

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

منتهی به ۳۱ فروردین ۱۴۰۰

گزارش عملکرد سه ماهه



فهرست مطالب

عنوان صفحه

۱ - مقدمه	۳
۲ - صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه	۳
۱-۲ - مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری	۴
۲-۲ - ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱	۵
۱-۳ - بازده صندوق	۶
۲-۳ - 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 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
کلاس پرونده:	۴۸۷
تاریخ ترازنامه:	۱۴۰۰/۰۱/۳۱
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود

ارکان صندوق

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

**۲-۱- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری**

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 ۲۳,۰۲۰,۳۹۱ میلیون ریال افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می‌باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه‌گذاری	میانگین صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۲,۵۵۴,۵۱۷	۱,۱۱۳,۸۲۱	۱۱.۱۰٪
۲	بانک صادرات	۲,۱۴۰,۳۸۳	۲,۱۰۲,۰۸۷	۹.۳۰٪
۳	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۹۶۱,۲۵۴	۸.۸۱٪
۴	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۹۷۶,۷۳۰	۶.۶۷٪
۵	کارگزاری مفید	۱,۹۱۴,۸۱۱	۵,۷۰۲,۰۴۳	۸.۳۳٪
۶	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹۰۲,۱۵۰	۴.۶۷٪
۷	بورس اوراق بهادار تهران	۱,۲۸۶,۴۹۰	۵,۲۶۹,۸۴۷	۵.۵۹٪
۸	کارگزاری آگاه	۹۴۷,۶۴۲	۵,۷۳۳,۶۱۲	۴.۱۲٪
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	۳.۰۲٪
۱۰	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۶۳,۳۴۶	۱,۵۰۷,۵۰۸	۲.۸۸٪
۱۱	سایر	۸,۱۷۹,۴۱۳	-	۳۵.۵۳٪
جمع		۲۳,۰۲۰,۳۹۱	-	۱۰۰٪



۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱

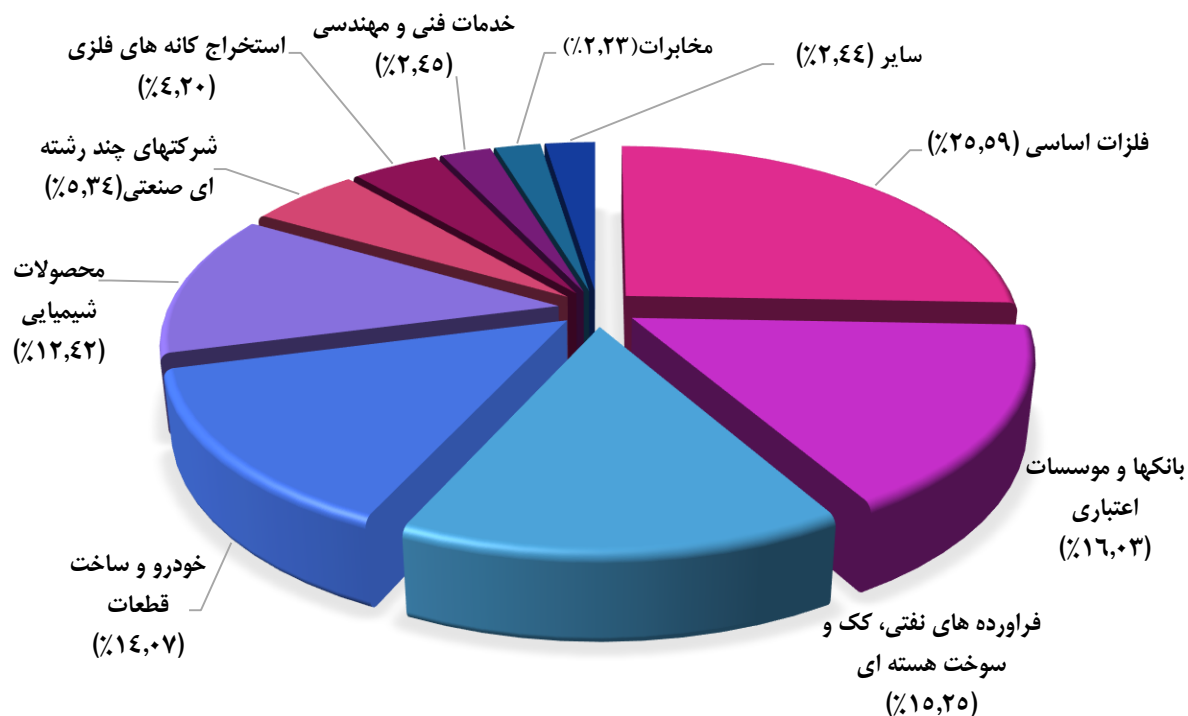
سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صناعی که صندوق در آن ها به بازارگردانی سهام پرداخته است، از ۲۳ صنعت در انتهای سال مالی گذشته، به ۲۶ صنعت در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ تغییر یافته است. همچنین صندوق در ۲۷۹ نماد در بازار سهام فعال بوده است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۴۰۰/۰۱/۳۱
فلزات اساسی	۲۵.۵۹٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۶.۰۳٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۵.۲۵٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۴.۰۷٪
محصولات شیمیایی	۱۲.۴۲٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۵.۳۴٪
استخراج کانه های فلزی	۴.۲۰٪
خدمات فنی و مهندسی	۲.۴۵٪
مخابرات	۲.۲۳٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۰.۸۷٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۰.۳۶٪
مواد و محصولات دارویی	۰.۲۸٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰.۲۲٪
سرمایه گذاریها	۰.۱۸٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰.۱۱٪
زراعت و خدمات وابسته	۰.۰۸٪
ساخت محصولات فلزی	۰.۰۷٪
بیمه و صندوق بازنشتگی به جز تامین اجتماعی	۰.۰۷٪
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۰۵٪
اطلاعات و ارتباطات	۰.۰۵٪
سایر واسطه گریهای مالی	۰.۰۲٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۰.۰۲٪
استخراج ذغال سنگ	۰.۰۲٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۰.۰۱٪
لاستیک و پلاستیک	۰.۰۱٪
سیمان، آهک و گچ	۰.۰۱٪
ماشین آلات و تجهیزات	۰.۰۰٪
جمع	۱۰۰٪



۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱

ترکیب دارایی‌های صندوق توسعه بازار سرمایه در سهام (درصد)



۳-۱- بازده صندوق

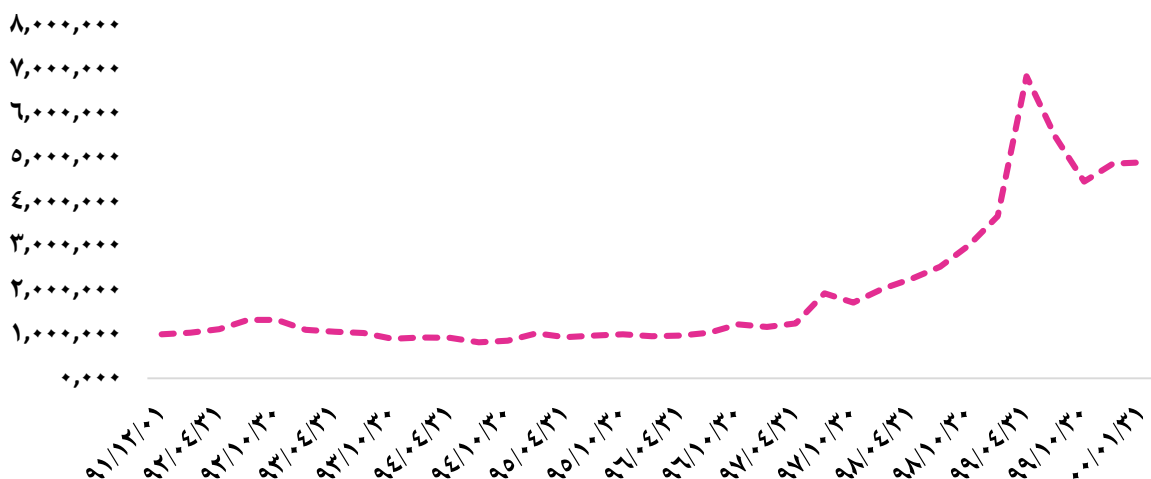
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۴۰۰/۰۱/۲۴	-۳,۲۸٪	-۲,۰۰٪
ماه گذشته	۱۴۰۰/۰۱/۰۱	-۹,۴۵٪	-۶,۷۴٪
۳ ماه گذشته	۱۳۹۹/۱۱/۰۱	۵,۷۰٪	۳,۰۰٪
۶ ماه گذشته	۱۳۹۹/۰۸/۰۱	-۱۰,۶۴٪	-۱۳,۶۵٪
۹ ماه گذشته	۱۳۹۹/۰۵/۰۱	-۲۸,۳۰٪	-۳۵,۸۵٪
یک سال گذشته	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	۳۱,۷۶٪	۷۲,۰۲٪

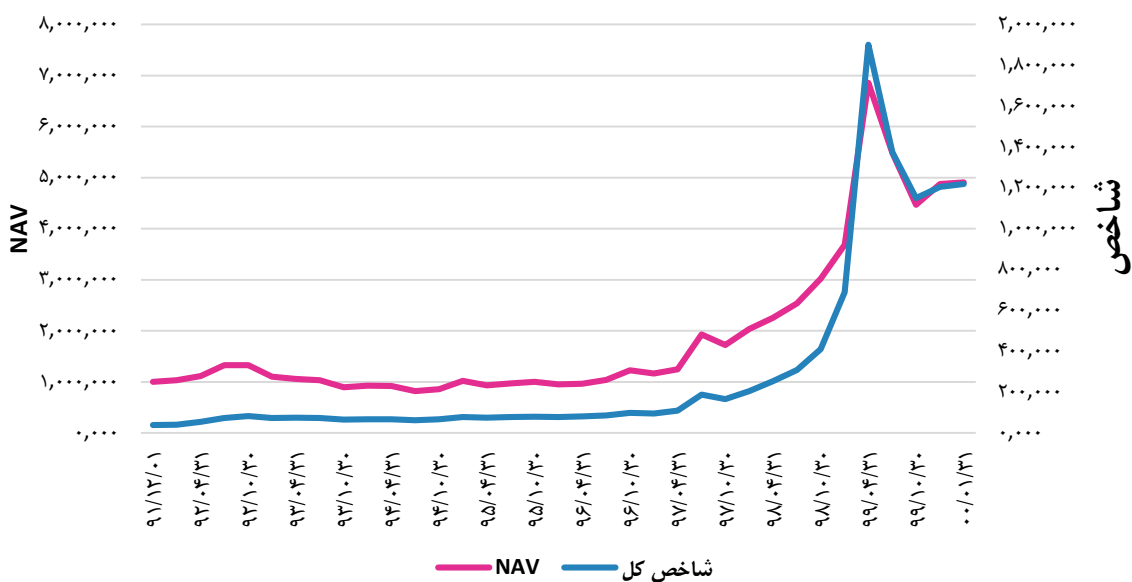


همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ به شرح نمودار ذیل می باشد:

خالص ارزش روز هر واحد سرمایه‌گذاری صندوق



روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل





۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

نام کارگزار	حجم معاملات خرید	رتبه در معاملات خرید	حجم معاملات فروش	رتبه در معاملات فروش	حجم کل معاملات	رتبه از کل معاملات	درصد از کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۲۱۵,۵۴۸,۷۰۷,۵۴۱,۰۱۳	۱	۱۳۰,۷۱۱,۶۳۷,۸۰۵,۴۸۲	۱	۳۴۶,۲۶۰,۳۴۵,۳۴۶,۴۹۵	۱	۹۵.۱۷٪
بانک ملی ایران	۵,۱۷۲,۳۵۵,۶۶۰,۶۲۵	۲	۱,۰۴۵,۶۱۶,۰۰۲,۸۲۸	۳	۶,۲۱۷,۹۷۱,۶۶۳,۴۵۳	۲	۱.۷۱٪
بانک پاسارگاد	۱,۵۴۹,۳۹۷,۸۶۸,۵۸۴	۴	۳,۵۰۵,۹۰۵,۳۰۴,۷۳۴*	۲	۵,۰۵۵,۳۰۳,۱۷۳,۳۱۸	۳	۱.۳۹٪
بانک تجارت	۳,۹۳۷,۰۲۴,۷۳۴,۳۹۲	۳	۵۹۱,۳۸۰,۲۴۵,۲۱۴	۴	۴,۵۲۸,۴۰۴,۹۷۹,۶۰۶	۴	۱.۲۴٪
بانک سپه	۸۰۲,۲۲۵,۱۱۳,۷۲۴	۵	۳۷,۱۰۹,۷۷۵,۲۷۵	۷	۸۳۹,۳۳۴,۸۸۸,۹۹۹	۵	۰.۲۳٪
بانک صادرات	۴۹۱,۹۷۹,۸۴۴,۷۴۱	۶	۳,۵۴۱,۳۰۶,۵۹۷	۸	۴۹۵,۵۲۱,۱۵۱,۳۳۸	۶	۰.۱۴٪
کیان	۰	-	۲۸۴,۶۹۳,۲۷۶,۹۶۵	۵	۲۸۴,۶۹۳,۲۷۶,۹۶۵	۷	۰.۰۸٪
بانک مسکن	۰	-	۱۳۴,۹۱۹,۴۸۰,۰۰۰	۶	۱۳۴,۹۱۹,۴۸۰,۰۰۰	۸	۰.۰۴٪
جمع	۲۲۷,۵۰۱,۶۹۰,۷۶۳,۰۷۹	-	۱۳۶,۳۱۴,۸۰۳,۱۹۷,۰۹۵	-	۳۶۳,۸۱۶,۴۹۳,۹۶۰,۱۷۴	-	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.