تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۲۰ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۶

تحولات بازار سرمایه

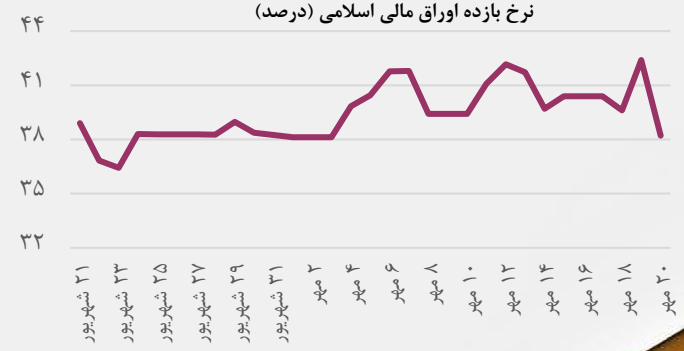
تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۰ مهرماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت همزمان با خروج پول حقیقی و افت نرخ بازدهی بدون ریسک همراه شد. کاهش نرخ بازدهی در این بازار به معنای افزایش قیمت اوراق است؛ بنابراین، با توجه به جذابیت نرخ‌های بازدهی بالا در روزهای قبل و تقویت تقاضا برای این اوراق، افت نرخ بازدهی در روز مورد بررسی می‌تواند نشان‌دهنده منتفع شدن بخشی از سرمایه‌گذاران از افزایش قیمت اوراق و ذخیره‌سازی سود از طریق فروش آن‌ها باشد. در این شرایط، خروج پول حقیقی را می‌توان تا حدی ناشی از فروش اوراق و تحقق سود سرمایه‌ای ارزیابی کرد؛ به‌ویژه آنکه کاهش ارزش معاملات نیز از افت حجم فعالیت معاملاتی حکایت دارد.

	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 (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۴.۷	۳۸.۲۲	-۰.۲۳	۱۴۶,۱۹۹
روز گذشته (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۴.۱	۴۲.۴	۰.۵۶	۱۴۹,۹۰۲
تغییرات (درصد)	+۰.۰۵	-۴.۱۹	-۱۴۰.۶	-۲.۵

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

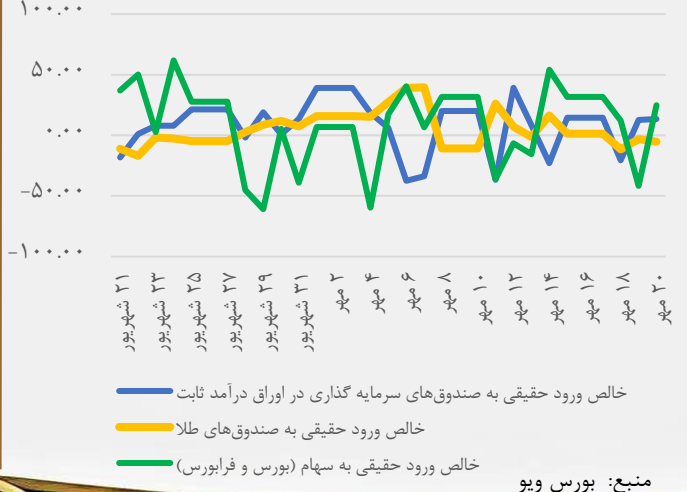
	فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
	شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
روز جاری (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۶۵,۳۱۱	۶۰.۱۱	۲۴۵,۲۰۴	۲,۱۸۱,۴۱۲	۱,۳۷۷,۷۷۰	۸,۳۳۳,۹۶۹
روز گذشته (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۶۴,۸۹۴	۹۴.۴۳	۴۰۹,۹۰۹	۲,۱۶۵,۲۱۹	۱,۳۶۲,۷۰۹	۸,۲۴۲,۸۶۷
تغییرات (درصد)	+۰.۶۴	-۳۶.۳	-۴۰	+۰.۷۵	+۱.۱۱	+۱.۱۱

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲۰ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از شروعی منفی، با تقویت تقاضا تغییر مسیر داد و با رشد حدود ۱.۱۱ و ۰.۷۵ درصدی شاخص کل و هم‌وزن به کار خود پایان داد. مثبت بودن حدود ۷۳ درصد نمادهای معاملاتی نشان داد که بهبود بازار به چند نماد بزرگ محدود نبوده و بخش گسترده‌تری از سهام با افزایش تقاضا مواجه شده‌اند.

همچنین، ورود پول حقیقی به سهام، بیانگر افزایش نسبی تمایل سرمایه‌گذاران به پذیرش ریسک در بازار سهام بود. در مجموع، معاملات این روز از بهبود مومنتوم بازار و تقویت تقاضا حکایت داشت؛ بااین‌حال، تداوم این روند به استمرار ورود نقدینگی و حفظ برتری تقاضا بر عرضه در روزهای آتی وابسته است.

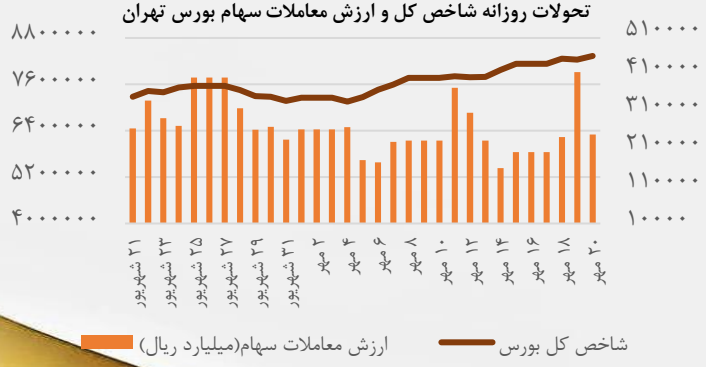
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۲۰ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۲۴.۷ و ۱۳.۵۵ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به ترتیب به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۵.۳۶ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از 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 دوشنبه مورخ ۲۰ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۶

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 (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۴,۳۱۳	۷۲,۰۲۰	۲۵۸,۴۹۰	۲۶۰,۰۶۶	۱۷۹,۴۷۸	۲۶۱,۹۰۰
روز گذشته (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۳۲۳	۷۲,۸۴۰	۲۶۰,۲۹۰	۲۶۲,۱۲۵	۱۷۸,۹۴۲	۲۶۵,۰۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۱۳	-۱.۱۳	-۰.۶۹	-۰.۷۹	+۰.۳۰	-۱.۱۷

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۰ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۱۷ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۱ هزار و ۹۰۰ 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 با کاهش قیمت مواجه شد و نرخ آن در پایان معاملات به محدوده ۲۶۲ هزار تومان رسید؛ سطحی که پایین‌ترین نرخ ثبت‌شده در حدود ۱۰ روز گذشته بود. این کاهش در ادامه عقب‌نشینی دلار از محدوده‌های بالاتر روزهای قبل رخ داد و با کاهش تقاضا و تعدیل انتظارات افزایشی در بازار دلار غیررسمی همراه بود. از منظر عوامل اثرگذار، مهم‌ترین سیگنال سیاسی روز، اظهارات اسماعیل بقایی، سخنگوی وزارت امور خارجه، درباره تداوم تبادل پیام میان ایران و آمریکا از طریق واسطه‌ها بود. این خبر در کنار ثبات نسبی فضای سیاسی توانست از شدت تقاضای احتیاطی برای ارز بکاهد. در مجموع، افت دلار در ۲۰ مهر را می‌توان حاصل هم‌زمان کاهش تقاضای خرید، تعدیل انتظارات افزایشی و اثرگذاری اخبار مربوط به تداوم ارتباطات دیپلماتیک ارزیابی کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

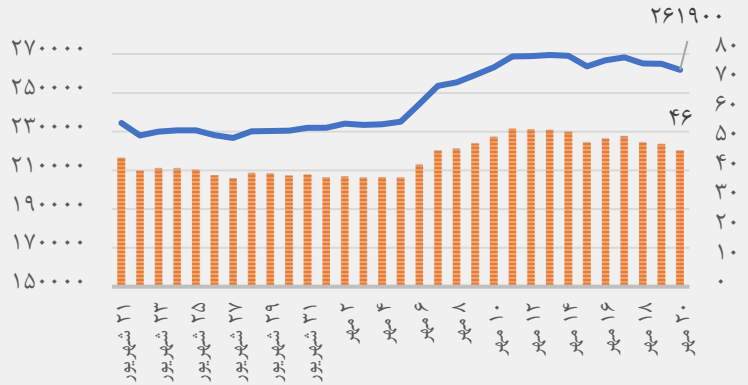
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۲۵	۴,۱۷۱	۰.۵۱۰	۳.۴۶۸	۲۶۴.۲۶	۲۵.۹۶	۲۶۳.۵۸
روز گذشته (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۸۲	۴,۱۹۶	۰.۵۲۴	۳.۵۰۷	۲۶۷.۱۴	۲۶.۳۰	۲۶۷.۲۶
تغییرات (درصد)	-۰.۹۲	-۰.۶۱	-۲.۶۳	-۱.۱۰	-۱.۰۸	-۱.۲۸	-۱.۳۸

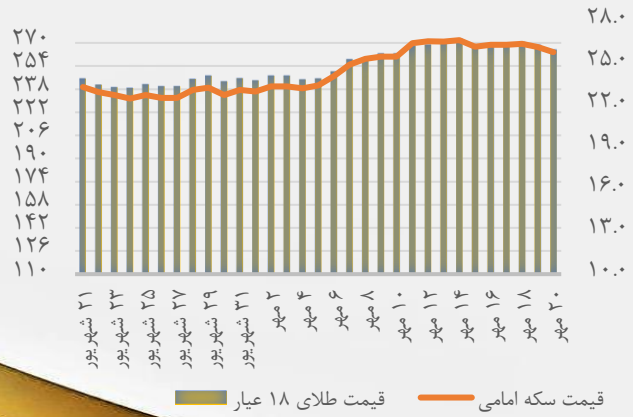
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲۰ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۱.۳۸ و ۱.۲۸ درصد کاهش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. از مهم‌ترین عوامل این کاهش می‌توان به کاهش قیمت جهانی اونس طلا و کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی اشاره کرد.

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

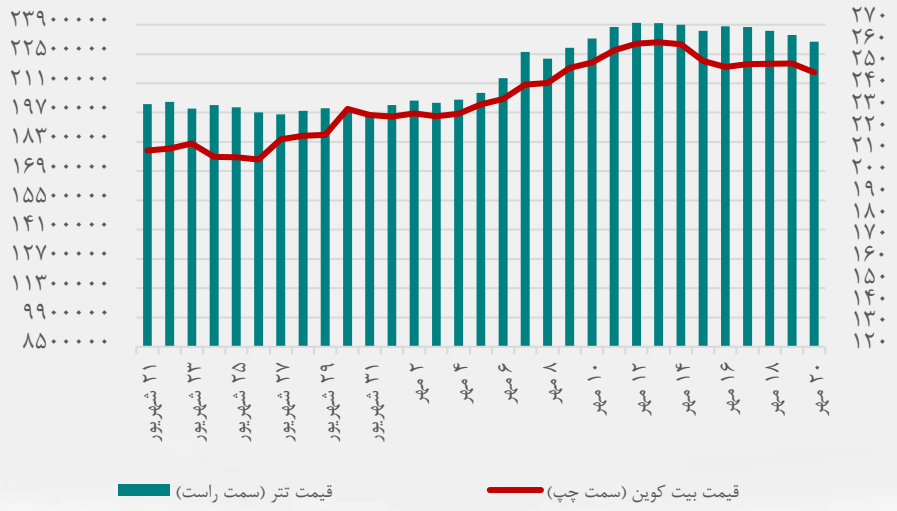
در روز جاری (۲۰ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۱.۹۱ و ۱.۶۲ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین پس از افزایش اولیه تا محدوده ۸۴ هزار دلار، تحت‌تأثیر تشدید ریسک‌های ژئوپلیتیکی و افزایش قیمت نفت، بخشی از رشد خود را از دست داد. افزایش نگرانی‌ها درباره اختلال در عرضه انرژی و تقویت فضای ریسک‌گریزی، در کنار خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین، فشار فروش را تشدید کرد. همچنین، حدود ۷۷۱ میلیون دلار از موقعیت‌های معاملاتی اهرمی بازار رمزارزها در ۲۴ ساعت لیکوییید شد که بخش عمده آن به موقعیت‌های خرید اختصاص داشت و به تشدید افت قیمت کمک کرد. در مجموع، افزایش ریسک‌گریزی، تضعیف جریان سرمایه نهادی و تصفیه گسترده موقعیت‌های اهرمی، مانع از تثبیت رشد اولیه بیت‌کوین شد و قیمت آن را به زیر سطح ۸۲ هزار دلار رساند.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۱۶ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۰ هزار و ۳۵۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۰,۳۵۰	۶۵۷.۳	۲۱,۶۲۰
روز گذشته (۱۹ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۳,۴۰۰	۶۶۸.۱	۲۲,۰۴۱
تغییرات (درصد)	-۱.۱۶	-۱.۶۲	-۱.۹۱

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی