تحولات بازارهای مالی در روز دوشنبه مورخ ۴ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۶

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

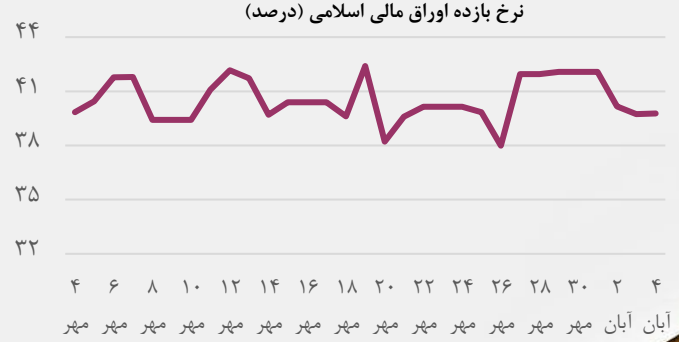
در معاملات ۴ آبان‌ماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت هم‌زمان با افزایش خروج پول حقیقی و ثبات نسبی نرخ بهره بدون ریسک، بیانگر کاهش رمق نسبی بازار اوراق بدهی در روز جاری بود.

افزایش خروج پول حقیقی می‌تواند ناشی از تغییر ترجیحات سرمایه‌گذاران و جابه‌جایی منابع میان ابزارهای مالی باشد؛ با این حال، با توجه به ثبات نسبی نرخ بهره، نمی‌توان این رفتار را صرفاً به تغییر بازدهی اوراق نسبت داد.

	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 (۴ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۵۸	۳۹.۷۸	-۰.۹۲۸	۳۹,۹۵۸
روز گذشته (۳ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۵۸	۳۹.۷۴	-۰.۶۳۱	۵۰,۷۲۱
تغییرات (درصد)	۰.۰	+۰.۰۴	-۴۷.۱	-۲۱.۲

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
روز جاری (۴ آبان ۱۴۰۵)	۶۶,۹۴۰	۴۷.۳۸	۲۴۵,۸۶۹	۲,۲۲۹,۵۷۰	۱,۳۳۲,۰۷۵	۸,۰۶۹,۷۸۸
روز گذشته (۳ آبان ۱۴۰۵)	۶۷,۱۱۶	۷۱.۶۶	۲۷۹,۳۶۳	۲,۲۳۳,۵۳۶	۱,۳۲۳,۱۲۱	۸,۰۱۵,۵۴۶
تغییرات (درصد)	-۰.۲۶	-۳۳.۹	-۱۲	-۰.۱۸	+۰.۶۸	+۰.۶۸

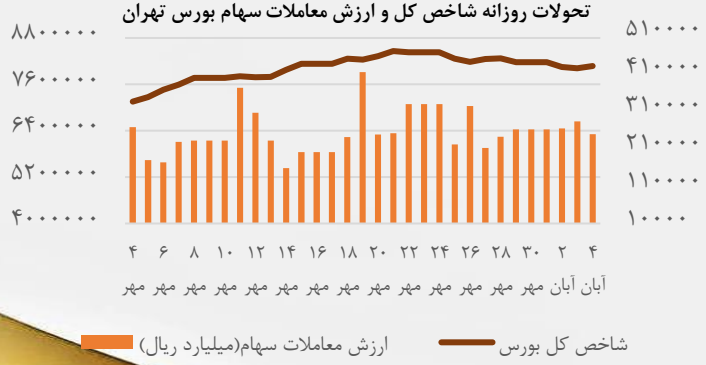
منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۴ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران تحت تأثیر بازگشت تقاضا پس از افت معاملات روزهای قبل و حمایت نمادهای بزرگ بازار، صعودی شد. به‌طوری‌که شاخص کل با رشد ۰.۶۸ درصدی به ۸ میلیون و ۷۰ هزار واحد رسید، در حالی که شاخص هم‌وزن ۰.۱۸ درصد کاهش یافت. در این میان، نمادهای «فملی» و «فارس» بیشترین اثر مثبت را بر شاخص داشتند.

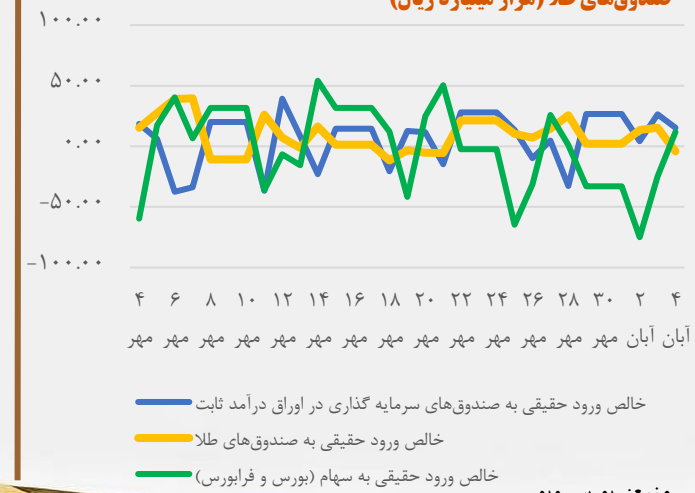
همچنین، ورود پول حقیقی به بازار سهام، از افزایش تمایل بخشی از سرمایه‌گذاران به پذیرش ریسک در این بازار حکایت داشت. با این حال، تداوم نااطمینانی‌های سیاسی و منطقه‌ای، در کنار اهمیت ارزندگی سهام و چشم‌انداز سودآوری شرکت‌ها، همچنان بر رفتار معامله‌گران اثرگذار بود.

در مجموع، با وجود بهبود تقاضا و رشد شاخص کل، افت شاخص هم‌وزن نشان داد که این روند هنوز فراگیر نشده و پایداری آن به کاهش ریسک‌های سیاسی، تداوم ورود نقدینگی و تقویت تقاضا در طیف گسترده‌تری از نمادها وابسته 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)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۴ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۱۲ و ۱۵.۲۱ 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 ۴.۲۴ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از صندوق‌های طلا اتفاق افتاده است.

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 ۴ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۶

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 (۴ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۴,۱۱۲	۷۴,۶۹۰	۲۶۹,۴۹۰	۲۶۴,۹۸۹	۱۸۵,۶۷۷	۲۷۱,۷۰۰
روز گذشته (۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۲,۹۰۱	۷۴,۳۶۰	۲۶۷,۶۹۰	۲۶۵,۹۵۳	۱۸۵,۳۰۶	۲۷۰,۴۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۴۴	+۰.۴۴	+۰.۶۷	-۰.۳۶	+۰.۲۰	+۰.۴۸

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۴ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۴۸ درصدی همراه شد و در سطح ۲۷۱ هزار و ۷۰۰ 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 یافت و مجدداً وارد محدوده ۲۷۰ هزار تومان شد. مهم‌ترین عوامل مطرح‌شده در اخبار همان روز، افزایش نگرانی‌ها از تشدید تنش‌های سیاسی و نظامی منطقه، اخباری درباره درگیری در تنگه هرمز و تقویت تقاضای احتیاطی برای دلار بود. در مقابل، تحرکات دیپلماتیک منطقه‌ای نیز انتظاراتی درباره امکان کاهش تنش‌ها ایجاد کرده بود، اما این اخبار در معاملات آن روز مانع رشد نرخ دلار نشدند. در کنار ریسک‌های ژئوپلیتیکی، انتظارات تورمی و وضعیت عرضه دلار نیز از عوامل مؤثر بر رفتار معامله‌گران بودند.

تحولات بازار سکه و طلا

تحولات بازار سکه، طلا و نقره

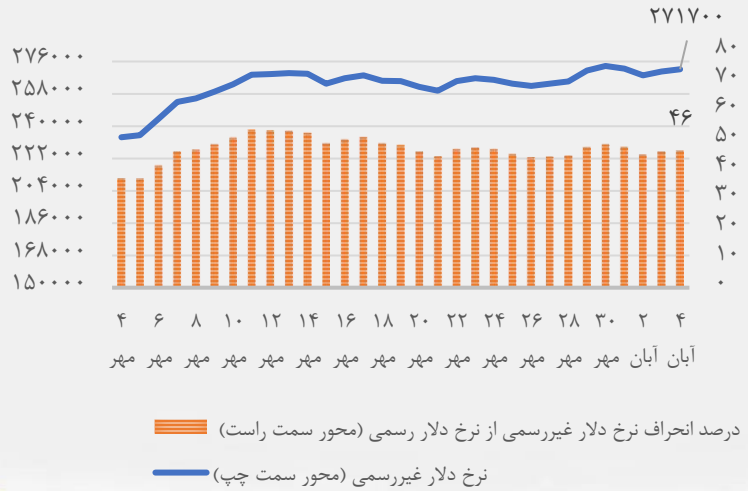
	قیمت (میلیون تومان / دلار)						
	اونس نقره (دلار)	اونس طلا (دلار)	گواهی سپرده شمش نقره	گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده سکه	طلای ۱۸ عیار	سکه امامی
روز جاری (۴ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۸۹	۴۰۱۲.۷	۰.۴۸۳۹	۳.۴۹۸	۲۶۶.۸۳	۲۶.۳۶	۲۶۷
روز گذشته (۳ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۹۲	۳۹۹۷.۳	۰.۴۸۵۷	۳.۴۵۵	۲۶۴.۱۱	۲۵.۹۹	۲۶۴.۷۴
تغییرات (درصد)	-۰.۰۴	+۰.۳۸	-۰.۳۷	+۱.۲۵	+۱.۰۳	+۱.۴۲	+۰.۸۶

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

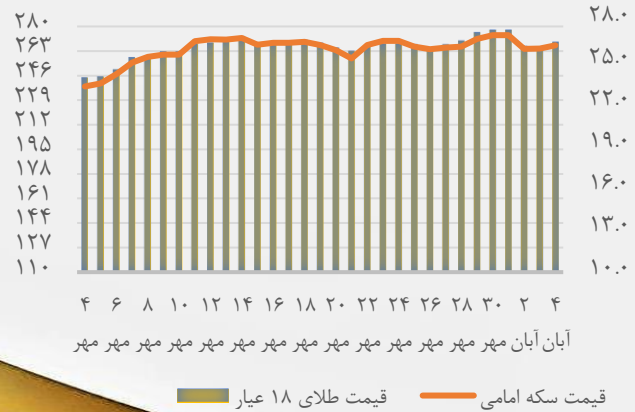
در روز جاری (۴ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۰.۸۶ و ۱.۴۲ درصد افزایش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند.

به نظر می‌رسد، افزایش قیمت دلار در بازار غیررسمی در کنار قیمت جهانی اونس طلا، نقش مهمی در افزایش 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 (۴ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۶ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۰.۲۹ و ۰.۹۶ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی براساس داده‌های تاریخی Investing، کاهش جزئی یافت. این افت در ادامه فشار فروش روزهای قبل و کاهش قیمت بیت‌کوین از محدوده ۸۴ هزار دلار در ۲۱ اکتبر رخ داد. عامل اصلی افت بیت‌کوین، تداوم فضای احتیاط در بازارهای جهانی بود. افزایش قیمت نفت و نگرانی از تداوم فشارهای تورمی، در کنار انتظار برای نشست بانک‌های مرکزی بزرگ و احتمال اتخاذ مواضع انقباضی‌تر در سیاست پولی، تمایل سرمایه‌گذاران به دارایی‌های پرریسک را کاهش داد. همچنین، افت سهام شرکت‌های فناوری در روزهای قبل بر فضای عمومی بازار دارایی‌های دیجیتال فشار وارد کرد.

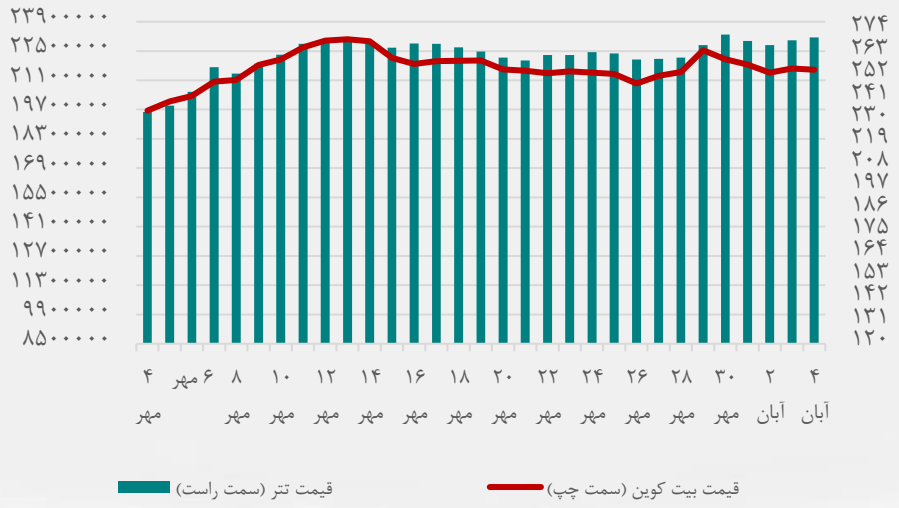
شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۵۲ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۷۰ هزار و ۳۰۰ تومان رسید.

قیمت (میلیون تومان / تومان)

	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومان)	تتر (تومان)
روز جاری (۴ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۵۹۸	۶۲۵.۹	۲۷۰,۳۰۰
روز گذشته (۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۶۶۱	۶۳۲	۲۶۸,۹۰۰
تغییرات (درصد)	-۰.۲۹	-۰.۹۶	+۰.۵۲

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