

بازار بدهی - منتهی به ۱۶ مرداد 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



هزار میلیاردمان

صندوق درآمد ثابت آسمان دامون

با نماد دامون

سبگردان آسمان

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی



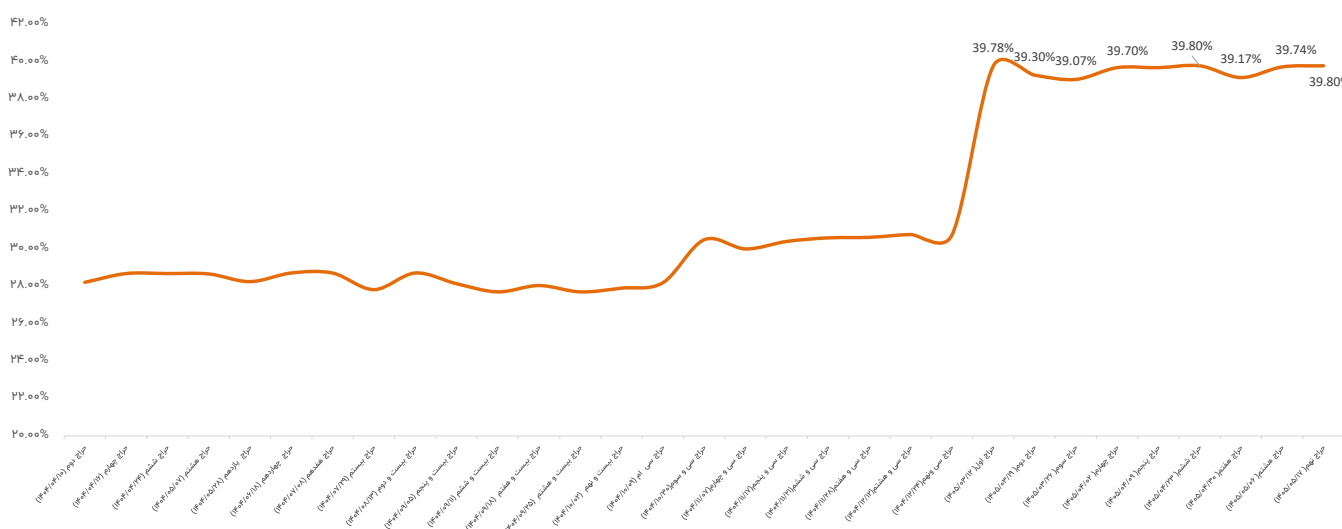
حراج اوراق دولتی

در نهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۵، مبلغ ۲۹/۱ 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) ۲ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی خریداری شده است. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج هشتم مبلغ ۳۱/۱ هزار میلیارد ریال بوده است، جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج نهم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۵/۰۵/۰۶

نماد اوراق	اراد۲۸۳	اراد۲۸۶	اراد۲۹۶	اراد۲۹۷	اراد۲۹۸
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۶۸/۸	۱۳۶/۴	۵۵/۲	۱۰۷/۷	۳۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۲/۰	۰/۰	۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۲۹/۱	۰/۰	۰/۰	۰/۰	۰/۰
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۳۹/۹	-	۳۹/۸۰	-	-
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج نهم هزار میلیارد ریال)	۳۱/۱				
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در نهمین حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۱۴۶۷/۰				

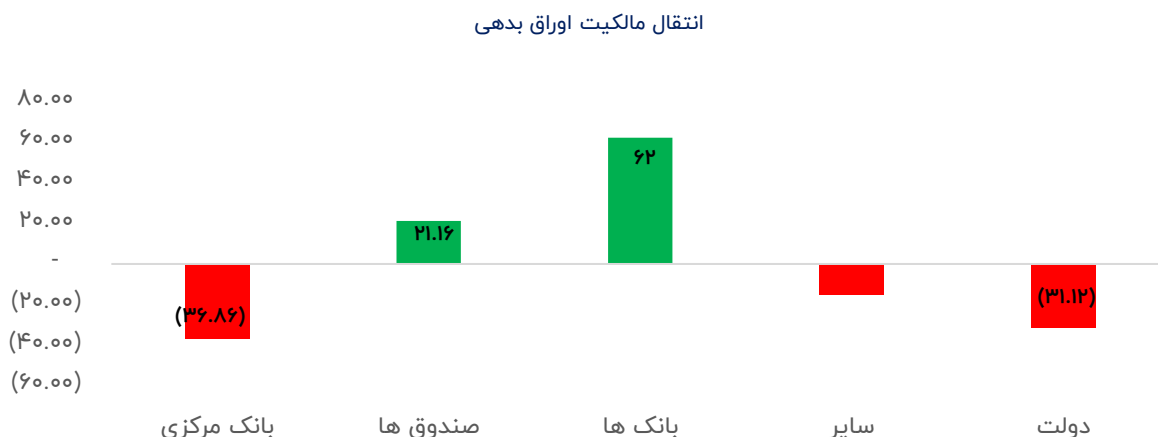
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۴ تا نهمین حراج ۱۴۰۵ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۱۶ مرداد ۱۴۰۵

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 ۳۱.۱۲ 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	۳۱/۱
اراد۲۸۶	۱۴۰۸ تیر	۱۴۰۵/۰۳/۱۹			۱۳۶/۴
اراد۲۹۶	۱۴۰۷ آذر	۱۴۰۵/۰۴/۳۰			۵۲/۷
اراد۲۹۷	۱۴۰۷ مهر	۱۴۰۵/۰۵/۰۶			۱۰۷/۷
اراد۲۹۸	۱۴۰۸ تیرماه	۱۴۰۵/۰۵/۱۴			۳۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

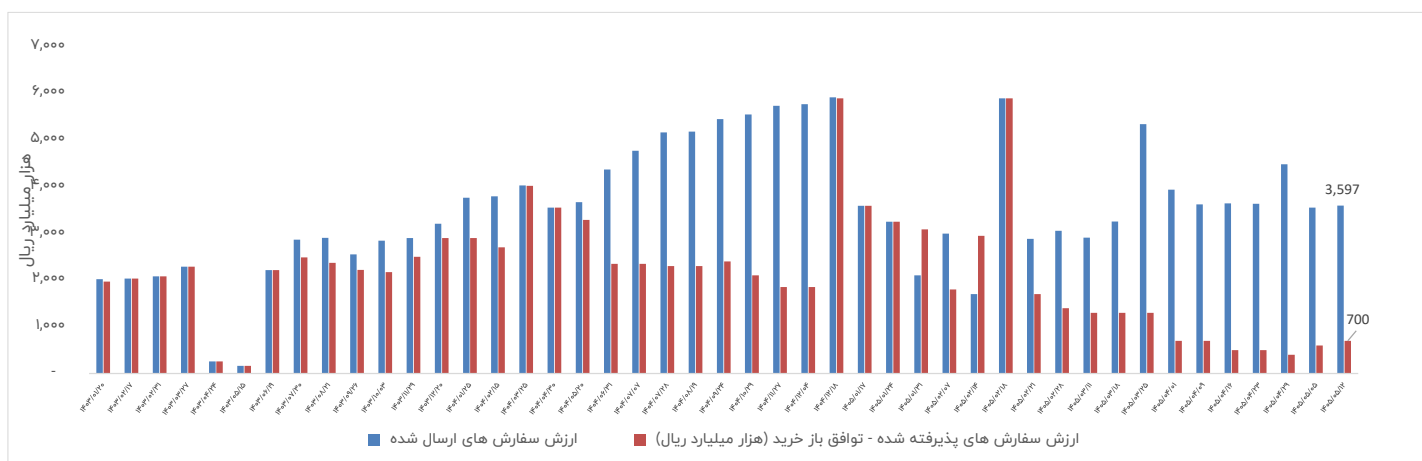


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۳۵۹۶/۹ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۷۰۰/۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

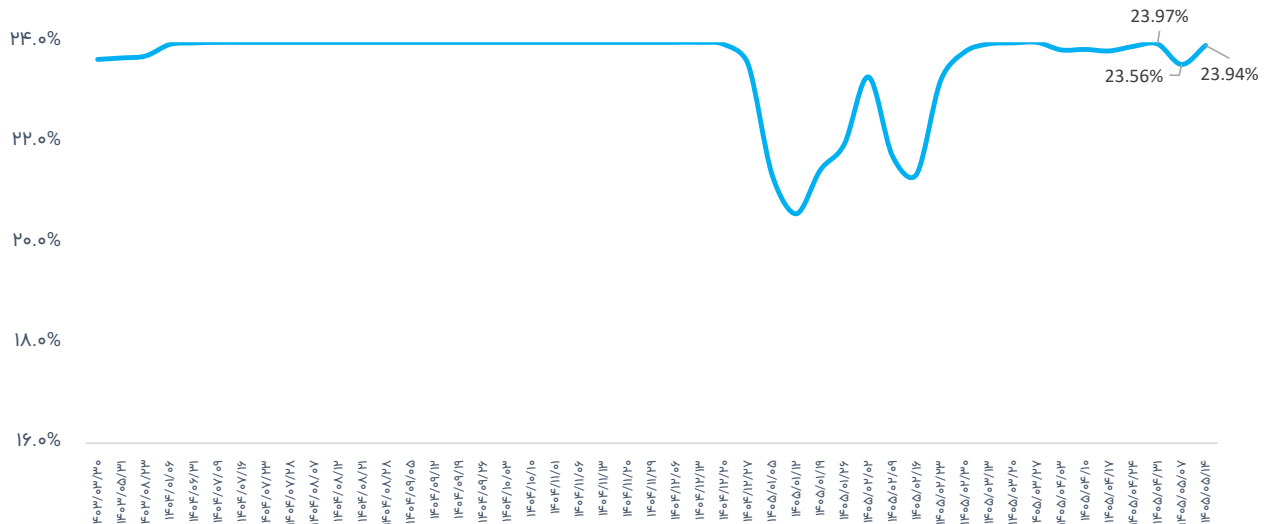
در تاریخ ۱۴۰۵/۰۵/۱۲	عملیات بازار باز
۱۸	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۱۵	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۳۵۹۶/۹	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۶۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق باز خرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۶۰۲/۶	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۷۰۰/۰	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.



بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی با تغییر مثبت ۰/۳۸٪ نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۳/۹۴ درصد ثبت گردیده 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	458,252	1.12%	3.26%	9.99%	19.74%	41.54%
2	کاج	113,081	0.98%	3.00%	9.85%	18.49%	41.53%
3	یارا	34,102	0.89%	3.12%	9.91%	17.94%	41.07%
4	اونیکس	246,331	1.09%	3.42%	10.18%	18.48%	40.51%
5	داریک	36,863	0.82%	3.04%	10.37%	16.91%	40.38%
6	سام	45,465	1.27%	3.65%	8.79%	16.54%	40.11%
7	افران	444,685	0.74%	3.21%	9.59%	18.76%	39.02%
8	نوسکا	154,385	0.79%	2.70%	9.20%	16.76%	38.98%
9	پایش	40,407	0.63%	2.86%	8.02%	17.17%	38.96%
10	زمرد کوروش	86,355	0.66%	2.82%	8.51%	16.53%	38.56%
11	سپر	522,598	0.56%	2.60%	8.48%	17.33%	38.52%
12	تصمیم	9,189	1.01%	3.64%	10.05%	19.37%	38.24%
13	ماهور	167,240	0.61%	2.47%	8.05%	18.01%	38.21%
14	دارا	50,695	0.57%	2.85%	8.96%	18.05%	38.15%
15	ثبات	249,457	0.64%	3.10%	8.53%	17.72%	38.11%
16	آکورد	85,463	0.63%	2.74%	8.37%	17.46%	38.07%
17	کارا	551,439	0.63%	2.63%	8.59%	17.65%	38.00%
18	طلوع	33,364	0.54%	2.62%	8.31%	17.15%	37.84%
19	پایا	107,552	0.59%	2.80%	8.79%	16.53%	37.83%
20	آرامش	89,206	0.63%	2.55%	8.86%	16.88%	37.78%
21	فردا	195,913	0.63%	2.74%	8.46%	17.50%	37.77%
22	فیروزا	368,192	0.64%	2.68%	8.61%	17.80%	37.69%
23	تداوم	278,286	0.65%	2.61%	8.34%	17.27%	37.56%
24	کیان	429,289	0.63%	2.64%	8.39%	17.64%	37.53%
25	اصیل	53,206	0.92%	3.29%	10.12%	18.01%	37.50%
26	لبخند	317,255	0.65%	2.60%	8.62%	17.50%	37.43%
27	نشان	40,123	1.04%	3.03%	9.63%	17.33%	37.37%
28	اعتبار	56,416	0.82%	2.97%	8.93%	17.47%	37.37%
29	رشد	94,770	0.63%	2.60%	8.39%	17.30%	37.34%
30	گنجین	50,514	0.64%	2.73%	8.21%	16.72%	37.31%
31	ساحل	116,647	0.76%	2.83%	8.80%	17.51%	37.27%
32	کامیاب	65,358	0.58%	2.41%	8.14%	17.29%	37.23%
33	ارکیده	131,941	0.56%	2.61%	8.16%	17.45%	37.22%
34	فاخر	65,742	0.77%	2.76%	10.51%	18.44%	37.20%
35	دامون	101,588	0.62%	2.79%	8.37%	17.11%	37.11%
36	کارآمد	176,681	0.63%	2.54%	8.29%	16.94%	37.09%
37	نیک گستر	7,153	0.59%	2.54%	7.86%	16.36%	37.08%
38	کارما	9,160	1.15%	3.17%	10.08%	16.60%	37.03%
39	ستاره	90,153	0.62%	2.68%	8.57%	17.02%	36.88%
40	خاتم	21,139	0.62%	2.66%	8.25%	16.99%	36.86%
41	بمان	14,388	0.92%	2.98%	9.92%	16.20%	36.83%
42	یاقوت	632,171	0.61%	2.62%	8.35%	17.10%	36.83%
43	شمیم	109,803	0.67%	2.69%	8.39%	17.13%	36.73%
44	ثابت اکسیژن	8,477	0.68%	2.32%	8.53%	16.64%	36.69%
45	پاداش	98,649	0.63%	2.60%	8.33%	17.14%	36.61%
46	کارین	328,404	0.61%	2.63%	8.27%	17.03%	36.59%
47	اعتماد	420,832	0.61%	2.33%	8.17%	16.57%	36.25%
48	اوصتا	157,573	0.18%	2.52%	8.43%	15.03%	36.25%
49	آتیه ملت	113,556	0.60%	2.78%	9.61%	17.93%	36.04%
50	درین	39,149	0.52%	2.59%	8.15%	16.88%	35.99%
51	آلا	41,936	0.60%	2.84%	8.17%	16.55%	35.87%
52	صنهای	28,196	0.52%	2.60%	8.05%	16.48%	35.76%
53	رابین	23,860	0.59%	2.36%	8.63%	16.16%	35.65%
54	اطمینان	6,624	1.02%	2.99%	8.57%	17.43%	35.56%
55	سپنارود	3,113	0.66%	2.40%	8.93%	16.08%	35.37%
56	خورشید	25,473	0.54%	2.58%	7.83%	16.00%	35.13%

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)							
۱۴۰۵/۰۵/۱۴	جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۳۶۵ روز	بین ۳۶۵ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز
اخزا	میانگین YTM	۲۹.۲۷٪	۲۹.۲۹٪	۰.۰۰٪	۲۸.۳۲٪	۲۹.۳۰٪	۰.۰۰٪
	معادل بانکی	۲۳.۵۸٪	۲۳.۶۰٪	۰.۰۰٪	۲۲.۸۸٪	۲۳.۶۱٪	۰.۰۰٪
	حجم معاملات (ورقه)	۵۳,۷۹۰	۳۰,۷۵۵	۰	۱۰۸	۱,۲۶۹,۵۲۸	۰
	ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۵۱	۲۸	۰	۷۶	۵۶۴	۷۱۸
اراد	جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۳۶۵ روز	بین ۳۶۵ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۸.۸۹٪	۲۷.۱۱٪	۲۵.۵۹٪	۰.۰۰٪	۲۶.۹۰٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۳.۳۰٪	۳۱۹۸.۰۰٪	۲۰.۸۴٪	۰.۰۰٪	۳۱.۸۲٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۲,۹۳۰,۰۰۰	۱۲۲,۸۱۵,۰۰۰	۲۷,۵۴۰,۰۰۰	۰	۱۵۴,۲۸۵,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۳,۶۹۴	۱۰۸,۳۱۲	۲۳,۶۰۷	۰	۱۳۵,۶۱۲
گام	جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۳۶۵ روز	بین ۳۶۵ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز
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
۱۹۳,۰۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۲۵۳,۰۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• آمار مهم:

• مهم‌ترین دستاوردها:

