

گزارش درجه بندی عملکرد صندوق سرمایه گذاری لیخنه فارابی (در اوراق بهادار با درآمد ثابت)

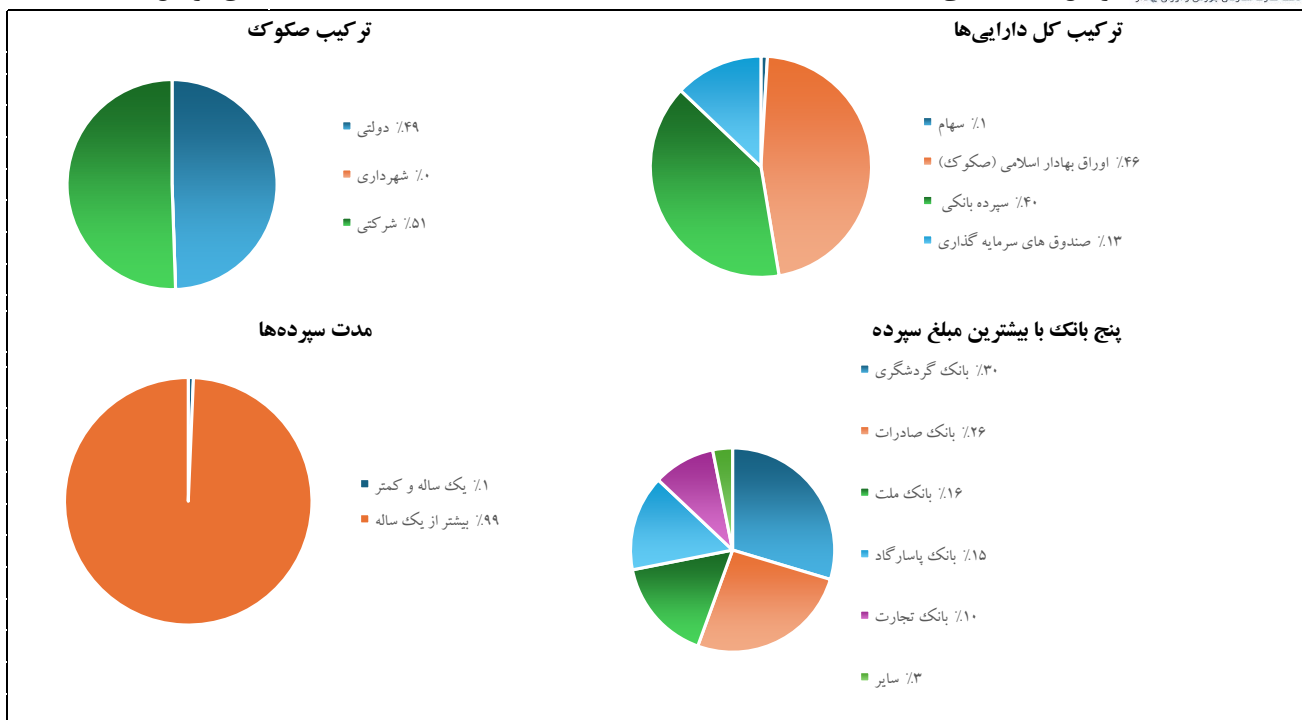
تاریخ گزارش: ۱۴۰۴/۰۴/۲۹

گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۲/۳۰

نوع صندوق سرمایه‌گذاری:		در اوراق بهادار با درآمد ثابت		تعداد اعضا		۱۳۵ صندوق	
گروه همتای فراگیر:				صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت			
درجه بندی با لحاظ عوامل تعدیلگر		درجه بندی بدون لحاظ عوامل تعدیلگر <sup>۱</sup>		درجه بندی با لحاظ عوامل تعدیلگر		درجه بندی بدون لحاظ عوامل تعدیلگر	
۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۳/۰۹/۳۰
۴ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره
خوب	خوب	خوب	خوب	خوب	خوب	خوب	خوب
عوامل تعدیلگر							
ریسک تمرکز:				زیاد			
ریسک نقدشوندگی و تمرکز سرمایه‌گذاران:				متوسط			
رتبه کیفیت مدیریت:				۳ ستاره			
بازدهی ماهانه صندوق در مقایسه با میانگین گروه همتای فراگیر و بازده بدون ریسک							
متنهی به ۱۴۰۳/۱۲/۳۰				تحلیل ریسک/ بازدهی			
یک ساله	دو ساله	سه ساله	بازدهی	یک ساله	دو ساله	سه ساله	بازدهی
۳۲.۷٪	۲۹.۹٪	NA	بازدهی صندوق-سالانه	۲۲.۶٪	۲۲.۵٪	۰.۰٪	بازدهی بدون ریسک-سالانه <sup>۲</sup>
۱۰.۱٪	۷.۴٪	NA	بازدهی مازاد-سالانه	۸.۲٪	۵.۷٪	۵.۲٪	میانگین گروه همتای فراگیر
۷.۹٪	۵.۴٪	۴.۷٪	میانگین گروه همتای فراگیر	۱۶.۳٪	۱۱.۲٪	۱۰.۰٪	حد اکثر گروه همتای فراگیر
۰.۰٪	۰.۱٪	-۲.۳٪	حد اقل گروه همتای فراگیر	-۱۲.۵٪	-۶.۲٪	-۲.۳٪	ریسک نامطلوب
۰.۰٪	۰.۱٪	۰.۱٪	میانگین گروه همتای فراگیر	۰.۰٪	۰.۱٪	۰.۱٪	میانگین گروه همتای فراگیر
۰.۱٪	۰.۲٪	۰.۲٪	حد اکثر گروه همتای فراگیر	۱.۶٪	۱.۰٪	۰.۹٪	حد اکثر گروه همتای فراگیر
۰.۰٪	۰.۰٪	۰.۰٪	حد اقل گروه همتای فراگیر	۰.۰٪	۰.۰٪	۰.۰٪	حد اقل گروه همتای فراگیر
تاریخچه درجه بندی							
بدون لحاظ عوامل تعدیلگر		با لحاظ عوامل تعدیلگر		بدون لحاظ عوامل تعدیلگر		با لحاظ عوامل تعدیلگر	
۱۴۰۳/۰۳/۳۱	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۳۰
NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA	NA
NA	۴ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	NA	۳ ستاره	۳ ستاره	۴ ستاره
۳ ستاره	۴ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۴ ستاره
اطلاعات واحدهای سرمایه‌گذاری (در تاریخ‌های مذکور)							
۱۴۰۳-۰۳-۳۱	۱۴۰۳-۰۶-۳۱	۱۴۰۳-۰۹-۳۰	۱۴۰۳-۱۲-۳۰	ارزش خالص دارایی‌ها (میلیون ریال)			
۵۴,۲۲۶,۴۰۸	۸۵,۱۴۷,۴۲۵	۸۰,۶۷۴,۳۰۸	۱۱۳,۵۳۹,۶۴۱	ارزش ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)			
۱۵,۵۰۷	۱۶,۶۱۹	۱۷,۸۳۰	۱۹,۲۸۵	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری عادی			
۳,۴۹۶,۹۸۸,۶۸۵	۵,۱۲۳,۴۹۸,۶۸۵	۴,۵۲۴,۶۳۸,۶۸۵	۵,۸۱۷,۴۵۸,۶۸۵	اطلاعات مالی (در دوره سه‌ماهه منتهی به تاریخ‌های مذکور) (میلیون ریال)			
۱۴۰۳-۰۳-۳۱	۱۴۰۳-۰۶-۳۱	۱۴۰۳-۰۹-۳۰	۱۴۰۳-۱۲-۳۰	جمع درآمد ها			
۳,۲۰۵,۷۴۳	۴,۶۲۹,۰۰۷	۶,۰۰۲,۴۳۷	۸,۰۶۸,۸۷۸	سود (زیان) فروش اوراق بهادار			
۱۲,۹۰۹	۶۴۵,۳۲۱	۶۲۱,۳۹۷	۸۱,۱۶۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار			
۷۵۹,۵۸۶	(۸۱,۴۷۴)	۲۹۵,۲۵۷	۱,۷۸۹,۷۰۴	سود سهام			
۱۳,۰۵۲	۳۴,۱۳۲	۸۳	۳,۸۴۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا سود سپرده بانکی			
۲,۴۲۰,۱۹۷	۴,۰۳۱,۰۲۷	۵,۰۸۵,۸۲۴	۶,۱۹۱,۰۴۳	سایر درآمدها			
(۱)	۱	(۱۲۴)	۳,۱۱۷	نسبت هزینه به ارزش خالص دارایی‌ها (درصد)			
۰.۱۸۰٪	۰.۱۵۲٪	۰.۱۹۷٪	NA	هزینه کارمزد ارکان			
۸۹,۵۸۱	۱۱۹,۳۸۹	۱۴۸,۸۹۹	۱۷۴,۰۱۵	هزینه معاملات			
۳,۸۳۹	۵,۲۹۶	۳,۶۵۴	NA	سایر هزینه ها			
۴,۲۱۶	۴,۸۲۶	۶,۱۲۱	۷,۵۷۲				

۱. درجه بندی با لحاظ عوامل تعدیلگر از ۵ ستاره و درجه بندی بدون لحاظ عوامل تعدیلگر از ۴ ستاره می باشد

۲. نرخ بازده بدون ریسک برابر است با نرخ مصوب برای سود سپرده یک ساله بانکی است.



**توزیع ریسک‌های تمرکز و نقدشوندگی در صندوق‌های گروه همتای فراگیر**

سطح ریسک	ریسک تمرکز سید دارایی های صندوق		ریسک نقدشوندگی سید دارایی های صندوق	
	تعداد صندوق	نسبت از کل	تعداد صندوق	نسبت از کل
بسیار زیاد	۵۳	۳۹٪	۴۲	۳۱٪
زیاد	۸۲	۶۱٪	۳۲	۲۴٪
متوسط	۰	۰٪	۲۷	۲۰٪
کم	۰	۰٪	۲۲	۱۶٪
بسیار کم	۰	۰٪	۱۲	۹٪
<b>جمع</b>	<b>۱۳۵</b>	<b>۱۰۰٪</b>	<b>۱۳۵</b>	<b>۱۰۰٪</b>

سایر معیار های ارزیابی عملکرد صندوق ها (حداکثر ۴ ستاره و بدون لحاظ عوامل تعدیلگر می‌باشند و این شاخص‌ها فقط برای صندوق‌هایی که حداقل ۳ سال از فعالیت آن‌ها گذشته است، محاسبه می‌شوند)

شرح	نسبت شارپ بر مبنای ...				
	امتیاز برهان	مورنینگ استار	انحراف معیار	نیم انحراف معیار	ریسک نامطلوب
حداکثر گروه همتای فراگیر	۰.۰۰۶۵	۰.۰۰۸	۱.۰۲	۲.۱۵	۳۷.۰۶
حداقل گروه همتای فراگیر	-۰.۰۰۸۷	-۰.۰۰۳	-۰.۰۰۵	-۰.۰۰۴	-۰.۰۱۸
میانگین گروه همتای فراگیر	۰.۰۰۱۵	۰.۰۰۴	۰.۴۳	۰.۸۷	۴.۱۵
میانه گروه همتای فراگیر	۰.۰۰۲۳	۰.۰۰۴	۰.۴۵	۰.۸۴	۲.۸۰
امتیاز صندوق موضوع رتبه‌بندی	۰.۰۰۰۰	۰.۰۰۰	۰.۰۰۰	۰.۰۰۰	۰.۰۰۰
جایگاه صندوق موضوع رتبه‌بندی	NA	NA	NA	NA	NA

**توضیحات:**

\* مقیاس درجه‌بندی: صندوق‌های سرمایه‌گذاری بر اساس شاخص ارزیابی عملکرد برهان مرتب شده و مطابق با توزیع آماری یکنواخت به هشت دسته تقسیم می‌شوند که فراوانی هر دسته برابر با ۱۲.۵ درصد از جامعه است؛ هشتک اول، نیم ستاره دریافت می‌کند و به ترتیب به هشتک‌های بعدی هر کدام نیم ستاره اضافه می‌شود (یعنی هشتک دوم ۱ ستاره، هشتک سوم ۱.۵ ستاره و به همین ترتیب هشتک هشتم ۴ ستاره دریافت می‌کند).

\* اطلاعات بدون تاریخ، مربوط به تاریخ پایان آخرین فصل قبل از تاریخ گزارش هستند.

\* علامت NA: نشان می‌دهد که اطلاعات مورد نظر در دسترس نمی‌باشد و در صورتی که اطلاعات مورد نظر در رتبه‌بندی عملکرد صندوق موضوع رتبه‌بندی تأثیرگذار 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](http://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 تارنمای رسمی صندوق، شرکت فرابورس ایران و سامانه اطلاع رسانی ناشران ([www.codal.ir](http://www.codal.ir)) تهیه شده است. مسئولیت صحت اطلاعات منابع مذکور، به عهده برهان نیست.