



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه

منتھی به ۳۱ تیر ماه ۱۳۹۸

فهرست مطالب

عنوان صفحه

۳.....	<u>۱- مقدمه</u>
۳.....	<u>۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه</u>
۴.....	<u>۱-۲- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری</u>
۵.....	<u>۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق</u>
۶.....	<u>۳- بررسی عملکرد صندوق</u>
۶.....	<u>۴- بازده صندوق</u>
۹.....	<u>۵- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری</u>
۱۰.....	<u>۶- معافیت‌های دریافت شده توسط هیأت مدیره صندوق</u>
۱۱.....	<u>۷-۱- سهم دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری از مجموع معافیت‌های دریافتی</u>
۱۲.....	<u>۷-۲- تأثیر معافیت‌های دریافت شده بر nav صندوق</u>
۱۳.....	<u>۷-۳- نسبت معاملات خرید و فروش در ۶ سال اخیر</u>
۱۴.....	<u>۸-۱- اوراق اختیار معامله</u>
۱۴.....	<u>۸-۲- درآمد فروش اوراق اختیار معامله</u>
۲۰.....	<u>۸-۳- درآمد حاصل از فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله</u>
۲۲.....	<u>۹-۱- فرآیند دریافت سود</u>
۲۳.....	<u>۹-۲- قیمت میانگین واحدهای سرمایه‌گذاری برای دارندگان</u>
۲۵.....	<u>۹-۳- خلاصه‌ای از عملکرد صندوق در ۶ سال اخیر</u>

۱ – مقدمه

صندوق توسعه بازار سرمایه در تاریخ ۱۳۹۱/۱۱/۲۱ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار به عنوان 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 به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل سهام شرکت‌های پذیرفته شده 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
کلاسه 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 رهیان

۱-مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری

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 سرمایه‌گذاری صندوق به شرح جدول ذیل می‌باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه‌گذاری 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 سرمایه‌گذاری 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	سرمایه‌گذاری غدیر	۵۰,۰۰۰	۰.۴۰%
۱۷	سرمایه‌گذاری فرهنگیان	۵۰,۰۰۰	۰.۴۰%
۱۸	سرمایه‌گذاری گروه توسعه ملی	۴۴,۴۶۹	۰.۳۵%
۱۹	صندوق بیمه اجتماعی روستائیان و عشایر	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۰	سرمایه‌گذاری توسعه معدن و فلزات	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۱	بانک سامان	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۲	گروه سرمایه‌گذاری سایپا	۳۵,۰۰۰	۰.۲۸%
۲۳	صنعتی و معدنی توسعه ملی	۳۴,۴۱۰	۰.۲۷%
۲۴	گروه سرمایه‌گذاری تدبیر	۳۰,۰۰۰	۰.۲۴%
۲۵	بانک کشاورزی	۱۵,۰۰۰	۰.۱۲%
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰,۰۰۰	۰.۰۸٪
۲۷	شرکت سرمایه‌گذاری پردیس	۵,۰۰۰	۰.۰۴٪
جمع			۱۰۰٪
۱۲,۶۲۷,۵۸۹			

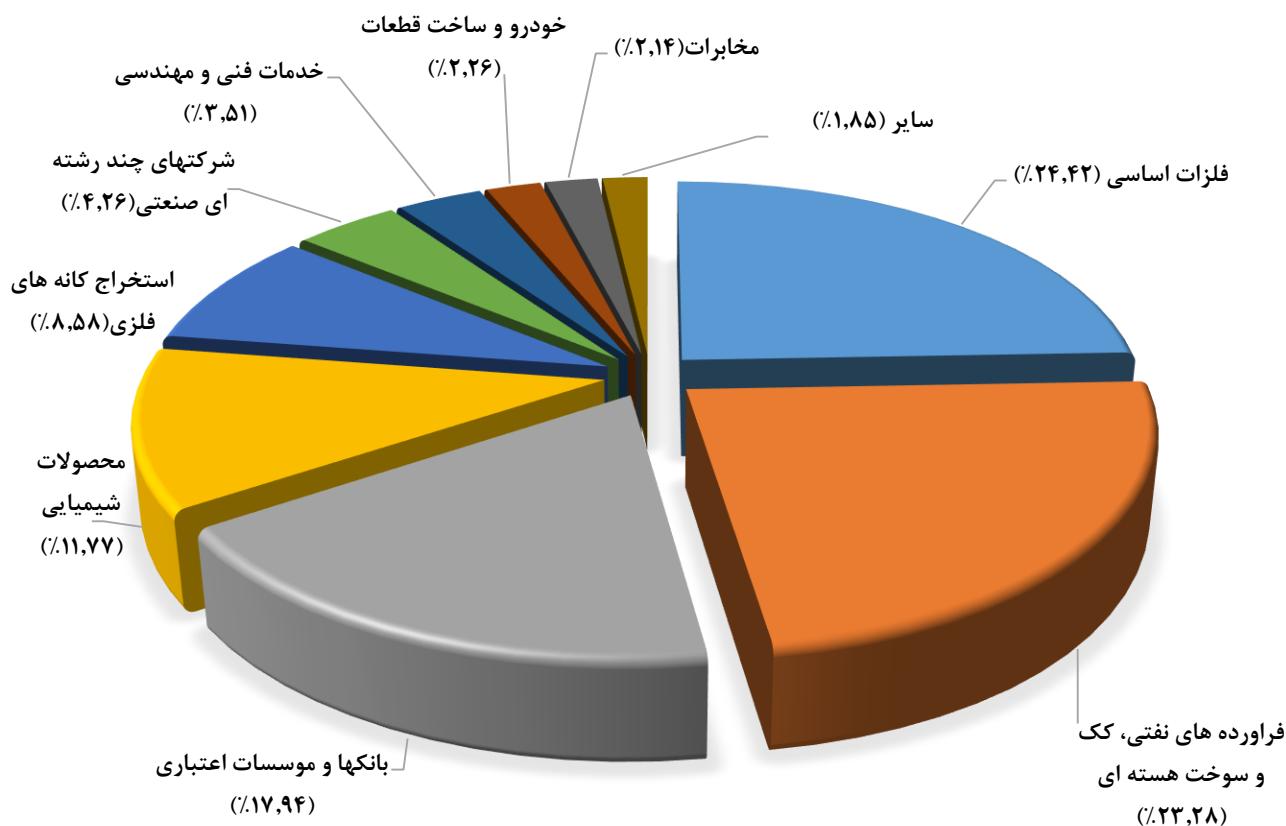
۲-۲- ترکیب پوتفوی صندوق در تاریخ ۳۱/۰۴/۹۸

سهم 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 می پردازد از ۱۹ صنعت، در تاریخ ۹۸/۰۴/۳۱ به ۱۸ صنعت تغییر یافته است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۳۱/۰۴/۹۸
فلزات اساسی	۲۴.۴۲%
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲۳.۲۸%
بانکها و موسسات اعتباری	۱۷.۹۴%
محصولات شیمیابی	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، اینبارداری 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)



۱-۳- بازده صندوق

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

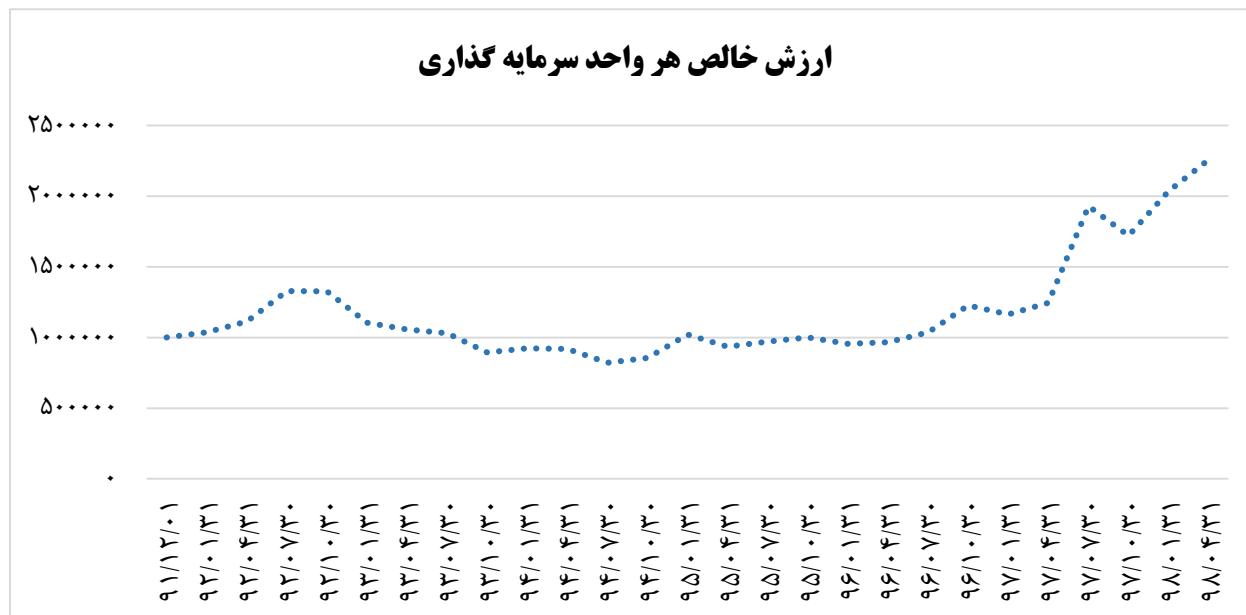
توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۸/۰۴/۲۴	%۰,۰۶۶۲	%(-۰,۰۹۷)
ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۴/۰۱	%۴,۸۷۶	%۸,۱۹۷
۳ ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۲/۰۱	%۱۱,۷۷۷	%۲۴,۷۴۶
۶ ماه گذشته	۱۳۹۷/۱۱/۰۱	%۳۲,۷۷۶	%۵۵,۳۰۶
یک سال گذشته	۱۳۹۷/۰۴/۳۱	%۸۱,۱۴۹	%۱۳۲,۵۲۳

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

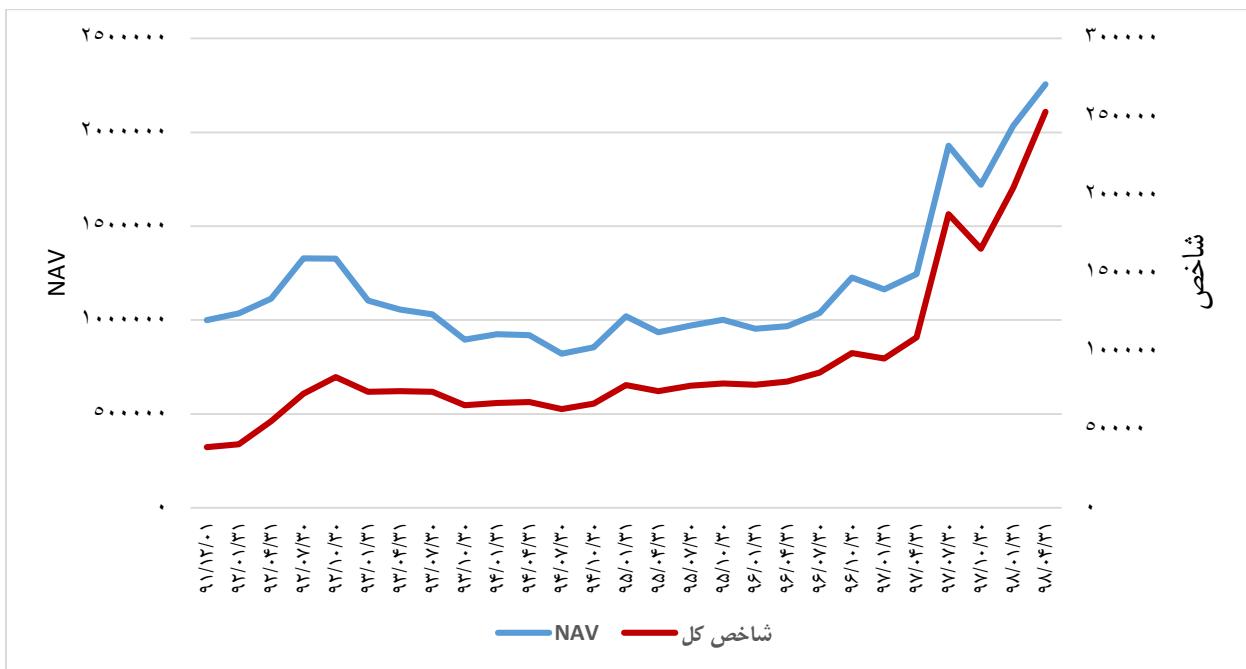
بازدهی	دوره
۱۹,۸۴۸%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱
۱۳,۴۶۲%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۳۱
۱۳,۶۰۱%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰
-۷,۴۷۱%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰
-۱۱,۱۹۶%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰
۸,۵۳۲%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۰/۳۰
-۴,۲۰۳%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰
۱۲,۳۳۲%	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۲/۲۹
۱۰,۳۰۲%	ماهانه 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 تعییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

به شرح نمودار ذیل می‌باشد:



روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل



۲-۳- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

کارگزار	حجم خرید	حجم معاملات	رتبه در معاملات خرید	حجم فروش	حجم معاملات	رتبه در معاملات فروش	حجم کل معاملات	رتبه در کل معاملات	درصد در کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۲۴,۲۹۰,۳۰۳,۹۱۸,۱۲۰	۲۴,۲۹۰,۳۰۳,۹۱۸,۱۲۰	۱	۲۹,۸۵۷,۰۳۷,۶۴۸,۲۱۴	۲۹,۸۵۷,۰۳۷,۶۴۸,۲۱۴	۱	۵۴,۱۴۷,۸۴۱,۵۶۶,۳۳۴	۱	۷۵.۱۹%
بانک تجارت	۲۰,۵۸,۸۳۵,۷۲۲,۱۱۴	۲۰,۵۸,۸۳۵,۷۲۲,۱۱۴	۳	۱۶۵۴,۵۷۰,۹۹۲,۸۴۶	۱۶۵۴,۵۷۰,۹۹۲,۸۴۶	۳	۳,۷۱۳,۴۰۶,۷۱۴,۹۶۰	۳	۵.۱۶%
بانک ملی ایران	۲۰,۸۲,۴۲۱,۲۲۴,۲۲۷	۲۰,۸۲,۴۲۱,۲۲۴,۲۲۷	۲	۹۹۸,۸۵۳,۰۱۲,۴۳۸	۹۹۸,۸۵۳,۰۱۲,۴۳۸	۵	۳,۰۸۱,۲۷۴,۲۳۶,۶۶۵	۵	۴.۲۸%
بانک سپه	۱,۴۸۰,۶۲۳,۰۸۸,۰۳۸	۱,۴۸۰,۶۲۳,۰۸۸,۰۳۸	۴	۷۶۲,۳۵۲,۱۸۸,۱۵۳	۷۶۲,۳۵۲,۱۸۸,۱۵۳	۶	۲,۲۴۲,۹۷۵,۲۷۶,۱۹۱	۶	۳.۱۱%
بانک صادرات	۱,۳۳۹,۰۰۷,۹۶۵,۸۷۳	۱,۳۳۹,۰۰۷,۹۶۵,۸۷۳	۵	۶۹۰,۰۱۴,۹۶۹,۵۷۳	۶۹۰,۰۱۴,۹۶۹,۵۷۳	۷	۲,۰۲۹,۰۲۲,۹۳۵,۴۴۶	۵	۲.۸۲%
حافظ*	۰	۰	-	۱,۶۸۶,۶۷۱,۰۳۵,۲۰۴	۱,۶۸۶,۶۷۱,۰۳۵,۲۰۴	۲	۱,۶۸۶,۶۷۱,۰۳۵,۲۰۴	۶	۲.۳۴%
بانک رفاه کارگران	۰	۰	-	۱,۲۶۲,۹۹۰,۴۸۶,۹۶۰	۱,۲۶۲,۹۹۰,۴۸۶,۹۶۰	۴	۱,۲۶۲,۹۹۰,۴۸۶,۹۶۰	۷	۱.۷۵%
بانک ملت	۶۷۱,۳۱۶,۵۰۵,۷۶۹	۶۷۱,۳۱۶,۵۰۵,۷۶۹	۶	۹۹,۹۳۷,۵۰۰,۰۰۰	۹۹,۹۳۷,۵۰۰,۰۰۰	۱۶	۷۷۱,۲۵۴,۰۰۰,۵۷۹	۸	۱.۰۷%
بانک پاسارگاد	۱۴۴,۰۹۷,۹۴۷,۳۵۵	۱۴۴,۰۹۷,۹۴۷,۳۵۵	۷	۶۱۱,۹۱۸,۳۰۴,۴۰۹	۶۱۱,۹۱۸,۳۰۴,۴۰۹	۸	۷۵۶,۰۱۶,۲۵۱,۷۶۴	۹	۱.۰۵%
فارابی	۰	۰	-	۵۰۸,۹۸۵,۷۱۲,۲۸۴	۵۰۸,۹۸۵,۷۱۲,۲۸۴	۹	۵۰۸,۹۸۵,۷۱۲,۲۸۴	۱۰	۰.۷۱%
بورس بیمه ایران	۱۰۷,۳۵۰,۹۶۴,۲۰۱	۱۰۷,۳۵۰,۹۶۴,۲۰۱	۸	۳۵۷,۱۸۱,۵۷۸,۰۵۳	۳۵۷,۱۸۱,۵۷۸,۰۵۳	۱۱	۴۶۴,۵۳۲,۵۴۲,۷۵۴	۱۱	۰.۶۵%
کیان	۰	۰	-	۳۶۴,۲۴۷,۳۰۳,۸۶۰	۳۶۴,۲۴۷,۳۰۳,۸۶۰	۱۰	۳۶۴,۲۴۷,۳۰۳,۸۶۰	۱۲	۰.۵۱%
اقتصاد بیدار	۱,۰۶۶,۵۹۵	۱,۰۶۶,۵۹۵	۱۰	۲۰۴,۸۲۰,۶۶۱,۹۳۱	۲۰۴,۸۲۰,۶۶۱,۹۳۱	۱۲	۲۰۴,۸۲۱,۷۲۸,۶۲۶	۱۳	۰.۲۸%
آتی ساز بازار	۰	۰	-	۱۸۹,۳۶۹,۳۸۹,۲۸۶	۱۸۹,۳۶۹,۳۸۹,۲۸۶	۱۳	۱۸۹,۳۶۹,۳۸۹,۲۸۶	۱۴	۰.۲۶%
بانک مسکن	۰	۰	-	۱۷۷,۵۷۳,۹۴۱,۶۵۲	۱۷۷,۵۷۳,۹۴۱,۶۵۲	۱۴	۱۷۷,۵۷۳,۹۴۱,۶۵۲	۱۵	۰.۲۵%
بانک پارسیان	۱۴,۹۶۸,۳۵۷,۵۴۲	۱۴,۹۶۸,۳۵۷,۵۴۲	۹	۱۱۳,۷۹۳,۱۴۶,۴۸۸	۱۱۳,۷۹۳,۱۴۶,۴۸۸	۱۵	۱۲۸,۷۶۱,۵۰۴,۰۳۰	۱۶	۰.۱۸%
بانک اقتصاد نوین	۰	۰	-	۷۲,۷۹۲,۳۹۴,۹۵۳	۷۲,۷۹۲,۳۹۴,۹۵۳	۱۷	۷۲,۷۹۲,۳۹۴,۹۵۳	۱۷	۰.۱۰%
سینما	۰	۰	-	۶۹,۹۷۸,۶۶۶,۵۹۰	۶۹,۹۷۸,۶۶۶,۵۹۰	۱۸	۶۹,۹۷۸,۶۶۶,۵۹۰	۱۸	۰.۱۰%
مفید	۰	۰	-	۴۵,۷۷۶,۶۱۹,۶۰۰	۴۵,۷۷۶,۶۱۹,۶۰۰	۱۹	۴۵,۷۷۶,۶۱۹,۶۰۰	۱۹	۰.۰۶%
صبا تامین	۰	۰	-	۲۸,۵۸۵,۴۸۷,۰۰۰	۲۸,۵۸۵,۴۸۷,۰۰۰	۲۰	۲۸,۵۸۵,۴۸۷,۰۰۰	۲۰	۰.۰۴%
صبا جهاد	۰	۰	-	۲۰,۸۷۶,۳۶۹,۶۰۰	۲۰,۸۷۶,۳۶۹,۶۰۰	۲۱	۲۰,۸۷۶,۳۶۹,۶۰۰	۲۱	۰.۰۳%
خبرگان سهام	۰	۰	-	۱۶,۵۷۳,۲۰۷,۴۰۵	۱۶,۵۷۳,۲۰۷,۴۰۵	۲۲	۱۶,۵۷۳,۲۰۷,۴۰۵	۲۲	۰.۰۲%
آگاه	۰	۰	-	۱۵,۷۳۶,۹۵۸,۰۰۵	۱۵,۷۳۶,۹۵۸,۰۰۵	۲۳	۱۵,۷۳۶,۹۵۸,۰۰۵	۲۳	۰.۰۲%
ایساتیس پویا	۰	۰	-	۱۳,۱۴۷,۳۳۲,۰۰۰	۱۳,۱۴۷,۳۳۲,۰۰۰	۲۴	۱۳,۱۴۷,۳۳۲,۰۰۰	۲۴	۰.۰۲%
مجموع	۳۲,۱۸۸,۹۲۶,۷۵۹,۹۳۴	۳۲,۱۸۸,۹۲۶,۷۵۹,۹۳۴	-	۳۹,۸۲۴,۳۸۴,۹۰۷,۰۰۴	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 ۵,۰۰۰ می باشد.

۳-۳-۳- معافیت‌های دریافت شده توسط هیأت مدیره صندوق

معافیت مالیاتی نامد ** معاملاتی	معافیت کارمزد در ایستگاه معاملاتی صندوق *	حجم معاملات در ایستگاه	حجم معاملات در سایر کارگزاری‌ها		تاریخ
			فروش	خرید	
.	۳,۳۳۱,۸۱۶,۵۲۴	۱۸۰,۱۶۰,۲۱۶,۹۸۷	۶۵۲,۷۹۰,۰۶۹,۲۸۶	۵,۰۵۰,۵۲۷,۷۷۰,۸۸۴	از ۱۳۹۵/۱۰/۰۱ تا 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	از ۱۳۹۶/۰۵/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۴/۳۱
۹۵,۲۵۶,۰۶۳,۳۷۵	۲۰۵,۷۷۱,۲۴۳,۰۴۵	۲۹,۸۵۷,۵۳۷,۶۴۸,۲۱۴	۲۶,۲۹۰,۳۰۳,۹۱۸,۱۲۰	۹,۹۶۶,۸۴۷,۲۵۸,۷۹۰	از ۱۳۹۷/۰۵/۰۱ تا 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
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 نامد معاملاتی صفر گردید.

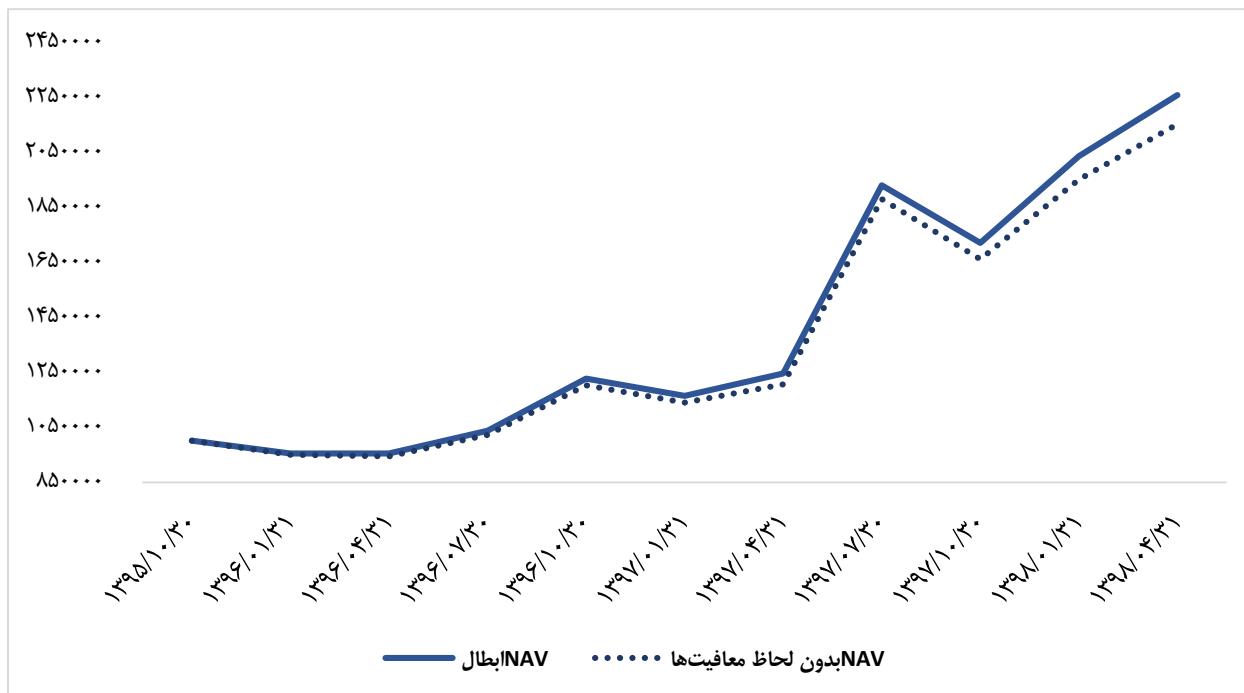
۱-۳-۳- سهم دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری از مجموع معافیت‌های دریافتی

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٪	۲۲,۶۹۴,۱۳۲,۹۶۵
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 معدن 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 پرديس	۰.۰۴٪	۱۷۲,۳۲۰,۹۶۷
جمع			۴۳۰,۸۰۲,۴۱۷,۵۴۲

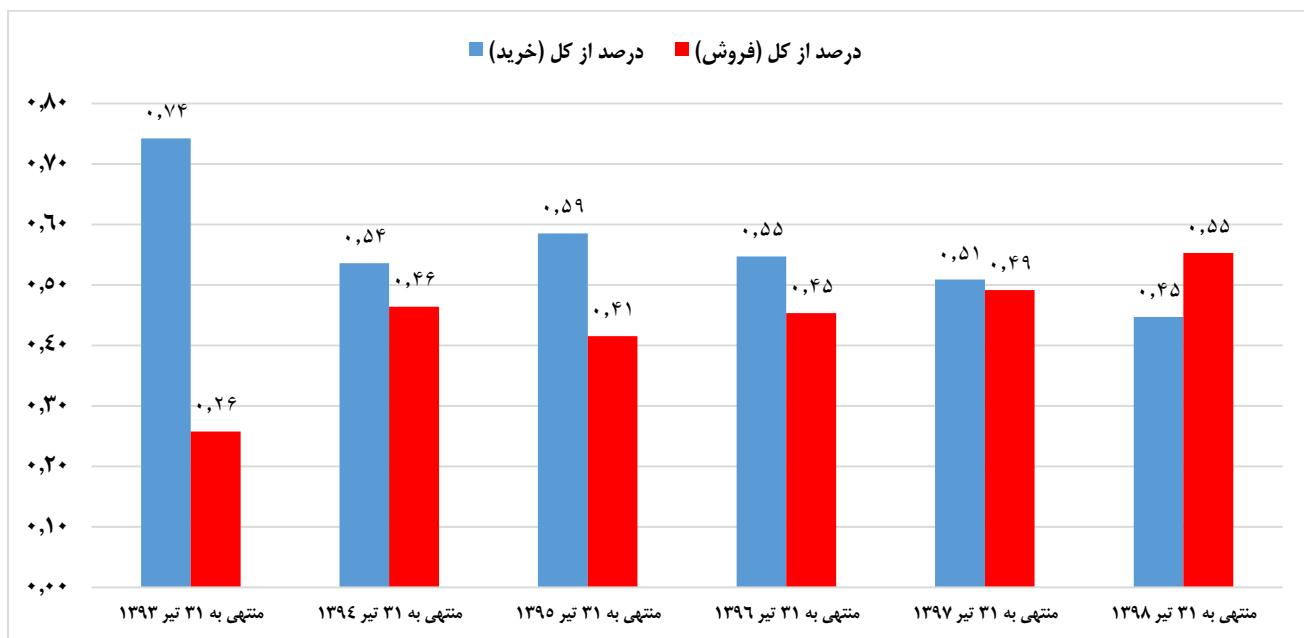
۳-۳-۲- تأثیر معافیت‌های دریافت شده بر NAV صندوق

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



۴-۳- 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
منتها به ۳۱ تیر ۱۳۹۳	۷,۱۵۳,۲۱۴,۹۹۹,۵۹۹	۲,۴۸۴,۱۴۱,۳۶۸,۷۸۰	۹,۶۳۷,۳۵۶,۳۶۸,۳۷۹
منتها به ۳۱ تیر ۱۳۹۴	۱۹,۴۴۱,۳۷۶,۷۷۹,۶۰۶	۱۶,۸۳۴,۴۳۲,۱۵۳,۲۶۸	۳۶,۲۷۵,۸۰۸,۹۳۲,۸۷۴
منتها به ۳۱ تیر ۱۳۹۵	۱۱,۱۹۵,۰۲۶,۴۶۶,۷۴۳	۷,۹۴۰,۰۹۱,۳۳۹,۹۰۴	۱۹,۱۳۵,۱۱۷,۸۰۶,۶۴۷
منتها به ۳۱ تیر ۱۳۹۶	۷,۷۷۹,۰۰۰,۸۷۱,۵۰۰	۶,۴۴۷,۳۴۴,۰۹۲,۱۵۸	۱۴,۲۲۶,۳۴۴,۹۶۳,۶۵۸
منتها به ۳۱ تیر ۱۳۹۷	۱۵,۸۱۳,۷۶۴,۸۸۱,۹۶۶	۱۵,۲۶۸,۸۰۱,۲۵۸,۵۶۳	۳۱,۰۸۲,۵۶۶,۱۴۰,۵۲۹
منتها به ۳۱ تیر ۱۳۹۸	۳۲,۱۸۸,۹۲۶,۷۵۹,۹۳۴	۳۹,۸۲۴,۳۸۴,۹۰۷,۰۰۴	۷۲,۰۱۳,۳۱۱,۶۶۶,۹۳۸

۳-۵-۳- اوراق اختیار معامله

۳-۵-۳-۱- 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	ضچاد	۷۰۰۷	۳۵۰	۴,۸۰۰	۴۰۶	۱۴۲,۰۵۰,۰۰۰
		ضچاد	۷۰۰۸	۵,۸۴۰	۵,۳۰۰	۲۱۴	۱,۲۴۸,۲۶۳,۰۰۰
		ضچاد	۷۰۰۹	۵,۲۵۰	۵,۸۰۰	۱۱۰	۵۷۸,۷۷۰,۰۰۰
	۱۳۹۸/۱۰/۰۴	ضچاد	۱۰۰۷	۱۵۰	۴,۸۰۰	۷۷۳	۱۱۵,۹۵۰,۰۰۰
		ضچاد	۱۰۰۸	۱,۶۲۰	۵,۳۰۰	۴۶۳	۷۵۰,۸۵۰,۰۰۰
		ضچاد	۱۰۰۹	۲,۶۰۰	۵,۸۰۰	۲۶۹	۷۰۰,۶۵۰,۰۰۰
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه و تجارت	۱۳۹۸/۰۷/۰۷	ضجار	۷۰۰۲	۱۰۳,۶۰۸	۵۰۰	۴۱	۴,۲۹۷,۲۹۵,۰۰۰
		ضجار	۷۰۰۳	۶۲,۳۸۴	۶۰۰	۲۲	۱,۴۰۱,۹۸۹,۰۰۰
		ضجار	۷۰۰۴	۳۹,۲۴۵	۷۰۰	۱۵	۵۸۳,۰۶۶,۰۰۰
	۱۳۹۸/۱۰/۰۸	ضجار	۱۰۰۲	۵۶,۹۴۹	۵۰۰	۷۱	۴,۰۵۹,۸۱۰,۰۰۰
		ضجار	۱۰۰۳	۶۲,۸۸۵	۶۰۰	۳۶	۲,۲۳۸,۱۱۰,۰۰۰
		ضجار	۱۰۰۴	۴۹,۶۹۹	۷۰۰	۲۱	۱,۰۱۹,۱۱۶,۰۰۰
اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه اخابر	۱۳۹۸/۰۷/۱۰	ضمخا	۷۰۱۱	۲,۲۳۵	۲,۵۸۴	۱۴۴	۳۲۲,۰۲۰,۰۰۰
		ضمخا	۷۰۱۲	۴,۴۸۰	۲,۷۸۴	۸۱	۳۶۴,۳۲۵,۰۰۰
		ضمخا	۷۰۱۳	۶,۶۲۰	۲,۹۸۴	۴۴	۲۹۰,۰۹۵,۰۰۰

مجموع ارزش فروش (ریال)	ارزش فروش (ریال)	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	تعداد قرارداد	قیمت اعمال	نماد	تاریخ اعمال	شرح
۴,۵۱۷,۵۰۰,۰۰۰	۱۶۴,۷۸۸,۰۰۰	۲۲	۷,۶۶۲	۳,۱۸۴	۷۰۱۴		اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه خودرو
	۶۹۲,۹۰۰,۰۰۰	۲۲۰	۳,۱۵۰	۳,۸۰۰	۱۰۱۳		
	۱,۲۱۱,۲۹۰,۰۰۰	۱۴۵	۸,۳۵۹	۴,۰۰۰	۱۰۱۴	۱۳۹۸/۱۰/۱۱	
۵,۳۳۰,۶۱۰,۰۰۰	۹۴۴,۸۰۰,۰۰۰	۱۲۸	۷,۳۸۰	۷,۰۰۰	۷۰۳۲	۱۳۹۸/۰۷/۱۴	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه رمپنا
	۳,۵۷۲,۷۰۰,۰۰۰	۴۱۵	۸,۵۹۹	۷,۰۰۰	۱۰۳۰	۱۳۹۸/۱۰/۱۵	
۵,۰۳۶,۹۹۰,۰۰۰	۱,۰۲۶,۴۰۰,۰۰۰	۳۲۶	۳,۱۵۰	۷,۰۰۰	۷۰۱۴		اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه رمپنا
	۷۷۴,۵۸۰,۰۰۰	۱۶۸	۴,۶۰۰	۷,۵۰۰	۷۰۱۵	۱۳۹۸/۰۷/۱۷	
	۹۶۱,۷۳۰,۰۰۰	۱۰۳	۹,۳۰۰	۸,۰۰۰	۷۰۱۶		
	۱,۲۰۶,۶۰۰,۰۰۰	۵۲۹	۲,۲۸۰	۸,۵۰۰	۷۰۱۰		
	۱,۱۳۳,۹۰۰,۰۰۰	۳۶۶	۳,۱۰۰	۹,۰۰۰	۱۰۱۱	۱۳۹۸/۱۰/۱۸	
	۲۲۷,۴۰۰,۰۰۰	۲۳۲	۹۸۰	۹,۵۰۰	۱۰۱۲		
۱۳,۳۵۴,۷۳۲,۰۰۰	۲۹۴,۸۴۰,۰۰۰	۲۸۹	۱,۰۲۱	۴,۶۰۰	۷۰۰۶		اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه و معادن
	۲۷۶,۵۴۰,۰۰۰	۲۲۸	۱,۱۶۳	۴,۸۰۰	۷۰۰۷	۱۳۹۸/۰۷/۱۷	
	۳,۱۰۸,۵۶۰,۰۰۰	۴۳۲	۷,۲۰۰	۴,۸۰۰	۱۰۰۷		
	۱,۳۵۷,۰۵۰,۰۰۰	۳۲۴	۴,۱۹۰	۵,۰۰۰	۱۰۰۸	۱۳۹۸/۱۰/۱۸	
	۷۱۵,۷۵۰,۰۰۰	۱,۱۰۱	۶۵۰	۱۰,۲۰۰	۷۰۴۰		اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه شپنا
	۳,۷۱۹,۲۴۰,۰۰۰	۶۰۴	۶,۱۵۹	۱۱,۲۰۰	۷۰۴۱		
	۲,۲۷۴,۷۰۵,۰۰۰	۳۳۱	۶,۸۶۴	۱۲,۲۰۰	۷۰۴۲		
	۱,۶۵۸,۶۸۷,۰۰۰	۱۴۳	۱۱,۶۰۸	۱۳,۲۰۰	۷۰۴۳		



مجموع ارزش فروش (ریال)	ارزش فروش (ریال)	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	تعداد قرارداد	قیمت اعمال	نماد	تاریخ اعمال	شرح
۳,۳۹۴,۰۰۴,۰۰۰	۹۵۷,۸۵۰,۰۰۰	۸۴	۱۱,۴۳۴	۱۴,۲۰۰	۷۰۴۴	۱۳۹۸/۱۰/۲۲	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه پارسان
	۲,۰۷۶,۰۰۰,۰۰۰	۱,۱۵۳	۱,۸۰۰	۱۲,۲۰۰	۱۰۲۸		
	۹۵۰,۶۰۰,۰۰۰	۷۲۶	۱,۳۱۰	۱۳,۲۰۰	۱۰۲۹		
	۱,۰۰۱,۹۰۰,۰۰۰	۴۶۴	۲,۱۶۰	۱۴,۲۰۰	۱۰۳۰		
۳,۴۴۷,۷۹۰,۰۰۰	۳۶۲,۰۸۵,۰۰۰	۴۵۰	۸۰۵	۴,۶۰۰	۷۰۳۴	۱۳۹۸/۰۷/۲۴	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه تاپیکو
	۹۰۸,۵۵۰,۰۰۰	۳۴۷	۲,۶۲۰,۰۰۰	۴,۸۰۰	۷۰۳۵		
	۹۷۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۶۰	۳,۷۴۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۷۰۳۶		
	۵۸۵,۸۰۰,۰۰۰	۱۱۹	۴,۹۲۵,۰۰۰	۵,۵۰۰	۷۰۳۷		
	۲۹۸,۷۸۹,۰۰۰	۵۹	۵,۱۰۱,۰۰۰	۶,۰۰۰	۷۰۳۸		
	۱۶۹,۰۱۰,۰۰۰	۳۴	۴,۹۹۰,۰۰۰	۶,۵۰۰	۷۰۳۹		
۳,۰۷۳,۹۲۴,۰۰۰	۹۶,۷۷۰,۰۰۰	۱۹	۵,۲۱۶,۰۰۰	۷,۰۰۰	۷۰۴۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فخوز
	۶۷۱,۷۵۰,۰۰۰	۸۹	۷,۵۲۵,۰۰۰	۳,۲۰۰	۷۰۰۷		
	۴۸۹,۳۰۰,۰۰۰	۶۲	۷,۸۷۵,۰۰۰	۳,۴۰۰	۷۰۰۸		
	۱,۵۱۶,۴۶۰,۰۰۰	۲۶۵	۵,۷۲۱,۰۰۰	۳,۲۰۰	۱۰۰۷		
	۷۷۰,۲۸۰,۰۰۰	۱۸۸	۴,۱۰۱,۰۰۰	۳,۴۰۰	۱۰۰۸		
	۴۲۷,۸۵۰,۰۰۰	۹۵۱	۴۵۰,۰۰۰	۹,۰۰۰	۷۰۰۶	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فخوز
	۱,۱۷۸,۵۱۰,۰۰۰	۴۷۱	۲,۵۰۱,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۷۰۰۷		
	۶۶۷,۹۰۴,۰۰۰	۱۸۱	۳,۶۹۷,۰۰۰	۱۱,۰۰۰	۷۰۰۸		
	۶۷۱,۰۹۰,۰۰۰	۸۰	۸,۳۴۵,۰۰۰	۱۲,۰۰۰	۷۰۰۹		

مجموع ارزش فروش (ریال)	ارزش فروش (ریال)	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	تعداد قرارداد	قیمت اعمال	نماد	تاریخ اعمال	شرح	
	۱۲۸,۵۷۰,۰۰۰	۵۸۴	۲۲۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰۰۷	۱۳۹۸/۱۰/۳۰		
۸,۶۸۳,۴۵۵,۰۰۰	۲,۰۹۷,۰۰۰	۶۹۹	۳,۰۰۰	۵,۰۰۰	۸۰۰۶	۱۳۹۸/۰۸/۰۱	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فارس	
	۴۲۹,۲۵۰,۰۰۰	۴۰۹	۱,۰۵۰,۰۰۰	۵,۵۰۰	۸۰۰۷			
	۱,۲۰۰,۹۴۸,۰۰۰	۲۷۱	۴,۴۳۴,۰۰۰	۶,۰۰۰	۸۰۰۸			
	۴۸۸,۶۰۰,۰۰۰	۱۲۱	۴,۰۵۰,۰۰۰	۶,۵۰۰	۸۰۰۹			
	۲,۸۵۵,۹۶۰,۰۰۰	۱,۰۹۸	۲,۶۰۱,۰۰۰	۶,۰۰۰	۱۱۰۸	۱۳۹۸/۱۱/۰۶		
	۱,۸۳۶,۴۰۰,۰۰۰	۷۷۰	۲,۳۸۵,۰۰۰	۶,۵۰۰	۱۱۰۹			
	۱,۴۲۹,۲۰۰,۰۰۰	۵۹۶	۲,۴۰۰,۰۰۰	۷,۰۰۰	۱۱۱۰			
	۴۴۱,۰۰۰,۰۰۰	۴۰۱	۱,۱۰۰,۰۰۰	۷,۵۰۰	۱۱۱۱			
۶,۸۴۶,۹۲۹,۰۰۰	۴۶,۹۵۰,۰۰۰	۹۳۹	۵۰,۰۰۰	۷,۲۰۰	۸۰۰۵	۱۳۹۸/۰۸/۱۲	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه شتران	
	۸۸,۲۰۰,۰۰۰	۵۸۸	۱۵۰,۰۰۰	۷,۷۰۰	۸۰۰۶			
	۸۸۴,۵۵۰,۰۰۰	۴۳۷	۲,۰۲۵,۰۰۰	۸,۲۰۰	۸۰۰۷			
	۱,۱۹۵,۶۳۰,۰۰۰	۳۲۶	۳,۶۶۵,۰۰۰	۸,۷۰۰	۸۰۰۸			
	۱,۸۵۷,۲۹۹,۰۰۰	۱۷۲	۱۰,۷۹۷,۰۰۰	۹,۲۰۰	۸۰۰۹			
	۱,۴۲۳,۸۵۰,۰۰۰	۹۱۳	۱,۰۵۰,۰۰۰	۸,۷۰۰	۱۱۰۸			
	۱,۳۵۰,۴۵۰,۰۰۰	۶۹۳	۱,۹۵۰,۰۰۰	۹,۲۰۰	۱۱۰۹			
۴,۲۲۸,۹۸۰,۰۰۰	۱,۱۰۰,۰۰۰	۱۱۰	۱۰,۰۰۰	۱,۴۰۰	۸۰۰۶	۱۳۹۸/۰۸/۱۴	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه خپارس	
	۱,۲۰۰,۰۰۰	۶۰	۲۰,۰۰۰	۱,۵۰۰	۸۰۰۷			
	۵۲۰,۰۰۰	۵۲	۱۰,۰۰۰	۱,۶۰۰	۸۰۰۸			

مجموع ارزش فروش (ریال)	ارزش فروش (ریال)	میانگین قیمت فروش اختیار خرید	تعداد قرارداد	قیمت اعمال	نماد	تاریخ اعمال	شرح
۲,۶۷۹,۰۰۰,۰۰۰	۱۹۴	۱۳,۸۰۰,۰۰۰	۱,۵۰۰	۱۱۰۷	ضیار	۱۳۹۸/۱۱/۱۳	
	۱۵۳	۵,۷۷۰,۰۰۰	۱,۶۰۰	۱۱۰۸			
	۱۲۸	۵,۱۹۱,۰۰۰	۱,۷۰۰	۱۱۰۹			
۱۰,۶۷۸,۷۶۹,۰۰۰	۵۶۶	۵۵۰,۰۰۰	۴,۰۵۰	۸۰۴۱	ضملی	۱۳۹۸/۰۸/۱۹	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه فملی
	۳۸۸	۴,۴۲۱,۰۰۰	۴,۲۵۰	۸۰۴۲			
	۳۱۱	۹,۳۲۸,۰۰۰	۴,۴۵۰	۸۰۴۳			
	۲۳۶	۱۲,۱۹۱,۰۰۰	۴,۶۵۰	۸۰۴۴			
	۱۷۳	۱۶,۵۸۷,۰۰۰	۴,۸۵۰	۸۰۴۵			
۵,۴۲۳,۵۴۰,۰۰۰	۲۱۱	۱,۷۰۰,۰۰۰	۲,۸۰۰	۸۰۰۶	ضدر	۱۳۹۸/۰۸/۲۲	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه وغدیر
	۱۷۶	۲,۰۵۰,۰۰۰	۳,۰۰۰	۸۰۰۷			
	۸۹	۹۱۱,۰۰۰	۳,۲۰۰	۸۰۰۸			
	۱۹۲	۵۰,۰۰۰	۲,۸۰۰	۱۱۰۶			
	۱۶۸	۱۵,۲۰۰,۰۰۰	۳,۰۰۰	۱۱۰۷			
۳,۶۹۹,۰۷۱,۰۰۰	۱۰۸	۱۸,۲۷۱,۰۰۰	۳,۲۰۰	۱۱۰۸	ضدر	۱۳۹۸/۱۱/۲۰	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه کگل
	۸۴	۱,۰۷۰,۰۰۰	۳,۴۰۰	۱۱۰۹			
	۷۹۴	۶۰۱,۰۰۰	۶,۴۲۰	۸۰۴۳			
	۵۶۸	۱,۲۰۰,۰۰۰	۶,۹۲۰	۸۰۴۴			
۱,۱۵۵,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۰	۲,۷۵۰,۰۰۰	۷,۴۲۰	۸۰۴۵	ضگل	۱۳۹۸/۰۸/۲۲	اوراق اختیار خرید منتشر شده بر نماد پایه کگل
	۲۴۱	۳,۰۲۶,۰۰۰	۷,۹۲۰	۸۰۴۶			

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 فولاد	۱۳۹۸/۰۸/۲۶	ضغل	۸۰۴۷	۸,۴۲۰	۳,۵۸۳,۰۰۰	۱۸۳	۶۵۵,۶۱۰,۰۰۰
		ضفلا	۸۰۴۵	۳,۹۰۰	۲۵۰,۰۰۰	۸۲۹	۲۰۷,۳۰۰,۰۰۰
		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 و بملت	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

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 لغاًیت ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ شامل اختیار خرید و فروش سهام می‌باشد، که تاکنون به تاریخ سرسید نرسیده است:

اختیار خرید سهام

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



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

اختیار فروش سهام

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

*بديهی است وجه دريافتی 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:

منتها به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱		منتها به ۱۳۹۷/۰۴/۳۱		منتها 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		۳۹,۰۶۹,۴۷۵,۷۵۵	مبلغ دریافت شده از مطالبات دوره جدید

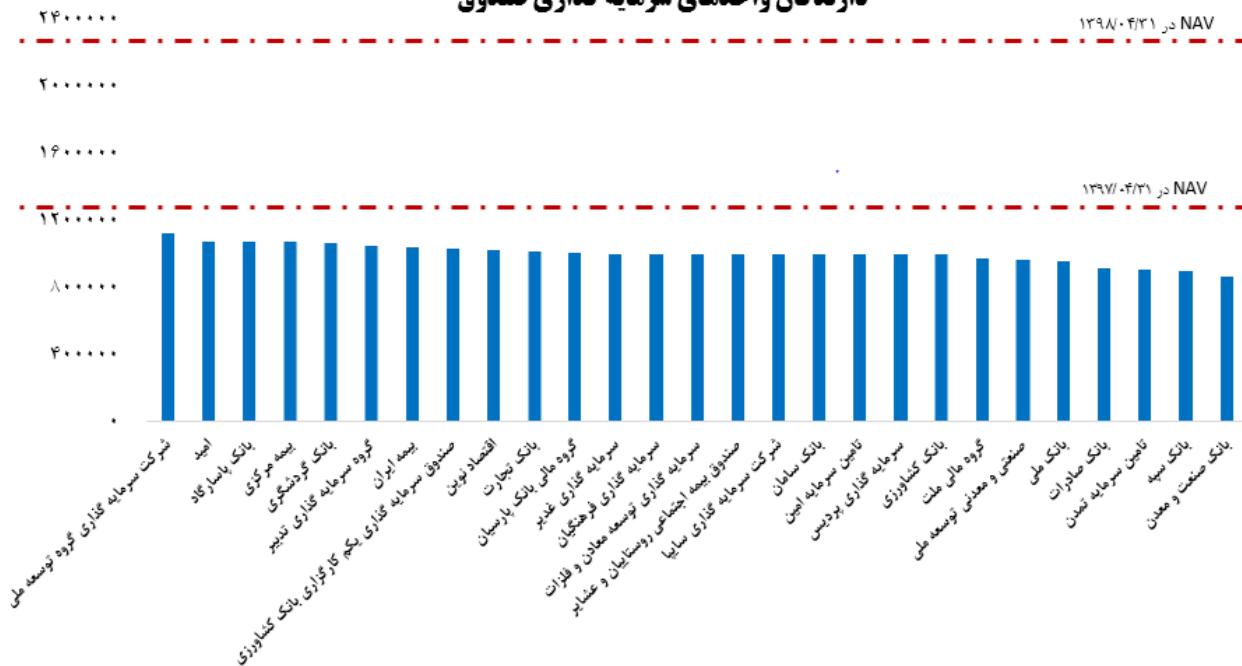
* مطالبات سود در این دوره مربوط به زمان تحويل صندوق به هیأت مدیره فعلی مورخ ۱۳۹۵/۱۰/۰۱ بوده که پس از پیگیری‌های انجام شده به مرحله وصول رسیده است.

** 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

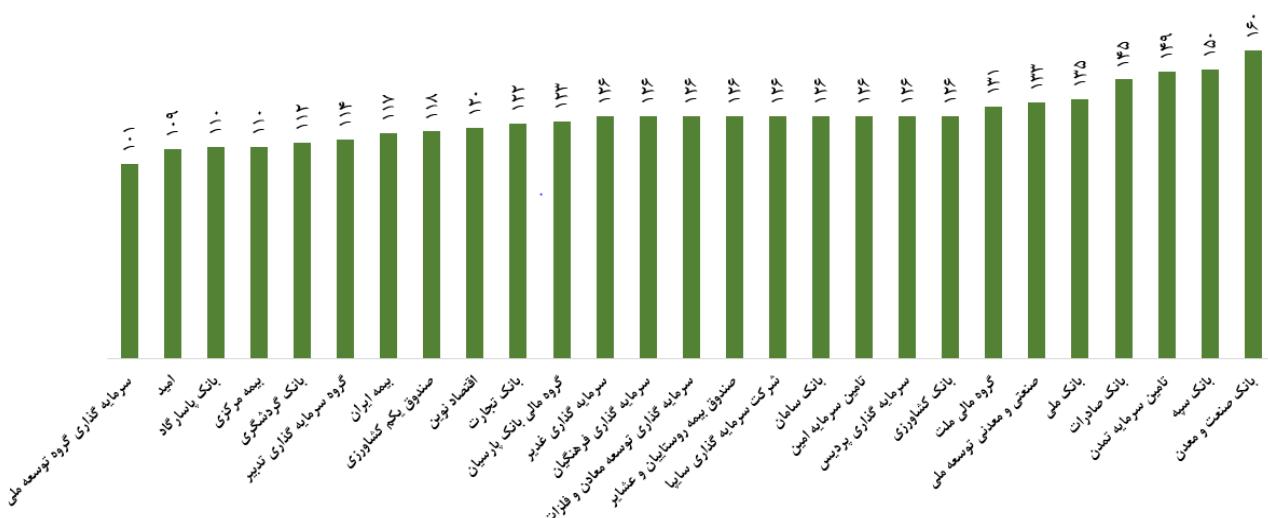
دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق



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 عشاير	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 سرمایه امین	۱,۰۰۰,۰۰۰
۵	بانک گردشگری	۱,۰۶۳,۸۹۲	۱۹	سرمایه‌گذاری پرديس	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 سرمایه تمدن	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 معدن و فلزات	۱,۰۰۰,۰۰۰			

۵- خلاصه‌ای از عملکرد صندوق در ۶ سال اخیر

خلاصه‌ای وضیعت عملکرد صندوق در بازار سرمایه از سال مالی منتهی به ۱۳۹۳/۰۴/۳۱ لغاًیت ۱۳۹۸/۰۴/۳۱، به شرح ذیل می‌باشد:

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

محمد ابراهیم آقابابائی

بانک ملی

عضو هیأت مدیره

حبيب رضا حدادی سیاهکلی

بانک سپه

عضو هیأت مدیره

محمد حسین صدرائی

بانک تجارت

رئیس هیأت مدیره