تحولات بازارهای مالی در روز یکشنبه مورخ ۱۹ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۵

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۹ مهرماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت افزایش یافت و ورود پول حقیقی به این بازار ثبت شد؛ همزمان، نرخ بازده تا سررسید اوراق بدهی نیز افزایش پیدا کرد که بیانگر بالا ماندن بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران و هزینه تأمین مالی بود. تداوم این وضعیت می‌تواند با افزایش جذابیت نسبی اوراق بدهی، منابع مالی را از بازار سهام دور کند و بر ارزش‌گذاری سهام فشار وارد سازد.

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 (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۴.۱	۴۲.۴	۰.۵۶	۱۴۹,۹۰۲
روز گذشته (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۳.۴	۳۹.۶۱	-۰.۳۷	۸۸,۱۶۱
تغییرات (درصد)	+۰.۰۵	+۲.۷۹	+۲۴۸.۵	+۷۰

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

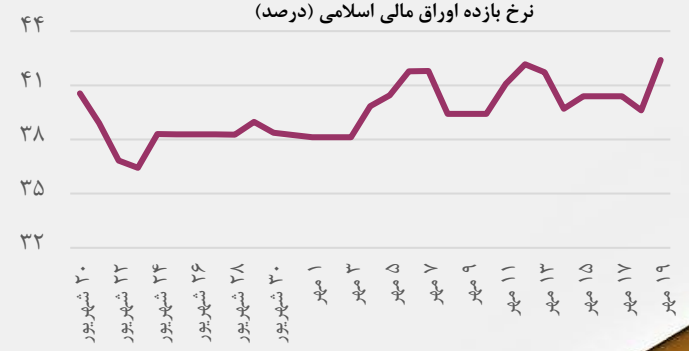
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
۶۴,۸۹۴	۹۴.۴۳	۴۰۹,۹۰۹	۲,۱۶۵,۲۱۹	۱,۳۶۲,۷۰۹	۸,۲۴۲,۸۶۷
۶۵,۱۵۷	۶۸.۷۶	۲۳۸,۰۹۲	۲,۱۷۲,۵۲۴	۱,۳۶۶,۴۴۸	۸,۲۶۵,۴۷۸
-۰.۴۰	۳۷.۳	۷۲	-۰.۳۴	-۰.۲۷	-۰.۲۷

روز جاری (۱۹ مهر ۱۴۰۵)
روز گذشته (۱۸ مهر ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

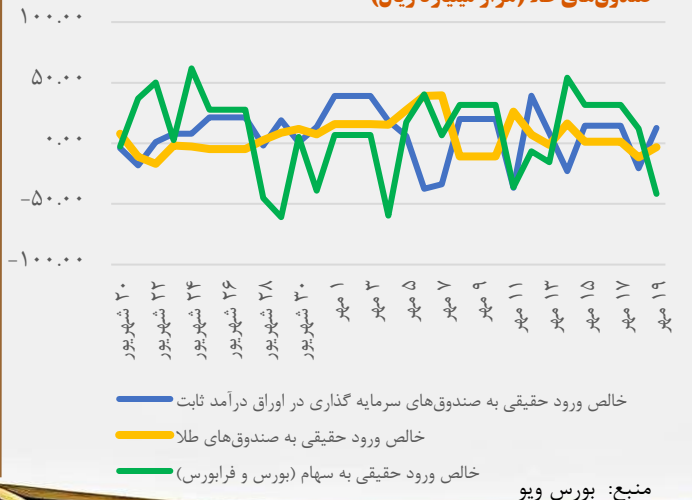
در معاملات بورس تهران در روز جاری (۱۹ مهر ۱۴۰۵)، شاخص کل با افت ۰.۲۷ درصدی به ۸ میلیون و ۲۴۲ هزار واحد رسید و شاخص هم‌وزن نیز حدود ۰.۳۴ درصد کاهش یافت. هم‌زمان، خروج پول حقیقی از بازار سهام، در کنار منفی بودن حدود ۶۲ درصد نمادها، از افزایش فشار فروش و شناسایی سود پس از رشدهای اخیر حکایت داشت. بااین‌حال، ارزش معاملات با ثبت افزایش ۷۲ درصدی به رکورد تاریخی رسید که نشان‌دهنده تداوم تحرک معاملاتی در بازار بود. در مجموع، معاملات این روز بیانگر اصلاح کوتاه‌مدت بازار در پی رشدهای قبلی و غلبه عرضه بر تقاضا بود؛ هرچند برای نتیجه‌گیری درباره تغییر روند میان‌مدت، بررسی تداوم خروج پول حقیقی و توان بازار در جذب عرضه‌ها ضروری است.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

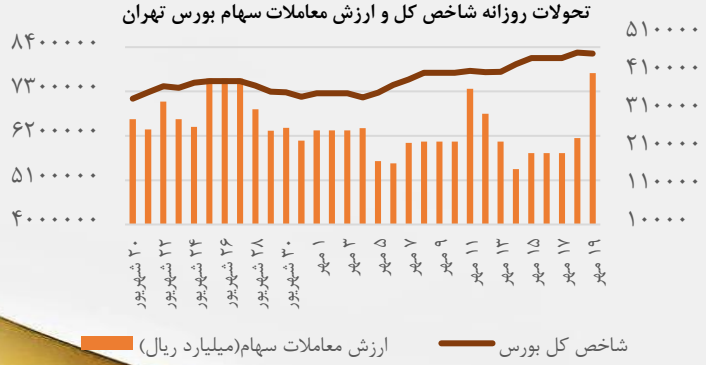
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۱۹ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۴۱.۶۸ و ۳.۱۴ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.. این درحالی است که حدود ۱۲.۷۹ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته 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 یکشنبه مورخ ۱۹ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۵

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 (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۳۲۳	۷۲,۸۴۰	۲۶۰,۲۹۰	۲۶۲,۱۲۵	۱۷۸,۹۴۲	۲۶۵,۰۰۰
روز گذشته (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۷۲۷	۷۲,۹۵۰	۲۶۱,۹۹۰	۲۵۹,۹۵۳	۱۷۸,۴۰۶	۲۶۵,۲۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۱۵	-۰.۱۵	-۰.۶۵	+۰.۸۴	+۰.۳۰	-۰.۰۸

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۹ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۰۸ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۵ هزار 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 تقریباً باثبات و متمایل به کاهش بود و در جریان معاملات تا محدوده ۲۶۵ هزار تومان عقب‌نشینی کرد؛ هرچند نرخ‌ها در طول روز نوسان محدودی داشتند. در مقابل، نرخ حواله دلار در مرکز مبادله افزایش یافت که نشان‌دهنده تفاوت جهت حرکت بازار آزاد و بازار رسمی بود. در مجموع، ثبات نسبی دلار با تمایل کاهشی را می‌توان نشانه محدود بودن تقاضای افزایشی در معاملات آن روز دانست. تداوم ابهامات سیاسی و تورمی نیز همچنان مانع از آن بود که کاهش محدود قیمت به‌عنوان تغییر پایدار روند بازار غیررسمی تفسیر شود.

تحولات بازار سکه و طلا

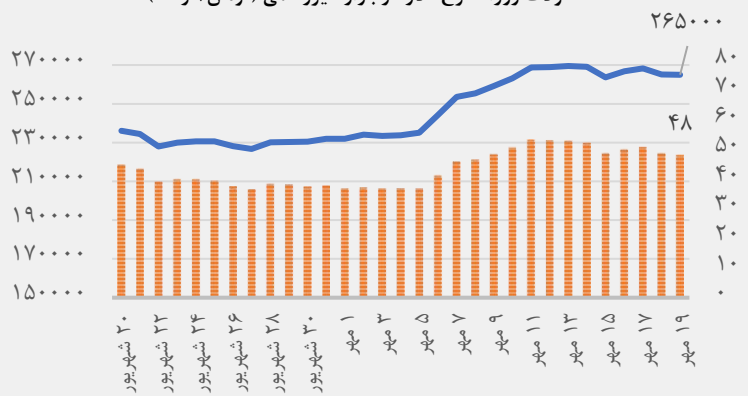
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۸۲	۴,۱۹۶	۰.۵۲۴	۳.۵۰۷	۲۶۷.۱۴	۲۶.۳۰	۲۶۷.۲۶
روز گذشته (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۸۲	۴,۱۹۶	۰.۵۳۰	۳.۵۳۸	۲۶۸.۷۵	۲۶.۵۰	۲۶۹.۳۱
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۱.۲۴	-۰.۸۸	-۰.۶۰	-۰.۷۵	-۰.۷۶

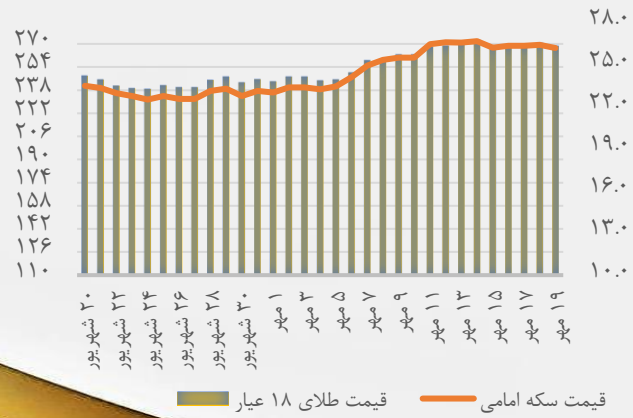
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۹ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب معادل ۰.۷۶ و ۰.۷۵ درصد کاهش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. این کاهش در شرایطی بود که قیمت دلار در بازار غیررسمی و قیمت جهانی اونس طلا تقریبا ثابت بودند. به نظر می‌رسد، تخلیه هیجانات خرید و ذخیره‌سازی سود پس از رشدهای اخیر، از مهم‌ترین عوامل موثر بر کاهش قیمت دارایی‌های مذکور بوده است.

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

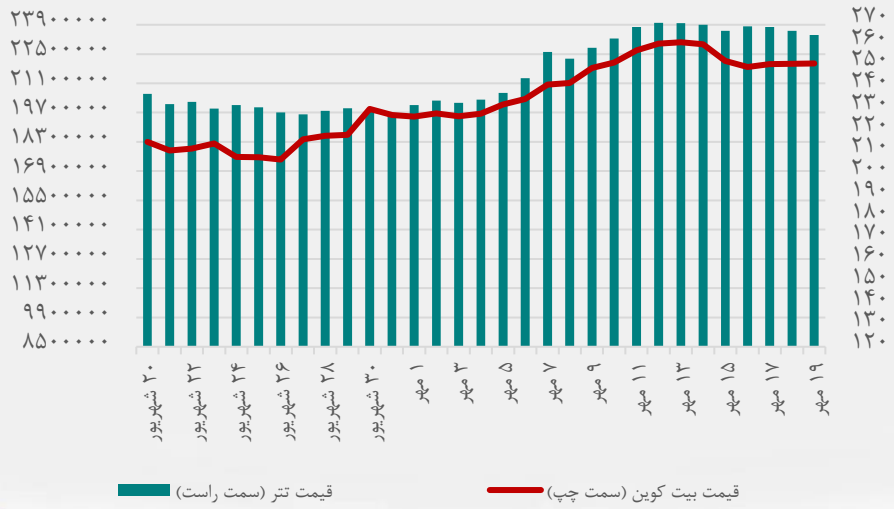
در روز جاری (۱۹ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب از ثبات نسبی و افزایش ۰.۳۷ درصدی برخوردار شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس پایگاه داده Investing، با افزایش ۰.۹۴ درصدی همراه شد و در محدوده ۸۳.۸ هزار دلار معامله شد. از نظر عوامل اثرگذار، فشار ناشی از افزایش بازده اوراق خزانه‌داری آمریکا، تقویت دلار و خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین، در روزهای معاملاتی پیشین بر بازار رمزارزها اثر گذاشته بود. در روز جاری، با وجود بازگشت محدود قیمت، ضعف مومنتوم و کاهش حجم معاملات مانع از تأیید بازگشت قدرتمند تقاضا شد. در مجموع، روند بیت‌کوین در این روز را می‌توان بازیابی محدود پس از افت قبلی، در شرایط تداوم احتیاط و ضعف مومنتوم بازار ارزیابی کرد. در بازار داخلی، قیمت ریالی بیت‌کوین تقریباً ثابت ماند و تنها ۰.۰۴ 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 ۰.۷۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۳ هزار و ۴۰۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۰۴۱	۶۶۸.۱	۲۶۳,۴۰۰
روز گذشته (۱۸ مهر ۱۴۰۵)	۲۲,۰۳۳	۶۶۵.۷	۲۶۵,۳۵۰
تغییرات (درصد)	+۰.۰۴	+۰.۳۷	−۰.۷۳

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی