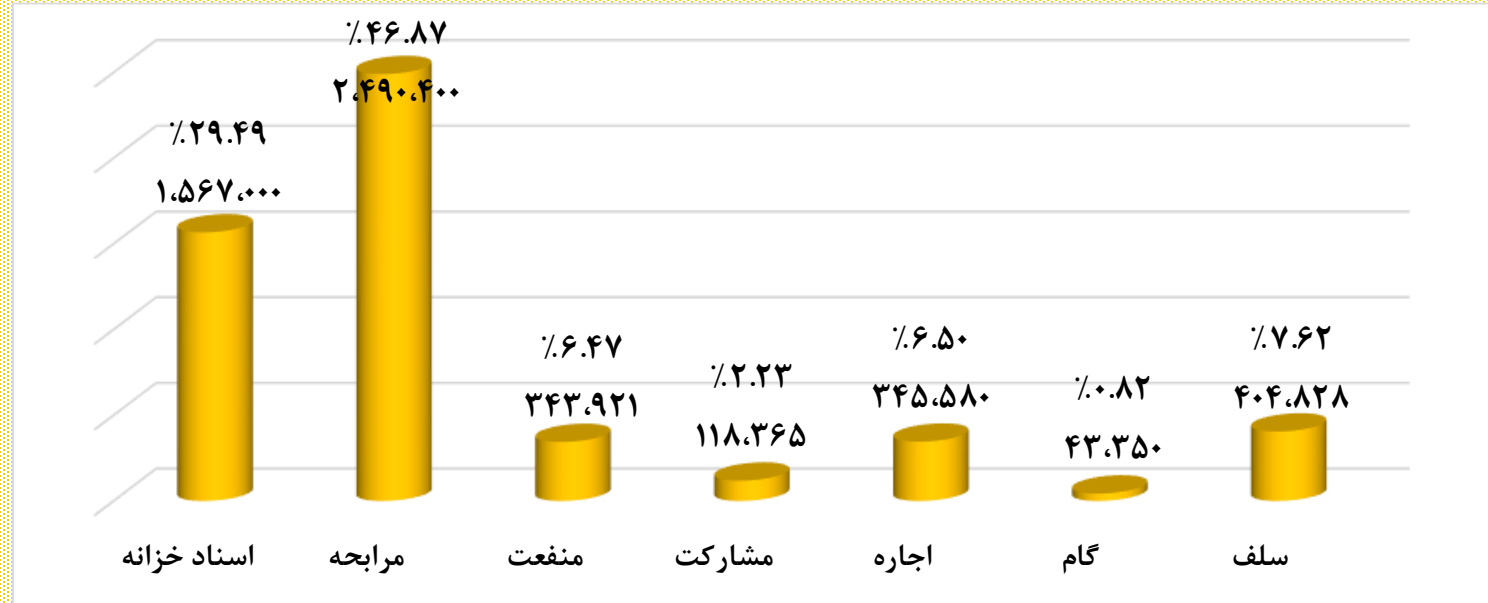


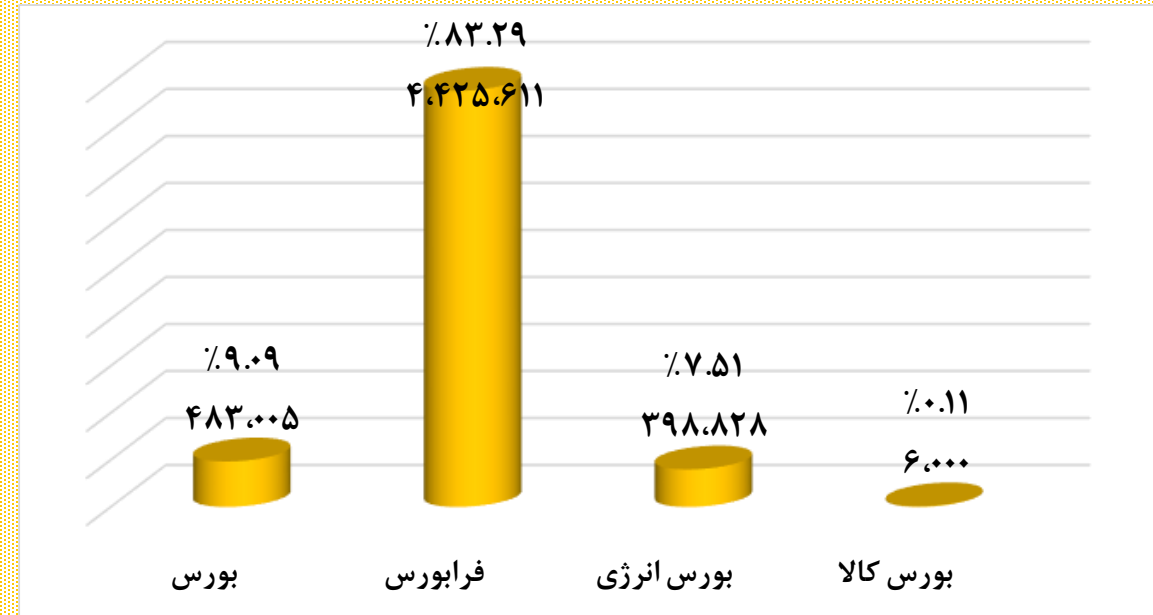
گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۲۳ تیر ۱۴۰۱

براساس نوع اوراق



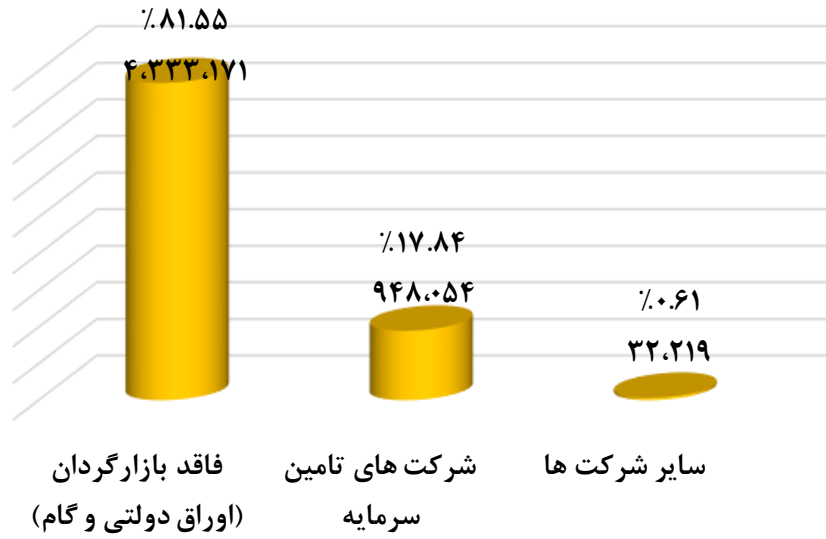
براساس نوع بازار



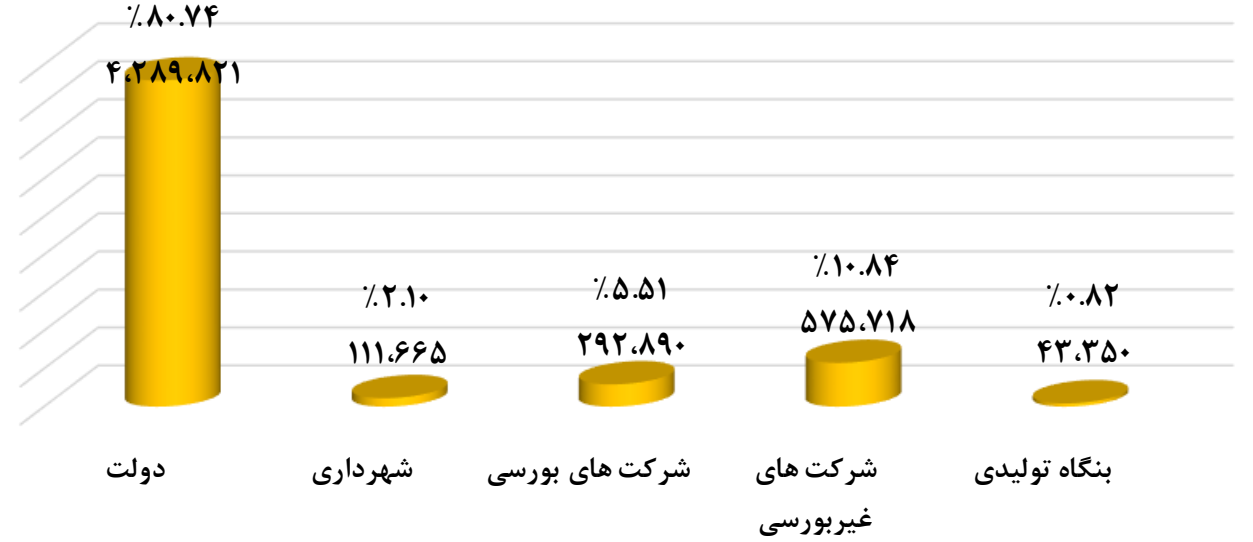
حجم اوراق موجود
بر مبنای قیمت سررسید
(ارقام به میلیارد ریال)



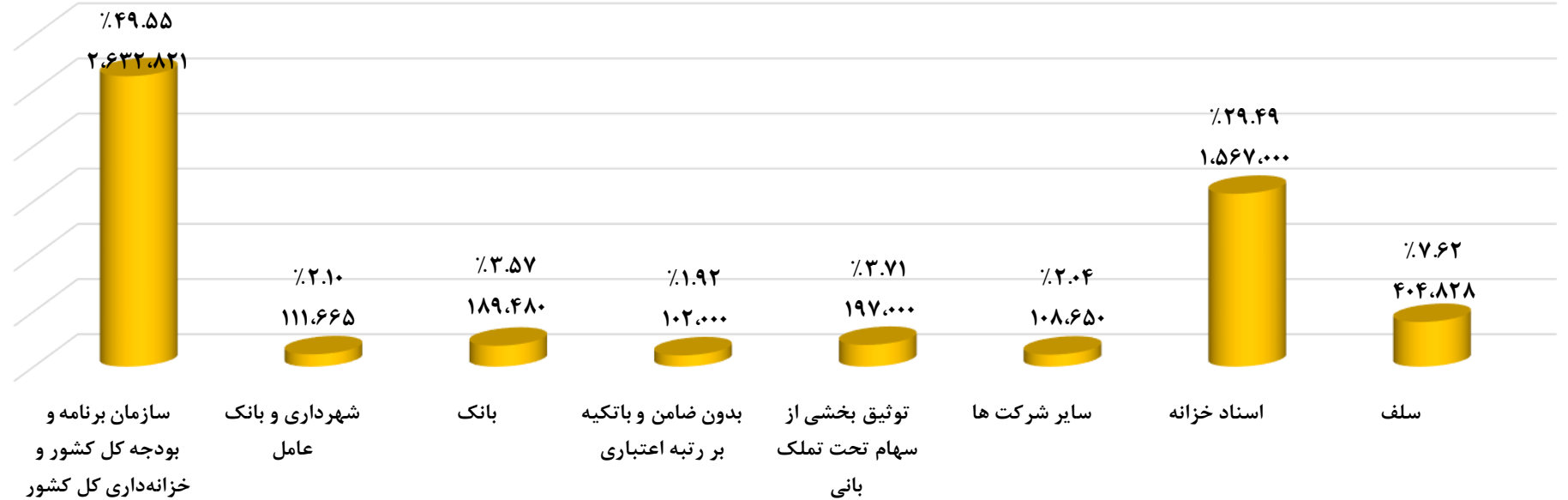
براساس نوع بازارگردان



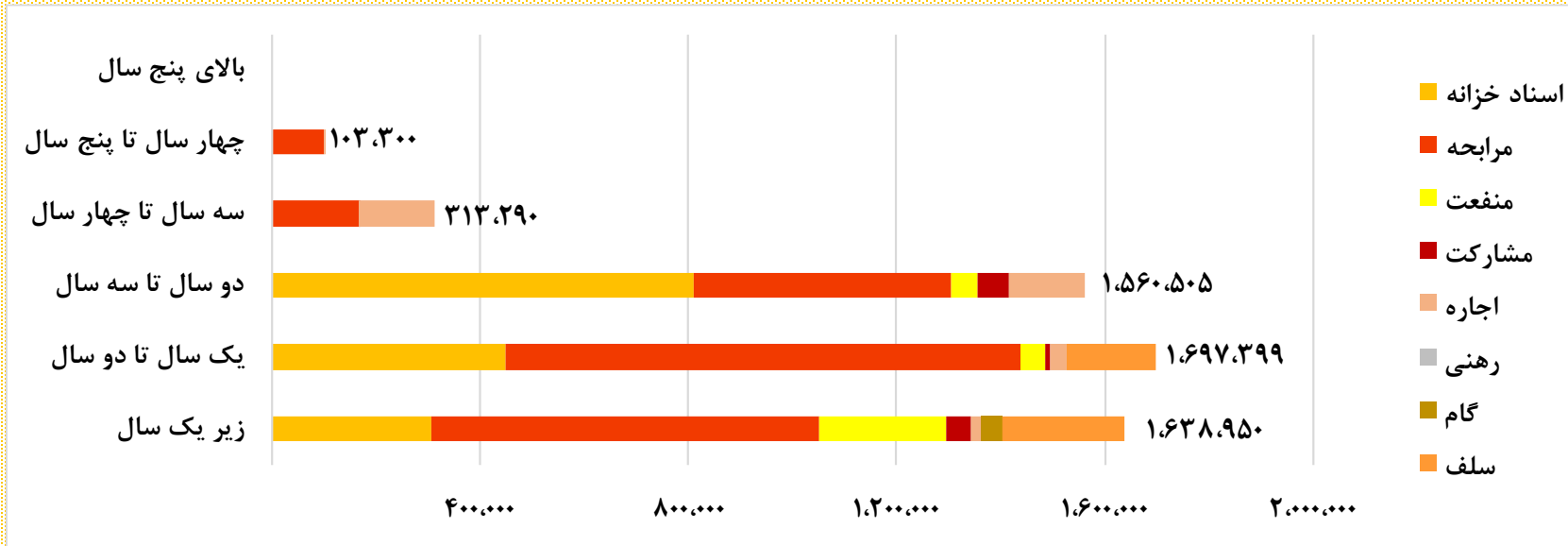
براساس نوع بانی



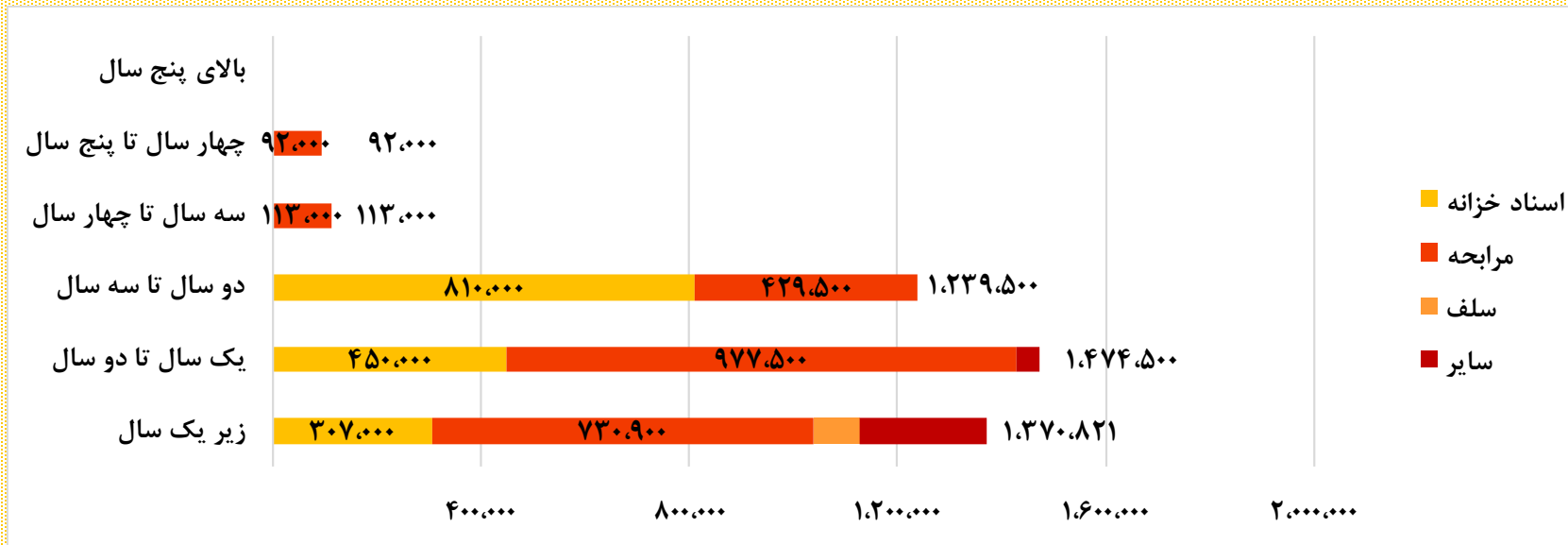
براساس نوع ضامن



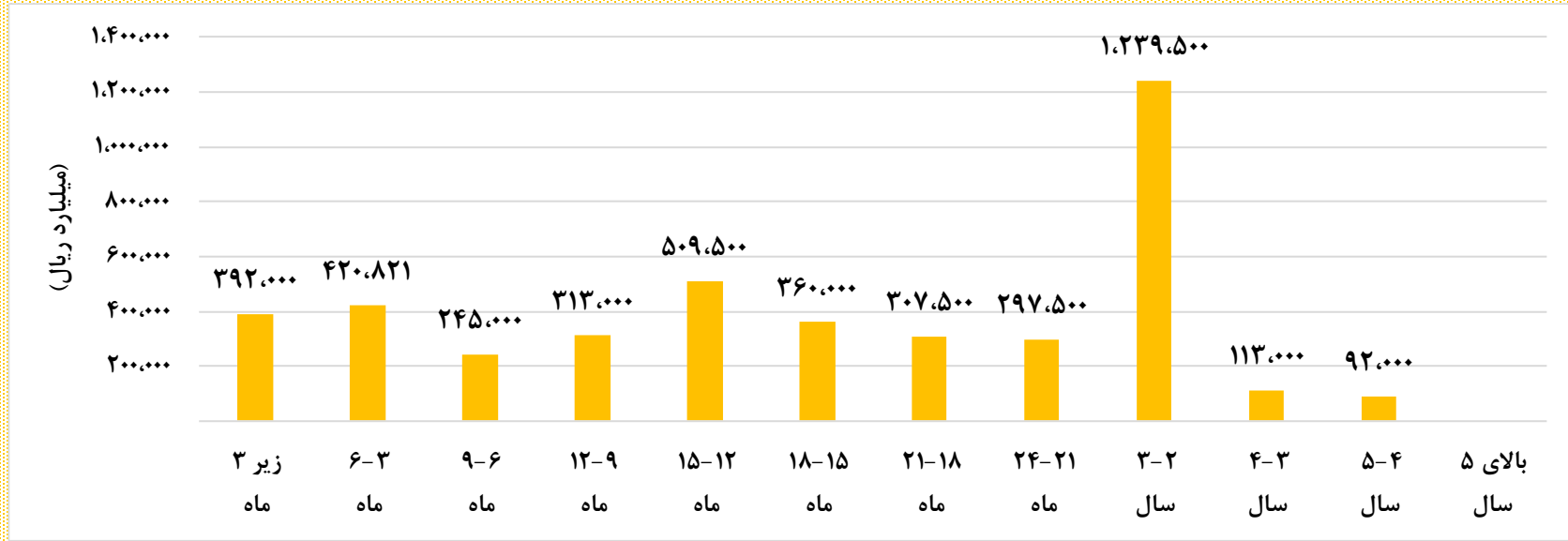
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

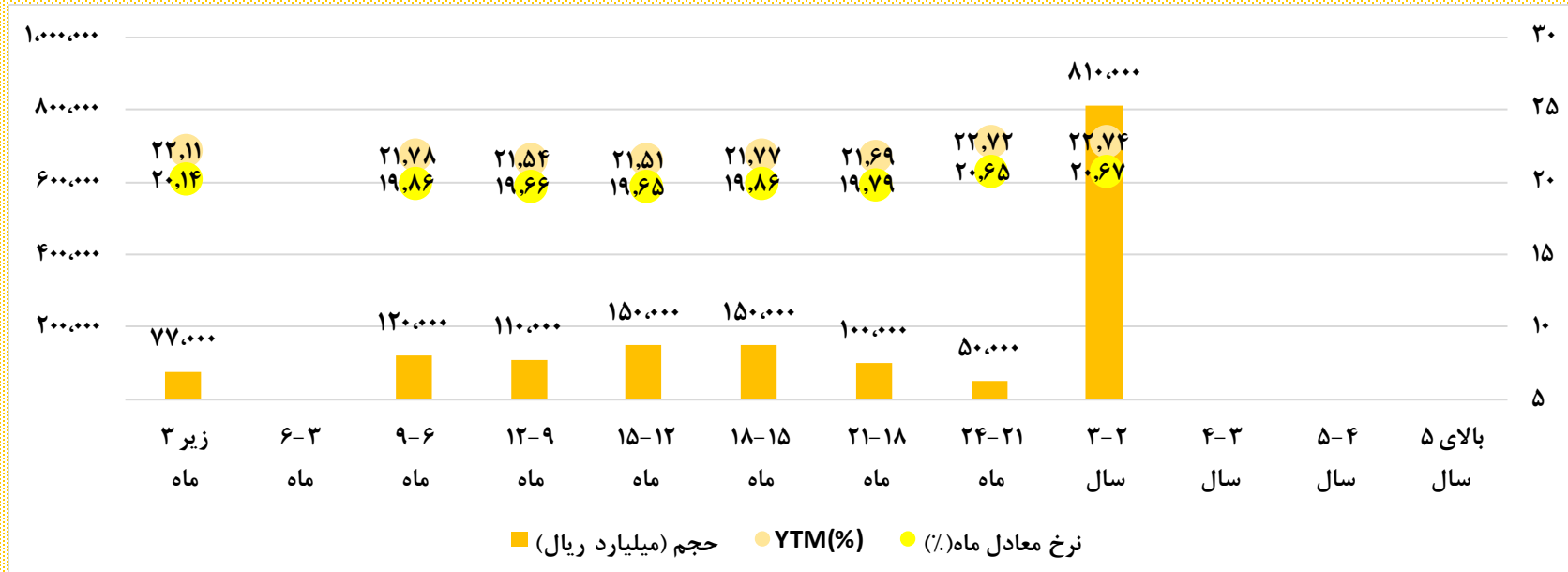


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* 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

٪۲۱.۷۳

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

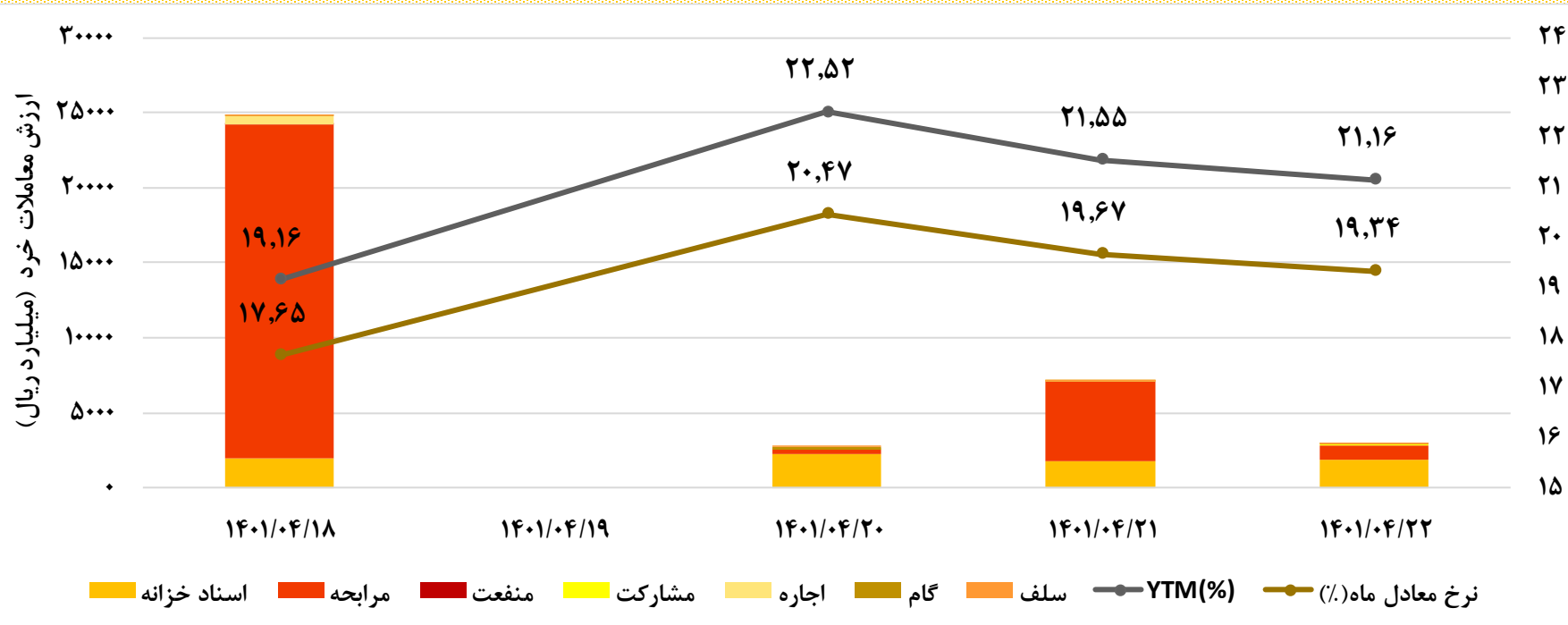
٪۲۲.۶۳

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

٪۱۹.۸۲

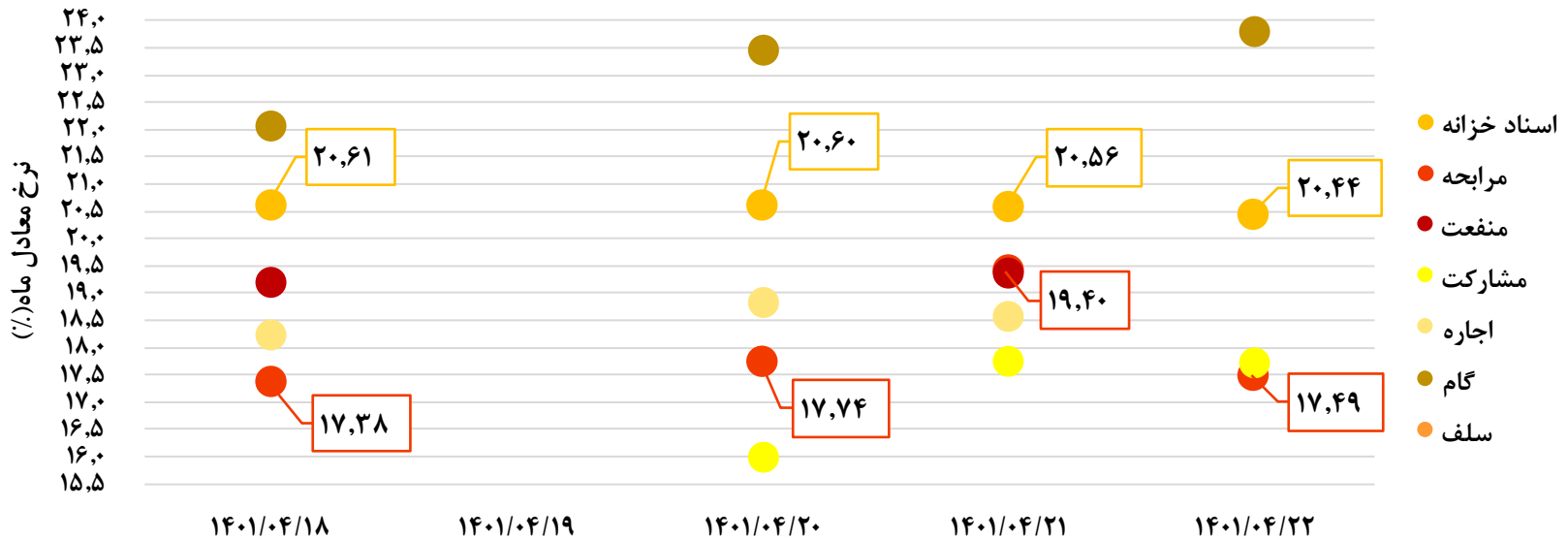
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

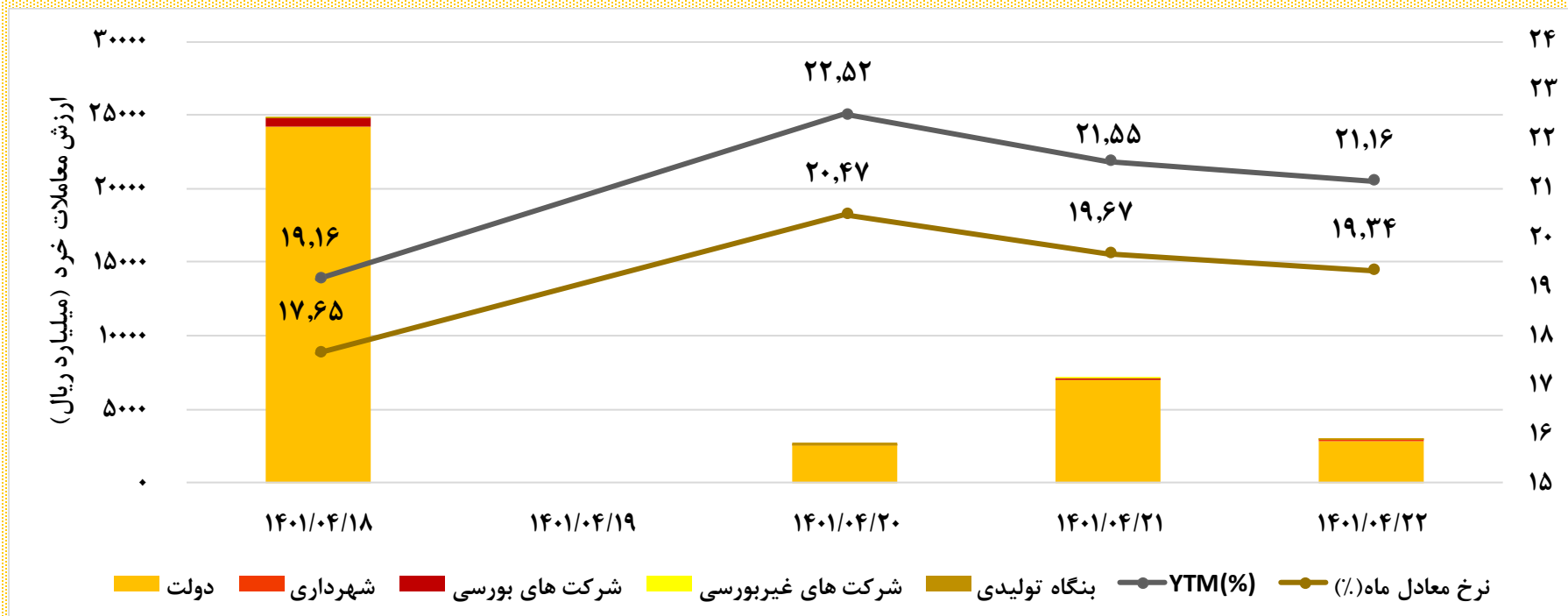
٪۲۰.۵۸



بازدهی معاملات طی هفته

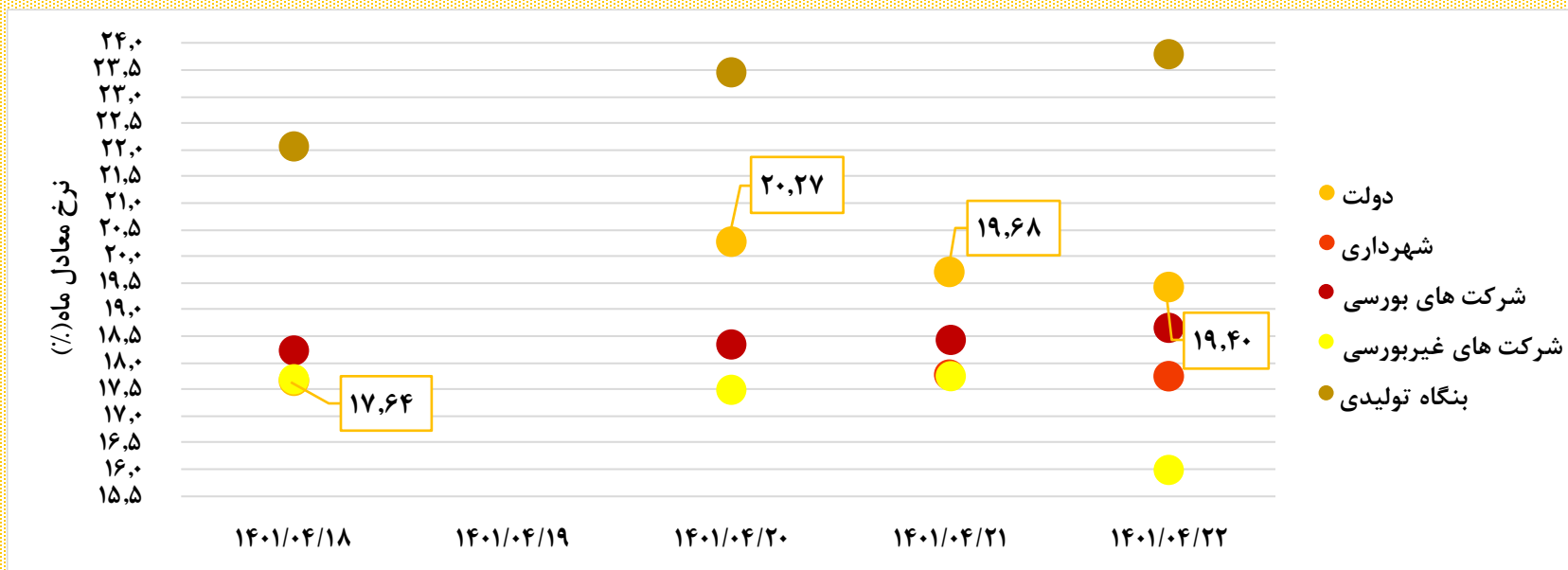
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روزهای معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده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

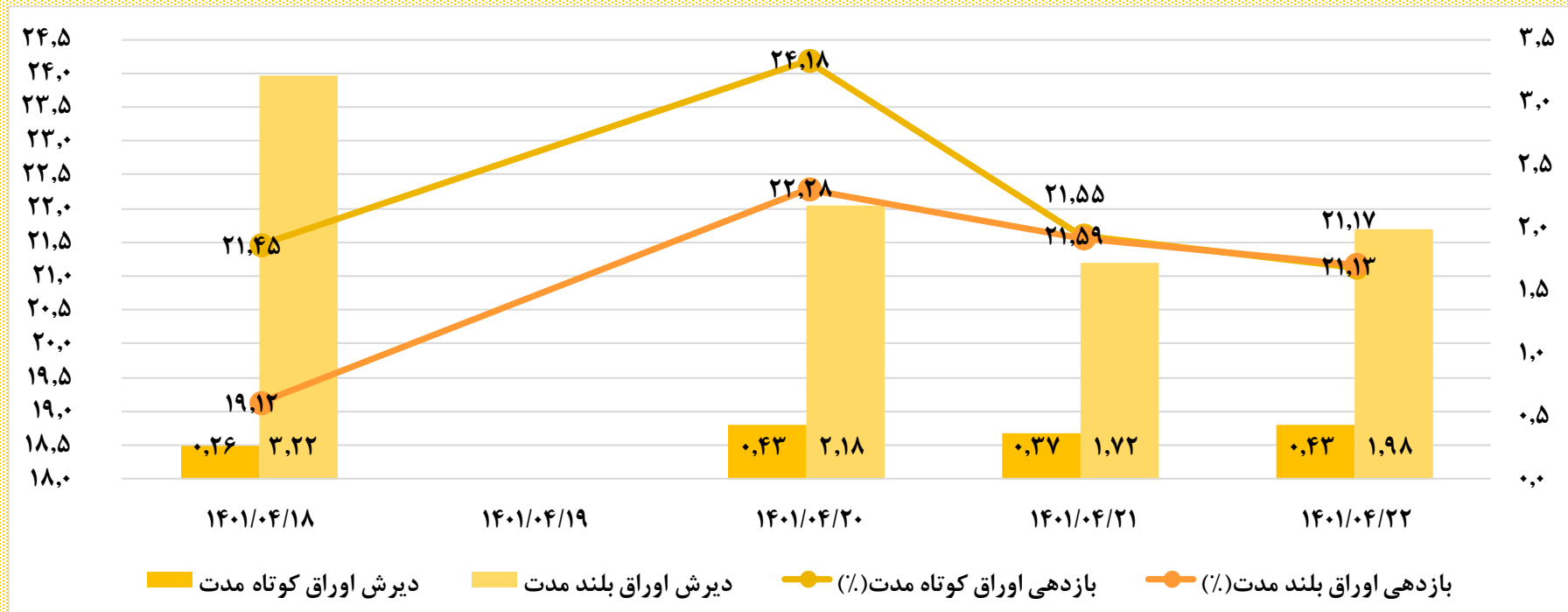




بازدهی معاملات طی هفته

* 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.





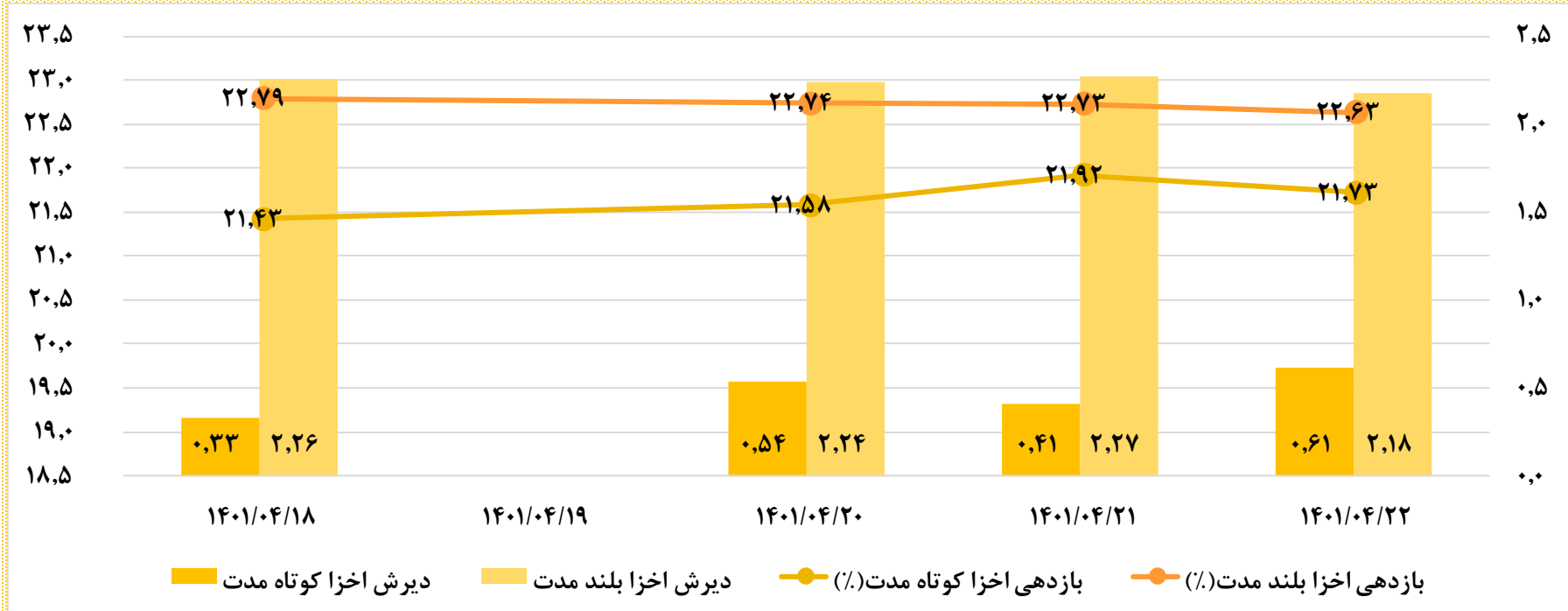
بازدهی معاملات طی هفته

*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	%۲۱.۹۷	%۰.۰۵
بازدهی اوراق بلند مدت	%۱۹.۹۲	-%۰.۶۱
بازدهی کل اوراق	%۲۰.۰۱	-%۰.۵۸
دیرش اوراق کوتاه مدت	۰.۳۸	-۰.۱۷
دیرش اوراق بلند مدت	۲.۷۹	۰.۸۳
دیرش کل اوراق	۲.۶۸	۰.۷۸

بازدهی معاملات طی هفته

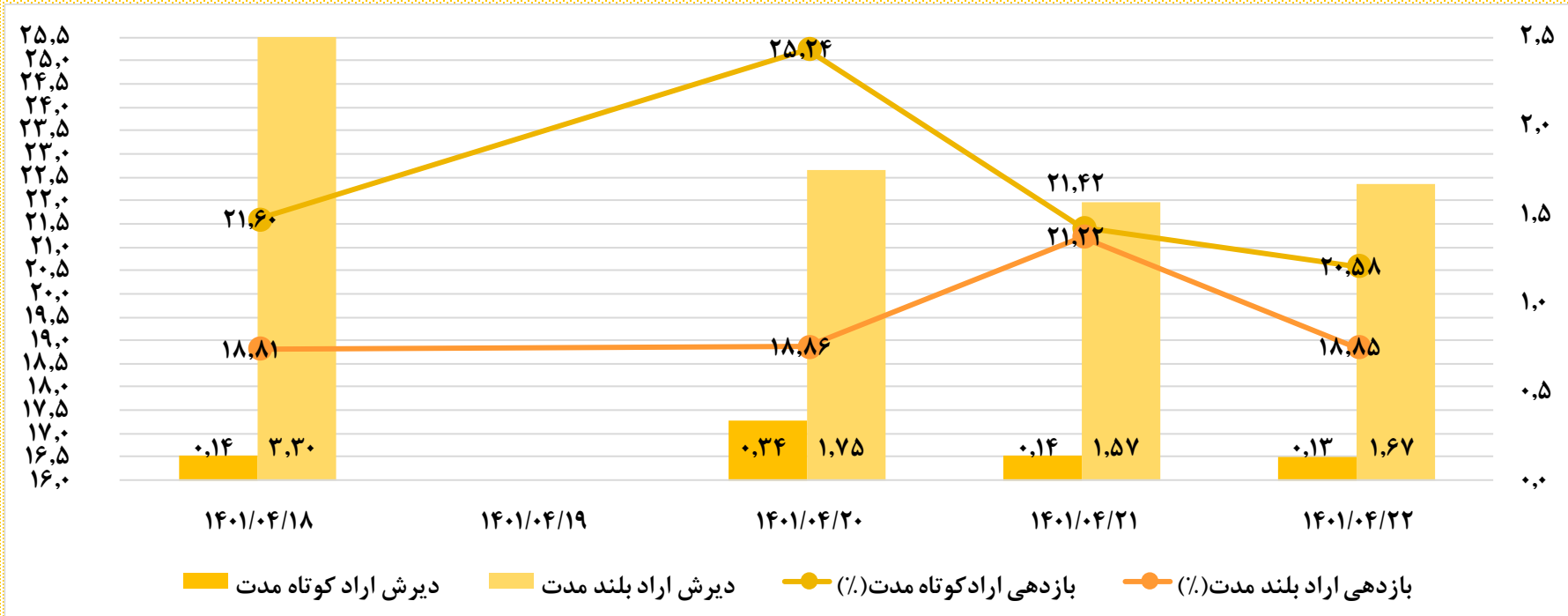


*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

*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		
بازدهی اخزا کوتاه مدت	٪۰.۱۷-	٪۲۱.۷۰
بازدهی اخزا بلند مدت	٪۰.۰۰	٪۲۲.۷۳
بازدهی کل اخزا	٪۰.۰۳	٪۲۲.۶۱
دیرش اخزا کوتاه مدت	۰.۰۹-	۰.۴۹
دیرش اخزا بلند مدت	۰.۰۲	۲.۲۴
دیرش کل اخزا	۰.۱۲	۲.۰۳

بازدهی معاملات طی هفته

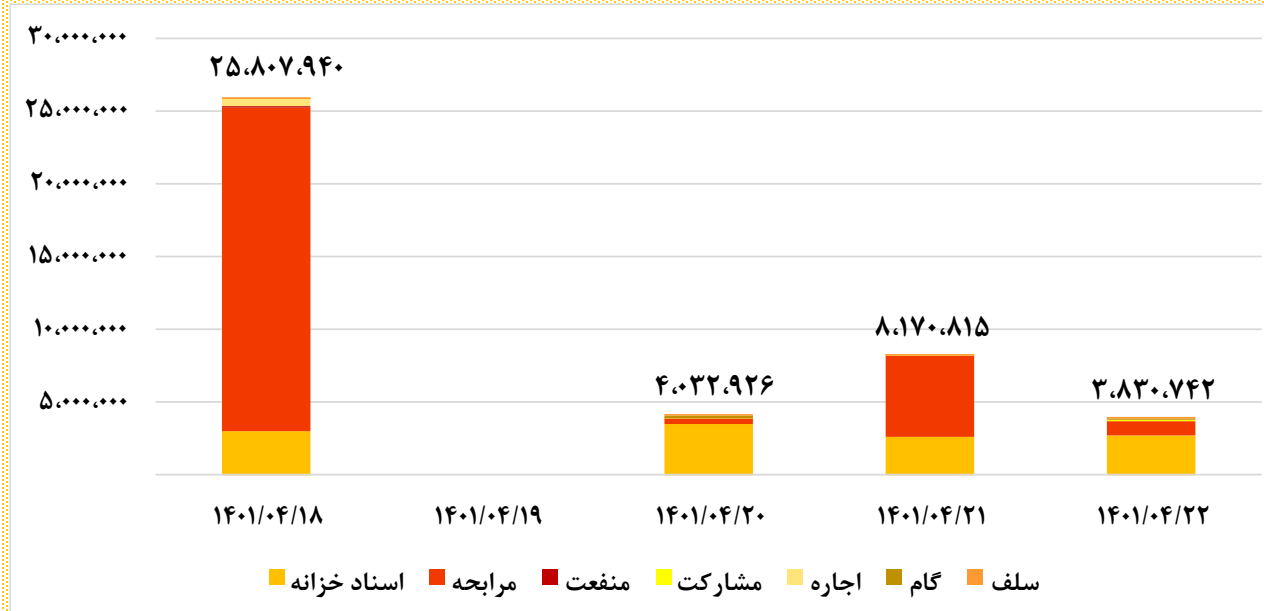


*ریسک نرخ بهره اراد بر مبنای دیرش موزون اراد های معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد.

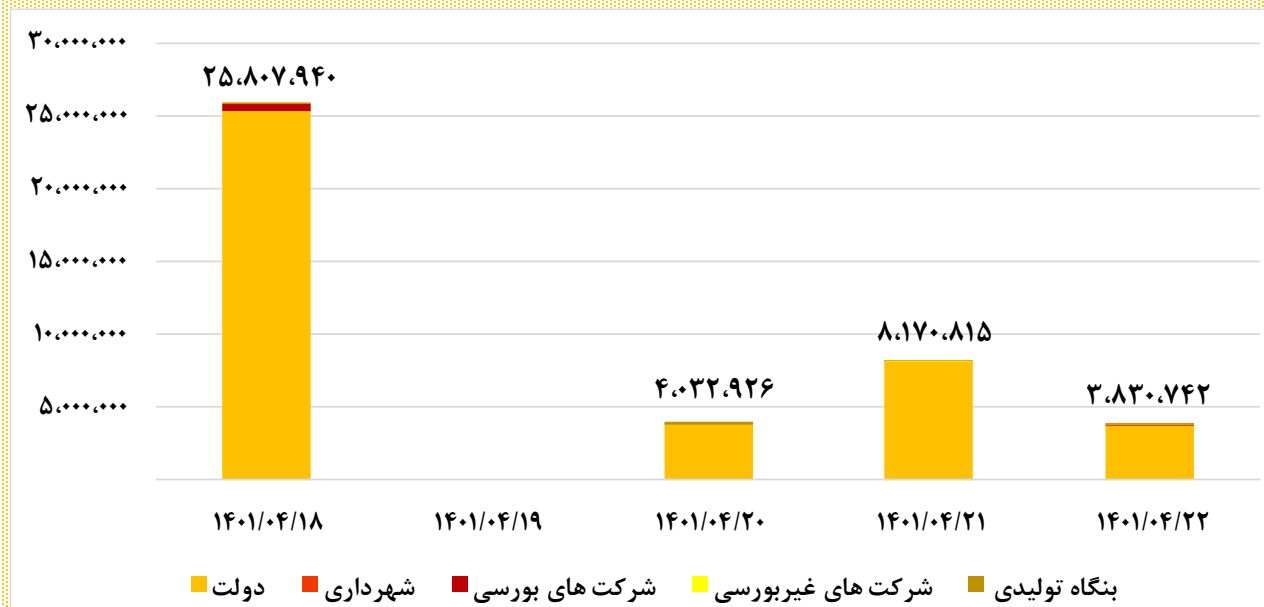
*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
۰.۲۲%	۲۱.۵۷%	بازدهی اراد کوتاه مدت
-۱.۹۵%	۱۹.۲۵%	بازدهی اراد بلند مدت
-۱.۹۳%	۱۹.۲۸%	بازدهی کل اراد
-۰.۳۴	۰.۱۵	دیرش اراد کوتاه مدت
۱.۴۰	۲.۹۲	دیرش اراد بلند مدت
۱.۳۹	۲.۸۸	دیرش کل اراد

براساس نوع اوراق



براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته
(نماد خرد)



ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات	تاریخ
۱۳,۱۲۳	۱۴,۹۰۳,۲۰۳	۱۴۰۱/۰۴/۱۸
-	-	۱۴۰۱/۰۴/۱۹
۲۳۱,۰۲۷	۳۱۳,۵۱۷,۷۳۱	۱۴۰۱/۰۴/۲۰
۱۲,۲۲۴	۱۳,۹۰۳,۸۵۸	۱۴۰۱/۰۴/۲۱
۱۰,۸۳۶	۱۲,۴۵۹,۴۸۱	۱۴۰۱/۰۴/۲۲

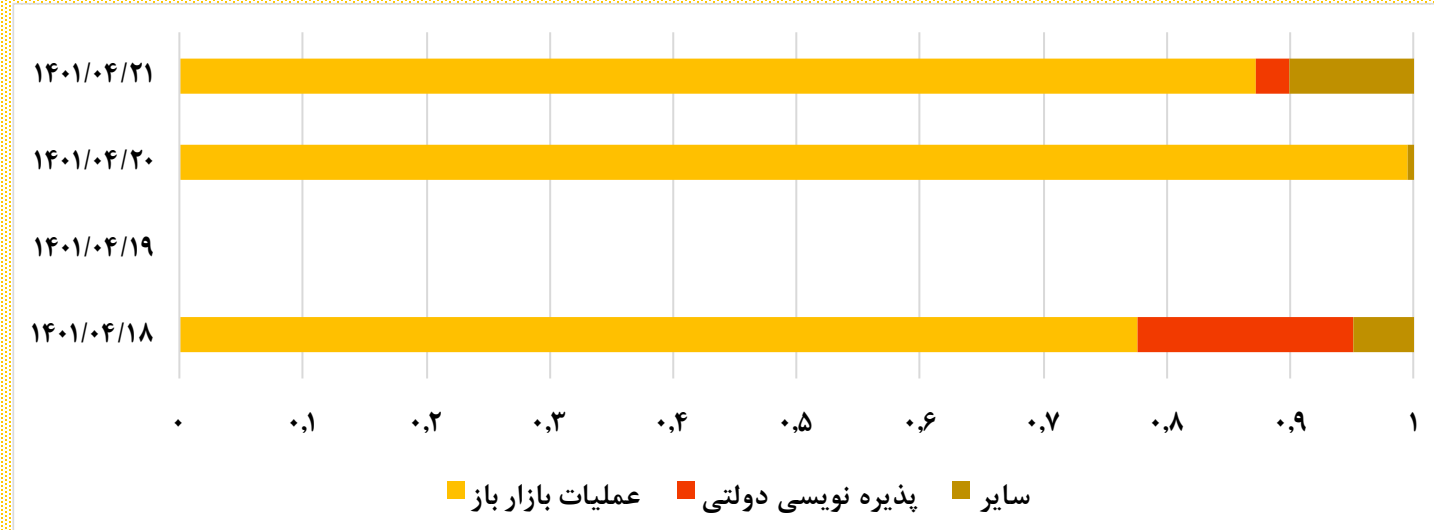
مرابحه عام دولت

ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات	تاریخ
۸۶,۶۲۲	۹۰,۲۴۶,۱۷۳	۱۴۰۱/۰۴/۱۸
-	-	۱۴۰۱/۰۴/۱۹
۱,۰۰۶,۸۲۶	۱,۰۵۴,۹۴۲,۰۵۷	۱۴۰۱/۰۴/۲۰
۱۵۶,۳۱۴	۱۶۱,۶۴۴,۰۴۱	۱۴۰۱/۰۴/۲۱
۱۵۳,۰۰۳	۱۵۸,۵۹۳,۰۵۱	۱۴۰۱/۰۴/۲۲

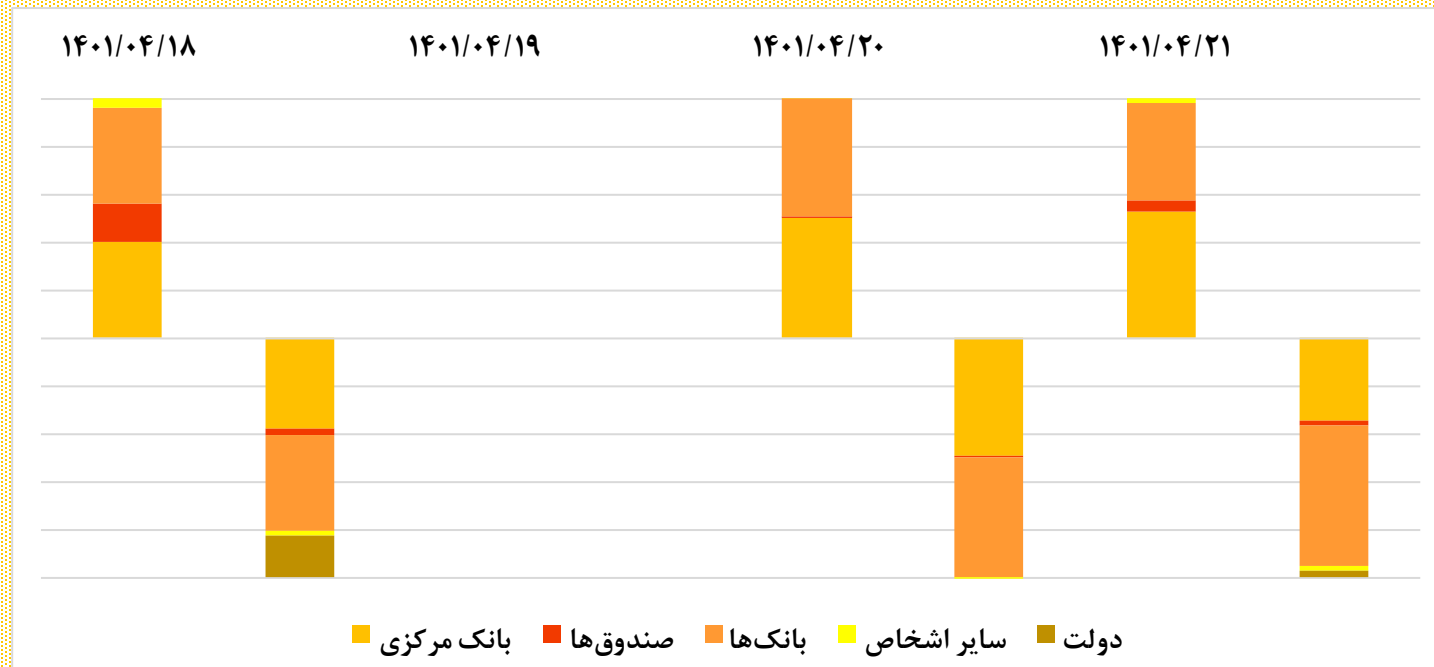
معاملات طی هفته
(نماد عمده)



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

اطلاعات اوراق		ارکان اوراق	
نوع اوراق	مشارکت	بازارگردان	شرکت تامین سرمایه نوین
نام اوراق	مشارکت گچساران - ۳ ماهه ۱۸٪	متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه نوین
نماد معاملاتی	مگچسا۱۰۴	ضامن	شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس و شرکت گروه پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان
نوع بازار	بورس	بانی / ناشر	شرکت پتروشیمی گچساران
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۲,۰۰۰,۰۰۰	نهاد واسط (ناشر)	-
تاریخ انتشار	۱۳۹۶/۰۴/۲۸	بازارگردان	شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس و شرکت گروه پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۴/۲۸	بازارگردان	شرکت تامین سرمایه نوین
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۸ درصد	متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه نوین
مواعد پرداخت سود	هر سه ماه یکبار	ضامن	شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس و شرکت گروه پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان
اجاره	صکوک اجاره سایپا - ۳ ماهه ۱۸٪	بانی / ناشر	شرکت سایپا
صکوک اجاره	صایپا۱۰۴	نهاد واسط (ناشر)	شرکت واسط مالی اسفند یکم
بورس	بورس	بازارگردان	شرکت تامین سرمایه نوین
۳,۹۰۰,۰۰۰	۲,۰۰۰,۰۰۰	ضامن	شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس و شرکت گروه پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان
۱۳۹۷/۰۴/۳۰	۱۳۹۶/۰۴/۲۸	بانی / ناشر	شرکت پتروشیمی گچساران
۱۴۰۱/۰۴/۳۰	۱۴۰۱/۰۴/۲۸	نهاد واسط (ناشر)	-
سالانه ۱۸ درصد	سالانه ۱۸ درصد	بازارگردان	شرکت تامین سرمایه نوین
هر سه ماه یکبار	هر سه ماه یکبار	متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه نوین
شرکت سایپا	شرکت پتروشیمی گچساران	ضامن	شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس و شرکت گروه پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان
شرکت واسط مالی اسفند یکم	-	بانی / ناشر	شرکت پتروشیمی گچساران
بانک ملت	شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس و شرکت گروه پتروشیمی سرمایه گذاری ایرانیان	بازارگردان	شرکت تامین سرمایه نوین
شرکت تامین سرمایه نوین	شرکت تامین سرمایه نوین	متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه نوین

اوراق منتشر شده
و
سررسید شده هفته آتی



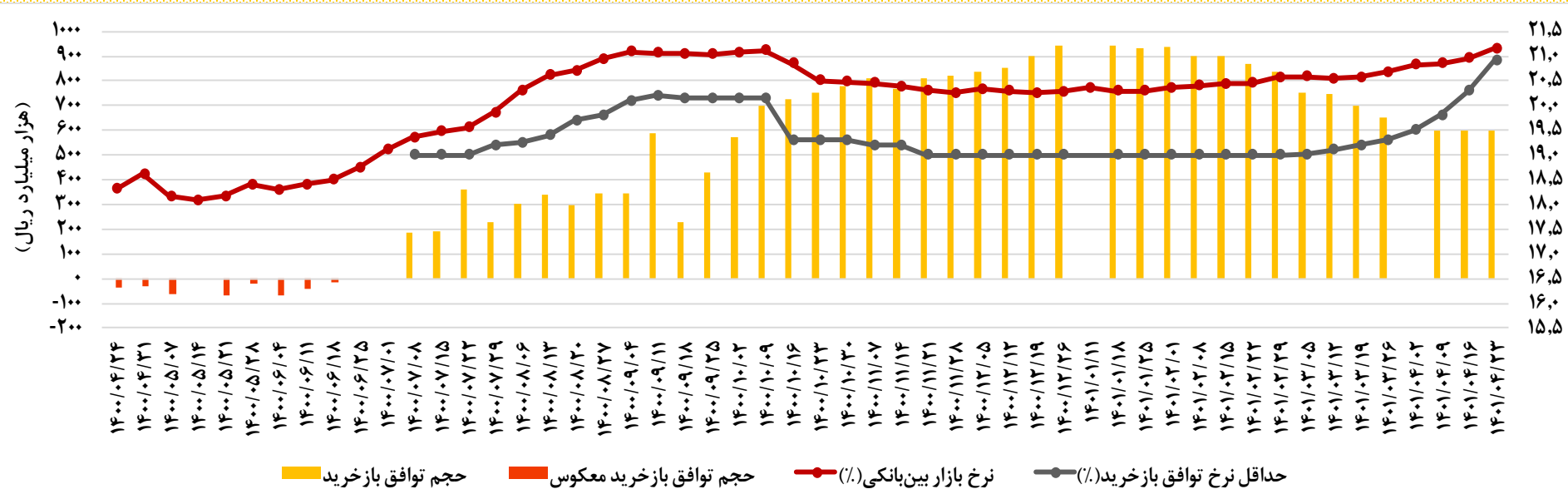
یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۴/۲۳

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)
۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۵۹۸.۹	-	۶۴۱.۹	-۴۳
۱۴۰۱/۰۴/۱۳	۵۹۹	-	۶۰۱.۲	-۲.۲
۱۴۰۱/۰۴/۲۰	۵۹۹	-	۶۰۱.۳	-۲.۳
جمع	۱۷۹۶.۹	-	۱۸۴۴.۴	-۴۷.۵

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی	
۲۰.۹۲	۱۴۰۱/۰۴/۱۸
تعطیل	۱۴۰۱/۰۴/۱۹
۲۱.۰۹	۱۴۰۱/۰۴/۲۰
۲۱.۱۱	۱۴۰۱/۰۴/۲۱
۲۱.۴۹	۱۴۰۱/۰۴/۲۲





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.ataashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz