

گزارش عملکرد مدیر صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱.۰۹.۳۰

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید که صندوقی با سرمایه باز محسوب می شود در تاریخ ۱۳۹۷/۰۸/۳۰ نزد ثبت شرکتها با شماره ۴۵۹۵۱ و شناسه ملی ۱۴۰۰۷۹۵۹۸۹۹ و در تاریخ ۱۳۹۷/۰۹/۱۲ تحت شماره ۱۱۶۱۷ نزد سازمان بورس به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار به منظور انجام تعهدات بازارگردانی و کسب منافع از این محل است.

با توجه به پذیرش ریسک مورد قبولی، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه‌ی به کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه‌ی اوراق بهادار بین همه‌ی سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه گذار کاهش مییابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه‌ی حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود و کپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش مییابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر داراییها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش مییابد. موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه گذاری در اوراق بهادار و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار است.

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، ۳ سال تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۸/۲۹ است. مرکز اصلی صندوق در تهران، محل کاوشیه، خیابان دیدار شمالی، خیابان پدیدار، پلاک ۴۵ طبقه ۱۰ واقع شده است.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱.۰۹.۳۰

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس <http://Mofidmmf.com> درج گردیده است.

۲-۱- ریسک سرمایه گذاری در صندوق

هر چند 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 ریسک های سرمایه گذاری در صندوق از جمله ریسک های زیر داشته باشند.

دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز و عادی با سرمایه گذاری در صندوق، تمام ریسک های فرا روی صندوق را می پذیرند. در سایر بندهای این بخش، برخی از ریسک های سرمایه گذاری در صندوق بر شمرده شده اند.

ریسک کاهش ارزش دارایی های صندوق:

قیمت اوراق بهادار در بازار، تابع عوامل متعددی از جمله وضعیت سیاسی، اقتصادی، اجتماعی، صنعت موضوع فعالیت و وضعیت خاص ناشر و ضامن آن است. با توجه به آنکه ممکن است در مواقعی تمام یا بخشی از داراییهای صندوق در اوراق بهادار سرمایه گذاری شده باشند و از آنجا که قیمت این اوراق می تواند در بازار کاهش یابد، لذا صندوق از این بابت ممکن است متضرر شده و این ضرر به سرمایه گذاران منتقل شود.

ریسک نکول اوراق بهادار با درآمد ثابت:

اوراق بهادار با درآمد ثابت شرکتها بخشی از دارایی های صندوق را تشکیل می دهد. گرچه صندوق در اوراق بهاداری سرمایه گذاری کند که سود حداقل برای آنها تعیین و پرداخت سود و اصلی سرمایه گذاری آن

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱.۰۹.۳۰

توسط یک مؤسسه ی معتبر تضمین شده باشد، یا برای پرداخت اصلی و سود سرمایه گذاری در آن ها، و ثایق معتبر و کافی وجود داشته باشد؛ ولی این احتمال وجود دارد که طرح سرمایه گذاری مرتبط با این اوراق، سودآوری کافی نداشته باشد یا ناشر و ضامن به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق بهادار، عمل ننمایند یا ارزش و ثایق به طرز قابل توجهی کاهش یابد به طوری که پوشش - دهنده ی اصلی سرمایه گذاری و سود متعلق به آن نباشند. وقوع این اتفاقات می تواند باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقبا سرمایه - گذاران شوند.

ریسک نوسان بازده بدون ریسک:

در صورتی که نرخ بازده بدون ریسک (نظیر سود علی الحساب اوراق مشارکت دولتی) افزایش یابد، به احتمال زیاد قیمت اوراق مشارکت و سایر اوراق بهاداری که سود حداقل یا ثابتی برای آنها تعیین شده است، در بازار کاهش مییابد. اگر صندوق در این نوع اوراق بهادار سرمایه گذاری کرده باشد و بازخرید آن به قیمت معین توسط یک مؤسسه ی معتبر (نظیر بانک) تضمین نشده باشد، افزایش نرخ بازده بدون ریسک، ممکن است باعث تحمیلی ضرر به صندوق و متعاقبا سرمایه گذاران گردد.

ریسک نقدشوندگی واحدهای ابطال شده:

از آن جایی که این صندوق فاقد رکن ضامن نقدشوندگی است، لذا در صورتی که دارنده واحد سرمایه گذاری قصد ابطال واحدهای سرمایه گذاری را داشته باشد، مدیر در ابتدا از محل وجوه نقد صندوق اقدام به پرداخت وجوه واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده می نماید. چنانچه وجوه نقد صندوق کفاف بازپرداخت واحدهای ابطال شده را نداشته باشد، مدیر صندوق مطابق اساسنامه اقدام به فروش داراییهای صندوق می نماید تا وجه مورد نیاز را تهیه کند. اگر به هر دلیلی از جمله بسته بودن نماد سهم، صف فروش و گره معاملاتی مدیر صندوق نتواند دارایی های صندوق را به وجه نقد تبدیل کند، مبالغ مربوط به واحدهای ابطال شده، تا تامین وجه نقد به حساب بستانکاری سرمایه گذار منظور میگردد و بازپرداخت این بدهیها با روشی FIFO و براساسی تاریخ و ساعت ثبت سفارشات ابطال انجام می گیرد.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱.۰۹.۳۰

۲- ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید از ارکان زیر تشکیل شده است :

مجمع صندوق سرمایه گذاری، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه گذاری ممتاز از حق رای در مجمع برخوردارند. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده اند شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک ممتاز
۱	شرکت سبد گردان مفید	۳,۴۹۶,۵۰۰	۹۹.۹%
۲	شرکت مشاور سرمایه گذاری ایده مفید	۳,۵۰۰	۰.۱%
	جمع	۳,۵۰۰,۰۰۰	۱۰۰%

مدیر صندوق، شرکت سبدگردان مفید است که در تاریخ ۱۳۹۵/۰۴/۱۵ با شماره ثبت ۴۹۷۴۰ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران - خیابان آفریقا - بعد از چهارراه جهان کودک - خیابان دیدار شمالی - نبش پدیدار شرقی پلاک ۴۵ طبقه ۷

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

متولی صندوق، مؤسسه حسابرسی فراز مشاور (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ به شماره ثبت ۳۴۹۱ نزد مرجع ثبت شرکتها و مؤسسات غیرتجاری تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران، ابتدای خیابان استاد مطهری، شماره ۴۴۴، طبقه سوم

حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی رازدار است که در تاریخ ۱۳۴۹/۱۱/۰۳ به شماره ثبت ۱۱۷۷ در اداره ثبت شرکتهای استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران - میدان آرژانتین - ابتدای خیابان احمد قصیر - خیابان نوزدهم - پلاک ۱۸ - واحد ۱۴

۳- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق بازارگردانی مفید در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰:

تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی): ۳ نفر

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۳۲۰,۰۶۱,۷۹۵ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحدهای سرمایه گذاری: ۴,۹۰۷,۷۹۲,۳۰۴,۷۷۵ ریال

NAV ابطال: ۱۵,۳۳۴ ریال

NAV صدور: ۱۵,۳۴۲ ریال

۴- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازارگردانی (شاخصی آرام) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۲,۷۴۰,۹۱۸,۶۵۷,۲۴۰	۲,۰۱۳,۶۱۳,۳۴۳,۵۴۱	۲۷۶,۴۶۸,۲۲۹	۲۰۵,۶۱۶,۸۶۴

۵- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (اطلس) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۴,۴۱۸,۶۸۲,۴۱۴,۴۱۷	۵,۶۵۰,۵۷۱,۴۳۰,۶۰۸	۱۶,۸۰۱,۶۴۳	۲۱,۴۸۸,۷۹۴

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱.۰۹.۳۰

۶- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (عیار) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معادلات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۷,۱۸۳,۱۱۹,۴۰۹,۳۸۱	۷,۲۱۴,۵۷۲,۷۴۹,۷۵۴	۱۸۶,۲۶۷,۱۲۳	۱۸۶,۵۵۷,۸۵۴

۷- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (و خاور) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معادلات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۱۱۳,۵۷۵,۵۳۶,۴۵۵	۴۱۵,۷۹۲,۲۳۶,۰۹۳	۲۸,۲۳۴,۱۳۷	۱۰۱,۴۹۴,۱۵۱

۸- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (آوند) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معادلات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۲۵,۱۷۹,۵۰۳,۵۴۲,۰۸۵	۲۴,۵۷۵,۶۴۹,۰۲۸,۲۲۱	۲,۴۱۸,۴۹۹,۰۷۴	۲,۳۵۸,۸۳۱,۰۲۴

۹- ترکیب دارائی های صندوق

عنوان	مبلغ	نسبت از کل دارایی
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۶۹۵,۳۳۱,۳۰۴,۸۶۹	۱۴.۱۵%
سرمایه گذاری در صندوقهای سرمایه گذاری	۳,۸۸۱,۴۱۹,۶۱۶,۰۰۵	۷۸.۹۸%
موجودی نقد	۲۰۸,۷۶۶,۷۲۱,۱۶۱	۴.۲۵%
سایر داراییها	۳۸۲,۰۶۵,۵۹۷	۰.۰۱%
جاری کارگزاران	۱۲۸,۵۱۹,۴۸۶,۴۶۶	۲.۶۲%
جمع	۴,۹۱۴,۴۱۹,۱۹۴,۰۹۸	۱۰۰.۰۰%

باتشکر
حجت اله نصرتیان ثابت
سیدگردان مفید
شماره ثبت: ۴۹۴۷۷۲

