تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۲۵ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۹

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۵ مهرماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت همزمان با کاهش خروج پول حقیقی و افت نرخ بهره بدون ریسک همراه شد. کاهش خروج پول حقیقی نشان‌دهنده تعدیل فشار فروش از سوی سرمایه‌گذاران حقیقی است. همچنین، کاهش نرخ بهره بدون ریسک، با توجه به رابطه معکوس نرخ بازده تا سررسید و قیمت اوراق بدهی، می‌تواند بیانگر افزایش قیمت اوراق و تقویت تقاضا در این بازار باشد. در مجموع، کاهش فشار خروج نقدینگی و افت نرخ بهره بدون ریسک حاکی از بهبود نسبی شرایط بازار اوراق بدهی است؛ هرچند کاهش ارزش معاملات نشان می‌دهد که این تغییرات لزوماً با افزایش تحرک فعالیت معاملاتی همراه نبوده است.

	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 (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۹.۷	۳۹.۸۵	-۰.۰۶	۷۸,۰۰۶
روز گذشته (۲۴ مهر ۱۴۰۵)	۱,۳۴۹.۱	۴۰.۱۴	-۰.۲۹	۳۱۳,۳۰۶
تغییرات (درصد)	+۰.۰۵	-۰.۲۹	+۷۸	-۷۵.۱

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

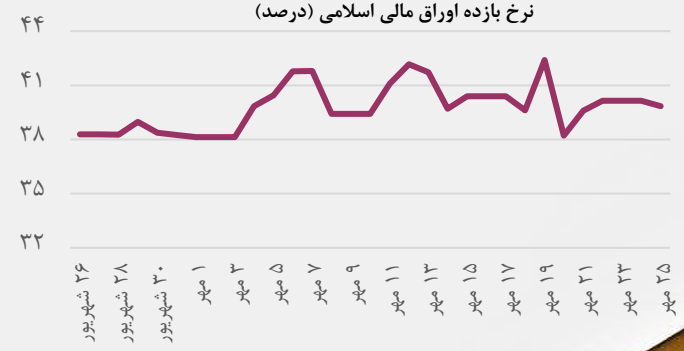
	فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
	شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
روز جاری (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۶۴,۹۰۳	۴۵.۵	۲۱۸,۶۴۴	۲,۱۹۲,۰۰۳	۱,۳۶۶,۳۸۷	۸,۲۶۵,۱۵۶
روز گذشته (۲۴ مهر ۱۴۰۵)	۶۶,۰۱۴	۸۳	۳۲۵,۱۲۳	۲,۲۲۵,۷۹۷	۱,۳۹۲,۹۳۳	۸,۴۲۵,۷۲۵
تغییرات (درصد)	-۱.۶۸	-۴۵.۱	-۳۳	-۱.۵۲	-۱.۹۱	-۱.۹۱

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲۵ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران با فشار فروش و افت هم‌زمان شاخص‌های اصلی مواجه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با کاهش ۱.۹۱ درصدی به ۸ میلیون و ۲۶۵ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با افت ۱.۵۱ درصدی به حدود ۲ میلیون و ۱۹۲ هزار واحد رسید. غلبه نمادهای منفی، افزایش صف‌های فروش و خروج پول حقیقی از بازار سهام، بیانگر تضعیف تقاضای مؤثر و افزایش احتیاط سرمایه‌گذاران بود. این افت می‌تواند تا حدی ناشی از ذخیره‌سازی سود و افزایش ریسک‌گریزی معامله‌گران باشد.

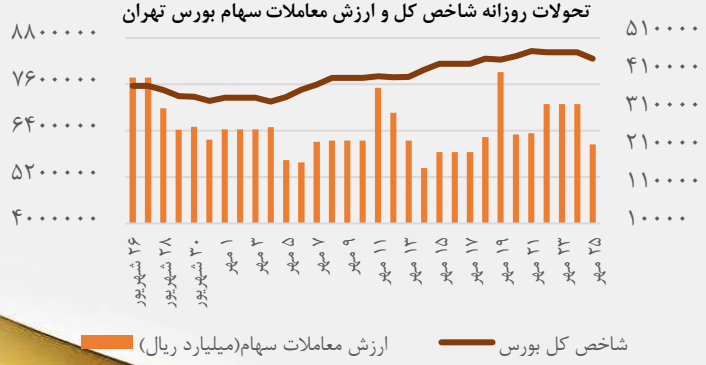
در مجموع، تداوم خروج نقدینگی و ضعف تقاضا می‌تواند اصلاح بازار را تشدید کند؛ ازاین‌رو، روند ورود پول حقیقی و ارزش معاملات در روزهای آتی برای ارزیابی پایداری این اصلاح اهمیت دارد.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

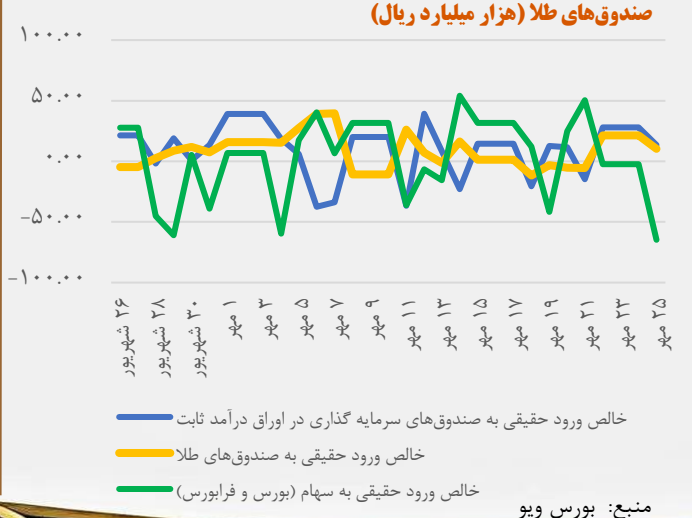


منبع: بورس ویو

تحولات روزانه شاخص کل و ارزش معاملات سهام بورس تهران



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 (۲۵ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۶۴.۷۲ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۱۰.۳۵ و ۱۳.۵۳ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های طلا و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته است.

منبع: بورس ویو

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 ۲۵ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۷۹

تحولات بازار ارز

تحولات نرخ‌های دلار

قیمت (تومان)	نرخ دلار برابر درهم	نرخ حواله درهم	نرخ دلار هرات	نرخ سامانه الکترونیک ارز (ETS)	نرخ حواله مرکز مبادله	نرخ دلار غیررسمی
روز جاری (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۵,۹۲۸	۷۲,۴۶۰	۲۶۰,۳۹۰	۲۵۹,۹۱۰	۱۸۱,۶۴۲	۲۶۳,۶۰۰
روز گذشته (۲۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۸۳۷	۷۲,۹۸۰	۲۶۲,۹۱۰	۲۵۶,۸۲۸	۱۸۱,۰۹۹	۲۶۵,۷۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۷۱	-۰.۷۱	-۰.۹۶	+۱.۲	+۰.۳۰	-۰.۷۹

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۷۹ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۳ هزار و ۶۰۰ 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 حدود ۲ هزار تومان نسبت به آخرین نرخ معاملاتی هفته قبل، به محدوده ۲۶۳ تا ۲۶۴ هزار تومان رسید. این افت در شرایطی رخ داد که ابهام در مذاکرات ایران و آمریکا با میانجی‌گری قطر و عمان و تداوم تنش‌های منطقه‌ای همچنان بر انتظارات معامله‌گران سایه انداخته بود. به نظر می‌رسد، احتیاط معامله‌گران و تعدیل تقاضای کوتاه‌مدت، در کاهش نرخ دلار مؤثر بوده باشد؛ بااین‌حال، انتشار خبر احتمال توقف صادرات ایران به پاکستان و نگرانی از اثر آن بر عرضه دلار، در کنار افزایش نرخ دلار حواله، مانع از شکل‌گیری چشم‌انداز کاهشی برای بازار دلار غیررسمی شد. در مجموع، کاهش قیمت دلار در این روز بیشتر نشان‌دهنده تعدیل کوتاه‌مدت نرخ در فضای انتظاری بازار بود و نه لزوماً کاهش پایدار ریسک‌های ارزی.

تحولات بازار سکه و طلا

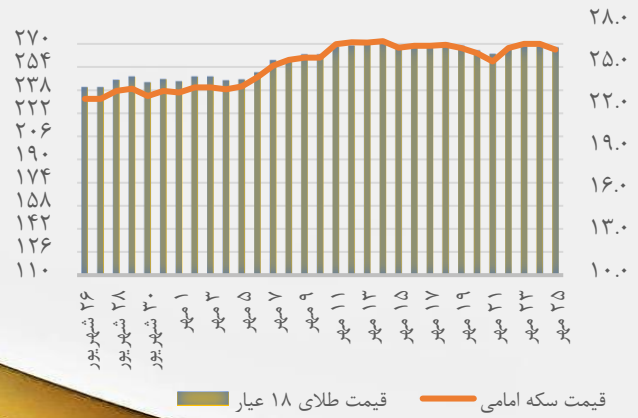
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۵۷	۴,۱۶۹	۰.۴۹۴	۳.۴۴۲	۲۶۴.۸۰	۲۶.۱۸	۲۶۵.۹۸
روز گذشته (۲۴ مهر ۱۴۰۵)	۵۷	۴,۱۶۹	۰.۵۰۶	۳.۵۱۸	۲۶۸.۴۷	۲۶.۲۶	۲۶۹.۹۲
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۲.۳۶	-۲.۱۵	-۱.۳۷	-۰.۲۸	-۱.۴۶

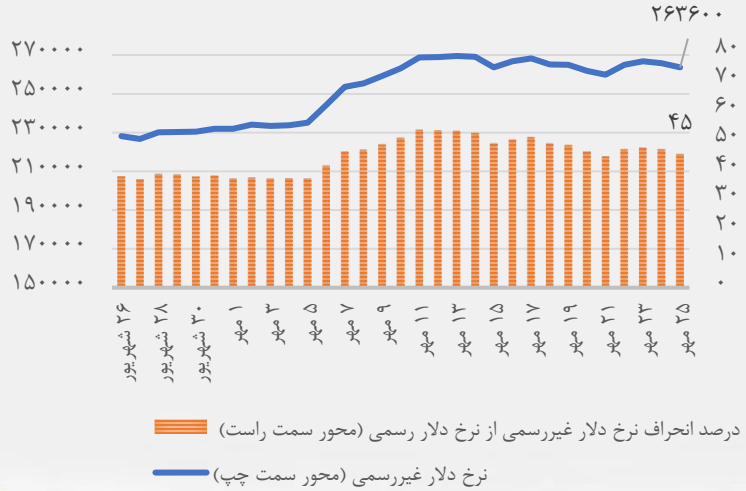
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۱.۴۶ و ۰.۲۸ درصد کاهش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. به نظر می‌رسد، کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی، نقش مهمی در کاهش دارایی‌های مذکور با وجود ثبات قیمت جهانی اونس طلا، داشته است.

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

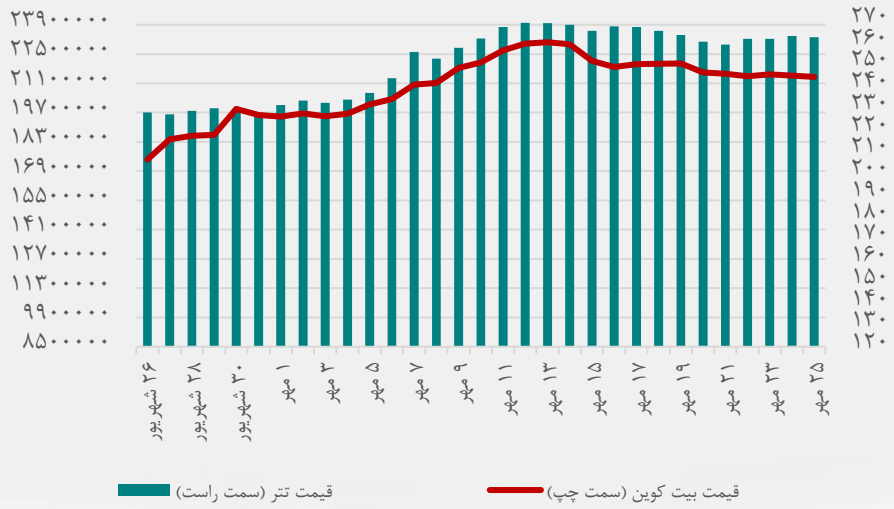
در روز جاری (۲۵ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۲۴ و افزایش ۰.۰۷ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی تحت تأثیر تداوم نگرانی‌های تورمی در آمریکا، ابهام در مسیر سیاست پولی فدرال رزرو و کاهش تمایل سرمایه‌گذاران به دارایی‌های پرریسک، با افت همراه شد و در محدوده ۸۱ تا ۸۲ هزار دلار نوسان کرد. همچنین، خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین و تضعیف بازار سهام فناوری آمریکا بر فشار فروش این رمزارز افزود. در مقابل، حمایت نسبی قیمت در محدوده ۸۰ هزار دلار مانع از تشدید افت شد. در مجموع، ترکیب نااطمینانی‌های اقتصاد کلان و کاهش جریان ورودی سرمایه به صندوق‌های سرمایه‌گذاری، بیانگر تداوم احتیاط معامله‌گران و محدود بودن زمینه شکل‌گیری روند صعودی پایدار در بازار بیت‌کوین طی این روز بود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۲۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۲ هزار و ۴۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۱,۴۰۹	۶۳۴.۶	۲۶۲,۴۰۰
روز گذشته (۲۴ مهر ۱۴۰۵)	۲۱,۴۶۱	۶۳۴.۲	۲۶۳,۰۰۰
تغییرات (درصد)	−۰.۲۴	+۰.۰۷	−۰.۲۳

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