

به نام خدا

گزارش عملکرد سالانه
به انضمام گزارش حسابرس



صندوق سرمایه گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۰



فهرست مطالب

عنوان صفحه

۱ - مقدمه.....	۳
۲- صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه در یک نگاه.....	۳
۲-۱- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری.....	۴
۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱.....	۵
۳ - بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱.....	۶
۳-۱- بازده صندوق.....	۶
۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری.....	۸
۳-۳- معافیت‌های دریافت شده توسط هیأت مدیره صندوق.....	۹
۳-۴- خلاصه‌ای از کل معاملات انجام شده از ابتدای تأسیس تاکنون.....	۱۰
۳-۵- نسبت معاملات خرید و فروش در ۸ سال اخیر.....	۱۱
۳-۶- گزارش معاملات اوراق اختیار معامله از ابتدای مدیریت هیأت مدیره صندوق.....	۱۲
۳-۷- گزارش معاملات اوراق اختیار فروش تبعی.....	۱۳
۳-۸- فرآیند دریافت سود سهام.....	۱۵
۳-۹- منابع تحت مدیریت صندوق.....	۱۵
۴- خلاصه‌ای از عملکرد صندوق در ۸ سال اخیر.....	۱۶

**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 و فرابورس 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:	۱۴۰۰/۰۴/۳۱
شروع فعالیت:	۱۳۹۱/۱۱/۲۱
دوره فعالیت:	نامحدود

ارکان صندوق

مدیر	هیأت مدیره صندوق
متولی	شرکت حسابرسی و خدمات مدیریت آزموده کاران
حسابرسی	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز



۲-۱ - 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 ۲۳,۹۹۴,۰۹۰ میلیون ریال افزایش یافته است. مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱ به شرح جدول ذیل می‌باشد:

ردیف	نام شرکت	واحدهای سرمایه‌گذاری	میانگین صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)	درصد مالکیت
۱	بانک تجارت	۲,۵۵۴,۵۱۷	۱,۱۱۳,۸۲۱	۱۰.۶۵%
۲	بانک صادرات	۲,۱۴۰,۳۸۳	۲,۱۰۲,۰۸۷	۸.۹۲%
۳	کارگزاری مفید	۲,۱۲۱,۷۵۶	۵,۶۳۳,۶۲۰	۸.۸۴%
۴	بانک ملی	۲,۰۲۸,۳۷۰	۹۶۱,۲۵۴	۸.۴۵%
۵	گروه مالی ملت	۱,۵۳۵,۳۶۰	۹۷۶,۷۳۰	۶.۴۰%
۶	بورس اوراق بهادار تهران	۱,۳۴۵,۴۹۲	۵,۲۵۷,۰۰۶	۵.۶۱%
۷	بانک سپه	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹۰۲,۱۵۰	۴.۴۸%
۸	کارگزاری آگاه	۱,۰۳۷,۳۳۵	۵,۶۷۰,۳۰۷	۴.۳۲%
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۶۹۴,۹۷۱	۱,۰۷۹,۳۲۴	۲.۹۰%
۱۰	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۶۶۳,۳۴۶	۱,۵۰۷,۵۰۸	۲.۷۶%
۱۱	سایر	۸,۷۹۷,۴۷۲	-	۳۶.۶۷%
جمع		۲۳,۹۹۴,۰۹۰	-	۱۰۰%

مجموع واحدهای سرمایه‌گذاری متعلق به هر یک از طبقات در کل به شرح نمودار ذیل می‌باشد:

نام	تعداد	درصد مالکیت
طبقه اول: بورس اوراق بهادار تهران، فرابورس ایران، سپرده‌گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه	۲,۰۵۳,۷۲۷	۸.۵۶%
طبقه دوم: بانک‌ها و مؤسسات مالی و اعتباری، شرکت‌ها و نهادهای بیمه‌ای	۱۰,۱۸۹,۹۶۶	۴۲.۴۷%
طبقه سوم: کانون‌ها، تشکل‌ها، نهادهای مالی و دیگر شرکت‌های ثبت‌شده نزد سازمان	۱۱,۷۵۰,۳۹۷	۴۸.۹۷%
جمع	۲۳,۹۹۴,۰۹۰	۱۰۰%



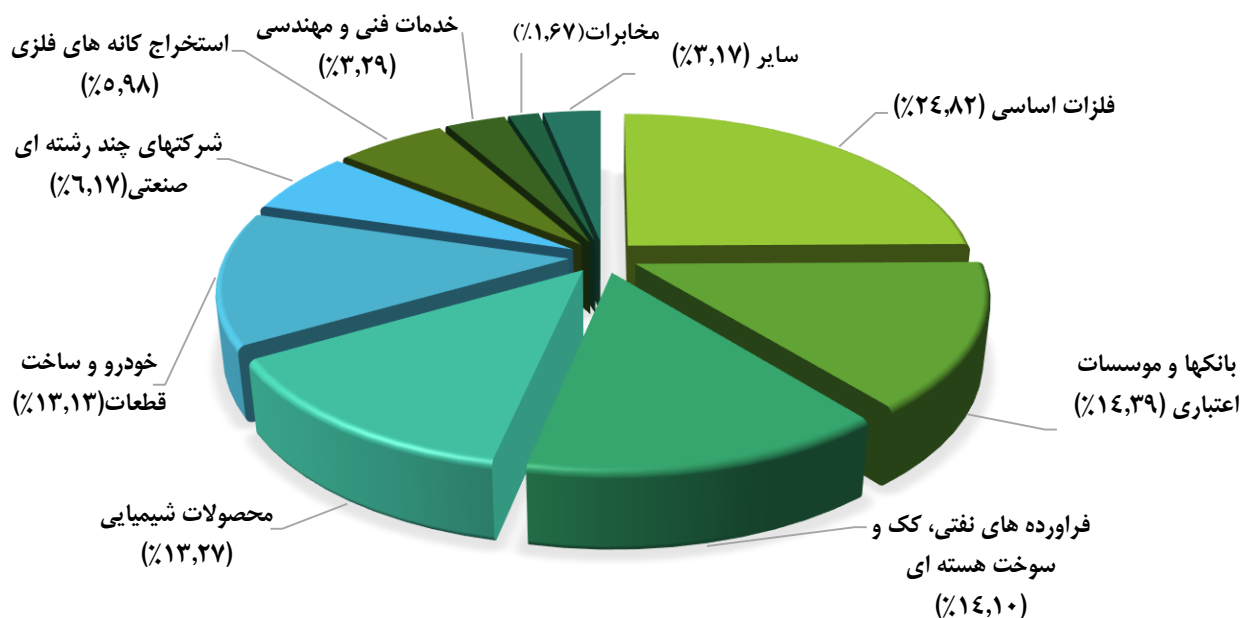
۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱

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 پرداخته است، از ۲۳ صنعت در انتهای سال مالی گذشته، به ۲۷ صنعت در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۴/۳۱ تغییر یافته است. همچنین صندوق در ۳۲۹ نماد در بازار سهام فعال بوده است.

صنعت	درصد از کل به ارزش روز ۱۴۰۰/۰۴/۳۱
فلزات اساسی	۲۴.۸۲٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۴.۳۹٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۴.۱۰٪
محصولات شیمیایی	۱۳.۲۷٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۳.۱۳٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۶.۱۷٪
استخراج کانه های فلزی	۵.۹۸٪
خدمات فنی و مهندسی	۳.۲۹٪
مخابرات	۱.۶۷٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۰.۸۸٪
مواد و محصولات دارویی	۰.۶۷٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۰.۳۸٪
سیمان، آهک و گچ	۰.۲۳٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۰.۲۲٪
سرمایه گذاریها	۰.۲۲٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰.۱۳٪
زراعت و خدمات وابسته	۰.۱۰٪
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۰.۰۸٪
ساخت محصولات فلزی	۰.۰۶٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۰.۰۵٪
اطلاعات و ارتباطات	۰.۰۵٪
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰.۰۴٪
استخراج ذغال سنگ	۰.۰۲٪
سایر واسطه گریهای مالی	۰.۰۲٪
ماشین آلات و تجهیزات	۰.۰۲٪
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۰.۰۱٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۰.۰۰٪
جمع	۱۰۰٪

۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱

ترکیب دارایی‌های صندوق توسعه بازار سرمایه در سهام (درصد)


۳-۱- بازده صندوق

بازده ماهانه، سه ماهه، شش ماهه، نه ماهه و سالانه صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

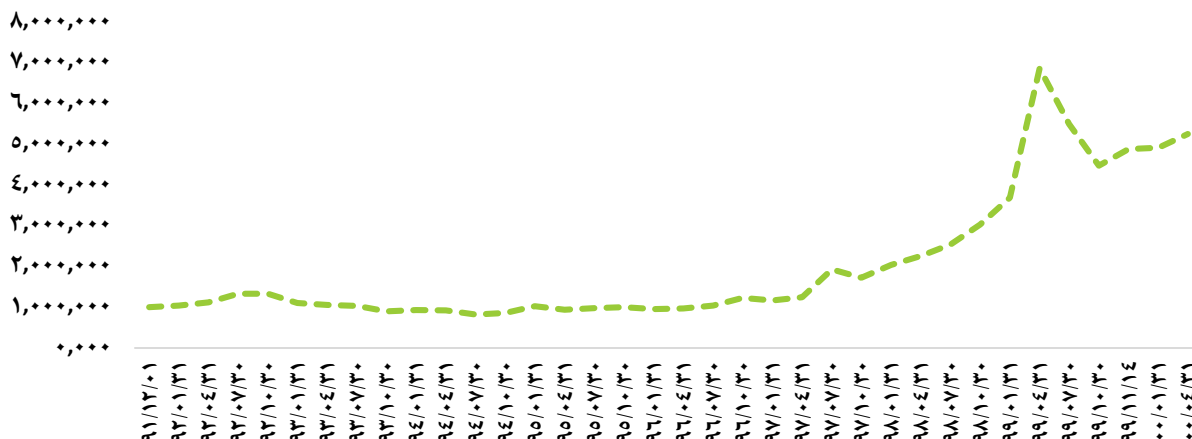
توضیحات	از تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
ماه گذشته	۱۴۰۰/۰۴/۰۱	۷,۲۶٪	۱۰,۴۸٪
۳ ماه گذشته	۱۴۰۰/۰۲/۰۱	۸,۸۱٪	۸,۶۳٪
۶ ماه گذشته	۱۳۹۹/۱۰/۰۱	۸,۶۵٪	۷,۳۰٪
۹ ماه گذشته	۱۳۹۹/۰۸/۰۱	-۴,۷۳٪	-۴,۵۷٪
یک سال گذشته	۱۳۹۹/۰۵/۰۱	-۲۳,۲۶۹٪	-۳۱,۰۲۶٪



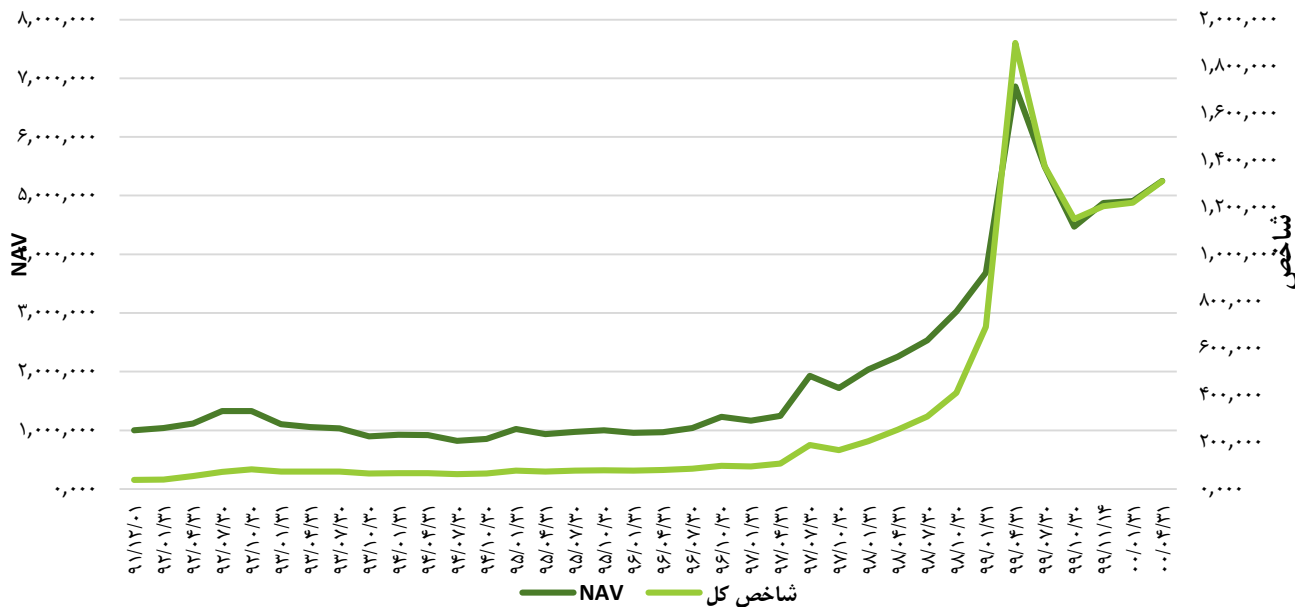
گزارش عملکرد صندوق توسعه بازار سرمایه

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱ به شرح نمودار ذیل می باشد:

خالص ارزش روز هر واحد سرمایه‌گذاری صندوق



روند تغییرات خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و شاخص کل





۳-۲- وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

نام کارگزار	رتبه در معاملات خرید	رتبه در معاملات فروش	رتبه از کل معاملات	رتبه از کل معاملات	درصد از کل معاملات
ایستگاه معاملاتی صندوق	۱	۱	۱	۱	۹۴.۹۶%
بانک ملی ایران	۲	۴	۲	۲	۱.۴۸%
بانک پاسارگاد	۴	۲	۳	۳	۱.۴۳%
بانک تجارت	۳	۶	۴	۴	۱.۱۰%
کیان	-	۳	۵	۵	۰.۳۱%
بانک سپه	۵	۸	۶	۶	۰.۲۳%
اقتصاد بیدار	-	۵	۷	۷	۰.۲۳%
بانک صادرات	۶	۱۰	۸	۸	۰.۱۲%
مفید	-	۷	۹	۹	۰.۱۰%
بانک مسکن	-	۹	۱۰	۱۰	۰.۰۳%
جمع	-	-	-	-	۱۰۰%

*حجم معاملات فروش در کارگزاری بانک پاسارگاد ناشی از فروش اوراق اختیار معامله و همچنین فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله با نرخ کارمزد ۰.۰۰۰۵ می باشد. شایان ذکر است کارمزد کارگزار صفر است.

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

هیأت‌مدیره صندوق به منظور کاهش هزینه‌های مترتب بر عملیات صندوق که از مسیر تأثیر بر کاهش NAV، منجر به کاهش ثروت دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری می‌شد، به محض استقرار اقدام به مذاکره و حذف برخی هزینه‌های عملیاتی صندوق نمود. موارد مذکور عبارتند از:

۱. استرداد مبلغ ۱,۴۶۱,۷۹۶,۷۸۱ ریال از کارگزاری صباجهاد و مبلغ ۱,۴۶۳,۸۱۹,۳۹۵ ریال از کارگزاری آراد ایرانیان در قالب مطالبات صندوق بابت تعدیلات ناشی از سقف کارمزد کارگزار پس از پیگیری‌های انجام‌شده و با رأی هیأت دآوری
۲. استرداد مبلغ ۱۱,۱۵۴,۳۴۰,۴۹۵ ریال از شرکت بورس اوراق بهادار تهران بابت بخش متغیر حق عضویت سالانه شرکت‌های کارگزاری در بورس از سال ۱۳۹۳ و اخذ معافیت
۳. اخذ معافیت کارمزد بخش کارگزار به موجب راه‌اندازی ایستگاه معاملاتی اختصاصی صندوق (در حال حاضر کلیه معاملات انجام شده در ایستگاه معاملاتی صندوق معاف از پرداخت کارمزد کارگزار می‌باشد).
۴. اخذ معافیت مالیات بر فروش سهام در ۱۰۴ نماد موضوع بازارگردانی صندوق (مطابق تأییدیه دریافتی از سازمان بورس و اوراق بهادار از تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۱، مالیات مربوط به ۱۰۴ نماد معاملاتی مصرح در امیدنامه صندوق صفر گردید).
۵. اخذ معافیت فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار خرید سهام (پس از پیگیری‌های انجام‌شده توسط صندوق مبنی بر اخذ معافیت معاملاتی بر معاملات فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله، به موجب بند ۲ صورتجلسه شورای عالی بورس مورخ ۱۳۹۸/۱۱/۲۱، مشمول معافیت مالیاتی گردید).

تاریخ	معافیت کارمزد معاملات در ایستگاه معاملاتی صندوق (ریال)*	معافیت مالیاتی ۱۰۴ نماد معاملاتی (ریال)**	معافیت مالیاتی فروش سهم ناشی از اعمال اوراق اختیار معامله (ریال)**	معافیت کارمزد حق عضویت سالانه بورس و فرابورس (کارمزد دسترسی)***	تعدیلات ناشی از سقف کارمزد وصول نشده از کارگزاری‌های آراد ایرانیان و صباجهاد	مجموع
استرداد وجوه ناشی از اخذ معافیت و وصول مطالبات پیش از دوره مدیریت هیأت‌مدیره صندوق	-	-	-	۳,۴۰۷,۳۱۹,۱۴۱	۲,۹۲۵,۶۱۶,۱۷۶	۶,۳۳۲,۹۳۵,۳۱۷
از ۱۳۹۵/۱۰/۰۱ لغایت ۱۳۹۶/۰۴/۳۱	۳,۳۳۱,۸۱۶,۵۲۴	۰	۰	۱,۷۹۷,۴۷۱,۲۱۵	-	۱۳۱,۵۷۲,۵۸۲,۳۳۷
از ۱۳۹۶/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۷/۰۴/۳۱	۶۳,۲۶۹,۵۴۲,۴۳۸	۶۳,۱۷۳,۷۵۲,۱۶۰	۰	۶,۳۴۹,۵۵۰,۱۳۹	-	۳۰۶,۰۲۷,۳۰۶,۴۲۰
از ۱۳۹۷/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۸/۰۴/۳۱	۲۰۵,۷۷۱,۲۴۳,۰۴۵	۹۵,۲۵۶,۰۶۳,۳۷۵	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	-	۷۱۰,۷۱۱,۳۱۶,۱۳۱
از ۱۳۹۸/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۹/۰۴/۳۱	۳۷۵,۸۸۸,۸۱۷,۸۵۳	۳۱۴,۳۶۴,۶۳۰,۸۱۳	۱۰,۴۵۷,۸۶۷,۴۶۵	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	-	۲,۰۳۸,۱۷۲,۳۱۵,۶۱۴
از ۱۳۹۹/۰۵/۰۱ لغایت ۱۴۰۰/۰۴/۳۱	۱,۲۰۹,۴۱۸,۷۲۹,۵۶۶	۸۰۴,۱۲۳,۹۶۳,۳۴۲	۱۴,۶۲۹,۶۲۲,۷۰۶	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	-	۳,۱۹۲,۸۱۶,۴۵۵,۸۱۹
مجموع	۱,۸۵۷,۶۸۰,۱۴۹,۴۲۶	۱,۲۷۶,۹۱۸,۴۰۹,۶۹۰	۲۵,۰۸۷,۴۹۰,۱۷۱	۳۰,۲۰۴,۷۹۰,۳۵۶		

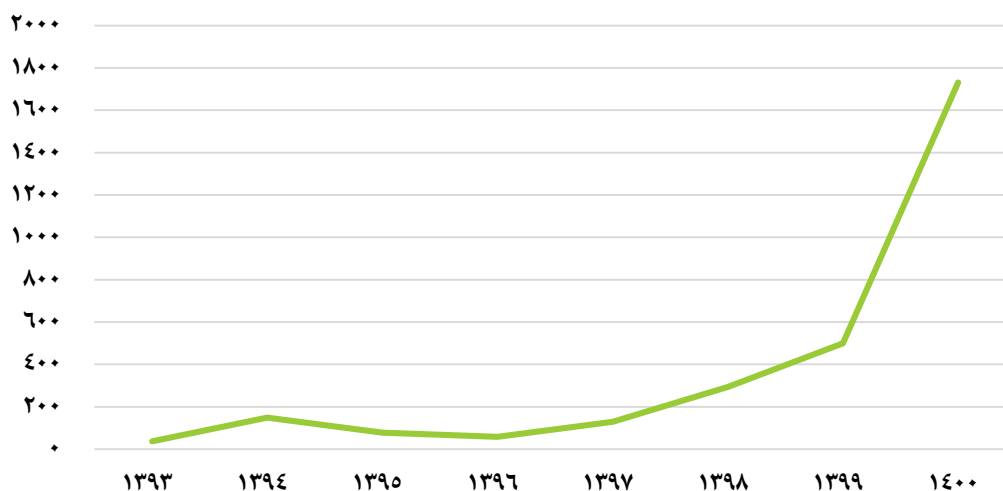


۳-۴- خلاصه‌ای از کل معاملات انجام شده از ابتدای تأسیس تاکنون

نسبت معاملاتی	حجم کل معاملات	حجم معاملات در ایستگاه	تاریخ
۱۷٪	۷۶,۹۷۳,۴۸۴,۳۵۶,۶۲۸	۱۳,۰۴۳,۴۵۱,۲۷۰,۳۵۹	از ابتدای تأسیس تا تاریخ ۱۳۹۵/۱۰/۰۱
۸۱٪	۶۴۴,۲۵۶,۳۵۴,۳۲۰,۹۹۶	۵۶۸,۸۳۹,۹۱۷,۵۴۳,۲۲۶	از تاریخ ۱۳۹۵/۱۰/۰۱ لغایت ۱۴۰۰/۰۴/۳۱ (دوره مدیریت هیأت مدیره صندوق)

همچنین متوسط گردش معاملات روزانه از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۳۱ به شرح نمودار ذیل می باشد:

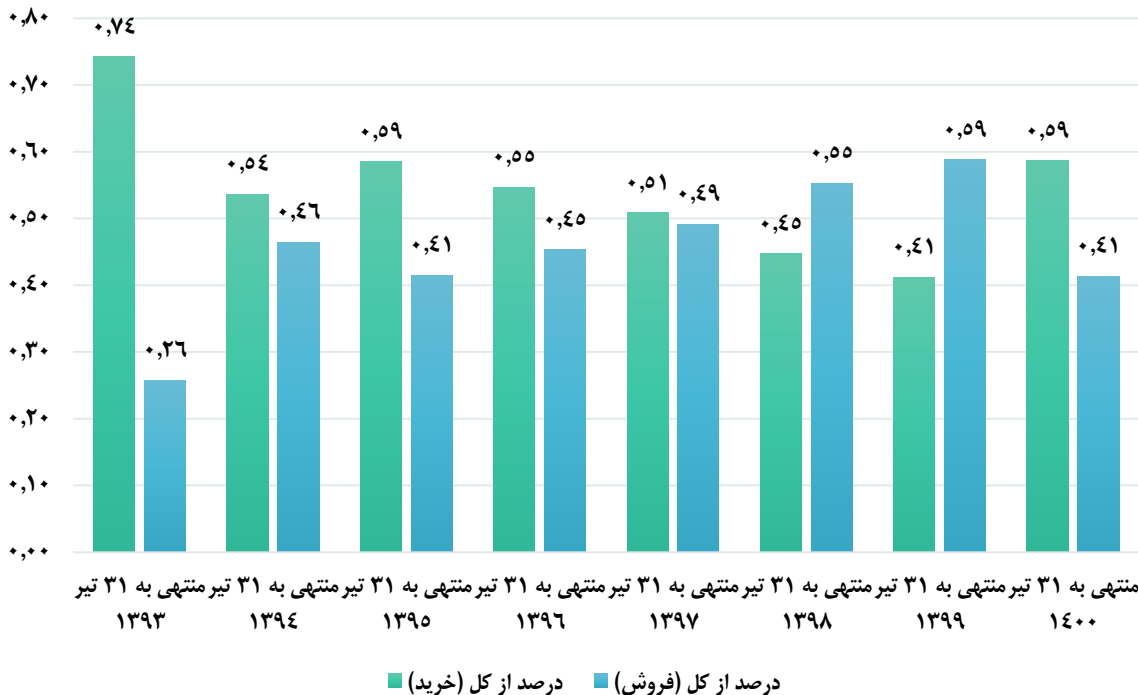
متوسط گردش معاملات روزانه (میلیارد ریال)





۳-۵- نسبت معاملات خرید و فروش در ۸ سال اخیر

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



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

سال مالی	ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	ارزش کل معاملات
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۳	۷,۱۵۳,۲۱۴,۹۹۹,۵۹۹	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
منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۹	۴۹,۳۹۶,۹۳۵,۴۲۶,۲۸۶	۷۰,۵۴۰,۳۳۱,۹۳۴,۹۵۴	۱۱۹,۹۳۷,۲۶۷,۳۶۱,۲۴۰
منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۰	۲۴۵,۷۶۳,۱۵۲,۸۰۰,۲۴۳	۱۷۳,۱۵۸,۹۱۲,۶۳۷,۱۱۶	۴۱۸,۹۲۲,۰۶۵,۴۳۷,۳۵۹

**۳-۶ - گزارش معاملات اوراق اختیار معامله از ابتدای مدیریت هیأت مدیره صندوق**

خلاصه‌ای از درآمدهای صندوق ناشی از فروش و اعمال اوراق اختیار معامله سهام که به تاریخ سررسید رسیده است، در ۵ سال اخیر به شرح جدول ذیل می‌باشد:

سال	تعداد قرارداد منتشر شده	درآمد حاصل از فروش اوراق (ریال)	تعداد قرارداد اعمال شده	درآمد ناشی از اعمال (ریال)
منتهی به ۹۶/۰۴/۳۱	۱۶,۵۲۶	۲۷,۱۷۲,۷۳۰,۰۰۰	۱۳,۰۵۷	۱۷۲,۲۳۸,۰۰۰,۰۰۰
منتهی به ۹۷/۰۴/۳۱	۷,۰۱۲	۱۷,۱۹۶,۱۲۸,۷۷۰	۵,۹۳۲	۱۰۸,۶۴۴,۹۵۲,۷۴۰
منتهی به ۹۸/۰۴/۳۱	۴۳۶,۴۹۹	۶۷,۹۶۶,۱۱۱,۱۴۵	۳۰۸,۳۲۸	۱,۵۹۲,۵۲۱,۵۸۶,۶۳۱
منتهی به ۹۹/۰۴/۳۱	۱,۳۵۲,۲۶۹	۳۶۲,۶۱۷,۵۰۳,۳۳۰	۱,۰۶۱,۳۹۳	۴,۴۰۳,۳۹۰,۴۸۷,۲۶۷
منتهی به ۰۰/۰۴/۳۱	۳,۵۰۱,۲۷۲	۱,۵۳۴,۷۰۲,۶۶۳,۷۰۵	۱,۰۳۵,۸۶۳	۲,۹۲۵,۹۲۴,۵۴۱,۱۹۶
مجموع	۵,۳۱۳,۵۷۷	۲,۰۰۹,۶۵۵,۱۳۶,۹۵۰	۲,۴۲۴,۵۷۳	۹,۲۰۲,۷۱۹,۵۶۷,۸۳۴

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

*حجم هر قرارداد برای سال مالی منتهی به تیر ماه سال ۱۳۹۶ و ۱۳۹۷، ۱۰,۰۰۰ عدد سهم و برای سال‌های ۱۳۹۹ و ۱۴۰۰، ۱۰۰۰ عدد سهم بوده است.



۳-۷- گزارش معاملات اوراق اختیار فروش تبعی

الف) اوراق اختیار فروش حمایتی

در راستای حمایت از بازار سهام و تشویق شرکت‌های ناشر بر انتشار اوراق اختیار فروش تبعی حمایتی، صندوق سرمایه-گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه نسبت به انتشار اوراق اختیار فروش تبعی به شرح ذیل اقدام نمود.

نماد اوراق اختیار فروش تبعی	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد انتشار	درآمد حاصل از فروش اوراق (ریال)	تعداد اعمال	ارزش سهم خریداری شده ناشی از اعمال (ریال)*
هجم ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۸	۳۸,۶۴۵	۲,۶۷۳,۹۵۶	۳۴,۳۷۴,۱۹۶	۳۳۶,۹۶۰	۶,۱۴۸,۷۶۷,۳۰۵
هخود ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۰	۳,۶۸۰	۶۲,۱۵۸,۲۲۹	۴,۴۳۲,۲۲۲,۸۹۰	۱۴,۸۸۰,۶۹۳	۱۸,۳۹۹,۱۳۱,۵۲۰
هرانف ۹۱۲	۱۳۹۹/۱۲/۰۳	۳۲,۱۲۰	۳,۰۰۰,۰۰۰	۱,۲۳۰,۰۵۱,۰۱۸	۵۹۴,۴۹۳	۱۲,۱۶۹,۶۵۷,۷۲۰
هپهن ۹۱۲	۱۳۹۹/۱۲/۰۲	۷۴,۵۹۰	۲,۰۰۰,۰۰۰	۲,۱۷۴,۱۸۶,۰۳۸	۲۱۷,۵۹۲	۱۱,۶۶۴,۰۸۵,۸۴۰
هشفن ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۶	۳۱۸,۰۶۰	۳۸۹,۱۳۳	۳۳۳,۲۰۲,۵۶۰	۱۸,۰۵۹	۳,۸۶۵,۰۶۵,۱۲۰
هشیر ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۷	۷۳,۴۸۰	۲,۴۳۳,۸۵۷	۱,۹۱۱,۴۲۶,۶۷۴	۱۷۶,۱۰۳	۸,۸۲۹,۵۰۳,۷۶۰
هصد ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۹	۱۹,۹۲۶	۳,۹۲۵,۱۲۷	۹۴۲,۱۰۳,۸۴۲	۱,۱۴۸,۵۱۲	۱۸,۱۷۶,۳۱۷,۸۶۶
همعاد ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۱۹	۱۹,۰۸۰	۴,۵۵۳,۰۰۰	۳۵۷,۰۳۸,۸۶۴	۱,۵۹۷,۰۰۵	۱۶,۶۲۵,۲۴۳,۵۲۰
هملت ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۲۵	۶,۷۷۰	۴۰,۹۷۸,۶۹۷	۵,۱۷۷,۷۷۳,۸۸۷	۱۳,۶۸۸,۹۱۲	۳۸,۲۷۹,۷۵۳,۱۷۰
ههفت ۹۱۲	۱۳۹۹/۱۲/۰۴	۱۵,۳۳۰	۶,۴۷۳,۲۱۹	۴۰۲,۱۷۳,۴۰۰	۰	۰
هپارس ۹۱۲	۱۳۹۹/۱۲/۱۰	۵,۹۲۰	۱۵,۶۵۸,۷۲۷	۳,۲۵۰,۸۰۳,۴۰۵	۵,۵۱۵,۳۹۱	۲۶,۷۲۵,۷۱۵,۶۸۰
همینا ۹۱۲	۱۳۹۹/۱۲/۱۱	۳۴,۸۲۰	۲,۱۷۸,۶۶۸	۱,۶۰۰,۸۱۹,۱۵۳	۹۹۴,۷۹۷	۱۹,۵۵۵,۰۷۵,۳۰۰
ذوب تبعی ۹۹۱۲۱	۱۳۹۹/۱۲/۲۴	۷,۳۳۰	۱۲,۶۰۵,۶۴۳	۱,۸۲۶,۹۳۹,۸۶۲	۱,۰۷۳,۵۴۷	۳,۵۶۴,۹۱۶,۱۸۰
هکاو ۹۱۱	۱۳۹۹/۱۱/۱۸	۲۵,۴۷۷	۲,۳۵۱,۰۰۵	۱,۸۰۹,۱۳۰,۵۵۴	۳۲۵,۴۴۱	۵,۵۴۲,۴۴۴,۹۱۹
جمع	-	-	۱۶۱,۳۷۹,۲۶۱	۲۵,۴۸۲,۲۴۶,۳۴۳	۴۰,۵۶۷,۵۰۵	۱۸۹,۵۴۵,۶۷۷,۹۰۰

* مبلغ پرداخت شده توسط صندوق ناشی از تسویه فیزیکی

** همچنین معادل مبلغ ۵۰,۰۶۷,۳۰۸,۲۸۷ ریال تسویه به صورت نقدی انجام گردیده است.

**ب) اوراق اختیار فروش تأمین مالی**

همچنین به منظور تأمین منابع نقد، این صندوق نسبت به عرضه اوراق مذکور با هدف تأمین مالی جمعاً به ارزش ۲۱ هزار و ۳۰۵ میلیارد ریال با نرخ سود روزشمار ۲۰ و ۲۱ درصد به شرح زیر اقدام نموده است.

نام	تاریخ انتشار	تعداد	جمع مبلغ تأمین مالی	سقف تعهدات صندوق بابت اعمال اوراق تبعی
اختیارف ت خودرو-۳۵۴۰-۰۰/۱۱/۰۶ (هخود۱۱)	۱۳۹۹/۱۱/۰۷	۲۸۳,۴۰۰,۰۰۰	۸۳۶,۰۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۳,۲۳۶,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت فملی-۱۴۴۰-۰۰/۱۱/۰۶ (هفملی ۱۱)	۱۳۹۹/۱۱/۰۷	۱۹۴,۰۰۰,۰۰۰	۲,۳۲۸,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۷۹۳,۶۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت فولاد-۱۰۵۸۰-۰۰/۱۱/۰۶ (هفولاد۱۱)	۱۳۹۹/۱۱/۰۷	۲۵۹,۳۵۴,۰۶۵	۲,۲۸۶,۶۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۷۴۳,۹۶۶,۰۱۲,۴۲۰
اختیارف ت همراه-۱۲۵۷۸-۰۱/۰۸/۲۱ (همراه ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۲۴,۵۸۳,۳۳۳	۲۵۰,۵۶۹,۵۴۸,۷۱۳	۳۰۹,۲۰۹,۱۶۶,۶۶۷
اختیارف ت فارس-۱۲۰۰۰-۰۱/۰۸/۰۹ (هفارس ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۵۵,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۳,۸۰۰,۰۷۸,۳۸۷	۶۶۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت وبصادر-۳۲۰۰-۰۱/۰۸/۱۰ (هصادر ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۵۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۳۴۲,۵۸۸,۷۱۵,۷۱۷	۱,۷۶۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت اخبر-۱۳۲۰۰-۰۱/۰۸/۱۸ (هخابر ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۱,۸۰۰,۹۸۸,۸۷۹	۶۶۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت تجارت-۳۶۰۰-۰۱/۰۸/۱۷ (هتجار ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۸۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۲۱۷,۱۲۹,۱۳۳,۰۹۶	۲,۹۱۶,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت سایپا-۲۷۵۰-۰۱/۰۸/۱۶ (هسایپا ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۲۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۲,۱۶۴,۱۲۲,۳۲۷	۶۶۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت خودرو-۲۸۵۰-۰۱/۰۸/۰۳ (هخود ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۲۰	۴۱۱,۰۰۰,۰۰۰	۸۹۶,۰۵۹,۴۳۴,۵۶۰	۱,۱۷۱,۳۵۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت شپنا-۱۴۵۰۰-۰۱/۰۸/۱۴ (هشپنا ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۱۸	۱۰۰,۵۰۰,۰۰۰	۱,۱۰۹,۴۱۹,۰۵۸,۳۹۶	۱,۴۵۷,۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت فملی-۱۶۰۷۰-۰۱/۰۸/۰۸ (هفملی ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۱۸	۲۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۹۴۳,۴۸۹,۱۸۵,۷۷۰	۳,۸۵۶,۸۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت شتران-۱۲۰۰۰-۰۱/۰۸/۱۱ (هتران ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۱۸	۲۱۳,۵۰۰,۰۰۰	۱,۹۵۲,۷۵۹,۰۲۴,۵۲۷	۲,۵۶۲,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
اختیارف ت فولاد-۱۱۹۱۲-۰۱/۰۸/۰۷ (هفولاد ۱۰۸)	۱۴۰۰/۰۲/۱۸	۳۹۹,۵۴۵,۴۵۲	۳,۶۳۴,۹۸۷,۰۶۵,۹۴۲	۴,۷۵۹,۳۸۵,۴۲۵,۴۲۱
جمع	-	۳,۸۳۰,۸۸۲,۸۵۰	۲۱,۳۰۵,۴۵۶,۳۵۶,۳۱۴	۲۷,۳۱۲,۷۹۶,۶۰۴,۵۰۸



۳-۸- فرآیند دریافت سود سهام

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

سال	مطالبات سود از ادوار گذشته	مبلغ دریافت شده از مطالبات ادوار گذشته	میزان وصول مطالبات (درصد)	سود سهام تعلق گرفته طی دوره	مبلغ دریافت شده از مطالبات دوره جدید	میزان وصول مطالبات (درصد)
منتهی به ۱۳۹۶/۰۴/۳۱	۴۶۸,۹۴۰,۴۲۳,۸۶۵*	۳۱۳,۵۴۲,۹۴۹,۱۹۱	۶۷٪	۴۲۵,۵۸۲,۳۶۱,۴۶۸*	۳۹,۰۶۹,۴۷۵,۷۵۵	۹٪**
منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۳۱	۵۴۱,۹۱۰,۳۶۰,۳۸۷	۵۳۳,۹۰۶,۳۰۳,۵۴۷	۹۹٪	۹۴۱,۲۳۹,۴۸۴,۱۳۵	۳۲۷,۵۲۷,۷۱۲,۹۵۳	۳۵٪**
منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱	۶۲۱,۷۱۵,۸۲۸,۰۲۲	۶۰۰,۳۴۳,۷۴۸,۴۵۱	۹۷٪	۱,۱۶۷,۲۲۰,۷۶۱,۶۳۳	۲۷۶,۳۱۲,۷۵۳,۳۲۳	۲۴٪**
منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱	۹۱۲,۲۸۰,۰۸۷,۸۸۱	۸۰۷,۵۲۷,۸۹۵,۹۸۳	۸۹٪	۴۱۲,۵۸۰,۴۶۰,۱۸۶	۲۱۵,۰۸۹,۹۱۲,۹۸۴	۵۲٪**
منتهی به ۱۴۰۰/۰۴/۳۱	۳۰۲,۵۴۹,۳۹۱,۴۷۴	۲۵۶,۰۳۷,۶۴۹,۸۹۶	۸۵٪	۳,۵۶۱,۵۱۱,۱۱۰,۵۱۲	۵۸۵,۲۵۲,۰۳۹,۲۹۴	۱۶٪**

* 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.

۳-۹- منابع تحت مدیریت صندوق

تاریخ	خالص ارزش فروش دارایی‌ها	NAV
تحویل صندوق به هیأت مدیره مورخ ۱۳۹۵/۱۰/۳۰	۱۰,۵۴۱,۹۵۳,۰۷۷,۷۴۴	۱,۰۰۱,۱۴۷
۱۳۹۹/۰۴/۳۱	۸۶,۶۴۲,۲۸۳,۵۳۳,۵۳۴	۶,۸۶۱,۳۴۸
۱۴۰۰/۰۴/۳۱	۱۲۵,۹۹۸,۷۴۶,۳۱۳,۶۱۱	۵,۲۵۱,۲۴۱



۴ - خلاصه‌ای از عملکرد صندوق در ۸ سال اخیر

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	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۸	منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۹	منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۰
تعداد روزهای معاملاتی	۲۴۳	۲۴۱	۲۴۵	۲۳۹	۲۳۹	۲۳۹	۲۳۸	۲۴۲
تعداد روزهای فعالیت صندوق	۲۰۲	۲۲۷	۲۲۵	۲۰۲	۲۳۹	۲۴۵	۲۳۸	۲۴۲
نسبت فعالیت صندوق از روزهای کاری	۸۲٪	۹۴٪	۹۲٪	۸۵٪	۱۰۰٪	۱۰۰٪	۱۰۰٪	۱۰۰٪
تعداد نمادهایی که صندوق در آن‌ها فعال بوده	۹۲	۱۴۰	۱۳۷	۱۶۳	۲۵۴	۱۹۴	۲۶۰	۳۳۹
نسبت معاملات خرید	۷۴٪	۵۴٪	۵۹٪	۵۵٪	۵۱٪	۴۵٪	۴۱٪	۵۹٪
نسبت معاملات فروش	۲۶٪	۴۶٪	۴۱٪	۴۵٪	۴۹٪	۵۵٪	۵۹٪	۴۱٪
ارزش کل معاملات (میلیارد ریال)	۹ هزار	۳۶ هزار	۱۹ هزار	۱۴ هزار	۳۱ هزار	۷۲ هزار	۱۱۹ هزار	۴۱۹ هزار
تعداد کارگزاری‌های همراه	۲۱	۳۳	۱۹	۲۲	۳۲	۲۳	۱۴	۹
ناو آماری صندوق در آخرین روز سال مالی (ریال)	۱,۰۵۹,۱۵۶	۹۱۹,۲۸۹	۹۳۵,۷۶۴	۹۵۴,۵۷۳	۱,۲۴۵,۸۲۹	۲,۲۵۶,۸۰۹	۶,۸۶۱,۳۴۸	۵,۲۵۱,۲۴۱