



کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

شماره

۱۷

گزارش جامع بازار بدهی ایران

منتها به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

تاریخ انتشار:

۱۴۰۲/۰۱/۱۰

شماره گزارش: ۱۷ (۲۹ اسفندماه ۱۴۰۱)

عنوان گزارش: گزارش جامع بازار بدهی ایران

نام واحد: معاونت توسعه

کارشناس: رضا رضایی ایبانه

ناظر علمی: علیرضا توکلی کاشی

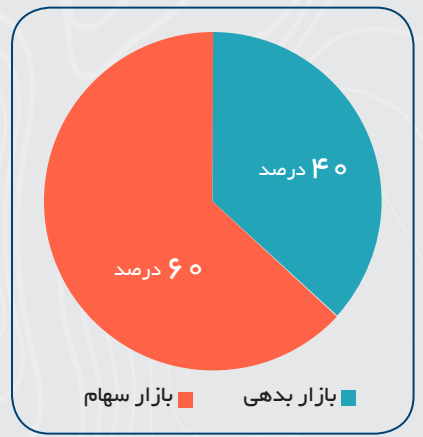
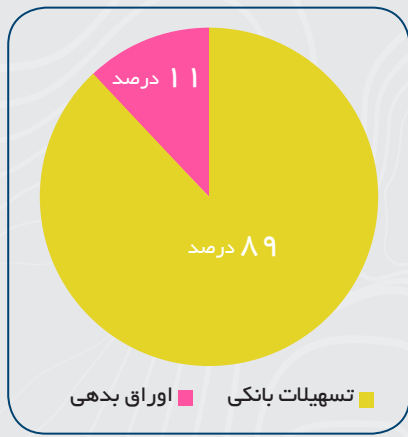
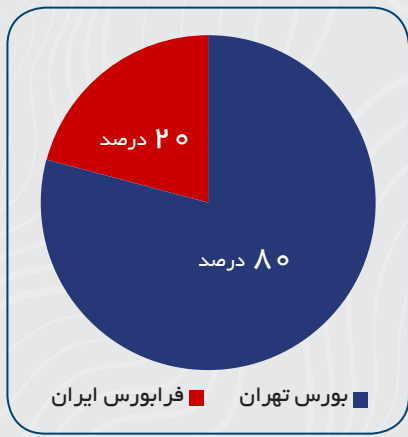
ناشر: کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

گرافیک: فاطمه فلاح

تاریخ انتشار: ۱۴۰۲/۰۱/۱۰

کلیه آمار و ارقام این گزارش بر مبنای داده‌های رسمی منتشر شده وزارت امور اقتصادی و دارایی، سازمان بورس و اوراق بهادار، شرکت بورس اوراق بهادار تهران، فرابورس ایران، بورس کالا، بورس انرژی و بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران تهیه و ارائه شده است. گاهی اوقات ممکن است اعداد و ارقام ماه‌های قبلی تغییرات جزئی داشته باشند؛ علت این موضوع تأخیر در اطلاع‌رسانی عمومی برخی از اوراق می‌باشد. به‌ویژه در مورد اوراق مشارکت شهرداری‌ها که با مجوز بانک مرکزی منتشر می‌شوند و همچنین اسناد خزانه اسلامی منتشر شده توسط دولت که اطلاعات آن‌ها با تأخیر منتشر می‌شوند، تغییرات داده‌های ماه‌های گذشته‌گیریز ناپذیر خواهد بود. نمودار نرخ‌های YTM در بازار بدهی بر مبنای نرخ مؤثر اوراق اسناد خزانه اسلامی منتشره توسط دولت محاسبه و منتشر شده است. برای افزایش دقت، صرفاً از نرخ اوراقی استفاده شده است که در هر روز مورد معامله قرار گرفته‌اند و فاصله تا سررسید آن‌ها بیش از ۱۰ روز بوده است. منظور از نرخ کوتاه مدت یا Short Term، میانگین نرخ اوراقی است که در هر روز فاصله تا سررسید آن‌ها حداکثر ۲۷۰ روز بوده است و طبیعتاً اوراق با سررسید بالای ۲۷۰ روز در زمره اوراق بلندمدت تقسیم‌بندی شده‌اند.

این گزارش به‌صورت منظم و ماهانه و در روز دهم هر ماه از طریق سایت رسمی کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران منتشر خواهد شد.



(واحد کلیه ارقام هزار میلیارد تومان می باشد)

آمار انتشار و سررسید اوراق دولت در یکسال اخیر

انتشار	سررسید	خالص انتشار	پرداخت سود	تاریخ
۰	۰	۰	۰	۱۴۰۱/۰۱
۱۵	(۱۳)	۲	۰	۱۴۰۱/۰۲
۳۰	(۱۴)	۱۷	۰	۱۴۰۱/۰۳
۱۷	(۱۰)	۷	۰	۱۴۰۱/۰۴
۹	(۱۴)	(۶)	۰	۱۴۰۱/۰۵
۱۹	(۱۴)	۴	۰	۱۴۰۱/۰۶
۷	(۱۳)	(۶)	۰	۱۴۰۱/۰۷
۱۰	(۱۴)	(۵)	۰	۱۴۰۱/۰۸
۰	(۸)	(۸)	۰	۱۴۰۱/۰۹
۴	(۱۳)	(۹)	۰	۱۴۰۱/۱۰
۲	(۱۰)	(۸)	۰	۱۴۰۱/۱۱
۵۱	(۵)	۴۶	۰	۱۴۰۱/۱۲
۱۶۳	(۱۲۷)	۳۵	۴۲	مجموع

ارزش بازارهای مالی ایران در ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

ارزش بازار بدهی			
تسهیلات بانکی	۸۹%	۵,۴۲۴	۴۰%
اوراق بدهی	۱۱%	۶۶۸	
ارزش بازار سهام			
بورس تهران	۸۰%	۷,۳۶۴	۶۰%
فرا بورس ایران	۲۰%	۱,۸۲۵	
ارزش بازارهای مالی ایران		۱۵,۲۸۱	

ارزش بازار بدهی به تفکیک ناشران

۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	
۴۵۸	۴۲۴	۲۹۳	۱۴۲	دولت
۸۸	۳۳	۲۱	۱۲	شهرداری
۵۲	۷	۴	۰	سازمان دولتی
۵۰	۴۵	۴۰	۱۱	خصوصی
۲۱	۲۶	۱۹	۱۰	بانکی
۶۶۸	۵۳۶	۳۷۸	۱۷۵	مجموع

آمار انتشار و سررسید اوراق دولت

۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	
۴۲۴	۲۹۳	۱۴۲	۹۰	مانده ابتدای دوره
۱۶۳	۱۹۷	۱۸۸	۸۲	انتشار
(۱۲۷)	(۶۶)	(۳۷)	(۲۹)	سررسید
۴۵۸	۴۲۴	۲۹۳	۱۴۲	مانده پایان دوره
۴۲	۳۲	۱۸	۶	سود پرداختی طی دوره
۳۳	۱۳۱	۱۵۱	۵۳	خالص تامین مالی

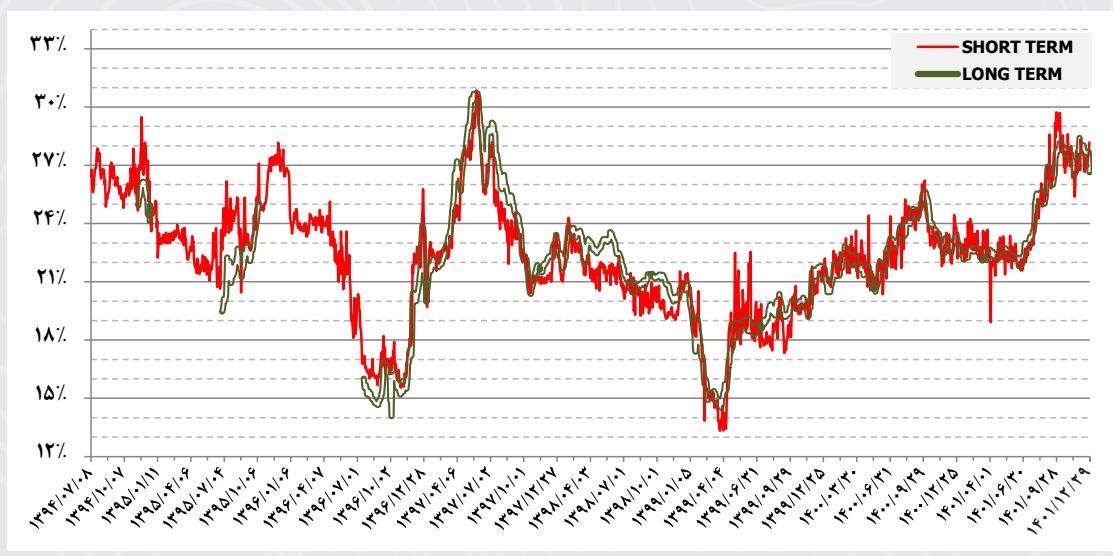
ارزش بازار بدهی به تفکیک نوع اوراق

۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	
۳۱۰	۲۱۸	۱۴۹	۲۳	اوراق مراهجه
۱۷۳	۱۸۰	۱۱۰	۷۱	استاد خزانه اسلامی
۷۰	۳۳	۲۴	۱۹	اوراق سلف
۵۲	۶	۳	۰	اوراق منفعت
۲۶	۴۲	۲۹	۱۰	اوراق گام
۲۱	۲۶	۲۳	۲۰	اوراق مشارکت
۱۵	۲۹	۳۷	۳۲	اوراق اجاره
۰	۰	۰	۰	اوراق رهنی
۰	۱	۲	۱	خرید دین
۰	۰	۰	۰	اوراق استصناع
۰	۰	۰	۰	مشارکت بانک مرکزی
۶۶۸	۵۳۶	۳۷۸	۱۷۵	مجموع

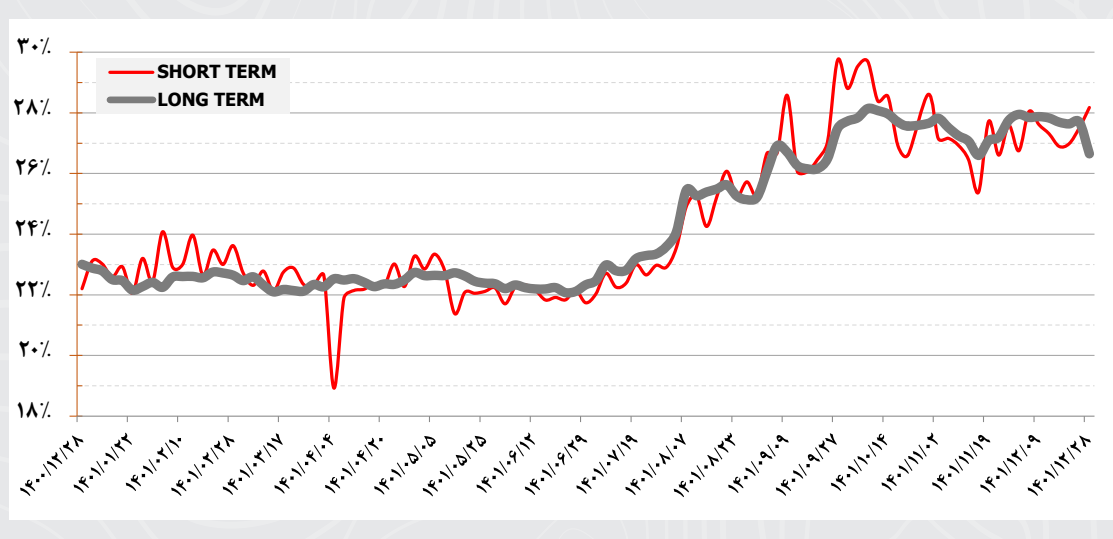
آمار انتشار و سررسید اوراق بخش خصوصی

۱۴۰۱/۱۲	۱۴۰۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	
۳۳	۲۱	۱۲	۱۰	مانده ابتدای دوره
۵۹	۱۹	۱۲	۴	انتشار
(۴)	(۶)	(۳)	(۲)	سررسید
۸۸	۳۳	۲۱	۱۲	مانده پایان دوره
۸	۴	۲	۲	سود پرداختی طی دوره
۵۴	۱۲	۹	۲	خالص تامین مالی

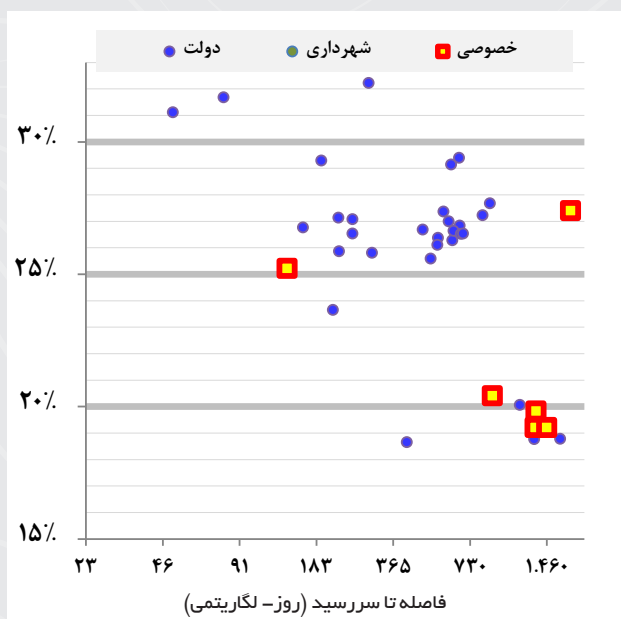
روند بلندمدت YTM از ۱۳۹۴/۰۷/۰۸ تا ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ *



روند نرخ YTM از تاریخ: ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ تا ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (T1=10 T2=270) *



نرخ سود کلیه اوراق بدهی موجود در بازار در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹



مقایسه منحنی نرخ سود بازار بدهی با ماه و سال گذشته در ایران *

