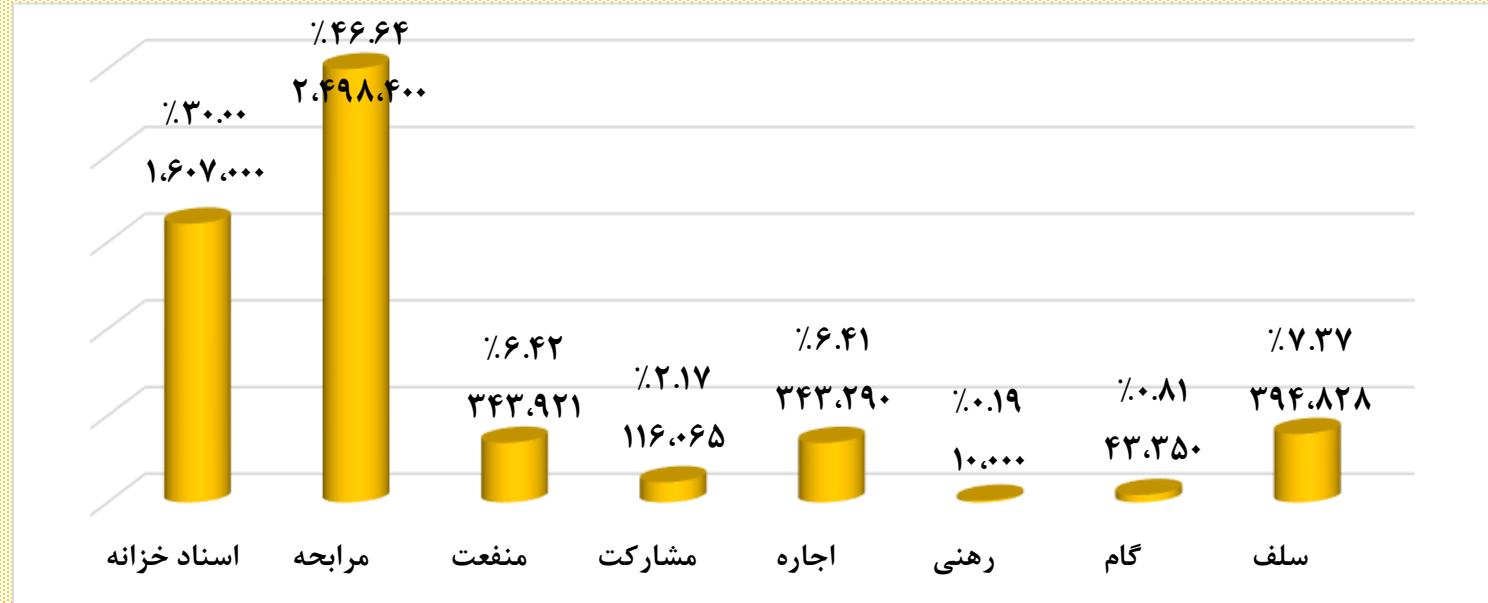


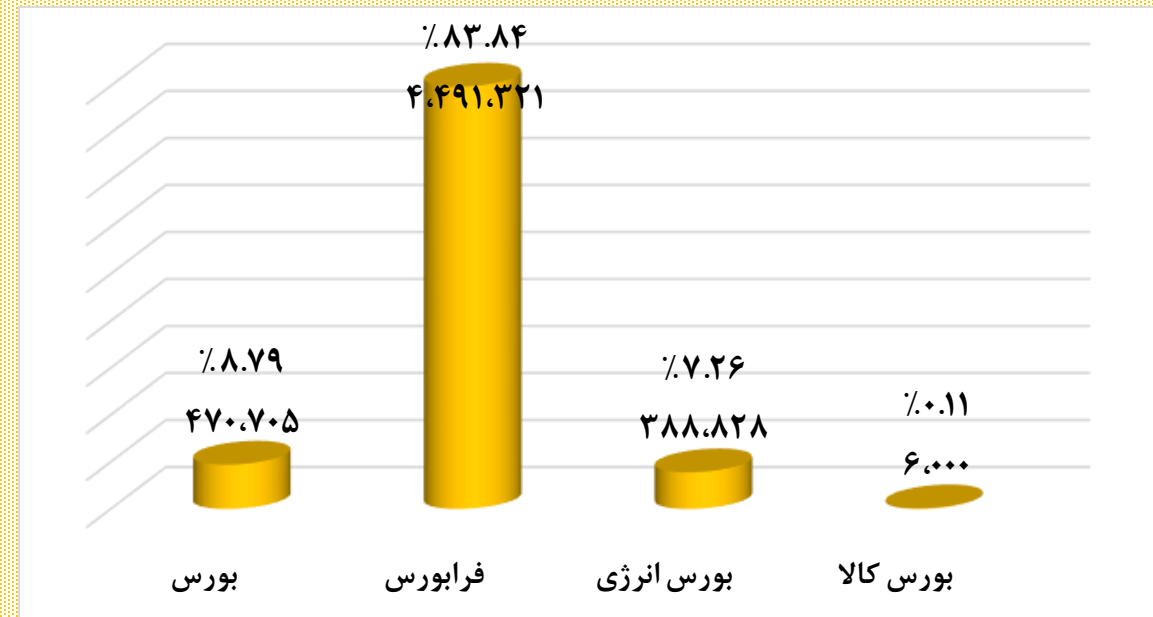
گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۲۶ خرداد ۱۴۰۱

براساس نوع اوراق



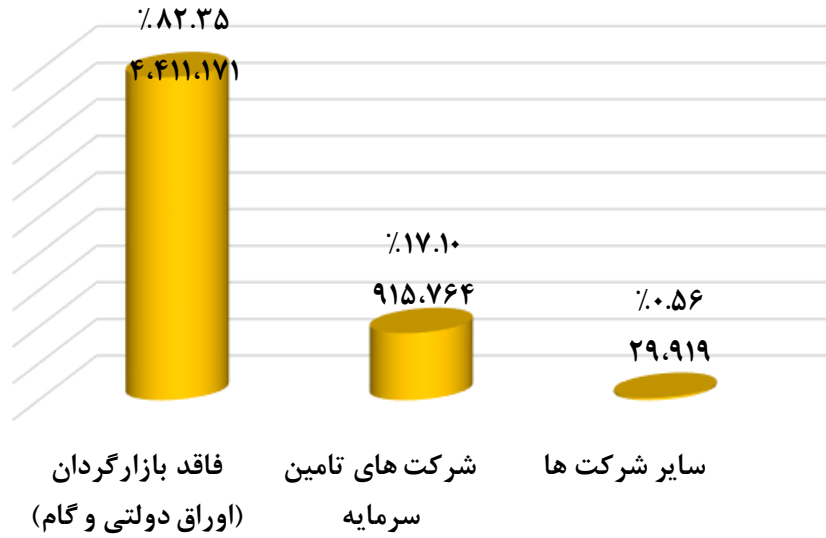
براساس نوع بازار



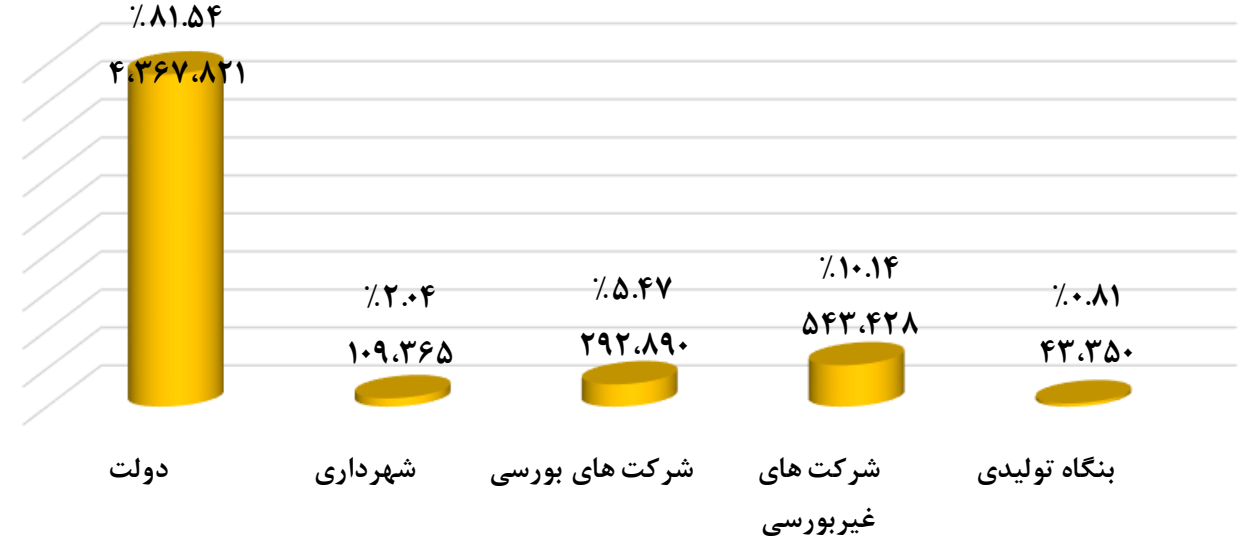
حجم اوراق موجود
بر مبنای قیمت سررسید
(ارقام به میلیارد ریال)



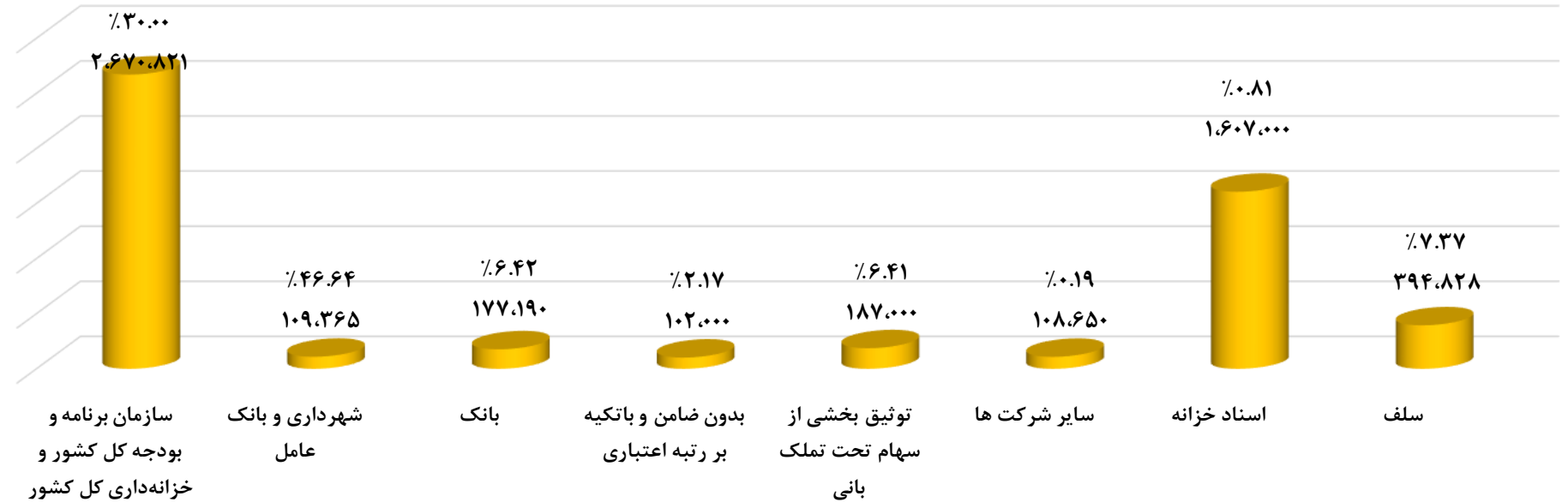
براساس نوع بازارگردان



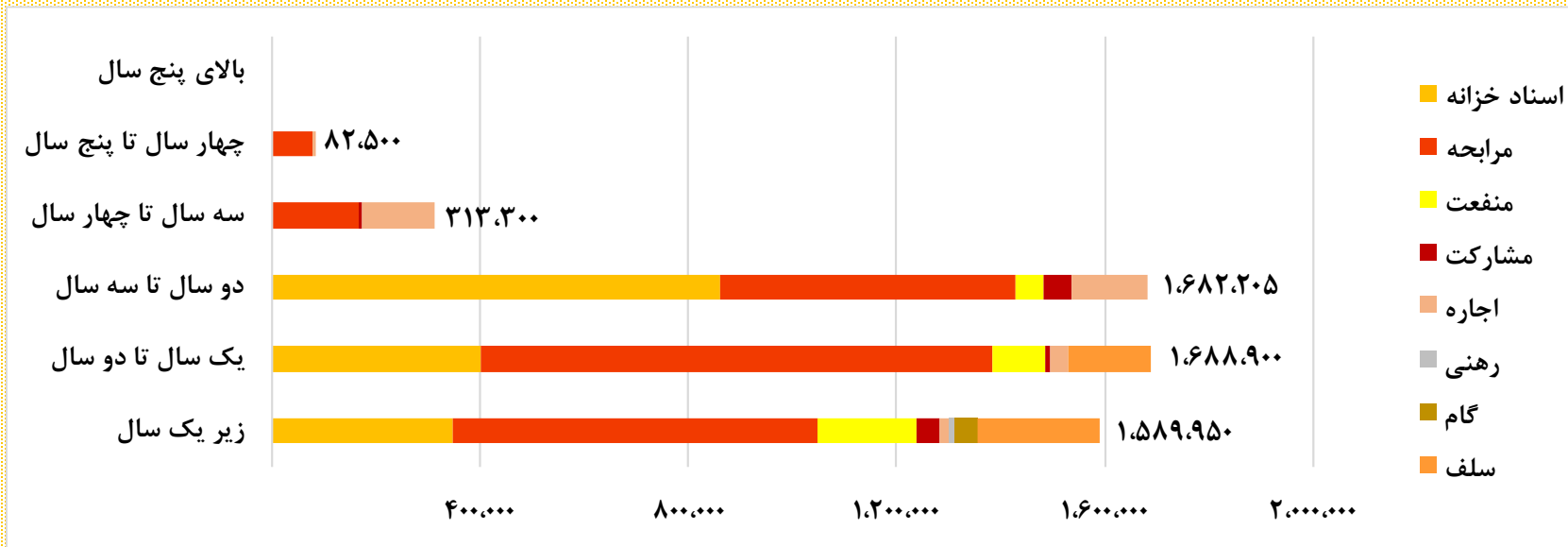
براساس نوع بانی



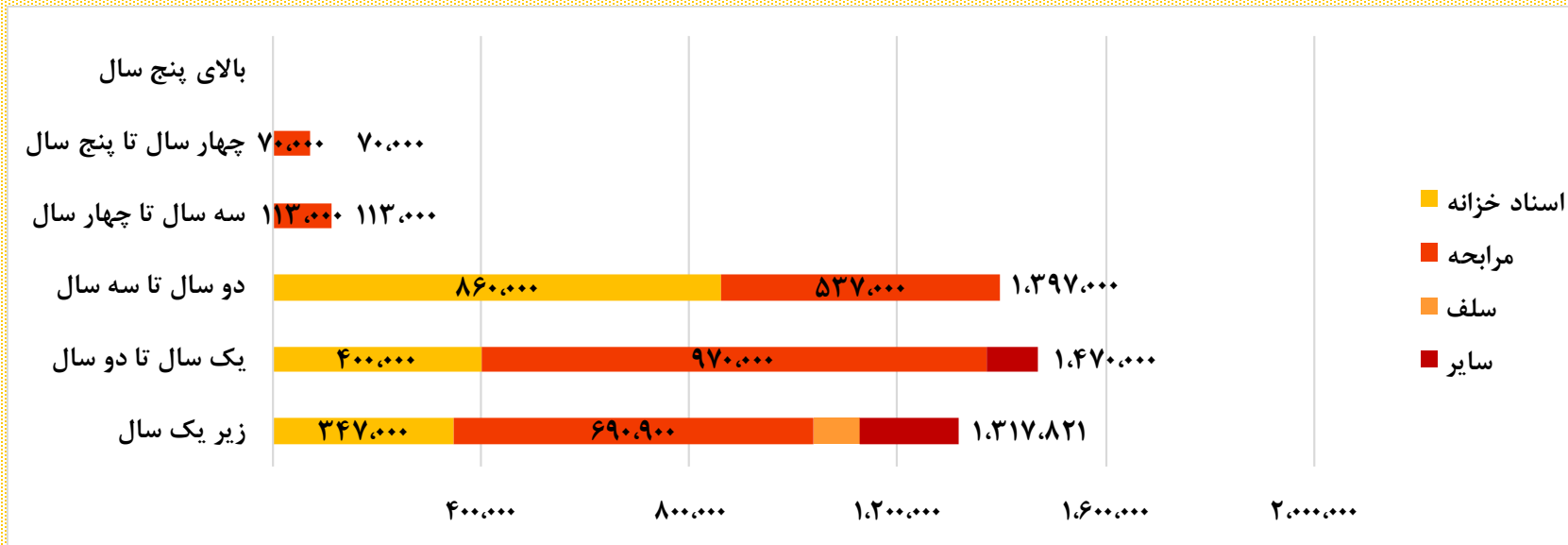
براساس نوع ضامن



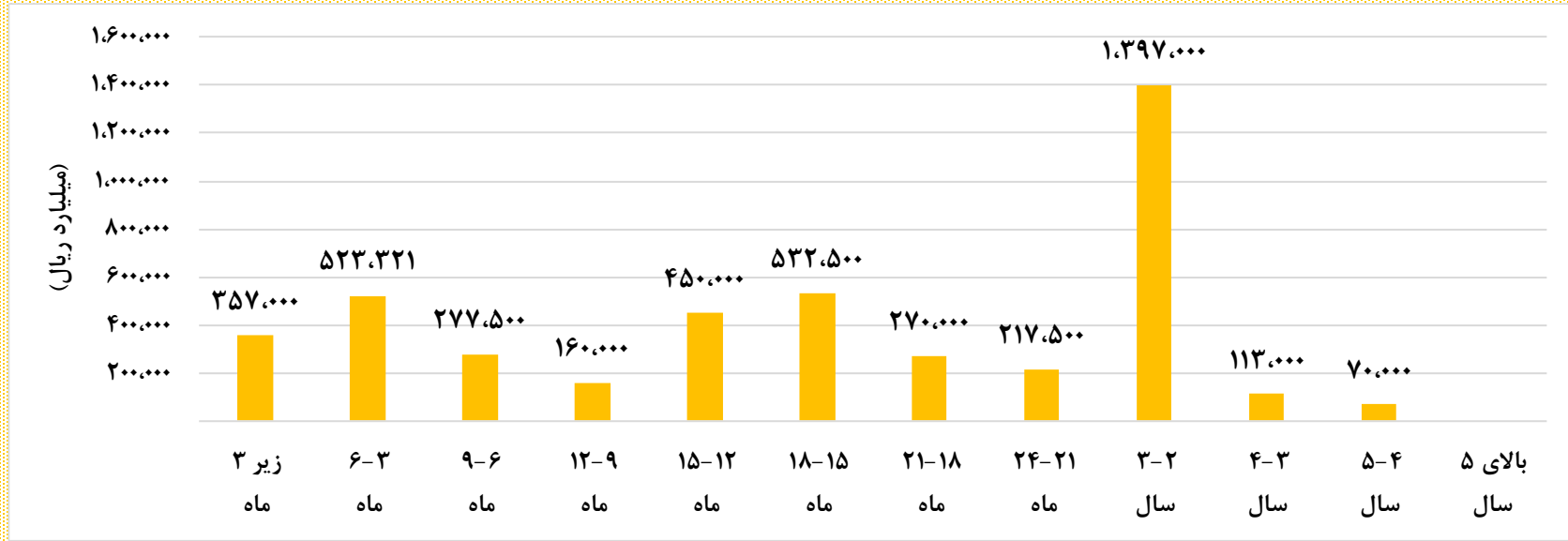
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

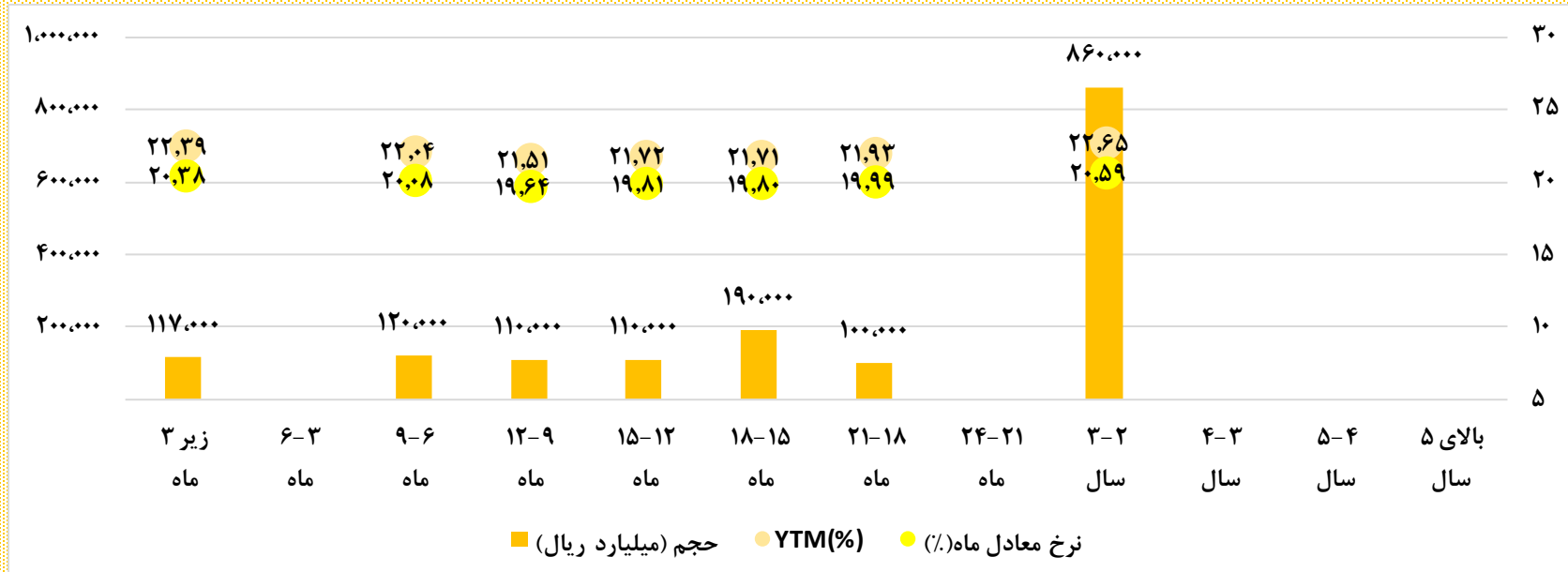


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* 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

%۲۱.۹۲

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

%۲۲.۵۴

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

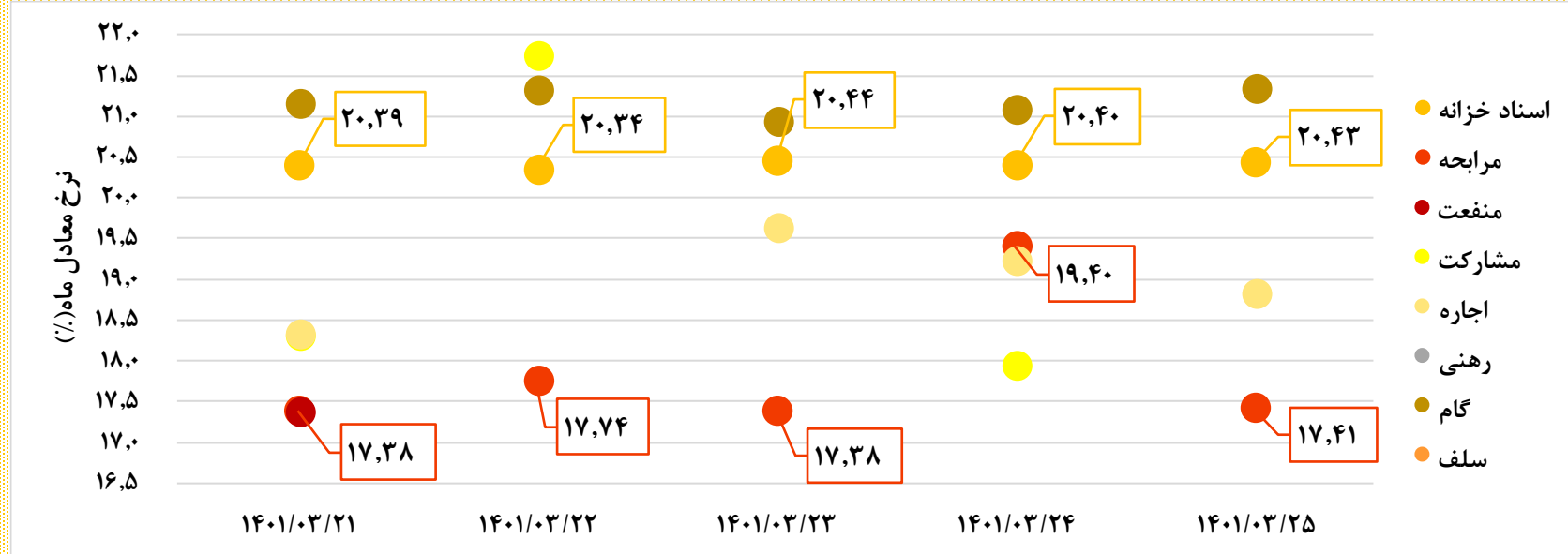
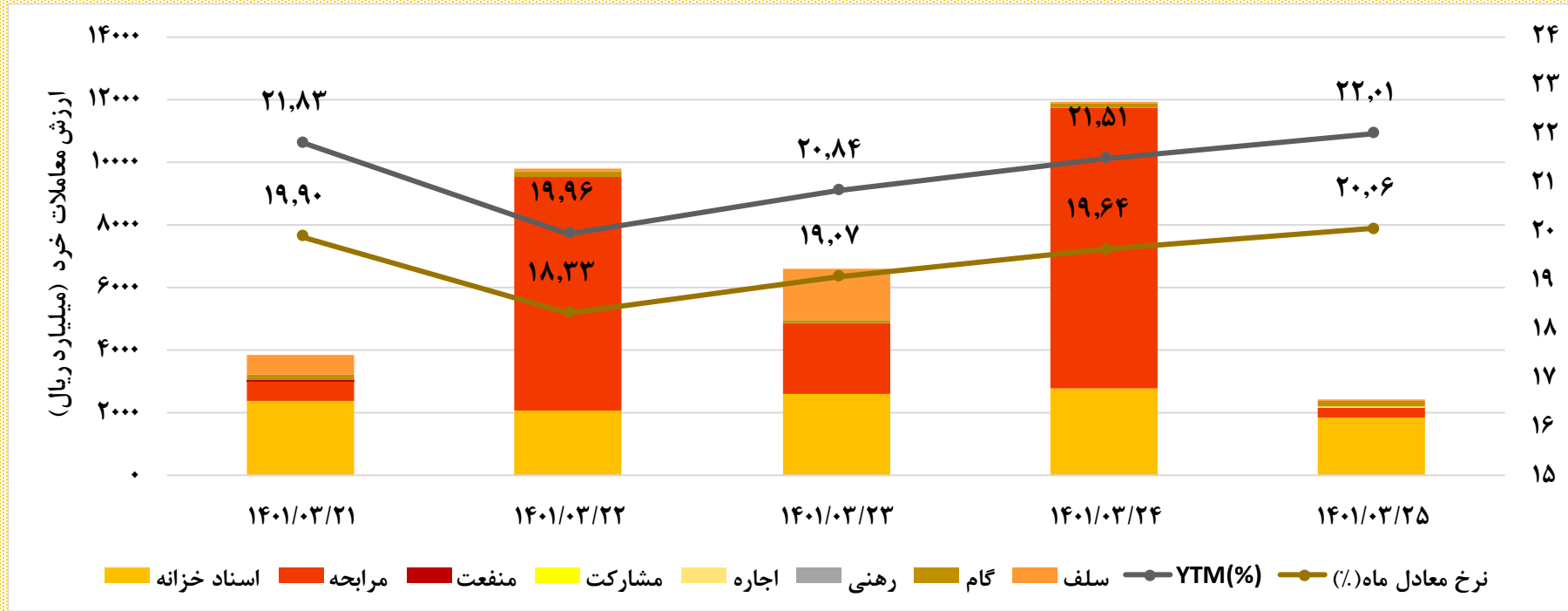
%۱۹.۹۸

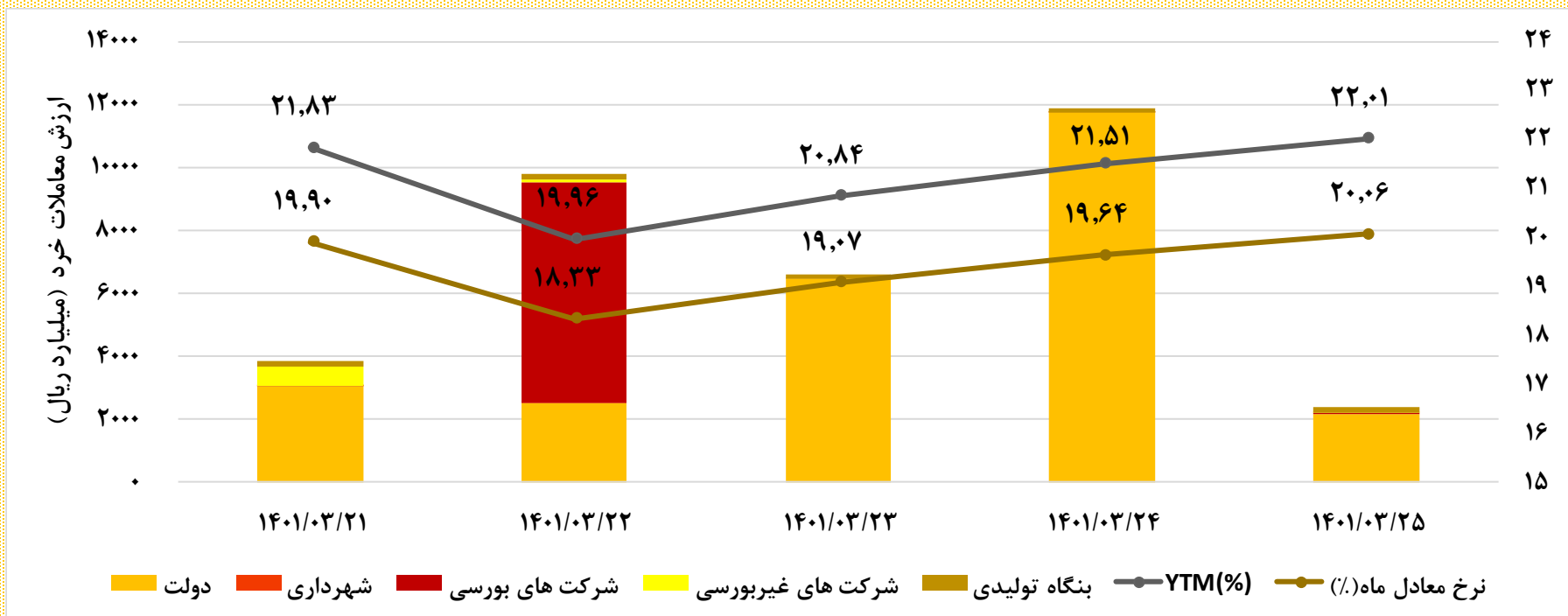
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

%۲۰.۵۰

بازدهی معاملات طی هفته

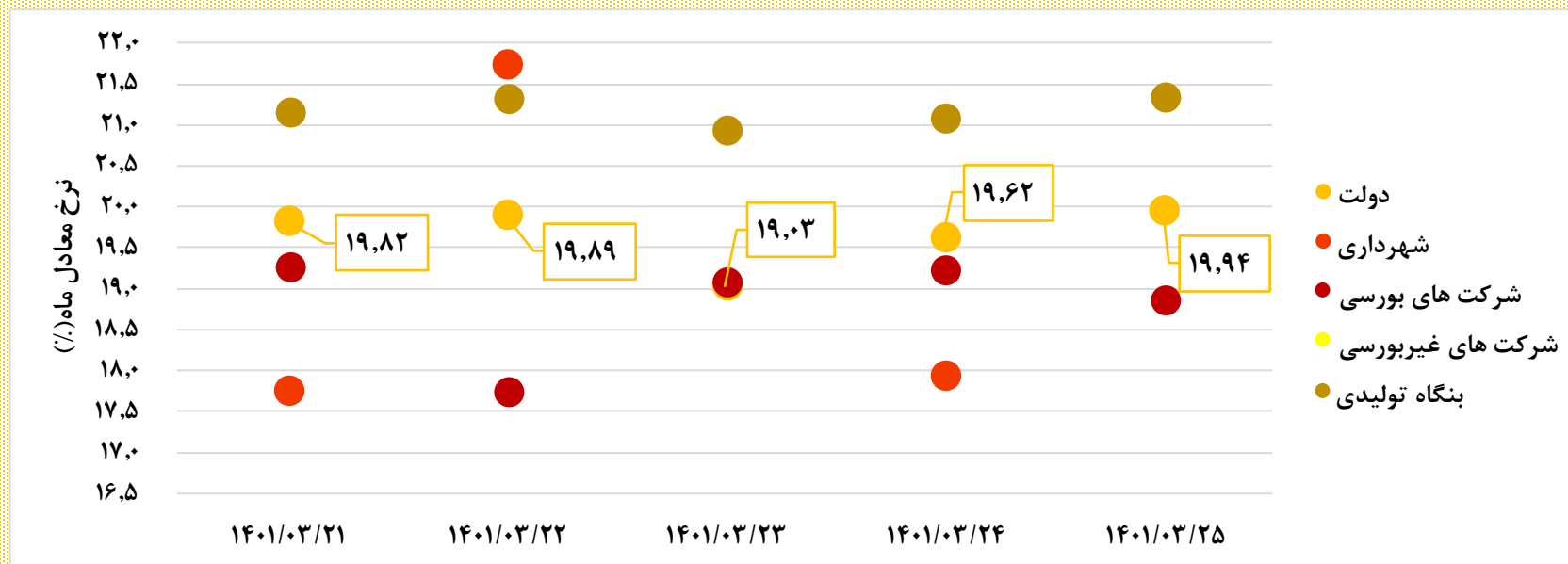
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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

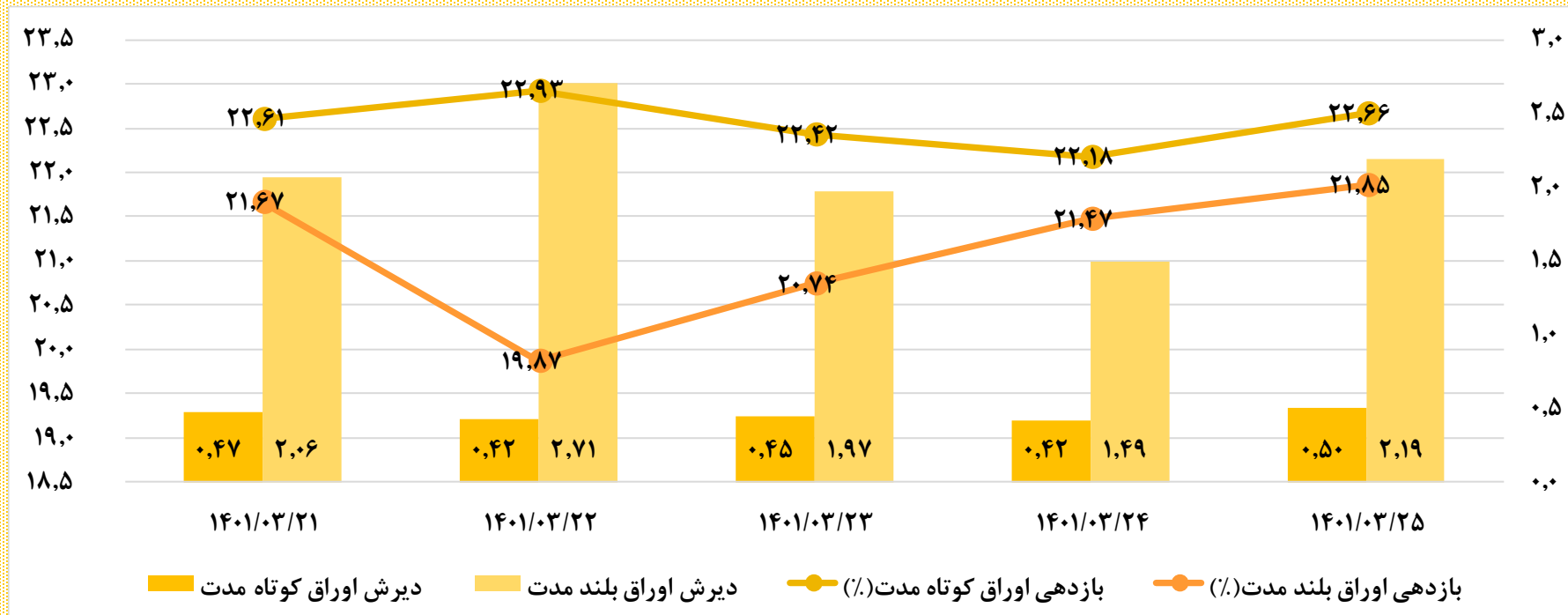




بازدهی معاملات طی هفته

* 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.





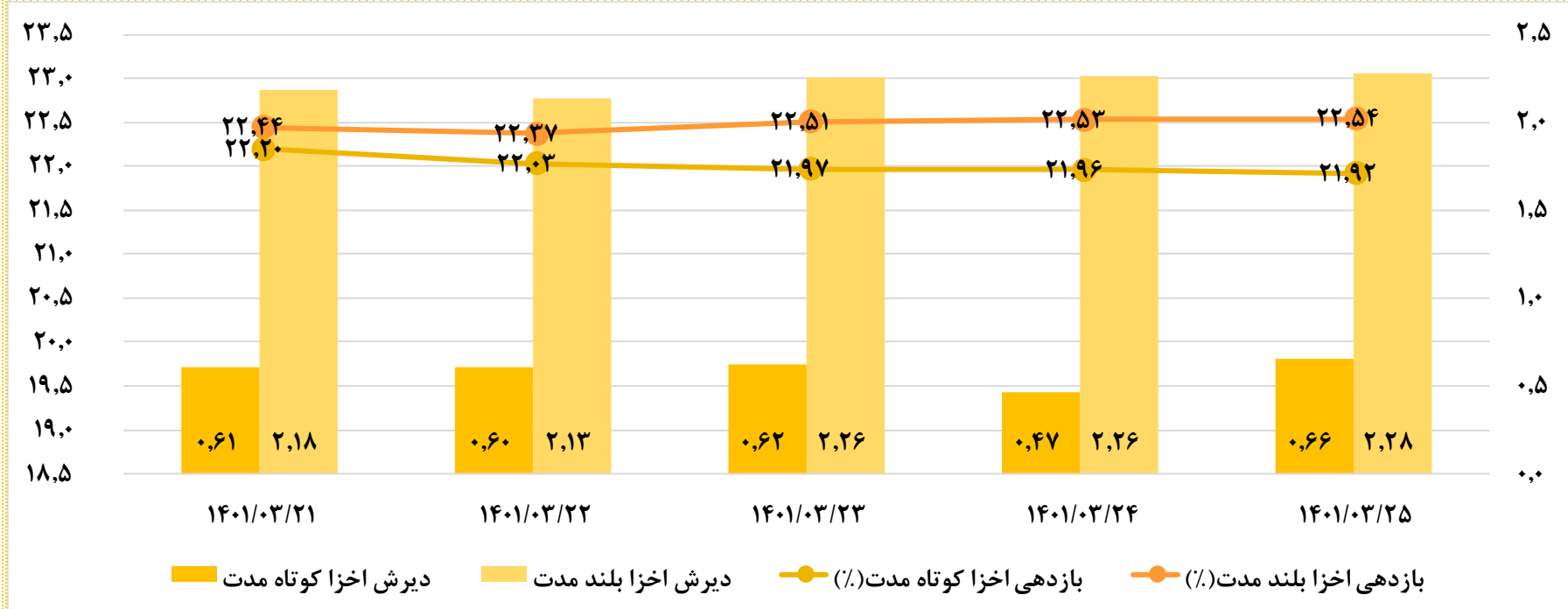
بازدهی معاملات طی هفته

*ریسک نرخ بهره اوراق بر مبنای دیرش موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد.

*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM 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.

تغییر نسبت به هفته قبل		
بازدهی اوراق کوتاه مدت	%۲۲.۵۱	%۰.۱۹
بازدهی اوراق بلند مدت	%۲۰.۸۸	-%۰.۵۹
بازدهی کل اوراق	%۲۱.۰۰	-%۰.۵۰
دیرش اوراق کوتاه مدت	۰.۴۵	-۰.۰۹
دیرش اوراق بلند مدت	۲.۰۵	۰.۰۷
دیرش کل اوراق	۱.۹۴	-۰.۰۱

بازدهی معاملات طی هفته

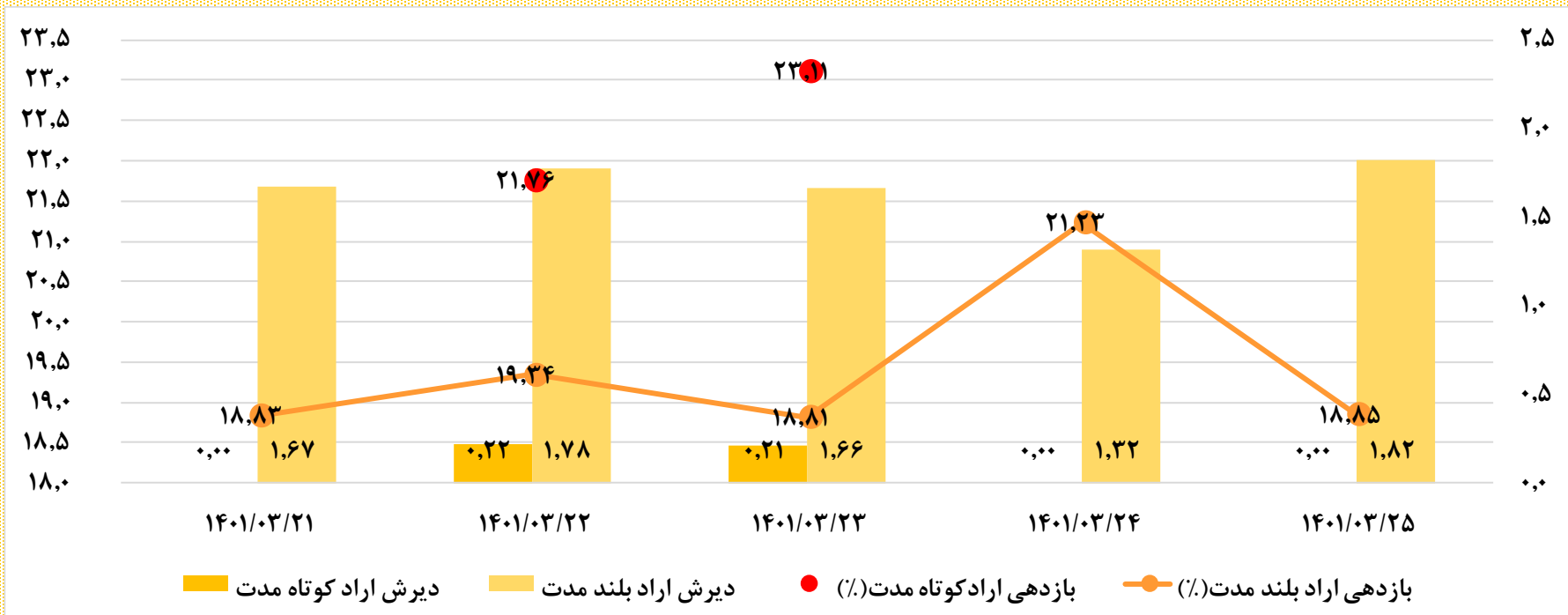


*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا 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.

تغییر نسبت به هفته قبل		
۰,۰۶٪	۲۲,۰۲٪	بازدهی اخزا کوتاه مدت
-۰,۱۱٪	۲۲,۴۸٪	بازدهی اخزا بلند مدت
-۰,۱۳٪	۲۲,۴۲٪	بازدهی کل اخزا
-۰,۰۸	۰,۵۷	دیرش اخزا کوتاه مدت
-۰,۱۰	۲,۲۲	دیرش اخزا بلند مدت
-۰,۲۰	۲,۰۲	دیرش کل اخزا

بازدهی معاملات طی هفته

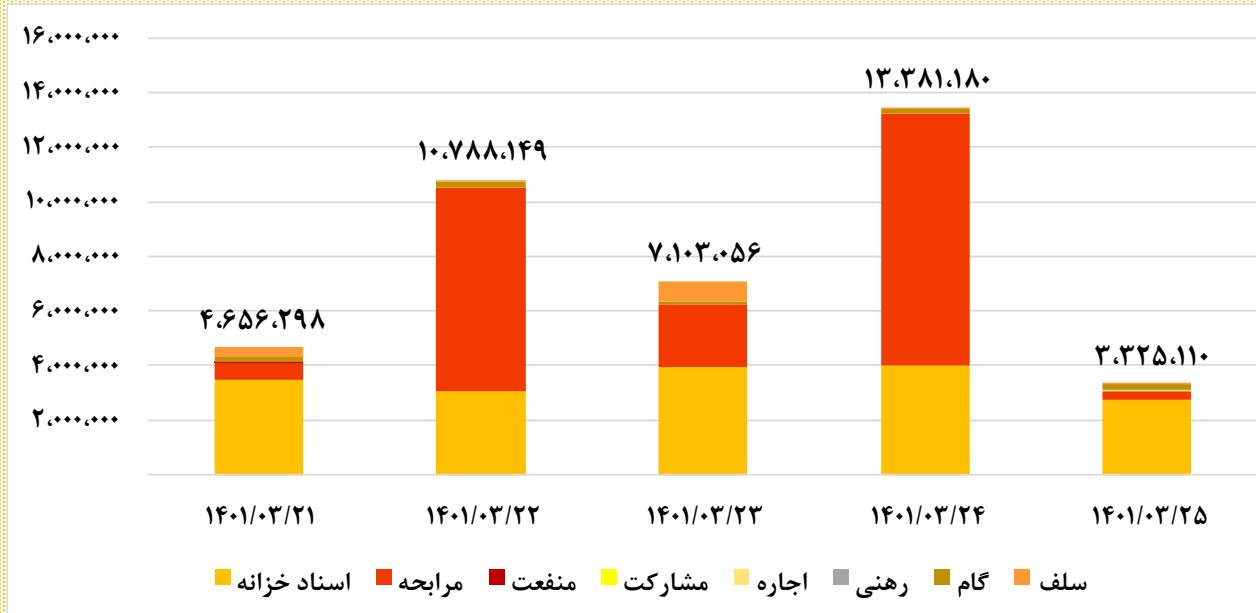


*ریسک نرخ بهره اوراق بر مبنای دیرش موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد.

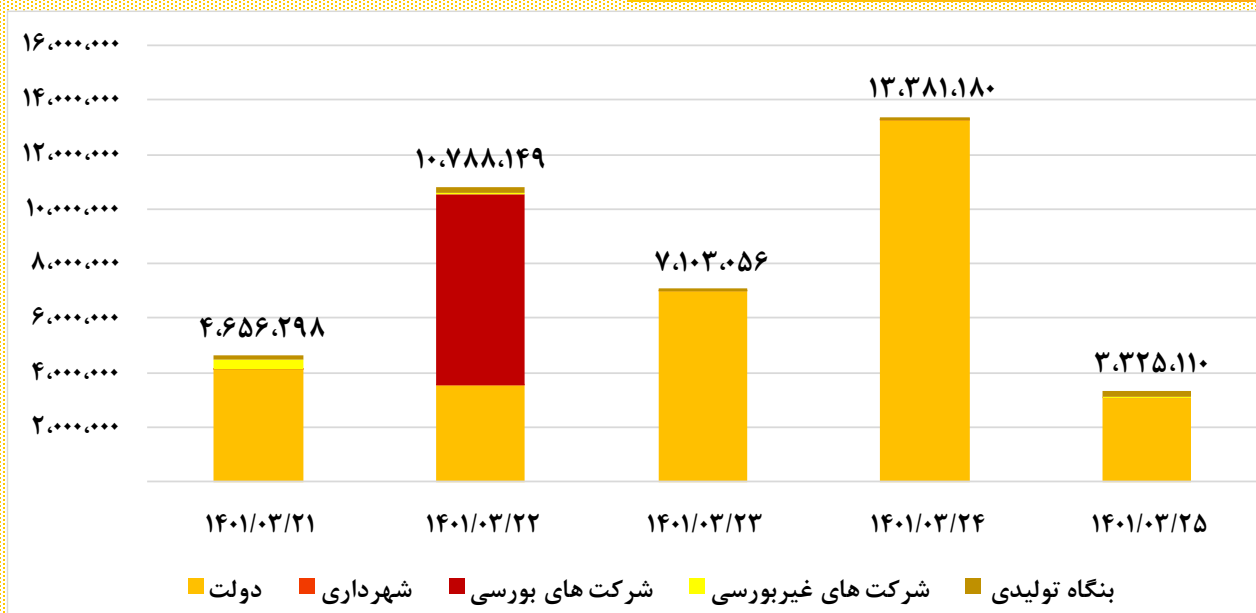
*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
٪۴.۰۵	٪۲۳.۰۰	بازدهی اوراق کوتاه مدت
-٪۰.۶۹	٪۲۰.۵۹	بازدهی اوراق بلند مدت
-٪۰.۶۹	٪۲۰.۵۹	بازدهی کل اوراق
-۰.۱۴	۰.۲۱	دیرش اوراق کوتاه مدت
-۰.۳۲	۱.۴۲	دیرش اوراق بلند مدت
-۰.۳۲	۱.۴۲	دیرش کل اوراق

براساس نوع اوراق



براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته
(نماد خرد)



تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۳/۲۱	۱۲,۰۷۶	۸
۱۴۰۱/۰۳/۲۲	۱,۴۱۰,۳۰۷	۸۴۰
۱۴۰۱/۰۳/۲۳	۲۸۴,۶۵۵,۰۳۵	۲۰۱,۵۹۹
۱۴۰۱/۰۳/۲۴	۱۱,۵۵۹,۰۵۹	۸,۲۳۸
۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۲۱,۱۱۰,۹۴۸	۱۴,۹۱۸

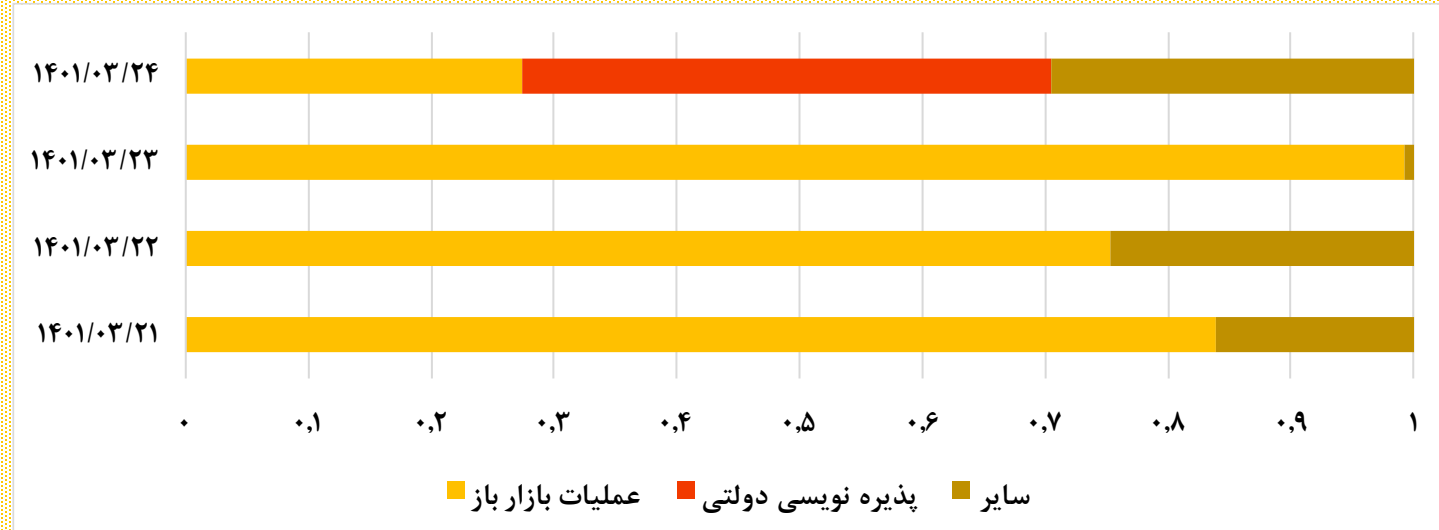
مرابحه عام دولت

تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۳/۲۱	۱۶,۵۶۱,۳۱۰	۱۶,۰۰۹
۱۴۰۱/۰۳/۲۲	۳۲,۹۲۴,۲۴۱	۳۲,۰۳۶
۱۴۰۱/۰۳/۲۳	۱,۱۴۲,۱۵۴,۵۲۹	۱,۰۹۰,۴۷۶
۱۴۰۱/۰۳/۲۴	۲۸,۱۸۹,۱۰۰	۲۷,۳۲۶
۱۴۰۱/۰۳/۲۵	۵,۳۱۶,۳۰۰	۴,۹۳۶

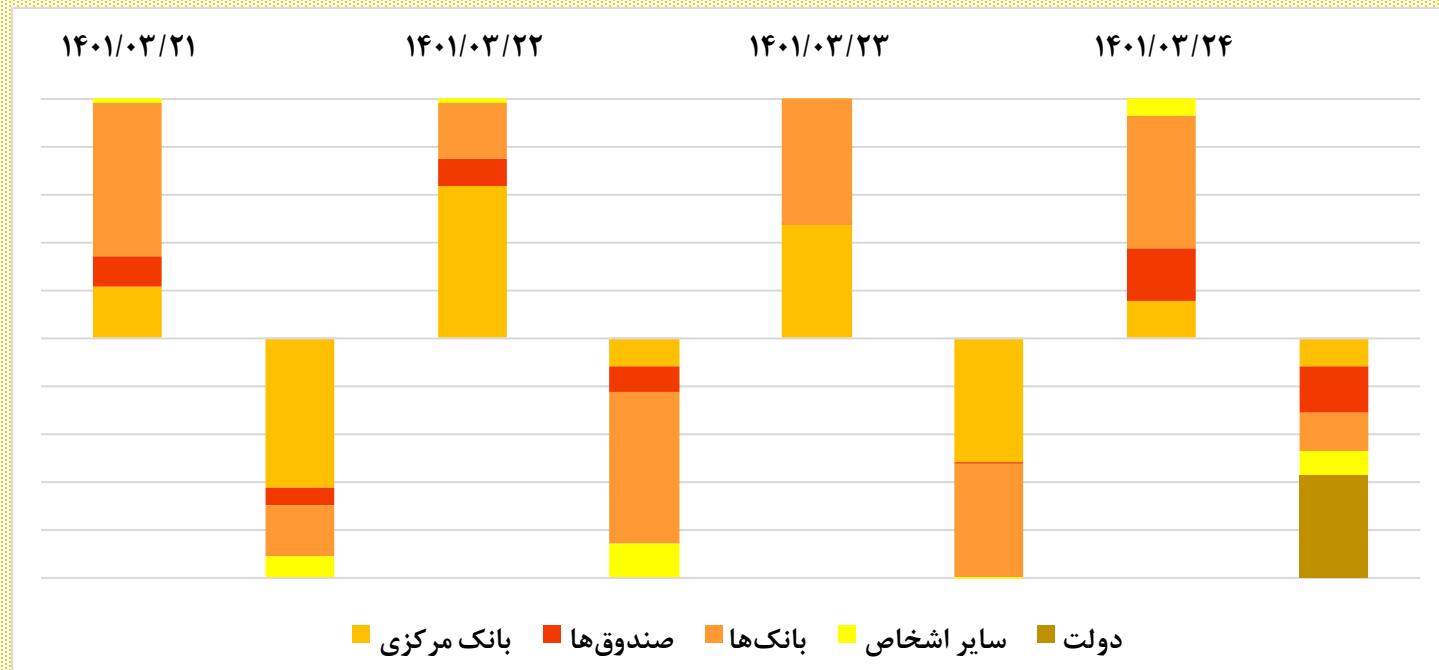
معاملات طی هفته
(نماد عمده)



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	مراجعه
نام اوراق	مراجعه عام دولت ۳-ش.خ ۰۱۰۴
نماد معاملاتی	۳۶اد۳
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۶۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۳۹۹/۰۴/۰۳
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۴/۰۳
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۵ درصد
مواعد پرداخت سود	هرشش ماه یکبار
ارکان اوراق	
بانی / ناشر	وزارت امور اقتصادی و دارایی
نهاد واسط (ناشر)	-
ضامن	سازمان برنامه و بودجه کل کشور و خزانه داری کل کشور
بازارگردان	-
متعهد پذیره نویس	-

یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۲۶

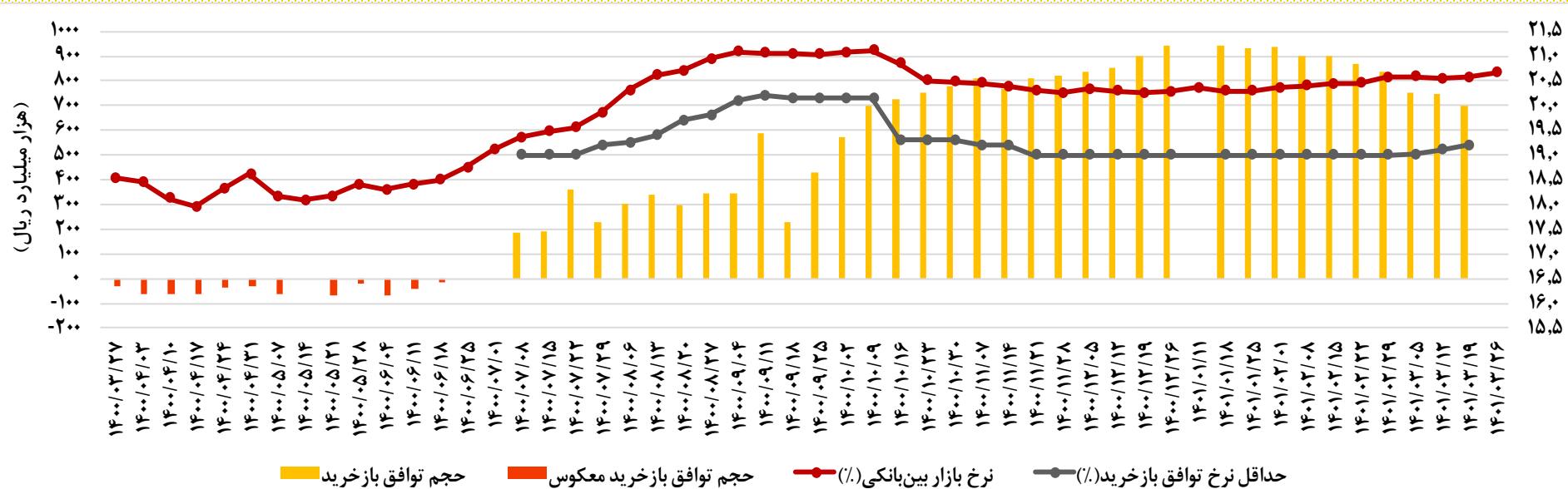
تاریخ	حجم توافق باز خرید (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید معکوس (ریپو معکوس) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید سررسید شده (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	خالص تزریق نقدینگی (هزار میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۳/۰۲	۷۵۰	-	۸۴۱.۶	-۹۱.۶
۱۴۰۱/۰۳/۰۹	۷۴۸	-	۷۵۲.۷	-۴.۷
۱۴۰۱/۰۳/۱۶	۶۹۹.۹	-	۷۵۰.۸	-۵۰.۹
جمع	۲۱۹۷.۹	-	۲۳۴۵.۱	-۱۴۷.۲

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی

۲۰.۶۵	۱۴۰۱/۰۳/۲۱
۲۰.۵۹	۱۴۰۱/۰۳/۲۲
۲۰.۷۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۳
۲۰.۷۱	۱۴۰۱/۰۳/۲۴
۲۰.۷۱	۱۴۰۱/۰۳/۲۵





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.ataashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz