



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه

منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۳۹۶

فهرست مطالب

عنوان صفحه

۳	۱- مقدمه
۳	۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه
۴	۱-۲- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری
۵	۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق
۶	۳- بررسی عملکرد صندوق در تاریخ ۹۶/۴/۳۱
۶	۱-۳- بازده صندوق
۹	۲-۳- معاملات
۱۲	۳-۳- اوراق اختیار
۱۳	۴-۳- فرایند دریافت سود سهام در صندوق
۱۴	۴- خلاصه ای از عملکرد صندوق در چهار سال اخیر

۱ - مقدمه

صندوق توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار به عنوان صندوق سرمایه گذاری 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 به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی های صندوق که عمدتاً شامل سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس می شود، توسط مدیر سرمایه گذاری صندوق صورت می گیرد. سرمایه گذاران در ازای سرمایه گذاری در این صندوق گواهی سرمایه گذاری دریافت می کنند. صدور واحد سرمایه گذاری و ابطال آن ها بر اساس ارزش خالص دارایی های روز بعد از ارائه درخواست صورت می گیرد.

۲ - صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه

مشخصات کلی صندوق سرمایه گذاری توسعه بازار سرمایه	
شماره ثبت اداره ثبت شرکت ها:	۳۰۸۹۵
شناسه ملی:	۱۰۳۲۰۸۴۹۸۴۶
تاریخ ثبت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
شماره ثبت سازمان بورس:	۱۱۱۳۰
شماره پرونده مالیاتی:	۱۰۴۰۰۴۳۶۷۸۶
شماره کد اقتصادی:	۴۱۱۴۱۹۶۴۴۳۱۹
واحد مالیاتی:	۴۰۱۳۳۳
کلاس پرونده:	۴۸۷
تاریخ ترازنامه:	۱۳۹۶/۰۴/۳۱
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود
ارکان صندوق	
مدیر	هیأت مدیره صندوق
متولی	مشاور سرمایه گذاری تأمین سرمایه نوین
مدیر ثبت	هیأت مدیره صندوق
حسابرس	موسسه حسابرسی مدبران مستقل

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 ۱۰,۸۴۴,۰۱۱ میلیون ریال افزایش یافته است. تغییرات مذکور به شرح جدول زیر ارائه شده است.

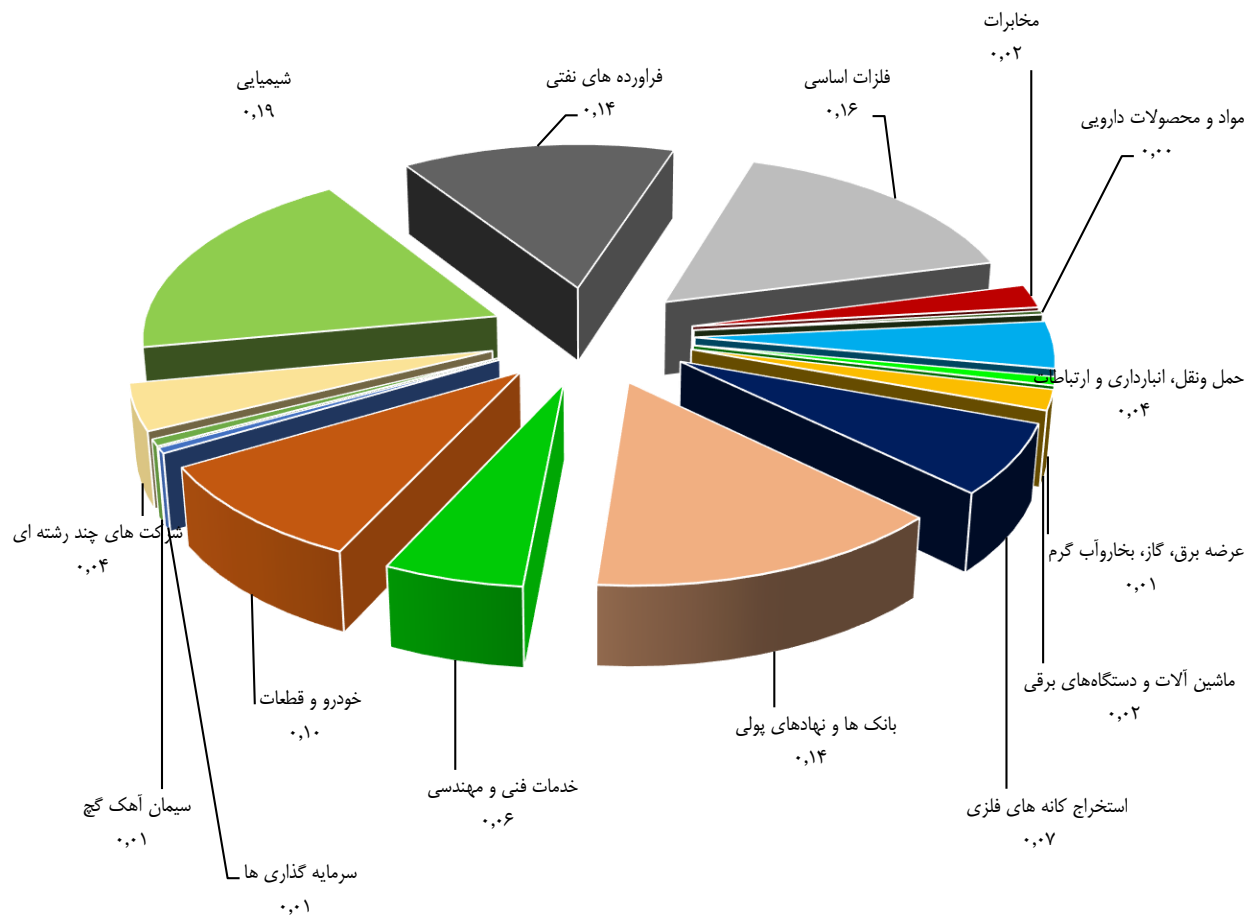
ردیف	نام شرکت	واحدهای صدور در زمان تأسیس	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۴/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۵/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۶/۰۴/۳۱	درصد تغییر سالانه سال مالی منتهی به ۹۶/۰۴/۳۱	مبلغ واریز شده در سال مالی منتهی به ۹۶/۰۴/۳۱
۱	بانک تجارت	۰	۱,۸۰۱,۴۰۵	۱,۹۱۰,۱۸۶	۱,۹۱۰,۱۸۶	۰.۰۰٪	۰
۲	بانک ملی	۰	۳۹۹,۷۶۹	۱,۵۰۴,۵۵۵	۱,۶۰۹,۳۸۶	۶.۹۷٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
۳	بانک صادرات	۰	۳۶۷,۹۰۶	۱,۴۴۰,۱۲۸	۱,۵۴۴,۶۰۵	۷.۲۵٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
۴	گروه مالی ملت	۰	۸۵۹,۶۴۱	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۴۳۹,۱۸۳	۰.۰۰٪	۰
۵	بانک سپه	۰	۱۵۷,۴۹۰	۸۳۲,۳۹۹	۹۷۸,۵۰۰	۱۷.۵۵٪	۱۴۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
۶	بانک پاسارگاد	۰	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۰.۰۰٪	۰
۷	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۰	۵۴۳,۹۰۵	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۰.۰۰٪	۰
۸	بیمه ایران	۰	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۰.۰۰٪	۰
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۰	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۰.۰۰٪	۰
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۰.۰۰٪	۰
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۰	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۰.۰۰٪	۰
۱۲	بانک گردشگری	۰	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۰.۰۰٪	۰
۱۳	بانک صنعت و معدن	۰	۵۵,۲۳۳	۱۱۵,۳۲۹	۱۱۵,۳۲۹	۰.۰۰٪	۰
۱۴	تامین سرمایه آرمان	۰	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۰.۰۰٪	۰
۱۵	شرکت سرمایه گذاری غدیر	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۱۶	شرکت سرمایه گذاری فرهنگیان	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۱۷	شرکت صنعتی و معدنی توسعه ملی	۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۰.۰۰٪	۰
۱۸	سرمایه گذاری و توسعه صنایع سیمان	۰	۴۴,۸۶۳	۴۴,۸۶۳	۴۴,۸۶۳	۰.۰۰٪	۰
۱۹	صندوق عشایر	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۰	سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۱	بانک سامان	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۲	شرکت گروه سرمایه گذاری سایپا	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۳	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۲۵,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۴	بانک کشاورزی	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۵	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
۲۶	شرکت سرمایه گذاری پردیس	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۰.۰۰٪	۰
	جمع	۳۰۰,۰۰۰	۶,۸۲۷,۰۵۲	۱۰,۴۸۸,۶۰۲	۱۰,۸۴۴,۰۱۱	۳.۳۹٪	۳۴۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰

۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۳۱

سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صنایع موجود در پورتفوی صندوق از تعداد ۱۶ صنعت در تاریخ ۱۳۹۳/۰۴/۳۱ به تعداد ۲۵ صنعت در تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۳۱ ارتقا یافته است.

ردیف	نام صنعت	ارزش روز کل	درصد از کل سبد سهام صندوق به ارزش روز
۱	محصولات شیمیایی	۱,۸۰۰,۶۶۵,۰۶۹,۸۵۶	۱۸.۵۰٪
۲	فلزات اساسی	۱,۵۴۲,۷۹۵,۵۳۴,۷۸۵	۱۵.۸۵٪
۳	بانک ها و موسسات اعتباری	۱,۳۶۶,۰۹۵,۶۱۶,۴۲۵	۱۴.۰۳٪
۴	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱,۳۴۸,۱۰۸,۳۷۷,۴۲۴	۱۳.۸۵٪
۵	خودرو و ساخت قطعات	۹۲۰,۹۴۲,۹۹۱,۰۷۶	۹.۴۶٪
۶	استخراج کانه های فلزی	۶۳۶,۲۳۰,۰۸۲,۱۹۶	۶.۵۴٪
۷	خدمات فنی و مهندسی	۵۳۰,۲۶۶,۴۰۹,۸۷۰	۵.۴۵٪
۸	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۴۲۱,۶۳۰,۸۴۳,۴۵۵	۴.۳۳٪
۹	شرکت های چند رشته ای صنعتی	۴۱۷,۷۶۹,۲۱۷,۴۸۱	۴.۲۹٪
۱۰	مخابرات	۲۱۱,۳۷۲,۳۵۵,۸۲۹	۲.۱۷٪
۱۱	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۱۸۰,۴۹۳,۷۰۱,۵۰۵	۱.۸۵٪
۱۲	رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۱۱۲,۰۰۰,۱۶۸,۴۰۲	۱.۱۵٪
۱۳	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۴,۳۰۱,۰۹۸,۵۲۹	۰.۷۷٪
۱۴	سیمان، آهک و گچ	۵۹,۸۰۲,۵۲۶,۱۴۱	۰.۶۲٪
۱۵	سرمایه گذاریها	۴۹,۰۳۱,۲۰۰,۲۶۸	۰.۵۰٪
۱۶	مواد و محصولات دارویی	۳۱,۸۶۰,۷۴۷,۷۳۶	۰.۳۳٪
۱۷	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۰,۱۱۵,۷۲۴,۷۸۴	۰.۱۱٪
۱۸	ماشین آلات و تجهیزات	۶,۵۱۴,۸۲۶,۴۳۶	۰.۰۷٪
۱۹	سایر واسطه گری های مالی	۶,۲۳۵,۰۰۷,۴۵۹	۰.۰۷٪
۲۰	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲,۴۷۶,۵۸۸,۷۷۷	۰.۰۲٪
۲۱	استخراج ذغال سنگ	۱,۹۶۲,۹۸۱,۶۹۵	۰.۰۲٪
۲۲	لاستیک و پلاستیک	۱,۲۲۲,۰۲۴,۷۷۵	۰.۰۱٪
۲۳	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱,۰۸۶,۳۵۰,۷۸۳	۰.۰۱٪
۲۴	قند و شکر	۸۷۲,۱۵۰,۱۸۳	۰.۰۱٪
۲۵	ساخت محصولات فلزی	۵۲۴,۳۸۳,۵۵۶	۰.۰۱٪
	جمع	۹,۷۳۴,۳۷۵,۹۷۹,۴۲۶	۱۰۰٪

سهام صنایع در سبد سهام صندوق



مطابق این جدول، صنایع شیمیایی، فلزات اساسی، فرآورده های نفتی و بانک ها و موسسات اعتباری بیشترین سهم را در سبد سهام صندوق به خود اختصاص داده اند.

۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۳۱

۳-۱- بازده صندوق

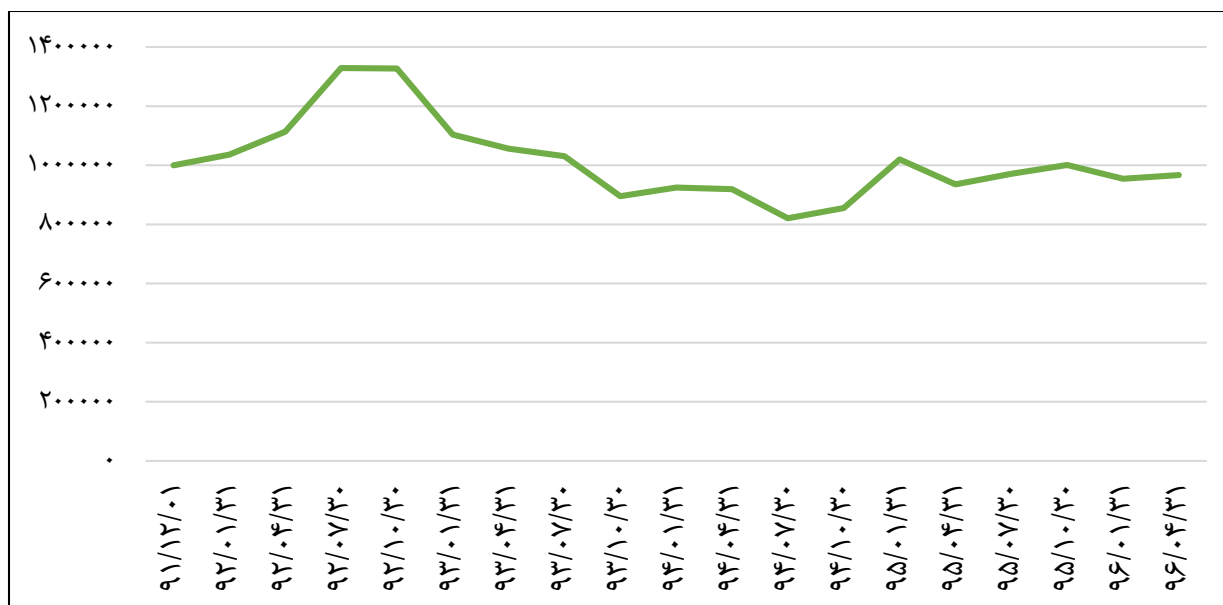
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۳۱ به شرح زیر است.

بازده بازار	بازده صندوق	قیمت ابطال در ۱۳۹۶/۰۴/۳۱	قیمت ابطال	از تاریخ	توضیحات
۱.۲۷٪	۱.۳۶۷٪	۹۵۴.۵۷۳	۹۴۱,۶۹۶	۱۳۹۶/۰۴/۲۴	۷ روز گذشته
۲.۴۵۷٪	۲,۷۷۳٪		۹۲۸,۸۱۸	۱۳۹۶/۰۴/۰۱	۳۰ روز گذشته
۱.۶۱۳٪	(۰.۵۹۱٪)		۹۶۰,۲۴۷	۱۳۹۶/۰۲/۰۳	۹۰ روز گذشته
۱.۷۷۵٪	(۴.۵۸۵٪)*		۱,۰۰۰,۴۴۵	۱۳۹۵/۱۱/۰۴	۱۸۰ روز گذشته
۸.۲۶۲٪	۱.۸۰۶٪		۹۳۷,۶۳۷	۱۳۹۵/۰۵/۰۱	۳۶۵ روز گذشته

* در تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۵، NAV صندوق به دلیل بازگشایی نماد بانک ملت از رقم ۱,۰۰۰,۴۴۵ به رقم ۹۷۶,۵۵۶ ریال کاهش پیدا کرده است (به ازای هر واحد ۲۳,۸۸۹ ریال). همچنین در تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۱۳، NAV صندوق به دلیل بازگشایی نماد بانک تجارت از رقم ۹۷۳,۰۹۷ به رقم ۹۵۹,۷۴۶ ریال کاهش پیدا کرده است (به ازای هر واحد ۱۳,۳۵۱ ریال). تا پیش از تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۵، سهم صنعت بانک ها و موسسات اعتباری در سبد صندوق ۱۵,۲۵٪ درصد بوده است. به موجب این بازگشایی سهم صنعت بانک ها و موسسات اعتباری به ۱۳,۷۵٪ کاهش یافته است. همچنین سهم این صنعت تا پیش از بازگشایی نماد بانک تجارت در صندوق ۱۳,۹۶٪ درصد بود که پس از بازگشایی به ۱۲,۴۷٪ کاهش یافت.

روند تغییرات خالص ارزش روز واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۳۱ به شرح زیر است.

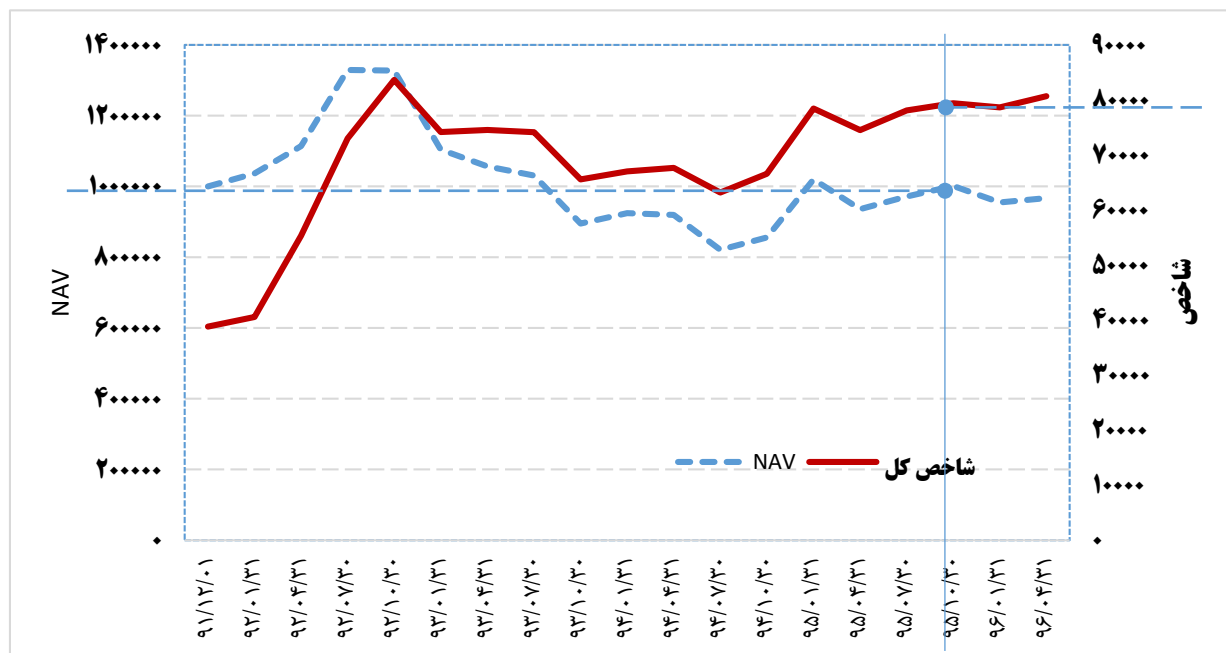
ارزش خالص هر واحد سرمایه‌گذاری



با توجه به خالص ارزش روز واحدهای سرمایه گذاری، نرخ بازدهی صندوق برای دوره‌های زمانی ماهانه در یک سال اخیر به شرح زیر می باشد.

بازدهی	دوره
۴.۳۳۹٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۵/۳۱
-۳.۰۵۵٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۶/۳۱
۲.۴۷۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۷/۳۰
۲.۰۰۳٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰
۱.۲۵۹٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۹/۳۰
-۰.۲۰۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۱۰/۳۰
-۳.۱۹۴٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰
-۱.۶۶۵٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۳۰
۰.۱۵۱٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۱/۳۱
۲.۴۳۸٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱
-۴.۷۴۶٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۳۱
۲.۷۷۳٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۴/۳۱

روند تغییرات ارزش خالص واحدهای سرمایه گذاری و شاخص کل



نمودار بالا نمایانگر روند تغییرات شاخص کل و NAV صندوق از سال ۱۳۹۱ تا سال ۱۳۹۶ می باشد. محور سمت راست مقدار عددی شاخص کل و محور سمت چپ مقدار عددی NAV صندوق را نشان میدهد. به عنوان مثال در تاریخ ۱۳۹۵/۱۰/۳۰ شاخص کل در محدوده ۸۰,۰۰۰ واحد و NAV صندوق برابر ۱,۱۴۷,۰۰۱,۰۰۰ ریال میباشد.

۳-۲- معاملات

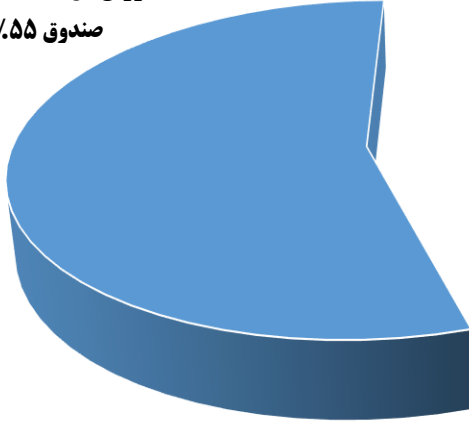
خرید و فروش ماهانه صندوق در بازار سرمایه ایران به شرح مندرج در جدول زیر است. قابل ذکر است کلیه عملیات خرید و فروش صندوق در بازار سرمایه منطبق بر آیین نامه‌ی تهیه شده و مصوب هیات مدیره صندوق، صورت می‌پذیرد.

روند معاملات صندوق (ریال)

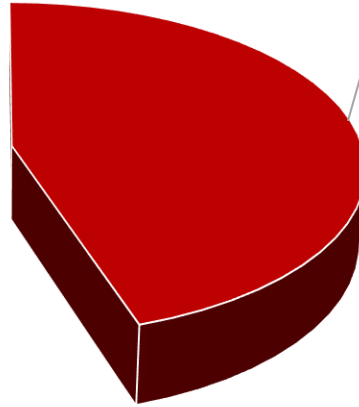
فروشی	خرید	تاریخ
۷۵,۹۶۱,۶۴۶,۰۰۰	۲۷۰,۸۸۵,۸۰۶,۸۰۰	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۵/۳۱
۳۹۰,۳۴۷,۷۷۱,۰۰۰	۵۰۳,۴۸۰,۴۰۹,۳۲۷	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۶/۳۱
۶۲,۱۱۷,۱۰۰,۰۰۰	۲۳,۶۹۰,۸۵۲,۸۴۴	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۷/۳۰
۵۳۰,۷۰۱,۹۱۳,۳۹۶	۱۰۹,۱۴۰,۰۷۷,۰۰۵	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰
۱۲۰,۰۳۰,۲۶۹,۸۰۶	۱۰۷,۲۵۲,۰۷۶,۰۴۲	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۰۹/۳۰
۱۴۱,۰۰۳,۱۹۰,۲۲۱	۴۴۳,۰۵۹,۰۷۶,۵۱۴	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۱۰/۳۰
۳۸۵,۳۸۰,۵۷۳,۷۳۶	۷۱۰,۸۶۵,۷۹۲,۶۵۴	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰
۲,۰۹۹,۵۷۸,۶۱۴,۵۴۶	۱,۵۸۳,۶۲۵,۸۱۰,۴۶۴	ماهانه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۳۰
۲۵۰,۱۵۰,۶۰۰,۲۳۲	۷۱۶,۹۹۶,۹۱۵,۷۲۲	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۱/۳۱
۱,۱۵۲,۴۶۹,۰۲۷,۶۷۳	۱,۵۲۴,۶۰۰,۰۶۵,۶۴۹	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱
۳۱۰,۵۹۰,۹۴۸,۹۴۲	۱,۰۶۱,۰۷۲,۷۸۷,۱۳۵	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۳۱
۹۲۹,۰۱۲,۴۳۶,۶۰۶	۷۲۴,۳۳۱,۲۰۱,۳۴۴	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۴/۳۱
۶,۴۴۷,۳۴۴,۰۹۲,۱۵۸	۷,۷۷۹,۰۰۰,۸۷۱,۵۰۰	مجموع

از کل معاملات صندوق مبلغ ۷،۷۷۹ میلیارد ریال خرید و مبلغ ۶،۴۴۷ میلیارد ریال فروش در سهام، حق تقدم و اوراق بهادار اسلامی بوده است.

ارزش کل معاملات خرید
صندوق ۵۵٪



ارزش کل معاملات فروش
صندوق ۴۵٪



در مجموع معاملات انجام شده، ۱۵ نماد بدون توجه به حجم معاملات (تعداد سهام) با بیشترین ارزش خرید و فروش از ۱۳۹۵/۴/۳۱ لغایت ۱۳۹۶/۴/۳۱ به شرح جدول زیر می باشد.

پانزده 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 (ریال)	نام نماد	رتبه	ارزش معاملات خرید (ریال)	نام نماد
۱	۱,۰۱۷,۱۲۷,۰۹۰,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران	۱	۵۷۱,۵۲۲,۲۳۳,۷۶۱	ملی صنایع مس ایران
۲	۵۴۷,۰۶۵,۲۶۴,۰۰۰	فولاد مبارکه اصفهان	۲	۵۶۵,۴۶۸,۰۶۸,۸۲۰	فولاد مبارکه اصفهان
۳	۴۵۵,۲۴۷,۲۶۵,۸۲۴	مخابرات ایران	۳	۴۶۵,۸۱۵,۲۹۱,۹۱۳	مخابرات ایران
۱۱	۳۹۶,۷۴۰,۴۱۴,۴۴۸	گسترش نفت و گاز پارسیان	۴	۳۹۸,۴۸۲,۹۰۰,۴۸۴	پالایش نفت بندرعباس
۱۲	۳۳۲,۳۶۵,۰۲۳,۲۰۳	شرکت ارتباطات سیار ایران	۵	۳۶۹,۰۲۱,۵۳۵,۹۴۷	معدنی و صنعتی گل گهر
-	۲۹۶,۷۰۸,۲۷۹,۱۱۲	پتروشیمی جم	۶	۳۶۸,۲۶۱,۹۴۶,۶۵۴	گروه مینا (سهامی عام)
-	۲۸۲,۰۷۹,۸۵۰,۰۰۰	صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۷	۳۵۳,۸۱۰,۰۶۷,۸۹۶	نفت و گاز و پتروشیمی تأمین
-	۲۶۱,۴۸۶,۵۰۰,۰۰۰	پتروشیمی پردیس	۸	۳۳۳,۲۲۶,۵۸۲,۱۹۱	پالایش نفت اصفهان
-	۲۵۵,۲۲۷,۳۰۹,۶۰۵	پتروشیمی مبین	۹	۳۲۴,۶۶۵,۳۸۷,۲۴۵	ایران خودرو
۵	۲۳۰,۵۲۵,۰۰۱,۳۱۲	معدنی و صنعتی گل گهر	۱۰	۳۰۶,۰۸۲,۳۳۹,۳۸۶	بانک ملت
۹	۲۰۶,۵۵۰,۷۵۰,۰۰۰	ایران خودرو	۱۱	۲۹۳,۹۵۱,۴۰۱,۹۲۶	گسترش نفت و گاز پارسیان
۱۰	۱۹۹,۳۸۴,۵۰۰,۰۰۰	بانک ملت	۱۲	۲۶۶,۱۲۵,۴۷۲,۰۰۹	شرکت ارتباطات سیار ایران
۱۳	۱۸۹,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری غدیر	۱۳	۲۴۹,۶۶۲,۹۲۱,۱۵۵	سرمایه گذاری غدیر
-	۱۶۸,۸۸۳,۴۳۸,۹۰۰	صندوق سهامداری سپاس	۱۴	۲۲۲,۴۳۷,۸۸۰,۶۹۲	سایپا
-	۱۶۸,۱۸۵,۰۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری امید	۱۵	۲۱۵,۳۵۲,۶۰۶,۰۸۵	پالایش نفت تهران

همچنین پانزده نماد برتر با بیشترین ارزش معاملات (خرید و فروش) به شرح جدول زیر می‌باشد.

پانزده نماد با بیشترین ارزش معاملات در صندوق

ردیف	نام نماد	ارزش معاملات (خرید و فروش) (ریال)
۱	ملی صنایع مس ایران	۱,۵۸۸,۶۴۹,۳۲۳,۷۶۱
۲	فولاد مبارکه اصفهان	۱,۱۱۲,۵۳۳,۳۳۲,۸۲۰
۳	مخابرات ایران	۹۲۱,۰۶۲,۵۵۷,۷۳۷
۴	گسترش نفت و گاز پارسیان	۶۹۰,۶۹۱,۸۱۶,۳۷۴
۵	معدنی و صنعتی گل گهر	۵۹۹,۵۴۶,۵۳۷,۲۵۹
۶	شرکت ارتباطات سیار ایران	۵۹۸,۴۹۰,۴۹۵,۲۱۲
۷	پالایش نفت بندرعباس	۵۳۶,۷۰۹,۴۰۰,۴۸۴
۸	ایران خودرو	۵۳۱,۲۱۶,۱۳۷,۲۴۵
۹	بانک ملت	۵۰۵,۴۶۶,۸۳۹,۳۸۶
۱۰	پتروشیمی جم	۴۸۷,۲۱۲,۴۷۳,۹۲۷
۱۱	نفت و گاز و پتروشیمی تأمین	۴۸۵,۷۵۰,۴۱۷,۸۹۶
۱۲	پالایش نفت اصفهان	۴۵۶,۳۷۸,۷۸۲,۱۹۱
۱۳	سرمایه‌گذاری غدیر	۴۳۸,۶۶۲,۹۲۱,۱۵۵
۱۴	پتروشیمی پردیس	۴۰۰,۹۶۸,۰۱۹,۹۶۶
۱۵	گروه مپنا	۳۹۶,۷۷۹,۹۴۶,۶۵۴

۳-۳- اوراق اختیار

درآمد ناشی از فروش قرارداد اختیار در سه دوره منتشره شده توسط صندوق توسعه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است عملیات انتشار اوراق اختیار معامله، مطابق با آیین نامه نحوه انتشار اوراق اختیار معامله تهیه شده توسط هیات مدیره صندوق و مصوب ایشان، انجام می‌پذیرد.

نام نماد	نوع اختیار	تعداد قرارداد	تعداد قرارداد اعمال شده	تاریخ سررسید	درآمد ناشی از فروش قرارداد	دوره انتشار
فولاد	خرید	۱۵,۰۲۱	۱۲,۵۲۳	۹۵/۱۱/۲۵	۲۵,۷۷۳,۷۰۰,۰۰۰	دوره اول
فملی	خرید	۴۶۳	۴۳۸	۹۵/۱۱/۲۳	۶۲۸,۶۵۰,۰۰۰	
خودرو	خرید	۱۲۲	۱	۹۵/۱۱/۲۷	۳۰۵,۱۲۰,۰۰۰	
پارسان	خرید	۴۲۲	۲۷۶	۹۶/۰۲/۱۹	۸۵۸,۴۰۰,۰۰۰	دوره دوم
پارسان	فروش	۵	۰	۹۶/۰۲/۱۹	۴۰۸,۳۲۰,۰۰۰	
فملی	خرید	۲۴۴	۸۹	۹۶/۰۲/۲۳	۱۷۱,۷۱۰,۰۰۰	
فولاد	خرید	۱,۱۲۱	۲۳۶	۹۶/۰۲/۲۵	۵۰۹,۳۰۰,۰۰۰	
خودرو	خرید	۱۲۲	۴۵	۹۶/۰۲/۲۷	۱۹۲,۹۵۰,۰۰۰	
خودرو	فروش	۳۹	۲۴	۹۶/۰۲/۲۷	۵۱,۶۰۰,۰۰۰	
فولاد	خرید	۱,۸۷۰		۹۶/۰۸/۲۴	۱,۸۴۶,۰۰۰,۰۰۰	دوره سوم
فملی	خرید	۱,۰۳۰		۹۶/۰۸/۱۷	۱,۶۶۱,۰۰۰,۰۰۰	
کروی	خرید	۳۹۰		۹۶/۰۷/۲۶	۱,۶۰۹,۸۰۰,۰۰۰	
کگل	خرید	۳۸۰		۹۶/۰۸/۳۰	۲۷۸,۷۰۰,۰۰۰	
پارسان	خرید	۵۴۰		۹۶/۰۷/۱۲	۹۷۲,۶۰۰,۰۰۰	
شپنا	خرید	۱۰		۹۶/۰۷/۲۳	۴۵,۱۰۰,۰۰۰	
مجموع قراردادها		۲۱,۷۸۹	۱۳,۶۳۲	درآمد ناشی از فروش قرارداد	۳۵,۳۱۲,۹۵۰,۰۰۰	

درآمد ناشی از فروش سهام از طریق قراردادهای اختیار به شرح جدول زیر است.

دوره اختیار	درآمد ناشی از فروش سهم به قیمت اعمال برای صندوق	تاریخ سررسید	تعداد قرارداد	نوع اختیار	نام نماد
دوره اول اختیارهای منتشره	۱۶۲,۷۹۹,۰۰۰,۰۰۰	۹۵/۱۱/۲۵	۱۲,۵۲۳	خرید	فولاد
	۵,۷۵۷,۰۰۰,۰۰۰	۹۵/۱۱/۲۳	۴۳۸	خرید	فملی
	۲۶,۰۰۰,۰۰۰	۹۵/۱۱/۲۷	۱	خرید	خودرو
دوره دوم اختیارهای منتشره	۴,۵۱۶,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۲/۱۹	۲۷۶	خرید	پارسان
	۱,۶۱۲,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۲/۲۳	۸۹	خرید	فملی
	۳,۰۵۸,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۲/۲۵	۲۳۶	خرید	فولاد
	۸۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۲/۲۷	۴۵	خرید	خودرو
	(۷۲۰,۰۰۰,۰۰۰)	۹۶/۰۲/۲۷	۲۴	فروش	خودرو
	۱۷۷,۹۱۸,۰۰۰,۰۰۰	مجموع درآمد ناشی از فروش سهم به قیمت اعمال	۱۳,۶۳۷	مجموع قراردادهای اعمال شده	

۳-۴- فرایند دریافت سود سهام در صندوق

نسبت	مبلغ دریافت شده از مطالبات دوره قبل توسط هیات مدیره صندوق	مطالبات سود در زمان تحویل صندوق
%۶۷	۳۱۳,۵۴۲,۹۴۹,۱۹۱	۴۶۸,۹۴۰,۴۲۳,۸۶۵

نسبت	مبلغ دریافت شده توسط هیات مدیره صندوق	سود سهام تعلق گرفته در زمان هیات مدیره صندوق
*/%۹	۳۹,۰۶۹,۴۷۵,۷۵۵	۴۲۵,۵۸۲,۳۶۱,۴۶۸

*پایین بودن مبلغ دریافت شده از مطالبات تعلق گرفته در زمان مدیریت صندوق توسط هیات مدیره ناشی از عدم اتمام مهلت ۸ ماهه دریافت سود و وقفه زمانی تقسیم سود سهام سهامداران با حجم بالای سهم، توسط شرکت ها در مجامع برگزار شده تا تاریخ ۱۳۹۶/۴/۳۱، می باشد.

۴- خلاصه ای از عملکرد صندوق در چهار سال اخیر

خلاصه ای از وضعیت عملکرد صندوق در بازار سرمایه از سال ۹۳/۰۴/۳۱ لغایت ۱۳۹۶/۰۴/۳۱، به شرح جدول زیر است.

عنوان	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۳	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۴	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۵	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۶
تعداد روزهای معاملاتی	۲۴۳	۲۴۱	۲۴۵	۲۳۹
تعداد روزهای فعالیت صندوق	۲۰۲	۲۲۷	۲۲۵	۲۰۲
نسبت فعالیت صندوق از کل روزهای کاری	۸۳٪	۹۴٪	۹۲٪	۸۵٪
تعداد سفارش های معاملاتی	۲,۳۱۲	۴,۹۶۱	۲,۳۶۴	۳,۵۳۶
تعداد سفارش های معاملاتی در سمت خرید	۱,۸۳۷	۴,۰۹۷	۱,۹۴۲	۳,۲۵۱
نسبت سفارش های خرید از کل رکوردها	۷۹٪	۸۳٪	۸۲٪	۹۲٪
تعداد سفارش های معاملاتی در سمت فروش	۴۷۵	۸۶۴	۴۲۲	۲۸۵
نسبت سفارش های فروش از کل رکوردها	۲۱٪	۱۷٪	۱۸٪	*۸٪
تعداد نمادهایی که صندوق در آن ها فعال بوده	۹۲	۱۴۰	۱۳۷	۱۶۳
نسبت معاملات خرید	۷۴٪	۵۴٪	۵۹٪	۵۵٪
نسبت معاملات فروش	۲۶٪	۴۶٪	۴۱٪	۴۵٪
ارزش کل معاملات	۹ هزار میلیارد ریال	۳۶ هزار میلیارد ریال	۱۹ هزار میلیارد ریال	۱۴ هزار میلیارد ریال
تعداد کارگزاری های همراه	۲۱	۳۳	۱۹	۲۲
ناو آماری صندوق در آخرین روز سال مالی (ریال)	۱,۰۵۹,۱۵۶	۹۱۹,۲۸۹	۹۳۵,۷۶۴	۹۵۴,۵۷۳

* مطابق اطلاعات، صندوق در سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۴/۳۱، در بخش فروش سهام، خرده فروشی نکرده است.