

بازار بدهی – منتهی به ۷ 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

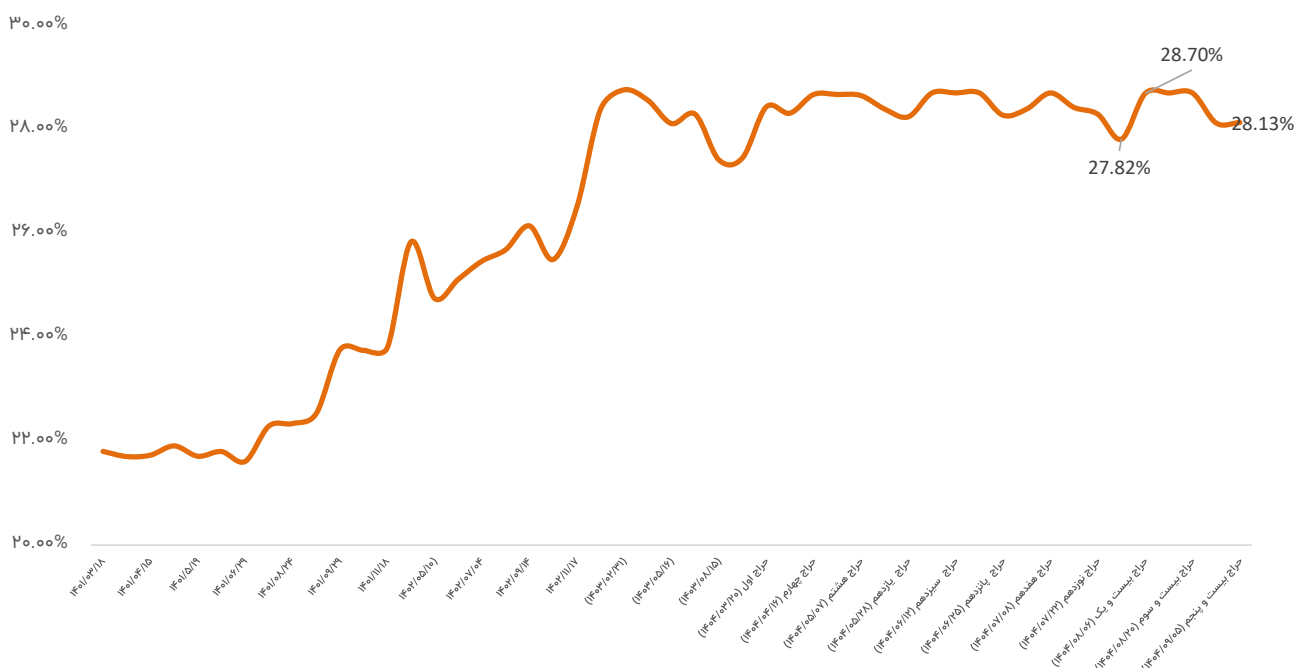


حراج اوراق دولتی

در بیست و پنجمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۲۶۶/۸ 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) ۱۴/۳ هزار میلیارد ریال خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیست و چهارم مبلغ ۲۸۱/۱ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج بیست و پنجم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۰۵			
نماد اوراق	اراد ۲۵۰	اراد ۲۵۱	اراد ۲۵۲
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۷۰/۰	۱۰۰/۰	۱۳۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۹/۷	۰/۰۰	۴/۶
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۵۶/۵	۹۴/۸	۱۱۵/۵
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۰۰	۲۷/۶۰	۲۸/۶۵
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیست و پنجم (هزار میلیارد ریال)			۲۸۱/۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست و پنج حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)			۴۲۱۲/۵

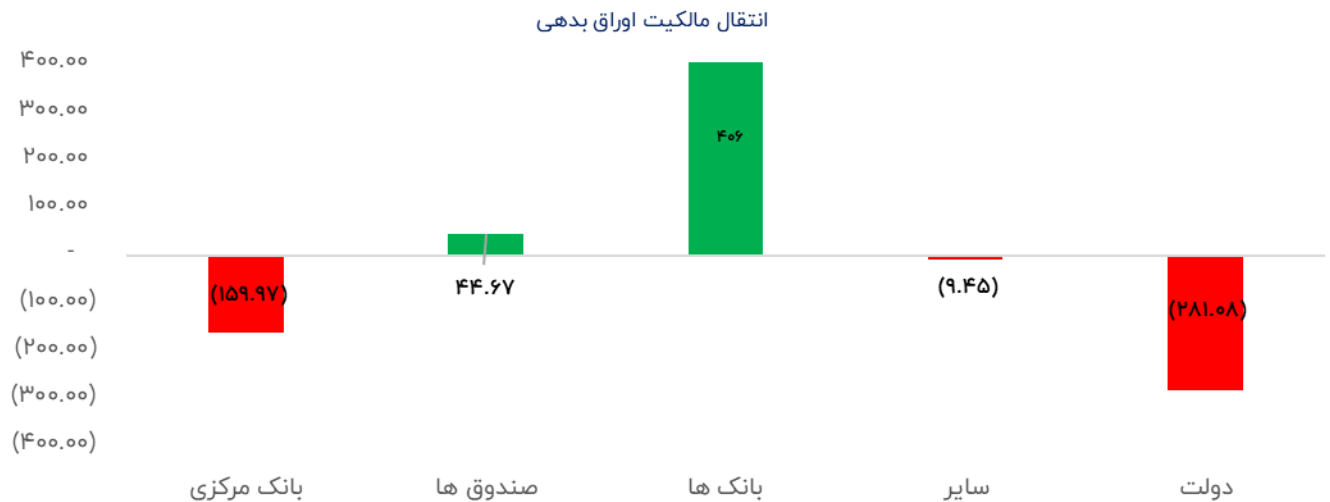
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا بیست و سوم حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۷ آذر ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال



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 ۲۸۱/۰۸ 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)
اراد۳۳	۱۴۰۷ خرداد	۱۴۰۴/۰۹/۱۱	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۰۰/۰
اراد۴۴	۱۴۰۷ آذر				۱۰۰/۰
اراد۵۵	۱۴۰۷ دی				۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

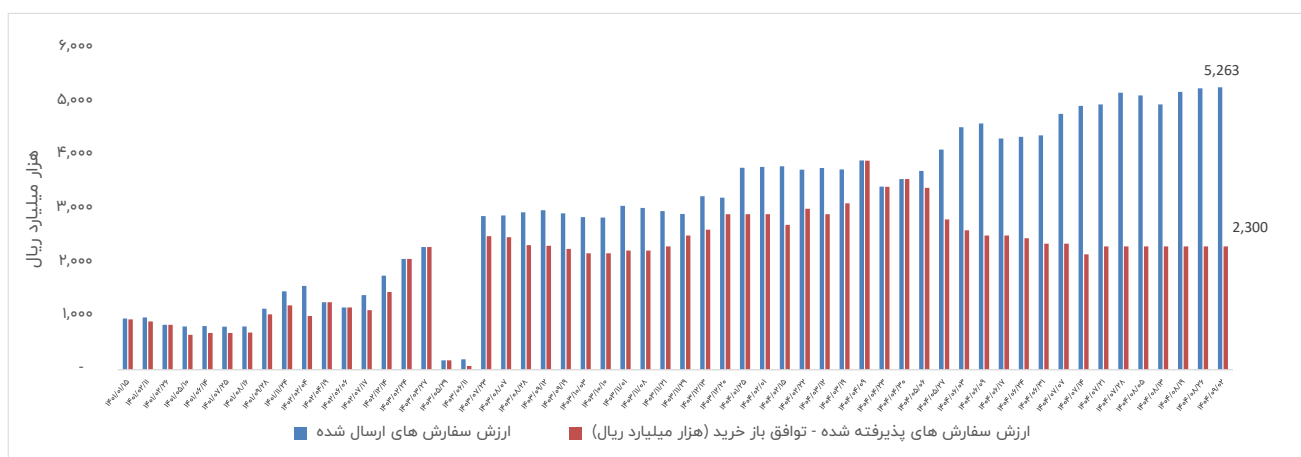


عملیات بازار باز در هفته گذشته

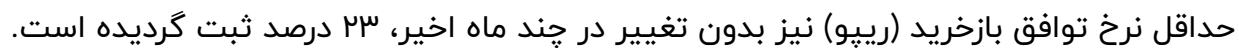
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۲۶۳/۲ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۰۲	عملیات بازار باز
۳۲	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۱	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۲۶۳/۲	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۸	مدت توافق باز خرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۳۰۸/۷	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۰۰/۰	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.

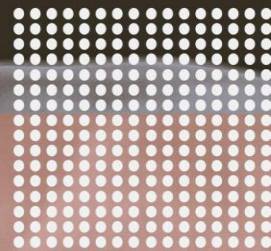


نمودار زیر روند تغییرات نرخ سود بین بانکی را از ابتدای ۱۴۰۰ نشان می‌دهد.



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
1	درین	29379.3	0.58%	2.58%	7.92%	16.68%	41.88%
2	ستاره	33580.9	0.46%	2.55%	8.00%	16.30%	39.35%
3	زمرد کوروش	64944.8	0.68%	2.74%	8.38%	16.26%	38.15%
4	ارکیده	82500.4	0.64%	2.85%	8.02%	15.61%	36.07%
5	کیان	240205.9	0.47%	3.15%	8.63%	17.22%	35.60%
6	کارا	278307.2	0.52%	2.49%	8.10%	16.23%	35.51%
7	فردا	89316.1	0.59%	2.56%	7.88%	16.31%	35.51%
8	لبخند	192136.5	0.71%	2.74%	8.36%	16.39%	35.41%
9	سپر	238375.5	0.48%	2.35%	8.02%	15.97%	35.36%
10	فیروزا	216367.8	0.59%	2.47%	7.95%	16.25%	35.05%
11	افران	296557.5	0.37%	2.05%	8.59%	16.30%	35.02%
12	رشد	27002.0	0.59%	2.44%	7.92%	16.28%	34.91%
13	کارآمد	69139.0	0.57%	2.69%	7.93%	16.10%	34.80%
14	آرامش	74813.7	0.58%	2.59%	8.41%	15.58%	34.77%
15	ثبات	109462.5	0.59%	2.29%	7.75%	16.08%	34.75%
16	یاقوت	364311.9	0.59%	2.56%	7.88%	16.13%	34.71%
17	ماه‌ور	96781.4	0.50%	2.38%	7.69%	17.11%	34.68%
18	کامیاب	18866.9	0.59%	2.57%	7.97%	16.18%	34.59%
19	نشان	22489.0	0.55%	2.52%	8.64%	15.77%	34.52%
20	دامون	50713.0	0.56%	2.58%	7.81%	15.82%	34.51%
21	آکورد	43116.0	0.60%	2.59%	8.43%	15.71%	34.43%
22	خاتم	12511.7	0.56%	2.52%	7.82%	16.44%	34.39%
23	اونی‌کس	157949.2	0.66%	2.60%	8.97%	16.05%	34.36%
24	رابین	18205.1	0.56%	2.36%	7.34%	15.20%	34.34%
25	ثابت اکسیژن	5877.6	0.61%	2.47%	8.01%	16.08%	34.32%
26	آوند	324926.7	0.59%	2.52%	7.69%	15.89%	34.27%
27	صن‌هال	17531.9	0.59%	2.48%	7.80%	15.53%	34.22%
28	دارا	35268.4	0.48%	2.45%	7.83%	16.05%	34.17%
29	پاداش	57175.6	0.58%	2.45%	7.84%	15.81%	34.10%
30	آلا	15907.1	0.52%	2.59%	7.82%	14.86%	34.08%

بخش چهارم

وضعیت معاملات بازار بدهی در هفته گذشته



وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک

سررسید (اخزا، اراد)

وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک سررسید (اخزا، اراد)							
جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۲۶۵ روز	بین ۲۶۵ تا ۷۲۰ روز	بین ۷۲۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز	۱۴۰۴ آذر
میانگین YTM	۵۱.۴۰٪	۲۴.۸۹٪	۲۶.۵۴٪	۲۶.۹۲٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۷.۲۷٪
معادل بانکی	۴۲.۲۰٪	۲۰.۳۱٪	۲۱.۵۵٪	۲۱.۸۴٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۲.۱۷٪
حجم معاملات (ورقه)	۱۷,۱۹۵	۱۰۰	۱۲۴,۵۷۹	۵۸۵,۵۰۴	۰	۰	۷۲۷,۳۷۸
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۷	۰	۹۵	۳۵۹	۰	۰	۴۷۱
اراد							
جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۲۶۵ روز	بین ۲۶۵ تا ۷۲۰ روز	بین ۷۲۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز	
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۲۵.۷۶٪	۰.۰۰٪	۲۶.۶۵٪	۲۷.۵۱٪	۲۸.۰۹٪	۲۷.۵۲٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۲۰.۹۶٪	۰.۰۰٪	۲۱.۶۴٪	۲۲.۲۸٪	۲۲.۷۱٪	۲۲.۲۸٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۵,۰۰۰	۰	۶,۲۷۰,۰۰۰	۲۳,۹۰۵,۰۰۰	۱۰,۷۶۰,۰۰۰	۴۰,۹۴۰,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۵	۰	۵,۴۸۱	۱۹,۴۶۸	۸,۴۶۹	۲۳,۴۲۳
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:

