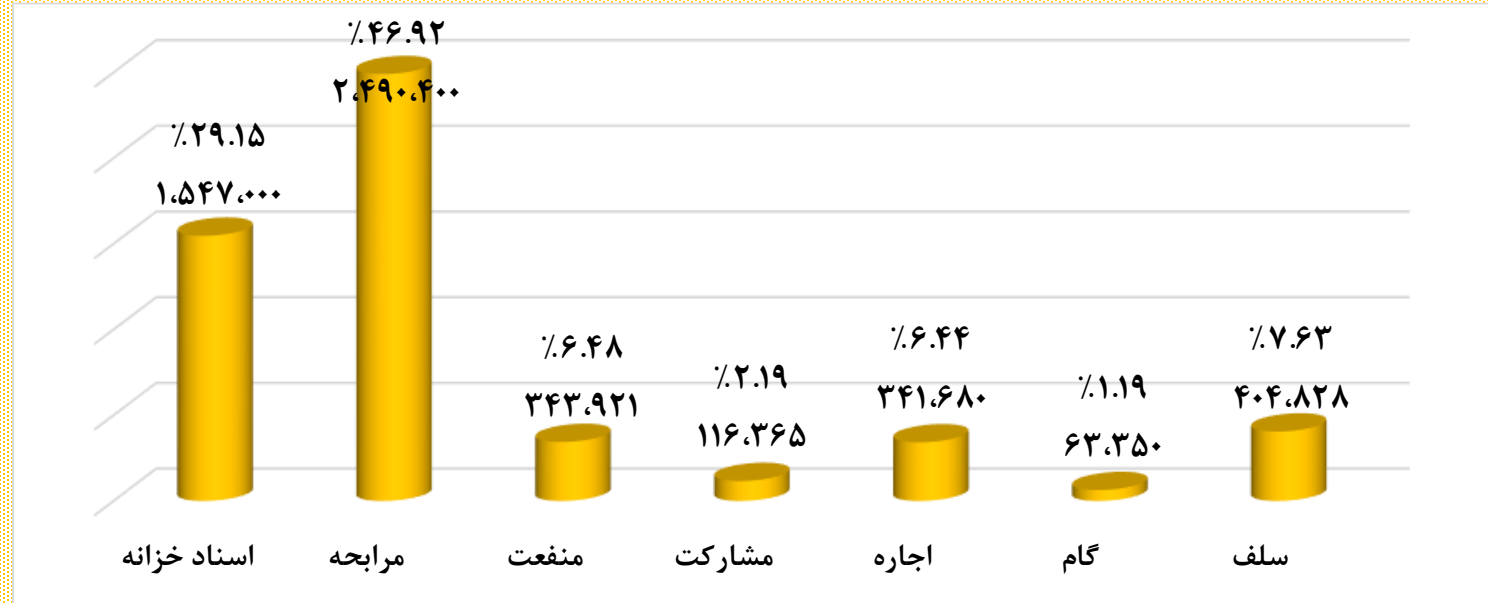


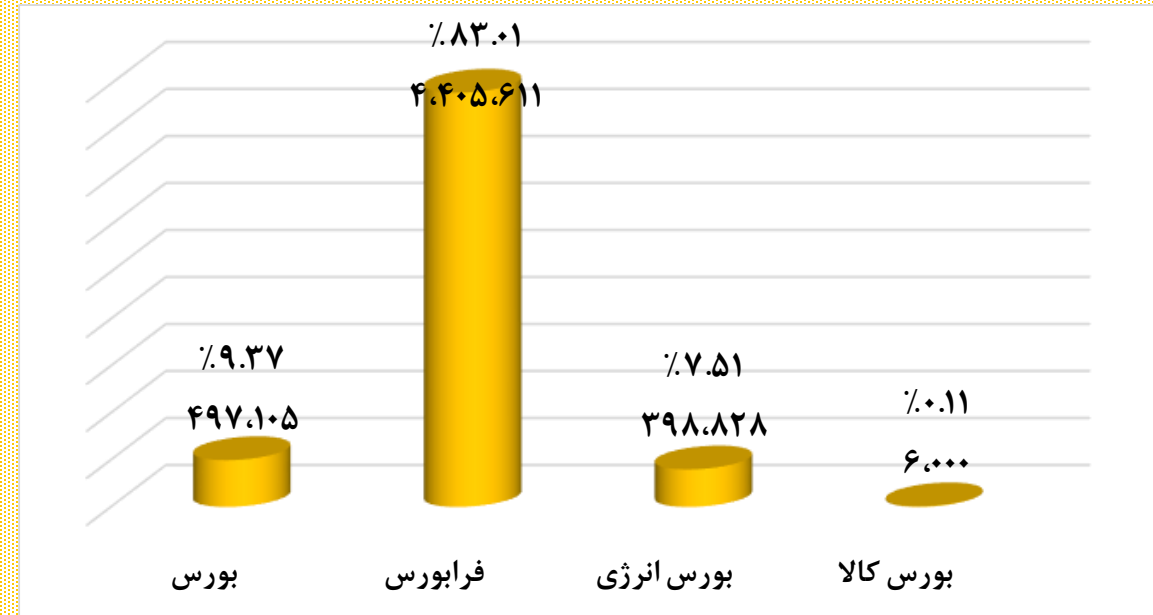
گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۶ مرداد ۱۴۰۱

براساس نوع اوراق



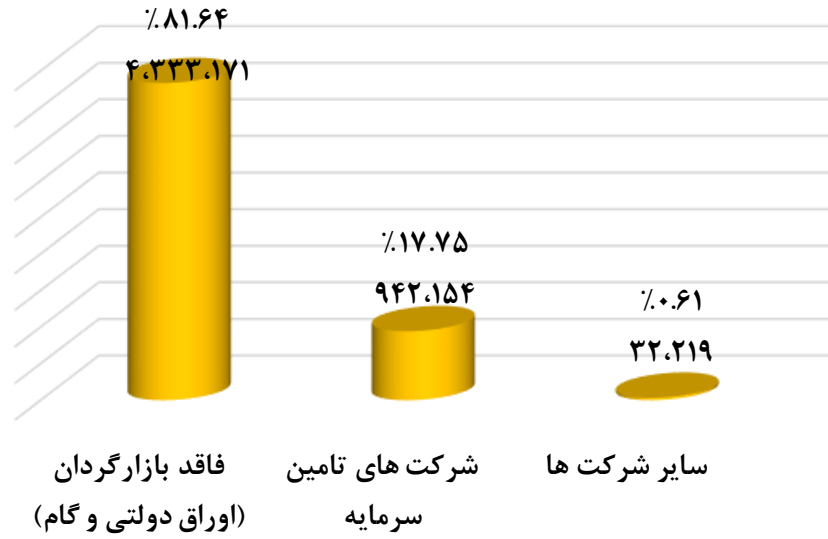
براساس نوع بازار



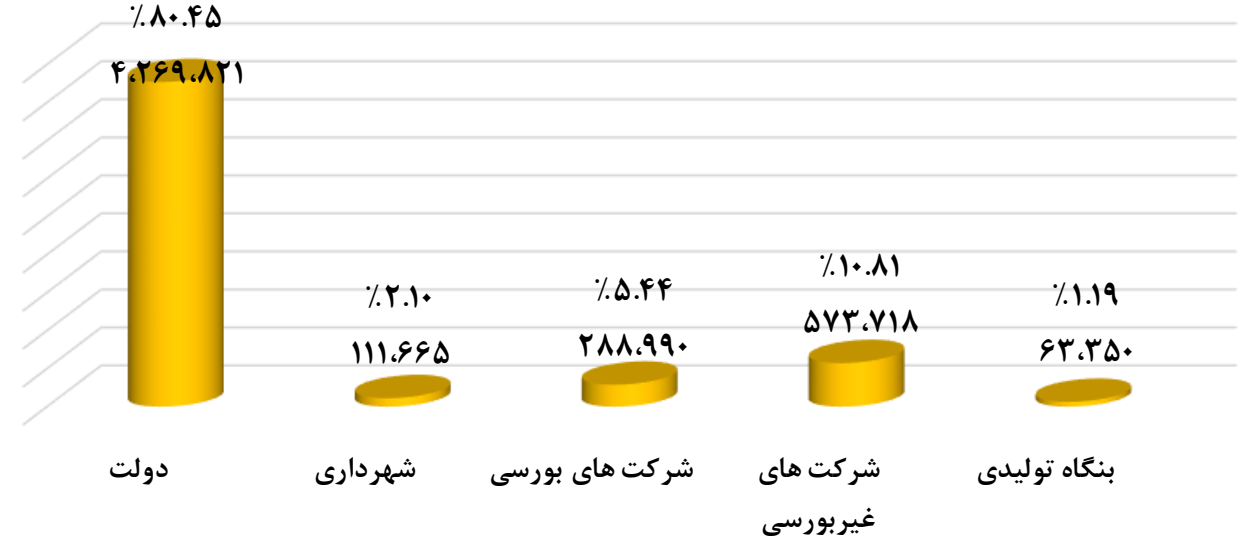
حجم اوراق موجود
بر مبنای قیمت سررسید
(ارقام به میلیارد ریال)



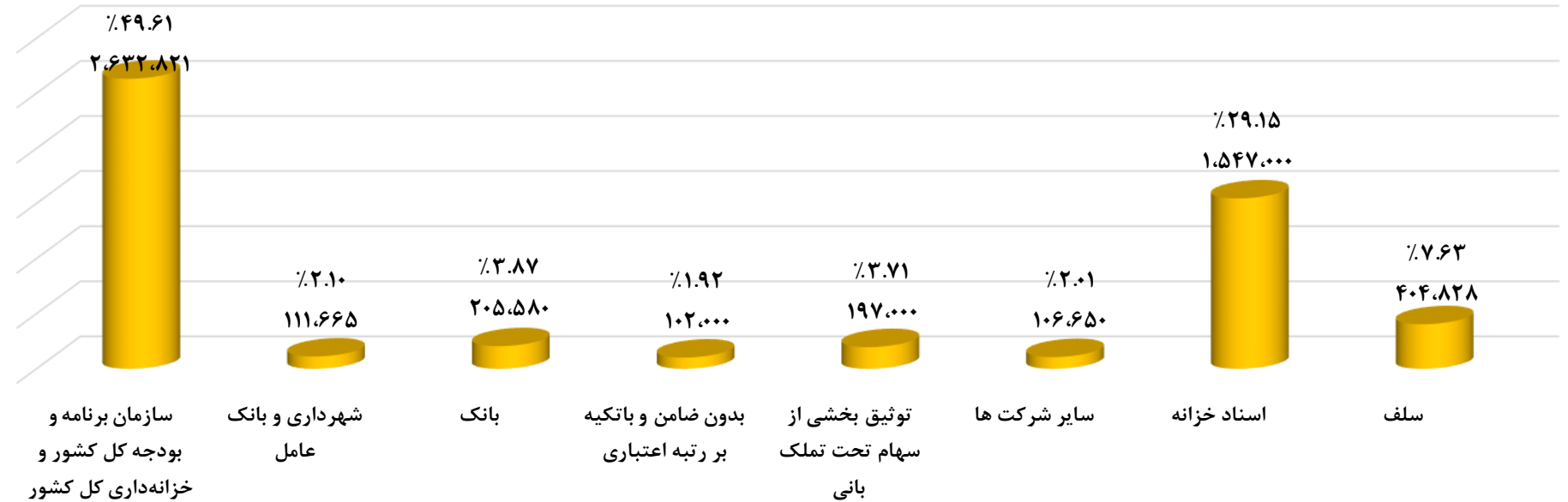
براساس نوع بازارگردان



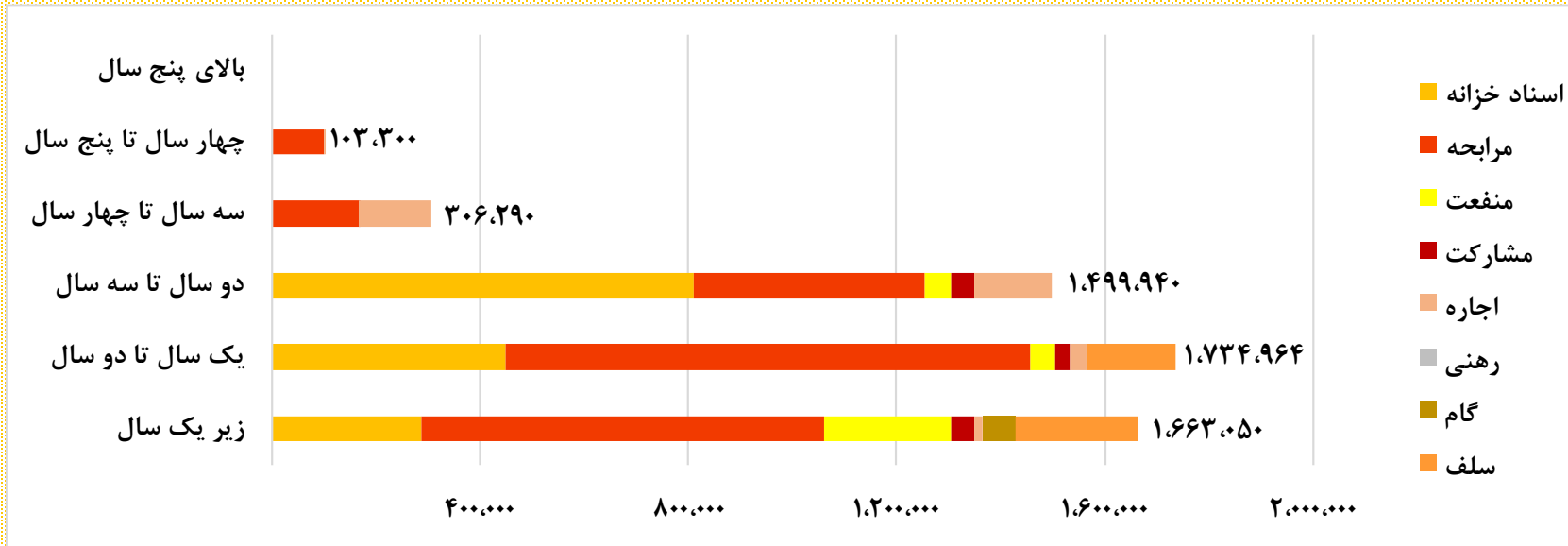
براساس نوع بانی



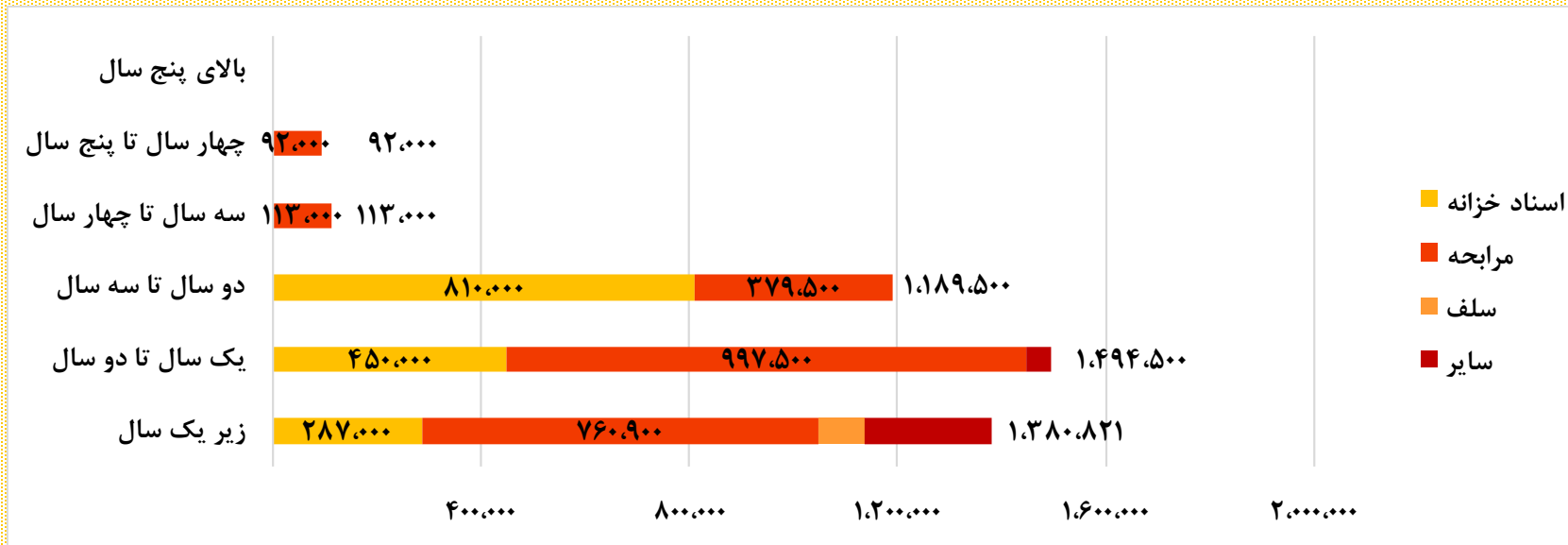
براساس نوع ضامن



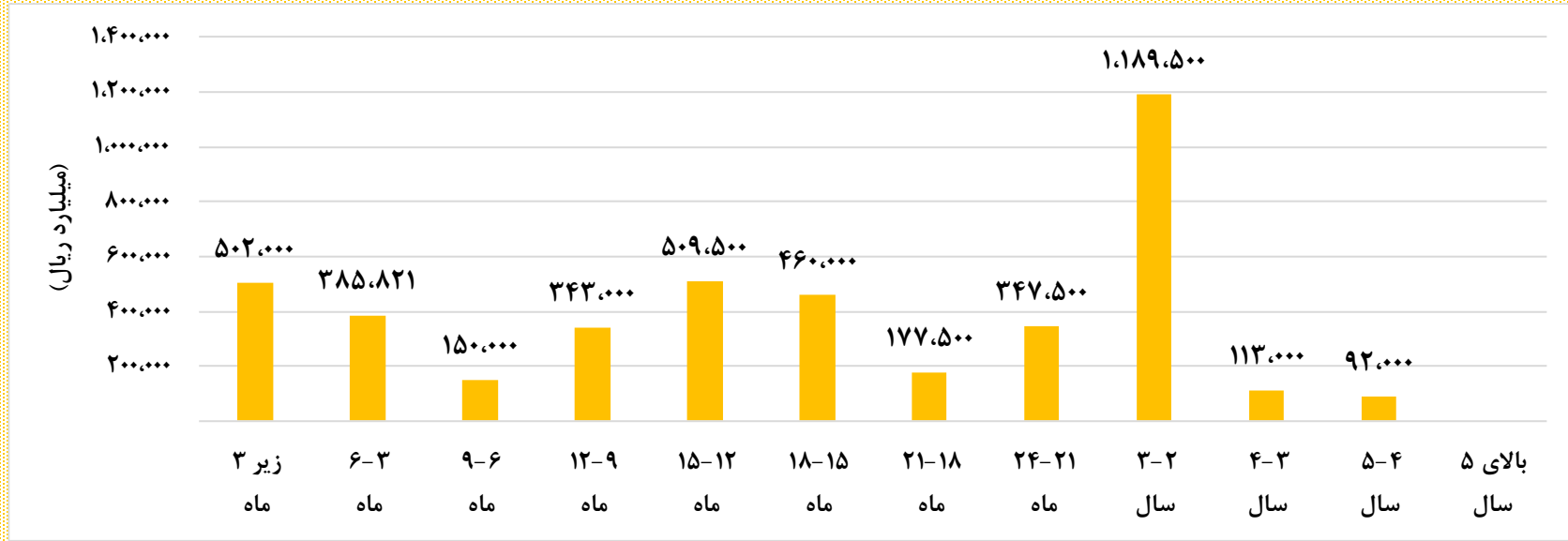
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

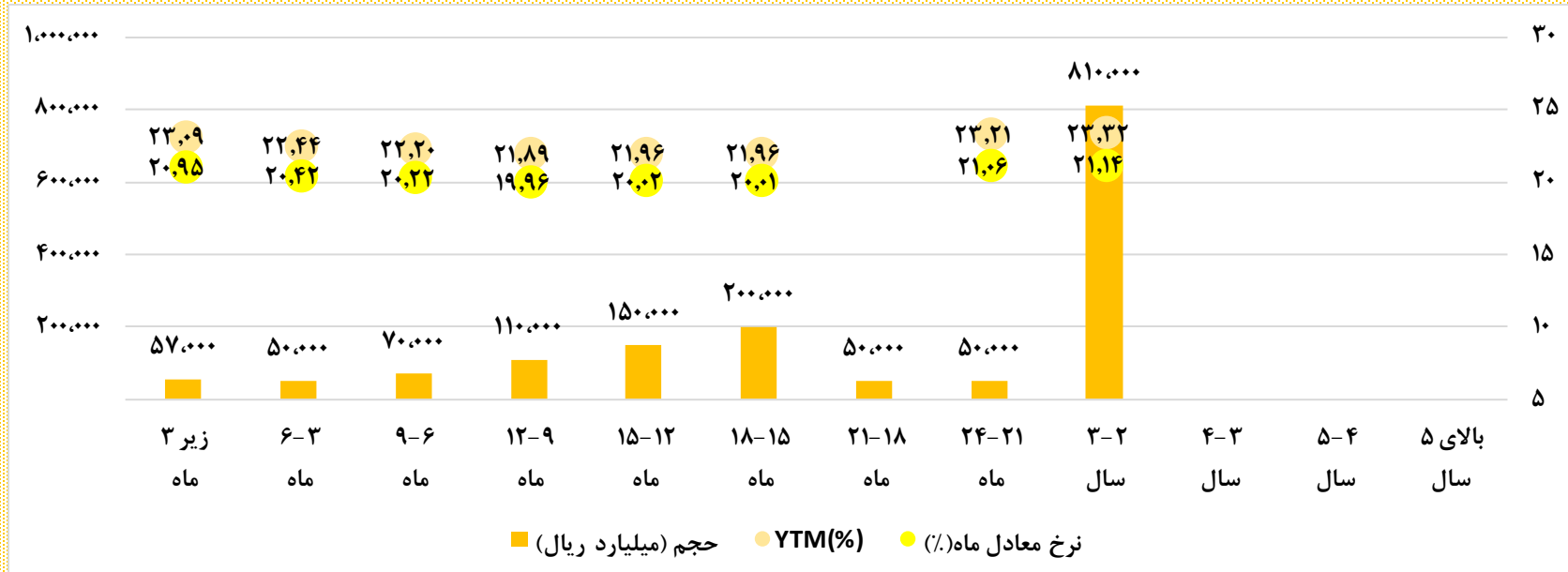


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* 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

٪۲۲.۵۹

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

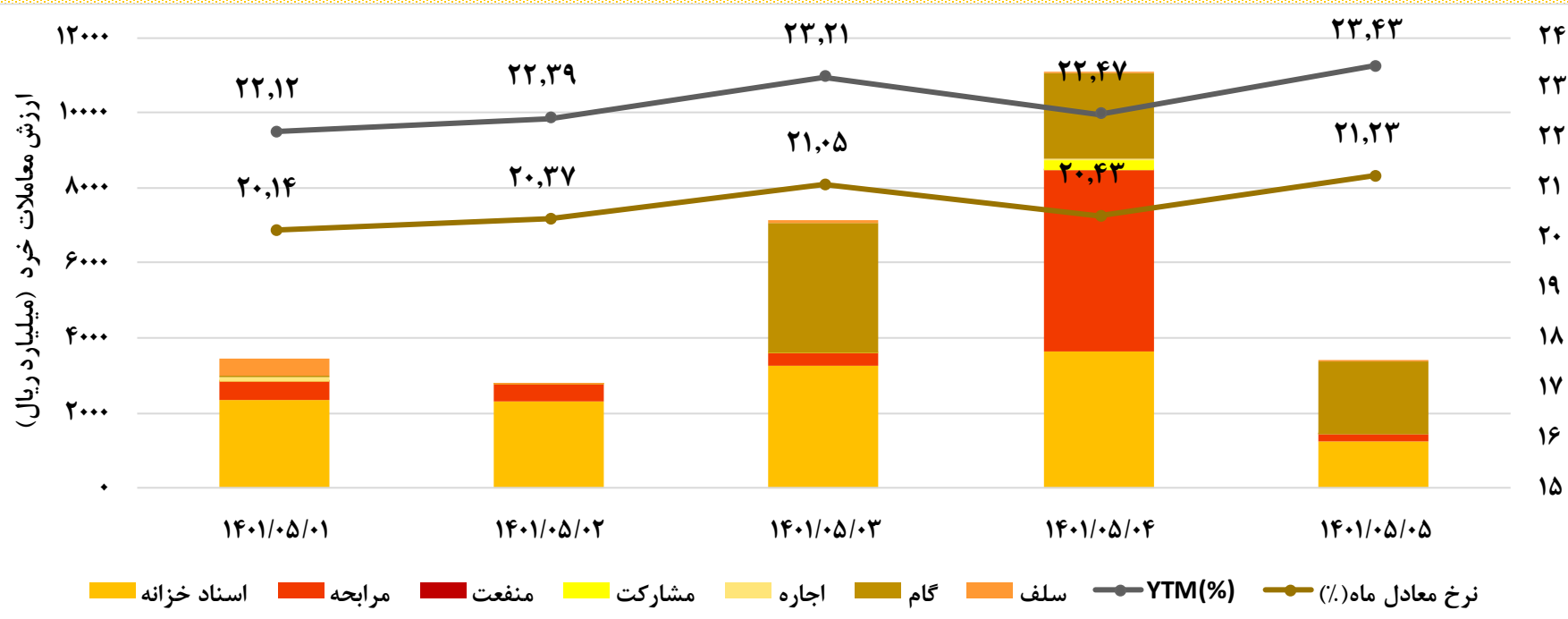
٪۲۳.۱۰

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

٪۲۰.۵۴

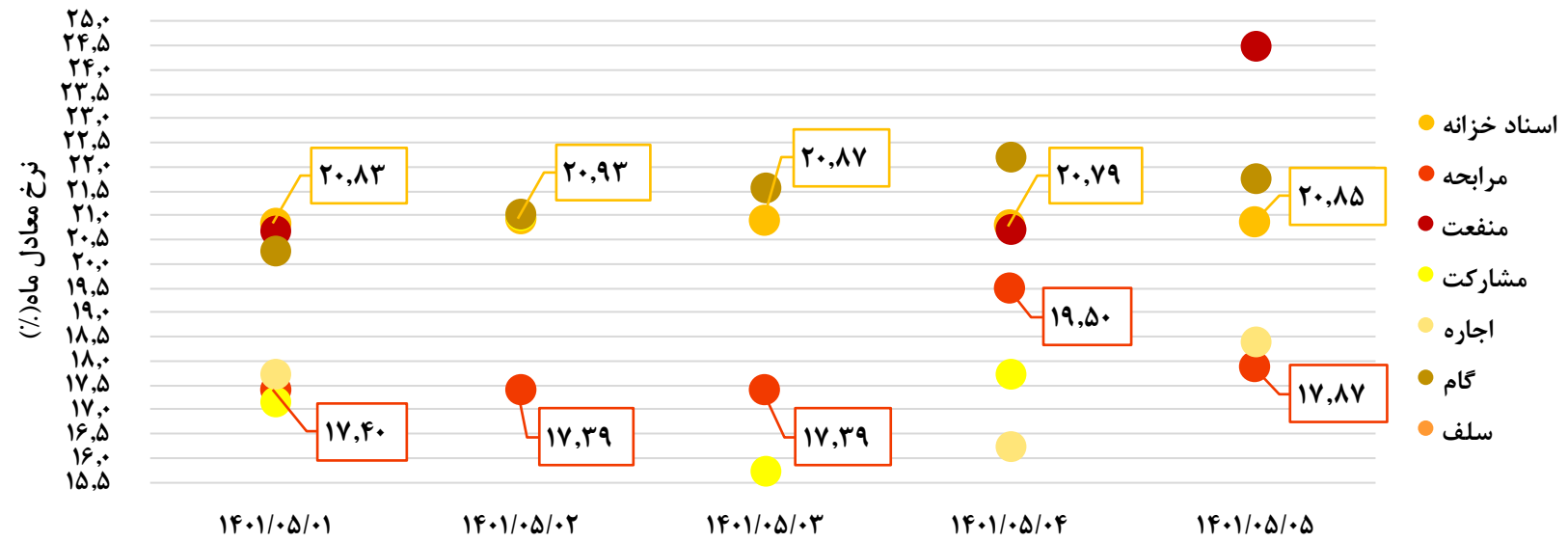
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

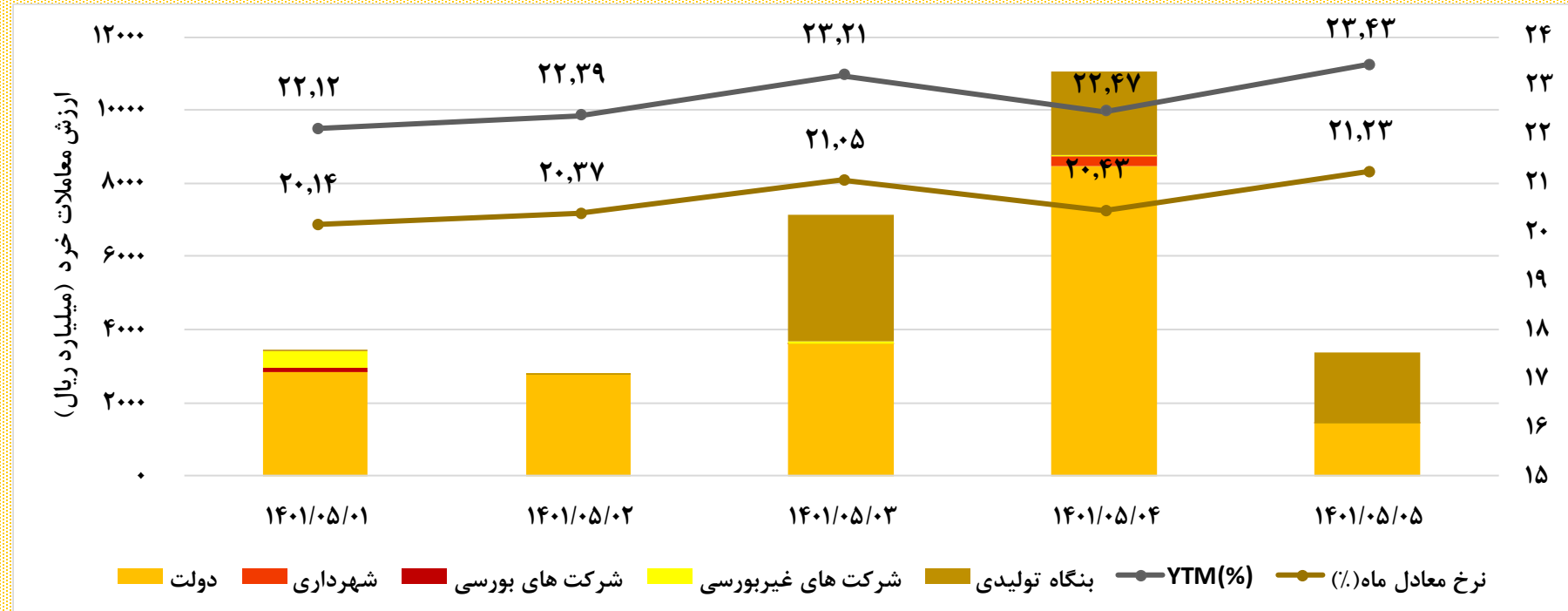
٪۲۰.۹۶



بازدهی معاملات طی هفته

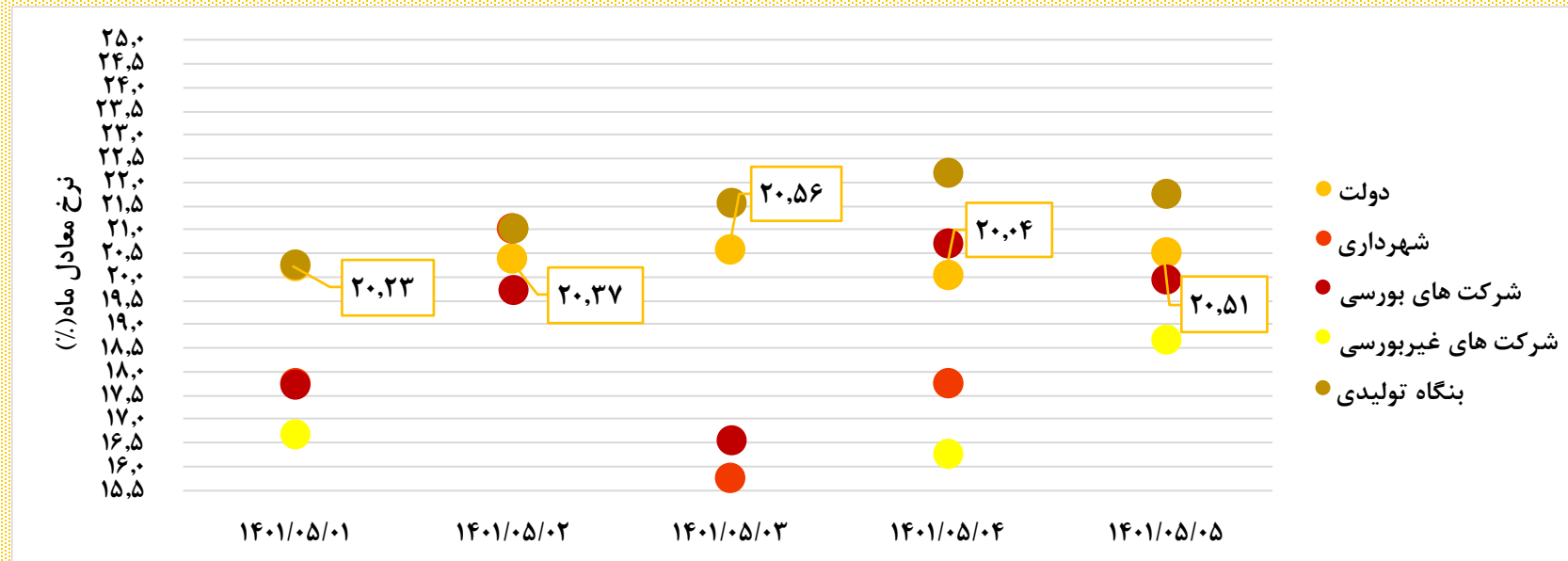
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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

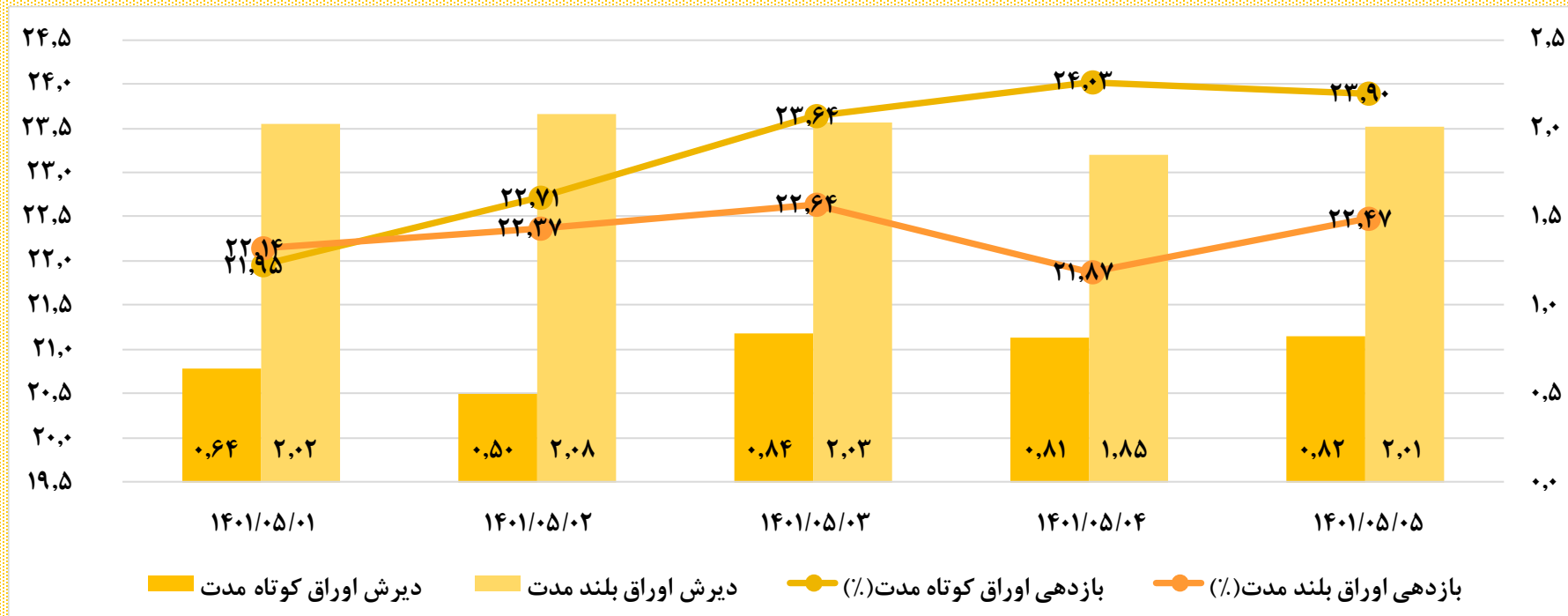




بازدهی معاملات طی هفته

* 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.





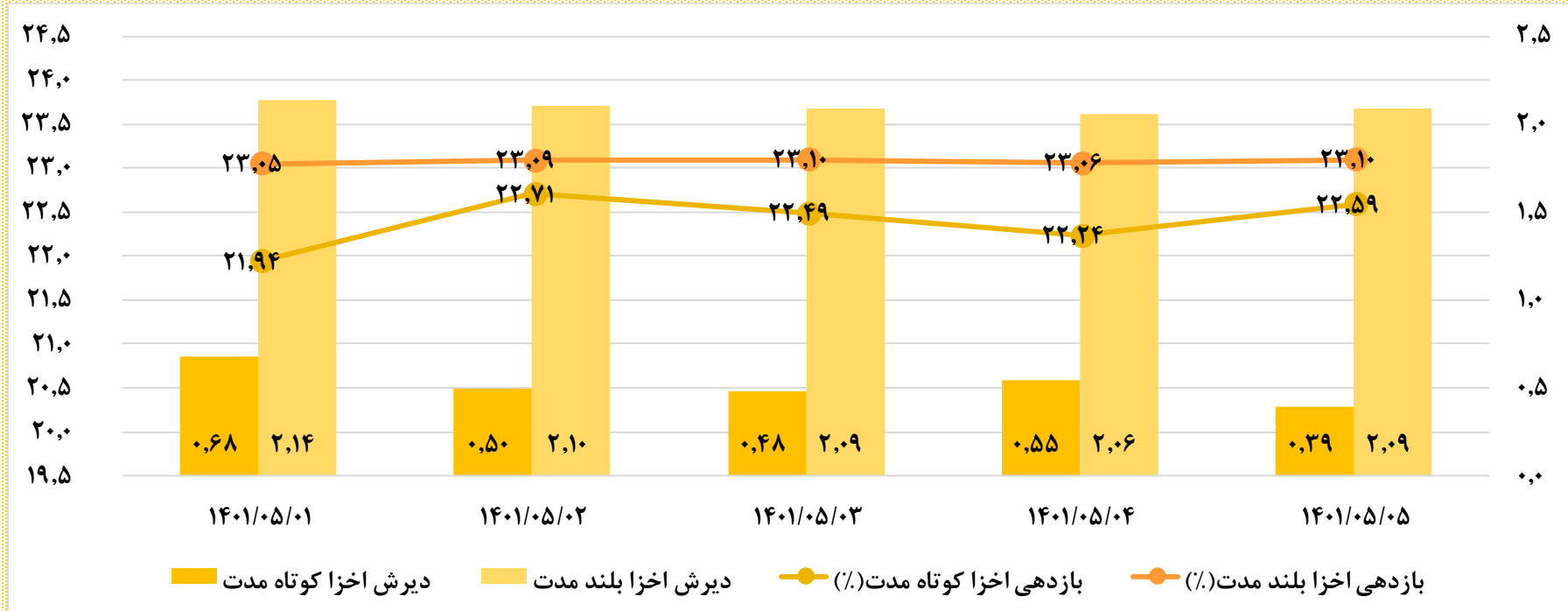
بازدهی معاملات طی هفته

*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		
٪۱.۷۹	٪۲۳.۷۵	بازدهی اوراق کوتاه مدت
٪۰.۴۱	٪۲۲.۱۶	بازدهی اوراق بلند مدت
٪۰.۹۷	٪۲۲.۷۳	بازدهی کل اوراق
۰.۳۶	۰.۸۲	دیرش اوراق کوتاه مدت
۰.۰۱	۱.۹۵	دیرش اوراق بلند مدت
-۰.۳۳	۱.۵۴	دیرش کل اوراق

بازدهی معاملات طی هفته

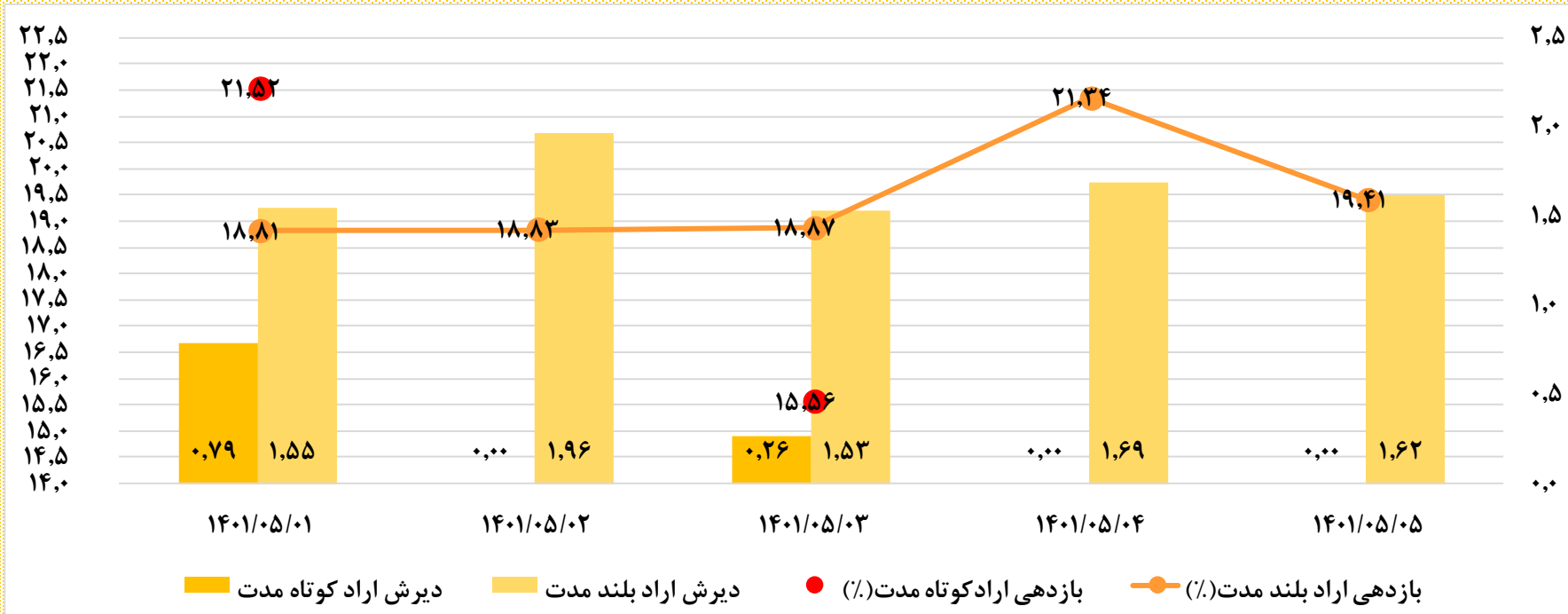


*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

*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		
۰.۳۲%	۲۲.۳۷%	بازدهی اخزا کوتاه مدت
۰.۲۰%	۲۳.۰۸%	بازدهی اخزا بلند مدت
۰.۱۵%	۲۲.۹۶%	بازدهی کل اخزا
۰.۰۳	۰.۵۱	دیرش اخزا کوتاه مدت
-۰.۰۸	۲.۱۰	دیرش اخزا بلند مدت
-۰.۱۹	۱.۸۴	دیرش کل اخزا

بازدهی معاملات طی هفته

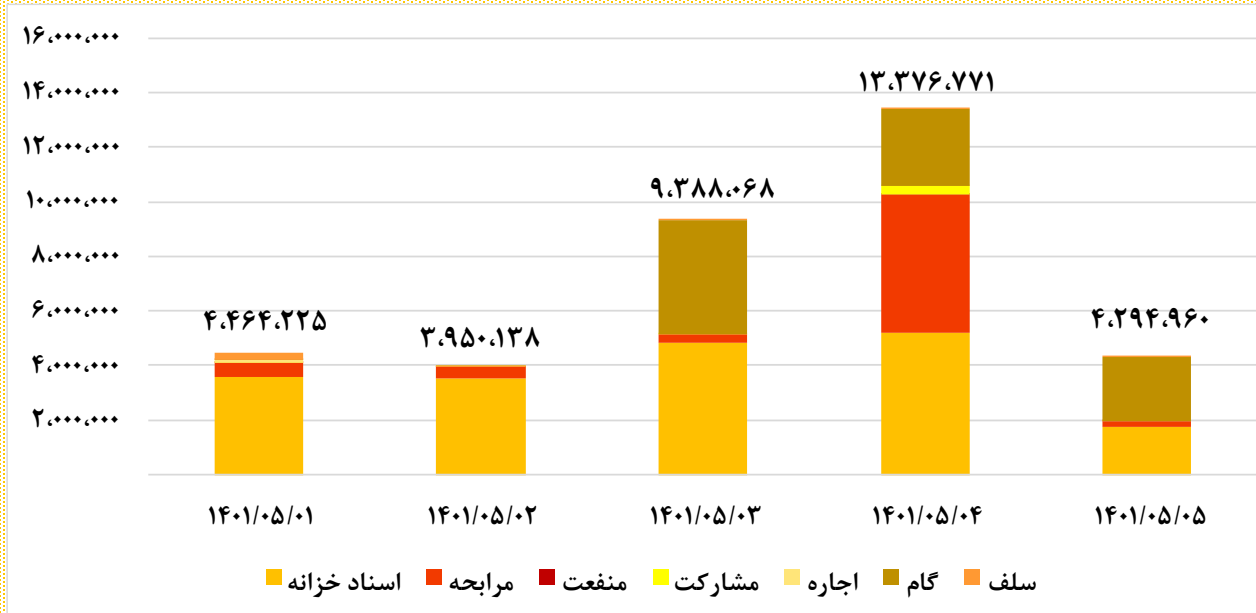


*ریسک نرخ بهره اراد بر مبنای دیرش موزون اراد های معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد.

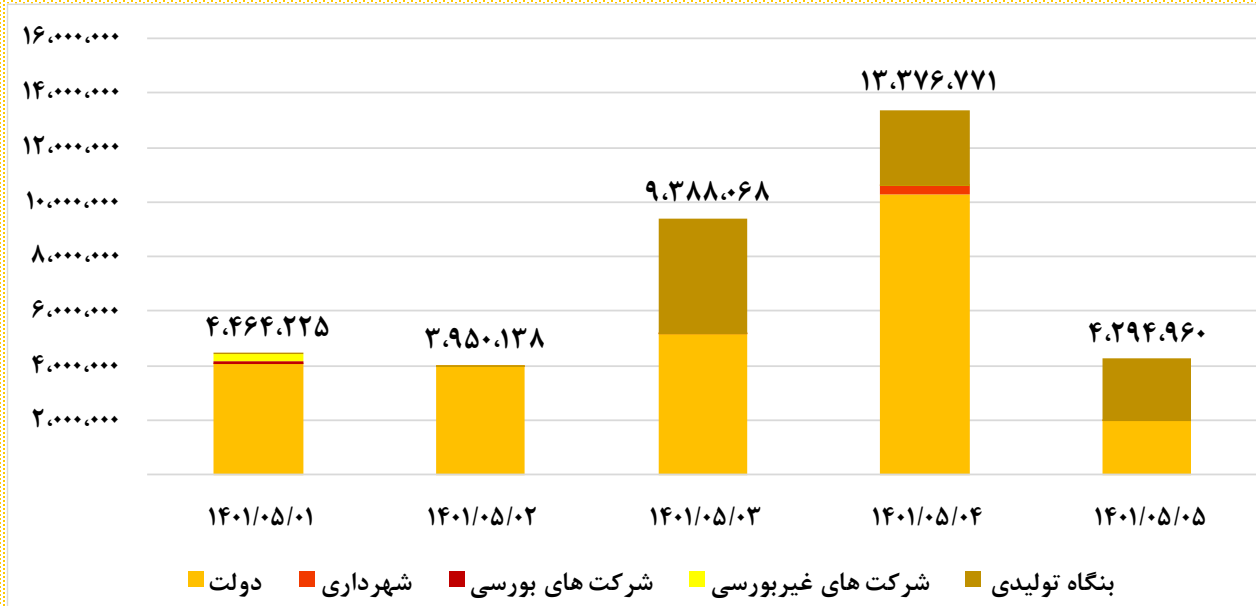
*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
٪۰.۴۲	٪۲۰.۵۲	بازدهی اراد کوتاه مدت
-%۰.۲۱	٪۲۰.۷۹	بازدهی اراد بلند مدت
-%۰.۲۱	٪۲۰.۷۹	بازدهی کل اراد
۰.۴۷	۰.۷۰	دیرش اراد کوتاه مدت
۰.۰۰	۱.۶۹	دیرش اراد بلند مدت
۰.۰۰	۱.۶۹	دیرش کل اراد

براساس نوع اوراق



براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته
(نماد خرد)



تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۵/۰۱	۴۹۳,۹۶۰	۲۹۵
۱۴۰۱/۰۵/۰۲	۱۶,۲۹۴	۱۰
۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۳۱۷,۱۱۵,۶۲۵	۲۳۱,۷۵۰
۱۴۰۱/۰۵/۰۴	۴۳,۹۷۲,۶۱۰	۳۲,۶۵۷
۱۴۰۱/۰۵/۰۵	۲۷,۱۶۵,۲۰۱	۲۰,۵۴۶

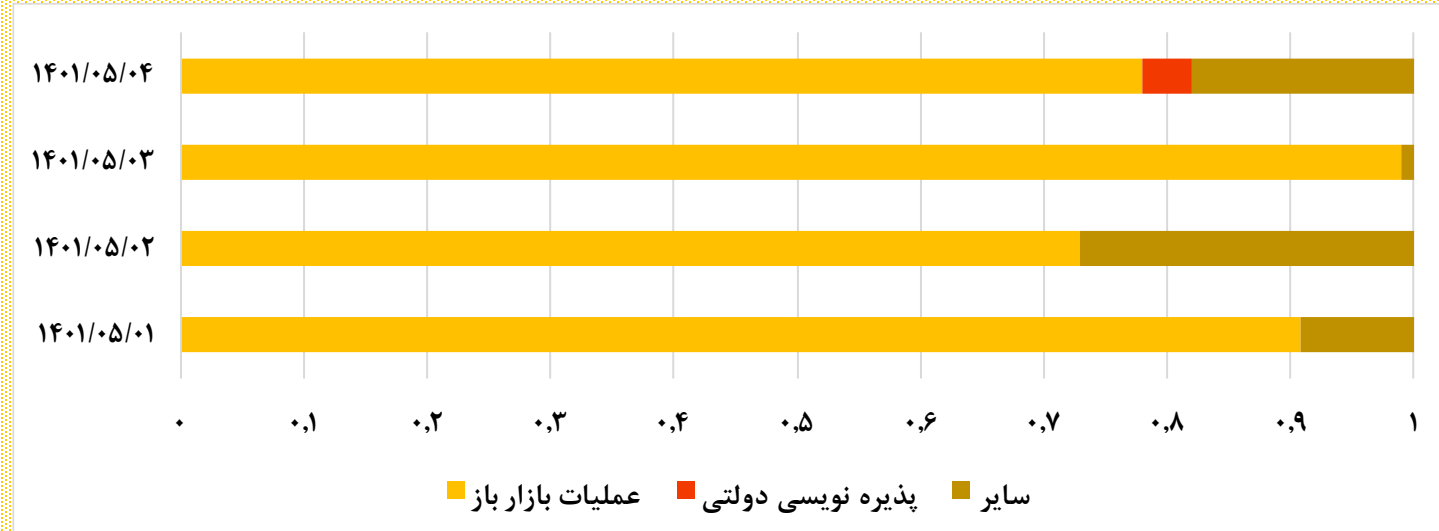
مرابحه عام دولت

تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۵/۰۱	۴۴,۱۳۶,۲۵۲	۴۰,۸۸۸
۱۴۰۱/۰۵/۰۲	۵۱,۳۶۹,۵۴۴	۴۷,۷۰۷
۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۱,۰۳۰,۱۷۴,۸۵۷	۹۷۷,۲۶۵
۱۴۰۱/۰۵/۰۴	۷۷,۱۷۱,۶۵۶	۷۳,۳۰۹
۱۴۰۱/۰۵/۰۵	۴۶,۹۹۷,۳۵۶	۴۳,۴۴۴

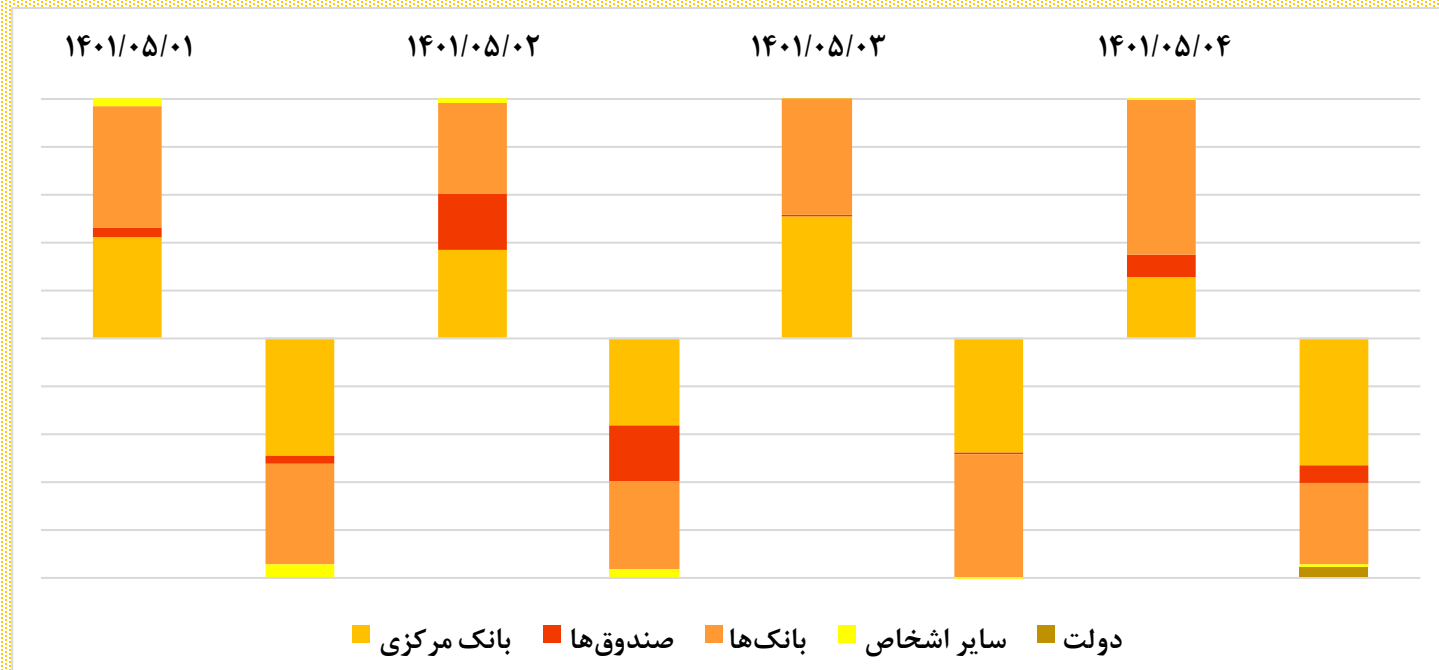
معاملات طی هفته
(نماد عمده)



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	اجاره	
اسناد خزانه-م ۱۷ بودجه ۹۸-۱۰۵۱۲	اجاره ریل کوثر ۱۴۰۱۰۵۰۹	نام اوراق
۸۱۷۱	ریل ۱۴۰۱	نماد معاملاتی
فرا بورس	فرا بورس	نوع بازار
۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۰۰,۰۰۰	حجم کل اوراق (میلیون ریال)
۱۳۹۸/۰۸/۱۲	۱۳۹۷/۰۵/۰۹	تاریخ انتشار
۱۴۰۱/۰۵/۱۲	۱۴۰۱/۰۵/۰۹	تاریخ سررسید
-	سالیانه ۱۶ درصد	نرخ سود اسمی
فاقد پرداخت سود	هر سه ماه یکبار از تاریخ انتشار	مواعد پرداخت سود
وزارت امور اقتصادی و دارایی	شرکت ریل سیر کوثر	بانی / ناشر
-	شرکت واسط مالی اسفند چهارم	نهاد واسط (ناشر)
خزانه داری کل کشور	بانک آینده	ضامن
-	شرکت تامین سرمایه تمدن	بازارگردان
-	شرکت تامین سرمایه تمدن	متعهد پذیره نویس

اوراق منتشر شده
و
سررسید شده هفته آتی



اطلاعات اوراق	
نوع اوراق	اجاره
نام اوراق	اجاره تامین اجتماعی ۱۴۰۵۰۵۰۹
نماد معاملاتی	تامین ۰۵
نوع بازار	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۴۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۴۰۱/۰۵/۰۹
تاریخ سررسید	۱۴۰۵/۰۵/۰۹
نرخ سود اسمی	۱۹ درصد سالانه
مواعد پرداخت سود	هر ۶ ماه یکبار از تاریخ انتشار
ارکان اوراق	
بانی / ناشر	سازمان تامین اجتماعی
نهاد واسط (ناشر)	شرکت واسط مالی مهر
ضامن	توثیق بخشی از سهام تحت تملک بانی
بازارگردان	شرکت تامین سرمایه امین
متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه امین

اوراق منتشر شده
و
سررسید شده هفته آتی



یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۰۶

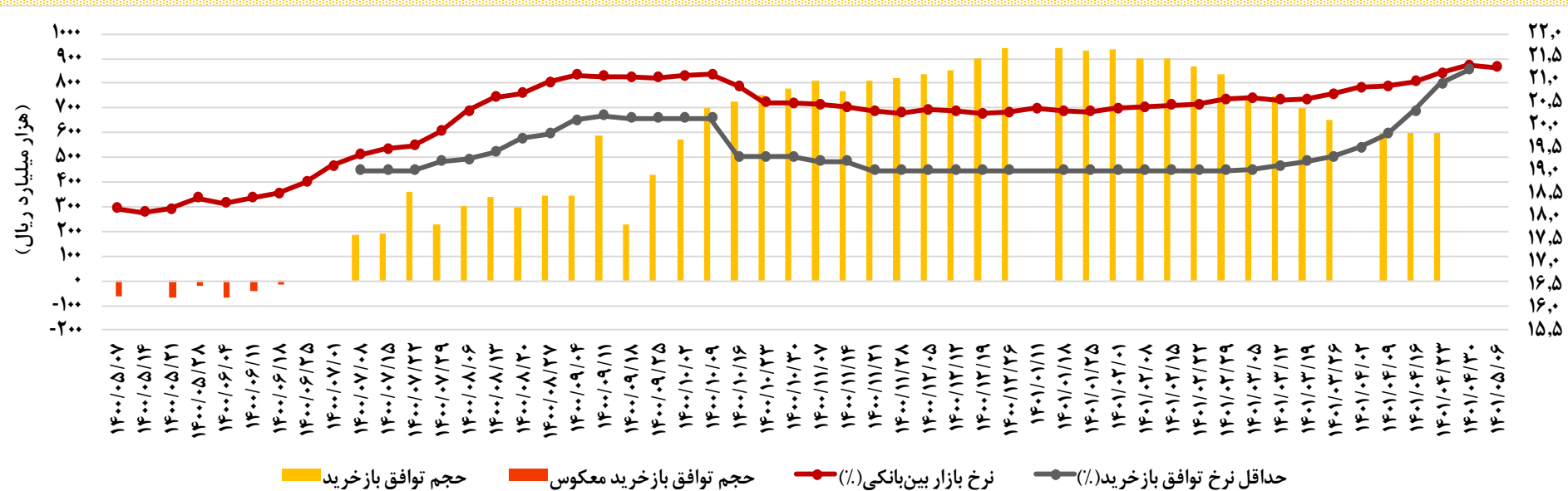
تاریخ	حجم توافق باز خرید (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید معکوس (ریپو معکوس) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید سررسید شده (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	خالص تزریق نقدینگی (هزار میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۴/۰۶	۵۹۸.۹	-	۶۴۱.۹	-۴۳
۱۴۰۱/۰۴/۱۳	۵۹۹	-	۶۰۱.۲	-۲.۲
۱۴۰۱/۰۴/۲۰	۵۹۹	-	۶۰۱.۳	-۲.۳
جمع	۱۷۹۶.۹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

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی

۲۱.۳۷	۱۴۰۱/۰۵/۰۱
۲۱.۳۸	۱۴۰۱/۰۵/۰۲
۲۱.۴۵	۱۴۰۱/۰۵/۰۳
۲۱.۳۹	۱۴۰۱/۰۵/۰۴
۲۰.۷۵	۱۴۰۱/۰۵/۰۵





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.atashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz