تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۲۰ آبان ۱۴۰۵ - شماره ۹۸

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲۰ آبان‌ماه ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با کاهش ارزش معاملات و در عین حال ورود پول حقیقی همراه شد. همزمان، نرخ بازدهی بدون ریسک نیز افزایش یافت که بیانگر افزایش بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران در بازار اوراق بدهی است. به نظر می‌رسد افزایش نرخ بازدهی، با تقویت جذابیت سرمایه‌گذاری در این اوراق، زمینه ورود نقدینگی حقیقی را فراهم کرده باشد؛ هرچند کاهش ارزش معاملات نشان می‌دهد تحرک معاملاتی بازار نسبت به روز قبل محدودتر بوده است. در مجموع، افزایش نرخ بازدهی در کنار ورود پول حقیقی، از تداوم تقاضا برای اوراق بدهی در سطوح بازدهی بالاتر 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)
روز جاری (۲۰ آبان ۱۴۰۵)	۱۳۷۵.۱	۳۸.۸	۰.۰۱	۱۱۵,۷۸۰
روز گذشته (۱۹ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۷۵.۱	۳۶.۶	-۰.۳۶	۲۴۵,۹۵۰
تغییرات (درصد)	۰.۰	+۲.۱۵	+۱۰۲.۷	-۵۲.۹

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
۷۰,۸۳۴	۶۰.۴	۲۶۳,۳۴۳	۲,۳۵۶,۴۳۳	۱,۳۹۱,۰۸۹	۸,۴۲۷,۳۰۴
۷۰,۴۵۹	۳۸.۶	۱۷۵,۹۱۴	۲,۳۳۸,۱۴۷	۱,۳۷۹,۶۲۳	۸,۳۵۷,۸۴۰
+۰.۵۳	+۵۶.۶	+۵۰	+۰.۷۸	+۰.۸۳	+۰.۸۳

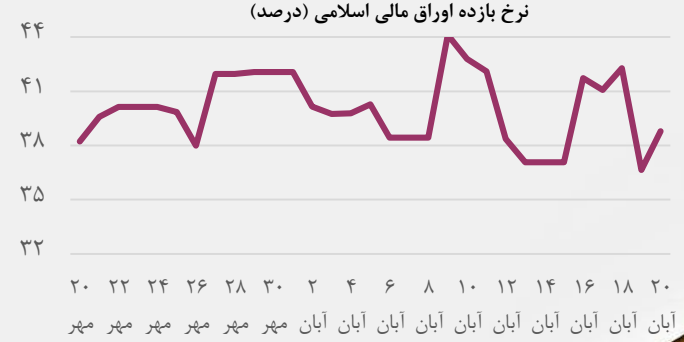
روز جاری (۲۰ آبان ۱۴۰۵)
روز گذشته (۱۹ آبان ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲۰ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران با رشد شاخص‌های اصلی همراه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با افزایش ۰.۸۳ درصدی به سطح ۸ میلیون و ۴۲۷ هزار واحد و شاخص کل هم‌وزن با رشد ۰.۷۸ درصدی به محدوده ۲ میلیون و ۳۵۶ هزار واحد رسید. رشد هم‌زمان شاخص‌ها و برتری تعداد نمادهای مثبت نسبت به منفی، بیانگر گسترش نسبی تقاضا در بازار بود. با این حال، نزدیک شدن شاخص کل به محدوده مقاومت تاریخی ۸ میلیون و ۴۶۰ هزار واحد، با افزایش عرضه و تمایل بخشی از سرمایه‌گذاران به شناسایی سود همراه شد و مانع از تداوم شتاب صعودی بازار گردید.

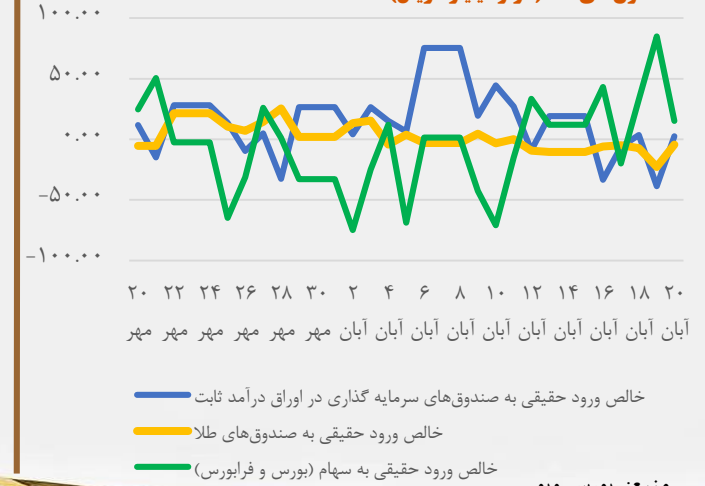
در مجموع، با وجود افزایش ارزش معاملات و حفظ جریان ورود پول حقیقی، تشدید عرضه در سطوح قیمتی بالاتر نشان‌دهنده تداوم احتیاط معامله‌گران و اهمیت توان بازار در جذب عرضه‌ها برای استمرار روند صعودی بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

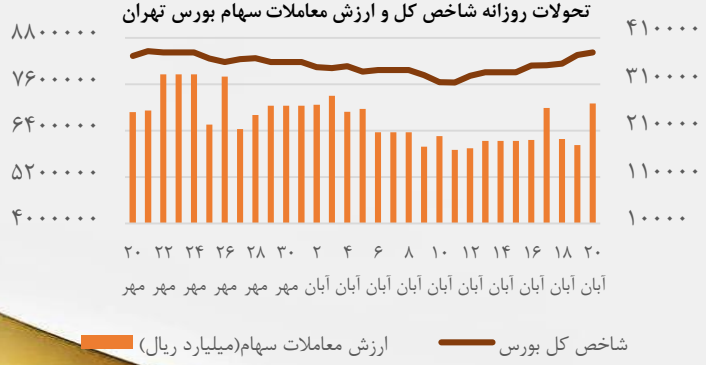
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۲۰ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۵.۱۹ و ۲.۶۱ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۴.۳۴ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا اتفاق افتاده 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 چهارشنبه مورخ ۲۰ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۸

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 (۲۰ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۶,۵۱۵	۷۲,۶۲۰	۲۶۰,۸۹۰	۲۶۲,۲۲۷	۱۹۰,۹۴۴	۲۶۳,۸۰۰
روز گذشته (۱۹ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۳,۲۱۲	۷۱,۷۲۰	۲۵۷,۱۹۰	۲۶۴,۷۸۲	۱۹۰,۵۶۳	۲۶۰,۹۰۰
تغییرات (درصد)	+۱.۲۵	+۱.۲۵	+۱.۴۴	-۰.۹۶	+۰.۲۰	+۱.۱۱

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲۰ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۱.۱۱ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۳ 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 نوسانات رفت‌وبرگشتی همراه بود. به‌طوری‌که پس از کاهش در ابتدای معاملات، بخشی از افت قیمت جبران شد و در نهایت با افزایش نسبت به روز قبل، به حدود ۲۶۴ هزار تومان رسید. در این روز، انتشار اخبار مربوط به افزایش فشارهای داخلی در آمریکا برای محدود کردن دامنه درگیری‌های نظامی و کاهش هزینه‌های ناشی از آن، زمینه تقویت انتظارات کاهشی در بازار دلار را فراهم کرد. همچنین، بازگشایی گذرگاه مرزی چذابه (الشیب در عراق) پس از حدود سه هفته توقف و ازسرگیری تردد کالا و مبادلات تجاری با عراق، با کاهش نگرانی‌ها نسبت به اختلال در مسیرهای تجارت خارجی و تقویت انتظارات درباره تداوم صادرات غیرنفتی همراه شد. این موضوع می‌تواند در صورت استمرار مبادلات و بازگشت ارز حاصل از صادرات، در میان‌مدت به بهبود عرضه دلار کمک کند. با این حال، تداوم ابهامات سیاسی و نبود چشم‌انداز روشن از کاهش تنش‌ها مانع از تثبیت انتظارات کاهشی شد و بخشی از تقاضا مجدداً به بازار بازگشت. در مجموع، با وجود انتشار اخبار کاهنده از جمله افزایش فشارهای داخلی آمریکا و ازسرگیری فعالیت تجاری گذرگاه چذابه، تداوم ریسک‌های سیاسی و انتظارات تورمی مانع از شکل‌گیری روند نزولی پایدار قیمت دلار شد.

تحولات بازار سکه و طلا

تحولات بازار سکه، طلا و نقره

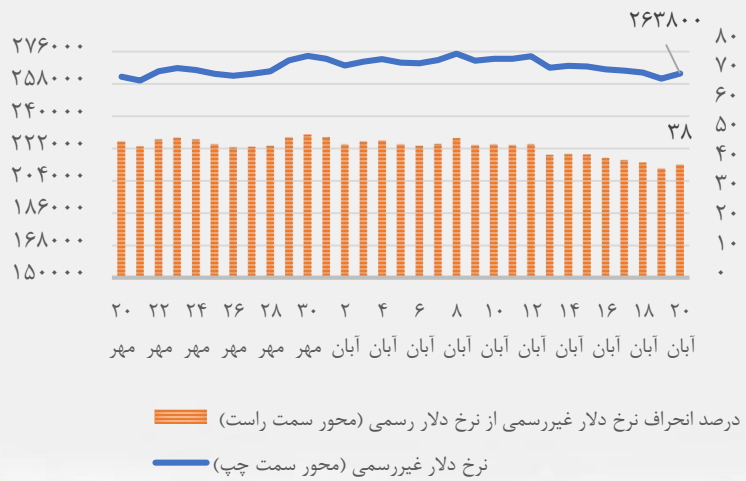
	قیمت (میلیون تومان / دلار)						
	اونس نقره (دلار)	اونس طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۲۰ آبان ۱۴۰۵)	۵۱.۸	۳۹۸۶	۰.۴۴۲۰	۳.۳۰۲	۲۵۲.۲	۲۵.۲	۲۵۴.۴
روز گذشته (۱۹ آبان ۱۴۰۵)	۵۱.۶	۴۰۳۵.۵	۰.۴۳۹۶	۳.۲۸۷	۲۵۱	۲۴.۹	۲۵۱.۷
تغییرات (درصد)	+۰.۴۵	-۱.۲۳	+۰.۵۷	+۰.۴۵	+۰.۴۷	+۰.۹۹	+۱.۰۷

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

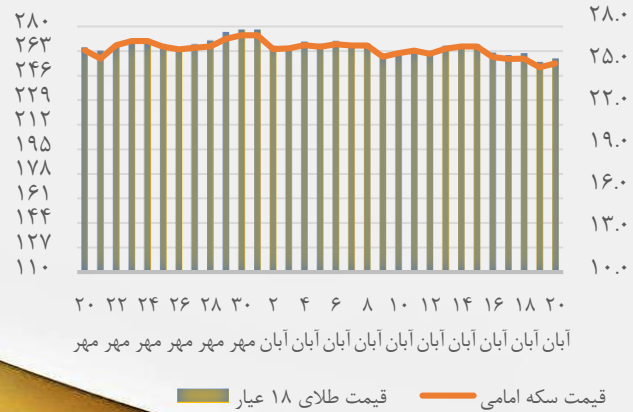
در روز جاری (۲۰ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۱.۰۷ و ۰.۹۹ درصد افزایش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

به نظر می‌رسد، با وجود کاهش قیمت جهانی اونس طلا در پی انتشار آمار تورم بالاتر از انتظار آمریکا و تقویت انتظارات نسبت به تداوم سیاست پولی انقباضی فدرال رزرو، قیمت طلا و سکه در بازار داخلی افزایش یافت. در این میان، رشد نرخ دلار در بازار غیررسمی، بخشی از اثر کاهشی افت قیمت جهانی اونس را خنثی کرد. با این حال، از آنجا که میزان افزایش دلار کمتر از درصد کاهش قیمت اونس جهانی بود، رشد قیمت دارایی‌های داخلی را می‌توان علاوه بر تغییرات نرخ دلار، متأثر از افزایش تقاضا و تعدیل حباب قیمتی در بازار داخلی دانست.

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

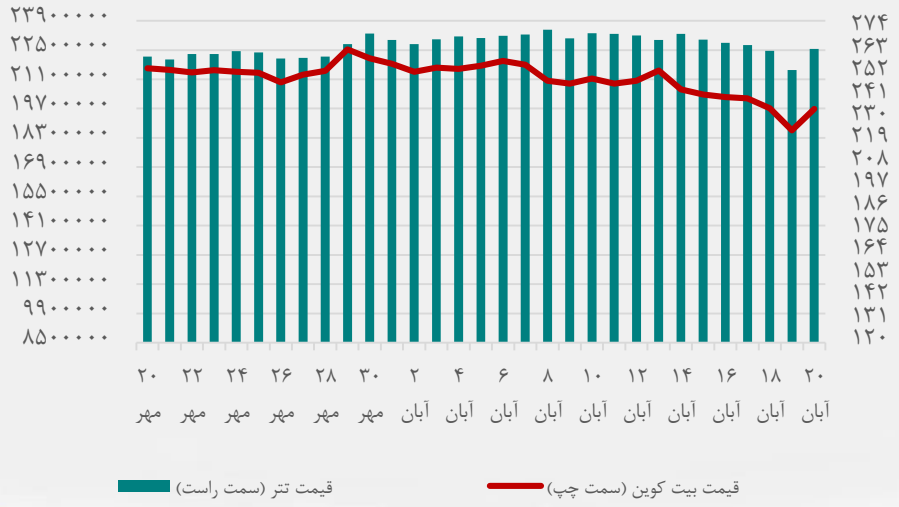
در روز جاری (۲۰ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۱۱ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۵.۴۸ و ۵.۷ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت جهانی بیت‌کوین پس از افت روز گذشته، با بهبود محدود همراه شد و با رشد حدود ۰.۳ درصدی در محدوده ۷۴ هزار دلار قرار گرفت. با این حال، فضای کلی بازار همچنان تحت تأثیر نگرانی‌ها از افزایش نرخ بهره در آمریکا و تداوم خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین قرار داشت. انتشار آمار تورم ماهانه آمریکا برای ماه اکتبر، که برابر با ۰.۴ درصد و در عین حال بیش از پیش‌بینی‌ها بود، احتمال افزایش نرخ بهره فدرال رزرو در نشست دسامبر را افزایش داد و از جذابیت دارایی‌های پرریسک کاست. همچنین، تداوم خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین برای چهارمین روز متوالی، با ثبت حدود ۹۵ میلیون دلار خروج خالص، مانع از تقویت تقاضای نهادی شد. در مقابل، کاهش شدت خروج سرمایه نسبت به روزهای قبل و افت فشار فروش ناشی از تسویه موقعیت‌های اهرمی، به تثبیت نسبی قیمت کمک کرد. در بازار داخلی نیز افزایش قیمت تتر در این روز، در کنار رشد محدود قیمت جهانی بیت‌کوین، توانست موجب افزایش قیمت ریالی این رمزارز شود. بنابراین، تغییرات نرخ تتر نقش مهمی در افزایش قیمت ریالی بیت‌کوین داشت.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۴.۰۶ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۴ هزار و ۱۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۲۰ آبان ۱۴۰۵)	۱۹,۶۸۲	۵۴۹.۵	۲۶۴,۱۰۰
روز گذشته (۱۹ آبان ۱۴۰۵)	۱۸,۶۶۰	۵۱۹.۹	۲۵۳,۸۰۰
تغییرات (درصد)	+۵.۴۸	+۵.۷۰	+۴.۰۶

منبع: نوسان پلاس

تحولات روزانه بیت کوین و تتر (هزار تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی