



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد شش ماه

منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۷

فهرست مطالب

عنوان صفحه

| | |
|---|--|
| ۳ | <u>۱- مقدمه</u> |
| ۳ | <u>۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه</u> |
| ۴ | <u>۱-۲- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری</u> |
| ۵ | <u>۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق</u> |
| ۶ | <u>۳- بررسی عملکرد صندوق</u> |
| ۶ | <u>۳-۱- بازده صندوق</u> |

۱ - مقدمه

صندوق توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار به‌عنوان صندوق سرمایه‌گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذرماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۱۱۳۰ نزد سبا به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه است. فعالیت این صندوق تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار انجام شده و متولی صندوق نیز به‌طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل سهام شرکت‌های پذیرفته‌شده در بورس می‌شود، توسط مدیر سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه‌گذاری دریافت می‌کنند.

۲ - صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه

| مشخصات کلی صندوق سرمایه‌گذاری توسعه بازار سرمایه | |
|--|--------------|
| شماره ثبت اداره ثبت شرکت‌ها: | ۳۰۸۹۵ |
| شناسه ملی: | ۱۰۳۲۰۸۴۹۸۴۶ |
| تاریخ ثبت: | ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ |
| شماره ثبت سازمان بورس: | ۱۱۱۳۰ |
| شماره پرونده مالیاتی: | ۱۰۴۰۰۴۳۲۶۷۸۶ |
| شماره کد اقتصادی: | ۴۱۱۴۱۹۶۴۴۳۱۹ |
| واحد مالیاتی: | ۴۰۱۳۲۳ |
| کلاس پرونده: | ۴۸۷ |
| تاریخ ترازنامه: | ۱۳۹۷/۰۴/۳۱ |
| شروع فعالیت: | ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ |
| دوره فعالیت: | نامحدود |

ارکان صندوق

| | |
|--------|--------------------------------------|
| مدیر | هیأت مدیره صندوق |
| متولی | مشاور سرمایه‌گذاری تأمین سرمایه نوین |
| حسابرس | موسسه حسابرسی رهبین |



۲-۱ - مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری

صندوق توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با سرمایه اولیه ۳۰۰،۰۰۰ میلیون ریال توسط ۱۰ شرکت تأسیس شد که طی چند مرحله این سرمایه به ۱۲،۷۸۶،۵۸۹ میلیون ریال افزایش یافته است. تغییرات مذکور به شرح جدول زیر ارائه شده است.

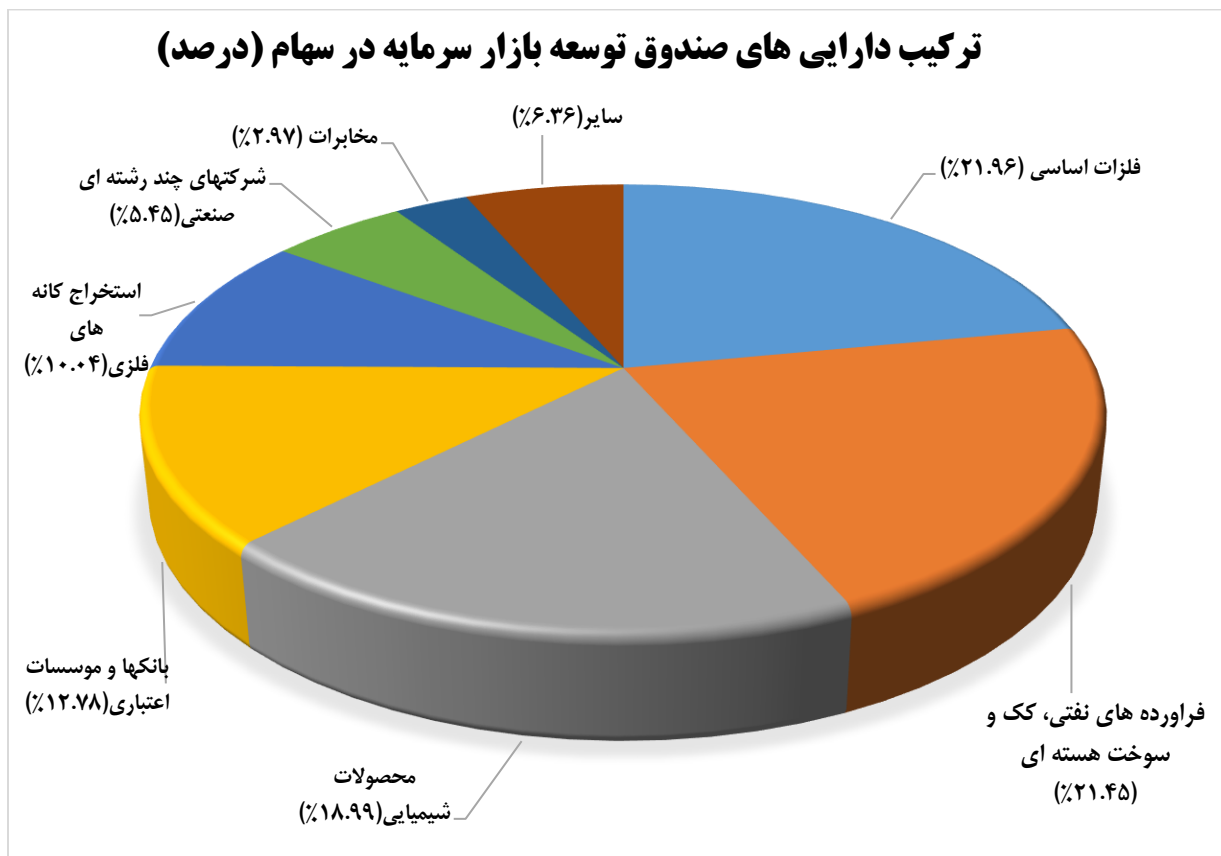
| ردیف | نام شرکت | واحدهای صدور در زمان تاسیس | واحدهای سرمایه گذاری در ۹۶/۰۴/۳۱ | واحدهای سرمایه گذاری در ۹۷/۰۴/۳۱ | واحدهای سرمایه گذاری در ۹۷/۱۰/۳۰ |
|------|--------------------------------------|----------------------------------|--|--|--|
| ۱ | بانک تجارت | ۰ | ۱،۹۱۰،۱۸۶ | ۲،۸۷۳،۱۷۵ | ۲،۷۱۳،۵۱۷ |
| ۲ | بانک ملی | ۰ | ۱،۶۰۹،۳۸۶ | ۱،۹۶۶،۵۲۱ | ۲،۰۲۸،۳۷۰ |
| ۳ | بانک صادرات | ۰ | ۱،۵۴۴،۶۰۵ | ۱،۶۳۰،۶۴۵ | ۱،۶۳۰،۶۴۵ |
| ۴ | گروه مالی ملت | ۰ | ۱،۴۳۹،۱۸۳ | ۱،۵۳۵،۳۶۰ | ۱،۵۳۵،۳۶۰ |
| ۵ | بانک سپه | ۰ | ۹۷۸،۵۰۰ | ۱،۰۷۵،۰۸۸ | ۱،۰۷۵،۰۸۸ |
| ۶ | گروه مدیریت سرمایه گذاری امید | ۰ | ۴۳۴،۴۲۴ | ۶۹۴،۹۷۱ | ۶۹۴،۹۷۱ |
| ۷ | بانک پاسارگاد | ۰ | ۶۵۰،۲۵۶ | ۶۵۰،۲۵۶ | ۶۵۰،۲۵۶ |
| ۸ | بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران | ۰ | ۶۰۵،۱۱۹ | ۶۰۵،۱۱۹ | ۶۰۵،۱۱۹ |
| ۹ | بیمه ایران | ۰ | ۵۲۹،۴۰۵ | ۵۲۹،۴۰۵ | ۵۲۹،۴۰۵ |
| ۱۰ | گروه مالی بانک پارسیان | ۰ | ۱۹۸،۳۷۰ | ۱۹۷،۹۶۸ | ۱۹۷،۹۶۸ |
| ۱۱ | بانک اقتصاد نوین | ۰ | ۱۹۵،۷۷۳ | ۱۹۵،۷۷۳ | ۱۹۵،۷۷۳ |
| ۱۲ | صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی | ۰ | ۰ | ۱۹۳،۱۷۷ | ۱۹۳،۱۷۷ |
| ۱۳ | بانک گردشگری | ۰ | ۱۸۷،۴۹۹ | ۱۸۷،۴۹۹ | ۱۸۷،۴۹۹ |
| ۱۴ | بانک صنعت و معدن | ۰ | ۱۱۵،۳۳۹ | ۱۱۵،۳۳۹ | ۱۱۵،۳۳۹ |
| ۱۵ | تامین سرمایه تمدن | ۰ | ۵۵،۲۳۳ | ۵۵،۲۳۳ | ۵۵،۲۳۳ |
| ۱۶ | سرمایه گذاری غدیر | ۵۰،۰۰۰ | ۵۰،۰۰۰ | ۵۰،۰۰۰ | ۵۰،۰۰۰ |
| ۱۷ | سرمایه گذاری فرهنگیان | ۵۰،۰۰۰ | ۵۰،۰۰۰ | ۵۰،۰۰۰ | ۵۰،۰۰۰ |
| ۱۸ | سرمایه گذاری گروه توسعه ملی | ۰ | ۰ | ۴۴،۴۶۹ | ۴۴،۴۶۹ |
| ۱۹ | صندوق بیمه اجتماعی روستائیان و عشایر | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ |
| ۲۰ | سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ |
| ۲۱ | بانک سامان | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ |
| ۲۲ | گروه سرمایه گذاری سایپا | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ | ۳۵،۰۰۰ |
| ۲۳ | صنعتی و معدنی توسعه ملی | ۰ | ۴۵،۸۸۰ | ۴۵،۸۸۰ | ۳۴،۴۱۰ |
| ۲۴ | گروه سرمایه گذاری تدبیر | ۲۵،۰۰۰ | ۳۰،۰۰۰ | ۳۰،۰۰۰ | ۳۰،۰۰۰ |
| ۲۵ | بانک کشاورزی | ۱۵،۰۰۰ | ۱۵،۰۰۰ | ۱۵،۰۰۰ | ۱۵،۰۰۰ |
| ۲۶ | شرکت تامین سرمایه امین | ۱۰،۰۰۰ | ۱۰،۰۰۰ | ۱۰،۰۰۰ | ۱۰،۰۰۰ |
| ۲۷ | شرکت سرمایه گذاری پردیس | ۵،۰۰۰ | ۵،۰۰۰ | ۵،۰۰۰ | ۵،۰۰۰ |
| ۲۸ | سرمایه گذاری و توسعه صنایع سیمان | ۰ | ۴۴،۸۶۳ | ۰ | ۰ |
| | جمع | ۲۹۵،۰۰۰ | ۱۰،۸۴۴،۰۱۱ | ۱۲،۸۹۵،۸۶۸ | ۱۲،۷۸۶،۵۸۹ |

۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۷/۱۰/۳۰

سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صنایعی که صندوق در آن ها به بازارگردانی سهام می‌پردازد از ۲۲ صنعت، در تاریخ ۹۷/۱۰/۳۰ به ۱۹ صنعت تغییر یافته است.

| صنعت | درصد از کل دارایی های صندوق به ارزش روز ۱۳۹۷/۱۰/۳۰ |
|--------------------------------------|--|
| فلزات اساسی | ۱۶,۸۶٪ |
| فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای | ۱۶,۴۶٪ |
| محصولات شیمیایی | ۱۴,۵۷٪ |
| بانکها و موسسات اعتباری | ۹,۸۱٪ |
| استخراج کانه های فلزی | ۷,۷۱٪ |
| شرکتهای چند رشته ای صنعتی | ۴,۱۸٪ |
| مخابرات | ۲,۲۸٪ |
| خودرو و ساخت قطعات | ۱,۳۶٪ |
| خدمات فنی و مهندسی | ۱,۱۷٪ |
| حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات | ۰,۹۶٪ |
| عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم | ۰,۷۲٪ |
| رایانه و فعالیت های وابسته به آن | ۰,۲۳٪ |
| مواد و محصولات دارویی | ۰,۲۲٪ |
| ماشین آلات و دستگاه های برقی | ۰,۱۱٪ |
| سرمایه گذاریها | ۰,۰۵٪ |
| خدمات ارزش افزوده | ۰,۰۴٪ |
| ساخت محصولات فلزی | ۰,۰۲٪ |
| فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط | ۰,۰۱٪ |
| سایر محصولات کانی غیر فلزی | ۰,۰۰٪ |

۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۱۰/۳۰



۳-۱ بازده صندوق

بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

| بازده بازار | بازده صندوق | از تاریخ | توضیحات |
|-------------|-------------|------------|--------------|
| ۰.۶۵۷٪ | ۱.۷۵۴٪ | ۱۳۹۷/۱۰/۲۳ | هفته گذشته |
| ۶.۰۸۱٪ | ۸.۵۳۲٪ | ۱۳۹۷/۰۹/۳۰ | ماه گذشته |
| -۱۱.۸۲۴٪ | -۱۰.۸۲٪ | ۱۳۹۷/۰۷/۳۰ | ۳ ماه گذشته |
| ۵۲.۷۵٪ | ۳۸.۰۹۶٪ | ۱۳۹۷/۰۴/۳۱ | ۶ ماه گذشته |
| ۶۷.۵۵۷٪ | ۴۰.۲۱۱٪ | ۱۳۹۶/۱۰/۳۰ | یک سال گذشته |

با توجه به خالص ارزش روز واحدهای سرمایه گذاری، نرخ بازدهی صندوق برای دوره‌های زمانی ماهانه در شش ماه اخیر به شرح زیر می باشد:

| بازدهی | دوره |
|----------|----------------------------|
| ۱۹,۸۴۸٪ | ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ |
| ۱۳,۴۶۳٪ | ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۳۱ |
| ۱۳,۶۰۱٪ | ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰ |
| -۷,۴۷۱٪ | ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰ |
| -۱۱,۱۹۶٪ | ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰ |
| ٪۸.۵۳۳ | ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۰/۳۰ |

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۱۰/۳۰ به شرح نمودار ذیل می باشد:

روند تغییرات ارزش خالص واحدهای سرمایه گذاری و شاخص کل

