



کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

شماره

۲

# گزارش جامع بازار بدهی ایران

منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

تاریخ انتشار:

۱۴۰۰/۱۰/۱۰

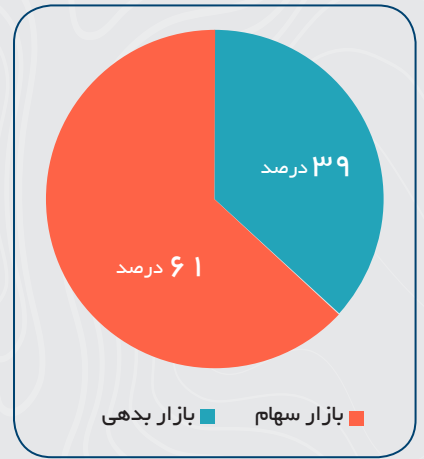
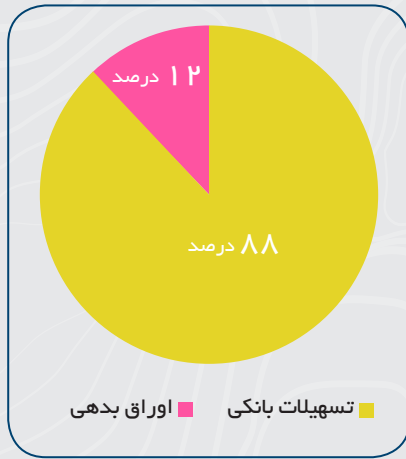
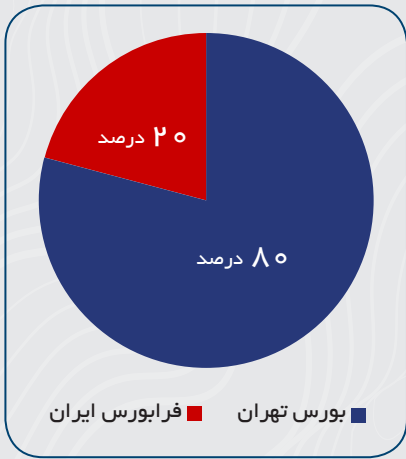
کلیه آمار و ارقام این گزارش بر مبنای داده‌های رسمی منتشر شده وزارت امور اقتصادی و دارایی، سازمان بورس و اوراق بهادار، شرکت بورس اوراق بهادار تهران، فرابورس ایران، بورس کالا، بورس انرژی و بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران تهیه و ارائه شده است. گاهی اوقات ممکن است اعداد و ارقام ماه‌های قبلی تغییرات جزئی داشته باشند؛ علت این موضوع تأخیر در اطلاع‌رسانی عمومی برخی از اوراق می‌باشد. به‌ویژه در مورد اوراق مشارکت شهرداری‌ها که با مجوز بانک مرکزی منتشر می‌شوند و همچنین اسناد خزانه اسلامی منتشر شده توسط دولت که اطلاعات آن‌ها با تأخیر منتشر می‌شوند، تغییرات داده‌های ماه‌های گذشته گریزناپذیر خواهد بود. نمودار نرخ‌های YTM در بازار بدهی بر مبنای نرخ مؤثر اوراق اسناد خزانه اسلامی منتشره توسط دولت محاسبه و منتشر شده است. برای افزایش دقت، صرفاً از نرخ اوراقی استفاده شده است که در هر روز مورد معامله قرار گرفته‌اند و فاصله تا سررسید آن‌ها بیش از ۱۰ روز بوده است. منظور از نرخ کوتاه مدت یا Short Term، میانگین نرخ اوراقی است که در هر روز فاصله تا سررسید آن‌ها حداکثر ۲۷۰ روز بوده است و طبیعتاً اوراق با سررسید بالای ۲۷۰ روز در زمره اوراق بلندمدت تقسیم‌بندی شده‌اند.

تهیه‌کنندگان

علیرضا توکلی کاشی، زهرا اسدی پور

معاونت توسعه کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران، اداره آمار

این گزارش به‌صورت منظم و ماهانه و در روز دهم هر ماه از طریق سایت رسمی کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران منتشر خواهد شد.



(واحد کلیه ارقام هزار میلیارد ریال می باشد)

### آمار انتشار و سررسید اوراق دولت در یک سال اخیر

انتشار	سررسید	خالص انتشار	پرداخت سود	تاریخ
۱۸۱	(۲۴)	۱۵۷	۳۱	۱۳۹۹/۱۰
۱۲۱	(۵۰)	۷۱	۲۳	۱۳۹۹/۱۱
۳۵۳	(۴)	۳۴۹	۳۱	۱۳۹۹/۱۲
۱۴۵	(۲۵)	۱۲۰	۱۴	۱۴۰۰/۰۱
۶۰۰	۰	۶۰۰	۱۰	۱۴۰۰/۰۲
۲۵۰	(۱۰)	۲۴۰	۲۸	۱۴۰۰/۰۳
۱۰۰	(۵۶)	۴۴	۴۲	۱۴۰۰/۰۴
۶۰	(۸۷)	(۲۷)	۲۵	۱۴۰۰/۰۵
۲۵۵	(۸۰)	۱۷۵	۵۶	۱۴۰۰/۰۶
۰	(۷۵)	(۷۵)	۸	۱۴۰۰/۰۷
۱۰۰	(۱۰۵)	(۵)	۱۱	۱۴۰۰/۰۸
۱۰۰	(۶۲)	۳۸	۵۰	۱۴۰۰/۰۹
۲,۲۶۵	(۵۷۹)	۱,۶۸۶	۳۳۰	مجموع

### ارزش بازارهای مالی ایران در ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

ارزش بازار بدهی			
تسهیلات بانکی	۸۸%	۳۷,۳۹۸	۳۹%
اوراق بدهی	۱۲%	۵,۰۷۴	
ارزش بازار سهام			
بورس تهران	۸۰%	۵۳,۷۷۴	۶۱%
فرا بورس ایران	۲۰%	۱۳,۵۴۲	
ارزش بازارهای مالی ایران		۱۰۹,۷۸۷	

### ارزش بازار بدهی به تفکیک ناشران

۱۳۹۷	۱۳۹۸	۱۳۹۹	۱۴۰۰/۰۹	ناشر
۹۰۰	۱,۴۷۳	۳,۱۳۸	۴,۲۴۸	دولت
۸۳	۱۰۳	۳۶۸	۳۳۱	سازمان دولتی
۹۷	۱۲۱	۲۵۳	۳۲۶	خصوصی
۱۰۱	۹۹	۱۱۰	۱۳۶	شهرداری
۰	۰	۴۴	۳۲	بانکی
۱,۱۸۰	۱,۷۹۶	۳,۹۱۴	۵,۰۷۴	مجموع

### آمار انتشار و سررسید اوراق دولت

۱۳۹۷	۱۳۹۸	۱۳۹۹	۱۴۰۰/۰۹	بخش
۷۵۳	۹۰۰	۱,۴۷۳	۳,۱۳۸	مانده ابتدای دوره
۴۵۷	۸۶۷	۲,۰۳۷	۱,۶۱۰	انتشار
(۳۱۰)	(۲۹۴)	(۳۷۲)	(۵۰۰)	سررسید
۹۰۰	۱,۴۷۳	۳,۱۳۸	۴,۲۴۸	مانده پایان دوره
۸۲	۶۳	۱۹۲	۲۴۴	سود پرداختی طی دوره
۱۴۷	۵۷۳	۱,۶۶۵	۱,۱۱۰	خالص تأمین مالی

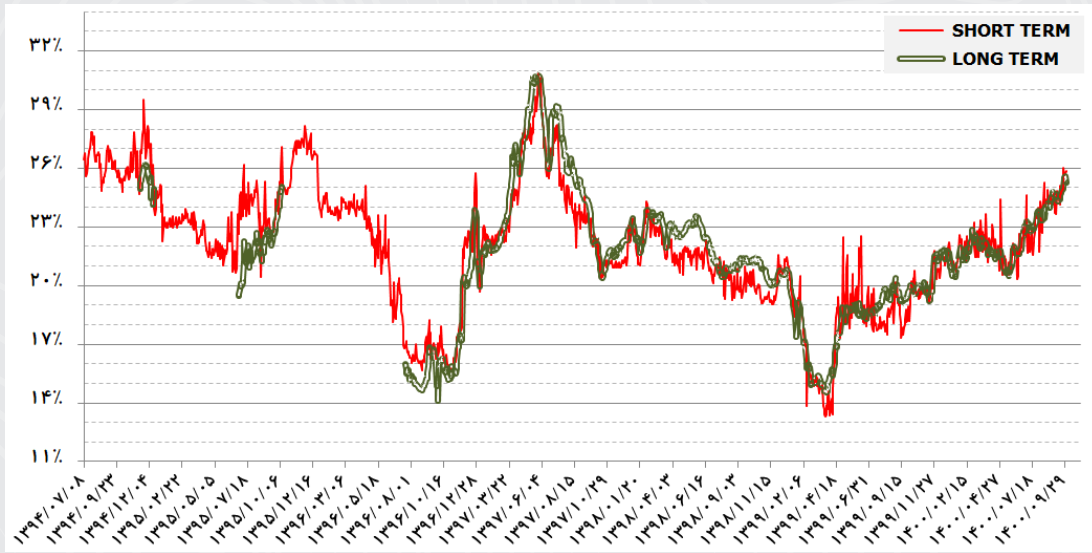
### ارزش بازار بدهی به تفکیک نوع اوراق

۱۳۹۷	۱۳۹۸	۱۳۹۹	۱۴۰۰/۰۹	نوع اوراق
۱۱۸	۲۳۱	۱,۶۴۹	۲,۰۵۱	اوراق مرابحه
۵۲۲	۷۱۲	۱,۱۰۵	۱,۸۲۲	استاد خزانه اسلامی
۸۱	۳۶۹	۴۲۱	۳۷۱	اوراق متفعت
۵۱	۹۹	۲۸۷	۳۲۷	اوراق سلف
۱۶۲	۱۸۷	۲۵۳	۲۹۲	اوراق اجاره
۲۴۴	۱۹۲	۱۴۹	۱۷۵	اوراق مشارکت
۰	۰	۳۴	۲۲	اوراق گام
۲	۵	۱۵	۱۲	اوراق رهنی
۰	۰	۰	۱	خرید دین
۰	۰	۰	۰	مشارکت بانک مرکزی
۰	۰	۰	۰	اوراق استصناع
۱,۱۸۰	۱,۷۹۶	۳,۹۱۴	۵,۰۷۴	مجموع

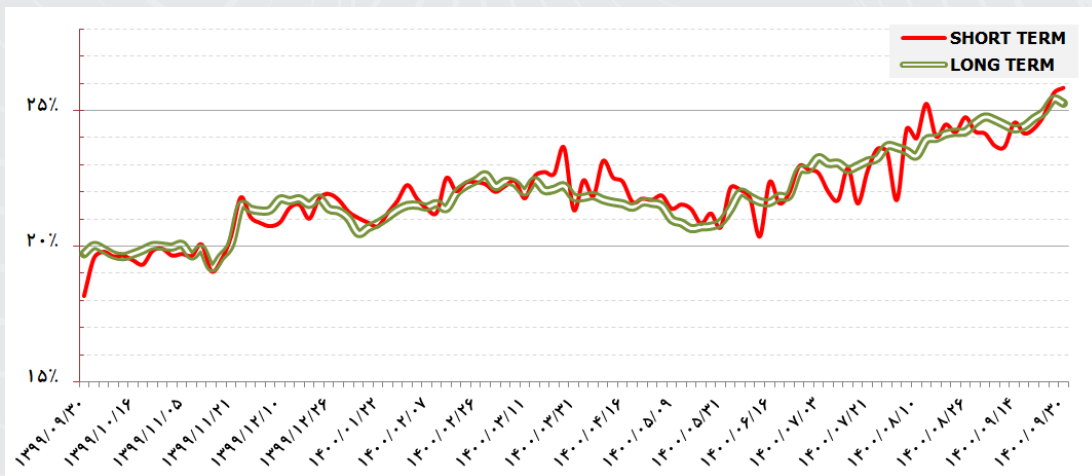
### آمار انتشار و سررسید اوراق بخش خصوصی

۱۳۹۷	۱۳۹۸	۱۳۹۹	۱۴۰۰/۰۹	بخش
۶۷	۹۷	۱۲۱	۲۵۳	مانده ابتدای دوره
۵۸	۴۴	۱۶۸	۱۱۳	انتشار
(۳۰)	(۱۸)	(۳۶)	(۴۰)	سررسید
۹۷	۱۲۱	۲۵۳	۳۲۶	مانده پایان دوره
۱۳	۱۷	۲۳	۳۶	سود پرداختی طی دوره
۳۰	۲۵	۱۳۲	۷۳	خالص تأمین مالی

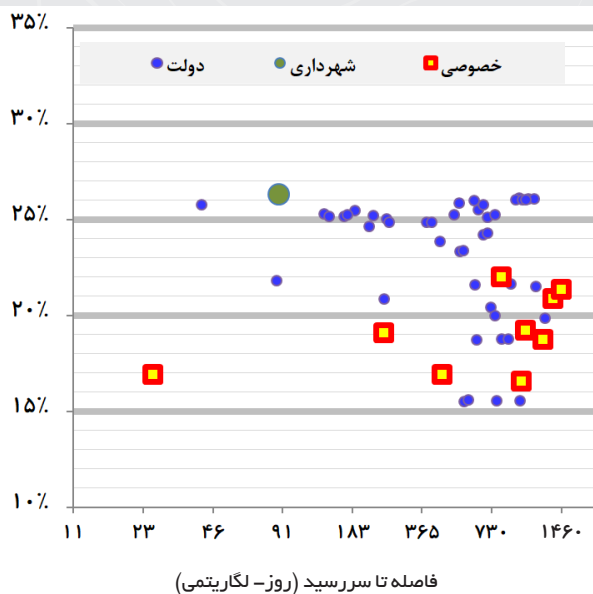
روند بلندمدت YTM از ۱۴۰۰/۰۷/۰۸ تا ۱۴۰۰/۰۹/۳۰\*



روند نرخ YTM از تاریخ: ۱۳۹۹/۰۹/۳۰ تا ۱۴۰۰/۰۹/۳۰ (T1=10 T2=270)\*



نرخ سود کلیه اوراق بدهی موجود در بازار در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۳۰



مقایسه متحنی نرخ سود بازار بدهی با ماه و سال گذشته در ایران\*

