



کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

شماره

۲۰

گزارش جامع بازار بدهی ایران

منتهی به ۳۱/۰۳/۱۴۰۲

تاریخ انتشار:

۱۴۰۲/۰۴/۱۰

شماره گزارش: ۲۰ (۳۱ خردادماه ۱۴۰۲)

عنوان گزارش: گزارش جامع بازار بدهی ایران

نام واحد: معاونت توسعه

کارشناس: رضا رضایی ایبانه،

محمد مهدی و کیلی، امیر خلیلی

ناشر: کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

گرافیک: فاطمه فلاح

تاریخ انتشار: ۱۴۰۲/۰۴/۱۰

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 گذشته گریز 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.

(واحد کلیه ارقام هزار میلیارد تومان می باشد)

آمار انتشار و سررسید اوراق گام

۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۱	۱۴۰۰	۱۳۹۹	
۵۴	۶	۳	۰	مانده ابتدای دوره
۰	۵۴	۷	۳	انتشار
(۷)	(۷)	(۴)	۰	سررسید
۴۷	۵۴	۶	۳	مانده پایان دوره
(۷)	۴۷	۳	۳	خالص تأمین مالی

آمار انتشار و سررسید اوراق بخش خصوصی

۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۱	۱۴۰۰	۱۳۹۹	
۸۸	۳۳	۲۱	۱۲	مانده ابتدای دوره
۶	۵۹	۱۹	۱۲	انتشار
(۱)	(۴)	(۶)	(۳)	سررسید
۹۳	۸۸	۳۳	۲۱	مانده پایان دوره
۳	۸	۴	۲	سود پرداختی طی دوره
۵	۵۴	۱۲	۹	خالص تأمین مالی

آمار سررسید اوراق بدهی به تفکیک ناشران

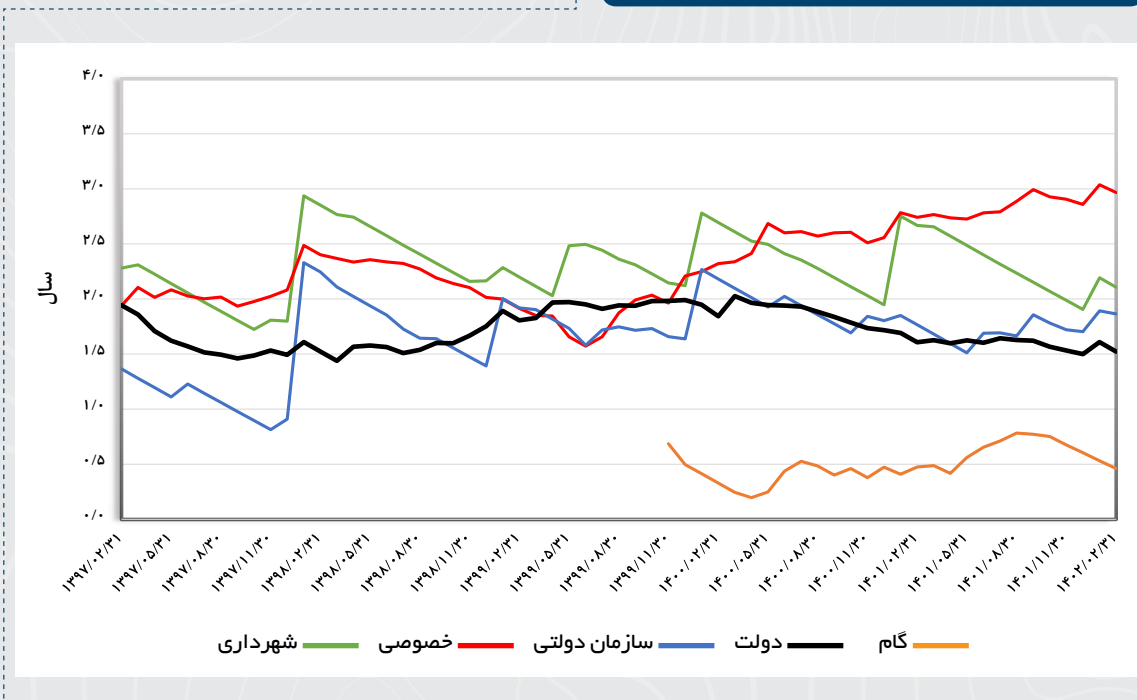
۱۲ ماه آینده

جمع	شهرداری/سازمان دولتی	گام	خصوصی	دولت	
(۲۲)	-	(۴)	-	(۱۸)	۱۴۰۲/۰۴
(۲۶)	-	(۷)	(۰)	(۱۹)	۱۴۰۲/۰۵
(۳۳)	(۶)	(۵)	(۰)	(۲۱)	۱۴۰۲/۰۶
(۳۱)	-	(۱۳)	-	(۱۹)	۱۴۰۲/۰۷
(۳۳)	(۰)	(۱۶)	-	(۱۸)	۱۴۰۲/۰۸
(۱۳)	-	(۱)	(۱)	(۱۲)	۱۴۰۲/۰۹
(۱۷)	(۱)	-	(۱)	(۱۵)	۱۴۰۲/۱۰
(۱۸)	(۱)	(۲)	(۰)	(۱۵)	۱۴۰۲/۱۱
(۲۱)	(۹)	(۱)	(۱)	(۱۰)	۱۴۰۲/۱۲
-	-	-	-	-	۱۴۰۳/۰۱
(۱۱)	-	-	(۱)	(۱۰)	۱۴۰۳/۰۲
(۱۷)	-	-	-	(۱۷)	۱۴۰۳/۰۳
(۲۴۲)	(۱۷)	(۱)	(۴۷)	(۱۷۳)	جمع ۱۲ ماه آتی

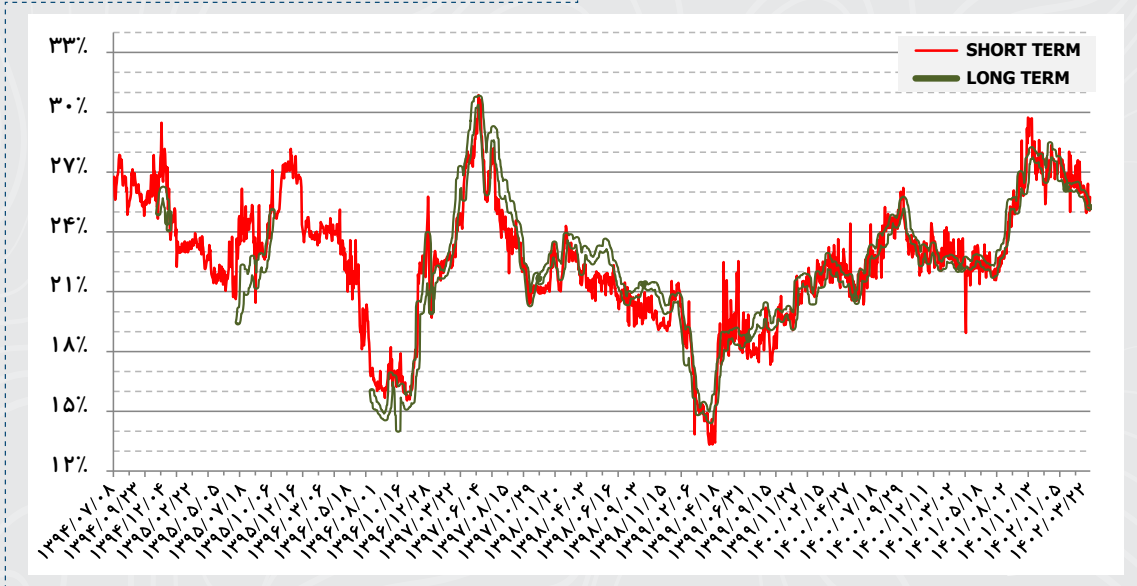
۱۲ ماه گذشته

جمع	شهرداری/سازمان دولتی	گام	خصوصی	دولت	
(۲۲)	(۲)	(۱)	(۵)	(۱)	۱۴۰۲/۰۳
(۳)	-	-	(۰)	-	۱۴۰۲/۰۲
(۳)	(۱)	-	(۲)	-	۱۴۰۲/۰۱
(۱۴)	(۴)	(۴)	(۱)	(۱)	۱۴۰۱/۱۲
(۱۲)	(۲)	-	-	(۰)	۱۴۰۱/۱۱
(۱۴)	(۱)	-	-	(۱)	۱۴۰۱/۱۰
(۸)	-	-	-	(۸)	۱۴۰۱/۰۹
(۱۵)	-	-	(۱)	-	۱۴۰۱/۰۸
(۱۷)	(۱)	-	(۲)	(۱)	۱۴۰۱/۰۷
(۱۷)	(۲)	-	-	(۱)	۱۴۰۱/۰۶
(۱۸)	(۲)	-	(۲)	(۰)	۱۴۰۱/۰۵
(۱۱)	-	-	-	(۱)	۱۴۰۱/۰۴
(۱۵۳)	(۱۶)	(۵)	(۱۲)	(۴)	جمع ۱۲ ماه گذشته

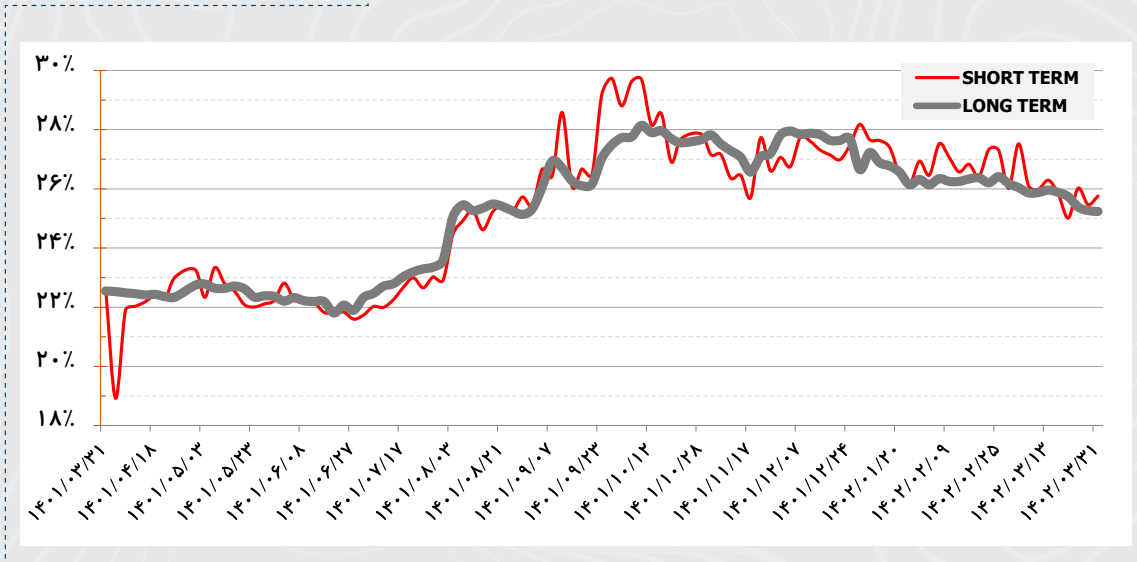
میانگین فاصله تا سررسید



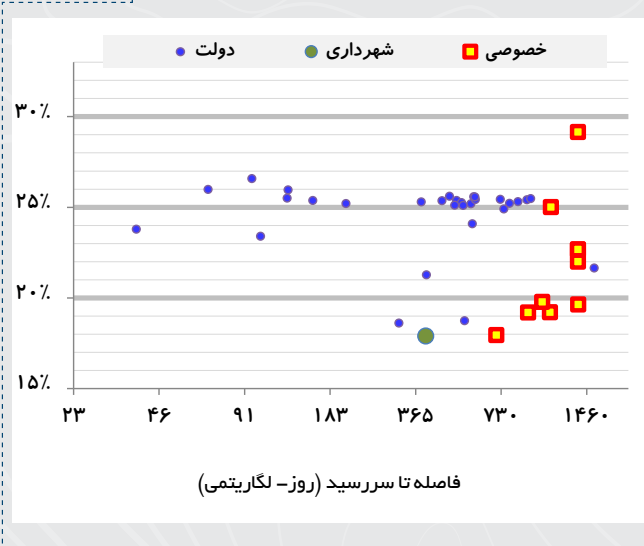
روند بلندمدت YTM از ۱۳۹۴/۰۷/۰۸ تا ۱۴۰۲/۰۳/۳۱*



روند نرخ YTM از تاریخ: ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ تا ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ (T1=10 T2=270)*



نرخ سود کلیه اوراق بدهی موجود در بازار در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۳۱



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

