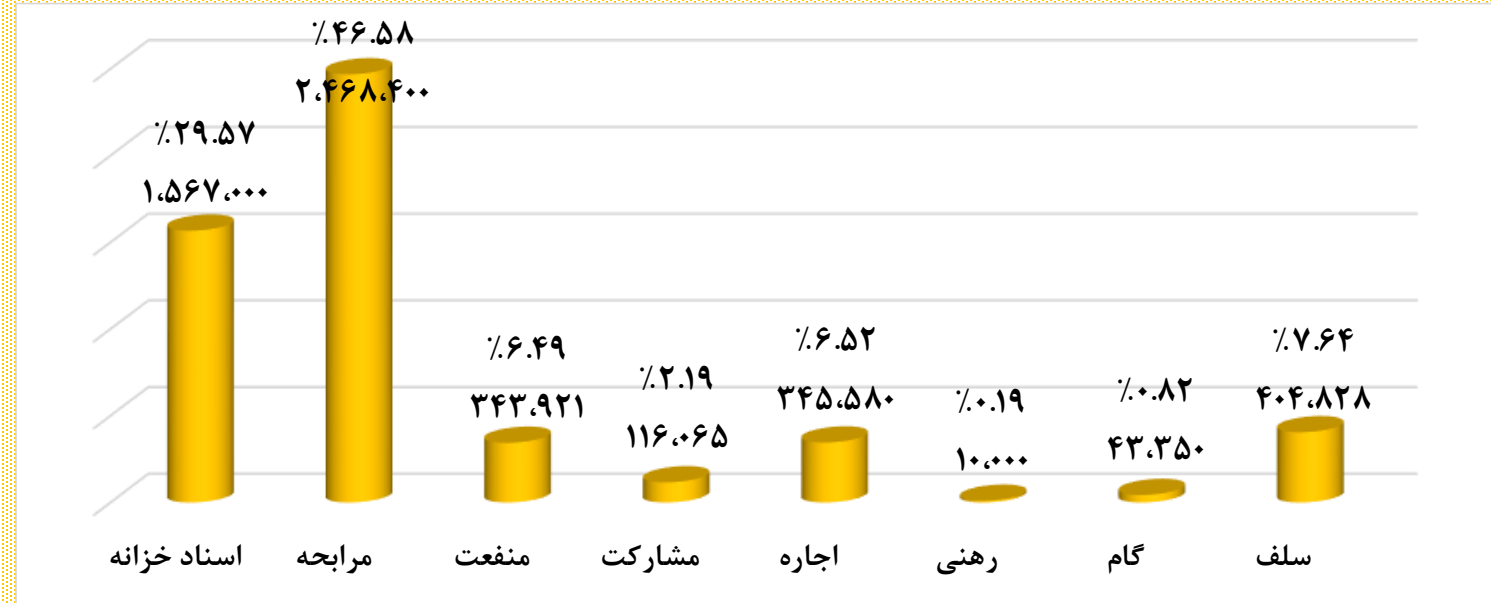


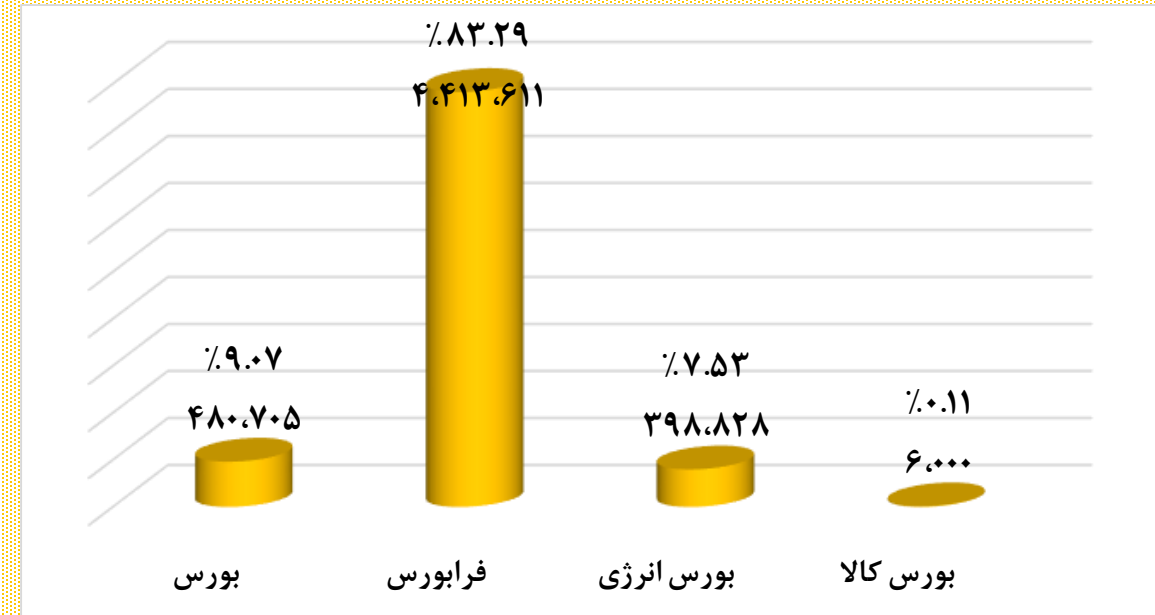
گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۱۶ تیر ۱۴۰۱

براساس نوع اوراق



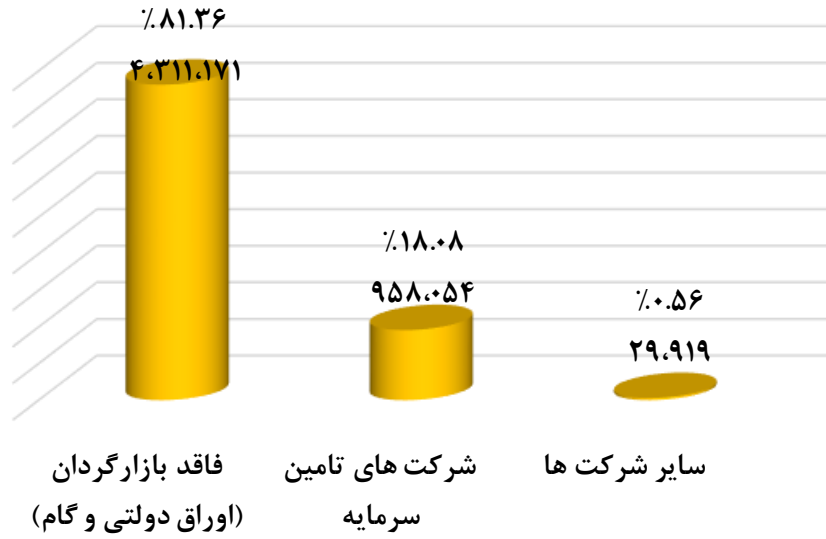
براساس نوع بازار



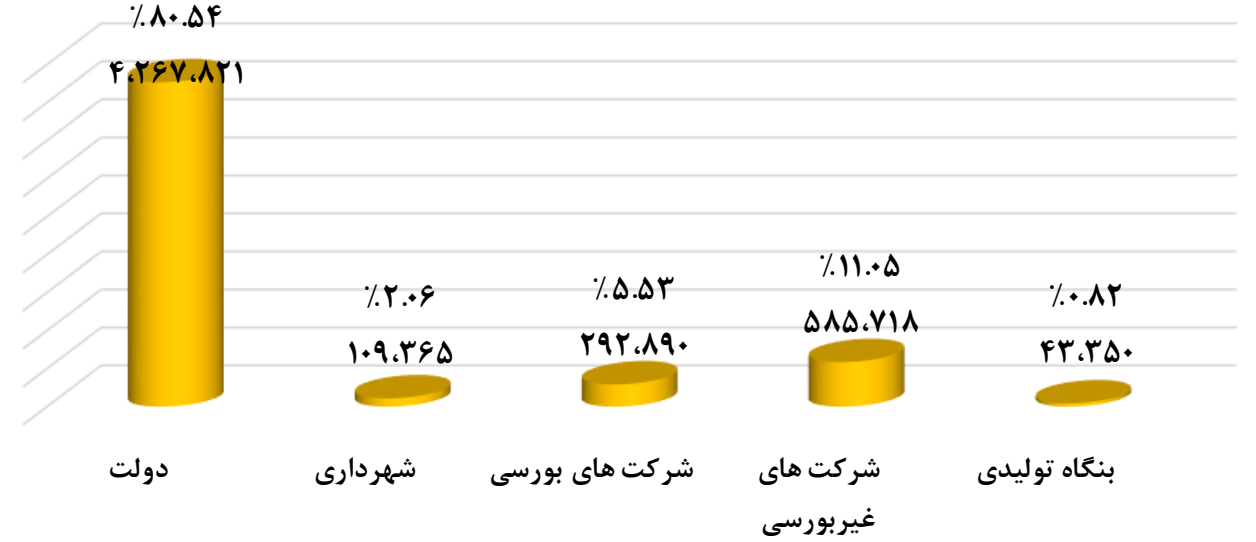
حجم اوراق موجود
بر مبنای قیمت سررسید
(ارقام به میلیارد ریال)



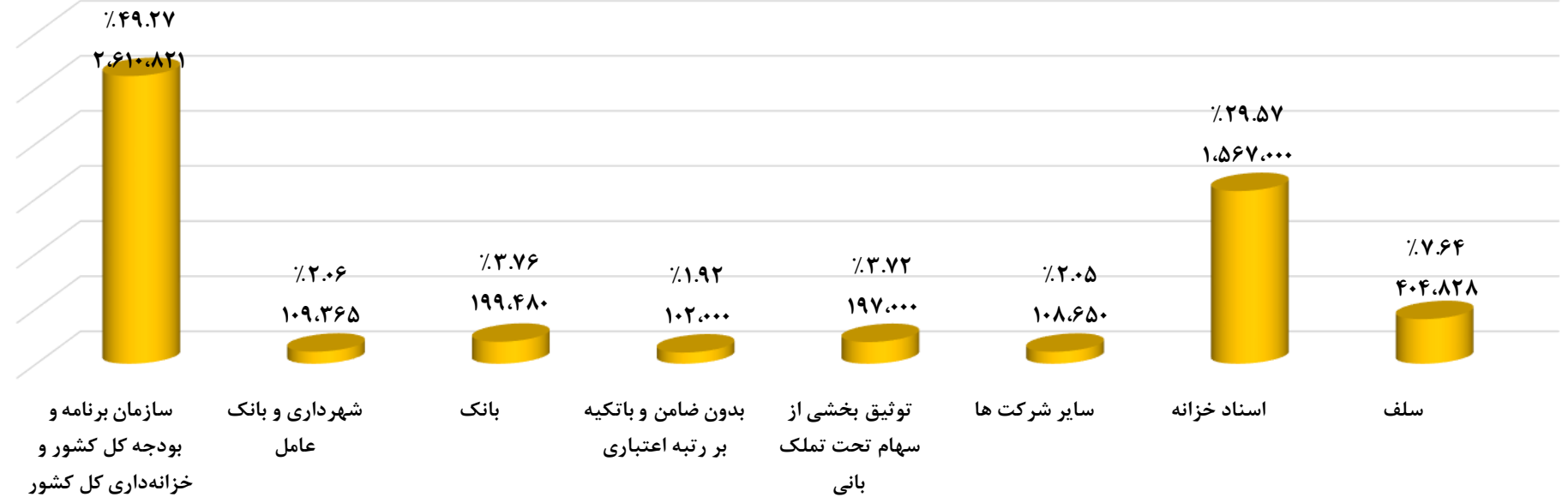
براساس نوع بازارگردان



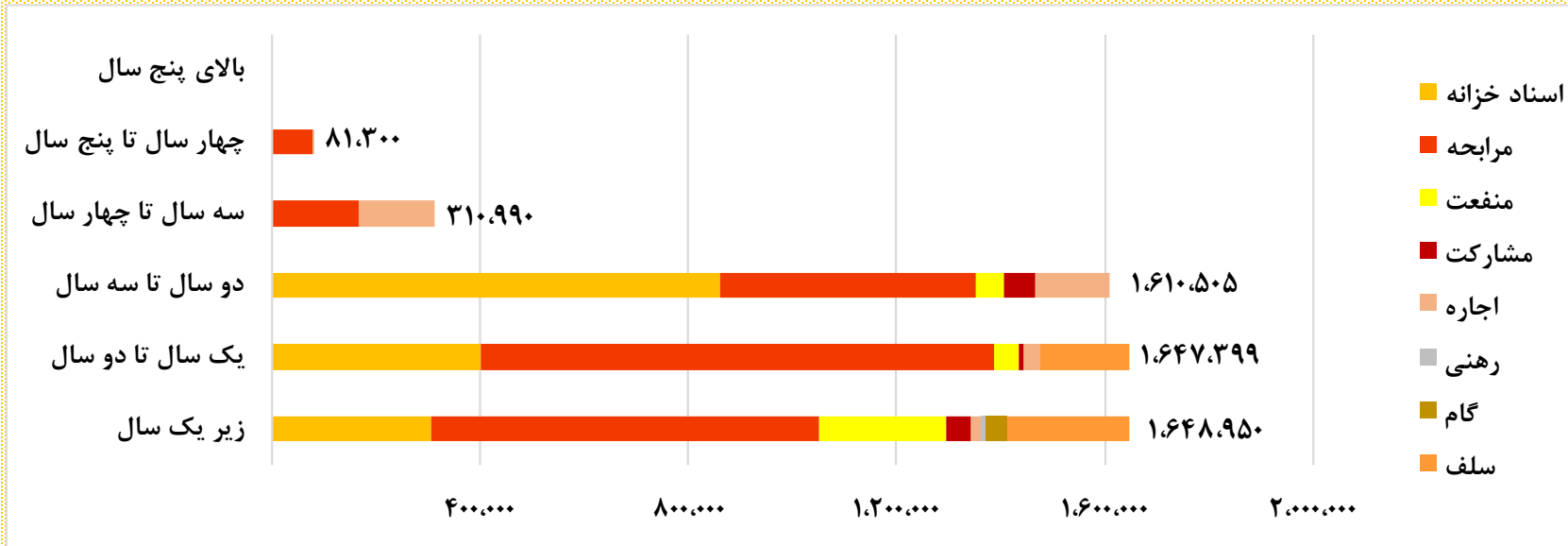
براساس نوع بانی



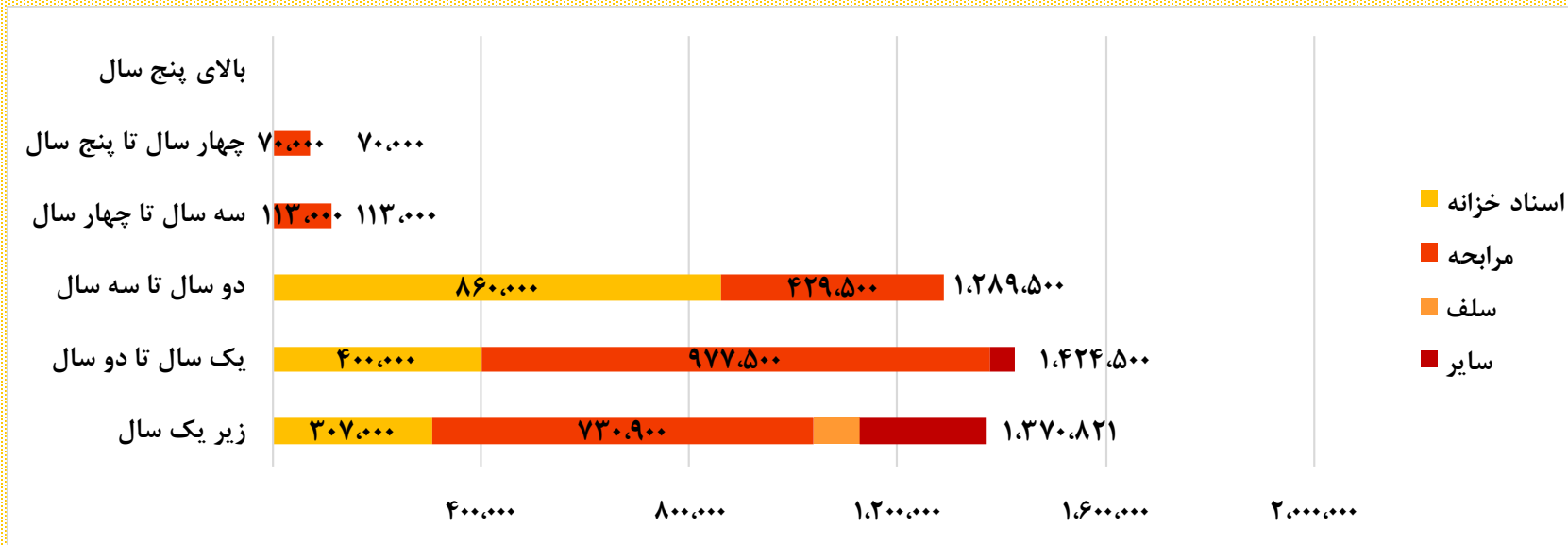
براساس نوع ضامن



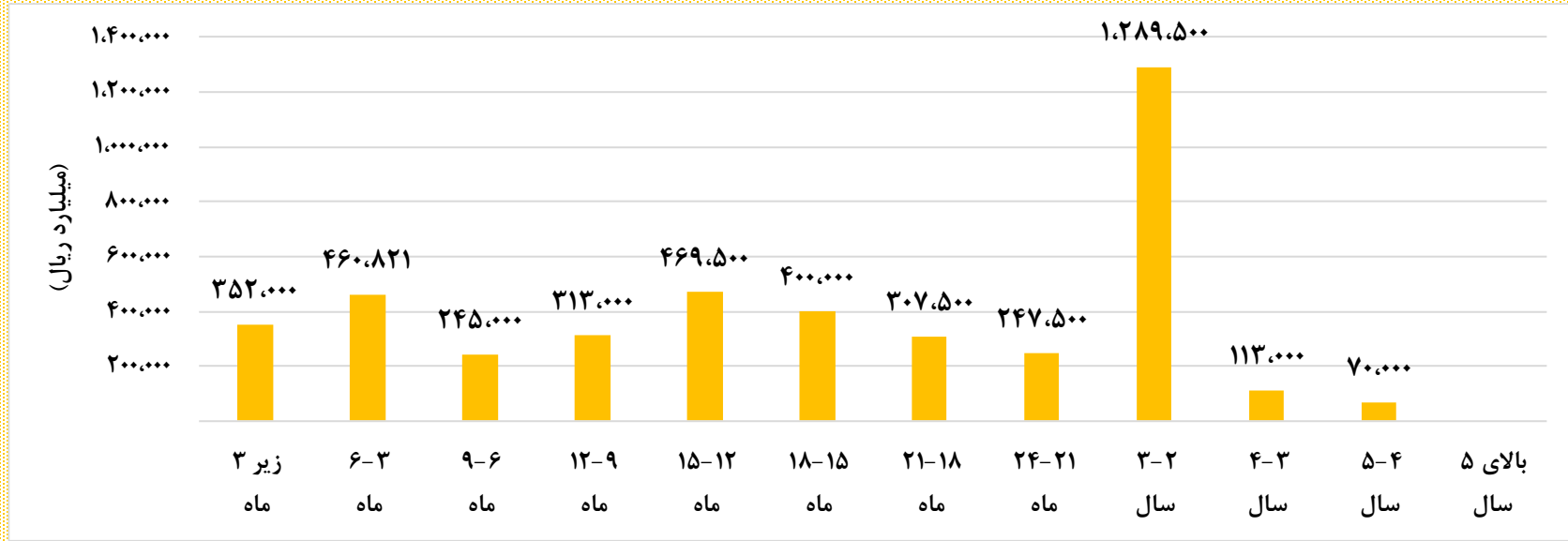
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

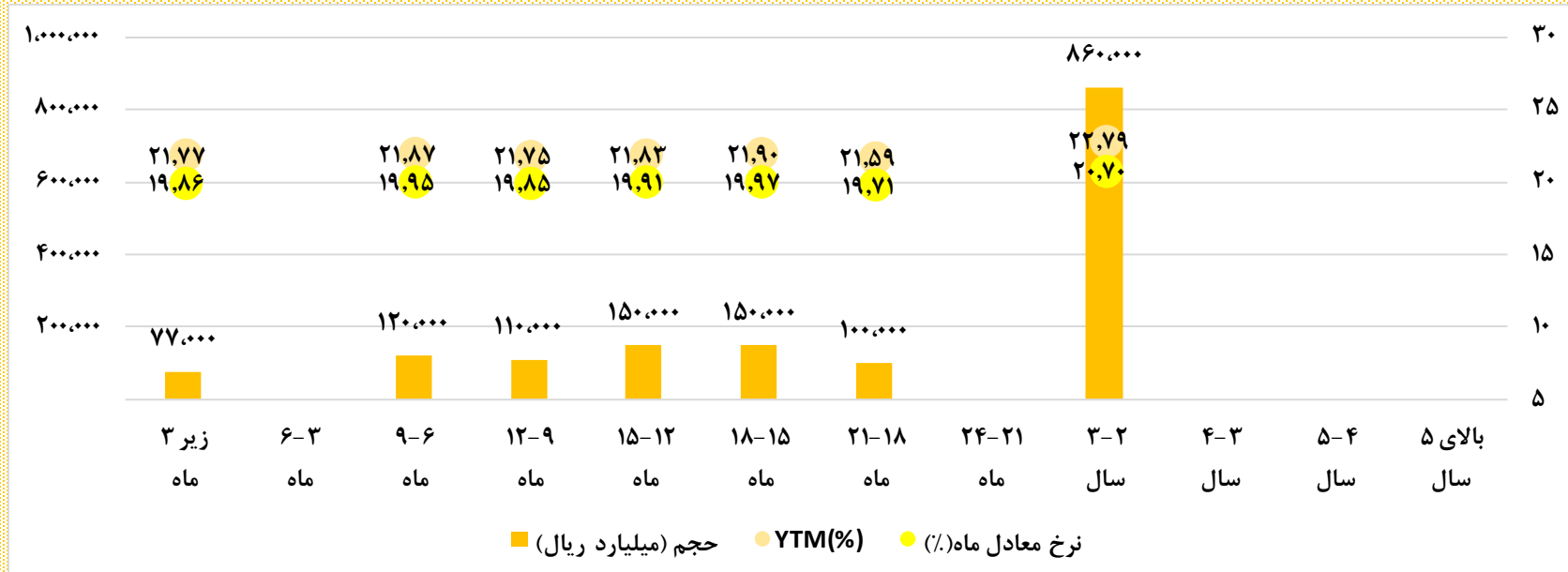


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* 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

۲۱.۸۳٪

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

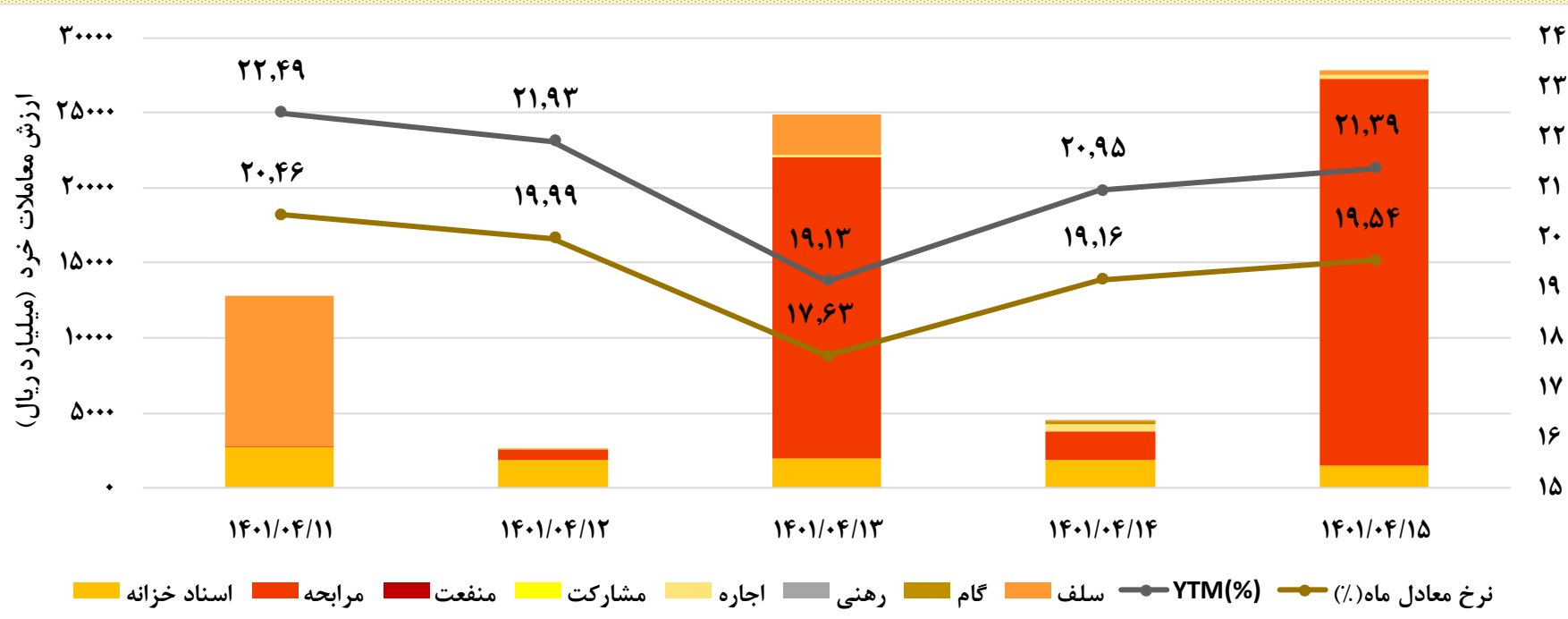
۲۲.۶۵٪

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

۱۹.۹۱٪

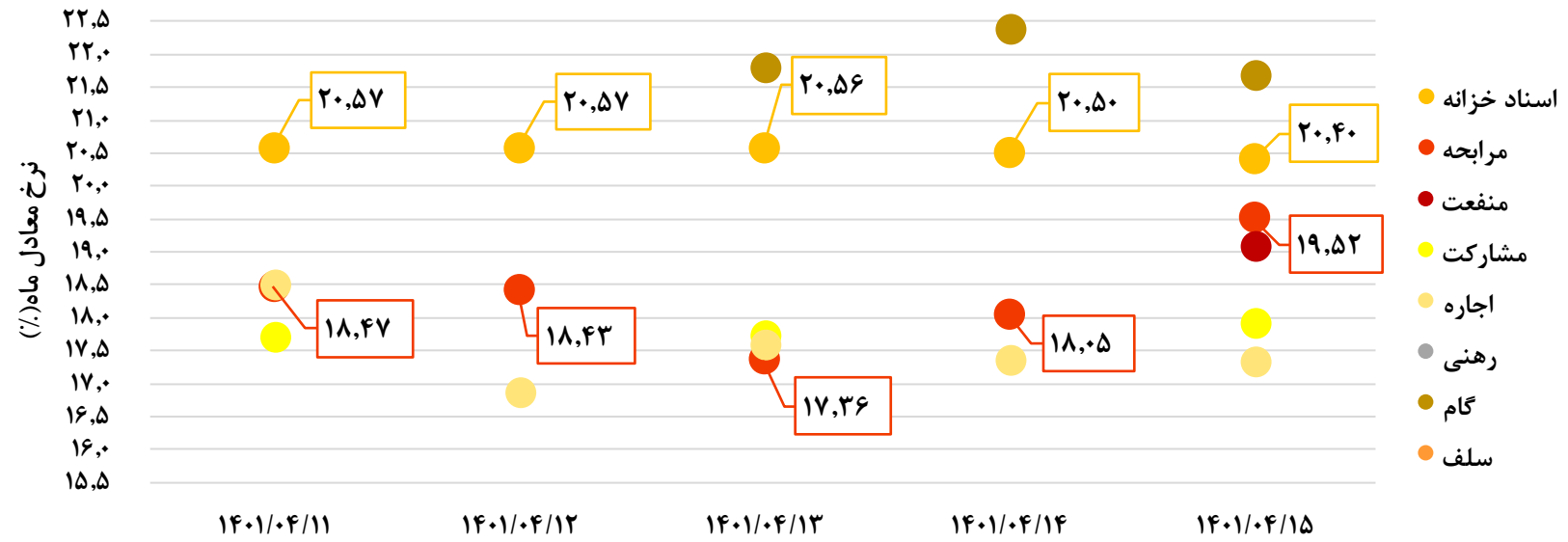
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

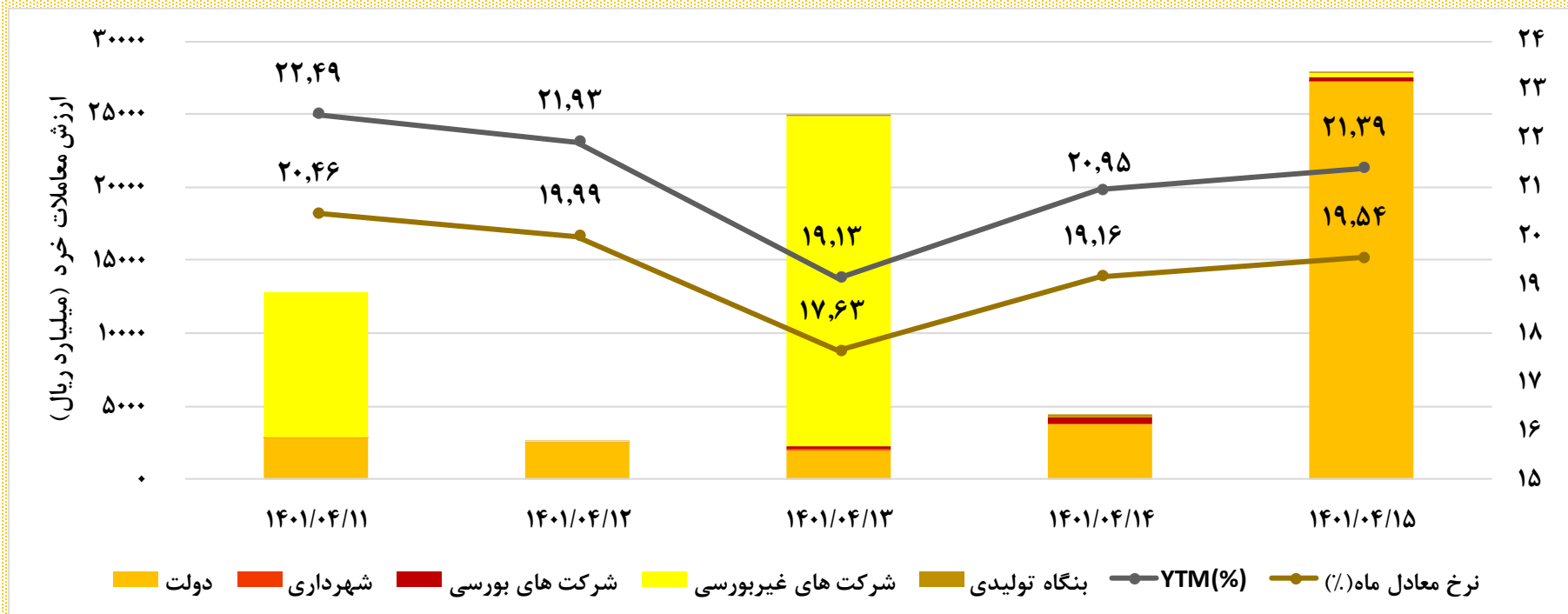
۲۰.۵۹٪



بازدهی معاملات طی هفته

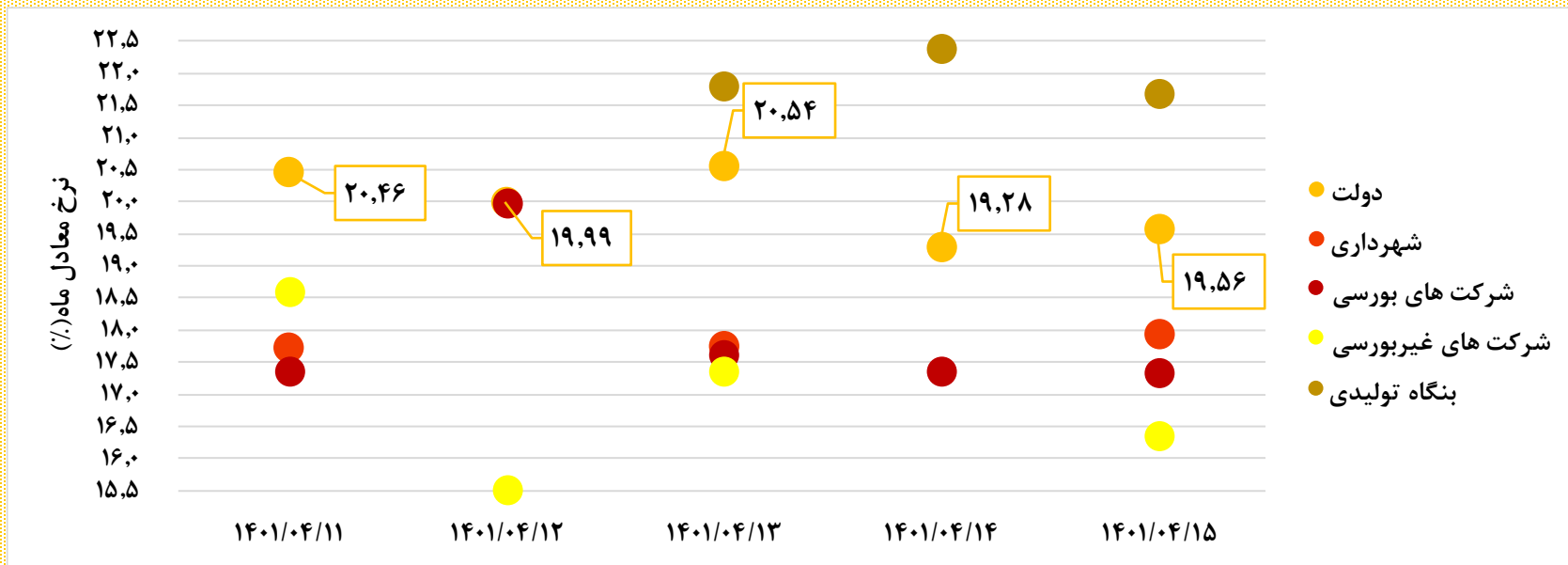
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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

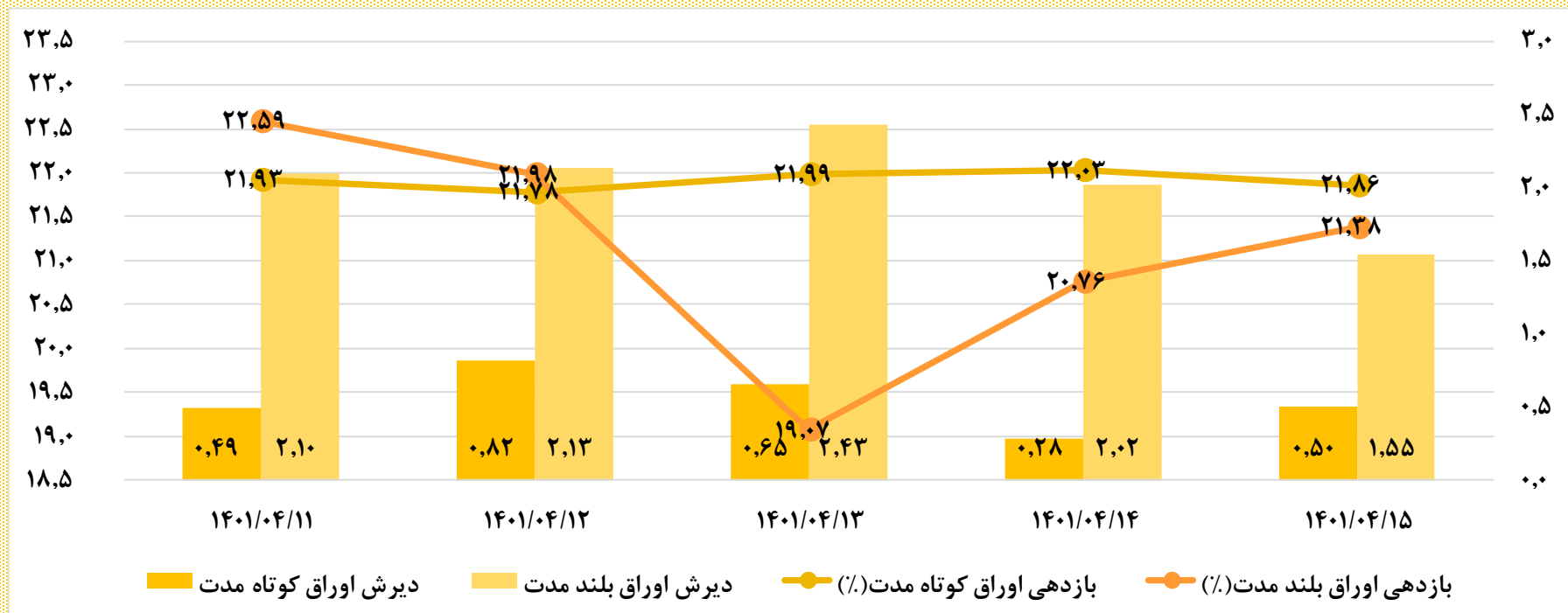




بازدهی معاملات طی هفته

* 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.





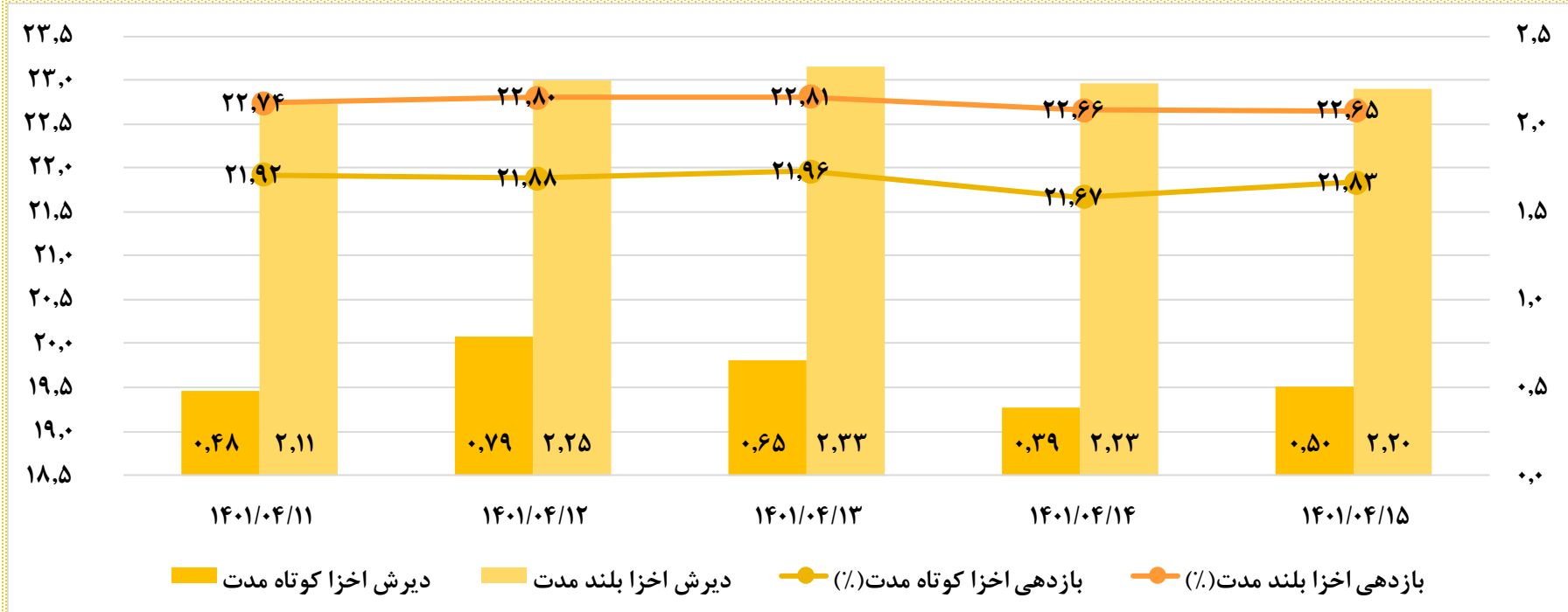
بازدهی معاملات طی هفته

*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	٪۲۱.۹۲	٪-۰.۱۵
بازدهی اوراق بلند مدت	٪۲۰.۵۳	٪-۰.۳۹
بازدهی کل اوراق	٪۲۰.۵۹	٪-۰.۳۸
دیرش اوراق کوتاه مدت	۰.۵۴	-۰.۰۳
دیرش اوراق بلند مدت	۱.۹۶	-۰.۳۰
دیرش کل اوراق	۱.۹۰	-۰.۲۹

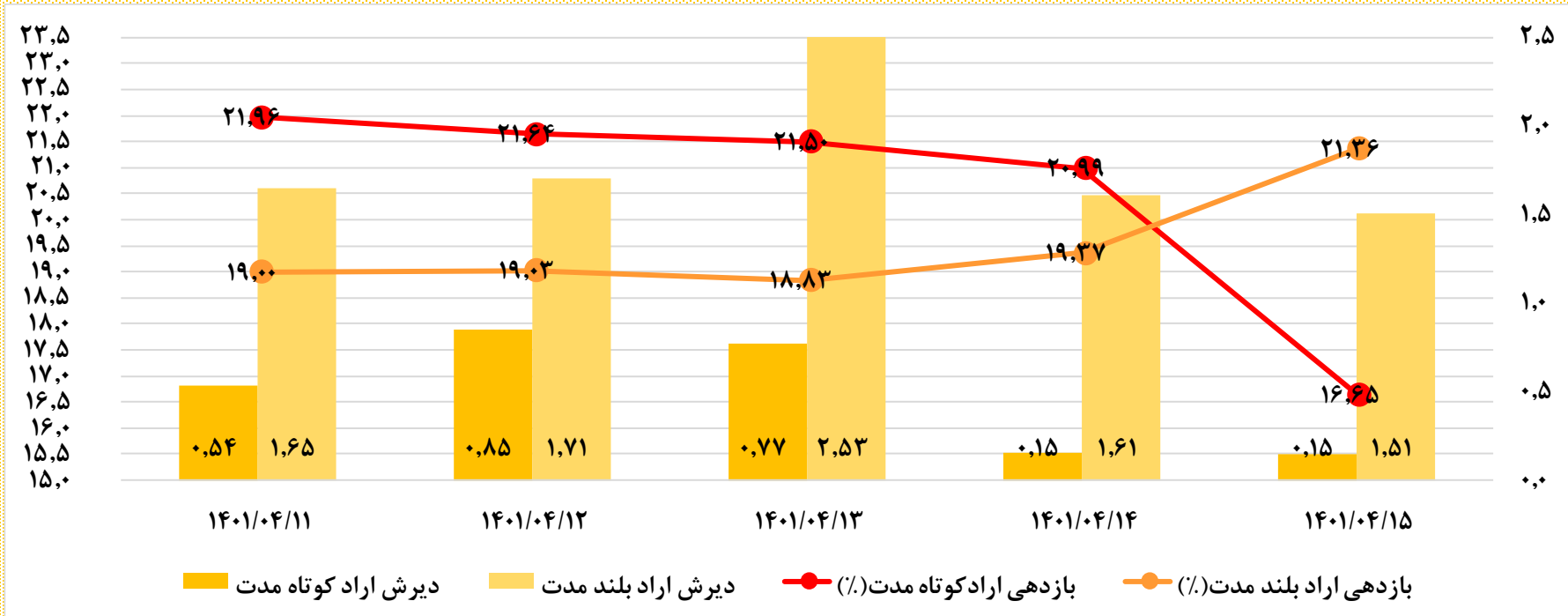
بازدهی معاملات طی هفته



*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		
٪-۰,۰۸	٪۲۱,۸۷	بازدهی اخزا کوتاه مدت
٪-۰,۱۳	٪۲۲,۷۳	بازدهی اخزا بلند مدت
٪-۰,۱۷	٪۲۲,۵۸	بازدهی کل اخزا
-۰,۰۵	۰,۵۸	دیرش اخزا کوتاه مدت
۰,۰۵	۲,۲۲	دیرش اخزا بلند مدت
-۰,۰۴	۱,۹۲	دیرش کل اخزا



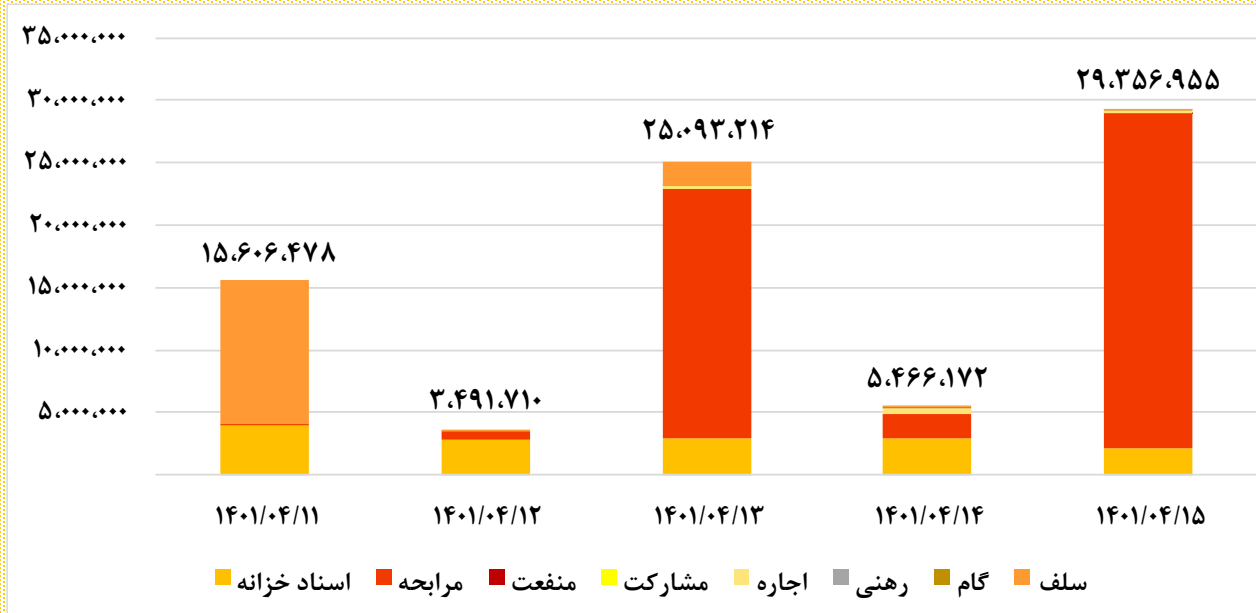
بازدهی معاملات طی هفته

*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.

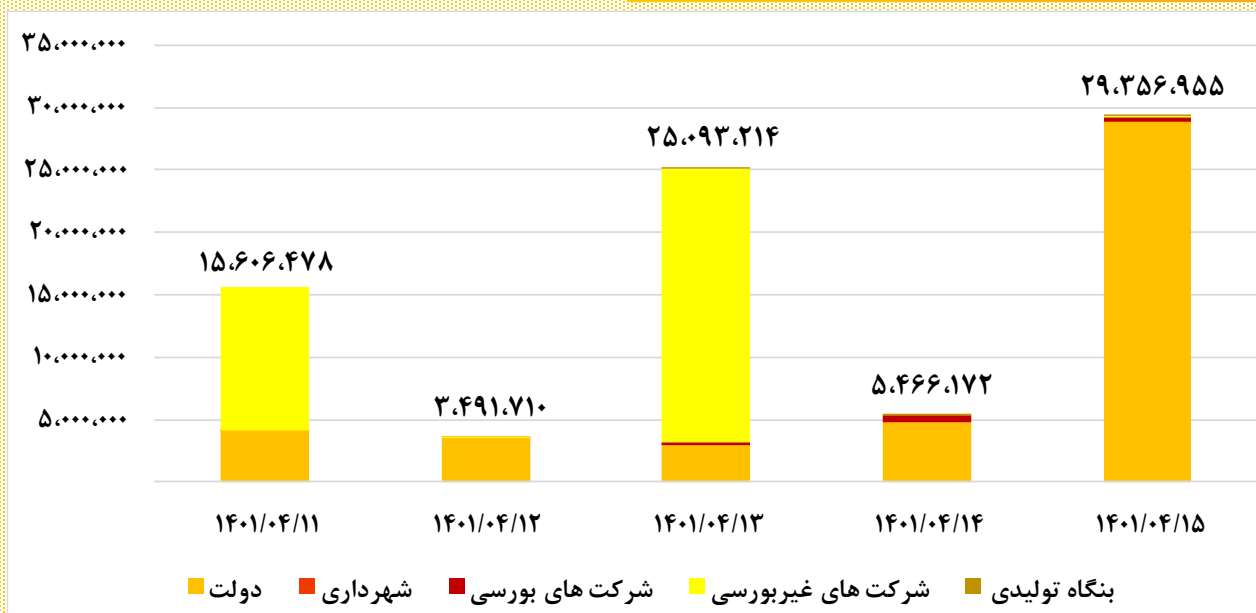
*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
٪-۱.۳۷	٪۲۱.۳۵	بازدهی اراد کوتاه مدت
٪۰.۰۰	٪۲۱.۲۰	بازدهی اراد بلند مدت
٪-۰.۰۱	٪۲۱.۲۱	بازدهی کل اراد
۰.۱۱	۰.۴۹	دیرش اراد کوتاه مدت
-۰.۳۲	۱.۵۲	دیرش اراد بلند مدت
-۰.۳۳	۱.۵۰	دیرش کل اراد

براساس نوع اوراق



براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته
(نماد خرد)



تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۴/۱۱	۲,۲۴۷,۶۵۸	۱,۵۷۶
۱۴۰۱/۰۴/۱۲	۱۸۰,۹۸۰	۱۴۸
۱۴۰۱/۰۴/۱۳	۳۰۸,۵۷۳,۴۱۴	۲۲۴,۲۸۰
۱۴۰۱/۰۴/۱۴	۷,۲۰۳,۴۲۲	۶,۴۱۵
۱۴۰۱/۰۴/۱۵	۱۳,۳۸۷,۸۴۴	۱۱,۸۶۳

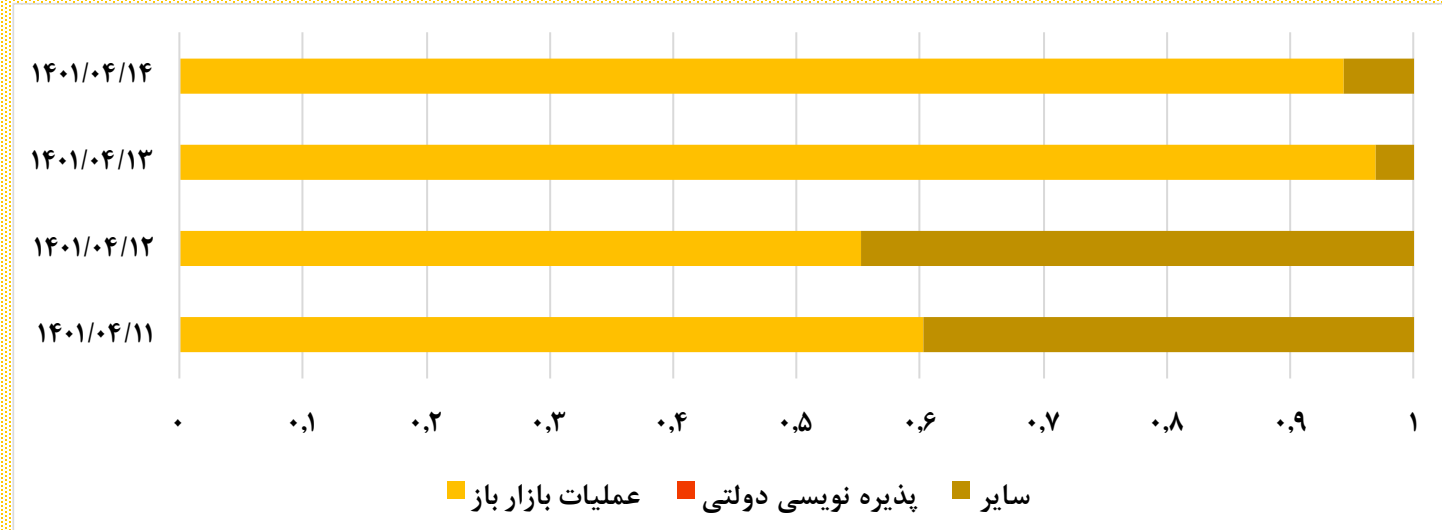
مراجعه عام دولت

تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۴/۱۱	۱۰,۹۲۶,۴۲۱	۱۰,۵۴۹
۱۴۰۱/۰۴/۱۲	۱۴,۱۷۶,۸۵۳	۱۳,۵۸۱
۱۴۰۱/۰۴/۱۳	۱,۰۲۵,۱۳۴,۴۷۹	۹۷۹,۶۴۸
۱۴۰۱/۰۴/۱۴	۱۱۰,۵۲۶,۹۶۰	۱۰۵,۱۴۸
۱۴۰۱/۰۴/۱۵	۱۵۲,۹۷۵,۱۲۸	۱۴۶,۸۷۸

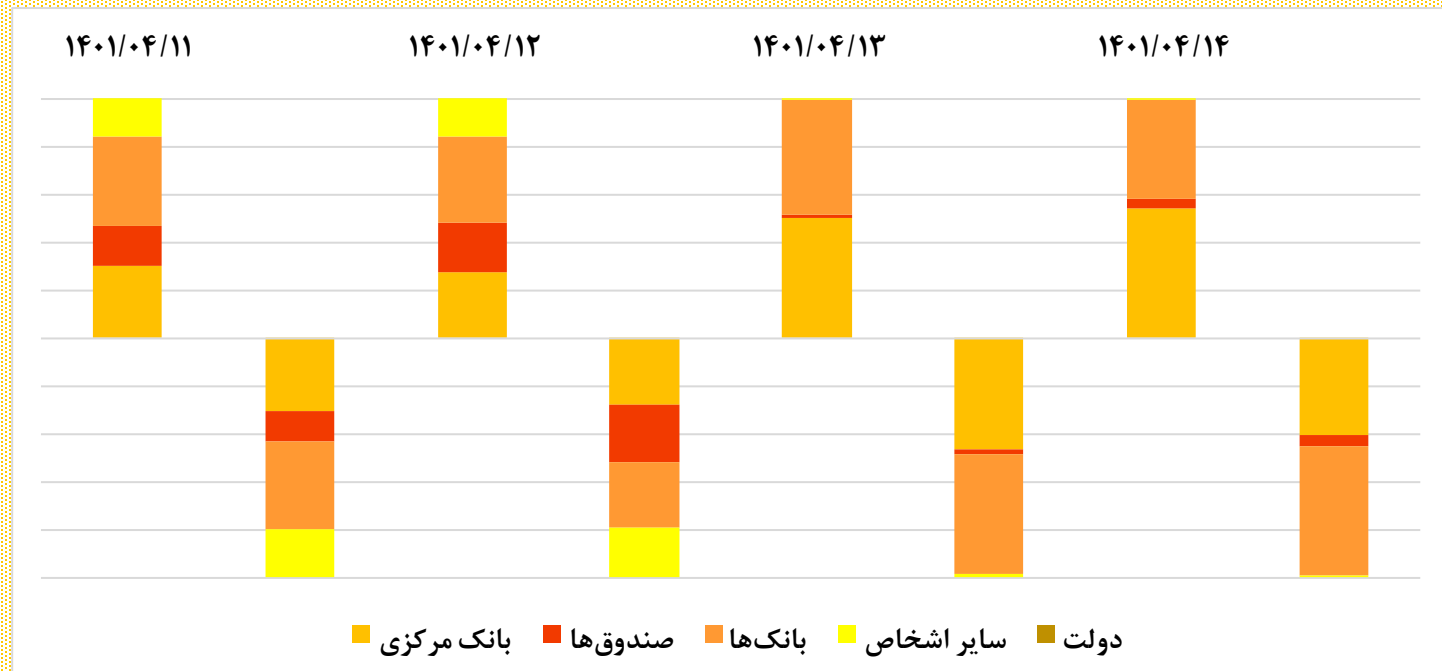
معاملات طی هفته
(نماد عمده)



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	رهنی
نام اوراق	اوراق رهنی بانک مسکن ۱۴۰۱۰۴۲۳
نماد معاملاتی	رهن ۰۱۰۴
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۱۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۳۹۹/۰۴/۲۳
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۴/۲۳
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۶ درصد
مواعد پرداخت سود	هر سه ماه یکبار
ارکان اوراق	
بانی / ناشر	بانک مسکن
نهاد واسط (ناشر)	شرکت واسط فروردین پنجم
ضامن	بانک مسکن
بازارگردان	شرکت تامین سرمایه بانک مسکن
متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه بانک مسکن

اوراق منتشر شده

اطلاعات اوراق	
نوع اوراق	مراجعه
نام اوراق	مراجعه عام دولت ۱۰۸-ش.خ.۰۶۰۲۱۸
نماد معاملاتی	اراد۱۰۸
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۲۲,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ عرضه / انتشار	۱۴۰۱/۰۴/۱۸
تاریخ سررسید	۱۴۰۶/۰۲/۱۸
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۸ درصد
مواعد پرداخت سود	هر شش ماه یک بار
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	سندیکایی متشکل از شرکت گروه خدمات بازار سرمایه کاریزما، صندوق با درآمد ثابت کمند، صندوق با درآمد ثابت کاریزما، صندوق نوع دوم کارا، صندوق ره آورد آباد مسکن و شرکت سرمایه گذاری مدیریت ثروت پایتخت
مشارکت	مشارکت ش مشهد ۴۰۶-۳ ماهه ۱۸٪
بورس	مشهد ۴۰۶
۲,۳۰۰,۰۰۰	
۱۴۰۱/۰۴/۲۰	
۱۴۰۴/۰۶/۳۱	
سالانه ۱۸ درصد	
هر سه ماه یک بار	
شهرداری مشهد	
-	
شهرداری مشهد و سازمان برنامه و بودجه (طبق مجوز بانک مرکزی) و بانک ملی (طبق قرارداد ضمانت)	
صندوق بازارگردانی سهم آشنا یکم	
-	

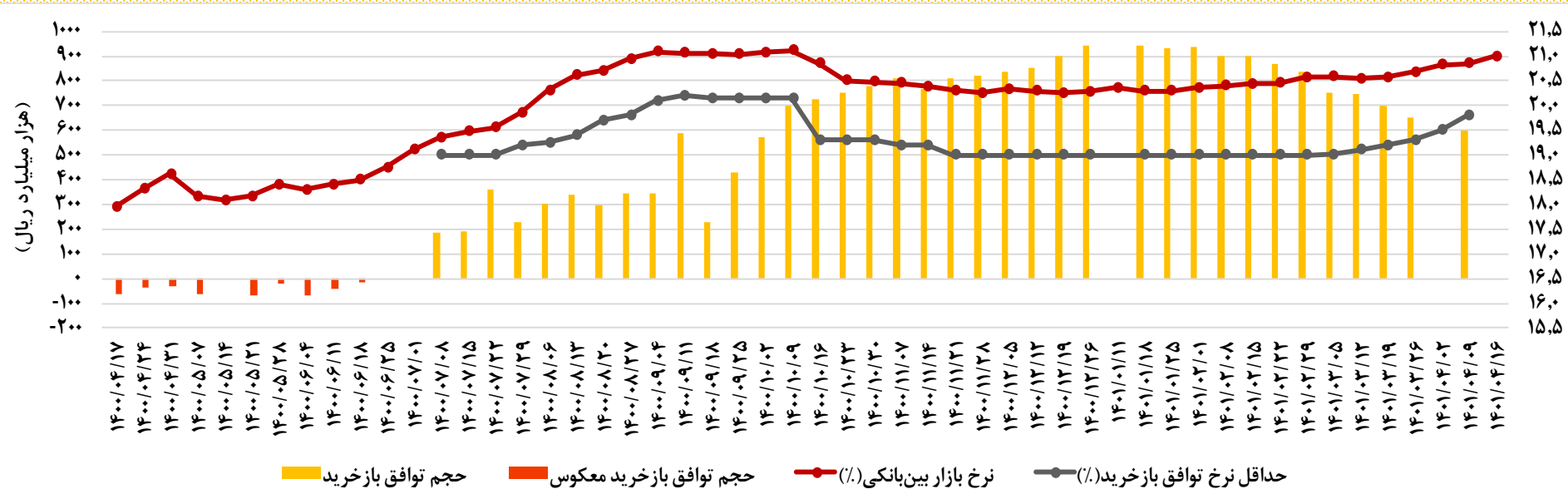
یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۴/۱۶

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	۶۹۹.۴	-	۷۵۰.۸	-۵۱.۴
۱۴۰۱/۰۳/۲۳	۶۵۰	-	۷۰۱.۹	-۵۱.۹
۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۵۹۸.۹	-	۶۴۱.۹	-۴۳
جمع	۲۶۹۶.۳	-	۲۸۴۷.۳	-۱۵۱

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی	
۲۰.۹۲	۱۴۰۱/۰۴/۱۱
۲۰.۹۳	۱۴۰۱/۰۴/۱۲
۲۱.۲۰	۱۴۰۱/۰۴/۱۳
۲۰.۹۶	۱۴۰۱/۰۴/۱۴
اعلام نشده	۱۴۰۱/۰۴/۱۵





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.atashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz