



صندوق سرمایه گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۴





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	
هیأت مدیره صندوق	مدیر
موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت ارقام نگر آریا	متولی
موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت سامان پندار	حسابرس

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 ۴۸,۲۹۸,۰۲۱ 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	۷,۲۸۲,۵۱۸	۶,۳۶۳,۹۰۱	%۱۵/۰۸
۲	بانک صادرات	۶,۱۳۵,۹۰۶	۷,۶۵۹,۷۱۰	%۱۲/۷۰
۳	بانک ملت	۳,۹۵۰,۶۶۰	۹,۸۸۱,۱۲۶	%۸/۱۸
۴	بانک ملی	۳,۷۷۰,۷۱۶	۴,۷۶۰,۳۰۱	%۷/۸۱
۵	صندوق بازنشستگی، وظیفه، ازکارافتادگی و پس انداز کارکنان بانکهای ملی و ادغام شده	۳,۷۱۷,۲۴۱	۱۰,۷۶۰,۶۵۴	%۷/۷۰
۶	کارگزاری مفید	۳,۳۸۰,۹۲۰	۶,۹۹۷,۸۶۸	%۷/۰۰
۷	بورس اوراق بهادار تهران	۲,۰۹۹,۶۷۲	۶,۱۳۵,۶۲۱	%۴/۳۵
۸	کارگزاری آگاه	۱,۵۱۲,۲۴۶	۶,۸۲۸,۴۵۷	%۳/۱۳
۹	بانک سپه	۱,۳۱۵,۹۱۶	۲,۷۸۸,۸۳۵	%۲/۷۲
۱۰	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	%۱/۴۴
۱۱	سایر	۱۴,۴۳۷,۲۵۵	—	%۲۹/۸۹
	جمع کل	۴۸,۲۹۸,۰۲۱	—	%۱۰۰



مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری

۲-۱

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	۳,۳۴۹,۰۰۴	۱۰,۵٪
۲	طبقه دوم: بانک ها و مؤسسات مالی و اعتباری، شرکت ها و نهادهای بیمه ای	۲۵,۷۸۱,۴۸۲	۳۵,۷٪
۳	طبقه سوم: کانون ها، تشکلات، نهادهای مالی و دیگر شرکت های ثبت شده نزد سازمان	۱۹,۱۶۷,۵۳۵	۵۳,۷٪
	جمع کل	۴۸,۲۹۸,۰۲۱	۱۰۰٪



ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

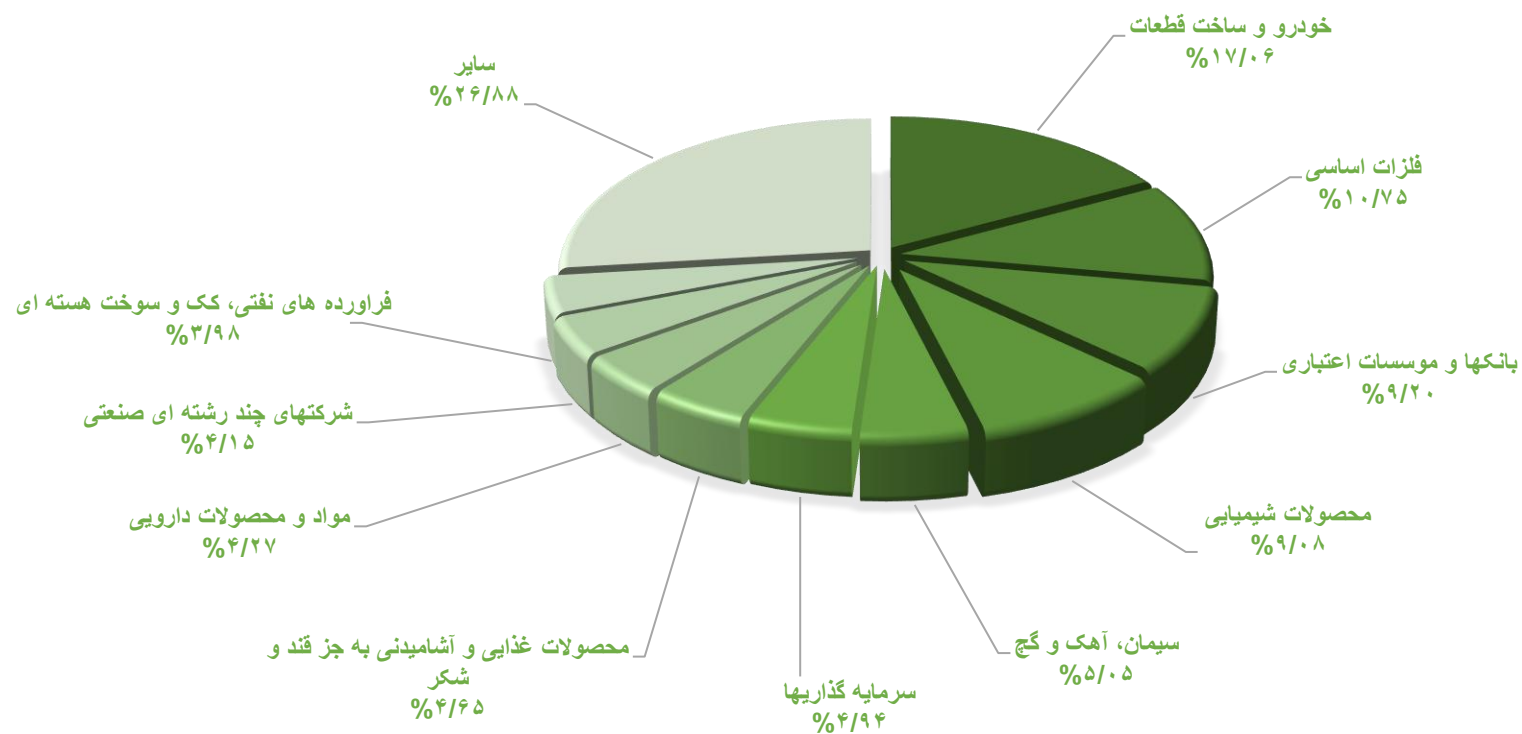
سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صناعی که صندوق در آنها به بازارگردانی سهام پرداخته است، ۴۵ صنعت در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ می باشد. همچنین صندوق در ۶۰۸ نماد در بازار سهام فعال بوده است.

ردیف	صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۴۰۴/۰۴/۳۱
۱	خودرو و ساخت قطعات	۱۷/۰۶٪
۲	فلزات اساسی	۱۰/۷۵٪
۳	بانکها و موسسات اعتباری	۹/۲۰٪
۴	محصولات شیمیایی	۹/۰۸٪
۵	سیمان، آهک و گچ	۵/۰۵٪
۶	سرمایه گذاریها	۴/۹۴٪
۷	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۴/۶۵٪
۸	مواد و محصولات دارویی	۴/۲۷٪
۹	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴/۱۵٪
۱۰	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳/۹۸٪
۱۱	سایر	۲۶/۸۸٪
جمع کل		۱۰۰٪



بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

۲-۳





بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

توضیحات	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
هفته گذشته	۲,۶۱٪	۲,۹۸٪
ماه گذشته	(۷,۹۵)٪	(۴,۷۱)٪
۳ ماه گذشته	(۱۱,۵۷)٪	(۹,۳۴)٪
۶ ماه گذشته	(۱,۹۷)٪	۱,۰۵٪
یک سال گذشته	۲۵,۰۱٪	۳۱,۱۲٪



خالص ارزش روز هر واحد سرمایه گذاری صندوق

۳-۱

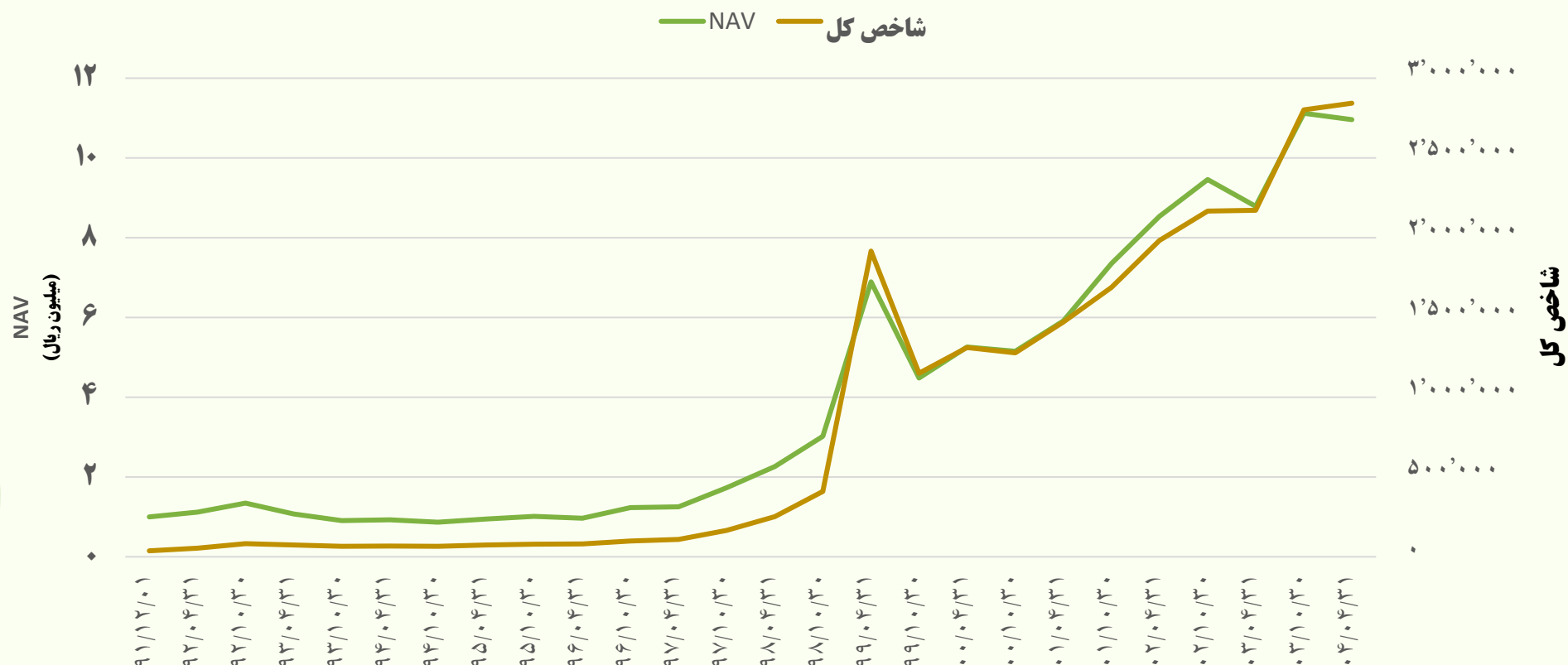
همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ به شرح نمودار زیر می باشد:





رشد 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 ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ به شرح نمودار زیر می باشد:





وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری (میلیون ریال)

نام کارگزار	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات	درصد از کل معاملات
کارگزاری ایستگاه معاملاتی صندوق	۱،۲۲۱،۲۸۳،۰۶۴	۱،۰۴۸،۰۹۱،۰۸۹	۲،۲۶۹،۳۷۴،۱۵۳	%۹۸،۹۴
کارگزاری مفید	۱۱،۷۲۵،۵۶۰	۱۲،۶۹۰،۶۸۰	۲۴،۴۱۶،۲۴۰	%۱،۰۶
جمع کل	۱،۲۳۳،۰۰۸،۶۲۴	۱،۰۶۰،۷۸۱،۷۶۹	۲،۲۹۳،۷۹۰،۳۹۳	%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 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،۸۷۴،۵۷۱	۲۰۵،۹۰۸،۵۵۲	%۶۷	%۳۳
۸	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۲	۴۵۱،۷۷۳،۳۱۵	۳۹۴،۶۸۳،۶۸۳	۸۴۶،۴۵۶،۹۹۷	%۵۳	%۴۷
۹	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۳	۶۲۹،۰۶۹،۸۶۲	۵۹۴،۱۴۷،۵۳۴	۱،۲۲۳،۲۱۷،۳۹۶	%۵۱	%۴۹
۱۰	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۴	۱،۲۳۳،۰۰۸،۶۲۴	۱،۰۶۰،۷۸۱،۷۶۹	۲،۲۹۳،۷۹۰،۳۹۳	%۵۴	%۴۶
	جمع کل	۲،۸۱۳،۰۲۹،۰۳۹	۲،۴۲۲،۶۶۸،۰۸۴	۵،۲۳۵،۶۹۷،۱۲۳	-	-



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	۱۴۰۳/۰۵/۳۱	۷۶,۲۱۸,۵۸۳	۷۸,۱۲۱,۲۴۱	۱۵۴,۳۳۹,۸۲۳	%۴۹	%۵۱
۲	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	۶۰,۳۹۱,۱۲۱	۵۴,۷۲۹,۶۷۰	۱۱۵,۱۲۰,۷۹۱	%۵۲	%۴۸
۳	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	۳۵,۵۵۰,۵۸۶	۲۵,۴۲۷,۸۰۱	۶۰,۹۷۸,۳۸۶	%۵۸	%۴۲
۴	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	۲۲,۷۳۸,۴۷۱	۱۵,۹۹۹,۹۳۰	۳۸,۷۳۸,۴۰۱	%۵۹	%۴۱
۵	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۴۲,۰۰۷,۵۹۰	۴۷,۷۶۷,۴۹۲	۸۹,۷۷۵,۰۸۲	%۴۷	%۵۳
۶	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۸۲,۷۸۴,۲۷۹	۸۲,۴۸۵,۳۵۳	۱۶۵,۲۶۹,۶۳۱	%۵۰	%۵۰
۷	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۸۴,۹۳۰,۰۱۴	۷۷,۷۹۵,۸۱۸	۱۶۲,۷۲۵,۸۳۱	%۵۲	%۴۸
۸	۱۴۰۳/۱۲/۳۰	۸۸,۸۳۶,۱۴۸	۷۹,۳۶۱,۰۰۹	۱۶۸,۱۹۷,۱۵۷	%۵۳	%۴۷
۹	۱۴۰۴/۰۱/۳۱	۶۳,۲۳۸,۶۴۱	۷۸,۶۶۲,۴۶۰	۱۴۱,۹۰۱,۱۰۱	%۴۵	%۵۵
۱۰	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	۱۵۲,۱۴۹,۰۴۷	۱۳۷,۷۸۲,۷۷۶	۲۸۹,۹۳۱,۸۲۴	%۵۲	%۴۸
۱۱	۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۸۰,۱۹۷,۱۹۴	۷۴,۷۱۷,۸۳۶	۱۵۴,۹۱۵,۰۳۰	%۵۲	%۴۸
۱۲	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۴۴۳,۹۶۶,۹۵۲	۳۰۷,۹۳۰,۳۸۳	۷۵۱,۸۹۷,۳۳۵	%۵۹	%۴۱
جمع کل		۱,۲۳۳,۰۰۸,۶۲۴	۱,۰۶۰,۷۸۱,۷۶۹	۲,۲۹۳,۷۹۰,۳۹۳	-	-

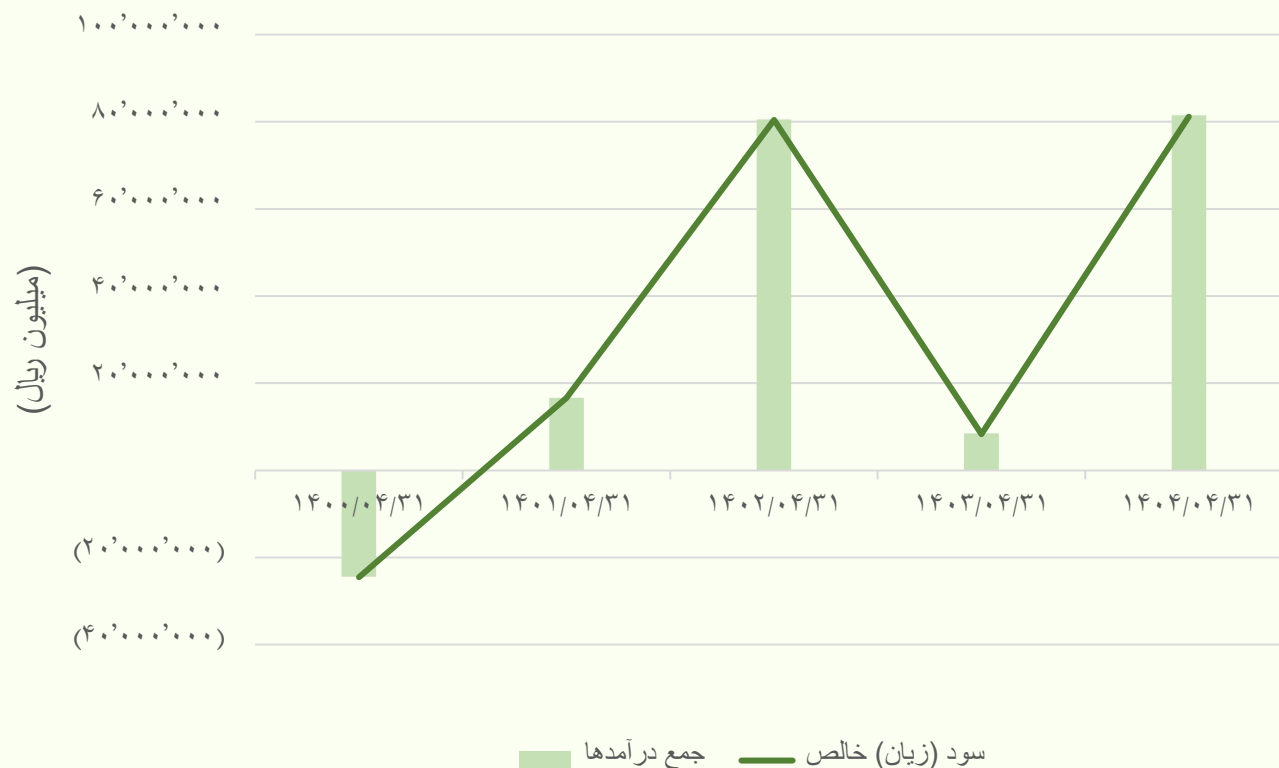


مقایسه صورت سود و زیان طی سه سال اخیر

۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	۱۴۰۲/۰۴/۳۱	درآمدها:
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	سود فروش اوراق بهادار
۶۶,۳۳۳,۱۹۹	۲۳,۹۶۲,۹۶۶	۶۰,۲۲۰,۵۰۰	زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
(۱۱,۷۶۰,۲۷۶)	(۴۰,۹۴۳,۶۵۴)	(۲,۸۸۶,۵۱۰)	سود سهام
۲۴,۶۲۴,۸۵۷	۲۴,۲۶۵,۰۹۶	۲۰,۴۷۰,۵۵۵	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۲,۲۵۲,۸۶۴	۱,۱۷۲,۲۹۸	۲,۷۳۵,۱۷۴	سایر درآمدها
۳۰,۷۳۶	۳۲,۳۵۶	۱۵,۴۲۶	جمع درآمدها
۸۱,۴۸۱,۳۸۱	۸۰,۴۸۹,۰۶۱	۸۰,۵۵۵,۱۴۵	هزینه‌ها:
			هزینه کارمزد ارکان
(۷,۳۰۸)	(۳,۸۲۶)	(۲,۶۹۹)	سایر هزینه‌ها
(۳۰۲,۸۷۸)	(۱۹۹,۱۸۵)	(۱۰۷,۲۷۷)	سود قبل از هزینه های مالی
۸۱,۱۷۱,۱۹۵	۸۰,۲۸۶,۰۴۹	۸۰,۴۴۵,۱۶۹	هزینه مالی
۸۱,۱۷۱,۱۹۵	۸۰,۲۸۶,۰۴۹	۸۰,۴۴۵,۱۶۹	سود خالص
۲۱/۴۸	۲/۶۲	۳۳/۹۰	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
۱۵/۴۲	۲/۷۳	۲۷/۵۳	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال



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



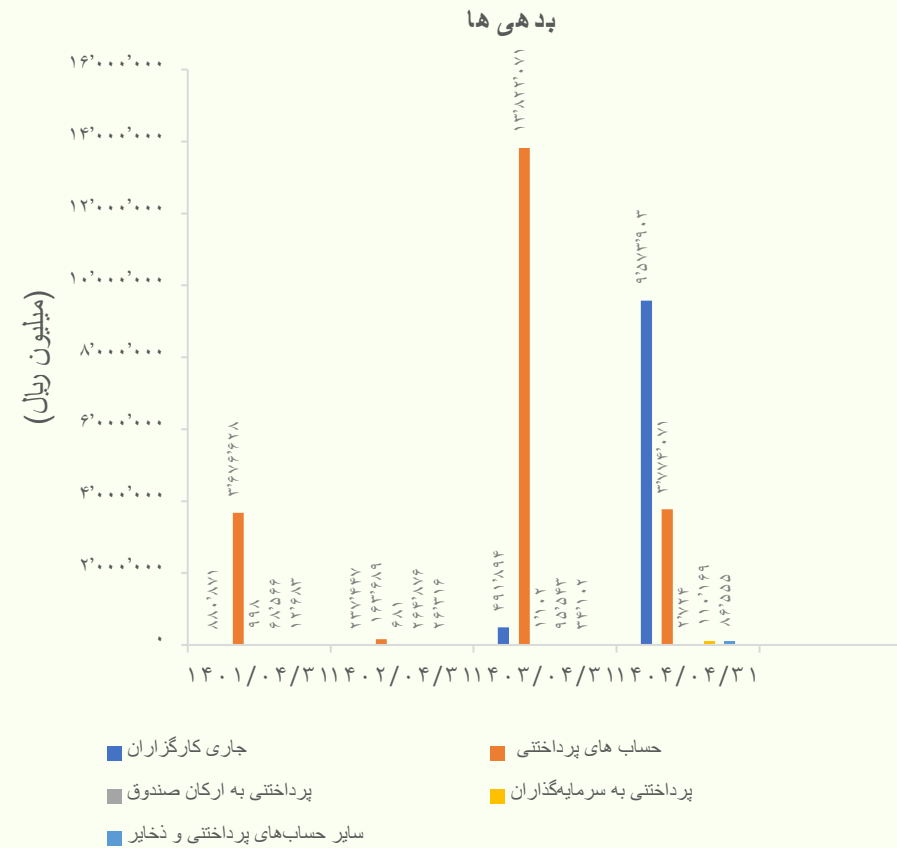


مقایسه صورت خالص دارایی‌ها طی سه سال اخیر

۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	۱۴۰۲/۰۴/۳۱	دارایی‌ها:
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	
۵۰۵,۸۴۳,۱۰۸	۲۶۶,۱۲۰,۰۲۵	۲۷۴,۸۱۵,۲۷۷	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۵۲۱,۹۷۶	۳۷,۱۶۳,۷۱۹	۲,۳۵۷,۹۱۲	سرمایه گذاری در صندوق‌های سرمایه گذاری
۱,۲۵۰,۱۰۰	۲,۱۵۰,۰۰۰	۲,۵۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱۴,۸۳۴,۳۴۳	۱۳,۶۰۴,۷۸۲	۱۲,۸۷۴,۹۷۸	حساب‌های دریافتی
۵,۹۷۳	۵,۵۳۶	۱	جاری کارگزاران
۳۵,۸۴۳	۴۰,۷۲۱	۲۷,۲۷۹	سایر دارایی‌ها
۱۹,۵۸۵,۰۳۲	۸۰,۹۶۴	۶۱۱,۰۶۱	موجودی نقد
<u>۵۴۲,۰۷۶,۳۷۵</u>	<u>۳۱۹,۱۶۵,۷۴۶</u>	<u>۲۹۳,۱۸۶,۵۰۸</u>	جمع دارایی‌ها
۹,۵۷۳,۹۰۳	۴۹۱,۸۹۴	۲۳۷,۴۴۷	بدهی‌ها:
۳,۷۷۴,۰۷۱	۱۳,۸۲۲,۰۷۱	۱۶۳,۶۸۹	جاری کارگزاران
۲,۷۲۴	۱,۱۰۲	۶۸۱	حساب‌های پرداختی
۱۱۰,۱۶۹	۹۵,۵۴۳	۲۶۴,۸۷۶	پرداختی به ارکان صندوق
۸۶,۵۵۵	۳۴,۱۰۲	۲۶,۳۱۶	پرداختی به سرمایه‌گذاران
<u>۱۳,۵۴۷,۴۲۲</u>	<u>۱۴,۴۴۴,۷۱۲</u>	<u>۶۹۳,۰۱۰</u>	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
<u>۵۲۸,۵۲۸,۹۵۳</u>	<u>۳۰۴,۷۲۱,۰۳۴</u>	<u>۲۹۲,۴۹۳,۴۹۸</u>	جمع بدهی‌ها
			خالص دارایی‌ها



رشد دارایی ها و بدهی ها طی ۴ سال اخیر





صندوق سرمایه گذاری مشترک
توسعه بازار سرمایه