تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۲۲ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۸

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۲ مهرماه ۱۴۰۵، افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت همزمان با خروج پول حقیقی و افزایش نرخ بهره بدون ریسک در بازار اوراق بدهی، نشان‌دهنده افزایش تحرک معاملاتی در کنار تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران است. خروج پول حقیقی‌ها می‌تواند بیانگر کاهش تمایل بخشی از سرمایه‌گذاران به نگهداری اوراق و جست‌وجوی فرصت در سایر بازارها باشد. درحالی‌که افزایش نرخ بازده بدون ریسک، با کاهش قیمت اوراق در بازار ثانویه همراه است و بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران از خرید اوراق جدید را افزایش می‌دهد. در مجموع، این وضعیت می‌تواند از تداوم فشار بر قیمت اوراق و افزایش جذابیت بازدهی ابزارهای درآمد ثابت حکایت داشته باشد.

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 (۲۲ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۶.۷	۴۰.۱۴	-۰.۲۷	۳۱۳,۳۰۶
روز گذشته (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۵.۵	۳۹.۵۹	۰.۱۴	۵۹,۳۰۶
تغییرات (درصد)	+۰.۰۹	+۰.۵۵	-۲۸۹.۹	+۴۲۸.۳

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

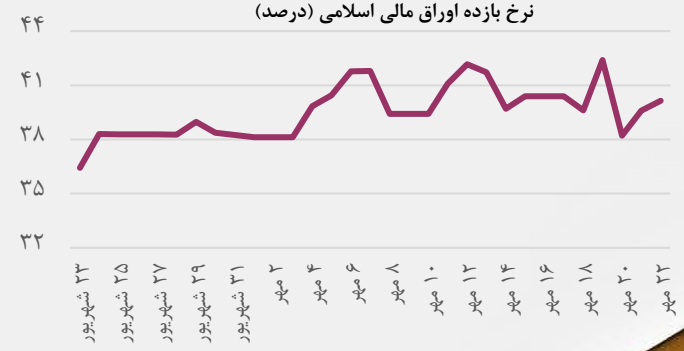
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

	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
روز جاری (۲۲ مهر ۱۴۰۵)	۶۶,۰۱۴	۸۳	۳۲۵,۱۲۳	۲,۲۲۵,۷۹۷	۱,۳۹۲,۹۳۳	۸,۴۲۵,۷۲۵
روز گذشته (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۶۶,۲۲۳	۵۶.۵۰	۲۴۸,۵۴۶	۲,۲۲۰,۰۴۵	۱,۳۹۸,۶۸۸	۸,۴۶۰,۴۹۷
تغییرات (درصد)	-۰.۳۲	+۴۶.۹	+۳۱	+۰.۲۶	-۰.۴۱	-۰.۴۱

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

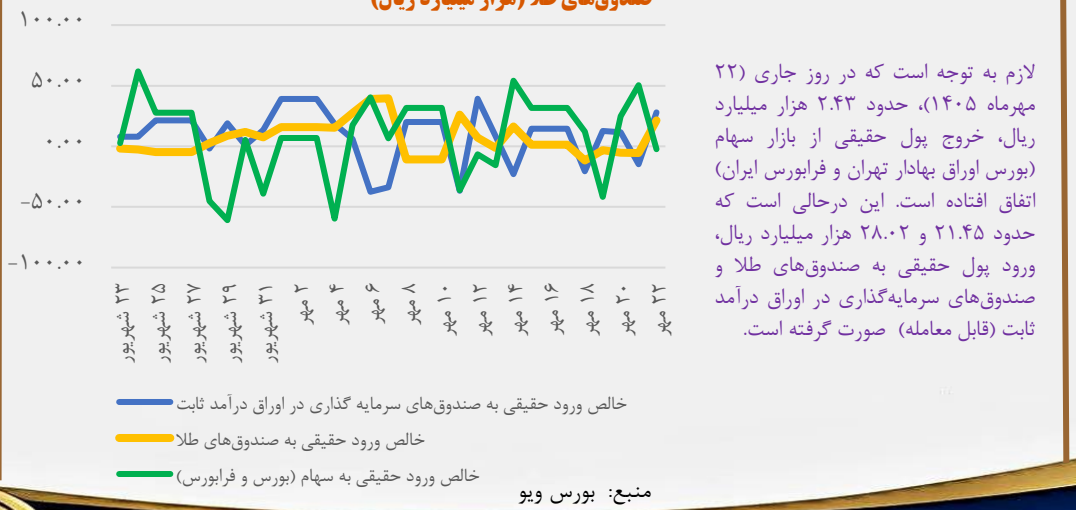
در روز جاری (۲۲ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از رشد قابل‌توجه روز معاملاتی قبل، با افزایش فشار فروش در نمادهای بزرگ مواجه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با افت ۰.۴۱ درصدی به ۸ میلیون و ۴۲۶ هزار واحد رسید، درحالی‌که شاخص هم‌وزن ۰.۲۶ درصد افزایش یافت. این واگرایی نشان می‌دهد که فشار عرضه بیشتر بر نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز متمرکز بوده و بخشی از سهام کوچک و متوسط همچنان از تقاضا برخوردار بوده‌اند. همچنین، خروج پول حقیقی از سهام، از افزایش احتیاط معامله‌گران حکایت داشت. به نظر می‌رسد، ذخیره‌سازی سود پس از رشد روز گذشته و افزایش عرضه در جریان معاملات، از عوامل اصلی عقب‌نشینی شاخص کل بوده‌اند.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

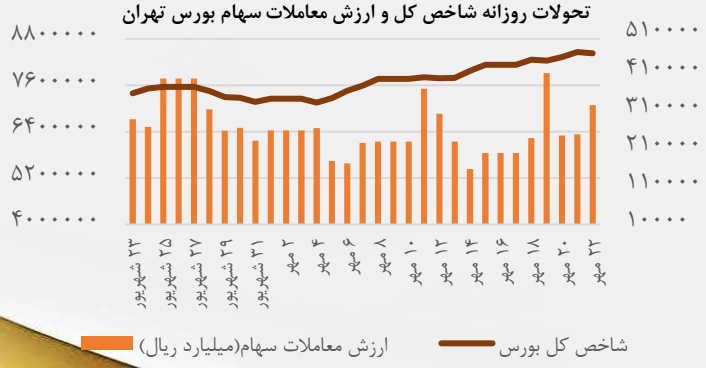
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



لازم به توجه است که در روز جاری (۲۲ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۲.۴۳ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۱.۴۵ و ۲۸.۰۲ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های طلا و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته است.

منبع: بورس ویو

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 چهارشنبه مورخ ۲۲ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۸

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 (۲۲ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۳۲۳	۷۲,۸۴۰	۲۶۱,۹۹۰	۲۵۷,۶۰۹	۱۸۰,۵۵۷	۲۶۵,۰۰۰
روز گذشته (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۲,۰۷۵	۷۱,۴۱۰	۲۵۶,۷۴۰	۲۵۹,۹۰۸	۱۸۰,۰۱۷	۲۵۹,۸۰۰
تغییرات (درصد)	+۲	+۲	+۲.۰۴	-۰.۸۸	+۰.۳۰	+۲

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۲ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲ 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 پس از افت روز قبل، مجدداً وارد کانال ۲۶۰ هزار تومان شد و در ادامه معاملات، روند افزایشی خود را تا ۲۶۵ هزار تومان حفظ کرد. نظر می‌رسد، افزایش حساسیت معامله‌گران به ریسک‌های سیاسی و تقویت تقاضای احتیاطی دلار، در بازگشت قیمت به مسیر صعودی مؤثر بوده است. به‌ویژه آنکه این افزایش پس از افت شدید روز قبل رخ داد و می‌تواند بیانگر پایداری تقاضا در قیمت‌های پایین‌تر باشد. در مجموع، بازگشت دلار به مسیر افزایشی را می‌توان ناشی از تعدیل تقاضای پس از افت روز قبل و تداوم حساسیت بازار به نااطمینانی‌های سیاسی ارزیابی کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

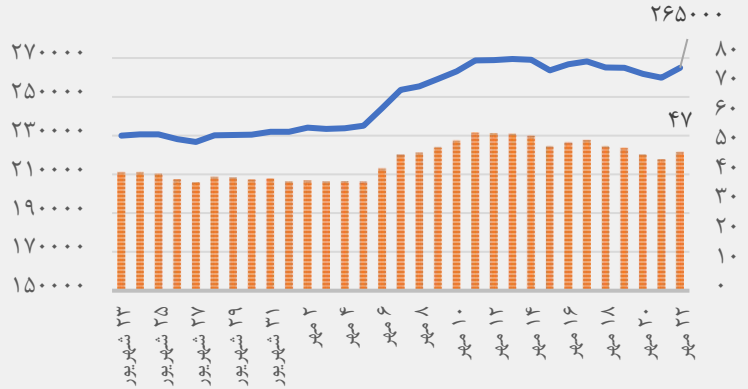
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۲۲ مهر ۱۴۰۵)	۵۵.۵۸	۴,۱۰۰	۰.۵۰۸	۳.۴۶۵	۲۶۴.۳۸	۲۶.۰۴	۲۶۷.۰۹
روز گذشته (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۵۹.۱۶	۴,۱۵۹	۰.۴۹۸	۳.۳۶۳	۲۵۵.۶۰	۲۵.۷۴	۲۵۷.۸۱
تغییرات (درصد)	-۶.۰۵	-۱.۴۲	+۲.۰۳	+۳.۰۲	+۳.۴۴	+۱.۱۶	+۳.۶۰

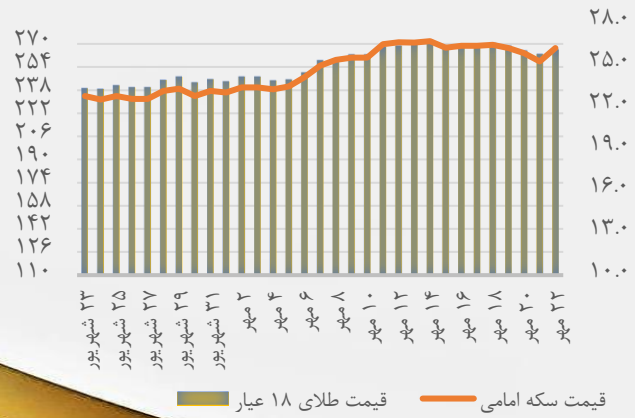
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲۲ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۳.۶ و ۱.۱۶ درصد افزایش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. به نظر می‌رسد، انتظارات سیاسی و افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی نقش مهمی در افزایش دارایی‌های مذکور با وجود کاهش قیمت جهانی اونس طلا، داشته 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

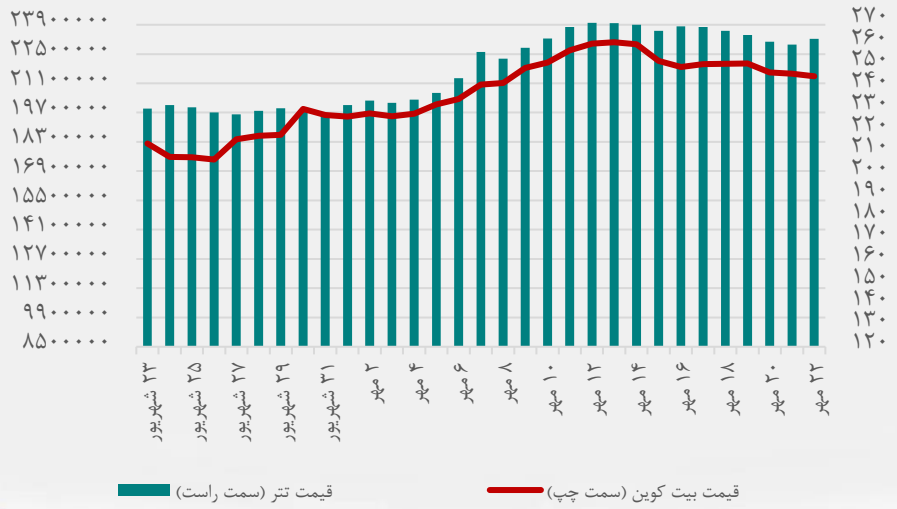
در روز جاری (۲۲ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۵۸ و ۲.۰۸ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت جهانی بیت‌کوین با افت ۱.۸ درصدی به حدود ۸۱.۷ هزار دلار رسید. افزایش احتیاط معامله‌گران در آستانه انتشار داده‌های تورمی آمریکا، نگرانی از تداوم فشارهای تورمی ناشی از افزایش قیمت نفت و احتمال تداوم سیاست پولی انقباضی فدرال رزرو، از عوامل مؤثر بر افت قیمت این رمزارز بودند. در مقابل، ورود خالص سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در روز قبل در آمریکا، عاملی حمایتی محسوب شد، اما نتوانست مانع کاهش قیمت شود. در بازار داخلی، افزایش نرخ تتر، بخشی از اثر منفی افت قیمت جهانی را خنثی کرد و مانع از انتقال کامل این کاهش به قیمت ریالی بیت‌کوین شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۱.۰۴ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۱ هزار و ۶۰۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۲ مهر ۱۴۰۵)	۲۱,۴۳۱	۶۳۶	۲۶۱,۶۰۰
روز گذشته (۲۱ مهر ۱۴۰۵)	۲۱,۵۵۵	۶۴۹.۵	۲۵۸,۹۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۵۸	-۲.۰۸	+۱.۰۴

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی