تحولات بازارهای مالی در روز یکشنبه مورخ ۲۶ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۸۰

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۶ مهرماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت هم‌زمان با افت نرخ بهره بدون ریسک و کمتر شدن میزان خروج پول حقیقی، بیانگر تعدیل نسبی فشار فروش و تغییر وضعیت نقدینگی بازار بود. کاهش نرخ بهره بدون ریسک می‌تواند با افزایش قیمت اوراق در بازار ثانویه همراه باشد و از جذابیت نسبی بازدهی اوراق جدید بکاهد. در مجموع، کاهش هم‌زمان نرخ بهره و خروج پول حقیقی می‌تواند نشانه‌ای از بهبود نسبی شرایط بازار باشد، هرچند افت ارزش معاملات از کاهش تحرک 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)	
۱,۳۵۰.۸	۳۷.۹۹	-۰.۰۴	۷۲,۸۲۴	روز جاری (۲۶ مهر ۱۴۰۵)
۱,۳۴۹.۷	۳۹.۸۵	-۰.۰۶	۷۸,۰۰۶	روز گذشته (۲۵ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۰۸	-۱.۸۶	+۳۵.۵	-۶.۶	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	
۶۵,۰۴۵	۷۰.۹	۳۲۰,۲۹۸	۲,۱۸۹,۷۱۴	۱,۳۵۲,۳۷۹	۸,۱۸۰,۴۲۰	روز جاری (۲۶ مهر ۱۴۰۵)
۶۴,۹۰۳	۴۵.۵	۲۱۸,۶۴۴	۲,۱۹۲,۰۰۳	۱,۳۶۶,۳۸۷	۸,۲۶۵,۱۵۶	روز گذشته (۲۵ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۲۲	+۵۵.۶	+۴۶	-۰.۱۰	-۱.۰۳	-۱.۰۳	تغییرات (درصد)

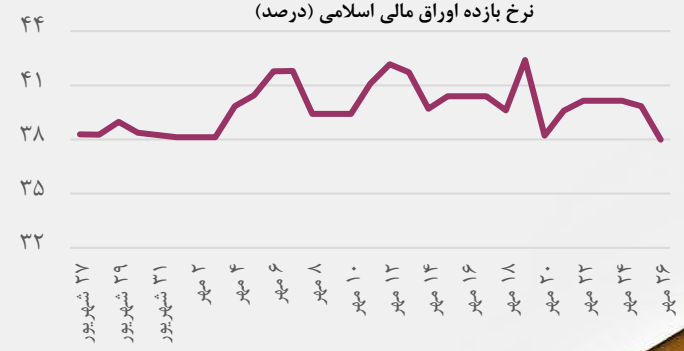
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲۶ مهر ۱۴۰۵)، بورس تهران با افت شاخص‌های اصلی همراه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با کاهش حدود ۱.۰۳ درصدی به محدوده ۸.۱۸ میلیون واحد رسید و شاخص هم‌وزن نیز کاهش یافت. افت بیشتر شاخص کل نشان می‌دهد، فشار فروش در نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز نقش پررنگ‌تری در تضعیف بازار داشته است.

از سوی دیگر، خروج پول حقیقی از بازار سهام، بیانگر تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران و غلبه تمایل به نقدشوندگی بود. هرچند در نیمه دوم معاملات از شدت صف‌های فروش کاسته شد و بخشی از نمادها به محدوده مثبت بازگشتند، لیکن این بهبود نتوانست افت شاخص کل را جبران کند.

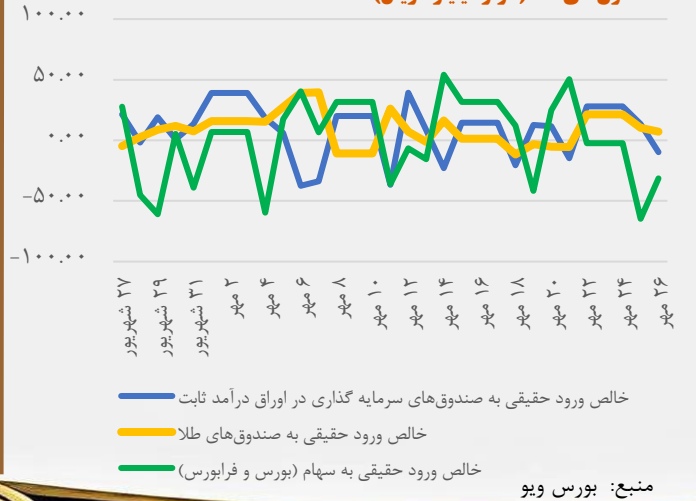
در مجموع، بازار با وجود تعدیل نسبی فشار عرضه، همچنان با ضعف جریان نقدینگی حقیقی مواجه بود و تداوم بهبود آن به کاهش فشار فروش و تقویت تقاضای پایدار وابسته است.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

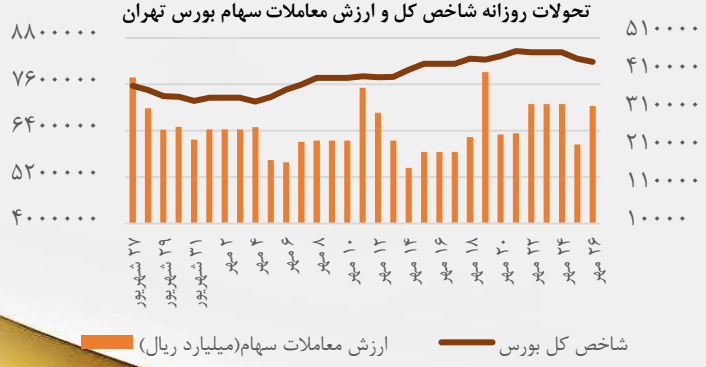
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



لازم به توجه است که در روز جاری (۲۶ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۱.۳۴ و ۹.۷۱ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۷.۱۰ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های طلا 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 یکشنبه مورخ ۲۶ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۸۰

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 (۲۶ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۴,۷۱۷	۷۲,۱۳۰	۲۵۹,۷۱۰	۲۵۹,۹۳۶	۱۸۲,۱۸۷	۲۶۲,۴۰۰
روز گذشته (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۵,۹۲۸	۷۲,۴۶۰	۲۶۰,۳۹۰	۲۵۹,۹۱۰	۱۸۱,۶۴۲	۲۶۳,۶۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۴۶	-۰.۴۶	-۰.۲۶	+۰.۰۱	+۰.۳۰	-۰.۴۶

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۶ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۴۶ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۲ هزار و ۴۰۰ 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 ۱۲۰۰ تومانی قیمت همراه شد. این روند در شرایطی شکل گرفت که ابهام در مذاکرات ایران و آمریکا و تداوم تنش‌های منطقه‌ای همچنان بر انتظارات معامله‌گران سایه انداخته بود. در مجموع، کاهش تقاضای احتیاطی و تعدیل انتظارات کوتاه‌مدت را می‌توان از عوامل احتمالی افت دلار ارزیابی کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

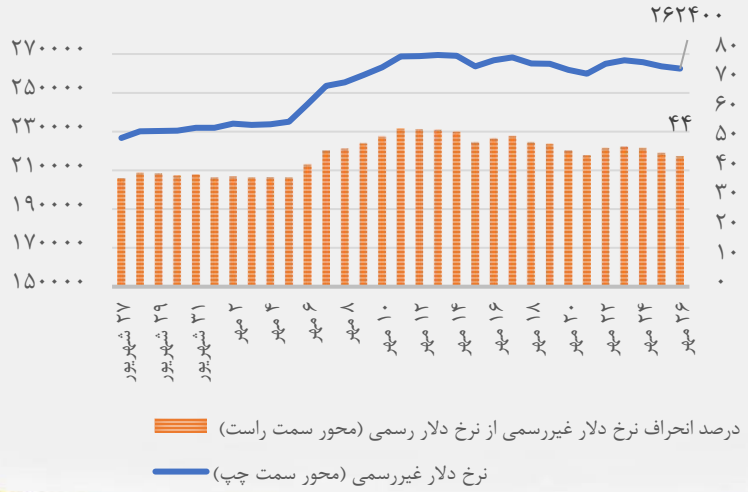
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۲۶ مهر ۱۴۰۵)	۵۷	۴,۱۶۹	۰.۴۸۴	۳.۴۳۲	۲۶۱.۴۲	۲۵.۹۴	۲۶۴.۱۹
روز گذشته (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۵۷	۴,۱۶۹	۰.۴۹۴	۳.۴۴۲	۲۶۴.۸۰	۲۶.۱۸	۲۶۵.۹۸
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۲.۱۲	-۰.۲۹	-۱.۲۸	-۰.۹۴	-۰.۶۷

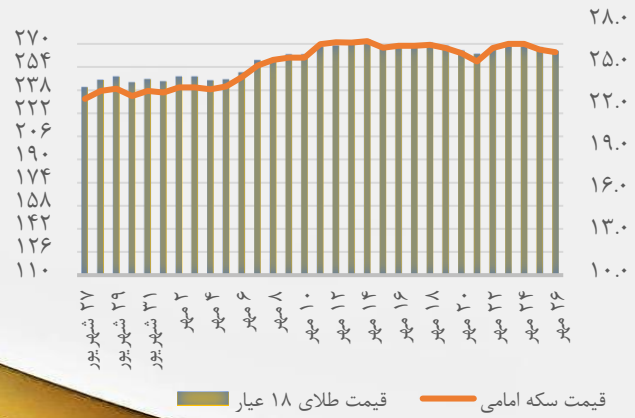
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲۶ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۶۷ و ۰.۹۴ 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 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

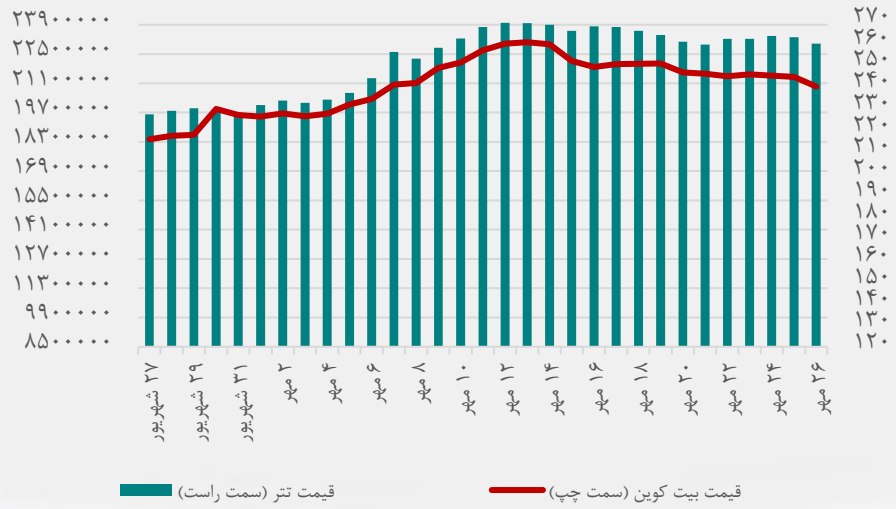
در روز جاری (۲۶ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۲.۱۶ و ۴.۳۱ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس داده‌های Investing، با افزایش حدود ۰.۷۸ درصدی، در سطح ۸۲ هزار دلار بسته شد. با این حال، تداوم نگرانی‌ها درباره تقاضای نهادی و خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین، همچنان از عوامل محدودکننده رشد پایدار قیمت بود. از سوی دیگر، قیمت ریالی بیت کوین در بازار داخلی برخلاف روند جهانی، کاهش یافت. کاهش نرخ تتر در کنار ذخیره‌سازی سود در بازار داخلی، اثر رشد قیمت جهانی بیت‌کوین را خنثی کرد و موجب افت قیمت ریالی این رمزارز شد. در مجموع، واگرایی میان بازدهی دلاری و ریالی بیت‌کوین در این روز نشان می‌دهد که تغییرات نرخ تتر و افزایش فشار فروش در بازار داخلی، نقش تعیین‌کننده‌ای در عملکرد ریالی این دارایی داشته است.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۱۴ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۵۹ هزار و ۴۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۲۶ مهر ۱۴۰۵)	۲۵۹,۴۰۰	۶۰۷.۳	۲۰,۹۴۷
روز گذشته (۲۵ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۲,۴۰۰	۶۳۴.۶	۲۱,۴۰۹
تغییرات (درصد)	-۱.۱۴	-۴.۳۱	-۲.۱۶

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