تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۱۸ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۶

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

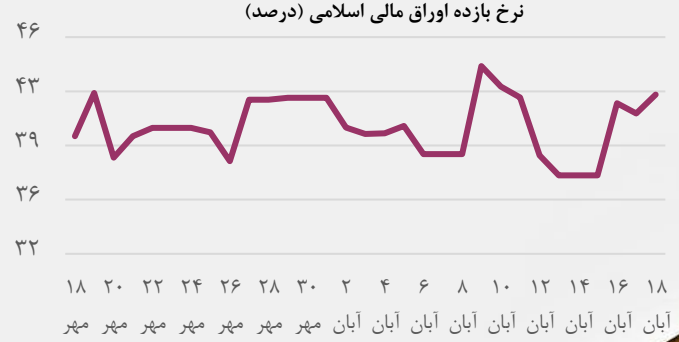
در روز ۱۸ آبان ۱۴۰۵، بازار اوراق بدهی با افزایش ارزش معاملات، تشدید خروج پول حقیقی و رشد نرخ بهره بدون ریسک همراه بود. افزایش نرخ بازده بدون ریسک، بیانگر کاهش قیمت اوراق در بازار ثانویه و افزایش بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران است؛ با این حال، تداوم و تشدید خروج پول حقیقی، علی‌رغم افزایش بازدهی اوراق، نشان می‌دهد جذابیت قیمتی ایجادشده نتوانسته است به تقویت تقاضا از سوی سرمایه‌گذاران حقیقی منجر شود و تمایل به خروج از این بازار همچنان غالب است.

در مجموع، تحولات مذکور حاکی از تداوم فشار فروش و ضعف نسبی تقاضا در بازار اوراق بدهی 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)	
۱,۳۷۳.۷	۴۲.۳	-۰.۱۲	۵۸,۳۶۱	روز جاری (۱۸ آبان ۱۴۰۵)
۱,۳۷۳.۷	۴۱.۱	-۰.۱۱	۱۹,۶۳۶	روز گذشته (۱۷ آبان ۱۴۰۵)
۰.۰	+۱.۲۱	-۵.۷	+۱۹۷.۲	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

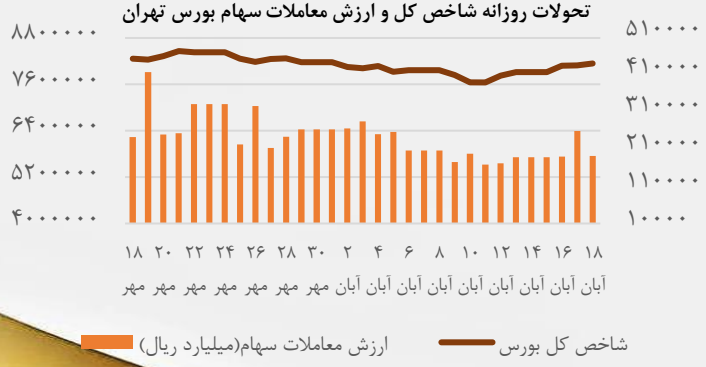
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۶۸,۸۱۴	۳۸.۲	۱۸۸,۴۸۶	۲,۲۸۲,۳۴۵	۱,۳۴۳,۳۲۸	۸,۱۳۷,۹۶۴	روز جاری (۱۸ آبان ۱۴۰۵)
۶۸,۱۰۶	۴۷.۳	۲۵۳,۸۱۹	۲,۲۵۹,۸۹۶	۱,۳۳۵,۴۱۰	۸,۰۸۹,۹۹۴	روز گذشته (۱۷ آبان ۱۴۰۵)
+۱.۰۴	-۱۹.۳	-۲۶	+۰.۹۹	+۰.۵۹	+۰.۵۹	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۱۸ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از افزایش فشار فروش در ابتدای معاملات، با تقویت تدریجی تقاضا تغییر مسیر داد. به‌طوری‌که شاخص کل با رشد ۰.۵۹ درصدی به سطح ۸ میلیون و ۱۳۸ هزار واحد و شاخص کل هم‌وزن با افزایش حدود یک‌درصدی به محدوده ۲ میلیون و ۲۸۲ هزار واحد رسید. پیشی گرفتن رشد شاخص هم‌وزن از شاخص کل، بیانگر گسترش تقاضا در طیف وسیع‌تری از سهام بود.

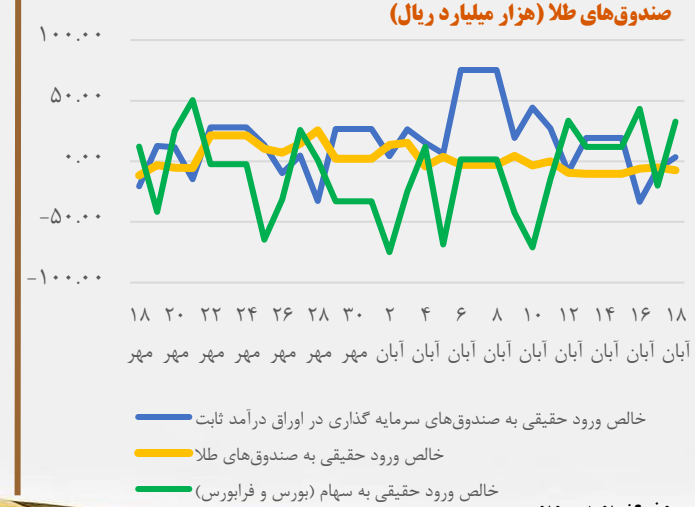
همچنین ورود نقدینگی حقیقی به بازار سهام، در کنار برتری محسوس سفارش‌های خرید نسبت به فروش، از بهبود نسبی انتظارات سرمایه‌گذاران تحت تاثیر تعدیل ریسک‌های سیاسی و افزایش تمایل به سرمایه‌گذاری در دارایی‌های پرریسک‌تر حکایت داشت. در مجموع، تداوم روند صعودی شاخص‌ها برای پنجمین روز متوالی نشان‌دهنده تقویت نسبی تقاضا در بازار است؛ هرچند پایداری این روند به استمرار ورود نقدینگی و حفظ برتری تقاضا بر عرضه وابسته خواهد بود.

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 (۱۸ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۲.۸۳ و ۳.۵۲ 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 ۷.۳۶ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا اتفاق افتاده 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 دوشنبه مورخ ۱۸ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۶

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 (۱۸ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۶,۵۱۵	۷۲,۶۲۰	۲۶۱,۲۹۰	۲۶۴,۶۱۲	۱۹۰,۱۸۲	۲۶۴,۲۰۰
روز گذشته (۱۷ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۷,۸۳۷	۷۲,۹۸۰	۲۶۱,۷۱۰	۲۶۶,۷۵۹	۱۸۹,۸۰۳	۲۶۵,۴۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۴۹	-۰.۴۹	-۰.۱۶	-۰.۸۰	+۰.۲۰	-۰.۴۵

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۸ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۴۵ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۴ هزار و ۲۰۰ 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 نوسان محدود و تمایل به کاهش همراه بود. این وضعیت در شرایطی رقم خورد که از یک‌سو، اظهارات دونالد ترامپ درباره پایین بودن احتمال حمله مجدد به ایران در صورت پیشرفت مذاکرات، سیگنال مثبتی در جهت کاهش ریسک‌های سیاسی به بازار مخابره کرد. اما از سوی دیگر، تأکید وی بر آمادگی آمریکا برای ازسرگیری حملات و تداوم گزارش‌های مربوط به تنش‌های دریایی در محدوده تنگه هرمز، مانع از تقویت انتظارات کاهشی شد. در نتیجه، با وجود انتشار اخبار نسبتاً مثبت دیپلماتیک، تداوم ابهامات سیاسی و نظامی و نبود چشم‌انداز روشن از حصول توافق، موجب احتیاط معامله‌گران و محدود ماندن نوسانات نرخ دلار غیررسمی 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 (۱۸ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۴	۴۱۴۴.۹	۰.۴۴۹۲	۳.۳۳۳	۲۵۴.۸	۲۵.۵	۲۵۷.۸
روز گذشته (۱۷ آبان ۱۴۰۵)	۵۲	۴۰۶۴	۰.۴۴۶۱	۳.۳۲۴	۲۵۴.۳	۲۵.۴	۲۵۷.۴
تغییرات (درصد)	+۲.۸۲	+۱.۹۹	+۰.۶۹	+۰.۲۸	+۰.۲۱	+۰.۵۰	+۰.۱۵

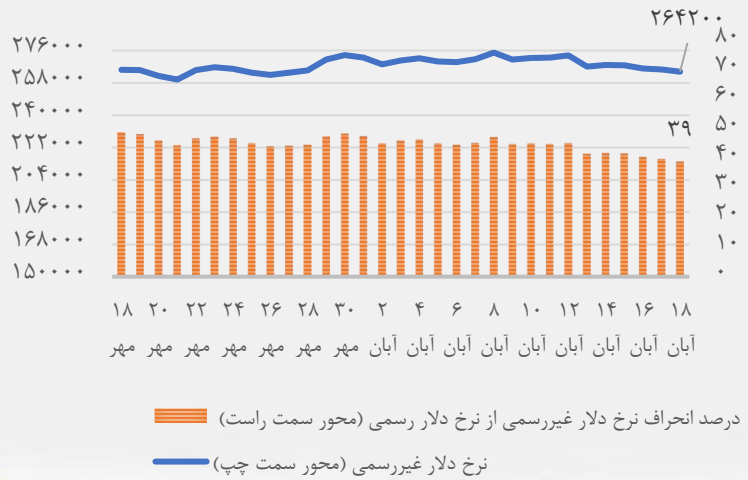
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۸ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۱۵ و ۰.۵ درصد افزایش داشتند.

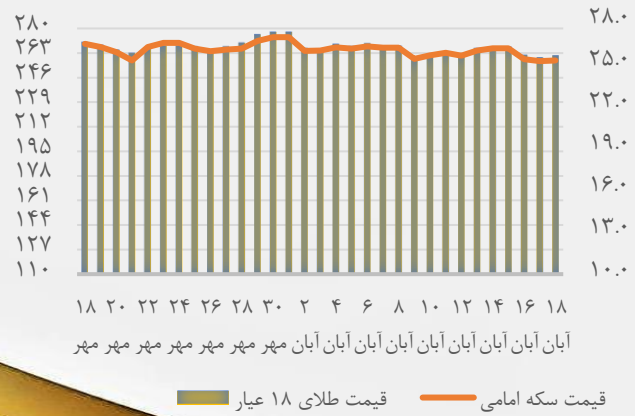
همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

لازم به توجه است، رشد قیمت بازار طلا و سکه در شرایطی رقم خورد که افزایش قیمت جهانی اونس طلا بر اثر کاهشی قیمت دلار در بازار غیررسمی غلبه کرده و در نهایت منجر به افزایش قیمت دارایی‌های مذکور شده 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

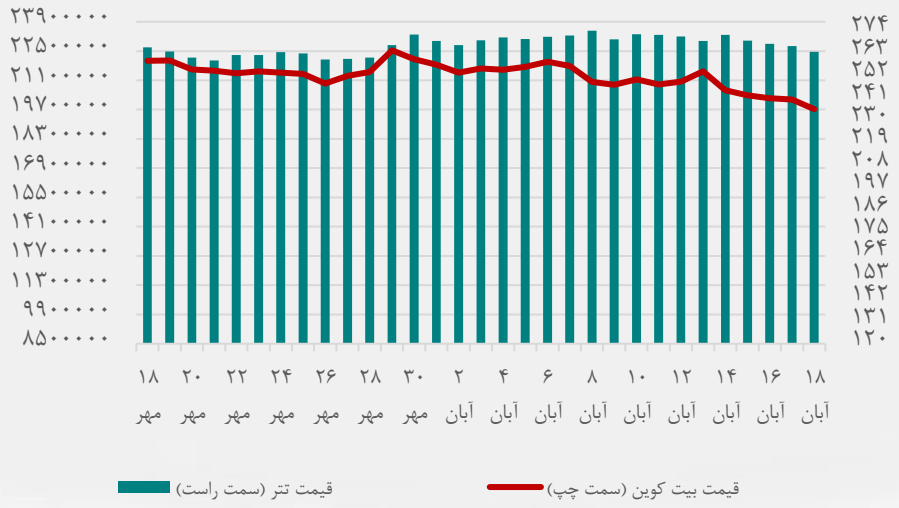
در روز جاری (۱۸ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۹ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۲.۳ و ۵.۳۹ درصدی همراه شدند. در معاملات روز جاری، قیمت ریالی بیت‌کوین برخلاف افزایش محدود بهای جهانی آن، با کاهش همراه شد. این واگرایی عمدتاً ناشی از افت نرخ تتر در بازار داخلی بود. به‌گونه‌ای که کاهش نرخ تتر اثر افزایشی تغییرات محدود قیمت جهانی بیت‌کوین را خنثی کرد و در نهایت به افت ارزش تومانی این رمزارز انجامید. در سطح جهانی نیز اگرچه بیت‌کوین در جریان معاملات با نوسانات و تلاش برای بازیابی قیمت همراه بود، اما فضای کلی بازار رمزارزها همچنان تحت تأثیر نگرانی‌ها از سخت‌گیرانه‌تر شدن مقررات این حوزه پس از انتخابات میان‌دوره‌ای آمریکا و همچنین انتشار اخبار مربوط به سرقت ۶ میلیارد دلاری از صرافی بایننس قرار داشت. در مجموع، کاهش قیمت ریالی بیت‌کوین در این روز بیش از آنکه ناشی از تضعیف ارزش جهانی آن باشد، از افت نرخ تتر در بازار داخلی تأثیر پذیرفت.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۰۹ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۳ هزار و ۲۰۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۸ آبان ۱۴۰۵)	۱۹,۷۱۸	۵۶۰.۷	۲۶۳,۲۰۰
روز گذشته (۱۷ آبان ۱۴۰۵)	۲۰,۱۸۳	۵۹۲.۶	۲۶۶,۱۰۰
تغییرات (درصد)	-۲.۳۰	-۵.۳۹	-۱.۰۹

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