تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۲۹ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۸۳

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۹ مهرماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت در کنار تشدید خروج پول حقیقی و افزایش نرخ بهره بدون ریسک، بیانگر تضعیف تقاضا در بازار اوراق بدهی بود. افزایش نرخ بهره بدون ریسک می‌تواند با افزایش بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران، جذابیت نگهداری اوراق را در سطوح قیمتی پایین‌تر تقویت کند. بااین‌حال، تشدید خروج نقدینگی نشان می‌دهد که در آن روز فشار عرضه بر تقاضای خرید غلبه داشته است. در مجموع، این تحولات از افزایش بازده مورد مطالبه سرمایه‌گذاران و تداوم احتیاط در بازار اوراق بدهی 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)	
۱,۳۵۲.۶	۴۲.۰۸	-۰.۲۲۵	۲۱,۰۰۱	روز جاری (۲۹ مهر ۱۴۰۵)
۱,۳۵۲.۶	۴۱.۹۶	-۰.۰۰۴	۱۸۸,۶۴۲	روز گذشته (۲۸ مهر ۱۴۰۵)
۰.۰	+۰.۱۲	-۶۲۰۲.۹	-۸۸.۹	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

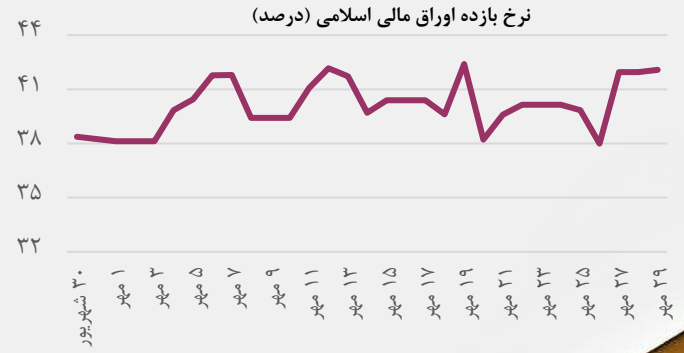
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۶۷,۴۴۴	۶۷.۰۹	۲۵۸,۵۰۰	۲,۲۵۵,۶۵۴	۱,۳۵۱,۲۳۴	۸,۱۷۳,۷۶۷	روز جاری (۲۹ مهر ۱۴۰۵)
۶۷,۱۹۰	۵۲.۲	۲۳۸,۹۱۱	۲,۲۵۱,۳۴۷	۱,۳۶۷,۵۶۴	۸,۲۷۲,۴۴۴	روز گذشته (۲۸ مهر ۱۴۰۵)
+۰.۳۸	+۲۸.۵	+۸	+۰.۱۹	-۱.۱۹	-۱.۱۹	تغییرات (درصد)

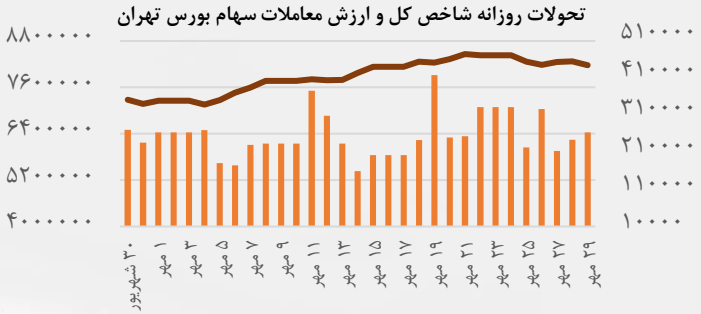
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در معاملات روز جاری بورس تهران (۲۹ مهر ۱۴۰۵)، شاخص کل با افت حدود ۱.۱۹ درصدی به محدوده ۸.۱۷ میلیون واحد رسید. درحالی‌که شاخص هم‌وزن حدود ۰.۱۹ درصد افزایش یافت. این واگرایی بیانگر تمرکز فشار فروش بر سهام شرکت‌های بزرگ و شاخص‌ساز و عملکرد نسبتاً بهتر بخش دیگری از بازار بود. بااین‌حال، خروج پول حقیقی از بازار سهام، از تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران و ضعف جریان نقدینگی حکایت داشت.

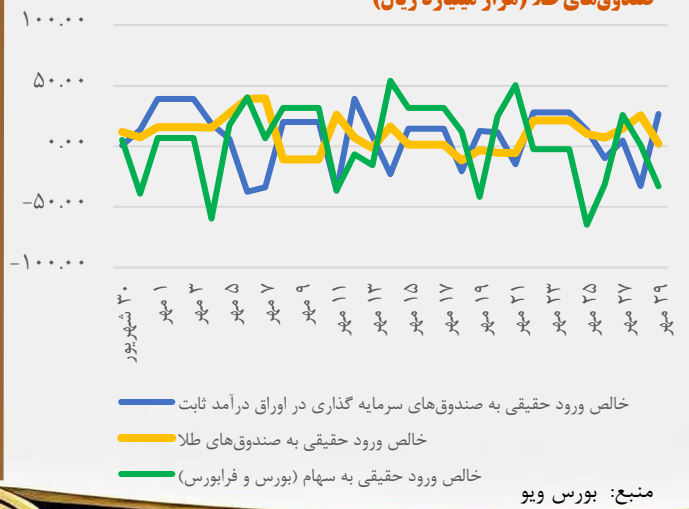
به نظر می‌رسد، شناسایی و ذخیره سود پس از رشدهای قبلی قیمت سهام می‌تواند از عوامل افزایش عرضه در معاملات روز ۲۹ مهر باشد. موضوعی که در کنار تشدید ابهامات سیاسی و خروج پول حقیقی، فشار فروش در نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز را افزایش داده است.



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 (۲۹ مهرماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۲.۸۹ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۶.۵۹ و ۲ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا صورت گرفته است.

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 ۲۹ مهر ۱۴۰۵ – شماره ۸۳

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 (۲۹ مهر ۱۴۰۵)	۲۷۳,۵۹۹	۷۴,۵۵۰	۲۶۹,۹۱۰	۲۵۸,۱۰۹	۱۸۳,۸۳۱	۲۷۱,۰۰۰
روز گذشته (۲۸ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۷,۱۳۹	۷۲,۷۹۰	۲۶۳,۲۹۰	۲۵۸,۰۱۶	۱۸۳,۲۸۲	۲۶۴,۹۰۰
تغییرات (درصد)	+۲.۴۲	+۲.۴۲	+۲.۵۱	+۰.۰۴	+۰.۳۰	+۲.۳۰

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۹ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۳ درصدی همراه شد و در سطح ۲۷۱ 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 روندی افزایشی داشت و در جریان معاملات از محدوده ۲۷۱ هزار تومان عبور کرد. تشدید نااطمینانی‌های سیاسی، تداوم تحریم‌ها و افزایش تقاضای احتیاطی از عوامل مؤثر بر رشد قیمت دلار غیررسمی بودند. در این شرایط، تداوم عرضه دلار از سوی بانک مرکزی و مداخلات بازارساز نیز نتوانست بر روند افزایشی آن تاثیر بگذارد. از نظر تحولات سیاسی، گزارش‌های منتشرشده در روز جاری، به بسته‌شدن مرزهای عراق، تشدید فشارهای اقتصادی آمریکا و ابهام در مسیر میانجی‌گری‌های دیپلماتیک اشاره داشتند. این اخبار با افزایش ریسک ادراک‌شده و تقویت تقاضای احتیاطی دلار سازگار بود؛ به‌ویژه آنکه نبود سیگنال مثبت و قطعی از مذاکرات، زمینه کاهش انتظارات خوش‌بینانه را فراهم می‌کرد.

تحولات بازار سکه و طلا

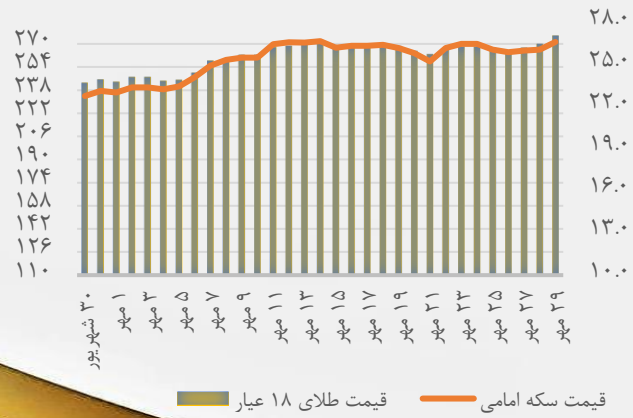
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۲۹ مهر ۱۴۰۵)	۵۷.۸۶	۴,۱۳۳.۵	۰.۴۹۵۶	۳.۵۲۰	۲۶۶.۱۹	۲۷.۰۶	۲۷۱.۴۳
روز گذشته (۲۸ مهر ۱۴۰۵)	۵۷.۷۹	۴,۱۲۱.۲	۰.۴۸۶۳	۳.۴۸۳	۲۶۵.۰۱	۲۶.۴۵	۲۶۶.۱۳
تغییرات (درصد)	+۰.۱۲	+۰.۳۰	+۱.۹۰	+۱.۰۹	+۰.۴۵	+۲.۲۹	+۱.۹۹

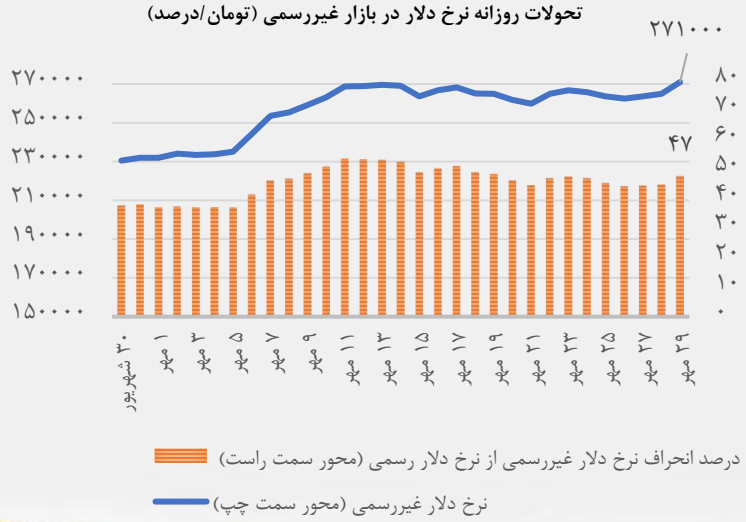
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲۹ مهرماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۱.۹۹ و ۲.۲۹ درصد افزایش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. به نظر می‌رسد، افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی، در کنار افزایش قیمت جهانی اونس طلا، نقش مهمی در افزایش قیمت دارایی‌های مذکور داشته‌اند.

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

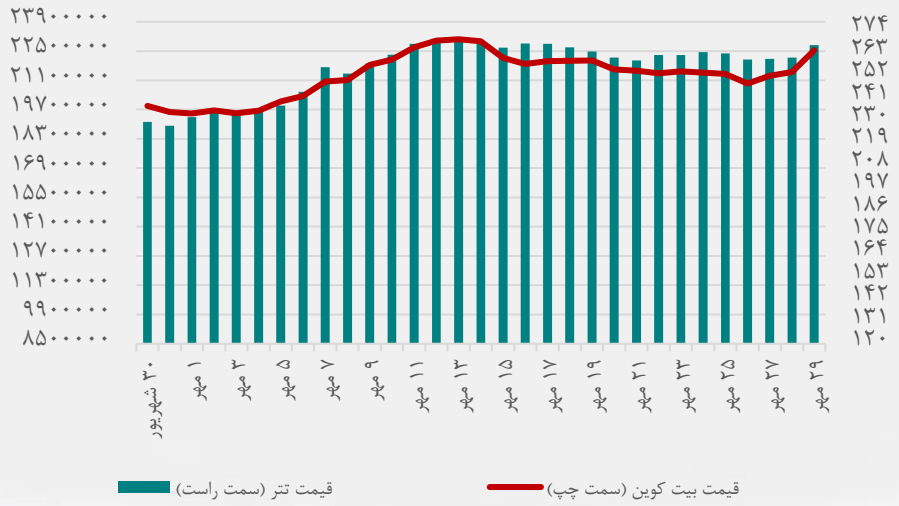
در روز جاری (۲۹ مهرماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۱ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۴.۸ و ۴.۷۲ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی با رشد همراه شد و براساس داده‌های تاریخی Investing، با رشد حدود ۱.۳۴ درصدی به حدود ۸۴ هزار دلار رسید. این صعود در پی بهبود نسبی تمایل سرمایه‌گذاران به دارایی‌های پرریسک، هم‌زمان با رشد سهام فناوری آمریکا و انتشار گزارش‌های مثبت درآمدی شرکت‌ها شکل گرفت. همچنین، افزایش ورود سرمایه به صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در آمریکا، از عوامل حمایتی بازار بود. بااین‌حال، تداوم قیمت بالای نفت در پی تنش‌های ژئوپلیتیکی خاورمیانه و روسیه و اوکراین، در کنار افزایش بازده اوراق خزانه‌داری آمریکا و نگرانی‌های مرتبط با سرمایه‌گذاری در حوزه هوش مصنوعی، مانع از تقویت بیشتر روند صعودی شد. در بازار داخلی، قیمت ریالی بیت کوین نسبت به قیمت جهانی آن بیشتر افزایش یافت. زیرا هم‌زمان، قیمت تتر نیز در بازار داخلی با افزایش همراه شد. در واقع، رشد هم‌زمان قیمت جهانی بیت‌کوین و نرخ تتر، هر دو در افزایش ارزش ریالی این رمزارز نقش داشتند.

.شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۲.۳۸ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۶ هزار و ۵۰۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۲۹ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۶,۵۰۰	۶۶۴.۵	۲۲,۵۳۳
روز گذشته (۲۸ مهر ۱۴۰۵)	۲۶۰,۳۰۰	۶۳۴.۵	۲۱,۵۰۱
تغییرات (درصد)	+۲.۳۸	+۴.۷۲	+۴.۸۰

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