

بازار بدهی - منتهی به ۲۵ 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



آلتون

طعم شیرین سرمایه‌گذاری در طلا
با صندوق طلای آسمان آلتون



سبدگردان آسمان

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

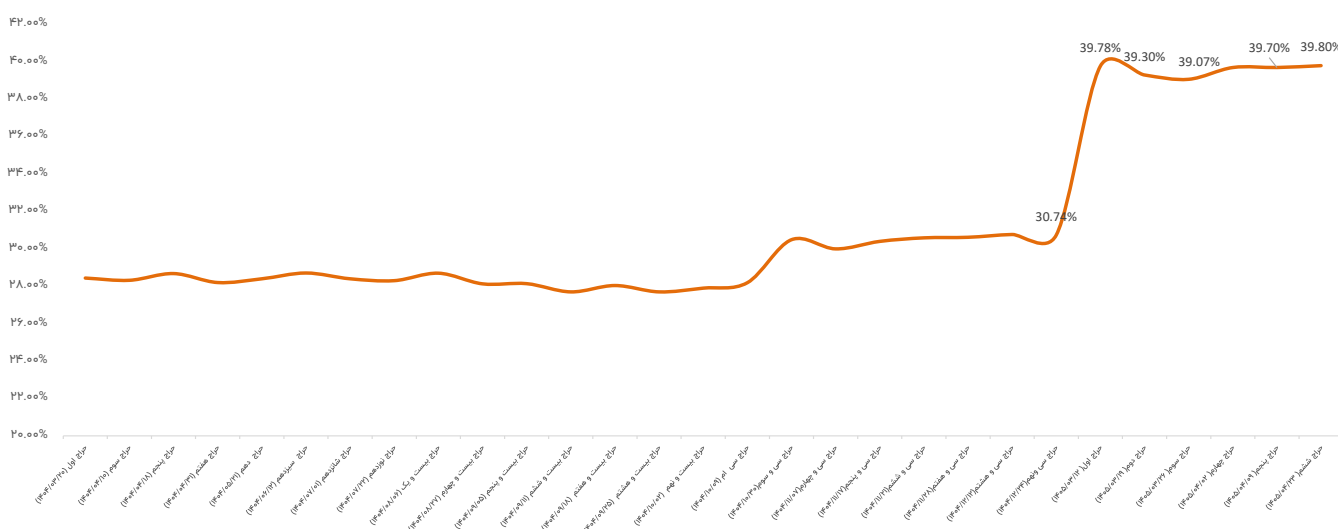


حراج اوراق دولتی

در ششمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۵، مبلغ ۱۶۴/۴۰ 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) ۱۰ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی خریداری شده است. بدین‌ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج ششم مبلغ ۱۷۴/۴ هزار میلیارد ریال بوده است، جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج ششم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۵/۰۴/۲۳					
نماد اوراق	اراد۲۸۳	اراد۲۸۶	اراد۲۸۹	اراد۲۹۱	اراد۲۹۲
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۱۱۶/۰	۱۳۶/۴	۱۸/۱	۵۳/۵	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۰/۰	۱۰/۰	۰/۱
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۳۶.۳	۰/۰	۱۴.۵	۳۳.۸	۷۹.۸
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۳۹.۹	-	۳۹.۸۰	۳۹.۷۰	۳۹.۵۳-۳۹.۸۰
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج ششم هزار میلیارد ریال)	۱۷۴.۴				
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در ششمین حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۱۱۱۲.۷				

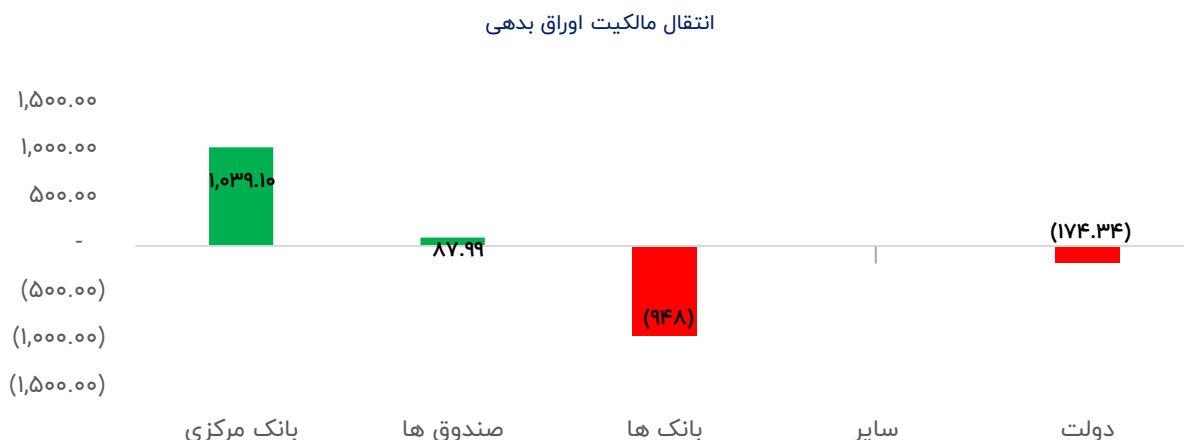
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۴ تا ششمین حراج ۱۴۰۵ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۲۵ تیر ۱۴۰۵

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال



همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته صندوق ها بزرگ‌ترین خریدار اوراق بدهی بوده‌اند. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۱۷۴/۳۴ 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	خرداد۱۴۰۸	۱۴۰۵/۰۳/۱۲	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۶۸/۸
اراد۲۸۶	تیر۱۴۰۸	۱۴۰۵/۰۳/۱۹			۱۳۶/۴
اراد۲۹۳	مرداد۱۴۰۷	۱۴۰۵/۰۴/۳۰			۱۰۰/۰
اراد۲۹۴	ارذیبهشت۱۴۰۷				۵۰/۰
اراد۲۹۵	شهریور۱۴۰۷				۱۰۰/۰
اراد۲۹۶	آذر۱۴۰۷				۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

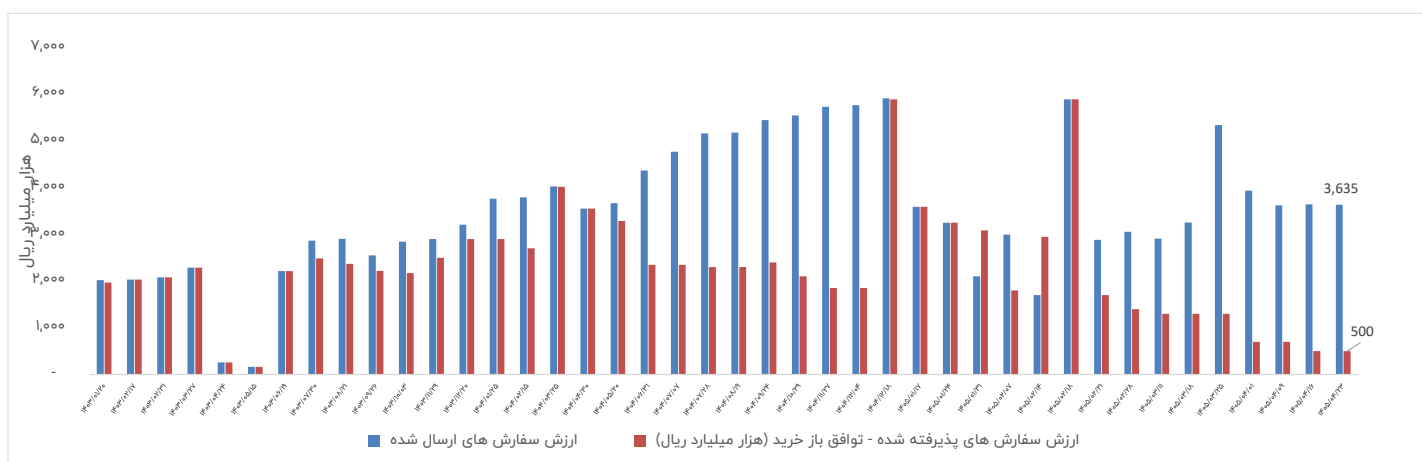


عملیات بازار باز در هفته گذشته

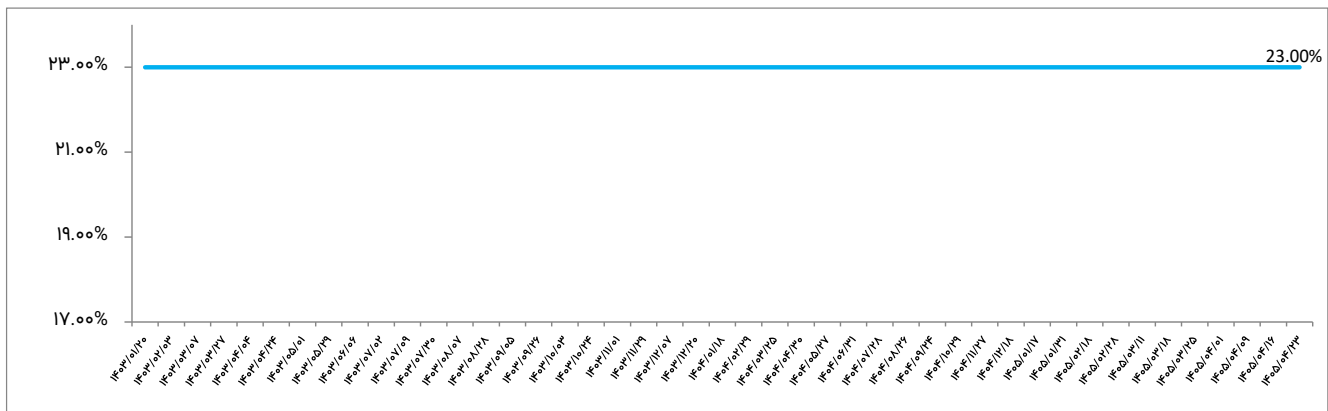
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۳۶۳۵/۳ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۵۰۰/۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۵/۰۴/۲۳	عملیات بازار باز
۱۵	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۱۶	تعداد بانک‌ها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۳۶۳۵/۳	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۵۰۰/۰	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)
۵۰۱/۹	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

ردیف	نماد	کل ارزش خالص دارایی‌ها	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سه ماهه	بازده شش ماهه	بازده یک ساله
1	پاسارگاد	430,368	0.57%	2.60%	9.71%	18.84%	40.98%
2	کاج	82,998	0.64%	3.43%	10.65%	17.29%	40.10%
3	افران	433,662	0.50%	2.99%	8.83%	17.71%	38.94%
4	یارا	32,938	0.48%	2.83%	10.20%	16.60%	38.93%
5	اونیکس	232,336	0.61%	2.72%	9.48%	17.58%	38.82%
6	سام	43,534	0.84%	3.21%	7.70%	15.97%	38.50%
7	ماهور	150,548	0.65%	2.76%	8.95%	17.35%	38.29%
8	توسکا	151,289	0.48%	2.81%	9.80%	16.40%	38.28%
9	سپر	513,127	0.65%	2.68%	8.53%	17.51%	38.21%
10	کارا	541,070	0.64%	2.63%	8.65%	17.59%	38.15%
11	فردا	176,772	0.64%	2.74%	8.46%	17.45%	38.08%
12	زمرد کوروش	80,508	0.65%	2.61%	8.36%	16.70%	37.97%
13	دارا	38,902	0.67%	2.69%	8.74%	17.91%	37.93%
14	ثبات	245,847	0.65%	3.00%	8.52%	17.61%	37.87%
15	آکورد	72,458	0.65%	2.68%	8.38%	17.58%	37.56%
16	کیان	410,920	0.63%	2.64%	8.44%	16.96%	37.55%
17	آرامش	73,409	0.54%	2.49%	8.96%	16.94%	37.55%
18	فیروزا	363,135	0.64%	2.67%	8.61%	17.65%	37.50%
19	تصمیم	10,503	1.03%	2.74%	9.33%	16.72%	37.48%
20	تداوم	274,962	0.59%	2.53%	8.37%	17.55%	37.48%
21	پایا	82,458	0.77%	2.89%	8.87%	16.62%	37.47%
22	طلوع	27,481	0.70%	2.79%	8.35%	17.25%	37.25%
23	گنجین	42,622	0.63%	2.69%	8.11%	16.63%	37.16%
24	لبخند	294,642	0.62%	2.58%	8.94%	17.25%	37.13%
25	یاقوت	576,073	0.65%	2.54%	8.33%	16.99%	37.10%
26	رشد	93,012	0.62%	2.60%	8.37%	17.24%	37.09%
27	کارآمد	157,223	0.63%	2.54%	8.30%	16.85%	37.03%
28	کامیاب	57,398	0.48%	2.52%	8.17%	17.11%	36.96%
29	خاتم	20,726	0.62%	2.65%	8.44%	16.98%	36.89%
30	دامون	53,888	0.65%	2.58%	8.15%	16.94%	36.87%
31	آوند	489,799	0.61%	2.89%	8.11%	16.84%	36.84%
32	ارکیده	127,421	0.65%	2.77%	8.40%	17.18%	36.84%
33	پایش	39,383	0.71%	2.09%	7.99%	16.76%	36.75%
34	ساحل	74,633	0.56%	2.71%	8.49%	16.85%	36.68%
35	فاخر	40,069	0.60%	2.84%	10.19%	17.88%	36.67%
36	داریک	29,433	0.66%	2.76%	9.68%	16.51%	36.66%
37	بمان	13,412	0.69%	2.98%	9.50%	15.12%	36.64%
39	ثابت اکسیژن	7,514	0.44%	2.46%	8.73%	16.94%	36.64%
40	ستاره	77,987	0.63%	2.64%	8.51%	16.97%	36.60%
41	اعتبار	52,700	0.56%	2.60%	8.49%	16.86%	36.49%
42	شمیم	102,089	0.62%	2.53%	8.17%	16.97%	36.48%
44	پاداش	94,287	0.61%	2.59%	8.40%	16.92%	36.46%
45	کارین	395,157	0.60%	2.63%	8.27%	17.21%	36.42%
46	اعتماد	309,962	0.39%	2.51%	8.53%	16.46%	36.37%
47	اصیل	46,087	0.64%	2.44%	9.56%	17.06%	36.27%
48	سپنتارود	3,188	0.94%	3.79%	9.03%	16.93%	36.01%
49	نیک گستر	7,029	0.59%	2.56%	7.88%	16.38%	35.95%
50	درین	38,326	0.46%	2.45%	8.12%	16.15%	35.83%
52	نشان	36,822	0.43%	2.29%	8.94%	16.09%	35.79%
53	صنهای	21,815	0.66%	2.44%	8.05%	16.38%	35.78%
54	آتیه ملت	91,154	0.63%	2.50%	9.37%	17.54%	35.68%
55	اوصتا	148,380	0.63%	2.66%	8.49%	14.76%	35.51%
56	سیناد	42,787	0.61%	2.48%	7.98%	16.62%	35.44%
58	آلا	23,861	0.60%	2.43%	7.88%	16.09%	35.41%
59	خورشید	23,065	0.70%	2.47%	7.79%	16.12%	35.26%
60	بازده	1,327	0.85%	2.37%	8.16%	15.38%	35.25%
61	رابین	20,549	0.29%	2.27%	8.19%	15.71%	35.15%
62	کارما	8,931	0.10%	3.06%	9.06%	13.80%	35.09%
63	اطمینان	6,071	0.59%	2.57%	8.16%	16.60%	34.50%
64	آسامید	981	0.29%	1.85%	7.05%	15.35%	34.43%
65	رایکا	522	0.57%	2.29%	7.59%	14.96%	34.26%

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)							
۱۴۰۵/۰۴/۲۳	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	۲۷.۵۲٪	۲۷.۵۴٪	۰.۰۰٪	۲۸.۷۸٪	۲۹.۲۷٪	۰.۰۰٪	۲۹.۱۸٪
معادل بانکی	۳۲.۲۹٪	۳۲.۲۰٪	۰.۰۰٪	۳۲.۲۲٪	۳۲.۶۶٪	۰.۰۰٪	۳۲.۵۲٪
حجم معاملات (ورقه)	۲۱,۰۹۲	۲۲,۵۲۷	۰	۱۲۸,۰۸۴	۱,۱۶۹,۱۰۴	۰	۱,۳۴۱,۸۵۲
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۰	۲۱	۰	۸۶	۵۱۱	۰	۶۳۷
اراد							
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۹.۷۹٪	۲۹.۷۹٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۲.۹۷٪	۳۲.۹۷٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۰	۰	۰	۱,۴۵۰,۰۰۰	۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۰	۰	۰	۱,۱۲۸	۰
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 ثبتي**

• مهم‌ترین دستاوردها:

