

گزارش صندوق‌های سرمایه‌گذاری

واحد مدیریت ریسک



آذر ۱۴۰۳

لوتوس LOTUS
تأمین سرمایه Investment Bank



سالروز ولادت امام علی (ع)
وروزیدر کرامی باد

تأمین سرمایه لوتوس پارسیان
فرصتساز قابل اتکا
www.lotusib.ir

// نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری / ۳

- تغییرات دارایی تحت مدیریت / ۴
- خالص ورود منابع / ۶
- تغییرات ترکیب دارایی / ۸
- حضور رکن ضامن نقدشوندگی / ۱۰

// صندوق‌های درآمد ثابت / ۱۱

- ترکیب صندوق‌ها به لحاظ قابلیت معامله و تقسیم سود / ۱۲
- تغییرات دارایی تحت مدیریت / ۱۳
- خالص ورود منابع / ۱۴
- پوشش ریسک نقدینگی / ۲۰
- بازدهی / ۲۱

// صندوق‌های سهامی / ۲۲

- تغییرات دارایی تحت مدیریت / ۲۳
- خالص ورود منابع / ۲۴
- بازدهی / ۳۰

// صندوق‌های کالایی / ۳۱

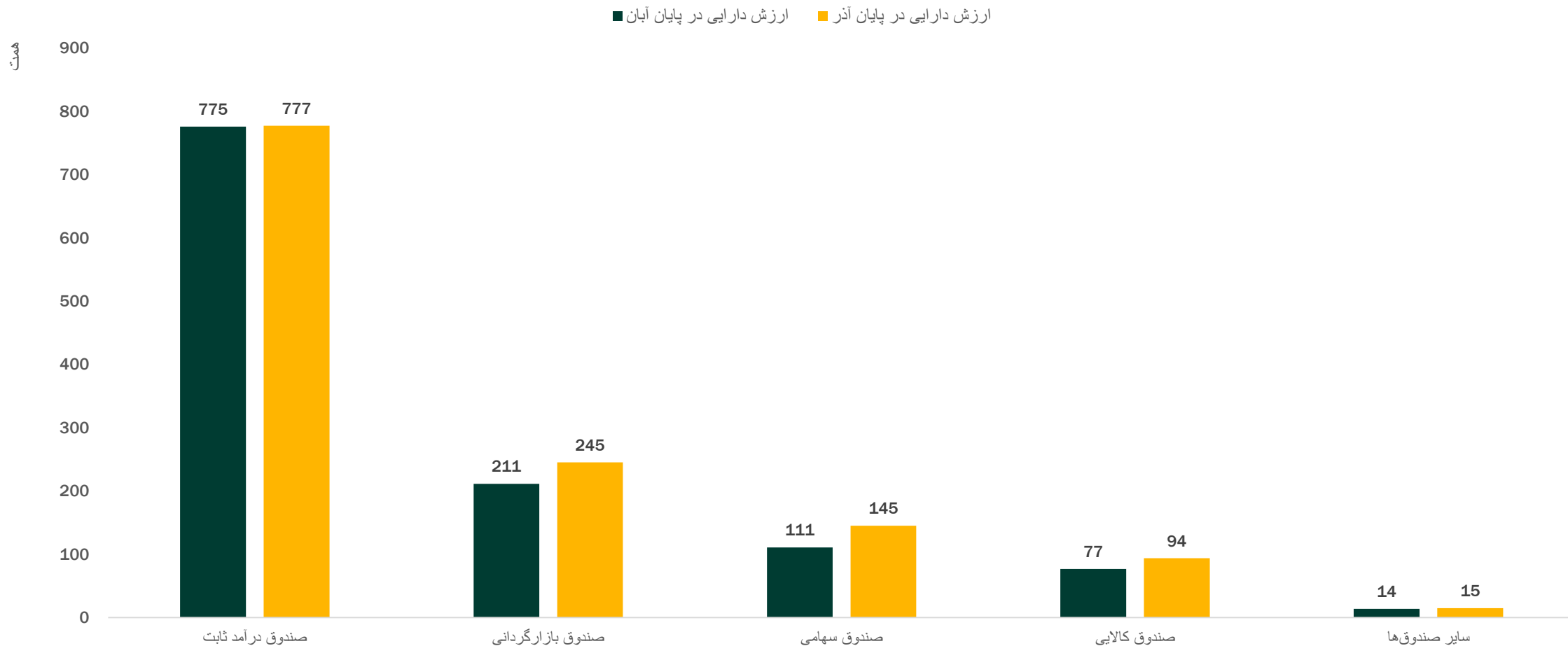
- تغییرات دارایی تحت مدیریت / ۳۲
- خالص ورود منابع / ۳۳
- حباب قیمتی / ۳۵
- بازدهی / ۳۶

// پیوست / ۳۸

نمای کلی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

- // تغییرات دارایی تحت مدیریت
- // خالص ورود منابع
- // تغییرات ترکیب دارایی
- // حضور رکن ضامن نقدشوندگی

تغییر دارایی تحت مدیریت در آذر ۱۴۰۳



// صندوق‌های اهرمی به صورت دو صندوق مجزای سهامی و درآمد ثابت (واحدهای ممتاز و عادی) در نظر گرفته شده‌اند.

تغییر دارایی تحت مدیریت و شمار صندوق‌ها در آذر ۱۴۰۳

ارزش دارایی و شمار صندوق‌های سرمایه‌گذاری در تاریخ‌های ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ و ۱۴۰۳/۰۸/۳۰							
تغییرات	پایان آبان			پایان آذر			نوع صندوق
	شمار صندوق	سهم از کل	ارزش دارایی (همت)	شمار صندوق	سهم از کل	ارزش دارایی (همت)	
رشد ارزش							
0.2%	158	65.3%	775.4	163	60.9%	776.8	صندوق درآمد ثابت
16.0%	109	17.8%	211.2	109	19.2%	245.0	صندوق بازارگردانی
31.0%	145	9.3%	110.8	148	11.4%	145.2	صندوق سهامی
22.4%	15	6.4%	76.6	18	7.4%	93.8	صندوق کالایی
6.7%	63	1.2%	13.8	64	1.2%	14.7	سایر صندوق‌ها
7.4%	490	100%	1,188	502	100%	1,275	مجموع

// در آذر ۱۴۰۳ ارزش دارایی تحت مدیریت **صندوق‌های درآمد ثابت** ۰,۲٪ رشد کرده و به ۷۷۶,۸ همت (سهم از بازار ۶۰,۹٪) رسیده است.

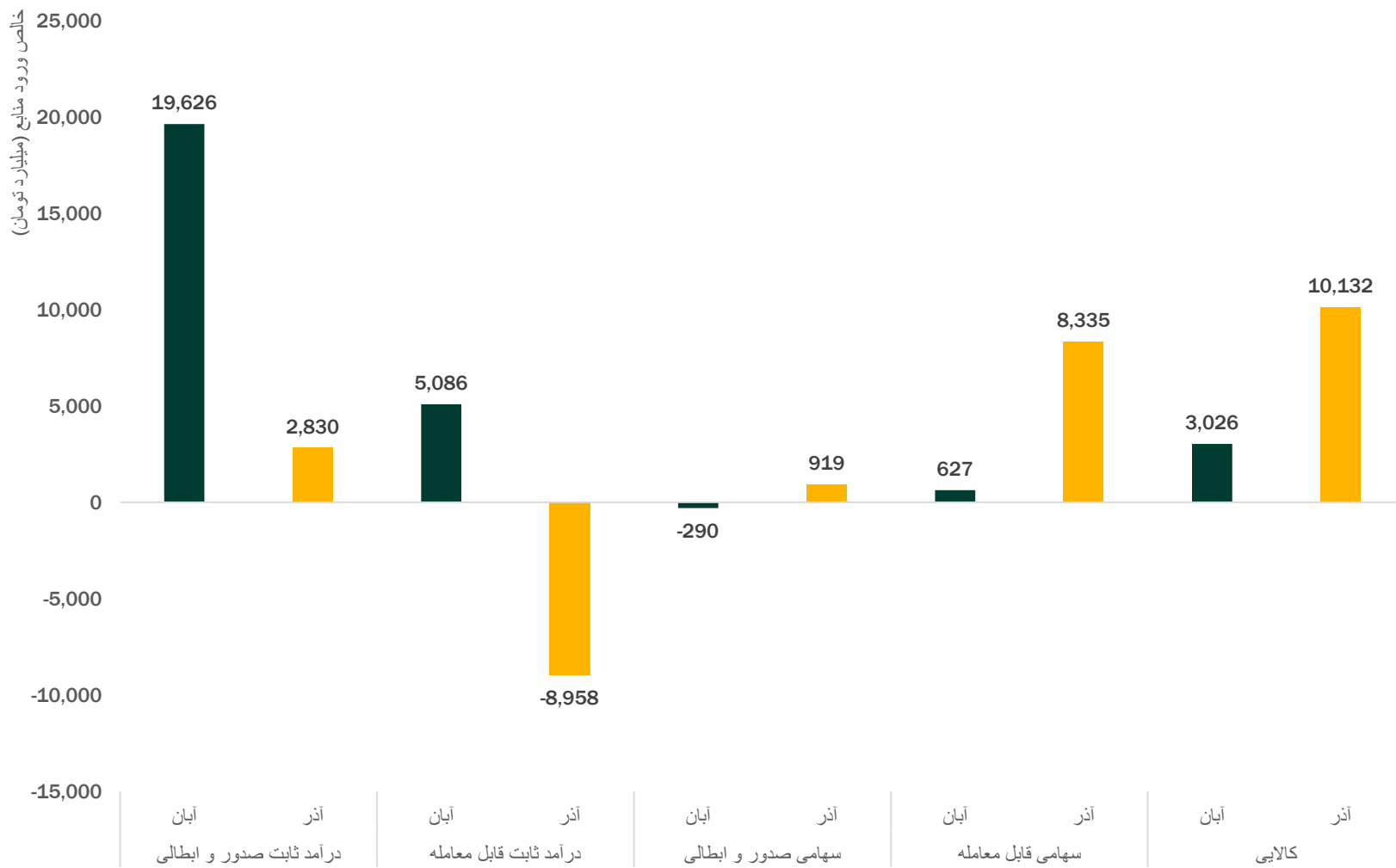
// ارزش دارایی تحت مدیریت **صندوق‌های کالایی** در این ماه ۲۲,۴٪ رشد کرده و به ۹۳,۸ همت رسیده است.

// ارزش دارایی تحت مدیریت **صندوق‌های سهامی** در این ماه ۳۱٪ رشد کرده است.

// در پایان آذر ۱۴۰۳ **صندوق‌های درآمد ثابت، سهامی، بازارگردانی و کالایی** در مجموع ۹۸,۸٪ از حجم دارایی‌های صندوق‌های سرمایه‌گذاری را تشکیل داده و ۱,۲٪ باقیمانده مربوط به صندوق‌های مختلط، املاک و مستغلات، خصوصی، جسورانه و صندوق در صندوق بوده است.

// تعداد صندوق‌های درآمد ثابت، پنج عدد و صندوق‌های سهامی و کالایی هرکدام سه عدد نسبت به ماه قبل افزایش یافتند.

خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳



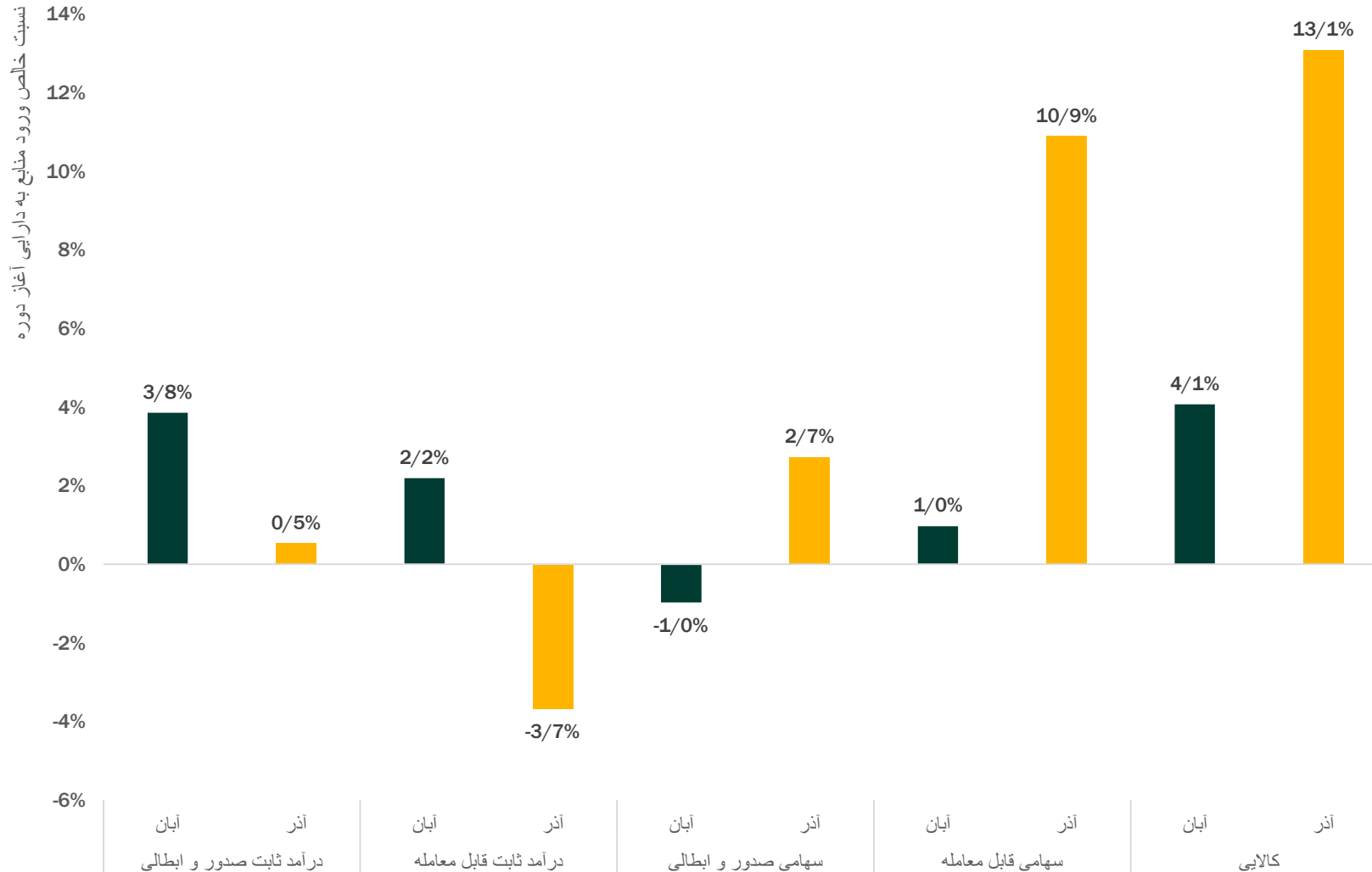
خالص ورود منابع به صندوق‌های سرمایه‌گذاری در آذر ۱۴۰۳ برابر ۱۳,۳ همت بوده است.

خالص ورود منابع به صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی در آذر ۱۴۰۳ نسبت به آبان‌ماه با افت ۸۶٪ به رقم ۲,۸ همت رسیده، همچنین خالص ورود منابع به صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله در آبان به خروج منابع در آذر تغییر یافته و با ۹ همت خروج منابع روبرو بوده‌اند.

صندوق‌های سهامی صدور و ابطالی در آذر برخلاف ماه گذشته ورود منابع را تجربه کرده‌اند. صندوق‌های قابل معامله نیز در آذر ۱۴۰۳ با خالص ورود منابع برابر با ۸,۳ همت روبرو بوده‌اند.

خالص ورود منابع به صندوق‌های کالایی در آذر ۱۴۰۳ با رشد شایان توجه ۲۳۵٪ نسبت به آبان به رقم ۱۰,۱ همت رسیده است.

نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در آذر ۱۴۰۳

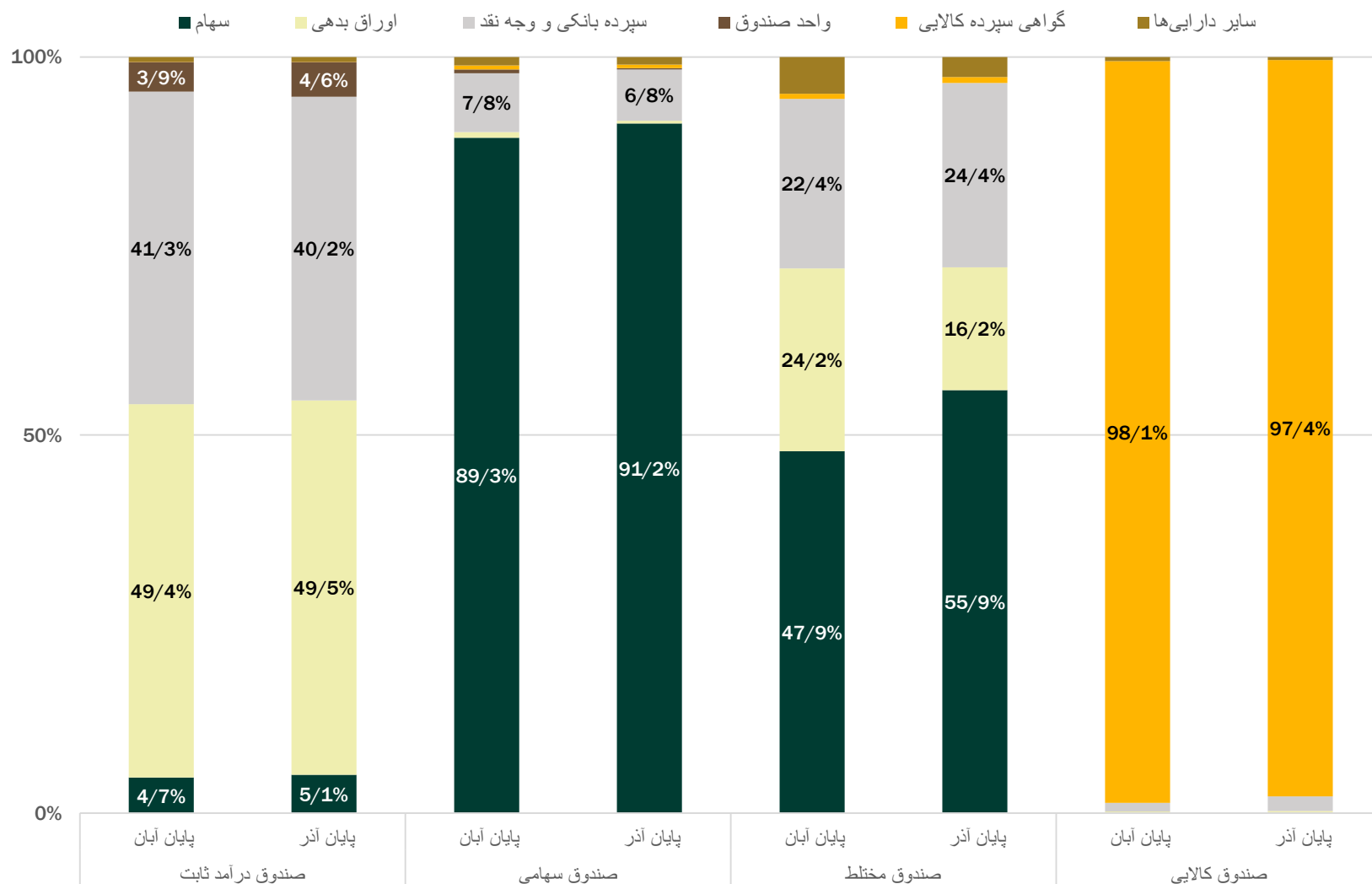


/// **صندوق‌های کالایی** در آذر ۱۴۰۳ با جذب منابع برابر با ۱۳,۱٪ از دارایی آغاز دوره‌شان در جایگاه نخست نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در میان **صندوق‌های سرمایه‌گذاری** قرار می‌گیرند.

/// **صندوق‌های سهامی** در آذر ۱۴۰۳ نسبت به ماه گذشته توانسته‌اند جذب بالاتری از منابع را تجربه کنند. صندوق‌های صدور و ابطالی و قابل معامله در این ماه به ترتیب با خالص ورود منابعی برابر با ۲,۷٪ و ۱۰,۹٪ دارایی آغاز دوره‌شان رو به‌رو بوده‌اند.

/// در میان **صندوق‌های درآمد ثابت** صندوق‌های صدور و ابطالی در این ماه توانسته‌اند نسبت جذب منابع (۰,۵٪) بالاتری را در مقایسه با صندوق‌های قابل معامله (-۳,۷٪) تجربه کنند؛ گرچه این نسبت در مقایسه با مقدار آن در ماه گذشته (۳,۸٪) رقم کمتری است.

تغییر ترکیب دارایی در آذر ۱۴۰۳



// سهم سهام از دارایی صندوق‌های درآمد ثابت در آذر ۱۴۰۳ با رشد ۰,۴٪ همراه بوده است. در سوی دیگر سهم سپرده بانکی و وجه نقد از دارایی این صندوق‌ها با کاهش ۱,۱٪ همراه شده است.

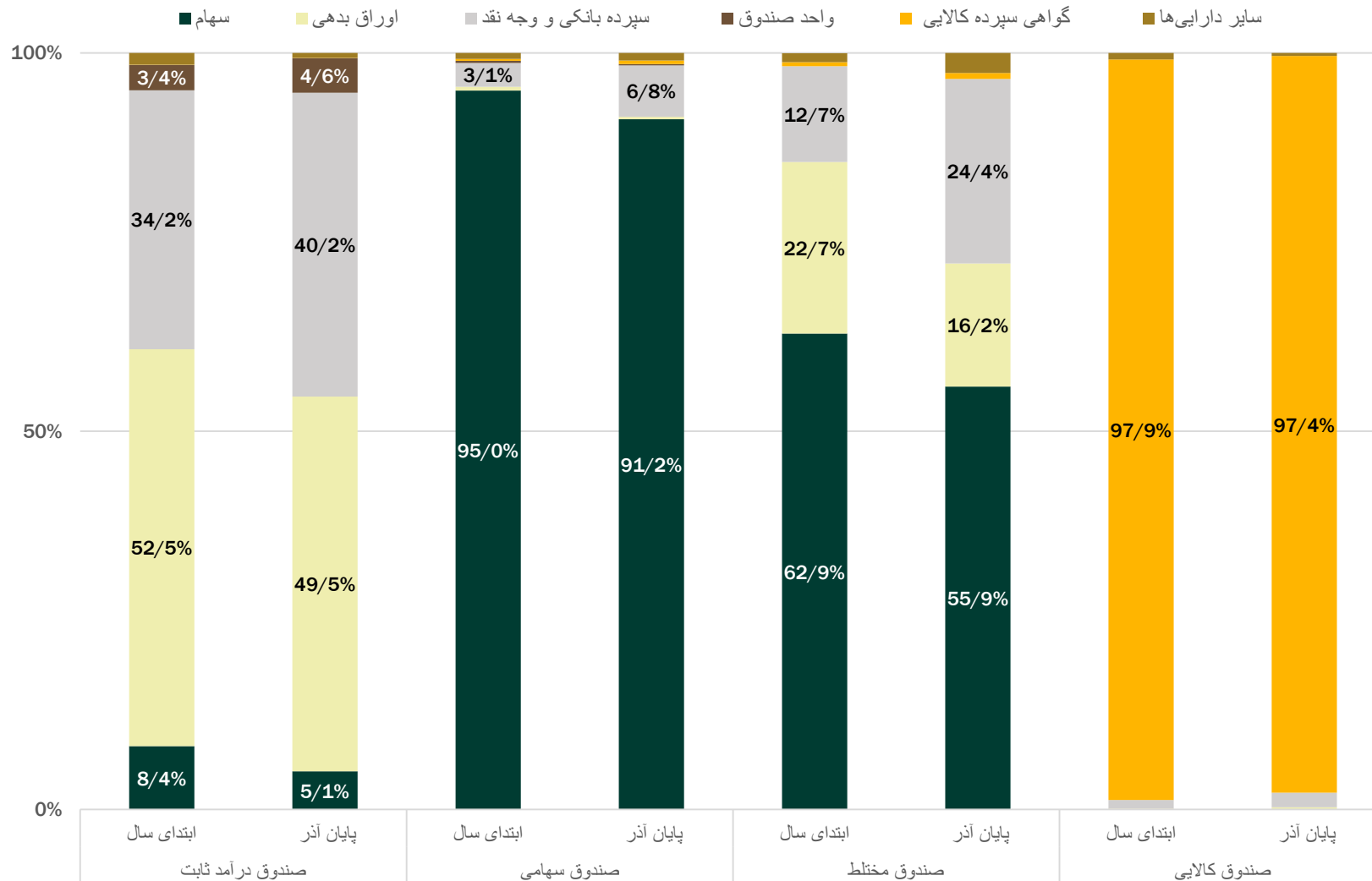
// سهم سهام از دارایی صندوق‌های سهامی در این بازه رشد ۱,۹٪ را تجربه کرده و سهم سپرده‌های بانکی و وجه نقد ۱,۰٪ کاهش یافته است.

// سهم سهام از دارایی صندوق‌های مختلط در این بازه رشد ۸,۰٪ را تجربه کرده و سهم اوراق بدهی ۸,۰٪ کاهش یافته است.

// ترکیب دارایی صندوق‌های کالایی با افت اندک سهم گواهی سپرده‌های کالایی در این بازه همراه بوده است (۰,۷٪)*.

*برای جزئیات آماری بیشتر به پیوست گزارش مراجعه نمایید.

تغییر ترکیب دارایی آذر ۱۴۰۳ نسبت به آغاز سال



سهم اوراق بدهی و سهام از دارایی صندوق‌های درآمد ثابت از ابتدای سال تا آذر ۱۴۰۳ به ترتیب با افت ۳,۰٪ و ۳,۳٪ همراه بوده است. در سوی دیگر سهم سپرده بانکی و وجه نقد با افزایش ۶,۰٪ همراه شده است.

سهم سهام از دارایی صندوق‌های سهامی در این بازه کاهش ۳,۸٪ را تجربه کرده و در سوی دیگر رشد ۳,۷٪ در سهم سپرده‌های بانکی و وجه نقد رخ داده است.

ترکیب دارایی صندوق‌های مختلط تا آذر ۱۴۰۳ با تغییرات چشمگیری روبه‌رو بوده است: افت سهم سهام (۷,۰٪)، افت سهم اوراق بدهی (۶,۵٪) و رشد سهم سپرده‌های بانکی و وجه نقد (۱۱,۷٪).

ترکیب دارایی صندوق‌های کالایی با کاهش اندک سهم گواهی سپرده‌های کالایی در این بازه همراه بوده است (۰,۵٪)*.

*برای جزئیات آماری بیشتر به پیوست گزارش مراجعه نمایید.

حضور رکن ضامن نقدشوندگی در پایان آذر ۱۴۰۳

حضور رکن ضامن نقدشوندگی در آذر ۱۴۰۳

شمار کل صندوق‌ها	شمار صندوق‌های دارای ضامن نقدشوندگی	سهم دارایی صندوق‌های دارای ضامن نقدشوندگی	ارزش دارایی صندوق‌های دارای ضامن نقدشوندگی (همت)	ارزش دارایی کل صندوق‌ها (همت)	
163	29	41.1%	318.9	776.8	صندوق درآمد ثابت
148	15	5.5%	8.0	145.2	صندوق سهامی
26	7	28.1%	2.0	7.2	صندوق مختلط
165	4	0.1%	0.2	346.3	سایر
502	55	25.8%	329.2	1,275.5	مجموع

// در پایان آذر ۱۴۰۳، ۴۱,۱٪ از دارایی تحت مدیریت صندوق‌های درآمد ثابت دارای ضامن نقدشوندگی بوده‌اند. این صندوق‌ها تنها ۲۹ عدد از ۱۶۳ صندوق درآمد ثابت فعال در بازار را در بر می‌گیرند.

// تنها ۱۵ صندوق از ۱۴۸ صندوق سهامی دارای ضامن نقدشوندگی هستند که ۵,۵٪ از دارایی تحت مدیریت صندوق‌های سهامی را تشکیل می‌دهند.

صندوق‌های درآمد ثابت

- // ترکیب صندوق‌ها به لحاظ قابلیت معامله و تقسیم سود
- // تغییرات دارایی تحت مدیریت
- // خالص ورود منابع
- // پوشش ریسک نقدینگی
- // بازدهی

ارزش دارایی و شمار صندوق‌ها به تفکیک قابلیت معامله و تقسیم سود در پایان آذر ۱۴۰۳

دارایی تحت مدیریت (همت)



// ۶۹٪ از دارایی تحت مدیریت صندوق‌های درآمد ثابت در پایان آذر ۱۴۰۳ برای صندوق‌های صدور و ابطالی بوده است.

// ۸۳٪ از دارایی تحت مدیریت صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی در پایان این ماه متعلق به صندوق‌های با تقسیم سود بوده است.

// در پایان آذر، ۸۱٪ از دارایی تحت مدیریت صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله در اختیار صندوق‌های بدون تقسیم سود قرار داشته است.*

*برای جزئیات آماری بیشتر به پیوست گزارش مراجعه نمایید.

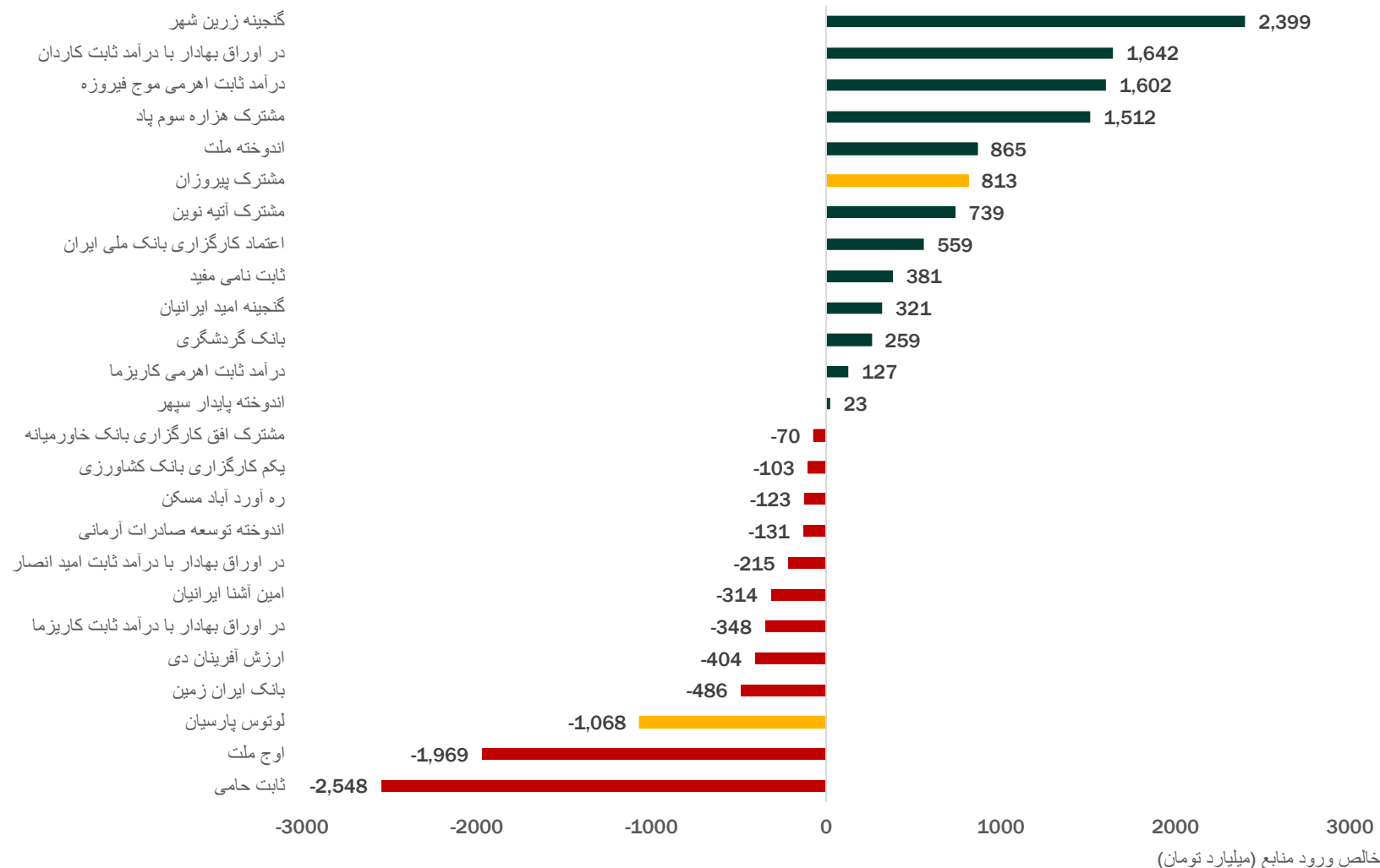
تغییر دارایی تحت مدیریت در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵ همت



دارایی تحت مدیریت صندوق‌های درآمد ثابت با دارایی بیش از ۵ همت در پایان آذر ۱۴۰۳ نسبت به پایان آبان از 611 همت به 615 همت رسیده است (۰,۶٪ رشد).

از ۴۰ صندوق با دارایی بیش از ۵ همت، 21 صندوق در این ماه با رشد ارزش دارایی و مابقی آن‌ها با افت ارزش دارایی تحت مدیریتشان روبه‌رو شده‌اند.

خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵ همت



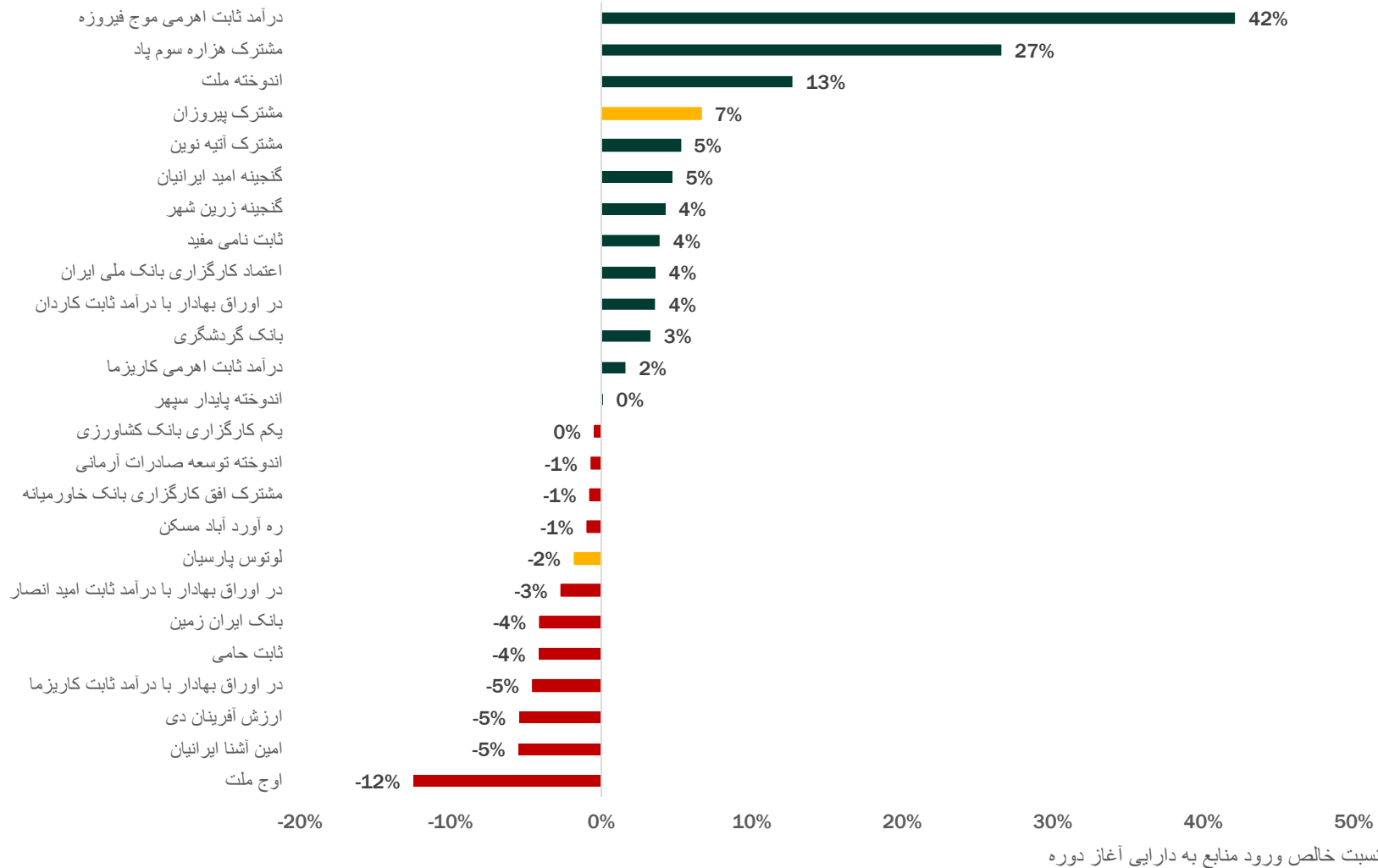
/// ۳,۵ همت در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص به صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی با دارایی بیش از ۵ همت وارد شده است.

/// از میان این صندوق‌ها صندوق گنجینه زرین شهر در این ماه نزدیک به ۲,۴ همت منابع را جذب کرده است.

/// صندوق‌های ثابت حامی، اوج ملت و لوتوس پارسیان در این ماه بیشترین خروج منابع را در میان صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی بزرگتر از ۵ همت تجربه کرده‌اند؛ به‌گونه‌ای که نزدیک به ۷۲٪ از کل خروج منابع از این صندوق‌ها در این ماه مربوط به این سه صندوق بوده است.

/// خالص ورود منابع به صندوق‌های مشترک پیروزان و لوتوس پارسیان در این ماه به‌ترتیب برابر با ۸۱۳ و ۱,۰۶۸- میلیارد تومان بوده است.

نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵ همت



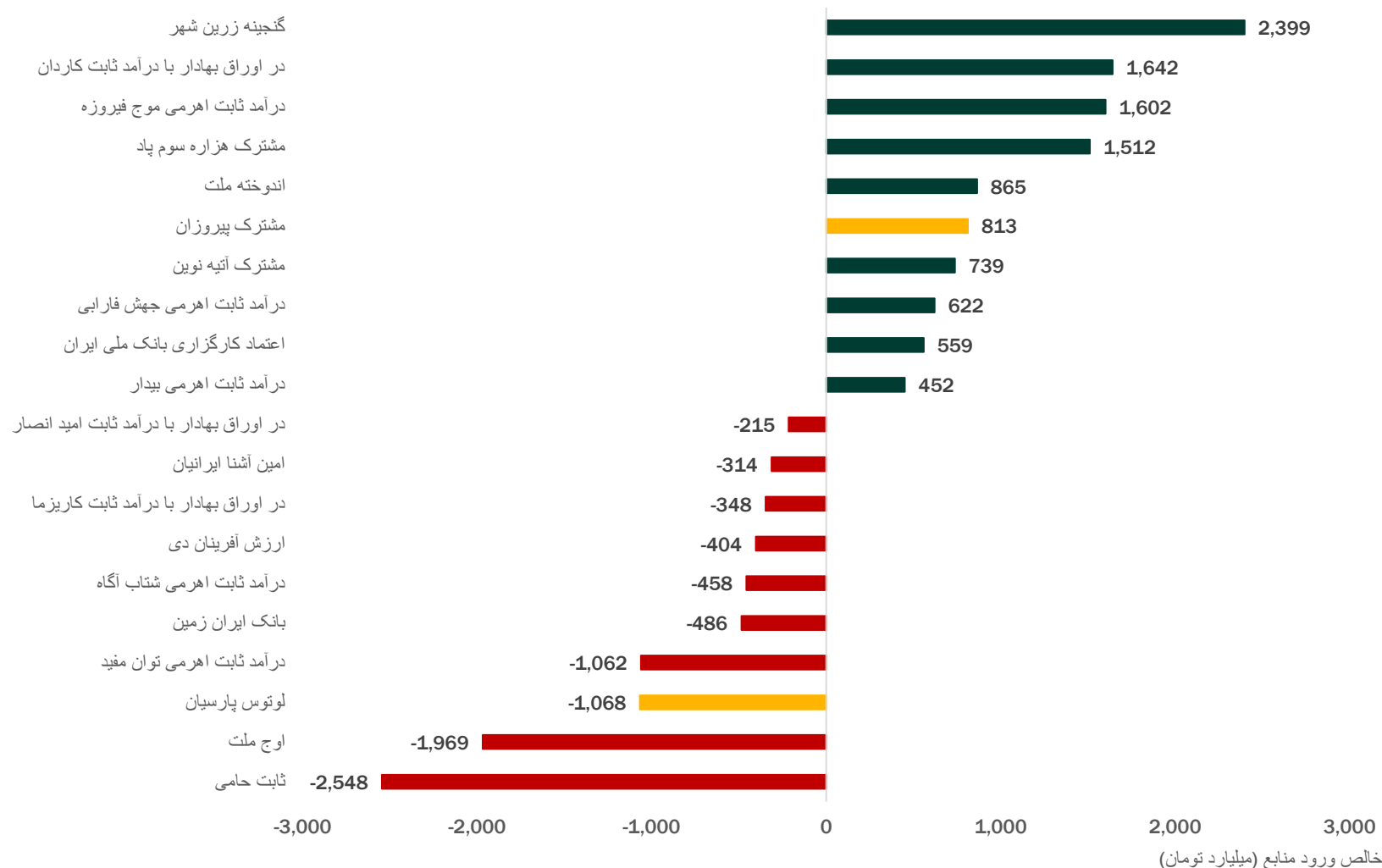
در آذر ۱۴۰۳ صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی در مجموع ورود منابعی برابر با ۰,۵٪ از دارایی آغاز دوره‌شان را تجربه کرده‌اند.

از میان صندوق‌ها با دارایی بیش از ۵ همت نسبت خالص ورود منابع به ارزش دارایی در آغاز ماه صندوق‌های درآمد ثابت اهرمی موج فیروزه، مشترک هزاره سوم پاد و اندوخته ملت در آذر ۱۴۰۳ به ترتیب برابر با ۴۲٪، ۲۷٪ و ۱۳٪ بوده است.

خالص خروج منابع صندوق اوج ملت در این ماه نسبت به دارایی آغاز دوره‌شان به ترتیب برابر ۱۲٪ بوده است.

نسبت خالص ورود منابع صندوق‌های مشترک پیروزان و لوتوس پارسیان در این ماه به ترتیب برابر با ۷٪ و ۲٪ بوده است.

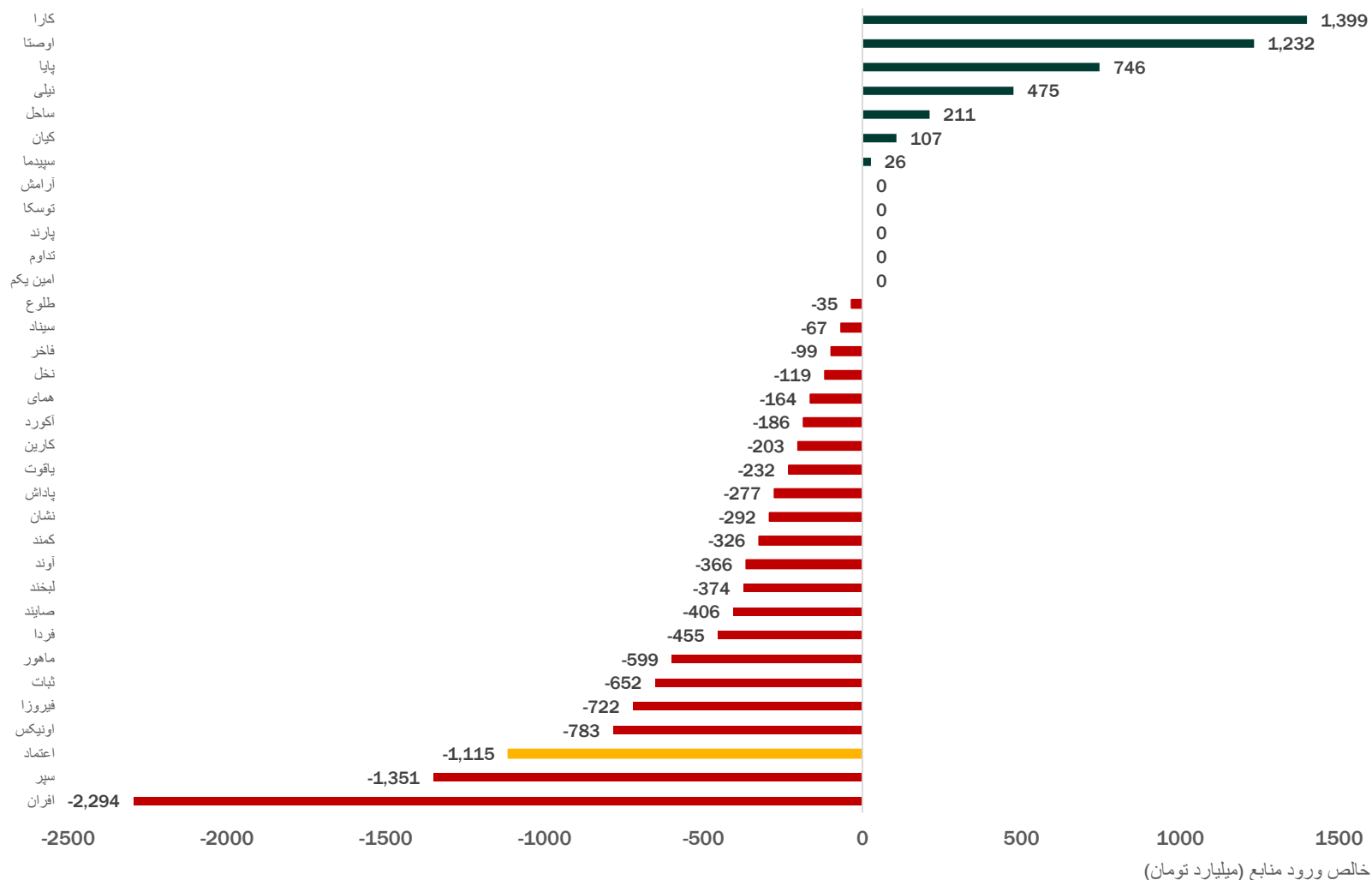
۲۰ صندوق با بیشترین و کمترین خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳



/// ۲,۸ همت در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص به صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی وارد شده است.

/// صندوق‌های گنجینه زرین شهر و ثابت حامی به‌ترتیب با جذب منابع ۲,۴ همت و خروج منابع ۲,۵ همت در جایگاه‌های نخست جذب و خروج منابع در این ماه قرار می‌گیرند.

خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۲ همت



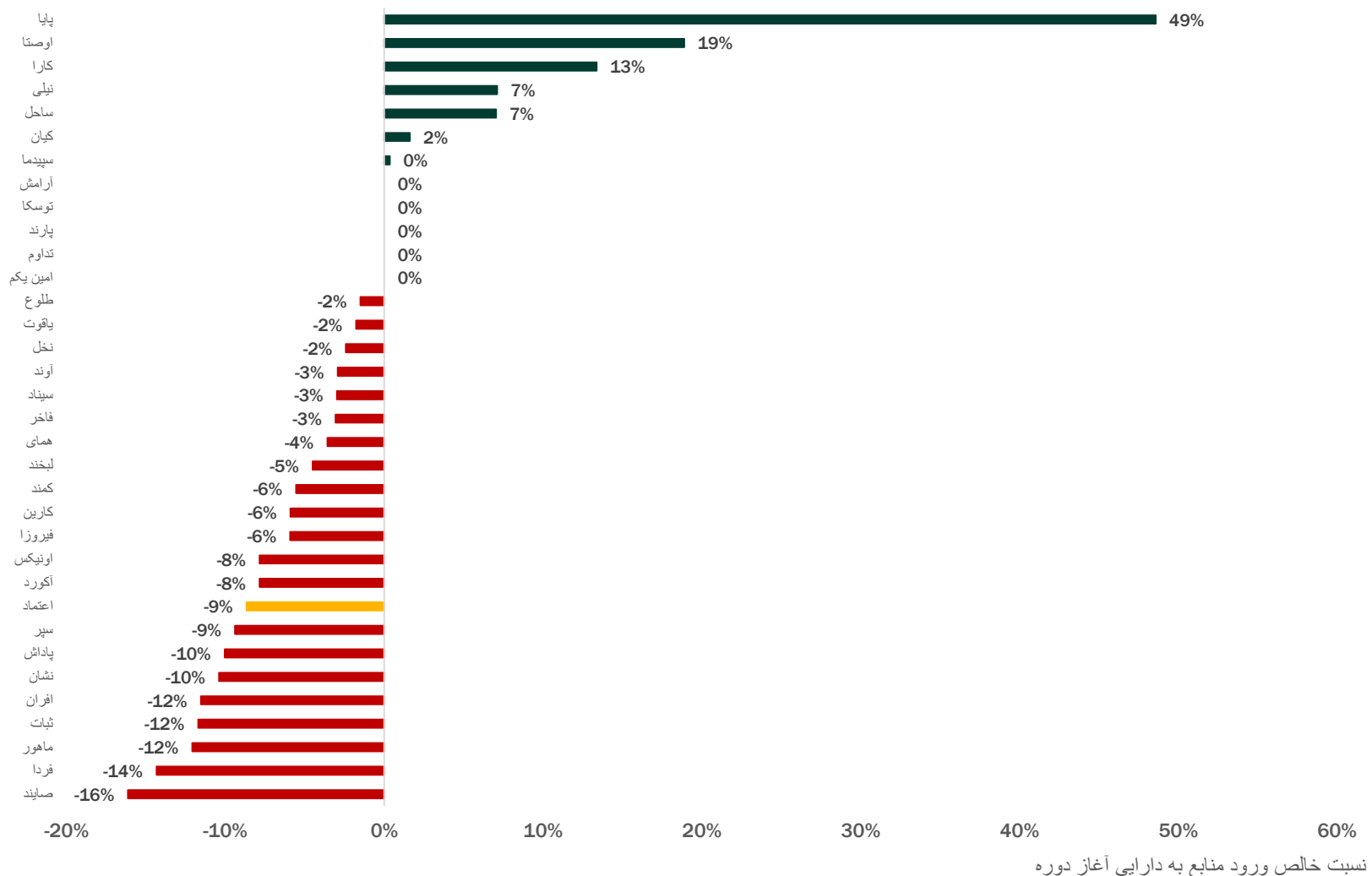
6,9 همت در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص از صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله با دارایی بیش از ۲ همت خارج شده است.

از میان این صندوق‌ها صندوق‌های کارا و اوصتا در این ماه بیش از ۲,۶ همت منابع را جذب کرده‌اند.

صندوق‌های افران، سپهر، و اعتماد در این ماه بیشترین خروج منابع را در میان صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله بزرگتر از ۲ همت تجربه کرده‌اند؛ به‌گونه‌ای که نزدیک به ۴۳٪ از کل خروج منابع از این صندوق‌ها در این ماه مربوط به این سه صندوق بوده است.

خالص خروج منابع از صندوق اعتماد در این ماه برابر با ۱,۱۱۵ میلیارد تومان بوده است.

نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۲ همت



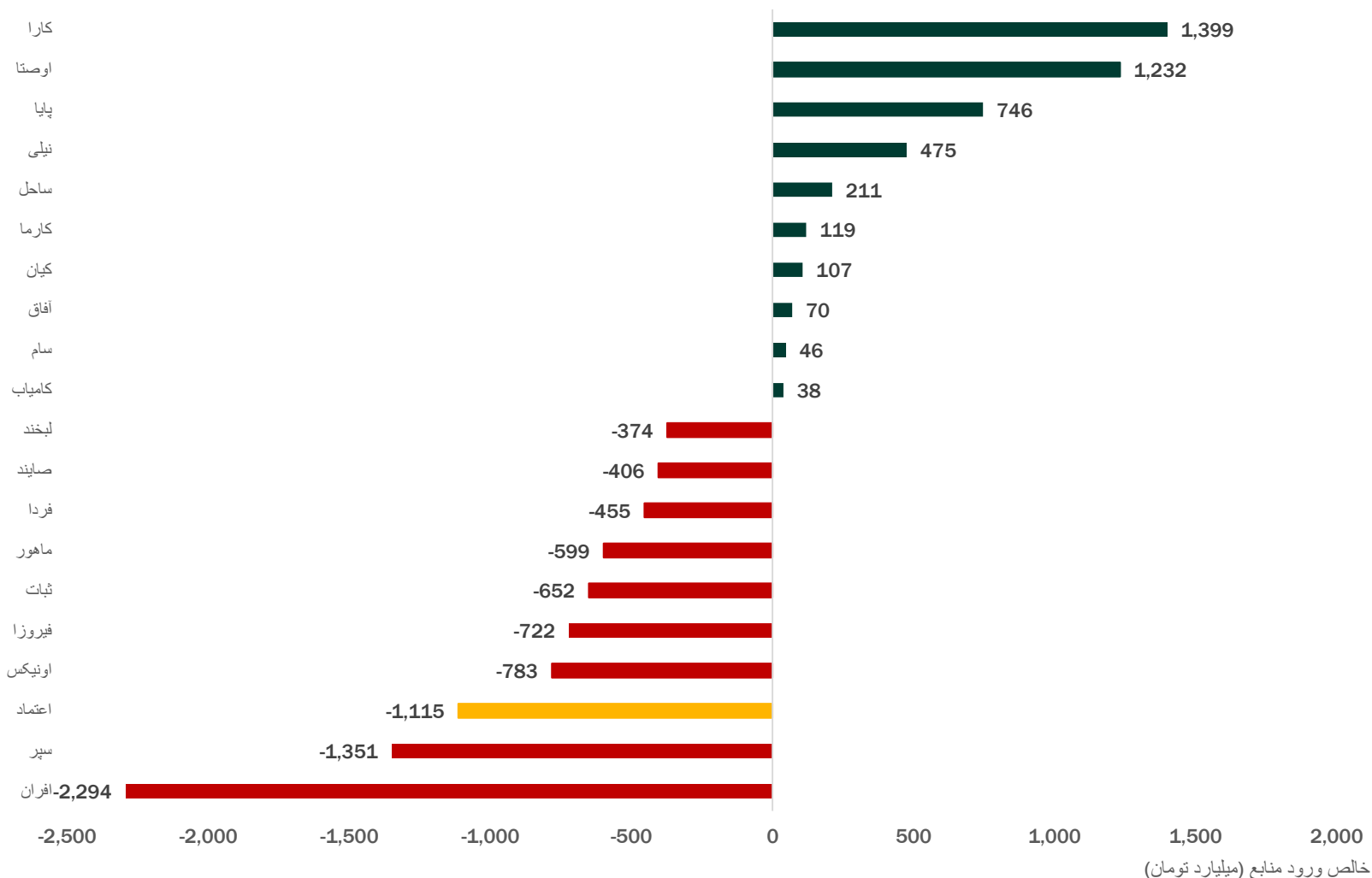
// در آذر ۱۴۰۳ صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله در مجموع خروج منابعی برابر با ۳,۷٪ از دارایی آغاز دوره‌شان را تجربه کرده‌اند.

// از میان صندوق‌ها با دارایی بیش از ۲ همت نسبت خالص ورود منابع به ارزش دارایی در آغاز ماه صندوق‌های پایا، اوصتا و کارا در آذر ۱۴۰۳ به ترتیب برابر با ۴۹٪، ۱۹٪ و ۱۳٪ بوده است.

// خالص خروج منابع صندوق‌های صایند و فردا در این ماه نسبت به دارایی آغاز دوره‌شان به ترتیب برابر ۱۶٪ و ۱۴٪ بوده است.

// نسبت خالص خروج منابع صندوق اعتماد در این ماه برابر با ۹٪ بوده است.

۲۰ صندوق با بیشترین و کمترین خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳



// ۹,۰ همت در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص از صندوق‌های درآمد ثابت قابل معامله خارج شده است.

// صندوق‌های کارا و افران به ترتیب با جذب منابع ۱,۴ همت و خروج منابع ۲,۳ در جایگاه‌های نخست جذب و خروج منابع در این ماه قرار می‌گیرند.

پوشش ریسک نقدینگی صندوق‌های فاقد ضامن نقدشوندگی در پایان آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های بزرگتر از ۱ همت

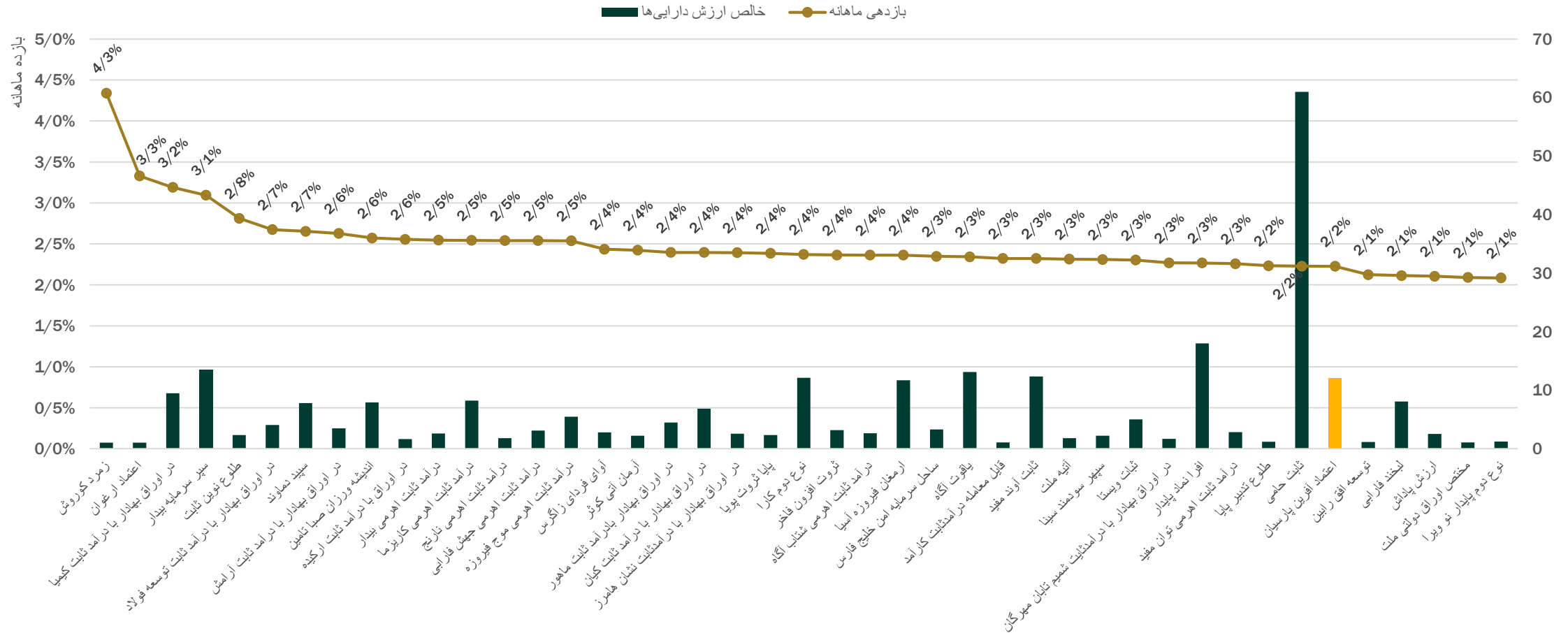
توان پوشش ریسک نقدینگی صندوق‌های صدور و ابطالی فاقد ضامن نقدشوندگی (بزرگتر از ۱ همت)

نام صندوق	سهم (%) سپرده بانکی و وجه نقد	ارزش دارایی تحت مدیریت (همت)
نگین رفاه	56.5	4.0
خزانه داریوش	56.2	2.8
پاداش سرمایه بهگزین	55.6	2.9
یکم کارگزاری بانک کشاورزی	54.5	22.9
ثابت حامی	51.8	61.0
ثابت نامی مفید	50.1	10.5
در اوراق بهادار با درآمد ثابت کوثر یکم	47.7	1.9
اعتماد کارگزاری بانک ملی ایران	46.6	16.2
اندوخته آمیتیس	44.7	1.7
الماس کوروش	42.8	1.8
در اوراق بهادار با درآمد ثابت اعتماد ملل	41.1	4.0
مشترک افق کارگزاری بانک خاورمیانه	41.0	9.3
در اوراق بهادار با درآمد ثابت کاریزما	40.7	7.3
بانک ایران زمین	39.6	11.4
امین آشنا ایرانیان	38.5	5.4
مشترک صنعت و معدن	38.0	1.3
مشترک آتیه نوین	35.2	14.7
مشترک یکم ایرانیان	31.3	4.7
هدیه فارابی	30.2	3.8
ارزش کاوان ایرانیان	27.5	2.0
امین انصار	19.0	1.5
حکمت آشنا ایرانیان	18.5	1.1

در هنگام وقوع بحران و نیاز به نقدینگی، وجه نقد و سپرده‌های صندوق‌ها برای پرداخت تعهدات مورد استفاده قرار می‌گیرند؛ ازین‌رو این معیار از مهم‌ترین معیارهای نقدشوندگی صندوق‌های درآمد ثابت فاقد ضامن نقدشوندگی است. اگرچه سطوح بالای وجه نقد می‌تواند منجر به کاهش سودآوری صندوق شود، با این حال برقراری تعادل میان این دو متغیر ضروری است.

در میان صندوق‌های درآمد ثابت صدور و ابطالی فاقد ضامن نقدشوندگی با دارایی بیش از ۱ همت صندوق‌های نگین رفاه، خزانه داریوش، پاداش سرمایه بهگزین، یکم کارگزاری بانک کشاورزی، ثابت حامی و ثابت نامی مفید بیش از نیمی از دارایی‌هایشان را به سپرده بانکی و وجه نقد اختصاص داده‌اند.

بازده ماهانه در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از یک همت



بازدهی صندوق‌ها بر پایه تغییرات NAV آن‌ها محاسبه شده است.

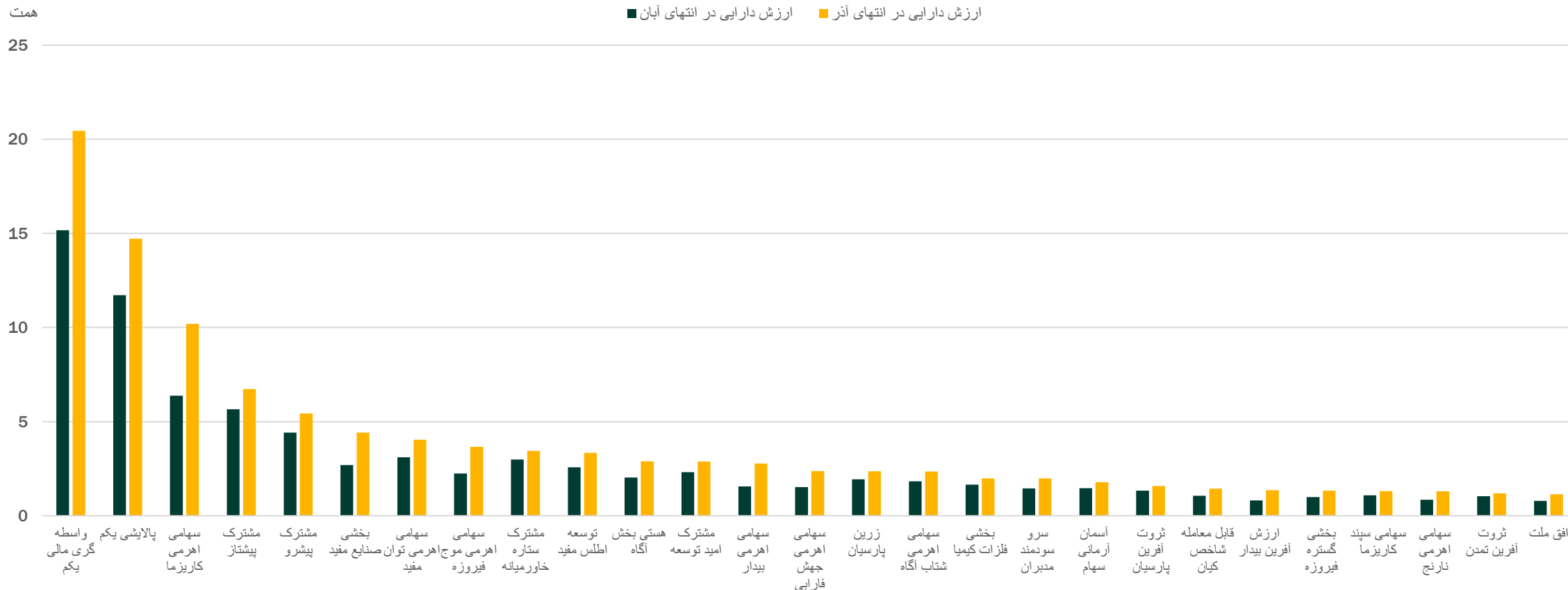
صندوق‌های سهامی

// تغییرات دارایی تحت مدیریت

// خالص ورود منابع

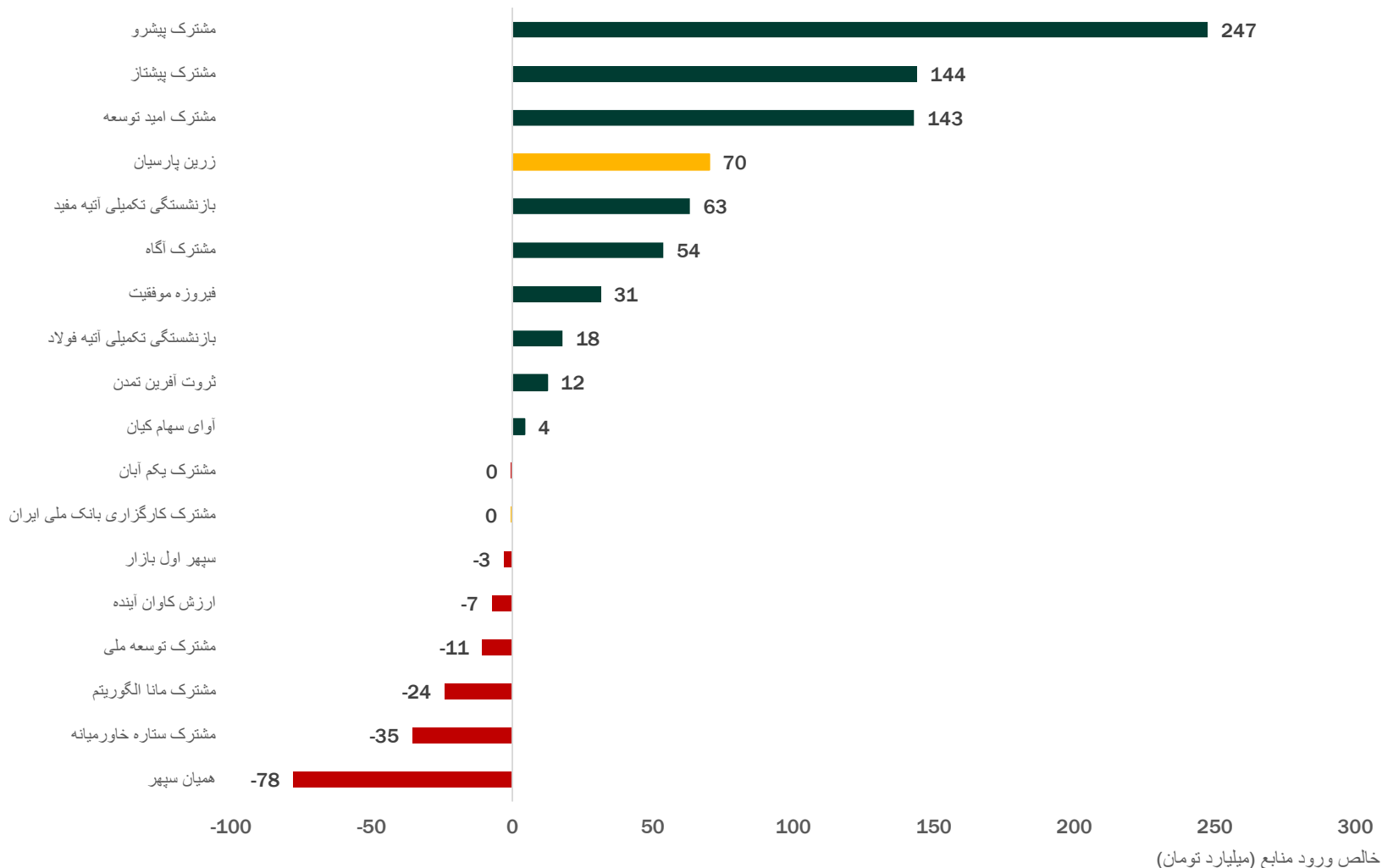
// بازدهی

تغییر دارایی تحت مدیریت در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از یک همت



دارایی‌های تحت مدیریت صندوق‌های سهامی با دارایی بیش از یک همت در پایان آذر ۱۴۰۳ نسبت به پایان آبان از ۸۰,۶۵ همت به ۱۰۸,۴ همت رسیده است (۳۴,۴٪ رشد).

خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان



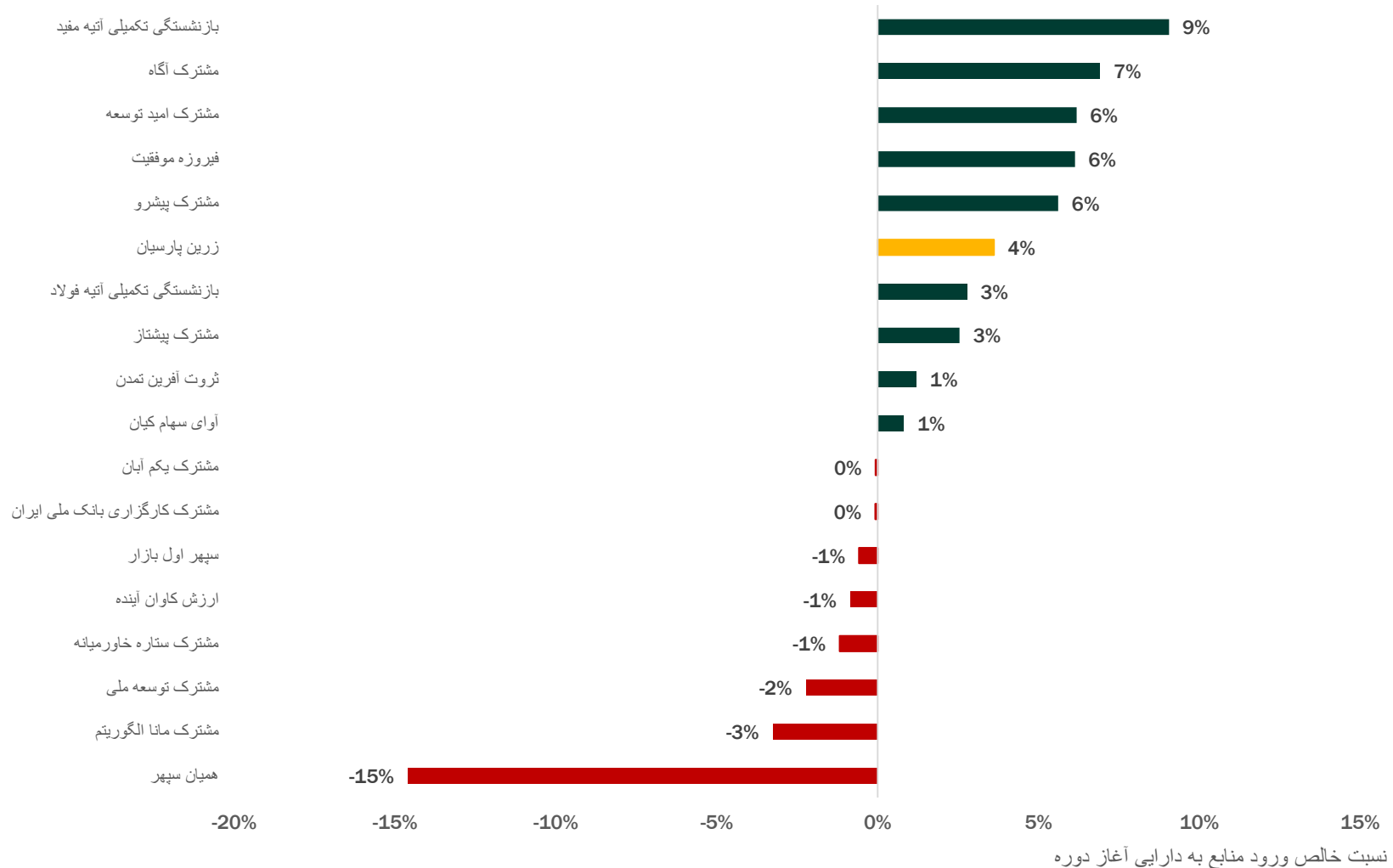
/// ۶۲۹ میلیارد تومان در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص به صندوق‌های سهامی صدور و ابطالی با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان وارد شده است.

/// در میان این صندوق‌ها صندوق‌های مشترک پیشرو، مشترک پیشتاز و مشترک امید توسعه در آذر ۱۴۰۳ ۵۳۴ میلیارد تومان منابع جذب کرده‌اند.

/// صندوق همیان سپهر در این ماه بیشترین خروج منابع را در میان صندوق‌های سهامی صدور و ابطالی بزرگتر از ۵۰۰ میلیارد تومان تجربه کرده است؛ به‌گونه‌ای که بیش از ۴۹٪ از کل خروج منابع از این صندوق‌ها در این ماه مربوط به این صندوق بوده است.

/// خالص ورود منابع به صندوق زرین پارسیان در این ماه برابر ۷۰ میلیارد تومان بوده است.

نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان



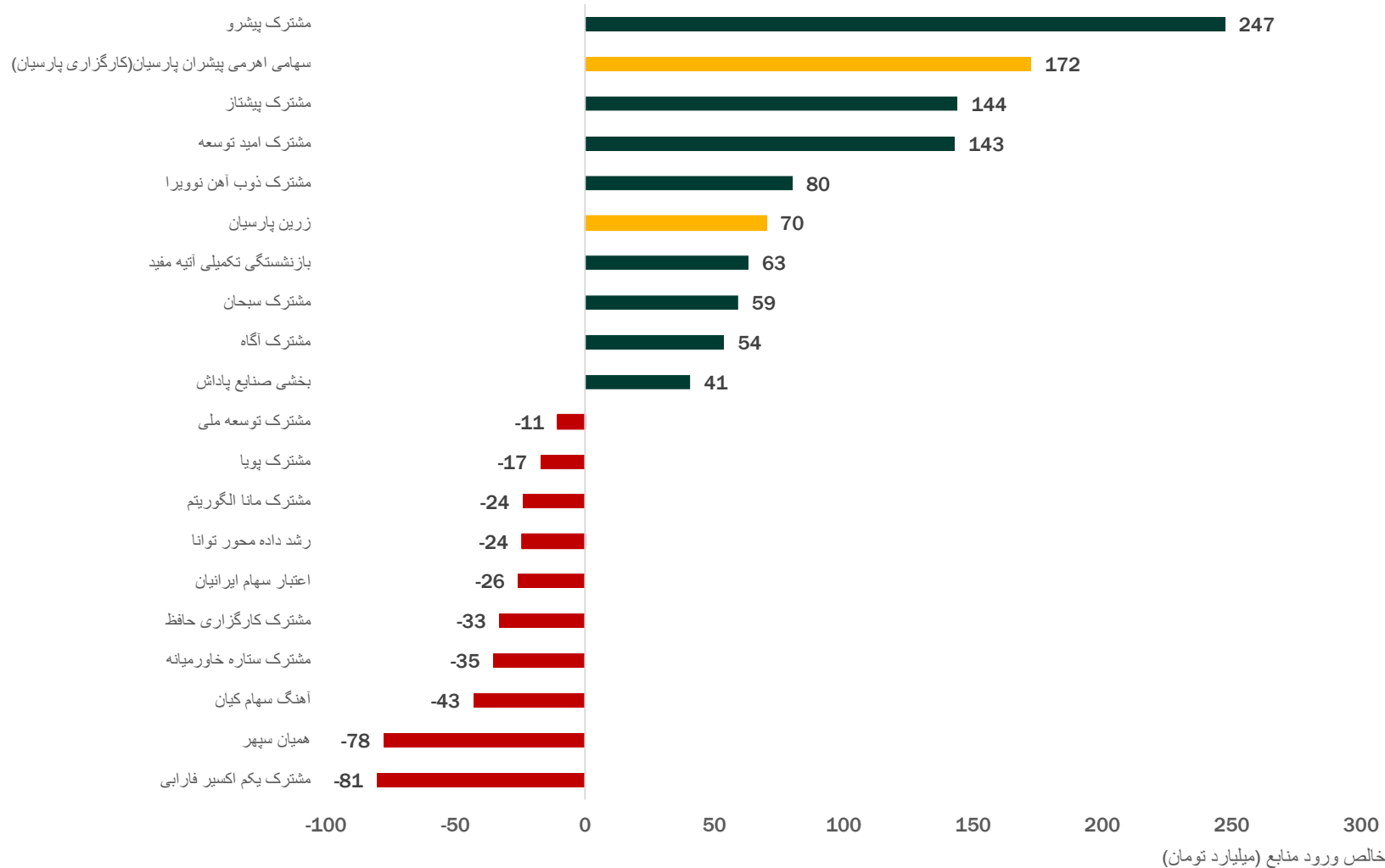
در آذر ۱۴۰۳ صندوق‌های سهامی صدور و ابطالی در مجموع ورود منابعی برابر با ۲,۷٪ از دارایی آغاز دوره‌شان را تجربه کرده‌اند.

از میان صندوق‌ها با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان صندوق سهامی بازنشستگی تکمیلی آتیه مفید در آذر ۱۴۰۳ با خالص ورود منابع ۹٪ نسبت به ارزش دارایی‌های خود در آغاز ماه روبه‌رو بوده است.

بیشترین خالص خروج منابع نسبت به دارایی آغاز دوره در این ماه مربوط به صندوق همیان سپهر برابر ۱۵٪ بوده است.

نسبت خالص ورود منابع صندوق زرین پارسیان در این ماه برابر با ۴٪ بوده است.

۲۰ صندوق با بیشترین و کمترین خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳

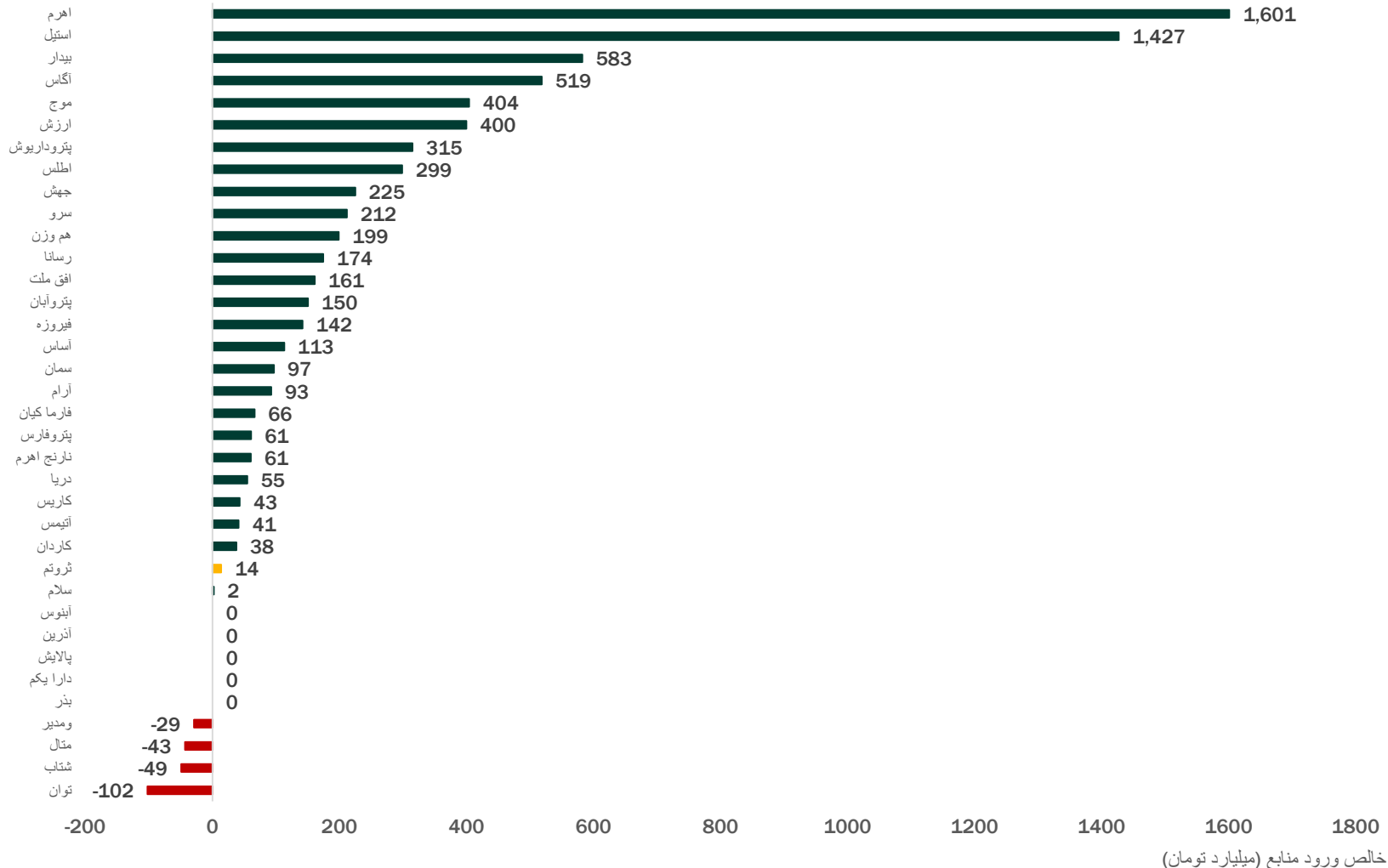


/// ۹۱۹ میلیارد تومان در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص به صندوق‌های سهامی صدور و ابطالی وارد شده است.

/// صندوق‌های مشترک پیشرو و مشترک یکم اکسیر فارابی به ترتیب با جذب منابع ۲۴۷ میلیارد و خروج منابع ۸۱ میلیارد تومان در جایگاه‌های نخست جذب و خروج منابع در این ماه قرار می‌گیرند.

/// صندوق سهامی اهرمی پیشران پارسیان با جذبی برابر با ۱۷۲ میلیارد تومان در این ماه در جایگاه دوم خالص ورود منابع قرار گرفته است.

خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان



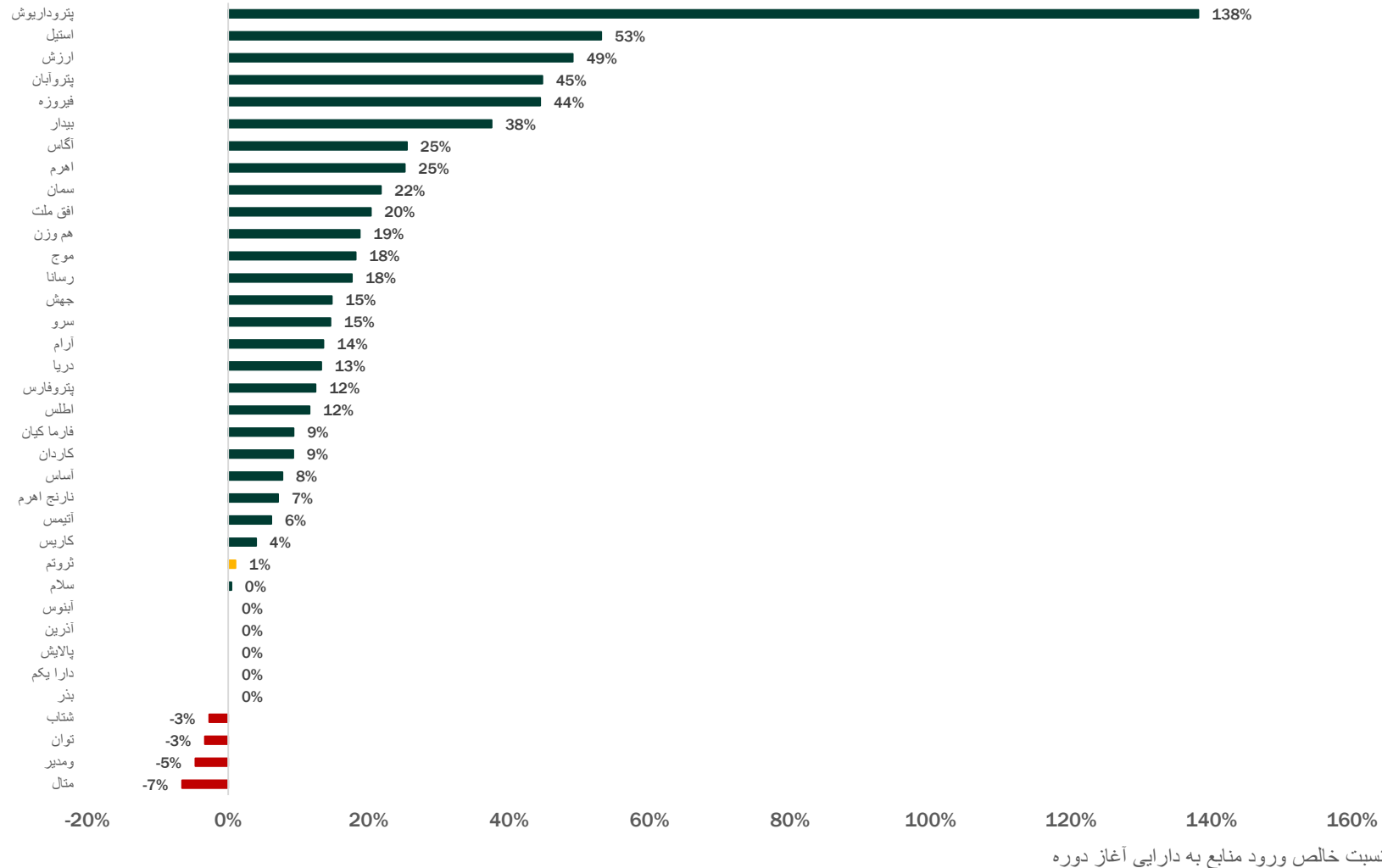
// ۷,۳ همت در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص به صندوق‌های سهامی قابل معامله با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان وارد شده است.

// در میان صندوق‌های سهامی قابل معامله بزرگتر از ۵۰۰ میلیارد تومان، صندوق‌های اهرم و استیل در آذر ۱۴۰۳ بیش از ۳ همت منابع جذب کرده‌اند.

// صندوق توان در این ماه بیشترین خروج منابع را در میان صندوق‌های سهامی قابل معامله بزرگتر از ۵۰۰ میلیارد تومان تجربه کرده؛ به‌گونه‌ای که نزدیک به ۴۶٪ از کل خروج منابع از این صندوق‌ها در این ماه مربوط به این صندوق بوده است.

// خالص ورود منابع به صندوق ثروتم در این ماه برابر با ۱۴ میلیارد تومان بوده است.

نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان



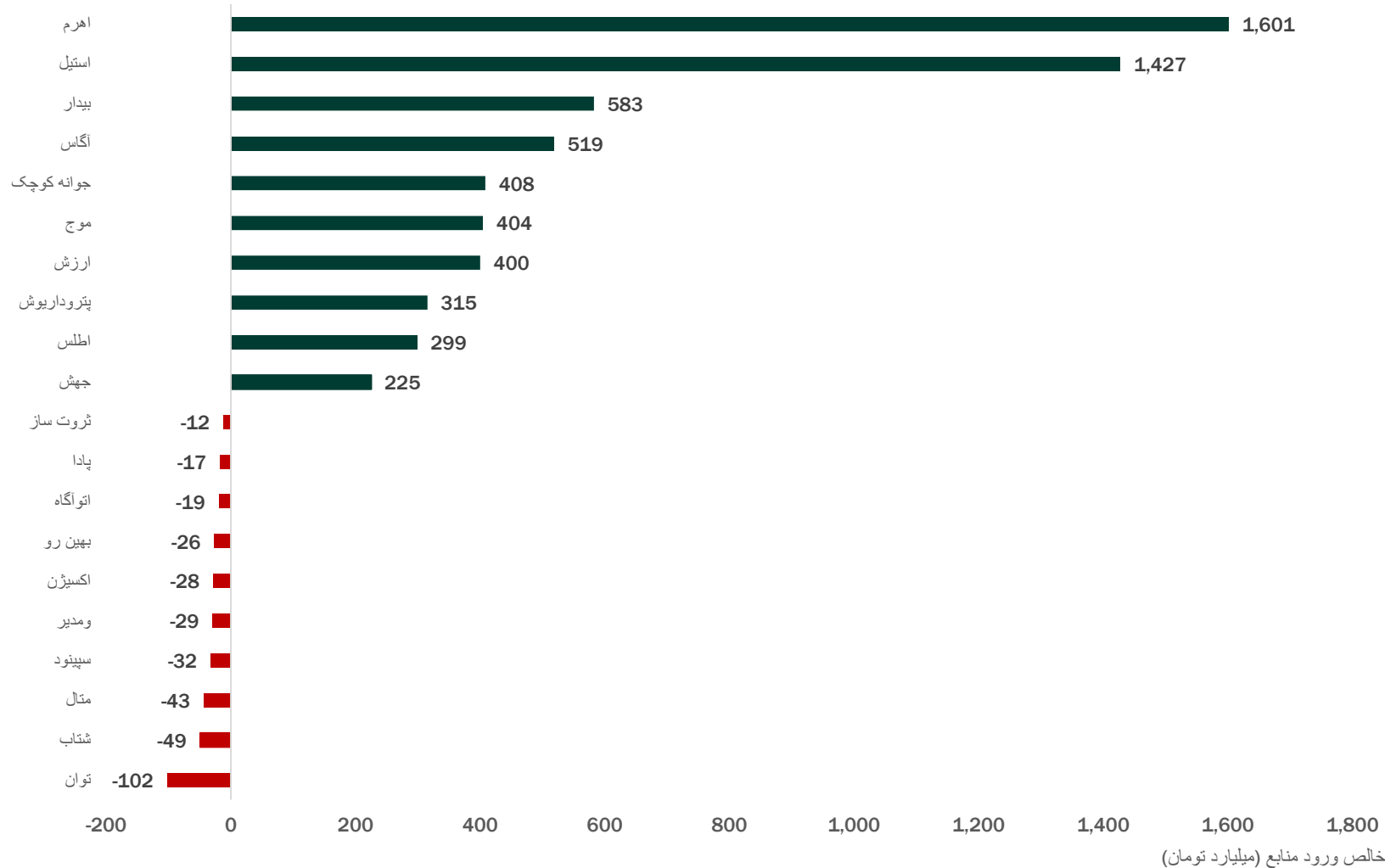
// در آذر ۱۴۰۳ صندوق‌های سهامی قابل معامله در مجموع توانسته‌اند منابعی برابر با ۱۰,۹٪ از دارایی آغاز دوره‌شان را جذب نمایند.

// از میان صندوق‌ها با دارایی بیش از ۵۰۰ میلیارد تومان صندوق‌های پتروداريوش، استیل، ارزش، پتروآبان و فیروزه در آذر ۱۴۰۳ با خالص ورود منابع بیش از ۴۰٪ نسبت به ارزش دارایی‌های خود در آغاز ماه روبه‌رو بوده‌اند.

// بیشترین خالص خروج منابع نسبت به دارایی آغاز دوره در این ماه مربوط به صندوق متال برابر ۷٪ بوده است.

// صندوق ثروتم در آذر ۱۴۰۳ برابر با ۱٪ از دارایی آغاز دوره‌اش را جذب نموده است.

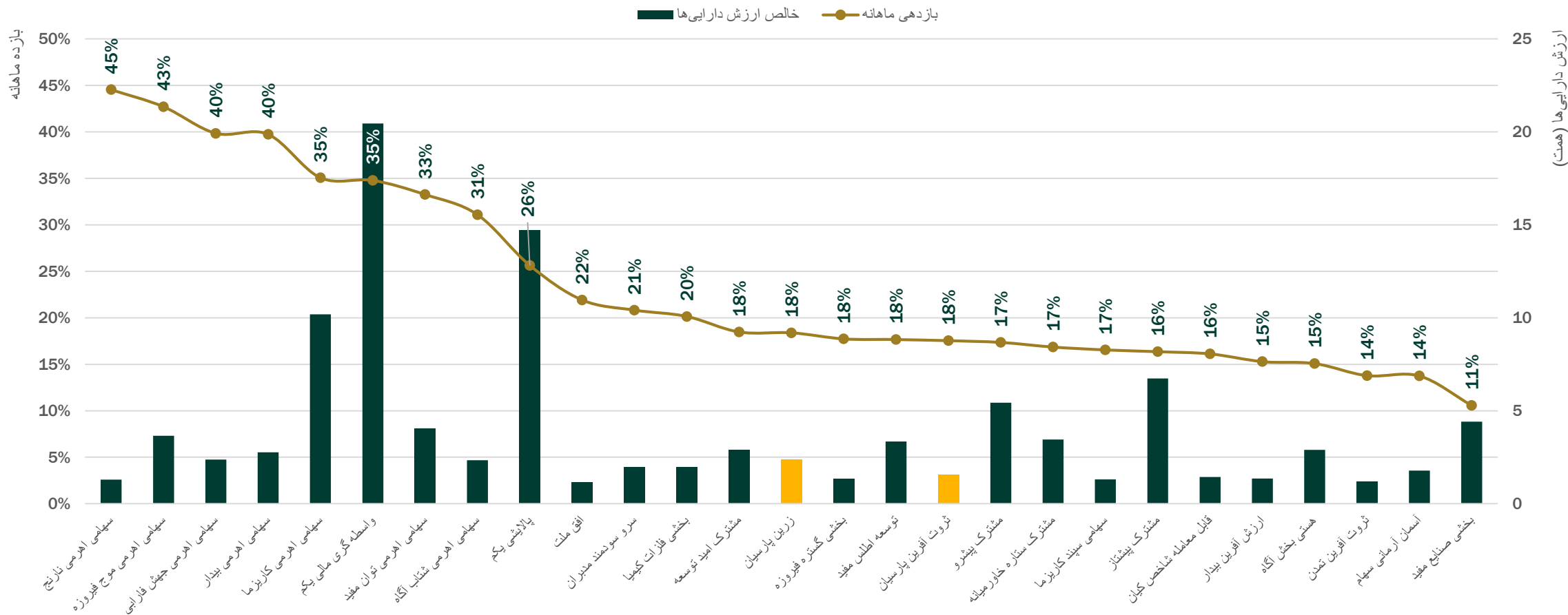
۲۰ صندوق با بیشترین و کمترین خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳



/// ۸,۳ همت در آذر ۱۴۰۳ به طور خالص به صندوق‌های سهامی قابل معامله وارد شده است.

/// صندوق‌های سهامی اهرمی و توان به‌ترتیب با جذب منابع ۱,۶ همت و خروج منابع ۱۰۲ میلیارد تومان در جایگاه‌های نخست جذب و خروج منابع در این ماه قرار می‌گیرند.

بازده ماهانه در آذر ۱۴۰۳، صندوق‌های با دارایی بیش از یک همت



بازدهی صندوق‌ها بر پایه تغییرات NAV آن‌ها محاسبه شده است.

صندوق‌های کالایی

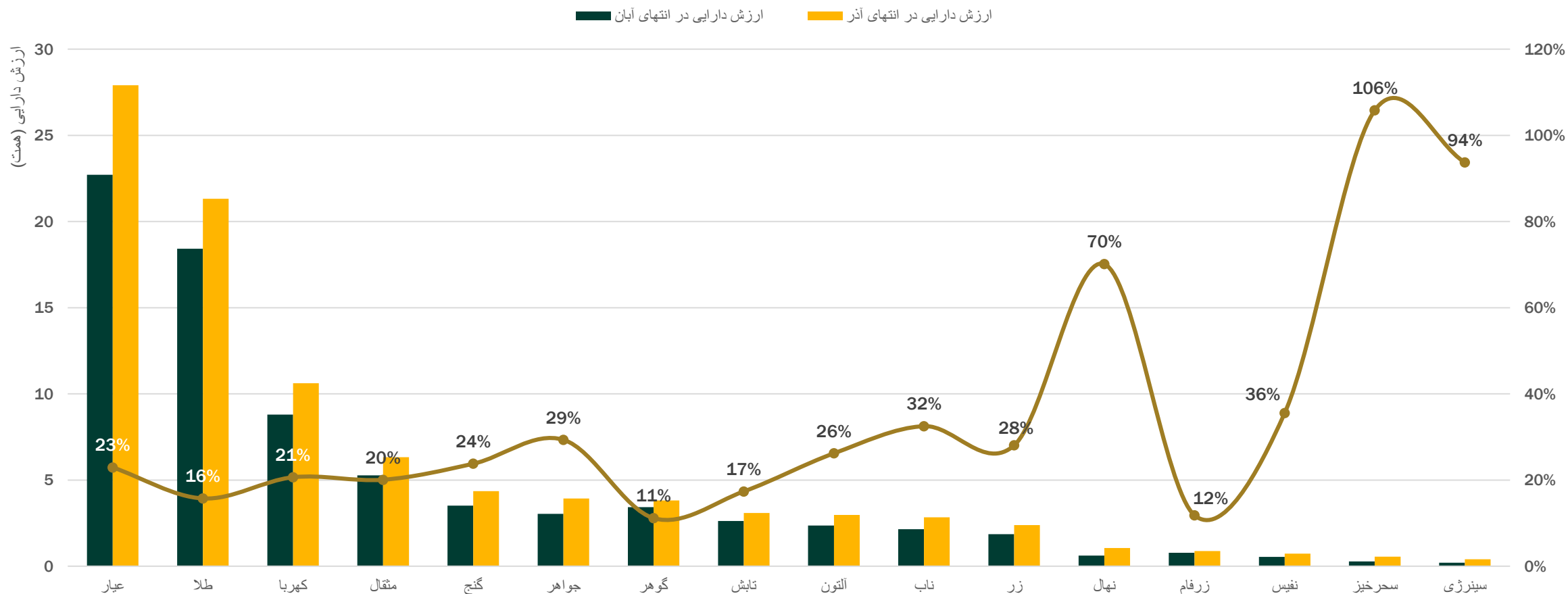
// تغییرات دارایی تحت مدیریت

// خالص ورود منابع

// حساب قیمتی

// بازدهی

تغییر دارایی تحت مدیریت در آذر ۱۴۰۳

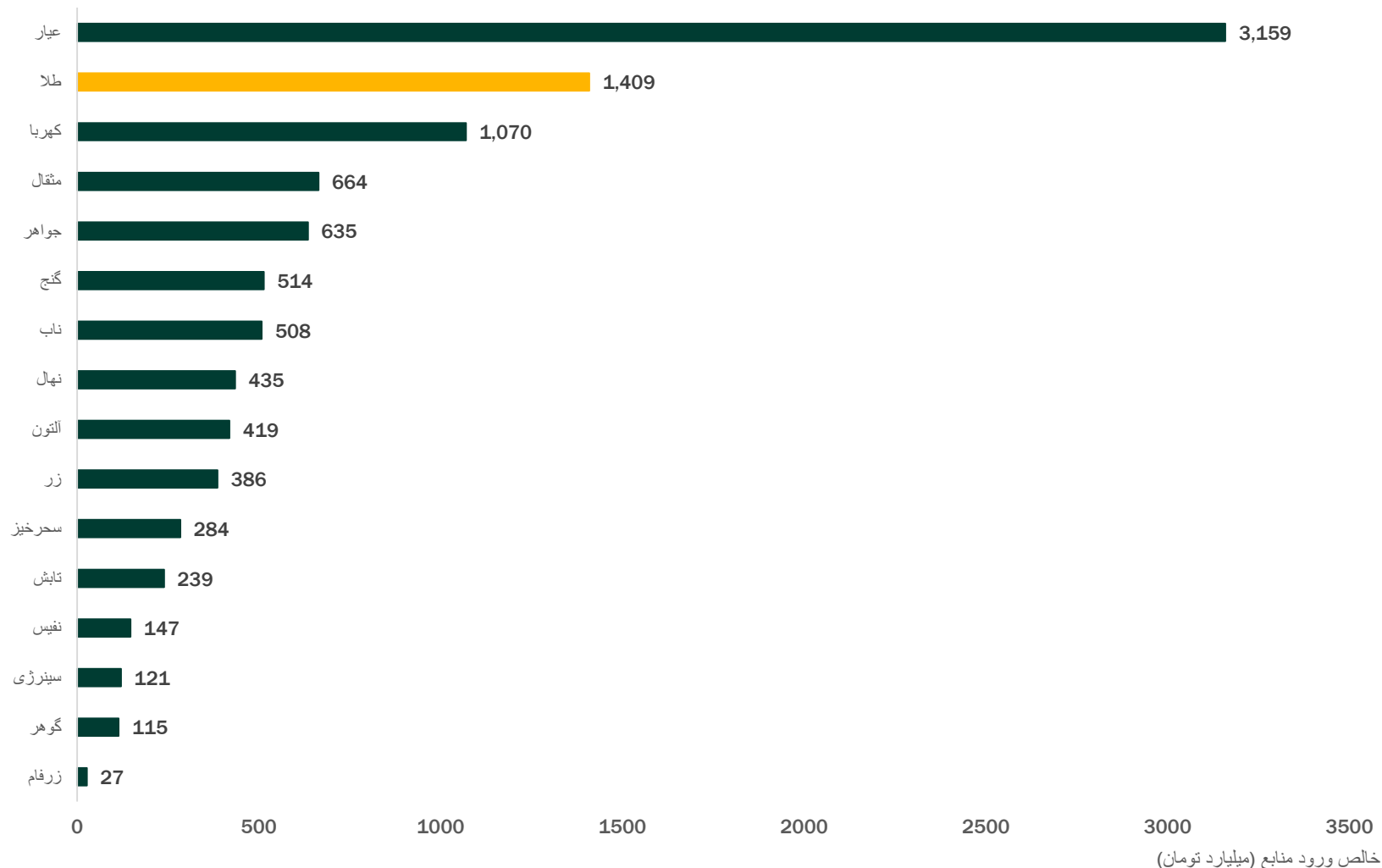


از میان ۱۶ صندوق کالایی موجود، دو صندوق نهال و سرخیز مبتنی بر زعفران، صندوق سینرژي مبتنی بر گواهی سپرده انرژی و صندوق‌های دیگر بر پایه طلا هستند.

ارزش دارایی‌های تحت مدیریت تمامی صندوق‌ها در این ماه با رشد همراه بوده و مجموعاً از ۷۶،۶ همت به ۹۳،۲ همت رسیده است (۲۱،۶٪ رشد).

دو صندوق بر پایه طلا زروان و درخشان نیز در انتهای ماه آذر عرضه شده‌اند.

خالص ورود منابع در آذر ۱۴۰۳

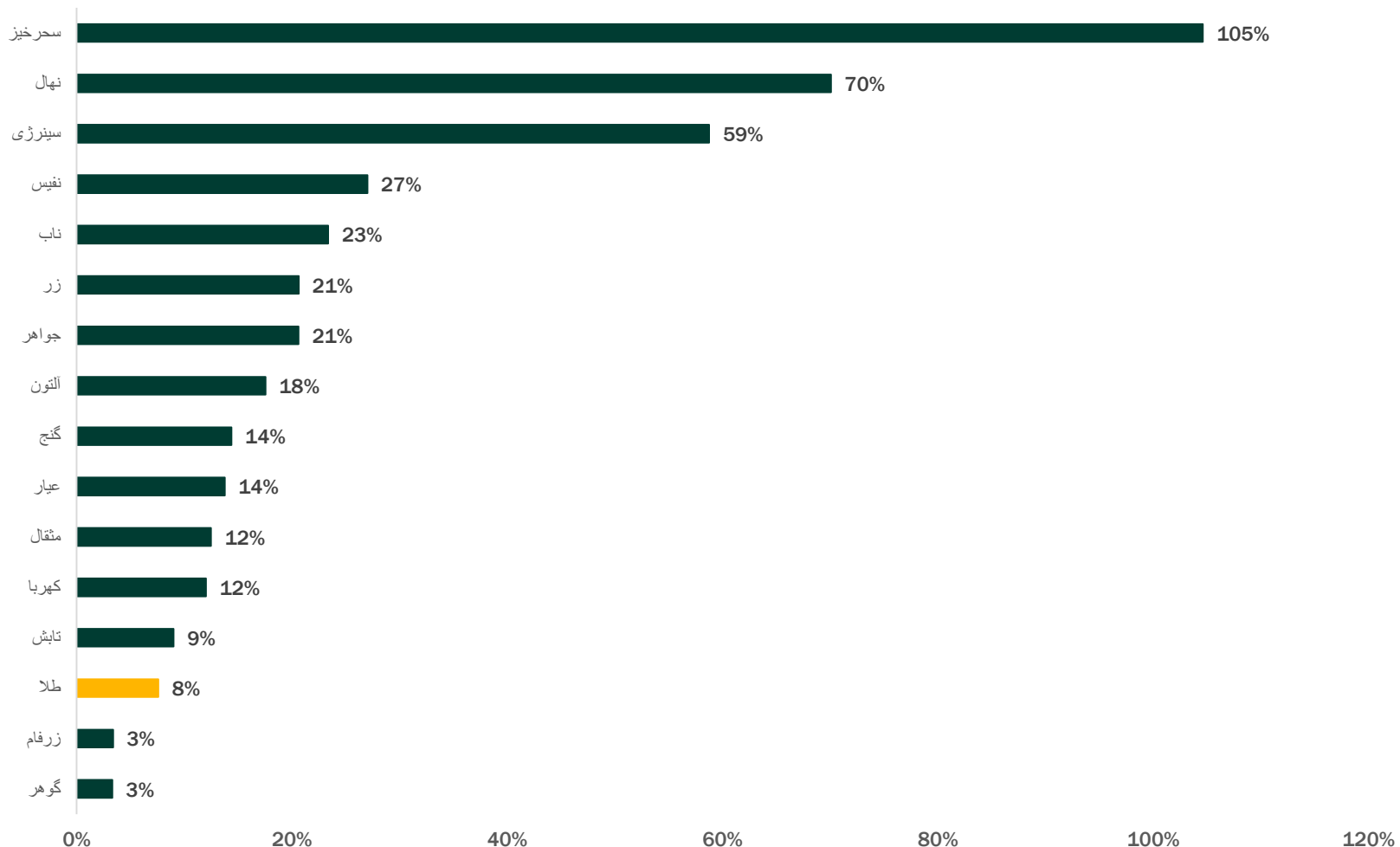


// در آذر ۱۴۰۳ در مجموع بیش از ۱۰,۷ همت به صندوق‌های کالایی وارد شده است.

// صندوق عیار با جذب منابع نزدیک به ۳,۲ همت رتبه نخست جذب منابع را در میان صندوق‌های کالایی به دست آورده است (۳۰٪ از کل جذب منابع).

// صندوق طلا در همین ماه با جذب منابع برابر با ۱,۴ همت در جایگاه دوم بیشترین خالص ورود منابع قرار می‌گیرد.

نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره در آذر ۱۴۰۳



نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره

// در آذر ۱۴۰۳ صندوق‌های کالایی در مجموع توانسته‌اند منابعی برابر با ۱۳,۹٪ از دارایی آغاز دوره‌شان جذب نمایند.

// صندوق سحرخیز در این دوره منابعی برابر با ۱۰۵٪ از دارایی آغاز دوره‌اش را توانسته جذب کند.

// در میان صندوق‌های با پشتوانه‌ی طلا صندوق نفیس در این دوره با جذب منابع برابر با ۲۷٪ از دارایی آغاز دوره در جایگاه نخست نسبت خالص ورود منابع به دارایی آغاز دوره قرار می‌گیرد.

// صندوق طلا در این ماه با ورود منابع برابر ۸٪ از دارایی آغاز دوره‌اش روبه‌رو بوده است.

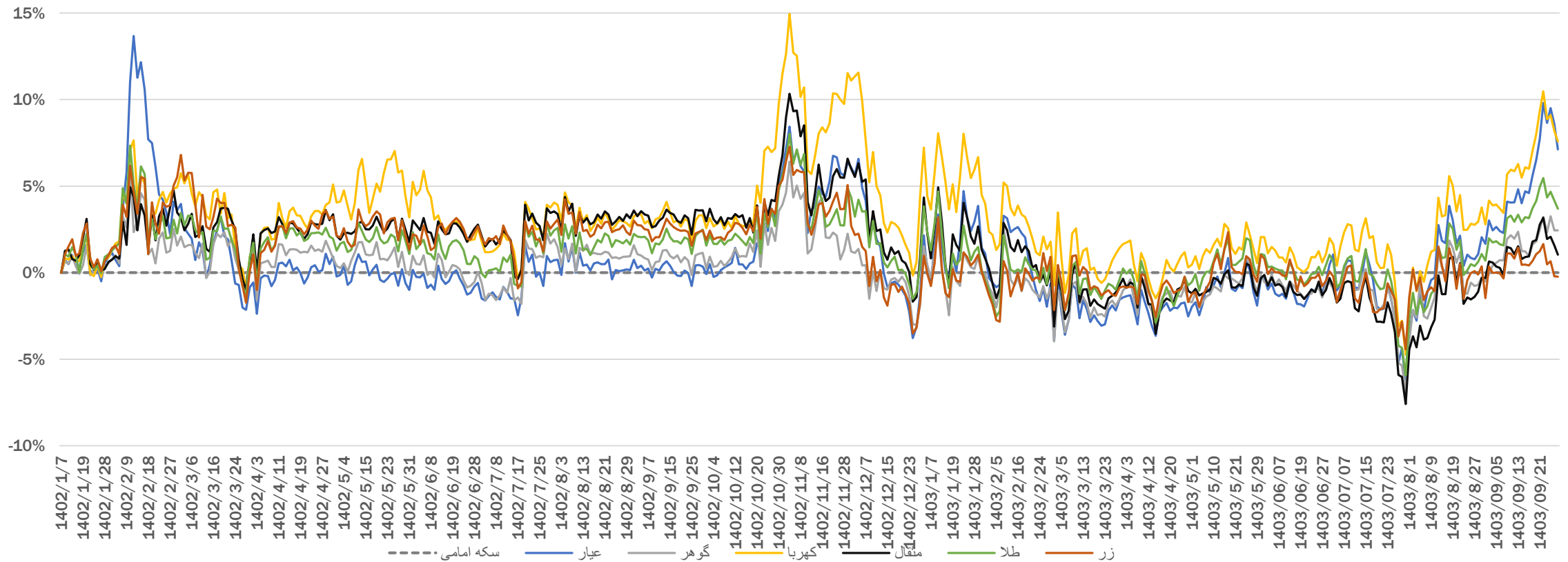
حساب قیمتی در آذر ۱۴۰۳

حساب صندوق‌های کالایی با پشتوانه طلا در آذر ۱۴۰۳								
نماد صندوق	دارایی آبان (همت)	دارایی آذر (همت)	تغییر	NAV ابطال (ریال)	قیمت پایانی (ریال)	میانگین حساب روزانه	میانگین ارزش معاملات روزانه	
							تغییر نسبت به ماه گذشته	حجم (میلیارد تومان)
گنج	3.52	4.36	23.8%	43,412	45,393	2.3%	111.0	-8%
عیار	22.71	27.91	22.9%	137,958	147,496	1.9%	813.8	14%
آلتون	2.36	2.98	26.2%	16,535	17,393	0.9%	80.4	10%
زر	1.86	2.38	28.1%	227,473	231,651	0.5%	30.8	14%
نفیس	0.54	0.73	35.5%	29,817	30,852	0.5%	28.6	276%
کهربا	8.80	10.61	20.6%	48,712	50,523	0.4%	217.4	6%
مقال	5.27	6.33	20.1%	40,659	41,635	0.3%	136.3	10%
جواهر	3.04	3.93	29.3%	19,062	19,736	0.3%	81.0	35%
طلا	18.43	21.32	15.7%	364,839	373,606	0.3%	456.1	-5%
گوهر	3.43	3.81	11.1%	247,471	254,209	0.2%	79.9	-3%
ناب	2.14	2.84	32.5%	17,320	17,939	0.1%	79.7	19%
تابش	2.63	3.08	17.3%	20,328	20,762	0.0%	46.5	-6%
زرغام	0.78	0.88	11.8%	38,647	39,769	0.0%	17.4	-30%

// جدول بالا حساب قیمتی صندوق‌های طلا را از بیشترین به کمترین نشان می‌دهد. شایان ذکر است به فاصله بین قیمت ابطال صندوق با قیمت روز آن، حساب قیمتی گفته می‌شود. خرید صندوق‌هایی که حساب کوچکتری دارند، ریسک کمتری دارد.

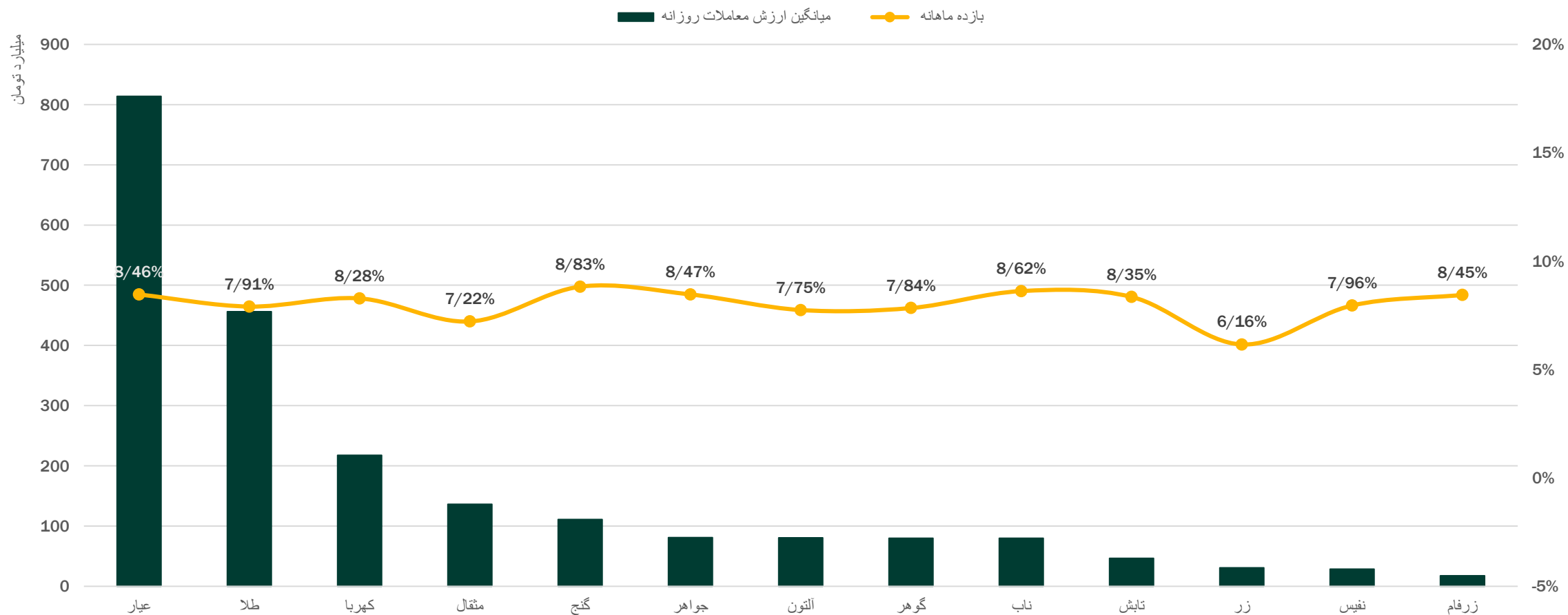
// میانگین ارزش معاملات روزانه بر اساس معاملات آذرماه محاسبه شده است. صندوق‌ها با ارزش معاملاتی بالاتر نقدشوندگی بالاتری فراهم می‌آورند.

مقایسه نسبت بازدهی قیمتی صندوق‌ها به سکه امامی از آغاز سال ۱۴۰۲ تا پایان آذر ۱۴۰۳



// مقادیر بالاتر از صفر برای این نسبت به معنی بازدهی بیشتر برای سرمایه‌گذارانی است که به جای خرید سکه امامی واحد صندوق کالایی با پشتوانه طلا را خریداری نموده‌اند.

// طی بازه‌ی زمانی یاد شده، تمام صندوق‌های مذکور به استثنای صندوق زر، توانسته‌اند عملکرد بهتری نسبت به سکه تمام امامی از خود نشان دهند.



میانگین ارزش معاملات روزانه افزون‌بر بازدهی صندوق متغیر دیگری است که در انتخاب صندوق‌های طلا باید به آن توجه کرد. صندوق‌هایی که ارزش معاملات بیشتری دارند، ریسک نقدشوندگی کمتری را به دارندگان منتقل می‌کنند.

پپوست

تغییر ترکیب دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری در آذر ۱۴۰۳

ترکیب دارایی صندوق‌ها در آغاز و پایان آذر ۱۴۰۳

سایر دارایی‌ها		گواهی سپرده کالایی		واحد صندوق		سپرده بانکی و وجه نقد		اوراق بدهی		سهام		نوع دارایی
آغاز ماه	پایان ماه	آغاز ماه	پایان ماه	آغاز ماه	پایان ماه	آغاز ماه	پایان ماه	آغاز ماه	پایان ماه	آغاز ماه	پایان ماه	نوع صندوق
0.6%	0.6%	0.0%	0.0%	3.9%	4.6%	41.3%	40.2%	49.4%	49.5%	4.7%	5.1%	صندوق درآمد ثابت
1.1%	1.0%	0.5%	0.5%	0.5%	0.2%	7.8%	6.8%	0.7%	0.4%	89.3%	91.2%	صندوق سهامی
4.9%	2.6%	0.7%	0.8%	0.0%	0.0%	22.4%	24.4%	24.2%	16.2%	47.9%	55.9%	صندوق مختلط
0.5%	0.4%	98.1%	97.4%	0.0%	0.0%	1.1%	1.9%	0.2%	0.3%	0.0%	0.0%	صندوق کالایی

تغییر ترکیب دارایی صندوق‌های سرمایه‌گذاری از آغاز سال تا آذر ۱۴۰۳

ترکیب دارایی صندوق‌ها در آغاز سال و پایان آذر ۱۴۰۳

سایر دارایی‌ها		گواهی سپرده کالایی		واحد صندوق		سپرده بانکی و وجه نقد		اوراق بدهی		سهام		نوع دارایی
ابتدای سال	پایان آذر	ابتدای سال	پایان آذر	ابتدای سال	پایان آذر	ابتدای سال	پایان آذر	ابتدای سال	پایان آذر	ابتدای سال	پایان آذر	نوع صندوق
1.5%	0.6%	0.0%	0.0%	3.4%	4.6%	34.2%	40.2%	52.5%	49.5%	8.4%	5.1%	صندوق درآمد ثابت
0.8%	1.0%	0.2%	0.5%	0.3%	0.2%	3.1%	6.8%	0.5%	0.4%	95.0%	91.2%	صندوق سهامی
1.2%	2.6%	0.5%	0.8%	0.0%	0.0%	12.7%	24.4%	22.7%	16.2%	62.9%	55.9%	صندوق مختلط
0.8%	0.4%	97.9%	97.4%	0.0%	0.0%	1.1%	1.9%	0.1%	0.3%	0.0%	0.0%	صندوق کالایی

ارزش دارایی و شمار صندوق‌های درآمد ثابت به تفکیک قابلیت معامله و تقسیم سود در پایان آذر ۱۴۰۳

دارایی تحت مدیریت و شمار صندوق‌های درآمد ثابت به تفکیک امکان معامله و تقسیم سود در پایان آذر ۱۴۰۳

شمار		سهام از دارایی تحت مدیریت		ارزش دارایی تحت مدیریت (همت)		نوع صندوق	
				ارزش کل	ارزش هر بخش		
تعداد کل	تعداد هر بخش	درصد کل	درصد هر بخش	ارزش کل	ارزش هر بخش		
87	69	69%	83%	537	448	با تقسیم سود	صدور و ابطالی
	18		17%		89	بدون تقسیم سود	
76	22	31%	19%	240	47	با تقسیم سود	قابل معامله
	54		81%		193	بدون تقسیم سود	
163		100%		777		مجموع	

