تحولات بازارهای مالی در روز سه شنبه مورخ ۵ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۷

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۵ آبان‌ماه ۱۴۰۵، افزایش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت، ورود پول حقیقی و رشد نرخ بهره بدون ریسک، بیانگر افزایش توجه سرمایه‌گذاران به ابزارهای درآمد ثابت بود. در شرایط افت بورس، ورود نقدینگی حقیقی به این بازار می‌تواند نشان‌دهنده تمایل بخشی از سرمایه‌گذاران به حفظ سرمایه و کسب بازدهی قابل‌پیش‌بینی‌تر باشد. همچنین، افزایش نرخ بهره بدون ریسک با بالا رفتن بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران همراه است و می‌تواند از طریق افزایش هزینه فرصت سرمایه‌گذاری، جذابیت نسبی سهام را کاهش 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 (۵ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۵۸.۹	۴۰.۲۷	۰.۰۲	۴۶۱.۸۰۹
روز گذشته (۴ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۵۸.۸	۳۹.۷۸	-۰.۹۲۸	۳۹.۹۵۸
تغییرات (درصد)	+۰.۰۱	+۰.۴۹	+۱۰۱.۹	+۱,۰۵۵.۷

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

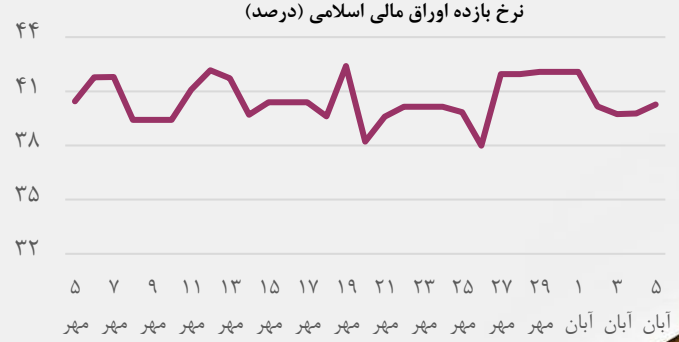
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی- ارزشی)	شاخص کل
۶۵,۹۹۳	۵۲.۲۰	۲۵۱,۹۸۰	۲,۲۰۲,۷۴۵	۱,۳۰۸,۵۵۹	۷,۹۲۷,۳۳۱
۶۶,۹۴۰	۴۷.۳۸	۲۴۵,۸۶۹	۲,۲۲۹,۵۷۰	۱,۳۳۲,۰۷۵	۸,۰۶۹,۷۸۸
-۱.۴۱	+۱۰.۲	+۲	-۱.۲۰	-۱.۷۷	-۱.۷۷

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۵ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران تحت تأثیر افزایش فشار فروش، روندی نزولی را تجربه کرد؛ به‌طوری‌که شاخص کل با افت ۱.۷۷ درصدی به ۷ میلیون و ۹۲۷ هزار واحد رسید و مجدداً به زیر سطح روانی ۸ میلیون واحد عقب‌نشینی کرد. هم‌زمان، شاخص کل هم‌وزن نیز حدود ۱.۲ درصد کاهش یافت و منفی بودن بخش عمده نمادهای معاملاتی، از گستردگی فشار عرضه در بازار حکایت داشت.

همچنین، خروج پول حقیقی از سهام و صندوق‌های سهامی، بیانگر تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران و تضعیف تقاضای مؤثر بود. در مجموع، با وجود ظرفیت حمایتی گزارش‌های بنیادی شرکت‌ها، غلبه نگرانی‌های سیاسی و ابهام در چشم‌انداز اقتصادی، در کنار خروج نقدینگی حقیقی، مانع از پایداری تقاضا شد و بازار را در مسیر نزولی قرار داد.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

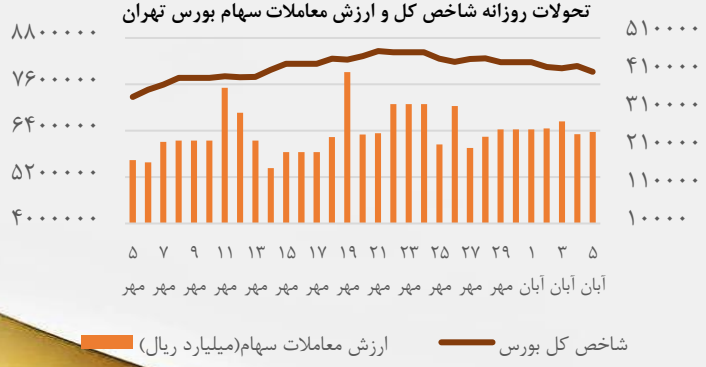
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



لازم به توجه است که در روز جاری (۵ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۶۸.۶۳ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران) اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۶.۳۵ و ۳.۸۳ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا صورت گرفته 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 سه شنبه مورخ ۵ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۷

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 (۵ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۲,۱۶۷	۷۴,۱۶۰	۲۶۶,۳۱۰	۲۶۵,۲۹۹	۱۸۶,۰۴۸	۲۶۹,۸۰۰
روز گذشته (۴ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۴,۱۱۲	۷۴,۶۹۰	۲۶۹,۴۹۰	۲۶۴,۹۸۹	۱۸۵,۶۷۷	۲۷۱,۷۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۷۱	-۰.۷۱	-۱.۱۸	+۰.۱۲	+۰.۲۰	-۰.۷۰

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۵ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۷ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۹ هزار و ۸۰۰ 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 روندی نزولی همراه شد. این کاهش در شرایطی رخ داد که گمانه‌زنی‌ها درباره تلاش‌های دیپلماتیک قطر برای میانجی‌گری میان ایران و آمریکا و طرح پیشنهادی برای کاهش تنش‌ها، امیدواری‌هایی نسبت به بهبود فضای سیاسی ایجاد کرده بود. همچنین، تداوم رایزنی‌های قطر و تحولات دیپلماتیک منطقه، از جمله اخبار مورد توجه معامله‌گران بود. در مقابل، ابهام درباره نتیجه مذاکرات و تداوم ریسک‌های ژئوپلیتیکی مانع از شکل‌گیری اطمینان پایدار در بازار شد. در مجموع، افت دلار را می‌توان بازتاب تعدیل نسبی انتظارات افزایشی در پی انتشار اخبار دیپلماتیک ارزیابی کرد؛ هرچند تداوم این روند به پیشرفت عملی مذاکرات و وضعیت عرضه و تقاضای دلار وابسته است.

تحولات بازار سکه و طلا

تحولات بازار سکه، طلا و نقره

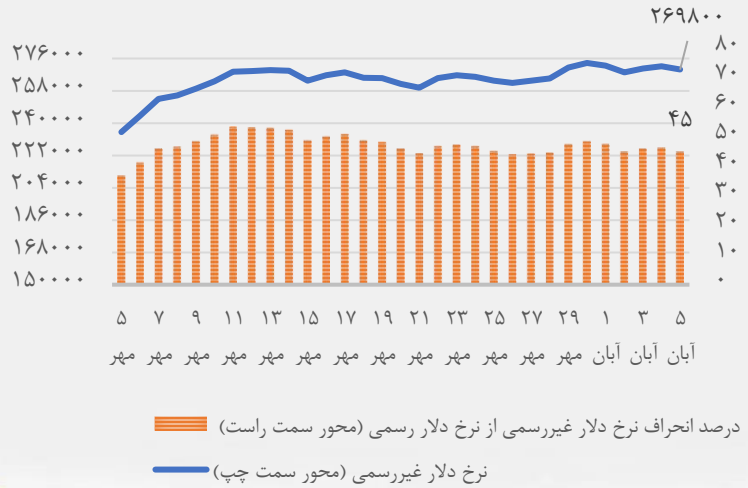
	قیمت (میلیون تومان/ دلار)						
	اونس نقره (دلار)	اونس طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۵ آبان ۱۴۰۵)	۵۴.۴	۴۰۵۹.۱	۰.۴۷۹۳	۳.۴۵۲	۲۶۵.۳	۲۶.۲	۲۶۶
روز گذشته (۴ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۹	۴۰۱۲.۷	۰.۴۸۳۹	۳.۴۹۸	۲۶۶.۸	۲۶.۴	۲۶۷
تغییرات (درصد)	+۰.۹۸	+۱.۱۶	-۰.۹۴	-۱.۳۲	-۰.۵۶	-۰.۵۹	-۰.۳۹

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

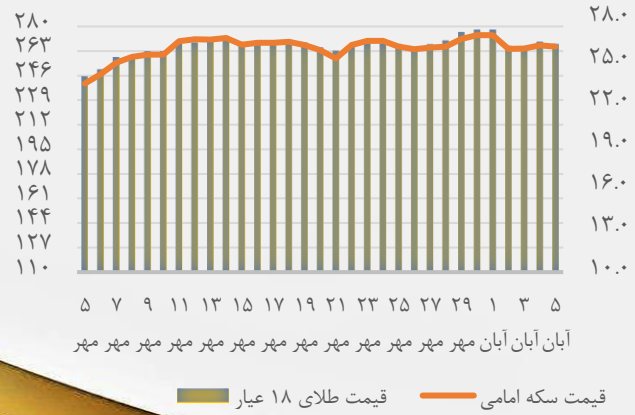
در روز جاری (۵ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۳۹ و ۰.۵۹ درصد کاهش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

با وجود افزایش قیمت جهانی اونس طلا، لیکن کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی در کنار تعدیل انتظارات سیاسی، 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

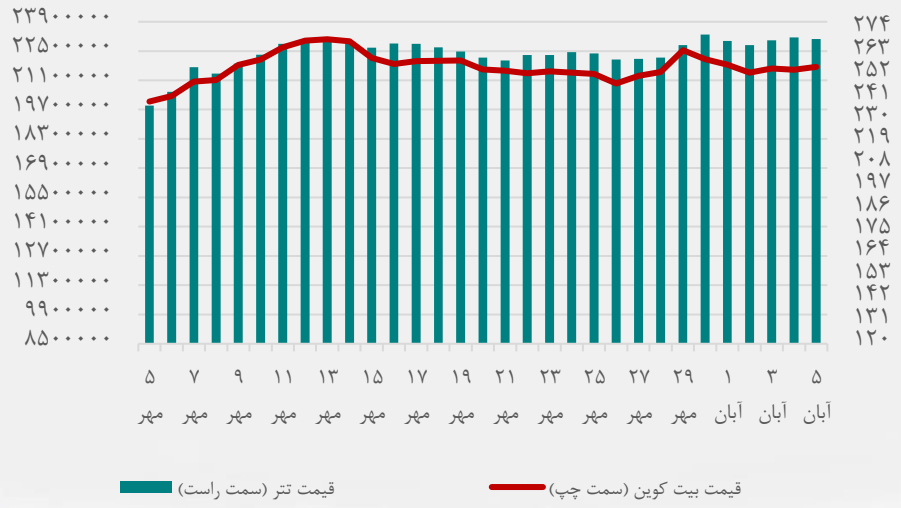
در روز جاری (۵ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۷ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۶۹ و ۰.۹۸ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس داده‌های تاریخی Investing، در محدوده ۷۹ تا ۸۱ هزار دلار معامله شده و قیمت پایانی آن حدود ۸۰.۹ هزار دلار بوده است؛ این رقم نسبت به روز قبل حدود ۰.۹۶ درصد افزایش داشت. مهم‌ترین عامل اثرگذار بر معاملات این روز، انتظار برای تصمیم فدرال رزرو آمریکا درباره نرخ بهره بود. نگرانی از تداوم سیاست پولی انقباضی و احتمال افزایش نرخ‌ها در ماه‌های بعد، جذابیت دارایی‌های پرریسک را تحت فشار قرار داده بود. بااین‌حال، کاهش قیمت نفت و بهبود نسبی فضای ریسک‌پذیری در بازارهای جهانی، این نگرانی نسبت به تداوم سیاست‌های انقباضی فدرال رزرو را کاهش داد و به بازیابی قیمت بیت‌کوین از کف روزانه کمک کرد. این رفتار نشان‌دهنده تقابل تقاضای حمایتی و نگرانی سرمایه‌گذاران از مسیر سیاست پولی آمریکا بود؛ بنابراین، تداوم روند صعودی به کاهش نااطمینانی‌های اقتصاد کلان و تقویت جریان سرمایه‌گذاری در بازار رمزارزها وابسته بود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۳۳ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۹ هزار و ۴۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۵ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۷۴۸	۶۳۲	۲۶۹,۴۰۰
روز گذشته (۴ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۵۹۸	۶۲۵.۹	۲۷۰,۳۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۶۹	+۰.۹۸	−۰.۳۳

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