

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه

منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۲

عنوان صفحه

۲	۱- مقدمه
۲	۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه
۳	۳- گزیده اطلاعات مالی
۴	۴- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری
۵	۵- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱
۶	۶- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱
۶	۷- بازده صندوق
۸	۸- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری
۹	۹- نسبت معاملات خرید و فروش در ۸ سال اخیر
۱۰	۱۰- نسبت معاملات خرید و فروش در یک‌سال اخیر
۱۱	۱۱- مقایسه صورت سود و زیان طی سه سال اخیر
۱۳	۱۲- مقایسه صورت خالص دارایی‌ها طی سه سال اخیر

۱- مقدمه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار به عنوان صندوق سرمایه‌گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار، مصوب آذر ماه ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۱۱۳۰ نزد سبا به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق براساس 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 دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل سهام شرکت‌های پذیرفته شده 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
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود
ارکان صندوق	
مدیر	هیأت مدیره صندوق
متولی	شرکت حسابرسی و خدمات مدیریت آموزده‌کاران
حسابرس	مؤسسه حسابرسی هوشیار ممیز

۳- گزیده اطلاعات مالی

۱-۳- اطلاعات عملکرد مالی طی سال

۱۴۰۱/۰۴/۳۱	۱۴۰۲/۰۴/۳۱	
میلیون ریال	میلیون ریال	
۱۶,۶۴۸,۷۲۴	۸۰,۵۵۵,۱۴۵	مجموع درآمد
۱۶,۵۹۰,۵۱۳	۸۰,۴۴۵,۱۶۹	سود (زیان) خالص
۸.۴۹	۲۷.۵۳	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال
۱۸۰,۶۳۲,۵۶۹	۲۹۳,۱۸۶,۵۰۸	جمع دارایی‌ها
۴,۶۳۹,۷۴۶	۶۹۳,۰۱۰	جمع بدهی‌ها
۱۲۵,۹۹۸,۷۴۶	۱۷۵,۹۹۲,۸۲۳	خالص دارایی‌ها در ابتدای سال
۱۷۵,۹۹۲,۸۲۳	۲۹۲,۴۹۳,۴۹۸	خالص دارایی‌ها در پایان سال
۵,۹۰۱,۳۰۸	۸,۵۲۶,۸۱۸	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)

۴- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری

صندوق توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با سرمایه اولیه ۳۰۰.۰۰۰ واحد توسط ۱۰ شرکت تأسیس شد که طی چند مرحله این سرمایه به ۳۴,۳۰۲,۷۷۴ واحد افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به شرح جدول زیر می‌باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه‌گذاری	میانگین صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)	درصد مالکیت
۱	کارگزاری مفید	۳,۹۲۱,۹۹۳	۶,۲۵۴,۲۲۳	۱۱.۴۳٪
۲	بانک تجارت	۳,۶۲۷,۳۸۸	۲,۹۸۹,۸۲۸	۱۰.۵۷٪
۳	بانک صادرات	۲,۱۴۰,۳۸۳	۲,۱۰۲,۰۸۷	۶.۲۴٪
۴	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۹۶۱,۲۵۴	۵.۹۱٪
۵	بورس اوراق بهادار تهران	۱,۸۷۵,۲۸۹	۵,۶۸۴,۷۱۴	۵.۴۷٪
۶	کارگزاری آگاه	۱,۷۸۰,۶۸۲	۶,۲۱۸,۴۰۰	۵.۱۹٪
۷	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۹۷۶,۷۳۰	۴.۴۸٪
۸	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹۰۲,۱۵۰	۳.۱۳٪
۹	سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه	۷۷۶,۸۸۲	۵,۸۹۱,۲۹۵	۲.۲۶٪
۱۰	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	۲.۰۳٪
۱۱	سایر	۱۴,۸۴۶,۳۶۸	-	۴۳.۲۸٪
	جمع کل	۳۴,۳۰۲,۷۷۴	-	۱۰۰٪

مجموع واحدهای سرمایه‌گذاری متعلق به هر یک از طبقات در کل به شرح جدول زیر می‌باشد:

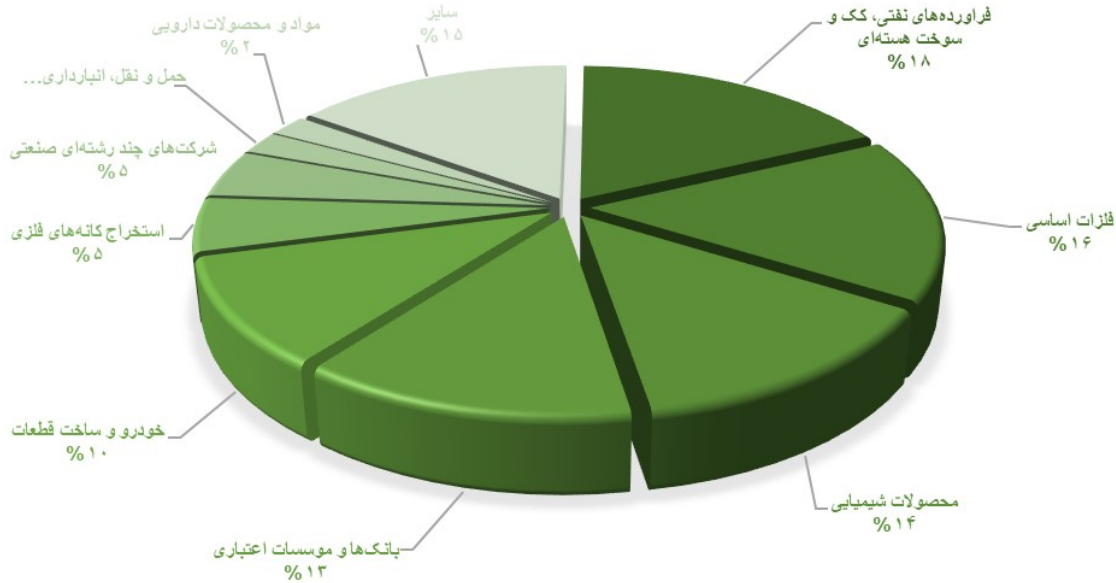
شرح	تعداد	درصد مالکیت
طبقه اول: بورس اوراق بهادار تهران، فرابورس ایران، سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه	۳,۶۱۹,۴۳۳	۱۰.۵۵٪
طبقه دوم: بانک‌ها و مؤسسات مالی و اعتباری، شرکت‌ها و نهادهای بیمه‌ای	۱۱,۷۲۵,۲۴۱	۳۴.۱۸٪
طبقه سوم: کانون‌ها، تشکل‌ها، نهادهای مالی و دیگر شرکت‌های ثبت شده نزد سازمان	۱۸,۹۵۸,۱۰۰	۵۵.۲۷٪
جمع	۳۴,۳۰۲,۷۷۴	۱۰۰٪

۵- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱

سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صناعی که صندوق در آنها به بازارگردانی سهام پرداخته است، از ۳۱ صنعت در انتهای سال مالی گذشته، به ۴۲ صنعت در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ تغییر یافته است. همچنین صندوق در ۴۰۷ نماد در بازار سهام فعال بوده است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۴۰۲/۰۴/۳۱
فراورده‌های نفتی، کک و سوخت هسته‌ای	۱۷٪
فلزات اساسی	۱۵٪
محصولات شیمیایی	۱۳٪
بانک‌ها و موسسات اعتباری	۱۲٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۰٪
استخراج کانه‌های فلزی	۵٪
شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	۴٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۲٪
مواد و محصولات دارویی	۲٪
سرمایه‌گذاری‌ها	۲٪
فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۲٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۲٪
سیمان، آهک و گچ	۱٪
خدمات فنی و مهندسی	۱٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱٪
سایر	۱۱٪
جمع	۱۰۰٪

۶- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱

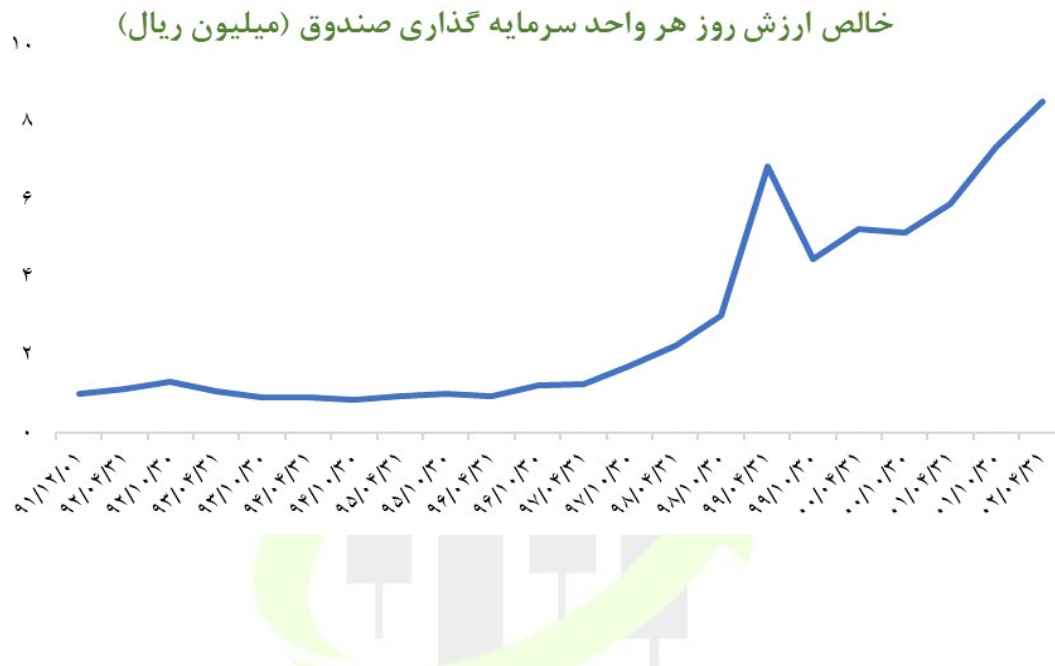


۷- بازده صندوق

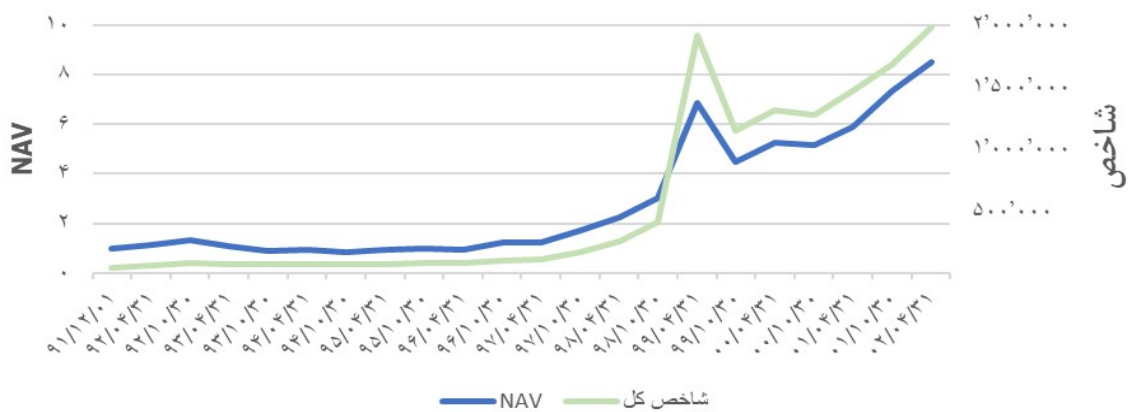
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

بازدهی بازار	بازدهی صندوق	توضیحات
٪(۴.۲۴)	٪(۴.۸۴)	هفته گذشته
٪(۸.۷۸)	٪(۱۰.۵۷)	ماه گذشته
٪(۱۴.۶۷)	٪(۱۵.۴۷)	۳ ماه گذشته
٪۱۹.۹۰	٪۱۸.۴۷	۶ ماه گذشته
٪۳۴.۷۳	٪۴۴.۴۹	یک سال گذشته

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل (میلیون ریال)



۸- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکتهای کارگزاری (میلیون ریال)

نام کارگزار	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات	درصد از کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۴۴۲,۷۰۶,۰۰۷	۳۸۶,۴۸۱,۱۸۶	۸۲۹,۱۸۷,۱۹۳	٪۹۷.۹۶
شرکت کارگزاری بانک پاسارگاد	۷۶۹,۴۴۷	۲۰۰,۴۴۴	۹۶۹,۸۹۲	٪۰.۱۱
شرکت کارگزاری مفید	۸,۲۹۷,۸۶۰	۸,۰۰۲,۰۵۲	۱۶,۲۹۹,۹۱۲	٪۱.۹۳
جمع کل	۴۵۱,۷۷۳,۳۱۵	۳۹۴,۶۸۳,۶۸۳	۸۴۶,۴۵۶,۹۹۷	٪۱۰۰

۹- نسبت معاملات خرید و فروش در ۸ سال اخیر (میلیون ریال)

نسبت معاملات (درصد از کل حجم معاملات) خرید و فروش در ۸ سال اخیر به شرح جدول زیر می‌باشد:

ردیف	دوره مالی	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات	درصد از کل (خرید)	درصد از کل (فروش)
۱	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۵	۱۱,۱۹۵,۱۵۷	۷,۸۸۱,۵۴۶	۱۹,۰۷۶,۷۰۳	۵۹٪	۴۱٪
۲	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۶	۷,۷۷۹,۰۱۳	۶,۳۹۹,۳۸۲	۱۴,۱۷۸,۳۹۴	۵۵٪	۴۵٪
۳	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۷	۱۵,۸۱۳,۷۶۵	۱۵,۲۶۶,۴۲۴	۳۱,۰۸۰,۱۸۹	۵۱٪	۴۹٪
۴	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۸	۳۲,۱۹۵,۰۴۹	۳۸,۲۴۶,۴۵۶	۷۰,۴۴۱,۵۰۵	۴۶٪	۵۴٪
۵	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۹	۴۹,۳۹۷,۱۲۱	۶۶,۱۵۲,۲۶۹	۱۱۵,۵۴۹,۳۹۰	۴۳٪	۵۷٪
۶	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۰	۲۴۵,۷۶۳,۱۵۳	۱۷۰,۲۳۴,۴۵۱	۴۱۵,۹۹۷,۶۰۴	۵۹٪	۴۱٪
۷	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۱	۱۳۷,۰۳۳,۹۸۱	۶۸,۱۷۴,۵۷۱	۲۰۵,۹۰۸,۵۵۲	۶۷٪	۳۳٪
۸	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۲	۴۵۱,۷۷۳,۳۱۵	۳۹۴,۶۸۳,۶۸۳	۸۴۶,۴۵۶,۹۹۷	۵۳٪	۴۷٪
	جمع کل	۹۵۰,۹۵۰,۵۵۲	۷۶۷,۷۳۸,۷۸۱	۱,۷۱۸,۶۸۹,۳۳۴	-	-

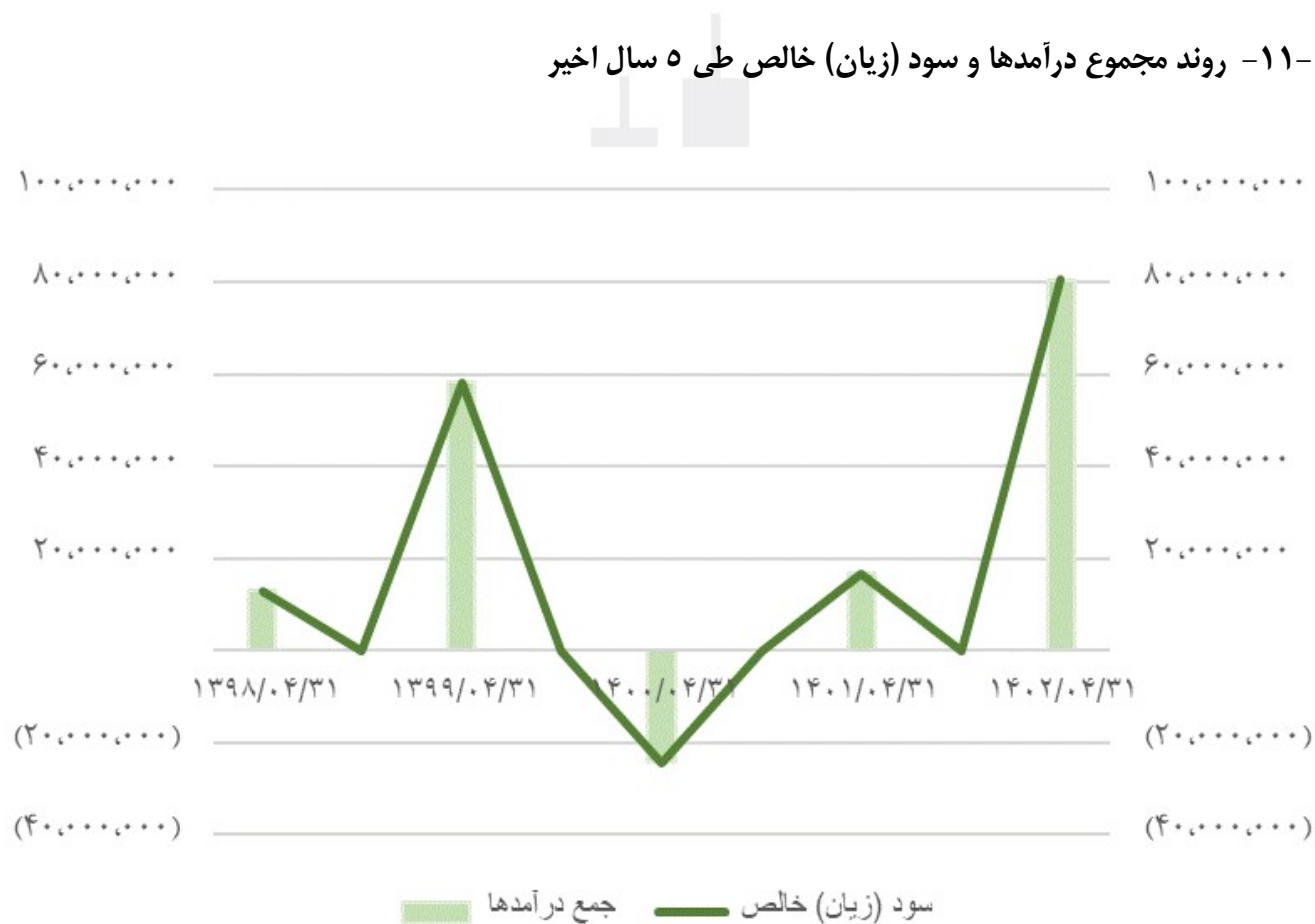
۱۰- نسبت معاملات خرید و فروش در یک سال اخیر (میلیون ریال)

دوره مالی	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات	درصد از کل (خرید)	درصد از کل (فروش)
۱۴۰۱/۰۵/۳۱	۱۳,۰۸۹,۳۹۹	۶,۵۶۵,۳۱۴	۱۹,۶۵۴,۷۱۳	۶۷٪	۳۳٪
۱۴۰۱/۰۶/۳۱	۹,۹۳۵,۵۰۸	۴,۷۲۰,۰۱۹	۱۴,۶۵۵,۵۲۷	۶۸٪	۳۲٪
۱۴۰۱/۰۷/۳۰	۹,۴۴۷,۵۴۵	۲۱,۵۸۳,۶۷۶	۳۱,۰۳۱,۲۲۱	۳۰٪	۷۰٪
۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۳۸,۴۵۱,۲۶۸	۲۲,۷۷۴,۲۰۶	۶۱,۲۲۵,۴۷۴	۶۳٪	۳۷٪
۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۱۶,۸۸۰,۵۷۰	۱۴,۳۶۷,۸۱۷	۳۱,۲۴۸,۳۸۷	۵۴٪	۴۶٪
۱۴۰۱/۱۰/۳۰	۲۴,۲۱۲,۲۲۱	۳۱,۶۴۲,۷۷۵	۵۵,۸۵۴,۹۹۵	۴۳٪	۵۷٪
۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۴۰,۴۰۲,۱۱۲	۲۹,۳۶۳,۵۶۱	۶۹,۷۶۵,۶۷۲	۵۸٪	۴۲٪
۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۴۹,۷۵۸,۹۳۷	۴۷,۰۵۳,۵۶۹	۹۶,۸۱۲,۵۰۵	۵۱٪	۴۹٪
۱۴۰۲/۰۱/۳۱	۴۳,۰۹۳,۹۶۰	۵۲,۹۱۴,۴۷۱	۹۶,۰۰۸,۴۳۱	۴۵٪	۵۵٪
۱۴۰۲/۰۲/۳۱	۱۰۹,۶۴۰,۸۸۸	۹۹,۴۰۷,۳۴۰	۲۰۹,۰۴۸,۲۲۸	۵۲٪	۴۸٪
۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۵۲,۵۸۹,۵۹۹	۲۸,۹۰۸,۹۴۰	۸۱,۴۹۸,۵۳۹	۶۵٪	۳۵٪
۱۴۰۲/۰۴/۳۱	۴۴,۲۷۱,۳۰۸	۳۵,۳۸۱,۹۹۵	۷۹,۶۵۳,۳۰۴	۵۶٪	۴۴٪
جمع	۴۵۱,۷۷۳,۳۱۵	۳۹۴,۶۸۳,۶۸۳	۸۴۶,۴۵۶,۹۹۷	-	-

۱۱ - مقایسه صورت سود و زیان طی سه سال اخیر

۱۴۰۲/۰۴/۳۱	۱۴۰۱/۰۴/۳۱	۱۴۰۰/۰۴/۳۱	درآمدها:
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۵۹,۰۴۶,۹۴۵	۶,۴۶۶,۲۳۰	(۲۲,۰۸۵,۸۲۰)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
(۲,۸۸۶,۵۱۰)	(۶,۱۸۷,۲۴۵)	(۸,۳۱۵,۶۹۶)	سود سهام
۲۰,۴۷۰,۵۵۵	۹,۳۷۴,۵۱۳	۳,۳۴۷,۱۰۰	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب
۳,۹۲۴,۱۵۵	۶,۹۹۵,۲۲۶	۲,۶۲۶,۸۸۲	جمع درآمدها
۸۰,۵۵۵,۱۴۵	۱۶,۶۴۸,۷۲۴	(۲۴,۴۲۷,۵۳۴)	هزینه‌ها:
(۲,۶۹۹)	(۱,۴۹۹)	(۹۰۰)	هزینه کارمزد ارکان
(۱۰۷,۲۷۷)	(۴۵,۳۶۰)	(۲۹,۶۷۱)	سایر هزینه‌ها
۸۰,۴۴۵,۱۶۹	۱۶,۶۰۱,۸۶۵	(۲۴,۴۵۸,۱۰۵)	سود (زیان) قبل از هزینه های مالی
	(۱۱,۳۵۲)	(۱۶,۶۸۳)	هزینه مالی
۸۰,۴۴۵,۱۶۹	۱۶,۵۹۰,۵۱۳	(۲۴,۴۷۴,۷۸۸)	سود (زیان) خالص
۳۳/۹۰	۱۰/۵۱	(۲۳/۵۷)	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
۲۷/۵۳	۸/۴۹	(۱۹/۲۲)	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال

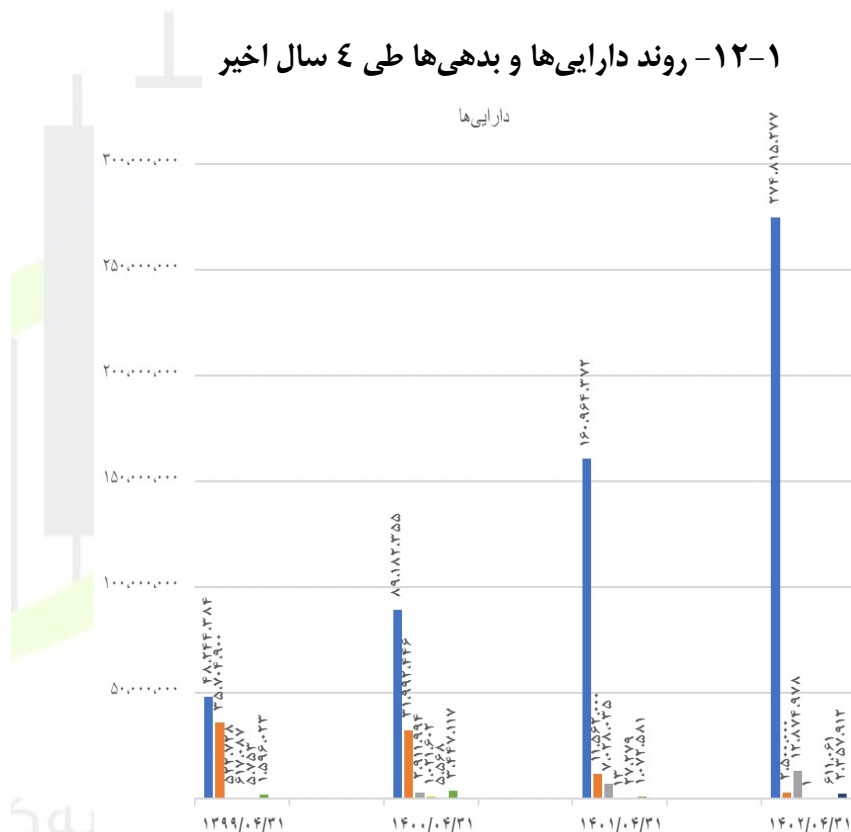
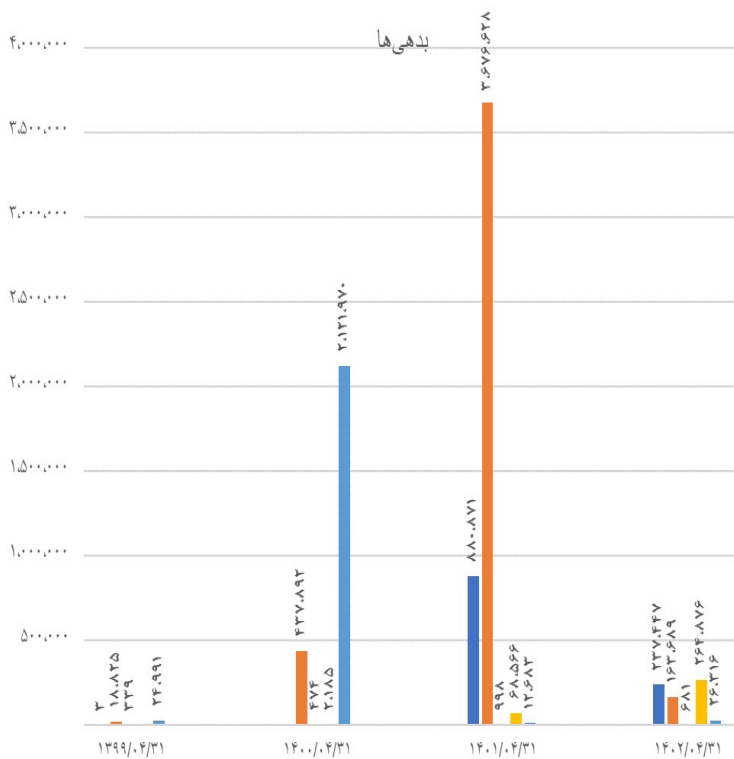
۱۱-۱ روند مجموع درآمدها و سود (زیان) خالص طی ۵ سال اخیر



۱۲ - مقایسه صورت خالص دارایی‌ها طی سه سال اخیر

۱۴۰۲/۰۴/۳۱	۱۴۰۱/۰۴/۳۱	۱۴۰۰/۰۴/۳۱	دارایی‌ها:
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	
۲۷۴,۸۱۵,۲۷۷	۱۶۰,۹۶۴,۳۷۲	۸۹,۱۸۲,۳۵۵	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۲,۳۵۷,۹۱۲	.	.	سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۲,۵۰۰,۰۰۰	۱۱,۵۶۲,۰۰۰	۳۱,۹۹۲,۴۴۶	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱۲,۸۷۴,۹۷۸	۷,۰۲۸,۰۳۵	۲,۹۱۱,۹۹۴	حساب‌های دریافتی
۱	۱۳	۱,۰۲۱,۶۰۲	جاری کارگزاران
۲۷,۲۷۹	۵,۵۶۸	۵,۷۵۳	سایر دارایی‌ها
۶۱۱,۰۶۱	۱,۰۷۲,۵۸۱	۳,۴۴۷,۱۱۷	موجودی نقد
۲۹۳,۱۸۶,۵۰۸	۱۸۰,۶۳۲,۵۶۹	۱۲۸,۵۶۱,۲۶۷	جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۲۳۷,۴۴۷	۸۸۰,۸۷۱	.	جاری کارگزاران
۱۶۳,۶۸۹	۳,۶۷۶,۶۲۸	۴۳۷,۸۹۲	حساب‌های پرداختی
۶۸۱	۹۹۸	۴۷۴	پرداختی به ارکان صندوق
۲۶۴,۸۷۶	۶۸,۵۶۶	۲,۱۸۵	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۲۶,۳۱۶	۱۲,۶۸۳	۲,۱۲۱,۹۷۰	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۶۹۳,۰۱۰	۴,۶۳۹,۷۴۶	۲,۵۶۲,۵۲۱	جمع بدهی‌ها
۲۹۳,۴۹۳,۴۹۸	۱۷۵,۹۹۲,۸۲۳	۱۲۵,۹۹۸,۷۴۶	خالص دارایی‌ها

۱۲-۱- روند دارایی‌ها و بدهی‌ها طی ۴ سال اخیر



- سرمایه‌گذاری در سبده و گواهی سبده بانکی
- سرمایه‌گذاری در سبده بانکی
- حساب‌های دریافتی
- جاری کارگزاران
- سایر دارایی‌ها
- موجودی نقد
- سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری

سایر حساب‌های برداختی و ذخایر ■ برداختی به سرمایه‌گذاران ■ برداختی به ارکان صندوق ■ حساب‌های برداختی ■ جاری کارگزاران ■



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه صندوق توسعه بازار سرمایه



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه