

ماهنامه دیدگاه بازار کاریزما



بهمن ماه ۱۴۰۲



CHARISMA MARKET INSIGHT

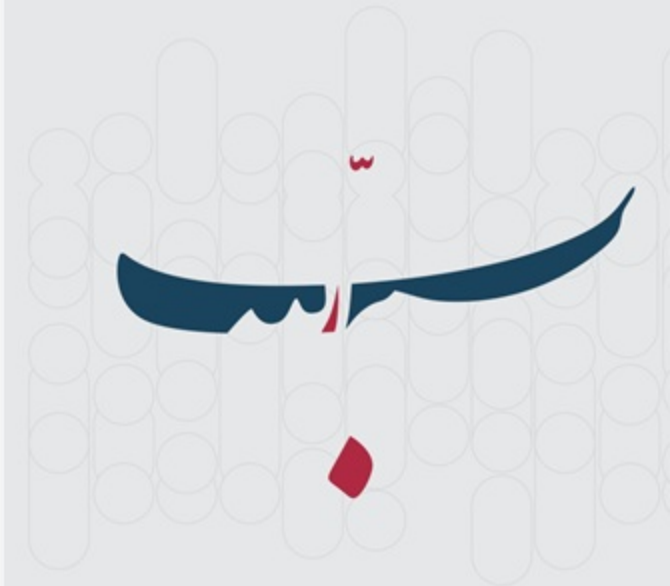
معرفی گزارش:

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
۲۶	تامین مالی دولت
۲۷	بازیگران کلیدی بازار بدهی
۳۱	معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی
۳۳	آمار معاملات اوراق درآمد ثابت
۳۶	بازدهی شاخص صکوک
۳۷	نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳۹	معاملات صندوق‌ها درآمد ثابت
۴۱	تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۴۲	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (قابل معامله)
۴۳	بازدهی صندوق‌های درآمد ثابت (صدور و ابطال)

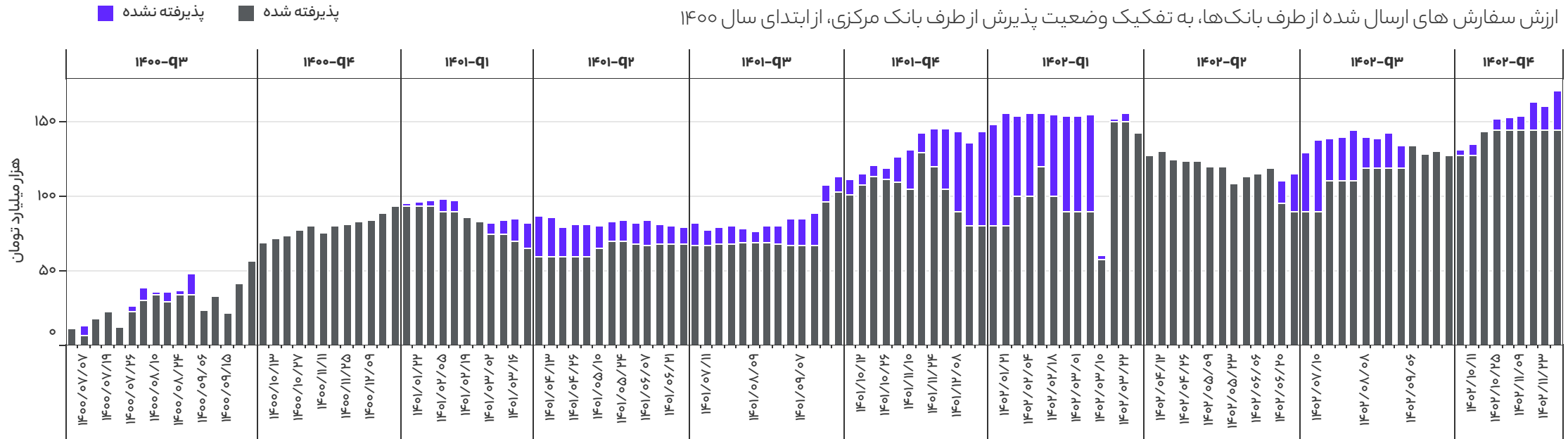


ECONOMY

سیاست‌های پولی

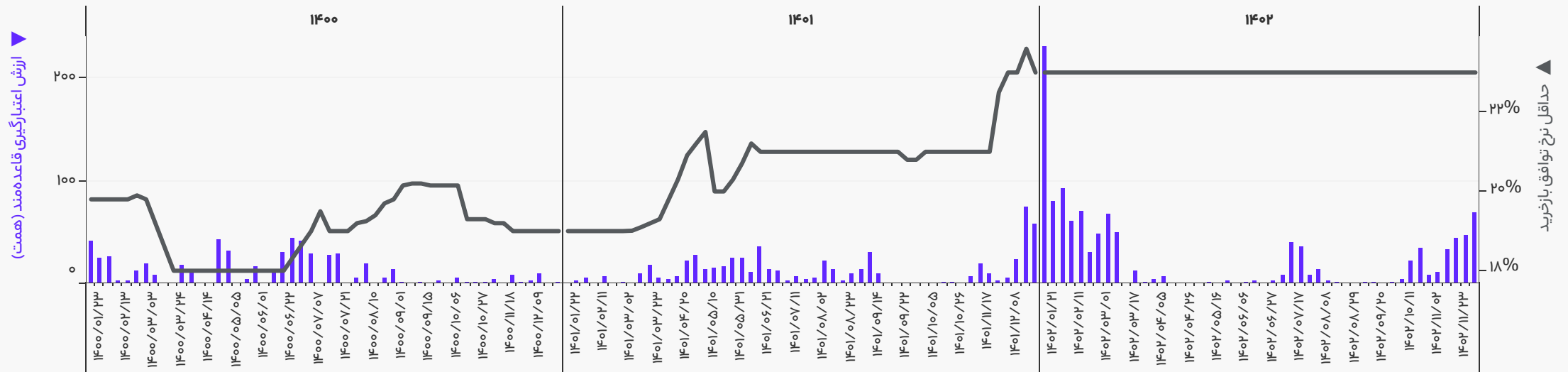
تامین مالی بانک‌ها از طریق قرارداد ریو

ارزش سفارش‌های ارسال شده از طرف بانک‌ها، به تفکیک وضعیت پذیرش از طرف بانک مرکزی، از ابتدای سال ۱۴۰۰



تامین مالی بانک‌ها از بانک مرکزی

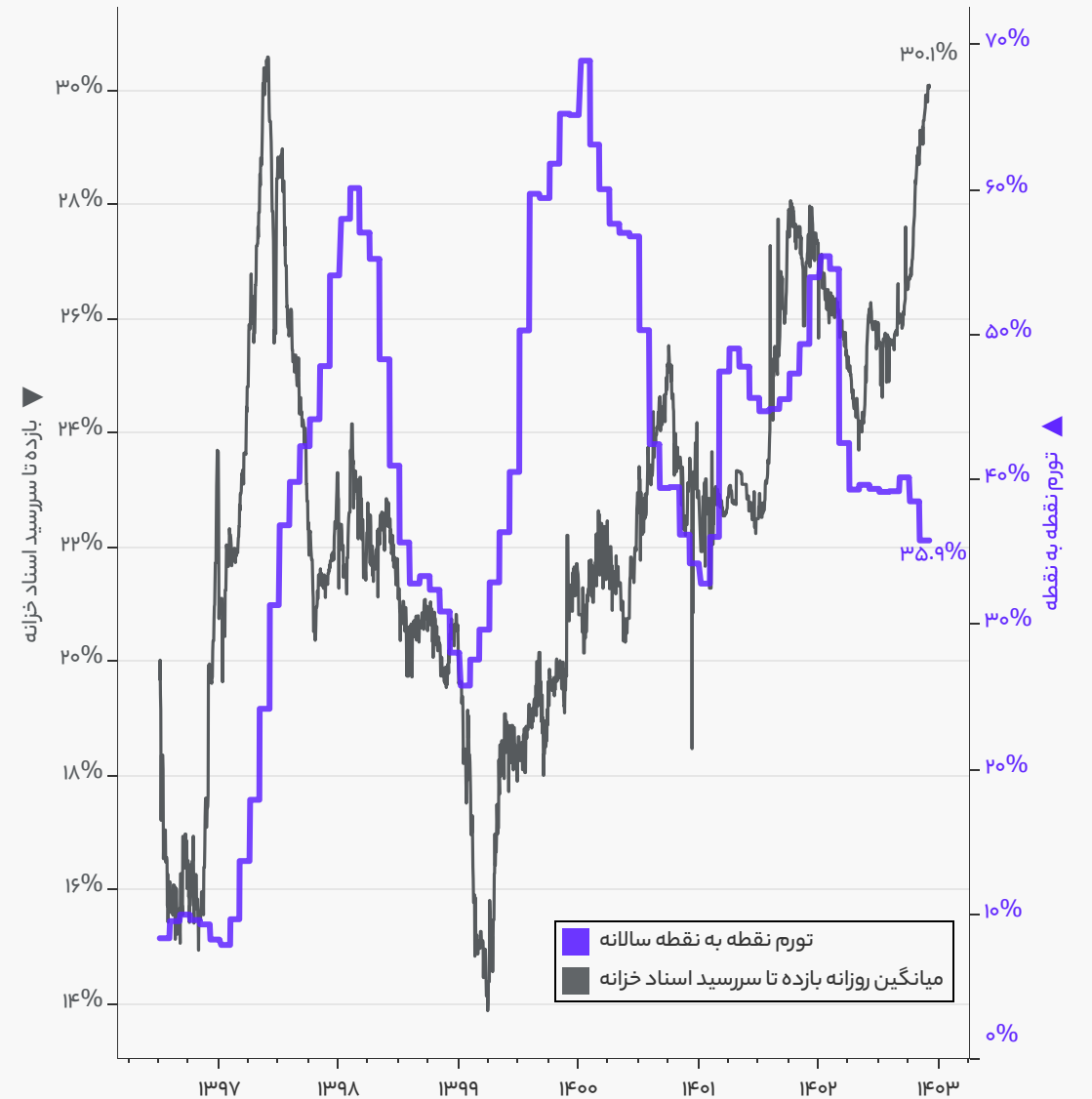
ارزش اعتبارگیری قاعده‌مند، هزار میلیارد تومان، به همراه حداقل نرخ توافق با خرید، از ابتدای سال ۱۴۰۰



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

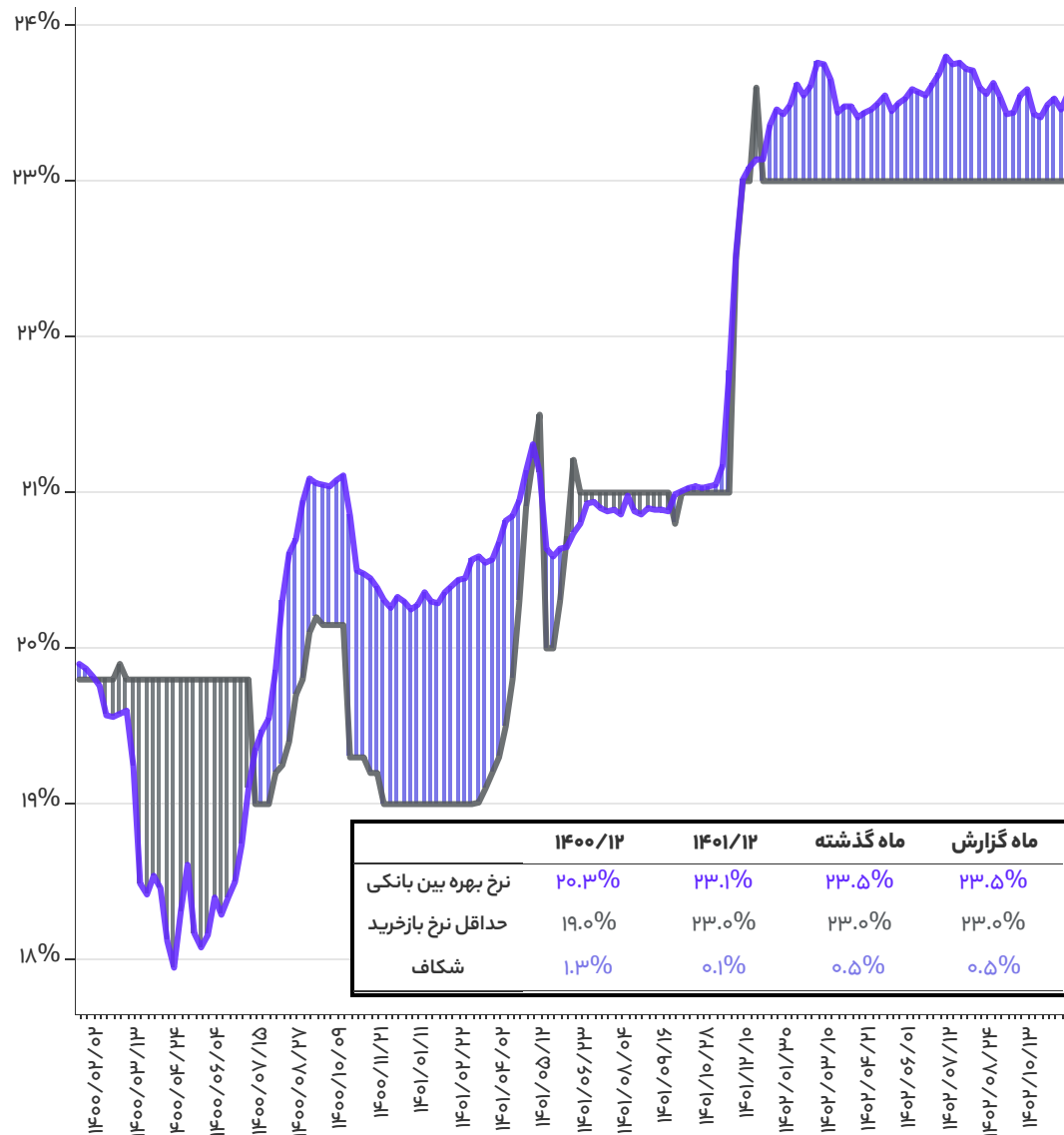


* برای محاسبه میانگین روزانه نرخ بازده تا سررسید اسناد خزانه، تنها اوراقی که بیش از ۳۰ روز تا سررسید فاصله دارند، استفاده شده است.

دسترسی پول برای بانکها

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

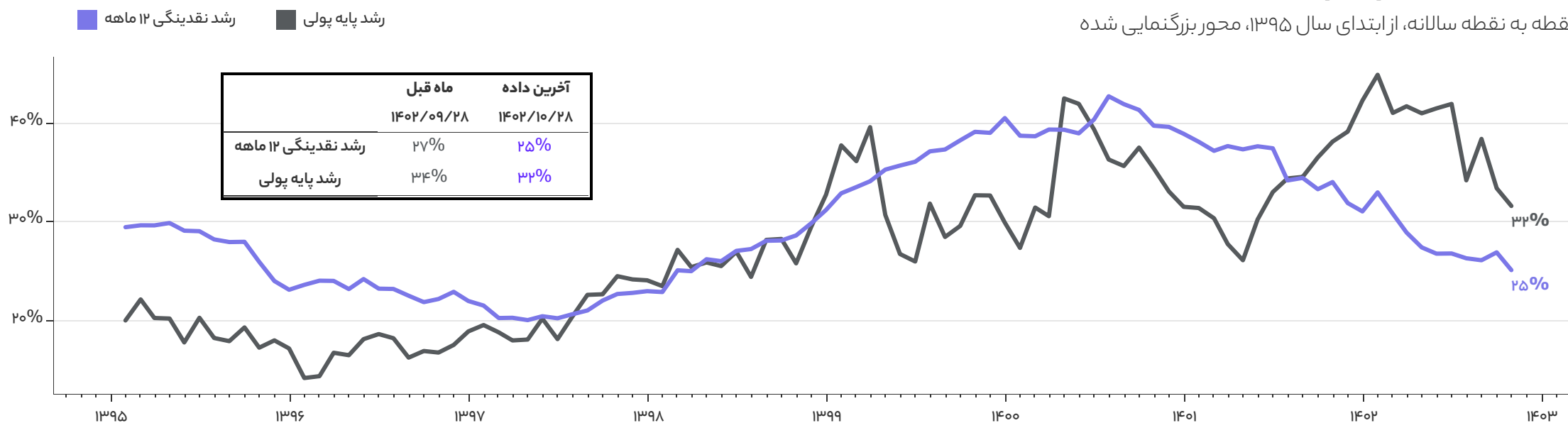
■ نرخ بهره بین بانکی ■ حداقل نرخ بهره بانکی



پایه پولی و نقدینگی

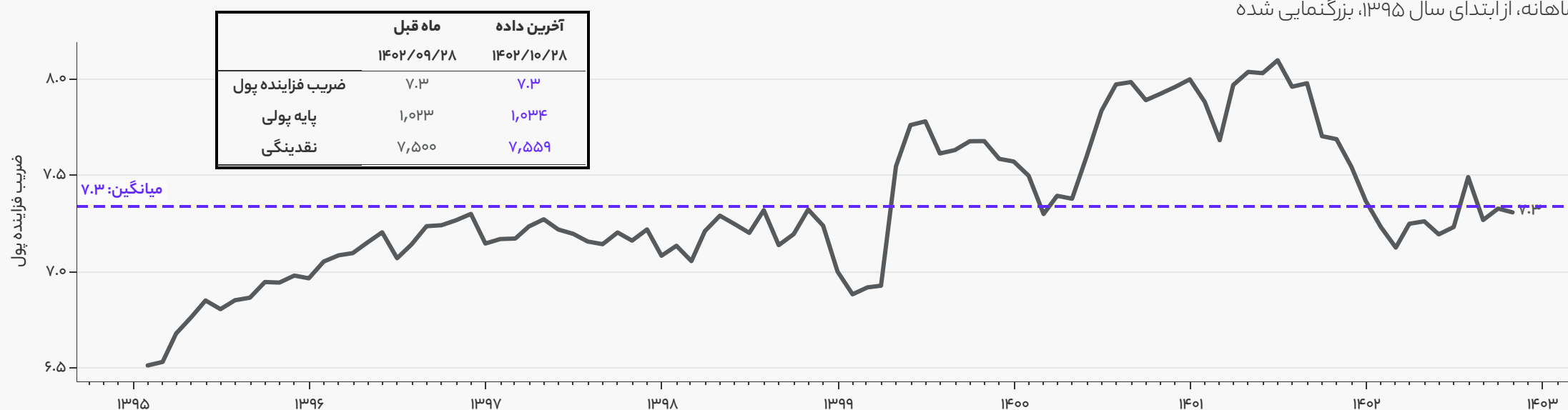
رشد نقدینگی و پایه پولی*

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



ضریب فزاینده پول**

ماهانه، از ابتدای سال ۱۳۹۵، بزرگنمایی شده

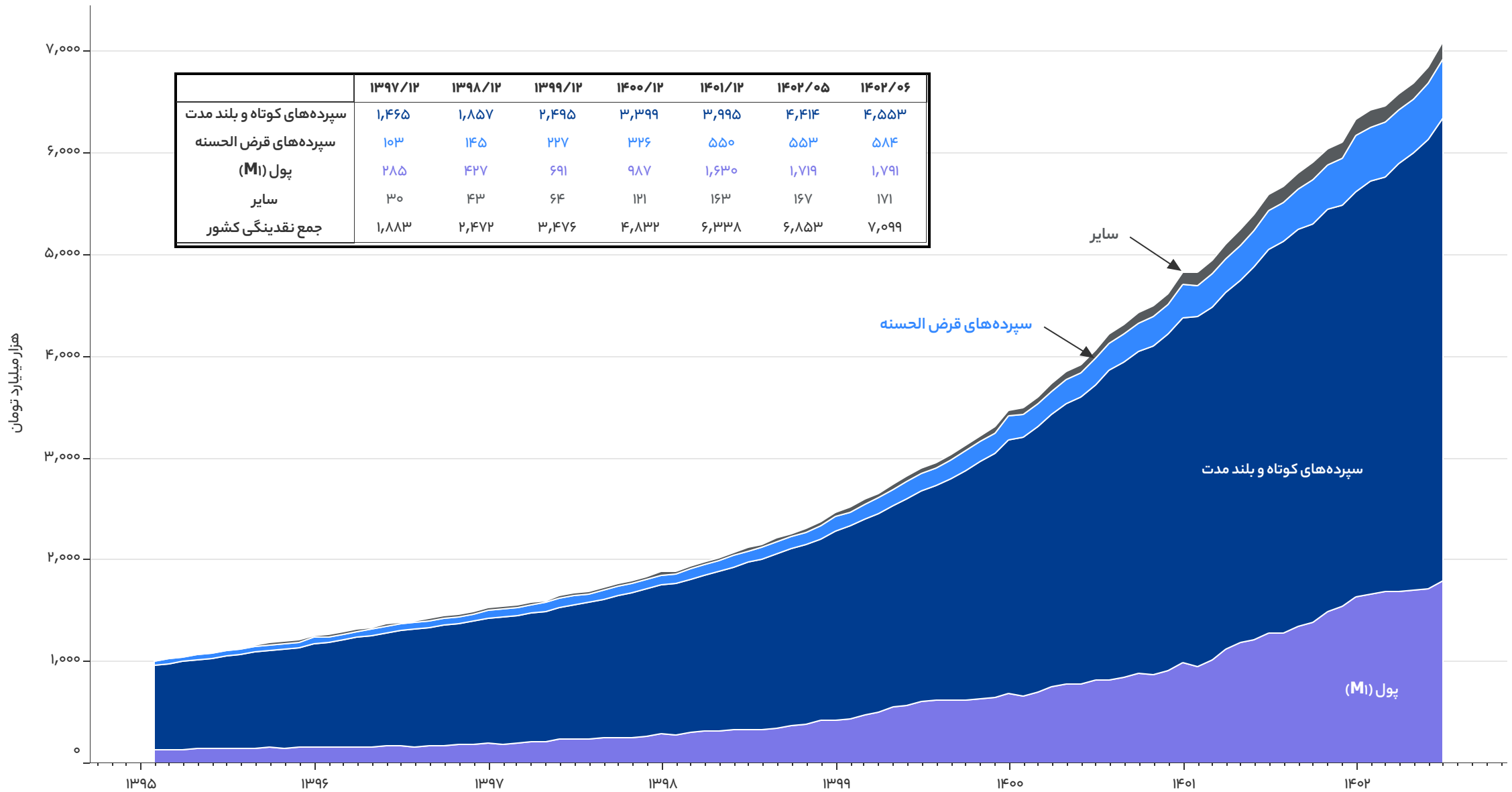


* برای نقدینگی و پایه پولی چند ماه گذشته که گزارشی به صورت رسمی از طرف بانک مرکزی منتشر نگردیده است، از آمار منتشره در اخبار رسمی و روش های تخمین زنی استفاده شده است.
** پایه پولی برح ۵ براساس اخبار رسمی محاسبه شده و فاصله تا آخرین آمار رسمی نیز تخمین زده شده است.

پایه پولی و نقدینگی

اجزای نقدینگی

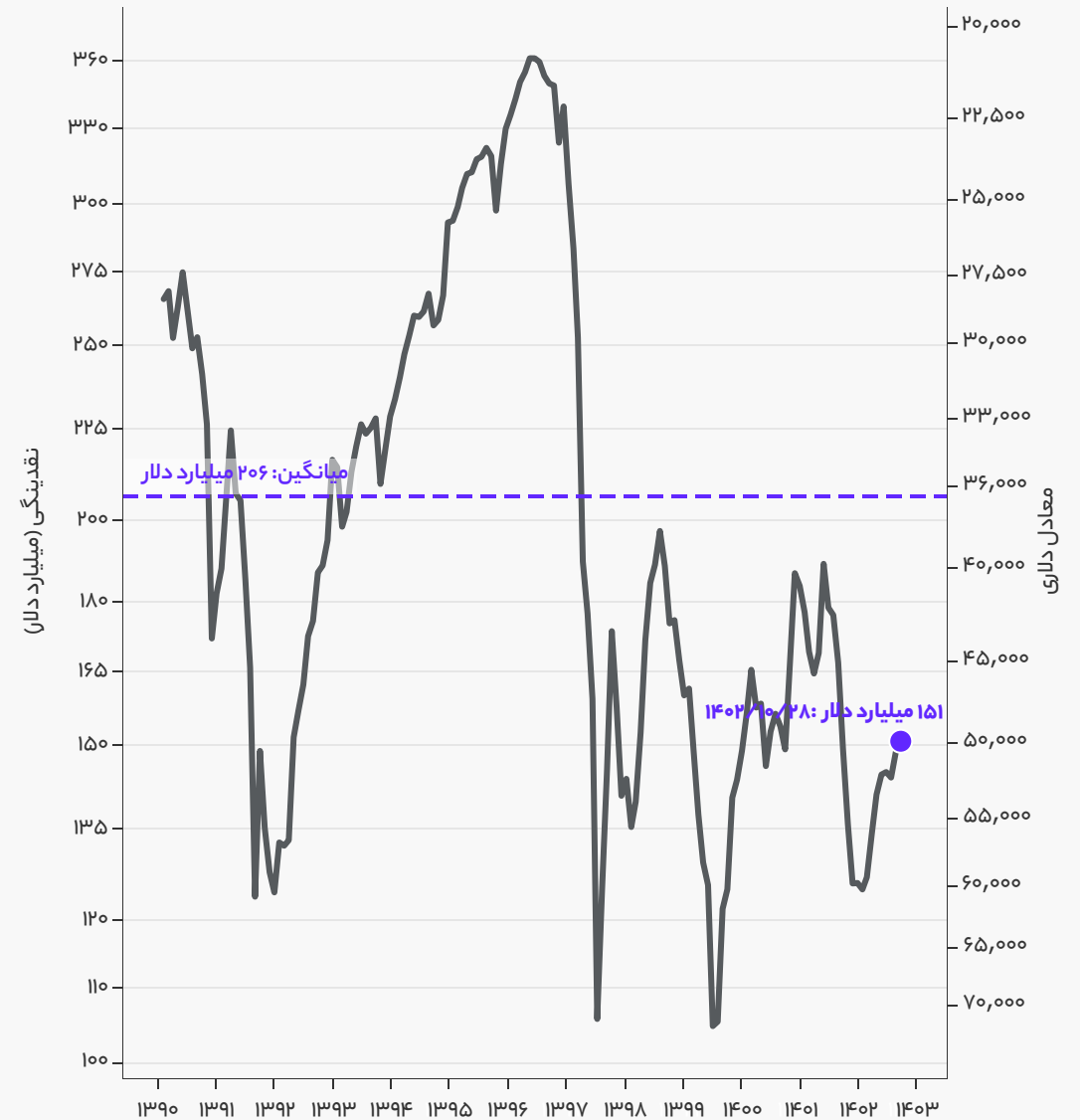
از سمت مصارف، از ابتدای سال ۱۳۹۵، (براساس آخرین داده‌ی منتشر شده توسط بانک مرکزی)، هزار میلیارد تومان



پایه پولی و نقدینگی

نقدینگی در ایران به دلار آمریکا

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

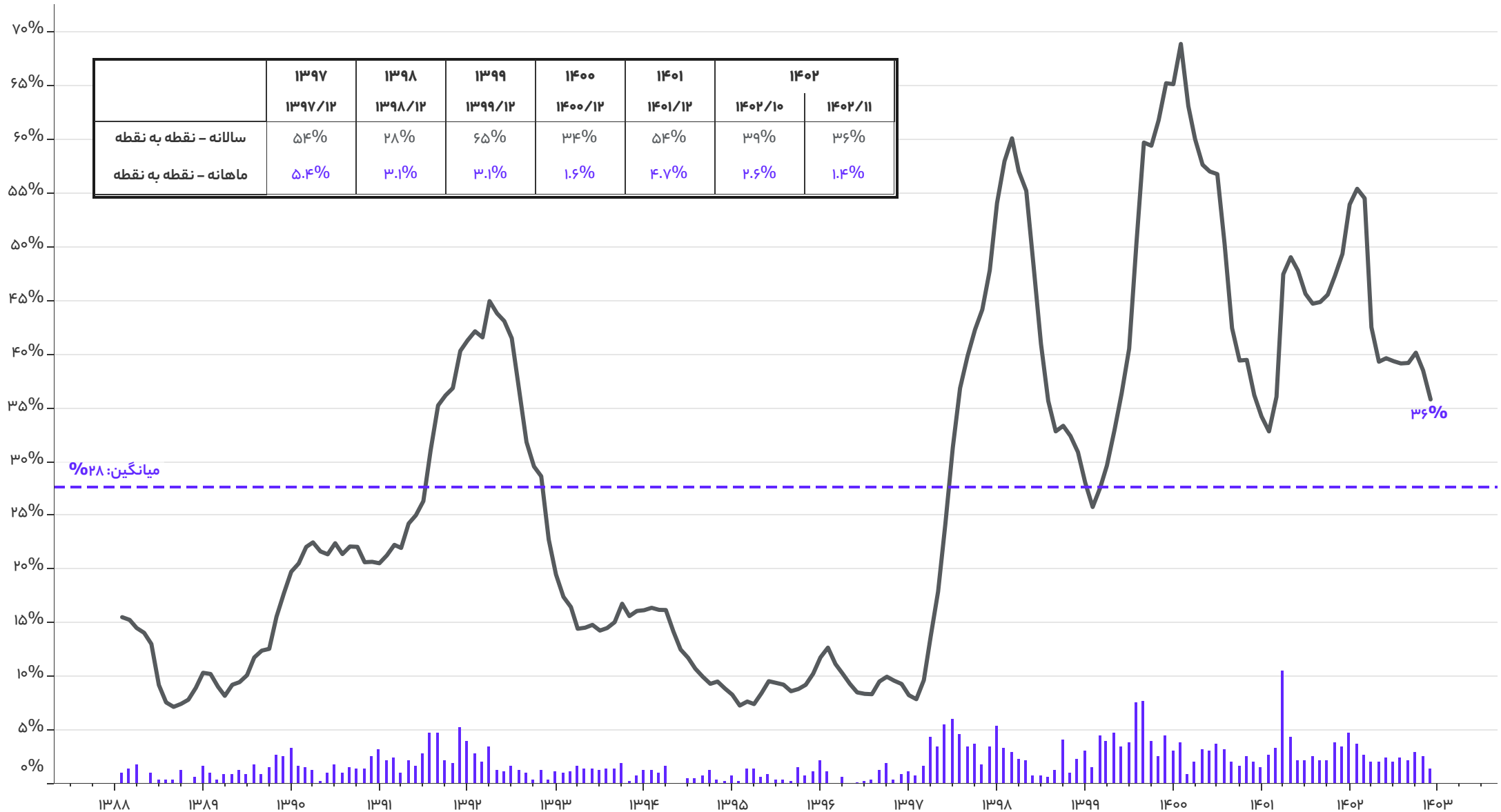


* قیمت دلاری لازم برای رسیدن به سطح نقدینگی دلاری مورد انتظار.
** نقدینگی چند ماه گذشته با استفاده از آمار رایج شده در اخبار توسط بانک مرکزی محاسبه گردیده است.

تورم و شاخص CPI

وضعیت تورم*

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

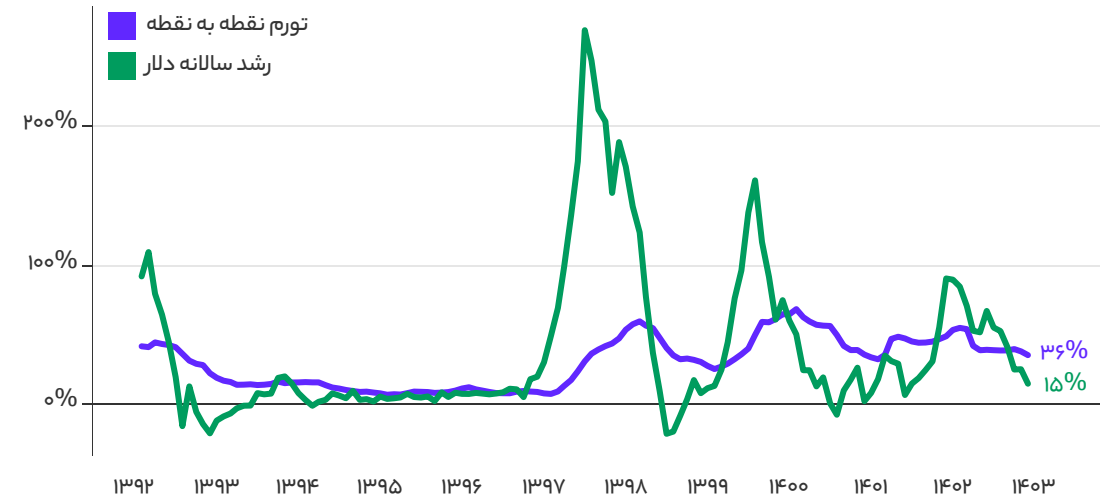


*دیتای استفاده شده برای تورم از سال ۱۴۰۰ به بعد از دیتای مرکز آمار و قبل از آن، از دیتای بانک مرکزی استفاده شده است.
 **برای تورم ۲ ماه گذشته از منابع غیررسمی و مصاحبه‌های صورت گرفته، استفاده گردیده است.

تورم و شاخص CPI

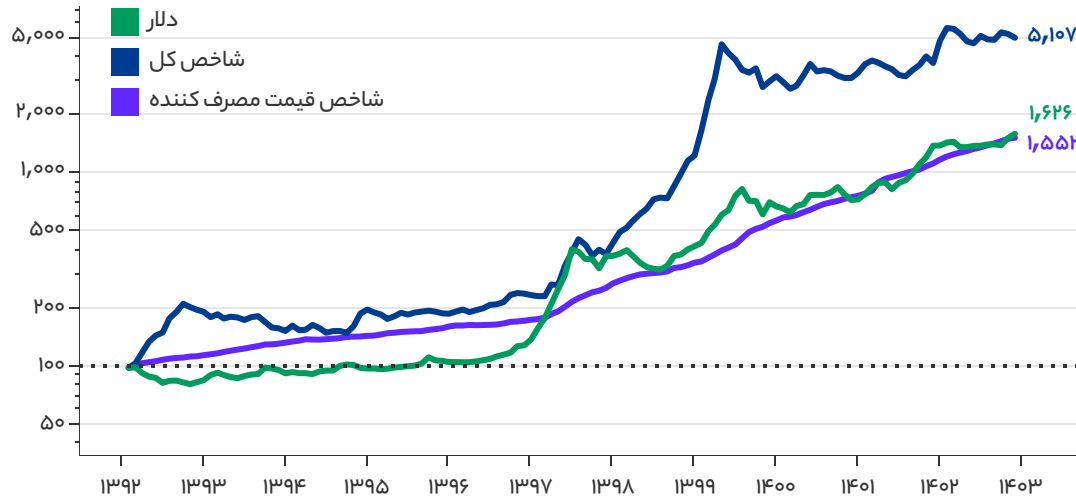
تورم و رشد دلار

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

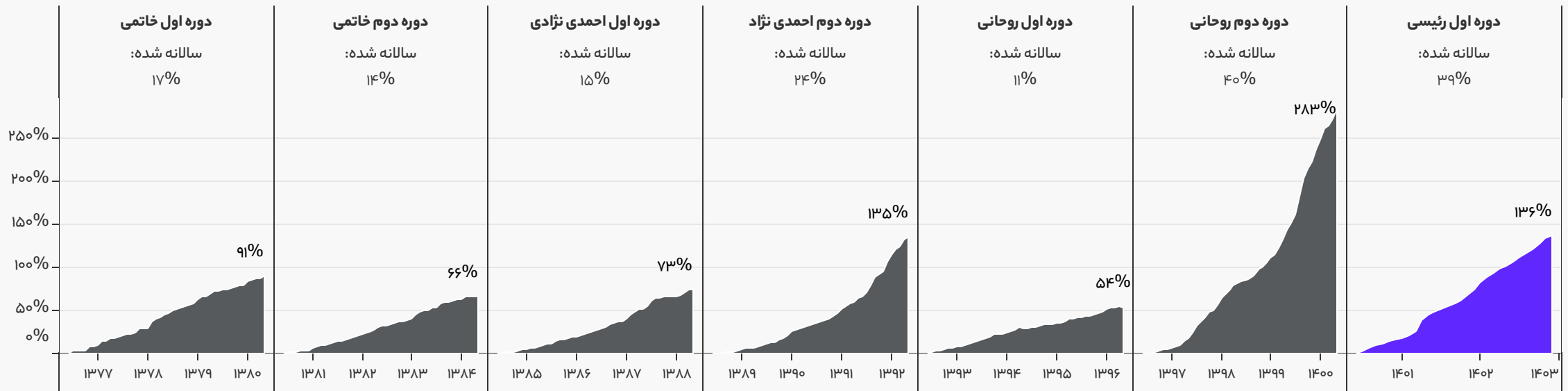


شاخص قیمت مصرف کننده در برابر دلار و بازدهی بازار سهام

مبنای تمامی شاخص‌ها سال ۱۳۹۲ بازنشاندگی 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

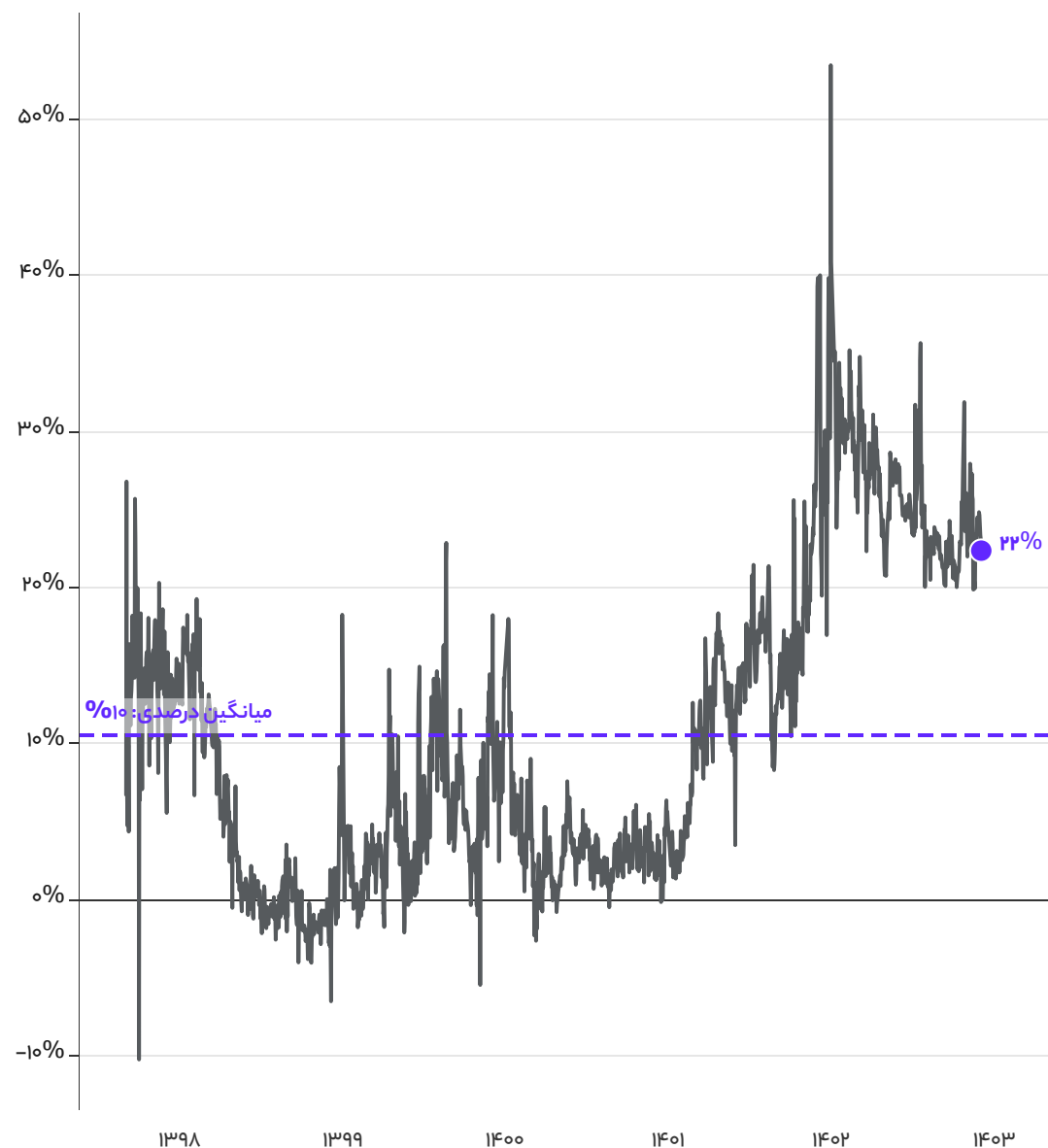
شکاف دلار آزاد و دلار نیمایی

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



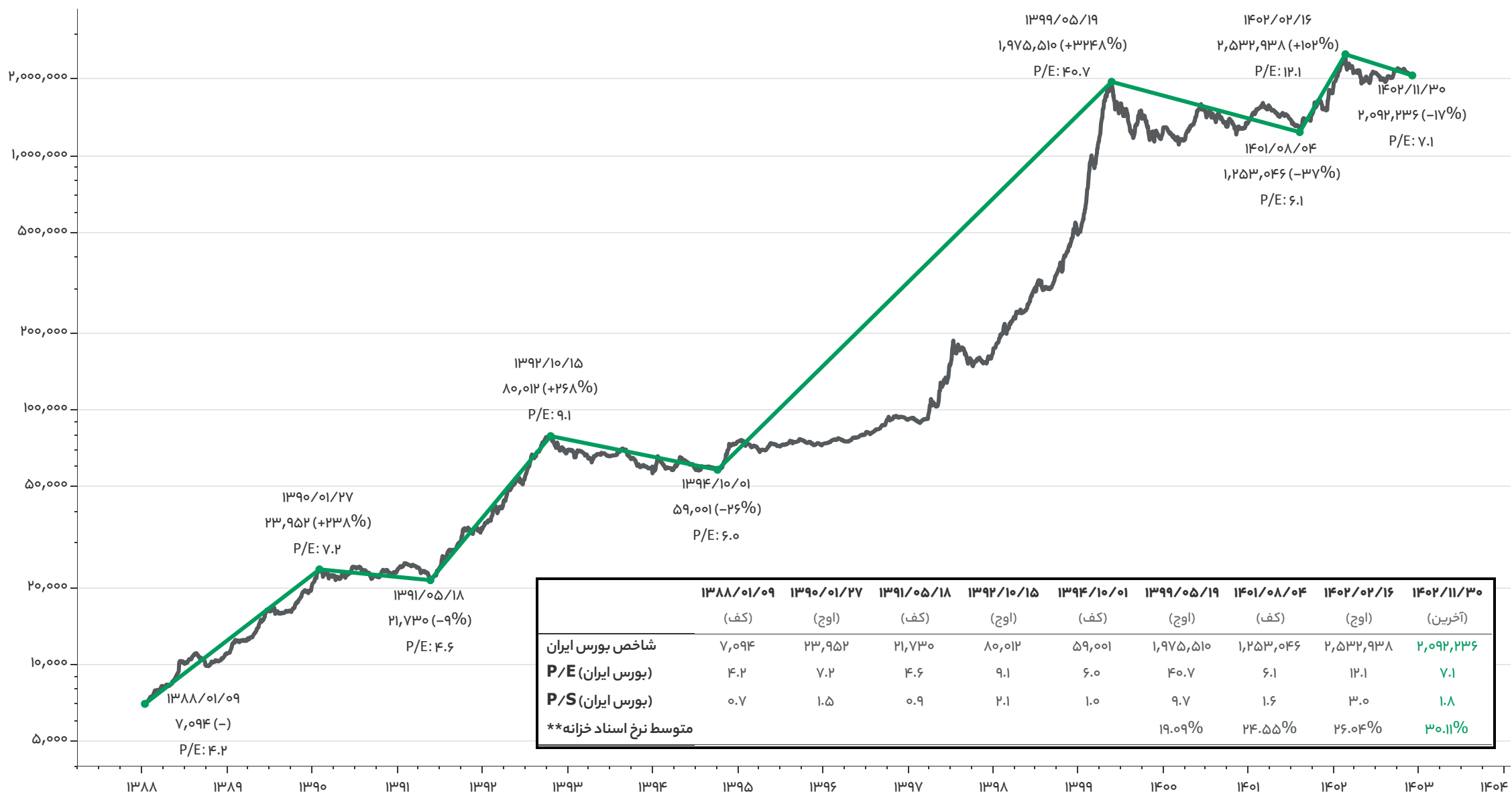


EQUITY

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

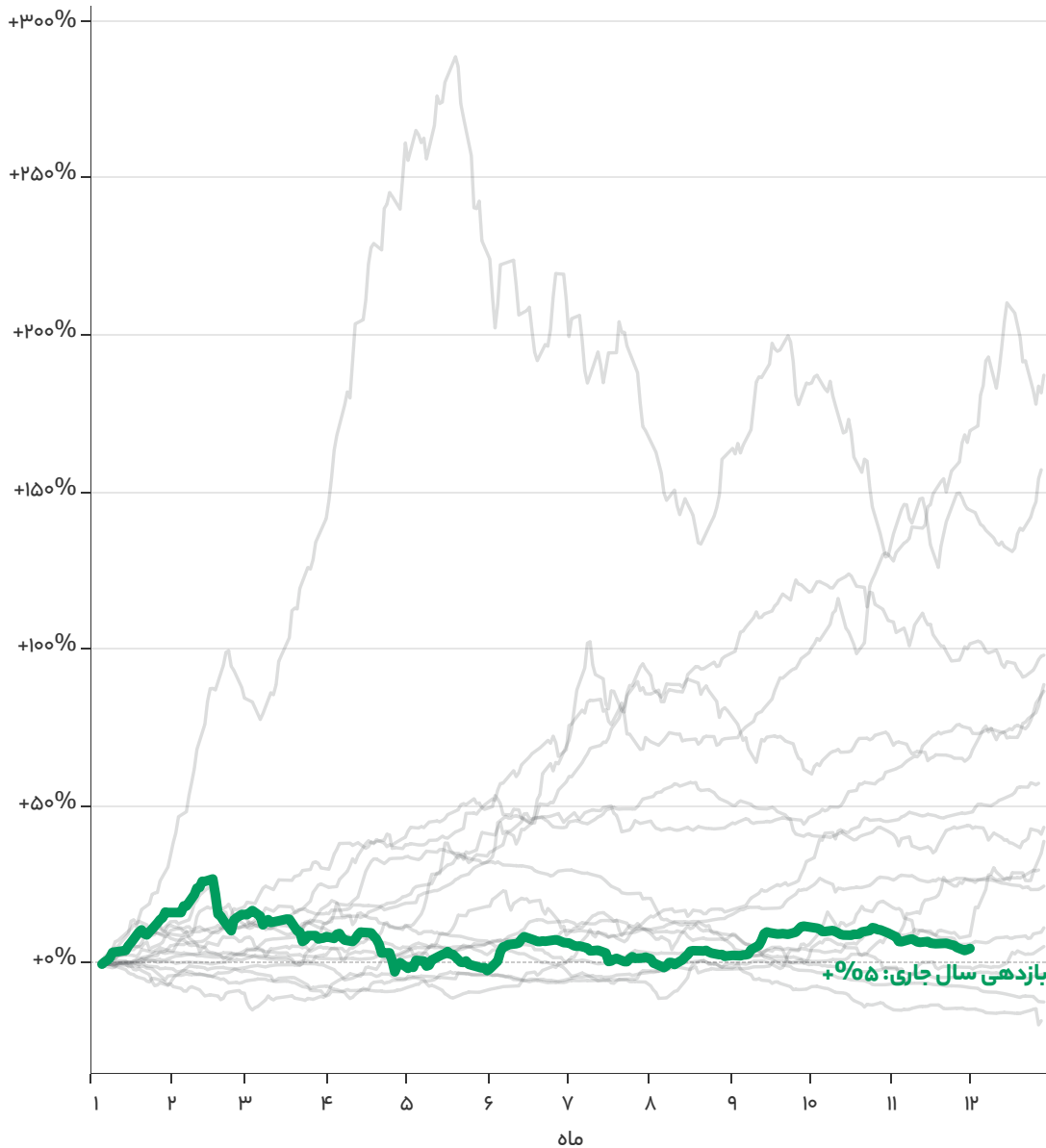


* شاخص بورس ایران (IREX) شاخصی است با سیستم وزن دهی ارزش محور، که شامل بورس تهران و فرابورس می باشد.

** 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

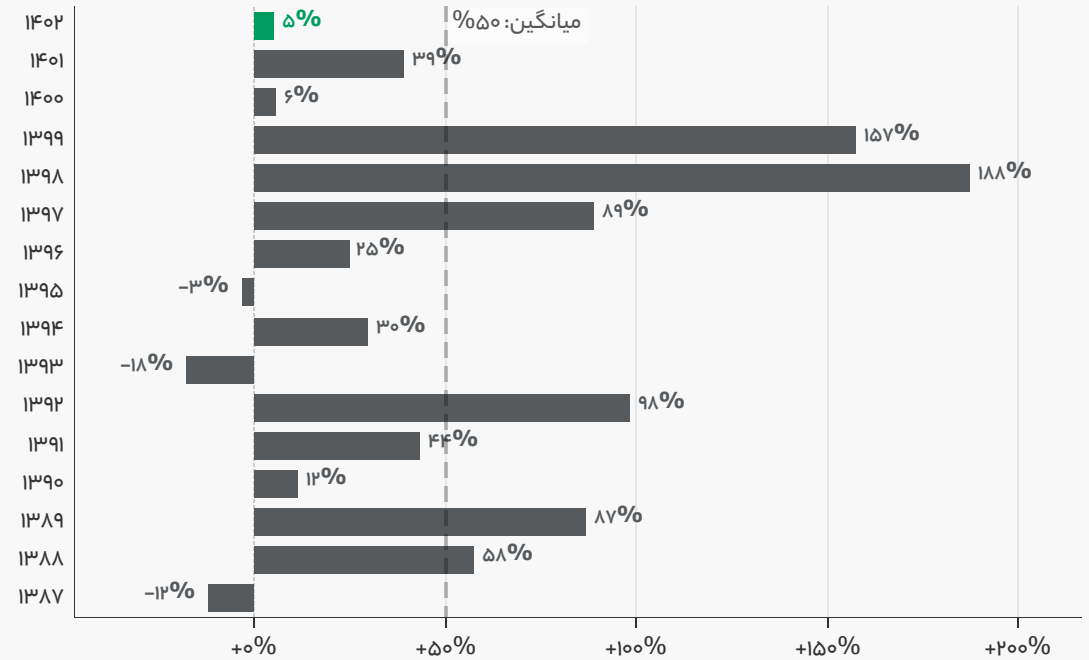
از سال ۱۳۸۷، مقایسه بازدهی سال جاری در مقابل سال‌های گذشته، شاخص بورس ایران



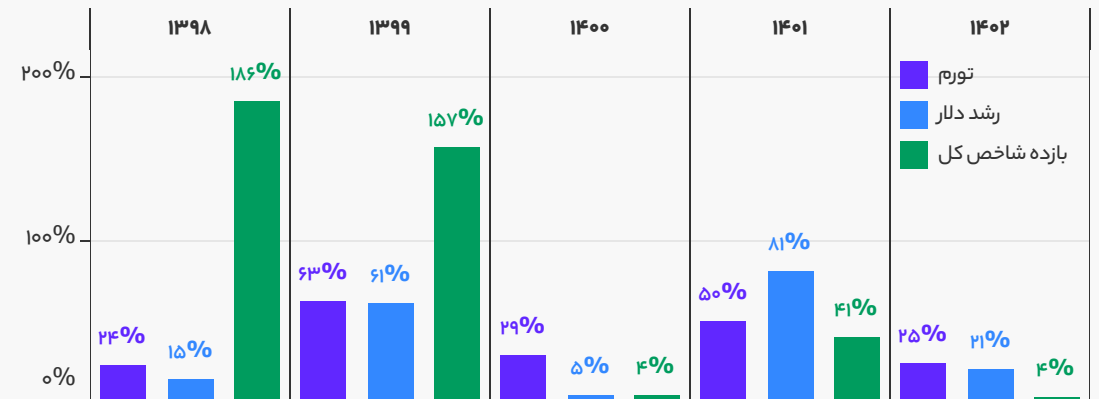
بررسی بلندمدت بازار سهام

بازدهی سالانه بازار سهام

از سال ۱۳۸۷، شاخص بورس ایران

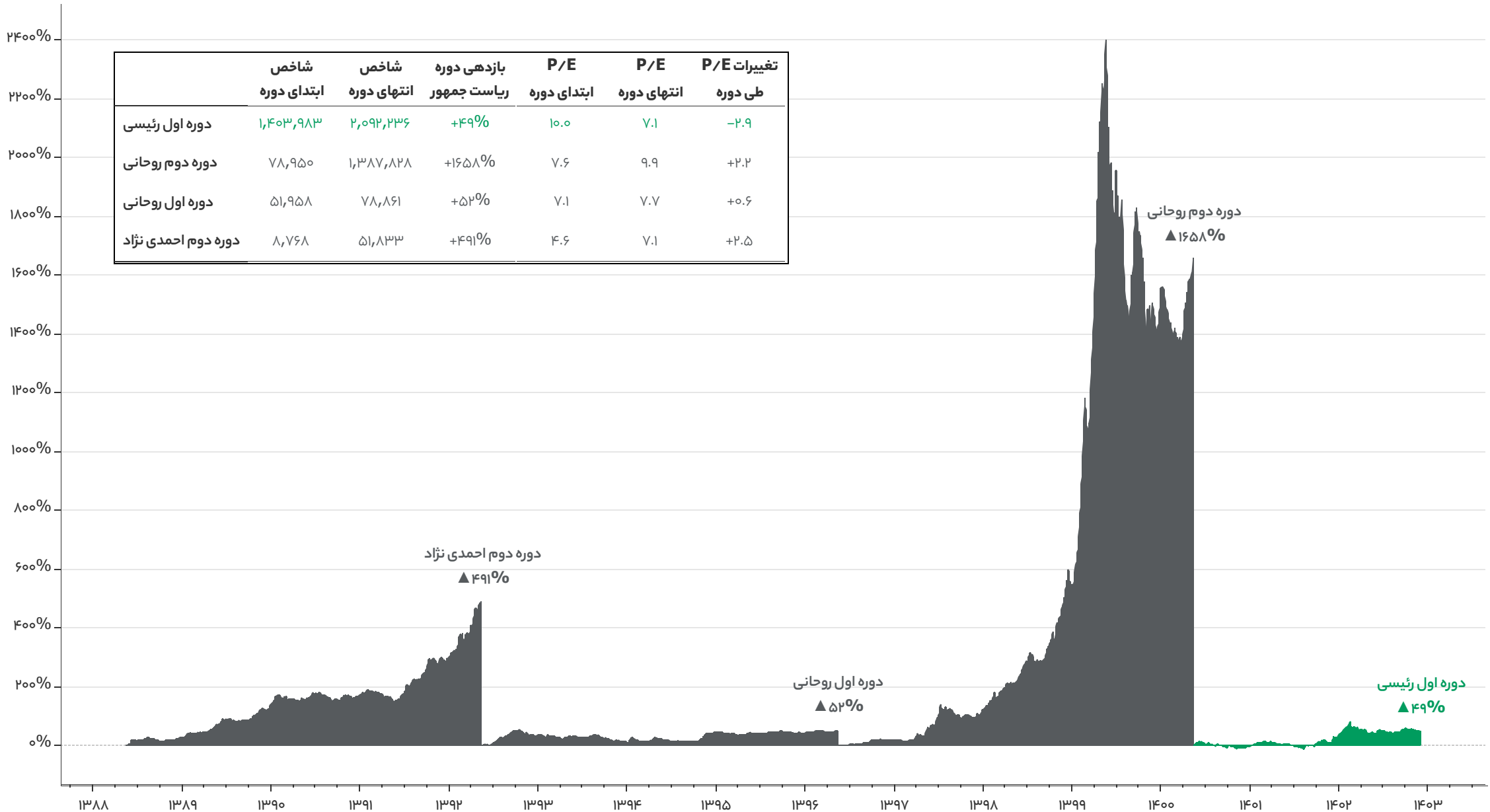


بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار



بررسی بلندمدت بازار سهام

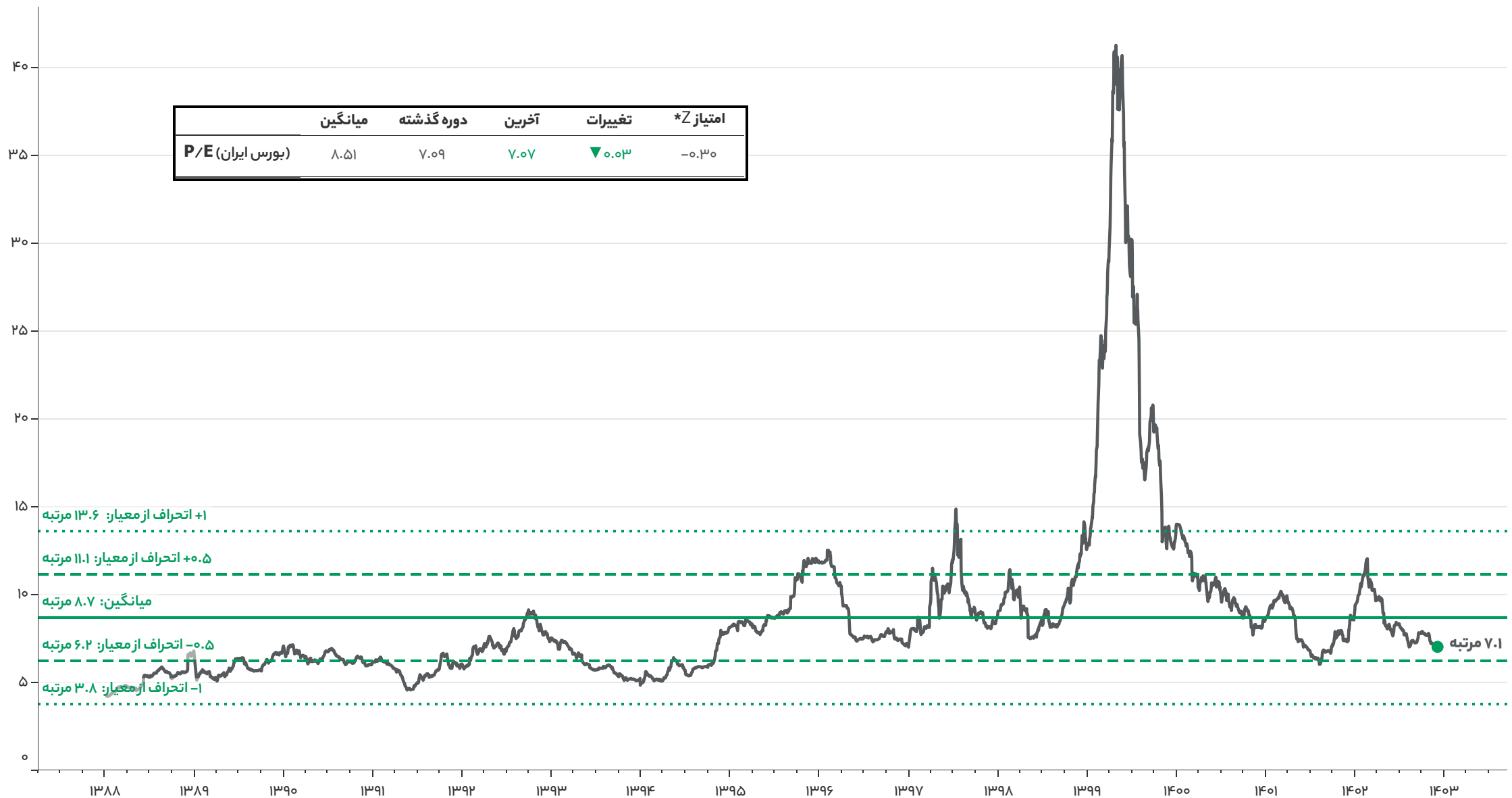
بازدهی شاخص بورس ایران طی دوره‌های ریاست جمهوری



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.

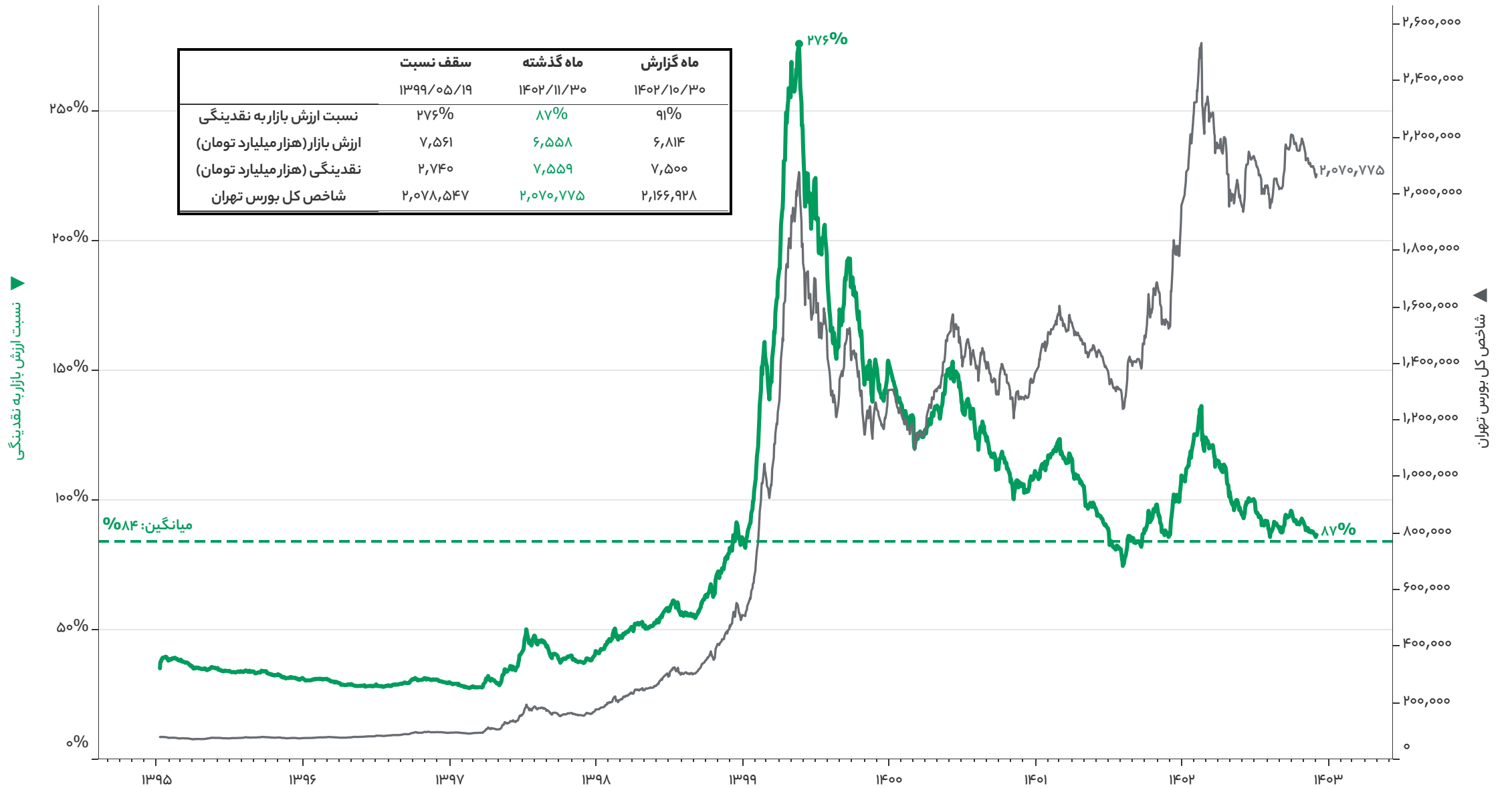


* ارزش ریالی بازار نیز پس از حذف عرضه‌های اولیه از سال ۱۳۹۵ محاسبه شده است.

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.

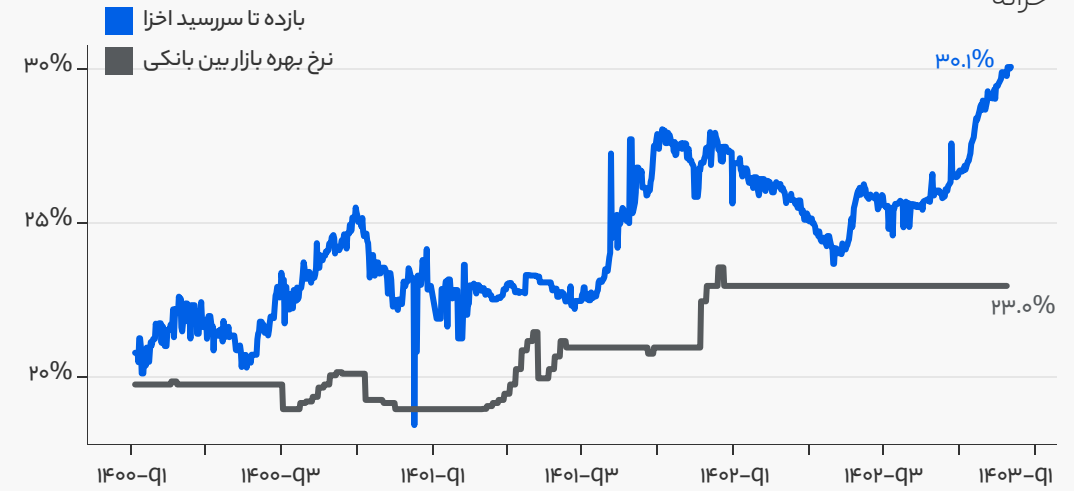


FIXED INCOME

مروری بر بازار درآمد ثابت

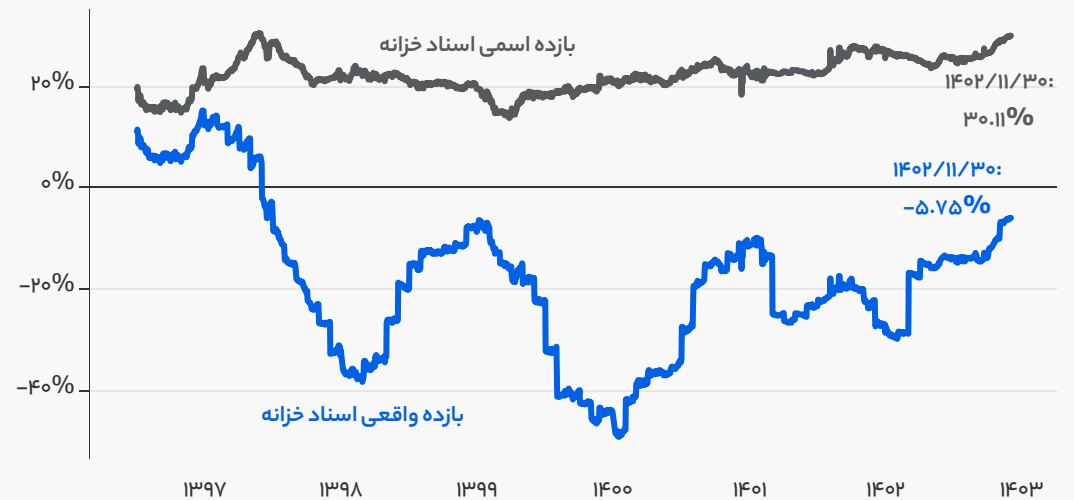
نرخ سود بین بانکی و بازده اسناد خزانه

از ابتدای سال ۱۴۰۰، حداقل نرخ بهره توافق با خرید 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



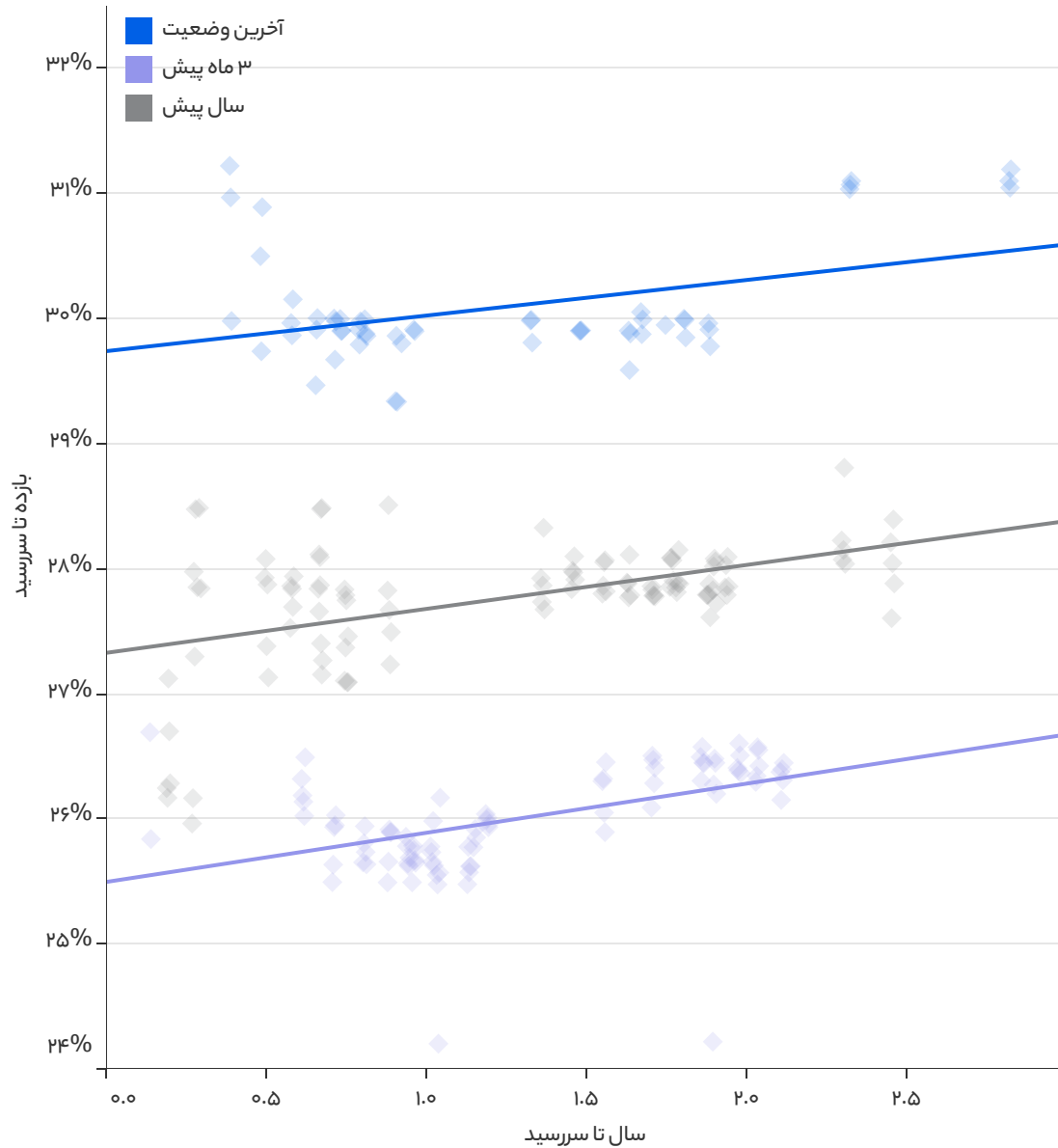
* میانگین روزانه بازده تا سررسید اسناد خزانه در سررسیدهای مختلف که بیش از ۳۰ روز تا سررسید خود فاصله دارند.

** 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

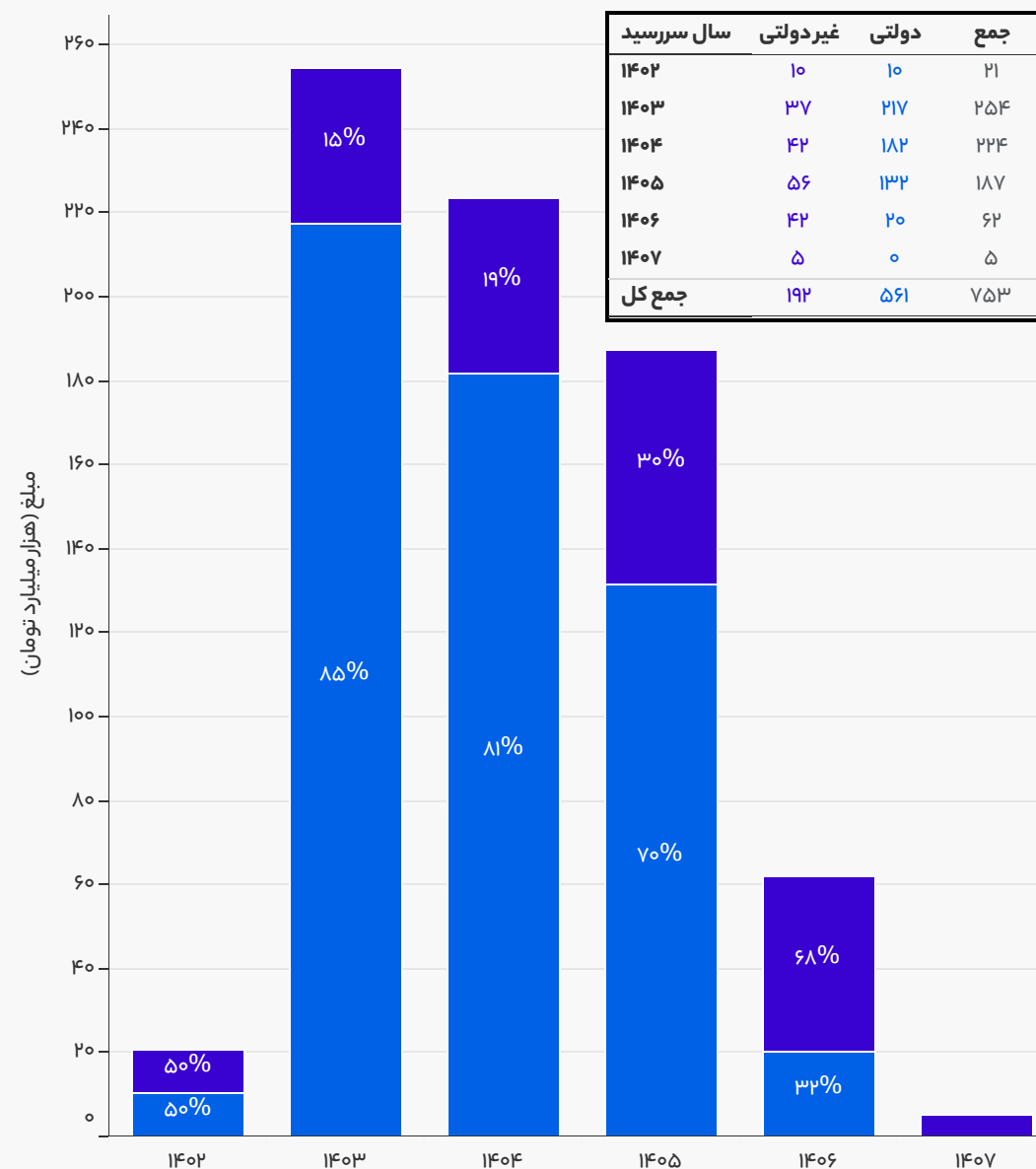
منحنی به همراه بازده تا سررسید اسناد خزانه***، برای آخرین روز، ۳ ماه پیش و سال پیش



دید کلی بازار بدهی

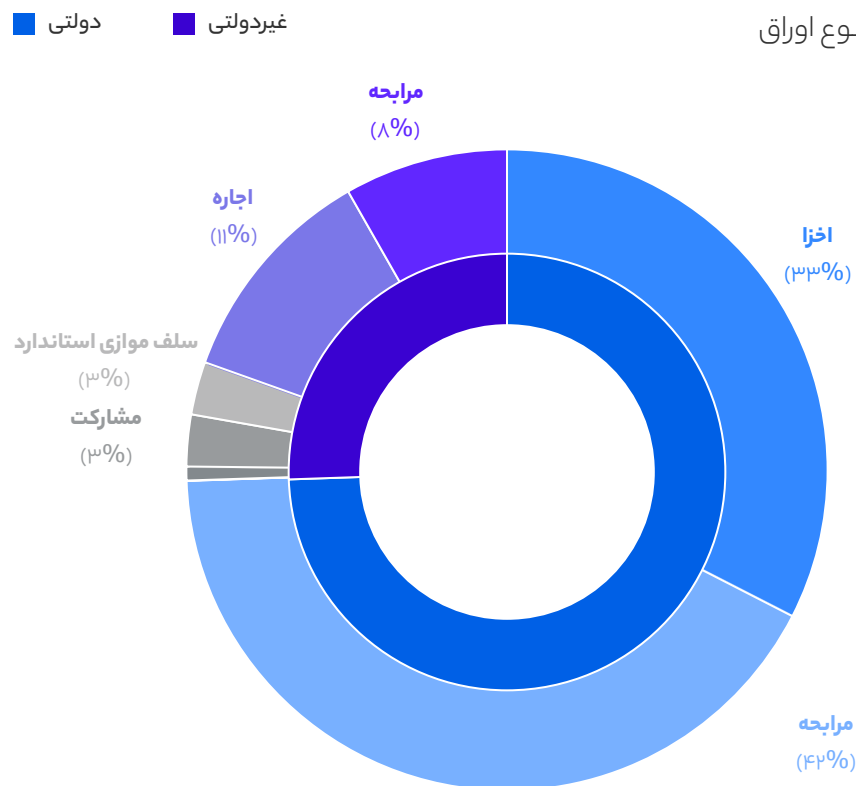
مانده اوراق به تفکیک سررسید

به تفکیک سال سررسید و ناشر*، هزار میلیارد تومان



ترکیب مانده اوراق به تفکیک نوع اوراق

به تفکیک ناشر و نوع اوراق



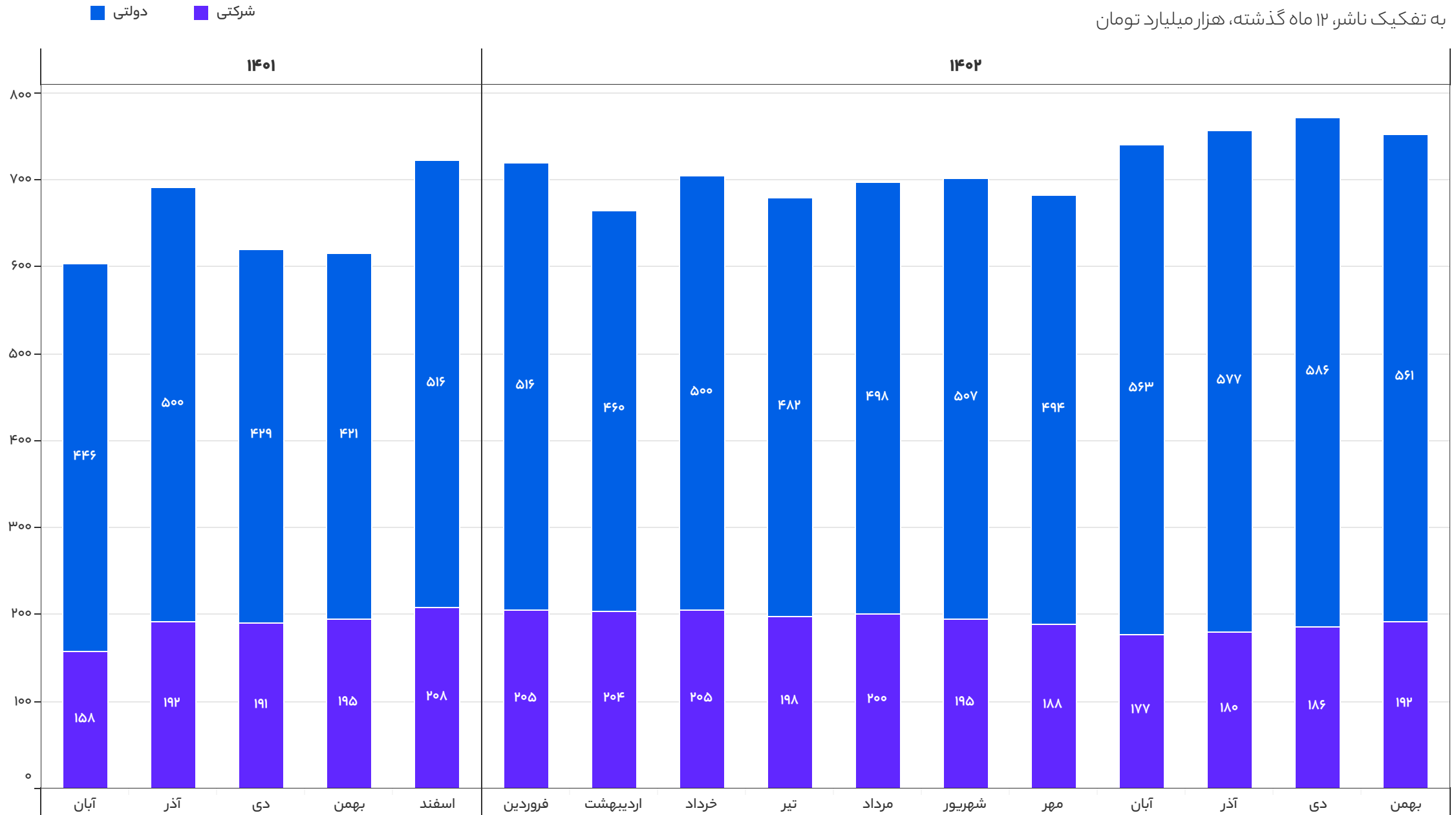
ناشر	نوع اوراق	مانده (همت)	درصد از کل
دولتی	مرابحه	۳۱۶	۴۲%
	اخزا	۲۴۵	۳۳%
	اجاره	۸۵	۱۱%
غیردولتی	مرابحه	۶۲	۸%
	مشارکت	۲۰	۳%
	سلف موازی استاندارد	۲۰	۳%
	منفعت	۵	۱%
جمع کل		۷۵۳	۱۰۰%

* 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

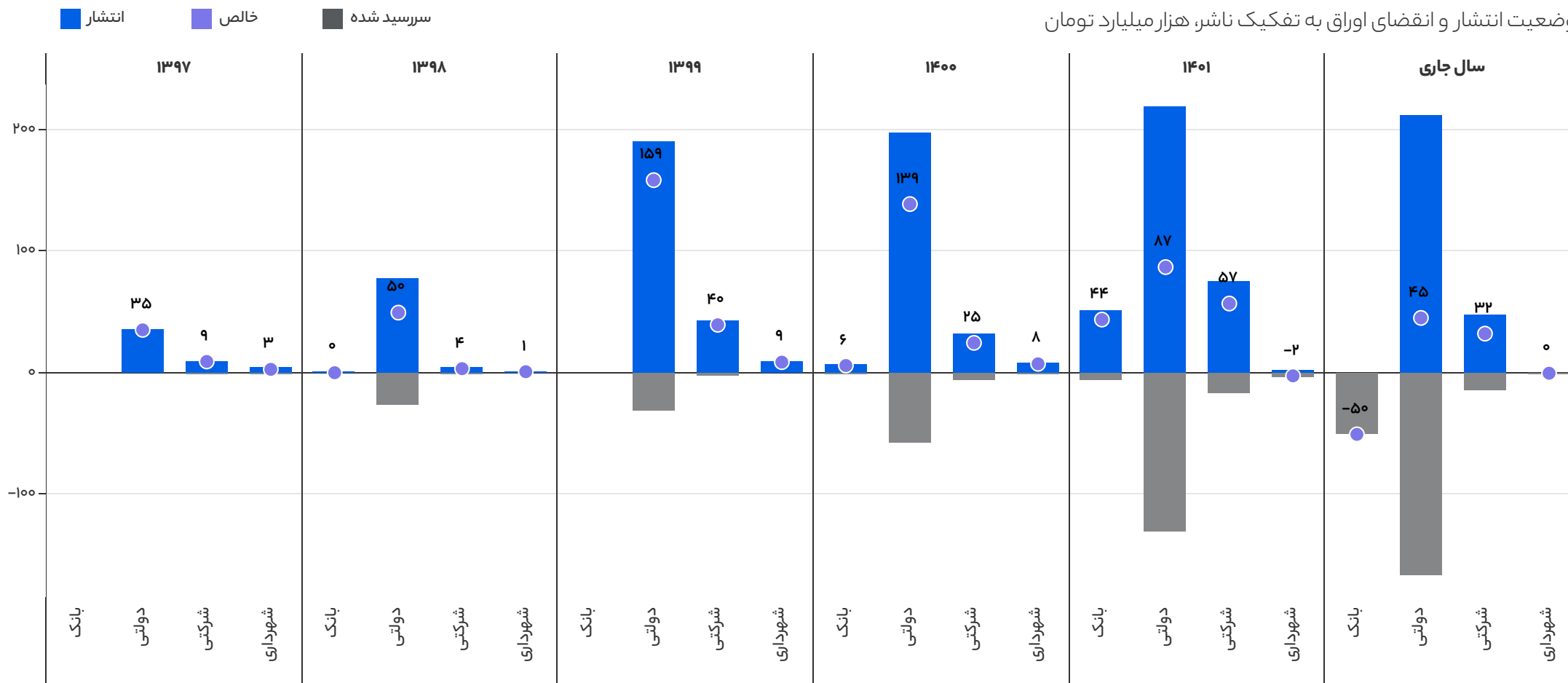
به تفکیک ناشر، ۱۲ ماه گذشته، هزار میلیارد تومان



انتشار و تسویه اوراق

خالص انتشار اوراق سال‌های گذشته

وضعیت انتشار و انقضای اوراق به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان



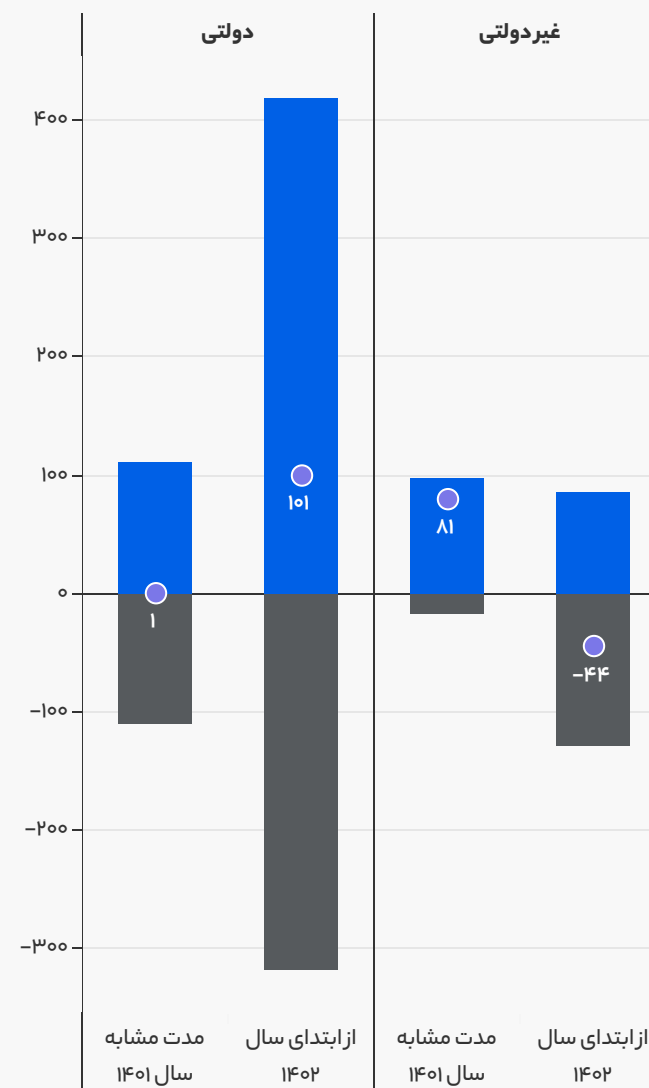
	۱۳۹۷				۱۳۹۸				۱۳۹۹				۱۴۰۰				۱۴۰۱				سال جاری			
	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری	بانک	دولتی	شرکتی	شهرداری
انتشار اوراق		۳۵	۱۰	۴	۰	۷۷	۴	۱	۱۹۰	۴۲	۹	۰	۱۹۷	۳۱	۸	۰	۲۱۹	۷۵	۲	۰	۲۱۲	۴۸	۰	۰
سررسید شده			۰	-۱		-۲۷	-۱			-۳۲	-۳			-۷	-۱		-۷	-۱۳۱	-۱۸	-۴	-۵۰	-۱۶۷	-۱۵	۰
خالص انتشار		۳۵	۹	۳	۰	۵۰	۴	۱	۱۵۹	۴۰	۹	۰	۱۳۹	۲۵	۸	۰	۸۷	۵۷	-۲	-۵۰	۴۵	۳۲	۰	۰

انتشار و تسویه اوراق

مقایسه انتشار اوراق در سال جاری

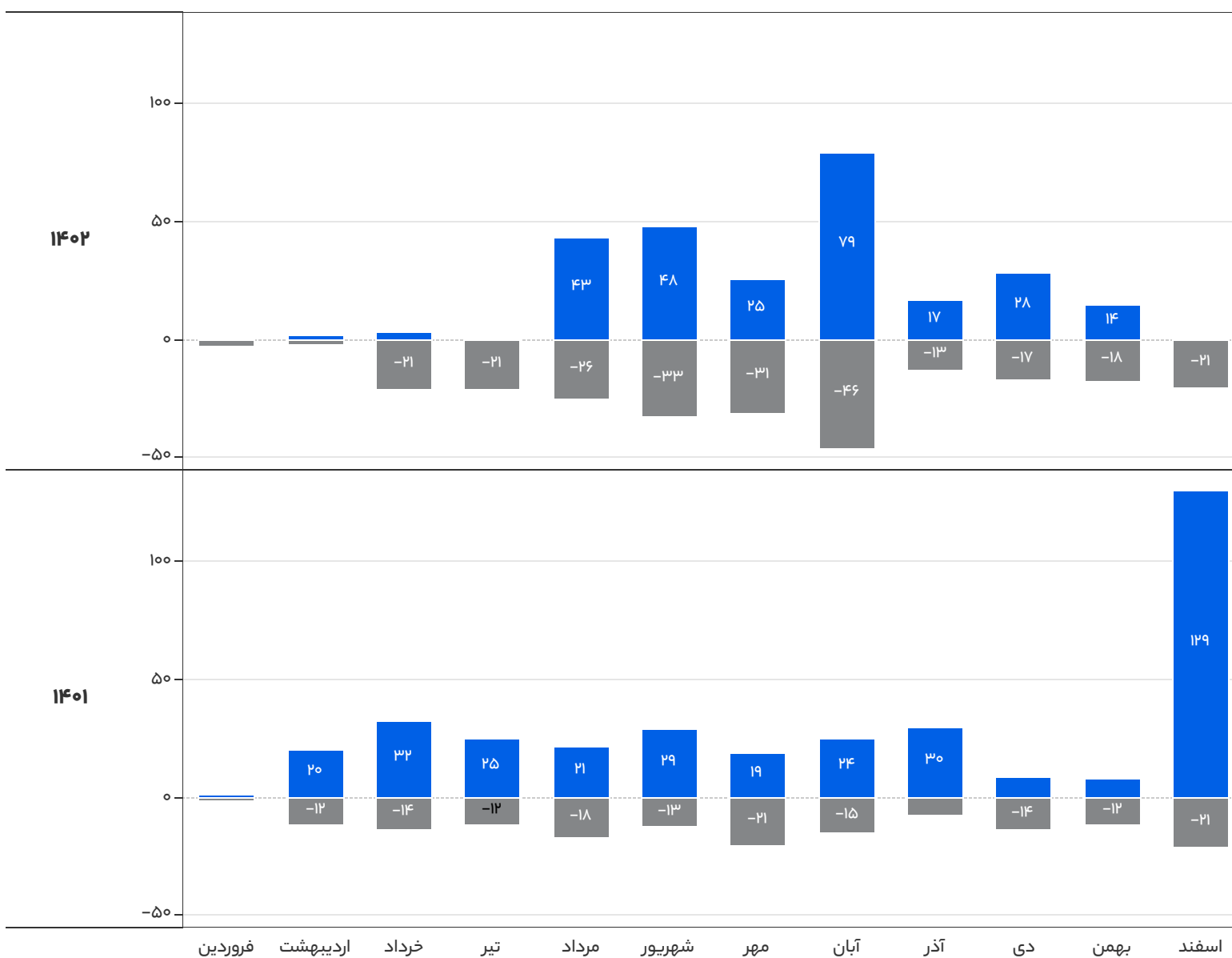
وضعیت انتشار و انقضای اوراق سال جاری نسبت به مدت مشابه سال گذشته، به تفکیک ناشر، هزار میلیارد تومان

انتشار خالص سررسید شده



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

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



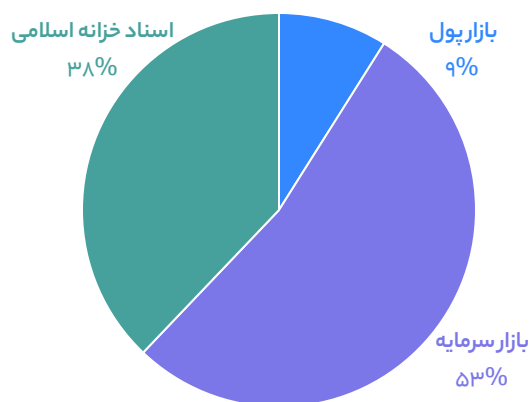
تامین مالی دولت (بر اساس آخرین داده، دی ماه ۱۴۰۲)

وضعیت تامین مالی دولت در سال جاری

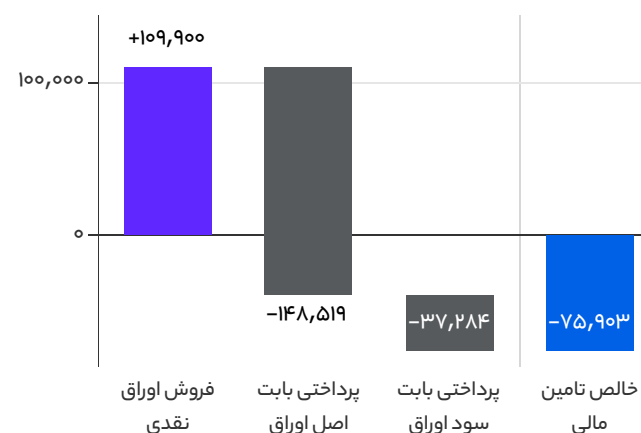
از ابتدای سال، نقدینگی جذب شده توسط دولت از طریق عرضه و تسویه اوراق، میلیارد تومان

تامین مالی دولت از ابتدای سال

مجموع از ابتدای سال، به تفکیک نوع فروش و بازار، میلیارد تومان



نوع فروش	بازار	حجم
نقدی	بازار پول	۱۵,۸۳۳
نقدی	بازار سرمایه	۹۴,۰۶۷
غیر نقدی	اسناد خزانه اسلامی	۶۷,۰۰۰

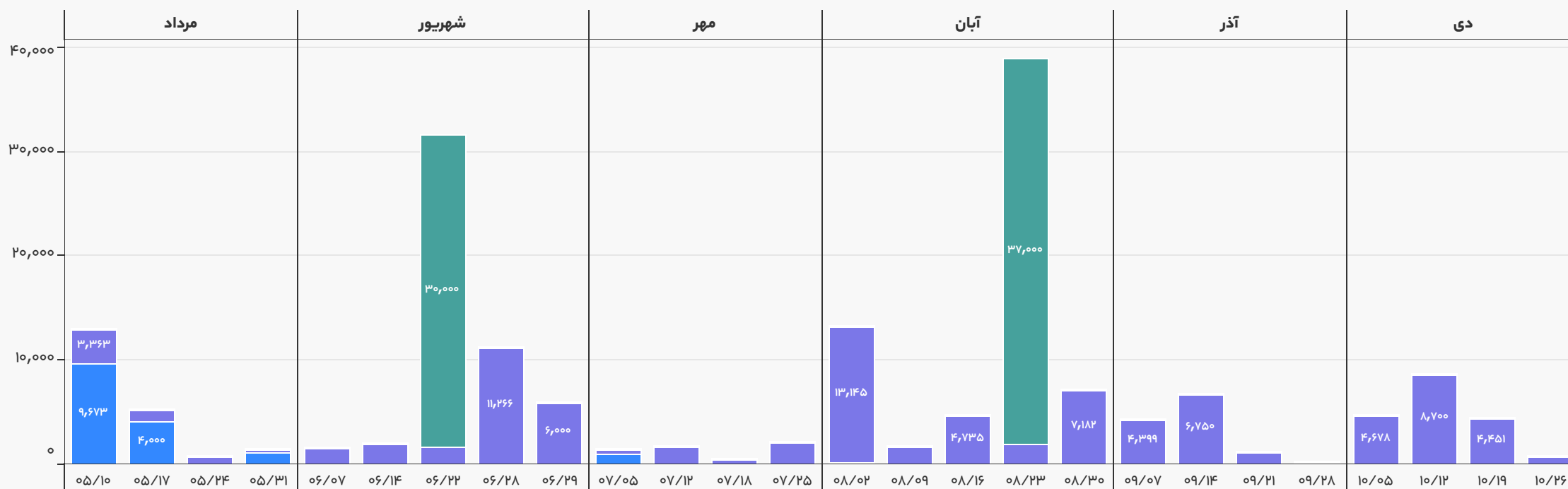


فروش اوراق نقدی	۱۰۹,۹۰۰
پرداختی بابت اصل اوراق	-۱۴۸,۵۱۹
پرداختی بابت سود اوراق	-۳۷,۲۸۴
خالص تامین مالی	-۷۵,۹۰۳

بازار پول بازار سرمایه اسناد خزانه اسلامی

عرضه اوراق دولتی در سال جاری

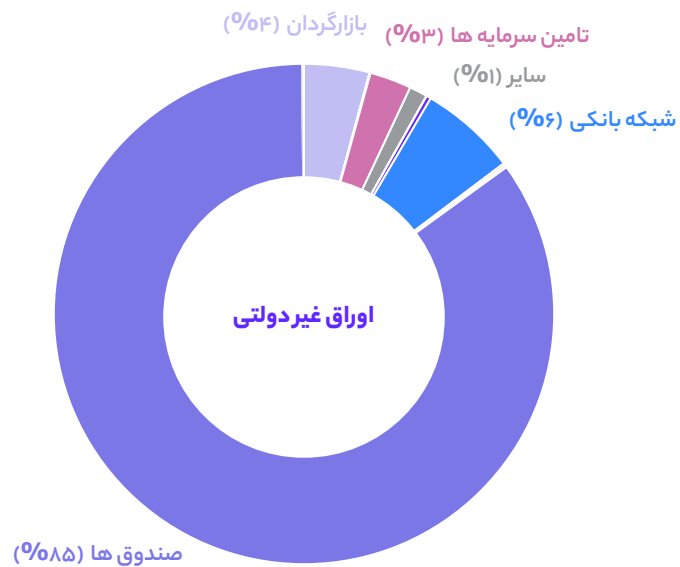
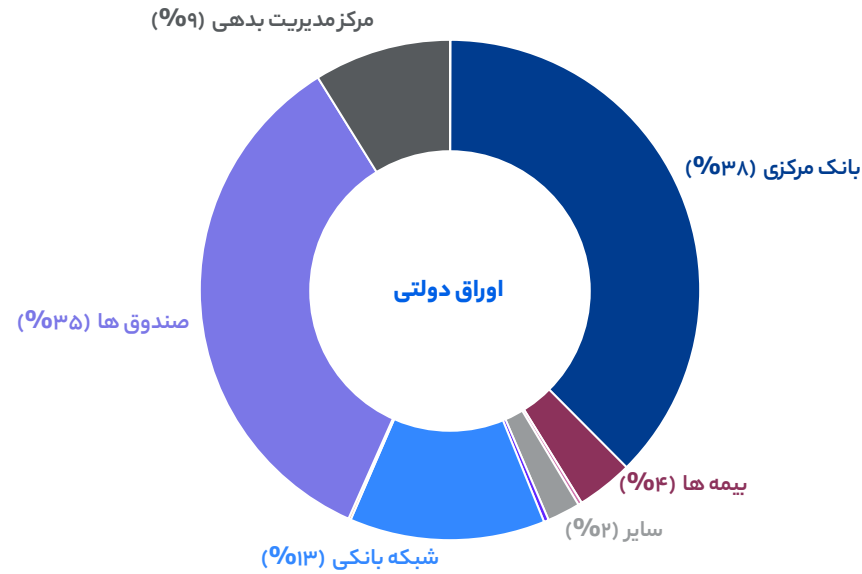
از ابتدای سال، به تفکیک عرضه، میلیارد تومان



بازیگران کلیدی بازار بدهی

ترکیب دارندگان درصدی اوراق

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



	۱۴۰۲	۱۴۰۳	۱۴۰۴	۱۴۰۵	۱۴۰۶	۱۴۰۷	جمع کل	
دولتی	بانک مرکزی	۳.۲	۵۳.۵	۵۰.۹	۱۹.۲	۷.۰		۱۳۳.۹
	صندوق ها	۶.۲	۶۲.۴	۴۱.۲	۹.۸	۳.۷		۱۲۳.۲
	شبکه بانکی	۰.۶	۲۴.۱	۱۲.۲	۴.۳	۳.۸		۴۵.۱
	مرکز مدیریت بدهی	-	۵.۹	۵.۱	۲۰.۶	-		۳۱.۶
	بیمه ها	-	۶.۴	۲.۳	۴.۰	۰.۲		۱۳.۰
	سایر	-	۱.۸	۴.۶	۱.۳	-		۷.۷
	سبدها	-	۰.۹	۰.۱	۰.۱	-		۱.۱
	تامین سرمایه ها	۰.۱	۰.۷	-	-	-		۰.۹
	شخص حقیقی	-	۰.۴	۰.۱	-	-		۰.۵
	بازارگردان	-	-	-	-	۰.۱		۰.۱
غیردولتی	صندوق ها	۶.۷	۲۵.۸	۲۳.۴	۳۶.۹	۲۷.۴	۱.۸	۱۲۲.۱
	شبکه بانکی	-	۰.۳	۰.۹	۷.۲	۰.۵	-	۹.۰
	بازارگردان	۱.۲	۰.۷	۱.۰	۲.۴	۰.۸	-	۶.۱
	تامین سرمایه ها	-	۰.۶	۱.۸	۰.۵	۰.۸	۰.۲	۳.۹
	سایر	-	۰.۲	-	-	۱.۰	۰.۵	۱.۷
	سبدها	-	-	-	-	۰.۴	-	۰.۴
	شخص حقیقی	-	-	-	-	۰.۱	۰.۱	۰.۲
	شرکت واسط مالی	-	-	-	-	-	۰.۲	۰.۲
	بیمه ها	-	-	-	۰.۱	-	-	۰.۱
	گروه خدمات بازار سر..	-	-	-	۰.۱	-	-	۰.۱
	گروه مالی	-	-	-	۰.۱	-	-	۰.۱
	کارگزاری	-	-	-	-	-	-	-
	سبدها	-	-	-	-	-	-	-
	سرمایه گذاری	-	-	-	-	-	-	-

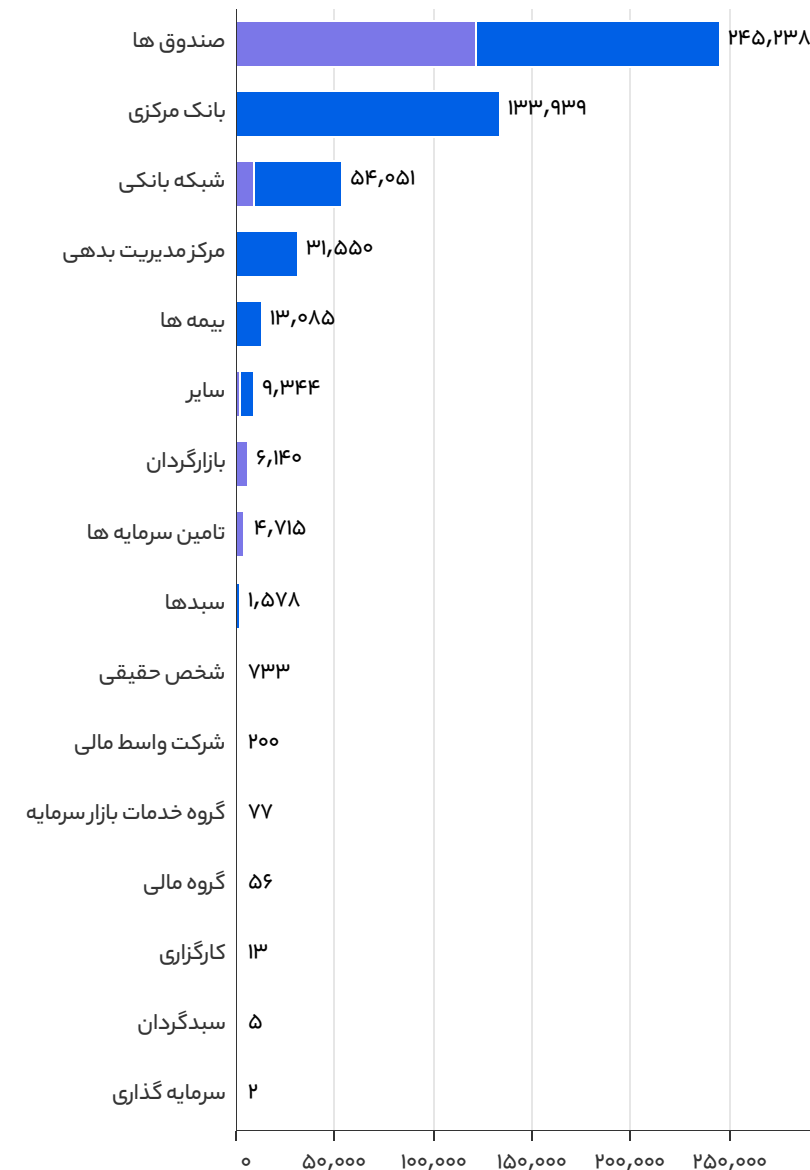
بازیگران کلیدی بازار بدهی

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
۲۴۵,۲۳۸	۱,۴۶۷	۴,۰۰۱	۱۱,۱۰۰	۱۱۷,۶۹۸	۰	۱۰,۲۰۴	۴۳,۷۶۵	۵۰	۵۶,۹۵۲
۱۳۳,۹۳۹	۰	۰	۰	۱۰۵,۱۸۳	۰	۰	۲۸,۷۵۷	۰	۰
۵۴,۰۵۱	۰	۱۰۰	۲۳۵	۲۹,۵۴۶	۰	۰	۱۸,۲۳۰	۰	۵,۹۴۰
۳۱,۵۵۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۳۱,۵۵۰	۰	۰
۱۳,۰۸۵	۰	۰	۰	۶,۷۴۸	۴۰	۰	۶,۲۹۷	۰	۰
۹,۳۴۴	۰	۰	۲۵	۲۱۱	۵۰	۰	۷,۵۵۳	۰	۱,۵۰۵
۴,۷۱۵	۰	۹۵	۴۴۵	۲,۹۳۵	۲	۷۸۹	۰	۵	۴۴۵
۶,۱۴۰	۰	۰	۶۹۹	۱,۵۰۶	۰	۱,۱۹۱	۰	۰	۲,۷۴۴
۱,۵۷۸	۰	۰	۰	۷۲۳	۰	۰	۶۶۳	۰	۱۹۲
۵	۰	۰	۰	۳	۲	۰	۰	۰	۰
۲	۰	۰	۰	۲	۰	۰	۰	۰	۰
۷۳۳	۰	۰	۰	۶۶۰	۰	۰	۷۳	۰	۰
۲۰۰	۰	۰	۰	۲۰۰	۰	۰	۰	۰	۰
۱۳	۰	۰	۰	۰	۳	۰	۰	۰	۱۰
۷۷	۰	۰	۰	۷۷	۰	۰	۰	۰	۰
۵۶	۰	۰	۰	۵۶	۰	۰	۰	۰	۰
۵	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
۲	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
۵۰۰,۷۲۶	۱,۴۶۷	۴,۱۹۶	۱۲,۵۰۴	۲۶۵,۵۴۸	۹۷	۱۲,۱۸۴	۱۳۶,۸۸۸	۵۵	۶۷,۷۸۷

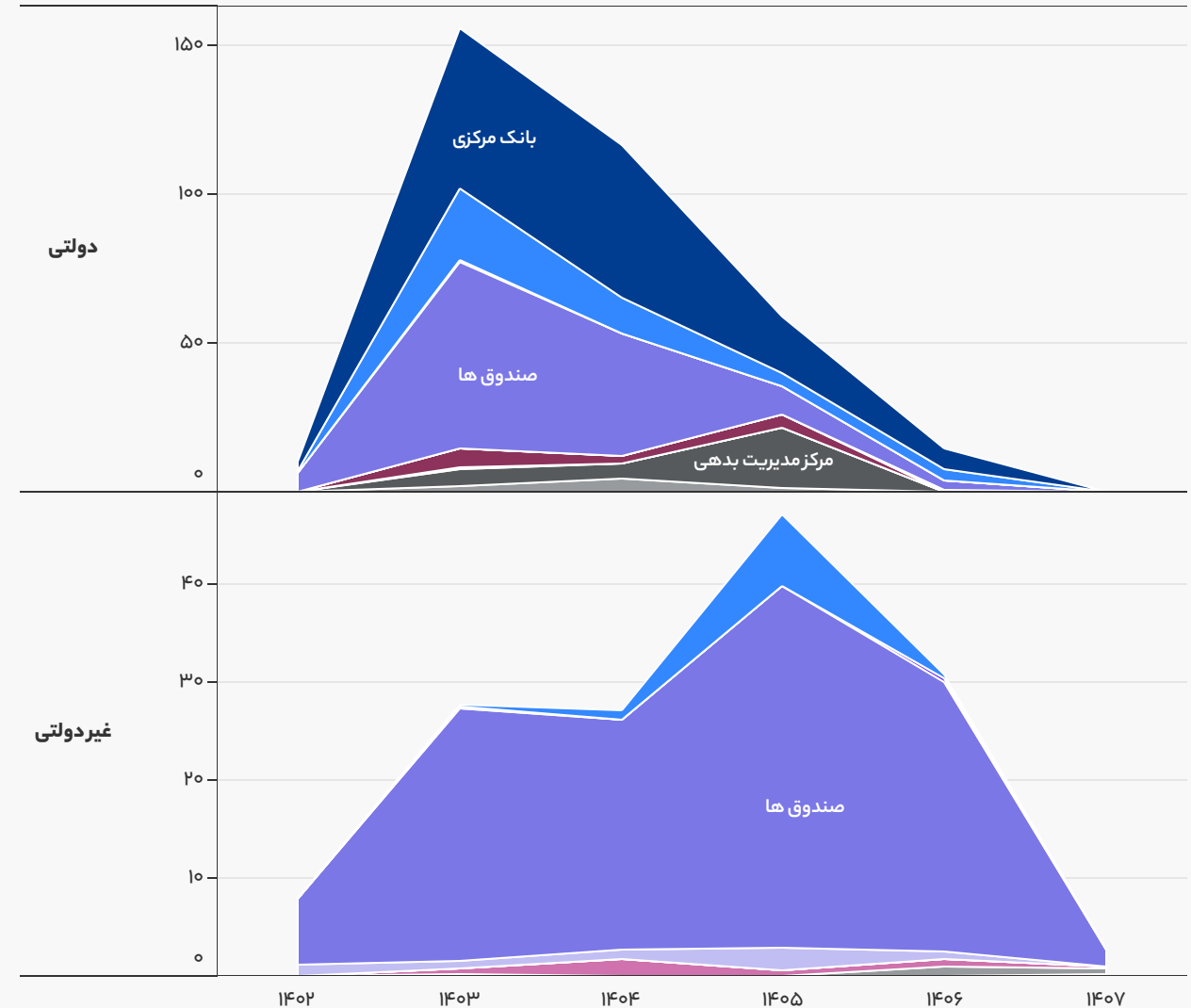


بازیگران کلیدی بازار بدهی

دارندگان درصدی اوراق به تفکیک سررسید

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

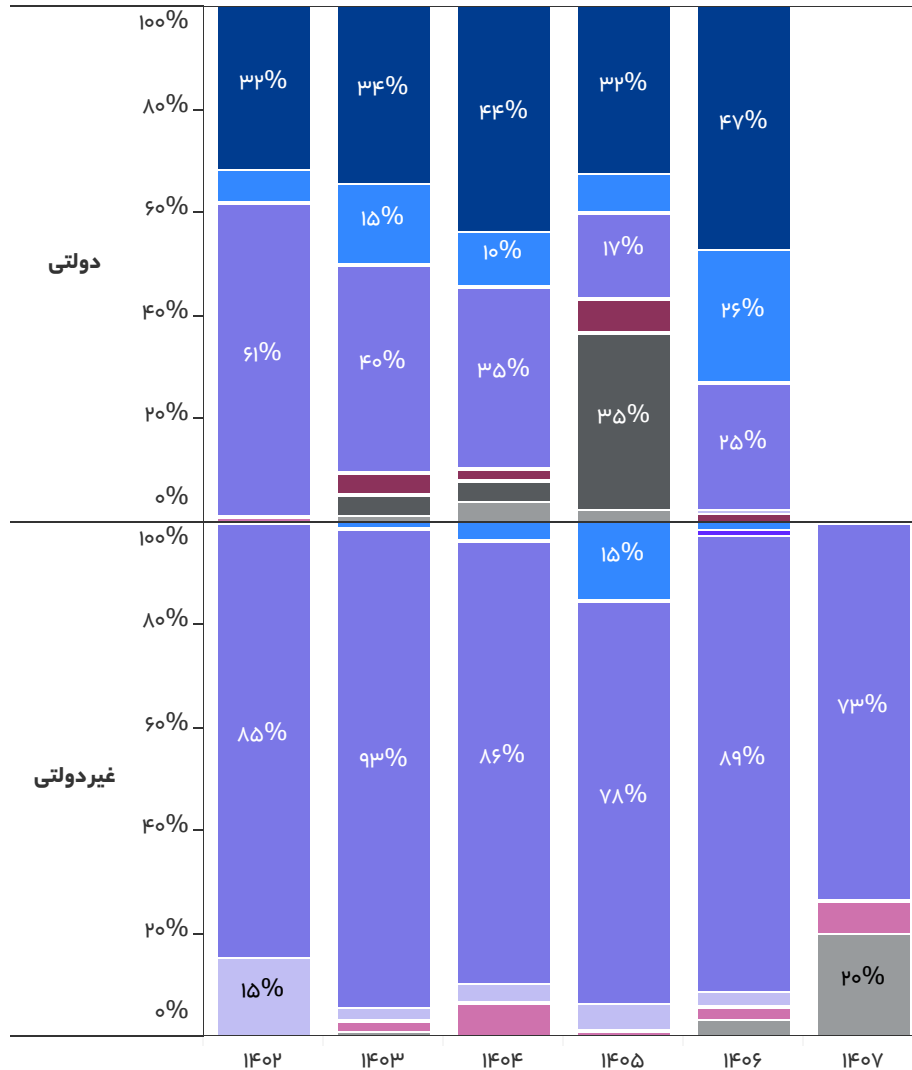
- بانک مرکزی
- صندوق‌ها
- تامین سرمایه‌ها
- شرکت واسط مالی
- شبکه بانکی
- بازارگردان
- مرکز مدیریت بدهی
- سبدها
- بیمه‌ها
- سایر



سهم دارندگان اوراق به تفکیک سررسید

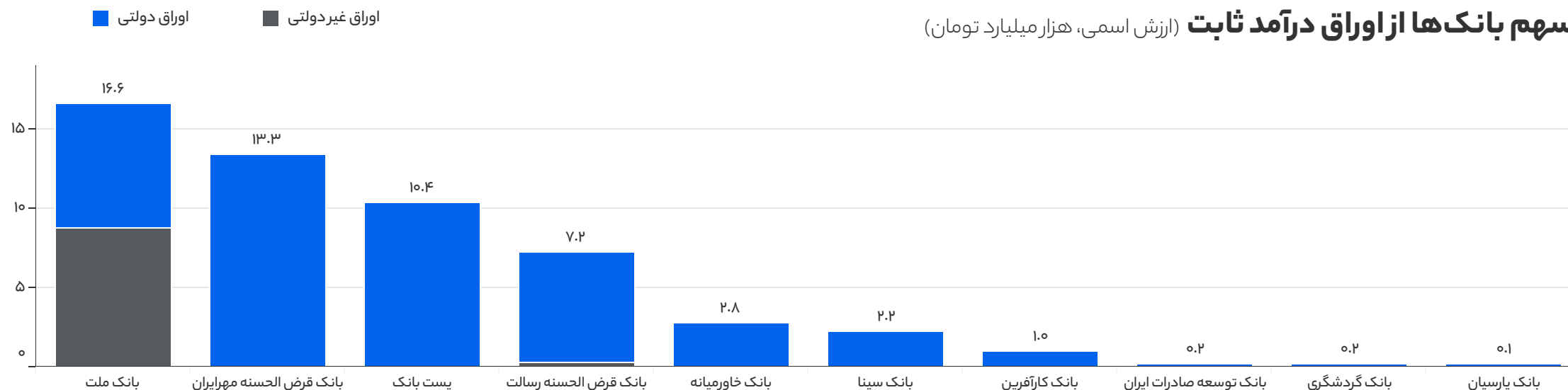
درصد از کل اوراق در هر سال، به تفکیک دارندگان اوراق (دارندگان درصدی)

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

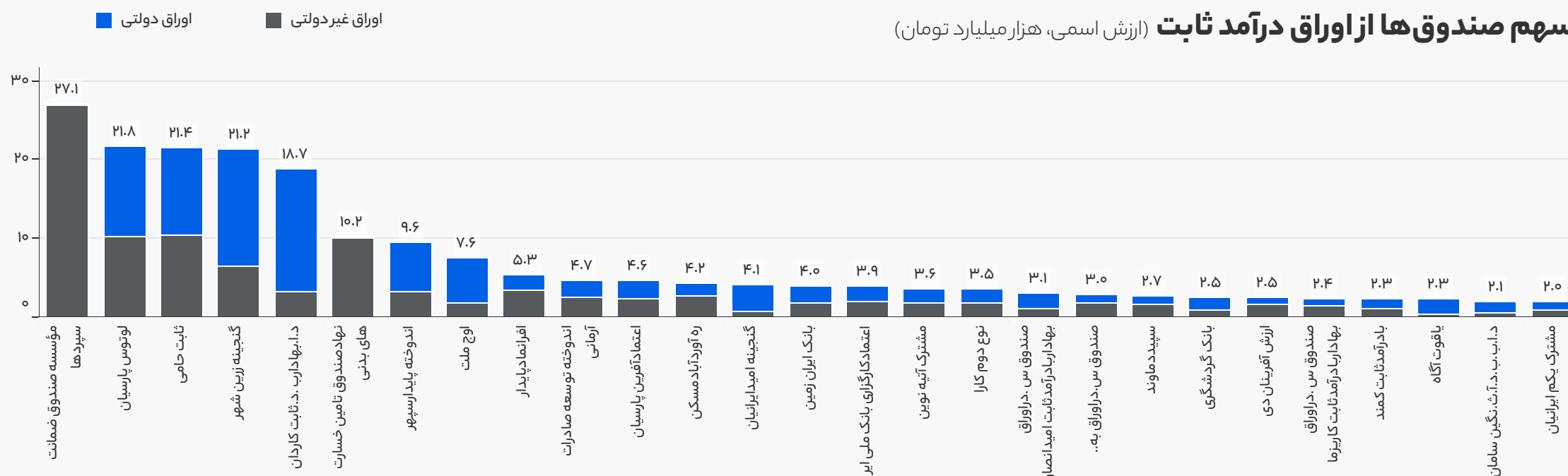


بازیگران کلیدی بازار بدهی

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



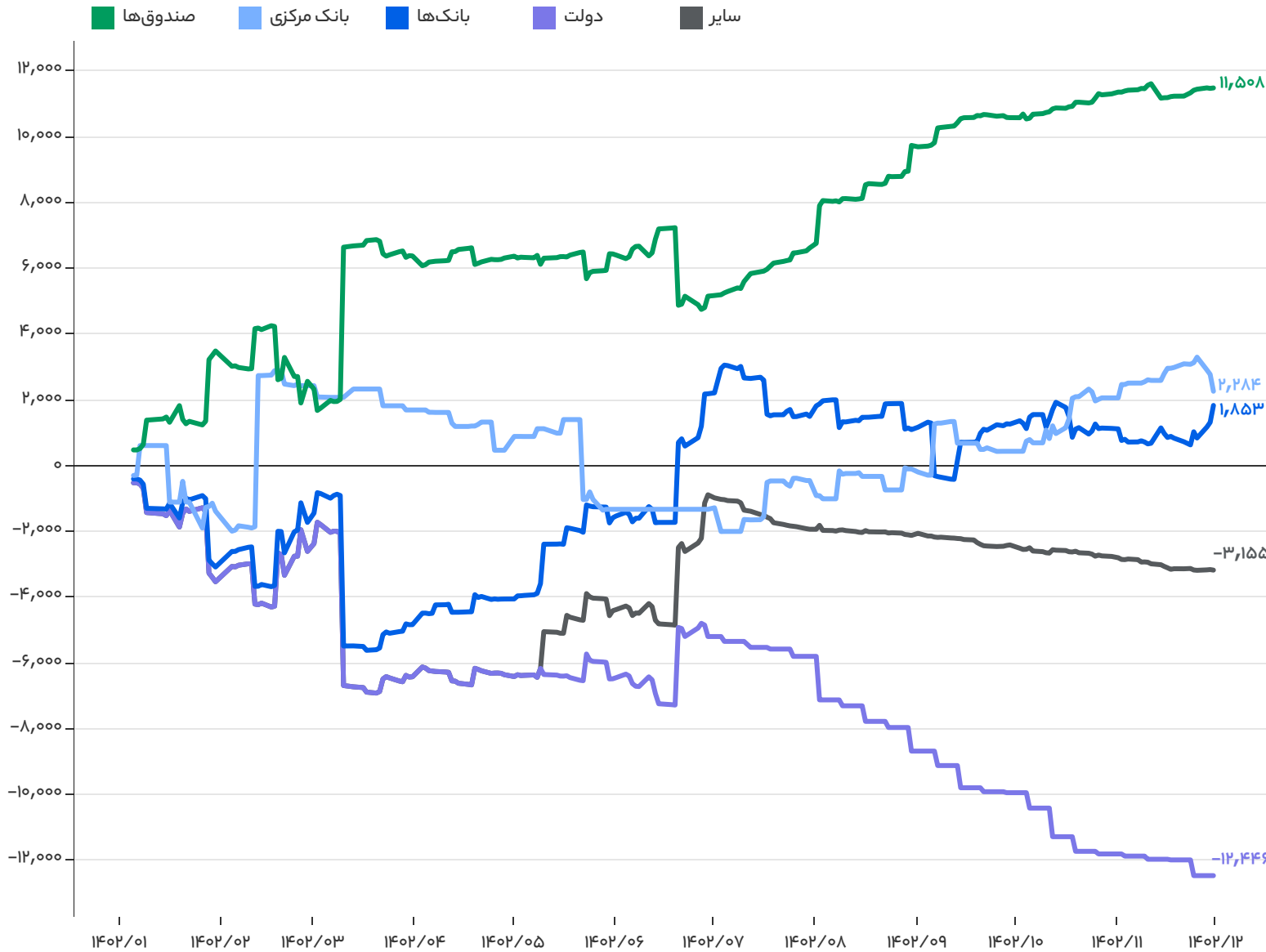
سهام صندوق‌ها از اوراق درآمد ثابت (ارزش اسمی، هزار میلیارد تومان)



معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

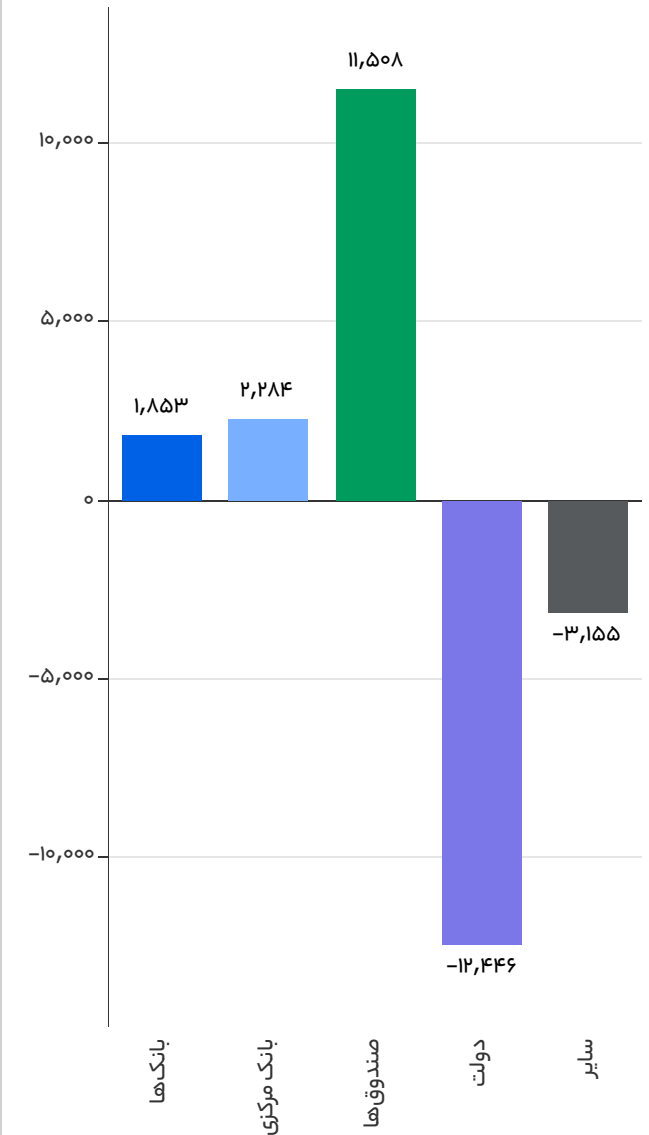
خالص معاملات اوراق

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

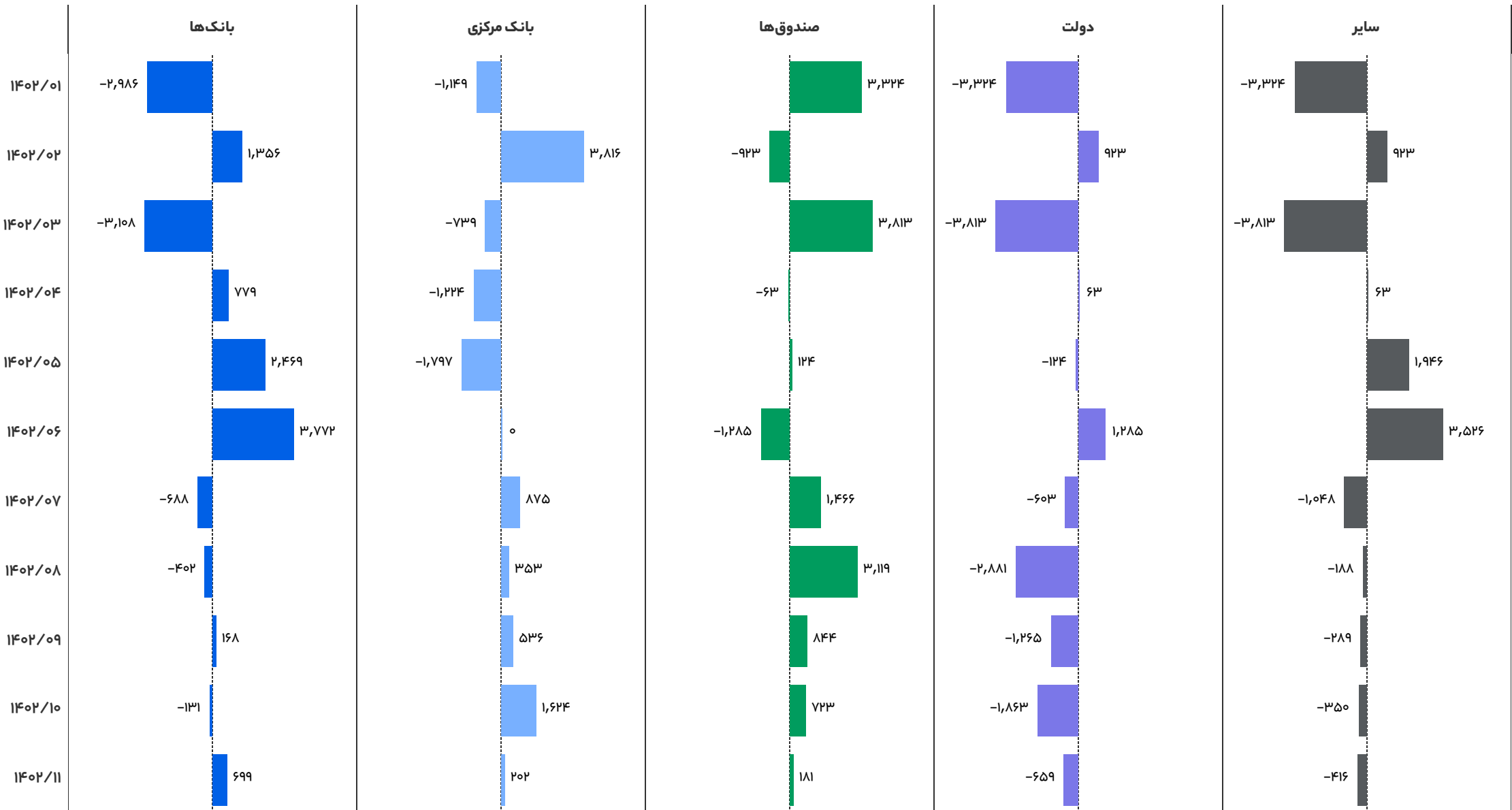


معاملات اوراق درآمد ثابت توسط بازیگران کلیدی

آمار معاملات اوراق به صورت ماهانه

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

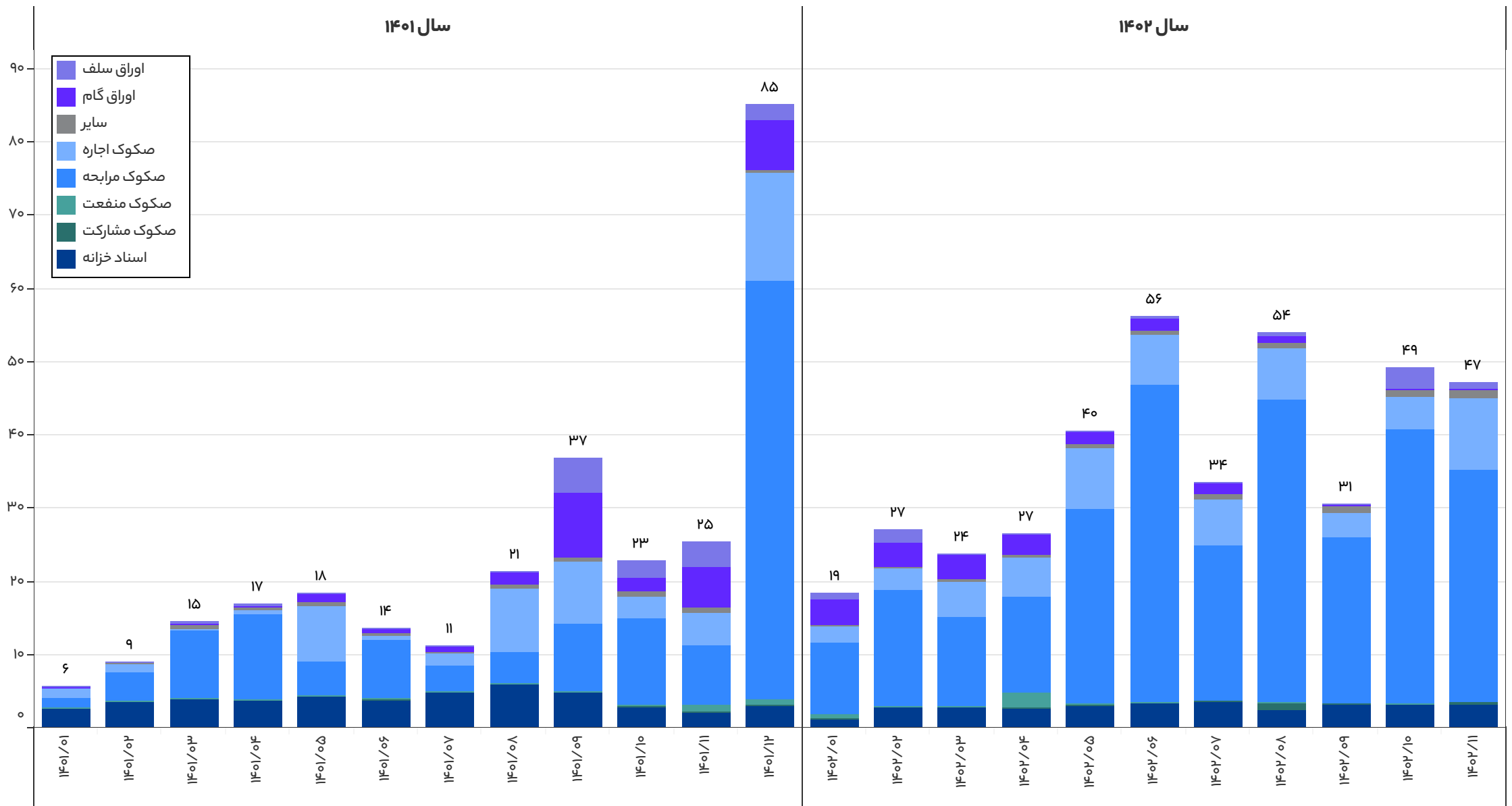
بانکها بانک مرکزی صندوقها دولت سایر



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق به صورت ماهانه

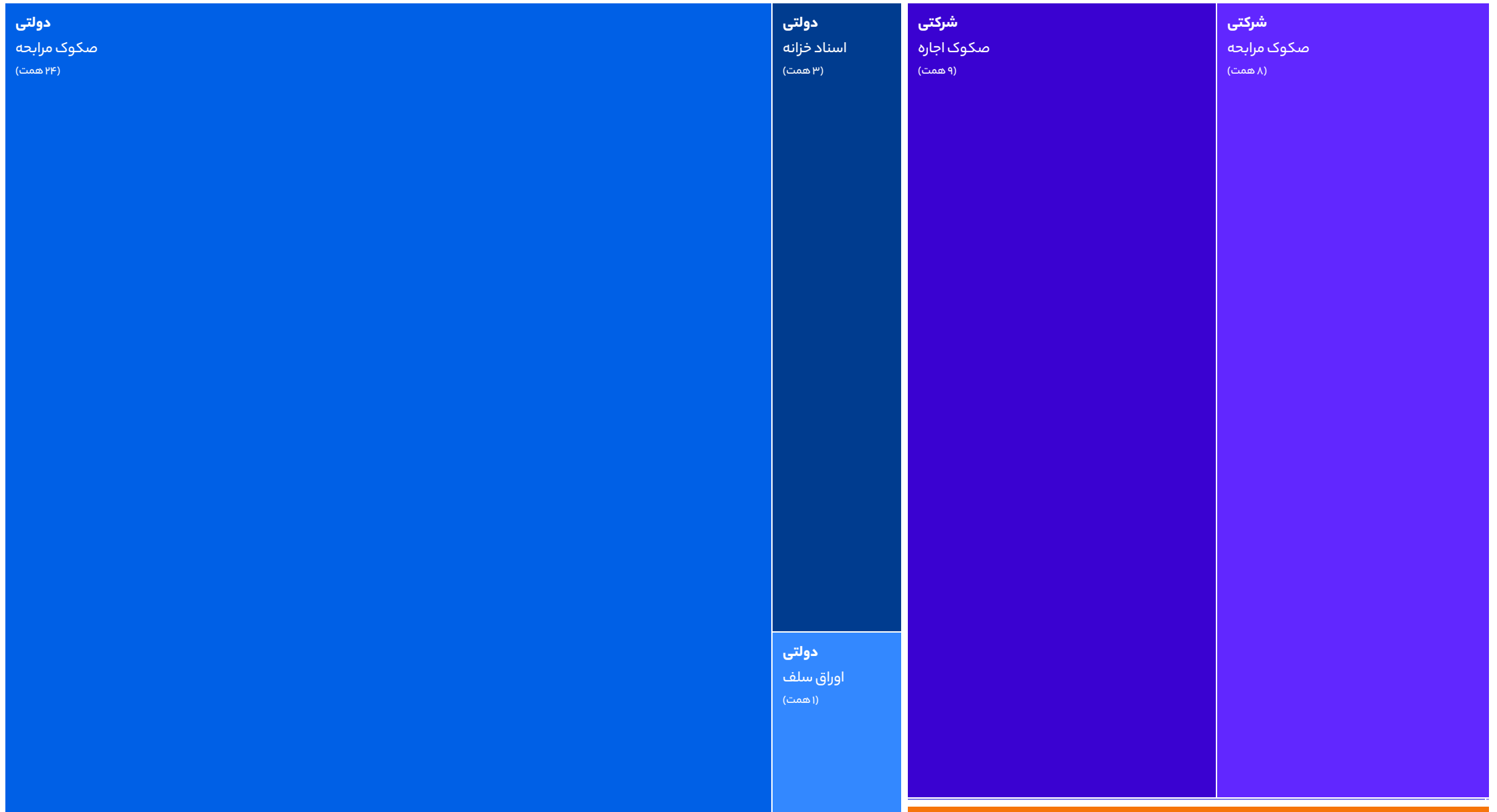
به تفکیک نوع اوراق، از ابتدای سال ۱۴۰۱، هزار میلیارد تومان



معاملات اوراق درآمد ثابت

ارزش معاملات اوراق ماه گزارش (به تفکیک ناشر و نوع اوراق)

- دولتی، اوراق سلف
- دولتی، اسناد خزانه
- شرکتی، سایر
- شرکتی، صکوک مرابحه
- دولتی، صکوک مرابحه
- شرکتی، اوراق گام
- شرکتی، صکوک اجاره
- شهرداری، صکوک مشارکت



معاملات اوراق درآمد ثابت

پر معامله ترین اوراق شرکت 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
۶۱۱	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۱۵	۲,۰۰۰
۰۶۱	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۰۴	۱,۴۰۹
۳۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۹/۱۵	۹۲۲
۰۶۲	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۰۴	۷۵۱
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۱/۰۹	۷۰۰
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۰/۲۳	۶۶۹
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۱۵	۶۳۵
۰۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۲/۲۴	۵۳۲
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۱۵	۵۰۰
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۴/۱۰/۱۵	۴۹۲
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۰/۲۰	۴۴۳
۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۸/۰۹	۴۲۶
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۰۹/۲۱	۴۰۰
۰۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۸/۱۵	۴۰۰
۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۵/۱۵	۳۵۲
۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۳/۲۷	۳۱۶
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۰۵/۱۵	۳۰۱
۰۶	صکوک اجاره	۱۴۰۶/۱۱/۱۵	۳۰۰
۰۹	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۸/۰۳	۳۰۰
۰۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۱۱/۱۸	۳۰۰
۰۷	صکوک اجاره	۱۴۰۷/۰۲/۳۰	۲۷۰
۵	صکوک اجاره	۱۴۰۵/۰۹/۱۵	۲۵۴
۰۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۱/۱۶	۲۵۰
۴	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۹/۱۵	۲۴۵
۳	صکوک اجاره	۱۴۰۳/۰۷/۱۵	۲۴۳

پر معامله ترین اوراق دولتی ماه گزارش

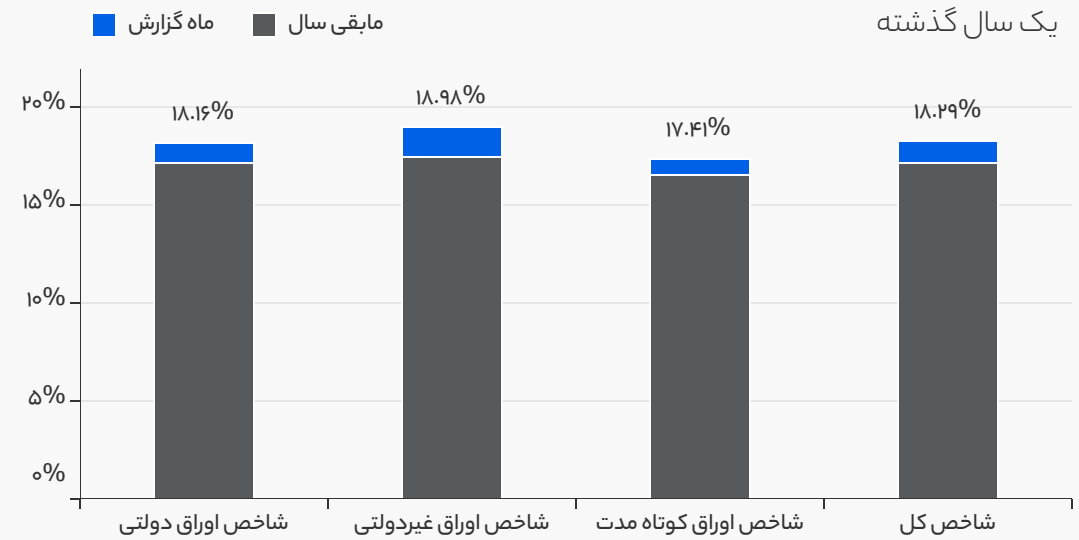
ارزش معاملات برای ۲۵ اوراق با بیشترین ارزش معامله، به همراه نوع اوراق، میلیارد تومان

اوراق سلف صکوک مرابحه اسناد خزانه

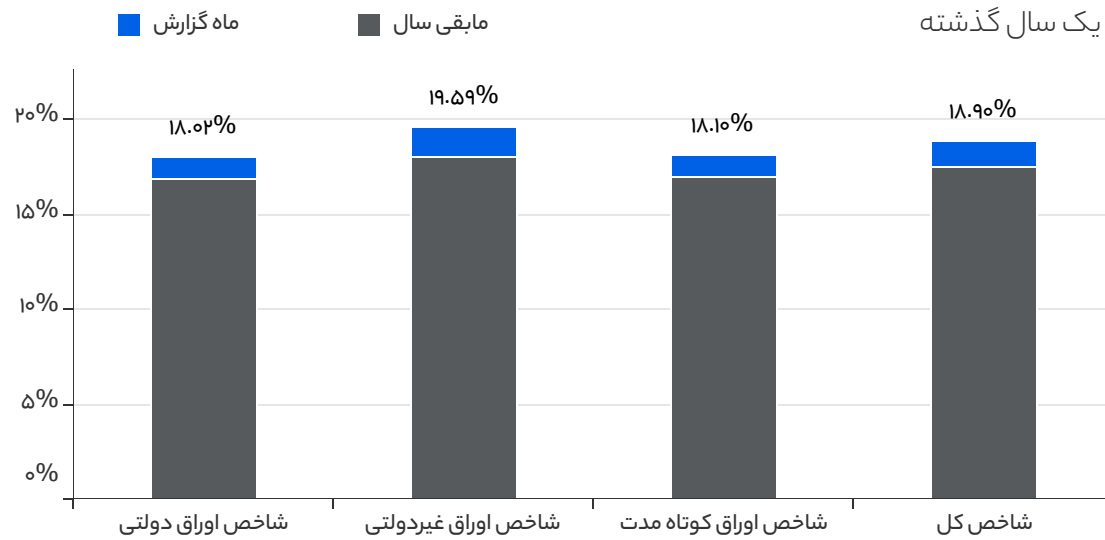
نماد	نوع	تاریخ سررسید	ارزش معاملات
۱۴۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۶/۲۶	۴,۱۹۰
۸۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۳/۰۴	۳,۲۲۷
۱۴۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۱۰/۰۹	۲,۳۷۹
۱۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۱/۱۰	۱,۹۹۲
۱۴۴	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	۱,۶۹۴
۱۰۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۷/۲۴	۱,۵۸۵
۱۲۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۲/۲۳	۱,۲۱۲
۱۴۸	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۵/۱۹	۹۵۷
۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۲/۱۵	۸۸۱
۲۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۳/۲۵	۶۷۴
۱۳۷	صکوک مرابحه	۱۴۰۶/۱۲/۲۹	۴۵۳
۱۴۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۱۰/۰۹	۴۵۱
۱۴	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۵/۰۴	۴۳۷
۰۳	اوراق سلف	۱۴۰۳/۰۲/۱۵	۳۷۸
۱۳۲	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۱۱/۱۰	۳۶۸
۱۰۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۵/۰۳	۳۵۰
۱۴۵	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۷/۰۷	۳۳۷
۱۲۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۵/۱۰	۳۳۱
۱۳۳	صکوک مرابحه	۱۴۰۵/۰۴/۱۰	۳۲۷
۲۰	اسناد خزانه	۱۴۰۵/۰۹/۲۳	۳۱۷
۱۰۷	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۷/۱۴	۳۱۴
۹۶	صکوک مرابحه	۱۴۰۳/۰۴/۱۴	۲۹۳
۱۰	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۳/۲۶	۲۷۱
۱۳۹	صکوک مرابحه	۱۴۰۴/۰۸/۰۴	۲۴۷
۱۰۴	اسناد خزانه	۱۴۰۴/۰۹/۱۷	۲۴۲

بازدهی شاخص صکوک

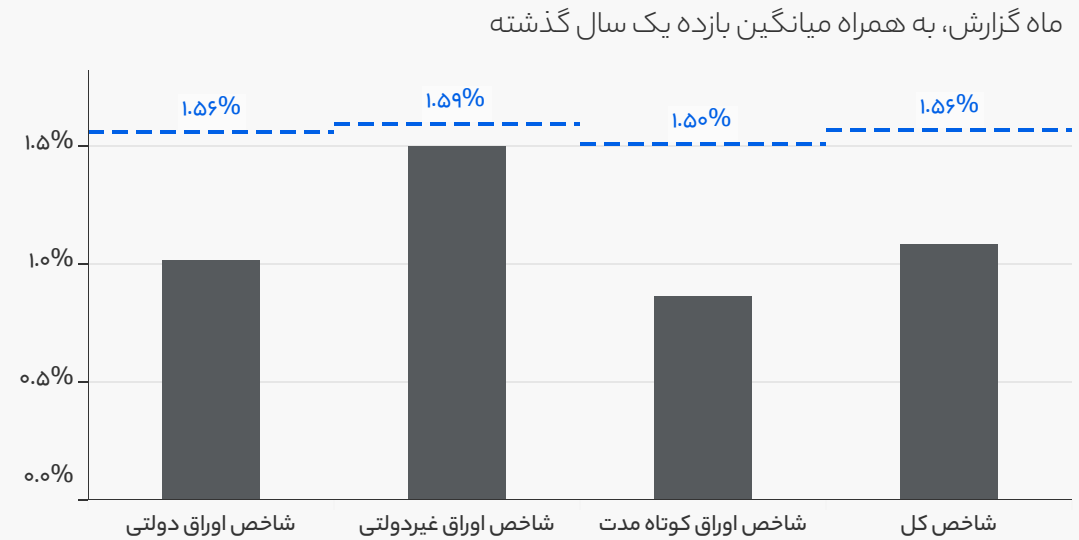
بازدهی شاخص های وزنی صکوک فرابورس ایران



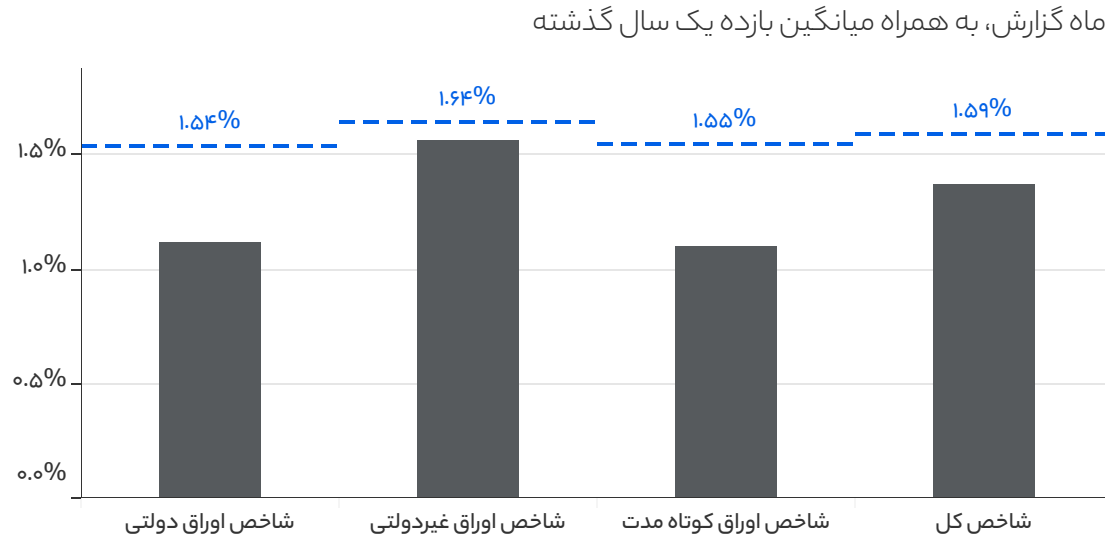
بازدهی شاخص های هم وزن صکوک فرابورس ایران



بازدهی شاخص های وزنی صکوک فرابورس ایران



بازدهی شاخص های هم وزن صکوک فرابورس ایران



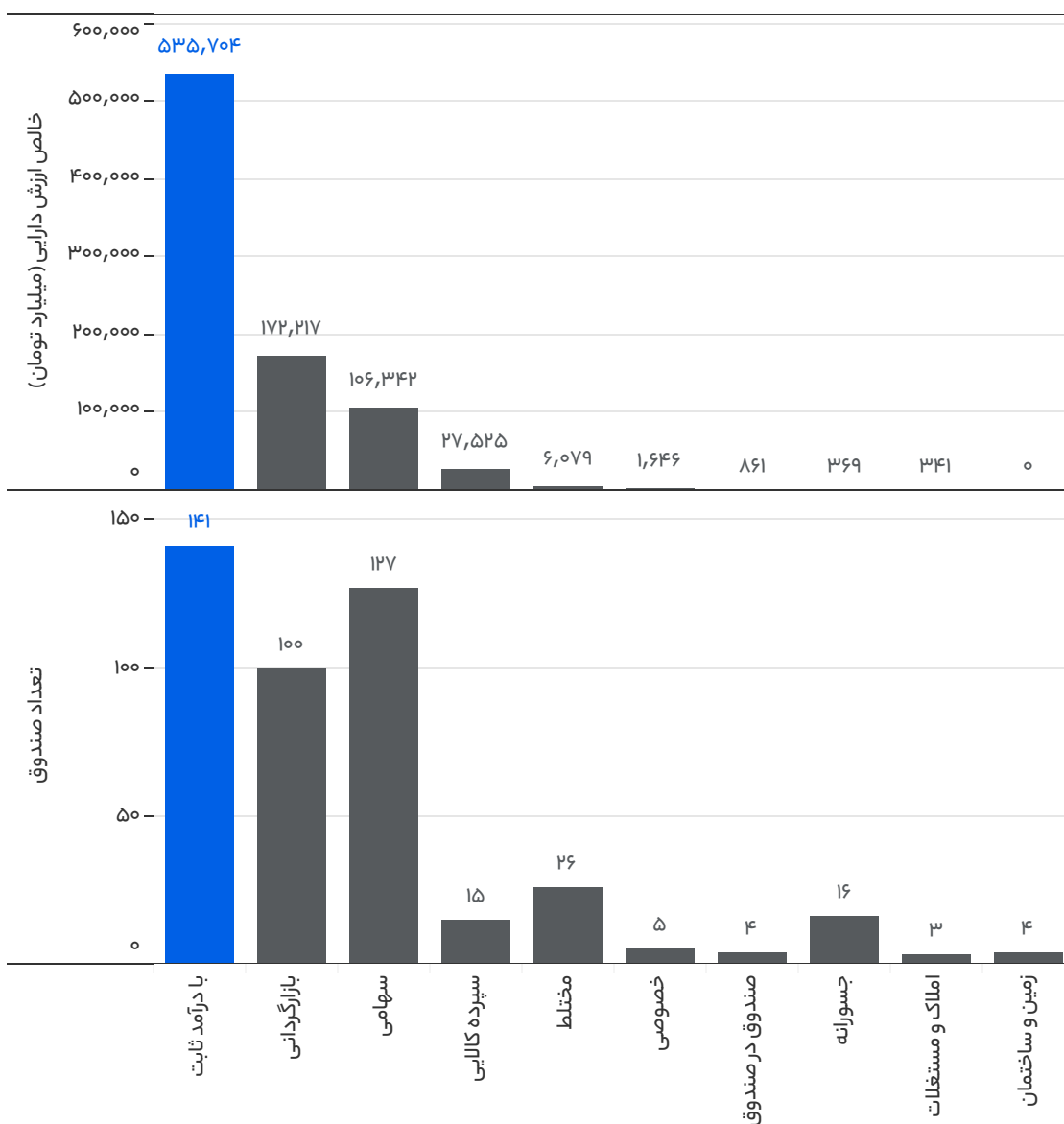
نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

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	۱۴۱	۵۳۵.۷
	سهامی	۱۲۷	۱۰۶.۳
	مختلط	۲۶	۶.۱
	صندوق در صندوق	۴	۰.۹
سرمایه‌گذاری خصوصی	خصوصی	۵	۱.۶
	جسورانه	۱۶	۰.۴
سرمایه‌گذاری جایگزین	بازارگردانی	۱۰۰	۱۷۲.۲
	سپرده کالاایی	۱۵	۲۷.۵
	پروژه‌ای	۱	۱.۱
	املاک و مستغلات	۳	۰.۳
	زمین و ساختمان	۴	۰.۰
جمع کل		۴۴۲	۸۵۲.۲

صندوق‌های جدید ماه گذشته

به تفکیک نوع صندوق و قابلیت معامله

نام صندوق	نوع	نوع معامله
ارزش آفرین فولاد	سهامی	قابل معامله
املاک و مستغلات امین شهریکم	املاک و مستغلات	قابل معامله
جاویدان سهام مانی	سهامی	قابل معامله
رشد داده محور توانا	سهامی	صدور و ابطال

نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

بزرگ‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

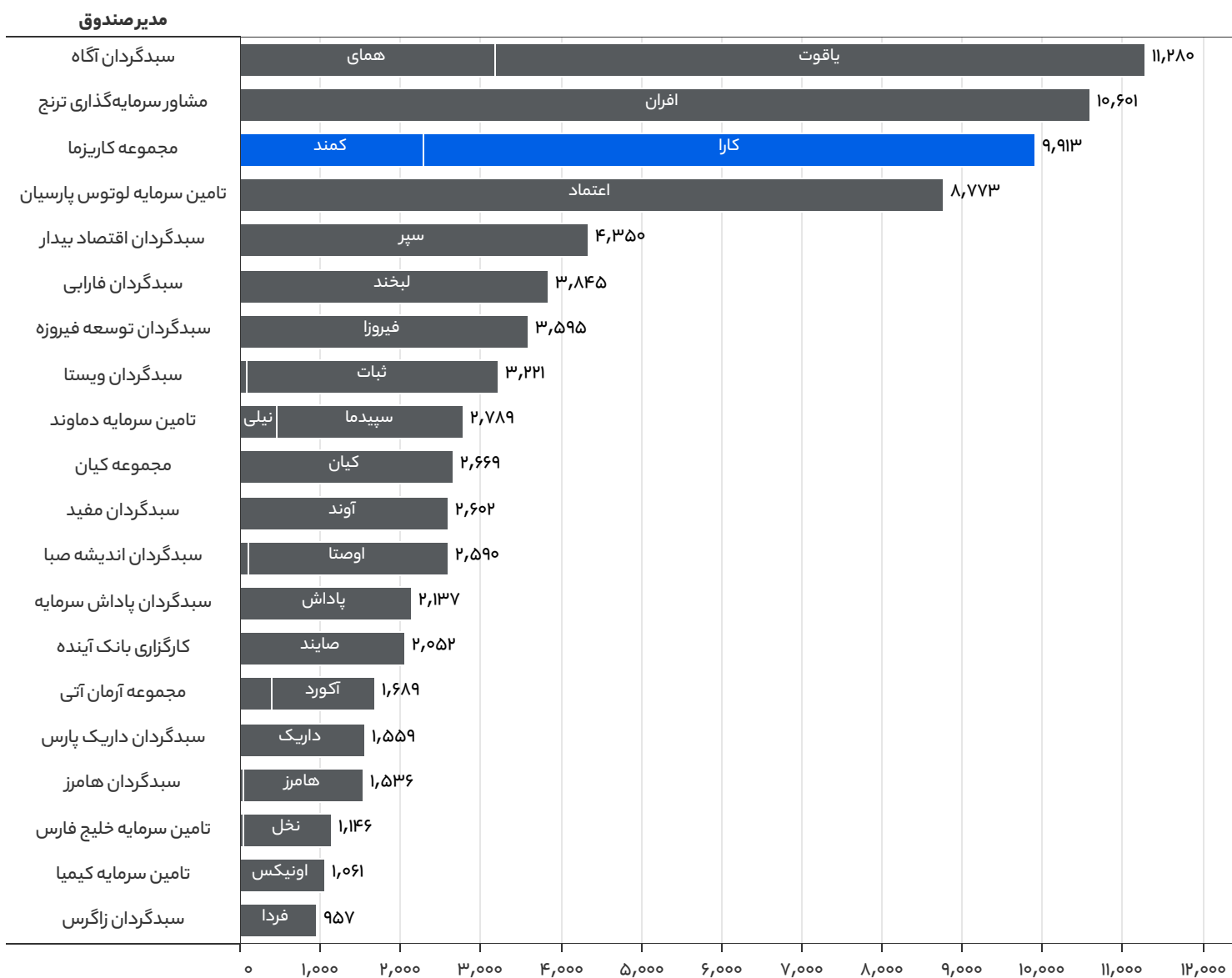
دازایی تحت مدیریت ۲۵ صندوق درآمد ثابت بزرگ، به همراه مدیر صندوق، میلیارد تومان

نام صندوق	مدیر صندوق	دارایی تحت مدیریت (میلیارد تومان)
لوتوس پارسیان	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	۵۶,۰۷۳
دراوراق بهادار با درآمد ثابت کاردان	تامین سرمایه کاردان	۳۹,۳۳۱
ثابت حامی	سبذگردان مفید	۳۹,۱۱۷
اندوخته پایدار سپهر	تامین سرمایه سپهر	۲۲,۴۴۰
اوج ملت	تامین سرمایه بانک ملت	۱۶,۱۶۲
افرا نماد پایدار	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	۱۴,۱۱۰
مشترک آتیه نوین	تامین سرمایه نوین	۱۳,۵۷۱
ره آورد آباد مسکن	تامین سرمایه بانک مسکن	۱۳,۲۷۰
سپید دماوند	تامین سرمایه دماوند	۱۲,۹۱۲
نوع دوم کارا	مجموعه کاریزما	۱۱,۹۳۲
بانک ایران زمین	مشاور سرمایه‌گذاری هدف حافظ	۱۱,۹۰۶
اعتماد کارگزاری بانک ملی ایران	کارگزاری بانک ملی ایران	۱۰,۴۰۱
اعتماد آفرین پارسیان	تامین سرمایه لوتوس پارسیان	۱۰,۱۷۴
دراوراق بهادار با درآمد ثابت کاریزما	مجموعه کاریزما	۷,۸۷۵
دراوراق بهادار با درآمد ثابت کمند	مجموعه کاریزما	۷,۷۷۲
دراوراق بهادار با درآمد ثابت خلیج فارس	تامین سرمایه خلیج فارس	۷,۷۶۹
بانک گردشگری	سبذگردان سرآمد بازار	۷,۵۷۴
یاقوت آگاه	سبذگردان آگاه	۷,۲۶۱
ارزش آفرینان دی	کارگزاری بانک دی	۶,۹۸۷
سپر سرمایه بیدار	سبذگردان اقتصاد بیدار	۶,۵۰۸
گنجینه امید ایرانیان	تامین سرمایه امید	۶,۴۷۲
مشترک افق کارگزاری بانک خاورمیانه	کارگزاری بانک خاورمیانه	۶,۴۵۱
مشترک یکم ایرانیان	تامین سرمایه نوین	۶,۲۶۳
دراوراق بهادار با درآمد ثابت امید انصار	تامین سرمایه امید	۵,۸۲۹
اندیشه وزران صبا تامین	سبذگردان اندیشه صبا	۵,۳۰۵

معاملات صندوق‌های درآمد ثابت

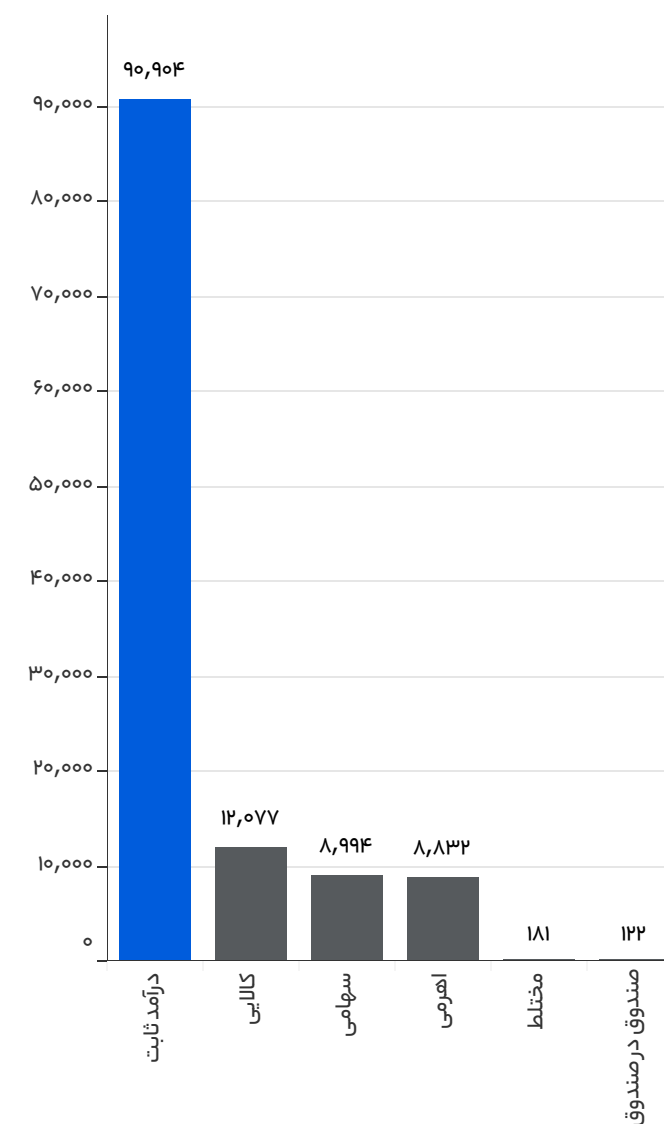
پرمعامله‌ترین صندوق‌های سرمایه‌گذاری درآمد ثابت

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

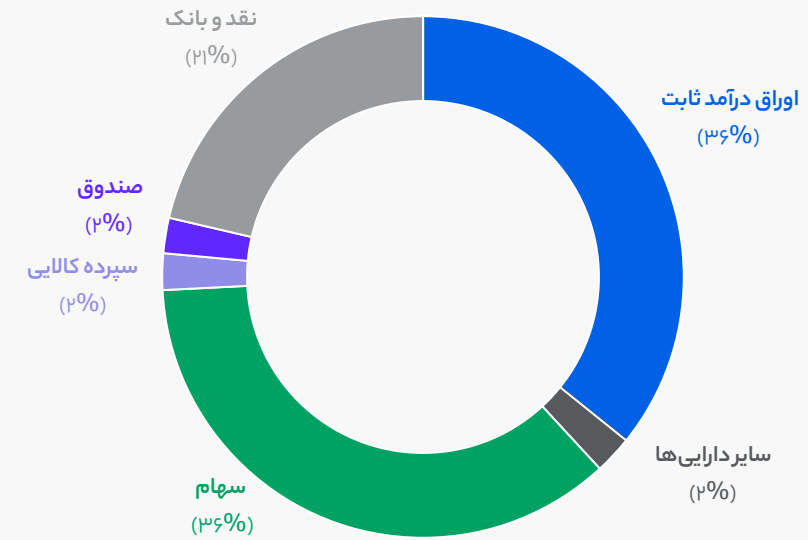
خالص ورود و خروج پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله، طی ماه گزارش، میلیارد تومان

نماد	مدیر صندوق	مقدار
افران	مشاور سرمایه‌گذاری ترنج	+۱۹۶
لبخند	سبدگردان فارابی	+۱۳۶
آوند	سبدگردان مفید	+۱۰۷
اونیکس	تامین سرمایه کیمیا	+۷۸
فیروزا	سبدگردان توسعه فیروزه	+۶۴
هامرز	سبدگردان هامرز	+۳۳
پاداش	سبدگردان پاداش سرمایه	+۲۸
یاقوت	سبدگردان آگاه	+۲۲
صایند	کارگزاری بانک آینده	+۱۹
نشان	سبدگردان هامرز	+۳
سپر	سبدگردان اقتصاد بیدار	+۱
آفاق	مجموعه آرمان آتی	-۱
اوصتا	سبدگردان اندیشه صبا	-۲
دیبا	سبدگردان اندیشه صبا	-۳
آکام	سبدگردان ویستا	-۵
ساحل	تامین سرمایه خلیج فارس	-۶
فردا	سبدگردان زاگرس	-۷
سپیدما	تامین سرمایه دماوند	-۱۰
نخل	تامین سرمایه خلیج فارس	-۱۴
نیلی	تامین سرمایه دماوند	-۱۴
ثبات	سبدگردان ویستا	-۵۴
همای	سبدگردان آگاه	-۶۱
دارپیک	سبدگردان دارپیک پارس	-۶۲
آکورد	مجموعه آرمان آتی	-۶۴
کمند	مجموعه کاریزما	-۹۱
کارا	مجموعه کاریزما	-۱۲۲
اعتماد	تامین سرمایه لوتوس پارسینان	-۲۲۲
کیان	مجموعه کیان	-۲۹۱

تخصیص دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

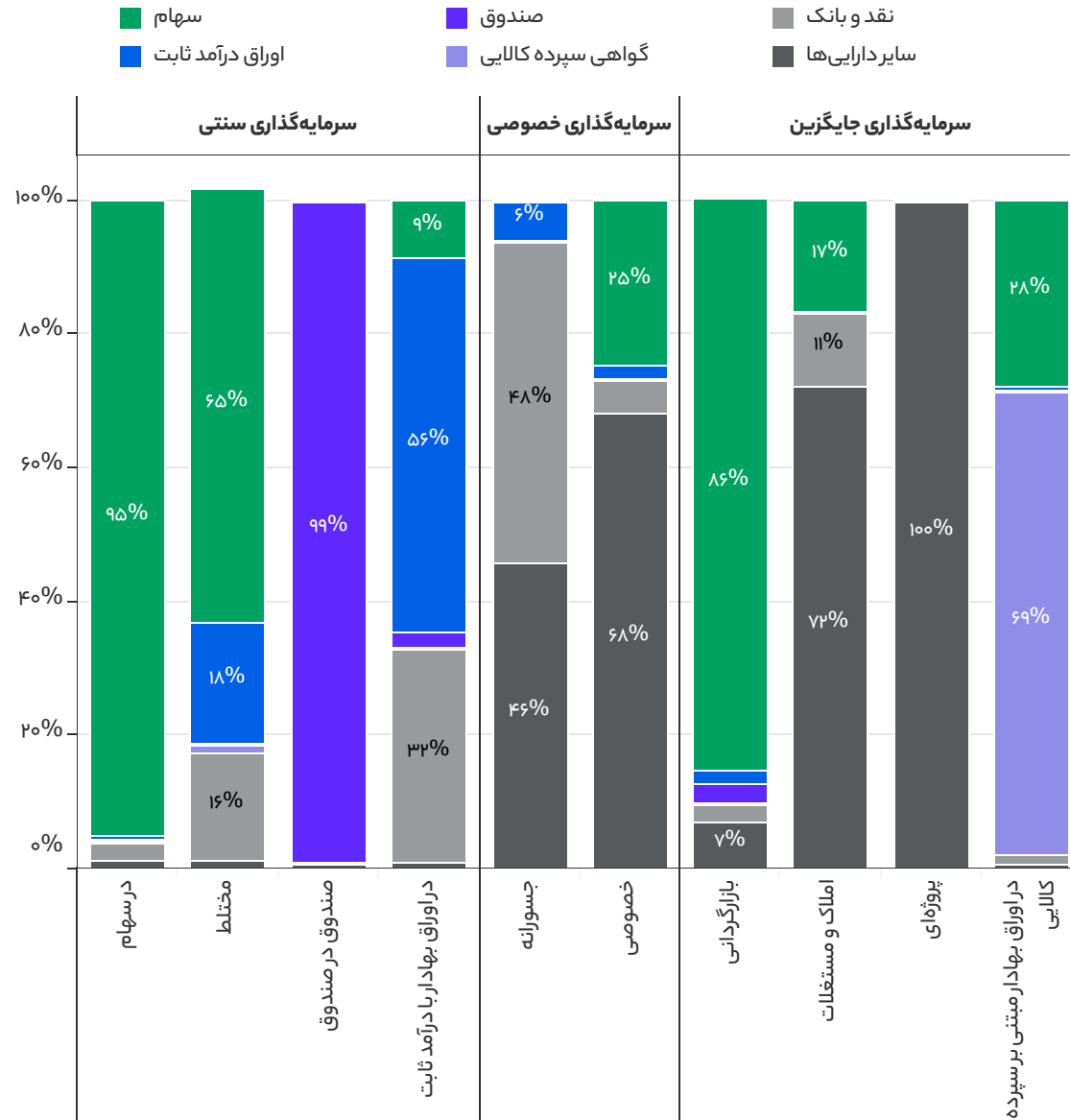
ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



ترکیب دارایی صندوق‌ها

به تفکیک کلاس سرمایه‌گذاری و نوع صندوق



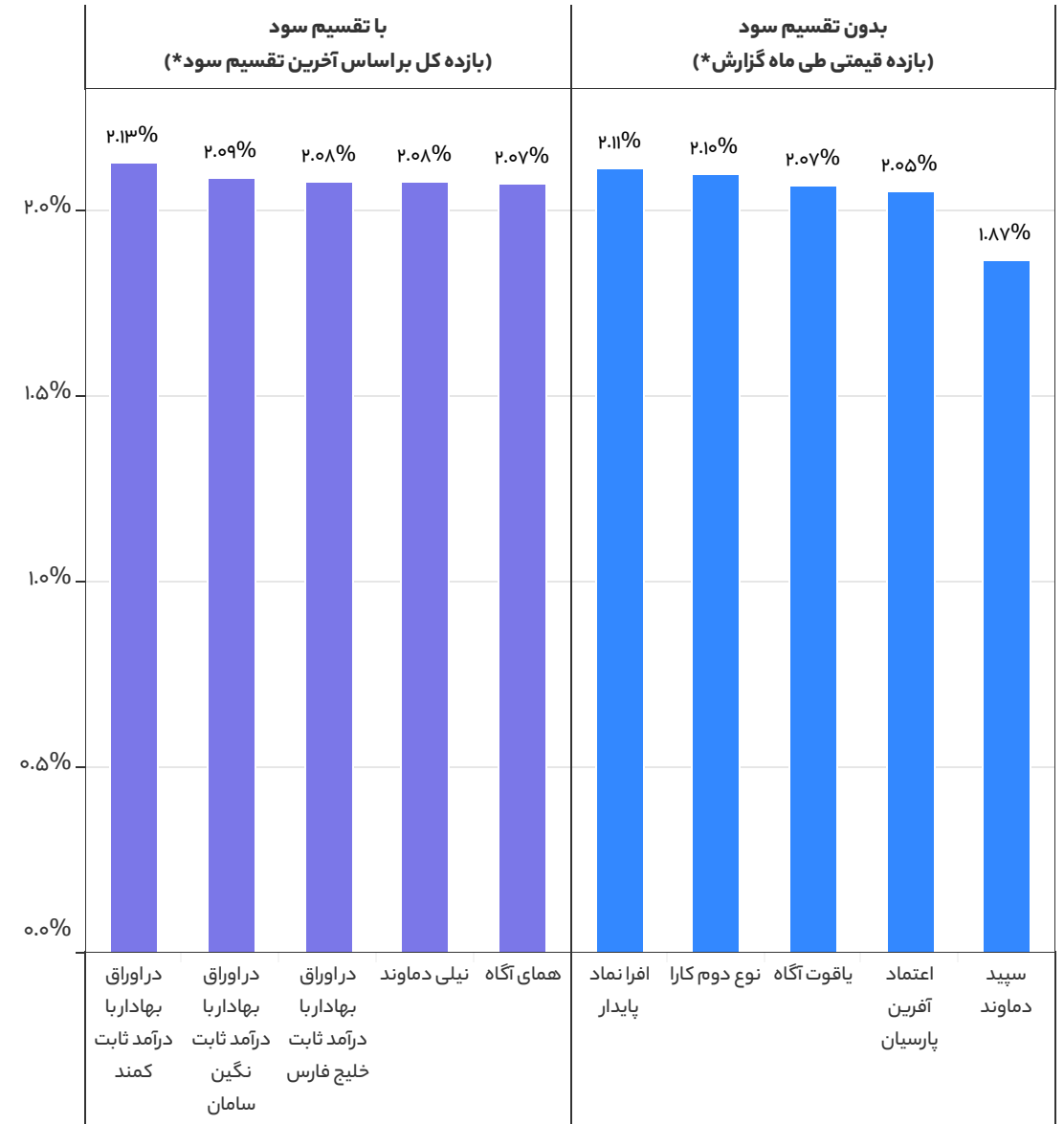
کلاس سرمایه‌گذاری	نوع صندوق	سهم	درآمد ثابت	سپرده کالایی	صندوق	نقد و بانک	سایر دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری سنتی	مختلط	۶۵%	۱۸%	۱%	-	۱۶%	۱%
	صندوق در صندوق	-	-	-	۹۹%	-	۱%
	در سهام	۹۵%	۱%	-	-	۳%	۱%
	درآمد ثابت	۹%	۵۶%	-	۲%	۳۲%	۱%
سرمایه‌گذاری خصوصی	جسورانه	-	۶%	-	-	۴۸%	۴۶%
	خصوصی	۲۵%	۲%	-	-	۵%	۶۸%
سرمایه‌گذاری جایگزین	اختصاصی بازارگردانی	۸۶%	۲%	-	۳%	۳%	۷%
	املاک و مستغلات	۱۷%	-	-	-	۱۱%	۷۲%
	پروژه‌ای	-	-	-	-	-	۱۰۰%
	کالایی	۲۸%	۱%	۶۹%	-	۱%	۱%
مجموع	کل	۳۶%	۳۶%	۲%	۲%	۲۱%	۲%

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	بازدهی ۶ ماهه	بازدهی ۳ ماهه	بازدهی ۱ ماهه	بازده ساده تقسیم سود	بازده موثر تقسیم سود
			**NAV	**NAV	**NAV	**NAV		
با تقسیم سود	دراوراق بهاداربا درآمد ثابت کمند	۸,۱۸۰	۲۴.۳%	۱۲.۲%	۶.۲%	۲.۰۷%	۲۵.۶%	۲۸.۸%
	دراوراق بهاداربا درآمد ثابت خلیج فارس	۷,۷۳۵	۲۴.۲%	۱۲.۱%	۶.۱%	۲.۰۵%	۲۴.۹%	۲۸.۰%
	نیلی دماوند	۴,۳۲۱	-	۱۱.۹%	۶.۱%	۲.۰۳%	۲۴.۹%	۲۸.۰%
	دراوراق بهاداربا درآمد ثابت نگین سامان	۴,۲۴۲	۲۳.۴%	۱۱.۸%	۶.۰%	۲.۰۶%	۲۵.۱%	۲۸.۲%
	همای آگاه	۳,۷۶۹	۲۳.۵%	۱۲.۰%	۶.۱%	۲.۰۴%	۲۴.۸%	۲۷.۹%
بدون تقسیم سود	افرا نماد پایدار	۱۴,۱۰۰	۲۷.۹%	۱۳.۰%	۶.۳%	۲.۱۱%		
	سپید دماوند	۱۲,۷۷۲	۲۴.۹%	۱۱.۸%	۵.۷%	۱.۸۷%		
	نوع دوم کارا	۱۲,۰۴۴	۲۷.۴%	۱۲.۹%	۶.۳%	۲.۱۰%		
	اعتماد آفرین پارسیان	۱۰,۰۶۳	۲۶.۰%	۱۲.۲%	۵.۹%	۲.۰۵%		
	یاقوت آگاه	۷,۱۸۰	۲۸.۰%	۱۲.۹%	۶.۳%	۲.۰۷%		

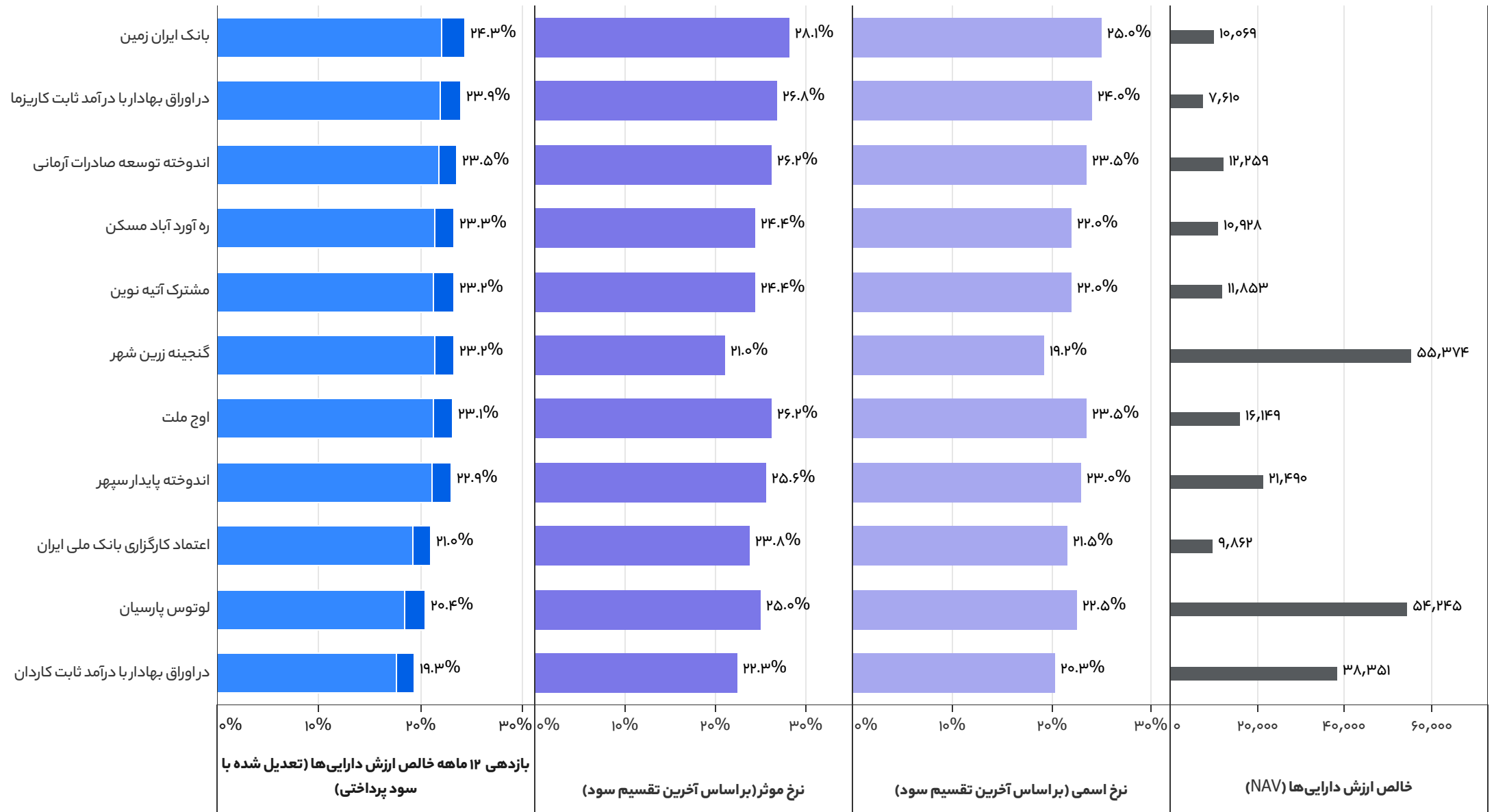


* محاسبه شده بر اساس قیمت معاملاتی هر واحد در بازار.
 ** در صورتی که صندوق تقسیم سود داشته باشد، بازده خالص ارزش دارایی هر واحد بر اساس تقسیم سود تعدیل می‌گردد.

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

