

بازار بدهی – منتهی به ۲۴ بهمن 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

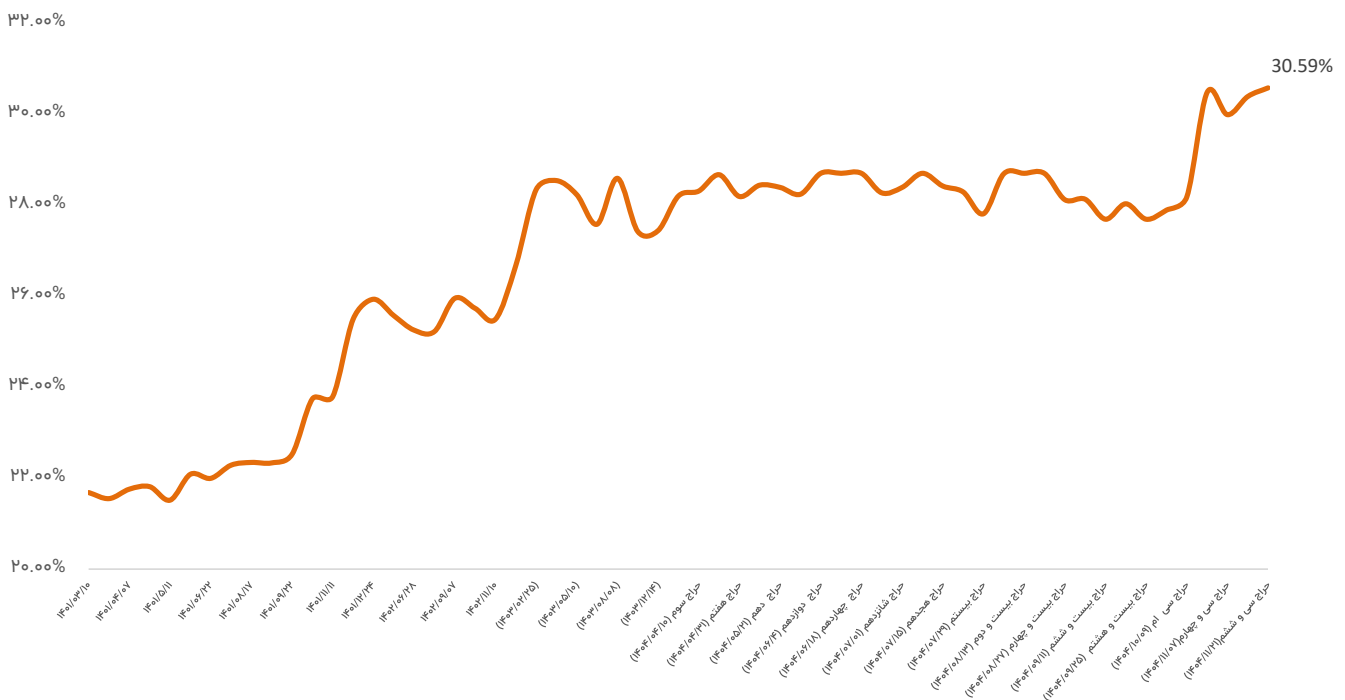


حراج اوراق دولتی

در سی و هشتمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۲۶۳/۷ 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) اوراق مالی اسلامی دولتی خریداری نگردید. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج سی و هشتم مبلغ ۶/۶ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج سی و هشتم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۲۱			
نماد اوراق	اراد ۲۶۸	اراد ۲۶۹	ارده ۲۷۰
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۱۰۰/۰	۱۰۰/۰	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۶/۶	۰/۰	۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۸۴/۹	۸۹/۵	۸۹/۳
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۱۷-۳۰/۴۹	۳۰/۵۴-۳۰/۶۰	۲۹/۲۰-۳۰/۷۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج سی و هشتم (هزار میلیارد ریال)			۲۷۰/۳
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در سی و شش حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)			۵۹۲۶/۵

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

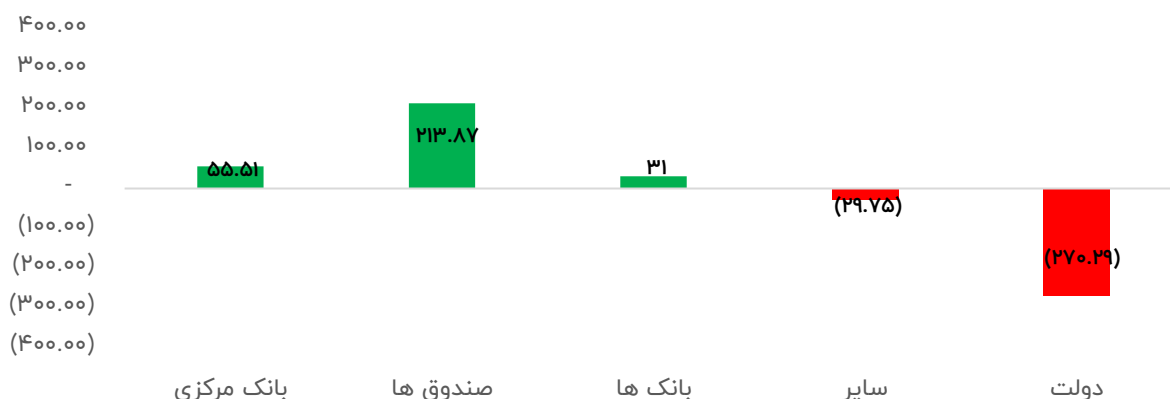


نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۲۴ بهمن ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال

انتقال مالکیت اوراق بدهی



همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته صندوق ها بزرگ‌ترین خریدار اوراق بدهی بوده‌است. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۲۷۰/۲۹ 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)
اراد۱	شهریور ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۱۱/۲۸	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۰۰/۰
اراد۳	دی ۱۴۰۷				۱۰۰/۰
اراد۳	بهمن ۱۴۰۷				۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

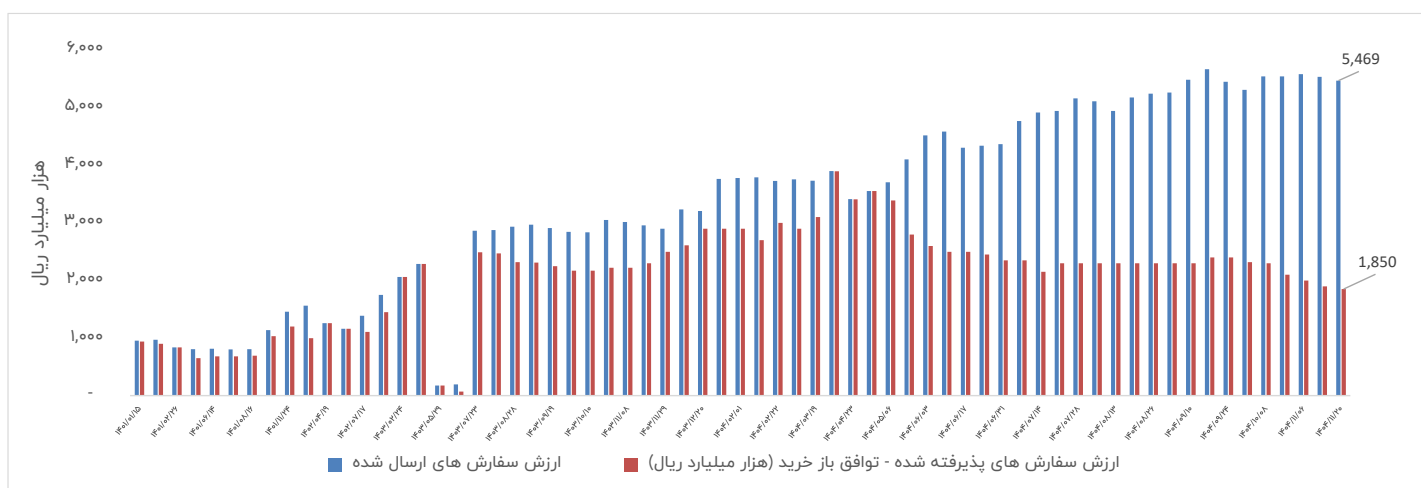


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۴۶۹.۳ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۱۸۵۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

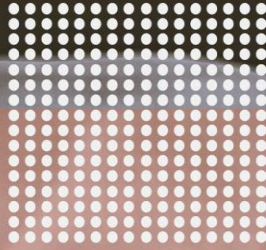
در تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۲۰	عملیات بازار باز
۴۳	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۲	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۴۶۹.۳	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۱۸۵۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق باز خرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۱۹۰۸/۴	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۱۸۵۰/۰	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.



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	۳۲,۶۱۹	-۰.۳۱%	۱.۱۰%	۶.۸۴%	۱۴.۹۷%	۴۰.۵۵%
۲	سام	۲۳,۸۷۲	۰.۷۱%	۲.۷۴%	۹.۹۳%	۱۹.۴۶%	۳۷.۵۷%
۳	ارکیده	۹۰,۶۸۹	۰.۵۰%	۲.۲۴%	۸.۱۲%	۱۶.۵۷%	۳۶.۵۲%
۴	سپر	۲۹۹,۱۴۱	۰.۶۹%	۳.۲۰%	۸.۳۳%	۱۶.۶۴%	۳۶.۴۰%
۵	زمرد کوروش	۷۲,۵۵۱	۰.۶۲%	۲.۸۱%	۸.۹۷%	۱۸.۱۱%	۳۶.۳۶%
۶	فردا	۱۳۹,۵۶۷	۰.۶۲%	۲.۶۸%	۸.۲۳%	۱۶.۷۵%	۳۶.۲۱%
۷	یاقوت	۳۲۷,۳۶۳	۰.۶۲%	۲.۵۶%	۸.۱۴%	۱۶.۸۴%	۳۶.۱۴%
۸	دیبا	۲۱۸,۶۴۶	۰.۶۱%	۲.۵۸%	۸.۰۰%	۱۶.۴۳%	۳۶.۰۵%
۹	کیان	۲۵۰,۲۱۴	۰.۶۹%	۲.۱۶%	۷.۶۳%	۱۶.۷۷%	۳۵.۹۵%
۱۰	پاسارگاد	۲۵۷,۶۶۶	۰.۷۰%	۲.۵۴%	۸.۲۶%	۱۷.۴۷%	۳۵.۸۴%
۱۱	کارآمد	۷۲,۱۵۴	۰.۵۴%	۲.۳۸%	۷.۹۶%	۱۶.۵۳%	۳۵.۸۲%
۱۲	خورشید	۴۴,۷۶۰	۰.۵۱%	۲.۴۷%	۸.۰۴%	۱۶.۶۸%	۳۵.۸۰%
۱۳	کارا	۴۵,۱۲۷	۰.۳۹%	۱.۶۹%	۷.۸۷%	۱۸.۷۷%	۳۵.۷۹%
۱۴	آرامش	۸۰,۳۸۷	۰.۷۵%	۲.۷۱%	۸.۴۶%	۱۷.۶۵%	۳۵.۷۵%
۱۵	فیروزا	۲۲۴,۷۲۲	۰.۶۰%	۲.۳۸%	۷.۹۹%	۱۶.۴۸%	۳۵.۷۴%
۱۶	لبخند	۳۵,۳۷۴	۰.۶۲%	۲.۶۰%	۷.۹۱%	۱۷.۲۰%	۳۵.۷۳%
۱۷	نجات	۱۸۴,۰۸۳	۰.۶۱%	۲.۲۱%	۸.۰۸%	۱۶.۵۳%	۳۵.۷۰%
۱۸	رشد	۵۴,۰۹۹	۰.۶۱%	۲.۵۲%	۸.۰۸%	۱۶.۵۴%	۳۵.۶۷%
۱۹	توسکا	۸۴,۵۵۴	۰.۵۳%	۲.۵۴%	۹.۴۷%	۱۸.۱۶%	۳۵.۶۰%
۲۰	ثابت اکسیژن	۷,۷۴۸	۰.۶۱%	۲.۴۹%	۸.۱۶%	۱۶.۷۷%	۳۵.۵۶%
۲۱	افران	۳۱۵,۳۹۹	۰.۴۲%	۲.۴۲%	۷.۷۰%	۱۶.۳۵%	۳۵.۵۲%
۲۲	پایا	۴۴,۰۲۴	۰.۸۴%	۲.۷۴%	۸.۵۵%	۱۸.۳۸%	۳۵.۵۱%
۲۳	صایند	۳۴,۳۸۲	۰.۶۱%	۲.۶۶%	۸.۰۹%	۱۶.۶۶%	۳۵.۵۰%
۲۴	آکورد	۸۱,۱۷۹	۰.۶۳%	۲.۸۶%	۸.۳۷%	۱۷.۴۶%	۳۵.۴۹%
۲۵	دامون	۶۰,۹۰۴	۰.۵۹%	۲.۴۲%	۸.۱۱%	۱۶.۴۳%	۳۵.۴۱%
۲۶	اعتماد	۲۲۱,۱۵۱	۰.۶۰%	۲.۲۹%	۷.۹۷%	۱۶.۳۸%	۳۵.۲۸%
۲۷	کارین	۱۹۸,۲۵۱	۰.۶۳%	۴.۲۹%	۸.۱۷%	۱۶.۵۰%	۳۵.۲۴%
۲۸	دارا	۳۷,۳۷۱	۰.۵۸%	۲.۴۹%	۸.۲۰%	۱۶.۶۱%	۳۵.۱۹%
۲۹	ماهور	۱۱۳,۷۸۳	-۰.۰۴%	۱.۸۹%	۷.۸۷%	۱۶.۳۶%	۳۵.۱۹%
۳۰	اوتیکس	۱۹۸,۸۱۴	۰.۷۲%	۲.۶۵%	۸.۶۶%	۱۸.۳۵%	۳۵.۱۸%
۳۱	خاتم	۱۴,۳۱۰	۰.۶۰%	۲.۴۹%	۷.۸۹%	۱۶.۳۶%	۳۵.۱۰%
۳۲	نیک گستر	۳,۲۴۳	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۷.۸۸%	۱۶.۴۹%	۳۵.۰۵%
۳۳	کاج	۴۶,۵۷۶	۰.۶۷%	۲.۵۶%	۸.۲۴%	۱۶.۵۵%	۳۵.۰۵%
۳۴	داریک	۳۳,۱۰۱	۰.۹۷%	۳.۰۲%	۱۲.۰۱%	۲۱.۱۵%	۳۵.۰۱%
۳۵	آوند	۳۴۳,۶۹۶	۰.۶۰%	۲.۵۱%	۷.۹۱%	۱۶.۲۳%	۳۴.۹۴%
۳۶	پاداش	۵۸,۸۴۹	۰.۵۷%	۲.۲۹%	۷.۷۸%	۱۶.۱۳%	۳۴.۹۲%
۳۷	آلا	۱۷,۴۶۴	۰.۷۹%	۲.۵۸%	۷.۸۸%	۱۶.۱۹%	۳۴.۸۶%
۳۸	کارما	۹,۶۰۳	۰.۵۸%	۱.۰۴%	۷.۴۴%	۱۶.۹۴%	۳۴.۶۷%
۳۹	پایش	۱۱,۴۶۹	۰.۷۲%	۲.۳۶%	۷.۹۰%	۱۸.۸۶%	۳۴.۵۹%
۴۰	اعتبار	۲۱,۰۲۷	۰.۵۶%	۲.۳۳%	۷.۸۳%	۱۶.۱۵%	۳۴.۵۹%
۴۱	رابین	۱۷,۵۵۷	۰.۵۳%	۲.۲۱%	۷.۹۴%	۱۶.۳۳%	۳۴.۵۵%
۴۲	شمیم	۳۶,۰۵۳	۰.۵۴%	۲.۳۲%	۷.۷۸%	۱۶.۲۴%	۳۴.۴۲%
۴۳	ساحل	۷۱,۱۵۷	۰.۵۴%	۲.۲۲%	۸.۰۰%	۱۶.۲۵%	۳۴.۳۲%
۴۴	نشان	۳۰,۰۱۱	۰.۴۵%	۱.۸۷%	۷.۳۰%	۱۶.۱۹%	۳۴.۱۶%
۴۵	یارا	۱۴,۴۸۶	۰.۵۳%	۱.۸۸%	۸.۱۳%	۱۸.۶۰%	۳۴.۰۶%
۴۶	تداوم	۱۳۷,۴۹۴	۰.۴۹%	۲.۶۹%	۸.۳۹%	۱۶.۹۳%	۳۴.۰۳%

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 بهمن	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	جمع
اخزا	۰.۰۰٪	۲۸.۳۰٪	۲۹.۲۰٪	۲۹.۸۵٪	۲۹.۶۱٪	۰.۰۰٪	۲۹.۵۱٪
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۲۲.۸۷٪	۲۲.۵۳٪	۲۴.۰۱٪	۲۲.۸۳٪	۰.۰۰٪	۲۲.۷۶٪
معادل بانکی	۰	۱۶,۰۲۲	۱۸۷,۳۲۹	۲۱۸,۹۸۵	۲۷۸	۰	۸۰۰,۰۴۶
حجم معاملات (ورقه)	۰	۱۴	۱۴۱	۱۲۹	۱۶۰	۰	۴۴۵
ارزش معاملات (میلیارد ریال)							
اراد	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۷.۷۱٪	۲۷.۹۸٪	۲۹.۴۴٪	۰.۰۰٪	۲۸.۶۹٪
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۲.۴۳٪	۲۲.۶۳٪	۲۲.۷۱٪	۰.۰۰٪	۲۲.۱۶٪
معادل بانکی	۰	۰	۱,۲۹۰,۰۰۰	۲۶,۲۶۵,۰۰۰	۲۹,۷۴۵,۰۰۰	۰	۵۷,۳۰۰,۰۰۰
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۱,۱۸۵	۲۲,۴۷۷	۲۲,۲۲۵	۰	۴۶,۹۸۷
ارزش معاملات (میلیارد ریال)							
گام	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
معادل بانکی	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۰	۰	۰	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.

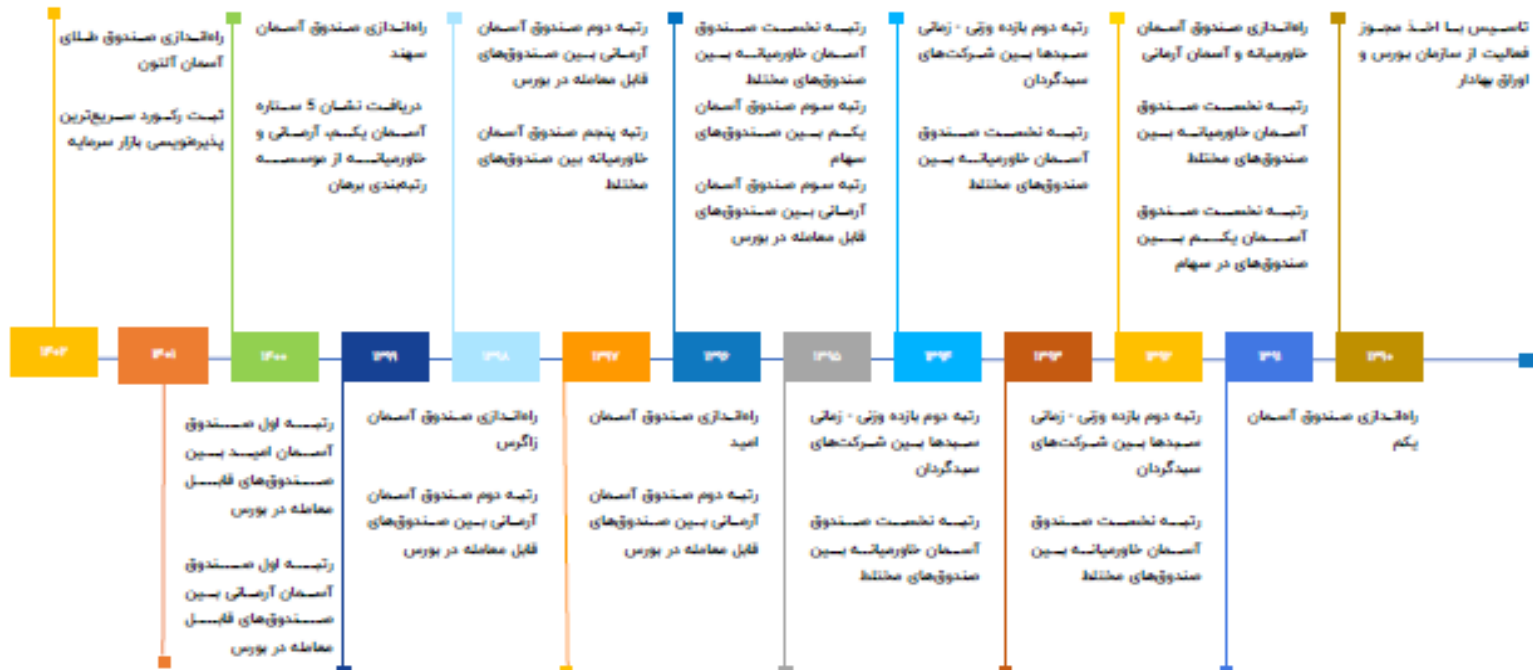
شرکت مدیریت دارایی آسمان با هدف ارائه خدمات تخصصی در زمینه مدیریت سرمایه‌گذاری اوراق بهادار در مرداد ماه ۱۳۹۰ تاسیس و با کسب مجوز سیدگردانی از سازمان بورس و اوراق بهادار، تحت نظارت این سازمان فعالیت خود را آغاز کرد. این شرکت با تکیه بر تجارب و سوابق مدیران خود در طی دوره فعالیت با راه‌اندازی صندوق‌های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

• خدمات:

• آمار مهم:



• مهم‌ترین دستاوردها:



• نکات کلیدی:

- بازدهی سالانه ۸۹ درصدی صندوق سهامی آسمان آرمانی سهام
- بازده سالانه ۹۰ درصدی صندوق سهامی آسمان یکم
- بازده ۷۷ درصدی صندوق مختلط آسمان خاورمیانه
- بازده ۲۷.۵ درصدی صندوق درآمد ثابت آسمان امید
- بازده ۲۸ درصدی صندوق درآمد ثابت آسمان سهند
- بازده ۷۵ درصدی سبدهای سرمایه‌گذاری تحت مدیریت