

بازار بدهی – منتهی به اسفند 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

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

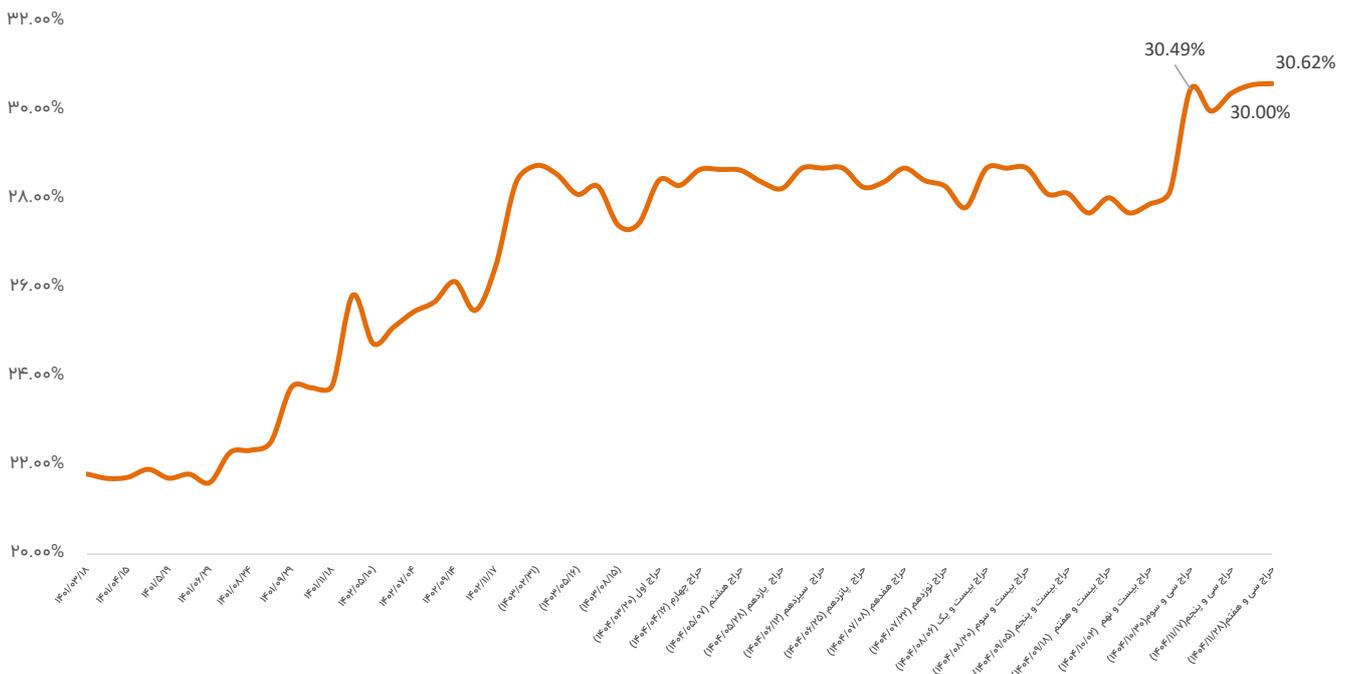


حراج اوراق دولتی

در سی هفتمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۲۳۷/۸ 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) ۳ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج سی و هفتم مبلغ ۲۴۰/۸ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

| برگزاری حراج سی و هفتم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۲۸ | | | |
|--|-------------|-------------|--|
| اراد ۲۷۳ | اراد ۲۷۲ | اراد ۲۷۱ | نماد اوراق |
| ۱۰۰/۰ | ۱۰۰/۰ | ۱۰۰/۰ | مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال) |
| ۰/۰ | ۰/۰ | ۳ | ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال) |
| ۷۹/۹ | ۷۰/۲ | ۸۷/۷ | ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال) |
| ۳۰/۷۰-۳۰/۷۱ | ۳۰/۶۷-۳۰/۷۱ | ۲۹/۵۲-۳۰/۴۸ | نرخ بازده تا سررسید (درصد) |
| ۲۴۰/۸ | | | ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج سی و هفتم (هزار میلیارد ریال) |
| ۶۱۶۷/۴ | | | ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در سی و هفت حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال) |

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

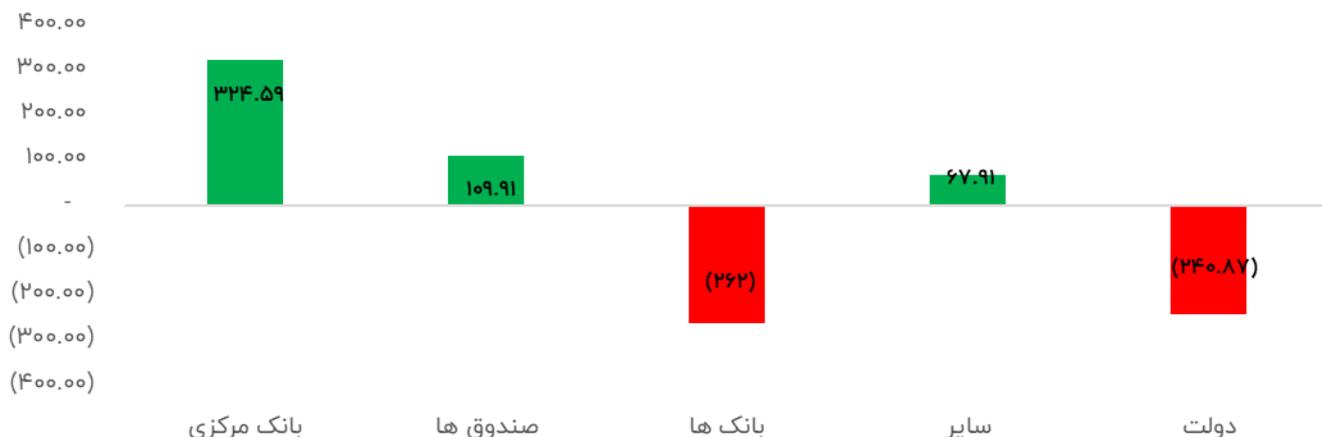


نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۱ اسفند ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال

انتقال مالکیت اوراق بدهی



همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته بانک مرکزی بزرگترین خریدار اوراق بدهی بوده است. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۲۴۰/۸۷ 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) |
|--------|---------------|--------------|----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| اراد۲۲ | دی ۱۴۰۷ | ۱۴۰۴/۱۱/۲۸ | ۲۳/۰۰ | ۱۰۰۰ | ۲۱/۴ |
| اراد۲۳ | بهمن ۱۴۰۷ | | | | ۱۰/۳ |
| اراد۲۴ | بهمن ۱۴۰۷ | ۱۴۰۴/۱۲/۰۵ | | | ۱۰۰/۰ |
| اراد۲۵ | اردیبهشت ۱۴۰۸ | | | | ۱۰۰/۰ |
| اراد۲۶ | خرداد ۱۴۰۸ | | | | ۱۰۰/۰ |

بخش دوم

معاملات بازار باز

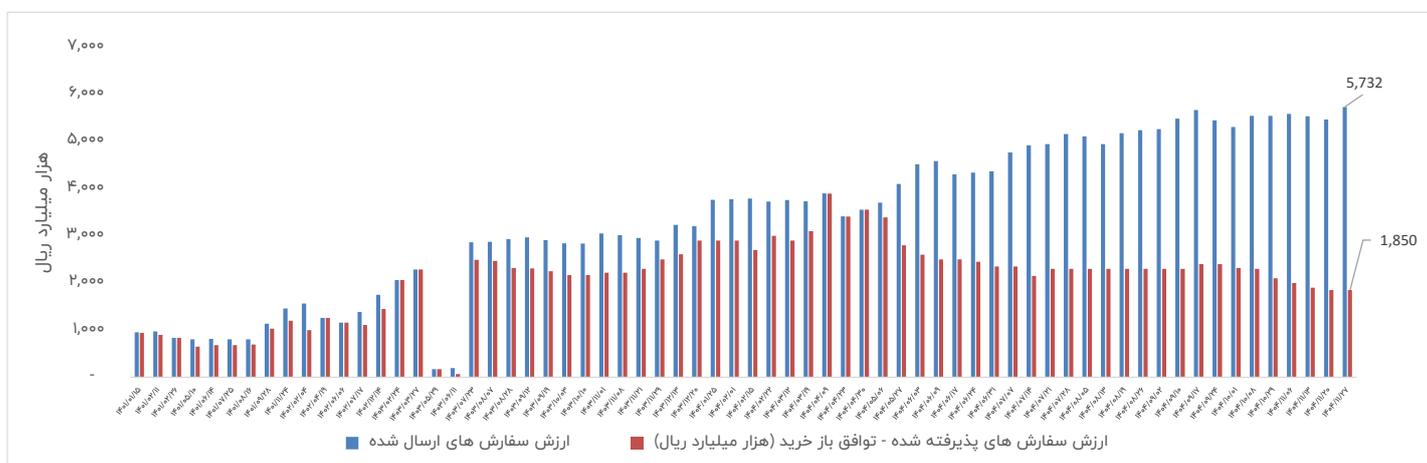


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۷۳۲/۰ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۱۸۵۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

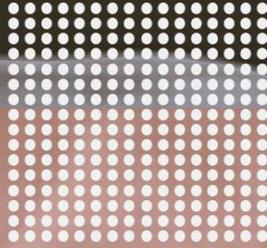
| در تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۲۷ | عملیات بازار باز |
|---------------------|---|
| ۴۴ | شماره حراج |
| توافق باز خرید | موضع عملیات بانک مرکزی |
| ۲۲ | تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج |
| ۵۷۳۲/۰ | ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال) |
| ۱۸۵۰/۰ | ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال) |
| ۷ | مدت توافق باز خرید (روز) |
| ۲۳/۰۰ | حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد) |
| ۱۸۵۸/۱ | 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 | ۳۲,۲۸۸ | ۱.۸۷% | ۲.۴۳% | ۷.۹۱% | ۱۶.۴۳% | ۴۲.۹۳% |
| ۲ | کارآمد | ۷۱,۵۱۹ | ۰.۶۷% | ۲.۴۴% | ۸.۰۷% | ۱۶.۶۱% | ۳۷.۲۲% |
| ۳ | ارکیده | ۹۱,۳۱۹ | ۱.۰۳% | ۲.۷۷% | ۸.۴۹% | ۱۷.۰۳% | ۳۷.۱۷% |
| ۴ | سام | ۲۲,۶۷۷ | -۰.۱۹% | ۱.۸۸% | ۹.۱۸% | ۱۸.۲۴% | ۳۶.۴۹% |
| ۵ | زمرد کوروش | ۷۰,۲۴۸ | ۰.۴۸% | ۲.۵۸% | ۸.۸۲% | ۱۷.۹۲% | ۳۶.۳۵% |
| ۶ | فردا | ۱۳۴,۳۹۱ | ۰.۶۲% | ۲.۶۸% | ۸.۲۵% | ۱۶.۷۸% | ۳۶.۲۷% |
| ۷ | کارا | ۳۳۳,۲۸۹ | ۰.۶۲% | ۲.۵۷% | ۸.۱۵% | ۱۶.۹۶% | ۳۶.۲۰% |
| ۸ | ستاره | ۴۸,۰۲۰ | ۰.۵۲% | ۲.۵۰% | ۷.۹۳% | ۱۶.۴۶% | ۳۵.۹۷% |
| ۹ | پاسارگاد | ۲۵۱,۳۷۸ | ۰.۶۲% | ۲.۵۸% | ۸.۲۸% | ۱۷.۵۳% | ۳۵.۹۴% |
| ۱۰ | سپر | ۳۰۱,۲۳۹ | ۰.۴۵% | ۲.۳۳% | ۸.۱۵% | ۱۷.۲۷% | ۳۵.۹۱% |
| ۱۱ | گنجین | ۳۵,۵۸۱ | ۰.۵۹% | ۲.۶۱% | ۷.۸۷% | ۱۷.۲۱% | ۳۵.۷۹% |
| ۱۲ | کیان | ۲۴۵,۶۳۷ | ۰.۴۲% | ۱.۹۹% | ۷.۴۴% | ۱۶.۶۴% | ۳۵.۷۹% |
| ۱۳ | ثبات | ۱۶۹,۹۹۰ | ۰.۶۰% | ۱.۹۱% | ۸.۰۹% | ۱۶.۵۵% | ۳۵.۷۵% |
| ۱۴ | لیخند | ۲۲۱,۳۸۹ | ۰.۵۸% | ۲.۴۶% | ۷.۹۵% | ۱۶.۵۷% | ۳۵.۷۵% |
| ۱۵ | رشد | ۵۲,۲۳۷ | ۰.۶۰% | ۲.۵۲% | ۸.۰۹% | ۱۶.۵۷% | ۳۵.۷۴% |
| ۱۶ | فیروزا | ۲۲۲,۶۴۲ | ۰.۶۲% | ۲.۵۲% | ۸.۰۲% | ۱۶.۴۹% | ۳۵.۷۴% |
| ۱۷ | کاج | ۴۴,۱۷۰ | ۰.۲۹% | ۱.۳۵% | ۷.۵۷% | ۱۸.۶۱% | ۳۵.۷۳% |
| ۱۸ | آکورد | ۸۱,۳۵۸ | ۰.۶۳% | ۲.۸۶% | ۸.۴۰% | ۱۷.۵۳% | ۳۵.۷۲% |
| ۱۹ | افران | ۳۲۰,۶۵۱ | ۰.۷۷% | ۲.۵۴% | ۷.۸۵% | ۱۸.۳۱% | ۳۵.۷۰% |
| ۲۰ | پایا | ۴۶,۲۷۱ | ۰.۴۵% | ۲.۴۷% | ۸.۴۲% | ۱۸.۰۵% | ۳۵.۶۵% |
| ۲۱ | ثابت اکسیژن | ۷,۱۷۱ | ۰.۶۱% | ۲.۵۳% | ۸.۱۵% | ۱۶.۸۸% | ۳۵.۶۳% |
| ۲۲ | کامیاب | ۳۵,۷۸۳ | ۰.۶۱% | ۲.۶۶% | ۸.۱۱% | ۱۶.۷۱% | ۳۵.۵۷% |
| ۲۳ | یاقوت | ۴۰۵,۹۶۵ | ۰.۶۱% | ۲.۵۹% | ۷.۹۱% | ۱۶.۴۱% | ۳۵.۵۷% |
| ۲۴ | دامون | ۶۰,۷۲۷ | ۰.۶۷% | ۲.۶۱% | ۸.۰۲% | ۱۶.۵۱% | ۳۵.۴۶% |
| ۲۵ | ماهور | ۱۱۰,۵۲۷ | ۰.۴۲% | ۱.۸۱% | ۷.۸۴% | ۱۶.۱۹% | ۳۵.۴۶% |
| ۲۶ | آرامش | ۸۰,۷۹۹ | ۰.۵۱% | ۲.۶۳% | ۸.۳۷% | ۱۷.۵۷% | ۳۵.۴۵% |
| ۲۷ | کارین | ۲۰۲,۲۱۸ | ۰.۶۳% | ۲.۶۴% | ۸.۲۱% | ۱۶.۵۹% | ۳۵.۳۰% |
| ۲۸ | دارا | ۳۵,۱۲۷ | ۰.۶۴% | ۲.۶۰% | ۸.۲۲% | ۱۶.۶۹% | ۳۵.۲۸% |
| ۲۹ | نیک گستر | ۳,۲۶۲ | ۰.۵۹% | ۲.۵۶% | ۷.۸۸% | ۱۶.۴۹% | ۳۵.۲۶% |
| ۳۰ | خاتم | ۱۴,۱۳۷ | ۰.۶۱% | ۲.۵۲% | ۷.۸۶% | ۱۶.۴۲% | ۳۵.۲۱% |
| ۳۱ | اونیکس | ۲۰۰,۸۶۰ | ۰.۵۲% | ۲.۴۹% | ۸.۵۷% | ۱۸.۲۸% | ۳۵.۱۹% |
| ۳۲ | داریک | ۳۱,۸۶۶ | ۰.۷۱% | ۳.۰۱% | ۱۲.۲۸% | ۲۲.۲۳% | ۳۵.۱۸% |
| ۳۳ | آلا | ۱۷,۲۱۵ | ۰.۵۲% | ۲.۶۷% | ۷.۸۳% | ۱۵.۷۵% | ۳۵.۰۶% |
| ۳۴ | پاداش | ۵۸,۴۱۶ | ۰.۶۴% | ۲.۴۸% | ۷.۸۳% | ۱۶.۱۶% | ۳۵.۰۳% |
| ۳۵ | آوند | ۳۴۳,۳۲۹ | ۰.۶۲% | ۲.۵۸% | ۷.۸۳% | ۱۶.۲۸% | ۳۵.۰۱% |
| ۳۶ | رابین | ۱۷,۴۴۹ | ۰.۸۱% | ۲.۴۳% | ۸.۰۸% | ۱۶.۲۵% | ۳۴.۹۶% |
| ۳۷ | توسکا | ۸۴,۴۶۴ | -۰.۰۶% | ۱.۹۵% | ۸.۴۸% | ۱۷.۴۴% | ۳۴.۹۰% |
| ۳۸ | اعتماد | ۲۲۶,۶۶۱ | ۰.۴۳% | ۲.۲۹% | ۷.۶۹% | ۱۶.۱۵% | ۳۴.۸۸% |
| ۳۹ | اعتبار | ۴۲,۷۸۹ | ۰.۵۷% | ۲.۶۲% | ۸.۱۲% | ۱۶.۶۹% | ۳۴.۷۵% |
| ۴۰ | صنهای | ۲۰,۱۱۹ | ۰.۶۴% | ۲.۴۲% | ۷.۸۷% | ۱۶.۲۵% | ۳۴.۶۳% |
| ۴۱ | پایش | ۱۱,۶۱۴ | ۰.۴۱% | ۲.۱۷% | ۷.۶۲% | ۱۸.۶۵% | ۳۴.۵۸% |
| ۴۲ | یارا | ۱۴,۵۱۳ | ۰.۱۹% | ۱.۳۱% | ۷.۴۸% | ۱۸.۳۲% | ۳۴.۵۰% |
| ۴۳ | شمیم | ۳۷,۶۴۵ | ۰.۶۳% | ۲.۴۰% | ۷.۸۲% | ۱۶.۲۲% | ۳۴.۴۶% |
| ۴۴ | ساحل | ۷۵,۳۵۱ | ۰.۶۰% | ۲.۳۲% | ۷.۹۸% | ۱۶.۶۹% | ۳۴.۳۸% |
| ۴۵ | تداوم | ۱۴۱,۳۶۱ | ۰.۶۹% | ۲.۵۳% | ۸.۵۰% | ۱۷.۱۱% | ۳۴.۲۹% |
| ۴۶ | نشان | ۲۸,۸۵۴ | ۰.۵۶% | ۱.۸۶% | ۷.۱۶% | ۱۶.۳۷% | ۳۴.۱۹% |
| ۴۷ | سپنتارود | ۱,۲۸۴ | ۰.۶۸% | ۲.۵۷% | ۹.۱۷% | ۱۶.۷۶% | ۳۴.۱۶% |

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 ۲۹ | 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 |
| میانگین YTM | ۷.۲۲٪ | ۴۰.۵۵٪ | ۴۰.۰۷٪ | ۴۰.۱۱٪ | ۲۹.۹۶٪ | ۰.۰۰٪ | ۴۰.۰۵٪ |
| معادل بانکی | ۶.۹۹٪ | ۲۴.۵۳٪ | ۲۴.۱۸٪ | ۲۴.۲۱٪ | ۲۴.۰۹٪ | ۰.۰۰٪ | ۲۴.۱۶٪ |
| حجم معاملات (ورقه) | ۱,۵۰۵ | ۱۰۰ | ۱۶۲,۵۸۹ | ۲۴۱ | ۲۵۴,۲۶۴ | ۰ | ۹۵۹,۲۸۲ |
| ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۲ | ۸۹ | ۱۲۴ | ۲۰۲ | ۱۵۱ | ۰ | ۵۶۸ |
| اراد | | | | | | | |
| 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 | جمع |
| میانگین YTM | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۲۱.۰۰٪ | ۲۵.۸۰٪ | ۴۰.۲۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۲۸.۸۸٪ |
| معادل بانکی | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۲۷.۲۱٪ | ۲۱.۰۰٪ | ۲۴.۲۷٪ | ۰.۰۰٪ | ۲۲.۲۰٪ |
| حجم معاملات (ورقه) | ۰ | ۰ | ۲,۵۲۰,۰۰۰ | ۲,۶۵۵,۰۰۰ | ۲۸,۸۲۵,۰۰۰ | ۰ | ۲۵,۰۱۰,۰۰۰ |
| ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۰ | ۰ | ۲,۴۲۴ | ۲,۲۲۸ | ۲۲,۱۹۹ | ۰ | ۲۷,۸۶۱ |
| گام | | | | | | | |
| 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 | جمع |
| میانگین YTM | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ |
| معادل بانکی | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ | ۰.۰۰٪ |
| حجم معاملات (ورقه) | ۰ | ۰ | ۰ | ۰ | ۰ | ۰ | ۰ |
| ارزش معاملات (میلیارد ریال) | ۰ | ۰ | ۰ | 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 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:



مدیریت حرفه‌ای
سبدهای اختصاصی



طراحی، راه‌اندازی و مدیریت حرفه‌ای
صندوق‌های سرمایه‌گذاری

آمار مهم:



سرمایه‌گذار فعال
۱۶۵.۰۰۰ نفر



منابع تحت مدیریت
۲۵۲.۰۰۰ میلیارد ریال



سرمایه ثبتی
۱۰۰۰ میلیارد ریال

مهم‌ترین دستاوردها:

