# تحولات بازارهای مالی در روز شنبه مورخ ۲ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۴

## تحولات بازار سرمایه

### تحولات بازار اوراق بدهی

در معاملات ۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵، ارزش معاملات اوراق درآمد ثابت افزایش یافت و هم‌زمان، خروج پول حقیقی تشدید شد. درحالی‌که نرخ بهره بدون ریسک کاهش پیدا کرد. کاهش نرخ بازده اوراق می‌تواند با افزایش قیمت آن‌ها در بازار ثانویه همراه باشد؛ 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. در این شرایط، به نظر می‌رسد، افزایش ارزش معاملات در کنار تشدید خروج پول حقیقی می‌تواند بیانگر افزایش فعالیت معاملاتی و تمایل برخی سرمایه‌گذاران به نقد کردن سود کسب‌شده باشد.

| 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 (۲ آبان ۱۴۰۵) | ۱,۳۵۵.۴ | ۴۰.۱۶ | -۰.۲۵۳ | ۱۶۰,۸۴۰ |
| روز گذشته (۲۹ مهر ۱۴۰۵) | ۱,۳۵۴.۵ | ۴۲.۰۸ | -۰.۲۲۵ | ۲۱,۰۰۱ |
| تغییرات (درصد) | +۰.۰۶ | -۱.۹۲ | -۱۲.۵ | +۶۶۵.۹ |

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

### تحولات ارزش معاملات و شاخص‌های بازار سهام

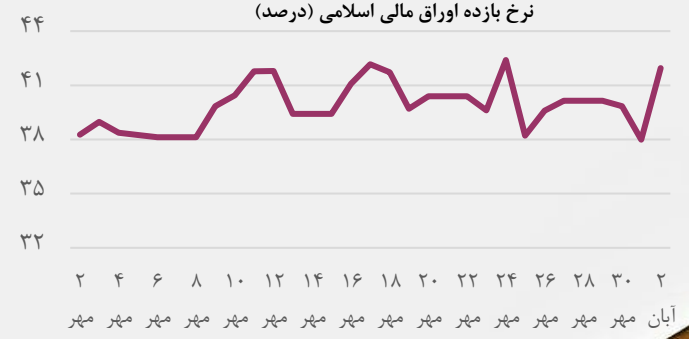
| فرابورس ایران | بورس اوراق بهادار تهران | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| شاخص کل | حجم معاملات سهام (میلیارد سهم) | ارزش معاملات سهام (میلیارد ریال) | شاخص کل هم وزن | شاخص قیمت (وزنی-ارزشی) | شاخص کل | |
| ۶۷,۰۳۱ | ۵۴.۰۵ | ۲۶۰,۵۲۸ | ۲,۲۳۶,۴۰۵ | ۱,۳۲۷,۹۲۶ | ۸,۰۴۴,۶۵۶ | روز جاری (۲ آبان ۱۴۰۵) |
| ۶۷,۴۴۴ | ۶۷.۰۹ | ۲۵۸,۵۰۰ | ۲,۲۵۵,۶۵۴ | ۱,۳۵۱,۲۳۴ | ۸,۱۷۳,۷۶۷ | روز گذشته (۲۹ مهر ۱۴۰۵) |
| -۰.۶۱ | -۱۹.۴ | +۱ | -۰.۸۵ | -۱.۷۲ | -۱.۵۸ | تغییرات (درصد) |

منبع: بورس ویو و فرابورس ایران

در روز جاری (۲ آبان ۱۴۰۵)، بورس تهران تحت تأثیر افزایش فشار فروش و خروج نقدینگی حقیقی، روندی نزولی را تجربه کرد. شاخص کل با افت ۱.۵۸ درصدی به حدود ۸ میلیون و ۴۵ هزار واحد و شاخص هم‌وزن با کاهش ۰.۸۵ درصدی به حدود ۲ میلیون و ۲۳۶ هزار واحد رسید. افت هم‌زمان شاخص‌ها، به‌ویژه کاهش بیشتر شاخص کل، بیانگر فشار فروش شدیدتر بر سهام شرکت‌های بزرگ بود.

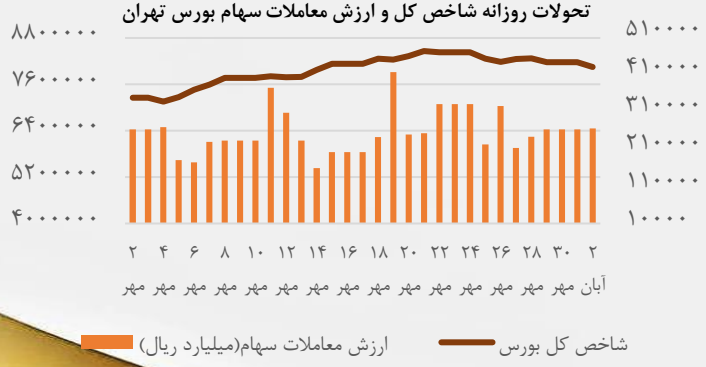
در این روز، تشدید نگرانی‌های سیاسی و افزایش احتیاط سرمایه‌گذاران، در کنار خروج پول حقیقی، از عوامل تضعیف تقاضا و غلبه عرضه بر معاملات محسوب شدند. به نحوی‌که، انتشار گزارش‌های نسبتاً مثبت عملکرد شش‌ماهه برخی شرکت‌ها نیز نتوانست بر فضای منفی بازار غلبه کند؛ موضوعی که نشان‌دهنده تأثیرگذاری بیشتر ریسک‌های حاکم بر انتظارات سرمایه‌گذاران در روز مورد بررسی بود.

نرخ بازده اوراق مالی اسلامی (درصد)

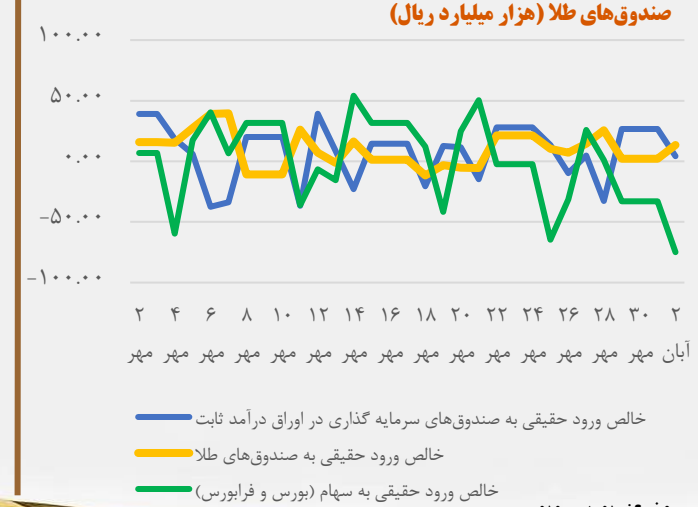



منبع: بورس ویو

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 (۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، حدود ۷۴.۹۳ هزار میلیارد ریال، خروج پول حقیقی از بازار سهام (بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران)، اتفاق افتاده است. این درحالی است که حدود ۴.۲۱ و ۱۳.۳۵ هزار میلیارد ریال، ورود پول حقیقی به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق درآمد ثابت (قابل معامله) و صندوق‌های طلا صورت گرفته 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 شنبه مورخ ۲ آبان ۱۴۰۵ – شماره ۸۴

## 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 (۲ آبان ۱۴۰۵) | ۲۷۰,۵۵۲ | ۷۳,۷۲۰ | ۲۶۶,۱۹۰ | ۲۶۲,۲۲۵ | ۱۸۴,۹۳۶ | ۲۶۸,۲۰۰ |
| روز گذشته (۱ آبان ۱۴۰۵) | ۲۷۴,۴۰۶ | ۷۴,۷۷۰ | ۲۷۰,۳۹۰ | ۲۶۱,۹۷۶ | ۱۸۴,۳۸۳ | ۲۷۲,۰۰۰ |
| تغییرات (درصد) | -۱.۴۰ | -۱.۴۰ | -۱.۵۵ | +۰.۱۰ | +۰.۳۰ | -۱.۴۰ |

منبع: نوسان پلاس و مرکز مبادله ارز و طلای ایران

در روز جاری (۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت دلار در بازار غیررسمی نسبت به روز گذشته، با کاهش ۱.۴ درصدی همراه شد و در سطح ۲۶۸ هزار و ۲۰۰ تومان قرار گرفت. همچنین، قیمت حواله مرکز مبادله ارز و طلای ایران در روز معاملاتی جاری نیز با افزایش ۰.۳ درصدی مواجه شد.

در روز جاری، قیمت دلار در بازار غیررسمی پس از افزایش در روزهای پایانی مهر و رسیدن به حدود ۲۷۳ هزار تومان، با کاهش همراه شد و به محدوده ۲۶۸ هزار تومان بازگشت. تلاش بازارساز برای کنترل نوسانات و افزایش عرضه دلار از عوامل مؤثر بر عقب‌نشینی قیمت عنوان شد. همچنین، خبر تأمین ۲۷ میلیارد دلار برای واردات از ابتدای سال و برنامه تأمین ۲۰ میلیارد دلار دیگر در نیمه دوم سال، بر ظرفیت عرضه دلار و انتظارات معامله‌گران اثرگذار بود.

بااین‌حال، نگرانی‌های ناشی از تنش‌های سیاسی و نظامی منطقه، در کنار ابهام در چشم‌انداز روابط خارجی ایران، همچنان زمینه‌ساز حفظ تقاضای احتیاطی در بازار بود. همچنین، گزارش‌های مربوط به تشدید تنش‌های تجاری میان ایران و پاکستان، از جمله محدودیت ورود کامیون‌های ایرانی و توقف صادرات گاز مایع به این کشور، بر فضای ریسک منطقه‌ای افزود. در مجموع، کاهش نرخ دلار در این روز را می‌توان حاصل افزایش عرضه و اصلاح قیمت پس از رشد روزهای قبل دانست؛ با این ملاحظه که تداوم نااطمینانی‌های سیاسی و ارزی، مانع از آن بود که این افت به‌تنهایی نشانه‌ای از شکل‌گیری روند نزولی پایدار تلقی شود.

## تحولات بازار سکه و طلا

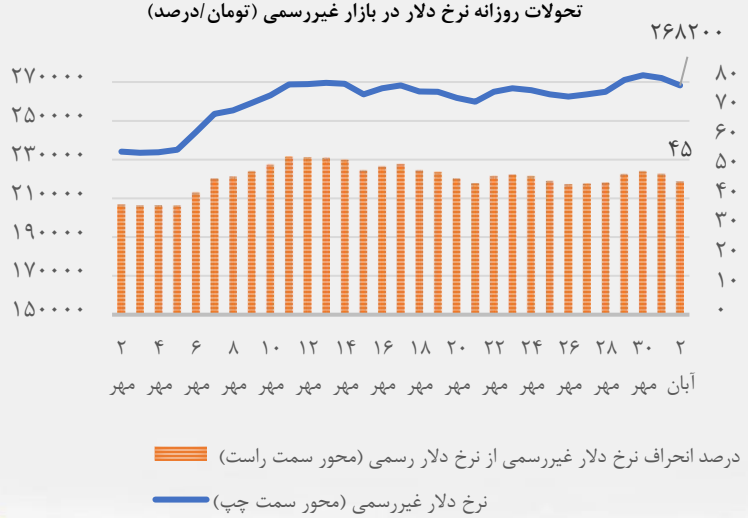
### تحولات بازار سکه، طلا و نقره

| | 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 (۲ آبان ۱۴۰۵) | ۵۳.۹ | ۳,۹۹۷.۳ | ۰.۴۸۴۱ | ۳.۴۶۰ | ۲۶۴.۲۱ | ۲۶.۰۶ | ۲۶۴.۴۶ |
| روز گذشته (۱ آبان ۱۴۰۵) | ۵۳.۹ | ۳,۹۹۷.۳ | ۰.۴۹۸۱ | ۳.۵۹۹ | ۲۷۳.۱۱ | ۲۷.۲۲ | ۲۷۳.۹۷ |
| تغییرات (درصد) | ۰.۰ | ۰.۰ | -۲.۸۱ | -۳.۸۶ | -۳.۲۶ | -۴.۲۶ | -۳.۴۷ |

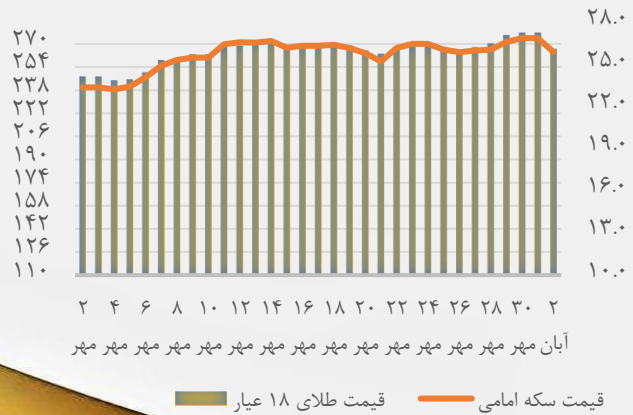
منبع: شبکه اطلاع رسانی طلا و ارز، بورس کالای ایران و Trading View

در روز جاری (۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵)، قیمت سکه امامی و طلای ۱۸ عیار به ترتیب ۳.۴۷ و ۴.۲۶ درصد کاهش داشتند. همچنین قیمت دارایی‌های مبتنی بر طلا در بورس کالا نیز از روند مشابهی برخوردار بودند. با وجود ثبات قیمت جهانی اونس طلا، لیکن کاهش قیمت دلار در بازار غیررسمی، 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 (۲ آبان‌ماه ۱۴۰۵ برابر با ۲۴ اکتبر ۲۰۲۶)، قیمت بیت‌کوین و اتریوم به ترتیب با کاهش ۱.۷۲ و ۲.۸۶ درصدی همراه شدند. در این روز، قیمت بیت‌کوین در بازار جهانی تحت تأثیر تشدید فشار فروش و تضعیف جریان سرمایه‌گذاری، به محدوده ۸۰ هزار دلار عقب‌نشینی کرد. در جریان این افت، حدود ۴۰۴ میلیون دلار از موقعیت‌های خرید اهرمی بازار رمزارزها نقد شد. همچنین، صندوق‌های قابل معامله بیت‌کوین در آمریکا طی روزهای پایانی مهرماه ۱۴۰۵، در مجموع حدود ۷۷۳ میلیون دلار خروج خالص سرمایه ثبت کردند. این تحولات، در کنار افت سهام شرکت‌های فناوری و افزایش نااطمینانی‌های ژئوپلیتیکی، بر احتیاط سرمایه‌گذاران و فشار فروش در بازار رمزارزها افزود. در بازار داخلی نیز کاهش قیمت جهانی بیت‌کوین، همراه با افت نرخ تتر، زمینه کاهش ارزش ریالی این رمزارز را فراهم کرد. در مجموع، تشدید نقدشدن موقعیت‌های اهرمی و خروج سرمایه از صندوق‌های قابل معامله، از عوامل اصلی تضعیف قیمت بیت‌کوین در این روز بود و تداوم روند آن به بهبود جریان سرمایه‌گذاری و کاهش فشار فروش وابسته خواهد بود.

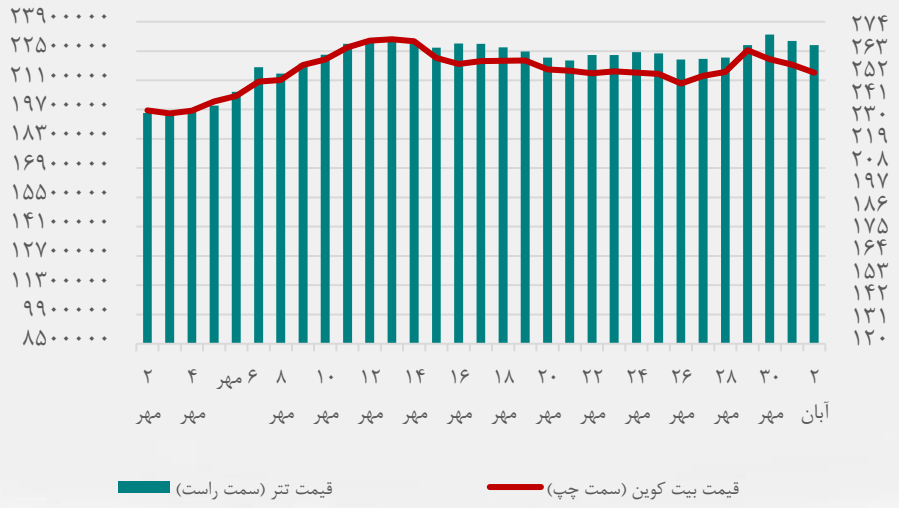
شایان توجه است که قیمت تتر در روز معاملاتی جاری نسبت به روز گذشته، با کاهش ۰.۷۸درصدی مواجه شد و به سطح ۲۶۶ هزار و ۵۰۰ تومان رسید.

**قیمت (میلیون تومان / تومان)**

| | تتر (تومان) | اتریوم (میلیون تومان) | بیت کوین (میلیون تومان) |
|---|---|---|---|
| روز جاری (۲ آبان ۱۴۰۵) | ۲۶۶,۵۰۰ | ۶۲۴.۹ | ۲۱,۴۶۶ |
| روز گذشته (۱ آبان ۱۴۰۵) | ۲۶۸,۶۰۰ | ۶۴۳.۳ | ۲۱,۸۴۲ |
| تغییرات (درصد) | -۰.۷۸ | -۲.۸۶ | -۱.۷۲ |

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