

بازار بدهی - منتهی به ۵ دی 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



هیرید

هنر تعادل در سرمایه‌گذاری

رتبه اول صندوق‌های مختلط



۵۱٪ بازدهی یکساله

صندوق مختلط آسمان خاورمیانه

ETF با نماد هیرید

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

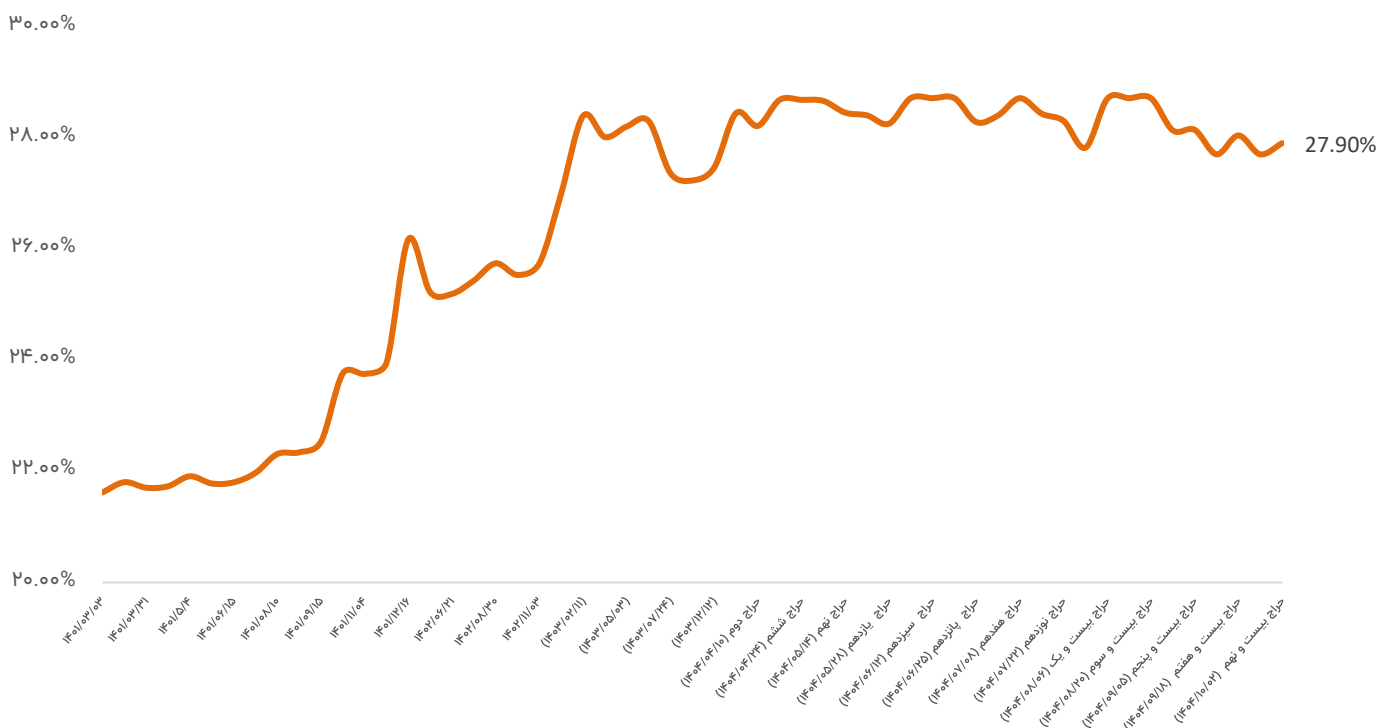


حراج اوراق دولتی

در بیست و نهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۹۵/۷ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی توسط اشخاص حقیقی و حقوقی (بازار سرمایه) خریداری شد. در این حراج توسط بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی (بازار پول) ۱۹/۵ میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیست و نهم مبلغ ۱۱۵/۲ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج بیست و نهم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۱۰/۰۲			
نماد اوراق	اراد۲۵۸	اراد۲۵۹	اراد۲۶۰
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۱۰۰/۰۰	۱۰۰/۰۰	۱۰۰/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۹/۵	۱۰/۰	۰/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۵۷/۹	۳۷/۸	۰/۰۰
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۷/۴۹	۲۸/۵	۲۸/۷۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیست و نهم (هزار میلیارد ریال)		۱۱۵/۲	
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست و نه حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)			۴۷۹۹/۸

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

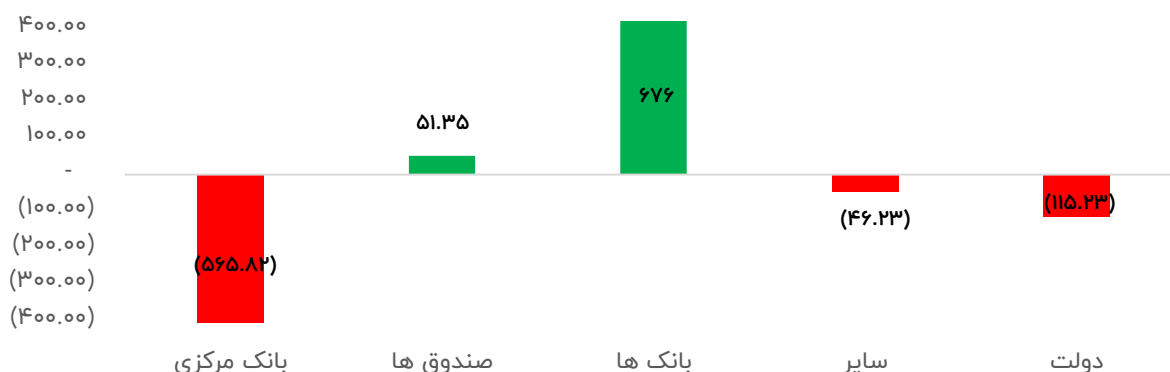


نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۵ دی ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال

انتقال مالکیت اوراق بدهی



همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته بانک ها بزرگ‌ترین خریدار اوراق بدهی بوده‌اند. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۱۱۵/۲۳ 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	۲۹/۲
اراد۲۵۹	مرداد۱۴۰۷				۴۸/۸
اراد۲۶۰	دی۱۴۰۷				۱۰۰/۰
اراد۲۶۱	مهر۱۴۰۷	۱۴۰۴/۱۰/۰۹			۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

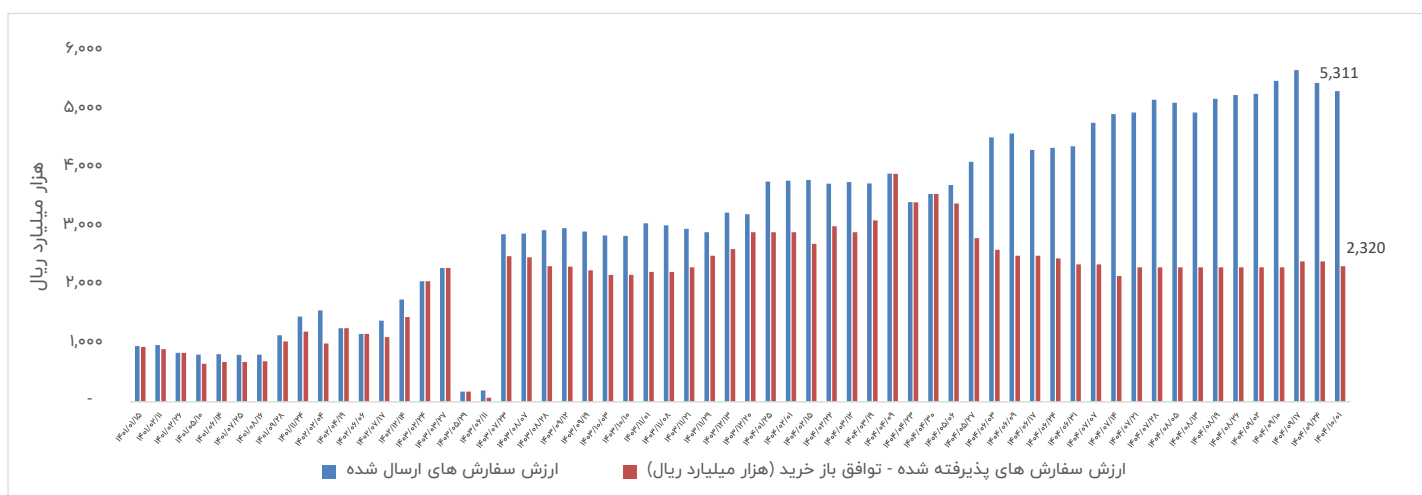


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۳۱۰/۵ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۲۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

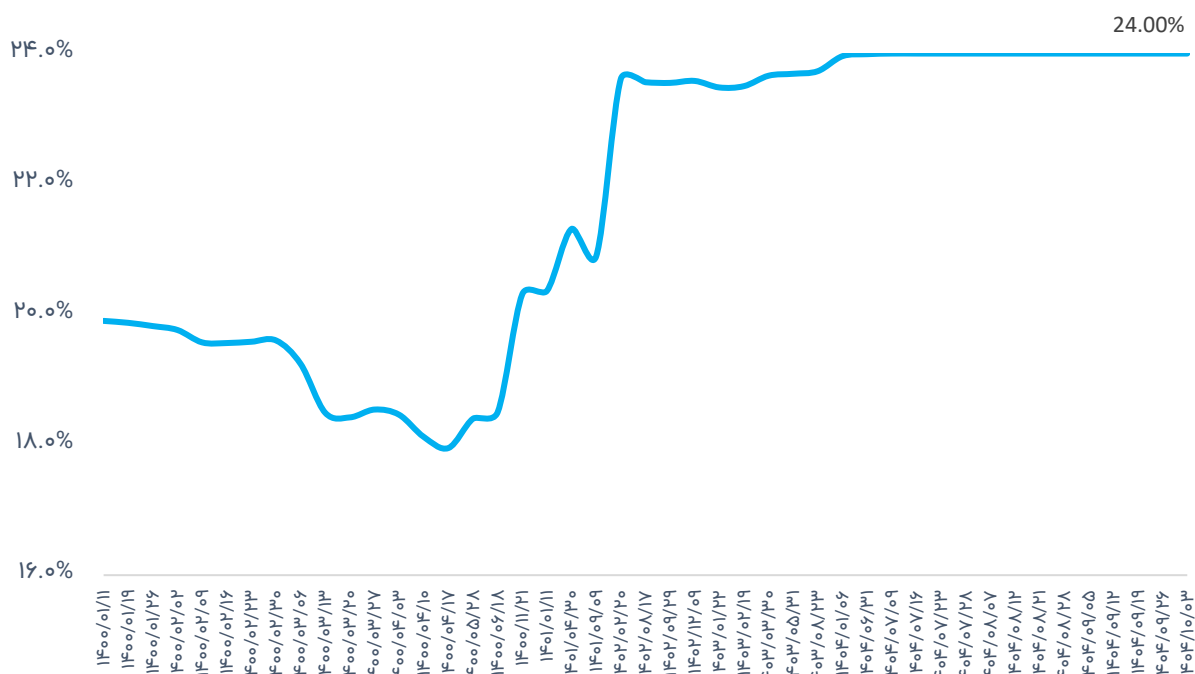
در تاریخ ۱۴۰۴/۱۰/۰۱	عملیات بازار باز
۳۳	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۳	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۳۱۰/۵	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۲۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق بازخرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۴۱۰/۶	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۲۰/۰	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.

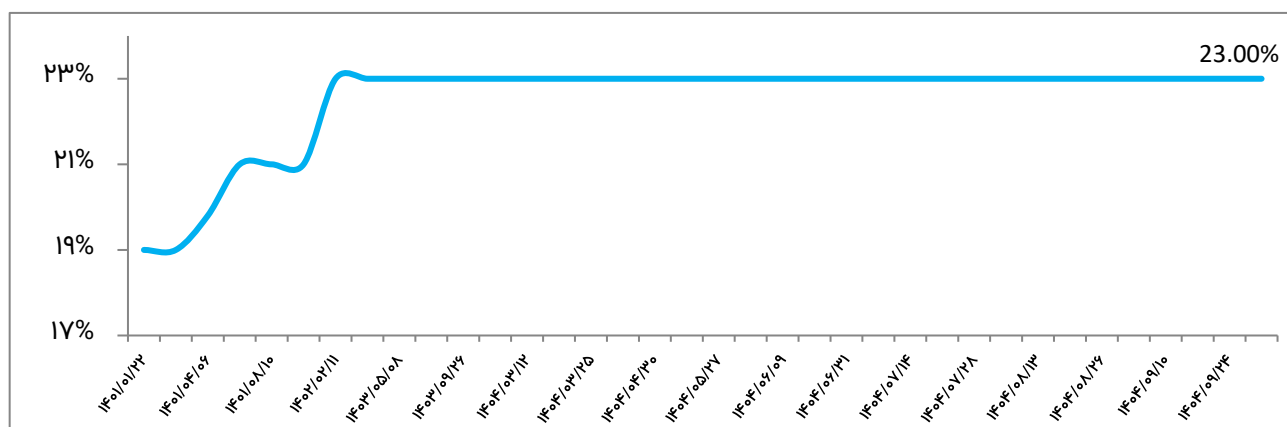


بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی بدون تغییر نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۴/۰۰ درصد ثبت گردیده است.

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



حداقل نرخ توافق بازخريد (ريپو) نیز بدون تغيير 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
1	درین	35,051	0.63%	2.22%	7.79%	16.46%	42.71%
2	ارکیده	89,398	1.36%	3.20%	9.41%	16.25%	37.07%
3	داریک	15,672	1.57%	6.44%	14.08%	15.25%	36.10%
4	سام	19,230	1.22%	4.23%	10.35%	18.26%	36.02%
5	پاسارگاد	137,263	0.16%	2.36%	8.36%	17.11%	35.90%
6	آلا	15,382	0.61%	3.45%	9.45%	17.25%	35.84%
7	فردا	133,665	0.62%	2.69%	8.01%	17.15%	35.83%
8	سپهر	277,949	0.51%	2.76%	8.87%	17.25%	35.83%
9	کیان	264,815	0.47%	2.41%	8.38%	17.63%	35.81%
10	کارا	293,070	0.63%	2.59%	8.15%	17.11%	35.75%
11	ماهور	101,455	0.84%	3.53%	8.30%	18.44%	35.72%
12	زمرد کوروش	69,722	0.74%	3.13%	8.48%	17.15%	35.66%
13	افران	313,573	0.90%	2.83%	8.31%	17.71%	35.64%
14	فیروزا	222,783	0.70%	2.58%	8.06%	16.89%	35.42%
15	آرامش	77,928	0.90%	3.02%	8.61%	17.10%	35.35%
16	کارما	10,517	1.06%	4.19%	9.88%	18.32%	35.30%
17	رشد	34,271	0.61%	2.48%	8.02%	16.39%	35.25%
18	رابین	17,197	0.82%	2.96%	7.83%	16.01%	35.20%
19	توسکا	65,339	1.22%	4.09%	9.51%	19.02%	35.17%
20	ثبات	128,556	0.61%	2.51%	7.89%	16.81%	35.09%
21	کارآمد	71,237	0.62%	2.59%	7.89%	16.71%	35.09%
22	دامون	66,482	0.69%	2.64%	8.11%	16.43%	35.04%
23	یاقوت	408,489	0.59%	2.56%	7.87%	16.66%	34.98%
24	لیخند	211,551	0.24%	2.53%	8.06%	17.05%	34.93%
25	کاج	36,847	0.83%	3.31%	8.85%	19.38%	34.92%
26	کامیاب	22,051	0.62%	2.60%	8.04%	16.33%	34.82%
27	پایا	29,645	0.75%	3.21%	8.85%	16.62%	34.73%
28	کارین	126,021	0.63%	3.08%	8.00%	16.20%	34.70%
29	نشان	26,829	0.58%	2.53%	8.06%	16.38%	34.68%
30	دارا	34,578	0.68%	2.73%	8.11%	16.36%	34.68%
31	اعتماد	197,012	0.78%	3.13%	8.13%	16.85%	34.64%
32	ثابت اکسیرن	6,998	0.61%	2.47%	8.09%	16.41%	34.64%
33	آکورد	43,234	0.61%	2.61%	8.20%	16.00%	34.61%
34	پاداش	60,227	0.58%	2.44%	7.87%	16.45%	34.55%
35	صنهای	16,902	0.60%	2.49%	7.86%	16.06%	34.49%
36	آوند	335,979	0.59%	2.53%	7.79%	16.60%	34.49%
37	ساحل	67,138	0.51%	2.87%	8.25%	16.35%	34.46%
38	خاتم	12,208.48	0.54%	2.43%	7.82%	16.62%	34.44%
39	اونیکس	185,441	1.03%	3.16%	9.04%	17.47%	34.37%
40	فاخر	21,977	0.70%	2.80%	7.98%	15.99%	34.29%
41	گنجین	33,954	0.60%	2.57%	8.40%	17.16%	34.14%
42	شمیم	32,490	0.68%	2.55%	7.99%	16.50%	34.14%
43	اعتبار	39,203	0.58%	2.69%	8.27%	15.90%	34.11%
44	پیمان	4,757	0.64%	2.73%	10.22%	17.28%	34.08%
45	یارا	14,031	1.10%	3.58%	10.61%	18.24%	34.08%
46	پایش	8,255	0.84%	2.90%	11.11%	16.45%	33.81%

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 دی	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	۲۵.۹۷٪	۲۴.۶۰٪	۲۶.۸۰٪	۲۷.۰۵٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
	معادل بانکی	۳۱.۱۲٪	۳۱.۴۴٪	۳۱.۷۵٪	۳۱.۹۴٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
	حجم معاملات (ورقه)	۱,۵۵۵	۲۲۶,۲۱۸	۲۹۵,۸۴۳	۲۷۷,۱۰۹	۰	۰
	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱	۱۹۵	۲۲۰	۱۸۹	۰	۰
اراد	میانگین YTM	۲۶.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۶.۸۷٪	۲۷.۲۶٪	۰.۰۰٪
	معادل بانکی	۳۱.۱۵٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۱.۸۰٪	۳۲.۱۷٪	۰.۰۰٪
	حجم معاملات (ورقه)	۸,۰۵۰,۰۰۰	۰	۰	۵۳۰,۰۰۰	۲,۹۴۰,۰۰۰	۰
	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۷,۸۹۸	۰	۰	۴۵۲	۲,۴۲۳	۰
گام	میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۸.۸۴٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
	معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۳.۲۷٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
	حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۱,۱۵۲,۴۵۰	۰	۰	۰
	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۹۲۰	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**



**سرمایه‌گذار فعال
۱۶۵.۲۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۲۳۲.۰۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• آمار مهم:

• مهم‌ترین دستاوردها:

