

بازار بدهی - منتهی به ۰۹ 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

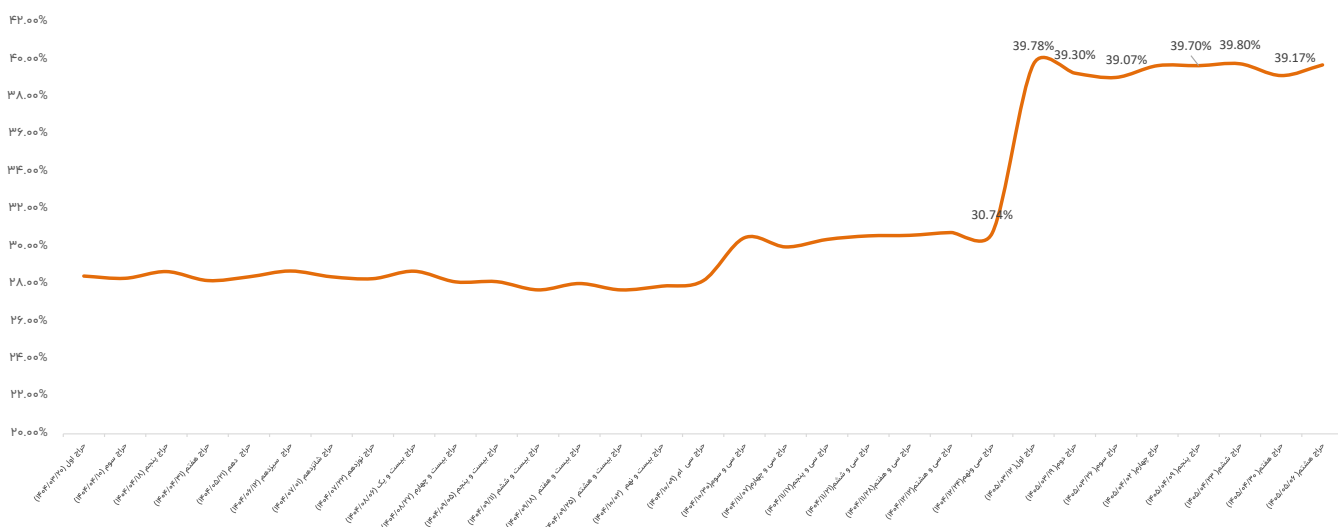


حراج اوراق دولتی

در هشتمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۵، مبلغ ۸۸/۷ 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 هشتم مبلغ ۸۸/۷ هزار میلیارد ریال بوده است، جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج هشتم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۵/۰۵/۰۶				
نماد اوراق	اراد۲۸۳	اراد۲۸۶	اراد۲۹۳	اراد۲۹۴
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۶۸/۸	۱۳۶/۴	۷۲/۳	۲۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۰/۰	۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰	۱۳/۷	۷۵/۰
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۰/۰	۳۹/۹۰	۳۹/۵۸-۳۹/۸۰	۳۹/۴۳-۳۹/۷۰
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج هشتم هزار میلیارد ریال)	۸۸/۷			
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در هشتمین حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۱۴۳۵/۹			

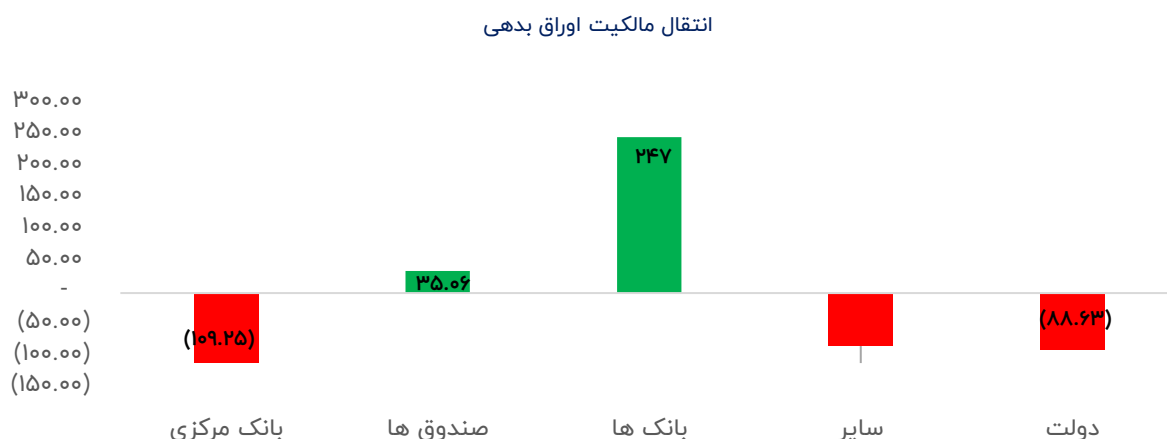
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۴ تا هشتمین حراج ۱۴۰۵ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۰۹ 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 ۸۸/۶۳ 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	۶۸/۸
اراد۲۸۶	۱۴۰۸ تیر	۱۴۰۵/۰۳/۱۹			۱۳۶/۴
اراد۲۹۶	۱۴۰۷ آذر	۱۴۰۵/۰۴/۳۰			۵۵/۲
اراد۲۹۷	۱۴۰۷ مهر	۱۴۰۵/۰۵/۰۶			۱۰۷/۷
اراد۲۹۸	۱۴۰۸ تیرماه	۱۴۰۵/۰۵/۱۴			۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

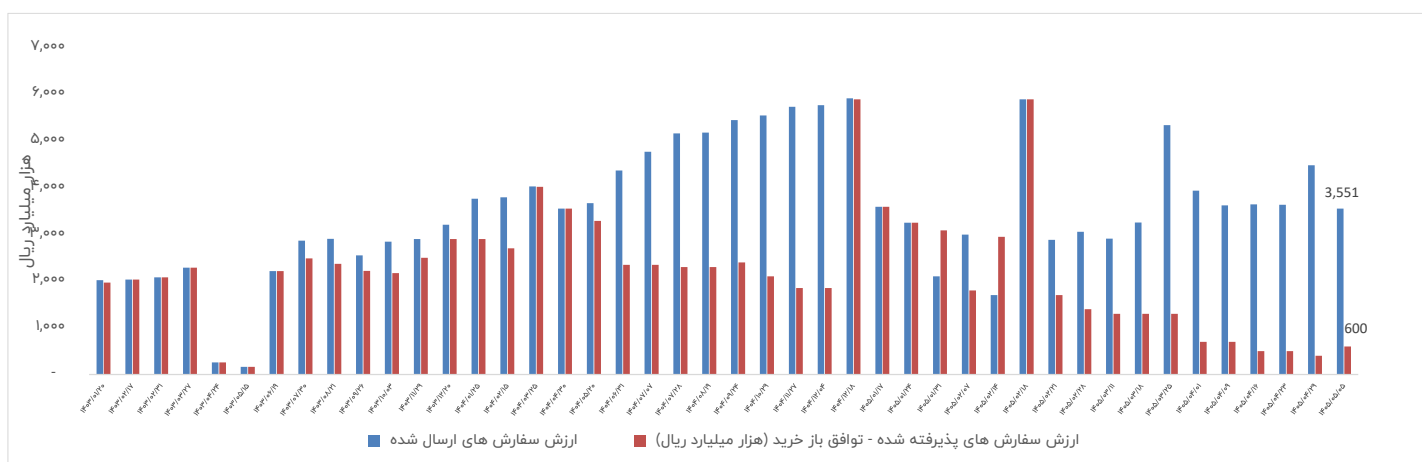


عملیات بازار باز در هفته گذشته

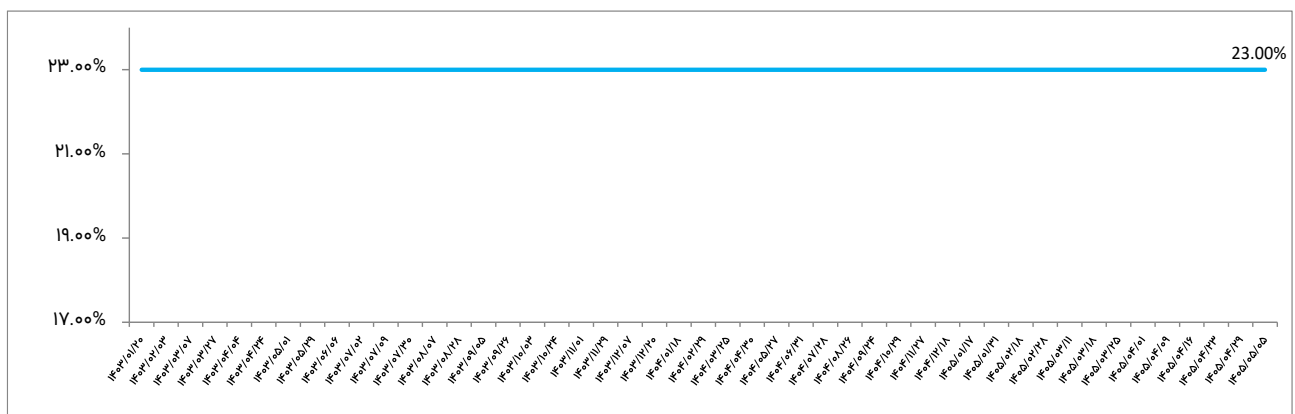
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۳۵۵۱/۳ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که به ۶۰۰/۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۵/۰۵/۰۵	عملیات بازار باز
۱۷	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۱۵	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۳۵۵۱/۳	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۶۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق بازخرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۴۰۱/۷	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۶۰۰/۰	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	453,174	0.79%	2.72%	9.47%	19.47%	40.70%
2	کاج	111,551	0.50%	2.62%	10.28%	18.13%	40.70%
3	یارا	33,802	0.84%	2.96%	9.67%	17.72%	40.29%
4	اونیکس	238,342	0.76%	2.99%	9.52%	17.97%	39.72%
5	افران	441,284	1.43%	3.39%	9.27%	18.58%	39.24%
6	سام	44,895	0.65%	3.29%	7.45%	15.77%	39.15%
7	طلوع	30,182	0.63%	2.67%	8.41%	17.08%	38.85%
8	توسکا	153,174	0.64%	2.63%	9.16%	16.31%	38.56%
9	سپر	519,702	0.60%	2.50%	8.56%	17.23%	38.54%
10	زمرد کوپوش	85,781	0.69%	2.55%	8.44%	16.47%	38.44%
11	دارا	50,460	0.31%	2.53%	9.03%	18.07%	38.19%
12	پایش	40,152	0.51%	2.80%	7.95%	16.94%	38.08%
13	ماهور	166,219	0.49%	2.54%	7.90%	17.20%	38.08%
14	ثبات	248,560	0.65%	3.13%	8.53%	17.68%	38.07%
15	کارا	547,963	0.64%	2.63%	8.63%	17.63%	37.98%
16	پایا	98,553	0.55%	2.85%	8.80%	16.75%	37.97%
17	فردا	194,688	0.63%	2.74%	8.46%	17.48%	37.96%
18	آکورد	73,509	0.63%	2.70%	8.37%	17.49%	37.86%
19	داریک	33,589	0.91%	2.63%	10.09%	16.78%	37.76%
20	آرامش	74,599	0.60%	2.45%	8.92%	16.90%	37.64%
21	فیروزا	364,873	0.64%	2.34%	8.61%	17.75%	37.62%
22	تصمیم	9,985	0.69%	3.20%	9.51%	18.66%	37.57%
23	تداوم	278,286	0.65%	2.61%	8.34%	17.27%	37.56%
24	کیان	426,604	0.64%	2.26%	8.46%	17.56%	37.51%
25	رشد	94,183	0.63%	2.59%	8.39%	17.28%	37.25%
26	کامیاب	59,419	0.73%	2.13%	8.18%	17.23%	37.22%
27	گنجین	50,195	0.64%	2.73%	8.18%	16.69%	37.22%
28	ارکیده	132,911	0.57%	2.62%	8.07%	17.34%	37.17%
29	فاخر	46,087	0.64%	2.68%	10.27%	18.66%	37.10%
30	کارآمد	171,470	0.63%	2.36%	8.29%	16.84%	37.08%
31	اصیل	49,743	0.81%	2.93%	9.55%	17.76%	37.08%
32	لیخند	315,205	0.65%	2.20%	8.61%	17.45%	37.08%
33	دامون	69,221	0.74%	2.70%	8.34%	17.08%	37.07%
34	اعتبار	53,893	0.84%	2.80%	8.69%	17.17%	37.05%
35	ساحل	85,408	0.61%	2.64%	8.63%	17.34%	37.01%
36	نیک گستر	7,111	0.59%	2.54%	7.86%	16.36%	37.00%
37	خاتم	20,623	0.88%	2.95%	8.25%	16.97%	36.93%
38	آوند	490,340	0.66%	2.94%	8.12%	16.85%	36.90%
39	یاقوت	628,318	0.63%	2.52%	8.35%	17.08%	36.80%
40	بمان	13,202	0.70%	2.68%	9.33%	15.81%	36.77%
41	ستاره	88,602	0.67%	2.29%	8.54%	16.69%	36.77%
42	شمیم	103,882	0.62%	2.45%	8.30%	17.01%	36.59%
43	کارین	379,774	0.61%	2.63%	8.27%	17.03%	36.53%
44	پاداش	98,032	0.62%	2.40%	8.31%	17.09%	36.51%
45	ثابت اکسیژن	8,050	0.56%	2.27%	8.29%	16.57%	36.45%
46	نشان	35,921	0.77%	2.56%	9.11%	16.85%	36.43%
47	اوصتا	148,214	0.88%	2.76%	8.74%	15.79%	36.38%
48	کارما	9,145	1.58%	2.67%	8.74%	15.53%	36.27%
49	اعتماد	349,186	0.63%	2.50%	8.31%	16.46%	36.10%
50	درین	39,712	0.79%	3.00%	8.34%	16.71%	36.07%
51	آتیه ملت	110,997	0.70%	2.73%	9.59%	17.85%	35.98%
52	صنهای	24,629	0.64%	2.49%	8.14%	16.51%	35.85%
53	الا	35,268	0.69%	2.67%	8.04%	15.48%	35.68%
54	رابین	23,094	0.55%	2.35%	8.49%	16.05%	35.61%
55	خورشید	23,594	0.66%	2.57%	7.87%	15.82%	35.26%
56	سپنارود	3,267	0.11%	2.43%	8.35%	15.74%	35.01%
57	اطمینان	6,224	0.59%	2.49%	7.91%	16.90%	34.96%
58	آسامید	981	0.25%	1.78%	6.97%	15.24%	34.36%
59	رایکا	528	0.60%	2.32%	7.52%	15.94%	34.05%

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)							
۱۴۰۵/۰۵/۰۷	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	۲۹.۳۰٪	۲۸.۴۵٪	۲۷.۷۳٪	۲۸.۹۶٪	۲۹.۲۴٪	۰.۰۰٪	۲۹.۴۹٪
معادل بانکی	۲۲.۶۱٪	۲۲.۹۸٪	۲۲.۴۴٪	۲۲.۶۵٪	۲۲.۹۳٪	۰.۰۰٪	۲۲.۷۵٪
حجم معاملات (ورقه)	۱۹,۹۴۳	۱۱۴,۸۸۹	۵,۵۴۹	۲۲۲,۵۶۸	۱,۷۸۵,۹۲۷	۰	۲,۱۴۸,۸۷۶
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۹	۱۰۲	۵	۱۵۵	۷۹۱	۰	۱,۰۷۰
اراد							
میانگین YTM	۳۷.۸۰٪	۳۷.۵۹٪	۰.۰۰٪	۳۶.۲۵٪	۳۸.۹۶٪	۰.۰۰٪	۳۸.۲۳٪
معادل بانکی	۳۲.۴۹٪	۳۲.۲۴٪	۰.۰۰٪	۳۱.۲۴٪	۳۲.۳۶٪	۰.۰۰٪	۳۲.۸۹٪
حجم معاملات (ورقه)	۲۱,۶۷۰,۰۰۰	۱۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۶,۴۰۰,۰۰۰	۶۲,۲۷۵,۰۰۰	۰	۱۰۱,۲۴۵,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۱۲۶۵	۱۰۷۱۴	۰	۵,۷۹۴	۴۹,۷۲۷	۰	۸۷,۴۹۹
گام							
میانگین YTM	۴۰.۲۶٪	۴۱.۳۷٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۴۰.۶۸٪
معادل بانکی	۳۴.۳۱٪	۳۵.۱۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۴.۶۲٪
حجم معاملات (ورقه)	۳۷۴,۶۵۰	۲۴۹,۸۵۰	۰	۰	۰	۰	۶۲۴,۵۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۳۵۶	۲۱۸	۰	۰	۰	۰	۵۷۴
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:

