

بازار بدهی - منتهی به ۱۹ تیر ماه ۱۴۰۵

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



صید سود کن!

سودآوری در یکسال **%۹۴**
با سبدگردانی اختصاصی آسمان



سبدگردان آسمان
www.asemanamc.com
۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

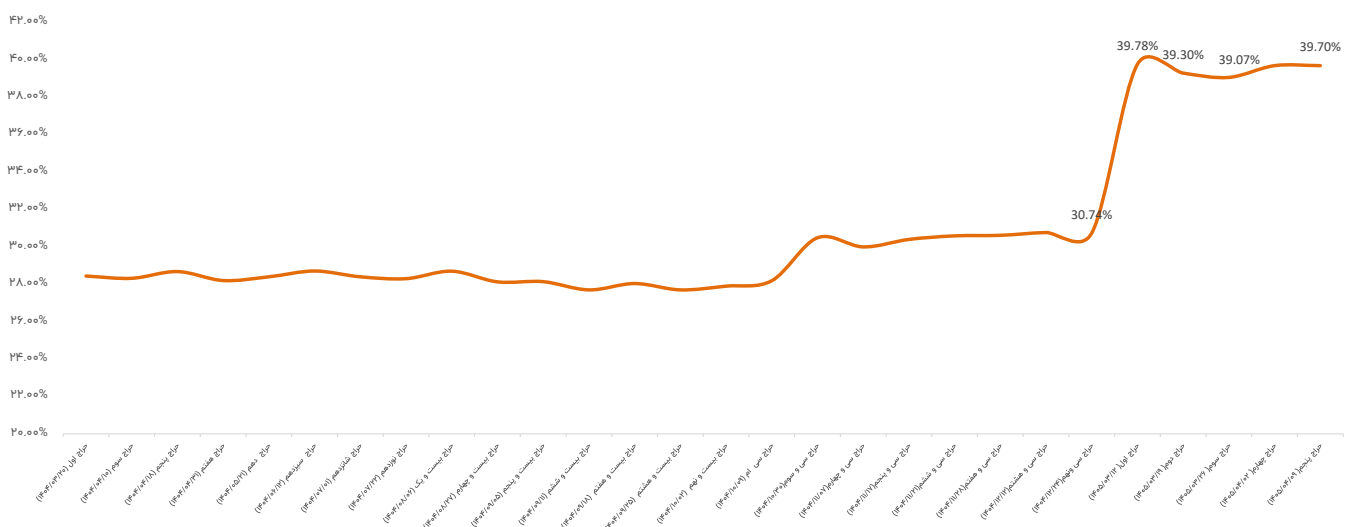


حراج اوراق دولتی

در پنجمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۵، مبلغ ۳۸/۰ 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 نشده است. بدین‌ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج پنجم مبلغ ۳۸/۰ هزار میلیارد ریال بوده است، جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج پنجم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۵/۰۴/۰۹					
نماد اوراق	اراد۳۸۳	اراد۲۸۶	اراد۲۸۹	اراد۲۹۱	اراد۲۹۲
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۱۱۶/۰	۱۳۶/۴	۱۸/۱	۱۰۰/۰	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۰/۰	۰/۰	۰/۱
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۰	۳۸/۰	۰/۰
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	-	-	-	۳۹/۷	-
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج پنجم هزار میلیارد ریال)	۳۸/۰				
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در پنجمین حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۹۳۸/۳				

نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۴ تا پنجمین حراج ۱۴۰۵ نشان می‌دهد.

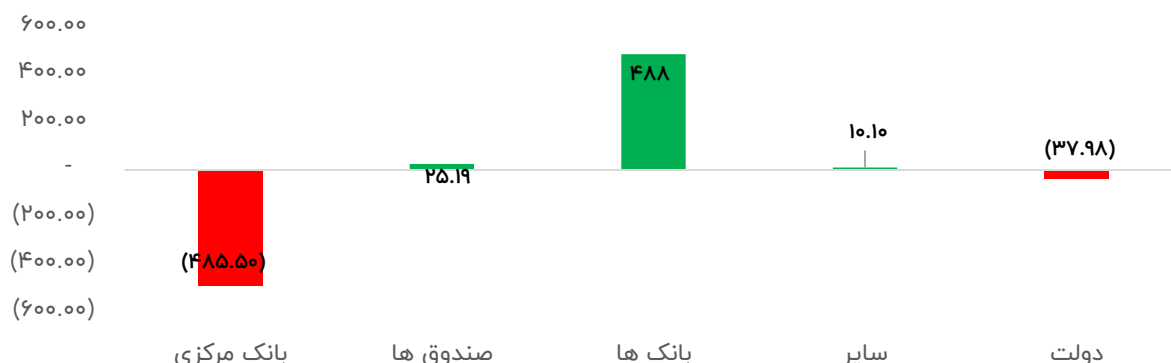


نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۱۹ تیر ۱۴۰۵

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 ۳۷/۹۸ 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)
اراد۲۸۳	۱۴۰۸ خرداد	۱۴۰۵/۰۳/۱۲	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۱۱۶/۰
اراد۲۸۶	۱۴۰۸ تیر	۱۴۰۵/۰۳/۱۹			۱۳۶/۴
اراد۲۸۹	۱۴۰۷ آبان	۱۴۰۵/۰۳/۲۶			۱۸/۱
اراد۲۹۱	۱۴۰۷ مرداد	۱۴۰۵/۰۴/۰۹			۵۳/۵
اراد۲۹۲	۱۴۰۷ آذر				۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

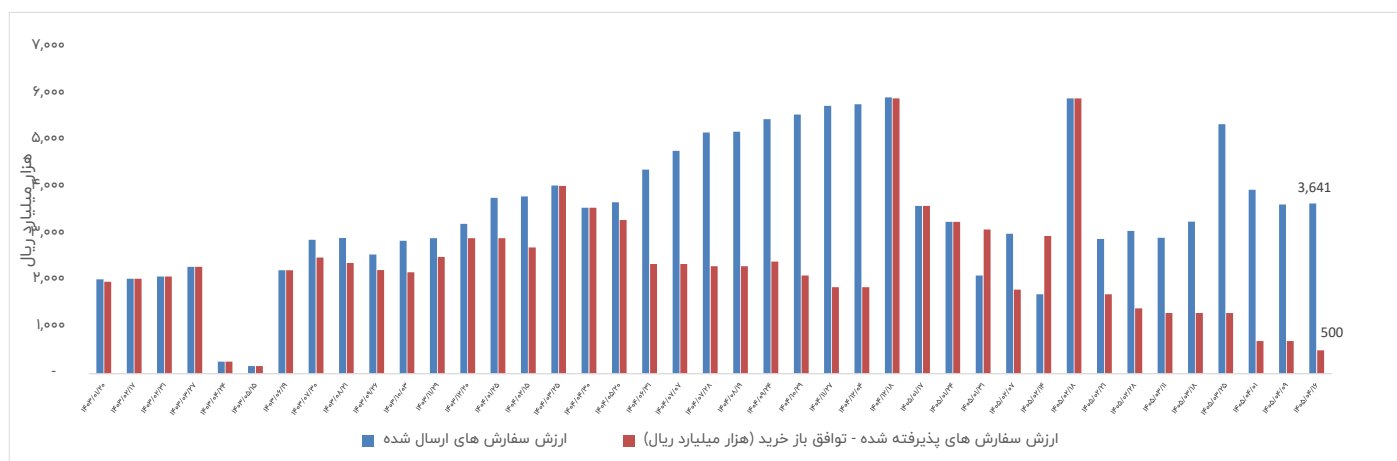


عملیات بازار باز در هفته گذشته

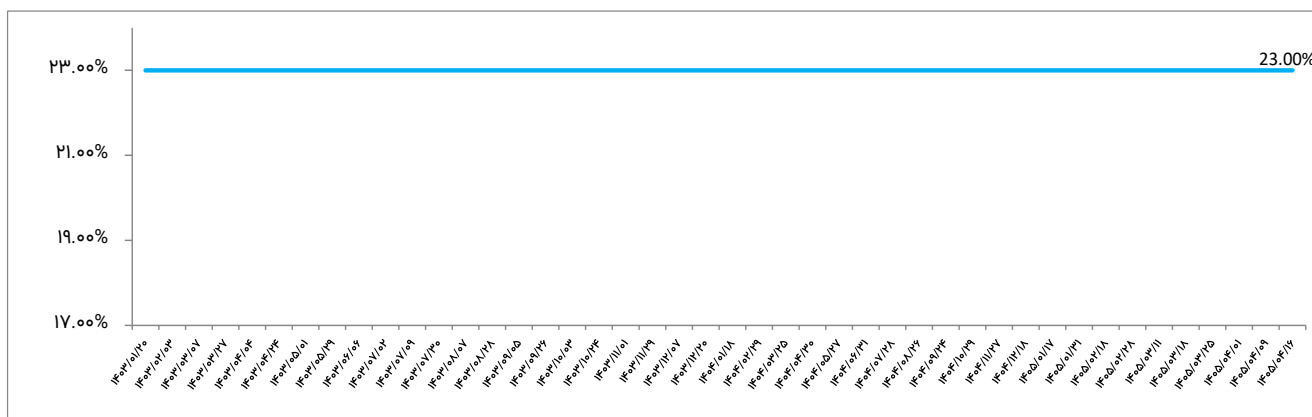
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۳۶۴۱/۲ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۵۰۰/۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۵/۰۴/۱۶	عملیات بازار باز
۱۶	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۰	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۳۶۴۱/۲	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۵۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق بازخرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۷۰۳/۵	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۵۰۰/۰	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.

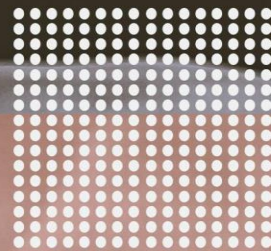


نمودار زیر روند تغییرات نرخ سود بین بانکی را از فروردین ۱۴۰۳ نشان می‌دهد.



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	پاسارگاد	427,947	0.60%	2.89%	9.79%	19.12%	40.84%
2	کاج	81,278	0.61%	3.40%	10.76%	17.19%	40.46%
3	یارا	33,113	0.72%	2.93%	10.01%	16.61%	40.22%
4	اونیक्स	230,926	0.67%	2.96%	9.38%	17.47%	39.16%
5	سام	39,825	0.88%	2.49%	7.19%	15.38%	39.05%
6	افران	430,285	0.92%	3.10%	8.98%	17.79%	39.04%
7	ماه‌ور	142,237	0.67%	2.46%	8.92%	17.38%	38.98%
8	توسکا	150,568	0.72%	2.95%	9.78%	16.41%	38.91%
9	سپر	502,952	0.48%	2.66%	8.50%	17.40%	38.45%
10	کارا	537,637	0.64%	2.63%	8.68%	17.55%	38.25%
11	فردا	185,239	0.63%	2.74%	8.45%	17.43%	38.07%
12	ثبات	242,679	1.01%	2.67%	8.51%	17.58%	38.04%
13	زمرد کوروش	76,834	0.41%	2.62%	8.35%	16.54%	37.89%
14	دارا	38,090	0.36%	2.76%	8.79%	17.77%	37.84%
15	کیان	391,434	0.30%	2.64%	8.49%	16.91%	37.81%
16	پایا	83,665	0.64%	2.76%	8.68%	16.19%	37.63%
17	لیخند	271,684	0.14%	2.57%	9.14%	17.24%	37.63%
18	طلوع	26,208	0.59%	3.82%	8.57%	16.93%	37.62%
19	آرامش	73,746	0.54%	2.57%	8.98%	16.88%	37.61%
20	تداوم	267,817	0.52%	2.64%	8.38%	17.43%	37.55%
21	فیروزا	360,973	0.34%	2.67%	8.61%	17.32%	37.48%
22	آکورد	72,435	0.59%	2.66%	8.44%	17.56%	37.42%
23	کامیاب	56,653	0.31%	2.66%	8.45%	17.27%	37.08%
24	گنجین	42,357	0.63%	2.66%	8.05%	16.54%	37.08%
25	کارآمد	158,093	0.44%	2.54%	8.22%	16.82%	37.07%
26	رشد	92,434	0.63%	2.60%	8.37%	17.22%	37.02%
27	خاتم	20,140	0.90%	2.65%	8.41%	16.89%	37.01%
28	یاقوت	572,358	0.52%	2.53%	8.27%	16.92%	37.01%
29	آوند	481,419	0.52%	2.64%	8.11%	16.82%	36.99%
30	ثابت اکسیژن	8,183	0.62%	2.70%	8.69%	17.07%	36.97%
31	پایش	39,332	0.57%	2.02%	7.77%	16.80%	36.92%
32	دامون	55,082	0.47%	2.54%	8.07%	16.87%	36.89%
33	اعتماد	305,839	0.77%	2.74%	8.60%	16.32%	36.79%
34	بمان	13,637	0.63%	3.08%	8.73%	14.89%	36.77%
35	ساحل	75,888	0.59%	2.96%	8.49%	17.15%	36.77%
36	فاخر	40,007	0.69%	3.26%	10.08%	17.59%	36.73%
37	ارکیده	123,835	0.56%	2.44%	8.19%	16.88%	36.70%
39	اعتبار	53,994	0.64%	2.80%	8.68%	16.82%	36.62%
40	پاداش	88,456	0.42%	2.59%	8.41%	16.90%	36.61%
41	اصیل	41,627	0.59%	2.74%	9.38%	17.31%	36.59%
42	تصمیم	10,876	0.57%	2.66%	8.85%	17.25%	36.58%
44	نیک گستر	6,988	0.59%	2.56%	7.88%	16.38%	36.57%
45	ستاره	77,501	0.24%	2.63%	8.51%	16.80%	36.57%
46	شمیم	103,065	0.41%	2.56%	8.07%	16.82%	36.50%
47	کارین	392,778	0.62%	2.64%	8.28%	17.06%	36.40%
48	داریک	25,893	0.48%	2.99%	9.65%	16.60%	36.38%
49	نشان	36,718	0.58%	2.68%	9.04%	16.35%	36.36%
50	درین	38,581	0.92%	2.68%	8.19%	16.22%	36.15%
52	اوصتا	132,795	0.44%	2.03%	8.42%	14.63%	35.90%
53	سیناد	46,283	0.60%	2.48%	7.95%	16.54%	35.87%
54	کارما	8,828	0.69%	3.32%	7.90%	14.09%	35.85%
55	صنهای	22,266	0.46%	2.39%	7.87%	16.29%	35.70%
56	سینتارود	3,217	0.70%	2.94%	8.65%	16.11%	35.66%
58	آتیه ملت	83,582	0.63%	3.05%	9.31%	17.46%	35.60%
59	بازده	1,330	0.12%	2.36%	7.43%	15.03%	35.56%
60	رایین	18,118	0.58%	2.48%	8.37%	15.96%	35.48%
61	رایکا	519	0.53%	2.33%	7.58%	14.09%	35.27%
62	آلا	23,301	0.44%	2.33%	7.69%	14.99%	35.12%
63	خورشید	22,449	0.54%	2.40%	7.61%	15.89%	35.08%
64	آسامید	978	0.34%	2.12%	7.32%	15.14%	34.92%
65	اطمینان	5,743	0.54%	2.56%	7.79%	16.55%	34.69%
66	گنجینه	10,161	0.43%	2.51%	7.77%	15.36%	34.02%

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)							
۱۴۰۵/۰۴/۱۷	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	۰.۰۰٪	۳۹.۳۴٪	۲۸.۹۵٪	۲۸.۹۹٪	۴۰.۲۲٪	۰.۰۰٪	۴۰.۰۱٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۲۳.۶۳٪	۲۲.۳۵٪	۲۲.۳۸٪	۲۴.۲۹٪	۰.۰۰٪	۲۴.۱۳٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۱۷,۹۶۴	۲۵,۸۴۱	۲۷,۱۷۵	۵۷۹,۰۶۱	۰	۶۵۰,۰۴۱
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۱۶	۲۲	۱۹	۲۴۶	۰	۳۰۳
اراد							
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۱.۴۷٪	۲۸.۱۰٪	۳۶.۶۰٪	۰.۰۰٪	۲۸.۰۷٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۷.۶۸٪	۲۲.۷۲٪	۳۱.۶۰٪	۰.۰۰٪	۲۲.۷۰٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۵,۰۰۰	۱,۳۲۰,۰۰۰	۵,۰۰۰	۰	۱,۳۲۵,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۵	۱,۱۶۹	۴	۰	۱,۱۷۳
گام							
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 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
۱۹۷.۰۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۲۳۵.۰۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• آمار مهم:

• مهم‌ترین دستاوردها:

