

کامرس

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردانی کاوش شماره ثبت: ۵۷۹۱۳



تاریخچه

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش در تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۱۰ تحت شماره ۱۲۳۲۴ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و با شماره ثبت ۵۷۹۱۳ و شناسه ملی ۱۴۰۱۳۶۲۰۹۱۴ در تاریخ ۱۴۰۴/۰۵/۱۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیرتجاری استان تهران به ثبت رسیده است.

هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق این امیدنامه و کسب منافع از این محل است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه تا تاریخ ۱۴۰۸/۰۶/۲۸ تمدید گردیده است. مرکز اصلی صندوق در فردوس خیابان شهید ابراهیمی پور بسابی شمالی کوچه دوم الف پلاک ۹ واحد ۳ واقع شده است.

اهداف سرمایه گذاری در صندوق

هدف بازارگردان در بازار سرمایه، حفظ ثبات و به حداقل رساندن نوسان قیمتی است. این وظیفه با خرید و فروش سهام توسط بازارگردان انجام می‌گیرد که این عمل باعث متعادل شدن عرضه و تقاضا و جلوگیری از نوسانات قیمتی نامتعارف می‌گردد. همچنین عمل خرید و فروش سهام توسط بازارگردان باعث ایجاد نقدشوندگی برای سهام می‌گردد. خرید و فروش سهام باید به گونه ای صورت پذیرد که در روزهای نزولی بازار که عرضه سهام زیاد است حمایت لازم از سهم در حد توان و تعهد صندوق صورت گرفته و در روزهای صعودی بازار که تقاضا برای سهم بالا است عرضه به میزان لازم و در حد توان و تعهد صندوق صورت پذیرد.

سیاست های سرمایه گذاری در صندوق

هدف از تشکیل صندوق بازارگردانی، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران (سرمایه گذاران نهادی) و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی (افزایش نقدشوندگی و کاهش نوسان قیمت) آن اوراق مطابق امیدنامه و کسب منافع از این محل است. همچنین در صورتیکه صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول تلاش میشود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش با توجه به موضوعات فعالیت یاد شده، در موارد زیر سرمایه گذاری می کند:

الف) سهام به شرح این موارد: سهام شرکتهای بند ۲ امیدنامه

ب) اوراق مشارکت، اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت مطابق با الزامات مورد نیاز ذکر شده در بند ۲ امیدنامه

ج) گواهی سپرده و هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و موسسات مالی و اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی

د) اتخاذ موقعیتهای خرید و فروش در قراردادهای آتی اوراق بهادار مطابق بند ۲ امیدنامه

استراتژی های سرمایه گذاری:

صندوق اختصاصی بازارگردانی کاوش بر اساس امیدنامه متعهد به انجام معاملات بر اساس شرایط زیر است:

الف: تفاوت بین کمترین قیمت خرید در سفارش خرید و بیشترین قیمت فروش در سفارش فروش نباید بیشتر از دامنه مظنه

ذکر شده در بند ۷ امیدنامه باشد.

ب: حجم سفارشیهای خرید و فروش وارده باید برابر با حداقل سفارش انباشته باشد. حداقل سفارش انباشته در بند ۷ امیدنامه

تعیین میگردد.

ج: تعهد روزانه صندوق مطابق بند ۷ امیدنامه تعیین میگردد.

مؤسسين و ارکان صندوق

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
۱	سبذگردان داناك	۳۴.۳۰۰	۹۸٪
۲	عباس محمدی متین	۳۵۰	۱٪
۳	احمد احمدآبادی	۳۵۰	۱٪
	جمع	۳۵.۰۰۰	۱۰۰٪

ارکان صندوق

مدیر صندوق، سبذگردان داناك که در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۲۳ به شماره ثبت ۶۰۱۹۷۷ نزد مرجع ثبت شرکتهای تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: محله فردوس خیابان شهید ابراهیم پور بسابی شمالی کوچه بن بست دوم الف پلاک ۹ طبقه ۳.

متولی صندوق، مؤسسه حسابرسی و بهبود سیستمهای مدیریت حسابرسین است که در تاریخ ۱۳۷۱/۰۳/۱۳ و به شماره ثبت ۶۸۷۰ و شناسه ملی ۱۰۱۰۰۶۱۷۶۳۲ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران خیابان قائم مقام فراهانی-بالا تر از خیابان مطهری پلاک ۲۱۶-طبقه سوم - واحد ۲۶.

حسابرس صندوق، موسسه هوشیار ممیز که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۲/۰۸ به شماره ثبت ۱۱۰۲۱ نزد مرجع ثبت شرکتهای استان تهران به ثبت رسیده است.

نشانی حسابرس تهران انتهای گاندی شمالی پلاک ۸ طبقه ۵ واحد ۱۹.

نرخ صدور و ابطال صندوق

ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری : ۱,۰۰۰,۰۰۰ ریال، نرخ صدور و ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش به ترتیب برابر ۲,۱۶۱,۲۵۴ ریال و ۲,۱۵۷,۲۸۱ ریال می باشد.

تعداد واحدهای سرمایه گذاری



نمودار زیر تغییرات تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش در دوره ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه سال ۱۴۰۴ را نمایش می دهد.

ترکیب دارایی های صندوق

شرح	۱۴۰۴/۰۹/۳۰ (نسبت از کل دارایی)	(درصد از کل دارایی)
نقد و بانک	۲۰,۲۷۹,۰۶۲,۶۶۲	۰.۲۲٪
صندوق سرمایه گذاری	۲,۰۶۷,۰۹۸,۱۴۰,۴۴۹	۲۴.۱۵٪
سهام	۶,۷۶۱,۰۶۴,۶۱۹,۲۷۸	۷۴.۹۴٪
سایر دارایی	۱,۱۳۶,۰۷۳,۲۶۷	۰.۶۸٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰

گزارشات مالی صندوق

صورت خالص دارایی‌های صندوق:

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

صورت خالص دارایی‌ها

به تاریخ ۳۰ آذر ماه ۱۴۰۴

۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۲,۵۸۳,۶۹۶,۹۴۲,۷۰۳	۶,۷۶۱,۰۶۴,۶۱۹,۳۷۶	۵	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۲,۲۲۶,۰۹۰,۶۵۲	۲۰,۲۷۹,۰۶۲,۶۶۲	۶	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱,۴۲۵,۹۸۸,۷۲۰,۷۸۵	۲,۱۷۹,۰۲۰,۲۹۶,۸۴۸	۷	سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۱,۱۰۵,۹۹۲,۹۲۹,۰۹۵	۲,۱۸۷,۶۱۸,۱۵۸	۸	حسابهای دریافتی
۱,۰۰۸,۰۷۵,۸۲۳	۱,۱۳۶,۰۷۳,۲۶۷	۹	سایر دارایی‌ها
۰	۸۸۹,۴۹۵,۰۰۱,۹۷۶	۱۰	جاری کارگزاران
۵,۱۱۸,۹۱۲,۷۵۹,۰۵۸	۹,۸۵۳,۱۸۲,۶۷۲,۱۸۷		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۹۷۶,۳۸۱,۱۶۸,۴۹۶	۰	۱۰	جاری کارگزاران
۸,۲۰۹,۴۹۸	۲,۷۰۲,۸۶۱,۴۰۸,۲۵۵	۱۱	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۹۶۸۰,۳۲۶,۹۴۵	۷,۱۹۰,۸۰۴,۵۶۶	۱۲	پرداختی به ارکان صندوق
۲,۳۲۲,۰۳۵,۱۱۷	۸۳۸,۴۶۵,۳۵۰,۱۳۷	۱۳	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۹۸۸,۲۹۱,۷۴۰,۰۵۶	۲,۵۴۸,۵۱۷,۵۶۲,۹۵۸		جمع بدهیها
۴,۱۳۰,۶۳۱,۰۱۹,۰۰۲	۶,۳۰۴,۶۶۵,۱۰۹,۳۳۹	۱۴	خالص دارایی‌ها
۲,۰۲۹,۵۸۹	۲,۱۵۷,۲۸۱		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال

یادداشت‌های توضیحی ، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی است.

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰

صورت سود و زیان صندوق:

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها

دوره ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۴

یادداشت	۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰	۴ ماه و ۷ روز منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰
درآمد ها:	ریال	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۵	۳,۰۹۰,۳۷۶,۶۰۲
سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۶	۲۱۸,۷۵۳,۳۵۶
سود سهام	۱۷	۲۲,۳۲۳,۸۱۱,۲۵۰
سود سپرده یتکی و گواهی سپرده یتکی	۱۸	۳,۵۷۹,۸۸۳,۱۷۲
سایر درآمدها	۱۹	۱,۳۹۳,۷۱۳,۳۲۴
جمع درآمدها		۹,۱۸۵,۳۹۰,۴۷۷
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارباب	۲۰	(۹,۴۵۵,۷۷۵,۱۸۹)
سایر هزینه ها	۲۱	(۱۰,۷۷۶,۸۳۶,۶۰۳)
سود (زیان) قبل از هزینه های مالی		۷,۶۵۳,۳۳۶,۸۸۴
هزینه مالی	۲۲	(۸۲,۸۰۴,۲۵۰,۴۰۱)
سود خالص		۶,۸۳۰,۰۸۲,۴۸۳
بازده میانگین سرمایه گذاری	۱۶.۳۸٪	۱۲.۹٪
بازده سرمایه گذاری پایان دوره	۹.۷۵٪	۱۱.۹۸٪

صورت خالص گردش دارایی ها

یادداشت	۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰	۴ ماه و ۷ روز منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰
خالص دارایی های (وا) حدهای سرمایه گذاری (وا)	تعداد	تعداد
واحد	ریال	واحد
خالص دارایی های (وا) حدهای سرمایه گذاری (وا)	۱,۳۶۳,۳۲۶	۳,۱۳۰,۶۲۱,۰۱۹,۰۰۲
واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره	۱۵۷۵,۷۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵۷۵,۷۹۰,۰۰۰,۰۰۰
واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره	(۱۶,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۶,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)
سود خالص طی دوره	۰	۶۹۳,۰۰۸,۲۲۳,۰۰۳
تعدیلات	۰	(۷۸,۰۲۲,۹۲۲,۷۷۷)
خالص دارایی های (وا) حدهای سرمایه گذاری (وا)	۲,۹۲۳,۵۰۵	۶,۳۰۴,۶۶۵,۱۰۹,۳۲۹

سود خالص

میانگین بازده سرمایه گذاری = میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

بازده میانگین سرمایه گذاری پایان دوره = تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال + سود (زیان) خالص

خالص دارایی های پایان دوره