



صندوق سرمایه‌گذاری شرکت توسعه بازار سرمایه

**صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه**

**گزارش عملکرد شش ماهه**

**منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۶**



## فهرست مطالب

### عنوان صفحه

۳	..... <u>۱- مقدمه</u>
۳	..... <u>۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه</u>
۴	..... <u>۱-۲- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری</u>
۵	..... <u>۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق</u>
۶	..... <u>۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۹۶/۱۰/۳۰</u>
۶	..... <u>۱-۳- بازده صندوق</u>
۸	..... <u>۲-۳- معاملات</u>



## 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:	۱۳۹۶/۱۰/۳۰
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود

### ارکان صندوق

مدیر	هیأت مدیره صندوق
متولی	مشاور سرمایه‌گذاری تأمین سرمایه نوین
حسابرس	موسسه حسابرسی رهبین

## 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 ۱۱,۴۲۲,۳۳۳ میلیون ریال افزایش یافته است. تغییرات مذکور به شرح جدول زیر ارائه شده است.

ردیف	نام شرکت	واحدهای صدور در زمان تاسیس	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۵/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۶/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۶/۱۰/۳۰	درصد تغییر ۶ ماهه سال مالی منتهی به ۹۷/۰۴/۳۱
۱	بانک تجارت	۰	۱,۹۱۰,۱۸۶	۱,۹۱۰,۱۸۶	۲,۰۰۶,۷۷۴	۵.۰۵٪
۲	بانک ملی	۰	۱,۵۰۴,۵۵۵	۱,۶۰۹,۳۸۶	۱,۷۰۵,۹۷۴	۶.۰۰٪
۳	بانک صادرات	۰	۱,۴۴۰,۱۲۸	۱,۵۴۴,۶۰۵	۱,۵۴۴,۶۰۵	۰.۰۰٪
۴	گروه مالی ملت	۰	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۵۳۵,۳۶۰	۶.۶۸٪
۵	بانک سپه	۰	۸۳۲,۳۹۹	۹۷۸,۵۰۰	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹.۸۷٪
۶	بانک پاسارگاد	۰	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۰.۰۰٪
۷	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۰	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۰.۰۰٪
۸	بیمه ایران	۰	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۰.۰۰٪
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۰	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۰.۰۰٪
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۰.۰۰٪
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۰	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۰.۰۰٪
۱۲	صندوق سرمایه گذاری یکم کارگزاری بانک کشاورزی	۰	۰	۰	۱۹۳,۱۷۷	۱۰۰٪
۱۳	بانک گردشگری	۰	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۰.۰۰٪
۱۴	بانک صنعت و معدن	۰	۱۱۵,۳۲۹	۱۱۵,۳۲۹	۱۱۵,۳۲۹	۰.۰۰٪
۱۵	تامین سرمایه آرمان	۰	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۰.۰۰٪
۱۶	شرکت سرمایه گذاری غدیر	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۱۷	شرکت سرمایه گذاری فرهنگیان	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۱۸	شرکت صنعتی و معدنی توسعه ملی	۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۰.۰۰٪
۱۹	شرکت سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۰	۴۴,۸۶۳	۴۴,۸۶۳	۴۴,۴۶۹	۰.۰۰٪
۲۰	صندوق عشایر	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۱	سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۲	بانک سامان	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۳	شرکت گروه سرمایه گذاری سایپا	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۴	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۲۵,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۵	بانک کشاورزی	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۷	شرکت سرمایه گذاری پردیس	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۰.۰۰٪

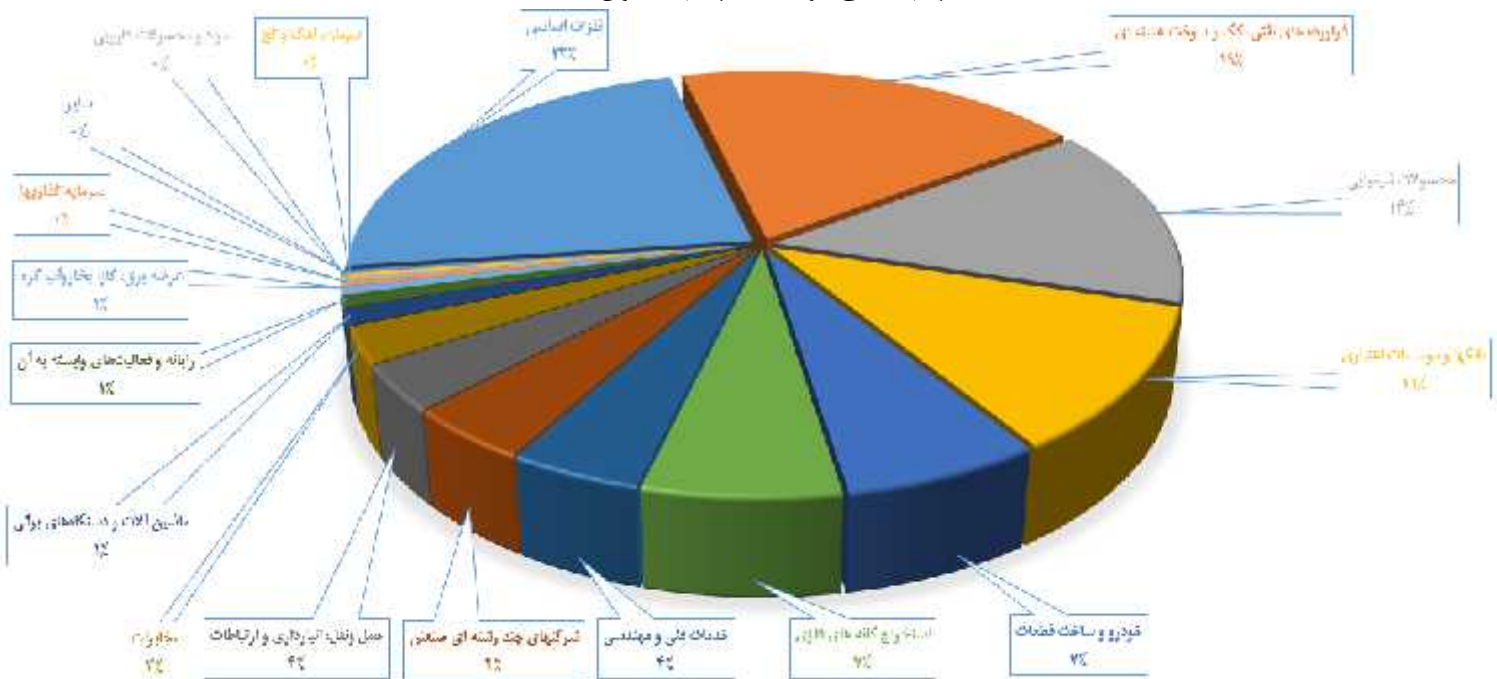


## ۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صنایعی که صندوق در آن ها به بازارگردانی سهام می‌پردازد از ۲۲ صنعت در تاریخ ۹۶/۱۰/۳۰ به ۲۵ صنعت تغییر یافته است.

ردیف	صنعت	سهم صنایع در سبد سهام صندوق (درصد)
۱	فلزات اساسی	۲۲,۹۹٪
۲	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۹,۱۸٪
۳	محصولات شیمیایی	۱۴,۲۹٪
۴	بانکها و موسسات اعتباری	۱۱,۲۱٪
۵	خودرو و ساخت قطعات	۶,۶۴٪
۶	استخراج کانه های فلزی	۶,۶۱٪
۷	خدمات فنی و مهندسی	۴,۴۴٪
۸	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴,۲۳٪
۹	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۳,۵۲٪
۱۰	مخابرات	۲,۸۰٪
۱۱	ماشین آلات و دستگاههای برقی	۱,۳۲٪
۱۲	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰,۹۲٪
۱۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۰,۶۲٪
۱۴	سرمایه گذاریها	۰,۳۵٪
۱۵	مواد و محصولات دارویی	۰,۳۱٪
۱۶	سیمان، آهک و گچ	۰,۲۹٪
۱۷	خدمات ارزش افزوده	۰,۰۸٪
۱۸	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰,۰۶٪
۱۹	ماشین آلات و تجهیزات	۰,۰۶٪
۲۰	سایر واسطه گریهای مالی	۰,۰۳٪
۲۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۰,۰۳٪
۲۲	ساخت محصولات فلزی	۰,۰۲٪
۲۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰,۰۰٪
۲۴	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۰,۰۰٪
۲۵	لاستیک و پلاستیک	۰,۰۰٪

سهام صنایع در سبد سهام صندوق



۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

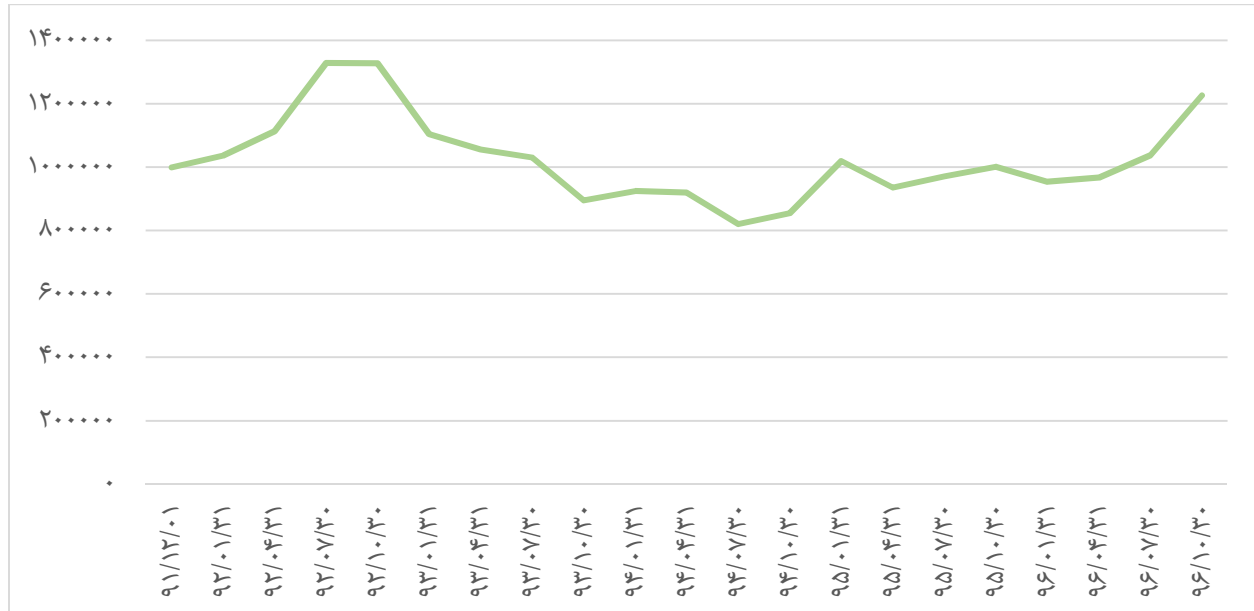
۳-۱- بازده صندوق

بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه و شش ماهه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۱۰/۳۰ به شرح زیر است.

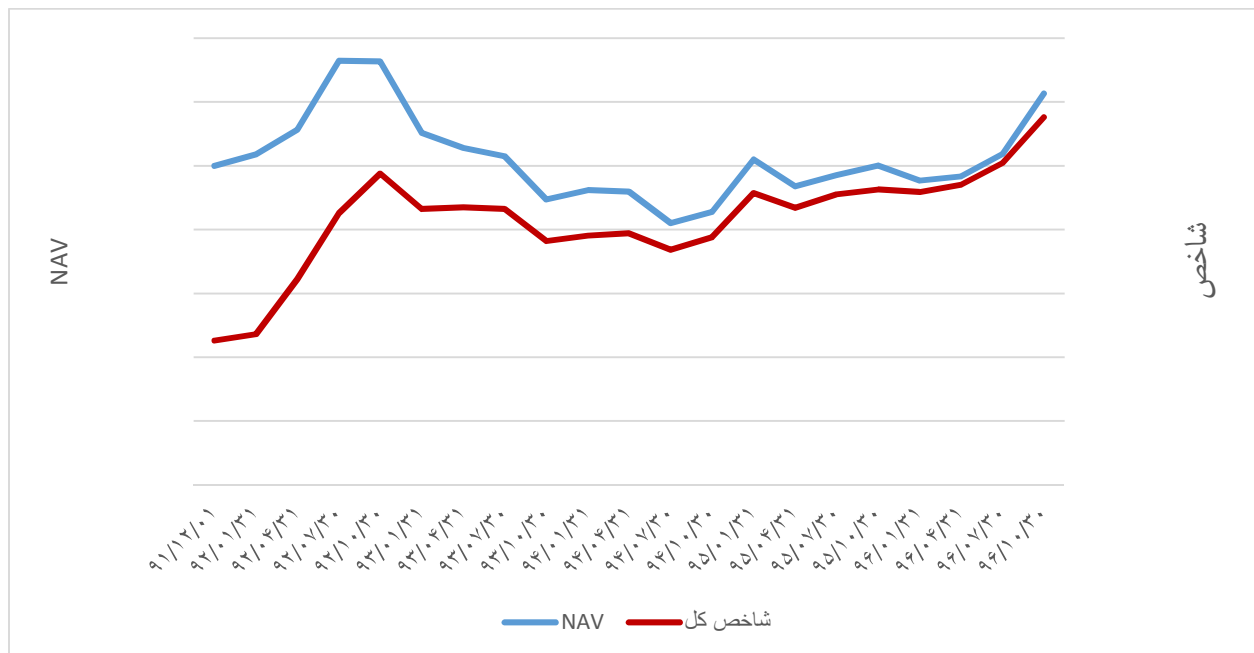
بازده بازار	بازده صندوق	از تاریخ	توضیحات
۲.۲۶%	۲.۷۲%	۱۳۹۶/۱۰/۲۳	۷ روز گذشته
۳.۴۶%	۳.۶۱%	۱۳۹۶/۰۹/۳۰	۳۰ روز گذشته
۱۴.۲۶%	۱۸.۲۳۷%	۱۳۹۶/۰۷/۳۰	۹۰ روز گذشته
۲۲.۰۹%	۲۸.۲۴%	۱۳۹۵/۰۵/۰۲	۱۸۰ روز گذشته

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۱۰/۳۰ به شرح نمودار زیر است.

ارزش خالص هر واحد سرمایه‌گذاری



روند تغییرات ارزش خالص واحدهای سرمایه‌گذاری و شاخص کل



با توجه به خالص ارزش روز واحدهای سرمایه گذاری، دارایی هر واحد، نرخ بازدهی صندوق برای دوره‌های زمانی ماهانه در شش ماه اخیر به شرح زیر می باشد.

بازدهی	دوره
۳.۴۴۸٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱
۴.۵۲۴٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱
۰.۲۷۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۷/۳۰
۴.۳۹۴٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰
۸.۸۰۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۳۰
۳.۶۳۱٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

### ۳-۲- معاملات

خرید و فروش ماهانه صندوق در بازار سرمایه ایران به شرح مندرج در جدول زیر است.

#### روند معاملات صندوق (ریال)

فروش	خرید	تاریخ
۱,۶۰۵,۳۳۴,۶۴۸,۲۳۱	۱,۹۵۹,۵۵۱,۱۷۷,۳۷۰	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱
۶۱۲,۴۲۰,۴۴۸,۲۶۹	۴۲۳,۸۲۷,۷۰۵,۲۱۷	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱
۸۳۹,۳۳۷,۷۶۳,۹۸۷	۵۸۵,۷۸۴,۲۲۲,۲۳۵	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۷/۳۰
۶۳۳,۹۵۷,۴۱۶,۲۰۰	۷۷۱,۵۵۵,۴۳۴,۲۴۱	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰
۵۰۰,۰۱۹,۳۱۹,۳۷۴	۲۸۸,۴۸۹,۸۸۲,۲۱۹	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۳۰
۴۲۰,۱۸۵,۹۵۵,۱۰۴	۵۹۰,۰۶۵,۴۷۵,۸۰۱	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰
۴,۶۱۱,۲۵۵,۵۵۱,۱۶۵	۴,۶۱۹,۲۷۳,۸۹۷,۰۸۳	مجموع

از کل معاملات صندوق مبلغ ۴,۶۱۹ میلیارد ریال خرید و مبلغ ۴,۶۱۱ میلیارد ریال فروش در سهام، حق تقدم و اوراق بهادار اسلامی بوده است.



## وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

ردیف	عنوان کارگزار	مجموع
۱	ایستگاه معاملاتی صندوق	٪۳۶,۴۶
۲	کارگزاری بانک تجارت	٪۱۲,۵۶
۳	کارگزاری بانک سپه	٪۱۲,۱۷
۴	کارگزاری بانک ملی ایران	٪۹,۰۷
۵	کارگزاری بانک صادرات	٪۷,۷۴
۶	کارگزاری بانک رفاه کارگران	٪۶,۴۱
۷	کارگزاری بانک ملت	٪۵,۲۰
۸	کارگزاری فارابی	٪۲,۹۰
۹	کارگزاری بانک پاسارگاد	٪۱,۳۱
۱۰	کارگزاری بورس بیمه ایران	٪۱,۲۰
۱۱	کارگزاری آگاه	٪۰,۸۳
۱۲	کارگزاری بانک اقتصاد نوین	٪۰,۶۴
۱۳	کارگزاری نهایت نگر	٪۰,۶۳
۱۴	کارگزاری آپادانا	٪۰,۵۸
۱۵	کارگزاری حافظ	٪۰,۴۱
۱۶	کارگزاری بانک سامان	٪۰,۳۹
۱۷	کارگزاری صبا تامین	٪۰,۳۵
۱۸	کارگزاری بانک صنعت و معدن	٪۰,۳۳
۱۹	کارگزاری آئل	٪۰,۲۵
۲۰	کارگزاری تامین سرمایه نوین	٪۰,۱۴
۲۱	کارگزاری بانک مسکن	٪۰,۱۳
۲۲	کارگزاری اراد ایرانیان	٪۰,۱۱
۲۳	کارگزاری سهام پویا	٪۰,۱۱
۲۴	کارگزاری عمران فارس	٪۰,۰۶
	مجموع	٪۱۰۰

در مجموع معاملات انجام شده، ۱۰ نماد با بیشترین ارزش خرید و فروش از ۱۳۹۶/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۶/۱۰/۳۰ به شرح جدول زیر می باشد.

### ده نماد با بیشترین ارزش خرید و فروش در صندوق

رتبه بندی بر مبنای بیشترین ارزش فروش			رتبه بندی بر مبنای بیشترین ارزش خرید		
رتبه در بخش خرید	ارزش معاملات فروش	نام نماد	رتبه	ارزش معاملات خرید	نام نماد
۱	۳۸۹,۳۳۴,۲۹۴,۴۹۴.۰۰	فولاد مبارکه اصفهان	۱	۵۷۱,۵۲۲,۲۳۳,۷۶۱	فولاد مبارکه اصفهان
۱۰	۳۳۴,۲۳۲,۶۳۴,۷۸۵.۰۰	ایران خودرو	۲	۵۶۵,۴۶۸,۰۶۸,۸۲۰	ملی صنایع مس ایران
۵	۲۷۵,۴۸۹,۶۵۹,۲۴۵.۰۰	پالایش نفت بندرعباس	۳	۴۶۵,۸۱۵,۲۹۱,۹۱۳	پالایش نفت اصفهان
۹	۲۵۲,۱۶۴,۳۹۰,۱۸۱.۰۰	نفت و گاز و پتروشیمی تأمین	۴	۳۹۸,۴۸۲,۹۰۰,۴۸۴	پالایش نفت تهران
۲	۲۳۵,۳۱۱,۵۹۳,۲۲۹.۰۰	ملی صنایع مس ایران	۵	۳۶۹,۰۲۱,۵۳۵,۹۴۷	پالایش نفت بندرعباس
۴	۲۲۶,۱۴۹,۰۹۹,۴۲۶.۰۰	پالایش نفت تهران	۶	۳۶۸,۲۶۱,۹۴۶,۶۵۴	معدنی و صنعتی گل گهر
۶	۲۲۳,۰۷۰,۸۶۰,۳۱۸.۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر	۷	۳۵۳,۸۱۰,۰۶۷,۸۹۶	گسترش نفت و گاز پارسیان
۳	۱۷۶,۵۲۱,۸۹۰,۹۶۴.۰۰	پالایش نفت اصفهان	۸	۳۳۳,۲۲۶,۵۸۲,۱۹۱	پالایش نفت تبریز
۷	۱۷۴,۲۹۲,۴۹۷,۹۳۵.۰۰	گسترش نفت و گاز پارسیان	۹	۳۲۴,۶۶۵,۳۸۷,۲۴۵	نفت و گاز و پتروشیمی تأمین
-	۱۷۱,۴۸۱,۷۹۳,۲۱۱.۰۰	صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۱۰	۳۰۶,۰۸۲,۳۳۹,۳۸۶	ایران خودرو

همچنین ده نماد برتر با بیشترین ارزش معاملات (خرید و فروش) به شرح جدول زیر می باشد.

### ده نماد با بیشترین ارزش معاملات در صندوق

نام نماد	ردیف
فولاد مبارکه اصفهان	۱
ملی صنایع مس ایران	۲
پالایش نفت تهران	۳
پالایش نفت بندرعباس	۴
پالایش نفت اصفهان	۵
ایران خودرو	۶
معدنی و صنعتی گل گهر	۷
س. نفت و گاز و پتروشیمی تأمین	۸
گسترش نفت و گاز پارسیان	۹
پالایش نفت تبریز	۱۰