

بازار بدهی - منتهی به ۲ 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

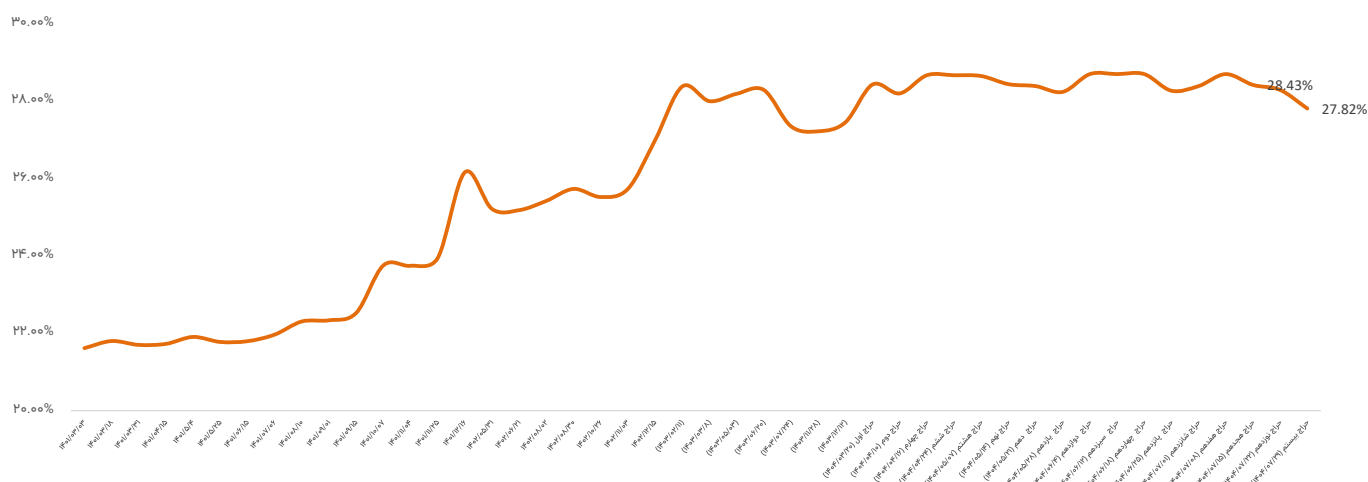


حراج اوراق دولتی

در نوزدهمین مرحله از حراج اوراق مالی اسلامی دولتی در سال ۱۴۰۴، مبلغ ۱۰۸/۵ 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) ۵/۹ هزارمیلیارد ریال خریداری شد. بدین ترتیب در مجموع ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی دولتی در حراج بیستم، مبلغ ۱۱۴/۴ هزار میلیارد ریال بوده است. جزئیات این حراج به شرح جدول زیر است:

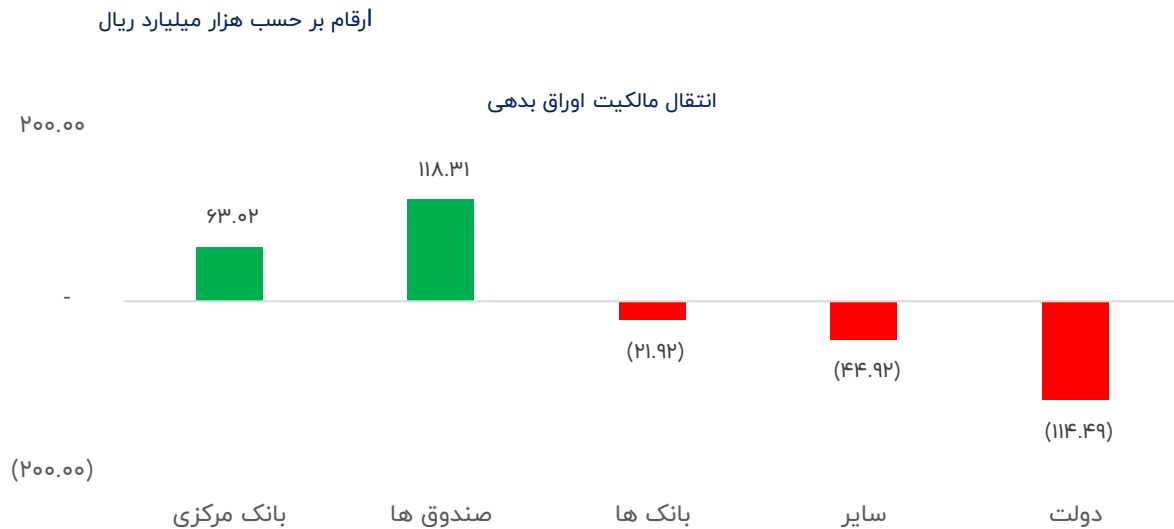
برگزاری حراج بیستم اوراق مالی اسلامی دولتی در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۲۹				
نماد اوراق	اراد۲۳۶	اراد۲۳۹	اراد۲۴۰	اراد۲۴۱
مبلغ عرضه (هزار میلیارد ریال)	۵۸/۷	۱۰۰/۰۰	۸۰/۰۰	۱۰۰/۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار پول (هزار میلیارد ریال)	۵/۹	۰۰/۰۰	۰/۰۰	۰۰/۰۰
ارزش اوراق فروخته شده در بازار سرمایه (هزار میلیارد ریال)	۱۱/۵	۰/۰	۷۶/۹	۲۰/۱
نرخ بازده تا سررسید (درصد)	۲۸/۷۰	۲۸/۷۱	۲۷/۴۰	۲۸/۷۱
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در حراج بیستم (هزار میلیارد ریال)	۱۱۴/۴			
ارزش کل فروش اوراق مالی اسلامی در بیست حراج برگزار شده (هزار میلیارد ریال)	۳۰۸۸/۸			

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



نمودار انتقال مالکیت اوراق

بدهی در هفته منتهی به ۲ 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 ۱۱۴/۴۹ 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	۳۹/۸
اراد۲۳۹	آذر ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۲۲			۱۰۰/۰
اراد۲۴۱	آبان ۱۴۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۲۹			۷۸/۲

بخش دوم

معاملات بازار باز

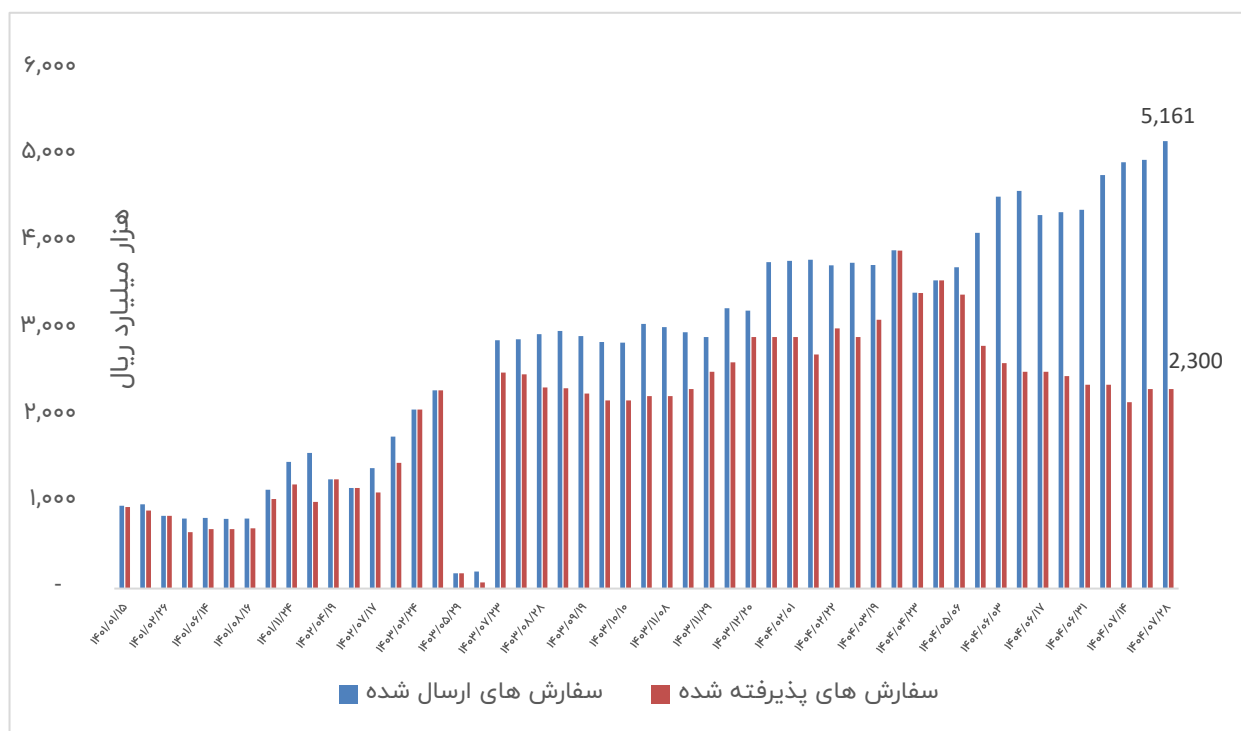


عملیات بازار باز در هفته گذشته

در معاملات بازار باز این هفته، بانک‌ها پیشنهاد ۵۱۳۱/۲ هزار میلیارد ریالی به بانک مرکزی دادند که با ۲۳۰۰ هزار میلیارد ریال آن موافقت گردید.

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۷/۲۸	عملیات بازار باز
۲۷	شماره حراج
توافق باز خرید	موضع عملیات بانک مرکزی
۲۳	تعداد بانکها و موسسات اعتباری غیر بانکی شرکت کننده در حراج
۵۱۶۱/۲	ارزش سفارش های ارسال شده (هزار میلیارد ریال)
۲۳۰۰/۰۰	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	۲۶,۸۷۱	۰.۶۳%	۲.۶۲%	۷.۸۶%	۱۶.۰۰%	۵۰.۶۹%
آسان	۳۱,۴۱۸	۰.۶۱%	۲.۳۷%	۸.۸۲%	۱۵.۹۲%	۴۹.۷۷%
کارآمد	۶۰,۷۶۷	۰.۵۱%	۲.۵۵%	۸.۰۰%	۱۶.۱۴%	۳۷.۴۸%
کیان	۲۱۳,۵۰۵	۰.۶۱%	۲.۷۲%	۸.۰۸%	۱۶.۴۷%	۳۷.۴۰%
سپر	۲۳۳,۹۱۸	۰.۸۸%	۲.۷۲%	۸.۵۳%	۱۵.۹۶%	۳۶.۰۴%
کارا	۲۷۰,۰۹۳	۰.۶۰%	۲.۶۵%	۸.۰۹%	۱۶.۳۳%	۳۵.۱۵%
فردا	۸۲,۰۰۶	۰.۶۰%	۲.۵۶%	۸.۲۰%	۱۶.۲۶%	۳۵.۱۵%
لبخند	۱۹۱,۲۳۶	۰.۷۳%	۲.۹۶%	۷.۸۹%	۱۶.۲۶%	۳۵.۱۴%
فیروزا	۲۱۲,۹۰۹	۰.۵۹%	۲.۶۴%	۷.۹۵%	۱۶.۳۰%	۳۴.۹۷%
ماه‌ور	۸۸,۸۰۹	۰.۳۶%	۲.۶۳%	۸.۱۲%	۱۶.۳۹%	۳۴.۷۸%
رشد	۲۷,۹۸۶	۰.۵۸%	۲.۷۲%	۸.۰۱%	۱۶.۴۳%	۳۴.۷۳%
ثبات	۹۱,۴۶۱	۰.۴۲%	۲.۷۸%	۸.۳۳%	۱۶.۴۸%	۳۴.۷۲%
اعتماد	۱۶۴,۰۰۹	۱.۰۷%	۲.۷۹%	۷.۸۷%	۱۶.۲۳%	۳۴.۶۹%
اونی‌کس	۱۰۲,۶۰۷	۰.۴۸%	۳.۳۰%	۸.۳۵%	۱۵.۴۱%	۳۴.۵۹%
آرامش	۶۸,۸۴۲	۰.۷۳%	۲.۹۲%	۸.۱۴%	۱۵.۶۵%	۳۴.۵۷%
کامیاب	۱۲,۲۲۳	۰.۵۸%	۲.۶۰%	۷.۸۴%	۱۶.۰۲%	۳۴.۴۱%
یاقوت	۳۵۱,۷۳۵	۰.۵۹%	۲.۵۶%	۸.۱۷%	۱۶.۰۵%	۳۴.۳۶%
دامون	۳۴,۷۲۲	۰.۵۸%	۲.۵۳%	۷.۷۸%	۱۵.۹۴%	۳۴.۲۷%
کارین	۹۶,۴۹۶	۰.۵۸%	۲.۶۰%	۷.۶۶%	۱۵.۸۵%	۳۴.۰۴%
آکورد	۴۰,۸۴۴	۰.۵۹%	۲.۷۸%	۷.۸۰%	۱۵.۶۶%	۳۴.۰۰%
فاخر	۲۵,۶۳۵	۰.۴۷%	۲.۵۲%	۷.۳۳%	۱۵.۵۰%	۳۳.۹۴%
دارا	۳۵,۸۹۷	۰.۵۶%	۲.۵۸%	۷.۸۲%	۱۵.۹۳%	۳۳.۸۷%
آوند	۲۹۹,۴۱۴	۰.۵۸%	۲.۵۰%	۷.۷۰%	۱۵.۸۷%	۳۳.۸۴%
ساحل	۶۸,۰۹۳	۰.۷۹%	۲.۸۲%	۷.۶۷%	۱۵.۶۲%	۳۳.۷۳%

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	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	۳۰ مهر ۱۴۰۴
میانگین YTM	۳۴.۶۶٪	۳۴.۹۵٪	۳۵.۲۴٪	۳۵.۵۷٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۵.۴۸٪
معادل بانکی	۳۰.۱۳٪	۳۰.۳۵٪	۳۰.۵۷٪	۳۰.۸۲٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۰.۷۵٪
حجم معاملات (ورقه)	۲۴,۵۳۵	۵۶	۱۳,۸۸۷	۴۱۷,۴۰۷	۰	۰	۴۵۵,۸۵۵
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۲۴	۰	۱۱	۲۴۹	۰	۰	۲۸۴
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٪	۳۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۳۶.۱۶٪	۰.۰۰٪	۳۶.۱۳٪
معادل بانکی	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۲۶.۵۳٪	۰.۰۰٪	۳۱.۲۷٪	۰.۰۰٪	۳۱.۲۴٪
حجم معاملات (ورقه)	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۱۰,۰۰۰	۰	۲,۴۰۵,۰۰۰	۰	۲,۴۱۵,۰۰۰
ارزش معاملات (میلیارد ریال)	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۱۰	۰	۲,۰۴۷	۰	۲,۰۵۷
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:

