

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



آذر ماه ۱۴۰۲



CHARISMA MARKET INSIGHT

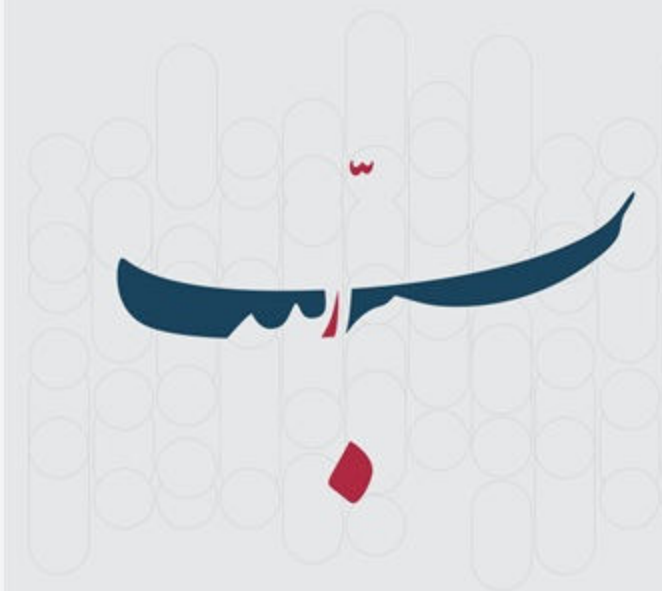
معرفی گزارش:

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.



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

فصل دوم	۱۳
سهام	
بررسی بلندمدت بازار سهام	۱۴
ارزندگی بازار سهام	۱۷

فصل سوم	۲۰
درآمد ثابت	
مروری بر بازار درآمد ثابت	۲۱
دید کلی بازار بدهی	۲۲
انتشار و تسویه اوراق	۲۴
تامین مالی دولت	۲۶
بازیگران کلیدی بازار بدهی	۲۷
معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی	۳۱
آمار معاملات اوراق درآمد ثابت	۳۳
بازدهی شاخص صکوک	۳۶
نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۳۷
معاملات صندوق‌ها درآمد ثابت	۳۹
تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۴۱
بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)	۴۲
بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (صدور و ابطال)	۴۳

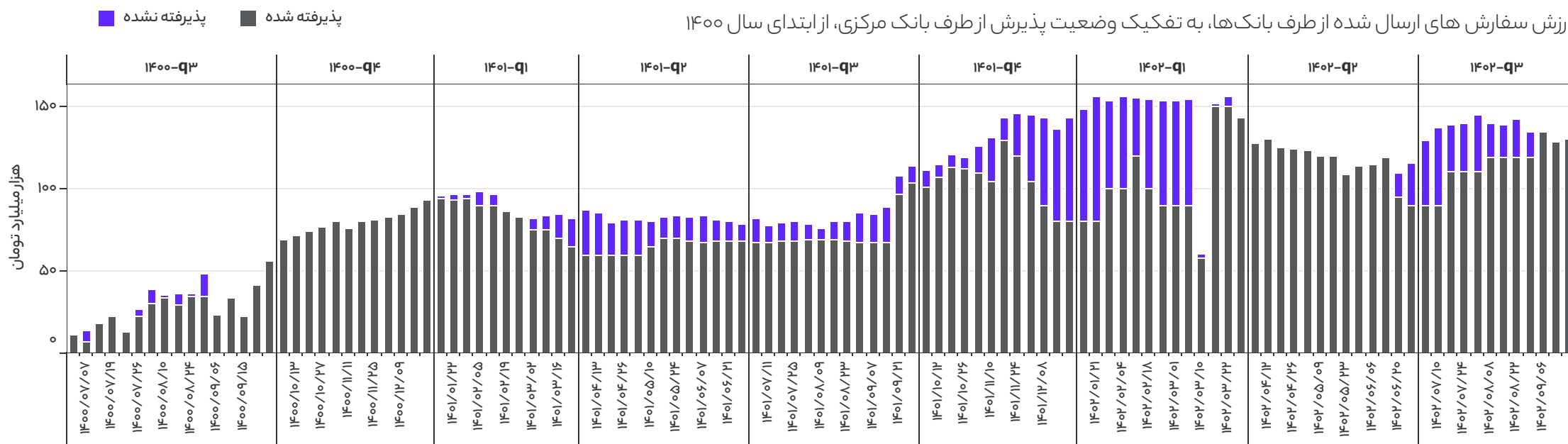


ECONOMY

سیاست‌های پولی

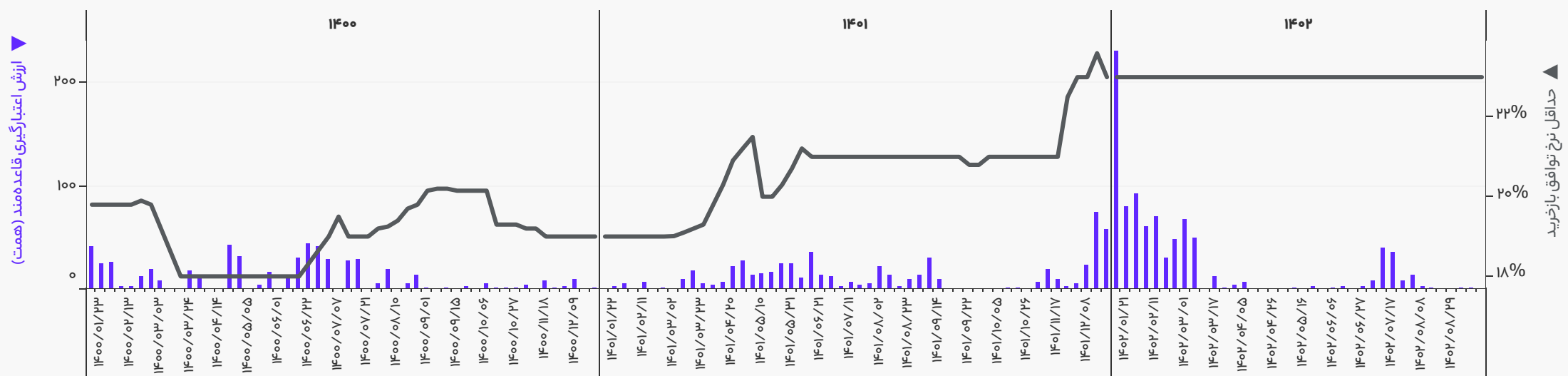
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

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

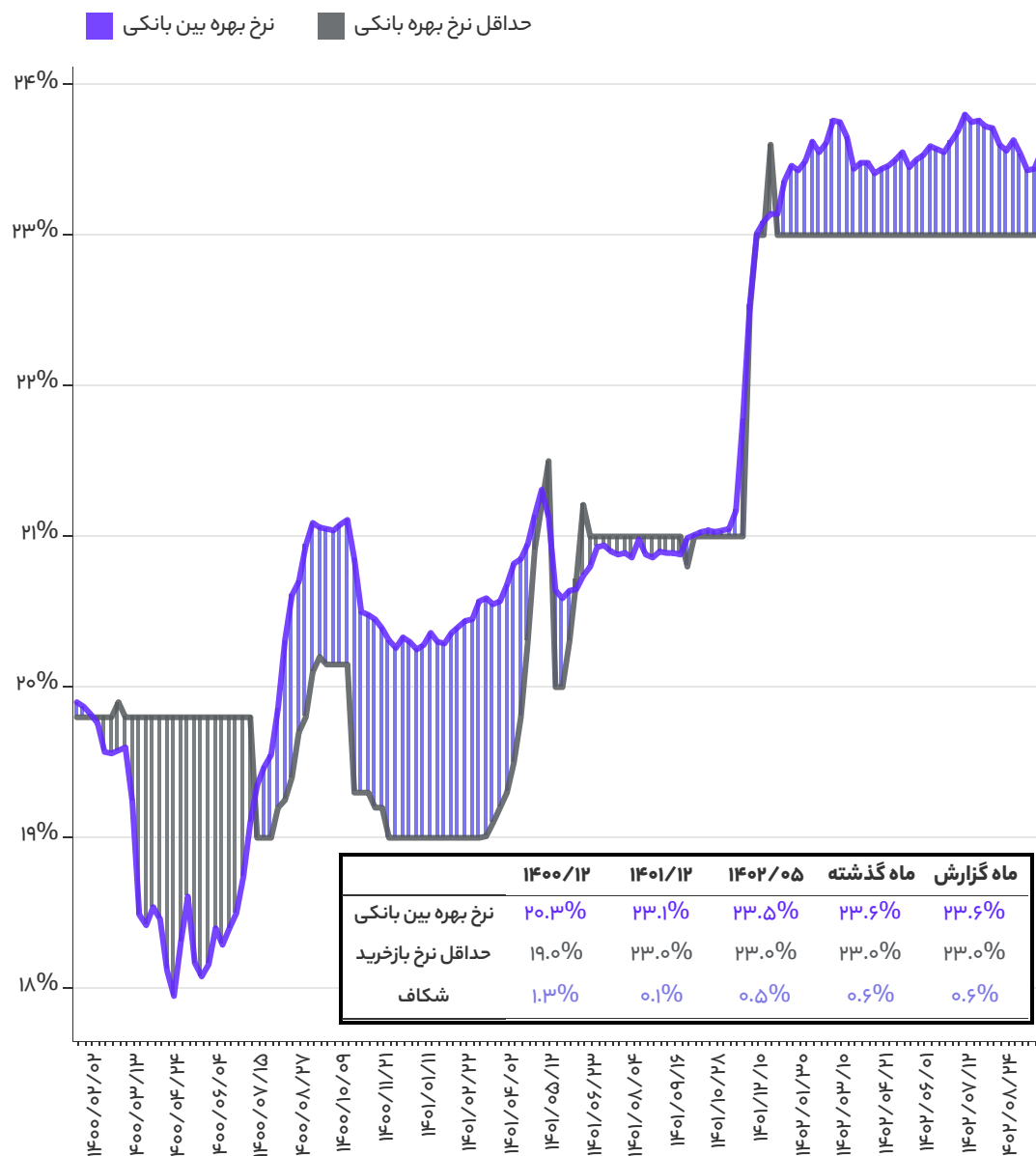
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* 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

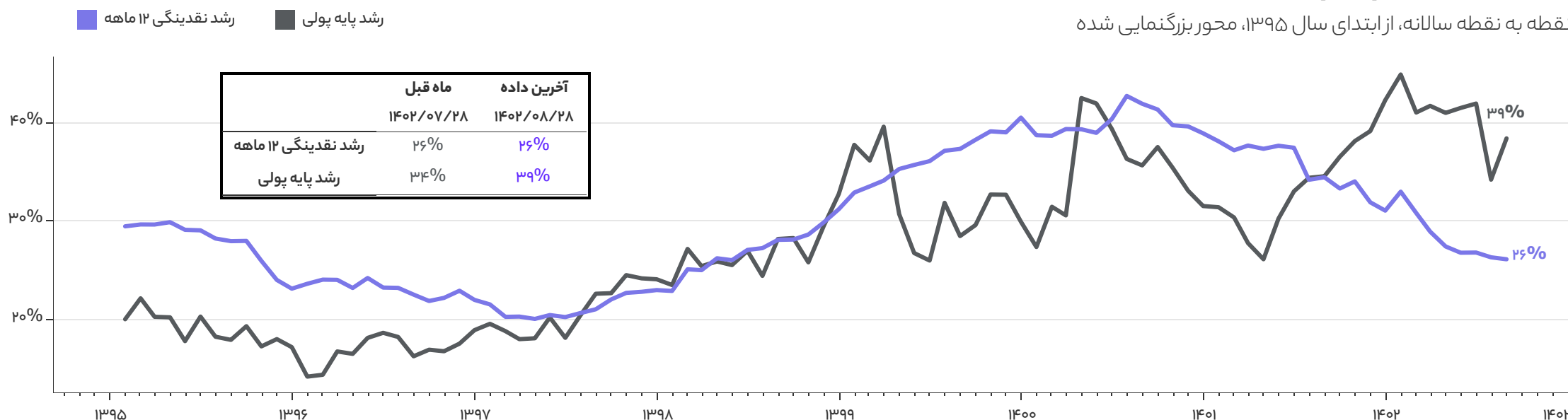
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

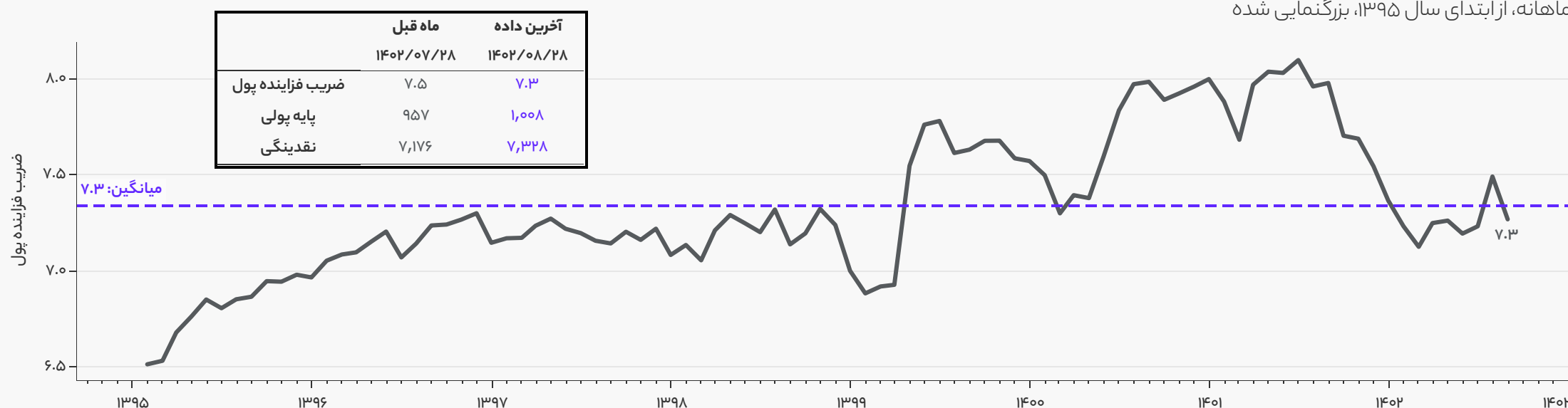
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول**

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

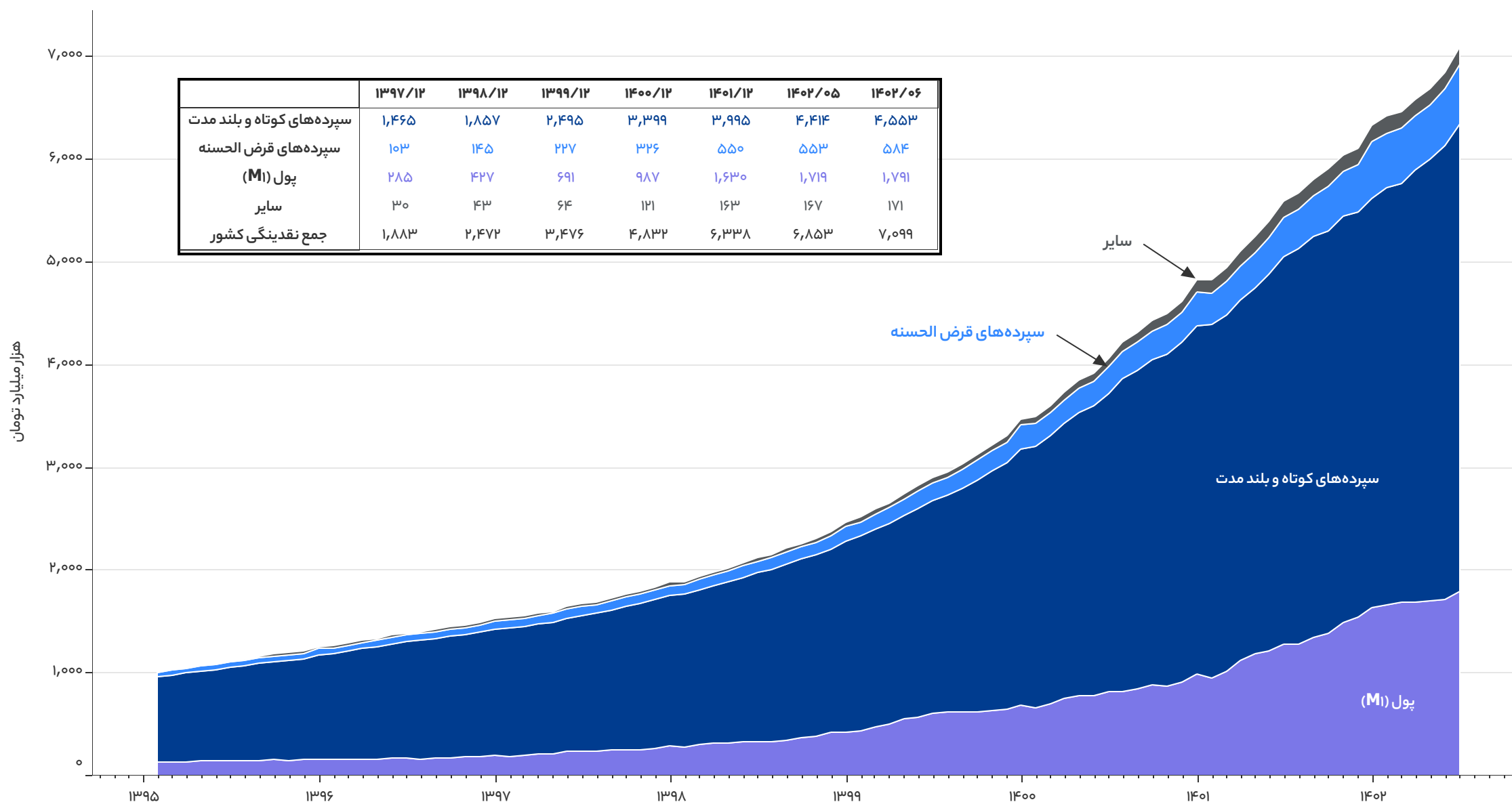


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.
** پایه پولی برح ۵ براساس اخبار رسمی محاسبه شده و فاصله تا آخرین آمار رسمی نیز تخمین زده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

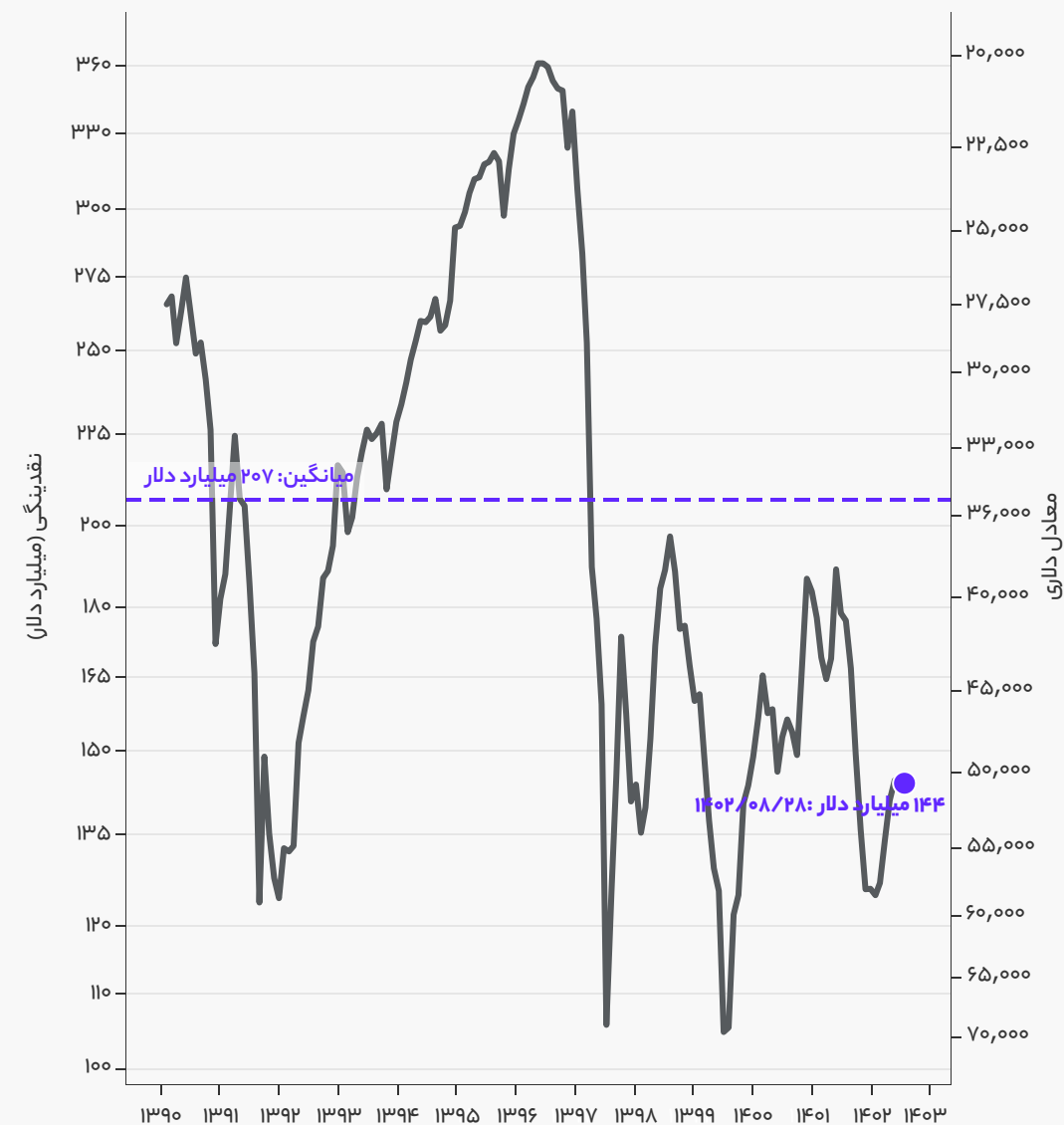
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، هزار میلیارد تومان



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 (M۱) به نقدینگی در ایران

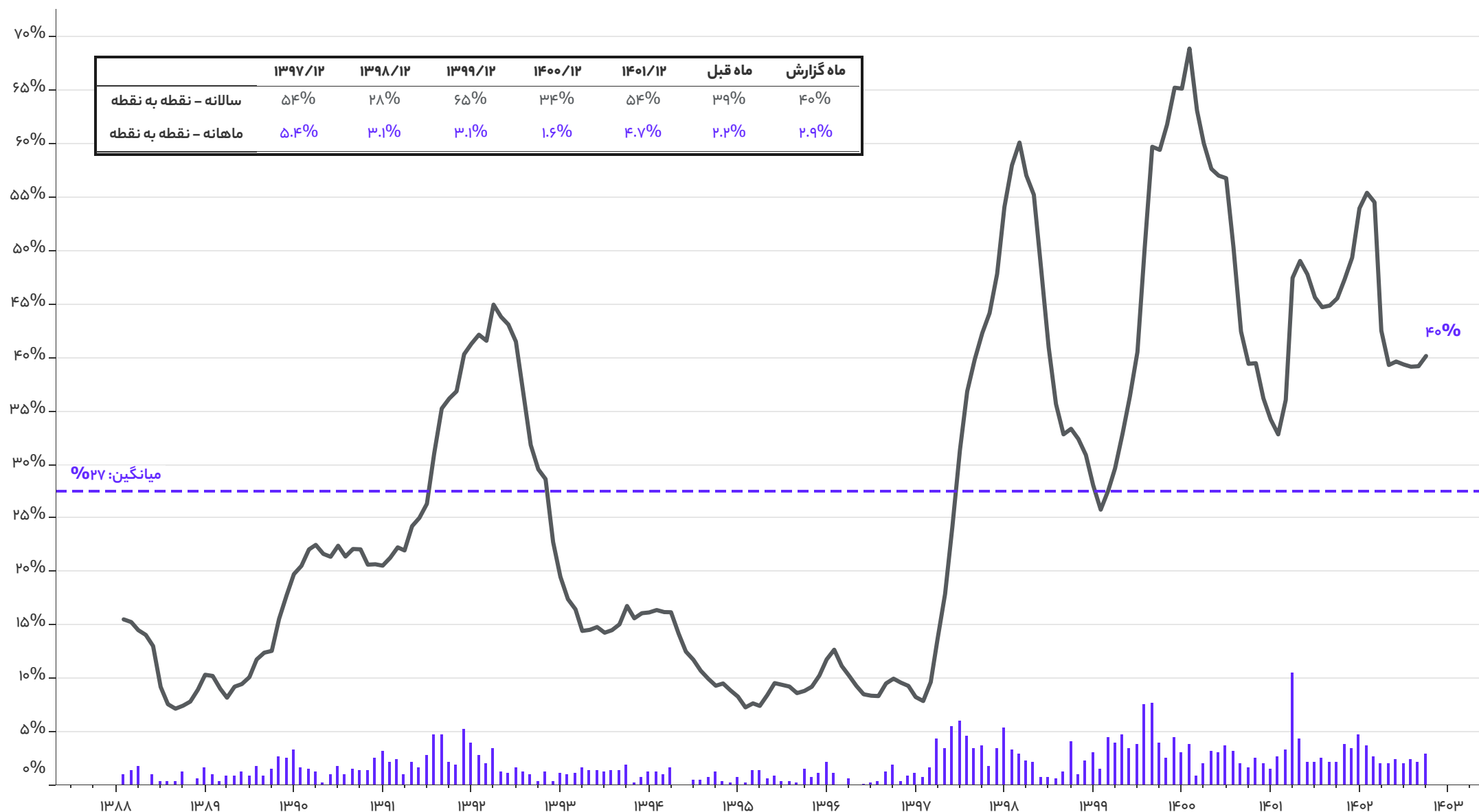


* قیمت دلاری لازم برای رسیدن به سطح نقدینگی دلاری مورد انتظار.
** نقدینگی چند ماه گذشته با استفاده از آمار ارایه شده در اخبار توسط بانک مرکزی محاسبه گردیده است.

تورم و شاخص CPI

وضعیت تورم*

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

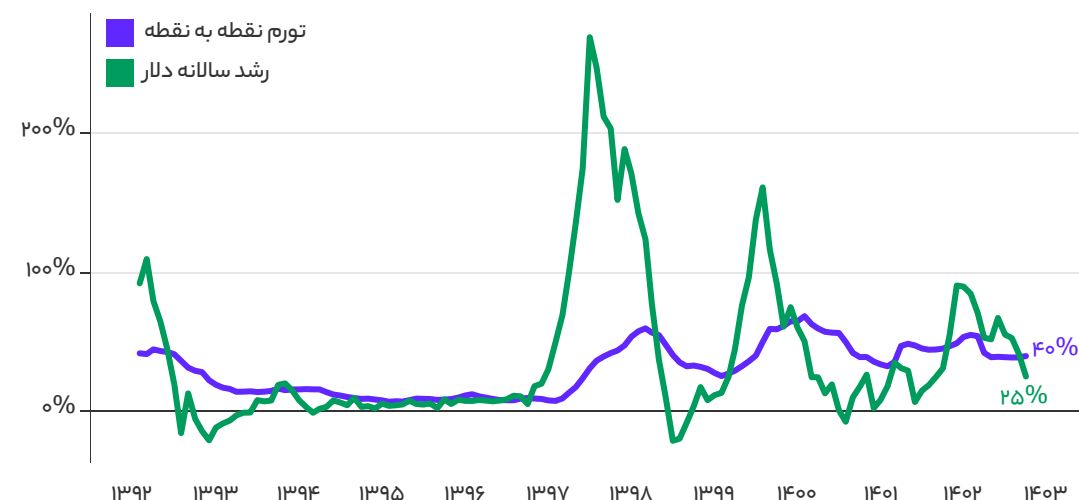


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

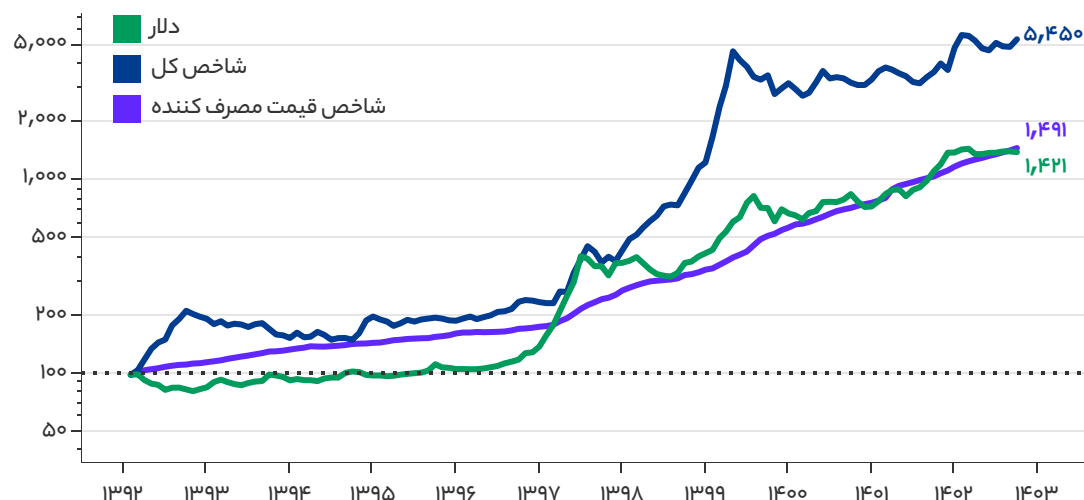
تورم و رشد دلار

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

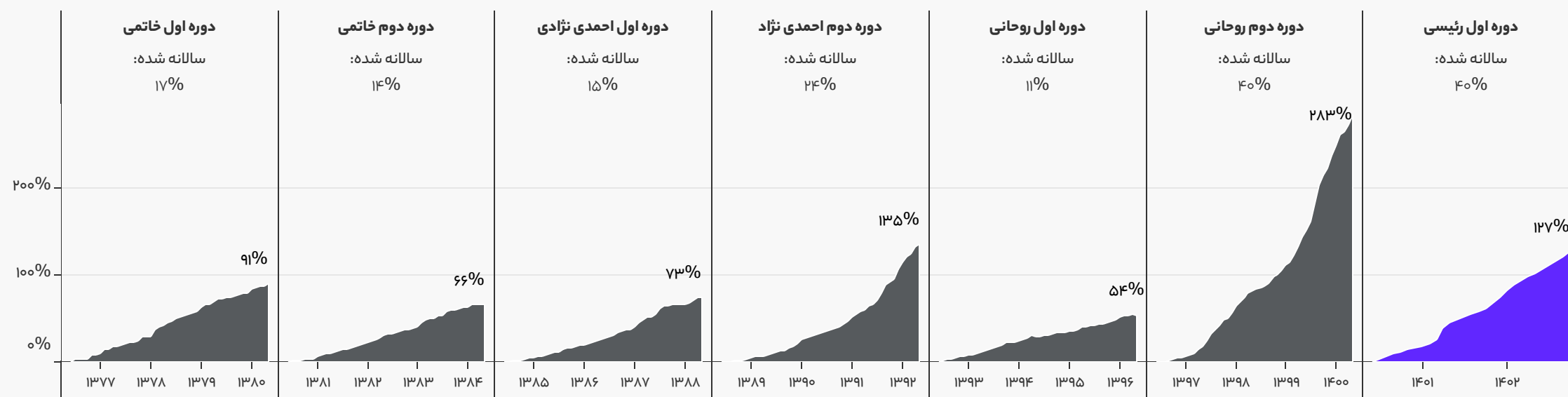


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

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

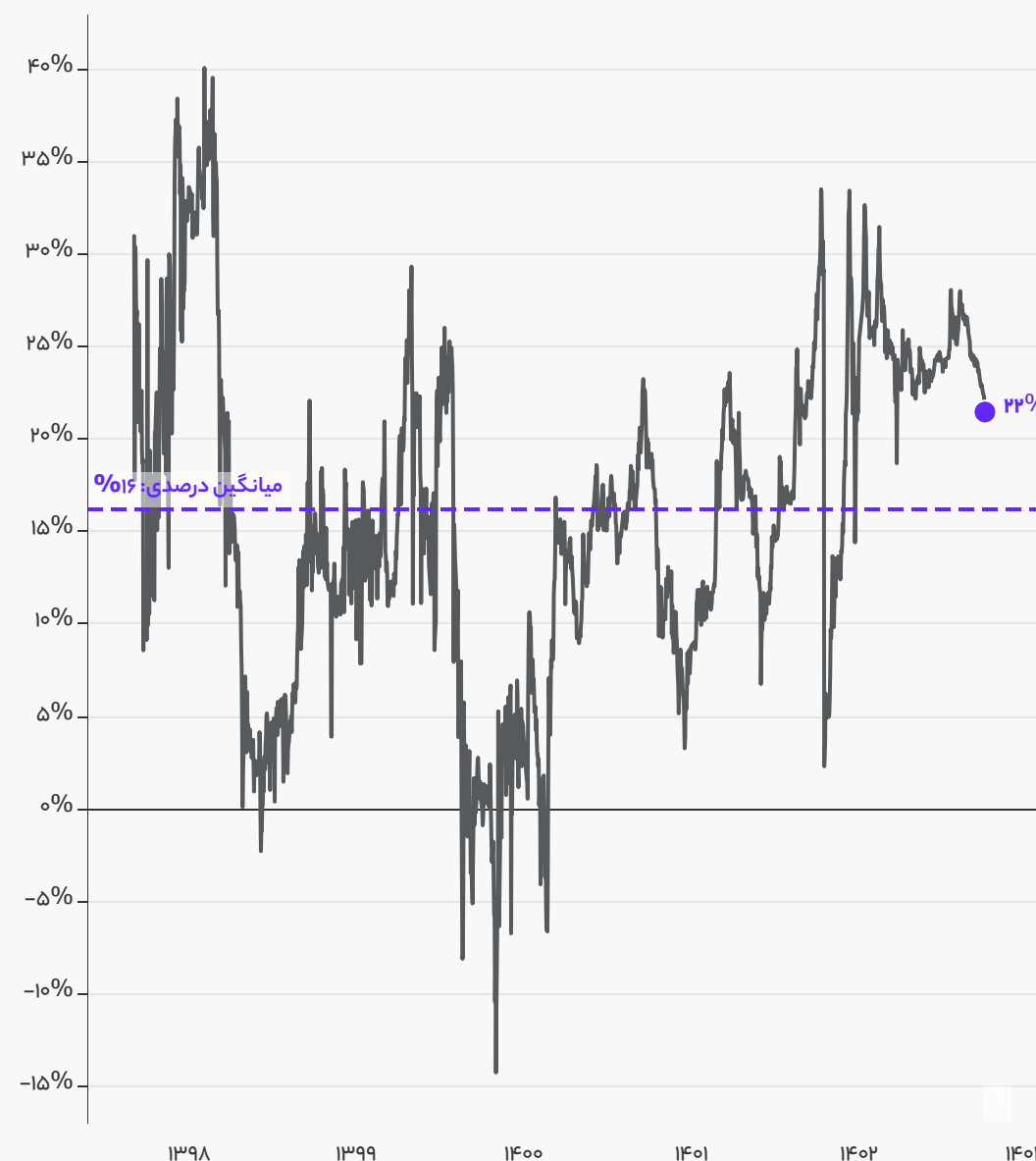


* دلار سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

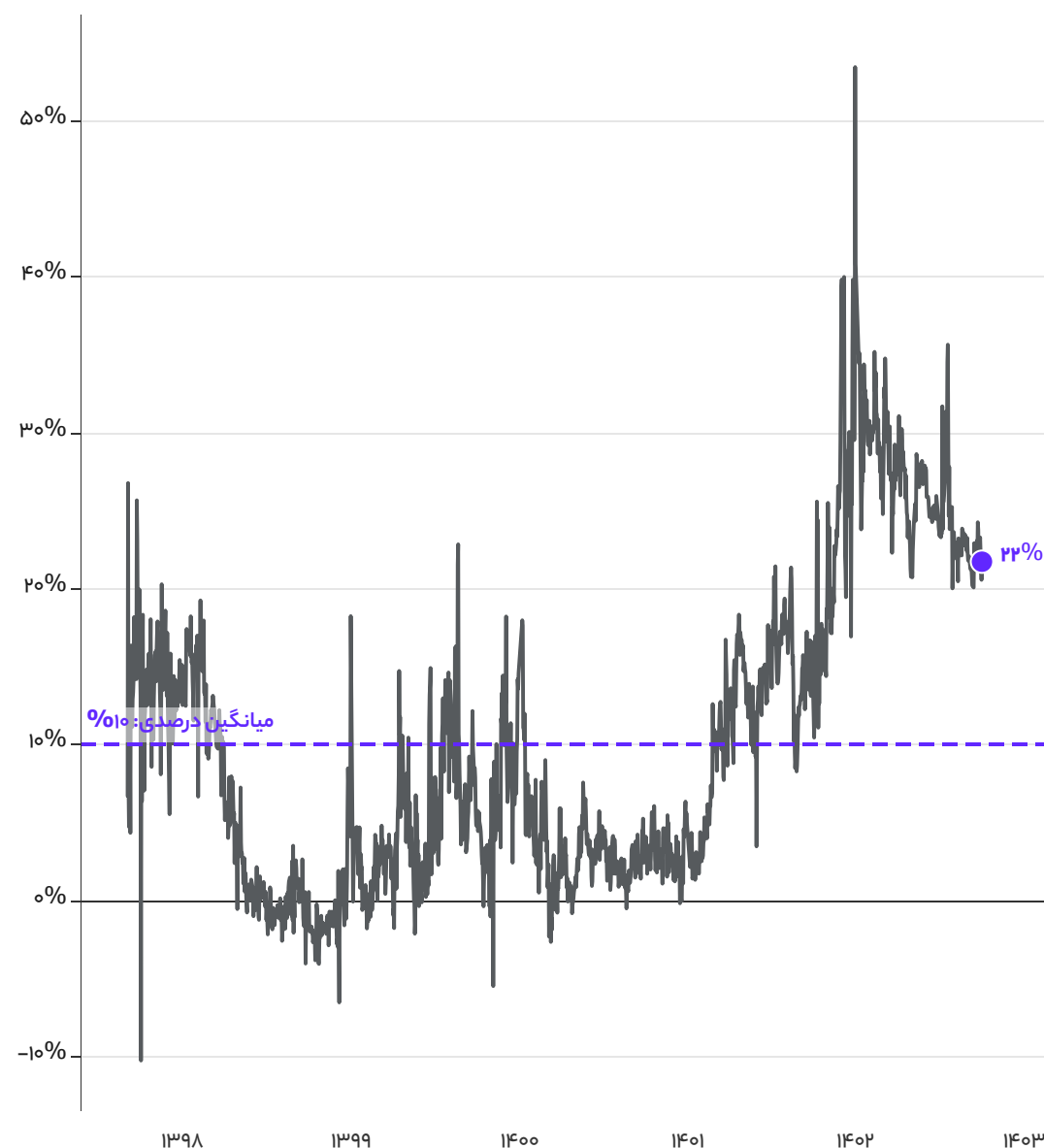
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



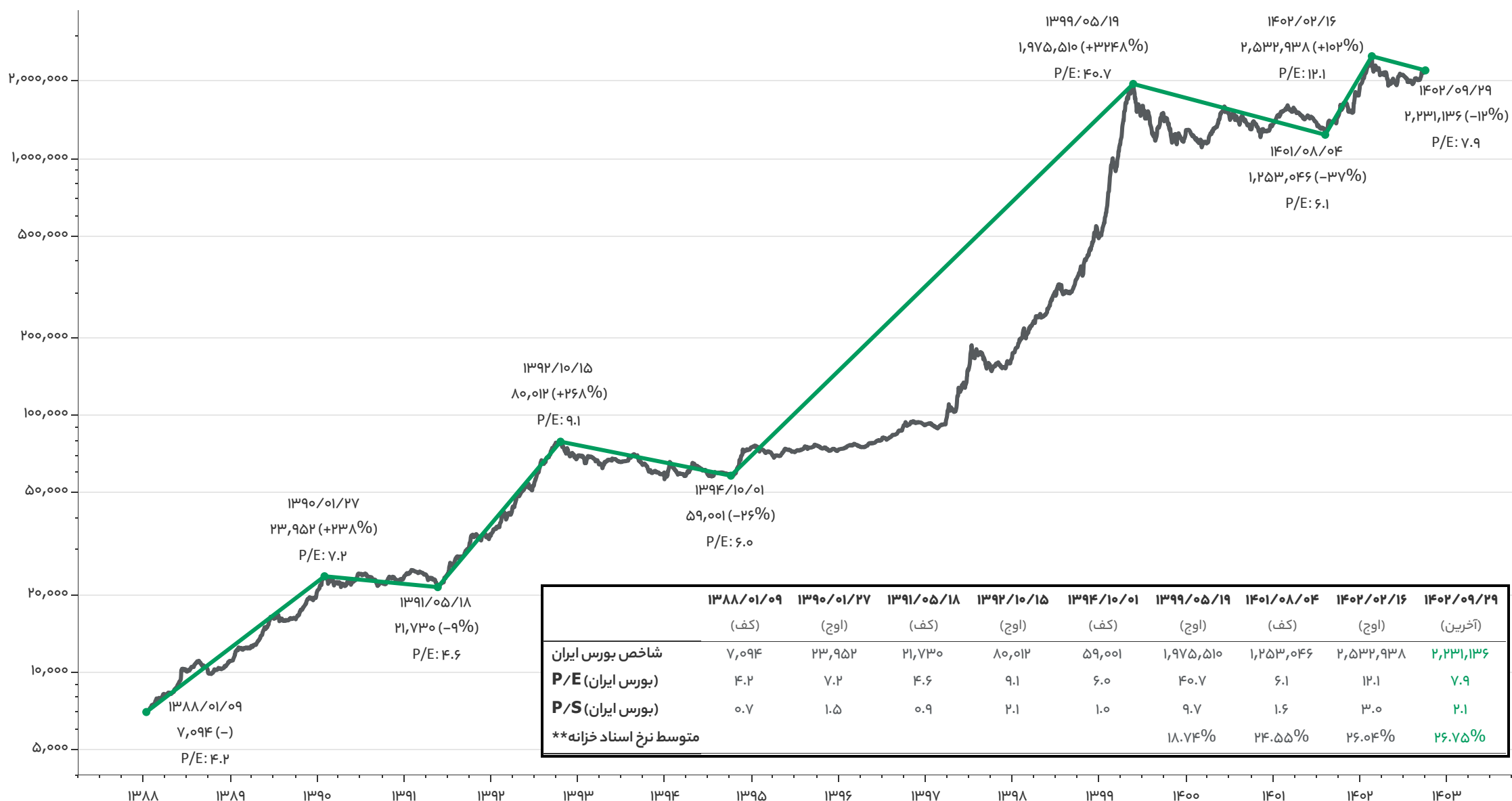


EQUITY

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

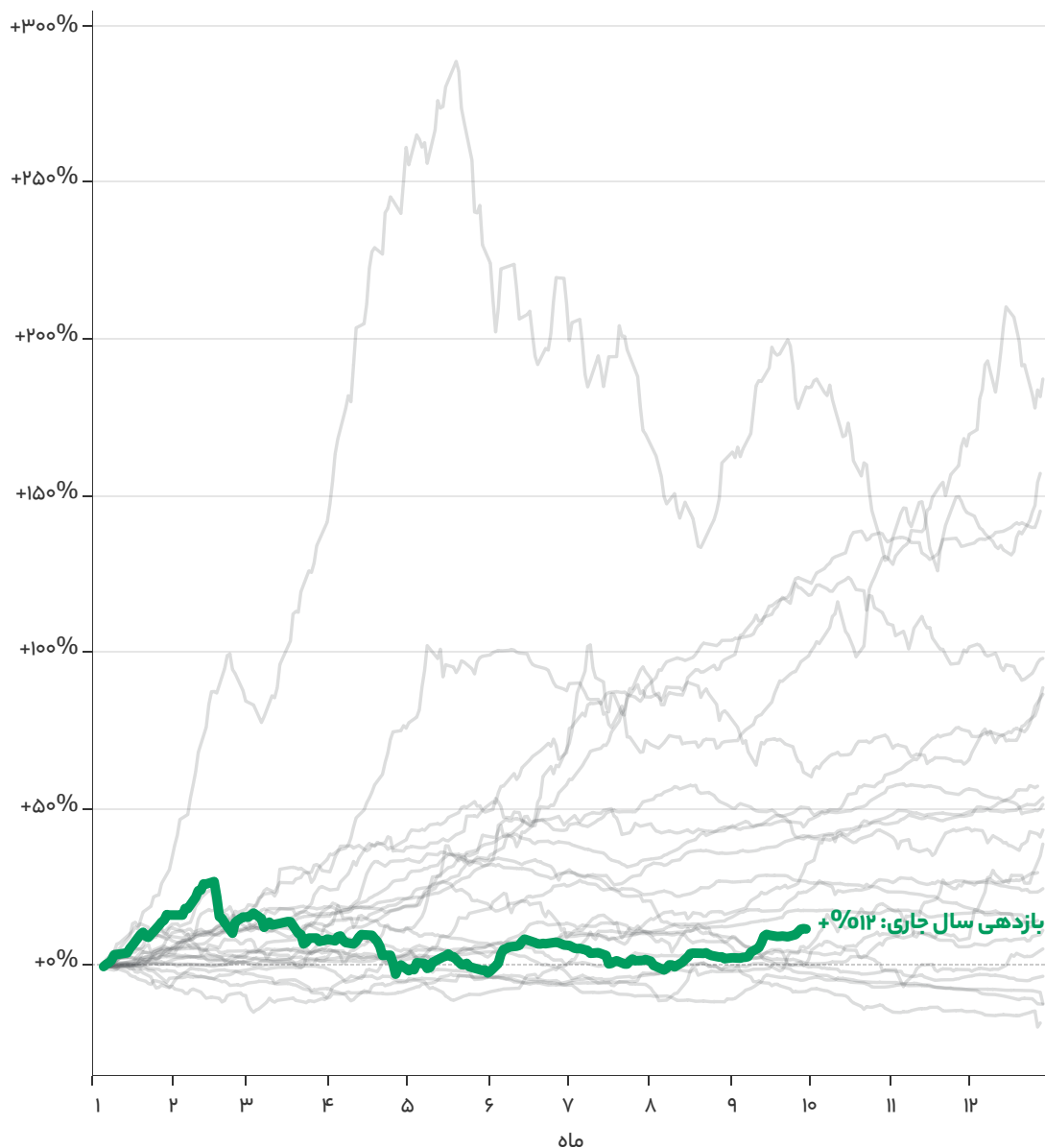


* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور، که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.

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

مقایسه بازدهی سال جاری

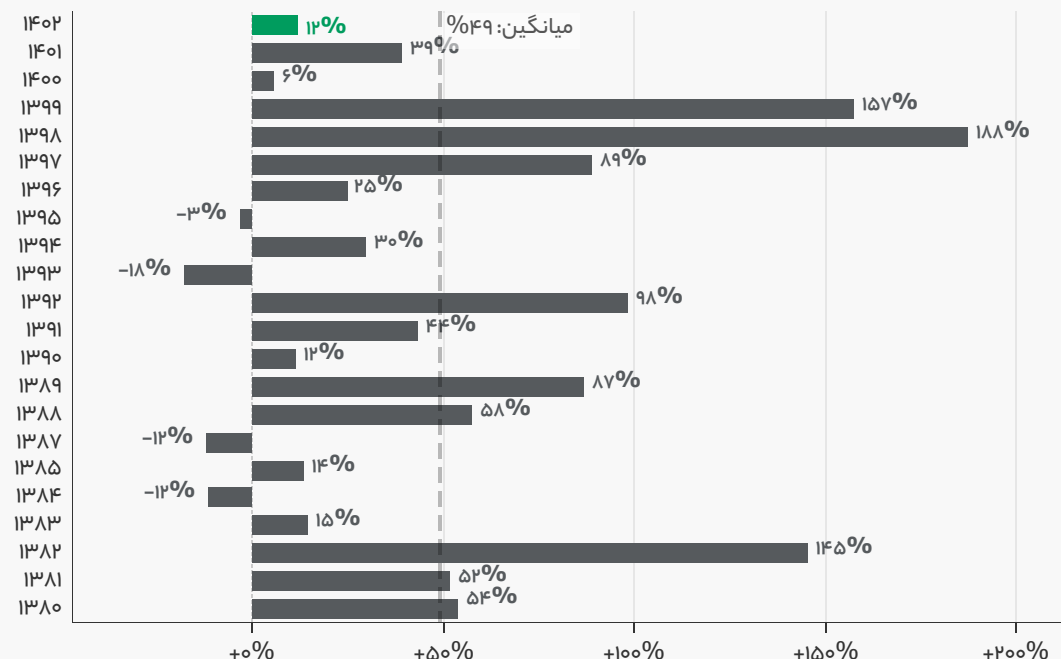
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



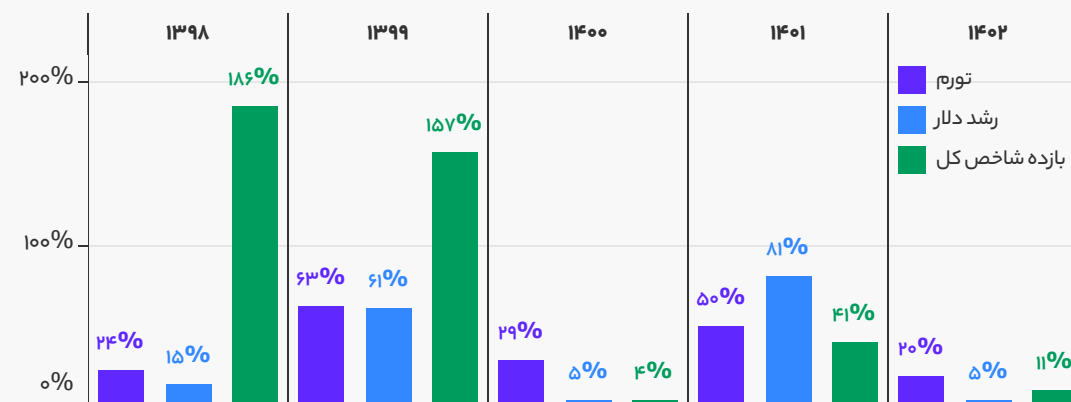
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

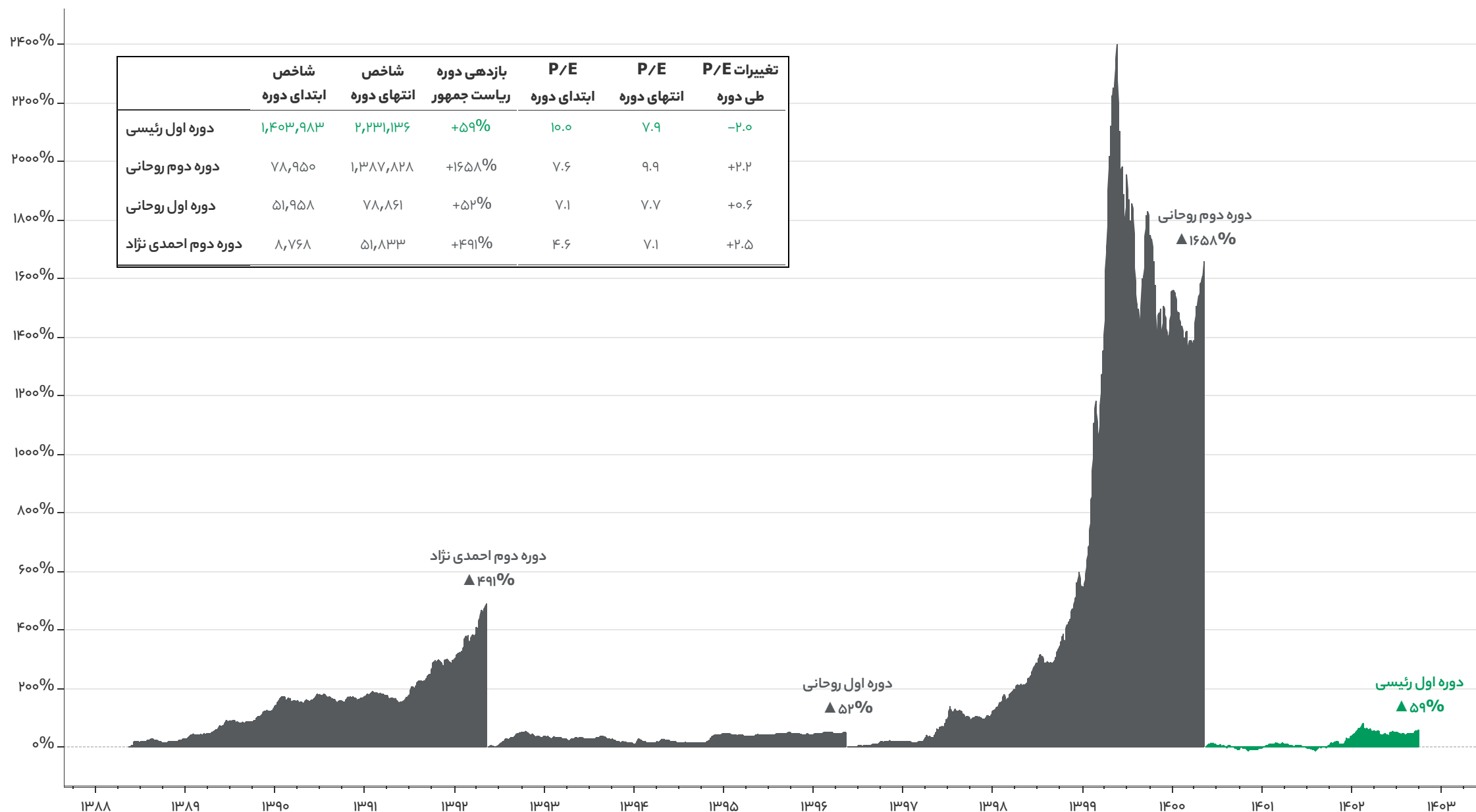


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلندمدت بازار سهام

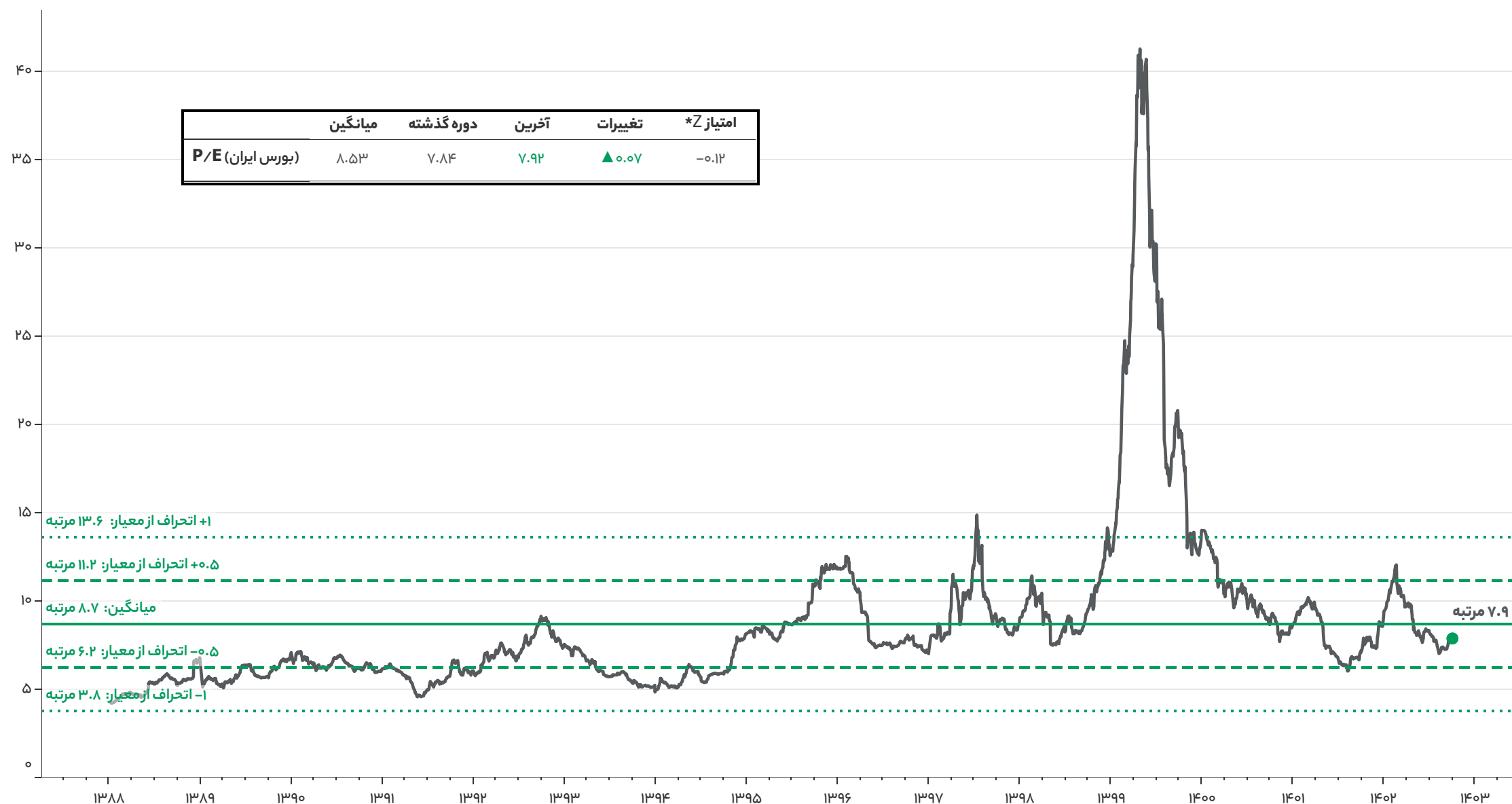
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



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.

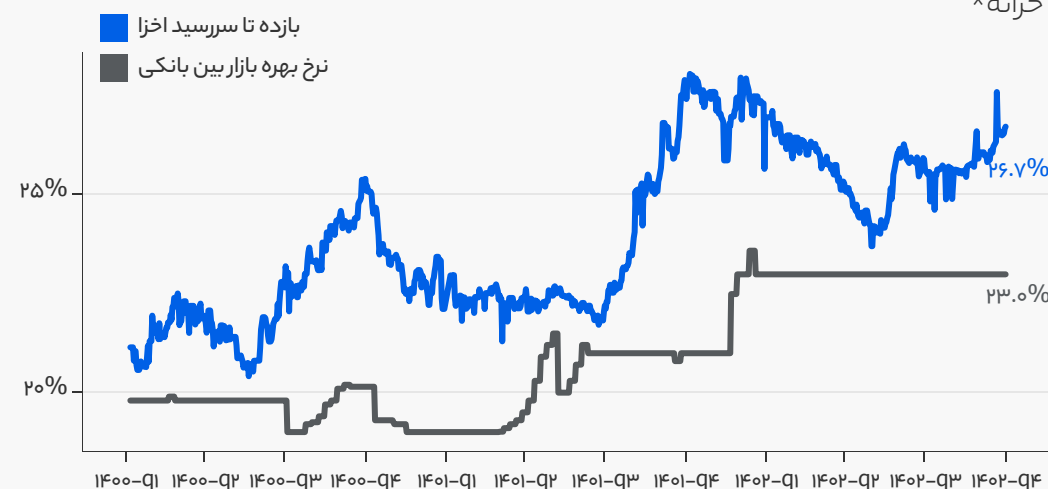


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

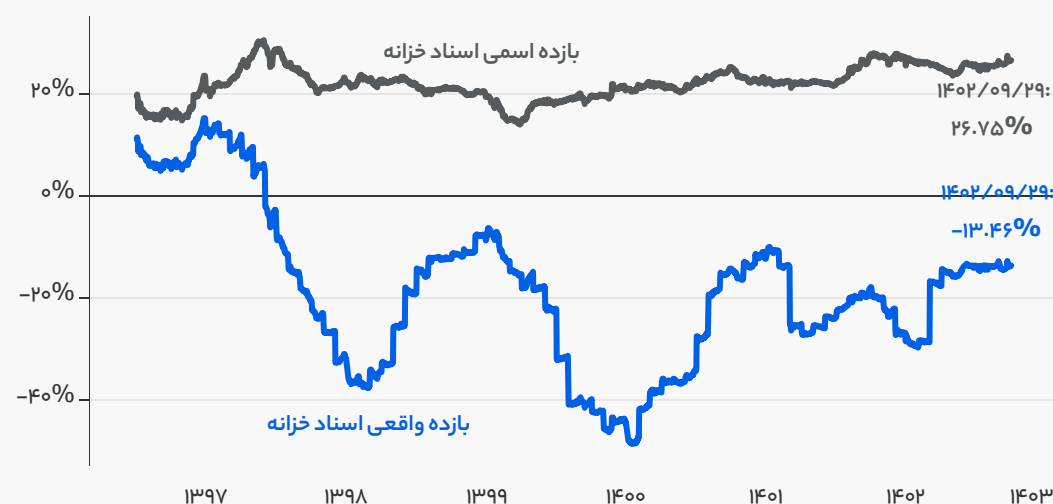
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

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



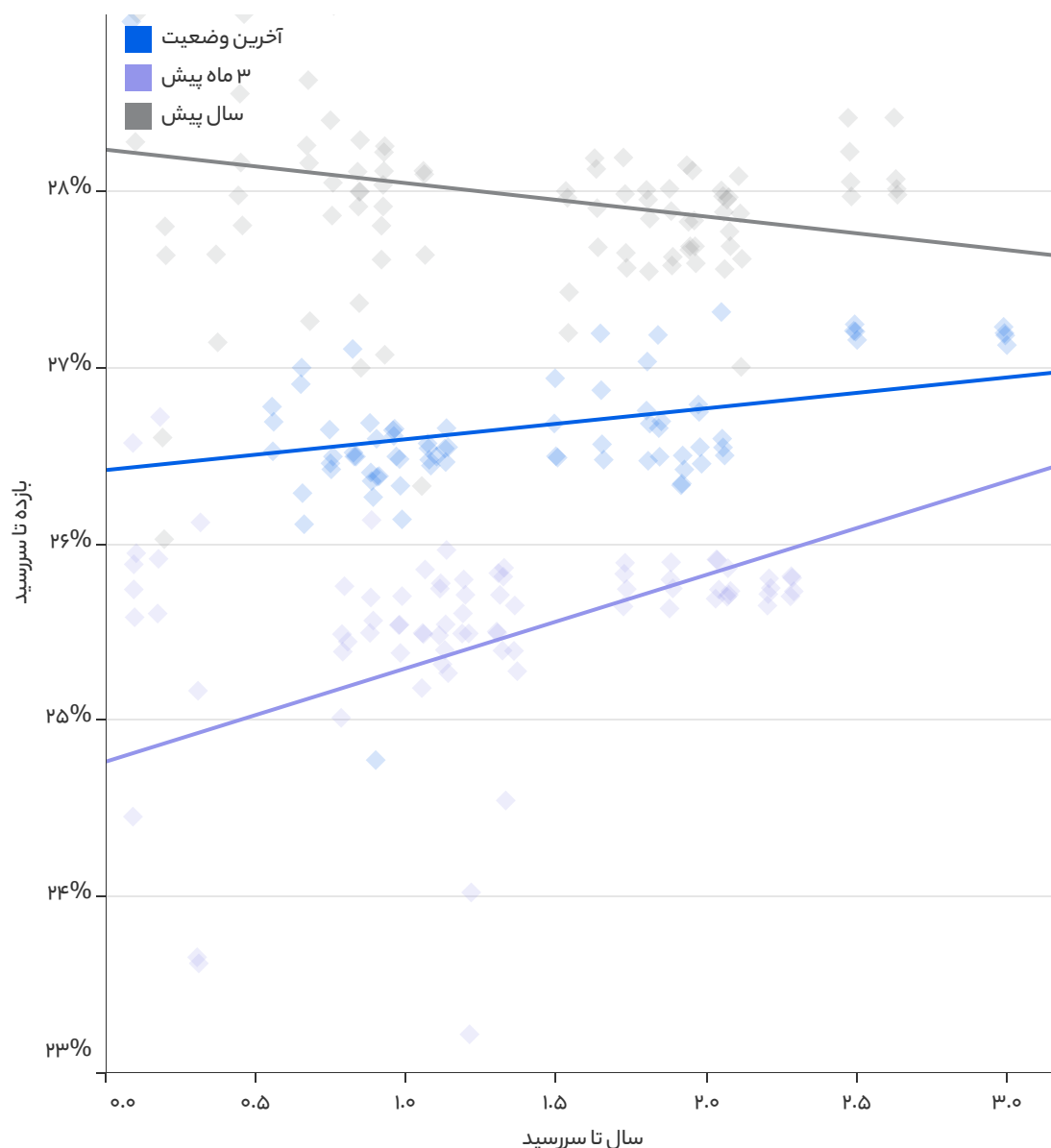
بازده اسمی و واقعی اسناد خزانه**

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.

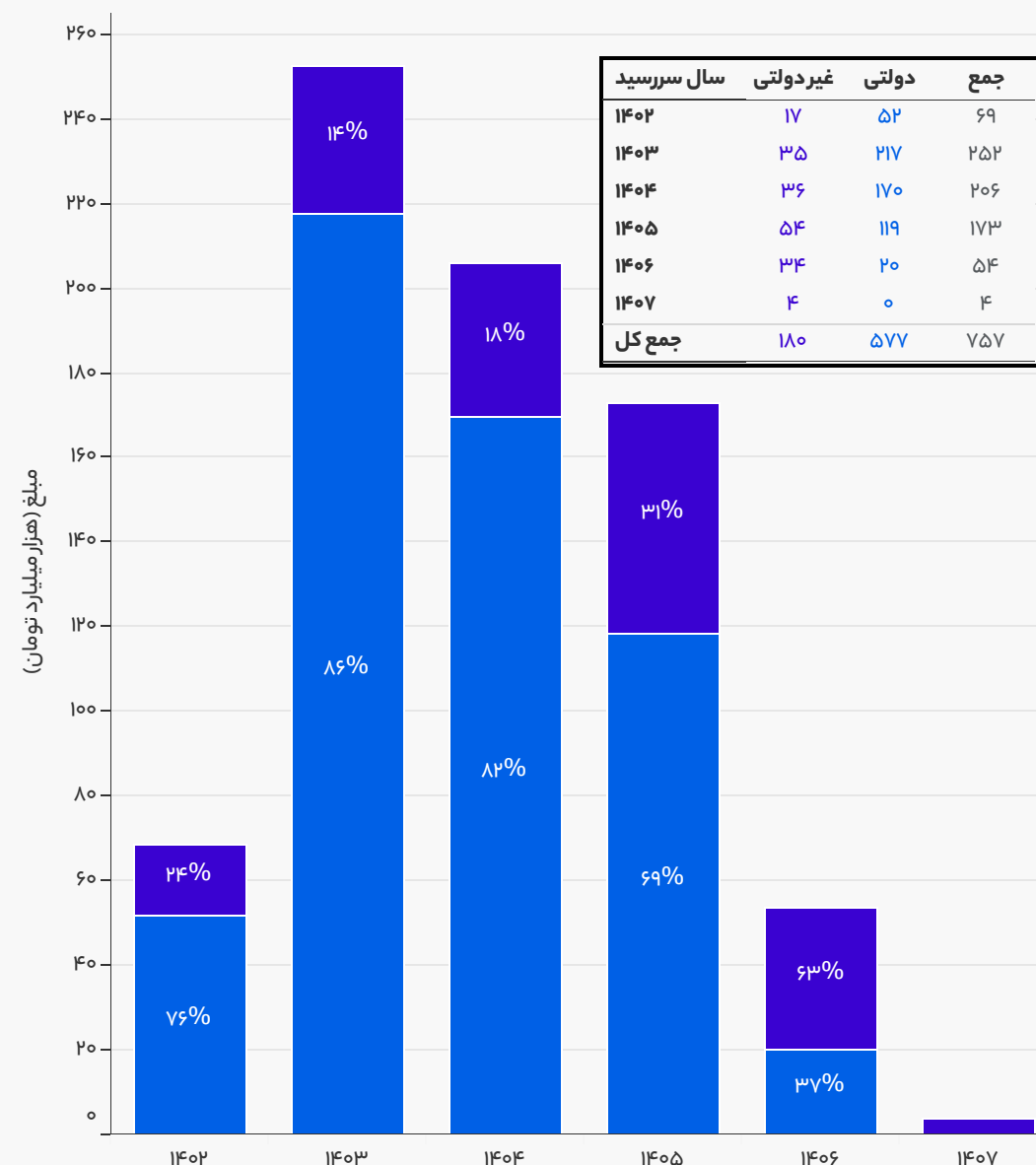
** بازده واقعی اسناد خزانه با نرخ تورم نقطه به نقطه سالانه محاسبه شده است.

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

دید کلی بازار بدهی

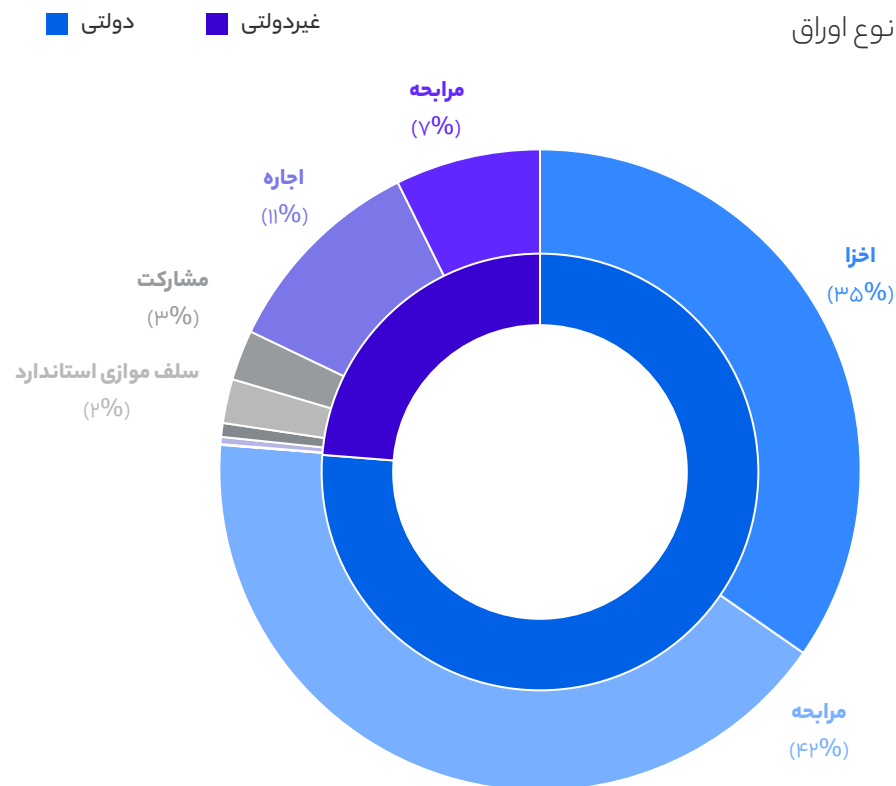
مانده اوراق به تفکیک سررسید

به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



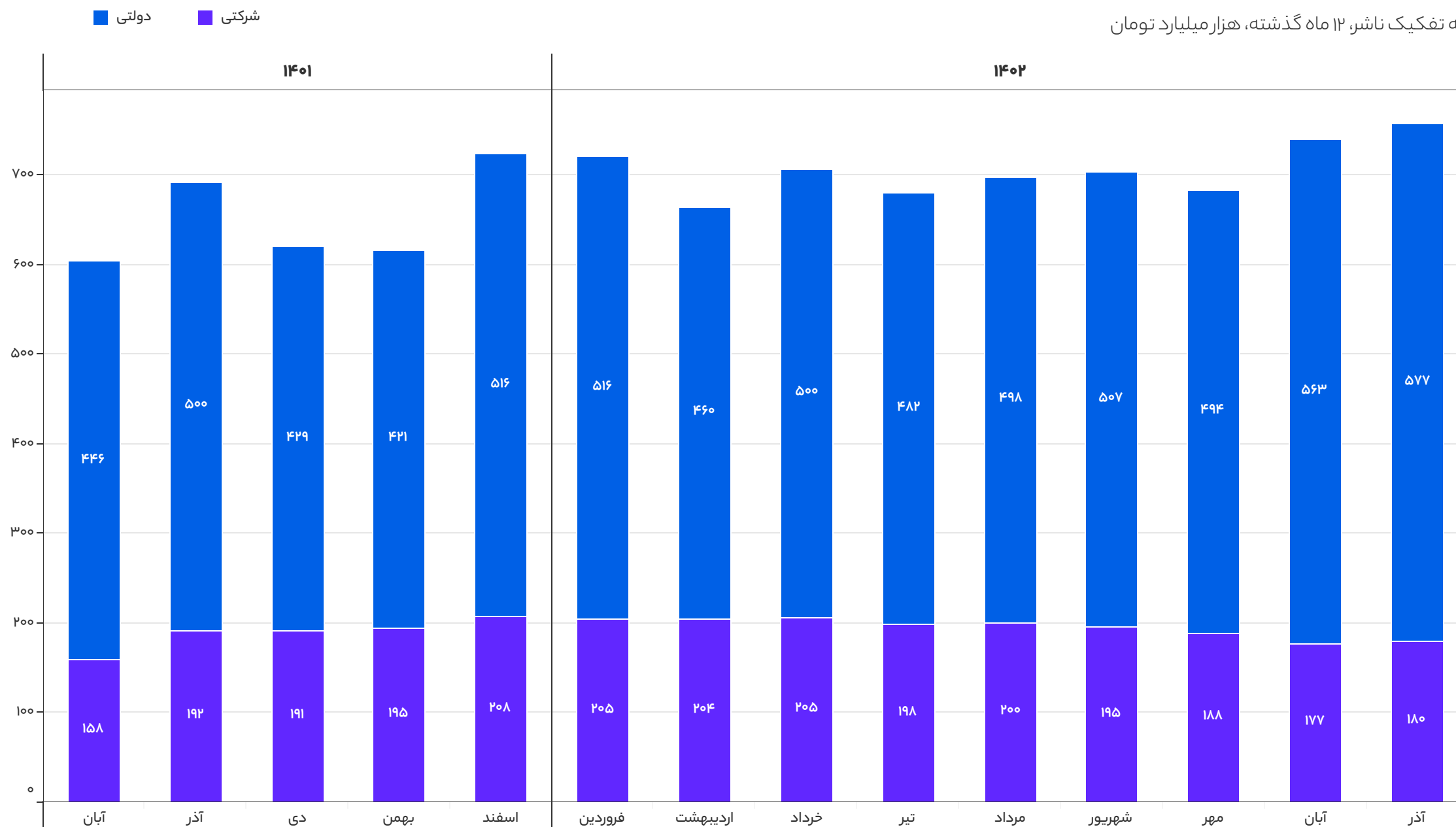
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مراجعه	۳۱۵	۴۲%
	اخزا	۲۶۳	۳۵%
غیردولتی	اجاره	۸۰	۱۱%
	مراجعه	۵۵	۷%
	مشارکت	۱۹	۳%
	سلف موازی استاندارد	۱۷	۲%
	منفعت	۵	۱%
	گام	۳	۰%
جمع کل		۷۵۷	۱۰۰%

* 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

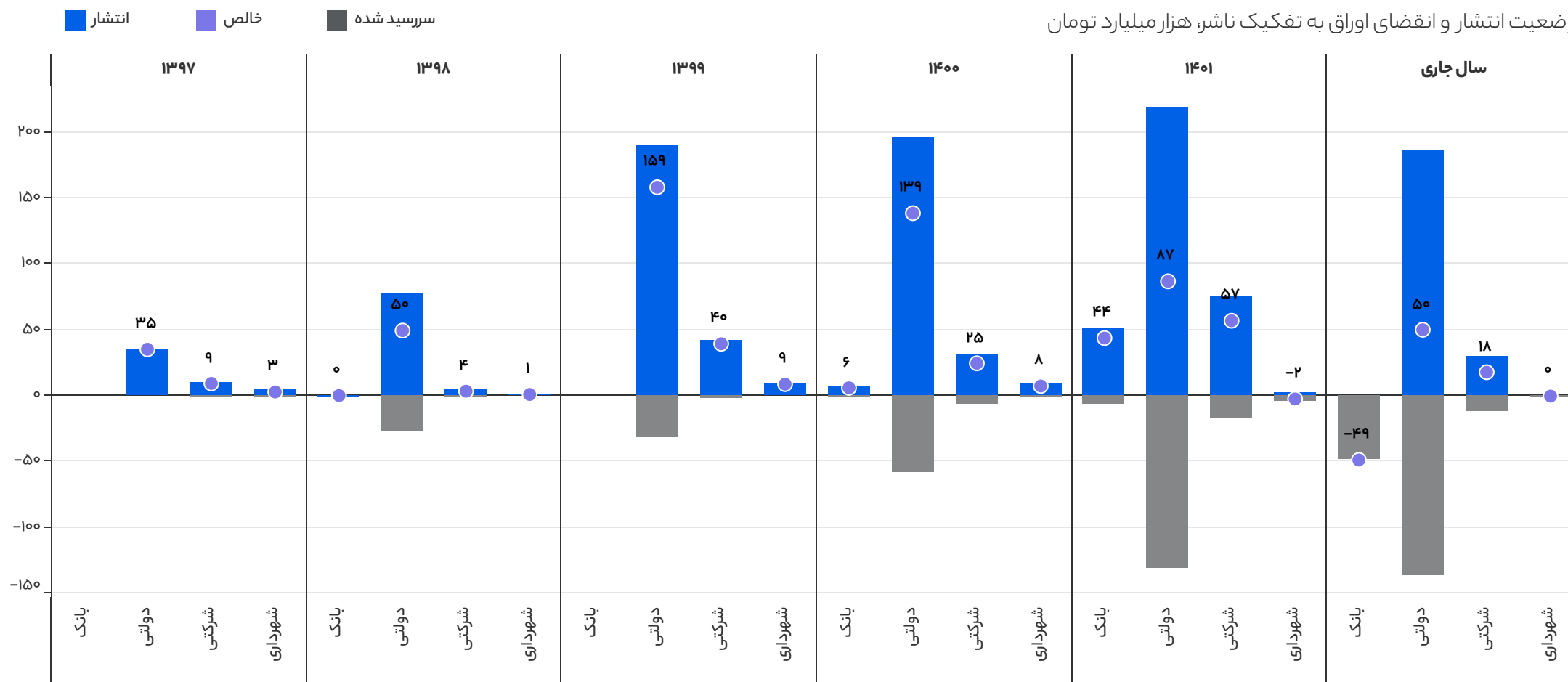
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

خالص انتشار اوراق سال‌های گذشته

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

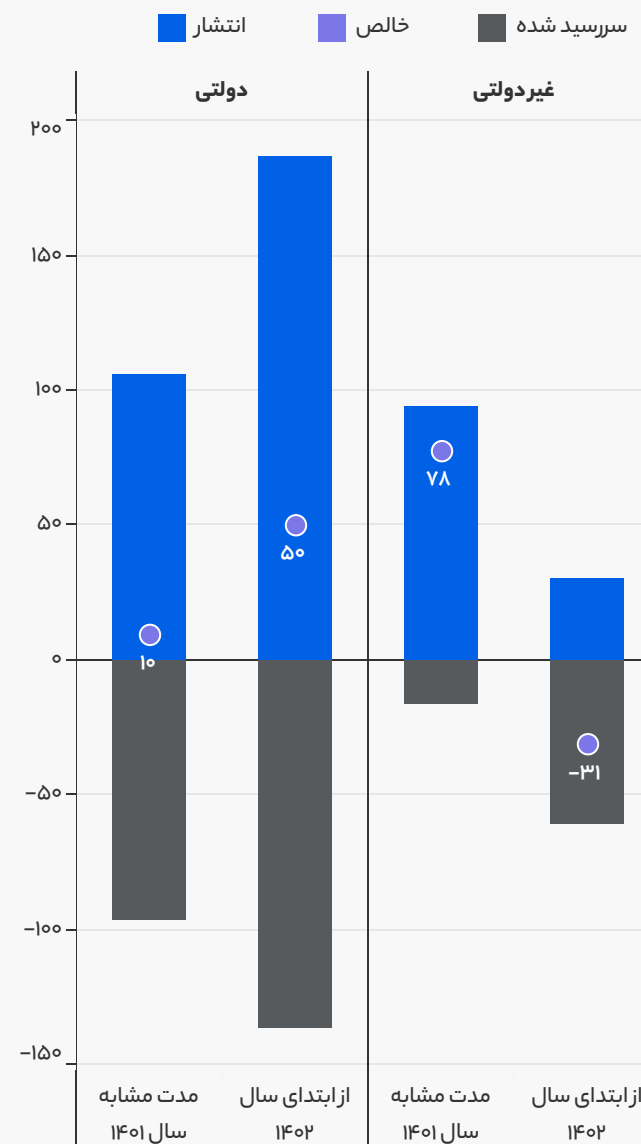


	۱۳۹۷				۱۳۹۸				۱۳۹۹				۱۴۰۰				۱۴۰۱				سال جاری			
	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری
انتشار اوراق		۳۵	۱۰	۴	۰	۷۷	۴	۱		۱۹۰	۴۲	۹	۶	۱۹۷	۳۱	۸	۵۱	۲۱۹	۷۵	۲		۱۸۷	۳۰	
سررسید شده			۰	-۱		-۲۷	-۱			-۳۲	-۳		۰	-۵۸	-۷	-۱	-۷	-۱۳۱	-۱۸	-۴	-۴۹	-۱۳۷	-۱۲	۰
خالص انتشار		۳۵	۹	۳	۰	۵۰	۴	۱		۱۵۹	۴۰	۹	۶	۱۳۹	۲۵	۸	۴۴	۸۷	۵۷	-۲	-۴۹	۵۰	۱۸	۰

انتشار و تسویه اوراق

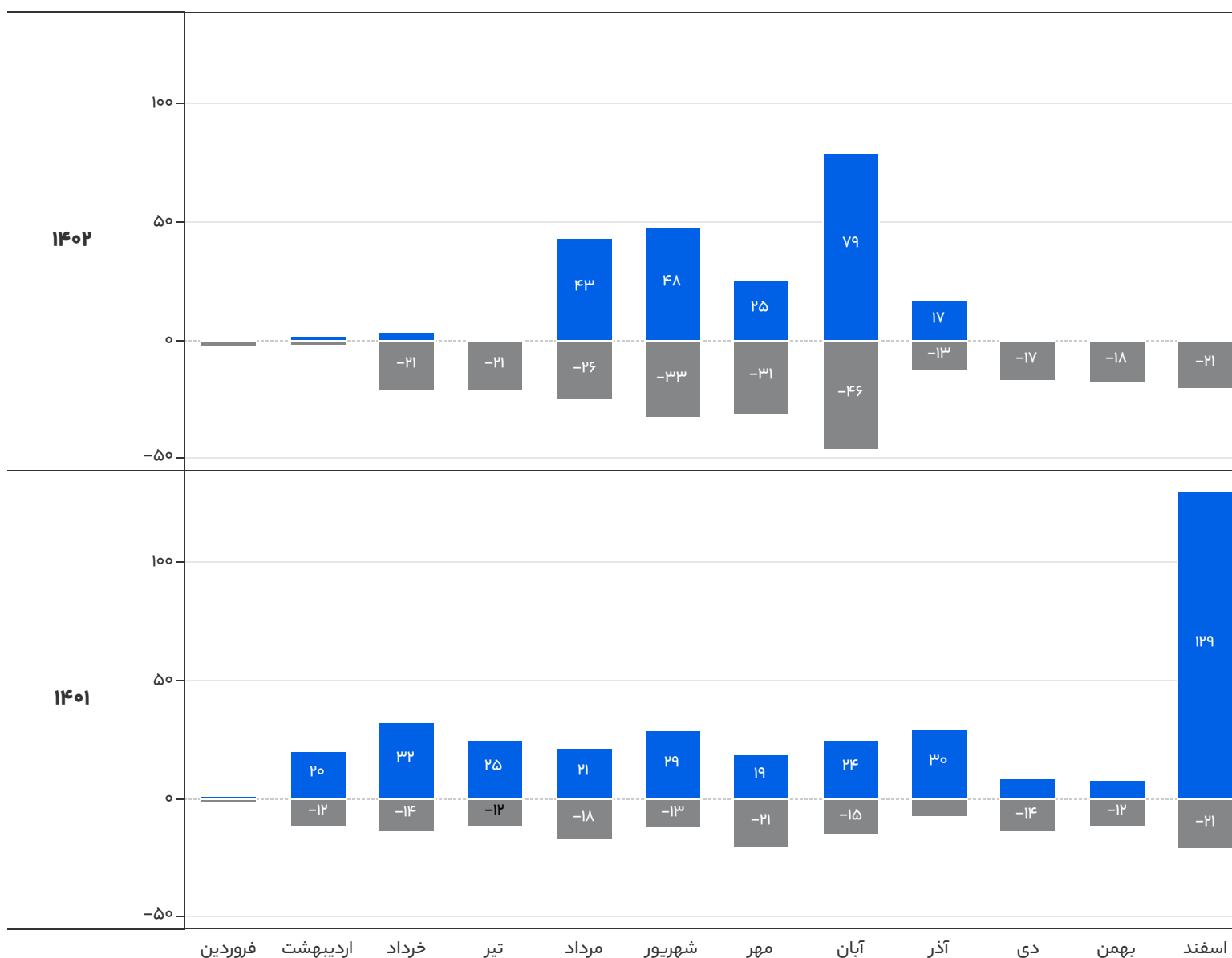
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

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



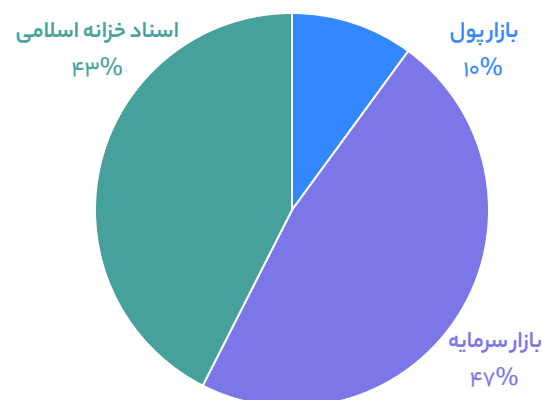
تامین مالی دولت

وضعیت تامین مالی دولت

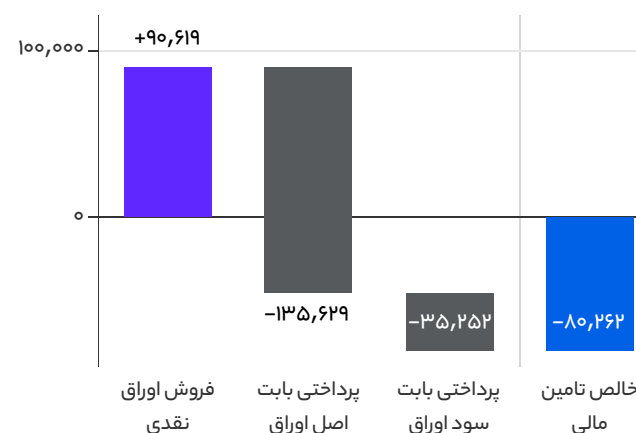
از ابتدای سال، نقدینگی جذب شده توسط دولت از طریق عرضه و تسویه اوراق، میلیارد تومان

تامین مالی دولت از ابتدای سال

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



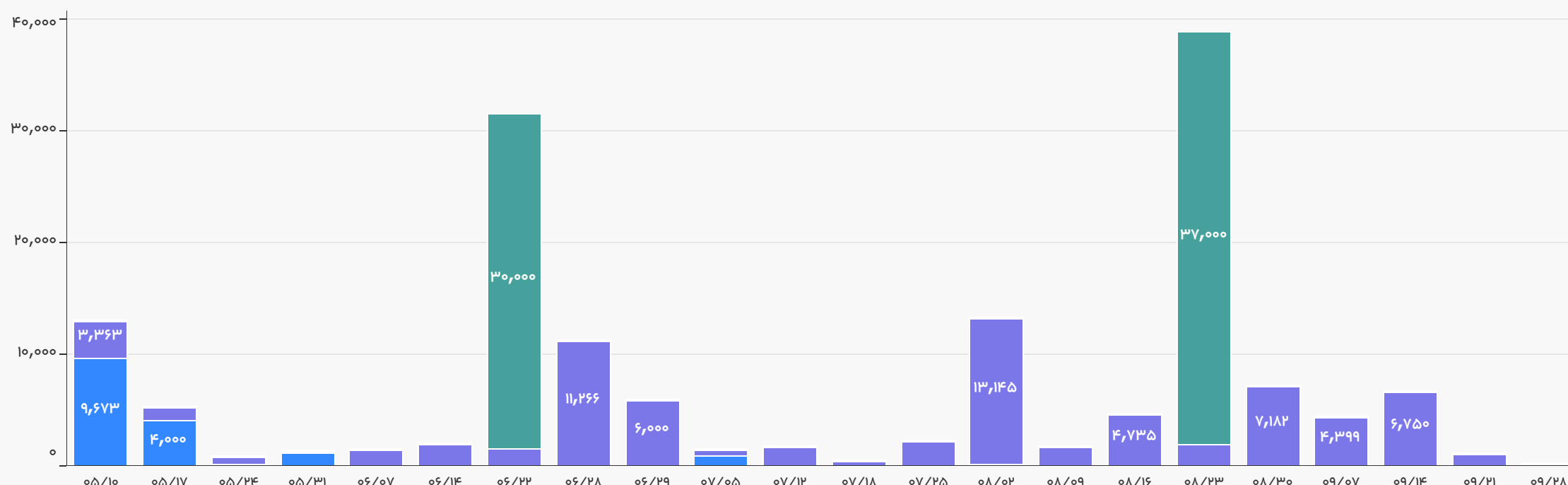
بازار	نوع فروش	حجم
بازار پول	نقدی	۱۵,۸۳۳
بازار سرمایه	نقدی	۷۴,۷۸۶
بازار سرمایه	غیر نقدی	۶۷,۰۰۰



فروش اوراق نقدی	۹۰,۶۱۹
پرداختی بابت اصل اوراق	-۱۳۵,۶۲۹
پرداختی بابت سود اوراق	-۳۵,۲۵۲
خالص تامین مالی	-۸۰,۲۶۲

عرضه اوراق دولتی در سال جاری

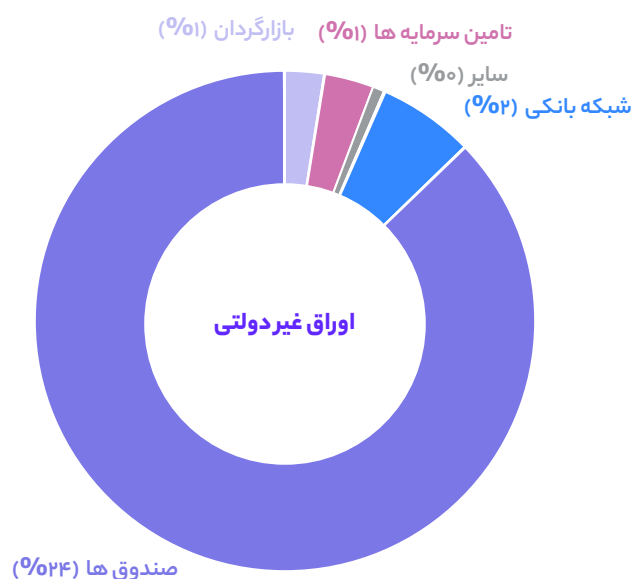
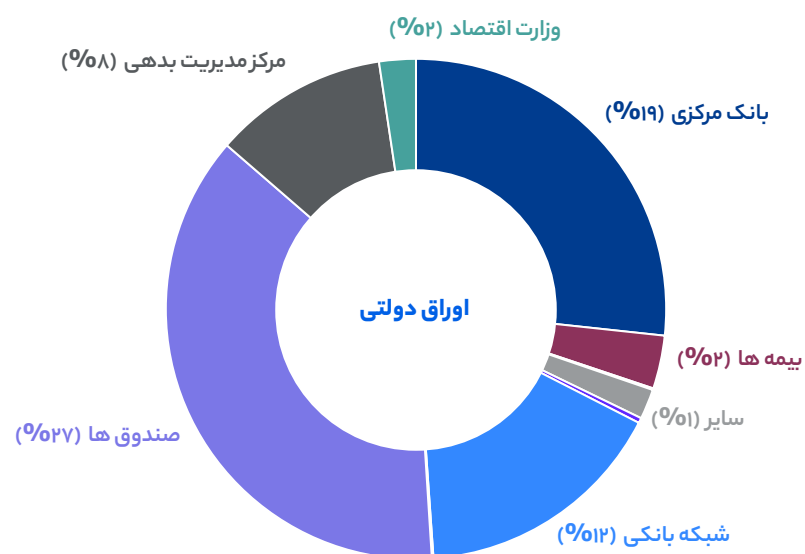
از ابتدای سال، به تفکیک عرضه، میلیارد تومان



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	۱۸.۹	۷۲.۸	۴۴.۶	۹.۴	۱۱.۱	۱۵۶.۹
	بانک مرکزی	۸.۴	۶۴.۲	۲۳.۲	۱۲.۵	۴.۴	۱۱۲.۲
	شبکه بانکی	۳.۵	۳۶.۹	۱۷.۹	۶.۵	۴.۵	۶۸.۸
	مرکز مدیریت بدهی	۷.۵	۷.۶	۵.۹	۲۶.۴	-	۴۷.۴
	بیمه ها	۵.۵	۸.۲	۲.۲	۳.۳	۵.۲	۱۴.۴
	وزارت اقتصاد	-	-	۴.۶	۵.۳	-	۹.۹
	سایر	۵.۱	۲.۶	۵.۲	۵.۲	۵.۱	۸.۲
	سبدها	-	۵.۹	۵.۳	۵.۱	-	۱.۳
	شخص حقیقی	-	۵.۴	۵.۱	-	-	۵.۵
	تأمین سرمایه ها	۵.۱	۵.۳	-	-	-	۵.۵
غیردولتی	صندوق ها	۱۳.۷	۳۳.۱	۳۱.۲	۴۲.۳	۱۸.۸	۱۴۵.۲
	شبکه بانکی	-	۵.۶	۵.۹	۶.۷	۱.۷	۹.۹
	تأمین سرمایه ها	-	۵.۳	۲.۷	۱.۵	۵.۸	۵.۱
	بازارگردان	۵.۹	۵.۷	۱.۵	۱.۱	۵.۴	۴.۵
	سایر	۵.۱	۵.۱	-	-	-	۱.۲
	سرمایه گذاری	-	-	-	-	۵.۳	۵.۳
	سبدها	-	-	-	-	۵.۱	۵.۲
	بیمه ها	-	-	-	۵.۱	-	۵.۱
	شخص حقیقی	-	-	-	-	۵.۱	۵.۱
	گروه مالی	-	-	-	۵.۱	-	۵.۱
	کارگزاری	-	-	-	-	-	-
	سبدگردان	-	-	-	-	-	-

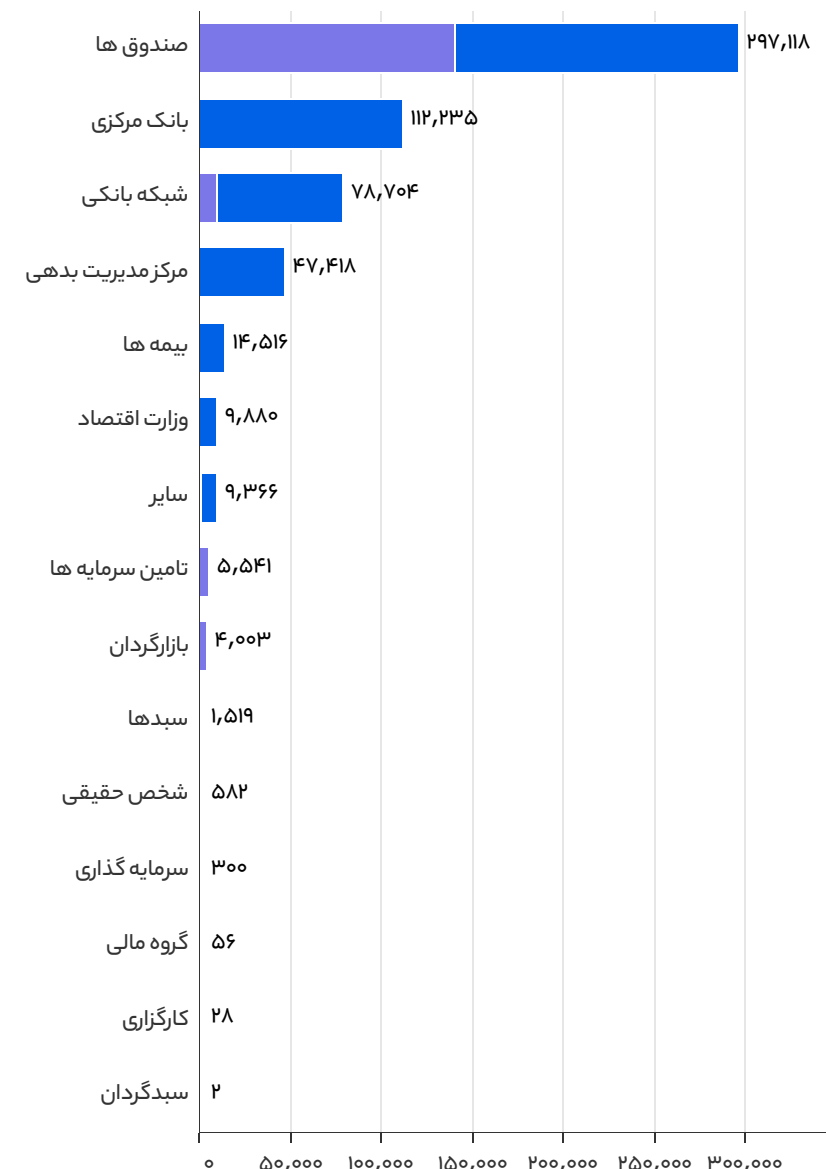
بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی

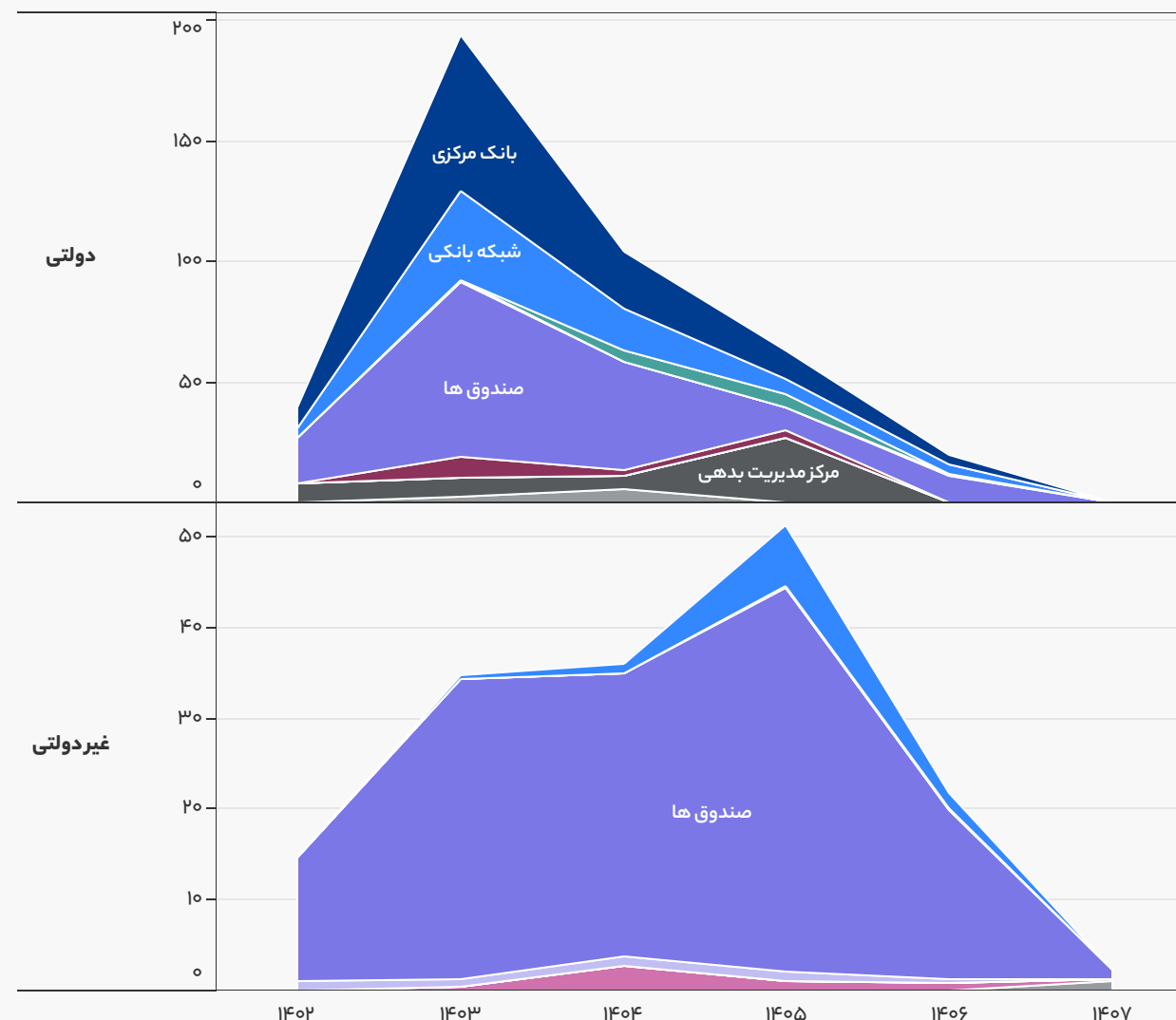
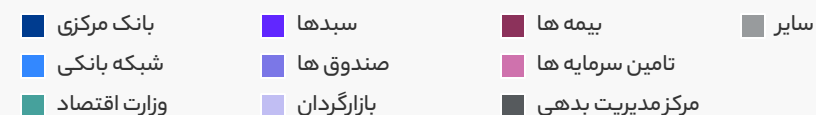
جمع	گام	منفعت	مشارکت	مربحه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره	
۲۹۷,۱۱۸	۱,۵۷۸	۵,۰۹۵	۱۶,۵۶۴	۱۴۹,۱۵۳	۰	۱۵,۰۱۰	۴۷,۳۲۸	۱۴۵	۶۲,۲۴۴	صندوق ها
۱۱۲,۲۳۵	۰	۰	۰	۸۸,۷۴۶	۰	۰	۲۳,۴۹۰	۰	۰	بانک مرکزی
۷۸,۷۰۴	۰	۱۰۰	۴۷۰	۳۹,۸۷۴	۰	۰	۳۲,۸۲۰	۰	۵,۴۴۰	شبکه بانکی
۴۷,۴۱۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۴۷,۴۱۸	۰	۰	مرکز مدیریت بدهی
۱۴,۵۱۶	۰	۰	۰	۷,۵۷۱	۴۰	۰	۶,۸۷۴	۰	۳۰	بیمه ها
۹,۳۶۶	۹۸	۰	۲۵	۲۶۵	۵۰	۰	۷,۹۲۴	۰	۱,۰۰۵	سایر
۵,۵۴۱	۰	۰	۱,۳۷۷	۲,۶۸۶	۲	۰	۰	۵	۱,۴۷۲	تامین سرمایه ها
۴,۰۰۳	۰	۰	۷۸۱	۱,۴۸۰	۰	۷۱۲	۰	۵	۱,۰۲۵	بازارگردان
۱,۵۱۹	۰	۰	۰	۸۲۶	۰	۰	۶۶۳	۰	۳۰	سبدها
۲	۰	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۰	۰	سبدگردان
۳۰۰	۰	۰	۰	۳۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	سرمایه گذاری
۵۸۲	۰	۰	۰	۵۲۲	۰	۰	۶۰	۰	۰	شخص حقیقی
۲۸	۰	۰	۰	۱۵	۳	۰	۰	۰	۱۰	کارگزاری
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰	گروه مالی
۹,۸۸۰	۰	۰	۰	۹,۸۸۰	۰	۰	۰	۰	۰	وزارت اقتصاد
۵۸۱,۲۶۸	۱,۶۷۵	۵,۱۹۵	۱۹,۲۱۸	۳۰۱,۳۷۴	۹۷	۱۵,۷۲۲	۱۶۶,۵۷۷	۱۵۵	۷۱,۲۵۶	جمع



بازیگران کلیدی بازار بدهی

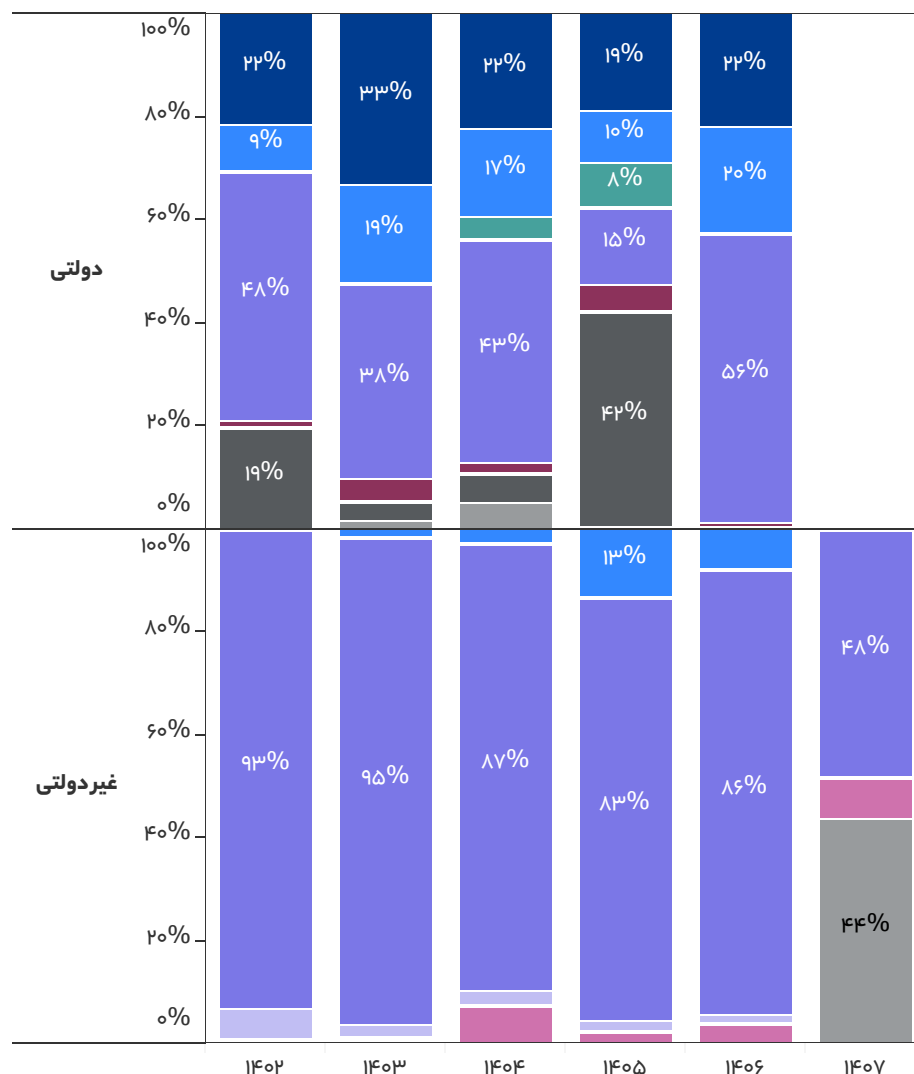
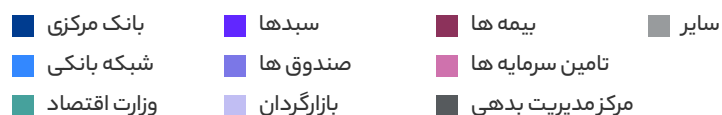
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

آخرین وضعیت مبلغ سرمایه گذاری دارنگان اوراق، ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان



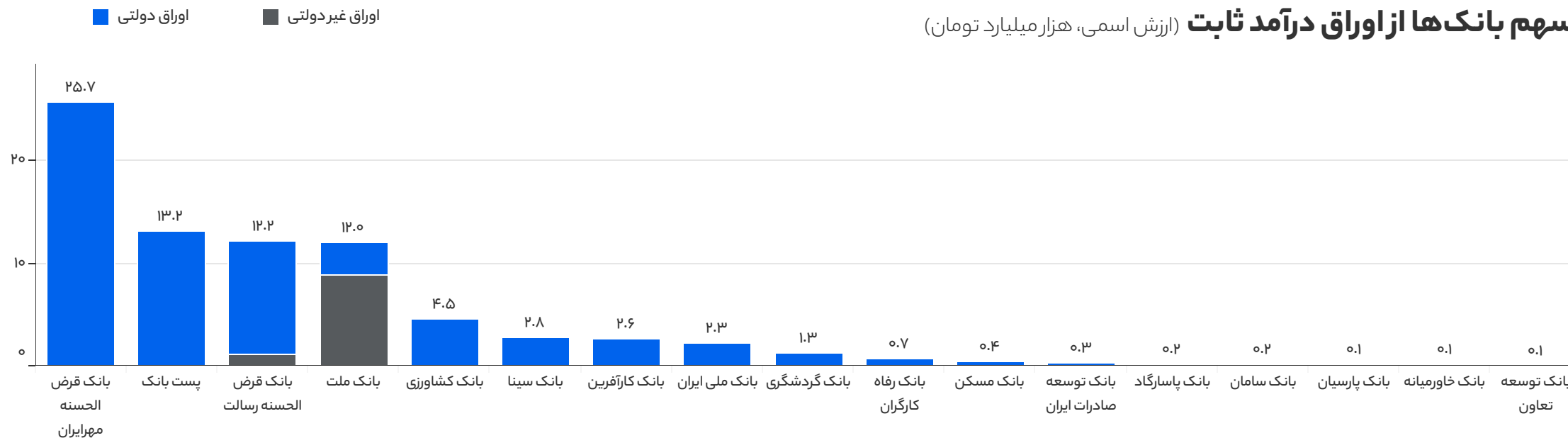
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

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

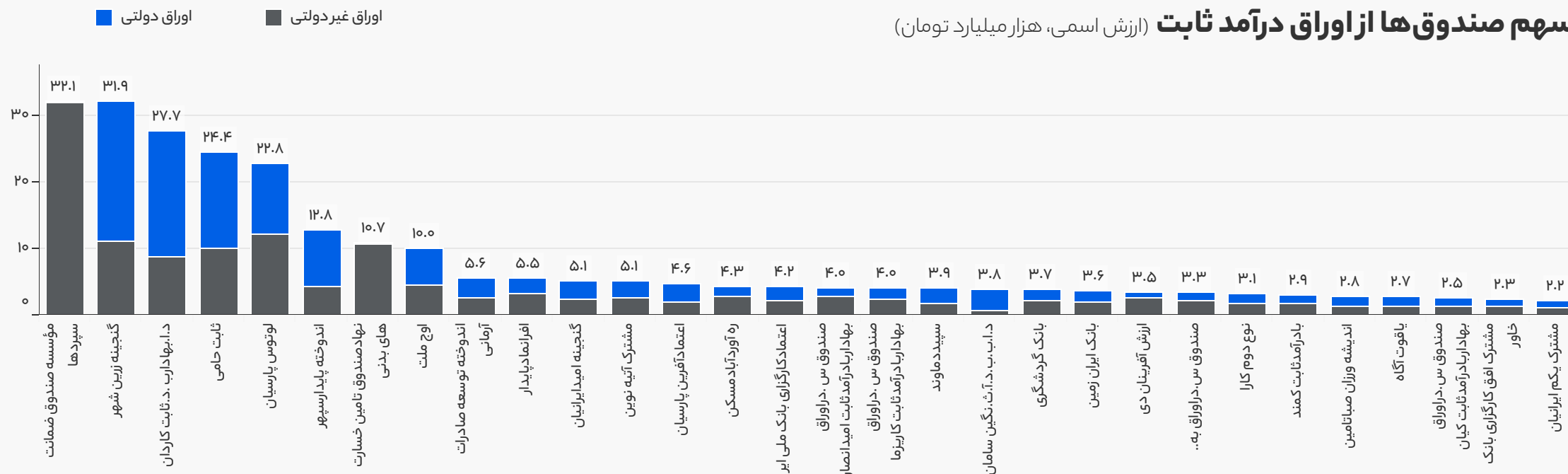


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



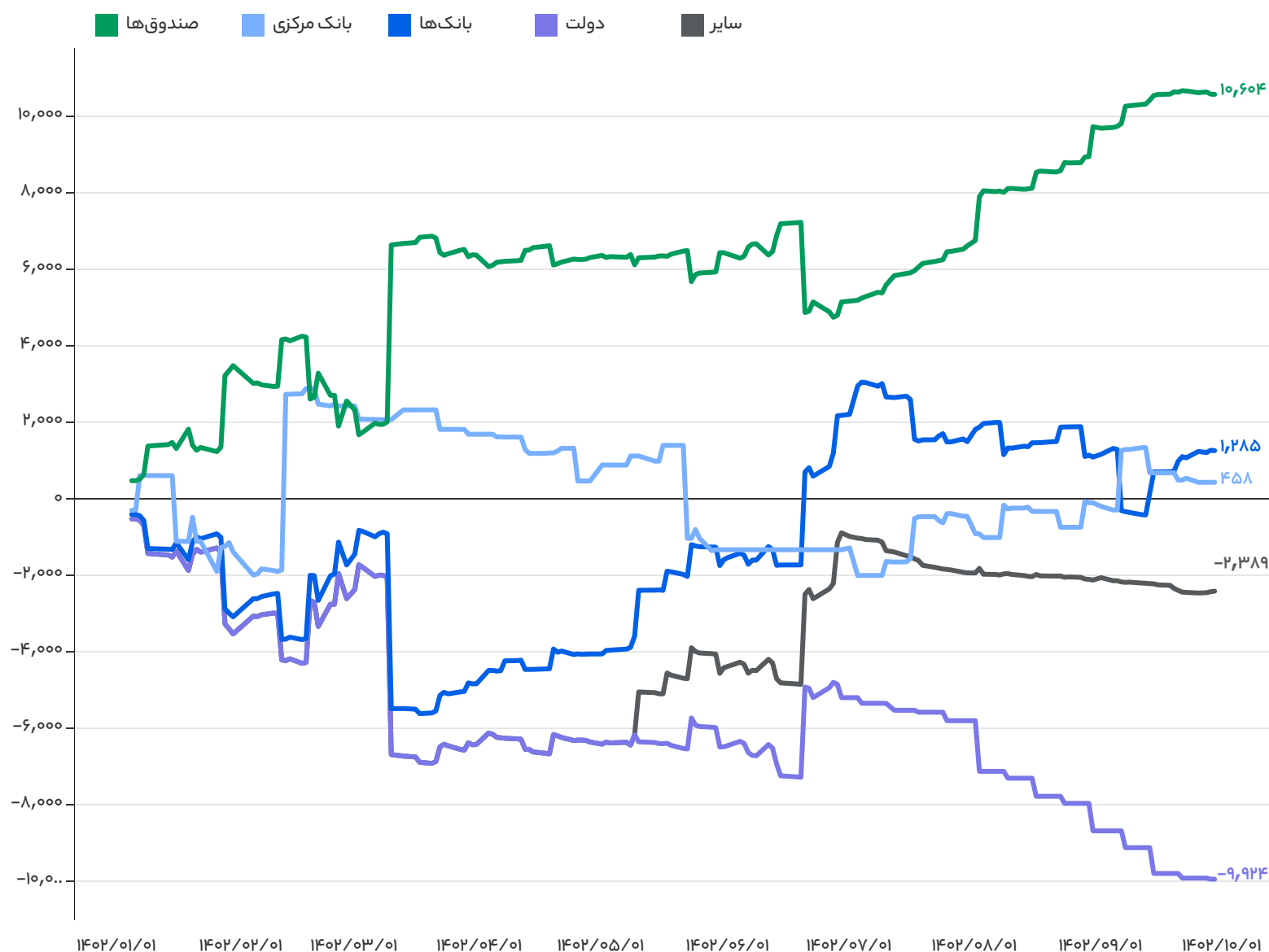
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

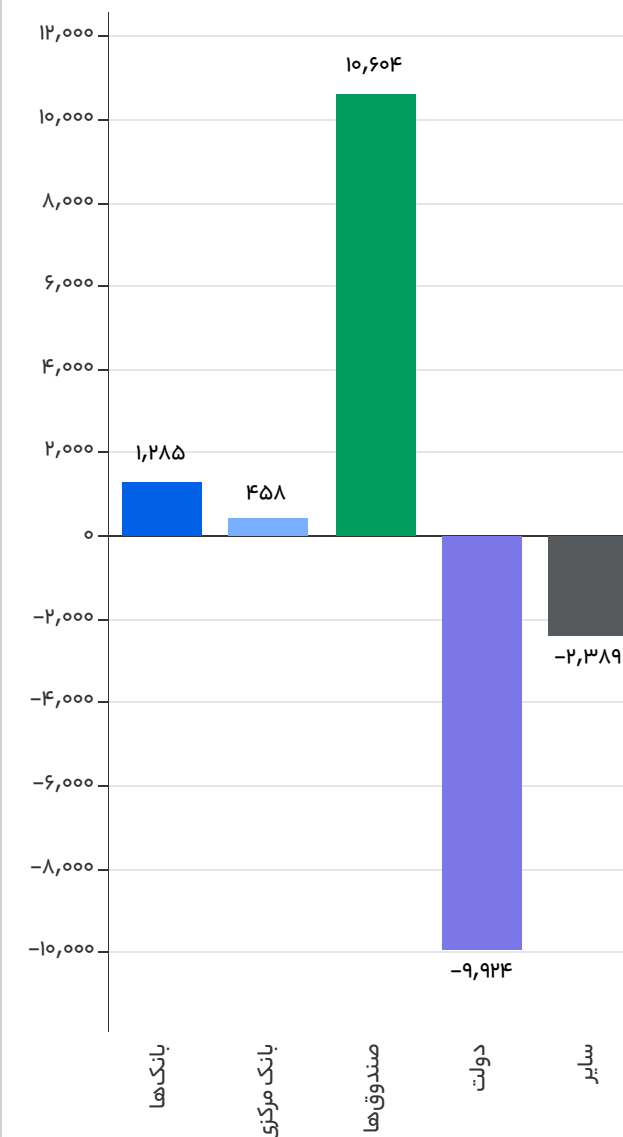
خالص معاملات اوراق

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

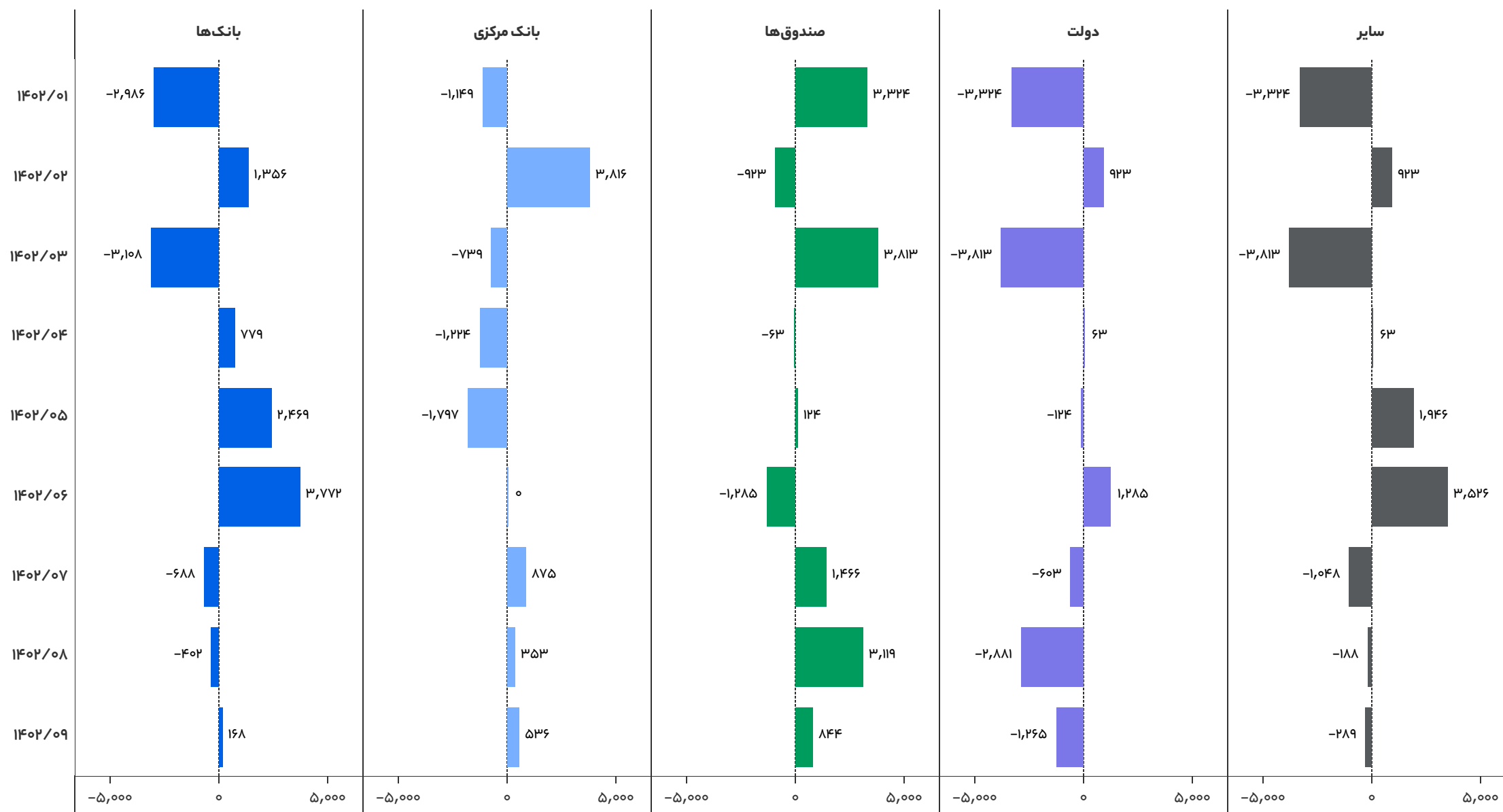


معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

آمار معاملات اوراق به صورت ماهانه

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

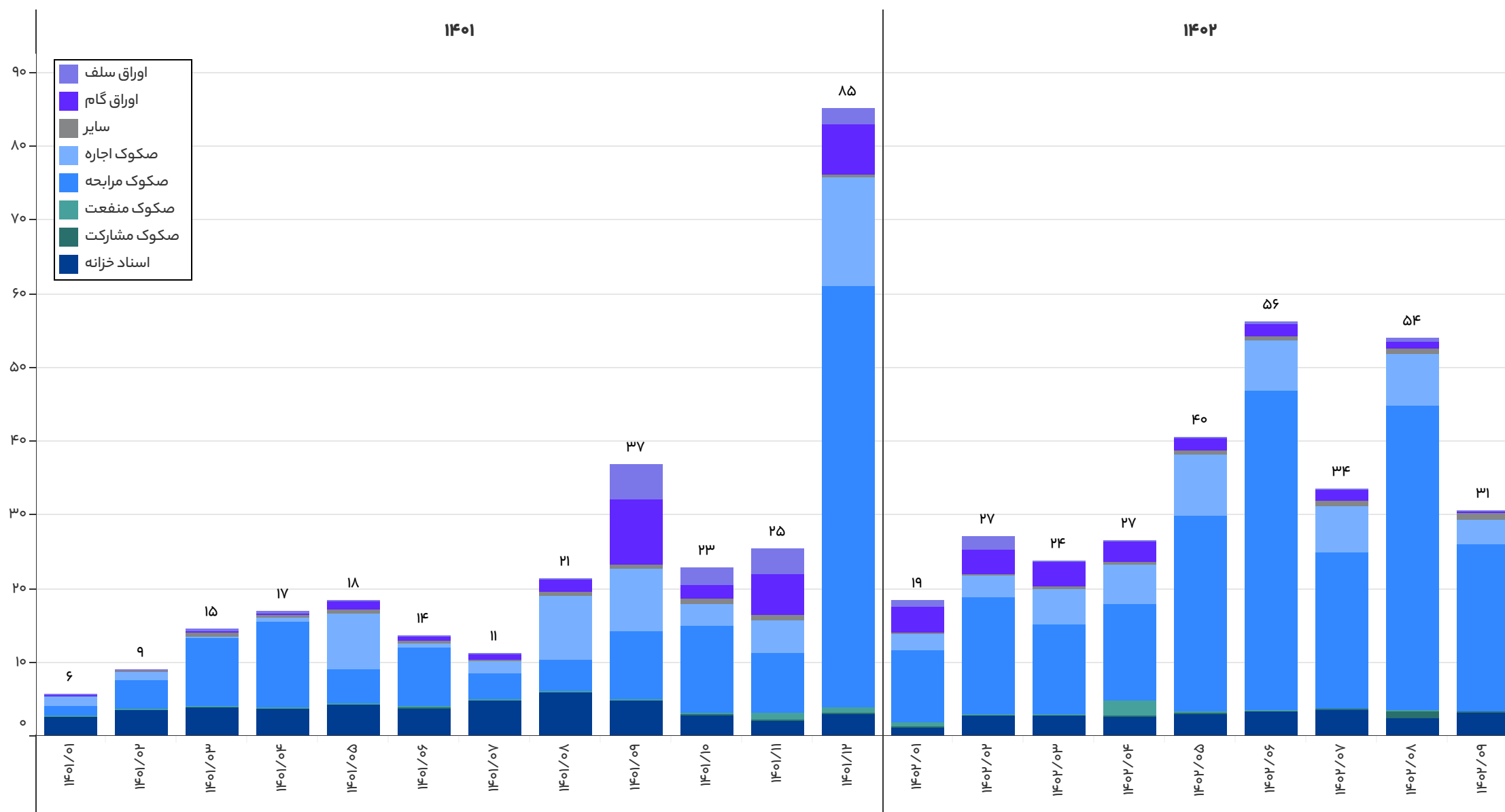
بانکها بانک مرکزی صندوقها دولت سایر



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق به صورت ماهانه

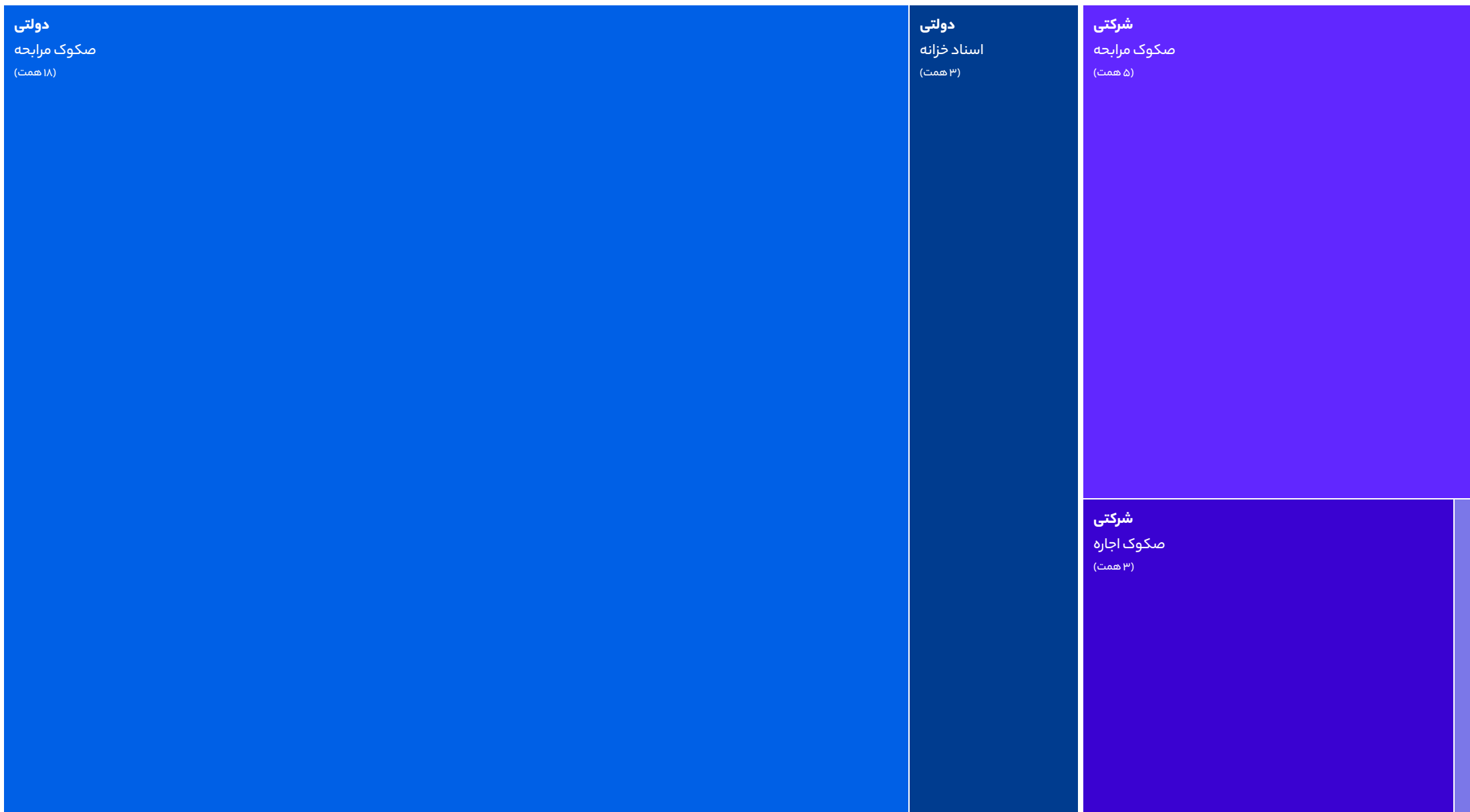
به تفکیک نوع اوراق، از ابتدای سال ۱۴۰۱، هزار میلیارد تومان



معاملات اوراق درآمد ثابت

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

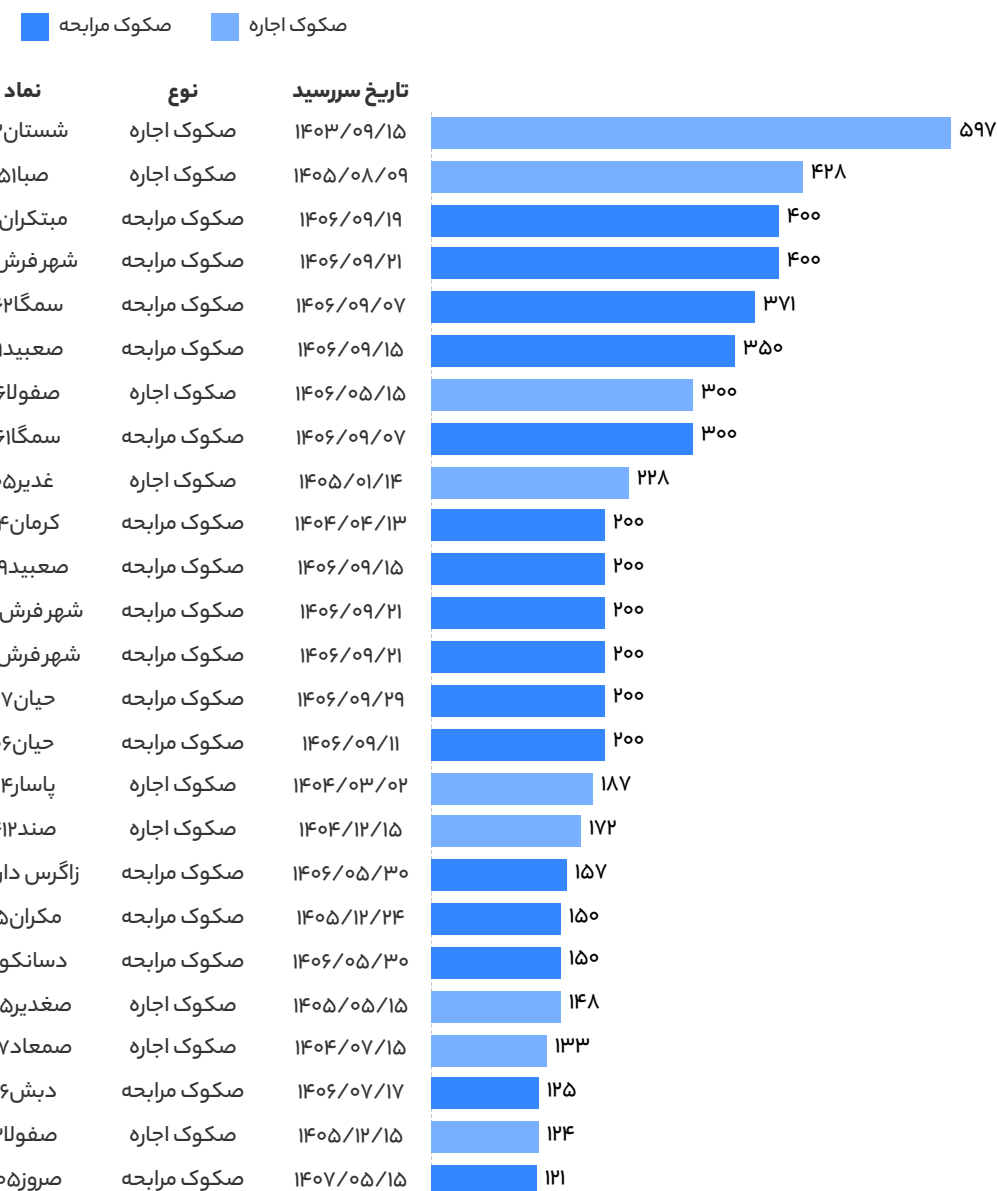
- دولتی، اوراق سلف
- دولتی، اسناد خزانه
- شرکتی، سایر
- شرکتی، صکوک مرابحه
- دولتی، صکوک مرابحه
- شرکتی، اوراق گام
- شرکتی، صکوک اجاره
- شهرداری، صکوک مشارکت



معاملات اوراق درآمد ثابت

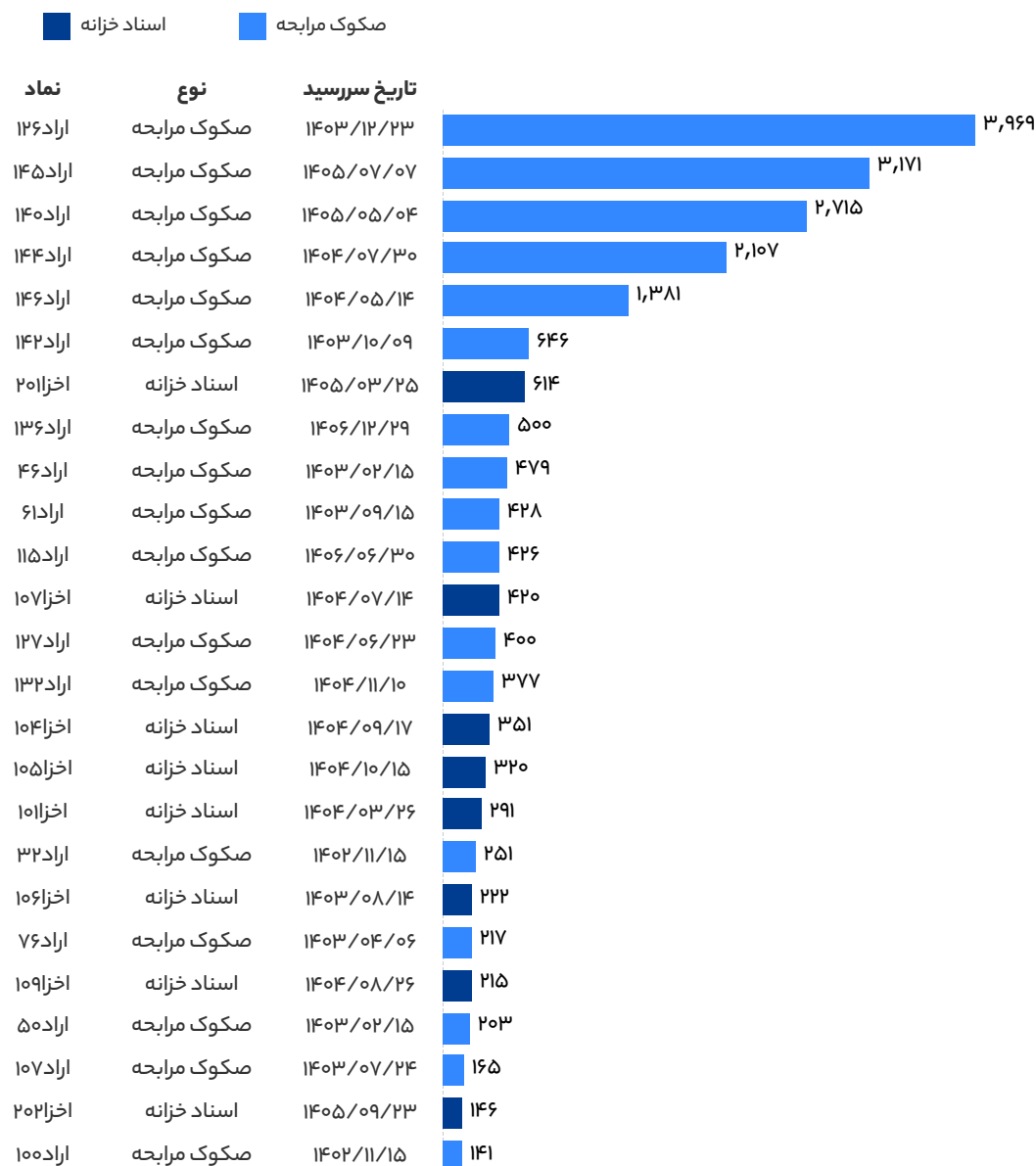
پرمعامله‌ترین اوراق شرکت ماه گزارش

ارزش معاملات برای ۲۵ اوراق با بیشترین ارزش معامله، به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان



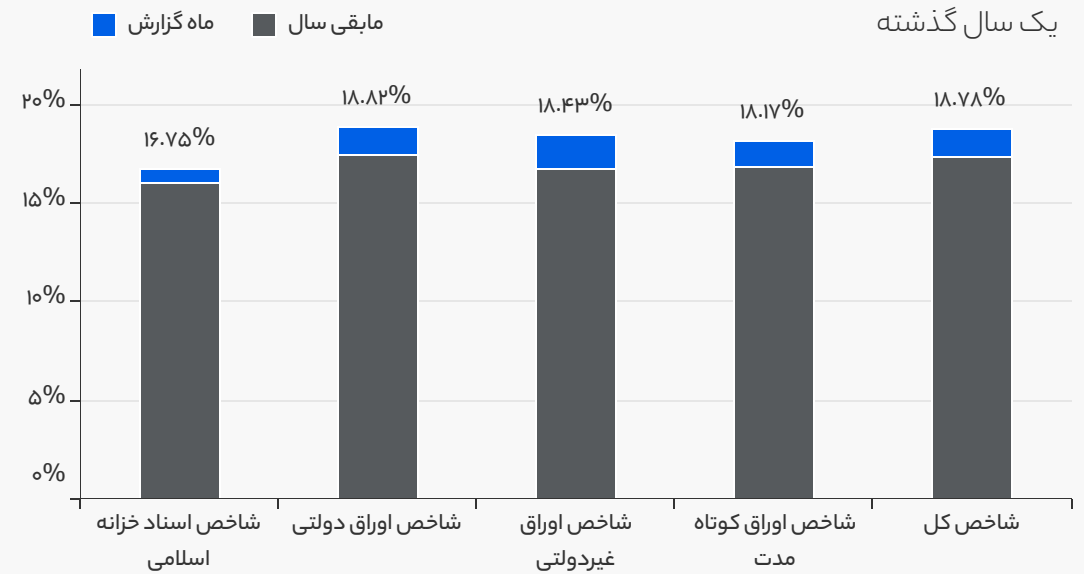
پرمعامله‌ترین اوراق دولتی ماه گزارش

ارزش معاملات برای ۲۵ اوراق با بیشترین ارزش معامله، به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

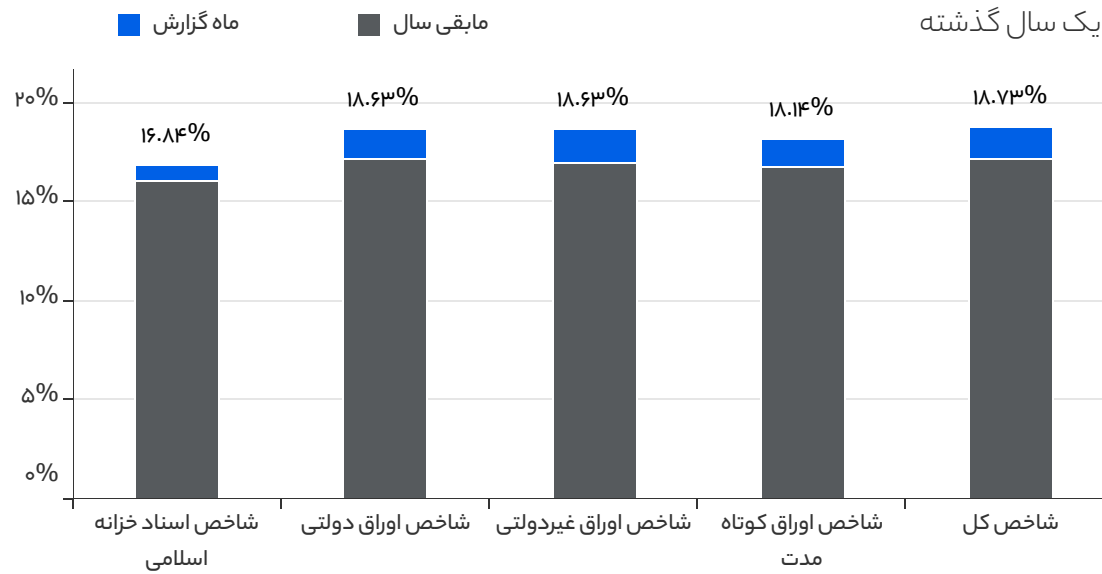


بازدهی شاخص صکوک

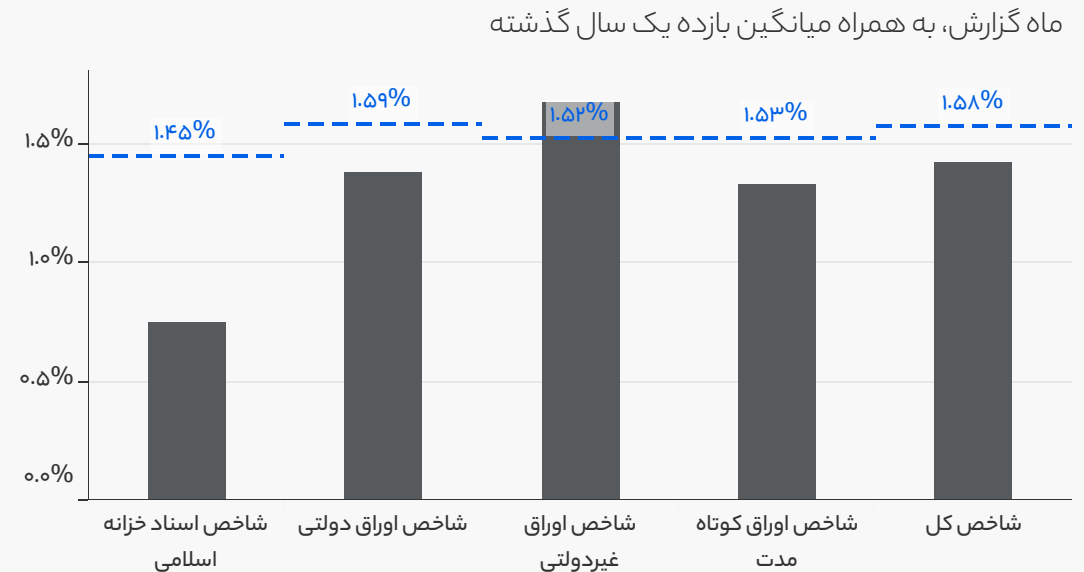
بازدهی شاخص‌های وزنی صکوک فرابورس ایران



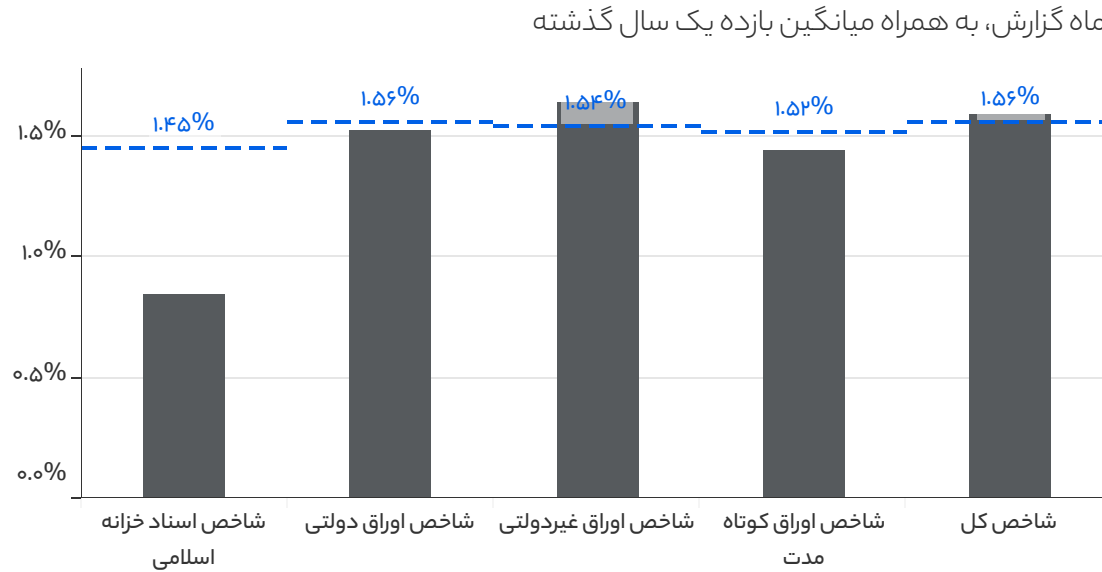
بازدهی شاخص‌های هم وزن صکوک فرابورس ایران



بازدهی شاخص‌های وزنی صکوک فرابورس ایران



بازدهی شاخص‌های هم وزن صکوک فرابورس ایران



نمای کلی صندوق های سرمایه گذاری

نمای کلی

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

خالص ارزش دارایی ها (همت)	تعداد صندوق	نوع صندوق	کلاس سرمایه گذاری
۵۶۴.۸	۱۳۹	با درآمد ثابت	سرمایه گذاری سنتی
۱۱۱.۵	۱۲۳	سهامی	
۶.۴	۲۶	مختلط	
۰.۸	۴	صندوق در صندوق	
۱.۷	۵	خصوصی	سرمایه گذاری خصوصی
۰.۴	۱۶	جسورانه	
۱۸۰.۵	۱۰۰	بازارگردانی	سرمایه گذاری جایگزین
۲۰.۴	۱۵	سپرده کالایی	
۱.۱	۱	پروژه های	
۰.۳	۲	املاک و مستغلات	
۰.۰	۴	زمین و ساختمان	
۸۸۷.۸	۴۳۵	جمع کل	

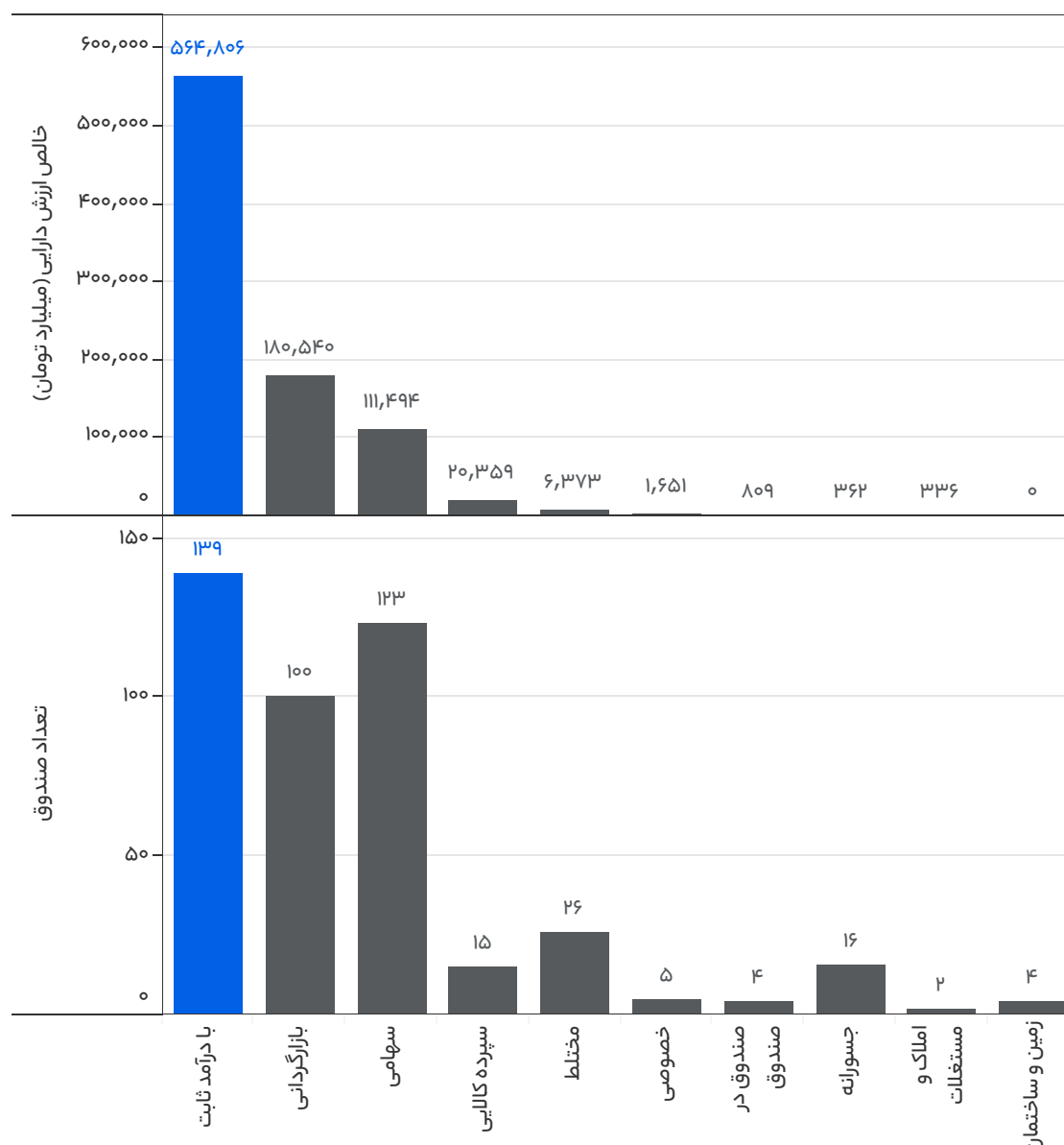
صندوق های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
قابل معامله	درآمد ثابت	آسمان دامون
صدور و ابطال	سهامی	بازنشستگی تکمیلی آتیه مفید
قابل معامله	درآمد ثابت	در اوراق بهادار با درآمد ثابت ماهور
قابل معامله	مختلط	رشد آفرین سرمایه
صدور و ابطال	سهامی	طلوع بامداد مهرگان
قابل معامله	کالایی	کالایی بلوط زاگرس

ارزش و تعداد صندوق های سرمایه گذاری

به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

بزرگ‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

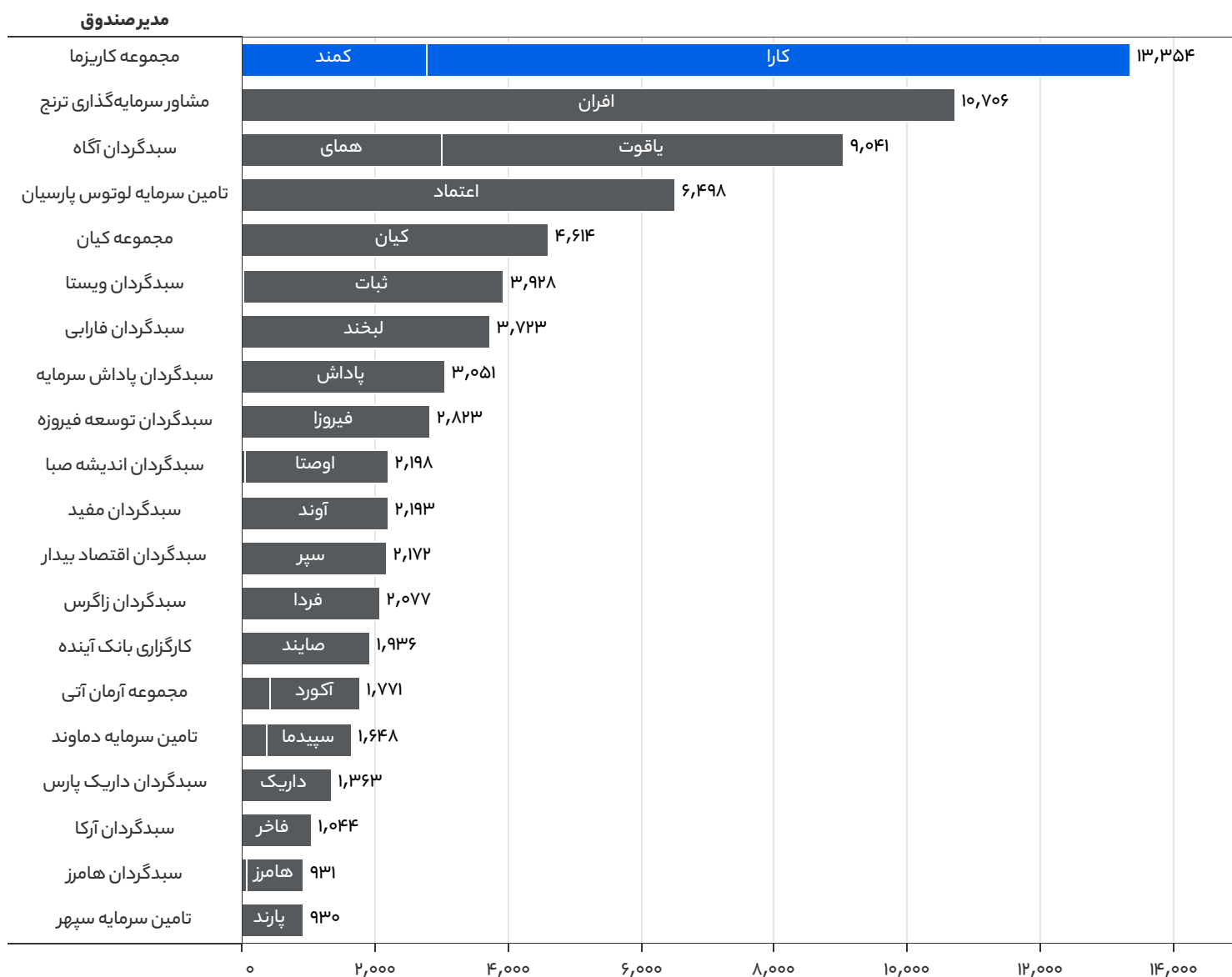
دارایی تحت مدیریت ۲۵ صندوق درآمد ثابت بزرگ، به همراه مدیر صندوق، میلیارد تومان

نام صندوق	مدیر صندوق	دارایی تحت مدیریت (میلیارد تومان)
گنجینه زرین شهر	تامین سرمایه تمدن	۶۴,۱۳۵
لوتوس پارسیان	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	۶۲,۲۰۷
دراوراق بهادار با درآمد ثابت کاردان	تامین سرمایه کاردان	۴۵,۴۳۳
ثابت حامی	سبدگردان مفید	۳۷,۸۸۰
اندوخته پایدار سپهر	تامین سرمایه سپهر	۲۷,۸۴۶
اوج ملت	تامین سرمایه بانک ملت	۱۷,۶۹۲
افرا نماد پایدار	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	۱۵,۳۷۴
نوع دوم کارا	مجموعه کاریزما	۱۴,۸۰۵
مشترک آتیه نوین	تامین سرمایه نوین	۱۳,۹۷۵
اعتماد آفرین پارسیان	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	۱۳,۷۳۵
اندوخته توسعه صادرات آرمانی	تامین سرمایه تمدن	۱۳,۰۱۵
سپید دماوند	تامین سرمایه دماوند	۱۳,۰۱۳
ره آورد آباد مسکن	تامین سرمایه بانک مسکن	۱۲,۷۰۷
اعتماد کارگزاری بانک ملی ایران	کارگزاری بانک ملی ایران	۱۰,۶۹۰
بانک ایران زمین	مشاور سرمایه‌گذاری هدف حافظ	۱۰,۰۷۳
دراوراق بهادار با درآمد ثابت کاریزما	مجموعه کاریزما	۱۰,۰۲۲
بانک گردشگری	سبدگردان سرآمد بازار	۹,۲۸۵
دراوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	مجموعه کاریزما	۸,۶۹۵
دراوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	تامین سرمایه خلیج فارس	۸,۰۹۷
یاقوت آگاه	سبدگردان آگاه	۸,۰۵۶
ارزش آفرینان دی	کارگزاری بانک دی	۷,۹۵۹
گنجینه امید ایرانیان	تامین سرمایه امید	۷,۱۰۵
مشترک افق کارگزاری بانک خاورمیانه	کارگزاری بانک خاورمیانه	۶,۵۶۶
اندیشه ورزان صبا تامین	سبدگردان اندیشه صبا	۶,۴۰۶
مشترک یکم ایرانیان	تامین سرمایه نوین	۶,۰۶۵

معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

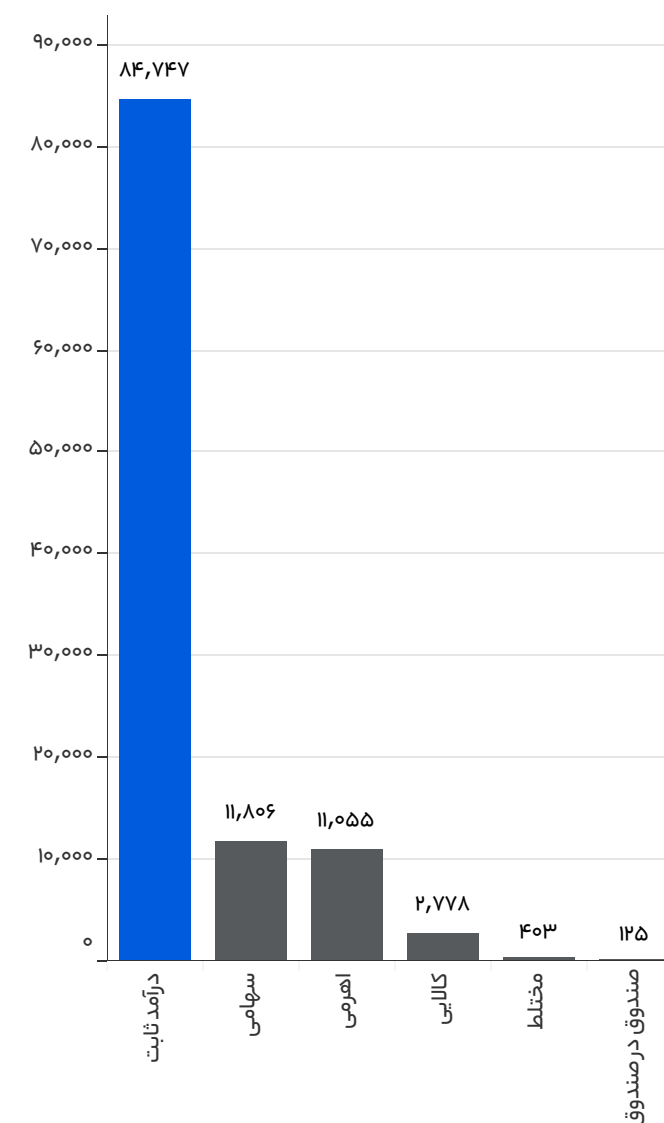
ارزش معاملات صندوق‌های درآمد ثابت هر مدیر صندوق در ماه گزارش، میلیارد تومان، برای ۲۰ مدیر صندوق برتر



ارزش معاملات انواع صندوق‌های

صندوق‌های سرمایه‌گذاری

مجموع ارزش معاملات در ماه گزارش، میلیارد تومان



معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت

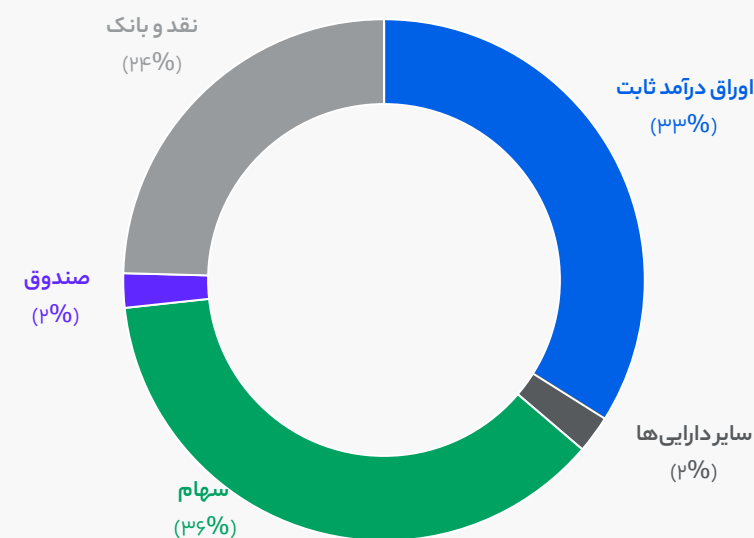
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	
صایند	کارگزاری بانک آینده	+۳۸۰
یاقوت	سبذگردان آگاه	+۱۵۶
همای	سبذگردان آگاه	+۱۱۲
فاخر	سبذگردان آرکا	+۶۶
آوند	سبذگردان مفید	+۶۵
هامرز	سبذگردان هامرز	+۴۹
فیروزا	سبذگردان توسعه فیروزه	+۴۰
پاداش	سبذگردان پاداش سرمایه	+۳۹
نشان	سبذگردان هامرز	+۷
سپیدما	تامین سرمایه دماوند	+۵
آکام	سبذگردان ویستا	+۳
آفاق	مجموعه آرمان آتی	+۳
دیبا	سبذگردان اندیشه صبا	+۱
اوستا	سبذگردان اندیشه صبا	-۱۳
فردا	سبذگردان زاگرس	-۲۲
آکورد	مجموعه آرمان آتی	-۳۳
ثبات	سبذگردان ویستا	-۴۴
سپر	سبذگردان اقتصاد بیدار	-۶۰
لبخند	سبذگردان فارابی	-۶۷
نیلی	تامین سرمایه دماوند	-۸۰
پارند	تامین سرمایه سپهر	-۹۶
کیان	مجموعه کیان	-۱۶۹
داریک	سبذگردان داریک پارس	-۲۳۴
کمند	مجموعه کاریزما	-۳۶۰
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	-۴۱۳
کارا	مجموعه کاریزما	-۴۵۸
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	-۷۱۴

تخصیص دارایی صندوق های سرمایه گذاری

ترکیب دارای صندوق ها

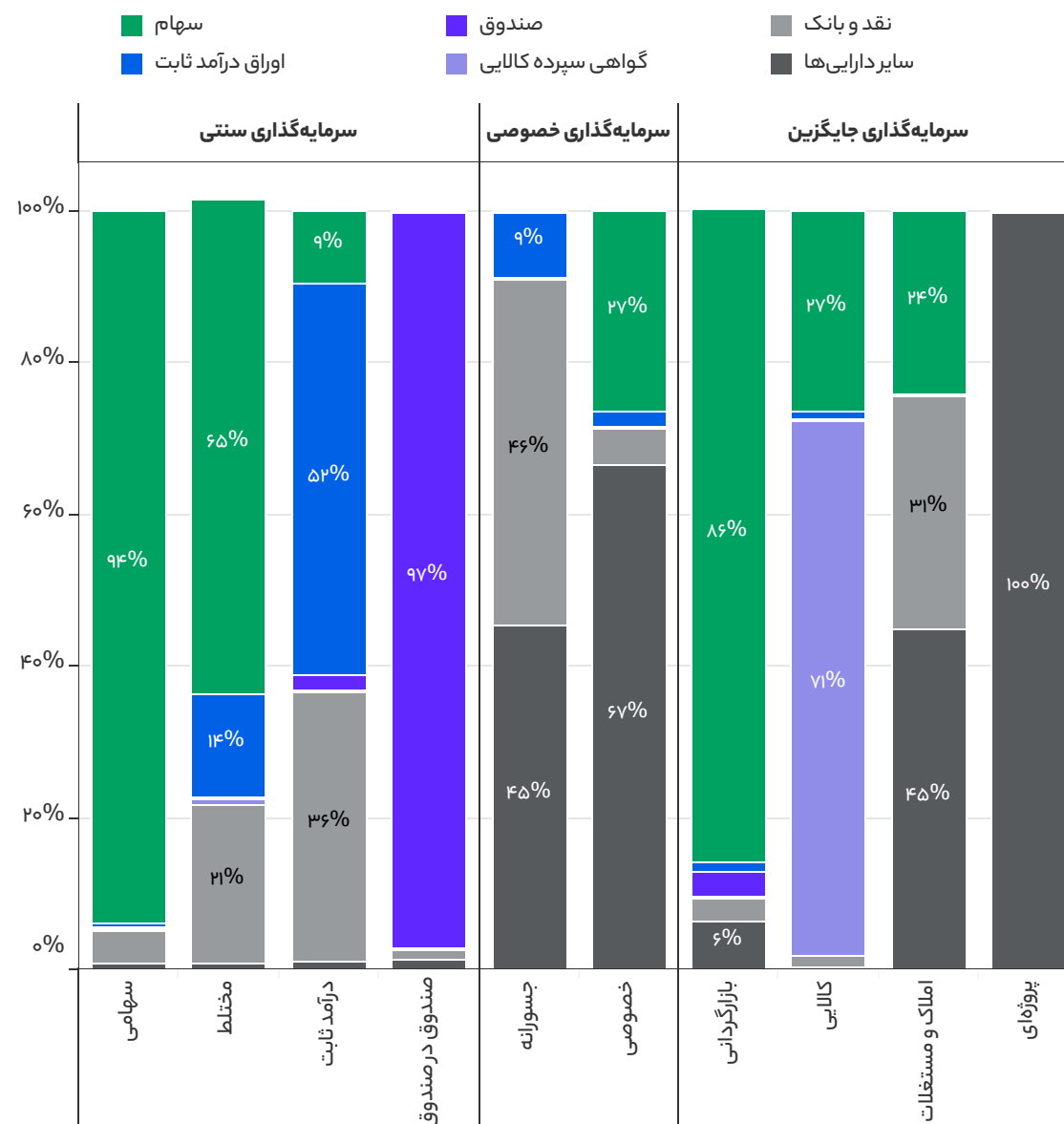
به تفکیک کلاس سرمایه گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه گذاری	نوع صندوق	سهم	درآمد ثابت	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی ها
سرمایه گذاری سنتی	سهامی	۹۴%	۱%	-	۴%	۱%
	مختلط	۶۵%	۱۴%	-	۲۱%	۱%
	درآمد ثابت	۹%	۵۲%	۲%	۳۶%	۱%
	صندوق در صندوق	-	-	۹۷%	۱%	۱%
سرمایه گذاری خصوصی	جسورانه	-	۹%	-	۴۶%	۴۵%
	خصوصی	۲۷%	۲%	-	۵%	۶۷%
سرمایه گذاری جایگزین	کالایی	۲۷%	۱%	-	۲%	-
	بازارگردانی	۸۶%	۱%	۳%	۳%	۶%
	املاک و مستغلات	۲۴%	-	-	۳۱%	۴۵%
	پروژه های	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۶%	۳۳%	۲%	۲۴%	۲%

ترکیب دارای صندوق ها

به تفکیک کلاس سرمایه گذاری و نوع صندوق

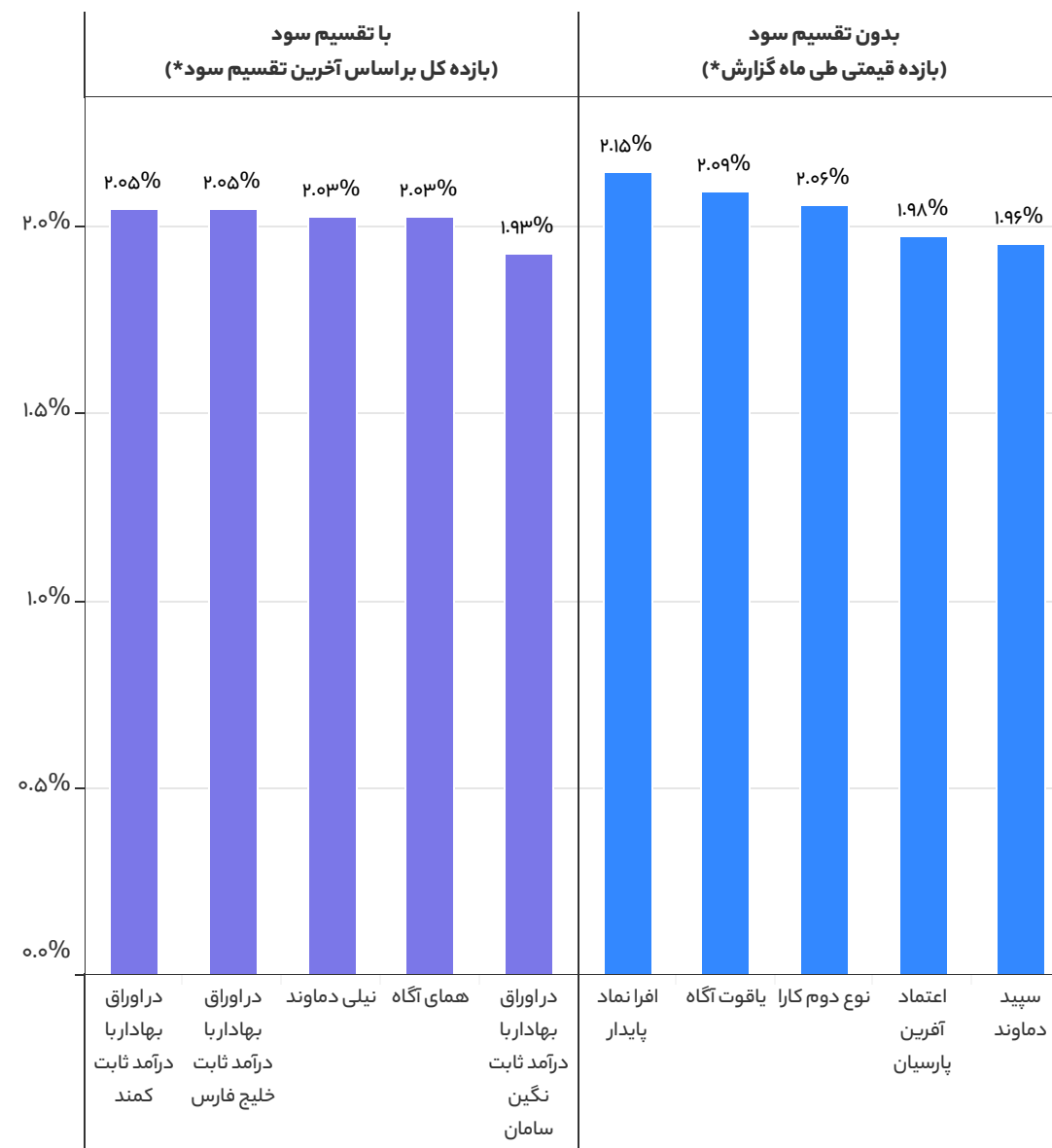


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

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 تومان)	بازدهی ۱۲ ماهه **NAV	بازدهی ۶ ماهه **NAV	بازدهی ۳ ماهه **NAV	بازدهی ۱ ماهه **NAV	بازده ساده تقسیم سود	بازده موثر تقسیم سود
با تقسیم سود	دراوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	۸,۶۱۲	۲۳.۹%	۱۱.۹%	۶.۰%	۲.۰۰%	۲۴.۶%	۲۷.۵%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۷,۹۲۰	۲۳.۹%	۱۲.۰%	۶.۰%	۲.۰۲%	۲۴.۶%	۲۷.۵%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت نگین سامان	۴,۶۳۴	۲۳.۱%	۱۱.۴%	۵.۷%	۱.۹۰%	۲۳.۱%	۲۵.۷%
	همای آگاه	۳,۷۹۴	۲۳.۰%	۱۱.۸%	۶.۰%	۲.۰۰%	۲۴.۳%	۲۷.۲%
	نیلی دماوند	۳,۵۶۵	-	۱۲.۰%	۶.۰%	۲.۰۲%	۲۴.۳%	۲۷.۲%
بدون تقسیم سود	افرا نماد پایدار	۱۴,۹۱۲	۲۷.۶%	۱۳.۰%	۶.۳%	۲.۱۵%		
	نوع دوم کارا	۱۴,۲۳۰	۲۷.۰%	۱۲.۹%	۶.۳%	۲.۰۶%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۱۳,۷۱۹	۲۵.۶%	۱۲.۳%	۶.۰%	۱.۹۸%		
	سپید دماوند	۱۲,۸۱۱	۲۴.۴%	۱۱.۸%	۵.۸%	۱.۹۶%		
	یاقوت آگاه	۷,۹۶۴	۲۶.۸%	۱۲.۸%	۶.۲%	۲.۰۹%		

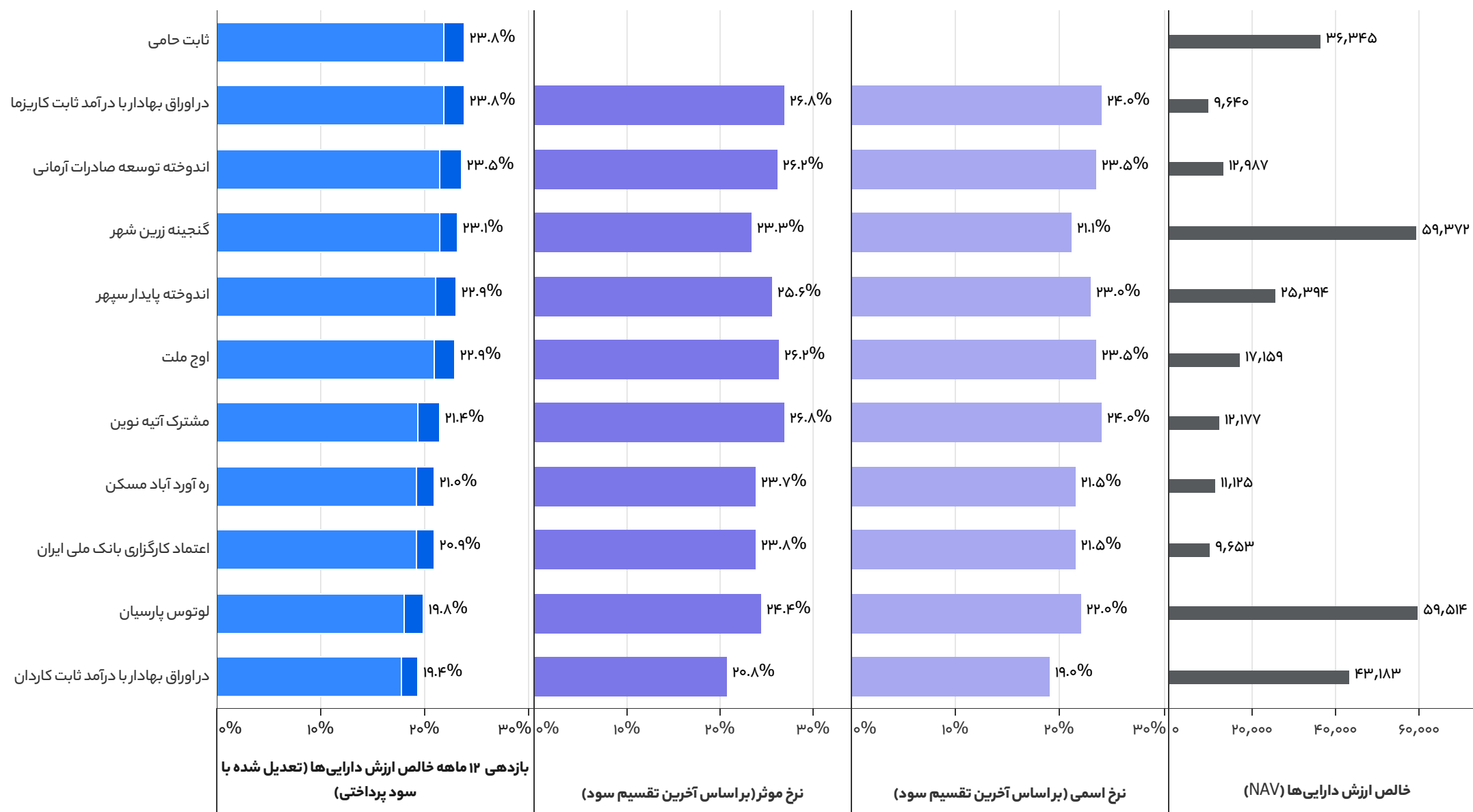


* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.
 ** در صورتی که صندوق تقسیم سود داشته باشد، بازده خالص ارزش دارایی هر واحد بر اساس تقسیم سود تعدیل می‌گردد.

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

