

بازار بدهی - منتهی به ۲۸ 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

یک پرتاب ۳۷ امتیازی

با صندوق درآمد ثابت آسمان دامون

۳۷%

سود روز شمار



قابل معامله در بورس (ETF)

با نماد دامون

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

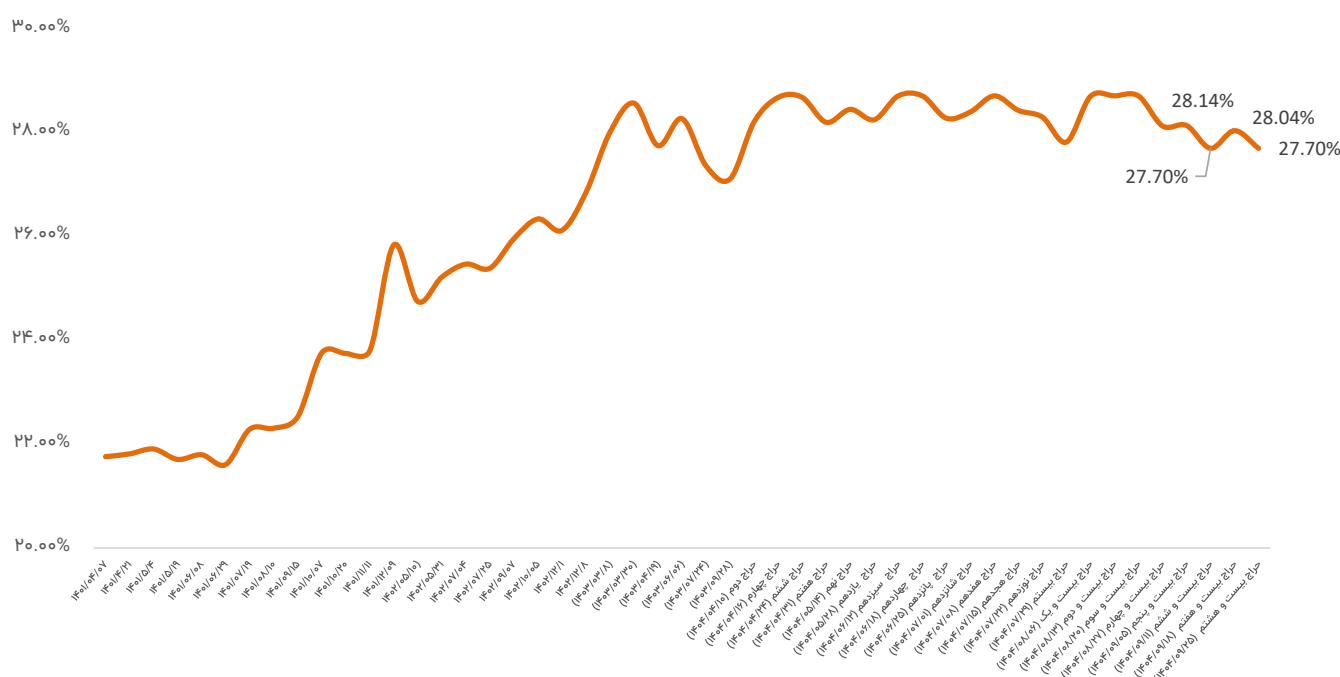


حراج اوراق دولتی

در بیست و هشتمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۲۹۲/۴ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی توسط اشخاص حقیقی و حقوقی (بازار سرمایه) خریداری شد. در این حراج اوراقی توسط بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی (بازار پول) خریداری نشد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیست و هشتم مبلغ ۲۹۲/۴ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج بیست و هشتم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۲۵				
نماد اوراق	اراد۴۲/۹	اراد۵۵/۷	اراد۵۶/۷	ارد۲۵۷
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۴۲/۹	۹۹/۷	۶۶/۷	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰۰	۰/۰۰	۰/۰۰	۰/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۳۹/۷	۹۲/۰	۶۳/۴	۹۷/۳
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱	۲۷/۴۹	۲۶/۴۹
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیست و هشتم (هزار میلیارد ریال)			۲۹۲/۴	
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست و هشتم حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)			۴۶۸۴/۶	

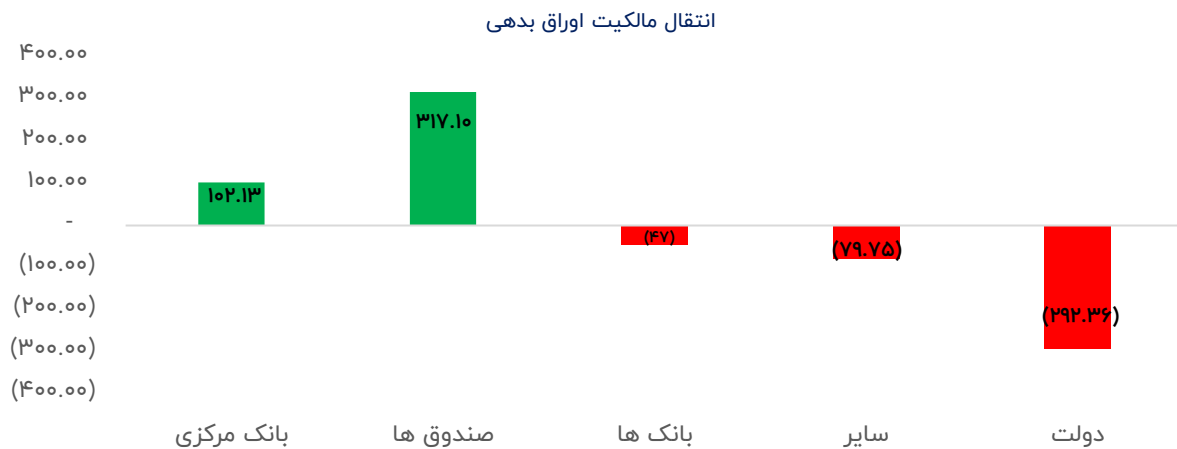
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا بیست و هشت حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۲۸ 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 ۲۹۲/۳۶ 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)
اراد۲۵۸	خرداد۱۴۰۷	۱۴۰۴/۱۰/۰۲	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۰۰/۰
اراد۲۵۹	مرداد۱۴۰۷				۱۰۰/۰
اراد۲۶۰	دی۱۴۰۷				۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

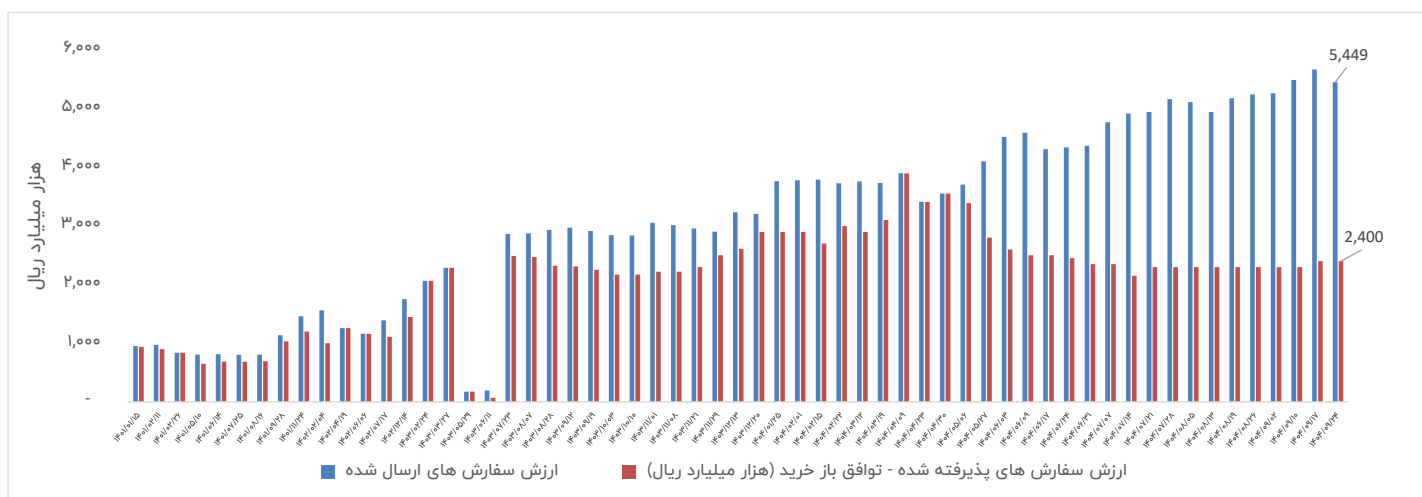


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۴۴۸/۹ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۴۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

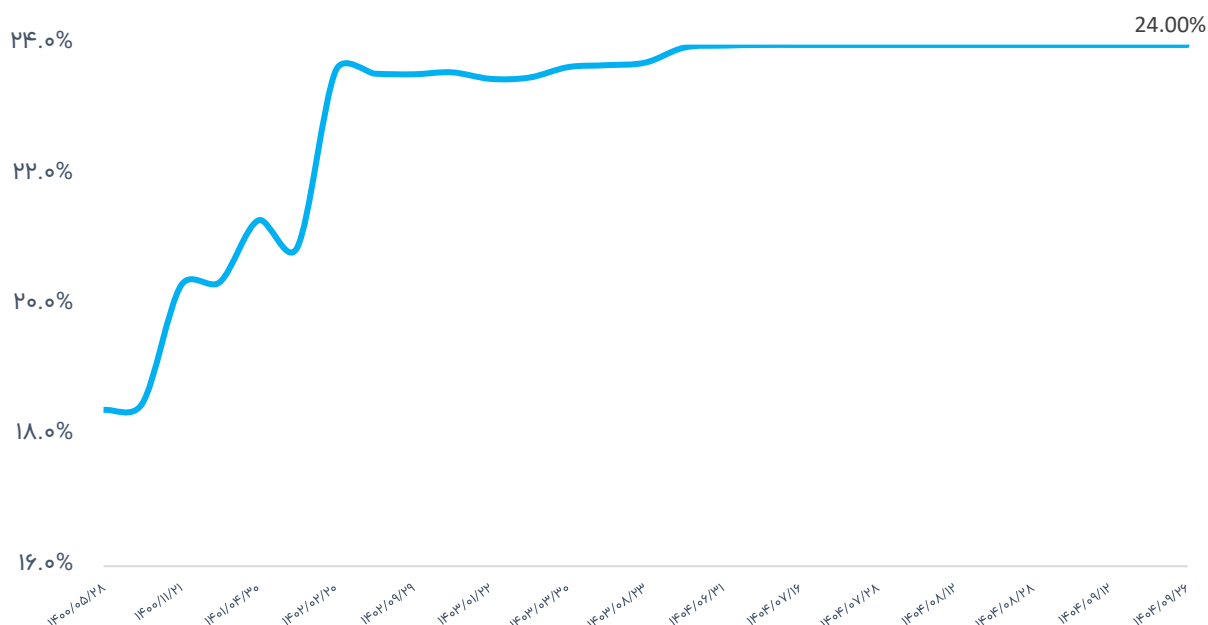
در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۲۴	عملیات بازار باز
۳۵	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۳	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۴۴۸/۹	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۴۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق باز خرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۴۱۰/۶	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.

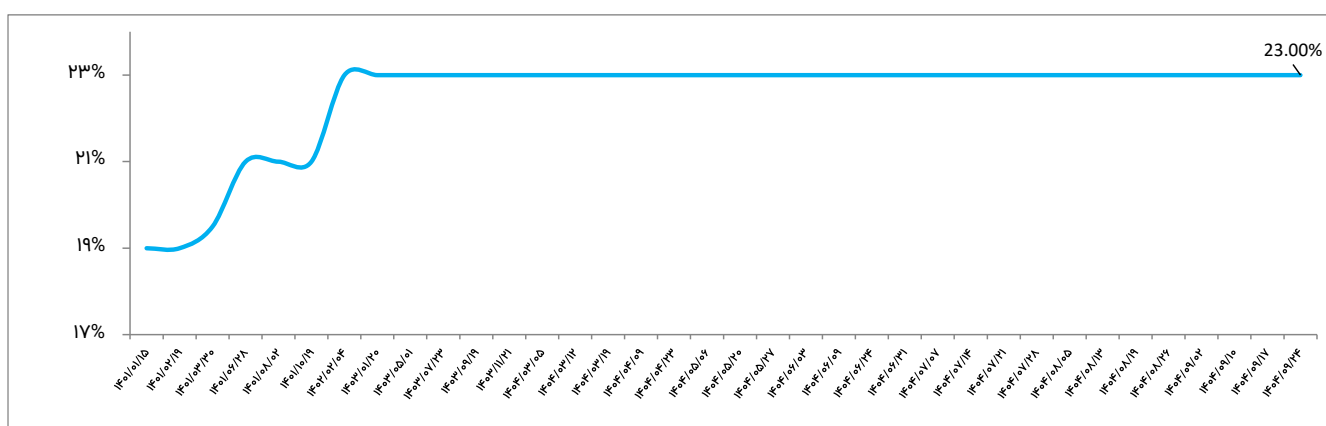


بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی بدون تغییر نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۴/۰۰ درصد ثبت گردیده است.

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



حداقل نرخ توافق بازخريد (ريپو) نیز بدون تغییر در چند ماه اخير، ۲۳ درصد ثبت گردیده است.



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	۳۲,۹۹۴	۰.۳۰%	۲.۱۴%	۷.۷۴%	۱۶.۳۷%	۴۱.۹۱%
۲	کیان	۲۵۶,۲۸۷	۰.۶۵%	۲.۵۲%	۸.۵۷%	۱۷.۷۷%	۳۶.۴۹%
۳	لبخند	۲۰۷,۶۳۶	۰.۸۰%	۳.۰۵%	۸.۹۵%	۱۷.۴۸%	۳۶.۱۵%
۴	ارکیده	۸۸,۹۸۶	۰.۵۷%	۲.۴۷%	۸.۲۳%	۱۶.۱۰%	۳۵.۹۸%
۵	فردا	۱۲۷,۵۴۶	۰.۶۲%	۲.۶۶%	۷.۹۸%	۱۷.۰۳%	۳۵.۷۶%
۶	ماه‌ور	۱۰۹,۱۳۳	۰.۸۳%	۳.۱۹%	۸.۳۳%	۱۸.۳۶%	۳۵.۷۰%
۷	کارا	۲۸۹,۱۹۵	۰.۶۱%	۲.۴۸%	۸.۱۵%	۱۷.۰۴%	۳۵.۶۹%
۸	پاسارگاد	۱۲۷,۵۴۴	۰.۷۴%	۲.۸۲%	۸.۷۵%	۱۷.۴۱%	۳۵.۶۸%
۹	زمرد کوروش	۶۹,۰۶۶	۰.۷۳%	۳.۰۵%	۹.۲۷%	۱۶.۸۵%	۳۵.۴۱%
۱۰	ستاره	۳۷,۰۰۴	۰.۵۸%	۲.۴۷%	۸.۰۸%	۱۶.۳۸%	۳۵.۲۶%
۱۱	افران	۳۱۰,۵۰۷	۰.۵۶%	۲.۳۰%	۷.۹۳%	۱۶.۶۳%	۳۵.۲۴%
۱۲	فیروزا	۲۱۹,۸۶۲	۰.۵۹%	۲.۴۷%	۷.۹۵%	۱۶.۷۸%	۳۵.۲۱%
۱۳	رشد	۲۹,۶۶۰	۰.۶۰%	۲.۴۶%	۷.۹۹%	۱۶.۳۵%	۳۵.۱۱%
۱۴	کارآمد	۷۰,۵۶۴	۰.۴۷%	۲.۵۷%	۷.۹۳%	۱۶.۶۷%	۳۵.۰۵%
۱۵	کارما	۹,۷۲۹	۱.۱۴%	۳.۲۰%	۹.۶۴%	۱۷.۷۱%	۳۵.۰۱%
۱۶	ثبات	۱۲۳,۵۶۷	۰.۶۱%	۲.۴۵%	۷.۸۷%	۱۶.۸۴%	۳۵.۰۰%
۱۷	رابین	۱۶,۷۷۵	۰.۸۵%	۲.۷۰%	۷.۲۰%	۱۵.۶۵%	۳۴.۹۲%
۱۸	یاقوت	۳۹۷,۴۹۷	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۷.۸۸%	۱۶.۶۴%	۳۴.۹۱%
۱۹	آرامش	۷۸,۲۵۳	۰.۷۴%	۲.۷۱%	۸.۴۵%	۱۶.۵۳%	۳۴.۸۵%
۲۰	دامون	۶۳,۷۸۶	۰.۶۴%	۲.۵۹%	۸.۰۰%	۱۶.۲۳%	۳۴.۷۵%
۲۱	کامیاب	۲۱,۰۳۲	۰.۵۹%	۲.۵۷%	۸.۰۲%	۱۶.۲۶%	۳۴.۷۳%
۲۲	سام	۱۹,۳۰۸	۰.۹۷%	۳.۵۰%	۹.۳۴%	۱۸.۴۱%	۳۴.۷۱%
۲۳	نشان	۲۷,۲۸۹	۰.۶۱%	۲.۶۰%	۸.۲۶%	۱۶.۲۰%	۳۴.۶۸%
۲۴	آکورد	۴۱,۶۷۸	۰.۶۰%	۲.۶۰%	۸.۱۷%	۱۵.۵۰%	۳۴.۵۶%
۲۵	ثابت اکسیژن	۶,۶۳۹	۰.۶۱%	۲.۴۷%	۸.۰۸%	۱۶.۳۷%	۳۴.۵۵%
۲۶	دارا	۳۴,۳۴۵	۰.۶۵%	۲.۵۵%	۸.۰۳%	۱۶.۰۸%	۳۴.۵۱%
۲۷	صنهای	۱۷,۲۴۶	۰.۵۹%	۲.۴۹%	۷.۸۴%	۱۵.۹۹%	۳۴.۴۸%
۲۸	ساحل	۶۸,۴۵۵	۰.۸۹%	۲.۸۸%	۸.۳۹%	۱۶.۵۱%	۳۴.۴۶%
۲۹	پایا	۲۵,۵۸۱	۰.۸۸%	۲.۹۹%	۸.۹۳%	۱۶.۵۷%	۳۴.۴۵%
۳۰	آوند	۳۳۱,۵۵۸	۰.۵۹%	۲.۵۴%	۷.۷۸%	۱۶.۴۹%	۳۴.۴۴%
۳۱	پاداش	۵۹,۳۸۱	۰.۵۸%	۲.۴۴%	۷.۸۶%	۱۶.۴۳%	۳۴.۴۳%
۳۲	خاتم	۱۲,۷۰۶	۰.۵۸%	۲.۴۵%	۷.۸۶%	۱۶.۵۹%	۳۴.۴۱%
۳۳	کارین	۱۳۰,۵۶۶	۰.۵۷%	۲.۵۵%	۷.۹۸%	۱۶.۱۳%	۳۴.۳۹%
۳۴	آلا	۱۵,۰۳۰	۰.۱۰%	۳.۴۶%	۸.۹۳%	۱۷.۱۴%	۳۴.۳۳%
۳۵	اعتماد	۱۹۹,۵۰۳	۰.۸۲%	۲.۶۳%	۸.۲۴%	۱۶.۵۱%	۳۴.۳۲%
۳۶	کاج	۳۲,۲۶۰	۰.۸۳%	۳.۰۸%	۱۰.۸۸%	۱۸.۹۵%	۳۴.۳۲%
۳۷	توسکا	۶۱,۳۷۹	۱.۰۵%	۳.۴۲%	۸.۹۵%	۱۷.۸۲%	۳۴.۱۸%
۳۸	سپر	۲۶۹,۷۴۴.۷۹	۰.۷۱%	۲.۷۲%	۸.۷۹%	۱۶.۹۹%	۳۴.۰۷%
۳۹	فاخر	۲۱,۶۱۵	۰.۶۰%	۲.۷۰%	۷.۷۹%	۱۵.۷۶%	۳۴.۰۱%
۴۰	اونیکس	۱۷۸,۴۶۹	۰.۵۶%	۲.۸۰%	۸.۹۴%	۱۶.۷۰%	۳۴.۰۱%
۴۱	بمان	۴,۷۷۸	۰.۶۷%	۲.۷۳%	۱۰.۱۹%	۱۶.۸۶%	۳۳.۹۶%

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 آذر ۲۵							
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
۲۶.۹۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۷.۱۲٪	۲۶.۶۶٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	میانگین YTM
۳۱.۸۴٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۱.۹۹٪	۳۱.۶۴٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	معادل بانکی
۱,۳۳۴,۹۵۴	۰	۰	۸۴۷,۴۰۲	۴۴۴,۲۶۱	۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۹۲۸	۰	۰	۵۴۲	۲۴۵	۰	۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
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	اراد
۲۶.۲۵٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۷.۹۸٪	۲۵.۸۱٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	میانگین YTM
۳۱.۲۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۲.۶۳٪	۳۱.۰۱٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	معادل بانکی
۱۶,۹۱۰,۰۰۰	۰	۰	۲,۶۰۵,۰۰۰	۱۳,۳۰۵,۰۰۰	۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۱۴,۶۱۸	۰	۰	۲,۹۲۲	۱۱,۶۸۶	۰	۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
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	گام
۲۹.۰۶٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۹.۰۶٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	میانگین YTM
۲۳.۴۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۳.۴۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	معادل بانکی
۳,۷۴۹,۵۰۰	۰	۰	۰	۳,۷۴۹,۵۰۰	۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۲,۹۱۱	۰	۰	۰	۲,۹۱۱	۰	۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
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:

