

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



آبان ماه ۱۴۰۲



CHARISMA MARKET INSIGHT

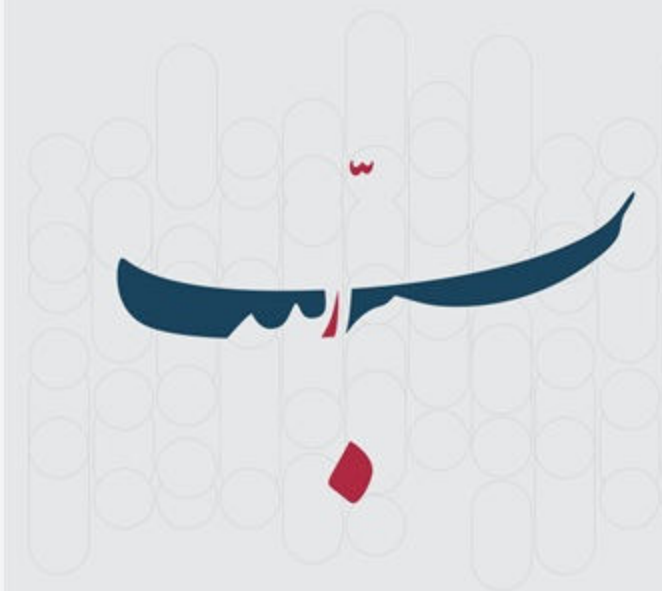
معرفی گزارش:

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 معاملات 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	فصل سوم
	درآمد ثابت
۲۱	مروری بر بازار درآمد ثابت
۲۲	دید کلی بازار بدهی
۲۴	انتشار و تسویه اوراق
۲۶	تامین مالی دولت
۲۷	بازیگران کلیدی بازار بدهی
۳۱	معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی
۳۳	آمار معاملات اوراق درآمد ثابت
۳۶	نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳۸	تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳۹	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)
۴۰	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (صدور و ابطال)

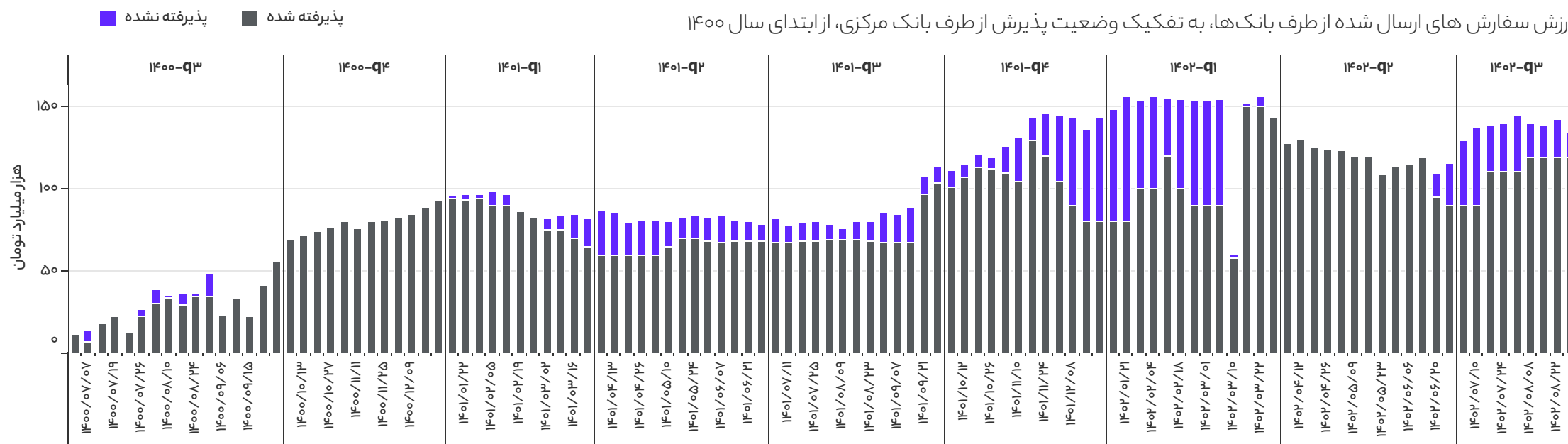


ECONOMY

سیاست‌های پولی

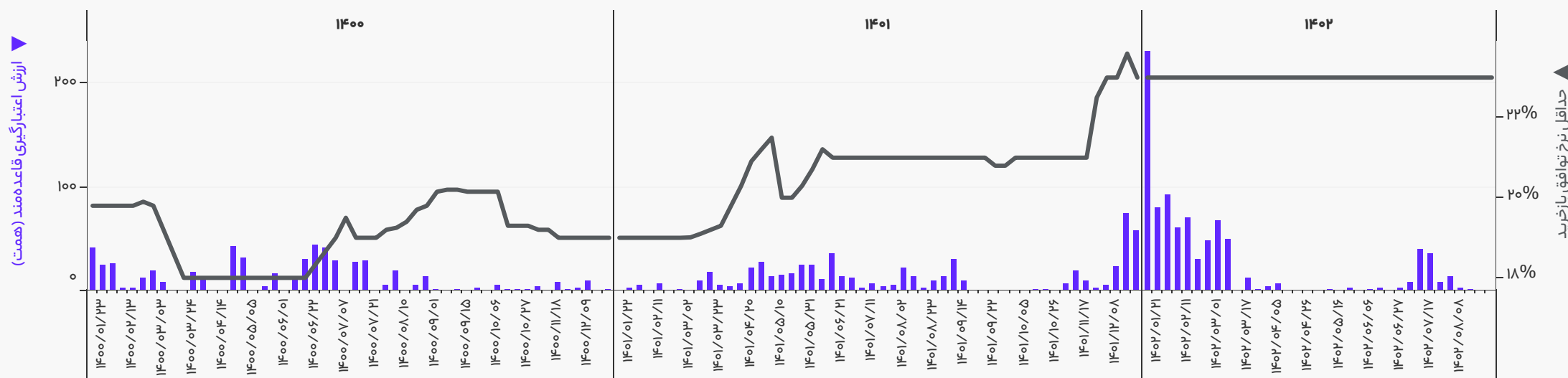
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

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

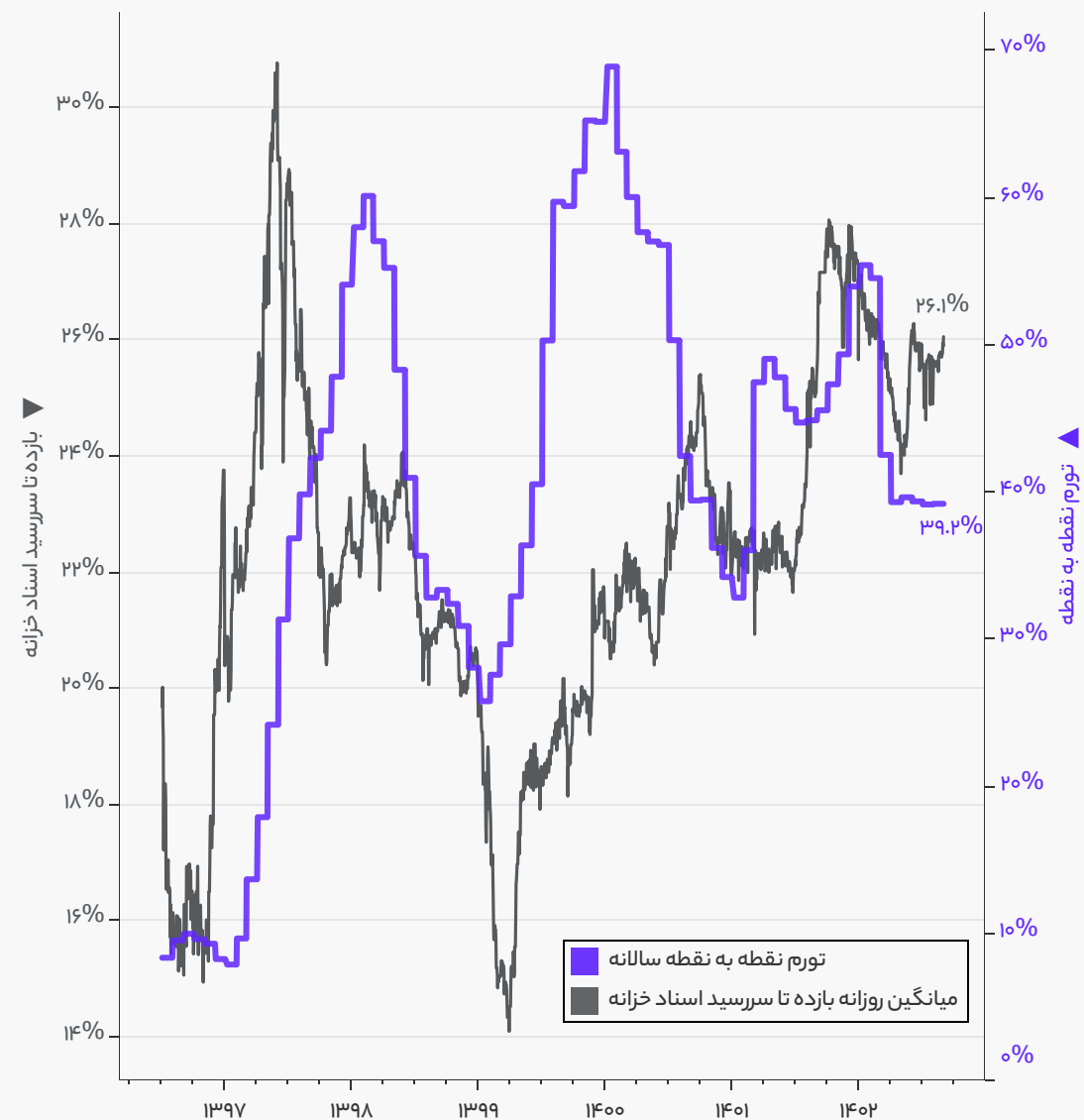
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق بازخريد، از ابتدای سال ۱۴۰۰



سیاست‌های پولی

تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

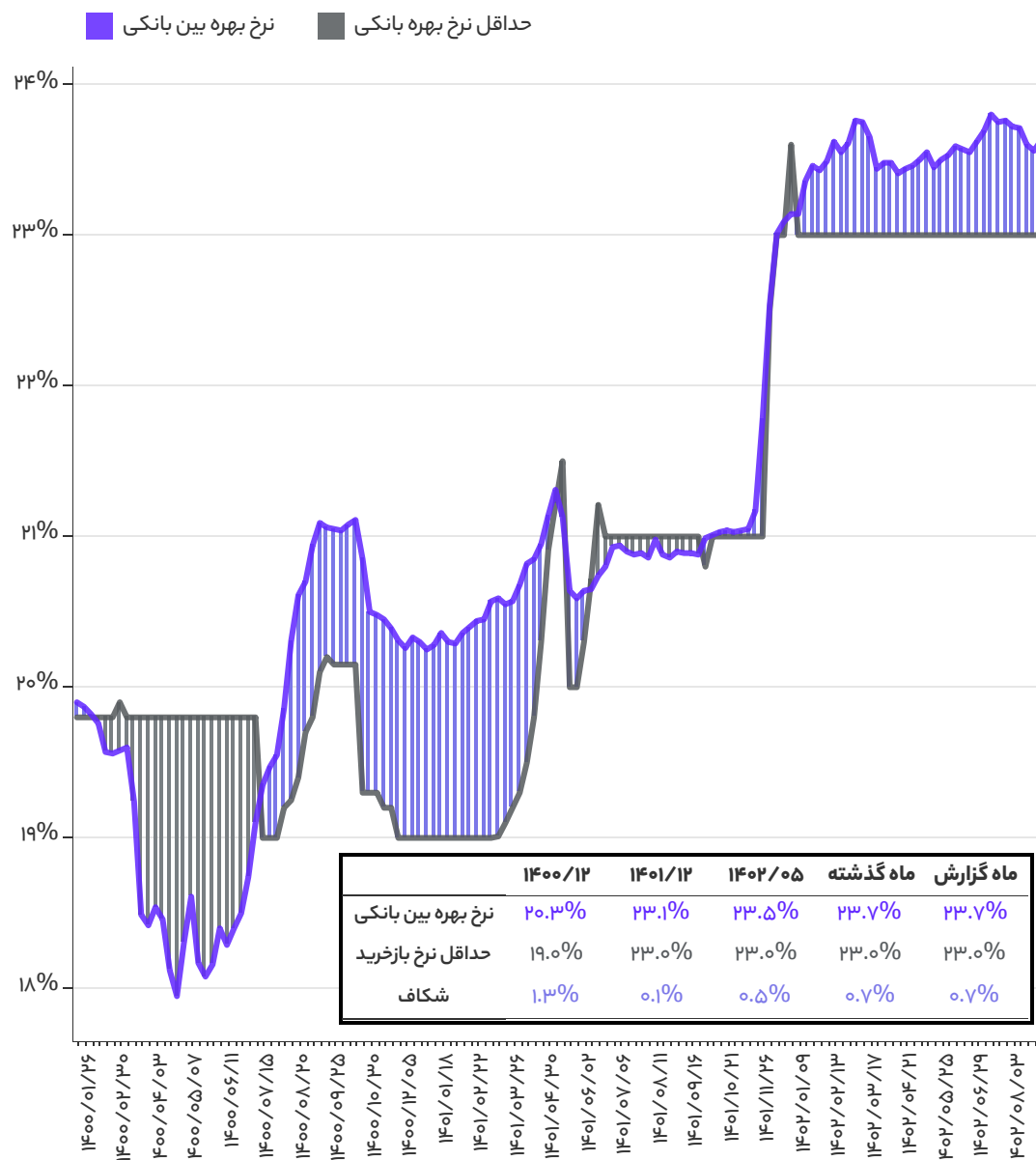
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* 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

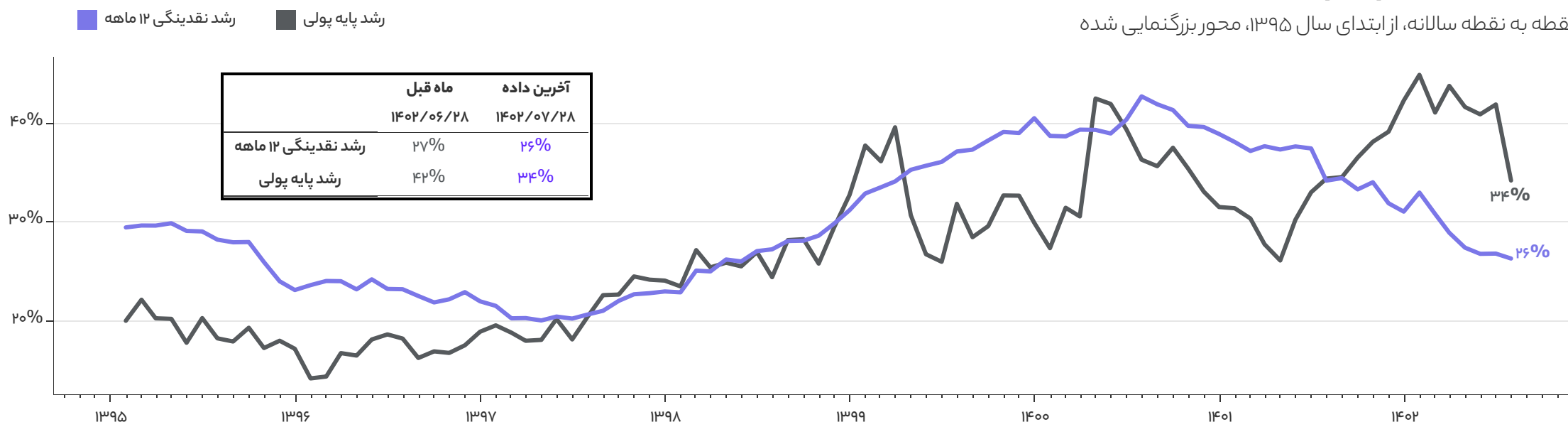
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

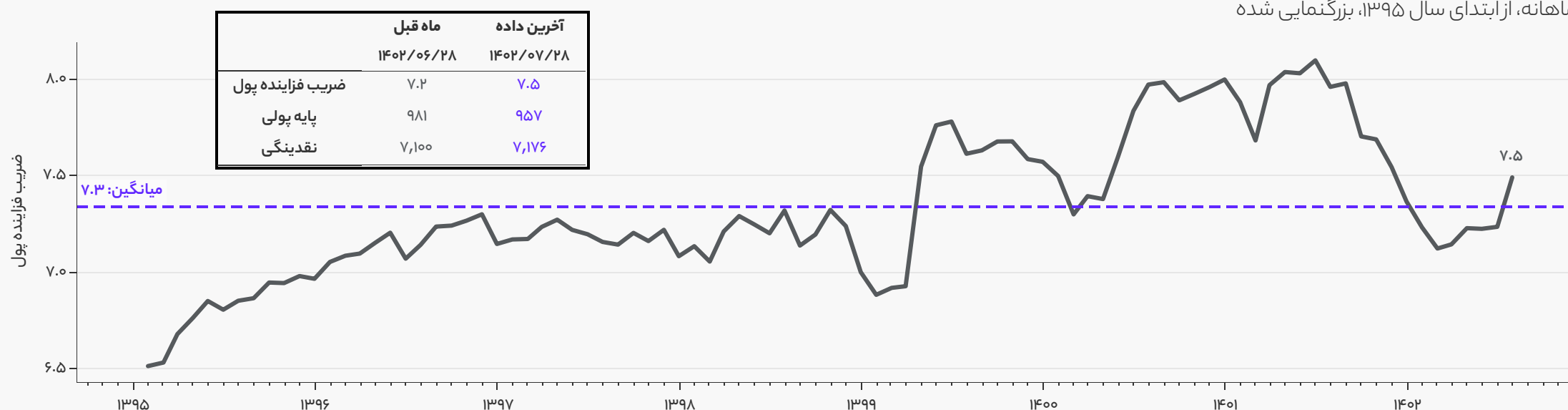
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول**

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

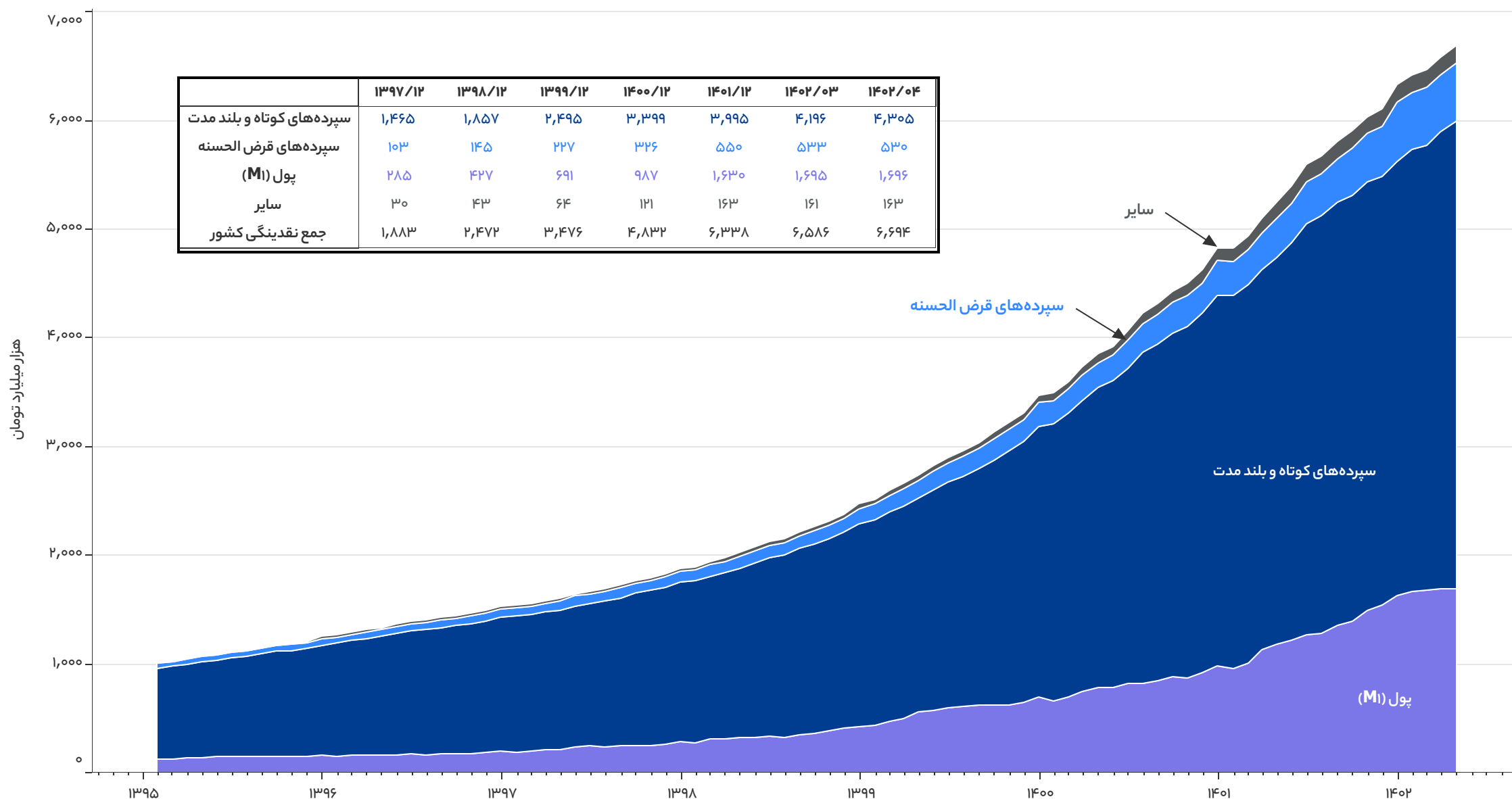


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.
** پایه پولی برح ۵ براساس اخبار رسمی محاسبه شده و فاصله تا آخرین آمار رسمی نیز تخمین زده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

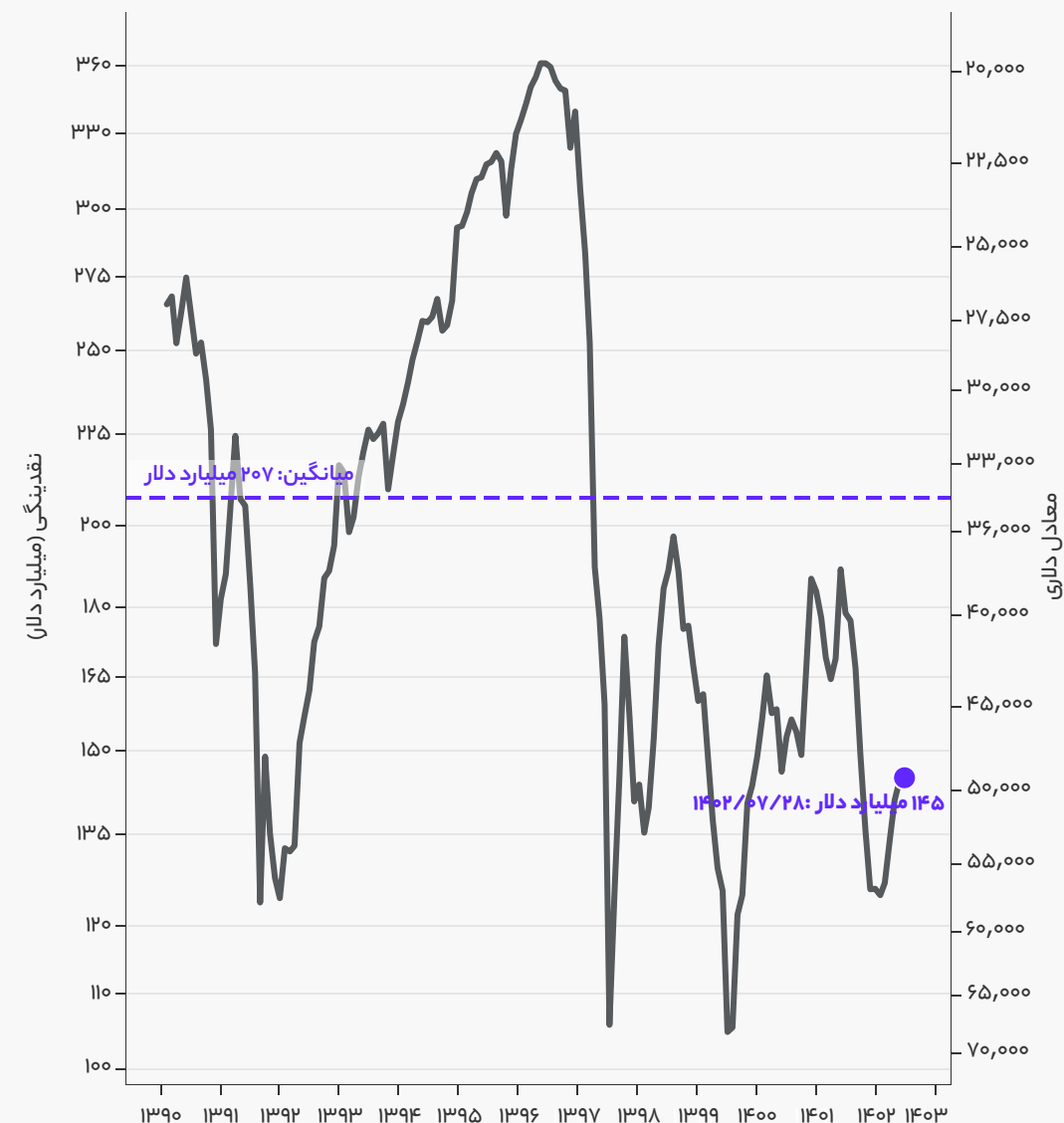
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، هزار میلیارد تومان



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

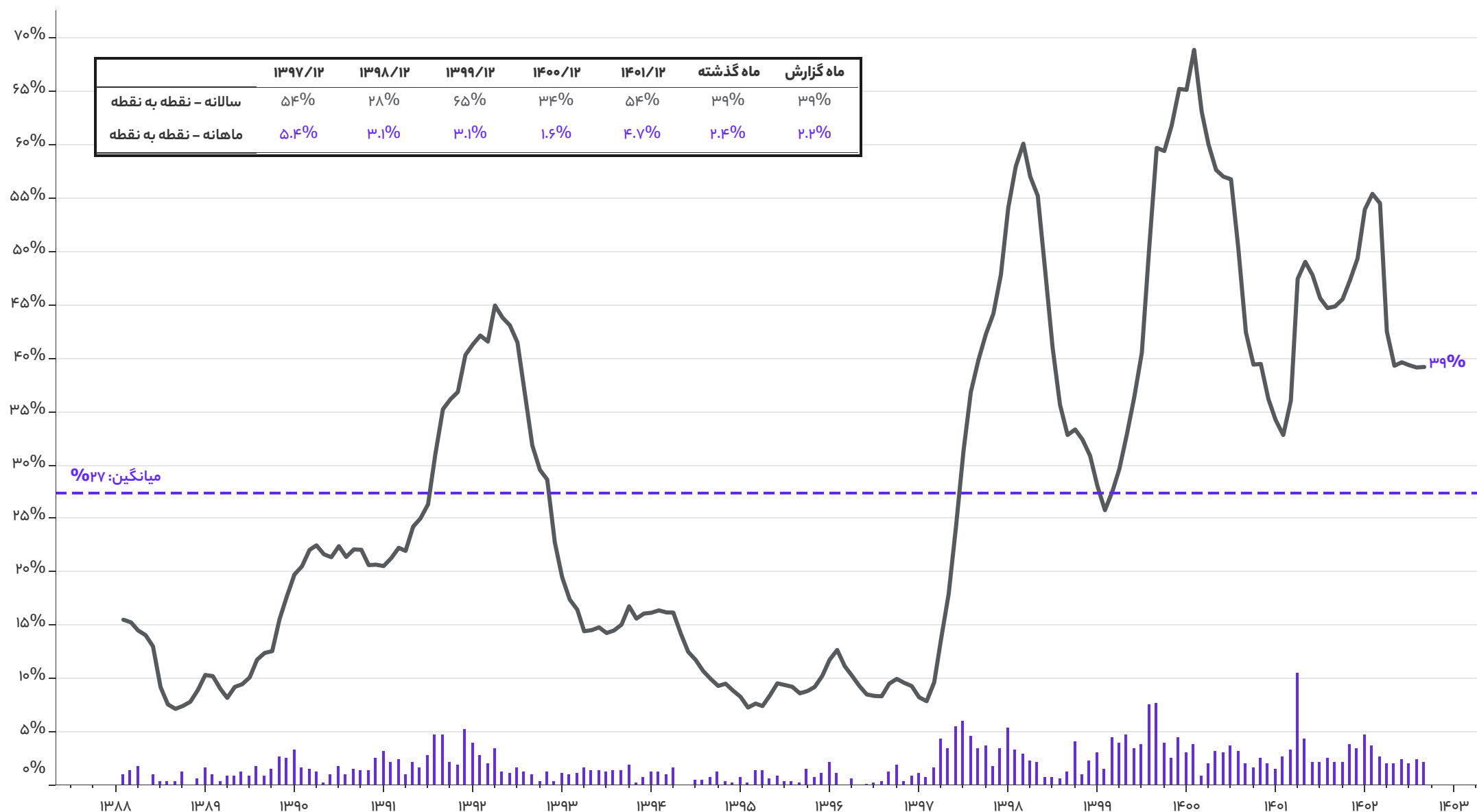


* قیمت دلاری لازم برای رسیدن به سطح نقدینگی دلاری مورد انتظار.
** نقدینگی چند ماه گذشته با استفاده از آمار ارایه شده در اخبار توسط بانک مرکزی محاسبه گردیده است.

تورم و شاخص CPI

وضعیت تورم*

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

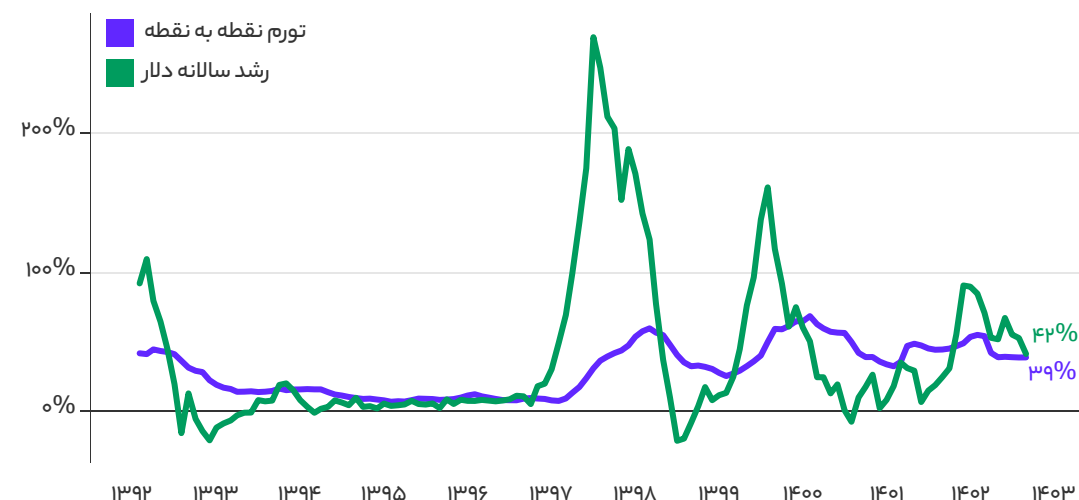


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

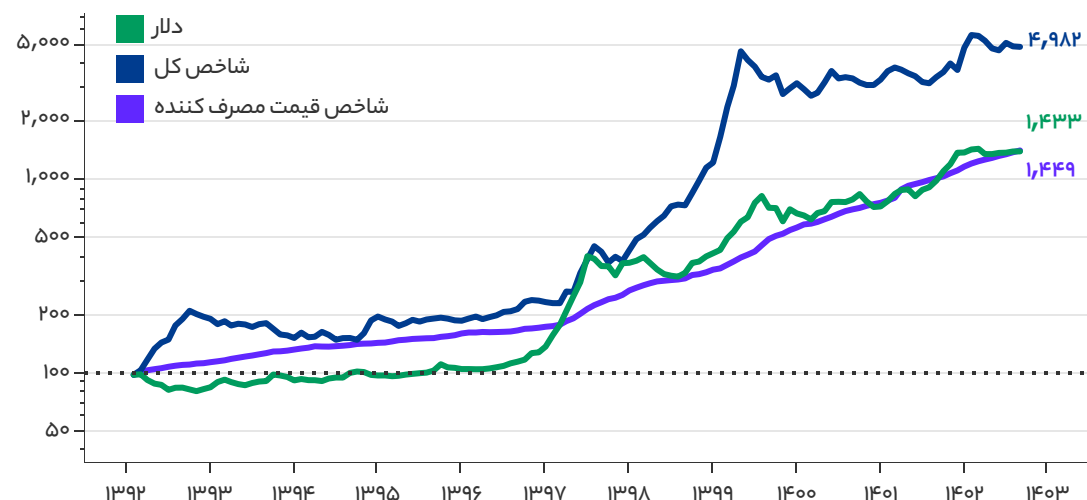
تورم و رشد دلار

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

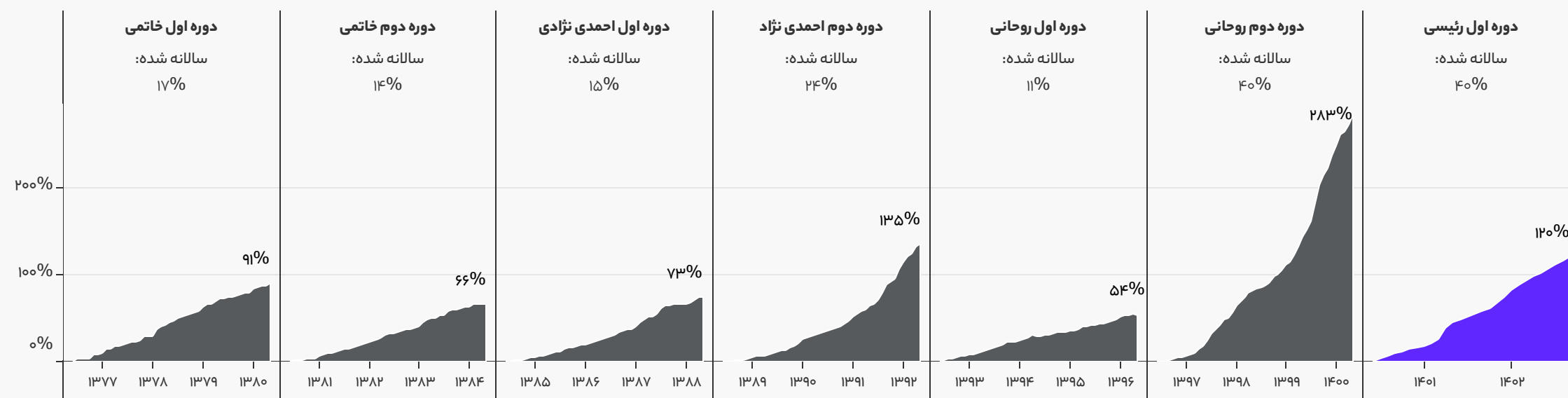


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

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

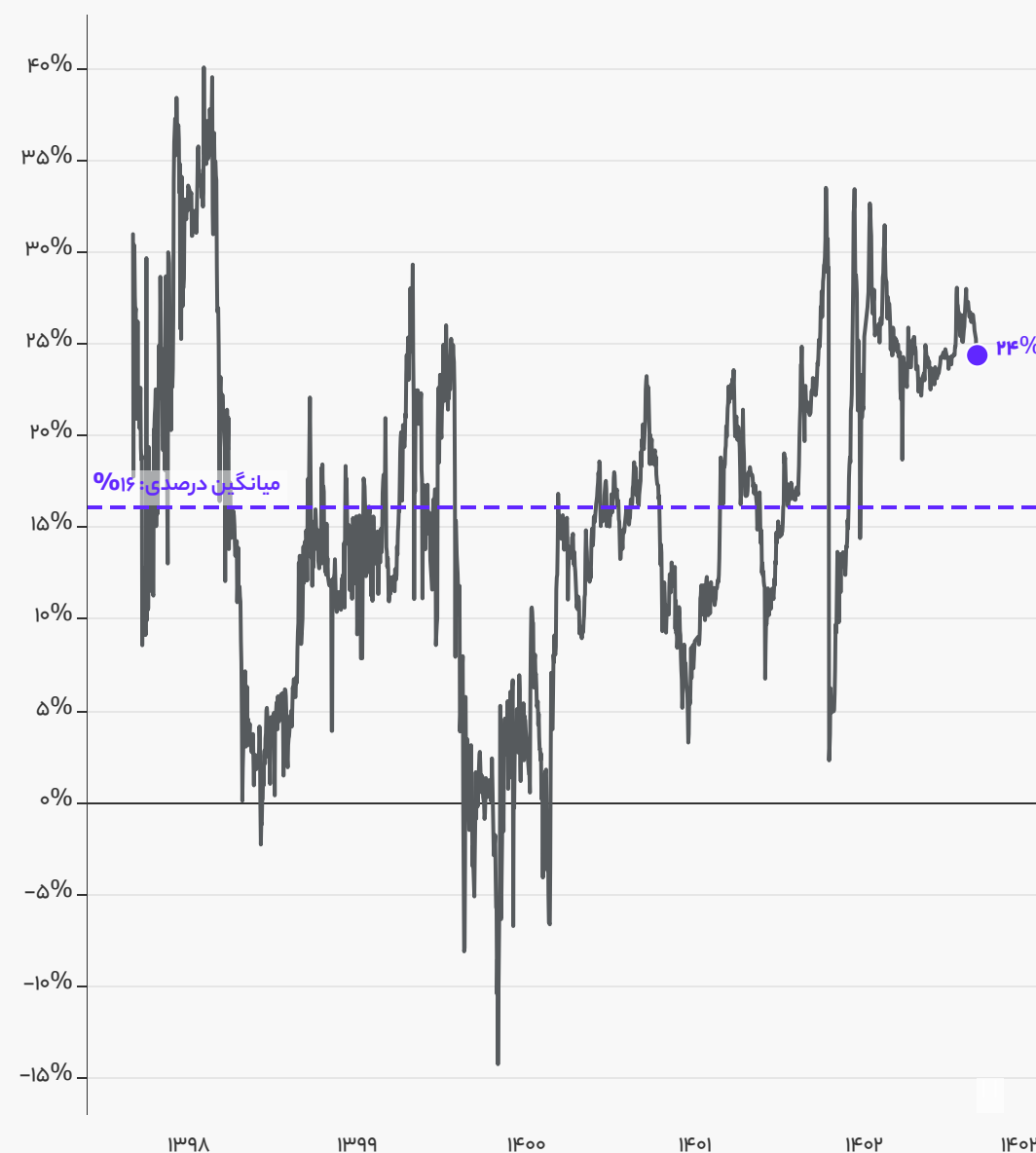


* دلار سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

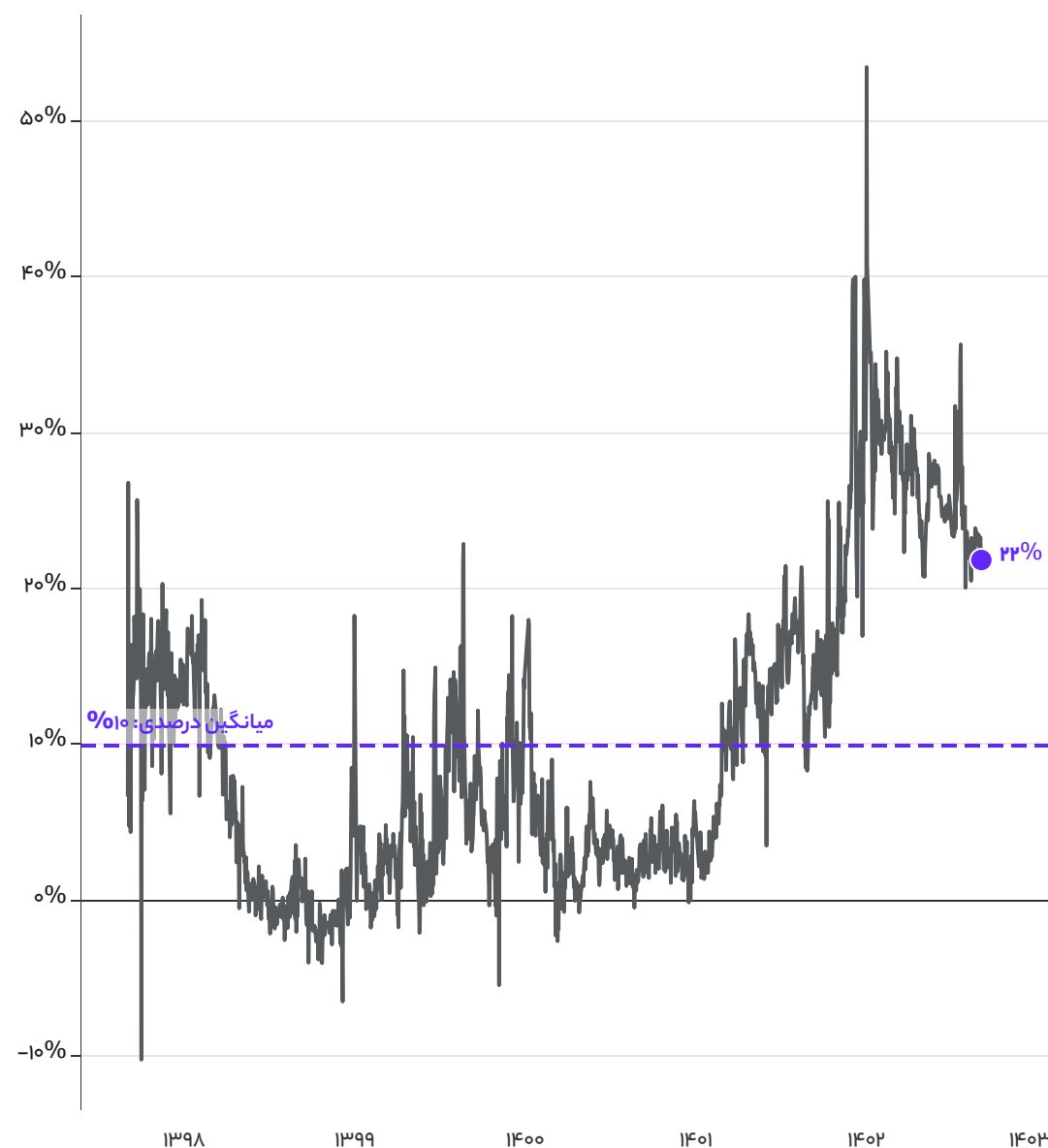
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



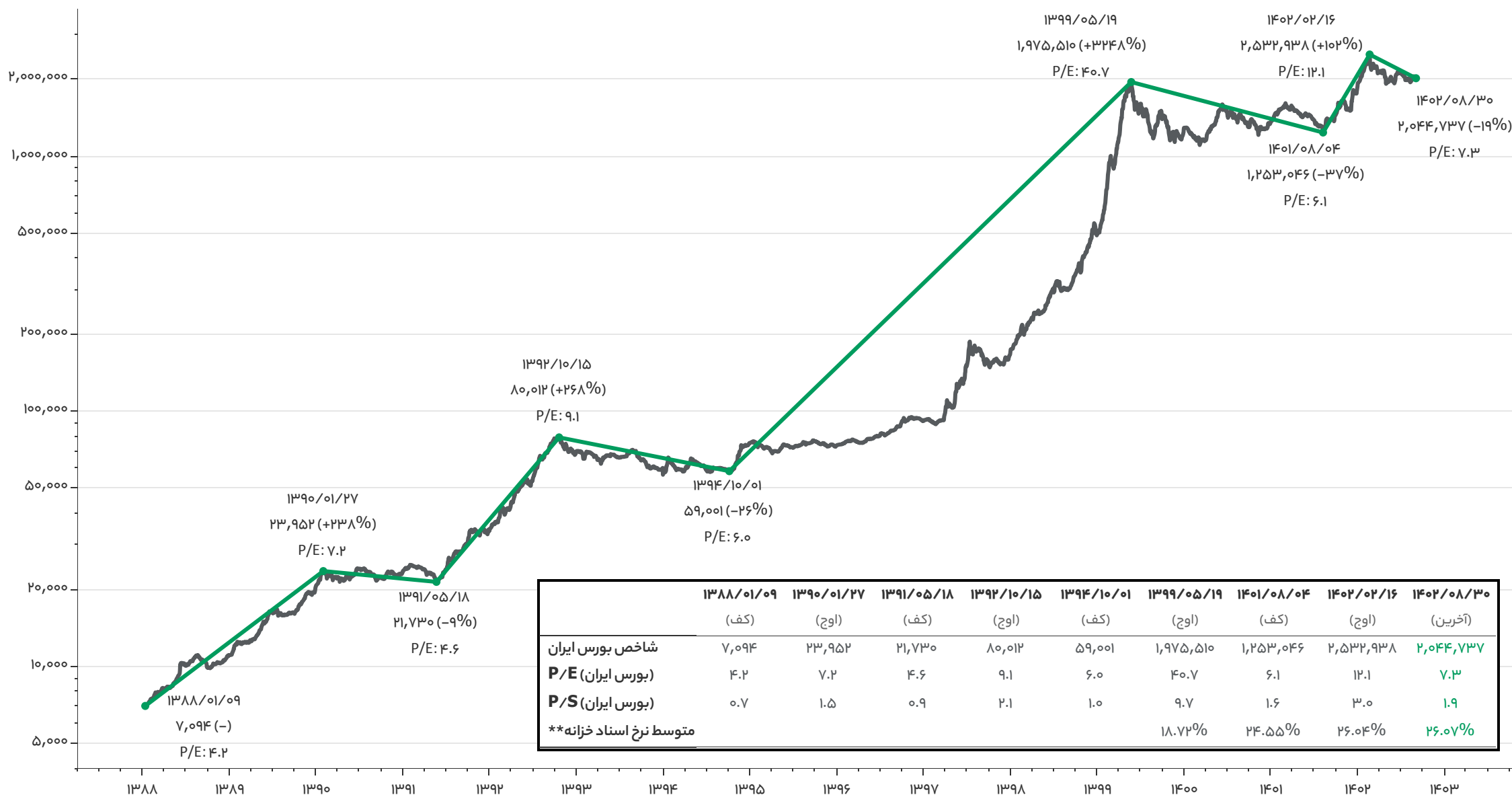


EQUITY

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

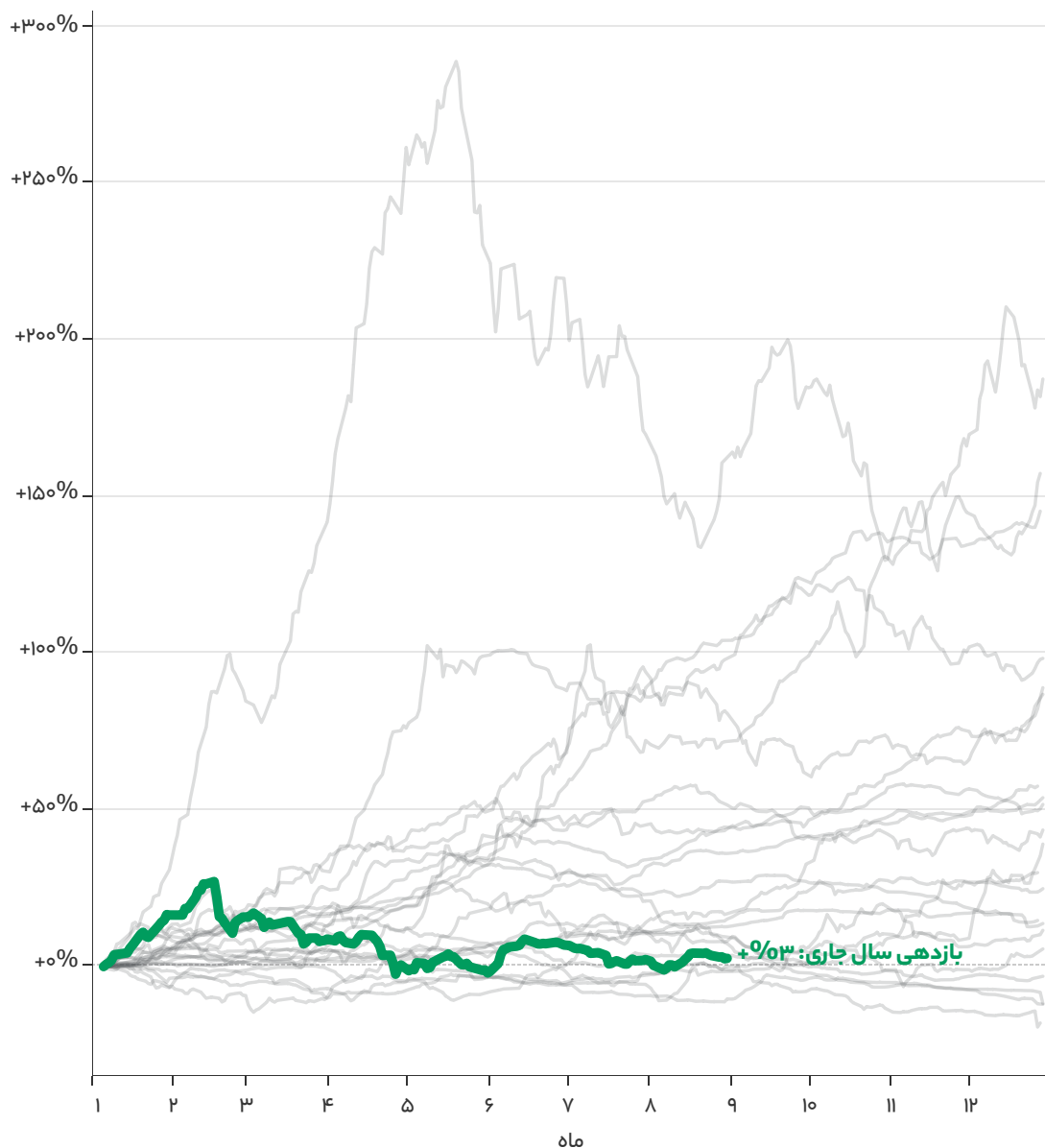


* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور، که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.

** 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

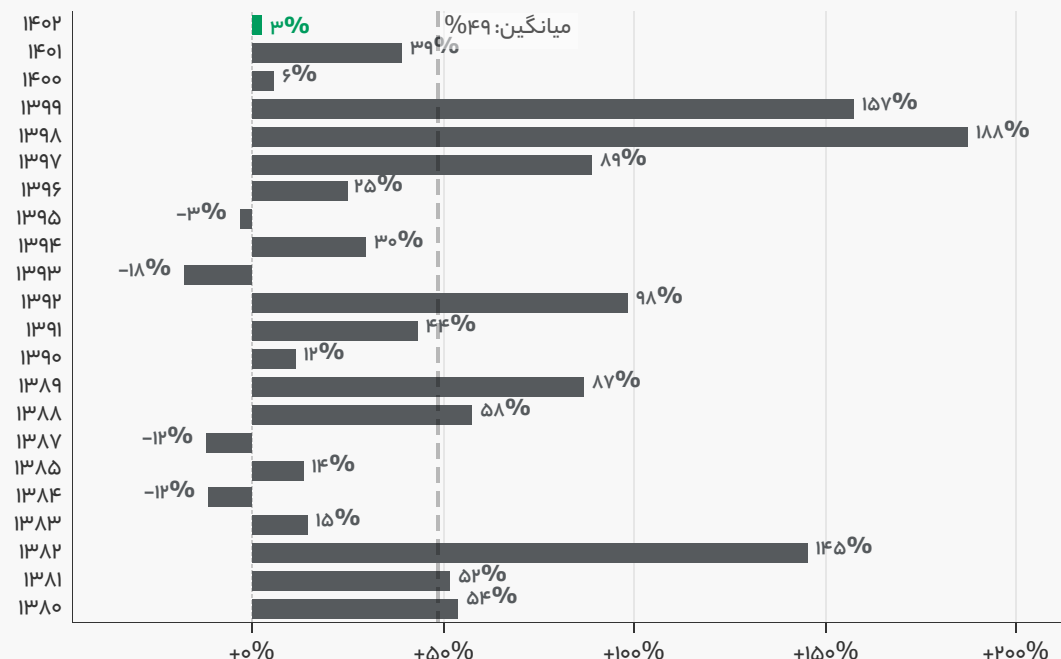
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



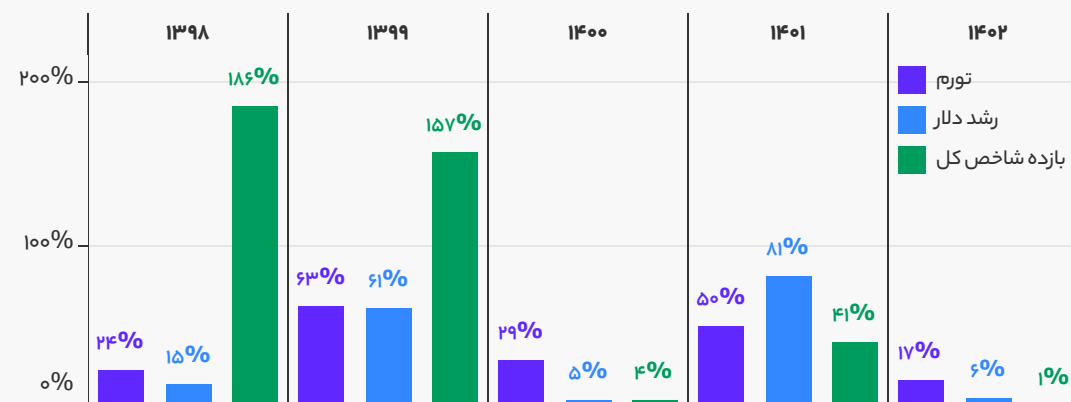
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

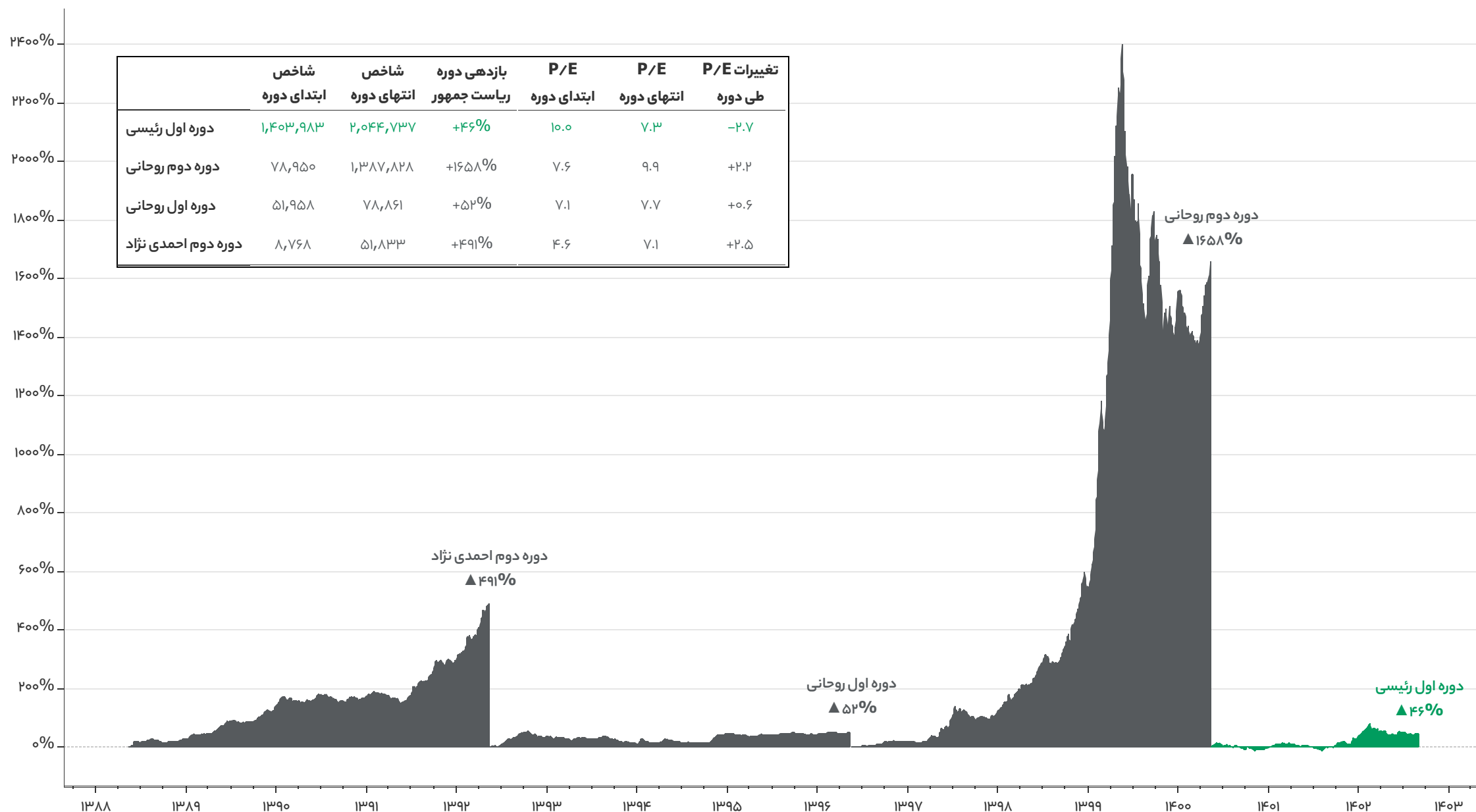


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلند مدت بازار سهام

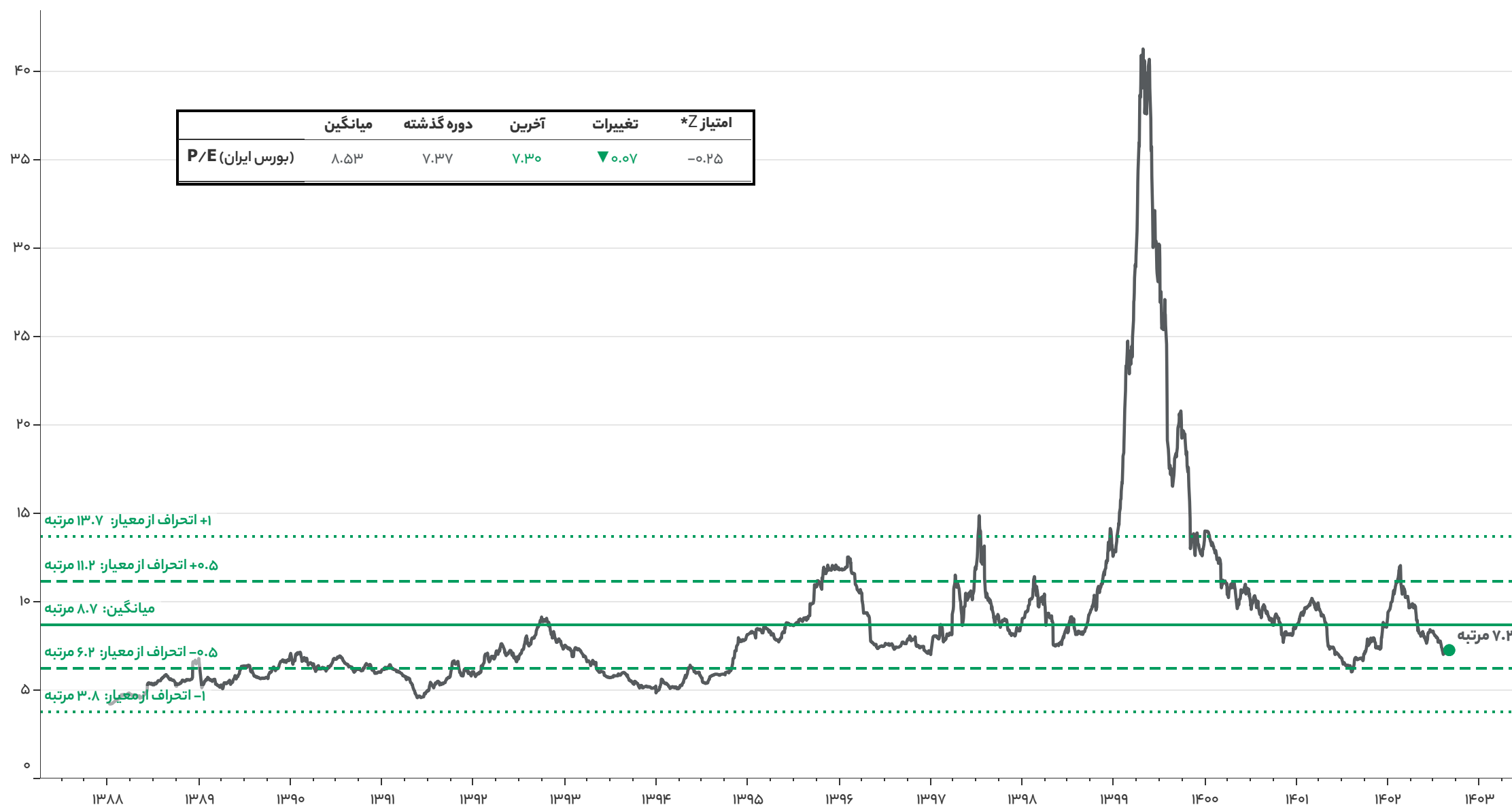
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



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.

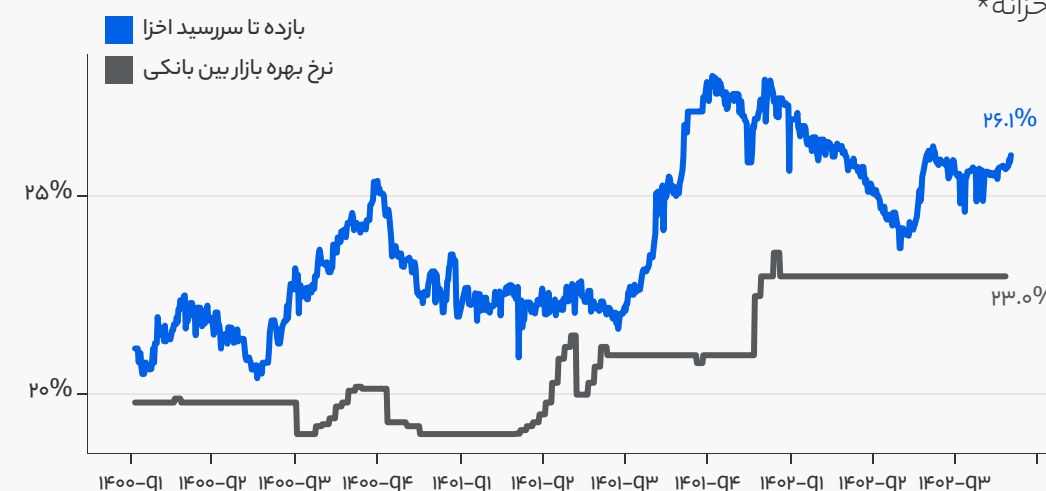


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

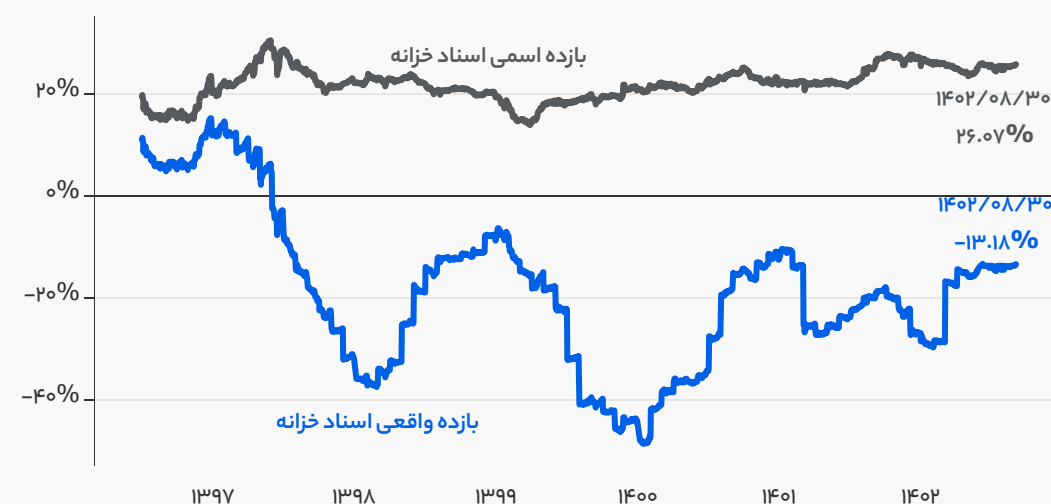
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

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



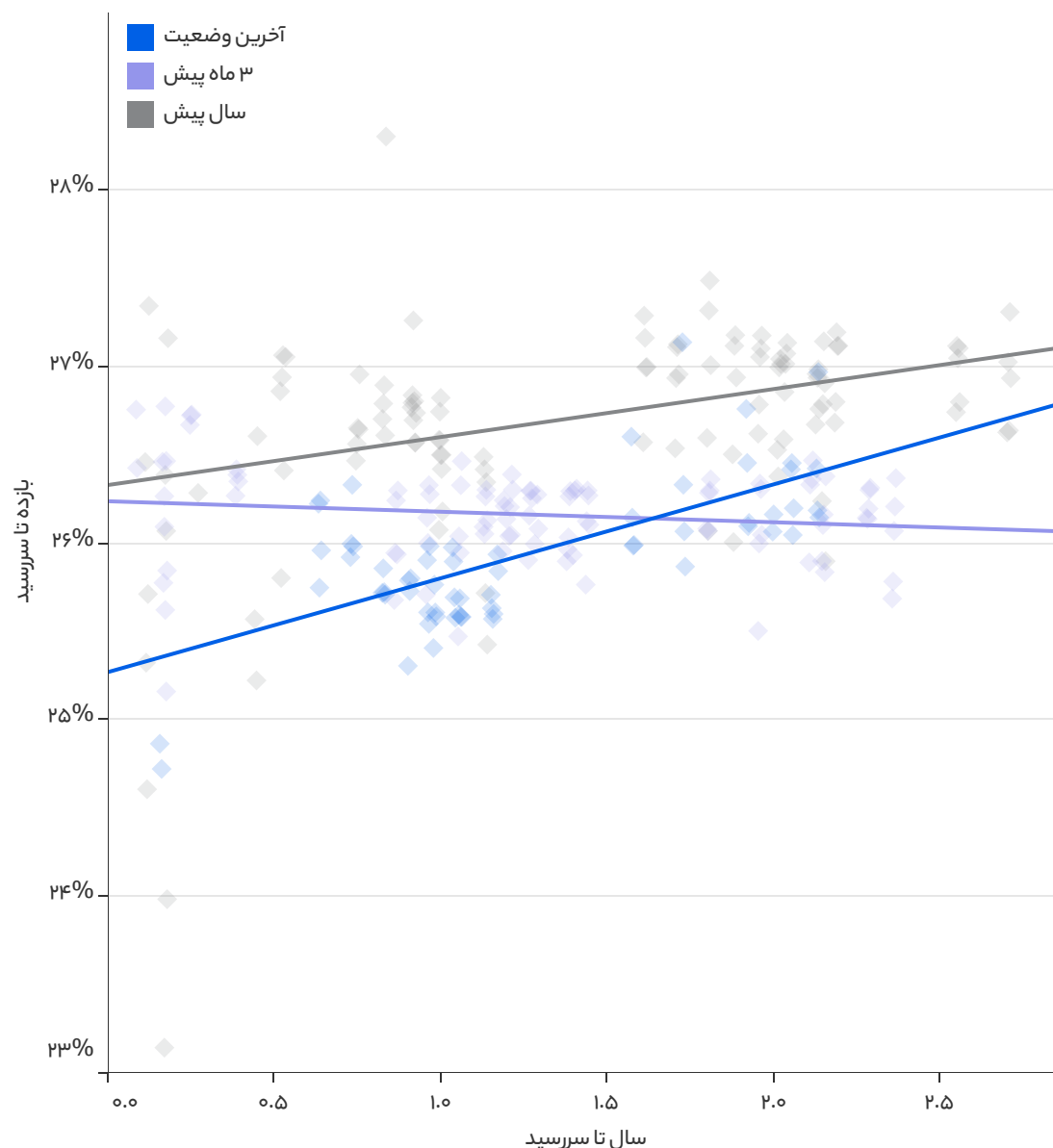
بازده اسمی و واقعی اسناد خزانه**

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



منحنی بازده تا سررسید اسناد خزانه

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



* میانگین روزانه بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف که بیش از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند.

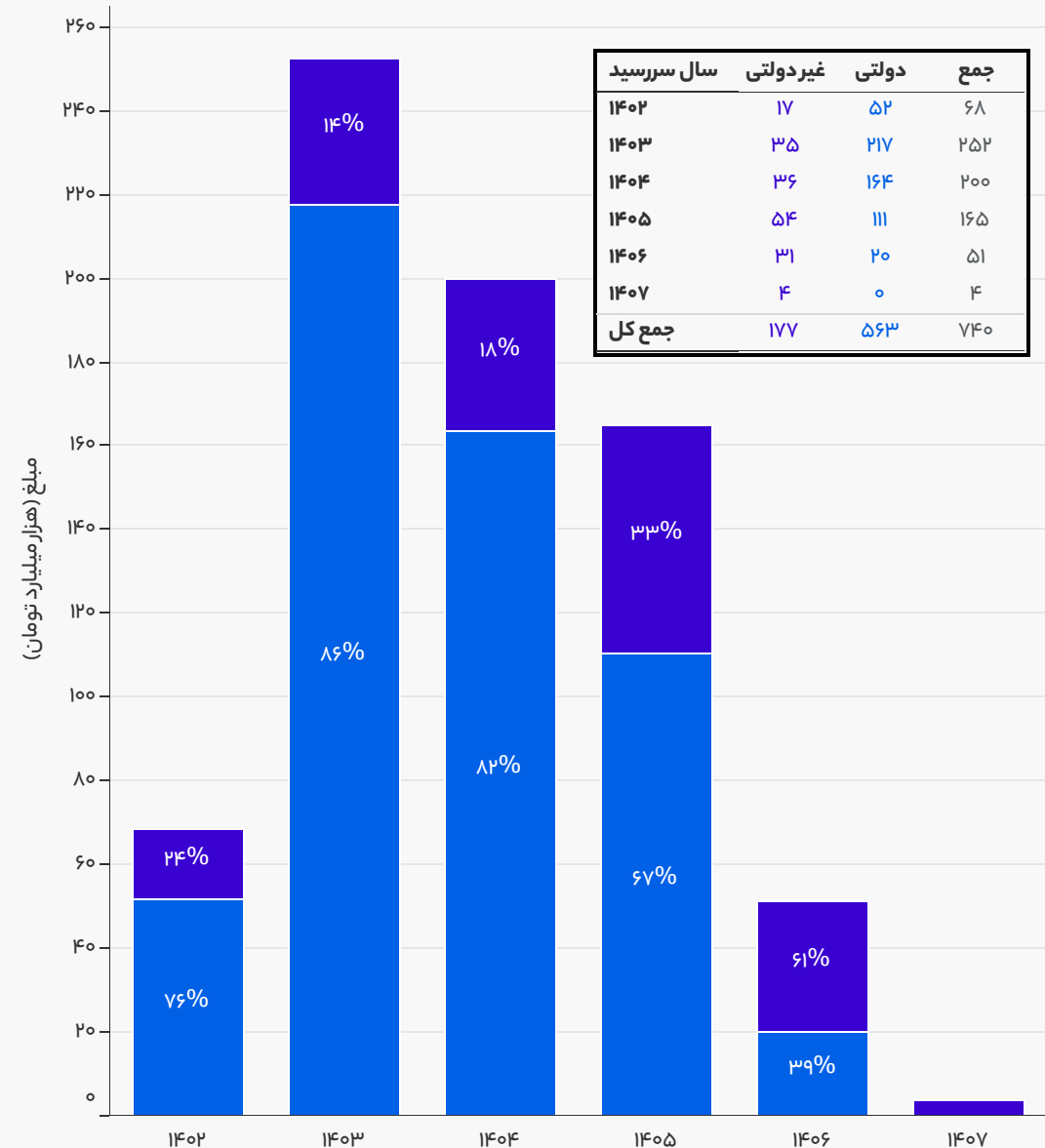
** بازده واقعی اسناد خزانه با نرخ تورم نقطه به نقطه سالانه محاسبه شده است.

*** برای رسم منحنی نیز اسناد خزانه با تاریخ سررسید کمتر از ۳۰ روز حذف گردیده‌اند.

دید کلی بازار بدهی

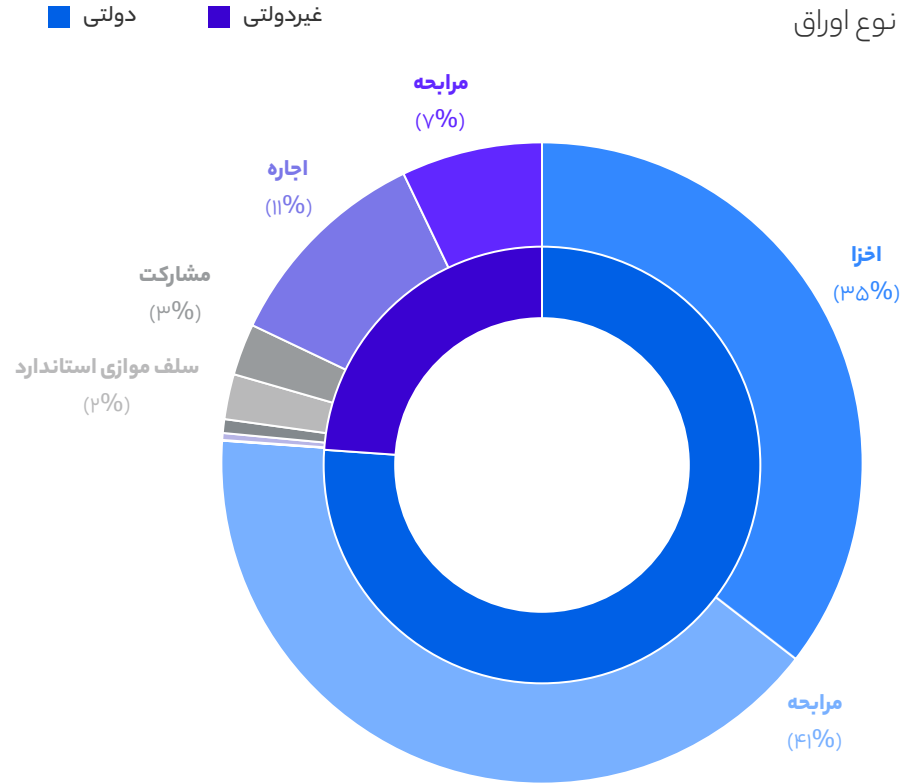
مانده اوراق به تفکیک سررسید

به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



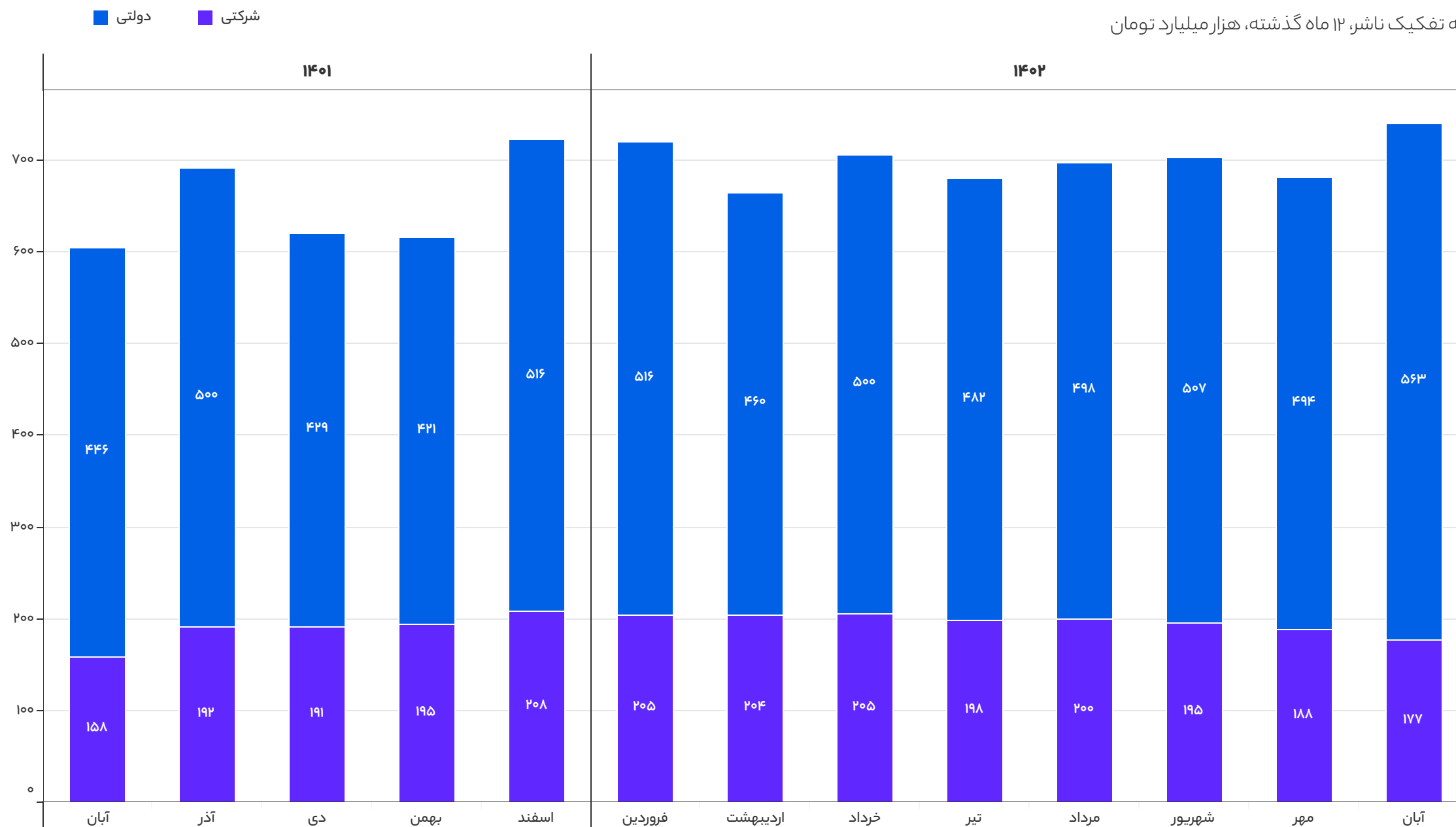
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مراجعه	۳۰۱	۴۱%
	اخزا	۲۶۳	۳۵%
غیردولتی	اجاره	۸۰	۱۱%
	مراجعه	۵۲	۷%
	مشارکت	۱۹	۳%
	سلف موازی استاندارد	۱۷	۲%
	منفعت	۵	۱%
	گام	۳	۰%
جمع کل		۷۴۰	۱۰۰%

* 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

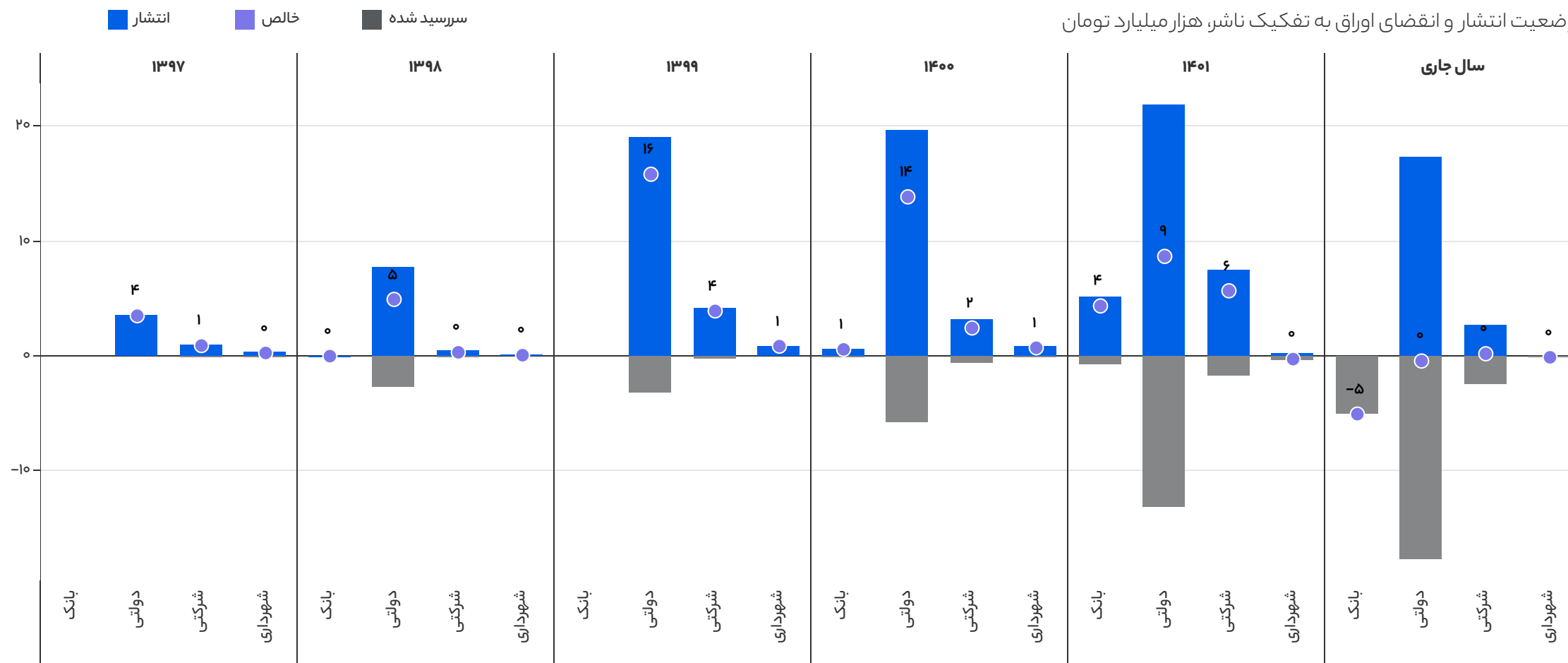
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

خالص انتشار اوراق سال‌های گذشته

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

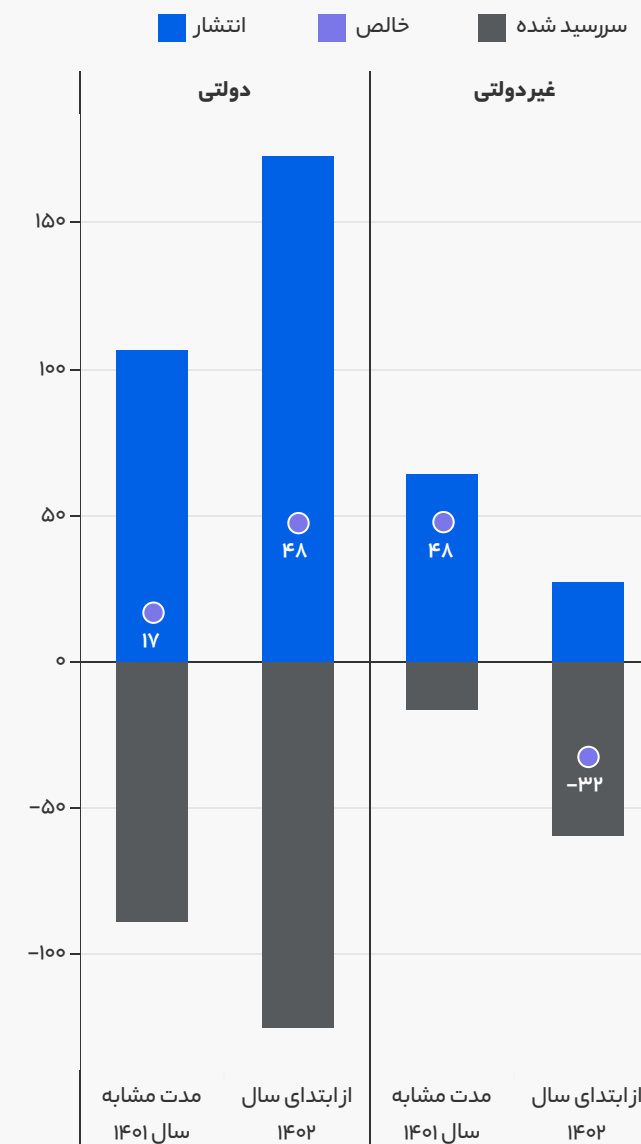


	سال جاری				۱۳۹۷				۱۳۹۸				۱۳۹۹				۱۴۰۰				۱۴۰۱			
	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری
انتشار اوراق		۱۷	۳			۴	۱	۰		۸	۰	۰		۱۹	۴	۱		۲۰	۳	۱		۲۲	۷	۰
سررسید شده	-۵	-۱۸	-۲	۰			۰	۰		-۳	۰			-۳	۰			-۶	-۱	۰		-۱۳	-۲	۰
خالص انتشار	-۵	۰	۰	۰		۴	۱	۰		۵	۰	۰		۱۶	۴	۱		۱۴	۲	۱		۹	۶	۰

انتشار و تسویه اوراق

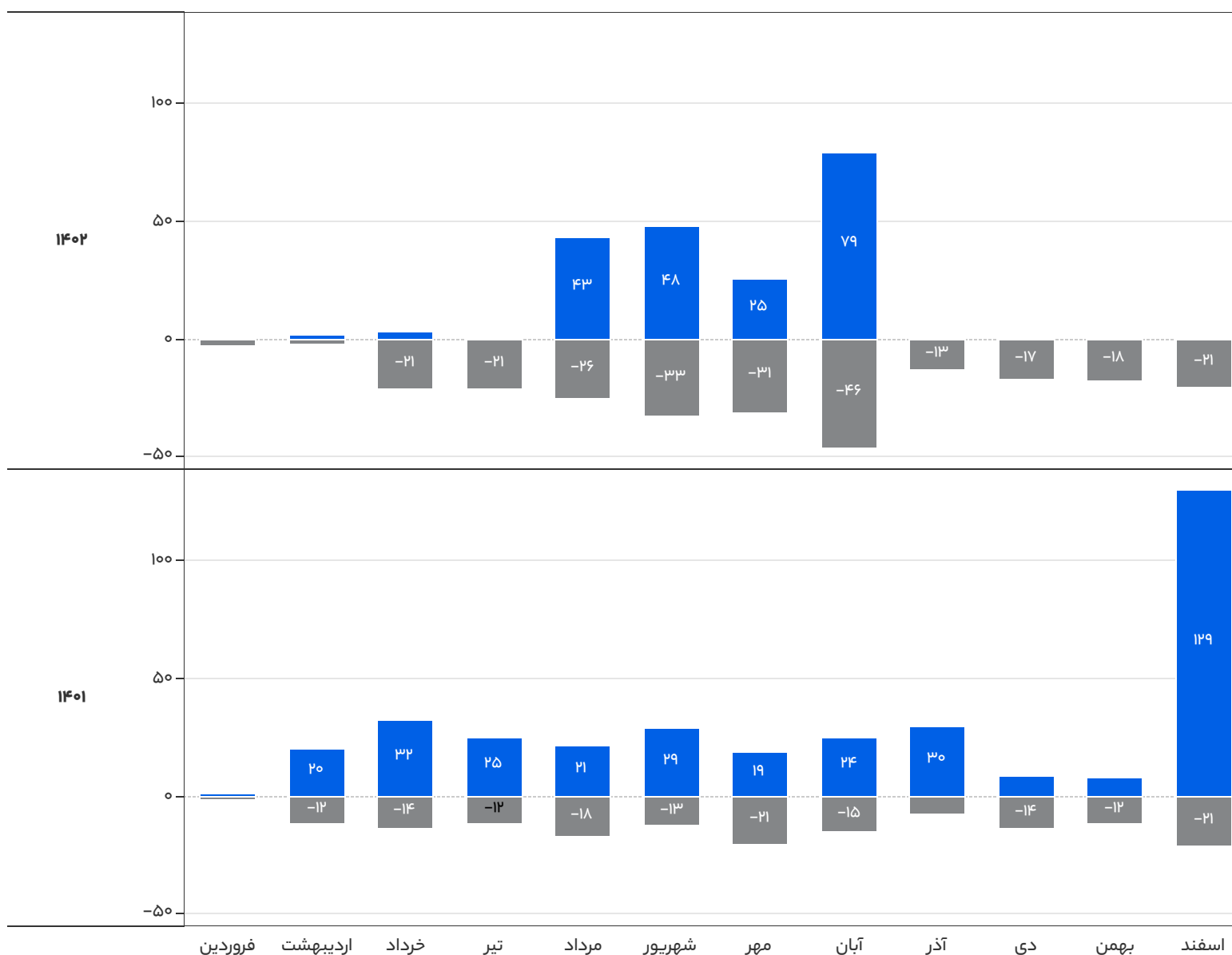
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

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



وضعیت سررسید و انتشار اوراق در سال جاری در برابر سال گذشته

حجم اوراق منتشر و سررسید شده، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



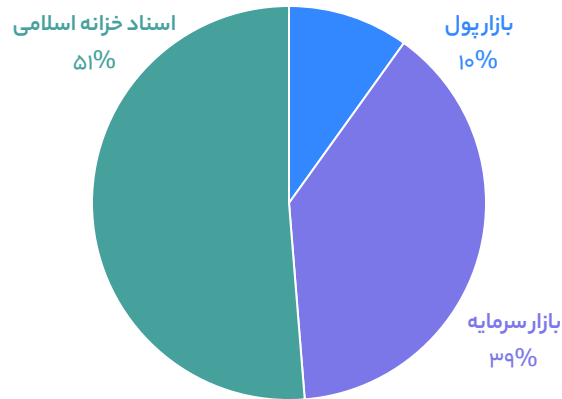
تامین مالی دولت

وضعیت تامین مالی دولت

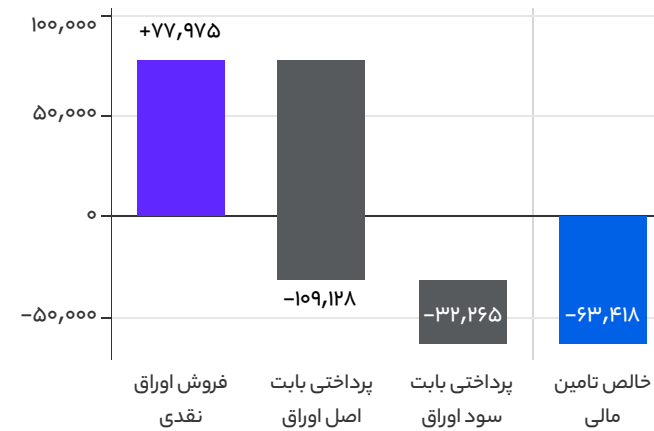
از ابتدای سال، نقدینگی جذب شده توسط دولت از طریق عرضه و تسویه اوراق، میلیارد تومان

تامین مالی دولت از ابتدای سال

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

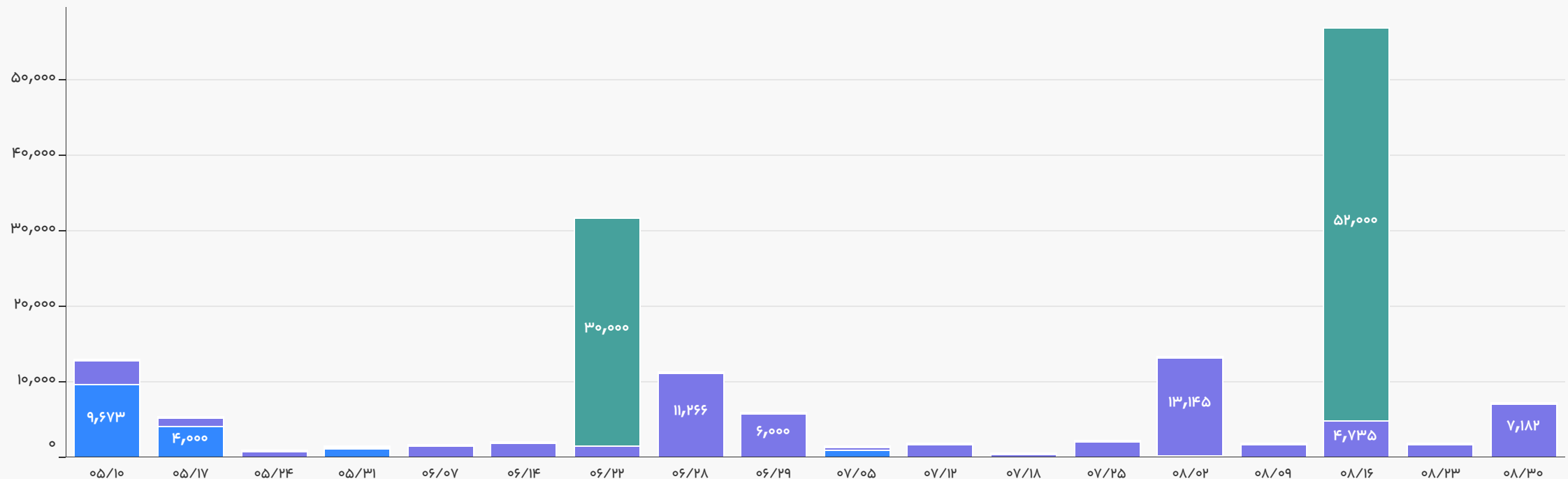


نوع فروش	بازار	حجم
نقدی	بازار پول	۱۵,۸۳۳
نقدی	بازار سرمایه	۶۲,۱۴۲
غیر نقدی	استناد خزانه اسلامی	۸۲,۰۰۰



فروش اوراق نقدی	۷۷,۹۷۵
پرداختی بابت اصل اوراق	-۱۰۹,۱۲۸
پرداختی بابت سود اوراق	-۳۲,۲۶۵
خالص تامین مالی	-۶۳,۴۱۸

بازار پول بازار سرمایه استناد خزانه اسلامی



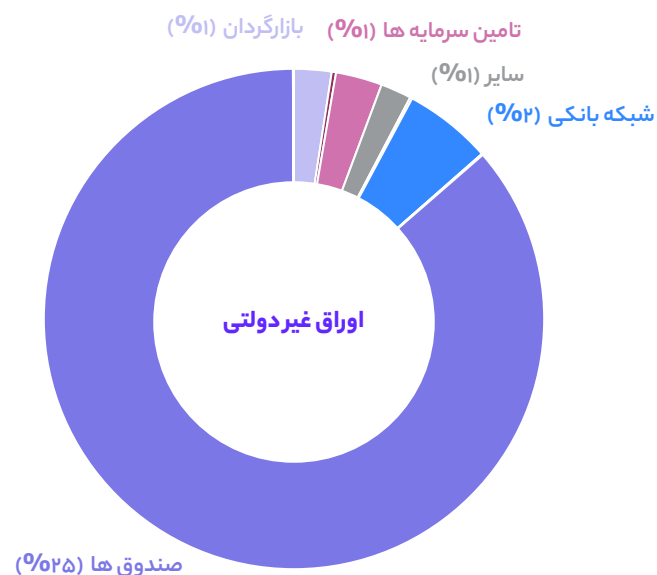
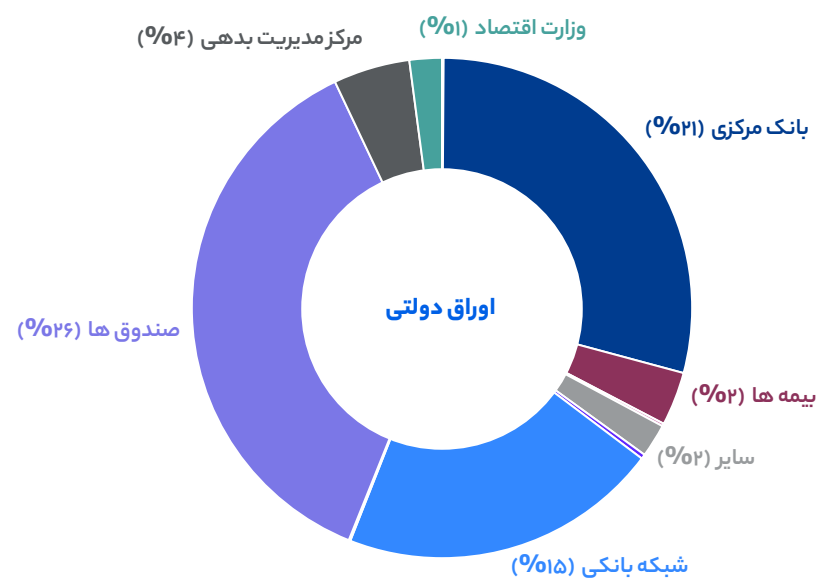
عرضه اوراق دولتی در سال جاری

از ابتدای سال، به تفکیک عرضه، میلیارد تومان

بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی اوراق، به تفکیک ناشر و دارنده اوراق، هزار میلیارد تومان



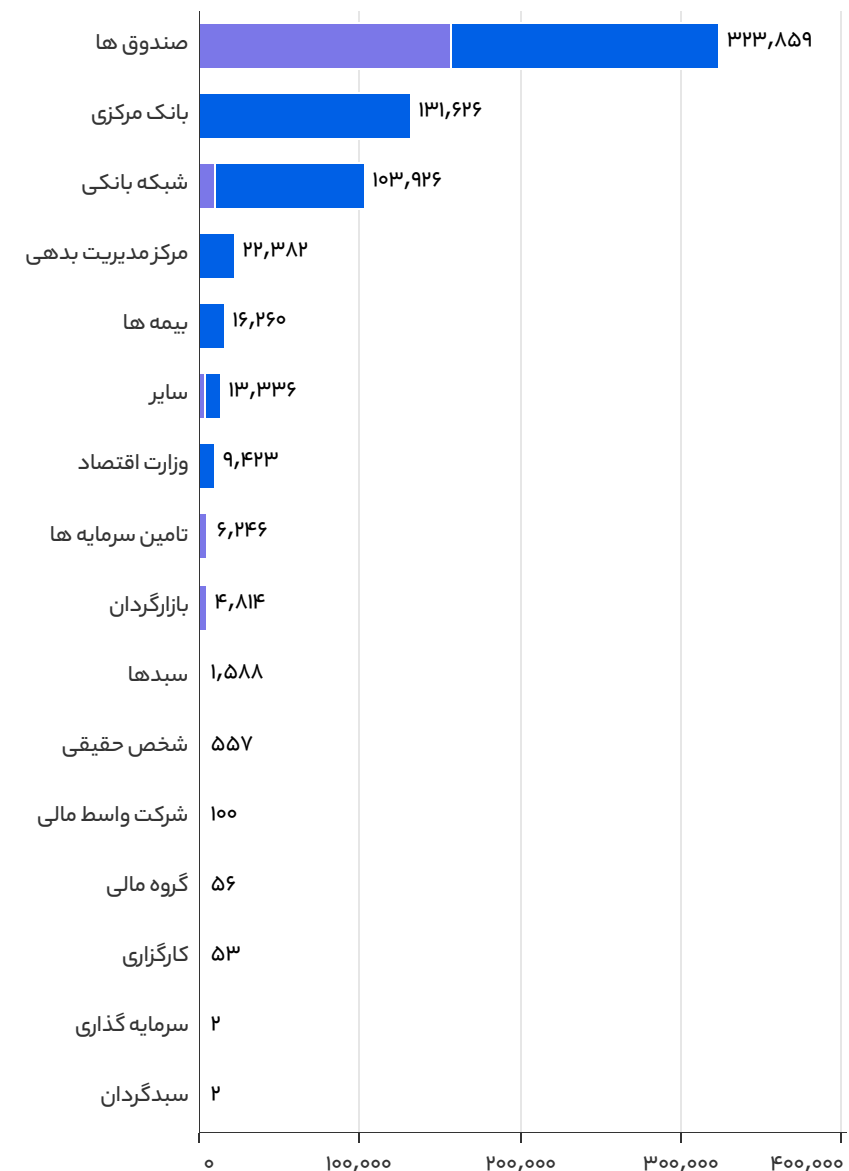
	۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	جمع کل
دولتی	صندوق ها	۲۴.۲	۷۲.۳	۵۰.۶	۸.۰	۱۱.۸	۱۶۶.۹
	بانک مرکزی	۱۶.۹	۵۸.۰	۴۴.۱	۸.۵	۴.۱	۱۳۱.۶
	شبکه بانکی	۱۳.۸	۴۱.۵	۲۸.۷	۶.۰	۳.۶	۹۳.۶
	مرکز مدیریت بدهی	۸.۱	۷.۶	۶.۷	-	-	۲۲.۴
	بیمه ها	۰.۷	۹.۶	۳.۶	۱.۵	۰.۲	۱۵.۸
	سایر	۰.۳	۲.۸	۶.۵	-	۰.۱	۹.۷
	وزارت اقتصاد	-	-	۵.۷	۳.۷	-	۹.۴
	سبدها	-	۰.۹	۰.۳	۰.۱	-	۱.۳
	تامین سرمایه ها	۰.۳	۰.۵	-	-	-	۰.۸
	شخص حقیقی	-	۰.۴	۰.۱	-	-	۰.۵
غیردولتی	بازارگردان	-	۰.۴	-	-	-	۰.۴
	صندوق ها	۲۲.۴	۳۳.۰	۳۱.۳	۴۴.۱	۲۵.۳	۱۵۷.۰
	شبکه بانکی	-	۰.۶	۱.۰	۷.۱	۱.۷	۱۰.۴
	تامین سرمایه ها	-	۰.۳	۲.۵	۱.۵	۰.۹	۵.۵
	بازارگردان	۰.۸	۰.۸	۱.۳	۱.۰	۰.۵	۴.۴
	سایر	۰.۸	۰.۱	-	۰.۲	۱.۵	۳.۶
	بیمه ها	۰.۵	-	-	-	-	۰.۵
	سبدها	۰.۱	-	-	-	۰.۱	۰.۲
	شرکت واسط مالی	-	-	-	-	۰.۱	۰.۱
	شخص حقیقی	-	-	-	-	۰.۱	۰.۱
	گروه مالی	-	-	-	۰.۱	-	۰.۱
	کارگزاری	-	-	-	-	-	۰.۱
	سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-
	سبدگردان	-	-	-	-	-	-

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی

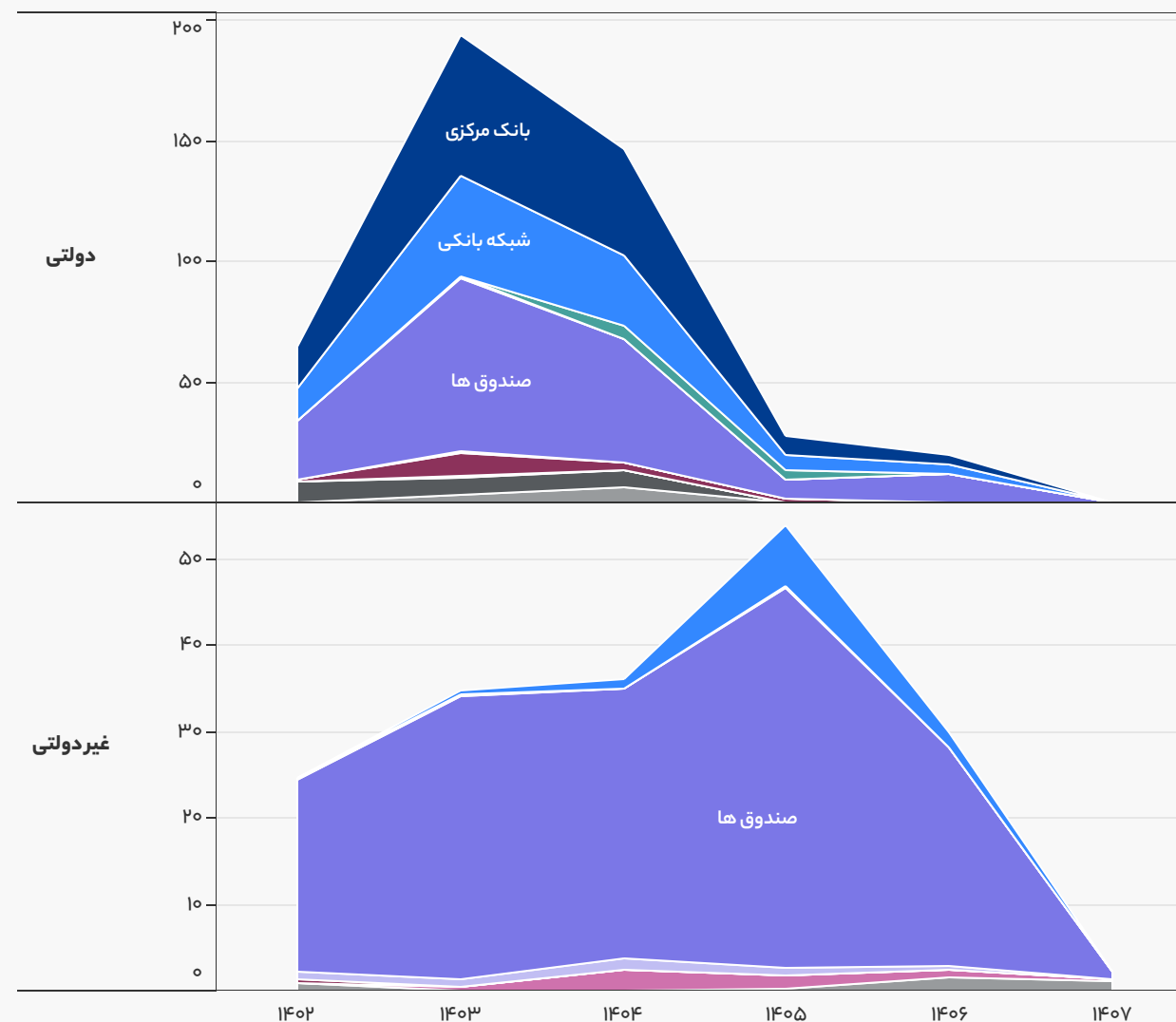
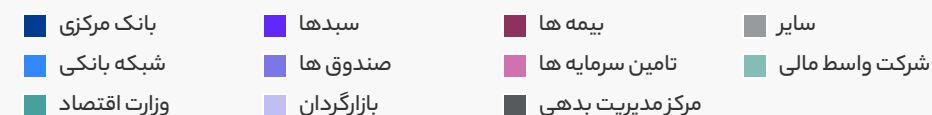


جمع	گام	منفعت	مشارکت	مربحه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره	
۳۰۷,۸۳۲	۹,۰۵۰	۵,۰۹۵	۱۶,۱۷۱	۱۶۰,۶۳۳	۰	۱۶,۰۲۷	۴۸,۲۷۹	۱۴۵	۶۸,۴۵۸	صندوق ها
۱۳۱,۶۲۶	۰	۰	۰	۱۰۲,۷۷۷	۰	۰	۲۸,۸۴۹	۰	۰	بانک مرکزی
۱۰۳,۹۲۶	۳۷	۱۰۰	۴۷۰	۴۸,۹۰۸	۰	۰	۴۸,۴۳۴	۰	۵,۹۷۸	شبکه بانکی
۲۲,۳۸۲	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۲۲,۳۸۲	۰	۰	مرکز مدیریت بدهی
۱۶,۲۶۰	۴۶۵	۰	۰	۹,۴۰۸	۴۰	۰	۶,۳۴۷	۰	۰	بیمه ها
۱۳,۳۳۶	۸۴۵	۰	۲۵	۲۶۵	۵۰	۰	۹,۴۴۷	۰	۲,۷۰۵	سایر
۶,۲۴۶	۰	۰	۱,۷۸۰	۲,۹۶۴	۲	۰	۰	۵	۱,۴۹۵	تامین سرمایه ها
۴,۰۴۱	۱۳۶	۰	۷۶۵	۲,۱۳۲	۰	۷۷۳	۰	۵	۱,۰۰۳	بازارگردان
۱,۵۸۸	۷۸	۰	۰	۸۱۸	۰	۰	۶۶۳	۰	۳۰	سبدها
۲	۰	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۰	۰	سبدگردان
۲	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۰	۰	۰	سرمایه گذاری
۵۵۷	۰	۰	۰	۴۹۷	۰	۰	۶۰	۰	۰	شخص حقیقی
۱۰۰	۰	۰	۰	۱۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	شرکت واسط مالی
۵۳	۰	۰	۰	۴۰	۳	۰	۰	۰	۱۰	کارگزاری
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰	گروه مالی
۹,۴۲۳	۰	۰	۰	۹,۴۲۳	۰	۰	۰	۰	۰	وزارت اقتصاد
۶۱۷,۴۳۲	۱۰,۶۱۱	۵,۱۹۵	۱۹,۲۱۲	۳۳۸,۰۲۲	۹۷	۱۶,۸۰۰	۱۶۴,۴۶۲	۱۵۵	۷۹,۶۷۸	جمع

بازیگران کلیدی بازار بدهی

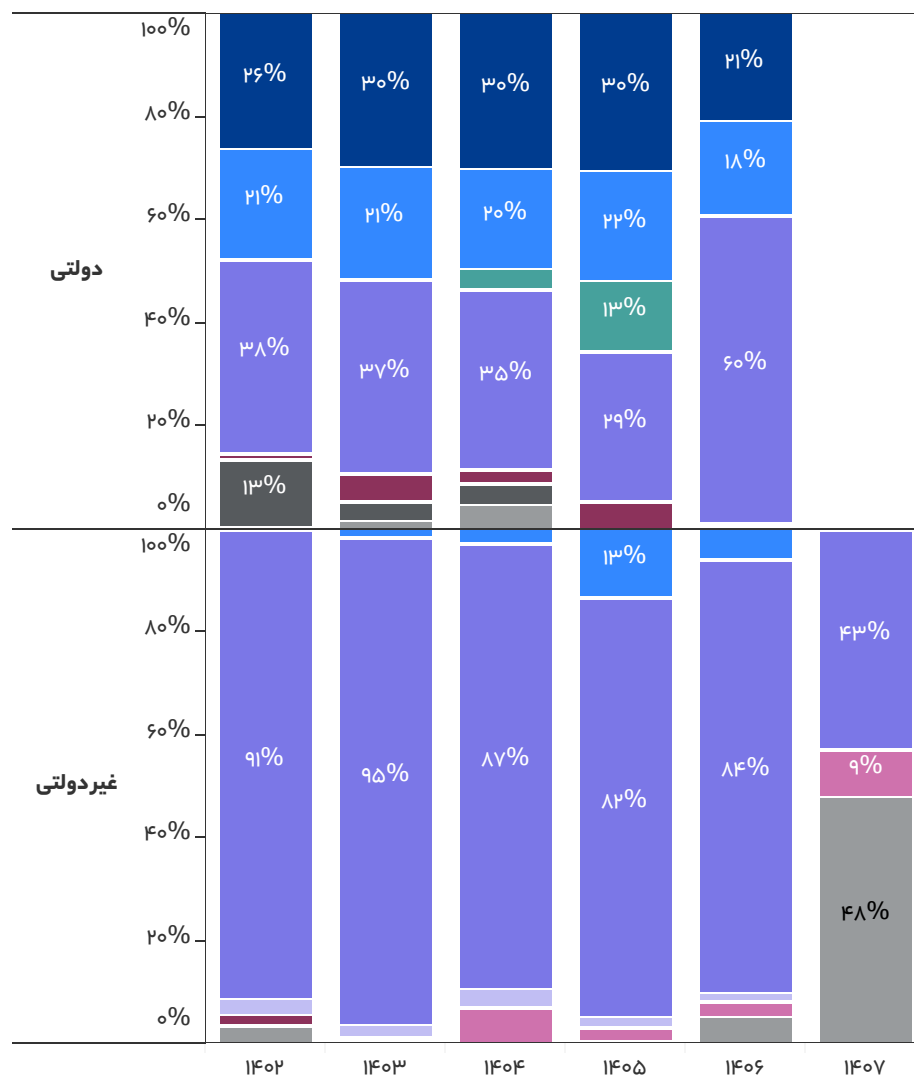
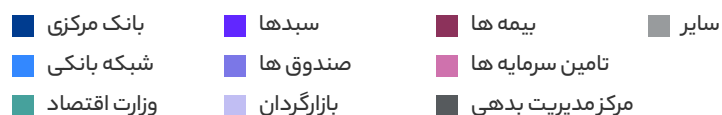
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

آخرین وضعیت مبلغ سرمایه‌گذاری دارندگان اوراق، ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان



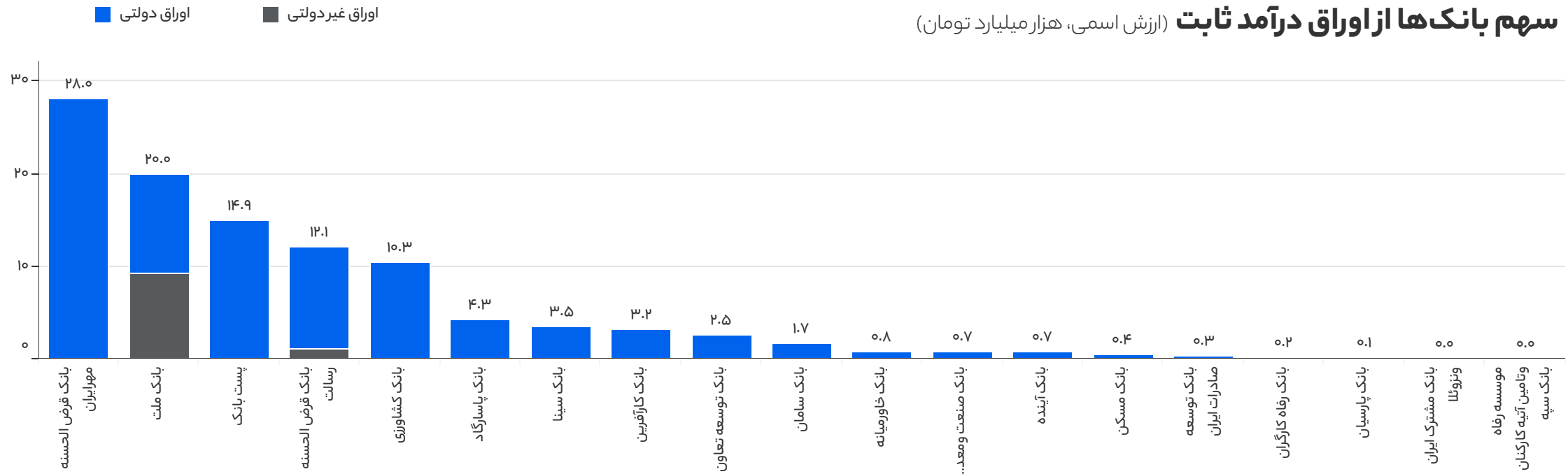
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

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

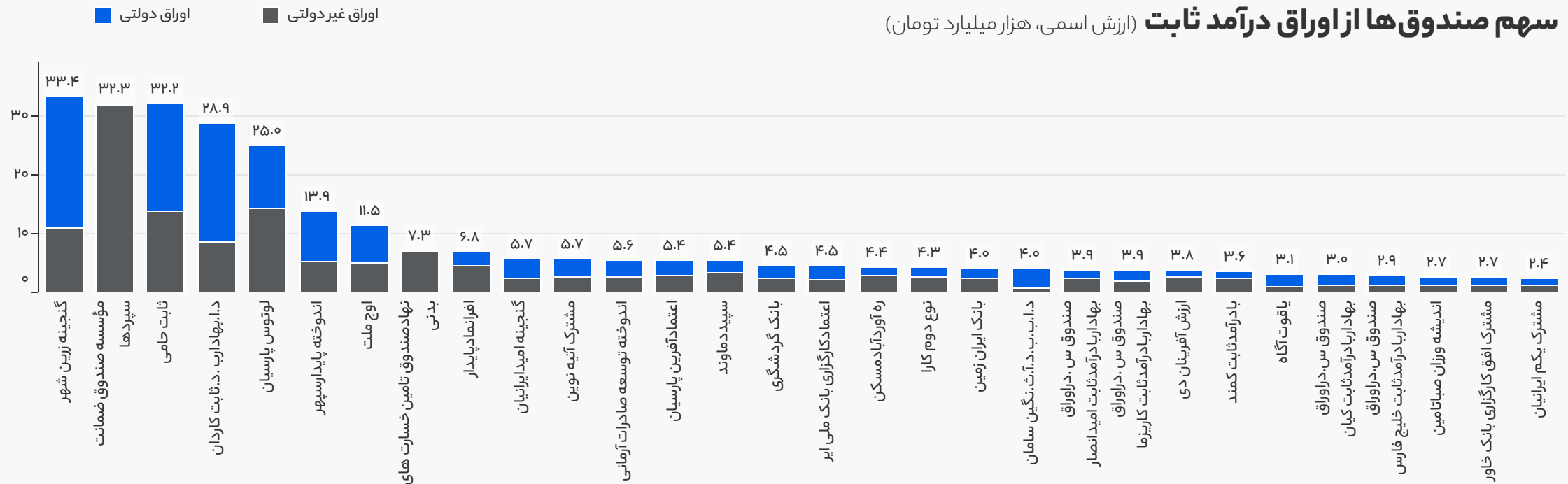


بازیگران کلیدی بازار بدهی

سهم بانک‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



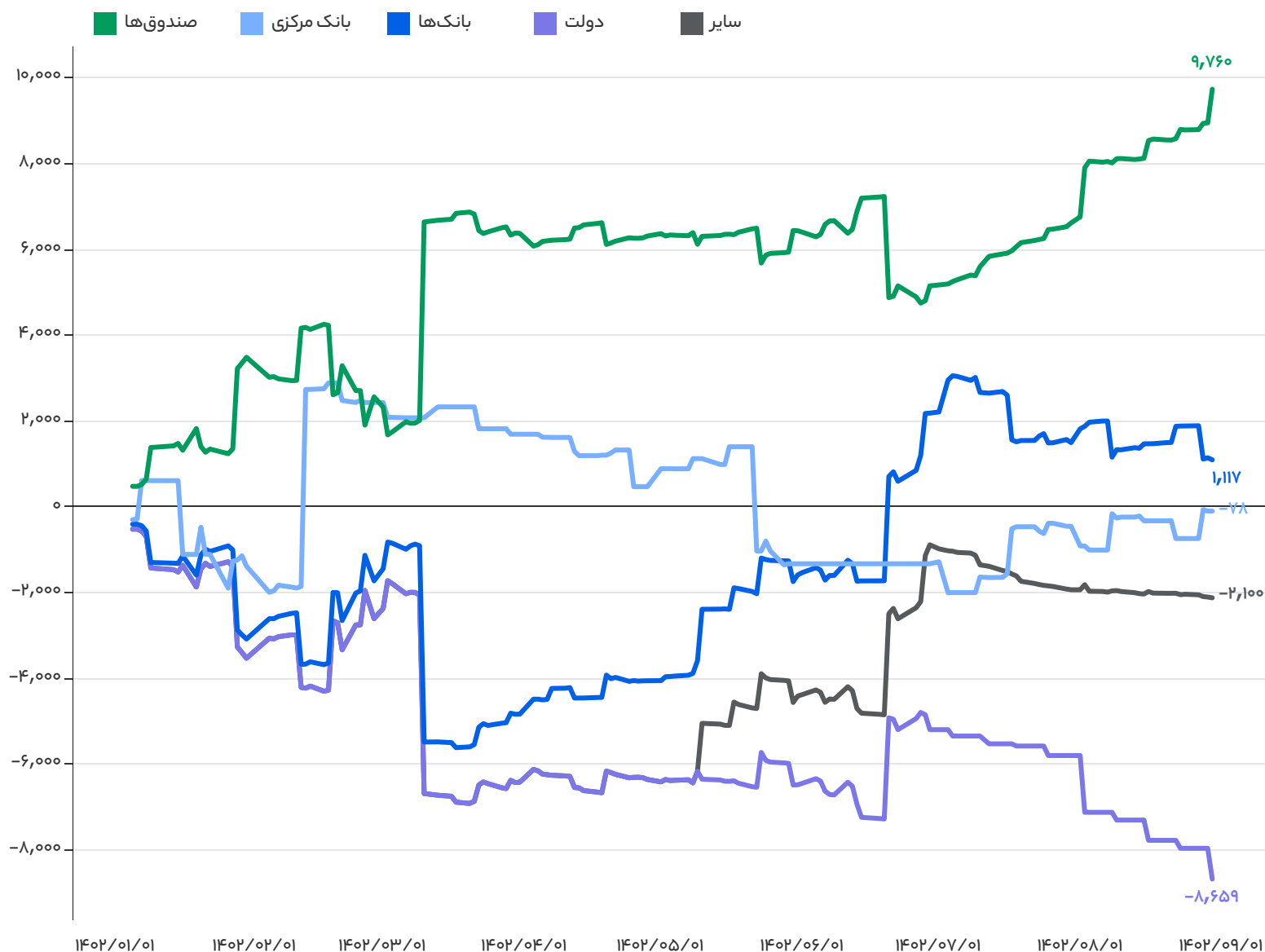
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

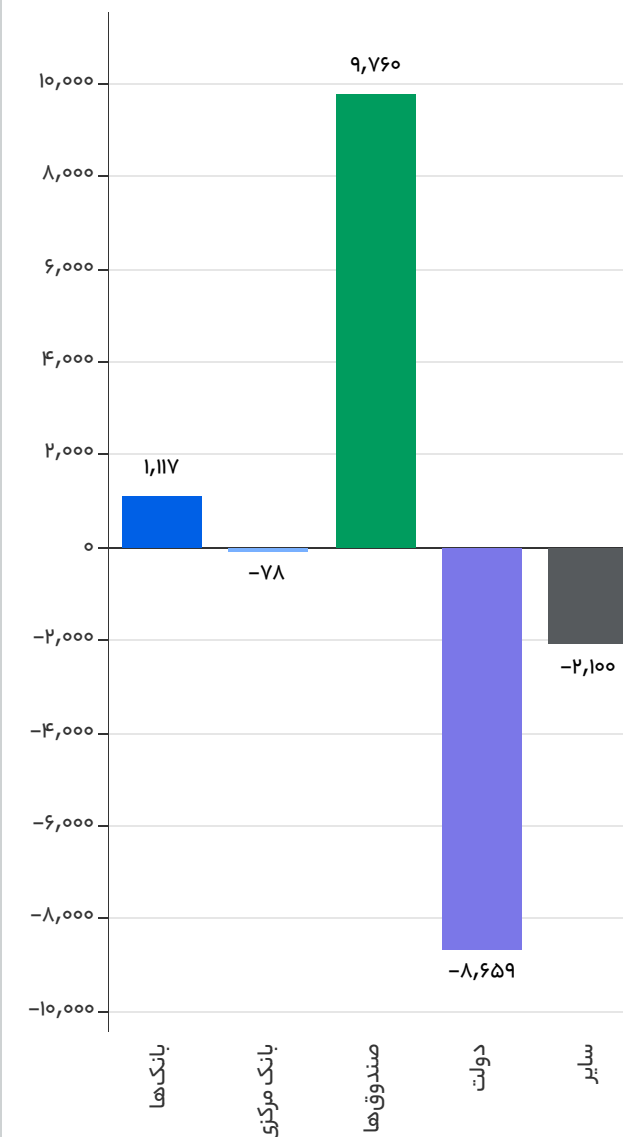
خالص معاملات اوراق

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



خلاصه معاملات اوراق

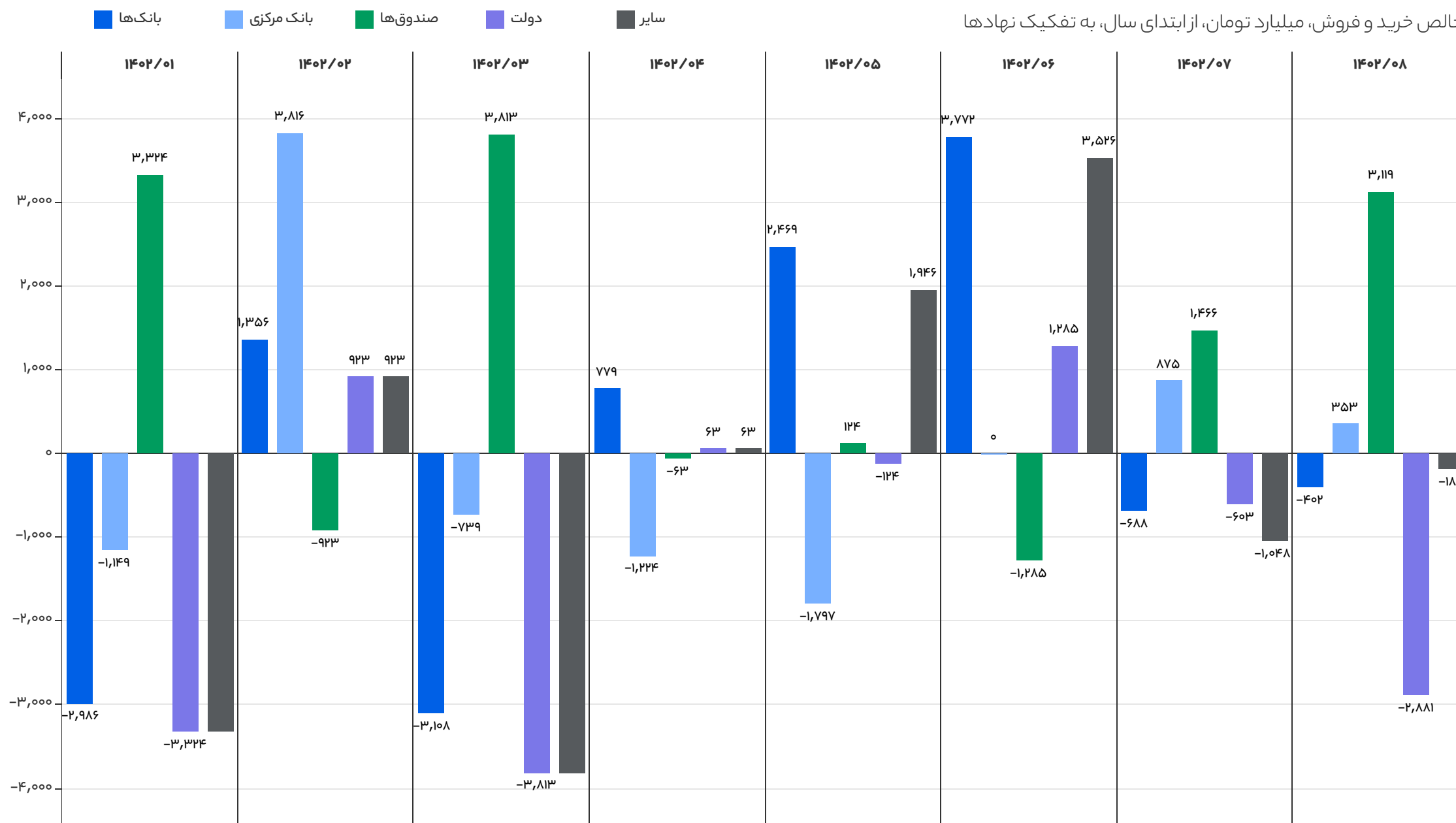
خالص خرید و فروش، میلیارد تومان، از ابتدای سال، به تفکیک نهادها



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

آمار معاملات اوراق به صورت ماهانه

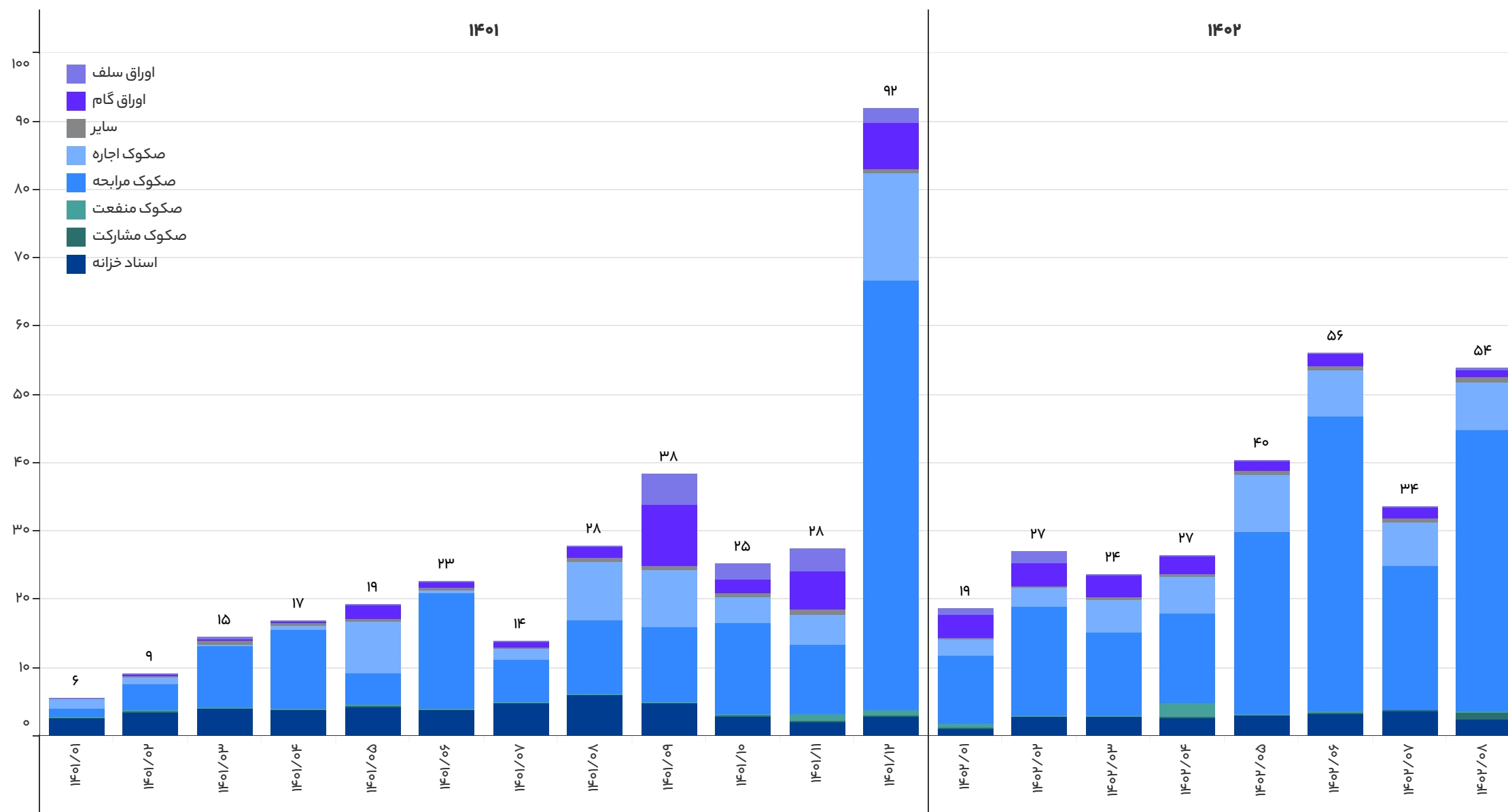
خالص خرید و فروش، میلیارد تومان، از ابتدای سال، به تفکیک نهادها



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق به صورت ماهانه

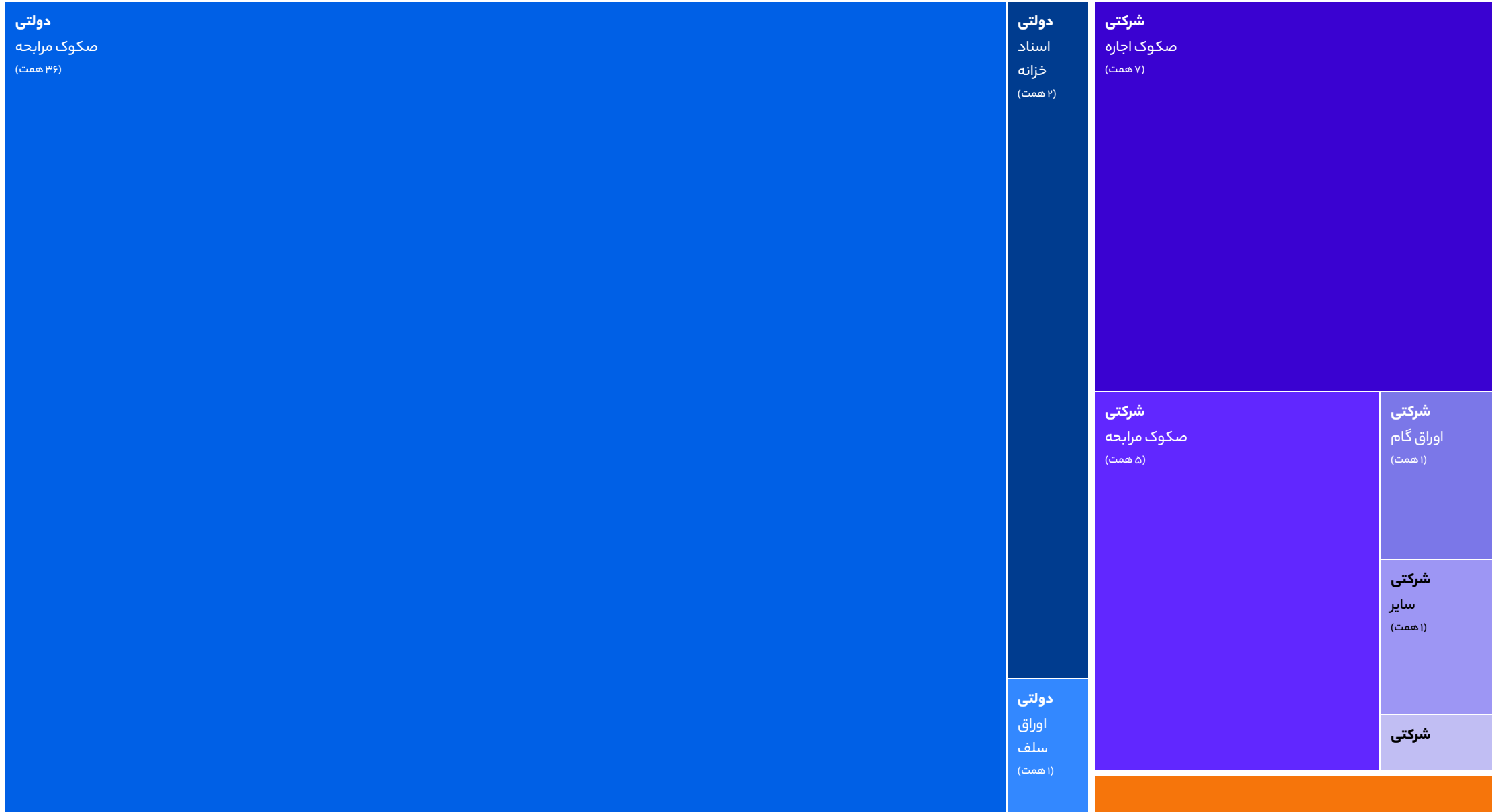
به تفکیک نوع اوراق، از ابتدای سال ۱۴۰۱، هزار میلیارد تومان



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق ماه گزارش (به تفکیک ناشر و نوع اوراق)

- شهرداری، صکوک مشارکت
- شرکتی، صکوک مرابحه
- شرکتی، صکوک اجاره
- شرکتی، صکوک منفعت
- دولتی، اسناد خزانه
- شرکتی، اوراق گام
- دولتی، اوراق سلف
- دولتی، صکوک مرابحه



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق شرکتی ماه گزارش

به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

صکوک منفعت صکوک اجاره صکوک مرابحه اوراق گام

نماد	نوع	تاریخ سررسید	ارزش
صفولا ۰۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۰۵/۱۵	۱,۷۱۸
مبین ۰۶۱	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۲/۲۷	۱,۲۶۰
گام ۰۲۰۸۱۳	اوراق گام	۱۴۰۲/۰۸/۱۳	۶۴۱
تابان ۰۴	صکوک اجاره	۱۴۰۳/۱۱/۲۶	۶۲۸
صقن ۰۱۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۲/۱۵	۵۹۹
صعبید ۰۲۰۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۲/۱۵	۵۵۲
صفولا ۰۱۱	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	۴۵۰
صاهن ۰۶۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۸/۱۵	۴۰۱
غدير ۰۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۱/۱۴	۳۸۰
پرنیا ۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۷/۱۸	۳۲۵
سگل ۰۵۹	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۹/۱۵	۳۰۰
صاما ۰۴۱۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۱۱/۱۵	۳۰۰
صاف فیلم ۰۵۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۱/۱۶	۳۰۰
صند ۰۴۱۲	صکوک اجاره	۱۴۰۴/۱۲/۱۵	۲۹۹
تابان ۱۱	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۰۶/۲۷	۲۹۸
غرب ۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۷/۰۴	۲۹۵
پرشیا ۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۸/۰۷	۲۷۹
مهان ۰۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۷/۱۵	۲۷۵
افق معادن ۰۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۷/۰۸/۱۷	۲۵۰
صنفت ۰۳۱۲	صکوک منفعت	۱۴۰۳/۱۲/۱۵	۲۲۱
صروز ۰۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۷/۰۵/۱۵	۲۰۷
مکران ۰۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۲/۲۴	۲۰۰
تابان ۰۹	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۸/۰۳	۲۰۰
صغدير ۰۸/۴۰	صکوک اجاره	۱۴۰۴/۰۸/۱۵	۱۵۶
تدبير ۰۴	صکوک اجاره	۱۴۰۴/۰۶/۰۶	۱۵۶

ارزش معاملات اوراق دولتی ماه گزارش

به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

اوراق سلف صکوک مرابحه اسناد خزانه

نماد	نوع	تاریخ سررسید	ارزش
اراد ۱۳۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۸/۰۴	۹,۱۱۲
اراد ۱۴۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۱۰/۰۹	۶,۵۷۴
اراد ۱۴۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۳/۰۲	۶,۱۵۷
اراد ۱۴۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۰/۰۹	۲,۴۱۷
اراد ۱۴۰	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۵/۰۴	۲,۲۷۳
اراد ۱۳۰	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۱/۱۰	۱,۳۹۰
اراد ۰۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۹/۱۵	۱,۰۴۸
اراد ۱۴۴	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	۹۹۳
اراد ۲۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۲/۱۲/۱۵	۹۸۴
اراد ۱۳۸	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۰/۰۴	۸۳۲
اراد ۱۳۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۱۱/۱۰	۶۹۰
عشادگان	اوراق سلف	۱۴۰۳/۰۸/۱۵	۵۰۲
اراد ۹۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۲/۰۸/۲۵	۴۹۹
اراد ۱۲۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۲/۲۳	۴۹۷
خزا ۱۰۱	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۳/۲۶	۴۴۱
اراد ۱۲۸	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۲/۲۴	۴۳۵
خزا ۱۰۴	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۹/۱۷	۴۲۳
خزا ۱۰۷	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۷/۱۴	۳۷۴
اراد ۰۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۹/۱۵	۳۵۸
خزا ۱۰۶	اسناد خزانه	۱۴۰۳/۰۸/۱۴	۳۱۳
اراد ۷۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۱/۱۵	۲۹۵
اراد ۱۰۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۷/۲۴	۲۴۱
اراد ۵۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۲/۰۹/۱۵	۲۲۲
اراد ۲۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۲/۱۲/۱۵	۲۰۹
اراد ۱۲۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۶/۲۳	۲۰۰

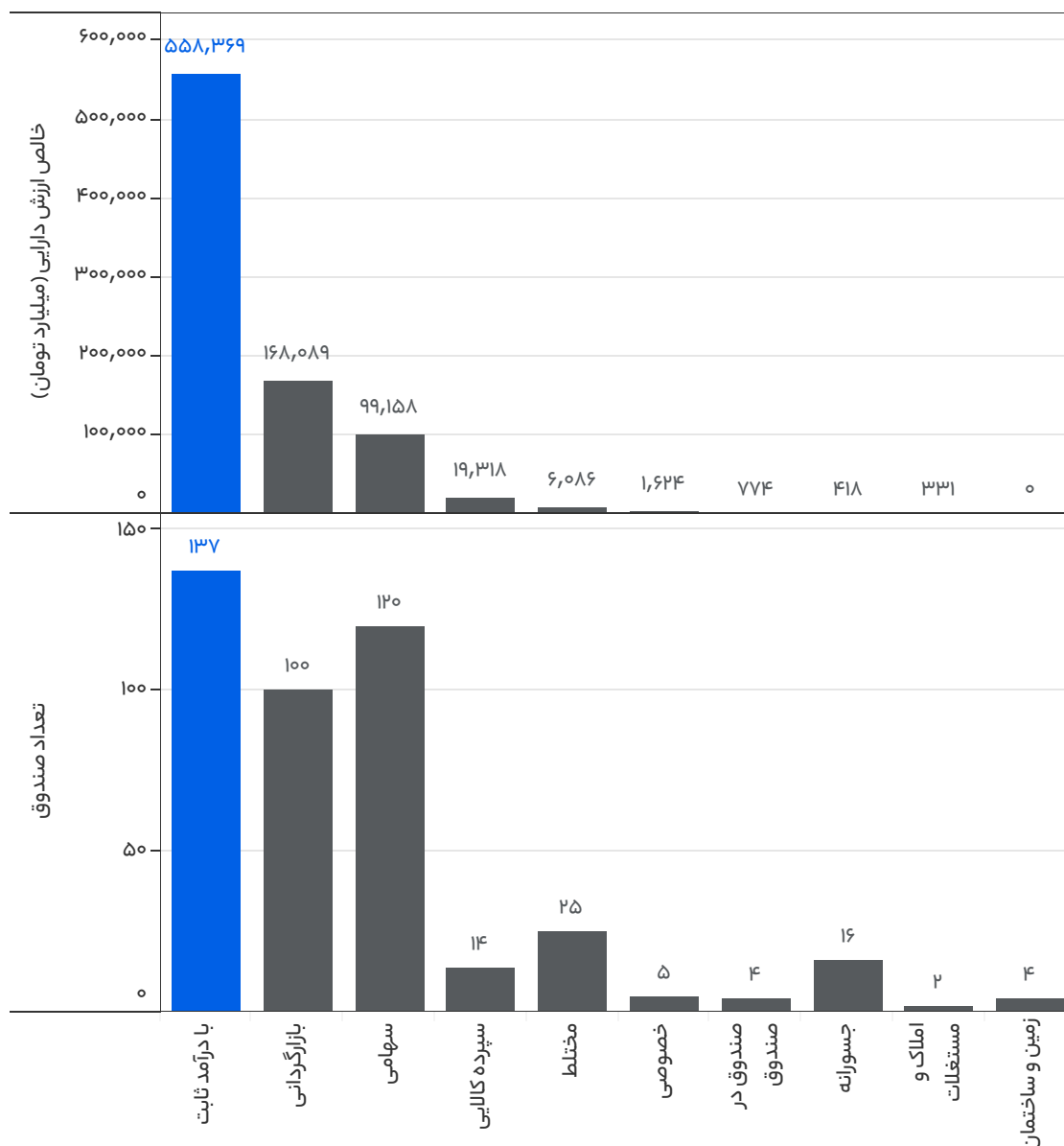
نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

نمای کلی

تعداد و خالص ارزش دارایی‌های صندوق‌ها، به تفکیک نوع صندوق

ارزش و تعداد صندوق‌های سرمایه‌گذاری

به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	تعداد صندوق	خالص ارزش دارایی‌ها (همت)
سرمایه‌گذاری سنتی	با درآمد ثابت	۱۳۷	۵۵۸.۴
	سهامی	۱۲۰	۹۹.۲
	مختلط	۲۵	۶.۱
	صندوق در صندوق	۴	۰.۸
سرمایه‌گذاری خصوصی	خصوصی	۵	۱.۶
	جسورانه	۱۶	۰.۴
سرمایه‌گذاری جایگزین	پروژه‌ای	۱	۵۵۸.۴
	بازارگردانی	۱۰۰	۱۶۸.۱
	سپرده کالایی	۱۴	۱۹.۳
	املاک و مستغلات	۲	۰.۳
	زمین و ساختمان	۴	۰.۰
جمع کل		۴۲۸	۱,۴۱۲.۵

نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

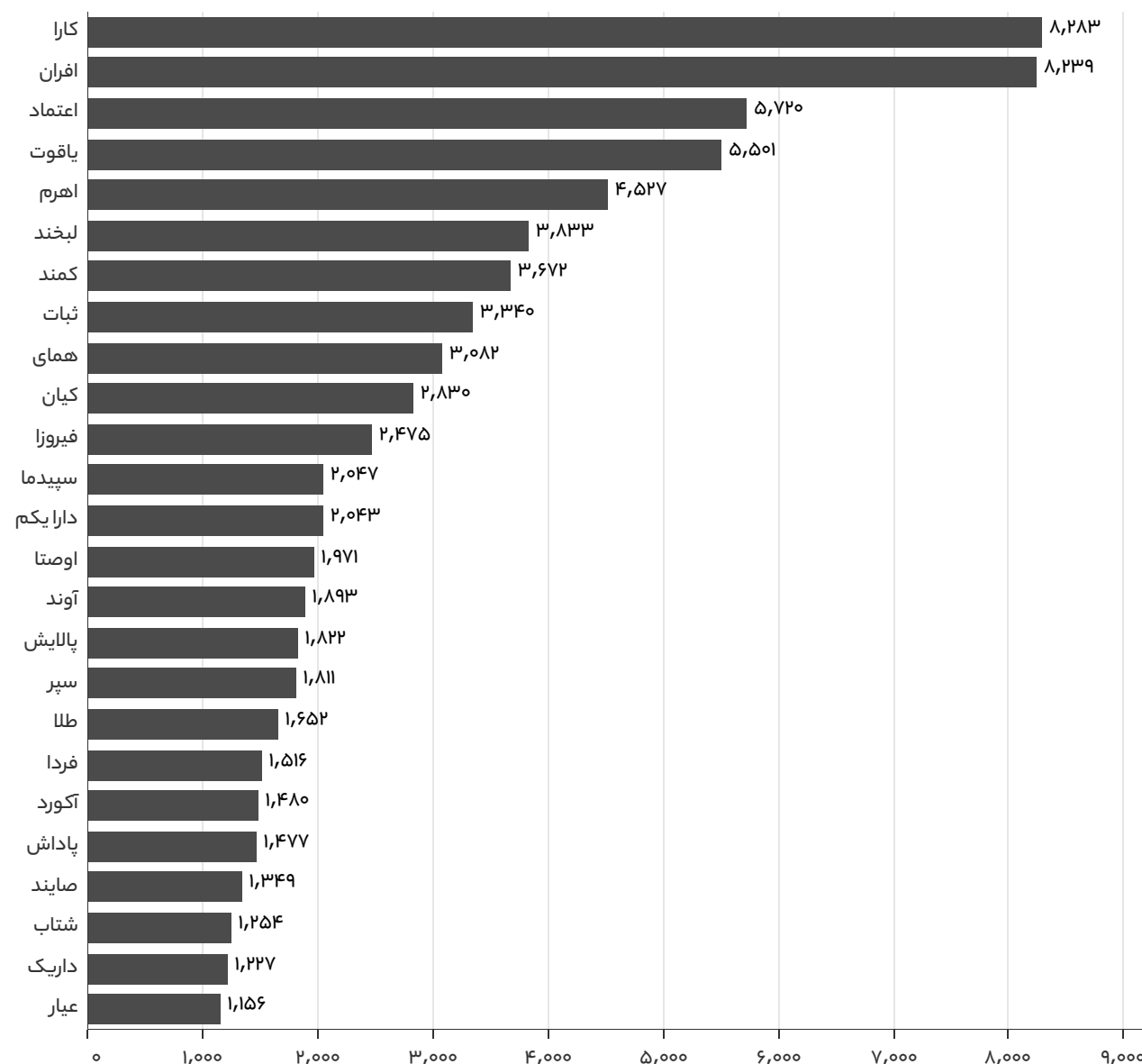
صندوق‌های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
صدور و ابطال	بازارگردانی	اختصاصی بازارگردانی حامی نوآفرین
صدور و ابطال	بازارگردانی	اختصاصی بازارگردانی هدف مسکن آتی
قابل معامله	سهامی	امین نهایت نگر
صدور و ابطال	مختلط	تضمین اصل مبلغ سرمایه خلیج فارس
صدور و ابطال	درآمد ثابت	ساحل آرام فیروزه

پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری

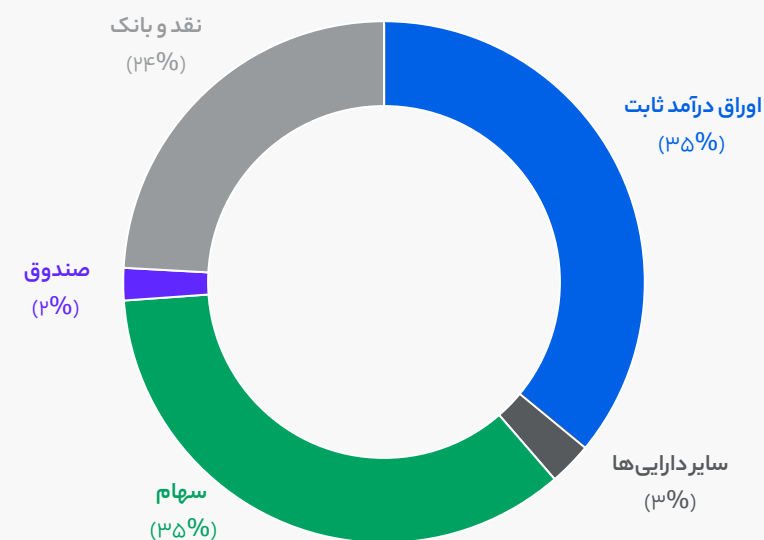
مجموع ارزش معاملات در ماه گذشته، میلیارد تومان



تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی صندوق‌ها

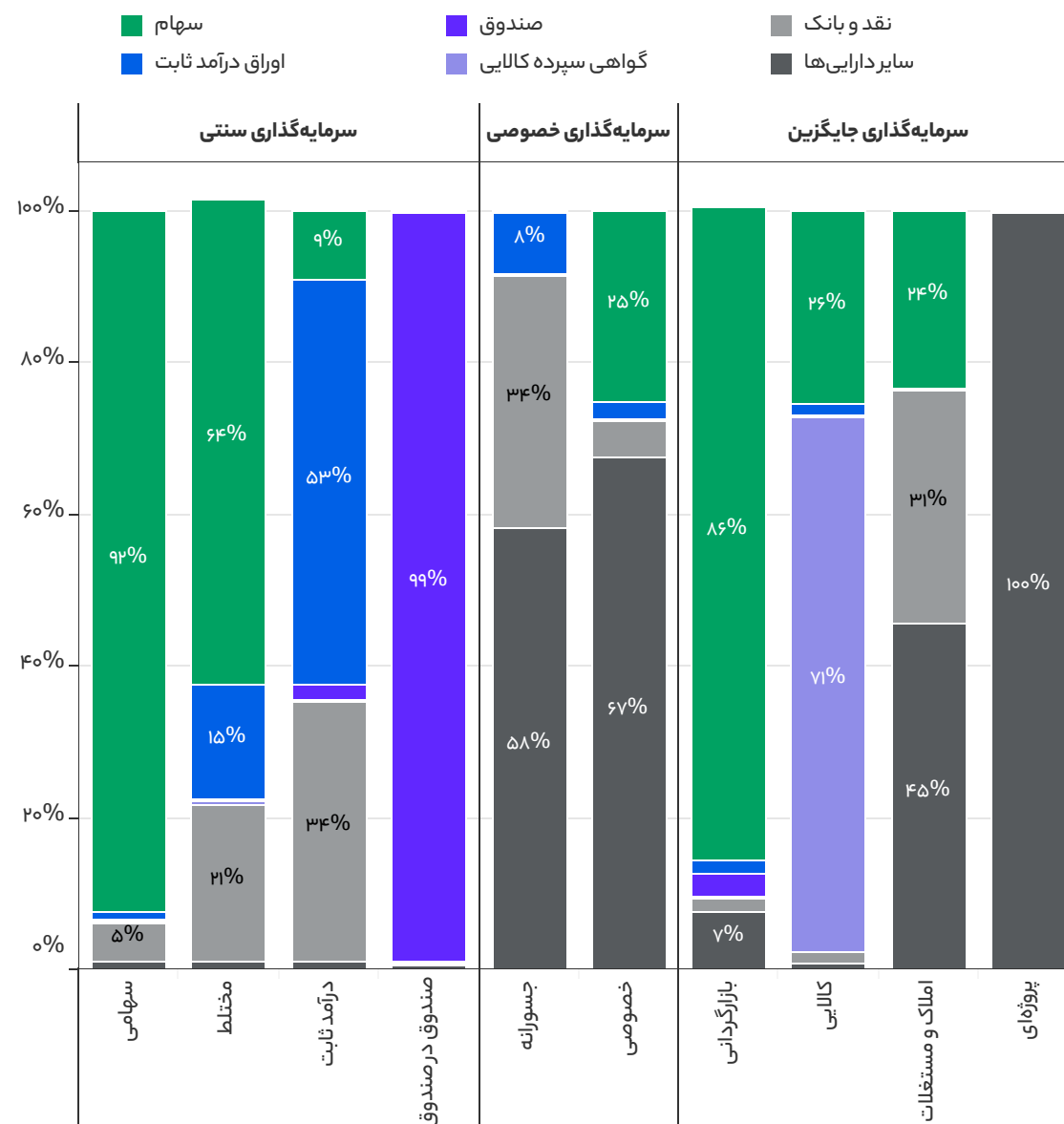
به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهم	درآمد ثابت	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	سهامی	۹۲%	۱%	-	۵%	۱%
	مختلط	۶۴%	۱۵%	-	۲۱%	۱%
	درآمد ثابت	۹%	۵۳%	۲%	۳۴%	۱%
	صندوق در صندوق	-	-	۹۹%	۱%	-
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۸%	-	۳۴%	۵۸%
	خصوصی	۲۵%	۲%	-	۵%	۶۷%
سرمایه‌گذاری جایگزین	کالایی	۲۶%	۱%	-	۲%	۱%
	بازارگردانی	۸۶%	۲%	۳%	۲%	۷%
	املاک و مستغلات	۲۴%	-	-	۳۱%	۴۵%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۵%	۳۵%	۲%	۲۴%	۳%

ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق

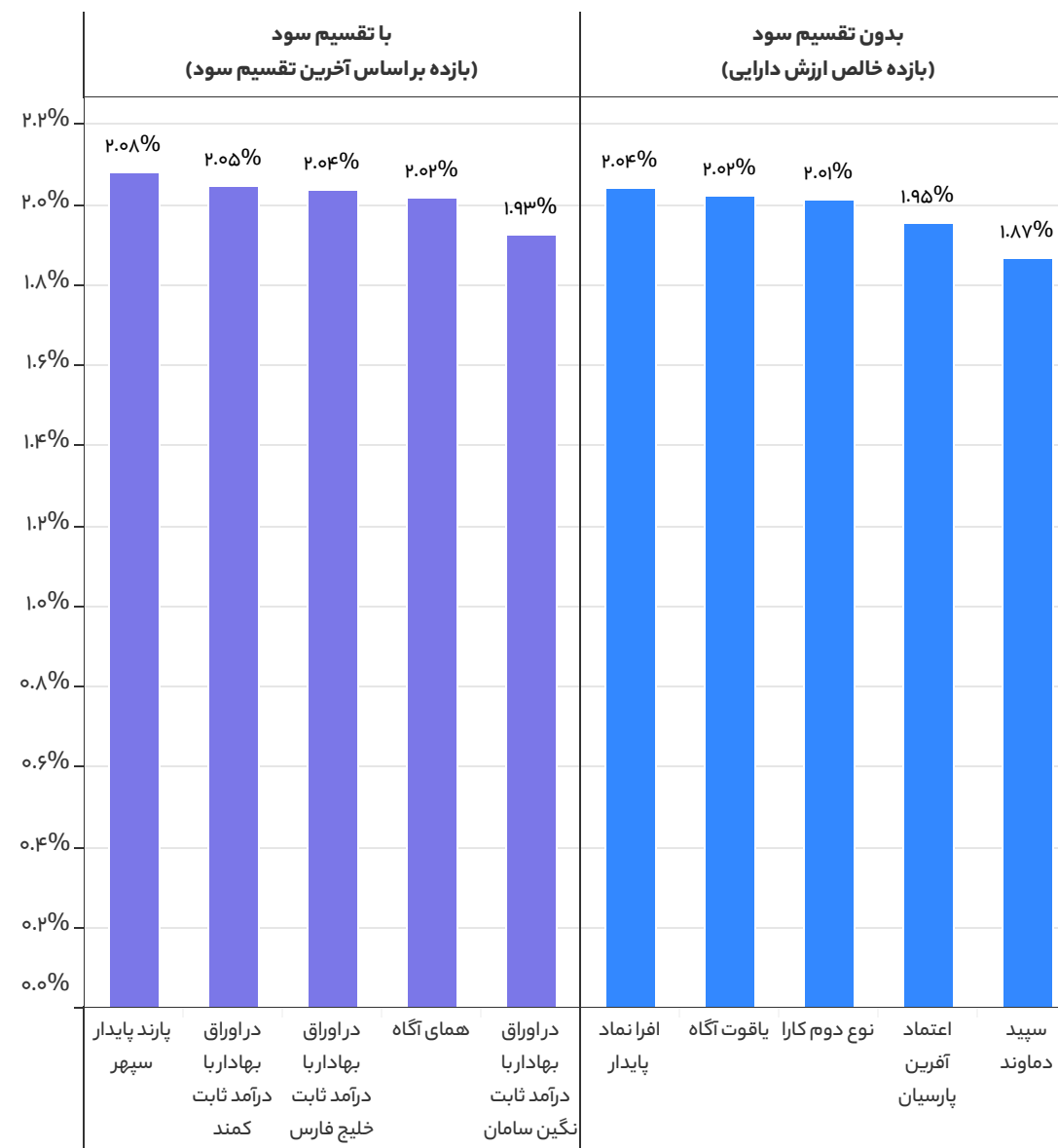


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

بازدهی ماه گذشته بزرگترین صندوق‌های درآمد ثابت

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

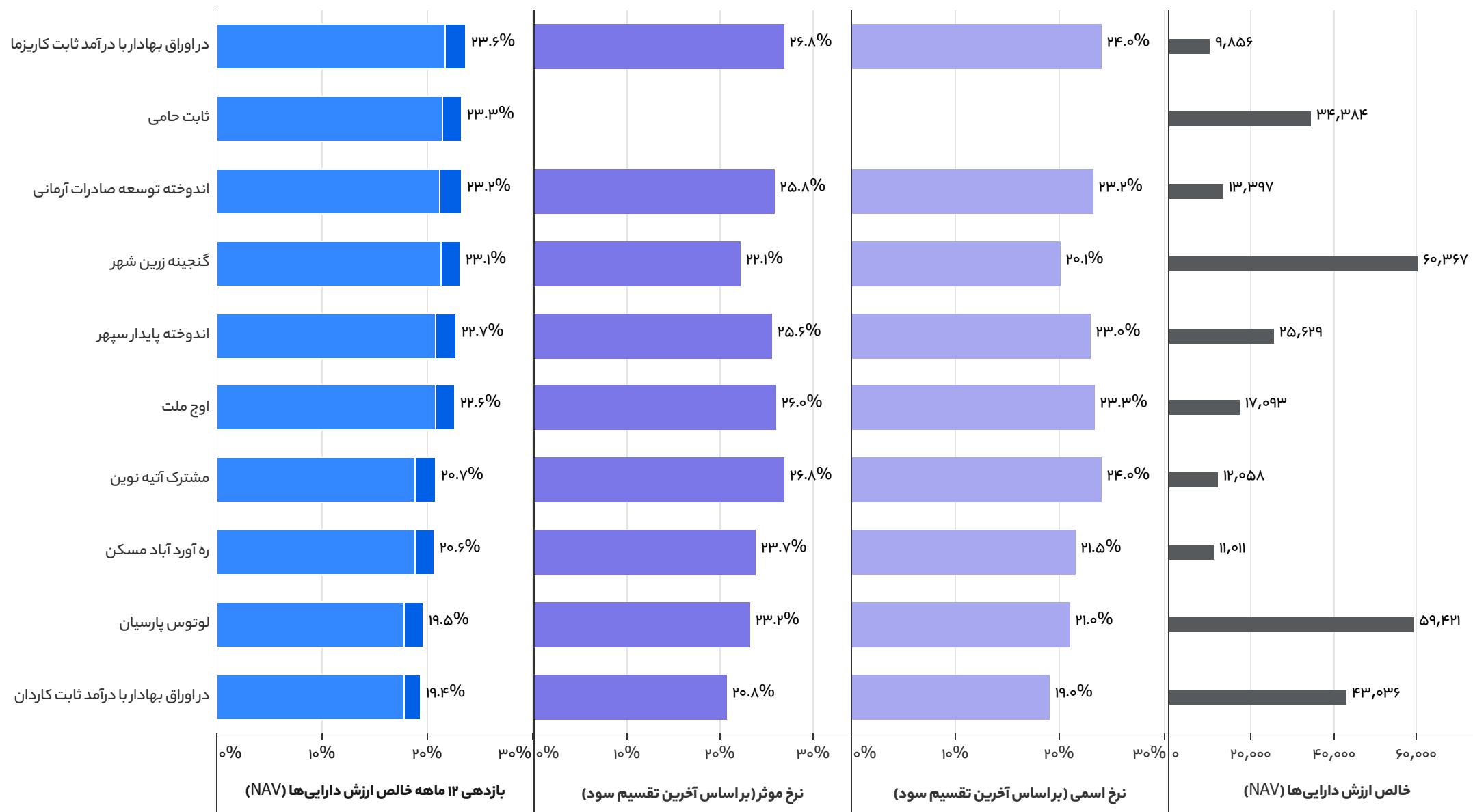
نوع صندوق	نام صندوق	خالص ارزش دارایی‌ها (میلیارد ..)	بازدهی ۱۲ ماهه NAV	بازدهی ۳ ماهه NAV	بازدهی ۶ ماهه NAV	بازدهی ۱ ماهه NAV	بازده ساده تقسیم سود	بازده موثر تقسیم سود
با تقسیم سود	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	۹,۵۴۶	۲۳.۷%	۶.۰%	۱۱.۹%	۲.۰۰%	۲۴.۶%	۲۷.۵%
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۷,۶۵۷	۲۳.۷%	۶.۰%	۱۲.۰%	۲.۰۱%	۲۴.۵%	۲۷.۴%
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت نگین سامان	۴,۹۳۸	۲۲.۹%	۵.۸%	۱۱.۶%	۱.۹۰%	۲۳.۱%	۲۵.۷%
	همای آگاه	۳,۵۹۱	۲۲.۸%	۶.۰%	۱۱.۶%	۲.۰۰%	۲۴.۲%	۲۷.۱%
	پارند پایدار سپهر	۲,۸۲۶	۲۳.۹%	۶.۴%	۸.۳%	۲.۳۷%	۲۴.۹%	۲۸.۰%
بدون تقسیم سود	افرا نماد پایدار	۱۵,۱۱۱	۲۷.۳%	۶.۳%	۱۳.۱%	۲.۰۴%		
	نوع دوم کارا	۱۴,۱۹۰	۲۶.۸%	۶.۲%	۱۳.۰%	۲.۰۱%		
	سپید دماوند	۱۳,۹۳۷	۲۴.۲%	۵.۷%	۱۱.۹%	۱.۸۷%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۱۳,۳۵۲	۲۵.۵%	۶.۰%	۱۲.۵%	۱.۹۵%		
	یاقوت آگاه	۶,۵۸۲	۲۶.۷%	۶.۲%	۱۲.۸%	۲.۰۲%		



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

