تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۲۳ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۹

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت با کاهش همراه شد، درحالی‌که خالص ورود پول حقیقی به این بازار افزایش یافت. بااین‌حال، افزایش نرخ بازدهی بدون ریسک نشان‌دهنده کاهش قیمت اوراق و تداوم فشار بر بازار بدهی است. به نظر می‌رسد، با وجود افزایش ورود پول حقیقی به بازار اوراق درآمد ثابت، افزایش نرخ بازدهی بدون ریسک حاکی از آن است که تقاضای ایجادشده در این بازار نتوانسته است مانع از افزایش نرخ بازدهی اوراق شود.

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 (۲۳ آبان ۱۴۰۵)	۱۳۷۶.۳	۳۹.۵	۰.۱۵	۷۰.۳۸۸
روز گذشته (۲۰ آبان ۱۴۰۵)	۱۳۷۶.۳	۳۸.۸	۰.۰۰۵	۱۱۵.۷۸۰
تغییرات (درصد)	۰.۰	+۰.۶۹	+۳۰۹۷.۲	-۳۹.۲

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

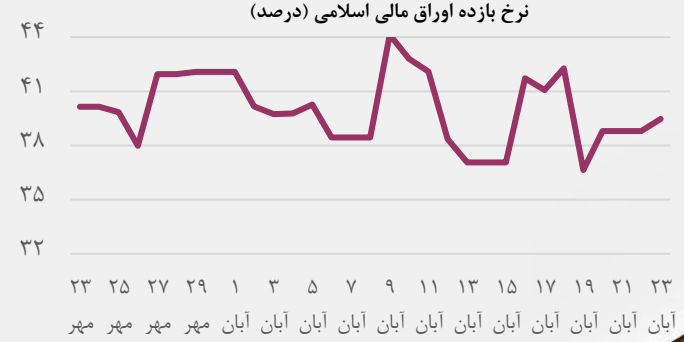
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۷۰,۳۰۳	۶۵.۴	۲۸۱,۳۷۷	۲,۳۵۲,۸۸۹	۱,۳۷۸,۹۶۲	۸,۳۵۴,۰۰۷	روز جاری (۲۳ آبان ۱۴۰۵)
۷۰,۸۳۴	۶۰.۴	۲۶۳,۳۴۳	۲,۳۵۶,۴۳۳	۱,۳۹۱,۰۸۹	۸,۴۲۷,۳۰۴	روز گذشته (۲۰ آبان ۱۴۰۵)
-۰.۷۵	+۸.۳	+۷	-۰.۱۵	-۰.۸۷	-۰.۸۷	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲۳ آبان ۱۴۰۵)، شاخص کل بورس تهران با افت ۰.۸۷ درصدی به سطح ۸ میلیون و ۳۵۴ هزار واحد رسید و شاخص کل هم‌وزن نیز کاهش ۰.۱۵ درصدی را تجربه کرد. افت بیشتر شاخص کل نسبت به شاخص هم‌وزن نشان‌دهنده اثرگذاری بیشتر فشار فروش در نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بود. در این میان، نمادهای «فملی» و «فارس» بیشترین تأثیر منفی را بر شاخص کل داشتند. همچنین، خروج پول حقیقی از بازار سهام، بیانگر تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران و ضعف تقاضای مؤثر در بازار بود.

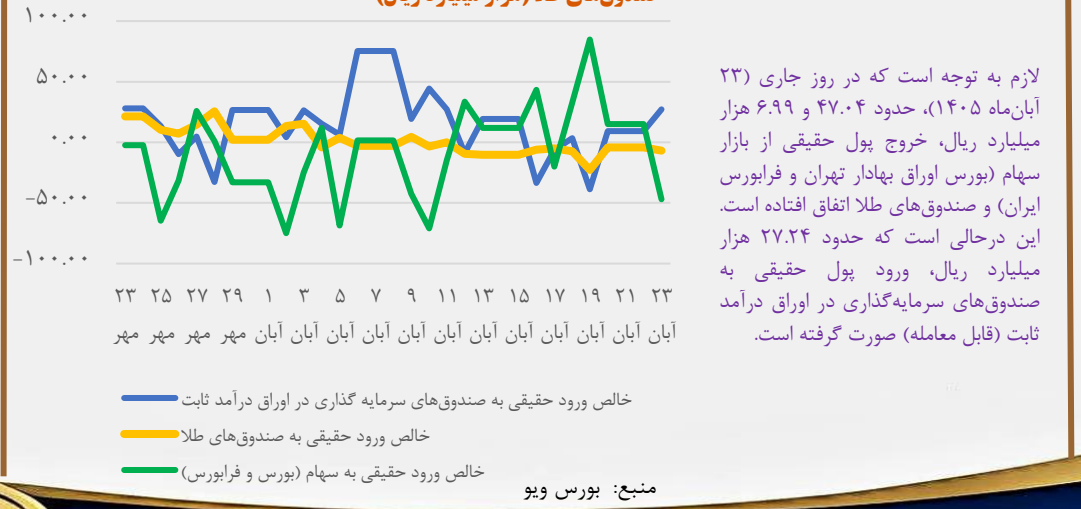
در مجموع، معاملات روز جاری تحت تأثیر فشار فروش در نمادهای بزرگ و خروج نقدینگی حقیقی، با افت شاخص‌های اصلی به پایان رسید.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

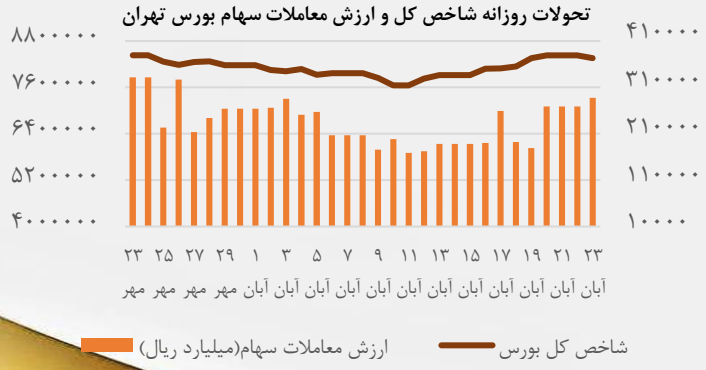
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۲۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۴۷.۰۴ و ۶.۹۹ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۷.۲۴ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته 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 شنبه مورخ ۲۳ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۹

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 (۲۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۱,۱۷۶	۷۳,۸۹۰	۲۶۵,۳۹۰	۲۶۳,۲۸۶	۱۹۱,۷۰۸	۲۶۸,۸۰۰
روز گذشته (۲۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۴,۱۸۶	۷۴,۷۱۰	۲۶۶,۹۹۰	۲۵۸,۲۰۰	۱۹۱,۳۲۶	۲۷۱,۸۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۱۰	-۱.۱۰	-۰.۶۰	+۱.۹۷	+۰.۲۰	-۱.۱۰

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۱ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۸ هزار و ۸۰۰ تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری نیز با افزایش ۰.۲ درصدی مواجه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی با روندی نزولی همراه شد. بررسی روند معاملات نشان می‌دهد، اگرچه افزایش تقاضا در ساعات ابتدایی، نرخ دلار را تا محدوده ۲۷۴ هزار تومان بالا برد، اما در ادامه با تضعیف تقاضای خرید و افزایش فشار عرضه، بخشی از رشد قیمت تخلیه شد. در واقع، عقب‌نشینی دلار از سقف روزانه را می‌توان به افزایش عرضه در سطوح قیمتی بالاتر و شناسایی سود توسط معامله‌گران نسبت داد. از سوی دیگر، تداوم ابهامات سیاسی پیرامون روابط ایران و آمریکا و نگرانی‌های مرتبط با محدودیت‌های تجاری، همچنان از عوامل تقویت‌کننده انتظارات احتیاطی در بازار ارز محسوب می‌شدند. در مجموع، کاهش قیمت دلار در این روز بیشتر بازتاب تعدیل نوسانات افزایشی و غلبه موقت عرضه بر تقاضا بود و به‌تنهایی نمی‌توان آن را نشانه تغییر روند بازار دلار غیررسمی دانست.

تحولات بازار سکه و طلا

تحولات بازار سکه، طلا و نقره

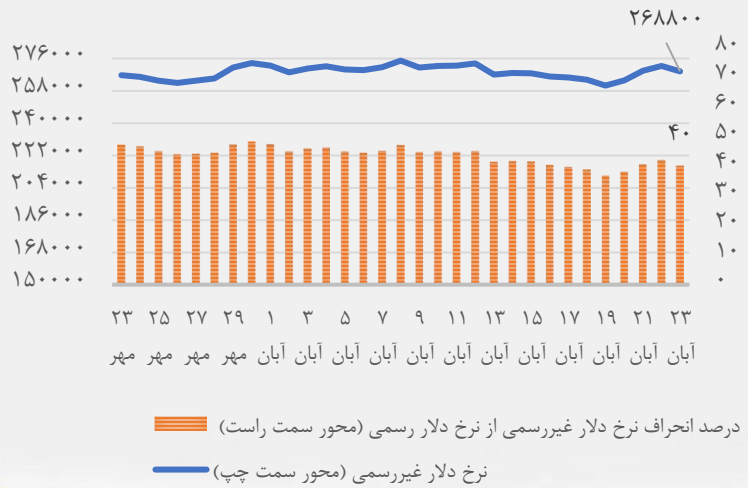
قیمت (میلیون تومان/ دلار)	اونس نقره (دلار)	اونس طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۲۳ آبان ۱۴۰۵)	۴۸.۹	۳۸۷۸.۳	۰.۴۳۲۵	۳.۲۹۴	۲۵۱.۷	۲۴.۸	۲۵۲.۵
روز گذشته (۲۲ آبان ۱۴۰۵)	۴۸.۹	۳۸۷۸.۳	۰.۴۴۴۷	۳.۳۰۴	۲۵۳	۲۵	۲۵۴
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۲.۷۶	-۰.۲۹	-۰.۵۲	-۰.۹۸	-۰.۵۷

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

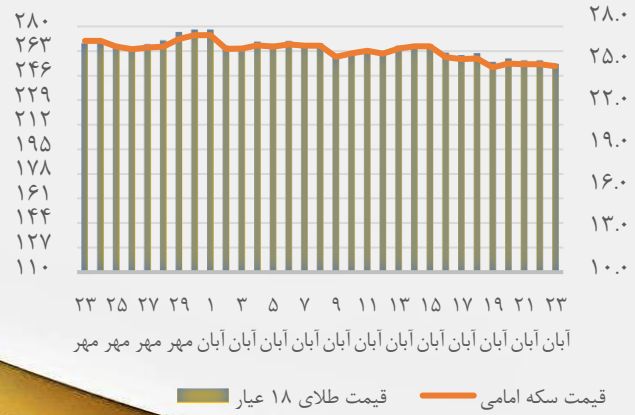
در روز جاری (۲۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۵۷ و ۰.۹۸ درصد کاهش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

از منظر عوامل اثرگذار، کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی، با وجود ثبات قیمت جهانی اونس طلا، از نقش مهمی در کاهش قیمت دارایی‌های مذکور برخوردار بوده 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

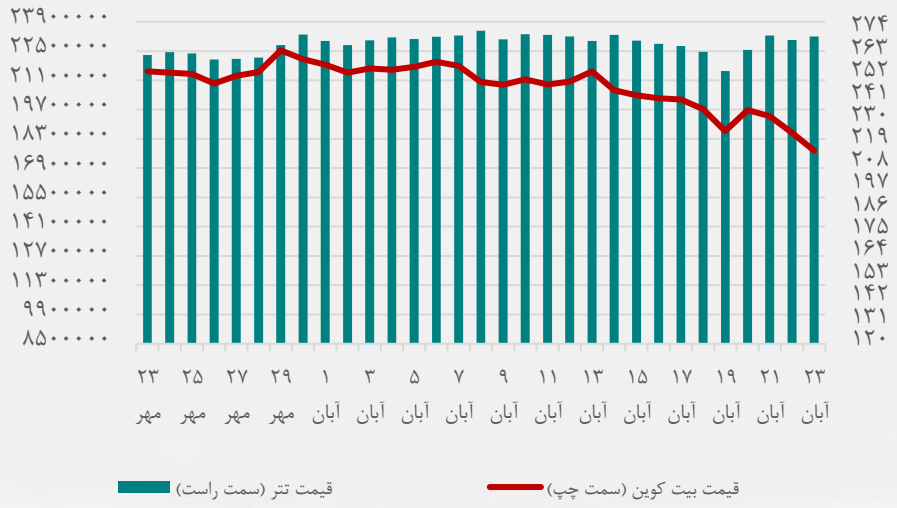
در روز جاری (۲۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۱۴ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۴.۶ و ۶.۰۴ درصدی همراه شدند. در این روز، بازار جهانی بیت‌کوین تحت تأثیر تشدید نگرانی‌ها از چشم‌انداز سیاست پولی آمریکا و تداوم خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بورسی در آمریکا با فشار فروش مواجه شد. از سوی دیگر، موج گسترده لیکوییدشدن موقعیت‌های خرید اهرمی در بازار مشتقات، فشار فروش را تشدید کرد. هرچند انتشار آمار تورم تولیدکننده آمریکا در روز قبل، پایین‌تر از انتظارات بازار بود، اما افزایش بازدهی اوراق خزانه‌داری آمریکا و تقویت انتظارات نسبت به افزایش نرخ بهره فدرال رزرو، مانع از تداوم اثر مثبت این داده بر بازار رمزارزها شد. داده‌های منتشرشده سایت Investing نیز نشان می‌دهد، قیمت جهانی بیت‌کوین در معاملات این روز با کاهش ۵.۶ درصدی تا محدوده ۶۴.۵ هزار دلار عقب‌نشینی کرد و به پایین‌ترین سطح خود از ماه اوت رسید. در بازار داخلی نیز، قیمت ریالی بیت کوین کاهش یافت اما مقدار کاهش آن تخت تاثیر افزایش نرخ تتر، کمتر از افت قیمت جهانی این رمز ارز بود.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۳ آبان ۱۴۰۵)	۱۷,۷۲۸	۴۹۴	۲۷۰,۷۰۰
روز گذشته (۲۲ آبان ۱۴۰۵)	۱۸,۵۸۳	۵۲۵.۷	۲۶۹,۰۰۰
تغییرات (درصد)	-۴.۶۰	-۶.۰۴	+۰.۶۳

منبع: نوسان پلاس

شایان توجه است که قیمت تتر در معاملات روز ۲۳ آبان نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۶۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۷۰ هزار و ۷۰۰ تومان رسید. در روز جاری، قیمت تتر با وجود کاهش نرخ دلار در بازار غیررسمی، افزایش یافت. این واگرایی را می‌توان عمدتاً ناشی از افزایش تقاضای احتیاطی برای تتر در پی تشدید ریزش بازار جهانی رمزارزها دانست. به‌طوری‌که با افت قیمت بیت‌کوین و سایر دارایی‌های پرریسک، بخشی از معامله‌گران با تبدیل دارایی‌های خود به تتر، درصدد حفظ ارزش سرمایه و کاهش ریسک معاملاتی برآمدند. برطبق اخبار منتشرشده، افزایش سهم ارزش بازار تتر نیز در بازار جهانی مؤید چرخش نقدینگی به سمت استیبل‌کوین‌ها بود. در نتیجه، تقویت تقاضا در بازار داخلی تتر، با وجود کاهش نرخ دلار، زمینه افزایش قیمت تومانی آن را فراهم کرد.

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