

بِسْمِ اللّٰهِ الرَّحْمٰنِ الرَّحِیْمِ



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد شش ماهه

منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹



فهرست مطالب

عنوان صفحه

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 ۱۳۹۹/۱۰/۳۰	۵
۳-۱ - بازده صندوق	۶
۳-۲ - وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری	۸

**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:	۱۳۹۹/۱۰/۳۰
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود

ارکان صندوق

مدیر	هیأت مدیره صندوق
متولی	شرکت حسابرسی و خدمات مدیریت آزموده‌کاران
حسابرس	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز

**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 ۲۰,۶۶۸,۲۶۸ میلیون ریال افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه گذاری	میانگین صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال)	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۲,۵۵۴,۵۱۷	۱,۱۱۳,۸۲۱	۱۲.۳۶%
۲	بانک صادرات	۲,۱۴۰,۳۸۳	۲,۱۰۲,۰۸۷	۱۰.۳۶%
۳	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۹۶۱,۲۵۴	۹.۸۱%
۴	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۹۷۶,۷۳۰	۷.۴۳%
۵	کارگزاری مفید	۱,۵۱۸,۳۳۰	۵,۸۸۹,۰۰۰	۷.۳۵%
۶	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹۰۲,۱۵۰	۵.۲۰%
۷	بورس اوراق بهادار تهران	۷۶۹,۱۱۸	۵۶۰۳,۸۱۱	۳.۷۲%
۸	کارگزاری آگاه	۷۶۴,۹۴۳	۵,۹۱۲,۱۴۲	۳.۷۰%
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	۳.۳۶%
۱۰	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۶۳,۳۴۶	۱,۵۰۷,۵۰۸	۳.۲۱%
۱۱	سایر	۶,۹۲۳,۸۴۲	-	۳۳.۵۳%
	جمع	۲۰,۶۶۸,۲۶۸	-	۱۰۰%



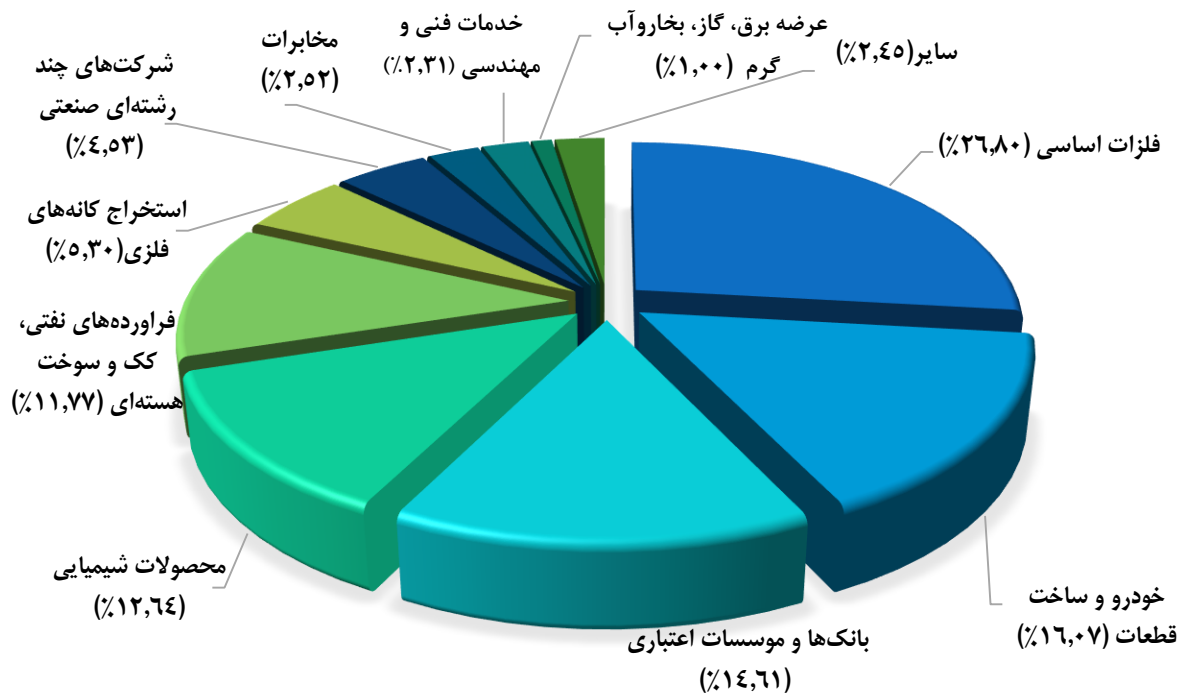
۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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 پرداخته است، از ۱۶ صنعت در انتهای سال مالی گذشته، به ۲۳ صنعت در دوره مالی شش ماهه منتهی به ۹۹/۱۰/۳۰ تغییر یافته است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۳۹۹/۱۰/۳۰
فلزات اساسی	۲۶.۸۰٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۶.۰۷٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۴.۶۱٪
محصولات شیمیایی	۱۲.۶۴٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۱.۷۷٪
استخراج کانه های فلزی	۵.۳۰٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴.۵۳٪
مخابرات	۲.۵۲٪
خدمات فنی و مهندسی	۲.۳۱٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱.۰۰٪
سرمایه گذاریها	۰.۷۸٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۰.۵۱٪
مواد و محصولات دارویی	۰.۳۸٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰.۲۶٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰.۱۴٪
زراعت و خدمات وابسته	۰.۱۲٪
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۰۸٪
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۰.۰۷٪
اطلاعات و ارتباطات	۰.۰۷٪
سیمان، آهک و گچ	۰.۰۳٪
سایر واسطه گریهای مالی	۰.۰۳٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۰.۰۰٪
خرده فروشی، باستانای وسایل نقلیه موتوری	۰.۰۰٪
جمع	۱۰۰٪

۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

ترکیب دارایی‌های صندوق توسعه بازار سرمایه در سهام (درصد)



۳-۱- بازده صندوق

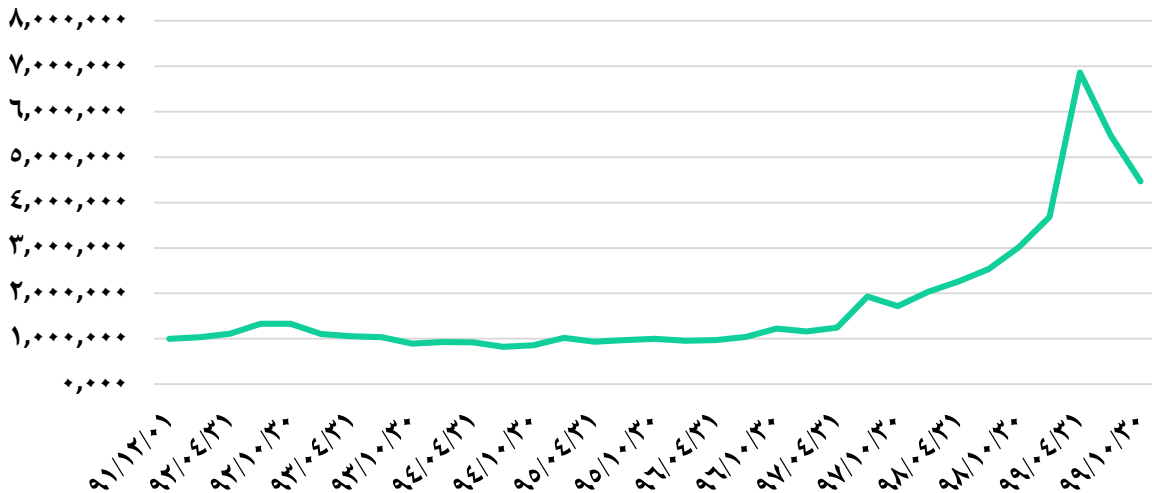
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۹/۱۰/۲۳	-۸,۸۷۱٪	-۸,۷۲۶٪
ماه گذشته	۱۳۹۹/۰۹/۳۰	-۲۲,۲۷۷٪	-۲۰,۰۰۴٪
۳ ماه گذشته	۳۰-۱۳۹۹/۰۷/	-۱۸,۵۷۳٪	-۱۸,۵۲۵٪
۶ ماه گذشته	۱۳۹۹/۰۵/۰۲	-۳۴,۷۱۴٪	-۳۹,۴۷۳٪
یک سال گذشته	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	۴۸,۵۳۵٪	۱۸۰,۷۹۵٪

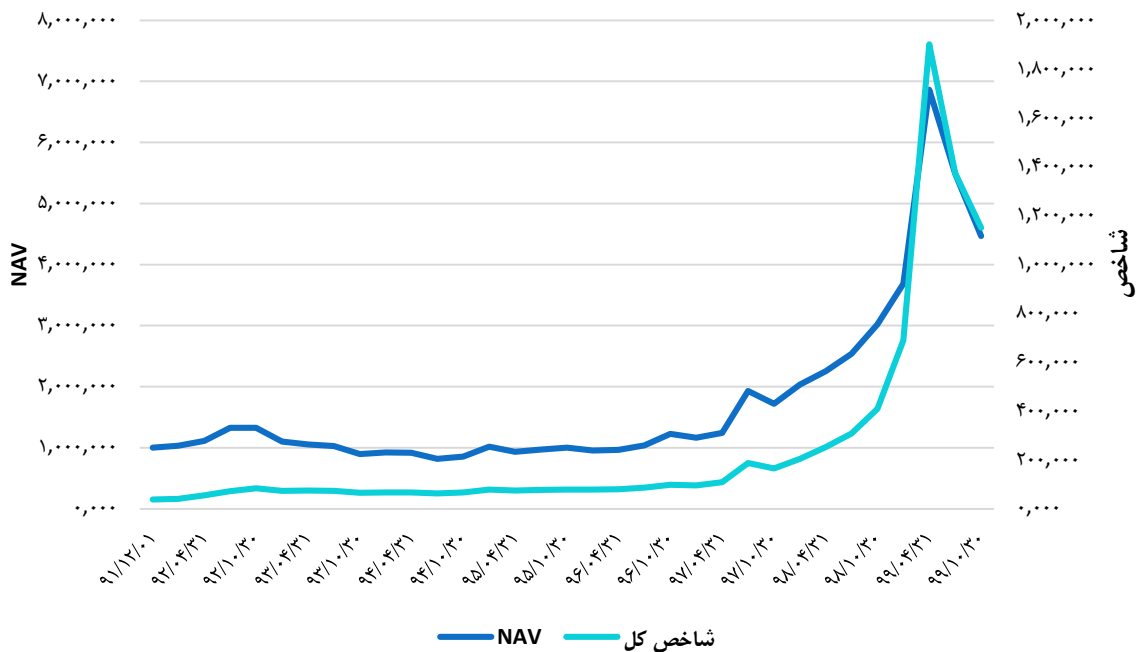


همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۳۰ به شرح نمودار ذیل می‌باشد:

ارزش خالص هر واحد سرمایه‌گذاری



روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل





۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

کارگزار	رتبه در معاملات خرید	حجم معاملات خرید	رتبه در معاملات فروش	حجم معاملات فروش	رتبه در کل معاملات	درصد در کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۱	۱۸۰,۰۷۶,۸۱۴,۷۲۵,۸۰۱	۱	۱۰۳,۲۳۳,۰۲۴,۷۲۵,۳۶۴	۱	۹۵.۸۳%
بانک ملی ایران	۲	۴,۲۳۳,۹۸۰,۲۶۷,۹۷۰	۳	۱,۰۱۶,۷۴۴,۱۶۰,۷۱۵	۲	۱.۷۸%
بانک تجارت	۳	۲,۸۲۱,۸۵۲,۸۵۹,۸۱۷	۴	۵۹۱,۳۸۰,۲۴۵,۲۱۴	۳	۱.۱۵%
بانک پاسارگاد	۴	۱,۵۴۹,۳۹۷,۸۶۸,۵۸۴*	۲	۱,۱۴۲,۶۲۴,۳۷۹,۳۶۳	۴	۰.۹۱%
بانک سپه	۵	۵۲۴,۶۸۹,۳۲۷,۹۵۳	-	۰	۵	۰.۱۸%
بانک صادرات	۶	۴۵۸,۱۶۸,۷۷۳,۲۶۸	-	۰	۶	۰.۱۵%
مجموع	-	۱۸۹,۶۶۴,۹۰۳,۸۲۳,۴۵۵	-	۱۰۵,۹۸۳,۷۷۳,۵۱۰,۶۵۶	-	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. شایان ذکر است کارمزد کارگزار صفر است.