

ام صندوق

تاریخ آغاز فعالیت

نوع صندوق سرمایه‌گذاری

پیش‌بینی سود

سود نقدی

مدیر صندوق

آزارگردانی

نامن تقدشوندگی

تولیدی

حسابرس

صندوق سرمایه‌گذاری توسعه اطلس مفید

۱۳۹۳/۱۰/۰۲

سهام

ندارد

ندارد

سبدگردان مفید

اختصاصی بازارگردانی مفید

ندارد

موسسه حسابرسی ارقام نگر آریا

موسسه حسابرسی داریا روش

نوع صندوق سرمایه‌گذاری:

گروه همتای فراگیر

در سهام

تعداد اعضا

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

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۴٫۵ ستاره

NA

۴ ستاره

۴ ستاره

عالی

NA

عالی

عالی

عوامل تعدیلگر:

ریسک نمر کز:

ریسک نقدشوندگی و تمرکز سرمایه‌گذاران:

رتبه کیفیت مدیریت:

خیلی کم

زیاد

۴٫۵ ستاره

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

۲۰٪

۱۵٪

۱۰٪

۵٪

۰٪

-۵٪

-۱۰٪

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۴/۰۶/۳۱

۱۴۰۴/۰۹/۳۰

۱۴۰۴/۱۲/۳۰

۱۴۰۵/۰۳/۳۱

۱۴۰۵/۰۶/۳۱

۱۴۰۵/۰۹/۳۰

۱۴۰۵/۱۲/۳۰

۱۴۰۶/۰۳/۳۱

صندوق موضوع رتبه‌بندی

میانگین بازدهی گروه

بازده شاخص کل

نتیجه به ۱۴۰۴ بهار

تحلیل ریسک/ بازدهی

سه ساله

دو ساله

یک ساله

بازدهی صندوق-سالانه

بازدهی بدون ریسک سالانه^۲

بازدهی مزاد-سالانه

میان گروه همتای فراگیر

میانگین گروه همتای فراگیر

حداکثر گروه همتای فراگیر

حداقل گروه همتای فراگیر

ریسک نامطلوب

میان گروه همتای فراگیر

میانگین گروه همتای فراگیر

حداکثر گروه همتای فراگیر

حداقل گروه همتای فراگیر

۳۴٫۶٪

۲۷٫۲٪

۶۴٫۴٪

۲۲٫۰٪

۲۲٫۵٪

۲۲٫۶٪

۱۲٫۶٪

۴٫۶٪

۴۱٫۸٪

۸٫۰٪

-۳٫۲٪

۲۸٫۹٪

۷٫۸٪

-۴٫۳٪

۲۸٫۰٪

۲۵٫۷٪

۱۳٫۱٪

۵۲٫۱٪

-۱۵٫۰٪

-۳۰٫۹٪

-۱۱٫۹٪

۲٫۵۹٪

۲٫۴۵٪

۱٫۵۳٪

۳٫۰٪

۳٫۱٪

۲٫۲٪

۳٫۱٪

۳٫۱٪

۴٫۷٪

۵٫۲٪

۴٫۷٪

۱٫۹٪

۰٫۰٪

تاریخچه درجه‌بندی

با لحاظ عوامل تعدیلگر

بدون لحاظ عوامل تعدیلگر

سه ساله

دو ساله

یک ساله

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۴ ستاره

NA

ستاره ۳٫۵

ستاره ۳

ستاره ۴٫۵

NA

ستاره ۳٫۵

ستاره ۳

ستاره ۴

ستاره ۳٫۵

ستاره ۴

ستاره ۳٫۵

ستاره ۳٫۵

ستاره ۳٫۵

اطلاعات واحدهای سرمایه‌گذاری (در تاریخ‌های مذکور)

خالص ارزش دارایی‌ها (میلیون ریال)

ارزش ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری عادی

۱۴۰۴/۰۳/۳۱

۱۴۰۳/۱۲/۳۰

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۴۲,۸۲۹,۱۴۶

۳۸,۰۴۲,۲۷۱

۳۳,۴۴۵,۳۹۹

۲۴,۴۹۲,۳۵۸

۶۶,۷۰۱

۵۸,۷۰۹

۵۶,۱۹۷

۴۳,۷۳۶

۷۱۷,۰۷۲,۲۴۰

۶۴۷,۹۸۲,۲۴۰

۵۹۵,۱۴۲,۲۴۰

۵۶۰,۰۰۷,۲۴۰

اطلاعات مالی (در دوره سه‌ماهه منتهی به تاریخ‌های مذکور)(میلیون ریال)

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

سبب هزینه به ارزش خالص دارایی‌ها (درصد)

هزینه کارمزد ارکان

هزینه معاملات

سایر هزینه ها

۱۴۰۴-۰۱-۳۱

۱۴۰۳-۱۰-۳۰

۱۴۰۳-۰۷-۳۰

۱۴۰۳-۰۴-۳۱

۳,۳۰۵,۱۹۴

۱۰,۱۳۸,۶۲۲

۱۰۰,۲۸۶

(۶۹۹,۶۲۸)

۱,۲۴۱,۰۵۸

۷۱۴,۷۵۵

(۵۰,۹۲۰)

۲۰,۵۹۱۴

۱,۳۷۱,۹۰۶

۸,۸۲۲,۷۹۰

(۲۷۷,۱۴۱)

۳۷۳,۴۸۱

۵۸۵,۲۲۹

۱۰۵,۴۵۸

۶۷,۱۴۰

۲۰,۱۹۲

NA

۰٫۳۷٪

۱۶۱,۷۷۳

۳۰۴,۹۹۷

۲۶۵,۱۱۲

۱۰۸,۱۲۸

۱۲,۲۷۷

NA

۶,۳۰۵

۴,۰۴۵

۶,۶۹۳

۶,۰۵۲

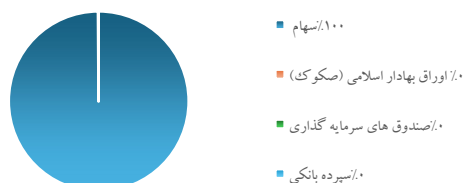
۵,۲۷۴

۵,۲۸۱

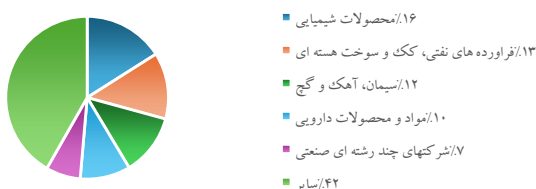
درجه بندی با عوامل تعدیلگر از ۵ ستاره و درجه بندی بدون عوامل تعدیلگر از ۴ ستاره است.

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

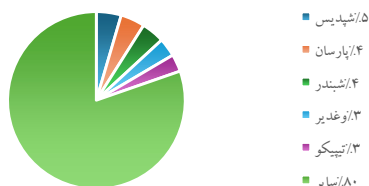
ترکیب کل دارایی‌ها



پنج صنعت با بیشترین درصد سرمایه گذاری



پنج شرکت با بیشترین مبلغ سرمایه گذاری



توزیع ریسک های تمرکز و نقدشوندگی در صندوق های گروه همتای فراگیر

سطح ریسک	ریسک تمرکز سبد دارایی های صندوق ها		ریسک نقدشوندگی سبد دارایی های صندوق ها	
	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 شارپ بر مبنای ...				آلفا	ترینور	T۲	نسبت اطلاعات
						مؤدیگیلانی	مؤدیگیلانی	مؤدیگیلانی	مؤدیگیلانی				
حداکثر گروه همتای فراگیر	-۰.۰۰۲۱۸	۰.۱۳	۰.۲۳	۰.۶۹	۶.۵۸	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۲	۰.۰۲	۰.۶۵
حداقل گروه همتای فراگیر	-۰.۰۵۲۳۸	-۰.۲۱	-۰.۰۷	-۰.۲۳	-۰.۲۸	-۰.۰۱	-۰.۰۱	-۰.۰۱	-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	۰.۰۰	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	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۱	۰.۰۰	۰.۱۷
امتیاز صندوق موضوع رتبه بندی	-۰.۰۱۴۷۵	۰.۰۴	۰.۱۴	۰.۴۹	۲.۴۹	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۴۱
جایگاه صندوق موضوع رتبه بندی	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۳.۵ ستاره	۴ ستاره

توضیحات:

- * مقیاس درجه بندی: صندوق های سرمایه گذاری بر اساس شاخص ارزیابی عملکرد برهان مرتب شده و مطابق با توزیع آماری یکنواخت به هشت دسته تقسیم می شوند که فراوانی هر دسته برابر با ۱۲.۵ درصد از جامعه است؛ هشتک اول، نیم ستاره دریافت می کند و به ترتیب به هشتک های بعدی هر کدام نیم ستاره اضافه می شود (یعنی هشتک دوم ۱ ستاره، هشتک سوم ۱.۵ ستاره و به همین ترتیب هشتک هشتم ۴ ستاره دریافت می کند).
- * اطلاعات بدون تاریخ، مربوط به تاریخ پایان آخرین فصل قبل از تاریخ گزارش هستند.
- * علامت NA: نشان می دهد که اطلاعات مورد نظر در دسترس نمی باشد و در صورتی که اطلاعات مورد نظر در رتبه بندی عملکرد صندوق موضوع رتبه بندی تاثیرگذار باشد کمترین امتیاز لحاظ می گردد.
- * برای اطلاعات بیشتر در مورد معیار درجه بندی عملکرد، به شیوه نامه درجه بندی عملکرد صندوق های سرمایه گذاری شرکت رتبه بندی اعتباری برهان، منتشره در تارنمای این شرکت به نشانی www.bcr.ir.
- بخش قوانین، مقررات و ضوابط / شیوه نامه های رتبه بندی مراجعه فرمائید.

بیانیه سلب مسئولیت :

- * عملکرد صندوق در آینده می تواند متفاوت از عملکرد گذشته صندوق باشد. بنابراین سرمایه گذاران در تصمیم گیری باید به عوامل دیگری غیر از عملکرد گذشته توجه داشته باشند.
- * درجه بندی ارائه شده توسط شرکت رتبه بندی اعتباری برهان، توصیه ای به سرمایه گذاری، نگهداری یا واگذاری واحدهای سرمایه گذاری صندوق محسوب نمی شود.
- * 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 برهان نیست.