

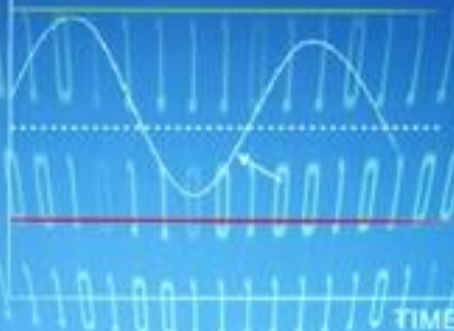


بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران

اداره عملیات بازار باز

عملکرد بازار بین بانکی ریالی و عملیات اجرایی سیاست پولی در سال ۱۴۰۰

INTEREST RATE

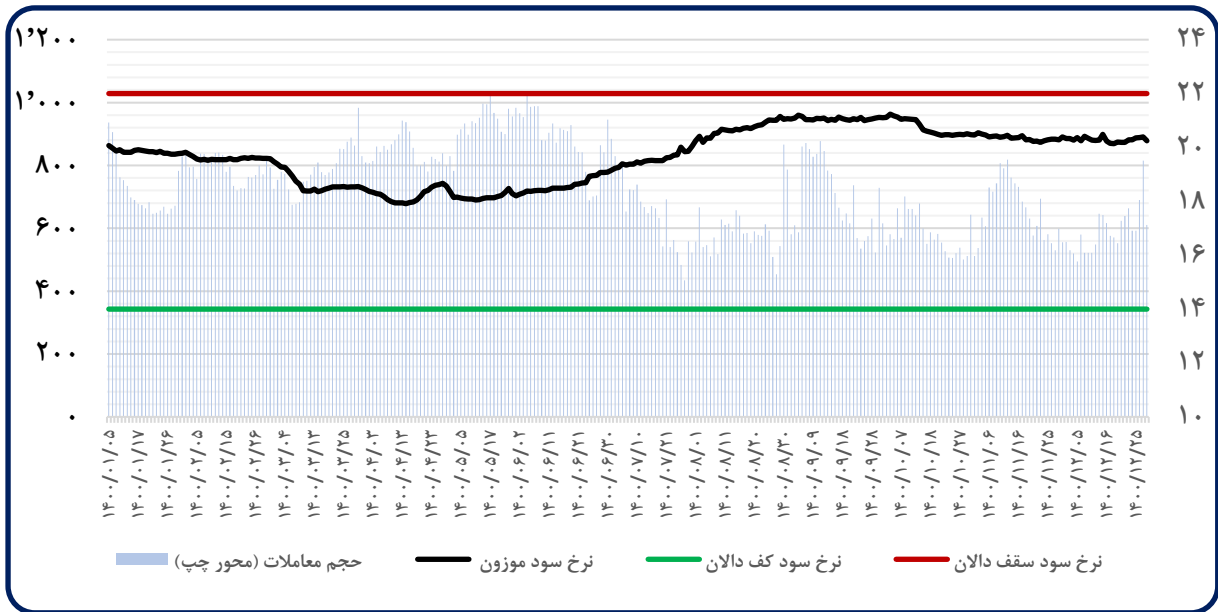


(بسمه تعالی)

الف) عملکرد بازار بین بانکی ریالی

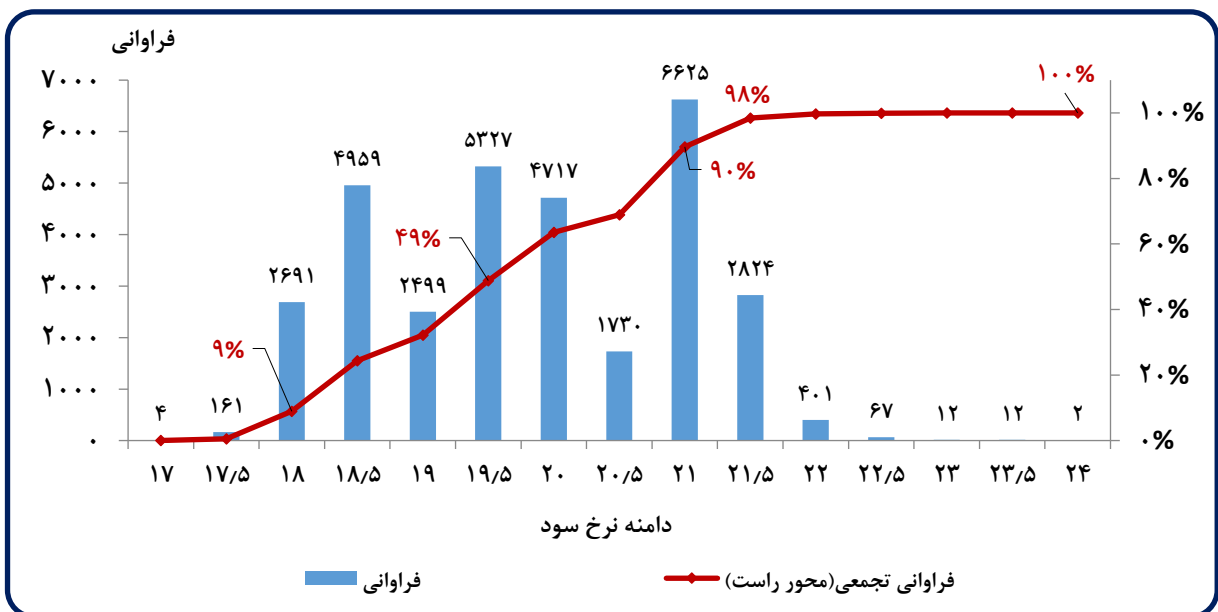
۱- عملکرد روزانه حجم و نرخ سود موزون بازار بین بانکی ریالی در سال ۱۴۰۰

نمودار ۱- عملکرد روزانه حجم و نرخ سود موزون بازار بین بانکی ریالی در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال-درصد)



۲- فراوانی نرخهای سود در بازار بین بانکی ریالی در سال ۱۴۰۰

نمودار ۲- فراوانی نرخهای سود در بازار بین بانکی ریالی در سال ۱۴۰۰ (درصد-فقره)



۳- عملکرد بازار بین بانکی ریالی به تفکیک گروه‌های بانکی در سال ۱۴۰۰

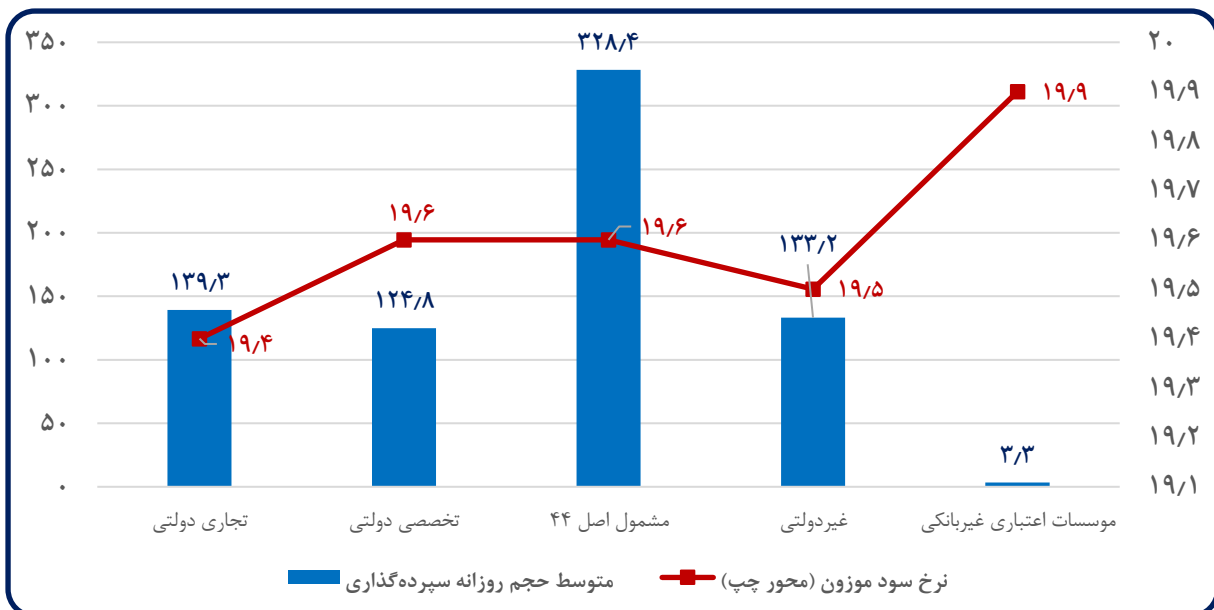
جدول ۱- متوسط حجم روزانه معاملات بازار به تفکیک گروه‌های بانکی سپرده‌گذار و سپرده‌پذیر در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال)

متوسط حجم روزانه سپرده‌گذاری	موسسات اعتباری غیربانکی	غیردولتی	مشمول اصل ۴۴	تخصصی دولتی	تجاری دولتی	سپرده‌پذیر / سپرده‌گذار
۱۳۹.۳	۱۲.۹	۷۵.۵	۲۸.۴	۵.۸	۲۲.۸	تجاری دولتی
۱۲۴.۸	۱۸.۶	۶۸.۲	۲۰.۳	۵.۳	۱۴.۵	تخصصی دولتی
۳۲۸.۴	۲۹.۴	۱۶۶.۹	۷۸.۱	۸.۸	۴۷.۲	مشمول اصل ۴۴
۱۳۳.۲	۱۲.۹	۵۳.۸	۴۵.۵	۳.۲	۲۳.۰	غیردولتی
۳.۳۰	۲.۴۳	۳.۲۱	۳.۴۴	۰	۲.۵	موسسات اعتباری غیربانکی
۷۲۴.۲	۷۲.۹	۳۶۳.۷	۱۷۱.۳	۱۶.۶	۱۰۲.۴	متوسط حجم روزانه سپرده‌پذیری

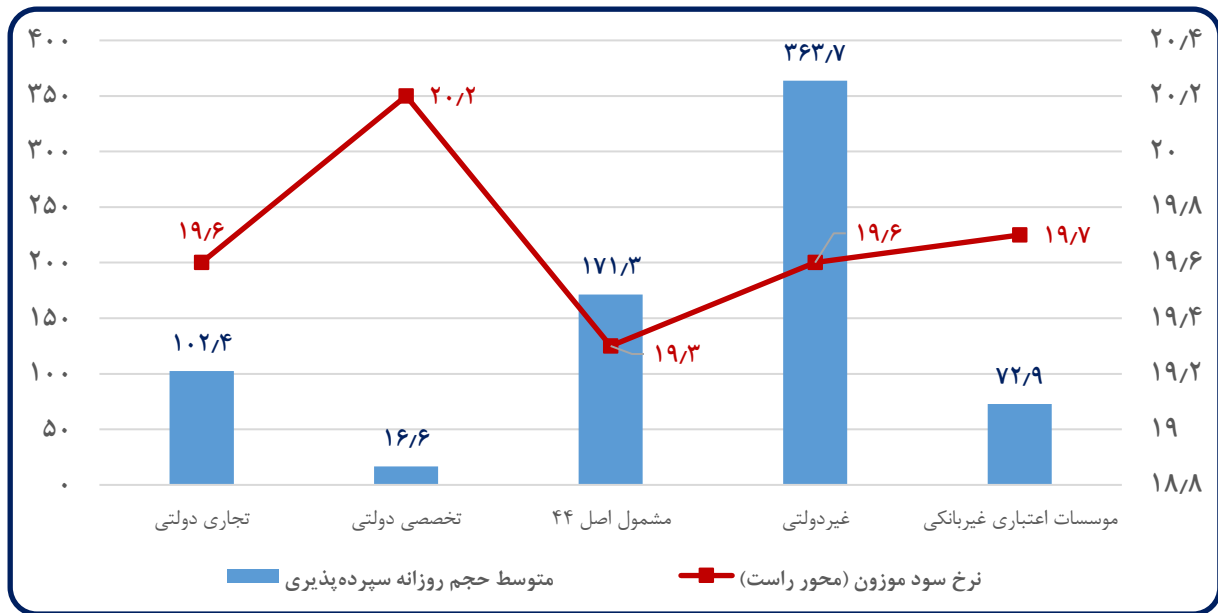
جدول ۲- نرخ سود موزون معاملات بازار به تفکیک گروه‌های بانکی سپرده‌گذار و سپرده‌پذیر در سال ۱۴۰۰ (درصد)

نرخ سود موزون سپرده‌گذاری	موسسات اعتباری غیربانکی	غیردولتی	مشمول اصل ۴۴	تخصصی دولتی	تجاری دولتی	سپرده‌پذیر / سپرده‌گذار
۱۹.۴	۱۹.۹	۱۹.۵	۱۹.۰	۱۹.۸	۱۹.۶	تجاری دولتی
۱۹.۶	۱۹.۶	۱۹.۶	۱۹.۴	۲۰.۴	۱۹.۷	تخصصی دولتی
۱۹.۶	۱۹.۷	۱۹.۷	۱۹.۴	۲۰.۱	۱۹.۵	مشمول اصل ۴۴
۱۹.۵	۱۹.۴	۱۹.۷	۱۹.۱	۲۰.۵	۱۹.۸	غیردولتی
۱۹.۹	۱۹.۵	۱۹.۸	۲۰.۶	۰	۱۹.۰	موسسات اعتباری غیربانکی
۱۹.۶	۱۹.۷	۱۹.۶	۱۹.۳	۲۰.۲	۱۹.۶	نرخ سود موزون سپرده‌پذیری

نمودار ۳- عملکرد سپرده‌گذاری بازار به تفکیک گروه‌های بانکی در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال - درصد)



نمودار ۴- عملکرد سپرده‌پذیری بازار به تفکیک گروه‌های بانکی در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال - درصد)

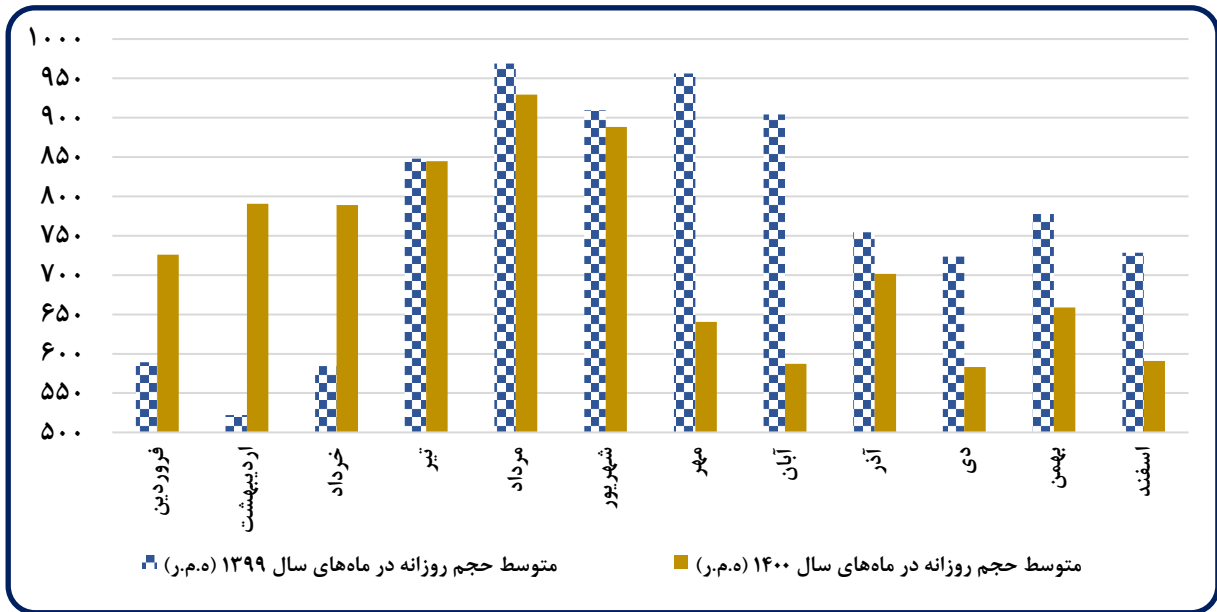


۴- عملکرد ماهانه بازار بین بانکی ریالی در سال‌های ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰

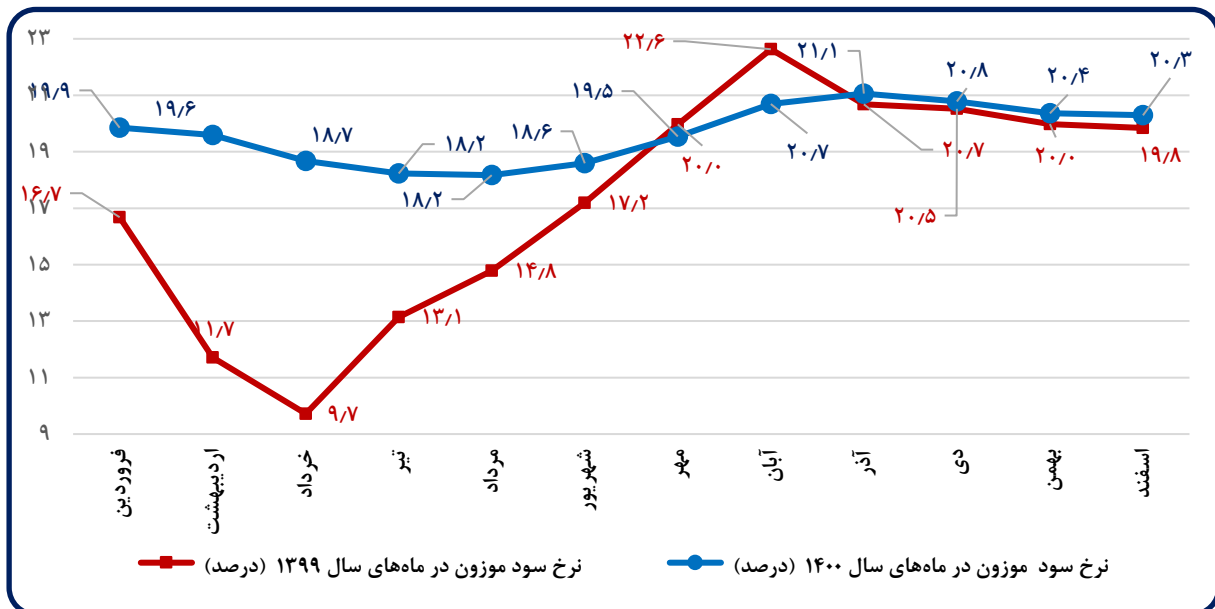
جدول ۳- عملکرد بازار بین بانکی ریالی به تفکیک ماه در سال‌های ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال - درصد)

ماه	وضعیت بازار		متوسط حجم روزانه (هزار میلیارد ریال)		نرخ سود موزون (درصد)	
	۱۳۹۹	۱۴۰۰	۱۳۹۹	۱۴۰۰	۱۳۹۹	۱۴۰۰
فروردین	۵۸۹.۴	۷۲۵.۹	۱۶.۷	۱۹.۹		
اردیبهشت	۵۲۱.۹	۷۹۰.۷	۱۱.۷	۱۹.۶		
خرداد	۵۸۴.۲	۷۸۹.۲	۹.۷	۱۸.۷		
تیر	۸۴۸.۱	۸۴۴.۶	۱۳.۱	۱۸.۲		
مرداد	۹۶۸.۹	۹۲۹.۶	۱۴.۸	۱۸.۲		
شهریور	۹۰۹.۳	۸۸۸.۲	۱۷.۲	۱۸.۶		
مهر	۹۵۶.۴	۶۴۰.۵	۲۰.۰	۱۹.۵		
آبان	۹۰۴.۱	۵۸۷.۱	۲۲.۶	۲۰.۷		
آذر	۷۵۴.۴	۷۰۱.۶	۲۰.۷	۲۱.۱		
دی	۷۲۳.۴	۵۸۳.۰	۲۰.۵	۲۰.۸		
بهمن	۷۷۷.۶	۶۵۸.۹	۲۰.۰	۲۰.۴		
اسفند	۷۲۸.۵	۵۹۰.۹	۱۹.۸	۲۰.۳		
مجموع	۷۷۵.۳	۷۲۴.۲	۱۷.۶	۱۹.۶		

نمودار ۵- متوسط حجم روزانه معاملات بازار در ماه‌های سال‌های ۱۴۰۰-۱۳۹۹ (هزار میلیارد ریال- درصد)

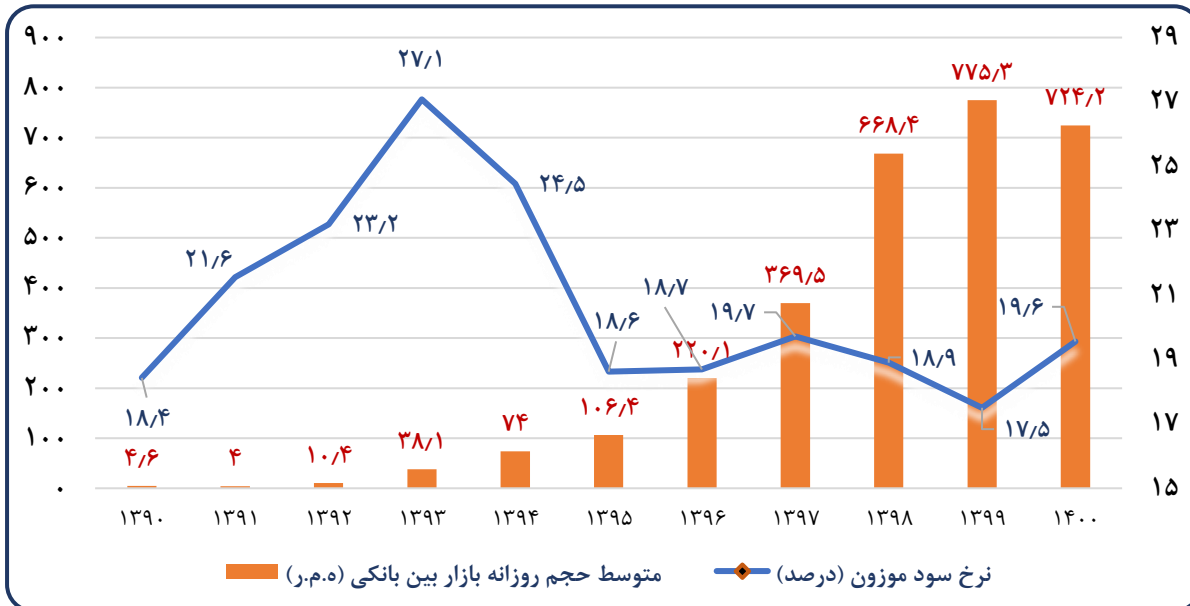


نمودار ۶- نرخ سود موزون بازار در ماه‌های سال‌های ۱۴۰۰-۱۳۹۹ (درصد)



۵- روند تاریخی عملکرد بازار بین بانکی ریالی

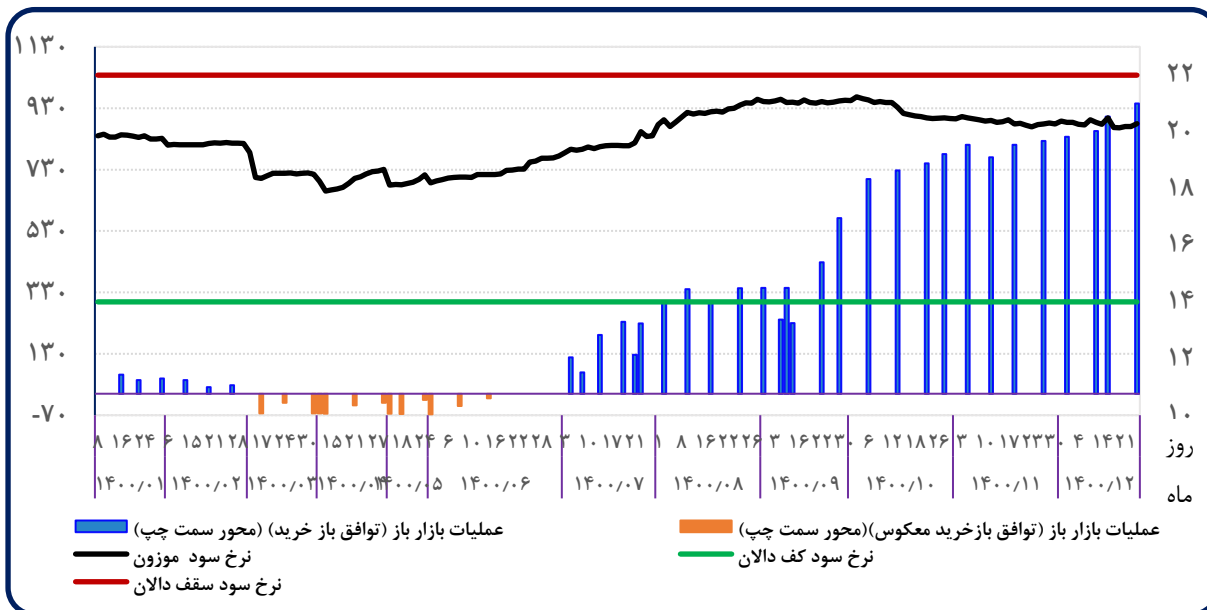
نمودار ۷- عملکرد بازار بین بانکی ریالی در سال های مختلف فعالیت (هزار میلیارد ریال - درصد)



ب) عملیات اجرایی سیاست پولی

۱- عملیات بازار باز

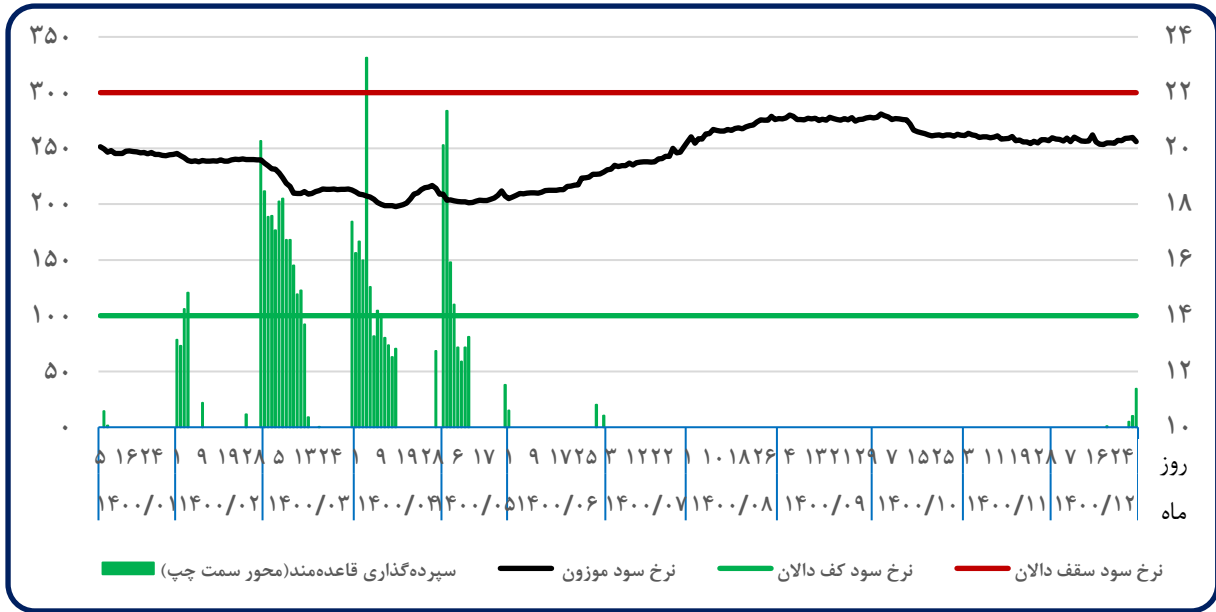
نمودار ۸- حجم عملیات بازار باز در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال - درصد)



۲- تسهیلات قاعده‌مند (مساعده‌های آماده)

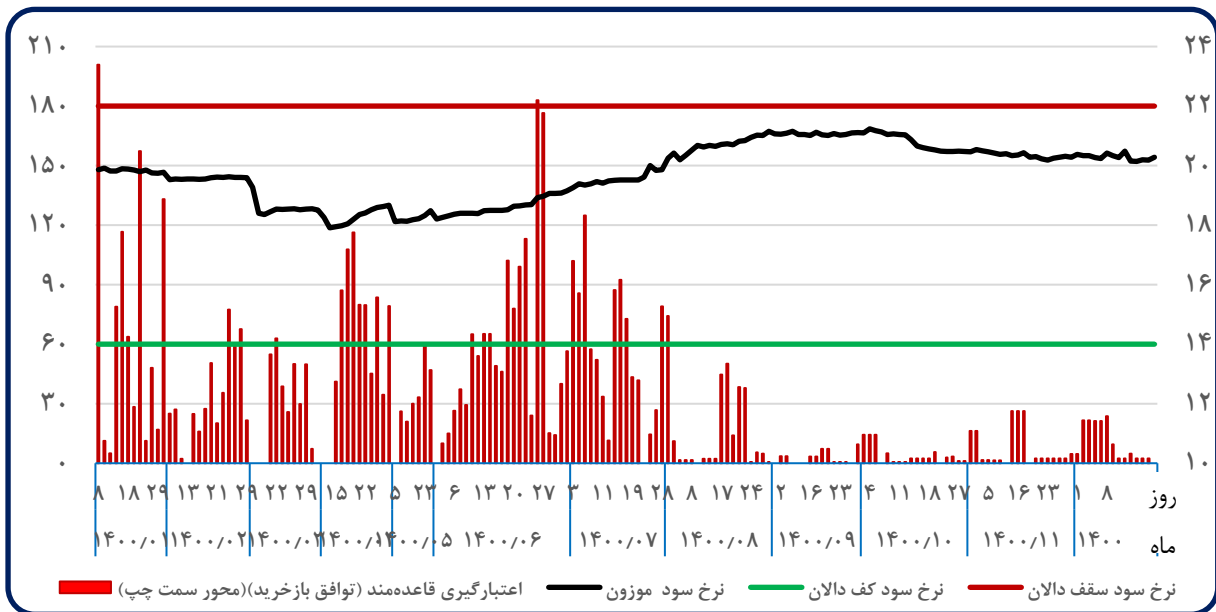
۱-۲- سپرده‌گذاری قاعده‌مند

نمودار ۹- حجم روزانه سپرده‌گذاری قاعده‌مند بانک‌ها و موسسات اعتباری غیربانکی در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال-درصد)



۲-۲- اعتبار‌گیری قاعده‌مند

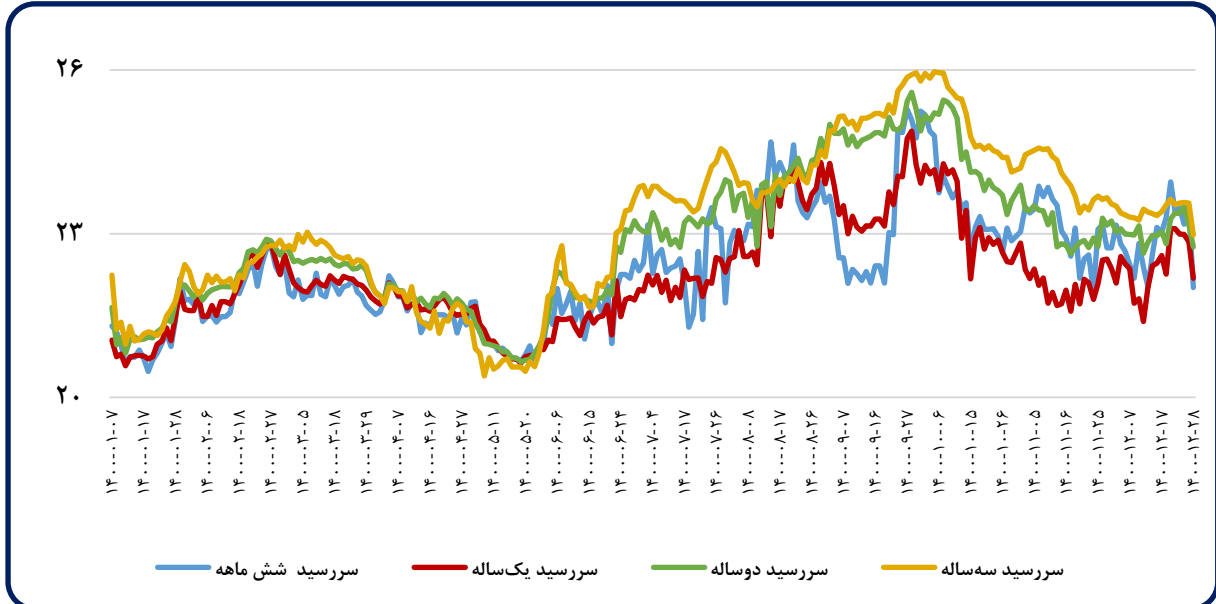
نمودار ۱۰- حجم اعتبار‌گیری قاعده‌مند بانک‌ها و موسسات اعتباری غیربانکی در سال ۱۴۰۰ (هزار میلیارد ریال-درصد)



ج) بازدهی بازار بدهی دولتی

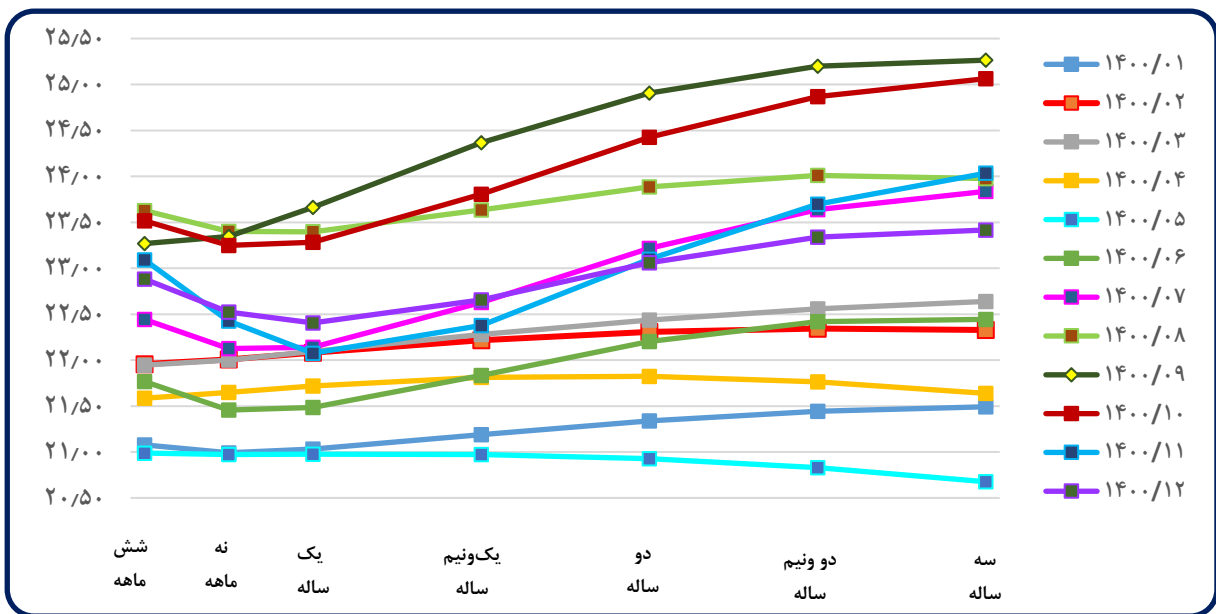
۱- نرخ بازده اسناد خزانه اسلامی

نمودار ۱۱- بازده اوراق خزانه اسلامی در بازار ثانویه (درصد)



۲- منحنی بازده اسناد خزانه اسلامی

نمودار ۱۲- منحنی بازده ماهانه اسناد خزانه اسلامی سال ۱۴۰۰ (درصد)^۱



^۱ برای برآورد نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه اسلامی از روش نلسون-سیگل-اسونسن استفاده شده است.