

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



آبان ماه ۱۴۰۳



CHARISMA MARKET INSIGHT

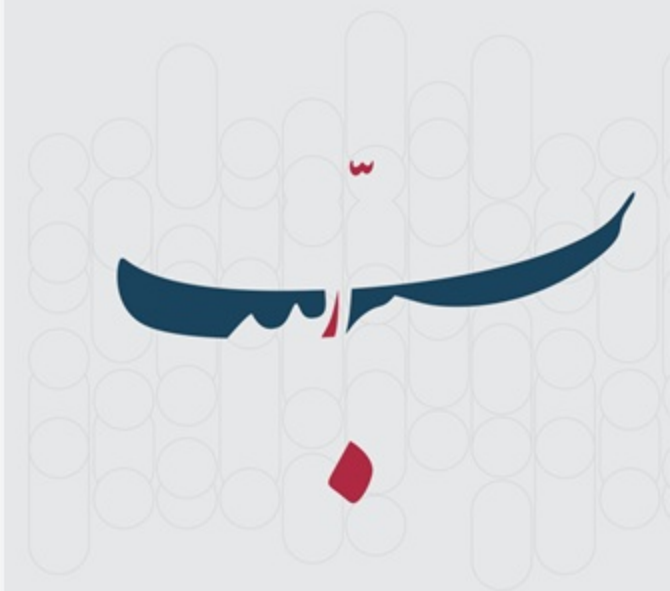
معرفی گزارش:

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 معاملات که بر مبنای اطلاعات این گزارش انجام گیرد، مسئولیتی نمی‌پذیرد. گزارش پیش رو بر مبنای اطلاعات و داده‌های موجود در منابع متعددی تهیه شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما در خصوص صحت اطلاعات مزبور نیز مسئولیتی بر عهده نخواهد داشت.

کلیه حقوق مادی و معنوی این گزارش متعلق به گروه مالی کاریزما می‌باشد.



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

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

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

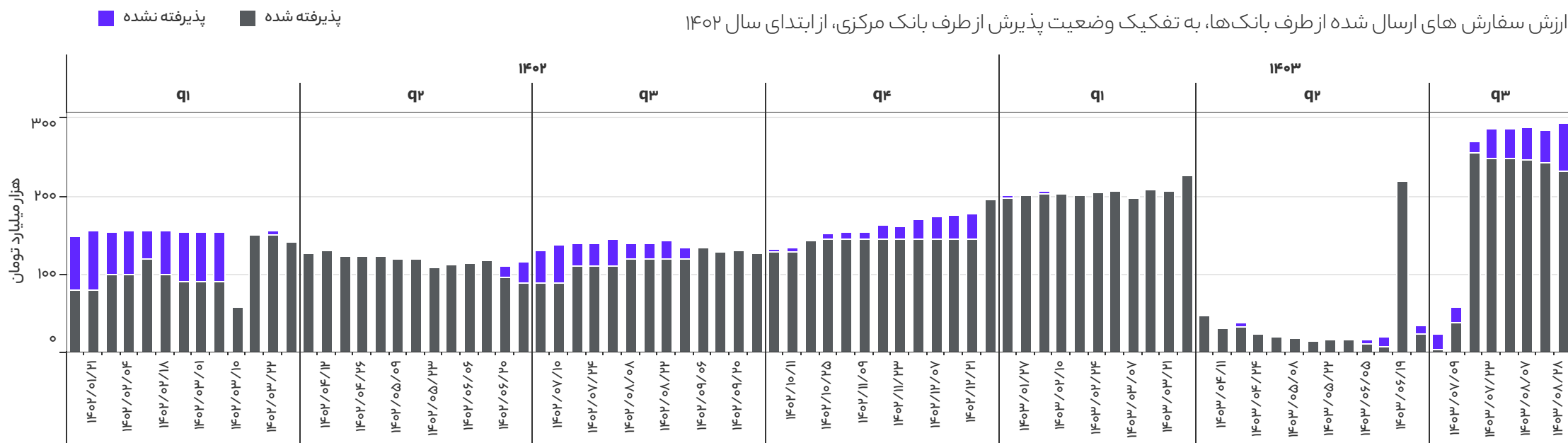


ECONOMY

سیاست‌های پولی

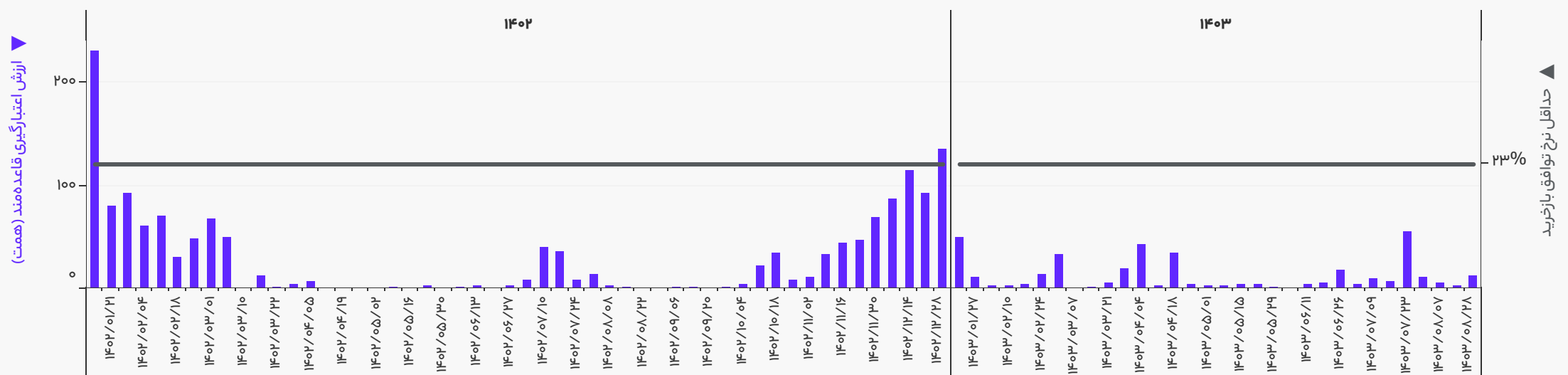
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

ارزش سفارش‌های ارسال شده از طرف بانک‌ها، به تفکیک وضعیت پذیرش از طرف بانک مرکزی، از ابتدای سال ۱۴۰۲



تامین مالی بانک‌ها از بانک مرکزی

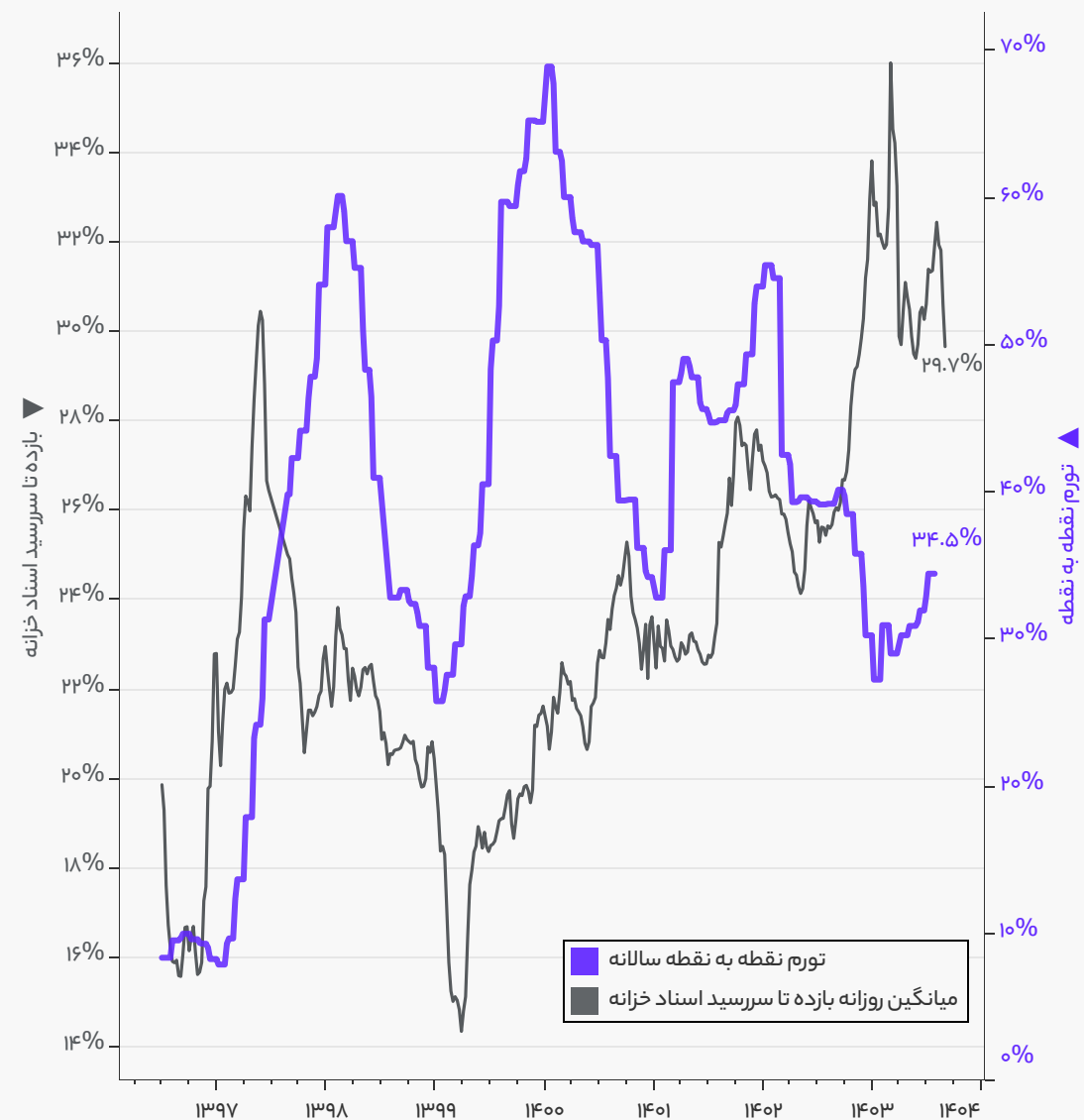
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق بازخريد، از ابتدای سال ۱۴۰۲



سیاست‌های پولی

تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

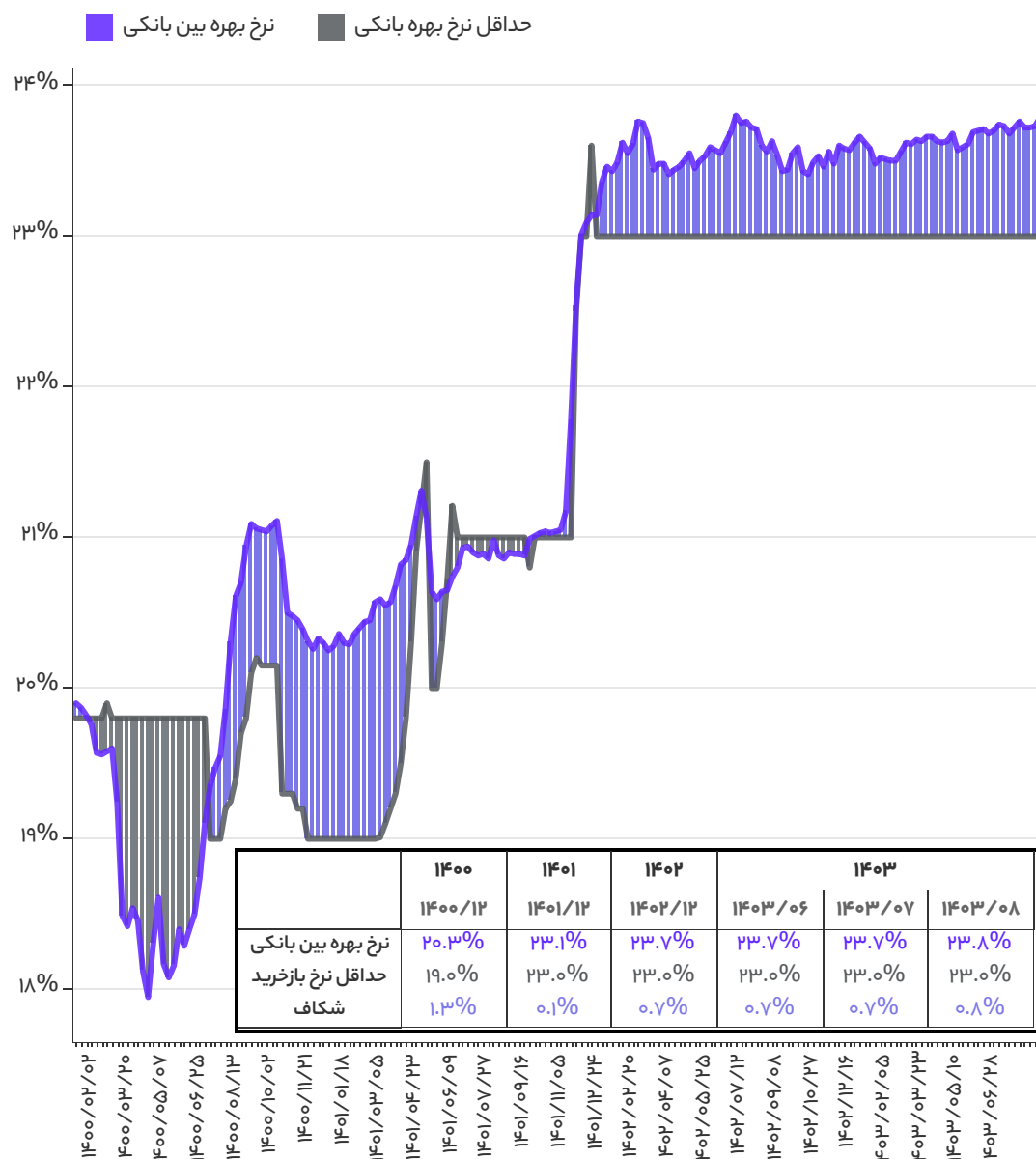
تورم نقطه به نقطه سالانه، در برابر میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف*، از مهر ۱۳۹۶، روزانه، بزرگنمایی شده



* 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

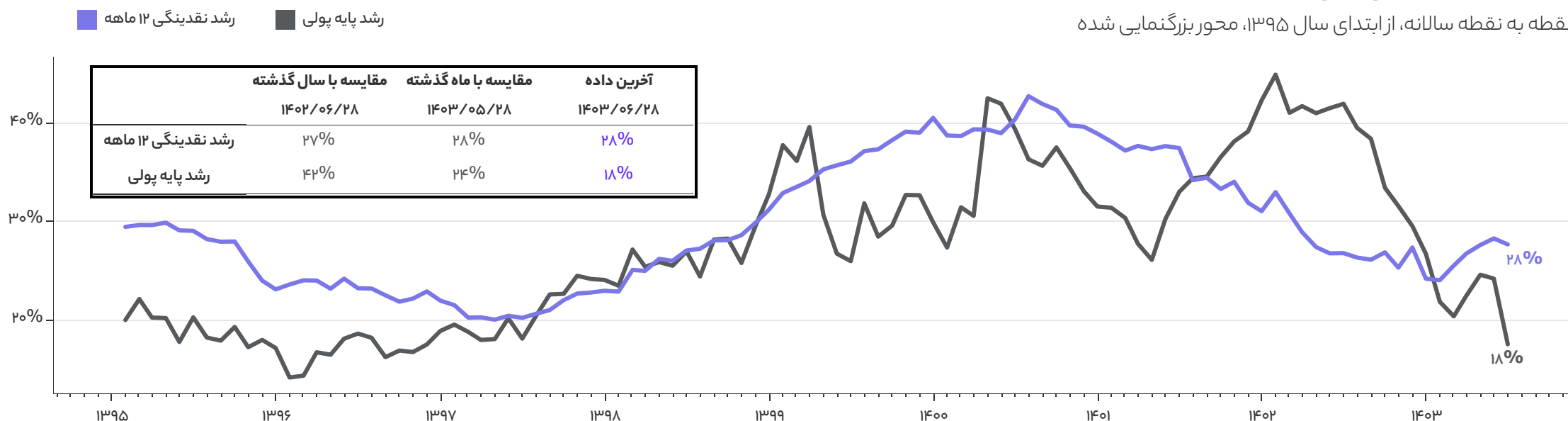
شکاف بین نرخ بهره بین بانکی و حداقل نرخ بهره بانکی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



پایه پولی و نقدینگی

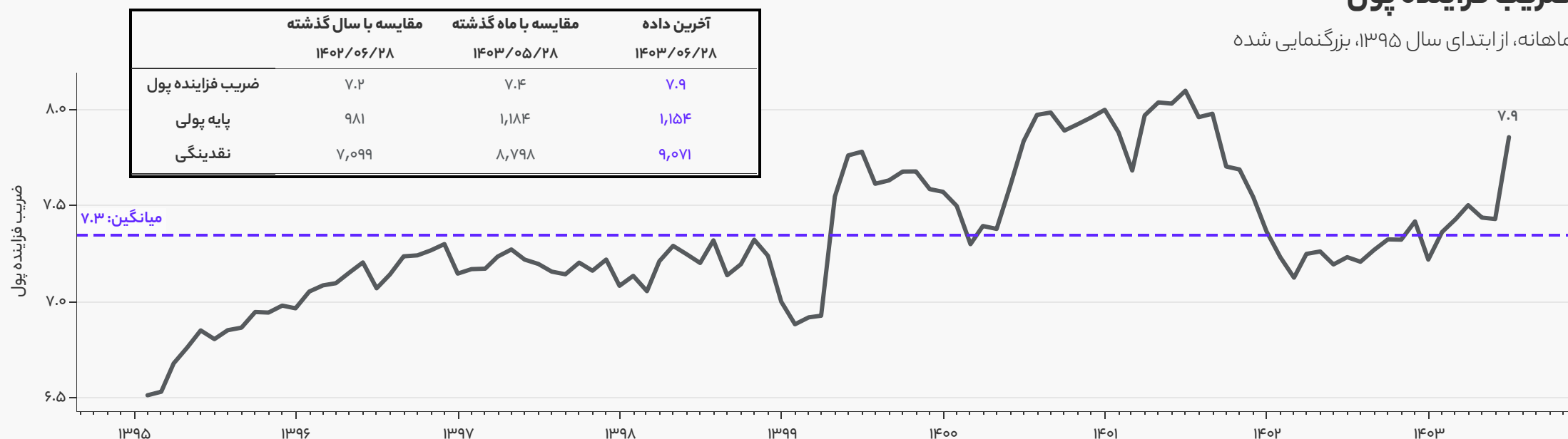
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

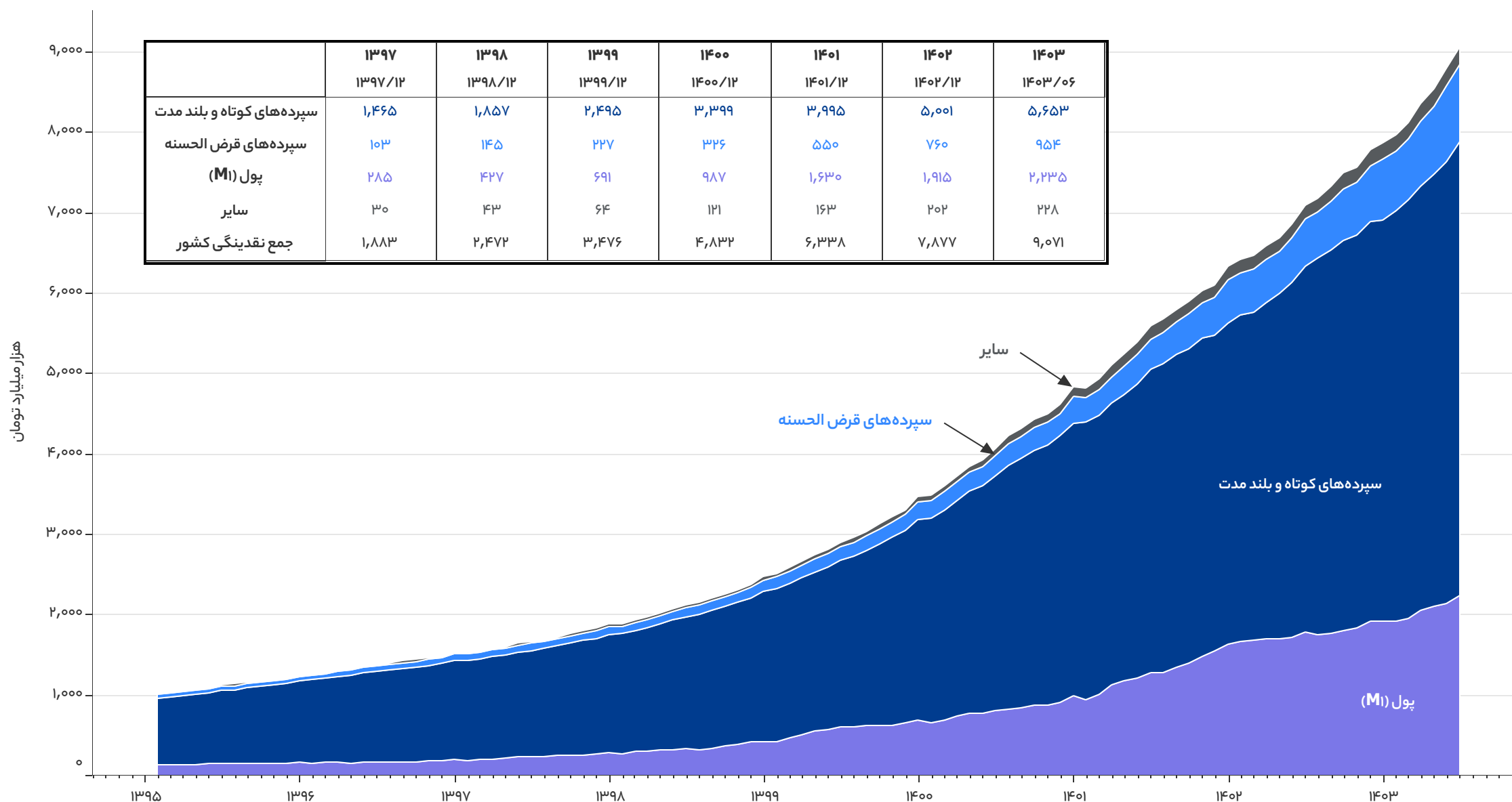


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

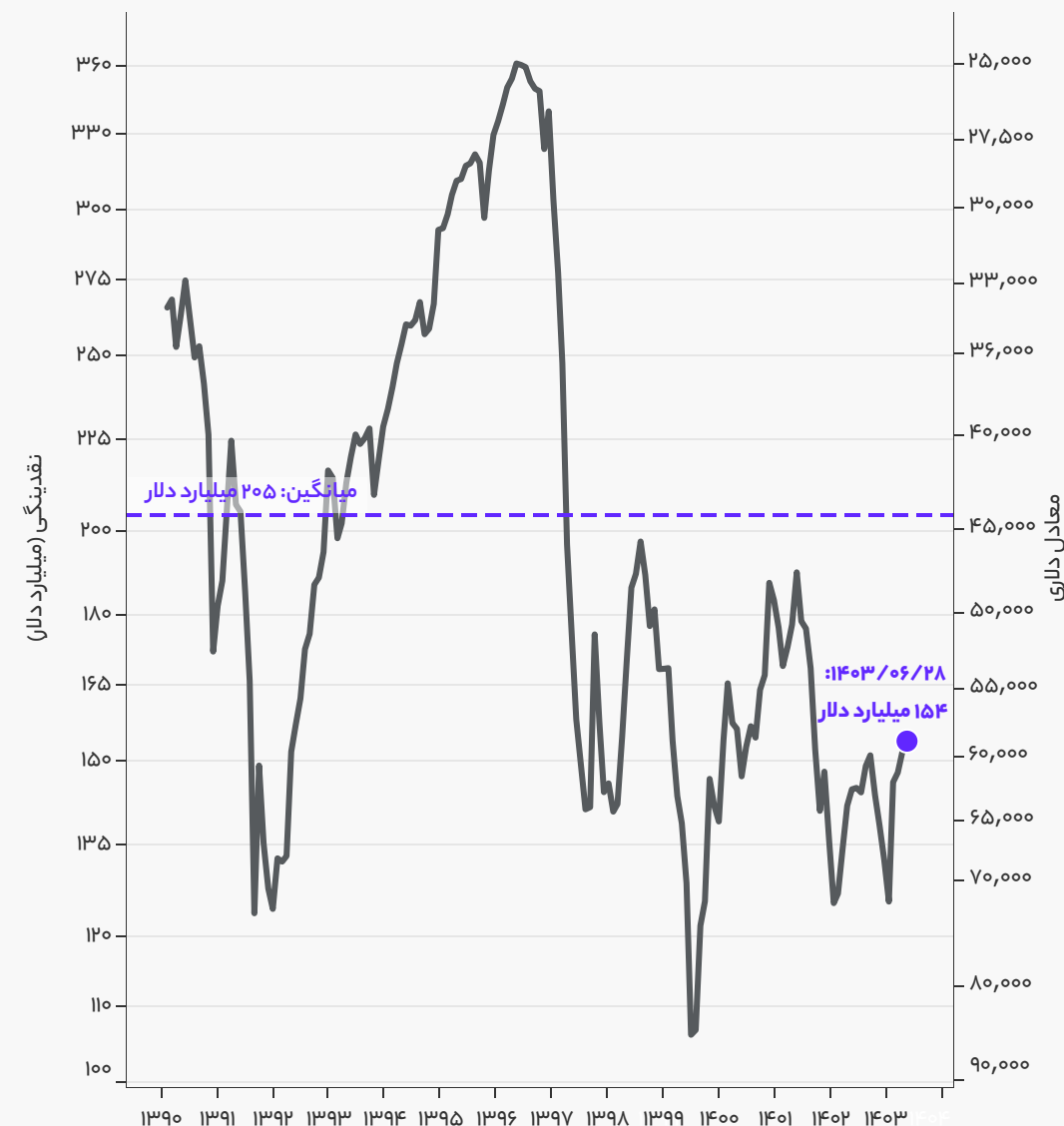
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، (براساس آخرین داده‌ی منتشر شده توسط بانک مرکزی)، هزار میلیارد تومان



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

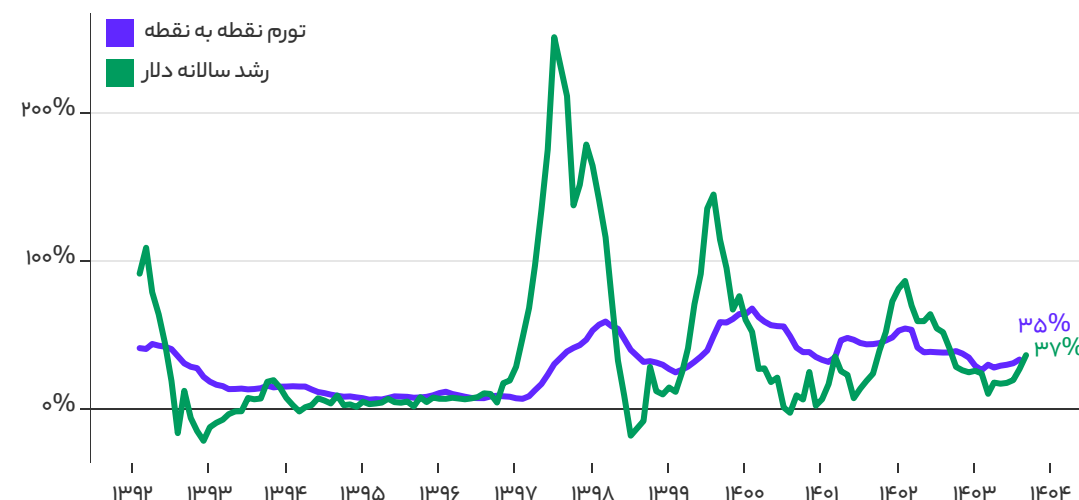


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

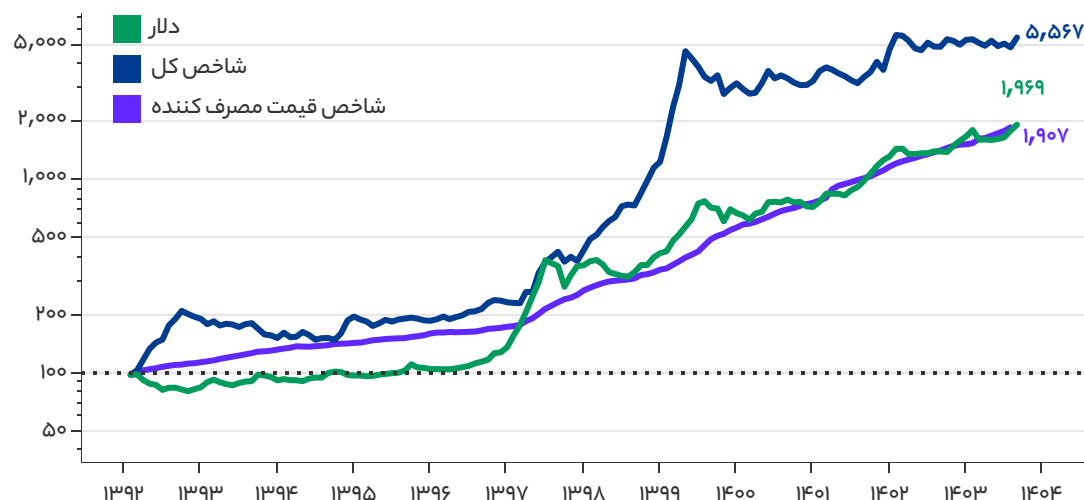
تورم و رشد دلار

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

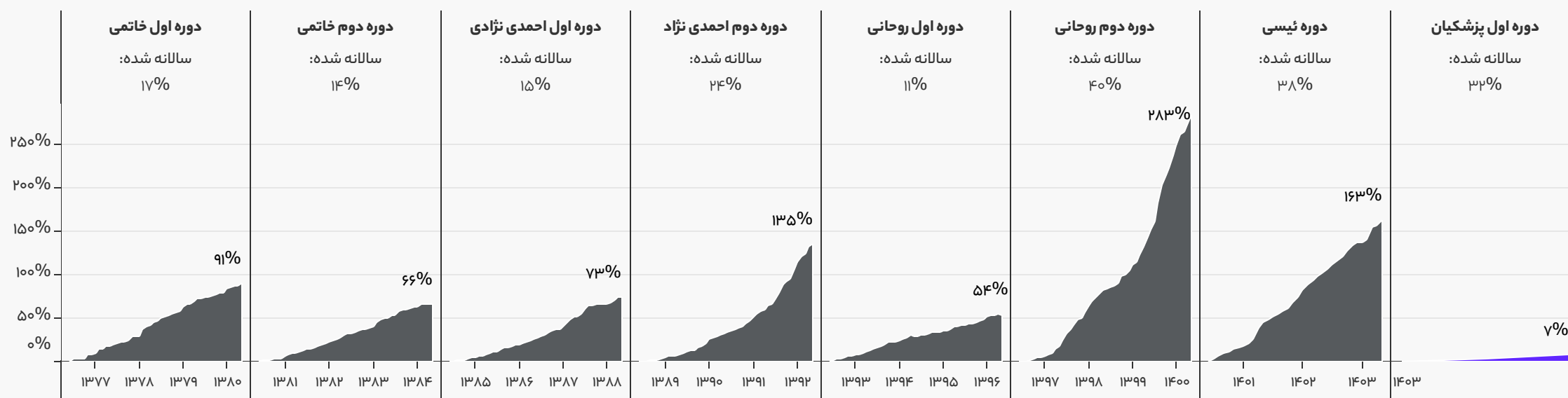


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

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 سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

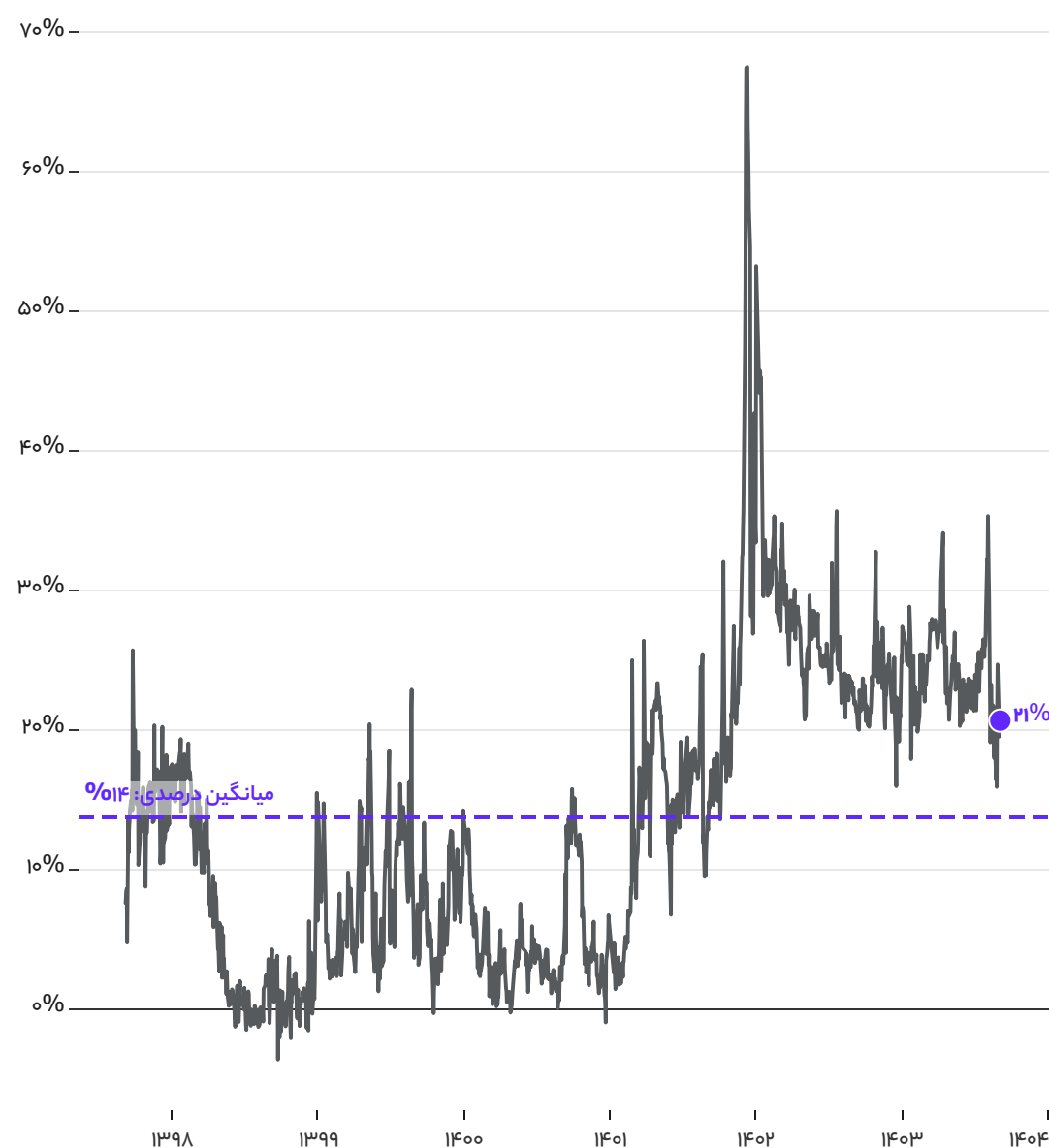
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



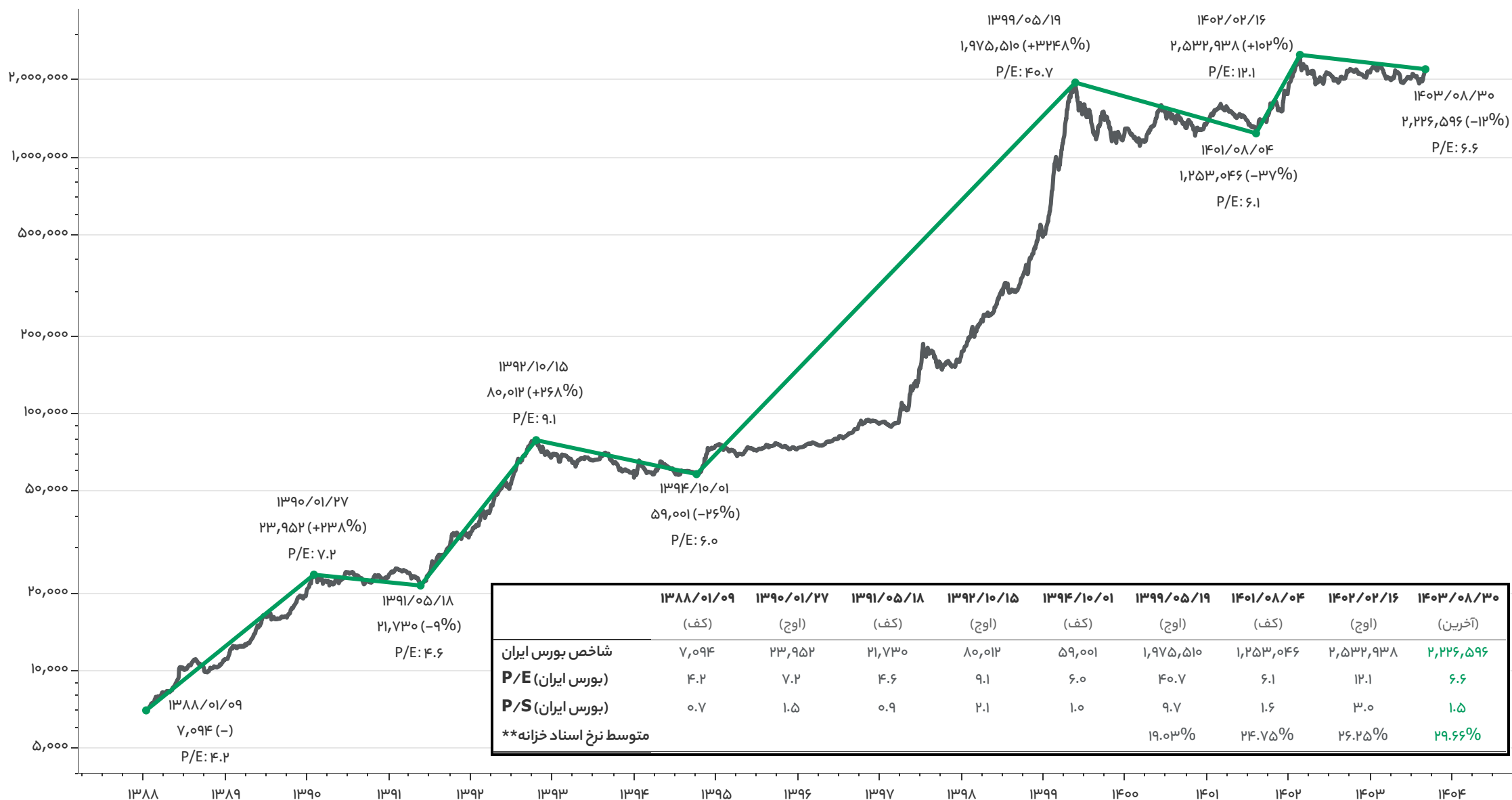


EQUITY

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



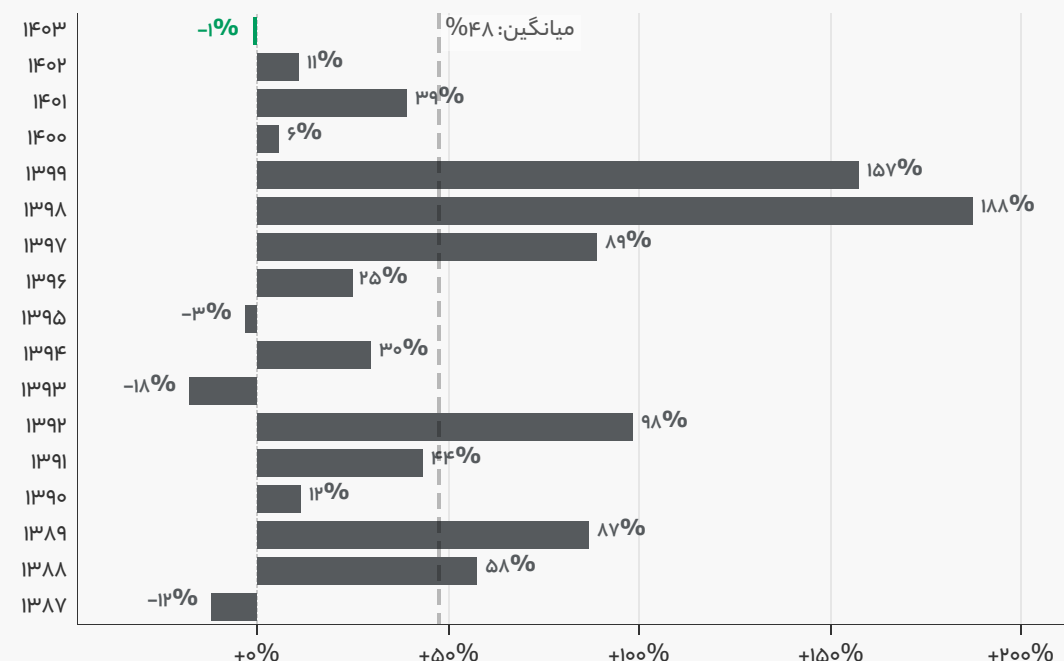
* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور، که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.

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

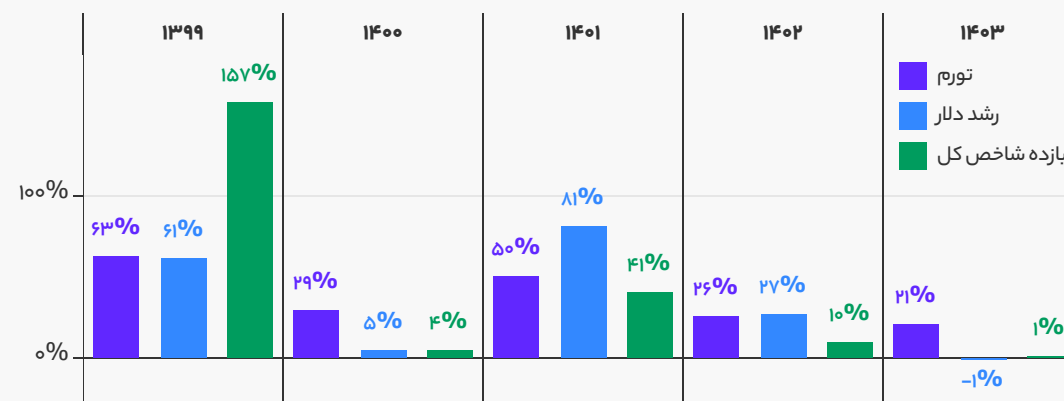
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

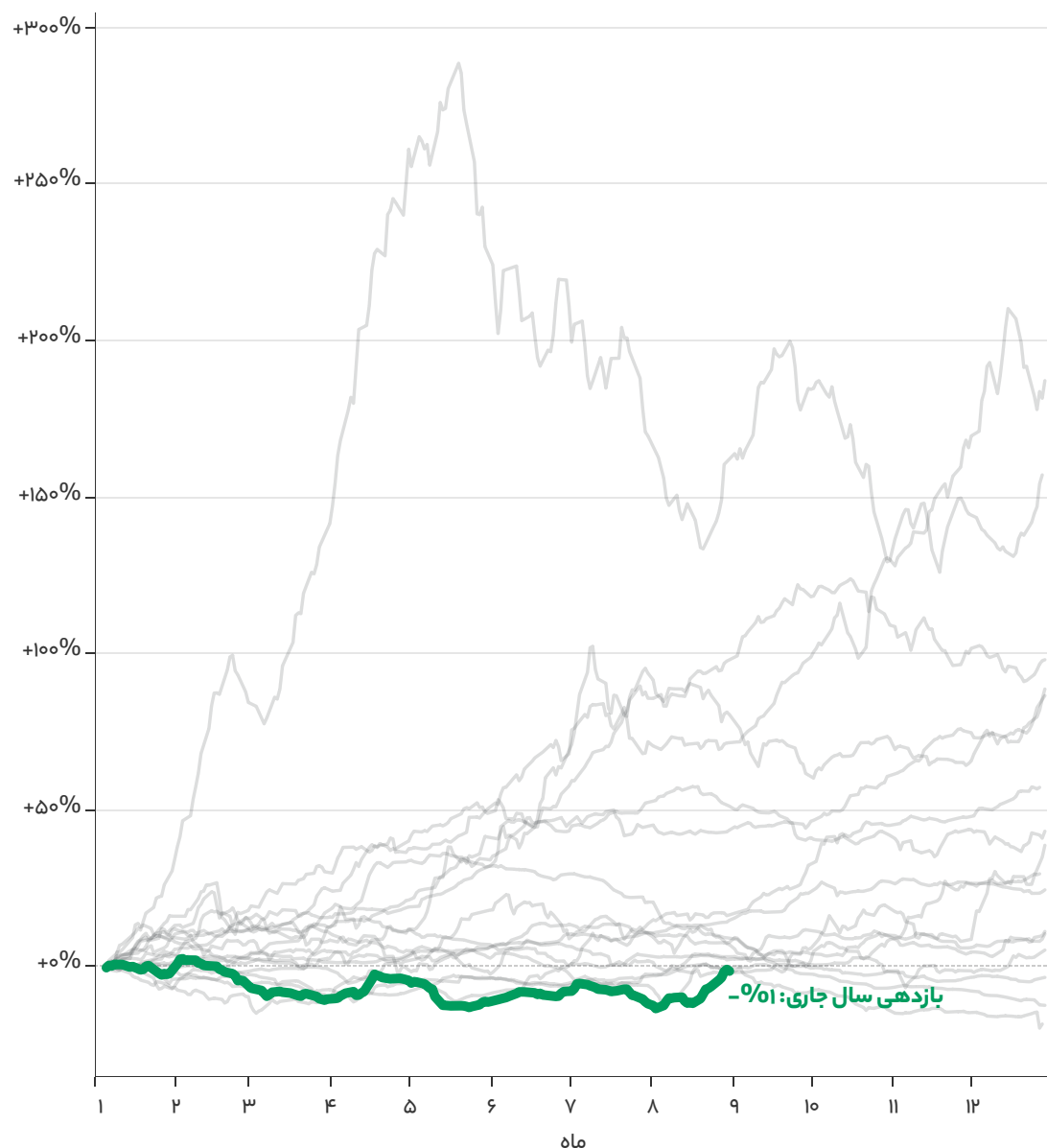


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



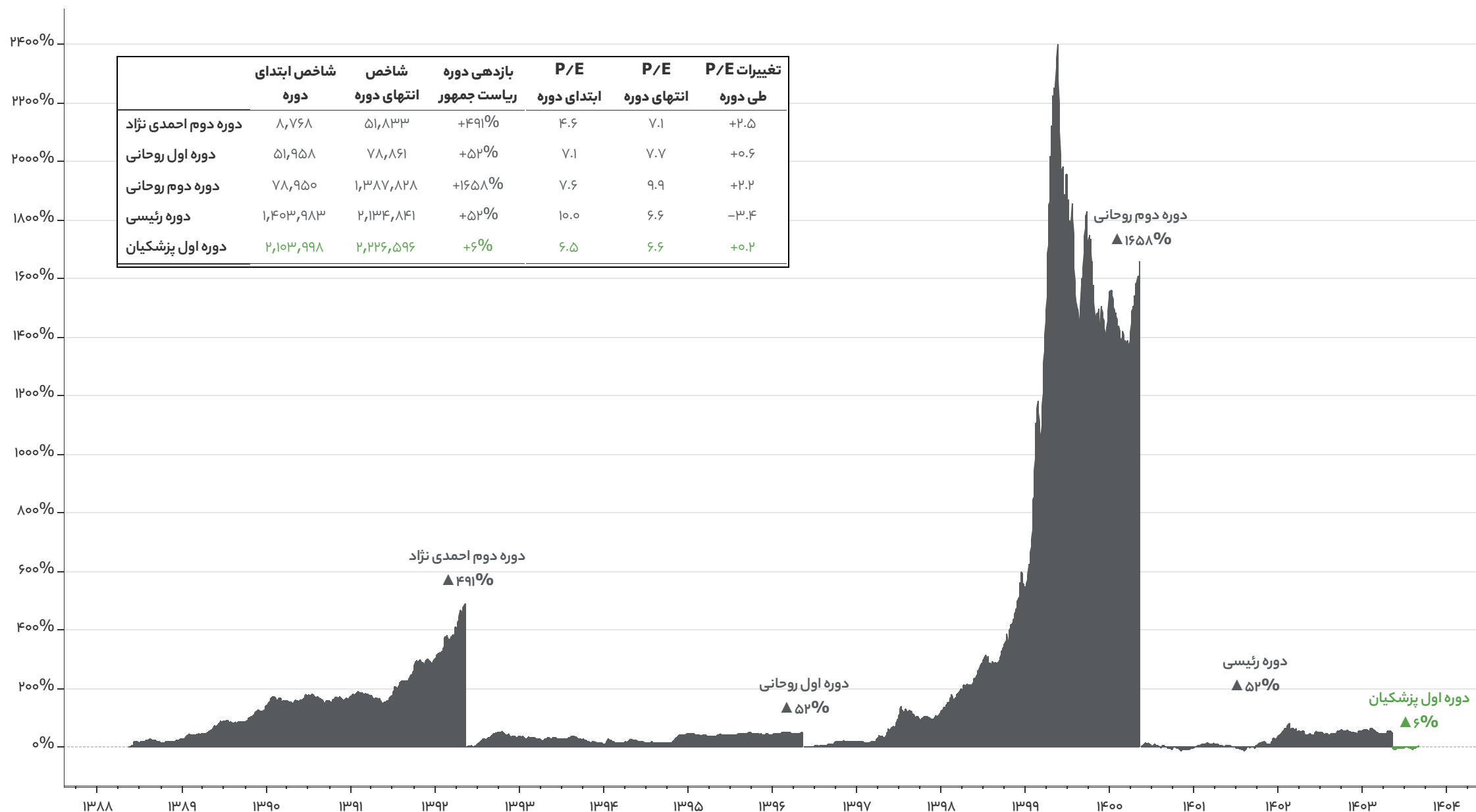
مقایسه بازدهی سال جاری

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



بررسی بلند مدت بازار سهام

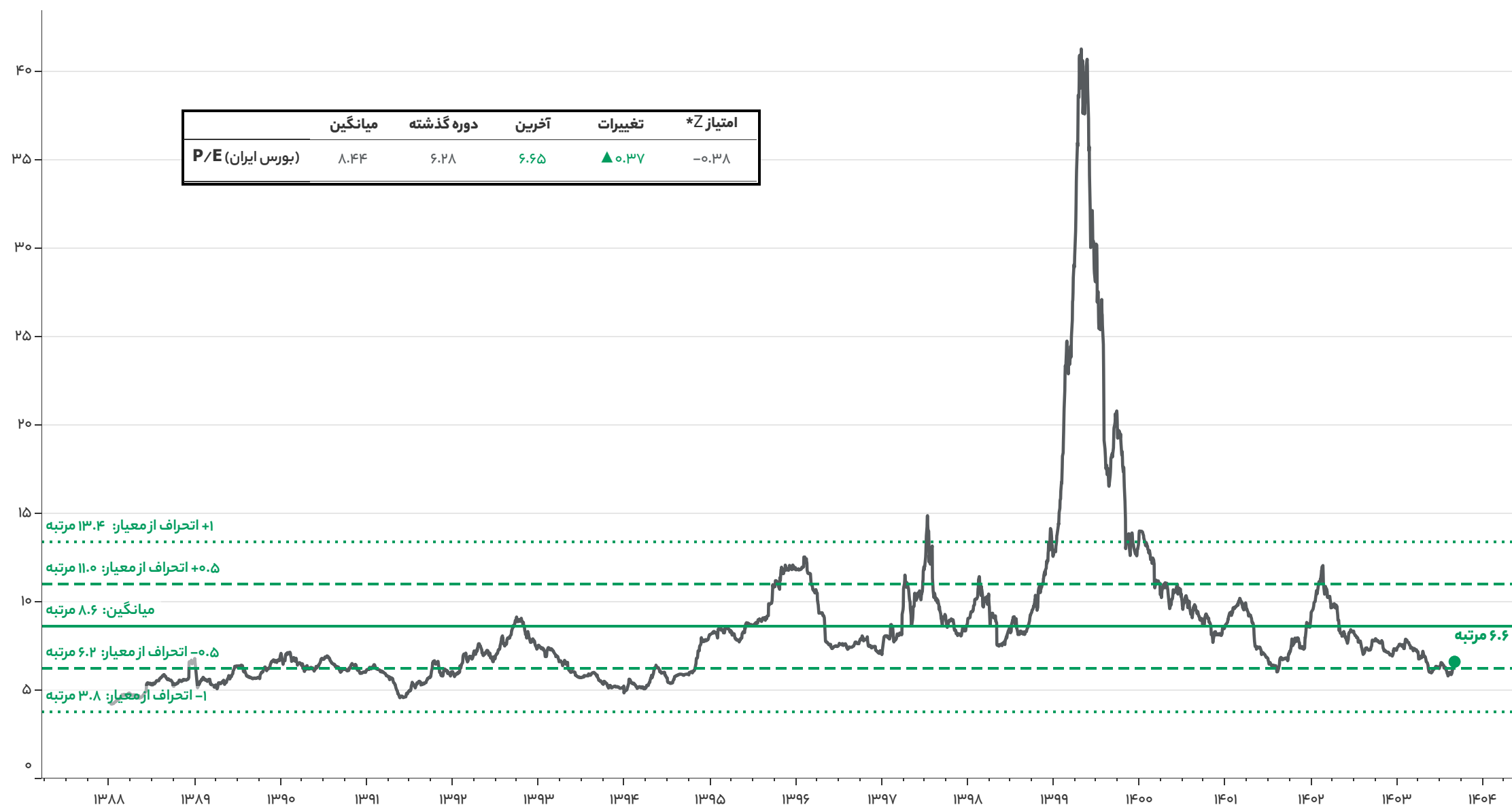
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



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.

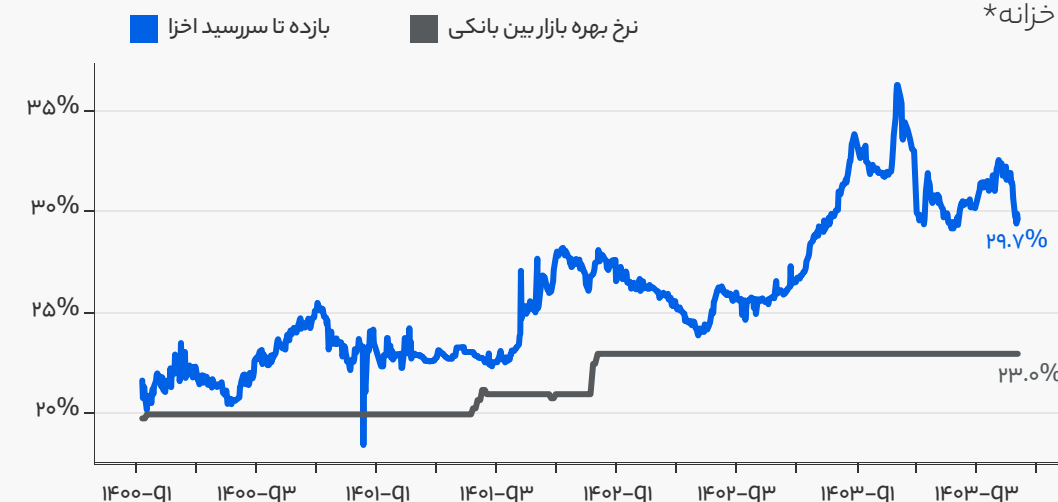


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

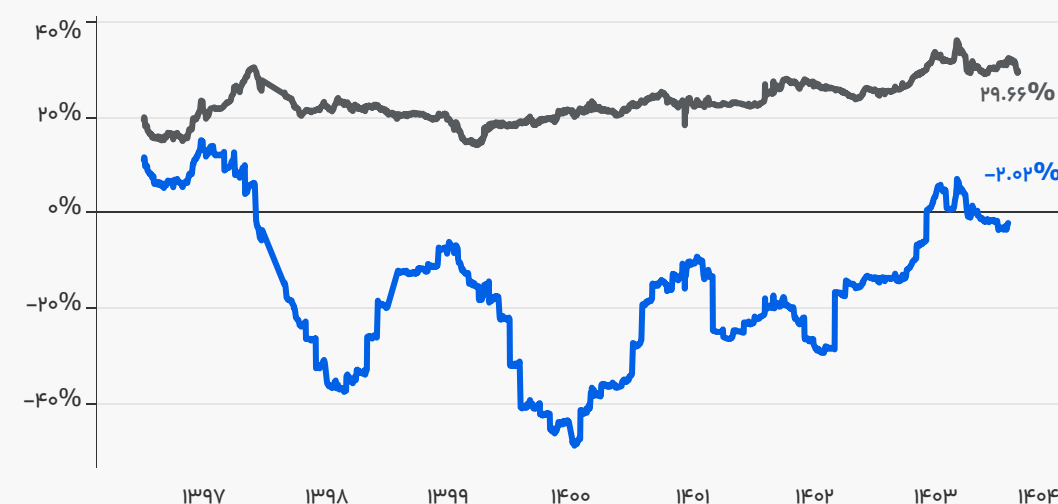
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

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



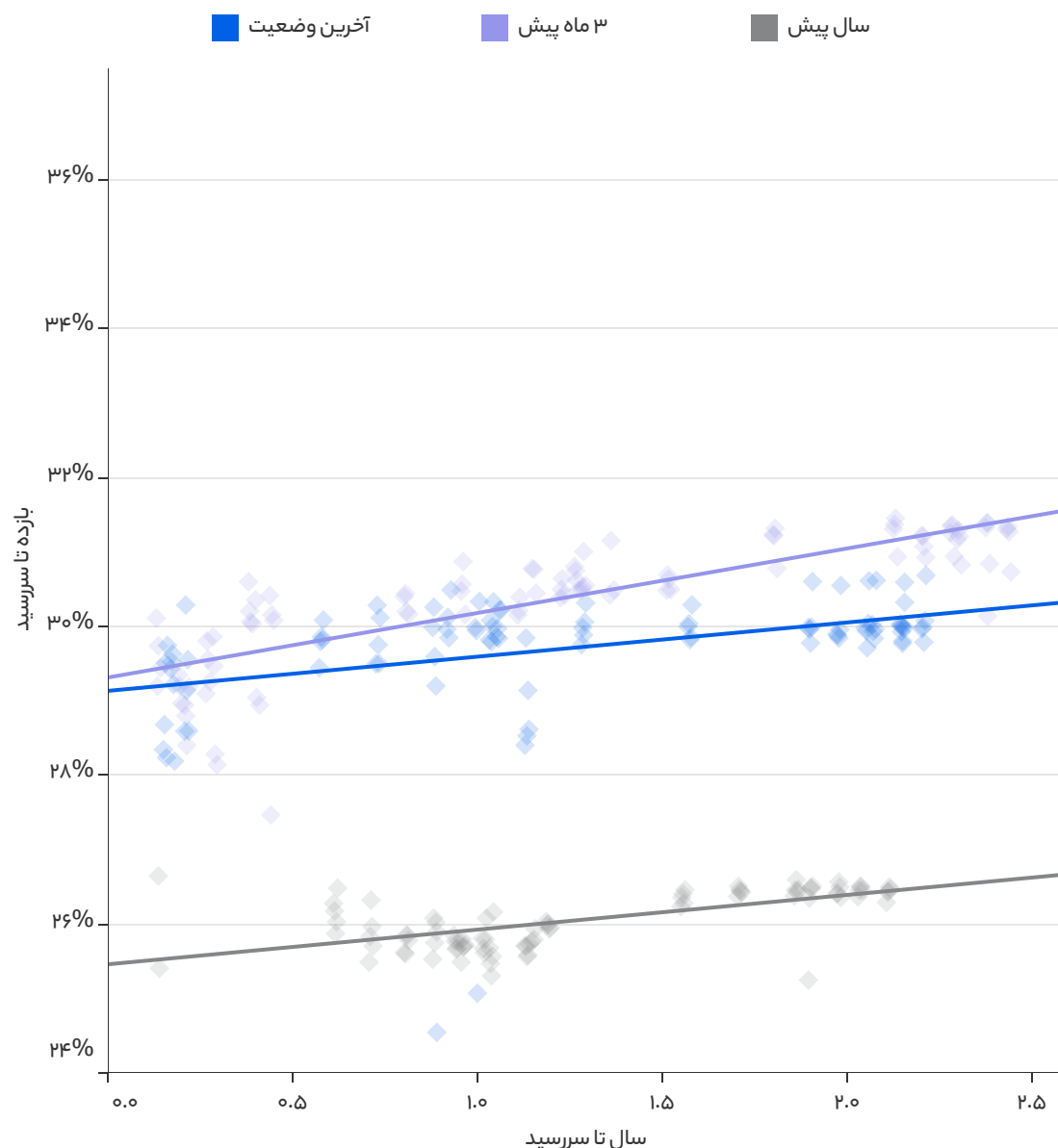
* میانگین روزانه بازده تا سررسيد اسناد خزانه در سررسيدهای مختلف که پیش از ۳۰ روز تا سررسيد خود فاصله دارند.

** 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

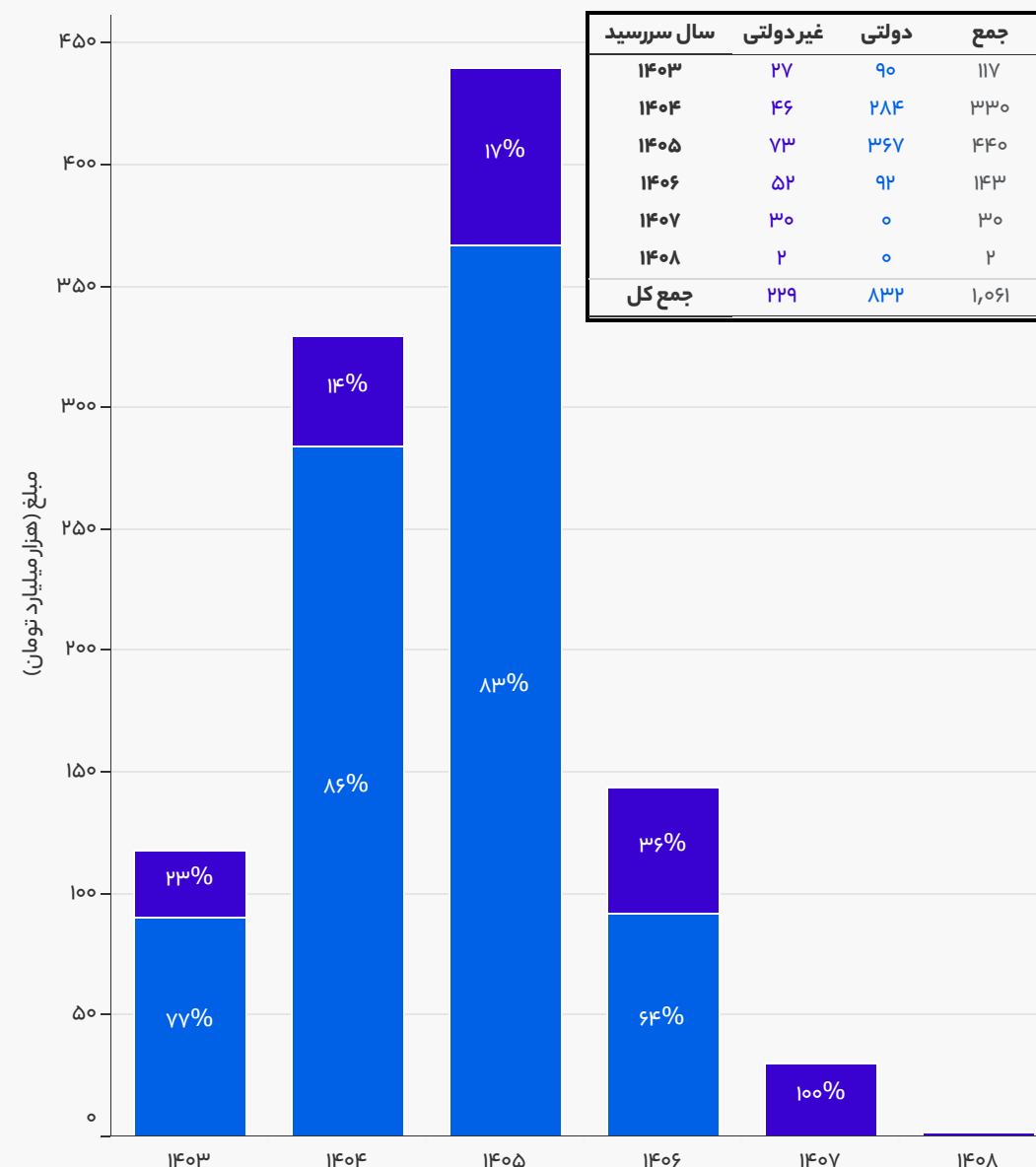
منحنی به همراه بازده تا سررسيد اسناد خزانه***، برای آخرین روز، ۳ ماه پیش و سال پیش



دید کلی بازار بدهی

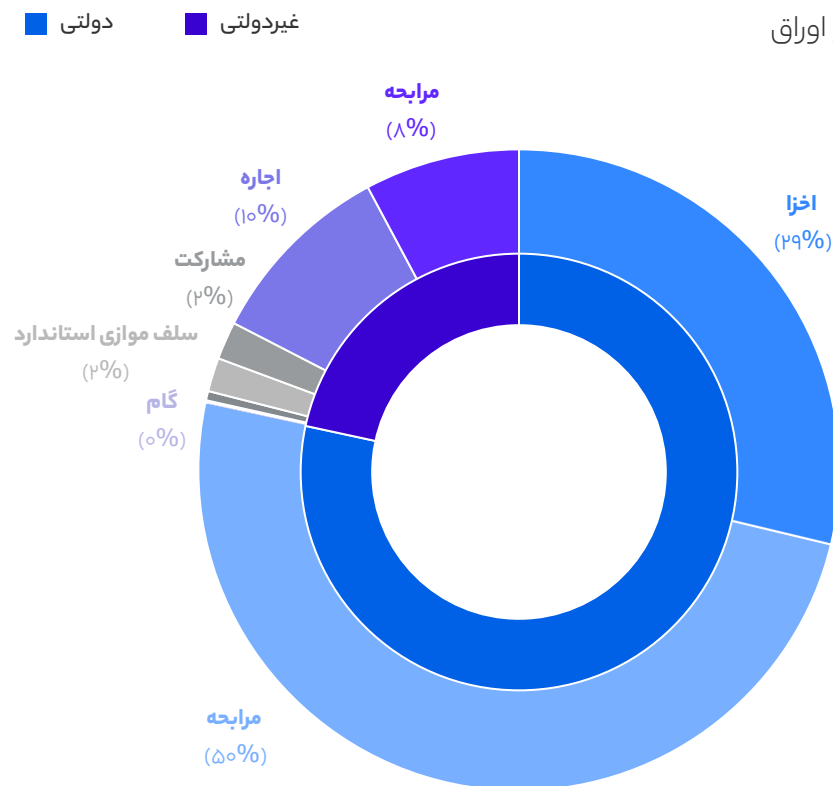
مانده اوراق به تفکیک سررسید

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	مرابحه	۵۲۷	۵۰%
	اخزا	۳۰۵	۲۹%
غیردولتی	اجاره	۱۰۲	۱۰%
	مرابحه	۸۳	۸%
	قرض الحسنه	۰	۰%
	مشارکت	۲۰	۲%
	سلف موازی استاندارد	۱۸	۲%
	منفعت	۵	۰%
	گام	۱	۰%
جمع کل		۱,۰۶۱	۱۰۰%

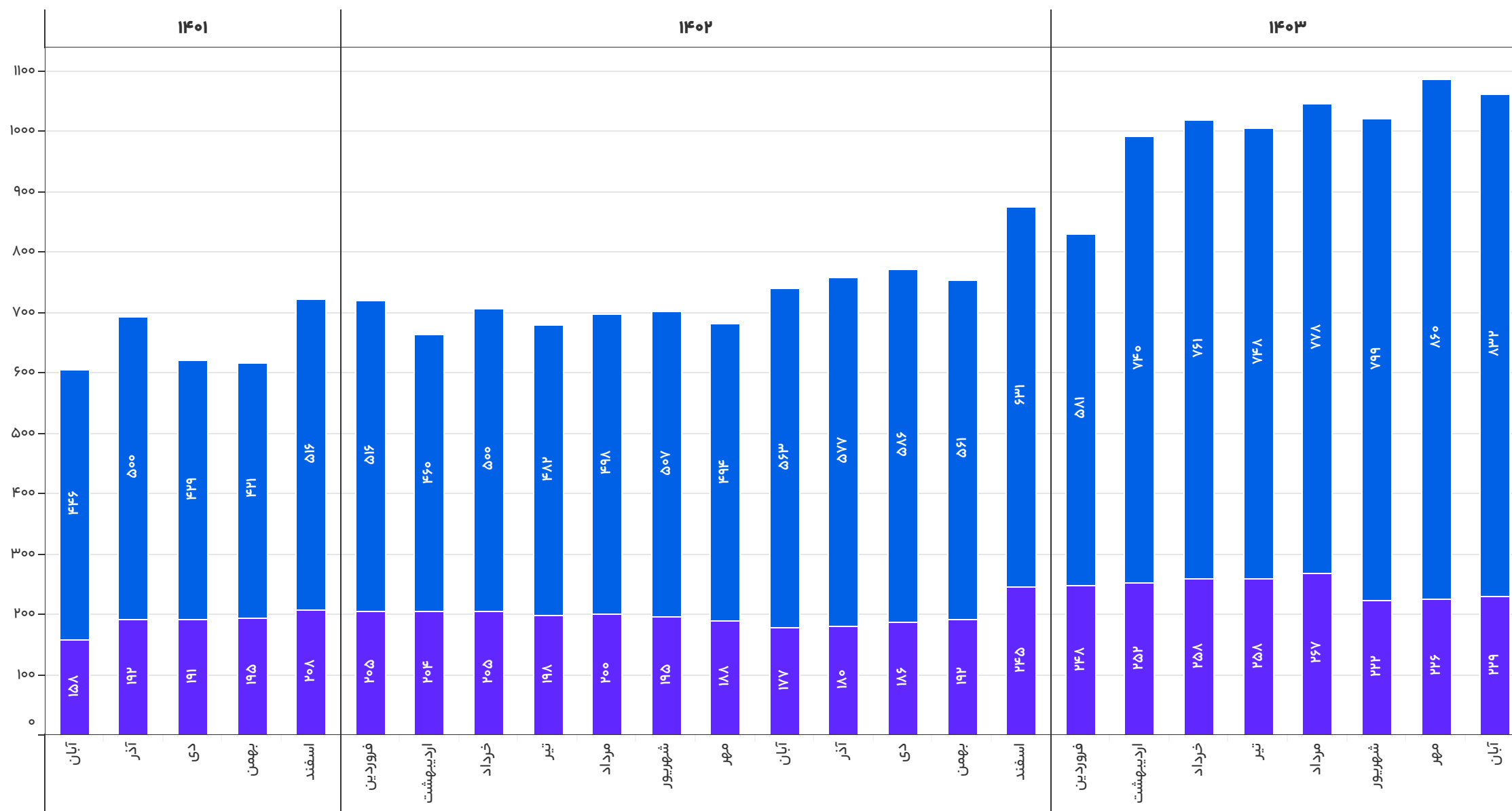
* با توجه به حجم پایین اوراق درآمد ثابت منتشر شده توسط شهرداری، ناشران در این گزارش به دو دسته دولتی و غیردولتی تقسیم شده اند.

دید کلی بازار بدهی

مانده اوراق به صورت تاریخی

به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان

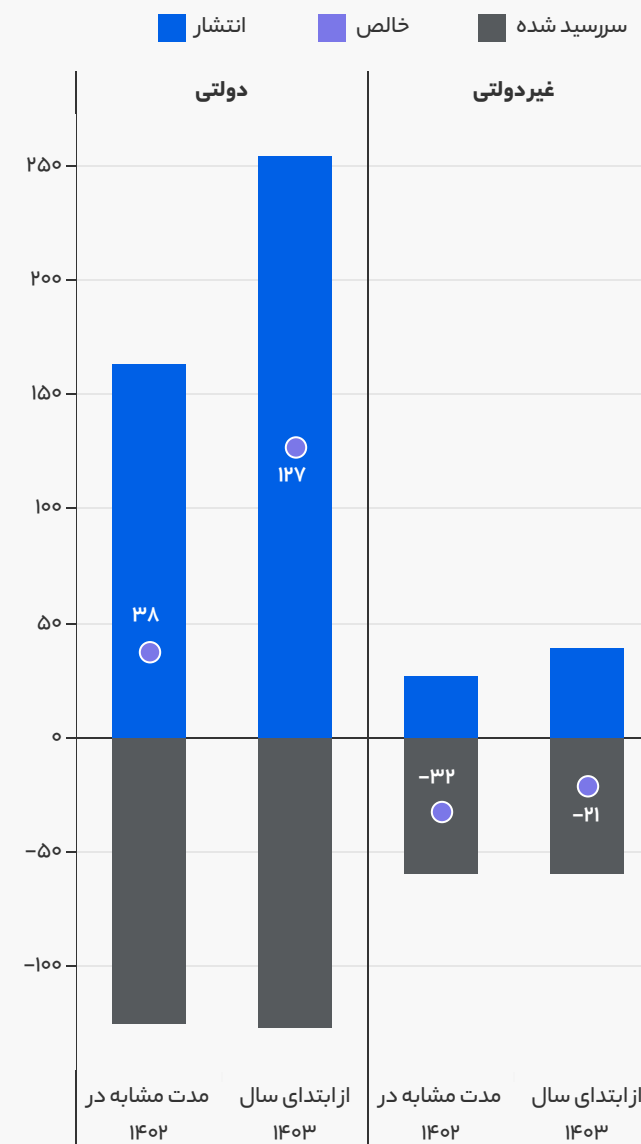
دولتی شرکتي



انتشار و تسویه اوراق

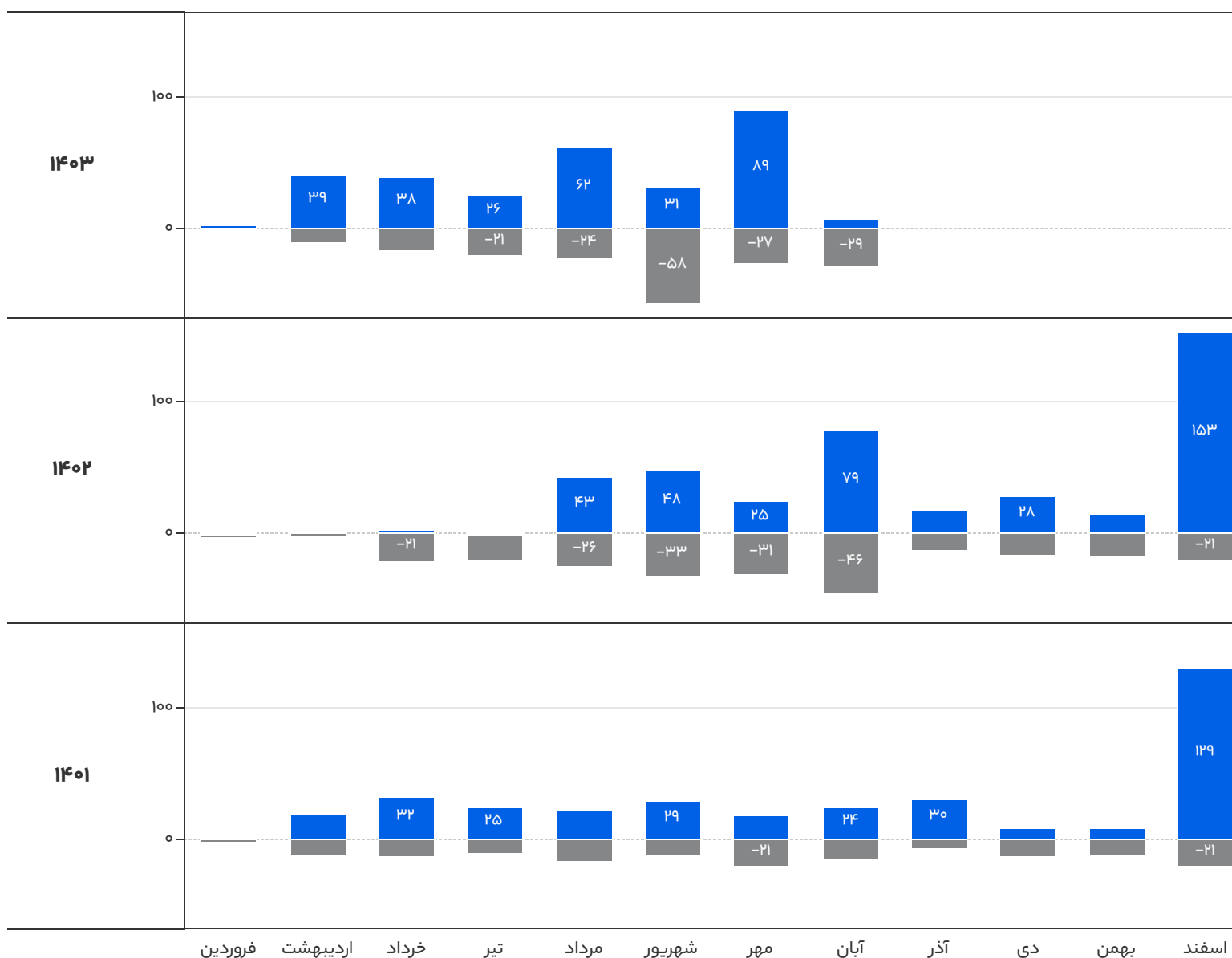
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

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

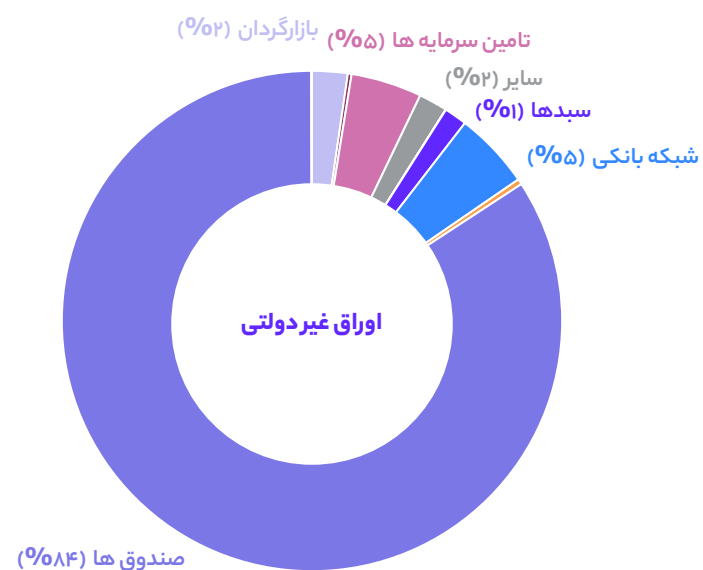
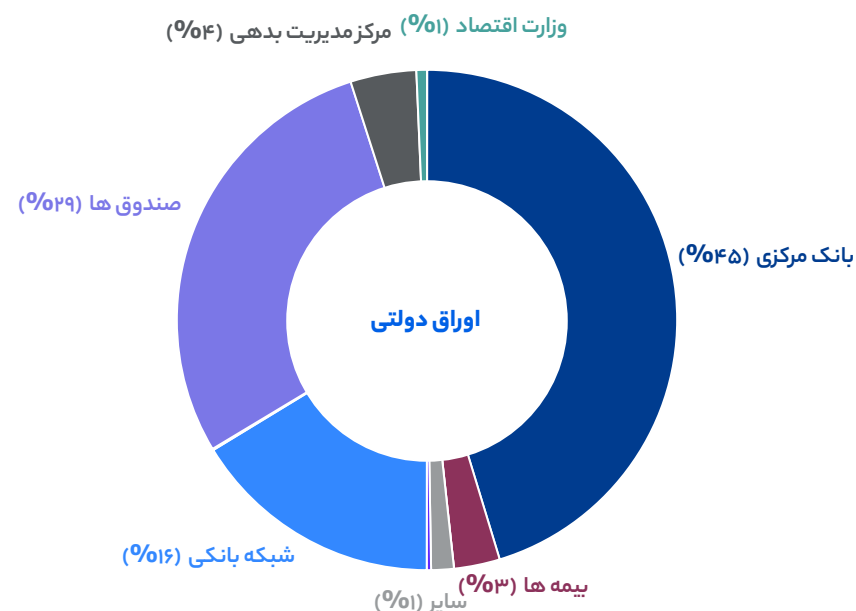
حجم اوراق منتشر و سررسید شده، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

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



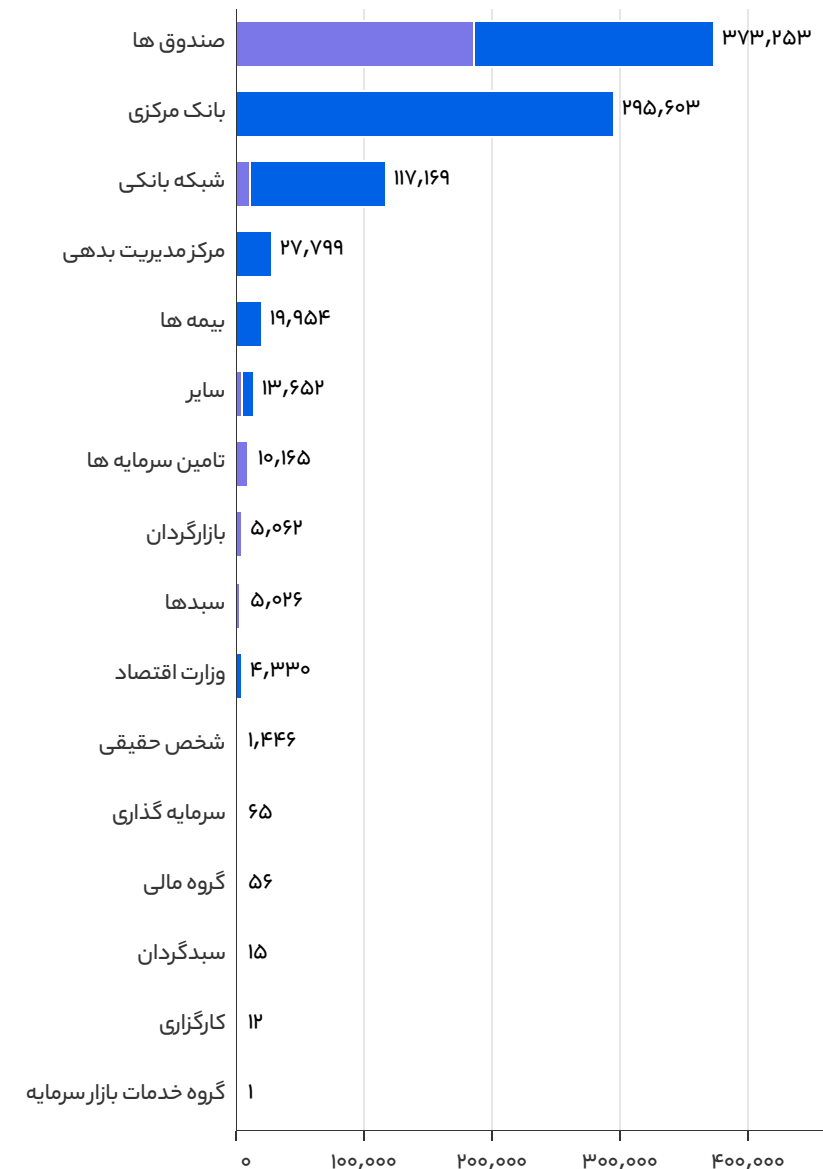
	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	۱۴۰۸	جمع کل
دولتی	بانک مرکزی	۲۲.۰	۹۳.۴	۱۳۶.۰	۴۴.۳		۲۹۵.۶
	سندوق ها	۳۴.۶	۷۴.۵	۵۶.۷	۲۱.۲		۱۸۷.۰
	شبکه بانکی	۹.۷	۴۷.۴	۳۰.۹	۱۸.۲		۱۰۶.۲
	مرکز مدیریت بدهی	۲.۲	۴.۹	۲۰.۷	-		۲۷.۸
	بیمه ها	۳.۳	۵.۱	۹.۸	۱.۲		۱۹.۴
	سایر	۰.۷	۷.۰	۱.۹	-		۹.۵
	وزارت اقتصاد	-	-	۴.۳	-		۴.۳
	سبدها	۰.۳	۰.۶	۰.۷	۰.۲		۱.۸
	شخص حقیقی	-	۰.۳	۰.۳	-		۰.۷
	تامین سرمایه ها	-	-	-	-		-
	بازارگردان	-	-	-	-		-
غیردولتی	سندوق ها	۲۲.۱	۳۶.۴	۵۸.۲	۴۴.۴	۲۳.۴	۱۸۶.۲
	شبکه بانکی	۱.۲	۰.۷	۷.۰	۱.۷	۰.۴	۱۱.۰
	تامین سرمایه ها	۰.۴	۲.۹	۲.۷	۲.۰	۲.۱	۱۰.۱
	بازارگردان	۰.۳	۱.۵	۲.۱	۰.۷	۰.۵	۵.۰
	سایر	۰.۲	۰.۳	۱.۱	۱.۳	۱.۲	۴.۱
	سبدها	۰.۶	۱.۷	۰.۳	۰.۳	۰.۴	۳.۳
	شخص حقیقی	۰.۳	-	۰.۱	۰.۲	۰.۳	۰.۸
	بیمه ها	۰.۱	۰.۱	۰.۲	۰.۱	۰.۱	۰.۶
	سرمایه گذاری	-	-	-	۰.۱	-	۰.۱
	گروه مالی	-	-	۰.۱	-	-	۰.۱
	سبدگردان	-	-	-	-	-	-
	کارگزاری	-	-	-	-	-	-
	گروه خدمات بازار سر..	-	-	-	-	-	-
جمع دولتی و غیردولتی		۹۷.۹	۲۷۶.۷	۳۳۳.۱	۱۳۵.۷	۲۸.۵	۸۷۳.۶

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی

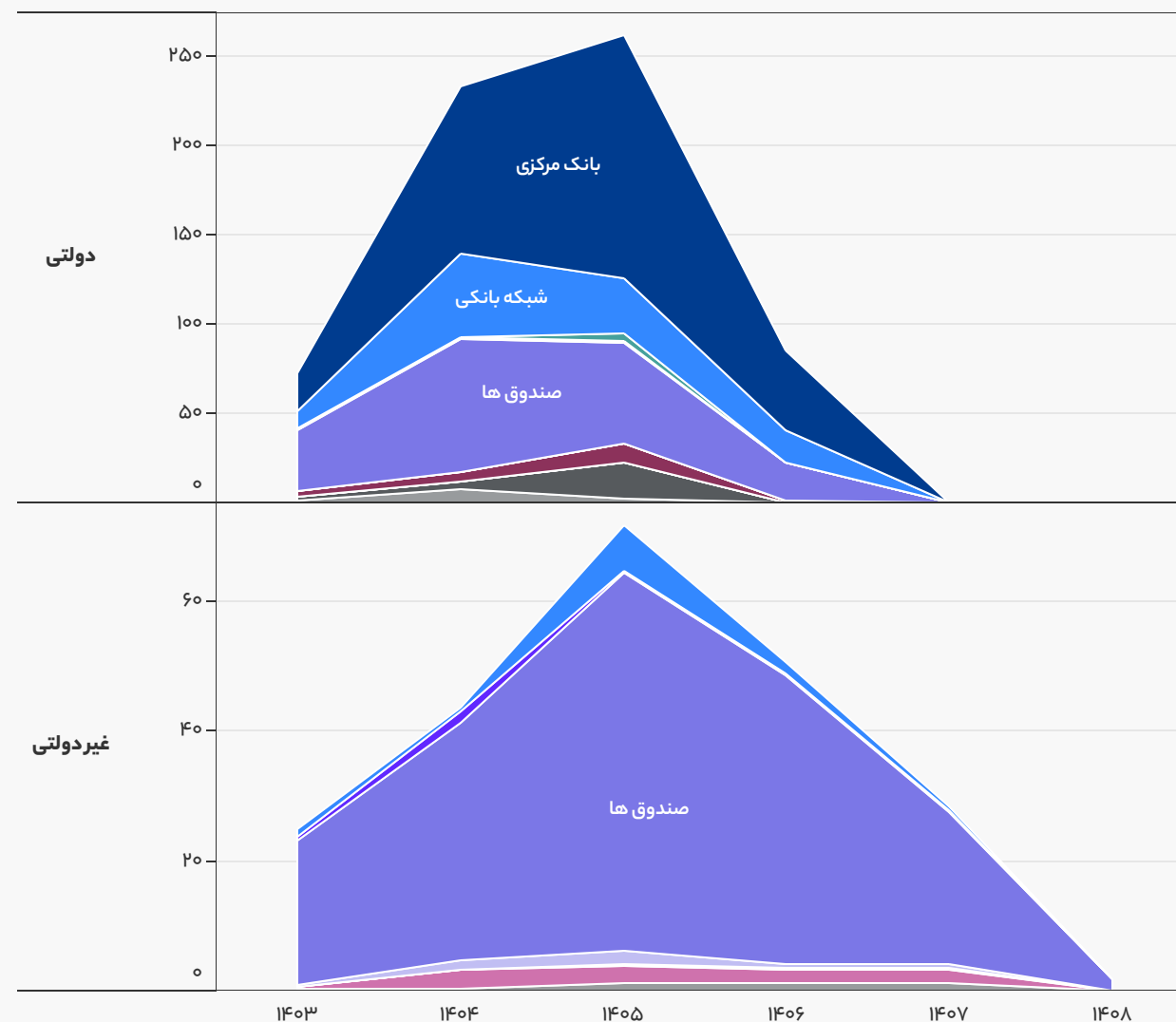
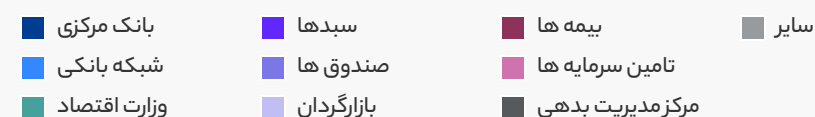


گام	منفعت	مشارکت	مراجعه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	اجاره
۶۲	۴,۵۸۲	۱۶,۲۰۱	۱۹۶,۵۲۷	۰	۱۳,۶۶۹	۶۰,۵۱۳	۸۱,۶۹۹
۰	۰	۰	۲۷۲,۲۲۲	۰	۰	۲۳,۳۸۱	۰
۰	۹۳	۰	۸۴,۳۷۹	۰	۷۲۶	۲۵,۷۰۵	۶,۲۶۷
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۲۷,۷۹۹	۰
۰	۰	۰	۸,۶۷۸	۴۰	۵۳	۱۰,۹۰۴	۲۷۹
۲۸	۰	۴۸۹	۷۷۲	۵۳	۳۸۴	۹,۳۳۴	۲,۵۹۲
۰	۹۵	۳۷۱	۲,۸۴۰	۲	۵۱۲	۰	۶,۳۴۵
۰	۱۰۷	۲۷	۲,۰۳۲	۱	۸۸۲	۰	۲,۰۱۳
۰	۰	۲,۲۲۷	۱,۲۷۶	۰	۱۱۴۳	۱,۱۳۳	۲۴۸
۰	۰	۰	۱۵	۰	۰	۰	۰
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۶۵
۰	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۱۰
۰	۰	۰	۱	۰	۰	۰	۰
۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰
۰	۰	۰	۴,۳۳۰	۰	۰	۰	۰
۰	۰	۲۱۲	۳۳۰	۰	۱۰۹	۶۶۰	۱۳۵
۹۰	۴,۸۷۷	۱۹,۵۲۷	۵۷۳,۴۵۸	۹۸	۱۶,۴۷۷	۱۵۹,۴۲۸	۹۹,۶۵۲

بازیگران کلیدی بازار بدهی

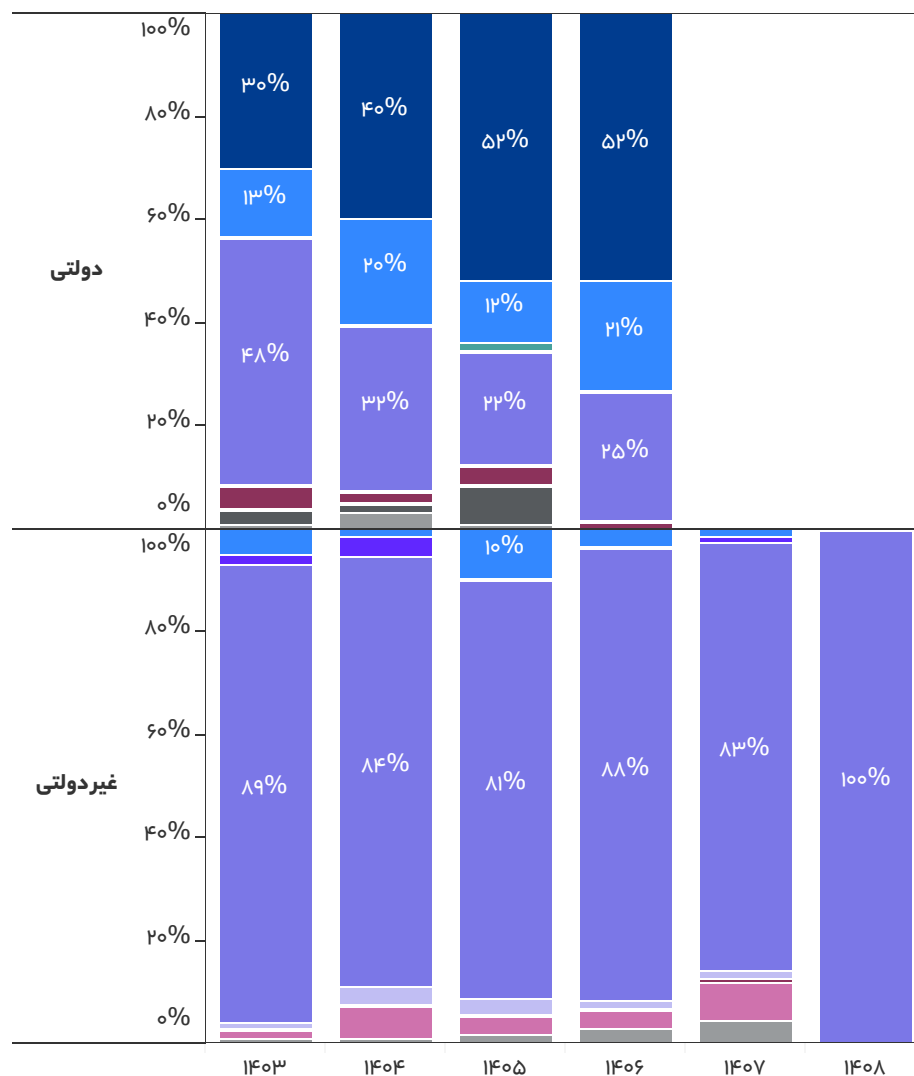
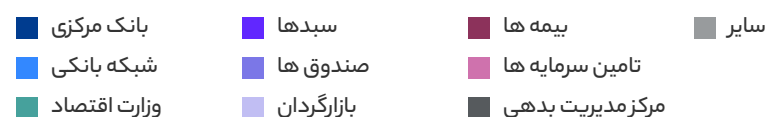
دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

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



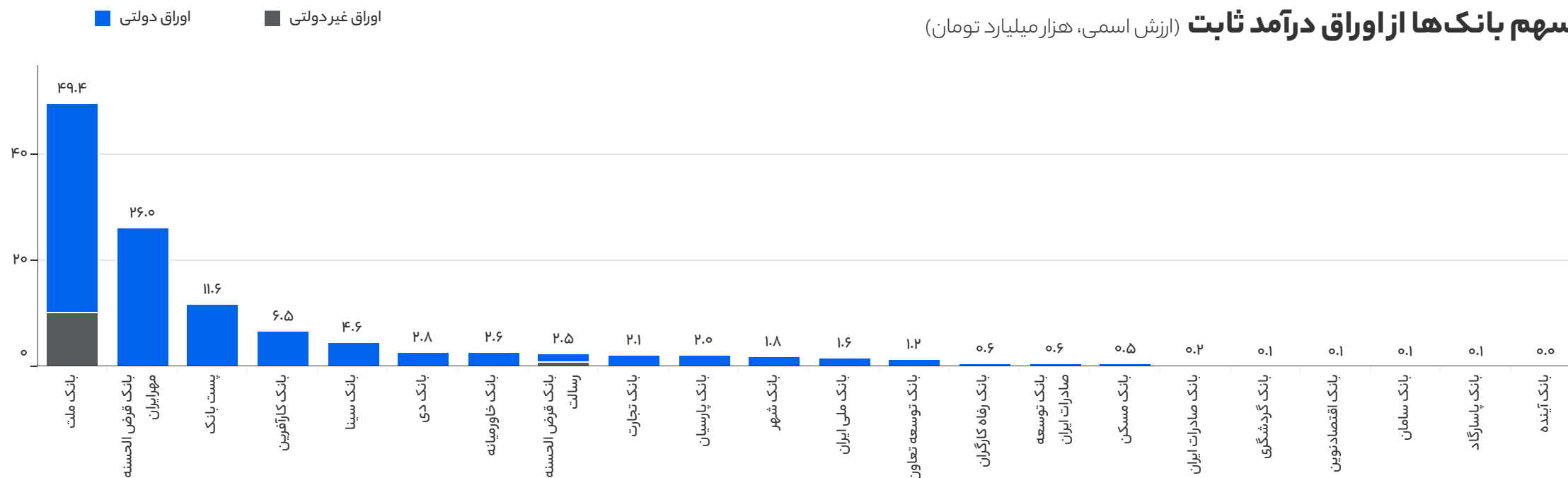
سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

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

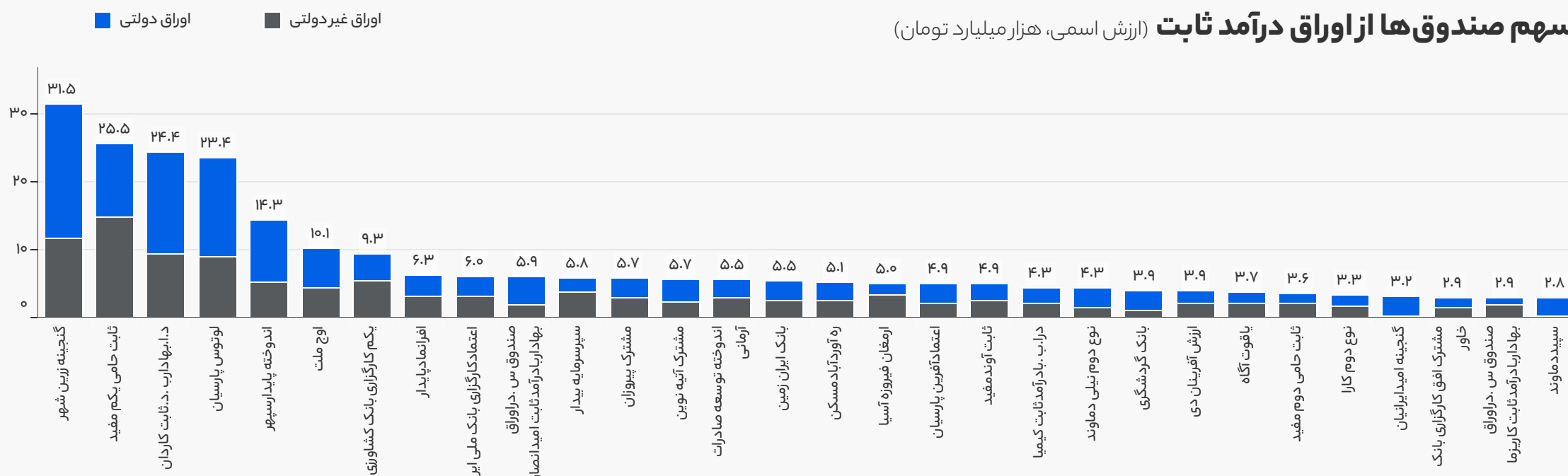


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



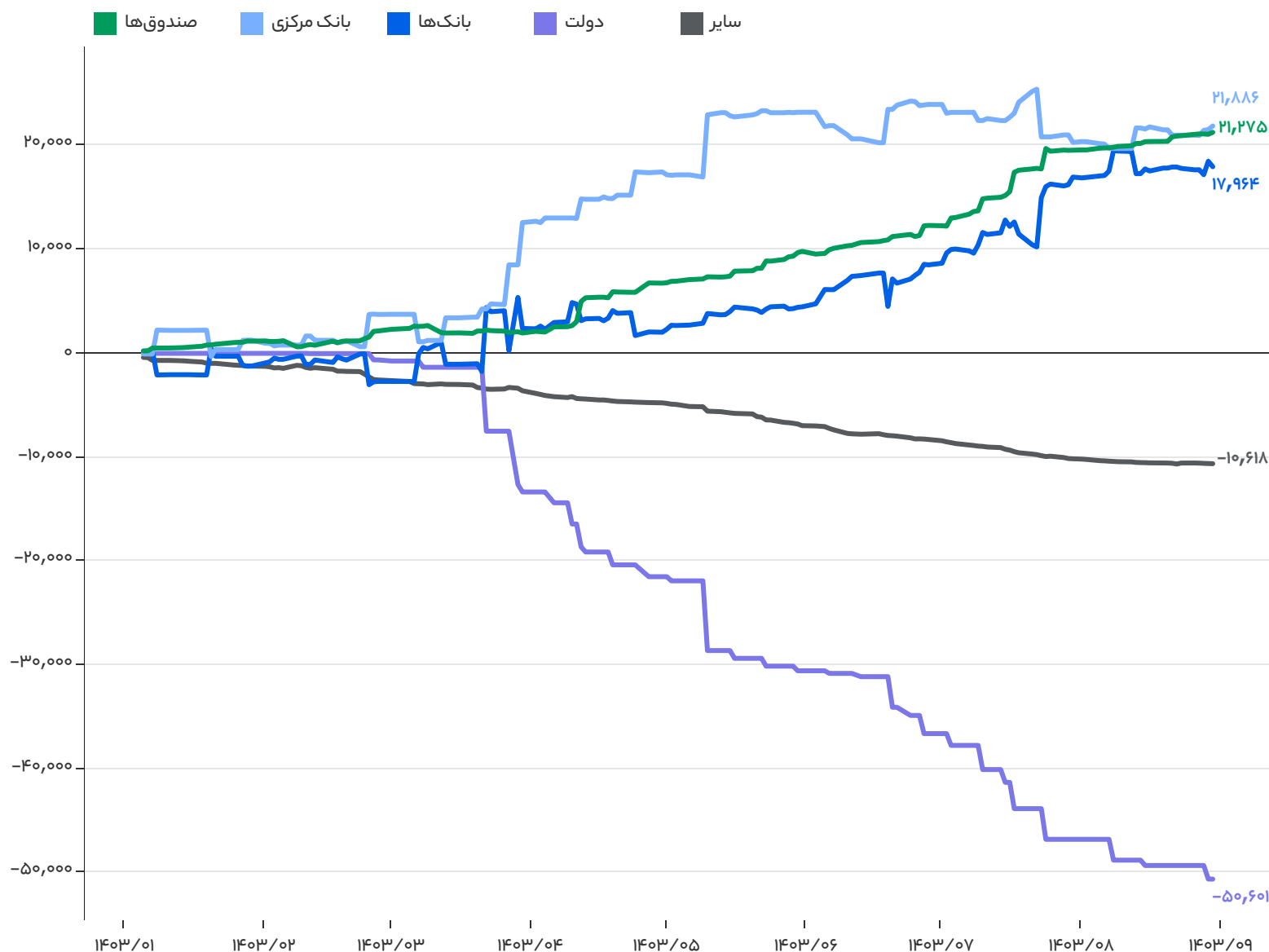
سهم صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

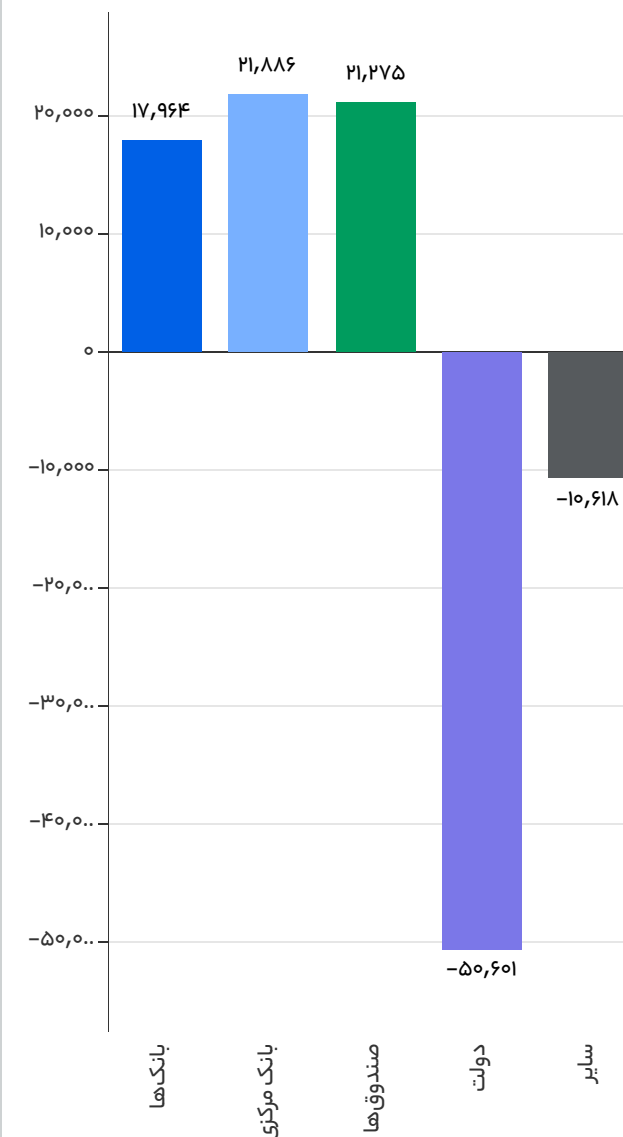
خالص معاملات اوراق

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

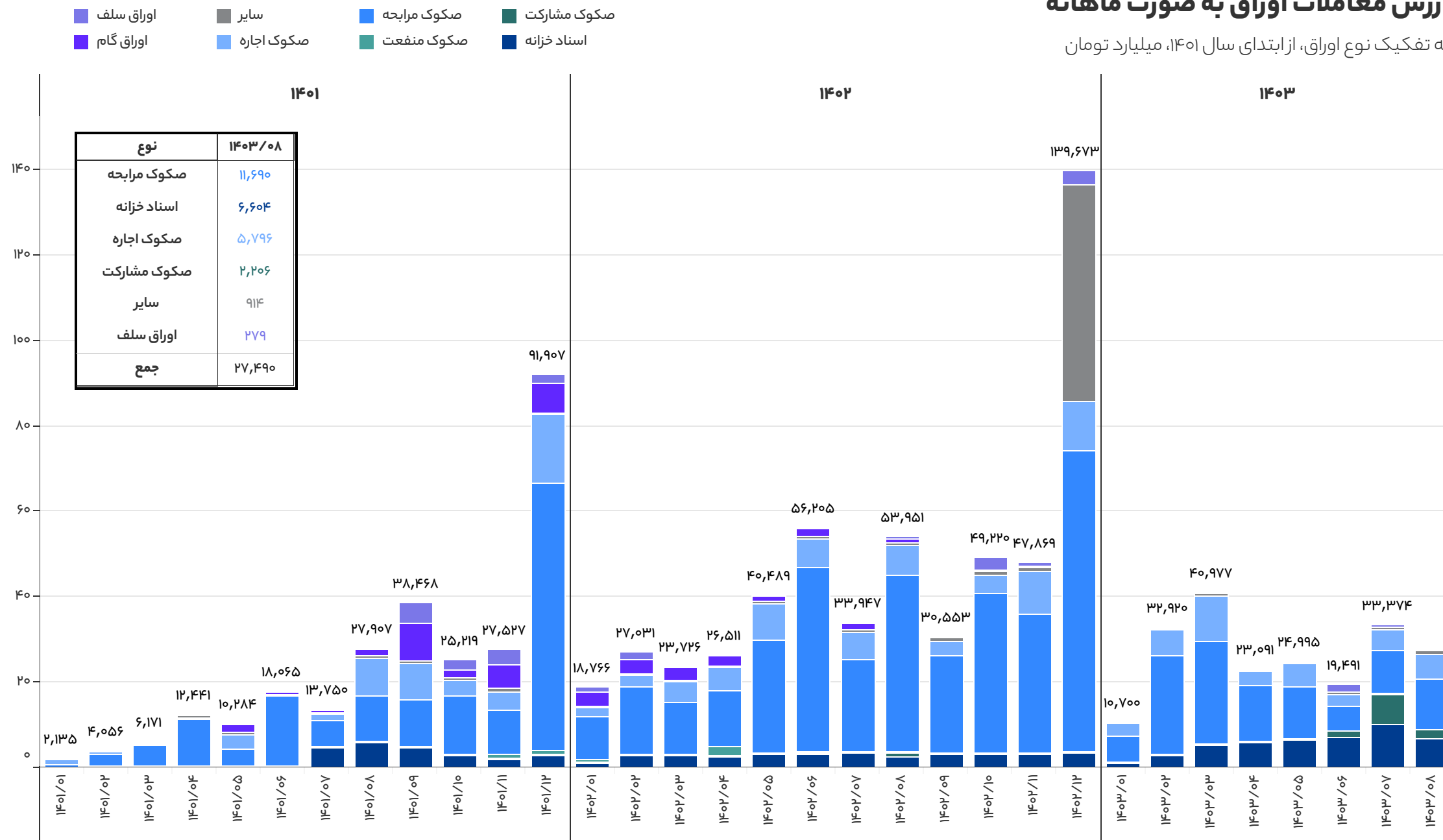
بانکها بانک مرکزی صندوقها دولت سایر

	بانکها	بانک مرکزی	صندوقها	دولت	سایر
۱۴۰۳/۰۸	۹۹۴	۱,۵۸۵	۱,۷۲۱	-۳,۸۲۸	-۴۷۴
۱۴۰۳/۰۷	۸,۴۵۲	-۳,۶۶۰	۷,۲۴۰	-۱۰,۱۷۴	-۱,۸۵۶
۱۴۰۳/۰۶	۴,۰۳۸	۷۵۶	۲,۴۹۶	-۶,۰۵۰	-۱,۳۲۸
۱۴۰۳/۰۵	۲,۴۴۶	۵,۷۴۲	۳,۰۶۲	-۹,۰۵۴	-۲,۱۹۶
۱۴۰۳/۰۴	-۳۶۶	۴,۸۷۵	۴,۷۹۷	-۸,۱۵۴	-۱,۱۶۴
۱۴۰۳/۰۳	۵,۱۰۰	۸,۸۴۴	-۱۹۸	-۱۲,۷۱۱	-۱,۰۴۱
۱۴۰۳/۰۲	-۱,۴۷۹	۲,۴۷۲	۹۸۱	-۶۳۰	-۱,۳۳۵
۱۴۰۳/۰۱	-۱,۴۴۰	۱,۳۳۲	۱,۰۲۳	۰	-۹۰۹
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	-۷۸۸	۶۴۰	۹۳۸	-۷۱۸	-۷۳

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

دولتی صکوک مرابحه (۸ همت)	شرکتی صکوک اجاره (۶ همت)	شرکتی صکوک مرابحه (۳ همت)
دولتی اسناد خزانه (۷ همت)	شهرداری صکوک مشارکت (۲ 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
۱,۸۰۸	۱۴۰۶/۰۵/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۰۰۶
۷۱۰	۱۴۰۵/۰۵/۱۵	صکوک اجاره	صغدیر۵۰۵
۷۰۰	۱۴۰۶/۰۶/۲۷	صکوک اجاره	تابان۱۱
۶۱۵	۱۴۰۷/۰۳/۱۵	صکوک اجاره	صفارس۷۰۳
۵۹۹	۱۴۰۵/۱۱/۱۶	صکوک مرابحه	صاف فیلم۵۱
۵۹۰	۱۴۰۶/۰۵/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۰۶
۳۱۲	۱۴۰۶/۱۲/۱۵	صکوک مرابحه	صفولا۶۱۲
۲۹۱	۱۴۰۶/۰۷/۰۴	صکوک مرابحه	غرب۰۶
۲۷۹	۱۴۰۷/۰۲/۱۱	صکوک مرابحه	فناپ زیرساخت..
۲۵۰	۱۴۰۵/۰۵/۰۹	صکوک اجاره	تامین۰۵
۲۵۰	۱۴۰۷/۱۰/۱۵	صکوک مرابحه	صزاگرس۷۱
۲۲۰	۱۴۰۶/۰۷/۱۵	صکوک مرابحه	صجم۶۰۷
۲۱۴	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صگستر۵۱۲
۱۹۳	۱۴۰۶/۱۲/۲۷	صکوک اجاره	مبین۰۶۳
۱۸۶	۱۴۰۴/۰۶/۰۲	صکوک مرابحه	کرمان۴۶۱
۱۴۲	۱۴۰۶/۱۲/۲۷	صکوک مرابحه	آرین سلامت۰۶
۱۰۸	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۵۲
۱۰۰	۱۴۰۶/۰۶/۲۰	صکوک مرابحه	گلدیران۰۶
۱۰۰	۱۴۰۶/۰۵/۱۰	صکوک مرابحه	فاران۰۶
۱۰۰	۱۴۰۵/۱۲/۱۵	صکوک اجاره	صفولا۱۲
۱۰۰	۱۴۰۶/۰۷/۱۲	صکوک مرابحه	آسمان۰۶
۹۸	۱۴۰۶/۱۱/۰۴	صکوک اجاره	اهداف۰۶
۹۵	۱۴۰۶/۱۱/۱۴	صکوک مرابحه	حسیر۰۶
۹۰	۱۴۰۵/۱۲/۲۳	صکوک مرابحه	کرمان۵۱۲۵
۹۰	۱۴۰۴/۱۰/۱۵	صکوک اجاره	تابان۰۵

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
۴,۳۲۹	۱۴۰۴/۰۶/۲۳	صکوک مرابحه	اراد۱۲۷
۲,۱۰۲	۱۴۰۴/۰۴/۱۷	صکوک مرابحه	اراد۱۲۰
۱,۲۹۳	۱۴۰۵/۰۹/۱۶	اسناد خزانه	اخزا۲۱۲
۹۱۹	۱۴۰۵/۱۰/۲۱	اسناد خزانه	اخزا۲۱۳
۸۹۱	۱۴۰۵/۱۱/۱۲	اسناد خزانه	اخزا۲۱۰
۷۳۰	۱۴۰۴/۰۹/۱۰	اسناد خزانه	اخزا۲۰۷
۶۲۷	۱۴۰۵/۰۷/۲۰	اسناد خزانه	اخزا۲۱۱
۵۴۴	۱۴۰۳/۰۹/۰۷	صکوک مرابحه	اراد۱۳۴
۵۲۵	۱۴۰۵/۰۳/۲۵	اسناد خزانه	اخزا۲۰۱
۵۰۷	۱۴۰۴/۱۲/۱۱	اسناد خزانه	اخزا۲۰۸
۴۶۶	۱۴۰۵/۰۹/۲۳	اسناد خزانه	اخزا۲۰۲
۴۵۰	۱۴۰۳/۰۸/۱۶	صکوک مرابحه	اراد۹۴
۲۲۷	۱۴۰۵/۰۵/۰۴	صکوک مرابحه	اراد۱۴۰
۱۷۳	۱۴۰۴/۰۳/۰۲	صکوک مرابحه	اراد۱۴۱
۱۴۴	۱۴۰۴/۰۲/۲۶	صکوک مرابحه	اراد۷۴
۱۲۷	۱۴۰۵/۰۸/۱۸	اسناد خزانه	اخزا۲۰۳
۱۲۲	۱۴۰۳/۱۱/۱۵	اوراق سلف	عبهمن
۱۱۲	۱۴۰۳/۱۱/۱۵	صکوک مرابحه	اراد۷۱
۹۶	۱۴۰۴/۰۳/۲۶	اسناد خزانه	اخزا۱۰۱
۹۶	۱۴۰۳/۱۰/۲۴	اسناد خزانه	اخزا۰۰۲
۸۳	۱۴۰۴/۱۱/۱۰	صکوک مرابحه	اراد۱۳۲
۷۳	۱۴۰۴/۰۹/۱۷	اسناد خزانه	اخزا۱۰۴
۷۱	۱۴۰۳/۰۱/۱۵	اوراق سلف	سپنتا۰۳۱
۷۰	۱۴۰۳/۱۱/۰۱	اسناد خزانه	اخزا۰۰۹
۴۳	۱۴۰۳/۰۳/۱۵	اوراق سلف	سپنتا۰۳۳

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
۷۴۸.۹	۱۵۰	با درآمد ثابت	سرمایه گذاری سنتی
۱۳۳.۴	۱۴۵	سهامی	
۷.۲	۲۶	مختلط	
۱.۹	۶	صندوق در صندوق	
۱.۸	۵	خصوصی	سرمایه گذاری خصوصی
۰.۴	۱۶	جسورانه	
۱۷۸.۵	۱۰۹	بازارگردانی	سرمایه گذاری جایگزین
۷۵.۹	۱۵	سپرده کالایی	
۳.۱	۵	املاک و مستغلات	
۱.۳	۱	پروژه ای	
۰.۰	۴	زمین و ساختمان	
۱,۱۵۲.۴	۴۸۲	جمع کل	

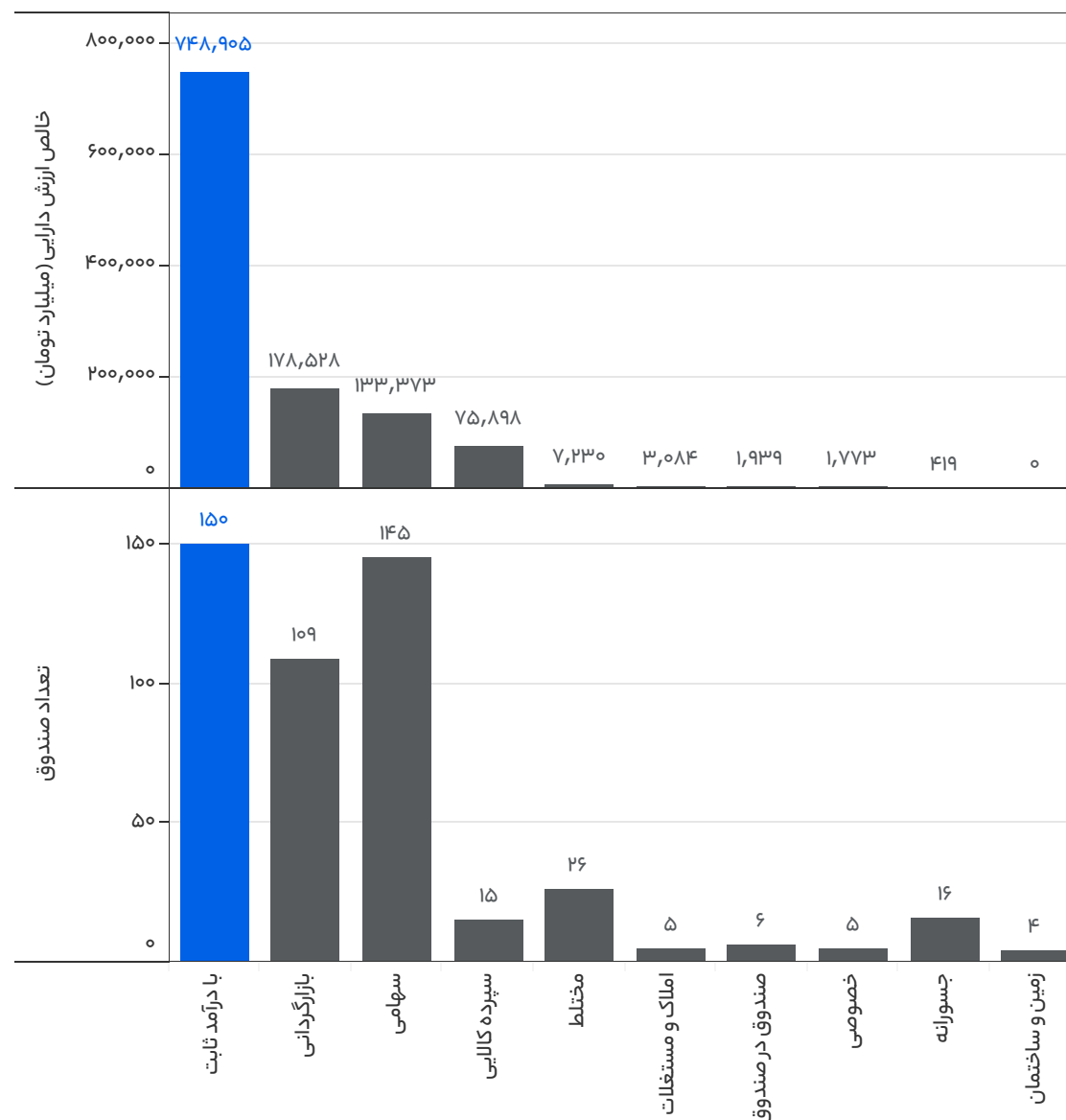
صندوق های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نوع معامله	نوع	نام صندوق
بازارگردانی	صدور و ابطال	اختصاصی بازارگردانی توازن بازار
بازارگردانی	صدور و ابطال	اختصاصی بازارگردانی روماک
بازارگردانی	صدور و ابطال	اختصاصی بازارگردانی کاوش
سهامی	صدور و ابطال	بازنشستگی تکمیلی آتیه فولاد
سهامی	قابل معامله	پناه ثروت هومان

ارزش و تعداد صندوق های سرمایه گذاری

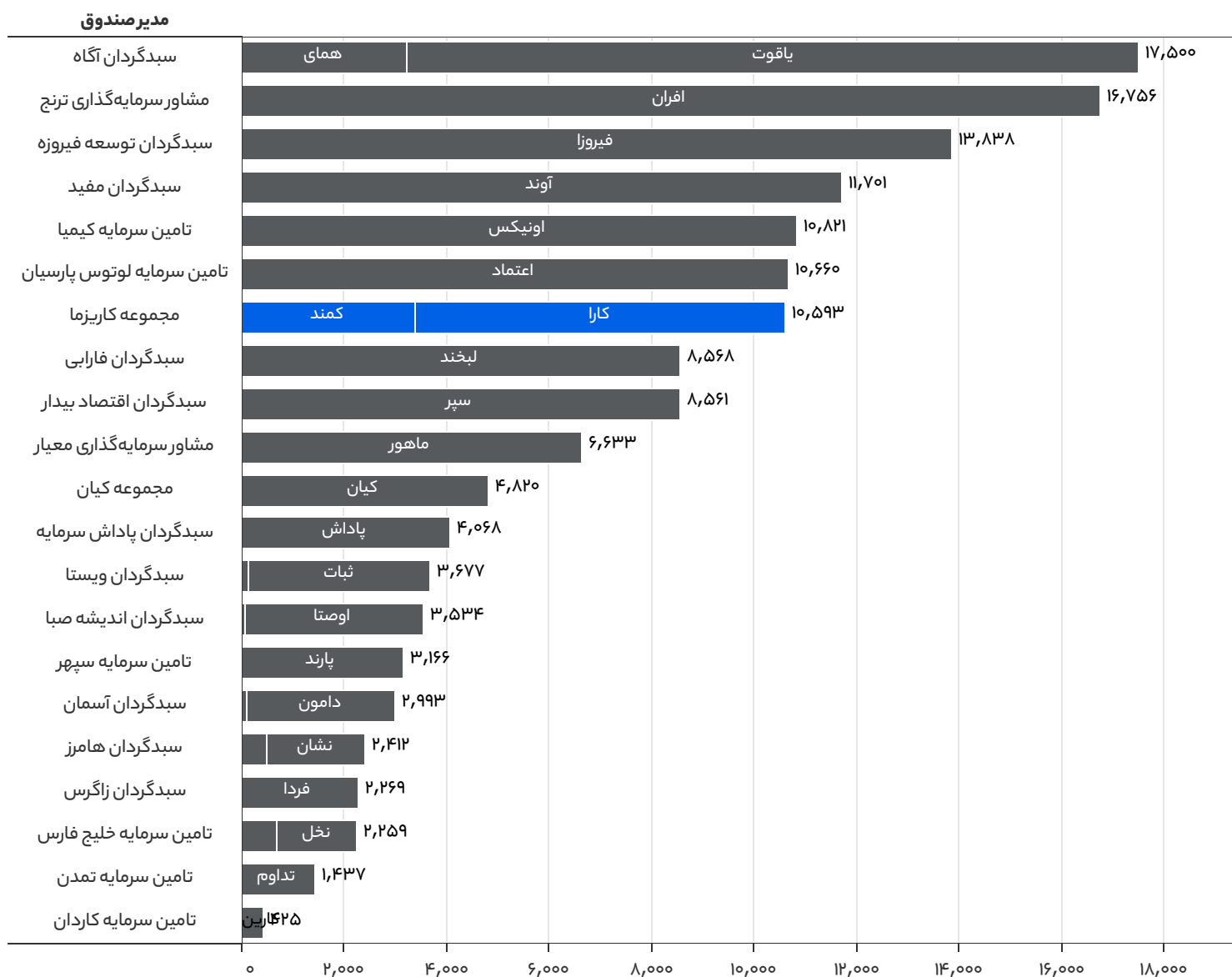
به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

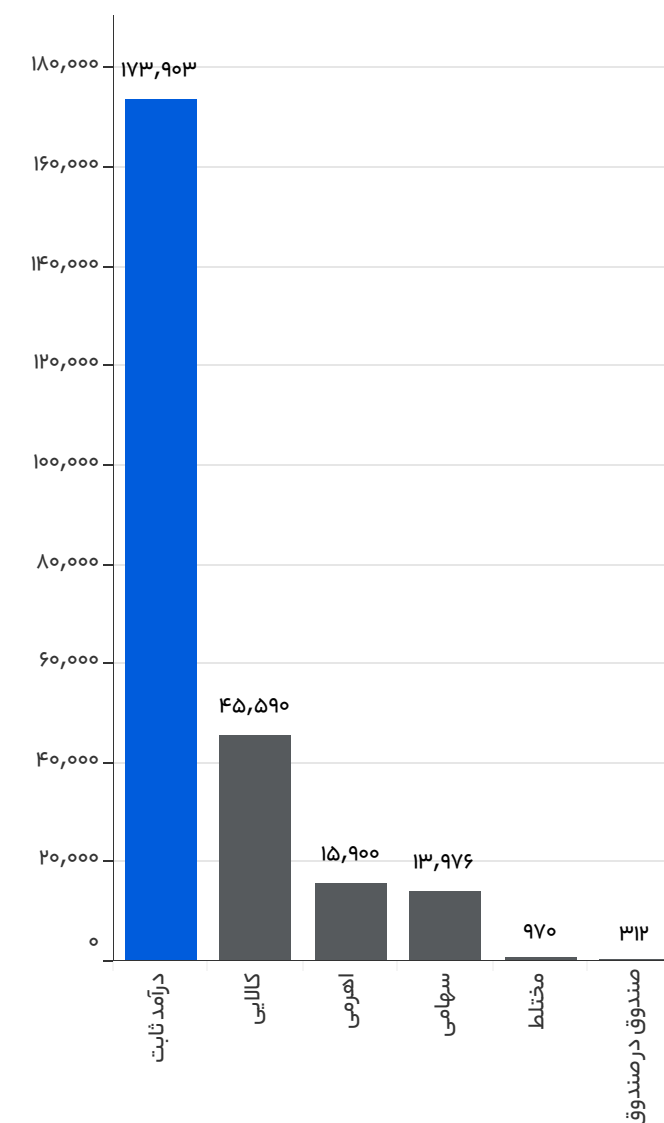
پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

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

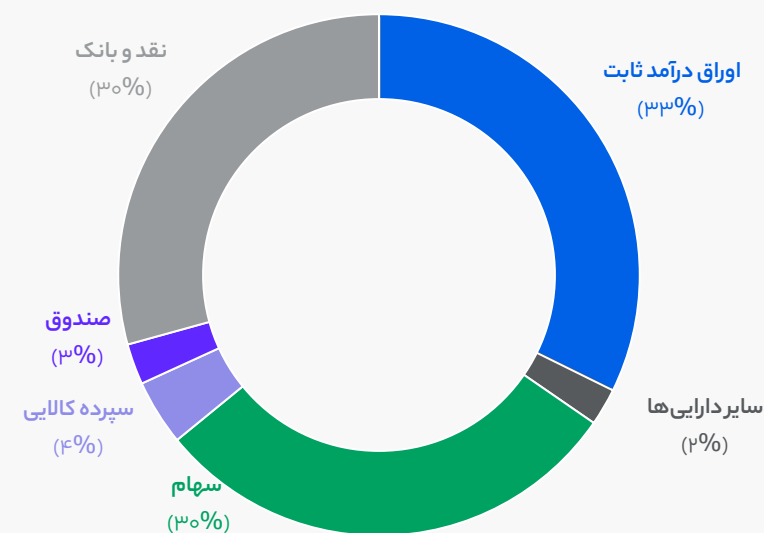
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	
آوند	سبدگردان مفید	+۸۵۴
یاقوت	سبدگردان آگاه	+۸۲۴
لبخند	سبدگردان فارابی	+۳۹۹
کیان	مجموعه کیان	+۳۷۰
تداوم	تامین سرمایه تمدن	+۲۶۲
اونیکس	تامین سرمایه کیمیا	+۲۶۱
فیروزا	سبدگردان توسعه فیروزه	+۲۵۳
پارند	تامین سرمایه سپهر	+۱۴۲
همای	سبدگردان آگاه	+۱۰۷
کمند	مجموعه کاریزما	+۶۲
کارین	تامین سرمایه کاردان	+۵۹
ثبات	سبدگردان ویستا	+۴۸
دامون	سبدگردان آسمان	+۴۰
نشان	سبدگردان هامرز	+۲۷
آکام	سبدگردان ویستا	+۱۲
ماهور	مشاور سرمایه‌گذاری معیار	+۱۰
ساحل	تامین سرمایه خلیج فارس	+۸
اوصتا	سبدگردان اندیشه صبا	+۱
دیبا	سبدگردان اندیشه صبا	-۱
آسامید	سبدگردان آسمان	-۳
کارا	مجموعه کاریزما	-۶
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	-۱۳
پاداش	سبدگردان پاداش سرمایه	-۲۶
نخل	تامین سرمایه خلیج فارس	-۳۶
فردا	سبدگردان زاگرس	-۵۱
سپر	سبدگردان اقتصاد بیدار	-۶۲
هامرز	سبدگردان هامرز	-۷۳
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	-۳۲۱

تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

ترکیب دارایی صندوق‌ها

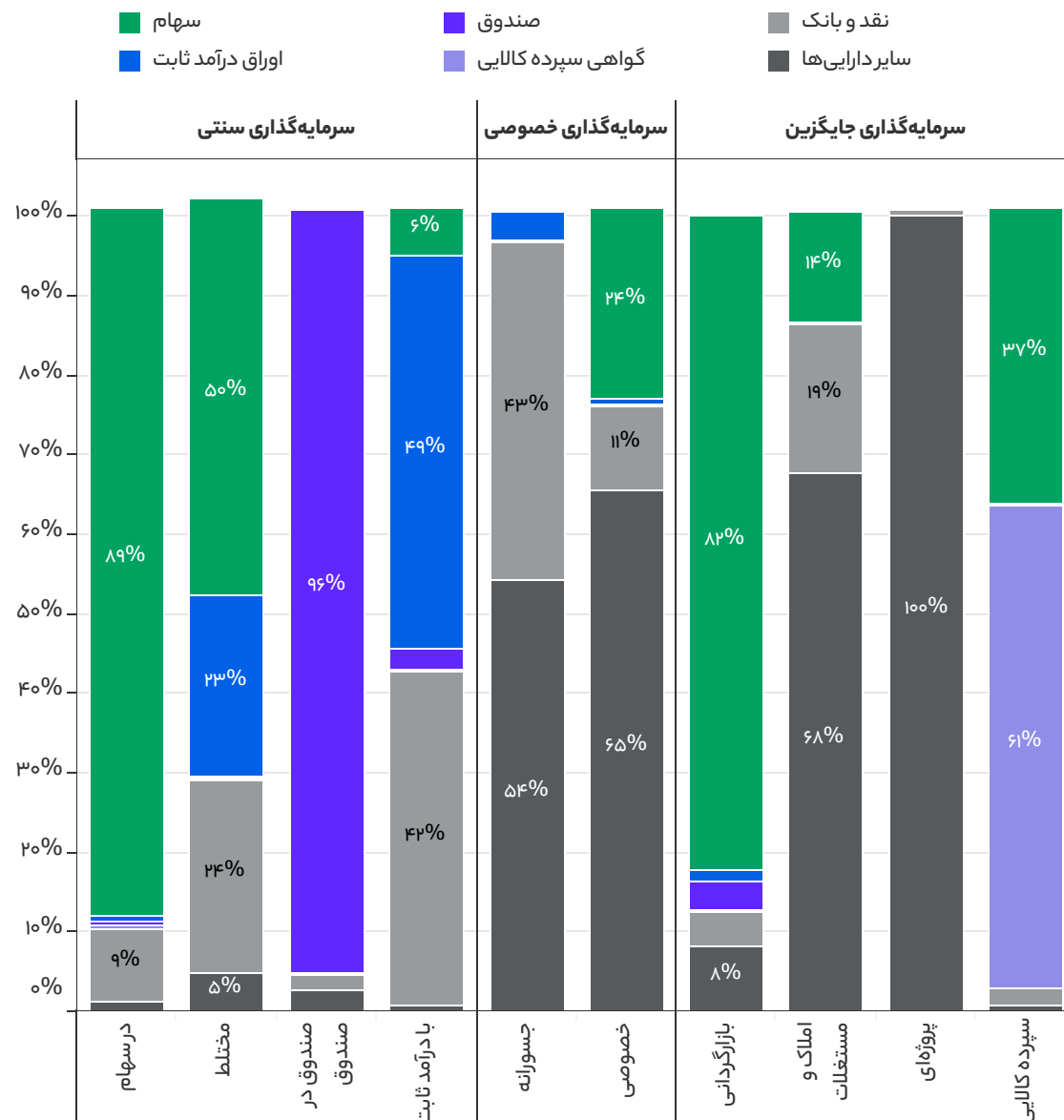
به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهام	درآمد ثابت	سپرده کالایی	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	مختلط	۵۰%	۲۳%	۱%	-	۲۴%	۵%
	صندوق در صندوق	-	-	-	۹۶%	۲%	۳%
	با درآمد ثابت	۶%	۴۹%	-	۳%	۴۲%	۱%
	در سهام	۸۹%	۱%	۱%	-	۹%	۱%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۴%	-	-	۴۳%	۵۴%
	خصوصی	۲۴%	۱%	-	-	۱۱%	۶۵%
سرمایه‌گذاری جایگزین	بازارگردانی	۸۲%	۱%	-	۴%	۵%	۸%
	املاک و مستغلات	۱۴%	-	-	-	۱۹%	۶۸%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	۱%	۱۰۰%
	سپرده کالایی	۳۷%	-	۶۱%	-	۲%	۱%
مجموع	کل	۳۰%	۳۳%	۴%	۳%	۳۰%	۲%

ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق

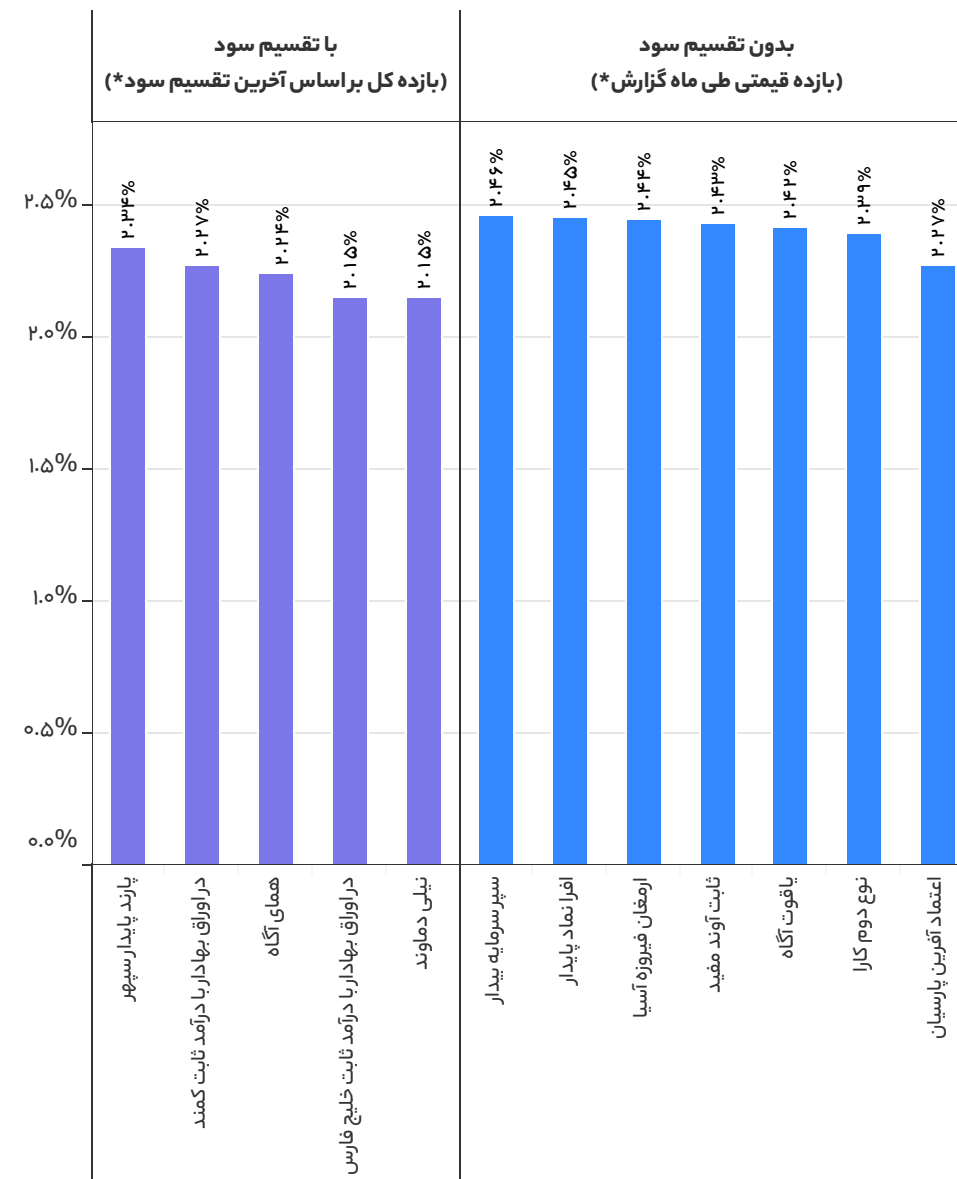


بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)

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	پارند پایدار سپهر	۳,۰۳۹	۲۵.۶%	۱۳.۴%	۶.۸%	۲.۱۵%	۲۸.۱%	۳۲.۰%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	۵,۸۶۲	۲۵.۹%	۱۲.۹%	۶.۵%	۲.۱۷%	۲۷.۳%	۳۰.۹%
	همای آگاه	۴,۵۹۰	۲۶.۰%	۱۳.۲%	۶.۶%	۲.۲۱%	۲۶.۹%	۳۰.۵%
	نیلی دماوند	۶,۶۸۳	۲۵.۳%	۱۲.۵%	۶.۳%	۲.۱۰%	۲۵.۸%	۲۹.۱%
	دراوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۴,۹۲۱	۲۵.۶%	۱۲.۸%	۶.۴%	۲.۱۲%	۲۵.۸%	۲۹.۱%
بدون تقسیم سود	یاقوت آگاه	۱۲,۸۳۷	۳۰.۱%	۱۴.۹%	۷.۲%	۲.۴۲%		
	نوع دوم کارا	۱۰,۴۴۷	۲۹.۷%	۱۴.۶%	۷.۰%	۲.۳۹%		
	سپر سرمایه بیدار	۱۴,۳۷۲	۳۱.۰%	۱۵.۵%	۷.۳%	۲.۴۶%		
	ثابت آوند مفید	۱۲,۴۷۱	۳۰.۴%	۱۵.۰%	۷.۲%	۲.۴۳%		
	افرا نماد پایدار	۱۹,۸۸۳	۳۰.۹%	۱۵.۲%	۷.۲%	۲.۴۵%		
	اعتماد آفرین پارسین	۱۲,۸۶۳	۲۹.۴%	۱۴.۶%	۷.۰%	۲.۲۷%		
	ارمغان فیروزه آسیا	۱۲,۱۵۹	۳۰.۸%	۱۵.۱%	۷.۴%	۲.۴۴%		

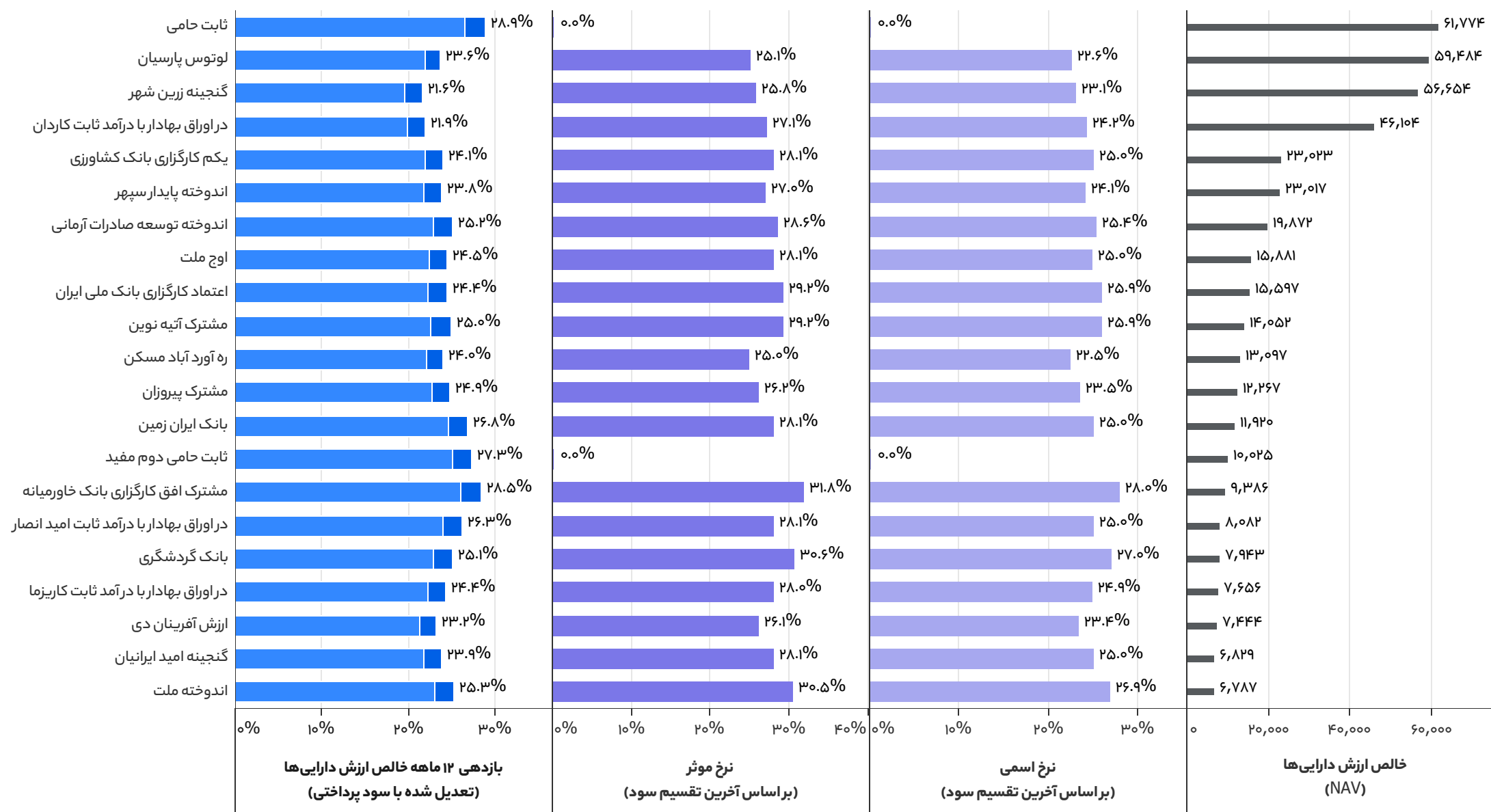


* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.
 ** در صورتی که صندوق تقسیم سود داشته باشد، بازده خالص ارزش دارایی هر واحد بر اساس تقسیم سود تعدیل می‌گردد.

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

