تحولات بازار سرمایه

در معاملات ۲۱ مهرماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات در کنار ورود پول حقیقی و افزایش نرخ بهره بدون ریسک، بیانگر اقبال سرمایه‌گذاران به اوراق درآمد ثابت، هم‌زمان با افزایش بازده مورد مطالبه سرمایه‌گذاران بود. ورود پول حقیقی نشان‌دهنده تمایل بخشی از سرمایه‌گذاران به استفاده از ظرفیت این بازار برای کسب بازده نسبتاً باثبات است. از سوی دیگر، افزایش نرخ بهره بدون ریسک می‌تواند با بالا بردن هزینه فرصت سرمایه‌گذاری، بر جذابیت نسبی بازار سهام اثرگذار باشد.

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)	
۱,۳۴۵.۵	۳۹.۵۹	۰.۱۴	۵۹,۳۰۶	روز جاری (۲۱ مهر ۱۴۰۵)
۱,۳۴۴.۷	۳۸.۲۲	-۰.۲۳	۱۴۶,۱۹۹	روز گذشته (۲۰ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۰۶	+۱.۳۸	+۱۶۲.۲	-۵۹.۴	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	
۶۶,۲۲۳	۵۶.۵۰	۲۴۸,۵۴۶	۲,۲۲۰,۰۴۵	۱,۳۹۸,۶۸۸	۸,۴۶۰,۴۹۷	روز جاری (۲۱ مهر ۱۴۰۵)
۶۵,۳۱۱	۶۰.۱۱	۲۴۵,۲۰۴	۲,۱۸۱,۴۱۲	۱,۳۷۷,۷۷۰	۸,۳۳۳,۹۶۹	روز گذشته (۲۰ مهر ۱۴۰۵)
+۱.۴۰	-۶	+۱	+۱.۷۷	+۱.۵۲	+۱.۵۲	تغییرات (درصد)

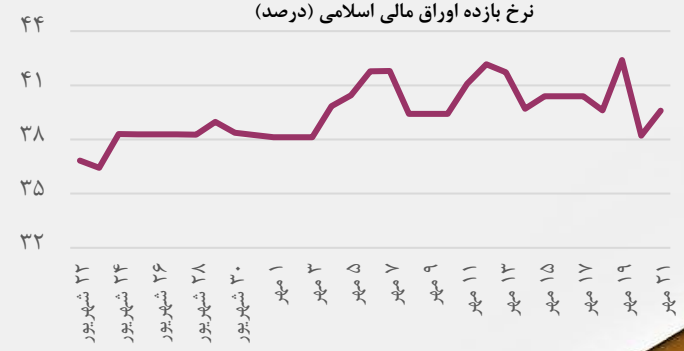
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲۱ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران با غلبه تقاضا و رشد قابل‌توجه شاخص‌ها همراه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با افزایش ۱.۵۲ درصدی به ۸ میلیون و ۴۶۰ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با رشد ۱.۷۷ درصدی به حدود ۲ میلیون و ۲۲۰ هزار واحد رسید. رشد بیشتر شاخص هم‌وزن و برتری نمادهای مثبت نسبت به منفی، بیانگر مشارکت گسترده‌تر سهام در روند صعودی بازار بود.

همچنین، ورود پول حقیقی به بازار سهام، از تقویت تقاضا و افزایش تمایل سرمایه‌گذاران به پذیرش ریسک حکایت داشت. بااین‌حال، عقب‌نشینی شاخص از سقف روزانه نشان داد که در سطوح بالاتر، عرضه و شناسایی سود نیز افزایش یافته است.

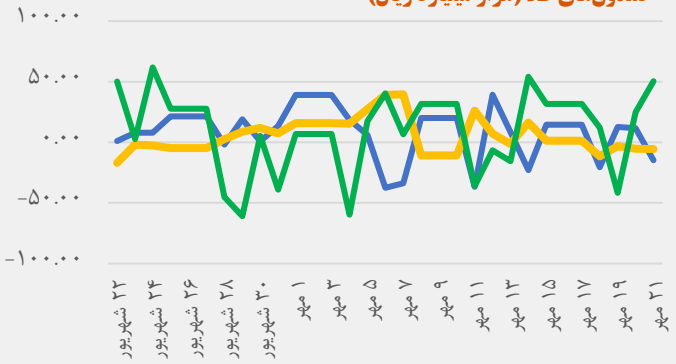
در مجموع، روند معاملات با تقویت تقاضا و بهبود جریان نقدینگی همراه بود؛ هرچند تداوم صعود به حفظ ورود پول حقیقی و پایداری تقاضا در روزهای بعد وابسته است.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

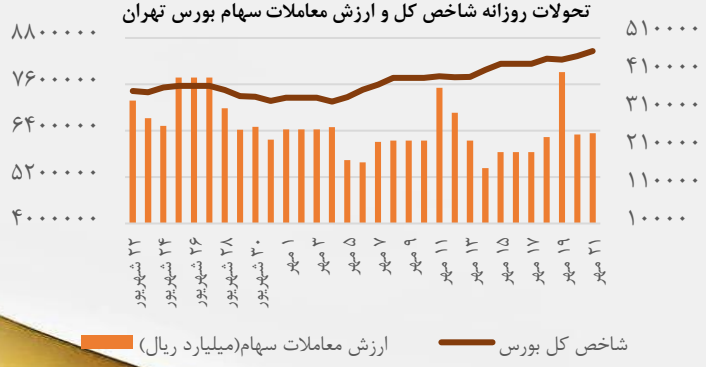
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۲۱ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۵۰.۵ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۵.۵۲ و ۱۴.۷۸ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) 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 سه شنبه مورخ ۲۱ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۷

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 (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۲,۰۷۵	۷۱,۴۱۰	۲۵۶,۷۴۰	۲۵۹,۹۰۸	۱۸۰,۰۱۷	۲۵۹,۸۰۰
روز گذشته (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۴,۳۱۳	۷۲,۰۲۰	۲۵۸,۴۹۰	۲۶۰,۰۶۶	۱۷۹,۴۷۸	۲۶۱,۹۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۸۵	-۰.۸۵	-۰.۶۸	-۰.۰۶	+۰.۳۰	-۰.۸۰

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۱ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۸ درصدی همراه شد و در سطح ۲۵۹ هزار و ۸۰۰ 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 روندی نزولی داشت. این افت در ادامه کاهش قیمت دلار در روزهای اخیر رخ داد و نشان‌دهنده تداوم فشار فروش در بازار ارز بود. از منظر عوامل اثرگذار، اظهارات عبدالناصر همتی، رئیس کل بانک مرکزی، در ۲۰ مهر درباره ادامه کاهش نرخ دلار و تأمین ۲۵ میلیارد دلار ارز برای تولید از ابتدای سال، در تقویت انتظارات کاهشی مؤثر بود. همچنین، برنامه عرضه ۲ میلیارد دلار ارز و محدودیت‌های اعمال‌شده در معاملات تتر در روزهای اخیر، با هدف افزایش عرضه و مهار نوسانات، فشار نزولی بر بازار وارد کرد.

در مقابل، اظهارات دونالد ترامپ در ۲۱ مهر مبنی بر تصمیم‌گیری قریب‌الوقوع واشنگتن درباره گام بعدی در قبال ایران، همچنان بر نااطمینانی سیاسی و ریسک بازار ارز می‌افزود. در مجموع، کاهش دلار در این روز بیش از آنکه ناشی از رفع ریسک‌های سیاسی و اقتصادی باشد، با تقویت عرضه دلار و تغییر انتظارات معامله‌گران همزمان بود. ازاین‌رو، تداوم روند نزولی به استمرار مداخله ارزی و تحولات سیاسی پیش‌رو وابستگی داشت.

تحولات بازار سکه و طلا

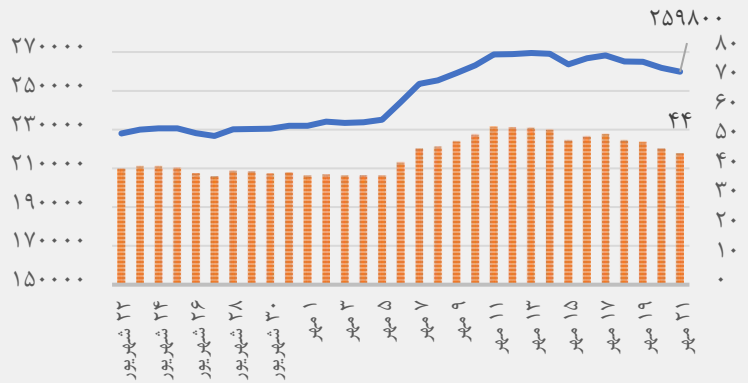
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۵۹.۱۶	۴,۱۵۹	۰.۴۹۸	۳.۳۶۳	۲۵۵.۶۰	۲۵.۷۴	۲۵۷.۸۱
روز گذشته (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۶۰.۲۵	۴,۱۷۱	۰.۵۱۰	۳.۴۶۸	۲۶۴.۲۶	۲۵.۹۶	۲۶۳.۵۸
تغییرات (درصد)	-۱.۸۲	-۰.۲۷	-۲.۴۴	-۳.۰۳	-۳.۲۸	-۰.۸۶	-۲.۱۹

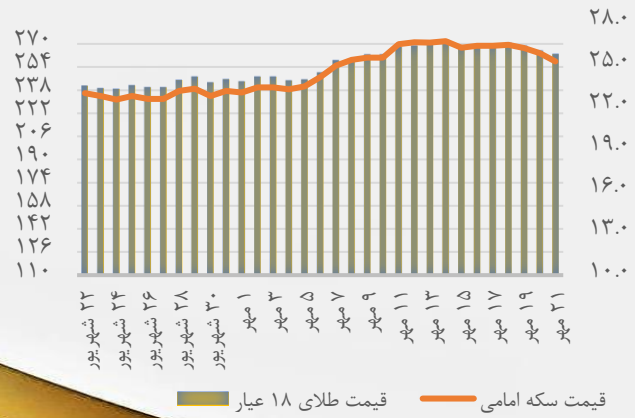
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲۱ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۲.۱۹ و ۰.۸۶ 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 (۲۱ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۳ و ۱.۱۹ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین پس از افت تا سطح ۸۱ هزار دلار، بخشی از کاهش خود را جبران کرد و با رشد روزانه ۱.۵۸ درصدی، در قیمت ۸۳ هزار دلار به کار خود پایان داد. در سمت عوامل کاهشی، تشدید نگرانی‌ها درباره بازدهی سرمایه‌گذاری‌های مرتبط با هوش مصنوعی، افت سهام شرکت‌های فناوری و تراشه‌سازی و افزایش احتیاط سرمایه‌گذاران در قبال دارایی‌های پرریسک، بر بازار رمزارزها فشار وارد کرد. در مقابل، تضعیف شاخص دلار آمریکا و بازنگری معامله‌گران در انتظارات مربوط به سیاست پولی فدرال رزرو، از جمله عواملی بود که توانست از فشار بر دارایی‌های پرریسک بکاهد. اظهارات رئیس فدرال رزرو نیویورک درباره احتمال یک مرحله افزایش نرخ بهره در سال جاری و نبود نیاز به افزایش بیشتر در سال ۲۰۲۷، در کنار انتظار بازار برای انتشار آمار تورم آمریکا، بر ارزیابی معامله‌گران از مسیر آتی سیاست پولی اثرگذار بود.

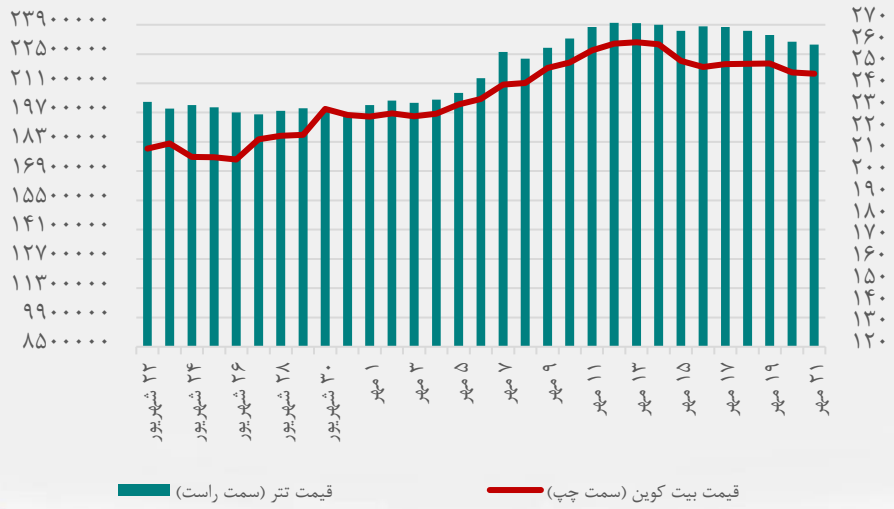
در بازار داخلی، با وجود افزایش قیمت دلاری بیت‌کوین، قیمت ریالی آن کاهش یافت؛ موضوعی که با افت نرخ تتر هم‌زمان بود. این واگرایی نشان می‌دهد که کاهش قیمت تتر در بازار داخلی توانسته است اثر رشد قیمت جهانی بیت‌کوین را خنثی کند و به افت ارزش ریالی آن بینجامد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۵۶ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۵۸ هزار و ۹۰۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۲۵۸,۹۰۰	۶۴۹.۵	۲۱,۵۵۵
روز گذشته (۲۰ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۰,۳۵۰	۶۵۷.۳	۲۱,۶۲۰
تغییرات (درصد)	-۰.۵۶	-۱.۱۹	-۰.۳۰

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی