تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۹ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۹

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۹ آبان‌ماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت هم‌زمان با خروج پول حقیقی و افزایش نرخ بهره بدون ریسک، بیانگر تضعیف تقاضا در این بازار و افزایش بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران است.

افزایش نرخ بهره بدون ریسک، از طریق بالا بردن بازدهی دارایی‌های کم‌ریسک، می‌تواند جذابیت نگهداری اوراق بدهی را تحت تأثیر قرار دهد و در صورت تداوم، هزینه فرصت سرمایه‌گذاری در بازار سهام را نیز افزایش دهد.

	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 (۹ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۶۱.۶	۴۴.۱۳	-۰.۱۰	۲۱,۹۲۸
روز گذشته (۶ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۶۰.۸	۳۸.۴۴	۰.۰۶	۶۷,۵۱۲
تغییرات (درصد)	+۰.۰۶	+۵.۶۹	-۲۶۹.۹	-۶۷.۵

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

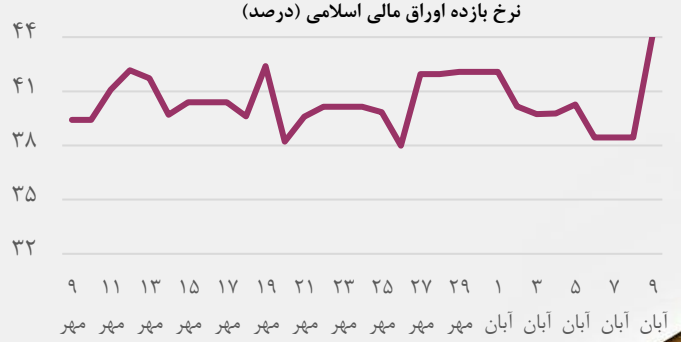
	فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
	شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
روز جاری (۹ آبان ۱۴۰۵)	۶۶,۱۲۸	۴۳.۹	۱۷۲,۰۹۹	۲,۱۹۶,۷۴۱	۱,۲۹۴,۰۲۰	۷,۸۳۹,۲۵۰
روز گذشته (۶ آبان ۱۴۰۵)	۶۶,۳۸۴	۳۹.۳	۲۰۲,۵۱۷	۲,۲۰۹,۷۴۶	۱,۳۱۵,۱۹۸	۷,۹۶۷,۵۵۱
تغییرات (درصد)	-۰.۳۹	+۱۱.۷	-۱۵	-۰.۵۹	-۱.۶۱	-۱.۶۱

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۹ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران با غلبه عرضه بر تقاضا و افت قابل‌توجه شاخص‌ها مواجه شد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با کاهش ۱.۶۱ درصدی به سطح ۷ میلیون و ۸۳۹ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با افت ۰.۵۹ درصدی به محدوده ۲ میلیون و ۱۹۷ هزار واحد رسید. کاهش بیشتر شاخص کل نسبت به شاخص هم‌وزن بیانگر فشار فروش شدیدتر در نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز بود. همچنین، خروج پول حقیقی از بازار سهام، از تضعیف تقاضا و افزایش احتیاط سرمایه‌گذاران حکایت داشت.

در بعد عوامل اثرگذار، تداوم نااطمینانی‌های سیاسی و ریسک‌های ژئوپلیتیکی منطقه، در کنار ابهامات سیاست‌گذاری در صنایع بزرگ، به‌ویژه پالایشی و پتروشیمی، بر انتظارات سرمایه‌گذاران فشار وارد کرد. در همین راستا، اعتراض کانون نهادهای سرمایه‌گذاری به نحوه جدید محاسبه قیمت خوراک و فرآورده‌های نفتی، نشان‌دهنده نگرانی فعالان بازار از افزایش عدم‌قطعیت در برآورد هزینه‌ها و سودآوری شرکت‌های این صنایع بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)


۴۴
۴۱
۳۸
۳۵
۳۲
۹ ۱۱ ۱۳ ۱۵ ۱۷ ۱۹ ۲۱ ۲۳ ۲۵ ۲۷ ۲۹ ۱ ۳ ۵ ۷ ۹
آبان آبان آبان

تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۹ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۹

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 (۹ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۳,۳۰۵	۷۴,۴۷۰	۲۶۷,۳۱۰	۲۶۷,۷۵۴	۱۸۷,۱۶۶	۲۷۰,۹۰۰
روز گذشته (۸ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۷,۲۳۲	۷۵,۵۴۰	۲۷۰,۷۴۰	۲۶۷,۸۹۷	۱۸۶,۷۹۳	۲۷۴,۸۰۰
تغییرات (درصد)	-۱.۴۲	-۱.۴۲	-۱.۲۷	-۰.۰۵	+۰.۲۰	-۱.۴۲

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۹ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۴۲ درصدی همراه شد و در سطح ۲۷۰ هزار و ۹۰۰ 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 همراه شد. این کاهش در شرایطی رخ داد که بازار دلار غیررسمی تحت تأثیر اخبار و تحولات سیاسی مرتبط با روابط ایران و آمریکا قرار داشت. در همین راستا، انتشار گزارش‌هایی درباره تداوم تلاش‌های میانجی‌گرانه قطر برای ازسرگیری مذاکرات تهران و واشنگتن و همچنین بررسی نامه جی‌دی ونس، معاون رئیس‌جمهور آمریکا، در سطوح عالی ایران، تا حدودی انتظارات مثبت نسبت به احتمال کاهش تنش‌ها را تقویت کرد. با این حال، اظهارات عباس عراقچی مبنی بر مشروط بودن ازسرگیری مذاکرات مستقیم به پذیرش مطالبات ایران، در کنار تداوم اختلافات دو طرف و نگرانی‌های امنیتی در منطقه، مانع از شکل‌گیری انتظارات پایدار درباره حصول توافق شد.

تحولات بازار سکه و طلا

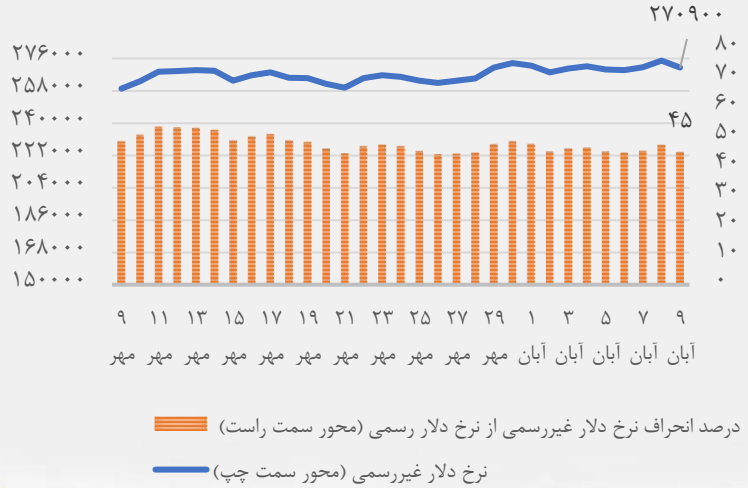
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

	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 (۹ آبان ۱۴۰۵)	۴۹.۲	۳۸۸۰.۴	۰.۴۶۰۶	۳.۳۳۶	۲۵۶.۱	۲۵.۲	۲۵۹
روز گذشته (۸ آبان ۱۴۰۵)	۴۹.۲	۳۸۸۰.۴	۰.۴۸۷۰	۳.۴۵۹	۲۶۴.۵	۲۶.۲	۲۶۶.۸
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	-۵.۴۲	-۳.۵۶	-۳.۱۷	-۳.۷۸	-۲.۹۲

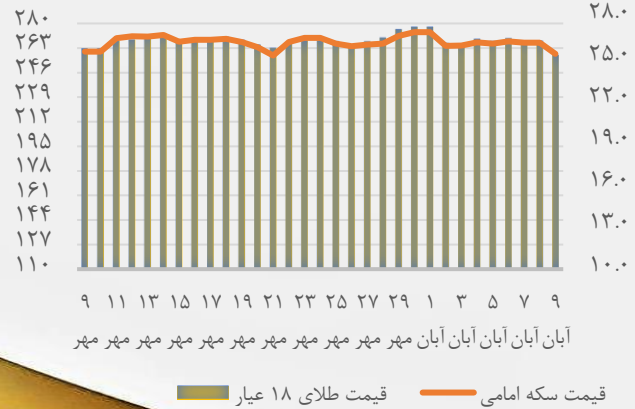
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۹ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۲.۹۲ و ۳.۷۸ 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 دلار در بازار غیررسمی با وجود ثبات قیمت جهانی اونس طلا، نقش مهمی در کاهش 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)



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

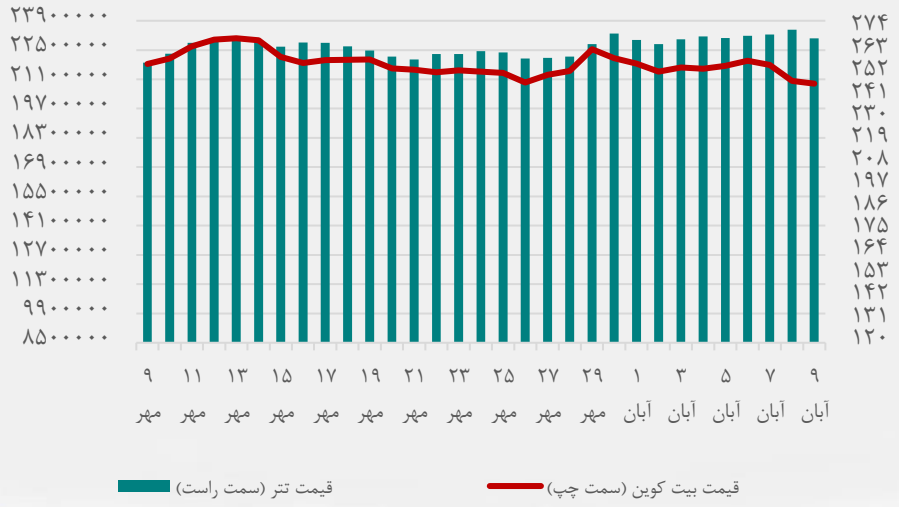
در روز جاری (۹ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۳۱ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۶۶ و ۰.۹۲ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت جهانی بیت‌کوین با افزایش محدود همراه شد؛ با این حال، قیمت ریالی آن به دلیل کاهش نرخ تتر، روند نزولی داشت. در بازار جهانی، تداوم خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین، تشدید نگرانی‌ها نسبت به امنیت بازار رمزارزها در پی اخبار مربوط به صرافی باینانس و افزایش لیکویید شدن موقعیت‌های اهرمی، از مهم‌ترین عوامل محدودکننده تقاضا بودند. همچنین، افت سهام شرکت‌های فناوری و افزایش احتیاط سرمایه‌گذاران در مواجهه با دارایی‌های ریسک‌پذیر، بر فضای معاملاتی این بازار اثر منفی گذاشت. در مجموع، با وجود بهبود جزئی قیمت جهانی بیت‌کوین، کاهش نرخ تتر موجب افت ارزش ریالی این رمزارز شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۵۴ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۹ هزار و ۳۰۰ تومان تنزل کرد.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۹ آبان ۱۴۰۵)	۲۰,۸۹۲	۶۰۷.۳	۲۶۹,۳۰۰
روز گذشته (۸ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۰۳۱	۶۱۲.۹	۲۷۳,۵۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۶۶	-۰.۹۲	-۱.۵۴

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