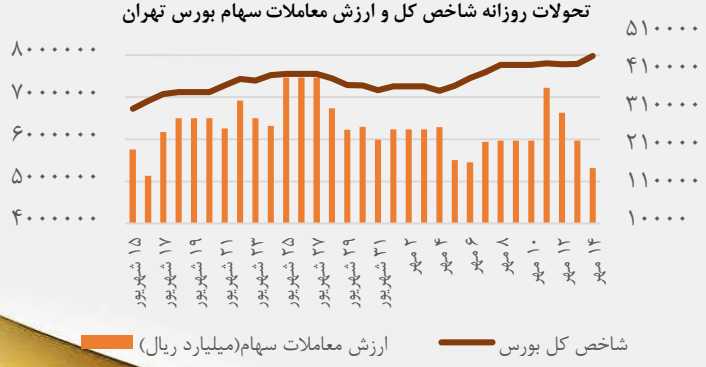
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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
۶۳,۳۳۹	۴۷.۲۲	۱۵۶,۲۱۸	۲,۱۱۳,۹۶۶	۱,۳۱۸,۷۸۵	۷,۹۷۷,۱۷۲
۶۱,۹۲۲	۶۸.۲۲	۲۲۹,۱۵۳	۲,۰۶۵,۷۷۵	۱,۲۸۷,۸۲۶	۷,۷۸۹,۹۰۷
+۲.۲۹	-۳۰.۸	-۳۲	+۲.۳۳	+۲.۴۰	+۲.۴۰

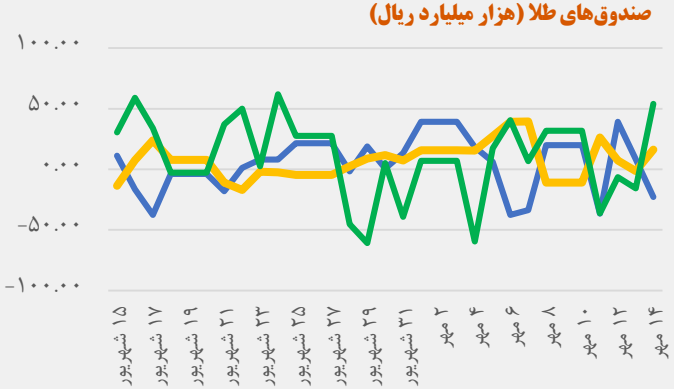
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۱۴ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران با تقویت قابل‌توجه تقاضا همراه شد و شاخص کل با رشد ۲.۴ درصدی به محدوده ۷.۹۸ میلیون واحد رسید و در آستانه عبور از مرز ۸ میلیون واحد قرار گرفت. شاخص هم‌وزن نیز ۲.۳۳ درصد افزایش یافت که نشان‌دهنده فراگیری رشد در بخش‌های مختلف بازار و محدود نبودن صعود به نمادهای بزرگ بود. همچنین، ورود پول حقیقی به سهام، بیانگر بازگشت نقدینگی و تقویت سمت تقاضا بود. از منظر تحلیلی، تداوم سطوح بالای نرخ دلار، در کنار بهبود نسبی فضای بازارهای جهانی و رشد قیمت برخی کالاهای پایه، انتظارات تورمی و سودآوری اسمی شرکت‌ها را تقویت کرد. در مجموع، معاملات این روز را می‌توان نقطه عطفی در موج صعودی اخیر بورس دانست؛ با این حال، نزدیکی شاخص به مرز روانی ۸ میلیون واحد می‌تواند در کوتاه‌مدت با افزایش عرضه و ذخیره‌سازی سود همراه شود و تداوم ورود پول حقیقی و افزایش ارزش معاملات، شرط مهم استمرار روند صعودی خواهد بود.

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 (۱۴ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۵۴.۰۸ و ۱۶.۲۹ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۲.۹۵ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از 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 سه شنبه مورخ ۱۴ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۲

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 (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۱,۳۶۰	۷۳,۹۴۰	۲۶۵,۴۹۰	۲۵۹,۴۸۰	۱۷۶,۸۱۰	۲۶۹,۱۰۰
روز گذشته (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۱,۸۷۴	۷۴,۰۸۰	۲۶۵,۳۱۰	۲۶۱,۹۱۹	۱۷۶,۲۸۲	۲۶۹,۵۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۱۹	-۰.۱۹	+۰.۰۷	-۰.۹۳	+۰.۳۰	-۰.۱۵

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۴ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۱۵ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۹ هزار و ۱۰۰ 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 پس از رشد روزهای قبل، عمدتاً در محدوده ۲۶۸ تا ۲۷۰ هزار تومان نوسان کرد و در پایان روز با تغییر بسیار محدودی همراه بود. در این روز، ادامه تماس‌های ایران و آمریکا از مسیر قطر سیگنال نسبتاً کاهشی به بازار داد، اما اظهارات روسیه درباره نبود چشم‌انداز روشن برای مذاکرات، مانع از شکل‌گیری افت قابل‌توجه نرخ شد. از سوی دیگر، پس از رشد شدید دلار در روزهای گذشته، بخشی از بازار وارد فاز احتیاط و تثبیت قیمت شد. بنابراین، می‌توان گفت، دلار در روز جاری تحت تأثیر تقابل دو نیروی متضاد سیگنال‌های سیاسی امیدوارکننده از تداوم تماس‌ها و ریسک‌های ناشی از ابهام در مذاکرات، عمدتاً باثبات و با تمایل خفیف به کاهش معامله شد؛ در واقع، بازار پس از جهش اخیر، در انتظار یک محرک سیاسی قوی‌تر برای تعیین مسیر بعدی قرار گرفت.

تحولات بازار سکه و طلا

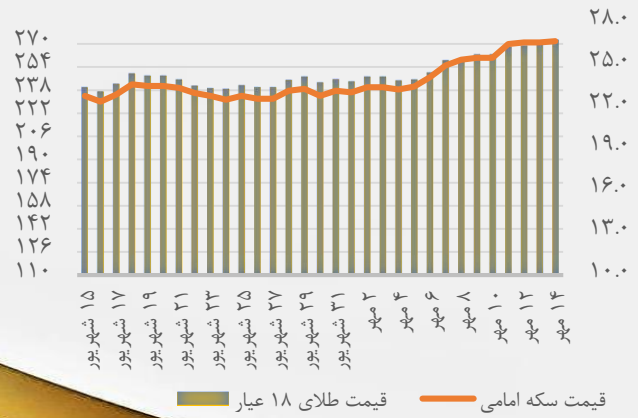
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۶۱.۳۴	۴,۱۶۴	۰.۵۴۵	۳.۵۵۷	۲۷۱.۲۱	۲۶.۷۴	۲۷۱.۹۱
روز گذشته (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۶۱.۰۹	۴,۱۴۱	۰.۵۳۵	۳.۵۴۷	۲۷۰.۱۷	۲۶.۵۵	۲۷۰.۹۳
تغییرات (درصد)	+۰.۴۲	+۰.۵۶	+۱.۹۶	+۰.۲۹	+۰.۳۹	+۰.۷۲	+۰.۳۶

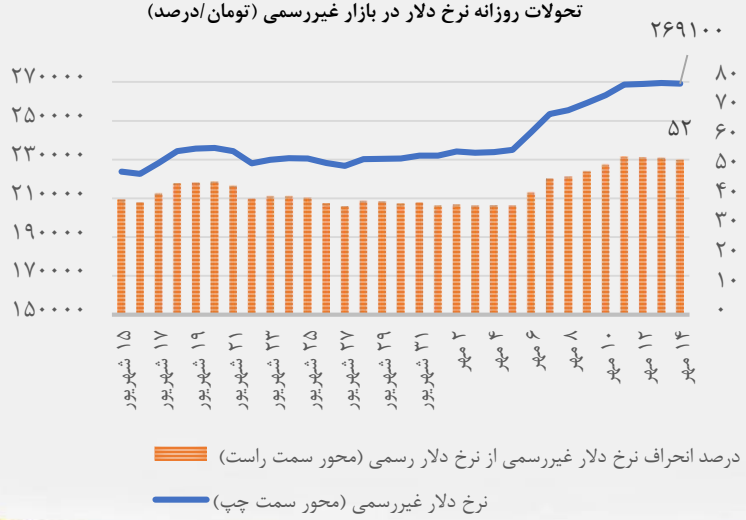
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۴ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب با افزایش ۰.۳۶ و ۰.۷۲ درصدی همراه شدند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. به نظر می‌رسد، افزایش قیمت جهانی اونس طلا با غلبه بر اثر کاهشی قیمت دلار در بازار غیررسمی، منجر به افزایش قیمت دارایی‌های مذکور شده 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

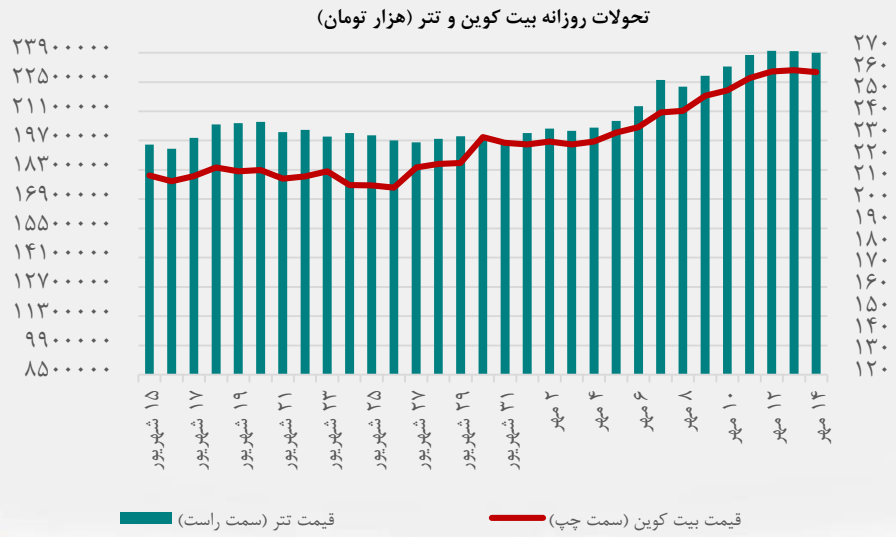
تحولات بازار ارزهای دیجیتال

در روز جاری (۱۴ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۳۹ و ۰.۸۷ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس پایگاه داده وبسایت Investing، با کاهش جزئی همراه شد و در محدوده ۸۵.۶ هزار دلار قرار گرفت. مهم‌ترین عامل فشار بر قیمت، افزایش بازدهی اوراق خزانه‌داری آمریکا و تقویت دلار بود که جذابیت دارایی‌های بدون بازدهی مانند بیت‌کوین را کاهش داد. با این حال، کاهش قیمت در این مقطع محدود بود و تداوم ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت کوین در آمریکا و قرار گرفتن قیمت در سطوح بالا، مانع از شکل‌گیری فشار فروش گسترده شد. در مجموع، معاملات روز جاری را می‌توان اصلاح محدود و استراحت بازار پس از رشد روزهای اخیر دانست.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۲۸ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۸ هزار و ۵۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۹۷۳	۷۲۲.۶	۲۶۸,۰۵۰
روز گذشته (۱۳ مهر ۱۴۰۵)	۲۳,۰۶۴	۷۲۹	۲۶۸,۸۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۳۹	-۰.۸۷	-۰.۲۸

منبع: نوسان پلاس



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی