

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری مشترک گنجینه مهر

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۶/۳۱



شرکت کارگزاری مهر اقتصاد ایران

محمد رضا نادریان

سعید ذوالفقاری

متولی صندوق (موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطمی)

مدیر صندوق (شرکت کارگزاری مهر اقتصاد ایران)

مهر ۱۳۹۷

فهرست مطالب

۱. تاریخچه فعالیت..... ۱
- ۱-۱- ارکان صندوق..... ۱
- ۱-۲- نحوه اطلاع رسانی و گزارش دهی..... ۱
۲. اهداف صندوق..... ۲
۳. دارایی های مجاز صندوق..... ۲
۴. ریسک سرمایه گذاری در صندوق..... ۳
۵. انواع واحدهای سرمایه گذاری و حقوق دارندگان آنها..... ۴
۶. بررسی وضعیت واحدهای سرمایه گذاری عادی و ممتاز صندوق..... ۵
۷. ترکیب سرمایه گذاران صندوق سرمایه گذاری مشترک گنجینه مهر..... ۵
- ۷-۱- دارندگان واحدهای ممتاز صندوق..... ۵
- ۷-۲- دارندگان واحدهای عادی صندوق..... ۶
۸. کارمزد ارکان..... ۶
- ۸-۱- هزینه کارمزد ارکان..... ۷
۱۰. جدول سود و زیان تحقق نیافته..... ۹
- ۱۰-۱- سود تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت..... ۹
- ۱۰-۲- جدول سود و زیان حاصل از فروش..... ۹
۱۱. سرمایه گذاری در سهام..... ۱۱
۱۲. مروری بر وضعیت صندوق..... ۱۱

۱. تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری مشترک گنجینه مهر که صندوقی با سرمایه باز در اندازه کوچک محسوب می شود، در تاریخ ۱۳۹۲/۱۱/۰۱ تحت شماره ۱۱۲۲۲ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم خرید سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس و اوراق بهادار با درآمد ثابت سرمایه گذاری می نماید.

۱-۱- ارکان صندوق

ارکان صندوق در تاریخ ۱۳۹۷/۰۶/۳۱ به شرح زیر می باشد:

ردیف	سمت	نام	شماره ثبت	محل ثبت	تاریخ تاسیس	نشانی
۱	مدیر صندوق	شرکت کارگزاری مهر اقتصاد ایرانیان	۱۶۲۵۱۴	تهران	۱۳۷۹/۰۲/۱۴	تهران - خیابان مطهری - خیابان میرزای شیرازی - کوچه هفدهم - پلاک ۱۷
۲	ضامن نقدشوندگی	شرکت گروه مالی مهر اقتصاد	۱۰۳۲۲۲	تهران	۱۳۷۷/۰۶/۲۳	تهران - خیابان ولیعصر - بالاتر از نیایش - کوچه مهیار، پلاک ۵۷
۳	متولی	موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر	۲۳۹۱	تهران	۱۳۶۱/۰۷/۰۱	تهران - خیابان وصال شیرازی - خیابان بزرگمهر غربی - کوی اسکو - پلاک ۱۴ - طبقه چهارم
۴	مجمع صندوق	دارندگان واحدهای ممتاز (بند ۱ و ۲)	-	-	-	-
۵	حسابرس	موسسه حسابرسی شاخص اندیشان	۱۵۵۶۶	تهران	۱۳۸۲/۰۴/۲۹	تهران - خیابان نفت شمالی - نبش خیابان نهم - پلاک ۳۹ - واحد ۲۲

۱-۲- نحوه اطلاع رسانی و گزارش دهی

کلیه اطلاعات مالی و گزارشات مربوط به عملکرد (مطابق ماده ۵۴ اساسنامه) در تارنمای صندوق به آدرس WWW.GANJINEHFUND.MEIBOURSE.COM منتشر می شود. همچنین روزنامه کثیرالانتشار صندوق، روزنامه جوان می باشد.

۲. اهداف صندوق

هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است؛ با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد.

با توجه به مشتریان مجموعه و چشم انداز موجود در بازار سرمایه و اقتصاد کشور جهت کاهش ریسک صندوق و ورود منابع جدید در نیمه دوم سال ۱۳۹۵ ماهیت صندوق از سهامی به مختلط تغییر یافت.

۳. دارایی های مجاز صندوق

صندوق فقط می تواند در دارایی های ریالی داخل کشور سرمایه گذاری کند و سرمایه گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز می باشد. صندوق در دارایی هایی به شرح زیر سرمایه گذاری می کند:

الف: سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

ب: حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

ج: اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهاداری که تمامی شرایط زیر را داشته باشد:

۱ - مجوز انتشار آنها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛

۲ - سود حداقلی برای آنها تضمین و مشخص شده باشد؛

۳ - به تشخیص مدیر، یکی از مؤسسات معتبر بازخرید آنها را قبل از سررسید تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

د: گواهی های سپرده منتشره توسط بانک ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

ه: هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

و: این صندوق از نوع صندوق های سرمایه گذاری در سهام است و اکثر وجوه خود را به شرح جدول زیر صرف خرید سهام و حق تقدم خرید سهام می کند. همچنین در طول عمر صندوق حد نصاب های زیر بر اساس ارزش روز دارایی های صندوق رعایت می شود:

معرفی درصد سرمایه گذاری معین شده در امید نامه صندوق

شرح	حد نصاب
سهم، حق تقدم سهم و قرارداد اختیار معامله سهم پذیرفته شده در بورس تهران یا بازار اول و دوم فرابورس ایران و واحد های سرمایه گذاری "صندوق های سرمایه گذاری غیر از اوراق بهادار" ثبت شده نزد سازمان.	حداقل ۴۰٪ و حداکثر ۶۰٪ از دارایی های صندوق
۱-۱- سهم و حق تقدم منتشره از طرف یک ناشر و قرارداد اختیار معامله همان سهم	حداکثر ۲۰٪ از دارایی های صندوق که به بند ۱ اختصاص داده شده اند
۱-۲- سهم و حق تقدم سهم و قرارداد اختیار معامله سهم طبقه بندی شده در یک صنعت	حداکثر ۳۰٪ از دارایی های صندوق که به بند ۱ اختصاص داده شده اند
۱-۳- سهم و حق تقدم منتشر شده از طرف یک ناشر	حداکثر ۵٪ از کل سهم و حق تقدم منتشره ناشر
۱-۴- واحدهای سرمایه گذاری "صندوق های سرمایه گذاری غیر از اوراق بهادار"	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق و تا سقف ۳۰٪ از تعداد واحدهای صندوق سرمایه پذیر که نزد سرمایه گذاران می باشد
۱-۵- اخذ موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله سهم	حداکثر ۵٪ از ارزش روز سهم و حق تقدم سهم صندوق
۱-۶- اخذ موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله خرید سهم	حداکثر به تعداد سهم پایه موجود در پرتفوی مجاز سرمایه گذاری صندوق در سهم
۲- اوراق بهادار با درآمد ثابت، گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی	حداقل ۴۰٪ و حداکثر ۶۰٪ از دارایی های صندوق
۲-۱- اوراق بهادار منتشره از طرف یک ناشر	حداکثر ۴۰٪ از دارایی های صندوق
۲-۲- اوراق بهادار تضمین شده توسط یک ضامن	حداکثر ۳۰٪ از دارایی های صندوق
۲-۳- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی	حداکثر ۲۵٪ از کل دارایی های صندوق
۳- سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده نزد یکی از بورس ها	حداکثر ۵٪ از دارایی های صندوق

این صندوق برای دست یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط بورس اوراق بهادار معیار (TEDPIX) تهران طراحی شده است. تغییرات شاخص قیمت و بازدهی نقدی محاسبه نرخ متوسط بازدهی بورس تهران است.

۴. ریسک سرمایه گذاری در صندوق

الف- تمهیدات لازم به عمل آمده است تا سرمایه گذاری در صندوق سودآور باشد، ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه گذاری های صندوق همواره وجود دارد. بنابراین سرمایه گذاران باید به همه ی ریسک های زیر توجه ویژه مبذول دارند.

ب- ریسک کاهش ارزش دارایی های صندوق: صندوق عمدتاً در سهام شرکت ها سرمایه گذاری می کند. ارزش سهام شرکت ها در بازار تابع عوامل متعددی از جمله وضعیت سیاسی، اقتصادی، اجتماعی صنعت موضوع فعالیت و وضعیت خاص شرکت است. قیمت سهام در بازار می تواند کاهش یابد و در اثر آن صندوق و سرمایه گذاران آن متضرر شوند.

ج- ریسک نکول اوراق مشارکت: اوراق مشارکت شرکت ها بخشی از دارایی های صندوق را تشکیل می دهد. گرچه صندوق در اوراق مشارکتی سرمایه گذاری می کند که سود و اصل آن توسط یک موسسه معتبر تضمین شده است، ولی این احتمال وجود دارد که ناشر و ضامن به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق مشارکت مذکور، عمل ننمایند.

ت- ریسک نوسان بازده بدون ریسک: در صورتی که نرخ سود بدون ریسک (نظیر سود علی الحساب اوراق مشارکت دولتی) در انتشارهای بعدی توسط ناشر افزایش یابد، قیمت اوراق مشارکتی که سود حداقلی برای آن ها تضمین شده است در بازار کاهش می یابد. اگر صندوق در این نوع اوراق مشارکت سرمایه گذاری کرده باشد، با افزایش نرخ اوراق بدون ریسک، صندوق ممکن است متضرر شود.

۵. انواع واحدهای سرمایه گذاری و حقوق دارندگان آنها

الف- در ازای سرمایه گذاری در صندوق، گواهی سرمایه گذاری صادر می شود. در گواهی سرمایه گذاری تعداد واحدهای سرمایه گذاری هر سرمایه گذار درج می شود. واحدهای سرمایه گذاری به دو نوع ممتاز و عادی تقسیم می شود. حقوق دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز و عادی از همه لحاظ با یکدیگر یکسان است، به جز آنچه در اساسنامه مستثنی شده است.

ب- دارنده واحدهای سرمایه گذاری ممتاز مادامی که حداقل تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز مذکور در اساسنامه را در اختیار داشته باشد، دارای حق رأی است و می تواند در مجمع صندوق، از حق رأی خود استفاده کند. اختیارات مجمع صندوق در اساسنامه و خلاصه آن در بند ۶-۲ امیدنامه توضیح داده شده است. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نمی توانند با درخواست ابطال واحدهای سرمایه گذاری خود، سهم خود را از دارایی های صندوق مطالبه کنند، ولی می توانند واحدهای سرمایه گذاری ممتاز خود را به دیگران واگذار کنند.

ج- دارنده واحدهای سرمایه گذاری عادی دارای حق رأی نیست و نمی تواند در مجامع صندوق شرکت نماید، بلکه می تواند مطابق اساسنامه درخواست ابطال واحدهای سرمایه گذاری را ارائه دهد و سهم خود را از دارایی های صندوق پس از کسر بدهی ها و سایر هزینه ها (معادل خالص ارزش روز واحدهای سرمایه گذاری خود پس از کسر کارمزد ابطال) دریافت کند. در صورتی که مجمع صندوق، رأی به تغییر اساسنامه یا امیدنامه (به استثنای تغییر مدیر، مدیر ثبت، متولی، ضامن و حسابرس) دهد، این تغییرات یک ماه بعد از اعلام، اعمال می شود تا دارندگان واحدهای سرمایه گذاری عادی، فرصت کافی برای تصمیم گیری برای

ادامه سرمایه گذاری یا ابطال واحدهای سرمایه گذاری خود داشته باشند. طی مدت ۳۰ روز یاد شده اساسنامه و امیدنامه قبلی کماکان حاکم خواهد بود.

د- واحدهای سرمایه گذاری ممتاز صندوق به میزان ۱ میلیارد ریال شامل تعداد ۱۰۰۰ واحد سرمایه گذاری ممتاز در ابتدای تأسیس صندوق و قبل از پذیره نویسی اولیه واحدهای سرمایه گذاری عادی صندوق تماماً به صورت نقد توسط مؤسسان خریداری شده و وجوه مربوطه به حساب صندوق در شرف تأسیس واریز شده است. هویت مؤسسان که مطابق اساسنامه حق رأی دارند، در هنگام پذیره نویسی اولیه منتشر شده است. هویت دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز که مطابق اساسنامه حق رأی دارند، هر ساله در گزارشهای مالی سالانه صندوق درج می شود.

۶. بررسی وضعیت واحدهای سرمایه گذاری عادی و ممتاز صندوق

۱۳۹۷/۰۶/۳۱		شرح
ریال	تعداد	
۱۳۷,۵۹۴,۷۰۵,۳۹۹	۶۵۲۴۸	واحدهای سرمایه گذاری عادی
۲,۱۰۸,۷۹۵,۷۵۵	۱,۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۱۳۹,۷۰۳,۵۰۱,۱۵۴	۶۶,۲۴۸	جمع

۷. ترکیب سرمایه گذاران صندوق سرمایه گذاری مشترک گنجینه مهر

با توجه به سهولت ورود و خروج به از صندوق های سرمایه گذاری، اصولاً ترکیب سرمایه گذاران این گونه صندوق ها دائماً در حال تغییر می باشد. آخرین ترکیب سرمایه گذاران صندوق سرمایه گذاری مشترک گنجینه مهر در تاریخ ۹۶/۱۲/۲۹ (پایان دوره مالی) به قرار زیر است:

۷-۱- دارندگان واحدهای ممتاز صندوق

واحدهای ممتاز تحت تملک		نام دارندگان واحدهای ممتاز
درصد	تعداد	
۱۰	۱۰۰	گروه مالی مهر اقتصاد
۳۰	۳۰۰	کارگزاری مهر اقتصاد ایرانیان
۶۰	۶۰۰	بانک مهر اقتصاد
۱۰۰	۱,۰۰۰	جمع

۷-۲- دارندگان واحدهای عادی صندوق

ترکیب سرمایه گذاران	تعداد سرمایه گذاران	تعداد واحدهای سرمایه	درصد سرمایه
عادی	عادی	گذاری	گذاری
سرمایه گذاران حقیقی	۹۲	۱,۳۱۲	۲
سرمایه گذاران حقوقی	۶	۶۴,۹۳۶	۹۸
جمع	۹۸	۶۶,۲۴۸	۱۰۰

۸. کارمزد ارکان

آن قسمت از هزینه های قابل پرداخت از محل دارایی های صندوق که از قبل قابل پیش بینی می باشد، به شرح جدول زیر است:

عنوان هزینه	شرح نحوه محاسبه هزینه
هزینه تاسیس	معادل شش در هزار (۰.۰۰۶) از وجوه جذب شده در پذیره نویسی اولیه حداکثر تا مبلغ ۲۵۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبته با تصوب مجمع صندوق.
هزینه برگزاری مجامع صندوق	حداکثر تا مبلغ ۵ میلیون ریال برای برگزاری مجامع در طول یک سال مالی با ارائه مدارک مثبته با تصوب مجمع صندوق.
حق پذیرش و عضویت در کانون ها	معادل مبلغ تعیین شده توسط کانونهای مذکور مشروط بر اینکه عضویت در این کانون ها طبق مقررات اجباری باشد یا عضویت به تصوب مجمع صندوق برسد.
کارمزد مدیر	سالانه ۲ درصد از ارزش روزانه سهام و حق تقدم تحت تملک صندوق بعلاوه ۰.۳ درصد از ارزش روزانه اوراق بهادار با درآمد ثابت تحت تملک صندوق موضوع بند ۲-۲-۳ امید نامه و ۱۰ درصد از مابه تفاوت روزانه سود علی الحساب دریافتنی ناشی از سپرده گذاری در بانک ها یا موسسات مالی و اعتباری نسبت به بالاترین سود علی الحساب دریافتی همان نوع سپرده در زمان افتتاح سپرده
کارمزد متولی	سالانه ۰.۴ درصد از متوسط روزانه ارزش خالص دارایی های صندوق و حداقل ۵۰ و حداکثر ۱۰۰ میلیون ریال
هزینه های دسترسی به نرم افزار، تارنما	هزینه دسترسی به نرم افزار صندوق، نصب و راه اندازی تارنمای آن و هزینه های پشتیبانی آنها سالانه تا سقف ۳۰۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبته و با تصوب مجمع عمومی صندوق
کارمزد ضامن	سالانه ۰/۵ درصد از ارزش روزانه سهام و حق تقدم تحت تملک صندوق در روز کاری قبل
حق الزحمه حسابرس	سالانه مبلغ ثابت ۱۰۰ میلیون ریال
کارمزد سازمان بورس	کارمزد ثبت و نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار به میزان ۰,۰۰۰۰۵ از سقف مجاز صندوق حداکثر تا ۵۰۰۰ میلیون ریال تعیین می گردد.
حق الزحمه و کارمزد تصفیه صندوق	معادل ۳/۱۰ درصد ارزش خالص دارایی های صندوق در آغاز دوره اولیه تصفیه می باشد. به منظور توزیع کارمزد تصفیه بین تمام سرمایه گذاران در طول عمر صندوق روزانه برابر ۰,۰۰۳ تقسیم بر ۳۶۵۸* ضرب حاصل در خالص ارزش دارایی های صندوق در پایان روز قبل در حساب ها، ذخیره میشود. ۸ برابر است با ۵ یا طول عمر صندوق به سال هر کدام کمتر باشد. هر زمان ذخیره صندوق ۰,۳ درصد ارزش خالص دارایی های صندوق با نرخ های روز قبل رسید، محاسبه ذخیره تصفیه و ثبت آن در حساب های صندوق متوقف می شود.

۸-۱- هزینه کارمزد ارکان

شرح	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۱/۰۶/۱۳۹۷	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۱/۰۶/۱۳۹۶	سال مالی منتهی به ۲۹/۱۲/۱۳۹۶
	ریال		
کارمزد مدیر	۷۰۹.۹۹۳.۸۱۶	۵۹۸.۷۸۶.۳۶۸	۱.۱۳۳.۶۱۶.۳۰۱
کارمزد متولی	۵۰.۹۵۸.۷۹۲	۲۹.۷۲۵.۹۶۲	۷۸.۷۶۶.۹۵۰
کارمزد ضامن	۱۵۹.۰۶۷.۴۲۱	۱۴۳.۳۰۹.۸۶۳	۲۷۶.۳۲۳.۶۶۲
حق الزحمه حسابرس	۴۵.۵۵۷.۹۲۰	۲۷.۹۰۸.۶۶۸	۷۹.۹۹۹.۹۹۵
جمع	۹۶۵.۵۷۷.۹۴۹	۷۹۹.۷۳۰.۸۶۱	۱.۵۶۸.۷۰۶.۹۰۸

۹. بررسی بازدهی سالانه صندوق (بر اساس بازدهی مورخ ۱۳۹۷/۰۶/۳۱ طراحی شده است)

نام صندوق های سرمایه گذاری	درج سود کشمین (%) شده	درج سود پیش بینی (%) شده	دوره های تقسیم سود(ماه)	تاریخ آگهی اطلاعات دریافت شده	مهر صندوق (روز)	ارزش ناخالص هر واحد سرمایه گذاری (NAV) (ریال)	خالص فروش دارایی صندوق (ریال)	درصد دارایی های نقدی	بازدهی ماهانه (%)
صندوق سرمایه گذاری مشترک گنجینه مهر	0	5	0	1397/06/31	1761	2,108,796	139,704M	0.31	21.48
شخص کل				1397/06/31					17.80
آرمان سپهر آیندگان (ETF)	0	0	0	1397/06/31	1851	25,318	133,745M	26.88	15.71
صندوق سرمایه گذاری مشترک پارس	0	0	0	1397/06/31	3114	10,026,044	129,627M	11.94	15.24
ارمغان یکم ملل	0	0	0	1397/06/26	2604	1,897,694	154,315M	22.99	14.85
صندوق سرمایه گذاری مشترک آسمان خاورمیانه	0	0	0	1397/06/31	1911	6,239,855	124,335M	2.11	13.23
کارگزاری بانک تجارت	0	0	0	1397/06/23	3695	13,178,495	140,615M	34.30	12.62
نیکوکاری ایتم برکت	0	16	0	1397/06/26	1342	1,361,294	252,704M	36.54	12.05
نیکی گستران	0	0	0	1397/06/26	1583	1,639,279	108,409M	28.44	11.51
توسعه پست بانک	0	0	0	1397/06/26	1331	2,219,088	109,039M	48.29	10.30
صندوق سرمایه گذاری مشترک کوثر	0	0	4	1397/06/19	2044	1,554,774	114,288M	7.08	9.87
مشترک آرمان شهر	0	0	0	1397/06/26	1798	2,657,516	289,874M	40.39	9.85
تجربه ایرانیان	0	0	0	1397/06/26	2636	5,171,532	4,869,349M	52.82	9.12
قابل معامله سپهر اندیشه نوین (ETF)	0	0	0	1397/06/29	1702	21,533	311,300M	43.42	8.46
ثروت آفرین پارسان (ETF)	0	0	0	1397/06/29	1128	22,911	650,883M	41.18	6.03
یکم نیکوکاری آگاه	0	0	0	1396/11/28	2507	1,782,650	17,236M	41.19	3.67

۱۰. جدول سود و زیان تحقق نیافته

نام سهم	تعداد	ارزش بازار	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	تحقق نیافته
ریال						
مخابرات ایران	۳,۰۰۰,۰۰۰	۷,۲۴۲,۰۰۰,۰۰۰	۵,۹۲۴,۳۵۹,۳۱۵	۳۴,۳۹۹,۵۰۰	۷,۲۴۲,۰۰۰	۱,۲۷۵,۹۹۹,۱۸۵
عمران و توسعه فارس	۲,۵۰۰,۰۰۰	۶,۰۴۷,۵۰۰,۰۰۰	۴,۵۵۱,۸۵۷,۱۵۲	۲۸,۷۲۵,۶۲۵	۶,۰۴۷,۵۰۰	۱,۴۶۰,۸۶۹,۷۲۳
صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۱,۳۹۰,۱۲۷	۱۱,۴۳۷,۹۶۴,۹۵۶	۱۱,۱۳۶,۰۷۱,۲۸۸	۵۴,۳۳۰,۳۳۴	۱۱,۴۳۷,۹۶۵	۲۳۶,۱۲۵,۳۶۹
سیمان تهران	۱,۴۰۰,۰۰۰	۳,۱۷۵,۲۰۰,۰۰۰	۲,۰۱۱,۱۳۷,۰۹۳	۱۵,۰۸۲,۲۰۰	۳,۱۷۵,۲۰۰	۱,۱۴۵,۸۰۵,۵۰۷
ایران مریئوس	۳,۳۵۵	۱۸,۸۰۴,۷۷۵	۱۹,۷۵۸,۲۶۵	۸۹,۳۲۳	۱۸,۸۰۵	(۱۰۶۱,۶۱۸)
بانک تجارت	۵,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۳,۲۰۳,۸۳۸,۷۶۴	۲۲,۳۷۲,۵۰۰	۴,۷۱۰,۰۰۰	۱,۴۷۹,۰۷۸,۷۳۶
سرمایه گذاری دارویی تامین	۱۰۰,۰۰۰	۵۱۹,۱۰۰,۰۰۰	۴۷۳,۰۸۴,۹۷۶	۲,۴۶۵,۷۲۵	۵۱۹,۱۰۰	۴۳,۰۳۰,۱۹۹
شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان	۴۵۰,۰۰۰	۵,۳۹۲,۳۵۰,۰۰۰	۴,۸۵۷,۴۲۴,۷۹۴	۲۵,۶۱۳,۶۶۳	۵,۳۹۲,۳۵۰	۵۰۳,۹۱۹,۱۹۳
کشت و صنعت شهداد ناپ خراسان	۳,۵۰۰,۰۰۰	۱۰,۱۸۸,۵۰۰,۰۰۰	۶,۶۹۴,۹۰۸,۵۴۷	۴۸,۳۹۵,۳۷۵	۱۰,۱۸۸,۵۰۰	۳,۴۳۵,۰۰۷,۵۷۸
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۱,۶۵۰,۰۰۰	۵,۳۹۵,۵۰۰,۰۰۰	۴,۲۳۳,۸۰۰,۸۰۳	۲۵,۶۲۸,۶۲۵	۵,۳۹۵,۵۰۰	۱,۱۳۰,۶۷۵,۰۷۲
تراکتورسازی ایران	۲,۸۹۵,۹۱۴	۱۰,۲۹۲,۰۷۸,۳۵۶	۹,۳۳۸,۷۸۶,۵۶۹	۴۸,۸۸۷,۳۷۲	۱۰,۲۹۲,۰۷۸	۸۹۴,۱۱۲,۳۳۷
بانک دی	۵,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۲۵,۰۰۰,۰۰۰	۳,۳۷۲,۰۹۷,۱۹۹	۲۲,۴۴۳,۷۵۰	۴,۷۲۵,۰۰۰	۱,۳۲۵,۷۳۴,۰۵۱
پتروشیمی فجر	۷۰۰,۰۰۰	۵,۲۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۴,۰۹۰,۰۵۰,۳۲۷	۲۴,۷۷۱,۲۵۰	۵,۲۱۵,۰۰۰	۱,۰۹۴,۹۶۳,۴۲۳
جمع		۷۴,۳۵۸,۹۹۸,۰۸۷	۵۹,۹۰۷,۱۷۵,۰۹۲	۳۵۳,۲۰۵,۲۴۲	۷۴,۳۵۸,۹۹۸	۱۴,۰۲۴,۲۵۸,۷۵۵

۱-۱۰ سود تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت

اوراق مشارکت	تعداد	ارزش بازار	ارزش دفتری	کارمزد	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
ریال					
اسناد خزانه - م ۱۰ بودجه ۹۶ - ۹۸۰۹۱۱	۱۹,۴۰۰	۱۴,۳۱۰,۴۱۰,۰۰۰	۱۳,۹۸۳,۷۷۶,۶۰۹	۱۰,۳۷۵,۰۴۷	۳۱۶,۲۵۸,۳۴۴
اسناد خزانه - م ۱۳ بودجه ۹۶ - ۹۸۱۰۱۶	۶۳,۰۰۰	۴۵,۴۲۹,۳۰۰,۰۰۰	۴۴,۵۱۱,۱۵۸,۲۸۰	۳۲,۹۳۶,۲۴۳	۸۸۵,۲۰۵,۴۷۷
جمع		۵۹,۷۳۹,۷۱۰,۰۰۰	۵۸,۴۹۴,۹۳۴,۸۸۹	۴۳,۳۱۱,۲۹۰	۱,۲۰۱,۴۶۳,۸۲۱

۱۰-۲ - جدول سود و زیان حاصل از فروش

سهام	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
ریال						
عمران و توسعه فارس	۴,۲۰۰,۰۰۰	۸,۲۷۴,۹۶۴,۵۶۲	۷,۸۳۲,۶۳۳,۸۳۲	۳۹,۷۸۱,۰۸۱	۳۵,۳۷۰,۴۲۴	۶۶۷,۱۸۹,۲۲۵
سیمان ارومیه	۱۰,۶۳,۷۸۱	۲,۶۴۵,۷۱۱,۹۱۰	۲,۲۵۵,۰۶۸,۳۳۷	۱۲,۵۶۷,۱۳۱	۱۳,۲۲۸,۵۵۷	۳۶۴,۸۴۷,۸۹۵
تراکتورسازی ایران	۲,۶۸۵,۹۸۱	۶,۹۱۷,۱۸۱,۷۷۰	۶,۷۶۲,۹۵۱,۶۳۷	۳۲,۸۵۶,۶۱۴	۳۴,۲۴۱,۰۱۵	۸۷,۱۳۲,۵۰۴
سرمایه گذاری امید	۶,۴۰۸,۹۷۵	۱۶,۴۶۰,۲۸۴,۵۹۳	۱۴,۷۰۱,۳۳۳,۸۷۴	۷۸,۱۸۶,۳۴۸	۸۲,۳۰۱,۴۲۴	۱,۵۹۸,۵۶۲,۹۴۷
بانک گردشگری	۲۰۰,۰۰۰	۲۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۴۲,۹۹۷,۶۰۰	۱,۰۴۵,۰۰۰	۱,۱۰۰,۰۰۰	(۲۶,۱۴۲,۶۰۰)
گروه صنعتی بارز	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۶۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۵۲۳,۱۵۷,۰۰۳	۱۲,۴۴۵,۰۰۰	۱۳,۱۰۰,۰۰۰	۷۱,۲۹۷,۹۹۷
صنعتی بهشهر	۷۵۰,۰۰۰	۱,۳۷۰,۰۲۵,۰۰۰	۱,۶۰۷,۱۷۵,۷۵۶	۶,۵۰۸,۶۸۷	۶,۸۵۱,۲۵۰	(۲۵۰,۳۸۵,۶۹۳)
گروه مینا (سهامی عام)	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۳,۲۶۷,۰۰۰,۰۰۰	۳,۰۶۵,۱۵۶,۶۳۹	۱۵,۵۱۸,۲۴۷	۱۶,۳۳۵,۰۰۱	۱۶۹,۹۹۰,۱۱۳
توسعه معادن و فلزات	۲,۲۳۴,۴۰۶	۵,۲۵۲,۱۶۵,۸۳۷	۴,۹۵۸,۰۳۴,۶۶۶	۲۴,۹۴۷,۷۸۸	۲۶,۲۶۰,۸۳۱	۲۴۲,۹۲۲,۵۵۲
کالسیمین	۱,۱۲۰,۰۰۰	۵,۸۷۷,۰۶۸,۴۴۹	۶,۲۵۶,۰۶۶,۸۴۳	۲۷,۹۱۶,۰۷۲	۲۹,۳۸۵,۳۴۱	(۴۳۶,۲۹۹,۰۰۷)
بانک صادرات ایران	۶۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۴۹۳,۳۶۱,۴۶۶	۳,۷۵۵,۰۴۲,۹۲۸	۲۱,۳۴۳,۴۷۰	۲۲,۴۶۶,۸۰۶	۶۹۴,۵۰۸,۲۴۲
حفاری شمال	۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۳۰,۷۳۹,۵۲۹	۵,۲۱۵,۷۸۹,۹۷۹	۲۸,۶۴۶,۰۱۰	۳۰,۱۵۳,۶۹۷	۷۵۶,۱۴۹,۸۴۳
نفت پاسارگاد	۱,۴۵۰,۰۰۰	۳,۷۴۸,۴۹۶,۰۶۰	۳,۲۷۸,۹۶۴,۰۲۸	۱۷,۸۰۵,۴۴۱	۱۸,۷۴۲,۴۸۱	۴۳۲,۹۸۴,۲۱۰
گروه صنعتی پاکشو	۳۰۰,۰۰۰	۲,۶۶۹,۱۸۱,۰۴۱	۲,۵۷۸,۲۱۴,۸۹۹	۱۲,۶۷۸,۶۱۰	۱۳,۳۴۵,۹۰۴	۶۴,۹۴۱,۶۲۸
پتروشیمی فجر	۳۰۰,۰۰۰	۲,۰۵۲,۶۶۰,۰۰۰	۱,۷۵۲,۸۷۸,۷۱۲	۹,۷۵۰,۱۳۴	۲۰,۵۲,۶۵۹	۲۸۷,۹۷۸,۴۹۵
پتروشیمی مبین	۱,۱۱۲,۷۵۲	۵,۲۴۰,۹۵۱,۵۹۷	۴,۸۳۴,۵۳۱,۵۲۷	۲۴,۸۹۴,۵۲۲	۲۶,۲۰۴,۷۵۷	۳۵۵,۳۲۰,۷۹۱
شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان	۱۵۰,۰۰۰	۱,۷۵۴,۷۸۰,۰۰۰	۱,۶۲۸,۹۶۸,۵۲۵	۸,۳۳۵,۲۰۵	۳,۹۶۳,۵۰۰	۱۱۳,۵۱۲,۷۷۰
شهداد ناب خراسان	۱۰,۳۳۲,۵۹۰	۱۹,۷۴۱,۶۳۲,۱۵۰	۱۸,۰۳۰,۹۱۲,۲۷۷	۹۳,۷۷۲,۷۴۹	۸۴,۸۶۶,۱۶۲	۱,۵۳۲,۰۸۰,۹۶۲
مس سرچشمه	۲۶۰,۰۰۰	۱,۲۲۰,۸۰۰,۰۰۰	۱,۰۶۷,۲۱۲,۱۸۵	۵,۷۹۸,۸۰۰	۶,۱۰۴,۰۰۰	۱۴۱,۶۸۵,۰۱۵
تولیدی چدن سازان	۱,۶۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۰۴۱,۰۰۰,۰۰۰	۳,۵۲۶,۸۷۴,۳۹۸	۱۹,۱۹۴,۷۵۱	۲۰,۲۰۵,۰۰۳	۴۷۴,۷۲۵,۸۴۸
مدیریت صنعت شوینده	۲۰,۲۱۹,۹۸۶	۵,۴۹۱,۷۷۵,۷۴۵	۴,۹۴۰,۴۸۱,۸۳۸	۲۶,۰۸۵,۹۲۲	۲۷,۴۵۸,۸۷۹	۴۹۷,۷۴۹,۱۰۶
فولاد مبارکه اصفهان	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۵۹,۰۵۷,۰۳۶	۲۳,۹۸۷,۴۹۹	۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۱,۹۰۵,۴۶۵
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۲۵۰,۰۰۰	۸۱۷,۵۰۰,۰۰۰	۶۴۱,۴۸۴,۹۷۱	۳,۸۸۳,۱۲۳	۸۱۷,۵۰۰	۱۷۱,۳۱۴,۴۰۶
پارس خودرو	۱,۵۰۰,۰۰۰	۹۹۳,۴۳۶,۹۲۵	۱,۰۰۸,۸۸۵,۲۳۹	۴,۷۱۸,۸۲۳	۴,۹۶۷,۱۸۴	(۲۵,۱۳۴,۳۲۱)
صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۲۱,۰۹۸,۷۳۲	۱۴,۱۹۰,۱۹۶,۸۹۹	۱۳,۳۲۹,۰۸۰,۸۲۳	۶۷,۴۰۳,۴۴۱	۶۷,۳۴۶,۳۴۹	۷۲۵,۶۳۸,۰۰۶
بانک تجارت	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۸۰۳,۸۰۰,۰۰۰	۱,۲۸۱,۵۳۵,۵۰۲	۸,۵۶۸,۰۳۴	۱,۸۰۳,۷۹۹	۵۱۱,۸۹۲,۶۶۵
ارتباطات سیار ایران	۳۵۰,۰۰۰	۵,۰۲۶,۶۰۲,۶۴۷	۴,۸۶۶,۲۴۶,۵۱۰	۲۳,۸۷۶,۳۵۶	۲۵,۱۳۲,۰۱۴	۱۱۱,۳۴۶,۷۶۷
پتروشیمی پارس	۲۹۷,۰۶۷	۹,۲۵۲,۰۵۲,۰۴۵	۹,۸۶۶,۶۸۰,۲۶۱	۴۳,۹۴۷,۲۵۰	۳۲,۲۴۶,۹۹۹	(۳۱۰,۸۲۳,۴۶۵)
هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه	۳۰۰,۰۰۰	۸۶۰,۱۰۰,۰۰۰	۸۲۲,۱۱۵,۵۲۶	۴۰,۸۵,۴۷۵	۴,۳۰۰,۵۰۰	۲۹,۵۹۸,۴۸۹
توسعه معادن روی ایران	۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۶,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۶۷۵,۹۶۲,۵۰۰	۷۹,۵۶۲,۵۰۰	۸۳,۷۵۰,۰۰۰	(۱۰,۸۹۳,۲۷۵,۰۰۰)
آتیه داده پرداز	۴۰۰,۰۰۰	۳,۰۷۰,۴۰۳,۵۳۱	۳,۱۲۴,۶۳۰,۹۱۷	۱۴,۵۸۴,۴۰۹	۸,۷۷۸,۲۶۷	(۷۷,۵۹۰,۰۶۲)
لیزینگ رایان سایپا	۱۱,۲۰۰,۰۰۰	۱۴,۹۹۰,۷۵۴,۵۶۱	۱۳,۱۹۸,۹۹۱,۰۹۱	۷۱,۲۰۶,۰۸۱	۴۰۰,۵۵,۵۶۴	۱,۶۸۰,۵۰۱,۸۲۵
معدنی و صنعتی گل گهر	۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷,۵۸۷,۳۶۵,۱۸۳	۶,۹۰۲,۴۲۰,۹۳۶	۳۶,۰۳۹,۹۸۸	۳۷,۹۳۶,۸۲۵	۶۱۰,۹۶۷,۴۳۴
بهمن دیزل	۵۵۰,۰۰۰	۱,۸۰۸,۹۵۰,۰۰۰	۱,۷۰۹,۲۳۰,۵۶۰	۸,۵۹۳,۵۱۱	۹,۰۴۴,۷۵۲	۸۲۰,۸۲۰,۱۷۷
سیمان تهران	۱,۲۰۰,۰۰۰	۲,۰۱۵,۸۶۳,۶۷۸	۱,۷۲۳,۸۳۱,۷۹۴	۹,۵۷۵,۳۵۱	۲,۰۱۵,۸۶۴	۲۸۰,۴۴۰,۶۶۹
شیشه همدان	۲,۷۷۴,۵۲۹	۵,۲۹۹,۹۷۰,۵۲۷	۴,۸۹۹,۵۶۶,۰۲۱	۲۵,۱۷۴,۸۵۹	۱۵,۵۷۶,۲۹۱	۳۵۹,۶۵۳,۳۵۶
گسترش سرمایه گذاری ایران خودرو	۱,۳۰۰,۰۰۰	۲,۷۷۷,۲۸۰,۶۴۶	۳,۱۶۹,۴۲۱,۸۹۳	۱۳,۱۹۲,۰۷۶	۱۳,۸۸۶,۴۰۲	(۴۱۹,۲۱۹,۷۲۵)
به پرداخت ملت	۴۵۰,۰۰۰	۳,۷۴۱,۶۰۱,۰۷۲	۴,۱۵۰,۱۲۶,۰۵۸	۱۷,۷۷۲,۶۱۵	۱۵,۱۹۶,۱۶۳	(۴۴۱,۴۹۳,۷۶۴)
مخابرات	۲,۴۰۰,۰۰۰	۵,۰۳۴,۵۵۱,۱۶۶	۴,۷۲۹,۴۸۷,۴۵۰	۲۳,۹۱۴,۱۲۹	۶,۶۴۹,۳۵۹	۲۴۴,۵۰۰,۲۲۸
جمع		۲۱۰,۵۶۰,۴۳۳,۵۸۹	۱۹۸,۳۰۴,۸۱۹,۹۷۱	۱,۰۰۰,۱۶۱,۹۸۲	۸۸۸,۲۹۲,۵۲۳	۱۰,۳۶۷,۱۵۹,۱۱۳

۱۱. سرمایه گذاری در سهام

صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل داراییها
	ریال	درصد	
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۴,۲۳۳,۸۰۰,۸۰۳	۵,۳۶۴,۴۷۵,۸۷۵	۳,۸۲
مخابرات	۵,۹۲۴,۳۵۹,۳۱۵	۷,۲۰۰,۳۵۸,۵۰۰	۵,۱۲
ماشین آلات و تجهیزات	۹,۳۳۸,۷۸۶,۵۶۸	۱۰,۲۳۲,۸۹۸,۹۰۵	۷,۲۸
مواد و محصولات دارویی	۴۷۳,۰۸۴,۹۷۶	۵۱۶,۱۱۵,۱۷۵	۰,۳۷
منسوجات	۱۹,۷۵۸,۲۶۵	۱۸,۶۹۶,۶۴۸	۰,۰۱
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۴,۰۹۰,۰۵۰,۳۲۷	۵,۱۸۵,۰۱۳,۷۵۰	۳,۶۹
انبوه سازی املاک و مستغلات	۴,۵۵۱,۸۵۷,۱۵۲	۶,۰۱۲,۷۲۶,۸۷۵	۴,۲۸
سیمان، آهک و گچ	۲,۰۱۱,۱۳۷,۰۹۳	۳,۱۵۶,۹۴۲,۶۰۰	۲,۲۵
بانکها و موسسات اعتباری	۶,۵۷۵,۹۳۵,۹۶۳	۹,۳۸۰,۷۴۸,۷۵۰	۶,۶۸
محصولات غذایی	۱۱,۵۹۸,۹۹۸,۷۱۱	۱۵,۴۹۱,۲۶۲,۳۳۴	۱۱,۰۲
محصولات شیمیایی	۱۱,۱۳۶,۰۷۱,۲۸۸	۱۱,۳۷۲,۱۹۶,۶۵۹	۸,۰۹
جمع	۵۹,۹۵۳,۸۴۰,۴۶۱	۷۳,۹۳۱,۴۳۶,۰۷۱	۵۲,۶۱

۱۲. مروری بر وضعیت صندوق

تاریخ	نرخ ابطال هر واحد (ریال)	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ارزش خالص دارایی های صندوق (ریال)
۱۳۹۶/۰۳/۳۱	۱,۴۴۲,۹۲۲	۷۰۹۰۳	۱۰۲,۳۰۷,۴۷۳,۳۰۴
۱۳۹۶/۰۶/۳۱	۱,۵۱۱,۶۳۹	۶۷۲۱۸	۱۰۱,۶۰۹,۳۸۱,۰۶۷
۱۳۹۶/۰۹/۳۰	۱,۶۰۲,۹۹۹	۶۶۵۱۹	۱۰۶,۶۲۹,۸۸۸,۸۲۰
۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱,۶۲۶,۱۱۹	۶۶۲۴۸	۱۰۷,۷۲۷,۱۴۰,۴۳۷
۱۳۹۷/۰۳/۳۱	۱,۷۴۸,۰۸۳	۶۶۲۴۸	۱۱۵,۸۰۶,۹۸۰,۶۲۵
۱۳۹۷/۰۴/۳۱	۱,۷۳۴,۵۵۱	۶۶۲۴۸	۱۱۴,۹۱۰,۵۰۴,۳۳۰
۱۳۹۷/۰۵/۳۱	۱,۷۳۵,۹۹۴	۶۶۲۴۸	۱۱۵,۰۰۶,۱۳۷,۴۷۶
۱۳۹۷/۰۶/۳۱	۲,۱۰۸,۷۹۶	۶۶۲۴۸	۱۳۹,۷۰۳,۵۰۱,۱۵۴



