



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه

منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۳۹۸

فهرست مطالب

عنوان صفحه

۱- مقدمه	۳
۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه	۳
۱-۲- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری	۴
۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق	۵
۳- بررسی عملکرد صندوق	۶
۱-۳- بازده صندوق	۶
۲-۳- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری	۹
۳-۳- معافیت‌های دریافت شده توسط هیأت مدیره صندوق	۱۰
۱-۳-۳- سهم دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری از مجموع معافیت‌های دریافتی	۱۱
۲-۳-۳- تأثیر معافیت‌های دریافت شده بر NAV صندوق	۱۲
۴-۳- نسبت معاملات خرید و فروش در ۶ سال اخیر	۱۳
۵-۳- اوراق اختیار معامله	۱۴
۱-۵-۳- درآمد فروش اوراق اختیار معامله	۱۴
۲-۵-۳- درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله	۲۰
۶-۳- فرآیند دریافت سود	۲۲
۴- قیمت میانگین واحدهای سرمایه‌گذاری برای دارندگان	۲۳
۵- خلاصه ای از عملکرد صندوق در ۶ سال اخیر	۲۵

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.

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:	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 سرمایه گذاری 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 ۱۲,۶۲۷,۵۸۹ میلیون ریال افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۸/۰۴/۳۱	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۲,۵۵۴,۵۱۷	۲۰,۲۳٪
۲	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۱۶,۰۶٪
۳	بانک صادرات	۱,۶۳۰,۶۴۵	۱۲,۹۱٪
۴	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۱۲,۱۶٪
۵	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۸,۵۱٪
۶	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۵,۵۰٪
۷	بانک پاسارگاد	۶۵۰,۲۵۶	۵,۱۵٪
۸	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۰۵,۱۱۹	۴,۷۹٪
۹	بیمه ایران	۵۲۹,۴۰۵	۴,۱۹٪
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۱۹۷,۹۶۸	۱,۵۷٪
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۱۹۵,۷۷۳	۱,۵۵٪
۱۲	صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی	۱۹۳,۱۷۷	۱,۵۳٪
۱۳	بانک گردشگری	۱۸۷,۴۹۹	۱,۴۸٪
۱۴	بانک صنعت و معدن	۱۱۵,۳۲۹	۰,۹۱٪
۱۵	تامین سرمایه تمدن	۵۵,۲۳۳	۰,۴۴٪
۱۶	سرمایه گذاری غدیر	۵۰,۰۰۰	۰,۴۰٪
۱۷	سرمایه گذاری فرهنگیان	۵۰,۰۰۰	۰,۴۰٪
۱۸	سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۴۴,۴۶۹	۰,۳۵٪
۱۹	صندوق بیمه اجتماعی روستائیان و عشایر	۳۵,۰۰۰	۰,۲۸٪
۲۰	سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات	۳۵,۰۰۰	۰,۲۸٪
۲۱	بانک سامان	۳۵,۰۰۰	۰,۲۸٪
۲۲	گروه سرمایه گذاری سایپا	۳۵,۰۰۰	۰,۲۸٪
۲۳	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۳۴,۴۱۰	۰,۲۷٪
۲۴	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۳۰,۰۰۰	۰,۲۴٪
۲۵	بانک کشاورزی	۱۵,۰۰۰	۰,۱۲٪
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰,۰۰۰	۰,۰۸٪
۲۷	شرکت سرمایه گذاری پردیس	۵,۰۰۰	۰,۰۴٪
	جمع	۱۲,۶۲۷,۵۸۹	۱۰۰٪

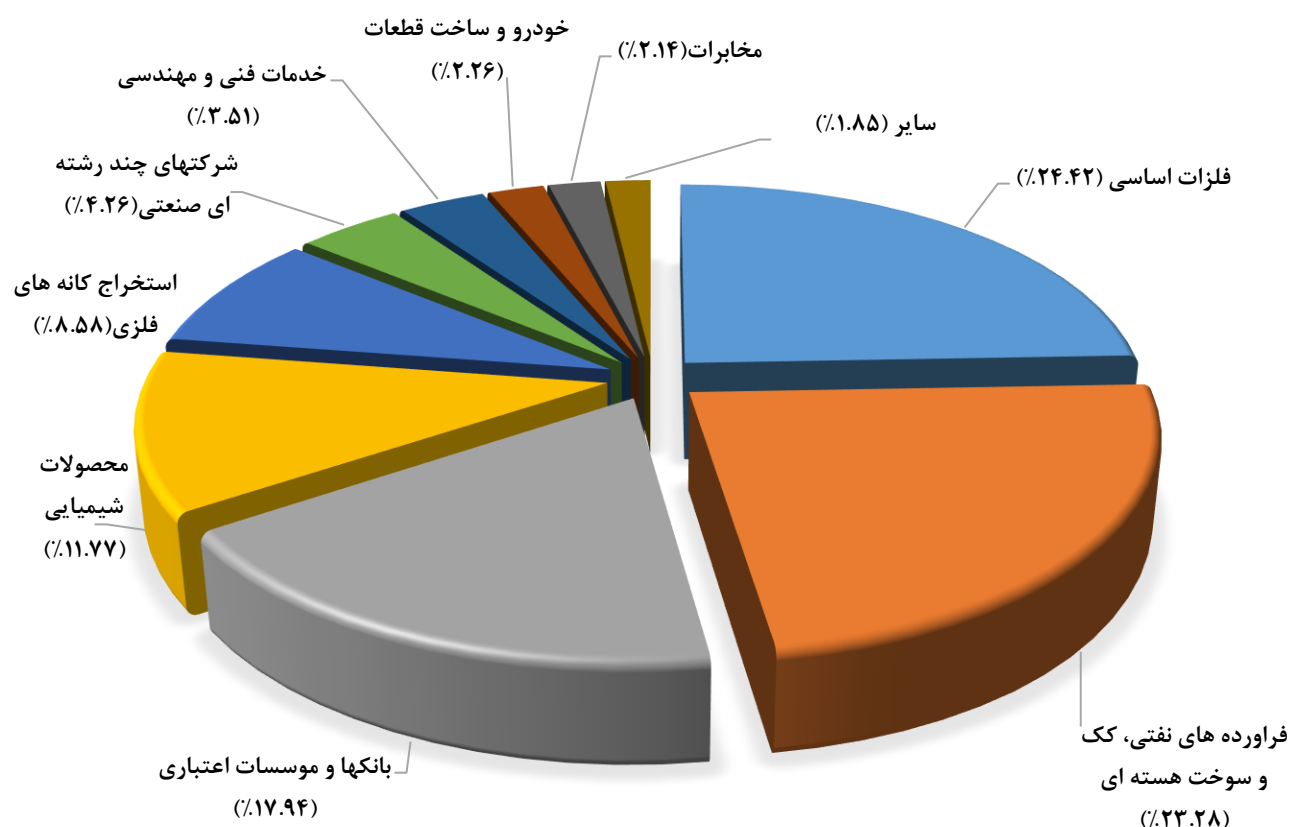
۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

سهام صنایع مختلف در پرتفوی صندوق توسعه بازار سرمایه به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است تعداد صناعی که صندوق در آن ها به بازارگردانی سهام می‌پردازد از ۱۹ صنعت، در تاریخ ۹۸/۰۴/۳۱ به ۱۸ صنعت تغییر یافته است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۳۹۸/۰۴/۳۱
فلزات اساسی	۲۴,۴۲٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲۳,۲۸٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۷,۹۴٪
محصولات شیمیایی	۱۱,۷۷٪
استخراج کانه های فلزی	۸,۵۸٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴,۲۶٪
خدمات فنی و مهندسی	۳,۵۱٪
خودرو و ساخت قطعات	۲,۲۶٪
مخابرات	۲,۱۴٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۰,۶۹٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۰,۵۶٪
مواد و محصولات دارویی	۰,۳۱٪
سیمان، آهک و گچ	۰,۰۸٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰,۰۸٪
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۰,۰۵٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰,۰۴٪
سرمایه گذاریها	۰,۰۳٪
سایر واسطه گریهای مالی	۰,۰۱٪

۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

ترکیب دارایی‌های صندوق توسعه بازار سرمایه در سهام (درصد)



۳-۱- بازده صندوق

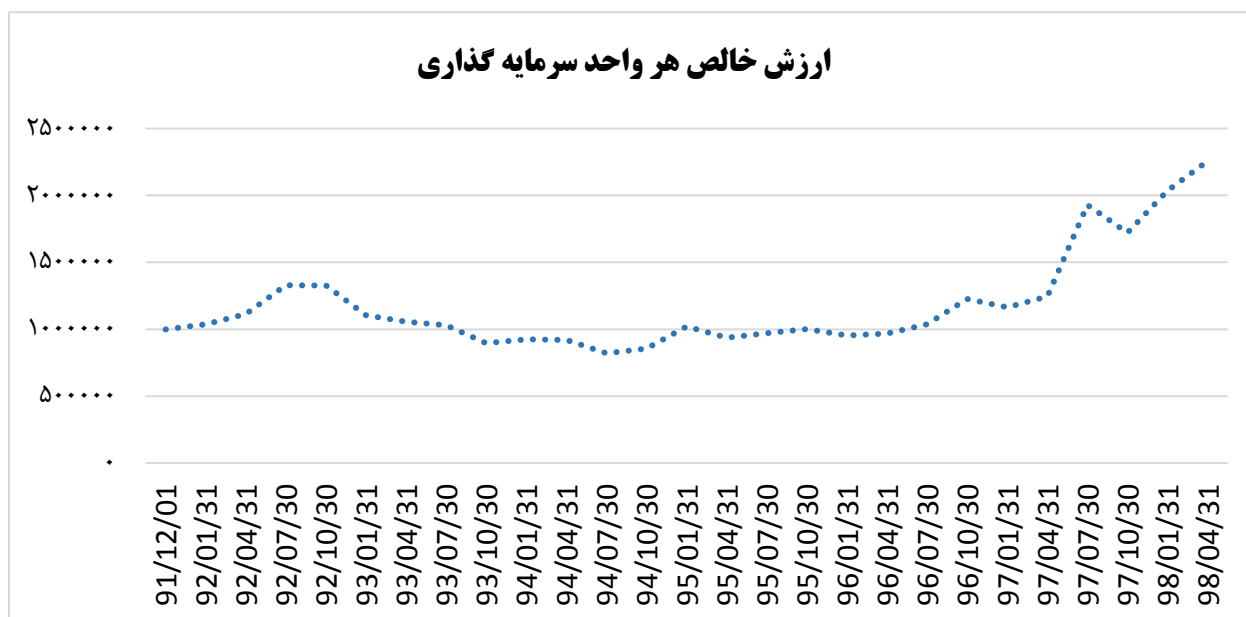
بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۸/۰۴/۲۴	۰.۰۶۶۲٪	۰.۰۹۷٪
ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۴/۰۱	۴.۸۷۶٪	۸.۱۹۷٪
۳ ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۲/۰۱	۱۱.۷۷۷٪	۲۴.۷۴۶٪
۶ ماه گذشته	۱۳۹۸/۱۱/۰۱	۳۲.۷۲۶٪	۵۵.۳۰۶٪
یک سال گذشته	۱۳۹۷/۰۴/۳۱	۸۱.۱۴۹٪	۱۳۲.۵۲۳٪

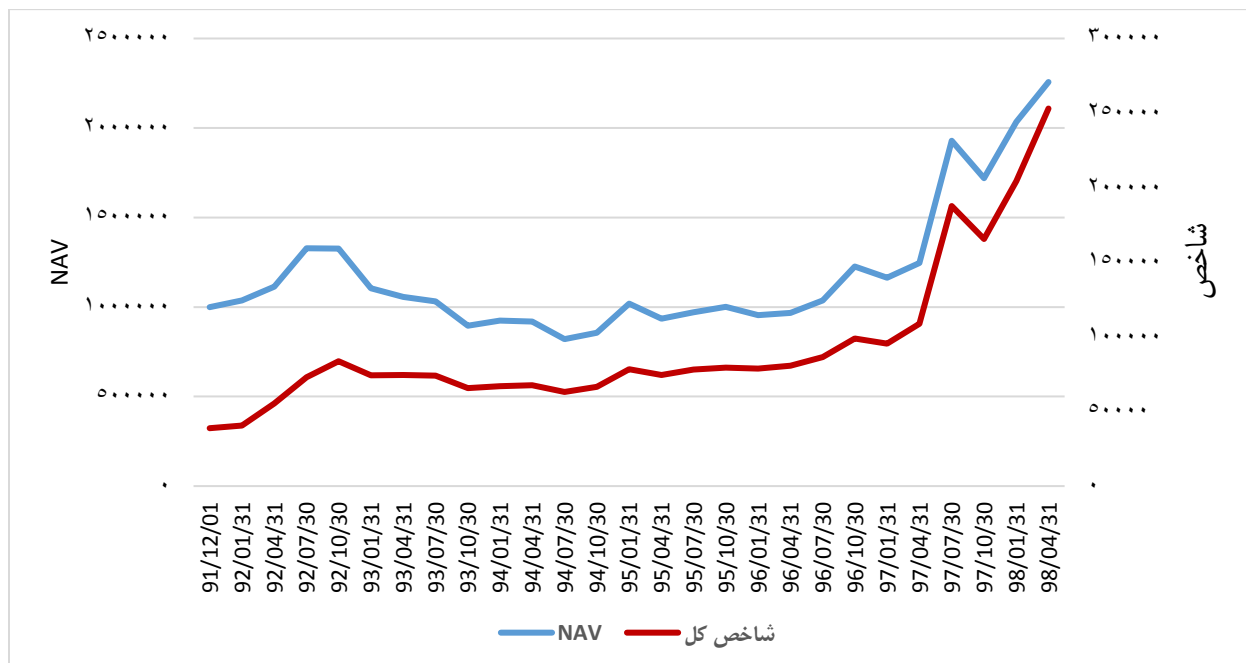
با توجه به خالص ارزش روز واحدهای سرمایه گذاری، نرخ بازدهی صندوق برای دوره‌های زمانی ماهانه در دوازده ماه اخیر به شرح زیر می باشد:

بازدهی	دوره
۱۹,۸۴۸٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱
۱۳,۴۶۳٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۳۱
۱۳,۶۰۱٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰
-۷,۴۷۱٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰
-۱۱,۱۹۶٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰
۸,۵۳۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۰/۳۰
-۴,۲۰۳٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰
۱۲,۳۳۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۲/۲۹
۱۰,۳۰۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱
۲,۲۵۷٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱
۳,۶۵۲٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱
۴,۸۷۶٪	ماهانه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ به شرح نمودار ذیل می باشد:



رشد تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل



۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت های کارگزاری

کارگزار	حجم معاملات خرید	رتبه در معاملات خرید	حجم معاملات فروش	رتبه در معاملات فروش	حجم کل معاملات	رتبه در کل معاملات	درصد در کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۲۴,۲۹۰,۳۰۳,۹۱۸,۱۲۰	۱	۲۹,۸۵۷,۵۳۷,۶۴۸,۲۱۴	۱	۵۴,۱۴۷,۸۴۱,۵۶۶,۳۳۴	۱	۷۵,۱۹٪
بانک تجارت	۲,۰۵۸,۸۳۵,۷۲۲,۱۱۴	۳	۱,۶۵۴,۵۷۰,۹۹۲,۸۴۶	۳	۳,۷۱۳,۴۰۶,۷۱۴,۹۶۰	۲	۵,۱۶٪
بانک ملی ایران	۲,۰۸۲,۴۲۱,۲۲۴,۲۲۷	۲	۹۹۸,۸۵۳,۰۱۲,۴۳۸	۵	۳,۰۸۱,۲۷۴,۲۳۶,۶۶۵	۳	۴,۲۸٪
بانک سپه	۱,۴۸۰,۶۲۳,۰۸۸,۰۳۸	۴	۷۶۲,۳۵۲,۱۸۸,۱۵۳	۶	۲,۲۴۲,۹۷۵,۲۷۶,۱۹۱	۴	۳,۱۱٪
بانک صادرات	۱,۳۳۹,۰۰۷,۹۶۵,۸۷۳	۵	۶۹۰,۰۱۴,۹۶۹,۵۷۳	۷	۲,۰۲۹,۰۲۲,۹۳۵,۴۴۶	۵	۲,۸۲٪
حافظ *	۰	-	۱,۶۸۶,۶۷۱,۰۳۵,۲۰۴	۲	۱,۶۸۶,۶۷۱,۰۳۵,۲۰۴	۶	۲,۳۴٪
بانک رفاه کارگران	۰	-	۱,۲۶۲,۹۹۰,۴۸۶,۹۶۰	۴	۱,۲۶۲,۹۹۰,۴۸۶,۹۶۰	۷	۱,۷۵٪
بانک ملت	۶۷۱,۳۱۶,۵۰۵,۷۶۹	۶	۹۹,۹۳۷,۵۰۰,۰۰۰	۱۶	۷۷۱,۲۵۴,۰۰۵,۷۶۹	۸	۱,۰۷٪
بانک پاسارگاد	۱۴۴,۰۹۷,۹۴۷,۳۵۵	۷	۶۱۱,۹۱۸,۳۰۴,۴۰۹	۸	۷۵۶,۰۱۶,۲۵۱,۷۶۴	۹	۱,۰۵٪
فارابی	۰	-	۵۰۸,۹۸۵,۷۱۲,۲۸۴	۹	۵۰۸,۹۸۵,۷۱۲,۲۸۴	۱۰	۰,۷۱٪
بورس بیمه ایران	۱۰۷,۳۵۰,۹۶۴,۲۰۱	۸	۳۵۷,۱۸۱,۵۷۸,۵۵۳	۱۱	۴۶۴,۵۳۲,۵۴۲,۷۵۴	۱۱	۰,۶۵٪
کیان	۰	-	۳۶۴,۳۴۷,۳۰۳,۸۶۰	۱۰	۳۶۴,۳۴۷,۳۰۳,۸۶۰	۱۲	۰,۵۱٪
اقتصاد بیدار	۱,۰۶۶,۶۹۵	۱۰	۲۰۴,۸۲۰,۶۶۱,۹۳۱	۱۲	۲۰۴,۸۲۱,۷۲۸,۶۲۶	۱۳	۰,۲۸٪
آتی ساز بازار	۰	-	۱۸۹,۳۶۹,۳۸۹,۲۸۶	۱۳	۱۸۹,۳۶۹,۳۸۹,۲۸۶	۱۴	۰,۲۶٪
بانک مسکن	۰	-	۱۷۷,۵۷۳,۹۴۱,۶۵۲	۱۴	۱۷۷,۵۷۳,۹۴۱,۶۵۲	۱۵	۰,۲۵٪
بانک پارسیان	۱۴,۹۶۸,۳۵۷,۵۴۲	۹	۱۱۳,۷۹۳,۱۴۶,۴۸۸	۱۵	۱۲۸,۷۶۱,۵۰۴,۰۳۰	۱۶	۰,۱۸٪
بانک اقتصاد نوین	۰	-	۷۲,۷۹۲,۳۹۴,۹۵۳	۱۷	۷۲,۷۹۲,۳۹۴,۹۵۳	۱۷	۰,۱۰٪
سینا	۰	-	۶۹,۹۷۸,۶۶۶,۵۹۰	۱۸	۶۹,۹۷۸,۶۶۶,۵۹۰	۱۸	۰,۱۰٪
مفید	۰	-	۴۵,۷۷۶,۶۱۹,۶۰۰	۱۹	۴۵,۷۷۶,۶۱۹,۶۰۰	۱۹	۰,۰۶٪
صبا تامین	۰	-	۲۸,۵۸۵,۴۸۷,۰۰۰	۲۰	۲۸,۵۸۵,۴۸۷,۰۰۰	۲۰	۰,۰۴٪
صبا جهاد	۰	-	۲۰,۸۷۶,۳۶۹,۶۰۰	۲۱	۲۰,۸۷۶,۳۶۹,۶۰۰	۲۱	۰,۰۳٪
خبرگان سهام	۰	-	۱۶,۶۷۳,۲۰۷,۴۰۵	۲۲	۱۶,۶۷۳,۲۰۷,۴۰۵	۲۲	۰,۰۲٪
آگاه	۰	-	۱۵,۷۳۶,۹۵۸,۰۰۵	۲۳	۱۵,۷۳۶,۹۵۸,۰۰۵	۲۳	۰,۰۲٪
ایستاتیس پویا	۰	-	۱۳,۱۴۷,۳۳۲,۰۰۰	۲۴	۱۳,۱۴۷,۳۳۲,۰۰۰	۲۴	۰,۰۲٪
مجموع	۳۲,۱۸۸,۹۲۶,۷۵۹,۹۳۴	-	۳۹,۸۲۴,۳۸۴,۹۰۷,۰۰۴	-	۷۲,۰۱۳,۳۱۱,۶۶۶,۹۳۸	-	۱۰۰٪

* حجم معاملات فروش در کارگزاری حافظ ناشی از فروش اوراق اختیار معامله و همچنین فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله با نرخ کارمزد ۰,۰۰۰۵ می باشد.

۳-۳- معافیت‌های دریافت شده توسط هیأت مدیره صندوق

معافیت مالیاتی نماد ۱۰۲ معاملاتی**	معافیت کارمزد در ایستگاه معاملاتی صندوق*	حجم معاملات در ایستگاه		حجم معاملات در سایر کارگزاری‌ها		تاریخ
		فروش	خرید	فروش	خرید	
۰	۳,۳۳۱,۸۱۶,۵۲۴	۱۸۰,۱۶۰,۲۱۶,۹۸۷	۶۵۲,۷۹۰,۸۶۹,۲۸۶	۵,۰۵۰,۵۲۷,۷۷۰,۸۸۴	۶,۱۱۱,۷۵۹,۳۲۷,۷۲۲	از ۱۳۹۵/۱۰/۰۱ لغایت ۱۳۹۶/۰۴/۳۱
۶۳,۱۷۳,۷۵۲,۱۶۰	۶۳,۲۶۹,۵۴۲,۴۳۸	۸,۸۲۵,۷۰۱,۶۳۲,۲۷۵	۷,۷۸۹,۶۸۶,۰۷۶,۵۷۱	۶,۴۵۶,۱۶۵,۳۴۵,۰۶۱	۸,۰۲۴,۰۷۸,۸۰۵,۳۹۵	از ۱۳۹۶/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۷/۰۴/۳۱
۹۵,۲۵۶,۰۶۳,۳۷۵	۲۰۵,۷۷۱,۲۴۳,۰۴۵	۲۹,۸۵۷,۵۳۷,۶۴۸,۲۱۴	۲۴,۲۹۰,۳۰۳,۹۱۸,۱۲۰	۹,۹۶۶,۸۴۷,۲۵۸,۱۷۰	۷,۸۹۸,۶۲۲,۸۴۱,۸۱۴	از ۱۳۹۷/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۸/۰۴/۳۱
۱۵۸,۴۲۹,۸۱۵,۵۳۵	۲۷۲,۳۷۲,۶۰۲,۰۰۷	۳۸,۸۶۳,۳۹۹,۴۹۷,۴۷۶	۳۲,۷۳۲,۷۸۰,۸۶۳,۹۷۷	۲۱,۴۷۳,۵۴۰,۳۷۴,۷۳۵	۲۲,۰۳۴,۴۶۰,۹۷۴,۹۳۱	مجموع
۴۳۰,۸۰۲,۴۱۷,۵۴۲		حاصل جمع معافیت‌های دریافتی توسط هیأت مدیره صندوق				

* کلیه معاملات انجام شده در ایستگاه معاملاتی صندوق معاف از پرداخت کارمزد کارگزار می‌باشد.

** مطابق تأییدیه دریافتی از سازمان بورس و اوراق بهادار از تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۱، مالیات مربوط به ۱۰۲ نماد معاملاتی صفر گردید.

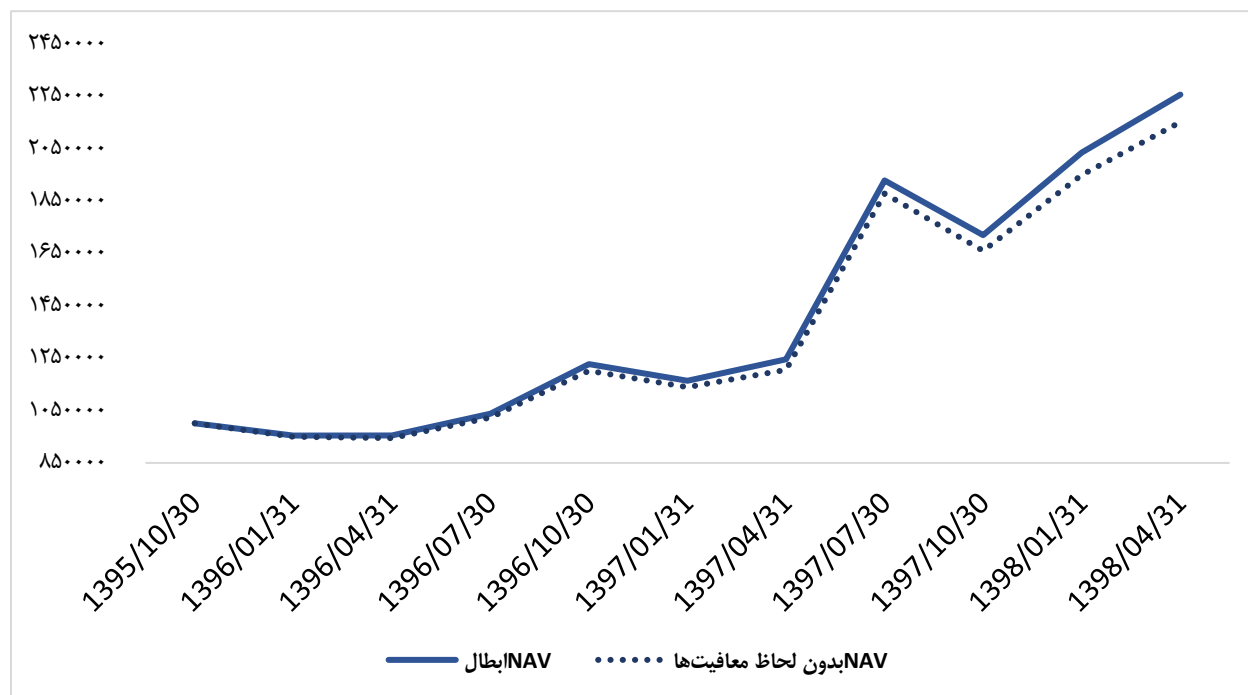
۳-۳-۱- سهم دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری از مجموع معافیت‌های دریافتی

مطابق جدول ۳-۳، با دریافت معافیت‌های مذکور به دلیل داشتن تأثیر مثبت بر NAV صندوق، سرمایه هر یک از دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به نسبت مالکیت ایشان مطابق جدول ذیل افزایش یافته است:

ردیف	نام شرکت	درصد مالکیت	سهم از معافیت (ریال)
۱	بانک تجارت	۲۰,۲۳٪	۸۷,۱۵۱,۳۲۹,۰۶۹
۲	بانک ملی	۱۶,۰۶٪	۶۹,۱۸۶,۸۶۸,۲۵۷
۳	بانک صادرات	۱۲,۹۱٪	۵۵,۶۱۶,۵۹۲,۱۰۵
۴	گروه مالی ملت	۱۲,۱۶٪	۵۲,۳۸۵,۵۷۳,۹۷۳
۵	بانک سپه	۸,۵۱٪	۳۶,۶۶۱,۲۸۵,۷۳۳
۶	گروه مدیریت سرمایه‌گذاری امید	۵,۵۰٪	۲۳,۶۹۴,۱۳۲,۹۶۵
۷	بانک پاسارگاد	۵,۱۵٪	۲۲,۱۸۶,۳۲۴,۵۰۳
۸	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۴,۷۹٪	۲۰,۶۳۵,۴۳۵,۸۰۰
۹	بیمه ایران	۴,۱۹٪	۱۸,۰۵۰,۶۲۱,۲۹۵
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۱,۵۷٪	۶,۷۶۳,۵۹۷,۹۵۵
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۱,۵۵٪	۶,۶۷۷,۴۳۷,۴۷۲
۱۲	صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی	۱,۵۳٪	۶,۵۹۱,۲۷۶,۹۸۸
۱۳	بانک گردشگری	۱,۴۸٪	۶,۳۷۵,۸۷۵,۷۸۰
۱۴	بانک صنعت و معدن	۰,۹۱٪	۳,۹۲۰,۳۰۲,۰۰۰
۱۵	تامین سرمایه تمدن	۰,۴۴٪	۱,۸۹۵,۵۳۰,۶۳۷
۱۶	سرمایه‌گذاری غدیر	۰,۴۰٪	۱,۷۲۳,۲۰۹,۶۷۰
۱۷	سرمایه‌گذاری فرهنگیان	۰,۴۰٪	۱,۷۲۳,۲۰۹,۶۷۰
۱۸	سرمایه‌گذاری گروه توسعه ملی	۰,۳۵٪	۱,۵۰۷,۸۰۸,۴۶۱
۱۹	صندوق بیمه اجتماعی روستائیان و عشایر	۰,۲۸٪	۱,۲۰۶,۲۴۶,۷۶۹
۲۰	سرمایه‌گذاری توسعه معادن و فلزات	۰,۲۸٪	۱,۲۰۶,۲۴۶,۷۶۹
۲۱	بانک سامان	۰,۲۸٪	۱,۲۰۶,۲۴۶,۷۶۹
۲۲	گروه سرمایه‌گذاری سایپا	۰,۲۸٪	۱,۲۰۶,۲۴۶,۷۶۹
۲۳	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۰,۲۷٪	۱,۱۶۳,۱۶۶,۵۲۷
۲۴	گروه سرمایه‌گذاری تدبیر	۰,۲۴٪	۱,۰۳۳,۹۲۵,۸۰۲
۲۵	بانک کشاورزی	۰,۱۲٪	۵۱۶,۹۶۲,۹۰۱
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۰,۰۸٪	۳۴۴,۶۴۱,۹۳۴
۲۷	شرکت سرمایه‌گذاری پردیس	۰,۰۴٪	۱۷۲,۳۲۰,۹۶۷
	جمع	۱۰۰٪	۴۳۰,۸۰۲,۴۱۷,۵۴۲

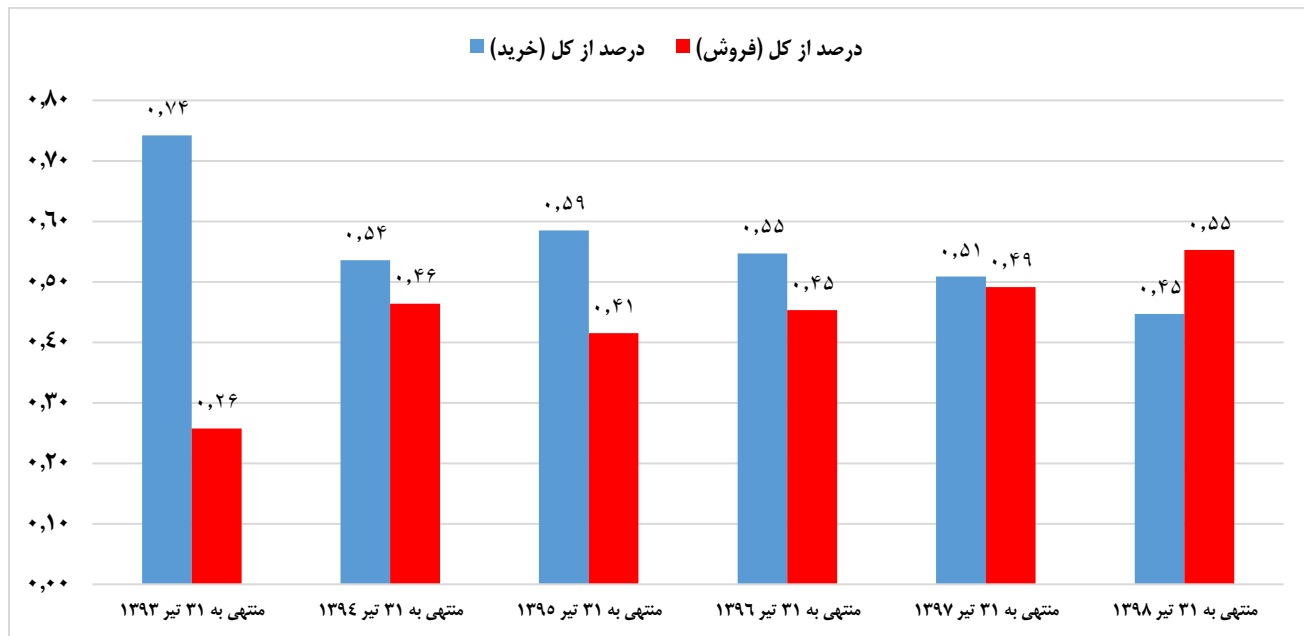
۳-۳-۲- تأثیر معافیت‌های دریافت شده بر NAV صندوق

تأثیر مثبت معافیت‌های دریافتی توسط هیأت مدیره صندوق به شرح نمودار ذیل می‌باشد:



۳-۴- نسبت معاملات خرید و فروش در ۶ سال اخیر

نسبت معاملات (درصد از کل حجم معاملات) خرید و فروش در چهار سال اخیر به شرح نمودار ذیل می‌باشد:



در جدول زیر ارزش معاملات صندوق به تفکیک در شش سال اخیر آورده شده است. (ارقام به میلیون ریال می‌باشد).

سال مالی	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۳	۷,۱۵۳,۳۱۴,۹۹۹,۵۹۹	۲,۴۸۴,۱۴۱,۳۶۸,۷۸۰	۹,۶۳۷,۳۵۶,۳۶۸,۳۷۹
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۴	۱۹,۴۴۱,۳۷۶,۷۷۹,۶۰۶	۱۶,۸۳۴,۴۳۲,۱۵۳,۲۶۸	۳۶,۲۷۵,۸۰۸,۹۳۲,۸۷۴
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۵	۱۱,۱۹۵,۰۲۶,۴۶۶,۷۴۳	۷,۹۴۰,۰۹۱,۳۳۹,۹۰۴	۱۹,۱۳۵,۱۱۷,۸۰۶,۶۴۷
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۶	۷,۷۷۹,۰۰۰,۸۷۱,۵۰۰	۶,۴۴۷,۳۴۴,۰۹۲,۱۵۸	۱۴,۲۲۶,۳۴۴,۹۶۳,۶۵۸
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۷	۱۵,۸۱۳,۷۶۴,۸۸۱,۹۶۶	۱۵,۲۶۸,۸۰۱,۲۵۸,۵۶۳	۳۱,۰۸۲,۵۶۶,۱۴۰,۵۲۹
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۸	۳۲,۱۸۸,۹۲۶,۷۵۹,۹۳۴	۳۹,۸۲۴,۳۸۴,۹۰۷,۰۰۴	۷۲,۰۱۳,۳۱۱,۶۶۶,۹۳۸

۳-۵- اوراق اختیار معامله

۳-۵-۱- درآمد فروش اوراق اختیار معامله

درآمد ناشی از فروش قراردادهای اختیار خرید سهام توسط صندوق به شرح جدول زیر است. قابل ذکر است فرآیند انتشار اوراق اختیار معامله مطابق با دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله سهام در بورس اوراق بهادار تهران و همچنین آیین نامه مصوب هیأت مدیره صندوق انجام می‌پذیرد.

شرح	تاریخ اعمال	نماد	قیمت اعمال	تعداد قرارداد	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	ارزش فروش (ریال)	مجموع ارزش فروش (ریال)
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه کچاد	۱۳۹۸/۰۷/۰۳	ضچاد۷۰۰۷	۴,۸۰۰	۳۵۰	۴۰۶	۱۴۲,۰۵۰,۰۰۰	۳,۵۳۶,۵۳۳,۰۰۰
		ضچاد۷۰۰۸	۵,۳۰۰	۵,۸۴۰	۲۱۴	۱,۲۴۸,۲۶۳,۰۰۰	
		ضچاد۷۰۰۹	۵,۸۰۰	۵,۲۵۰	۱۱۰	۵۷۸,۷۷۰,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۰/۰۴	ضچاد۷۰۰۷	۴,۸۰۰	۱۵۰	۷۷۳	۱۱۵,۹۵۰,۰۰۰	
		ضچاد۷۰۰۸	۵,۳۰۰	۱,۶۲۰	۴۶۳	۷۵۰,۸۵۰,۰۰۰	
		ضچاد۷۰۰۹	۵,۸۰۰	۲,۶۰۰	۲۶۹	۷۰۰,۶۵۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه تجارت	۱۳۹۸/۰۷/۰۷	ضجار۷۰۰۲	۵۰۰	۱۰,۳۶۰۸	۴۱	۴,۲۹۷,۲۹۵,۰۰۰	۱۳,۵۹۹,۳۸۶,۰۰۰
		ضجار۷۰۰۳	۶۰۰	۶۲,۳۸۴	۲۲	۱,۴۰۱,۹۸۹,۰۰۰	
		ضجار۷۰۰۴	۷۰۰	۳۹,۲۴۵	۱۵	۵۸۳,۰۶۶,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۰/۰۸	ضجار۷۰۰۲	۵۰۰	۵۶,۹۴۹	۷۱	۴,۰۵۹,۸۱۰,۰۰۰	
		ضجار۷۰۰۳	۶۰۰	۶۲,۸۸۵	۳۶	۲,۳۳۸,۱۱۰,۰۰۰	
		ضجار۷۰۰۴	۷۰۰	۴۹,۶۹۹	۲۱	۱,۰۱۹,۱۱۶,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه اخبر	۱۳۹۸/۰۷/۱۰	ضمخا۷۰۱۱	۲,۵۸۴	۲,۲۳۵	۱۴۴	۳۳۲,۰۲۰,۰۰۰	۳,۰۴۵,۴۱۸,۰۰۰
		ضمخا۷۰۱۲	۲,۷۸۴	۴,۴۸۰	۸۱	۳۶۴,۳۲۵,۰۰۰	
		ضمخا۷۰۱۳	۲,۹۸۴	۶,۶۲۰	۴۴	۲۹۰,۰۹۵,۰۰۰	

شرح	تاریخ اعمال	نماد	قیمت اعمال	تعداد قرارداد	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	ارزش فروش (ریال)	مجموع ارزش فروش (ریال)
	۱۳۹۸/۱۰/۱۱	ضمخا۷۰۱۴	۳,۱۸۴	۷,۶۶۲	۲۲	۱۶۴,۷۸۸,۰۰۰	
		ضمخا۱۰۱۳	۳,۸۰۰	۳,۱۵۰	۲۲۰	۶۹۲,۹۰۰,۰۰۰	
		ضمخا۱۰۱۴	۴,۰۰۰	۸,۳۵۹	۱۴۵	۱,۲۱۱,۲۹۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه خودرو	۱۳۹۸/۰۷/۱۴	ضخود۷۰۳۲	۷,۰۰۰	۷,۳۸۰	۱۲۸	۹۴۴,۸۰۰,۰۰۰	۴,۵۱۷,۵۰۰,۰۰۰
	۱۳۹۸/۱۰/۱۵	ضخود۱۰۳۰	۷,۰۰۰	۸,۵۹۹	۴۱۵	۳,۵۷۲,۷۰۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه رمپنا	۱۳۹۸/۰۷/۱۷	ضپنا۷۰۱۴	۷,۰۰۰	۳,۱۵۰	۳۲۶	۱,۰۲۶,۴۰۰,۰۰۰	۵,۳۳۰,۶۱۰,۰۰۰
		ضپنا۷۰۱۵	۷,۵۰۰	۴,۶۰۰	۱۶۸	۷۷۴,۵۸۰,۰۰۰	
		ضپنا۷۰۱۶	۸,۰۰۰	۹,۳۰۰	۱۰۳	۹۶۱,۷۳۰,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۰/۱۸	ضپنا۱۰۱۰	۸,۵۰۰	۲,۲۸۰	۵۲۹	۱,۲۰۶,۶۰۰,۰۰۰	
		ضپنا۱۰۱۱	۹,۰۰۰	۳,۱۰۰	۳۶۶	۱,۱۳۳,۹۰۰,۰۰۰	
		ضپنا۱۰۱۲	۹,۵۰۰	۹۸۰	۲۳۲	۲۲۷,۴۰۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه ومعدن	۱۳۹۸/۰۷/۱۷	ضمعا۷۰۰۶	۴,۶۰۰	۱,۰۲۱	۲۸۹	۲۹۴,۸۴۰,۰۰۰	۵,۰۳۶,۹۹۰,۰۰۰
		ضمعا۷۰۰۷	۴,۸۰۰	۱,۱۶۳	۲۳۸	۲۷۶,۵۴۰,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۰/۱۸	ضمعا۱۰۰۷	۴,۸۰۰	۷,۲۰۰	۴۳۲	۳,۱۰۸,۵۶۰,۰۰۰	
		ضمعا۱۰۰۸	۵,۰۰۰	۴,۱۹۰	۳۲۴	۱,۳۵۷,۰۵۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه شپنا	۱۳۹۸/۰۷/۲۱	ضشنا۷۰۴۰	۱۰,۲۰۰	۶۵۰	۱,۱۰۱	۷۱۵,۷۵۰,۰۰۰	۱۳,۳۵۴,۷۳۲,۰۰۰
		ضشنا۷۰۴۱	۱۱,۲۰۰	۶,۱۵۹	۶۰۴	۳,۷۱۹,۲۴۰,۰۰۰	
		ضشنا۷۰۴۲	۱۲,۲۰۰	۶,۸۶۴	۳۳۱	۲,۲۷۴,۷۰۵,۰۰۰	
		ضشنا۷۰۴۳	۱۳,۲۰۰	۱۱,۶۰۸	۱۴۳	۱,۶۵۸,۶۸۷,۰۰۰	

شرح	تاریخ اعمال	نماد	قیمت اعمال	تعداد قرارداد	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	ارزش فروش (ریال)	مجموع ارزش فروش (ریال)
	۱۳۹۸/۱۰/۲۲	ضشنا۷۰۴۴	۱۴,۲۰۰	۱۱,۴۳۴	۸۴	۹۵۷,۸۵۰,۰۰۰	
		ضشنا۱۰۲۸	۱۲,۲۰۰	۱,۸۰۰	۱,۱۵۳	۲,۰۷۶,۰۰۰,۰۰۰	
		ضشنا۱۰۲۹	۱۳,۲۰۰	۱,۳۱۰	۷۲۶	۹۵۰,۶۰۰,۰۰۰	
		ضشنا۱۰۳۰	۱۴,۲۰۰	۲,۱۶۰	۴۶۴	۱,۰۰۱,۹۰۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه پارسان	۱۳۹۸/۰۷/۲۴	ضسان۷۰۳۴	۴,۶۰۰	۸۰۵	۴۵۰	۳۶۲,۰۸۵,۰۰۰	۳,۳۹۴,۰۰۴,۰۰۰
		ضسان۷۰۳۵	۴,۸۰۰	۲,۶۲۰,۰۰۰	۳۴۷	۹۰۸,۵۵۰,۰۰۰	
		ضسان۷۰۳۶	۵,۰۰۰	۳,۷۴۵,۰۰۰	۲۶۰	۹۷۳,۰۰۰,۰۰۰	
		ضسان۷۰۳۷	۵,۵۰۰	۴,۹۲۵,۰۰۰	۱۱۹	۵۸۵,۸۰۰,۰۰۰	
		ضسان۷۰۳۸	۶,۰۰۰	۵,۱۰۱,۰۰۰	۵۹	۲۹۸,۷۸۹,۰۰۰	
		ضسان۷۰۳۹	۶,۵۰۰	۴,۹۹۰,۰۰۰	۳۴	۱۶۹,۰۱۰,۰۰۰	
		ضسان۷۰۴۰	۷,۰۰۰	۵,۲۱۶,۰۰۰	۱۹	۹۶,۷۷۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه تاپیکو	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	ضپیک۷۰۰۷	۳,۲۰۰	۷,۵۲۵,۰۰۰	۸۹	۶۷۱,۷۵۰,۰۰۰	۳,۴۴۷,۷۹۰,۰۰۰
		ضپیک۷۰۰۸	۳,۴۰۰	۷,۸۷۵,۰۰۰	۶۲	۴۸۹,۳۰۰,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ضپیک۱۰۰۷	۳,۲۰۰	۵,۷۲۱,۰۰۰	۲۶۵	۱,۵۱۶,۴۶۰,۰۰۰	
		ضپیک۱۰۰۸	۳,۴۰۰	۴,۱۰۱,۰۰۰	۱۸۸	۷۷۰,۲۸۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فخوز	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	ضخوز۷۰۰۶	۹,۰۰۰	۴۵۰,۰۰۰	۹۵۱	۴۲۷,۸۵۰,۰۰۰	۳,۰۷۳,۹۲۴,۰۰۰
		ضخوز۷۰۰۷	۱۰,۰۰۰	۲,۵۰۱,۰۰۰	۴۷۱	۱,۱۷۸,۵۱۰,۰۰۰	
		ضخوز۷۰۰۸	۱۱,۰۰۰	۳,۶۹۷,۰۰۰	۱۸۱	۶۶۷,۹۰۴,۰۰۰	
		ضخوز۷۰۰۹	۱۲,۰۰۰	۸,۳۴۵,۰۰۰	۸۰	۶۷۱,۰۹۰,۰۰۰	

شرح	تاریخ اعمال	نماد	قیمت اعمال	تعداد قرارداد	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	ارزش فروش (ریال)	مجموع ارزش فروش (ریال)
	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ضخوز۷۱۰۰	۱۰,۰۰۰	۲۲۰,۰۰۰	۵۸۴	۱۲۸,۵۷۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فارس	۱۳۹۸/۰۸/۰۱	ضفار۸۰۰۶	۵,۰۰۰	۳,۰۰۰	۶۹۹	۲,۰۹۷,۰۰۰	۸,۶۸۳,۴۵۵,۰۰۰
		ضفار۸۰۰۷	۵,۵۰۰	۱,۰۵۰,۰۰۰	۴۰۹	۴۲۹,۲۵۰,۰۰۰	
		ضفار۸۰۰۸	۶,۰۰۰	۴,۴۳۴,۰۰۰	۲۷۱	۱,۲۰۰,۹۴۸,۰۰۰	
		ضفار۸۰۰۹	۶,۵۰۰	۴,۰۵۰,۰۰۰	۱۲۱	۴۸۸,۶۰۰,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۱/۰۶	ضفار۱۱۰۸	۶,۰۰۰	۲,۶۰۱,۰۰۰	۱,۰۹۸	۲,۸۵۵,۹۶۰,۰۰۰	
		ضفار۱۱۰۹	۶,۵۰۰	۲,۳۸۵,۰۰۰	۷۷۰	۱,۸۳۶,۴۰۰,۰۰۰	
		ضفار۱۱۱۰	۷,۰۰۰	۲,۴۰۰,۰۰۰	۵۹۶	۱,۴۲۹,۲۰۰,۰۰۰	
		ضفار۱۱۱۱	۷,۵۰۰	۱,۱۰۰,۰۰۰	۴۰۱	۴۴۱,۰۰۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه شتران	۱۳۹۸/۰۸/۱۲	ضترا۸۰۰۵	۷,۲۰۰	۵۰,۰۰۰	۹۳۹	۴۶,۹۵۰,۰۰۰	۶,۸۴۶,۹۲۹,۰۰۰
		ضترا۸۰۰۶	۷,۷۰۰	۱۵۰,۰۰۰	۵۸۸	۸۸,۲۰۰,۰۰۰	
		ضترا۸۰۰۷	۸,۲۰۰	۲,۰۲۵,۰۰۰	۴۳۷	۸۸۴,۵۵۰,۰۰۰	
		ضترا۸۰۰۸	۸,۷۰۰	۳,۶۶۵,۰۰۰	۳۲۶	۱,۱۹۵,۶۳۰,۰۰۰	
		ضترا۸۰۰۹	۹,۲۰۰	۱۰,۷۹۷,۰۰۰	۱۷۲	۱,۸۵۷,۲۹۹,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۱/۰۸	ضترا۱۱۰۸	۸,۷۰۰	۱,۵۶۰,۰۰۰	۹۱۳	۱,۴۲۳,۸۵۰,۰۰۰	
		ضترا۱۱۰۹	۹,۲۰۰	۱,۹۵۰,۰۰۰	۶۹۳	۱,۳۵۰,۴۵۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه خپارس	۱۳۹۸/۰۸/۱۴	ضپار۸۰۰۶	۱,۴۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۱۰	۱,۱۰۰,۰۰۰	۴,۲۲۸,۹۸۰,۰۰۰
		ضپار۸۰۰۷	۱,۵۰۰	۲۰,۰۰۰	۶۰	۱,۲۰۰,۰۰۰	
		ضپار۸۰۰۸	۱,۶۰۰	۱۰,۰۰۰	۵۲	۵۲۰,۰۰۰	

شرح	تاریخ اعمال	نماد	قیمت اعمال	تعداد قرارداد	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	ارزش فروش (ریال)	مجموع ارزش فروش (ریال)
	۱۳۹۸/۱۱/۱۳	ضپار۱۱۰۷	۱،۵۰۰	۱۳،۸۰۰،۰۰۰	۱۹۴	۲،۶۷۹،۰۰۰،۰۰۰	
		ضپار۱۱۰۸	۱،۶۰۰	۵،۷۷۰،۰۰۰	۱۵۳	۸۸۲،۶۰۰،۰۰۰	
		ضپار۱۱۰۹	۱،۷۰۰	۵،۱۹۱،۰۰۰	۱۲۸	۶۶۴،۵۶۰،۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فملی	۱۳۹۸/۰۸/۱۹	ضملی۸۰۴۱	۴،۰۵۰	۵۵۰،۰۰۰	۵۶۶	۳۱۱،۳۵۰،۰۰۰	۱۰،۶۷۸،۷۶۹،۰۰۰
		ضملی۸۰۴۲	۴،۲۵۰	۴،۴۲۱،۰۰۰	۳۸۸	۱،۷۱۴،۸۰۷،۰۰۰	
		ضملی۸۰۴۳	۴،۴۵۰	۹،۳۲۸،۰۰۰	۳۱۱	۲،۹۰۳،۷۳۷،۰۰۰	
		ضملی۸۰۴۴	۴،۶۵۰	۱۲،۱۹۱،۰۰۰	۲۳۶	۲،۸۷۶،۱۶۸،۰۰۰	
		ضملی۸۰۴۵	۴،۸۵۰	۱۶،۵۸۷،۰۰۰	۱۷۳	۲،۸۷۲،۷۰۷،۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه وغدیر	۱۳۹۸/۰۸/۲۲	ضغدر۸۰۰۶	۲،۸۰۰	۱،۷۰۰،۰۰۰	۲۱۱	۳۵۸،۲۰۰،۰۰۰	۵،۴۲۳،۵۴۰،۰۰۰
		ضغدر۸۰۰۷	۳،۰۰۰	۲،۰۵۰،۰۰۰	۱۷۶	۳۶۰،۰۵۰،۰۰۰	
		ضغدر۸۰۰۸	۳،۲۰۰	۹۱۱،۰۰۰	۸۹	۸۰،۹۱۰،۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۱/۲۰	ضغدر۱۱۰۶	۲،۸۰۰	۵۰،۰۰۰	۱۹۲	۹۶۱۰،۰۰۰	
		ضغدر۱۱۰۷	۳،۰۰۰	۱۵،۲۰۰،۰۰۰	۱۶۸	۲،۵۵۸،۹۴۰،۰۰۰	
		ضغدر۱۱۰۸	۳،۲۰۰	۱۸،۲۷۱،۰۰۰	۱۰۸	۱،۹۶۵،۹۸۰،۰۰۰	
		ضغدر۱۱۰۹	۳،۴۰۰	۱،۰۷۰،۰۰۰	۸۴	۸۹،۸۵۰،۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه کگل	۱۳۹۸/۰۸/۲۲	ضگل۸۰۴۳	۶،۴۲۰	۶۰۱،۰۰۰	۷۹۴	۴۷۷،۲۵۰،۰۰۰	۳،۶۹۹،۰۷۱،۰۰۰
		ضگل۸۰۴۴	۶،۹۲۰	۱،۲۰۰،۰۰۰	۵۶۸	۶۸۱،۸۵۰،۰۰۰	
		ضگل۸۰۴۵	۷،۴۲۰	۲،۷۵۰،۰۰۰	۴۲۰	۱،۱۵۵،۰۰۰،۰۰۰	
		ضگل۸۰۴۶	۷،۹۲۰	۳،۰۲۶،۰۰۰	۲۴۱	۷۳۹،۳۶۱،۰۰۰	

شرح	تاریخ اعمال	نماد	قیمت اعمال	تعداد قرارداد	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	ارزش فروش (ریال)	مجموع ارزش فروش (ریال)
		ضگل ۸۰۴۷	۸,۴۲۰	۳,۵۸۳,۰۰۰	۱۸۳	۶۵۵,۶۱۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فولاد	۱۳۹۸/۰۸/۲۶	ضفلا ۸۰۴۵	۳,۹۰۰	۲۵۰,۰۰۰	۸۲۹	۲۰۷,۳۰۰,۰۰۰	۲۶,۸۱۴,۶۱۱,۰۰۰
		ضفلا ۸۰۴۶	۴,۱۰۰	۳,۰۵۰,۰۰۰	۶۶۴	۲,۰۲۵,۹۰۰,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۴۷	۴,۳۰۰	۴,۸۱۸,۰۰۰	۵۵۸	۲,۶۸۶,۳۶۸,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۴۸	۴,۵۰۰	۳,۹۱۵,۰۰۰	۴۳۳	۱,۶۹۶,۳۰۰,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۴۹	۴,۷۰۰	۳,۶۳۰,۰۰۰	۳۲۳	۱,۱۷۲,۹۷۵,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۵۰	۵,۲۰۰	۶,۳۱۰,۰۰۰	۱۹۶	۱,۲۳۵,۳۵۰,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۵۱	۵,۷۰۰	۱۰,۳۱۰,۰۰۰	۱۳۸	۱,۴۲۱,۸۱۸,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۵۲	۶,۲۰۰	۹,۳۸۰,۰۰۰	۷۰	۶۵۹,۹۴۵,۰۰۰	
		ضفلا ۸۰۵۳	۶,۷۰۰	۴,۸۳۰,۰۰۰	۵۴	۲۶۲,۵۵۵,۰۰۰	
	۱۳۹۸/۱۱/۲۷	ضفلا ۱۱۴۴	۵,۲۰۰	۱,۵۰۰,۰۰۰	۴۹۵	۷۴۳,۰۰۰,۰۰۰	
		ضفلا ۱۱۴۵	۵,۷۰۰	۲۶,۳۵۰,۰۰۰	۳۲۱	۸,۴۶۲,۸۰۰,۰۰۰	
		ضفلا ۱۱۴۶	۶,۲۰۰	۲۸,۵۶۰,۰۰۰	۲۱۸	۶,۲۴۰,۳۰۰,۰۰۰	
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه وبملت	۱۳۹۸/۰۸/۲۹	ضملت ۸۰۰۴	۳,۲۰۰	۲,۲۵۰,۰۰۰	۶۳۲	۱,۴۲۱,۴۰۰,۰۰۰	
		ضملت ۸۰۰۵	۳,۴۰۰	۱,۳۰۰,۰۰۰	۵۲۰	۶۷۶,۳۵۰,۰۰۰	
		ضملت ۸۰۰۶	۳,۶۰۰	۴,۶۲۰,۰۰۰	۴۸۰	۲,۲۱۷,۷۰۰,۰۰۰	
		ضملت ۸۰۰۷	۳,۸۰۰	۱۰,۲۲۲,۰۰۰	۳۹۹	۴,۰۸۰,۲۲۵,۰۰۰	
		ضملت ۸۰۰۸	۴,۰۰۰	۸,۷۲۶,۰۰۰	۳۲۴	۲,۸۲۸,۵۹۵,۰۰۰	
		ضملت ۸۰۰۹	۴,۲۰۰	۱۷,۱۶۳,۰۰۰	۳۲۸	۵,۶۲۷,۹۸۰,۰۰۰	
مجموع							۱۴۱,۵۶۴,۴۹۲,۰۰۰

۳-۵-۲- درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله

درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله و همچنین درآمد ناشی از فروش اوراق اختیار معامله پیش از تاریخ اعمال به شرح جدول ذیل می‌باشد. لازم به ذکر است جدول زیر نمایانگر اوراق اختیار معامله منتشره از تاریخ ۱۳۹۷/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ شامل اختیار خرید و فروش سهام می‌باشد، که تاکنون به تاریخ سررسید نرسیده است:

اختیار خرید سهام

نماد پایه	تاریخ سررسید	تعداد قرارداد	درآمد فروش قرارداد اختیار	تعداد قرارداد اعمال شده	درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال	*تعداد قرارداد اعمال نشده
خودرو	۱۳۹۷/۰۷/۱۸	۱۱,۳۹۵	۴۸۵,۵۱۱,۲۸۰	۲,۴۰۲	۵,۷۵۰,۳۸۸,۰۰۰	۸,۹۹۳
	۱۳۹۷/۱۰/۱۹	۱۶,۳۹۶	۲,۳۴۳,۰۳۶,۶۶۶	۷,۳۸۴	۲۰,۵۴۸,۰۰۰,۰۰۰	۹,۰۱۲
	۱۳۹۸/۰۳/۱۹	۲۹,۴۷۴	۳,۵۷۱,۹۱۳,۰۰۰	۲۹,۲۸۹	۹۱,۸۸۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۸۵
شپنا	۱۳۹۷/۰۷/۲۲	۲,۲۹۵	۹۲۷,۷۰۰,۰۴۷	۲,۲۱۵	۱۰,۴۷۵,۵۰۰,۰۰۰	۸۰
	۱۳۹۷/۱۰/۲۳	۳,۵۶۷	۹۲۸,۳۲۱,۱۵۱	۹۰۰	۶,۵۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۶۶۷
	۱۳۹۸/۰۳/۲۲	۲۷,۲۰۳	۳,۵۸۰,۰۱۸,۰۰۰	۲۶,۲۲۲	۱۲۴,۲۸۳,۵۰۰,۰۰۰	۹۸۱
پارسان	۱۳۹۷/۰۷/۲۵	۲۹,۹۸۵	۳,۲۶۶,۷۴۵,۸۰۲	۶,۴۶۲	۱۷,۵۲۲,۶۰۰,۰۰۰	۲۳,۵۲۳
	۱۳۹۷/۱۰/۲۶	۱,۵۳۶	۲۸۰,۷۲۲,۹۴۴	۰	۰	۱,۵۳۶
	۱۳۹۸/۰۳/۲۶	۲۲,۹۷۶	۲,۲۵۹,۵۳۱,۰۰۰	۲۲,۴۷۵	۷۴,۵۹۴,۴۰۰,۰۰۰	۵۰۱
شبندر	۱۳۹۷/۰۸/۲۰	۷,۱۹۷	۸۱۳,۸۷۱,۴۳۶	۲,۶۶۷	۲۸,۷۲۴,۹۵۰,۰۰۰	۴,۵۳۰
	۱۳۹۷/۱۱/۱۴	۱,۸۷۱	۱,۰۰۲,۴۰۰,۳۳۵	۲۹۵	۲,۹۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۵۷۶
	۱۳۹۸/۰۲/۱۸	۲۹,۹۸۰	۳,۹۳۲,۱۴۷,۱۹۲	۲۷,۹۲۷	۳۷۲,۳۲۰,۵۰۰,۰۰۰	۲,۰۵۳
فملی	۱۳۹۷/۰۸/۲۳	۵,۰۷۲	۱,۱۴۳,۶۳۶,۹۱۶	۲,۹۵۱	۹,۸۵۳,۵۵۰,۰۰۰	۲,۱۲۱
	۱۳۹۷/۱۱/۱۷	۱۰,۲۰۲	۱,۳۲۷,۴۵۹,۵۱۸	۰	۰	۱۰,۲۰۲
	۱۳۹۸/۰۲/۲۵	۳۸,۷۳۸	۵,۴۶۲,۹۷۰,۰۰۰	۲۷,۶۷۷	۹۶,۷۱۳,۲۰۰,۰۰۰	۱۱,۰۶۱
کگل	۱۳۹۷/۰۸/۲۷	۱,۲۵۸	۱,۴۵۳,۷۴۲,۰۷۵	۱,۲۵۸	۴,۵۸۹,۹۰۰,۰۰۰	۰
	۱۳۹۷/۱۱/۲۸	۵۱۰	۲۸۶,۳۵۵,۶۶۵	۰	۰	۵۱۰
	۱۳۹۸/۰۲/۲۹	۲۷,۰۳۲	۴,۶۹۸,۹۵۴,۰۰۰	۲۳,۴۸۷	۱۰۷,۹۴۷,۷۶۷,۸۱۶	۳,۵۴۵

نماد پایه	تاریخ سررسید	تعداد قرارداد	درآمد فروش قرارداد اختیار	تعداد قرارداد اعمال شده	درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال	*تعداد قرارداد اعمال نشده
فولاد	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	۲۱,۶۹۸	۱۱,۷۱۴,۳۳۱,۰۵۱	۲۱,۴۲۸	۵۸,۰۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۲۷۰
	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۱,۴۲۸	۴۴۸,۹۳۲,۴۱۷	۱۰۰	۴۹۹,۹۷۰,۵۰۰	۱,۳۲۸
	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	۳۰,۷۷۰	۵,۲۳۰,۷۵۷,۳۸۲	۳۰,۷۳۰	۱۶۲,۶۲۱,۷۱۸,۴۶۵	۴۰
اخابر	۱۳۹۸/۰۳/۲۹	۱۹,۱۷۷	۸۸۶,۹۹۶,۰۰۰	۱۷,۰۷۴	۴۳,۰۱۷,۴۱۶,۰۰۰	۲,۱۰۳
فخوز	۱۳۹۸/۰۲/۱۶	۱۰,۹۰۰	۱,۱۳۹,۵۳۰,۰۰۰	۸,۹۷۱	۵۲,۱۵۱,۰۰۰,۰۰۰	۱,۹۲۹
وبملت	۱۳۹۸/۰۲/۲۲	۵۷,۶۴۹	۶,۸۴۴,۹۳۷,۲۶۸	۵۶,۸۷۲	۱۱۶,۸۹۳,۲۰۰,۰۰۰	۷۷۷
رمپنا	۱۳۹۸/۰۳/۱۲	۲۸,۱۸۹	۳,۹۳۵,۵۹۰,۰۰۰	۲۸,۰۲۳	۱۸۴,۶۱۵,۰۲۵,۸۵۰	۱۶۶
مجموع		۴۳۶,۴۹۹	۶۷,۹۶۶,۱۱۱,۱۴۵	۳۴۶,۸۰۹	۱,۵۹۲,۵۲۱,۵۸۶,۶۳۱	۸۹,۶۹۰

اختیار فروش سهام

نماد پایه	تاریخ سررسید	تعداد قرارداد	درآمد فروش قرارداد اختیار	تعداد قرارداد اعمال شده	درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال	*تعداد قرارداد اعمال نشده
فملی	۱۳۹۷/۰۸/۲۳	۱۰۰	۱,۳۹۸,۸۸۰	۰	۰	۱۰۰
کگل	۱۳۹۷/۰۸/۲۷	۱۰۰	۲,۰۹۸,۳۲۰	۰	۰	۱۰۰
فولاد	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	۱۰۰	۱,۰۹۹,۱۲۰	۰	۰	۱۰۰
رمپنا	۱۳۹۸/۰۳/۱۲	۳۰۰	۶۰,۶۰۰,۰۰۰	۰	۰	۳۰۰
خودرو	۱۳۹۸/۰۳/۱۹	۴۰۰	۳۲,۸۰۰,۰۰۰	۰	۰	۴۰۰
مجموع		۱,۰۰۰	۹۷,۹۹۶,۳۲۰	۰	۰	۱,۰۰۰

*بدیهی است وجه دریافتی ناشی از فروش قراردادهای اعمال نشده، به عنوان درآمد صندوق تلقی می‌گردد.

۳-۶- فرآیند دریافت سود سهام

فرآیند وصول مطالبات صندوق ناشی از سود سهام از ابتدای دوره مدیریت هیأت مدیره صندوق، به شرح جدول ذیل می‌باشد:

منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱		منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۳۱		منتهی به ۱۳۹۶/۰۴/۳۱		شرح
میزان وصول مطالبات (درصد)	مبلغ (ریال)	میزان وصول مطالبات (درصد)	مبلغ (ریال)	میزان وصول مطالبات (درصد)	مبلغ (ریال)	
۹۷٪	۶۲۱،۷۱۵،۸۲۸،۰۲۲	۹۹٪	۵۴۱،۹۱۰،۳۶۰،۳۸۷	۶۷٪	۴۶۸،۹۴۰،۴۲۳،۸۶۵*	مطالبات سود از ادوار گذشته
	۶۰۰،۳۴۳،۷۴۸،۴۵۱		۵۳۳،۹۰۶،۳۰۳،۵۴۷		۳۱۳،۵۴۲،۹۴۹،۱۹۱	مبلغ دریافت شده از مطالبات ادوار گذشته
۲۴٪**	۱،۱۶۷،۲۲۰،۷۶۱،۶۳۳	۳۵٪**	۹۴۱،۲۳۹،۴۸۴،۱۳۵	۹٪**	۴۲۵،۵۸۲،۳۶۱،۴۶۸*	سود سهام تعلق گرفته
	۲۷۶،۳۱۲،۷۵۳،۳۲۳		۳۲۷،۵۲۷،۷۱۲،۹۵۳		۳۹۰،۰۶۹،۴۷۵،۷۵۵	مبلغ دریافت شده از مطالبات دوره جدید

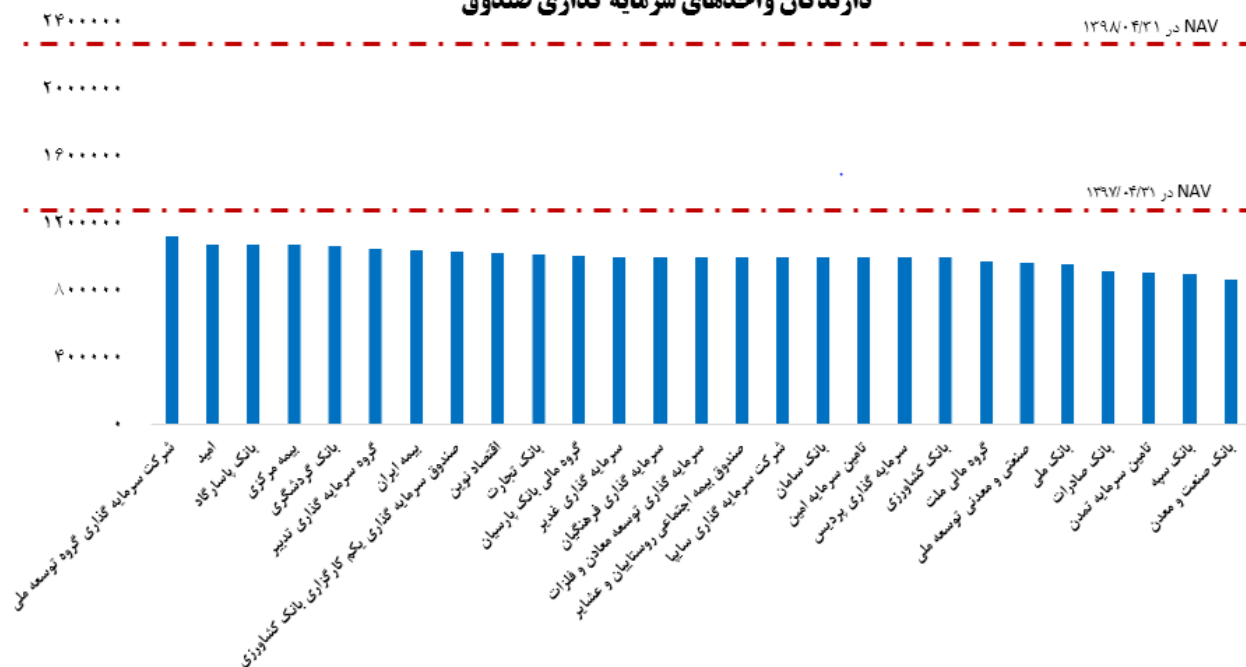
* مطالبات سود در این دوره مربوط به زمان تحویل صندوق به هیأت مدیره فعلی مورخ ۱۳۹۵/۱۰/۰۱ بوده که پس از پیگیری‌های انجام شده به مرحله وصول رسیده است.

** پایین بودن مبلغ دریافت شده از مطالبات تعلق گرفته مربوط به همان دوره ناشی از عدم اتمام مهلت ۸ ماهه دریافت سود و وقفه زمانی تقسیم سود سهام سهامداران با حجم بالای سهم، در مجامع برگزار شده تا ۳۱ تیر ماه هر سال می‌باشد.

۴- قیمت میانگین واحدهای سرمایه‌گذاری برای دارندگان

میانگین صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال) و NAV

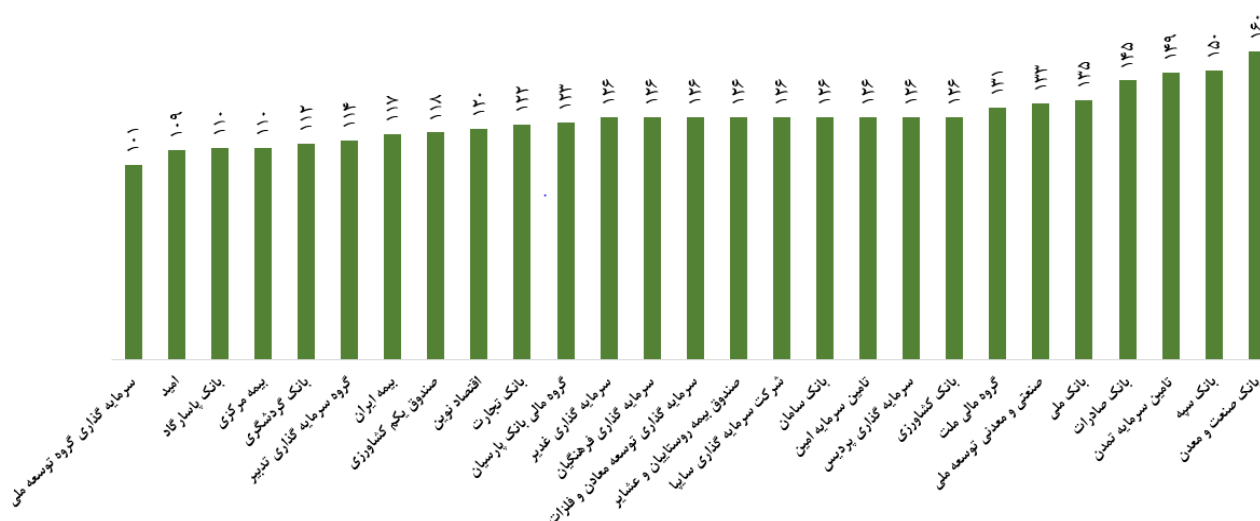
دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق



همانگونه که در نمودار فوق مشاهده می‌گردد، NAV صندوق از ۱,۲۴۵,۸۲۹ به ۲,۲۵۶,۸۰۹ افزایش پیدا کرده و کلیه سرمایه‌گذاران با توجه به میانگین صدور واحدهای سرمایه‌گذاری خود در سود می‌باشند.

بازده دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری نسبت به میانگین صدور واحدهای سرمایه‌گذاری متعلق به ایشان به شرح نمودار ذیل می‌باشد:

بازده دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری (درصد)



میانگین نرخ صدور برای دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می‌باشد:

ردیف	عنوان	میانگین صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)	ردیف	عنوان	میانگین صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)
۱	سرمایه‌گذاری گروه توسعه ملی	۱,۱۲۲,۹۰۹	۱۵	صندوق بیمه روستاییان و عشایر	۱,۰۰۰,۰۰۰
۲	امید	۱,۰۷۹,۳۲۴	۱۶	شرکت سرمایه‌گذاری سایپا	۱,۰۰۰,۰۰۰
۳	بانک پاسارگاد	۱,۰۷۶,۴۹۷	۱۷	بانک سامان	۱,۰۰۰,۰۰۰
۴	بیمه مرکزی	۱,۰۷۴,۱۶۸	۱۸	تامین سرمایه‌امین	۱,۰۰۰,۰۰۰
۵	بانک گردشگری	۱,۰۶۳,۸۹۲	۱۹	سرمایه‌گذاری پردیس	۱,۰۰۰,۰۰۰
۶	گروه سرمایه‌گذاری تدبیر	۱,۰۵۳,۷۹۷	۲۰	بانک کشاورزی	۱,۰۰۰,۰۰۰
۷	بیمه ایران	۱,۰۳۸,۸۹۹	۲۱	گروه مالی ملت	۹۷۶,۷۳۰
۸	صندوق یکم کشاورزی	۱,۰۳۵,۲۶۷	۲۲	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۹۶۷,۵۳۲
۹	اقتصاد نوین	۱,۰۲۳,۶۸۱	۲۳	بانک ملی	۹۶۱,۲۶۷
۱۰	بانک تجارت	۱,۰۱۸,۷۲۹	۲۴	بانک صادرات	۹۱۹,۴۳۶
۱۱	گروه مالی بانک پارسیان	۱,۰۱۰,۲۹۰	۲۵	تامین سرمایه‌تمدن	۹۰۵,۱۷۲
۱۲	سرمایه‌گذاری غدیر	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲۶	بانک سپه	۹۰۲,۱۵۰
۱۳	سرمایه‌گذاری فرهنگیان	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲۷	بانک صنعت و معدن	۸۶۷,۰۴۲
۱۴	سرمایه‌گذاری توسعه معادن و فلزات	۱,۰۰۰,۰۰۰			

۵- خلاصه‌ای از عملکرد صندوق در ۶ سال اخیر

خلاصه‌ی وضعیت عملکرد صندوق در بازار سرمایه از سال مالی منتهی به ۱۳۹۳/۰۴/۳۱ لغایت ۱۳۹۸/۰۴/۳۱، به شرح ذیل می‌باشد:

عنوان	منتهی به تیر ۱۳۹۳	منتهی به تیر ۱۳۹۴	منتهی به تیر ۱۳۹۵	منتهی به تیر ۱۳۹۶	منتهی به تیر ۱۳۹۷	منتهی به تیر ۱۳۹۸
تعداد روزهای معاملاتی	۲۴۳	۲۴۱	۲۴۵	۲۳۹	۲۳۹	۲۴۵
تعداد روزهای فعالیت صندوق	۲۰۲	۲۲۷	۲۲۵	۲۰۲	۲۳۹	۲۴۵
نسبت فعالیت صندوق از روزهای کاری	۸۲٪	۹۴٪	۹۲٪	۸۵٪	۱۰۰٪	۱۰۰٪
تعداد نمادهایی که صندوق در آن‌ها فعال بوده	۹۲	۱۴۰	۱۳۷	۱۶۳	۲۵۴	۱۹۴
نسبت معاملات خرید	۷۴٪	۵۴٪	۵۹٪	۵۵٪	۵۱٪	۴۵٪
نسبت معاملات فروش	۲۶٪	۴۶٪	۴۱٪	۴۵٪	۴۹٪	۵۵٪
ارزش کل معاملات	۹ هزار میلیارد ریال	۳۶ هزار میلیارد ریال	۱۹ هزار میلیارد ریال	۱۴ هزار میلیارد ریال	۳۱ هزار میلیارد ریال	۷۲ هزار میلیارد ریال
تعداد کارگزاری‌های همراه	۲۱	۳۳	۱۹	۲۲	۳۲	۲۳
ناو آماری صندوق در آخرین روز سال مالی (ریال)	۱,۰۵۹,۱۵۶	۹۱۹,۲۸۹	۹۳۵,۷۶۴	۹۵۴,۵۷۳	۱,۲۴۵,۸۲۹	۲,۲۵۶,۸۰۹

محمد ابراهیم آقابابائی

بانک ملی

عضو هیأت مدیره

حبیب رضا حدادی سیاهکلی

بانک سپه

عضو هیأت مدیره

محمد حسین صدرائی

بانک تجارت

رئیس هیأت مدیره