

بازار بدهی - منتهی به ۲۵ 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



۲.۵ برابر شاخص کل در سود هستیم

سبدگردانی اختصاصی آسمان



www.asemanamc.com

۰۲۱۴۱۷۹۳۰۰۰

بخش اول

تامین مالی دولت از بازار بدهی

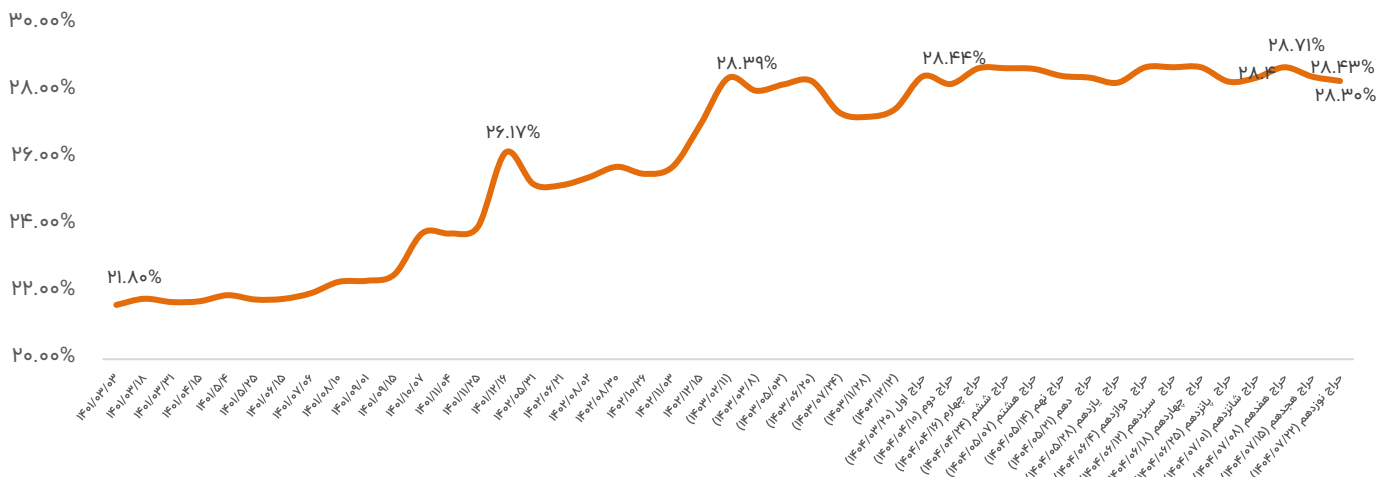


حراج اوراق دولتی

در نوزدهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۹۷/۳ 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) خریداری نگردید. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج نوزدهمین ، مبلغ ۹۷/۳ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

برگزاری حراج نوزدهم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۲۲				
نماد اوراق				
۲۳۹ارداد	۲۳۸ارداد	۲۳۶ارداد	۲۳۴ارداد	مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)
۱۰۰/۰	۵۰/۰۰	۱۰۰/۰۰	۱۲/۶	ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)
۰۰/۰۰	۰/۰۰	۰۰/۰۰	۰/۰۰	ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)
۰۰/۰۰	۴۷/۶	۳۸/۱	۱۱/۶	نرخ بازده تا سررسید (درصد)
۲۸/۷۱	۲۷/۸۹	۲۸/۷۱	۲۸/۷۱	
۹۷/۳				ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج نوزدهم(هزار میلیارد ریال)
۲۹۷۴/۳				ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در نوزده حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)

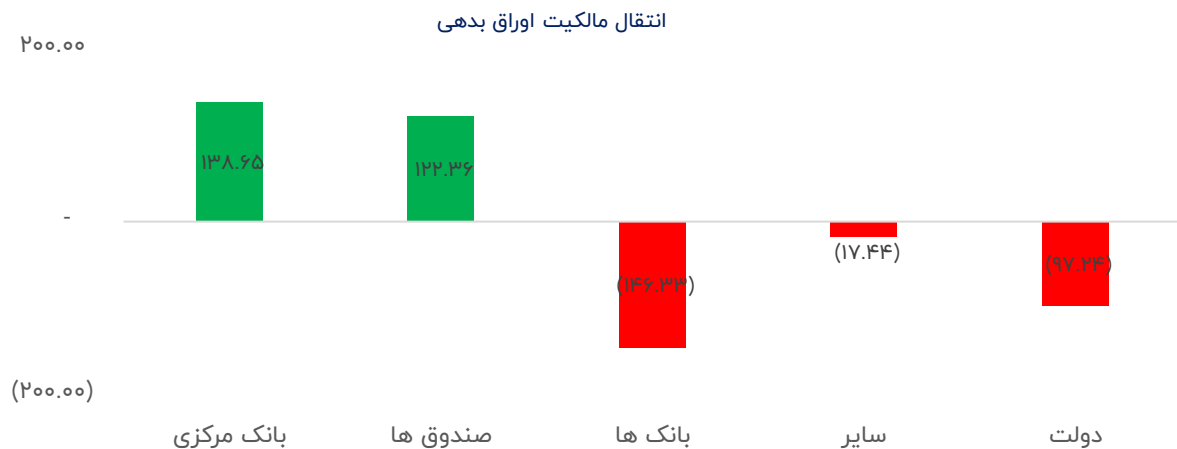
نمودار زیر روند نرخ بازده تا سررسید اوراق فروش رفته از طریق حراج را از سال ۱۴۰۱ تا نوزده حراج ۱۴۰۴ نشان می‌دهد.



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۲۵ 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 ۹۷/۲۴ 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)
اراد۲۳۶	آبان ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۱۵	۲۳/۰۰	۱۰۰۰	۵۸/۷
اراد۲۳۹	آذر ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۲۲			۱۰۰/۰
اراد۲۴۰	آذر ۱۴۰۶	۱۴۰۴/۰۷/۲۹			۸۰/۰۰
اراد۲۴۱	آذر ۱۴۰۷				۱۰۰/۰

بخش دوم

معاملات بازار باز

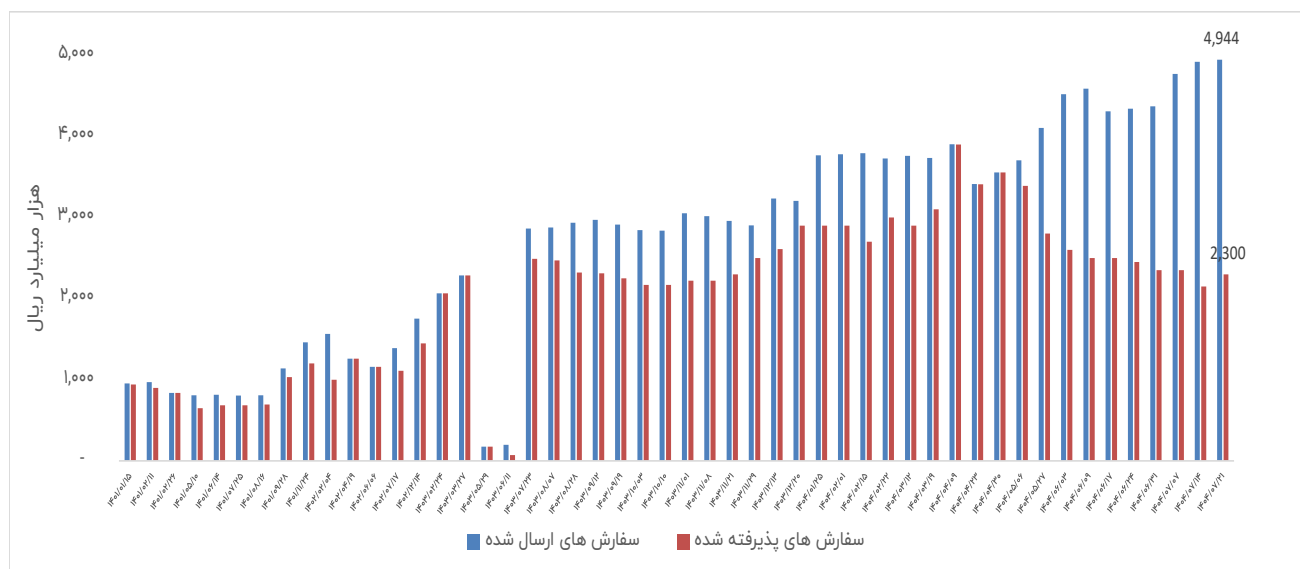


عملیات بازار باز در هفته گذشته

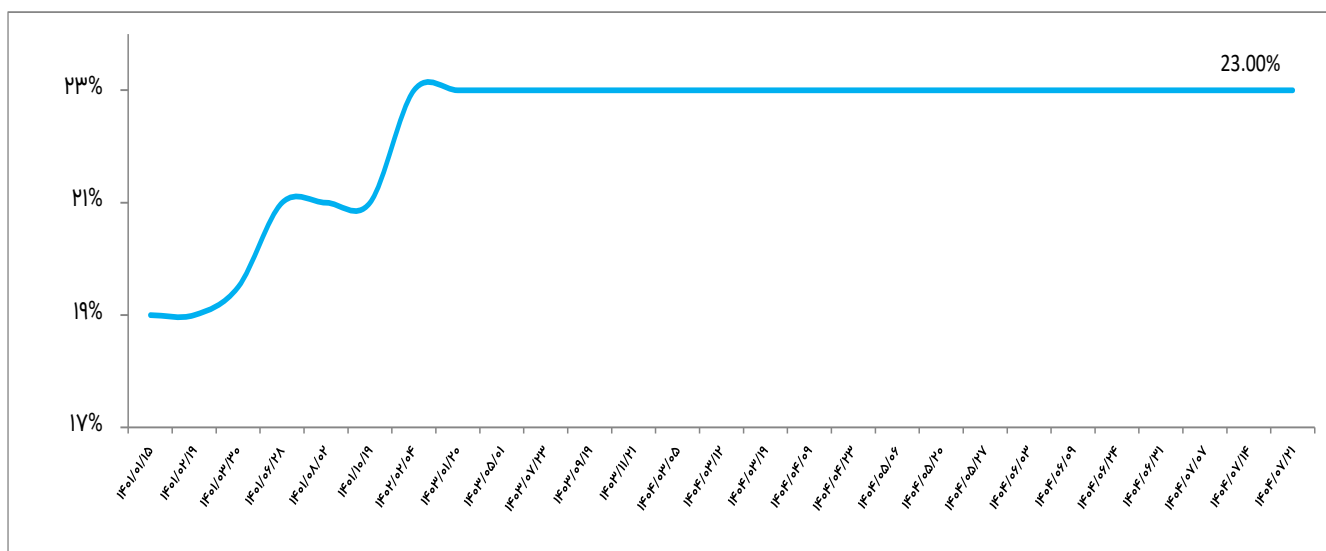
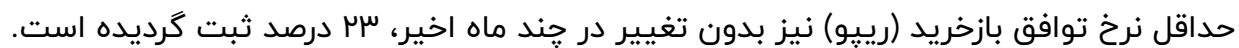
در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۴۹۴۳/۶ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۲۱	عملیات بازار باز
۲۶	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۲	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۴۹۴۳/۶	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)
۲۱۵۹/۵	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	26,770	0.20%	2.46%	7.80%	15.86%	49.29%
درین	22,057	0.70%	2.56%	7.78%	16.55%	39.89%
کیان	213,988	0.74%	2.70%	8.09%	16.34%	37.27%
داریک	11,597	0.18%	4.22%	5.11%	11.66%	37.18%
کارآمد	58,750	0.55%	2.68%	8.08%	16.11%	37.07%
ارکیده	67,923	0.66%	2.95%	7.36%	16.20%	35.77%
افران	293,383	1.06%	3.80%	8.66%	16.47%	35.51%
اعتماد	164,287	1.06%	3.27%	8.63%	16.54%	35.41%
فردا	82,880	0.60%	2.56%	8.25%	16.26%	35.10%
کارا	268,936	0.59%	2.53%	8.08%	16.16%	35.03%
سام	14,579	0.62%	2.71%	8.19%	15.47%	34.88%
لیخند	194,483	0.30%	2.83%	7.65%	15.96%	34.82%
فیروزا	216,228	0.25%	2.47%	7.88%	16.01%	34.81%
یارا	5,372	1.06%	4.00%	8.72%	14.09%	34.78%
ماه‌ور	90,783	0.47%	2.79%	8.47%	16.59%	34.77%
سپر	236,684	0.80%	3.72%	8.19%	15.71%	34.59%
اونیکس	102,338	0.51%	3.49%	8.44%	15.40%	34.51%
رشد	29,072	0.59%	2.55%	7.91%	16.19%	34.50%
ثبات	89,367	0.60%	2.64%	7.88%	16.07%	34.49%
آرامش	69,874	0.56%	2.87%	7.94%	15.45%	34.39%
یاقوت	350,545	0.59%	2.56%	8.18%	16.04%	34.32%
نشان	21,413	0.58%	2.60%	7.94%	15.58%	34.26%
کامیاب	12,582	0.59%	2.63%	7.73%	15.90%	34.24%
فاخر	25,614	0.64%	2.71%	7.72%	15.75%	34.20%
رابین	15,999	0.55%	2.71%	7.76%	15.30%	34.17%
دامون	31,159	0.59%	2.52%	7.75%	15.88%	34.16%
آوند	296,321	0.59%	2.53%	7.95%	15.79%	33.96%
آکورد	40,604	0.68%	2.77%	7.79%	15.61%	33.95%
خاتم	13,058	0.59%	2.59%	8.01%	15.90%	33.92%

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)							
۱۴۰۴مهر ۲۳							
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
۳۵.۸۲%	۴۰.۸۳%	۳۶.۰۱%	۳۵.۱۷%	۳۵.۴۵%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	میانگین YTM
۳۱.۰۱%	۳۴.۷۳%	۳۱.۱۵%	۳۰.۵۲%	۳۰.۷۳%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	معادل بانکی
۶۳۳,۴۲۱	۲۸,۴۵۱	۴۵,۰۰۰	۷۷,۲۵۹	۴۸۲,۷۱۱	۰	۰	حجم معاملات (ورقه)
۴۱۸	۲۷	۴۰	۶۱	۲۹۰	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
۳۲.۳۲%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۳۲.۱۸%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۳۶.۷۴%	میانگین YTM
۲۸.۳۴%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۲۸.۲۲%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۳۱.۷۰%	معادل بانکی
۳,۲۲۰,۰۰۰	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۳,۱۰۰,۰۰۰	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۱۲۰,۰۰۰	حجم معاملات (ورقه)
۳,۰۴۱	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۲,۹۴۵	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۹۷	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
مقادیر ذکر شده "میانگین YTM" و "معادل بانکی" در ستون جمع تمامی جداول، میانگین وزنی نرخ اوراق در سررسیدهای 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
۱۶۲.۵۰۰ نفر**



**منابع تحت مدیریت
۱۶۵.۰۰۰ میلیارد ریال**



**۱۰۰۰ میلیارد ریال
سرمایه ثبتی**

• مهم‌ترین دستاوردها:

