

صندوق اختصاصی بازارگردانی

پشتاپا



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ثروت پویا

گزارش عملکرد

دوره ۶ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳

۱- اطلاعات کلی صندوق

تاریخچه تاسیس صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ثروت پویا در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۶ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه گذاری موضوع ماده ۲۸ و بند ۶ ماده ۷ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، و ماده ۲ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید مصوب آذر ماه ۱۳۸۸ فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۱۹۵۴ و شناسه ملی ۱۴۰۱۰۹۰۵۸۹۱ در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۳ نزد سبا و طی شماره ۵۳۳۱۳ مورخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۱ نزد اداره ثبت شرکتها به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه بوده و فعالیت این صندوق تحت نظارت سبا انجام می شود.

دوره فعالیت صندوق

دوره فعالیت صندوق از تاریخ قید شده در مجوز فعالیت (۱۴۰۰/۱۲/۲۶) که توسط سازمان به نام صندوق صادر می شود؛ شروع شده و از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکتها به مدت سه سال شمسی ادامه می یابد. این مدت مطابق ماده ۴۹ قابل تمدید است. سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای فروردین ماه هر سال تا انتهای اسفندماه همان سال است، به جز اولین سال مالی صندوق که از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکتها آغاز شده و تا پایان اولین اسفندماه خاتمه می یابد.

محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق واقع در تهران، بزرگراه کردستان، محله آراغات، جنب پل کردستان، بن بست فرشید، پلاک ۸ واحد ۱۱ می باشد.

اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ثروت پویا مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس <https://pservatfund.ir/> درج گردیده است.

ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ثروت پویا که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱- مجمع صندوق:

از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل نصف به علاوه یک واحدهای سرمایه گذاری را دارا باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند.

در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سبدگردان ثروت پویا	۳۴.۶۵۰	۹۹
۲	محمد مهدی جمشیدیان	۳۵۰	۱
جمع		۳۵.۰۰۰	۱۰۰

۲- مدیر صندوق:

شرکت سبدگردان ثروت پویا (سهامی خاص) است که در ۱۴۰۰/۰۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۷۷۹۰۵ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، بزرگراه کردستان، محله آرات، جنب پل کردستان، بن بست فرشید، پلاک ۸ واحد ۱۱ تلفن: ۰۲۱۸۸۰۳۴۶۳۲

۳- متولی صندوق:

متولی صندوق، موسسه حسابرسی هوشیار ممیز است که در ۱۳۸۷/۰۲/۰۸ به شماره ثبت ۱۱۰۲۱ و شناسه ملی ۱۰۱۰۰۴۳۹۶۴۵ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران، انتهای گاندی شمالی - پلاک ۸ - طبقه پنجم - واحد ۱۹ - کد پستی ۱۹۶۹۹۴۴۴۱۵ - شماره تلفن: ۰۲۱۸۸۲۰۹۸۱۷

۴- حسابرس صندوق:

مؤسسه حسابرسی کاربرد تحقیق است که در سال ۱۳۷۲ با شماره ثبت ۵۰۸ و شناسه ملی ۱۰۱۶۰۱۰۳۰۰۰ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: میدان آرژانتین، ابتدای خیابان بخارست، شماره ۴۹، ساختمان طلا، طبقه دوم واحد ۳ تلفن: ۰۲۱۸۸۵۳۸۲۳۴

۲- اهداف و استراتژی های صندوق:

۱-۲ موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در این امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در این امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است. صندوق در اجرای موضوعات فعالیت یادشده، موارد زیر را رعایت می کند:

۱-۲-۱- تعهدات بازارگردانی صندوق با شرایط مندرج در این امیدنامه شامل بازارگردانی اوراق بهادار به شرح جدول بند ۷-۱ است؛

۱-۲-۲- صندوق می‌تواند مازاد منابع خود را در دارایی‌های مالی واجد شرایط زیر سرمایه‌گذاری نماید:

اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت که دارای تمامی شرایط زیر هستند، سرمایه‌گذاری نماید:

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

ب- سود حداقلی برای آن‌ها مشخص شده و پرداخت اصل سرمایه‌گذاری و سود آن‌ها تضمین شده یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه‌گذاری وثایق کافی وجود داشته باشد؛

ج- در یکی از بورس‌ها پذیرفته شده و معاملات ثانویه آن‌ها در بورس امکان‌پذیر باشد.

گواهی‌های سپرده منتشره توسط بانک‌ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

هر نوع سپرده‌گذاری نزد بانک‌ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۱-۲-۳- اوراق بهاداری که صندوق در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید آن‌ها مشارکت می‌کند، باید علاوه بر خصوصیات مندرج در بند ۲-۲-۲، دارای خصوصیات زیر باشند:

۱-۲-۴- اتخاذ موقعیت فروش قراردادهای آتی اوراق بهادار، صرفاً به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت اوراق بهادار مجاز موجود در صندوق سرمایه‌گذاری و اتخاذ موقعیت خرید در قراردادهای آتی اوراق بهادار صرفاً به منظور بستن موقعیت‌های فروشی که قبلاً در قراردادهای آتی اوراق بهادار اتخاذ نموده‌اند.

۲-۲- این صندوق از نوع صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی است و با استفاده از وجوه در اختیار خود عموماً اقدام به انجام عملیات بازارگردانی اوراق بهادار موضوع بند ۲-۲-۱ می‌کند. هدف صندوق افزایش نقدشوندگی، تنظیم عرضه و تقاضا و تحدید دامنه نوسان قیمت اوراق بهادار موضوع بند ۲-۲-۱ این امیدنامه و کسب منفعت از این محل است.

۲-۳- مدیر می‌تواند به‌منظور پوشش ریسک نوسان قیمت اوراق بهادار موجود در سبد دارایی صندوق، در بازار معاملات آتی اوراق بهادار شرکت نموده و تا سقف دارایی هر ورقه در صندوق، اقدام به اتخاذ موقعیت فروش در قرارداد آتی آن ورقه نماید. در هر زمان باید تعداد اوراق بهادار در موقعیت‌های فروش باز صندوق در قراردادهای آتی، از تعداد همان نوع ورقه که در سبد دارایی صندوق قرار دارد کمتر باشد. در صورتی که در اثر فروش اوراق بهادار، تعداد اوراق بهادار موجود در سبد دارایی از تعداد اوراق بهاداری که صندوق در قراردادهای آتی متعهد به فروش آن‌ها شده است، کمتر گردد؛ مدیر موظف است قبل از فروش اوراق بهادار مربوطه، با اتخاذ موقعیت تعهد

خرید در قراردادهای آتی اوراق بهادار، تعداد اوراق بهاداری را که صندوق در قرارداد آتی متعهد به فروش آن شده است را به میزان کافی کاهش دهد.

۳- انواع واحدهای سرمایه گذاری و حقوق دارندگان آن‌ها:

۳-۱- در ازای سرمایه گذاری در صندوق، گواهی سرمایه گذاری صادر می شود. در گواهی سرمایه گذاری تعداد واحدهای سرمایه گذاری هر سرمایه گذار و نیز اوراق بهادار مورد عملیات بازارگردانی مورد نظر 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 که در اساسنامه قید شده که خلاصه آن در بندهای ۴-۲ و ۴-۳ این امیدنامه درج شده است.

۳-۲- دارنده واحدهای سرمایه گذاری ممتاز، 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 ۶-۱ این امیدنامه توضیح داده شده است. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز می توانند واحدهای سرمایه گذاری ممتاز خود را به دیگران واگذار کنند. در صورت حذف نماد ورقه بهادار از موضوع فعالیت بازارگردانی و موافقت سازمان با ابطال واحدهای ممتاز متناظر با آن، سهم دارندگان این واحدها از خالص دارایی های اوراق بهادار مورد عملیات بازارگردانی در صندوق، به آنها قابل پرداخت است.

۳-۳- 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 ارزش خالص روز واحدهای سرمایه گذاری خود پس از کسر کارمزد ابطال) به شرط آن که طبق اساسنامه مدیر امکان نقد کردن دارایی های صندوق را داشته باشد؛ دریافت کند. در صورتی که مجمع صندوق، رأی به تغییر اساسنامه یا امیدنامه (به استثنای تغییر مدیر، متولی و حسابرس) دهد، این تغییرات ۳۰ روز 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 یادشده، اساسنامه و امیدنامه قبلی کماکان حاکم خواهد بود. کاهش مدت یادشده با تقاضای مدیر یا متولی صندوق و تأیید سازمان امکان پذیر است. سازمان در صورتی با کاهش مدت یادشده موافقت خواهد کرد که تشخیص دهد این امر با اصل حفظ منافع و حمایت از سرمایه گذاران صندوق در تعارض نمی باشد.

۳-۴- تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز صندوق باید دست کم ۷۰٪ حداقل واحدهای سرمایه گذاری صندوق باشد. هویت دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز که مطابق اساسنامه حق رأی دارند، برای سرمایه گذاران متقاضی سرمایه گذاری در صندوق افشاء شده و هر ساله در گزارش های مالی سالانه صندوق درج می شود.

۴- صورت خالص دارایی ها در تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۳۱

۱۴۰۲/۱۲/۲۹	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی ها
۱۵,۰۷۷,۲۰۵,۳۰۱,۹۲۷	۷,۷۸۹,۸۹۷,۱۸۱,۳۱۸	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۶,۹۳۷,۹۱۸,۳۳۵	۲,۷۸۹,۳۰۱,۵۷۷	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۴۴۸,۵۲۳,۶۳۸,۵۷۲	۱,۳۷۱,۶۴۰,۶۰۰,۲۴۹	سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری
۷۰,۷۴۳,۸۶۱,۵۸۷	۹۸۰,۱۲۱,۵۴۷,۵۵۳	حساب های دریافتنی
۱,۴۷۱	۱,۶۰۲,۷۳۲,۶۳۶	سایر دارایی ها
۱۹۶,۶۱۹,۱۵۱,۹۵۵	۵۴۲,۶۷۶,۸۷۶,۸۰۱	جاری کارگزاران
۱۵,۸۲۰,۰۲۹,۸۷۳,۸۴۷	۱۰,۶۸۸,۷۲۸,۲۴۰,۱۳۴	جمع دارایی ها
		بدهی ها
۲۹,۹۵۸,۴۰۳,۳۹۰	۲۰,۶۹۷,۰۰۷,۲۶۲	پرداختنی به ارکان صندوق
۶,۳۰۲,۷۸۳,۸۹۹,۳۵۳	۱۵۱,۷۷۵,۳۴۳,۶۷۶	پرداختنی به سرمایه گذاران
۴۸۶,۱۵۰,۴۶۷,۷۲۱	۱,۰۸۷,۳۷۶,۶۶۲,۷۳۳	تسهیلات مالی دریافتی
۱۱۰,۰۵۹,۶۲۹,۰۳۱	۶,۲۵۳,۰۷۰,۶۲۲	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۶,۹۲۸,۹۵۲,۳۹۹,۴۹۵	۱,۲۶۶,۱۰۲,۰۸۴,۲۹۳	جمع بدهی ها
۸,۸۹۱,۰۷۷,۴۷۴,۳۵۲	۹,۴۲۲,۶۲۶,۱۵۵,۸۴۱	خالص دارایی ها
۱,۱۸۹,۴۲۷	۱,۱۱۷,۵۶۰	خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

۵- صورت سود(زیان) منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۳۱

دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲	دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳	
ریال	ریال	
		درآمدها:
۱,۷۵۱,۴۲۷,۸۵۲,۵۸۴	(۲۴۶,۳۰۵,۷۱۶,۴۴۴)	سود فروش اوراق بهادار
۲,۴۶۷,۶۶۷,۵۹۵,۳۳۱	(۲۲,۵۷۸,۱۵۴,۱۴۹)	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۵۲,۱۵۷,۴۴۱,۸۱۴	۶۸۲,۳۶۳,۴۴۴,۸۷۹	سود سهام
۱۰۷,۱۰۴,۷۴۷,۹۱۵	۱۱۹,۲۴۳,۳۵۳,۸۶۷	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۳,۷۹۷,۱۹۸,۱۵۷	۴۴,۳۳۱,۶۳۸,۱۷۴	درآمد حاصل از بازارگردانی
۳,۱۲۷,۰۲۶,۵۲۵	۷,۵۶۴,۳۰۲,۲۰۷	سایر درآمدها
۴,۴۸۵,۲۸۱,۸۶۲,۳۲۶	۵۸۴,۶۱۸,۸۶۸,۵۳۴	جمع درآمدها
		هزینه ها :
(۸۵,۲۰۳,۳۰۷,۶۲۷)	(۳۶,۲۵۲,۱۷۷,۰۲۸)	هزینه کارمزد ارکان
(۲,۹۸۶,۶۷۷,۵۵۰)	(۴,۴۹۳,۳۰۳,۹۷۰)	سایر هزینه ها
۴,۳۹۷,۰۹۱,۸۷۷,۱۴۹	۵۴۳,۸۷۳,۳۸۷,۵۳۶	سود قبل از هزینه های مالی
(۵,۹۸۲,۴۷۴,۵۲۶)	(۶۲,۱۸۲,۱۴۶,۱۴۰)	هزینه های مالی
۴,۳۹۱,۱۰۹,۴۰۲,۶۲۳	۴۸۱,۶۹۱,۲۴۱,۳۹۶	سود خالص
۴۶٪	۵/۲۲٪	بازده میانگین سرمایه گذاری
۱/۳۳٪	۱۲/۴۹٪	بازده سرمایه گذاری پایان دوره

۶- گردش خالص دارایی ها منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱

صورت گردش خالص دارایی‌ها				
دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲		دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۴,۳۹۲,۲۴۰,۵۳۳,۴۳۲	۳,۹۹۹,۰۳۴	۸,۸۹۱,۰۷۷,۴۷۴,۳۵۲	۹,۰۷۷,۱۰۹	خالص دارایی‌های (واحدهای سرمایه‌گذاری) اول دوره
۶,۸۴۲,۳۶۲,۰۰۰,۰۰۰	۶,۸۴۲,۳۶۲	۲,۲۳۹,۷۴۷,۰۰۰,۰۰۰	۲,۲۳۹,۷۴۷	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۱,۵۲۰,۳۹۹,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۵۲۰,۳۹۹)	(۲,۸۸۵,۴۲۶,۰۰۰,۰۰۰)	(۲,۸۸۵,۴۲۶)	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۴,۳۹۱,۱۰۹,۴۰۲,۶۲۳	-	۴۸۱,۶۹۱,۲۴۱,۳۹۶	-	سود خالص دوره
(۶۶۰,۰۱۶,۶۶۴,۶۶۸)	-	۶۹۵,۵۳۶,۴۴۰,۰۹۳	-	تعدیلات
۱۳,۴۴۵,۲۹۶,۲۷۱,۳۸۷	۹,۳۲۰,۹۹۷	۹,۴۲۲,۶۲۶,۱۵۵,۸۴۱	۸,۴۳۱,۴۳۰	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره