



صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک توسعه بازار سرمایه

گزارش عملکرد سالانه

منتهی به ۳۱ فروردین 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 تا تاریخ ۹۷/۰۱/۳۱
۶	۱-۳- بازده صندوق
۹	۲-۳- معاملات
۱۲	۳-۳- اوراق اختیار

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:	۱۳۹۷/۰۱/۳۱
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 ۱۱,۴۲۰,۹۹۱ میلیون ریال افزایش یافته است. تغییرات مذکور به شرح جدول زیر ارائه شده است.

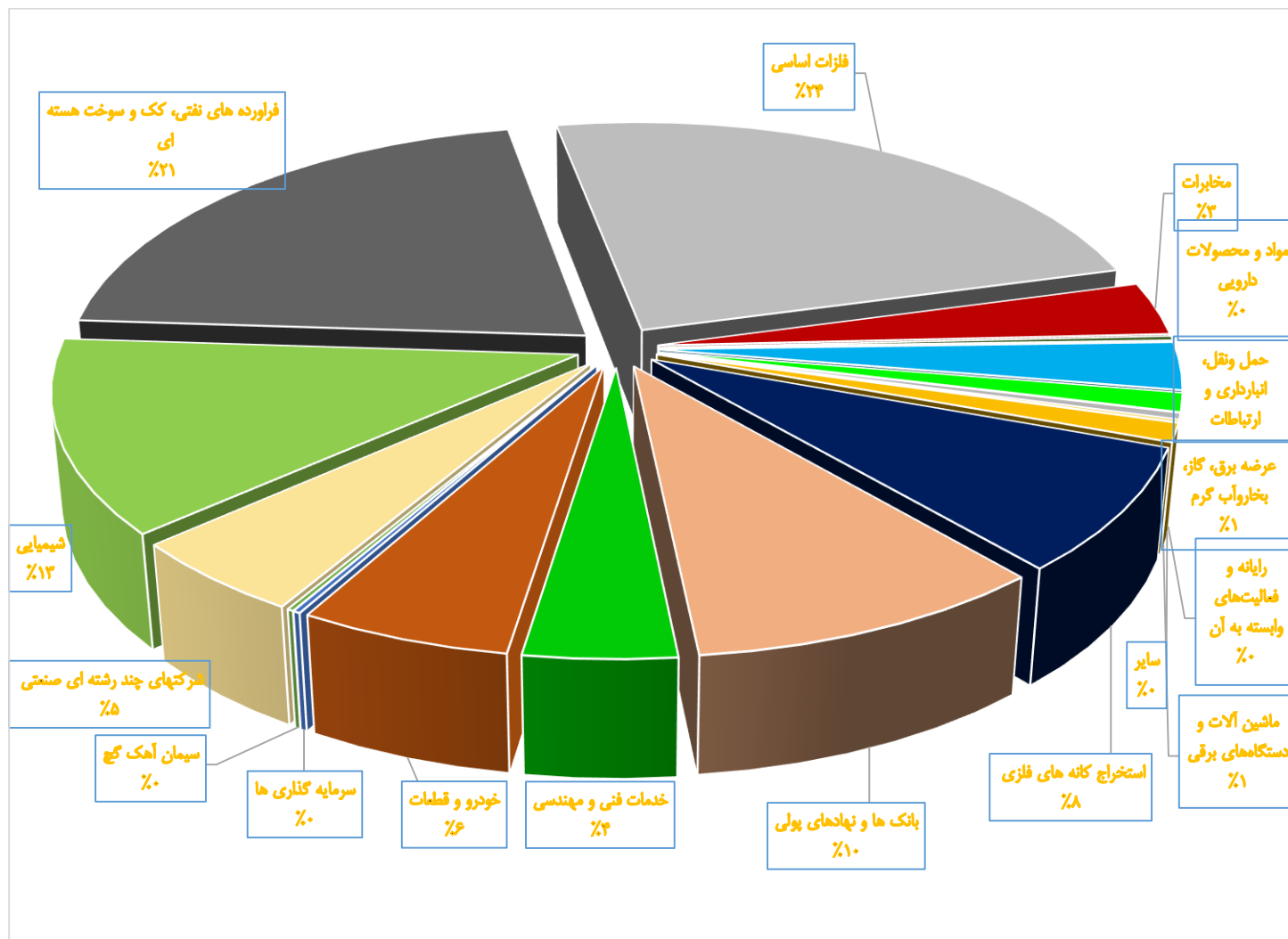
ردیف	نام شرکت	واحدهای صدور در زمان تأسیس	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۵/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۶/۰۴/۳۱	واحدهای سرمایه گذاری در ۹۷/۰۱/۳۱	درصد تغییر ۹ ماهه سال مالی منتهی به ۹۷/۰۴/۳۱
۱	بانک تجارت	۰	۱,۹۱۰,۱۸۶	۱,۹۱۰,۱۸۶	۲,۰۰۵,۴۳۲	۴.۹۹٪
۲	بانک ملی	۰	۱,۵۰۴,۵۵۵	۱,۶۰۹,۳۸۶	۱,۷۰۵,۹۷۴	۶.۰۰٪
۳	بانک صادرات	۰	۱,۴۴۰,۱۲۸	۱,۵۴۴,۶۰۵	۱,۵۴۴,۶۰۵	۰.۰۰٪
۴	گروه مالی ملت	۰	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۴۳۹,۱۸۳	۱,۵۳۵,۳۶۰	۶.۶۸٪
۵	بانک سپه	۰	۸۳۲,۳۹۹	۹۷۸,۵۰۰	۱,۰۷۵,۰۸۸	۹.۸۷٪
۶	بانک پاسارگاد	۰	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۶۵۰,۲۵۶	۰.۰۰٪
۷	بیمه مرکزی جمهوری اسلامی ایران	۰	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۶۰۵,۱۱۹	۰.۰۰٪
۸	بیمه ایران	۰	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۵۲۹,۴۰۵	۰.۰۰٪
۹	گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۰	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۴۳۴,۴۲۴	۰.۰۰٪
۱۰	گروه مالی بانک پارسیان	۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۱۹۸,۳۷۰	۰.۰۰٪
۱۱	بانک اقتصاد نوین	۰	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۱۹۵,۷۷۳	۰.۰۰٪
۱۲	صندوق سرمایه گذاری یکم کارگزاری بانک کشاورزی	۰	۰	۰	۱۹۴,۱۷۷	جدید
۱۳	بانک گردشگری	۰	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۱۸۷,۴۹۹	۰.۰۰٪
۱۴	بانک صنعت و معدن	۰	۱۱۵,۳۳۹	۱۱۵,۳۳۹	۱۱۵,۳۳۹	۰.۰۰٪
۱۵	تامین سرمایه آرمان	۰	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۵۵,۲۳۳	۰.۰۰٪
۱۶	شرکت سرمایه گذاری غدیر	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۱۷	شرکت سرمایه گذاری فرهنگیان	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۱۸	شرکت صنعتی و معدنی توسعه ملی	۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۴۵,۸۸۰	۰.۰۰٪
۱۹	شرکت سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۰	۴۴,۸۶۳	۴۴,۸۶۳	۴۴,۴۶۹	۰.۰۰٪
۲۰	صندوق عشایر	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۱	سرمایه گذاری توسعه معادن و فلزات	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۲	بانک سامان	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۳	شرکت گروه سرمایه گذاری سایپا	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۴	گروه سرمایه گذاری تدبیر	۲۵,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۵	بانک کشاورزی	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۶	شرکت تامین سرمایه امین	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
۲۷	شرکت سرمایه گذاری پردیس	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	۰.۰۰٪

۲-۲- ترکیب پرتفوی صندوق در تاریخ ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

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 ۹۷/۰۱/۳۱ به ۲۱ صنعت تغییر یافته است.

ردیف	صنعت	سهام صنایع در سبد سهام صندوق (درصد)
۱	فلزات اساسی	۲۳,۳۵٪
۲	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲۰,۷۲٪
۳	محصولات شیمیایی	۱۲,۳۹٪
۴	بانکها و موسسات اعتباری	۹,۵۷٪
۵	استخراج کانه های فلزی	۷,۹۸٪
۶	خودرو و ساخت قطعات	۵,۵۹٪
۷	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴,۸۸٪
۸	خدمات فنی و مهندسی	۴,۰۳٪
۹	مخابرات	۳,۴۲٪
۱۰	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۳,۰۳٪
۱۱	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱,۲٪
۱۲	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۱,۱۷٪
۱۳	رایانه و فعالیتهای وابسته به آن	۰,۳۹٪
۱۴	مواد و محصولات دارویی	۰,۲۸٪
۱۵	سرمایه گذاری ها	۰,۱۹٪
۱۶	سیمان، آهک و گچ	۰,۱۷٪
۱۷	خدمات ارزش افزوده	۰,۰۷٪
۱۸	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۰,۰۴٪
۱۹	ماشین آلات و تجهیزات	۰,۰۱٪
۲۰	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۰,۰۱٪
۲۱	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۰,۰۰٪

سهام صنایع در سبد سهام صندوق



۳- بررسی عملکرد صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

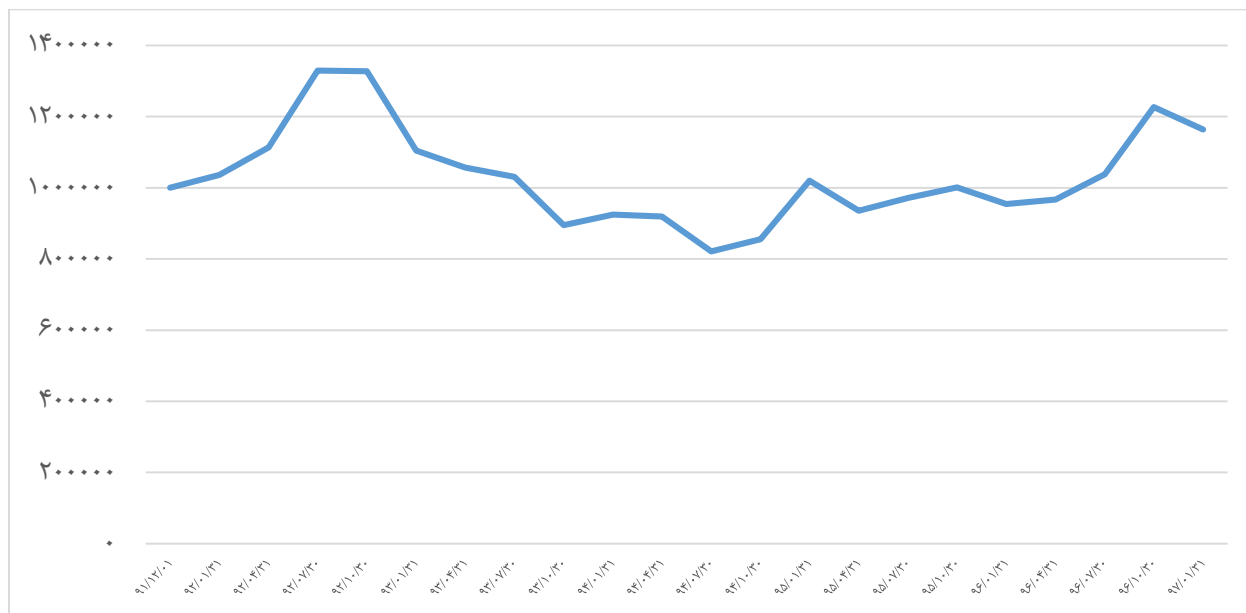
۳-۱- بازده صندوق

بازده هفتگی، ماهانه، سه ماهه و شش ماهه صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ به شرح زیر است.

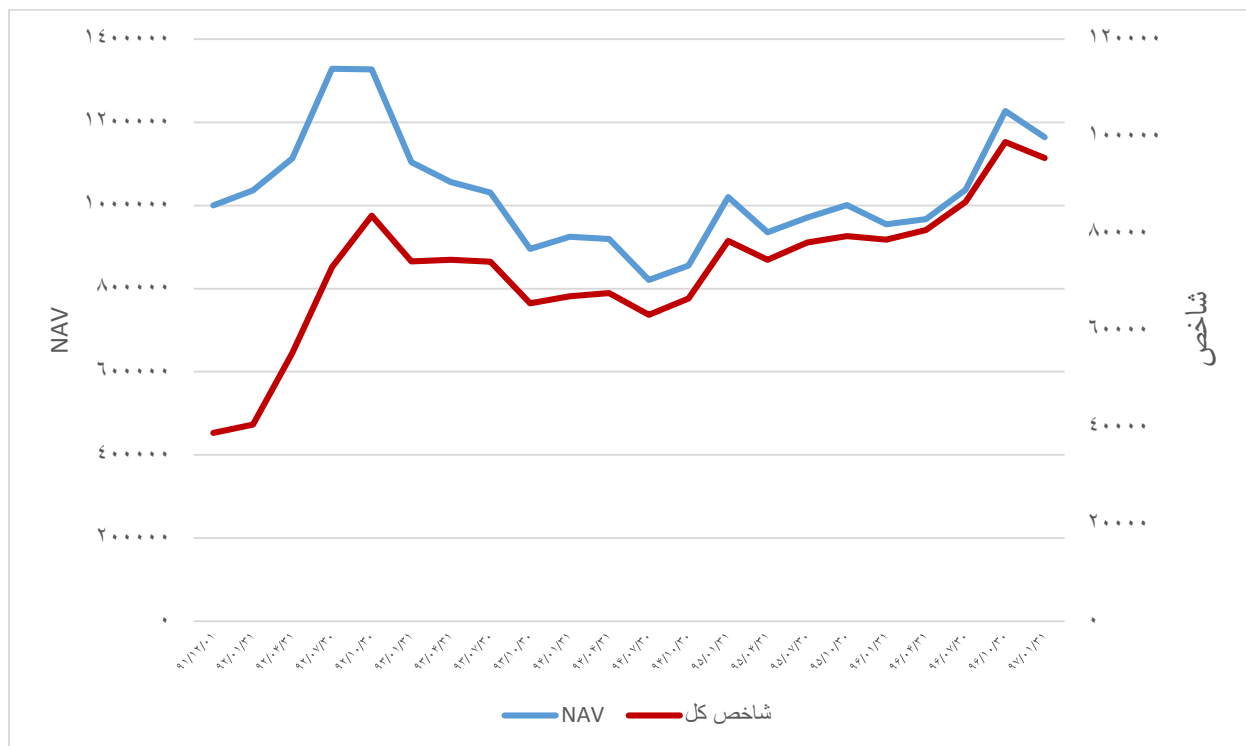
بازده بازار	بازده صندوق	از تاریخ	توضیحات
-۰.۷۳۹٪	-۰.۶۹۹٪	۱۳۹۷/۰۱/۲۴	۷ روز گذشته
-۰.۷۹۶٪	-۰.۴۷۹٪	۱۳۹۷/۰۱/۰۱	۳۰ روز گذشته
-۳.۳۳۳٪	-۵.۱۲۵٪	۱۳۹۶/۱۰/۳۰	۹۰ روز گذشته
٪۱۰.۴۵۸	٪۱۲.۱۷۷	۱۳۹۶/۰۷/۳۰	۱۸۰ روز گذشته

همچنین روند تغییرات خالص ارزش روز هر یک از واحدهای سرمایه‌گذاری از ابتدای فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ به شرح نمودار زیر است.

ارزش خالص هر واحد سرمایه‌گذاری



روند تغییرات ارزش خالص واحد های سرمایه گذاری 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

۳-۲- معاملات

خرید و فروش ماهانه صندوق در بازار سرمایه ایران به شرح مندرج در جدول زیر است.

روند معاملات صندوق (ریال)

فروش	خرید	تاریخ
۴۲۰,۱۸۵,۹۵۵,۱۰۴	۵۹۰,۰۶۵,۴۷۵,۸۰۱	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱
۵۰۰,۰۱۹,۳۱۹,۳۷۴	۲۸۸,۴۸۹,۸۸۲,۲۱۹	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱
۶۳۳,۹۵۷,۴۱۶,۲۰۰	۷۷۱,۵۵۵,۴۳۴,۲۴۱	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۷/۳۰
۸۳۹,۱۱۸,۹۰۵,۷۸۷	۵۸۵,۷۸۴,۲۲۲,۲۳۵	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰
۶۱۲,۴۲۰,۴۴۸,۲۶۹	۴۲۳,۸۲۷,۷۰۵,۲۱۷	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۳۰
۱,۶۰۵,۳۳۴,۶۴۸,۲۳۱	۱,۹۵۹,۵۵۱,۱۷۷,۳۷۰	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰
۶۷۰,۱۳۵,۲۸۳,۲۸۳	۱,۳۸۳,۶۲۶,۷۸۰,۶۳۰	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰
۵۵۵,۵۵۳,۹۲۴,۹۶۴	۱,۴۲۲,۹۲۵,۴۲۷,۰۷۷	ماهانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹
۶۹۳,۶۹۴,۳۵۱,۴۷۶	۹۶۱,۴۳۷,۱۱۹,۷۰۴	ماهانه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱
۶,۵۳۰,۴۲۰,۲۵۲,۷۸۸	۸,۳۸۷,۲۶۳,۲۲۴,۴۹۴	مجموع

وضعیت معاملاتی صندوق در شرکت‌های کارگزاری

ردیف	عنوان کارگزار	مجموع
۱	ایستگاه معاملاتی صندوق	۳۹.۱۰٪
۲	شرکت کارگزاری بانک تجارت	۱۵.۷۳٪
۳	شرکت کارگزاری بانک ملی ایران	۱۱.۴۷٪
۴	شرکت کارگزاری بانک سپه	۷.۶۴٪
۵	کارگزاری بانک صادرات	۶.۷۰٪
۶	شرکت کارگزاری بانک رفاه کارگران	۵.۱۳٪
۷	شرکت کارگزاری فارابی	۳.۴۷٪
۸	شرکت کارگزاری بانک ملت	۳.۲۲٪
۹	شرکت کارگزاری آگاه	۱.۹۸٪
۱۰	شرکت کارگزاری بورس بیمه ایران	۱.۳۴٪
۱۱	شرکت کارگزاری بانک پاسارگاد	۰.۸۱٪
۱۲	شرکت کارگزاری بانک اقتصاد نوین	۰.۴۹٪
۱۳	کارگزاری تامین سرمایه نوین	۰.۴۶٪
۱۴	کارگزاری نهایت نگر	۰.۳۹٪
۱۵	شرکت کارگزاری آپادانا	۰.۳۶٪
۱۶	شرکت کارگزاری بانک سامان	۰.۲۶٪
۱۷	کارگزاری حافظ	۰.۲۵٪
۱۸	صبا تامین	۰.۲۲٪
۱۹	شرکت کارگزاری بانک صنعت و معدن	۰.۲۰٪
۲۰	کارگزاری بانک پارسیان	۰.۱۷٪
۲۱	سهام گستران شرق	۰.۱۶٪
۲۲	شرکت کارگزاری آتل	۰.۱۶٪
۲۳	شرکت کارگزاری بانک مسکن	۰.۰۸٪
۲۴	شرکت کارگزاری آراد ایرانیان	۰.۰۷٪
۲۵	شرکت کارگزاری سهام پویا	۰.۰۷٪
۲۶	کارگزاری عمران فارس	۰.۰۴٪
۲۷	شرکت کارگزاری بانک توسعه صادرات	۰.۰۳٪
	مجموع	٪۱۰۰

در مجموع معاملات انجام شده، ۱۰ نماد با بیشترین ارزش خرید و فروش از ۱۳۹۶/۰۵/۰۱ لغایت ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ به شرح جدول زیر می باشد.

ده 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	نام نماد	رتبه	ارزش معاملات خرید	نام نماد
۱	۵۴۷,۱۹۴,۴۰۰,۰۹۵	فولاد مبارکه اصفهان	۱	۸۵۱,۲۷۲,۵۴۶,۳۲۸	فولاد مبارکه اصفهان
۸	۴۶۶,۱۳۲,۸۴۹,۳۱۲	پتروشیمی تأمین	۲	۶۷۹,۳۱۷,۵۸۹,۵۶۳	ملی صنایع مس ایران
۹	۳۷۹,۷۸۲,۶۰۰,۸۰۶	ایران خودرو	۳	۵۶۴,۵۴۸,۳۱۸,۰۶۸	پالایش نفت اصفهان
۲	۳۴۳,۴۹۳,۵۸۵,۱۶۳	ملی صنایع مس ایران	۴	۵۱۹,۹۹۷,۸۳۵,۳۷۱	پالایش نفت تهران
۶	۳۰۳,۲۱۱,۸۵۸,۸۲۳	گسترش نفت و گاز پارسیان	۵	۳۸۴,۲۴۶,۷۱۷,۷۵۵	معدنی و صنعتی گل گهر
۵	۲۸۸,۸۰۷,۶۶۰,۸۳۸	معدنی و صنعتی گل گهر	۶	۳۲۲,۲۳۹,۱۳۸,۷۶۸	گسترش نفت و گاز پارسیان
-	۲۸۰,۷۰۸,۴۷۷,۱۰۷	صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۷	۳۰۳,۱۶۶,۵۴۹,۰۹۹	پالایش نفت بندرعباس
۷	۲۷۵,۴۸۹,۶۵۹,۲۴۵	پالایش نفت بندرعباس	۸	۲۷۴,۲۰۹,۲۴۵,۷۹۹	پتروشیمی تأمین
۳	۲۶۹,۶۶۳,۱۵۴,۲۴۶	پالایش نفت اصفهان	۹	۲۵۸,۲۱۰,۳۰۳,۷۱۵	ایران خودرو
۴	۲۲۶,۱۴۹,۰۹۹,۴۲۶	پالایش نفت تهران	۱۰	۲۳۸,۴۰۶,۹۶۰,۵۹۱	فولاد خوزستان

همچنین ده نماد برتر با بیشترین ارزش معاملات (خرید و فروش) به شرح جدول زیر می باشد.

ده نماد با بیشترین ارزش معاملات در صندوق

ردیف	نام نماد
۱	فولاد مبارکه اصفهان
۲	ملی صنایع مس ایران
۳	پالایش نفت اصفهان
۴	پالایش نفت تهران
۵	س. نفت و گاز و پتروشیمی تأمین
۶	معدنی و صنعتی گل گهر
۷	ایران خودرو
۸	گسترش نفت و گاز پارسیان
۹	پالایش نفت بندرعباس
۱۰	صنایع پتروشیمی خلیج فارس

۳-۳- اوراق اختیار

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

دوره انتشار	درآمد ناشی از فروش قرارداد	تاریخ سررسید	تعداد قرارداد فروش	موقعیت	نوع اختیار	نام نماد
			رفته قبل از ۹۶/۰۵/۰۱			
دوره سوم	*	۹۶/۰۷/۰۵	*	فروش	خرید	اخابر
	۲۳,۰۰۰,۰۰۰		۱۰			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۷/۱۲	۵۴۰	فروش	خرید	پارسان
	*		*			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۷/۲۳	۱۰	فروش	خرید	شپنا
	۱۵۶,۰۰۰,۰۰۰		۴۰			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۷/۲۶	۲۹۰	فروش	خرید	کروی
	۱,۶۰۷,۳۰۰,۰۰۰		۲۵۰			
	*	۹۶/۰۸/۱۰	*	فروش	فروش	خودرو
	۴۰,۰۰۰,۰۰۰		۱۰			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۸/۱۷	۱,۰۳۰	فروش	خرید	فملی
	۲,۴۴۹,۸۶۰,۰۰۰		۲۵۲			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۸/۲۴	۱۰۴۳	فروش	خرید	فولاد
	۴,۷۷۴,۳۳۰,۰۰۰		۹۳۳			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۸/۳۰	۱۲۰	فروش	خرید	کگل
	۳,۱۳۵,۹۱۰,۰۰۰		۷۱۸			
	در صورت های مالی دوره قبل لحاظ گردیده است.	۹۶/۰۸/۳۰	*	فروش	فروش	
	۲۰۰,۰۰۰		۴			

نام نماد	نوع اختیار	موقعیت	تعداد قرارداد فروش رفته	تاریخ سررسید	درآمد ناشی از فروش قرارداد	دوره انتشار
فملی	خرید	فروش	۱۱۷	۹۶/۱۱/۱۱	۶۱,۶۳۰,۰۰۰	دوره چهارم
فولاد	خرید	فروش	۵۵	۹۶/۱۱/۲۵	۱۲۰,۴۰۰,۰۰۰	
شبندر	خرید	فروش	۲۰۰	۹۷/۰۲/۱۸	۲,۴۰۰,۰۰۰	دوره پنجم
فملی	خرید	فروش	۱۵۵۰	۹۷/۰۲/۲۳	۱۱۲,۶۵۰,۰۰۰	
کگل	خرید	فروش	۴۰۸۰	۹۷/۰۲/۲۶	۹۴۶,۸۰۰,۰۰۰	
فولاد	خرید	فروش	۴۰۰۰	۹۷/۰۲/۳۱	۵۲۴,۳۸۰,۰۰۰	
مجموع قراردادها			۱۵,۲۵۲	درآمد ناشی از فروش قرارداد	۱۳,۹۵۴,۸۶۰,۰۰۰	

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

نام نماد	نوع اختیار	تعداد قرارداد اعمال شده	تاریخ سررسید	درآمد ناشی از فروش سهم به قیمت اعمال برای صندوق	دوره اختیار
اخابر	خرید	۱۰	۹۶/۰۷/۰۵	۱۸۰,۰۰۰,۰۰۰	اختیارهای منتشره دوره سوم
پارسان	خرید	۳۸۰	۹۶/۰۷/۱۲	۶,۷۴۰,۰۰۰,۰۰۰	
شپنا	خرید	۵۰	۹۶/۰۷/۲۳	۱,۴۱۵,۰۰۰,۰۰۰	
کروی	خرید	۵۲۰	۹۶/۰۷/۲۶	۱۰,۸۸۰,۰۰۰,۰۰۰	
خودرو	فروش	۱۰	۹۶/۰۸/۱۰	-۳۱۸,۵۰۰,۰۰۰	
فملی	خرید	۱,۱۸۷	۹۶/۰۸/۱۷	۱۶,۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	
فولاد	خرید	۲,۵۶۳	۹۶/۰۸/۲۴	۳۸,۱۳۸,۰۰۰,۰۰۰	
کگل	خرید	۷۳۸	۹۶/۰۸/۳۰	۱۵,۶۰۸,۰۰۰,۰۰۰	
مجموع قراردادهای اعمال شده		۵۴۵۸	مجموع درآمد فروش سهم به قیمت اعمال	۸۸,۸۹۲,۵۰۰,۰۰۰	