

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



تیر ماه ۱۴۰۳



CHARISMA MARKET INSIGHT

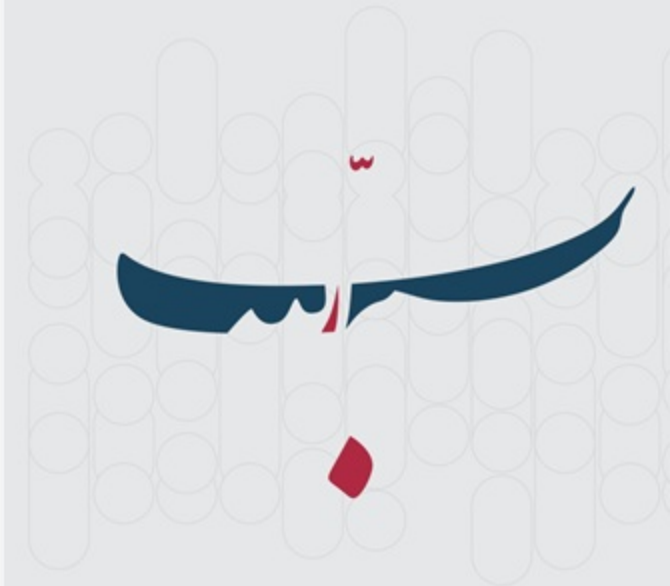
معرفی گزارش:

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 بر اساس نظرات کارشناسان این مجموعه تدارک دیده شده و شرکت مشاور سرمایه‌گذاری کاریزما هیچ‌گونه 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 بر اساس 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.



۰۴	سیاست‌های پولی
۰۶	پایه پولی و نقدینگی
۰۹	تورم و شاخص قیمت مصرف‌کننده
۱۱	ارز خارجی

۱۴	بررسی بلندمدت بازار سهام
۱۷	ارزندگی بازار سهام

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 صدکوک
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)

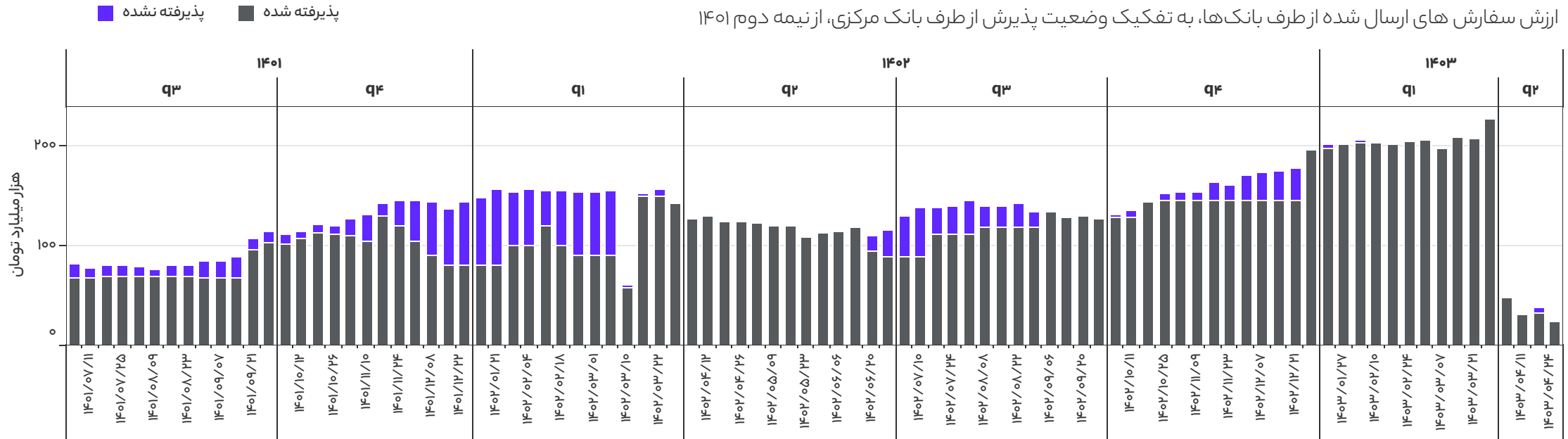


ECONOMY

سیاست‌های پولی

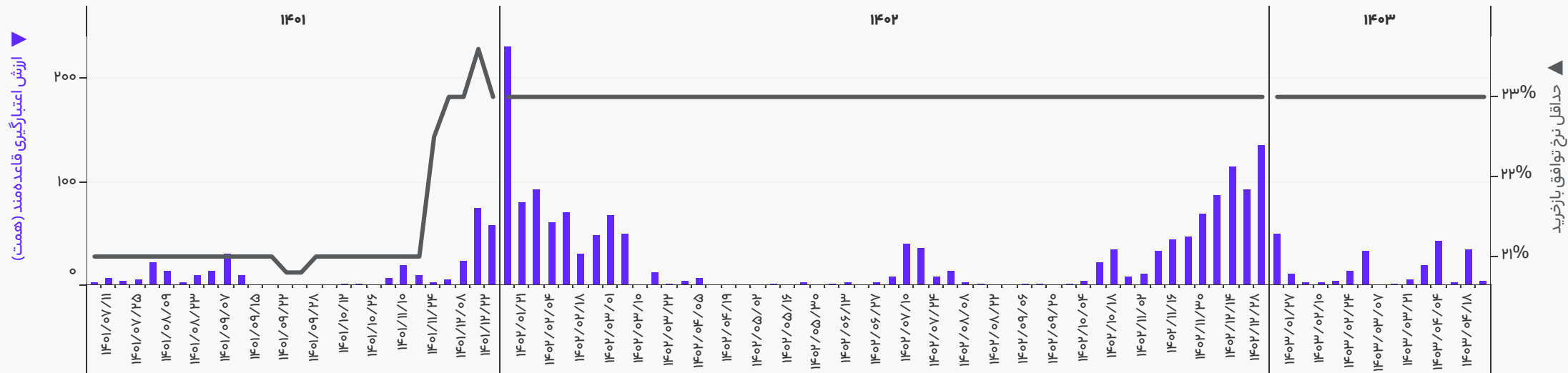
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریپو

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

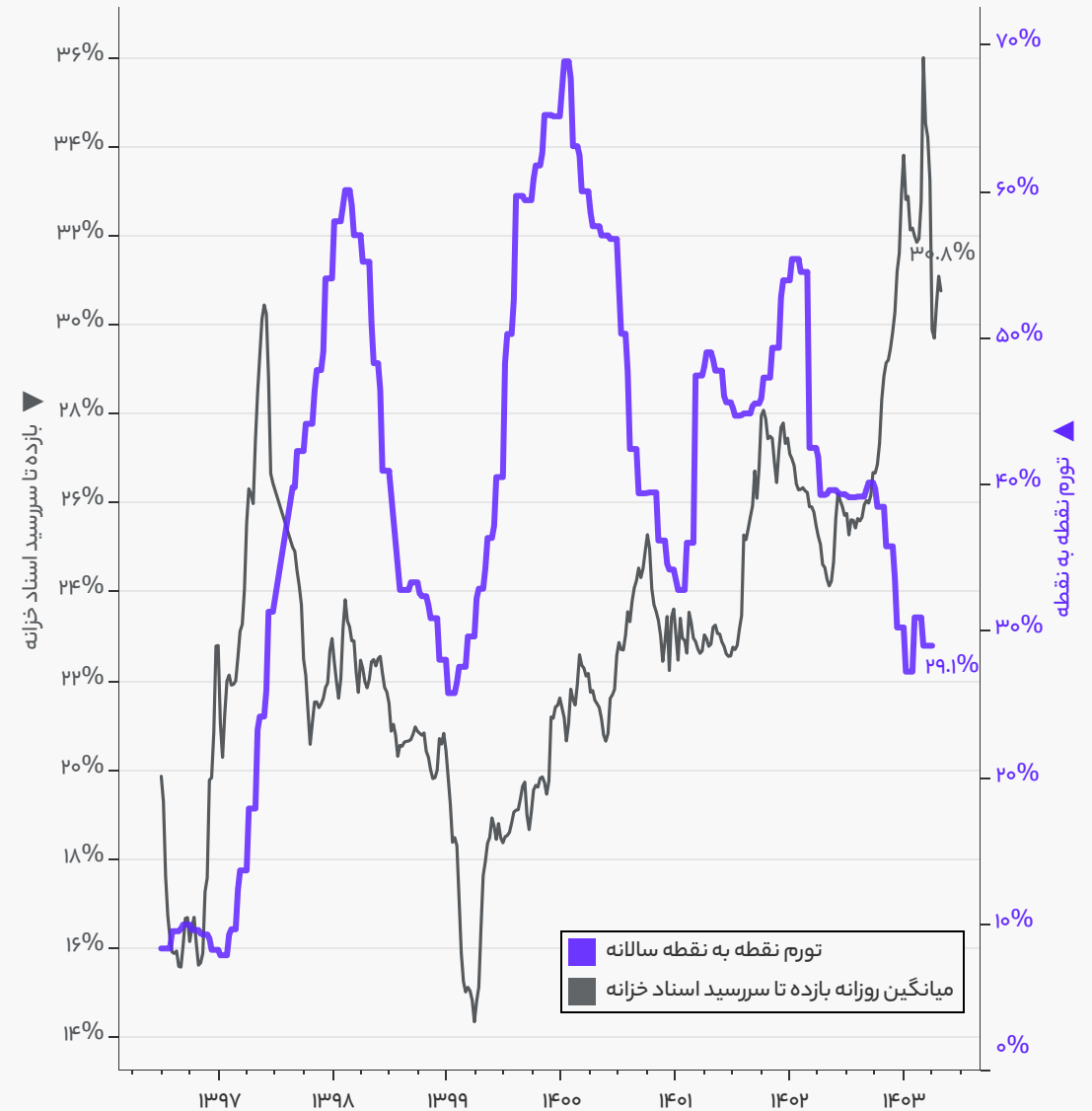
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق با خرید، از نیمه دوم ۱۴۰۱



سیاست‌های پولی

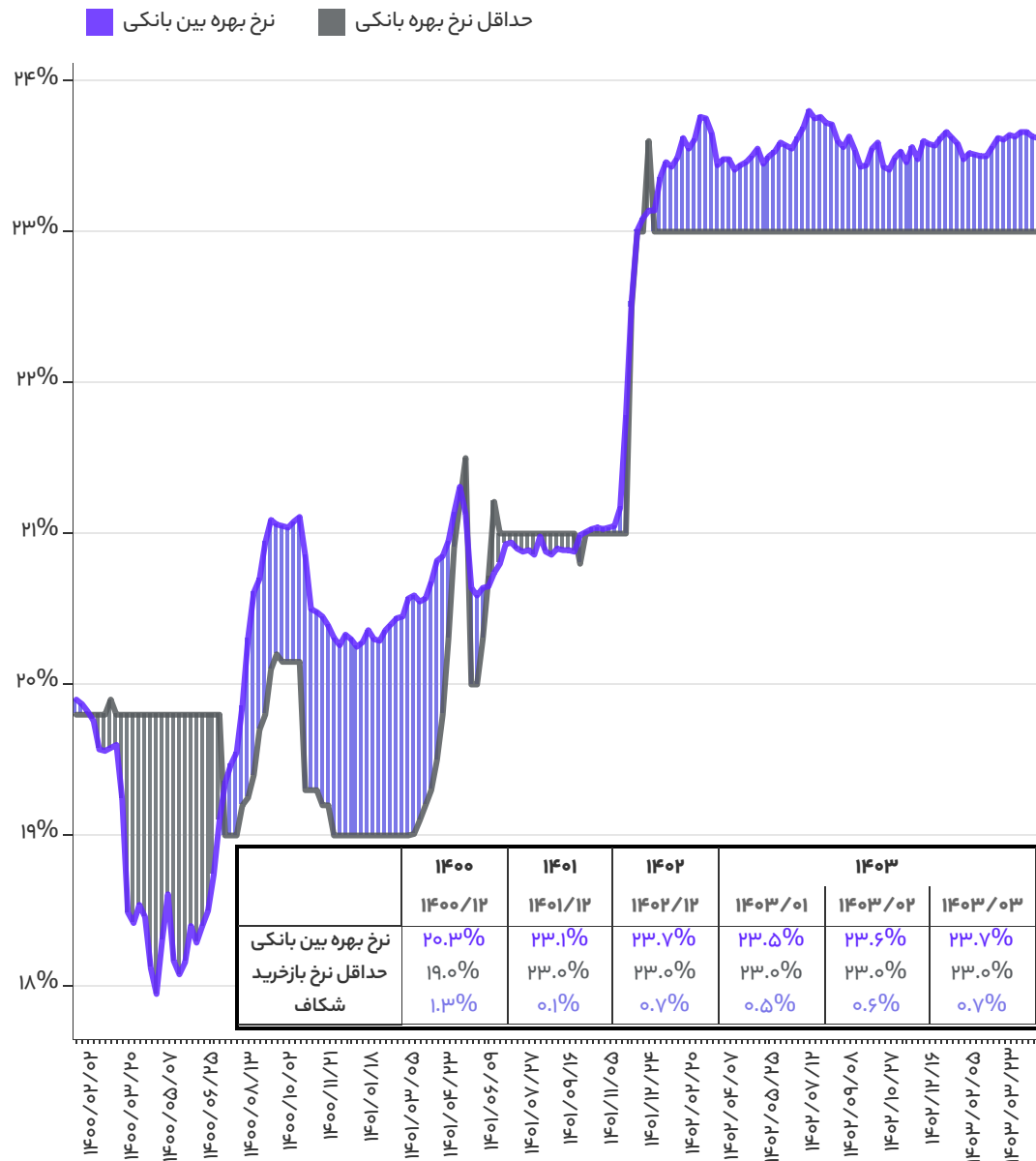
تورم و نرخ بازده اسناد خزانه

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



دسترسی پول برای بانکها

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

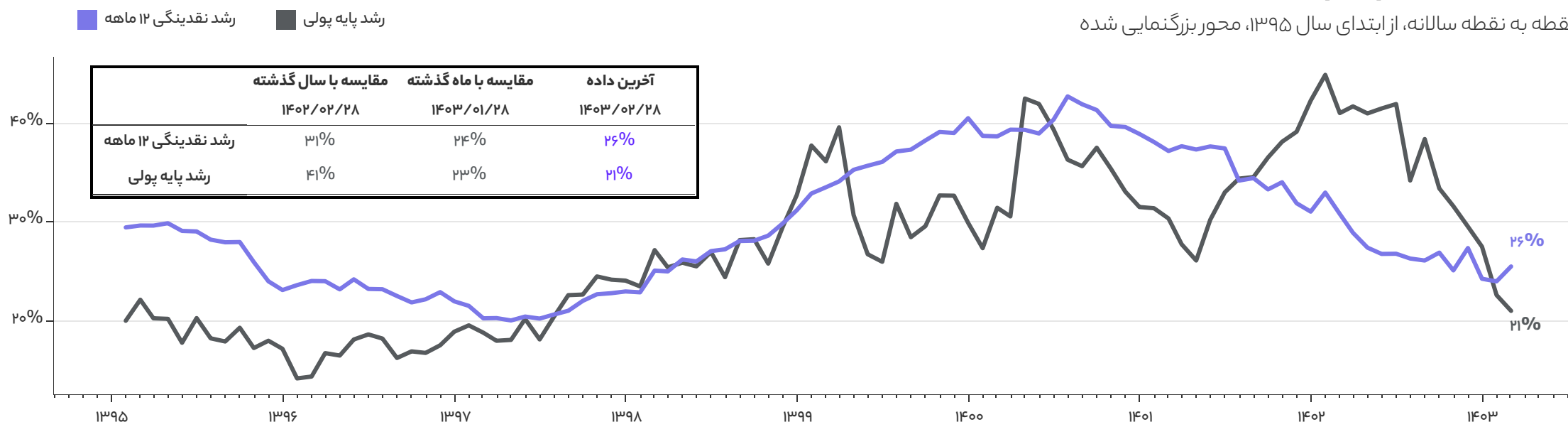


* برای محاسبه میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه، تنها اوراقی که بیش از ۳۰ روز تا سررسید فاصله دارند، استفاده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

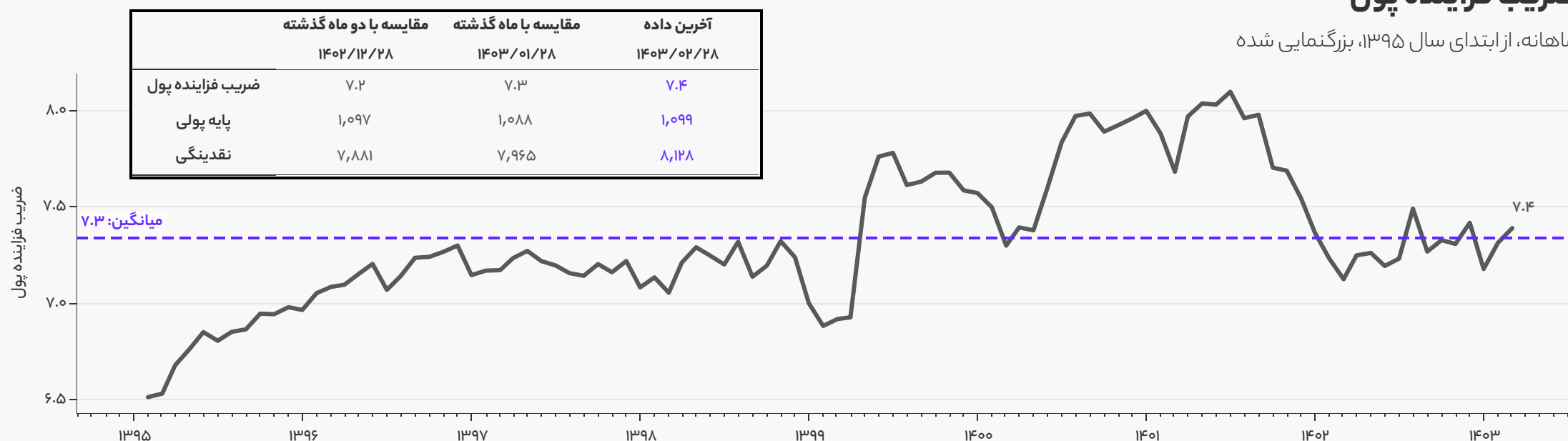
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

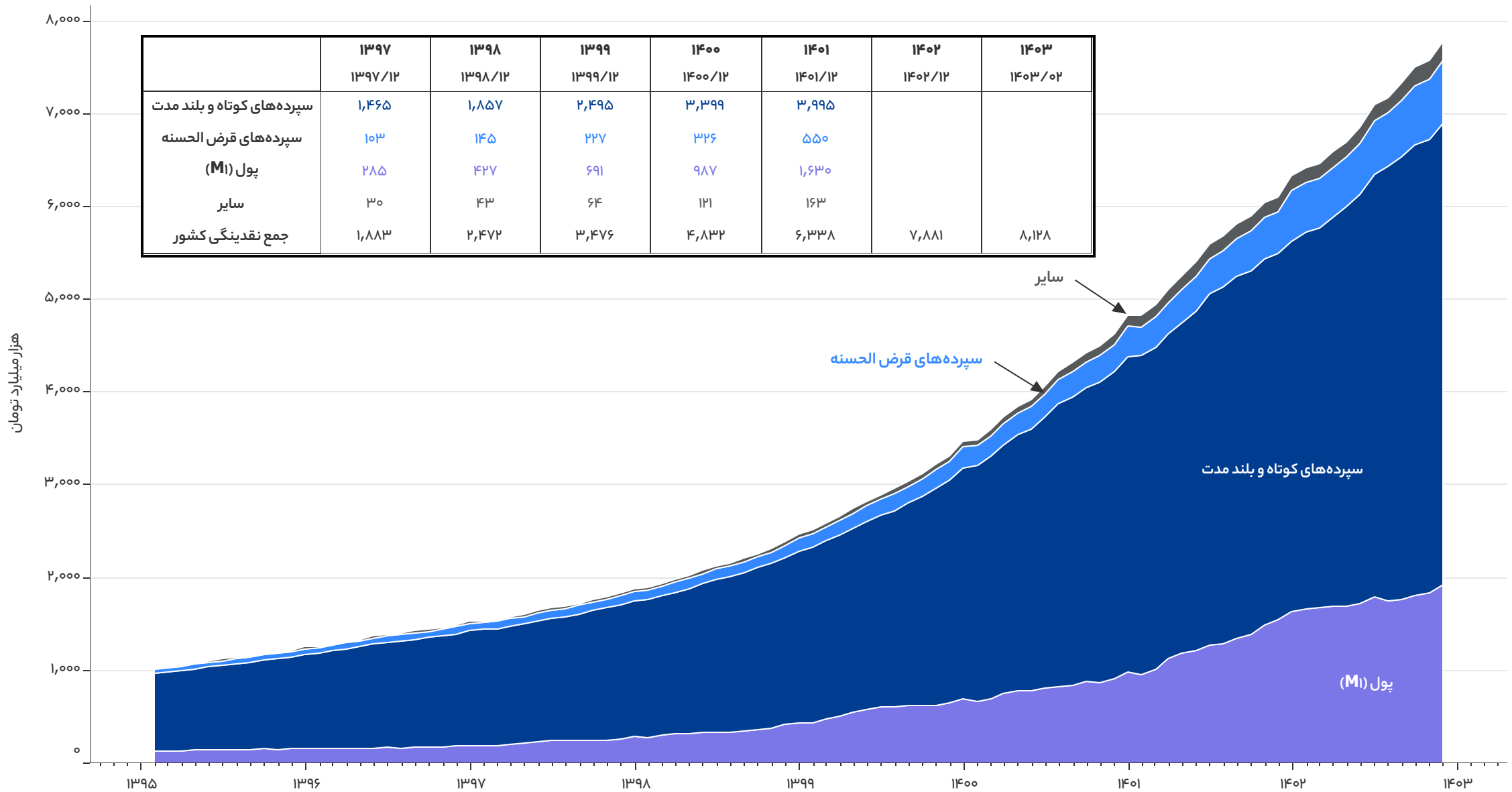


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

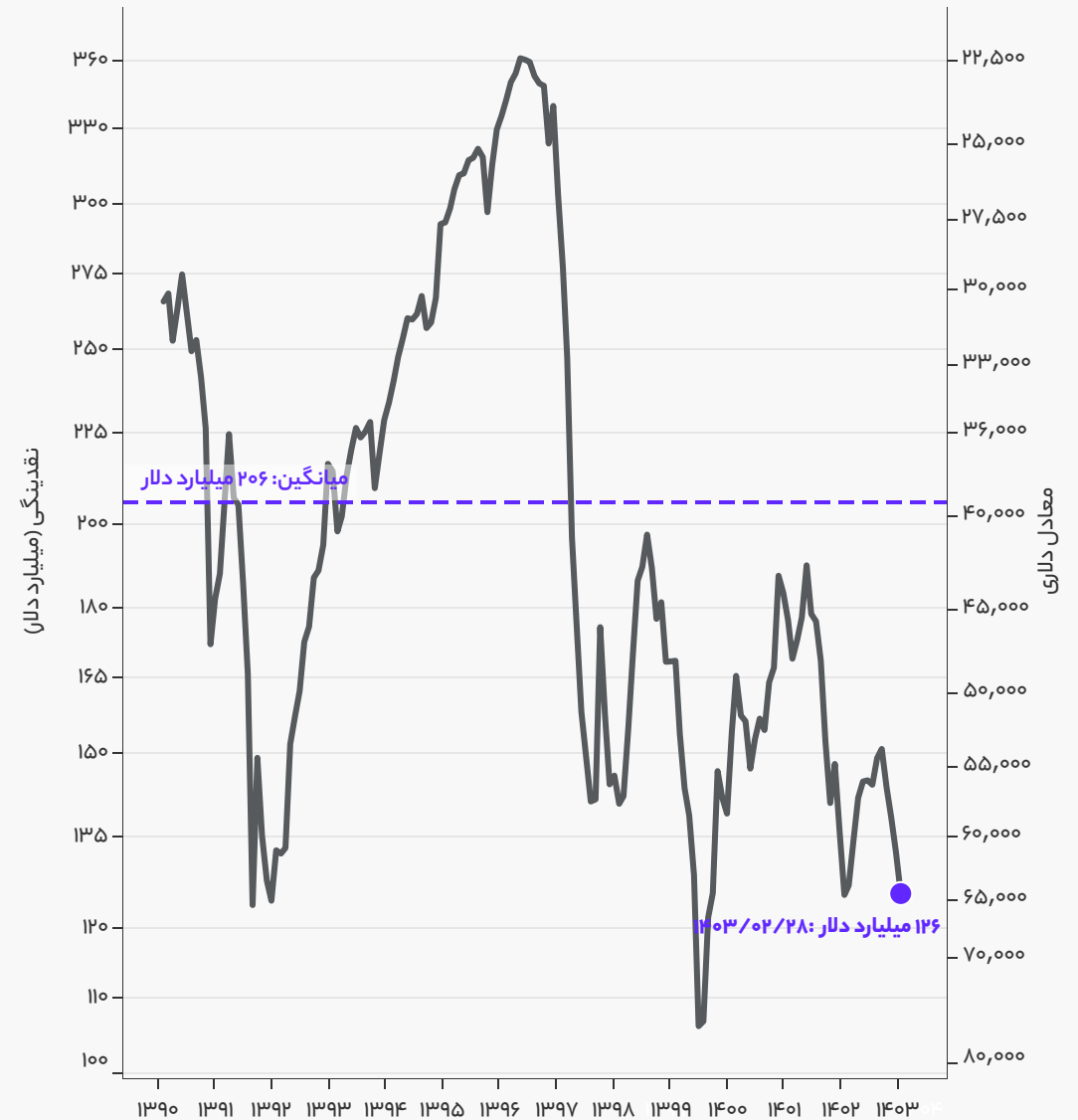
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، (براساس آخرین داده‌ی منتشر شده توسط بانک مرکزی)، هزار میلیارد تومان



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

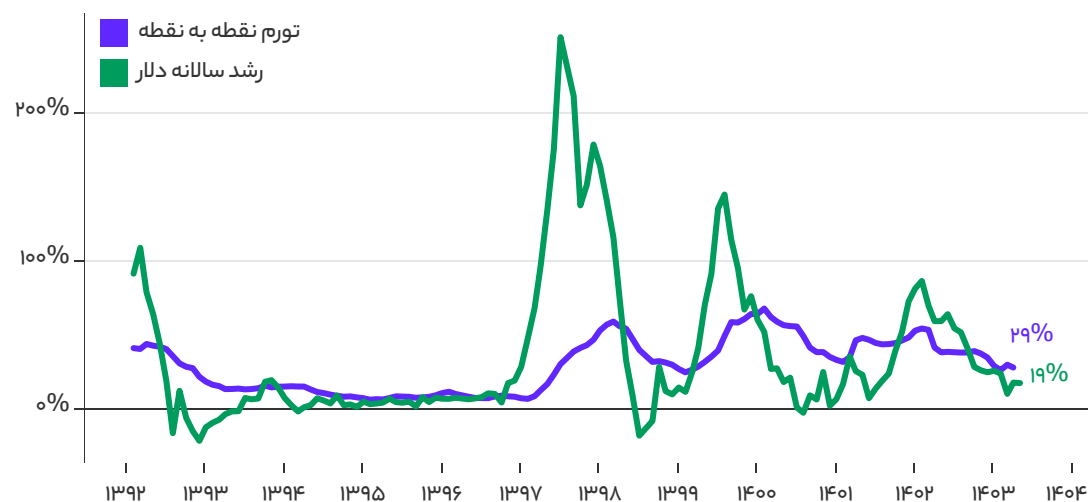


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

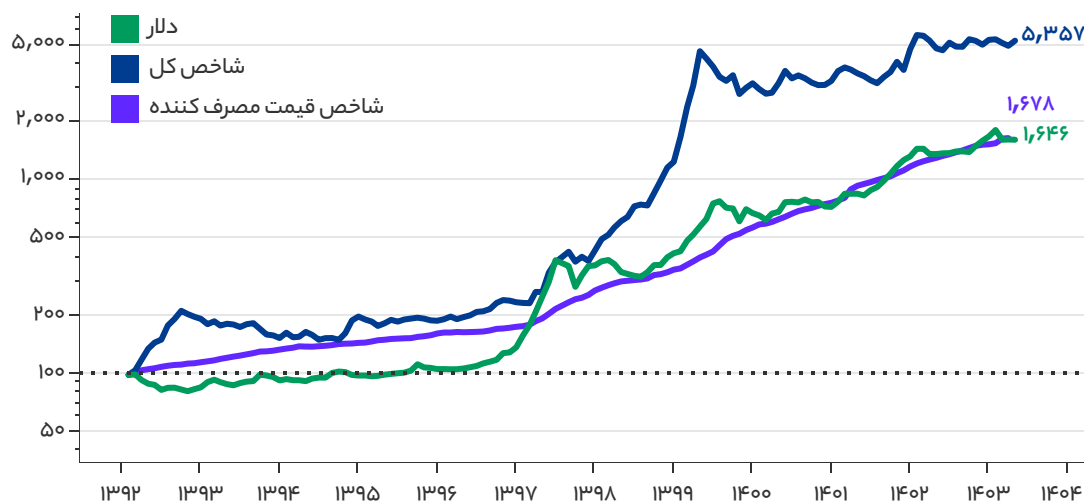
تورم و رشد دلار

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

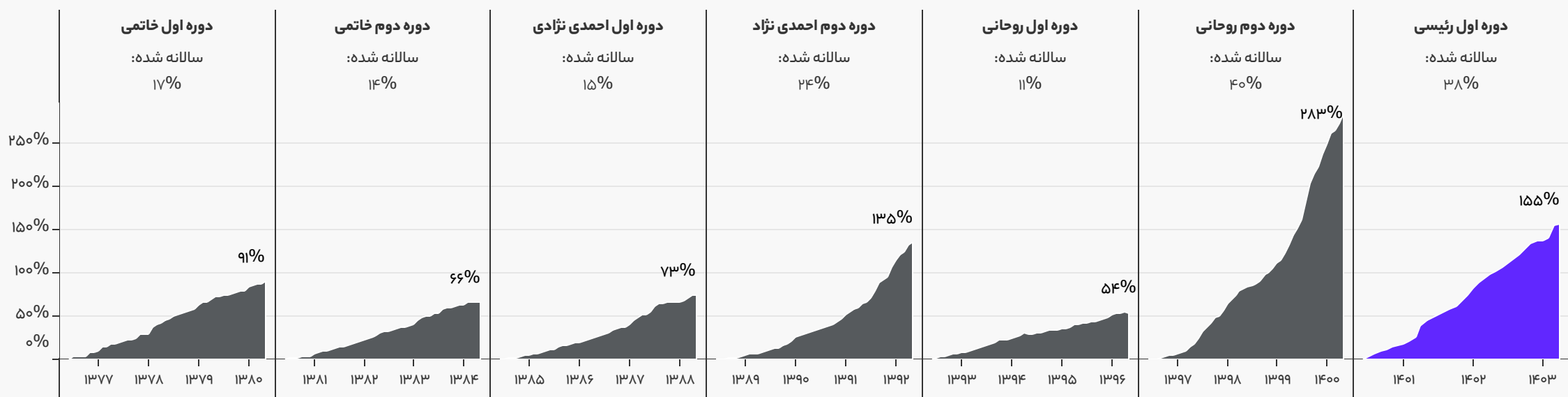


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

مبنای تمامی شاخص‌ها سال ۱۳۹۲ بازنشانده 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

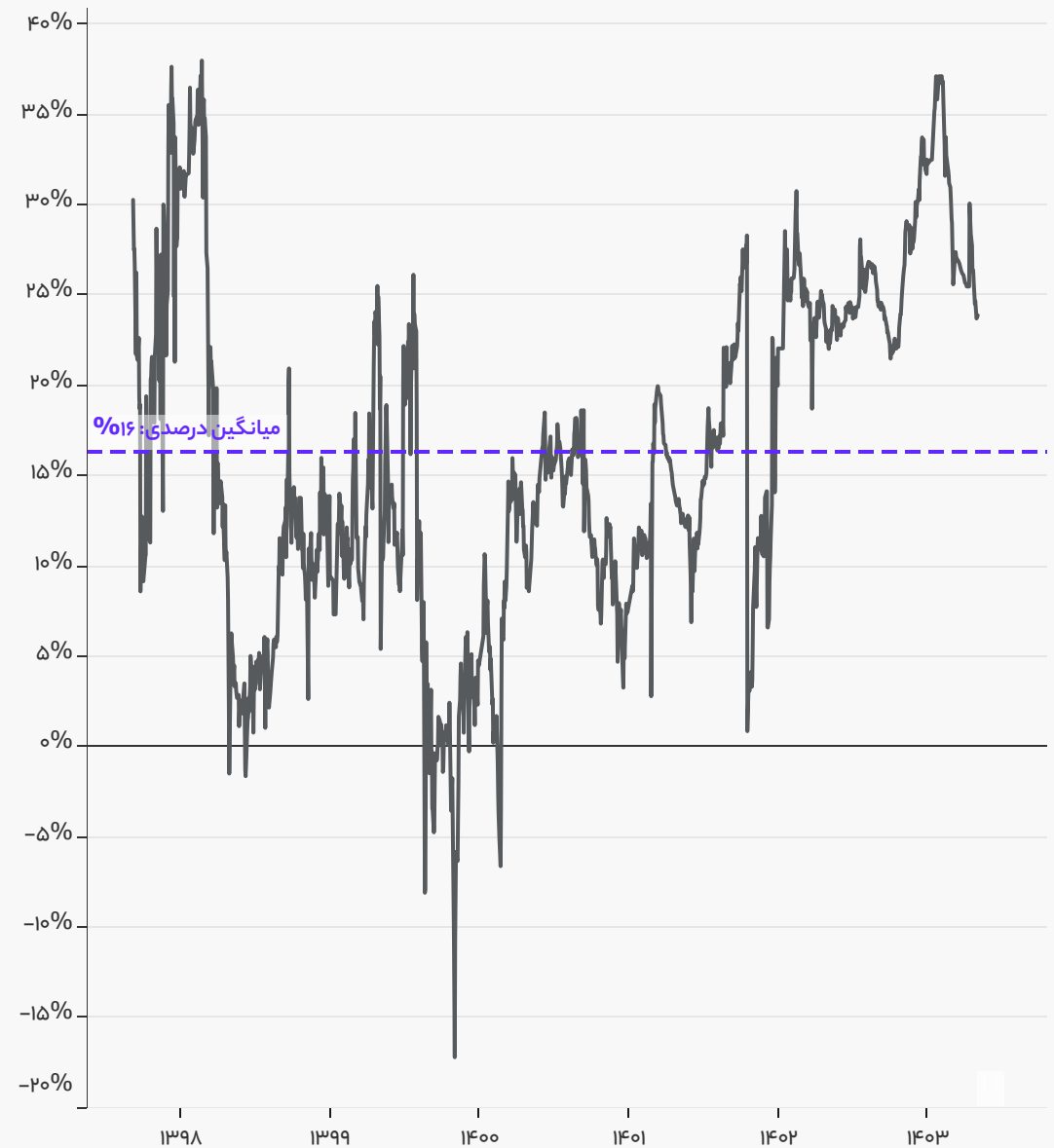


* دلار سکه با استفاده از سکه امامی محاسبه شده است.

ارز خارجی

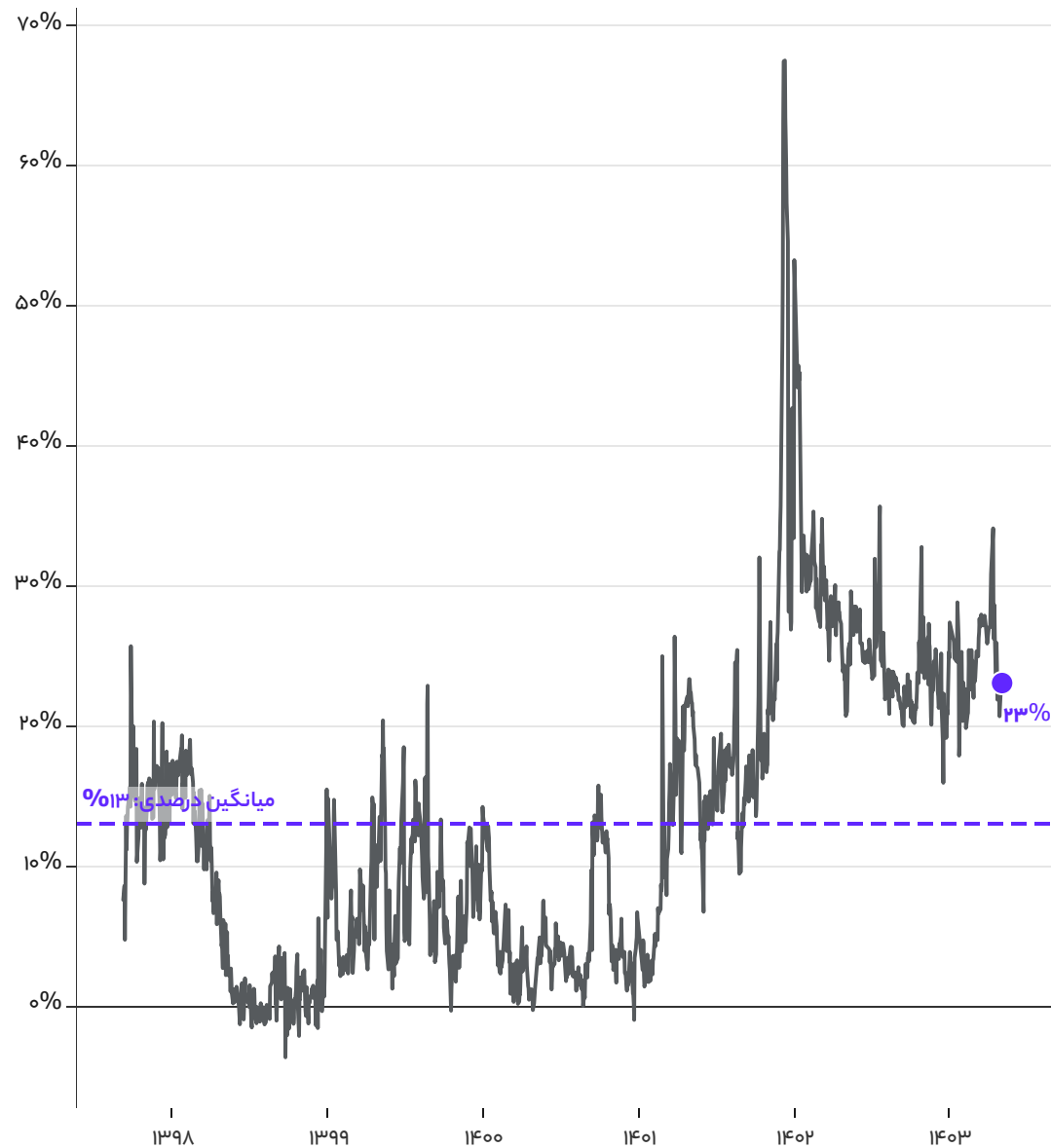
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



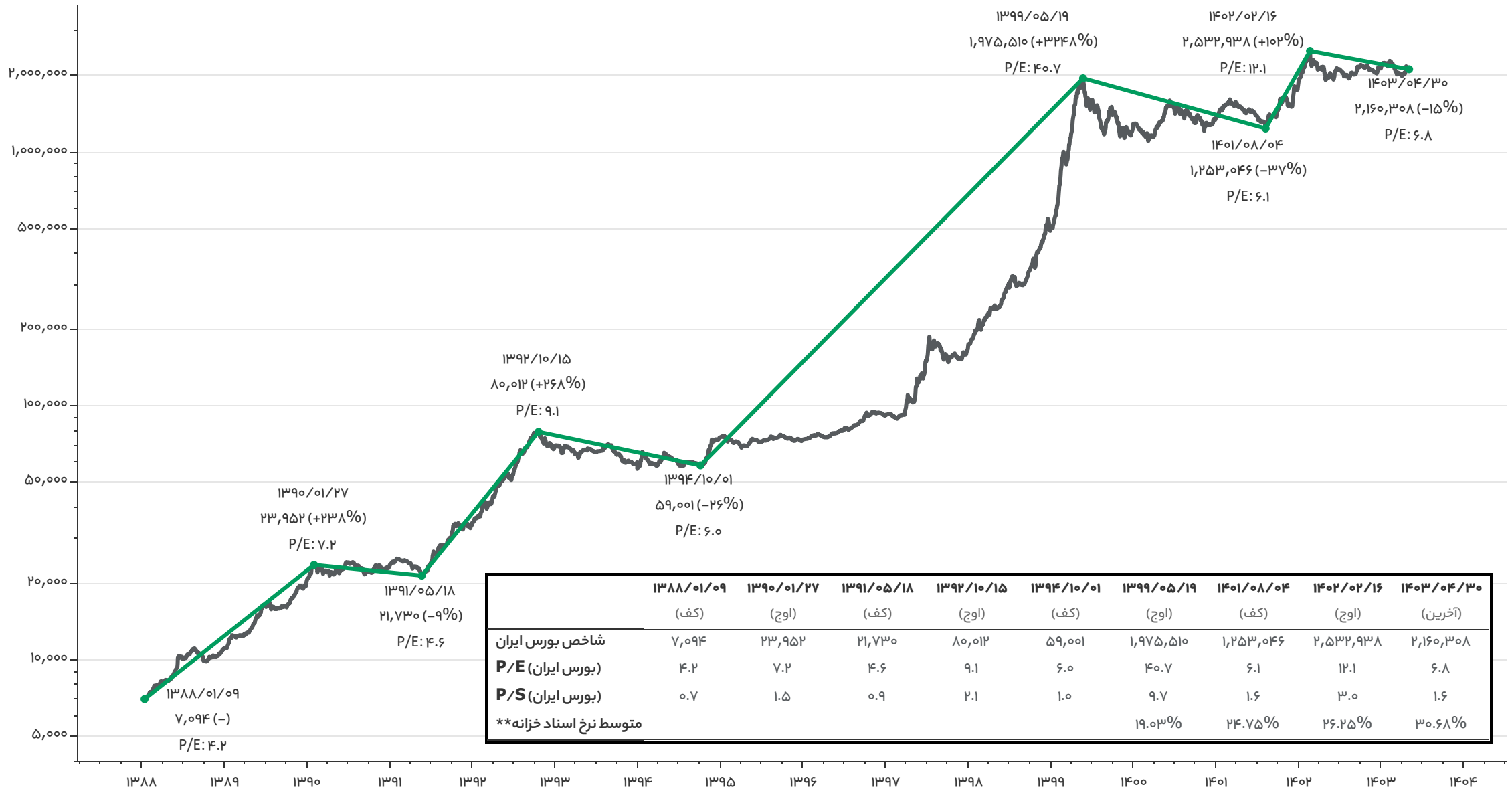


EQUITY

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 بر اساس شاخص بورس ایران

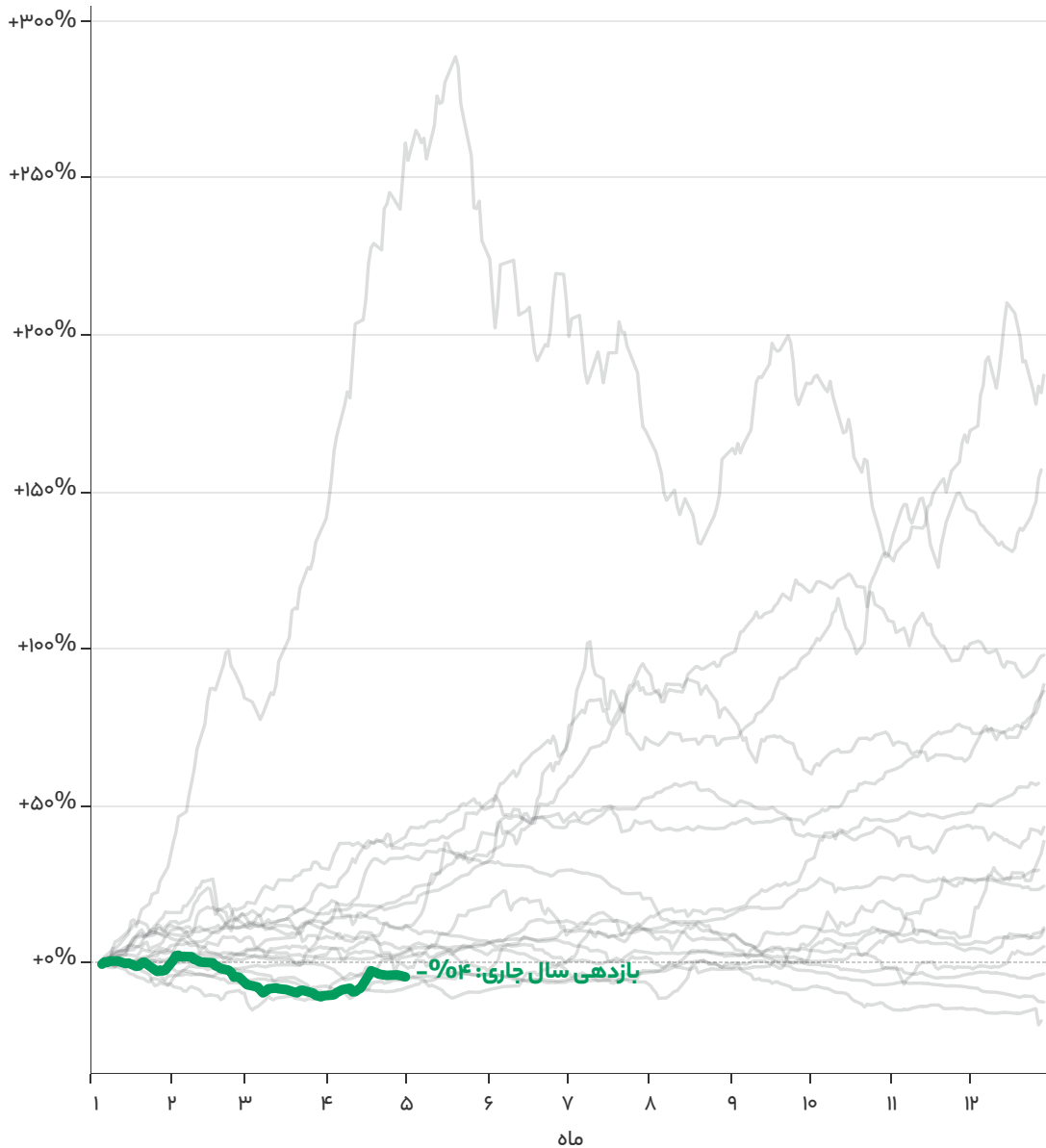


	۱۳۸۸/۰۱/۰۹	۱۳۹۰/۰۱/۲۷	۱۳۹۱/۰۵/۱۸	۱۳۹۲/۱۰/۱۵	۱۳۹۴/۱۰/۰۱	۱۳۹۹/۰۵/۱۹	۱۴۰۱/۰۸/۰۴	۱۴۰۲/۰۲/۱۶	۱۴۰۳/۰۴/۳۰
	(کف)	(اوج)	(کف)	(اوج)	(کف)	(اوج)	(کف)	(اوج)	(آخرین)
شاخص بورس ایران	۷,۰۹۴	۲۳,۹۵۲	۲۱,۷۳۰	۸۰,۰۱۲	۵۹,۰۰۱	۱,۹۷۵,۵۱۰	۱,۲۵۳,۰۴۶	۲,۵۳۲,۹۳۸	۲,۱۶۰,۳۰۸
P/E (بورس ایران)	۴.۲	۷.۲	۴.۶	۹.۱	۶.۰	۴۰.۷	۶.۱	۱۲.۱	۶.۸
P/S (بورس ایران)	۰.۷	۱.۵	۰.۹	۲.۱	۱.۰	۹.۷	۱.۶	۳.۰	۱.۶
متوسط نرخ اسناد خزانه**						۱۹.۰۳%	۲۴.۷۵%	۲۶.۲۵%	۳۰.۶۸%

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

مقایسه بازدهی سال جاری

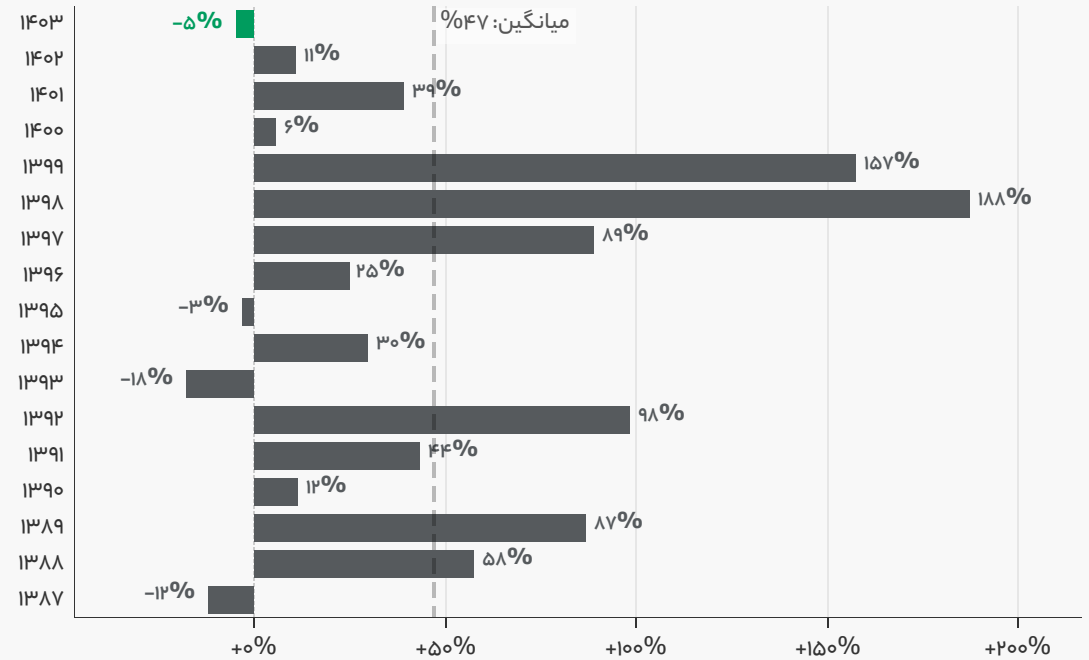
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



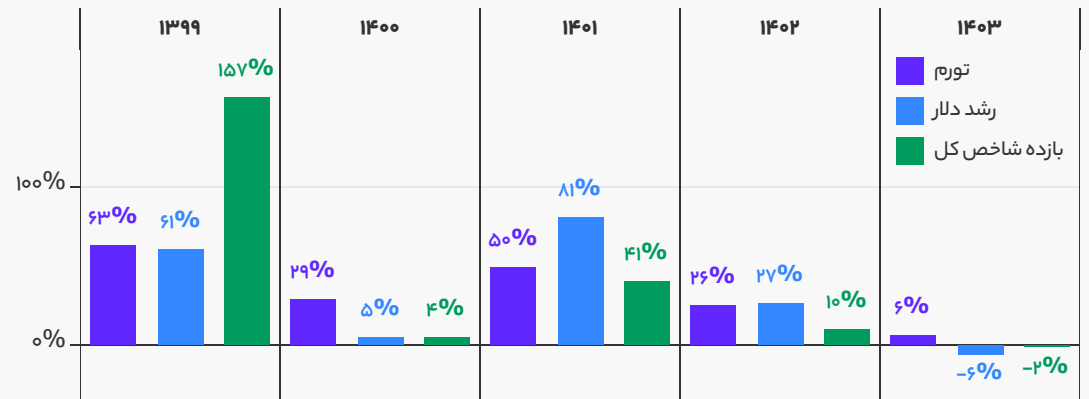
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

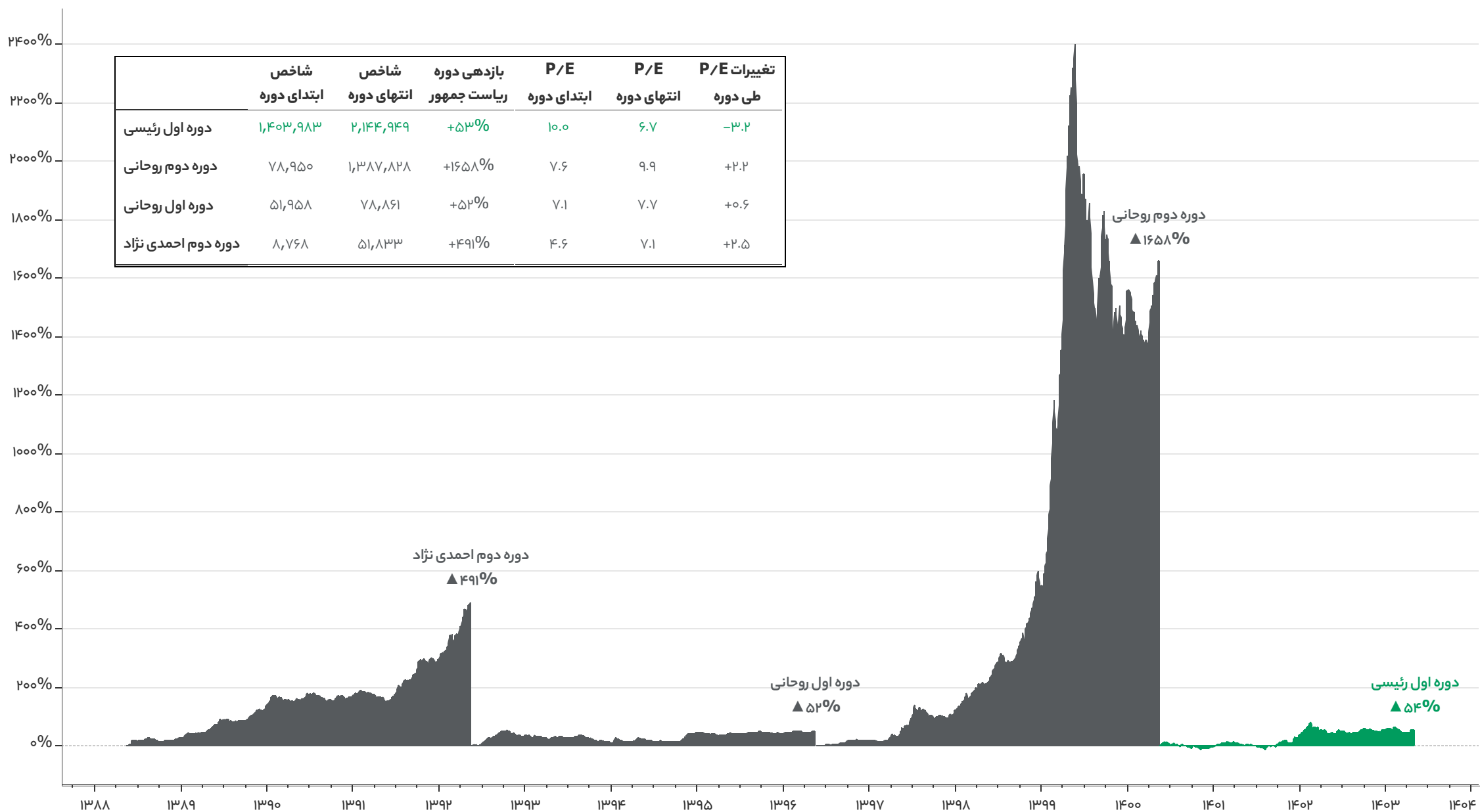


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلندمدت بازار سهام

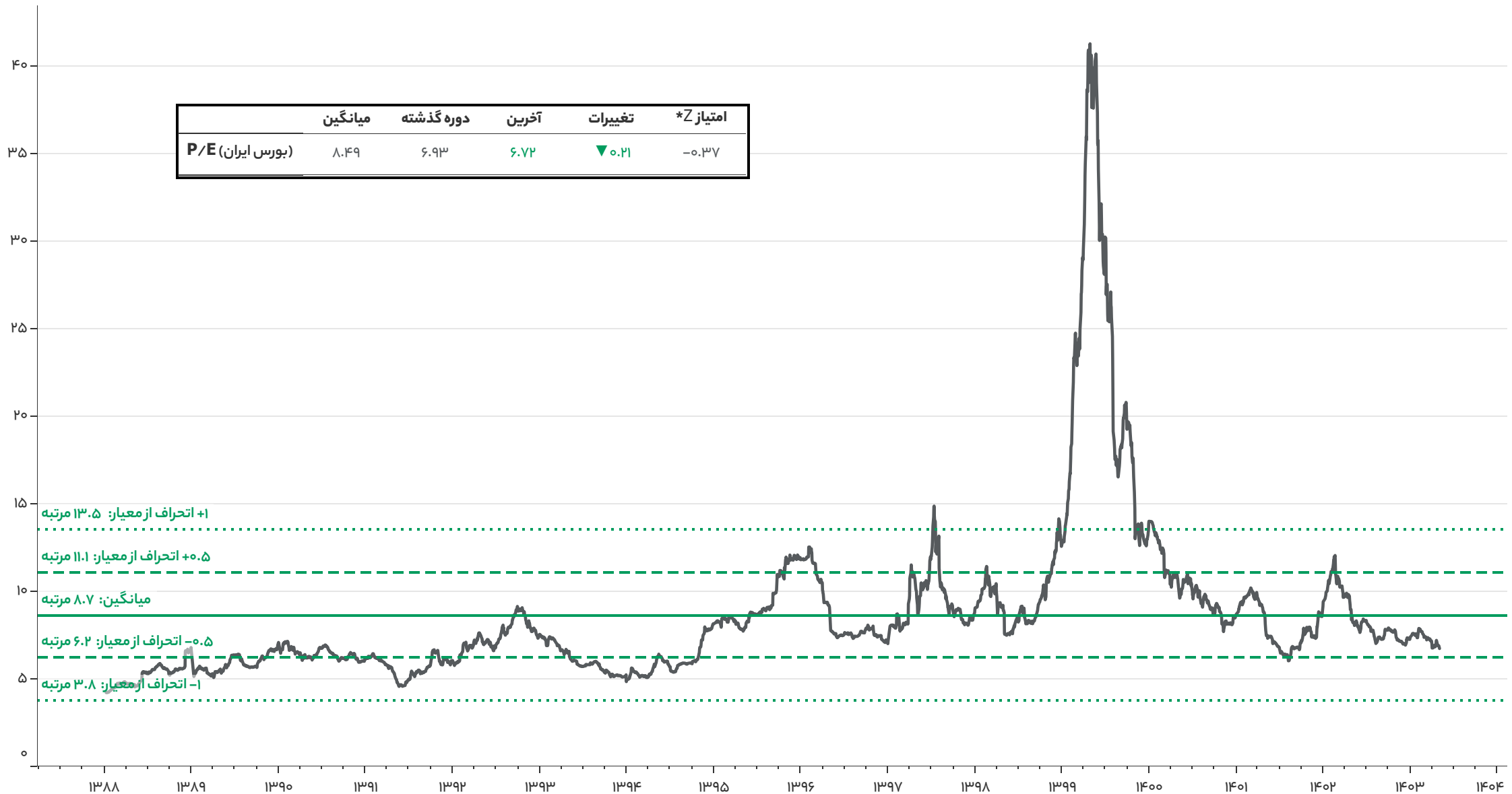
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



ارزندگی بازار سهام

نسبت قیمت به سود (P/E) بورس ایران

از ابتدای سال ۱۳۸۸، نسبت قیمت به سود گذشته نگر بورس ایران*



* میانگین وزنی نسبت قیمت به سود سهام براساس ارزش بازار

ارزندگی بازار سهام

ارزش دلاری بازار

از سال ۱۳۹۵، ارزش بازار بورس تهران و فرابورس، میلیارد دلار، محاسبه شده با دلار آزاد، در برابر شاخص کل بورس تهران، برای مقایسه بهتر عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف شده‌اند.



* ارزش ریالی بازار نیز پس از حذف عرضه‌های اولیه از سال ۱۳۹۵ محاسبه شده است.

ارزندگی بازار سهام

نسبت ارزش کل بازار به نقدینگی کشور*

از سال ۱۳۹۵، ارزش کل بازار بورس تهران و فرابورس**، در برابر شاخص کل بورس تهران



* با توجه به اختلاف زمانی چند ماهه انتشار اطلاعات نقدینگی کشور، ماه‌های منتهی با استفاده از مدل‌های آماری برآورد گردیده‌اند.
 ** برای مقایسه بهتر، عرضه اولیه‌های سال ۱۳۹۵ به بعد حذف گردیده‌اند.

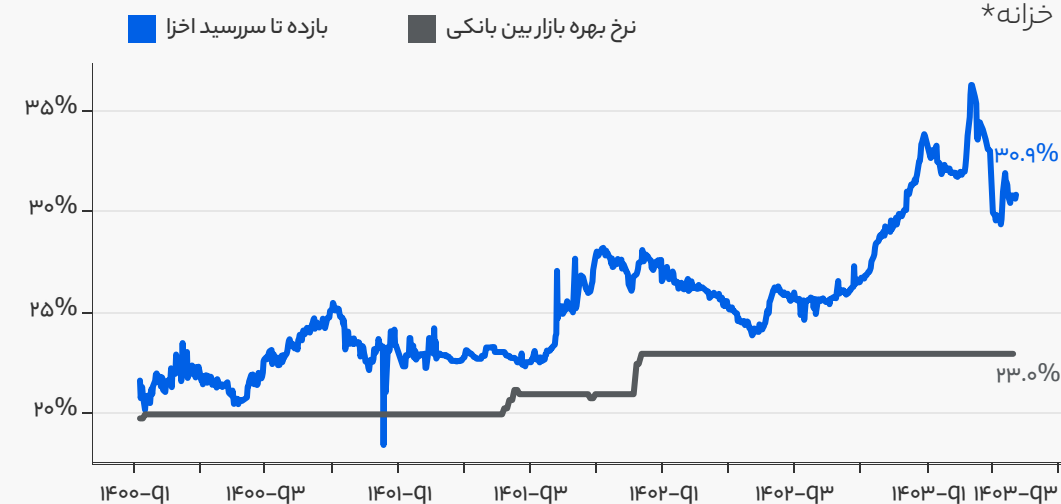


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

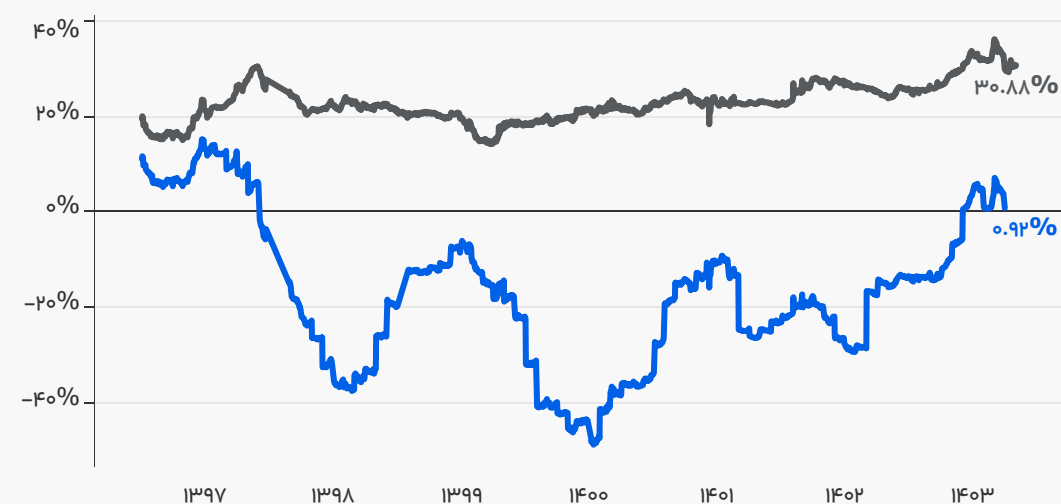
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

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



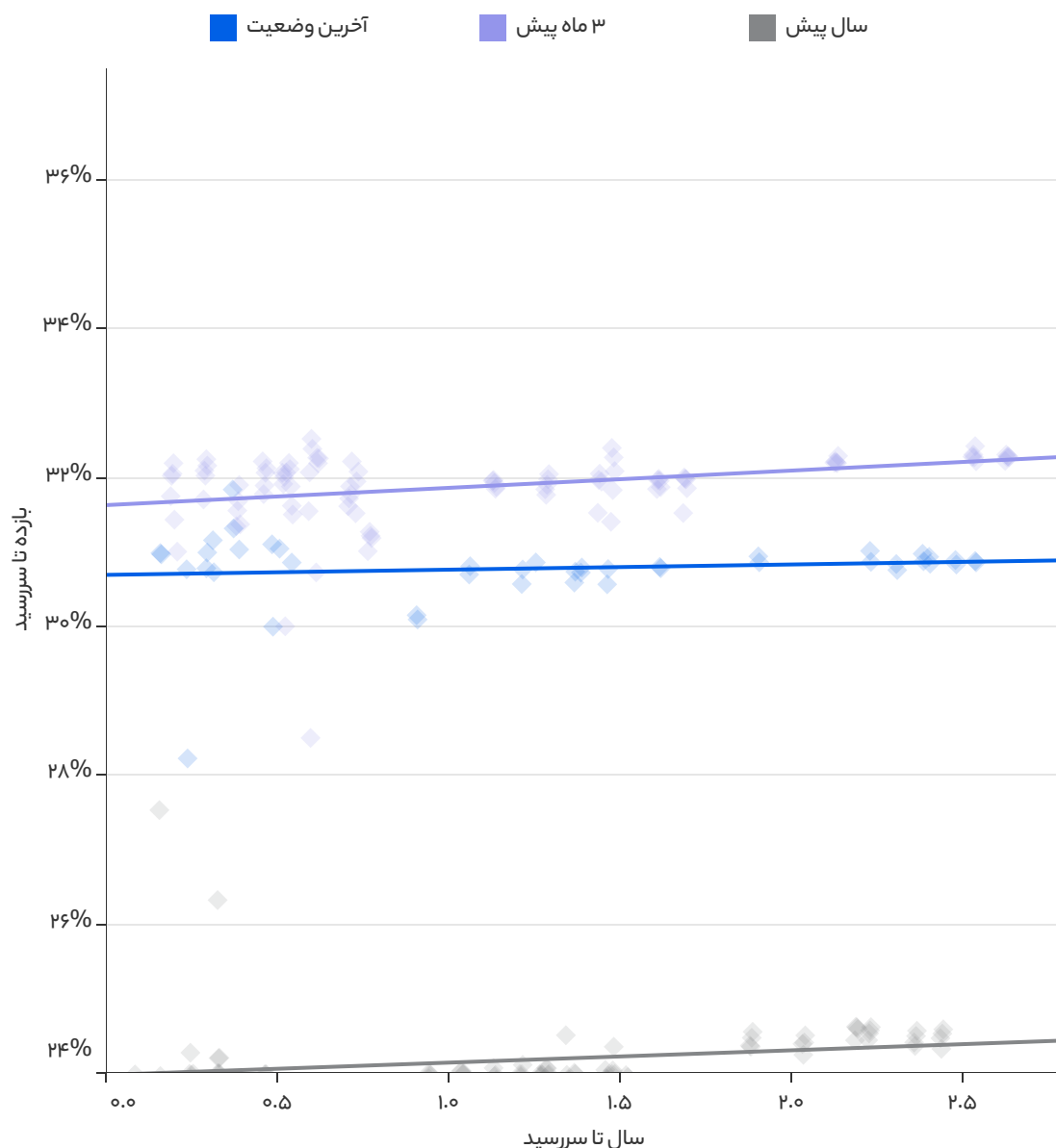
بازده اسمی و واقعی اسناد خزانه**

از سال ۱۳۹۵، میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسيد اسناد خزانه



منحنی بازده تا سررسيد اسناد خزانه

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

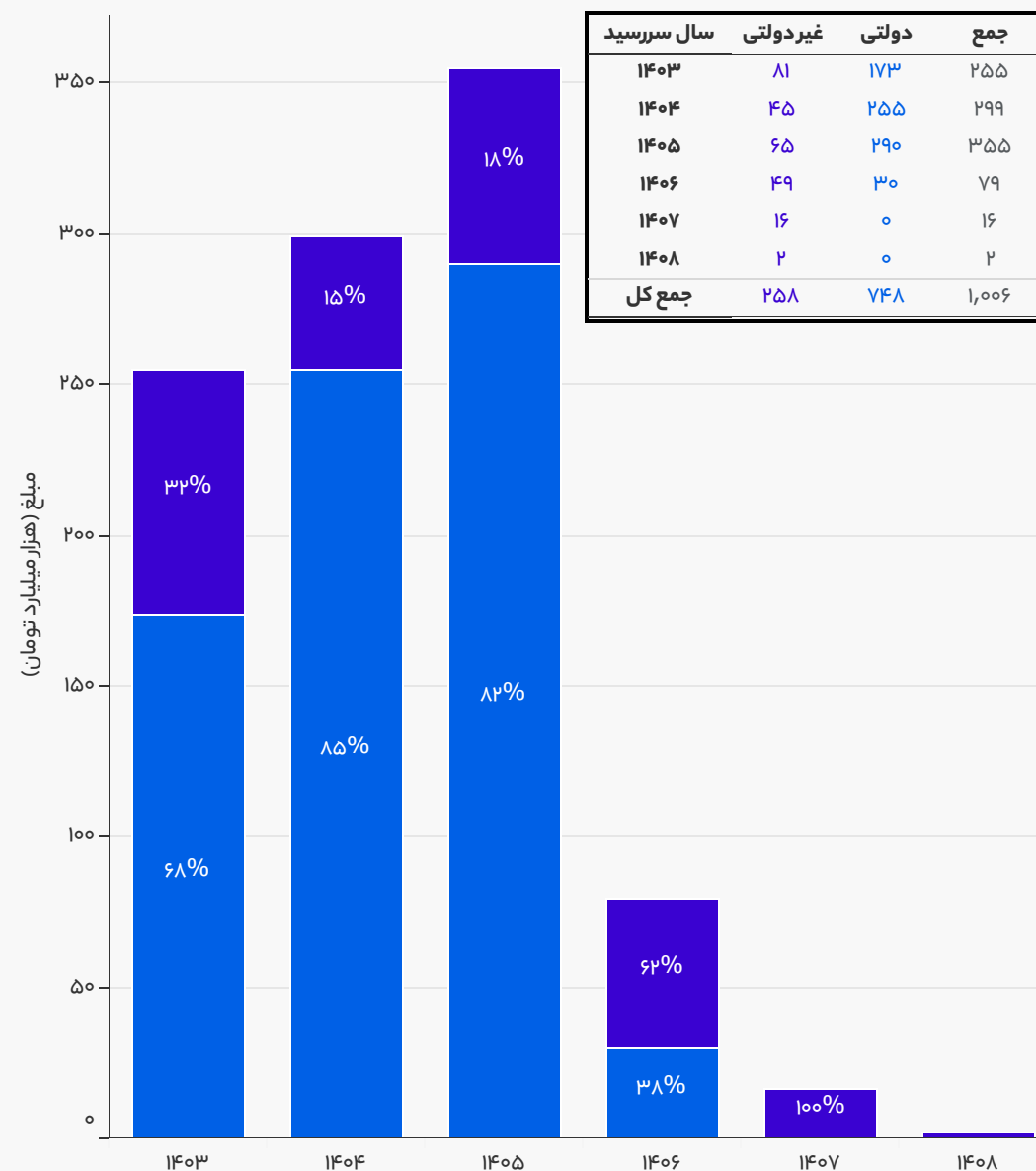


* میانگین روزانه بازده تا سررسيد اسناد خزانه در سررسيدهای مختلف که بیش از ۳۰ روز تا سررسيد خود فاصله دارند.
 ** بازده واقعی اسناد خزانه با نرخ تورم نقطه به نقطه سالانه محاسبه شده است.
 *** برای رسم منحنی نیز اسناد خزانه با تاریخ سررسيد کمتر از ۳۰ روز حذف گردیده‌اند.

دید کلی بازار بدهی

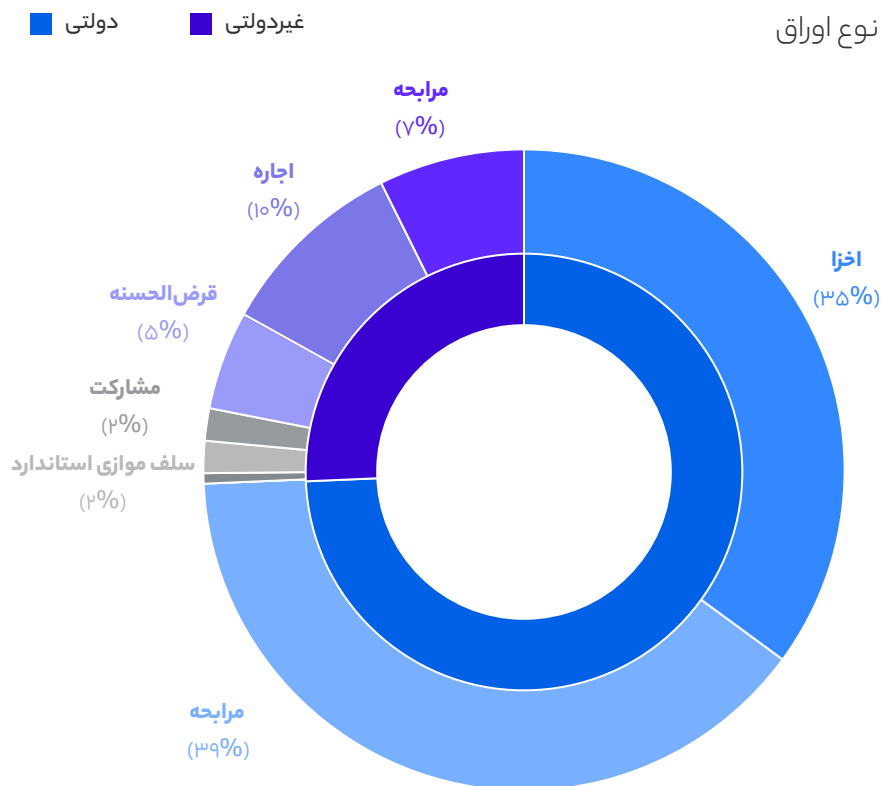
مانده اوراق به تفکیک سررسید

به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



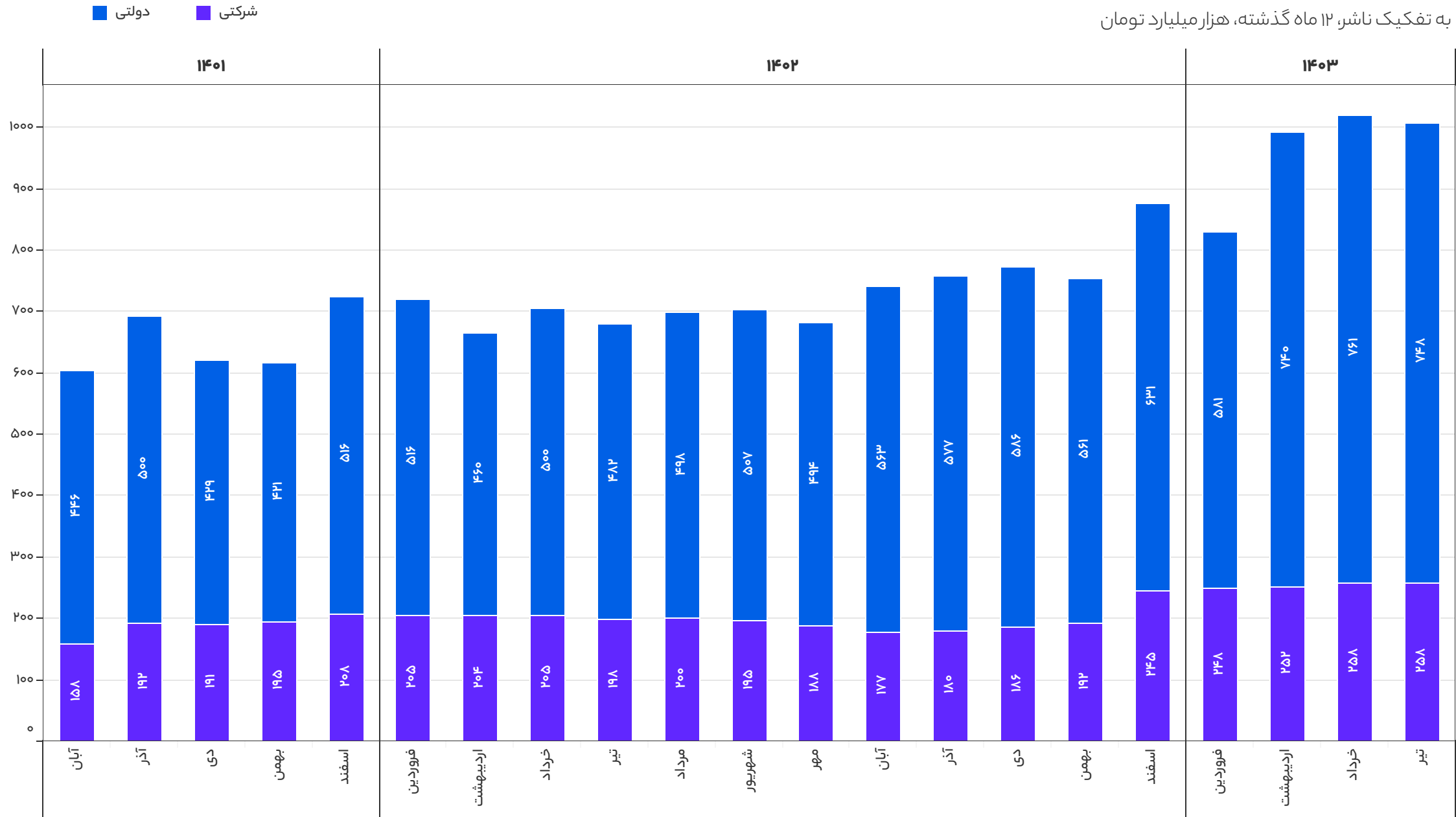
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مراجعه	۳۹۵	۳۹%
	اخزا	۳۵۳	۳۵%
غیردولتی	اجاره	۹۶	۱۰%
	مراجعه	۷۴	۷%
	قرض الحسنه	۵۰	۵%
	مشارکت	۱۷	۲%
	سلف موازی استاندارد	۱۶	۲%
	منفعت	۵	۱%
جمع کل		۱,۰۰۶	۱۰۰%

* 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

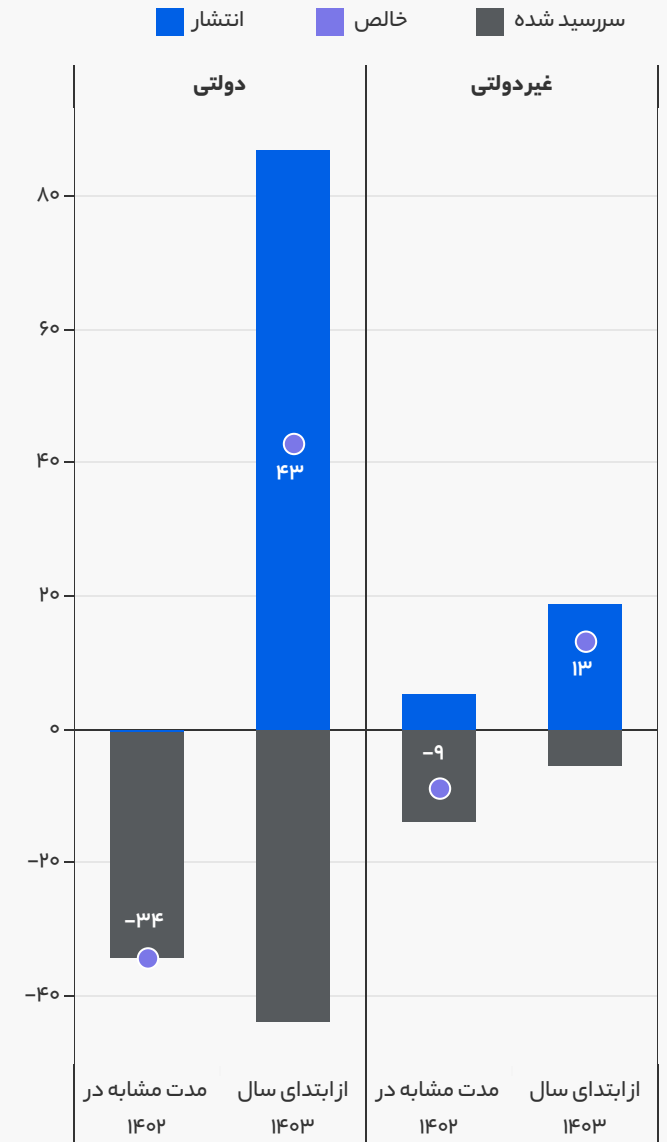
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

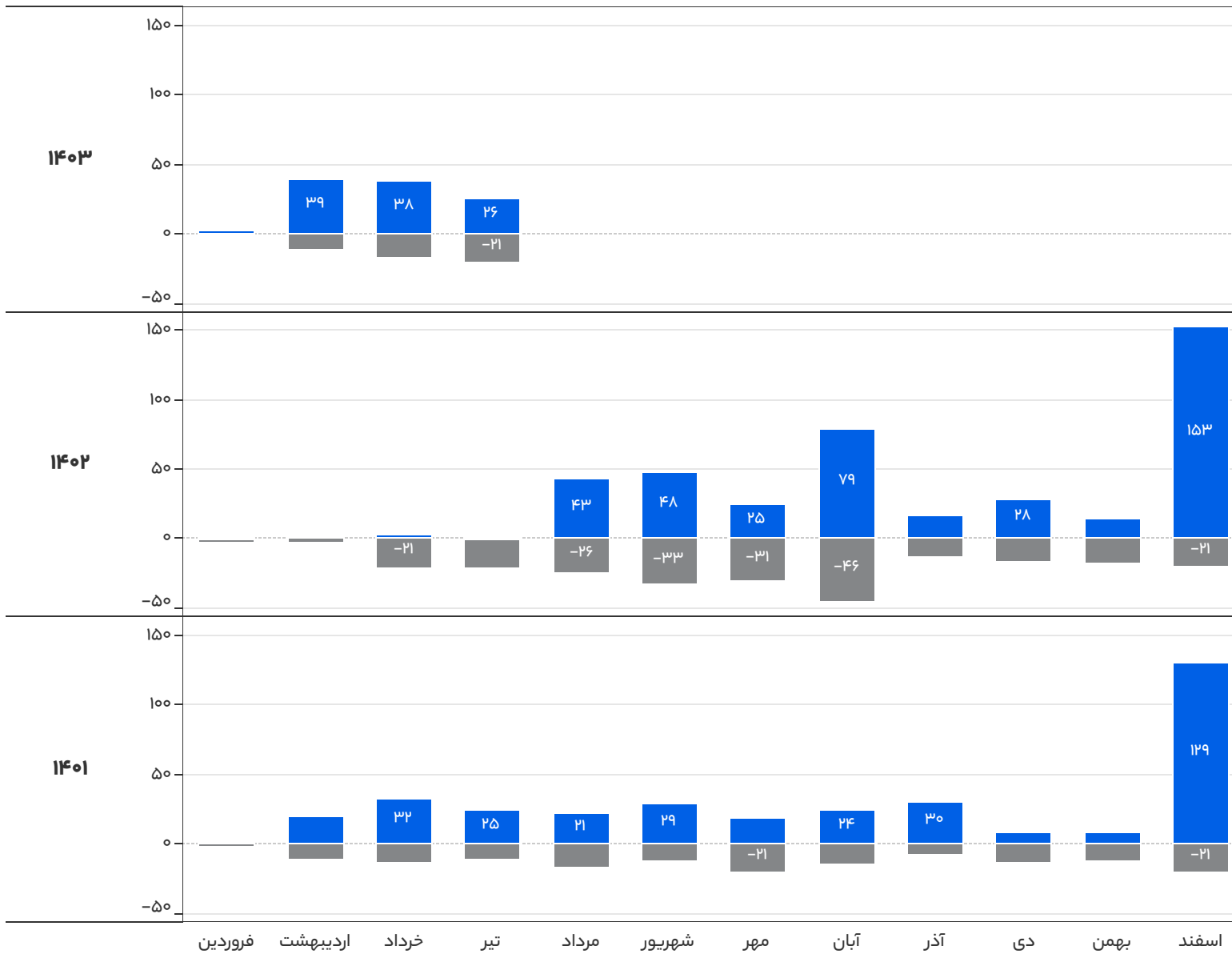
مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

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

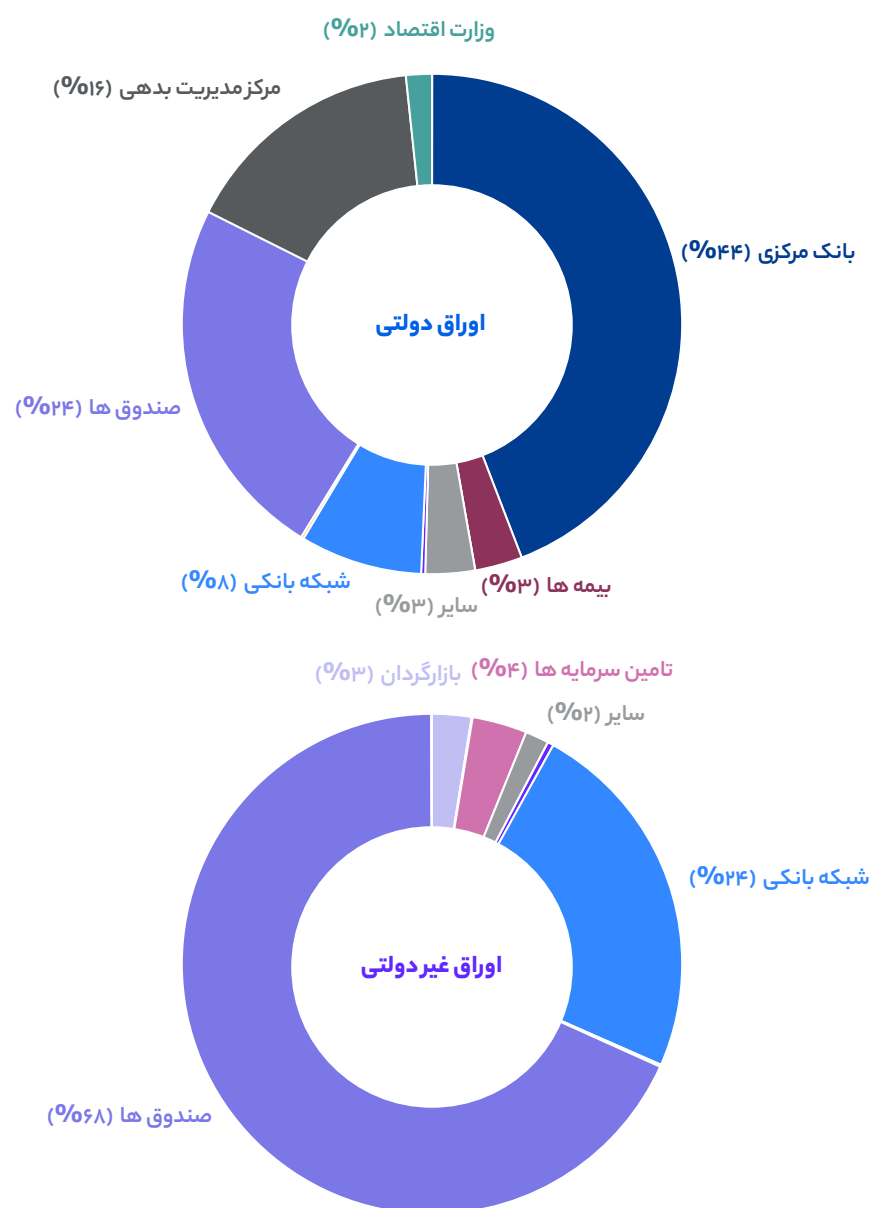
حجم اوراق منتشر و سررسید شده، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

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



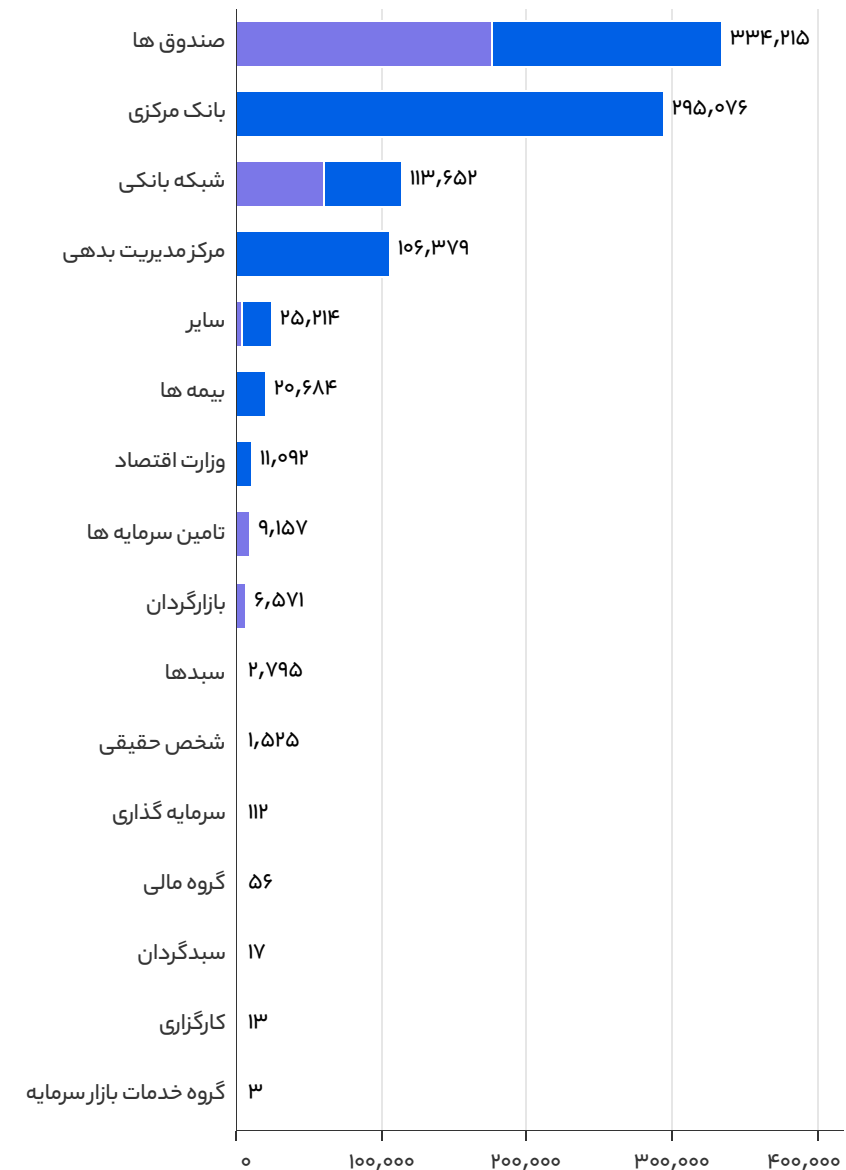
	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	۱۴۰۸	جمع کل	
دولتی	بانک مرکزی	۶۰.۴	۱۱۵.۱	۱۰۳.۰	۱۶.۵			۲۹۵.۱
	صندوق ها	۶۳.۱	۵۸.۶	۲۸.۴	۷.۷			۱۵۷.۸
	مرکز مدیریت بدهی	۶.۶	۶.۴	۹۳.۴	-			۱۰۶.۴
	شبکه بانکی	۱۷.۳	۲۶.۴	۴.۶	۴.۴			۵۲.۸
	سایر	۱.۶	۱۴.۵	۵.۱	-			۲۱.۳
	بیمه ها	۷.۱	۴.۹	۷.۴	۱.۱			۲۰.۵
	وزارت اقتصاد	-	-	۱۱.۱	-			۱۱.۱
	سبدها	۱.۰	۰.۷	۰.۱	-			۱.۸
	شخص حقیقی	-	۰.۸	۰.۳	-			۱.۱
	تامین سرمایه ها	-	-	-	-			-
بازارگردان	-	-	-	-			-	
غیردولتی	صندوق ها	۳۰.۲	۳۷.۴	۵۲.۴	۴۱.۳	۱۳.۴	۱.۷	۱۷۶.۴
	شبکه بانکی	۵۱.۰	۰.۷	۷.۲	۲.۰	-	-	۶۰.۹
	تامین سرمایه ها	۰.۶	۳.۶	۲.۳	۱.۹	۰.۷	-	۹.۱
	بازارگردان	۰.۹	۲.۲	۲.۱	۱.۰	۰.۳	-	۶.۵
	سایر	۰.۲	۰.۱	۰.۳	۲.۴	۱.۰	-	۳.۹
	سبدها	-	-	۰.۳	۰.۴	۰.۳	-	۱.۰
	شخص حقیقی	۰.۱	-	-	-	۰.۲	-	۰.۴
	بیمه ها	۰.۱	-	-	-	۰.۱	-	۰.۲
	سرمایه گذاری	-	-	-	-	۰.۱	-	۰.۱
	گروه مالی	-	-	۰.۱	-	-	-	۰.۱
	سبدگردان	-	-	-	-	-	-	-
	کارگزاری	-	-	-	-	-	-	-
	گروه خدمات بازار سر..	-	-	-	-	-	-	-
جمع دولتی و غیردولتی	۲۴۰.۱	۲۷۱.۴	۳۱۸.۲	۷۸.۹	۱۶.۲	۱.۷	۹۲۶.۶	

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق

ارزش اسمی، به تفکیک ناشر اوراق، میلیارد تومان

دولتی غیردولتی



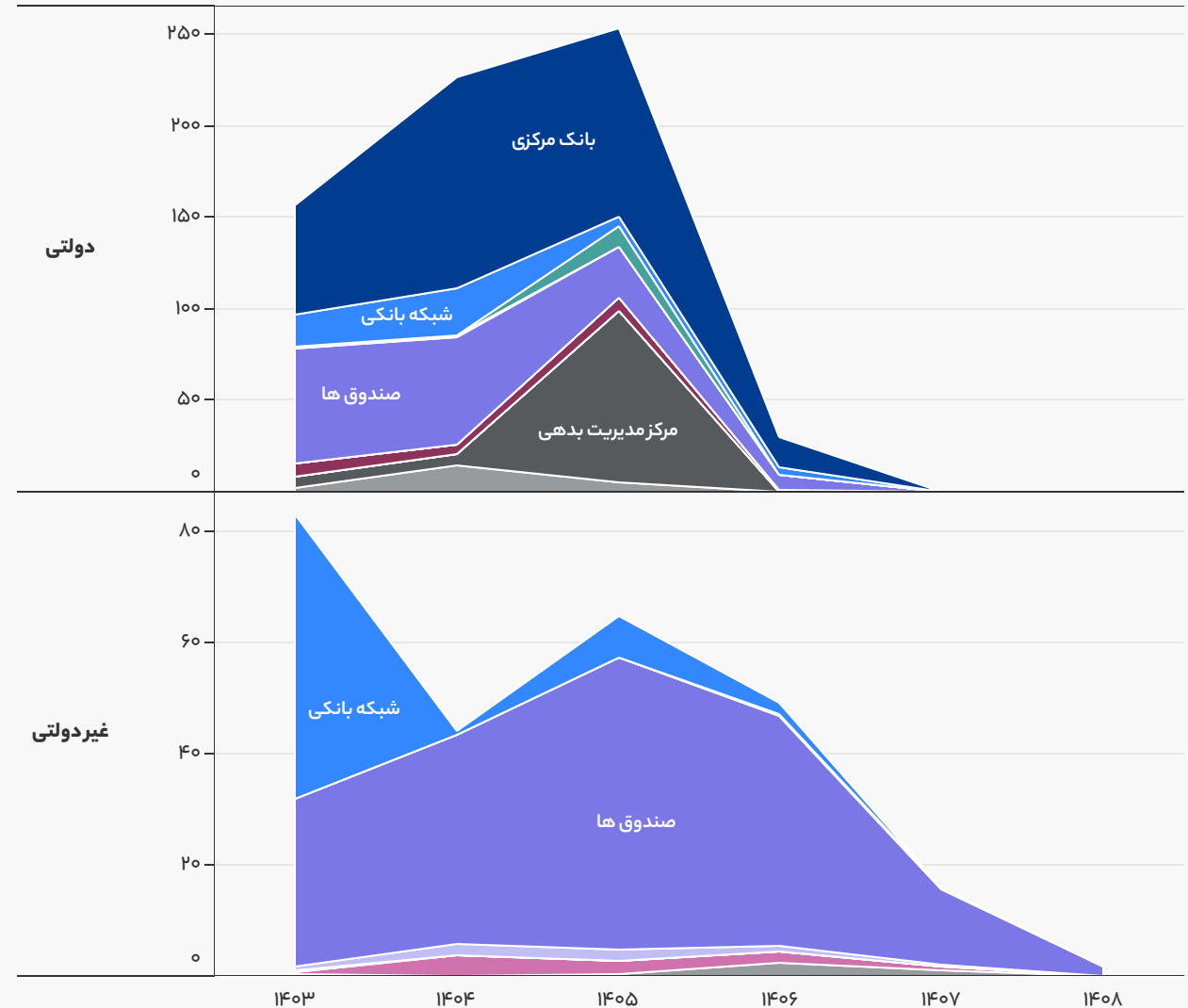
جمع	گام	منفعت	مشارکت	مراجعه	قرض الحسنه	سلف موازی استاندارد	خزانه اسلامی	خرید دین	اجاره
۳۳۴,۴۱۵	۰	۴,۸۸۶	۱۵,۲۲۷	۱۵۹,۷۵۰	۰	۱۳,۹۴۰	۶۱,۳۲۰	۵۰	۷۹,۲۴۲
۲۹۵,۰۷۶	۰	۰	۰	۲۴۰,۶۷۷	۰	۰	۵۴,۳۹۹	۰	۰
۱۱۳,۶۵۲	۰	۱۰۰	۴۷۰	۳۲,۳۳۳	۵۰,۰۰۰	۰	۲۴,۶۶۰	۰	۶,۱۰۰
۱۰۶,۳۷۹	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱۰۶,۳۷۹	۰	۰
۲۰,۶۸۴	۰	۰	۰	۹,۴۲۷	۴۰	۴۵	۱۱,۱۳۳	۰	۴۰
۲۵,۲۱۴	۰	۰	۲۵	۱۷۳	۵۲	۰	۲۱,۲۶۴	۰	۳,۷۰۰
۹,۱۵۷	۰	۹۵	۱,۰۹۵	۳,۱۷۹	۲	۵۱۲	۰	۵	۴,۲۶۹
۶,۵۷۱	۰	۱۰۷	۱,۱۳۸	۲,۰۹۵	۰	۱,۰۴۵	۰	۰	۲,۱۸۵
۲,۷۹۵	۰	۰	۰	۱,۲۸۷	۰	۱۸۵	۱,۱۳۰	۰	۱۹۴
۱۷	۰	۰	۰	۱۷	۰	۰	۰	۰	۰
۱۱۲	۰	۰	۰	۱۲	۰	۰	۰	۰	۱۰۰
۱,۵۲۵	۰	۰	۰	۲۶۲	۰	۹۰	۱,۱۳۲	۰	۴۱
۱۳	۰	۰	۰	۰	۳	۰	۰	۰	۱۰
۳	۰	۰	۰	۳	۰	۰	۰	۰	۰
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰
۱۱,۰۹۲	۰	۰	۰	۱۱,۰۹۲	۰	۰	۰	۰	۰
۹۲۶,۷۶۲	۰	۵,۱۸۹	۱۷,۹۵۵	۴۶۰,۳۵۳	۵۰,۰۹۷	۱۵,۸۱۶	۲۸۱,۴۱۷	۵۵	۹۵,۸۸۱

بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

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

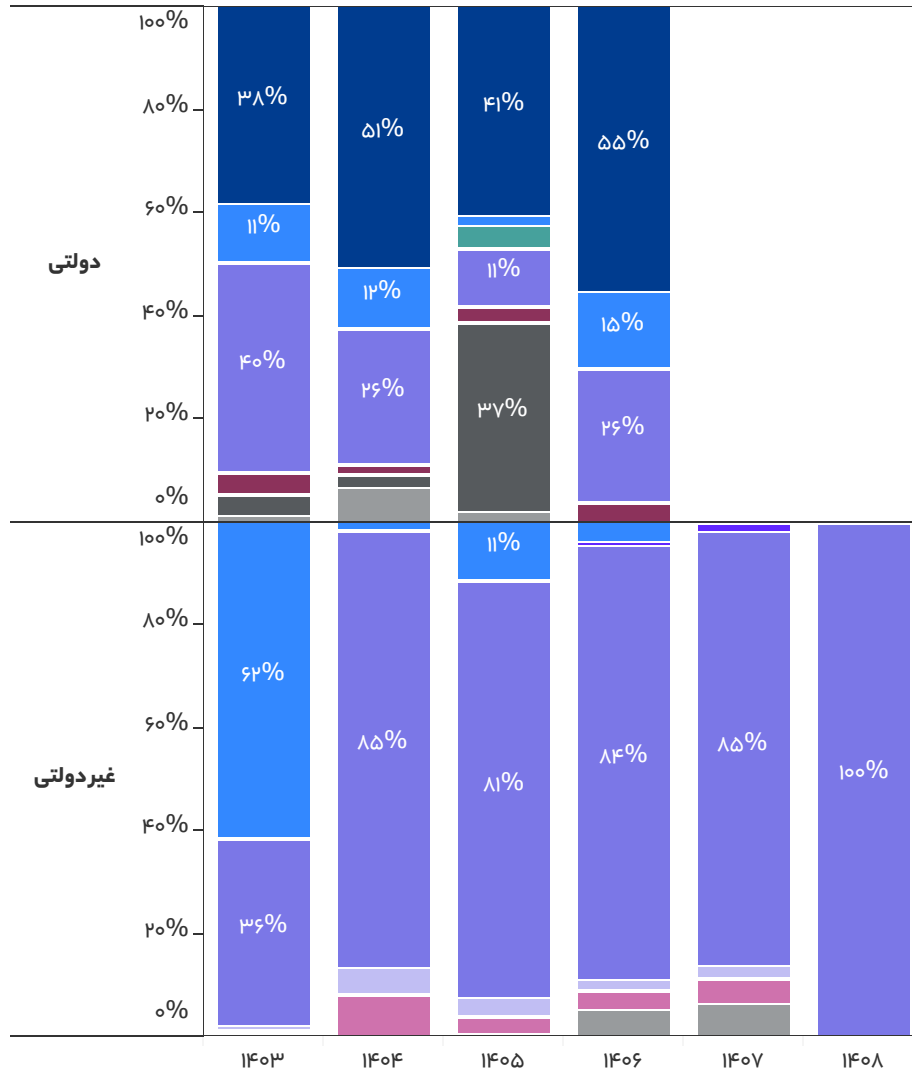
- بانک مرکزی
- سبدها
- بیمه‌ها
- سایر
- شبکه بانکی
- صندوق‌ها
- تامین سرمایه‌ها
- وزارت اقتصاد
- بازارگردان
- مرکز مدیریت بدهی



سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

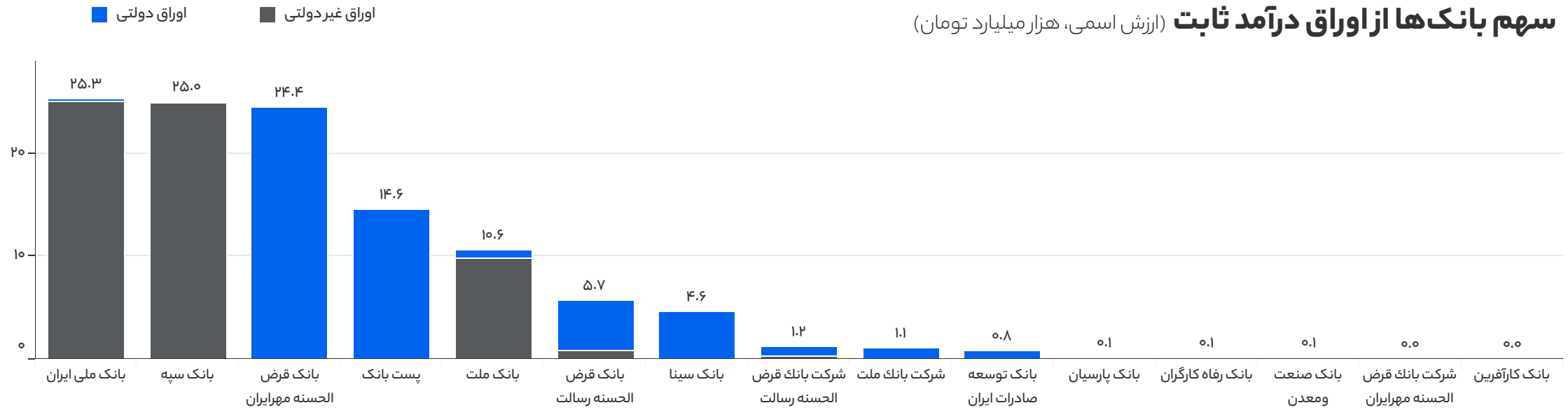
درصد از کل اوراق در هر سال، به تفکیک دارندگان اوراق (دارندگان درصدی)

- بانک مرکزی
- سبدها
- بیمه‌ها
- سایر
- شبکه بانکی
- صندوق‌ها
- تامین سرمایه‌ها
- وزارت اقتصاد
- بازارگردان
- مرکز مدیریت بدهی

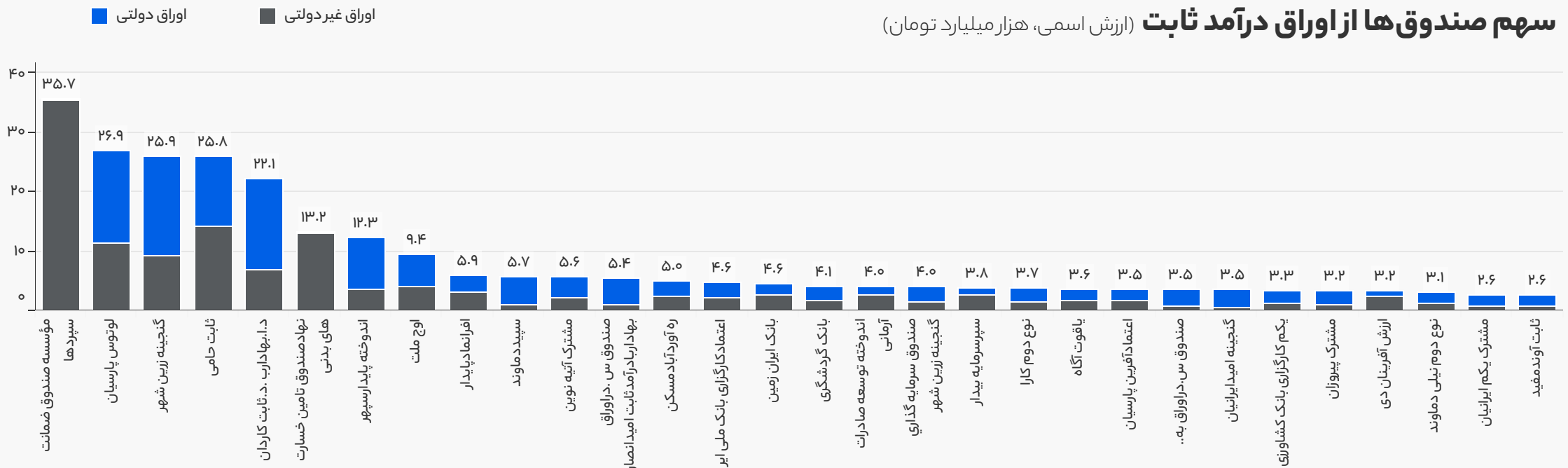


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



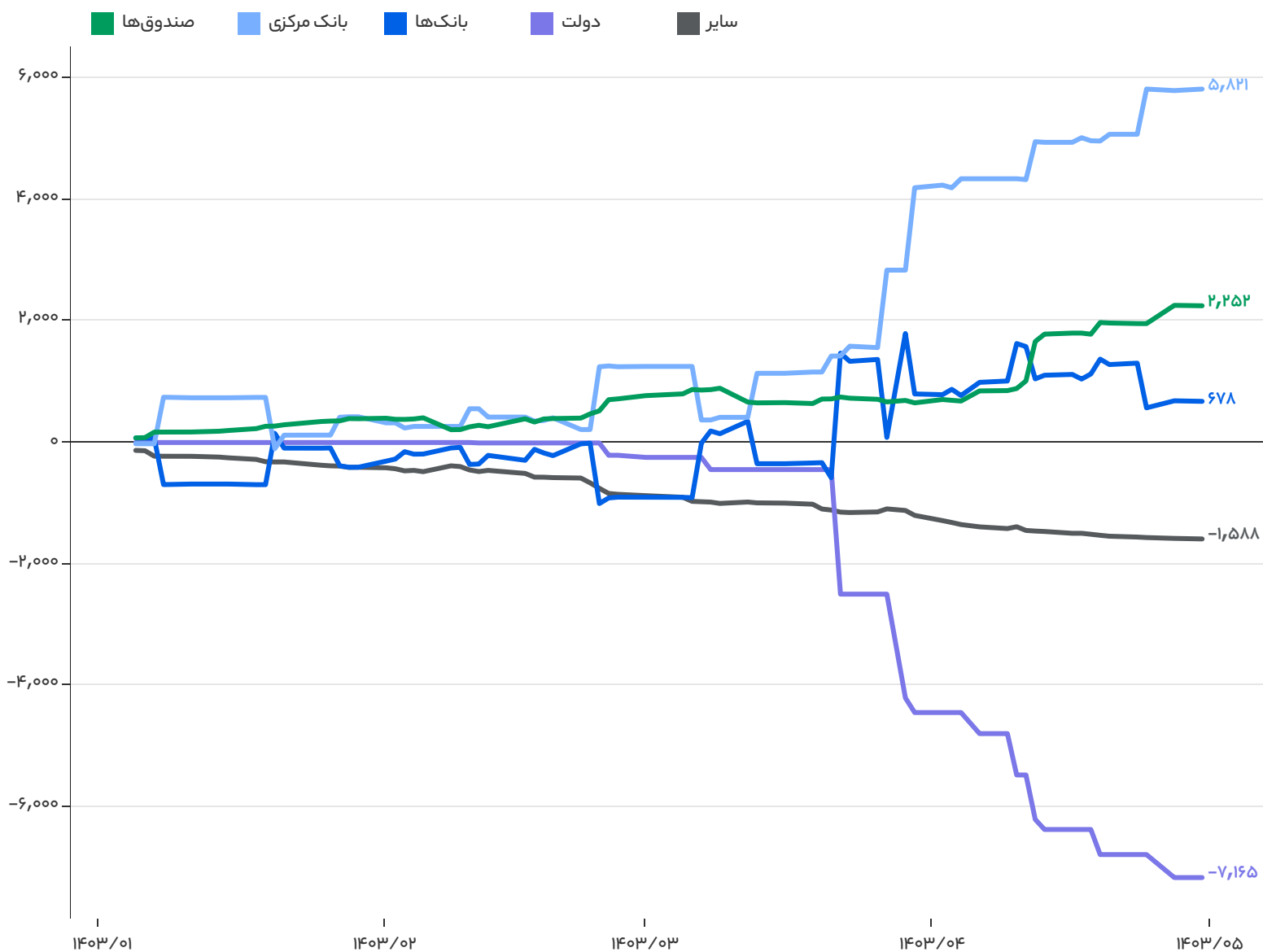
سهام صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

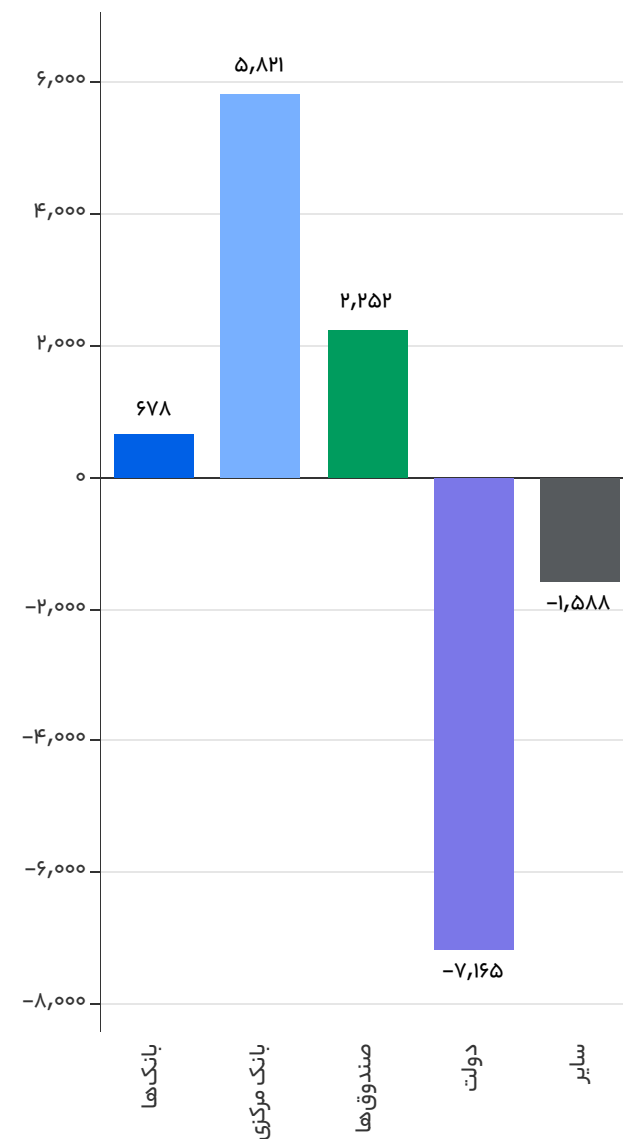
خالص معاملات اوراق

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



خلاصه معاملات اوراق

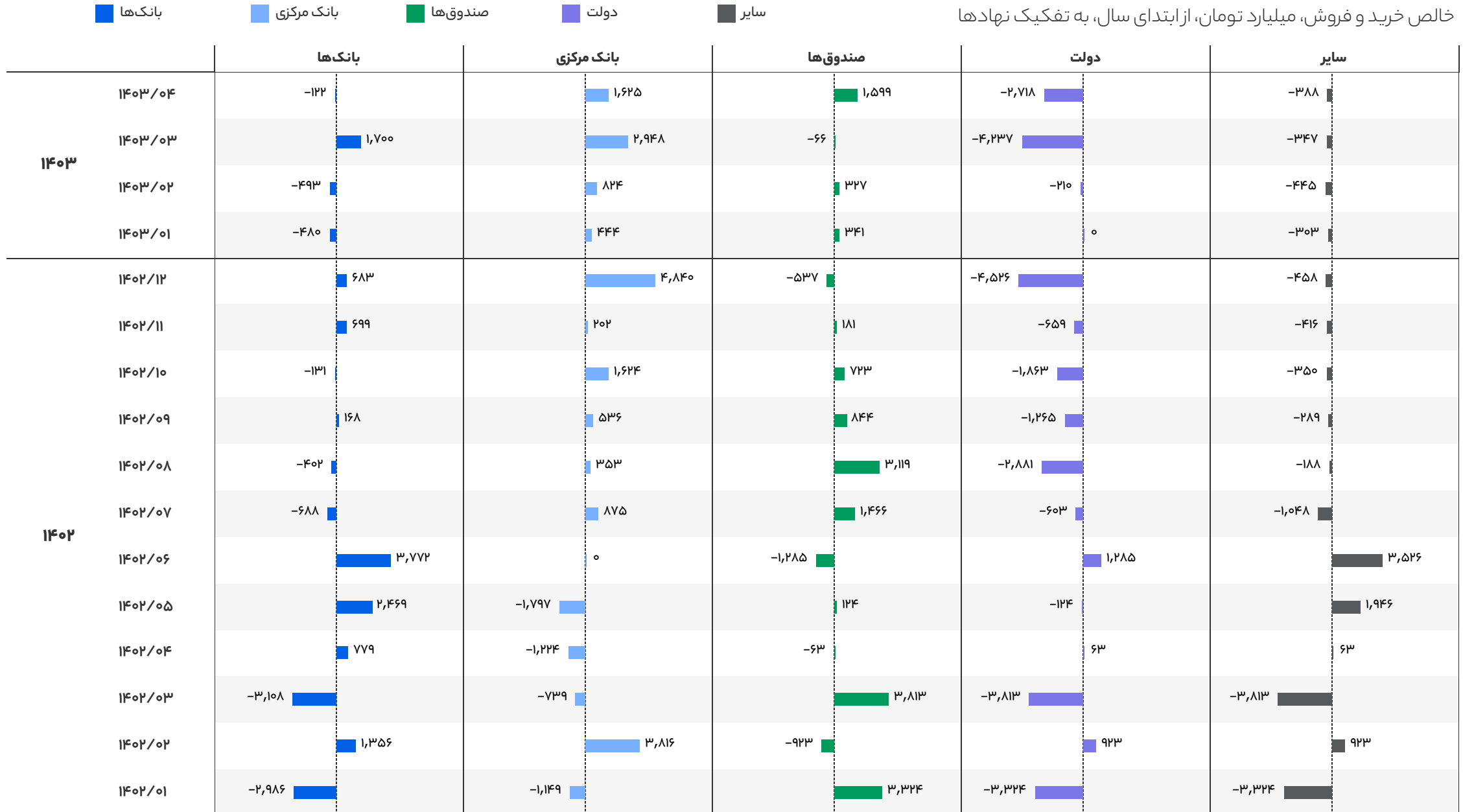
خالص خرید و فروش، میلیارد تومان، از ابتدای سال، به تفکیک نهادها



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

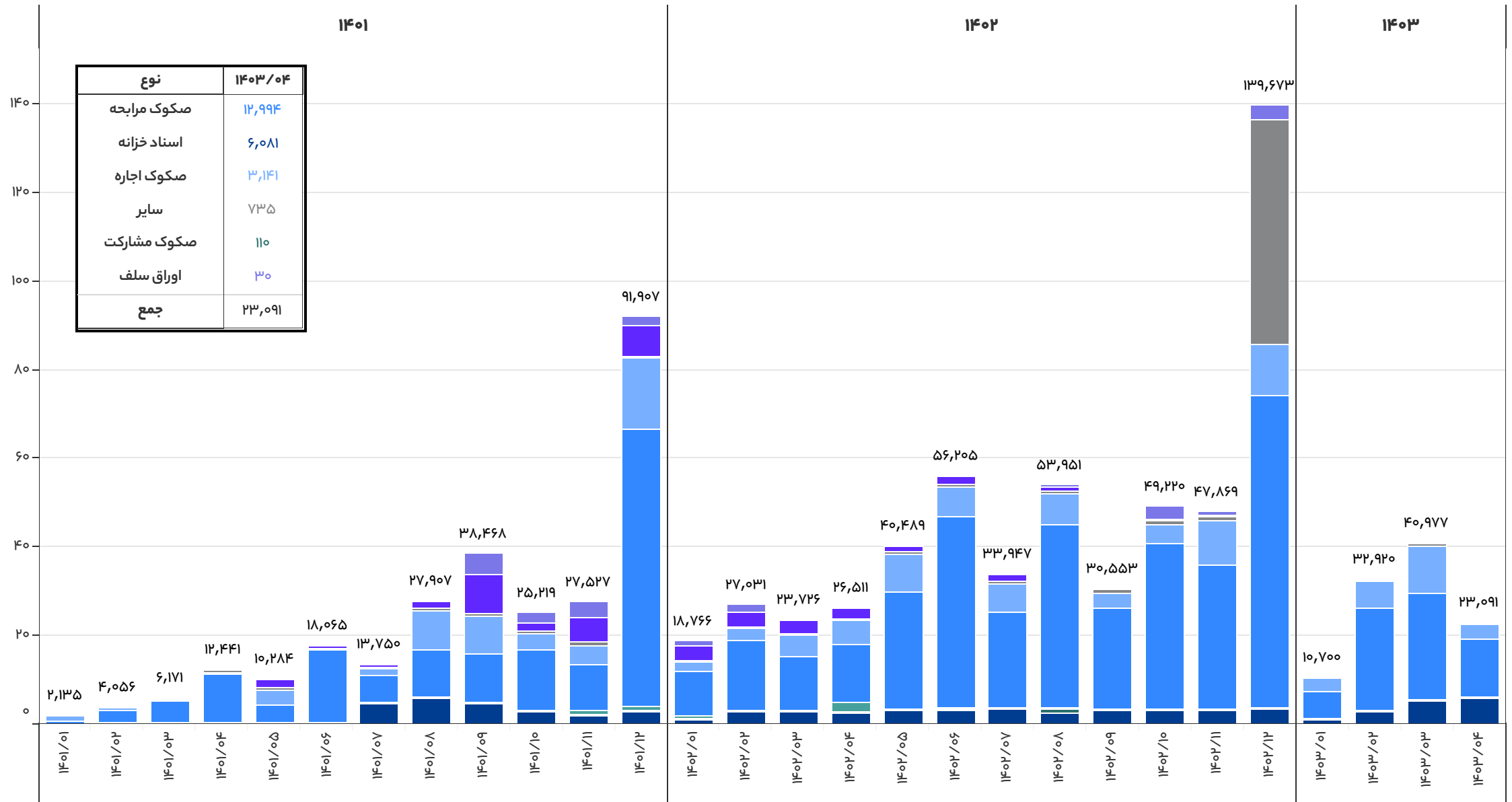


معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق به صورت ماهانه

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

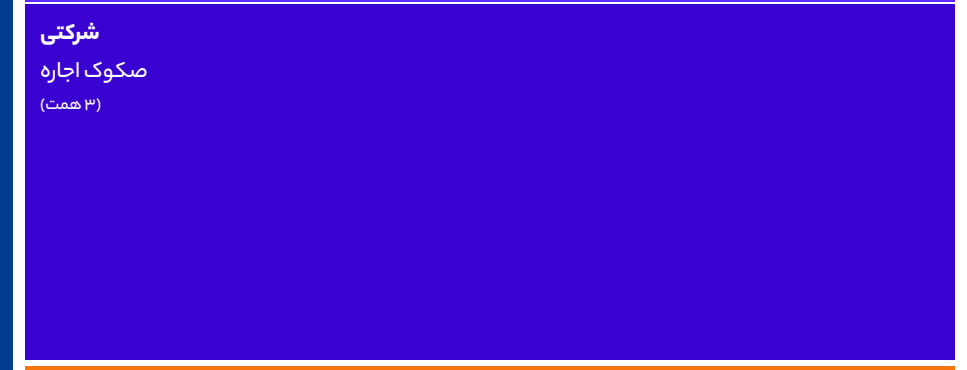
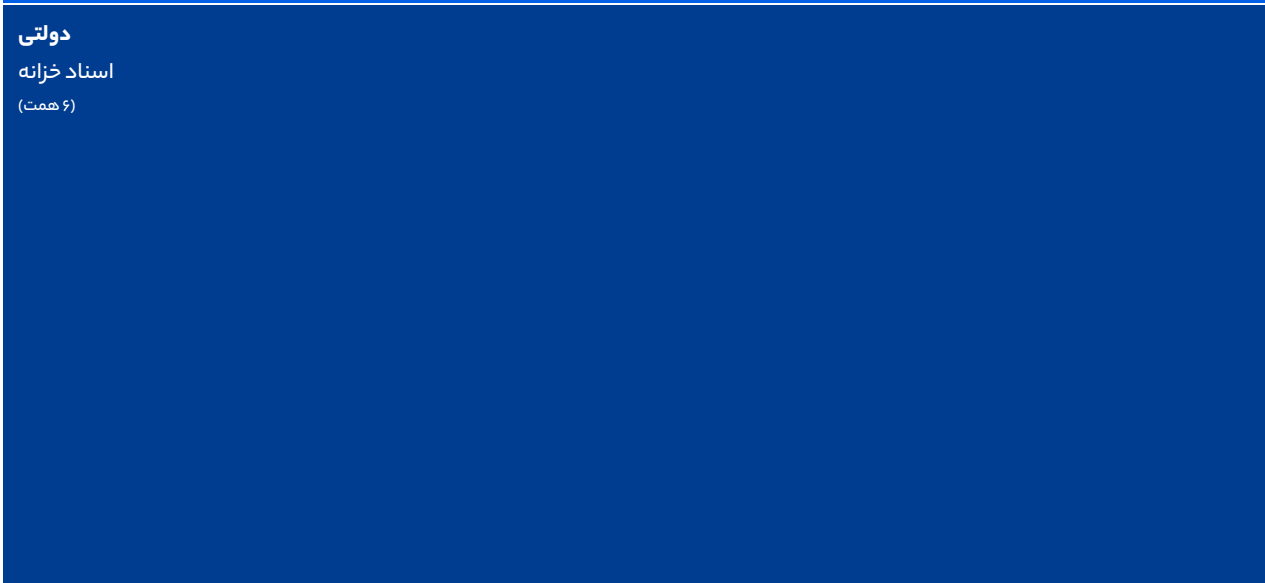
- اوراق سلف
- سایر
- صکوک مرابحه
- صکوک مشارکت
- اوراق گام
- صکوک اجاره
- صکوک منفعت
- اسناد خزانه



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



معاملات اوراق درآمد ثابت

پر معامله ترین 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
۶۱۲۰۱۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۲/۱۵	۱,۵۵۷
۷۰۳	صکوک اجاره	۱۴۰۷/۰۳/۱۵	۶۵۳
۵۰۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۲/۱۵	۶۳۸
۰۸	صکوک مرابحه	۱۴۰۸/۰۲/۱۰	۴۵۶
۳۰۷	صکوک اجاره	۱۴۰۳/۰۷/۱۵	۴۵۱
۰۷۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۷/۰۳/۱۵	۴۲۷
۰۹	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۸/۰۳	۴۰۰
۵۳۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۳/۲۷	۳۹۴
۵۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۱/۱۷	۲۶۴
۵۱۲۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۲/۲۳	۲۵۰
۴۶۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۶/۰۲	۲۰۱
۱۳	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۰۶/۲۷	۲۰۱
۷۱۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۷/۱۱/۱۵	۲۰۰
۷۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۷/۱۰/۱۵	۱۹۵
۷۰۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۷/۰۵/۱۵	۱۸۸
۵۰۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۳/۱۵	۱۶۳
۴۶۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۶/۰۲	۱۵۰
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۲/۲۷	۱۴۶
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۰/۲۳	۱۴۴
۰۶۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۰/۲۰	۱۴۴
۰۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۵/۰۹	۱۲۹
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۱۵	۱۲۲
۰۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۸/۰۹	۱۱۰
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۳/۰۶/۱۵	۱۰۱
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۰۵/۱۵	۱۰۰

پر معامله ترین اوراق دولتی ماه گزارش

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

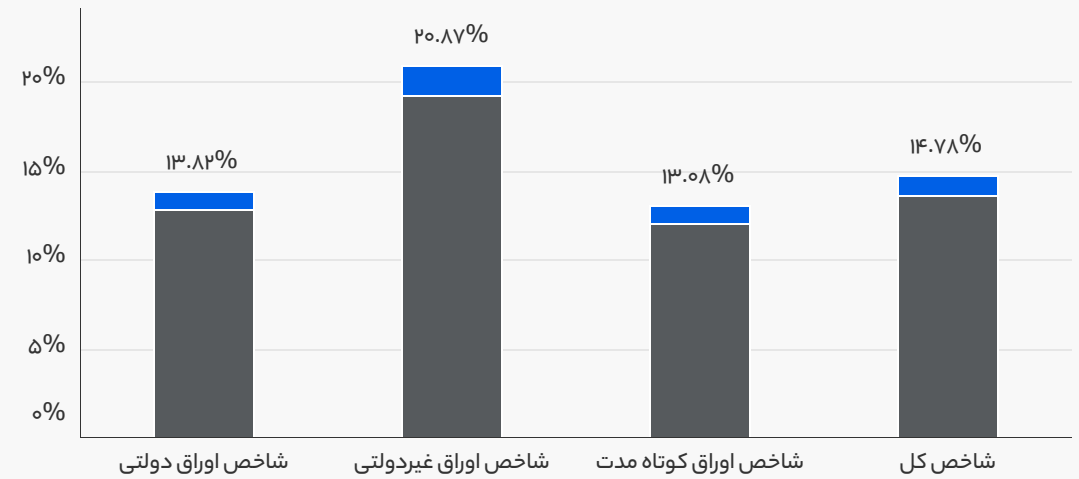
صکوک مرابحه اسناد خزانه

نماد	نوع	تاریخ سررسید	ارزش معاملات
۱۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۲/۱۱	۳,۹۹۱
۲۱۱	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۷/۲۰	۱,۱۱۰
۲۱۲	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۹/۱۶	۱,۰۸۵
۹۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۴/۱۴	۸۱۵
۲۱۳	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۱۰/۲۱	۶۵۳
۲۰۱	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۳/۲۵	۵۵۰
۱۳۱	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۴/۱۰	۴۹۲
۲۰۷	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۹/۱۰	۴۲۵
۲۰۲	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۹/۲۳	۳۹۲
۱۴۰	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۵/۰۴	۳۶۵
۱۴۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۱۰/۰۹	۳۰۴
۲۱۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۱۱/۱۲	۲۸۰
۲۰۸	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۱۲/۱۱	۲۶۰
۱۰۱	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۳/۲۶	۱۶۵
۱۳۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۸/۰۴	۱۳۹
۱۰۴	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۹/۱۷	۱۳۴
۰۰۴	اسناد خزانه	۱۴۰۳/۰۵/۲۲	۱۱۳
۱۲۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۲/۲۳	۱۰۸
۲۰۳	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۸/۱۸	۱۰۷
۰۰۸	اسناد خزانه	۱۴۰۳/۰۹/۱۹	۹۵
۱۲۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۵/۱۰	۹۵
۱۰۵	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۱۰/۱۵	۹۱
۱۰۷	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۷/۱۴	۹۱
۱۰۶	اسناد خزانه	۱۴۰۳/۰۸/۱۴	۸۱
۱۵۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۴/۲۲	۷۵

بازدهی شاخص صکوک

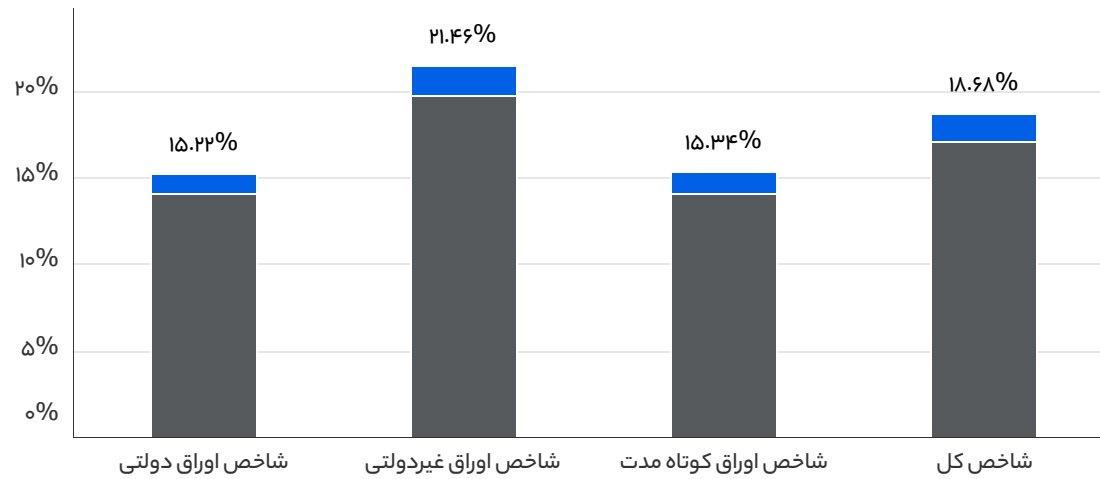
بازدهی شاخص های وزنی صکوک فرابورس ایران

یک سال گذشته مابقی سال ماه گزارش



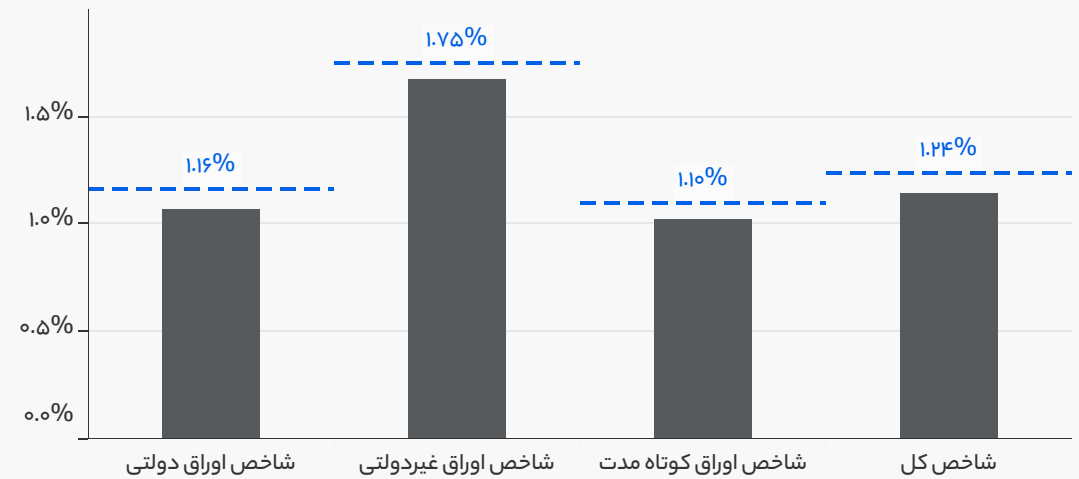
بازدهی شاخص های هم وزن صکوک فرابورس ایران

یک سال گذشته مابقی سال ماه گزارش



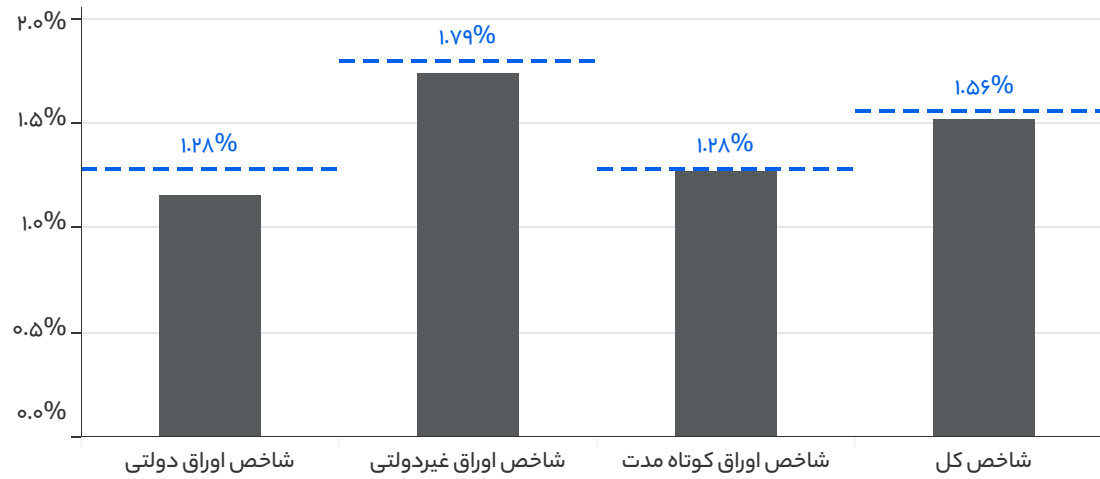
بازدهی شاخص های وزنی صکوک فرابورس ایران

ماه گزارش، به همراه میانگین بازده یک سال گذشته



بازدهی شاخص های هم وزن صکوک فرابورس ایران

ماه گزارش، به همراه میانگین بازده یک سال گذشته



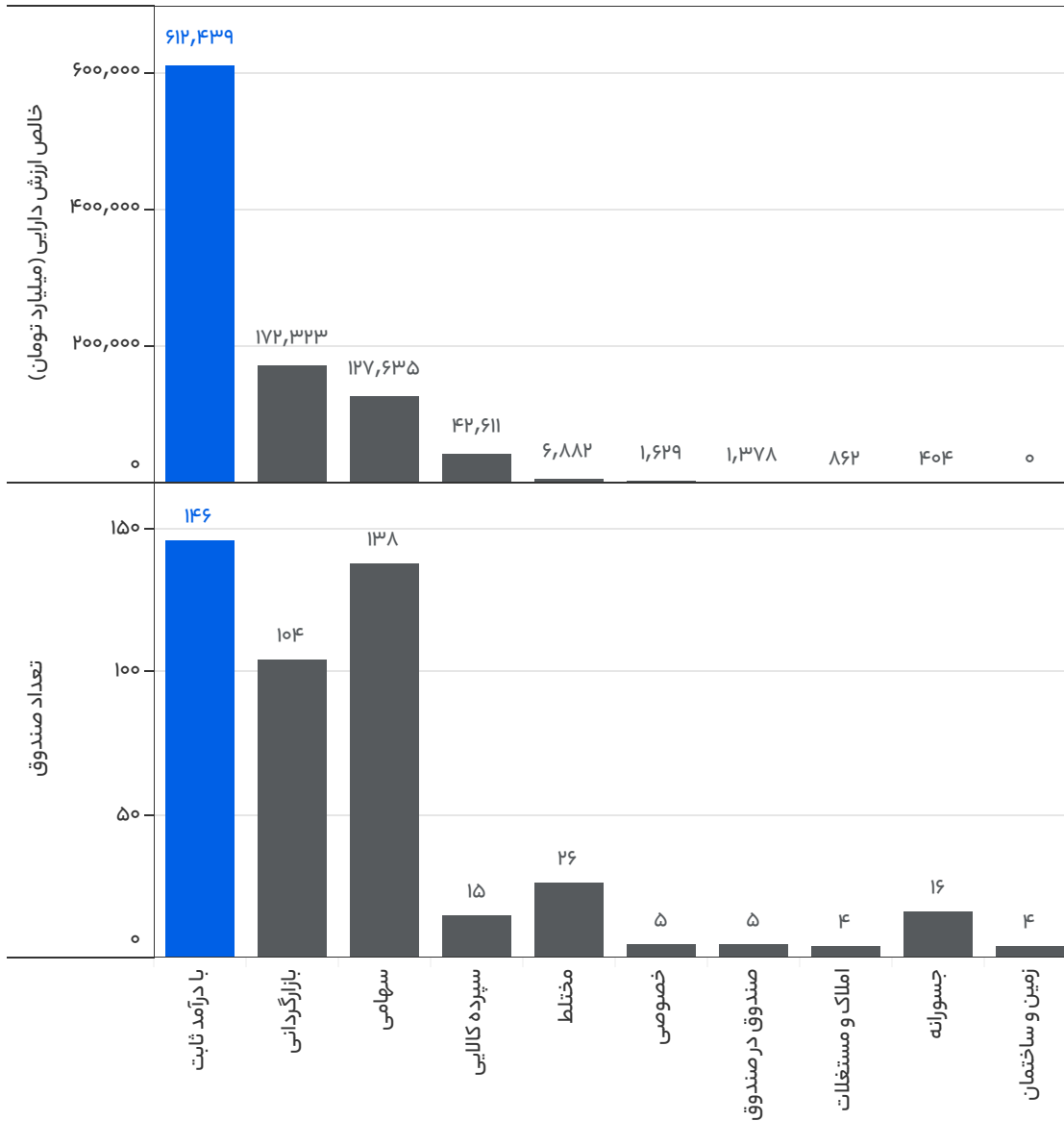
نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

نمای کلی

تعداد و خالص ارزش دارایی‌های صندوق‌ها، به تفکیک نوع صندوق

ارزش و تعداد صندوق‌های سرمایه‌گذاری

به تفکیک نوع صندوق، مرتب شده براساس خالص ارزش دارایی



کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	تعداد صندوق	خالص ارزش دارایی‌ها (همت)
سرمایه‌گذاری سنتی	با درآمد ثابت	۱۴۶	۶۱۲.۴
	سهامی	۱۳۸	۱۲۷.۶
	مختلط	۲۶	۶.۹
	صندوق در صندوق	۵	۱.۴
سرمایه‌گذاری خصوصی	خصوصی	۵	۱.۶
	جسورانه	۱۶	۰.۴
سرمایه‌گذاری جایگزین	بازارگردانی	۱۰۴	۱۷۲.۳
	سپرده کالایی	۱۵	۴۲.۶
	پروژه‌ای	۱	۱.۱
	املاک و مستغلات	۴	۰.۹
	زمین و ساختمان	۴	۰.۰
جمع کل		۴۶۴	۹۶۷.۳

صندوق‌های جدید ماه گذشته

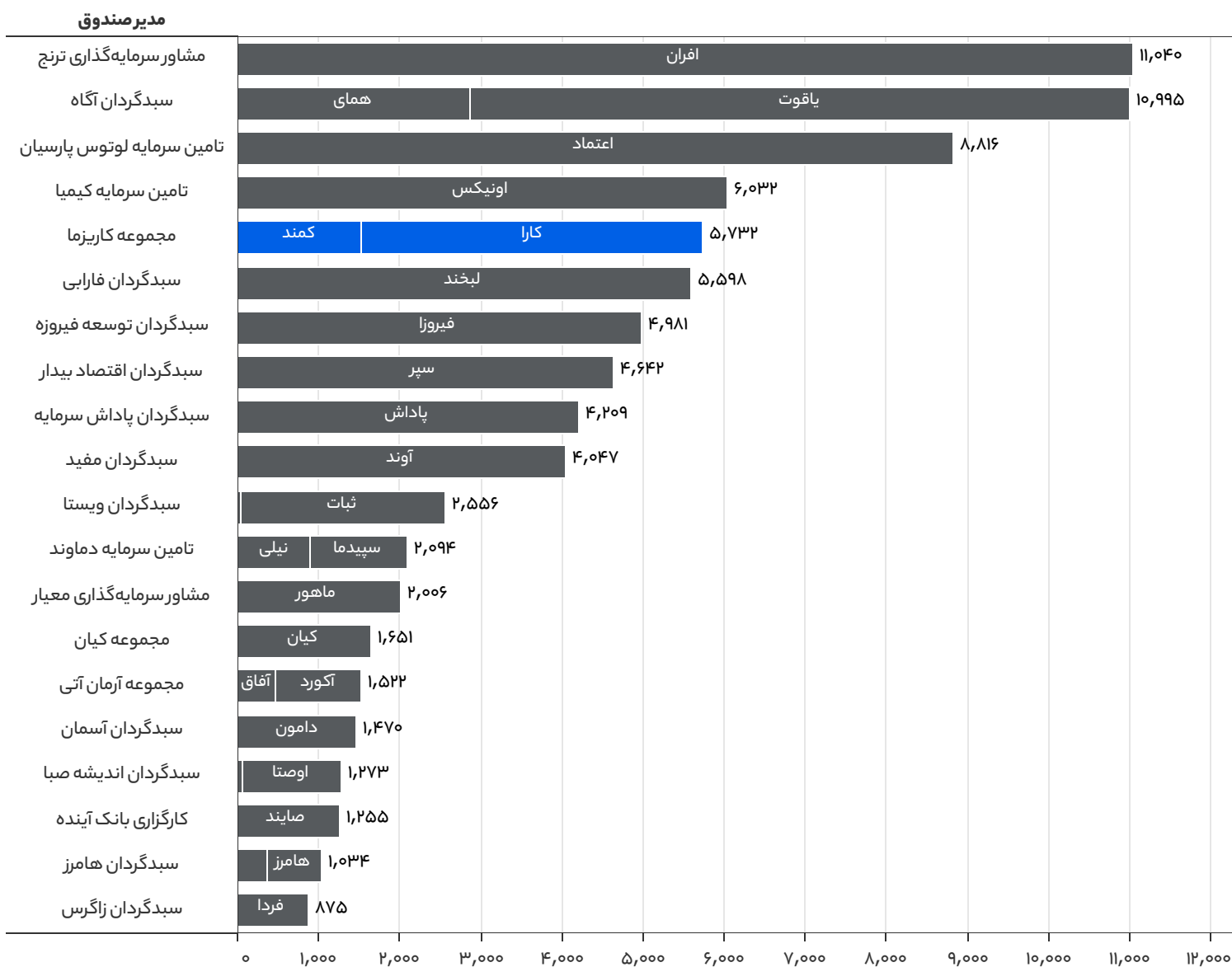
به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نام صندوق	نوع	نوع معامله
خوشه گندم نوویرا	صندوق در صندوق	قابل معامله
دراوراق بهادر با درآمد ثابت آرامش	درآمد ثابت	قابل معامله
سهام نگرکیمیا	سهامی	قابل معامله
سهامی اهرمی بیدار	سهامی	قابل معامله
سهامی اهرمی نارنج	سهامی	قابل معامله
شمیم تابان مهرگان	درآمد ثابت	قابل معامله
همگام آشنا ایرانیان	درآمد ثابت	قابل معامله

معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

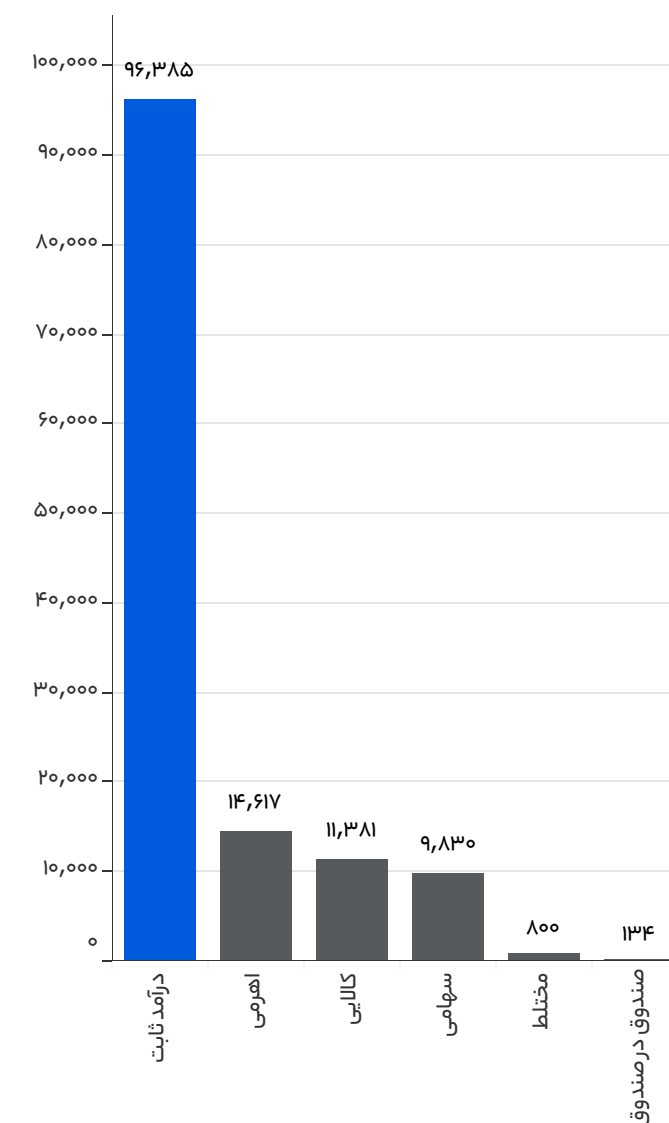
پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

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

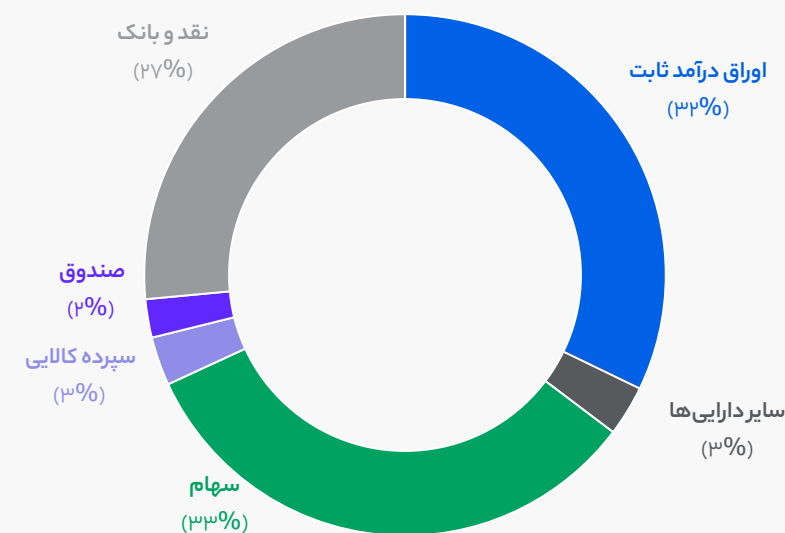
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	مقدار
آوند	سبذگردان مفید	+۴۴۲
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	+۴۲۳
یاقوت	سبذگردان آگاه	+۳۲۰
سپر	سبذگردان اقتصاد بیدار	+۲۳۵
ماه‌ور	مشاور سرمایه‌گذاری معیار	+۱۹۷
همای	سبذگردان آگاه	+۱۴۹
کیان	مجموعه کیان	+۱۲۶
ثبات	سبذگردان ویستا	+۵۶
فردا	سبذگردان زاگرس	+۳۹
آفاق	مجموعه آرمان آتی	+۲۸
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسین	+۲۷
آکورد	مجموعه آرمان آتی	+۲۶
کمند	مجموعه کاریزما	+۲۵
آکام	سبذگردان ویستا	+۹
لبخند	سبذگردان فارابی	+۹
سپیدما	تامین سرمایه دماوند	+۴
اوستا	سبذگردان اندیشه صبا	+۲
ارمغان	تامین سرمایه نوین	+۰
دیبا	سبذگردان اندیشه صبا	+۰
آسامید	سبذگردان آسمان	-۲
نیلی	تامین سرمایه دماوند	-۶
پاداش	سبذگردان پاداش سرمایه	-۱۷
دامون	سبذگردان آسمان	-۵۳
سنهال	تامین سرمایه نوین	-۹۰
فیروزا	سبذگردان توسعه فیروزه	-۹۶
صایند	کارگزاری بانک آینده	-۱۸۹
کارا	مجموعه کاریزما	-۲۳۴
اونیکس	تامین سرمایه کیمیا	-۳۹۹

تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

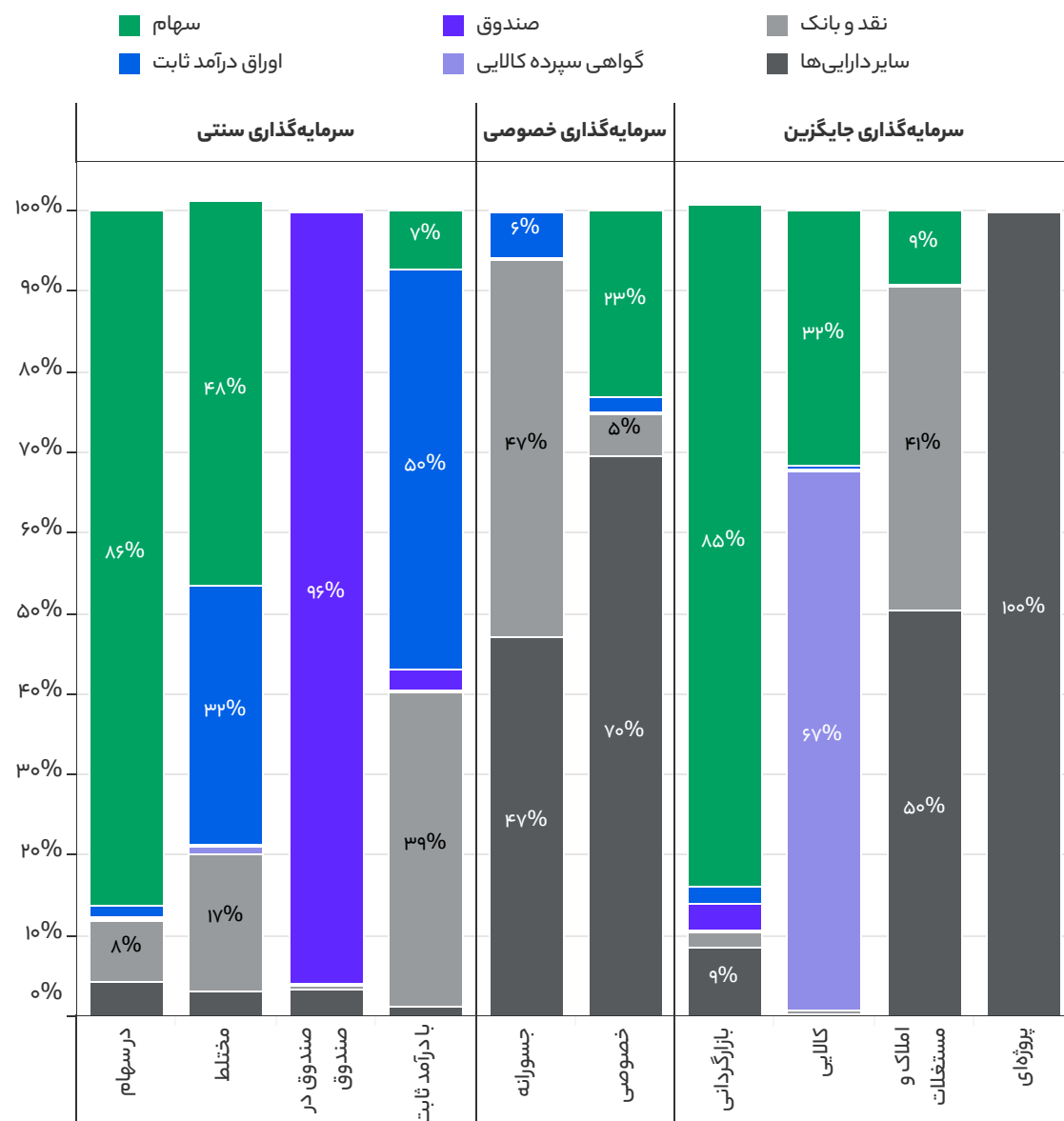
ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



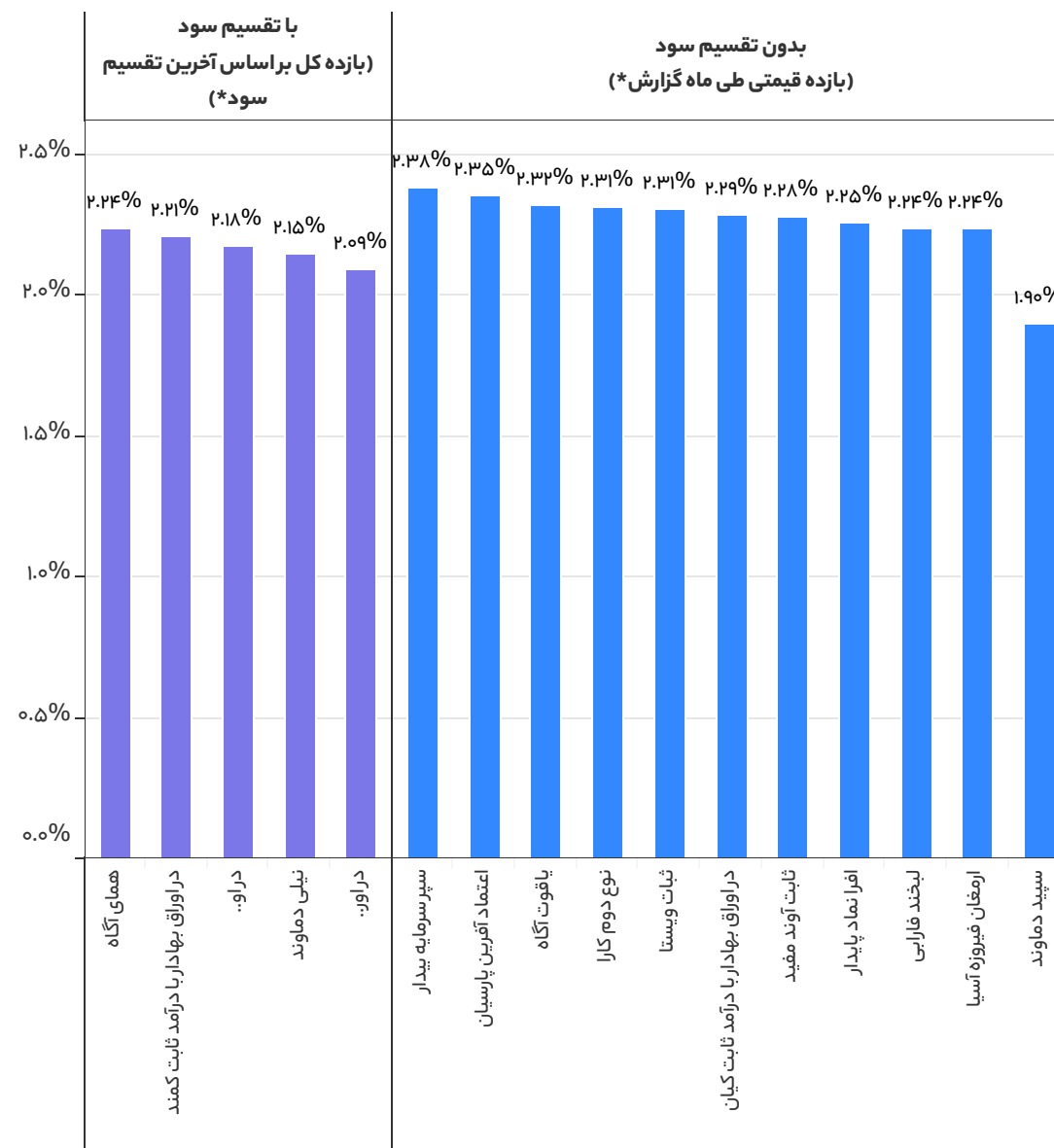
کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهم	درآمد ثابت	سپرده کالایی	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	مختلط	۴۸%	۳۲%	۱%	-	۱۷%	۳%
	صندوق در صندوق	-	-	-	۹۶%	۱%	۳%
	با درآمد ثابت	۷%	۵۰%	-	۳%	۳۹%	۱%
	در سهام	۸۶%	۱%	-	-	۸%	۴%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۶%	-	-	۴۷%	۴۷%
	خصوصی	۲۳%	۲%	-	-	۵%	۷۰%
سرمایه‌گذاری جایگزین	کالایی	۳۲%	-	۶۷%	-	-	-
	بازارگردانی	۸۵%	۲%	-	۳%	۲%	۹%
	املاک و مستغلات	۹%	-	-	-	۴۱%	۵۰%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	-	۱۰۰%
مجموع	کل	۳۳%	۳۲%	۳%	۲%	۲۷%	۳%

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					بازده موثر تقسیم سود
			بازدهی ۱۲ ماهه **NAV	بازدهی ۶ ماهه **NAV	بازدهی ۳ ماهه **NAV	بازدهی ۱ ماهه **NAV	بازده ساده تقسیم سود	
با تقسیم سود	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	۵,۹۸۴	۲۵.۲%	۱۲.۶%	۶.۴%	۲.۱۲%	۲۶.۵%	۳۰.۰%
	نبلی دماوند	۵,۸۸۰	۲۵.۰%	۱۲.۵%	۶.۳%	۲.۱۰%	۲۵.۸%	۲۹.۱%
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	۵,۱۲۳	۲۵.۱%	۱۲.۷%	۶.۵%	۲.۱۵%	۲۶.۱%	۲۹.۵%
	همای آگاه	۴,۱۵۷	۲۵.۱%	۱۲.۸%	۶.۶%	۲.۲۱%	۲۶.۸%	۳۰.۴%
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت نگین سامان	۲,۷۸۸	۲۴.۲%	۱۲.۳%	۶.۲%	۲.۰۸%	۲۵.۱%	۲۸.۲%
بدون تقسیم سود	افرا نماد پایدار	۱۸,۰۷۷	۲۹.۲%	۱۴.۳%	۷.۲%	۲.۲۵%		
	سپر سرمایه بیدار	۱۲,۳۵۴	۲۹.۱%	۱۴.۳%	۷.۴%	۲.۳۸%		
	سپید دماوند	۱۱,۷۰۳	۲۵.۳%	۱۲.۱%	۵.۹%	۱.۹۰%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۱۱,۴۳۱	۲۷.۸%	۱۳.۹%	۷.۱%	۲.۳۵%		
	یاقوت آگاه	۹,۳۲۷	۲۸.۵%	۱۳.۹%	۷.۱%	۲.۳۲%		
	نوع دوم کارا	۸,۹۶۲	۲۸.۶%	۱۳.۸%	۶.۹%	۲.۳۱%		
	ارمغان فیروزه آسیا	۷,۷۳۳	۲۹.۰%	۱۴.۳%	۷.۰%	۲.۲۴%		
	ثابت آوند مفید	۶,۸۴۸	۲۸.۵%	۱۴.۱%	۷.۱%	۲.۲۸%		
	لبخند فارابی	۵,۷۶۵	۲۹.۰%	۱۴.۲%	۷.۲%	۲.۳۴%		
	ثبات ویستا	۵,۰۶۳	۲۹.۱%	۱۴.۳%	۷.۲%	۲.۳۱%		
	در اوراق بهادار با درآمد ثابت کیان	۵,۰۴۴	۲۸.۵%	۱۴.۱%	۷.۲%	۲.۲۹%		

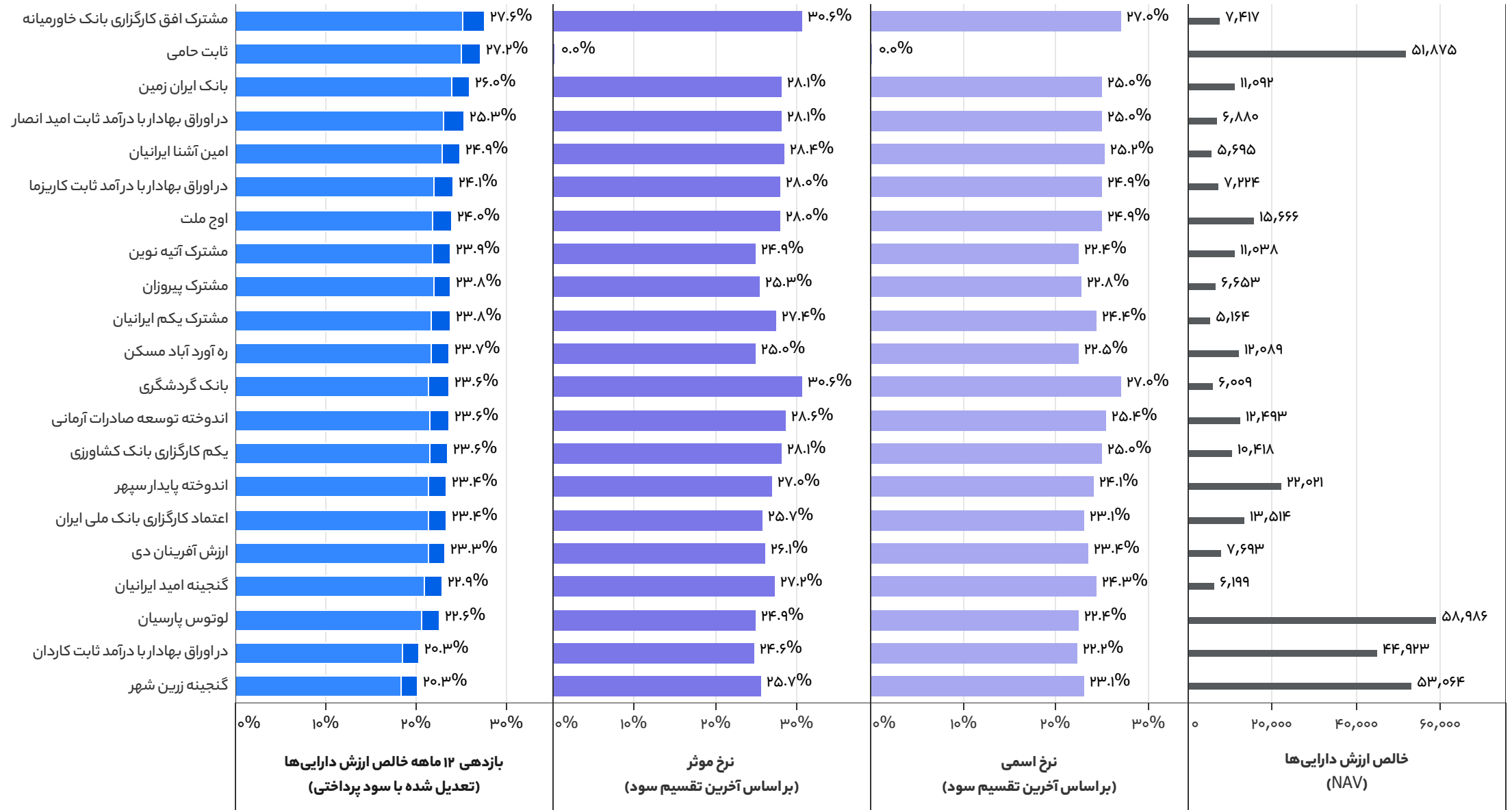


* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.
 ** در صورتی که صندوق تقسیم سود داشته باشد، بازده خالص ارزش دارایی هر واحد بر اساس تقسیم سود تعدیل می‌گردد.

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

