



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد شش ماهه

منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۸

فهرست مطالب

- ۱ - مقدمه ۳
- ۲ - صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه ۳
- ۲ - ۱ - مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ۴
- ۲ - ۲ - ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۳۰ ۵
- ۳ - بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۳۰ ۶
- ۳-۱ - بازده صندوق ۶
- ۴ - وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری ۸
- ۵ - قیمت میانگین واحدهای سرمایه‌گذاری برای دارندگان ۹



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 ۱۲,۶۲۷,۵۸۹ میلیون ریال افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می باشد:

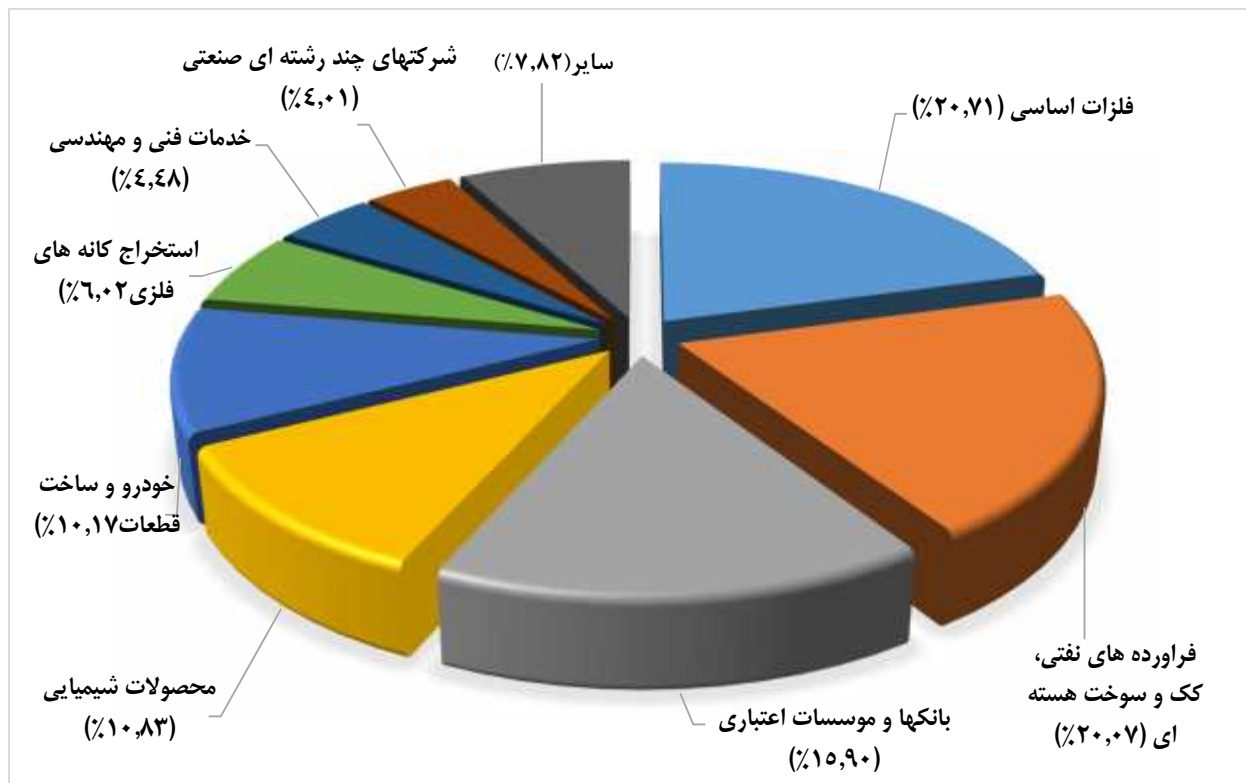
ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۸/۱۰/۳۰	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۲,۵۵۴,۵۱۷	۲۰.۲۳%
۲	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۱۶.۰۶%
۳	بانک صادرات	۱,۶۳۰,۶۴۵	۱۲.۹۱%
۴	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۱۲.۱۶%
۵	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۸.۵۱%
۶	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۵.۵۰%
۷	بانک پاسارگاد	۶۵۰,۲۵۶	۵.۱۵%
۸	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۰۵,۱۱۹	۴.۷۹%
۹	بیمه ایران	۵۲۹,۴۰۵	۴.۱۹%
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۱۹۷,۹۶۸	۱.۵۷%
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۱۹۵,۷۷۳	۱.۵۵%
۱۲	صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی	۱۹۳,۱۷۷	۱.۵۳%
۱۳	بانک گردشگری	۱۸۷,۴۹۹	۱.۴۸%
۱۴	بانک صنعت و معدن	۱۱۵,۳۲۹	۰.۹۱%
۱۵	تامین سرمایه تمدن	۵۵,۲۳۳	۰.۴۴%
۱۶	سرمایه گذاری غدیر	۵۰,۰۰۰	۰.۴۰%
۱۷	سرمایه گذاری فرهنگیان	۵۰,۰۰۰	۰.۴۰%
۱۸	سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۴۴,۴۶۹	۰.۳۵%
۱۹	صندوق بیمه اجتماعی روستائیان و عشایر	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۰	سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۱	بانک سامان	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۲	گروه سرمایه گذاری سایپا	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۳	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۳۴,۴۱۰	۰.۲۷%
۲۴	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۳۰,۰۰۰	۰.۲۴%
۲۵	بانک کشاورزی	۱۵,۰۰۰	۰.۱۲%
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰,۰۰۰	۰.۰۸%
۲۷	شرکت سرمایه گذاری پردیس	۵,۰۰۰	۰.۰۴%
	جمع	۱۲,۶۲۷,۵۸۹	۱۰۰%



۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صناعی که صندوق در آن ها به بازارگردانی سهام می پردازد از ۱۸ صنعت در تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱، به ۲۵ صنعت تغییر یافته است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۳۹۸/۱۰/۳۰
فلزات اساسی	۲۰.۷۱۵٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲۰.۰۶۵٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۵.۸۹۸٪
محصولات شیمیایی	۱۰.۸۳۱٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۰.۱۶۷٪
استخراج کانه های فلزی	۶.۰۲۰٪
خدمات فنی و مهندسی	۴.۴۷۸٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴.۰۱۱٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱.۸۶۲٪
مخابرات	۱.۸۴۸٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱.۳۳۰٪
مواد و محصولات دارویی	۰.۵۷۷٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۰.۳۶۶٪
سیمان، آهک و گچ	۰.۳۵۷٪
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۰.۳۰۹٪
زراعت و خدمات وابسته	۰.۲۱۶٪
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۰.۱۹۲٪
سرمایه گذاریها	۰.۱۶۳٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰.۱۶۰٪
خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۰.۱۳۲٪
ساخت محصولات فلزی	۰.۱۱۸٪
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۰.۰۶۸٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۰.۰۶۱٪
سایر واسطه گریهای مالی	۰.۰۵۱٪
قند و شکر	۰.۰۰۵٪
ماشین آلات و تجهیزات	۰.۰۰۳٪

۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۳۰
ترکیب دارایی‌های صندوق توسعه بازار سرمایه در سهام (درصد)

۳-۱- بازده صندوق

بازده هفتگی، ماهانه و سه ماهه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

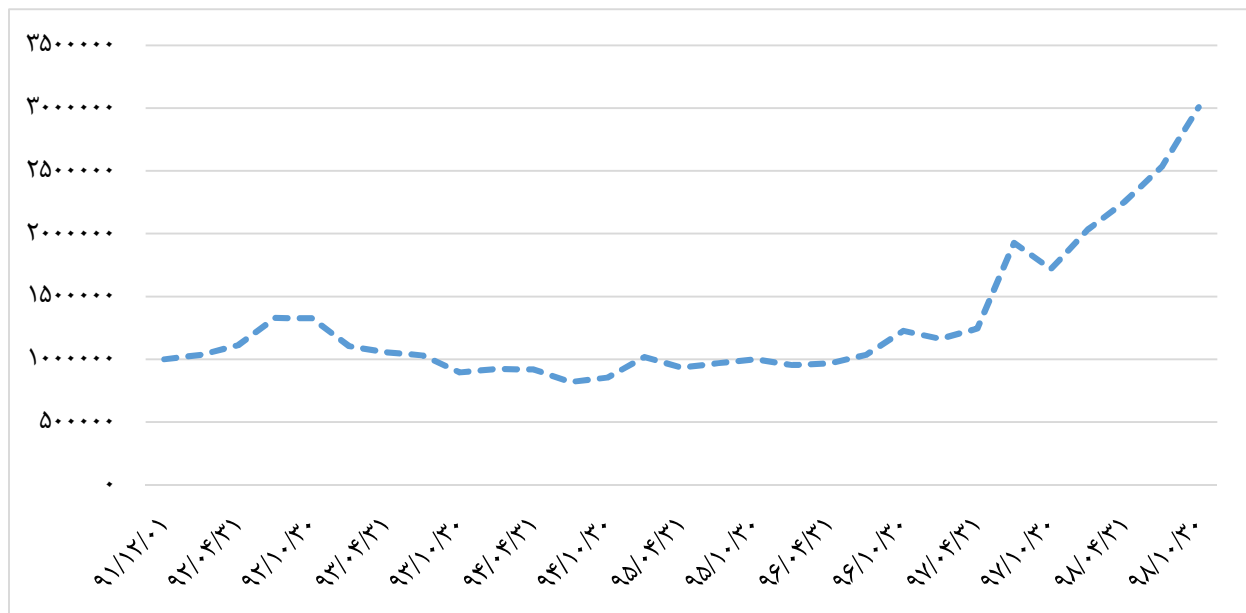
توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۸/۱۰/۲۳	۳,۴۸٪	۴,۵۳۳٪
ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۹/۳۰	۱۱,۴۹۲٪	۱۵,۷۶۶٪
۳ ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	۱۸,۶۴۲٪	۳۲,۹۱۹٪

با توجه به خالص ارزش روز واحدهای سرمایه‌گذاری، نرخ بازدهی صندوق برای دوره‌های زمانی ماهانه در شش ماه اخیر به شرح زیر می‌باشد:

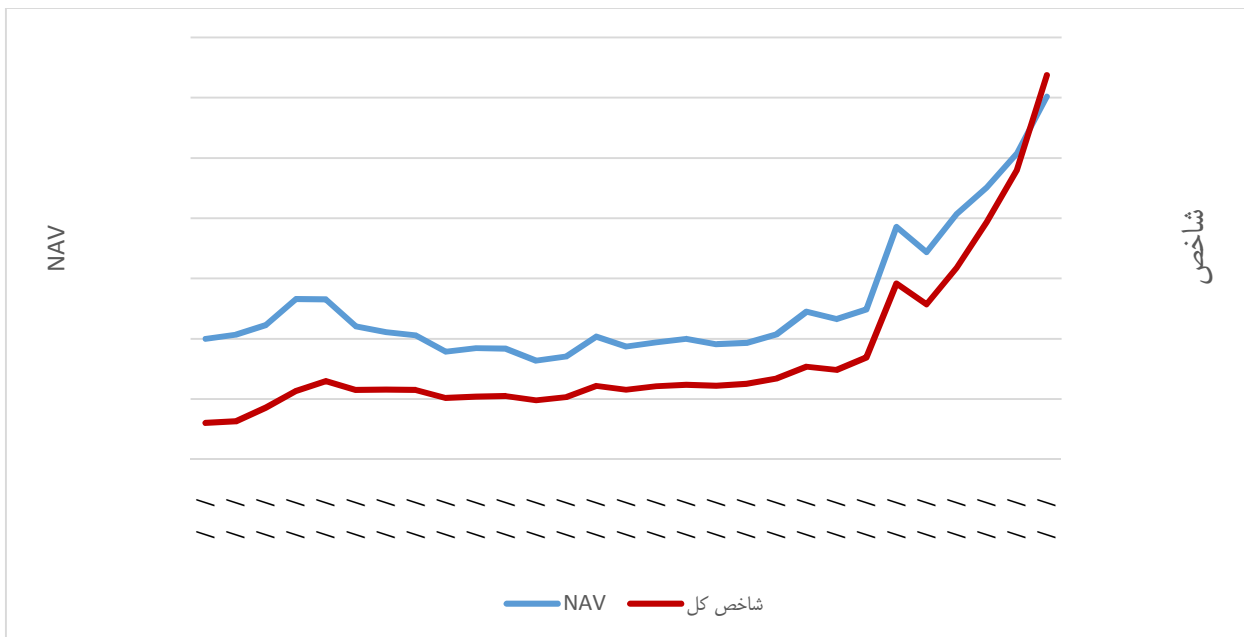
بازدهی	دوره
۱,۶۳۵٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱
۷,۰۶۶٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱
۳,۷۰۳٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰
۰,۶۳۶٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰
۷,۰۹۴٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰
۱۱,۴۹۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۳۰ به شرح نمودار ذیل می‌باشد:

ارزش خالص هر واحد سرمایه‌گذاری



روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل

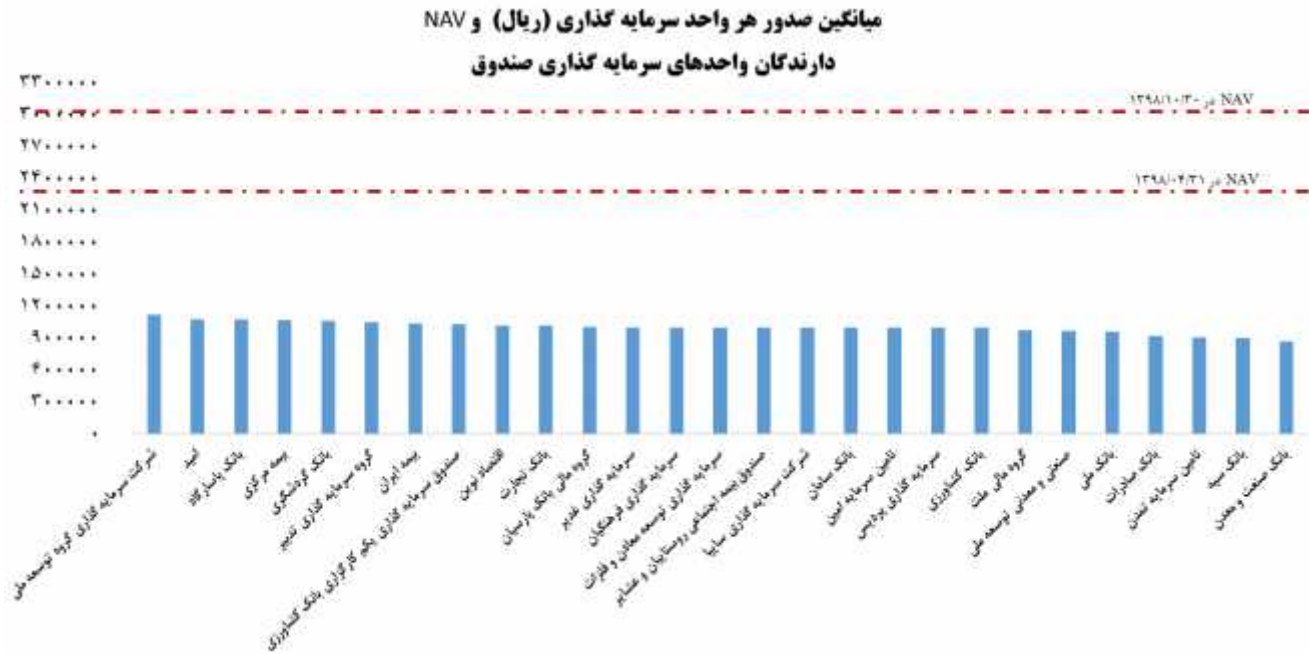


۴- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

کارگزار	حجم معاملات خرید	رتبه در معاملات خرید	حجم معاملات فروش	رتبه در معاملات فروش	حجم کل معاملات	رتبه در کل	درصد از کل
ایستگاه معاملاتی صندوق	۱۶,۴۶۰,۰۵۳,۳۱۰,۳۶۲	۱	۲۲,۵۷۴,۷۷۱,۵۳۳,۴۵۳	۱	۳۹,۰۳۴,۸۲۴,۸۴۳,۸۱۵	۱	۷۲.۵٪
بانک تجارت	۲,۸۷۵,۳۱۴,۱۱۱,۶۳۱	۲	۷۶۱,۲۲۲,۲۸۹,۴۹۷	۳	۳,۶۳۶,۵۳۶,۴۰۱,۱۲۸	۲	۶.۸٪
بانک ملی ایران	۲,۱۱۵,۴۷۷,۵۷۵,۳۶۳	۳	۶۰۱,۴۲۶,۵۸۶,۰۰۱	۴	۲,۷۱۶,۹۰۴,۱۶۱,۳۶۴	۳	۵.۰٪
بانک پاسارگاد	۸۸۶,۹۰۵,۴۰۴,۸۳۸	۷	۱,۸۲۶,۷۲۸,۴۸۲,۳۵۵ *	۲	۲,۷۱۳,۶۳۳,۸۸۷,۱۹۳	۴	۵.۰٪
بانک صادرات	۱,۵۰۳,۸۴۷,۱۴۴,۲۵۷	۴	۵۱۵,۲۲۳,۹۶۲,۲۶۵	۵	۲,۰۱۹,۰۷۱,۱۰۶,۵۲۲	۵	۳.۸٪
بانک سپه	۱,۲۶۱,۷۷۳,۷۸۷,۵۹۰	۵	۱۳۱,۶۲۲,۵۰۶,۱۸۲	۷	۱,۳۹۳,۳۹۶,۲۹۳,۷۷۲	۶	۲.۶٪
بانک ملت	۱,۰۷۲,۲۸۸,۴۵۷,۷۰۱	۶	۰	-	۱,۰۷۲,۲۸۸,۴۵۷,۷۰۱	۷	۲.۰٪
بورس بیمه ایران	۶۵۰,۴۱۲,۰۰۹,۵۰۸	۸	۱۵۷,۸۲۶,۴۷۱,۰۴۴	۶	۸۰۸,۲۳۸,۴۸۰,۵۵۲	۸	۱.۵٪
اقتصاد بیدار	۰	-	۱۱۵,۰۹۸,۴۱۷,۵۹۵	۸	۱۱۵,۰۹۸,۴۱۷,۵۹۵	۹	۰.۲٪
بانک پارسیان	۱۰۴,۱۴۹,۷۴۰,۸۹۶	۹	۰	-	۱۰۴,۱۴۹,۷۴۰,۸۹۶	۱۰	۰.۲٪
امین آوید	۰	-	۷۲,۳۶۰,۱۲۶,۵۰۰	۹	۷۲,۳۶۰,۱۲۶,۵۰۰	۱۱	۰.۱٪
کیان	۰	-	۵۳,۴۲۴,۹۸۰,۳۹۰	۱۰	۵۳,۴۲۴,۹۸۰,۳۹۰	۱۲	۰.۱٪
بانک رفاه کارگران	۰	-	۴۴,۸۲۰,۴۵۰,۰۰۰	۱۱	۴۴,۸۲۰,۴۵۰,۰۰۰	۱۳	۰.۱٪
سهام گستران شرق	۰	-	۳۱,۶۲۳,۳۱۷,۵۰۰	۱۲	۳۱,۶۲۳,۳۱۷,۵۰۰	۱۴	۰.۱٪
جمع	۲۶,۹۳۰,۲۲۱,۵۴۲,۱۴۶	-	۲۶,۸۸۶,۱۴۹,۱۲۲,۷۸۲	-	۵۳,۸۱۶,۳۷۰,۶۶۴,۹۲۸	-	۱۰۰٪

* اکثر معاملات فروش انجام گرفته در کارگزاری پاسارگاد، ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله می‌باشد.

۵- قیمت میانگین واحدهای سرمایه‌گذاری برای دارندگان



همانگونه که در نمودار فوق مشاهده می‌گردد، NAV صندوق از ۲،۲۵۶،۸۰۹ در تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱، به ۳،۰۰۸،۷۰۰ افزایش پیدا کرده است.