

به نام خدا

گزارش درجه بندی عملکرد صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری مشترک امید توسعه (در سهام)
گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۳/۳۱
تاریخ گزارش: ۱۴۰۴/۰۶/۲۳

نام صندوق

تاریخ آغاز فعالیت

نوع صندوق سرمایه گذاری

پیش بینی سود

سود نقدی

مدیر صندوق

بازارگردانی

ضامن نقدشوندگی

متولی

حسابرس

صندوق سرمایه گذاری مشترک امید توسعه

۱۳۹۱/۱۲/۰۶

سهام

ندارد

دارد

سیدگردان مفید

ندارد

ندارد

موسسه حسابرسی ارقام نگر آریا

موسسه حسابرسی داریا روش

نوع صندوق سرمایه گذاری:

گروه همتای فراگیر

صندوق های سرمایه گذاری در سهام

۱۰۴ صندوق

درجه بندی با لحاظ عوامل تعدیلگر^۱

درجه بندی بدون لحاظ عوامل تعدیلگر

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۴٫۵ ستاره

NA

عالی

NA

۴ ستاره

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۴ ستاره

۳٫۵ ستاره

خوب

عوامل تعدیلگر:

ریسک تمرکز:

ریسک نقدشوندگی و تمرکز سرمایه گذاران:

رتبه کیفیت مدیریت:

کم

زیاد

۴٫۵ ستاره

بازدهی ماهانه صندوق در مقایسه با میانگین گروه همتای فراگیر و بازده شاخص بورس اوراق بهادار

۲۵٪

۲۰٪

۱۵٪

۱۰٪

۵٪

۰٪

-۵٪

-۱۰٪

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

صندوق موضوع رتبه بندی

میانگین بازدهی گروه

بازده شاخص کل

منتهی به ۱۴۰۴ بهار

تحلیل ریسک/ بازدهی

سه ساله

دو ساله

یک ساله

بازدهی صندوق-سالانه

۳۲٫۹٪

۲۶٫۲٪

۶۶٫۳٪

بازدهی بدون ریسک سالانه^۲

۲۲٫۰٪

۲۲٫۵٪

۲۲٫۶٪

بازدهی مازاد-سالانه

۱۰٫۹٪

۳٫۶٪

۴۳٫۷٪

میان گروه همتای فراگیر

۸٫۰٪

-۳٫۲٪

۲۸٫۹٪

میانگین گروه همتای فراگیر

۷٫۸٪

-۴٫۳٪

۲۸٫۰٪

حداکثر گروه همتای فراگیر

۲۵٫۷٪

۱۳٫۱٪

۵۲٫۱٪

حداقل گروه همتای فراگیر

-۱۵٫۰٪

-۳۰٫۹٪

-۱۱٫۹٪

ریسک نامطلوب

۲٫۸۱٪

۲٫۶۹٪

۱٫۸۴٪

میان گروه همتای فراگیر

۳٫۰٪

۳٫۱٪

۲٫۲٪

میانگین گروه همتای فراگیر

۳٫۱٪

۳٫۱٪

۲٫۳٪

حداکثر گروه همتای فراگیر

۴٫۷٪

۵٫۲٪

۴٫۷٪

حداقل گروه همتای فراگیر

۲٫۲٪

۱٫۹٪

۰٫۰٪

تاریخچه درجه بندی

با لحاظ عوامل تعدیلگر

بدون لحاظ عوامل تعدیلگر

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۴ ستاره

NA

۳ ستاره

۲٫۵ ستاره

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۴ ستاره

NA

۳ ستاره

۲٫۵ ستاره

سه ساله

دو ساله

یک ساله

اطلاعات واحدهای سرمایه گذاری (در تاریخ های مذکور)

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۳۳,۸۸۸,۱۹۲

۲۹,۰۳۳,۹۶۲

۲۸,۸۴۸,۱۲۷

۲۱,۳۱۷,۱۷۳

۴۸,۴۹۳

۴۲,۹۹۶

۴۲,۶۰۹

۳۳,۳۲۵

۶۹۸,۸۳۱,۴۵۳

۶۷۵,۲۶۴,۹۳۱

۶۷۷,۰۴۹,۳۳۷

۶۳۷,۵۷۳,۱۲۳

اطلاعات مالی (در دوره سه ماهه منتهی به تاریخ های مذکور)(میلیون ریال)

۱۴۰۴-۰۳-۳۱

۱۴۰۳-۱۲-۳۰

۱۴۰۳-۰۹-۳۰

۱۴۰۳-۰۶-۳۱

۴,۶۱۴,۹۲۷

۸۹۳,۳۷۷

۶,۴۸۵,۰۴۶

۱,۸۲۱,۲۵۰

۵,۳۲۰,۳۷۴

۶۷۰,۲۷۲

۹۰,۷۸۲

(۳۴,۷۰۸)

(۱,۲۱۶,۶۹۷)

(۱,۱۵۴,۳۶۰)

۵,۹۹۰,۲۷۰

۲۵۳,۷۸۴

۱۲۰,۷۳۰

۲۹,۴۸۰

۲

۰٫۸۸۹٪

۰٫۶۱۰٪

NA

۲۷۳,۵۹۷

۱۶۰,۷۹۱

۱۶۷,۹۰۸

۱۸۴,۴۹۴

۲۹,۶۳۷

NA

۳,۹۵۷

۱,۰۰۱

۶,۵۵۱

۷,۰۷۸

۴,۱۶۸

۴,۰۲۲

جمع درآمد ها

سود (زیان) فروش اوراق بهادار

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار

سود سهام

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا سود سپرده بانکی

سایر درآمدها

نسبت هزینه به ارزش خالص دارایی ها (درصد)

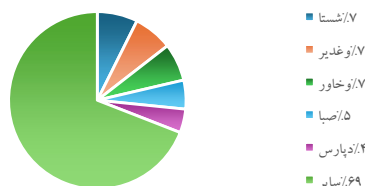
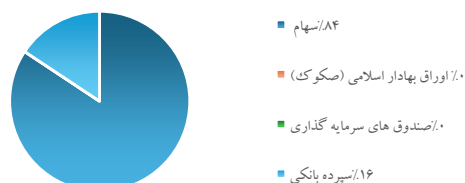
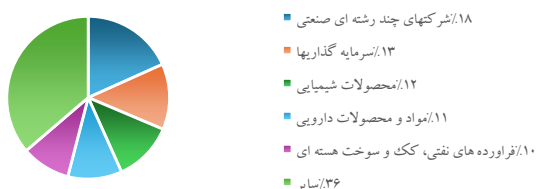
هزینه کارمزد ار کان

هزینه معاملات

سایر هزینه ها

۱. درجه بندی با عوامل تعدیلگر از ۵ ستاره و درجه بندی بدون عوامل تعدیلگر از ۴ ستاره است.

۲. نرخ بازده بدون ریسک برابر است با نرخ مصوب برای سود سپرده یک ساله بانکی است.



توزیع ریسک‌های تمرکز و نقدشوندگی در صندوق‌های گروه همتای فراگیر				
سطح ریسک	ریسک تمرکز سید دارایی‌های صندوق‌ها		ریسک نقدشوندگی سید دارایی‌های صندوق‌ها	
	تعداد صندوق	نسبت از کل	تعداد صندوق	نسبت از کل
بسیار زیاد	۱	۱٪	۹۴	۹۰٪
زیاد	۲	۲٪	۱۰	۱۰٪
متوسط	۴۱	۳۹٪	۰	۰٪
کم	۲۹	۲۸٪	۰	۰٪
بسیار کم	۳۱	۳۰٪	۰	۰٪
جمع	۱۰۴	۱۰۰٪	۱۰۴	۱۰۰٪

سایر معیارهای ارزیابی عملکرد صندوق ها (حداکثر ۴ ستاره می باشد و این شاخص ها فقط برای صندوق های که حداقل ۳ سال از فعالیت آنها گذشته است محاسبه می شوند)										
شرح	امتیاز برهان	مورنینگ استار	انحراف معیار	نیم انحراف معیار	ریسک نامطلوب	نسبت شارب بر مبنای ...	آلفا	ترینور	T ^۲	نسبت اطلاعات
						مؤدیگیانی - مؤدیگیانی				
حداکثر گروه همتای فراگیر	۰.۰۲۱۸	۰.۱۳	۰.۲۳	۰.۶۹	۶.۵۸	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۲	۰.۰۲	۰.۶۵
حداقل گروه همتای فراگیر	۰.۰۵۳۸	۰.۲۱	۰.۰۷	۰.۲۳	۰.۲۸	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۲۹
میانگین گروه همتای فراگیر	۰.۰۲۲۱۱	۰.۰۱	۰.۱۰	۰.۳۳	۱.۵۵	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۱	۰.۰۰	۰.۱۸
میان گروه همتای فراگیر	۰.۰۲۱۴۵	۰.۰۱	۰.۱۰	۰.۳۴	۱.۲۶	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۱	۰.۰۰	۰.۱۷
امتیاز صندوق موضوع رتبه بندی	۰.۰۱۷۶۹	۰.۰۲	۰.۱۲	۰.۴۶	۲.۳۷	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۳۴
جایگاه صندوق موضوع رتبه بندی	۳.۵ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳.۵ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳ ستاره	۳.۵ ستاره

توضیحات:

* مقیاس درجه‌بندی: صندوق‌های سرمایه‌گذاری بر اساس شاخص ارزیابی عملکرد برهان مرتب شده و مطابق با توزیع آماری یکنواخت به هشت دسته تقسیم می‌شوند که فراوانی هر دسته برابر با ۱۲.۵ درصد از جامعه است؛ هشتک اول، نیم ستاره دریافت می‌کند و به ترتیب به هشتک‌های بعدی هر کدام نیم ستاره اضافه می‌شود (یعنی هشتک دوم ۱ ستاره، هشتک سوم ۱.۵ ستاره و به همین ترتیب هشتک هشتم ۴ ستاره دریافت می‌کند).

* اطلاعات بدون تاریخ، مربوط به تاریخ پایان آخرین فصل قبل از تاریخ گزارش هستند.

* علامت NA: نشان می‌دهد که اطلاعات مورد نظر دردسترس نمی‌باشد و در صورتی که اطلاعات مورد نظر در رتبه بندی عملکرد صندوق موضوع رتبه بندی تاثیر گذار باشد کمترین امتیاز لحاظ می‌گردد.

* برای اطلاعات بیشتر در مورد معیار درجه‌بندی عملکرد، به شیوه‌نامه درجه‌بندی عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری شرکت رتبه‌بندی اعتباری برهان، منتشره در تارنمای این شرکت به نشانی www.bcr.ir، بخش قوانین، مقررات و ضوابط / شیوه‌نامه‌های رتبه‌بندی مراجعه فرمائید.

ماننه سلب مسئولیت :

* عملکرد صندوق در آینده می‌تواند متفاوت از عملکرد گذشته صندوق باشد. بنابراین، سرمایه‌گذاران در تصمیم‌گیری باید به عوامل دیگری غیر از عملکرد گذشته توجه داشته باشند.

* درجه بندی ارائه شده توسط شرکت رتبه بندی اعتباری برهان، توصیه‌ای به سرمایه‌گذاری، نگهداری یا واگذاری واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق محسوب نمی‌شود.

* این گزارش بر مبنای اطلاعات دریافتی از منابع معتبر از جمله مدیر صندوق، سازمان بورس و اوراق بهادار و اطلاعات منتشره در تارنماهای رسمی صندوق، شرکت فرابورس ایران و سامانه اطلاع رسانی ناشران (www.codal.ir) تهیه شده است. مسئولیت صحت اطلاعات منابع مذکور، به عهده پرهان نیست.