



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

## صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سه ماهه

منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۳۹۹

## فهرست مطالب

### عنوان صفحه

۳	۱- مقدمه
۳	۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه
۴	۱-۲- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری
۵	۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق
۶	۳- بررسی عملکرد صندوق
۷	۳-۱- بازده صندوق
۹	۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری



## ۱ - مقدمه

صندوق توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار به عنوان صندوق سرمایه گذاری 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 به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی های صندوق که عمدتاً شامل سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس می شود، توسط مدیر سرمایه گذاری صندوق صورت می گیرد. سرمایه گذاران در ازای سرمایه گذاری در این صندوق گواهی سرمایه گذاری دریافت می کنند.

## ۲ - صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه

مشخصات کلی صندوق سرمایه گذاری توسعه بازار سرمایه	
شماره ثبت اداره ثبت شرکت ها:	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
کلاسسه پرونده:	۴۸۷
تاریخ ترازنامه:	۱۳۹۹/۰۷/۳۰
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود

### ارکان صندوق

مدیر	هیأت مدیره صندوق
متولی	مشاور سرمایه گذاری 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 ۱۶,۶۲۶,۷۹۹ میلیون ریال افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه گذاری در ۱۳۹۹/۰۷/۳۰	میانگین صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال)	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۲,۵۵۴,۵۱۷	۱,۰۱۸,۷۲۹	۱۵,۳۶%
۲	بانک صادرات	۲,۱۴۰,۳۸۳	۲,۱۰۲,۰۸۷	۱۲,۸۷%
۳	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۹۶۱,۲۶۷	۱۲,۲۰%
۴	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۹۷۶,۷۳۰	۹,۲۳%
۵	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹۰۲,۱۵۰	۶,۴۷%
۶	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	۴,۱۸%
۷	کارگزاری مفید	۶۷۲,۸۸۹	۶,۳۴۸,۱۹۵	۴,۰۵%
۸	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۶۳,۳۴۶	۱,۵۰۷,۵۰۸	۳,۹۹%
۹	بانک پاسارگاد	۶۵۰,۲۵۶	۱,۰۷۶,۴۹۷	۳,۹۱%
۱۰	بیمه ایران	۵۲۹,۴۰۵	۱,۰۳۸,۸۹۹	۳,۱۸%
۱۱	سایر	۴,۰۸۲,۲۱۴	-	۲۴,۵۵%
	جمع	۱۶,۶۲۶,۷۹۹	-	۱۰۰%



## ۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

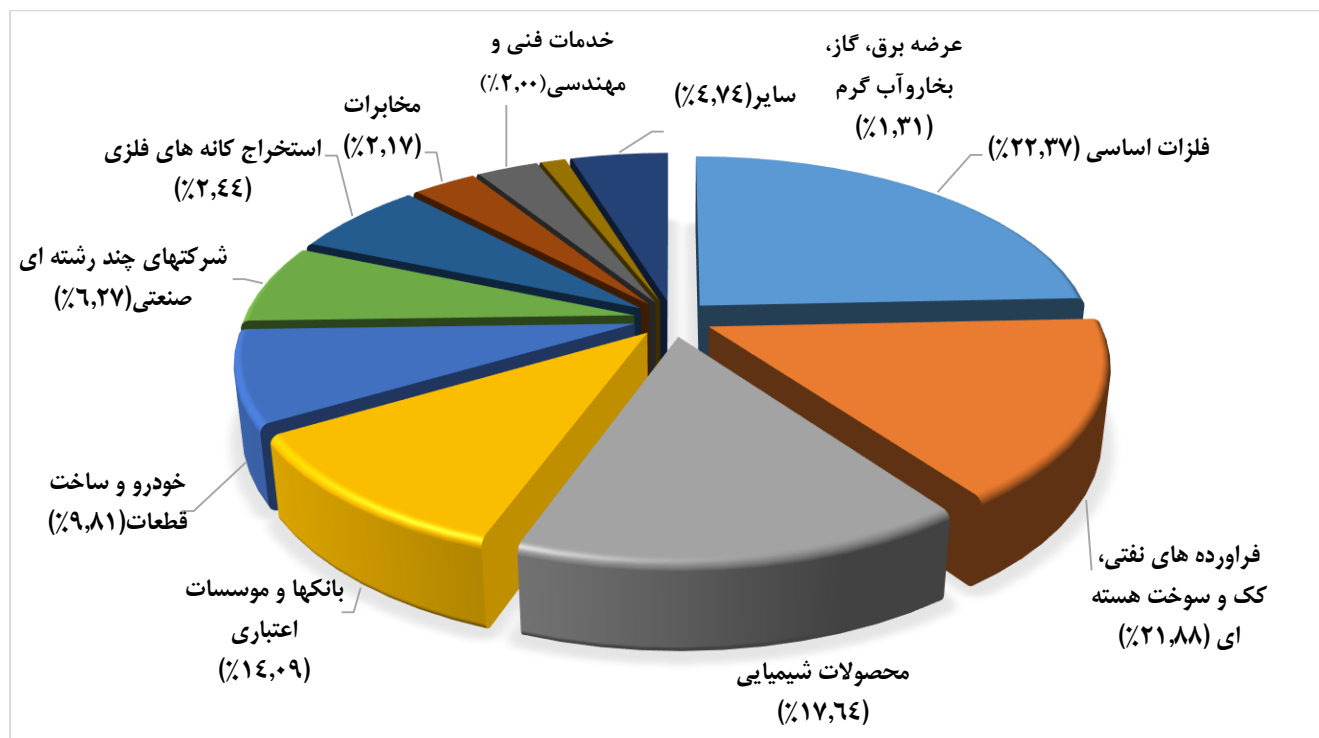
سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صنایعی که صندوق در آن ها به بازارگردانی سهام پرداخته است، از ۱۶ صنعت در انتهای سال مالی گذشته، به ۳۲ صنعت در سال مالی منتهی به ۹۹/۰۴/۳۱ تغییر یافته است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۳۹۹/۰۷/۳۰
فلزات اساسی	۲۴.۳۱٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۵.۷۵٪
محصولات شیمیایی	۱۵.۴۸٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۰.۹۵٪
خودرو و ساخت قطعات	۸.۰۳٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۶.۸۹٪
استخراج کانه های فلزی	۶.۵۲٪
مخابرات	۳.۱۱٪
خدمات فنی و مهندسی	۳.۰۰٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱.۲۱٪
سرمایه گذاریها	۰.۹۶٪
مواد و محصولات دارویی	۰.۹۵٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۰.۶۱٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰.۳۷٪
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۳۱٪
سایر صنایع	۰.۲۶٪
زراعت و خدمات وابسته	۰.۲۳٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰.۲۳٪
سیمان، آهک و گچ	۰.۲۰٪
ساخت محصولات فلزی	۰.۱۰٪
لاستیک و پلاستیک	۰.۰۹٪
دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۰.۰۸٪
سایر واسطه گری های مالی	۰.۰۸٪
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۰.۰۷٪
واسطه گری های مالی و پولی	۰.۰۵٪

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۳۹۹/۰۷/۳۰
تجارت عمده فروشی به جز وسایل نقلیه موتور	۰.۰۴%
قند و شکر	۰.۰۴%
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۰.۰۳%
حمل و نقل آبی	۰.۰۱%
استخراج ذغال سنگ	۰.۰۱%
ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۰.۰۱%
خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۰.۰۰%
<b>جمع</b>	<b>۱۰۰%</b>

### ۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

#### ترکیب دارایی‌های صندوق توسعه بازار سرمایه در سهام (درصد)



### ۳-۱- بازده صندوق

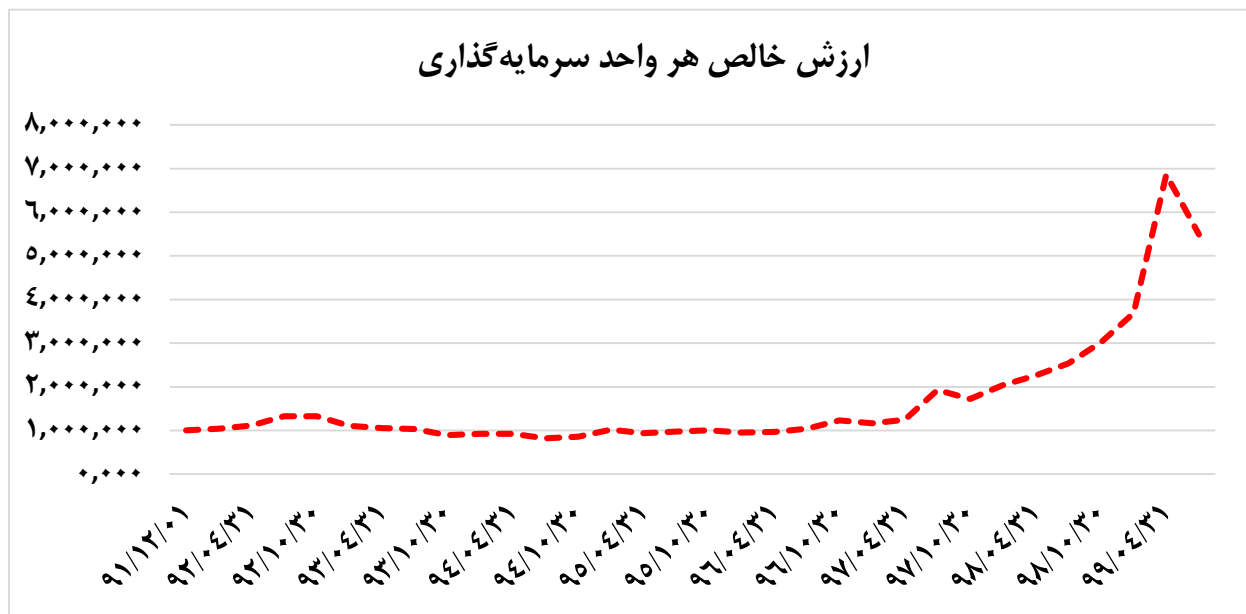
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

بازده بازار	بازده صندوق	از تاریخ	توضیحات
-۹,۵۴۷٪	-۸,۶۰۳٪	۱۳۹۹/۰۷/۲۳	هفته گذشته
-۱۱,۴۵۹٪	-۸,۹۵۱٪	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	ماه گذشته
-۲۵,۷۱۱٪	-۱۹,۸۲۲٪	۱۳۹۹/۰۵/۰۲	۳ ماه اخیر
۹۰,۳۶۲٪	۴۵,۰۳۸٪	۱۳۹۹/۰۲/۰۵	۶ ماه
۳۵۸,۰۸۸٪	۱۱۶,۴۲۱٪	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	یک سال اخیر

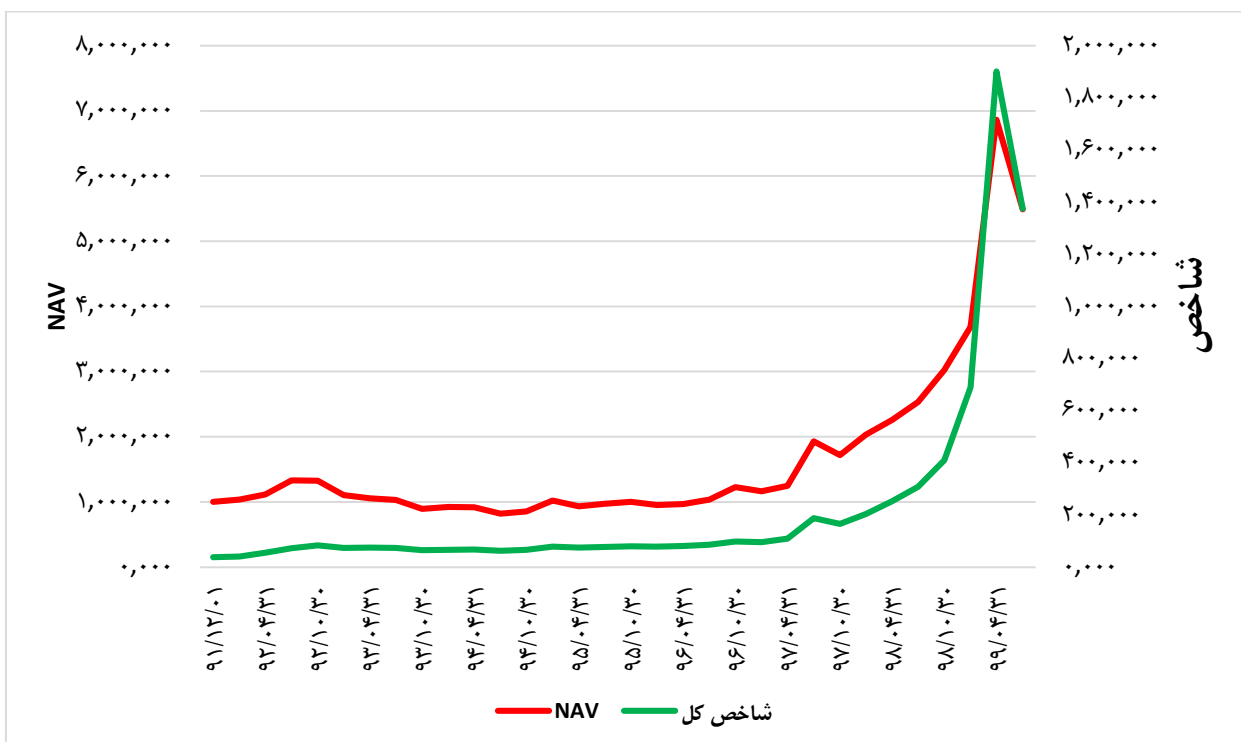
با توجه به خالص ارزش روز واحدهای سرمایه‌گذاری، نرخ بازدهی صندوق برای دوره‌های زمانی ماهانه در دوازده ماه اخیر به شرح زیر می باشد:

بازدهی	دوره
-۸,۲۰۴٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱
-۳,۱۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱
-۸,۹۵٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۳۰ به شرح نمودار ذیل می باشد:



### روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل





### ۳-۲- 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 معاملات	درصد در کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۹۱,۰۲۶,۶۸۶,۴۳۳,۶۳۶	۱	۵۳,۷۴۶,۲۷۳,۶۰۸,۹۹۹	۱	۱۴۴,۷۷۲,۹۶۰,۰۴۲,۶۳۵	۱	۹۳.۴۲٪
بانک ملی ایران	۳,۹۵۳,۰۷۱,۸۸۰,۰۰۸	۲	۱,۰۱۶,۷۴۴,۱۶۰,۷۱۵	۲	۴,۹۶۹,۸۱۶,۰۴۰,۷۲۳	۲	۳.۲۱٪
بانک تجارت	۲,۳۰۰,۸۸۰,۷۸۵,۴۷۲	۳	۵۹۱,۳۸۰,۲۴۵,۲۱۴	۳	۲,۸۹۲,۲۶۱,۰۳۰,۶۸۶	۳	۱.۸۷٪
بانک پاسارگاد	۱,۵۴۹,۳۹۷,۸۶۸,۵۸۴	۴	۲۰۱,۱۸۷,۸۷۸,۳۴۷	۴	۱,۷۵۰,۵۸۵,۷۴۶,۹۳۱	۴	۱.۱۳٪
بانک سپه	۳۹۹,۲۱۱,۲۴۳,۰۴۸	۵	۰	۵	۳۹۹,۲۱۱,۲۴۳,۰۴۸	۵	۰.۲۶٪
بانک صادرات	۱۹۰,۱۰۱,۵۴۷,۵۵۶	۶	۰	۵	۱۹۰,۱۰۱,۵۴۷,۵۵۶	۶	۰.۱۲٪
مجموع	۹۹,۴۱۹,۳۴۹,۷۵۸,۳۰۴	-	۵۵,۵۵۵,۵۸۵,۸۹۳,۲۷۵	-	۱۵۴,۹۷۴,۹۳۵,۶۵۱,۵۷۹	-	۱۰۰٪

\*حجم معاملات فروش در کارگزاری بانک پاسارگاد ناشی از فروش اوراق اختیار معامله و همچنین فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله با نرخ کارمزد ۰,۰۰۰۵ می باشد.