

بازار بدهی - منتهی به ۳۰ 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

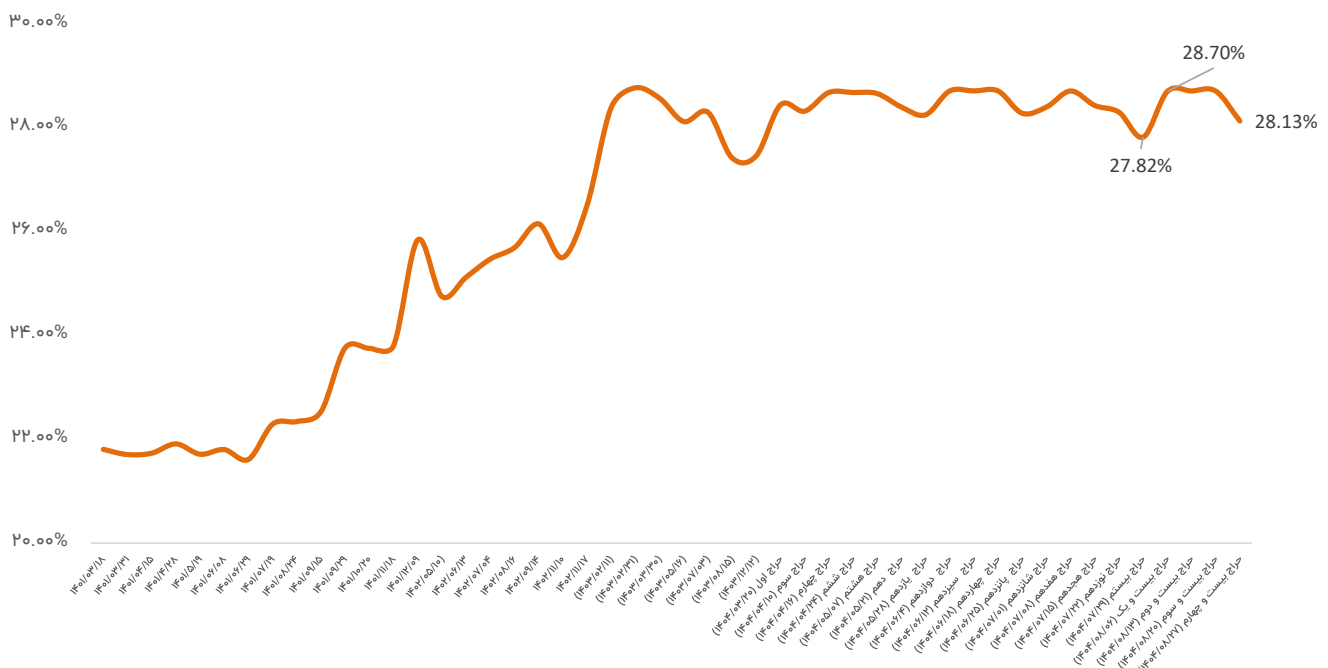


حراج اوراق دولتی

در بیست و چهارمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۲۴۴ 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) ۴۴/۵ هزار میلیارد ریال خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیست و چهارم مبلغ ۲۸۸/۵ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج بیست و چهارم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۸/۲۷					
نماد اوراق	اراد ۲۴۴	اراد ۲۴۶	اراد ۲۴۷	اراد ۲۴۸	اراد ۲۴۹
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۹۷/۷	۱۹/۸	۷۰	۵۰	۷۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰	۰/۰۰	۰/۰۰	۴۴/۵	۰/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۹۰/۲	۱۸/۳	۶۴/۶	۳/۶	۶۷/۳
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۱	۲۸/۷۰	۲۸/۷۱	۲۸/۴۰	۲۸/۱۹
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیست و چهارم (هزار میلیارد ریال)	۲۸۸/۵				
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست و چهار حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۳۹۳۱/۵				

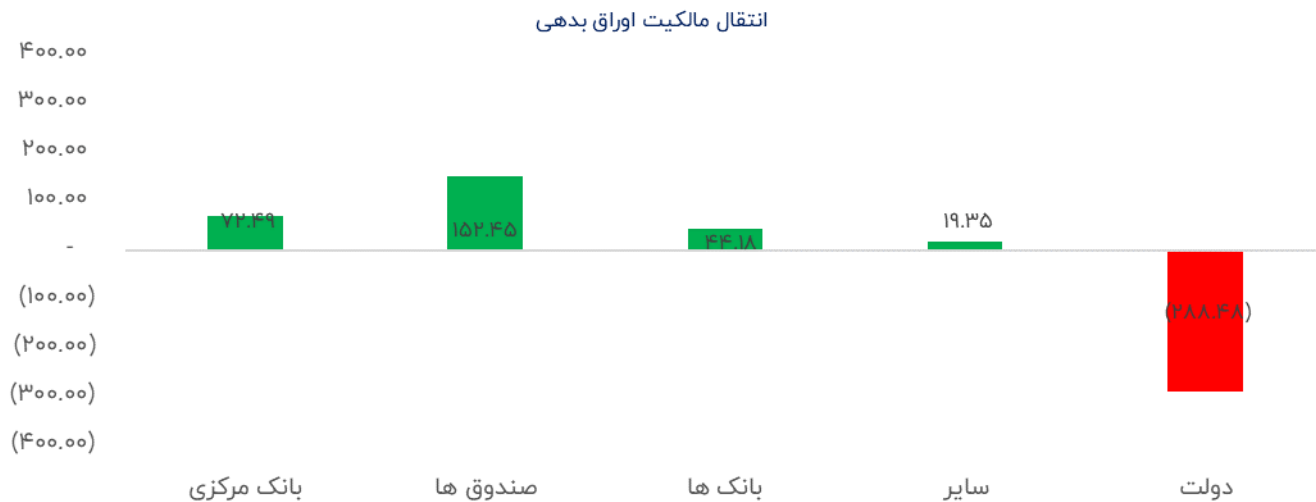
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا بیست و سوم حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۴

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 ۲۸۸/۴۸ 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)
اراده ۲۵۰	اردیبهشت ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۹/۰۵	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۷۰
اراداد ۲۵۱	تیر ۱۴۰۷				۱۰۰
ارادد ۲۵۲	آذرماه ۱۴۰۷				۱۳۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

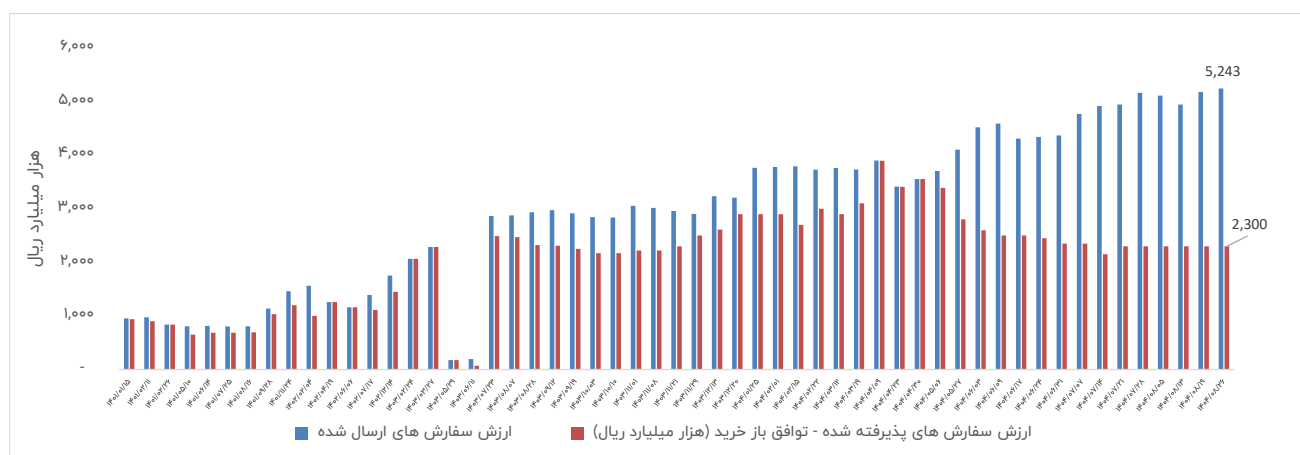


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۲۴۳/۴ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

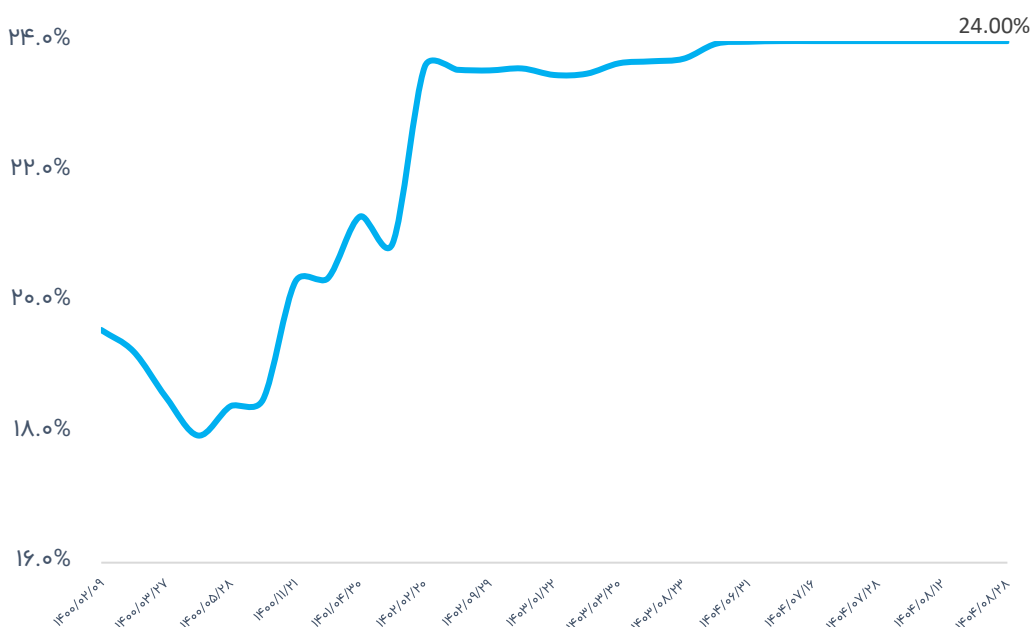
در تاریخ ۱۴۰۴/۰۸/۲۶	عملیات بازار باز
۳۱	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۲	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۲۴۳/۴	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۰۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۶	مدت توافق باز خرید (روز)
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.

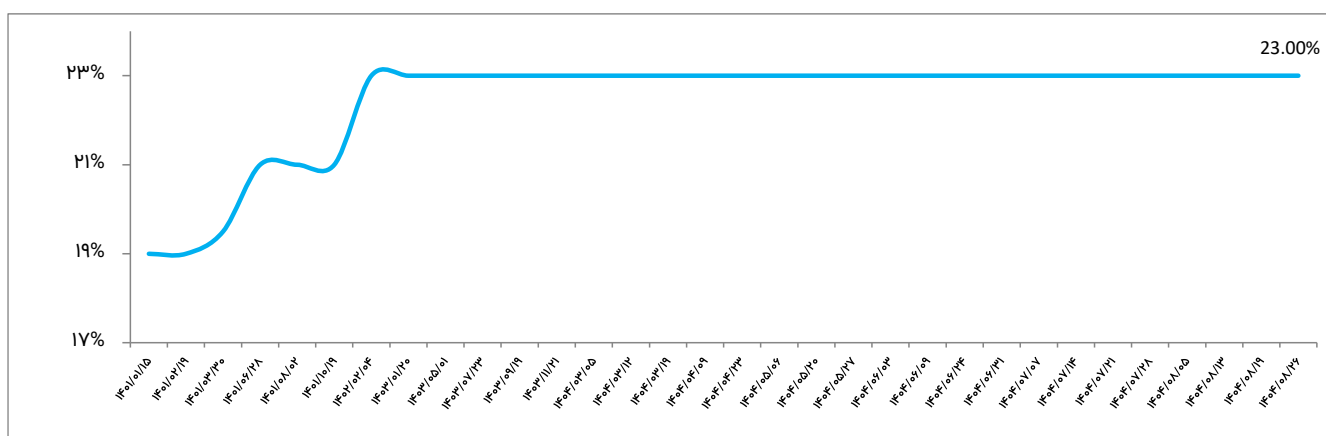


بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی بدون تغییر نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۴/۰۰ درصد ثبت گردیده است.

نمودار زیر روند تغییرات نرخ سود بین بانکی را از ابتدای ۱۴۰۰ نشان می‌دهد.



حداقل نرخ توافق بازخريد (ريپو) نیز بدون تغییر در چند ماه اخير، ۲۳ درصد ثبت گردیده است.



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	ستاره	33,406.70	0.62%	2.58%	7.91%	16.26%	43.96%
2	درین	29,392.05	0.86%	2.65%	7.90%	16.66%	41.54%
3	زمرد کوروش	65,032.39	0.62%	2.58%	8.36%	16.13%	37.34%
4	کیان	237,127.10	0.60%	2.90%	8.56%	16.88%	36.26%
5	ارکیده	78,412.41	0.68%	4.85%	7.87%	15.14%	36.05%
6	کارا	265,410.06	0.62%	2.64%	8.15%	16.25%	35.60%
7	فردا	82,472.73	0.60%	2.56%	7.87%	16.29%	35.46%
8	افران	291,764.48	0.62%	4.70%	9.70%	16.45%	35.26%
9	فیروزا	220,076.60	0.59%	2.47%	7.88%	16.21%	35.09%
10	لیخند	195,845.46	0.61%	2.60%	7.90%	16.24%	34.97%
11	رشد	28,030.61	0.59%	2.44%	7.91%	16.26%	34.83%
12	آرامش	74,381.46	0.58%	2.59%	8.46%	15.68%	34.77%
13	کارآمد	69,172.87	0.57%	2.61%	7.90%	16.20%	34.73%
14	ثبات	109,081.96	0.59%	2.26%	7.83%	16.09%	34.72%
15	ماه‌ور	95,924.98	0.48%	2.32%	7.83%	16.73%	34.66%
16	یاقوت	358,041.67	0.59%	2.56%	7.88%	16.12%	34.65%
17	کامیاب	13,922.66	0.60%	2.57%	7.95%	16.17%	34.57%
18	اوانیکس	156,914.86	0.58%	2.52%	8.94%	15.90%	34.54%
19	نشان	22,207.54	0.65%	2.57%	8.52%	15.80%	34.54%
20	دامون	48,780.87	0.71%	2.63%	7.83%	15.95%	34.53%
21	سپر	240,545.82	0.59%	2.38%	8.40%	16.06%	34.49%
22	خاتم	12,596.69	0.64%	2.65%	7.94%	16.38%	34.42%
23	ثابت اکسیژن	5,596.81	0.62%	2.60%	8.07%	16.06%	34.41%
24	آکورد	43,181.34	0.60%	2.58%	8.42%	15.73%	34.36%
25	آوند	313,971.58	0.58%	2.60%	7.77%	15.85%	34.28%
26	داریک	14,258.17	0.47%	1.37%	8.86%	10.17%	34.25%
27	دارا	35,167.59	0.62%	2.55%	7.82%	16.08%	34.21%
28	رابین	18,053.47	0.69%	2.36%	7.56%	15.17%	34.19%
29	صنهای	16,977.88	0.60%	2.47%	7.77%	15.47%	34.19%
30	یارا	13,495.72	0.79%	3.10%	10.08%	14.78%	34.07%
31	پاداش	57,271.60	0.60%	2.46%	7.73%	15.72%	34.00%

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 ۲۸							
جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۲۶۵ روز	بین ۲۶۵ تا ۷۲۰ روز	بین ۷۲۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز	اخزا
۳۷.۴۷٪	۳۸.۵۰٪	۳۷.۰۲٪	۳۶.۲۹٪	۳۶.۵۱٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	میانگین YTM
۳۲.۲۵٪	۳۳.۰۱٪	۳۱.۹۲٪	۳۱.۴۴٪	۳۱.۵۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	معادل بانکی
۱,۰۴۹,۷۴۱	۴۰۰,۲۹۹	۲۰۷,۱۴۷	۱۴۹,۸۰۳	۲۹۲,۴۹۲	۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۸۹۵	۳۹۰	۱۹۰	۱۱۷	۱۹۸	۰	۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۲۶۵ روز	بین ۲۶۵ تا ۷۲۰ روز	بین ۷۲۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز	اراد
۳۲.۴۴٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۱.۷۰٪	۰.۰۰٪	۳۷.۳۱٪	۳۷.۲۶٪	میانگین YTM
۲۸.۴۳٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۷.۸۵٪	۰.۰۰٪	۳۲.۱۳٪	۳۲.۰۹٪	معادل بانکی
۲۶,۹۱۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۲,۷۹۵,۰۰۰	۰	۴,۱۱۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	حجم معاملات (ورقه)
۲۴,۶۵۲	۰	۰	۲۱,۳۵۹	۰	۳,۲۸۹	۴	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
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 تاسیس 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:



**۱۶۵.۰۰۰ نفر
سرمایه‌گذار فعال**



**۱۹۰.۰۰۰ میلیارد ریال
منابع تحت مدیریت**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• مهم‌ترین دستاوردها:

