



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه

منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۳۹۷

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
۶	۱-۳- بازده صندوق
۹	۲-۳- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری
۱۰	۳-۳- نسبت معاملات خرید و فروش در ۴ سال اخیر
۱۲	۳-۴- اوراق اختیار
۱۵	۴- قیمت میانگین واحدهای سرمایه‌گذاری برای دارندگان
۱۶	۵- 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 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:	۱۳۹۷/۰۴/۳۱
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 ۱۲,۸۹۵,۸۶۸ میلیون ریال افزایش یافته است. تغییرات مذکور به شرح جدول زیر ارائه شده است.

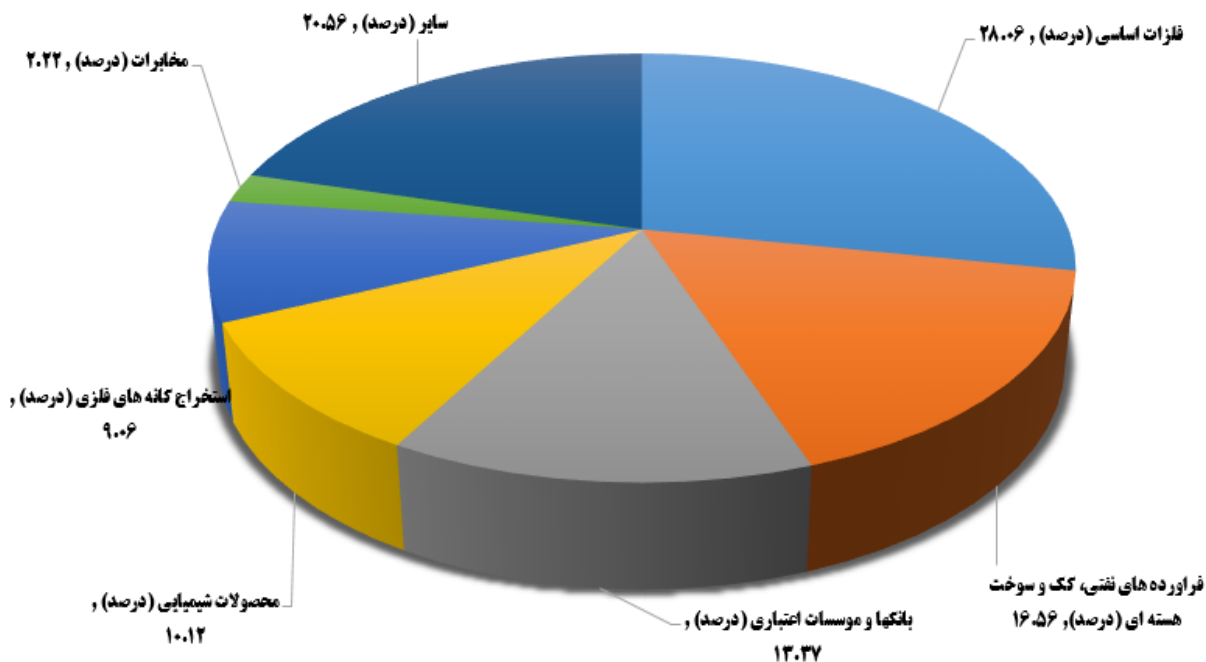
ردیف	نام شرکت	واحدهای صدور در زمان تاسیس	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۴/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۵/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۶/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۷/۰۴/۳۱	درصد تغییر
۱	بانک تجارت	۰	۱,۸۰۱,۴۰۵	۱,۹۱۰,۱۸۶	۱,۹۱۰,۱۸۶	۲,۸۷۳,۱۷۵	۵۰.۴٪
۲	بانک ملی	۰	۳۹۹,۷۶۹	۱,۵۰۴,۵۵۵	۱,۶۰۹,۳۸۶	۱,۹۶۶,۵۲۱	۲۲.۲٪
۳	بانک صادرات	۰	۳۶۷,۹۰۶	۱,۴۴۰,۱۲۸	۱,۵۴۴,۶۰۵	۱,۶۳۰,۶۴۵	۵.۶٪
۴	گروه مالی ملت	۰	۸۵۹,۶۴۱	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۵۳۵,۳۶۰	۶.۷٪
۵	بانک سپه	۰	۱۵۷,۴۹۰	۸۳۲,۳۹۹	۹۷۸,۵۰۰	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹.۹٪
۶	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۰	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۶۹۴,۹۷۱	۶۰.۰٪
۷	بانک پاسارگاد	۰	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۰.۰٪
۸	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۰	۵۴۲,۹۰۵	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۰.۰٪
۹	بیمه ایران	۰	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۰.۰٪
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۷,۹۶۸	-۰.۲٪
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۰	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۰.۰٪
۱۲	صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی	۰	۰	۰	۰	۱۹۳,۱۷۷	-
۱۳	بانک گردشگری	۰	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۰.۰٪
۱۴	بانک صنعت و معدن	۰	۵۵,۲۳۳	۱۱۵,۳۲۹	۱۱۵,۳۲۹	۱۱۵,۳۲۹	۰.۰٪
۱۵	تامین سرمایه تمدن	۰	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۰.۰٪
۱۶	سرمایه گذاری غدیر	۵۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰٪
۱۷	سرمایه گذاری فرهنگیان	۵۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰٪
۱۸	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۰.۰٪
۱۹	سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۰	۰	۰	۰	۴۴,۴۶۹	-
۲۰	صندوق بیمه اجتماعی روستائیان و عشایر	۳۵۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰٪
۲۱	سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات	۳۵۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰٪
۲۲	بانک سامان	۳۵۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰٪
۲۳	گروه سرمایه گذاری سایپا	۳۵۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰٪
۲۴	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۲۵۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۰.۰٪
۲۵	بانک کشاورزی	۱۵۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۰.۰٪
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۰.۰٪
۲۷	شرکت سرمایه گذاری پردیس	۵۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۰.۰٪
۲۸	سرمایه گذاری و توسعه صنایع سیمان	۰	۴۴,۸۶۳	۴۴,۸۶۳	۴۴,۸۶۳	۰	-
	جمع	۲۹۵,۰۰۰	۶,۸۲۷,۰۵۲	۱۰,۴۸۸,۶۰۲	۱۰,۸۴۴,۰۱۱	۱۲,۸۹۵,۸۶۸	۱۸.۹٪

۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۳۱

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 ۹۷/۰۴/۳۱ به ۱۹ صنعت تغییر یافته است.

صنعت	درصد از کل دارایی صندوق به ارزش روز ۱۳۹۷/۰۴/۳۱
محصولات شیمیایی	۱۰.۱۲٪
فلزات اساسی	۲۸.۰۶٪
بانک ها و موسسات اعتباری	۱۳.۳۷٪
فراورده های نفتی و سوخت هسته‌ای	۱۶.۵۶٪
خودرو و ساخت قطعات	۵.۶۹٪
استخراج کانه های فلزی	۹.۰۶٪
خدمات فنی و مهندسی	۴.۰۸٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۳.۱۴٪
شرکت‌های چند رشته ای صنعتی	۴.۸۶٪
مخابرات	۲.۲۲٪
ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۱.۱۴٪
رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۰.۳۰٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱.۰۵٪
سیمان، آهک و گچ	۰.۰۳٪
سرمایه گذاری ها	۰.۱۰٪
مواد و محصولات دارویی	۰.۰۵٪
غذایی و آشامیدنی بجز قندو شکر	۰.۰۶٪
ماشین آلات و تجهیزات	۰.۰۱٪
ساخت محصولات فلزی	۰.۰۳٪

ترکیب دارایی های صندوق توسعه در سهام (درصد)



۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۳۱

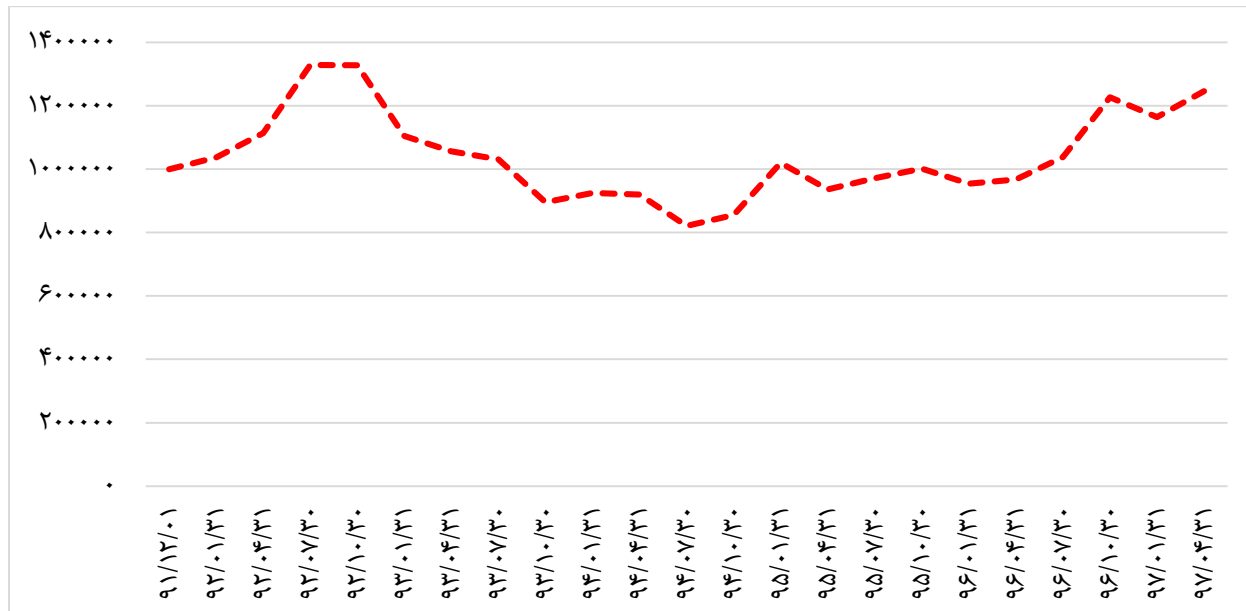
۳-۱- بازده صندوق

بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه و شش ماهه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۳۱ به شرح زیر است.

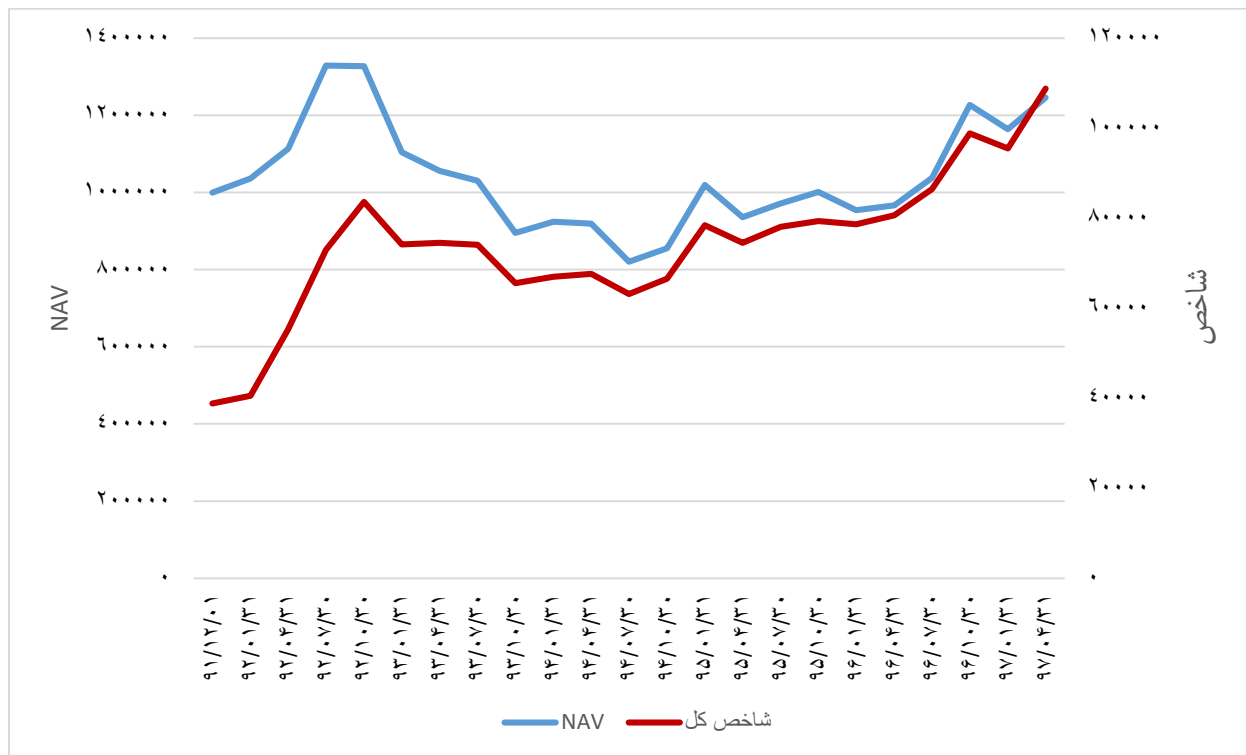
توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۷/۰۴/۲۴	-۰.۱۹۱%	۰.۷۰۲%
ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۴/۰۱	-۲.۶۷%	-۰.۰۳۹%
۳ ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۲/۰۳	۸.۳۲۸%	۱۵.۴۱%
۶ ماه گذشته	۱۳۹۶/۱۱/۰۳	۱.۹۴۹%	۹.۶۸۱%
یک سال گذشته	۱۳۹۶/۰۴/۳۱	۳۰.۵۱۲%	۳۴.۹۰۷%

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۳۱ 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 نه 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
-۱.۶۲۳٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰
-۳.۳۰۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹
-۰.۴۷۹٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱
-۰.۳۲۸٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱
۱۰.۸۳۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱
-۲.۶۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۳۱

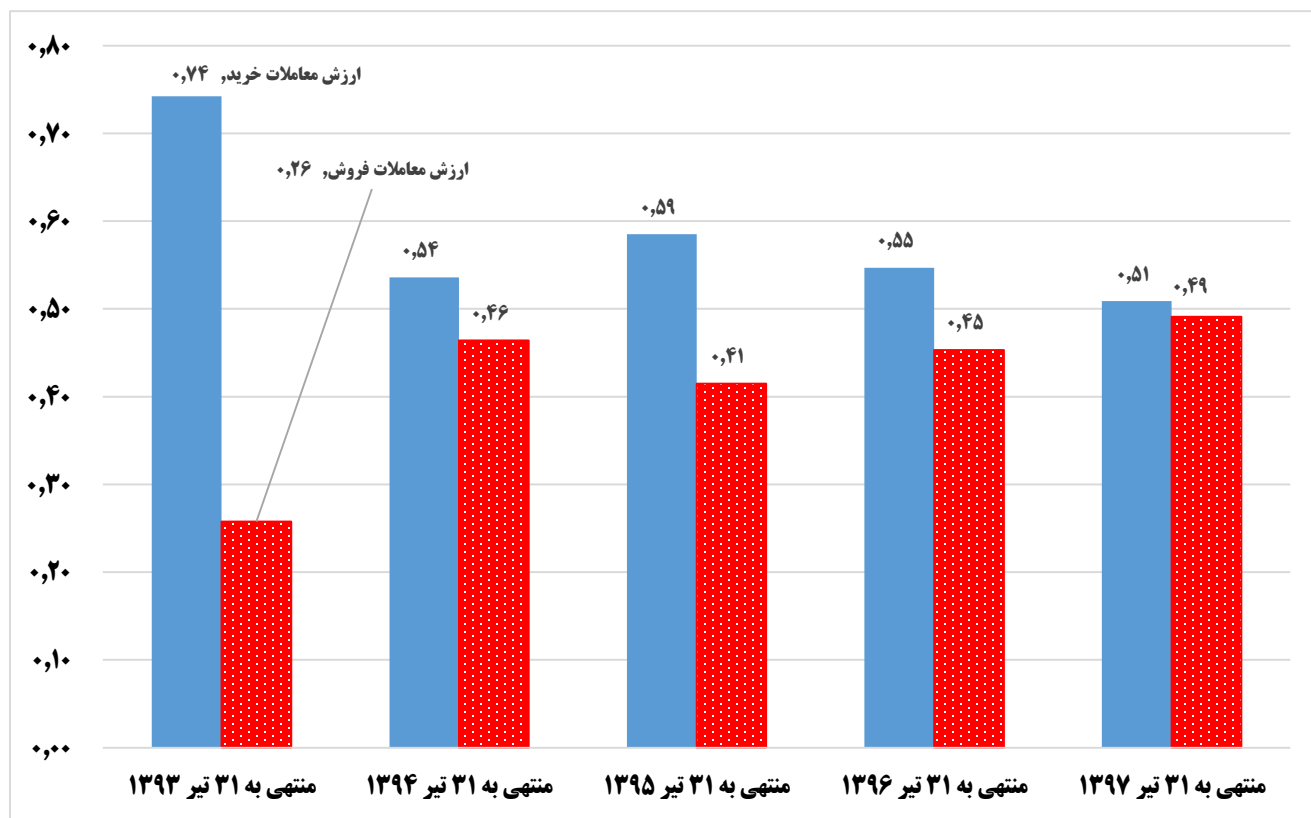
۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

کارگزاری	ارزش معاملات خرید	رتبه در معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	رتبه در معاملات فروش	حجم کل معاملات	رتبه در کل	درصد از حجم معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۷,۷۸۹,۶۸۶,۰۷۶,۵۷۱	۱	۸,۸۲۵,۷۰۱,۶۳۲,۲۷۵	۱	۱۶,۶۱۵,۳۸۷,۷۰۸,۸۴۶	۱	۵۳٪
بانک تجارت	۲,۸۶۰,۷۱۶,۰۵۷,۷۵۶	۲	۵۹۲,۴۷۵,۳۷۳,۸۶۹	۵	۳,۴۵۳,۱۹۱,۴۳۱,۶۲۵	۲	۱۱٪
بانک ملی ایران	۲,۰۲۷,۶۹۸,۷۱۶,۵۸۱	۳	۲۴۱,۱۰۳,۶۶۱,۹۱۹	۱۱	۲,۲۶۸,۸۰۲,۳۷۸,۵۰۰	۳	۷٪
بانک سپه	۱,۰۵۰,۷۱۴,۳۲۰,۹۶۶	۴	۲۹۸,۵۸۵,۳۲۸,۸۹۳	۱۰	۱,۳۴۷,۲۹۹,۵۰۵,۵۸۵	۴	۴٪
بانک صادرات	۹۱۳,۳۳۴,۶۲۱,۲۷۱	۵	۳۶۷,۶۹۹,۹۲۱,۶۲۱	۷	۱,۲۸۰,۹۸۴,۵۴۲,۸۹۲	۵	۴٪
بانک رفاه کارگران	۰	-	۱,۲۳۱,۷۸۲,۳۸۹,۷۵۹	۲	۱,۲۳۱,۷۸۲,۳۸۹,۷۵۹	۶	۴٪
بانک ملت	۴۶۴,۵۰۸,۵۹۸,۲۵۳	۷	۳۴۷,۷۹۳,۷۸۴,۹۵۸	۹	۸۱۲,۳۰۲,۳۸۳,۲۱۱	۷	۳٪
فارابی	۰	-	۷۳۹,۰۳۶,۶۲۳,۷۴۷	۳	۷۳۹,۰۳۶,۶۲۳,۷۴۷	۸	۲٪
پاسارگاد	۶۸۵,۸۲۴,۶۹۷,۰۵۵	۶	۴۸,۴۲۳,۶۹۵,۹۱۵	۲۴	۷۳۴,۲۴۸,۳۹۲,۹۷۰	۹	۲٪
بورس بیمه ایران	۰	-	۶۳۵,۸۲۵,۷۴۸,۰۴۹	۴	۶۳۵,۸۲۵,۷۴۸,۰۴۹	۱۰	۲٪
آگاه	۰	-	۴۳۷,۵۸۷,۰۳۳,۴۰۰	۶	۴۳۷,۵۸۷,۰۳۳,۴۰۰	۱۱	۱٪
بانک کشاورزی	۰	-	۳۵۱,۵۹۴,۳۱۹,۴۸۵	۸	۳۵۱,۵۹۴,۳۱۹,۴۸۵	۱۲	۱٪
خبرگان سهام	۰	-	۱۹۶,۰۱۴,۵۶۷,۵۰۰	۱۲	۱۹۶,۰۱۴,۵۶۷,۵۰۰	۱۳	۱٪
حافظ	۰	-	۱۲۸,۹۹۳,۵۸۶,۹۳۳	۱۳	۱۲۸,۹۹۳,۵۸۶,۹۳۳	۱۴	۰٪
بانک اقتصاد نوین	۰	-	۹۳,۲۲۲,۳۲۶,۱۴۴	۱۴	۹۳,۲۲۲,۳۲۶,۱۴۴	۱۵	۰٪
اقتصاد بیدار	۰	-	۸۳,۷۵۳,۴۸۴,۸۹۰	۱۵	۸۳,۷۵۳,۴۸۴,۸۹۰	۱۶	۰٪
بانک مسکن	۰	-	۷۷,۰۷۸,۹۷۴,۵۰۰	۱۶	۷۷,۰۷۸,۹۷۴,۵۰۰	۱۷	۰٪
نهایت نگر	۰	-	۷۲,۳۱۵,۳۰۶,۰۵۰	۱۷	۷۲,۳۱۵,۳۰۶,۰۵۰	۱۸	۰٪
تامین سرمایه نوین	۰	-	۶۹,۰۶۶,۸۹۶,۱۸۵	۱۸	۶۹,۰۶۶,۸۹۶,۱۸۵	۱۹	۰٪
مفید	۰	-	۵۷,۲۳۰,۷۳۴,۶۰۰	۱۹	۵۷,۲۳۰,۷۳۴,۶۰۰	۲۰	۰٪
آتل	۰	-	۵۵,۴۸۱,۱۱۳,۶۴۸	۲۰	۵۵,۴۸۱,۱۱۳,۶۴۸	۲۱	۰٪
آبادانا	۰	-	۵۳,۳۸۶,۱۳۶,۰۰۰	۲۱	۵۳,۳۸۶,۱۳۶,۰۰۰	۲۲	۰٪
دلیران پارس	۰	-	۵۲,۸۴۸,۲۹۰,۶۰۰	۲۲	۵۲,۸۴۸,۲۹۰,۶۰۰	۲۳	۰٪
بانک سامان	۲,۳۴۳,۴۴۲,۲۰۰	۹	۴۸,۸۱۵,۹۵۳,۷۲۰	۲۳	۵۱,۱۵۹,۳۹۵,۹۲۰	۲۴	۰٪
بانک پارسیان	۱۸,۹۳۸,۲۵۱,۳۱۳	۸	۲۷,۴۴۷,۱۲۷,۸۲۱	۲۷	۴۶,۳۸۵,۴۷۹,۱۳۴	۲۵	۰٪
صبا تامین	۰	-	۳۲,۳۷۰,۳۲۵,۰۰۰	۲۵	۳۲,۳۷۰,۳۲۵,۰۰۰	۲۶	۰٪
بانک صنعت و معدن	۰	-	۳۰,۵۵۷,۲۸۰,۶۱۶	۲۶	۳۰,۵۵۷,۲۸۰,۶۱۶	۲۷	۰٪
سهام گستران شرق	۰	-	۲۳,۵۵۶,۱۰۴,۳۹۳	۲۸	۲۳,۵۵۶,۱۰۴,۳۹۳	۲۸	۰٪
بورسیران	۰	-	۱۸,۳۷۶,۳۸۴,۵۰۰	۲۹	۱۸,۳۷۶,۳۸۴,۵۰۰	۲۹	۰٪
آراد ایرانیان	۰	-	۱۰,۵۸۷,۵۶۰,۷۰۴	۳۰	۱۰,۵۸۷,۵۶۰,۷۰۴	۳۰	۰٪

کارگزاری	ارزش معاملات خرید	رتبه در معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	رتبه در معاملات فروش	حجم کل معاملات	رتبه در کل	درصد از حجم معاملات
سهام پویا	۰	-	۱۰,۱۹۴,۷۳۵,۱۸۰	۳۱	۱۰,۱۹۴,۷۳۵,۱۸۰	۳۱	۰٪
عمران فارس	۰	-	۵,۷۶۳,۸۴۲,۶۸۹	۳۲	۵,۷۶۳,۸۴۲,۶۸۹	۳۲	۰٪
بانک توسعه صادرات	۰	-	۴,۱۸۱,۰۱۳,۰۰۰	۳۳	۴,۱۸۱,۰۱۳,۰۰۰	۳۳	۰٪
مجموع	۱۵,۸۱۳,۷۶۴,۸۸۱,۹۶۶	-	۱۵,۲۶۸,۸۰۱,۲۵۸,۵۶۳	-	۳۱,۰۸۲,۵۶۶,۱۴۰,۵۲۹	-	۱۰۰٪

۳-۳- نسبت معاملات خرید و فروش در ۴ سال اخیر

نسبت معاملات (درصد از کل حجم معاملات) خرید و فروش در چهار سال اخیر به شرح جدول زیر می باشد.



در جدول زیر ارزش معاملات صندوق به تفکیک در چهار سال اخیر آورده شده است. (ارقام به ریال می باشد)

ارزش کل معاملات	ارزش معاملات فروش	ارزش معاملات خرید	
۹,۶۳۷,۳۵۶,۳۶۸,۳۷۹	۲,۴۸۴,۱۴۱,۳۶۸,۷۸۰	۷,۱۵۳,۲۱۴,۹۹۹,۵۹۹	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۳
۳۶,۲۷۵,۸۰۸,۹۳۲,۸۷۴	۱۶,۸۳۴,۴۳۲,۱۵۳,۲۶۸	۱۹,۴۴۱,۳۷۶,۷۷۹,۶۰۶	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۴
۱۹,۱۳۵,۱۱۷,۸۰۶,۶۴۷	۷,۹۴۰,۰۹۱,۳۳۹,۹۰۴	۱۱,۱۹۵,۰۲۶,۴۶۶,۷۴۳	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۵
۱۴,۲۲۶,۳۴۴,۹۶۳,۶۵۸	۶,۴۴۷,۳۴۴,۰۹۲,۱۵۸	۷,۷۷۹,۰۰۰,۸۷۱,۵۰۰	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۶
۳۱,۰۸۲,۵۶۶,۱۴۰,۵۲۹	۱۵,۲۶۸,۸۰۱,۲۵۸,۵۶۳	۱۵,۸۱۳,۷۶۴,۸۸۱,۹۶۶	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۷



۳-۴- اوراق اختیار

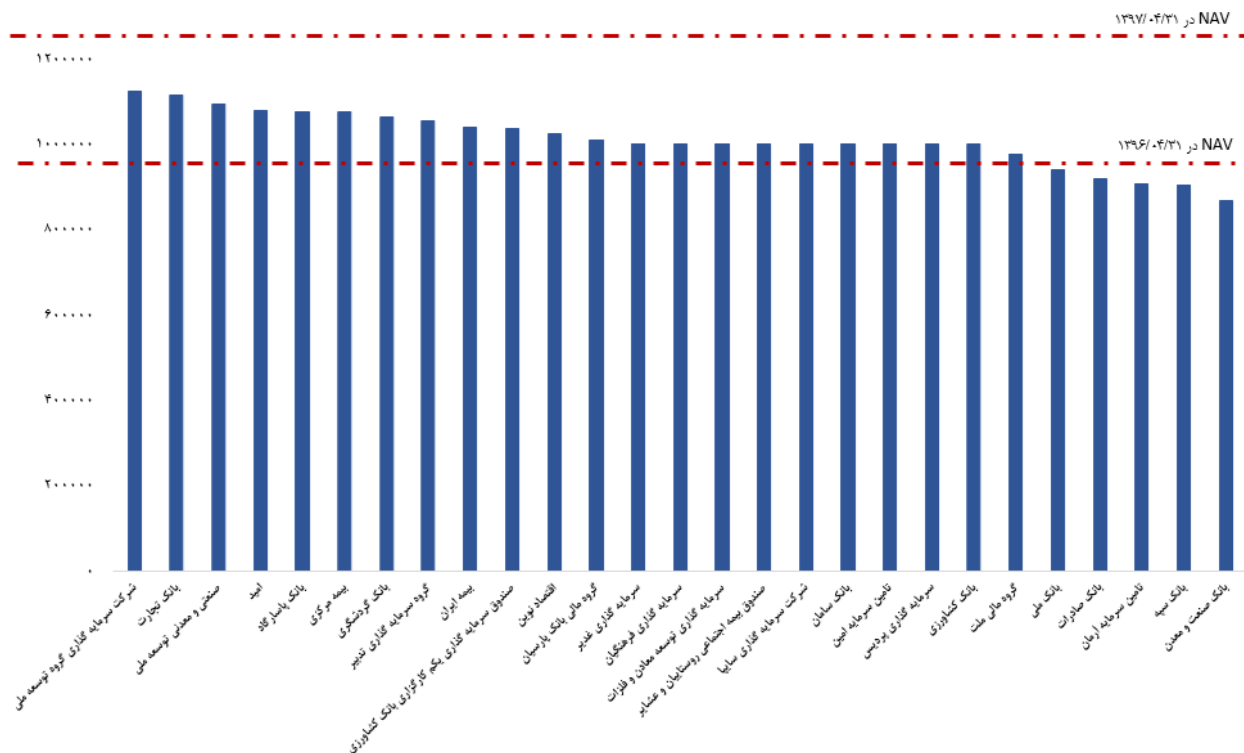
درآمد ناشی از فروش قرارداد اختیار منتشره شده توسط صندوق توسعه به شرح جدول زیر است.

دوره انتشار	درآمد ناشی از فروش قرارداد	تاریخ سررسید	موقعیت	نوع اختیار	نام نماد
دوره سوم	۲۳,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۰۵	فروش	خرید	اخابر
	۹۷۲,۶۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۱۲	فروش	خرید	پارسان
	۱۵۵,۸۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۲۳	فروش	خرید	شپنا
	۱,۶۰۷,۳۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۲۶	فروش	خرید	کروی
	۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۱۰	فروش	فروش	خودرو
	۲,۳۹۱,۹۶۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۱۷	فروش	خرید	فملی
	۲,۵۴۲,۵۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۲۴	فروش	خرید	فولاد
	۳,۴۶۱,۳۱۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۳۰	فروش	خرید	کگل
	۲۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۳۰	فروش	فروش	
دوره چهارم	۶۱,۶۳۰,۰۰۰	۹۶/۱۱/۱۱	فروش	خرید	فملی
	۱۲۰,۴۰۰,۰۰۰	۹۶/۱۱/۲۵	فروش	خرید	فولاد
دوره پنجم	۳۰۵,۸۵۰	۹۷/۰۲/۱۲	فروش	خرید	تاپیکو
	۲,۵۰۰,۰۰۰	۹۷/۰۲/۱۸	فروش	خرید	شبندر
	۱۱۱,۷۵۰,۰۰۰	۹۷/۰۲/۲۳	فروش	خرید	فملی
	۹۷۲,۴۴۰,۰۰۰	۹۷/۰۲/۲۶	فروش	خرید	کگل
	۵۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷/۰۲/۳۱	فروش	خرید	فولاد
	۳۶,۴۴۵,۰۰۰	۹۷/۰۳/۰۷	فروش	خرید	شپنا
دوره ششم	۶۳,۶۰۰,۰۰۰	۹۷/۰۷/۱۸	فروش	خرید	خودرو
	۲۲۲,۴۶۵,۰۰۰	۹۷/۰۷/۲۲	فروش	خرید	شپنا
	۱,۱۷۴,۱۶۴,۰۰۰	۹۷/۰۷/۲۵	فروش	خرید	پارسان
	۴۶۳,۴۷۷,۰۰۰	۹۷/۰۸/۲۰	فروش	خرید	شبندر
	۲۴۹,۳۵۰,۰۰۰	۹۷/۰۸/۲۳	فروش	خرید	فملی
	۱,۴۰۰,۰۰۰			فروش	
	۹۷۴,۷۴۸,۰۰۰	۹۷/۰۸/۲۷	فروش	خرید	کگل
	۲,۱۰۰,۰۰۰			فروش	
	۹,۰۸۲,۲۹۰,۰۰۰	۹۷/۰۸/۳۰	فروش	خرید	فولاد
	۱,۱۰۰,۰۰۰			فروش	
	۲۵,۲۶۴,۸۳۴,۸۵۰	درآمد ناشی از فروش قرارداد	مجموع قراردادها		

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

دوره اختیار	درآمد ناشی از فروش سهام به قیمت اعمال برای صندوق	تاریخ سررسید	تعداد قرارداد اعمال شده	نوع اختیار	نام نماد
دوره اختیارهای منتشره دوره سوم	۱۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۰۵	۱۰	خرید	اخابر
	۶,۷۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۱۲	۳۷۰	خرید	پارسان
	۱,۴۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۲۳	۵۰	خرید	شینا
	۱۰,۸۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۷/۲۶	۵۲۰	خرید	کروی
	-۳۱۸,۵۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۱۰	۱۰	فروش	خودرو
	۱۶,۲۵۰,۱۹۱,۱۸۰	۹۶/۰۸/۱۷	۱,۱۸۷	خرید	فملی
	۳۸,۱۳۸,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۲۴	۲,۵۶۳	خرید	فولاد
	۱۵,۶۰۷,۶۰۰,۰۰۰	۹۶/۰۸/۳۰	۷۳۸	خرید	کگل
دوره چهارم	۲,۶۹۴,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۱۱/۱۱	۱۱۷	خرید	فملی
	۱,۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶/۱۱/۲۵	۵۳	خرید	فولاد
دوره پنجم	۱۵,۰۹۲,۸۶۱,۵۶۰	۹۷/۰۲/۲۶	۴,۰۶۰	خرید	کگل
	۲۸,۸۰۰,۰۰۰	۹۷/۰۲/۳۱	۹	خرید	فولاد
	۱۰۸,۰۰۷,۹۵۲,۷۴۰	مجموع درآمد ناشی از فروش سهام به قیمت اعمال	۹,۶۸۷		مجموع قراردادهای اعمال شده

۴- قیمت میانگین واحدهای سرمایه گذاری برای دارندگان



مطابق اطلاعات جدول، در تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۳۱ این تاریخ در سود می باشند.

میانگین نرخ صدور برای دارندگان واحدهای سرمایه گذاری صندوق به شرح جدول زیر است.

ردیف	عنوان	میانگین صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال)	ردیف	عنوان	میانگین صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال)
۱	سرمایه گذاری توسعه ملی	۱,۱۲۲,۹۰۹	۱۵	توسعه معادن و فلزات	۱,۰۰۰,۰۰۰
۲	بانک تجارت	۱,۱۱۳,۷۴۸	۱۶	صندوق بیمه روستاییان و عشایر	۱,۰۰۰,۰۰۰
۳	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۱,۰۹۳,۶۶۲	۱۷	سرمایه گذاری سایپا	۱,۰۰۰,۰۰۰
۴	امید	۱,۰۷۹,۳۲۴	۱۸	بانک سامان	۱,۰۰۰,۰۰۰
۵	بانک پاسارگاد	۱,۰۷۶,۴۹۷	۱۹	تامین سرمایه امین	۱,۰۰۰,۰۰۰
۶	بیمه مرکزی	۱,۰۷۴,۱۶۸	۲۰	سرمایه گذاری پردیس	۱,۰۰۰,۰۰۰
۷	بانک گردشگری	۱,۰۶۳,۸۹۲	۲۱	بانک کشاورزی	۱,۰۰۰,۰۰۰
۸	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۱,۰۵۳,۷۹۷	۲۲	گروه مالی ملت	۹۷۶,۷۳۰
۹	بیمه ایران	۱,۰۳۸,۸۹۹	۲۳	بانک ملی	۹۴۰,۶۴۹
۱۰	صندوق یکم کشاورزی	۱,۰۳۵,۲۶۷	۲۴	بانک صادرات	۹۱۹,۴۳۶
۱۱	اقتصاد نوین	۱,۰۲۳,۶۸۱	۲۵	تامین سرمایه آرمان	۹۰۵,۱۷۲
۱۲	گروه مالی بانک پارسیان	۱,۰۱۰,۳۹۰	۲۶	بانک سپه	۹۰۲,۱۵۰
۱۳	سرمایه گذاری غدیر	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲۷	بانک صنعت و معدن	۸۶۷,۰۴۲
۱۴	سرمایه گذاری فرهنگیان	۱,۰۰۰,۰۰۰			

۵- خلاصه ای از عملکرد صندوق در چهار سال اخیر

خلاصه ای از وضعیت عملکرد صندوق در بازار سرمایه از سال ۱۳۹۳/۰۴/۳۱ لغایت ۱۳۹۷/۰۴/۳۱، 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	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۷
تعداد روزهای معاملاتی	۲۴۳	۲۴۱	۲۴۵	۲۳۹	۲۳۹
تعداد روزهای فعالیت صندوق	۲۰۲	۲۲۷	۲۲۵	۲۰۲	۲۳۹
نسبت فعالیت صندوق از کل روزهای کاری	۸۳٪	۹۴٪	۹۲٪	۸۵٪	۱۰۰٪
تعداد نمادهایی که صندوق در آن ها فعال بوده	۹۲	۱۴۰	۱۳۷	۱۶۳	۲۵۴
نسبت معاملات خرید	۷۴٪	۵۴٪	۵۹٪	۵۵٪	۵۱٪
نسبت معاملات فروش	۲۶٪	۴۶٪	۴۱٪	۴۵٪	۴۹٪
ارزش کل معاملات	۹ هزار میلیارد ریال	۳۶ هزار میلیارد ریال	۱۹ هزار میلیارد ریال	۱۴ هزار میلیارد ریال	۳۱ هزار میلیارد ریال
تعداد کارگزاری های همراه	۲۱	۳۳	۱۹	۲۲	۳۲
ناو آماری صندوق در آخرین روز سال مالی (ریال)	۱,۰۵۹,۱۵۶	۹۱۹,۲۸۹	۹۳۵,۷۶۴	۹۵۴,۵۷۳	۱,۲۴۵,۸۲۹