

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



اردیبهشت ماه ۱۴۰۳



CHARISMA MARKET INSIGHT

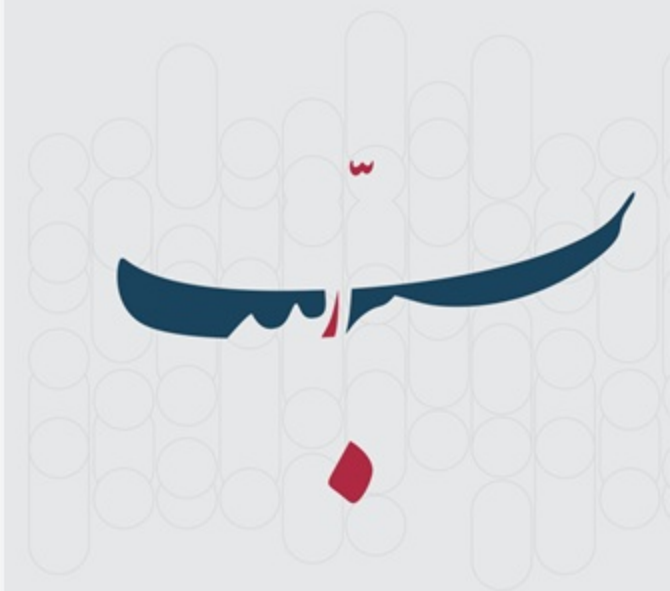
معرفی گزارش:

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.



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
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)

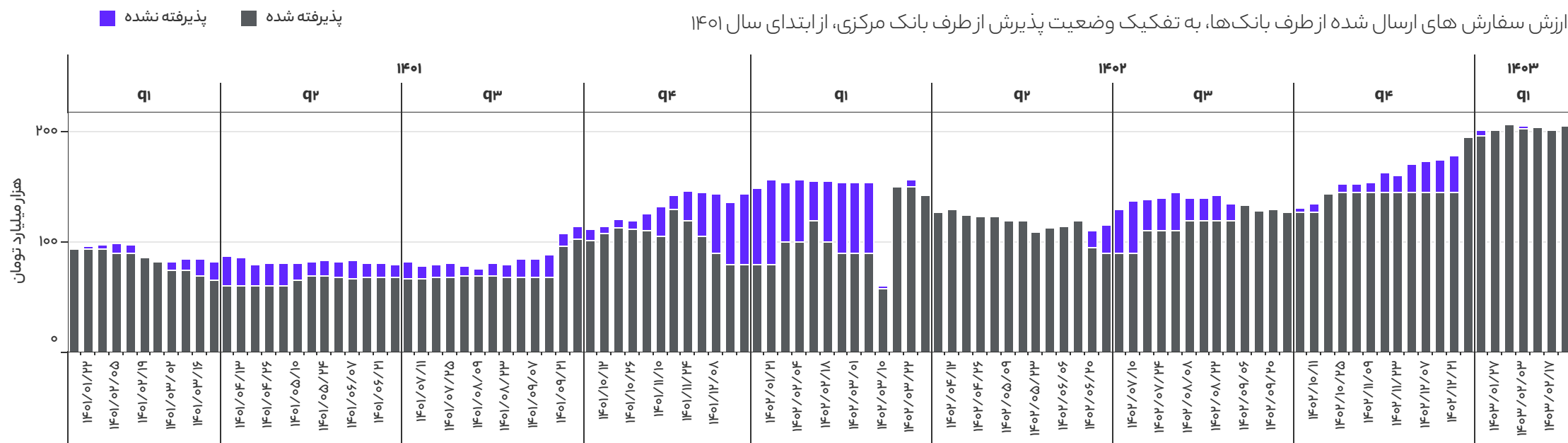


ECONOMY

سیاست‌های پولی

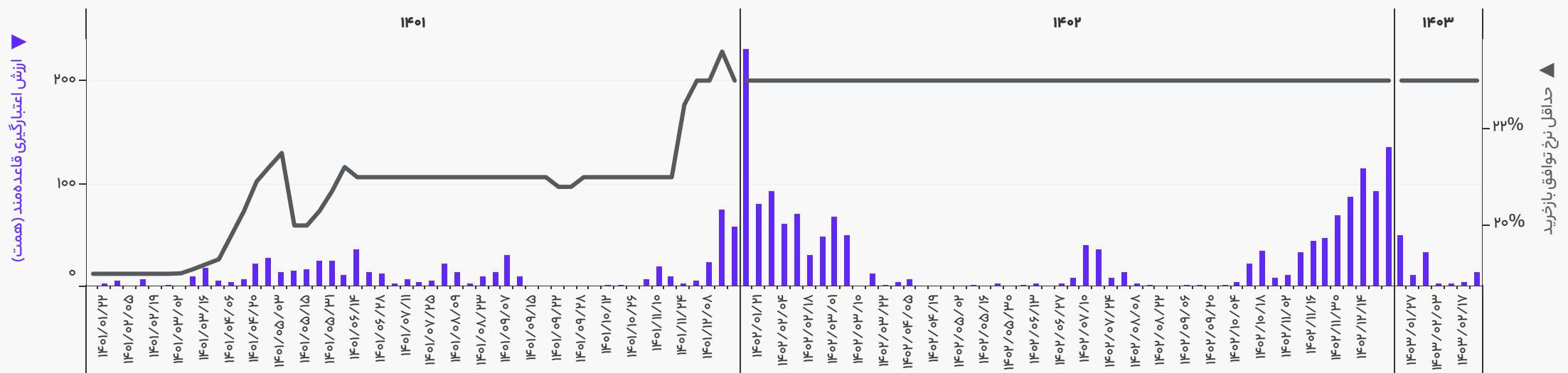
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

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

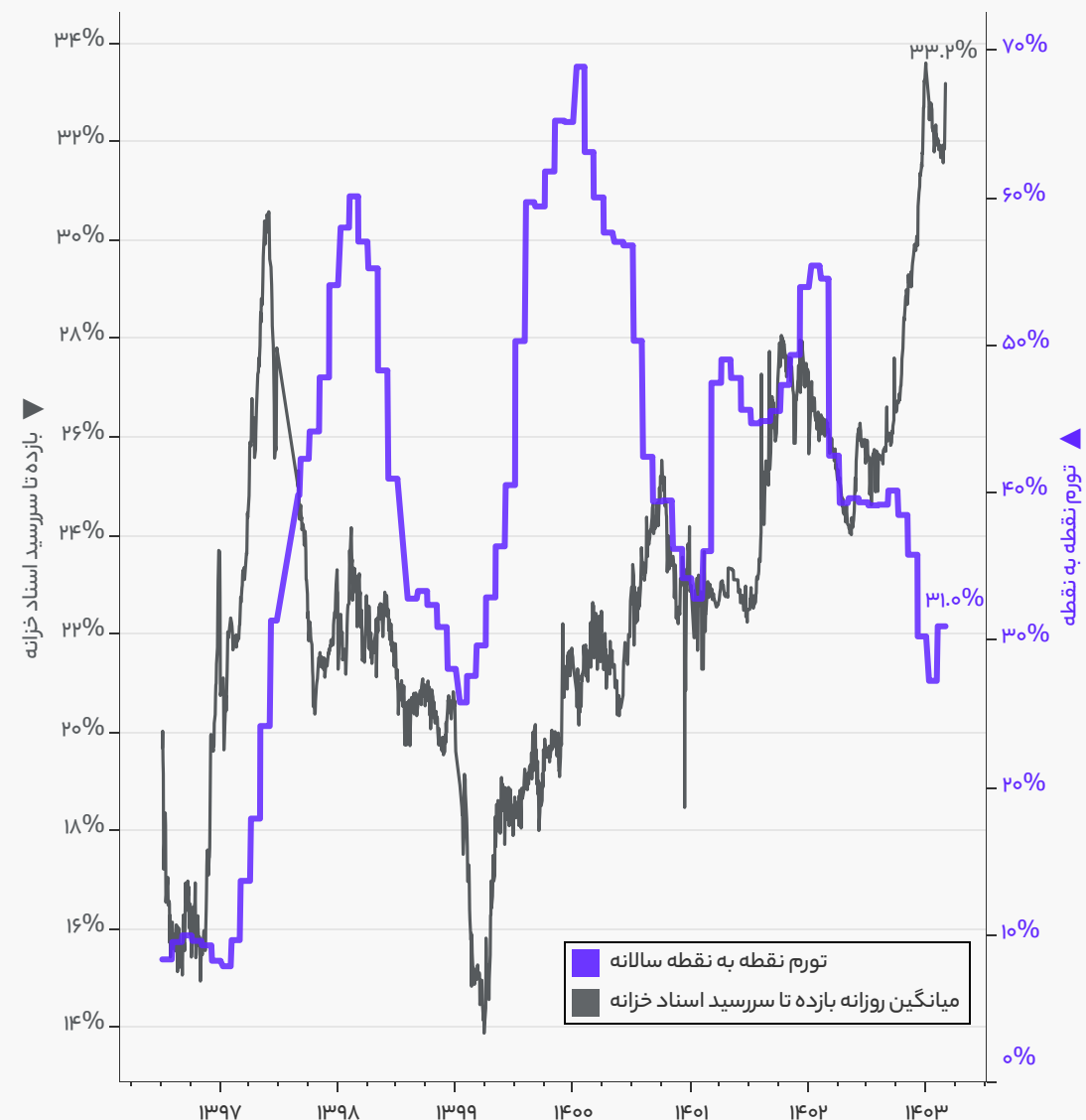
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق بازخريد، از ابتدای سال ۱۴۰۱



سیاست‌های پولی

تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

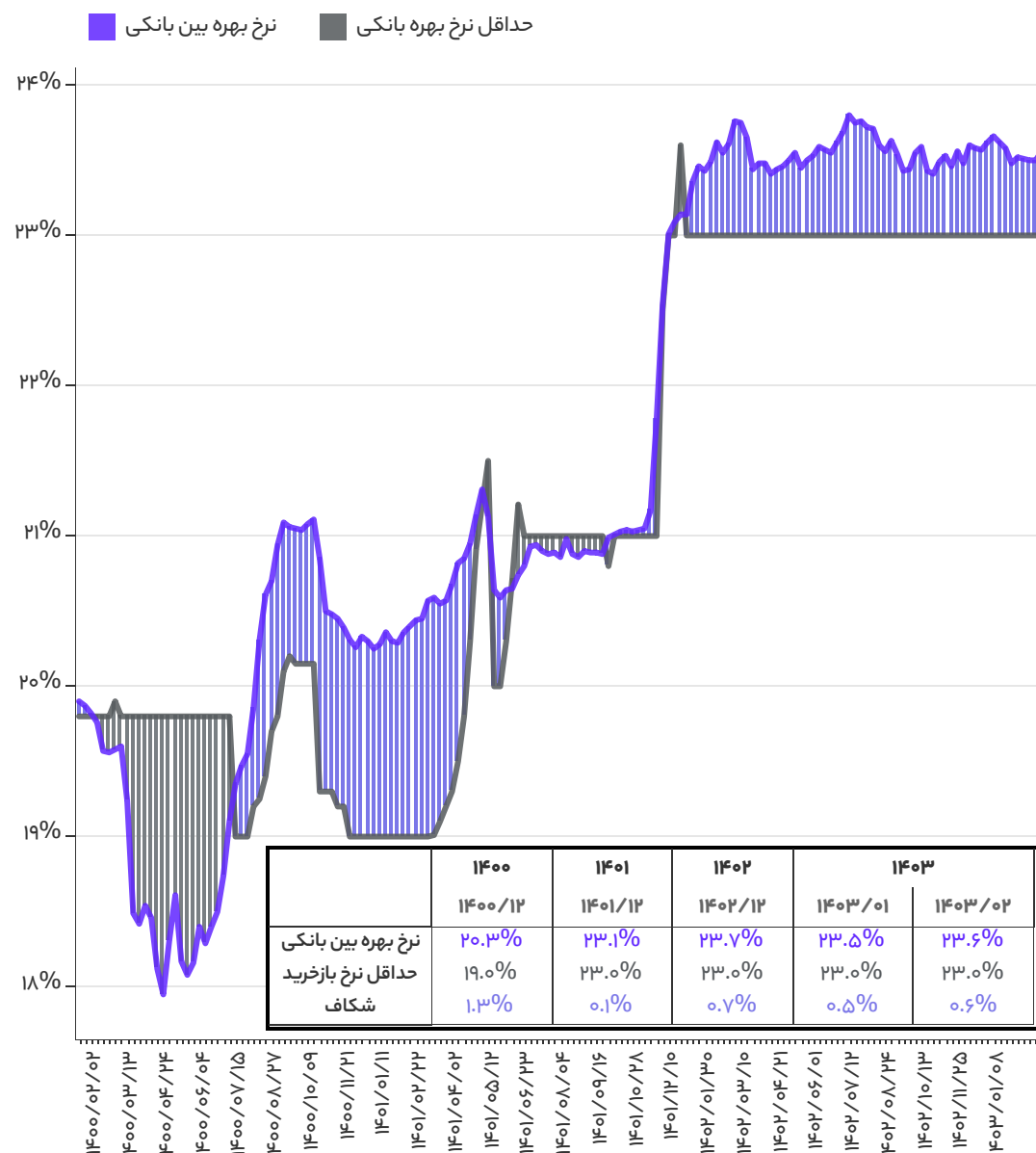
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* 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

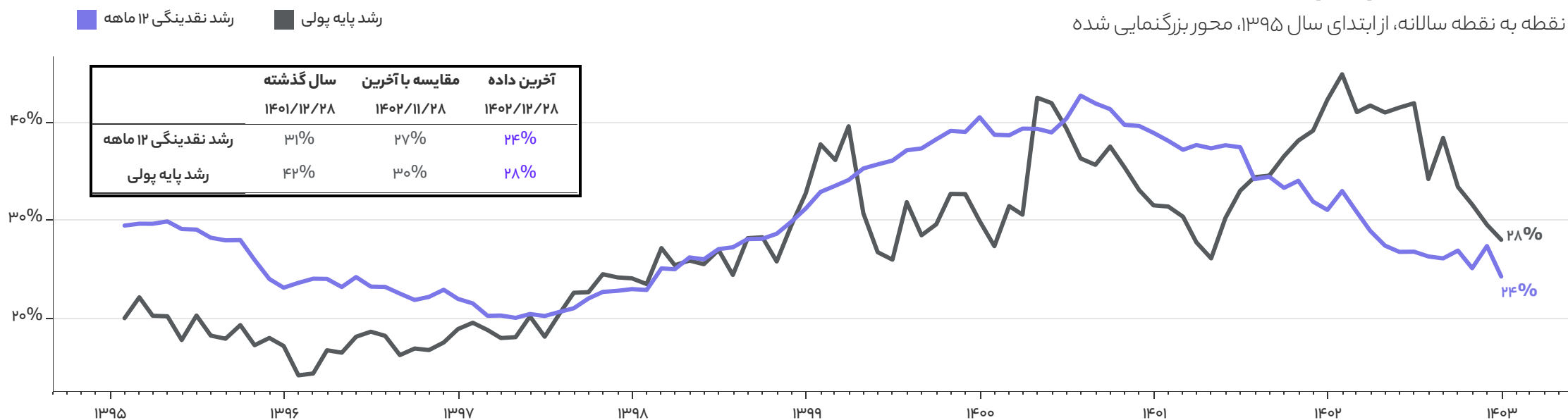
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

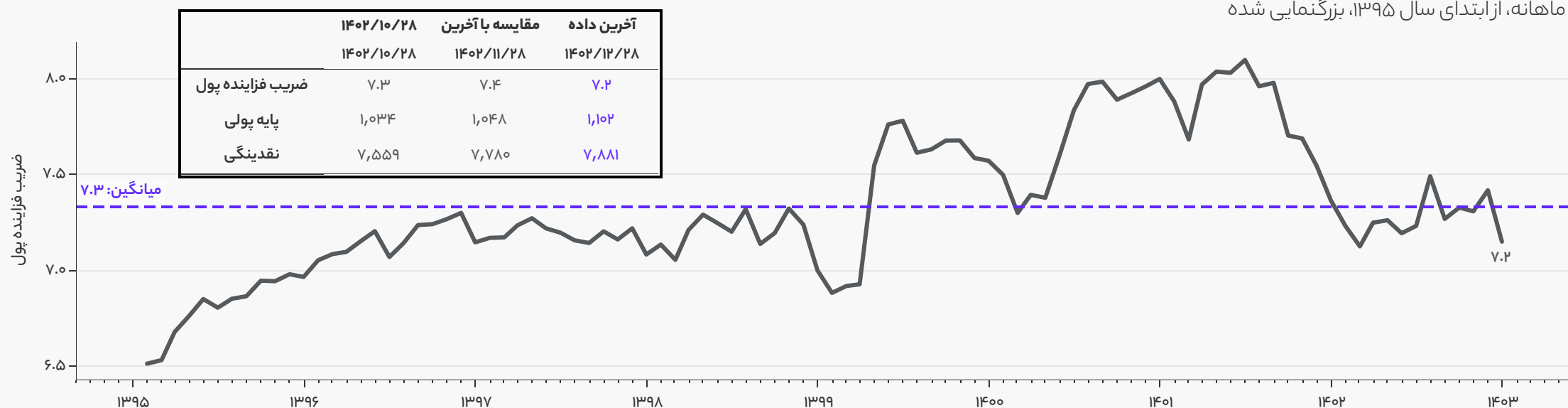
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

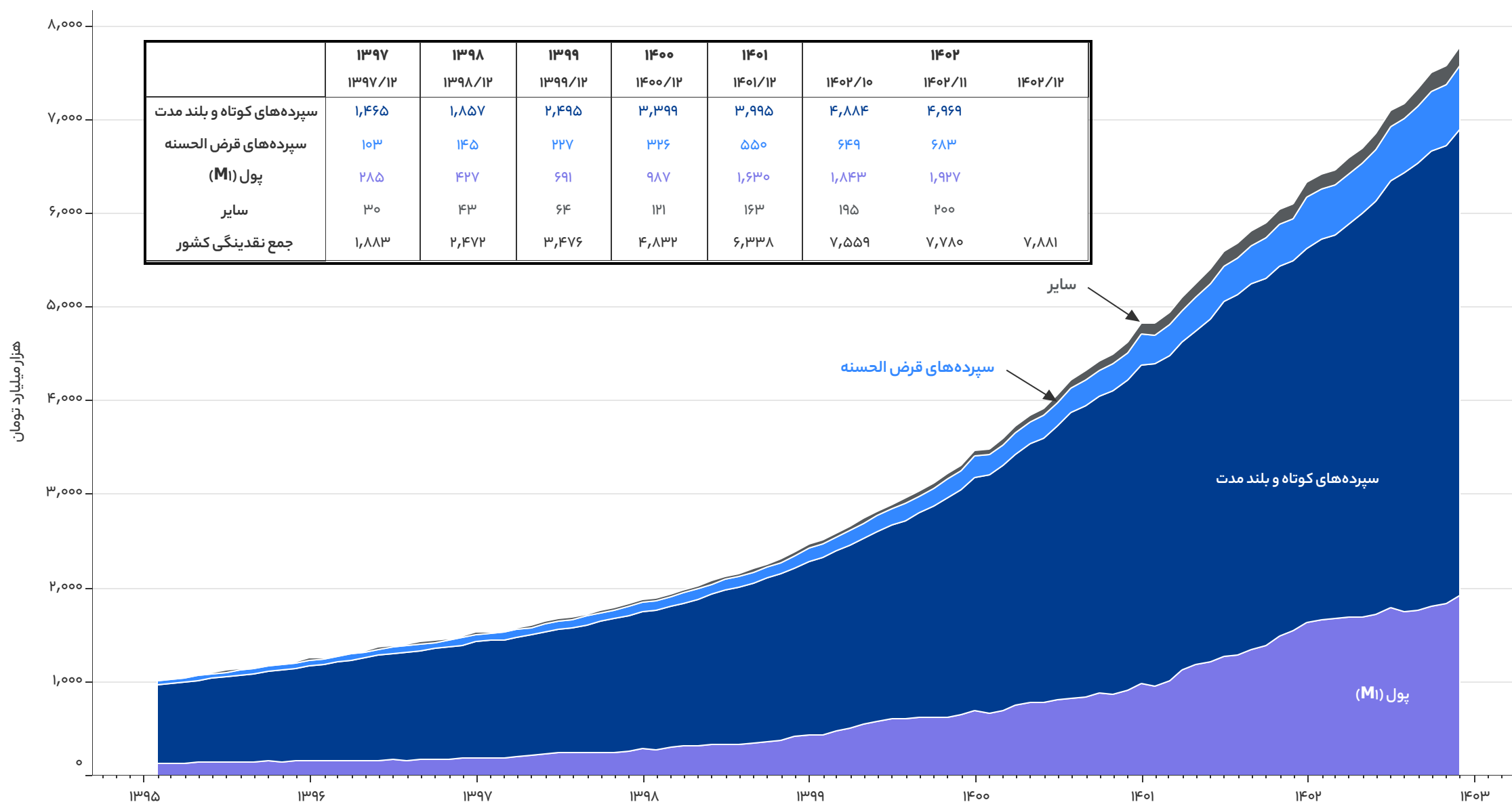


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

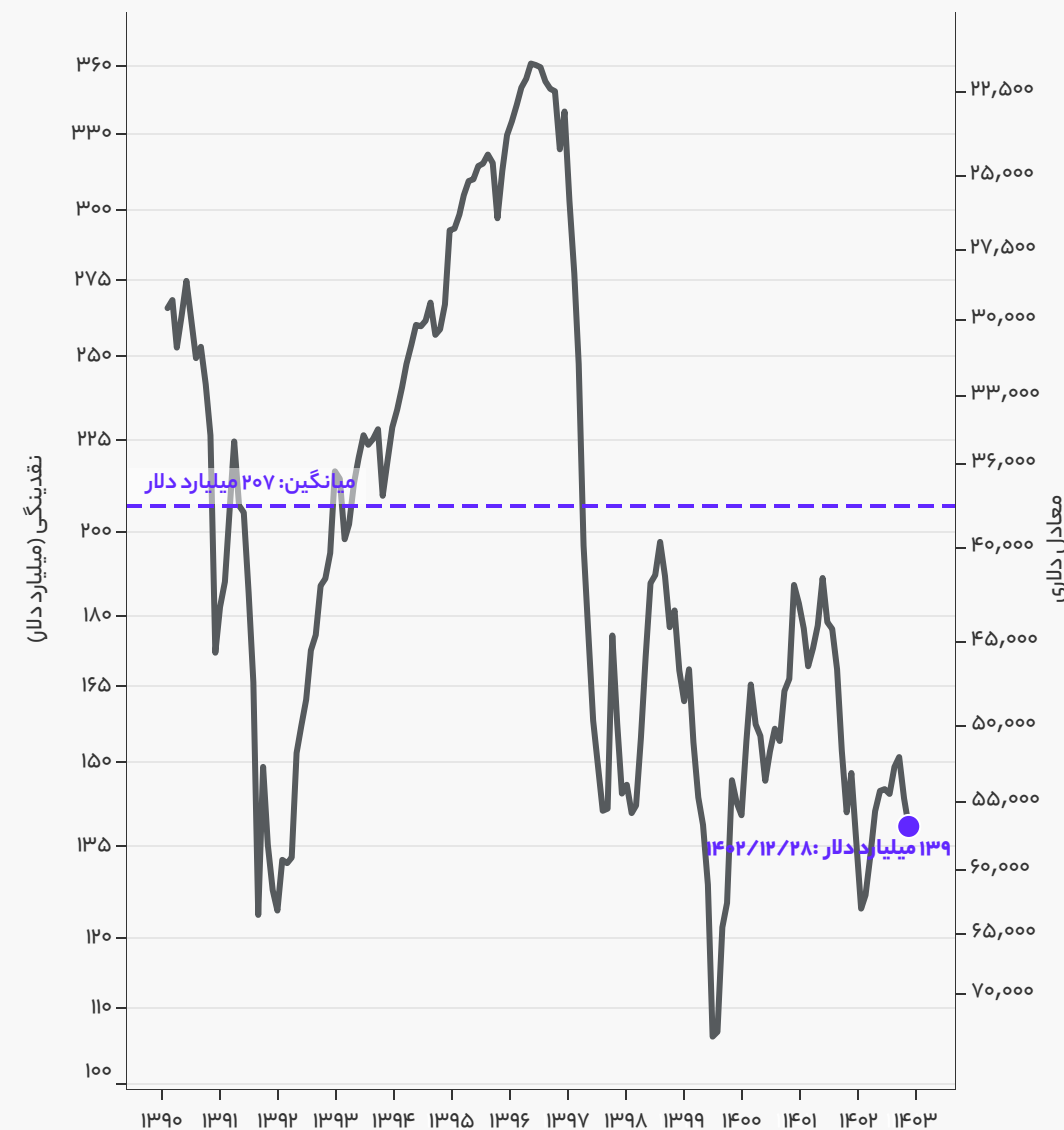
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، (براساس آخرین داده‌ی منتشر شده توسط بانک مرکزی)، هزار میلیارد تومان



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

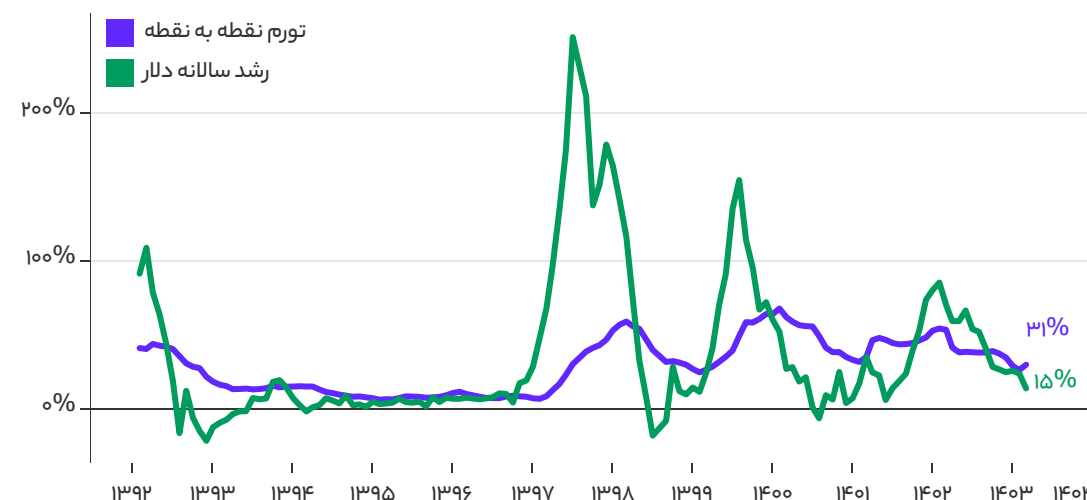


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

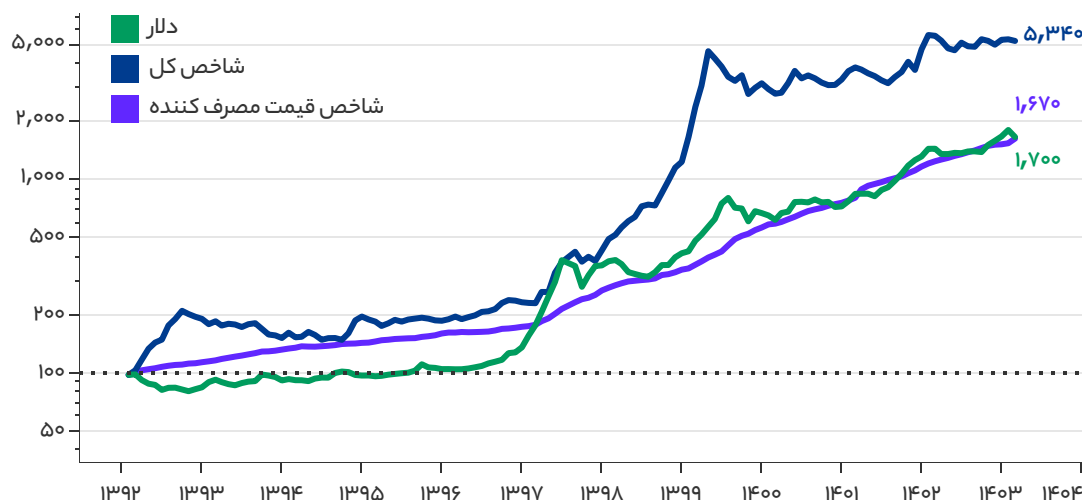
تورم و رشد دلار

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

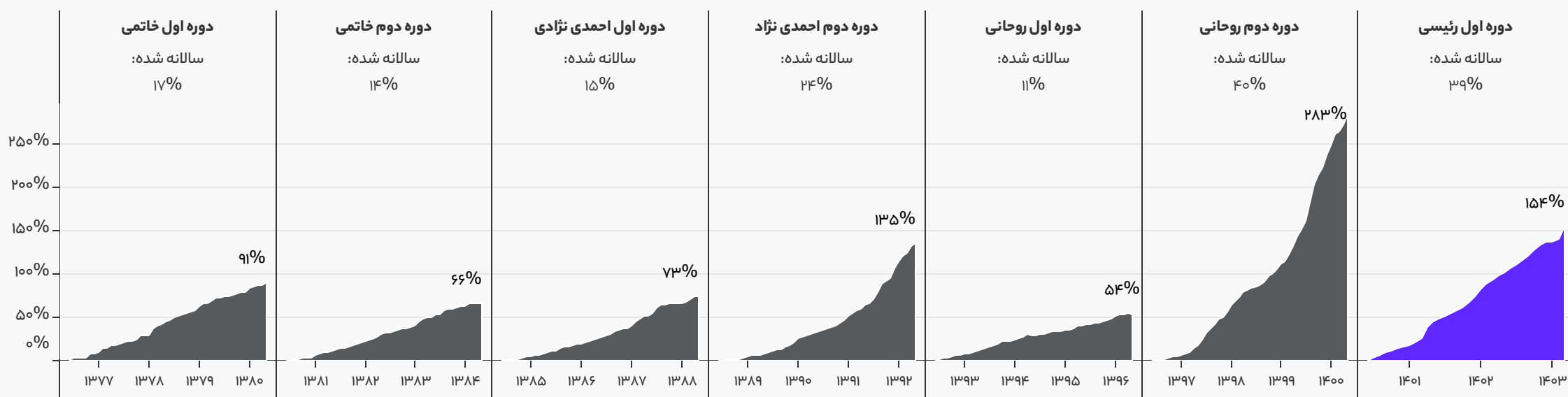


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

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

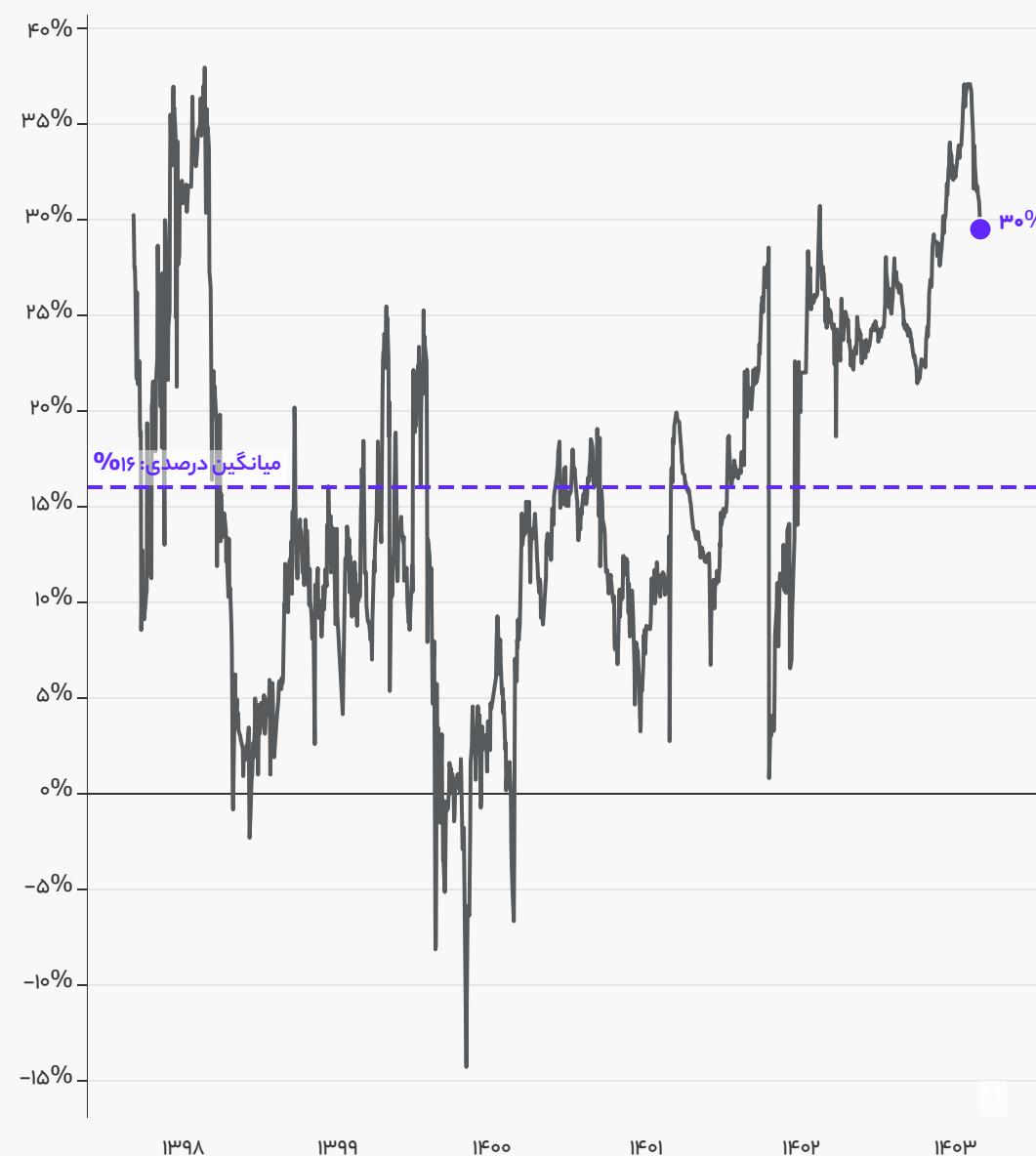


* دلار سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

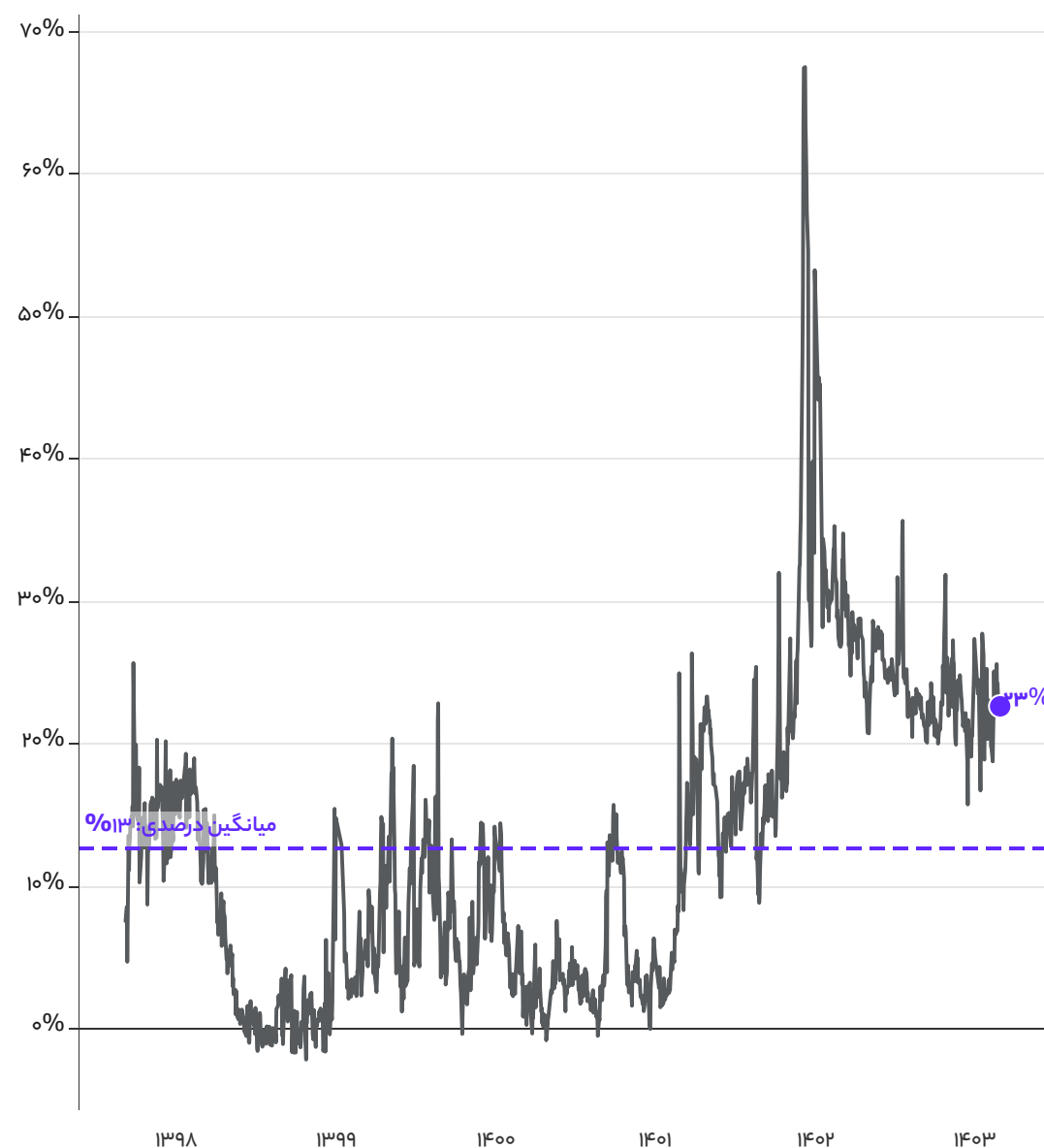
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



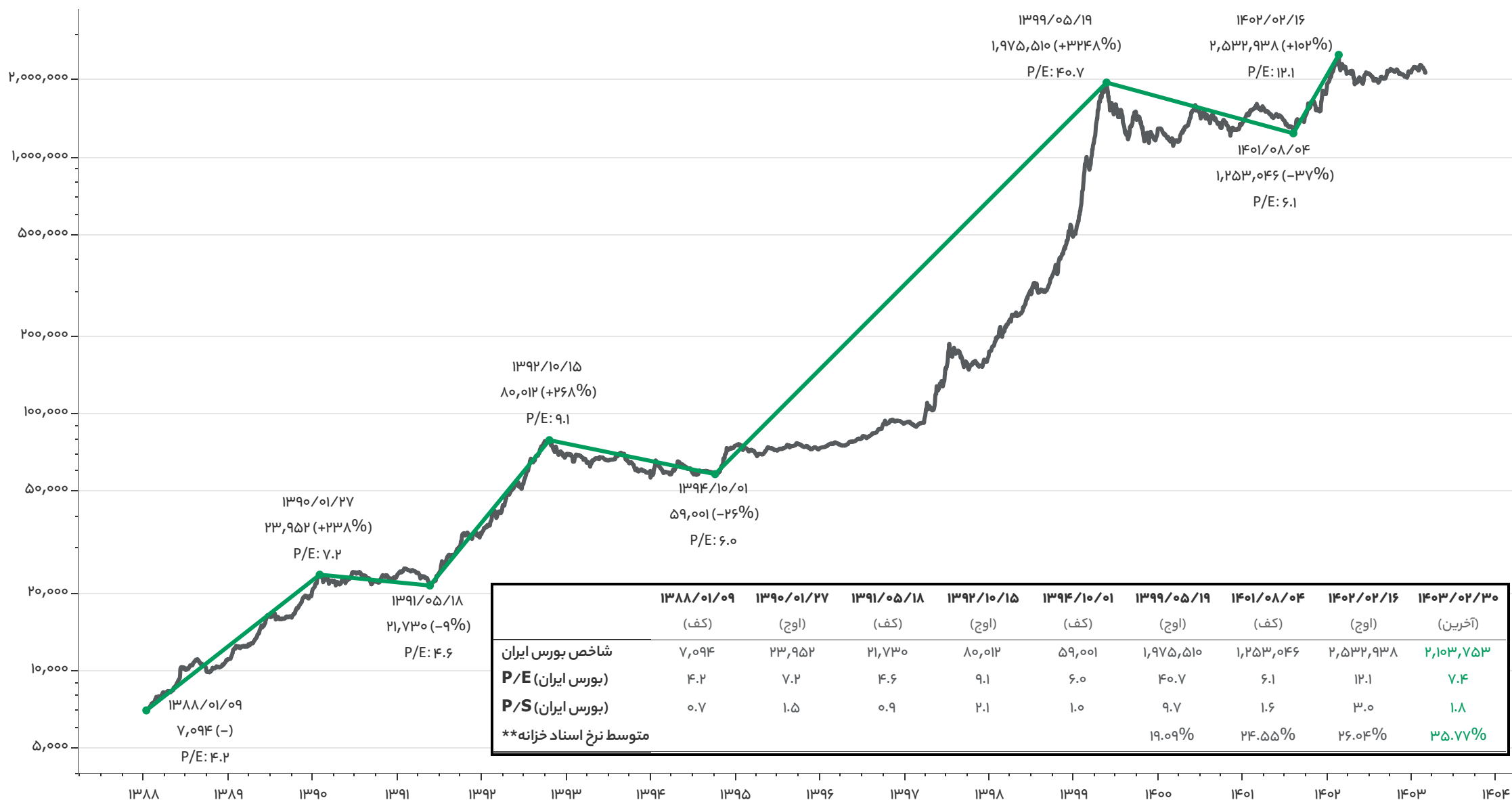


EQUITY

بررسی بلندمدت بازار سهام

روندهای بلندمدت شاخص بورس ایران*

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



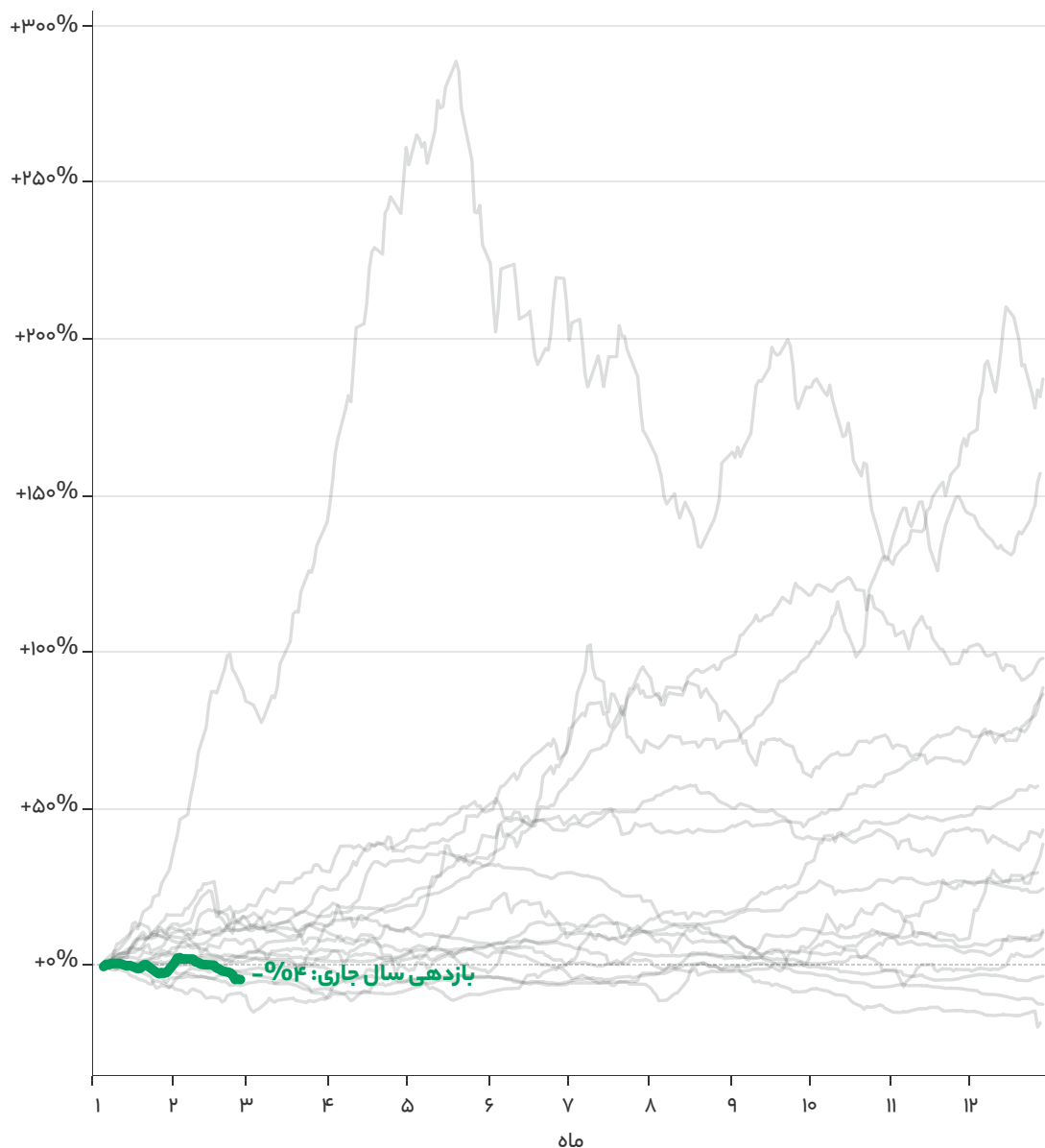
	۱۳۸۸/۰۱/۰۹	۱۳۹۰/۰۱/۲۷	۱۳۹۱/۰۵/۱۸	۱۳۹۲/۱۰/۱۵	۱۳۹۴/۱۰/۰۱	۱۳۹۹/۰۵/۱۹	۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱۴۰۲/۰۲/۱۶	۱۴۰۳/۰۲/۳۰
	(کف)	(اوج)	(کف)	(اوج)	(کف)	(اوج)	(کف)	(اوج)	(آخرین)
شاخص بورس ایران	۷,۰۹۴	۲۳,۹۵۲	۲۱,۷۳۰	۸۰,۰۱۲	۵۹,۰۰۱	۱,۹۷۵,۵۱۰	۱,۲۵۳,۰۴۶	۲,۵۳۲,۹۳۸	۲,۱۰۳,۷۵۳
P/E (بورس ایران)	۴.۲	۷.۲	۴.۶	۹.۱	۶.۰	۴۰.۷	۶.۱	۱۲.۱	۷.۴
P/S (بورس ایران)	۰.۷	۱.۵	۰.۹	۲.۱	۱.۰	۹.۷	۱.۶	۳.۰	۱.۸
متوسط نرخ استاندارد خزانة**						۱۹.۰۹%	۲۴.۵۵%	۲۶.۰۴%	۳۵.۷۷%

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

** متوسط نرخ استاندارد خزانة اسلامی، میانگین نرخ بازدهی اوراق در سرسبدهای مختلف می باشد که بیش از ۳۰ روزه تا سررسید خویش فاصله دارند.

مقایسه بازدهی سال جاری

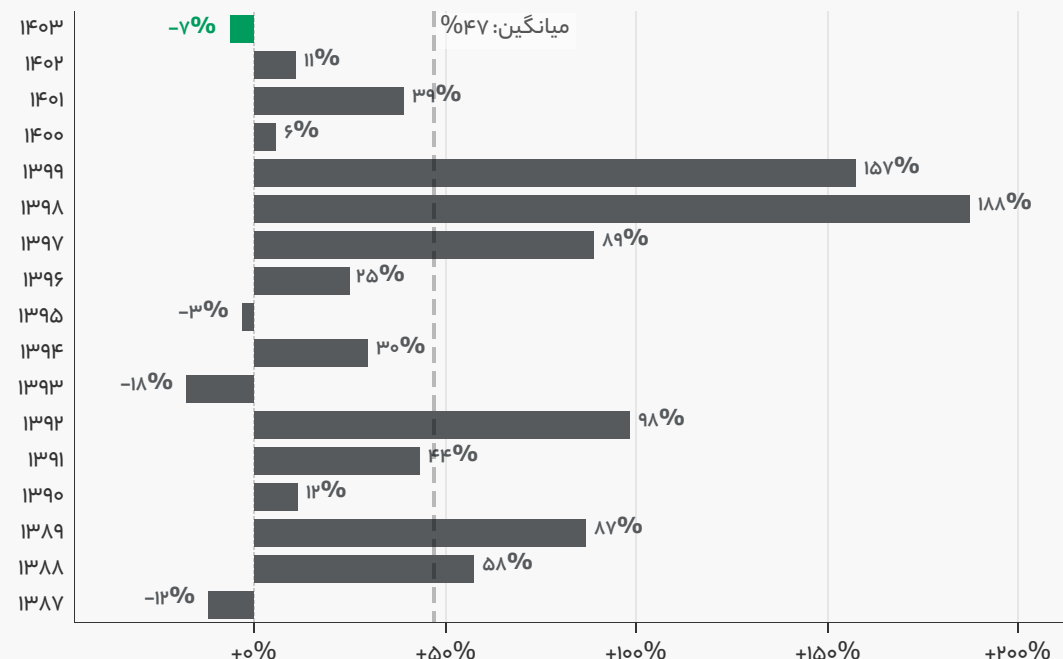
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



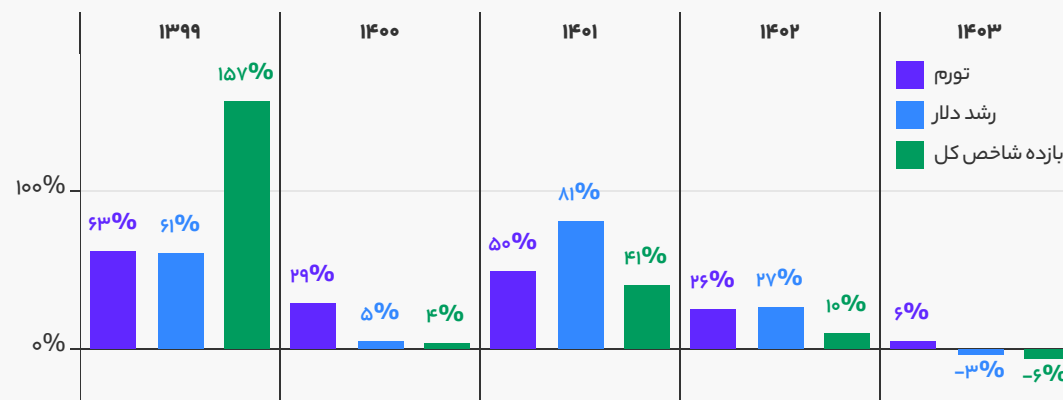
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

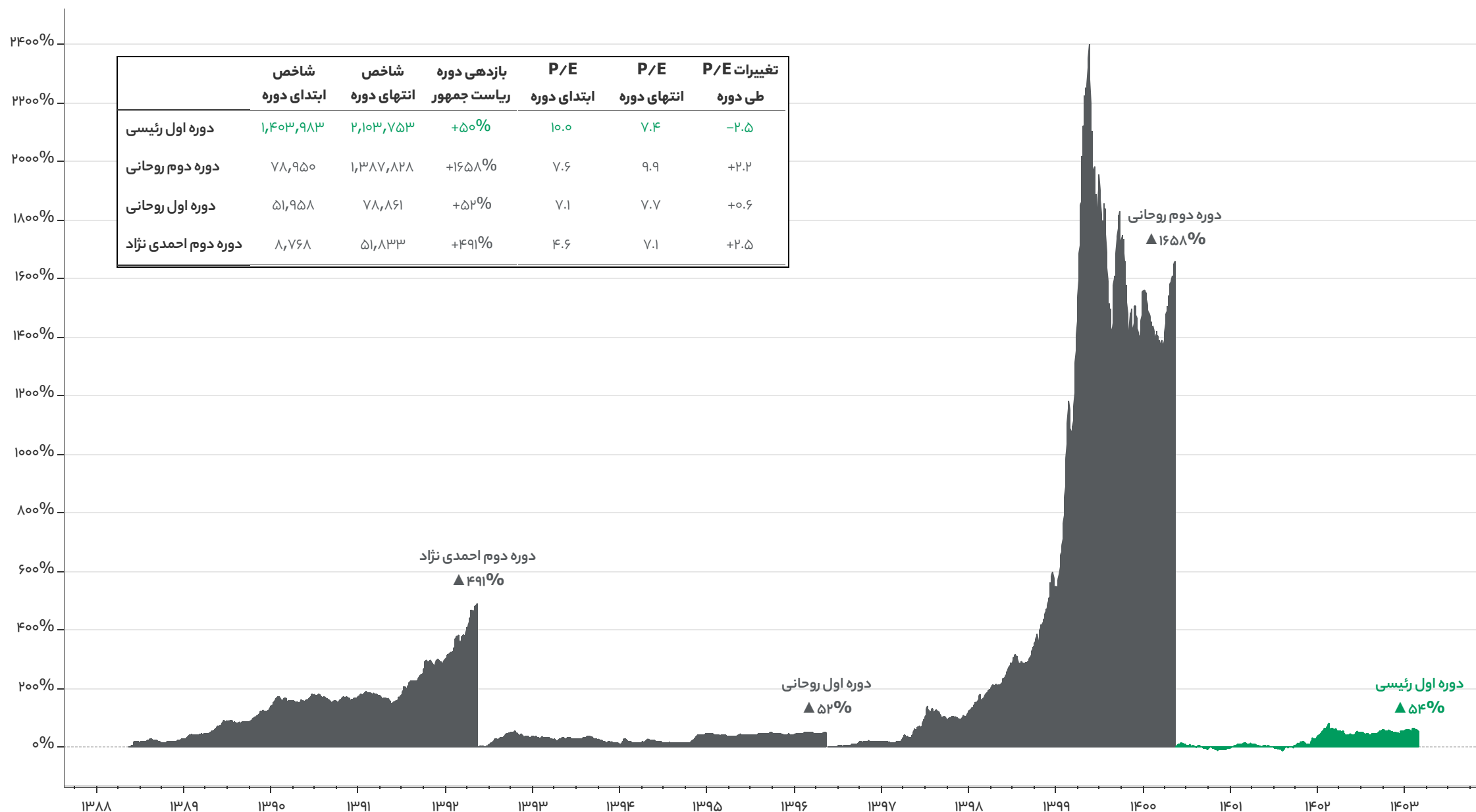


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلند مدت بازار سهام

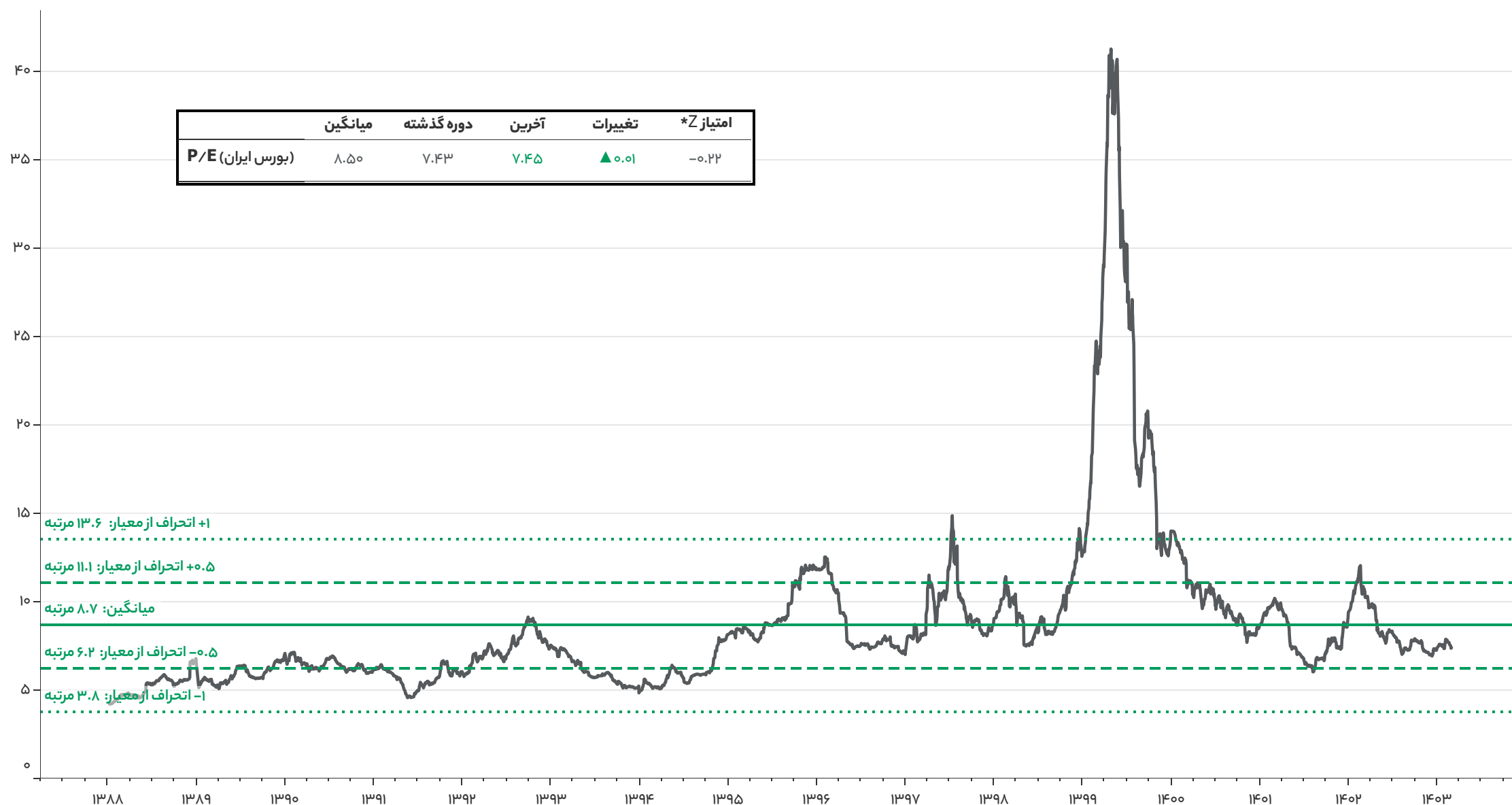
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



ارزندی 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.

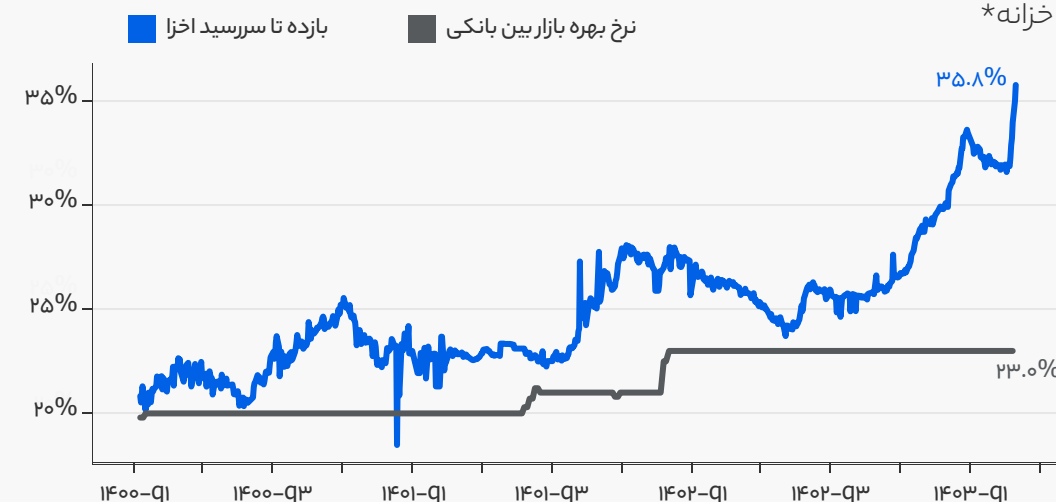


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

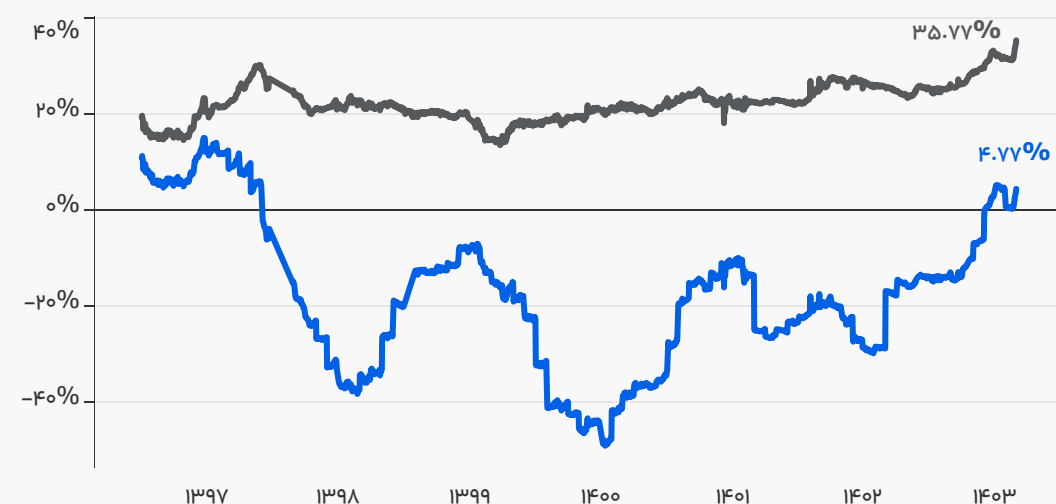
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

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



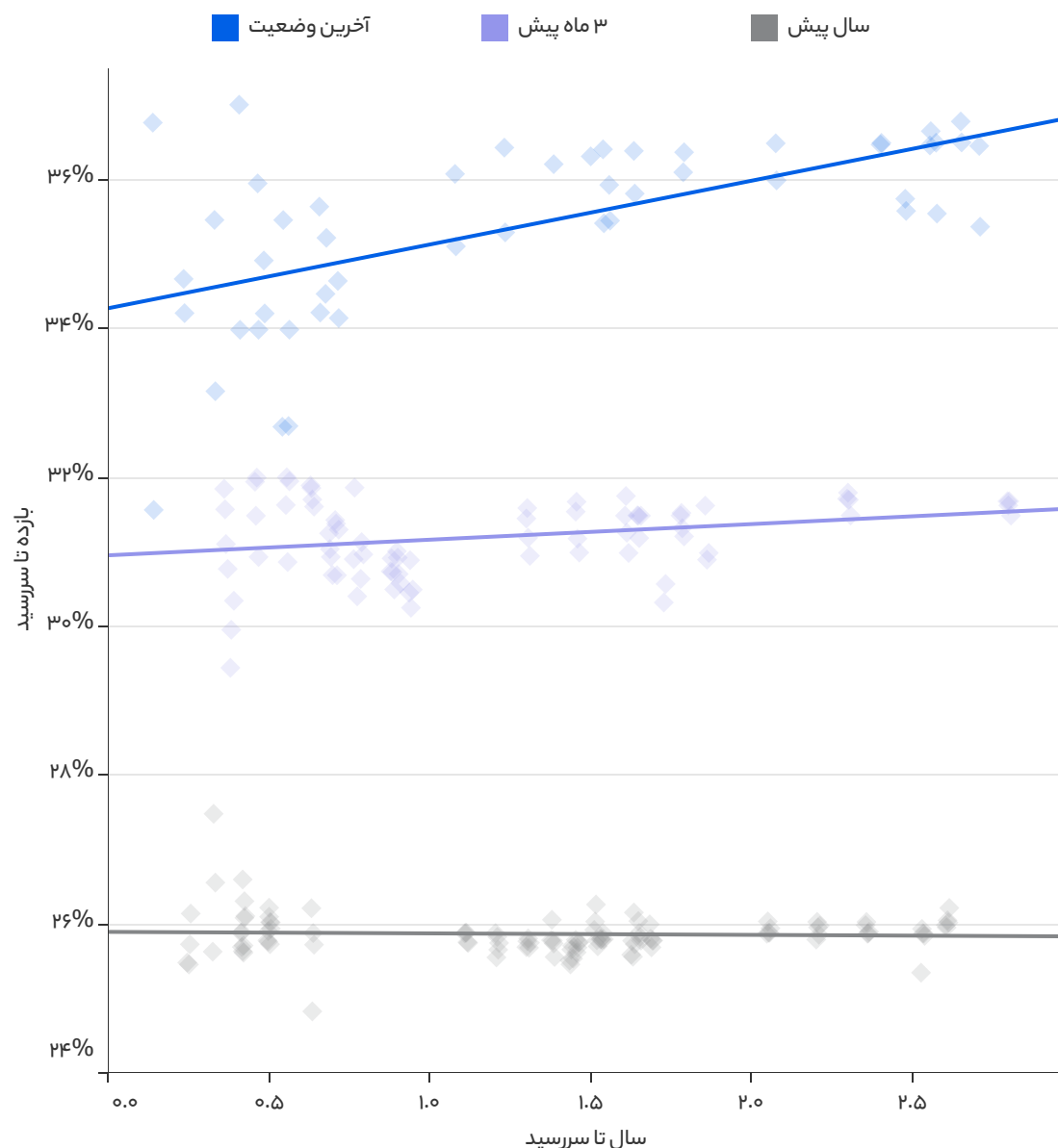
* میانگین روزانه بازده تا سررسيد اسناد خزانه در سررسيدهای مختلف که پیش از ۳۰ روز تا سررسيد خود فاصله دارند.

** 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.

منحنی بازده تا سررسيد اسناد خزانه

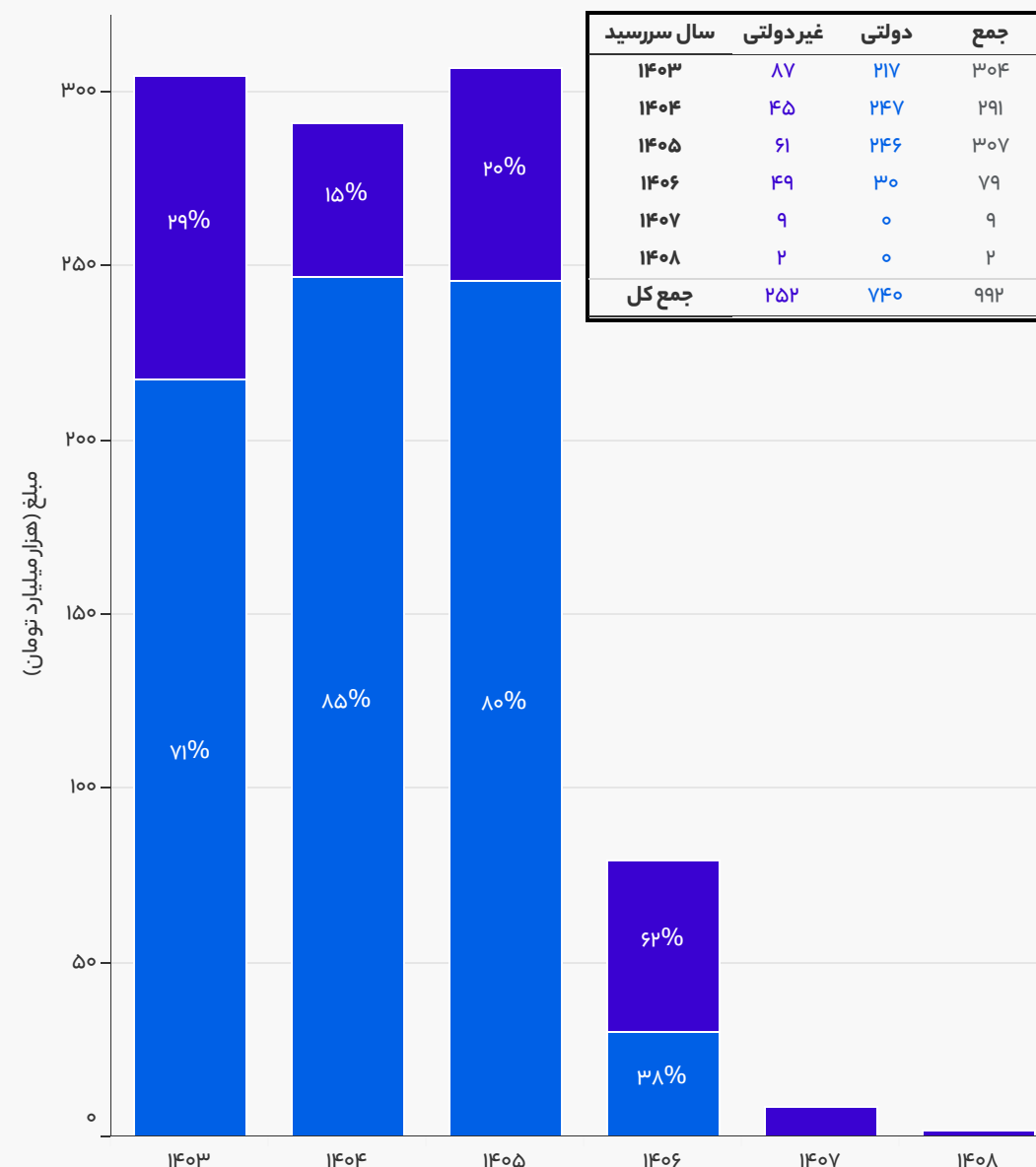
منحنی به همراه بازده تا سررسيد اسناد خزانه***، برای آخرین روز، ۳ ماه پیش و سال پیش



دید کلی بازار بدهی

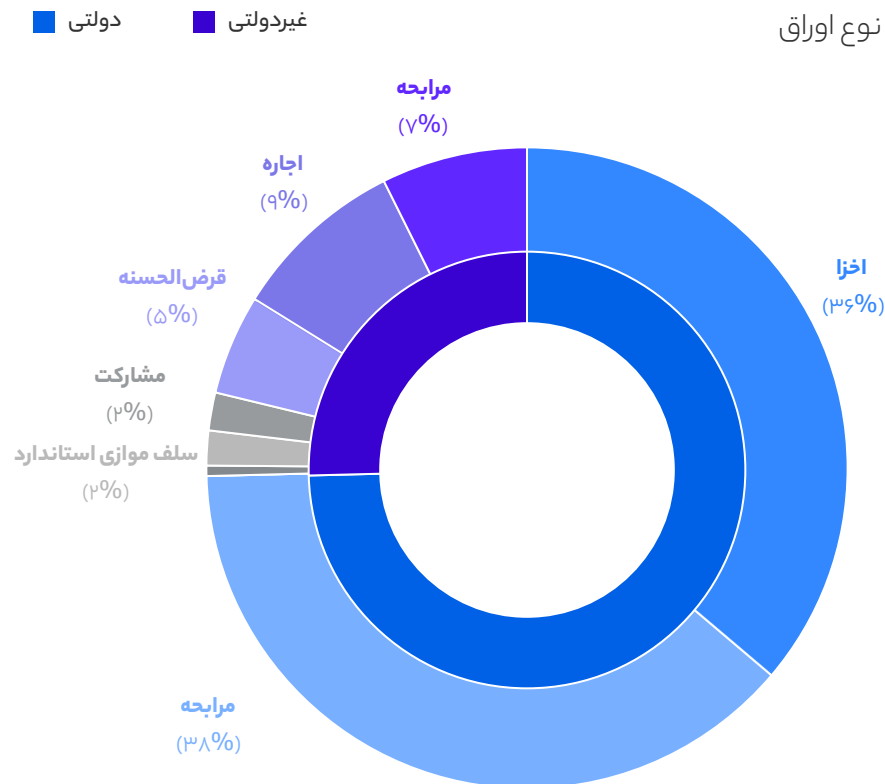
مانده اوراق به تفکیک سررسید

به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



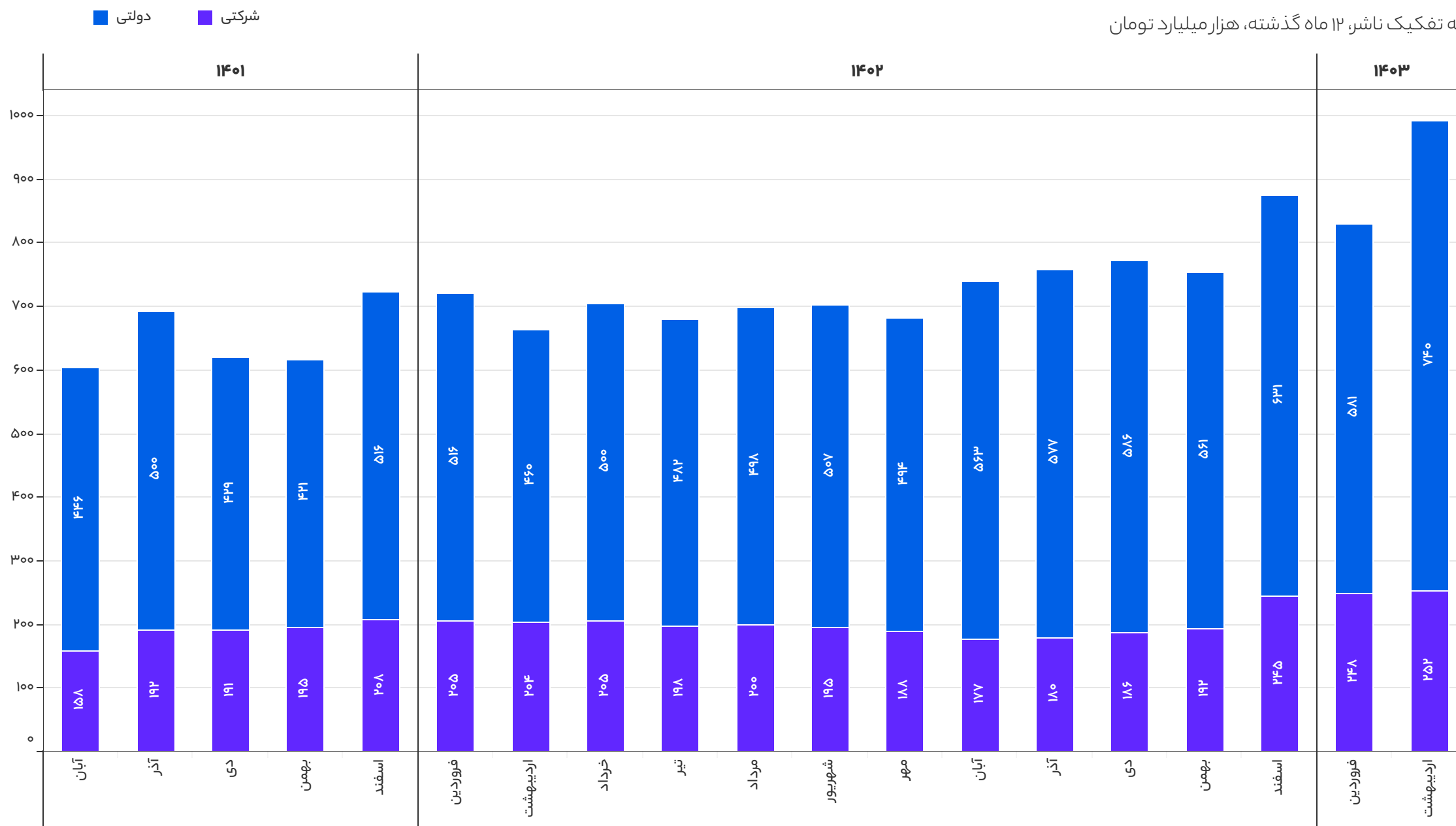
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مربحه	۳۸۱	۳۸%
	اخزا	۳۵۹	۳۶%
غیردولتی	اجاره	۸۷	۹%
	مربحه	۷۳	۷%
	قرض الحسنه	۵۰	۵%
	مشارکت	۱۹	۲%
	سلف موازی استاندارد	۱۷	۲%
	منفعت	۵	۱%
جمع کل		۹۹۲	۱۰۰%

* 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

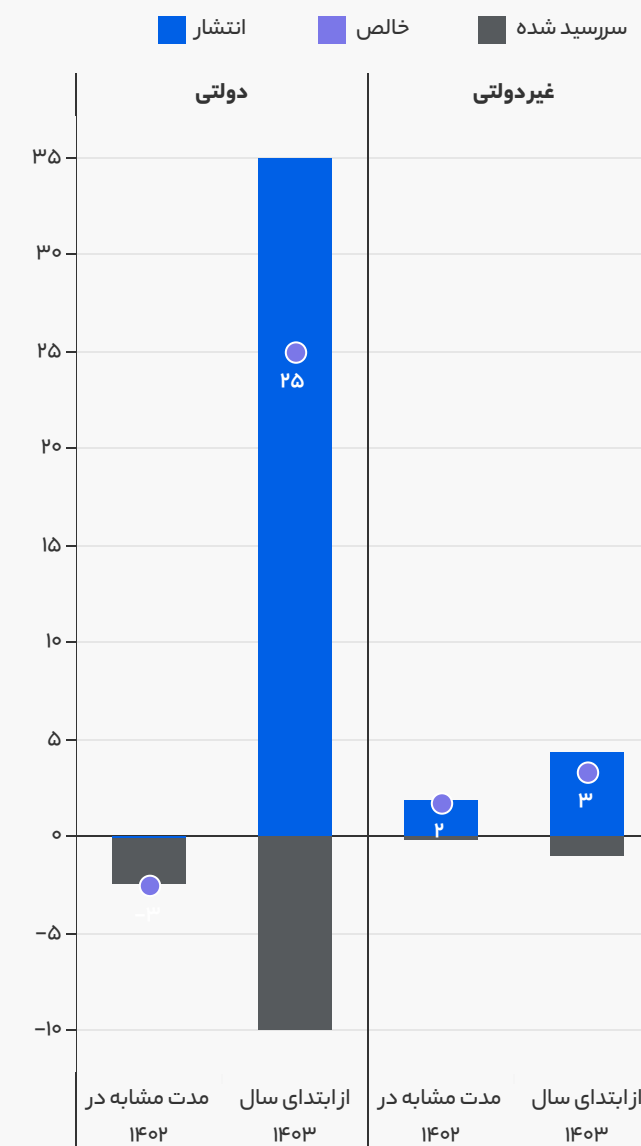
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

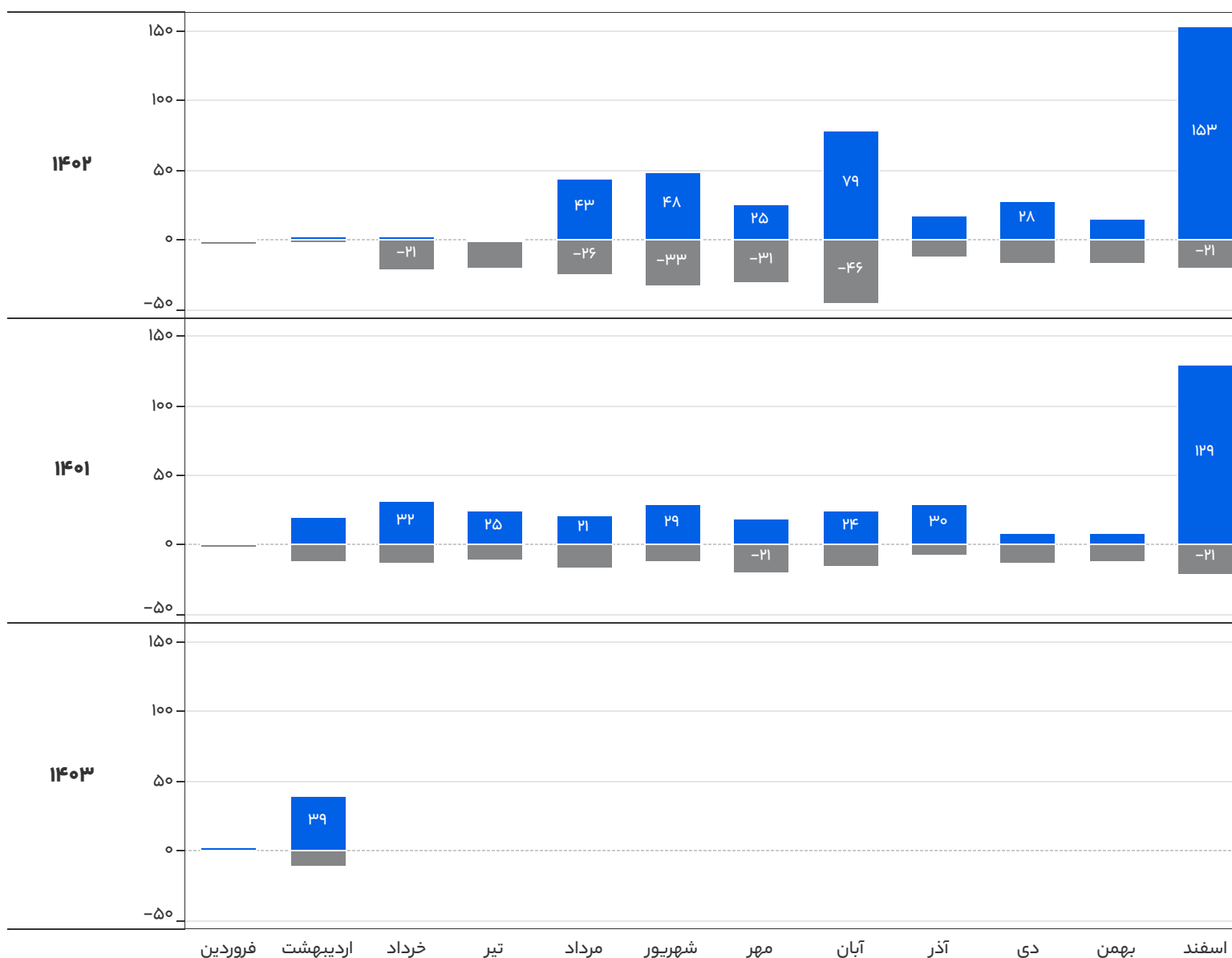
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

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

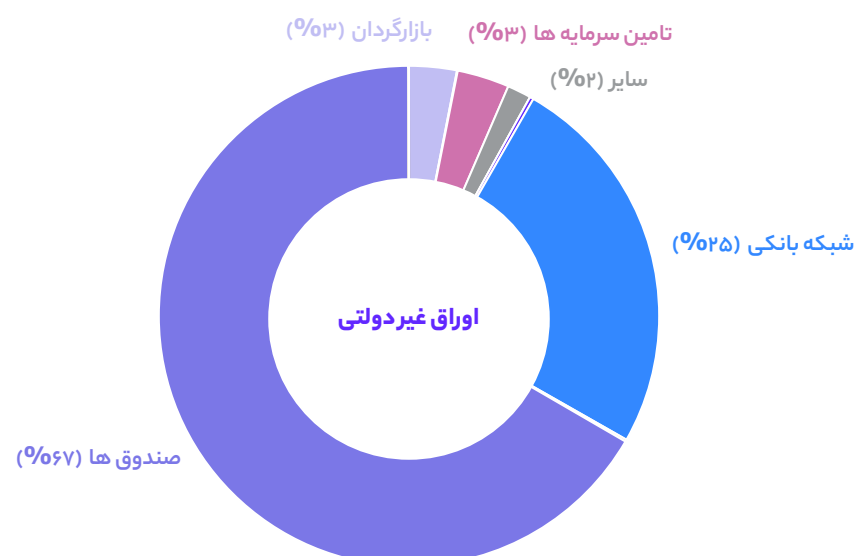
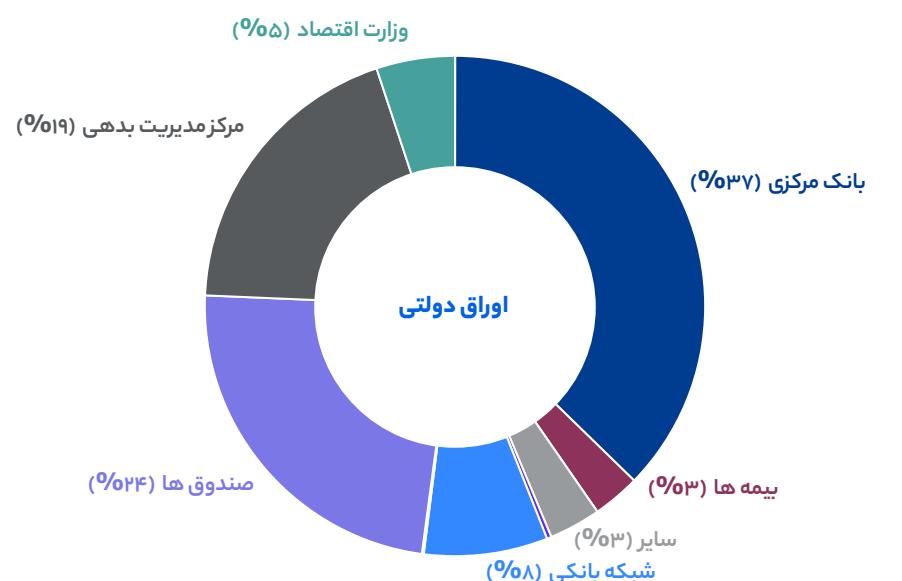
حجم اوراق منتشر و سررسید شده، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

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



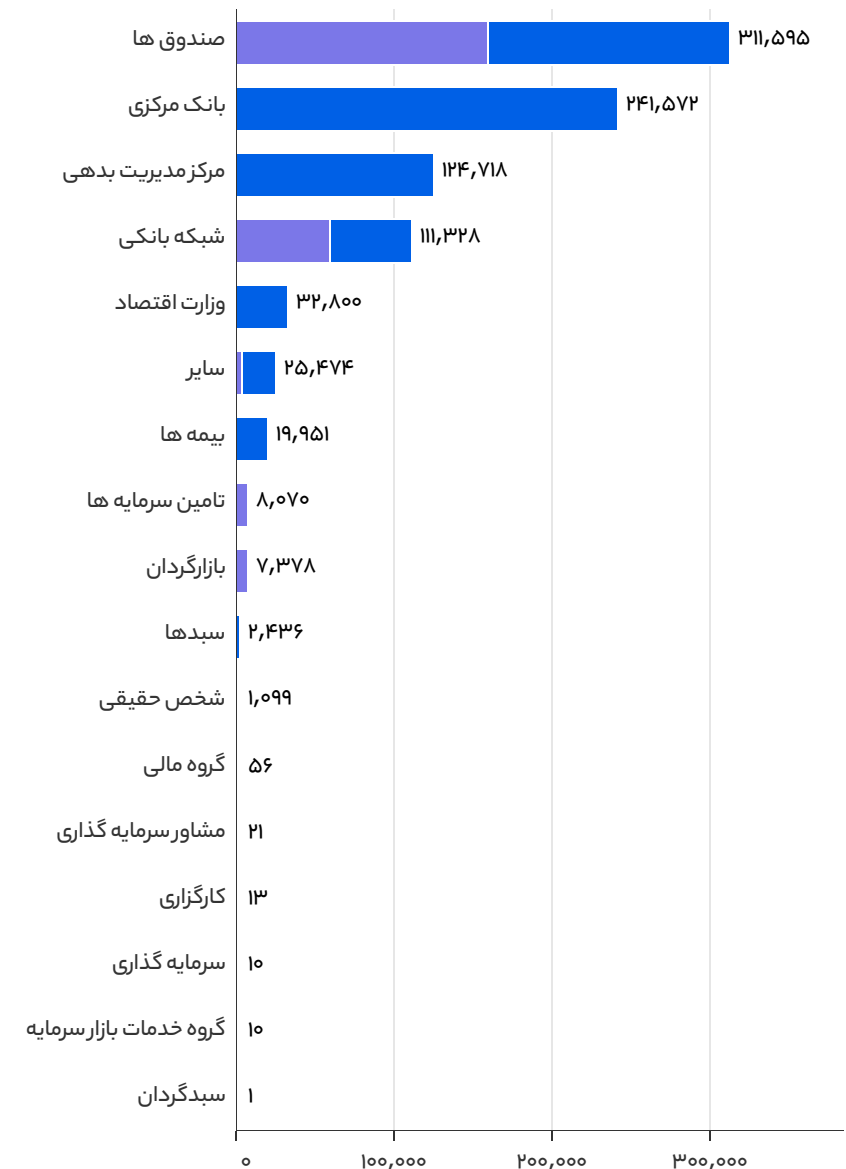
	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	۱۴۰۸	جمع کل
دولتی	بانک مرکزی	۷۱.۵	۱۰۲.۵	۶۱.۰	۶.۶		۲۴۱.۶
	سندوق ها	۷۱.۴	۵۸.۷	۱۳.۹	۸.۵		۱۵۲.۶
	مرکز مدیریت بدهی	۷.۰	۷.۷	۱۱۰.۱	-		۱۲۴.۷
	شبکه بانکی	۱۹.۹	۲۳.۵	۵.۳	۳.۰		۵۱.۷
	وزارت اقتصاد	-	۴.۰	۱۸.۸	۱۰.۰		۳۲.۸
	سایر	۲.۲	۱۷.۴	۲.۲	-		۲۱.۸
	بیمه ها	۸.۰	۳.۸	۷.۹	۰.۲		۱۹.۸
	سبدها	۱.۰	۰.۷	۰.۱	-		۱.۹
	شخص حقیقی	-	۰.۸	-	-		۰.۸
	تامین سرمایه ها	-	-	-	-		-
غیردولتی	بازارگردان	-	-	-	-		-
	سندوق ها	۳۴.۴	۳۷.۵	۴۲.۰	۳۸.۱	۵.۳	۱۵۹.۰
	شبکه بانکی	۵۰.۶	۰.۹	۶.۴	۱.۷	-	۵۹.۶
	تامین سرمایه ها	۰.۷	۳.۴	۱.۷	۲.۰	۰.۳	۸.۰
	بازارگردان	۰.۸	۲.۱	۲.۱	۲.۱	۰.۳	۷.۳
	سایر	۰.۲	۰.۱	-	۲.۴	۱.۰	۳.۷
	سبدها	-	-	۰.۲	۰.۳	-	۰.۶
	شخص حقیقی	۰.۱	-	-	۰.۱	۰.۲	۰.۳
	بیمه ها	۰.۱	-	-	-	-	۰.۱
	گروه مالی	-	-	۰.۱	-	-	۰.۱
	مشاور سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-
	کارگزاری	-	-	-	-	-	-
	گروه خدمات بازار سر..	-	-	-	-	-	-
	سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-
	سبدها	-	-	-	-	-	-

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی

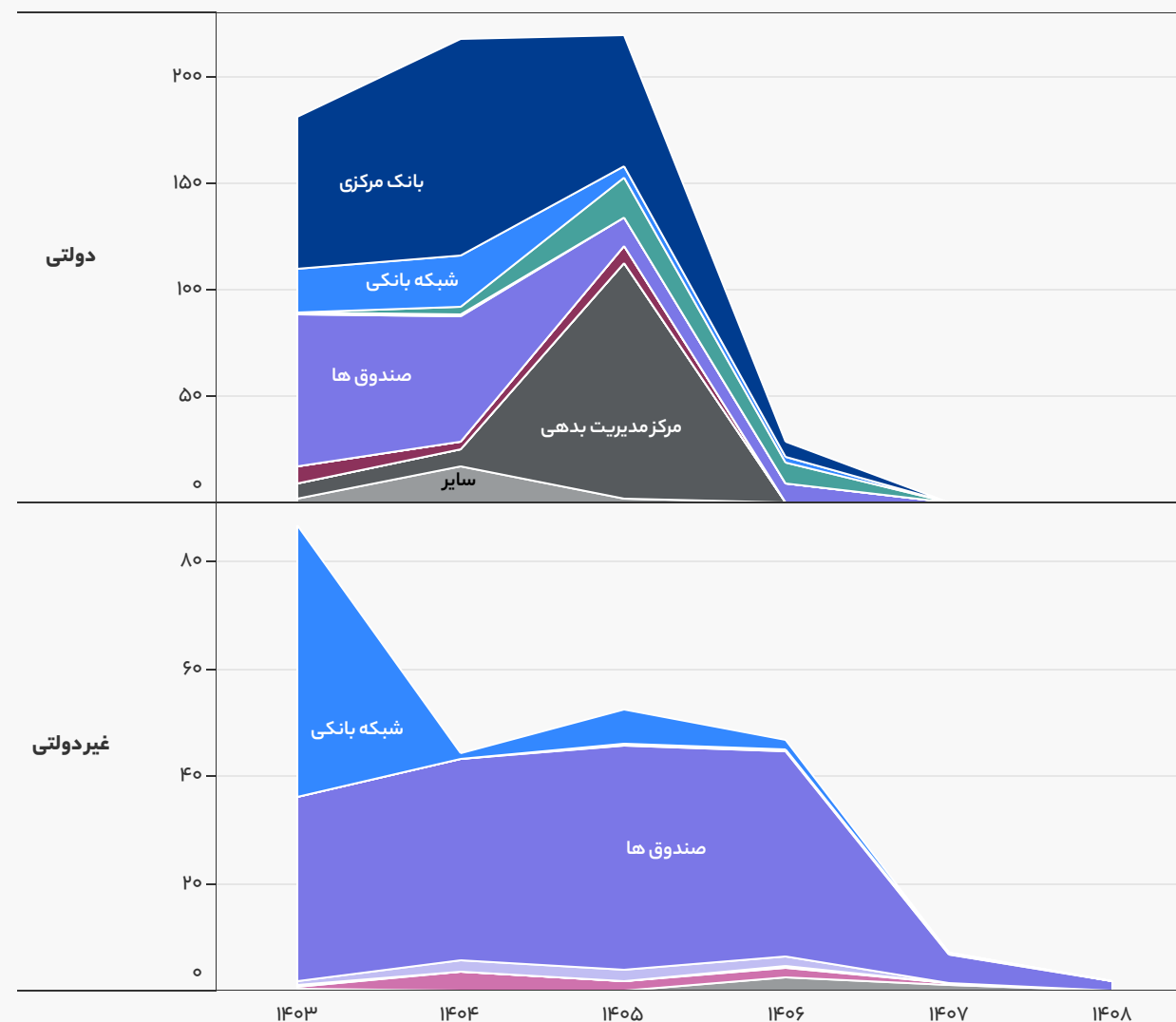
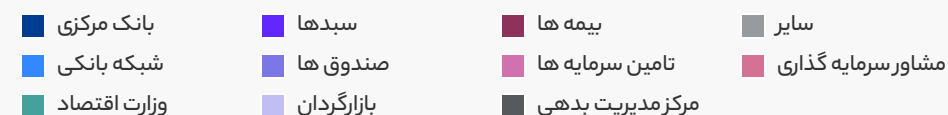


جمع	گام	منفعت	مشارکت	مربحه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره
۳۱۱,۵۹۵	۰	۴,۸۸۶	۱۶,۲۰۲	۱۴۸,۰۵۰	۰	۱۵,۰۴۶	۶۱,۵۵۹	۵۰	۶۵,۸۰۲
۲۴۱,۵۷۲	۰	۰	۰	۱۹۱,۹۵۳	۰	۰	۴۹,۶۱۹	۰	۰
۱۱۱,۳۲۸	۰	۱۰۰	۴۷۰	۳۰,۰۵۹	۵۰,۰۰۰	۰	۲۵,۰۶۲	۰	۵,۶۳۷
۱۲۴,۷۱۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱۲۴,۷۱۸	۰	۰
۱۹,۹۵۱	۰	۰	۰	۹,۸۳۲	۴۰	۴۵	۱۰,۰۳۴	۰	۰
۲۵,۴۷۴	۰	۰	۲۵	۲۶۱	۵۱	۸۴	۲۱,۶۵۳	۰	۳,۴۰۰
۸,۰۷۰	۰	۹۵	۱,۱۷۵	۳,۱۹۶	۲	۵۰۶	۰	۵	۳,۰۹۰
۷,۳۷۸	۰	۱۰۷	۱,۱۴۷	۲,۳۴۳	۰	۹۴۰	۰	۰	۲,۸۴۱
۲,۴۳۶	۰	۰	۰	۹۸۷	۰	۹۸	۱,۱۸۱	۰	۱۷۰
۱	۰	۰	۰	۱	۰	۰	۰	۰	۰
۱۰	۰	۰	۰	۱۰	۰	۰	۰	۰	۰
۱,۰۹۹	۰	۰	۰	۲۳۲	۰	۸۲	۷۸۵	۰	۰
۱۳	۰	۰	۰	۰	۳	۰	۰	۰	۱۰
۱۰	۰	۰	۰	۱۰	۰	۰	۰	۰	۰
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰
۳۲,۸۰۰	۰	۰	۰	۳۲,۸۰۰	۰	۰	۰	۰	۰
۲۱	۰	۰	۰	۲۱	۰	۰	۰	۰	۰
۸۸۶,۵۳۳	۰	۵,۱۸۹	۱۹,۰۲۰	۴۱۹,۸۱۱	۵۰,۰۹۶	۱۶,۸۰۲	۲۹۴,۶۱۱	۵۵	۸۰,۹۵۰

بازیگران کلیدی بازار بدهی

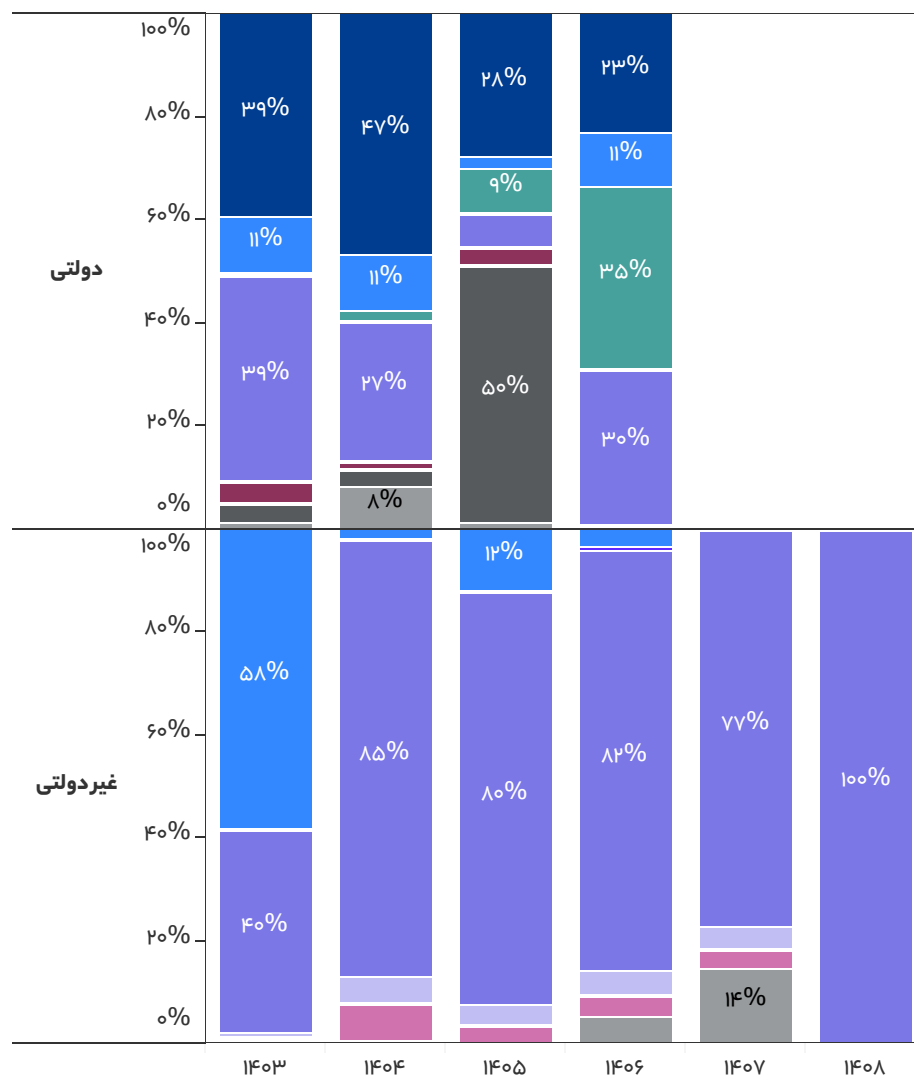
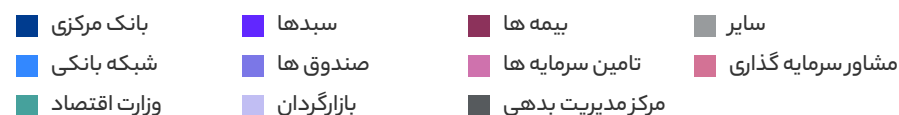
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

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



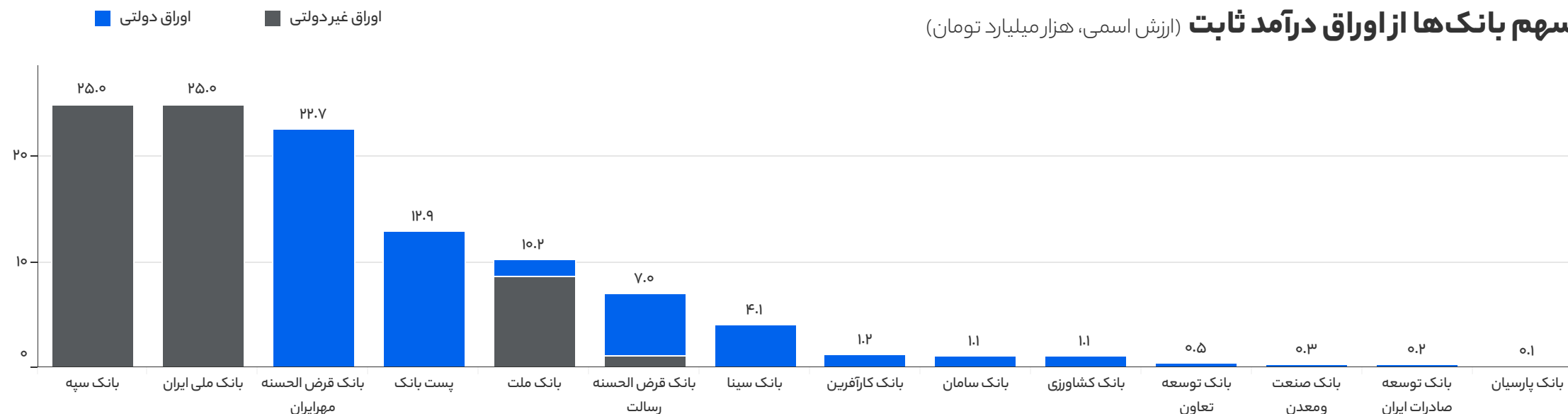
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

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

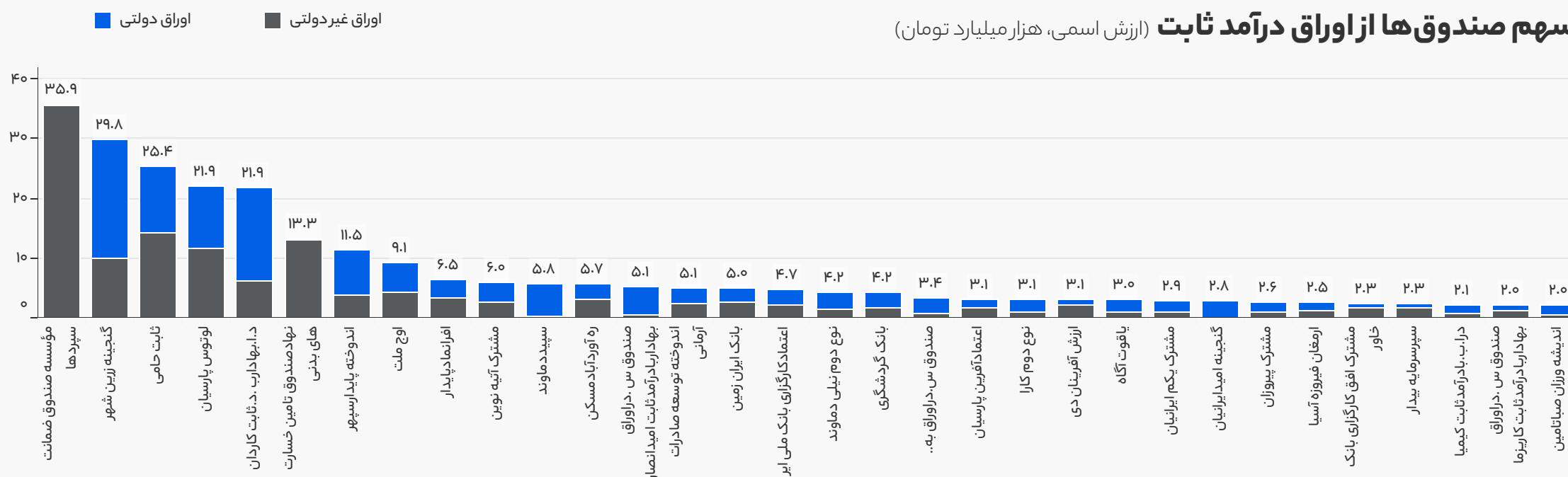


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



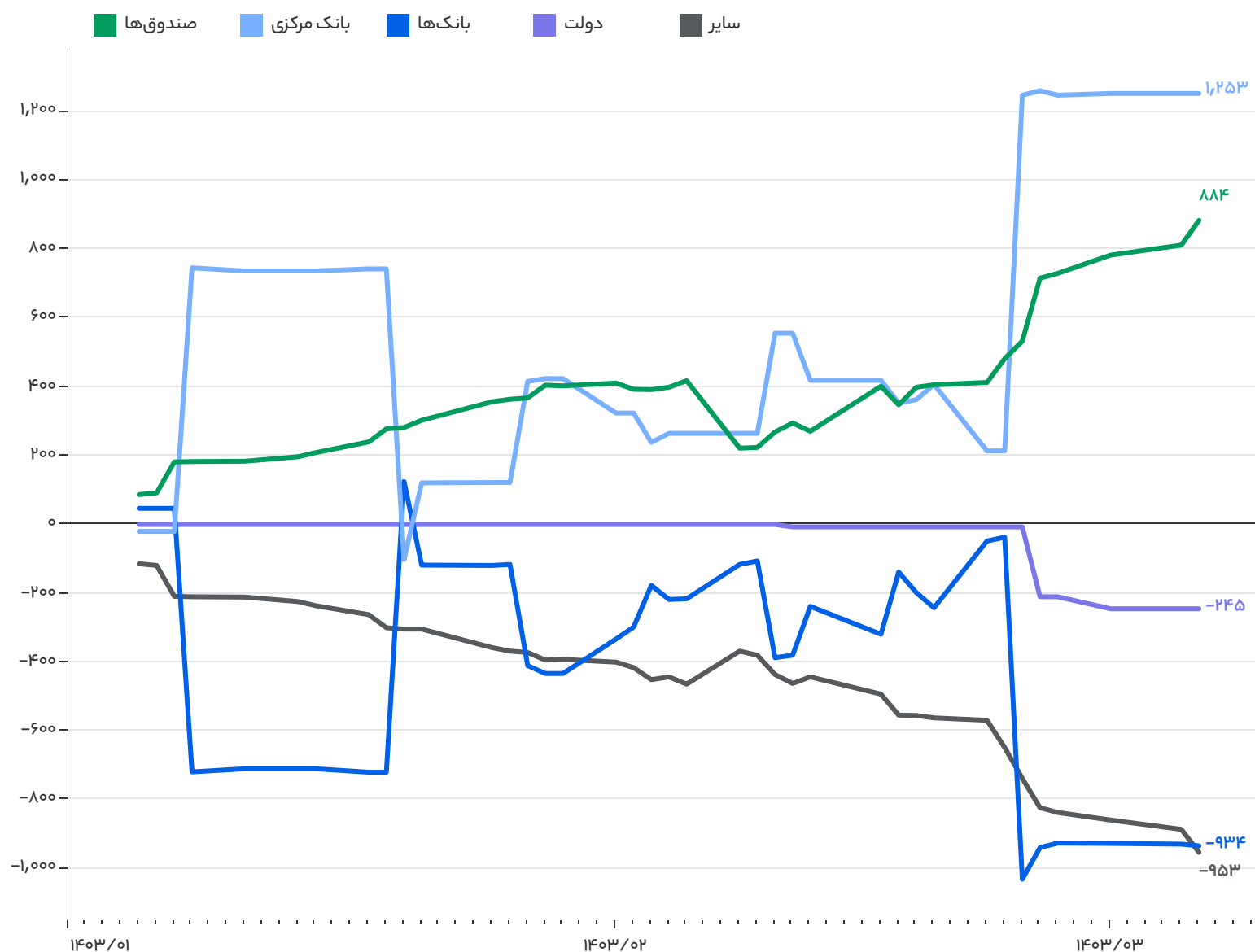
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

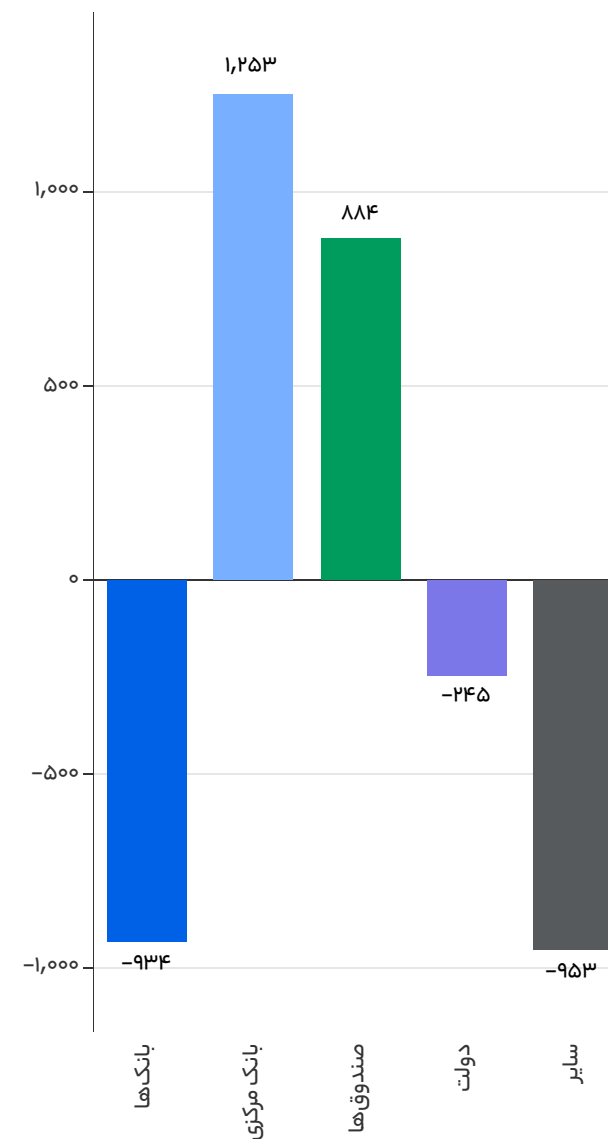
خالص معاملات اوراق

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

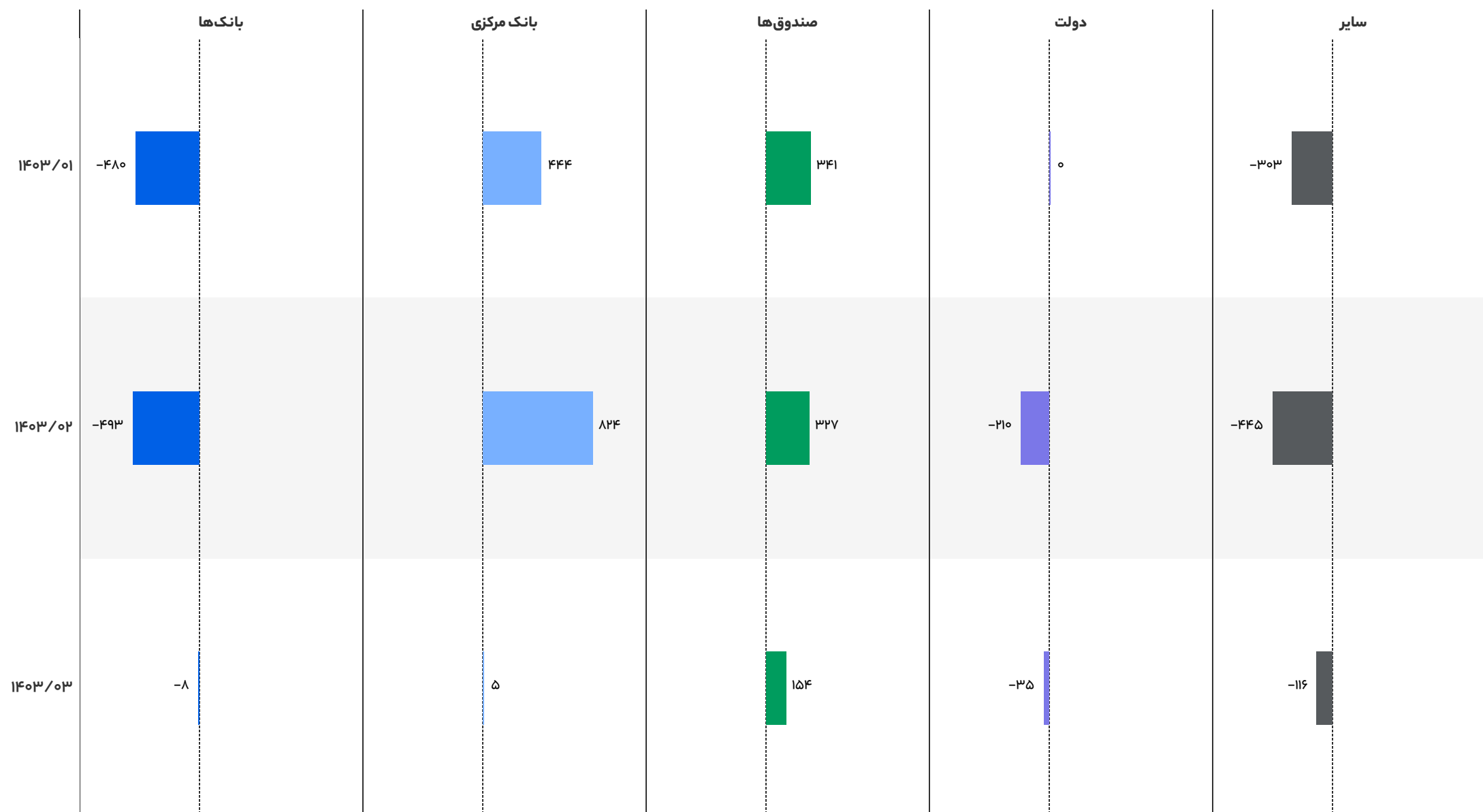


معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

آمار معاملات اوراق به صورت ماهانه

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

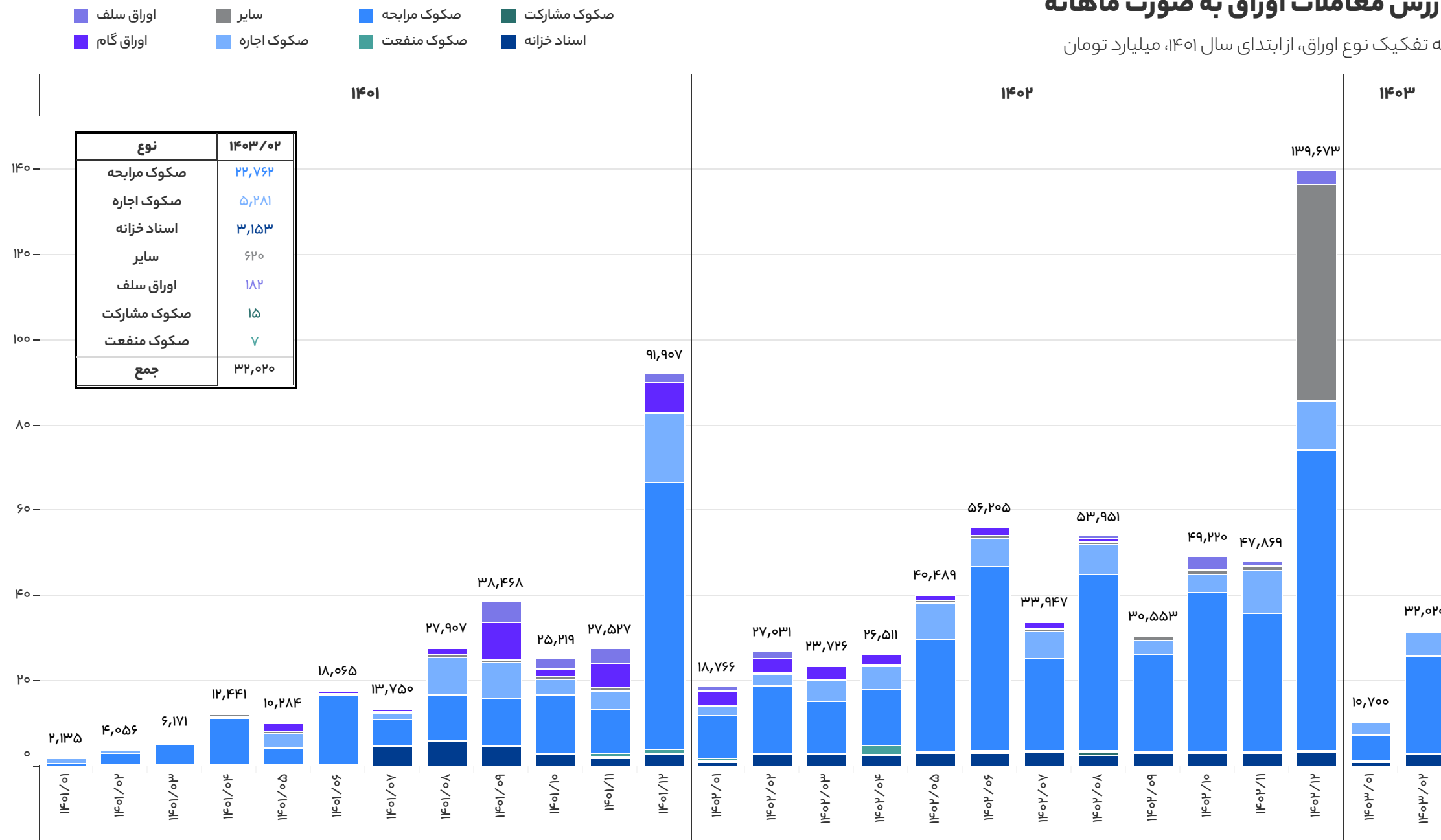
بانکها بانک مرکزی صندوقها دولت سایر



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق به صورت ماهانه

به تفکیک نوع اوراق، از ابتدای سال ۱۴۰۱، 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
- شرکتی، صکوک منفعت
- دولتی، صکوک مرابحه
- شرکتی، سایر
- شرکتی، صکوک مرابحه
- شهرداری، صکوک مشارکت



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
۱,۳۰۴	۱۴۰۶/۱۲/۲۷	صکوک اجاره	مبین۰۶۱
۷۷۱	۱۴۰۴/۰۶/۰۲	صکوک مرابحه	کرمان۴۶۲
۷۲۳	۱۴۰۵/۱۱/۱۷	صکوک مرابحه	کاله۵۳
۶۶۶	۱۴۰۶/۱۲/۱۵	صکوک مرابحه	صفوللا۶۱۲
۵۴۰	۱۴۰۸/۰۲/۱۰	صکوک مرابحه	ماناتریل۰۸
۴۸۶	۱۴۰۶/۱۰/۲۰	صکوک مرابحه	نقشینه۰۶۱
۴۳۵	۱۴۰۶/۱۲/۲۲	صکوک اجاره	تابان۱۴
۳۲۶	۱۴۰۳/۰۶/۱۴	صکوک مرابحه	کرمان۰۳
۳۰۹	۱۴۰۵/۰۱/۱۴	صکوک اجاره	غدیر۰۵
۳۰۰	۱۴۰۸/۰۲/۰۲	صکوک مرابحه	لورج۰۸
۲۸۳	۱۴۰۷/۱۰/۱۵	صکوک مرابحه	صزاگرس۰۷
۲۷۵	۱۴۰۵/۰۷/۱۵	صکوک اجاره	مهان۰۵
۲۵۰	۱۴۰۷/۰۲/۲۴	صکوک مرابحه	عالیس۰۷۱
۲۳۲	۱۴۰۴/۰۱/۱۵	صکوک مرابحه	صخودا۰۴
۲۲۷	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صفوللا۵۱۲
۲۲۵	۱۴۰۶/۱۱/۰۴	صکوک اجاره	اهداف۰۶۱
۲۲۴	۱۴۰۵/۰۳/۲۷	صکوک مرابحه	کرمان۵۳۱
۲۲۳	۱۴۰۳/۰۶/۱۵	صکوک اجاره	پارسا۳۰۶
۲۱۵	۱۴۰۵/۰۵/۱۵	صکوک اجاره	صغدیرو۵۰۵
۲۰۰	۱۴۰۷/۰۲/۲۴	صکوک مرابحه	عالیس۰۷۲
۲۰۰	۱۴۰۶/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صرمد۰۶۲
۲۰۰	۱۴۰۶/۱۰/۱۵	صکوک مرابحه	صالبه۰۶۱
۲۰۰	۱۴۰۷/۰۲/۱۰	صکوک مرابحه	سیرنگ۰۷
۲۰۰	۱۴۰۷/۰۲/۰۵	صکوک مرابحه	آرگون۰۷
۱۹۴	۱۴۰۵/۰۶/۲۹	صکوک مرابحه	پدیده۰۵

پرمعامله‌ترین اوراق دولتی ماه گزارش

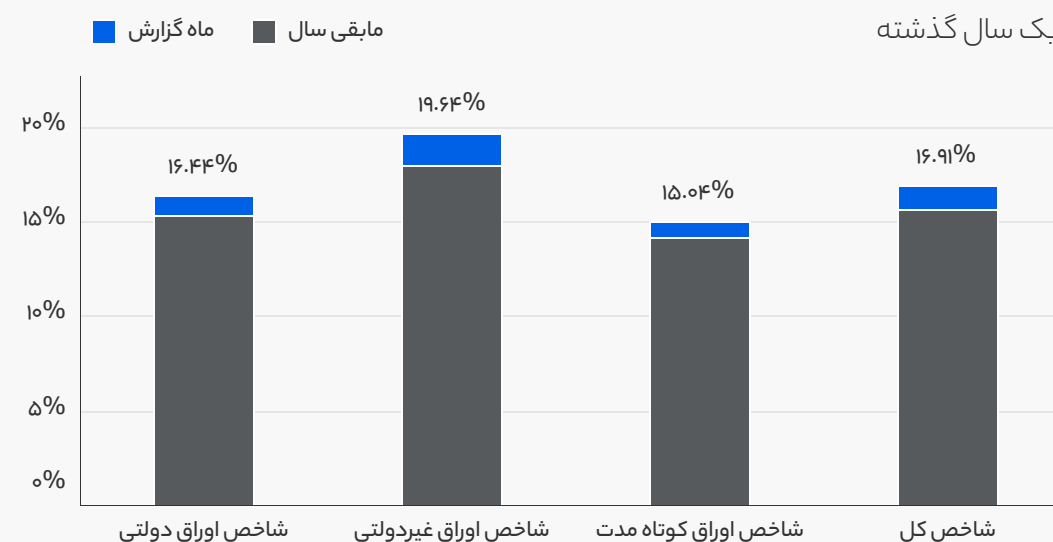
ارزش معاملات برای ۲۵ اوراق با بیشترین ارزش معامله، به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

صکوک مرابحه اسناد خزانه

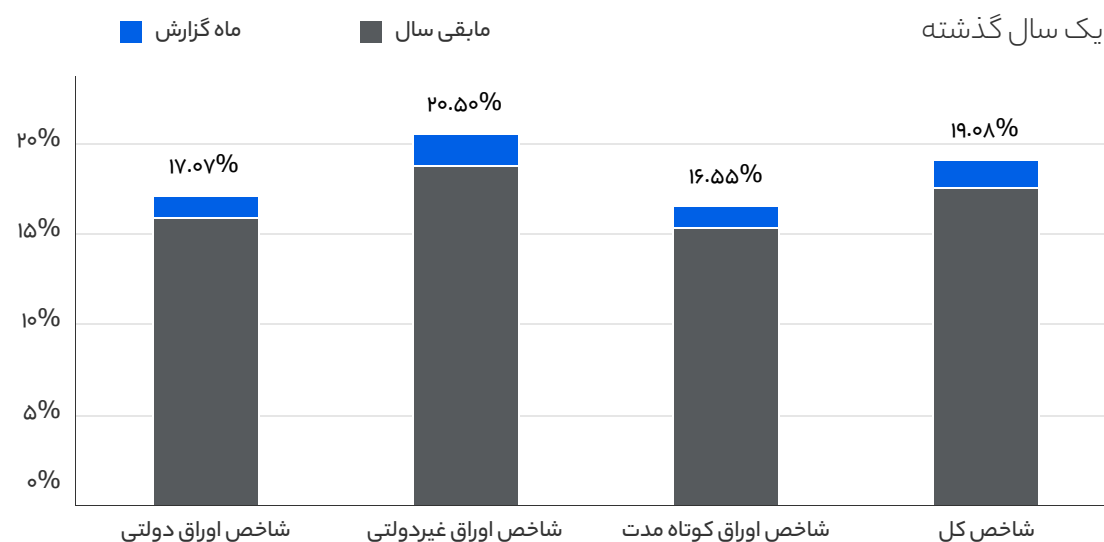
ارزش معاملات	تاریخ سررسید	نوع	نماد
۲,۸۰۵	۱۴۰۳/۰۷/۲۴	صکوک مرابحه	اراد۱۰۷
۱,۳۰۴	۱۴۰۳/۰۵/۱۰	صکوک مرابحه	اراد۱۲۹
۱,۰۰۰	۱۴۰۴/۰۴/۱۱	صکوک مرابحه	اراد۱۵۷
۹۹۸	۱۴۰۳/۰۲/۱۵	صکوک مرابحه	اراد۴۶
۹۲۴	۱۴۰۴/۰۵/۱۹	صکوک مرابحه	اراد۱۴۸
۹۱۳	۱۴۰۶/۱۲/۲۹	صکوک مرابحه	اراد۱۳۷
۸۸۰	۱۴۰۴/۱۰/۰۹	صکوک مرابحه	اراد۱۴۳
۷۳۳	۱۴۰۴/۰۸/۰۴	صکوک مرابحه	اراد۱۳۹
۶۵۴	۱۴۰۵/۱۲/۲۴	صکوک مرابحه	اراد۱۲۸
۶۵۳	۱۴۰۴/۰۹/۱۰	اسناد خزانه	اخزا۲۰۷
۵۰۵	۱۴۰۵/۰۴/۲۲	صکوک مرابحه	اراد۱۵۵
۵۰۱	۱۴۰۵/۰۶/۲۲	صکوک مرابحه	اراد۱۵۶
۴۲۹	۱۴۰۳/۰۳/۱۵	صکوک مرابحه	اراد۳۳
۴۱۱	۱۴۰۵/۰۳/۲۵	اسناد خزانه	اخزا۲۰۱
۳۹۶	۱۴۰۴/۰۳/۰۲	صکوک مرابحه	اراد۱۴۱
۳۷۳	۱۴۰۳/۱۲/۲۳	صکوک مرابحه	اراد۱۲۶
۳۵۰	۱۴۰۴/۱۲/۱۱	اسناد خزانه	اخزا۲۰۸
۳۴۸	۱۴۰۳/۰۳/۰۴	صکوک مرابحه	اراد۸۷
۲۶۱	۱۴۰۳/۰۹/۰۷	صکوک مرابحه	اراد۱۳۴
۲۵۲	۱۴۰۵/۰۹/۲۳	اسناد خزانه	اخزا۲۰۲
۲۴۷	۱۴۰۵/۰۵/۰۴	صکوک مرابحه	اراد۱۴۰
۲۰۹	۱۴۰۳/۱۲/۱۱	صکوک مرابحه	اراد۱۰۲
۲۰۷	۱۴۰۴/۰۷/۱۴	اسناد خزانه	اخزا۱۰۷
۱۹۶	۱۴۰۳/۰۵/۰۳	صکوک مرابحه	اراد۱۰۵
۱۸۹	۱۴۰۴/۱۱/۱۰	صکوک مرابحه	اراد۱۳۲

بازدهی شاخص صکوک

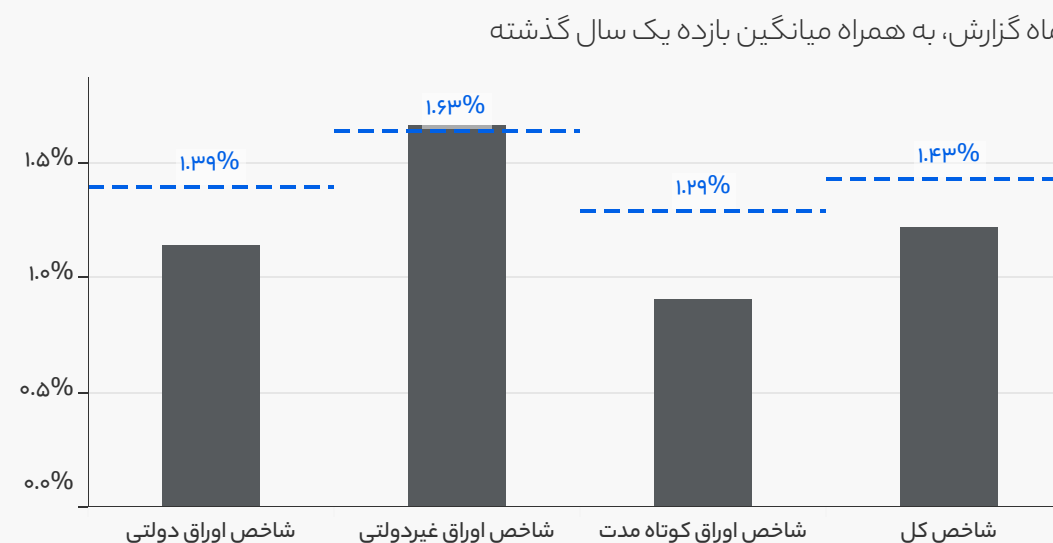
بازدهی شاخص‌های وزنی صکوک فرابورس ایران



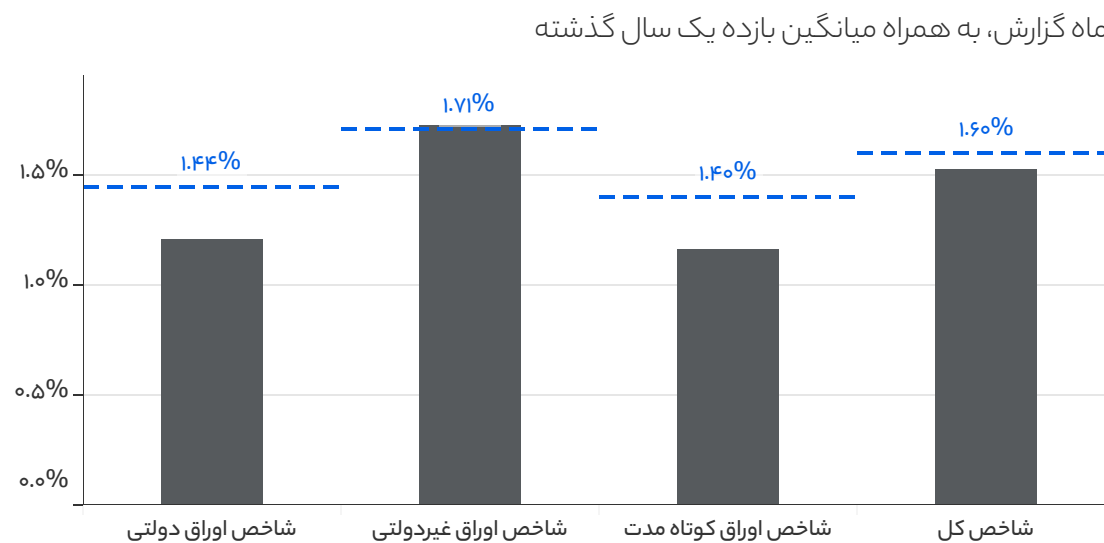
بازدهی شاخص‌های هم وزن صکوک فرابورس ایران



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
۵۵۴.۶	۱۴۳	با درآمد ثابت	سرمایه گذاری سنتی
۱۱۱.۶	۱۳۴	سهامی	
۶.۴	۲۶	مختلط	
۱.۴	۵	صندوق در صندوق	
۱.۷	۵	خصوصی	سرمایه گذاری خصوصی
۰.۴	۱۶	جسورانه	
۱۶۹.۸	۱۰۴	بازارگردانی	سرمایه گذاری جایگزین
۳۸.۹	۱۵	سپرده کالایی	
۱.۱	۱	پروژه های	
۰.۳	۳	املاک و مستغلات	
۰.۰	۴	زمین و ساختمان	
۸۸۶.۲	۴۵۶	جمع کل	

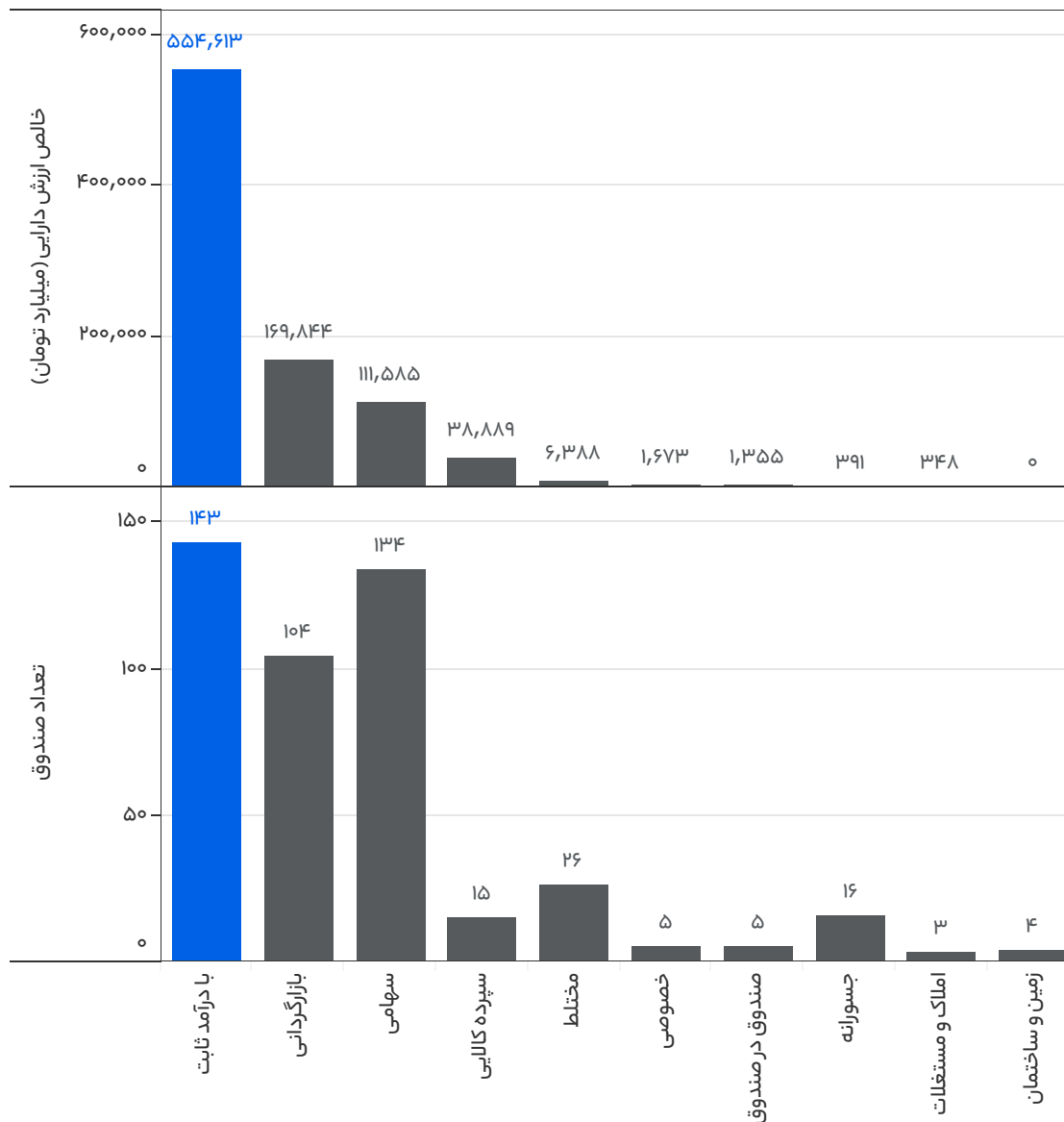
صندوق های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
قابل معامله	درآمد ثابت	دراورق بهادار با درآمد ثابت پایش
قابل معامله	سهامی	سهامی به آفرید سپینود
قابل معامله	سهامی	سهامی ثروت ساز دیا
صدور و ابطال	درآمد ثابت	نیکوکاری مهرآور راهین

ارزش و تعداد صندوق های سرمایه گذاری

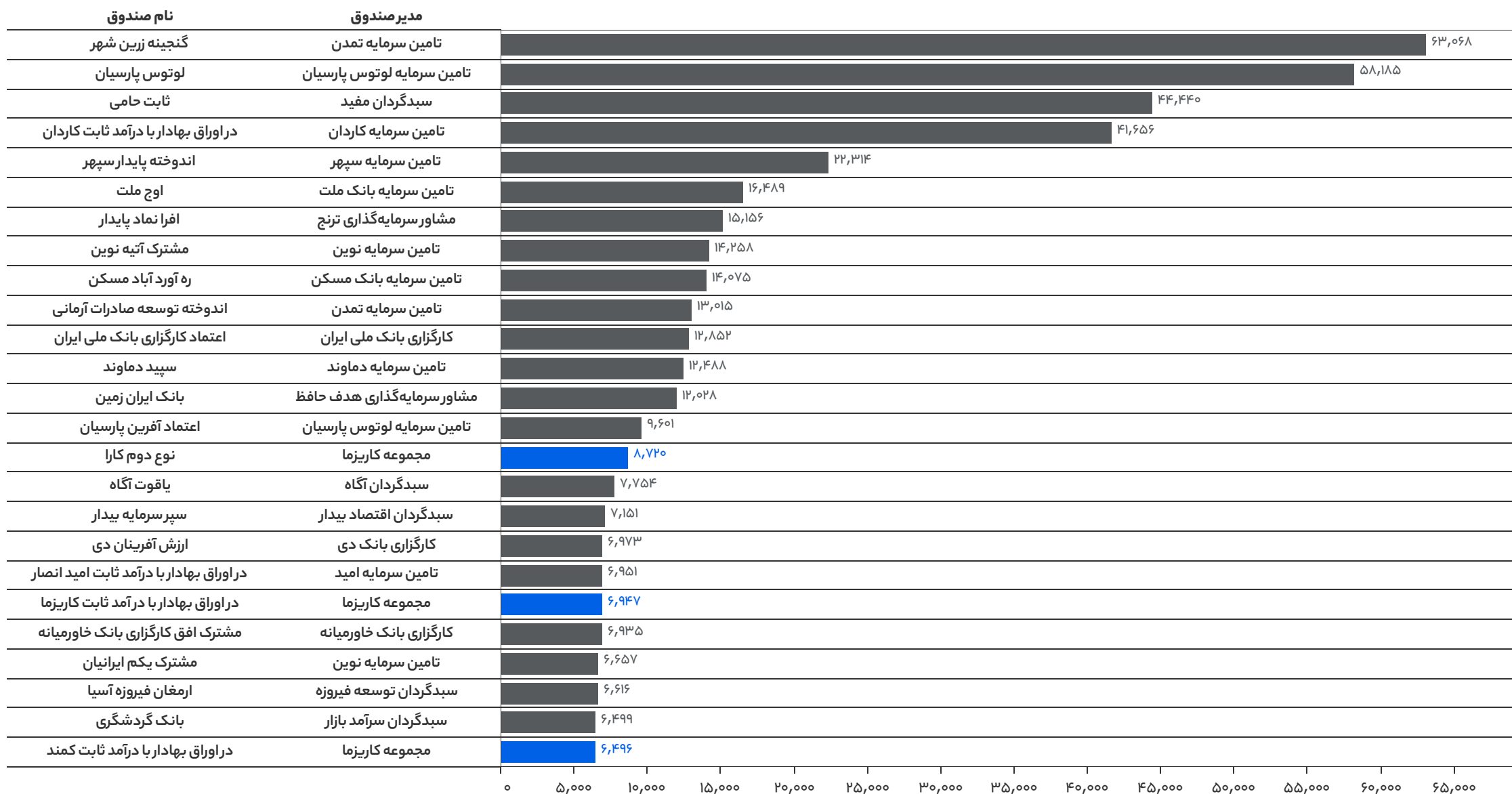
به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

بزرگ‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

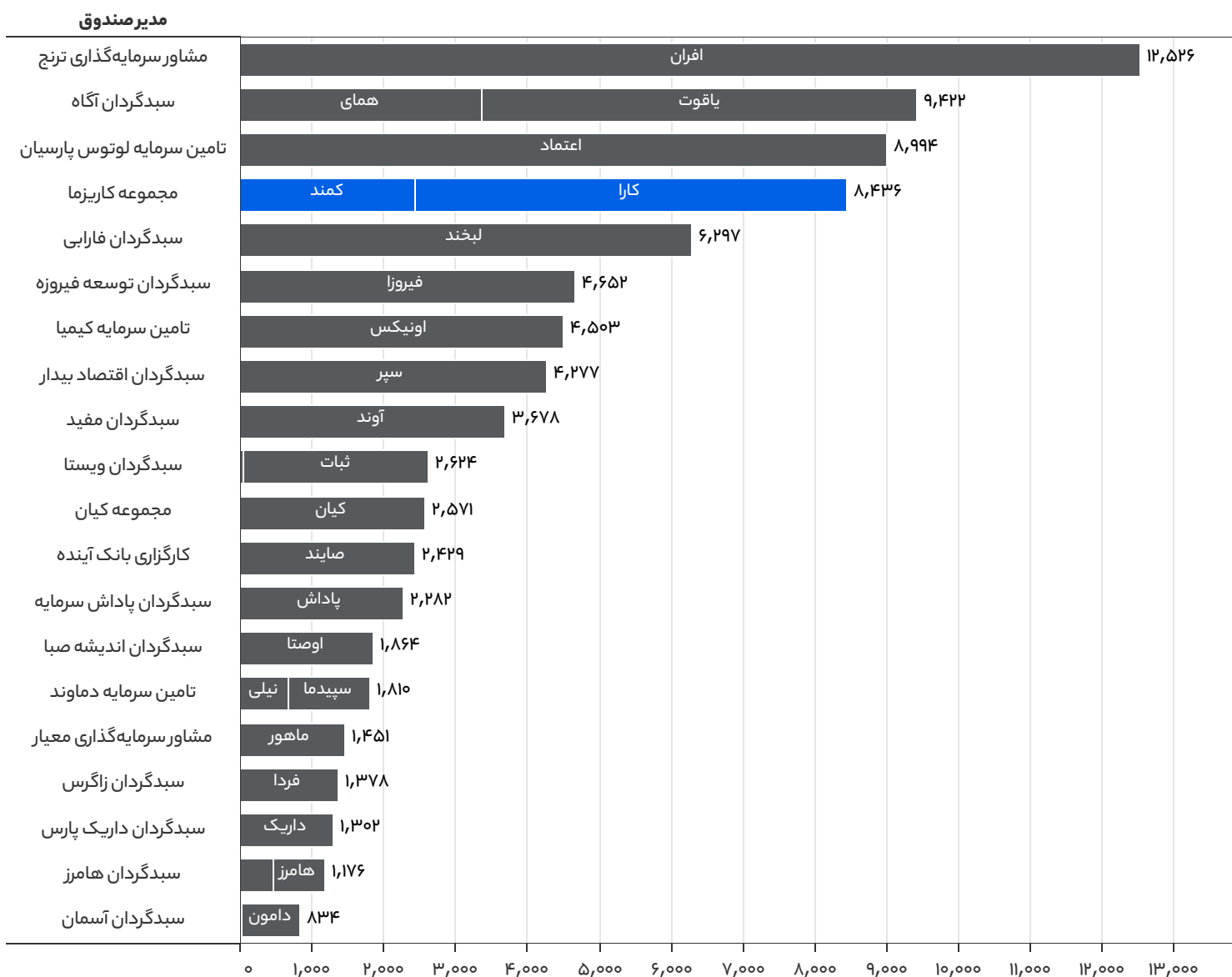
دارایی تحت مدیریت ۲۵ صندوق درآمد ثابت بزرگ، به همراه مدیر صندوق، میلیارد تومان



معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

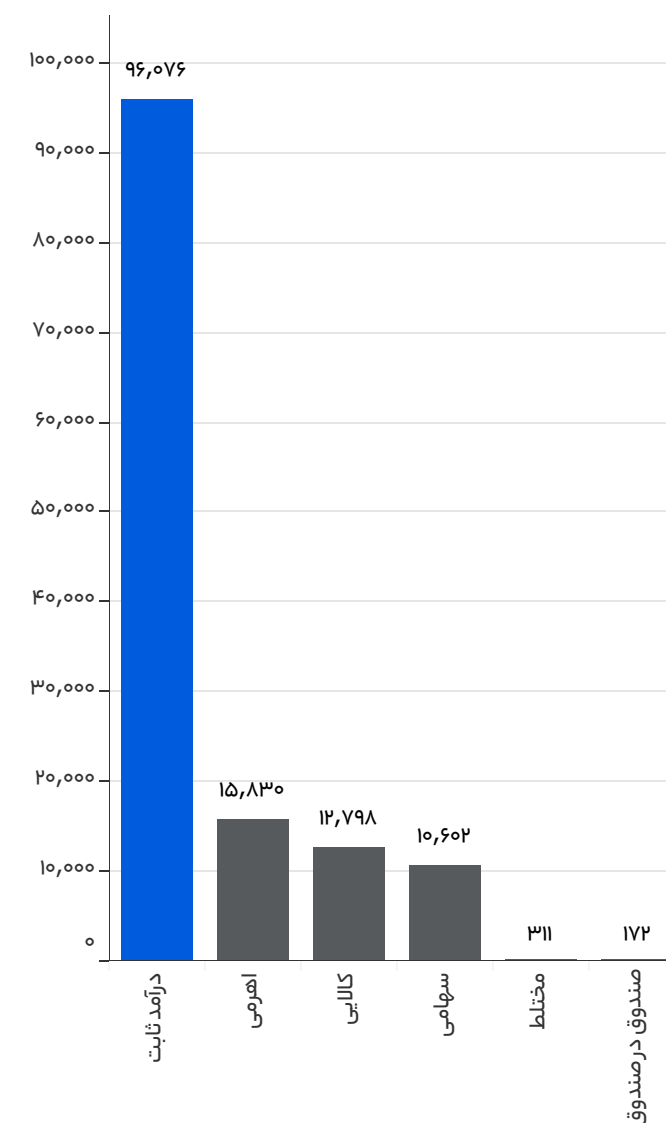
پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

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

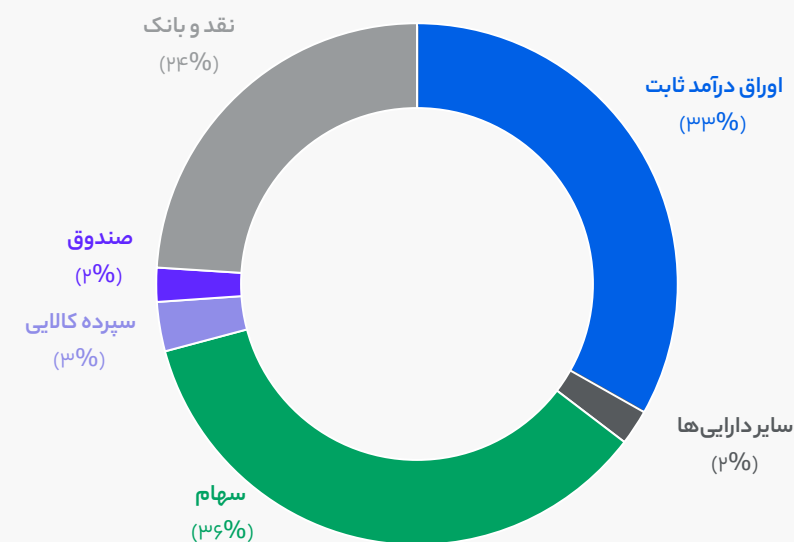
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	
اونیکس	تامین سرمایه کیمیا	+۲,۰۴۷
آوند	سبدگردان مفید	+۶۶۴
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	+۳۸۹
همای	سبدگردان آگاه	+۲۵۳
لبخند	سبدگردان فارابی	+۱۸۵
نشان	سبدگردان هامرز	+۱۴۵
ماهور	مشاور سرمایه‌گذاری معیار	+۱۱۸
دامون	سبدگردان آسمان	+۸۹
فردا	سبدگردان زاگرس	+۵۰
صایند	کارگزاری بانک آینده	+۵۰
فیروز	سبدگردان توسعه فیروزه	+۳۰
هامرز	سبدگردان هامرز	+۲۵
ثبات	سبدگردان ویستا	+۲
دیا	سبدگردان اندیشه صبا	-۱
آکام	سبدگردان ویستا	-۱
آسامید	سبدگردان آسمان	-۷
سپیدما	تامین سرمایه دماوند	-۱۰
نیلی	تامین سرمایه دماوند	-۱۵
اوصتا	سبدگردان اندیشه صبا	-۱۸
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	-۲۷
سپر	سبدگردان اقتصاد بیدار	-۳۹
کمند	مجموعه کاریزما	-۴۳
یاقوت	سبدگردان آگاه	-۹۰
پاداش	سبدگردان پاداش سرمایه	-۱۰۹
داریک	سبدگردان داریک پارس	-۱۸۳
کیان	مجموعه کیان	-۲۳۳
کارا	مجموعه کاریزما	-۳۵۶

تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی صندوق‌ها

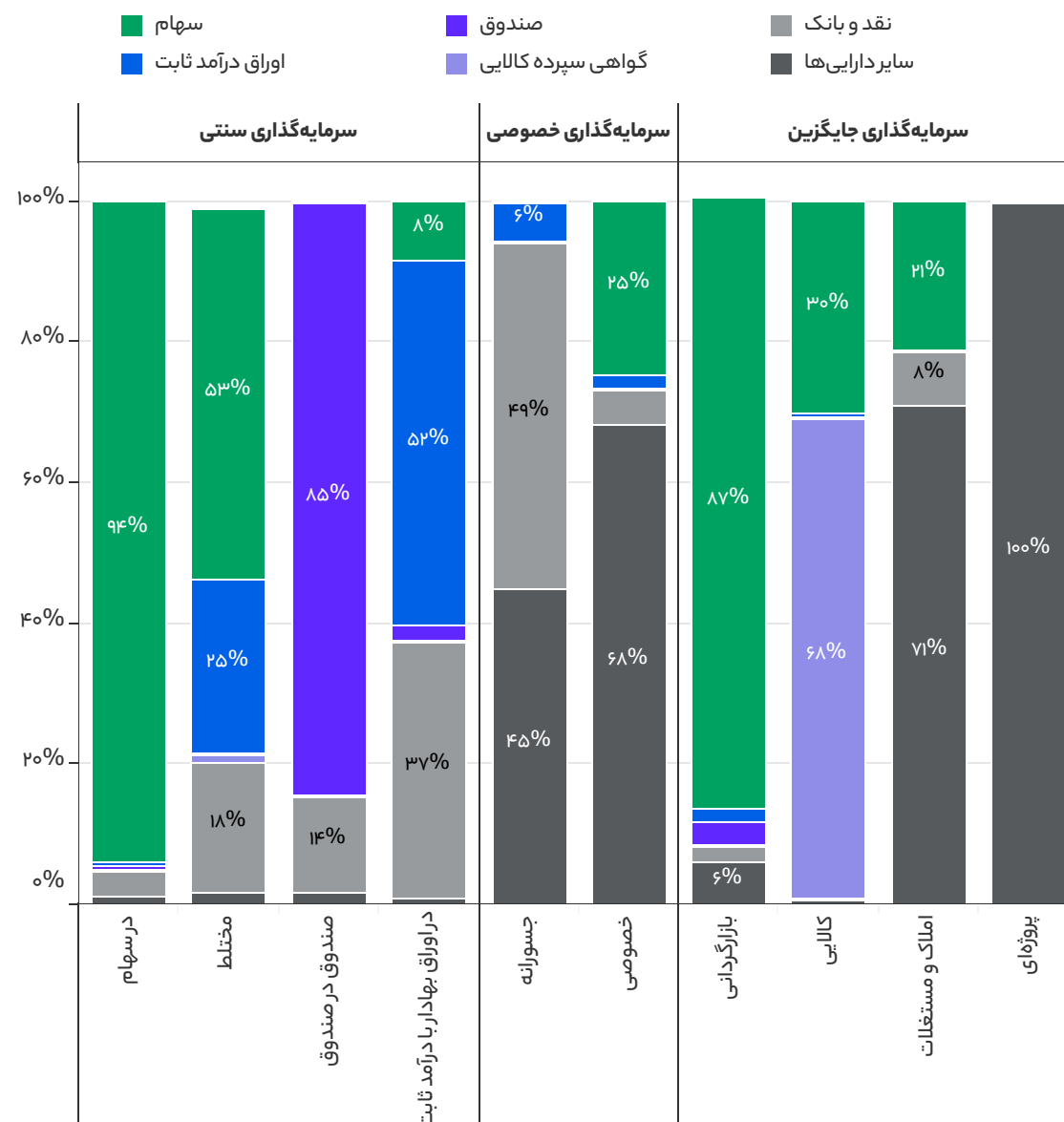
به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهام	درآمد ثابت	سپرده کالایی	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	مختلط	۵۳%	۲۵%	۱%	-	۱۸%	۲%
	صندوق در صندوق	-	-	-	۸۵%	۱۴%	۲%
	در سهام	۹۴%	۱%	-	-	۳%	۱%
	درآمد ثابت	۸%	۵۲%	-	۲%	۳۷%	۱%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۶%	-	-	۴۹%	۴۵%
	خصوصی	۲۵%	۲%	-	-	۵%	۶۸%
سرمایه‌گذاری جایگزین	کالایی	۳۰%	-	۶۸%	-	-	-
	اختصاصی بازارگردانی	۸۷%	۲%	-	۳%	۲%	۶%
	املاک و مستغلات	۲۱%	-	-	-	۸%	۷۱%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۶%	۳۳%	۳%	۲%	۲۴%	۲%

ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق

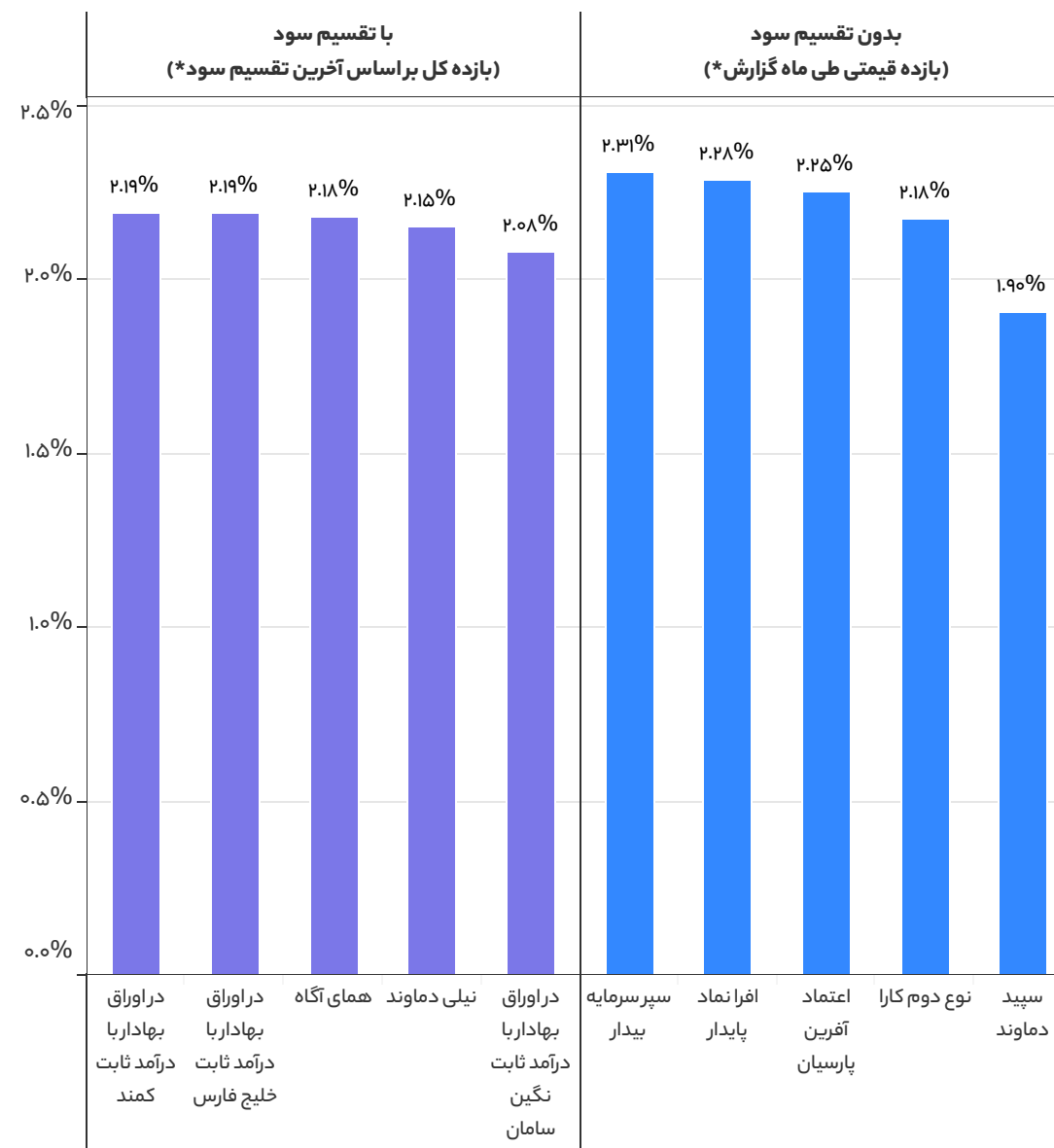


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

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 بهادار با درآمد ثابت کمند	۵,۹۸۵	۲۴.۹%	۱۲.۶%	۶.۴%	۲.۲۰%	۲۶.۳%	۲۹.۷%
	همای آگاه	۳,۸۷۴	۲۴.۴%	۱۲.۴%	۶.۳%	۲.۱۵%	۲۶.۱%	۲۹.۵%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۶,۱۳۳	۲۴.۸%	۱۲.۴%	۶.۴%	۲.۱۵%	۲۶.۳%	۲۹.۷%
	نیلی دماوند	۶,۴۱۰	۲۴.۳%	۱۲.۳%	۶.۳%	۲.۱۱%	۲۵.۸%	۲۹.۱%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت نگین سامان	۲,۸۲۶	۲۴.۱%	۱۲.۲%	۶.۲%	۲.۰۷%	۲۵.۰%	۲۸.۰%
بدون تقسیم سود	سپر سرمایه بیدار	۸,۰۷۹	۲۸.۱%	۱۳.۳%	۶.۶%	۲.۳۱%		
	افرا نماد پایدار	۱۵,۷۳۳	۲۸.۵%	۱۳.۴%	۶.۷%	۲.۲۸%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۹,۳۳۰	۲۷.۰%	۱۲.۸%	۶.۵%	۲.۲۵%		
	نوع دوم کارا	۷,۹۲۱	۲۷.۸%	۱۳.۱%	۶.۴%	۲.۱۸%		
	سپید دماوند	۱۱,۹۶۴	۲۵.۱%	۱۱.۸%	۵.۷%	۱.۹۰%		

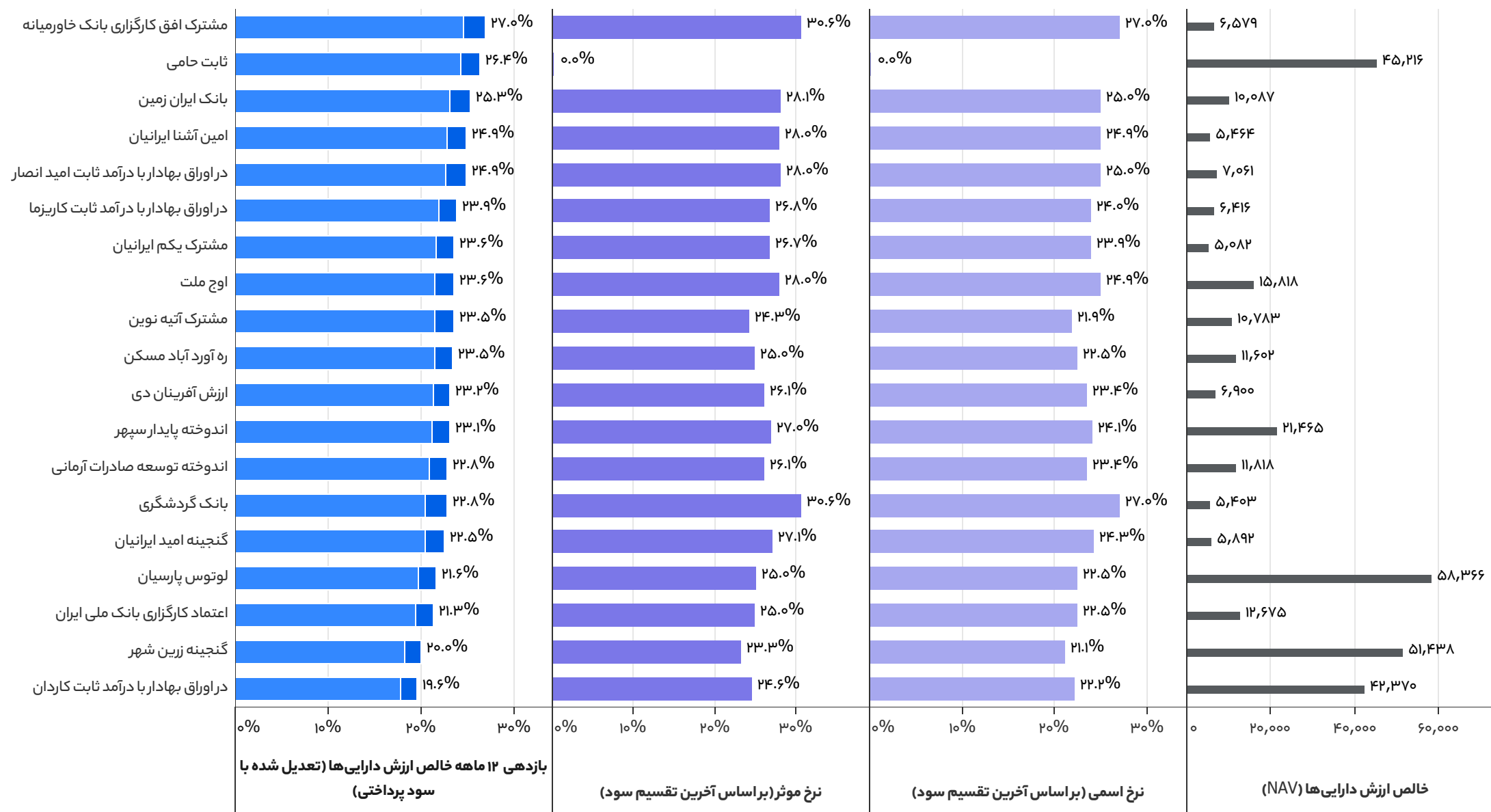


* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.
 ** در صورتی که صندوق تقسیم سود داشته باشد، بازده خالص ارزش دارایی هر واحد بر اساس تقسیم سود تعدیل می‌گردد.

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

