

بازار بدهی - منتهی به 18 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

یک پرتاب ۳۶ امتیازی

۳۶٪ سود روزشمار معاف از مالیات

آسمان دامون

ETF با نماد دامون

آسمان سهند

صدور ابطالی



هر ۱۰۰ میلیون تومان = سود ماهانه ۲,۵۶۰,۰۰۰ تومان

www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

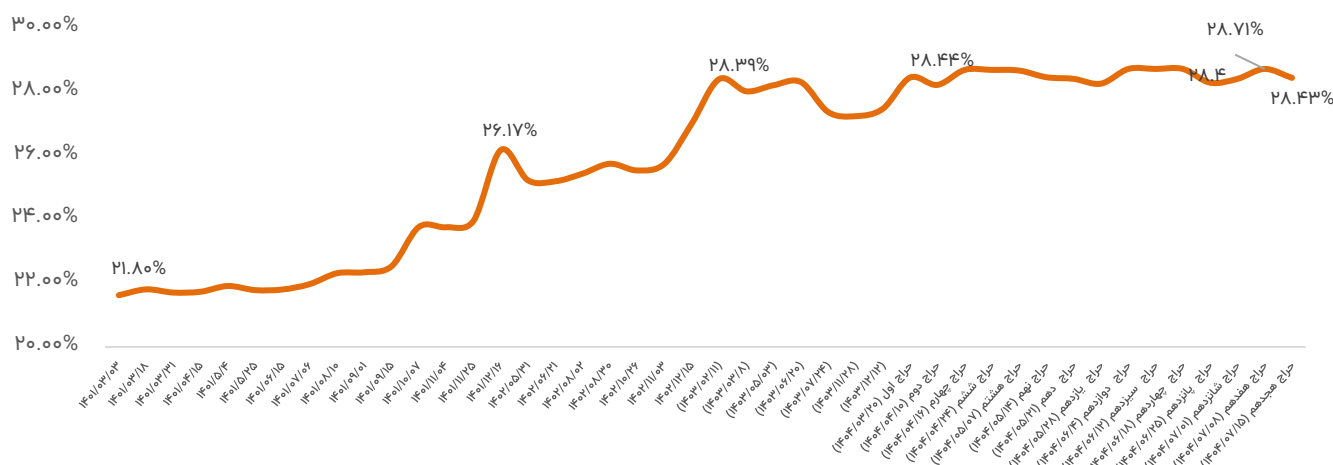


حراج اوراق دولتی

در هجدهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۱۱۹/۴ هزار میلیارد ریال اوراق مالی اسلامی دولتی توسط اشخاص حقیقی و حقوقی (بازار سرمایه) خریداری شد. در این حراج، مبلغ ۴۸/۴ 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 هجدهمین، مبلغ ۱۶۷/۸ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج هجدهم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۱۵				
نماد اوراق	اراد۲۳۴	اراد۲۳۵	اراد۲۳۶	اراد۲۳۷
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۲۲/۴	۷۰/۰۰	۱۰۰/۰	۲۳۷/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۰/۰۰	۱۶/۴	۰/۰۰	۳۲/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۹/۰۰	۵۰/۱	۰	۶۰/۳
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۱	۲۸/۰۰	۰/۰۰	۲۸/۷۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج هجدهم (هزار میلیارد ریال)	۱۶۷/۸			
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در هجده حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۲۸۷۷/۰			

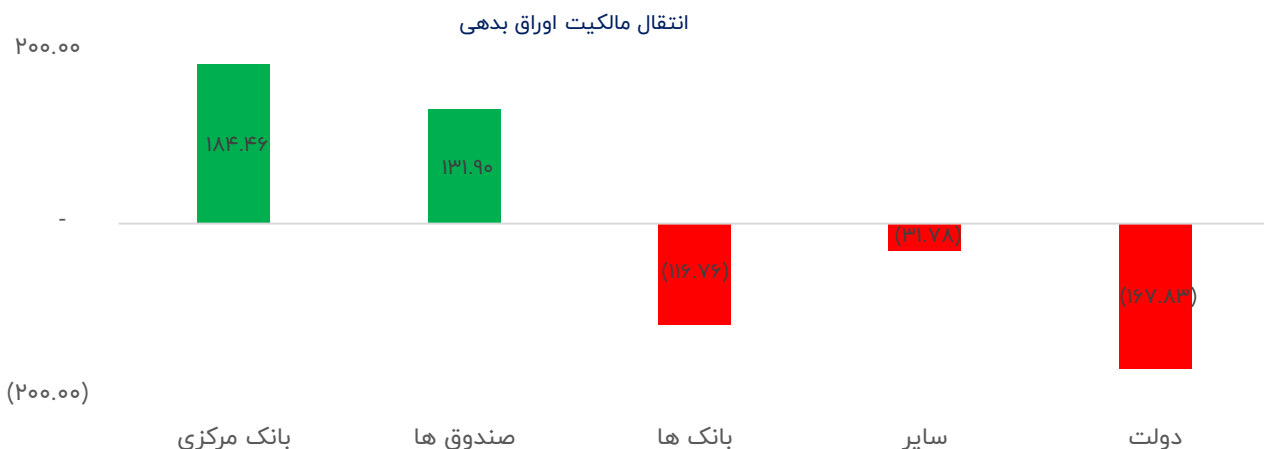
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا هجده حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۱۸ مهر ۱۴۰۴

ارقام بر حسب هزار میلیارد ریال



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 ۱۶۷/۸۳ 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)
اراد۲۳۴	آبان ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۰۸	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۲/۶
اراد۲۳۶	آبان ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۱۵	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

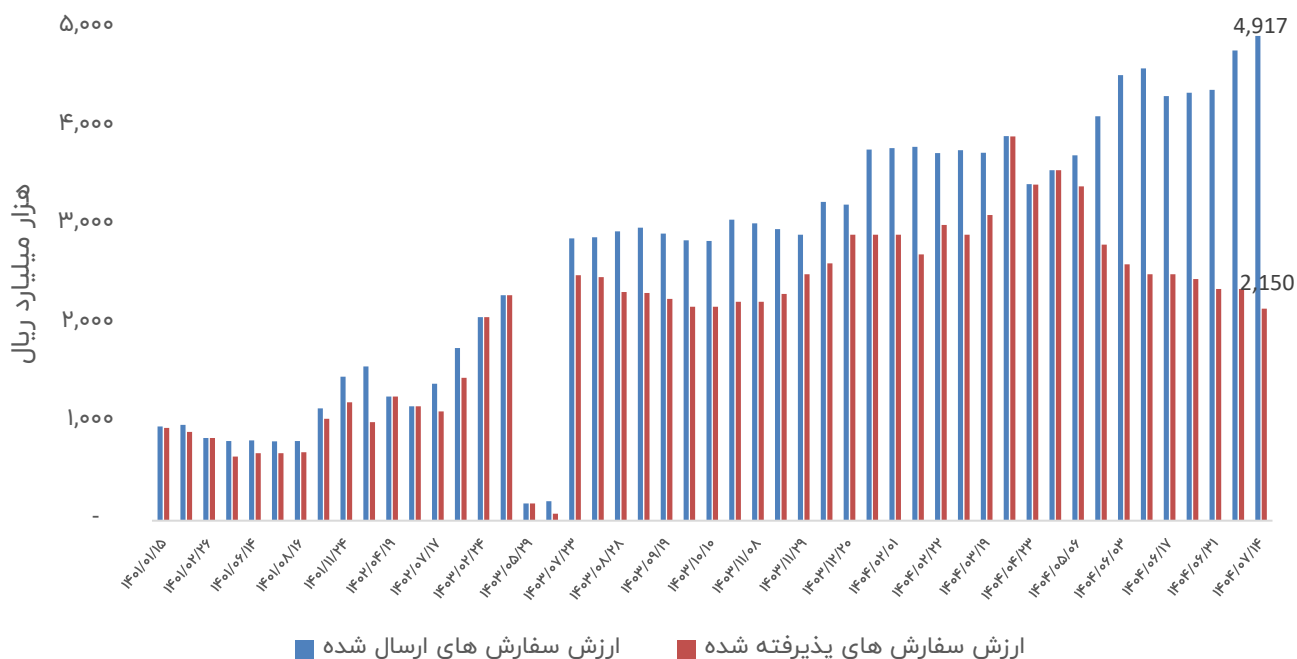


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۴۹۱۶/۹ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۱۵۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

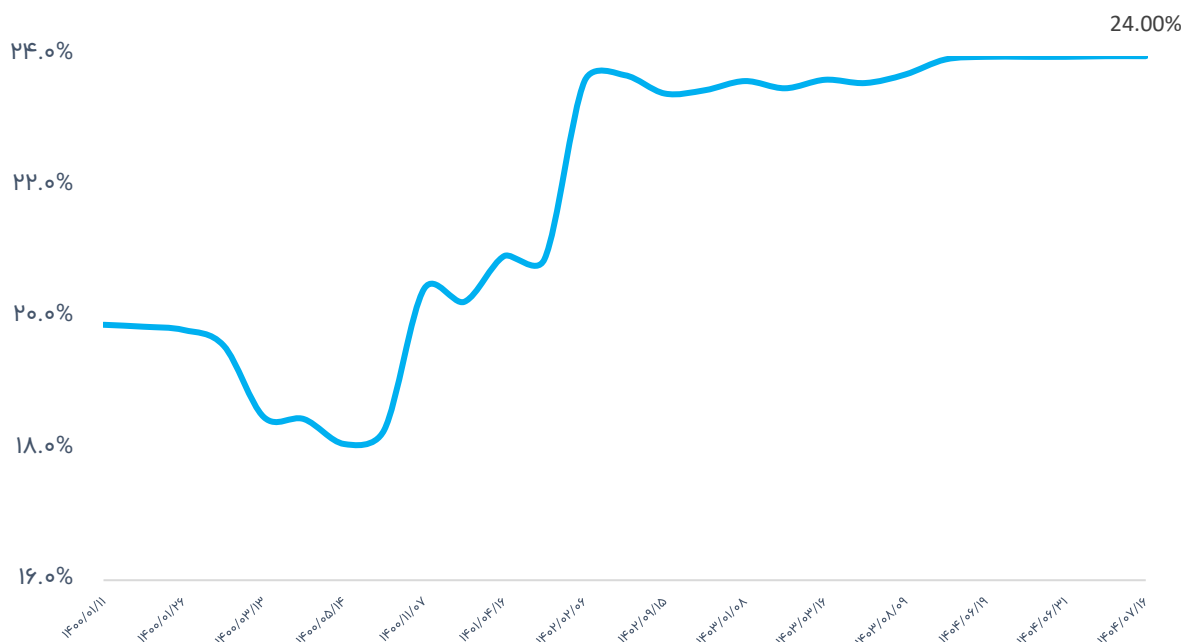
در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۱۴	عملیات بازار باز
۲۵	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۲	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۴۹۱۶/۹	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۱۵۰/۰	ارزش سفارش های پذیرفته شده - توافق باز خرید (هزار میلیارد ریال)
۷	مدت توافق باز خرید (روز)
۲۳/۰۰	حداقل نرخ توافق باز خرید (درصد)
۲۳۶۰/۴	ارزش توافق باز خرید سر رسید شده (هزار میلیارد ریال)
۲۱۵۰/۰	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.

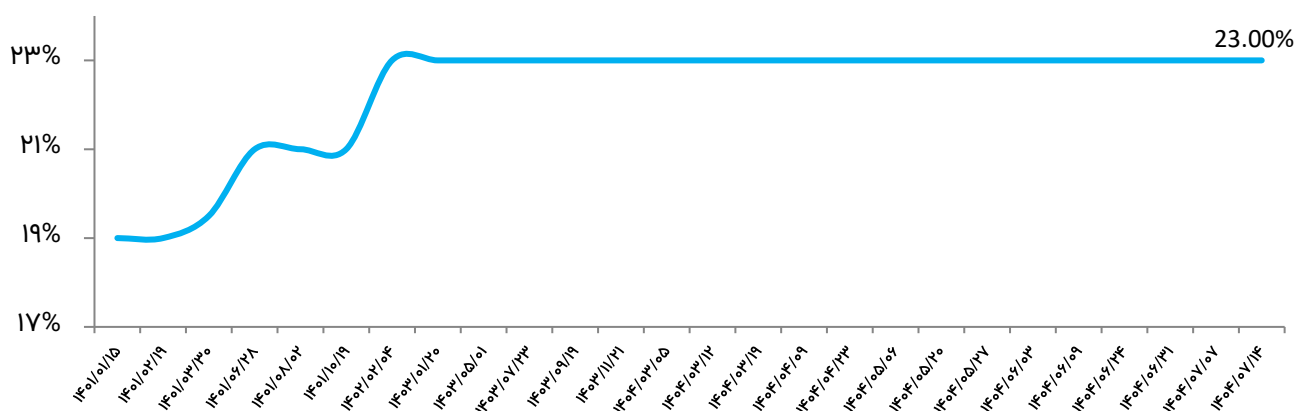


بر اساس آمار هفتگی منتشر شده از سوی بانک مرکزی، نرخ سود بین بانکی بدون تغییر نسبت به هفته قبل، نرخ ۲۴/۰۰ درصد ثبت گردیده است.

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

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	۲۶,۶۶۸	۰.۸۶%	۲.۶۹%	۸.۱۲%	۱۶.۲۴%	۴۷.۳۴%
درین	۲۳,۸۲۵	۰.۶۰%	۲.۴۰%	۷.۸۲%	۱۶.۴۸%	۳۸.۵۴%
کیان	۲۰۶,۱۹۳	۰.۵۳%	۲.۴۶%	۷.۹۹%	۱۶.۰۹%	۳۶.۷۶%
کارآمد	۵۸,۲۸۱	۰.۵۸%	۲.۶۶%	۸.۱۵%	۱۶.۱۷%	۳۶.۳۲%
ارکیده	۶۷,۰۷۱	۰.۶۷%	۲.۳۸%	۷.۱۷%	۱۶.۴۱%	۳۵.۴۰%
فیروزا	۲۱۴,۵۶۳	۰.۹۳%	۲.۷۹%	۸.۲۵%	۱۶.۵۸%	۳۵.۲۱%
لبخند	۱۹۰,۶۷۰	۰.۶۸%	۲.۷۸%	۸.۱۱%	۱۶.۲۹%	۳۵.۱۵%
ماه‌ور	۸۹,۵۸۶	۰.۵۵%	۲.۸۳%	۸.۹۷%	۱۷.۲۹%	۳۵.۱۳%
سام	۱۴,۲۴۸	۰.۸۴%	۲.۵۹%	۸.۳۱%	۱۵.۶۰%	۳۵.۰۷%
کارا	۲۵۶,۳۲۷	۰.۵۹%	۲.۵۹%	۸.۲۶%	۱۶.۱۴%	۳۵.۰۱%
فردا	۸۰,۴۲۹	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۸.۳۴%	۱۶.۲۴%	۳۴.۹۹%
افران	۲۹۲,۲۸۹	۰.۲۸%	۲.۸۰%	۸.۵۴%	۱۵.۸۵%	۳۴.۵۱%
اونیکس	۹۲,۱۰۰	۰.۸۷%	۳.۴۶%	۸.۶۴%	۱۵.۵۰%	۳۴.۴۹%
آرامش	۷۱,۷۸۰	۰.۶۵%	۲.۹۰%	۸.۰۲%	۱۵.۶۶%	۳۴.۴۶%
اعتماد	۱۶۵,۱۶۲	۰.۵۰%	۲.۵۸%	۸.۰۹%	۱۶.۲۴%	۳۴.۴۵%
رشد	۲۷,۴۴۰	۰.۵۹%	۲.۵۴%	۷.۸۸%	۱۶.۱۹%	۳۴.۴۱%
ثبات	۸۹,۷۸۲	۰.۶۰%	۲.۵۲%	۷.۸۲%	۱۶.۰۶%	۳۴.۳۷%
نشان	۲۰,۸۹۵	۰.۶۲%	۲.۷۷%	۸.۰۲%	۱۵.۵۹%	۳۴.۳۶%
داریک	۱۱,۵۱۵	۱.۷۲%	۴.۲۶%	۴.۹۴%	۱۱.۷۰%	۳۴.۳۴%
یاقوت	۳۴۸,۴۸۳	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۸.۱۷%	۱۶.۰۲%	۳۴.۲۵%
کامیاب	۱۲,۸۴۰	۰.۵۹%	۲.۶۰%	۷.۶۸%	۱۵.۸۶%	۳۴.۱۲%
دامون	۲۹,۰۴۵	۰.۵۸%	۲.۵۰%	۷.۸۵%	۱۵.۹۵%	۳۴.۱۰%
سپر	۲۳۴,۲۳۰	۰.۹۶%	۲.۴۷%	۸.۰۵%	۱۶.۱۰%	۳۴.۱۰%
رابین	۱۴,۵۷۸	۰.۵۶%	۲.۷۱%	۷.۶۸%	۱۵.۲۷%	۳۴.۰۴%
فاخر	۲۴,۴۲۱	۰.۹۵%	۲.۶۶%	۷.۶۶%	۱۵.۸۱%	۳۴.۰۲%
آوند	۲۹۲,۱۶۴	۰.۵۹%	۲.۵۳%	۸.۲۲%	۱۵.۷۷%	۳۳.۸۹%

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)							
جمع	بیش از ۱۰۹۵ روز	بین ۱۰۹۵ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۳۶۵ روز	بین ۳۶۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۹۰ روز	کمتر از ۹۰ روز	اخزا
۳۵.۸۱٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۵.۹۲٪	۳۵.۱۳٪	۳۵.۱۹٪	۳۳.۴۹٪	میانگین YTM
۳۱.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۱.۰۹٪	۳۰.۴۹٪	۳۰.۵۳٪	۲۹.۲۴٪	معادل بانکی
۵۳۸,۵۱۷	۰	۰	۵۱۵,۰۱۹	۷,۵۴۶	۲,۱۶۰	۱۳,۷۹۲	حجم معاملات (ورقه)
۳۲۸	۰	۰	۳۰۶	۶	۲	۱۳	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
جمع	بیش از ۱۰۹۵ روز	بین ۱۰۹۵ تا ۷۳۰ روز	بین ۷۳۰ تا ۳۶۵ روز	بین ۳۶۰ تا ۱۸۰ روز	بین ۱۸۰ تا ۹۰ روز	کمتر از ۹۰ روز	اراد
۳۵.۸۳٪	۳۷.۰۱٪	۳۵.۹۵٪	۳۶.۰۹٪	۳۵.۴۷٪	۳۴.۹۹٪		میانگین YTM
۳۱.۰۲٪	۳۱.۹۱٪	۳۱.۱۱٪	۳۱.۲۱٪	۳۰.۷۴٪	۳۰.۳۸٪		معادل بانکی
۱۱۵,۶۱۵,۰۰۰	۱۴,۸۳۵,۰۰۰	۵۷,۵۸۰,۰۰۰	۱۰,۷۶۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۵,۰۰۰	۲۲,۴۳۵,۰۰۰		حجم معاملات (ورقه)
۱۰۱۲۷۸	۱۱۸۸۳	۴۸۱۷۷	۹۸۲۴	۹۴۴۸	۲۱۹۴۷		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 تأسیس و با کسب مجوز سیدگردانی 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



۱۹۷۰۰ نفر
سرمایه‌گذار فعال



۹۸.۷۰۰ میلیارد ریال
منابع تحت مدیریت



۶۸۱ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی

• آمار مهم:

• مهم‌ترین دستاوردها:



• نکات کلیدی:

بازدهی سالانه ۸۹ درصدی صندوق سهامی آسمان آرمانی سهام

بازده سالانه ۹۰ درصدی صندوق سهامی آسمان یکم

بازده ۷۷ درصدی صندوق مختلط آسمان خاورمیانه

بازده ۲۷.۵ درصدی صندوق درآمد ثابت آسمان امید

بازده ۲۸ درصدی صندوق درآمد ثابت آسمان سهند

بازده ۷۵ درصدی سبدهای سرمایه‌گذاری تحت مدیریت