ماهنامه بازار بدهی

شماره ۷ - دی ۱۴۰۲

شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت

دارا الگوریتم

بازدهی محقق شده در دی ماه ۱۴۰۲

٪۲۷۱۶

مؤثر سالیانه

هم‌پای هم رشد می‌کنیم

صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت

راسا الگوریتم

تقسیم سود ۲۴/۹۴ درصد سالیانه در دی ماه ۱۴۰۲

آخرین نرخ بازدهی مؤثر سالیانه

٪۲۸

هم‌پای هم رشد می‌کنیم

فهرست

بـــازار پول

- رونـــد نقـــدینگی و پـــایه پولی
- رشد ماهانه نقدینگی و پایه پولی
- ضریب فزاینده نقدینگی و نسبت پول به نقدینگی

بـــازار بدهی

- شـــاخص صـکوک
- ترکیب اوراق بدهی
- عملیات بـــازار بـــاز
- معاملات اوراق اسلامی
- نرخ بهره
- اسناد خزانه اسلامی
- گواهی اعتبـــار مولد
- مقایسه اوراق منتشر شده و بودجه

صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

- با تقسـیم ســـود
- بدون تقسیم سود

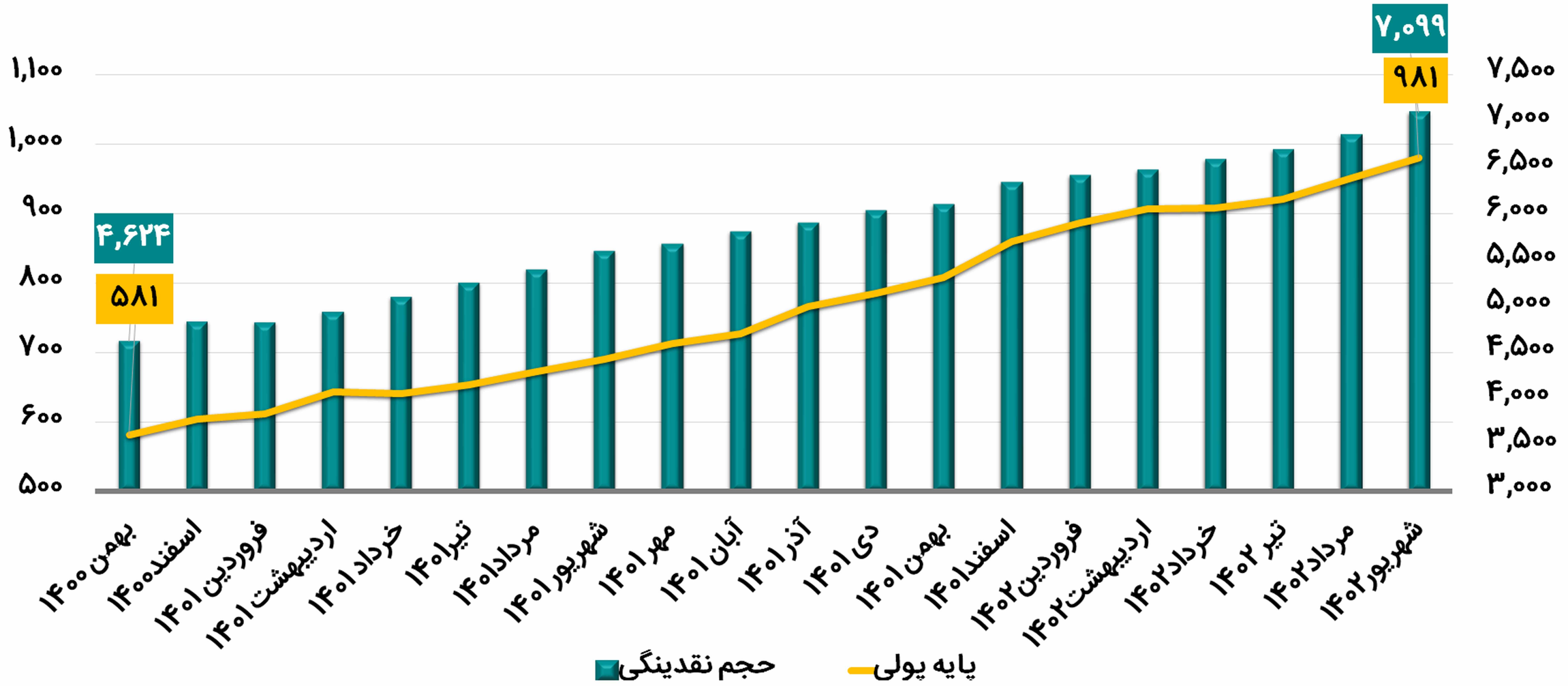
شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL



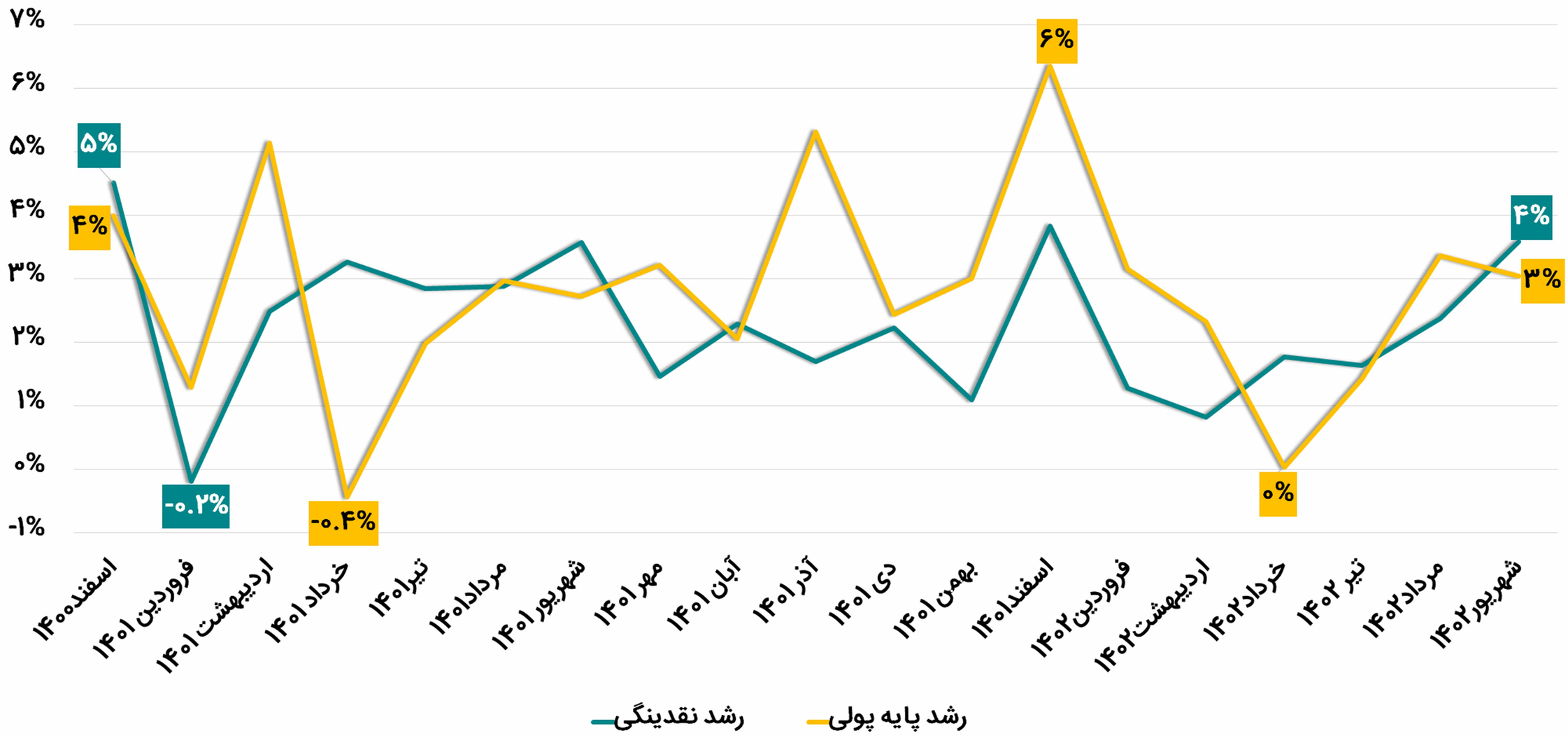
بـــازار پول

شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

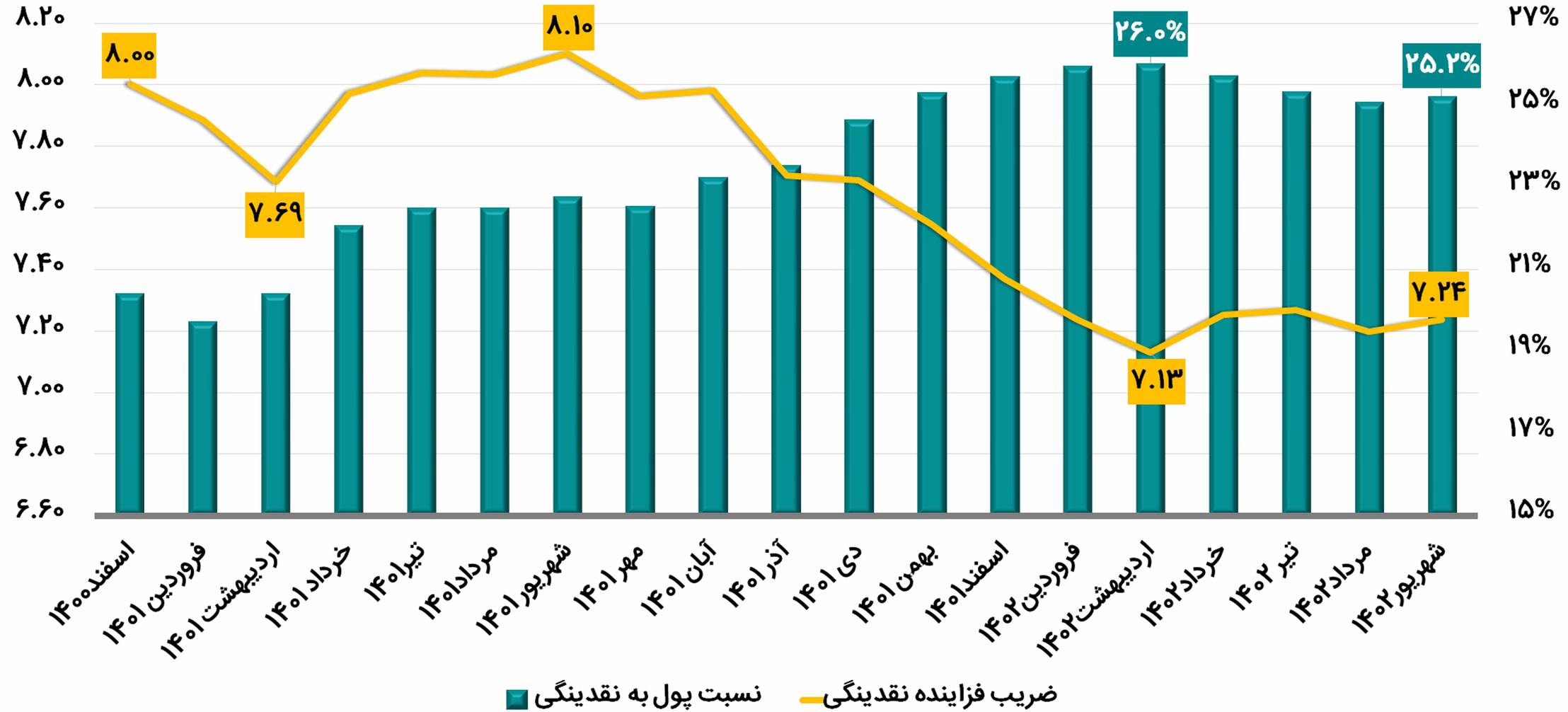
روند نقدینگی و پایه پولی (هزار میلیارد تومان)



رشد ماهانه نقدینگی و پایه پولی



ضریب فزاینده نقدینگی و نسبت پول به نقدینگی

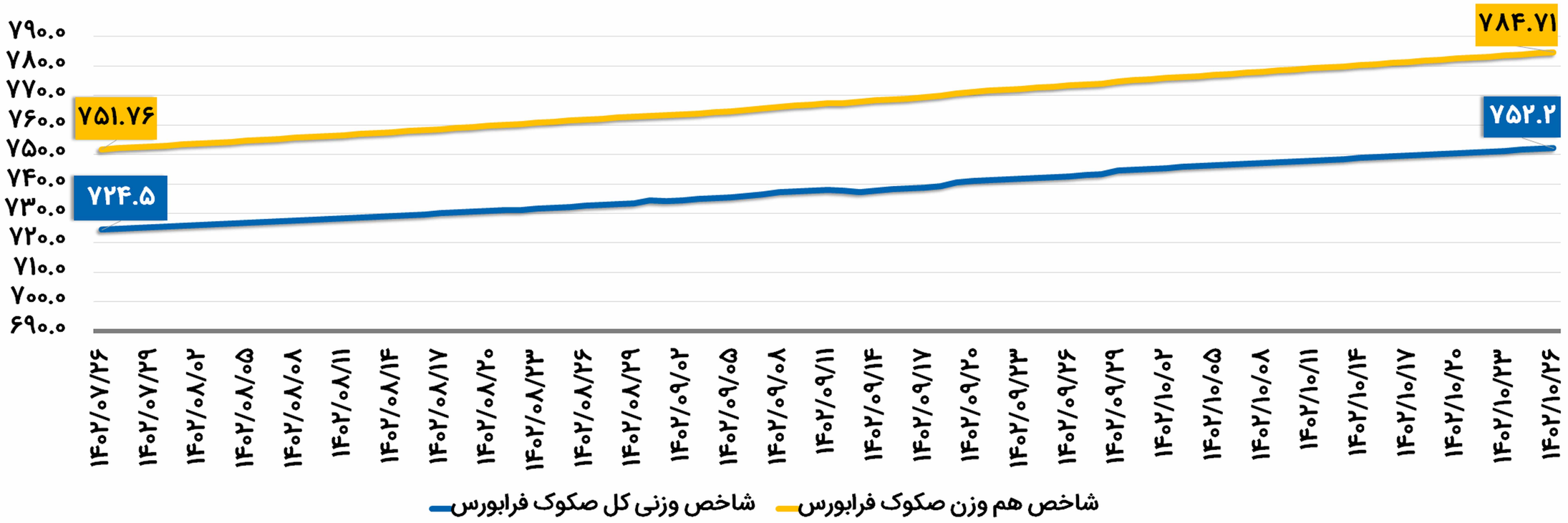


بـــازار بدهی



شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

روند شاخص صکوک



شاخص وزنی کل صکوک فرابورس

- بازدهی یک ماه گذشته: ۱.۳۱%
- بازدهی یک سال گذشته: ۱۸.۸%

شاخص هم وزن صکوک فرابورس

- بازدهی یک ماه گذشته: ۱.۵۱%
- بازدهی یک سال گذشته: ۱۹.۰%

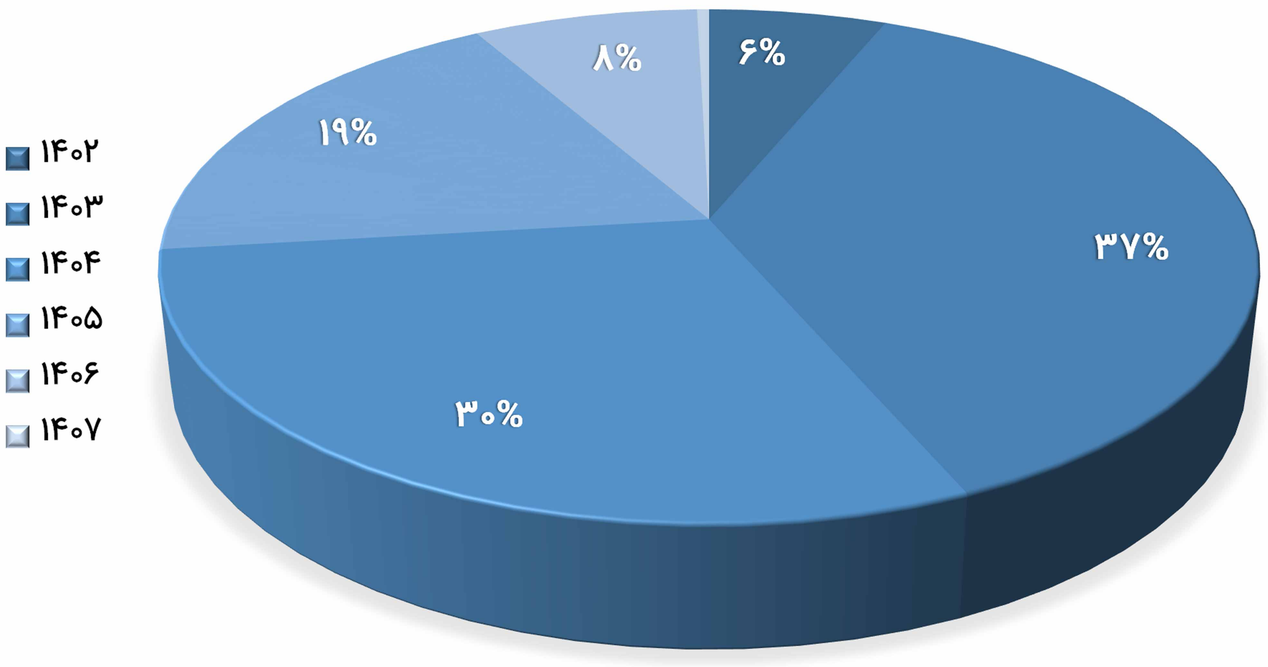
ترکیب اوراق براساس ماهیت ناشر و نوع اوراق (ارقام به هزار میلیارد تومان)

ناشـر	نوع اوراق	ارزش اوراق	جمع
دولتی	اسناد خزانه	۱۴۱	۴۵۸
	مرابحه	۳۰۹	
	سلف	۲	
	منفعت	۵	
غیر دولتی/ خصوصی	اجاره	۷۱	۱۵۱
	اوراق گام	۱	
	مرابحه	۵۸	
	مشارکت	۰.۱	
	سلف	۲۰	
	منفعت	۰.۲	
	قرض الحسنه	۰.۱	
	خرید دین	۰.۰۰	
غیر دولتی/ شهرداری‌ها	مشارکت	۱۹	۱۹

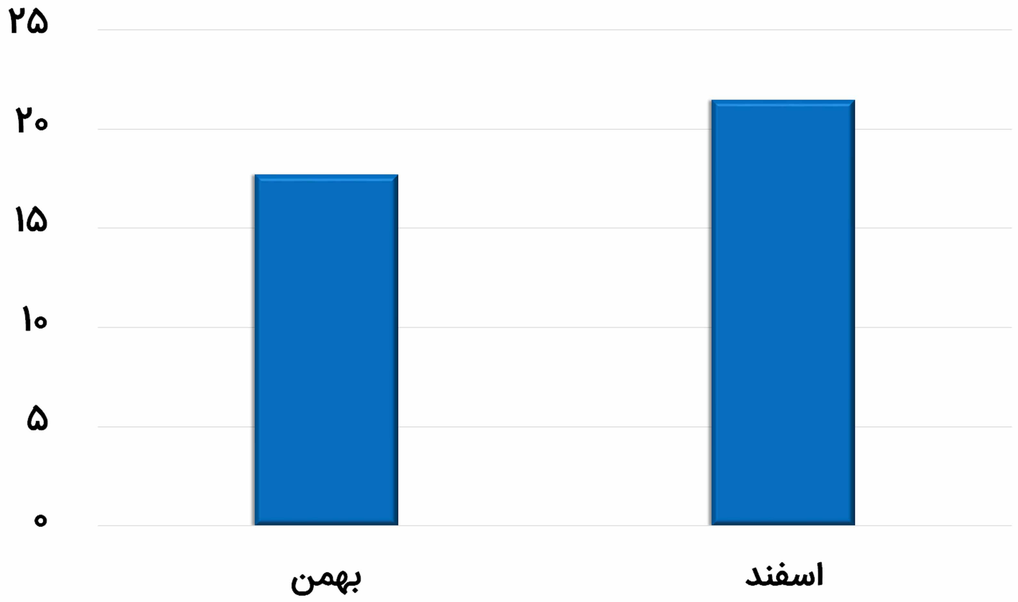
جمع کل اوراق	۶۲۸ هزار میلیارد تومان

ترکیب اوراق بر اساس سررسید (ارقام به هزار میلیارد تومان)

سال	ارزش اوراق
۱۴۰۲	۳۹
۱۴۰۳	۲۳۴
۱۴۰۴	۱۸۶
۱۴۰۵	۱۱۷
۱۴۰۶	۴۹
۱۴۰۷	۲.۷
جمع	۶۲۸



ارزش اوراق با سررسید در سال ۱۴۰۲ (ارقام به هزار میلیارد تومان)

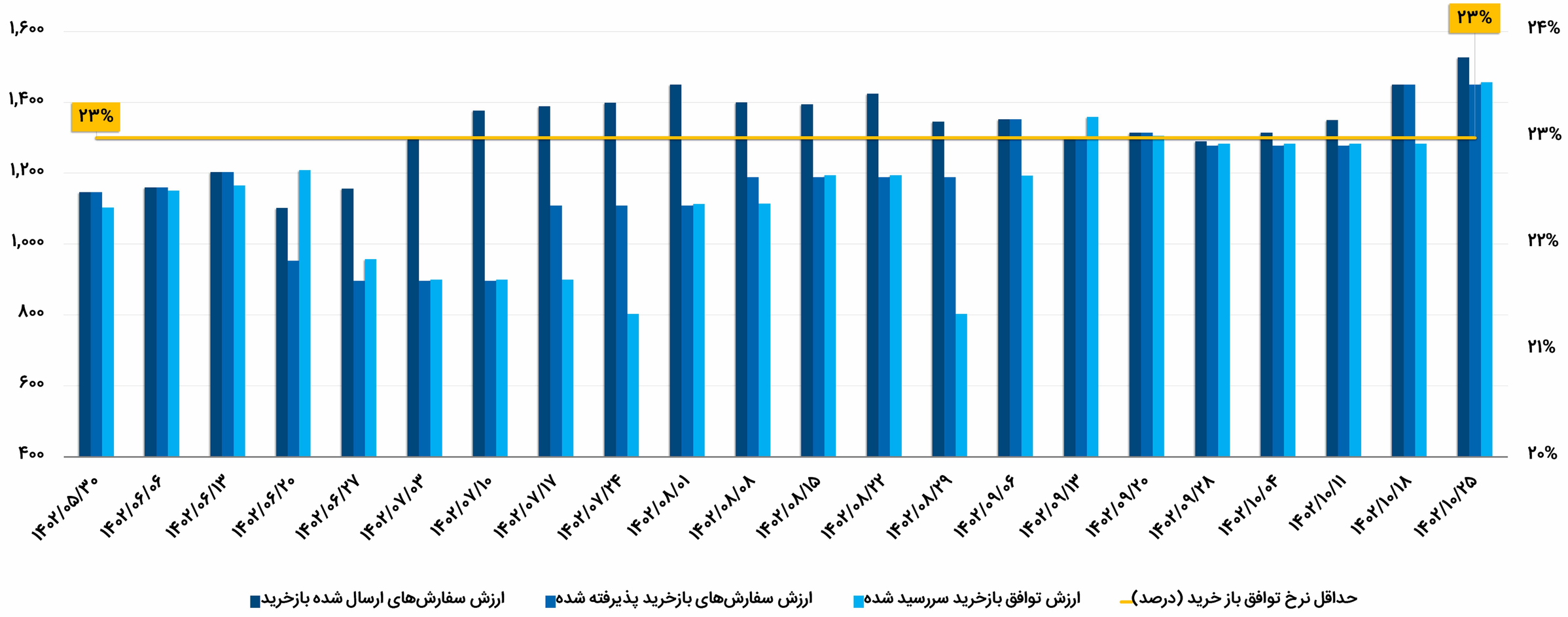


ماه	ارزش اوراق ۱۴۰۲/۱۰/۳۰	درصد از کل اوراق ۱۴۰۲
بهمن	۱۸	۴۵%
اسفند	۲۱	۵۵%
جمع	۳۹	۱۰۰%

عملیات بازار باز (ارقام به هزار میلیارد ریال)

تاریخ	موضع بانک مرکزی	ارزش سفارش‌های ارسال شده	ارزش سفارش‌های پذیرفته شده	حداقل نرخ توافق باز خرید درصد	ارزش توافق بازخرید سررسید شده	ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند	ارزش توافق بازخرید سررسید شده قاعده‌مند
۱۴۰۲/۱۰/۰۴	توافق باز خرید	۱,۳۱۴.۲	۱,۲۷۸.۰	۲۳.۰%	۱,۲۸۳.۷	۳۷.۵	۰.۰
۱۴۰۲/۱۰/۱۱	توافق باز خرید	۱,۳۴۹.۸	۱,۲۷۸.۰	۲۳.۰%	۱,۲۸۳.۷	۲۲۵.۸	۲۱۵.۴
۱۴۰۲/۱۰/۱۸	توافق باز خرید	۱,۴۴۹.۹	۱,۴۴۹.۹	۲۳.۰%	۱,۲۸۳.۷	۳۴۸.۱	۳۹۱.۶
۱۴۰۲/۱۰/۲۵	توافق باز خرید	۱,۵۲۶.۷	۱,۴۴۹.۹	۲۳.۰%	۱,۴۵۶.۳	۸۰.۸	۸۲.۲

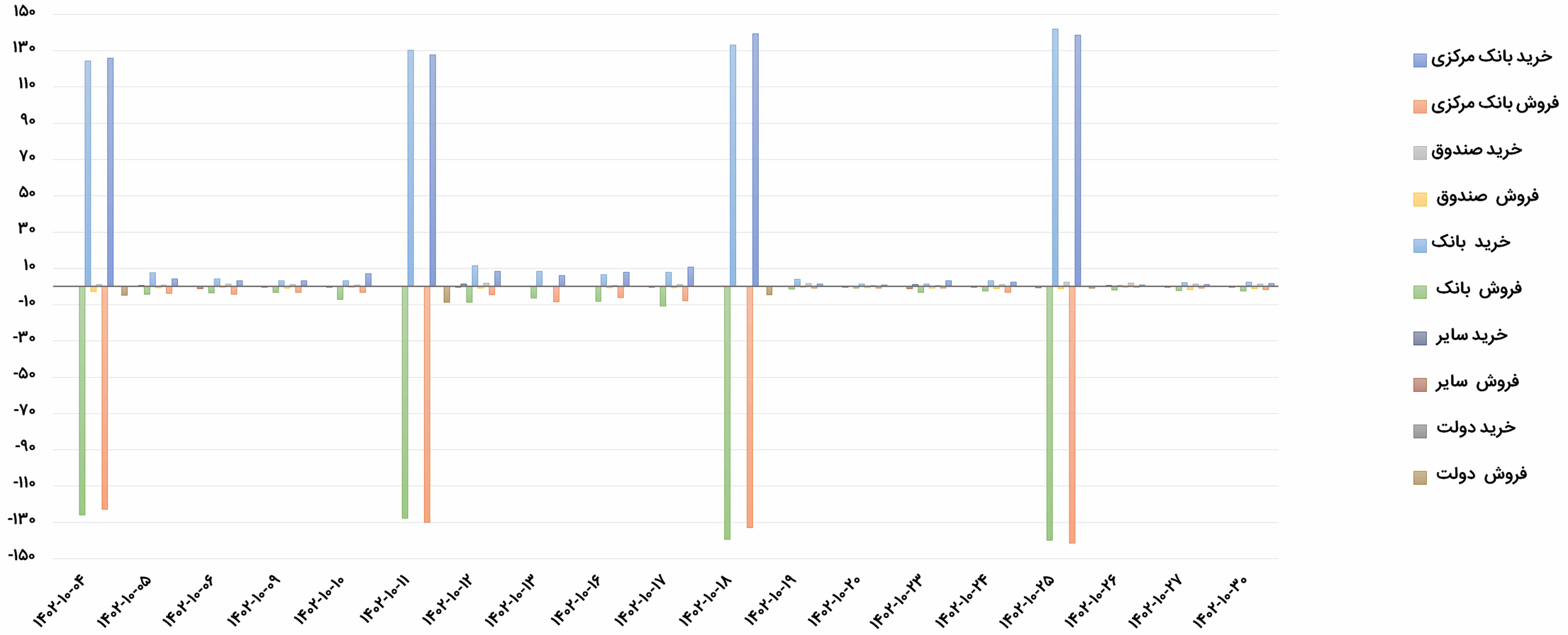
عملیات بازار باز (ارقام به هزار میلیارد ریال)



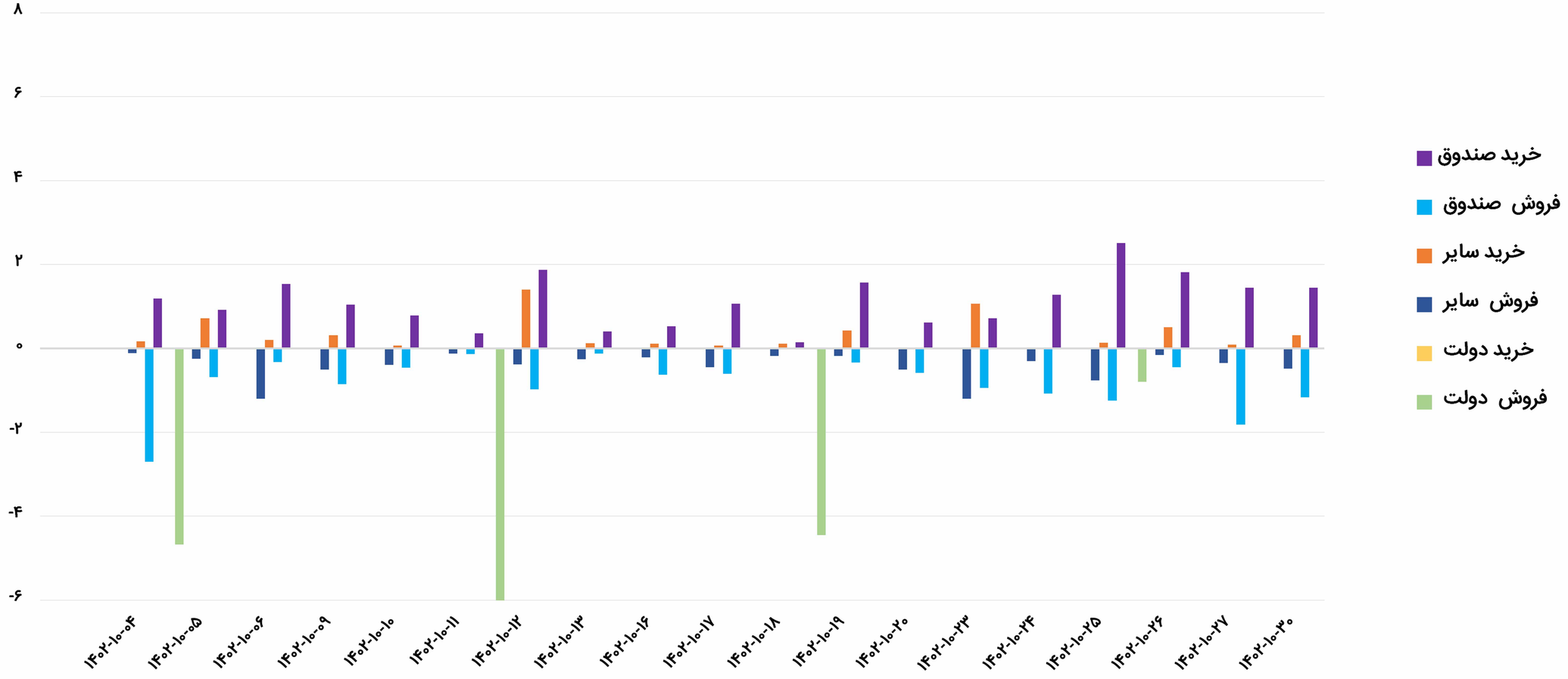
شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

معاملات اوراق مالی اسلامی (ارقام به هزار میلیارد تومان)

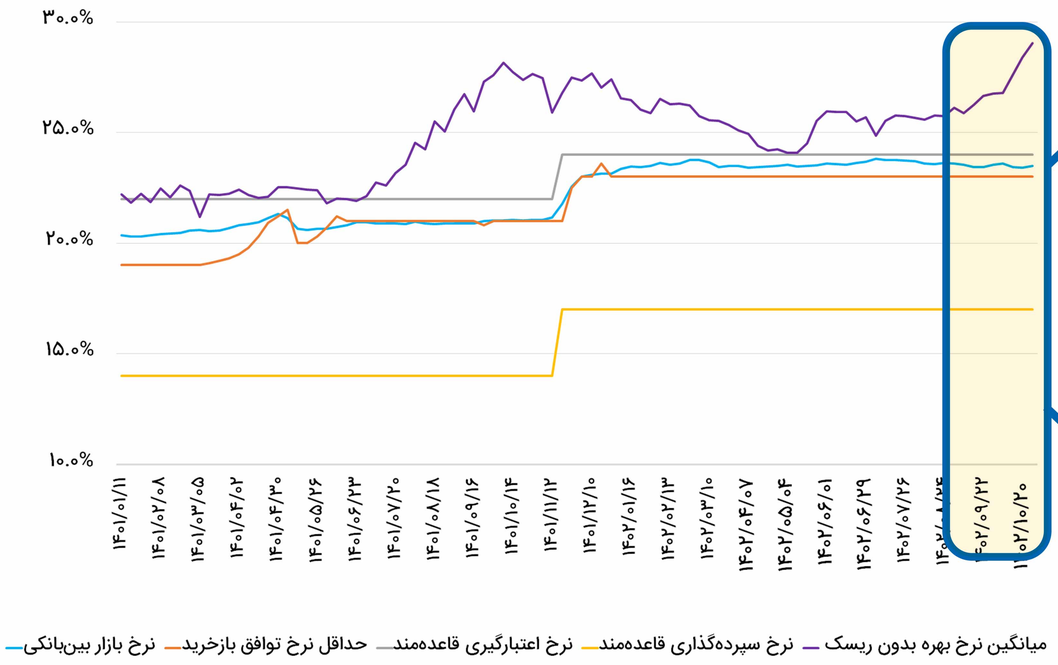
آمار معاملات روزانه اوراق اسلامی به تفکیک خریدار و فروشنده - دی ۱۴۰۲

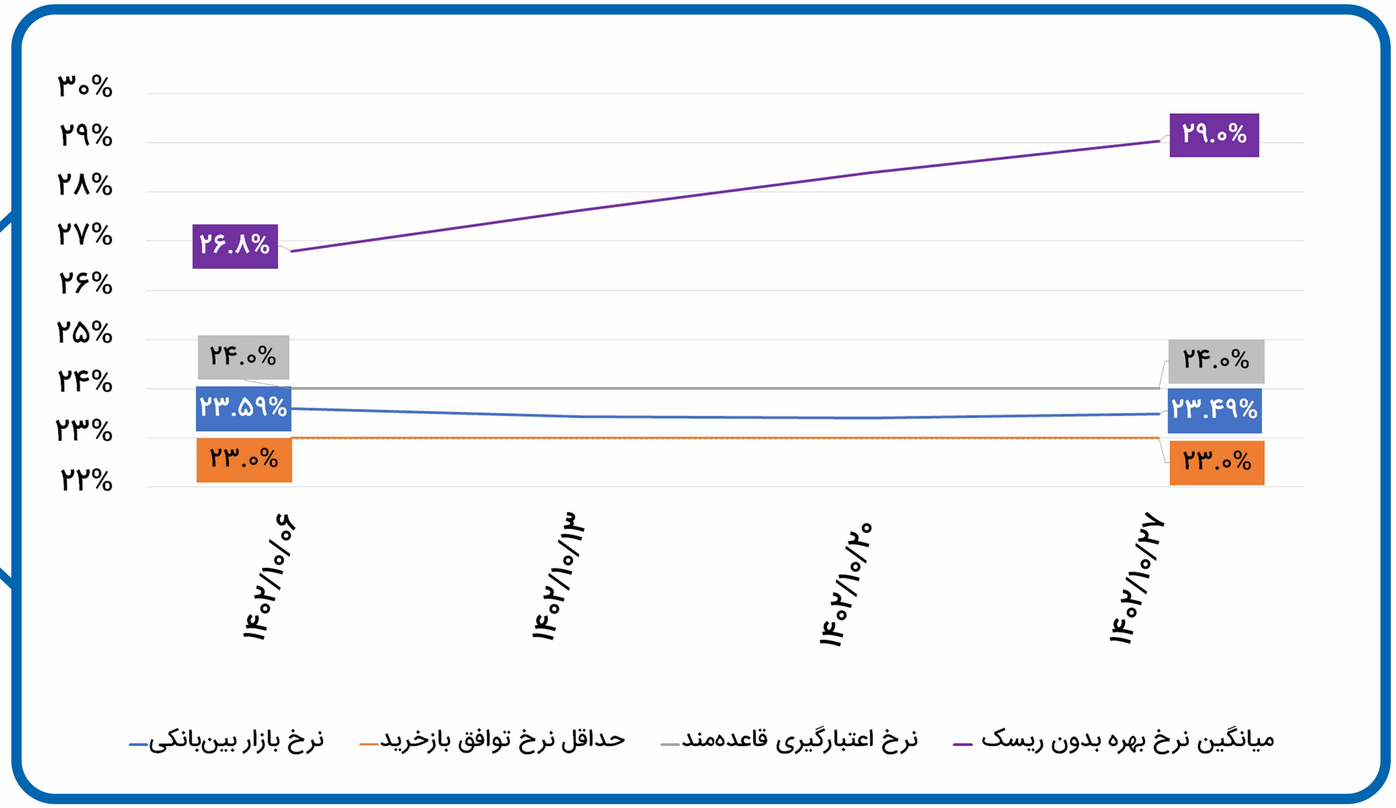


آمار معاملات روزانه اوراق اسلامی به تفکیک خریدار و فروشنده - دی ۱۴۰۲
فیلتر خریداران و فروشندگان بزرگ (بانک‌ها و بانک مرکزی) به منظور مشاهده دقیق تر سایرین



روند نرخ بهره (بانکی و غیربانکی)





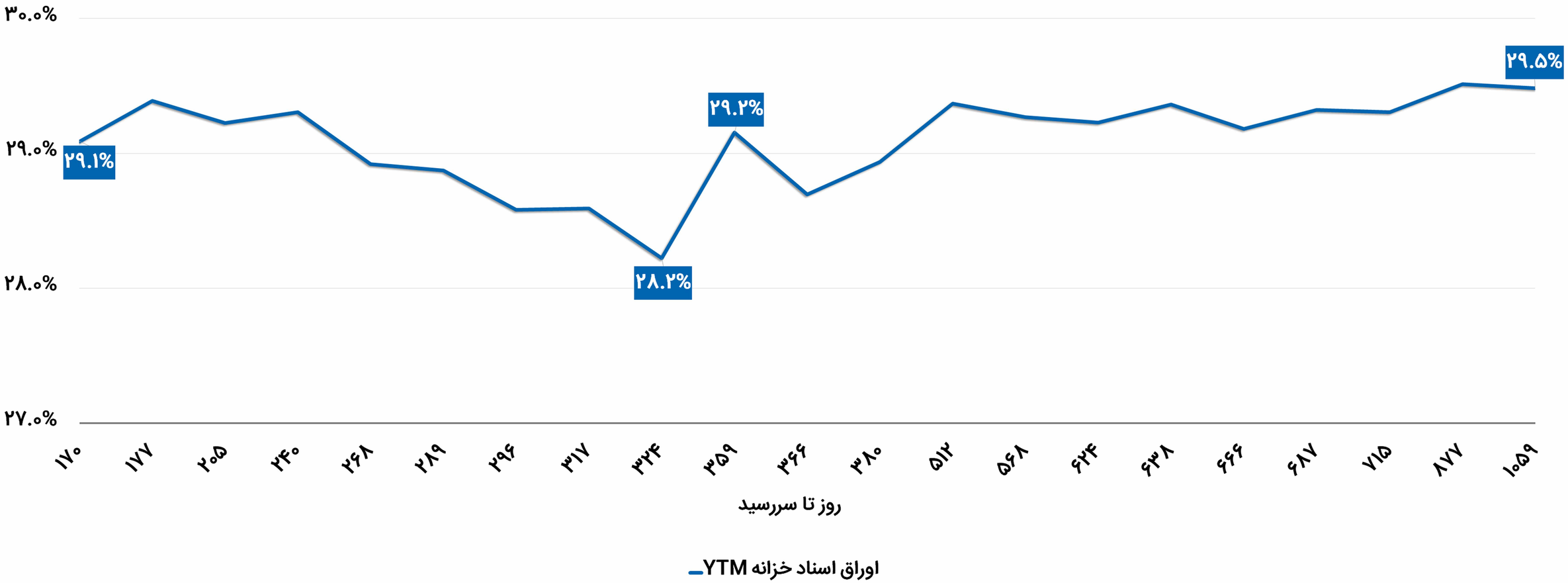
شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

اسناد خزانه اسلامی

اسناد خزانه اسلامی بیانگر تعهد دولت به بازپرداخت مبلغ اسمی این اوراق در آینده می‌باشد. اسناد خزانه از ابزارهای مالی با ماهیت بدهی بوده که بدون کوپن سود منتشـــر می‌شود. یکی از اهداف انتشار اوراق مذکور، تامین کسری بودجه دولت است. اسناد خزانـه اصلی‌ترین ابزار بـازار پول جهت اعمال سیاست‌های پولی است. اوراقی که در ادامه آورده شده، شامل اوراقی است که از سررسید آن‌ها بیش از یک ماه باقی مانده است.

ردیف	نماد	تاریخ سررسید	تعداد روز تا سررسید	تعداد انتشار	نرخ موثر بازده تا سررسید
۱	اخزا۲۰۱	۲۵/۰۳/۱۴۰۵	۸۷۷	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۵%
۱۹	اخزا۲۰۲	۲۳/۰۹/۱۴۰۵	۱,۰۵۹	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۵%
۸	اخزا۰۱۲	۲۵/۰۴/۱۴۰۳	۱۷۷	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۴%
۵	اخزا۱۰۱	۲۵/۰۳/۱۴۰۴	۵۱۲	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۴%
۳	اخزا۱۰۸	۲۷/۰۷/۱۴۰۴	۶۳۸	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۴%
۱۷	اخزا۱۰۴	۱۶/۰۹/۱۴۰۴	۶۸۷	۱۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۳%
۲	اخزا۰۰۵	۲۶/۰۶/۱۴۰۳	۲۴۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۳%
۷	اخزا۱۰۵	۱۴/۱۰/۱۴۰۴	۷۱۵	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۳%
۶	اخزا۱۰۳	۱۹/۰۵/۱۴۰۴	۵۶۸	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۳%
۱۸	اخزا۱۰۷	۱۳/۰۷/۱۴۰۴	۶۲۴	۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۲%
۴	اخزا۰۰۴	۲۲/۰۵/۱۴۰۳	۲۰۵	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۲%
۱۱	اخزا۱۰۹	۲۵/۰۸/۱۴۰۴	۶۶۶	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۲%
۲۰	اخزا۰۰۲	۲۴/۱۰/۱۴۰۳	۳۵۹	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۲%
۹	اخزا۰۰۳	۱۸/۰۴/۱۴۰۳	۱۷۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۹.۱%
۱۶	اخزا۰۱۰	۱۵/۱۱/۱۴۰۳	۳۸۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۹%
۱۵	اخزا۰۰۶	۲۳/۰۷/۱۴۰۳	۲۶۸	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۹%
۱۰	اخزا۱۰۶	۱۴/۰۸/۱۴۰۳	۲۸۹	۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۹%
۱۳	اخزا۰۰۹	۰۱/۱۱/۱۴۰۳	۳۶۶	۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۷%
۱۴	اخزا۰۰۷	۱۲/۰۹/۱۴۰۳	۳۱۷	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۶%
۱۲	اخزا۰۰۱	۲۱/۰۸/۱۴۰۳	۲۹۶	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۶%
۲۱	اخزا۰۰۸	۱۹/۰۹/۱۴۰۳	۳۲۴	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸.۲%

ساختار زمانی نرخ YTM اوراق اسناد خزانه اسلامی



شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

اوراق گواهی اعتبار مولد

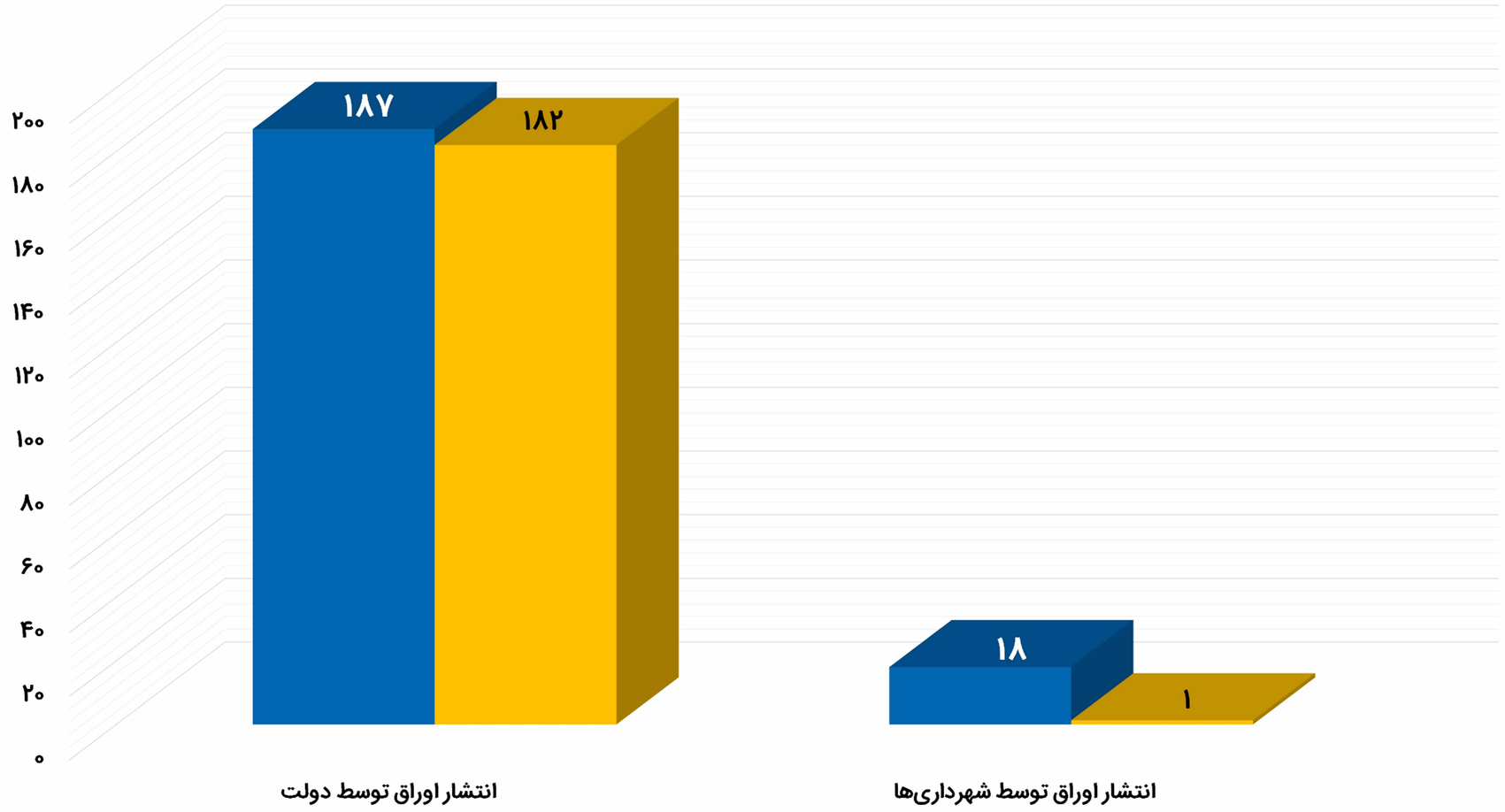
گام، مخفف عبارت "گواهی اعتبار مولد" است و منظور از اوراق گام، اوراقی است که بانک ها برای تامین نقدینگی بنگاه‌های اقتصادی صادر می‌کنند. این اوراق برای کمک به رفع چالش‌های خرید مواد اولیه و تامین سرمایه در گردش بنگاه‌های تولیدی کوچک و متوسط ایجاد شده‌اند.

ردیف	نماد	ناشـــر	تاریخ سررسید	نرخ بازده تا سررسید اوراق
۱	اگ۰۲۱۱۱۲	بانک ملت	۳۰/۱۱/۱۴۰۲	۲۹.۰%

اوراق منتشر شده در دی ۱۴۰۲

ردیف	نماد	نام و نوع اوراق	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	مدت اوراق‌ماه	نرخ سود سالانه اوراق	مواعد پرداخت سود	تعداد اوراق پذیرش شده	مبلغ کل اوراق هزار میلیارد تومان
۱	اراد۱۴۷	مرابحه عام دولت۰۵۰۵	۱۴۰۲/۱۰/۰۵	۱۴۰۵/۰۵/۰۵	۳۱	۰.۲۰۵	۶ماهه	۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۸
۲	انتخاب۰۴	اوراق مرابحه شرکت گروه صنعتی انتخاب الکترونیک آرمان	۱۴۰۲/۱۰/۰۶	۱۴۰۴/۱۰/۰۶	۲۴	۰.۲۶	۳ماهه	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱
۳	اراد۱۴۸	مرابحه عام دولت۰۴۰۵	۱۴۰۲/۱۰/۱۹	۱۴۰۴/۰۵/۱۹	۱۹	۰.۲۰۵	۶ماهه	۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۷
۴	بسپار۰۶	اوراق مرابحه شرکت بسپار شیمی سپیدان	۱۴۰۲/۱۰/۲۰	۱۴۰۶/۱۰/۲۰	۴۸	۰.۲۳	۳ماهه	۵,۰۰۰,۰۰۰	۰.۵
۵	نقشینه تبریز(۰۶۱ و۰۶۲)	اوراق مرابحه شرکت نقشینه چاپ تبریز	۱۴۰۲/۱۰/۲۰	۱۴۰۶/۱۰/۲۰	۴۸	۰.۲۳	۳ماهه	۴,۰۰۰,۰۰۰	۰.۴
۶	فردا‌موتور۰۶	اوراق مرابحه شرکت صنایع اتومبیل سازي فردا	۱۴۰۲/۱۰/۲۳	۱۴۰۶/۱۰/۲۳	۴۸	۰.۲۳	۳ماهه	۵,۰۰۰,۰۰۰	۰.۵
۷	ابیان۰۷	اوراق مرابحه شرکت ابیان دارو	۱۴۰۲/۱۰/۲۳	۱۴۰۷/۱۰/۲۳	۶۰	۰.۲۳	۶ماهه	۱,۰۰۰,۰۰۰	۰.۱
۸	اراد۱۴۹	مرابحه عام دولت۰۵۰۶	۱۴۰۲/۱۰/۲۶	۱۴۰۵/۰۶/۲۶	۳۲	۰.۲۰۵	۶ماهه	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵
۹	دتولید۰۶	اوراق مرابحه شرکت داروسازي تولید دارو	۱۴۰۲/۱۰/۳۰	۱۴۰۶/۱۰/۳۰	۴۸	۰.۲۳	۳ماهه	۱,۲۰۰,۰۰۰	۰.۱۲

مقایسه اوراق منتشر شده و بودجه (ارقام به هزار میلیارد تومان)





صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت با تقسیم سود

نرخ موثر سالانه

ردیف	نام صندوق	نوع صندوق	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	۱۴۰۲/۰۹	۱۴۰۲/۱۰
۱	مشترک اندیشه فردا	صدور و ابطال	۲۸.۱%	۲۶.۸%	۲۸.۱%	۲۹.۳%
۲	گنجینه داریوش	قابل معامله	۲۹.۲%	۲۹.۲%	۲۹.۲%	۲۹.۲%
۳	الماس کوروش	صدور و ابطال	۲۹.۱%	۲۹.۱%	۲۹.۱%	۲۹.۱%
۴	ترنج سودمند	صدور و ابطال	۲۸.۲%	۲۸.۲%	۲۸.۲%	۲۹.۱%
۵	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	قابل معامله	۲۷.۴%	۲۷.۵%	۲۷.۵%	۲۸.۷%
۶	بانک ایران زمین	صدور و ابطال	۲۵.۰%	۲۵.۰%	۲۸.۷%	۲۸.۷%
۷	نوع دوم افق آتی	قابل معامله	۲۷.۸%	۲۸.۰%	۲۸.۲%	۲۸.۶%
۸	آسمان دامون	قابل معامله	-	-	۲۷.۹%	۲۸.۶%
۹	امین انصار	صدور و ابطال	۲۸.۲%	۲۸.۲%	۲۸.۲%	۲۸.۳%
۱۰	ارزش کاوان ایرانیان	صدور و ابطال	۲۸.۲%	۲۸.۳%	۲۸.۸%	۲۸.۲%
۱۱	مشترک افق کارگزاری بانک خاورمیانه	صدور و ابطال	۲۸.۱%	۲۸.۲%	۲۸.۲%	۲۸.۲%
۱۲	ارمغان ایرانیان	قابل معامله	۲۵.۷%	۲۸.۲%	۲۸.۱%	۲۸.۱%
۱۳	امین آشنا ایرانیان	صدور و ابطال	۲۸.۲%	۲۸.۱%	۲۸.۱%	۲۸.۱%
۱۴	حکمت آشنا ایرانیان	صدور و ابطال	۲۸.۱%	۲۸.۱%	۲۸.۱%	۲۸.۱%
۱۵	در اوراق بهادار با درآمد ثابت اعتماد ملل	صدور و ابطال	۲۸.۱%	۲۸.۱%	۲۸.۱%	۲۸.۱%
۱۶	پارند پایدار سپهر	قابل معامله	۲۸.۰%	۲۸.۰%	۲۸.۰%	۲۸.۰%
۱۷	راسا الگوریتم	صدور و ابطال	۲۷.۵%	۲۷.۵%	۲۷.۵%	۲۸.۰%
۱۸	در اوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	قابل معامله	۲۷.۴%	۲۷.۴%	۲۷.۵%	۲۷.۸%
۱۹	همای آگاه	قابل معامله	۲۷.۱%	۲۷.۲%	۲۷.۲%	۲۷.۸%
۲۰	در اوراق بهادار با درآمد ثابت سام	قابل معامله	۲۸.۶%	۲۸.۰%	۲۸.۲%	۲۷.۷%
۲۱	نیلی دماوند	قابل معامله	۲۷.۱%	۲۷.۲%	۲۷.۷%	۲۷.۷%
۲۲	شکوه بامداد زاگرس	صدور و ابطال	۲۷.۴%	۲۷.۵%	۲۷.۵%	۲۷.۵%
۲۳	شکوه اوج دماوند	صدور و ابطال	۲۷.۴%	۲۷.۵%	۲۷.۵%	۲۷.۵%
۲۴	اتحاد آرمان اقتصاد	صدور و ابطال	۲۶.۵%	۲۷.۸%	۲۷.۳%	۲۷.۳%
۲۵	گسترش فردای ایرانیان	صدور و ابطال	۲۷.۱%	۲۷.۱%	۲۷.۱%	۲۷.۱%

صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت بدون تقسیم سود

نرخ موثر سالانه

ردیف	نام صندوق	نوع صندوق	۱۴۰۲/۰۷	۱۴۰۲/۰۸	۱۴۰۲/۰۹	۱۴۰۲/۱۰
۱	نوع دوم اعتبار	قابل معامله	۲۶.۷%	۲۶.۱%	۲۷.۱%	۳۰.۷%
۲	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کیمیا	قابل معامله	۲۶.۰%	۲۷.۶%	۲۸.۸%	۳۰.۱%
۳	اعتماد ارغوان	قابل معامله	۲۸.۳%	۳۲.۲%	۳۱.۰%	۳۰.۱%
۴	طلوع تدبیر پایا	قابل معامله	۳۷.۱%	۲۸.۷%	۲۹.۶%	۲۹.۵%
۵	طلوع نوین ثابت	قابل معامله	۲۷.۵%	۲۷.۶%	۲۹.۰%	۲۹.۴%
۶	سپهر سودمند سینا	قابل معامله	۲۸.۴%	۲۹.۰%	۳۰.۱%	۲۹.۳%
۷	آرمان آتی کوثر	قابل معامله	۲۶.۳%	۲۸.۱%	۲۸.۵%	۲۹.۲%
۸	ثروت افزون فاخر	قابل معامله	۲۹.۴%	۲۷.۸%	۲۹.۹%	۲۸.۸%
۹	توسعه افق رابین	قابل معامله	۲۸.۰%	۲۸.۲%	۲۹.۳%	۲۸.۸%
۱۰	آوای فردای زاگرس	قابل معامله	۲۷.۴%	۲۷.۴%	۲۸.۳%	۲۸.۷%
۱۱	در اوراق بهادار با درآمد ثابت ماهور	قابل معامله	-	-	۳۴.۳%	۲۸.۶%
۱۲	اعتماد داریک	قابل معامله	۲۵.۹%	۲۶.۱%	۲۶.۴%	۲۸.۶%
۱۳	نوع دوم کارا	قابل معامله	۲۷.۵%	۲۷.۴%	۲۸.۲%	۲۸.۶%
۱۴	درین بها بازار	قابل معامله	۲۶.۶%	۲۷.۴%	۲۸.۵%	۲۸.۵%
۱۵	اندیشه ورزان صبا تامین	قابل معامله	۲۷.۱%	۲۷.۱%	۲۸.۰%	۲۸.۵%
۱۶	ثبات ویستا	قابل معامله	۲۷.۲%	۲۷.۴%	۲۹.۱%	۲۸.۳%
۱۷	در اوراق بهادار با درآمد ثابت توسعه فولاد	قابل معامله	۲۴.۶%	۲۷.۷%	۲۹.۳%	۲۸.۳%
۱۸	نوع دوم پایدار نو ویرا	قابل معامله	۲۷.۶%	۲۷.۶%	۲۸.۴%	۲۸.۲%
۱۹	مشترک آسمان امید	قابل معامله	۲۷.۵%	۲۷.۴%	۲۶.۵%	۲۸.۲%
۲۰	سپر سرمایه بیدار	قابل معامله	۲۷.۴%	۲۷.۵%	۲۸.۶%	۲۸.۱%
۲۱	گنجینه آینده روشن	قابل معامله	۲۹.۴%	۳۳.۲%	۲۹.۳%	۲۸.۰%
۲۲	لبخند فارابی	قابل معامله	۲۷.۵%	۲۷.۳%	۲۹.۴%	۲۷.۹%
۲۳	ارزش پاداش	قابل معامله	۲۷.۶%	۲۷.۷%	۲۷.۹%	۲۷.۸%
۲۴	پایا ثروت پویا	قابل معامله	۲۷.۸%	۲۷.۰%	۲۸.۲%	۲۷.۸%
۲۵	بازده مانا	قابل معامله	-	-	-	۲۷.۸%

همپای هم رشـد می‌کنیم



شرکت سبدگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL

@algorithmcapital

www.algocm.com

۰۲۱ ۶۶ ۹۷ ۲۶ ۵۵
فکس ۶۶ ۹۷ ۲۸ ۰۴