تحولات بازارهای مالی در روز چهارشنبه مورخ ۶ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۸

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵، افزایش ورود پول حقیقی و افت نرخ بهره بدون ریسک، بیانگر بهبود نسبی تقاضا در این بازار بود. کاهش نرخ بهره بدون ریسک را می‌توان نشانه‌ای از افزایش قیمت اوراق بدهی و کاهش بازده مورد انتظار آن‌ها دانست.

همچنین افزایش ورود نقدینگی حقیقی، با وجود افت ارزش معاملات، نشان می‌دهد که تمایل سرمایه‌گذاران به نگهداری اوراق درآمد ثابت تقویت شده است. در مجموع، کاهش نرخ بهره بدون ریسک می‌تواند از طریق کاهش نرخ تنزیل جریان‌های نقدی و تعدیل بازده مورد انتظار دارایی‌های کم‌ریسک، در صورت تداوم، زمینه را برای بهبود نسبی جذابیت بازار سهام فراهم 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)	
۱,۳۵۸.۹	۳۸.۴۴	۰.۰۶	۶۷,۵۱۲	روز جاری (۶ آبان ۱۴۰۵)
۱,۳۵۸.۹	۴۰.۲۷	۰.۰۲	۴۶۱,۸۰۹	روز گذشته (۵ آبان ۱۴۰۵)
۰.۰	-۱.۸۳	+۲۲۸	-۸۵.۴	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	
۶۶,۳۸۴	۳۹.۳۲	۲۰۲,۵۱۷	۲,۲۰۹,۷۴۶	۱,۳۱۵,۱۹۸	۷,۹۶۷,۵۵۱	روز جاری (۶ آبان ۱۴۰۵)
۶۵,۹۹۳	۵۲.۲۰	۲۵۱,۹۸۰	۲,۲۰۲,۷۴۵	۱,۳۰۸,۵۵۹	۷,۹۲۷,۳۳۱	روز گذشته (۵ آبان ۱۴۰۵)
+۰.۵۹	-۲۴.۷	-۲۰	+۰.۳۲	+۰.۵۱	+۰.۵۱	تغییرات (درصد)

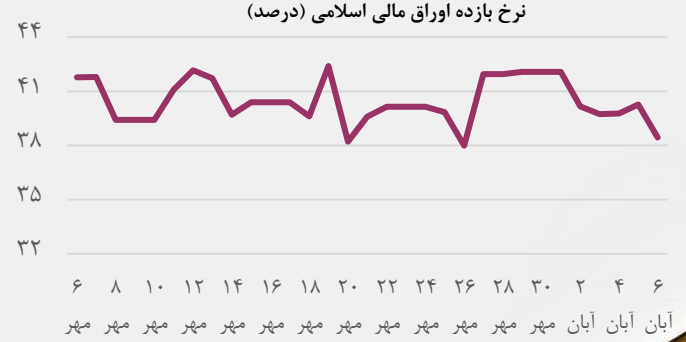
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۶ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران پس از افت قابل‌توجه شاخص کل در ابتدای معاملات، با تقویت تدریجی تقاضا تغییر مسیر داد و در پایان روز با رشد ۰.۵۱ درصدی شاخص کل و افزایش ۰.۳۲ درصدی شاخص هم‌وزن همراه شد.

افزایش تعداد نمادهای مثبت و برتری ارزش سفارش‌های خرید نسبت به فروش، بیانگر بهبود نسبی تقاضا و کاهش فشار فروش در بازار بود.

در مجموع، رشد این روز را می‌توان نشانه‌ای از بهبود کوتاه‌مدت معاملات پس از افت‌های اخیر ارزیابی کرد. بااین‌حال، تداوم روند صعودی به تقویت جریان نقدینگی حقیقی و کاهش نااطمینانی‌های سیاسی و اقتصادی وابسته خواهد بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

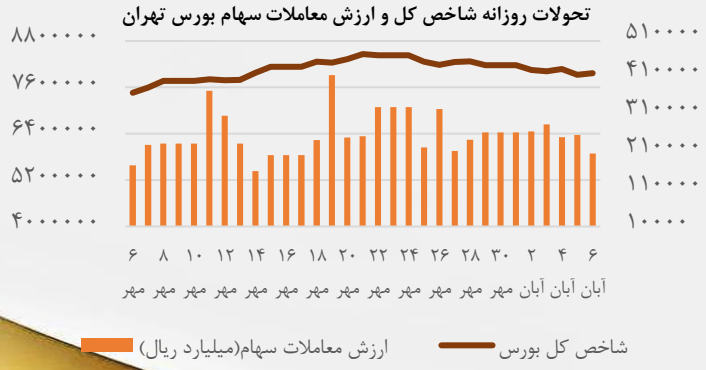
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۱.۴۸ و ۷۵.۳۲ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) و صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) صورت گرفته است. این درحالی است که حدود ۲.۹۷ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.

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 ۶ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۸

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 (۶ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۱,۸۷۴	۷۴,۰۸۰	۲۶۷,۸۱۰	۲۶۷,۹۰۸	۱۸۶,۴۲۰	۲۶۹,۵۰۰
روز گذشته (۵ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۲,۱۶۷	۷۴,۱۶۰	۲۶۶,۳۱۰	۲۶۵,۲۹۹	۱۸۶,۰۴۸	۲۶۹,۸۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۱۱	-۰.۱۱	+۰.۵۶	+۰.۹۸	+۰.۲۰	-۰.۱۱

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۱۱ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۹ هزار و ۵۰۰ 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 نوسان محدود و تمایل به کاهش همراه بود و با افت حدود ۳۰۰ تومانی نسبت به روز گذشته، در محدوده ۲۶۹ هزار تومان قرار گرفت. از منظر سیاسی، انتشار اخبار مربوط به تلاش میانجی‌گران قطری برای تسهیل مذاکرات میان ایران و آمریکا، با وجود تداوم ابهام در چشم‌انداز دیپلماسی، تا حدودی از انتظارات افزایشی در بازار ارز کاست. در کنار این موضوع، عرضه دلار از سوی بازارساز نیز از عوامل محدودکننده رشد قیمت دلار بود. در مجموع، ثبات نسبی و تمایل نزولی دلار در این روز را می‌توان به اثرگذاری انتظارات ناشی از تحولات دیپلماتیک نسبت داد.

تحولات بازار سکه و طلا

تحولات بازار سکه، طلا و نقره

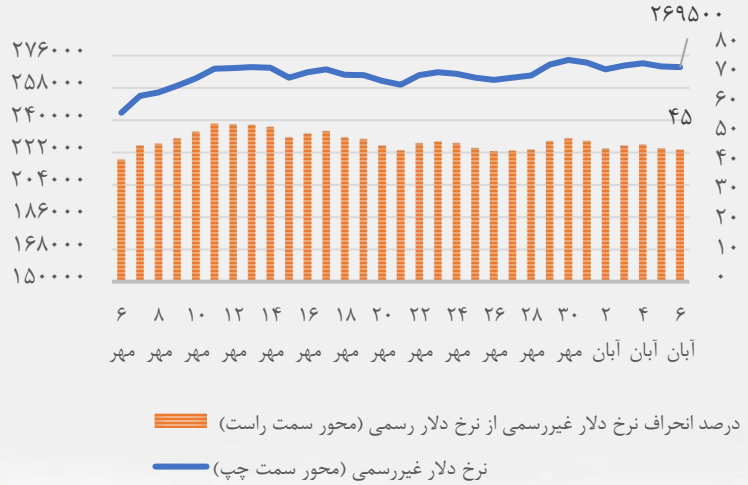
	قیمت (میلیون تومان/ دلار)						
	اونس نقره (دلار)	اونس طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۶ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۹	۴۰۵۷.۷	۰.۴۸۸۸	۳.۴۵۴	۲۶۴.۷	۲۶.۴	۲۶۷.۷
روز گذشته (۵ آبان ۱۴۰۵)	۵۴.۴	۴۰۵۹.۱	۰.۴۷۹۳	۳.۴۵۲	۲۶۵.۳	۲۶.۲	۲۶۶
تغییرات (درصد)	-۱.۰۴	-۰.۰۳	+۱.۹۷	+۰.۰۶	-۰.۲۶	+۰.۷۷	+۰.۶۴

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

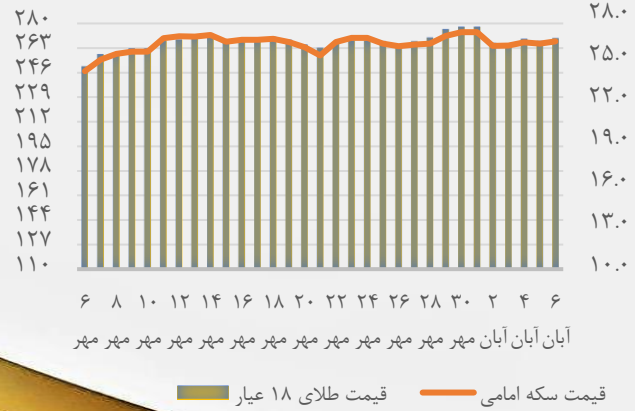
در روز جاری (۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۶۴ و ۰.۷۷ درصد افزایش داشتند.

با توجه به محدود بودن تغییرات دو متغیر اصلی اثرگذار بر قیمت طلا، به نظر می‌رسد تحرکات تقاضای داخلی، تغییرات حباب قیمتی سکه و انتظارات معامله‌گران در افزایش قیمت دارایی‌های مذکور نقش داشته‌اند.

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

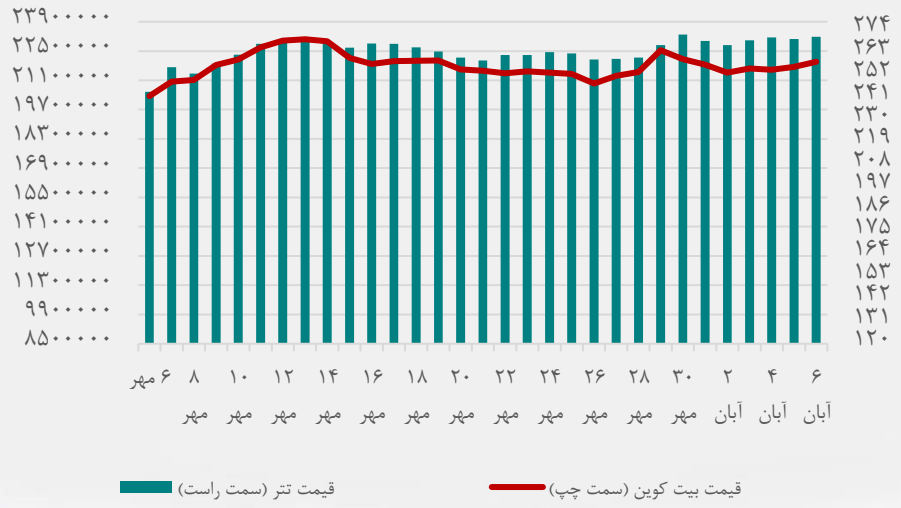
در روز جاری (۶ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۸ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۱.۰۷ و ۱.۱۵ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس داده‌های تاریخی Investing، با رشد حدود ۰.۵۷ درصدی به ۸۱.۴ هزار دلار رسید. از منظر عوامل اثرگذار، مهم‌ترین محرک رشد بیت‌کوین در این روز، بهبود نسبی فضای ریسک‌پذیری در بازارهای جهانی و افزایش تقاضا برای دارایی‌های پرریسک بود. رشد سهام شرکت‌های فناوری و تراشه‌سازی، به‌ویژه در پی انتشار عملکرد مالی مطلوب شرکت کره‌ای SK Hynix، به تقویت تمایل سرمایه‌گذاران به دارایی‌های ریسک‌پذیر کمک کرد. همچنین، تصمیم فدرال رزرو آمریکا برای تثبیت نرخ بهره در محدوده ۳.۷۵ تا ۴ درصد، مطابق انتظارات بازار، از عوامل حمایت‌کننده قیمت بیت‌کوین بود. بااین‌حال، تأکید فدرال رزرو بر تداوم تورم بالا و مخالفت دو عضو این نهاد با تثبیت نرخ بهره و ترجیح افزایش ۰.۲۵ واحد درصدی آن، مانع از تقویت بیشتر قیمت شد. از سوی دیگر، افزایش قیمت نفت و نگرانی‌ها درباره محدودیت عرضه انرژی نیز بر رشد دارایی‌های پرریسک فشار وارد کرد. در مجموع، افزایش محدود قیمت بیت‌کوین در ۶ آبان را می‌توان حاصل بهبود نسبی اشتهای ریسک در بازارهای جهانی و تثبیت نرخ بهره آمریکا دانست. بااین‌حال، تداوم نگرانی‌ها درباره تورم و احتمال اتخاذ سیاست پولی انقباضی در ماه‌های آتی، همچنان از عوامل محدودکننده رشد این رمزارز محسوب شد.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۴۱ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۷۰ هزار و ۵۰۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)			
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۶ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۹۸۱	۶۳۹.۳	۲۷۰,۵۰۰
روز گذشته (۵ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۷۴۸	۶۳۲	۲۶۹,۴۰۰
تغییرات (درصد)	+۱.۰۷	+۱.۱۵	+۰.۴۱

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