تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۱۳ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۳

تحولات بازار سرمایه

در بازار اوراق بدهی، معاملات روز ۱۳ آبان ۱۴۰۵ با کاهش ارزش معاملات و محدودتر شدن خروج نقدینگی حقیقی همراه بود. هم‌زمان، نرخ بهره بدون ریسک نیز کاهش یافت. کاهش خروج پول حقیقی، در کنار افت نرخ بازده بدون ریسک، می‌تواند بیانگر تعدیل فشار فروش و بهبود نسبی تقاضا در بازار اوراق بدهی باشد. بااین‌حال، کاهش ارزش معاملات نشان می‌دهد سطح فعالیت و گردش نقدینگی در این بازار محدودتر شده است. از سوی دیگر، کاهش نرخ بازده بدون ریسک به معنای کاهش بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران است و می‌تواند منجر به جذابیت نسبی بازار سهام در مقایسه با ابزارهای کم‌ریسک‌تر شود

تحولات بازار اوراق بدهی

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)	
۱,۳۶۸.۲	۳۷.۱	-۰.۱۲	۸۸,۶۶۰	روز جاری (۱۳ آبان ۱۴۰۵)
۱,۳۶۶.۴	۳۸.۴	-۰.۹۸	۱۱۱,۶۸۴	روز گذشته (۱۲ آبان ۱۴۰۵)
+۰.۱۳	-۱.۲۹	+۸۸.۳	-۲۰.۶	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	
۶۷,۰۱۴	۳۲.۵	۱۸۴,۵۲۴	۲,۲۲۸,۸۱۶	۱,۳۰۶,۱۴۶	۷,۹۱۲,۷۰۷	روز جاری (۱۳ آبان ۱۴۰۵)
۶۶,۷۱۹	۳۱.۶	۱۶۹,۱۱۶	۲,۲۱۴,۸۳۶	۱,۲۹۱,۶۰۲	۷,۸۲۴,۶۰۳	روز گذشته (۱۲ آبان ۱۴۰۵)
+۰.۴۴	+۳.۱	+۹	+۰.۶۳	+۱.۱۳	+۱.۱۳	تغییرات (درصد)

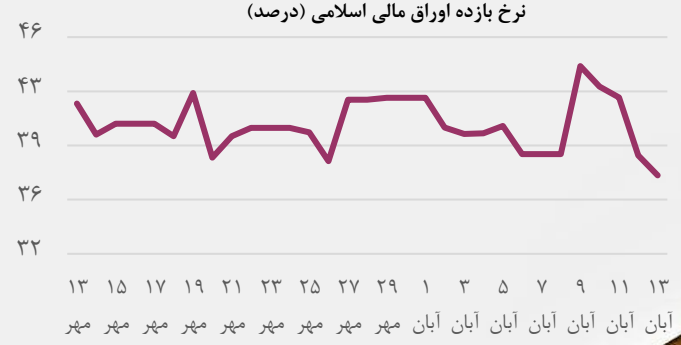
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۱۳ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران با بهبود تقاضا و رشد شاخص‌های اصلی همراه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل و هم وزن معادل ۱.۱۳ و ۰.۶۳ درصد با افزایش مواجه شدند. اثرگذاری بیشتر نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بر رشد شاخص کل، نشان‌دهنده تمرکز تقاضا در شرکت‌های بزرگ‌تر بازار بود.

از منظر عوامل اثرگذار، به نظر می‌رسد تعدیل قیمت سهام پس از افت روزهای ابتدایی آبان و فعال‌شدن تقاضای اصلاحی، نقش مهمی در بهبود معاملات داشته است. با وجود رشد بازار، کاهش نرخ دلار در بازار غیررسمی در بازارهای جهانی، مانع از آن است که این صعود را به بهبود متغیرهای بازار نسبت دهیم.

در مجموع، رشد معاملات این روز را می‌توان نشانه‌ای از بازگشت نسبی تقاضا پس از اصلاح قیمت‌ها دانست. بااین‌حال، تداوم ورود نقدینگی حقیقی و افزایش ارزش معاملات برای تأیید پایداری روند صعودی بازار ضروری است.

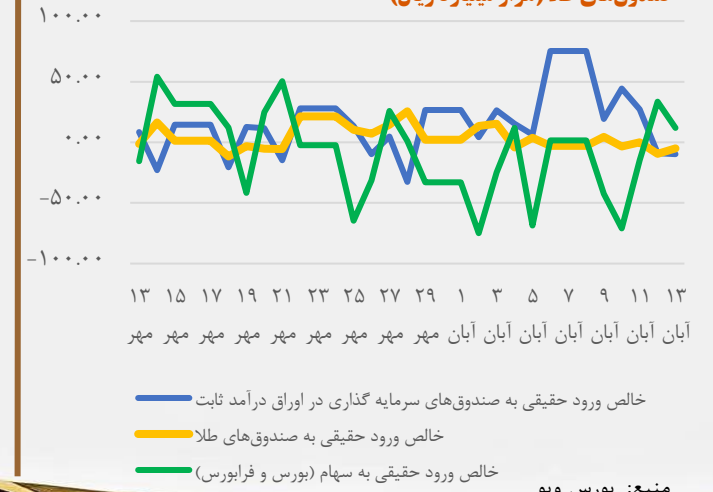
نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

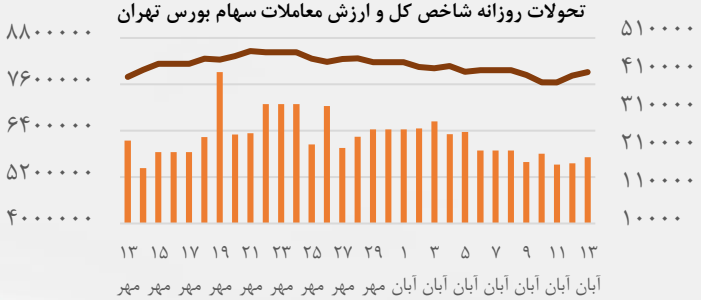
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)

لازم به توجه است که در روز جاری (۱۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۱.۸۸ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۹.۸۳ و ۴.۹۵ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.



منبع: بورس ویو

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 ۱۳ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۳

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 (۱۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۹,۳۴۱	۷۳,۳۹۰	۲۶۳,۴۹۰	۲۶۸,۷۴۴	۱۸۸,۶۶۸	۲۶۷,۰۰۰
روز گذشته (۱۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۵,۶۱۷	۷۵,۱۰۰	۲۶۸,۴۹۰	۲۶۷,۸۶۷	۱۸۸,۲۹۲	۲۷۳,۳۰۰
تغییرات (درصد)	-۲.۲۸	-۲.۲۸	-۱.۸۶	+۰.۳۳	+۰.۲۰	-۲.۳۱

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۲.۳۱ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۷ 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 پس از افزایش روزهای قبل، با کاهش همراه شد. مهم‌ترین عامل اثرگذار بر این روند، تحولات سیاسی آمریکا و نتایج انتخابات میان‌دوره‌ای این کشور بود. پیروزی حزب دموکرات و کسب اکثریت در هر دو مجلس نمایندگان و سنا، ضمن افزایش احتمال محدودتر شدن اختیارات دولت ترامپ، انتظارات بازار نسبت به تحولات سیاسی و اقتصادی آینده آمریکا را تحت تأثیر قرار داد. از سوی دیگر، اظهارات ترامپ درباره تداوم مذاکرات غیرمستقیم با ایران و نبود برنامه فوری برای تشدید درگیری نظامی، در کنار تغییر فضای سیاسی آمریکا، به تعدیل نسبی انتظارات افزایشی و کاهش ریسک سیاسی در بازار دلار غیررسمی کمک کرد.

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 (۱۳ آبان ۱۴۰۵)	۵۲.۳	۴۰۶۲.۷	۰.۴۵۹۹	۳.۴۰۴	۲۶۰.۷	۲۶.۱	۲۶۴.۶
روز گذشته (۱۲ آبان ۱۴۰۵)	۴۹.۶	۳۹۲۲.۶	۰.۴۵۱۸	۳.۳۴۸	۲۵۷.۰	۲۵.۵	۲۶۱.۱
تغییرات (درصد)	+۵.۳۶	+۳.۵۷	+۱.۷۹	+۱.۶۷	+۱.۴۲	+۲.۱۷	+۱.۳۵

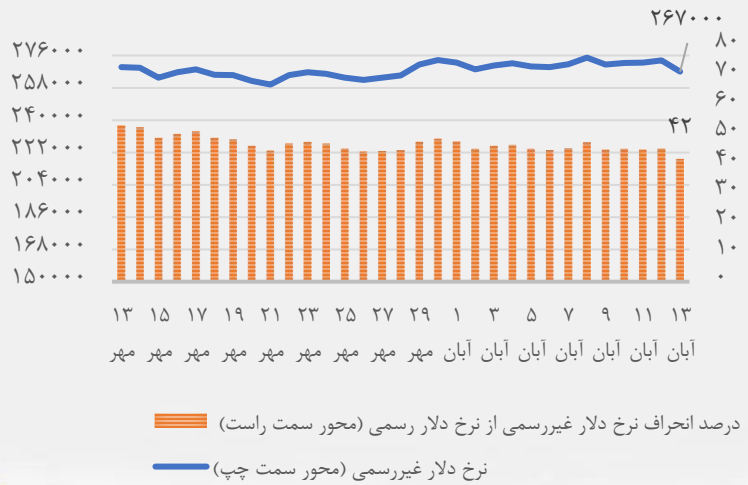
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۱.۳۵ و ۲.۱۷ درصد افزایش داشتند.

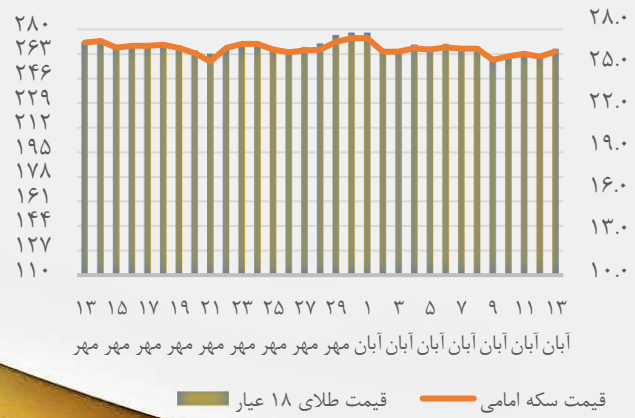
همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

لازم به توجه است، افزایش قیمت جهانی اونس طلا در پی تضعیف شاخص دلار در بازارهای جهانی، بر اثر کاهشی افت نرخ دلار در بازار غیررسمی غلبه کرده و در نهایت به افزایش قیمت طلا و سکه در بازار داخلی منجر 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

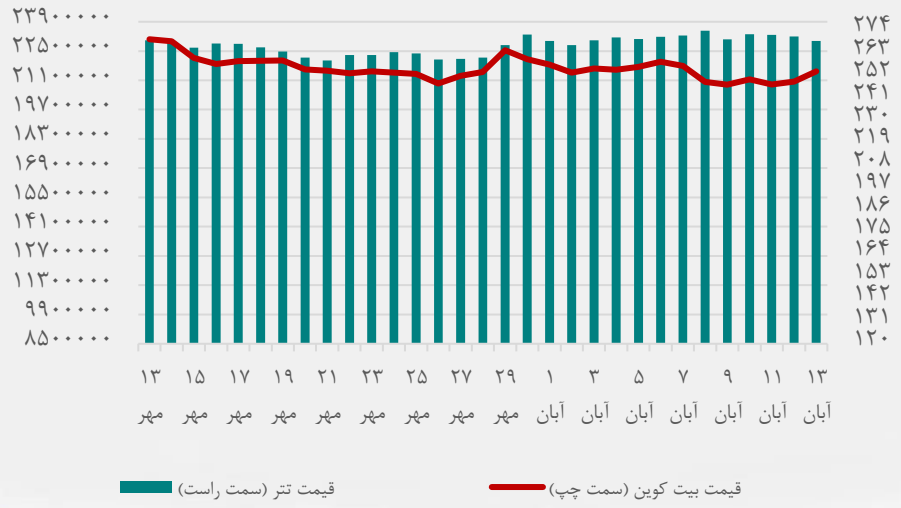
در روز جاری (۱۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۴ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۲.۳۴ و ۴.۸۵ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت کوین تحت تأثیر تحولات سیاسی آمریکا و تغییر انتظارات سرمایه‌گذاران نسبت به سیاست‌های اقتصادی و مقرراتی این کشور، با نوسانات قابل‌توجهی همراه بود. پس از افت قیمت در پی اعلام نتایج انتخابات میان‌دوره‌ای آمریکا و عقب‌نشینی بیت‌کوین تا محدوده ۷۶ هزار دلار، با بهبود فضای معاملات سهام آمریکا و تضعیف شاخص دلار، تقاضا در بازار رمزارزها تقویت شد و قیمت بیت‌کوین با افزایش ۳.۹ درصدی در بازارهای جهانی (براساس داده‌های تاریخی Investing)، مجدداً به محدوده ۸۰ هزار دلار بازگشت. از سوی دیگر، بخشی از بازگشت قیمت ناشی از بسته‌شدن موقعیت‌های فروش اهرمی و فشار بر معامله‌گران نزولی بود. در مجموع، روند بیت‌کوین در این روز عمدتا تحت تأثیر تغییر انتظارات سیاسی و بازگشت کوتاه‌مدت ریسک‌پذیری در بازارهای جهانی قرار داشت.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۸۱ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۸ هزار و ۵۰۰ تومان تنزل کرد.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۱۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۶۸,۵۰۰	۶۴۷.۹	۲۱,۵۲۶
روز گذشته (۱۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۰,۷۰۰	۶۱۸	۲۱,۰۳۳
تغییرات (درصد)	-۰.۸۱	+۴.۸۵	+۲.۳۴

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