

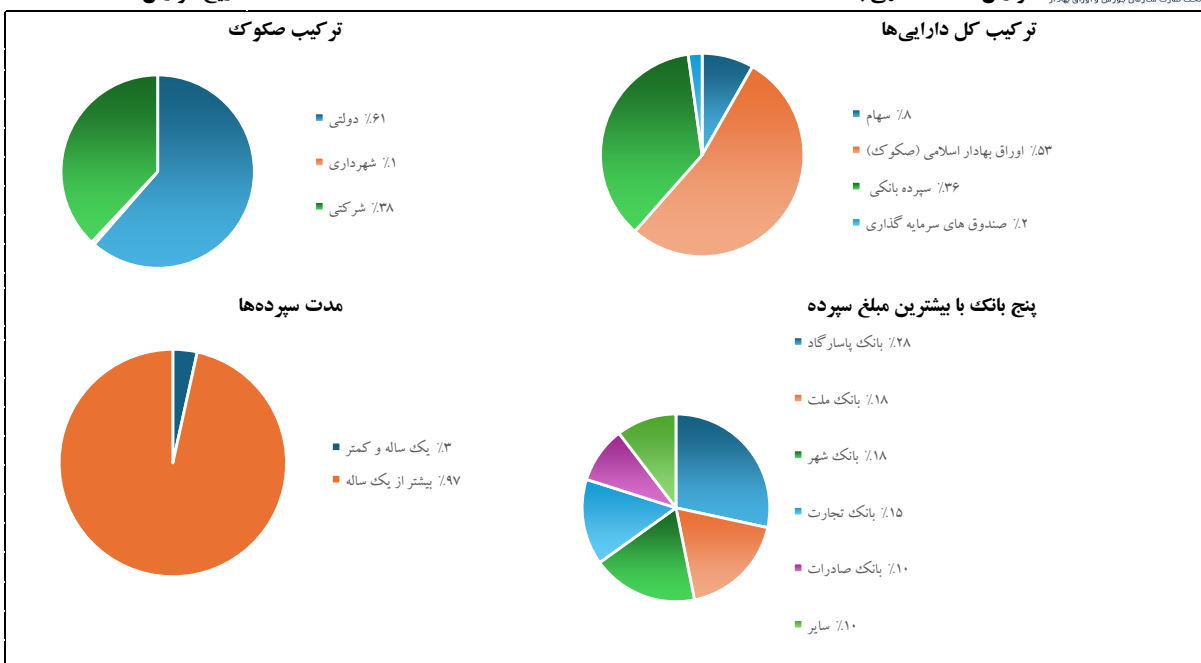
به نام خدا

گزارش درجه بندی عملکرد صندوق سرمایه گذاری ثابت آوند مفید (در اوراق بهادار با درآمد ثابت)

تاریخ گزارش: ۱۴۰۵/۰۱/۲۳

گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰

در اوراق بهادار با درآمد ثابت		نوع صندوق سرمایه گذاری:		مشخصات صندوق																																																									
تعداد اعضا	گروه همتای فراگیر:	ثابت آوند مفید	ثابت آوند مفید	نام صندوق	تاریخ آغاز فعالیت																																																								
۱۴۳ صندوق	صندوق های سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۴۰۱/۰۵/۰۱	۱۴۰۱/۰۵/۰۱	صندوق سرمایه گذاری	۱۴۰۱/۰۵/۰۱																																																								
		ندارد	ندارد	پیش بینی سود	ندارد																																																								
		ندارد	ندارد	سود نقدی	ندارد																																																								
		سیدگردان مفید	سیدگردان مفید	مدیر صندوق	سیدگردان مفید																																																								
		صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید	صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید	بازارگردانی	صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید																																																								
		ندارد	ندارد	ضامن نقدشوندگی	ندارد																																																								
		موسسه حساسیرسی رازدار	موسسه حساسیرسی رازدار	متولی	موسسه حساسیرسی رازدار																																																								
		موسسه حساسیرسی بیات رایان	موسسه حساسیرسی بیات رایان	حسابرس	موسسه حساسیرسی بیات رایان																																																								
درجه بندی عملکرد یک ساله با لحاظ عوامل تعدیل گر																																																													
۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	درجه بندی عملکرد یک ساله بدون لحاظ عوامل تعدیل گر	درجه بندی عملکرد یک ساله با لحاظ عوامل تعدیل گر																																																								
۳.۵ ستاره	۲ ستاره	۴ ستاره	۳ ستاره	۳.۵ ستاره	۲ ستاره																																																								
خوب	متوسط	خوب	متوسط	خوب	متوسط																																																								
عوامل تعدیل گر (در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۳۰)																																																													
ریسک تمرکز سرمایه گذاری ها: زیاد																																																													
سک نقدشوندگی دارایی ها و تمرکز سرمایه گذاران: کم																																																													
رتبه کیفیت مدیریت: ۴.۵ ستاره																																																													
بازدهی ماهانه صندوق در مقایسه با میانگین گروه همتای فراگیر و بازده بدون ریسک																																																													
<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="4">منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰</th> </tr> <tr> <th>یک سال</th> <th>دو سال اخیر</th> <th>سه سال اخیر</th> <th>تحلیل ریسک/ بازدهی</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>۳۲.۱٪</td> <td>۳۱.۸٪</td> <td>۳۱.۰٪</td> <td>بازدهی صندوق-سالانه</td> </tr> <tr> <td>۲۲.۶٪</td> <td>۲۲.۵٪</td> <td>۲۲.۵٪</td> <td>بازدهی بدون ریسک-سالانه^۱</td> </tr> <tr> <td>۹.۶٪</td> <td>۹.۳٪</td> <td>۸.۴٪</td> <td>بازدهی مازاد-سالانه</td> </tr> <tr> <td>۱۰.۰٪</td> <td>۸.۵٪</td> <td>۷.۴٪</td> <td>میان گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>۹.۸٪</td> <td>۸.۵٪</td> <td>۷.۰٪</td> <td>میانگین گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>۱۸.۴٪</td> <td>۱۴.۴٪</td> <td>۱۲.۱٪</td> <td>حداکثر گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>-۱۱.۴٪</td> <td>-۳.۵٪</td> <td>-۰.۷٪</td> <td>حداقل گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>۰.۰٪</td> <td>۰.۰٪</td> <td>۰.۰٪</td> <td>ریسک نامطلوب</td> </tr> <tr> <td>۰.۰٪</td> <td>۰.۱٪</td> <td>۰.۱٪</td> <td>میان گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>۰.۱٪</td> <td>۰.۱٪</td> <td>۰.۱٪</td> <td>میانگین گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>۱.۴٪</td> <td>۱.۰٪</td> <td>۰.۷٪</td> <td>حداکثر گروه همتای فراگیر</td> </tr> <tr> <td>۰.۰٪</td> <td>۰.۰٪</td> <td>۰.۰٪</td> <td>حداقل گروه همتای فراگیر</td> </tr> </tbody> </table>						منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰				یک سال	دو سال اخیر	سه سال اخیر	تحلیل ریسک/ بازدهی	۳۲.۱٪	۳۱.۸٪	۳۱.۰٪	بازدهی صندوق-سالانه	۲۲.۶٪	۲۲.۵٪	۲۲.۵٪	بازدهی بدون ریسک-سالانه ^۱	۹.۶٪	۹.۳٪	۸.۴٪	بازدهی مازاد-سالانه	۱۰.۰٪	۸.۵٪	۷.۴٪	میان گروه همتای فراگیر	۹.۸٪	۸.۵٪	۷.۰٪	میانگین گروه همتای فراگیر	۱۸.۴٪	۱۴.۴٪	۱۲.۱٪	حداکثر گروه همتای فراگیر	-۱۱.۴٪	-۳.۵٪	-۰.۷٪	حداقل گروه همتای فراگیر	۰.۰٪	۰.۰٪	۰.۰٪	ریسک نامطلوب	۰.۰٪	۰.۱٪	۰.۱٪	میان گروه همتای فراگیر	۰.۱٪	۰.۱٪	۰.۱٪	میانگین گروه همتای فراگیر	۱.۴٪	۱.۰٪	۰.۷٪	حداکثر گروه همتای فراگیر	۰.۰٪	۰.۰٪	۰.۰٪	حداقل گروه همتای فراگیر
منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰																																																													
یک سال	دو سال اخیر	سه سال اخیر	تحلیل ریسک/ بازدهی																																																										
۳۲.۱٪	۳۱.۸٪	۳۱.۰٪	بازدهی صندوق-سالانه																																																										
۲۲.۶٪	۲۲.۵٪	۲۲.۵٪	بازدهی بدون ریسک-سالانه ^۱																																																										
۹.۶٪	۹.۳٪	۸.۴٪	بازدهی مازاد-سالانه																																																										
۱۰.۰٪	۸.۵٪	۷.۴٪	میان گروه همتای فراگیر																																																										
۹.۸٪	۸.۵٪	۷.۰٪	میانگین گروه همتای فراگیر																																																										
۱۸.۴٪	۱۴.۴٪	۱۲.۱٪	حداکثر گروه همتای فراگیر																																																										
-۱۱.۴٪	-۳.۵٪	-۰.۷٪	حداقل گروه همتای فراگیر																																																										
۰.۰٪	۰.۰٪	۰.۰٪	ریسک نامطلوب																																																										
۰.۰٪	۰.۱٪	۰.۱٪	میان گروه همتای فراگیر																																																										
۰.۱٪	۰.۱٪	۰.۱٪	میانگین گروه همتای فراگیر																																																										
۱.۴٪	۱.۰٪	۰.۷٪	حداکثر گروه همتای فراگیر																																																										
۰.۰٪	۰.۰٪	۰.۰٪	حداقل گروه همتای فراگیر																																																										
تاریخچه درجه بندی																																																													
بدون لحاظ عوامل تعدیلگر				با لحاظ عوامل تعدیلگر																																																									
۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۹/۳۰																																																						
NA	NA	۳.۵ ستاره	۳ ستاره	NA	NA	۴ ستاره	۴ ستاره																																																						
۴ ستاره	۴ ستاره	۴ ستاره	۲.۵ ستاره	NA	۴.۵ ستاره	۴.۵ ستاره	۳.۵ ستاره																																																						
۳ ستاره	۴ ستاره	۳.۵ ستاره	۲ ستاره	NA	۴.۵ ستاره	۴ ستاره	۳ ستاره																																																						
اطلاعات واحدهای سرمایه گذاری (در تاریخ های مذکور)																																																													
۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	خالص ارزش دارایی ها (میلیون ریال)																																																									
۱۶۱,۰۵۱,۹۳۳	۲۰۱,۴۰۰,۷۲۰	۲۷۸,۵۶۰,۶۴۱	۳۲۸,۹۲۵,۳۱۳	ارزش ابطال هر واحد سرمایه گذاری (ریال)																																																									
۱۹,۰۵۹	۲۰,۴۶۴	۲۲,۱۷۷	۲۳,۹۰۷	تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی																																																									
۸,۴۵۰,۲۶۹,۴۷۸	۹,۸۴۱,۷۰۸,۳۵۰	۱۲,۵۶۰,۷۰۰,۹۷۲	۱۳,۷۵۸,۷۳۱,۹۸۷	اطلاعات مالی (در دوره سه ماهه منتهی به تاریخ های مذکور) (میلیون ریال)																																																									
۱۴۰۳-۱۱-۳۰	۱۴۰۴-۰۲-۳۱	۱۴۰۴-۰۵-۳۱	۱۴۰۴-۰۸-۳۰	جمع درآمدها																																																									
۱۰,۱۸۹,۳۶۳	۱۳,۱۷۶,۹۲۰	۱۶,۹۹۸,۸۸۴	۲۲,۵۷۱,۱۰۳	سود (زیان) فروش اوراق بهادار																																																									
(۳۴۷,۷۲۴)	۱,۴۳۲,۸۲۱	۳۶۳,۱۲۰	۲۵۱,۸۷۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار																																																									
۲,۶۹۸,۱۹۷	(۱,۰۳۴,۳۵۱)	۲,۳۴۶,۳۳۱	(۲,۷۴۲,۱۶۳)	سود سهام																																																									
.	.	۳۷۲,۱۱۹	۶,۰۸۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا سود سپرده بانکی																																																									
۷,۸۳۸,۹۵۴	۸,۱۱۸,۵۷۷	۱۲,۸۱۷,۰۶۹	۱۷,۹۳۰,۳۱۹	سایر درآمدها																																																									
(۶۴)	۴,۶۵۹,۸۷۳	۱,۰۹۰,۲۴۵	۷,۱۲۴,۹۸۵	نسبت هزینه به ارزش خالص دارایی ها (درصد)																																																									
NA	۰.۱۹۸٪	NA	۰.۱۹۸٪	هزینه کارمزد ارکان																																																									
۳۰۱,۰۷۳	۳۹۱,۴۰۴	۴۹۲,۴۹۰	۶۳۳,۹۰۰	هزینه معاملات																																																									
NA	۳۳۷	NA	۵,۵۶۷	سایر هزینه ها																																																									
۷,۷۵۸	۶,۳۸۱	۶,۸۵۴	۱۱,۶۳۶																																																										
۱. درجه بندی با لحاظ عوامل تعدیل گر حداقل ۰.۵ و حداکثر ۵ ستاره و درجه بندی بدون لحاظ عوامل تعدیل گر حداقل ۰.۵ و حداکثر ۴ ستاره می باشد.																																																													
۲. نرخ بازده بدون ریسک برابر با نرخ مصوب برای سود سپرده یک ساله بانکی است.																																																													



توزیع ریسک‌های تمرکز و نقدشوندگی در صندوق‌های گروه همتای فراگیر

سطح ریسک	ریسک تمرکز سبد دارایی‌ها		ریسک نقدشوندگی سبد دارایی‌ها	
	تعداد صندوق	نسبت از کل	تعداد صندوق	نسبت از کل
بسیار زیاد	۵۶	۳۹٪	۱۰	۷٪
زیاد	۸۷	۶۱٪	۶۰	۴۲٪
متوسط	۰	۰٪	۶۲	۴۳٪
کم	۰	۰٪	۱۱	۸٪
بسیار کم	۰	۰٪	۰	۰٪
جمع	۱۴۳	۱۰۰٪	۱۴۳	۱۰۰٪

درجه‌بندی صندوق بر مبنای سایر معیارهای ارزیابی عملکرد (بر اساس عملکرد سه ساله بدون لحاظ عوامل تعدیل‌گر)

شرح	امتیاز برهان		مورنینگ استار		نسبت شارپ بر مبنای ...	
	ستاره	میانگین	انحراف معیار	نیم انحراف معیار	ریسک نامطلوب	ریسک نامطلوب
حداکثر گروه همتای فراگیر	۰.۰۰۷۱	۰.۱۰	۱.۵۱	۲.۷۱	۸۶.۱۰	۸۶.۱۰
حداقل گروه همتای فراگیر	-۰.۰۰۶۹	-۰.۰۱	-۰.۰۱	۰.۰۰	-۰.۰۲	-۰.۰۲
میانگین گروه همتای فراگیر	۰.۰۰۳۴	۰.۰۶	۰.۶۳	۱.۱۷	۸.۷۴	۸.۷۴
میانه گروه همتای فراگیر	۰.۰۰۳۸	۰.۰۶	۰.۶۰	۱.۰۷	۴.۶۳	۴.۶۳
امتیاز صندوق موضوع رتبه‌بندی	۰.۰۰۵۴	۰.۰۷	۱.۱۶	۱.۹۶	۲۴.۴۴	۲۴.۴۴
جایگاه صندوق موضوع رتبه‌بندی	۳ ستاره	۳ ستاره	۴ ستاره	۴ ستاره	۴ ستاره	۴ ستاره

توضیحات:

* مقیاس درجه‌بندی: درجه‌بندی عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری بر اساس شاخص ارزیابی عملکرد برهان بدون لحاظ عوامل تعدیل‌گر، حداقل نیم و حداکثر پنج ستاره تعیین می‌شود (نیم ستاره ضعیف‌ترین و پنج ستاره بهترین عملکرد است).

* اطلاعات بدون تاریخ، مربوط به تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۳۰ است.

* علامت NA: نشان می‌دهد که اطلاعات مورد نظر در دسترس نمی‌باشد و در صورتی که اطلاعات مورد نظر در رتبه‌بندی عملکرد صندوق موضوع رتبه‌بندی تاثیرگذار باشد کمترین امتیاز لحاظ می‌گردد.

* برای اطلاعات بیشتر در مورد معیار درجه‌بندی عملکرد، به شیوه‌نامه درجه‌بندی عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری شرکت رتبه‌بندی اعتباری برهان، منتشره در تارنمای این شرکت به نشانی www.bcr.ir، بخش قوانین، مقررات و ضوابط / شیوه‌نامه‌های رتبه‌بندی مراجعه فرمائید.

بیانیه سلب مسئولیت :

* عملکرد صندوق در آینده می‌تواند متفاوت از عملکرد گذشته صندوق باشد. بنابراین سرمایه‌گذاران در تصمیم‌گیری باید به عوامل دیگری غیر از عملکرد گذشته توجه داشته باشند.

* درجه‌بندی ارائه شده توسط شرکت رتبه‌بندی اعتباری برهان، توصیه‌ای به سرمایه‌گذاری، نگهداری یا واگذاری واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق محسوب نمی‌شود.

* این گزارش بر مبنای اطلاعات دریافتی از منابع معتبر از جمله مدیر صندوق، سازمان بورس و اوراق بهادار و اطلاعات منتشره در تارنماهی رسمی صندوق، شرکت فرابورس ایران و سامانه اطلاع‌رسانی ناشران (www.codal.ir) تهیه شده است. مسئولیت صحت اطلاعات منابع مذکور، به عهده برهان نیست.