



صندوق سرمایه گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳





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.





صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه

۲

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

مشخصات کلی صندوق سرمایه گذاری مشترک 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



مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری

۲-۱

صندوق سرمایه گذاری مشترک 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 ۳۴,۷۲۵,۱۷۴ واحد افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری صندوق به شرح جدول زیر می باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه گذاری	میانگین صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال)	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۴,۲۵۶,۹۷۹	۳,۸۳۹,۶۳۳	%۱۲/۲۶
۲	کارگزاری مفید	۳,۸۴۰,۹۲۰	۶,۵۶۱,۹۶۳	%۱۱/۰۶
۳	بانک صادرات	۲,۱۹۸,۳۴۴	۲,۲۷۴,۱۰۶	%۶/۳۳
۴	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۹۶۱,۲۵۴	%۵/۸۴
۵	بورس اوراق بهادار تهران	۱,۹۸۸,۷۸۰	۵,۸۸۰,۹۶۷	%۵/۷۳
۶	کارگزاری آگاه	۱,۷۳۱,۲۹۲	۶,۴۸۳,۰۹۳	%۴/۹۹
۷	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۹۷۶,۷۳۰	%۴/۴۲
۸	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹۰۲,۱۵۰	%۳/۱۰
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	%۲/۰۰
۱۰	ییمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۶۳,۳۴۶	۱,۵۰۷,۵۰۸	%۱/۹۱
۱۱	سایر	۱۴,۷۱۱,۷۲۴	—	%۴۲/۳۷
	جمع کل	۳۴,۷۲۵,۱۷۴	—	%۱۰۰



مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری

مجموع واحدهای سرمایه گذاری متعلق به هر یک از طبقات در کل به شرح جدول زیر می باشد:

ردیف	شرح	تعداد	درصد مالکیت
۱	طبقه اول: بورس اوراق بهادار تهران، فرابورس ایران، مدیریت فناوری بورس تهران و سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه	۳,۶۶۳,۴۸۲	%۱۰/۵۵
۲	طبقه دوم: بانک ها و مؤسسات مالی و اعتباری، شرکت ها و نهادهای بیمه ای	۱۲,۴۱۲,۷۹۳	%۳۵/۷۵
۳	طبقه سوم: کانون ها، تشکل ها، نهادهای مالی و دیگر شرکت های ثبت شده نزد سازمان	۱۸,۶۴۸,۸۹۹	%۵۳/۷۰
جمع کل		۳۴,۷۲۵,۱۷۴	%۱۰۰



ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱

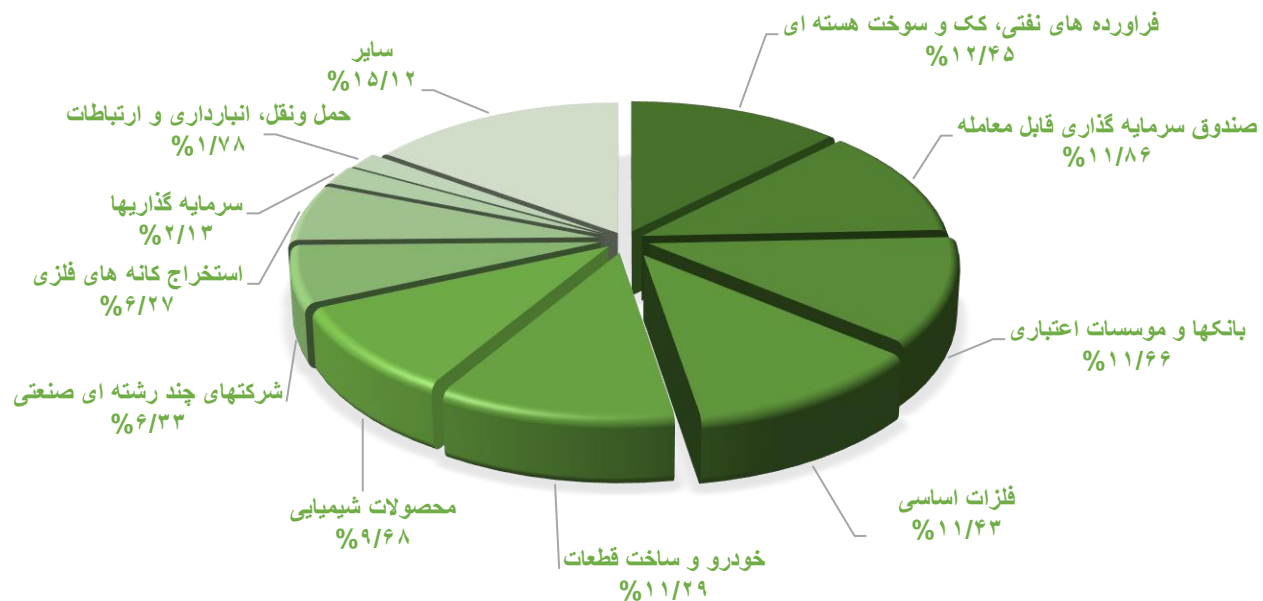
سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صناعی که صندوق در آنها به بازارگردانی سهام پرداخته است، ۴۲ صنعت در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ می باشد. همچنین صندوق در ۴۵۸ نماد در بازار سهام فعال بوده است.

ردیف	صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۴۰۳/۰۴/۳۱
۱	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۲/۴۵٪
۲	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله	۱۱/۸۶٪
۳	بانک ها و موسسات اعتباری	۱۱/۶۶٪
۴	فلزات اساسی	۱۱/۴۳٪
۵	خودرو و ساخت قطعات	۱۱/۲۹٪
۶	محصولات شیمیایی	۹/۶۸٪
۷	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۶/۳۳٪
۸	استخراج کانه های فلزی	۶/۲۷٪
۹	سرمایه گذاریها	۲/۱۳٪
۱۰	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱/۷۸٪
۱۱	سایر	۱۵/۱۲٪
	جمع کل	۱۰۰٪



بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱

۲-۳





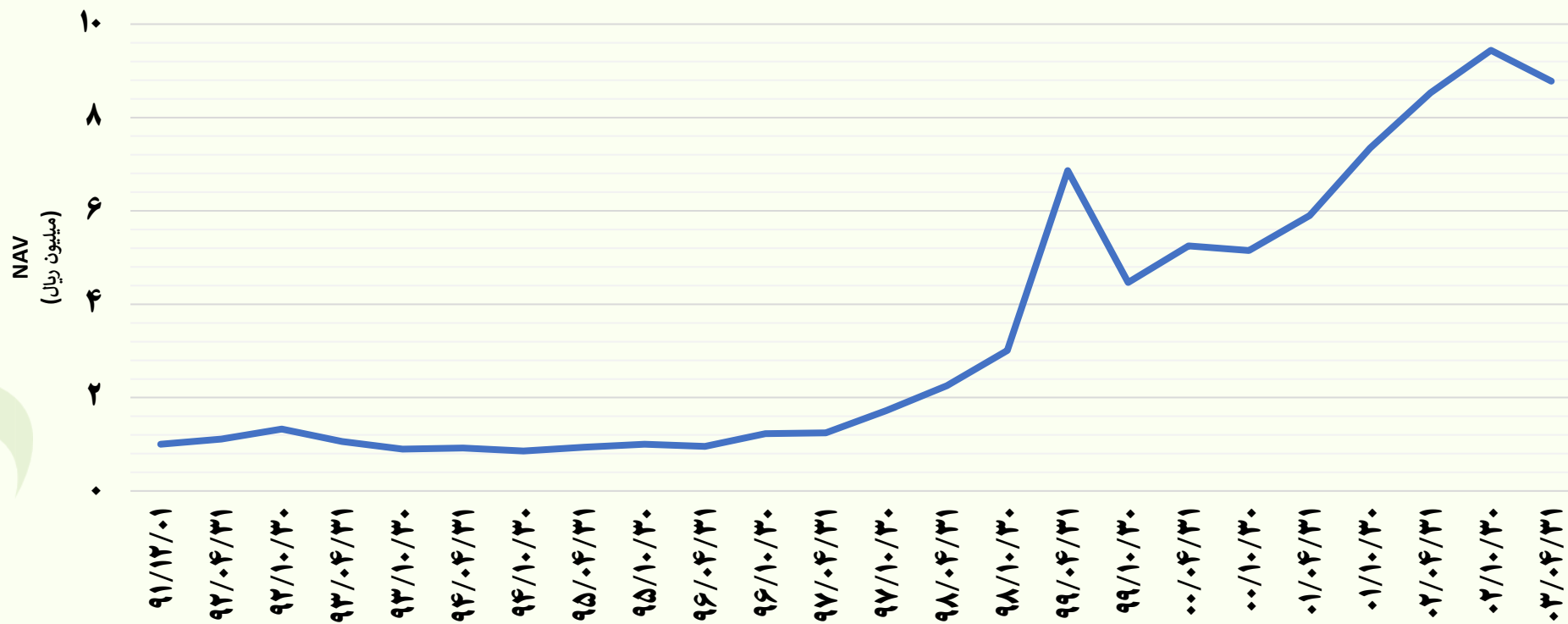
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

توضیحات	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
هفته گذشته	%(۲,۳۱)	%(۱,۳۲)
ماه گذشته	%۳,۷۹	%۶,۲۷
۳ ماه گذشته	%(۱۱,۸۲)	%(۶,۲۴)
۶ ماه گذشته	%(۳,۵۴)	%۲,۴۶
یک سال گذشته	%۲,۹۱	%۹,۵۳



خالص ارزش روز هر واحد سرمایه گذاری صندوق

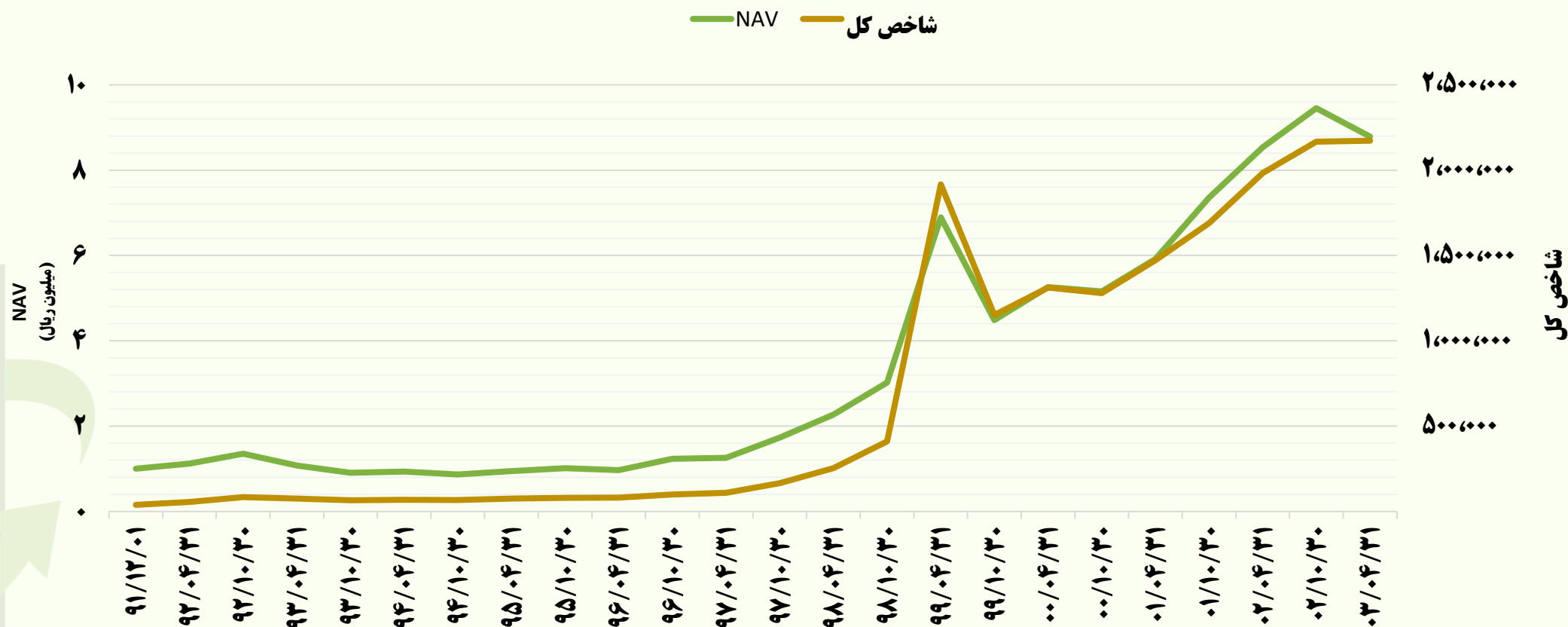
همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ به شرح نمودار زیر می باشد:





روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه گذاری صندوق و شاخص کل

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ به شرح نمودار زیر می باشد:





وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت های کارگزاری (میلیون ریال)

نام کارگزار	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات	درصد از کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۶۱۳,۶۱۱,۳۷۶	۵۸۵,۹۳۰,۸۷۱	۱,۱۹۹,۵۴۲,۲۴۷	۹۸,۰۶%
کارگزاری بانک پاسارگاد	۸۸۹	۳۹	۹۲۸	۰,۰۰%
کارگزاری مفید	۱۵,۴۵۷,۵۹۷	۸,۲۱۶,۶۲۴	۲۳,۶۷۴,۲۲۱	۱,۹۴%
جمع کل	۶۲۹,۰۶۹,۸۶۲	۵۹۴,۱۴۷,۵۳۴	۱,۲۲۳,۲۱۷,۳۹۶	۱۰۰%



نسبت معاملات خرید و فروش در ده سال اخیر (میلیون ریال)

نسبت معاملات (درصد از کل حجم معاملات) خرید و فروش در ده سال اخیر به شرح جدول زیر می باشد:

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 ۱۳۹۴	۱۹,۴۴۱,۳۱۷	۱۶,۷۲۴,۴۶۸	۳۶,۱۶۵,۷۸۶	%۵۴	%۴۶
۲	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۵	۱۱,۱۹۵,۱۵۷	۷,۸۸۱,۵۴۶	۱۹,۰۷۶,۷۰۳	%۵۹	%۴۱
۳	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۶	۷,۷۷۹,۰۱۳	۶,۳۹۹,۳۸۲	۱۴,۱۷۸,۳۹۴	%۵۵	%۴۵
۴	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۷	۱۵,۸۱۳,۷۶۵	۱۵,۲۶۶,۴۲۴	۳۱,۰۸۰,۱۸۹	%۵۱	%۴۹
۵	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۸	۳۲,۱۹۵,۰۴۹	۳۸,۲۴۶,۴۵۶	۷۰,۴۴۱,۵۰۵	%۴۶	%۵۴
۶	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۹	۴۹,۳۹۷,۱۲۱	۶۶,۱۵۲,۲۶۹	۱۱۵,۵۴۹,۳۹۰	%۴۳	%۵۷
۷	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۰	۲۴۵,۷۶۳,۱۵۳	۱۷۰,۲۳۴,۴۵۱	۴۱۵,۹۹۷,۶۰۴	%۵۹	%۴۱
۸	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۱	۱۳۷,۰۳۳,۹۸۱	۶۸,۸۷۴,۵۷۱	۲۰۵,۹۰۸,۵۵۲	%۶۷	%۳۳
۹	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۲	۴۵۱,۷۷۳,۳۱۵	۳۹۴,۶۸۳,۶۸۳	۸۴۶,۴۵۶,۹۹۷	%۵۳	%۴۷
۱۰	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۳	۶۲۹,۰۶۹,۸۶۲	۵۹۴,۱۴۷,۵۳۴	۱,۲۲۳,۲۱۷,۳۹۶	%۵۱	%۴۹
	جمع کل	۱,۵۹۹,۴۶۱,۷۳۲	۱,۳۷۸,۶۱۰,۷۸۳	۲,۹۷۸,۰۷۲,۵۱۵	-	-



نسبت معاملات خرید و فروش در یکسال اخیر (میلیون ریال)

نسبت معاملات (درصد از کل حجم معاملات) خرید و فروش در یکسال اخیر به شرح جدول زیر می باشد:

ردیف	دوره مالی	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات	درصد از کل (خرید)	درصد از کل (فروش)
۱	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	۴۹,۵۷۳,۶۸۸	۴۴,۸۷۳,۳۵۶	۹۴,۴۴۷,۰۴۴	%۵۲	%۴۸
۲	۱۴۰۲/۰۶/۳۱	۶۲,۲۳۳,۲۵۸	۵۴,۷۷۸,۲۳۲	۱۱۷,۰۱۱,۴۹۱	%۵۳	%۴۷
۳	۱۴۰۲/۰۷/۳۰	۶۲,۴۵۹,۹۳۲	۵۴,۷۹۵,۸۰۵	۱۱۷,۲۵۵,۷۳۷	%۵۳	%۴۷
۴	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۶۵,۲۴۳,۳۰۴	۶۳,۹۴۳,۵۴۷	۱۲۹,۱۸۶,۸۵۱	%۵۱	%۴۹
۵	۱۴۰۲/۰۹/۳۰	۷۱,۵۷۹,۹۱۷	۶۸,۷۳۰,۷۰۷	۱۴۰,۳۱۰,۶۲۴	%۵۱	%۴۹
۶	۱۴۰۲/۱۰/۳۰	۶۷,۵۱۶,۰۰۱	۵۸,۶۶۸,۶۹۴	۱۲۶,۱۸۴,۶۹۵	%۵۴	%۴۶
۷	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	۸۰,۹۲۲,۰۰۲	۸۲,۵۲۴,۵۷۷	۱۶۳,۴۴۶,۵۷۸	%۵۰	%۵۰
۸	۱۴۰۲/۱۲/۲۹	۳۸,۱۵۱,۸۱۱	۳۸,۹۶۵,۱۴۹	۷۷,۱۱۶,۹۶۰	%۴۹	%۵۱
۹	۱۴۰۳/۰۱/۳۱	۳۱,۲۸۶,۸۴۳	۲۸,۳۶۱,۲۹۶	۵۹,۶۴۸,۱۳۹	%۵۲	%۴۸
۱۰	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	۲۶,۸۳۴,۹۵۱	۲۶,۲۲۷,۰۷۰	۵۳,۰۶۲,۰۲۱	%۵۱	%۴۹
۱۱	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	۲۳,۶۶۶,۴۸۹	۲۴,۷۹۳,۸۵۶	۴۸,۴۶۰,۳۴۶	%۴۹	%۵۱
۱۲	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	۴۹,۶۰۱,۶۶۶	۴۷,۴۸۵,۲۴۴	۹۷,۰۸۶,۹۱۰	%۵۱	%۴۹
جمع کل		۶۲۹,۰۶۹,۸۶۲	۵۹۴,۱۴۷,۵۳۴	۱,۲۲۳,۲۱۷,۳۹۶	-	-



مقایسه صورت سود و زیان طی سه سال اخیر

۱۴۰۳/۰۴/۳۱	۱۴۰۲/۰۴/۳۱	۱۴۰۱/۰۴/۳۱	درآمدها:
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	سود فروش اوراق بهادار
۲۳,۹۶۲,۹۶۶	۶۰,۲۲۰,۵۰۰	۶,۴۶۶,۲۳۰	زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
(۴۰,۹۴۳,۶۵۴)	(۲,۸۸۶,۵۱۰)	(۶,۱۸۷,۲۴۵)	سود سهام
۲۴,۲۶۵,۰۹۶	۲۰,۴۷۰,۵۵۵	۹,۳۷۴,۵۱۳	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۱۷۲,۲۹۸	۲,۷۳۵,۱۷۴	۶,۹۹۵,۲۲۶	سایر درآمدها
۳۲,۳۵۶	۱۵,۴۲۶		جمع درآمدها
۸,۴۸۹,۰۶۱	۸۰,۵۵۵,۱۴۴	۱۶,۶۴۸,۷۲۴	هزینه‌ها:
			هزینه کارمزد ارکان
(۳,۸۲۶)	(۲,۶۹۹)	(۱,۴۹۹)	سایر هزینه‌ها
(۱۹۹,۱۸۵)	(۱۰۷,۲۷۷)	(۴۵,۳۶۰)	سود قبل از هزینه های مالی
۸,۲۸۶,۰۴۹	۸۰,۴۴۵,۱۶۸	۱۶,۶۰۱,۸۶۵	هزینه مالی
		(۱۱,۳۵۲)	سود خالص
۸,۲۸۶,۰۴۹	۸۰,۴۴۵,۱۶۸	۱۶,۵۹۰,۵۱۳	
۲/۶۲	۳۳/۹۰	۱۰/۵۱	بازده میانگین سرمایه گذاری
۲/۷۳	۲۷/۵۳	۸/۴۹	بازده سرمایه گذاری پایان سال



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

۴-۱



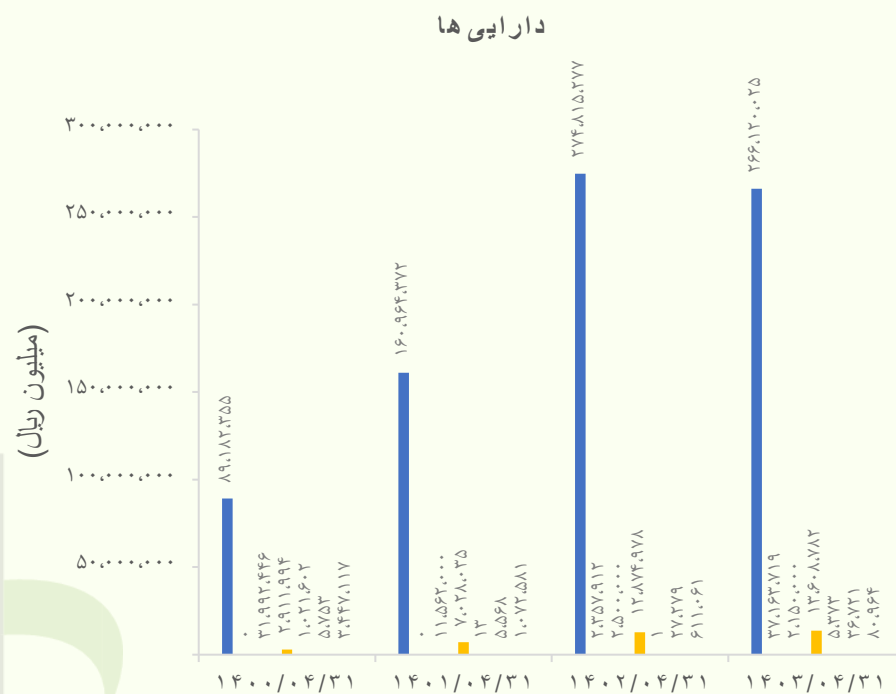


مقایسه صورت خالص دارایی‌ها طی سه سال اخیر

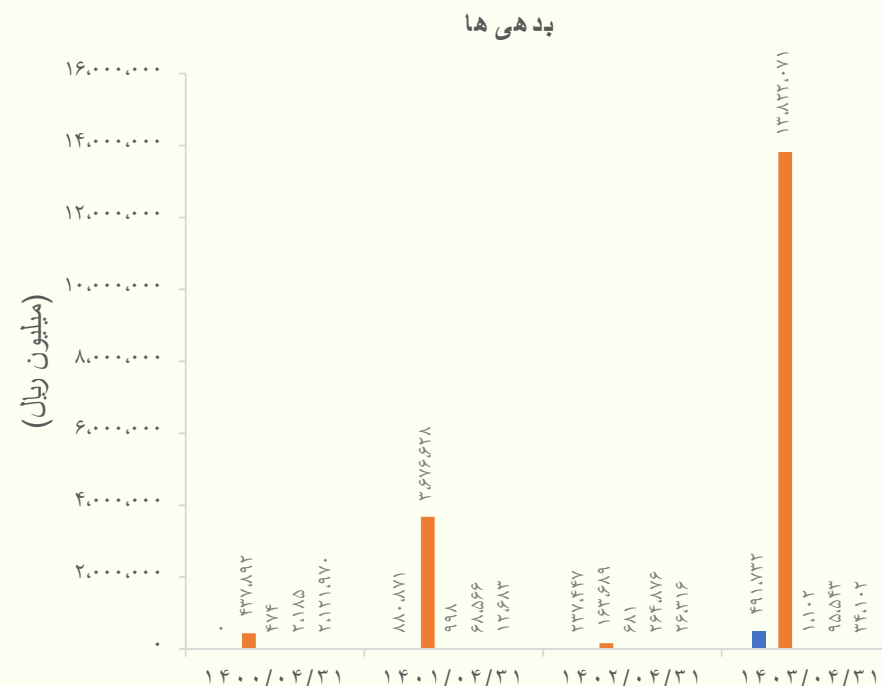
۱۴۰۳/۰۴/۳۱	۱۴۰۲/۰۴/۳۱	۱۴۰۱/۰۴/۳۱	دارایی‌ها:
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	
۲۶۶,۱۲۰,۰۲۵	۲۷۴,۸۱۵,۲۷۷	۱۶۰,۹۶۴,۳۷۲	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۳۷,۱۶۳,۷۱۹	۲,۳۵۷,۹۱۲		سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۲,۱۵۰,۰۰۰	۲,۵۰۰,۰۰۰	۱۱,۵۶۲,۰۰۰	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱۳,۶۰۸,۷۸۲	۱۲,۸۷۴,۹۷۸	۷,۰۲۸,۰۳۵	حساب‌های دریافتی
۵,۳۷۳		۱۳	جاری کارگزاران
۳۶,۷۲۱	۲۷,۲۷۹	۵,۵۶۸	سایر دارایی‌ها
۸۰,۹۶۴	۶۱۱,۰۶۱	۱۰,۷۲۵,۵۸۱	موجودی نقد
۳۱۹,۱۶۵,۵۸۴	۲۹۳,۱۸۶,۵۰۷	۱۸۰,۶۳۲,۵۶۹	جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۴۹۱,۷۳۲	۲۳۷,۴۴۷	۸۸۰,۸۷۱	جاری کارگزاران
۱۳,۸۲۲,۰۷۱	۱۶۳,۶۸۹	۳,۶۷۶,۶۲۸	حساب‌های پرداختی
۱,۱۰۲	۶۸۱	۹۹۸	پرداختی به ارکان صندوق
۹۵,۵۴۳	۲۶۴,۸۷۶	۶۸,۵۶۶	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۳۴,۱۰۲	۲۶,۳۱۶	۱۲,۶۸۳	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۱۴,۴۴۴,۵۵۰	۶۹۳,۰۰۹	۴,۶۳۹,۷۴۶	جمع بدهی‌ها
۳۰۴,۷۲۱,۰۳۴	۲۹۲,۴۹۳,۴۹۸	۱۷۵,۹۹۲,۸۲۳	خالص دارایی‌ها



رند دارایی ها و بدهی ها طی ۴ سال اخیر



- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
- سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
- جاری کارگزاران
- موجودی نقد
- سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
- حساب‌های دریافتی
- سایر دارایی‌ها



- حساب‌های پرداختی
- پرداختی به سرمایه‌گذاران
- پرداختی به ارکان صندوق
- سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
- جاری کارگزاران



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه