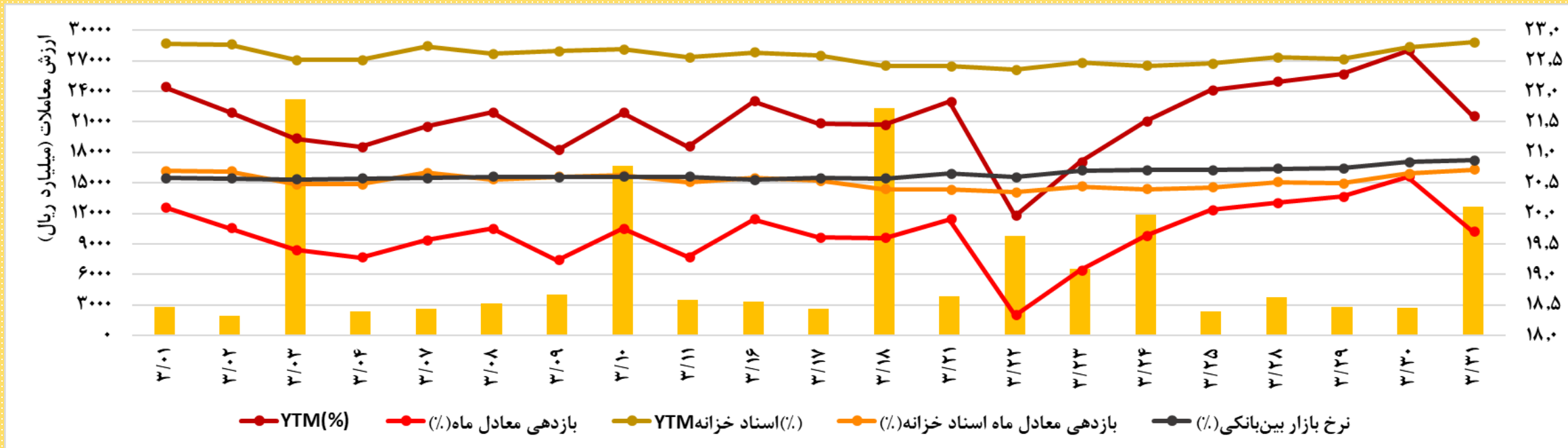


گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۲ تیر ۱۴۰۱
به انضمام نگاهی کلی بر خرداد ماه



* بازدهی 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.

میانگین YTM اسناد خزانه

٪۲۲.۵۷

اردیبهشت ماه: ٪۲۲.۷۸

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه

٪۲۰.۵۳

اردیبهشت ماه: ٪۲۰.۷۰

میانگین YTM

٪۲۱.۴۰

اردیبهشت ماه: ٪۲۱.۰۷

میانگین بازدهی معادل ماه

٪۱۹.۵۴

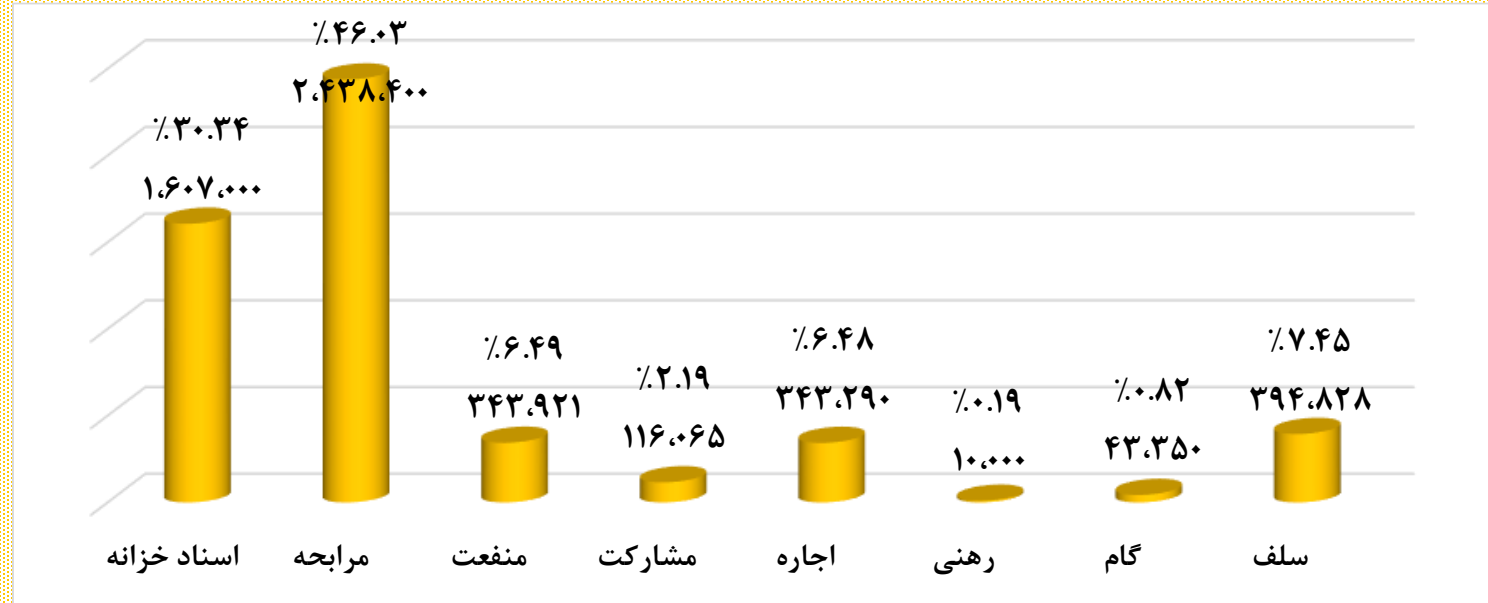
اردیبهشت ماه: ٪۱۹.۲۶

میانگین نرخ بازار بین بانکی

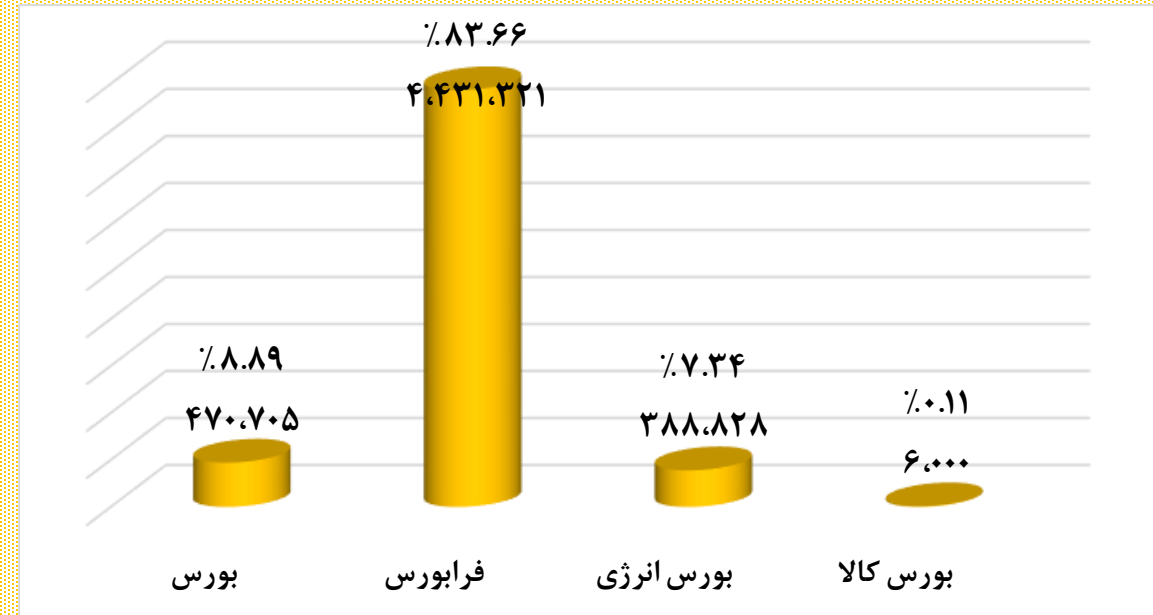
٪۲۰.۶۴

اردیبهشت ماه: ٪۲۰.۴۷

براساس نوع اوراق



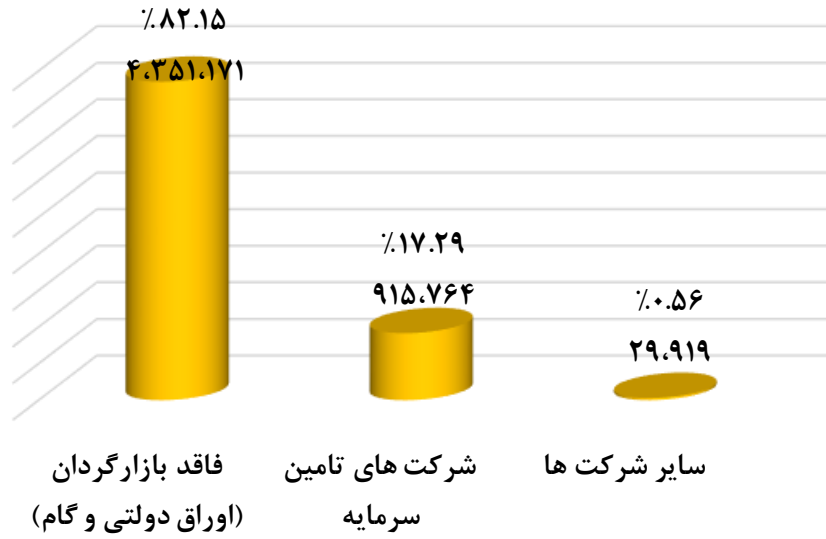
براساس نوع بازار



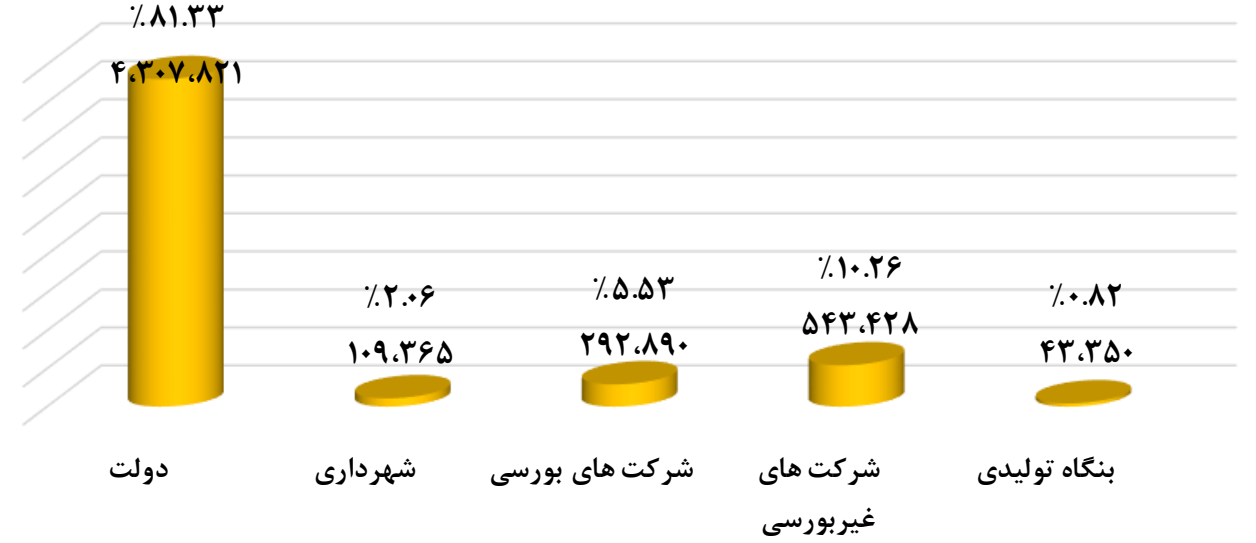
حجم اوراق موجود
بر مبنای قیمت سررسید
(ارقام به میلیارد ریال)



براساس نوع بازارگردان



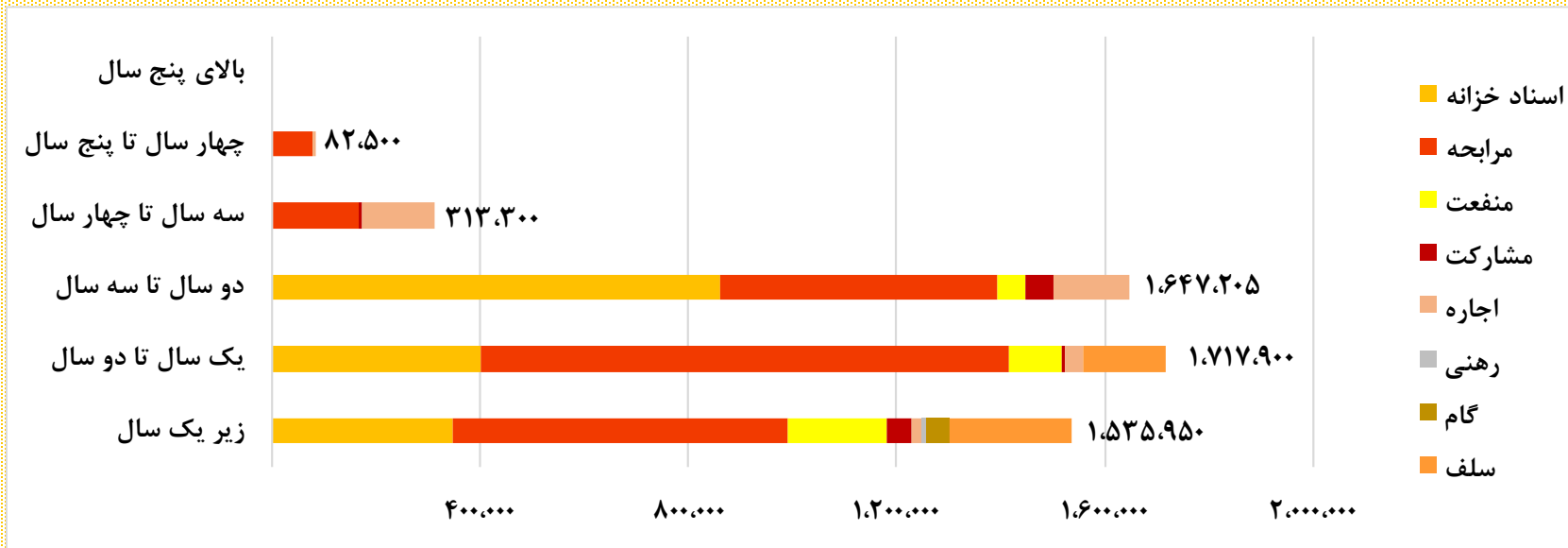
براساس نوع بانی



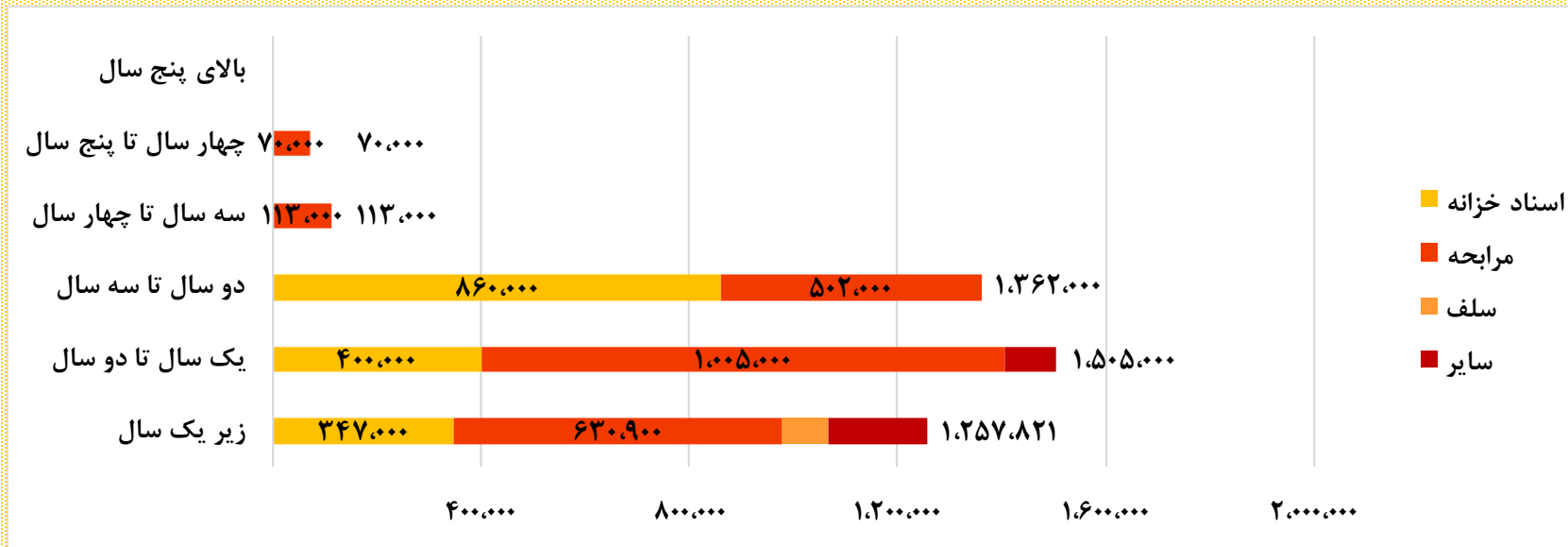
براساس نوع ضامن



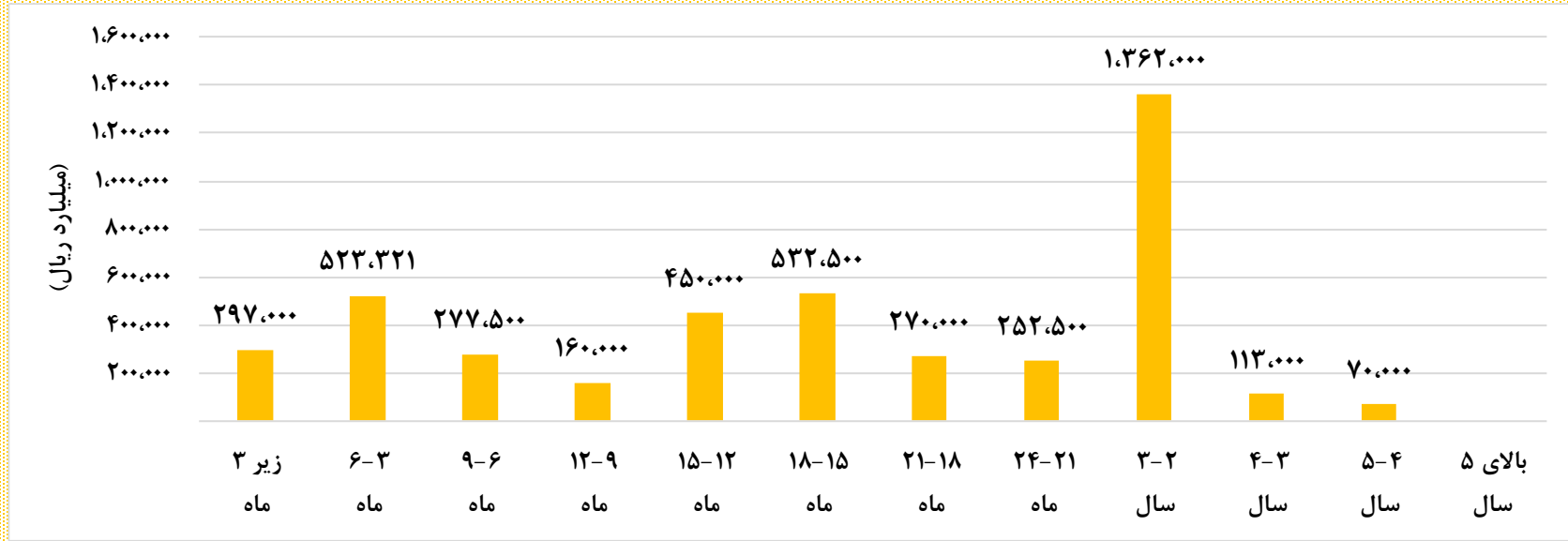
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

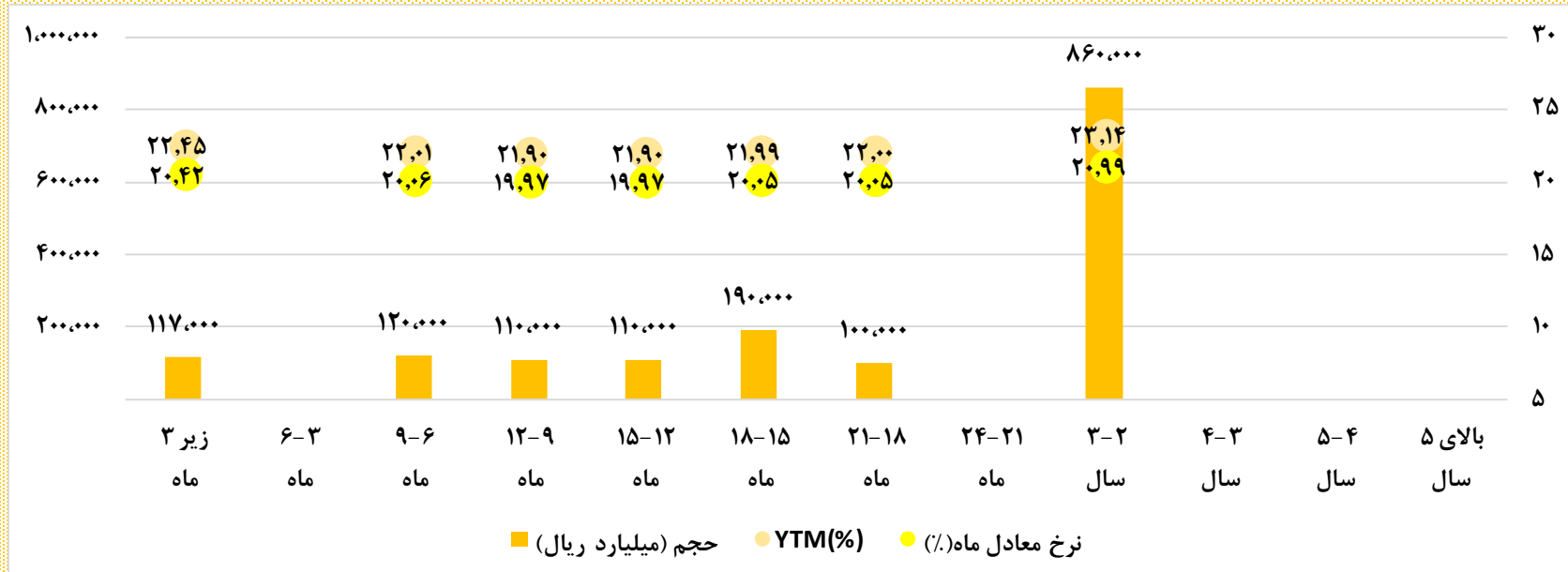


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* 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

%۲۱.۹۹

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

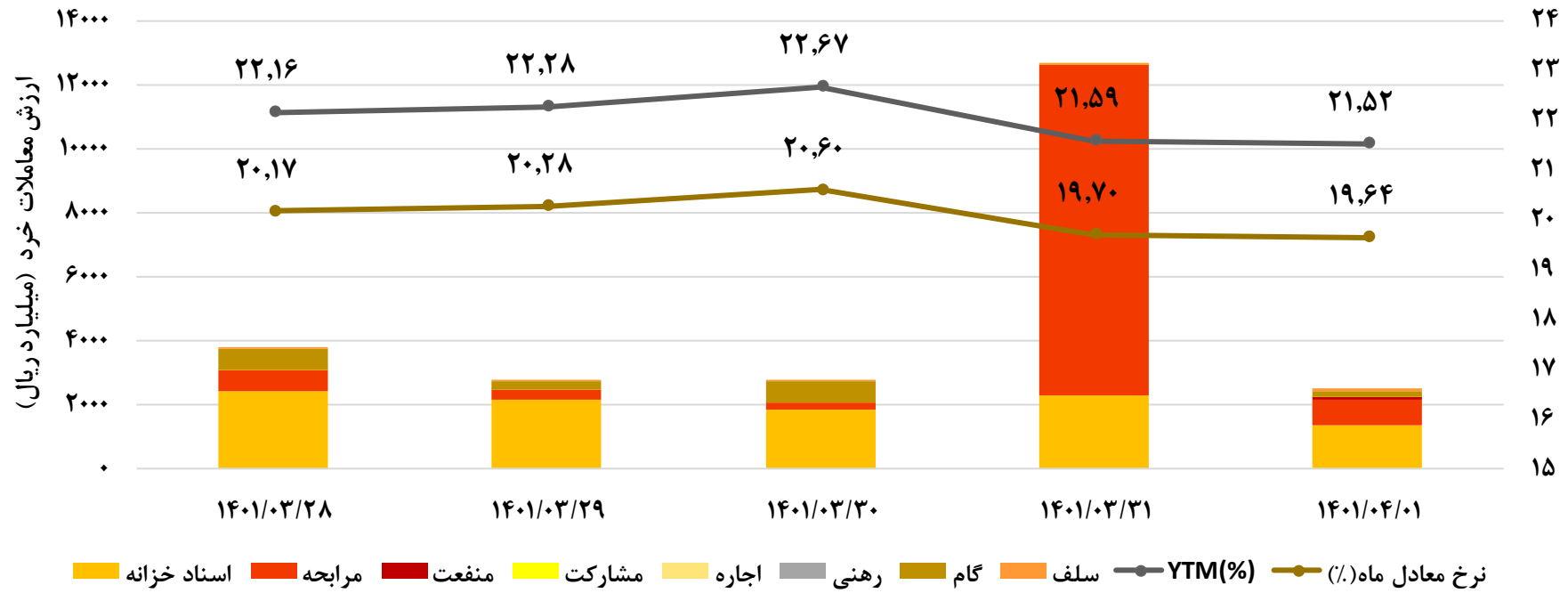
%۲۲.۹۷

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

%۲۰.۰۴

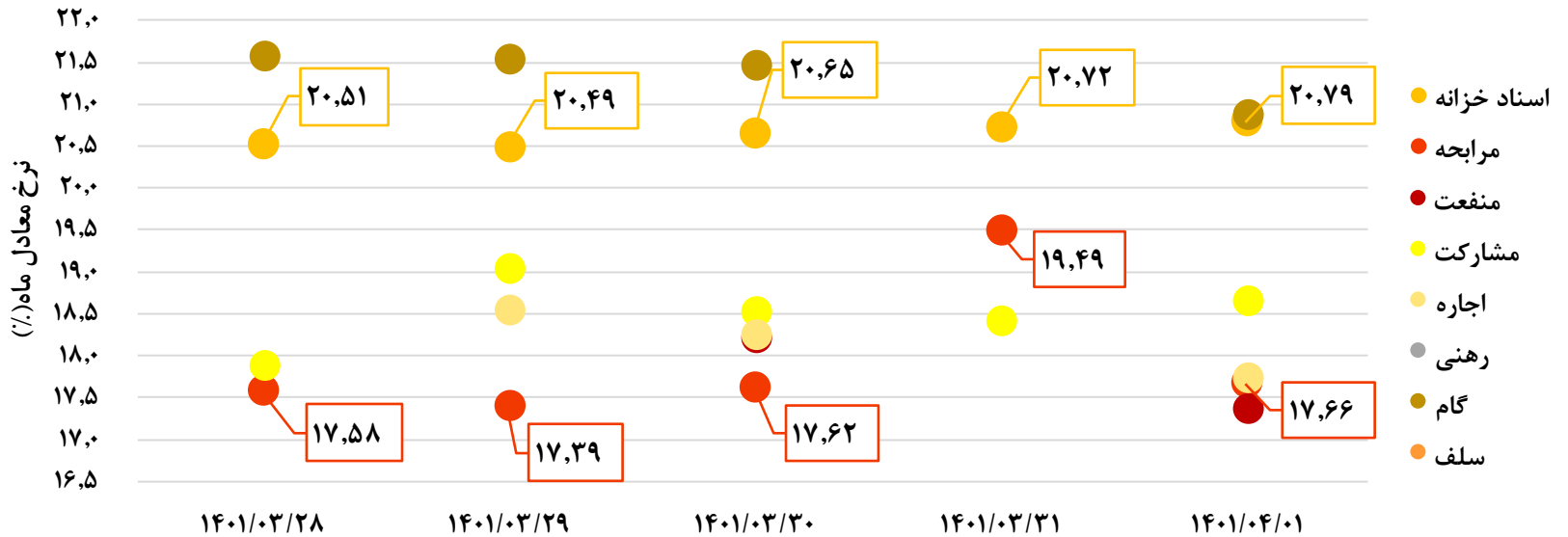
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

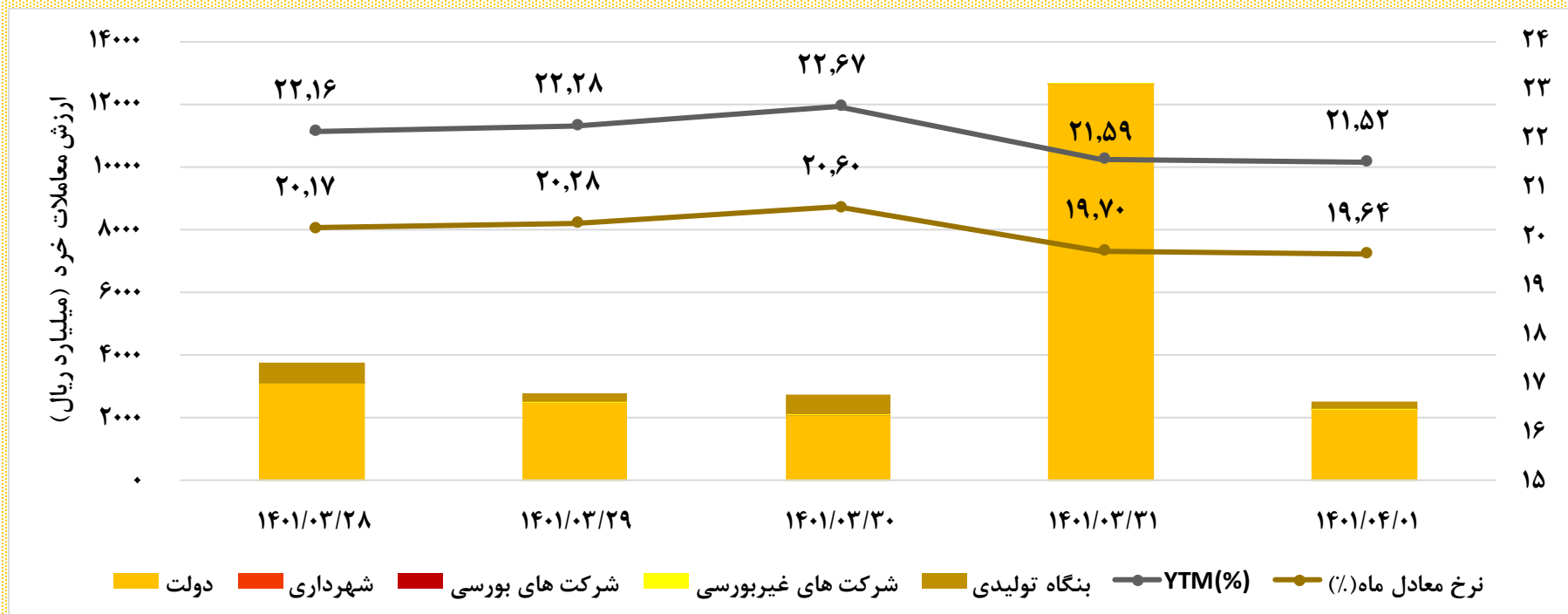
%۲۰.۸۵



بازدهی معاملات طی هفته

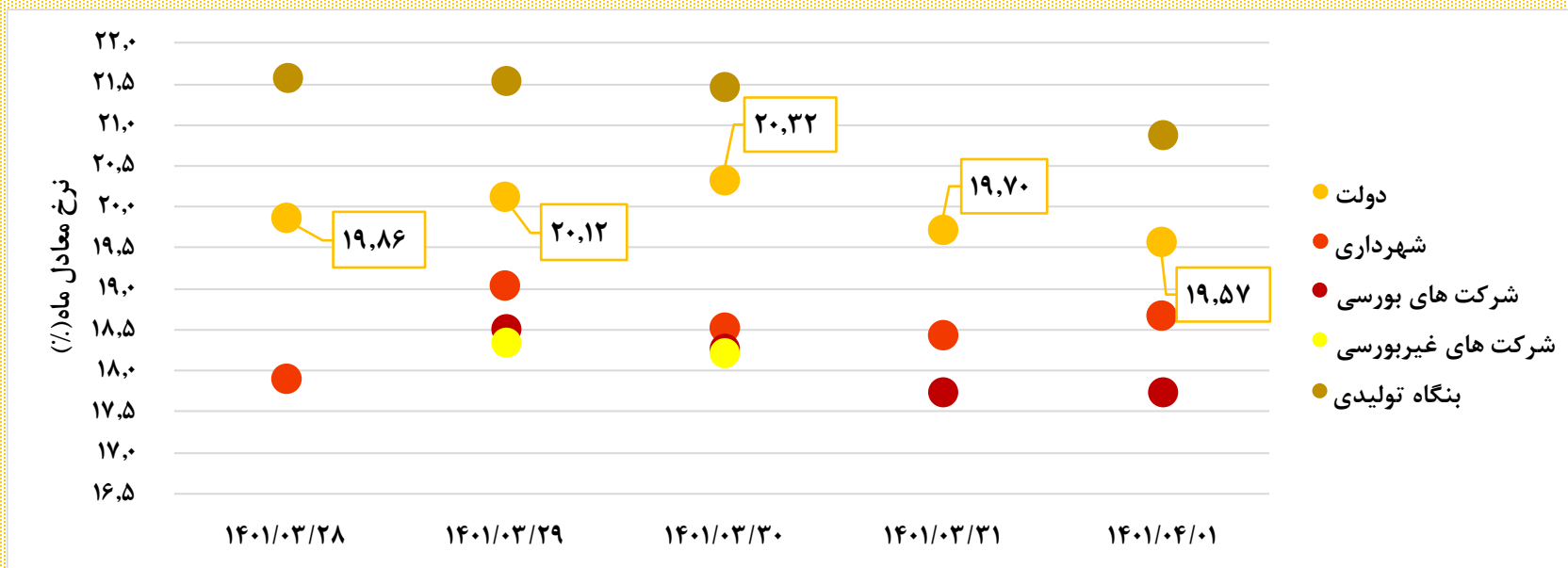
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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

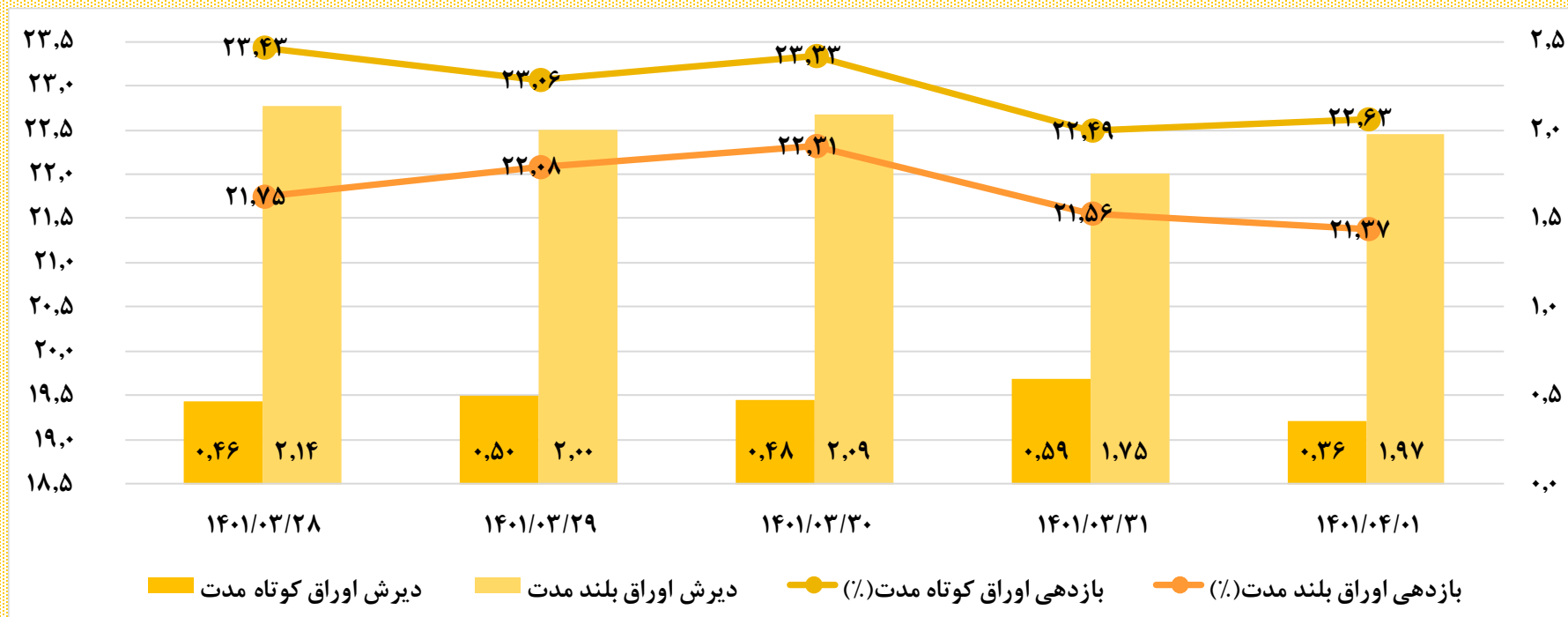




بازدهی معاملات طی هفته

* 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.





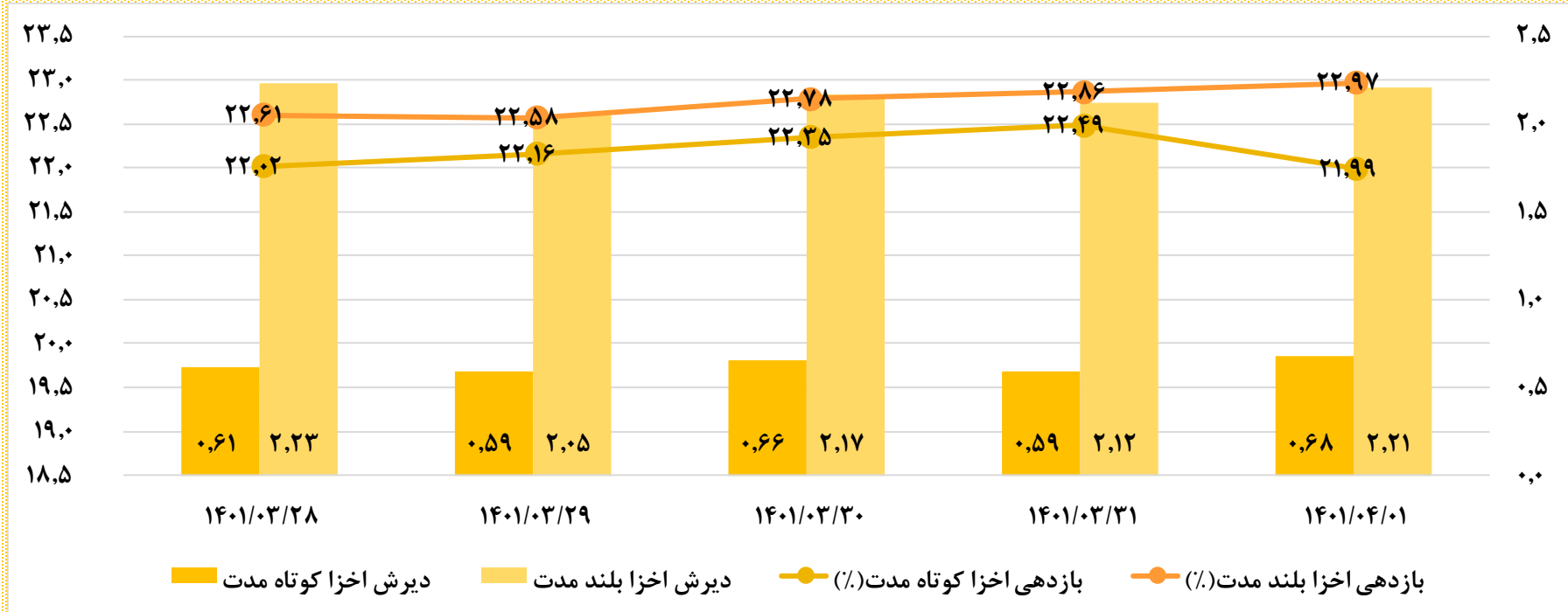
بازدهی معاملات طی هفته

*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	%۰.۶۳	%۲۳.۱۴
بازدهی اوراق بلند مدت	%۰.۷۹	%۲۱.۶۸
بازدهی کل اوراق	%۰.۸۶	%۲۱.۸۶
دیرش اوراق کوتاه مدت	۰.۰۳	۰.۴۸
دیرش اوراق بلند مدت	-۰.۱۷	۱.۸۸
دیرش کل اوراق	-۰.۲۳	۱.۷۱

بازدهی معاملات طی هفته

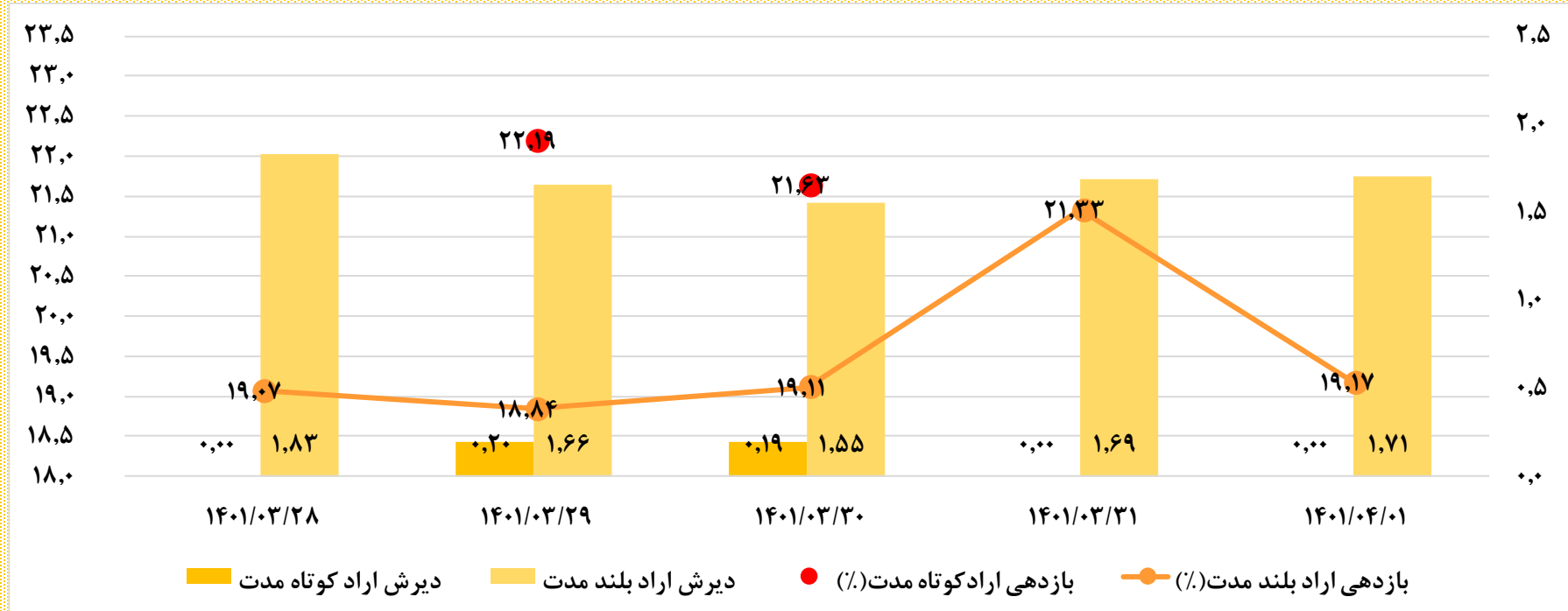


*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

*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		
۰.۲۴%	۲۲.۲۶%	بازدهی اخزا کوتاه مدت
۰.۲۶%	۲۲.۷۴%	بازدهی اخزا بلند مدت
۰.۲۶%	۲۲.۶۸%	بازدهی کل اخزا
۰.۰۵	۰.۶۲	دیرش اخزا کوتاه مدت
-۰.۰۷	۲.۱۵	دیرش اخزا بلند مدت
-۰.۰۵	۱.۹۷	دیرش کل اخزا

بازدهی معاملات طی هفته

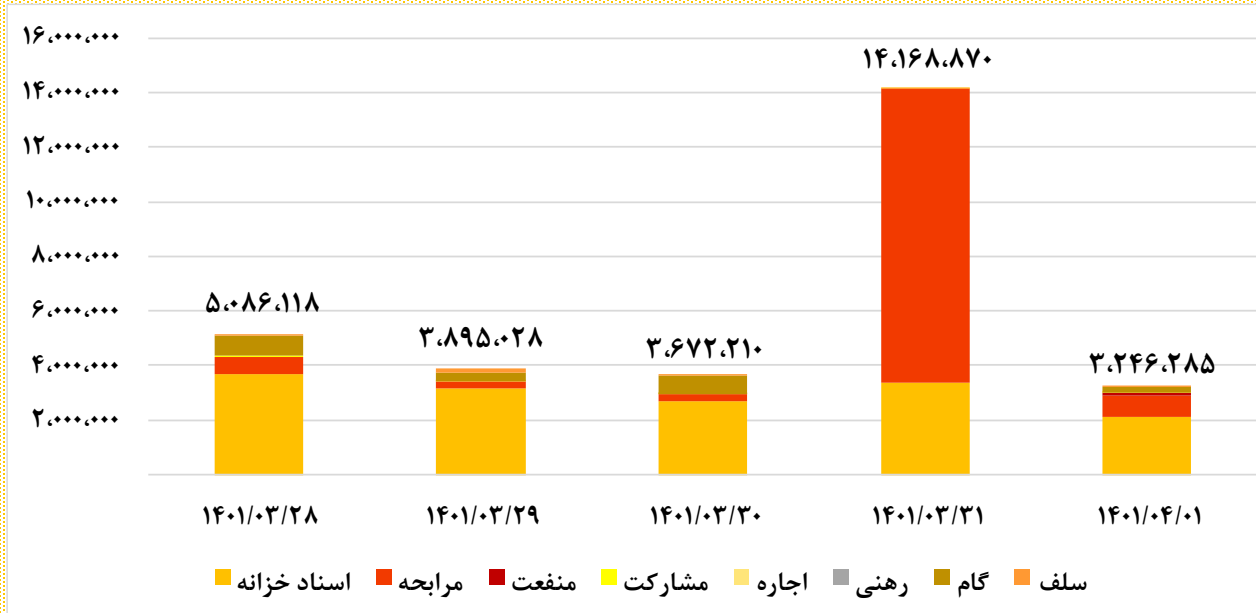


*ریسک نرخ بهره اراد بر مبنای دیرش موزون اراد های معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد.

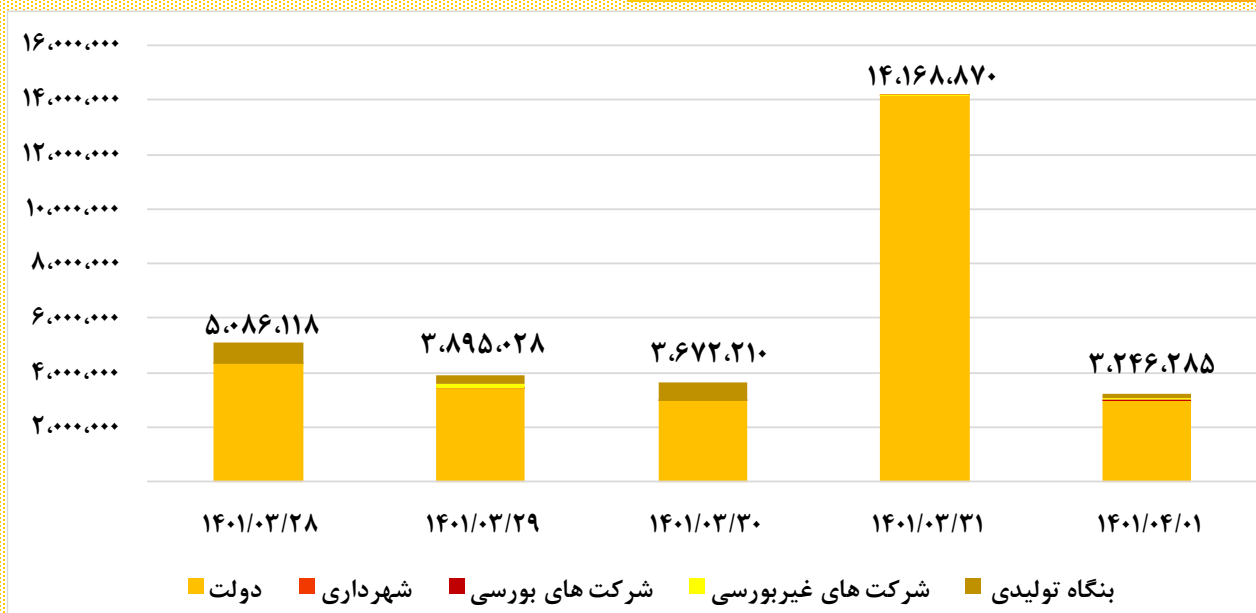
*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
بازدهی اراد کوتاه مدت	۲۱.۸۰%	-۱.۲۰%
بازدهی اراد بلند مدت	۲۰.۹۷%	۰.۳۸%
بازدهی کل اراد	۲۰.۹۷%	۰.۳۸%
دیرش اراد کوتاه مدت	۰.۲۰	-۰.۰۲
دیرش اراد بلند مدت	۱.۶۹	۰.۲۸
دیرش کل اراد	۱.۶۹	۰.۲۸

براساس نوع اوراق



براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته
(نماد خرد)



ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات	تاریخ
۷,۷۵۷	۱۰,۸۳۹,۲۵۶	۱۴۰۱/۰۳/۲۸
۳۹۰	۵۵۴,۹۷۲	۱۴۰۱/۰۳/۲۹
۲۴۹,۵۶۱	۳۴۳,۸۹۹,۰۵۹	۱۴۰۱/۰۳/۳۰
۲,۱۵۰	۲,۸۰۵,۳۴۸	۱۴۰۱/۰۳/۳۱
۱۵۴	۱۷۵,۸۰۸	۱۴۰۱/۰۴/۰۱

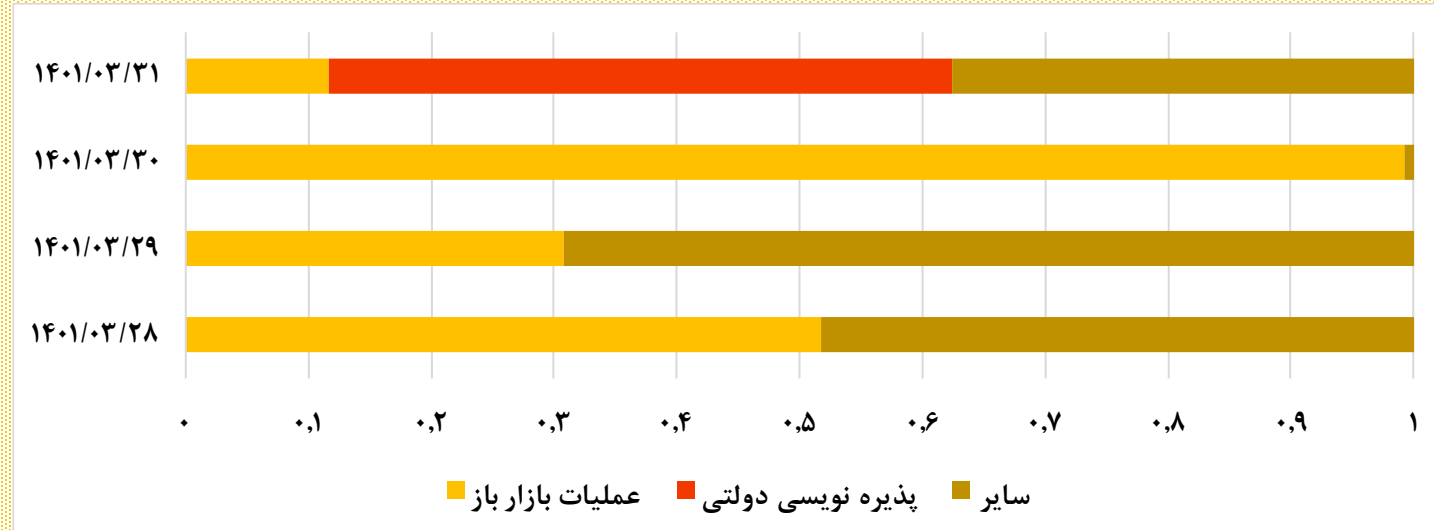
مرابحه عام دولت

ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات	تاریخ
۷,۷۴۱	۸,۱۴۹,۰۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۸
۹,۰۹۳	۹,۶۸۹,۴۰۰	۱۴۰۱/۰۳/۲۹
۹۵۹,۵۰۹	۱,۰۰۴,۶۶۳,۸۰۶	۱۴۰۱/۰۳/۳۰
۲۳,۸۶۵	۲۴,۳۰۳,۳۳۰	۱۴۰۱/۰۳/۳۱
۱۲,۵۸۶	۱۳,۳۶۴,۷۰۰	۱۴۰۱/۰۴/۰۱

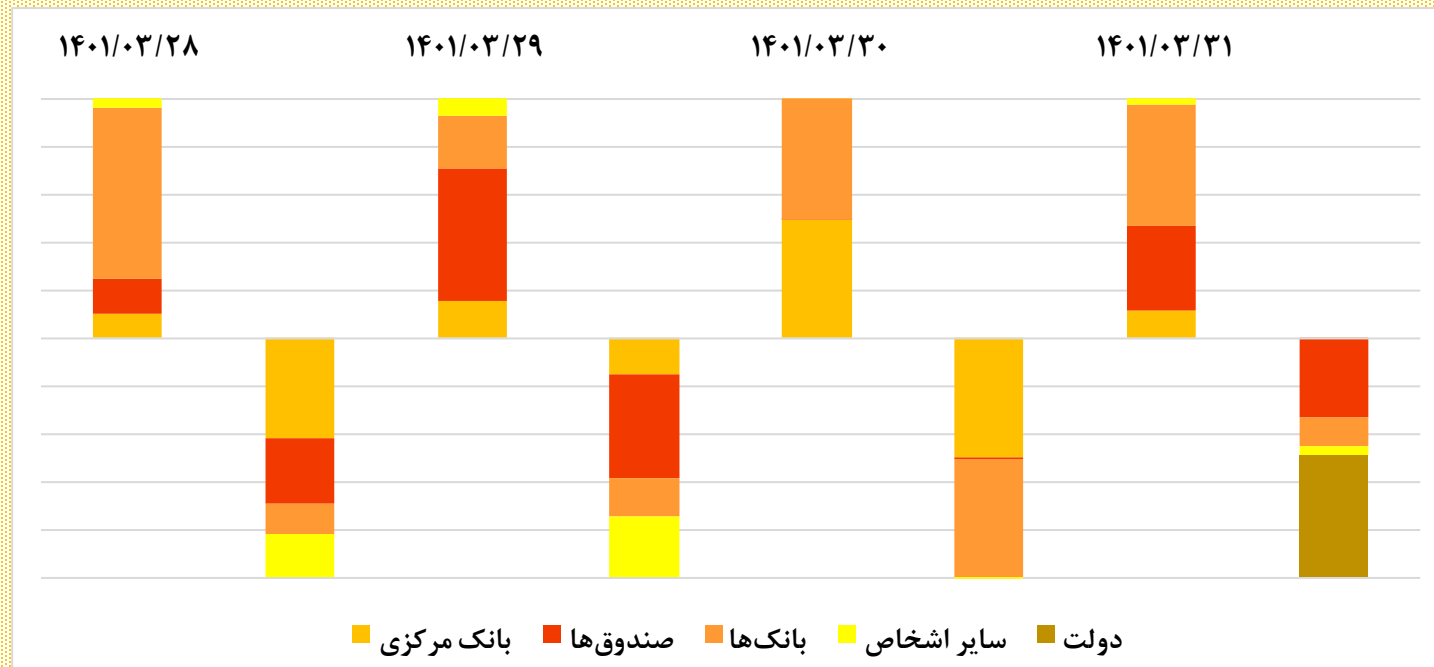
معاملات طی هفته
(نماد عمده)



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	اسناد خزانه اسلامی
نام اوراق	اسناد خزانه-م ۱۵م ۱۵م ۹۸-۰۱۰۴۰۶
نماد معاملاتی	اخزا۸۱۵
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۴۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۳۹۸/۰۴/۰۶
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۴/۰۶
نرخ سود اسمی	فاقد 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	-



اوراق منتشر شده
و
سررسید شده هفته آتی

اطلاعات اوراق	
نوع اوراق	اجاره
نام اوراق	اجاره سلولزی ماریناسان ۱۴۰۵/۰۴/۰۵
نماد معاملاتی	ماریناسان ۰۵
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۲,۲۹۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۴۰۱/۰۴/۰۵
تاریخ سررسید	۱۴۰۵/۰۴/۰۵
نرخ سود اسمی	۱۸ درصد سالانه
مواعد پرداخت سود	هر ۳ ماه یکبار از تاریخ انتشار
ارکان اوراق	
بانی / ناشر	شرت صنایع سلولزی ماریناسان
نهاد واسط (ناشر)	شرت واسط مالی شهرپور پنجم
ضامن	بانک ملت
بازارگردان	شرکت تامین سرمایه بانک ملت
متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه بانک ملت

یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۴/۰۲

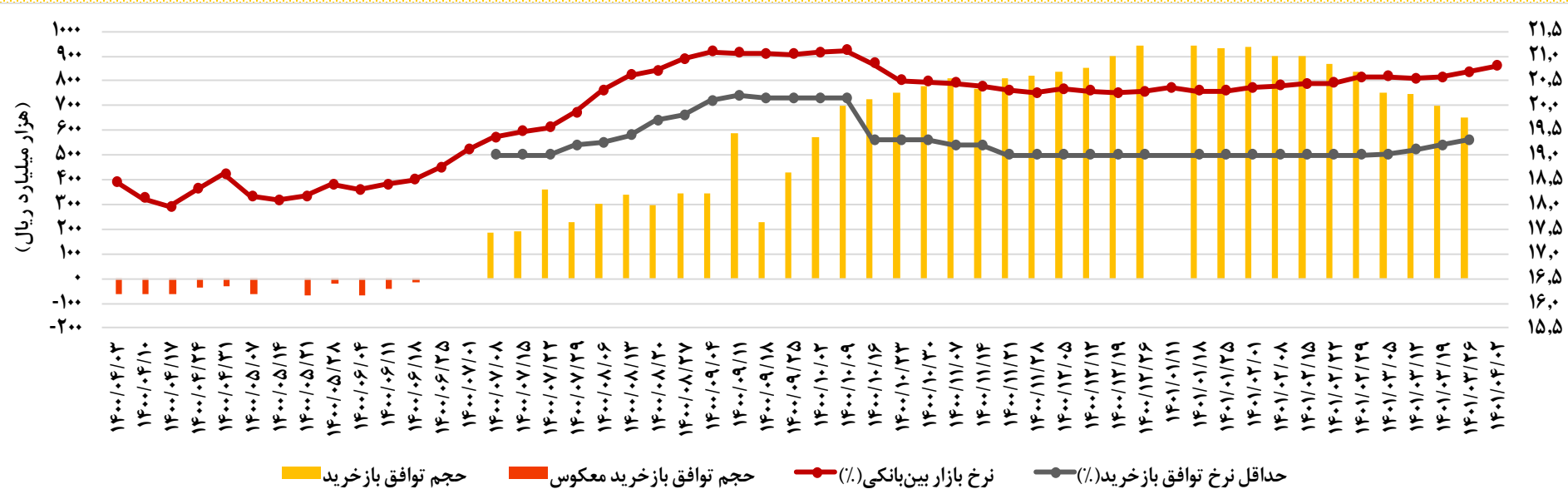
تاریخ	حجم توافق باز خرید (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید معکوس (ریپو معکوس) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید سررسید شده (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	خالص تزریق نقدینگی (هزار میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۳/۰۹	۷۴۸	-	۷۵۲.۷	-۴.۷
۱۴۰۱/۰۳/۱۶	۶۹۹.۹	-	۷۵۰.۸	-۵۰.۹
۱۴۰۱/۰۳/۲۳	۶۵۰	-	۷۰۱.۹	-۵۱.۹
جمع	۲۰۹۷.۹	-	۲۲۰۵.۵	-۱۰۷.۵

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی

۲۰.۷۳	۱۴۰۱/۰۳/۲۸
۲۰.۷۴	۱۴۰۱/۰۳/۲۹
۲۰.۸۴	۱۴۰۱/۰۳/۳۰
۲۰.۸۷	۱۴۰۱/۰۳/۳۱
اعلام نشده	۱۴۰۱/۰۴/۰۱





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.atashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz