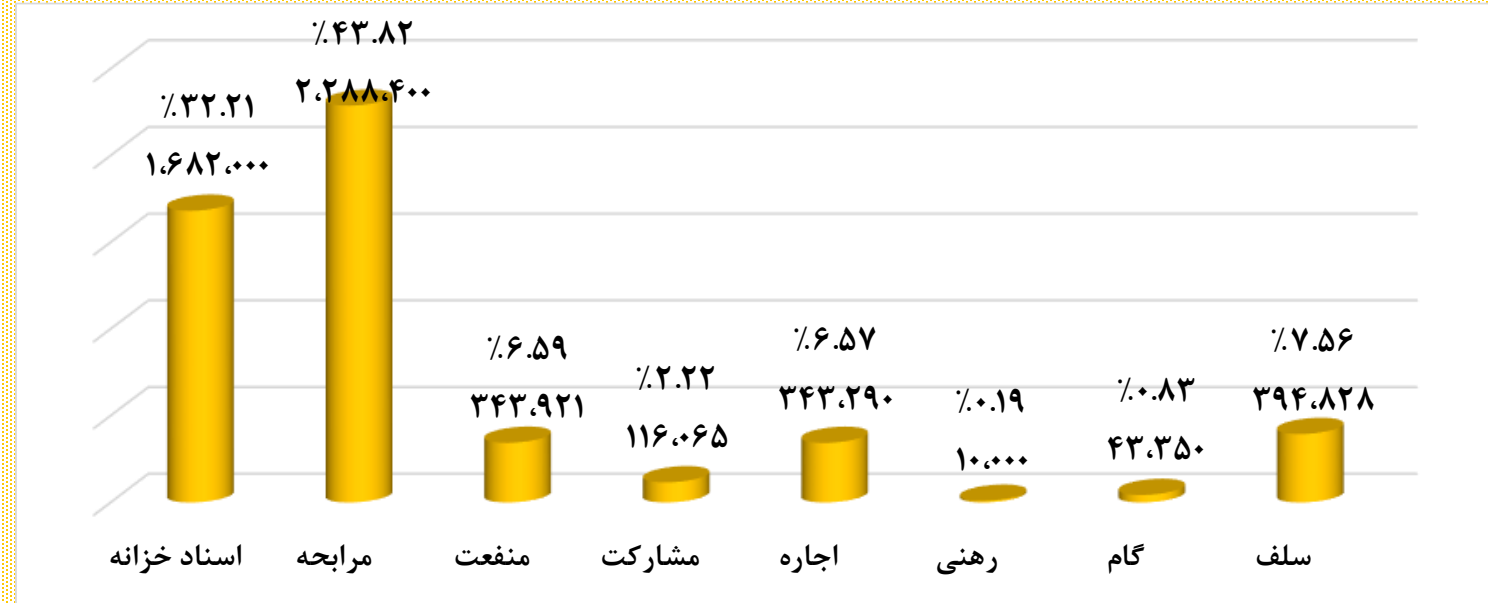


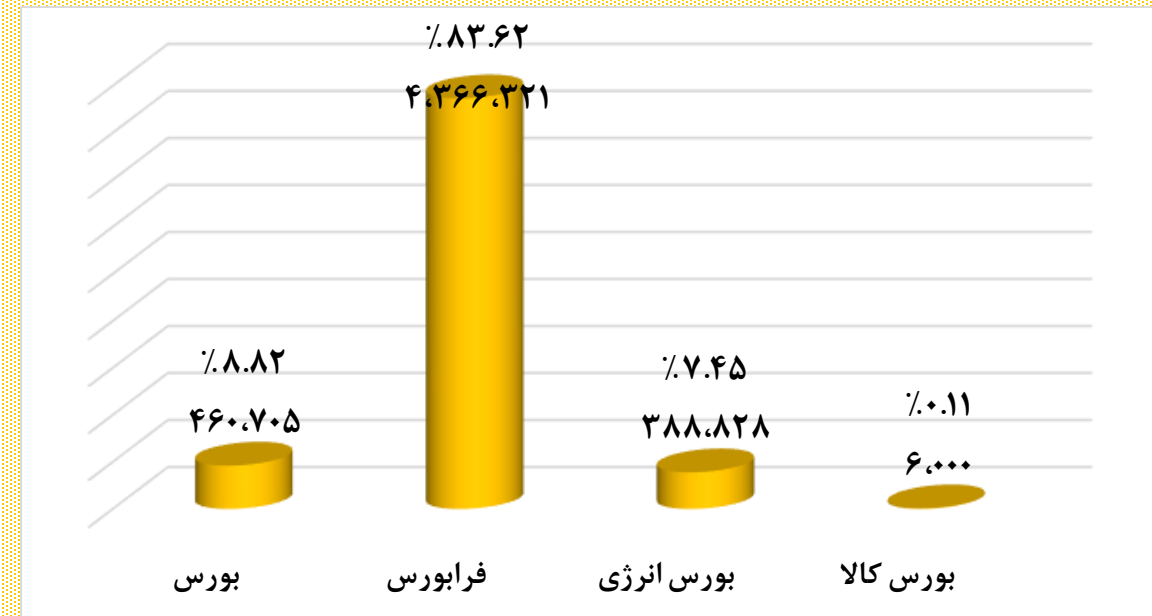
گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۱۲ خرداد ۱۴۰۱

براساس نوع اوراق



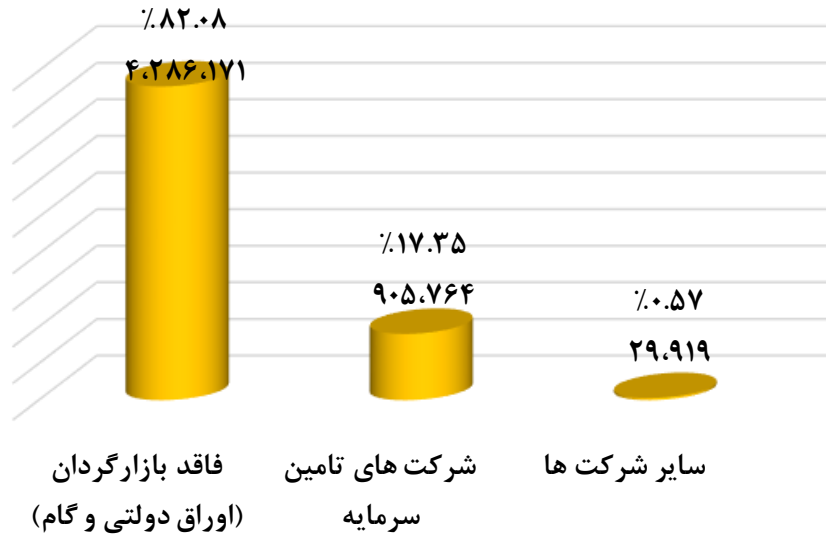
براساس نوع بازار



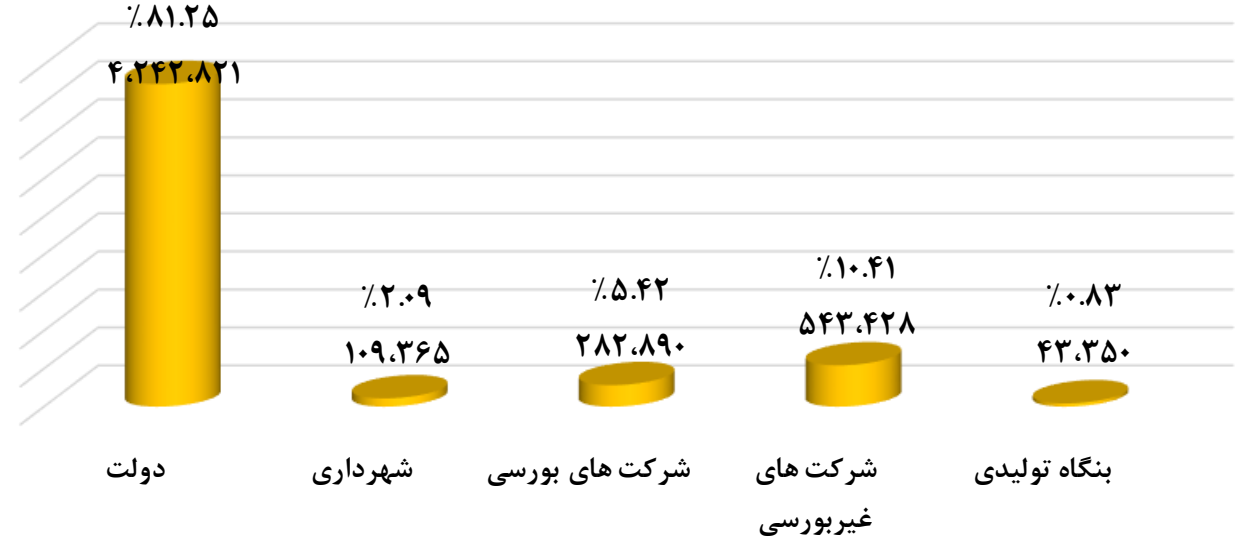
حجم اوراق موجود
بر مبنای قیمت سررسید
(ارقام به میلیارد ریال)



براساس نوع بازارگردان



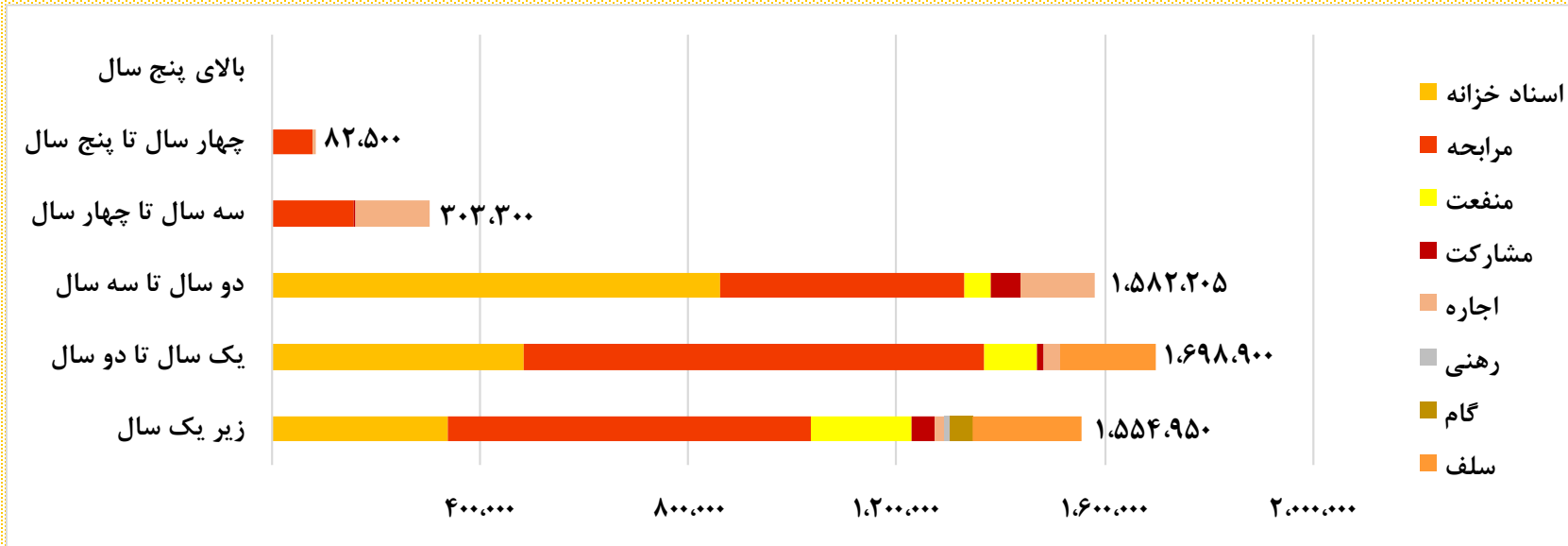
براساس نوع بانی



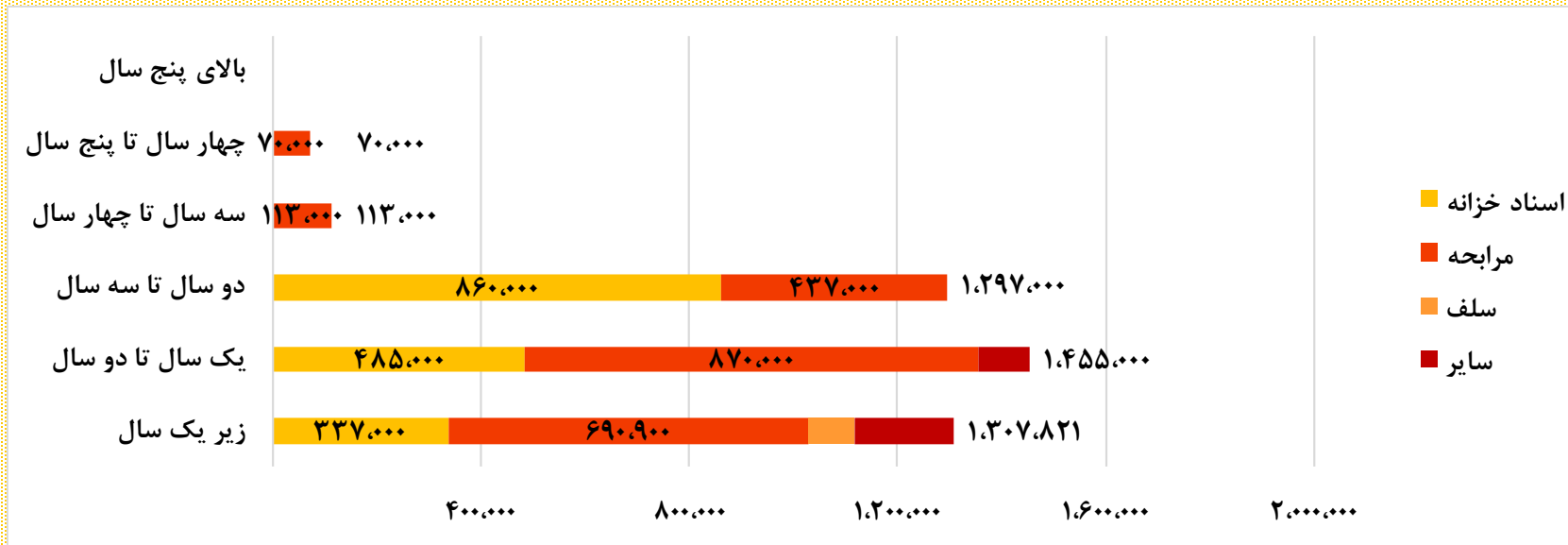
براساس نوع ضامن



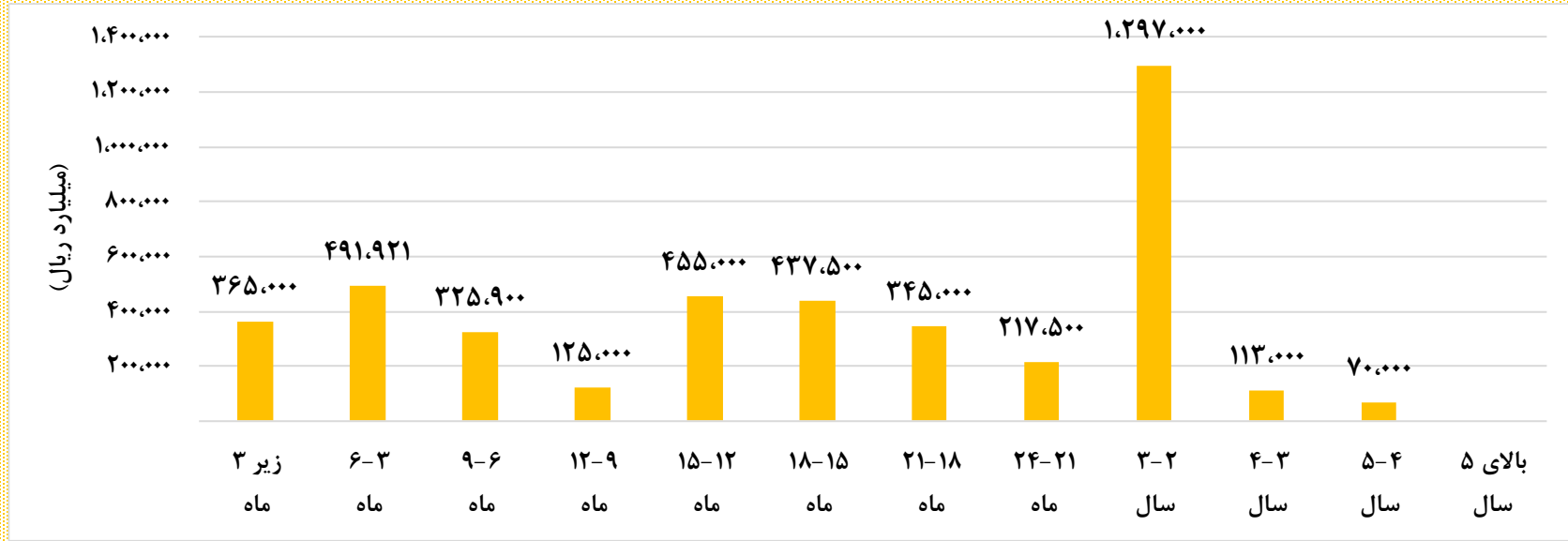
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

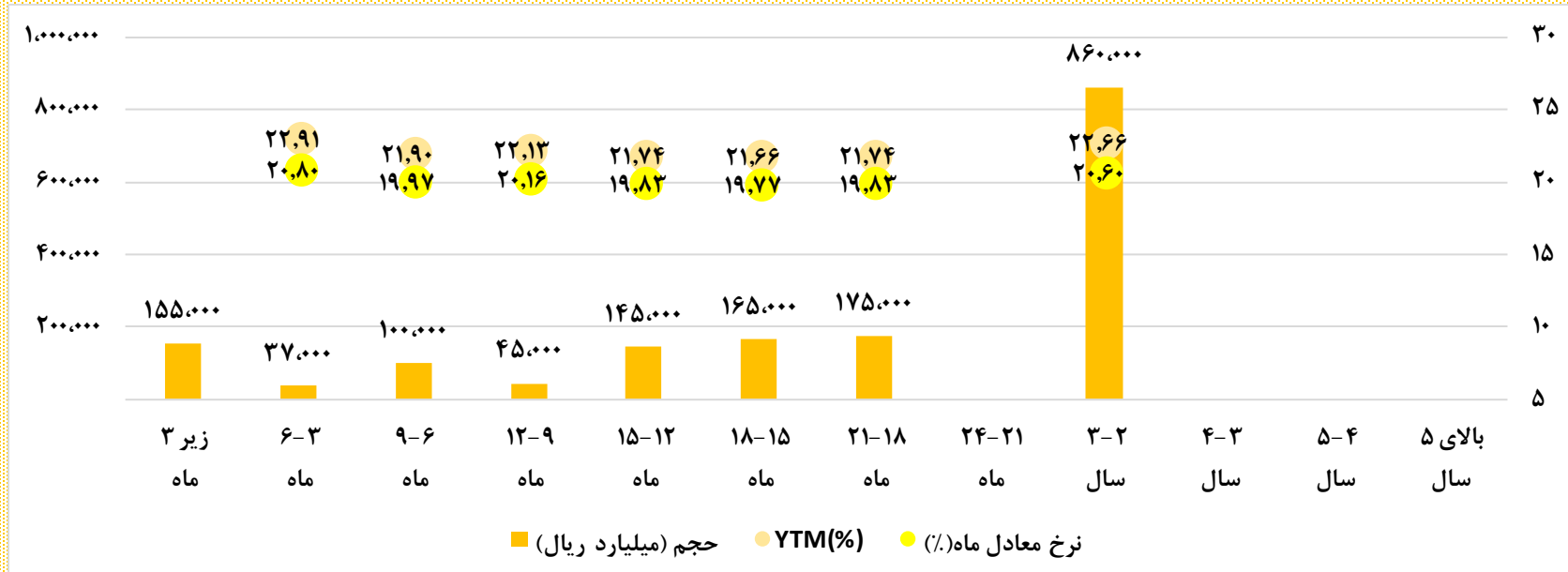


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* بازدهی بر مبنای بازدهی موزون اخزاهای معامله شده در آخرین روز معاملاتی هفته محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل ماه اوراق معامله شده در نزدیک چهل روز مانده به سررسید به صورت بازدهی ساده محاسبه گردیده است.

حجم اسناد خزانه موجود براساس زمان تا سررسید



میانگین YTM اسناد خزانه کوتاه مدت

٪۲۱.۹۳

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

٪۲۲.۶۴

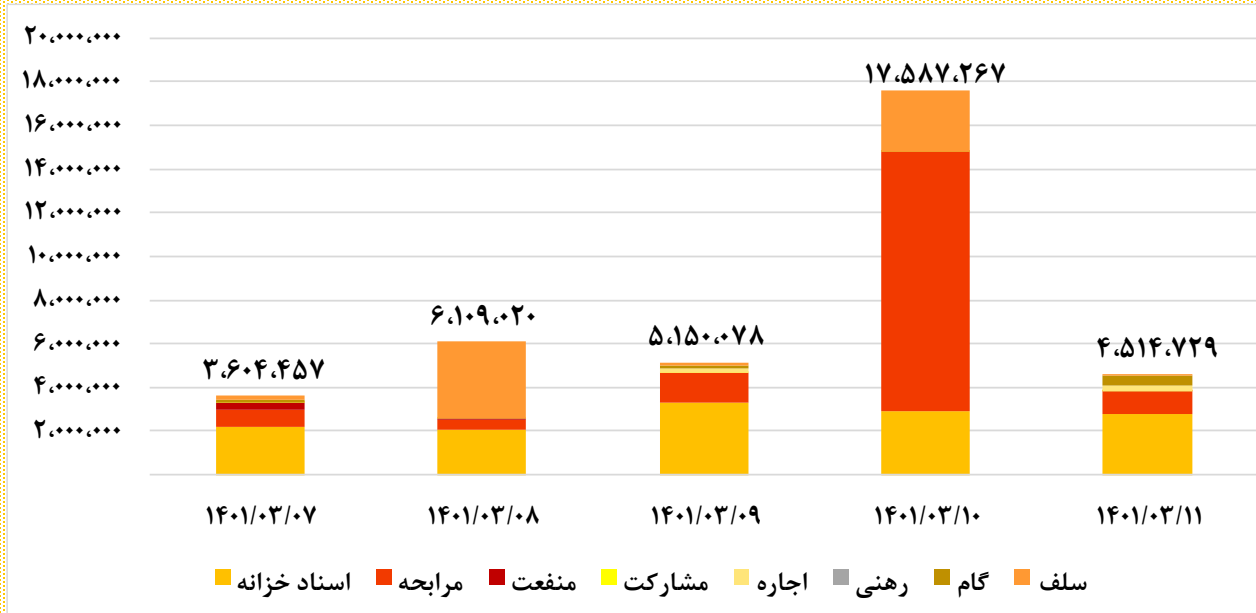
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

٪۱۹.۹۹

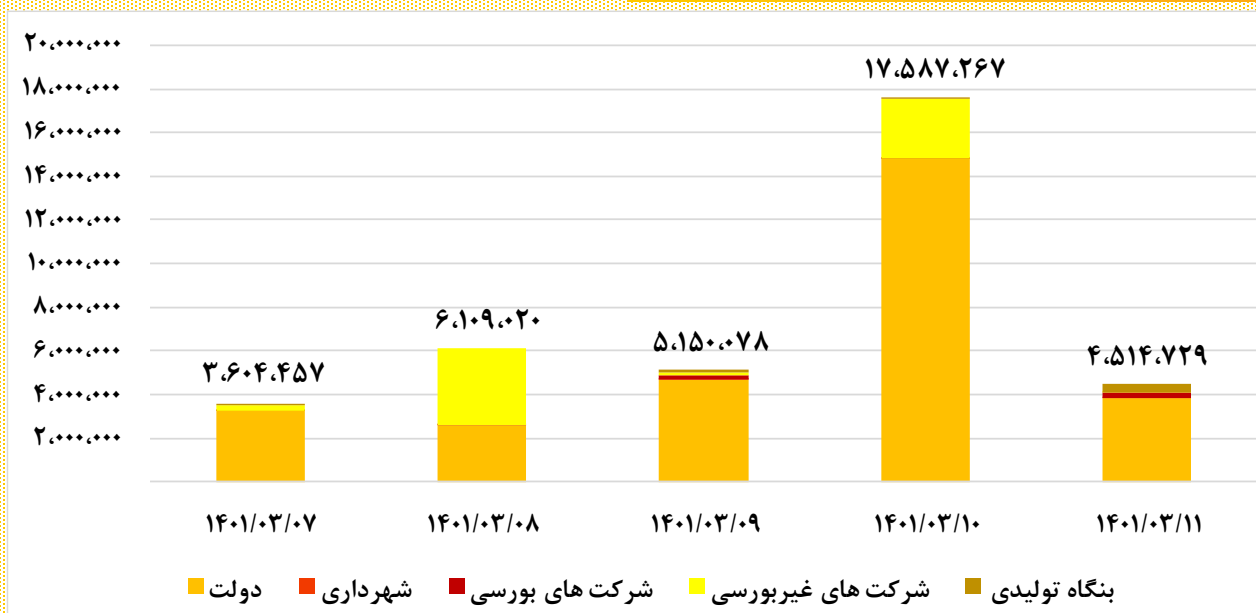
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

٪۲۰.۵۸

براساس نوع اوراق

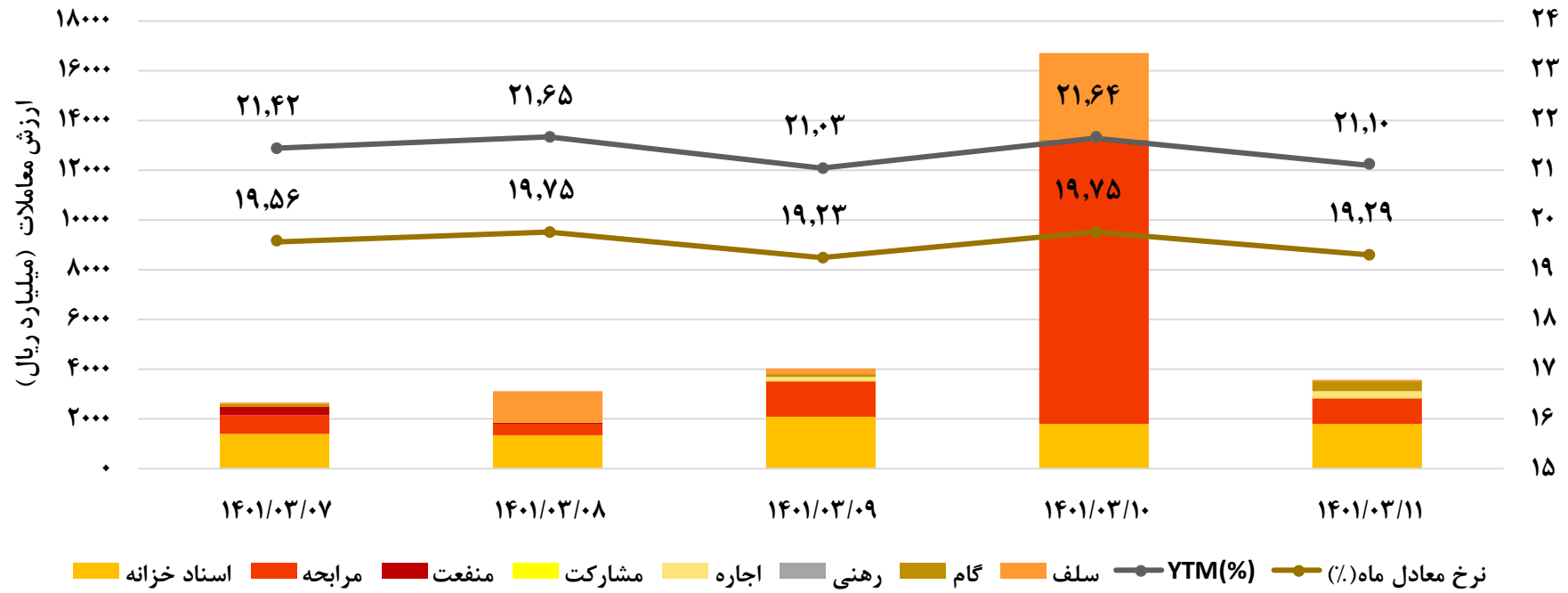


براساس نوع بانی



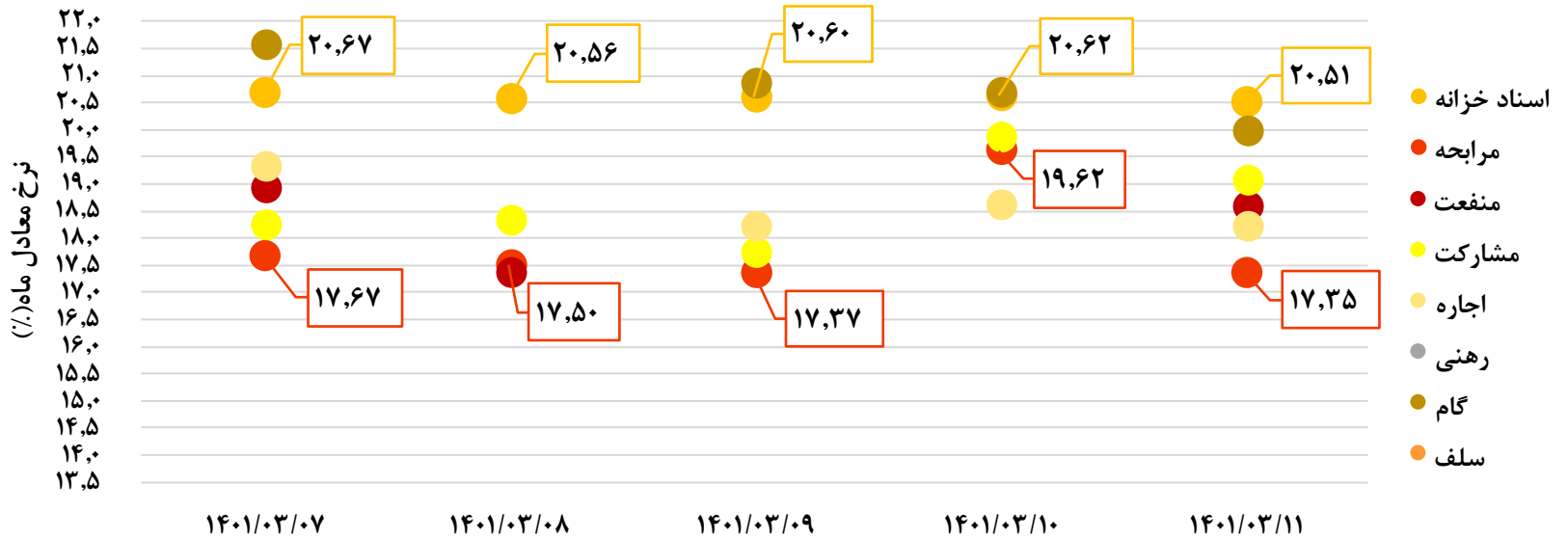
حجم معاملات طی هفته

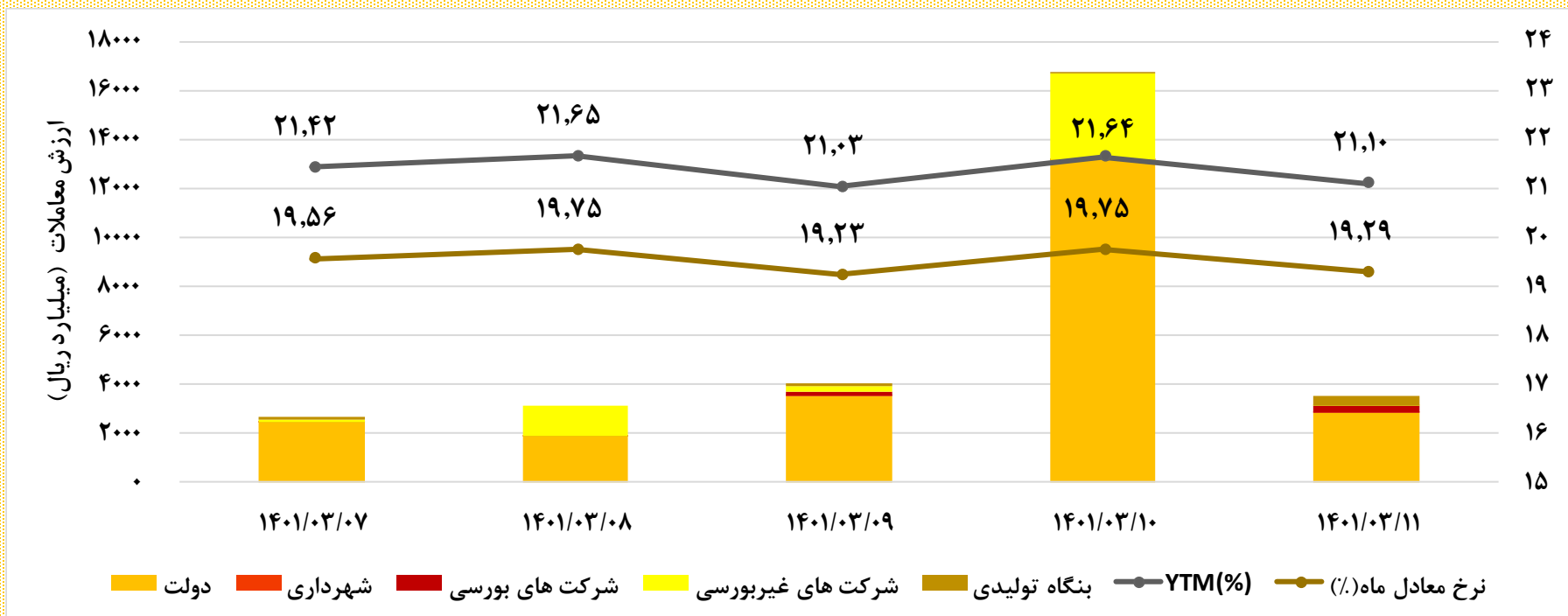




بازدهی معاملات طی هفته

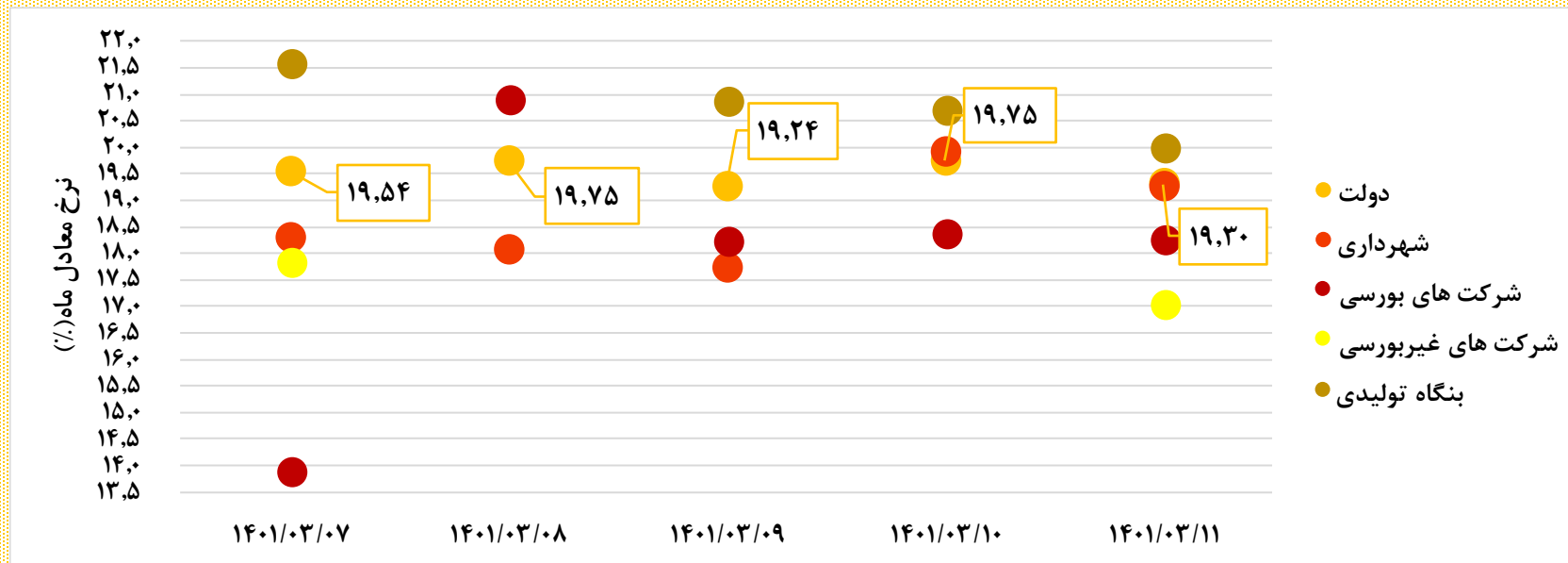
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل ماه اوراق معامله شده در نزدیک چهل روز مانده به سررسید به صورت بازدهی ساده محاسبه گردیده است.



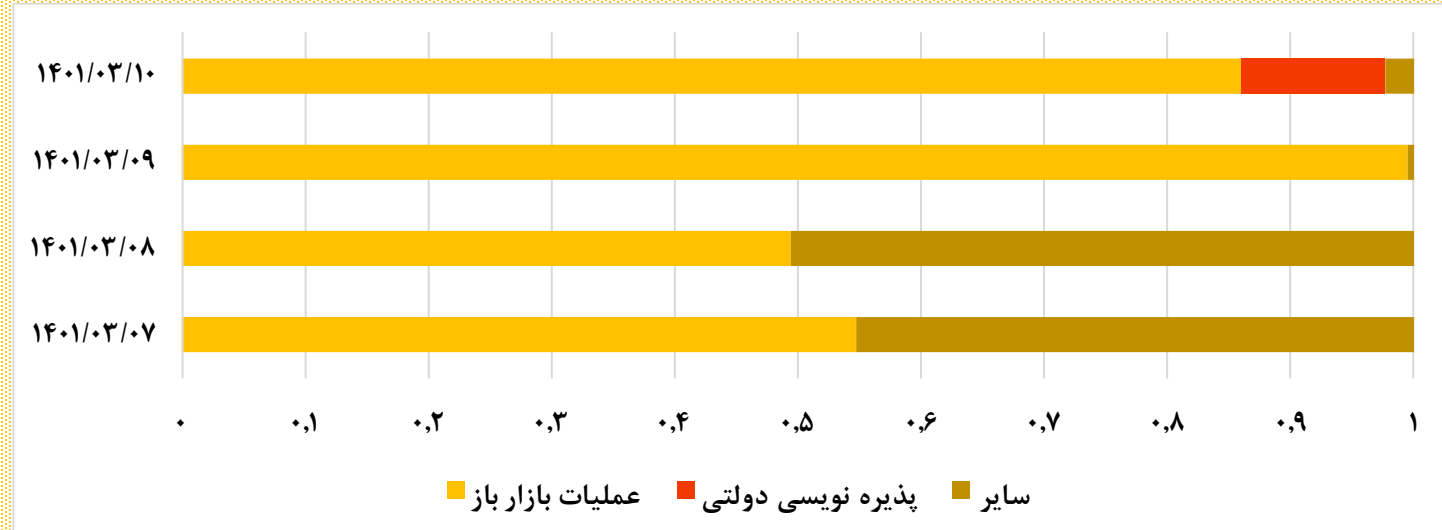


بازدهی معاملات طی هفته

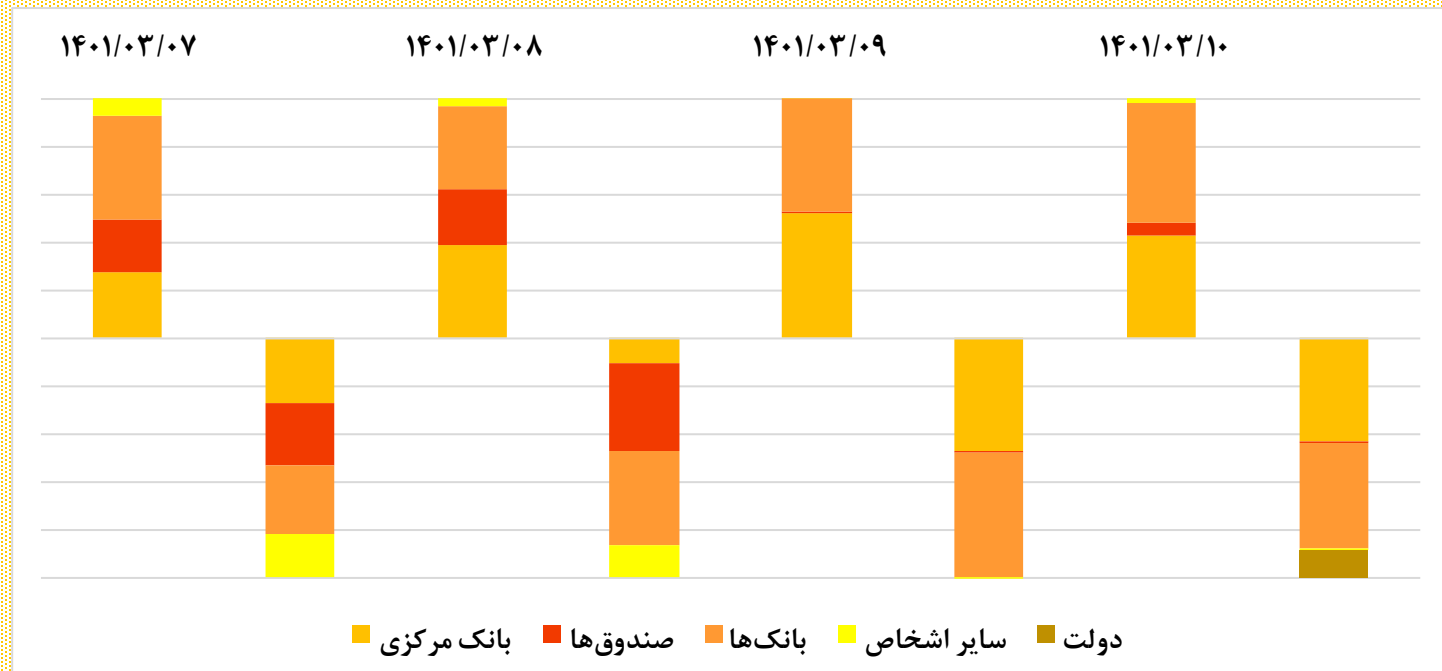
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل ماه اوراق معامله شده در نزدیک چهل روز مانده به سررسید به صورت بازدهی ساده محاسبه گردیده است.



به تفکیک نوع معامله



به تفکیک خریدار و فروشنده



آمار معاملات اوراق طی
هفته فرابورس
(چهار روز معاملاتی هفته
منتهی به سه شنبه)

خریدار

فروشنده



اوراق منتشر شده
و
سررسید شده هفته آتی

اطلاعات اوراق	
نوع اوراق	اسناد خزانه اسلامی
نام اوراق	اسناد خزانه - م ۱۴ بودجه ۹۸ - ۰۱۰۳۱۸
نماد معاملاتی	اخز۱۴۸۱
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۳۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۳۹۸/۰۳/۱۸
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۳/۱۸
نرخ سود اسمی	بدون پرداخت سود
مواعد پرداخت سود	-
ارکان اوراق	
بانی / ناشر	وزارت امور اقتصادی و دارایی
نهاد واسط (ناشر)	-
ضامن	خزانه داری کل کشور
بازارگردان	-
متعهد پذیره نویس	-

یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۱۲

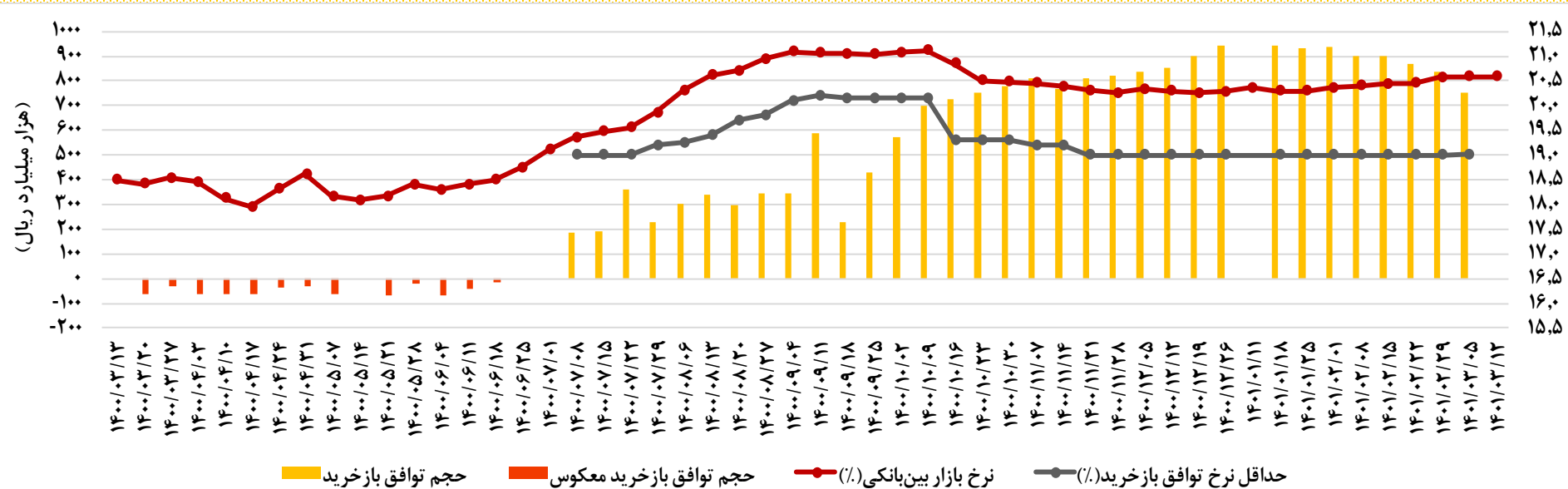
تاریخ	حجم توافق باز خرید (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید معکوس (ریپو معکوس) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید سررسید شده (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	خالص تزریق نقدینگی (هزار میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۲/۱۹	۸۷۱	-	۹۰۳.۴	-۳۲.۴
۱۴۰۱/۰۲/۲۶	۸۳۸.۵	-	۸۷۴.۳	-۳۵.۸
۱۴۰۱/۰۳/۰۲	۷۵۰	-	۸۴۱.۶	-۹۱.۶
جمع	۲۴۵۹.۵	-	۲۶۱۹.۳	-۱۵۹.۸

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی

۲۰.۵۸	۱۴۰۱/۰۳/۰۷
۲۰.۶۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۸
۲۰.۵۹	۱۴۰۱/۰۳/۰۹
۲۰.۶۰	۱۴۰۱/۰۳/۱۰
۲۰.۶۰	۱۴۰۱/۰۳/۱۱





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.atashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz