تحولات بازارهای مالی در روز سه شنبه مورخ ۱۲ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۲

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

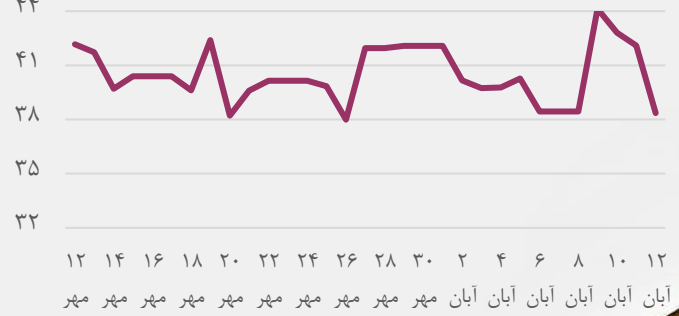
در معاملات ۱۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵، افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت هم‌زمان با کاهش نرخ بازده بدون ریسک و تشدید خروج پول حقیقی همراه بود. کاهش نرخ بازده بدون ریسک می‌تواند بیانگر افزایش قیمت اوراق بدهی و بهبود نسبی تقاضا در این بازار باشد. با این حال، افزایش خروج پول حقیقی نشان می‌دهد بخشی از سرمایه‌گذاران تمایل بیشتری به خروج از دارایی‌های کم‌ریسک و انتقال منابع به گزینه‌های پربازده‌تر داشته‌اند. با توجه به رشد قابل‌توجه بورس در این روز و ورود نقدینگی حقیقی به سهام، به نظر می‌رسد افزایش جذابیت بازار سهام و بهبود انتظارات نسبت به بازدهی دارایی‌های ریسکی، از عوامل مؤثر بر جابه‌جایی نقدینگی از بازار اوراق بدهی به سمت بازار سهام بوده 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)
۱,۳۶۶.۴	۳۸.۴		-۰.۹۸	۱۱۱,۶۸۴
۱,۳۶۴.۶	۴۲.۱۰		-۰.۰۵	۴۵,۹۷۱
+۰.۱۳	-۳.۷۴		-۱۹۰۴.۱	+۱۴۲.۹

روز جاری (۱۲ آبان ۱۴۰۵)
روز گذشته (۱۱ آبان ۱۴۰۵)
تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

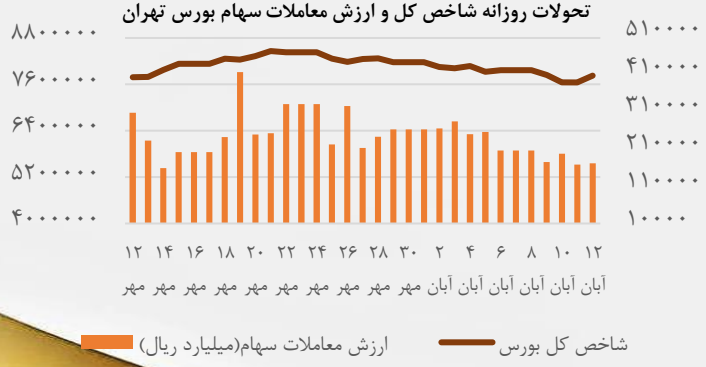
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران					
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل	
۶۶,۷۱۹	۳۱.۶	۱۶۹,۱۱۶	۲,۲۱۴,۸۳۶	۱,۲۹۱,۶۰۲	۷,۸۲۴,۶۰۳	روز جاری (۱۲ آبان ۱۴۰۵)
۶۵,۵۴۹	۳۰.۸	۱۶۵,۳۴۴	۲,۱۷۵,۵۴۷	۱,۲۶۲,۶۸۳	۷,۶۴۹,۴۰۹	روز گذشته (۱۱ آبان ۱۴۰۵)
+۱.۷۸	+۲.۳	+۲	+۱.۸۱	+۲.۲۹	+۲.۲۹	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۱۲ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران با افزایش قابل‌توجه تقاضا و رشد شاخص‌های بازار همراه بود؛ به‌طوری‌که شاخص کل با رشد ۲.۲۹ درصدی به سطح ۷ میلیون و ۸۲۵ هزار واحد و شاخص کل هم‌وزن با افزایش ۱.۸۱ درصدی به محدوده ۲ میلیون و ۲۱۵ هزار واحد رسید. رشد هم‌زمان دو شاخص و مثبت بودن بخش عمده نمادهای معاملاتی نشان‌دهنده گسترش تقاضا در بازار بود؛ هرچند رشد بیشتر شاخص کل حاکی از اثرگذاری پررنگ‌تر نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بر عملکرد بازار است.

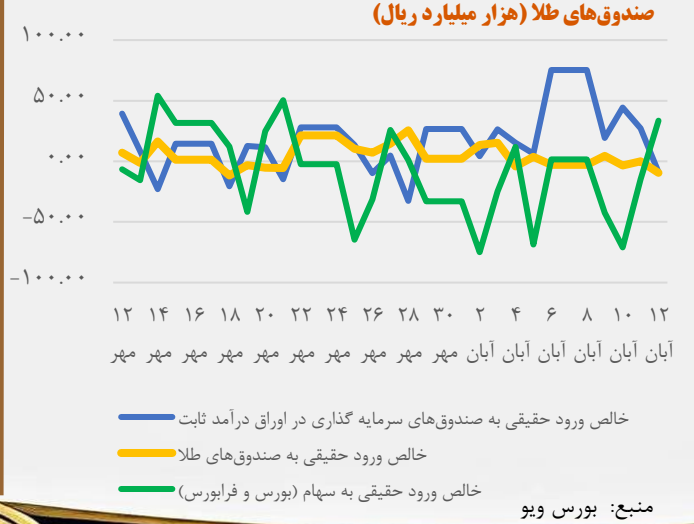
این رشد در شرایطی رقم خورد که بازار پس از سه روز افت متوالی، با بازگشت تقاضا و ورود پول حقیقی مواجه شد. به نظر می‌رسد کاهش قیمت سهام در روزهای قبل و فراهم شدن فرصت‌های خرید، در کنار افزایش انتظارات تورمی متأثر از رشد نرخ دلار و جذابیت نسبی سهام شرکت‌های دارایی‌محور و صادرات‌محور، در تقویت تقاضا مؤثر بوده است.

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 (۱۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۳۳.۴۵ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۹.۰۷ و ۹.۴۹ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و 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 سه شنبه مورخ ۱۲ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۲

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 (۱۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۵,۶۱۷	۷۵,۱۰۰	۲۶۸,۴۹۰	۲۶۷,۸۶۷	۱۸۸,۲۹۲	۲۷۳,۳۰۰
روز گذشته (۱۱ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۴,۴۰۶	۷۴,۷۷۰	۲۶۸,۴۹۰	۲۶۷,۸۶۵	۱۸۷,۹۱۶	۲۷۲,۰۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۴۴	+۰.۴۴	۰	۰	+۰.۲۰	+۰.۴۸

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۴۸ درصدی همراه شد و در سطح ۲۷۳ هزار و ۳۰۰ 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 افزایش محدودی را تجربه کرد. مهم‌ترین عامل افزایشی بازار، تشدید نااطمینانی‌های ژئوپلیتیکی بود. انتشار اخباری در خصوص حملات محدود آمریکا به جزیره قشم در شب قبل و افزایش تنش‌ها در محدوده تنگه هرمز، نگرانی‌ها نسبت به احتمال ازسرگیری درگیری‌های نظامی را تقویت کرد و با افزایش تقاضای احتیاطی، فشار صعودی بر نرخ دلار وارد آورد.

در مقابل، اظهارات دونالد ترامپ درباره امکان دستیابی به توافق با ایران و اعلام قطر مبنی بر ادامه مذاکرات غیرمستقیم و پیشرفت در روند میانجی‌گری، از عوامل بازدارنده رشد بیشتر دلار بود. با این حال، تأکید مقامات ایران بر فاصله قابل‌توجه مواضع دو طرف و تداوم اختلافات، مانع از شکل‌گیری انتظارات مثبت و پایدار نسبت به حصول توافق 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 (۱۲ آبان ۱۴۰۵)	۴۹.۶	۳۹۲۲.۶	۰.۴۵۱۸	۳.۳۴۸	۲۵۷.۰	۲۵.۵	۲۶۱.۱
روز گذشته (۱۱ آبان ۱۴۰۵)	۵۰.۶	۳۹۴۱.۹	۰.۴۵۹۱	۳.۳۷۲	۲۵۹.۴	۲۵.۸	۲۶۳.۲
تغییرات (درصد)	-۱.۹۶	-۰.۴۹	-۱.۶۰	-۰.۷۲	-۰.۹۳	-۱.۱۸	-۰.۸۱

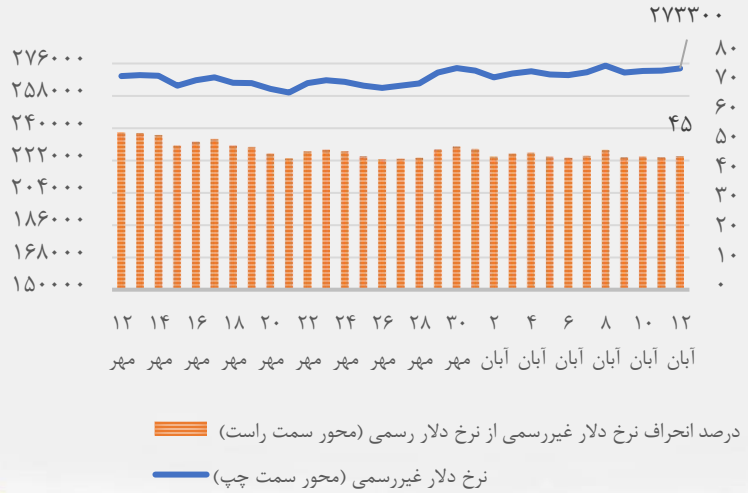
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۸۱ و ۱.۱۸ درصد کاهش داشتند.

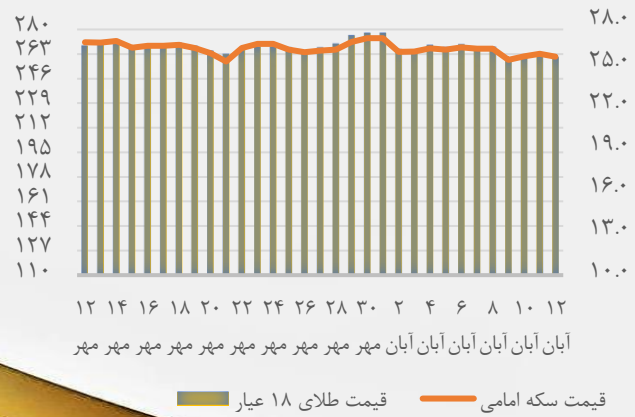
همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

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

تحولات روزانه نرخ دلار در بازار غیررسمی (تومان/درصد)



تحولات روزانه قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار (میلیون تومان)



نویسنده: دکتر رعنا عباسقلی نژاد اسبقی

تحولات بازار ارزهای دیجیتال

در روز جاری (۱۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۳ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۶۷ و ۱.۰۹ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین پس از افت در ساعات ابتدایی معاملات، در ادامه با بهبود تقاضا کاهش خود را جبران کرد. این تغییر مسیر عمدتاً تحت تأثیر بهبود نسبی فضای معاملات سهام فناوری در وال‌استریت و افزایش تمایل سرمایه‌گذاران به دارایی‌های پرریسک‌تر در ساعات پایانی معاملات بود. با این حال، نگرانی‌های مرتبط با امنیت بازار رمزارزها (سرقت گسترده دارایی‌های کاربران از صرافی باینانس در اواخر اکتبر) همچنان از عوامل محدودکننده رشد قیمت بود. همچنین، تشدید نگرانی‌ها درباره سیاست‌های نظارتی پس از انتخابات میان‌دوره‌ای آمریکا بر قیمت بیت کوین تاثیر منفی گذاشت. در مجموع، رشد قیمت بیت‌کوین در این روز بیشتر ناشی از بهبود نسبی فضای ریسک‌پذیری و بازگشت تقاضا در بازارهای جهانی بود. با این حال، نگرانی‌های امنیتی و ابهامات سیاست‌گذاری آمریکا همچنان مانع از شکل‌گیری روند صعودی قدرتمند و پایدار در بازار رمزارزها بود.

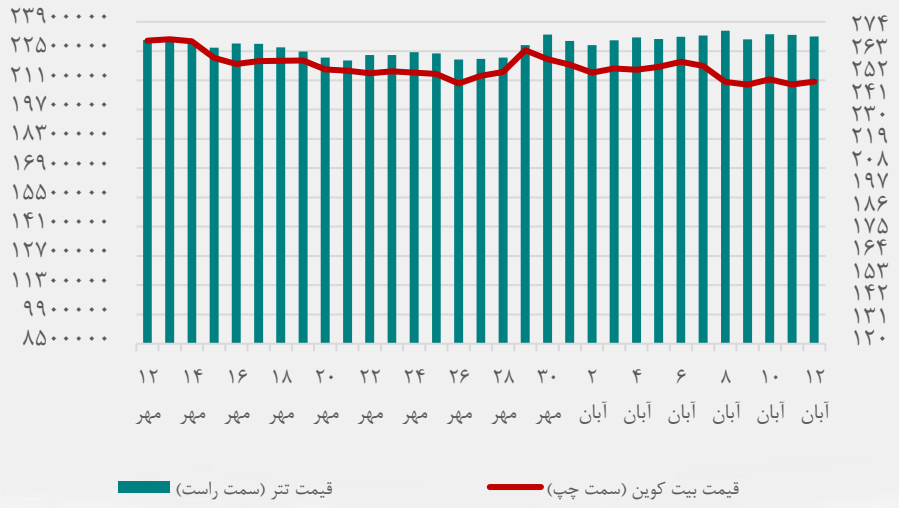
شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۲۹ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۷۰ هزار و ۷۰۰ تومان تنزل کرد. لازم به ذکر است، کاهش قیمت تتر علی‌رغم افزایش نرخ دلار غیررسمی در روز ۱۲ آبان، عمدتاً ناشی از تفاوت شرایط عرضه و تقاضا در دو بازار و تضعیف نسبی تقاضای معاملاتی تتر بود. در واقع، افزایش تقاضای احتیاطی برای دلار فیزیکی لزوماً به بازار رمزارزها منتقل نشد و افزایش عرضه یا کاهش تقاضای تتر در صرافی‌های داخلی، زمینه افت قیمت آن را فراهم کرد.

قیمت (میلیون تومان / تومان)

	تتر (تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	بیت کوین (میلیون تومان)
روز جاری (۱۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۰,۷۰۰	۶۱۸	۲۱,۰۳۳
روز گذشته (۱۱ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۱,۵۰۰	۶۱۱.۳	۲۰,۸۹۴
تغییرات (درصد)	-۰.۲۹	+۱.۰۹	+۰.۶۷

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