تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۱۱ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۱

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۱۱ آبان‌ماه ۱۴۰۵، افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت هم‌زمان با کاهش نرخ بهره بدون ریسک و محدودتر شدن خروج پول حقیقی، بیانگر بهبود نسبی تحرک معاملاتی و کاهش فشار فروش در این بازار بود.
از سوی دیگر، کاهش نرخ بازده بدون ریسک، با افزایش قیمت اوراق بدهی در بازار ثانویه و کاهش بازده مورد انتظار آن‌ها همراه است و می‌تواند از جذابیت نسبی بازار سهام در مقایسه با اوراق درآمد ثابت حمایت کند

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)	
۱,۳۶۴.۶	۴۲.۱۰	-۰.۰۷	۴۵.۹۷۱	روز جاری (۱۱ آبان ۱۴۰۵)
۱,۳۶۳.۸	۴۲.۸	-۰.۱۲	۳۵.۱۴۸	روز گذشته (۱۰ آبان ۱۴۰۵)
+۰.۰۶	-۰.۷۰	+۴۲.۱	+۳۰.۸	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

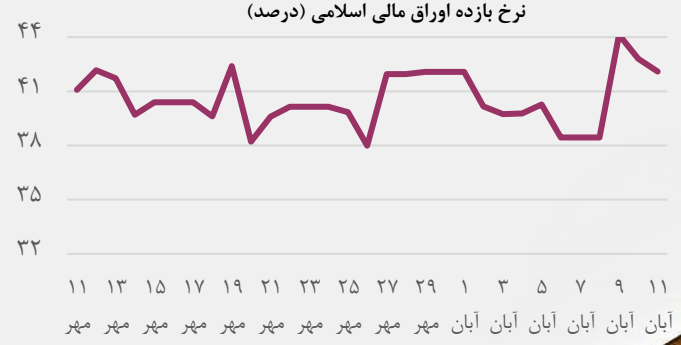
تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

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	
۶۵,۵۴۹	۳۰.۸	۱۶۵,۳۴۴	۲,۱۷۵,۵۴۷	۱,۲۶۲,۶۸۳	۷,۶۴۹,۴۰۹	روز جاری (۱۱ آبان ۱۴۰۵)
۶۵,۲۱۰	۴۲	۱۹۴,۴۸۴	۲,۱۶۵,۹۰۱	۱,۲۶۳,۵۲۴	۷,۶۵۴,۵۰۲	روز گذشته (۱۰ آبان ۱۴۰۵)
+۰.۵۲	-۲۶.۶	-۱۵	+۰.۴۵	-۰.۰۷	-۰.۰۷	تغییرات (درصد)

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

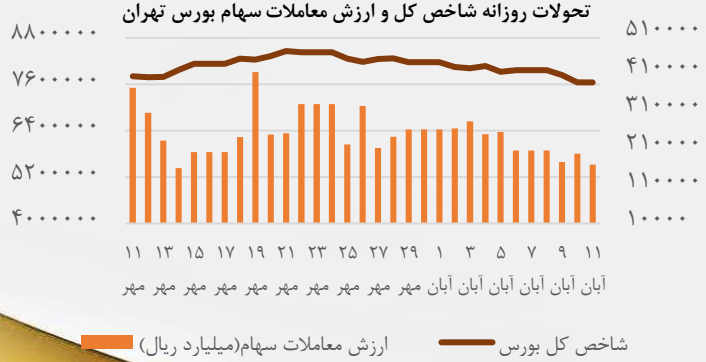
در روز جاری (۱۱ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از دو روز افت متوالی، با کاهش فشار فروش و بهبود نسبی تقاضا همراه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با افت محدود حدود ۰.۰۷ درصدی در محدوده ۷ میلیون و ۶۴۹ هزار واحد قرار گرفت، درحالی‌که شاخص هم‌وزن ۰.۴۵ درصد افزایش یافت. رشد شاخص هم‌وزن و مثبت بودن اکثریت نمادها نشان‌دهنده وضعیت مناسب‌تر سهام کوچک و متوسط در مقایسه با نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بود. همچنین، در روز جاری خروج پول حقیقی نیز از بازار سهام نسبت به روز قبل کاهش یافت.
تعدیل نسبی انتظارات منفی سیاسی و انتشار اخبار مربوط به تداوم رایزنی‌های دیپلماتیک ایران و آمریکا، توانست در کاهش فشار فروش مؤثر باشد. در مجموع، اگرچه معاملات این روز از بهبود نسبی تقاضا و کاهش شدت عرضه‌ها حکایت داشت، اما تداوم خروج پول حقیقی نشان‌دهنده تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

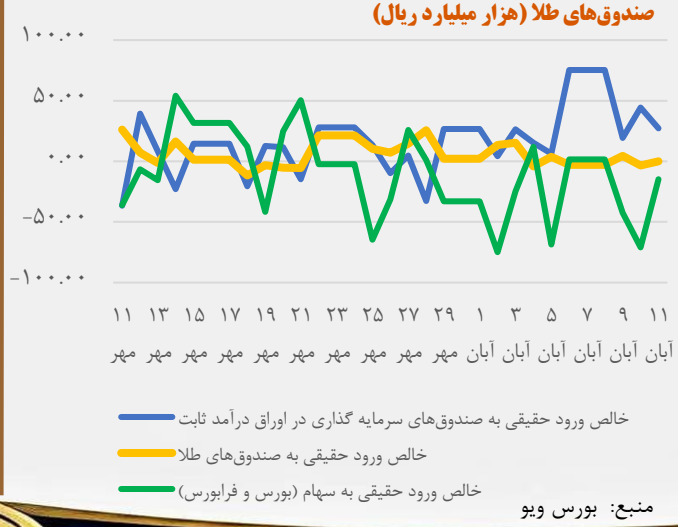


منبع: بورس ویو

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 (۱۱ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۴.۸۱ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۷.۱۸ و ۰.۰۹ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا صورت گرفته 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 ۱۱ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۹۱

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 (۱۱ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۴,۴۰۶	۷۴,۷۷۰	۲۶۸,۴۹۰	۲۶۷,۸۶۵	۱۸۷,۹۱۶	۲۷۲,۰۰۰
روز گذشته (۱۰ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۴,۱۸۶	۷۴,۷۱۰	۲۶۸,۸۹۰	۲۶۸,۸۷۱	۱۸۷,۵۴۱	۲۷۱,۹۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۰۸	+۰.۰۸	-۰.۱۵	-۰.۳۷	+۰.۲۰	+۰.۰۴

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۱۱ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش جزئی ۰۰۴ درصدی همراه شد و در سطح ۲۷۲ 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 تقریباً باثبات بود. ثبات نسبی نرخ دلار در شرایطی رقم خورد که از یک‌سو انتشار اخبار مربوط به تداوم رایزنی‌های دیپلماتیک ایران و آمریکا و احتمال کاهش تنش‌های منطقه‌ای، مانع از شکل‌گیری تقاضای هیجانی شد و از سوی دیگر، تداوم ابهامات سیاسی و نگرانی‌های ژئوپلیتیکی، از افت معنادار نرخ دلار جلوگیری کرد. در مجموع، تقابل انتظارات مثبت سیاسی و ریسک‌های اقتصادی و منطقه‌ای، موجب احتیاط معامله‌گران و تثبیت نسبی دلار در محدوده قیمتی روزهای اخیر 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 (۱۱ آبان ۱۴۰۵)	۵۰.۶	۳۹۴۱.۹	۰.۴۵۹۱	۳.۳۷۲	۲۵۹.۴	۲۵.۸	۲۶۳.۲
روز گذشته (۱۰ آبان ۱۴۰۵)	۴۹.۲	۳۸۸۰.۴	۰.۴۵۵۳	۳.۳۵۸	۲۵۷.۳	۲۵.۶	۲۶۱.۴
تغییرات (درصد)	+۲.۸۶	+۱.۵۹	+۰.۸۲	+۰.۴۲	+۰.۸۱	+۰.۹۲	+۰.۶۹

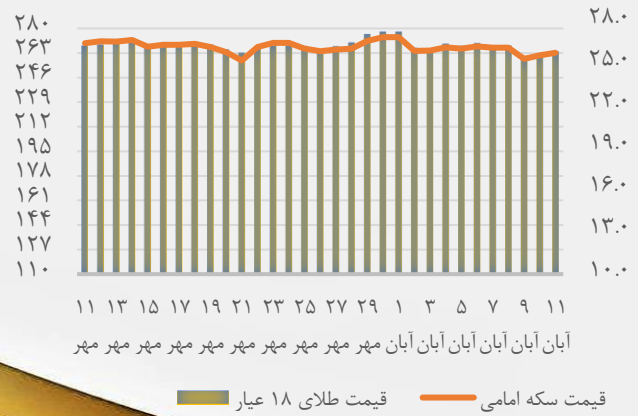
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۱۱ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۶۹ و ۰.۹۲ درصد افزایش داشتند.

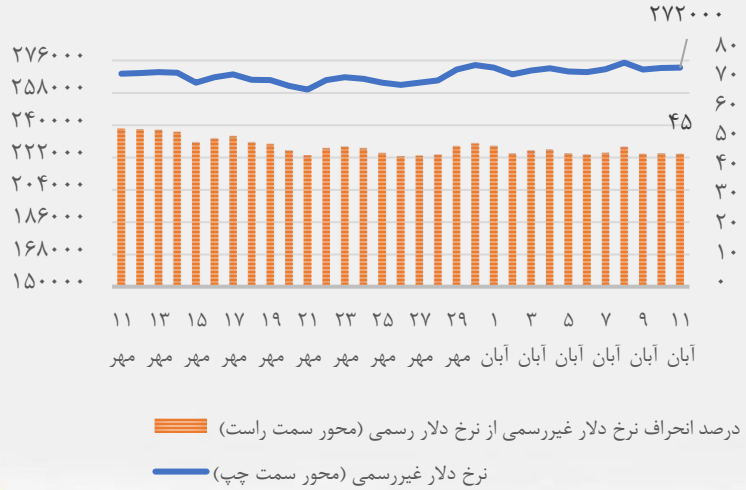
همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

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

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



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



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

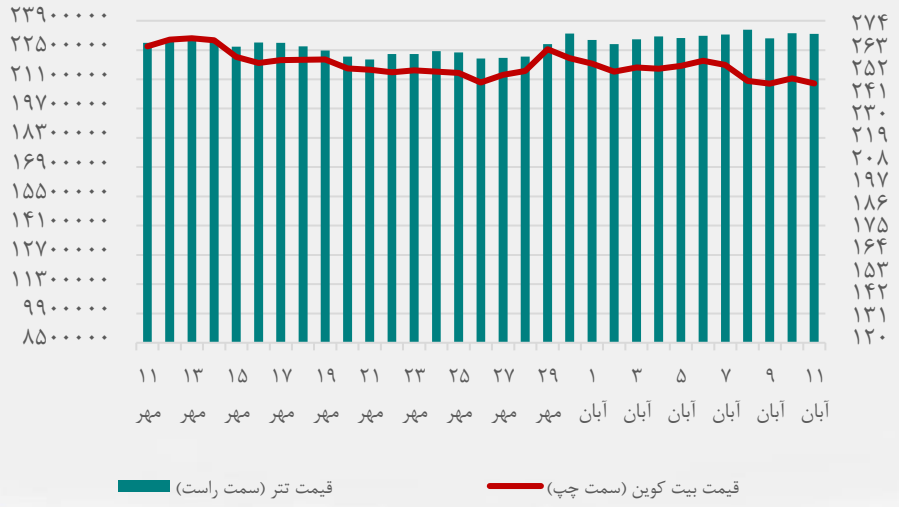
در روز جاری (۱۱ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۲ نوامبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۱.۱۶ و ۰.۳۱ درصدی همراه شدند. تداوم نگرانی‌ها نسبت به امنیت بازار رمزارزها در پی حمله سایبری گسترده به صرافی بایننس و سرقت حدود ۶.۳ میلیارد دلار از دارایی‌های این پلتفرم، از عوامل تضعیف اعتماد سرمایه‌گذاران و افزایش فشار فروش بود. همچنین، خروج حدود ۳۹۸.۶ میلیون دلار سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در آمریکا در همین روز، در کنار خروج قابل‌توجه سرمایه در روزهای معاملاتی قبل، بیانگر تضعیف تقاضای نهادی بود. از سوی دیگر، افزایش تقاضا برای پوشش ریسک در بازار مشتقات و تداوم فضای احتیاط در بازار دارایی‌های پرریسک، بر فشار نزولی قیمت افزود. در مجموع، تشدید نگرانی‌های امنیتی، خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله و تداوم ضعف تمایل سرمایه‌گذاران به پذیرش ریسک، زمینه‌ساز افت قیمت بیت‌کوین در این روز شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش محدود ۰.۱۱ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۷۱ هزار و ۵۰۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۱۱ آبان ۱۴۰۵)	۲۰,۸۹۴	۶۱۱.۳	۲۷۱,۵۰۰
روز گذشته (۱۰ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۱۳۸	۶۱۳.۳	۲۷۱,۸۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۱۶	-۰.۳۱	-۰.۱۱

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