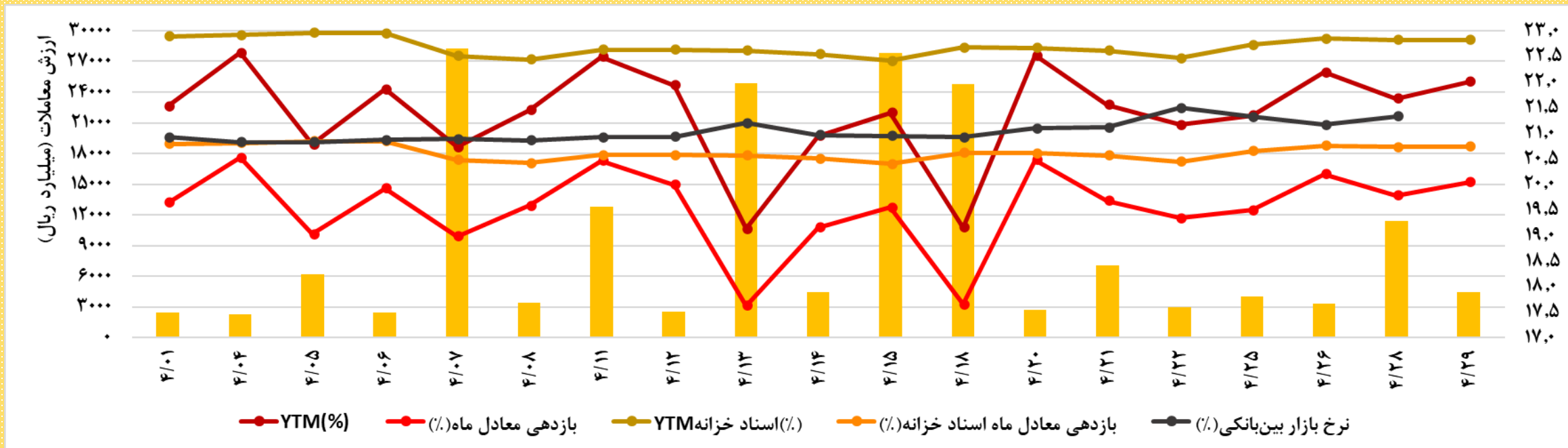


# گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۳۰ تیر ۱۴۰۱  
به انضمام نگاهی کلی بر تیرماه



\* 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

٪۲۲.۷۰

خرداد ماه: ٪۲۲.۵۷

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه

٪۲۰.۶۳

خرداد ماه: ٪۲۰.۵۳

میانگین YTM

٪۲۰.۷۲

خرداد ماه: ٪۲۱.۴۰

میانگین بازدهی معادل ماه

٪۱۸.۹۷

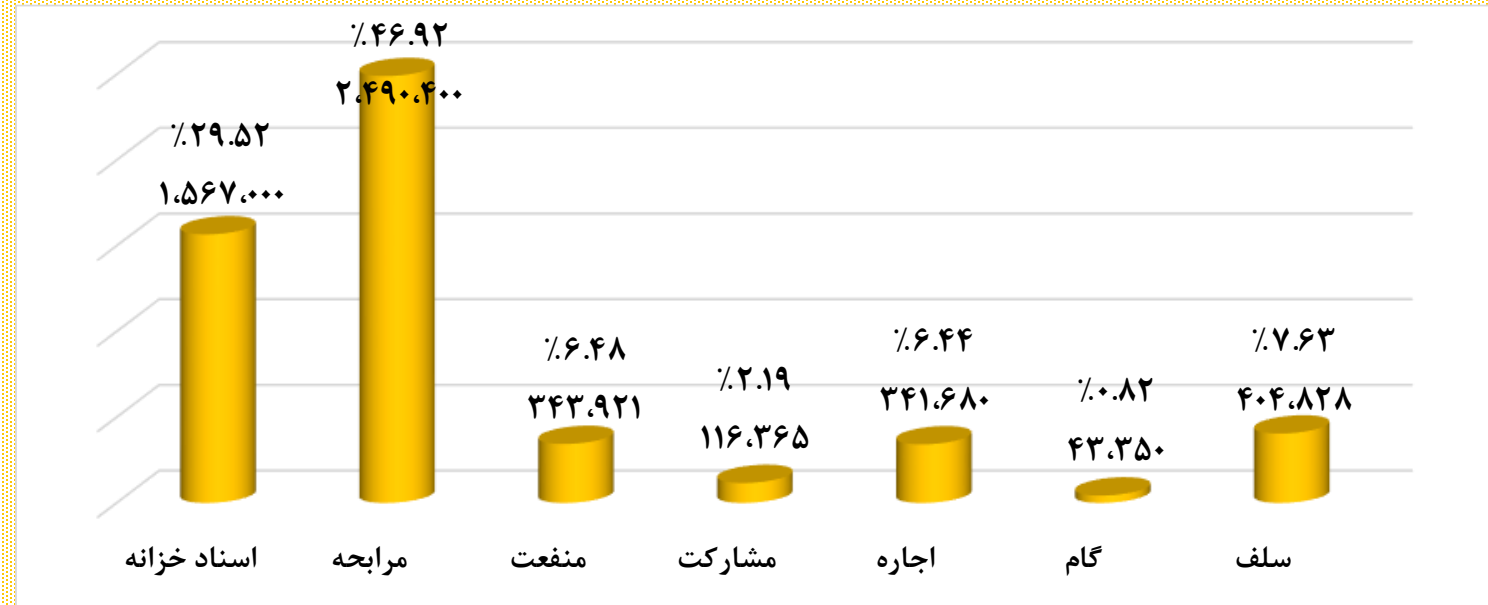
خرداد ماه: ٪۱۹.۵۴

میانگین نرخ بازار بین بانکی

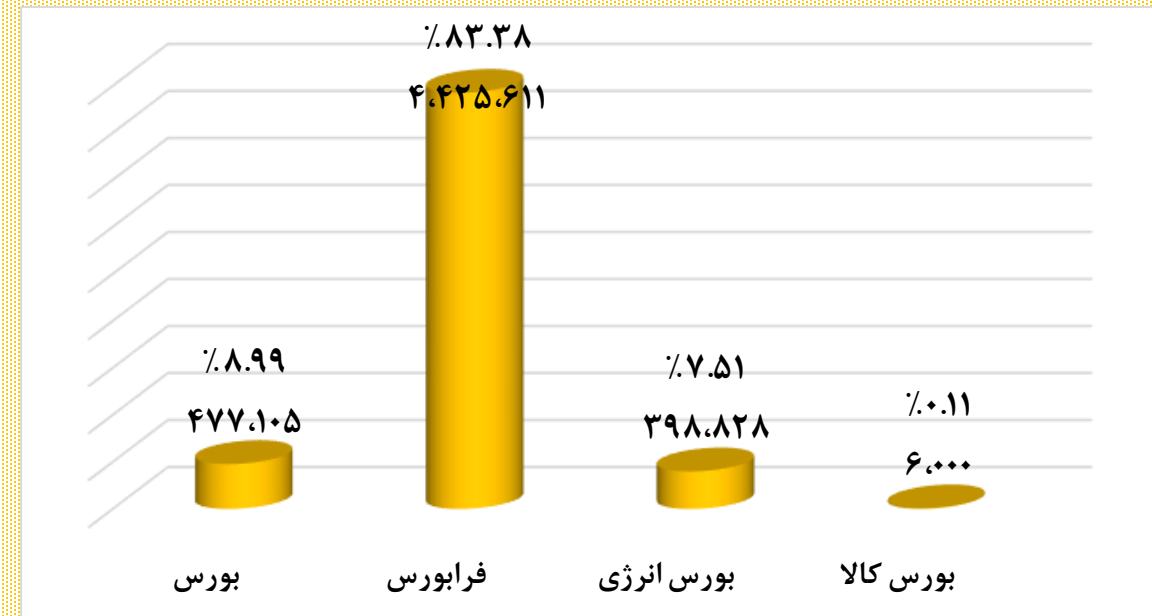
٪۲۱.۰۳

خرداد ماه: ٪۲۰.۶۴

## براساس نوع اوراق



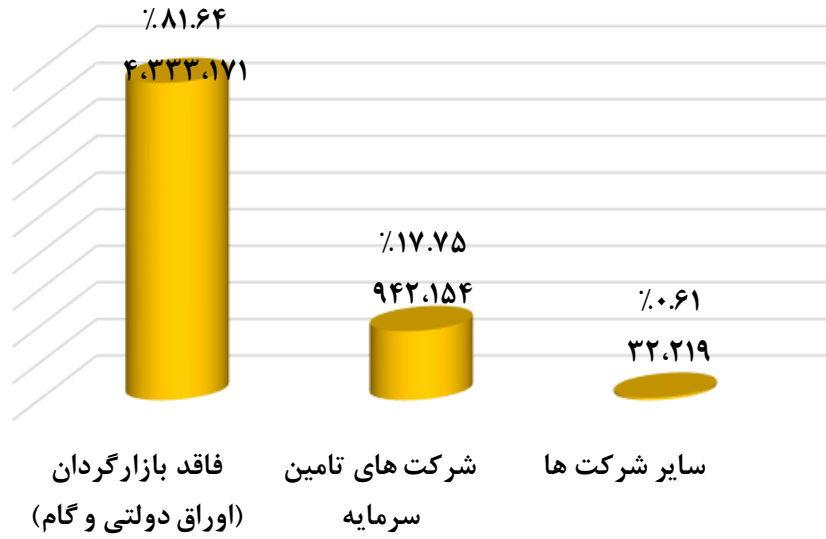
## براساس نوع بازار



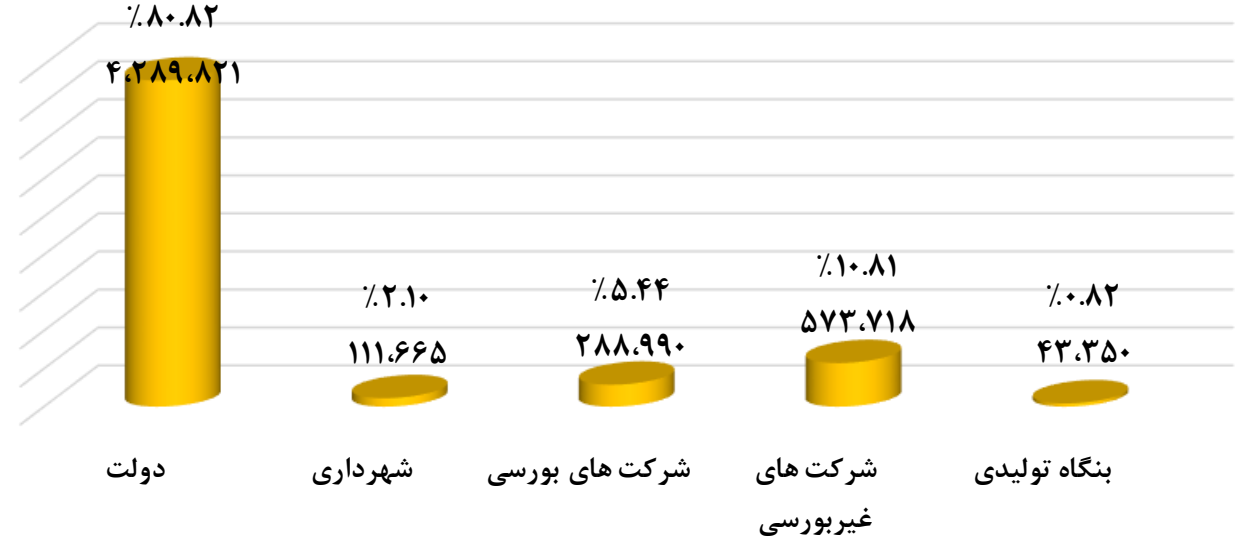
حجم اوراق موجود  
بر مبنای قیمت سررسید  
(ارقام به میلیارد ریال)



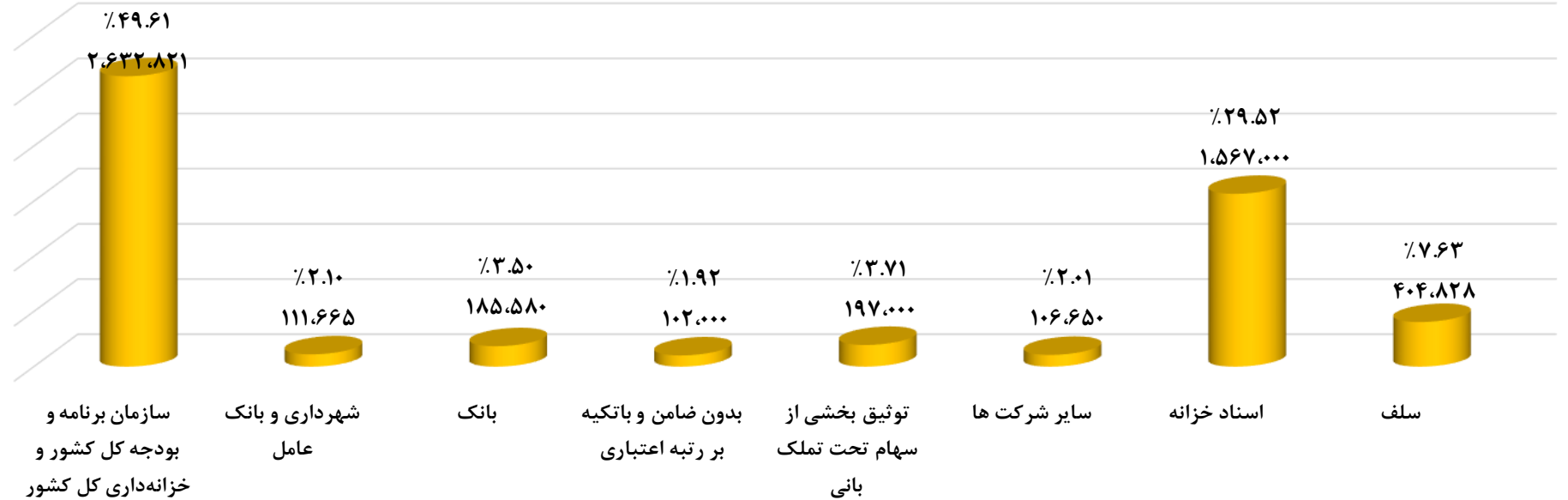
## براساس نوع بازارگردان



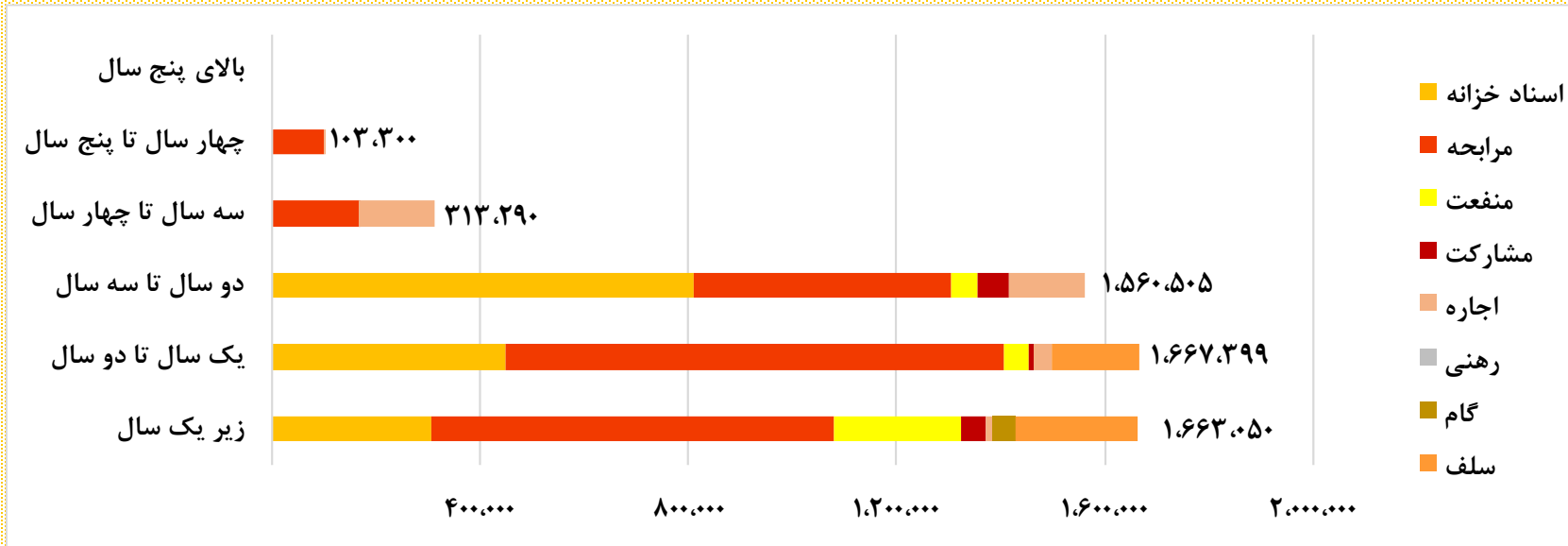
## براساس نوع بانی



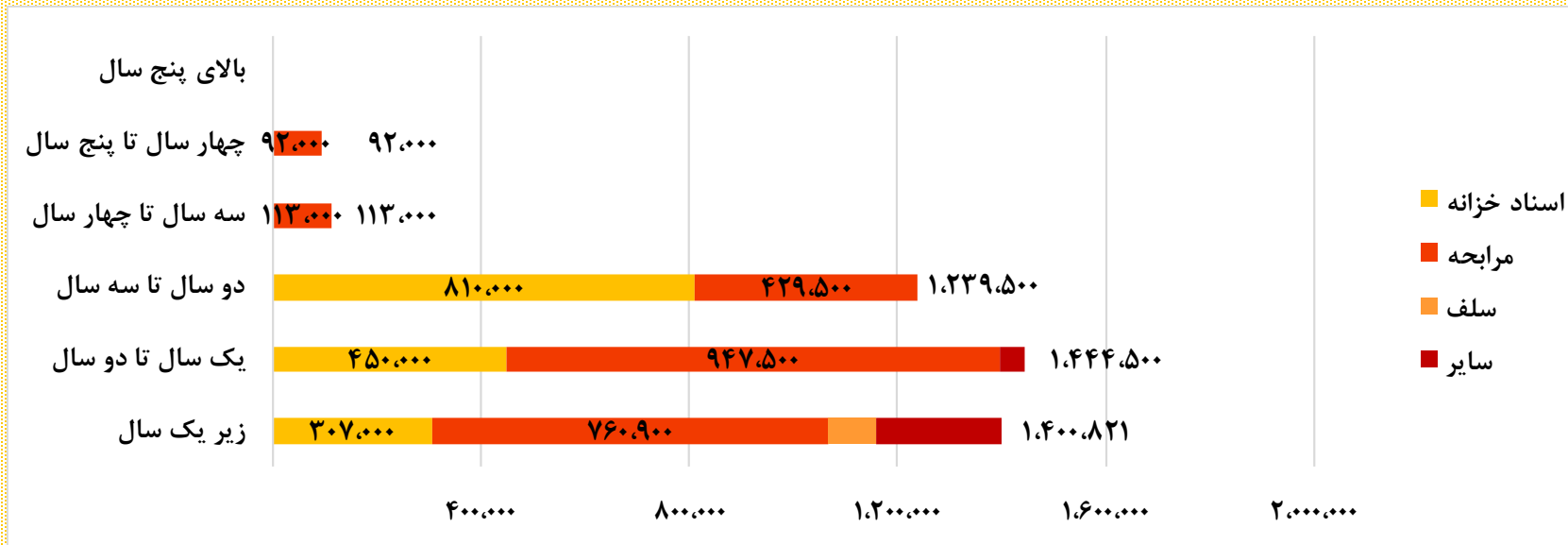
## براساس نوع ضامن



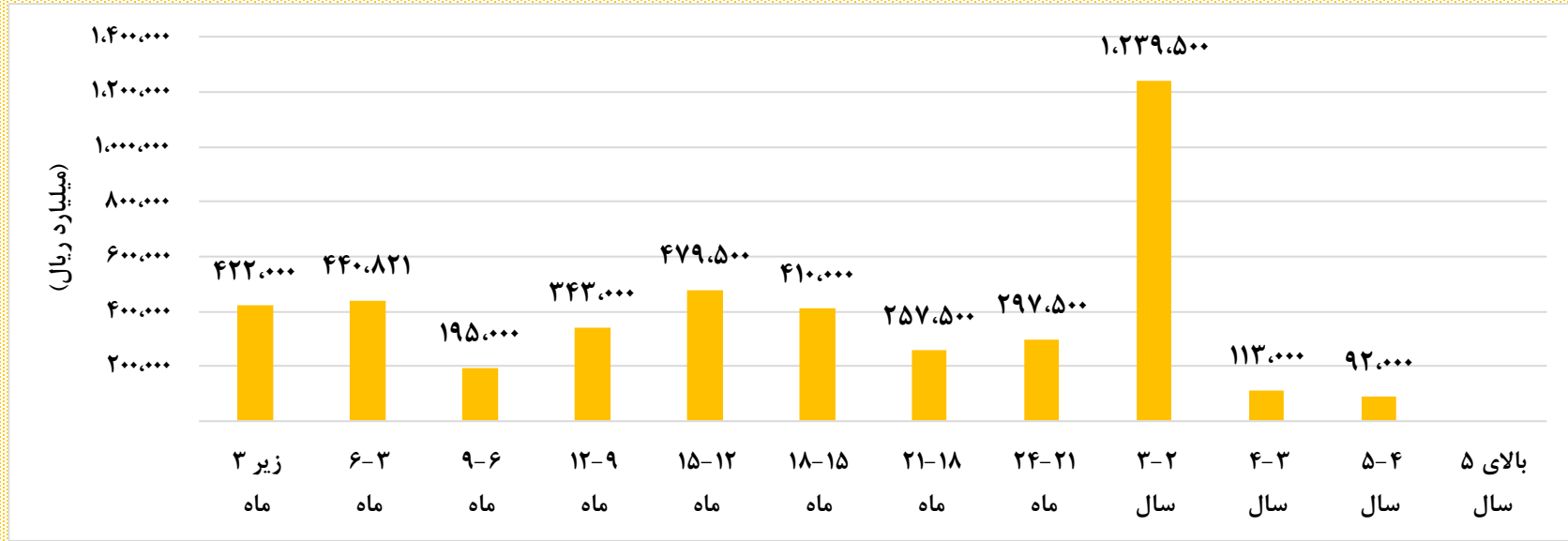
## براساس زمان تا سررسید



## حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

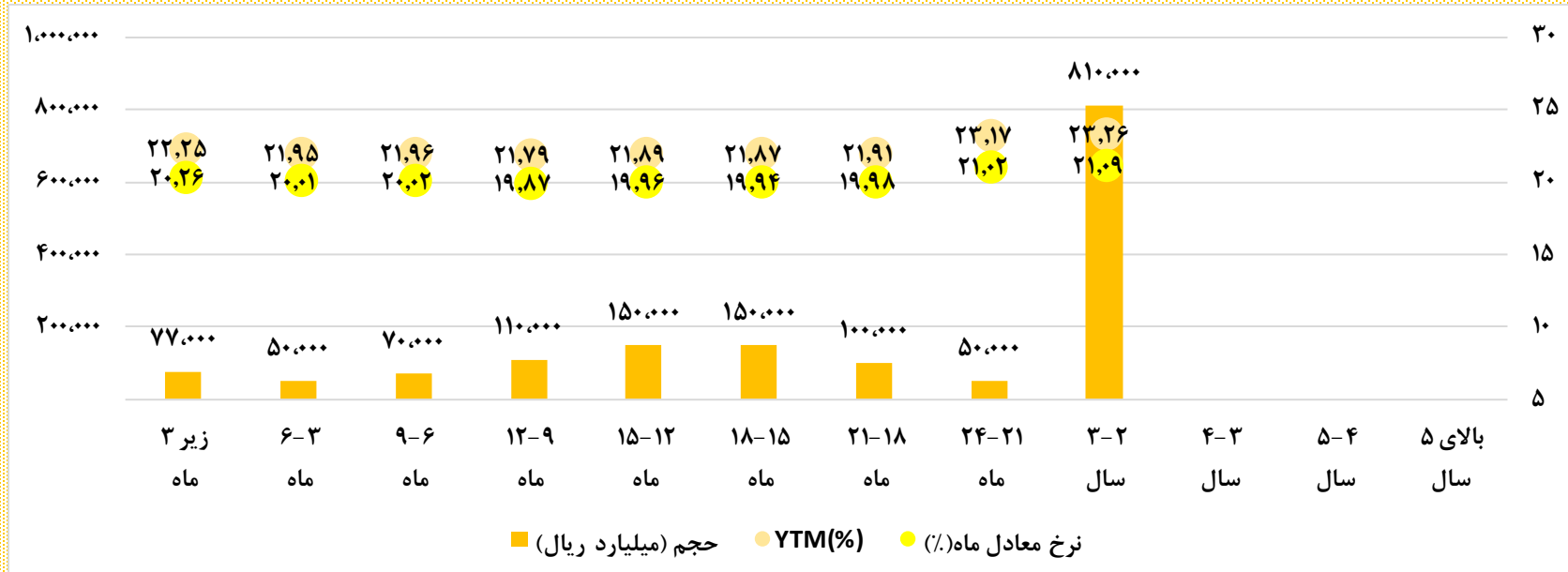


## حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



\* 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

٪۲۲.۰۲

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

٪۲۲.۹۶

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

٪۲۰.۰۷

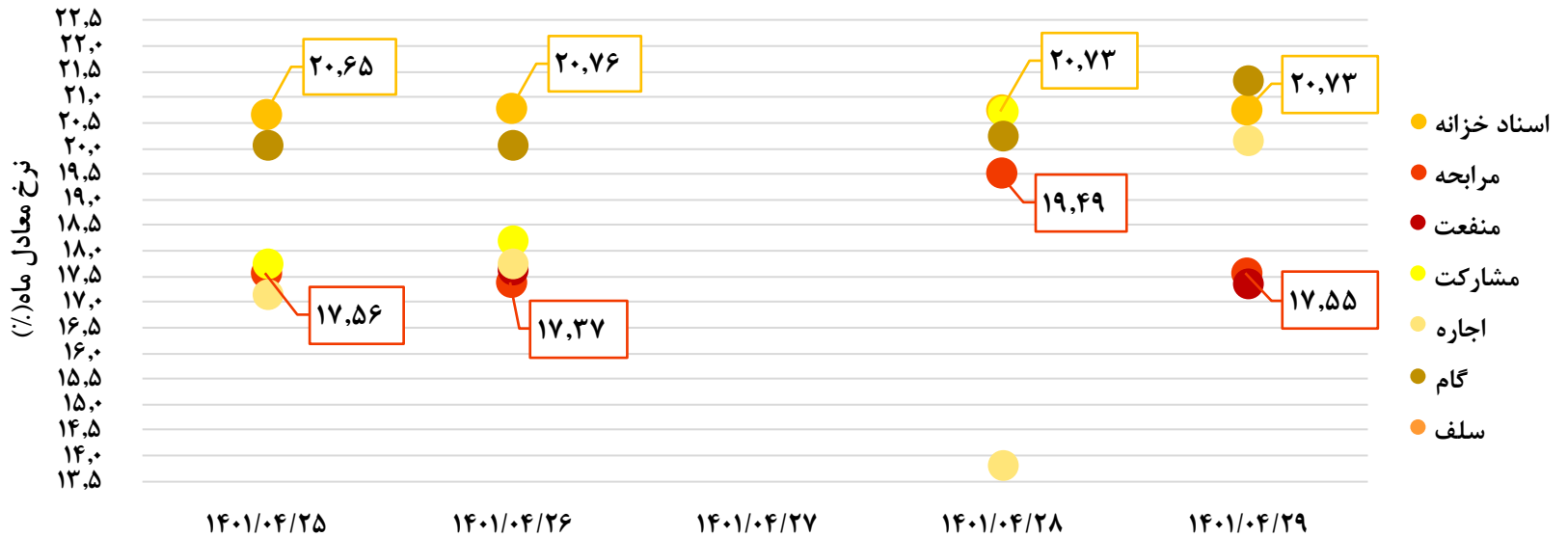
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

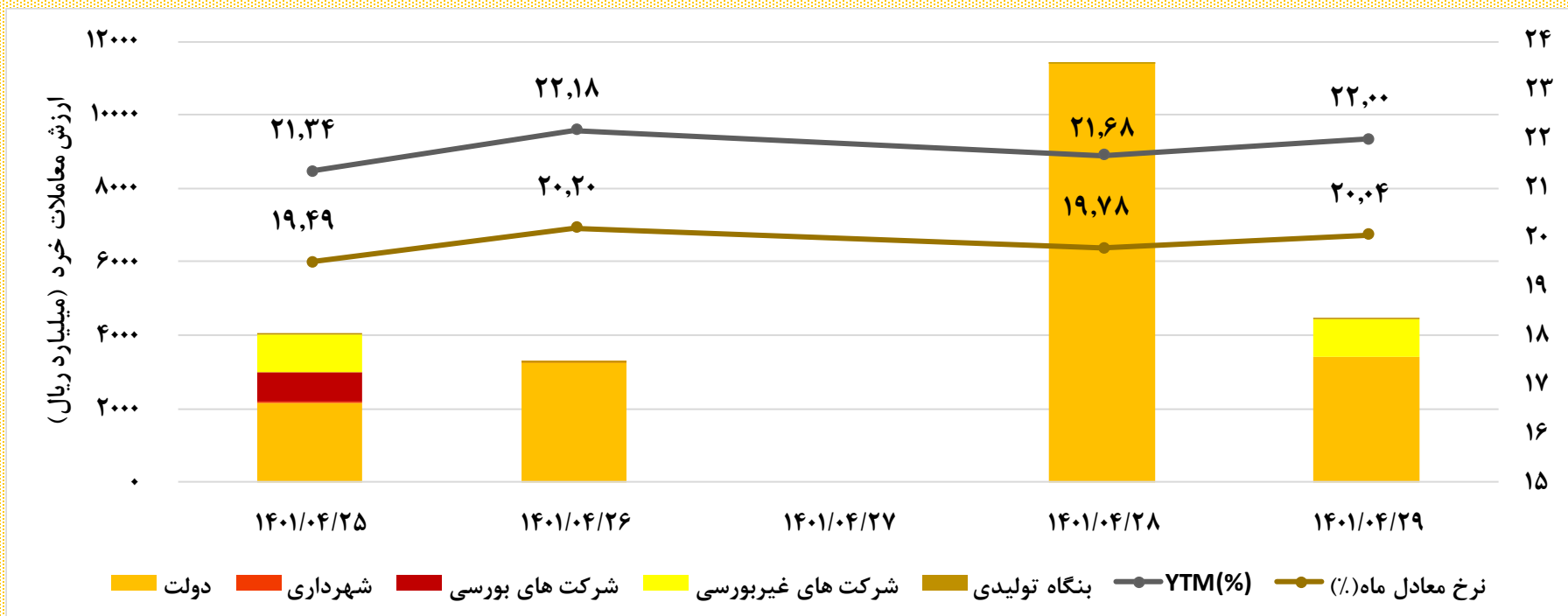
٪۲۰.۸۴



بازدهی معاملات طی هفته

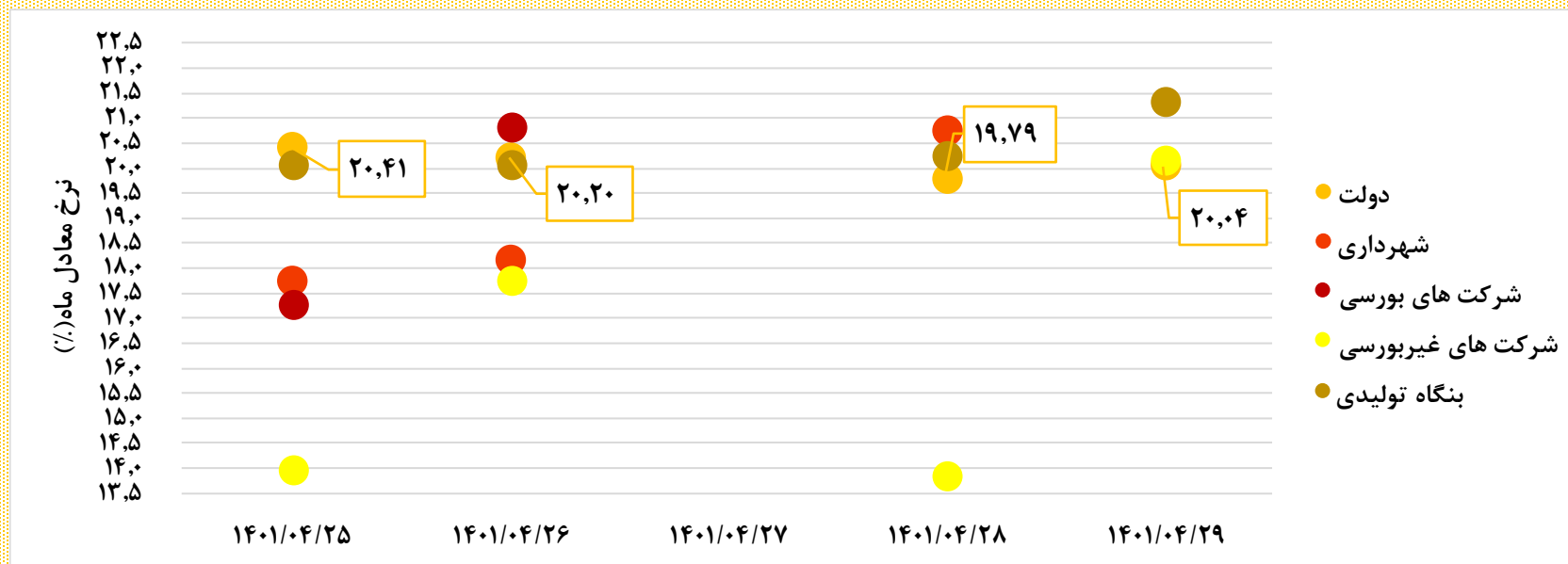
\* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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



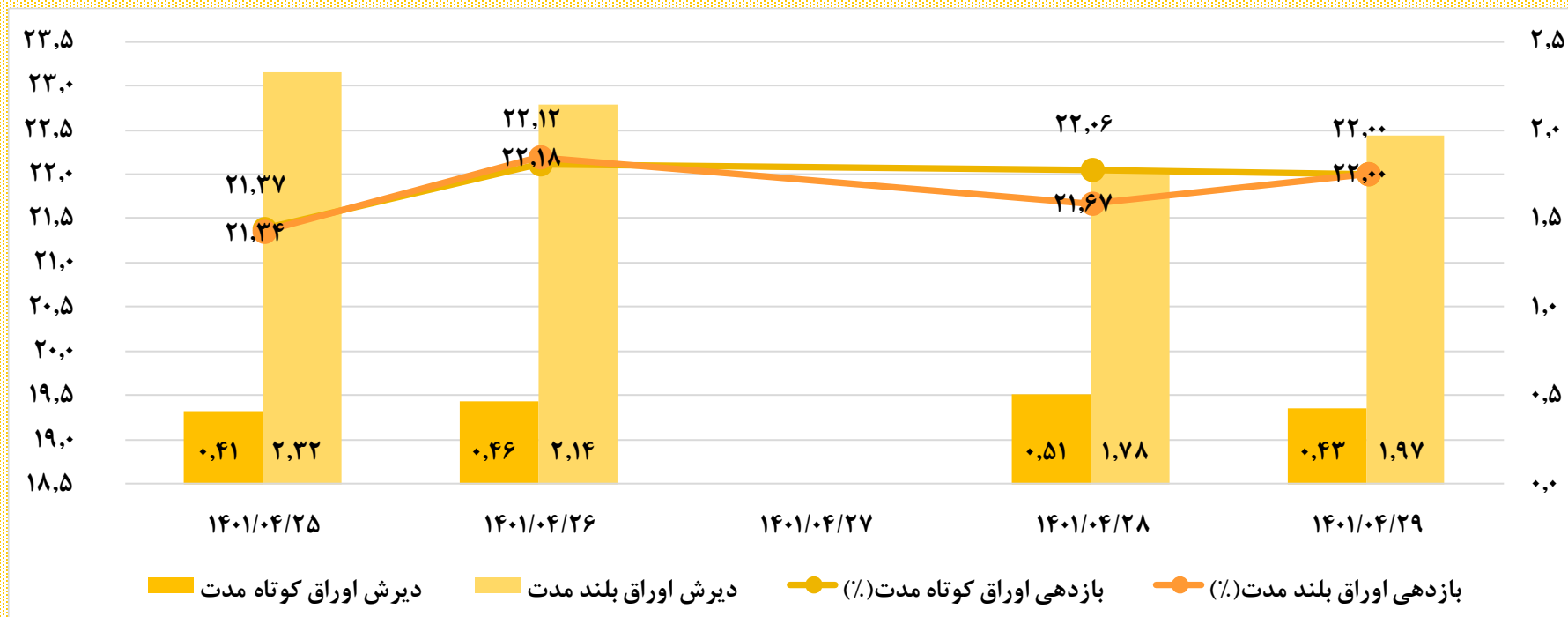


### بازدهى معاملات طى هفته

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







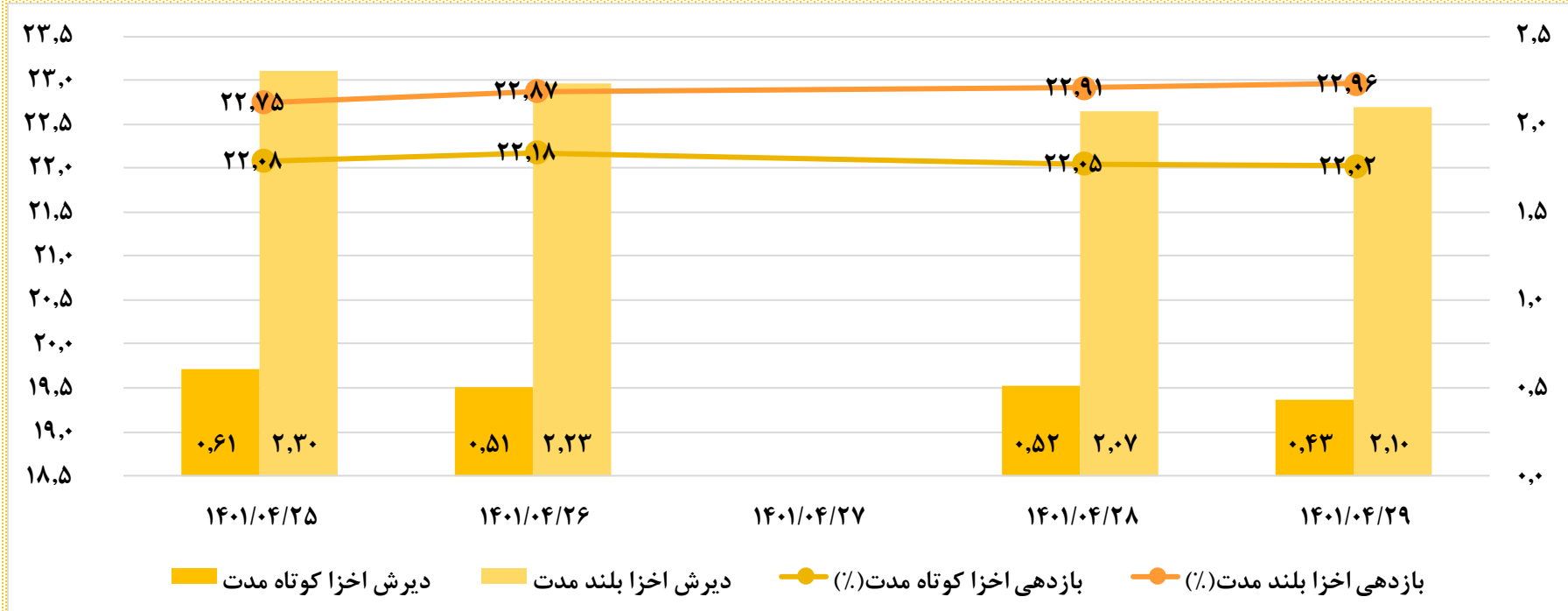
بازدهی معاملات طی هفته

\*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	%۲۱.۹۶	-%۰.۰۱
بازدهی اوراق بلند مدت	%۲۱.۷۵	%۱.۸۳
بازدهی کل اوراق	%۲۱.۷۶	%۱.۷۵
دیرش اوراق کوتاه مدت	۰.۴۶	۰.۰۸
دیرش اوراق بلند مدت	۱.۹۴	-۰.۸۴
دیرش کل اوراق	۱.۸۷	-۰.۸۱

بازدهی معاملات طی هفته

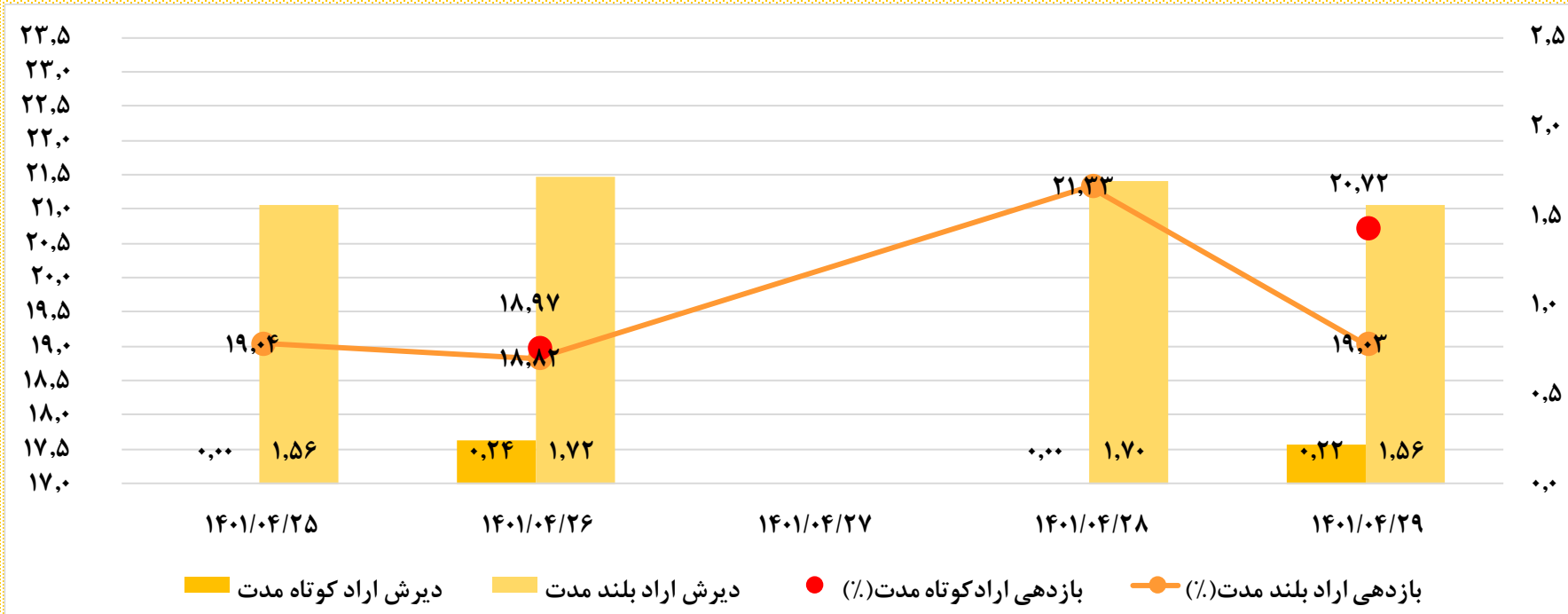


\*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

\*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		
۰.۳۵%	۲۲.۰۵%	بازدهی اخزا کوتاه مدت
۰.۱۵%	۲۲.۸۸%	بازدهی اخزا بلند مدت
۰.۲۰%	۲۲.۸۱%	بازدهی کل اخزا
-۰.۰۱	۰.۴۸	دیرش اخزا کوتاه مدت
-۰.۰۶	۲.۱۷	دیرش اخزا بلند مدت
۰.۰۰	۲.۰۳	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.

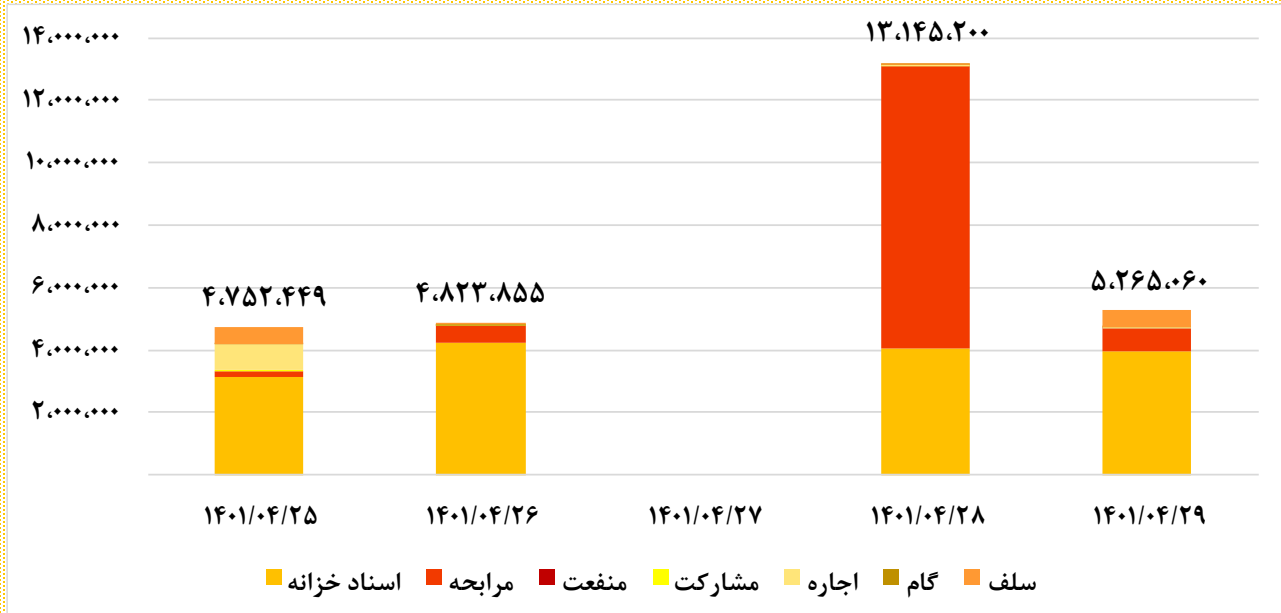
\*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
۱.۴۷٪-	۲۰.۱۰٪	بازدهی اراد کوتاه مدت
۱.۷۴٪	۲۱.۰۰٪	بازدهی اراد بلند مدت
	۲۱.۰۰٪	بازدهی کل اراد
۰.۰۸	۰.۲۳	دیرش اراد کوتاه مدت
۱.۲۳-	۱.۶۸	دیرش اراد بلند مدت
۱.۲۰-	۱.۶۸	دیرش کل اراد

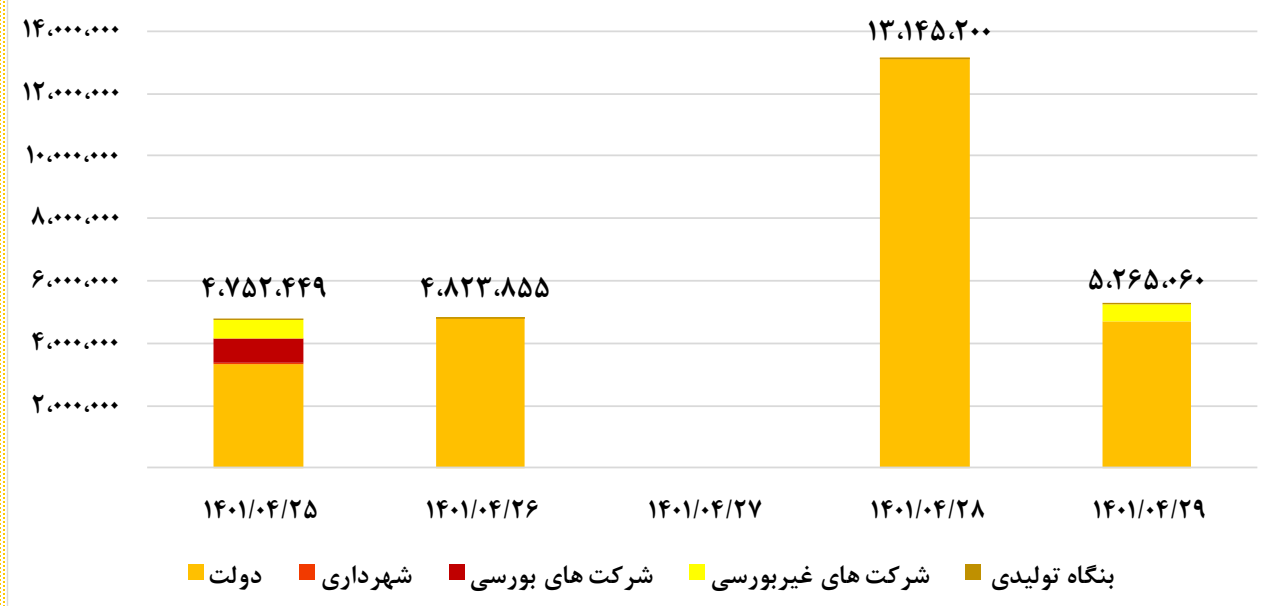
حجم معاملات طی هفته  
(نماد خرد)



## براساس نوع اوراق



## براساس نوع بانی



تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۴/۲۵	۷,۹۸۲,۲۸۲	۵,۹۶۶
۱۴۰۱/۰۴/۲۶	۳۰۸,۴۷۹,۵۵۹	۲۲۳,۲۷۷
۱۴۰۱/۰۴/۲۷	-	-
۱۴۰۱/۰۴/۲۸	۲,۲۴۱,۴۶۸	۱,۶۳۸
۱۴۰۱/۰۴/۲۹	۱۱۳,۲۱۵	۹۷

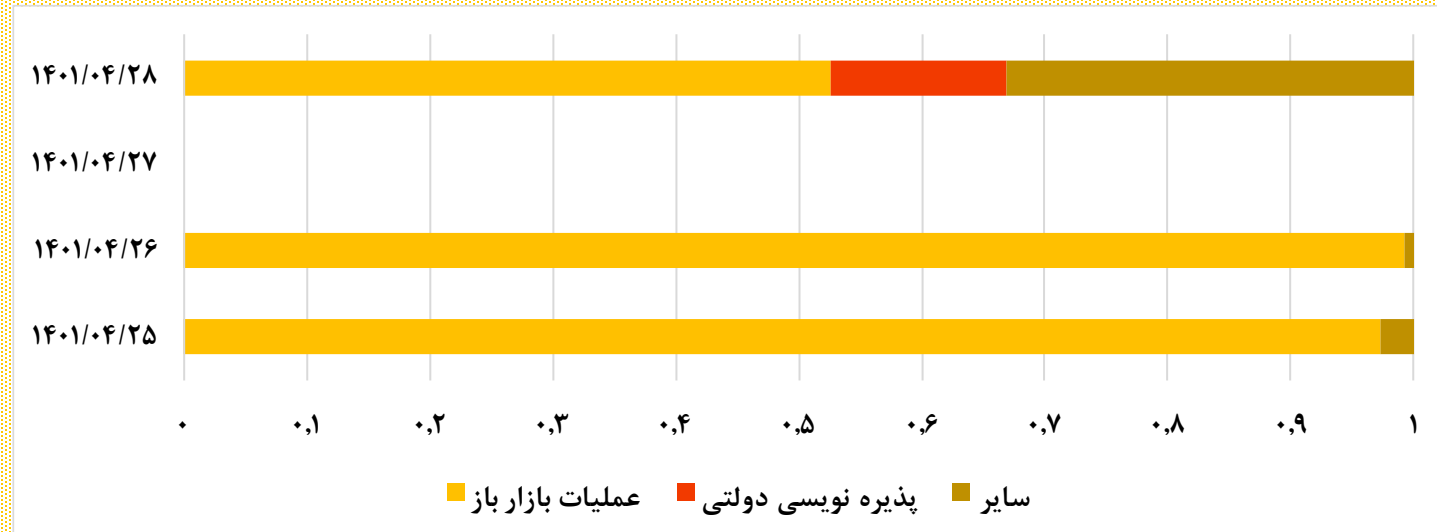
مرابحه عام دولت

تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۴/۲۵	۱۷۱,۴۹۳,۵۶۵	۱۶۴,۳۴۰
۱۴۰۱/۰۴/۲۶	۱,۰۷۸,۲۳۳,۹۶۸	۱,۰۲۷,۰۵۳
۱۴۰۱/۰۴/۲۷	-	-
۱۴۰۱/۰۴/۲۸	۴۶,۳۲۳,۵۴۵	۴۴,۵۵۷
۱۴۰۱/۰۴/۲۹	۴۴,۶۰۴,۸۵۳	۴۱,۶۲۷

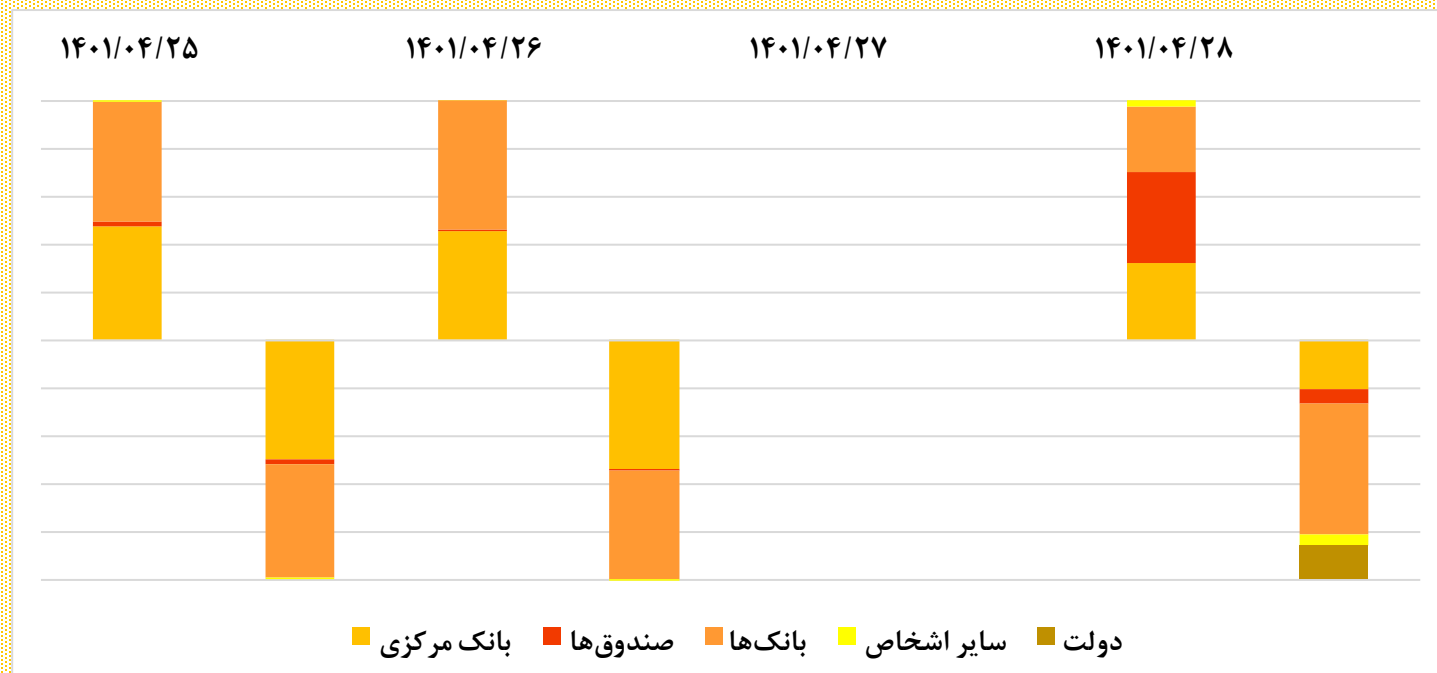
معاملات طی هفته  
(نماد عمده)



## 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	
نوع اوراق	اسناد خزانه اسلامی
نام اوراق	اسناد خزانه-م ۱۶ بودجه ۹۸-۰۳/۰۵/۰۱
نماد معاملاتی	اخزا۸۱۶
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۲۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۳۹۸/۰۵/۰۳
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۵/۰۳
نرخ سود اسمی	-
مواعد پرداخت سود	فاقد 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



یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۴/۳۰

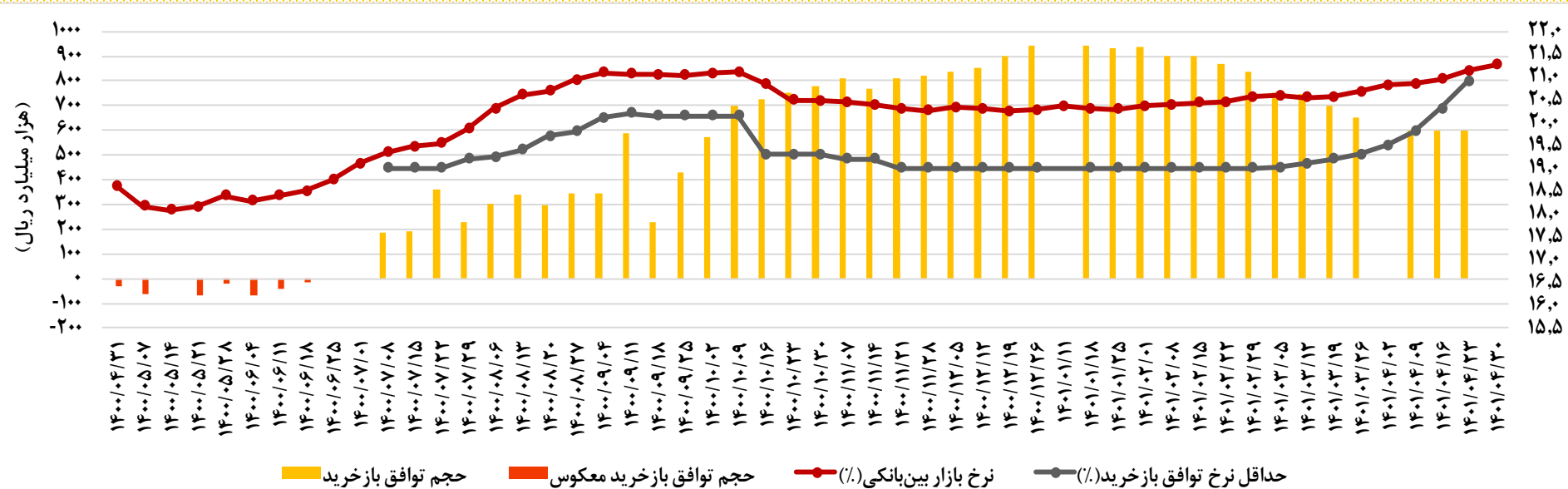
تاریخ	حجم توافق باز خرید (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید معکوس (ریپو معکوس) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید سررسید شده (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	خالص تزریق نقدینگی (هزار میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۵۹۸.۹	-	۶۴۱.۹	-۴۳
۱۴۰۱/۰۴/۱۳	۵۹۹	-	۶۰۱.۲	-۲.۲
۱۴۰۱/۰۴/۲۰	۵۹۹	-	۶۰۱.۳	-۲.۳
جمع	۱۷۹۶.۹	-	۱۸۴۴.۴	-۴۷.۵

ابزارهای سیاست پولی  
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی

۲۱.۳۲	۱۴۰۱/۰۴/۲۵
۲۱.۱۶	۱۴۰۱/۰۴/۲۶
تعطیل	۱۴۰۱/۰۴/۲۷
۲۱.۳۳	۱۴۰۱/۰۴/۲۸
اعلام نشده	۱۴۰۱/۰۴/۲۹







هانیه آتش روز  
دانشجوی ارشد مهندسی مالی  
دانشگاه تهران

 [h.atashrooz@ut.ac.ir](mailto:h.atashrooz@ut.ac.ir)

 Hanieh Atashrooz