



کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

شماره

۳

# گزارش جامع بازار بدهی ایران

منتها به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

تاریخ انتشار:

۱۴۰۰/۱۱/۱۰

شماره گزارش: ۰۳ (۳۰۰ ادی ماه ۱۴۰۰)

عنوان گزارش: گزارش جامع بازار بدهی ایران

نام واحد: معاونت توسعه

کارشناس: زهرا اسدی پور

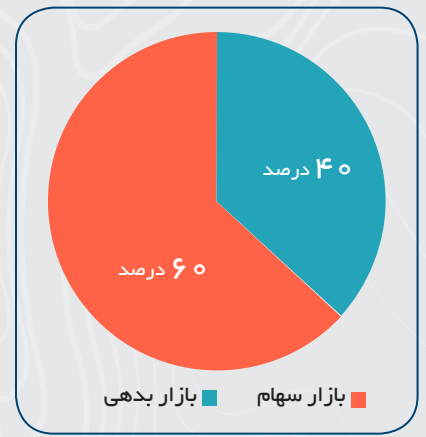
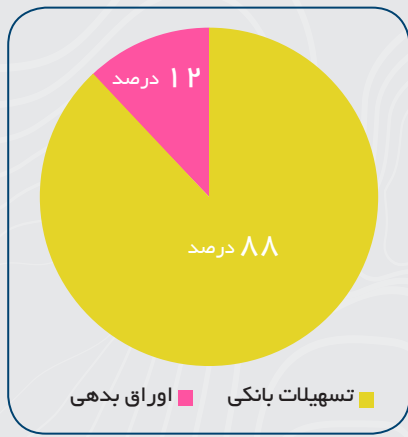
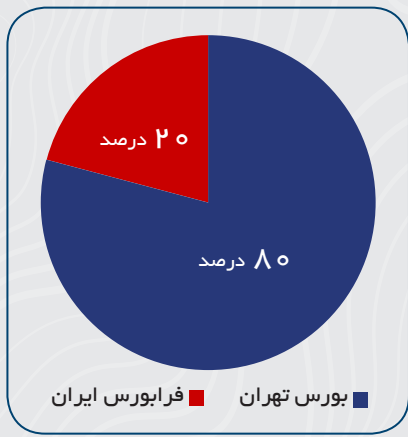
ناظر علمی: علیرضا توکلی کاشی

ناشر: کانون نهادهای سرمایه‌گذاری ایران

گرافیک: فاطمه فلاح

تاریخ انتشار: ۱۴۰۰/۱۱/۱۰

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 گذشته‌گیر 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 ریال می باشد)

### آمار انتشار و سررسید اوراق دولت در یکسال اخیر

انتشار	سررسید	خالص انتشار	پرداخت سود
۱۳۹۹/۱۱	(۵۰)	۷۱	۲۳
۱۳۹۹/۱۲	(۴)	۳۴۹	۳۱
۱۴۰۰/۰۱	(۲۵)	۱۲۰	۱۴
۱۴۰۰/۰۲	۰	۶۰۰	۱۰
۱۴۰۰/۰۳	(۱۰)	۲۴۰	۲۸
۱۴۰۰/۰۴	(۵۶)	۴۴	۴۲
۱۴۰۰/۰۵	(۸۷)	(۲۷)	۲۵
۱۴۰۰/۰۶	(۸۰)	۱۷۵	۵۶
۱۴۰۰/۰۷	(۷۵)	(۷۵)	۸
۱۴۰۰/۰۸	(۱۰۵)	(۵)	۱۱
۱۴۰۰/۰۹	(۶۲)	۳۸	۵۰
۱۴۰۰/۱۰	(۶۰)	۴۰	۴۰
<b>مجموع</b>	<b>(۶۱۴)</b>	<b>۱,۵۷۰</b>	<b>۳۳۹</b>

### ارزش بازارهای مالی ایران در ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

ارزش بازار بدهی		
تسهیلات بانکی	۸۸٪	۳۸,۱۴۲
اوراق بدهی	۱۲٪	۵,۱۸۵
ارزش بازار سهام		
بورس تهران	۸۰٪	۵۲,۱۴۰
فرا بورس ایران	۲۰٪	۱۲,۹۶۸
<b>ارزش بازارهای مالی ایران</b>		<b>۱۰۸,۴۳۶</b>

### ارزش بازار بدهی به تفکیک ناشران

۱۴۰۰/۱۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	۱۳۹۷	
۴,۲۸۸	۳,۱۳۸	۱,۴۷۳	۹۰۰	دولت
۴۰۱	۳۹۸	۱۰۳	۸۳	سازمان دولتی
۳۰۱	۲۲۳	۱۲۱	۹۷	خصوصی
۱۴۸	۱۲۱	۹۹	۱۰۱	شهرداری
۴۷	۴۴	۰	۰	بانکی
<b>۵,۱۸۵</b>	<b>۳,۹۲۵</b>	<b>۱,۷۹۶</b>	<b>۱,۱۸۰</b>	<b>مجموع</b>

### آمار انتشار و سررسید اوراق دولت

۱۴۰۰/۱۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	۱۳۹۷	
۳,۱۳۸	۱,۴۷۳	۹۰۰	۷۵۳	مانده ابتدای دوره
۱,۷۱۰	۲,۰۳۷	۸۶۷	۴۵۷	انتشار
(۵۶۰)	(۳۷۲)	(۲۹۴)	(۳۱۰)	سررسید
۴,۲۸۸	۳,۱۳۸	۱,۴۷۳	۹۰۰	مانده پایان دوره
۲۸۵	۱۹۲	۶۳	۸۲	سود پرداختی طی دوره
۱,۱۵۰	۱,۶۶۵	۵۷۳	۱۴۷	خالص تأمین مالی

### ارزش بازار بدهی به تفکیک نوع اوراق

۱۴۰۰/۱۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	۱۳۹۷	
۲,۱۴۱	۱,۶۴۹	۲۳۱	۱۱۸	اوراق مرابحه
۱,۷۸۲	۱,۱۰۵	۷۱۲	۵۲۲	اسناد خزانه اسلامی
۳۷۱	۴۲۱	۳۶۹	۸۱	اوراق منفعت
۳۳۲	۲۸۷	۹۹	۵۱	اوراق سلف
۳۳۲	۲۵۳	۱۸۷	۱۶۲	اوراق اجاره
۱۷۶	۱۶۰	۱۹۲	۲۴۴	اوراق مشارکت
۳۷	۳۴	۰	۰	اوراق گام
۱۲	۱۵	۵	۲	اوراق رهنی
۱	۰	۰	۰	خرید دین
۰	۰	۰	۰	اوراق استصناع
۰	۰	۰	۰	مشارکت بانک مرکزی
<b>۵,۱۸۵</b>	<b>۳,۹۲۵</b>	<b>۱,۷۹۶</b>	<b>۱,۱۸۰</b>	<b>مجموع</b>

### آمار انتشار و سررسید اوراق بخش خصوصی

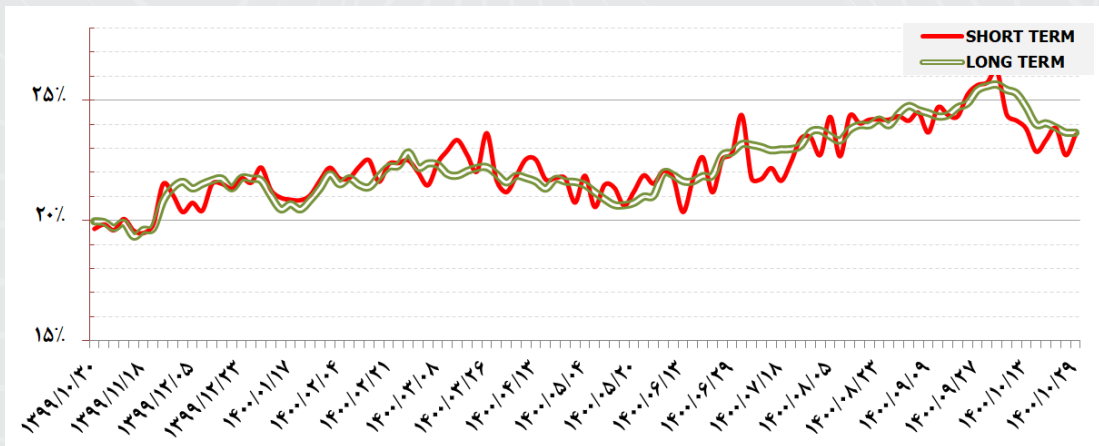
۱۴۰۰/۱۰	۱۳۹۹	۱۳۹۸	۱۳۹۷	
۲۲۳	۱۲۱	۹۷	۶۷	مانده ابتدای دوره
۱۱۸	۱۳۸	۴۴	۵۸	انتشار
(۴۱)	(۳۶)	(۱۹)	(۲۹)	سررسید
۳۰۱	۲۲۳	۱۲۱	۹۷	مانده پایان دوره
۳۶	۲۳	۱۷	۱۳	سود پرداختی طی دوره
۷۸	۱۰۲	۲۵	۳۰	خالص تأمین مالی

کلیه آمار و ارقام این گزارش بر مبنای داده‌های رسمی منتشر شده وزارت اقتصاد، سازمان بورس و اوراق بهادار تهران، بورس اوراق بهادار تهران، فرا بورس ایران، بورس کالا، بورس انرژی و بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران ارائه شده است. گاهی اوقات ممکن است اعداد و ارقام ماه‌های قبلی تغییر یابند؛ علت این موضوع تأخیر در اطلاع‌رسانی عمومی اطلاعات اوراق منتشر شده قبلی است. به ویژه اطلاعات اوراق مشارکت شهرداری‌ها و همچنین اسناد خزانه اسلامی منتشر شده توسط دولت با تأخیر منتشر می‌شوند.

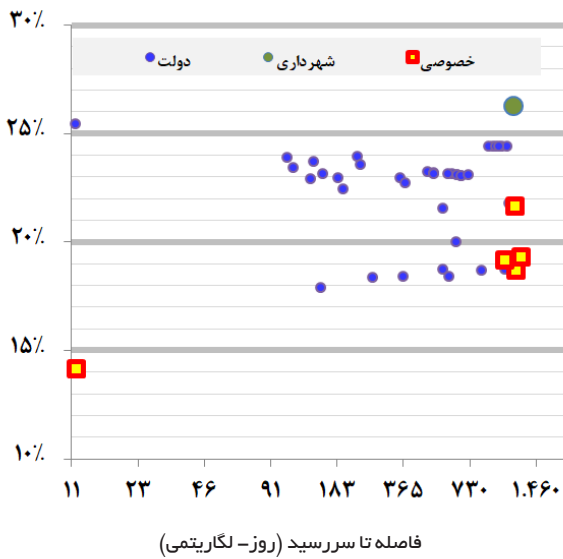
روند بلندمدت YTM از ۱۴۰۰/۰۷/۰۸ تا ۱۴۰۰/۱۰/۳۰\*



روند نرخ YTM از تاریخ: ۱۳۹۹/۱۰/۳۰ تا ۱۴۰۰/۱۰/۳۰ (T1=10 T2=270)\*



نرخ سود کلیه اوراق بدهی موجود در بازار در تاریخ ۱۴۰۰/۱۰/۲۹



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

