تحولات بازارهای مالی در روز یکشنبه مورخ ۳ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۵

تحولات بازار سرمایه

تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵، کاهش ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت هم‌زمان با افزایش خروج پول حقیقی و افت نرخ بازده بدون ریسک همراه شد. این وضعیت بیانگر کاهش تحرک معاملاتی و تداوم خروج نقدینگی حقیقی از بازار اوراق بدهی بود. همچنین، کاهش نرخ بازده اوراق با افزایش قیمت آن‌ها در بازار ثانویه همراه است. ازاین‌رو، بخشی از سرمایه‌گذاران حقیقی با فروش اوراقی که پیش‌تر خریداری کرده و از محل افزایش قیمت آن‌ها منتفع شده بودند، درصدد شناسایی و ذخیره‌سازی سود برآمدند.

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 (۳ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۵۸	۳۹.۷۴	-۰.۶۳۱	۵۰,۷۲۱
روز گذشته (۲ آبان ۱۴۰۵)	۱,۳۵۶.۶	۴۰.۱۶	-۰.۲۵۳	۱۶۰,۸۴۰
تغییرات (درصد)	+۰.۱۰	-۰.۴۲	-۱۴۹.۲	-۶۸.۵

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

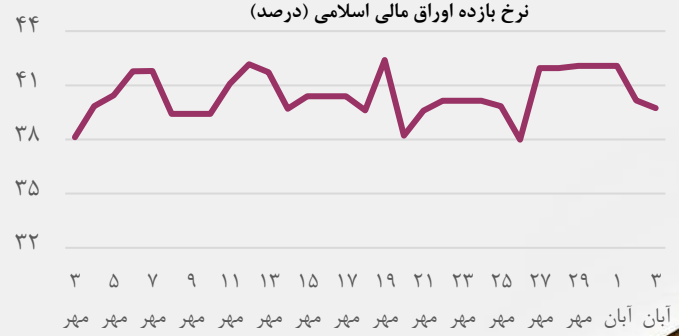
فرابورس ایران	بورس اوراق بهادار تهران				
شاخص کل	حجم معاملات سهام (میلیارد سهم)	ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال)	شاخص کل هم وزن	شاخص قیمت (وزنی-ارزشی)	شاخص کل
۶۷,۱۱۶	۷۱.۶۶	۲۷۹,۳۶۳	۲,۲۳۳,۵۳۶	۱,۳۲۳,۱۲۱	۸,۰۱۵,۵۴۶
۶۷,۰۳۱	۵۴.۰۵	۲۶۰,۵۲۸	۲,۲۳۶,۴۰۵	۱,۳۲۷,۹۲۶	۸,۰۴۴,۶۵۶
+۰.۱۳	+۳۲.۶	+۷	-۰.۱۳	-۰.۳۶	-۰.۳۶

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۳ آبان ۱۴۰۵)، در معاملات بورس تهران، شاخص کل با افت ۰.۳۶ درصدی به حدود ۸ میلیون و ۱۵ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با کاهش ۰.۱۳ درصدی به حدود ۲ میلیون و ۲۳۳ هزار واحد رسید. افت بیشتر شاخص کل در مقایسه با شاخص هم‌وزن نشان داد که فشار فروش در نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز شدت بیشتری داشته است. همچنین، با وجود افزایش ارزش معاملات، خروج پول حقیقی از بازار سهام ثبت شد که بیانگر تداوم احتیاط سرمایه‌گذاران و غلبه نسبی عرضه بر تقاضا بود.

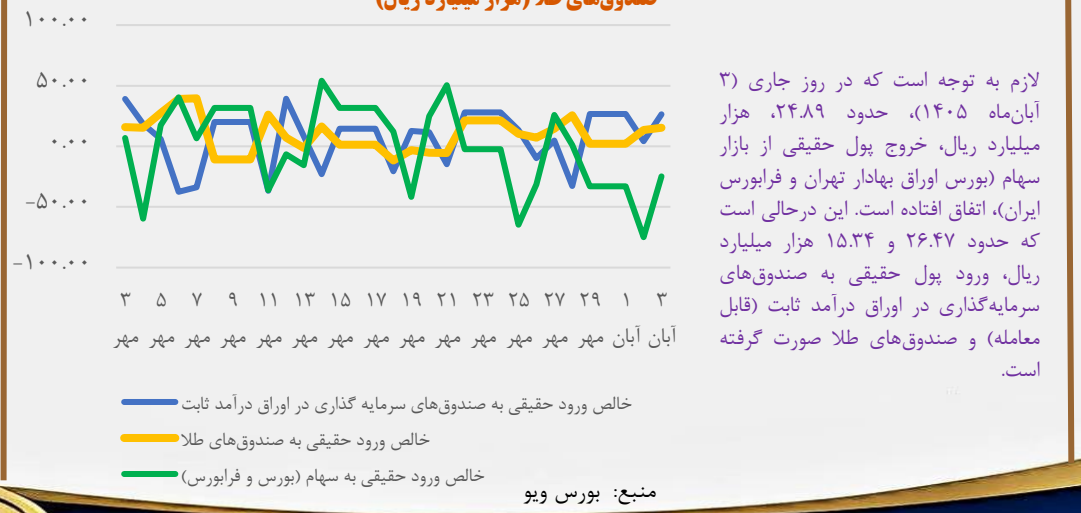
تداوم ریسک‌های سیاسی و تمایل به ذخیره‌سازی سود را می‌توان از عوامل احتمالی احتیاط معامله‌گران در این روز دانست.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)



منبع: بورس ویو

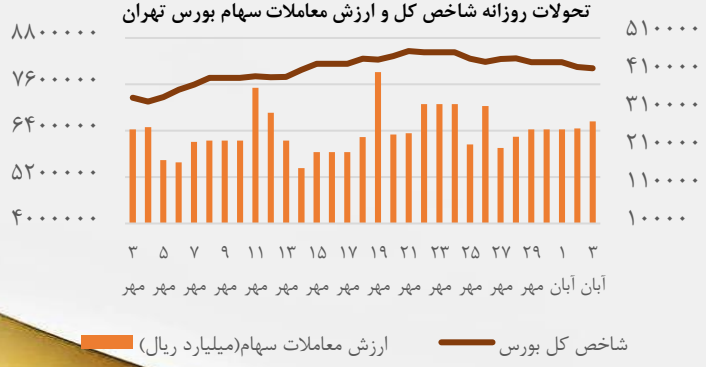
خالص ورود حقیقی به سهام (بورس و فرابورس)، صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت(قابل معامله) و صندوق‌های طلا (هزار میلیارد ریال)



منبع: بورس ویو

لازم به توجه است که در روز جاری (۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۲۴.۸۹ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۲۶.۴۷ و ۱۵.۳۴ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا صورت گرفته 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 یکشنبه مورخ ۳ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۵

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 (۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۲,۹۰۱	۷۴,۳۶۰	۲۶۷,۶۹۰	۲۶۵,۹۵۳	۱۸۵,۳۰۶	۲۷۰,۴۰۰
روز گذشته (۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۷۰,۵۵۲	۷۳,۷۲۰	۲۶۶,۱۹۰	۲۶۲,۲۲۵	۱۸۴,۹۳۶	۲۶۸,۲۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۸۷	+۰.۸۷	+۰.۵۶	+۱.۴۲	+۰.۲۰	+۰.۸۲

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۸۲ درصدی همراه شد و در سطح ۲۷۰ هزار و ۴۰۰ 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 روند صعودی در پیش گرفت و با افزایش حدود ۲ هزار تومانی نسبت به روز گذشته، به محدوده ۲۷۰ هزار تومان رسید. این افزایش در شرایطی رخ داد که انتشار اخباری درباره تلاش کشورهای اروپایی برای پیشبرد تفاهم میان ایران و آمریکا، زمینه تعدیل انتظارات افزایشی را فراهم می‌کرد. بااین‌حال، تداوم ابهامات سیاسی و نگرانی‌های ناشی از تنش‌های منطقه‌ای مانع از شکل‌گیری انتظارات کاهشی پایدار شد. همچنین، تداوم افزایش نرخ حواله دلار در مرکز مبادله ارز و طلای ایران نشان‌دهنده رشد نرخ در بازار رسمی حواله نیز بود. در مجموع، افزایش نرخ دلار در بازار غیررسمی را می‌توان بازتاب تداوم نااطمینانی سیاسی و غلبه عوامل افزایشی بر اثر کاهنده اخبار دیپلماتیک این روز دانست.

تحولات بازار سکه و طلا

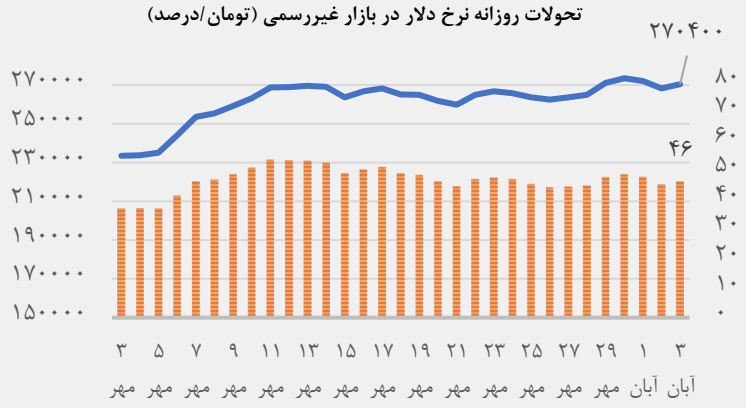
تحولات بازار سکه، طلا و نقره

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 (۳ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۹	۳۹۹۷.۳	۰.۴۸۵۷	۳.۴۵۵	۲۶۴.۱۱	۲۵.۹۹	۲۶۴.۷۴
روز گذشته (۲ آبان ۱۴۰۵)	۵۳.۹	۳,۹۹۷.۳	۰.۴۸۴۱	۳.۴۶۰	۲۶۴.۲۱	۲۶.۰۶	۲۶۴.۴۶
تغییرات (درصد)	۰.۰	۰.۰	+۰.۳۲	-۰.۱۵	-۰.۰۴	-۰.۲۷	+۰.۱۰

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

در روز جاری (۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی با افزایش ۰.۱ درصدی همراه شد، درحالی‌که قیمت طلای ۱۸ عیار ۰.۲۷ درصد کاهش یافت. با توجه به ثبات قیمت اونس جهانی طلا و افزایش نرخ دلار در بازار غیررسمی، واگرایی قیمت دو دارایی مذکور را می‌توان ناشی از تفاوت عوامل مؤثر بر بازار سکه و طلای ۱۸ عیار دانست. افزایش نرخ دلار، اثر حمایتی بر قیمت ریالی طلا داشت، اما کاهش قیمت طلای ۱۸ عیار نشان می‌دهد که این عامل به‌تنهایی برای حفظ روند صعودی کافی نبوده است. در مقابل، رشد محدود سکه امامی می‌تواند علاوه بر اثر نرخ دلار، تحت تأثیر تغییرات تقاضا و حباب قیمتی سکه قرار گرفته باشد.

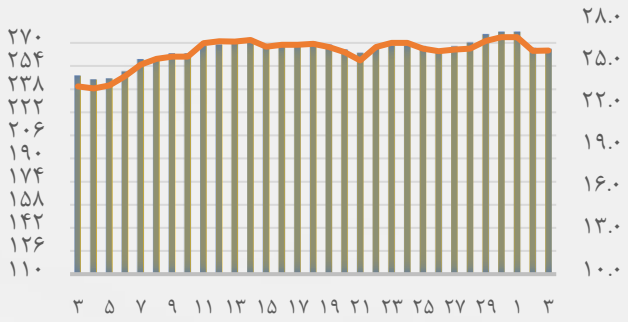
تحولات روزانه نرخ دلار در بازار غیررسمی (تومان/درصد)



درصد انحراف نرخ دلار غیررسمی از نرخ دلار رسمی (محور سمت راست)

نرخ دلار غیررسمی (محور سمت چپ)

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



قیمت طلای ۱۸ عیار

قیمت سکه امامی

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

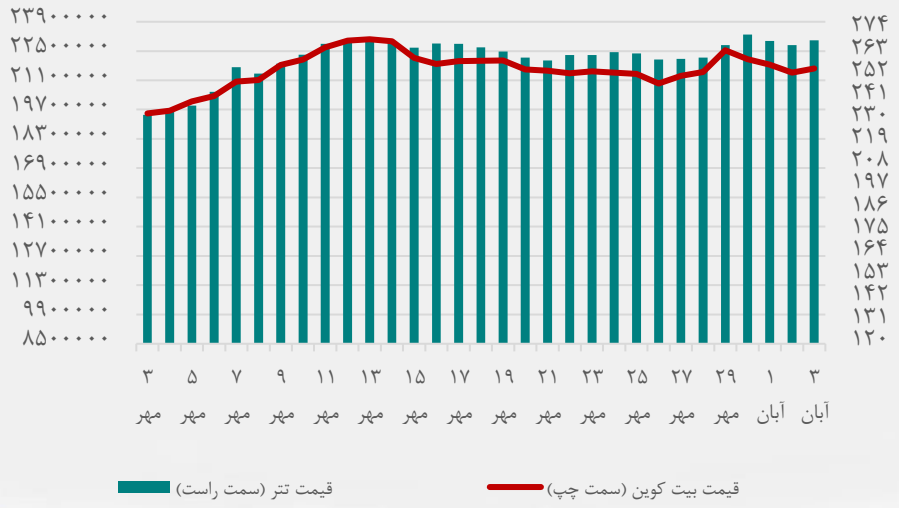
در روز جاری (۳ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۵ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با افزایش ۰.۹۱ و ۱.۱۳ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی با کاهش حدود ۰.۹۱ درصدی به محدوده ۸۰.۱ هزار دلار عقب نشینی کرد. نوسان قیمت در محدوده ۸۱ هزار دلار، نشان‌دهنده تداوم فشار فروش و غلبه نسبی عرضه بر تقاضا در معاملات روزانه بود. این کاهش در ادامه روند اصلاحی روزهای پیشین رخ داد و می‌توان آن را در چارچوب احتیاط سرمایه‌گذاران نسبت به چشم‌انداز سیاست پولی آمریکا و تمایل به کاهش مواجهه با دارایی‌های پرریسک تحلیل کرد. این در حالی است که قیمت ریالی آن در بازار داخلی افزایش یافت. این واگرایی را می‌توان ناشی از تفاوت روند نرخ دلار در بازار داخلی با تغییرات قیمت جهانی بیت‌کوین دانست؛ به‌گونه‌ای که افزایش نرخ دلار می‌تواند اثر کاهشی افت قیمت جهانی این رمزارز را جبران کند. از سوی دیگر، تغییرات تقاضا و قیمت‌گذاری بیت‌کوین در بازار داخلی نیز بر قیمت ریالی آن اثرگذار است. بنابراین، رشد قیمت ریالی بیت‌کوین در این روز، با وجود افت قیمت جهانی، نشان‌دهنده تأثیر عوامل دلاری و شرایط بازار داخلی بر ارزش‌گذاری این دارایی بود.

شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با افزایش ۰.۹ درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۸ هزار و ۹۰۰ تومان رسید.

	قیمت (میلیون تومان / تومان)		
	بیت کوین (میلیون تومان)	اتریوم (میلیون تومانّ)	تتر (تومان)
روز جاری (۳ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۶۶۱	۶۳۲	۲۶۸,۹۰۰
روز گذشته (۲ آبان ۱۴۰۵)	۲۱,۴۶۶	۶۲۴.۹	۲۶۶,۵۰۰
تغییرات (درصد)	+۰.۹۱	+۱.۱۳	+۰.۹۰

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