

بازار بدهی - منتهی به ۱۶ آبان ماه ۱۴۰۴

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

یک پرتاب ۳۷ امتیازی

با صندوق درآمد ثابت آسمان دامون

۳۷%

سود روز شمار



قابل معامله در بورس (ETF)

با نماد دامون

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

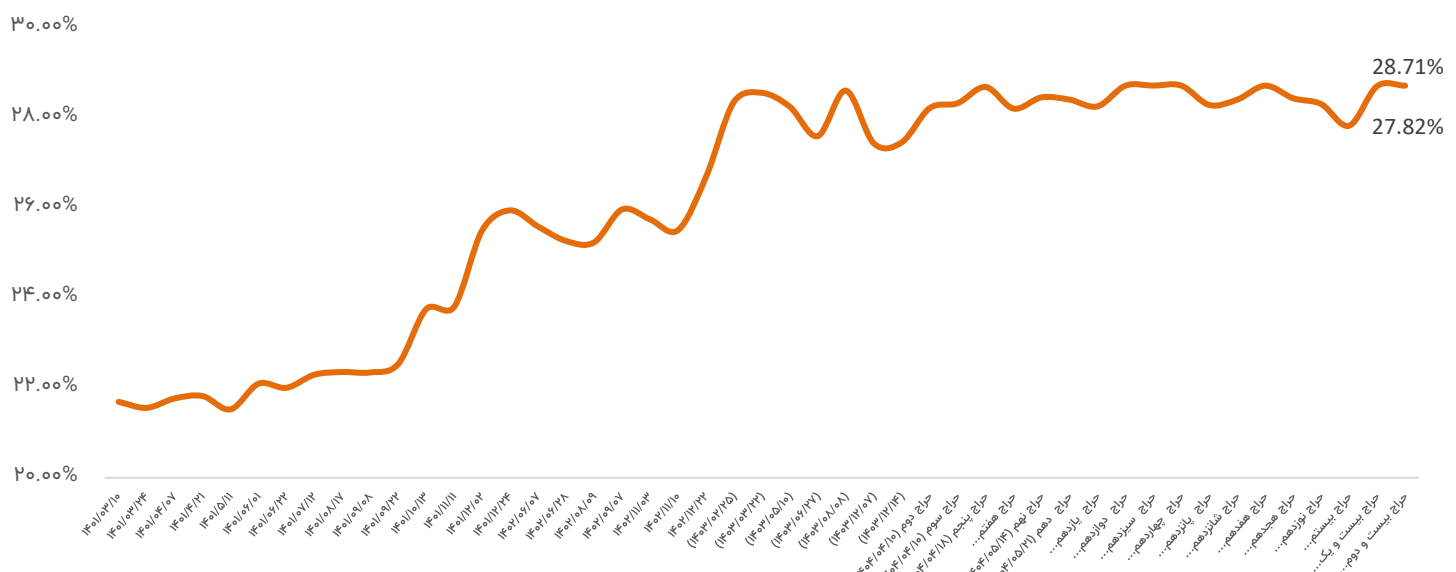


حراج اوراق دولتی

در بیست و دومین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۱۰۸/۲ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی توسط اشخاص حقیقی و حقوقی (بازار سرمایه) خریداری شد. در این حراج اوراقی توسط بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی (بازار پول) ۴۹/۹ هزارمیلیارد ریال خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیست و دوم، مبلغ ۱۵۸/۱ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

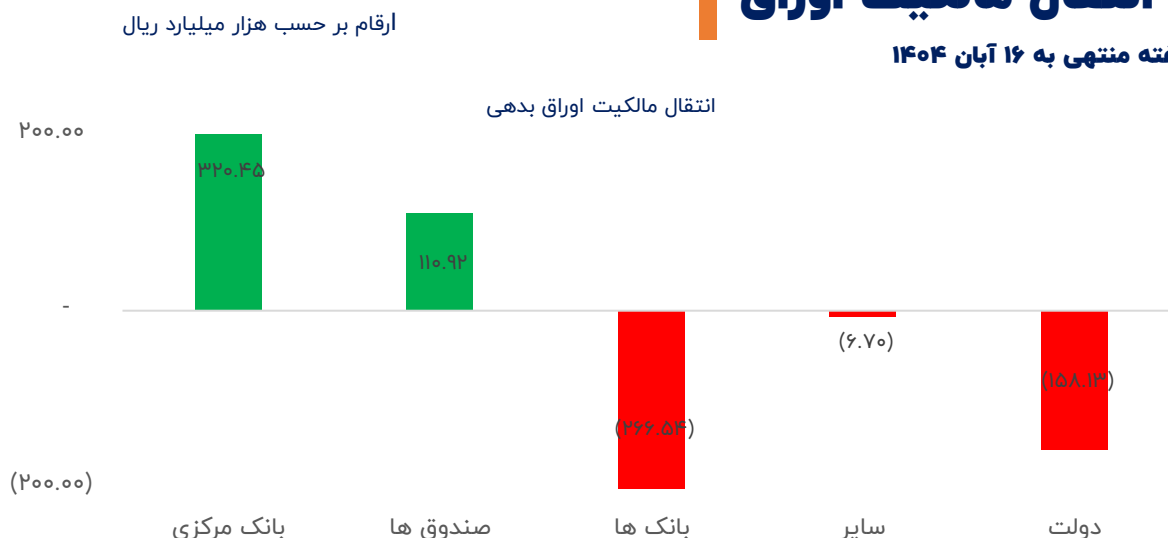
برگزاری حراج بیست و دوم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۸/۱۳				
نماد اوراق	اراد۲۳۹	اراد۲۴۳	اراد۲۴۴	اراد۲۴۵
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۳/۶	۱۰۰/۰۰	۱۰۰/۰۰	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۳/۳	۴۶/۶	۰/۰۰	۰/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۳۰/۹	۲/۱	۷۵/۲
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیست و دوم (هزار میلیارد ریال)			۱۵۸/۱	
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست و دوم حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)			۳۵۳۷/۱	

نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا بیست و دوم حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۱۶ آبان ۱۴۰۴



همانطور که ملاحظه می‌شود در هفته گذشته بانک مرکزی بزرگ‌ترین خریدار اوراق بدهی بوده‌اند. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۱۵۸/۱۳ 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)
اراد۳	آذر ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۸/۰۶	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۶/۰
اراد۴	آذر ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۸/۱۳			۹۷/۷
اراد۵	آبان ۱۴۰۷				۱۸/۵
اراد۶	آبان ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۸/۲۰			۱۰۰/۰
اراد۷	آذرماه ۱۴۰۷				۷۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

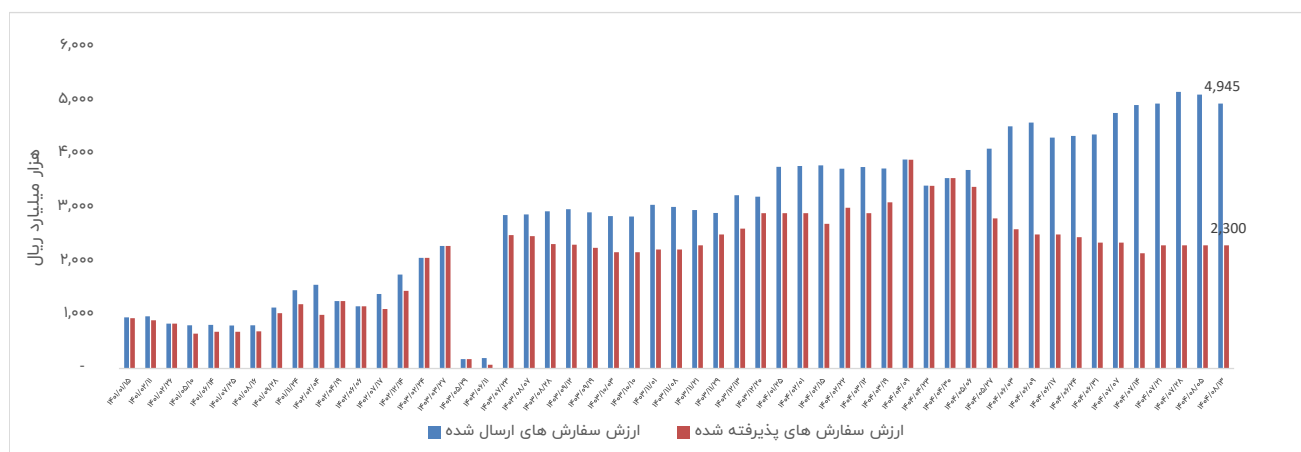


عملیات بازار باز در هفته گذشته

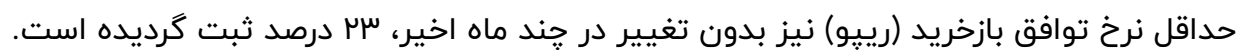
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۴۹۴۴/۶ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۸/۱۲	عملیات بازار باز
۲۹	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۲	تعداد بانک‌ها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۴۹۴۴/۶	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق بازخرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۳۱۰/۱	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۰۰/۰	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 ابتدای ۱۴۰۰ 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)

نماد	کل ارزش خالص دارایی‌ها	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سه ماهه	بازده شش ماهه	بازده یک ساله
ستاره	32,602	0.63%	2.46%	7.97%	16.14%	49.10%
درین	22,782	0.64%	2.59%	7.82%	16.54%	41.69%
دارپیک	13,118	0.29%	3.39%	8.09%	11.82%	38.97%
کیان	227,140	0.59%	2.92%	8.49%	16.89%	36.87%
یارا	11,970	1.32%	3.99%	10.40%	14.51%	36.23%
ارکیده	69,083	0.77%	2.84%	7.68%	15.27%	35.92%
افران	294,145	0.51%	2.95%	8.01%	16.56%	35.75%
زمرد کوروش	65,954	0.56%	2.40%	8.48%	15.90%	35.53%
کارا	277,676	0.63%	2.59%	8.04%	16.19%	35.40%
فردا	85,193	0.59%	2.56%	7.89%	16.28%	35.38%
لبخند	197,642	0.69%	2.46%	7.82%	16.21%	35.29%
فیروزا	241,303	0.59%	2.29%	7.86%	16.12%	34.99%
سپر	240,374	0.40%	3.21%	8.37%	16.00%	34.83%
ماهور	92,391	0.47%	1.92%	8.03%	16.05%	34.77%
رشد	29,672	0.58%	2.45%	7.96%	16.24%	34.77%
ثبات	103,483	0.60%	1.99%	7.85%	16.10%	34.68%
آرامش	75,011	0.63%	2.68%	8.30%	15.69%	34.61%
اونیکس	133,750	0.52%	2.29%	8.75%	15.49%	34.60%
اعتماد	170,776	0.59%	2.56%	7.80%	15.54%	34.54%
یاقوت	367,055	0.59%	2.56%	7.92%	16.09%	34.52%
کامیاب	12,245	0.59%	2.64%	7.89%	16.11%	34.51%
کارآمد	67,406	0.57%	2.36%	7.88%	16.04%	34.43%
نشان	22,123	0.59%	2.64%	8.24%	15.71%	34.37%
رابین	17,697	0.55%	1.90%	7.85%	15.30%	34.31%
دامون	47,253	0.61%	2.57%	7.74%	15.73%	34.26%
آکورد	44,748	0.60%	2.66%	8.05%	15.66%	34.21%
خاتم	12,985	0.59%	2.52%	7.93%	15.99%	34.21%
ثابت اکسیژن	5,973	0.61%	2.59%	7.82%	15.96%	34.11%
آوند	318,090	0.59%	2.52%	7.82%	15.84%	34.08%
فاخر	24,311	0.86%	2.39%	7.37%	15.32%	34.04%
صنهای	17,956	0.58%	2.43%	7.69%	15.40%	34.01%
دارا	38,096	0.60%	2.46%	7.77%	15.95%	33.99%
فاخر	26,023	0.50%	2.62%	7.69%	15.34%	33.86%

بخش چهارم

وضعیت معاملات بازار بدهی در هفته گذشته



وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک

سررسید (اخزا، اراد)

وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک سررسید (اخزا، اراد)							
۱۴۰۴ آبان	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	۳۷.۸۲٪	۳۶.۶۹٪	۳۵.۳۱٪	۳۵.۵۷٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
معادل بانکی	۳۲.۵۱٪	۳۰.۱۵٪	۳۰.۶۲٪	۳۰.۸۲٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
حجم معاملات (ورقه)	۱۵,۱۸۹	۸۶۷	۱۰۴,۲۸۷	۱,۳۶۲,۰۰۱	۰	۰	۱,۴۸۲,۳۴۴
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۱۵	۱	۷۹	۸۳۹	۰	۰	۹۳۳
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	جمع
میانگین YTM	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۳.۱۳٪	۳۶.۶۳٪	۰.۰۰٪	۳۵.۹۷٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۸.۹۶٪	۳۱.۶۲٪	۰.۰۰٪	۳۱.۱۲٪
حجم معاملات (ورقه)	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰	۴,۸۲۵,۰۰۰	۲۲,۳۳۵,۰۰۰	۰	۲۷,۱۶۰,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰	۰	۰	۴,۳۹۳	۱۸,۹۰۴	۰	۲۳,۲۹۷
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**

• آمار مهم:



**سرمایه‌گذار فعال
۱۶۰.۰۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۱۶۷.۰۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• مهم‌ترین دستاوردها:

