

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



مرداد ماه ۱۴۰۳



CHARISMA MARKET INSIGHT

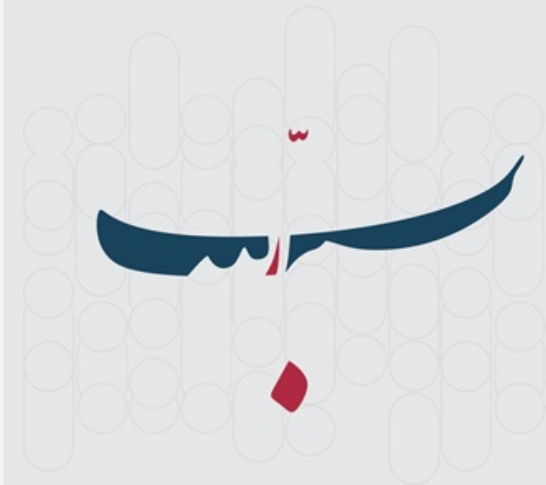
معرفی گزارش:

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 درمورد 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 ریسک پذیری، 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.



۵۴	سیاست‌های پولی	۰۳	فصل اول
۵۶	پایه پولی و نقدینگی		اقتصاد
۵۹	تورم و شاخص قیمت مصرف‌کننده		
۱۱	ارز خارجی		

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

۲۱	مروری بر بازار درآمد ثابت	۲۰	فصل سوم
۲۲	دید کلی بازار بدهی		درآمد ثابت
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)		

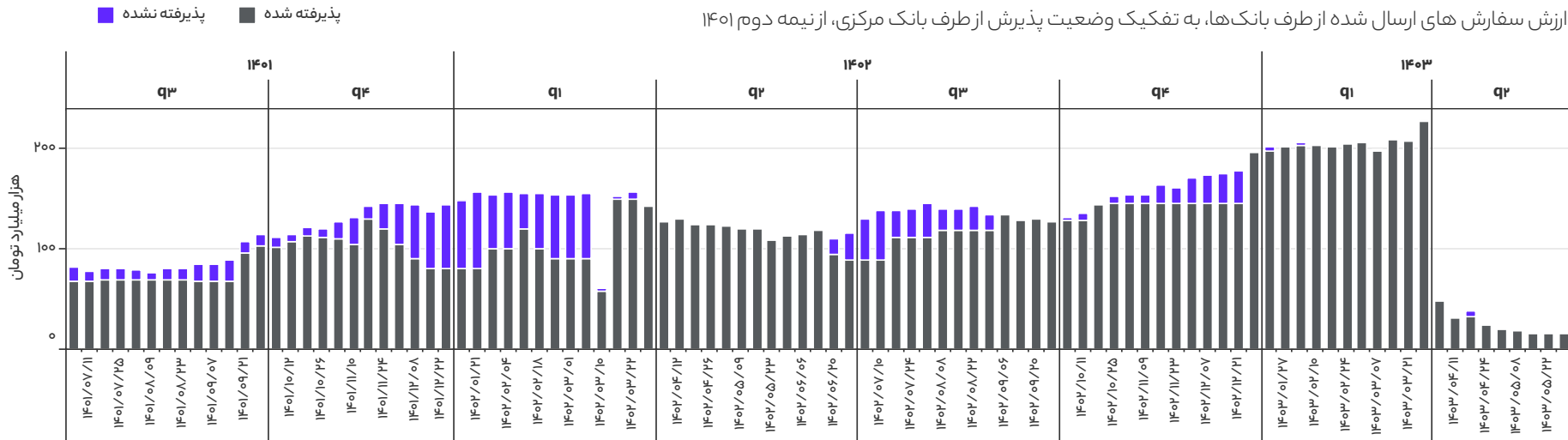


ECONOMY

سیاست‌های پولی

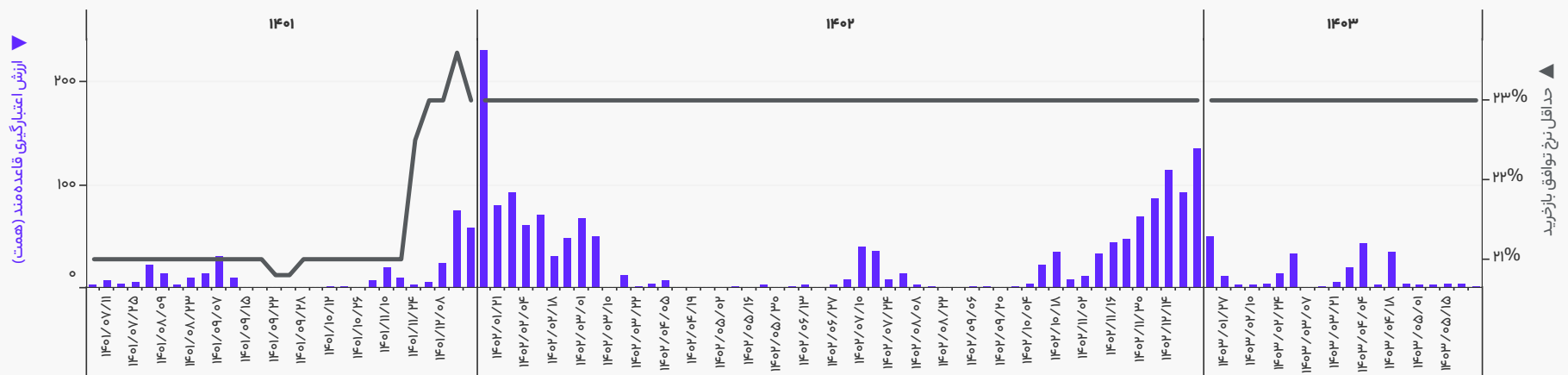
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

ارزش سفارش‌های ارسال شده از طرف بانک‌ها، به تفکیک وضعیت پذیرش از طرف بانک مرکزی، از نیمه دوم ۱۴۰۱



تامین مالی بانک‌ها از بانک مرکزی

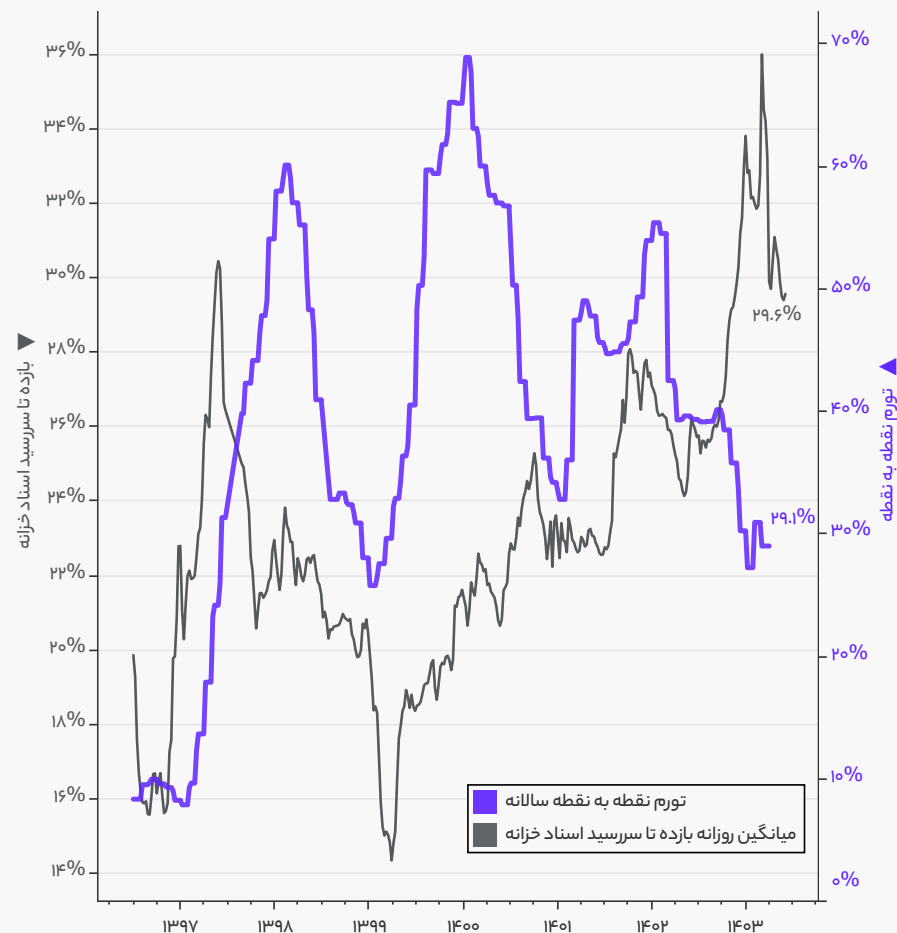
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق بازخريد، از نیمه دوم ۱۴۰۱



سیاست‌های پولی

تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

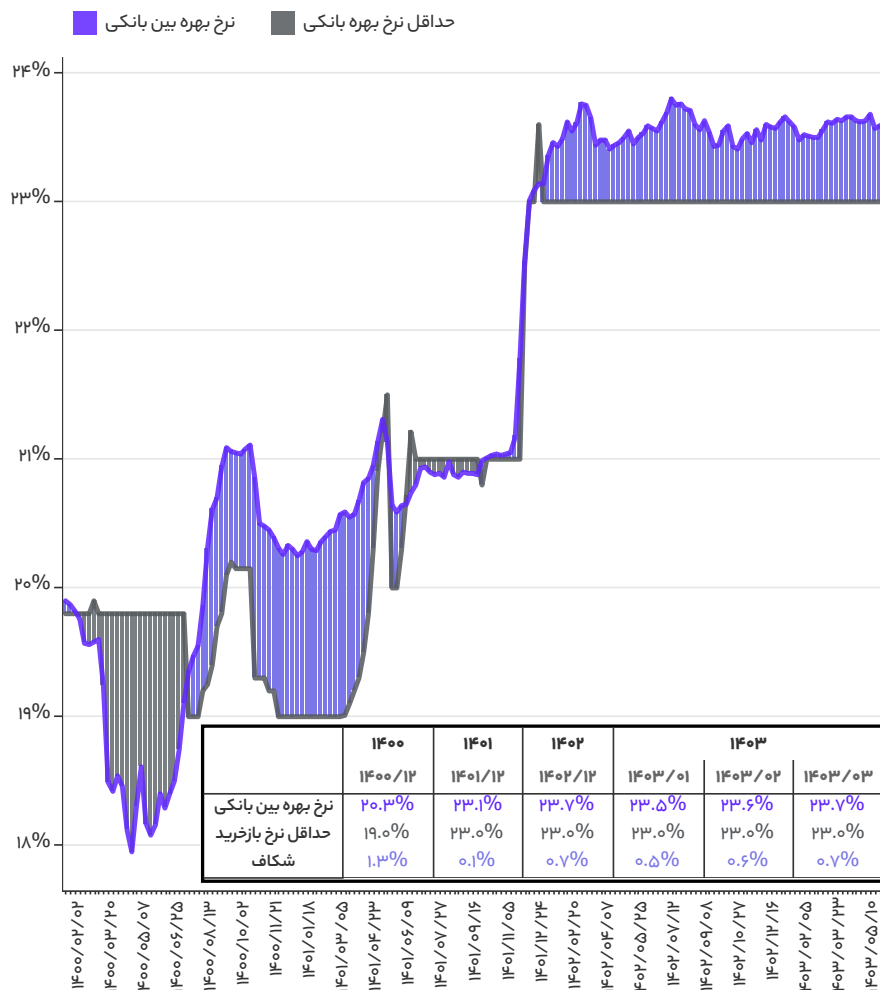
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* 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

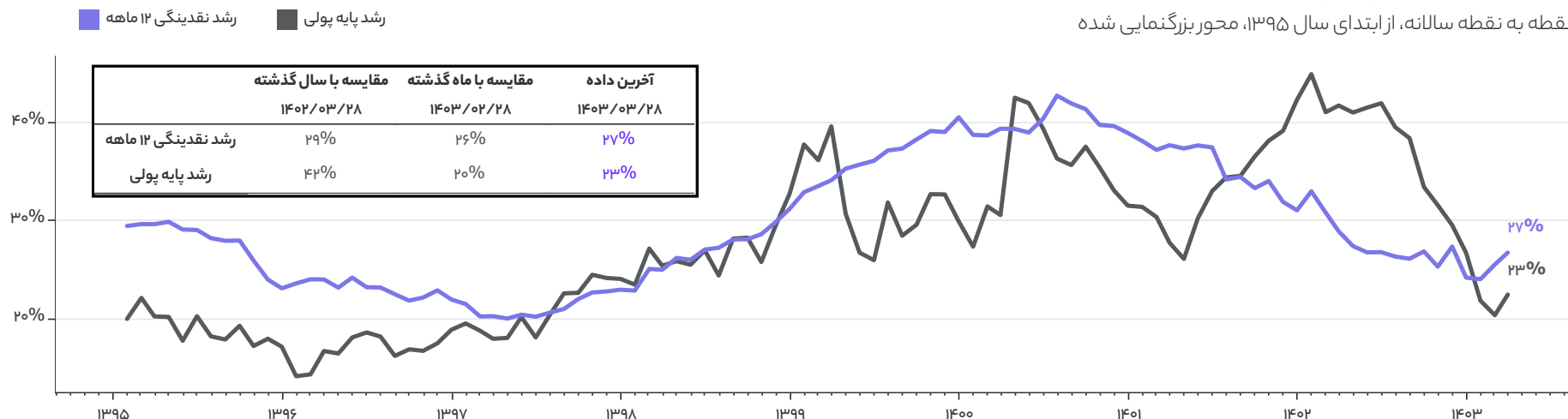
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

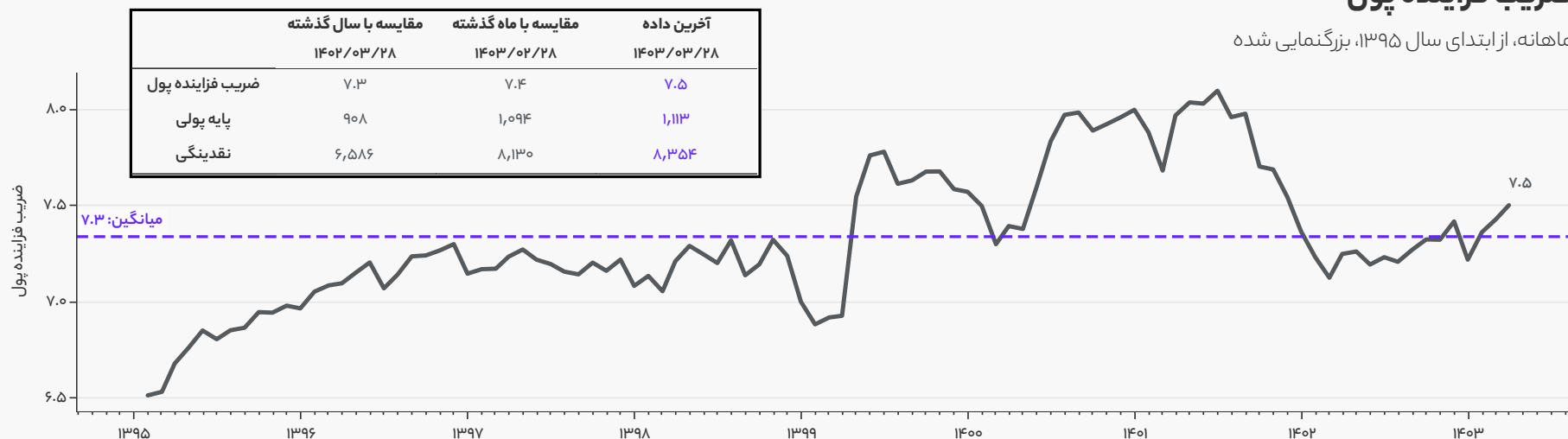
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

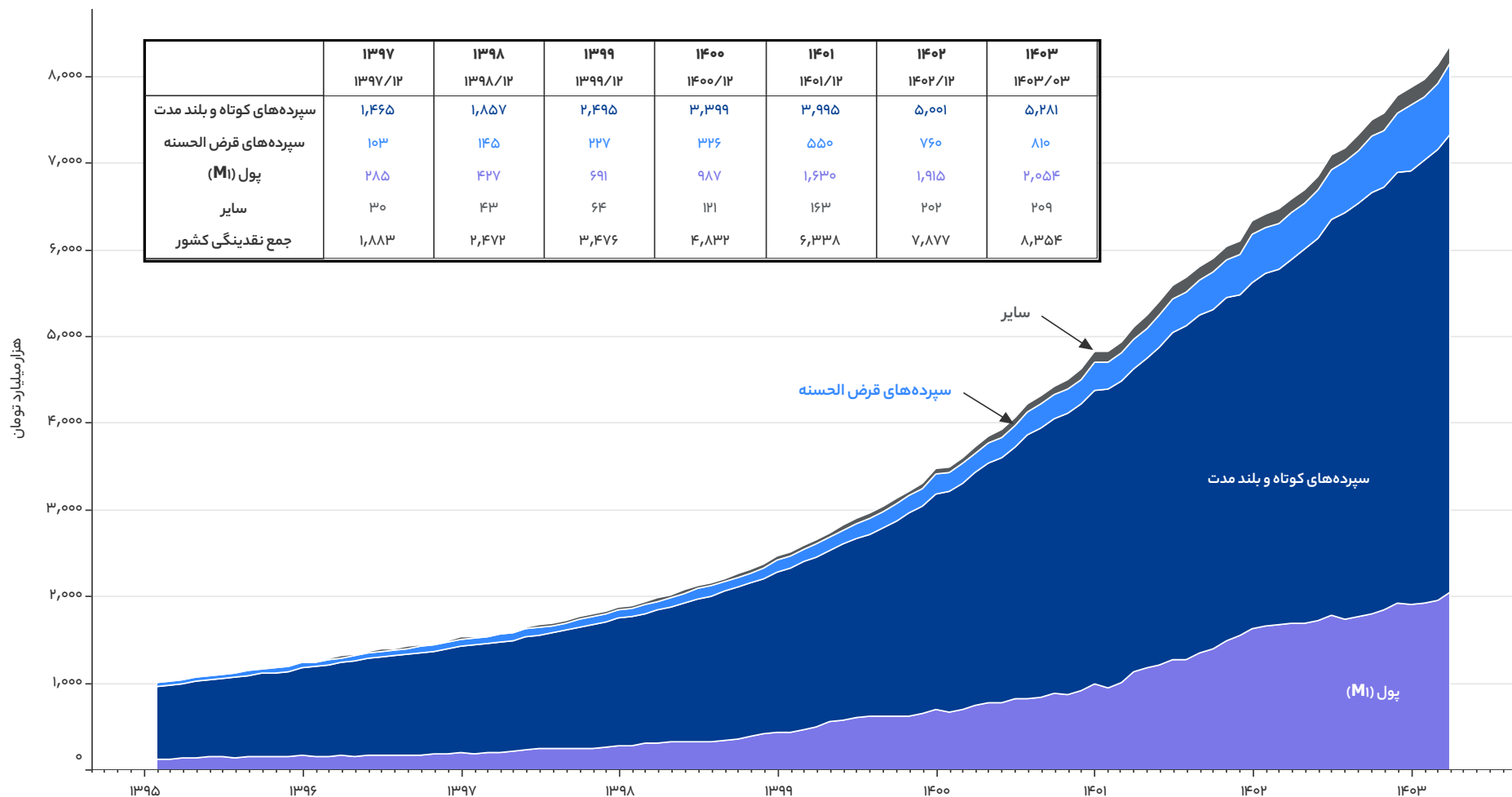


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارش به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، (بر اساس 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 رایج 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

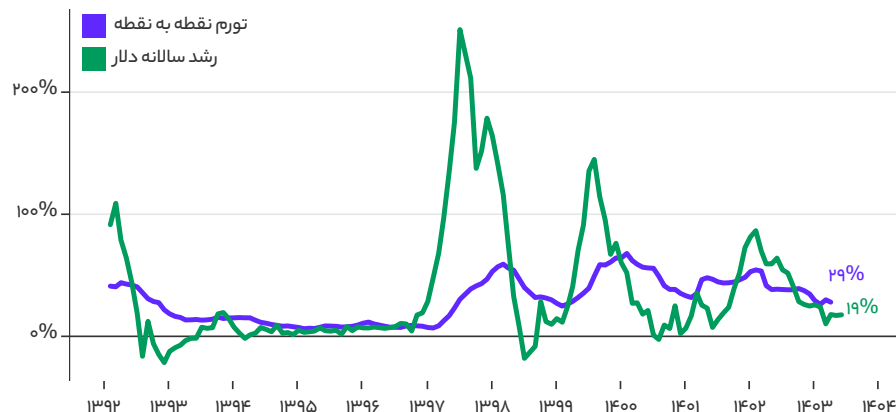


* دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 ** برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیر رسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

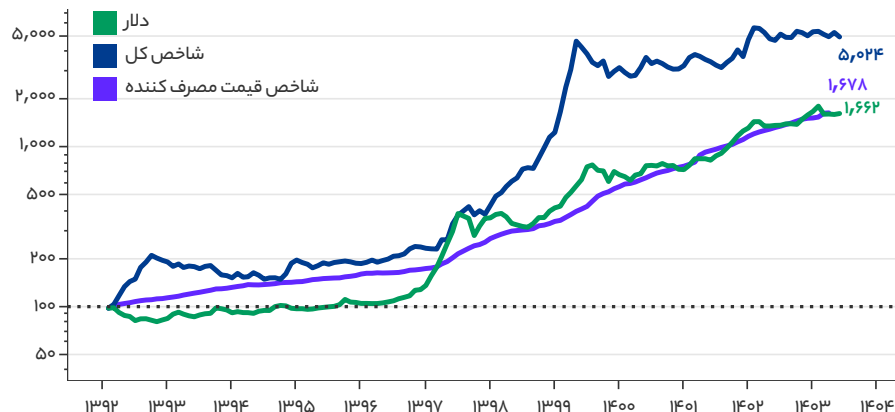
تورم و رشد دلار

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

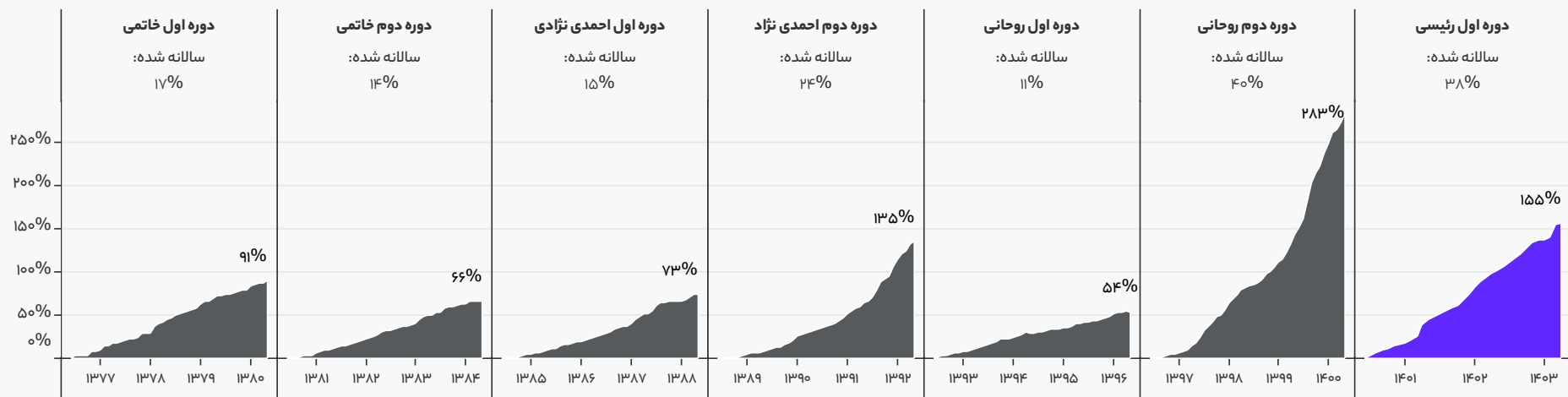


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

مبنای تمامی شاخص ها سال ۱۳۹۲ بازنشانه شده، عدد پایه ۱۰۰، محور لگاریتمی



تورم تجمعی در دوره های ریاست جمهوری گذشته



ارز خارجی

وضعیت دلار

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



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

ارز خارجی

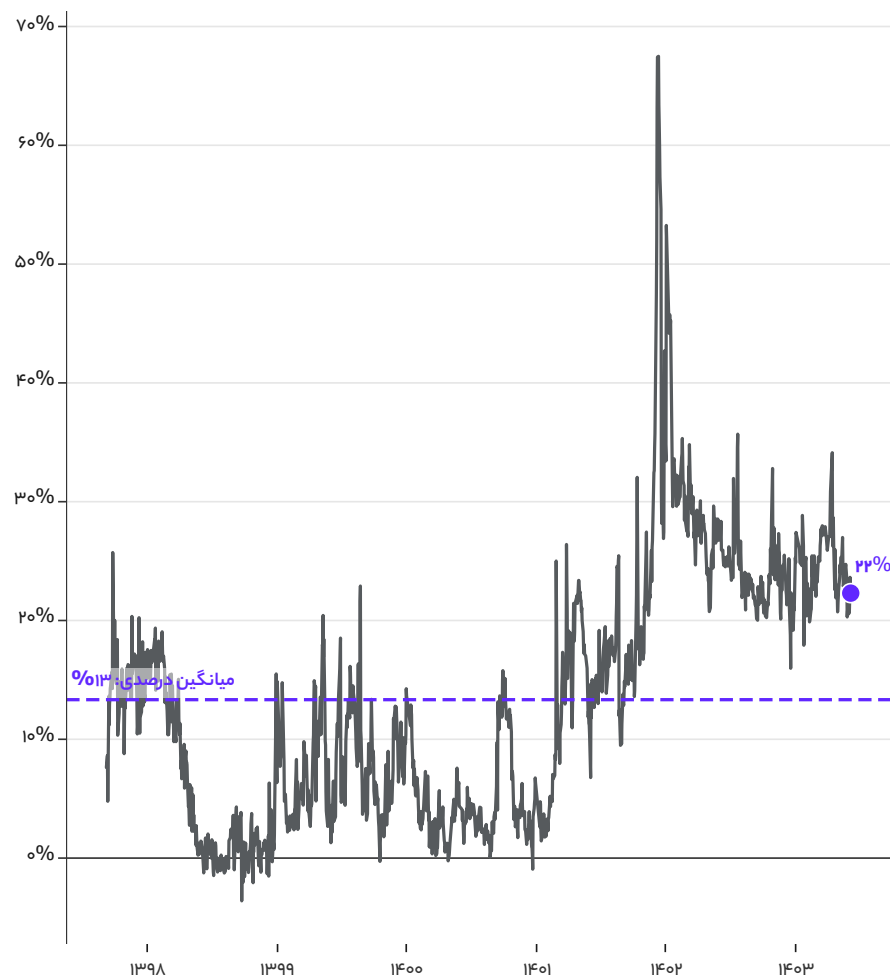
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



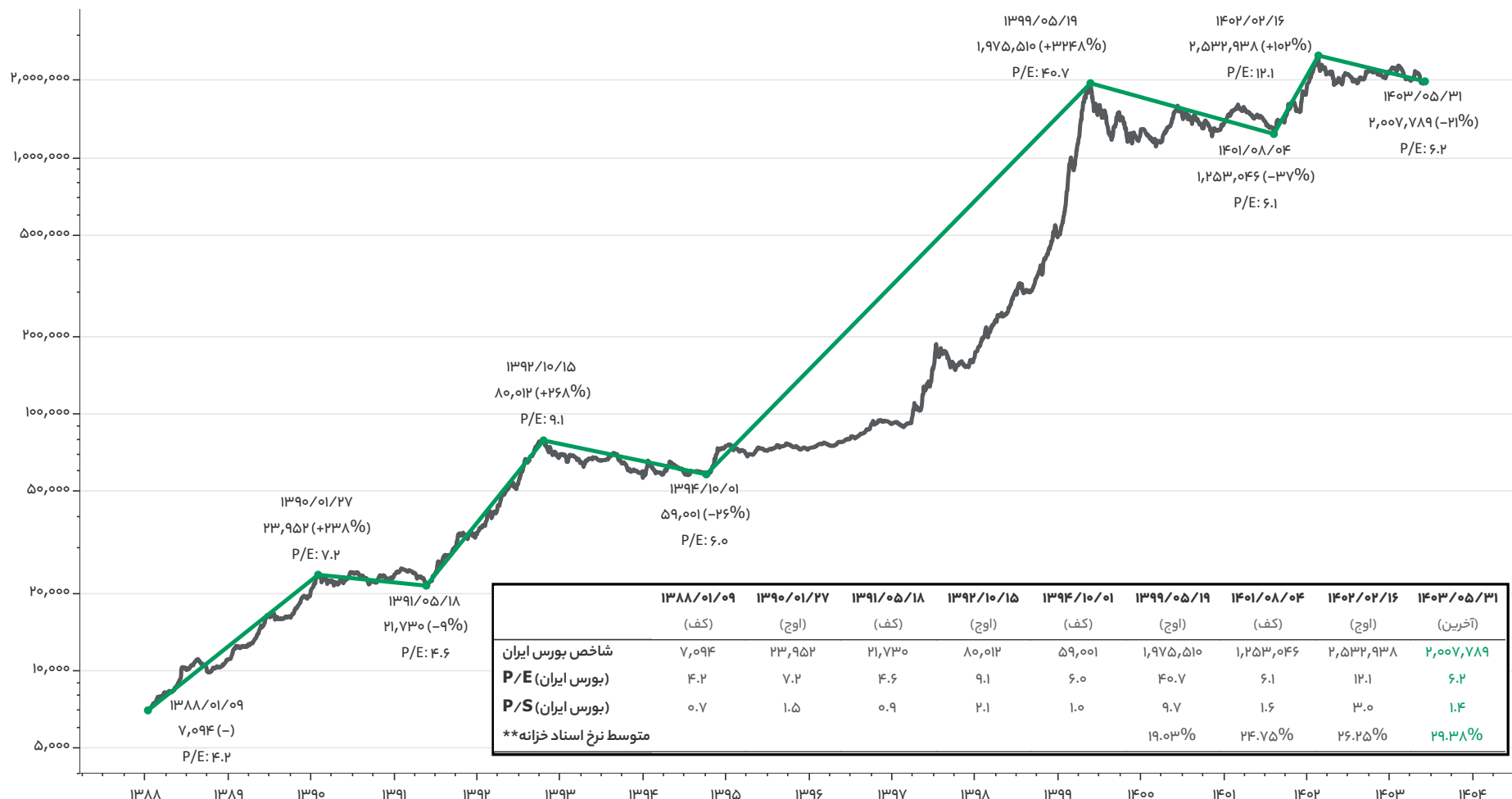


EQUITY

بررسی بلندمدت بازار سهام

روندهای بلندمدت شاخص بورس ایران*

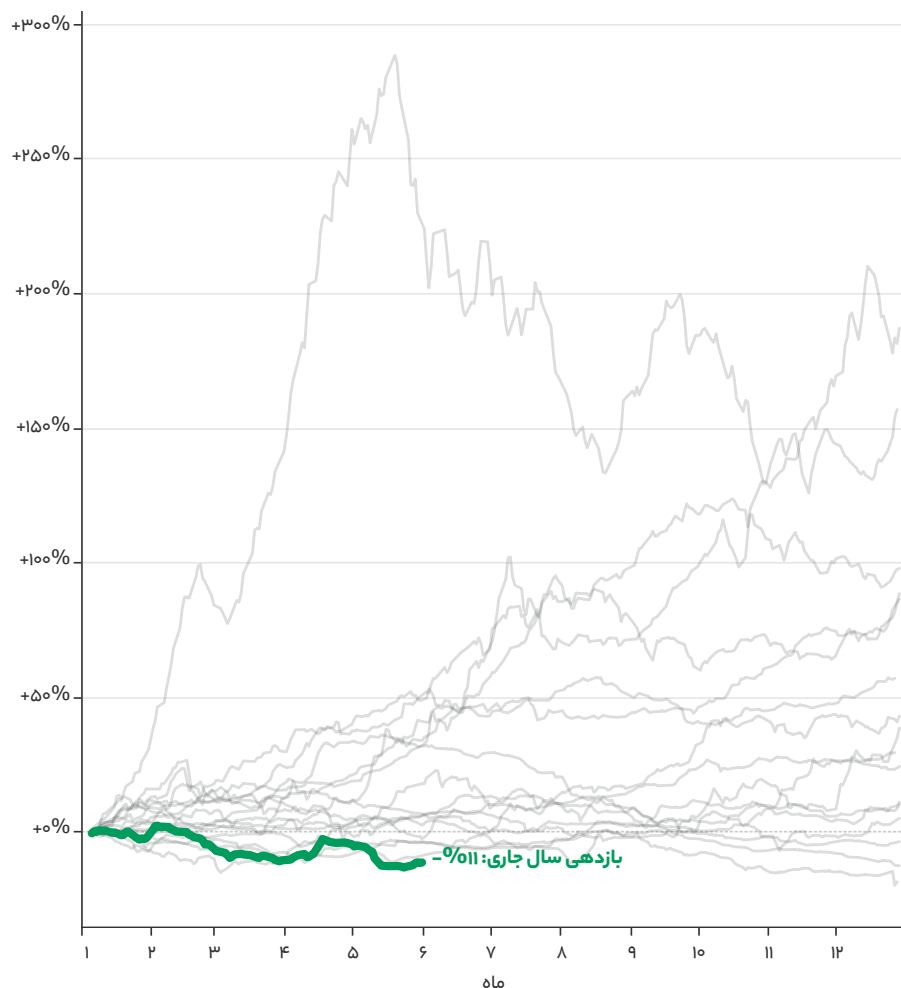
از ابتدای روند صعودی سال ۱۳۸۸، محور لگاریتمی، بزرگنمایی شده، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بر اساس شاخص بورس ایران



* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.
 ** متوسط نرخ اسناد خزانه اسلامی، میانگین نرخ بازدهی اوراق در سررسیدهای مختلف می باشد که بیش از ۳۰ روز تا سررسید خویش فاصله دارند.

مقایسه بازدهی سال جاری

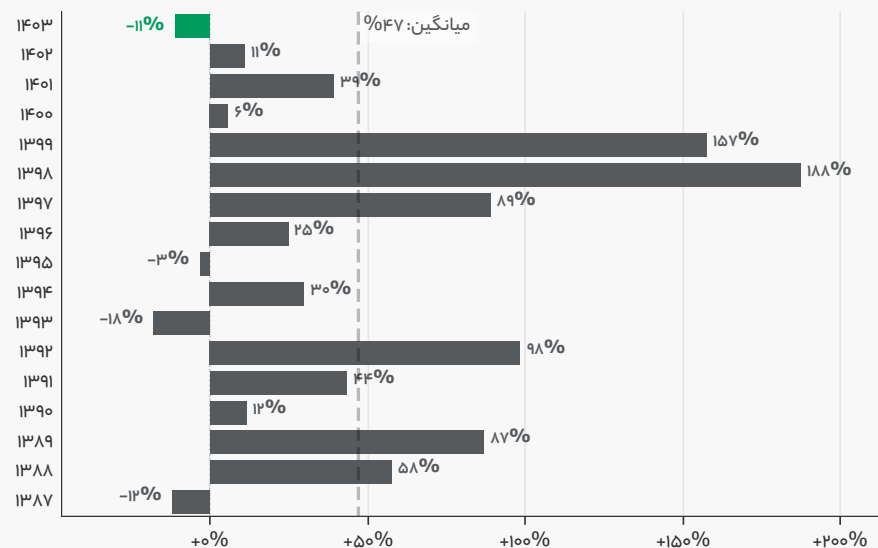
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



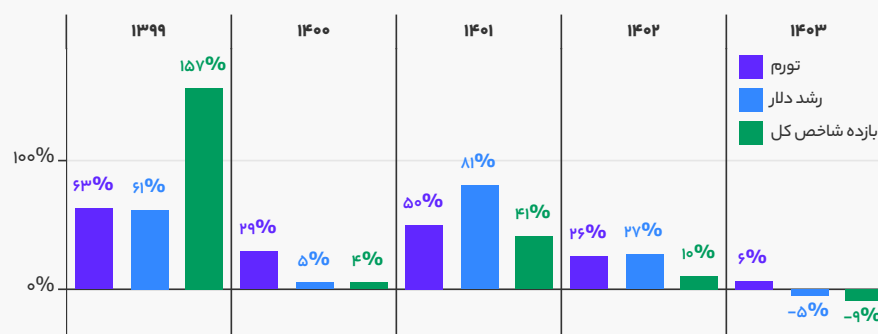
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

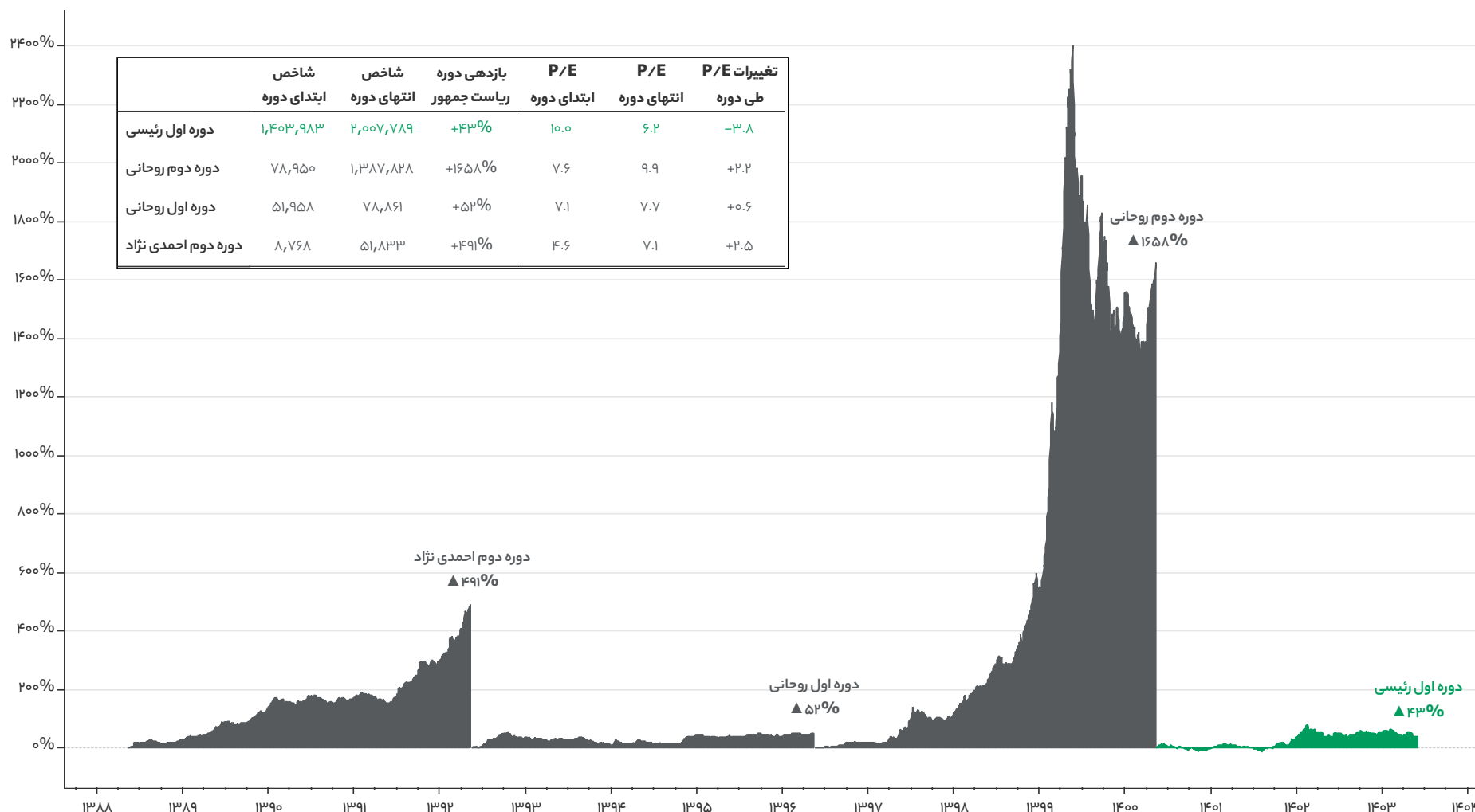


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلندمدت بازار سهام

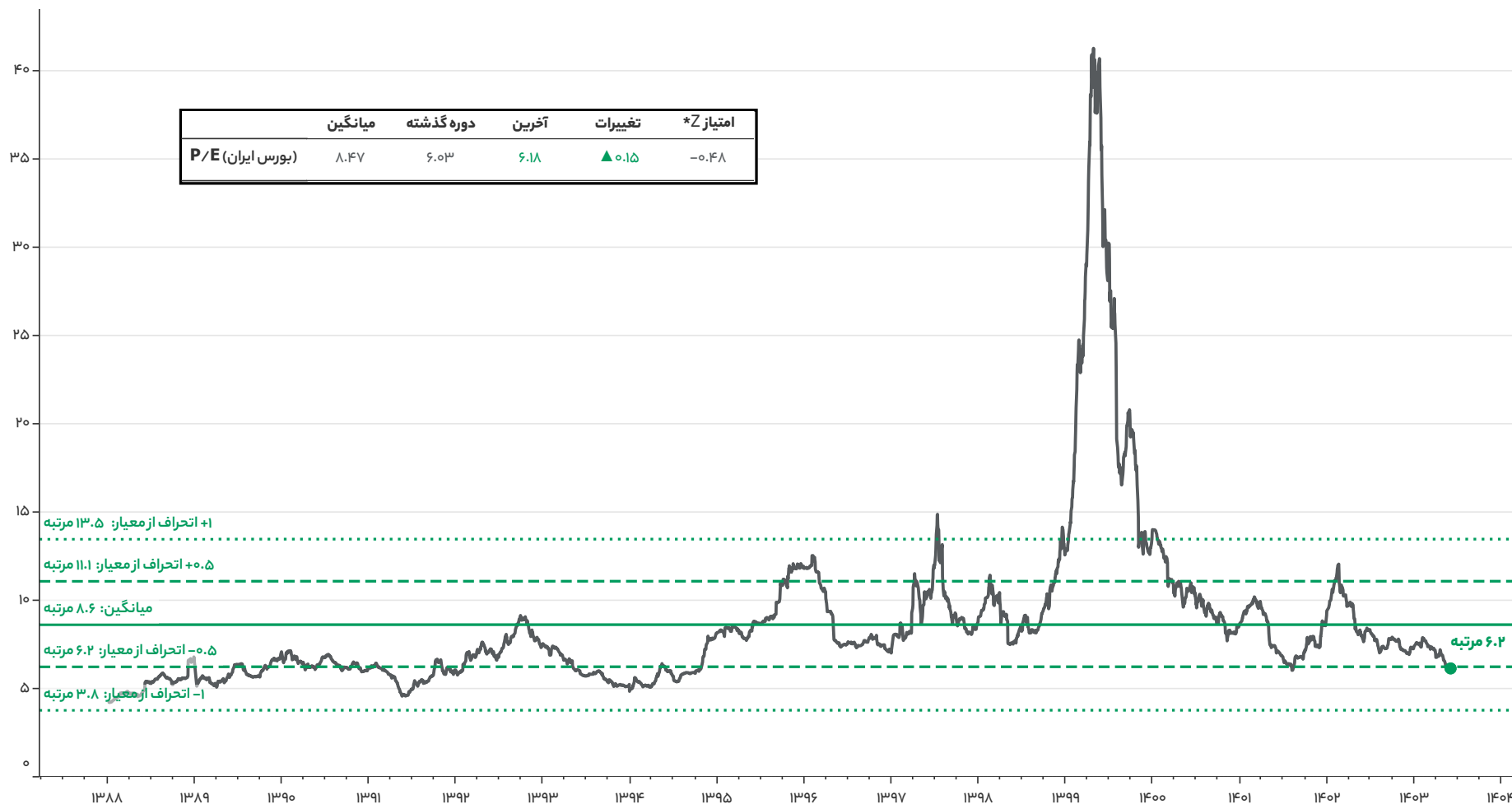
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



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 بر اساس ارزش بازار

ارزندی 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.

ارزندی 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.

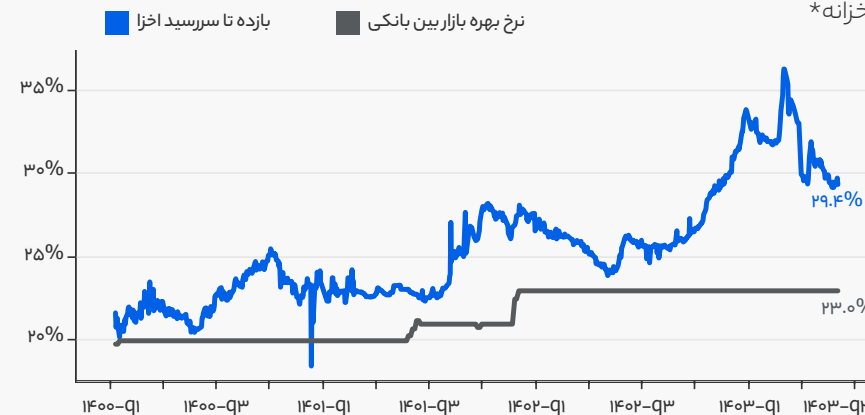


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

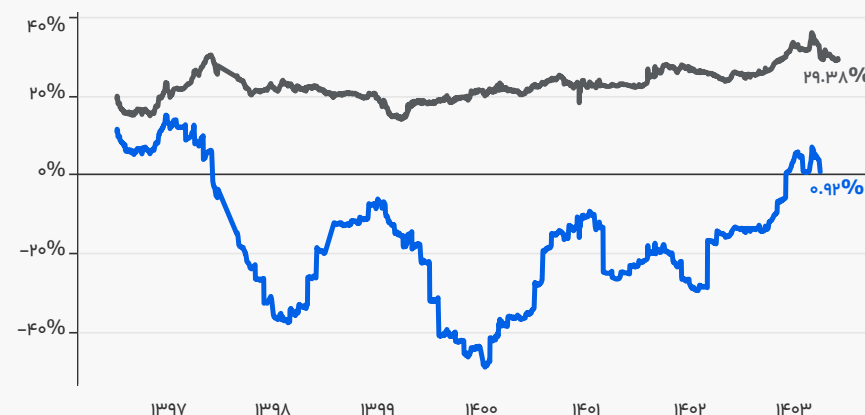
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

از ابتدای سال ۱۴۰۰، حداقل نرخ بهره توافقی 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



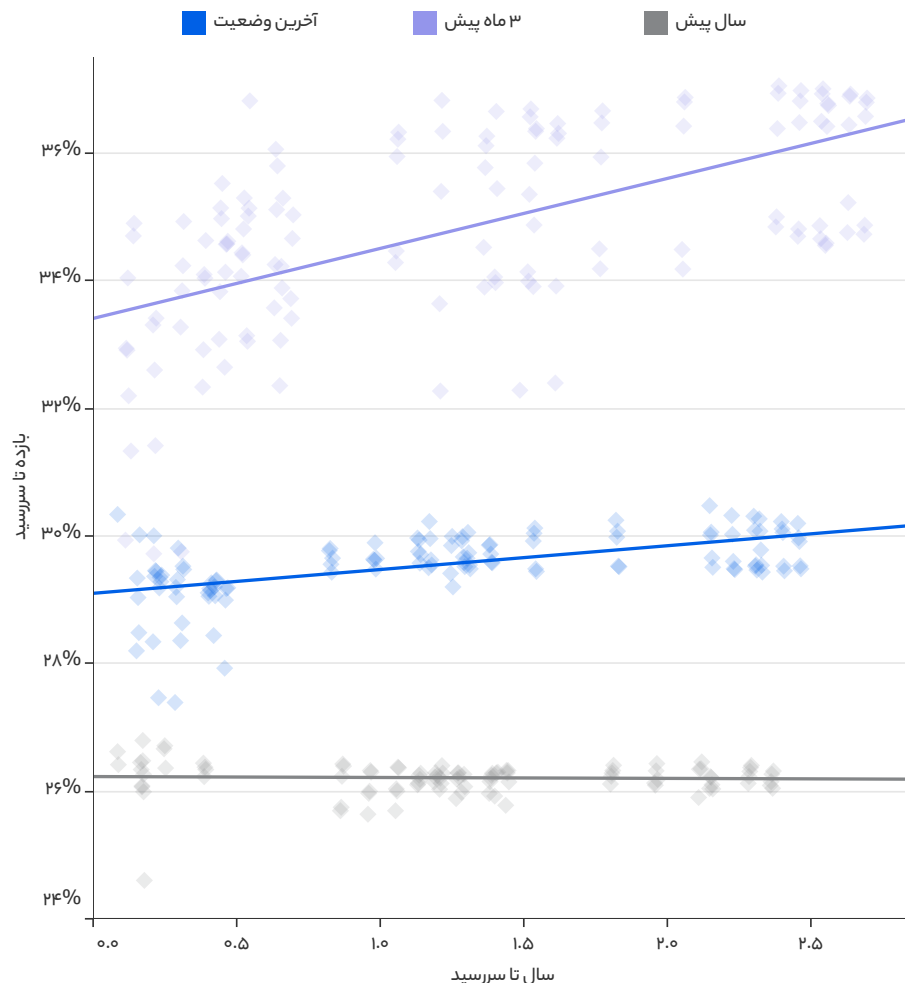
* میانگین روزانه بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف که بیش از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند.

** 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.

منحنی بازده تا سررسید اسناد خزانه

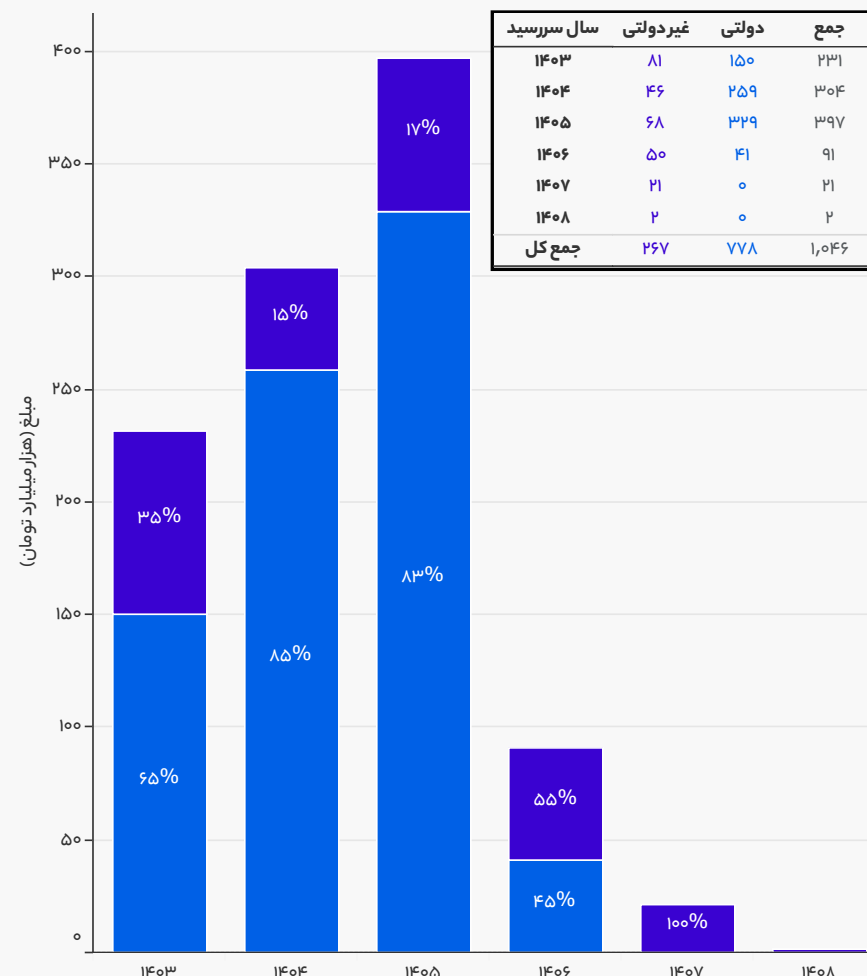
منحنی به همراه بازده تا سررسید اسناد خزانه***، برای آخرین روز، ۳ ماه پیش و سال پیش



دید کلی بازار بدهی

مانده اوراق به تفکیک سررسید

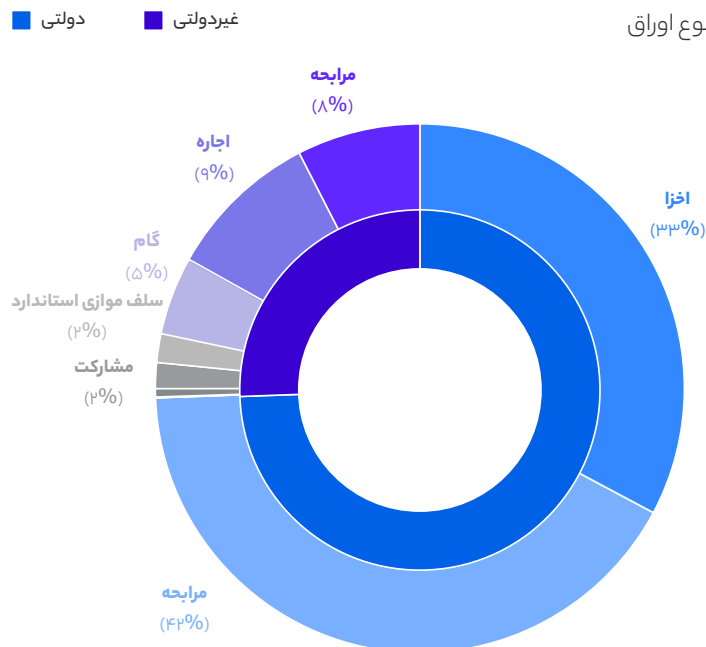
به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



* 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.

ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق

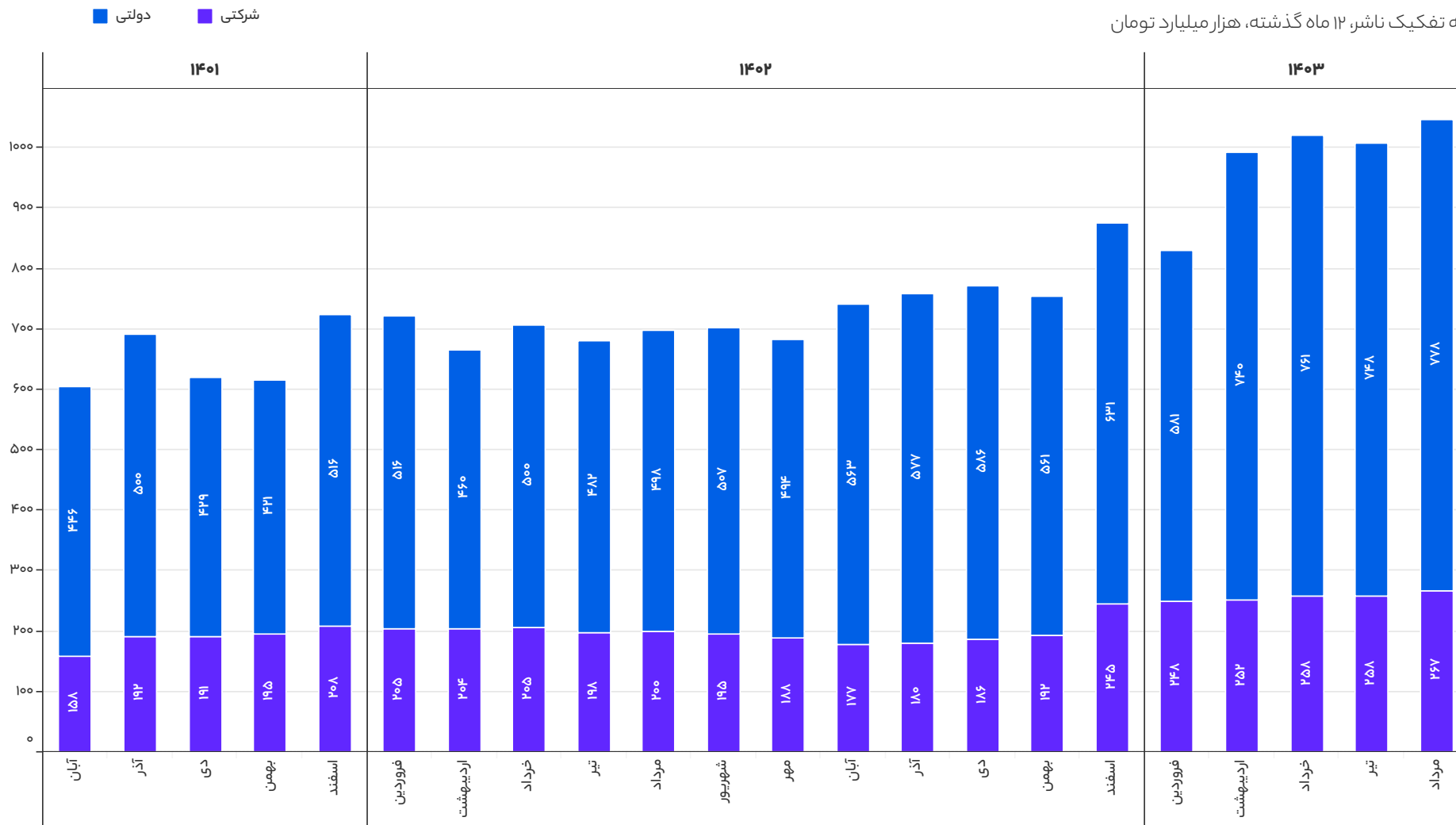


ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مرابحه	۴۳۵	۴۲%
	اخزا	۳۴۳	۳۳%
غیردولتی	اجاره	۹۸	۹%
	مرابحه	۷۹	۸%
	قرض الحسنه	۰	۰%
	مشارکت	۱۷	۲%
	سلف موازی استاندارد	۱۸	۲%
	منفعت	۵	۰%
	گام	۵۰	۵%
جمع کل		۱,۰۴۵	۱۰۰%

دید کلی بازار بدهی

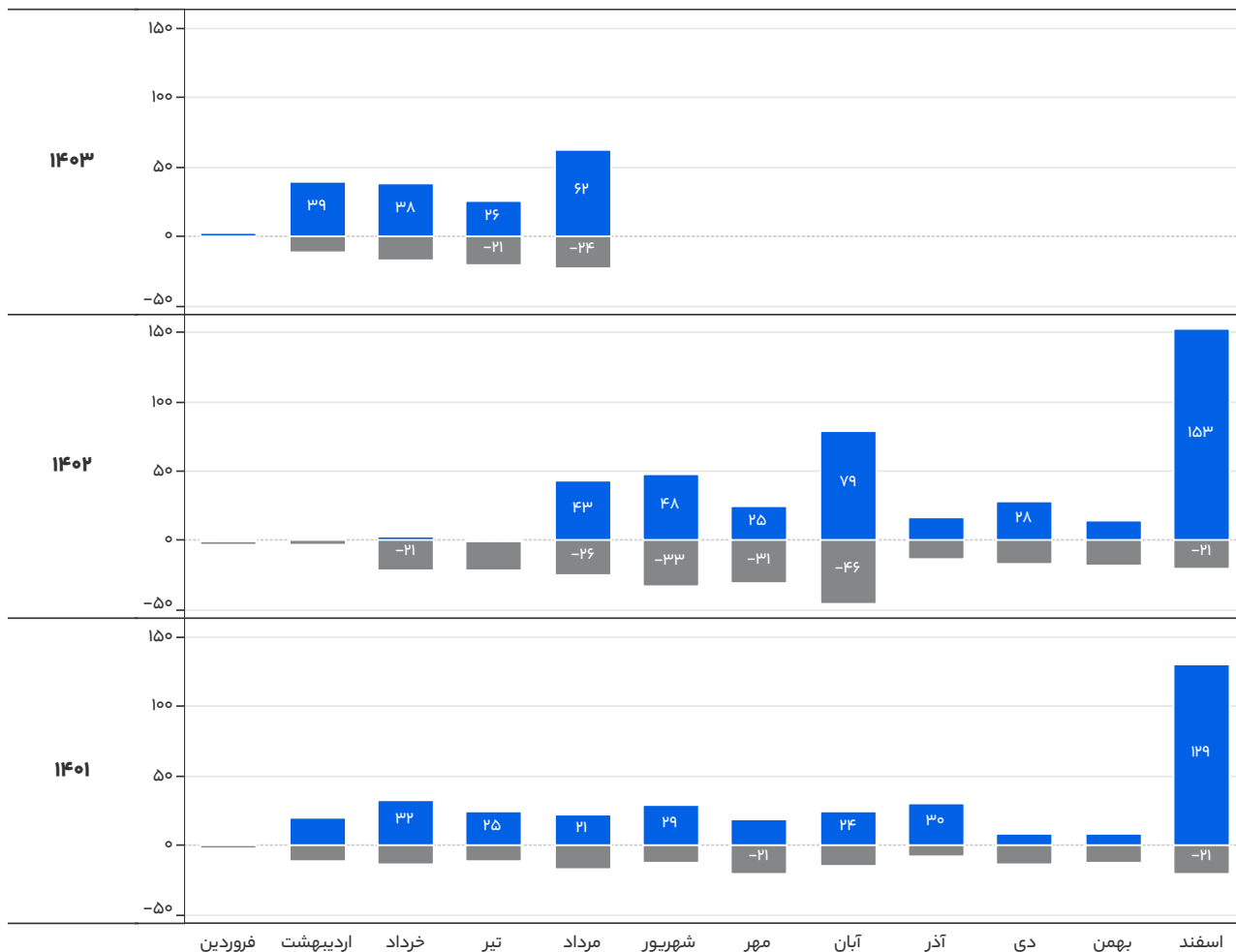
مانده اوراق به صورت تاریخی

به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



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

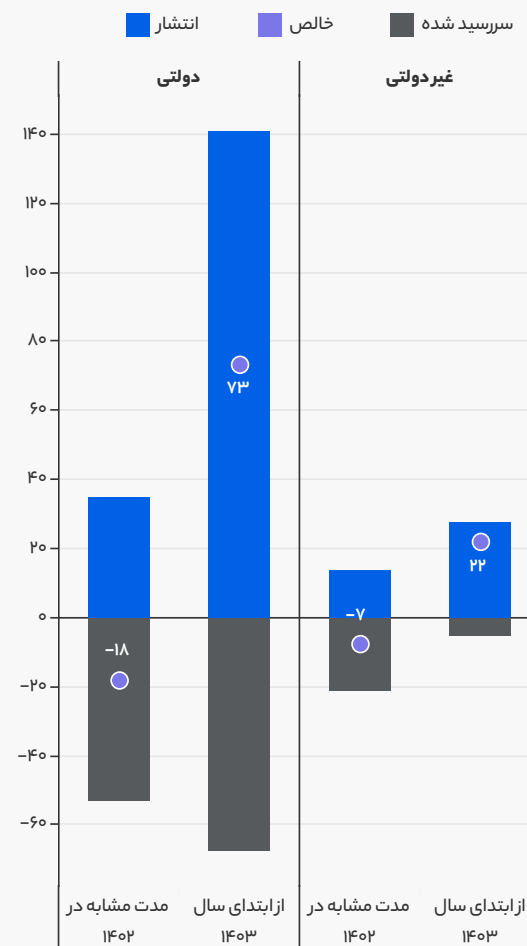
حجم اوراق منتشر و سررسید شده، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

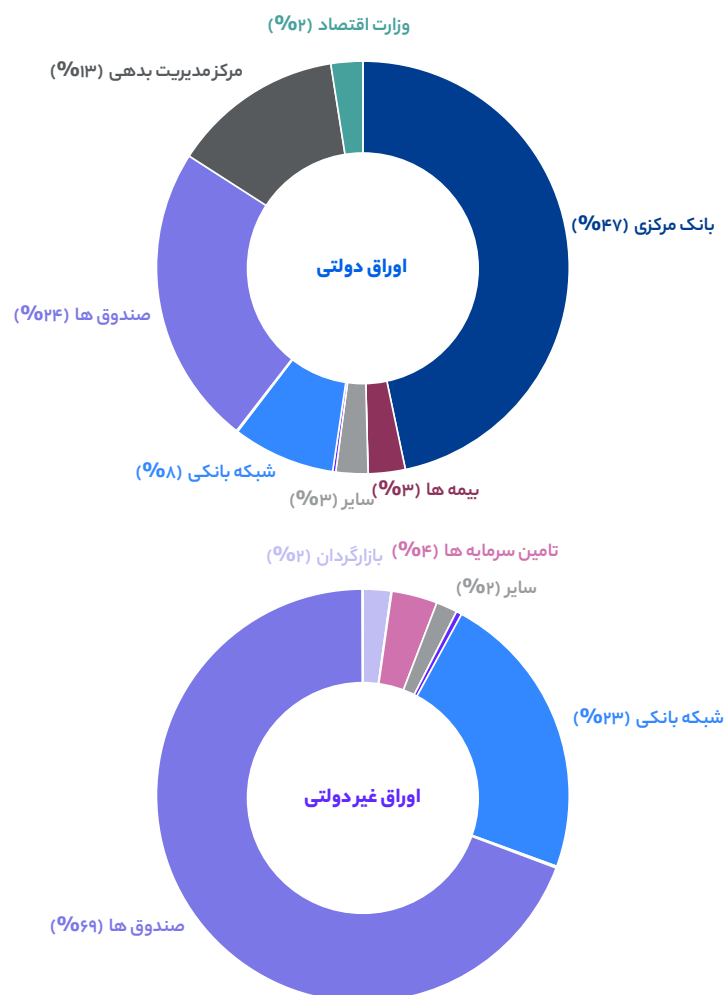
وضعیت انتشار و انقضای اوراق سال جاری نسبت به مدت مشابه سال گذشته، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

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



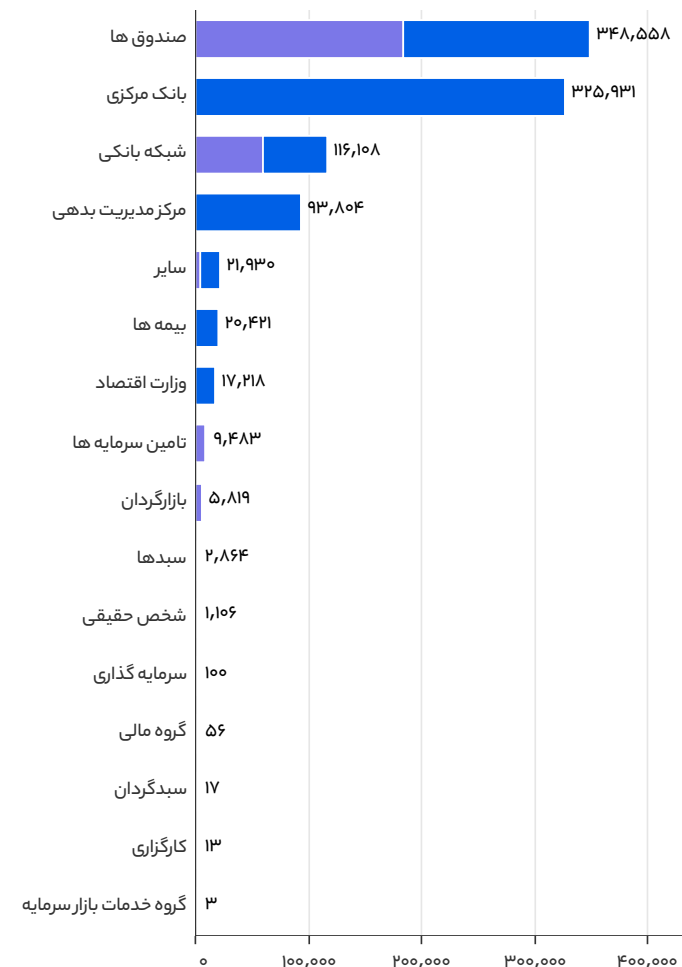
	جمع کل	۱۴۰۸	۱۴۰۷	۱۴۰۶	۱۴۰۵	۱۴۰۴	۱۴۰۳
دولتی	۳۲۵.۹			۱۶.۶	۱۳۹.۶	۱۱۷.۳	۵۲.۴
	۱۶۴.۷			۹.۲	۳۹.۰	۶۰.۱	۵۶.۴
	۹۳.۸			-	۸۲.۷	۶.۳	۴.۸
	۵۶.۰			۲.۸	۹.۵	۲۹.۵	۱۴.۱
	۲۰.۲			۱.۱	۷.۴	۵.۵	۶.۳
	۱۷.۵			-	۳.۹	۱۲.۳	۱.۳
	۱۷.۲			۱۱.۰	۶.۲	-	-
	۱.۷			-	۰.۱	۰.۷	۰.۹
	۰.۷			-	-	۰.۷	-
	-			-	-	-	-
غیردولتی	-			-	-	-	-
	۱۸۳.۸	۱.۷	۱۶.۵	۴۲.۱	۵۴.۹	۳۸.۵	۳۰.۲
	۶۰.۱	-	-	۱.۷	۷.۲	۰.۷	۵۰.۵
	۹.۵	-	۱.۱	۲.۰	۲.۳	۳.۵	۰.۶
	۵۰.۸	-	۰.۱	۰.۹	۲.۰	۲.۰	۰.۶
	۴.۴	-	۱.۵	۱.۹	۰.۵	۰.۲	۰.۳
	۱.۲	-	۰.۱	۰.۴	۰.۶	-	-
	۰.۴	-	۰.۳	-	-	-	-
	۰.۲	-	۰.۱	-	-	-	۰.۱
	۰.۱	-	۰.۱	-	-	-	-
	۰.۱	-	-	-	۰.۱	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
جمع دولتی و غیردولتی		۱.۷	۱۹.۸	۹۰.۰	۳۵۶.۱	۲۷۷.۵	۲۱۸.۴

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی

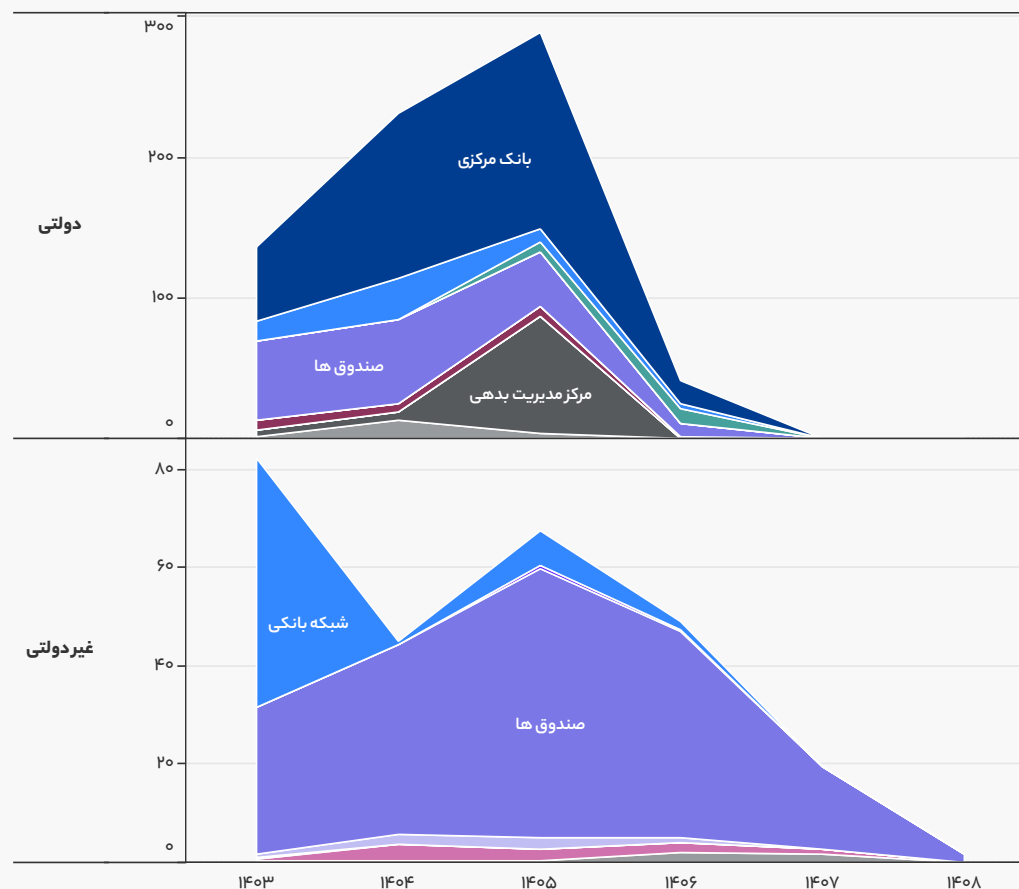
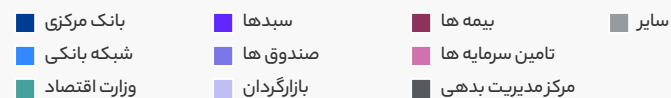


جمع	گام	منفعت	مشارکت	مراجعه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره	صندوق ها
۳۴۸,۵۵۸	۴۸	۴,۸۸۶	۱۴,۴۸۰	۱۶۹,۸۳۴	۰	۱۶,۲۶۶	۶۲,۵۳۳	۵۰	۸۰,۴۶۱	صندوق ها
۳۲۵,۹۳۱	۰	۰	۰	۲۶۹,۸۲۵	۰	۰	۵۶,۱۰۶	۰	۰	بانک مرکزی
۱۱۶,۱۰۸	۰	۱۰۰	۰	۳۲,۳۳۳	۵۰,۰۰۰	۰	۲۷,۵۷۶	۰	۶,۱۰۰	شبکه بانکی
۹۳,۸۰۴	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۹۳,۸۰۴	۰	۰	مرکز مدیریت بدهی
۲۰,۴۲۱	۰	۰	۰	۹,۰۲۷	۴۰	۴۵	۱۱,۲۶۹	۰	۴۰	بیمه ها
۲۱,۹۳۰	۱	۰	۲۵	۷۳۳	۵۲	۲۶۹	۱۷,۵۰۹	۰	۳,۳۴۱	سایر
۹,۴۸۳	۰	۹۵	۹۶۵	۳,۳۸۷	۲	۵۰۹	۰	۵	۴,۵۱۹	تامین سرمایه ها
۵,۸۱۹	۰	۱۰۷	۱,۰۴۲	۲,۰۲۳	۰	۹۱۵	۰	۰	۱,۷۳۲	بازارگردان
۲,۸۶۴	۰	۰	۰	۱,۰۶۰	۰	۱۸۵	۱,۱۳۰	۰	۴۹۰	سبدها
۱۷	۰	۰	۰	۱۷	۰	۰	۰	۰	۰	سبدگردان
۱۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱۰۰	سرمایه گذاری
۱,۱۰۶	۱	۰	۰	۳۲۵	۰	۰	۷۳۹	۰	۴۱	شخص حقیقی
۱۳	۰	۰	۰	۰	۳	۰	۰	۰	۱۰	کارگزاری
۳	۰	۰	۰	۳	۰	۰	۰	۰	۰	گروه خدمات بازار سرمایه
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰	گروه مالی
۱۷,۲۱۸	۰	۰	۰	۱۷,۲۱۸	۰	۰	۰	۰	۰	وزارت اقتصاد
۹۶۳,۴۳۱	۵۰	۵,۱۸۹	۱۶,۵۱۲	۵۰۵,۸۳۹	۵۰,۰۹۷	۱۸,۱۹۰	۲۷۰,۶۶۵	۵۵	۹۶,۸۳۵	جمع

بازیگران کلیدی بازار بدهی

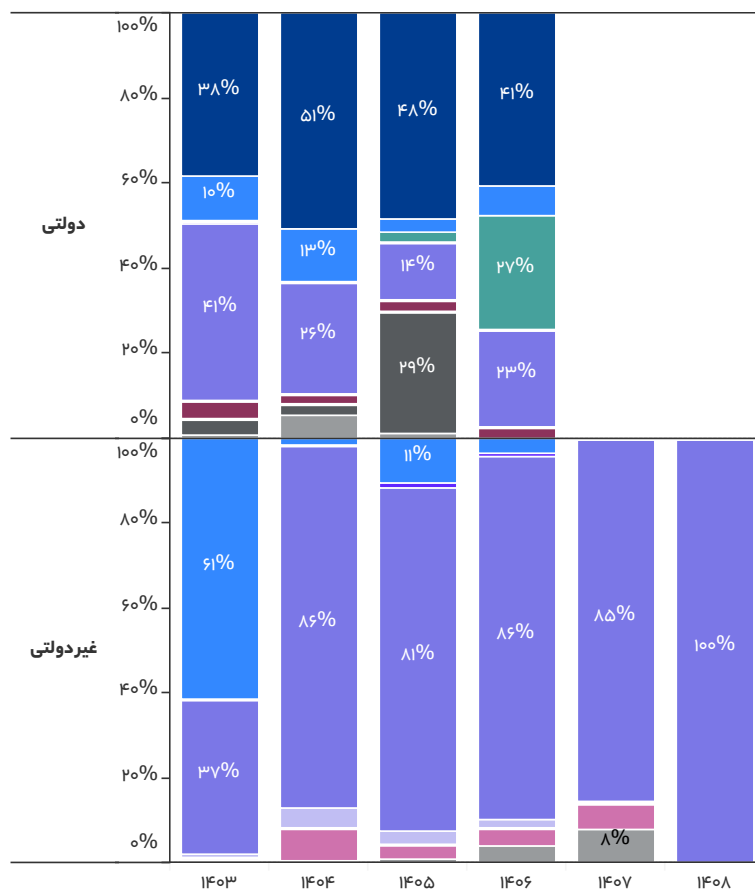
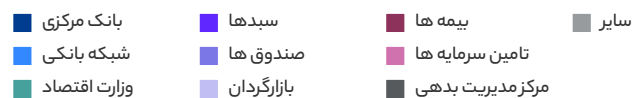
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

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



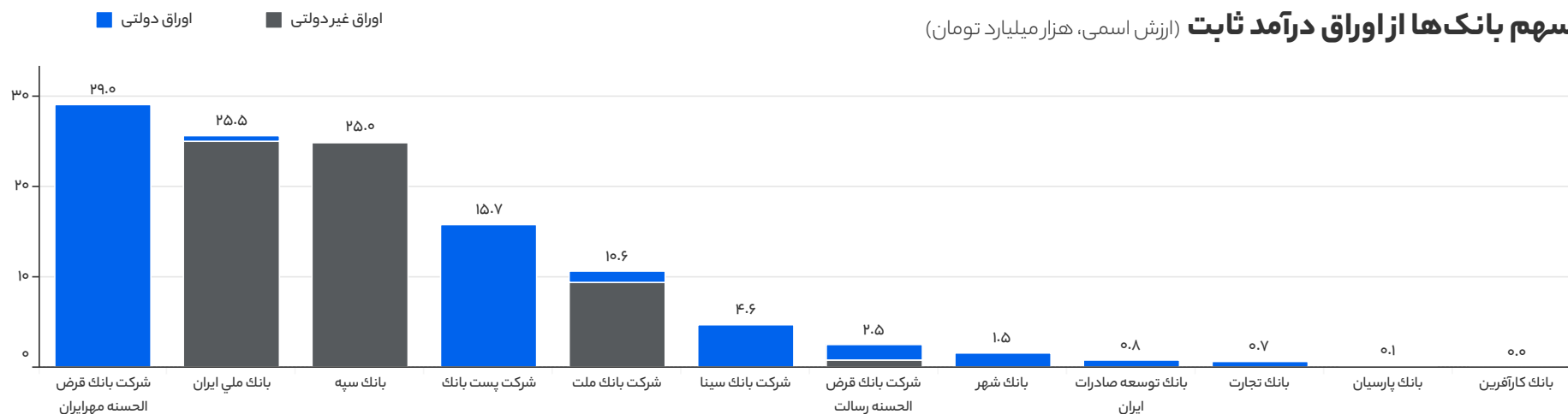
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

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

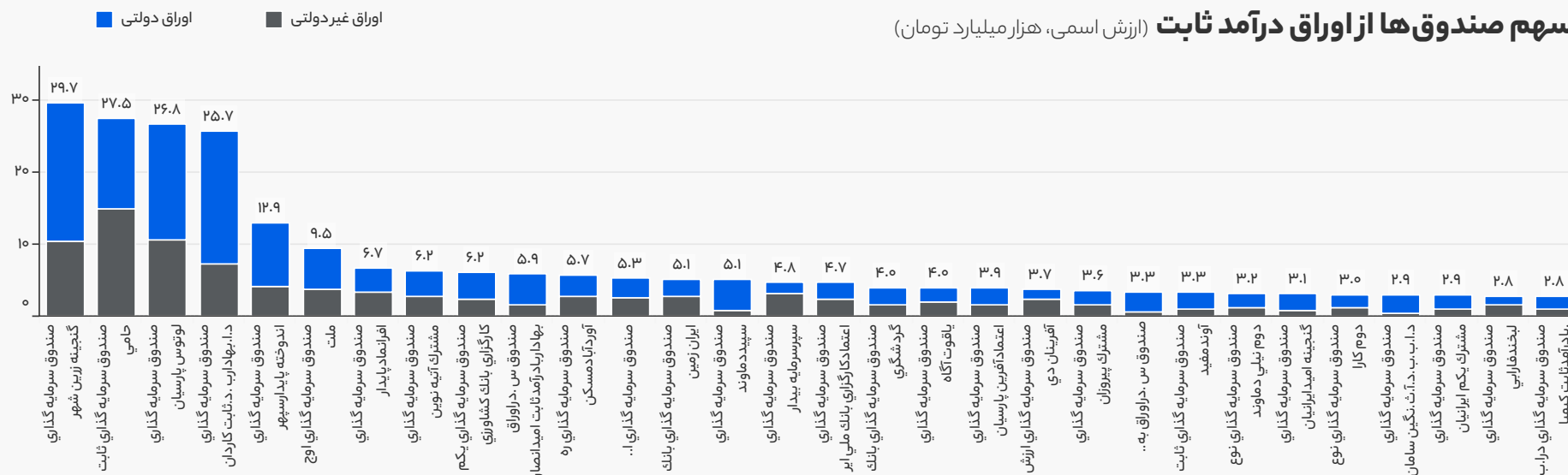


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



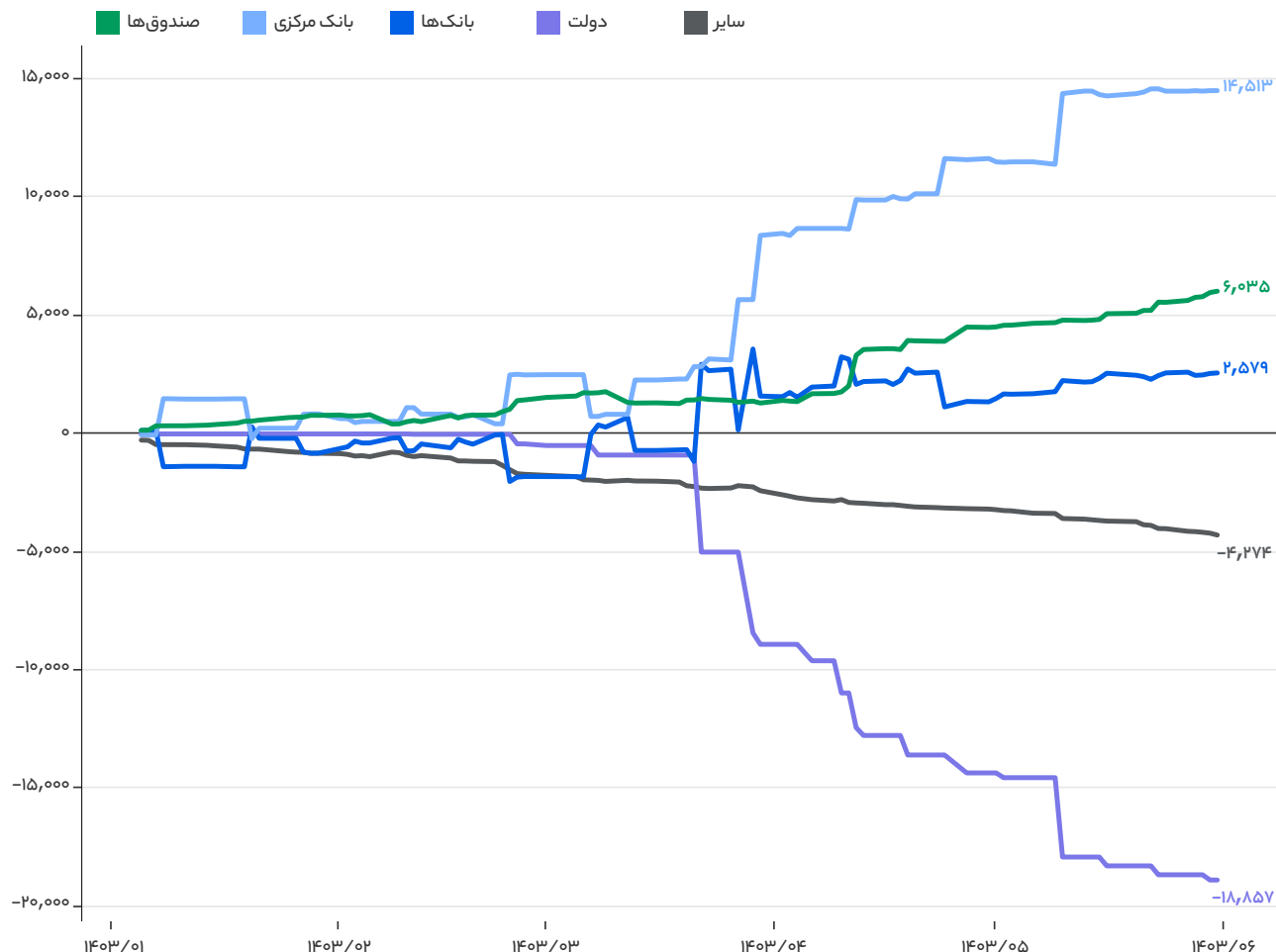
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

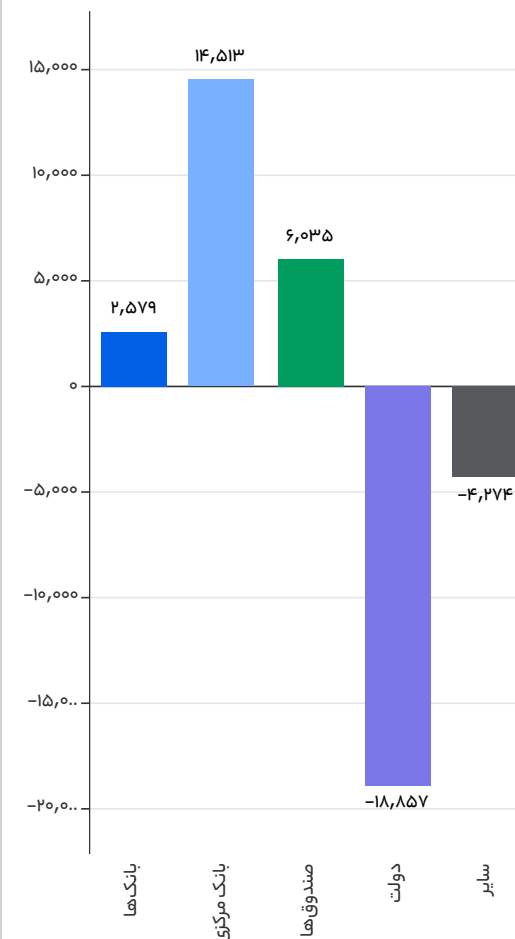
خالص معاملات اوراق

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 نهادهای

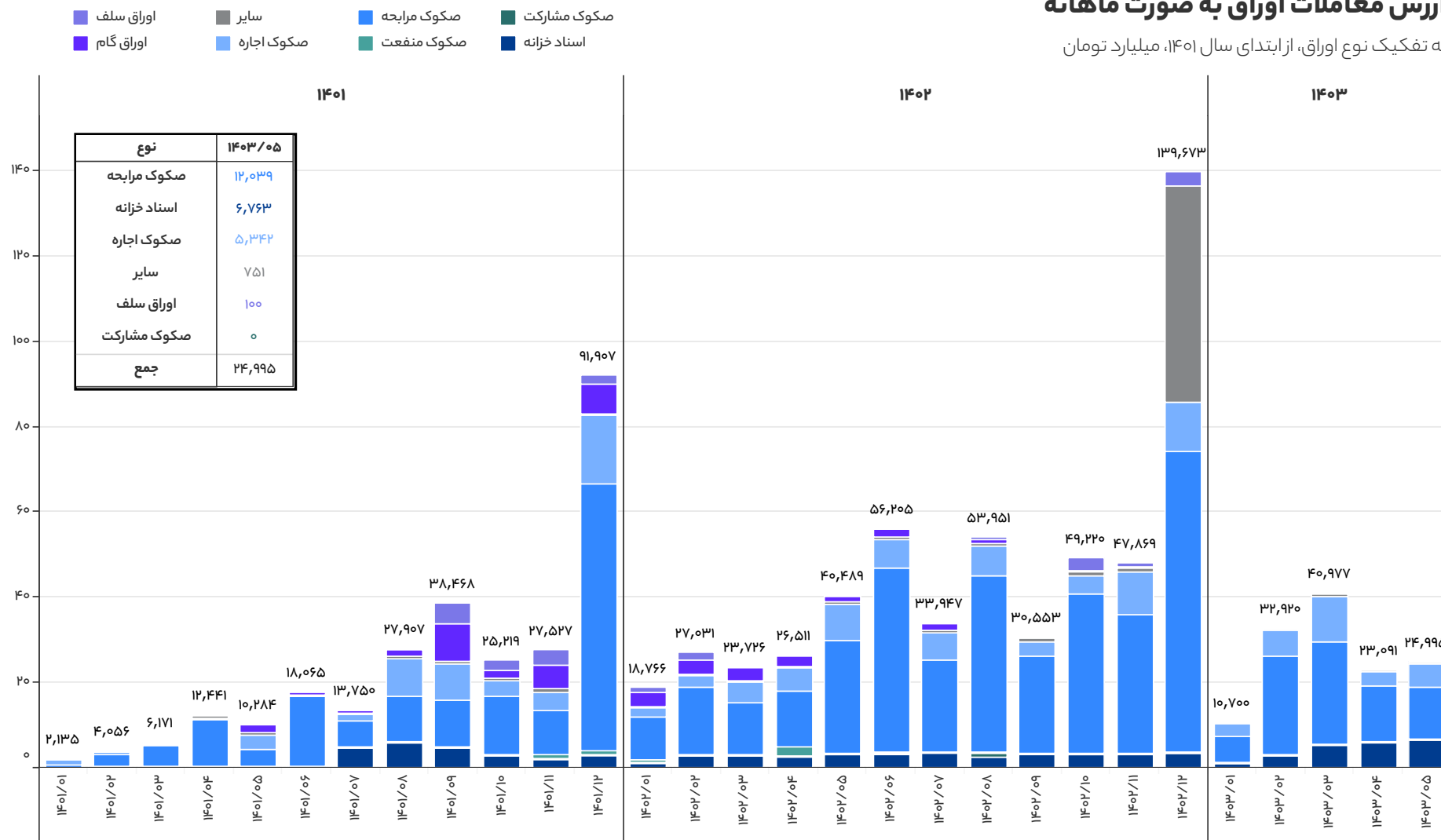
سایر دولت صندوق‌ها بانک مرکزی بانک‌ها

	بانک‌ها	بانک مرکزی	صندوق‌ها	دولت	سایر
۱۴۰۳/۰۵	۱,۲۳۳	۲,۸۷۱	۱,۵۳۱	-۴,۵۲۷	-۱,۰۹۸
۱۴۰۳/۰۴	-۲۴۴	۳,۲۵۰	۳,۱۹۸	-۵,۴۳۶	-۷۷۶
۱۴۰۳/۰۳	۳,۴۰۰	۵,۸۹۶	-۱۳۲	-۸,۴۷۴	-۶۹۴
۱۴۰۳/۰۲	-۹۸۶	۱,۶۴۸	۶۵۴	-۴۲۰	-۸۹۰
۱۴۰۳/۰۱	-۹۶۰	۸۸۸	۶۸۲	۰	-۶۰۶
۱۴۰۲/۱۲	۶۸۳	۴,۸۴۰	-۵۳۷	-۴,۵۲۶	-۴۵۸
۱۴۰۲/۱۱	۶۹۹	۲۰۲	۱۸۱	-۶۵۹	-۴۱۶
۱۴۰۲/۱۰	-۱۳۱	۱,۶۲۴	۷۲۳	-۱,۸۶۳	-۳۵۰
۱۴۰۲/۰۹	۱۶۸	۵۳۶	۸۴۴	-۱,۲۶۵	-۲۸۹
۱۴۰۲/۰۸	-۴۰۲	۳۵۳	۳,۱۱۹	-۲,۸۸۱	-۱۸۸
۱۴۰۲/۰۷	-۶۸۸	۸۷۵	۱,۴۶۶	-۶۰۳	-۱,۰۴۸
۱۴۰۲/۰۶	۳,۷۷۲	۰	-۱,۲۸۵	۱,۲۸۵	۳,۵۲۶
۱۴۰۲/۰۵	۲,۴۶۹	-۱,۷۹۷	۱۲۴	-۱۲۴	۱,۹۴۶
۱۴۰۲/۰۴	۷۷۹	-۱,۲۲۴	-۶۳	۶۳	۶۳
۱۴۰۲/۰۳	-۳,۱۰۸	-۷۳۹	۳,۸۱۳	-۳,۸۱۳	-۳,۸۱۳
۱۴۰۲/۰۲	۱,۳۵۶	۳,۸۱۶	-۹۲۳	۹۲۳	۹۲۳
۱۴۰۲/۰۱	-۲,۹۸۶	-۱,۱۴۹	۳,۳۲۴	-۳,۳۲۴	-۳,۳۲۴

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 شرکتهای، صکوک اجاره شهرداری، صکوک مشارکت دولتی، صکوک مرابحه شرکتهای، سایر شرکتهای، صکوک مرابحه

دولتی صکوک مرابحه (۷ همت)	شرکتی صکوک اجاره (۵ همت)	شرکتی صکوک مرابحه (۵ همت)
دولتی اسناد خزانه (۷ 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

نماد	نوع	تاریخ سررسید	ارزش معاملات
۱۴۰۶/۱۲/۲۲	صکوک اجاره	تابان ۱۴	۱,۰۰۰
۱۴۰۷/۰۳/۱۵	صکوک اجاره	صفارس ۷۰۳	۸۹۲
۱۴۰۵/۰۵/۱۵	صکوک اجاره	صغدیر ۵۰۵	۶۴۰
۱۴۰۶/۱۲/۱۵	صکوک مرابحه	صفولای ۶۱۲	۵۰۵
۱۴۰۷/۰۲/۱۶	صکوک اجاره	وامین ۰۷	۴۲۹
۱۴۰۵/۰۵/۰۹	صکوک اجاره	تامین ۰۵	۴۱۶
۱۴۰۵/۱۲/۲۳	صکوک اجاره	صاروج ۰۵	۳۶۹
۱۴۰۶/۰۶/۲۶	صکوک مرابحه	لوازم مادی ۰۶	۳۰۰
۱۴۰۷/۱۰/۲۳	صکوک مرابحه	ایبان ۰۷	۳۰۰
۱۴۰۷/۱۱/۱۵	صکوک مرابحه	صعبید ۷۱۱	۲۹۹
۱۴۰۶/۱۲/۲۷	صکوک اجاره	مبین ۰۶	۲۹۵
۱۴۰۷/۰۸/۱۷	صکوک مرابحه	افق معادن ۰۷	۲۹۱
۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صفولای ۱۲	۲۴۹
۱۴۰۶/۰۶/۱۵	صکوک مرابحه	صفار ۰۶	۲۴۹
۱۴۰۶/۰۵/۱۵	صکوک مرابحه	صپترو ۰۵	۲۴۱
۱۴۰۵/۰۳/۲۷	صکوک مرابحه	کرمان ۵۳۱	۲۱۴
۱۴۰۷/۰۲/۱۰	صکوک مرابحه	سینک ۰۷	۲۰۰
۱۴۰۵/۱۲/۲۳	صکوک مرابحه	کرمان ۵۱۲۳	۱۸۶
۱۴۰۶/۰۶/۲۷	صکوک اجاره	تابان ۱۳	۱۷۶
۱۴۰۶/۱۲/۲۷	صکوک مرابحه	آرین سلامت ۰۶	۱۵۰
۱۴۰۸/۰۱/۱۵	صکوک مرابحه	صناگرس ۰۸	۱۵۰
۱۴۰۳/۱۱/۱۵	صکوک اجاره	صشستا ۳۱۱	۱۴۱
۱۴۰۴/۱۲/۱۵	صکوک مرابحه	صآریا ۴۱۲	۱۴۰
۱۴۰۶/۰۵/۱۰	صکوک مرابحه	فاران ۰۶	۱۳۲
۱۴۰۷/۱۰/۱۵	صکوک مرابحه	صناگرس ۰۷	۱۲۹

پرمعامله‌ترین اوراق دولتی ماه گزارش

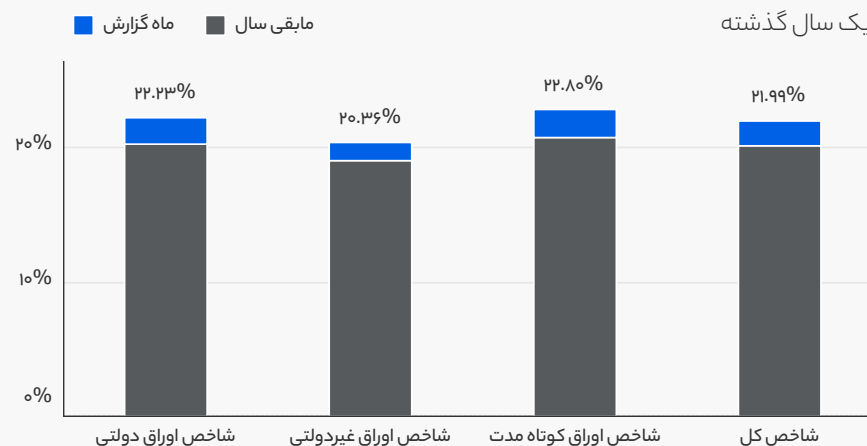
ارزش معاملات برای ۲۵ اوراق با بیشترین ارزش معامله، به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

صکوک مرابحه اسناد خزانه

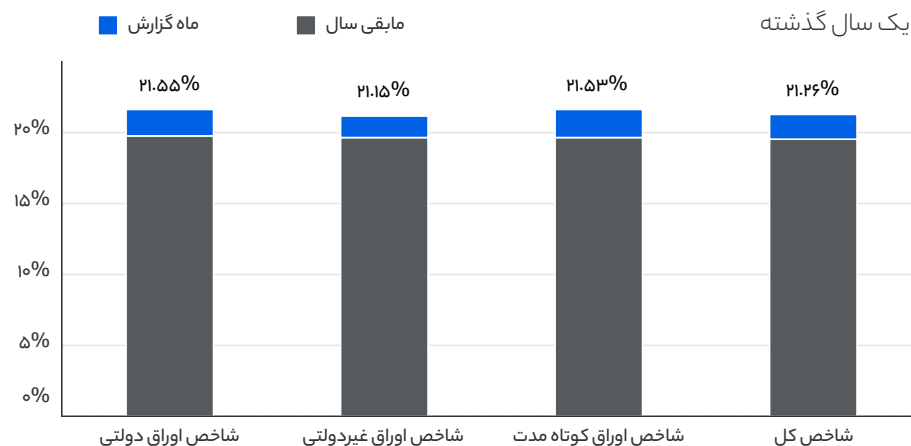
نماد	نوع	تاریخ سررسید	ارزش معاملات
۱۴۰۴/۰۵/۱۹	صکوک مرابحه	اراد ۱۴۸	۱,۹۴۰
۱۴۰۶/۰۶/۳۰	صکوک مرابحه	اراد ۱۱۶	۱,۴۰۶
۱۴۰۴/۰۴/۱۰	صکوک مرابحه	اراد ۱۳۱	۱,۳۱۳
۱۴۰۵/۰۹/۱۶	اسناد خزانه	اخزا ۲۱۲	۱,۲۶۴
۱۴۰۵/۱۰/۲۱	اسناد خزانه	اخزا ۲۱۳	۸۶۹
۱۴۰۵/۰۷/۲۰	اسناد خزانه	اخزا ۲۱۱	۸۳۳
۱۴۰۴/۰۲/۲۲	صکوک مرابحه	اراد ۱۵۱	۷۹۹
۱۴۰۶/۰۲/۱۸	صکوک مرابحه	اراد ۱۰۸	۶۵۹
۱۴۰۳/۰۷/۲۴	صکوک مرابحه	اراد ۱۰۷	۶۰۹
۱۴۰۵/۰۳/۲۵	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۱	۶۰۱
۱۴۰۵/۱۱/۱۲	اسناد خزانه	اخزا ۲۱۰	۵۳۷
۱۴۰۴/۰۹/۱۰	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۷	۴۵۷
۱۴۰۵/۰۹/۲۳	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۲	۴۰۲
۱۴۰۵/۰۵/۰۴	صکوک مرابحه	اراد ۱۴۰	۳۷۹
۱۴۰۴/۱۲/۱۱	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۸	۳۷۴
۱۴۰۴/۰۳/۲۶	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۱	۲۰۴
۱۴۰۴/۰۹/۱۷	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۴	۱۷۹
۱۴۰۵/۰۸/۱۸	اسناد خزانه	اخزا ۲۰۳	۱۷۰
۱۴۰۳/۱۰/۲۴	اسناد خزانه	اخزا ۰۰۲	۱۲۴
۱۴۰۳/۱۰/۰۴	صکوک مرابحه	اراد ۱۳۸	۱۱۸
۱۴۰۳/۰۷/۲۳	اسناد خزانه	اخزا ۰۰۶	۱۰۲
۱۴۰۳/۱۲/۲۳	صکوک مرابحه	اراد ۱۲۶	۱۰۱
۱۴۰۳/۰۸/۱۴	اسناد خزانه	اخزا ۱۰۶	۹۰
۱۴۰۳/۰۶/۲۶	اسناد خزانه	اخزا ۰۰۵	۷۹
۱۴۰۳/۱۱/۱۰	صکوک مرابحه	اراد ۱۳۰	۷۵

بازدهی شاخص صکوک

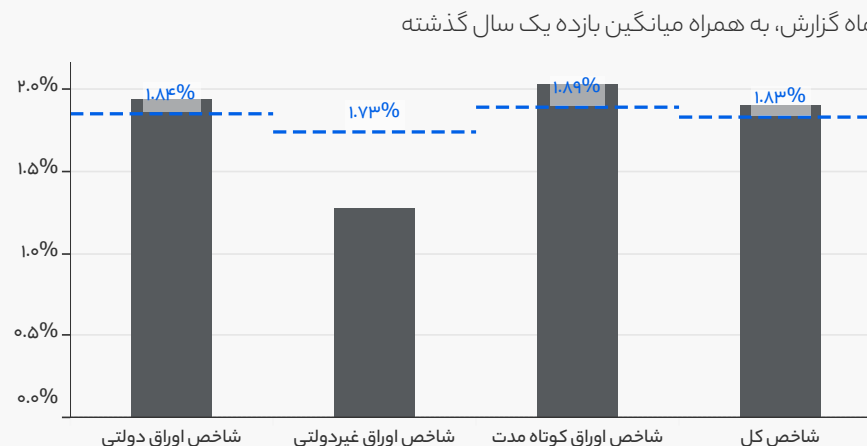
بازدهی شاخص‌های وزنی صکوک فرابورس ایران



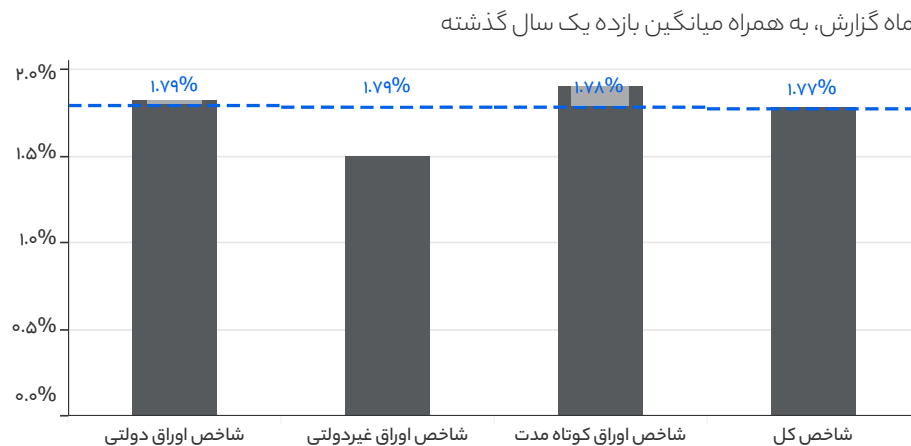
بازدهی شاخص‌های هم وزن صکوک فرابورس ایران



بازدهی شاخص‌های وزنی صکوک فرابورس ایران



بازدهی شاخص‌های هم وزن صکوک فرابورس ایران



نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

نمای کلی

تعداد و خالص ارزش دارایی‌های صندوق‌ها، به تفکیک نوع صندوق

خالص ارزش دارایی‌ها (همت)	تعداد صندوق	نوع صندوق	کلاس سرمایه‌گذاری
۶۲۷.۴	۱۴۶	با درآمد ثابت	سرمایه‌گذاری سنتی
۱۱۷.۸	۱۴۰	سهامی	
۶.۷	۲۶	مختلط	
۱.۳	۵	صندوق در صندوق	
۱.۶	۵	خصوصی	سرمایه‌گذاری
۰.۴	۱۶	جسورانه	خصوصی
۱۶۳.۲	۱۰۵	بازارگردانی	سرمایه‌گذاری جایگزین
۴۸.۸	۱۵	سپرده کالایی	
۲.۶	۴	املاک و مستغلات	
۱.۱	۱	پروژه‌ای	
۰.۰	۴	زمین و ساختمان	
۹۷۱.۰	۴۶۷	جمع کل	

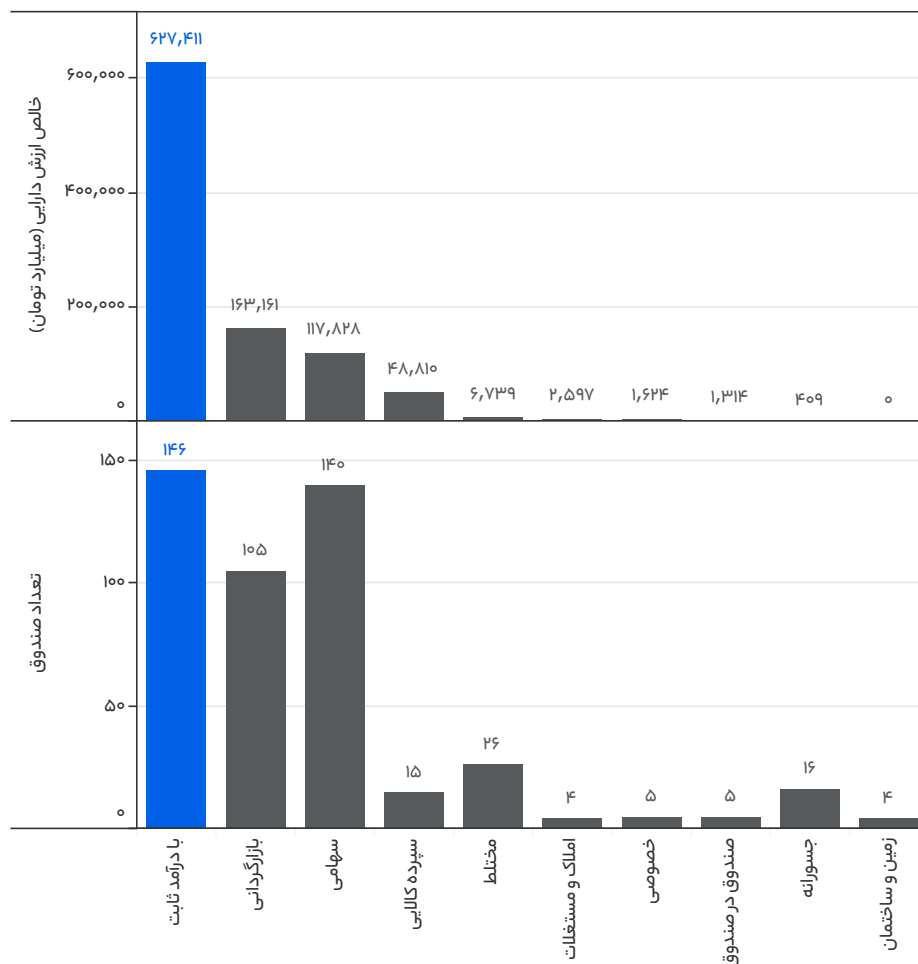
صندوق‌های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
بازارگردانی	صدور و ابطال	اختصاصی بازارگردانی هومان
سهامی	قابل معامله	بخشی خبره صنعت خلیج فارس
سهامی	قابل معامله	بخشی گستره فیروزه
سهامی	قابل معامله	ثروت البرز
جسورانه	قابل معامله	جسورانه افق نگر
جسورانه	قابل معامله	جسورانه دوم دانشگاه تهران
درآمد ثابت	قابل معامله	درآمد ثابت ارکیده
درآمد ثابت	قابل معامله	درآمد ثابت اطمینان هیوا
سهامی	قابل معامله	فرصت آفرین سرمایه
درآمد ثابت	قابل معامله	مختص اوراق دولتی ملت

ارزش و تعداد صندوق‌های سرمایه‌گذاری

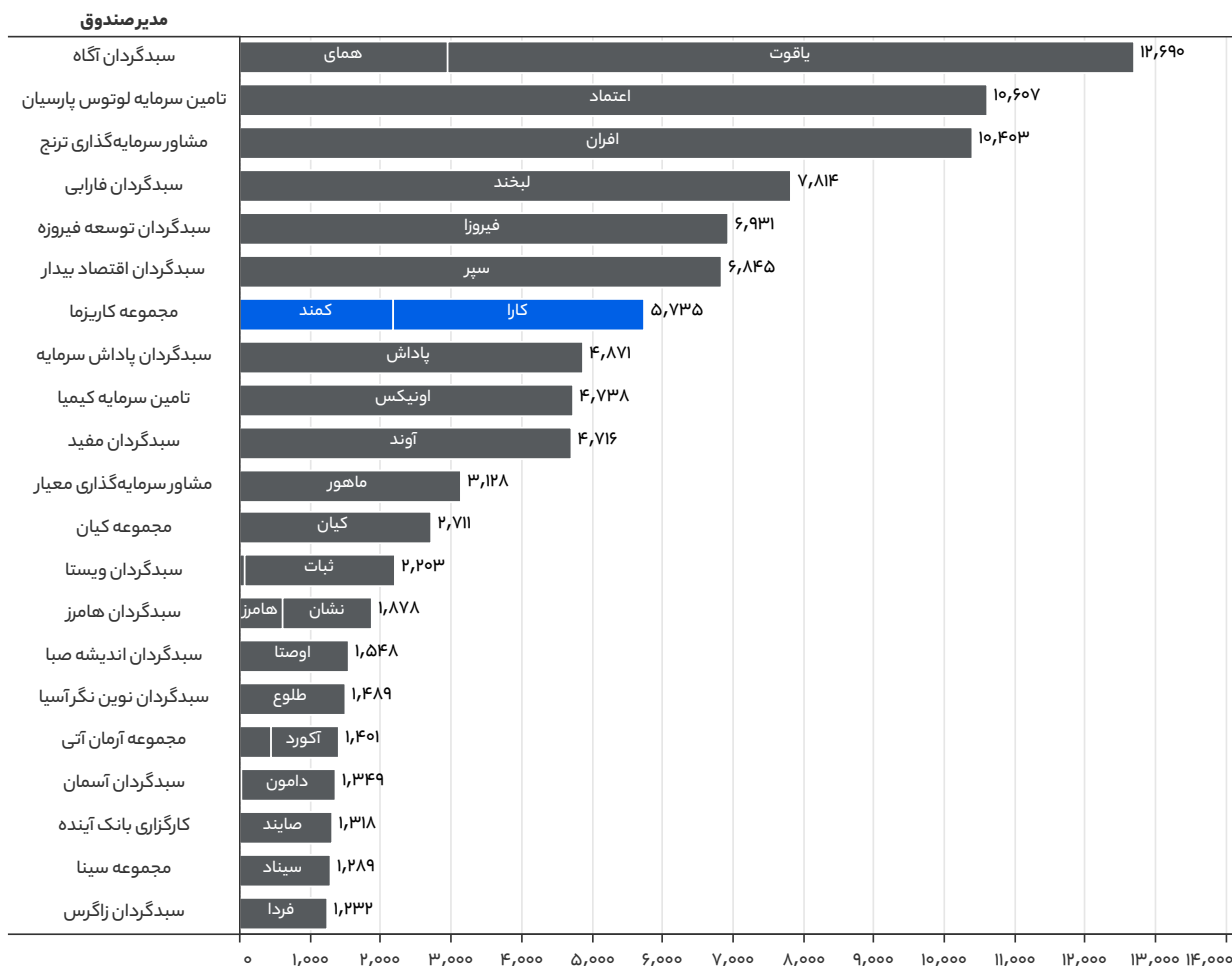
به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده بر اساس خالص ارزش دارایی



معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

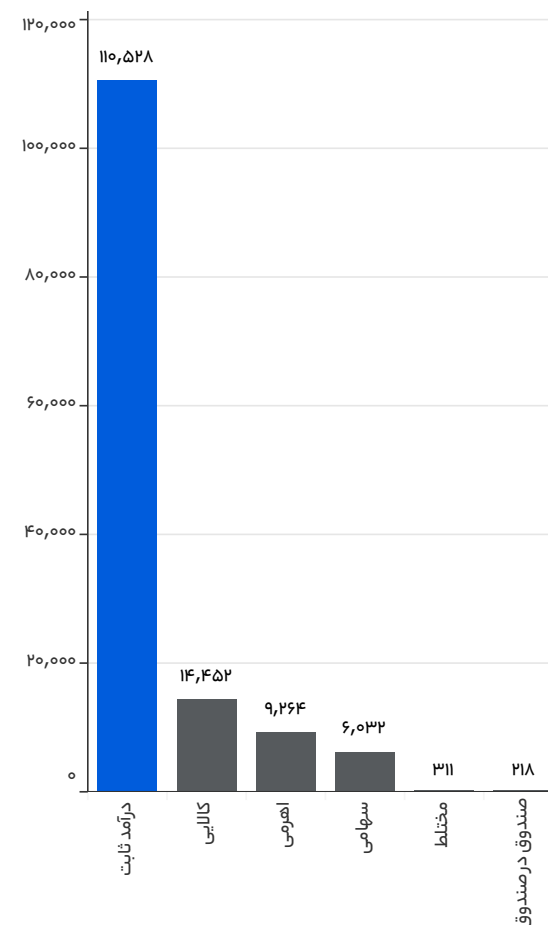
پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

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

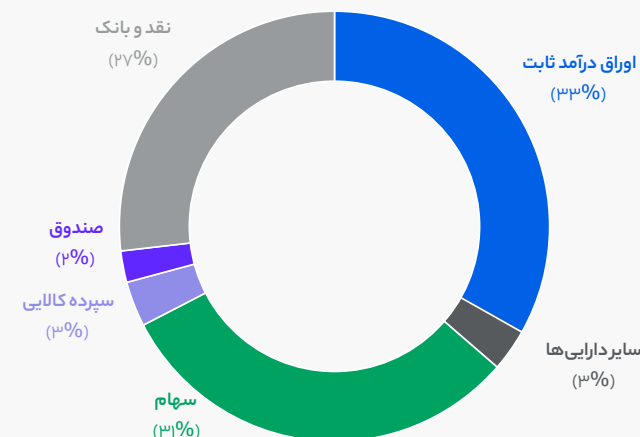
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	
طلوع	سبدگردان نوین نگر آسیا	+۵۱۴
فیروزا	سبدگردان توسعه فیروزه	+۴۴۹
یاقوت	سبدگردان آگاه	+۴۰۷
اونیکس	تامین سرمایه کیمیا	+۳۰۶
ماه‌ور	مشاور سرمایه‌گذاری معیار	+۲۸۲
سپر	سبدگردان اقتصاد بیدار	+۲۶۹
آوند	سبدگردان مفید	+۲۲۳
لبخند	سبدگردان فارابی	+۱۴۷
آفاق	مجموعه آرمان آتی	+۱۰۴
نشان	سبدگردان هامرز	+۱۰۲
دامون	سبدگردان آسمان	+۲۳
فردا	سبدگردان زاگرس	+۱۵
آکورد	مجموعه آرمان آتی	+۱۰
آکام	سبدگردان ویستا	+۰
دیپا	سبدگردان اندیشه صبا	-۱
آسامید	سبدگردان آسمان	-۵
همای	سبدگردان آگاه	-۶
اوصتا	سبدگردان اندیشه صبا	-۸
سیناد	مجموعه سینا	-۱۱
هامرز	سبدگردان هامرز	-۲۸
پاداش	سبدگردان پاداش سرمایه	-۳۲
کمند	مجموعه کاریزما	-۸۸
ثبات	سبدگردان ویستا	-۱۰۳
کارا	مجموعه کاریزما	-۱۰۵
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	-۲۲۴
صایند	کارگزاری بانک آینده	-۲۳۴
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسین	-۲۵۷
کیان	مجموعه کیان	-۳۳۴

تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی صندوق‌ها

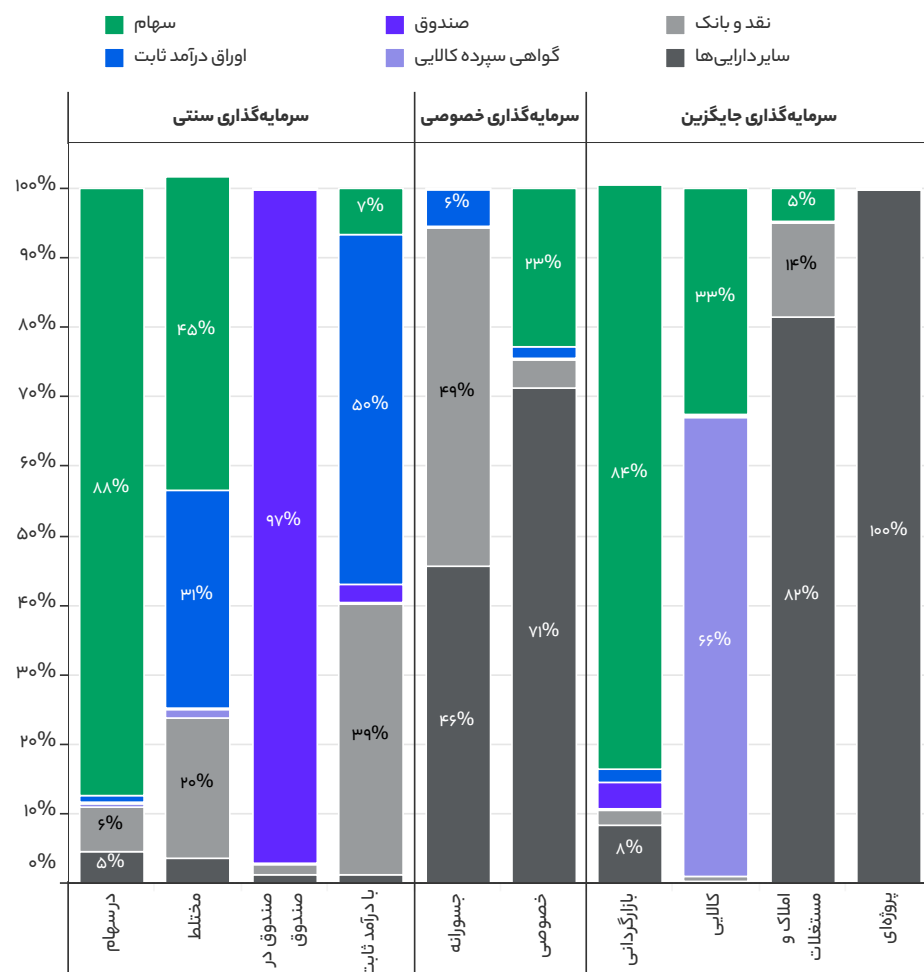
به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهام	درآمد ثابت	سپرده کالایی	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	مختلط	۴۵%	۳۱%	۱%	-	۲۰%	۳%
	صندوق در صندوق	-	-	-	۹۷%	۲%	۱%
	با درآمد ثابت	۷%	۵۰%	-	۲%	۳۹%	۱%
	در سهام	۸۸%	۱%	-	-	۶%	۵%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۶%	-	-	۴۹%	۴۶%
	خصوصی	۲۳%	۲%	-	-	۴%	۷۱%
سرمایه‌گذاری جایگزین	کالایی	۳۳%	-	۶۶%	-	۱%	-
	بازارگردانی	۸۴%	۲%	-	۴%	۳%	۸%
	املاک و مستغلات	۵%	-	-	-	۱۴%	۸۲%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۱%	۳۳%	۳%	۲%	۲۷%	۳%

ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق

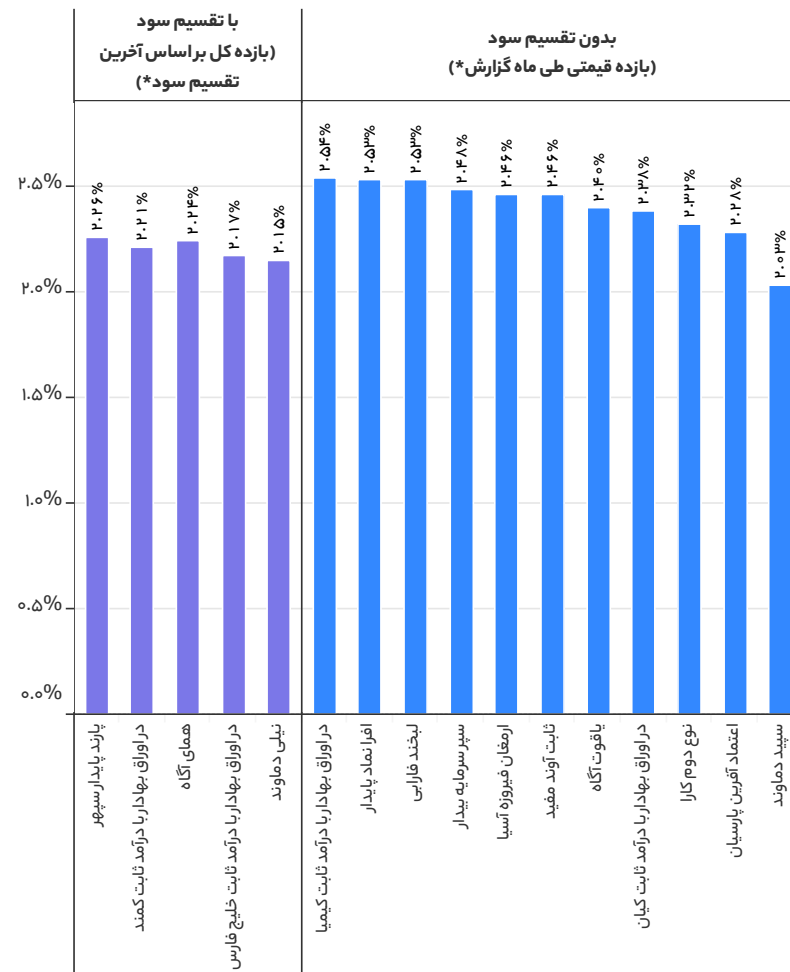


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

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	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	۶,۰۶۱	۲۵.۵%	۱۲.۹%	۶.۵%	۲.۲۵%	۲۶.۵%	۳۰.۰%
	پارند پایدار سپهر	۲,۵۹۸	۲۵.۴%	۱۳.۲%	۶.۶%	۲.۲۴%	۲۷.۱%	۳۰.۷%
	همای آگاه	۴,۱۳۹	۲۵.۳%	۱۲.۹%	۶.۶%	۲.۲۱%	۲۶.۸%	۳۰.۴%
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۵,۴۲۶	۲۵.۳%	۱۲.۸%	۶.۴%	۲.۱۳%	۲۶.۰%	۲۹.۴%
	نیلی دماوند	۶,۴۸۲	۲۴.۸%	۱۲.۶%	۶.۳%	۲.۱۰%	۲۵.۸%	۲۹.۱%
بدون تقسیم سود	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کیمیا	۶,۰۴۷	۲۸.۷%	۱۶.۲%	۷.۶%	۲.۵۴%		
	افرا نماد پایدار	۱۸,۲۹۸	۲۹.۷%	۱۴.۸%	۷.۵%	۲.۵۳%		
	لیخند فارابی	۶,۳۴۱	۲۹.۵%	۱۴.۶%	۷.۴%	۲.۵۳%		
	سپر سرمایه بیدار	۱۳,۵۲۶	۲۹.۶%	۱۴.۸%	۷.۶%	۲.۴۸%		
	ارمغان فیروزه آسیا	۹,۴۱۱	۲۹.۴%	۱۴.۶%	۷.۲%	۲.۴۶%		
	ثابت آوند مفید	۷,۹۳۰	۲۹.۰%	۱۴.۵%	۷.۳%	۲.۴۶%		
	یاقوت آگاه	۹,۵۶۵	۲۹.۰%	۱۴.۳%	۷.۲%	۲.۴۰%		
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کیان	۵,۷۷۱	۲۸.۹%	۱۴.۵%	۷.۲%	۲.۳۸%		
	نوع دوم کارا	۸,۸۷۱	۲۸.۷%	۱۴.۰%	۷.۰%	۲.۳۲%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۱۱,۸۵۲	۲۸.۱%	۱۴.۱%	۷.۱%	۲.۲۸%		
	سپید دماوند	۸,۹۸۸	۲۵.۴%	۱۲.۲%	۶.۱%	۲.۰۳%		



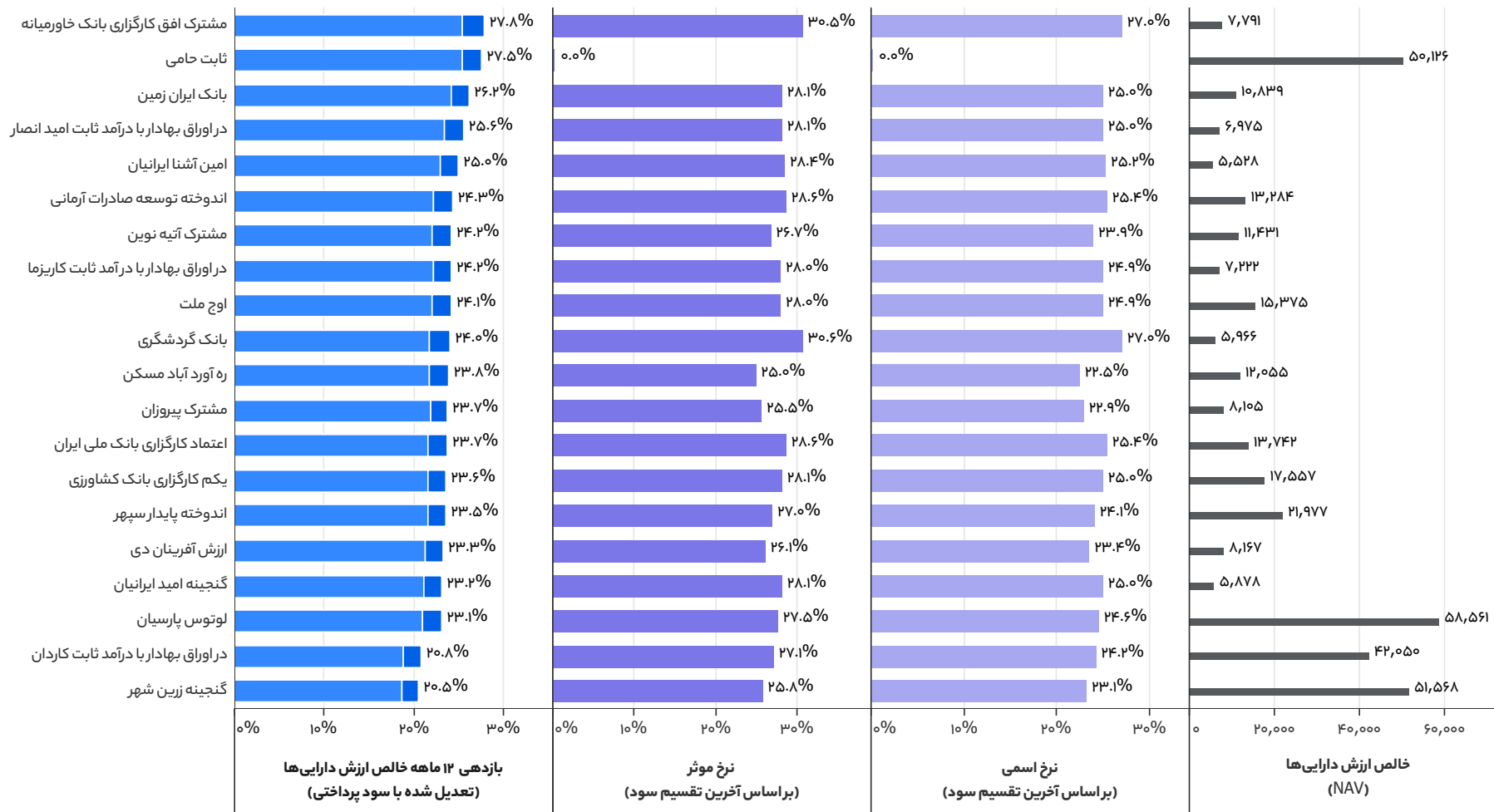
* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.

** 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 ابطالی)

بازدهی ماه گذشته بزرگترین صندوق‌های درآمد ثابت

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



 CharismaHolding

 Charisma.ir

 CharismaHolding

