تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۱۸ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۴

تحولات بازار سرمایه

در معاملات ۱۸ مهرماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت افزایش یافت؛ بااین‌حال، خروج پول حقیقی از این بازار در کنار کاهش نرخ بهره بدون ریسک، از تغییر ترکیب دارایی‌های سرمایه‌گذاران حکایت داشت. کاهش نرخ بازده اوراق می‌تواند از جذابیت نسبی ابزارهای درآمد ثابت بکاهد و زمینه انتقال بخشی از منابع به دارایی‌های ریسکی‌تر، از جمله سهام را فراهم کند. هم‌زمانی این تحولات با رشد بورس و ورود نقدینگی حقیقی به بازار سهام، می‌تواند نشانه‌ای از افزایش تمایل بخشی از سرمایه‌گذاران به پذیرش ریسک بیشتر باشد؛ هرچند تأیید این روند به بررسی جریان نقدینگی در روزهای آتی نیاز دارد.

تحولات بازار اوراق بدهی

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)	
۱,۳۴۳.۴	۳۹.۶۱	-۰.۳۷	۸۸,۱۶۱	روز جاری (۱۸ مهر ۱۴۰۵)
۱,۳۴۲.۶	۴۰.۴	۰.۱۴	۳۰,۴۳۹	روز گذشته (۱۵ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۰۶	-۰.۷۹	-۳۶۴.۳	+۱۸۹.۶	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

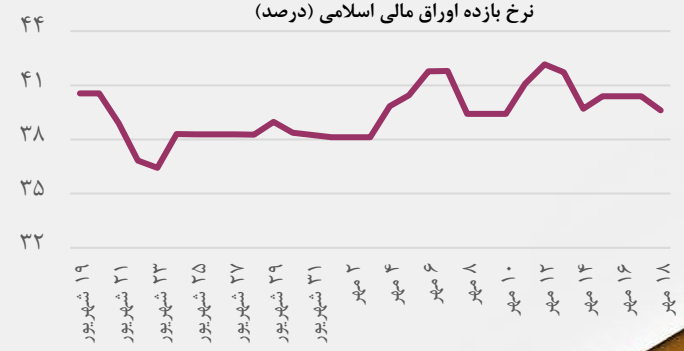
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۶۵,۱۵۷	۶۸.۷۶	۲۳۸,۰۹۲	۲,۱۷۲,۵۲۴	۱,۳۶۶,۴۴۸	۸,۲۶۵,۴۷۸	روز جاری (۱۸ مهر ۱۴۰۵)
۶۴,۴۴۸	۵۷.۷۰	۱۹۸,۷۹۲	۲,۱۵۰,۴۳۲	۱,۳۴۴,۲۲۹	۸,۱۳۱,۰۸۰	روز گذشته (۱۵ مهر ۱۴۰۵)
+۱.۱۰	+۱۹.۲	+۲۰	+۱.۰۳	+۱.۶۵	+۱.۶۵	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز معاملاتی جاری (۱۸ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران به روند صعودی خود ادامه داد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با رشد ۱.۶۵ درصدی به حدود ۸ میلیون و ۲۶۵ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با افزایش ۱.۰۳ درصدی به محدوده ۲ میلیون و ۱۷۲ هزار واحد رسید. بیشتر بودن رشد شاخص کل نسبت به شاخص هم‌وزن نشان می‌دهد که نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز نقش پررنگ‌تری در صعود بازار داشته‌اند.

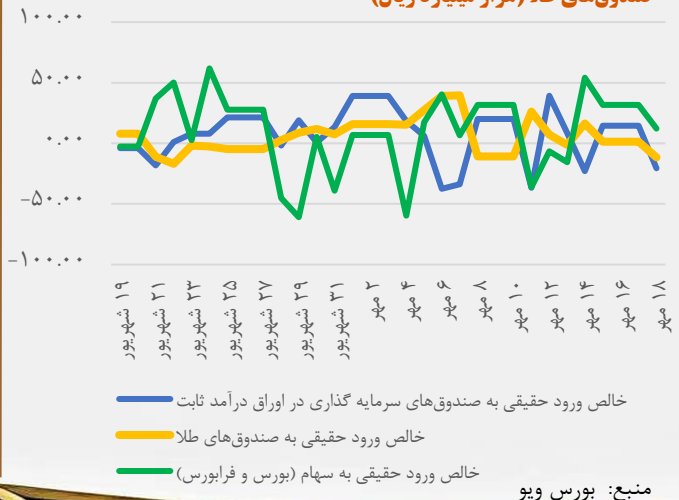
از منظر عوامل اثرگذار، عبور شاخص کل از مرز روانی ۸ میلیون واحد و ورود نقدینگی حقیقی، چشم‌انداز صعودی بورس را تقویت کرد؛ بااین‌حال، تداوم این روند به استمرار ورود نقدینگی و پایداری تقاضا در روزهای آتی وابسته خواهد بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

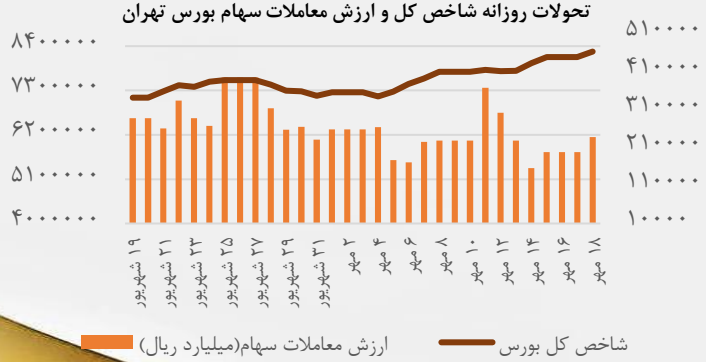
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۱۸ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۲.۱۶ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۲۰.۶۲ و ۱۱.۶۷ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



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 ۱۸ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۴

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 (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۷۲۷	۷۲,۹۵۰	۲۶۱,۹۹۰	۲۵۹,۹۵۳	۱۷۸,۴۰۶	۲۶۵,۲۰۰
روز گذشته (۱۷ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۰,۵۵۲	۷۳,۷۲۰	۲۶۳,۷۱۰	۲۶۱,۹۲۷	۱۷۷,۸۷۳	۲۶۸,۲۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۰۴	-۱.۰۴	-۰.۶۵	-۰.۷۵	+۰.۳۰	-۱.۱۲

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۸ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۱۲ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۵ هزار و ۲۰۰ 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 نوسانات روزانه، در مجموع با کاهش همراه شد و قیمت پایانی آن به حدود ۲۶۵ هزار و ۲۰۰ تومان رسید. این عقب‌نشینی را می‌توان به تعدیل تقاضای خرید و شناسایی سود معامله‌گران پس از رشد نرخ در ابتدای معاملات نسبت داد. در این روز، ابهامات سیاسی و نگرانی‌ها درباره تحولات منطقه‌ای همچنان از عوامل مؤثر بر انتظارات بازار ارز بودند؛ بااین‌حال، کاهش فشار خرید در ادامه روز مانع از تثبیت دلار در سطوح بالاتر شد. در مجموع، افت نرخ دلار بیشتر بیانگر اصلاح کوتاه‌مدت قیمت در پی تعدیل تقاضا بود تا رفع عوامل بنیادی اثرگذار بر بازار ارز.

تحولات بازار سکه و طلا

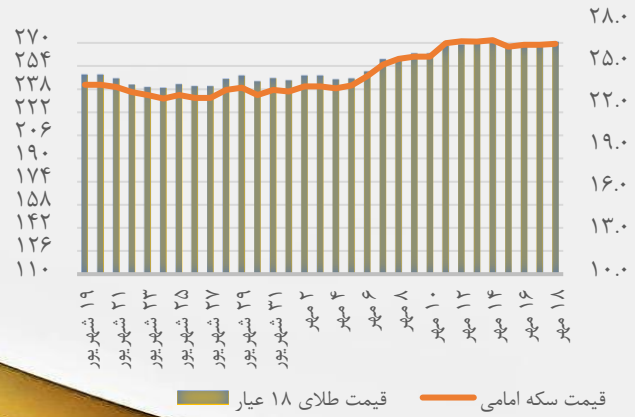
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۸۲	۴,۱۹۶	۰.۵۳۰	۳.۵۳۸	۲۶۸.۷۵	۲۶.۵۰	۲۶۹.۳۱
روز گذشته (۱۷ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۸۲	۴,۱۹۶	۰.۵۳۱	۳.۵۱۴	۲۶۸.۶۶	۲۶.۳۱	۲۶۸.۷۹
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۰.۱۱	+۰.۶۷	+۰.۰۳	+۰.۷۲	+۰.۱۹

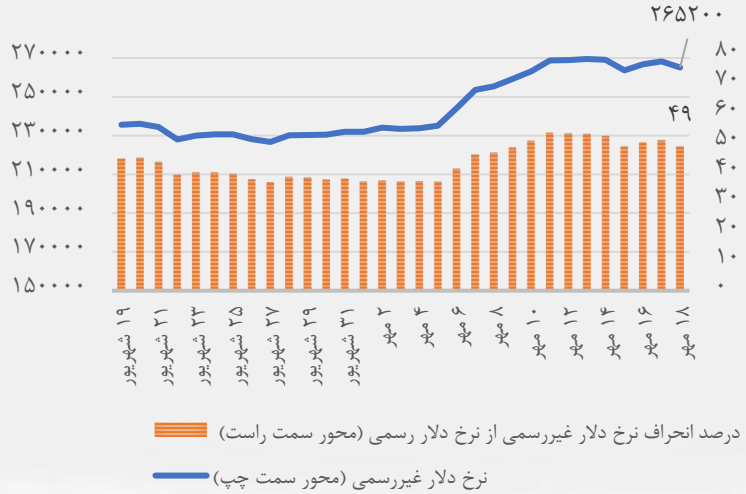
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۸ مهرماه ۱۴۰۵)، با وجود کاهش نرخ دلار در بازار غیررسمی و ثبات قیمت جهانی اونس طلا، قیمت سکه و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۱۹ و ۰.۷۲ درصد در بازار داخلی افزایش یافت. این روند حاکی از مقاومت قیمت‌ها در برابر عوامل مذکور در شرایط بالا بودن نااطمینانی اقتصادی و سیاسی است و می‌تواند تحت تأثیر تداوم انتظارات تورمی و تقاضای سفته‌بازی در بازار طلا و سکه شکل گرفته باشد. در واقع، تقاضای سرمایه‌ای با هدف پوشش ریسک تورم و حفظ ارزش دارایی‌ها، مانع از تعدیل قیمت‌ها متناسب با کاهش دلار شده است؛ ضمن آنکه تداوم تقاضای سفته‌بازانه می‌تواند فشار صعودی بر قیمت سکه وارد کند.

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

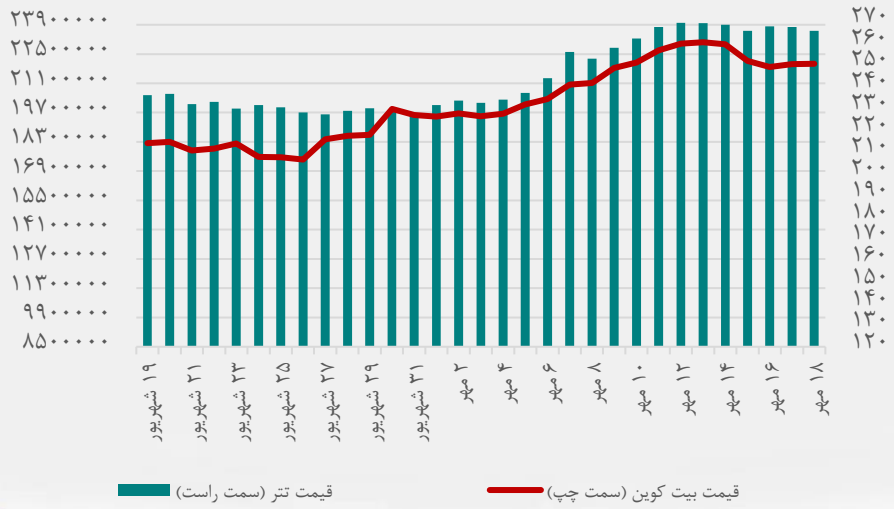
در روز جاری (۱۸ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب از ثبات نسبی و افزایش ۰.۵۲ درصدی برخوردار شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی با افزایش محدود قیمت همراه شد و در محدوده ۸۳ هزار دلار معامله شد. بهبود جریان سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بورسی و افزایش نسبی تمایل سرمایه‌گذاران به خرید پس از افت قیمت در روزهای پیشین، از عوامل حمایت‌کننده قیمت بود. بااین‌حال، افزایش نگرانی‌ها درباره تداوم سیاست پولی انقباضی آمریکا و انتشار گزارش‌هایی درباره دستکاری احتمالی کیف‌پول‌های سخت‌افزاری لجر در زنجیره تأمین جنوب شرق آسیا و سرقت رمزارزها، بر فضای احتیاطی بازار افزود و مانع از تقویت بیشتر روند صعودی شد. در بازار داخلی، قیمت ریالی بیت‌کوین تقریباً ثابت ماند و تنها ۰.۰۸ درصد افزایش یافت؛ زیرا کاهش قیمت تتر، اثر رشد محدود قیمت جهانی بیت‌کوین را تا حد زیادی خنثی کرد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۶۶ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۵ هزار و ۳۵۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۰۳۳	۶۶۵.۷	۲۶۵,۳۵۰
روز گذشته (۱۷ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۰۱۵	۶۶۲.۳	۲۶۷,۱۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۰۸	+۰.۵۲	-۰.۶۶

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



وزارت امور اقتصادی و دارایی، معاونت امور بانکی، بیمه و شرکت‌های دولتی، مرکز ملی تامین مالی
نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی