

بازار بدهی - منتهی به ۰۲ 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



چله تابستون با

%۴۰

سود روز شمار

صندوق درآمد ثابت آسمان دامون

با نماد دامون

سبدگردان آسمان

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی



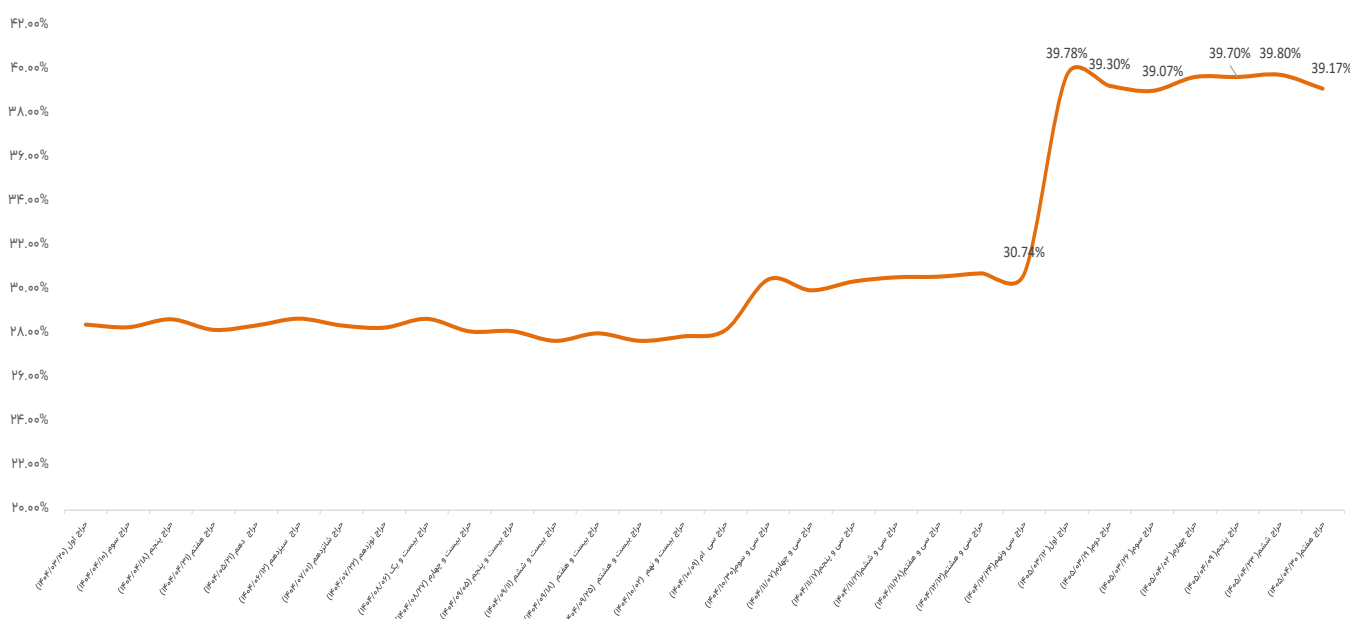
حراج اوراق دولتی

در هفتمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۵، مبلغ ۱۶۲/۳ 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) ۸۷/۲ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی خریداری شده است. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج هفتم مبلغ ۲۳۴/۵ هزار میلیارد ریال بوده است، جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج هفتم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۵/۰۴/۳۰

نماد اوراق	اراد ۸۳	اراد ۸۶	اراد ۲۹۳	اراد ۲۹۴	اراد ۲۹۵	اراد ۲۹۶
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۶۸/۸	۱۳۶/۴	۱۰۰	۵۰/۰	۱۰۰/۰	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۲۰/۰	۳۷/۲	۱۵/۰	۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۶۹/۸	۴/۴	۶۶/۱	۲۲
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۰/۰	۰/۰	۳۸/۱۵-۳۸/۳۵	۳۹/۵۹-۳۹/۶۰	۳۹/۶۹	۳۹/۸۰-۳۹/۷۶
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج هفتم هزار میلیارد ریال)	۲۳۴/۵					
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در هفتمین حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۱۳۴۷/۳					

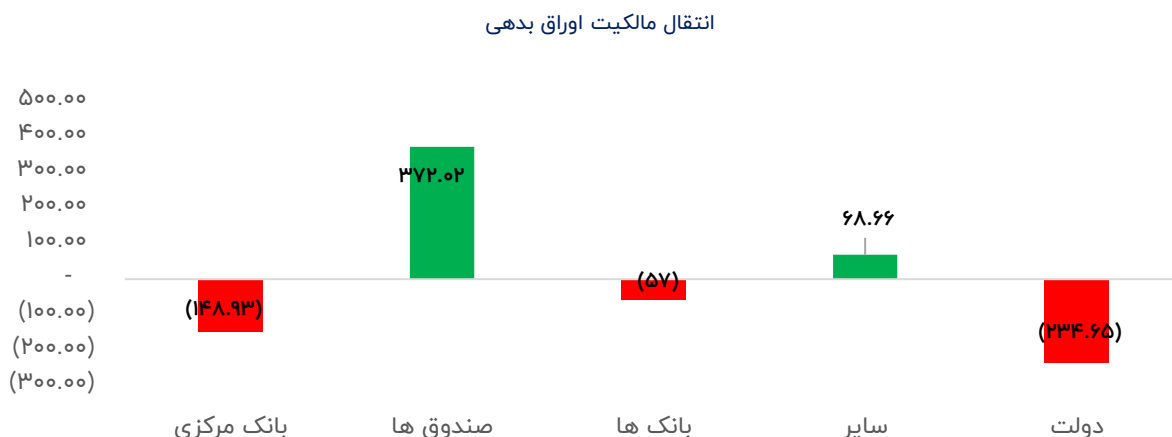
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۴ تا هفتمین حراج ۱۴۰۵ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۰۲ مرداد 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 ۲۳۴/۶۵ 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
اراد۲۹۶	آذر۱۴۰۷	۱۴۰۵/۰۴/۳۰			۷۲/۳
اراد۲۹۷	مهر۱۴۰۷				۲۰۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

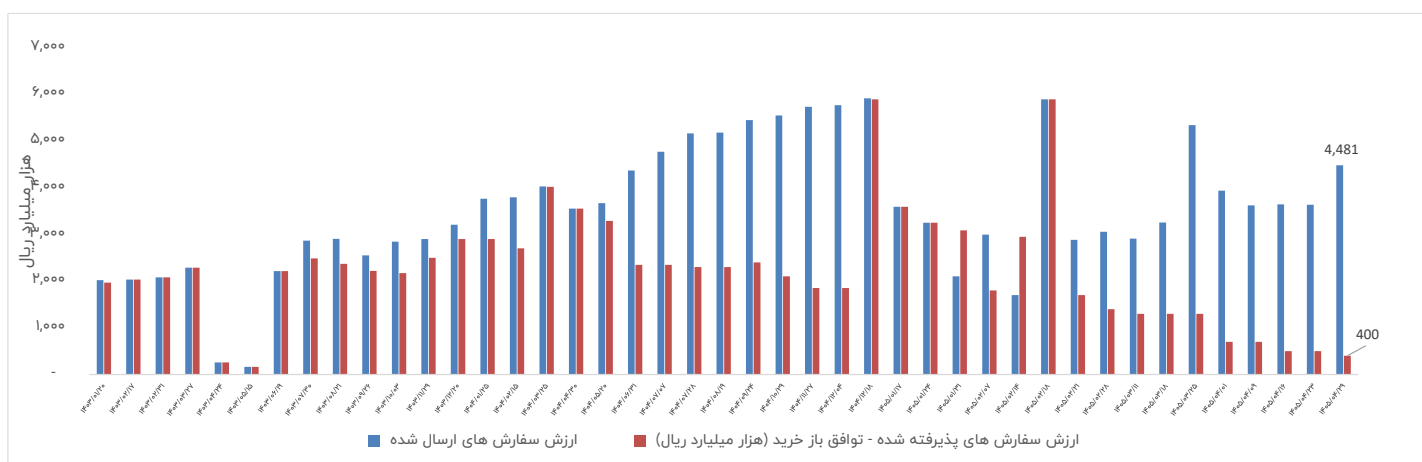


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۴۴۸۱.۷ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۴۰۰/۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

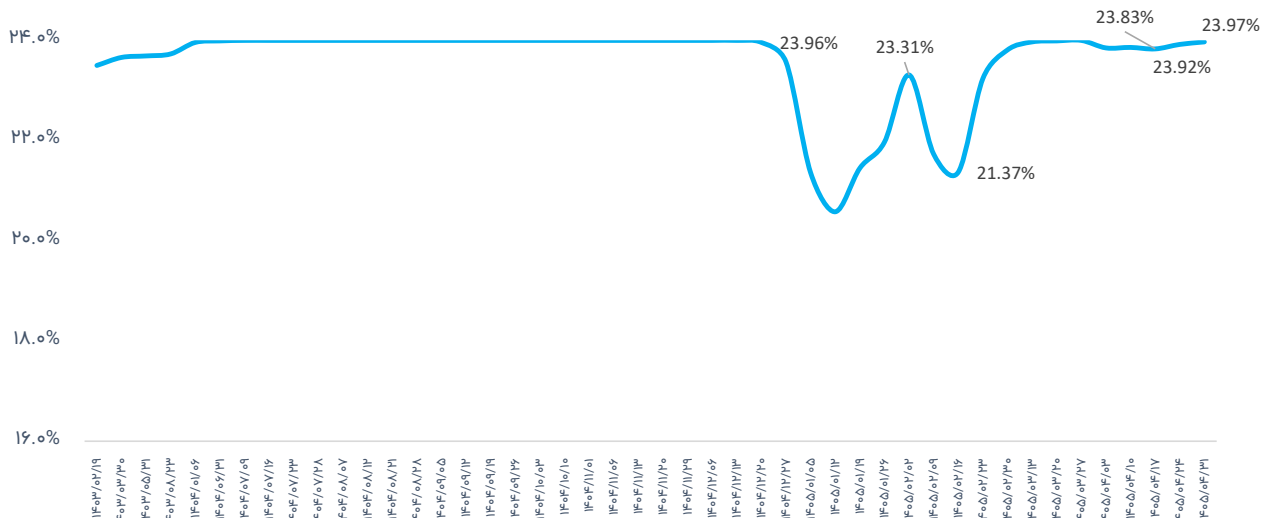
در تاریخ ۱۴۰۵/۰۴/۲۹	عملیات بازار باز
۱۶	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۱۶	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۴۴۸۱/۷	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۴۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق باز خرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۵۰۲/۲	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۴۰۰/۰	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.

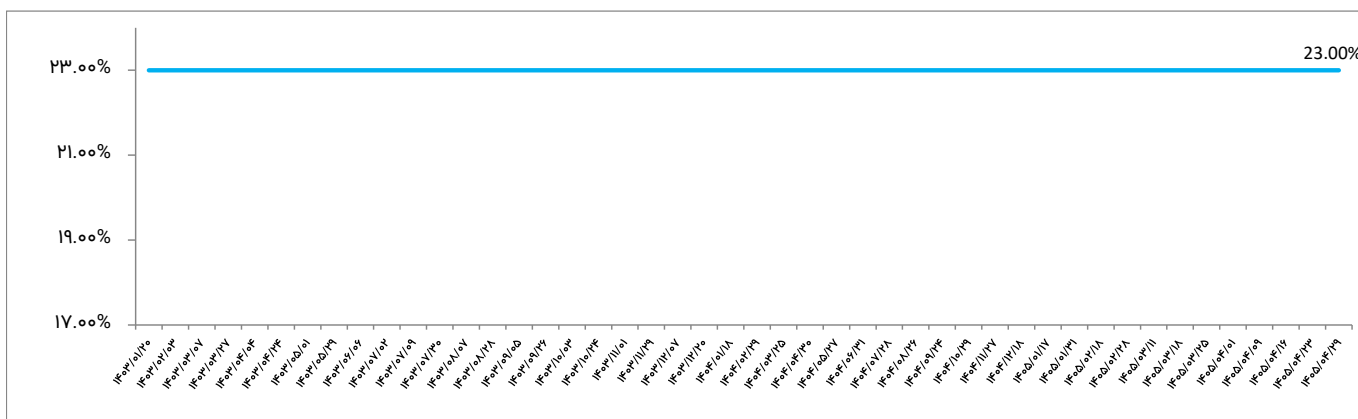


بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی با تغییر مثبت ۰/۵٪ نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۳/۹۷ درصد ثبت گردیده است.

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



حداقل نرخ توافق بازاری (ریپو) نیز بدون تغییر در چند ماه اخیر، ۲۳ درصد ثبت گردیده 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	پاسارگاد	۴۴۹,۶۲۷	۰.۶۰%	۲.۶۴%	۹.۶۵%	۱۹.۰۵%	۴۰.۳۵%
۲	کاج	۸۳,۵۷۶	۰.۶۹%	۳.۳۷%	۱۰.۵۶%	۱۷.۶۹%	۴۰.۳۴%
۳	یارا	۳۳,۱۸۵	۰.۷۵%	۳.۱۳%	۱۰.۳۱%	۱۶.۹۶%	۳۹.۳۸%
۴	اونیکس	۲۳۴,۰۶۵	۰.۷۴%	۳.۰۳%	۹.۶۳%	۱۷.۷۹%	۳۹.۰۲%
۵	سام	۴۴,۴۸۸	۰.۷۱%	۳.۸۱%	۷.۷۵%	۱۵.۹۸%	۳۸.۶۳%
۶	دارا	۴۴,۲۸۶	۱.۱۵%	۳.۲۰%	۹.۳۴%	۱۸.۴۹%	۳۸.۶۲%
۷	سپر	۵۱۶,۶۰۹	۰.۶۸%	۲.۶۹%	۸.۵۷%	۱۷.۵۰%	۳۸.۴۲%
۸	توسکا	۱۵۲,۲۰۲	۰.۶۰%	۲.۷۹%	۹.۵۸%	۱۶.۳۹%	۳۸.۲۳%
۹	افران	۴۳۴,۶۹۴	۰.۳۷%	۲.۸۱%	۸.۱۸%	۱۷.۶۱%	۳۸.۲۱%
۱۰	ماه‌ور	۱۶۵,۴۱۱	۰.۵۶%	۲.۸۵%	۹.۰۷%	۱۷.۶۸%	۳۸.۱۶%
۱۱	زمرد کوروش	۸۲,۳۹۷	۰.۶۳%	۲.۶۵%	۸.۳۴%	۱۶.۵۱%	۳۸.۱۰%
۱۲	فردا	۱۷۵,۷۷۴	۰.۶۳%	۲.۷۴%	۸.۴۶%	۱۷.۴۶%	۳۸.۰۲%
۱۳	کارا	۵۴۴,۴۹۲	۰.۶۳%	۲.۶۳%	۸.۶۴%	۱۷.۶۱%	۳۷.۹۶%
۱۴	ثبات	۲۴۸,۳۴۴	۰.۶۴%	۳.۱۰%	۸.۵۲%	۱۷.۶۴%	۳۷.۹۳%
۱۵	طلوع	۲۸,۸۴۸	۰.۶۲%	۲.۷۱%	۸.۳۸%	۱۷.۰۷%	۳۷.۶۹%
۱۶	آکورد	۷۰,۰۶۵	۰.۶۵%	۲.۷۱%	۸.۳۸%	۱۷.۶۱%	۳۷.۶۷%
۱۷	فیروزا	۳۶۴,۳۵۹	۰.۶۴%	۲.۶۴%	۸.۶۱%	۱۷.۷۰%	۳۷.۵۶%
۱۸	تداوم	۲۷۸,۲۸۶	۰.۶۵%	۲.۶۱%	۸.۳۴%	۱۷.۲۷%	۳۷.۵۶%
۱۹	آرامش	۷۴,۰۲۷	۰.۶۱%	۲.۶۰%	۹.۰۶%	۱۶.۹۳%	۳۷.۵۶%
۲۰	کیان	۴۰۸,۲۲۱	۰.۶۳%	۲.۶۰%	۸.۵۱%	۱۷.۰۰%	۳۷.۵۴%
۲۱	تصمیم	۱۱,۱۴۱	۰.۷۱%	۳.۴۵%	۹.۴۷%	۱۸.۱۵%	۳۷.۴۱%
۲۲	لیخد	۳۱۳,۱۸۱	۰.۶۴%	۲.۸۰%	۸.۸۲%	۱۷.۴۲%	۳۷.۴۰%
۲۳	پایا	۸۰,۵۴۹	۰.۷۱%	۳.۰۹%	۸.۹۹%	۱۶.۷۰%	۳۷.۳۰%
۲۴	رشد	۹۳,۵۹۷	۰.۶۳%	۲.۶۰%	۸.۳۹%	۱۷.۲۶%	۳۷.۱۸%
۲۵	یاقوت	۵۷۹,۷۸۳	۰.۶۴%	۲.۵۵%	۸.۳۴%	۱۷.۰۴%	۳۷.۱۶%
۲۶	گنجین	۴۴,۸۹۱	۰.۶۳%	۲.۷۱%	۸.۱۴%	۱۶.۶۵%	۳۷.۱۳%
۲۷	پایش	۳۹,۹۵۰	۰.۸۴%	۲.۵۵%	۷.۹۶%	۱۷.۰۹%	۳۷.۱۰%
۲۸	کارآمد	۱۵۵,۰۶۹	۰.۶۲%	۲.۵۹%	۸.۲۹%	۱۶.۸۷%	۳۷.۰۶%
۲۹	ارکیده	۱۲۶,۱۷۳	۰.۶۹%	۲.۸۹%	۸.۲۳%	۱۷.۳۰%	۳۷.۰۰%
۳۰	کامیاب	۶۱,۱۵۶	۰.۶۰%	۲.۵۱%	۸.۰۷%	۱۷.۰۹%	۳۷.۰۰%
۳۱	ساحل	۷۹,۱۹۸	۰.۷۱%	۲.۷۲%	۸.۶۳%	۱۷.۱۶%	۳۶.۹۱%
۳۲	آوند	۴۹۰,۳۴۰	۰.۶۶%	۲.۹۴%	۸.۱۲%	۱۶.۸۵%	۳۶.۹۰%
۳۳	دامون	۵۵,۰۷۴	۰.۶۶%	۲.۶۶%	۸.۱۹%	۱۷.۰۰%	۳۶.۸۸%
۳۴	اصیل	۴۹,۶۸۱	۰.۷۴%	۲.۹۰%	۹.۶۳%	۱۷.۰۸%	۳۶.۶۷%
۳۵	ستاره	۸۶,۰۲۰	۰.۶۲%	۲.۷۰%	۸.۴۸%	۱۶.۹۳%	۳۶.۶۶%
۳۶	داریک	۳۵,۴۸۰	۰.۴۸%	۲.۵۵%	۹.۶۷%	۱۶.۳۹%	۳۶.۶۱%
۳۷	شمیم	۱۰۲,۶۹۷	۰.۶۹%	۲.۶۳%	۸.۲۷%	۱۷.۰۱%	۳۶.۵۹%
۳۹	اعتبار	۵۳,۱۱۴	۰.۵۸%	۲.۵۵%	۸.۴۴%	۱۷.۰۰%	۳۶.۵۹%
۴۰	خاتم	۲۰,۱۰۱	۰.۳۸%	۲.۴۰%	۸.۱۸%	۱۶.۷۳%	۳۶.۵۹%
۴۱	کارین	۳۷۷,۴۸۵	۰.۶۲%	۲.۶۲%	۸.۲۷%	۱۷.۰۴%	۳۶.۵۰%
۴۲	فاخر	۳۹,۶۴۹	۰.۵۷%	۲.۸۴%	۱۰.۱۷%	۱۷.۵۲%	۳۶.۴۹%
۴۴	ثابت اکسیژن	۷,۶۸۲	۰.۵۱%	۲.۶۱%	۸.۶۰%	۱۶.۷۶%	۳۶.۴۸%
۴۵	پاداش	۹۶,۲۳۱	۰.۶۳%	۲.۵۷%	۸.۳۷%	۱۷.۰۷%	۳۶.۴۳%
۴۶	بازده	۱,۳۶۱	۰.۶۲%	۲.۵۰%	۷.۷۶%	۱۵.۷۹%	۳۶.۳۳%
۴۷	اعتماد	۲۹۰,۰۶۶	۰.۵۷%	۲.۶۵%	۸.۵۴%	۱۶.۵۳%	۳۶.۱۷%
۴۸	نیک گستر	۷,۰۶۹	۰.۵۷%	۲.۵۴%	۷.۸۶%	۱۶.۳۶%	۳۶.۰۸%
۴۹	بمان	۱۲,۸۵۳	۰.۵۰%	۲.۸۲%	۹.۲۶%	۱۵.۲۶%	۳۵.۹۶%
۵۰	نشان	۳۶,۰۷۴	۰.۶۱%	۲.۶۳%	۸.۹۲%	۱۶.۱۵%	۳۵.۸۹%
۵۲	درین	۳۹,۹۲۸	۰.۶۸%	۲.۷۳%	۸.۱۷%	۱۶.۳۵%	۳۵.۸۴%
۵۳	آتیه ملت	۸۹,۹۶۲	۰.۶۴%	۲.۷۱%	۹.۴۵%	۱۷.۶۷%	۳۵.۷۹%
۵۴	صنهای	۲۳,۳۰۲	۰.۶۴%	۲.۵۵%	۸.۱۱%	۱۶.۴۲%	۳۵.۷۷%
۵۵	آلا	۲۸,۵۳۹	۰.۷۸%	۲.۶۶%	۸.۱۰%	۱۶.۳۲%	۳۵.۵۸%
۵۶	سیناد	۴۲,۷۴۴	۰.۶۱%	۲.۵۲%	۷.۹۴%	۱۶.۵۵%	۳۵.۴۹%
۵۸	اوصتا	۱۵۳,۷۱۶	۰.۶۵%	۲.۸۵%	۸.۵۳%	۱۴.۹۰%	۳۵.۴۵%
۵۹	رایین	۲۱,۵۳۶	۰.۷۷%	۲.۶۰%	۸.۴۹%	۱۶.۰۷%	۳۵.۳۵%
۶۰	خورشید	۲۲,۲۱۵	۰.۵۲%	۲.۳۸%	۷.۷۷%	۱۵.۹۶%	۳۵.۲۸%
۶۱	سپینتارود	۳,۲۰۲	۰.۵۵%	۳.۳۸%	۹.۴۸%	۱۶.۲۲%	۳۵.۲۸%
۶۲	اطمینان	۶,۰۸۳	۰.۶۳%	۲.۶۸%	۸.۱۲%	۱۶.۸۰%	۳۴.۸۰%
۶۳	کارما	۸,۴۹۱	۰.۱۷%	۲.۳۱%	۸.۶۰%	۱۳.۸۹%	۳۴.۶۹%

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)							
۱۴۰۵/۰۴/۳۱	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							
میانگین YTM	۲۹.۲۴٪	۲۶.۰۹٪	۲۶.۲۶٪	۲۸.۴۲٪	۲۹.۷۴٪	۰.۰۰٪	۲۹.۴۹٪
معادل بانکی	۲۳.۵۶٪	۲۱.۲۱٪	۲۱.۳۴٪	۲۲.۹۵٪	۲۳.۹۳٪	۰.۰۰٪	۲۳.۷۵٪
حجم معاملات (ورقه)	۱,۵۱۷	۲۱,۰۳۹	۳۱,۰۸۹	۱۷,۹۹۲	۱,۷۸۲,۴۶۵	۰	۱,۸۶۵,۱۰۲
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱	۲۷	۲۶	۱۲	۷۸۰	۰	۸۴۸
اراد							
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۵.۲۸٪	۳۷.۸۵٪	۳۷.۷۷٪	۰.۰۰٪	۳۹.۷۹٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۰.۶۰٪	۳۲.۵۳٪	۳۲.۴۷٪	۰.۰۰٪	۳۳.۹۷٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۱,۱۱۰,۰۰۰	۵۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۸۸۰,۰۰۰	۰	۱,۴۵۰,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۱,۰۳۱	۴۸,۵۹۶	۵,۷۰۴	۰	۱,۱۲۸
گام							
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۴۲.۳۱٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۴۲.۳۱٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۵.۸۱٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۵.۸۱٪
حجم معاملات (ورقه)	۰	۰	۲۵۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۲۵۰,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۱۸۷	۰	۰	۰	۱۸۷
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
سادهای اختصاصی



طراحی، راه‌اندازی و مدیریت حرفه‌ای
صندوق‌های سرمایه‌گذاری



۱۹۷.۰۰۰ نفر
سرمایه‌گذار فعال



۲۳۵.۰۰۰ میلیارد ریال
منابع تحت مدیریت



۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی

● **مهم ترین دستاوردها:**

