

بازار بدهی - منتهی به ۴ مهر 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



اول تو ماشه رو بکش!

صندوق طلای **آلتون** یک شلیک پرسود

ETF با نماد آلتون



سبدگردان آسمان

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

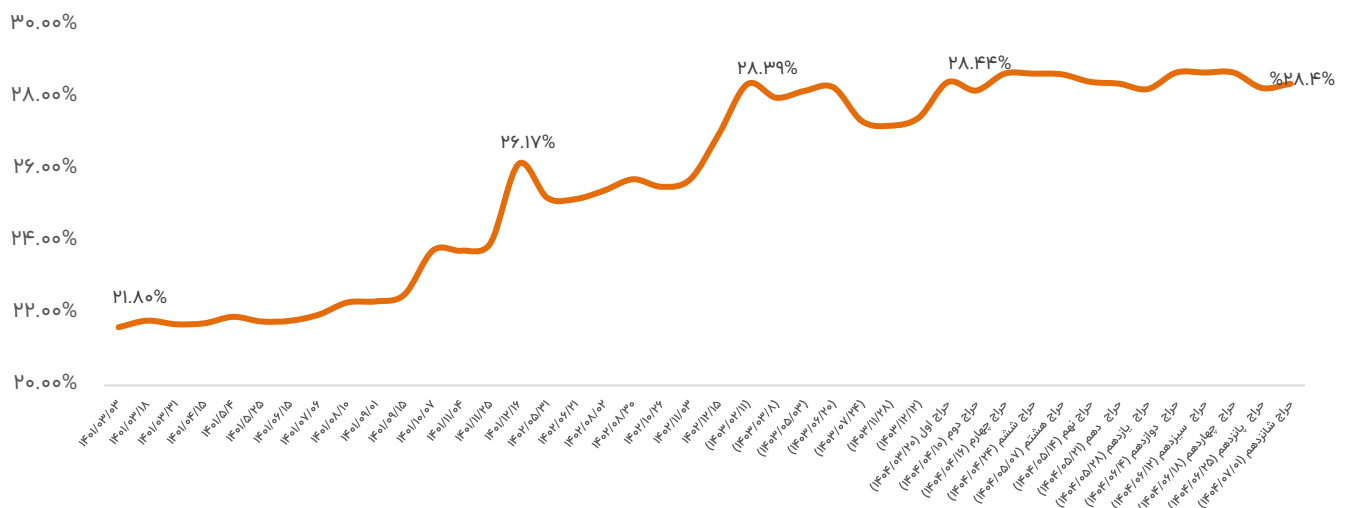


حراج اوراق دولتی

در شانزدهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۱۰۴/۵ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی توسط اشخاص حقیقی و حقوقی (بازار سرمایه) خریداری شد. در این حراج، مبلغ ۲۷/۴ هزار میلیارد ریال اوراق توسط بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی (بازار پول) خریداری گردید. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج شانزدهمین، مبلغ ۱۳۱/۹ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج شانزدهم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۱			
نماد اوراق	اراده ۲۳۰	اراد ۲۳۲	اراد ۲۳۳
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۱/۶	۲۰۰	۸۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	-	-	۲۷/۴
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۱/۵	۵۴/۴	۴۸/۶
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱	۲۸/۰
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج شانزدهم (هزار میلیارد ریال)	۱۳۱/۹		
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در شانزده حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۲۵۰۷/۴		

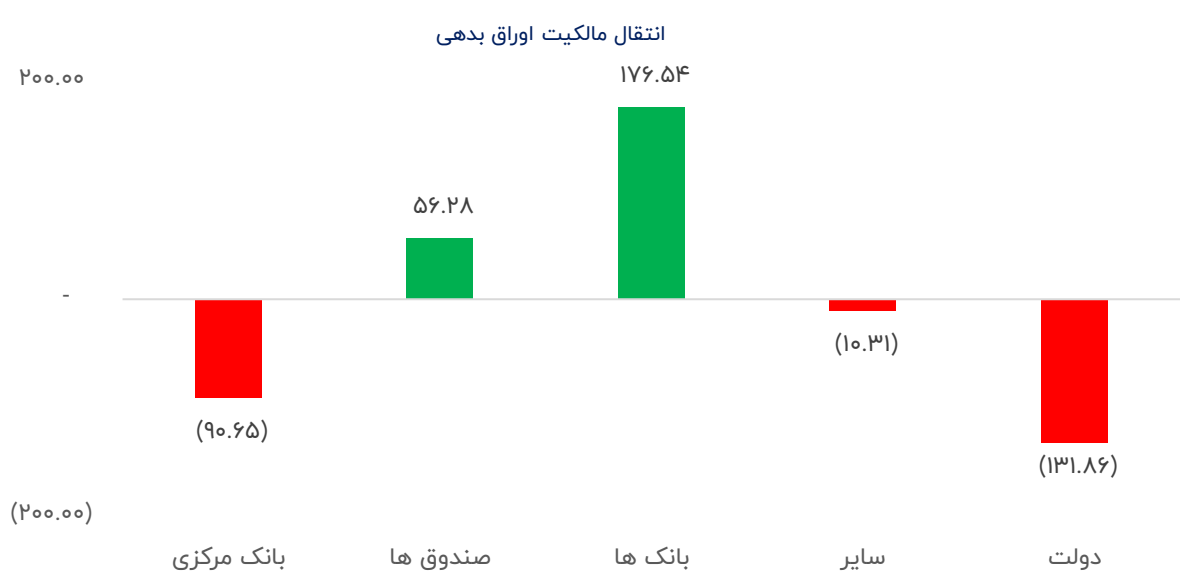
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا شانزده حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۴ مهر ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال



همانطور که ملاحظه می شود در هفته گذشته بانک ها بزرگترین خریدار اوراق بدهی بوده اند. همچنین وزارت امور اقتصادی و دارایی به نیابت از دولت اقدام به تامین منابع نقدی به مبلغ ۱۳۱/۸۶ 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)
اراد۲۳۲	مهر ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۶/۲۵	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۴۱/۱
اراد۲۳۴	آبان ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۰۸	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۰۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

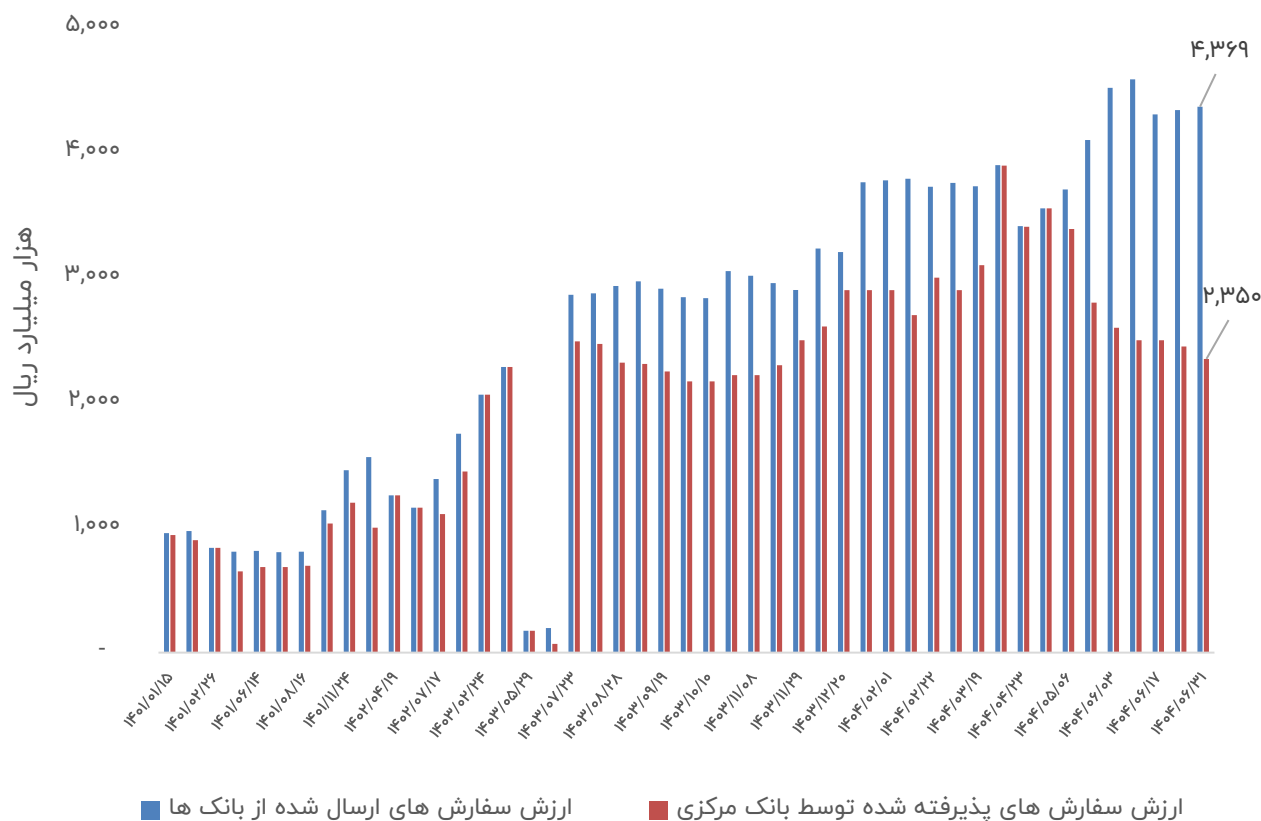


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۴۳۶۸/۷ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۵۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

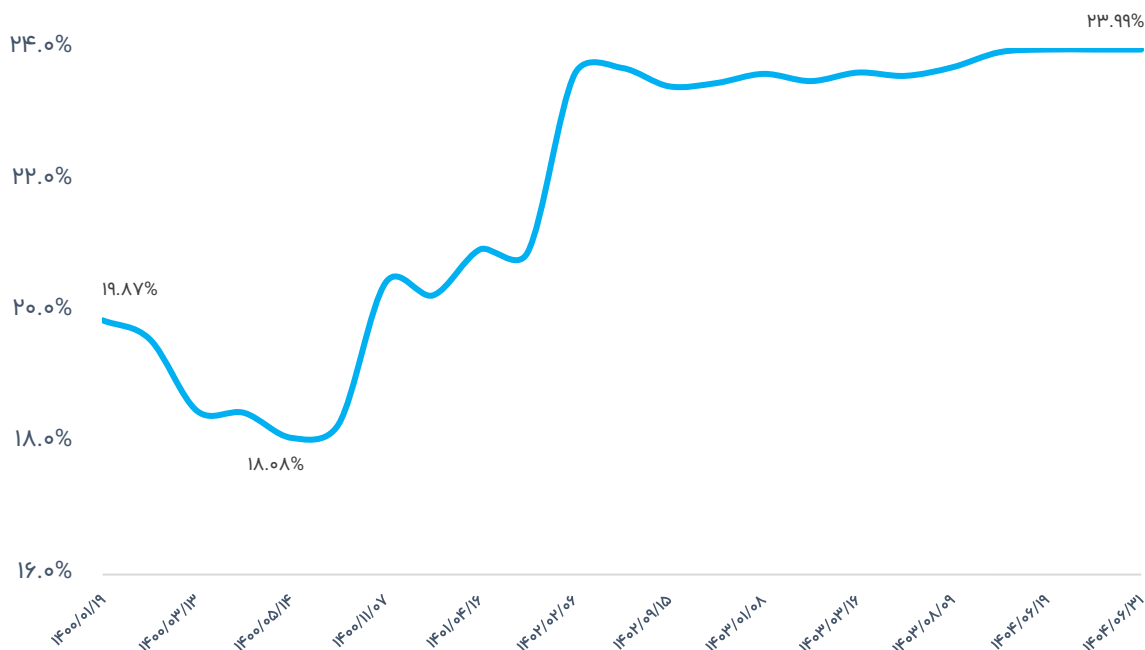
در تاریخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۱	عملیات بازار باز
۲۳	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۲	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۴۳۶۸/۷	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۵۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده -توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق بازخرید (روز)
۲۳	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۴۶۰/۸	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۵۰	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.

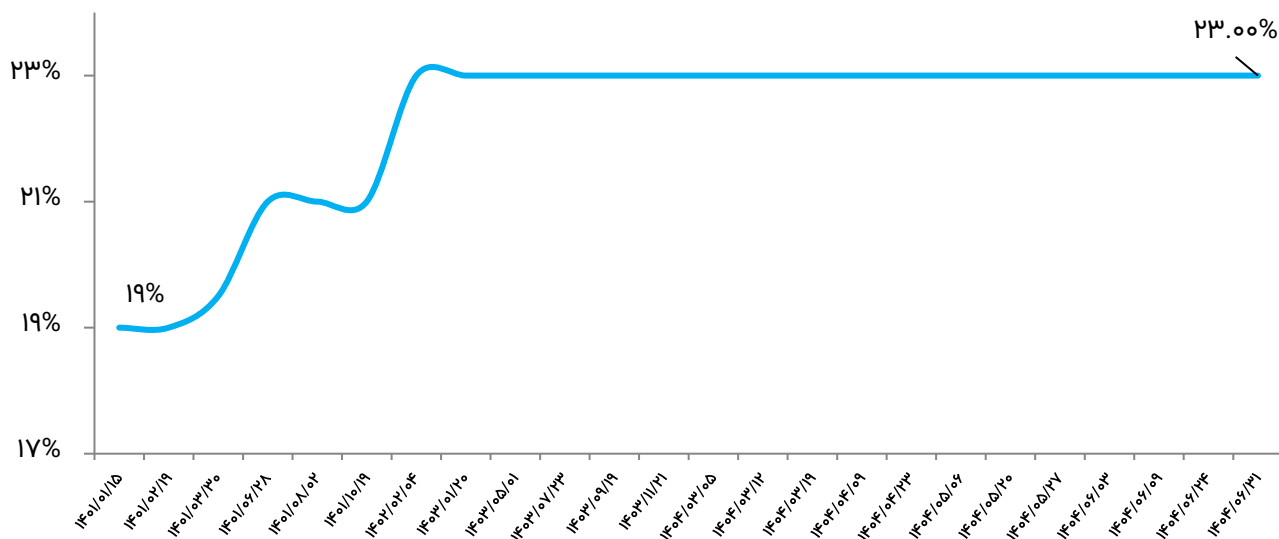


بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی بدون تغییر نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۳/۹۹ درصد ثبت گردیده است.

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

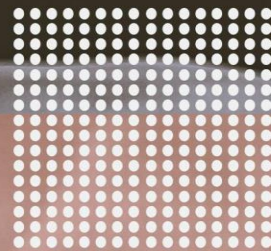


حداقل نرخ توافق بازخريد (ريپو) نیز بدون تغيير در چند ماه اخير، ۲۳ درصد ثبت گردیده است.



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)

نماد	کل ارزش خالص دارایی‌ها (میلیارد ریال)	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سه ماهه	بازده شش ماهه	بازده یک ساله
ستاره	۲۴,۱۸۳	۰.۵۷%	۲.۴۰%	۷.۶۴%	۱۵.۵۸%	۴۳.۵۲%
درین	۲۵,۰۵۸	۰.۵۸%	۲.۲۷%	۸.۰۴%	۱۶.۴۳%	۳۷.۳۸%
کیان	۱۹۵,۹۳۷	۰.۶۴%	۲.۴۹%	۸.۵۴%	۱۶.۱۹%	۳۶.۶۵%
فردا	۶۹,۳۵۹	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۸.۴۵%	۱۶.۲۳%	۳۴.۷۹%
کارا	۲۳۸,۸۶۹	۰.۶۴%	۲.۵۷%	۸.۲۹%	۱۶.۱۳%	۳۴.۷۷%
کارآمد	۵۴,۳۱۵	۰.۶۶%	۲.۶۴%	۸.۱۷%	۱۶.۱۵%	۳۴.۷۵%
لیخند	۱۷۸,۸۲۱	۰.۸۹%	۲.۳۷%	۸.۲۲%	۱۵.۸۹%	۳۴.۷۴%
رابین	۱۴,۵۲۵	۱.۳۳%	۲.۶۱%	۷.۹۷%	۱۶.۰۲%	۳۴.۷۰%
ارکیده	۶۵,۹۸۰	۰.۲۷%	۱.۹۱%	۶.۲۵%	۱۵.۲۸%	۳۴.۶۳%
فیروزا	۱۹۲,۸۵۲	۰.۵۹%	۲.۴۷%	۸.۳۱%	۱۵.۹۱%	۳۴.۶۱%
سپر	۲۲۴,۸۶۸	۰.۴۳%	۲.۰۰%	۷.۷۰%	۱۵.۲۴%	۳۴.۳۳%
افران	۲۸۲,۳۵۶	۰.۵۶%	۳.۱۵%	۸.۶۸%	۱۵.۷۴%	۳۴.۳۱%
ماهور	۸۶,۶۶۵	۰.۸۸%	۲.۸۸%	۹.۲۵%	۱۶.۶۳%	۳۴.۲۹%
آرامش	۷۰,۲۰۸	۰.۸۲%	۲.۸۲%	۷.۷۳%	۱۴.۹۴%	۳۴.۲۶%
سام	۱۳,۶۱۷	۰.۱۹%	۲.۱۸%	۶.۸۲%	۱۵.۰۴%	۳۴.۲۵%
ثبات	۸۵,۹۸۷	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۸.۲۷%	۱۶.۰۳%	۳۴.۱۷%
یاقوت	۳۳۷,۰۲۴	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۸.۱۵%	۱۶.۰۰%	۳۴.۱۴%
رشد	۲۴,۵۰۳	۰.۵۷%	۲.۳۸%	۷.۸۰%	۱۶.۰۹%	۳۴.۱۱%
دامون	۳۱,۰۳۹	۰.۶۰%	۲.۳۳%	۷.۶۹%	۱۵.۸۴%	۳۴.۰۰%
کامیاب	۱۲,۹۵۵	۰.۶۰%	۲.۵۳%	۷.۶۷%	۱۵.۸۶%	۳۳.۹۷%
اعتماد	۱۵۶,۵۱۴	۰.۷۴%	۲.۶۱%	۷.۹۱%	۱۵.۸۸%	۳۳.۹۳%
آوند	۲۸۵,۶۵۹	۰.۵۸%	۲.۴۹%	۸.۲۰%	۱۵.۶۲%	۳۳.۷۱%
خاتم	۱۰,۸۹۴	۰.۵۷%	۲.۴۵%	۸.۱۶%	۱۵.۷۵%	۳۳.۶۹%
فاخر	۲۴,۷۰۳	۰.۵۲%	۲.۴۸%	۷.۴۲%	۱۵.۵۲%	۳۳.۶۰%
نشان	۲۳,۴۱۰	۰.۳۳%	۲.۸۵%	۷.۴۵%	۱۵.۱۱%	۳۳.۶۰%
صنهای	۱۷,۶۴۵	۰.۵۸%	۲.۴۵%	۷.۶۱%	۱۵.۴۱%	۳۳.۵۸%
دارا	۳۱,۱۶۸	۰.۶۰%	۲.۴۵%	۷.۶۳%	۱۵.۶۲%	۳۳.۴۸%
کارین	۹۲,۸۳۹	۰.۵۷%	۲.۴۷%	۷.۷۳%	۱۵.۸۶%	۳۳.۴۵%
آکورد	۳۲,۶۵۳	۰.۵۹%	۲.۸۲%	۷.۲۱%	۱۵.۴۲%	۳۳.۴۱%
ساحل	۶۴,۲۳۸	۰.۶۴%	۲.۶۱%	۷.۴۸%	۱۵.۲۰%	۳۳.۴۱%
اعتبار	۲۱,۷۳۰	۰.۵۲%	۲.۳۰%	۷.۰۵%	۱۴.۸۷%	۳۳.۳۹%
نیک گستر	۲,۶۶۳	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۷.۷۴%	۱۵.۴۵%	۳۳.۳۲%
خورشید	۲۷,۹۸۱	۰.۶۴%	۲.۴۵%	۷.۷۸%	۱۵.۰۱%	۳۳.۲۲%
اونیکس	۸۴,۴۵۴	۰.۸۲%	۲.۹۶%	۷.۴۹%	۱۴.۱۹%	۳۳.۱۲%
پاداش	۵۴,۵۷۷	۰.۵۸%	۲.۴۲%	۷.۹۵%	۱۵.۶۱%	۳۳.۰۶%
تداوم	۷۲,۳۳۵	۰.۷۶%	۲.۵۷%	۷.۴۴%	۱۴.۴۴%	۳۳.۰۴%
ثابت اکسیژن	۵,۰۴۰	۰.۶۰%	۲.۵۲%	۷.۷۰%	۱۵.۵۹%	۳۳.۰۳%
شمیم	۳۰,۰۴۵	۰.۵۸%	۲.۴۷%	۷.۹۶%	۱۵.۱۴%	۳۲.۹۸%
توسکا	۵۰,۵۴۸	۰.۷۰%	۲.۹۱%	۸.۶۹%	۱۵.۶۸%	۳۲.۹۳%

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)							
۲ مهر ۱۴۰۴	وضعیت کلی معاملات اوراق بدهی به تفکیک سررسید (اخزا، اراد)						
جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۳۶۰ روز	بین ۳۶۰ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز	اخزا
۳۵.۴۲%	۳۵.۳۱%	۳۵.۳۶%	۳۵.۱۴%	۳۵.۵۳%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	میانگین YTM
۳۰.۷۱%	۳۰.۶۳%	۳۰.۶۶%	۳۰.۵۰%	۳۰.۷۹%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	معادل بانکی
۲,۹۷۸,۶۵۱	۴۸۶,۷۴۸	۲۱۲,۷۶۰	۲۷۶,۹۶۴	۲,۰۰۲,۱۷۹	۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۲,۰۵۲	۴۵۹	۱۹۵	۲۲۳	۱,۱۷۶	۰	۰	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
جمع	کمتر از ۹۰ روز	بین ۹۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۳۶۰ روز	بین ۳۶۰ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۱۰۹۵ روز	بیش از ۱۰۹۵ روز	اراد
۳۵.۷۷%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۲۷.۵۷%	۰.۰۰%	۳۶.۳۰%	۰.۰۰%	میانگین YTM
۳۰.۹۷%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۲۴.۶۰%	۰.۰۰%	۳۱.۳۸%	۰.۰۰%	معادل بانکی
۱۳,۷۹۵,۰۰۰	۰	۰	۷۲۰,۰۰۰	۰	۱۳,۰۷۵,۰۰۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۱۱,۳۸۸	۰	۰	۶۹۵	۰	۱۰,۶۹۳	۰	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**



**سرمایه‌گذار فعال
۷۸.۰۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۱۳۵.۰۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• آمار مهم:

• مهم‌ترین دستاوردها:

