

۱۵

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید

دوره ۹ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳

«ثبت شده به شماره ۱۱۹۸۷ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار»

۱- کلیات

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید با شناسه ملی ۱۴۰۱۱۲۴۹۹۸۷ و شماره ثبت ۵۳۷۶۶ در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۲۵ در اداره ثبت شرکت‌ها و مؤسسات غیرتجاری تهران و طی شماره ۱۱۹۸۷ مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۰۸ به‌عنوان نهاد مالی نزد سازمان بورس و اوراق بهادار تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آن‌ها به خرید انواع اوراق بهادار به منظور انجام تعهدات بازارگردانی مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری از صرفه‌جویی‌های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه‌گذاران می‌باشد. این شرکت در تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۵ موفق به اخذ مجوز فعالیت به شماره ۱۲۲/۱۰۷۸۰۴ به مدت ۵ سال شمسی، از سازمان بورس و اوراق بهادار شده است. به جز اولین سال مالی صندوق که از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکت‌ها آغاز شده و تا پایان آذر ماه همان سال خاتمه می‌یابد، سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای دی‌ماه هر سال تا انتهای آذر ماه سال بعد است. مرکز اصلی شرکت واقع در تهران، محله کاووسییه، خیابان گاندی جنوبی، کوچه شانزدهم، پلاک ۹، طبقه ۳، واحد ۵، کد پستی ۱۵۱۷۹۱۶۱۱۸ می‌باشد.

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید مطابق ماده ۴۵ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس **tavazonfund.navidfg.com** درج گردیده است.

۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود، از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱-۲- مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رأی صندوق تشکیل می‌شود. در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده‌اند، شامل اشخاص زیر است:

۲-۲- مدیر صندوق: شرکت سبد گردان نوید (سهامی خاص) با شناسه ملی ۱۴۰۱۰۲۳۸۹۱۴ و شماره ثبت ۵۸۲۵۶۰ در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۱۰ در اداره ثبت شرکت‌ها و مؤسسات غیرتجاری تهران و طی شماره ۱۱۸۷۹ مورخ ۱۴۰۰/۰۶/۱۷ به عنوان نهاد مالی نزد سازمان بورس و اوراق بهادار تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران، محله کاووسییه، خیابان گاندی جنوبی، کوچه شانزدهم، پلاک ۹، طبقه ۳، واحد ۵.

۳-۲- متولی صندوق: موسسه حسابرسی حسابرسین با شناسه ملی ۱۰۱۰۰۳۱۶۹۹۱ که در تاریخ ۱۳۷۱/۰۳/۱۳ به شماره ثبت ۶۸۷۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: استان تهران، شهید بهشتی-خیابان شهید علی میرزا حسنی-خیابان قائم مقام فراهانی-پلاک ۱۸۶.

۴-۲- حسابرس صندوق: موسسه حسابرسی دش و همکاران با شناسه ۱۰۱۰۰۱۷۱۲۷۱ که در تاریخ ۱۳۵۸/۰۳/۰۵ به شماره ثبت ۱۹۷۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: بزرگراه نیایش، آشناسان- سردار جنگل شمالی- خیابان پنج‌تن- خیابان شهید نوروز پور- نبش کوچه سوم غربی- پلاک ۲۴.

۳- واحدهای سرمایه‌گذاری: واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو دسته‌ی واحدهای سرمایه‌گذاری عادی و واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تقسیم می‌شود. واحدهای سرمایه‌گذاری عادی فاقد حق رای، قابل ابطال اما غیر قابل انتقال است. واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رای در مجمع، قابل انتقال اما غیر قابل ابطال می‌باشد. تعداد واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید در تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۳۱، تعداد ۱،۴۴۱،۷۸۰ بوده که این تعداد شامل ۳۵،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز و ۱،۴۰۶،۷۸۰ واحد سرمایه‌گذاری عادی می‌باشد.

۴- سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار طی دوره ۹ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳

اوراق بهادار	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	کارمزد و مالیات (میلیون ریال)	سود (زیان) فروش (میلیون ریال)
گروه توسعه هنر ایران (وهنر)	۲۸،۰۲۲،۹۸۲	۱۸۰،۲۱۲	(۱۴۵،۵۲۴)	(۳۴)	۳۴،۶۵۵
بیمه میهن (میهن)	۶،۳۹۹،۰۳۰	۸۵،۲۳۱	(۸۷،۲۴۷)	(۶۵)	(۲،۰۸۰)
تولیدی و صنعتی گوهر فام (شفام)	۱۴۰	۱	(۱)	۰	۰
گنجینه آینده روشن (صایند)	۴،۴۹۳،۱۶۴،۲۶۴	۶۹،۱۱۴،۸۴۳	(۶۹،۰۵۹،۹۲۹)	(۱،۶۵۱)	۵۳،۲۶۳
سپر سرمایه بیدار (سپر)	۵۰۵،۸۰۰	۱۰،۵۱۰	(۱۰،۴۳۸)	(۲)	۷۰
افرا نماد پایدار (افران)	۳،۱۵۶،۱۹۳	۷۸،۱۳۰	(۷۷،۸۳۶)	(۱۰)	۲۸۴
نوع دوم اعتبار (اعتبار)	۱،۰۰۰،۰۰۰	۱۳،۴۹۴	(۱۳،۳۲۶)	(۲)	۱۶۵
ص. س. اعتماد داریک (داریک)	۱،۶۹۶،۵۵۳	۳۳،۶۶۱	(۳۲،۷۹۶)	(۶)	۸۵۹
درآمد ثابت کیمیا (اونیکس)	۸،۷۸۹،۹۹۶	۹۹،۹۸۸	(۹۹،۷۸۹)	(۱۳)	۱۸۶
سرمایه گذاری لیخند فارابی (لیخند)	۷،۰۰۰،۰۰۰	۹۷،۴۳۳	(۹۷،۳۲۵)	(۳۳)	۷۵
نوع دوم کارا (کارا)	۱،۳۸۵،۳۷۴	۲۴،۵۳۸	(۲۴،۴۸۵)	(۴)	۴۹
مشترک نوین نگر آسیا (طلوع)	۴،۳۲۰	۱۸۴	(۱۸۳)	۰	۰
توسعه افق رابین (رابین)	۸،۰۰۰،۰۰۰	۱۰۷،۴۰۹	(۱۰۷،۱۰۱)	(۶)	۳۱۳
اسناد خزانه-م-بودجه ۰۱-۰۴۰۳۲۶ (اخزا ۱۰۱)	۲۵،۴۰۰	۱۷،۸۱۳	(۱۷،۸۵۴)	(۱۳)	(۵۴)

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید

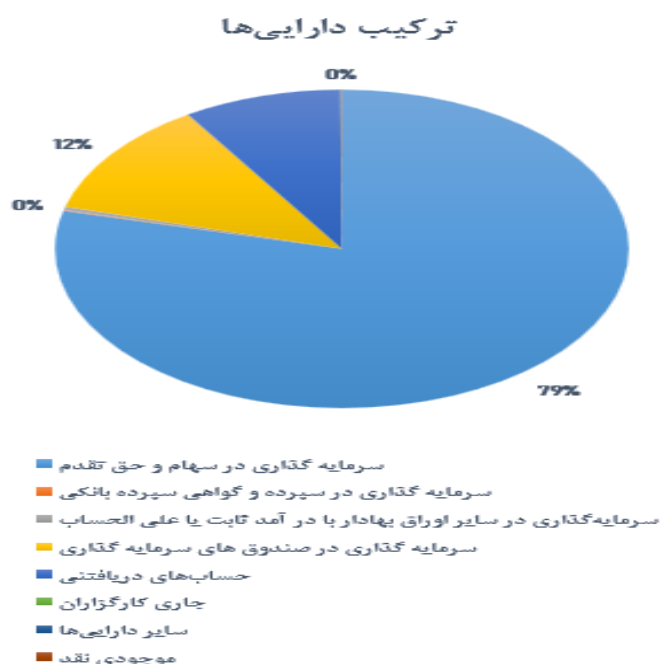
اوراق بهادار	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	کارمزد و مالیات (میلیون ریال)	سود (زیان) فروش (میلیون ریال)
اسناد خزانه-م ۳ بودجه ۰۱-۰۴۰۵۲۰ (اخزا ۱۰۳)	۱۸,۴۰۰	۱۲,۳۸۱	(۱۲,۴۱۵)	(۹)	(۴۳)
اسناد خزانه-م ۷ بودجه ۰۱-۰۴۰۷۱۴ (اخزا ۱۰۷)	۲۲,۰۰۰	۱۴,۲۴۰	(۱۴,۳۵۵)	(۱۰)	(۱۲۶)
اسناد خزانه-م ۳ بودجه ۰۰-۰۳۰۴۱۸ (اخزا ۰۰۳)	۱۷,۱۰۰	۱۵,۲۶۸	(۱۵,۴۲۶)	(۱۱)	(۱۶۹)
اسناد خزانه-م ۵ بودجه ۰۰-۰۳۰۶۲۶ (اخزا ۰۰۵)	۲۰,۰۰۰	۱۷,۰۰۶	(۱۷,۱۱۸)	(۱۲)	(۱۲۴)
اسناد خزانه-م ۵ بودجه ۰۱-۰۴۱۰۱۵ (اخزا ۱۰۵)	۳۵,۸۰۰	۲۱,۷۴۵	(۲۲,۰۶۸)	(۱۶)	(۳۳۸)
اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۰۱-۰۴۰۹۱۷ (اخزا ۱۰۴)	۱۱,۰۰۰	۶,۸۰۴	(۶,۸۶۸)	(۵)	(۶۹)
اسناد خزانه-م ۶ بودجه ۰۰-۰۳۰۷۲۳ (اخزا ۰۰۶)	۱۵,۴۰۰	۱۲,۶۸۵	(۱۲,۹۴۷)	(۹)	(۲۷۱)
اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۰۰-۰۳۰۵۲۲ (اخزا ۰۰۴)	۱۸,۵۰۰	۱۶,۲۶۶	(۱۶,۴۳۱)	(۱۲)	(۱۷۶)
اسناد خزانه-م ۸ بودجه ۰۲-۰۴۱۲۱۱ (اخزا ۲۰۸)	۸۶۹	۵۶۹	(۵۶۹)	.	.
اسناد خزانه-م ۱۳ بودجه ۰۲-۰۵۱۰۲۱ (اخزا ۲۱۳)	۱۹	۱۱	(۱۰)	.	.

۵- وضعیت سرمایه‌گذاری ها در پایان دوره ۹ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳

۵-۱- جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه‌گذاری های صندوق در سال مالی مورد گزارش را نشان می‌دهد.

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۳۱	
عنوان	خالص ارزش (ریال)
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۱,۵۷۸,۲۳۹,۵۵۱,۷۱۵
سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۱,۳۷۲,۸۳۳,۶۷۰
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۷,۴۱۲,۱۰۷,۴۳۱
سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری	۲۳۴,۱۵۷,۷۸۵,۴۰۴
حساب‌های دریافتنی	۱۷۸,۶۵۷,۹۹۲,۵۲۵
جاری کارگزاران	۳۳۲,۲۹۳
سایر دارایی‌ها	۱,۱۰۲,۴۵۸,۱۴۷
موجودی نقد	۸۰۹,۱۹۴,۶۷۹
جمع کل	۲,۰۰۱,۷۵۲,۲۵۵,۸۶۴

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید



۲-۵- ترکیب دارایی‌های صندوق در سهام و حق تقدم به تفکیک صنعت در پرتفوی بورسی

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۳۱ به تفکیک صنعت به شرح زیر است:

صنعت	خالص ارزش فروش (ریال)	درصد به کل دارایی‌ها
بیمه و بازنشستگی	۴۵۷,۹۶۸,۹۷۴,۳۲۷	٪۰.۲۳
فعالیت‌های هنری	۹۴,۹۸۳,۷۲۲,۲۶۹	٪۰.۰۵
انبوه سازی املاک و مستغلات	۱,۰۲۵,۲۸۶,۸۵۵,۱۱۹	٪۰.۵۱
جمع کل	۱,۵۷۸,۲۳۹,۵۵۱,۷۱۵	٪۰.۲۸

۳-۵- سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار طی دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳

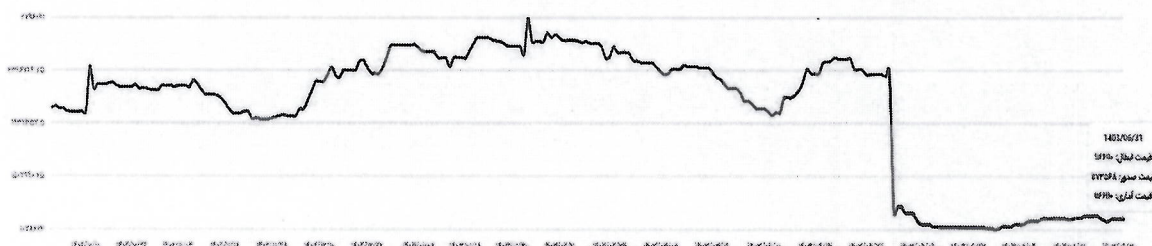
اوراق بهادار	تعداد	ارزش بازار (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	کارمزد و مالیات (میلیون ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته (میلیون ریال)
بیمه میهن (میهن)	۹۶,۹۷۷,۸۴۵	۴۵۸,۳۱۷	(۶۰۰,۰۴۲)	(۳۴۸)	(۱۴۲,۰۷۳)
سر. توس گستر (وتوس)	۵۴,۵۲۷,۶۴۸	۱,۰۳۴,۳۸۹	(۱,۱۶۳,۴۰۹)	(۹,۱۰۳)	(۱۳۸,۱۲۲)
گروه توسعه هنر ایران (وهنر)	۱۶,۳۳۲,۶۴۰	۹۵,۰۵۶	(۸۵,۶۱۷)	(۷۲)	۹,۳۶۷
درآمد ثابت کیمیا (اونیکس)	۲۹۶,۰۹۹	۳,۹۷۸	(۳,۹۲۸)	۰	۵۰
گنجینه آینده روشن (صایند)	۱۳,۳۱۱,۱۱۹	۲۲۹,۱۷۷	(۲۲۸,۸۸۴)	(۸)	۲۸۵
مشترک نوین نگر آسیا (طلوع)	۲۲,۹۱۸	۱,۰۱۲	(۹۷۴)	(۱)	۳۷

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید

اوراق بهادار	تعداد	ارزش بازار (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	کارمزد و مالیات (میلیون ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته (میلیون ریال)
اسناد خزانه/م ۱۳ بودجه ۰۵۱۰۲۱/۰۲ (اخزا ۲۱۳۱)	۵,۰۷۶	۲,۶۹۹	(۲,۶۴۶)	(۲)	۵۱
اسناد خزانه/م ۸ بودجه ۰۴۱۲۱۱/۰۲ (اخزا ۲۰۸۱)	۲,۴۷۹	۱,۶۹۲	(۱,۶۲۴)	(۱)	۶۶
اسناد خزانه/م ۱۰ بودجه ۰۵۱۱۱۲/۰۲ (اخزا ۲۱۰۱)	۵,۷۸۵	۳,۰۲۵	(۲,۹۷۵)	(۲)	۴۸
اسناد خزانه/م ۱ بودجه ۰۵۰۳۲۵/۰۲ (اخزا ۲۰۱۱)	۲	۱	(۱)	.	.

۶- خالص ارزش دارایی‌های صندوق

شاخص ارزیابی صندوق های سرمایه‌گذاری، خالص ارزش دارایی‌های صندوق به ازای هر واحد می‌باشد. نمودار زیر بیانگر تغییرات شاخص یاد شده در صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توازن نوید برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۳۱ می‌باشد.



۷- استراتژی صندوق سرمایه‌گذاری

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی 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 جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد.

مدیر صندوق	نماینده	امضا
شرکت سبدگردان نوید	سید مجتبی شفیعی پور	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی

بازارگردانی توازن نوید