

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



فروردین ماه ۱۴۰۳



CHARISMA MARKET INSIGHT

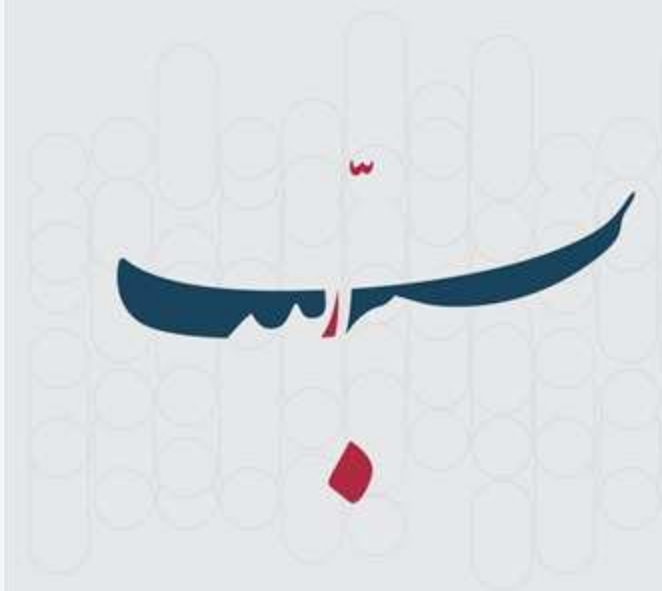
معرفی گزارش:

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.



فصل اول
اقتصاد

۵۴	سیاست‌های پولی
۵۶	پایه پولی و نقدینگی
۵۹	تورم و شاخص قیمت مصرف‌کننده
۱۱	ارز خارجی

فصل دوم
سهام

۱۴	بررسی بلندمدت بازار سهام
۱۷	ارزندگی بازار سهام

فصل سوم
درآمد ثابت

۲۱	مروری بر بازار درآمد ثابت
۲۲	دید کلی بازار بدهی
۲۴	انتشار و تسویه اوراق
۲۵	بازیگران کلیدی بازار بدهی
۲۹	معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی
۳۱	آمار معاملات اوراق درآمد ثابت
۳۴	بازدهی شاخص صکوک
۳۵	نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳۷	معاملات صندوق‌ها درآمد ثابت
۳۹	تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۴۰	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)
۴۱	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (صدور و ابطال)

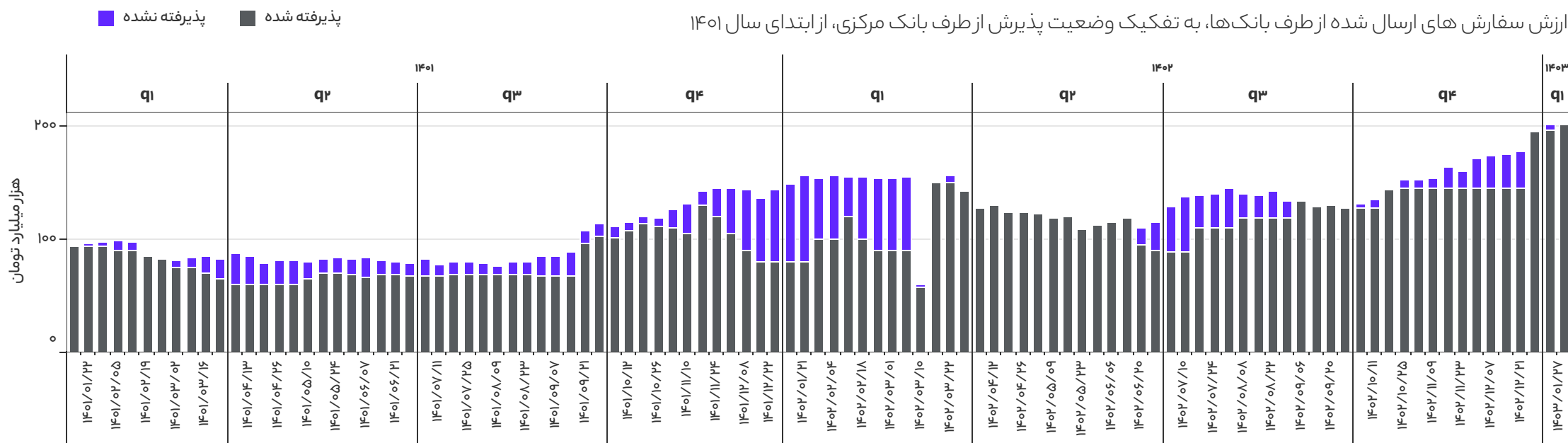


ECONOMY

سیاست‌های پولی

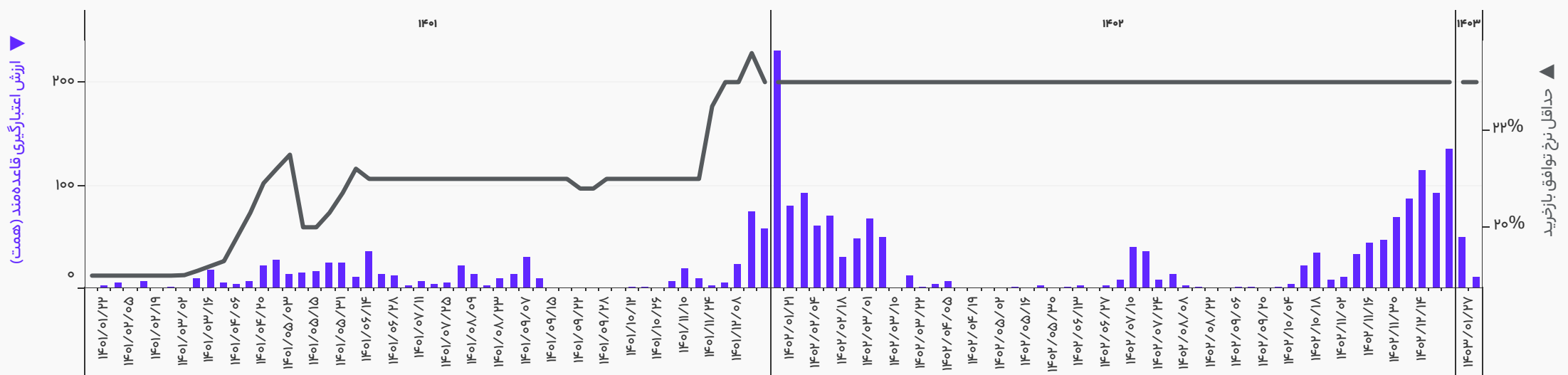
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

ارزش سفارش‌های ارسال شده از طرف بانک‌ها، به تفکیک وضعیت پذیرش از طرف بانک مرکزی، از ابتدای سال ۱۴۰۱



تامین مالی بانک‌ها از بانک مرکزی

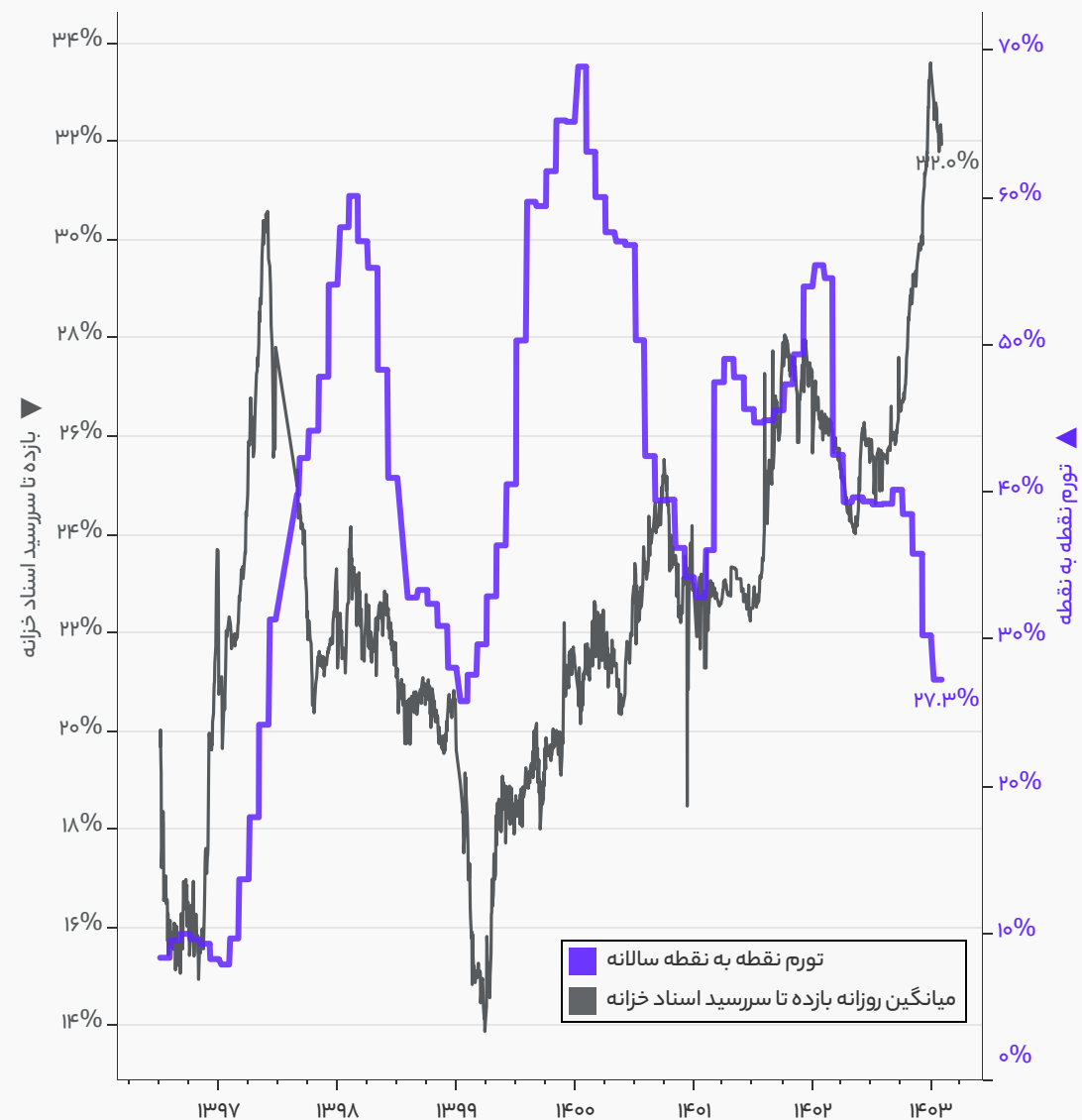
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق بازخريد، از ابتدای سال ۱۴۰۱



سیاست‌های پولی

تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

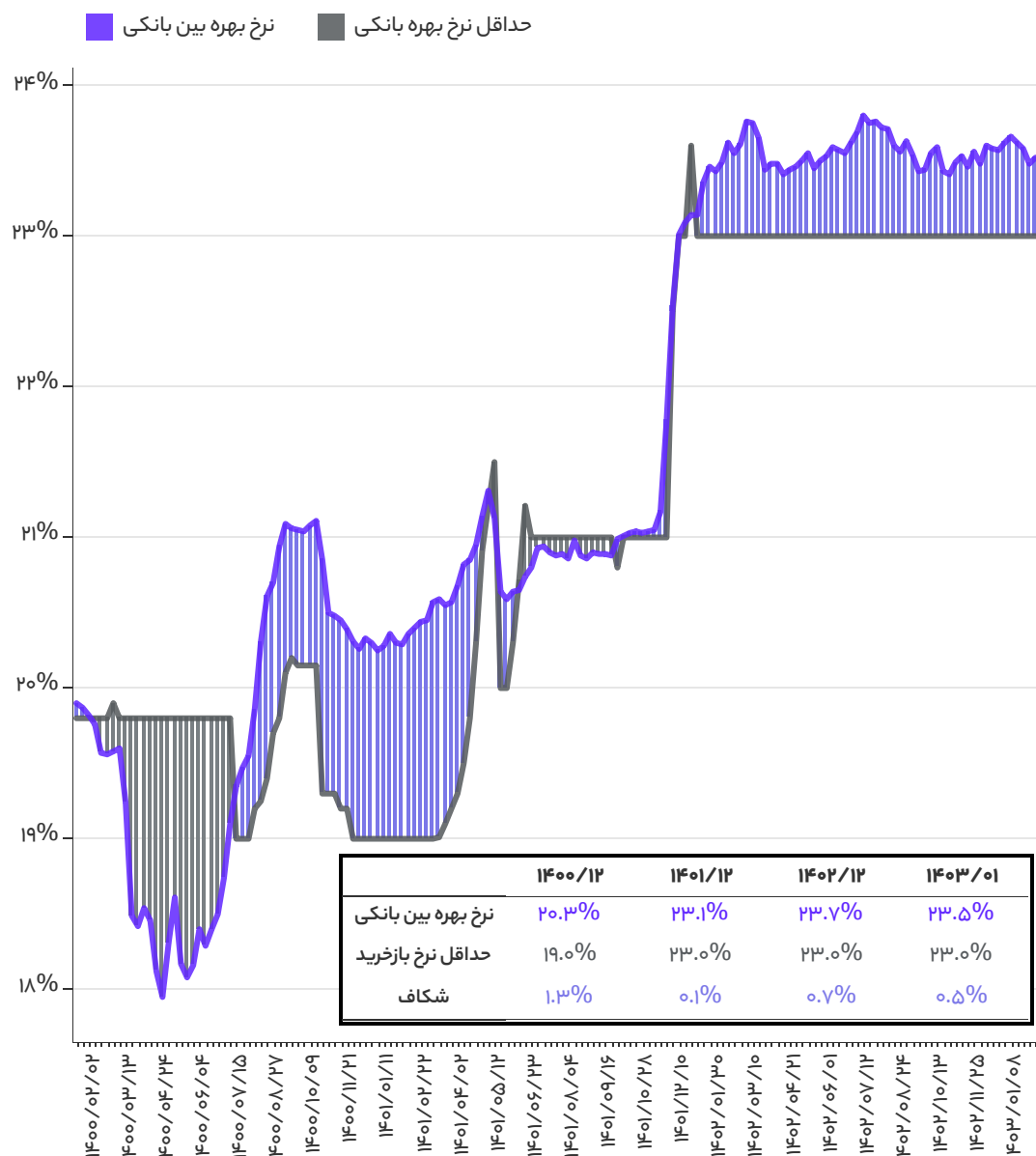
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* 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

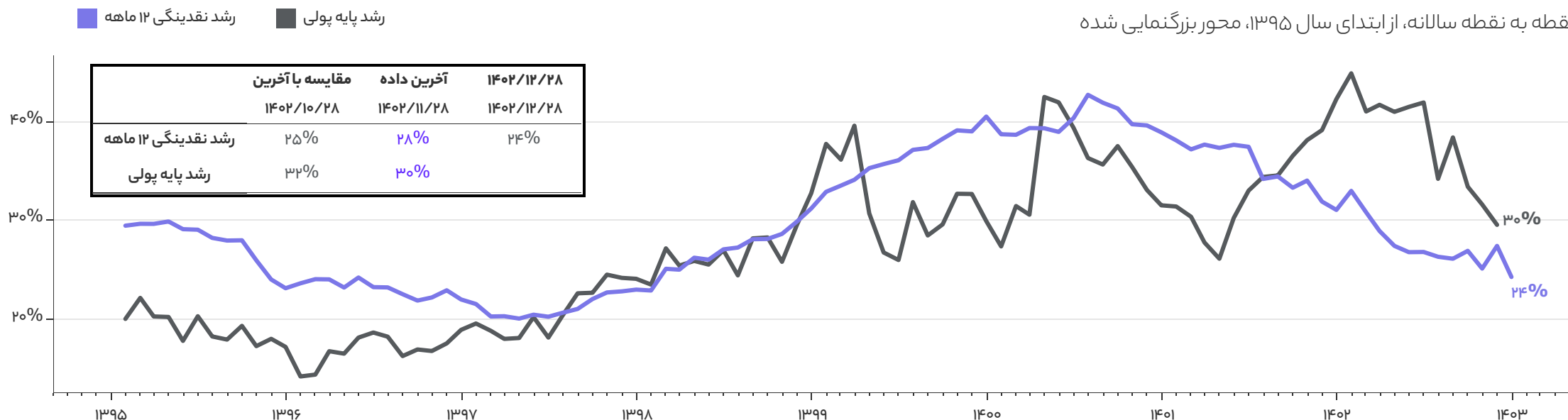
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

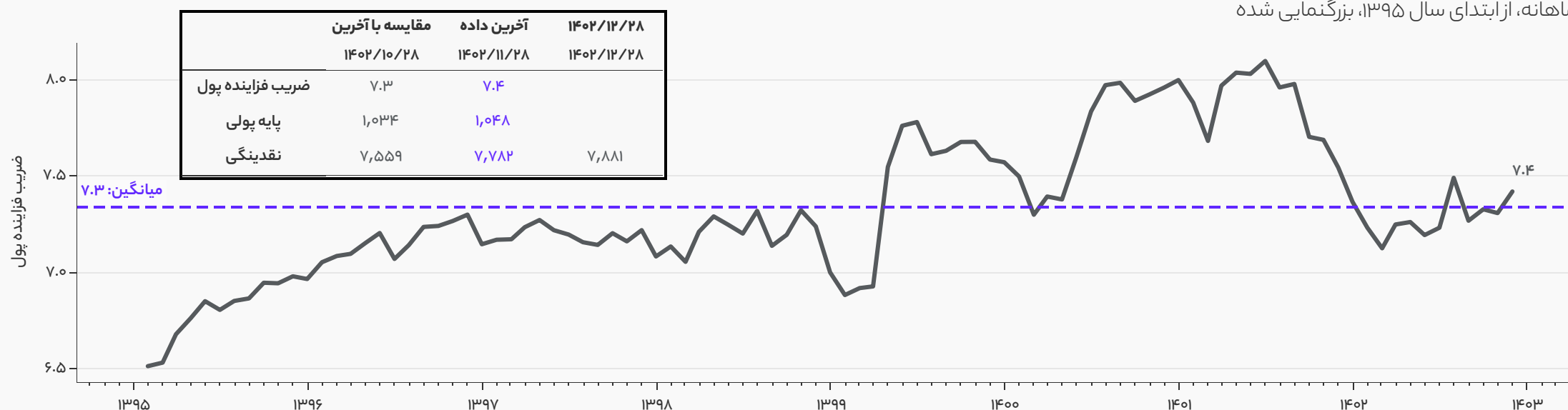
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

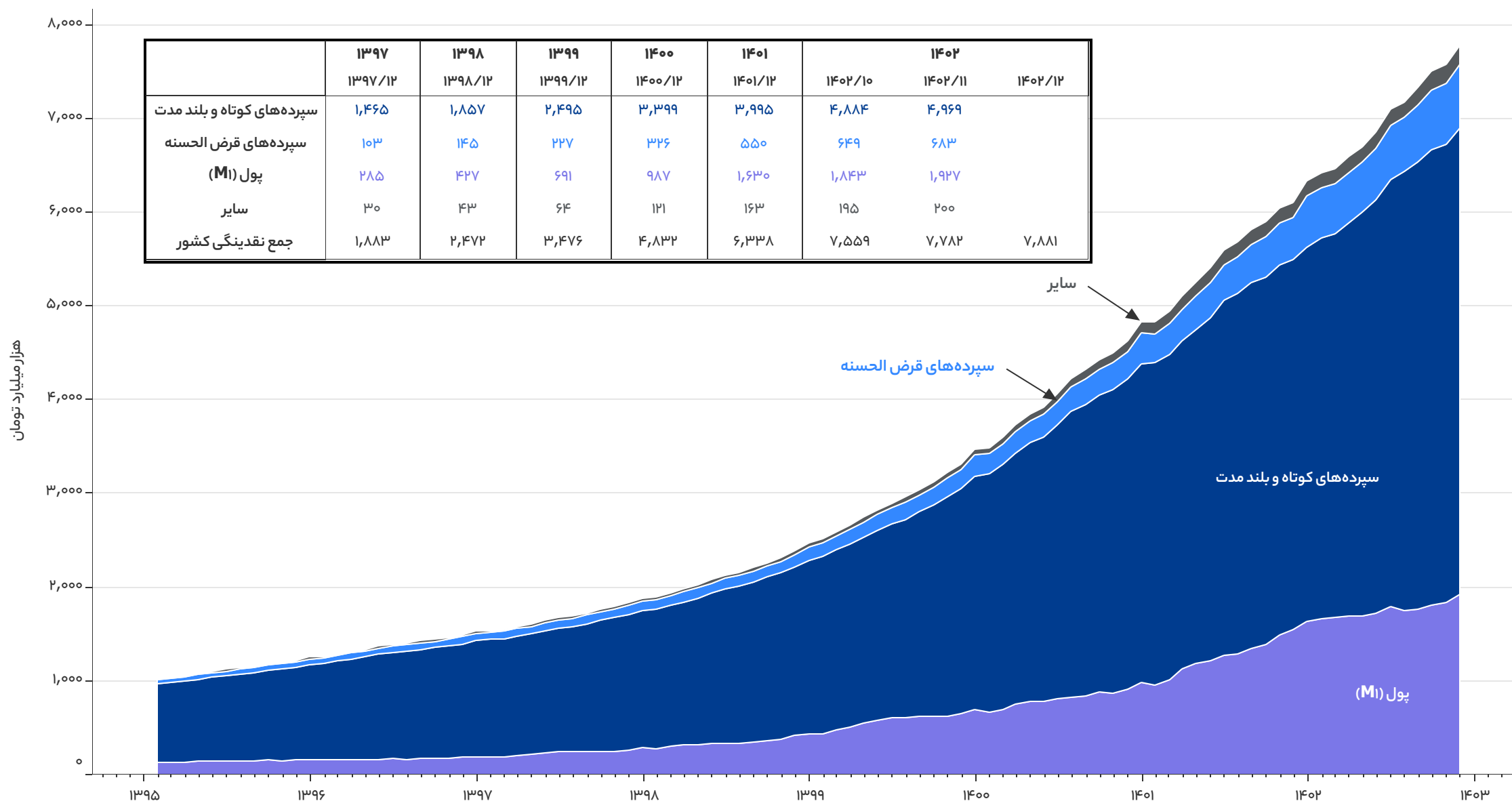


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

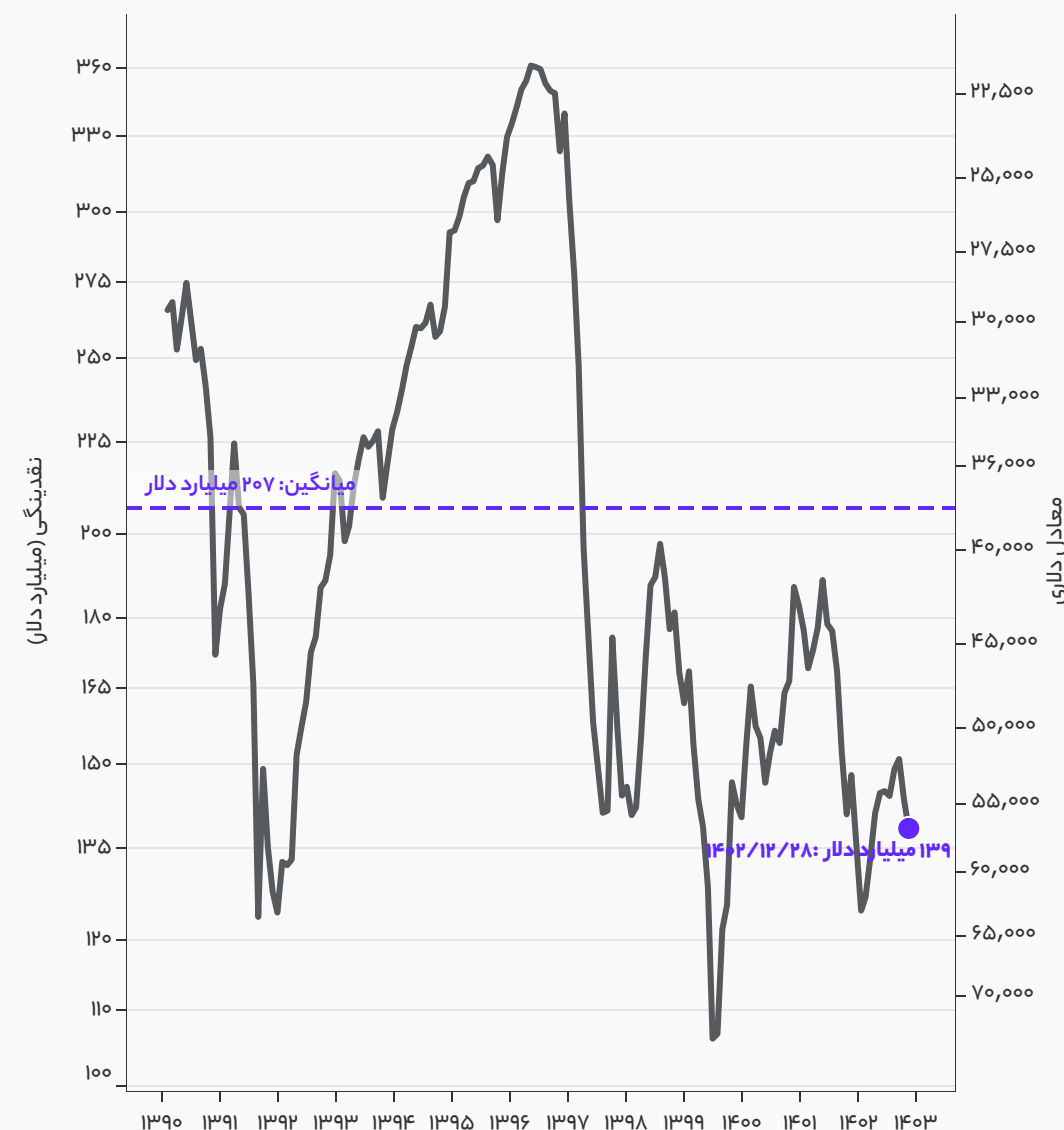
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، (براساس آخرین داده‌ی منتشر شده توسط بانک مرکزی)، هزار میلیارد تومان



پایه پولی و نقدینگی

نقدینگی در ایران به دلار آمریکا و دلار تعادلی

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

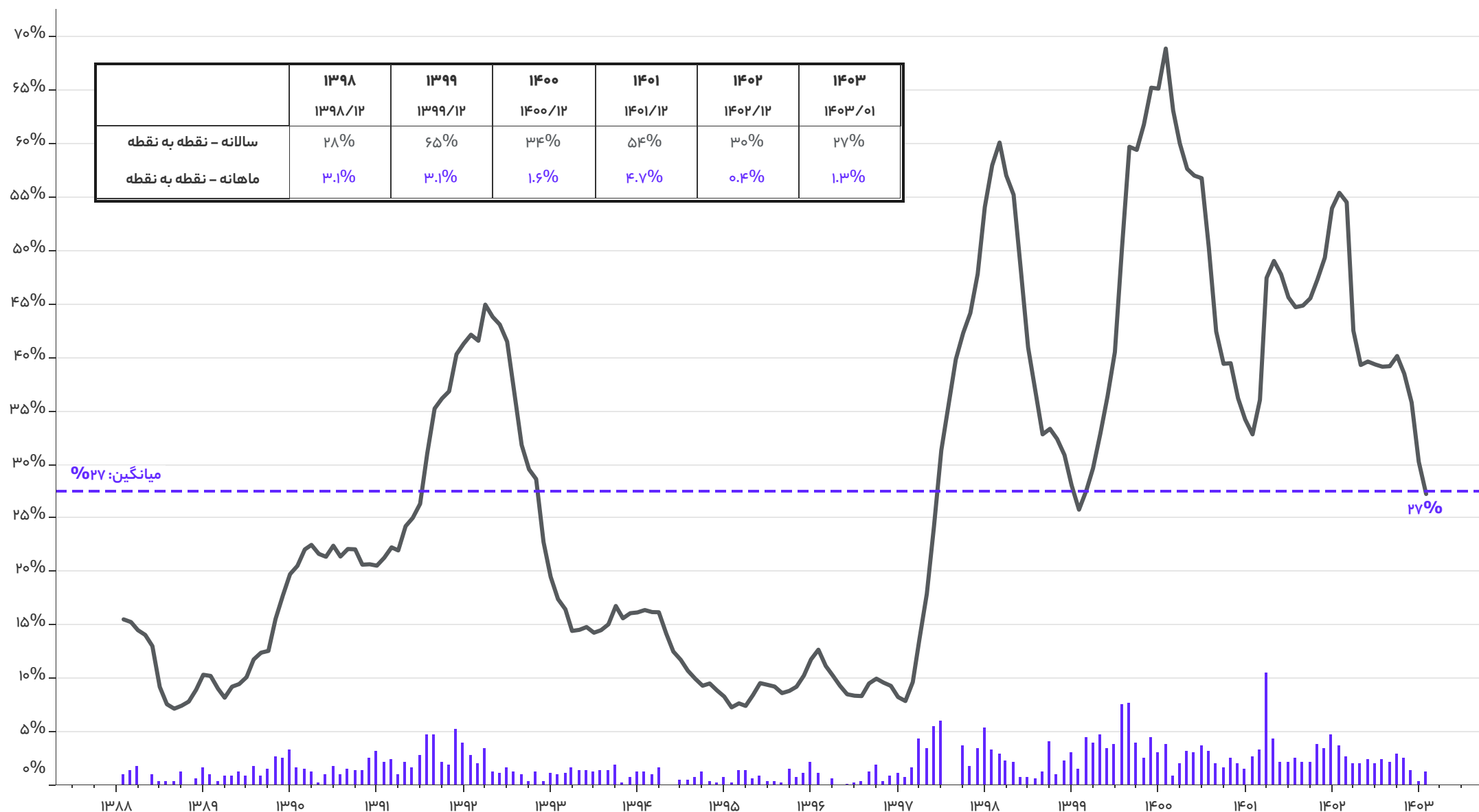


* قیمت دلاری لازم برای رسیدن به سطح نقدینگی دلاری مورد انتظار.
** نقدینگی چند ماه گذشته با استفاده از آمار ارایه شده در اخبار توسط بانک مرکزی محاسبه گردیده است.

تورم و شاخص CPI

وضعیت تورم*

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

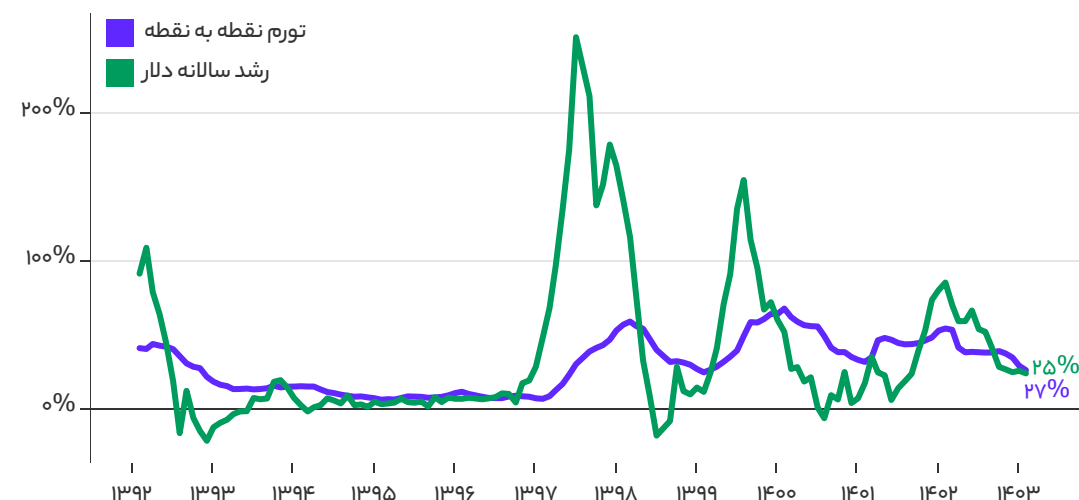


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
**برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

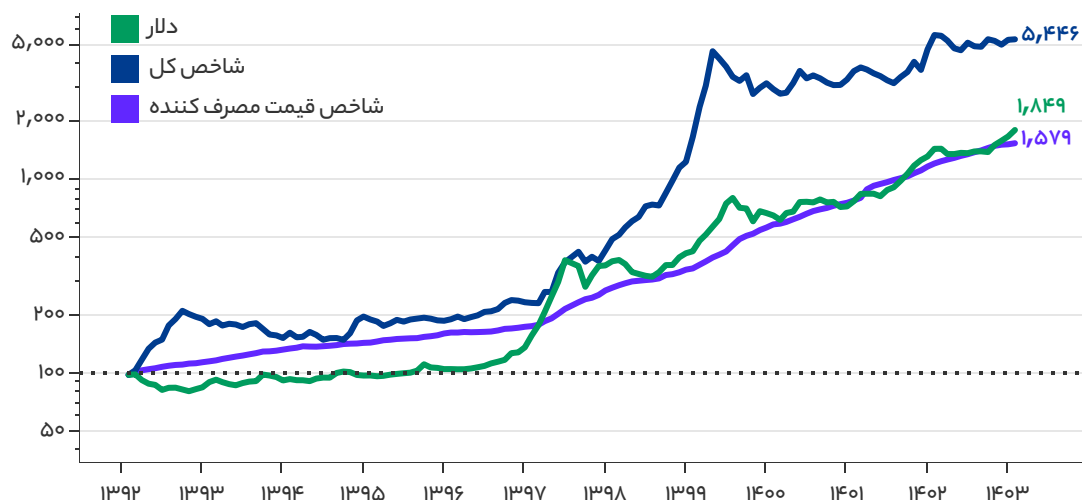
تورم و رشد دلار

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

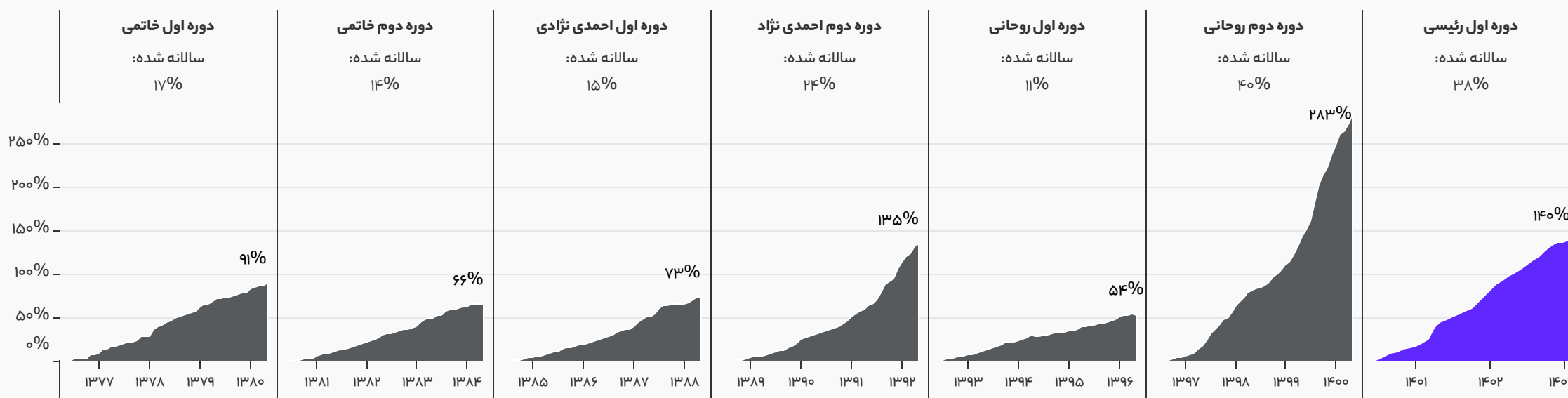


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

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

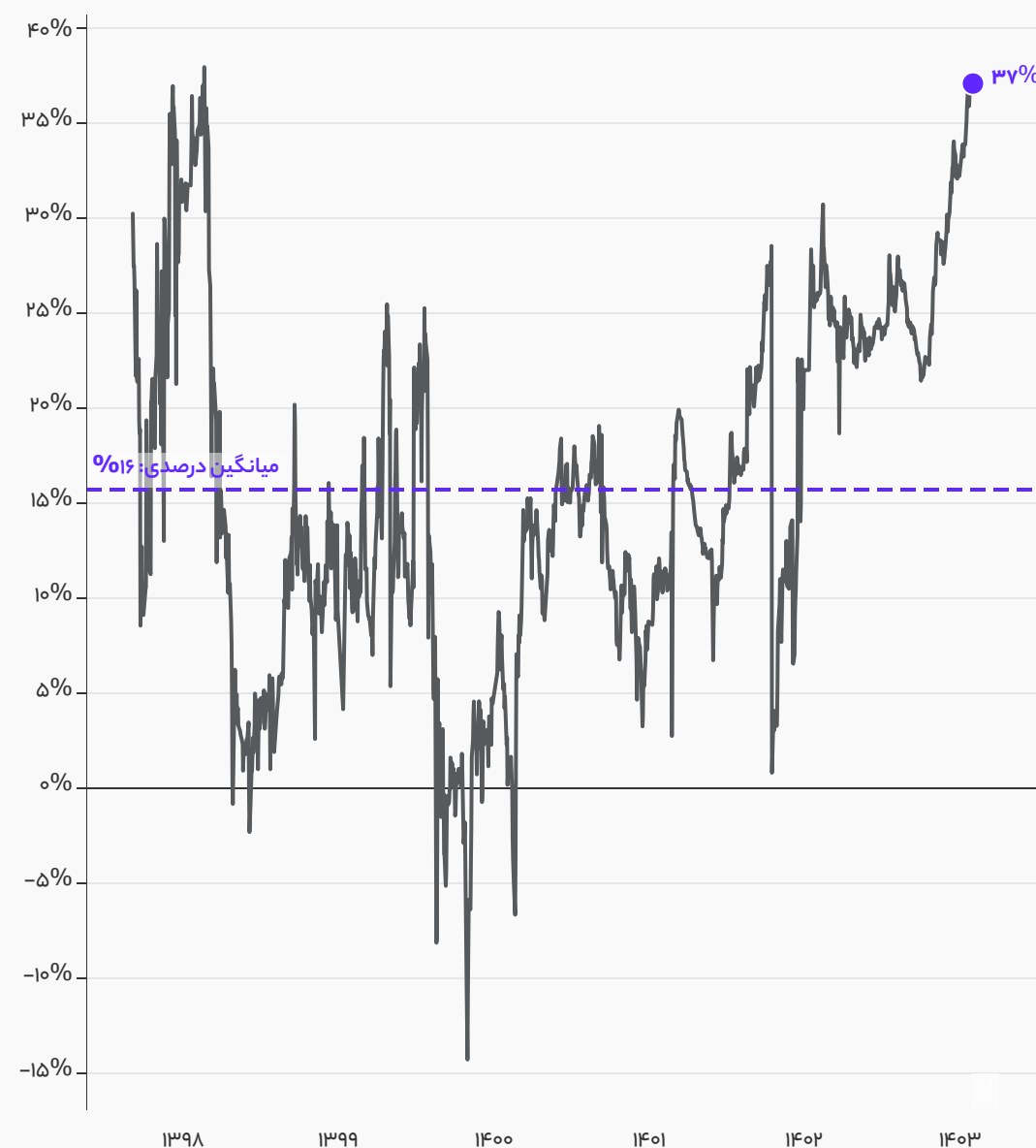


* دلار سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

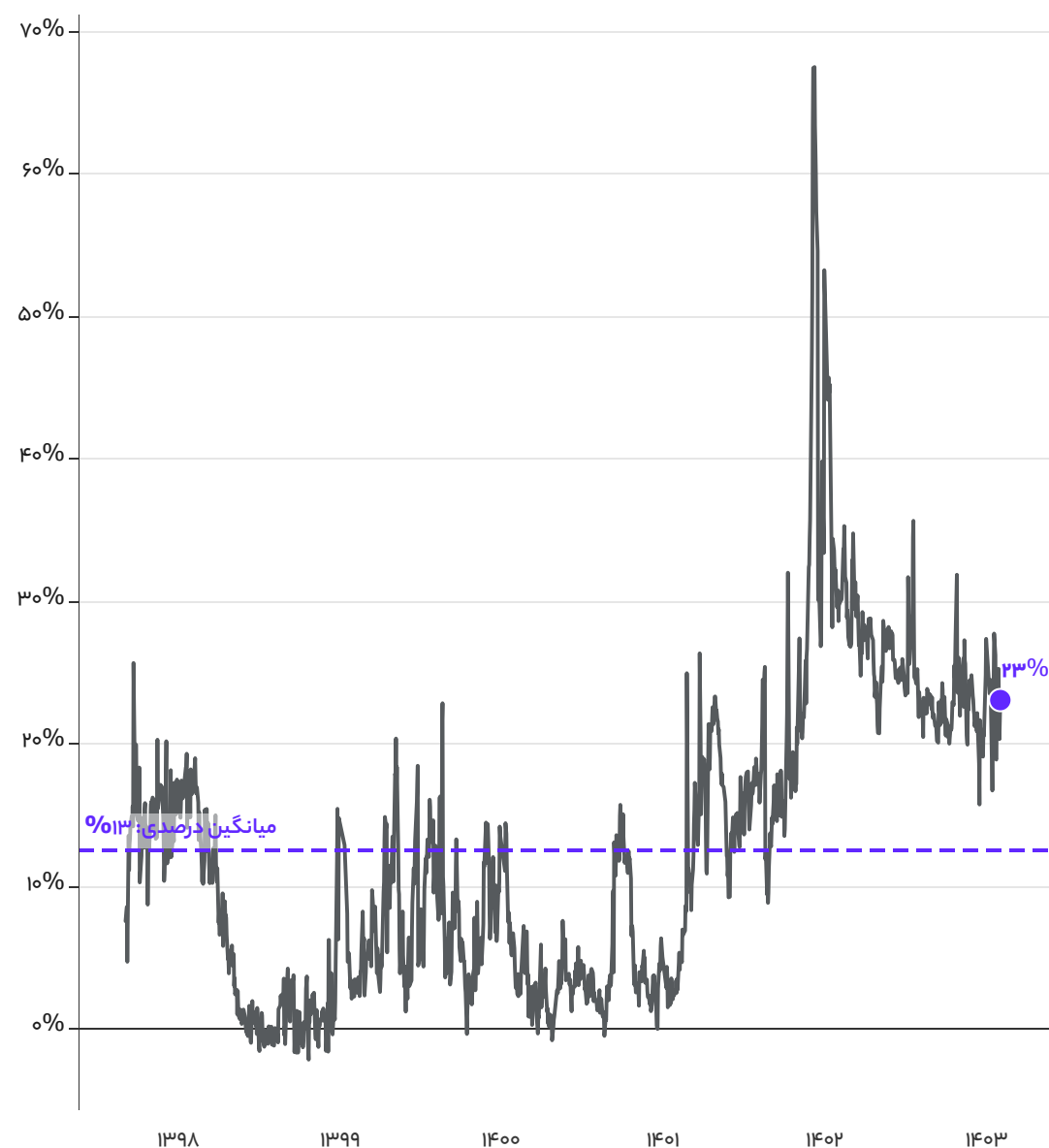
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



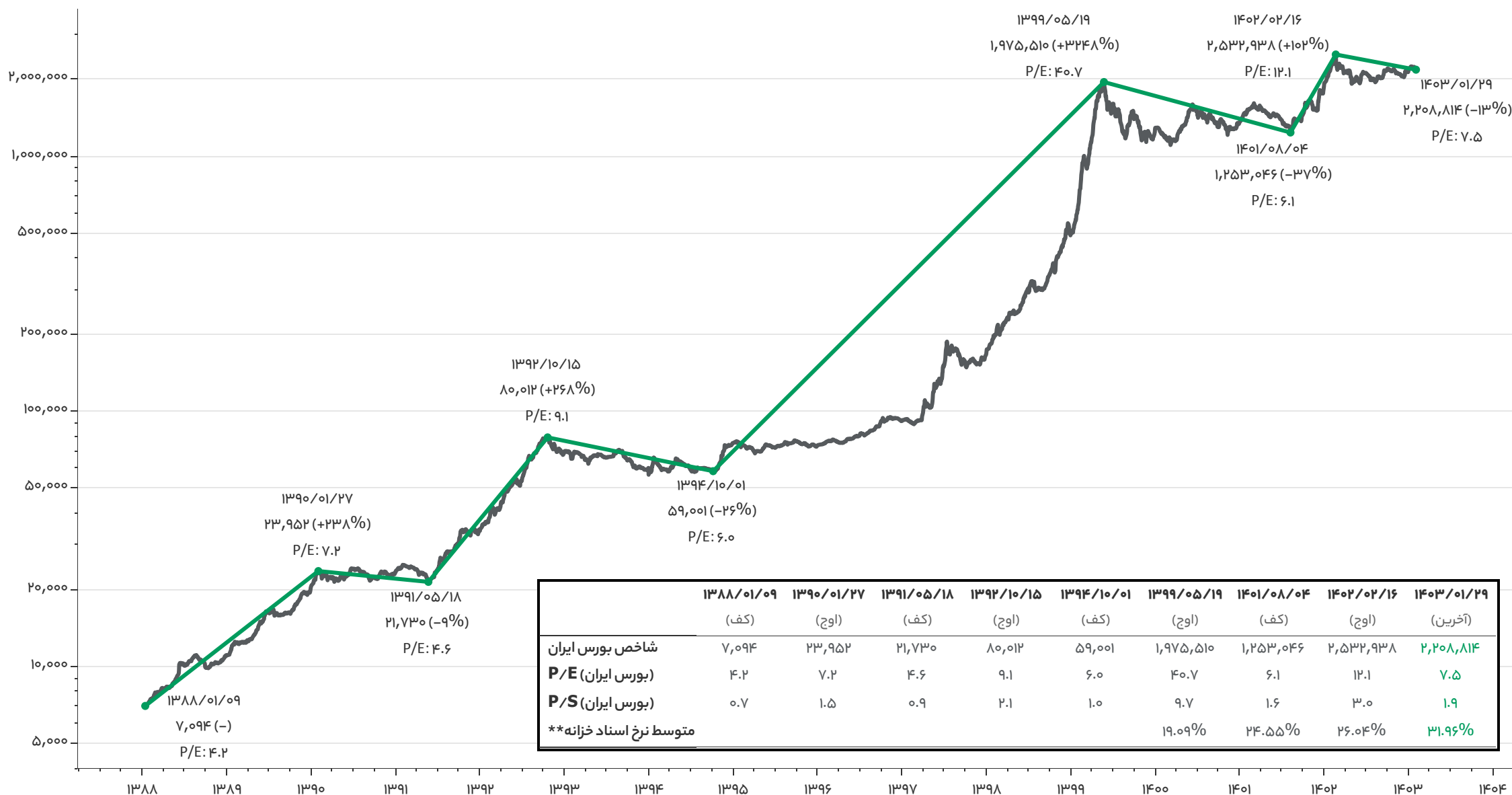


EQUITY

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

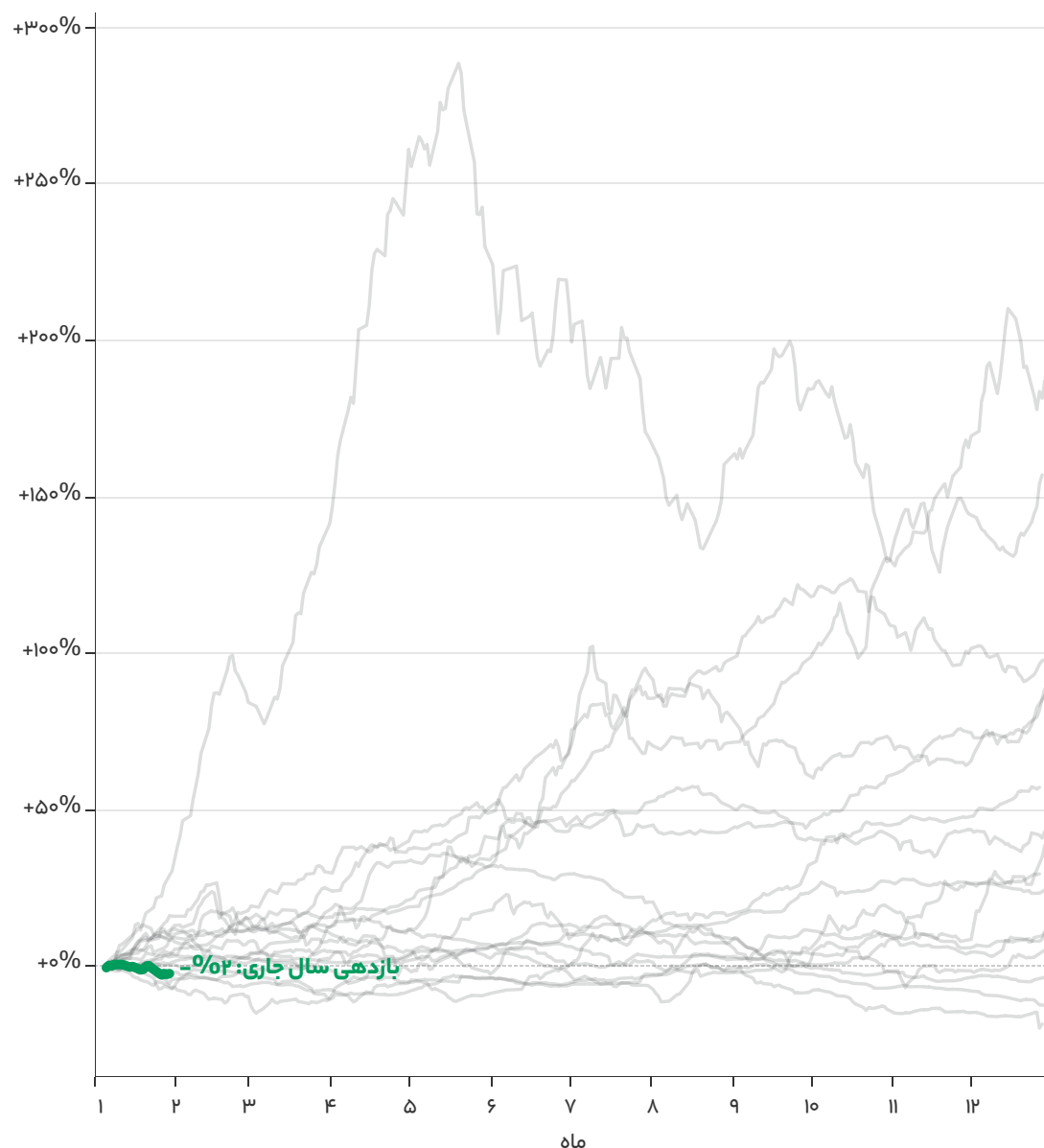


* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور، که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.

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

مقایسه بازدهی سال جاری

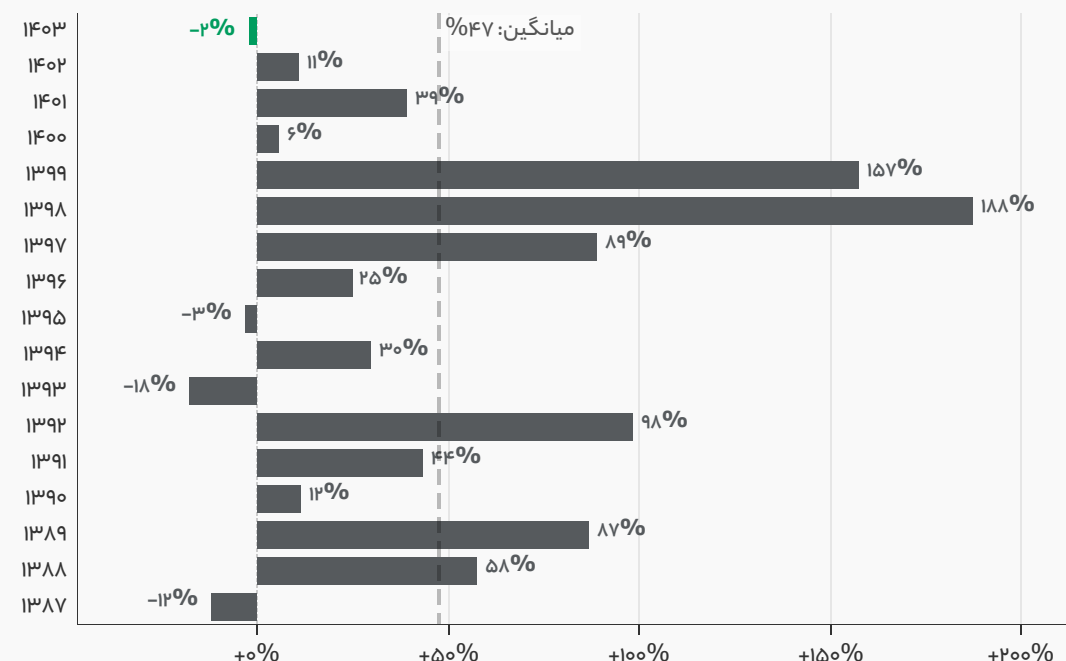
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



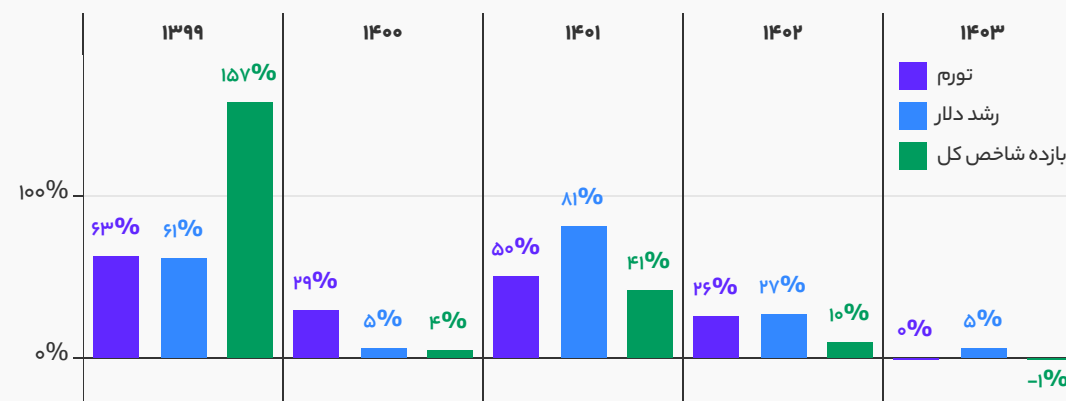
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

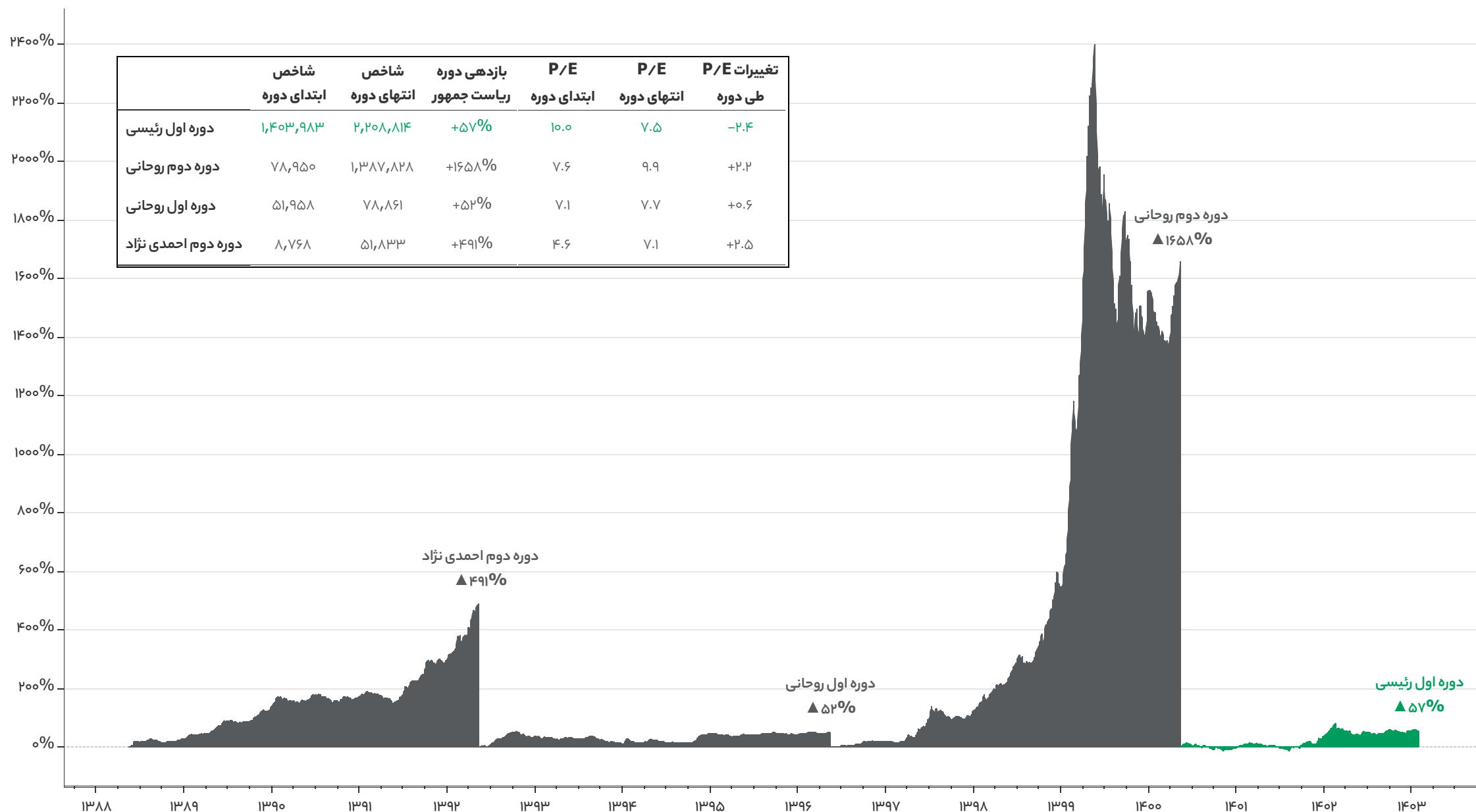


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلند مدت بازار سهام

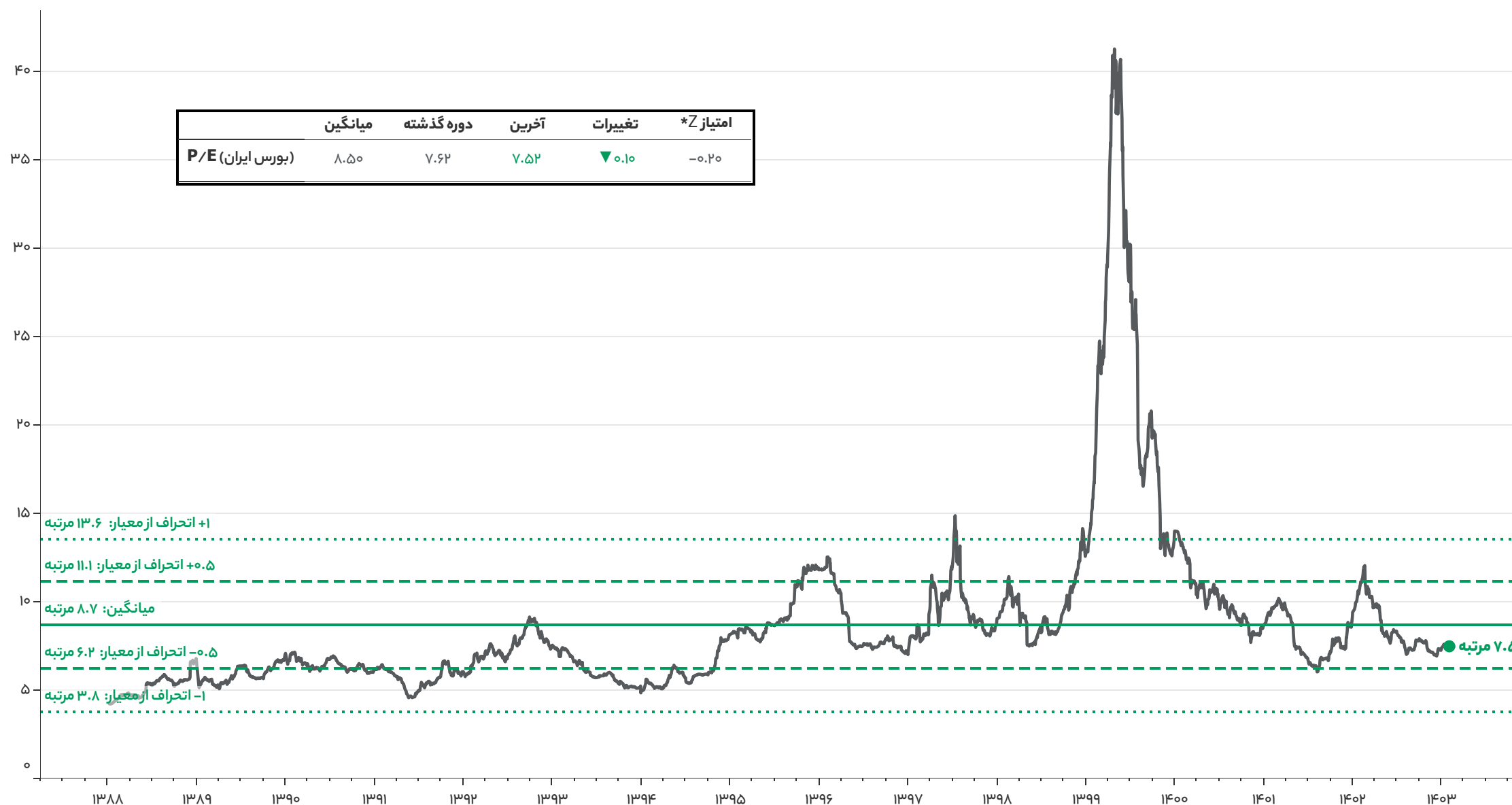
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



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 برزورد گردیده‌اند.
** برای مقایسه بهتر، عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف گردیده‌اند.



FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

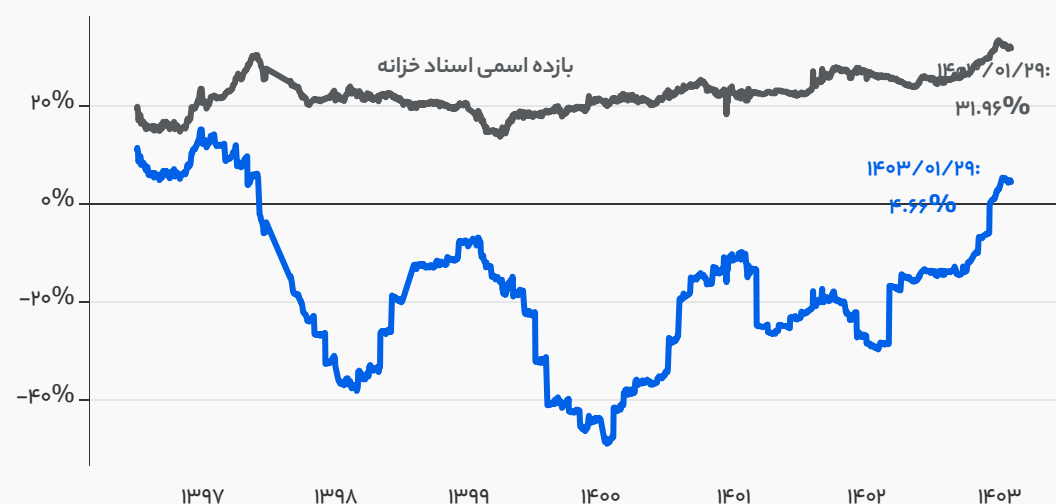
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

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



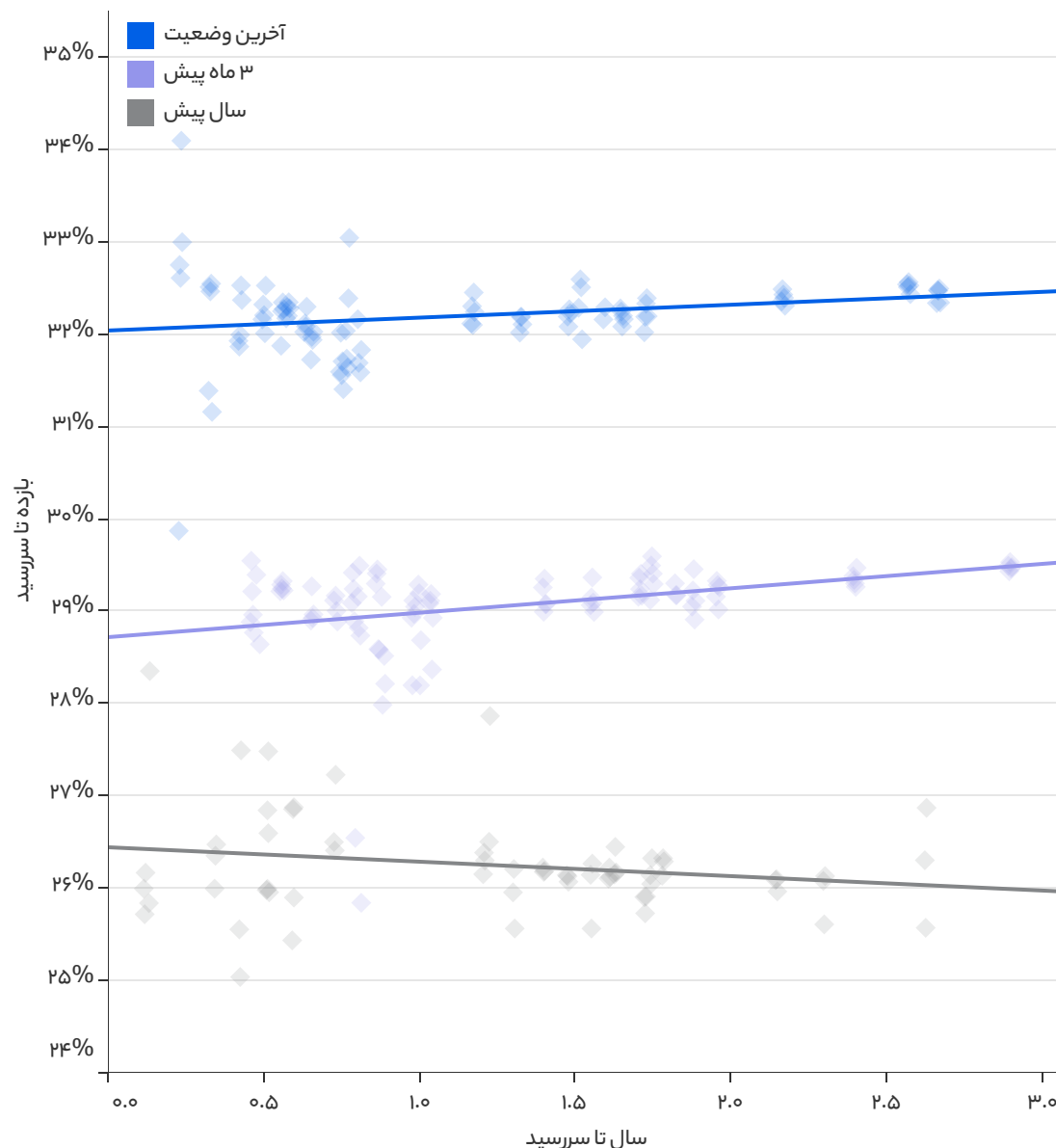
بازده اسمی و واقعی اسناد خزانه**

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 پیش و سال پیش



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

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

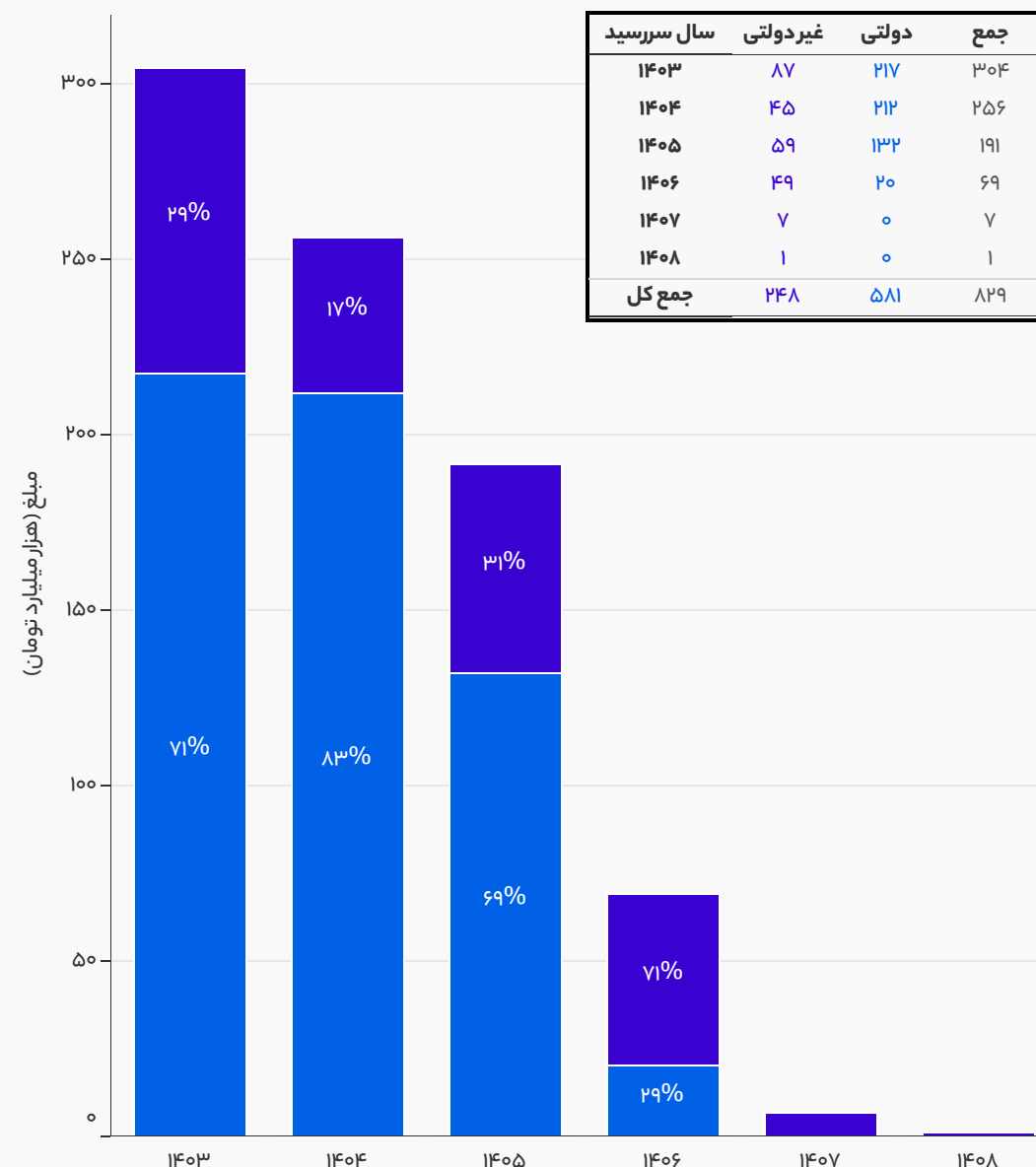
*** برای رسم منحنی نیز اسناد خزانه با تاریخ سررسيد کمتر از ۳۰ روز حذف گردیده‌اند.

دید کلی بازار بدهی

مانده اوراق به تفکیک سررسید

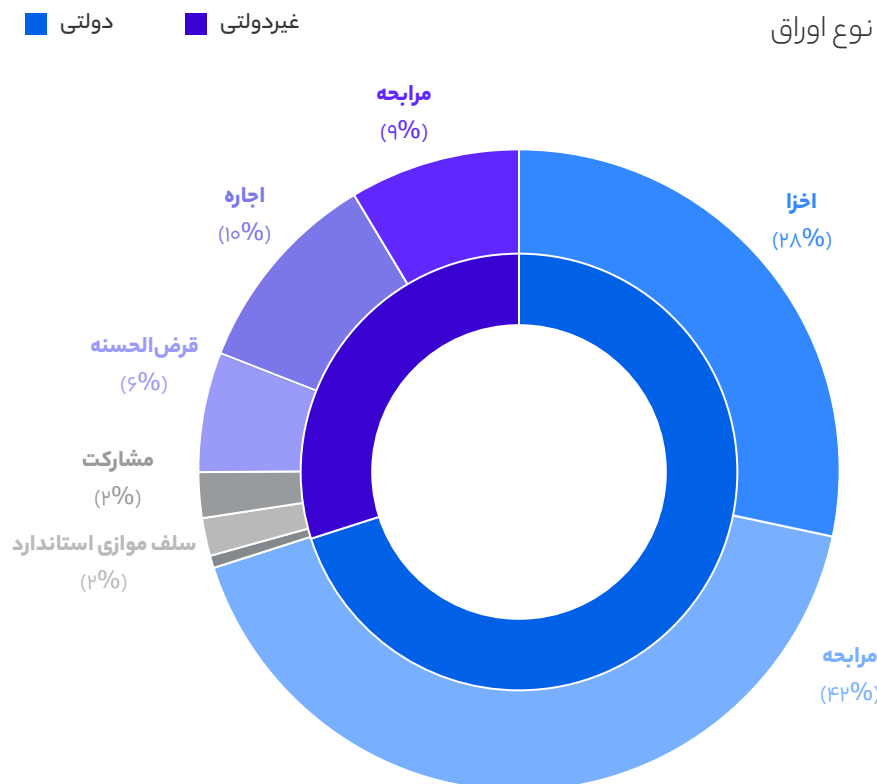
به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان

جمع	دولتی	غیردولتی	سال سررسید
۳۵۴	۲۱۷	۸۷	۱۴۰۳
۲۵۶	۲۱۲	۴۵	۱۴۰۴
۱۹۱	۱۳۲	۵۹	۱۴۰۵
۶۹	۲۰	۴۹	۱۴۰۶
۷	۰	۷	۱۴۰۷
۱	۰	۱	۱۴۰۸
۸۲۹	۵۸۱	۲۴۸	جمع کل



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



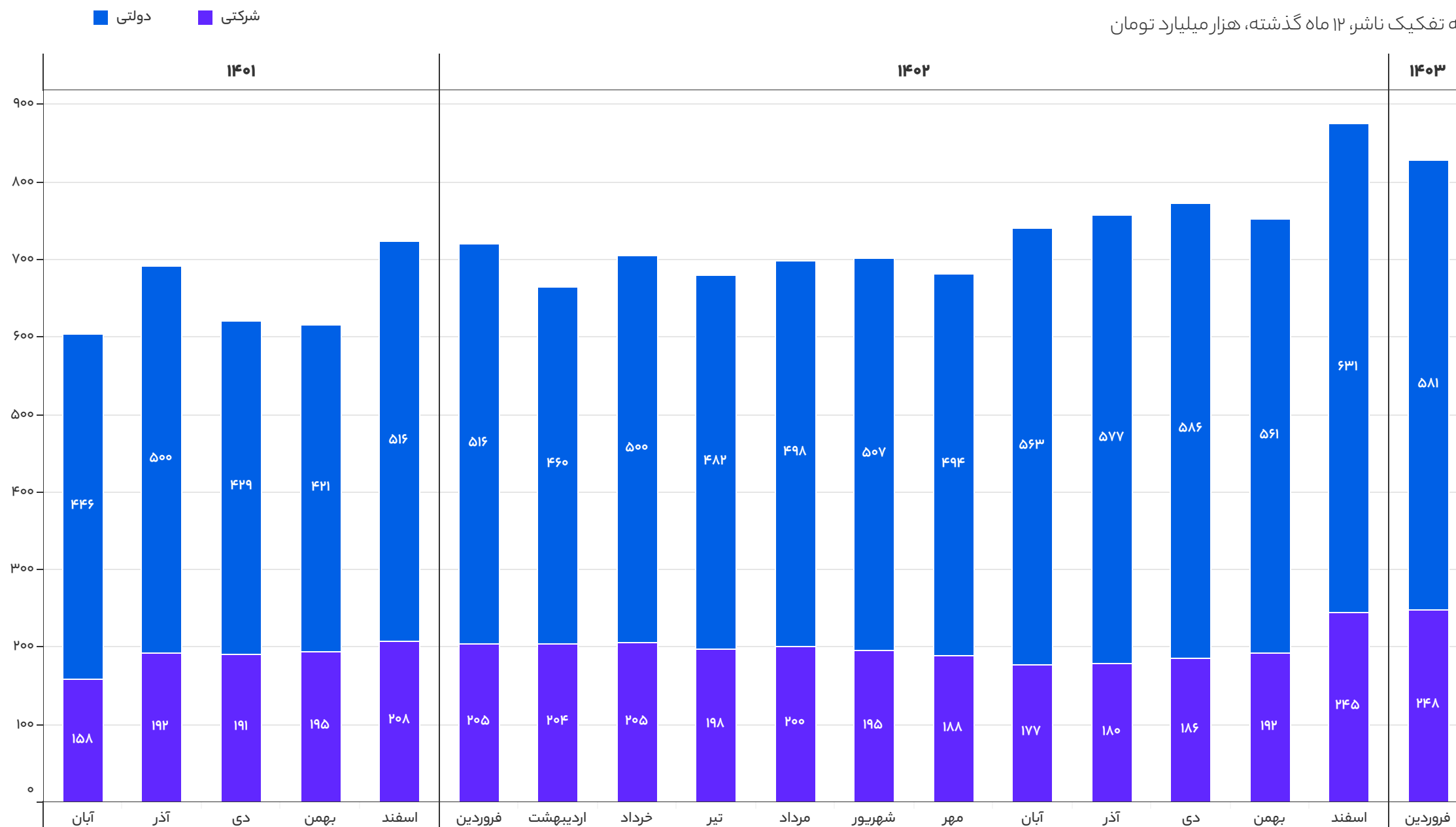
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مراجعه	۳۴۶	۴۲%
	اجاره	۲۳۵	۲۸%
غیردولتی	اجاره	۸۷	۱۰%
	مراجعه	۷۱	۹%
	قرض الحسنه	۵۰	۶%
	مشارکت	۱۹	۲%
	سلف موازی استاندارد	۱۶	۲%
	منفعت	۵	۱%
	خرید دین	۰	۰%
جمع کل		۸۲۹	۱۰۰%

* 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

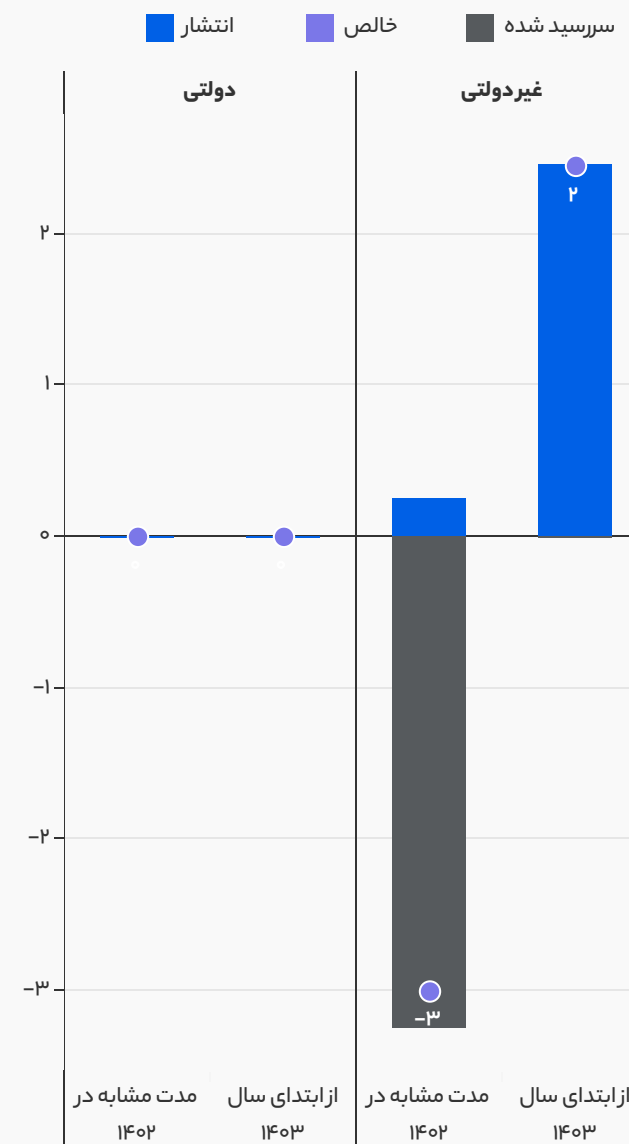
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

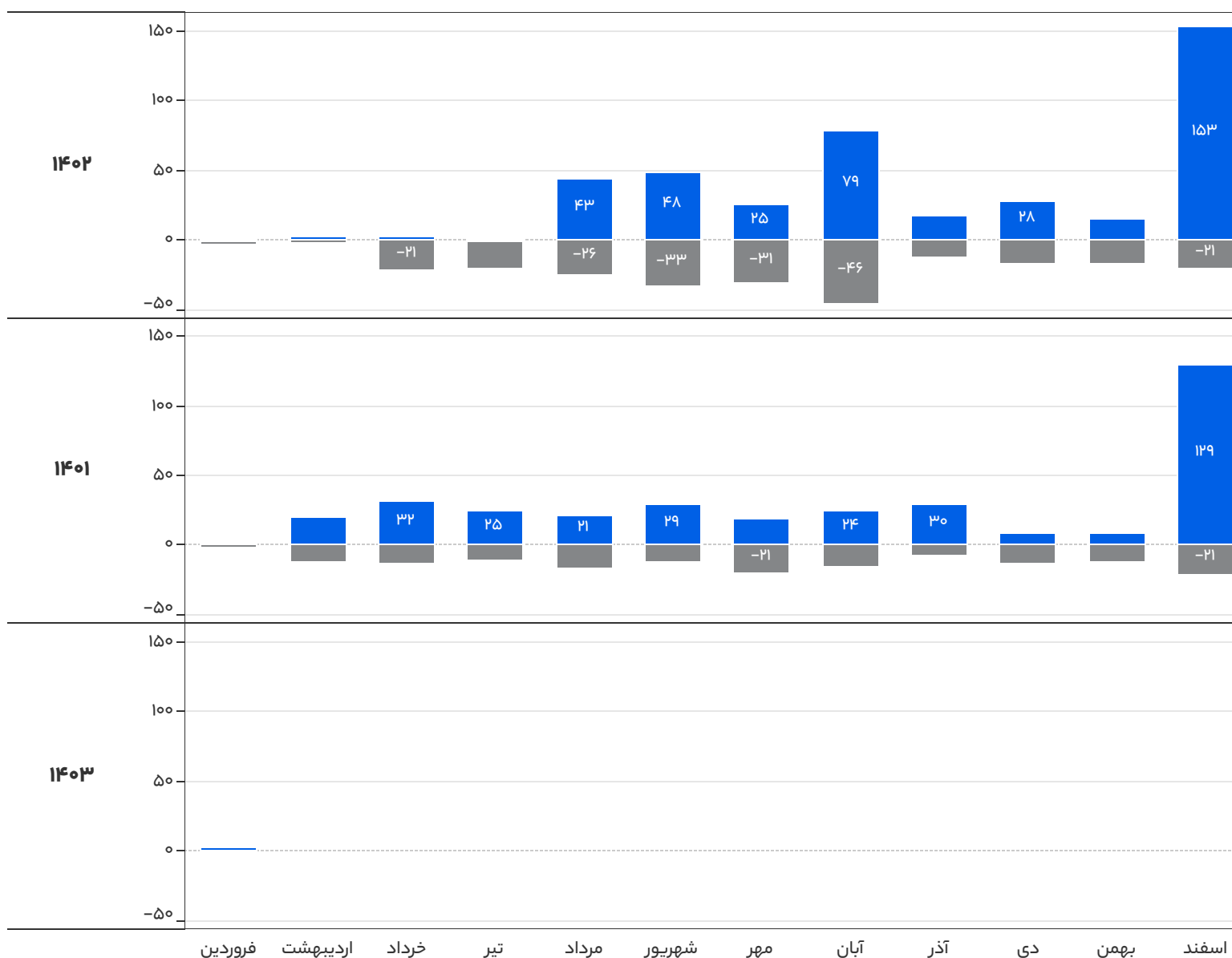
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

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

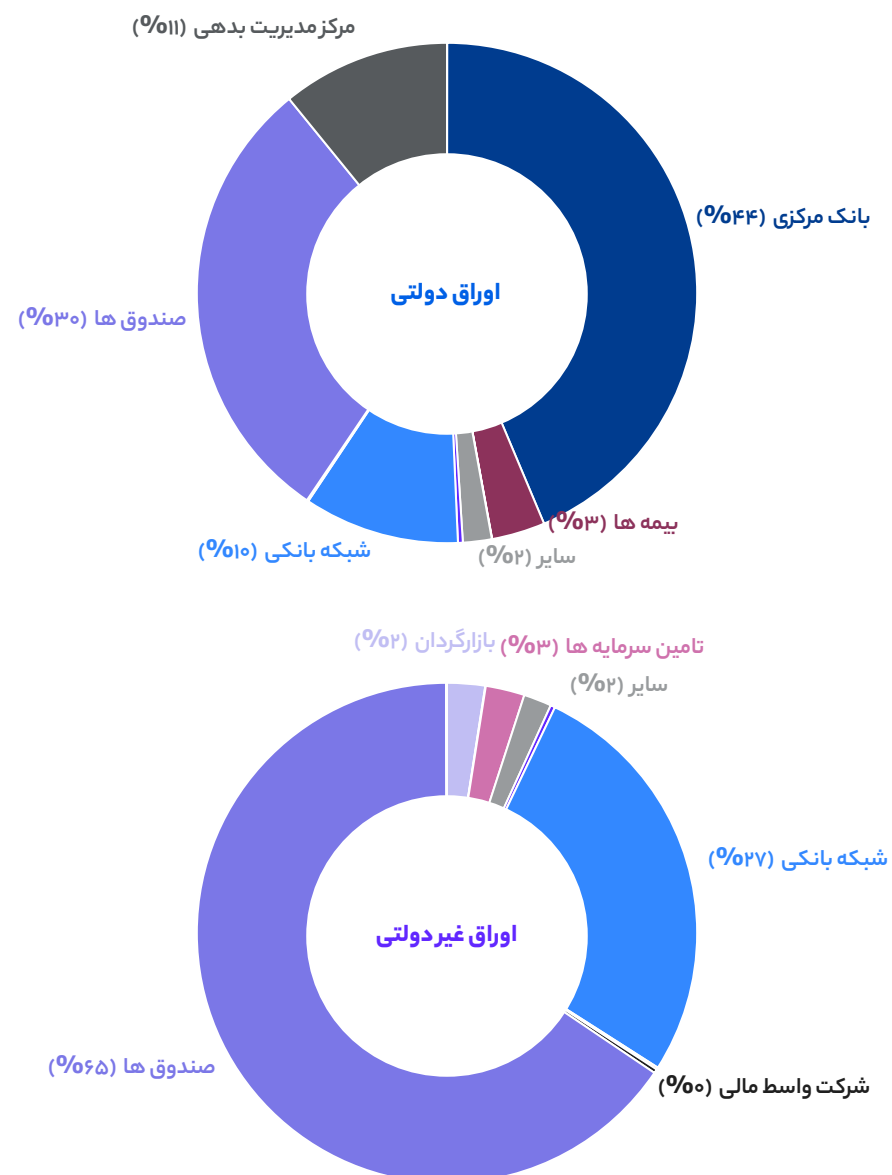
حجم اوراق منتشر و سررسید شده، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

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



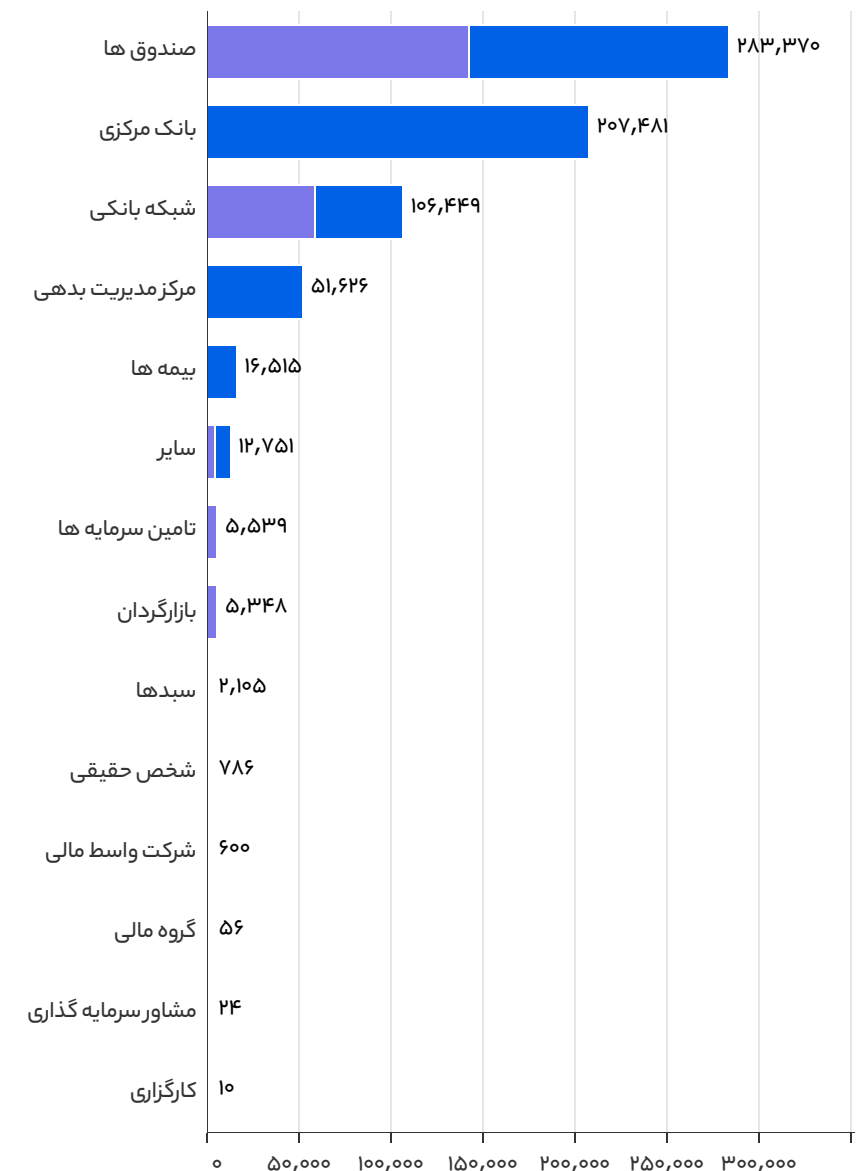
	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	۱۴۰۸	جمع کل
دولتی	بانک مرکزی	۶۱.۴	۹۶.۴	۴۲.۰	۷.۷		۲۰۷.۵
	صندوق ها	۶۴.۵	۵۴.۳	۱۴.۶	۷.۵		۱۴۱.۰
	مرکز مدیریت بدهی	۷.۰	۴.۷	۳۹.۹	-		۵۱.۶
	شبکه بانکی	۲۰.۰	۲۰.۳	۳.۲	۴.۳		۴۷.۸
	بیمه ها	۶.۶	۲.۸	۶.۸	۰.۲		۱۶.۴
	سایر	۱.۷	۴.۶	۲.۵	-		۸.۸
	سبدها	۱.۰	۰.۳	۰.۱	-		۱.۵
	شخص حقیقی	۰.۴	۰.۱	-	-		۰.۵
	تامین سرمایه ها	۰.۱	-	-	-		۰.۱
	بازارگردان	-	-	-	-		۰.۱
غیردولتی	صندوق ها	۳۲.۸	۳۱.۴	۳۴.۶	۳۸.۹	۳.۷	۱۴۲.۴
	شبکه بانکی	۵۰.۶	۰.۹	۵.۹	۱.۲	-	۵۸.۶
	تامین سرمایه ها	۰.۵	۱.۹	۱.۱	۱.۸	۰.۲	۵.۵
	بازارگردان	۰.۷	۲.۶	۱.۰	۰.۹	-	۵.۳
	سایر	۰.۱	۰.۱	۰.۱	۲.۷	۱.۰	۳.۹
	سبدها	-	-	۰.۱	۰.۴	۰.۱	۰.۶
	شرکت واسط مالی	-	-	۰.۲	-	۰.۲	۰.۴
	شخص حقیقی	۰.۱	-	-	۰.۱	۰.۲	۰.۳
	بیمه ها	-	-	-	-	-	۰.۱
	گروه مالی	-	-	۰.۱	-	-	۰.۱
	مشاور سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-
	کارگزاری	-	-	-	-	-	-
	شرکت واسط مالی	-	-	-	-	-	-
	گروه مالی	-	-	-	-	-	-
	مشاور سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی

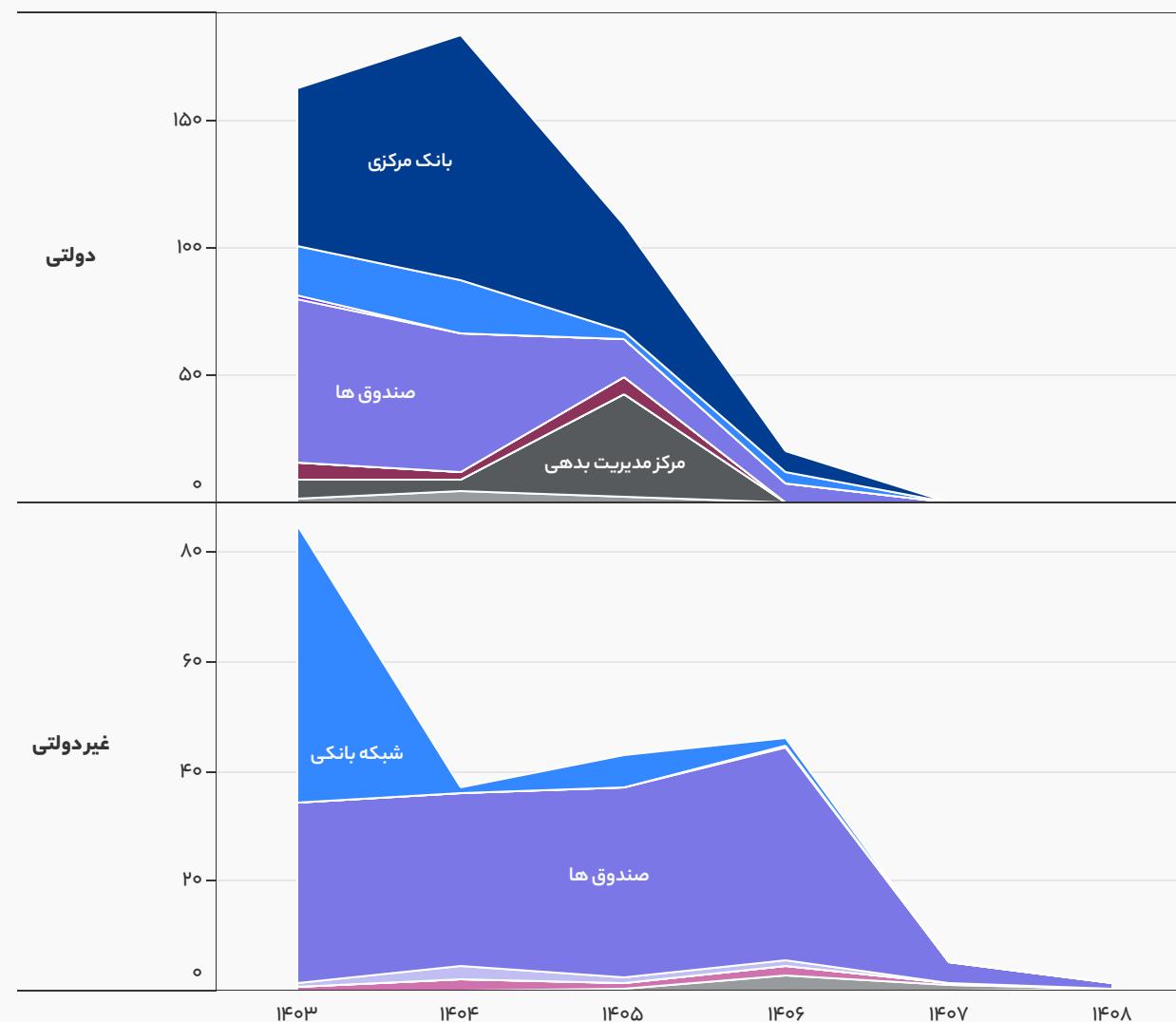
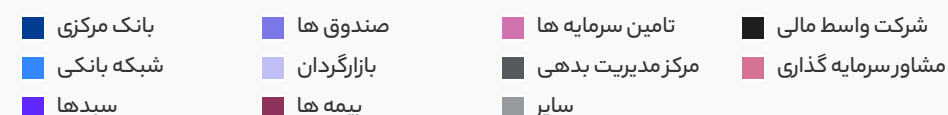


جمع	گام	منفعت	مشارکت	مربحه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره
۲۸۳,۳۷۰	۰	۴,۸۹۴	۱۵,۸۹۴	۱۳۹,۲۹۴	۰	۱۲,۲۲۰	۵۳,۲۴۹	۵۰	۵۷,۷۶۹
۲۰۷,۴۸۱	۰	۰	۰	۱۸۳,۳۰۱	۰	۰	۲۴,۱۸۰	۰	۰
۱۰۶,۴۴۹	۰	۱۰۰	۴۷۰	۳۲,۶۹۷	۵۰,۰۰۰	۰	۱۸,۰۴۵	۰	۵,۱۳۷
۵۱,۶۲۶	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۵۱,۶۲۶	۰	۰
۱۶,۵۱۵	۰	۰	۰	۷,۸۹۲	۰	۴۵	۸,۵۷۸	۰	۰
۱۲,۷۵۱	۰	۰	۲۵	۷۷۱	۰	۰	۸,۴۹۵	۰	۳,۴۶۰
۵,۵۳۹	۰	۹۵	۵۴۶	۲,۶۷۳	۰	۵۵۴	۰	۵	۱,۶۶۶
۵,۳۴۸	۰	۱۰۷	۱,۰۹۷	۱,۹۲۵	۰	۱,۴۶۰	۰	۰	۷۵۸
۲,۱۰۵	۰	۰	۰	۱,۰۱۳	۰	۰	۸۱۱	۰	۲۸۱
۷۸۶	۰	۰	۰	۶۷۲	۰	۵۴	۶۰	۰	۰
۶۰۰	۰	۰	۰	۶۰۰	۰	۰	۰	۰	۰
۱۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱۰
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰
۲۴	۰	۰	۰	۲۴	۰	۰	۰	۰	۰
۶۹۲,۶۶۰	۰	۵,۱۹۷	۱۸,۰۳۲	۳۷۰,۹۱۷	۵۰,۰۰۰	۱۴,۳۳۳	۱۶۵,۰۴۴	۵۵	۶۹,۰۸۱

بازیگران کلیدی بازار بدهی

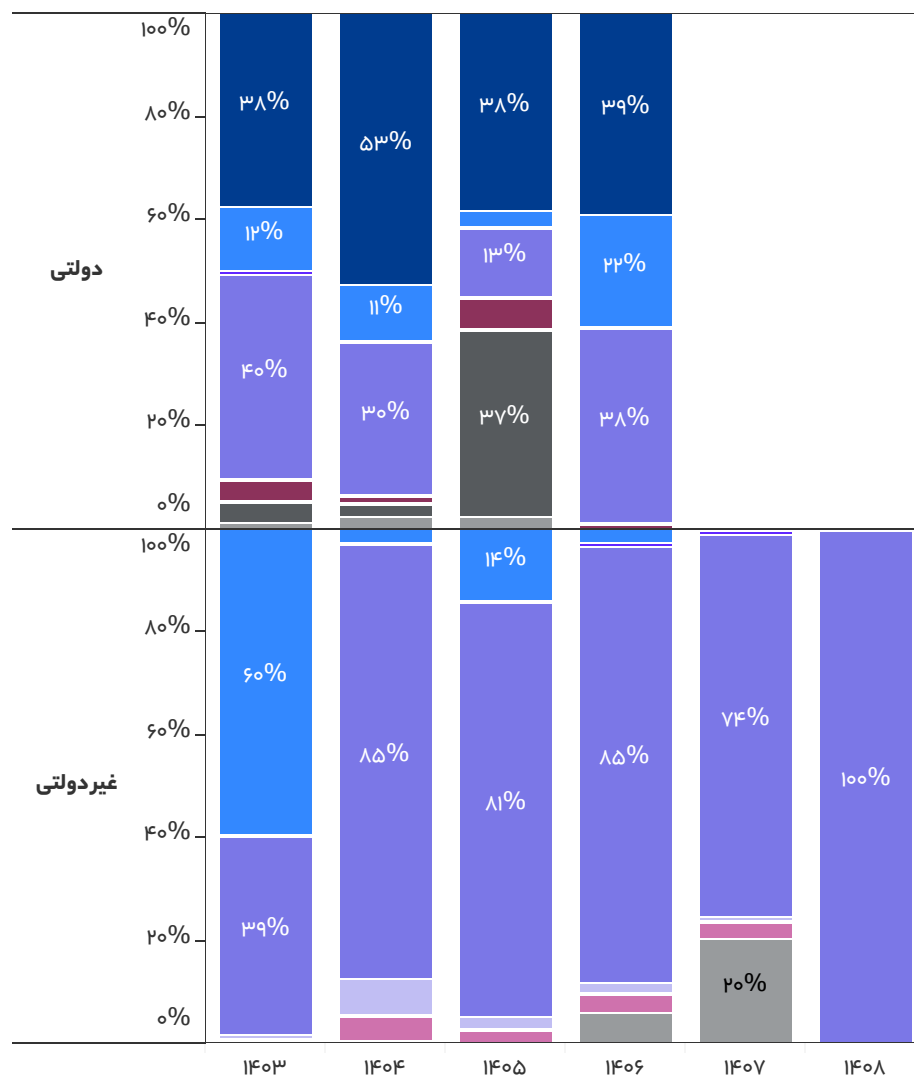
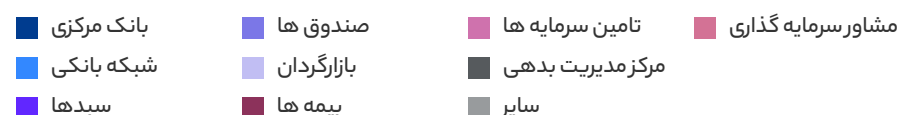
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

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



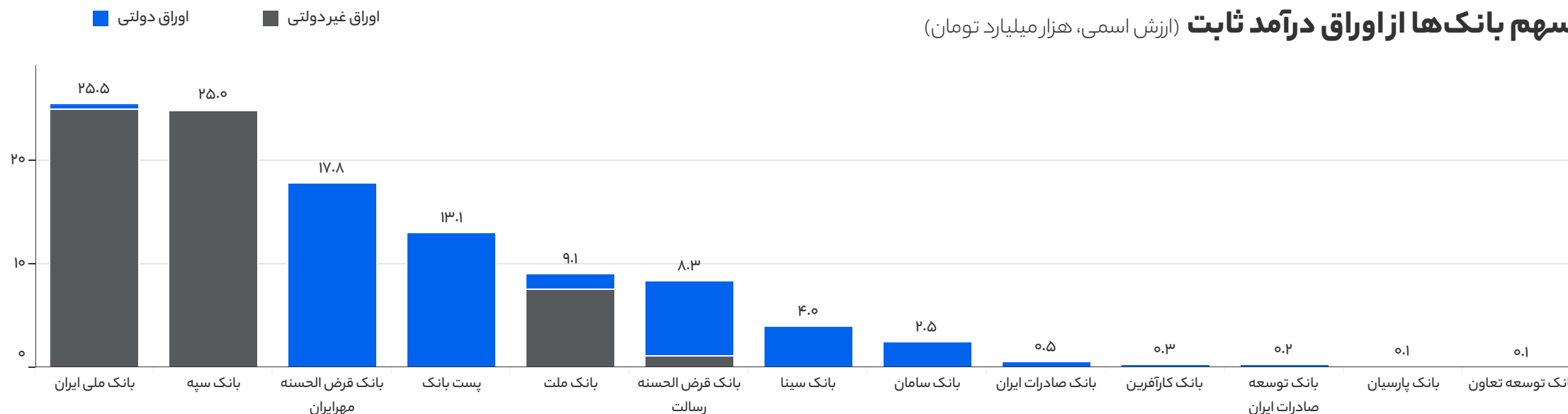
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

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

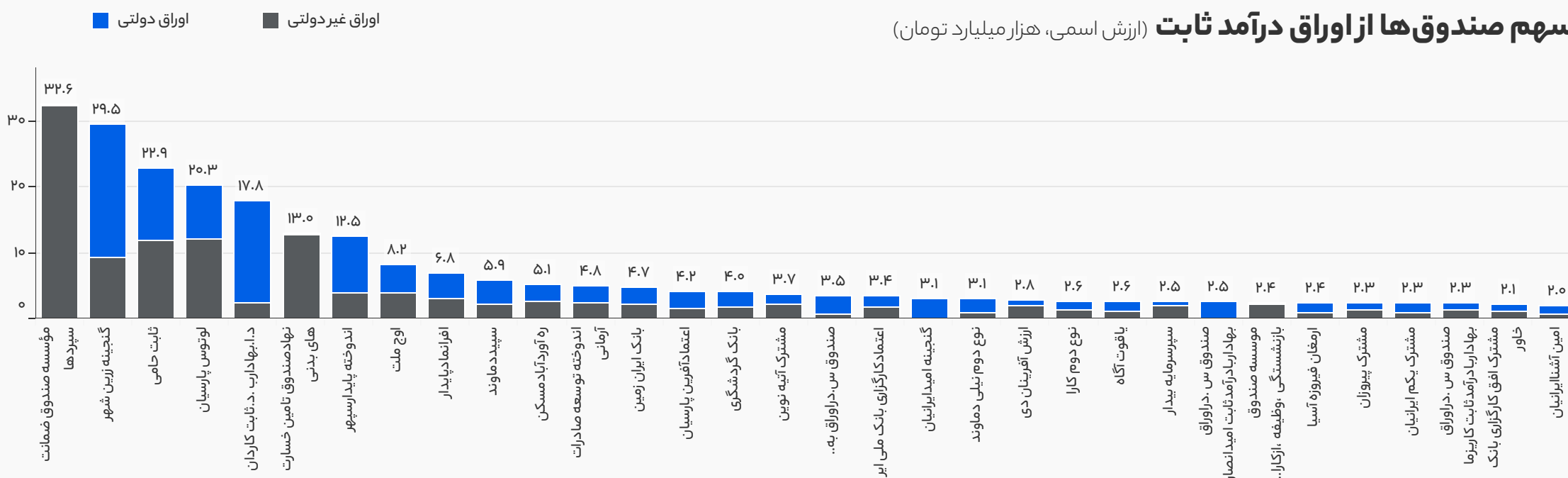


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



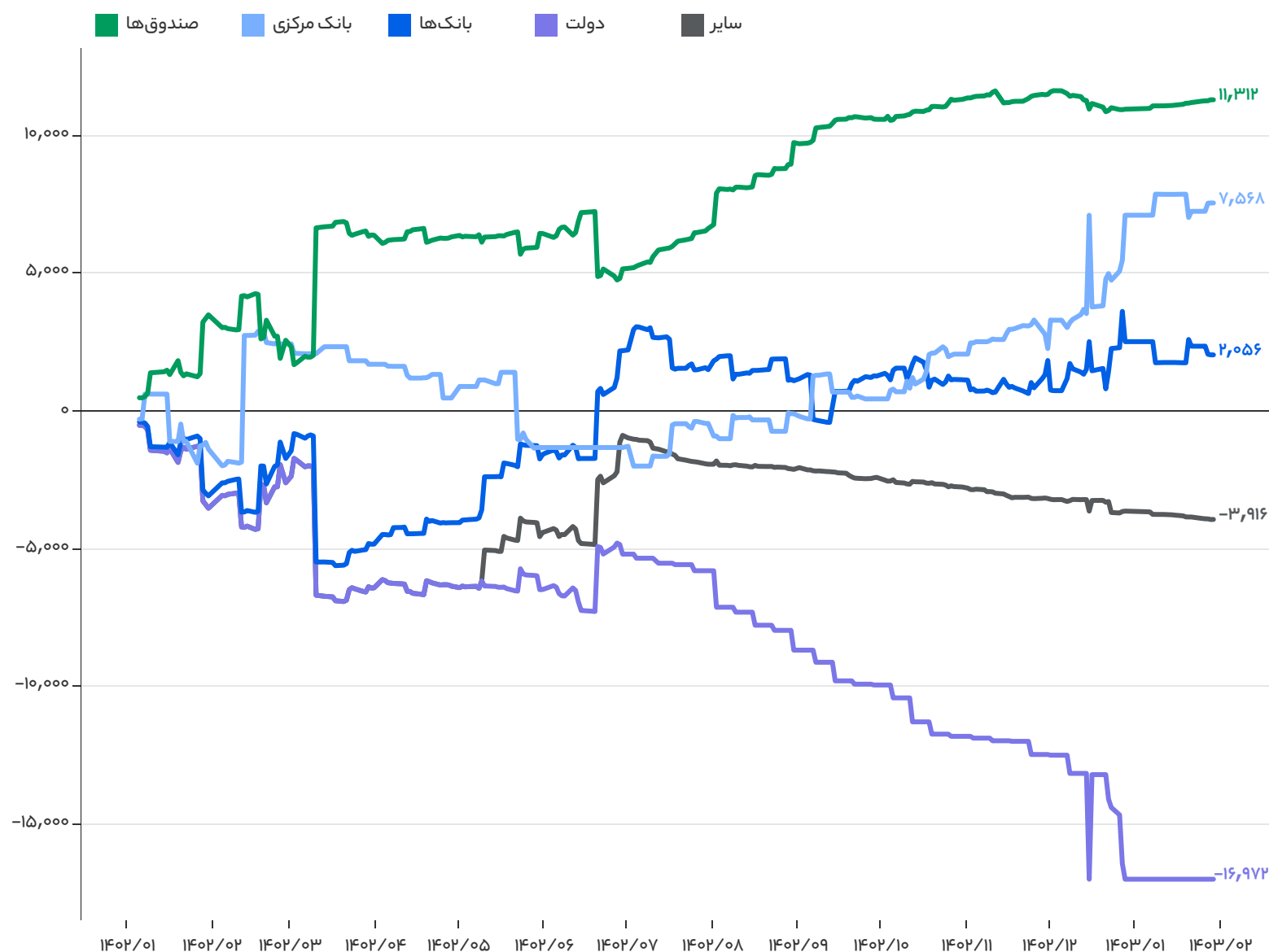
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

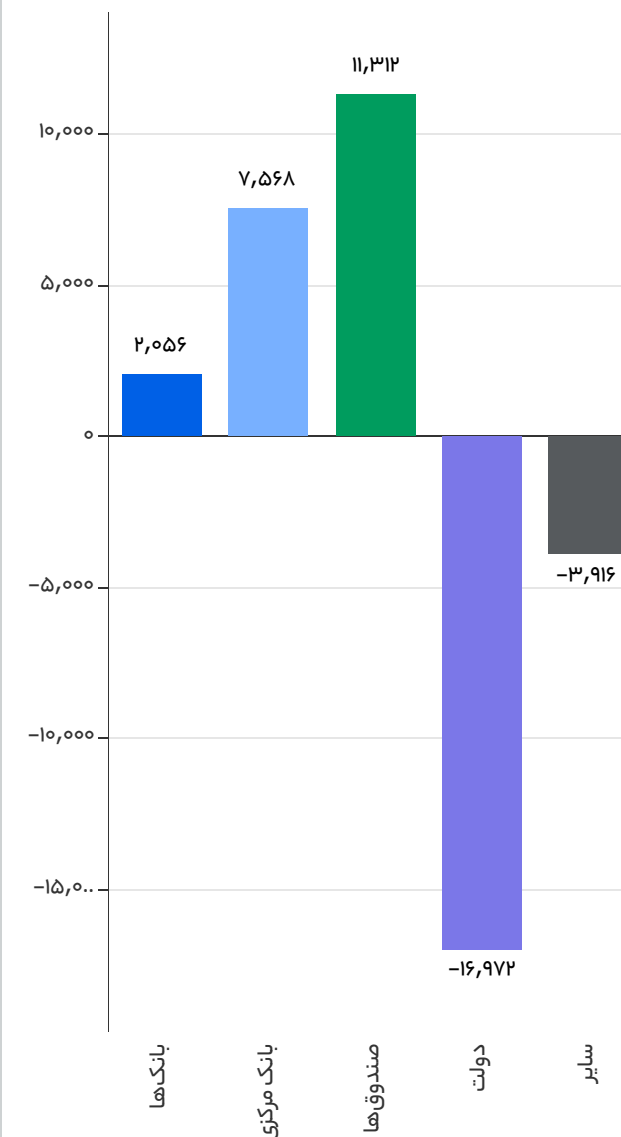
خالص معاملات اوراق

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

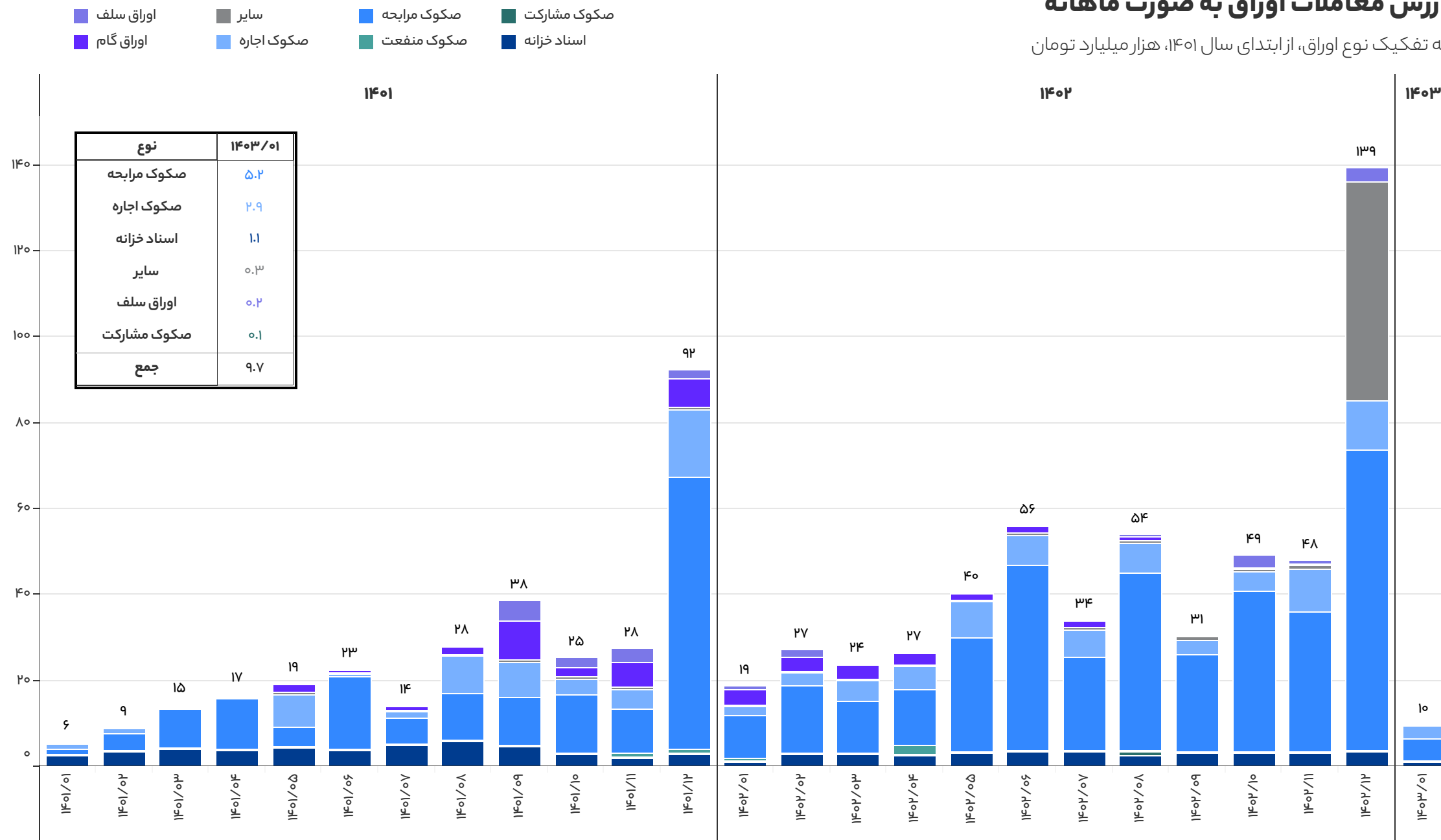
بانکها بانک مرکزی صندوقها دولت سایر

	بانکها	بانک مرکزی	صندوقها	دولت	سایر
۱۴۰۲/۰۱	-۲,۹۸۶	-۱,۱۴۹	۳,۳۲۴	-۳,۳۲۴	-۳,۳۲۴
۱۴۰۲/۰۲	۱,۳۵۶	۳,۸۱۶	-۹۲۳	۹۲۳	۹۲۳
۱۴۰۲/۰۳	-۳,۱۰۸	-۷۳۹	۳,۸۱۳	-۳,۸۱۳	-۳,۸۱۳
۱۴۰۲/۰۴	۷۷۹	-۱,۲۲۴	-۶۳	۶۳	۶۳
۱۴۰۲/۰۵	۲,۴۶۹	-۱,۷۹۷	۱۲۴	-۱۲۴	۱,۹۴۶
۱۴۰۲/۰۶	۳,۷۷۲	۰	-۱,۲۸۵	۱,۲۸۵	۳,۵۲۶
۱۴۰۲/۰۷	-۶۸۸	۸۷۵	۱,۴۶۶	-۶۰۳	-۱,۰۴۸
۱۴۰۲/۰۸	-۴۰۲	۳۵۳	۳,۱۱۹	-۲,۸۸۱	-۱۸۸
۱۴۰۲/۰۹	۱۶۸	۵۳۶	۸۴۴	-۱,۲۶۵	-۲۸۹
۱۴۰۲/۱۰	-۱۳۱	۱,۶۲۴	۷۲۳	-۱,۸۶۳	-۳۵۰
۱۴۰۲/۱۱	۶۹۹	۲۰۲	۱۸۱	-۶۵۹	-۴۱۶
۱۴۰۲/۱۲	۶۸۳	۴,۸۴۰	-۵۳۷	-۴,۵۲۶	-۴۵۸
۱۴۰۳/۰۱	-۴۸۰	۴۴۴	۳۴۱	۰	-۳۰۳

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، صکوک اجاره
- شهرداری، صکوک مشارکت
- دولتی، صکوک مرابحه
- شرکتی، سایر
- شرکتی، صکوک مرابحه

شرکتی صکوک اجاره (۳۱ همت)		دولتی صکوک مرابحه (۳۱ همت)	
شرکتی صکوک مرابحه (۲۱ همت)		دولتی اسناد خزانه (۱۱ همت)	دولتی اوراق سلف (۰۱ همت)

معاملات اوراق درآمد ثابت

پرمعامله‌ترین اوراق شرکتی ماه گزارش

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

صکوک اجاره صکوک مرابحه

ارزش معاملات	تاریخ سررسید	نوع	نماد
۶۴۸	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۵۲
۶۲۳	۱۴۰۵/۱۰/۱۳	صکوک اجاره	توسعه انرژی ۵۵
۴۰۰	۱۴۰۶/۱۲/۲۲	صکوک اجاره	تابان ۱۴
۳۰۰	۱۴۰۷/۰۱/۱۵	صکوک مرابحه	صکویراه ۷
۲۹۸	۱۴۰۵/۱۲/۲۳	صکوک اجاره	صاروج ۵۵
۲۹۶	۱۴۰۵/۰۲/۱۵	صکوک مرابحه	صبهمن ۵۲
۲۵۹	۱۴۰۶/۰۵/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۵۶
۲۰۰	۱۴۰۷/۰۱/۱۵	صکوک مرابحه	صکویراه ۷
۱۹۰	۱۴۰۵/۰۱/۱۴	صکوک اجاره	غدیر ۵۵
۱۸۰	۱۴۰۴/۱۲/۱۵	صکوک مرابحه	صآریا ۴۱
۱۸۰	۱۴۰۵/۰۸/۱۴	صکوک مرابحه	طب نوین ۵۵
۱۶۳	۱۴۰۵/۰۸/۰۹	صکوک اجاره	صبا ۵۱
۱۰۱	۱۴۰۷/۰۱/۰۶	صکوک مرابحه	پوراطب ۷۲
۱۰۰	۱۴۰۵/۰۷/۲۴	صکوک مرابحه	کیش ۵۵
۱۰۰	۱۴۰۶/۰۶/۲۷	صکوک اجاره	تابان ۱۳
۱۰۰	۱۴۰۷/۰۱/۰۶	صکوک مرابحه	پوراطب ۷۱
۸۹	۱۴۰۵/۱۱/۱۷	صکوک مرابحه	کاله ۵۳
۸۴	۱۴۰۵/۰۶/۲۹	صکوک مرابحه	پدیده ۵۵
۸۲	۱۴۰۶/۱۰/۲۳	صکوک مرابحه	فرداموتور ۶۰
۶۰	۱۴۰۶/۱۰/۲۰	صکوک مرابحه	نقشینه ۶۱
۶۰	۱۴۰۵/۰۳/۱۵	صکوک مرابحه	صبیا ۵۳
۵۳	۱۴۰۷/۰۹/۰۴	صکوک مرابحه	داروک ۷۲
۵۱	۱۴۰۶/۱۲/۱۵	صکوک مرابحه	صفولا۶۱
۵۰	۱۴۰۷/۰۸/۳۰	صکوک مرابحه	عالی‌فرد ۷۳
۵۰	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۱۲

پرمعامله‌ترین اوراق دولتی ماه گزارش

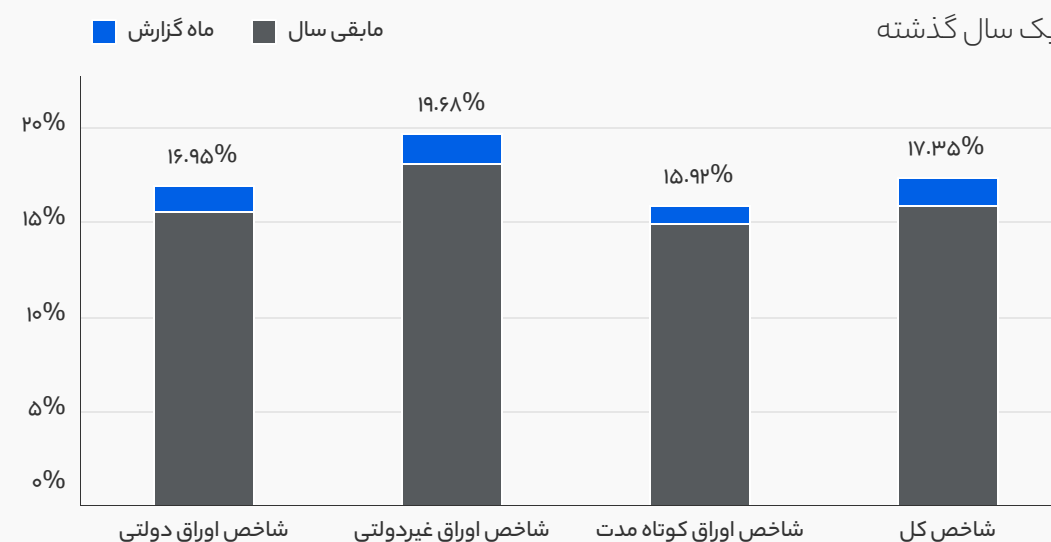
ارزش معاملات برای ۲۵ اوراق با بیشترین ارزش معامله، به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

اوراق سلف صکوک مرابحه اسناد خزانه

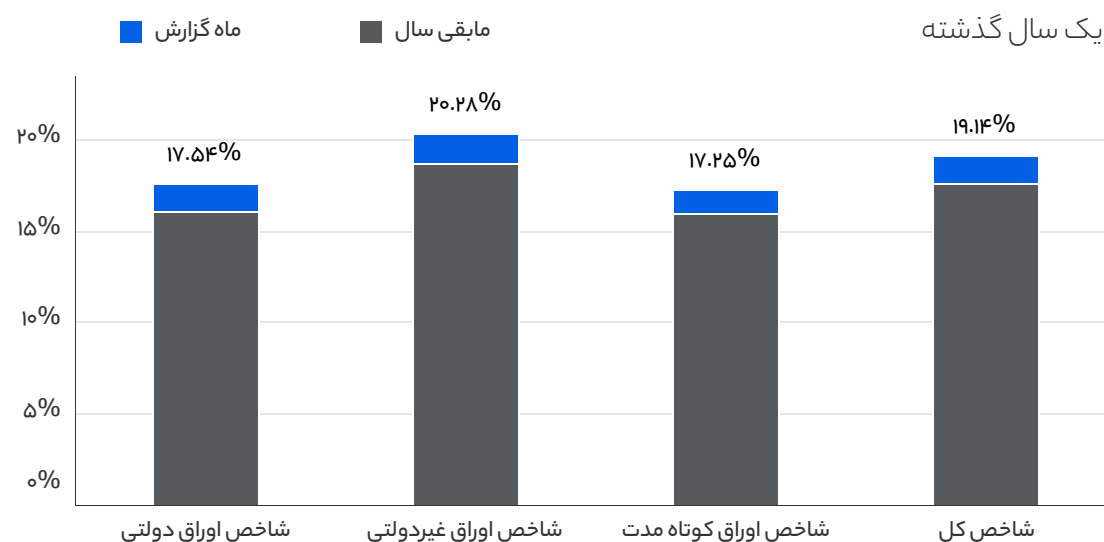
ارزش معاملات	تاریخ سررسید	نوع	نماد
۹۷۶	۱۴۰۳/۰۵/۱۰	صکوک مرابحه	اراداد ۱۲۹
۳۲۷	۱۴۰۳/۰۲/۱۵	صکوک مرابحه	اراداد ۴۶
۲۹۳	۱۴۰۴/۰۴/۱۷	صکوک مرابحه	اراداد ۱۲۰
۲۲۶	۱۴۰۳/۰۷/۲۴	صکوک مرابحه	اراداد ۱۰۷
۲۰۸	۱۴۰۴/۱۱/۱۰	صکوک مرابحه	اراداد ۱۳۲
۲۰۷	۱۴۰۵/۰۳/۲۵	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۱
۱۵۹	۱۴۰۳/۰۹/۱۵	صکوک مرابحه	اراداد ۵۷
۱۴۸	۱۴۰۵/۰۵/۰۴	صکوک مرابحه	اراداد ۱۴۰
۱۳۸	۱۴۰۵/۰۹/۲۳	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۲
۱۲۶	۱۴۰۳/۰۵/۰۳	صکوک مرابحه	اراداد ۱۰۵
۱۰۶	۱۴۰۴/۱۱/۱۵	اوراق سلف	عکرمان ۱
۹۳	۱۴۰۵/۰۸/۱۸	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۳
۹۲	۱۴۰۴/۰۳/۰۲	صکوک مرابحه	اراداد ۱۴۱
۷۳	۱۴۰۴/۰۳/۲۶	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۱
۷۱	۱۴۰۴/۰۹/۱۷	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۴
۶۷	۱۴۰۴/۰۷/۱۴	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۷
۶۴	۱۴۰۳/۰۹/۱۹	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۸
۵۳	۱۴۰۳/۱۲/۲۳	صکوک مرابحه	اراداد ۱۲۶
۴۷	۱۴۰۴/۰۵/۲۰	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۳
۳۸	۱۴۰۳/۰۴/۱۴	صکوک مرابحه	اراداد ۹۶
۳۴	۱۴۰۴/۱۰/۱۵	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۵
۳۴	۱۴۰۳/۰۸/۱۴	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۶
۳۱	۱۴۰۳/۰۶/۲۶	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۵
۳۰	۱۴۰۴/۰۶/۱۵	اوراق سلف	عکیوی ۱
۲۹	۱۴۰۳/۰۸/۲۱	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۰

بازدهی شاخص صکوک

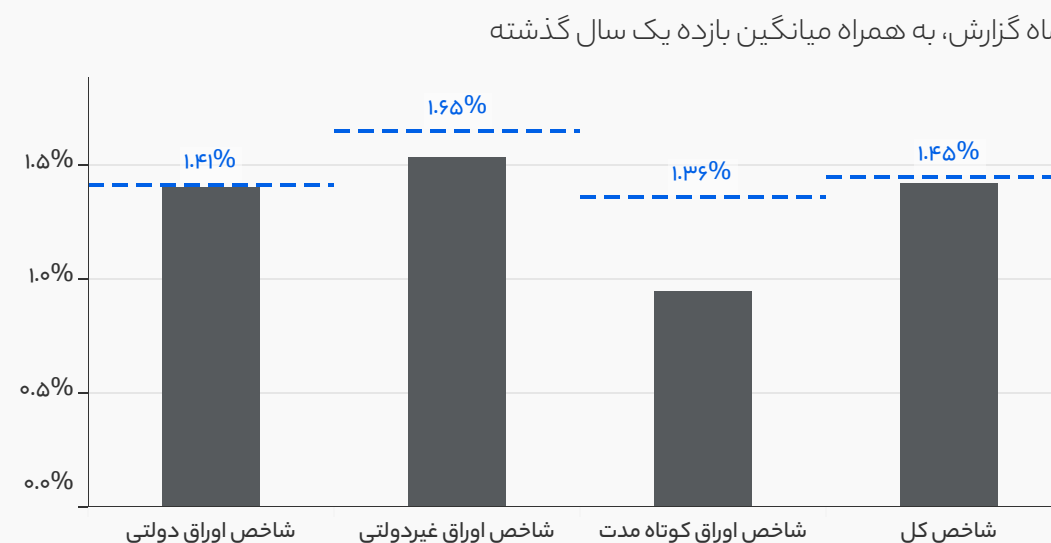
بازدهی شاخص‌های وزنی صکوک فرابورس ایران



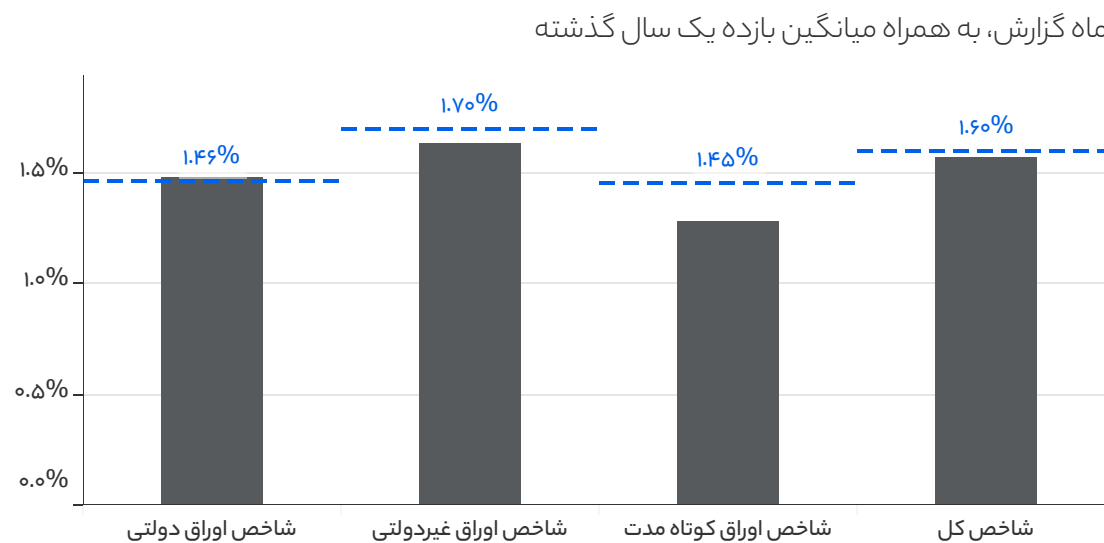
بازدهی شاخص‌های هم وزن صکوک فرابورس ایران



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
۵۴۲.۷	۱۴۱	با درآمد ثابت	سرمایه گذاری سنتی
۱۱۶.۳	۱۳۳	سهامی	
۶.۲	۲۶	مختلط	
۱.۵	۵	صندوق در صندوق	
۱.۷	۵	خصوصی	سرمایه گذاری خصوصی
۰.۴	۱۶	جسورانه	
۱۷۴.۰	۱۰۴	بازارگردانی	سرمایه گذاری جایگزین
۴۱.۳	۱۵	سپرده کالایی	
۱.۱	۱	پروژه ای	
۰.۳	۳	املاک و مستغلات	
۰.۰	۴	زمین و ساختمان	
۸۸۵.۳	۴۵۳	جمع کل	

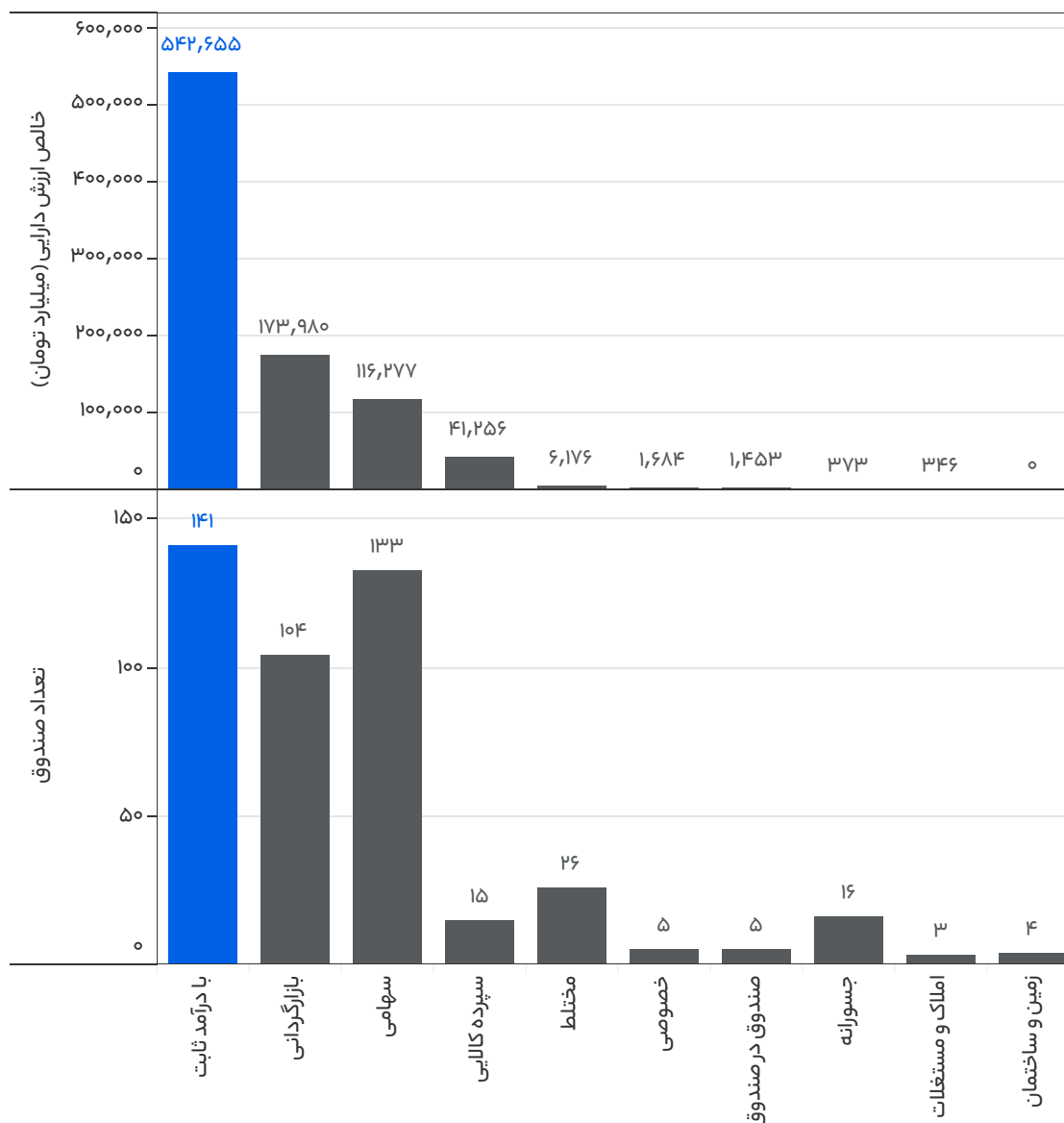
صندوق های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
صدور و ابطال	صندوق در صندوق	بازنشستگی تکمیلی کاریز
قابل معامله	سهامی	بخشی صنایع معیار

ارزش و تعداد صندوق های سرمایه گذاری

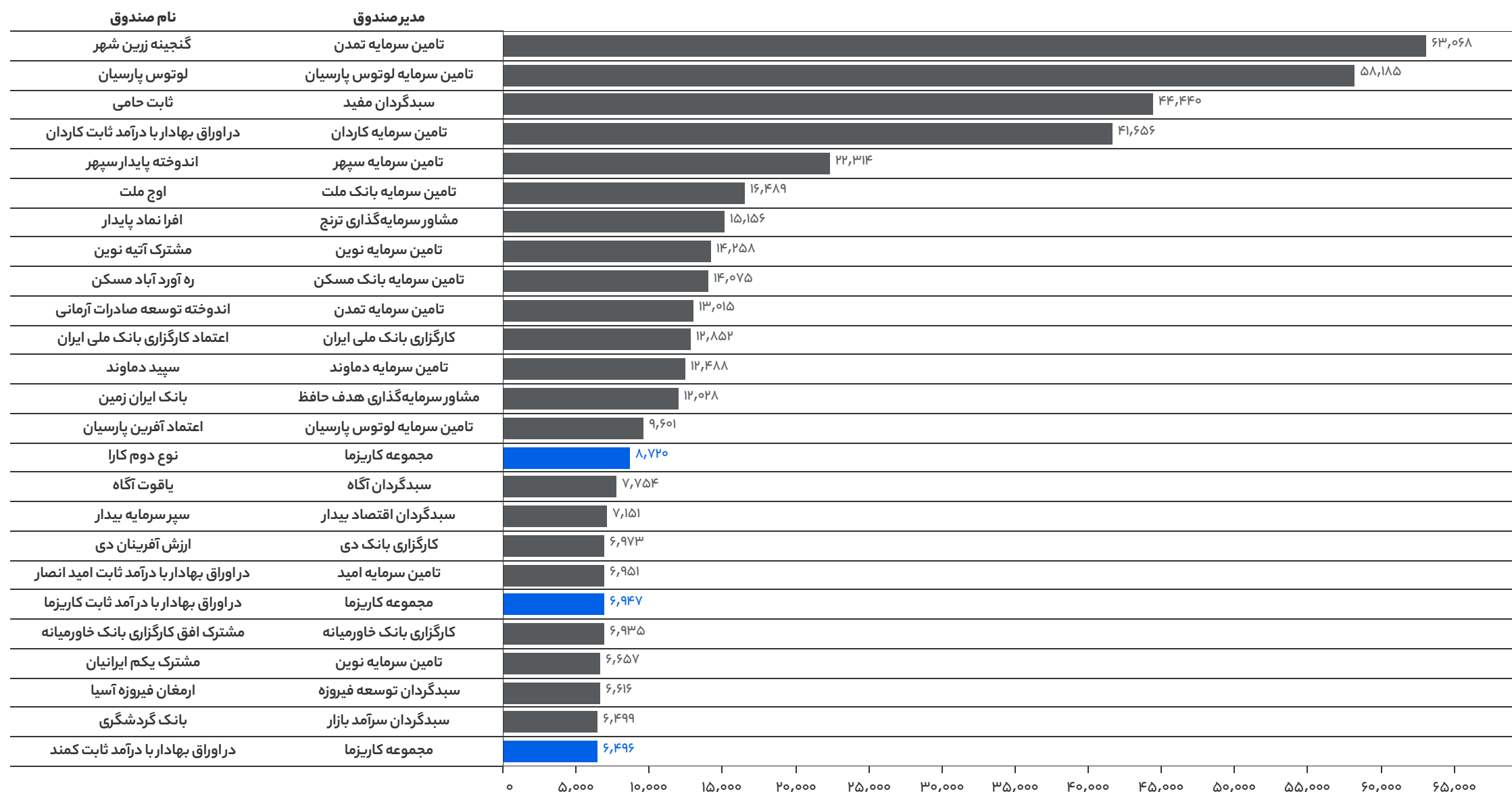
به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

بزرگ‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

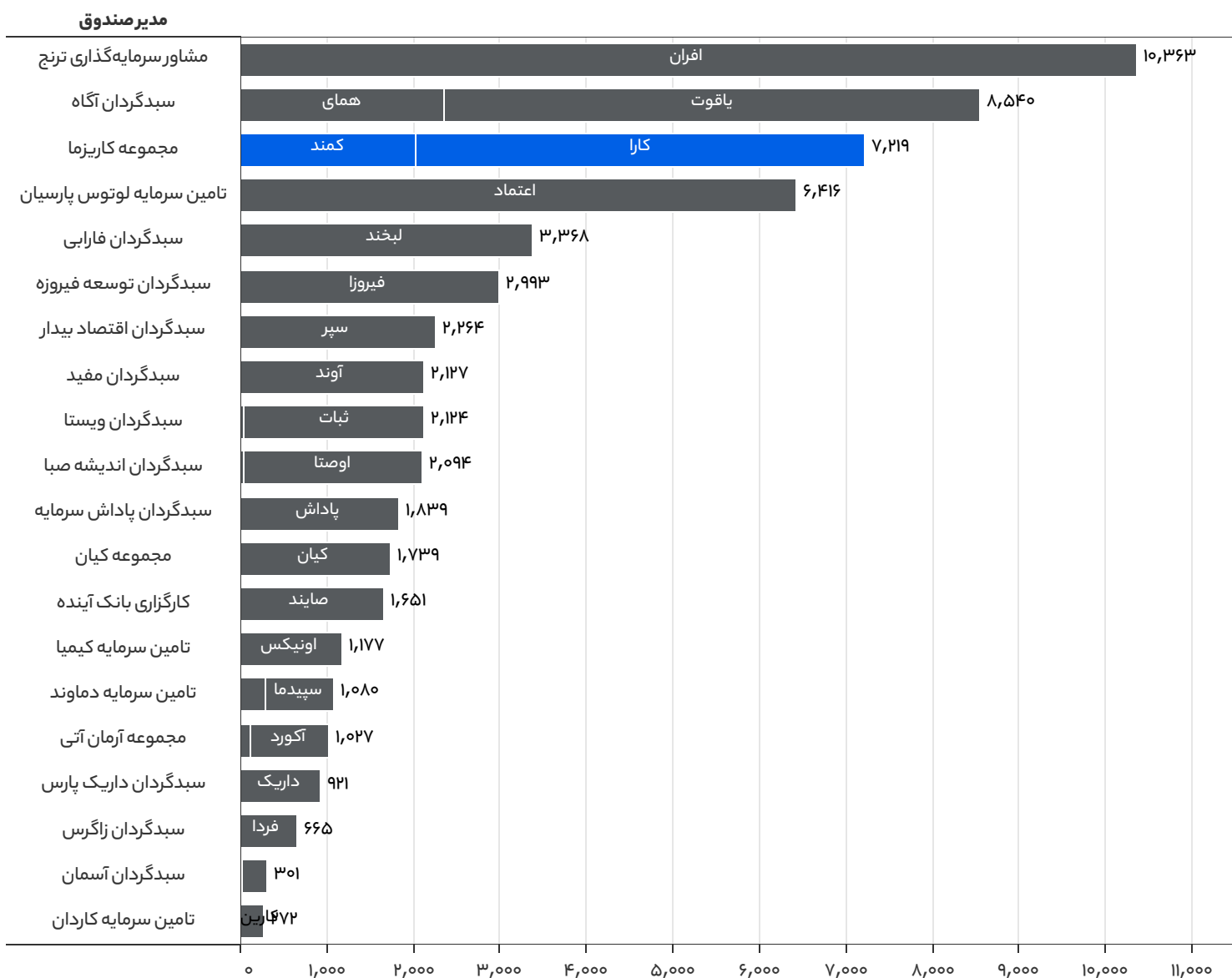
دارایی تحت مدیریت ۲۵ صندوق درآمد ثابت بزرگ، به همراه مدیر صندوق، میلیارد تومان



معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

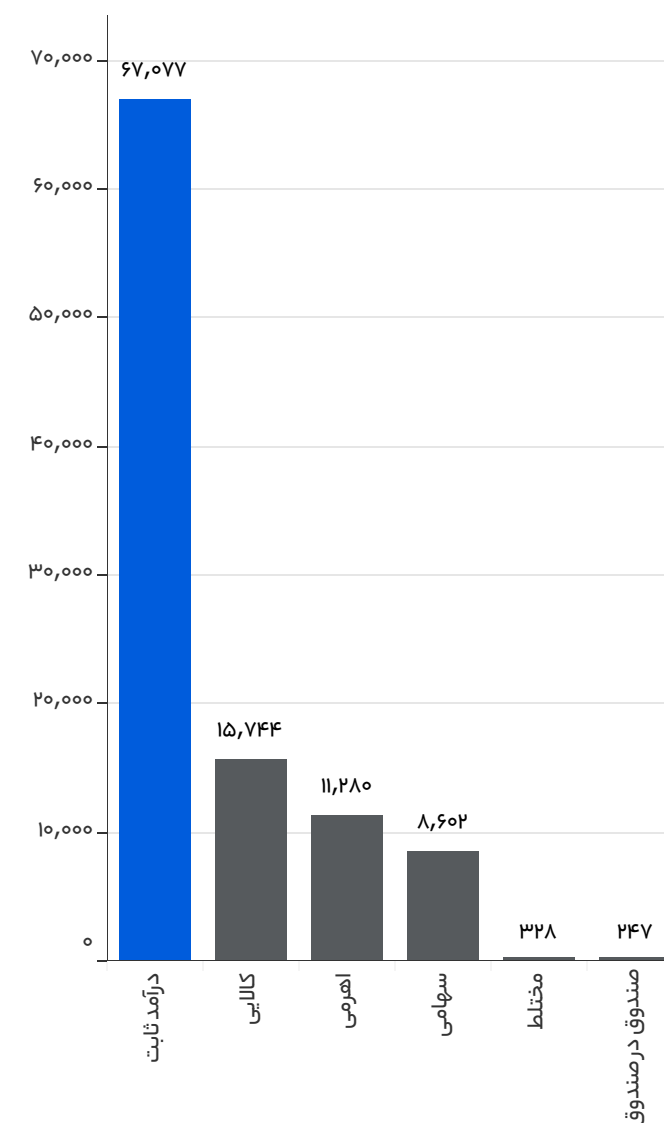
پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

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



ارزش معاملات انواع صندوق‌های سرمایه‌گذاری

مجموع ارزش معاملات در ماه گزارش، میلیارد تومان



معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت

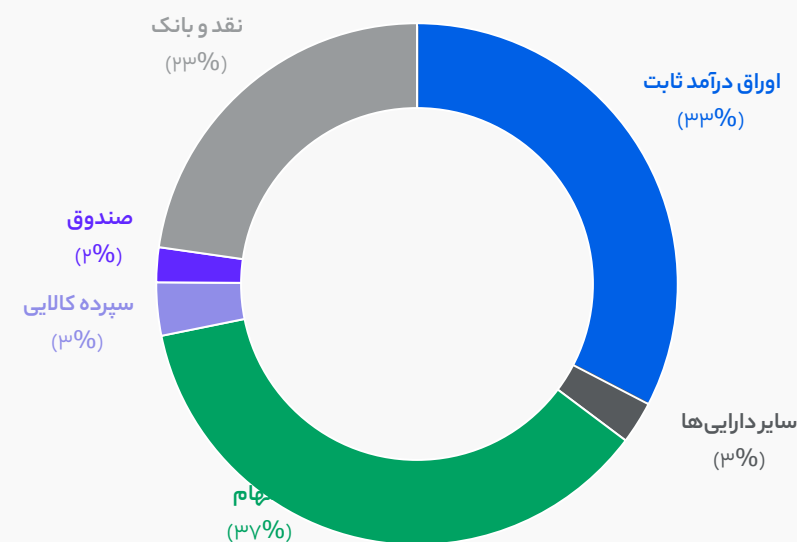
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	
فیروزا	سبدگردان توسعه فیروزه	+۴۰۹
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	+۳۸۶
یاقوت	سبدگردان آگاه	+۲۱۱
آوند	سبدگردان مفید	+۱۷۵
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	+۱۴۴
لبخند	سبدگردان فارابی	+۹۵
سپر	سبدگردان اقتصاد بیدار	+۸۶
ثبات	سبدگردان ویستا	+۵۴
صایند	کارگزاری بانک آینده	+۴۸
دامون	سبدگردان آسمان	+۲۴
اونیکس	تامین سرمایه کیمیا	+۱۲
سپیدما	تامین سرمایه دماوند	+۹
کارین	تامین سرمایه کاردان	+۲
آکام	سبدگردان ویستا	+۰
آسامید	سبدگردان آسمان	-۲
دیبا	سبدگردان اندیشه صبا	-۳
فردا	سبدگردان زاگرس	-۳
آفاق	مجموعه آرمان آتی	-۵
نیلی	تامین سرمایه دماوند	-۱۱
کیان	مجموعه کیان	-۱۱
اوستا	سبدگردان اندیشه صبا	-۱۷
اکورد	مجموعه آرمان آتی	-۳۰
پاداش	سبدگردان پاداش سرمایه	-۴۰
همای	سبدگردان آگاه	-۷۳
داریک	سبدگردان داریک پارس	-۸۹
کمند	مجموعه کاریزما	-۱۳۳
کارا	مجموعه کاریزما	-۱۴۳

تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی صندوق‌ها

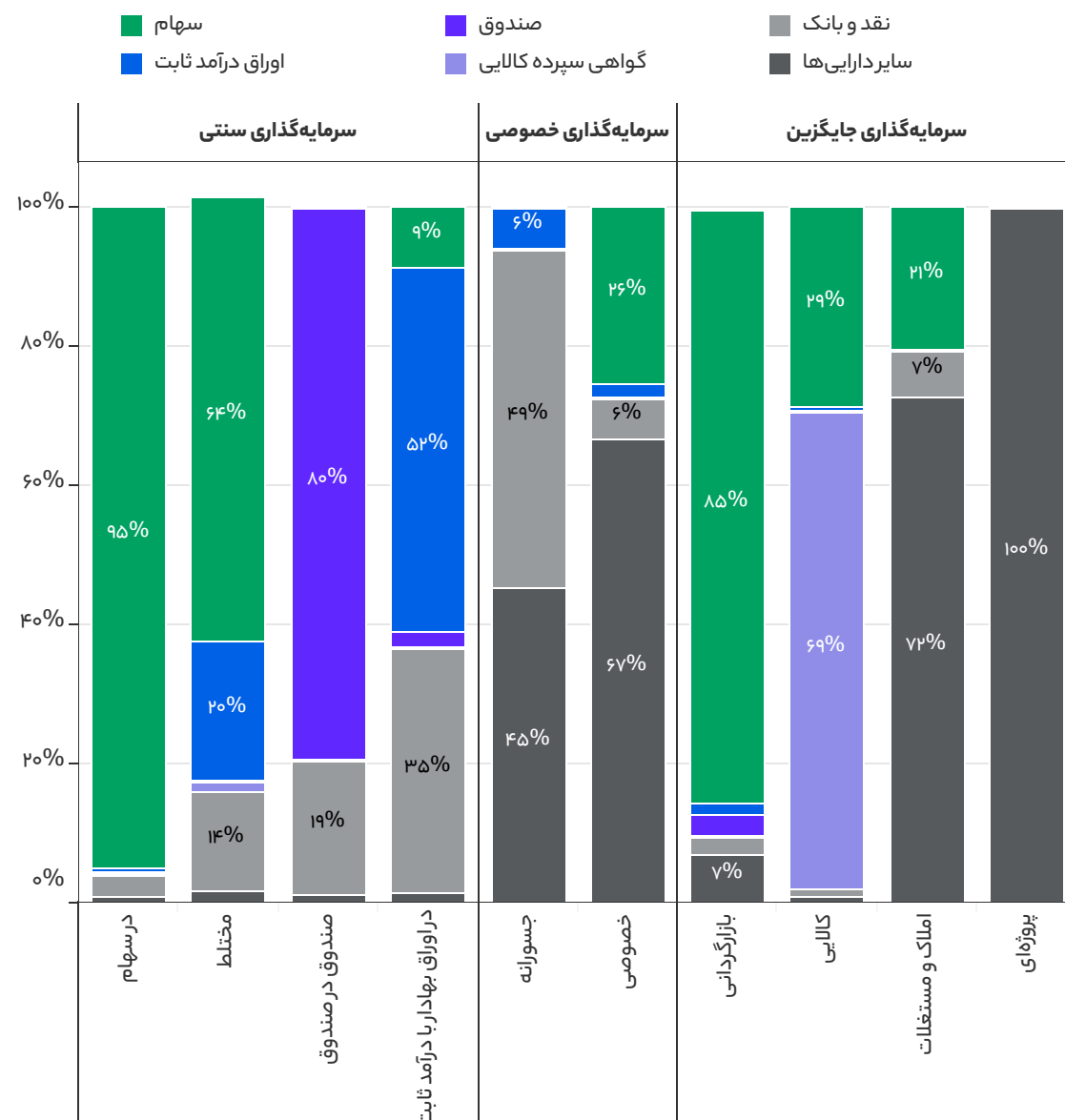
به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهام	درآمد ثابت	سپرده کالایی	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	مختلط	۶۴%	۲۰%	۱%	-	۱۴%	۲%
	صندوق در صندوق	-	-	-	۸۰%	۱۹%	۱%
	در سهام	۹۵%	۱%	-	-	۳%	۱%
	درآمد ثابت	۹%	۵۲%	-	۲%	۳۵%	۱%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۶%	-	-	۴۹%	۴۵%
	خصوصی	۲۶%	۲%	-	-	۶%	۶۷%
سرمایه‌گذاری جایگزین	کالایی	۲۹%	۱%	۶۹%	-	۱%	۱%
	اختصاصی بازارگردانی	۸۵%	۲%	-	۳%	۳%	۷%
	املاک و مستغلات	۲۱%	-	-	-	۷%	۷۲%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۷%	۳۳%	۳%	۲%	۲۳%	۳%

ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق

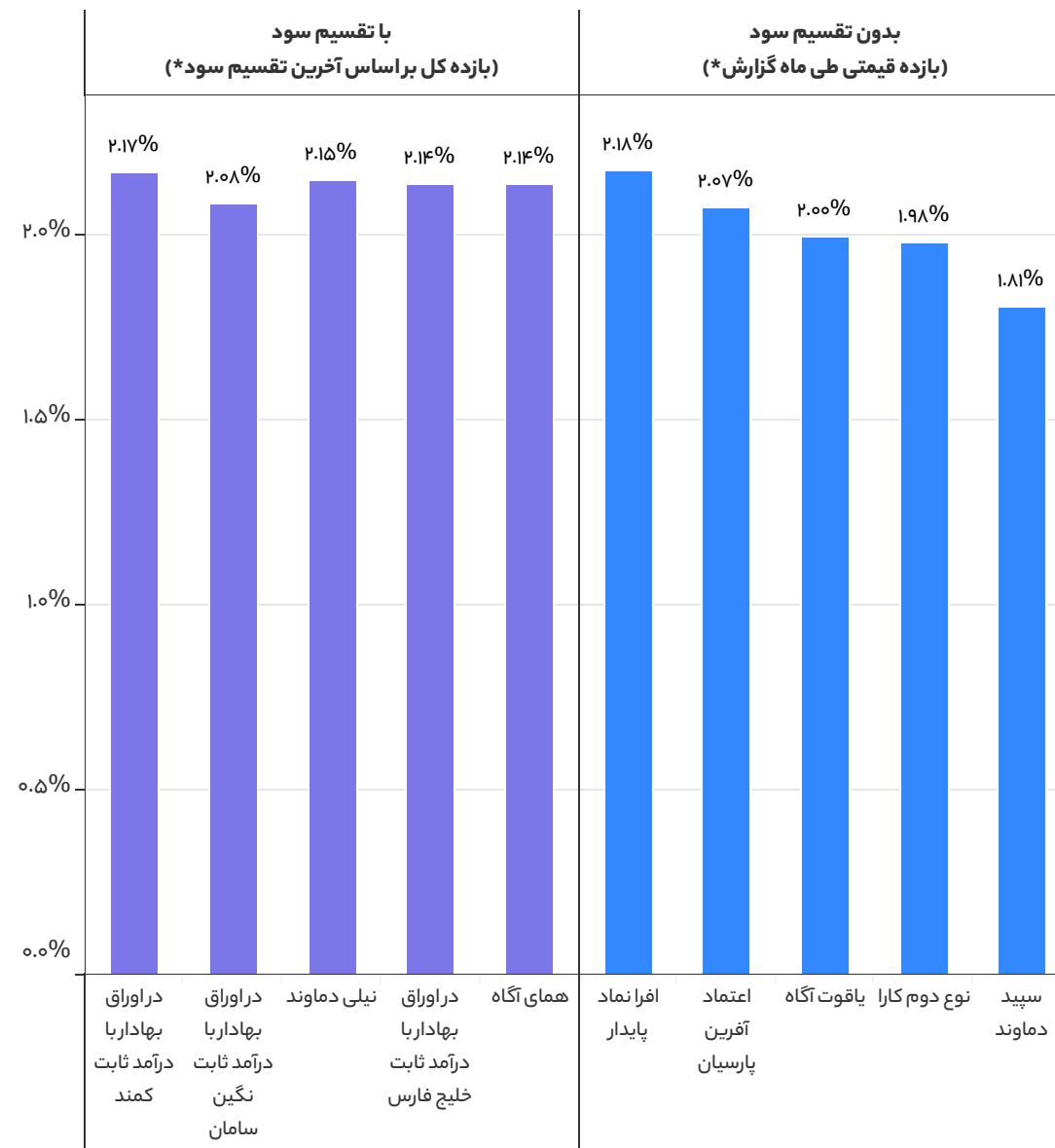


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

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 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 بهاداربا درآمد ثابت کمند	۶,۴۳۶	۲۴.۶%	۱۲.۴%	۶.۳%	۲.۱۸%	۲۶.۱%	۲۹.۴%
	دراوراق بهاداربا درآمد ثابت خلیج فارس	۶,۲۵۵	۲۴.۶%	۱۲.۳%	۶.۲%	۲.۱۵%	۲۵.۷%	۲۸.۹%
	نیلی دماوند	۵,۱۱۵	۲۴.۲%	۱۲.۲%	۶.۲%	۲.۱۵%	۲۵.۸%	۲۹.۱%
	همای آگاه	۳,۶۷۰	۲۴.۵%	۱۲.۲%	۶.۲%	۲.۰۹%	۲۵.۶%	۲۸.۸%
	دراوراق بهاداربا درآمد ثابت نگین سامان	۲,۸۹۰	۲۳.۸%	۱۲.۱%	۶.۲%	۲.۱۷%	۲۵.۵%	۲۸.۱%
بدون تقسیم سود	افرا نماد پایدار	۱۵,۰۴۶	۲۸.۲%	۱۳.۳%	۶.۶%	۲.۱۸%		
	سپید دماوند	۱۲,۲۸۶	۲۵.۱%	۱۱.۸%	۵.۸%	۱.۸۱%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۹,۵۴۱	۲۶.۶%	۱۲.۵%	۶.۴%	۲.۰۷%		
	نوع دوم کارا	۸,۵۰۷	۲۷.۸%	۱۳.۰%	۶.۵%	۱.۹۸%		
	یاقوت آگاه	۷,۸۱۵	۲۷.۱%	۱۲.۹%	۶.۳%	۲.۰۰%		

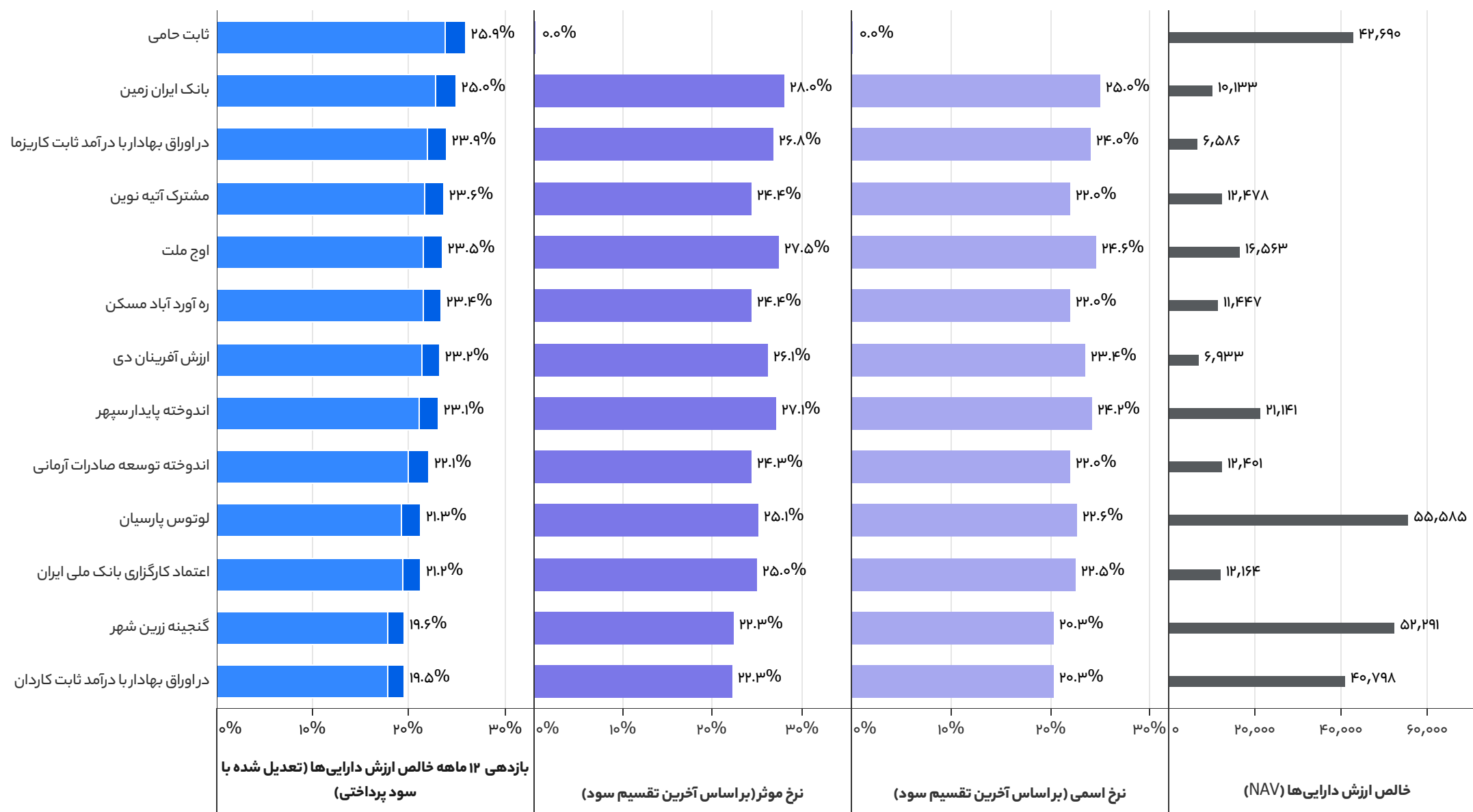


* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.
 ** در صورتی که صندوق تقسیم سود داشته باشد، بازده خالص ارزش دارایی هر واحد بر اساس تقسیم سود تعدیل می‌گردد.

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

