

بازار بدهی - منتهی به ۲۱ آذر ماه ۱۴۰۴

۳

تامین مالی دولت از بازار بدهی

۶

معاملات بازار باز

۹

مقایسه صندوق‌های با درآمد ثابت قابل معامله

۱۱

وضعیت معاملات بازار بدهی در هفته گذشته



آلتون

مسیری امن، آینده‌ای طلایی

صندوق طلای آسمان آلتون

ETF با نماد آلتون



www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

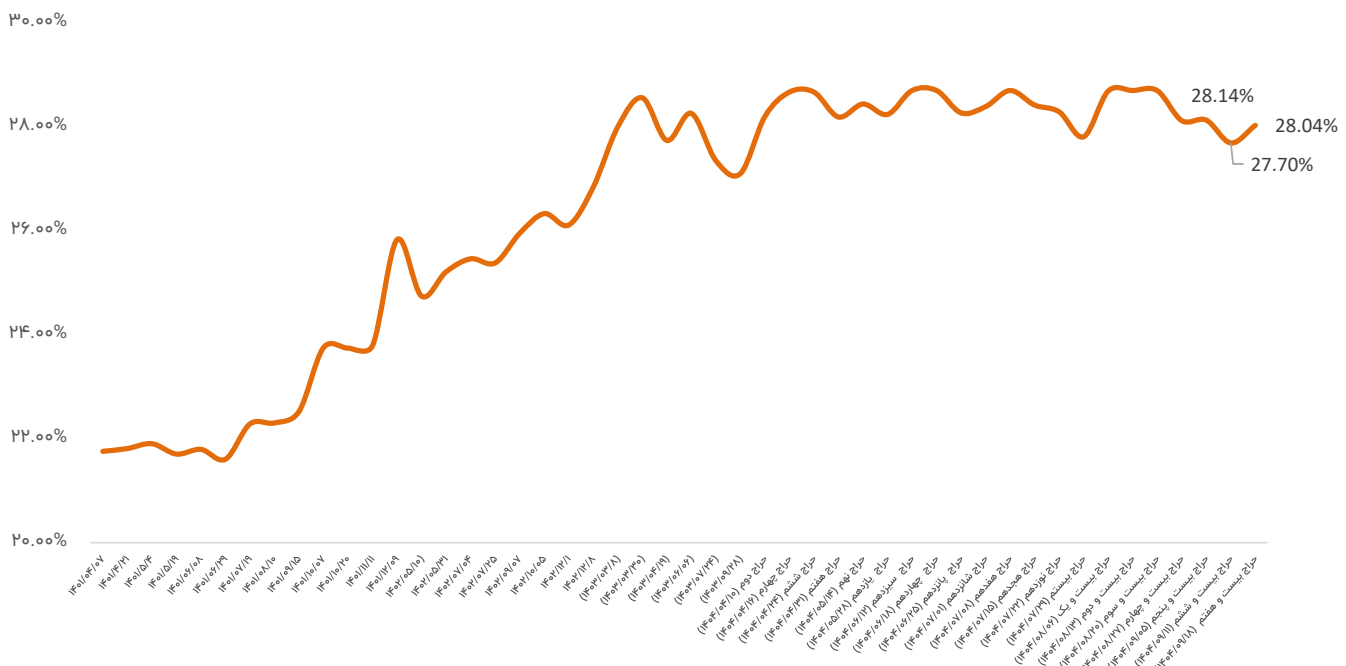


حراج اوراق دولتی

در بیست و هفتمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۴۹/۵ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی توسط اشخاص حقیقی و حقوقی (بازار سرمایه) خریداری شد. در این حراج مبلغ ۷/۱ هزار میلیارد ریال اوراق توسط بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی (بازار پول) خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیست و هفتم مبلغ ۵۶/۶ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج بیست و هفتم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۱۸			
نماد اوراق	اراد۲۵۴	اراد۲۵۵	اراد۲۵۶
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۶۹/۶	۱۰۰/۰	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۲/۱	۰/۰۰	۵/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۲۲/۶	۰/۳	۲۶/۶
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱	۲۷/۵۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیست و هفتم (هزار میلیارد ریال)		۵۶/۶	
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست و هفت حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)			۴۳۹۲/۲

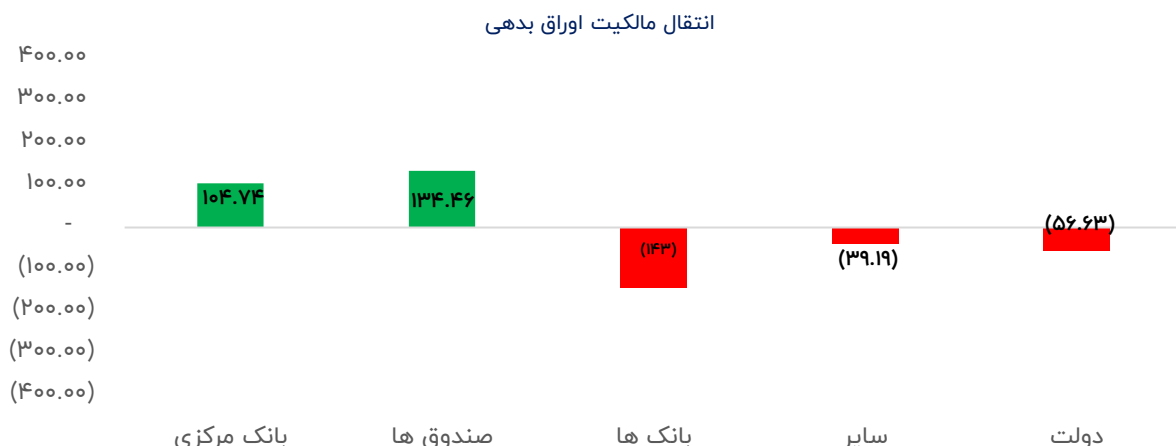
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا بیست و هفت حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۲۱ آذر ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال



همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته صندوق ها بزرگ‌ترین خریدار اوراق بدهی بوده‌اند. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۵۶/۶۳ هزار میلیارد ریال از طریق اوراق بهادار اسلامی نموده است که در ابتدای این گزارش به آن اشاره شده است.

عرضه جدید اوراق

اوراق بدهی دولتی که در هفته پیش رو عرضه خواهد شد؛ به شرح جدول زیر است.

نماد	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار	نرخ سود اسمی (درصد سالانه)	قیمت اسمی هر ورقه (هزار ریال)	مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)
اراد۲۵۴	آذر ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۹/۱۱	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۴۲/۹
اراد۲۵۵	دی ۱۴۰۷				۹۹/۷
اراد۲۵۶	خرداد ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۹/۱۸			۶۶/۷
اراد۲۵۷	آبان ۱۴۰۶	۱۴۰۴/۰۹/۲۵			۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

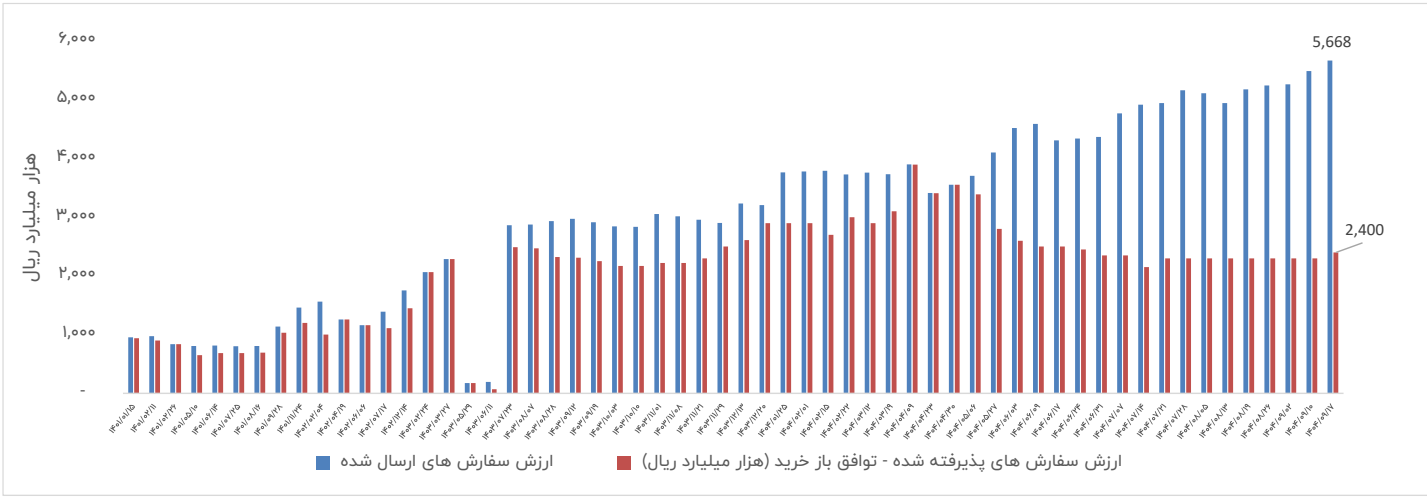


عملیات بازار باز در هفته گذشته

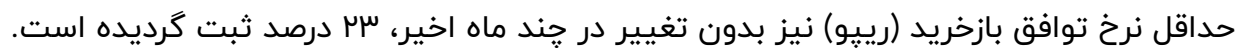
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۶۶۸/۳ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۴۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۱۷	عملیات بازار باز
۳۴	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۳	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۶۶۸/۳	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۴۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده -توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق بازخرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۳۱۰/۰	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۲۴۰۰/۰	ارزش توافق باز خرید سر رسید نشده (هزار میلیارد ریال)

نمودار زیر نشان می‌دهد در هر مقطع بانک‌ها چه میزان سفارش را به بانک مرکزی ارسال کرده‌اند و بانک مرکزی با چه مقدار از این سفارشات موافقت کرده است.



نمودار زیر روند تغییرات نرخ سود بین بانکی را از ابتدای ۱۴۰۰ نشان می‌دهد.



بخش سوم

مقایسه صندوق‌های با درآمد ثابت قابل معامله

بازده صندوق‌های سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت قابل معامله در بازه زمانی مختلف به شرح جدول زیر است. (مرتب شده بر اساس بازده یکساله)

ردیف	نماد	کل ارزش خالص دارایی‌ها	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سه ماهه	بازده شش ماهه	بازده یک ساله
۱	درین	۳۳,۷۵۹	۰.۵۸%	۲.۴۳%	۸.۰۲%	۱۶.۶۶%	۴۲.۱۲%
۲	ستاره	۳۴,۹۱۹	۰.۶۲%	۲.۵۲%	۸.۱۱%	۱۶.۲۳%	۳۶.۲۴%
۳	کیان	۲۵۰,۳۴۲	۰.۳۹%	۲.۵۵%	۸.۵۶%	۱۶.۸۹%	۳۶.۱۸%
۴	ارکیده	۸۸,۴۸۱	۰.۵۷%	۲.۷۴%	۸.۲۸%	۱۵.۸۸%	۳۶.۰۰%
۵	لبخند	۱۹۸,۵۰۲	۰.۶۴%	۲.۸۵%	۸.۴۰%	۱۵.۹۱%	۳۵.۹۱%
۶	آلا	۱۴,۷۱۱	۱.۹۵%	۴.۰۳%	۹.۶۶%	۱۷.۷۵%	۳۵.۷۶%
۷	فردا	۱۲۲,۷۴۹	۰.۶۳%	۲.۶۳%	۷.۹۵%	۱۶.۴۲%	۳۵.۶۷%
۸	کارا	۲۸۷,۴۴۵	۰.۶۲%	۲.۴۹%	۸.۱۹%	۱۶.۶۰%	۳۵.۶۵%
۹	زمرد کوروش	۶۶,۷۲۰	۰.۶۲%	۲.۹۵%	۸.۶۴%	۱۶.۶۳%	۳۵.۲۰%
۱۰	افران	۳۰۹,۰۲۹	۰.۴۹%	۲.۳۳%	۸.۳۲%	۱۶.۰۵%	۳۵.۱۷%
۱۱	فیروزا	۲۳۴,۱۳۹	۰.۵۹%	۲.۴۷%	۷.۹۵%	۱۶.۳۶%	۳۵.۱۶%
۱۲	ماه‌ور	۱۰۳,۵۰۳	۰.۶۴%	۲.۸۱%	۸.۲۵%	۱۷.۹۰%	۳۵.۰۹%
۱۳	رشد	۲۹,۴۹۱	۰.۶۰%	۲.۴۶%	۷.۹۷%	۱۶.۳۲%	۳۵.۰۷%
۱۴	کارآمد	۷۰,۴۶۸	۰.۶۱%	۲.۸۰%	۸.۱۸%	۱۶.۵۴%	۳۵.۰۷%
۱۵	ثبات	۱۲۳,۶۴۴	۰.۶۲%	۲.۱۶%	۷.۸۴%	۱۶.۲۴%	۳۴.۹۱%
۱۶	یاقوت	۳۸۶,۲۴۷	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۷.۸۸%	۱۶.۲۲%	۳۴.۸۵%
۱۷	سپر	۲۶۵,۸۲۹	۰.۴۸%	۲.۶۸%	۸.۸۵%	۱۶.۵۰%	۳۴.۷۳%
۱۸	آرامش	۷۷,۸۲۹	۰.۵۷%	۲.۵۴%	۸.۴۷%	۱۵.۸۹%	۳۴.۷۰%
۱۹	کامیاب	۲۱,۸۴۸	۰.۶۰%	۲.۵۷%	۸.۰۷%	۱۶.۲۰%	۳۴.۶۹%
۲۰	دامون	۶۱,۱۸۹	۰.۶۲%	۲.۵۶%	۷.۹۲%	۱۵.۹۴%	۳۴.۶۳%
۲۱	نشان	۲۵,۶۲۸	۰.۶۱%	۲.۵۴%	۸.۱۵%	۱۵.۹۰%	۳۴.۶۲%
۲۲	آکورد	۴۱,۴۹۷	۰.۶۰%	۲.۵۹%	۸.۴۲%	۱۵.۶۴%	۳۴.۵۹%
۲۳	ثابت اکسیژن	۷,۲۲۱	۰.۶۱%	۲.۴۷%	۸.۰۵%	۱۶.۱۴%	۳۴.۴۸%
۲۴	رابین	۱۷,۰۵۹	۰.۵۶%	۲.۵۱%	۷.۸۰%	۱۵.۴۱%	۳۴.۴۴%
۲۵	دارا	۳۴,۲۱۸	۰.۶۴%	۲.۵۲%	۸.۰۲%	۱۶.۲۵%	۳۴.۴۰%
۲۶	صنهاب	۱۶,۸۰۳	۰.۶۱%	۲.۵۰%	۷.۸۳%	۱۵.۷۰%	۳۴.۴۰%
۲۷	خاتم	۱۲,۸۱۲	۰.۵۸%	۲.۴۵%	۷.۸۴%	۱۶.۲۱%	۳۴.۳۹%
۲۸	آوند	۳۲۶,۳۳۲	۰.۵۹%	۲.۵۳%	۷.۷۷%	۱۵.۵۵%	۳۴.۳۸%
۲۹	اونیکس	۱۷۴,۰۸۳	۰.۶۶%	۲.۸۱%	۹.۰۱%	۱۶.۶۱%	۳۴.۳۴%
۳۰	پاداش	۵۹,۲۴۶	۰.۵۸%	۲.۴۶%	۷.۸۶%	۱۵.۹۷%	۳۴.۳۳%
۳۱	سام	۱۶,۹۱۶	۰.۷۳%	۳.۰۱%	۹.۰۸%	۱۷.۰۴%	۳۴.۲۵%
۳۲	کارین	۱۰۳,۱۷۱	۰.۶۰%	۲.۵۷%	۷.۹۸%	۱۶.۰۰%	۳۴.۲۴%
۳۳	یارا	۱۳,۷۹۶	۰.۶۸%	۳.۲۱%	۱۰.۵۱%	۱۶.۳۵%	۳۴.۱۳%
۳۴	کارما	۹,۲۰۰	۰.۶۷%	۲.۷۰%	۸.۶۵%	۱۶.۱۰%	۳۴.۰۹%
۳۵	پایا	۲۵,۳۱۳	۰.۳۵%	۲.۷۲%	۸.۷۴%	۱۵.۶۱%	۳۴.۰۸%
۳۶	ساحل	۶۸,۵۱۵	۰.۶۷%	۲.۵۶%	۸.۰۶%	۱۵.۹۲%	۳۴.۰۱%
۳۷	فاخر	۲۱,۹۶۰	۰.۶۷%	۲.۶۴%	۷.۷۵%	۱۵.۶۱%	۳۳.۹۳%

بخش چهارم

وضعیت معاملات بازار بدهی در هفته گذشته



وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک

سررسید (اخزا، اراد، گام)

وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک سررسید (اخزا، اراد، گام)							
۱۴۰۴/۱۹	جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۳۶۵ روز	بین ۳۶۵ تا ۷۲۰ روز	بین ۷۲۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز
اخزا							
میانگین YTM	۲۸.۰۶٪	۰.۰۰٪	۲۶.۱۴٪	۲۶.۶۹٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
معادل بانکی	۲۲.۶۹٪	۰.۰۰٪	۲۱.۲۵٪	۲۱.۶۷٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
حجم معاملات (ورقه)	۱۶,۲۱۸	۰	۵۱,۰۶۲	۴۱۴,۶۰۴	۰	۰	۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۶	۰	۲۹	۲۵۵	۰	۰	۰
اراد							
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۷.۲۸٪	۳۶.۲۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۲.۱۸٪	۳۱.۳۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۰	۱,۲۸۰,۰۰۰	۳۷,۲۵۰,۰۰۰	۰	۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۰	۱,۱۷۵	۳۱,۷۸۶	۰	۰
گام							
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۲۷.۸۰٪	۲۸.۵۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۲۲.۵۰٪	۲۲.۰۲٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۲۰۰,۰۰۰	۲,۷۵۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۱۸۲	۲,۹۰۵	۰	۰	۰	۰
مقادیر ذکر شده "میانگین YTM" و "معادل بانکی" در ستون جمع تمامی جداول، میانگین وزنی نرخ اوراق در سررسید های مختلف هستند.							

شرکت مدیریت دارایی آسمان با هدف ارائه خدمات تخصصی در زمینه مدیریت سرمایه‌گذاری اوراق بهادار در مرداد ماه ۱۳۹۰ تأسیس و با کسب مجوز سبدگردانی از سازمان بورس و اوراق بهادار، تحت نظارت این سازمان فعالیت خود را آغاز کرد. این شرکت با تکیه بر تجارب و سوابق مدیران خود در طی دوره فعالیت با راه‌اندازی صندوق‌های سرمایه‌گذاری مختلف و ایجاد سبدهای اختصاصی برای سرمایه‌گذاران، در جهت منافع آنان گام برداشته است.

• خدمات:



**مدیریت حرفه‌ای
سبدهای اختصاصی**



**طراحی، راه‌اندازی و مدیریت حرفه‌ای
صندوق‌های سرمایه‌گذاری**

• آمار مهم:



**سرمایه‌گذار فعال
۱۶۵.۰۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۱۹۰.۵۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• مهم‌ترین دستاوردها:

