

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 ۱۴۰۳/۰۵/۱۵ 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 ۱۴۰۸/۰۵/۱۴ می‌باشد. سال مالی صندوق به مدت یکسال از اول تیر ماه هر سال تا انتهای خرداد ماه سال بعد است. مرکز اصلی صندوق در استان تهران، شهر تهران، محله فردوس، خیابان شهید ابراهیمی پور بسایی 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 روزهایی 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 2 امیدنامه

ب) اوراق مشارکت، اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت مطابق با الزامات مورد نیاز ذکر شده در بند 2 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 2 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 7 امیدنامه باشد.

ب: حجم سفارشیهای خرید و فروش وارده باید برابر با حداقل سفارش انباشته باشد. حداقل سفارش انباشته در بند 7 امیدنامه تعیین میگردد.

ج: تعهد روزانه صندوق مطابق بند 7 امیدنامه تعیین میگردد.

مؤسسين و ارکان صندوق

در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها 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
1	سبدگردان داناک	۳۴,۳۰۰	٪۹۸
2	عباس محمدی متین	۳۵۰	٪۱
3	احمد احمدآبادی	۳۵۰	٪۱
	جمع	۳۵۰۰۰	٪۱۰۰

ارکان صندوق

مدیر صندوق، شرکت سبدگردان داناک که در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۲۳ به شماره ثبت ۶۰۱۹۷۷ نزد مرجع ثبت شرکت- های تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: استان تهران، شهر تهران، 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 ۱۰۱۰۰۳۱۶۹۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران خیابان قائم مقام فراهانی بالاتر از بیمارستان تهران کلینیک پلاک ۱۸۶ - طبقه سوم - واحد ۲۶.

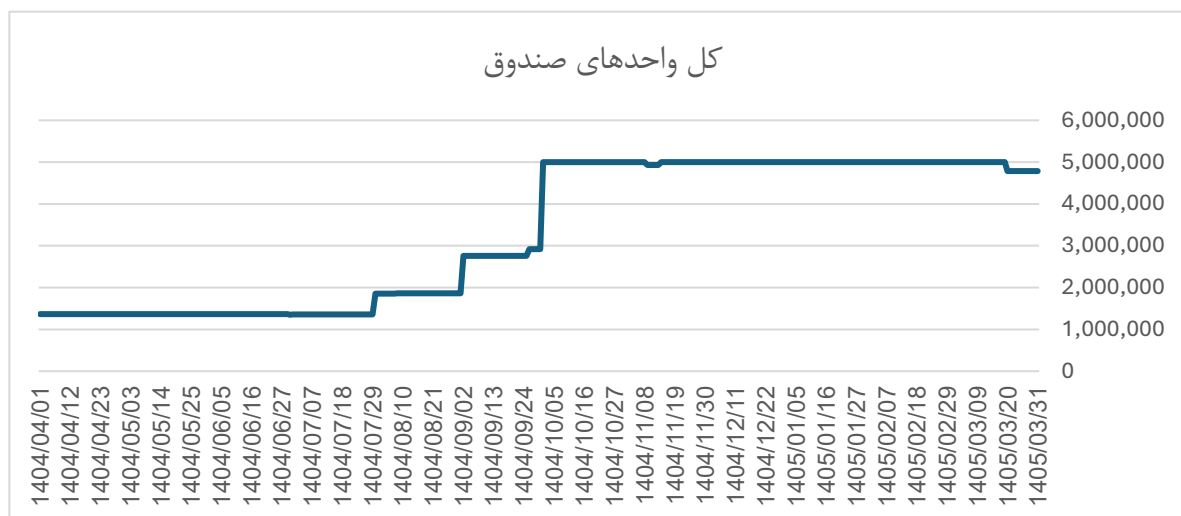
حسابرس صندوق، مؤسسه حسابرسی هوشیار ممیز که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۲/۰۸ به شماره ثبت ۱۱۰۲۱ نزد مرجع ثبت شرکت‌های استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، خیابان نلسون ماندلا (آفریقا، جردن)، بالاتر از چهارراه جهان کودک، خیابان پدیدار، پلاک ۶۲، ساختمان شهروز، طبقه ۷

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 ۲,۰۷۷,۶۵۶ ریال و ۲,۰۷۵,۲۹۸ ریال می باشد.

تعداد واحدهای سرمایه گذاری

نمودار زیر تغییرات تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش در سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه سال ۱۴۰۵ را نمایش می دهد.



تعهدات بازارگردانی صندوق

صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۳/۳۱ متعهد است که خرید و فروش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی را با لحاظ شرایط ذیل انجام دهد:

صندوق/شرکت	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت کیهان	۱۸۳,۳۵۰	۳,۶۶۷,۰۰۰	۱ درصد
شرکت مهرمام میهن	۲۱۳,۲۹۱	۴,۲۶۵,۸۲۰	۲.۲۵ درصد
شرکت لبنیات کالبر	۱۳,۶۰۰	۲۷۲,۰۰۰	۲.۵ درصد
اوراق مشارکت شهرداری شیراز	۲,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	عدم درج نماد
پتروشیمی جم پیلن	۳,۹۵۱	۷۹,۲۰۰	۲.۲۵ درصد
آترا زیست آرای	۲۰۰,۰۰۰	۴,۰۰۰,۰۰۰	۳ درصد
کیمیا کالای رازی	۶۲,۲۸۶	۱,۲۴۵,۷۰۲	۲.۷۵ درصد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

گزارش عملکرد سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

صندوق در بخشی از سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱ بازارگردانی شرکت سرمایه گذاری مشانیر را نیز بر

عهده داشته است که با اتمام بازارگردانی شرکت مذکور، صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۳/۳۱ تعهدی درباره

بازارگردانی شرکت مذکور ندارد.

ترکیب دارایی‌های صندوق

شرح	۱۴۰۵/۰۳/۳۱ (نسبت از کل دارایی)	درصد از کل دارایی
نقد و بانک	۵۱۵,۱۴۸,۳۱۱,۵۷۵	%۵.۰۹
صندوق سرمایه گذاری	۶۰۰,۲۲۳,۳۳۷,۷۹۱	%۵.۹۳
سهام	۷,۳۲۹,۲۹۳,۳۶۸,۰۰۱	%۷۲.۳۸
سایر دارایی	۱,۶۸۱,۸۰۲,۳۷۹,۹۲۸	%۱۶.۶۱

گزارشات مالی صندوق

صورت خالص دارایی های صندوق:

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

صورت خالص دارایی ها

به تاریخ ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۵

۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۵/۰۳/۳۱	یادداشت	دارایی ها:
ریال	ریال		
۲,۵۸۳,۶۹۶,۹۴۲,۷۰۳	۷,۳۲۹,۲۹۳,۳۶۸,۰۰۱	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲,۲۲۶,۰۹۰,۶۵۲	۵۱۵,۱۴۸,۳۱۱,۵۷۵	۶	سرمایه گذاری در سپرده بانکی
۱,۴۲۵,۹۸۸,۷۲۰,۷۸۵	۶۰۰,۲۲۳,۳۳۷,۷۹۱	۷	سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری
۱,۱۰۵,۹۹۲,۹۲۹,۰۹۵	۱,۶۴۶,۳۰۲,۹۳۶,۳۶۳	۸	حسابهای دریافتنی
۱,۰۰۸,۰۷۵,۸۲۳	۱,۹۵۱,۴۹۸,۲۹۱	۹	سایر دارایی ها
۴۶,۶۸۳,۹۶۰,۰۰۴	۸۵,۷۶۷,۹۳۷,۵۱۵	۱۰	جاری کارگزاران
۰	۳۳,۵۴۷,۹۴۵,۲۷۴	۱۱	پیش پرداخت ها
۵,۱۶۵,۵۹۶,۷۱۹,۰۶۲	۱۰,۲۱۲,۲۳۵,۳۳۴,۸۱۰		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
۱,۰۲۲,۹۶۵,۱۲۸,۵۰۰	۱۱۶,۸۶۳,۴۵۴,۱۳۶	۱۰	جاری کارگزاران
۰	۹۰,۸۷۷,۷۶۲,۲۳۸	۱۲	پیش دریافت ها
۸,۲۰۹,۴۹۸	۸,۰۱۷,۳۶۴	۱۳	پرداختنی به سرمایه گذاران
۹,۶۸۰,۳۲۶,۹۴۵	۱۱,۸۵۱,۰۹۷,۲۹۶	۱۴	پرداختنی به ارکان صندوق
۲,۲۲۲,۰۳۵,۱۱۷	۵۵,۱۲۶,۷۱۴,۴۷۶	۱۵	سایر حسابهای پرداختنی و ذخایر
۱,۰۳۴,۹۷۵,۷۰۰,۰۶۰	۲۷۴,۷۲۷,۰۴۵,۵۱۰		جمع بدهیها
۴,۱۳۰,۶۲۱,۰۱۹,۰۰۲	۹,۹۳۷,۵۰۸,۲۸۹,۳۰۰	۱۶	خالص دارایی ها
۳,۰۲۹,۵۸۹	۲,۰۷۵,۲۹۸		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری-ریال

یادداشت های توضیحی ، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی است.

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

گزارش عملکرد سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

صورت سود و زیان صندوق:

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کاوش

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۵

یادداشت	سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱	دوره ۱۰ ماه و ۱۷ روزه منتهی به ۱۴۰۴/۰۳/۳۱
درآمدها:		
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۷	ریال
سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۸	ریال
سود سهام	۱۹	ریال
سود سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی	۲۰	ریال
درآمد ناشی از بازارگردانی	۲۱	ریال
سایر درآمدها	۲۲	ریال
جمع درآمدها	۳,۰۵۲,۳۶۶,۶۲۴,۰۸۶	۱,۶۲۸,۷۰۲,۶۷۲,۰۰۳
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۳	ریال
هزینه سود ترجیحی اوراق تحت بازارگردانی	۲۴	ریال
سایر هزینه ها	۲۵	ریال
سود (زیان) قبل از هزینه های مالی		
هزینه مالی	۲۶	ریال
سود خالص	۲,۸۷۴,۵۱۶,۰۸۹,۶۷۶	۱,۶۰۶,۵۱۶,۱۰۶,۳۶۲
بازده میانگین سرمایه گذاری	۴۳.۲۰٪	۱۴۵.۷۵٪
بازده سرمایه گذاری پایان دوره	۲۹.۰۲٪	۳۸.۸۹٪

صورت خالص گردش دارایی ها

یادداشت	سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱		دوره ۱۰ ماه و ۱۷ روزه منتهی به ۱۴۰۴/۰۳/۳۱	
	تعداد	مبلغ	تعداد	مبلغ
	واحد	ریال	واحد	ریال
خالص دارایی های (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره	۱,۳۶۳,۴۲۶	۴,۱۳۰,۶۲۱,۰۱۹,۰۰۲	۰	۰
	۳,۷۱۹,۱۹۳	۳,۷۱۹,۱۹۳,۰۰۰,۰۰۰	۱,۳۶۳,۴۲۶	۱,۳۶۳,۴۲۶,۰۰۰,۰۰۰
	(۲۹۴,۱۴۵)	(۲۹۴,۱۴۵,۰۰۰,۰۰۰)	۰	۰
سود خالص طی دوره	۰	۲,۸۷۴,۵۱۶,۰۸۹,۶۷۶	۰	۱,۶۰۶,۵۱۶,۱۰۶,۳۶۲
تعدیلات	۲۷	(۴۹۲,۶۷۶,۸۱۹,۳۷۸)	۰	۱,۱۶۰,۶۷۸,۹۱۲,۶۴۰
خالص دارایی های (واحدهای سرمایه گذاری) پایان دوره	۴,۷۸۸,۴۷۴	۹,۹۳۷,۵۰۸,۲۸۹,۳۰۰	۱,۳۶۳,۴۲۶	۴,۱۳۰,۶۲۱,۰۱۹,۰۰۲

سود خالص

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

تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال + سود (زیان) خالص

بازده میانگین سرمایه گذاری پایان دوره = خالص دارایی های پایان دوره

یادداشت های توضیحی ، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی است.