تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۱۶ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۴

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در بازار اوراق بدهی، در روز ۱۶ آبان ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات در کنار تشدید خروج نقدینگی حقیقی و افزایش نرخ بازده بدون ریسک، بیانگر تضعیف تقاضا برای دارایی‌های کم‌ریسک و کاهش جذابیت نسبی این بازار بود. افزایش نرخ بازده بدون ریسک نیز با توجه به رابطه معکوس قیمت و بازده اوراق بدهی، می‌تواند منعکس‌کننده افزایش فشار فروش و کاهش قیمت اوراق باشد.
هم‌زمانی این تحولات با رشد قابل‌توجه بورس و ورود نقدینگی حقیقی به سهام، می‌تواند نشان‌دهنده جابه‌جایی بخشی از منابع سرمایه‌گذاران از دارایی‌های کم‌ریسک به سمت بازار سهام و افزایش نسبی تمایل به پذیرش ریسک باشد.

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 (۱۶ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۷۱.۹	۴۱.۷	-۰.۳۹	۴۸,۶۲۸
روز گذشته (۱۳ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۷۰.۴	۳۷.۱	-۰.۲۷	۸۸,۶۴۸
تغییرات (درصد)	+۰.۱۱	+۴.۷	-۴۱.۷	-۴۵.۱

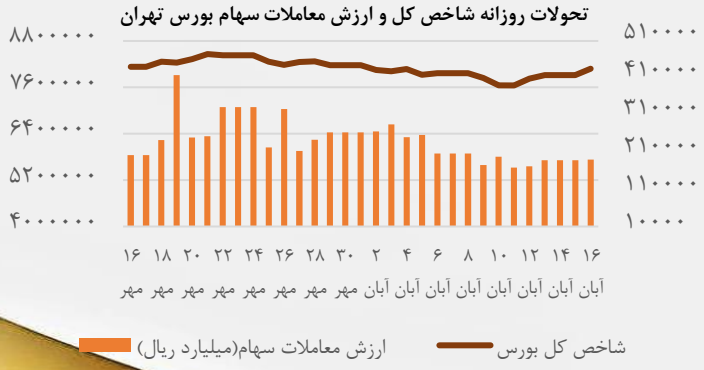
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

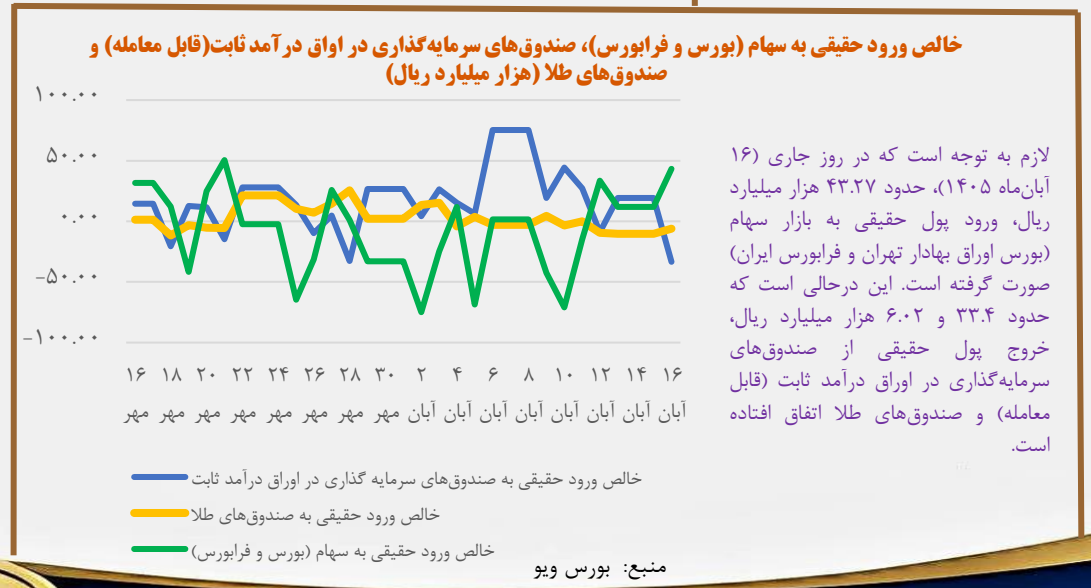
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۶۷,۹۶۲	۳۴.۲	۱۸۶,۳۴۸	۲,۲۵۹,۷۱۹	۱,۳۳۴,۳۵۷	۸,۰۸۳,۶۱۶	روز جاری (۱۶ آبان ۱۴۰۵)
۶۷,۰۱۴	۳۲.۵	۱۸۴,۵۲۴	۲,۲۲۸,۸۱۶	۱,۳۰۶,۱۴۶	۷,۹۱۲,۷۰۷	روز گذشته (۱۳ آبان ۱۴۰۵)
+۱.۴۲	+۵.۱	+۱	+۱.۳۹	+۲.۱۶	+۲.۱۶	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

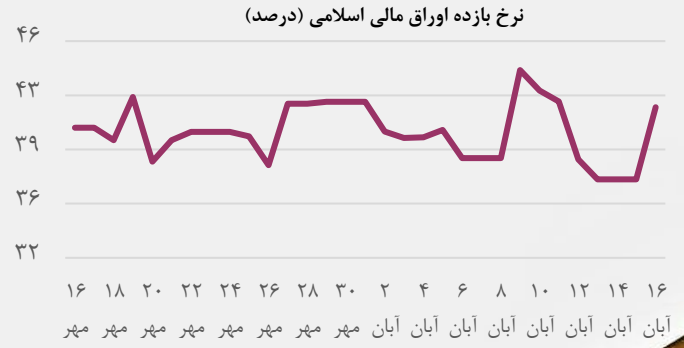
در روز جاری (۱۶ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران با تقویت محسوس تقاضا و بازگشت جریان نقدینگی حقیقی، روندی صعودی را تجربه کرد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با رشد ۲.۱۶ درصدی مجدداً از مرز ۸ میلیون واحد عبور کرد و شاخص کل هم‌وزن نیز ۱.۳۹ درصد افزایش یافت.
این تحولات در شرایطی رخ داد که بازار در دو هفته متوالی قبل با افت شاخص کل و خروج نقدینگی حقیقی مواجه بود. ازاین‌رو، بازگشت تقاضا را می‌توان تا حدی ناشی از تقویت خرید پس از اصلاح اخیر قیمت‌ها و بهبود انتظارات سرمایه‌گذاران دانست. همچنین، انتشار اخبار مرتبط با عملکرد شرکت‌ها و چشم‌انداز برخی صنایع، از جمله گروه اوره، در تقویت تقاضا مؤثر بود. در مجموع، ورود نقدینگی حقیقی و افزایش مشارکت خریداران، نشانه‌ای از بهبود فضای معاملاتی و افزایش ریسک‌پذیری سرمایه‌گذاران بود؛ بااین‌حال، تداوم روند صعودی به استمرار ورود نقدینگی و کاهش نااطمینانی‌های اقتصادی و سیاسی وابسته خواهد بود.





لازم به توجه است که در روز جاری (۱۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۴۳.۲۷ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۳۳.۴ و ۶.۰۲ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.

منبع: بورس ویو



منبع: بورس ویو

نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی

تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۱۶ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۴

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 (۱۶ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۸,۳۵۰	۷۳,۱۲۰	۲۶۱,۶۹۰	۲۶۸,۷۲۶	۱۸۹,۴۲۴	۲۶۶,۰۰۰
روز گذشته (۱۵ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۹,۸۵۵	۷۳,۵۳۰	۲۶۳,۹۹۰	۲۶۸,۶۸۰	۱۸۹,۰۴۶	۲۶۷,۷۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۵۶	-۰.۵۶	-۰.۸۷	+۰.۰۲	+۰.۲۰	-۰.۶۴

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۶۴ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۶ هزار 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 کاهش جزئی همراه شد. انتشار اخبار مربوط به تلاش مقامات آمریکایی برای آغاز مسیر دیپلماسی غیرمستقیم میان ایران و آمریکا از طریق قطر و پاکستان و همچنین رایزنی‌های تلفنی وزیر امور خارجه ایران با همتایان منطقه‌ای، از جمله عوامل تقویت‌کننده انتظارات کاهشی و تعدیل تقاضای احتیاطی در بازار ارز بود. بااین‌حال، اظهارات ترامپ درباره احتمال اقدام نظامی علیه ایران و افزایش تنش‌ها در تنگه هرمز، مانع از تشدید کاهش قیمت شد. در مجموع، عقب‌نشینی دلار را می‌توان حاصل تعدیل انتظارات افزایشی و کاهش نسبی تقاضای احتیاطی دانست؛ هرچند تداوم نااطمینانی‌های سیاسی همچنان مانع شکل‌گیری چشم‌انداز نزولی قطعی در بازار ارز بود.

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 (۱۶ آبان ۱۴۰۵)	۵۲	۴۰۶۴	۰.۴۵۶۰	۳.۳۶۱	۲۵۶.۷	۲۵.۶	۲۵۸.۸
روز گذشته (۱۵ آبان ۱۴۰۵)	۵۲	۴۰۶۴	۰.۴۶۵۸	۳.۴۳۷	۲۶۳.۱	۲۶.۲	۲۶۶.۲
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۲.۱۲	-۲.۲۳	-۲.۴۳	-۲.۱۹	-۲.۷۷

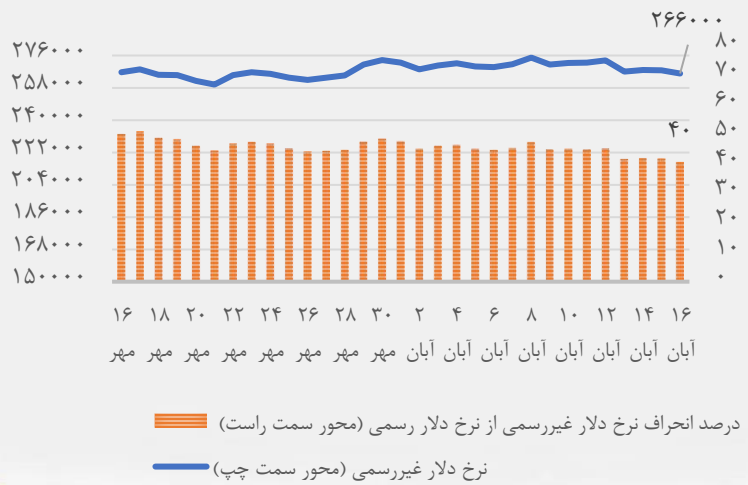
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۲.۷۷ و ۲.۱۹ درصد کاهش داشتند.

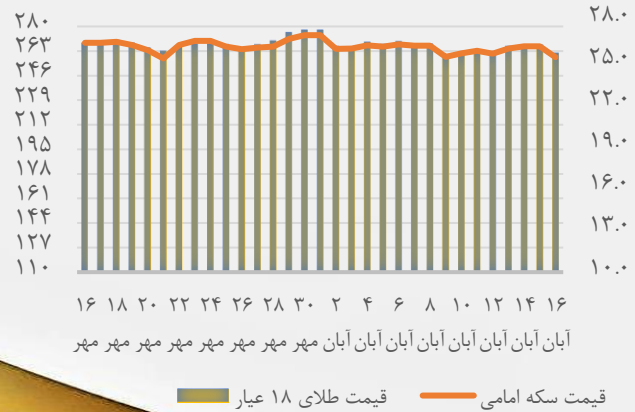
همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

لازم به توجه است، کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی، با وجود ثبات قیمت جهانی اونس طلا، نقش مهمی در کاهش قیمت دارایی‌های مذکور داشته اشت.

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 (۱۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۷ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۶۲ و ۰.۴۵ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت جهانی بیت‌کوین تقریباً ثابت و در محدوده ۷۶ هزار دلار نوسان داشت. ثبات نسبی قیمت پس از افت شدید روزهای قبل، عمدتاً از کاهش فشار فروش و تعدیل موج معاملات اهرمی و لیکوییدشدن موقعیت‌های خرید پس از افت‌های اخیر ناشی شد. به‌طوری‌که با فروکش‌کردن فشار فروش اجباری، از شدت نوسانات کاهشی کاسته شد. بااین‌حال، تداوم خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در آمریکا، به میزان حدود ۴۱۲ میلیون دلار در روز قبل، همچنان بیانگر ضعف تقاضای نهادی بود. همچنین، افت سهام شرکت‌های فناوری آمریکا و افزایش نگرانی‌ها درباره سرمایه‌گذاری در حوزه هوش مصنوعی، مانع از تقویت تقاضا برای دارایی‌های پرریسک شد. از سوی دیگر، کاهش نرخ تتر با وجود ثبات نسبی قیمت جهانی بیت‌کوین، به کاهش قیمت ریالی این رمزارز انجامید. در مجموع، بازار بیت‌کوین در این روز در وضعیت تثبیت نسبی قرار داشت، اما تداوم خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله همچنان مانع از شکل‌گیری روند صعودی قدرتمند بود.

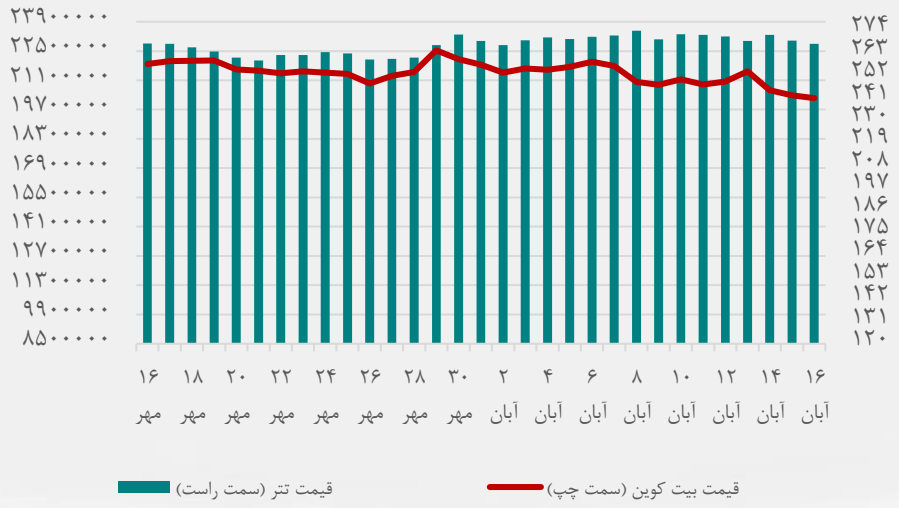
شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۵۶ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۷ هزار و ۲۰۰ تومان تنزل کرد.

قیمت (میلیون تومان / تومان)

	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۶ آبان ۱۴۰۵)	۲۰,۲۴۸	۵۹۷	۲۶۷,۲۰۰
روز گذشته (۱۵ آبان ۱۴۰۵)	۲۰,۳۷۴	۵۹۹.۷	۲۶۸,۷۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۶۲	-۰.۴۵	-۰.۵۶

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