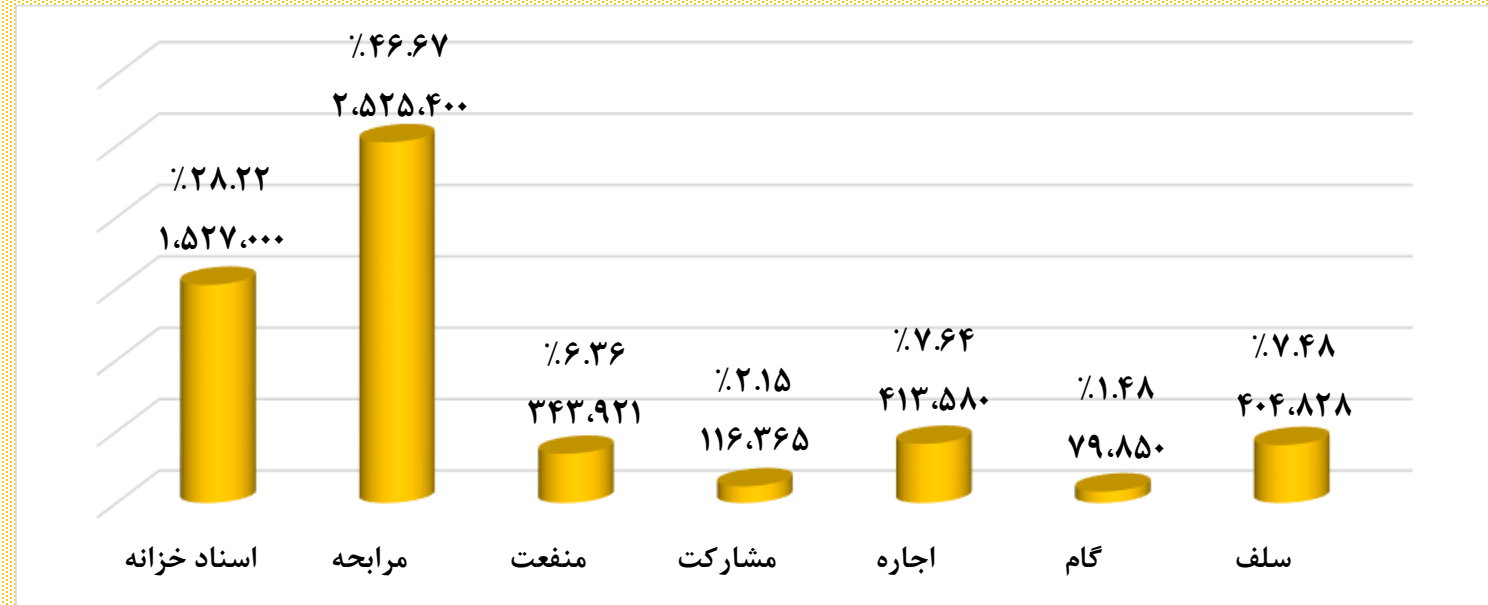


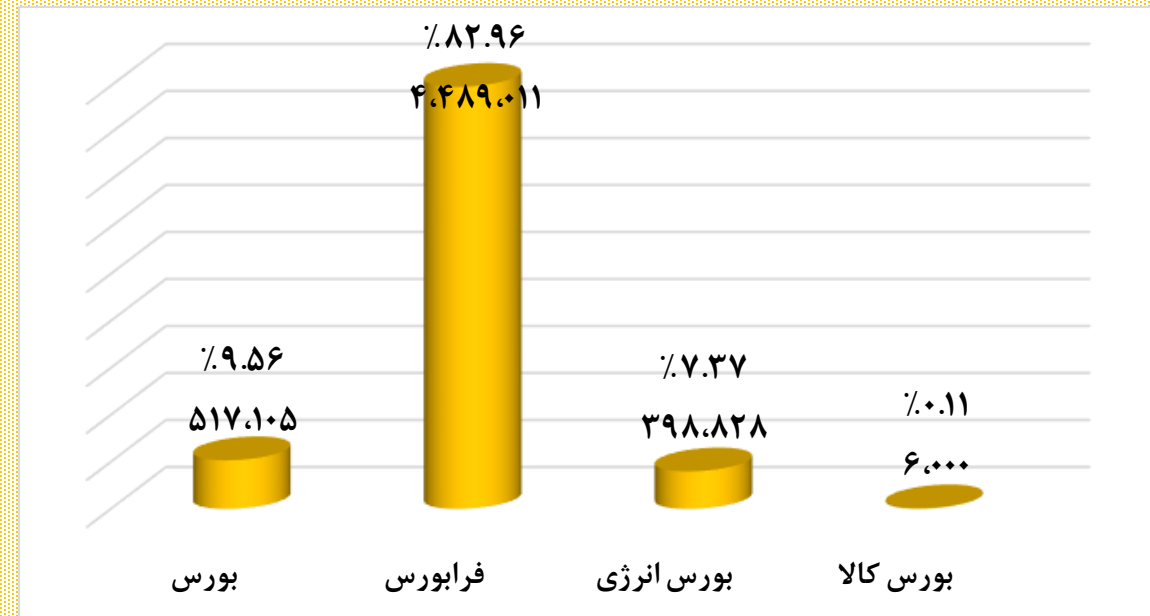
گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۲۰ مرداد ۱۴۰۱

براساس نوع اوراق



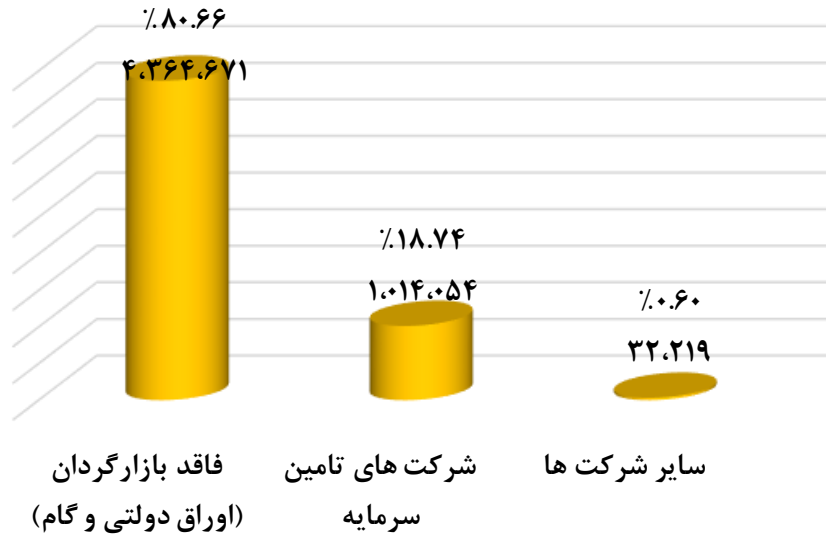
براساس نوع بازار



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



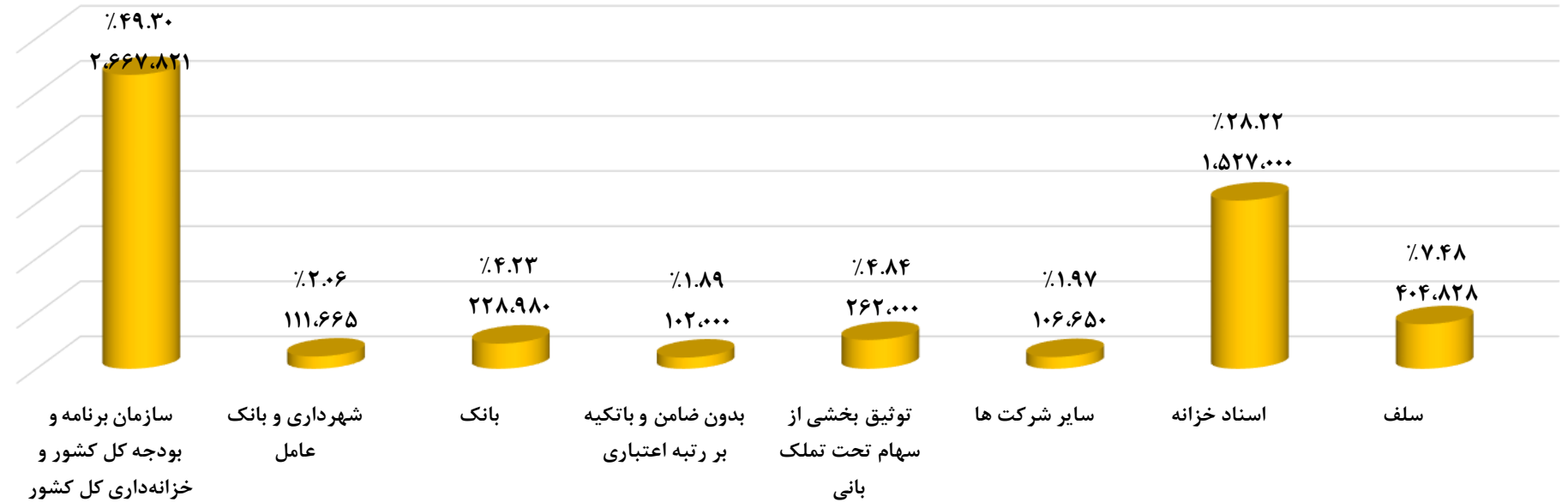
براساس نوع بازارگردان



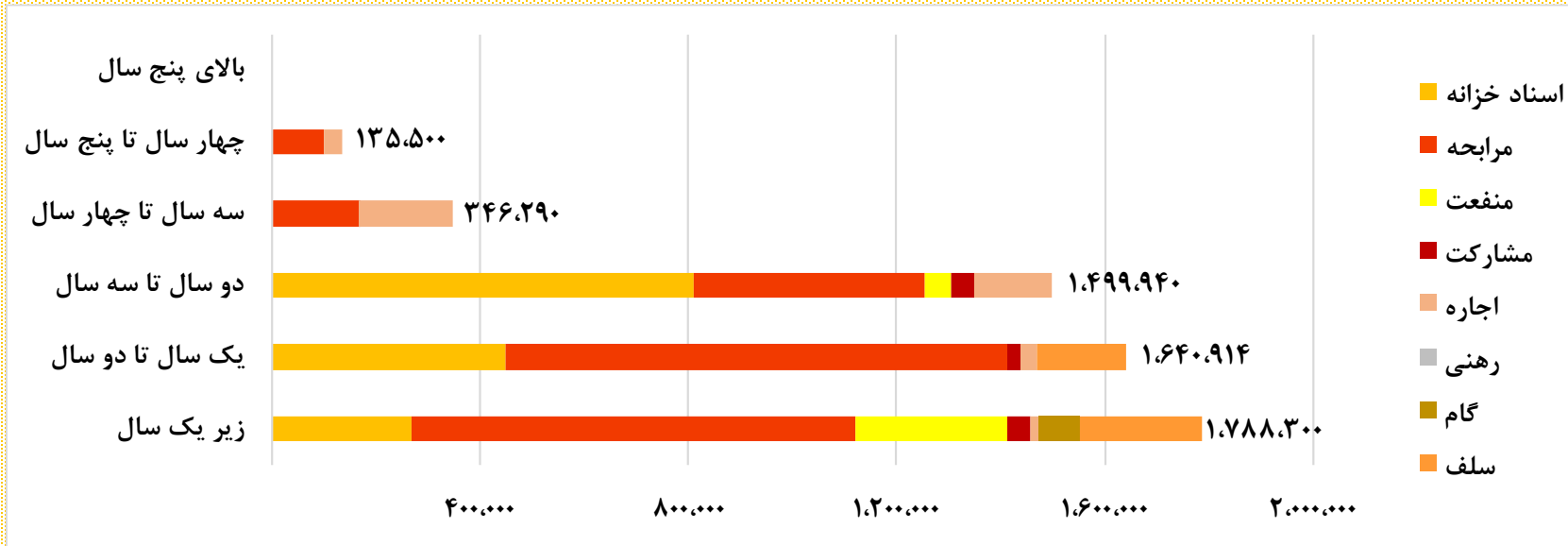
براساس نوع بانی



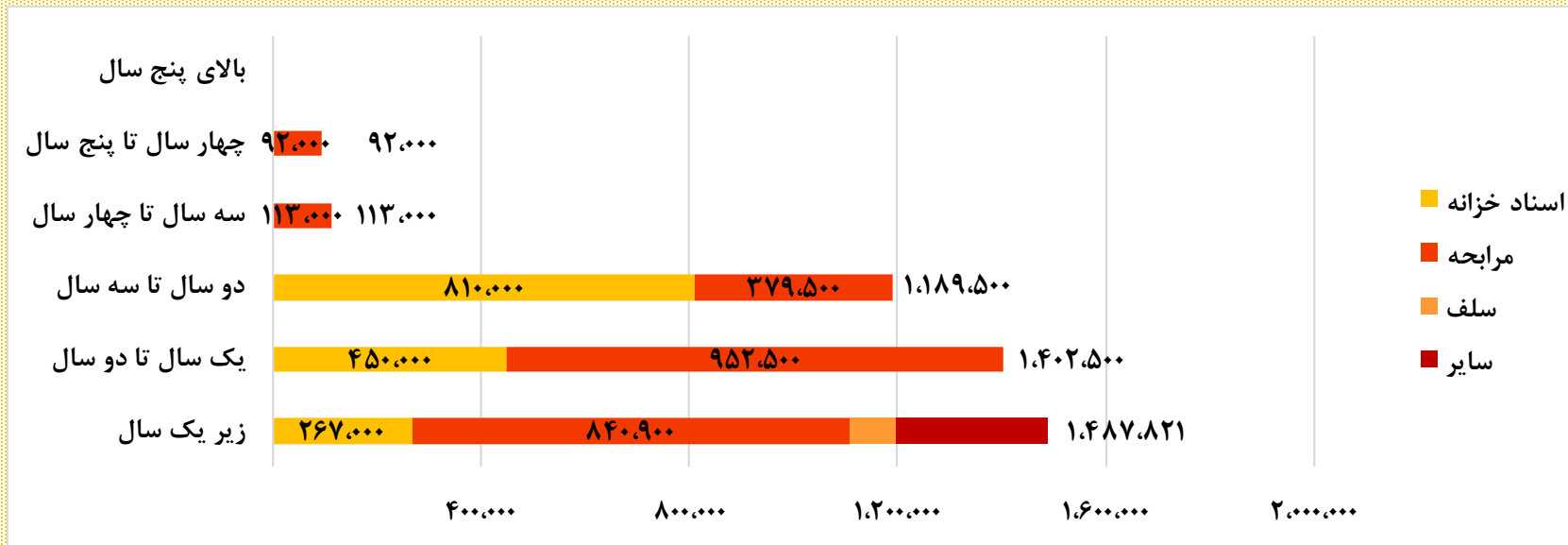
براساس نوع ضامن



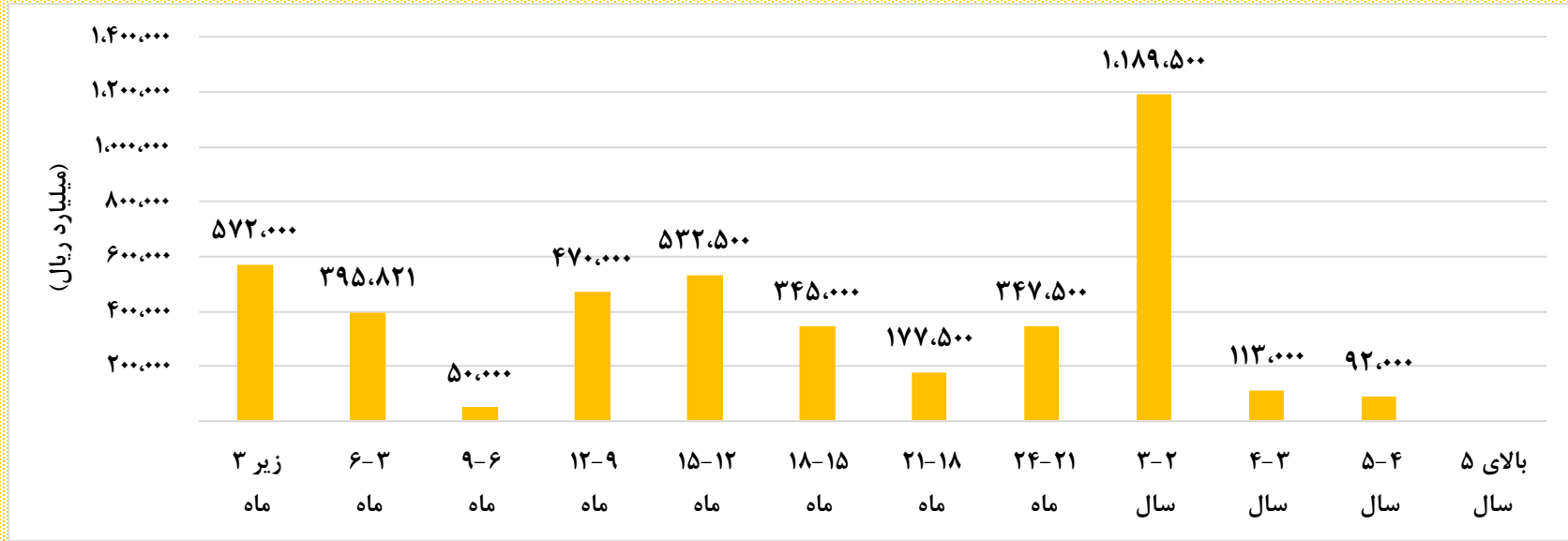
براساس زمان تا سررسید



حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

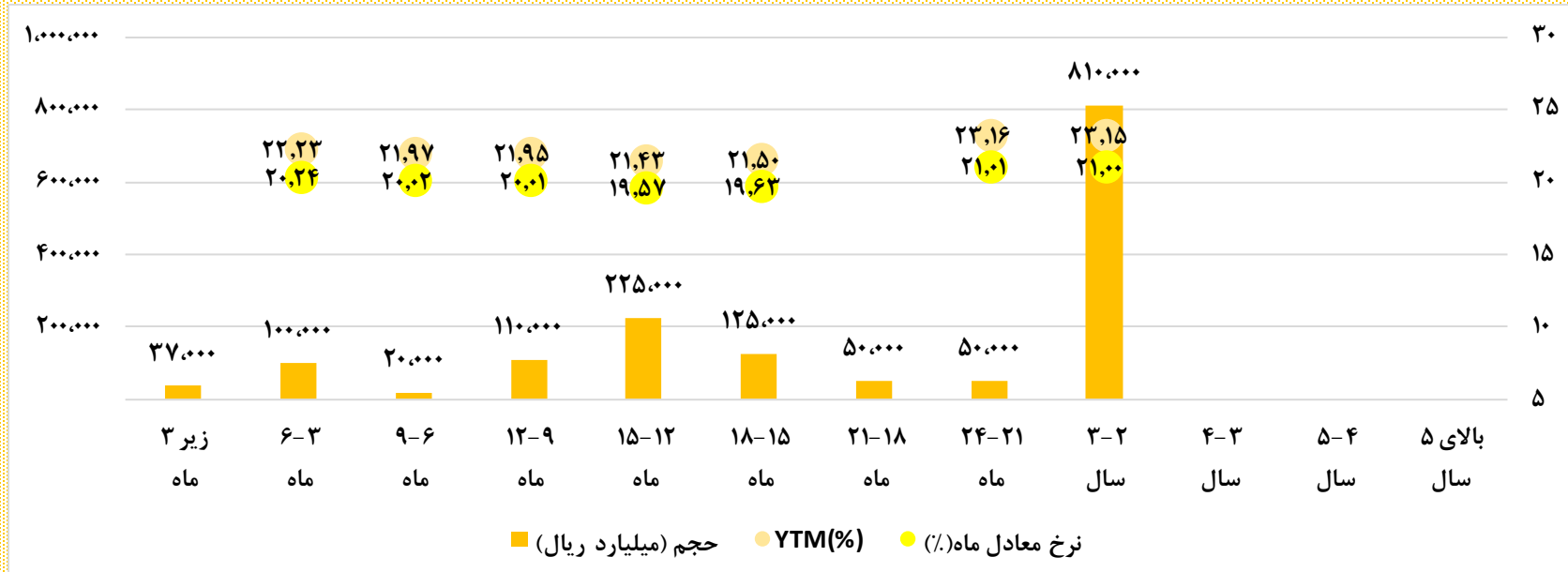


حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



* 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

%۲۲.۲۱

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

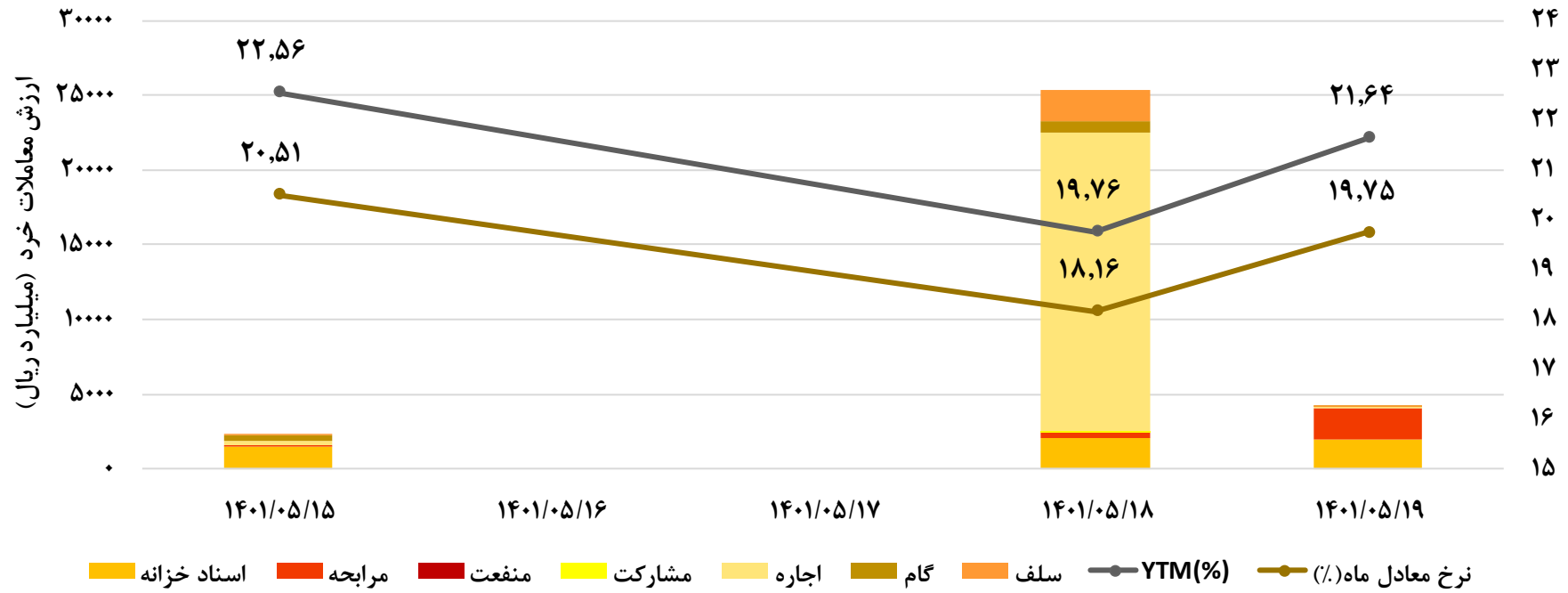
%۲۲.۶۵

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

%۲۰.۲۲

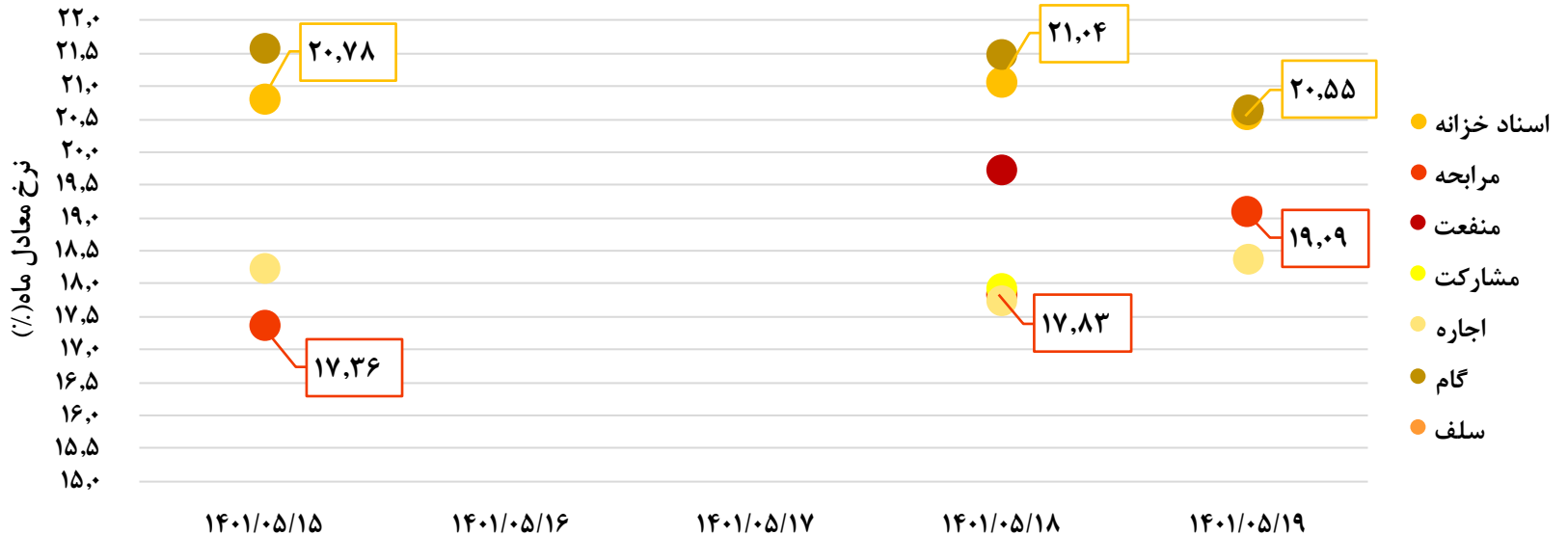
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

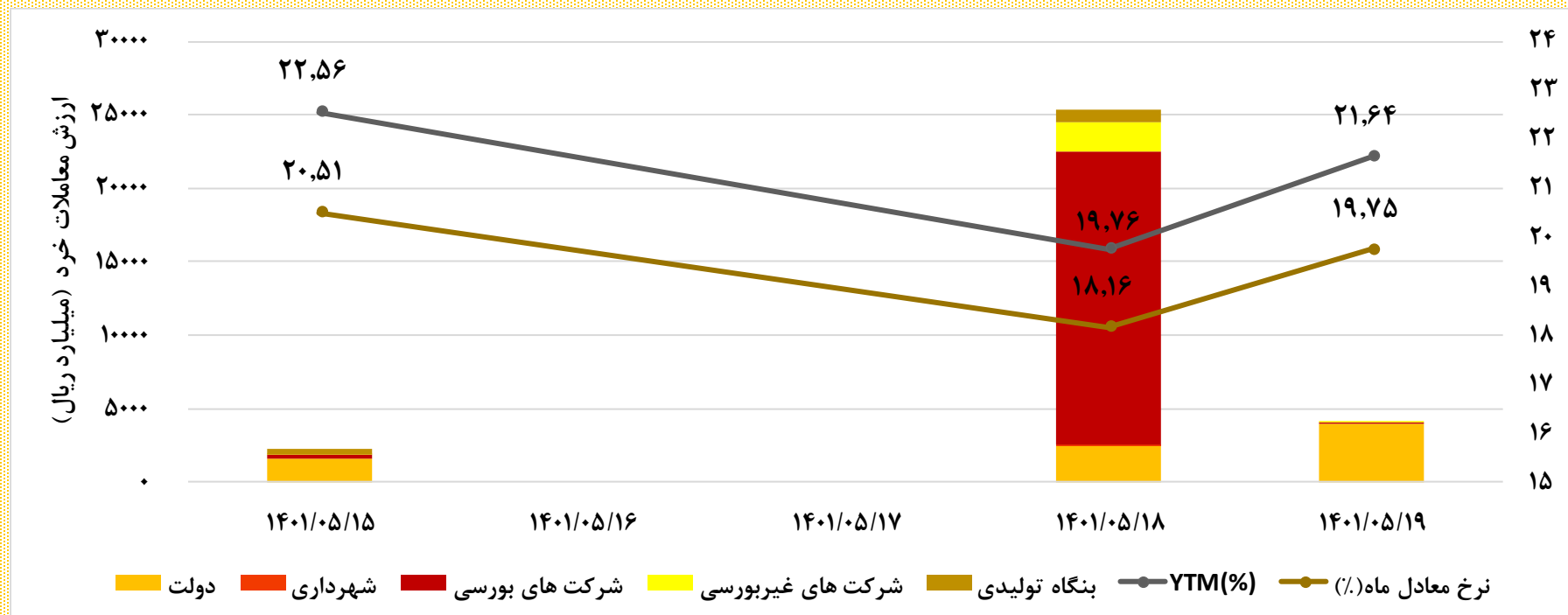
%۲۰.۵۹



بازدهی معاملات طی هفته

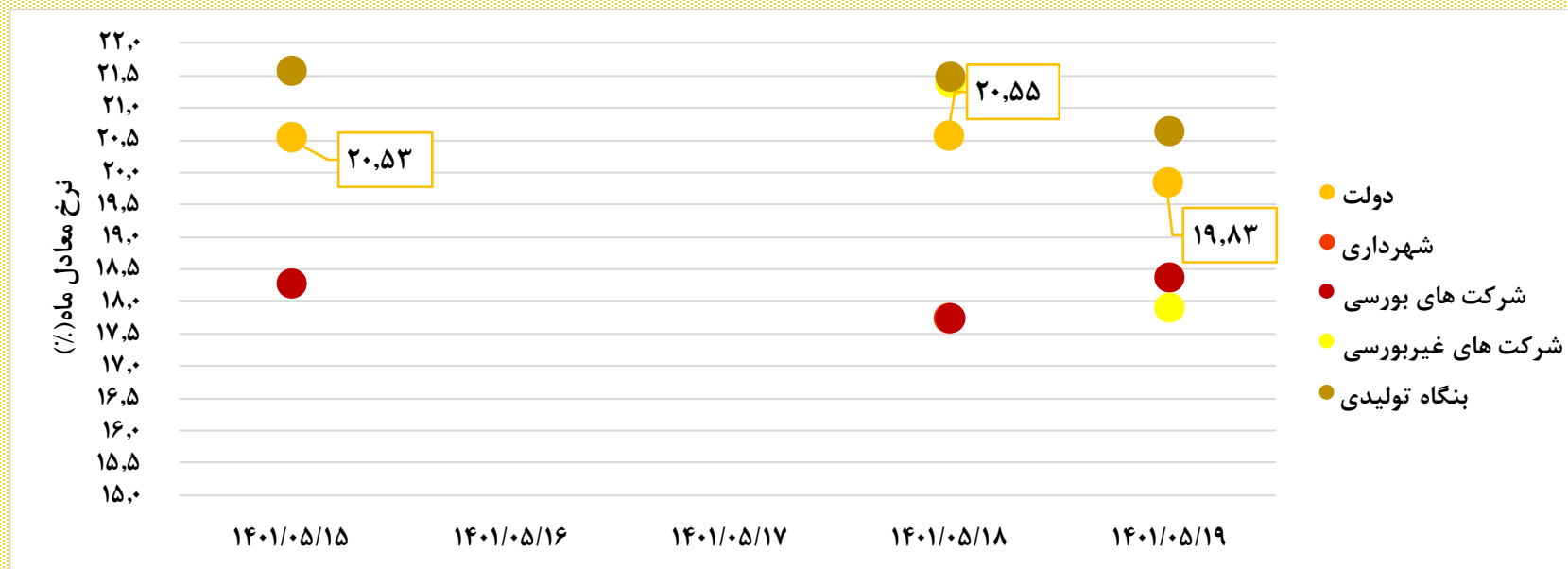
* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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

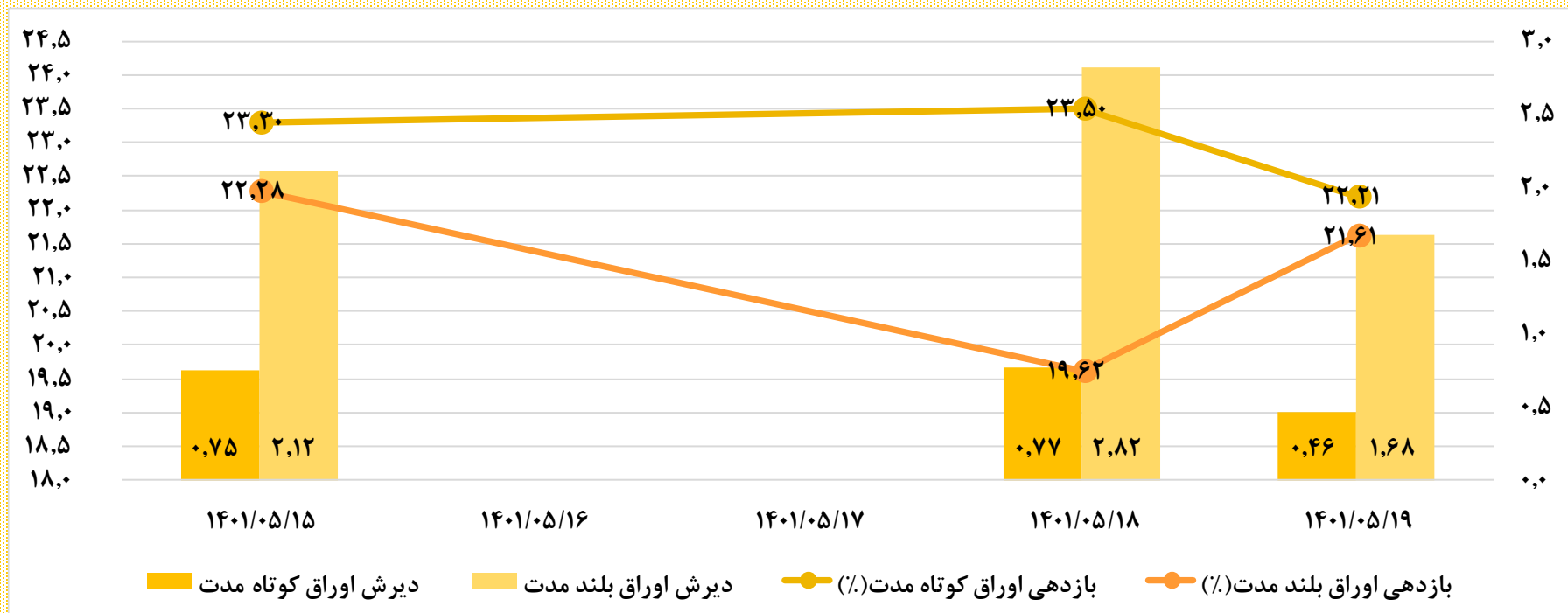




بازدهی معاملات طی هفته

* 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.





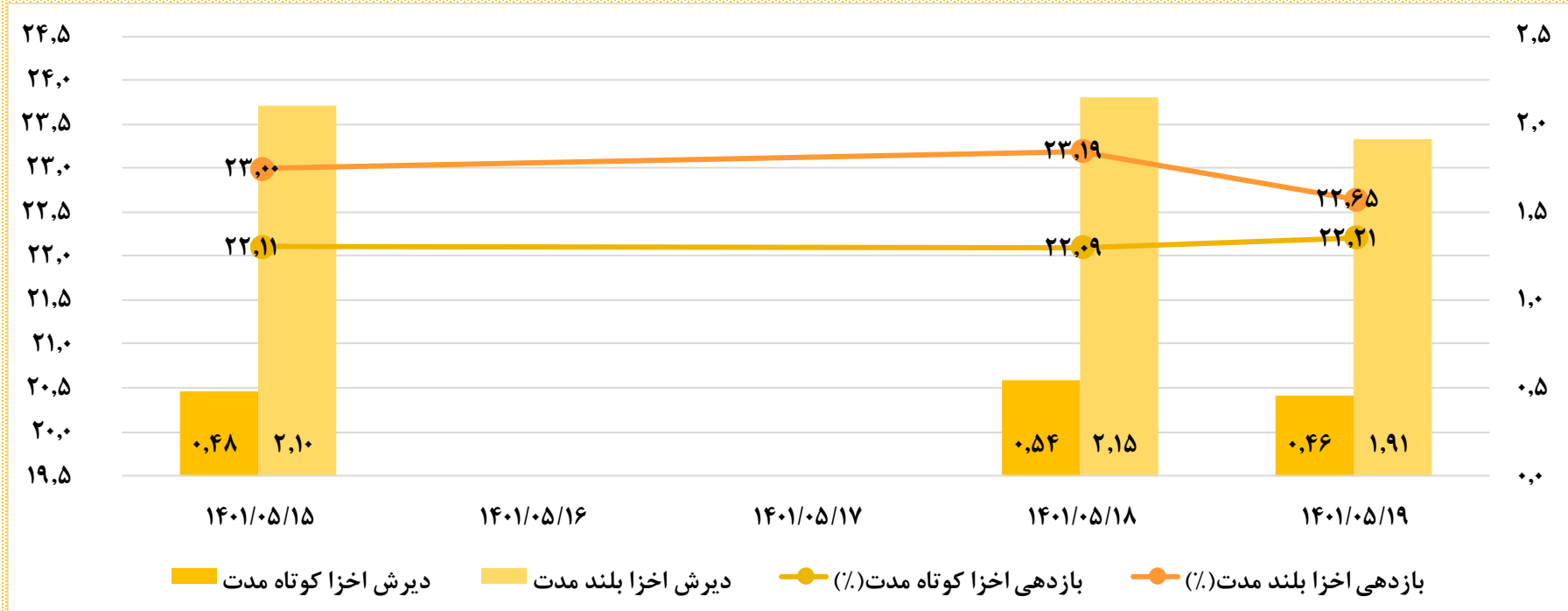
بازدهی معاملات طی هفته

*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		
-۰.۷۷٪	۲۳.۲۸٪	بازدهی اوراق کوتاه مدت
-۰.۱۴٪	۲۰.۰۵٪	بازدهی اوراق بلند مدت
-۰.۲۳٪	۲۰.۲۳٪	بازدهی کل اوراق
-۰.۰۹	۰.۷۲	دیرش اوراق کوتاه مدت
-۰.۲۶	۲.۶۲	دیرش اوراق بلند مدت
-۰.۲۲	۲.۵۱	دیرش کل اوراق

بازدهی معاملات طی هفته

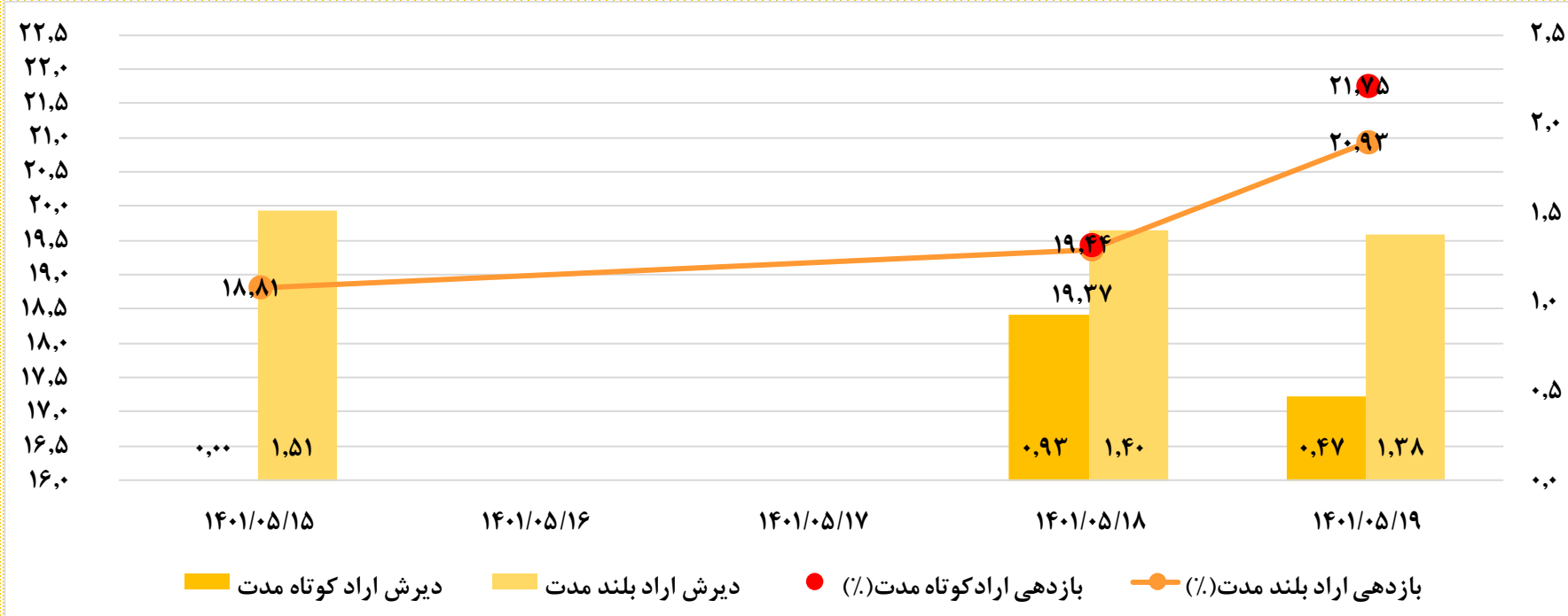


*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

*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		
بازدهی اخزا کوتاه مدت	%۲۲.۱۶	%۰.۱۲
بازدهی اخزا بلند مدت	%۲۲.۹۶	-%۰.۱۹
بازدهی کل اخزا	%۲۲.۹۰	-%۰.۱۷
دیرش اخزا کوتاه مدت	۰.۴۷	-۰.۱۹
دیرش اخزا بلند مدت	۲.۰۶	-۰.۰۷
دیرش کل اخزا	۱.۹۵	-۰.۰۹

بازدهی معاملات طی هفته

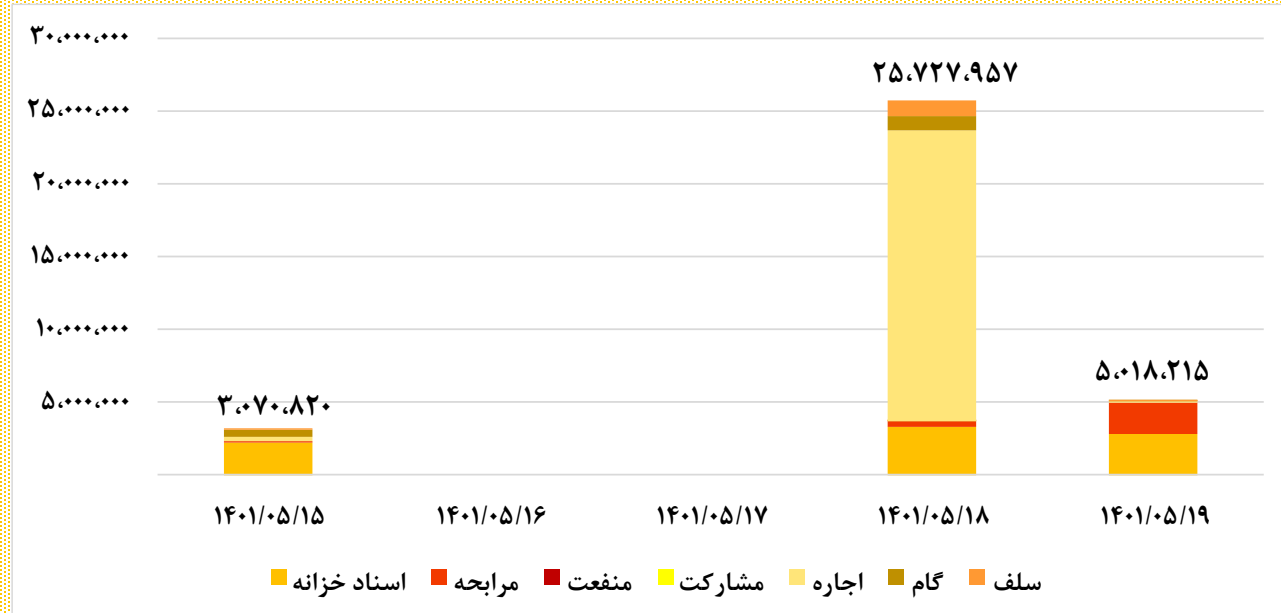


*ریسک نرخ بهره اراد بر مبنای دیرش موزون اراد های معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد.

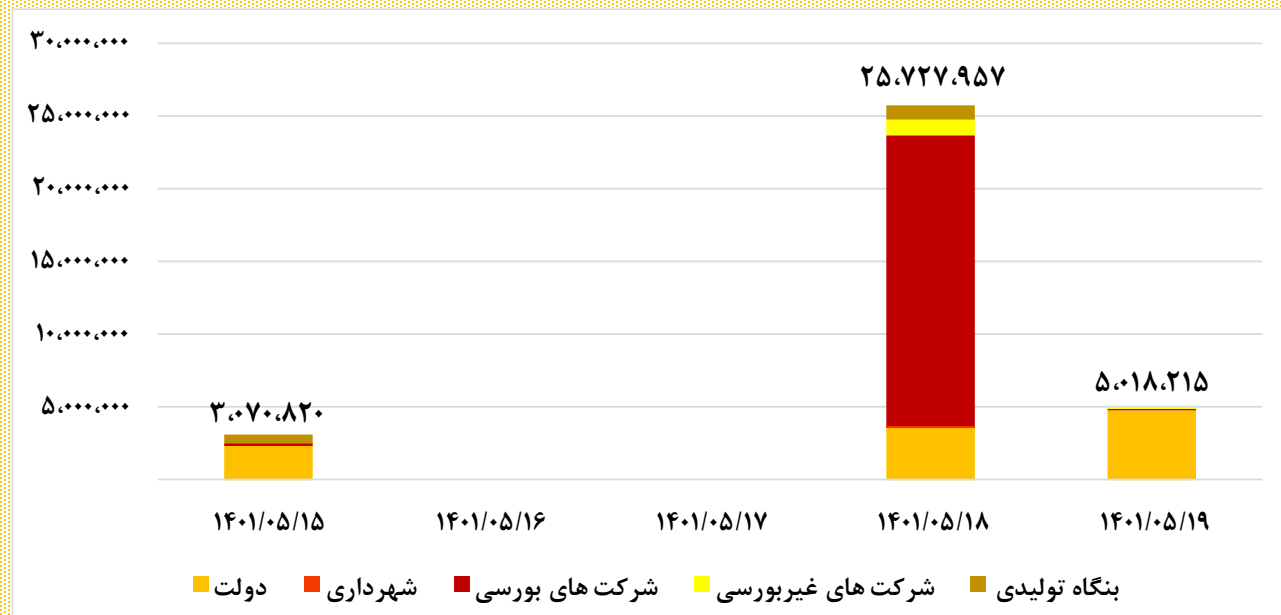
*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
-۰.۷۶٪	۱۹.۸۶٪	بازدهی اراد کوتاه مدت
۰.۲۰٪	۲۰.۶۰٪	بازدهی اراد بلند مدت
۰.۱۹٪	۲۰.۵۹٪	بازدهی کل اراد
۰.۶۵	۰.۸۵	دیرش اراد کوتاه مدت
-۰.۳۶	۱.۳۹	دیرش اراد بلند مدت
-۰.۳۶	۱.۳۹	دیرش کل اراد

براساس نوع اوراق



براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته
(نماد خرد)



ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات	تاریخ
۲۴۹,۸۰۰	۳۳۹,۲۹۹,۲۵۰	۱۴۰۱/۰۵/۱۵
-	-	۱۴۰۱/۰۵/۱۶
-	-	۱۴۰۱/۰۵/۱۷
۲۲,۳۷۳	۳۰,۳۶۳,۷۹۲	۱۴۰۱/۰۵/۱۸
۲۱,۷۴۳	۲۹,۱۲۲,۶۳۹	۱۴۰۱/۰۵/۱۹

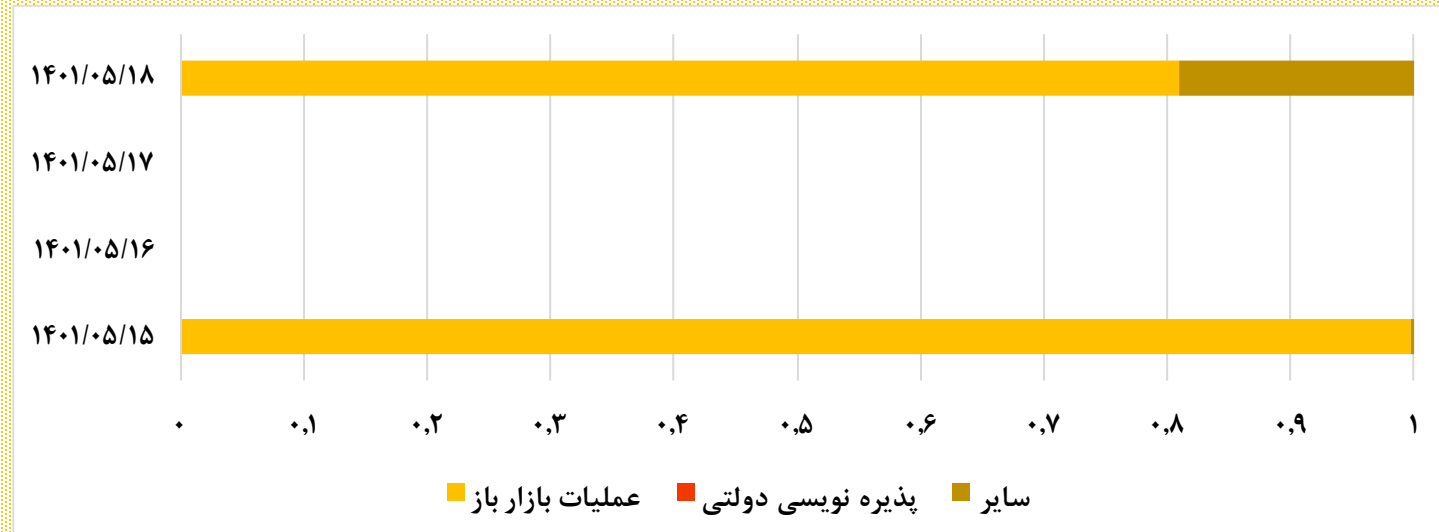
مراجعه عام دولت

ارزش معاملات (میلیارد ریال)	حجم معاملات	تاریخ
۱,۱۱۷,۳۸۵	۱,۱۷۳,۶۵۱,۶۲۸	۱۴۰۱/۰۵/۱۵
-	-	۱۴۰۱/۰۵/۱۶
-	-	۱۴۰۱/۰۵/۱۷
۷۷,۷۷۲	۸۱,۰۱۸,۲۰۸	۱۴۰۱/۰۵/۱۸
۷۱,۳۲۷	۷۴,۴۰۲,۴۸۰	۱۴۰۱/۰۵/۱۹

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	مراجعه	مراجعه
نام اوراق	مراجعه عام دولت ۳-ش.خ ۰۱۰۵	مراجعه عام دولت ۹۱-ش.خ ۰۱۰۵۲۵
نماد معاملاتی	اراد۳۸	اراد۹۱
نوع بازار	فرا بورس	فرا بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۳۹۹/۰۴/۲۴	۱۴۰۰/۰۸/۲۵
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۵/۲۴	۱۴۰۱/۰۵/۲۵
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۶ درصد	سالانه ۱۵ درصد
مواعد پرداخت سود	هر شش ماه یکبار	هر شش ماه یکبار
ارکان اوراق		
بانی / ناشر	وزارت امور اقتصادی و دارایی	وزارت امور اقتصادی و دارایی
نهاد واسط (ناشر)	-	-
ضامن	سازمان برنامه و بودجه کشور و خزانه داری کل کشور	سازمان برنامه و بودجه کشور و خزانه داری کل کشور
بازارگردان	-	-
متعهد پذیره نویس	-	-



اوراق منتشر شده
و
سررسید شده هفته آتی

اطلاعات اوراق	
نوع اوراق	مراجعه
نام اوراق	صکوک مراجعه کرازی ۵۰۵-۳ماهه ۱۸٪
نماد معاملاتی	صرازی ۵۰۵
نوع بازار	بورس
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۶,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار	۱۴۰۱/۰۵/۲۲
تاریخ سررسید	۱۴۰۵/۰۵/۲۲
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۸ درصد
مواعد پرداخت سود	هر سه ماه یک بار
ارکان اوراق	
بانی / ناشر	شرکت کارخانجات تولیدی شیشه دارویی رازی
نهاد واسط (ناشر)	شرکت واسط مالی مرداد پنجم
ضامن	بانک کارآفرین
بازارگردان	شرکت تامین سرمایه بانک ملت
متعهد پذیره نویس	شرکت تامین سرمایه بانک ملت

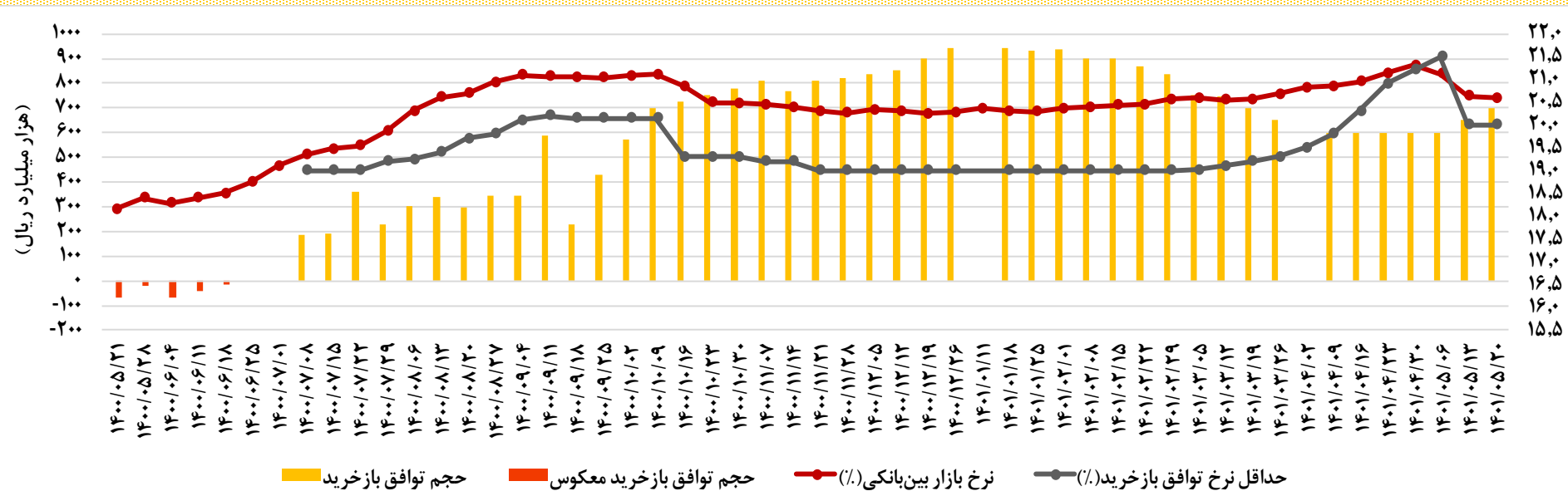
یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۲۰

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)
۱۴۰۱/۰۴/۲۶	۵۹۹	-	۶۰۱.۱	-۲.۱
۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۵۹۹	-	۶۰۱.۹	-۲.۹
۱۴۰۱/۰۵/۱۰	۶۵۰.۱	-	۶۰۱.۵	۴۸.۶
۱۴۰۱/۰۵/۱۵	۶۹۹.۸	-	۶۵۱.۹	۴۷.۹
جمع	۲۵۴۷.۹	-	۲۴۵۶.۴	۹۱.۵

ابزارهای سیاست پولی
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی	
۲۰.۵۸	۱۴۰۱/۰۵/۱۵
تعطیل	۱۴۰۱/۰۵/۱۶
تعطیل	۱۴۰۱/۰۵/۱۷
۲۰.۵۸	۱۴۰۱/۰۵/۱۸
۲۰.۶۱	۱۴۰۱/۰۵/۱۹





هانیه آتش روز
دانشجوی ارشد مهندسی مالی
دانشگاه تهران

 h.atashrooz@ut.ac.ir

 Hanieh Atashrooz