

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



مهر ماه ۱۴۰۲



CHARISMA MARKET INSIGHT

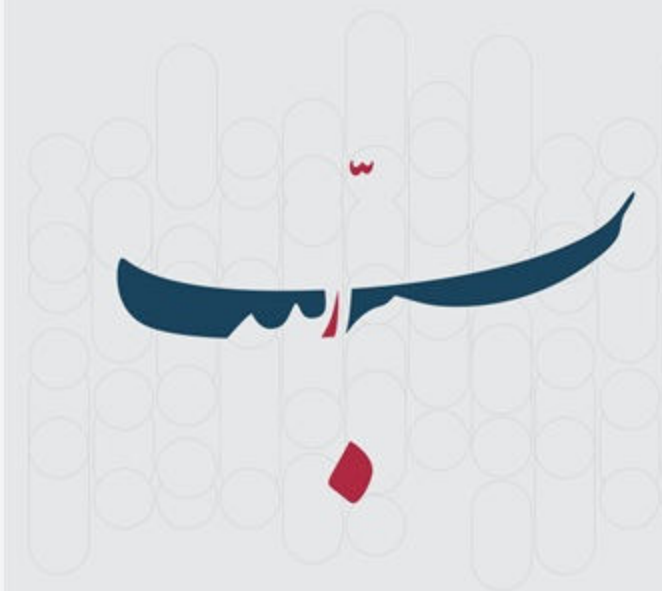
معرفی گزارش:

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما جهت ارائه گزارشی جامع از وضعیت اقتصادی کشور، بازار سهام و بازار بدهی به صورت ماهانه در اختیار علاقمندان قرار می‌گیرد. از جمله موارد پوشش داده شده در گزارش، می‌توان به سیاست‌های پولی، نقدینگی در سطح کشور، تورم، وضعیت ارز، وضعیت بازار سهام و بدهی، بازیگران کلیدی اوراق درآمد ثابت، صندوق‌های سرمایه‌گذاری و گزارش‌های فروش ماهانه شرکت‌ها، و اشاره نمود. گزارش ذکر شده توسط مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما، با همکاری شرکت سبدگردانی کاریزما و واحد مدیریت ریسک مجموعه تهیه گردیده است.

سلب مسئولیت:

محتوای این گزارش با رعایت بی‌طرفی، استقلال و دقت و براساس نظرات کارشناسان این مجموعه تدارک دیده شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما هیچ گونه تضمینی در مورد نتایج سرمایه‌گذاری بر مبنای این گزارش را ارائه نمی‌دهد. با وجود گردآوری بخش‌های مختلف، این گزارش به تنهایی نمی‌تواند تمامی ملاحظات لازم برای تصمیم‌گیری را فراهم نماید و صرف استفاده از این گزارش نباید مبنای خرید یا فروش هرگونه دارایی قرار گیرد. مدیریت سرمایه هر شخص باید براساس سطح ریسک‌پذیری، اهداف مالی، محدودیت‌ها، افق زمانی و سایر ویژگی‌های فردی صورت گیرد و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در قبال معاملاتی که بر مبنای اطلاعات این گزارش انجام گیرد، مسئولیتی نمی‌پذیرد. گزارش پیش رو بر مبنای اطلاعات و داده‌های موجود در منابع متعددی تهیه شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

کلیه حقوق مادی و معنوی این گزارش متعلق به گروه مالی کاریزما می‌باشد.



۰۳	فصل اول
	اقتصاد
۰۴	سیاست‌های پولی
۰۶	پایه پولی و نقدینگی
۰۹	تورم و شاخص قیمت مصرف‌کننده
۱۱	ارز خارجی

۱۳	فصل دوم
	سهام
۱۴	بررسی بلندمدت بازار سهام
۱۷	ارزندگی بازار سهام
۲۰	برترین گزارش‌های ماهانه

۲۲	فصل سوم
	درآمد ثابت
۲۳	مروری بر بازار درآمد ثابت
۲۴	دید کلی بازار بدهی
۲۶	انتشار و تسویه اوراق
۲۹	تامین مالی دولت
۲۸	بازیگران کلیدی بازار بدهی
۳۳	معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی
۳۴	نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳۶	تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳۷	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)
۳۸	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (صدور و ابطال)

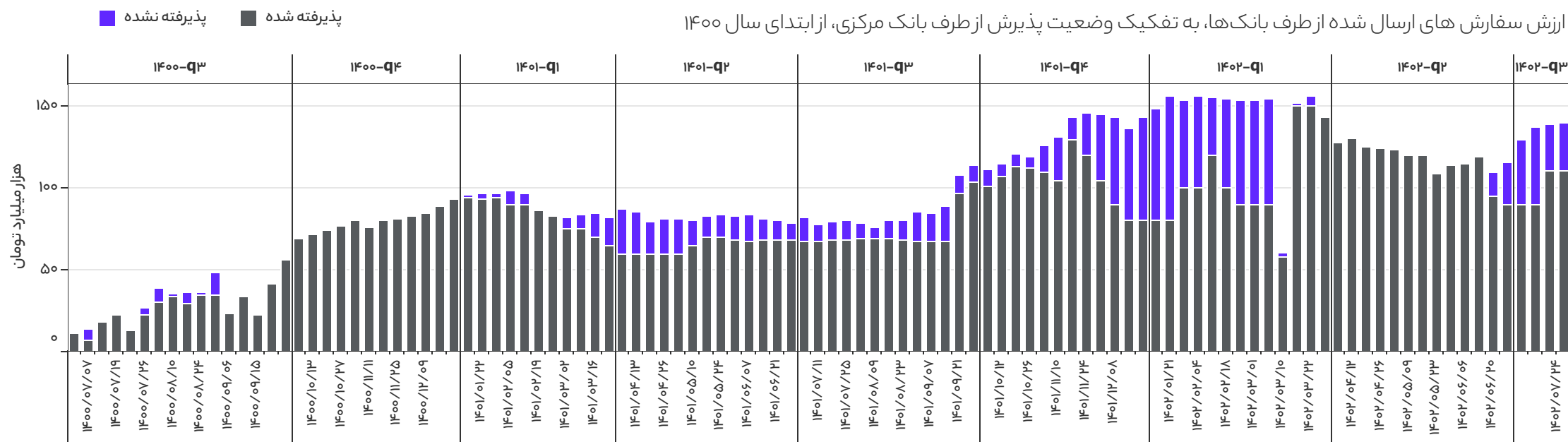


ECONOMY

سیاست‌های پولی

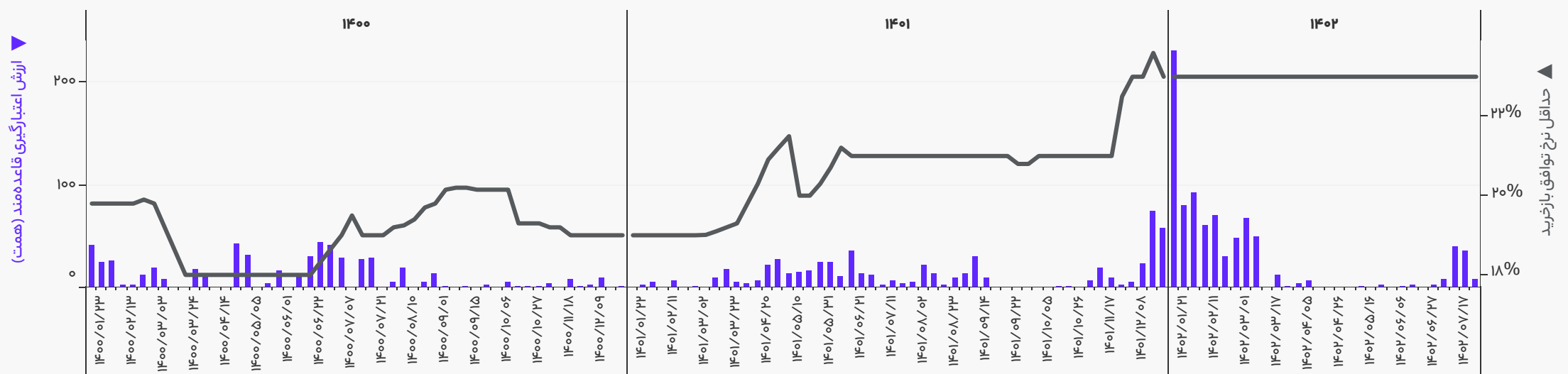
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

ارزش سفارش‌های ارسال شده از طرف بانک‌ها، به تفکیک وضعیت پذیرش از طرف بانک مرکزی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



تامین مالی بانک‌ها از بانک مرکزی

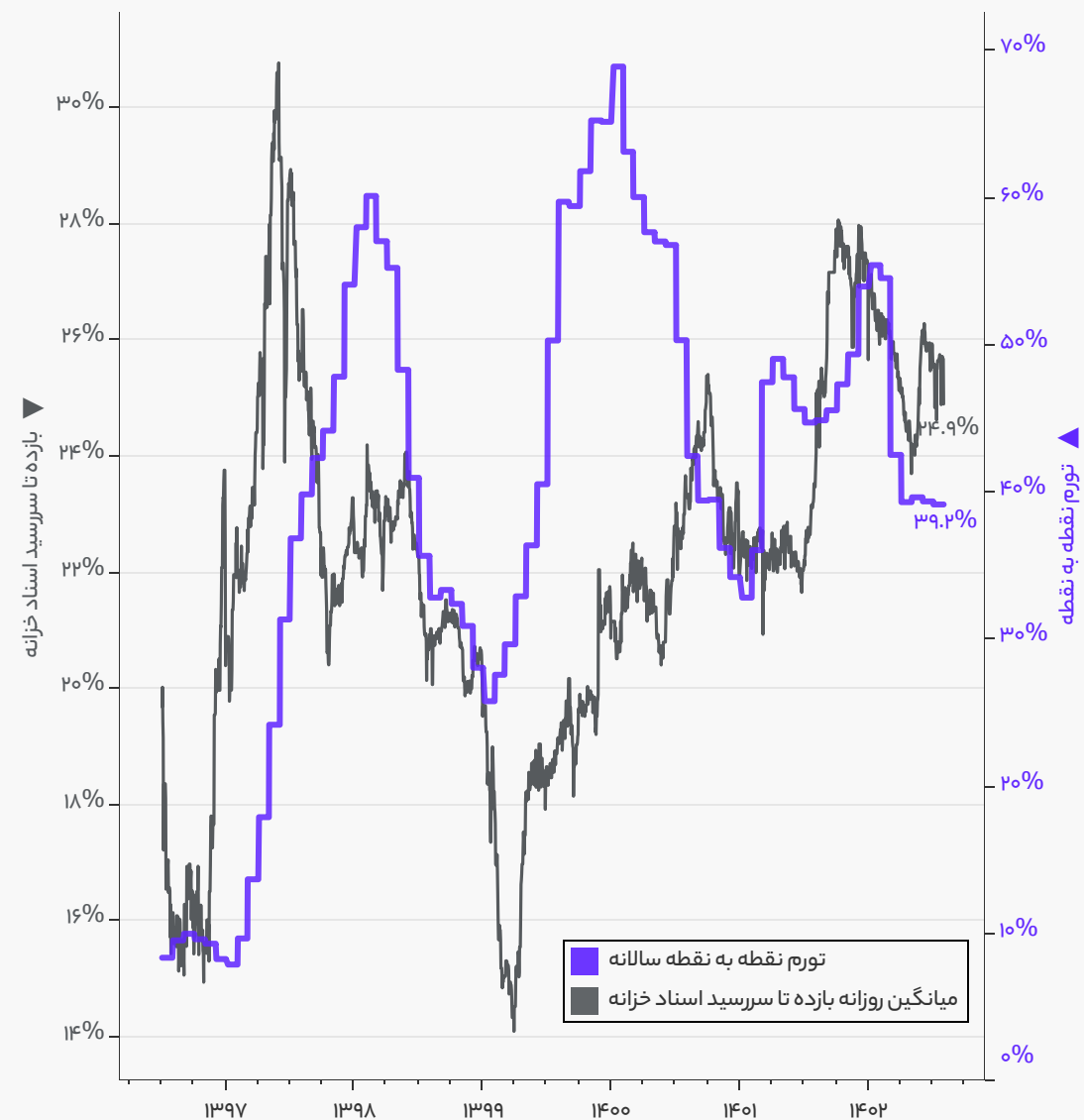
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق بازخريد، از ابتدای سال ۱۴۰۰



سیاست‌های پولی

تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

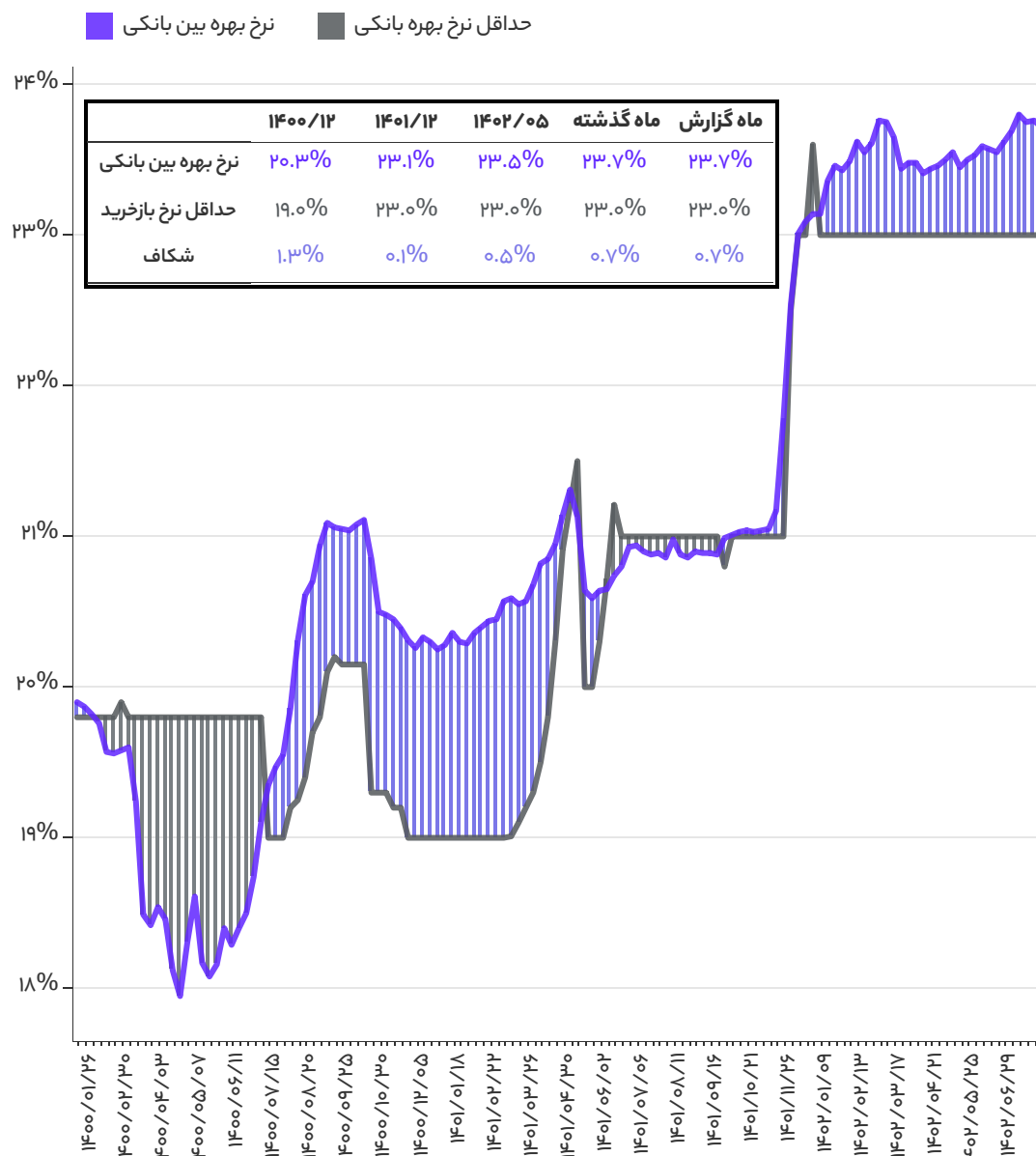
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* برای محاسبه میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه، تنها اوراقی که بیش از ۳۰ روز تا سررسید فاصله دارند، استفاده شده است.

دسترسی پول برای بانک‌ها

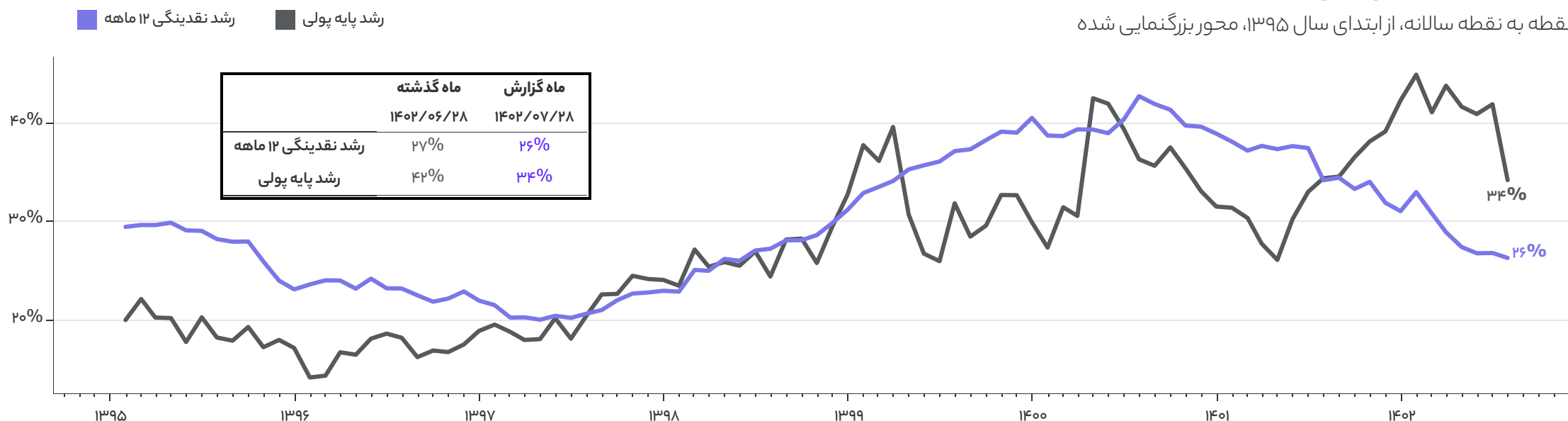
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

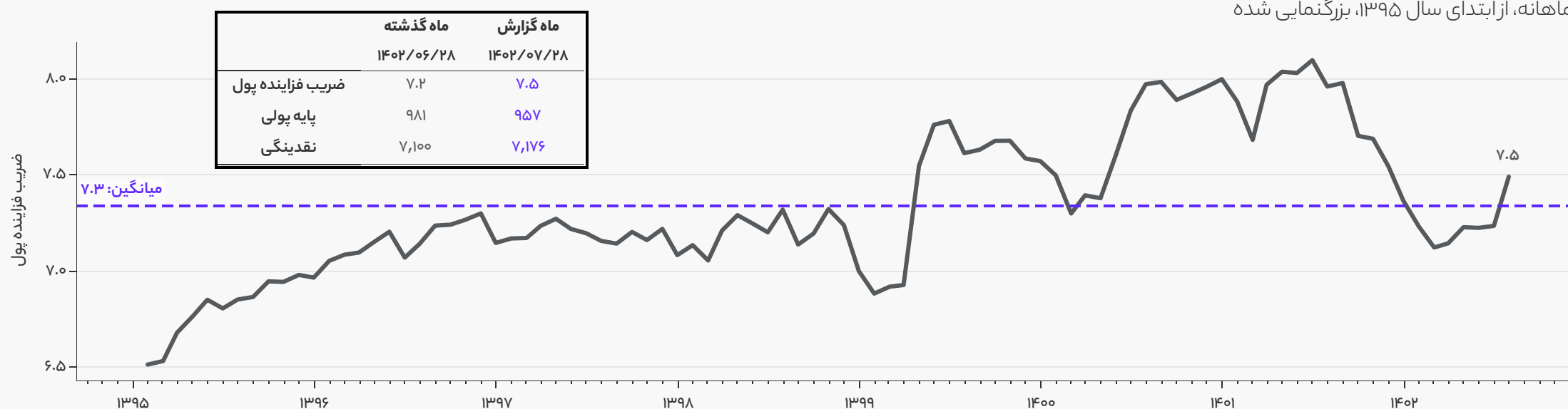
رشد نقدینگی و پایه پولی*

نقطه به نقطه سالانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، محور بزرگنمایی شده



ضریب فزاینده پول**

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

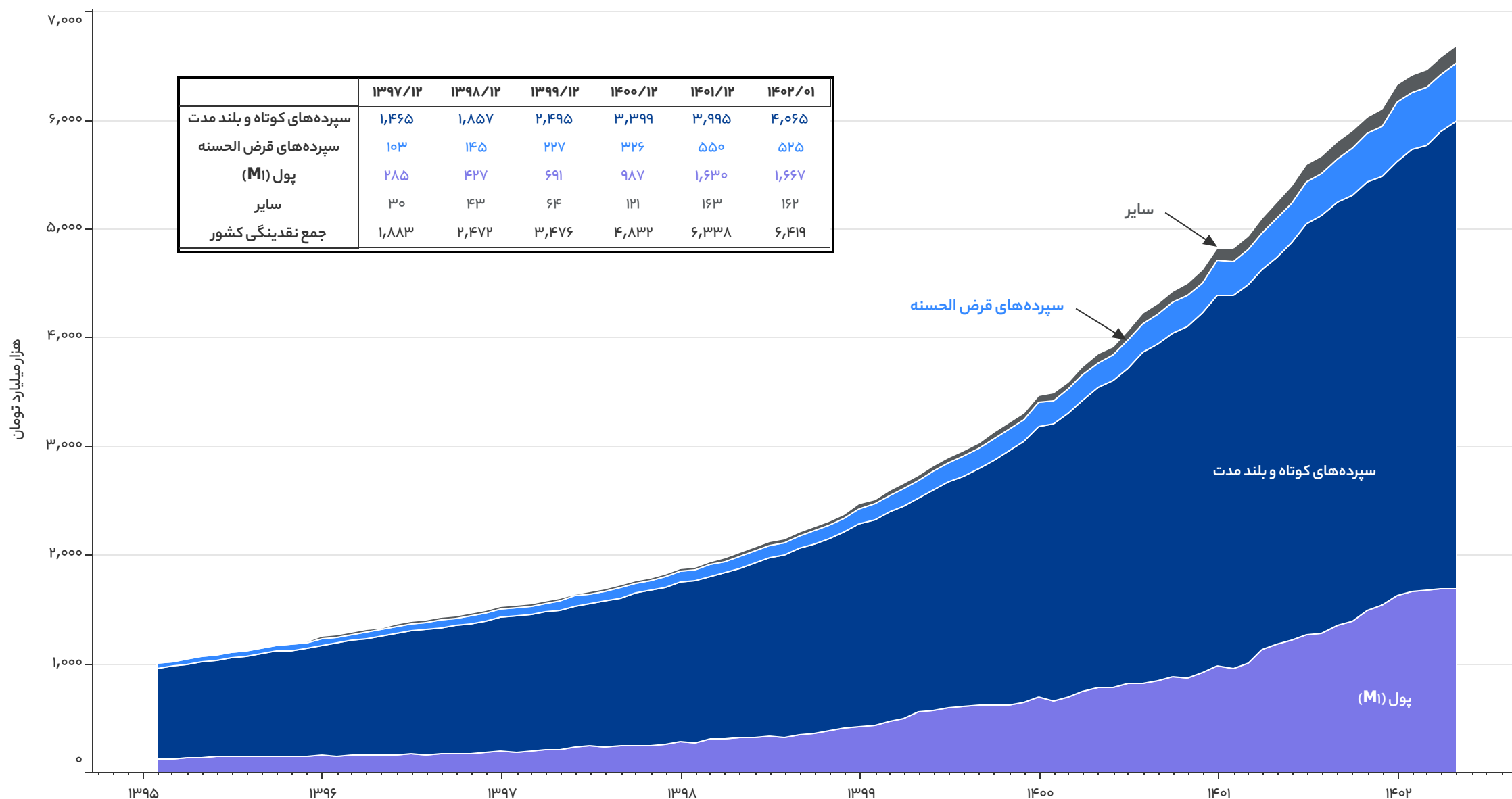


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.
** پایه پولی برج ۵ براساس اخبار رسمی محاسبه شده و فاصله تا آخرین آمار رسمی نیز تخمین زده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

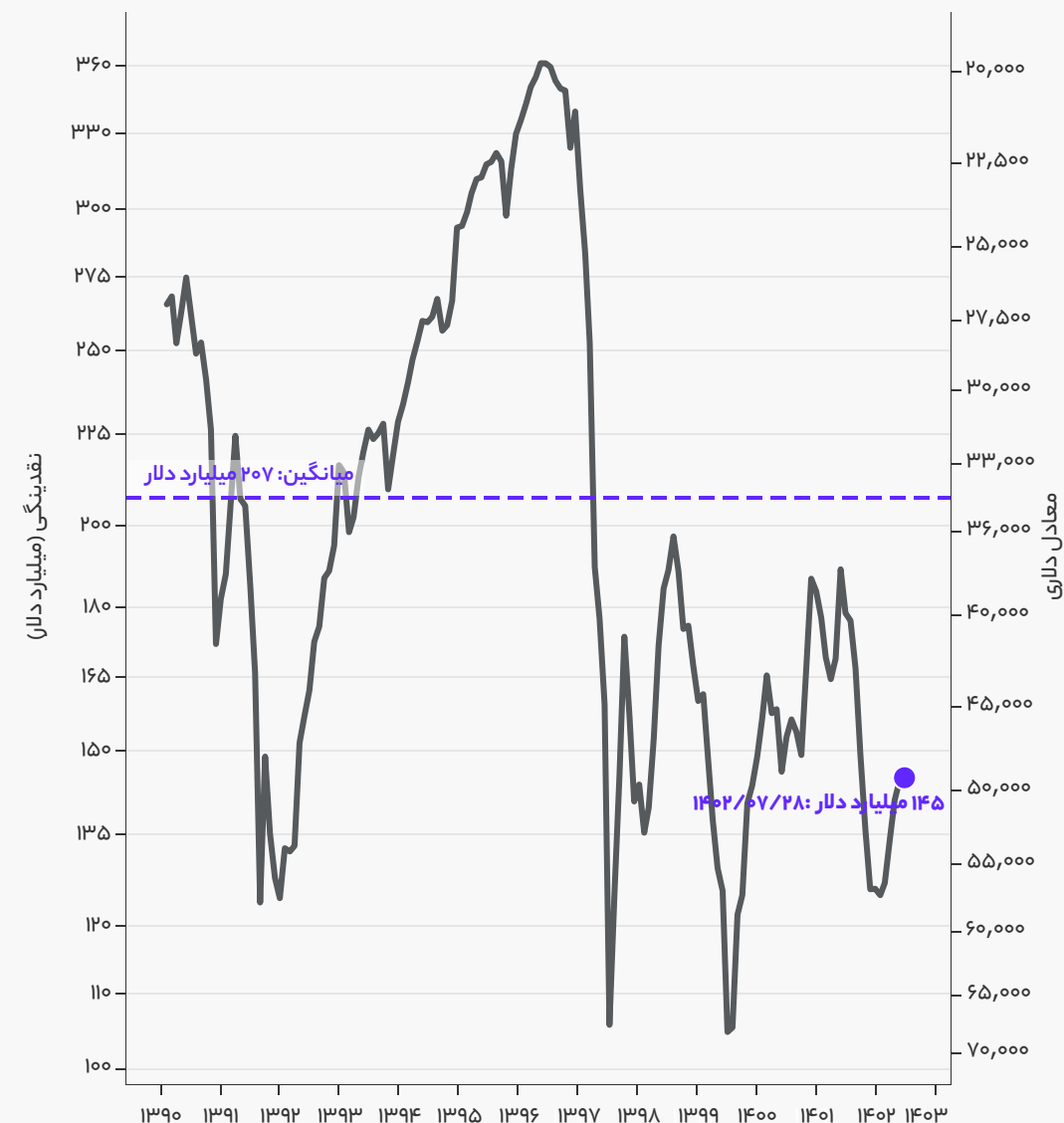
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، هزار میلیارد تومان



پایه پولی و نقدینگی

نقدینگی در ایران به دلار آمریکا

میلیارد دلار، از ابتدای سال ۱۳۹۰، محور لگاریتمی، بزرگنمایی شده، به همراه میانگین، محور سمت راست دلار تعادلی* مورد انتظار برای رسیدن به معادل دلاری سطح نقدینگی**



نسبت پول به نقدینگی

از ابتدای سال ۱۳۹۰، نسبت پول (M1) به نقدینگی در ایران

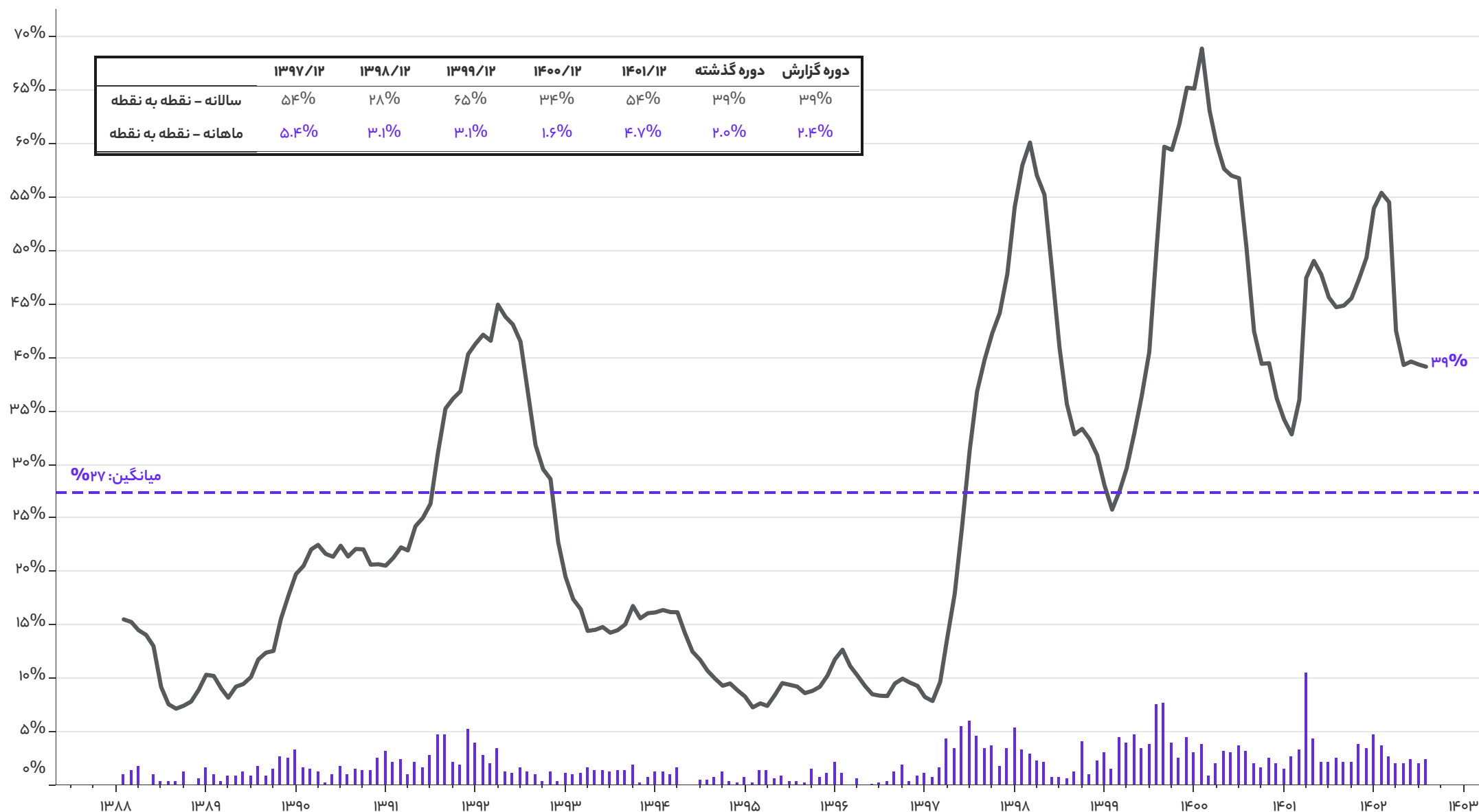


* قیمت دلاری لازم برای رسیدن به سطح نقدینگی دلاری مورد انتظار.
** نقدینگی چند ماه گذشته با استفاده از آمار ارایه شده در اخبار توسط بانک مرکزی محاسبه گردیده است.

تورم و شاخص CPI

وضعیت تورم*

نقطه به نقطه سالانه، به همراه تورم ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۸۸

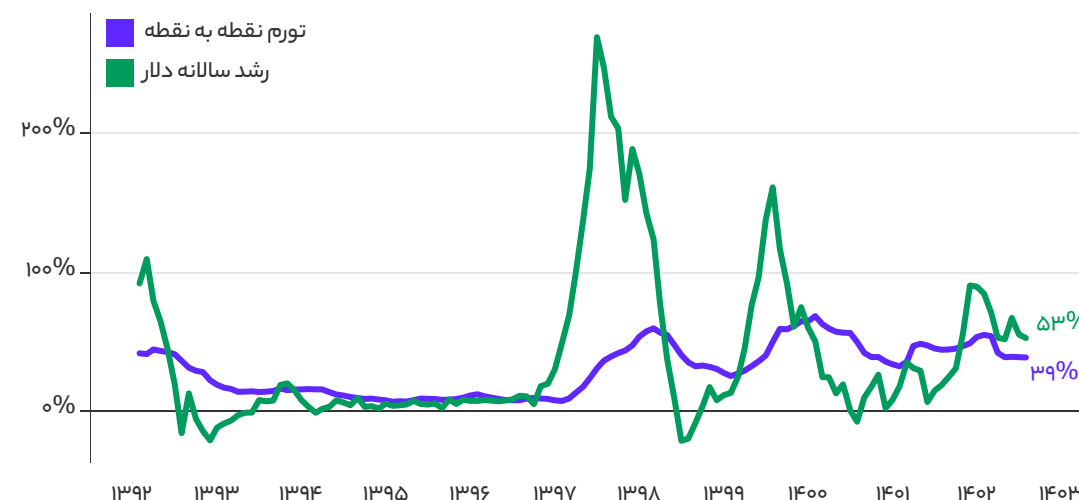


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

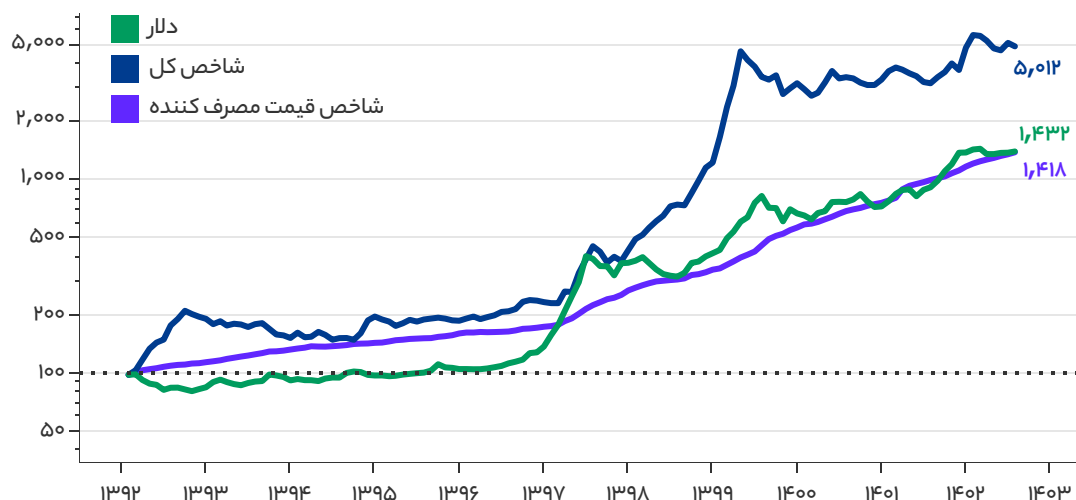
تورم و رشد دلار

از ابتدای سال ۱۳۹۲، تورم نقطه به نقطه سالانه در برابر رشد نقطه به نقطه قیمت دلار

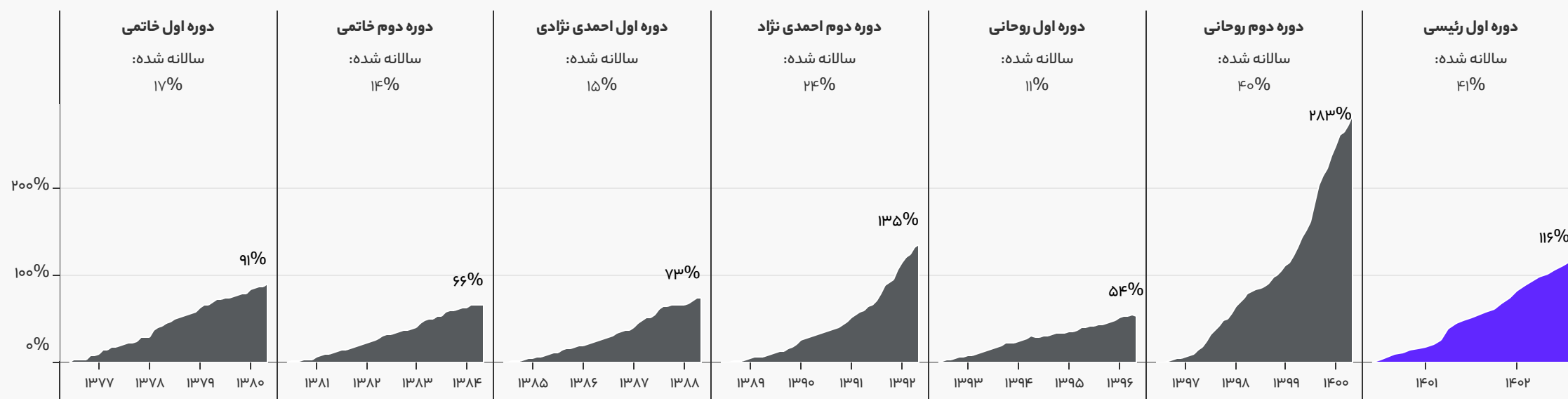


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

مبنای تمامی شاخص‌ها سال ۱۳۹۲ بازنشاندن شده، عدد پایه ۱۰۰، محور لگاریتمی



تورم تجمعی در دوره‌های ریاست جمهوری گذشته



ارز خارجی

وضعیت دلار

از آذر ۱۳۹۷، تومان، دلار آزاد در برابر دلار نیمایی و دلار سکه*

دلار آزاد دلار نیمایی دلار سکه

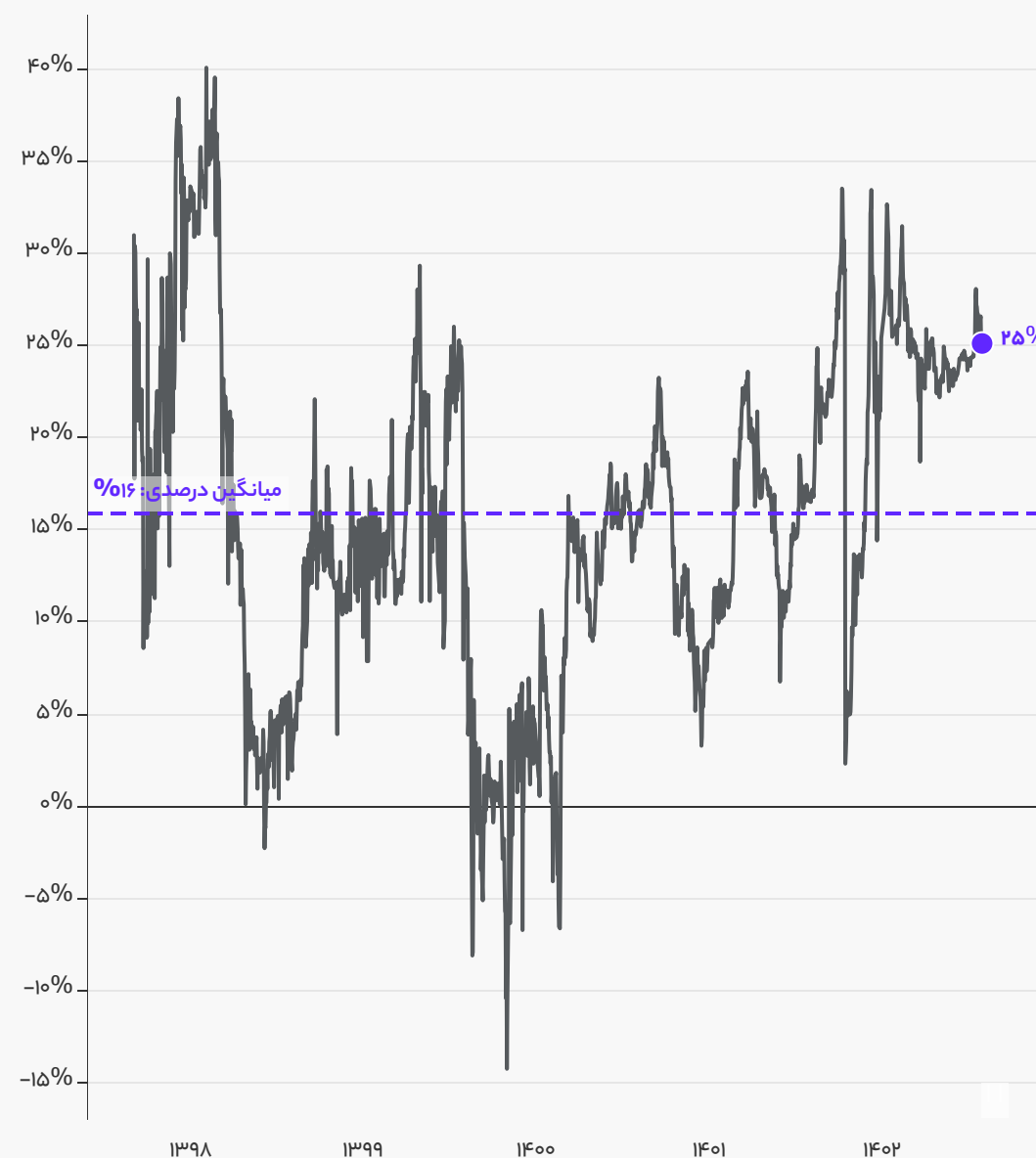


* دلار سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

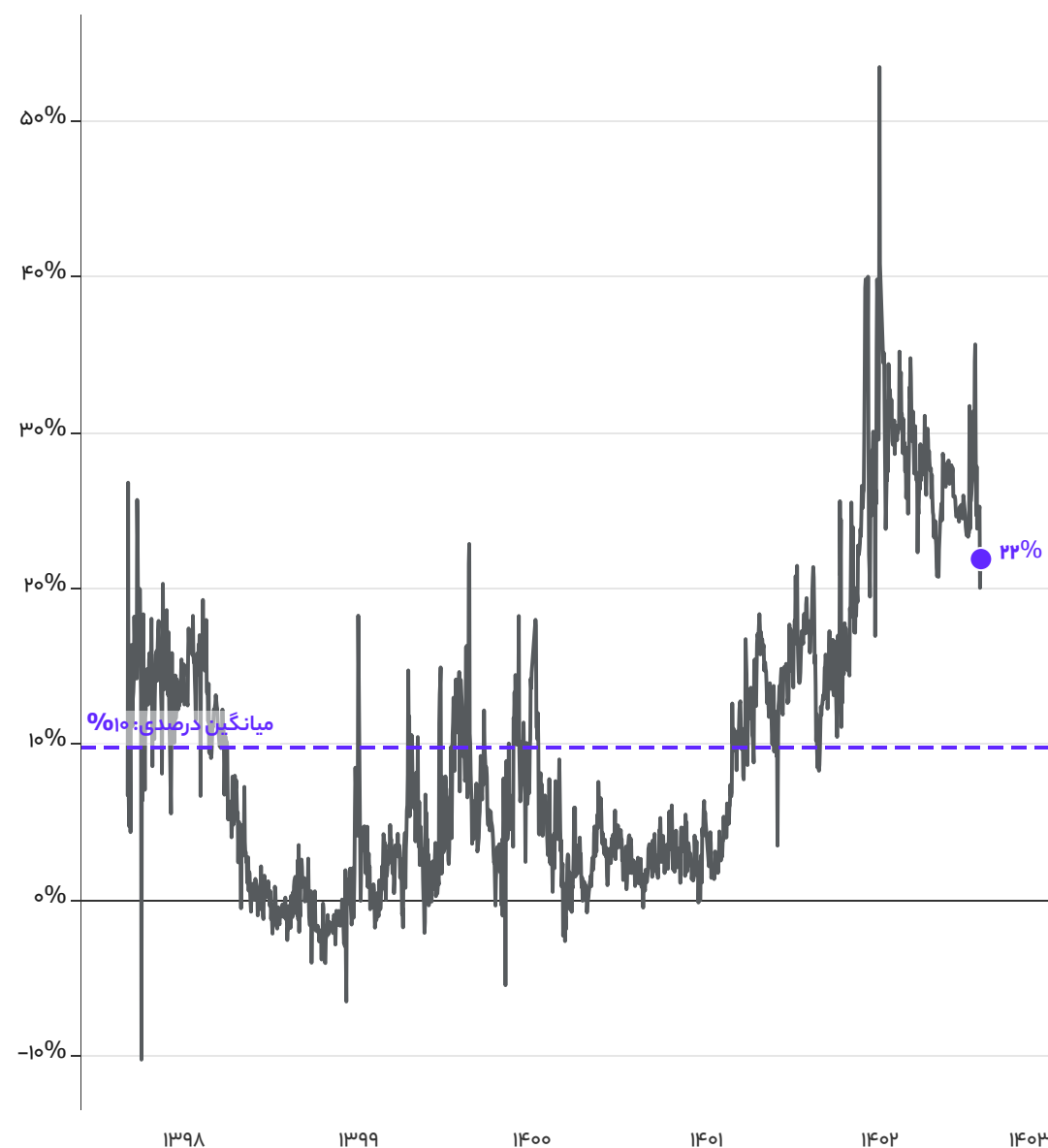
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

از آذر ۱۳۹۷، اختلاف درصدی دلار آزاد و دلار نیمایی



شکاف دلار آزاد و دلار سکه

از آذر ۱۳۹۷، اختلاف درصدی دلار آزاد و دلار سکه



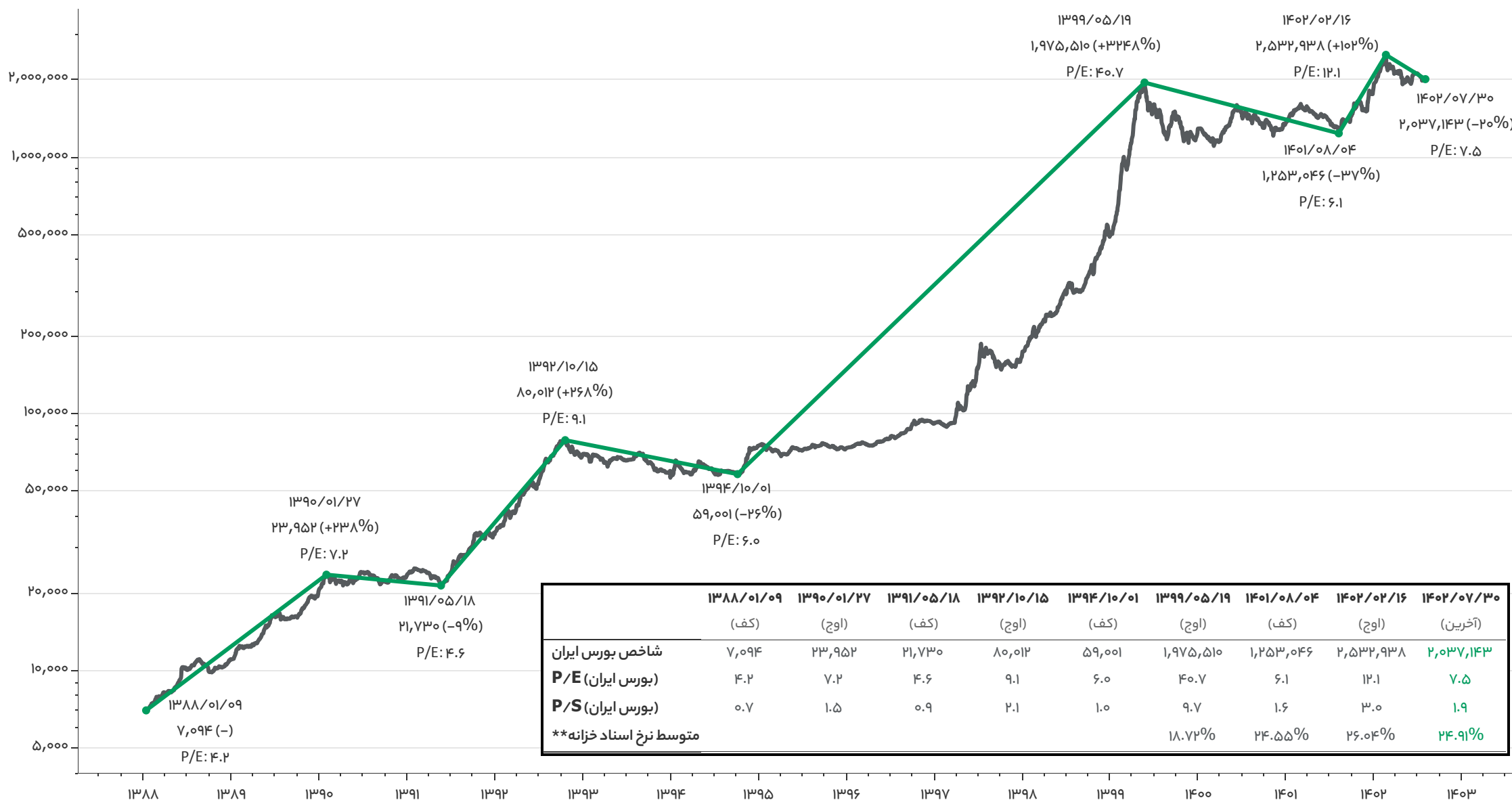


EQUITY

بررسی بلندمدت بازار سهام

روندهای بلندمدت شاخص بورس ایران*

از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۸۸، محور لگاریتمی، بزرگنمایی شده، نسبت قیمت به سود گذشته نگر براساس شاخص بورس ایران

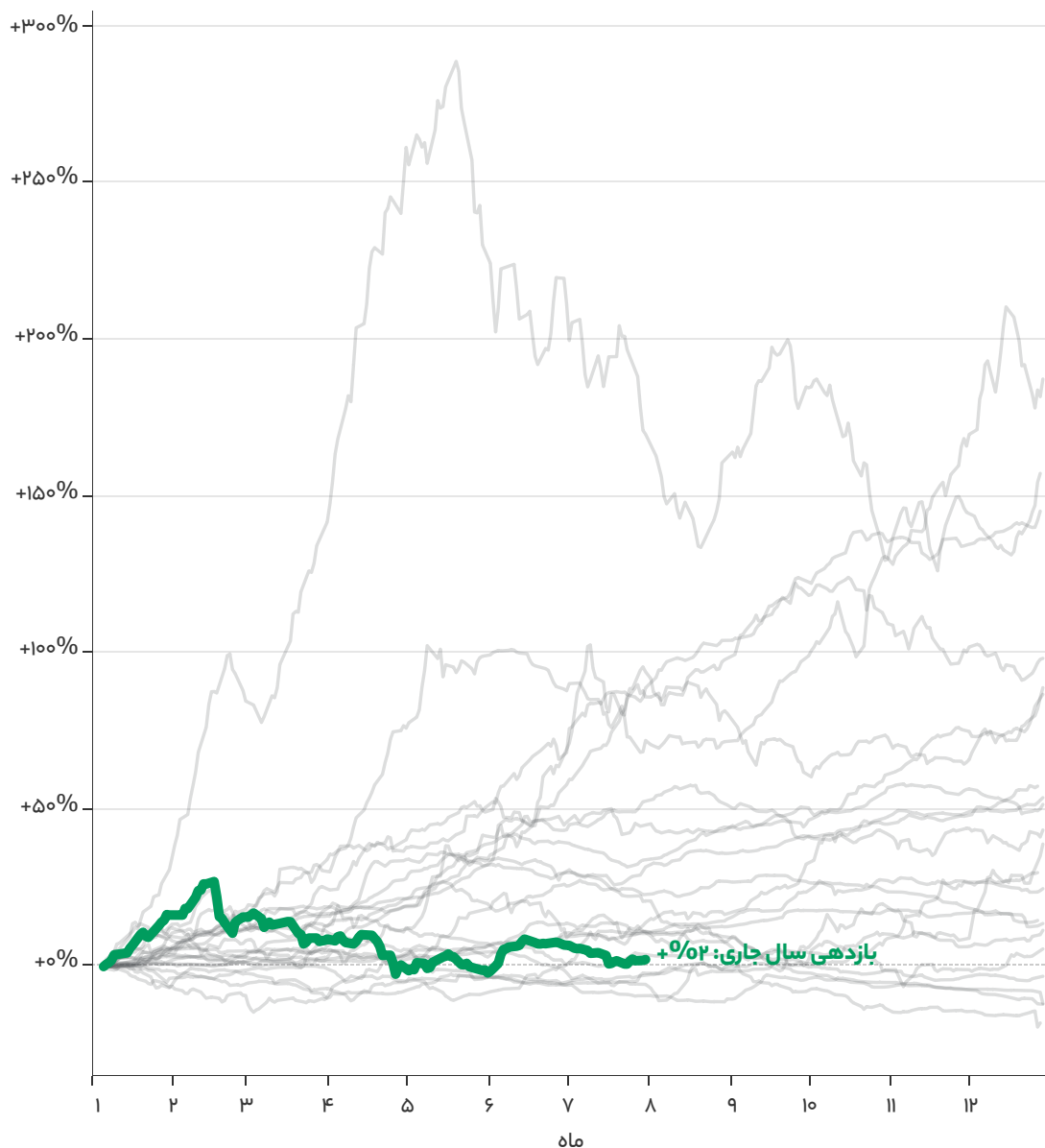


* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور، که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.

** متوسط نرخ اسناد خزانه اسلامی، میانگین نرخ بازدهی اوراق در سررسیدهای مختلف می باشد که بیش از ۳۰ روز تا سررسید خویش فاصله دارند.

مقایسه بازدهی سال جاری

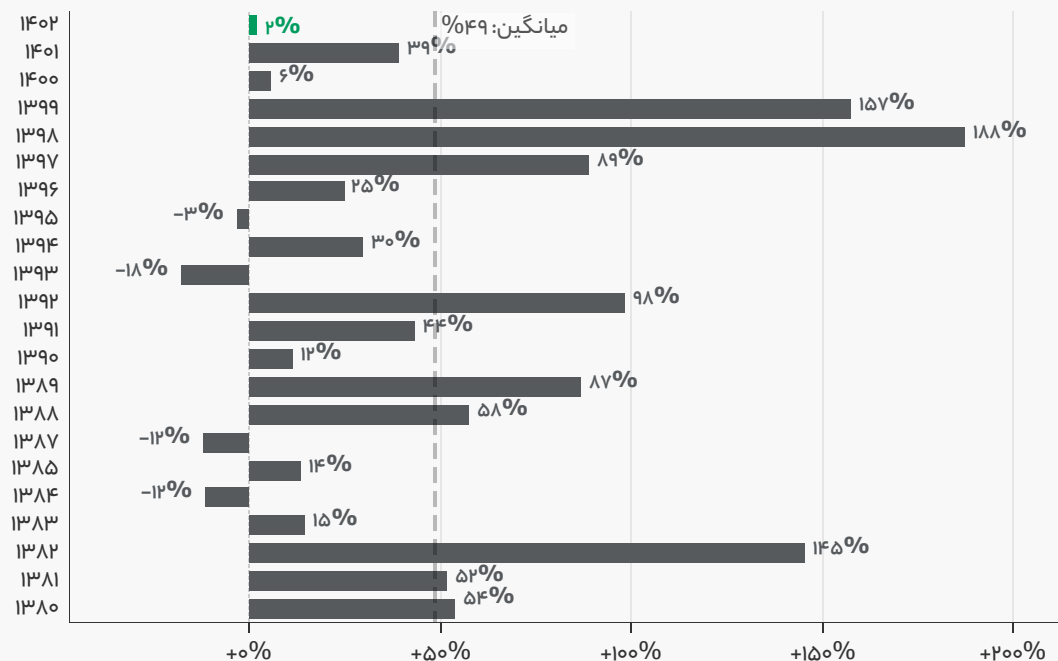
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



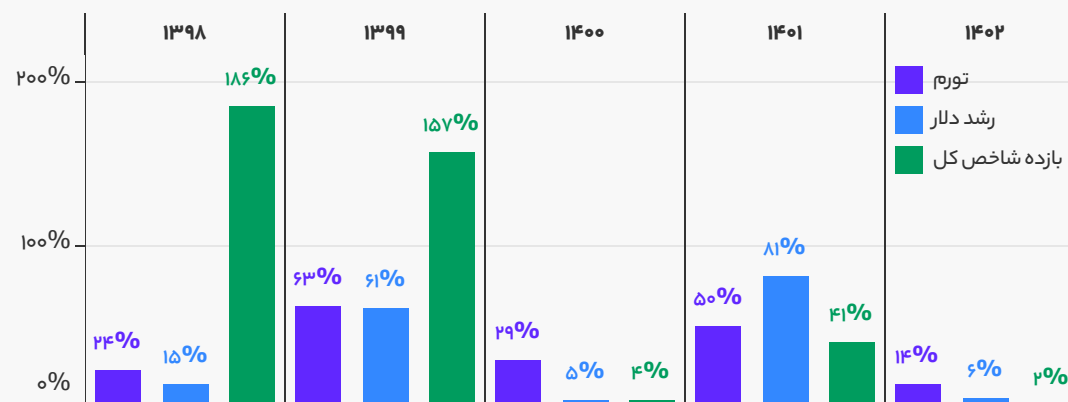
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

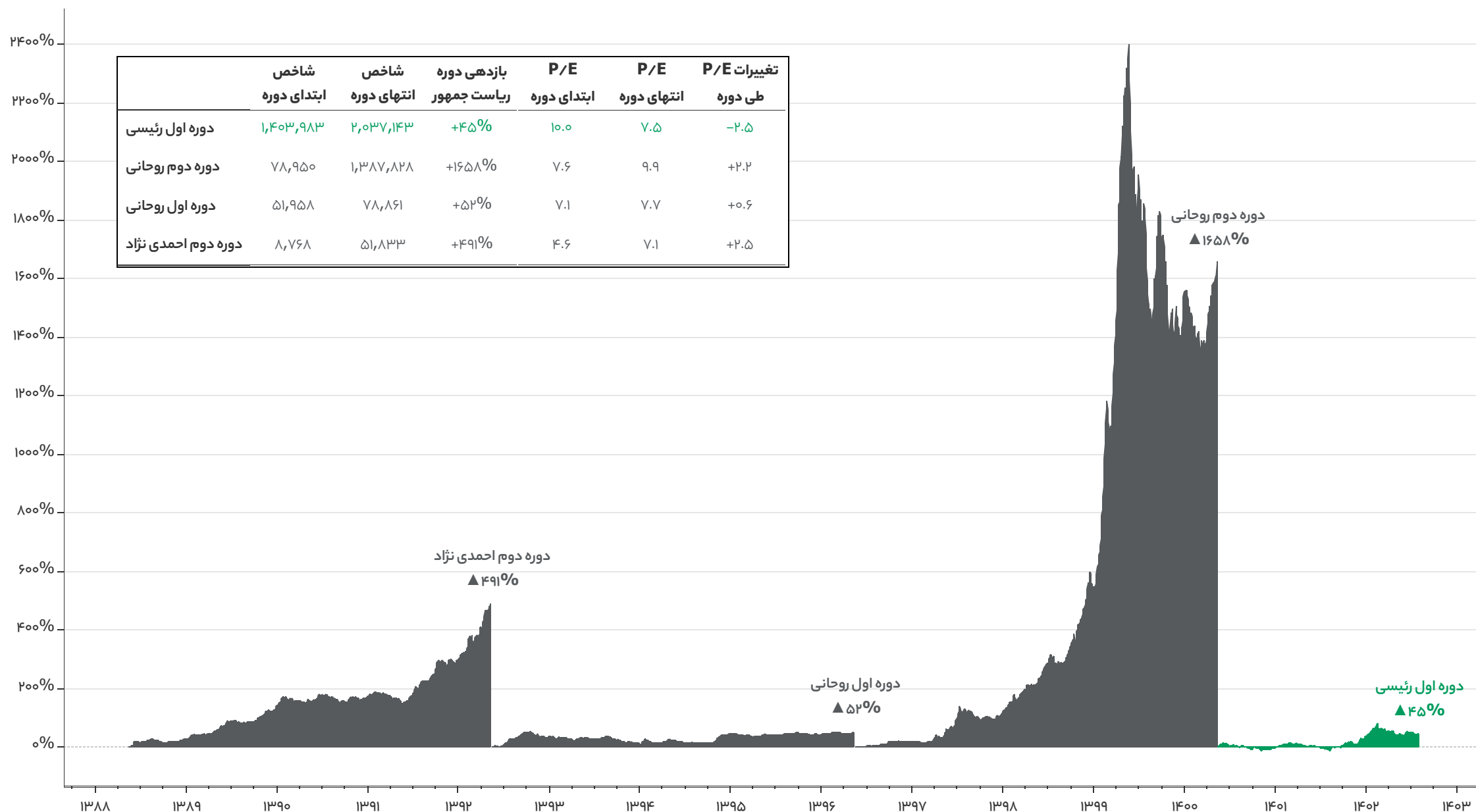


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلندمدت بازار سهام

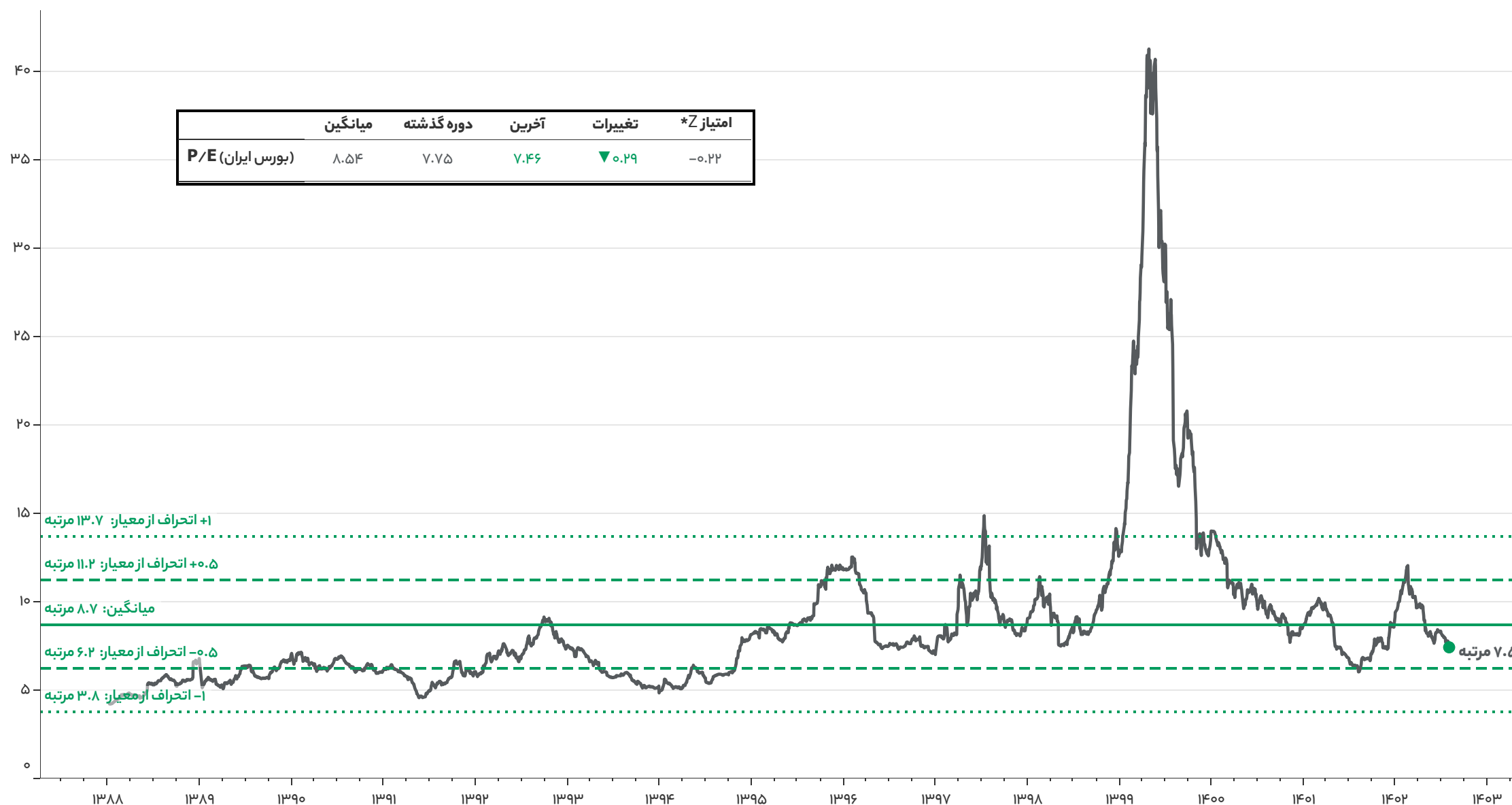
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



ارزندگی بازار سهام

نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران*



* میانگین وزنی نسبت قیمت به سود سهام براساس ارزش بازار

ارزندگی بازار سهام

ارزش دلاری بازار

از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده‌اند.



* ارزش ریالی بازار نیز پس از حذف عرضه‌های اولیه از سال ۱۳۹۵ محاسبه شده است.

ارزندگی بازار سهام

نسبت ارزش کل بازار به نقدینگی کشور*

از سال ۱۳۹۵، ارزش کل بازار بورس تهران و فرابورس**، در برابر شاخص کل بورس تهران

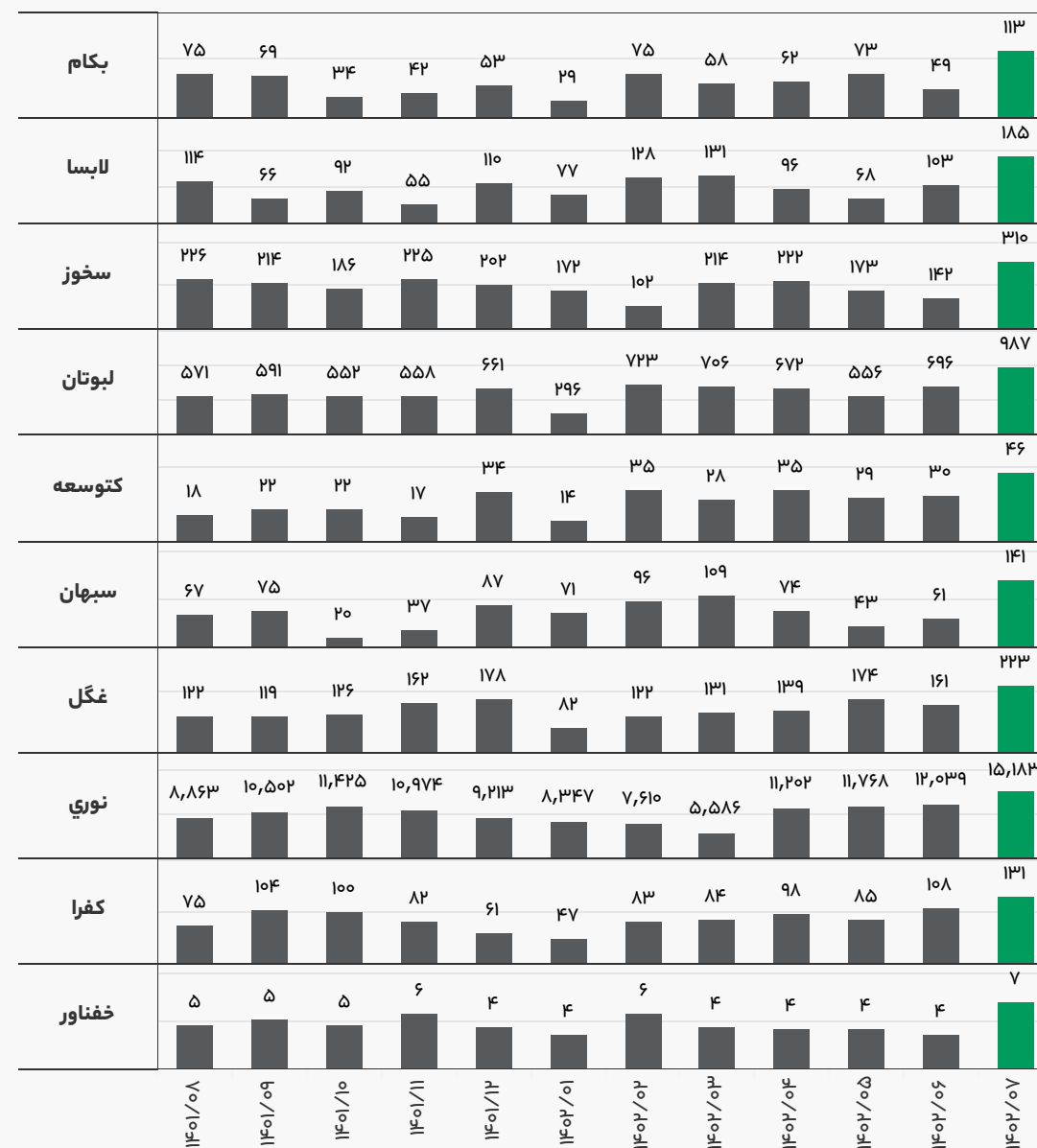


* با توجه به اختلاف زمانی چند ماهه انتشار اطلاعات نقدینگی کشور، ماه‌های منتهی با استفاده از مدل‌های آماری برآورد گردیده‌اند.
** برای مقایسه بهتر، عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف گردیده‌اند.

برترین گزارش‌های ماهانه

برترین رکوردشکنی‌ها در فروش ماهانه

روند فروش ماهانه برای ۱۰ نماد با بیشترین اختلاف با رکورد تاریخی فروش خود، میلیارد تومان



* در فیلتر فوق تمامی گزارش‌های ماهانه لحاظ نشده و حدود ۹۵% نمادها، مورد بررسی قرار گرفته است.

برترین رکوردشکنی‌ها در فروش ماهانه

۲۰ رکورد شکنی برتر، مرتب شده براساس اختلاف با رکورد تاریخی، به تفکیک سکتور و صنعت

رشد نسبت به میانگین ۶ ماهه	رشد نسبت به میانگین ۳ ماهه	اختلاف با رکورد فروش	نماد	صنعت	سکتور
۹۵%	۸۴%	۴۸%	بکام	تجهیزات صنعتی	صنعتی
۸۴%	۱۰۸%	۴۱%	لابسا	ماشین آلات	
۵۲%	۳۷%	۱۶%	چدن	محصولات فلزی	
۳۴%	۲۶%	۹%	فجام		
۶۲%	۵۴%	۳۷%	لبوتان	وسایل خانگی	مصرفی دوره‌ای
۶۲%	۷۵%	۲۱%	خفناور	قطعات خودرو	
۷۱%	۴۶%	۱۸%	نمرینو	نساجی	
۶۲%	۴۶%	۳۲%	کتوسعه	سایر مواد معدنی	مواد پایه
۸۱%	۷۳%	۳۷%	سخوز		
۸۵%	۱۳۷%	۲۹%	سبهان	سیمان، آهک و گچ	
۲۹%	۲۰%	۱۰%	سارییل		
۶۱%	۳۰%	۲۵%	نوري	مواد شیمیایی-متنوع	
۵۵%	۳۵%	۲۱%	کفرا	سایر محصولات کانی غیرفلزی	
۴۹%	۲۶%	۱۴%	کگاز	ظروف شیشه‌ای	
۶۶%	۴۱%	۲۶%	غگل	سایر محصولات غذایی	مصرفی غیردوره‌ای
۳۷%	۳۱%	۱۸%	غسالم	شیرینیجات	
۵۱%	۵۳۰%	۱۲%	قپیرا	شکر	
۱۹%	۱۵%	۱۰%	زفکا	محصولات کشاورزی	
۵۳%	۳۸%	۱۹%	دبالک	دارویی	بهداشت
۶۸%	۳۷%	۱۳%	دتولید		

بیشترین رشد در فروش های ماهانه

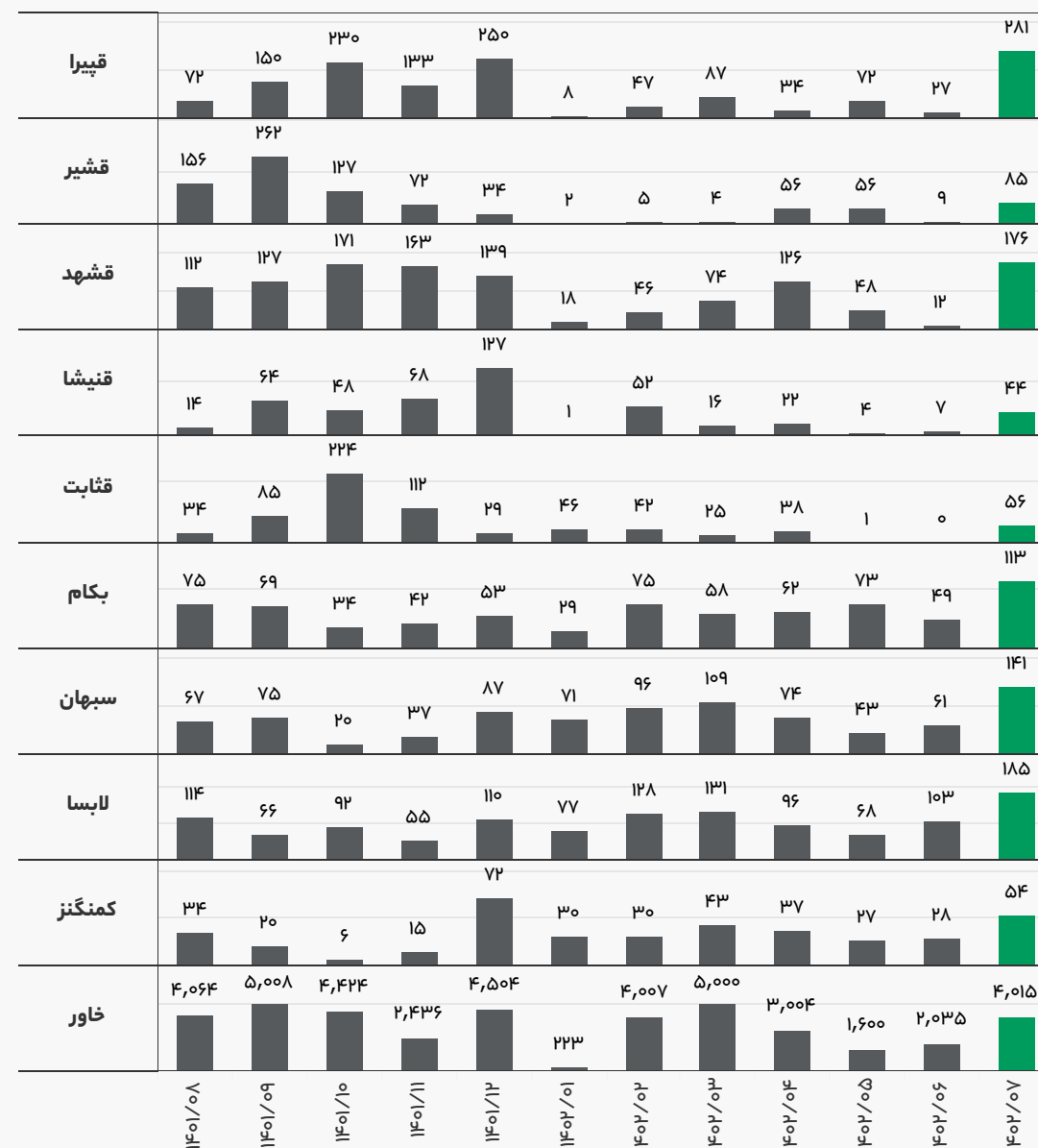
۲۰ نماد با بیشترین رشد نسبت به میانگین فروش ۶ ماهه، به تفکیک سکتور و صنعت

سکتور	صنعت	نماد	میانگین ۳ ماهه	میانگین ۶ ماهه
مصرفی غیردوره ای	شکر	قپیرا	۵۳۰%	۵۱۱%
		قشیر	۱۰۸%	۲۸۱%
		قشهد	۱۸۵%	۲۲۷%
		قنیشا	۳۰۰%	۱۵۵%
		قثابت	۳۳۴%	۱۲۲%
		قهکمت	۶۳%	۹۹%
مواد پایه	سیمان، اهک و گچ	سبهان	۱۳۷%	۸۵%
		سخوز	۷۳%	۸۱%
		سهرمز	۶۹%	۶۱%
	تولید کود و ترکیبات نیتروژن	کرماشا	۶۷%	۷۰%
		کمنگنز	۷۵%	۶۵%
		شیران	۶۲%	۴۵%
مصرفی دوره ای	قطعات خودرو	فوکا	۶۷%	۳۲%
		خفناور	۷۵%	۶۲%
	خچرخش	خاور	۸۱%	۵۲%
		پکویر	۶۲%	۲۸%
	تجهیزات صنعتی	بکام	۸۴%	۹۵%
		لابسا	۱۰۸%	۸۴%
بهداشت	دارویی	درازک	۶۱%	۳۷%

برترین گزارش های ماهانه

بیشترین رشد در فروش های ماهانه

روند فروش ماهانه برای ۱۰ نماد با بیشترین رشد نسبت به میانگین ۶ ماهه، میلیارد تومان



* در فیلتر فوق تمامی گزارش های ماهانه لحاظ نشده و حدود ۹۵% نمادها، مورد بررسی قرار گرفته است.

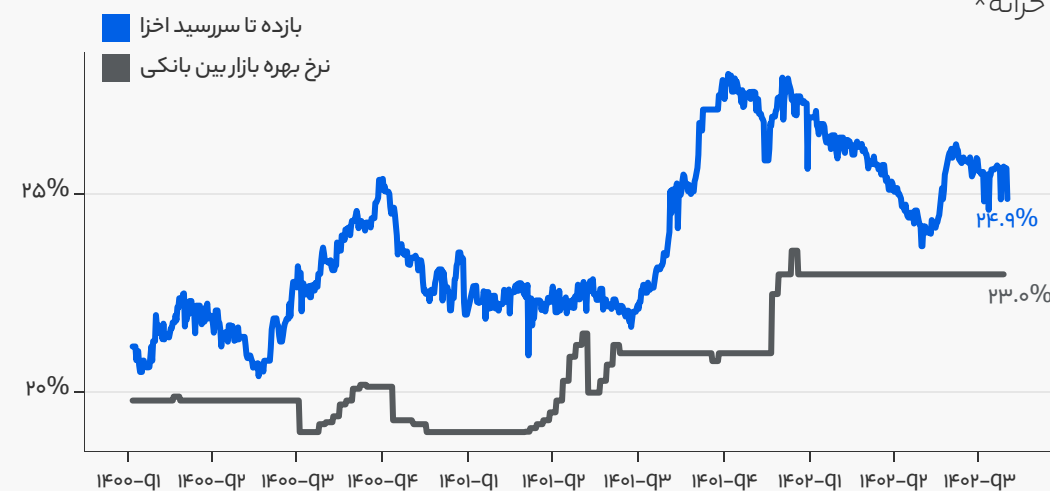


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

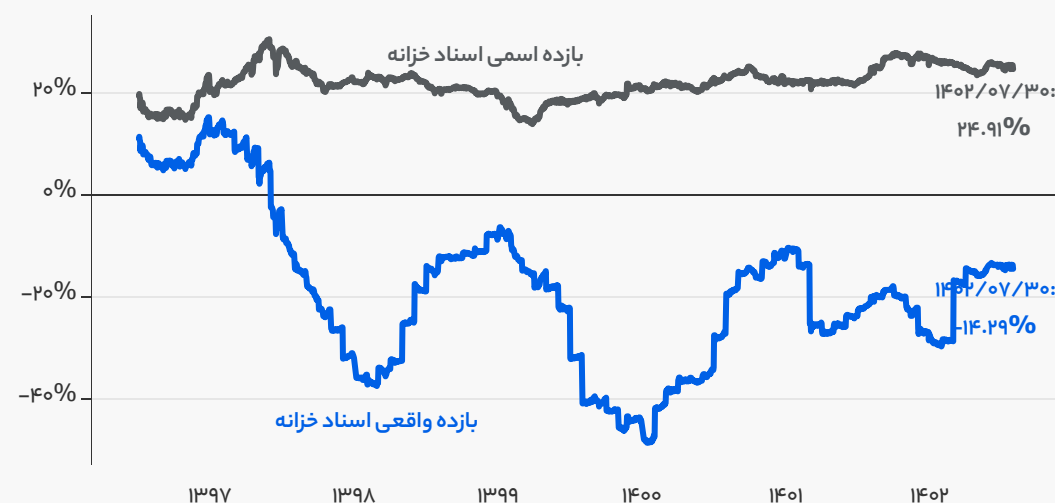
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

از ابتدای سال ۱۴۰۰، حداقل نرخ بهره توافق بازخريد در مقابل میانگین روزانه بازده تا سررسيد اسناد خزانه*



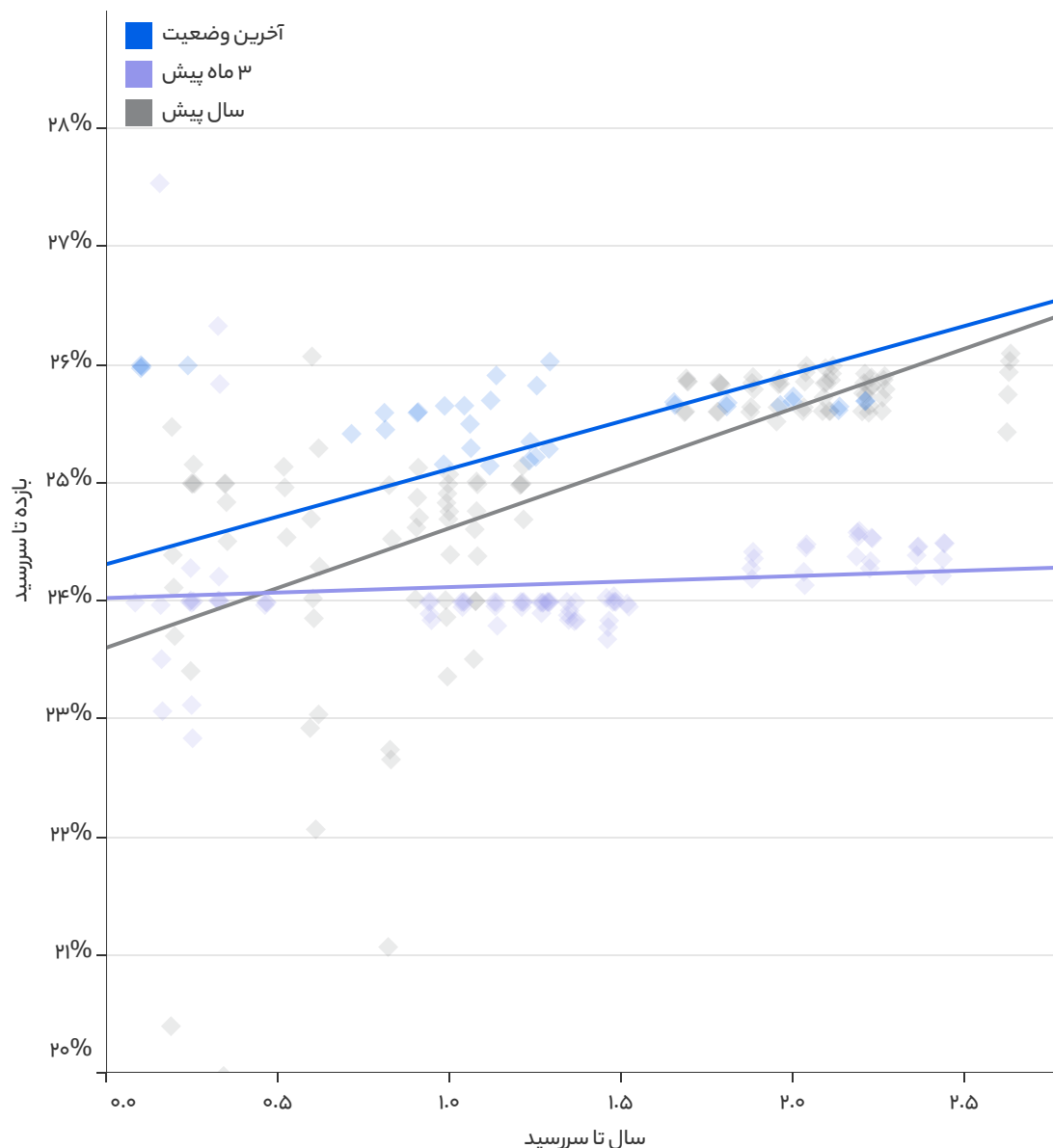
بازده اسمی و واقعی اسناد خزانه**

از سال ۱۳۹۵، میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسيد اسناد خزانه



منحنی بازده تا سررسيد اسناد خزانه

منحنی به همراه بازده تا سررسيد اسناد خزانه***، برای آخرین روز، ۳ ماه پيش و سال پيش



* میانگین روزانه بازده تا سررسيد اسناد خزانه در سررسيدهای مختلف که پيش از ۳۰ روز تا سررسيد خود فاصله دارند.

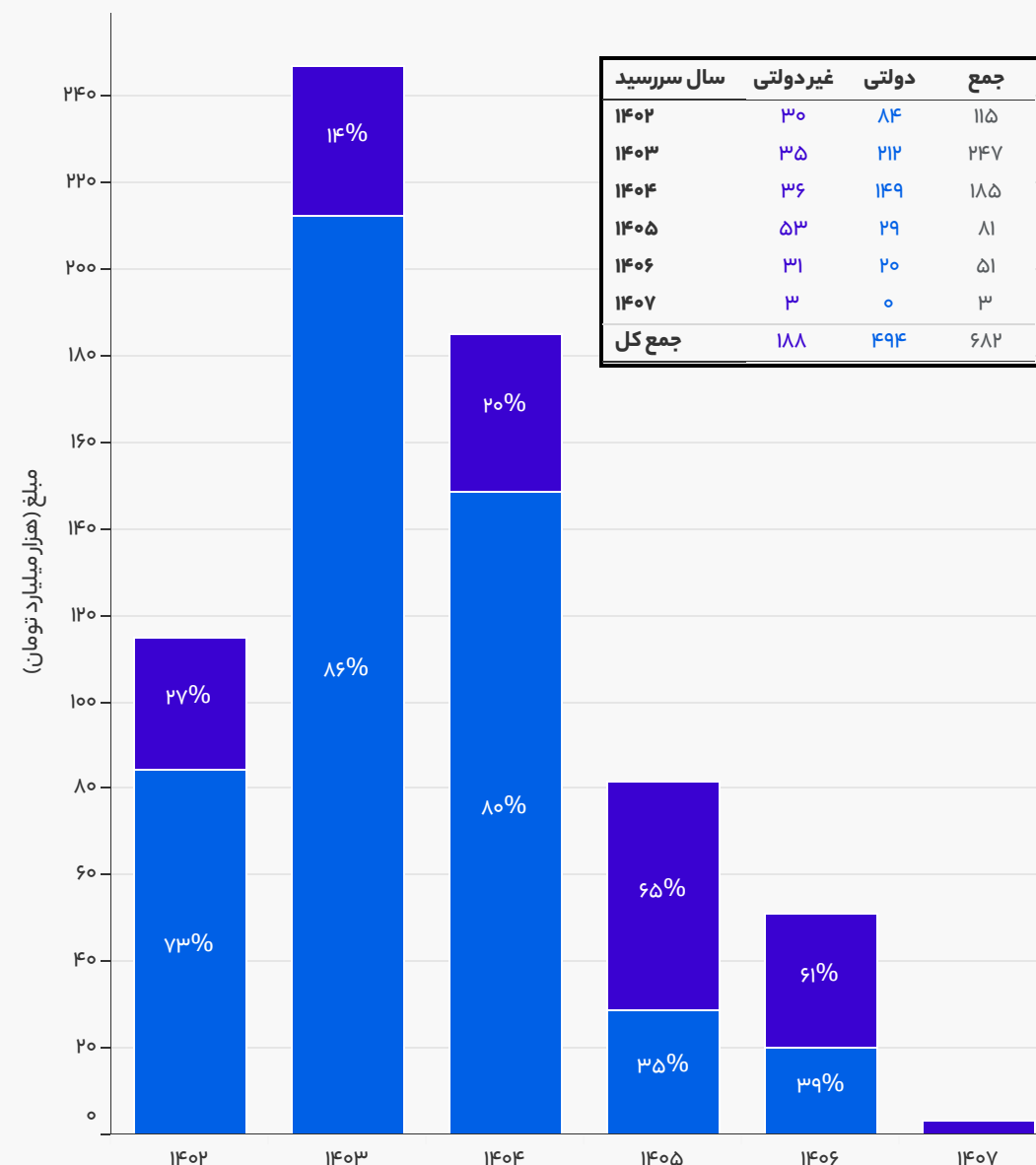
** بازده واقعی اسناد خزانه با نرخ تورم نقطه به نقطه سالانه محاسبه شده است.

*** برای رسم منحنی نیز اسناد خزانه با تاریخ سررسيد کمتر از ۳۰ روز حذف گردیده اند.

دید کلی بازار بدهی

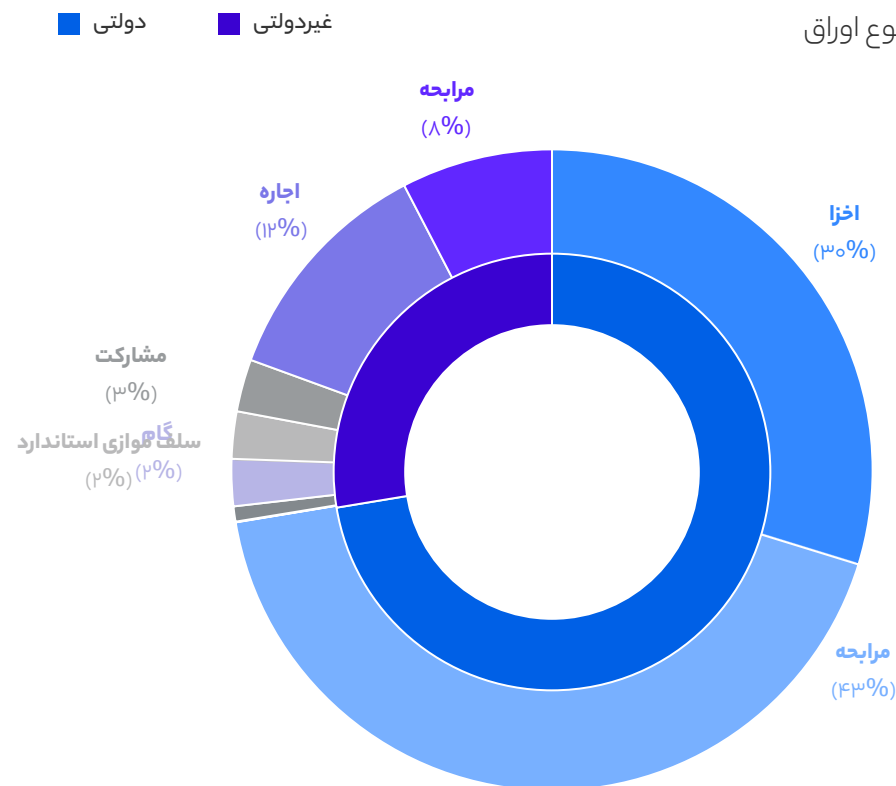
مانده اوراق به تفکیک سررسید

به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



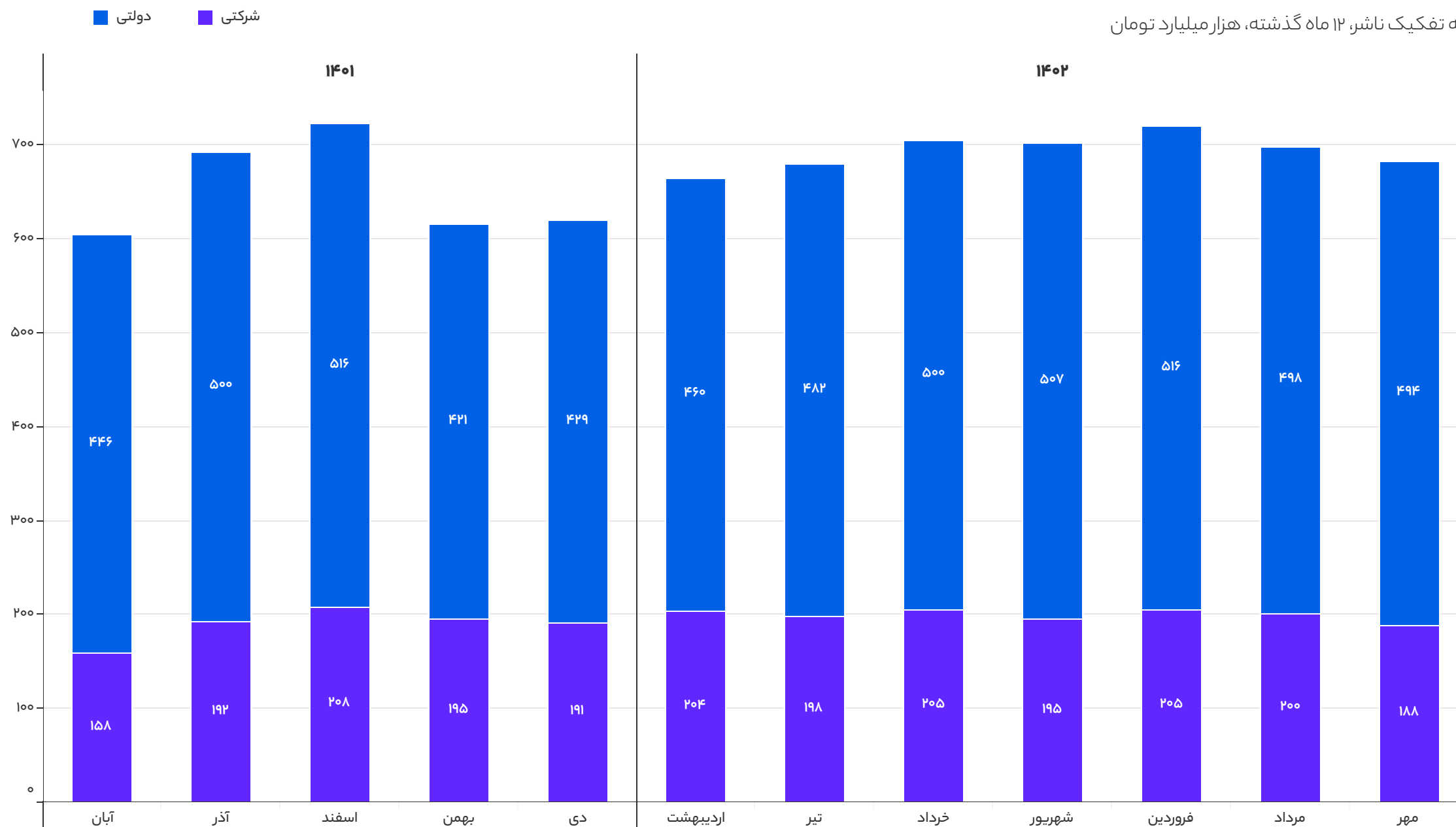
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مربحه	۲۹۱	۴۳%
	اخزا	۲۰۳	۳۰%
غیردولتی	مربحه	۵۲	۸%
	اجاره	۸۰	۱۲%
	مشارکت	۱۸	۳%
	سلف موازی استاندارد	۱۶	۲%
	گام	۱۶	۲%
	منفعت	۵	۱%
جمع کل		۶۸۲	۱۰۰%

* با توجه به حجم پایین اوراق درآمد ثابت منتشر شده توسط شهرداری، ناشران در این گزارش به دو دسته دولتی و غیردولتی تقسیم شده اند.

دید کلی بازار بدهی

مانده اوراق به صورت تاریخی

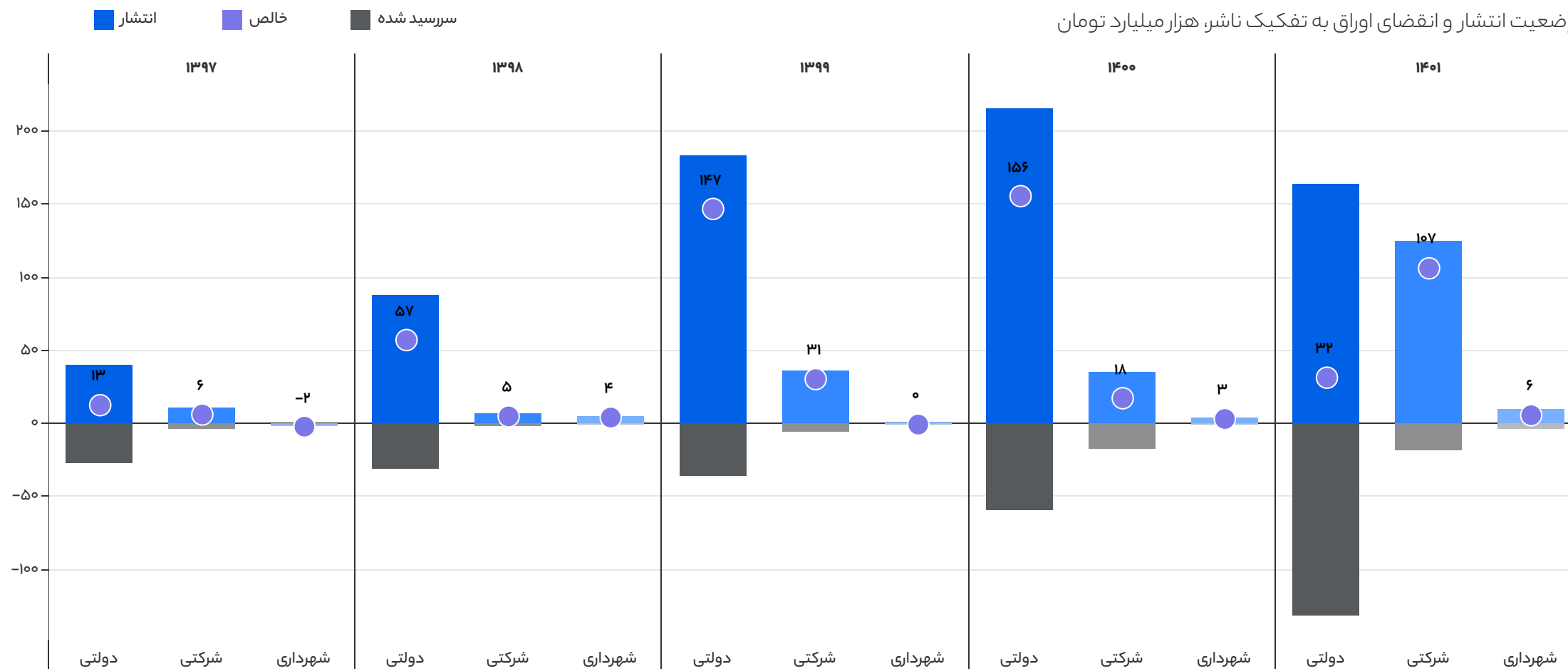
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

خالص انتشار اوراق سال‌های گذشته

وضعیت انتشار و انقضای اوراق به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان

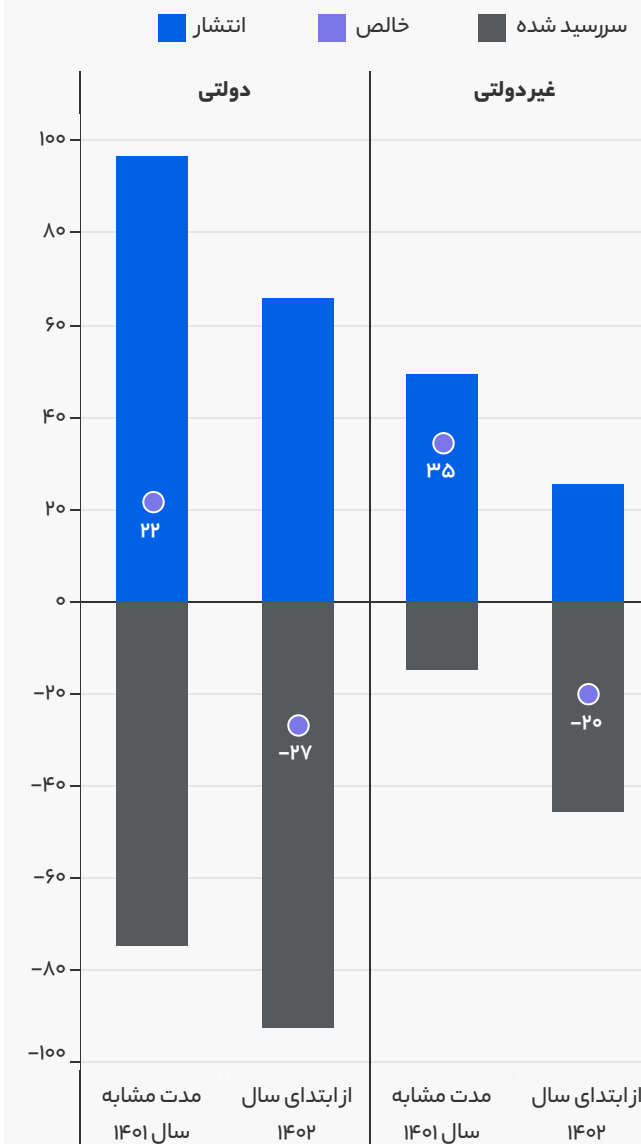


	۱۳۹۷			۱۳۹۸			۱۳۹۹			۱۴۰۰			۱۴۰۱		
	دولتی	شرکتی	شهرداری	دولتی	شرکتی	شهرداری	دولتی	شرکتی	شهرداری	دولتی	شرکتی	شهرداری	دولتی	شرکتی	شهرداری
انتشار اوراق	۴۰	۱۱	۰	۸۸	۷	۵	۱۸۳	۳۶	۱	۲۱۶	۳۵	۴	۱۶۴	۱۲۵	۱۰
سررسید شده	-۲۷	-۴	-۲	-۳۱	-۲	-۱	-۳۶	-۶	-۱	-۶۰	-۱۷	-۱	-۱۳۲	-۱۸	-۴
خالص انتشار/سررسید	۱۳	۶	-۲	۵۷	۵	۴	۱۴۷	۳۱	۰	۱۵۶	۱۸	۳	۳۲	۱۰۷	۶

انتشار و تسویه اوراق

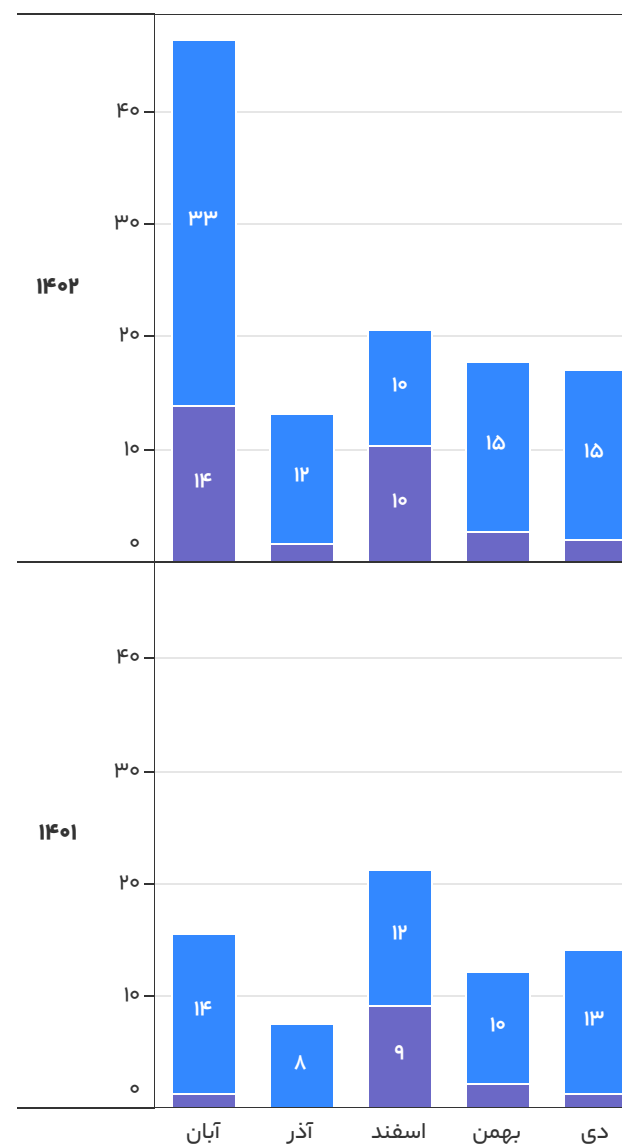
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

وضعیت انتشار و انقضای اوراق سال جاری نسبت به مدت مشابه سال گذشته، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



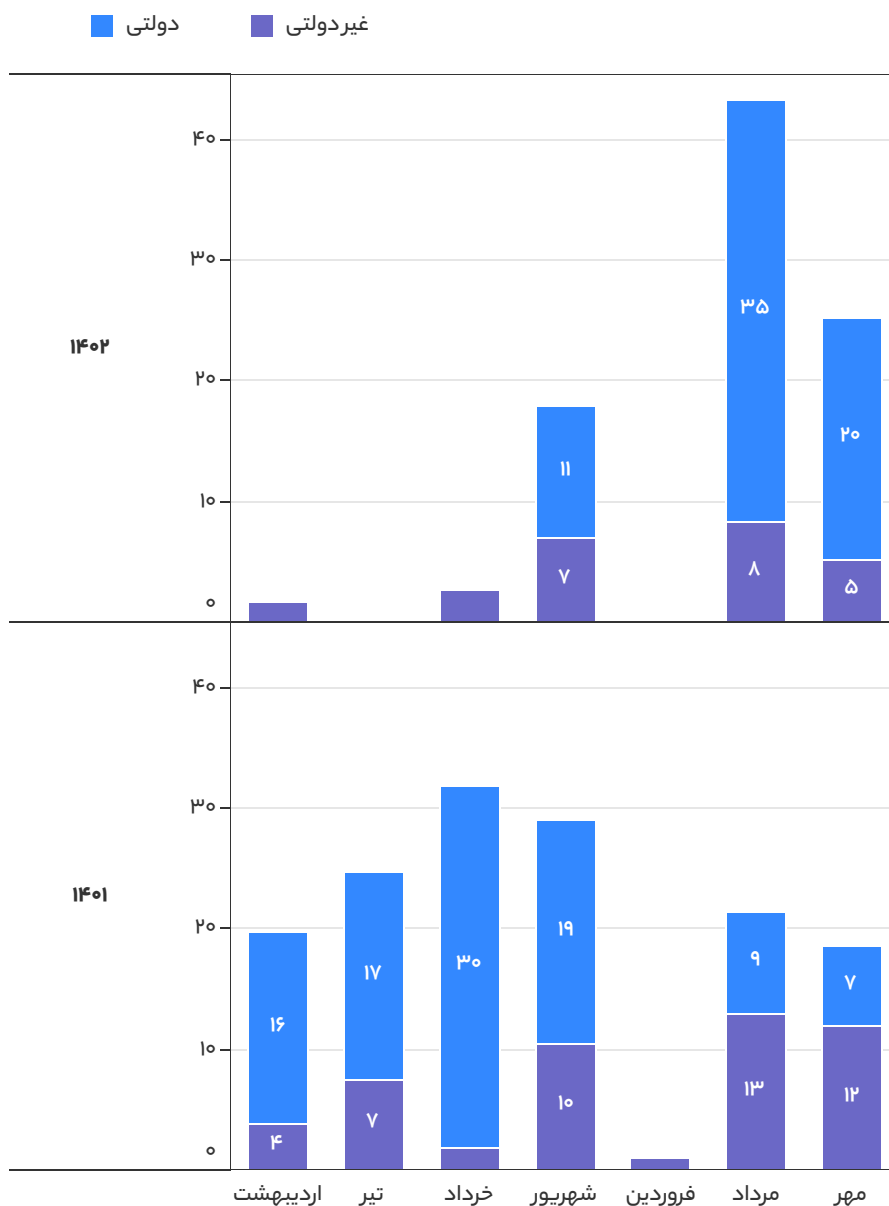
اوراق با سررسید در سال جاری

حجم اوراقی که در سال جاری سررسید خواهند شد، ماهانه، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



انتشار اوراق طی سال جاری

ماهانه، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



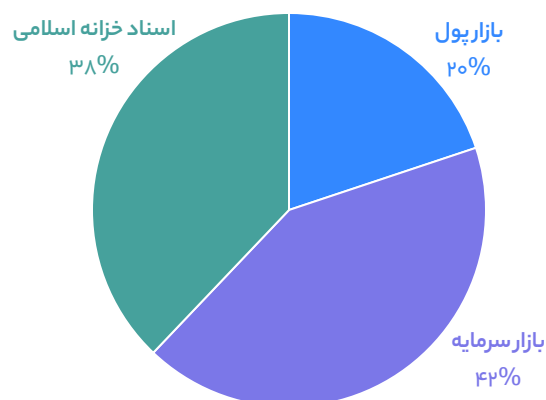
تامین مالی دولت

وضعیت تامین مالی دولت

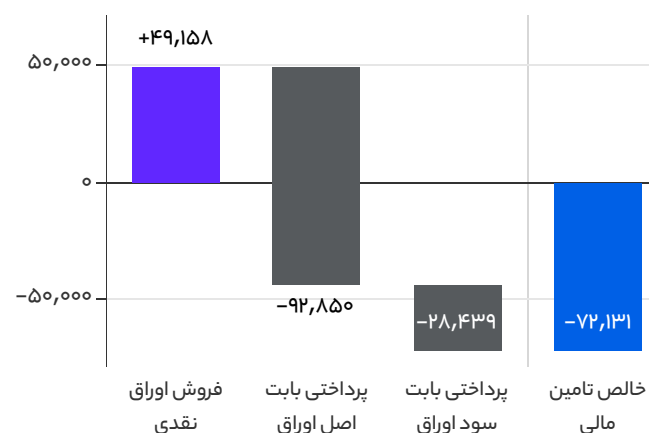
از ابتدای سال، نقدینگی جذب شده توسط دولت از طریق عرضه و تسویه اوراق، میلیارد تومان

تامین مالی دولت از ابتدای سال

مجموع از ابتدای سال، به تفکیک نوع فروش و بازار، میلیارد تومان

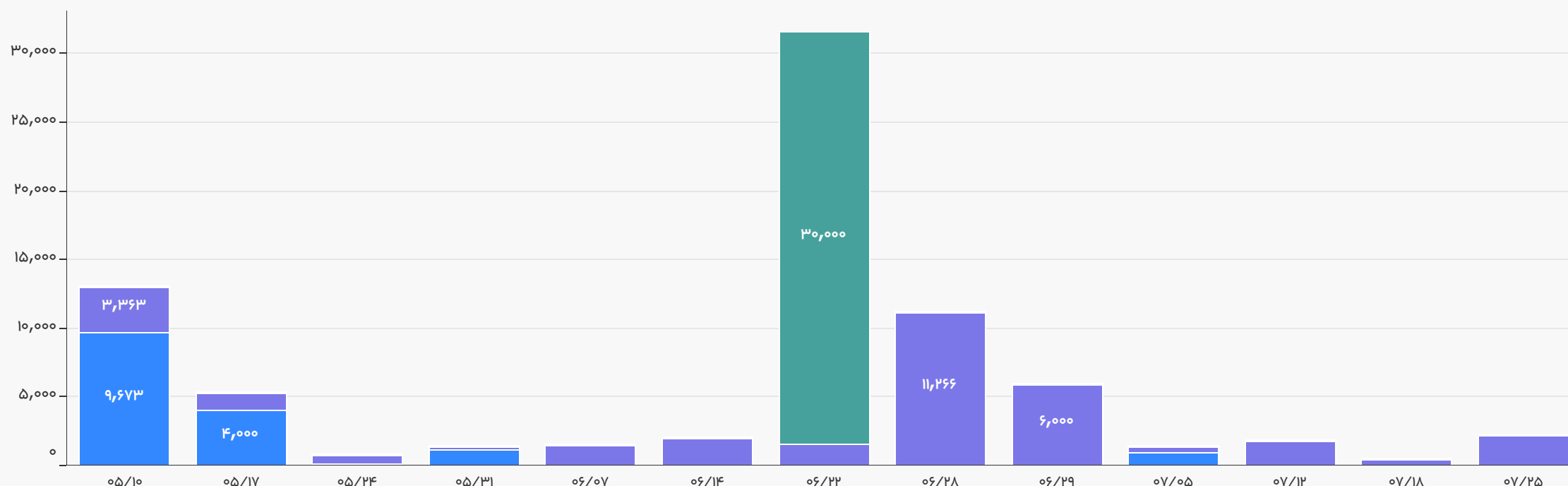


نوع فروش	بازار	حجم
نقدی	بازار پول	۱۵,۷۳۶
نقدی	بازار سرمایه	۳۳,۴۲۲
غیر نقدی	بازار سرمایه	۳۰,۰۰۰



فروش اوراق نقدی	۴۹,۱۵۸
پرداختی بابت اصل اوراق	-۹۲,۸۵۰
پرداختی بابت سود اوراق	-۲۸,۴۳۹
خالص تامین مالی	-۷۲,۱۳۱

بازار پول بازار سرمایه اسناد خزانه اسلامی



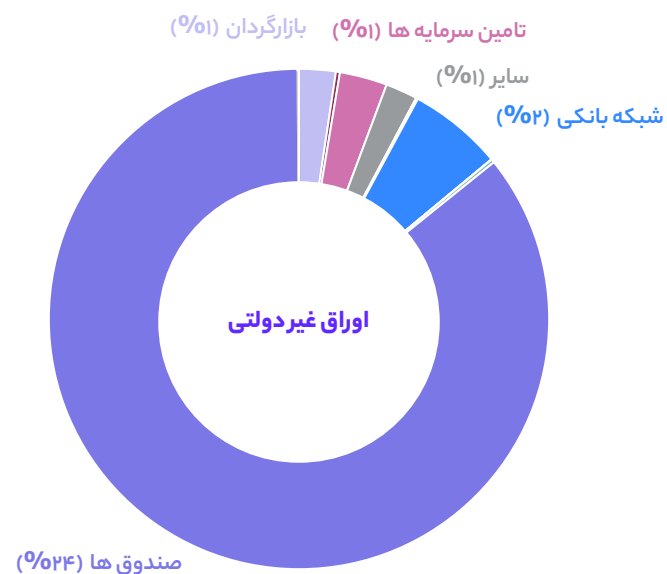
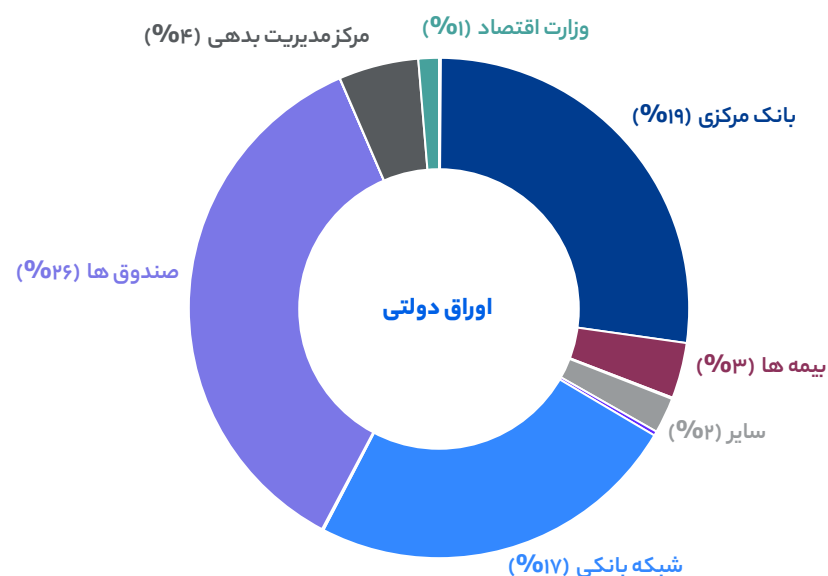
عرضه اوراق دولتی در سال جاری

از ابتدای سال، به تفکیک عرضه، میلیارد تومان

بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

به تفکیک ناشر و دارنده اوراق، هزار میلیارد تومان



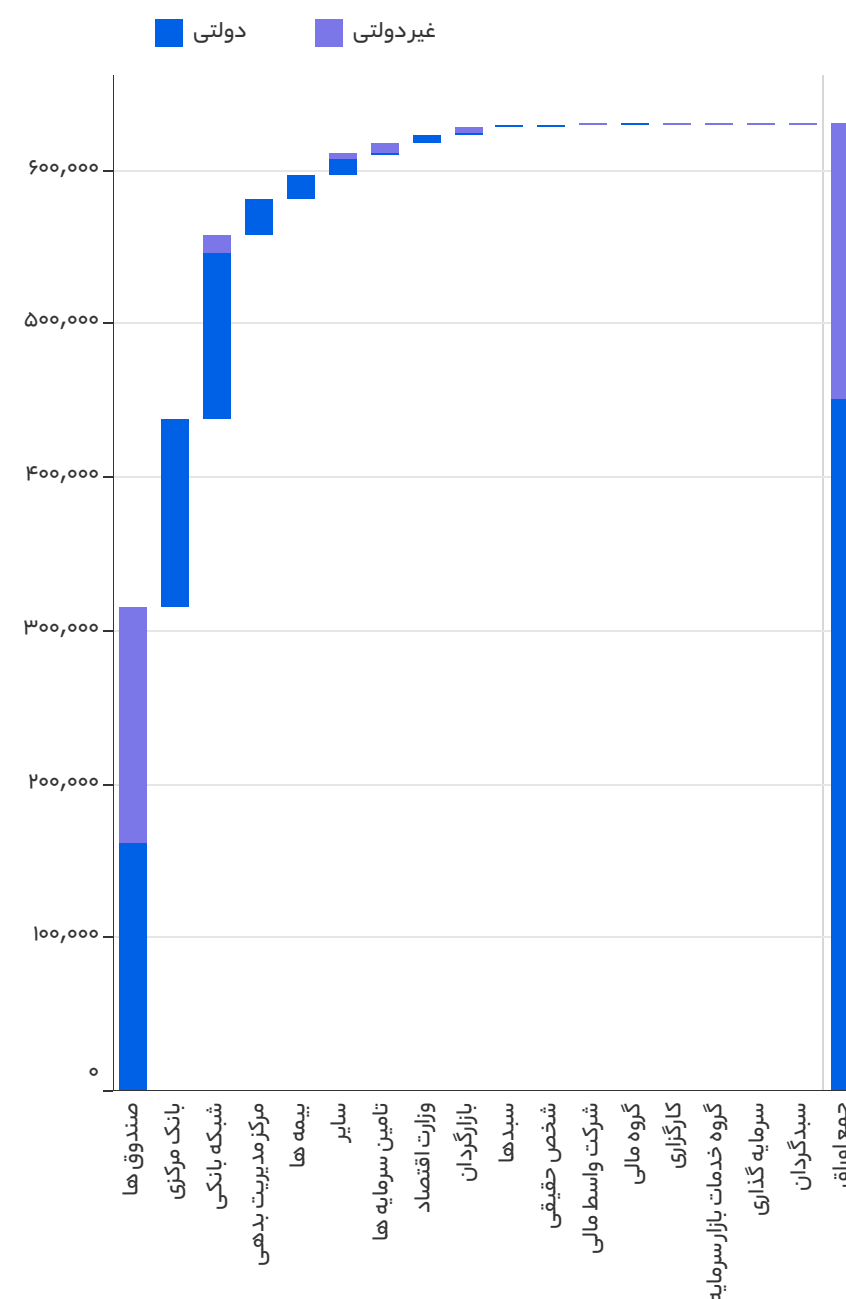
	۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	جمع کل
دولتی	صندوق ها	۳۵.۳	۶۷.۱	۴۱.۰	۶.۰	۱۱.۸	۱۶۱.۲
	بانک مرکزی	۱۴.۳	۵۴.۸	۴۲.۶	۷.۹	۲.۸	۱۲۲.۳
	شبکه بانکی	۲۴.۴	۴۴.۷	۲۸.۰	۶.۷	۴.۹	۱۰۸.۸
	مرکز مدیریت بدهی	۸.۵	۷.۷	۷.۱	-	-	۲۳.۳
	بیمه ها	۱.۳	۹.۶	۳.۶	۱.۵	۰.۲	۱۶.۲
	سایر	۰.۳	۲.۸	۷.۱	-	۰.۱	۱۰.۴
	وزارت اقتصاد	-	-	-	۵.۹	-	۵.۹
	سبدها	-	۰.۹	۰.۳	-	-	۱.۲
	بازارگردان	۰.۱	۰.۴	-	-	-	۰.۵
	شخص حقیقی	-	۰.۴	۰.۱	-	-	۰.۵
	تامین سرمایه ها	-	۰.۴	-	-	-	۰.۴
	گروه مالی	-	-	-	-	-	-
غیردولتی	صندوق ها	۲۲.۸	۳۲.۶	۳۱.۳	۴۳.۵	۲۳.۳	۱۵۴.۳
	شبکه بانکی	-	۰.۶	۱.۰	۶.۷	۲.۷	۱۱.۰
	تامین سرمایه ها	-	۰.۵	۲.۵	۱.۱	۱.۵	۵.۵
	بازارگردان	۰.۹	۰.۶	۱.۳	۱.۰	۰.۵	۴.۲
	سایر	۰.۹	۰.۱	-	۰.۲	۱.۵	۳.۷
	بیمه ها	۰.۳	-	-	۰.۲	-	۰.۵
	شرکت واسطه مالی	-	-	-	-	۰.۴	۰.۴
	سبدها	۰.۱	-	-	-	-	۰.۲
	گروه مالی	-	-	-	۰.۱	-	۰.۱
	کارگزاری	-	-	-	-	-	۰.۱
	شخص حقیقی	-	-	-	-	-	-
	گروه خدمات بازارسز.	-	-	-	-	-	-
	سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-
	سبدها	-	-	-	-	-	-

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

به تفکیک ناشر اوراق، هزار میلیارد تومان

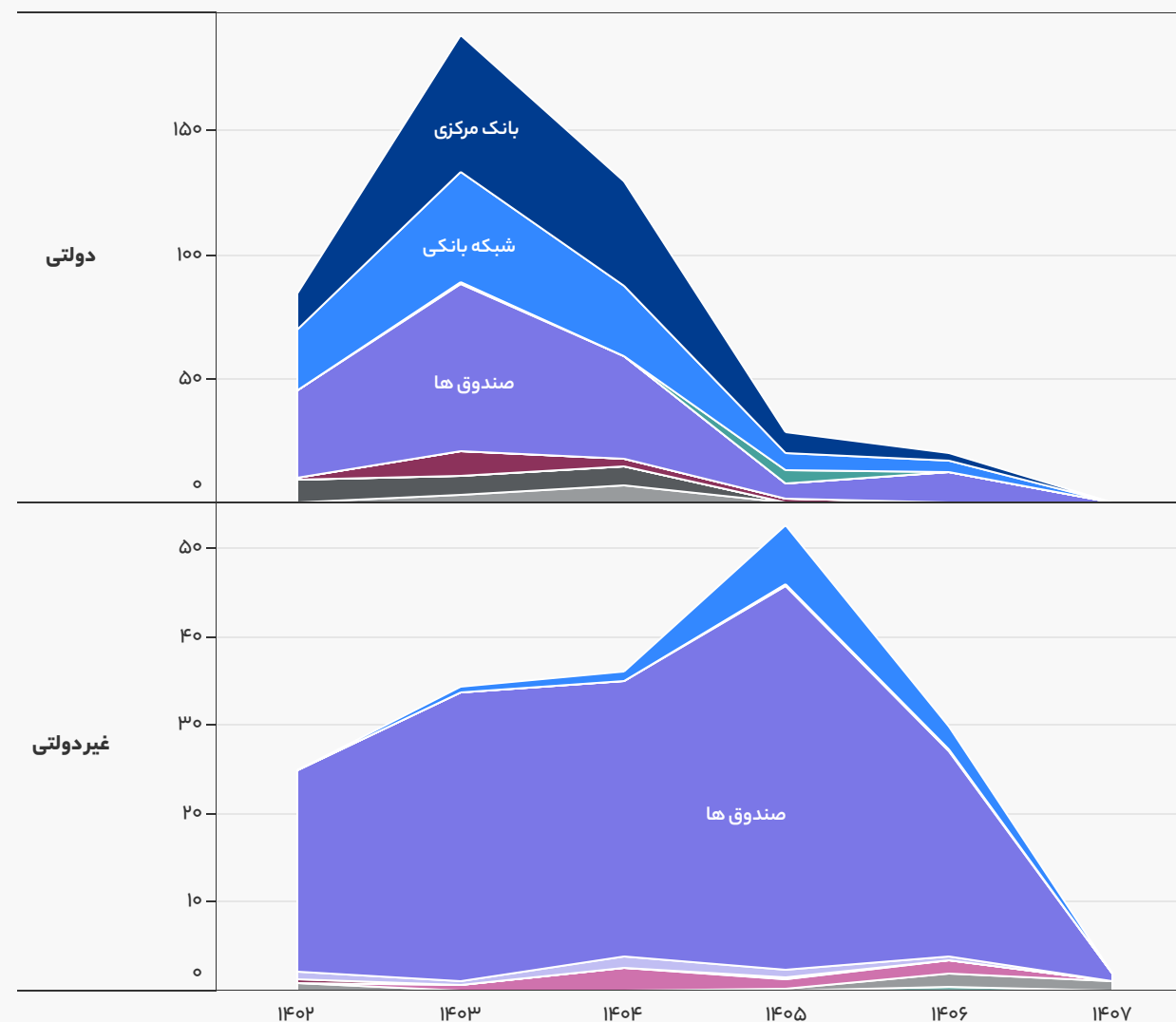
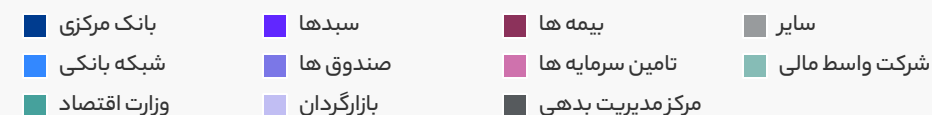
جمع	گام	منفعت	مشارکت	مراجعه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره	
۲۹۹,۹۲۸	۹,۱۰۳	۵,۰۹۵	۱۵,۵۷۶	۱۵۴,۲۲۷	۰	۱۵,۵۳۴	۴۸,۶۵۹	۱۴۵	۶۷,۱۲۲	صندوق ها
۱۲۲,۳۰۰	۰	۰	۰	۹۴,۹۹۸	۰	۰	۲۷,۳۰۲	۰	۰	بانک مرکزی
۱۱۹,۷۳۹	۳۷	۱۰۰	۴۷۰	۶۰,۴۸۵	۰	۰	۵۱,۸۶۴	۰	۶,۷۸۳	شبکه بانکی
۲۳,۲۸۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۲۳,۲۸۸	۰	۰	مرکز مدیریت بدهی
۱۶,۶۴۶	۲۸۲	۰	۰	۹,۶۵۴	۴۰	۰	۶,۵۲۰	۰	۱۵۰	بیمه ها
۱۴,۰۹۷	۹۲۴	۰	۲۵	۲۶۵	۵۰	۰	۱۰,۱۲۹	۰	۲,۷۰۵	سایر
۵,۹۲۹	۰	۰	۱,۰۸۴	۲,۶۴۰	۲	۰	۰	۵	۲,۱۹۹	تامین سرمایه ها
۳,۹۹۱	۲۱۸	۰	۷۶۱	۲,۰۱۱	۰	۷۷۳	۰	۵	۹۹۵	بازارگردان
۱,۴۶۵	۷۸	۰	۰	۶۹۵	۰	۰	۶۶۳	۰	۳۰	سبدها
۲	۰	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۰	۰	سبذگردان
۲	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۰	۰	۰	سرمایه گذاری
۵۳۲	۰	۰	۰	۴۷۲	۰	۰	۶۰	۰	۰	شخص حقیقی
۴۰۰	۰	۰	۰	۴۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	شرکت واسط مالی
۵۳	۰	۰	۰	۴۰	۳	۰	۰	۰	۱۰	کارگزاری
۲۰	۰	۰	۰	۲۰	۰	۰	۰	۰	۰	گروه خدمات بازار سرمایه
۱۱۰	۰	۰	۰	۱۱۰	۰	۰	۰	۰	۰	گروه مالی
۵,۸۷۱	۰	۰	۰	۵,۸۷۱	۰	۰	۰	۰	۰	وزارت اقتصاد
۶۱۴,۳۷۲	۱۰,۶۴۱	۵,۱۹۵	۱۷,۹۱۷	۳۳۱,۸۹۰	۹۷	۱۶,۳۰۷	۱۶۸,۴۸۵	۱۵۵	۷۹,۹۹۳	جمع



بازیگران کلیدی بازار بدهی

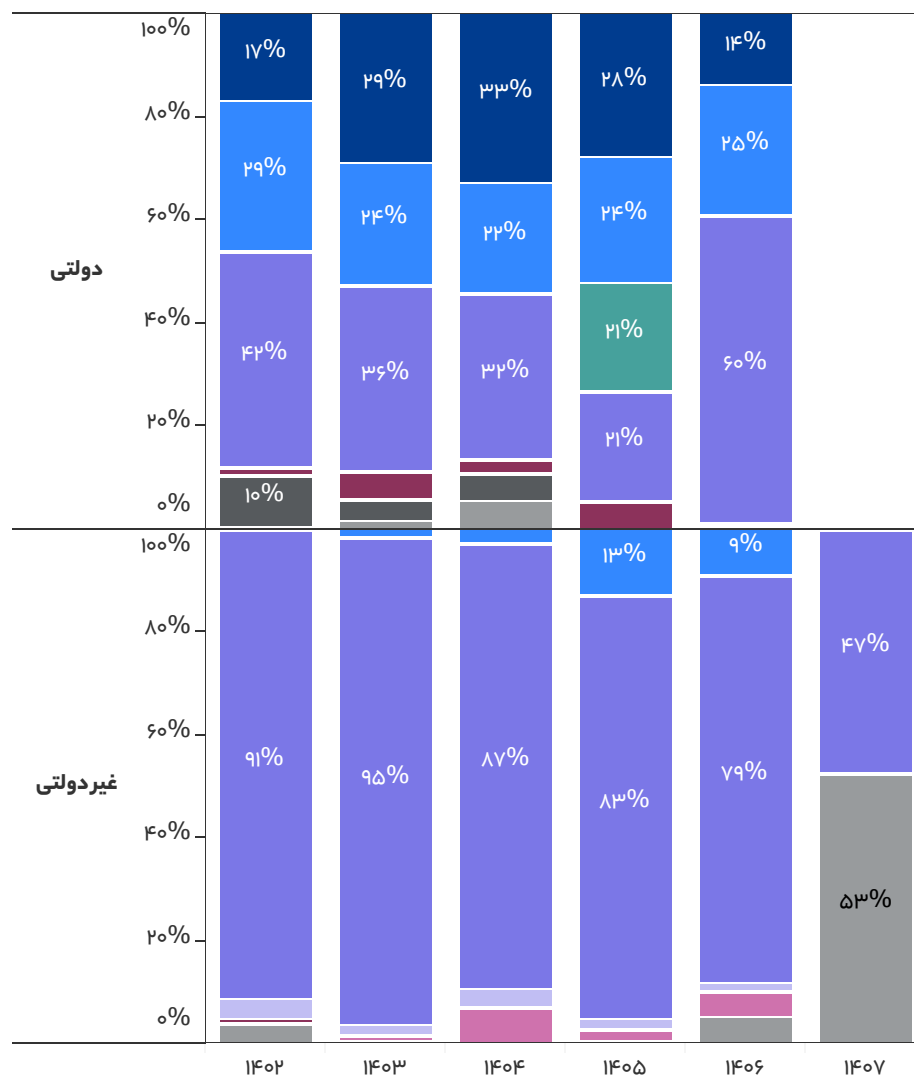
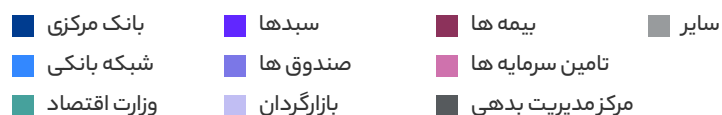
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

آخرین وضعیت مبلغ سرمایه‌گذاری دارندگان اوراق، هزار میلیارد تومان



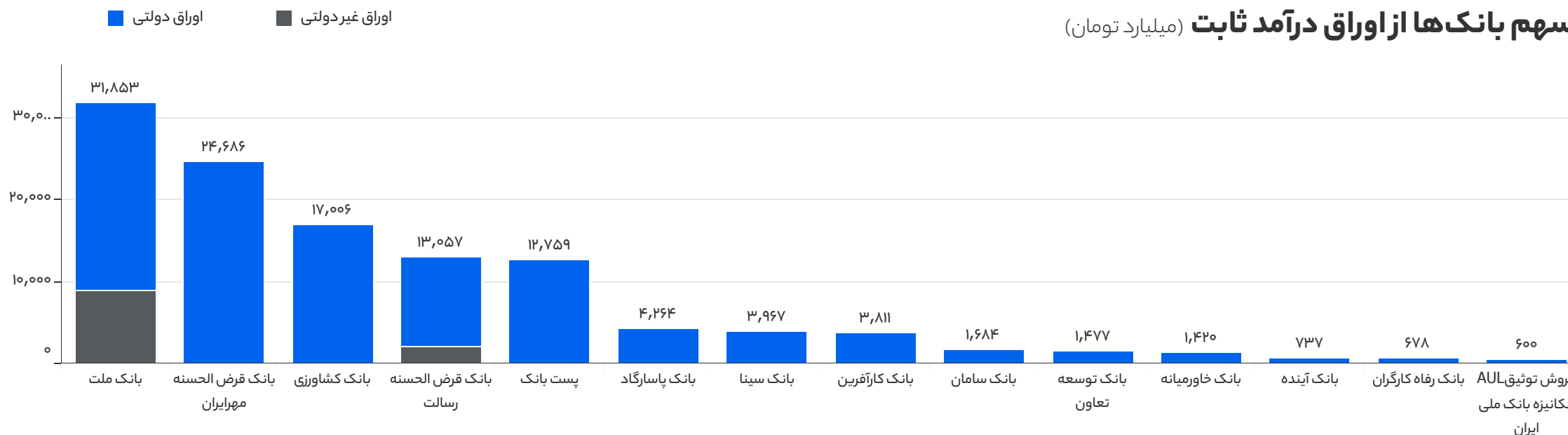
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

درصد از کل اوراق در هر سال، به تفکیک دارندگان اوراق (دارندگان درصدی)

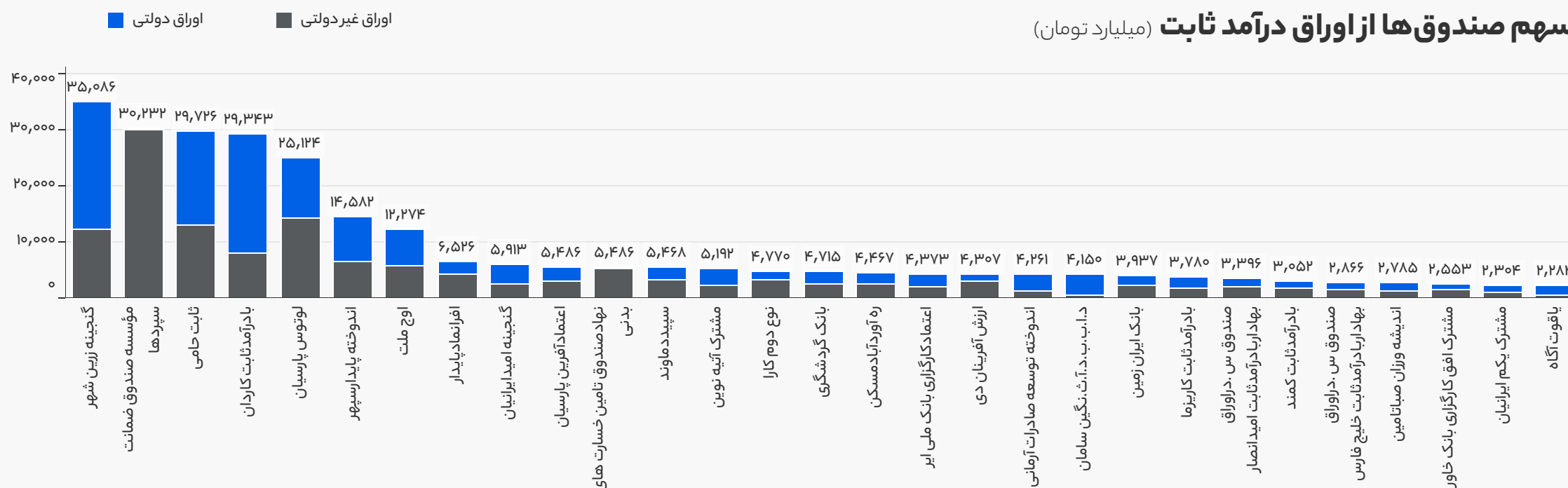


بازیگران کلیدی بازار بدهی

سهم بانک‌ها از اوراق درآمد ثابت (میلیارد تومان)



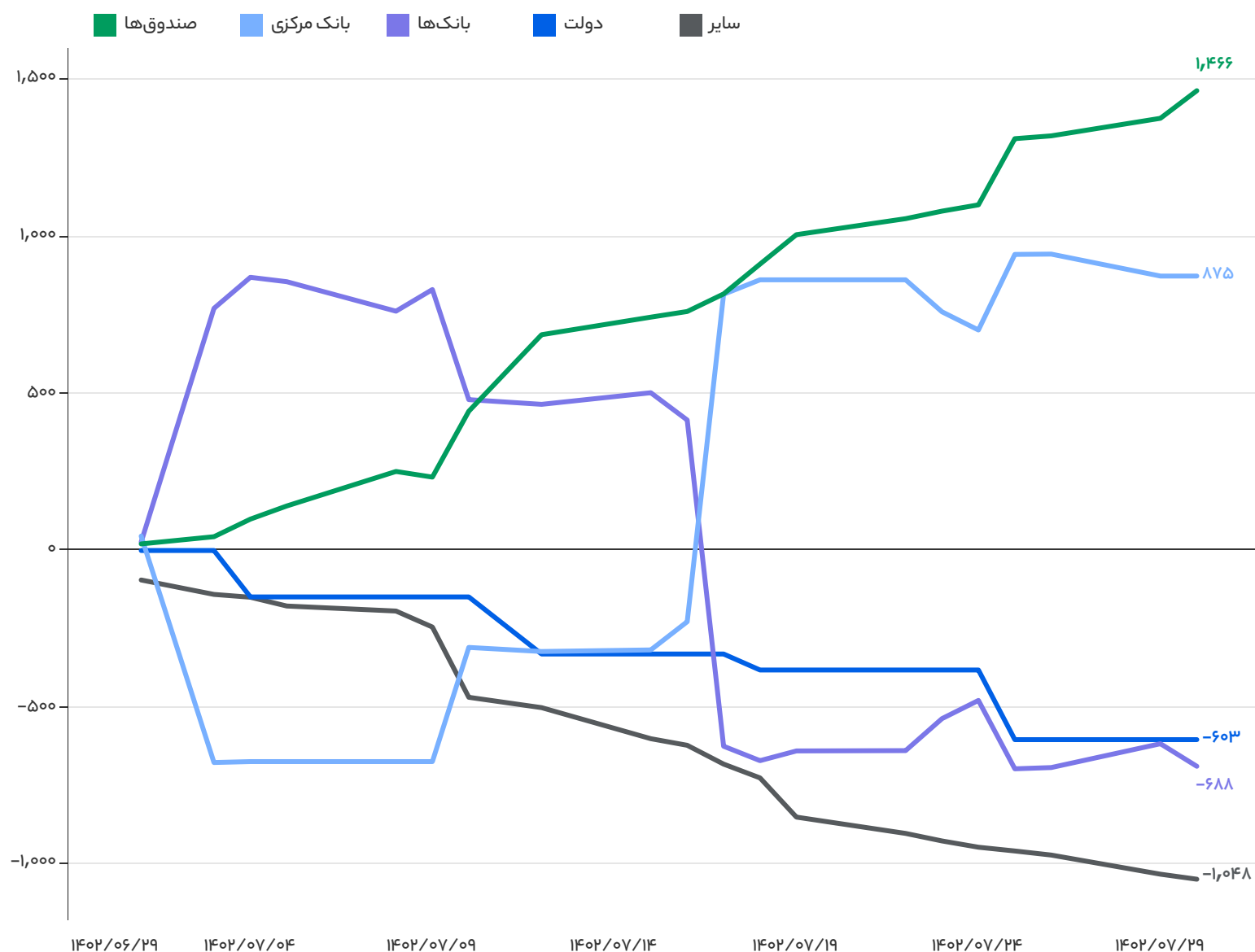
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

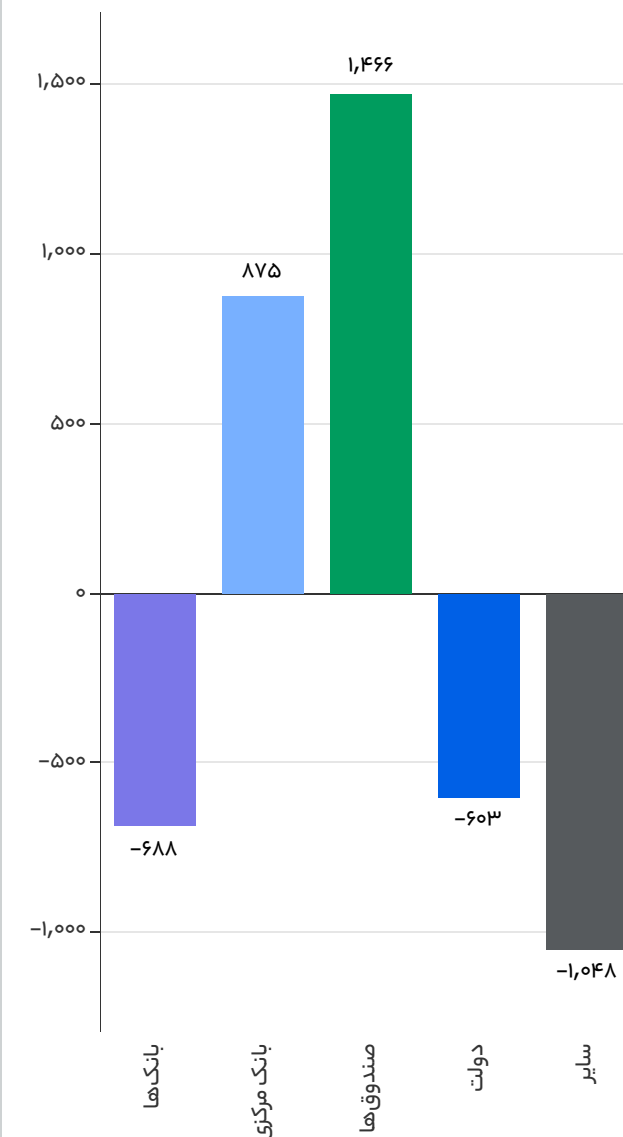
خالص معاملات اوراق

روزانه، خالص خرید و فروش، میلیارد تومان، به صورت تجمع از ۲ سال پیش، به تفکیک نهادها



خلاصه معاملات اوراق

خالص خرید و فروش، میلیارد تومان، طی ۲ سال گذشته، به تفکیک نهادها



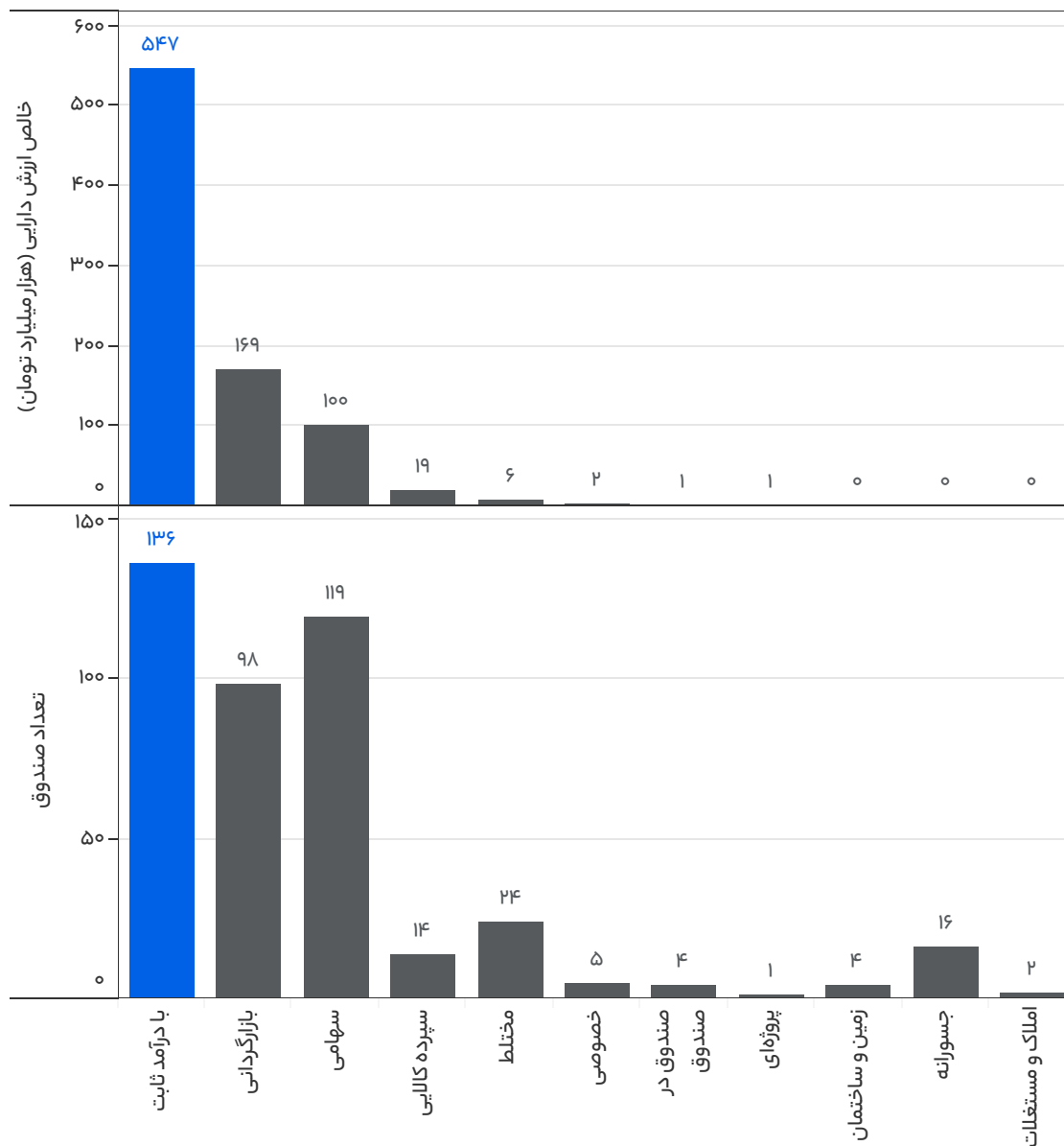
نمای کلی صندوق های سرمایه گذاری

نمای کلی

تعداد و خالص ارزش دارایی های صندوق ها، به تفکیک نوع صندوق

ارزش و تعداد صندوق های سرمایه گذاری

به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



کلاس سرمایه گذاری	نوع صندوق	تعداد صندوق	خالص ارزش دارایی ها (همت)
سرمایه گذاری سنتی	با درآمد ثابت	۱۳۶.۰	۵۴۷
	سهامی	۱۱۹.۰	۱۰۰
	مختلط	۲۴.۰	۶
	صندوق در صندوق	۴.۰	۱
سرمایه گذاری خصوصی	خصوصی	۵.۰	۲
	جسورانه	۱۶.۰	۰
سرمایه گذاری جایگزین	بازارگردانی	۹۸.۰	۱۶۹
	سپرده کالایی	۱۴.۰	۱۹
	پروژه ای	۱.۰	۱
	املاک و مستغلات	۲.۰	۰
	زمین و ساختمان	۴.۰	۰
جمع کل		۴۲۳.۰	۸۴۵

نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

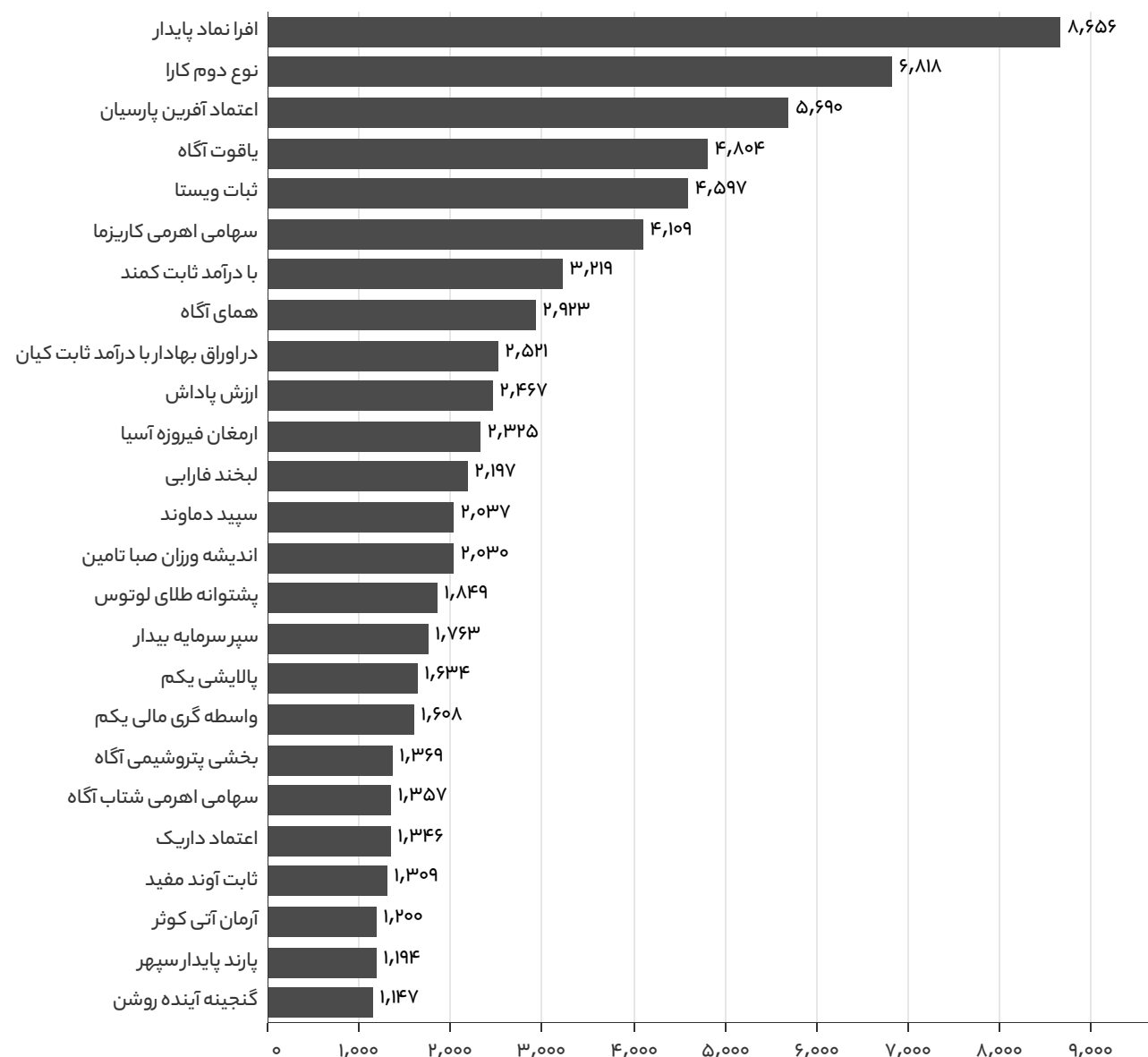
صندوق‌های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
قابل معامله	سهامی	بخشی بهین خودرو
قابل معامله	سهامی	بخشی پتروشیمی اندیشه صبا
قابل معامله	سهامی	بخشی ثروت پویا
قابل معامله	سهامی	بخشی فلز فارابی
قابل معامله	سهامی	بخشی فلزات دایا
قابل معامله	سهامی	بخشی فلزات رویین
قابل معامله	سهامی	بخشی فلزات کیمیا
صدور و ابطال	درآمد ثابت	ثبات نوید
قابل معامله	درآمد ثابت	دراوراق بهادار با درآمد ثابت اکسیژن
صدور و ابطال	سهامی	حفظ ارزش دماوند
قابل معامله	سهامی	سهامی تیام
قابل معامله	سهامی	سهامی هوش تصمیم

پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری

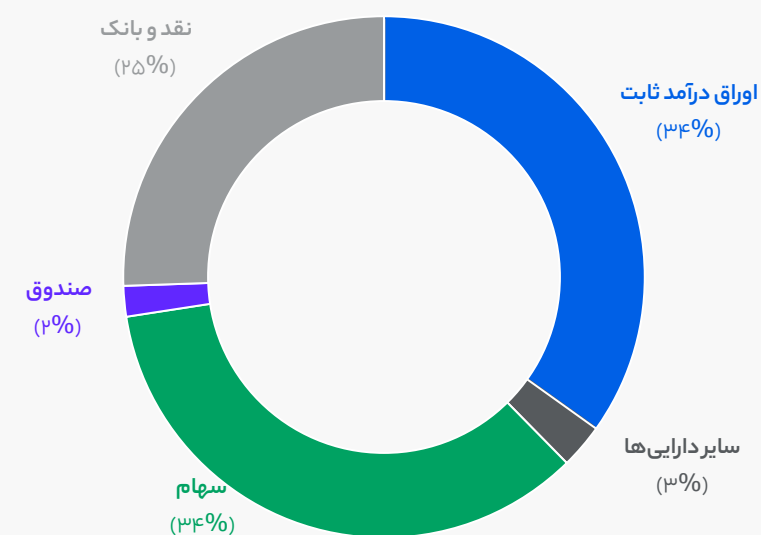
مجموع ارزش معاملات در ماه گذشته، میلیارد تومان



تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی صندوق‌ها

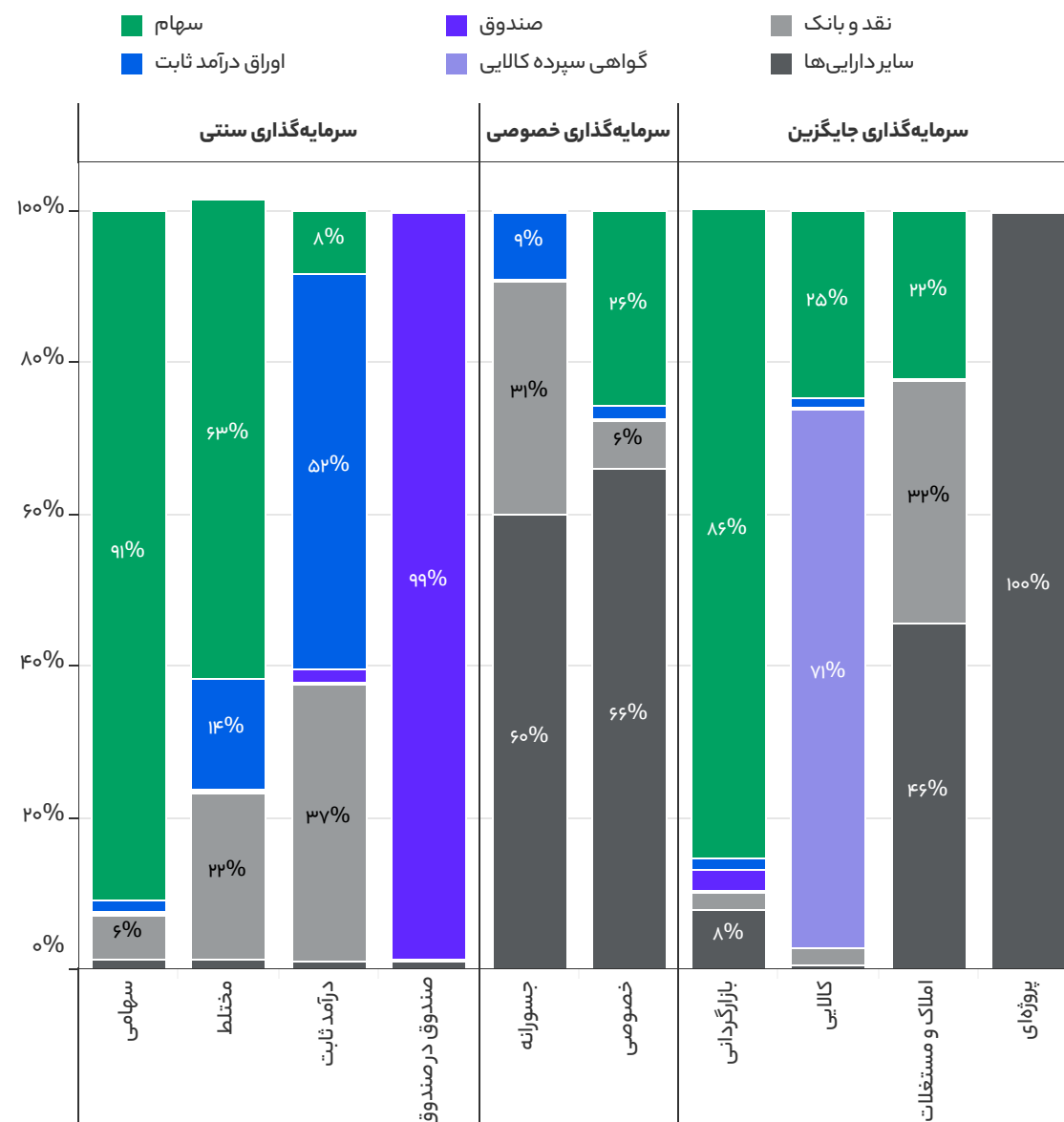
به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهم	درآمد ثابت	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	سهامی	۹۱%	۱%	-	۶%	۱%
	مختلط	۶۳%	۱۴%	-	۲۲%	۱%
	درآمد ثابت	۸%	۵۲%	۲%	۳۷%	۱%
	صندوق در صندوق	-	-	۹۹%	-	۱%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۹%	-	۳۱%	۶۰%
	خصوصی	۲۶%	۲%	-	۶%	۶۶%
سرمایه‌گذاری جایگزین	کالایی	۲۵%	۱%	-	۲%	۱%
	بازارگردانی	۸۶%	۲%	۳%	۲%	۸%
	املاک و مستغلات	۲۲%	-	-	۳۲%	۴۶%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۴%	۳۴%	۲%	۲۵%	۳%

ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق

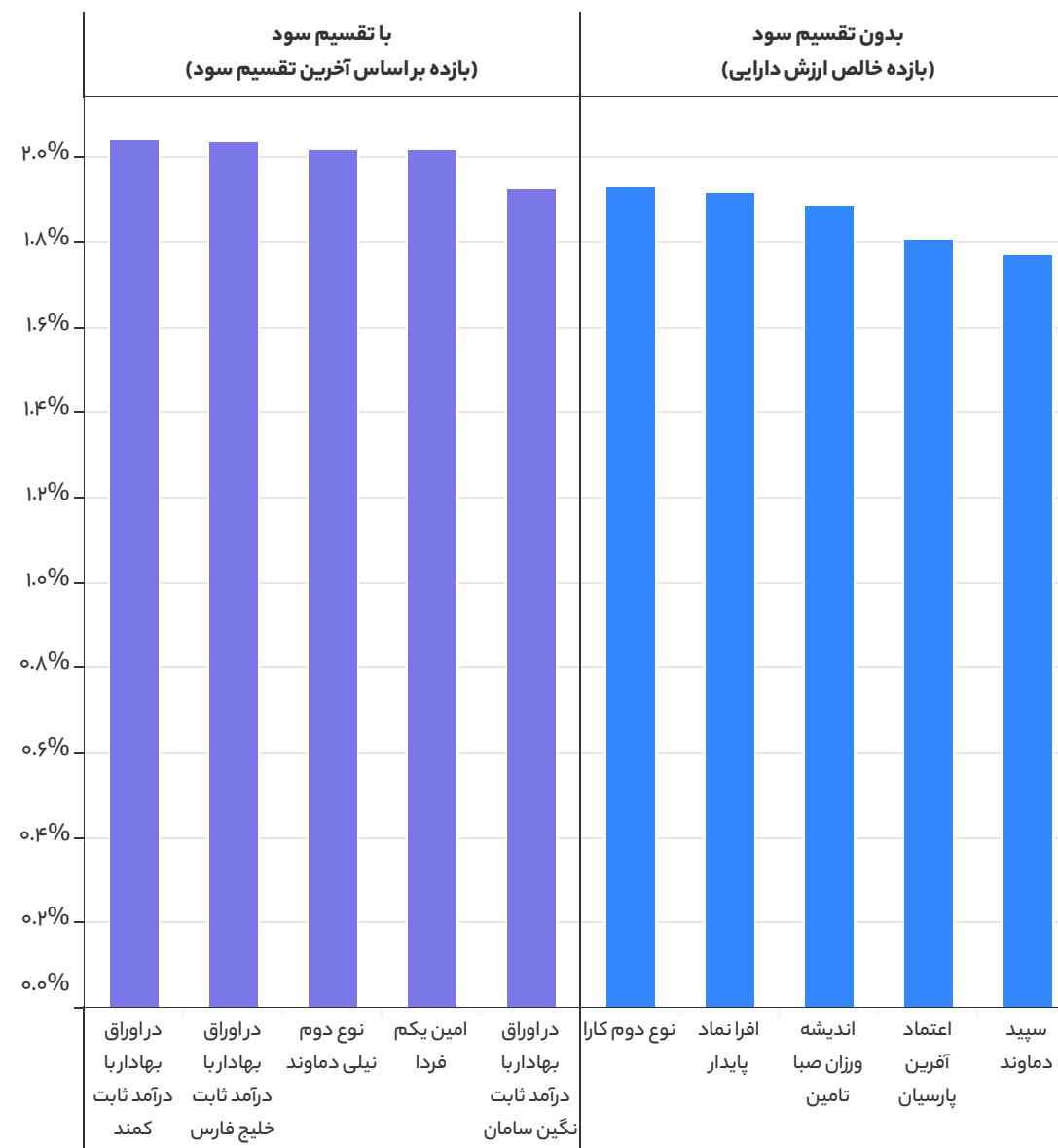


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

بازدهی ماه گذشته بزرگترین صندوق‌های درآمد ثابت

صندوق‌های قابل معامله، به تفکیک نوع از نظر تقسیم سود تقسیم سود

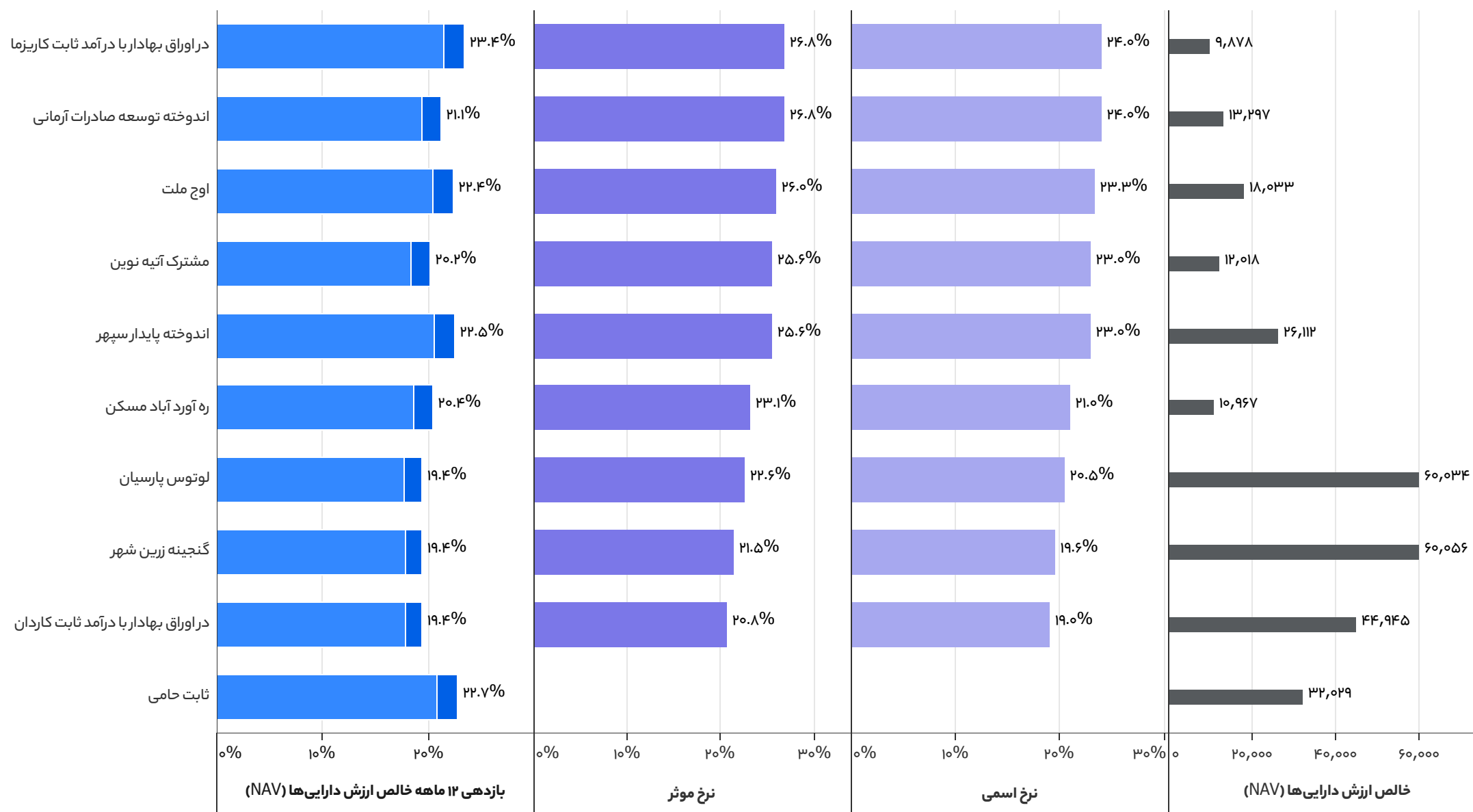
نوع صندوق	نام صندوق	خالص ارزش دارایی‌ها (میلیارد ..)	بازدهی ۱۲ ماهه NAV	بازدهی ۳ ماهه NAV	بازدهی ۶ ماهه NAV	بازدهی ۱ ماهه NAV	بازده ساده تقسیم سود	بازده موثر تقسیم سود
با تقسیم سود	دراوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	۱۰,۱۸۰	۲۳.۵%	۶.۰%	۱۱.۹%	۱.۹۷%	۲۴.۵%	۲۷.۴%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۶,۷۳۵	۲۳.۵%	۶.۰%	۱۱.۸%	۲.۰۱%	۲۴.۵%	۲۷.۴%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت نگین سامان	۵,۴۸۱	۲۲.۸%	۵.۷%	۱۱.۴%	۱.۹۰%	۲۳.۱%	۲۵.۷%
	نوع دوم نیلی دماوند	۳,۶۴۱	-	۶.۲%	۱۱.۹%	۱.۹۵%	۲۴.۳%	۲۷.۱%
	امین یکم فردا	۳,۵۷۹	۲۲.۵%	۵.۹%	۱۱.۵%	۱.۹۹%	۲۴.۲%	۲۷.۱%
بدون تقسیم سود	افرا نماد پایدار	۱۵,۲۵۶	۲۷.۲%	۶.۳%	۱۳.۰%	۱.۹۲%		
	نوع دوم کارا	۱۴,۴۸۹	۲۶.۷%	۶.۳%	۱۲.۹%	۱.۹۳%		
	سپید دماوند	۱۴,۴۷۷	۲۴.۳%	۵.۸%	۱۱.۶%	۱.۷۷%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۱۳,۳۶۱	۲۵.۴%	۶.۰%	۱۲.۳%	۱.۸۱%		
	اندیشه ورزان صبا تامین	۶,۰۴۳	۲۶.۳%	۶.۲%	۱۲.۹%	۱.۸۹%		



بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (صدور و ابطال)

بازدهی ماه گذشته بزرگترین صندوق‌های درآمد ثابت

صندوق‌های صدور و ابطال، خالص ارزش دارایی بر اساس میلیارد تومان، مرتب شده بر اساس بازده سالانه خالص ارزش دارایی‌ها



 CharismaHolding

 Charisma.ir

 CharismaHolding

