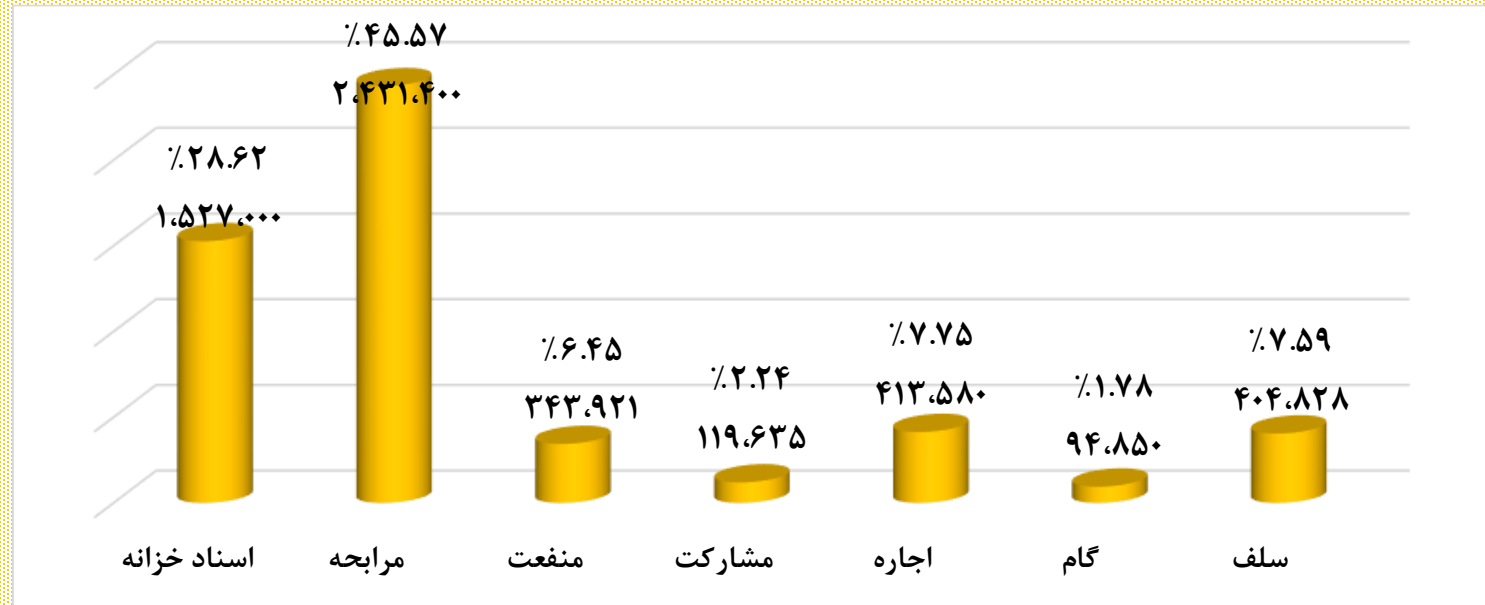


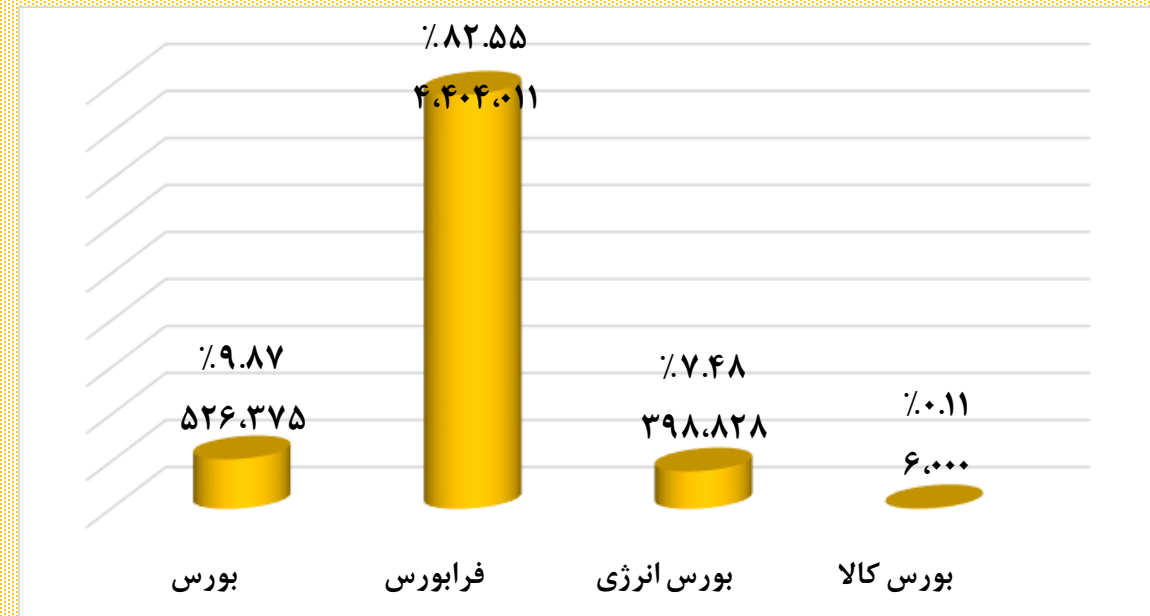
# گزارش هفتگی بازار اوراق بدهی

هفته منتهی به ۲۷ مرداد ۱۴۰۱

## براساس نوع اوراق



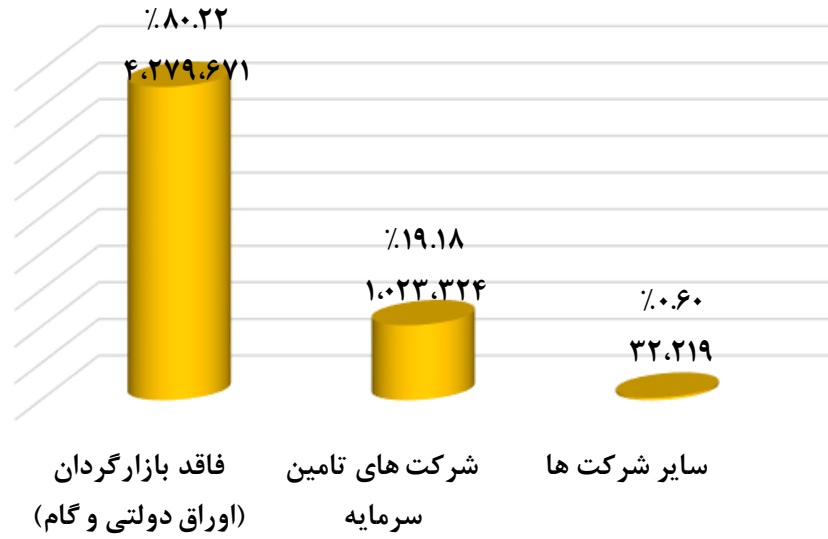
## براساس نوع بازار



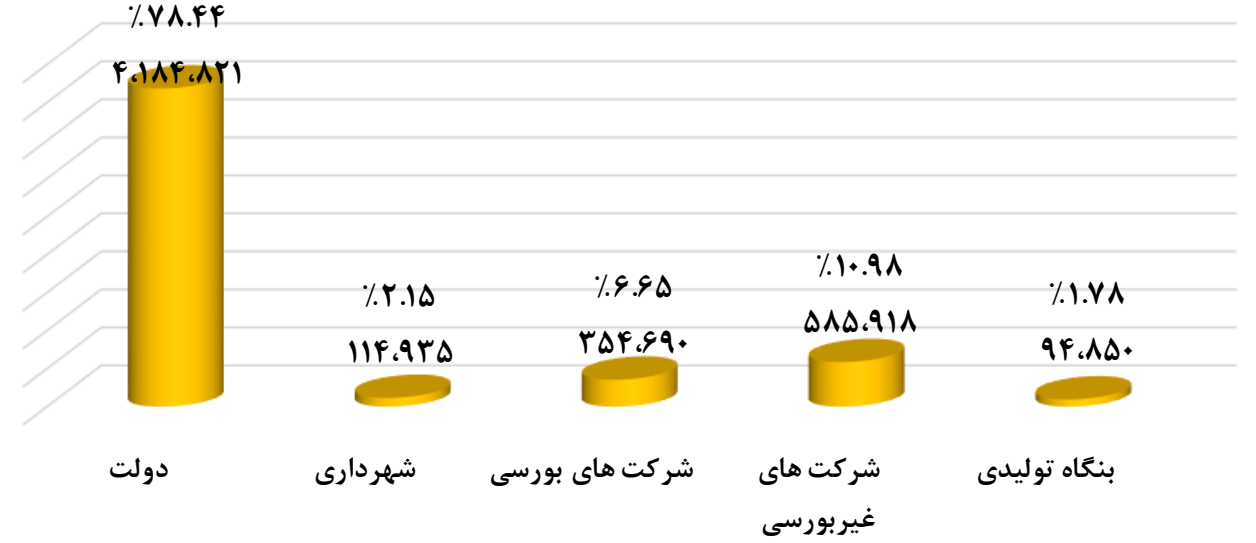
حجم اوراق موجود  
بر مبنای قیمت سررسید  
(ارقام به میلیارد ریال)



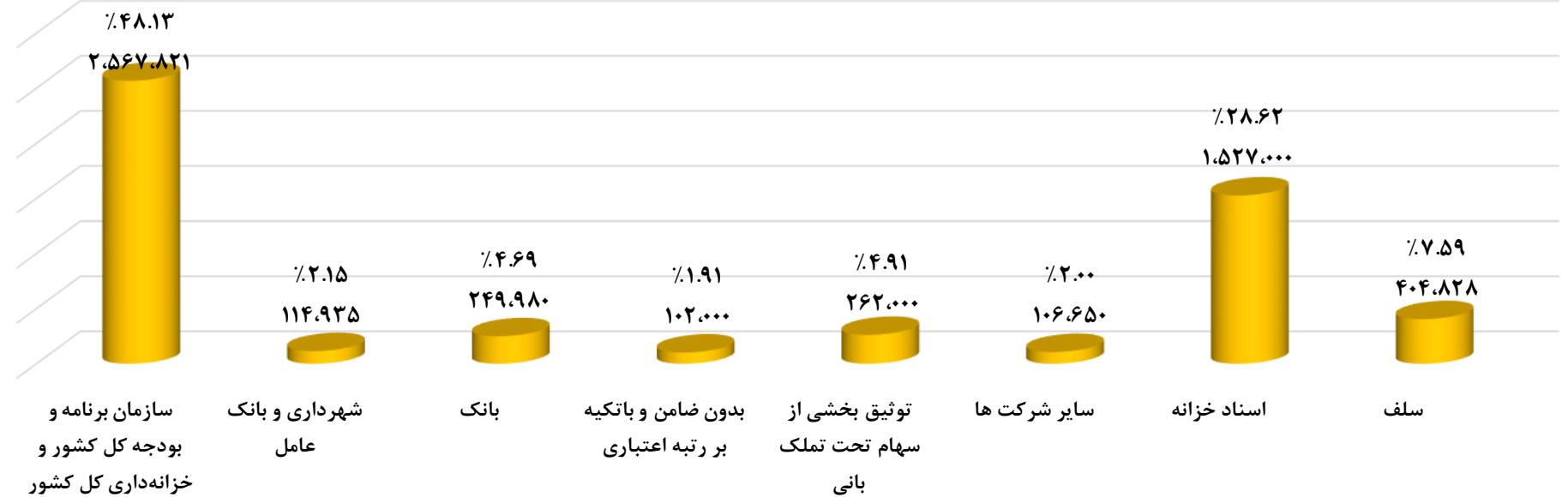
## براساس نوع بازارگردان



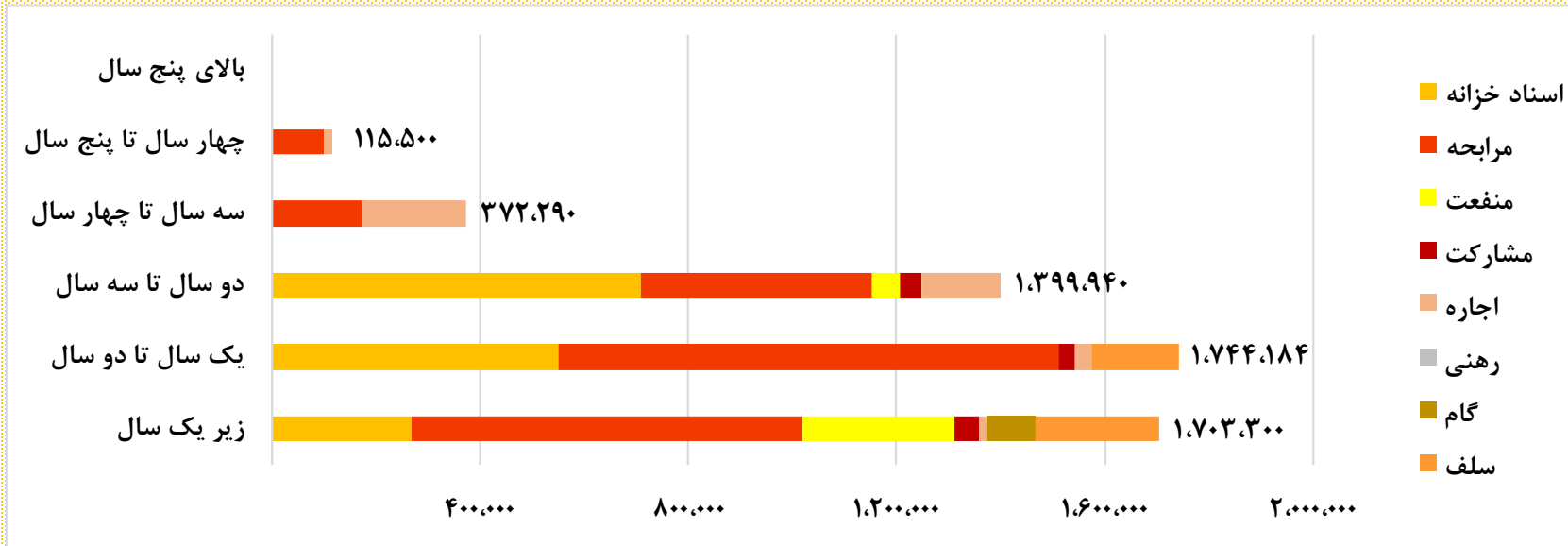
## براساس نوع بانی



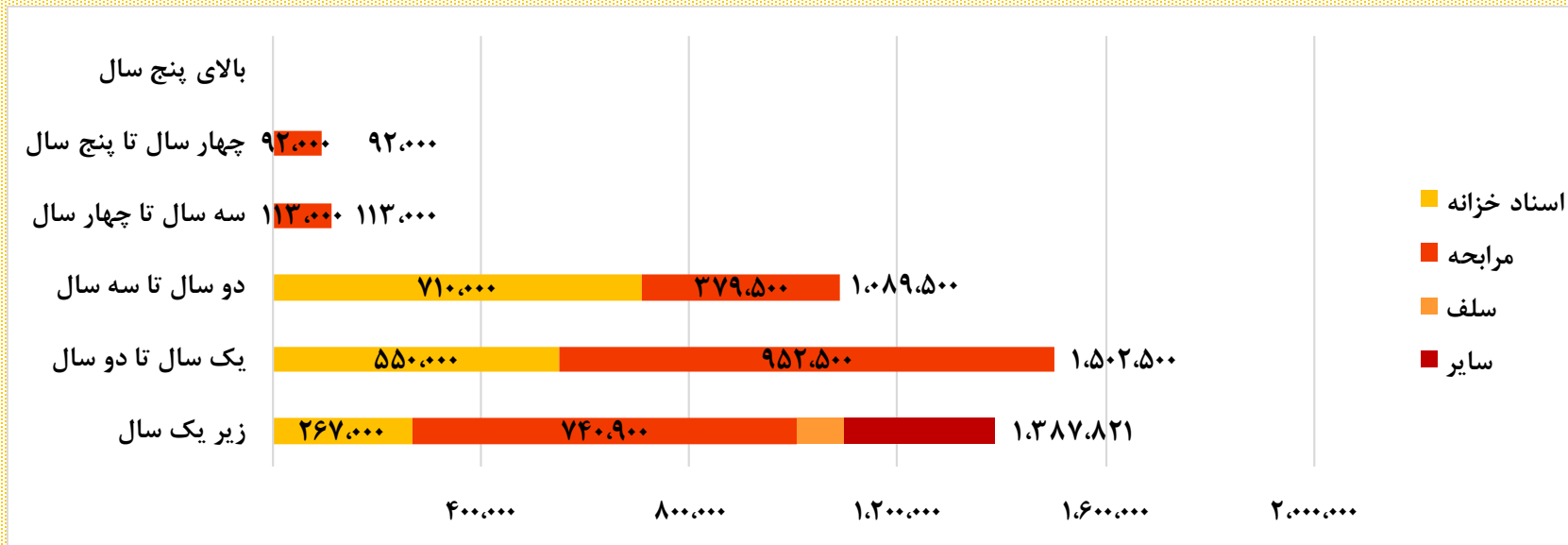
## براساس نوع ضامن



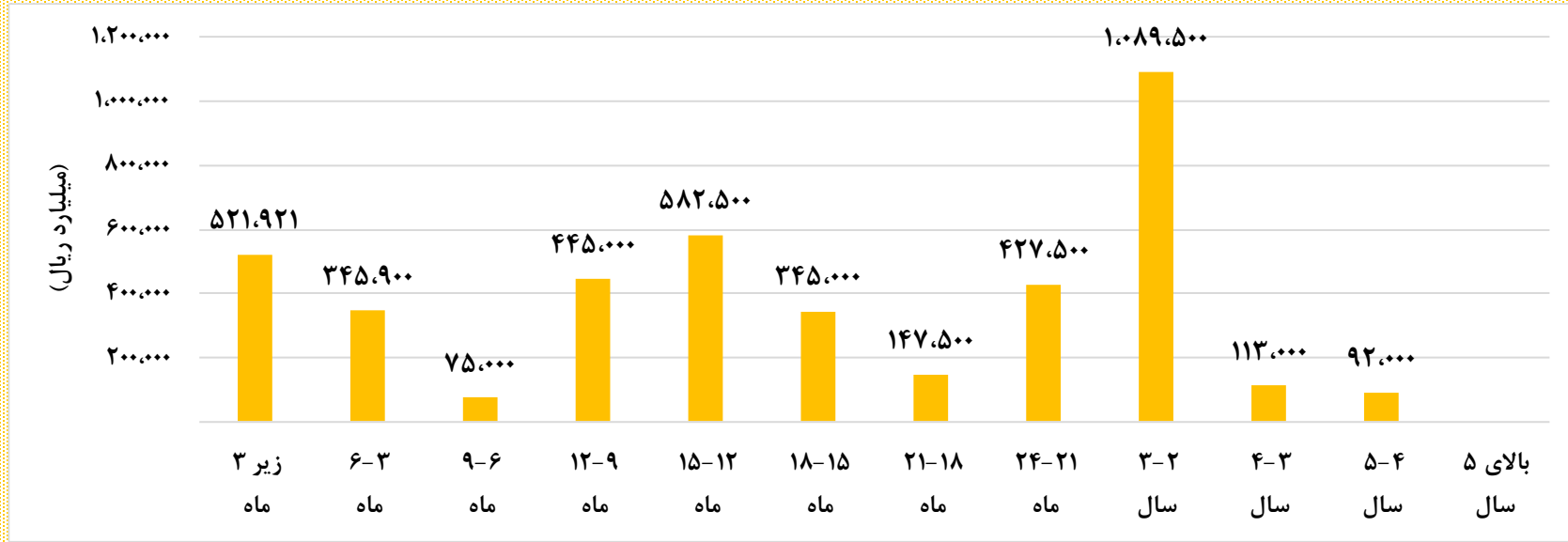
## براساس زمان تا سررسید



## حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید

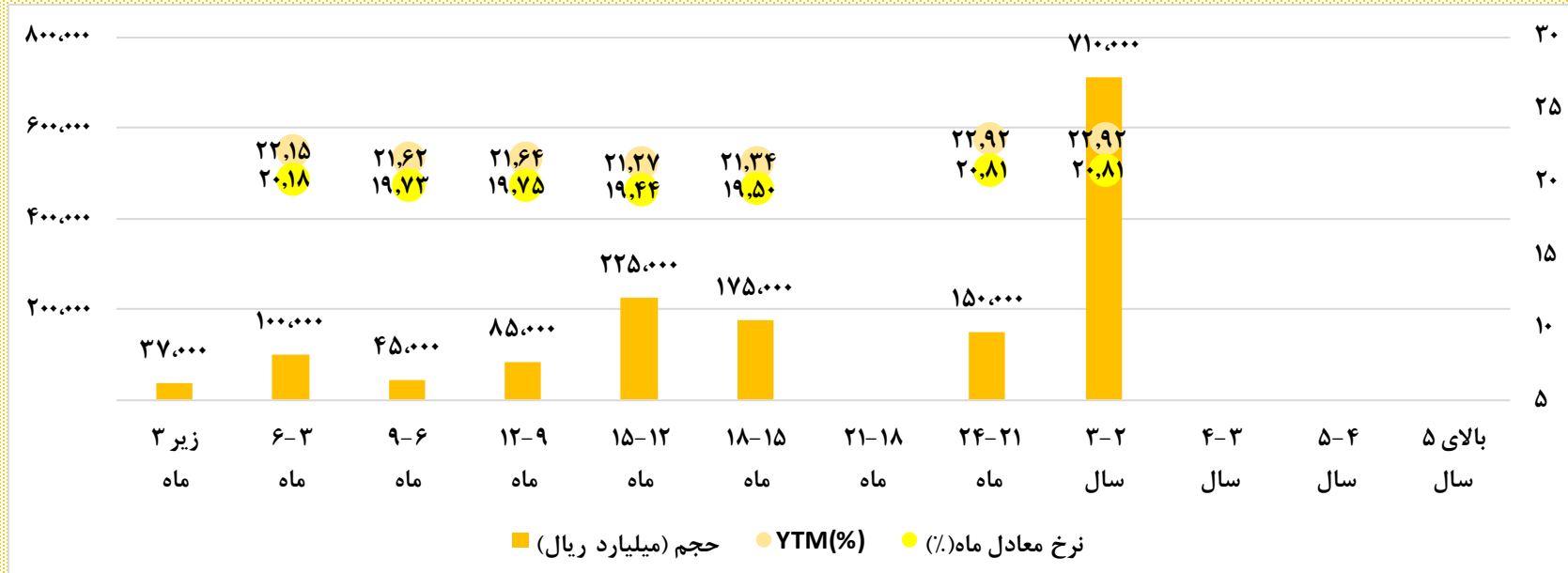


## حجم اوراق دولتی موجود براساس زمان تا سررسید



\* 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

٪۲۲.۰۹

میانگین YTM اسناد خزانه بلند مدت

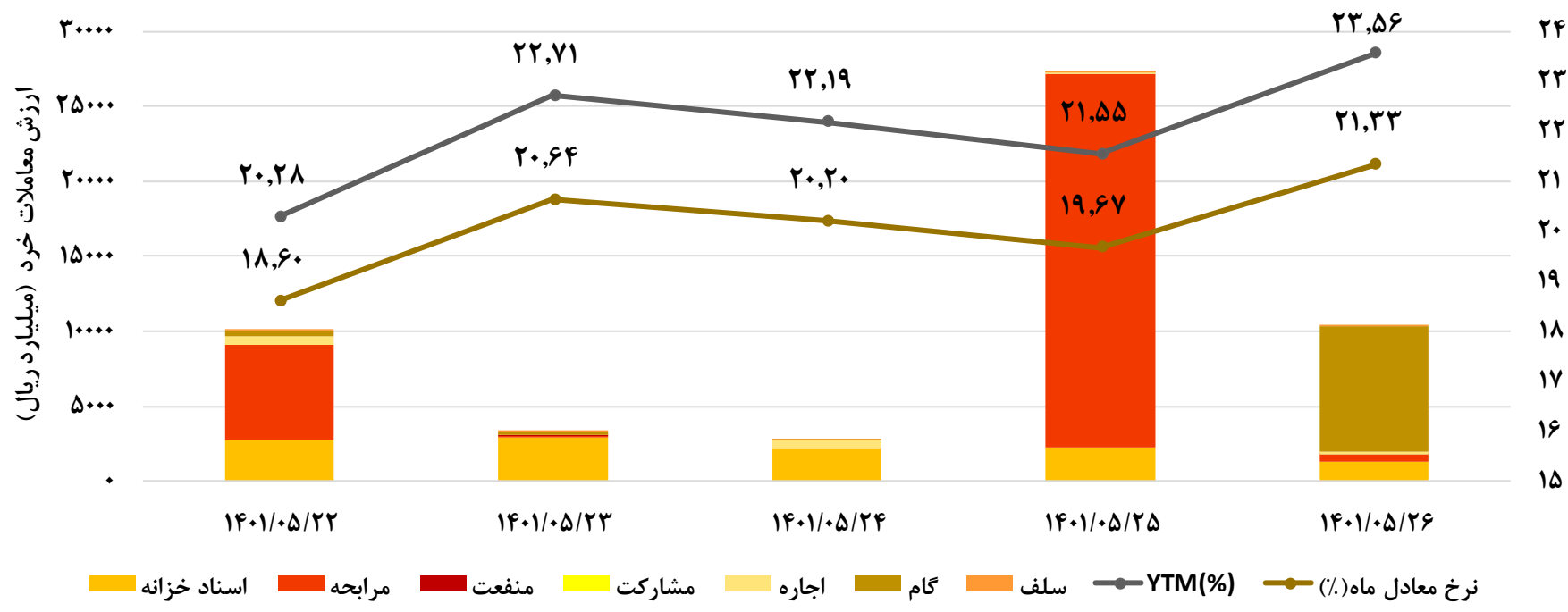
٪۲۲.۷۳

میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه کوتاه مدت

٪۲۰.۱۲

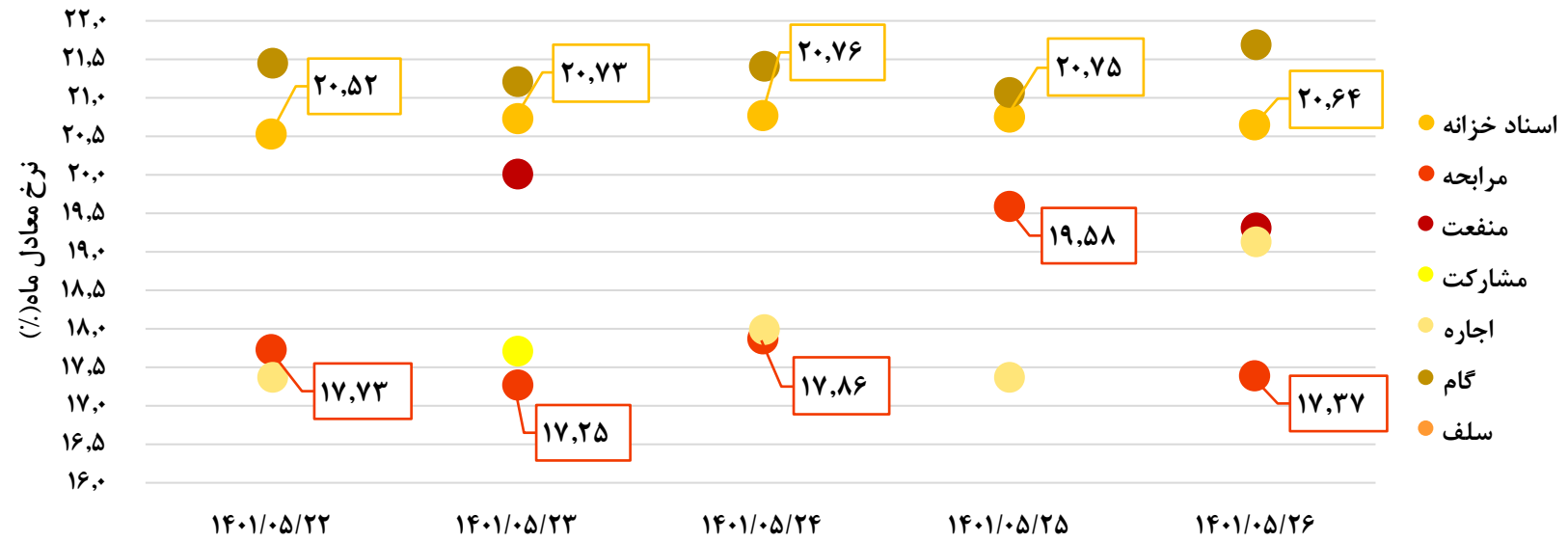
میانگین بازدهی معادل ماه اسناد خزانه بلند مدت

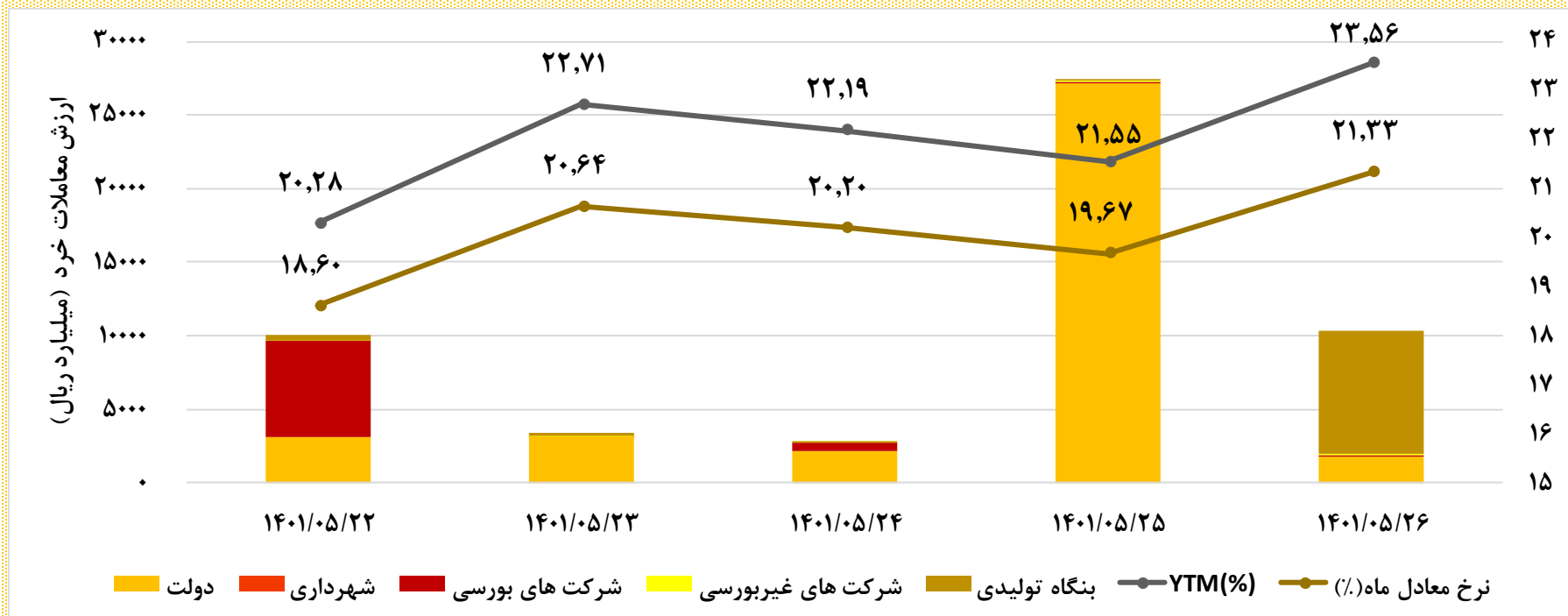
٪۲۰.۶۶



بازدهی معاملات طی هفته

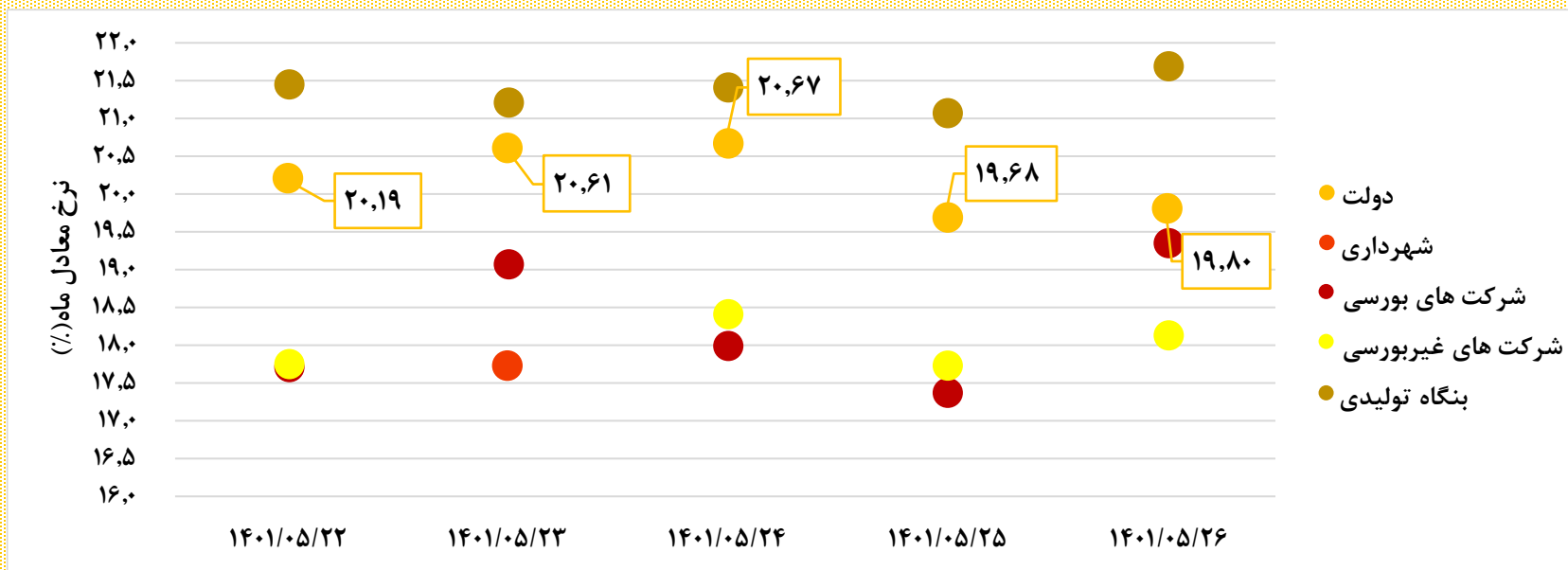
\* بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون اوراق معامله شده در طی روزهای معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و نرخ بازدهی معادل ماه و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته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

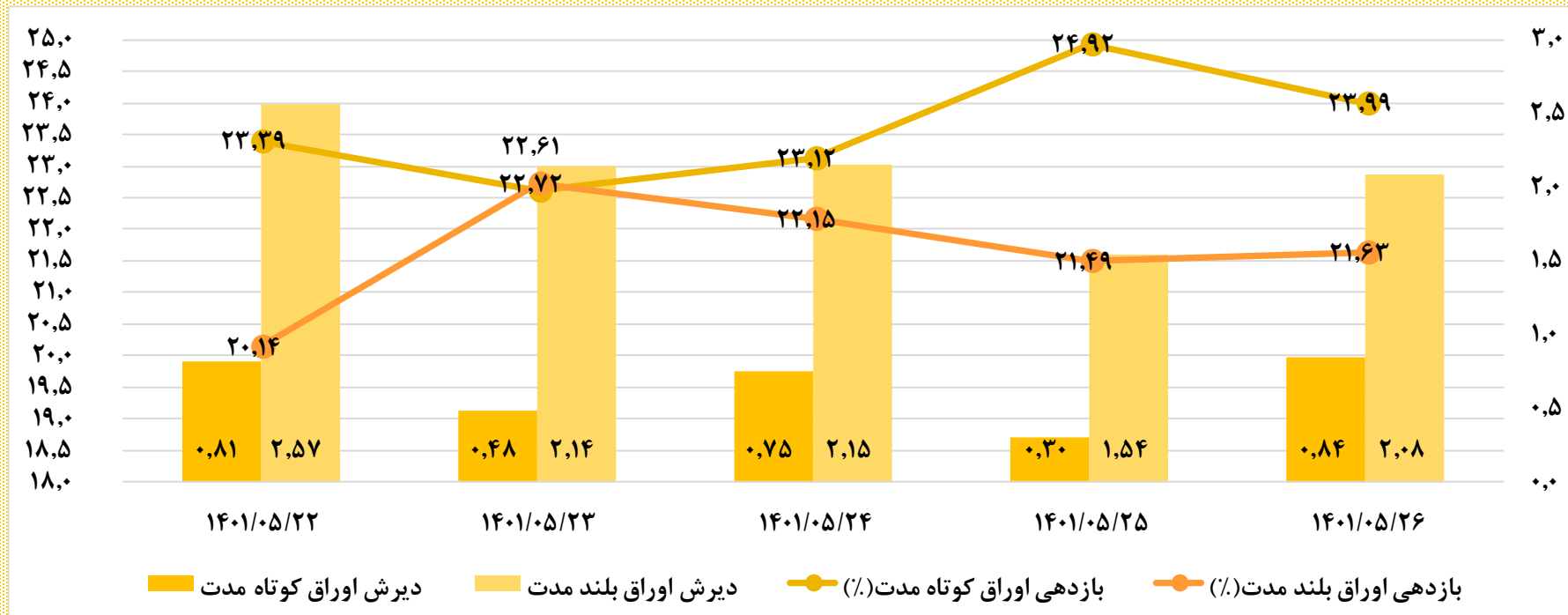




### بازدهی معاملات طی هفته

\* 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

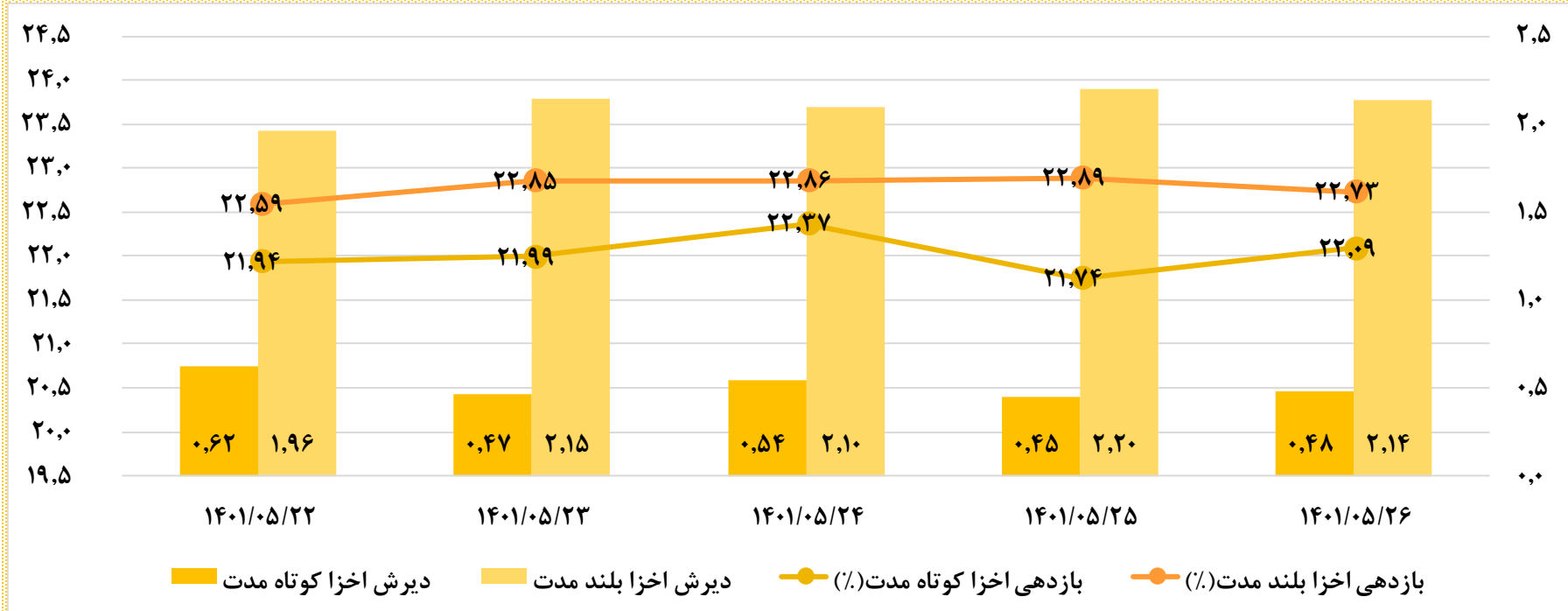
\*ریسک نرخ بهره اوراق بر مبنای دیرش موزون اوراق معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اوراق می باشد.

\*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		
۰.۶۷%	۲۳.۹۵%	بازدهی اوراق کوتاه مدت
۱.۲۷%	۲۱.۳۲%	بازدهی اوراق بلند مدت
۱.۵۷%	۲۱.۸۰%	بازدهی کل اوراق
۰.۰۷	۰.۸۰	دیرش اوراق کوتاه مدت
-۰.۷۵	۱.۸۷	دیرش اوراق بلند مدت
-۰.۸۴	۱.۶۷	دیرش کل اوراق



بازدهی معاملات طی هفته

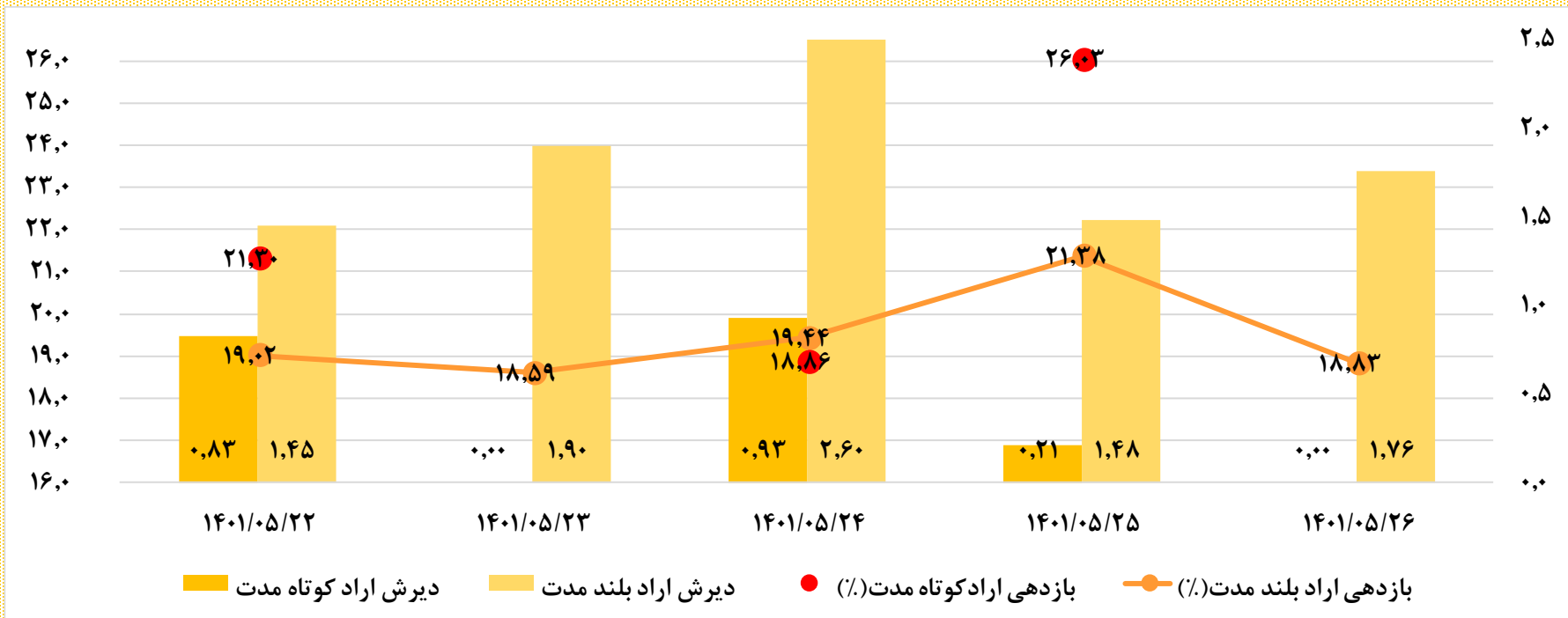


\*ریسک نرخ بهره اخزا بر مبنای دیرش موزون اخزاهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اخزا می باشد. دیرش اوراق بدون کوپن برابر با زمان تا سررسید آنها می باشد.

\*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	%۲۱.۹۴	-۰.۲۱%
بازدهی اخزا بلند مدت	%۲۲.۷۸	-۰.۱۸%
بازدهی کل اخزا	%۲۲.۷۶	-۰.۱۵%
دیرش اخزا کوتاه مدت	۰.۵۰	۰.۰۳
دیرش اخزا بلند مدت	۲.۱۰	۰.۰۴
دیرش کل اخزا	۲.۰۵	۰.۱۰

بازدهی معاملات طی هفته

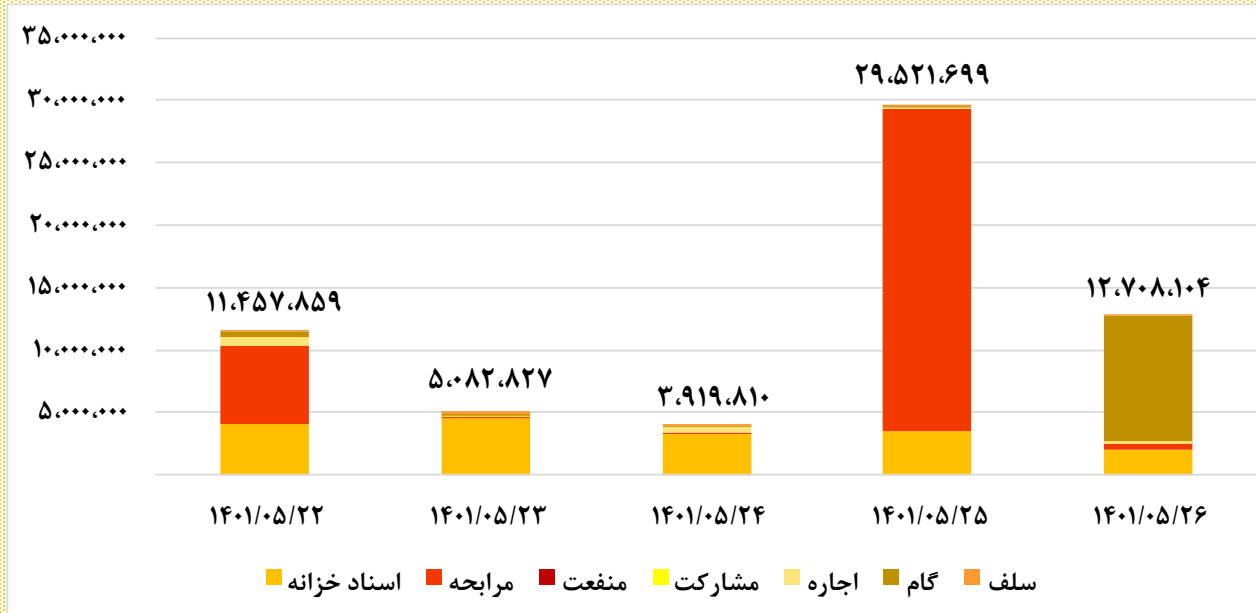


\*ریسک نرخ بهره اراد بر مبنای دیرش موزون اراد های معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد.

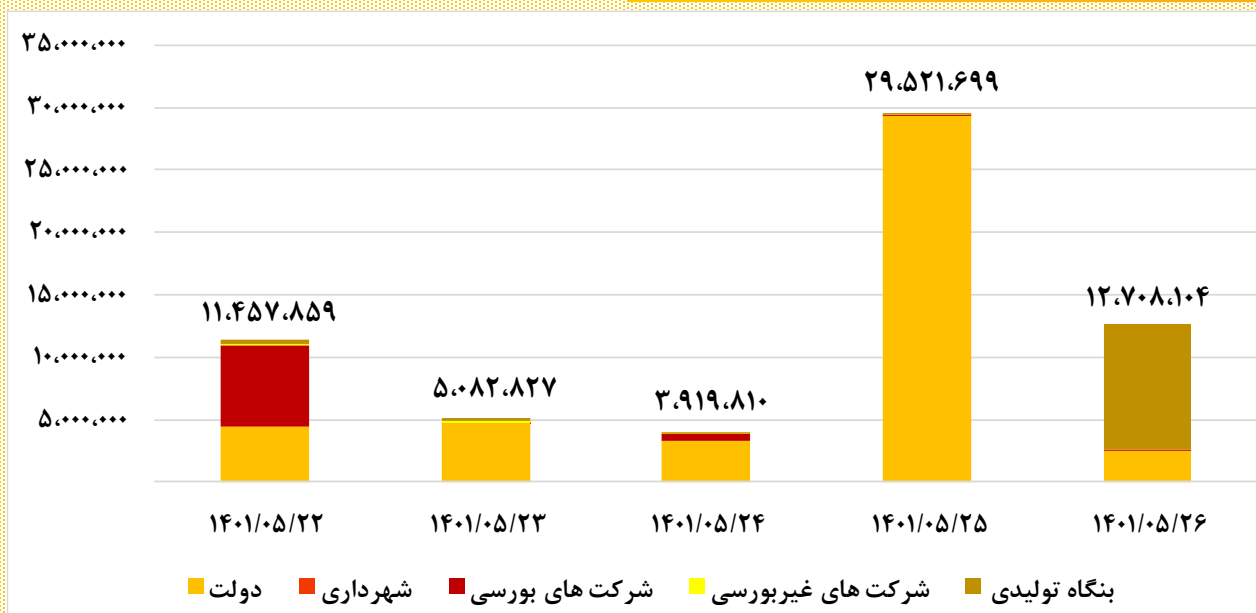
\*بازدهی معاملات طی هفته بر مبنای بازدهی موزون ارادهای معامله شده در طی روز های معاملاتی محاسبه گردیده است؛ بازدهی انتخاب شده YTM و وزن محاسبه شده ارزش معاملات روز اراد می باشد. بازدهی آن دسته از اوراقی که به دلیل شرایط خاص بازار بسیار بالا و یا بسیار پایین می باشد نادیده گرفته شده است و نرخ بازدهی معادل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

تغییر نسبت به هفته قبل		
٪۶.۰۶	٪۲۵.۹۲	بازدهی اراد کوتاه مدت
٪۰.۶۹	٪۲۱.۲۹	بازدهی اراد بلند مدت
٪۰.۷۶	٪۲۱.۳۵	بازدهی کل اراد
-۰.۶۳	۰.۲۲	دیرش اراد کوتاه مدت
۰.۱۰	۱.۴۹	دیرش اراد بلند مدت
۰.۰۹	۱.۴۷	دیرش کل اراد

## براساس نوع اوراق



## براساس نوع بانی



حجم معاملات طی هفته  
(نماد خرد)



تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۵/۲۲	۲۸,۸۳۱,۲۷۵	۲۱,۴۹۹
۱۴۰۱/۰۵/۲۳	۳۳,۸۵۸,۸۲۴	۲۵,۴۷۸
۱۴۰۱/۰۵/۲۴	۳۳۴,۵۸۶,۹۶۵	۲۴۸,۳۳۹
۱۴۰۱/۰۵/۲۵	۳۷,۵۰۶,۱۷۸	۳۱,۴۹۳
۱۴۰۱/۰۵/۲۶	۳۰,۹۹۶,۷۷۲	۲۴,۷۱۵

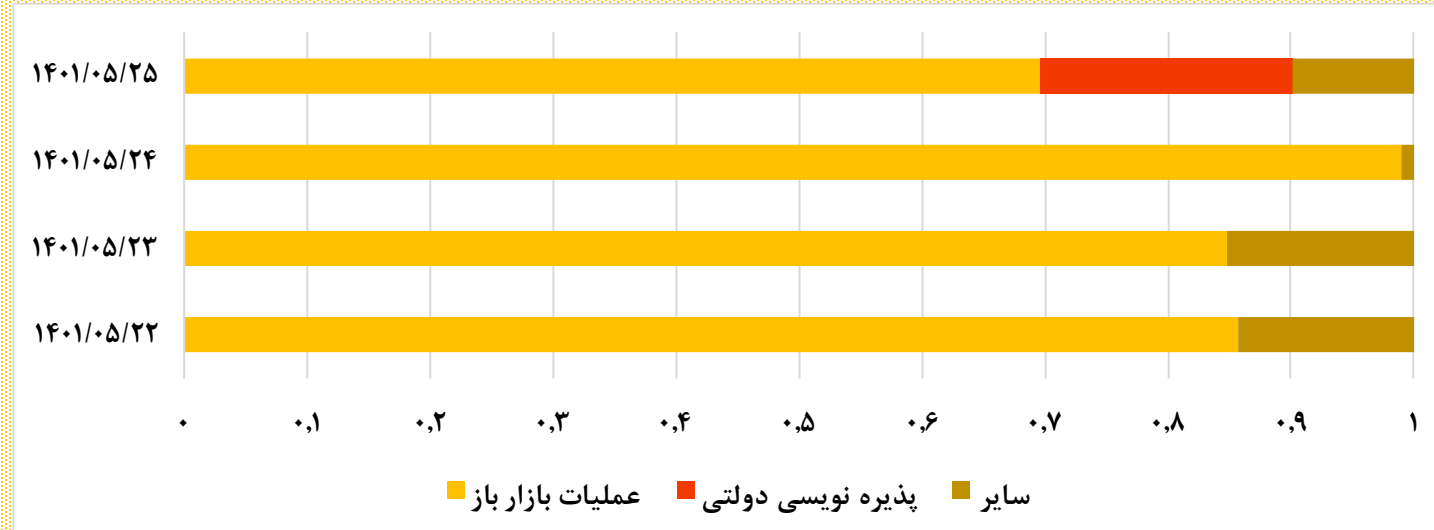
مرابحه عام دولت

تاریخ	حجم معاملات	ارزش معاملات (میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۵/۲۲	۷۰,۲۳۴,۸۹۶	۶۷,۰۴۲
۱۴۰۱/۰۵/۲۳	۶۸,۸۲۹,۷۰۹	۶۵,۷۵۱
۱۴۰۱/۰۵/۲۴	۱,۳۴۸,۵۹۵,۴۴۵	۱,۲۸۶,۲۴۵
۱۴۰۱/۰۵/۲۵	۱۱۵,۹۸۱,۳۷۳	۱۱۲,۱۱۲
۱۴۰۱/۰۵/۲۶	۱۰۱,۶۴۸,۱۰۴	۹۷,۶۴۶

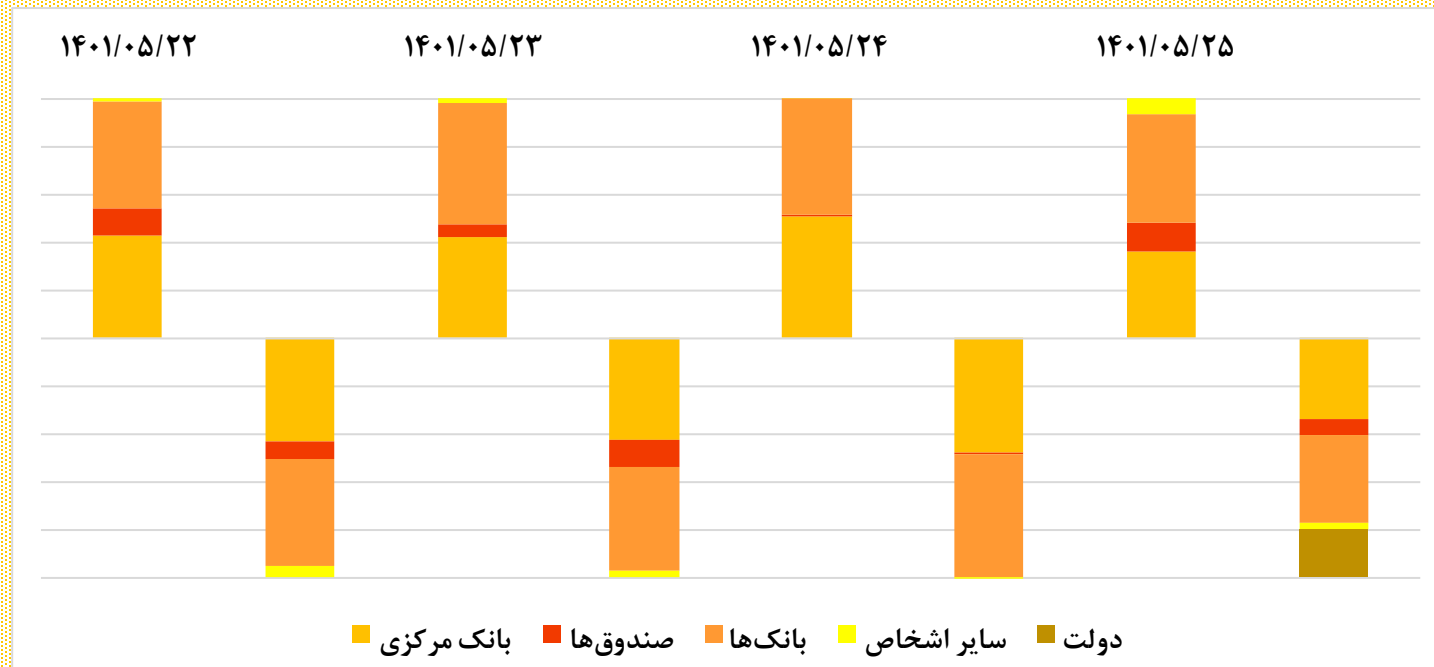
معاملات طی هفته  
(نماد عمده)



## 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	گام	سلف موازی استاندارد
نام اوراق	گام بانک تجارت ۰۱۰۵	سلف پلی اتیلن سنگین تزریقی
نماد معاملاتی	اگ۰۱۰۵۱۸	عپلی جم
نوع بازار	بورس	بورس کالا
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰
تاریخ انتشار/عرضه	۱۴۰۰/۱۰/۲۶	۱۳۹۹/۰۶/۰۴
تاریخ سررسید	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	۱۴۰۱/۰۶/۰۴
نرخ سود اسمی	بدون پرداخت سود	بدون پرداخت سود
مواعد پرداخت سود	-	-
ارکان اوراق		
بانی / ناشر	بانک تجارت	شرکت پتروشیمی جم
نهاد واسط (ناشر)	-	-
ضامن	بانک تجارت و بنگاه متعهد	-
بازارگردان	ندارد	شرکت تامین سرمایه امین
متعهد پذیره نویس	ندارد	شرکت تامین سرمایه امین

اطلاعات اوراق		ارکان اوراق	
نوع اوراق	مشارکت	مشارکت	نوع اوراق
نام اوراق	مشارکت ش اردبیل ۴۷-۳ ماهه ۱۸٪	مشارکت ش اردبیل ۴۷-۳ ماهه ۱۸٪	نام اوراق
نماد معاملاتی	اردبیل ۴۷	اردبیل ۴۷	نماد معاملاتی
نوع بازار	بورس	بورس	نوع بازار
حجم کل اوراق (میلیون ریال)	۶۰۰،۰۰۰	۶۰۰،۰۰۰	حجم کل اوراق (میلیون ریال)
تاریخ انتشار	۱۴۰۱/۰۵/۲۹	۱۴۰۱/۰۶/۰۱	تاریخ انتشار
تاریخ سررسید	۱۴۰۴/۰۷/۱۰	۱۴۰۴/۰۴/۰۱	تاریخ سررسید
نرخ سود اسمی	سالانه ۱۸ درصد	سالانه ۱۸ درصد	نرخ سود اسمی
مواعد پرداخت سود	هر سه ماه یک بار از تاریخ انتشار	هر شش ماه یک بار از تاریخ انتشار	مواعد پرداخت سود
بانی / ناشر	شهرداری اردبیل	وزارت امور اقتصادی و دارایی	بانی / ناشر
نهاد واسط (ناشر)	-	-	نهاد واسط (ناشر)
ضامن	براساس مجوز بانک مرکزی شهرداری اردبیل و سازمان برنامه و بودجه کشور و براساس قرارداد ضمانت بانک ملی	سازمان برنامه و بودجه کل کشور و خزانه داری کل کشور	ضامن
بازارگردان	شرکت تامین سرمایه تمدن	ندارد	بازارگردان
متعهد پذیره نویسی	-	ندارد	متعهد پذیره نویسی

اوراق منتشر شده  
و  
سررسید شده هفته آتی



یک ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۲۷

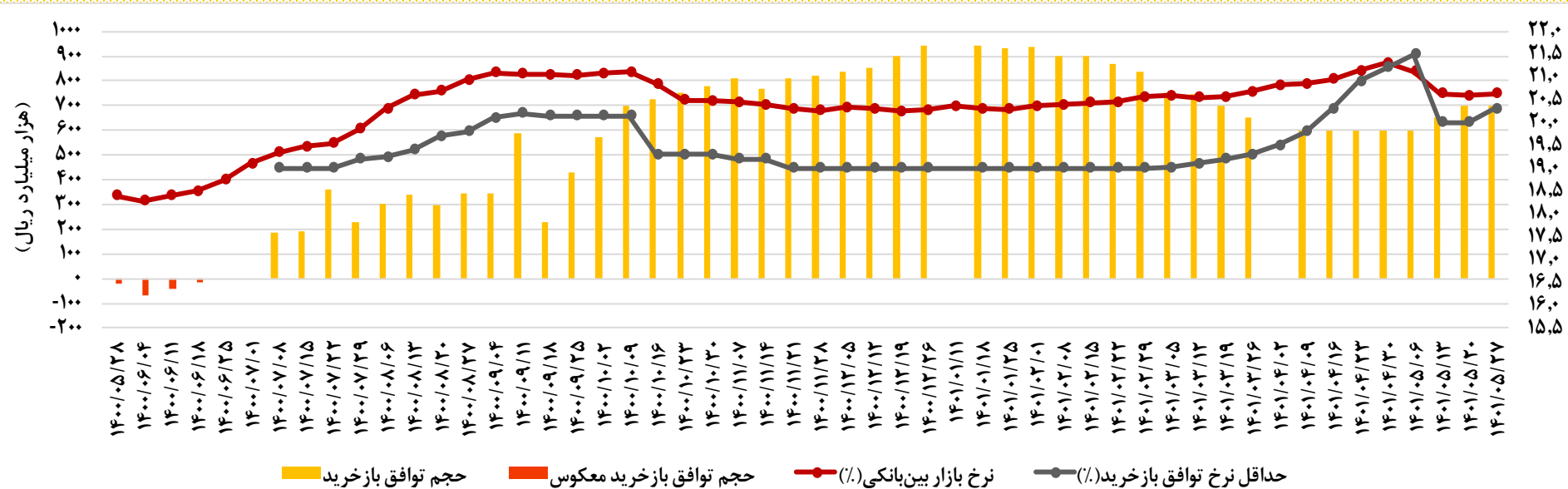
تاریخ	حجم توافق باز خرید (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید معکوس (ریپو معکوس) (هزار میلیارد ریال)	حجم توافق باز خرید سررسید شده (ریپو) (هزار میلیارد ریال)	خالص تزریق نقدینگی (هزار میلیارد ریال)
۱۴۰۱/۰۵/۰۳	۵۹۹	-	۶۰۱.۹	-۲.۹
۱۴۰۱/۰۵/۱۰	۶۵۰.۱	-	۶۰۱.۵	۴۸.۶
۱۴۰۱/۰۵/۱۵	۶۹۹.۸	-	۶۵۱.۹	۴۷.۹
۱۴۰۱/۰۵/۲۴	۷۰۰	-	۷۰۳.۳	-۳.۳
جمع	۲۶۴۸.۹	-	۲۵۵۸.۶	۹۰.۳

ابزارهای سیاست پولی  
بانک مرکزی



نرخ بازار بین بانکی

۲۰.۶۱	۱۴۰۱/۰۵/۲۲
۲۰.۶۱	۱۴۰۱/۰۵/۲۳
۲۰.۶۲	۱۴۰۱/۰۵/۲۴
۲۰.۶۵	۱۴۰۱/۰۵/۲۵
۲۰.۷۱	۱۴۰۱/۰۵/۲۶







هانیه آتش روز  
دانشجوی ارشد مهندسی مالی  
دانشگاه تهران

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

 Hanieh Atashrooz

