

گزارش عملکرد مدیر صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲.۰۹.۳۰

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید که صندوقی با سرمایه باز محسوب می‌شود 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، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران 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 می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد: اولاً هزینه‌ی به‌کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه‌ی اوراق بهادار بین همه‌ی سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه‌گذاران، کلیه‌ی حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود و کپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. ثالثاً، امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر در اربابها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری 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-میدان ولی عصر-خیابان شهید فرامرز به آفرین-خیابان رودسر-پلاک ۶۷-ساختمان میلاد-طبقه اول-واحد ۱ واقع شده است.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲.۰۹.۳۰

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.ir> درج گردیده است.

۱-۲- 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:

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲.۰۹.۳۰

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 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 نمایند 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 بازخرد 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

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲.۰۹.۳۰

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.

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%

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

مدیر صندوق، شرکت سبدگردان مفید است که در تاریخ ۱۳۹۵/۰۴/۱۵ با شماره ثبت ۴۹۷۴۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های 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

متولی صندوق، موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت ارقام نگر آریا در سال ۱۳۸۳ تحت شماره ۱۷۷۵۵ با شناسه ملی ۱۰۱۰۰۶۱۷۶۳۲ در اداره ثبت شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری تهران ثبت گردیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران، میدان توحید، خیابان توحید، پلاک ۶۸

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 ۱۴۰۲/۰۹/۳۰:

تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی): ۵ نفر

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۷۱۲,۶۱۱,۰۰۶ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحدهای سرمایه گذاری: ۱۳,۵۸۷,۳۷۳,۳۳۱,۸۷۱ ریال

NAV ابطال: ۱۹,۰۶۷ ریال

NAV صدور: ۱۹,۰۸۲ ریال

۴- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازارگردانی (طلائی عیار مفید) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۱۷,۷۹۱,۷۲۶,۱۷۸,۰۲۷	۱۷,۷۸۹,۳۸۲,۵۴۱,۹۵۹	۲۵۴,۳۵۶,۷۶۳	۲۵۴,۱۵۸,۹۱۴

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲.۰۹.۳۰

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
۱۹,۴۵۸,۹۳۸,۵۳۶,۶۵۰	۳,۲۷۶,۰۲۶,۳۱۲,۰۲۸	۶۰,۰۹۱,۷۱۲	۲۹,۲۸۱,۴۴۹

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

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۴۴,۶۲۴,۷۶۹,۴۱۴	۱۱۲,۹۵۳,۳۹۸,۴۶۳	۱۱,۰۷۲,۲۹۲	۲۲,۷۳۶,۴۶۷

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

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۲,۸۵۰,۲۷۲,۸۴۹,۰۲۰	۲,۸۱۶,۵۳۸,۴۸۰,۳۸۴	۱۹۲,۷۹۱,۹۶۲	۱۹۰,۱۴۴,۹۰۴

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

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۵۰,۷۶۵,۰۵۴,۶۱۴,۶۱۱	۵۰,۵۴۴,۱۶۲,۱۱۴,۷۵۷	۳,۹۲۳,۱۶۹,۰۴۶	۳,۹۰۰,۰۳۹,۵۹۶

۹- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (نیان) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۲,۴۳۲,۳۶۰,۳۶۴,۶۶۶	۲,۸۱۷,۲۳۹,۴۱۰,۹۶۴	۲۶,۶۷۸,۴۷۵	۲۵,۶۰۶,۲۷۶

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

۱۰- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (استیل) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۵,۶۷۴,۹۱۴,۶۲۱,۳۲۴	۳,۵۷۶,۸۱۲,۱۵۱,۷۵۶	۵۵۰,۹۴۹,۲۹۶	۳۴۶,۱۴۹,۱۰۱

۱۱- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (عشادگان) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۴۰,۱۰۹,۳۹۲,۰۰۰	۰	۳۳,۴۰۰	۰

۱۲- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (صعبید) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۵,۰۰۰	۰

۱۳- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد صندوق مورد بازارگردانی (شهر فرش) طی دوره مالی:

ارزش معاملات خرید	ارزش معاملات فروش	حجم معاملات خرید	حجم معاملات فروش
ریال	ریال	تعداد	تعداد
۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۳۰,۰۰۰	۰

۱۴- ترکیب دارائی های صندوق:

۱۴۰۲/۰۹/۳۰		
عنوان	مبلغ (میلیون ریال)	نسبت از کل دارایی (درصد)
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۵,۱۲۸,۹۹۴,۹۲۲,۱۶۹	۳۷.۵۷%
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۷۵,۳۰۷,۴۹۴,۷۶۷	۰.۵۵%
سرمایه گذاری در صندوقهای سرمایه گذاری	۷,۲۱۵,۵۳۵,۰۱۶,۶۶۲	۵۲.۸۵%
موجودی نقد	۵۲۷,۱۹۰,۳۸۶,۷۹۲	۳.۸۶%
سایر داراییها	۳۹۸,۶۷۵,۱۸۹	۰.۰۰%
جاری کارگزاران	۷۰۵,۱۹۳,۱۵۷,۴۲۲	۵.۱۷%
جمع داراییها	۱۳,۶۵۲,۶۱۹,۶۵۳,۰۰۱	۱۰۰%