



سازمان بورس و اوراق بهادار
SECURITIES & EXCHANGE ORGANIZATION

گزارش ماهانه از صندوق‌های سرمایه‌گذاری

منتهی به ۱۴۰۰/۰۱/۳۱



تهیه شده توسط اداره بازرسی صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

تغییرات ارزش و وضعیت بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری:

تغییرات ارزش و وضعیت بازدهی به تفکیک نوع صندوق به شرح جدول زیر می‌باشد:

جدول شماره ۱: وضعیت خالص دارایی‌ها و بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری (میلیارد ریال)

| انحراف معیار روز کاری (درصد) | میانگین بازدهی یک سال گذشته (درصد) | میانگین بازدهی شش ماه گذشته (درصد) | میانگین بازدهی یک ماه گذشته (درصد) | خالص ارزش دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ | سود تقسیمی طی دوره | تغییرات ارزش طی دوره | خالص صدور طی دوره | خالص ارزش دارایی‌ها در تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ | نوع صندوق |
|------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|---|--------------------|----------------------|-------------------|---|---------------|
| ۴۳ | ۲۳.۴۵ | ۹.۲۱ | ۱.۵۶ | ۳,۲۳۰,۲۱۸ | ۴۷,۷۲۸ | ۴۸,۵۹۰ | ۸۳,۳۵۶ | ۳,۱۴۶,۰۰۰ | با درآمد ثابت |
| ۱۸۱ | ۵۹.۰۰ | (۸.۰۷) | (۹.۵۶) | ۴۹۸,۴۹۱ | ۷۹ | (۵۲,۵۱۰) | (۱۰,۶۸۶) | ۵۶۱,۷۶۶ | در سهام |
| ۱۱۵ | ۴۸.۰۰ | (۴.۱۷) | (۳.۳۶) | ۲۶,۰۳۱ | ۱۲ | (۹۱۶) | (۷۸۸) | ۲۷,۷۴۷ | مختلط |
| ۲۹۵ | ۴۰.۸۳ | (۲۳.۴۲) | (۷.۲۹) | ۶۹۹,۰۳۰ | ۰ | (۱۰۹,۰۰۹) | ۳۵,۸۶۷ | ۷۷۲,۱۷۲ | بازارگردانی |
| ۱۸۰ | ۴۸.۴۵ | (۲۹.۸۷) | (۶.۹۶) | ۱۷,۵۹۴ | ۰ | ۱,۴۳۸ | ۰ | ۱۶,۱۵۶ | کالا |
| | | | | ۴,۴۷۱,۳۶۴ | ۴۷,۸۱۹ | (۱۱۲,۴۰۷) | ۱۰۷,۷۴۹ | ۴,۵۲۳,۸۴۱ | جمع |

وضعیت ترکیب دارایی‌های صندوق‌های سرمایه‌گذاری:

کل دارایی‌های صندوق‌های سرمایه‌گذاری در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ مبلغ ۴,۶۹۲,۰۴۱ میلیارد ریال است به گونه‌ای که جزئیات ترکیب دارایی‌های صندوق‌های سرمایه‌گذاری در تاریخ فوق به شرح جدول ذیل می‌باشد:

جدول شماره ۲: وضعیت ترکیب دارایی‌های صندوق‌های سرمایه‌گذاری (میلیارد ریال)

| نوع صندوق | ارزش دارایی‌های صندوق | گواهی سپرده و سپرده‌های بانکی | درصد | اوراق بهادار با درآمد ثابت | درصد | سهام، حق تقدم، اختیار معامله، واحد صندوق و گواهی کالایی | درصد | سایر دارایی‌ها | درصد |
|-------------|-----------------------|-------------------------------|------|----------------------------|------|---|------|----------------|------|
| درآمد ثابت | ۳,۴۱۷,۳۹۹ | ۱,۳۸۴,۵۱۶ | ۴۱ | ۱,۵۸۲,۵۷۷ | ۴۶ | ۳۸۷,۱۵۱ | ۱۱ | ۶۳,۱۵۵ | ۲ |
| در سهام | ۴۹۱,۹۹۵ | ۴,۸۵۲ | ۱ | ۱۰۱,۲۱۱ | ۲۱ | ۴۷۱,۴۳۰ | ۹۶ | ۵,۵۹۱ | ۱ |
| مختلط | ۲۶,۹۱۷ | ۲,۴۹۷ | ۹ | ۸,۲۵۶ | ۳۱ | ۱۵,۴۴۷ | ۵۷ | ۶۷۸ | ۲ |
| بازارگردانی | ۷۳۷,۹۷۸ | ۲۴,۸۴۸ | ۴ | ۱,۹۶۲ | ۰ | ۷۰۰,۹۴۱ | ۹۵ | ۱۰,۲۲۷ | ۱ |
| کالا | ۱۷,۷۵۳ | ۱۵۷ | ۱ | ۶۲۲ | ۴ | ۱۶,۹۵۲ | ۹۵ | ۲۲ | ۰ |
| جمع | ۴,۶۹۲,۰۴۱ | ۱,۴۱۶,۸۷۱ | ۳۰ | ۱,۶۹۴,۶۲۷ | ۳۶ | ۱,۵۹۱,۹۲۱ | ۳۴ | ۷۹,۶۷۳ | ۲ |

بیشترین حجم سهام و حق تقدم، اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده‌های بانکی سرمایه‌گذاری شده توسط صندوق‌های سرمایه‌گذاری به شرح جدول زیر می‌باشد:

جدول شماره ۳: بیشترین حجم سهام، اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده‌های بانکی (میلیارد ریال)

| نام صندوق | سهام و حق تقدم | درصد | نام صندوق | اوراق بهادار با درآمد ثابت | درصد | نام صندوق | سپرده بانکی | درصد |
|-----------------------------------|----------------|------|--------------------------------|----------------------------|------|---------------------|-------------|------|
| واسطه گری مالی یکم | ۱۰۸,۴۷۸ | ۷ | لوتوس پارسیان | ۱۵۰,۹۲۰ | ۹ | گنجینه زرین شهر | ۲۴۹,۴۰۴ | ۱۸ |
| توسعه بازار سرمایه | ۱۰۵,۶۲۳ | ۷ | ثابت حامی | ۱۲۱,۳۷۶ | ۷ | لوتوس پارسیان | ۱۴۱,۴۵۹ | ۱۰ |
| پالایشی یکم | ۹۰,۸۷۸ | ۶ | کاردان | ۱۱۷,۶۵۱ | ۷ | کاردان | ۸۸,۶۳۲ | ۶ |
| بازارگردانی تجارت ایرانیان اعتماد | ۸۴,۲۸۸ | ۵ | گنجینه زرین شهر | ۱۱۰,۹۹۵ | ۷ | آتیه نوین | ۷۵,۶۲۹ | ۵ |
| بازارگردانی سپهر بازار سرمایه | ۷۴,۶۸۶ | ۵ | ره آورد آباد مسکن | ۸۱,۲۲۸ | ۵ | اندوخته پایدار سپهر | ۷۱,۸۵۶ | ۵ |
| گنجینه زرین شهر | ۶۳,۲۴۲ | ۴ | اندوخته پایدار سپهر | ۶۸,۷۲۶ | ۴ | ره آورد آباد مسکن | ۵۹,۳۹۳ | ۴ |
| بازارگردانی خلیج فارس | ۵۲,۱۲۷ | ۳ | اعتماد آفرین پارسیان | ۵۴,۳۵۷ | ۳ | بانک گردشگری | ۵۱,۳۷۵ | ۴ |
| بازارگردانی ملت | ۴۰,۱۹۵ | ۳ | اعتماد کارگزاری بانک ملی ایران | ۵۰,۹۰۷ | ۳ | بانک ایران زمین | ۴۵,۶۰۰ | ۳ |
| تثبیت بازار سرمایه | ۳۳,۶۸۶ | ۲ | کمند | ۴۸,۶۱۶ | ۳ | کمند | ۴۳,۳۴۱ | ۳ |
| لوتوس پارسیان | ۳۳,۵۰۸ | ۲ | اوج ملت | ۴۸,۳۸۷ | ۳ | توسعه تعاون صبا | ۴۳,۱۷۰ | ۳ |
| جمع | ۶۸۶,۷۱۲ | ۱۵ | | ۸۵۳,۱۶۱ | ۱۸ | | ۸۶۹,۸۵۹ | ۱۹ |

وضعیت سپرده های بانکی صندوق های سرمایه گذاری:

بیشترین حجم سپرده‌های بانکی صندوق‌های سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت در بانک شهر به میزان ۱۴,۸٪ از کل سپرده‌ها، سرمایه‌گذاری شده است. سپرده های بانکی به تفکیک بانک و نرخ میانگین سودی که به صندوق‌های سرمایه‌گذاری تعلق می‌گیرد در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ به شرح جدول زیر می‌باشد:

جدول شماره ۴: وضعیت سپرده‌های بانکی به تفکیک بانک (میلیارد ریال)

| نام بانک | سرمایه گذاری در سپرده های بانکی | | نرخ میانگین موزون سپرده بانکی | تعداد حساب بانکی | تعداد صندوق |
|--------------|---------------------------------|-------|-------------------------------|------------------|-------------|
| | مبلغ | درصد | | | |
| شهر | ۱۹۱,۰۷۷ | ۱۴.۷۹ | ۱۷.۸۷ | ۲۳۴ | ۴۴ |
| گردشگری | ۱۳۰,۷۹۳ | ۱۰.۱۲ | ۱۸.۷۳ | ۱۸۴ | ۴۱ |
| اقتصاد نوین | ۱۲۶,۸۵۳ | ۹.۸۲ | ۱۸.۶۵ | ۱۴۷ | ۳۰ |
| پاسارگاد | ۱۰۹,۲۳۳ | ۸.۴۵ | ۱۹.۵۳ | ۱۷۳ | ۴۶ |
| آینده | ۹۵,۷۲۲ | ۷.۴۱ | ۲۰.۱۶ | ۲۲۹ | ۵۶ |
| رفاه کارگران | ۷۱,۰۲۲ | ۵.۵۰ | ۱۸.۱۲ | ۱۱۵ | ۳۷ |
| صادرات | ۶۵,۶۶۹ | ۵.۰۸ | ۱۸.۲۵ | ۱۳۰ | ۱۶ |
| پارسیان | ۶۱,۷۴۴ | ۴.۷۸ | ۱۷.۹۶ | ۱۰۶ | ۳۶ |
| تجارت | ۶۰,۵۱۴ | ۴.۶۸ | ۱۷.۶۶ | ۶۱ | ۲۳ |
| مسکن | ۶۰,۰۹۰ | ۴.۶۵ | ۱۷.۲۱ | ۴۸ | ۲۲ |

صندوق‌های سرمایه‌گذاری بادرآمد ثابت به میزان ۱,۲۶۸,۷۹۰ میلیارد ریال در سپرده‌های بانکی بیشتر از ۱۵٪ سرمایه‌گذاری نمودند که به شرح زیر می‌باشد. ۹۲٪ از کل سپرده‌های بانکی و ۳۷٪ از کل دارایی‌های صندوق‌های سرمایه‌گذاری مزبور را شامل می‌شود. بیشترین حجم سپرده‌های بانکی بانکی بیشتر از ۱۵٪ در بانک شهر سرمایه‌گذاری شده است.

جدول شماره ۵: وضعیت سپرده‌های بانکی بانکی با نرخ ۱۵٪ و بالاتر به تفکیک هر بانک (میلیارد ریال)

| نام بانک | سرمایه گذاری در سپرده های بانکی | | میانگین نرخ سود سپرده | درصد از کل سپرده ها | درصد از کل دارایی ها |
|--------------|---------------------------------|------|-----------------------|---------------------|----------------------|
| | مبلغ | درصد | | | |
| شهر | ۱۹۰,۴۴۹ | ۱۵ | ۱۸ | ۱۴ | ۶ |
| گردشگری | ۱۲۹,۸۵۳ | ۱۰ | ۱۹ | ۹ | ۴ |
| اقتصاد نوین | ۱۲۴,۷۲۲ | ۱۰ | ۱۹ | ۹ | ۴ |
| پاسارگاد | ۱۰۹,۰۵۴ | ۹ | ۲۰ | ۸ | ۳ |
| آینده | ۹۶,۶۰۵ | ۸ | ۲۰ | ۷ | ۳ |
| رفاه کارگران | ۶۷,۶۹۸ | ۵ | ۱۹ | ۵ | ۲ |
| صادرات | ۶۵,۱۸۰ | ۵ | ۱۸ | ۵ | ۲ |
| پارسیان | ۶۰,۵۵۰ | ۵ | ۱۸ | ۴ | ۲ |
| مسکن | ۵۹,۰۲۶ | ۵ | ۱۸ | ۴ | ۲ |
| تجارت | ۵۷,۲۵۰ | ۵ | ۱۹ | ۴ | ۲ |

وضعیت اوراق بهادار با درآمد ثابت در بورس و فرابورس و در صندوق‌های سرمایه‌گذاری:

در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ میزان اوراق بهادار با درآمد ثابت پذیرفته شده در کلیه بورسها به مبلغ ۳,۷۷۲,۴۵۱ میلیارد ریال است که تا تاریخ

فوق به میزان ۱,۵۷۷,۹۵۱ میلیارد ریال در پرتفوی صندوق‌های سرمایه‌گذاری موجود است که حدود ۴۲ درصد از اوراق منتشره می‌باشد.

اوراق بهادار با درآمد ثابت به تفصیل در جدول زیر ارائه شده است:

جدول ۶: وضعیت اوراق بهادار با درآمد ثابت (میلیارد ریال)

| اوراق موجود در صندوق | | | اوراق منتشره | | دولتی-شرکتی | |
|----------------------|------|-----------|--------------|-----------|-------------------|---------------|
| درصد از اوراق منتشره | درصد | مبلغ | درصد | مبلغ | نوع اوراق | دولتی - شرکتی |
| ۱۷ | ۱۱ | ۱۷۹,۸۴۷ | ۲۸ | ۱,۰۴۴,۹۱۲ | اسناد خزانه | دولتی |
| ۳۷ | ۳۷ | ۵۹۳,۱۶۰ | ۴۲ | ۱,۵۹۱,۵۴۴ | مراجعه دولتی | |
| ۷۵ | ۱ | ۲۳,۹۶۹ | ۱ | ۳۲,۰۰۰ | مشارکت دولتی | |
| ۵۴ | ۱۰ | ۱۵۶,۵۵۷ | ۸ | ۲۹۰,۰۰۰ | منفعت دولتی | |
| ۳۲ | ۶۰ | ۹۵۳,۵۳۳ | ۷۸ | ۲,۹۵۸,۴۵۵ | جمع دولتی | |
| ۸۸ | ۱۲ | ۱۹۹,۵۸۹ | ۶ | ۲۲۷,۵۳۶ | اجاره شرکتی | شرکتی |
| ۷۱ | ۱۵ | ۲۳۳,۷۵۲ | ۹ | ۳۲۷,۰۷۶ | سلف شرکتی | |
| ۹۸ | ۱ | ۱۴,۸۳۵ | ۰ | ۱۵,۰۸۷ | صکوک رهنی | |
| ۸۸ | ۲ | ۳۶,۷۵۵ | ۱ | ۴۲,۰۰۰ | مراجعه شرکتی | |
| ۸۵ | ۱ | ۱۷,۷۲۶ | ۱ | ۲۰,۹۴۰ | مشارکت شرکتی | |
| ۸۵ | ۴ | ۶۳,۰۷۹ | ۲ | ۷۴,۰۰۰ | منفعت شرکتی | |
| ۸۰ | ۳۶ | ۵۶۵,۷۳۷ | ۲۰ | ۷۰۶,۶۳۹ | جمع شرکتی | |
| ۹۳ | ۴ | ۷۰,۰۵۹ | ۲ | ۷۵,۳۵۶ | اوراق مشارکت | شهرداری |
| ۹۳ | ۴ | ۷۰,۰۵۹ | ۲ | ۷۵,۳۵۶ | جمع شهرداری | |
| ۳۰ | ۱ | ۹,۴۷۹ | ۱ | ۳۲,۰۰۰ | گواهی اعتبار مولد | بانک مرکزی |
| ۳۰ | ۱ | ۹,۴۷۹ | ۱ | ۳۲,۰۰۰ | جمع بانک مرکزی | |
| ۴۲ | ۱۰۰ | ۱,۵۹۸,۸۰۷ | ۱۰۰ | ۳,۷۷۲,۴۵۱ | جمع کل | |

در طی ماه گذشته هیچ اوراقی سررسید نشده است ولیکن اوراق به شرح جدول زیر، طی ماه آینده سررسید می شود:

جدول ۷: وضعیت اوراق بهادار بادرآمد ثابت سررسید شده طی ماه آینده (میلیارد ریال)

| نماد | نرخ سود | بازارگردان - متعهد پذیره نویس | تاریخ سررسید | حجم انتشار | مبلغ | صندوق های تحت مدیریت | تعداد | درصد |
|-----------|---------|-------------------------------------|-----------------|------------|--------|-------------------------|-----------|------|
| ع فولاد ۲ | ۱۹ | تامین سرمایه بانک ملت | ۱۴۰۰/۰۲/۳۰ | ۱۹,۲۹۹,۴۳۰ | ۱۰,۰۰۰ | کارگزاری بانک مسکن | ۶,۳۷۰,۷۴۷ | ۳۳ |
| | | | | | | تامین سرمایه نوین | ۵,۲۰۰,۰۰۰ | ۲۷ |
| | | | | | | سایر | ۴,۸۳۳,۰۰۰ | ۲۵ |

وضعیت سرمایه گذاری در سهام، حق تقدم توسط صندوق های سرمایه گذاری:

در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ وضعیت سهام و حق تقدم صندوق های سرمایه گذاری به شرح جدول زیر می باشد و ۵۵٪ از کل مبلغ سرمایه گذاری شده در سهام و حق تقدم در صندوق های سرمایه گذاری در ۳۰ شرکت بورسی برتر می باشد.

جدول ۸: سرمایه گذاری صندوق ها در سهام، حق تقدم شرکت ها به تفکیک نوع صندوق (میلیارد ریال)

| شرکت های با ارزش بالای ۱۰۰۰ هزار میلیارد ریال | | | | | | ۳۰ شرکت برتر | | | | | | نوع صندوق |
|--|---------|------|----------|------|---------|--------------|-----------|------|----------|------|---------|-------------------------------|
| درصد | جمع | درصد | فرا بورس | درصد | بورس | درصد | جمع | درصد | فرا بورس | درصد | بورس | |
| ۲۰ | ۷۶,۷۳۳ | ۲ | ۷,۷۳۲ | ۱۸ | ۶۹,۰۰۲ | ۵۵ | ۲۱۲,۰۵۸ | ۷ | ۲۷,۸۳۸ | ۴۸ | ۱۸۴,۲۲۰ | در اوراق بهادار با درآمد ثابت |
| ۸ | ۳۹,۵۷۷ | ۰ | ۱,۱۴۵ | ۸ | ۳۸,۴۳۲ | ۷۰ | ۳۲۹,۸۵۰ | ۵ | ۲۲,۰۴۱ | ۶۵ | ۳۰۷,۸۰۹ | سهام |
| ۱۴ | ۲,۱۶۰ | ۰ | ۰ | ۱۴ | ۲,۱۶۰ | ۳۶ | ۵,۶۱۹ | ۵ | ۸۲۹ | ۳۱ | ۴,۷۹۰ | مختلط |
| ۱۳ | ۹۴,۴۴۳ | ۱ | ۴,۳۳۶ | ۱۳ | ۹۰,۱۰۷ | ۶۸ | ۴۷۹,۶۶۹ | ۱۴ | ۹۹,۷۴۲ | ۵۴ | ۳۷۹,۹۲۷ | بازارگردانی |
| ۱۴ | ۲۱۲,۹۱۳ | ۱ | ۱۳,۲۱۳ | ۱۳ | ۱۹۹,۷۰۱ | ۶۵ | ۱,۰۲۷,۱۹۶ | ۱۰ | ۱۵۰,۴۵۰ | ۵۶ | ۸۷۶,۷۴۶ | جمع |