تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۱۵ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۳

تحولات بازار سرمایه

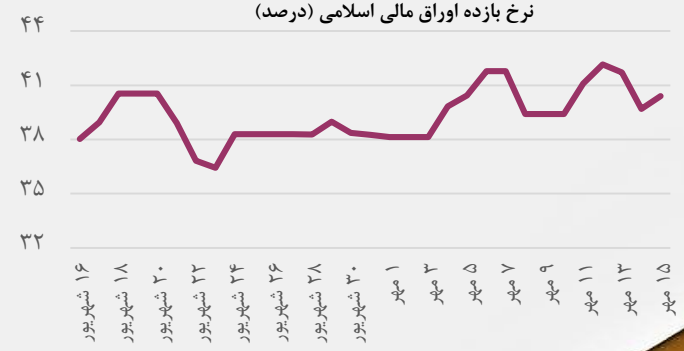
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۵ مهرماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت، افزایش ورود پول حقیقی و رشد نرخ بهره بدون ریسک همراه شد. افزایش نرخ بازده اوراق، معمولاً با کاهش قیمت آنها در بازار ثانویه همراه است و می‌تواند فرصت خرید برای سرمایه‌گذارانی فراهم کند که با انتظار کسب بازده از نگهداری اوراق تا سررسید یا تغییرات آتی قیمت وارد بازار می‌شوند. بااین‌حال، کاهش ارزش معاملات حاکی از محدود بودن تحرک دادوستدها، علی‌رغم افزایش خالص ورود پول حقیقی است. از سوی دیگر، افزایش نرخ بهره بدون ریسک با بالا بردن بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاری در دارایی‌های کم‌ریسک، هزینه فرصت سرمایه‌گذاری در سهام را افزایش می‌دهد و می‌تواند مانعی در برابر رشد بازار سهام ایجاد 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 (۱۵ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۱.۲	۴۰.۴	۰.۱۴	۳۰,۴۳۹
روز گذشته (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۰.۳	۳۹.۷۰	۰.۰۲	۱۶۱,۱۳۲
تغییرات (درصد)	+۰.۰۶	+۰.۷۱	+۶۰۲.۹	-۸۱.۱

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

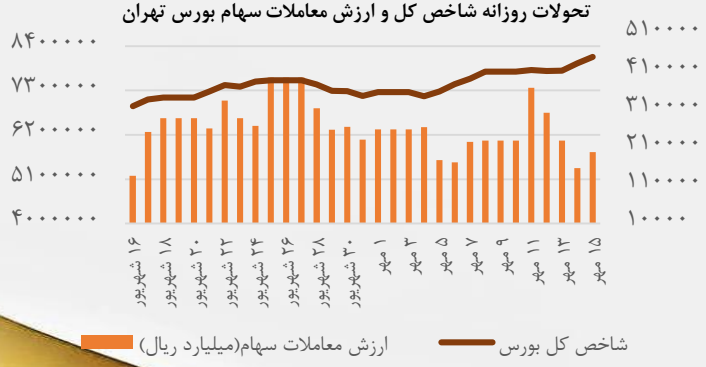
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۶۴,۴۴۸	۵۷.۷۰	۱۹۸,۷۹۲	۲,۱۵۰,۴۳۲	۱,۳۴۴,۲۲۹	۸,۱۳۱,۰۸۰	روز جاری (۱۵ مهر ۱۴۰۵)
۶۳,۳۳۹	۴۷.۲۲	۱۵۶,۲۱۸	۲,۱۱۳,۹۶۶	۱,۳۱۸,۷۸۵	۷,۹۷۷,۱۷۲	روز گذشته (۱۴ مهر ۱۴۰۵)
+۱.۷۵	+۲۲.۲	+۲۷	+۱.۷۳	+۱.۹۳	+۱.۹۳	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

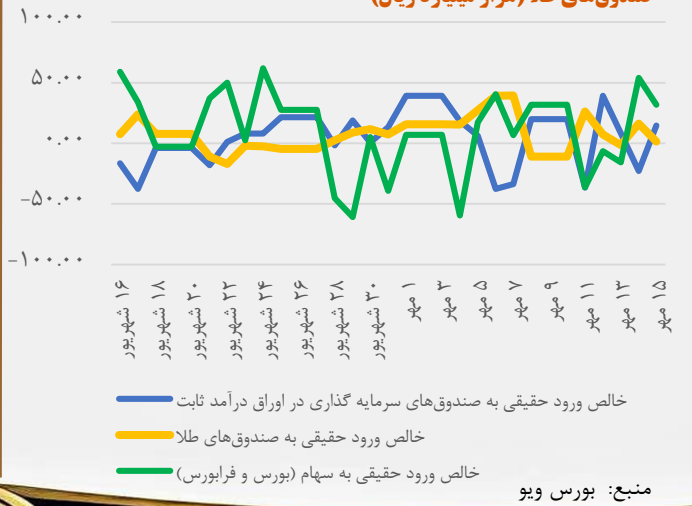
در روز معاملاتی جاری (۱۵ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران به روند صعودی خود ادامه داد و شاخص کل با رشد ۱.۹۳ درصدی به سطح ۸ میلیون و ۱۳۱ هزار واحد رسید و رکورد تاریخی جدیدی ثبت کرد. هم‌زمان، شاخص هم‌وزن نیز ۱.۷۳ درصد افزایش یافت که بیانگر گسترش نسبی تقاضا در میان نمادهای بازار بود. همچنین، افزایش ارزش معاملات و ورود پول حقیقی به بازار سهام در روز جاری، از تقویت تحرک معاملاتی و افزایش مشارکت فعالان بازار حکایت داشت.

به نظر می‌رسد، تداوم انتظارات تورمی و تمایل سرمایه‌گذاران به حفظ ارزش دارایی‌ها در برابر کاهش ارزش پول ملی، در کنار بهبود تقاضا و ورود نقدینگی، از عوامل مؤثر بر رشد بازار بوده‌اند. در مجموع، هم‌زمانی رشد شاخص‌ها، افزایش ارزش معاملات و ورود پول حقیقی، نشان‌دهنده تقویت تقاضا و تداوم فضای مثبت بازار بود؛ بااین‌حال، استمرار این روند به حفظ جریان نقدینگی و پایداری انتظارات سرمایه‌گذاران وابسته است.

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 (۱۵ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۱.۶۹ و ۱۴.۵۶ و ۱.۴۱ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا 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 چهارشنبه مورخ ۱۵ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۳

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 (۱۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۶,۰۳۸	۷۲,۴۹۰	۲۶۱,۰۱۰	۲۶۱,۶۴۹	۱۷۷,۳۴۱	۲۶۳,۷۰۰
روز گذشته (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۱,۳۶۰	۷۳,۹۴۰	۲۶۵,۴۹۰	۲۵۹,۴۸۰	۱۷۶,۸۱۰	۲۶۹,۱۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۹۶	-۱.۹۶	-۱.۶۹	+۰.۸۴	+۰.۳۰	-۲.۰۱

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۲ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۳ 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 پس از رشد قابل‌توجه روزهای قبل، با اصلاح قیمت مواجه شد و نرخ پایانی آن به حدود ۲۶۳ هزار و ۷۰۰ تومان تنزل کرد. این کاهش را می‌توان در چارچوب تعدیل قیمت پس از جهش‌های متوالی و کاهش موقت فشار تقاضا ارزیابی کرد. بااین‌حال، فضای سیاسی و اقتصادی همچنان تحت تأثیر تشدید فشارهای آمریکا، محدودیت‌های صادرات نفت و ابهام در چشم‌انداز روابط خارجی قرار داشت؛ عواملی که از مسیر محدود کردن عرضه دلار و تقویت انتظارات تورمی، زمینه افزایش ریسک در بازار دلار غیررسمی را فراهم می‌کند. همچنین، اعلام برنامه‌های دولت برای مدیریت شرایط اقتصادی و کنترل قیمت‌ها تا حدودی بر انتظارات معامله‌گران بازار دلار موثر بود. در مجموع، کاهش قیمت این روز بیش از آنکه به‌تنهایی نشانه تغییر روند بنیادی بازار باشد، بیانگر اصلاح کوتاه‌مدت پس از رشد سریع روزهای گذشته بود؛ در شرایطی که تحولات سیاسی، میزان دسترسی به منابع ارزی و انتظارات تورمی همچنان از متغیرهای کلیدی تعیین‌کننده مسیر دلار محسوب می‌شدند.

تحولات بازار سکه و طلا

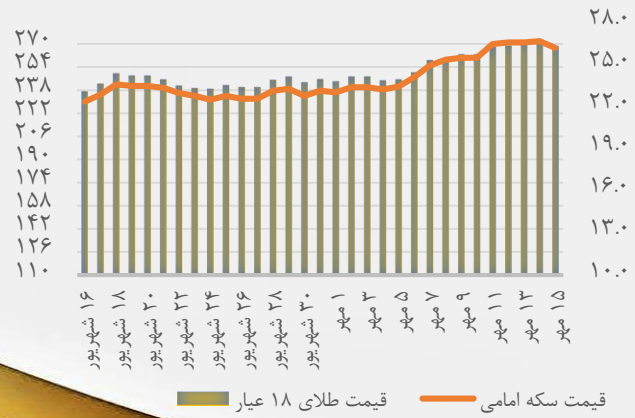
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۱۵ مهر ۱۴۰۵)	۵۹.۸۴	۴,۱۱۲	۰.۵۲۶	۳.۴۷۴	۲۶۶.۳۰	۲۶.۲۸	۲۶۷.۲۸
روز گذشته (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۶۱.۳۴	۴,۱۶۴	۰.۵۴۵	۳.۵۵۷	۲۷۱.۲۱	۲۶.۷۴	۲۷۱.۹۱
تغییرات (درصد)	-۲.۴۴	-۱.۲۴	-۳.۴۱	-۲.۳۳	-۱.۸۱	-۱.۷۱	-۱.۷۰

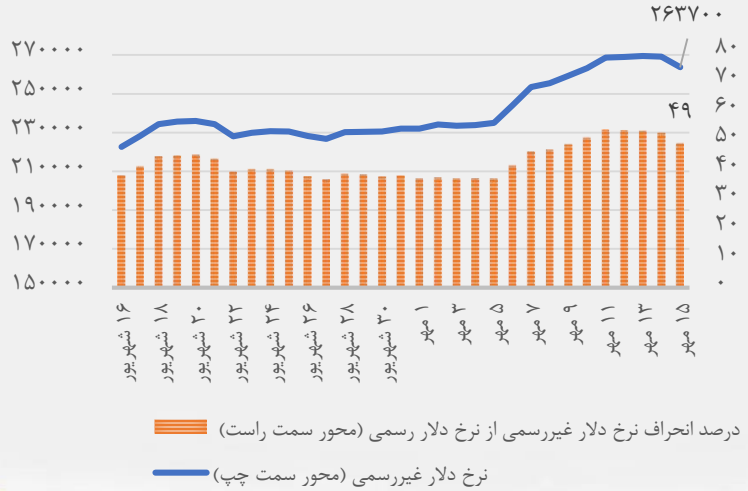
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب با کاهش ۱.۷ و ۱.۷۱ درصدی همراه شدند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. کاهش قیمت جهانی اونس طلا در کنار کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی، از مهم‌ترین عوامل موثر بر بازار سکه و 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

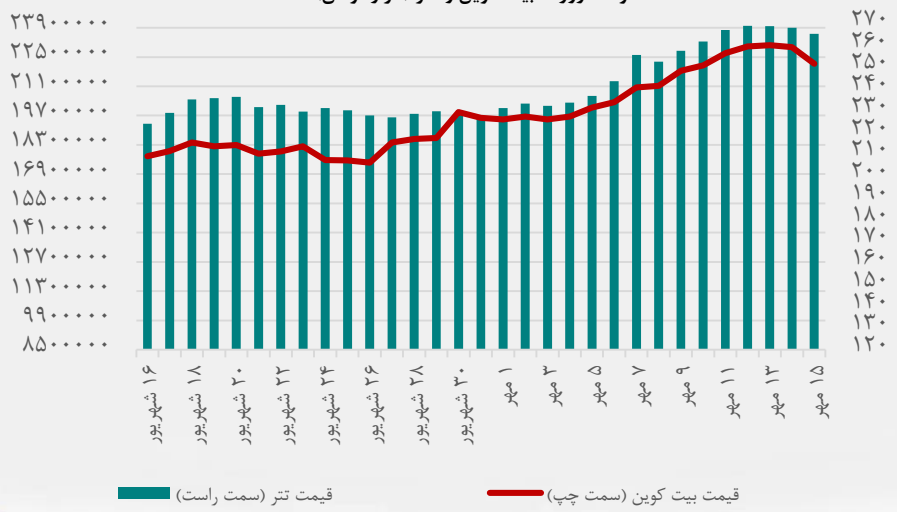
در روز جاری (۱۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۳.۴۷ و ۵.۳۷ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس پایگاه داده وبسایت Investing با افت قابل‌توجهی مواجه شد و به زیر سطح ۸۴ هزار دلار سقوط کرد؛ به‌طوری‌که در ادامه معاملات، قیمت آن تا محدوده ۸۳.۵ هزار دلار نیز کاهش یافت. تقویت شاخص دلار آمریکا و افزایش بازده اوراق خزانه‌داری، جذابیت دارایی‌های پرریسک را کاهش داد و بر بازار رمزارزها فشار وارد کرد. همچنین، صورت‌جلسه نشست ۱۵ و ۱۶ سپتامبر فدرال رزرو که در ۷ اکتبر (۱۵ مهرماه) منتشر شد، نشان داد بسیاری از سیاست‌گذاران احتمال افزایش مجدد نرخ بهره تا پایان سال را مطرح می‌دانستند؛ بااین‌حال، بخش مهمی از انتظارات سیاست پولی پیش‌تر در قیمت‌ها منعکس شده بود و انتشار صورت‌جلسه بیشتر از منظر جزئیات دیدگاه اعضا اهمیت داشت. در بازار مشتقات نیز حدود ۵۴۷ میلیون دلار از موقعیت‌های اهرمی لیکویید شد که عمدتاً به موقعیت‌های خرید مربوط بود و با تشدید فشار فروش، افت قیمت را تقویت کرد. در مجموع، تقویت دلار و بازده اوراق و تسویه گسترده موقعیت‌های اهرمی از مهم‌ترین عوامل افت بیت‌کوین در این روز بودند.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۰۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۵ هزار و ۳۰۰ تومان تنزل کرد.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۱۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۵,۳۰۰	۶۸۳.۸	۲۲,۱۷۶
روز گذشته (۱۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۸,۰۵۰	۷۲۲.۶	۲۲,۹۷۳
تغییرات (درصد)	-۱.۰۳	-۵.۳۷	-۳.۴۷

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی