

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی

بازارگردانی معاملات سرآمد

گزارش عملکرد

دوره مالی ۱۰ ماه و ۱۱ روزه

منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۲



فهرست مطالب

- ۱- اطلاعات کلی صندوق ۲
- ۱-۱ تاریخچه صندوق ۲
- ۱-۲ اطلاع رسانی ۲
- ۲ - ارکان صندوق ۲
- ۳- اهداف و استراتژی‌های صندوق ۳
- ۴- انواع واحدهای سرمایه‌گذاری و حقوق دارندگان آنها ۴
- ۵- ترکیب دارایی‌های صندوق منتهی به دوره مالی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ ۵
- ۶- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه‌گذاران صندوق منتهی به دوره مالی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ ۶
- ۷- تعهدات بازارگردانی طبق بند ۷ امید نامه به شرح زیر است: ۶



گزارش عملکرد دوره مالی ۱۰ ماه و ۱۱ روزه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۲ صندوق اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱ تاریخچه صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری معاملات سرآمد در تاریخ ۱۴۰۲/۰۲/۲۰ با شماره ثبت ۵۵۵۵۸ و با شناسه ملی ۱۴۰۱۲۲۲۰۹۸۵ نزد اداره ثبت شرکت‌ها و در تاریخ ۱۴۰۲/۰۲/۲۵ تحت شماره ۱۲۱۲۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. این صندوق از نوع صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی بوده و با هدف مشخص بازارگردانی مجموعه‌ای از سهام اعلام شده در امیدنامه این صندوق در بورس تهران و فرابورس ایران تاسیس شده و هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. مدت فعالیت این صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، پنج سال شمسی و مرکز اصلی صندوق تهران، ملاصدرا، خیابان شیخ بهایی جنوبی، کوچه چهارم، پلاک ۵ می‌باشد. شایان ذکر است با توجه به اینکه فعالیت صندوق از تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۱۷ آغاز گردیده است، فاقد صورت سود و زیان اقلام مقایسه‌ای می‌باشد.

۲-۱ اطلاع‌رسانی

کلید اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد مطابق با ماده ۴۵ اساسنامه در تارنمای صندوق به نشانی www.msramadfund.ir درج گردیده است.

۲-۲ ارکان صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود، از ارکان زیر تشکیل شده است. مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحد‌های ممتاز تشکیل می‌شود.

در تاریخ تهیه گزارش دارندگان واحد‌های سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رای بوده شامل ارکان زیر هستند:

| ردیف | نام دارندگان واحد‌های ممتاز | تعداد | درصد به کل واحد‌های سرمایه‌گذاری ممتاز |
|------|-----------------------------|--------|--|
| ۱ | هلدینگ سرآمد | ۳۴,۹۶۵ | ۹۹,۹۰٪ |
| ۲ | هادی رئیس زاده | ۳۵ | ۰,۱٪ |
| | جمع | ۳۵,۰۰۰ | ۱۰۰٪ |



گزارش عملکرد دوره مالی ۱۰ ماه و ۱۱ روزه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۲ صندوق اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد

مدیر صندوق: شرکت هلدینگ سرآمد که در تاریخ ۱۳۹۳/۰۷/۲۰ با شماره ۴۶۱۷۵۱ نزد مرجع ثبت شرکتها در شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارتست از: تهران- شیخ بهایی جنوبی- بن بست چهارم- پلاک ۵

متولی صندوق: موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت آزموده کاران که در تاریخ ۱۳۷۹/۰۳/۱۷ به شماره ثبت ۱۲۰۰۵ نزد مرجع ثبت شرکتها در شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: خیابان شریعتی، قلهک، نرسیده به یخچال، کوی شریف، پلاک ۵

حسابرس: موسسه حسابرسی بیات رایان که در تاریخ ۱۳۵۷/۰۲/۰۷ به شماره ثبت ۱۹۱۰ نزد مرجع ثبت شرکتها در شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، خیابان احمد قصیر (بخارست) کوچه پژوهشگاه دوم، پلاک ۲۲، طبقه دوم

۳- اهداف و استراتژی های صندوق

۳-۱- 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 می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه به کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه هزینه هر سرمایه گذار کاهش می یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش می یابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر دارایی ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش می یابد.

۳-۲- 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 است. صندوق در اجرای موضوعات فعالیت یادشده، موارد زیر را رعایت می کند:

- ۳-۲-۱- تعهدات بازارگردانی صندوق با شرایط مندرج در این امیدنامه شامل بازارگردانی اوراق بهادار به شرح جدول بند ۷-۱ است؛
- ۳-۲-۲- صندوق می تواند مازاد منابع خود را در دارایی های مالی واجد شرایط زیر سرمایه گذاری نماید:
 - اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت که دارای تمامی شرایط زیر هستند، سرمایه گذاری نماید:
- الف- مجوز انتشار آن ها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛
- ب- سود حداقلی برای آن ها مشخص شده و پرداخت اصل سرمایه گذاری و سود آن ها تضمین شده یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه گذاری وثایق کافی وجود داشته باشد؛
- ج- در یکی از بورس ها پذیرفته شده و معاملات ثانویه آن ها در بورس امکان پذیر باشد.



گزارش عملکرد دوره مالی ۱۰ ماه و ۱۱ روزه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۲ صندوق اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد

- 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.

۳-۳-۲ 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.

۳-۳-۲-۴ انتشار قرارداد اختیار معامله خرید تا ۲۰ درصد از تعداد سهام پایه موضوع بازارگردانی موجود در پرتفوی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی مجاز است. همچنین انتشار (اوراق اختیار فروش تبعی) طبق نظر بورس مربوطه با لحاظ مدیریت ریسک‌های مترتب بلامانع است.

۳-۳-۲-۵ تا سقف ۲۰ درصد از دارایی‌های صندوق را در صندوق‌های "در اوراق بهادار با درآمد ثابت قابل معامله" سرمایه‌گذاری نمایند مشروط به آنکه بازارگردانی آن بر عهده صندوق سرمایه‌گذار نباشد.

۳-۳-۳ 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.

۳-۳-۴ مدیر می‌تواند به منظور 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.

۴- انواع واحدهای سرمایه‌گذاری و حقوق دارندگان آن‌ها

۴-۱-۱ در ازای سرمایه‌گذاری در صندوق، گواهی سرمایه‌گذاری صادر می‌شود. در گواهی سرمایه‌گذاری تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری هر سرمایه‌گذار و نیز اوراق بهادار مورد عملیات بازارگردانی موردنظر درج می‌شود. واحدهای سرمایه‌گذاری به دو نوع ممتاز و عادی تقسیم می‌شود. حقوق دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری 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.

۴-۲-۱ دارنده واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز، دارای حق رأی است و می‌تواند 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 سرمایه‌گذاری ممتاز می‌توانند واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز خود را به دیگران واگذار کنند. در صورت حذف نماد ورقه بهادار از موضوع فعالیت



گزارش عملکرد دوره مالی ۱۰ ماه و ۱۱ روزه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۲ صندوق اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد

بازارگردانی و موافقت سازمان با ابطال واحدهای ممتاز متناظر با آن، سهم دارندگان این واحدها از خالص دارایی‌های اوراق بهادار مورد عملیات بازارگردانی در صندوق، به آنها قابل پرداخت است.

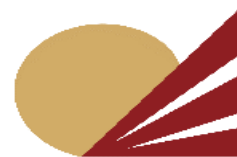
۳-۴- دارنده واحدهای سرمایه‌گذاری عادی دارای حق رأی نیست و نمی‌تواند در مجامع صندوق شرکت نماید، بلکه می‌تواند مطابق اساسنامه درخواست ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری را ارائه دهد و سهم خود را از دارایی‌های صندوق پس از کسر بدهی‌ها و سایر هزینه‌ها (معادل ارزش خالص روز واحدهای سرمایه‌گذاری خود پس از کسر کارمزد ابطال) به شرط آن که طبق اساسنامه مدیر امکان نقد کردن دارایی‌های 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 می‌شود تا دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری عادی، فرصت کافی برای تصمیم‌گیری برای ادامه سرمایه‌گذاری یا ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری 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 امکان‌پذیر است. سازمان در صورتی با کاهش مدت یادشده موافقت خواهد کرد که تشخیص دهد این امر با اصل حفظ منافع و حمایت از سرمایه‌گذاران صندوق در تعارض نمی‌باشد.

۴-۴- تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز صندوق باید دست کم ۷۰٪ حداقل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق باشد. هویت دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز که مطابق اساسنامه حق رأی دارند، برای سرمایه‌گذاران متقاضی سرمایه‌گذاری در صندوق افشاء شده و هر ساله در گزارش‌های مالی سالانه صندوق درج می‌شود.

۵- ترکیب دارایی‌های صندوق منتهی به دوره مالی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

| شرح | ارزش ریالی | درصد |
|--|-----------------|--------|
| سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی | ۳,۱۶۱,۰۸۱,۶۰۸ | ۰,۳۶٪ |
| حساب‌های دریافتی تجاری | ۵,۱۲۳,۰۱۹,۸۷۶ | ۰,۵۸٪ |
| سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم شرکت‌ها | ۸۷۷,۹۳۳,۸۴۷,۷۲۶ | ۹۹,۰۶٪ |
| مخارج انتقالی به دوره‌های آتی | ۸۴,۰۳۷,۹۲۱ | ۰,۰۱٪ |
| جمع کل | ۸۸۶,۳۰۱,۹۸۷,۱۳۱ | ۱۰۰٪ |

گزارش عملکرد دوره مالی ۱۰ ماه و ۱۱ روزه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۲
صندوق اختصاصی بازارگردانی معاملات سرآمد



۶- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران صندوق منتهی به دوره مالی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

| | |
|-------------------------------------|-----------------|
| خالص ارزش روز دارایی ها | ۴۹۲,۲۳۹,۸۸۲,۸۰۸ |
| آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری | ۹۸۴,۴۷۹ |
| گواهی های ممتاز | ۳۵,۰۰۰ |
| گواهی های عادی | ۴۶۵,۰۰۰ |

۷- تعهدات بازارگردانی طبق بند ۷ امید نامه به شرح زیر است:

| ردیف | نام شرکت | نماد | دامنه مظنه | حداقل سفارش در روز-تعداد | حداقل معاملات روزانه-تعداد |
|------|----------------------------|--------|------------|--------------------------|----------------------------|
| ۱ | بیمه سامان | بساما | ۲/۲۵ | ۲۰,۰۰۰ | ۴۰۰,۰۰۰ |
| ۲ | شیشه همدان | کهمدا | ۲/۲۵ | ۵۳,۰۰۰ | ۱,۰۶۰,۰۰۰ |
| ۳ | پرداخت الکترونیک سامان کیش | سپ | ۲/۵ | ۱۴,۷۵۰ | ۲۹۵,۰۰۰ |
| ۴ | بانک سامان | سامان | ۴ | ۵۶۴,۸۵۰ | ۱۱,۲۹۷,۰۰۰ |
| ۵ | بیمه اتکابی سامان | اتکاسا | ۴ | ۱۰۳,۷۵۳ | ۲,۰۷۵,۰۴۵ |