

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

دوره مالی ۶ منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی مربوط به دوره مالی ۶ماهه ۳۰ اسفند ۱۳۹۹ که در اجرای مفاد بند ۷ ماده ۴۷ اساسنامه صندوق بر اساس سوابق، مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده به شرح زیر تقدیم می‌گردد.

شماره صفحه	
۲	صورت خالص دارایی‌ها
۴-۳	صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها یادداشت‌های توضیحی:
۵	۱- اطلاعات کلی صندوق
۵-۶	۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	۳- مبنای تهیه صورت‌های مالی
۸-۶	۴- خلاصه اهم رویه‌های حسابداری
۱۲-۹	۵- گزارشات مرتبط با عملکرد

با سپاس


گزارش مالی میان دوره‌ای

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

دارایی‌ها:	یادداشت	۱۳۹۹/۱۲/۳۰	۱۳۹۹/۰۶/۳۱
		ریال	ریال
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۵	۹۷۷.۶۶۶.۲۶۹.۳۴۱	۴۸۶.۴۷۶.۰۳۳.۷۵۹
حساب‌های دریافتی	۶	۲۰۹.۰۳۵.۶۳۳	۰
جاری کارگزاران	۹	۳۲.۴۱۵.۲۹۲.۱۴۸	۰
سایر دارایی‌ها	۷	۲۴۹.۵۴۰.۶۵۰	۴۵۷.۰۵۱.۳۴۵
موجودی نقد	۸	۱۵.۴۵۳.۸۵۷.۹۲۳	۳۲۹.۳۶۱.۳۴۹
جمع دارایی‌ها		۱.۰۲۵.۹۹۳.۹۹۵.۶۹۵	۴۸۷.۲۶۲.۴۴۶.۴۵۳
بدهی‌ها:			
جاری کارگزاران	۹	-	۵۷.۵۰۷.۸۵۶.۲۱۷
پرداختی به ارکان صندوق	۱۰	۵.۷۵۰.۶۴۷.۶۱۰	۸۵۲.۹۲۱.۲۷۱
پرداختی به سرمایه‌گذاران	۱۱	۵.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۰
سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر	۱۲	۱.۳۸۴.۵۱۳.۰۲۶	۰
جمع بدهی‌ها		۱۲.۱۳۵.۱۶۰.۶۳۶	۵۸.۳۶۰.۷۷۷.۴۸۸
خالص دارایی‌ها	۱۳	۱.۰۱۳.۸۵۸.۸۳۵.۰۵۹	۴۲۸.۱۸۹.۲۲۷.۶۵۸
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال		۷۷۷.۳۷۹	۱.۰۰۹.۰۲۱

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدایی ناپذیر صورت‌های مالی می‌باشد.



گزارش مالی میان دوره‌ای

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

درآمدها:	یادداشت	۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰	۳ ماهه و ۲۵ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱
		ریال	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۴	۶۳,۵۶۴,۲۸۳,۲۷۹	۱۰,۶۴۱,۹۵۴,۴۰۹
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۵	(۲۶۰,۳۱۰,۱۷۹,۱۶۱)	(۴۱,۳۴۱,۱۶۹,۱۸۷)
سود سهام	۱۶	۲۰۹,۰۳۵,۶۳۳	.
سایر درآمدها	۱۷	۱,۰۳۴,۱۷۹,۰۷۱	.
جمع درآمدها		(۱۹۵,۵۰۲,۶۸۱,۱۷۸)	(۳۰,۶۹۹,۲۱۴,۷۷۸)
هزینه:			
هزینه کارمزد ارکان	۱۸	(۸,۸۹۳,۴۵۴,۱۴۴)	(۸۵۲,۹۲۱,۲۷۱)
سایر هزینه‌ها	۱۹	(۷۹۳,۴۳۸,۲۳۹)	(۲۵۳,۴۹۹,۹۶۲)
جمع هزینه‌ها		(۹,۶۸۶,۸۹۲,۳۸۳)	(۳۱۸,۰۵۶,۳۶۰,۰۱۱)
سود (زیان) خالص		(۲۰۵,۱۸۹,۵۷۳,۵۶۱)	(۳۱۸,۰۵۶,۳۶۰,۰۱۱)
بازده میانگین سرمایه‌گذاری ^(۱)		%۲۱,۷۰	%۳۱,۹۵-
بازده سرمایه‌گذاری در پایان دوره ^(۲)		%۲۹,۰۲	%۶,۷۳

سود(زیان) خالص

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

۱- بازده میانگین سرمایه‌گذاری =

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

خالص دارایی‌های پایان سال

۲- بازده سرمایه‌گذاری پایان سال =

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی
 گزارش مالی میان‌دوره‌ای
 صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها
 ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

صورت گردش خالص دارایی‌ها		یادداشت	
۳ ماهه و ۲۵ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰		
ریال	ریال	تعداد	واحد‌های سرمایه‌گذاری
۰	۴۲۸,۱۸۹,۲۲۷,۶۵۸	۴۲۴,۳۶۱	خالص دارایی‌ها (واحد‌های سرمایه‌گذاری) اول دوره
۴۲۴,۳۶۱,۰۰۰,۰۰۰	۹,۰۲۷,۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۰۲۷,۲۰	واحد‌های سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
۰	(۲۲,۸۸۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۲,۸۸۰)	واحد‌های سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
(۳۱,۸۰۵,۶۳۶,۰۱۱)	(۲۰۵,۱۸۹,۵۷۳,۵۶۱)	۰	سود (زیان) خالص
۳۵,۶۳۳,۸۶۳,۶۶۹	(۸۸,۹۸۰,۸۱۹,۰۳۸)	۰	تعدیلات
۴۲۸,۱۸۹,۲۲۷,۶۵۸	۱,۰۱۳,۸۵۸,۸۳۵,۰۵۹	۱,۳۰۴,۲۰۱	خالص دارایی‌ها (واحد‌های سرمایه‌گذاری) در پایان دوره

یادداشت‌های توضیحی، همراه، بخش جدایی‌ناپذیر صورت‌های مالی می‌باشند.

توسعه سهام نیکی
 صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
 ۴۹۸۴۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۳ ما منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۳۹۹

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی دارنده شناسه ملی به شماره ۱۴۰۰۹۱۱۴۳۴۷، صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی اختصاصی محسوب می‌شود که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۱۴ تحت شماره ۱۱۷۱۰ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و شماره ۴۹۵۴۸ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. مدت فعالیت صندوق به موجب نامه شماره ۱۲۲/۶۴۷۲۸ سازمان بورس و اوراق بهادار تهران ۳ سال (۱۴۰۲/۰۲/۱۴) است. مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان کریمخان زند، خیابان استاد نجات الهی خیابان ورشو پلاک ۲۱ واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی‌باشد.

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی مطابق بابتند ۳۷ ماده یک اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس www.nicibfund.com درج گردیده است.

۱-۳- سال مالی صندوق

به موجب مفاد ماده ۵ اساسنامه سال مالی صندوق از اول مهر ماه هر سال شمسی لغایت ۳۱ شهریور سال بعد تعیین شده است لازم به ذکر است از آنجا که مجوز صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۱۴ صادر شده است طول اولین دوره مالی صندوق ۳ ماه و ۲۵ روز می‌باشد و به همین علت صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها و یادداشت‌های توضیحی مرتبط به صورت ۲ ستونه ارائه شده است.

۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۲-۱- مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود و تشریفات دعوت، تشکیل و تصمیم‌گیری آن در اساسنامه قید شده است. مجمع صندوق می‌تواند اساسنامه، آئیننامه، مدیر، متولی و حسابرس را تغییر دهد. فقط دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز، با شرایط مذکور در ماده ۲۵ اساسنامه، در مجامع صندوق حق رأی دارند.

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد مالکیت واحدهای ممتاز
۱	شرکت کارگزاری سرمایه‌گذاری ملی ایران	۵۰۰	٪۱
۲	شرکت مدیریت سرمایه‌گذاری ملی ایران	۱۹,۵۰۰	٪۳۹
۳	شرکت سرمایه‌گذاری ملی ایران	۳۰,۰۰۰	٪۶۰
	جمع	۵۰,۰۰۰	٪۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

۲-۲- مدیر صندوق:

شرکت کارگزاری سرمایه‌گذاری ملی ایران که در تاریخ ۰۱/۰۴/۱۳۸۴ به شماره ثبت ۲۴۸۹۶۷ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: استان تهران-منطقه ۱۵، شهرستان تهران بخش مرکزی، شهر تهران، محله میدان ولی عصر خیابان استاد نجات الهی، خیابان ورشو پلاک ۲۱

۲-۳- متولی:

موسسه حسابرسی و بهبود سیستم های مدیریت که در تاریخ ۱۳/۰۳/۱۳۷۱ به شماره ثبت ۶۸۷۰ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: قائم مقام فراهانی بالاتر از بیمارستان تهران کلینیک-ساختمان ۲۱۶-طبقه سوم واحد ۲۶

۲-۴- حسابرس:

موسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود که در تاریخ ۲۹/۰۴/۱۳۸۱ به شماره ثبت ۱۴۱۸۷ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: خیابان احمد قصیر، کوچه ششم، پلاک ۳۶، طبقه چهارم

۳- مبنای تهیه صورت‌های مالی:

صورت‌های مالی صندوق بر مبنای ارزش‌های جاری در پایان دوره مالی تهیه شده است.

۴- خلاصه اهم رویه‌های حسابداری

۴-۱- سرمایه‌گذاری‌ها

سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار شامل سهام و سایر انواع اوراق بهادار در هنگام تحصیل به بهای تمام شده ثبت و در اندازه‌گیری‌های بعدی به خالص ارزش فروش طبق دستورالعمل "نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری" مصوب ۳۰/۱۱/۱۳۸۶ هیات مدیره سازمان بورس اوراق بهادار اندازه‌گیری می‌شود.

۴-۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌های بورسی یا فرابورسی:

سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌های بورسی یا فرابورسی به خالص ارزش فروش منعکس می‌شود. خالص ارزش فروش سهام عبارت است از ارزش بازار سهم در پایان روز یا قیمت تعدیل شده سهم، منهای کارمزد معاملات و مالیات فروش سهام. با توجه به دستورالعمل "نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری"، مدیر صندوق می‌تواند در صورت وجود شواهد و ارائه مستندات کافی ارزش سهم در پایان روز را به میزان حداکثر ۲۰ درصد افزایش یا کاهش دهد و قیمت تعدیل شده را مبنای محاسبه خالص ارزش فروش قرار دهد.

۴-۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت پذیرفته شده در بورس یا فرابورس:

خالص ارزش فروش اوراق مشارکت در هر روز با کسر کارمزد فروش از قیمت بازار آنها محاسبه می‌گردد.

۴-۱-۳- سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت و گواهی سپرده بانکی غیر بورسی یا غیر فرابورسی:

خالص ارزش فروش اوراق مشارکت غیربورسی در هر روز مطابق ساز و کار بازخرید آنها توسط ضامن، تعیین می‌شود.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

۲-۴- سایر دارایی‌ها

سایر دارایی‌ها شامل آن بخش از مخارج می‌باشد که تا تاریخ گزارش مستهلک نشده و به عنوان دارایی به دوره های آتی منتقل می‌شود. لازم به ذکر است مخارج تاسیس طی عمرصندوق (تا تاریخ ۱۴/۰۲/۱۴۰۲)، مخارج عضویت در کانون تا پایان شمسی (۱۳۹۹/۱۲/۳۰) و مخارج نرم افزار طی یک سال از تاریخ شروع فعالیت صندوق و مخارج برگزاری مجامع نیز پس از تشکیل مجمع از محل دارایی‌های صندوق پرداخت و ظرف مدت یک سال یا تا پایان دوره فعالیت صندوق هر کدام کمتر باشد، به طور روزانه مستهلک می‌گردد.

۳-۴- در آمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها:

۱-۳-۴- سود سهام:

درآمد حاصل از سود سهام شرکت‌ها در زمان تصویب سود توسط مجمع عمومی صاحبان سهام شرکت‌های سرمایه پذیر شناسایی می‌شود. همچنین سود سهام متعلق به صندوق سرمایه‌گذاری به ارزش فعلی محاسبه و در حساب‌ها منعکس می‌گردد. برای محاسبه ارزش فعلی سود سهام تحقق یافته و دریافت نشده، مبلغ سود دریافتی با توجه به برنامه زمانبندی پرداخت سود توسط شرکت سرمایه‌پذیر و حداکثر ظرف ۸ ماه، با استفاده از نرخ سود علی‌الحساب سالانه آخرین اوراق مشارکت دولتی به علاوه ۵ درصد تنزیل می‌شود. تفاوت بین ارزش تنزیل شده و ارزش اسمی با گذشت زمان به حساب سایر درآمدها منظور می‌شود.

۲-۳-۴- سود سپرده بانکی و اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب:

سود تضمین شده اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب، سپرده و گواهی‌های سپرده بانکی بر اساس مدت زمان و با توجه به مانده اصل سرمایه‌گذاری شناسایی می‌شود. همچنین سود سپرده بانکی به طور روزانه با توجه به کمترین مانده وجوه در حساب سپرده و نرخ سود علی‌الحساب محاسبه می‌گردد. مبلغ محاسبه شده سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب، سپرده و گواهی‌های سپرده بانکی با استفاده از نرخ سود همان اوراق و با در نظر گرفتن مدت باقی مانده تا دریافت سود با همان نرخ قبلی تنزیل شده و در حساب‌های صندوق سرمایه‌گذاری منعکس می‌شود.

۴-۴- ذخایر کارمزد ارکان و تصفیه

کارمزد ارکان و تصفیه صندوق سرمایه‌گذاری به صورت روزانه به شرح جدول زیر محاسبه و در حساب‌ها ثبت می‌شود:

عنوان هزینه	شرح نحوه محاسبه هزینه
کارمزد مدیر	سالانه ۲ درصد از متوسط روزانه ارزش سهام و حق تقدم تحت تملک سهام صندوق بعلاوه ۰/۳ درصد از ارزش روزانه اوراق بهادار با درآمد ثابت تحت تملک صندوق و سالانه حداکثر ۲ درصد سود حاصل از گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی و تا میزان نصاب مجاز سرمایه‌گذاری در آنها*
کارمزد متولی	سالانه پنج در هزار (۰/۰۰۵) از متوسط روزانه ارزش خالص دارایی‌های صندوق که حداقل ۳۵۰ و حداکثر ۷۰۰ میلیون ریال خواهد بود.
حق الزحمه حسابرس	مبلغ ثابت ۲۱۸ میلیون ریال به ازای هر سال مالی
کارمزد تصفیه صندوق	معادل یک در هزار (۰/۰۰۱) خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق می‌باشد.**

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

حق پذیرش و عضویت در کانون ها	معادل مبلغ تعیین شده توسط کانون های مذکور، مشروط بر اینکه عضویت در این کانون ها طبق مقررات اجباری باشد یا عضویت به تصویب مجمع صندوق برسد.
هزینه دسترسی به نرم افزار، تارنما و خدمات پشتیبانی	هزینه های دسترسی به نرم افزار صندوق، نصب و راه اندازی تارنمای آن و هزینه های پشتیبانی آنها سالانه تا سقف ۶۱۰ میلیون ریال با ارایه مدارک مثبت و با تصویب مجمع صندوق***
هزینه تأسیس	معادل ۰/۰۱ درصد حداقل سرمایه اولیه تا سقف ۵ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبت با تصویب مجمع صندوق

۴-۵- بدهی به ارکان صندوق

با توجه به تبصره ۳ ماده ۵۵ اساسنامه، کارمزد مدیر، متولی، ضامن هر سه ماه یک بار تا سقف ۹۰ درصد قابل پرداخت است. باقی مانده کارمزد ارکان به عنوان تعهد صندوق به ارکان در حسابها منعکس می‌شود.

۴-۶- مخارج تأمین مالی

سود و کارمزد تسهیلات دریافتی از بانکها، موسسات مالی اعتباری و خرید اقساطی سهام مخارج تأمین مالی را در بر می‌گیرد و در دوره وقوع به عنوان هزینه شناسایی می‌شود.

۴-۷- تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال

این تعدیلات به دلیل تفاوت در نحوه محاسبه قیمت صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری ایجاد می‌شود. برای محاسبه قیمت صدور واحدهای سرمایه‌گذاری کارمزد پرداختی بابت تحصیل دارایی مالی به ارزش خرید دارایی‌های مالی اضافه می‌شود. همچنین برای محاسبه قیمت ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری کارمزد معاملات و مالیات از قیمت فروش دارایی‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری کسر می‌گردد. نظر به اینکه بر طبق ماده ۱۵ اساسنامه صندوق ارزش روز دارایی‌های صندوق برابر با قیمت ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری است، به دلیل آنکه دارایی‌های صندوق در ترازنامه به ارزش روز اندازه‌گیری و ارائه می‌شود؛ لذا تفاوت قیمت صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری تحت عنوان تعدیلات ناشی از قیمت صدور و ابطال منعکس می‌شود.

۴-۸- تعهدات و شرایط بازارگردانی :

صندوق متعهد است که خرید و فروش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی را طبق بند ۷ امیدنامه صندوق انجام دهد و یا در شرایط مشخص شده، معاف از ایفای تعهدات است.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

۱-۸-۴- تعهدات بازارگردانی اوراق تعریف شده در بند ۱-۳-۷ امیدنامه و بر اساس آخرین تغییرات تا تاریخ صورت خالص

دارایی‌ها به شرح زیر است:

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه
۱	سرمایه‌گذاری ملی ایران	ونیکی	۳ درصد	۳۰۰,۰۰۰	۶,۰۰۰,۰۰۰
۲	صنعتی آما	فاما	۳ درصد	۶۵,۰۰۰	۱,۳۰۰,۰۰۰
۳	شهد ایران	غشهد	۳ درصد	۱۰۰,۰۰۰	۲,۰۰۰,۰۰۰
۴	لوله و ماشین سازی ایران	فلوله	۳ درصد	۲۸,۰۰۰	۵۶۰,۰۰۰
۵	فیبر ایران	چفیبر	۳ درصد	۷۰,۰۰۰	۱,۴۰۰,۰۰۰
۶	کارخانجات ایران مریئوس	تمرینو	۳ درصد	۱۱,۵۰۰	۲۳۰,۰۰۰
۷	ایران خودرو	خودرو	۳ درصد	۴,۶۱۰,۰۰۰	۹۲,۲۰۰,۰۰۰
۸	فمراد	آلومراد	۳ درصد	۵,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰
۹	فالوم	آلومتک	۲ درصد	۲۴,۰۰۰	۴۷۰,۰۰۰
۱۰	افرانت	افرا	۳ درصد	۱۰,۶۰۴	۲۱۲,۸۰۹
۱۱	افست	چافست	۳ درصد	۲۸,۰۰۰	۵۶۰,۰۰۰
۱۲	کابل البرز	بالبر	۳ درصد	۲۸,۰۰۰	۵۶۰,۰۰۰

۲-۸-۴- باید همواره سفارش‌های خرید و فروش اوراق با رعایت شرایط زیر وارد سامانه معاملات مربوطه گردد:

الف) به گونه‌ای که تفاوت بین کمترین قیمت خرید در سفارش‌های خرید و بیشترین قیمت فروش در سفارش‌های فروش صندوق، حداکثر برابر دامنه مظنه باشد.

ب) به گونه‌ای که حجم سفارش‌های خرید و فروش وارده برابر حداقل سفارش انباشته باشد.

و در صورتی که در اثر انجام معامله، حجم سفارش خرید یا فروش کمتر از حداقل سفارش انباشته شود یا تساوی میان آن‌ها از بین برود، صندوق موظف است سفارش‌های مذکور را ترمیم کند.

ج) به گونه‌ای که صف خرید یا فروش اوراق مستمراً بیش از یک ساعت معاملاتی تداوم نیابد. در صورت عدم وجود اوراق در کد صندوق و عدم امکان خرید اوراق در سقف دامنه نوسان روزانه قیمت، صندوق ملزم به رعایت این بند نبوده، لیکن موظف است سفارش خرید را در سامانه معاملاتی حفظ نماید.

۳-۸-۴- در صورت تقاضای صندوق مبنی بر توقف نماد معاملاتی ورقه بهادار، بورس تهران/ فرابورس ایران مربوطه می‌تواند دلایل صندوق را بررسی و در صورت توافق و تطابق با مقررات مربوطه، نماد معاملاتی ورقه بهادار را متوقف نماید. بورس تهران/ فرابورس ایران می‌تواند در راستای کمک تعادل عرضه و تقاضای بازار حسب درخواست صندوق در زمان بازگشایی، دامنه نوسان قیمت نماد معاملاتی ورقه بهادار مذکور را تا ۲ برابر دامنه نوسان عادی افزایش دهد.

۴-۸-۴- در شرایطی مطابق با هر یک از موارد زیر، صندوق تعهد به انجام وظایف بازارگردانی را ندارد:

۱-۴-۸-۴- هرگاه حجم معاملات صندوق بر روی هر ورقه بهادار در یک روز معاملاتی، برابر یا بیش از حداقل معاملات روزانه آن ورقه بهادار شود، تعهد صندوق در خصوص ورقه بهادار مذکور در آن روز معاملاتی، ایفا شده تلقی می‌شود.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

۴-۸-۴-۲ در صورتی که نماد معاملاتی ورقه بهادار مورد نظر بسته باشد.
۴-۸-۴-۳ در مورد اوراق بهاداری که محدودیت دامنه نوسان قیمت موضوعیت دارد، در صورتی که قیمت ورقه بهادار در ۵ جلسه معاملاتی متوالی بیش از ۳ برابر دامنه مجاز نوسان، در یک جهت تغییر کند و در عین حال عرضه و تقاضای ورقه بهادار به تعادل نرسیده باشد؛ که مدت زمان معافیت صندوق بر اساس این بند توسط بورس تهران/ فرابورس ایران مربوطه حسب مورد تعیین می‌شود.

۴-۹- محاسبه NAV چندگانه

بر اساس مفاد ماده ۹ اساسنامه، خالص ارزش هر واحد سرمایه‌گذاری برای عملیات بازارگردانی هر یک از شرکت‌ها در پایان هر روز برابر با ارزش روز دارایی‌های صندوق برای عملیات بازارگردانی شرکت مربوطه در پایان آن روز، منهای بدهی‌های صندوق در پایان آن روز برای عملیات بازارگردانی شرکت مذکور تقسیم بر تعداد واحد‌های سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران برای عملیات بازارگردانی شرکت مربوطه در پایان همان روز است. خالص ارزش روز هر واحد سرمایه‌گذاری برای عملیات بازارگردانی شرکت مربوطه در صندوق به صورت مجزا و نیز برای کل صندوق محاسبه و گزارش می‌شود. ضمناً بر اساس مفاد بند ۴ ماده ۴۵ خالص ارزش روز قیمت صدور و قیمت ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری به تفکیک عملیات بازارگردانی هر یک از شرکت‌ها و کل صندوق در پایان هر روز به طور روزانه تا ساعت ۱۴ روز کاری بعد در تارنمای صندوق افشا می‌گردد.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

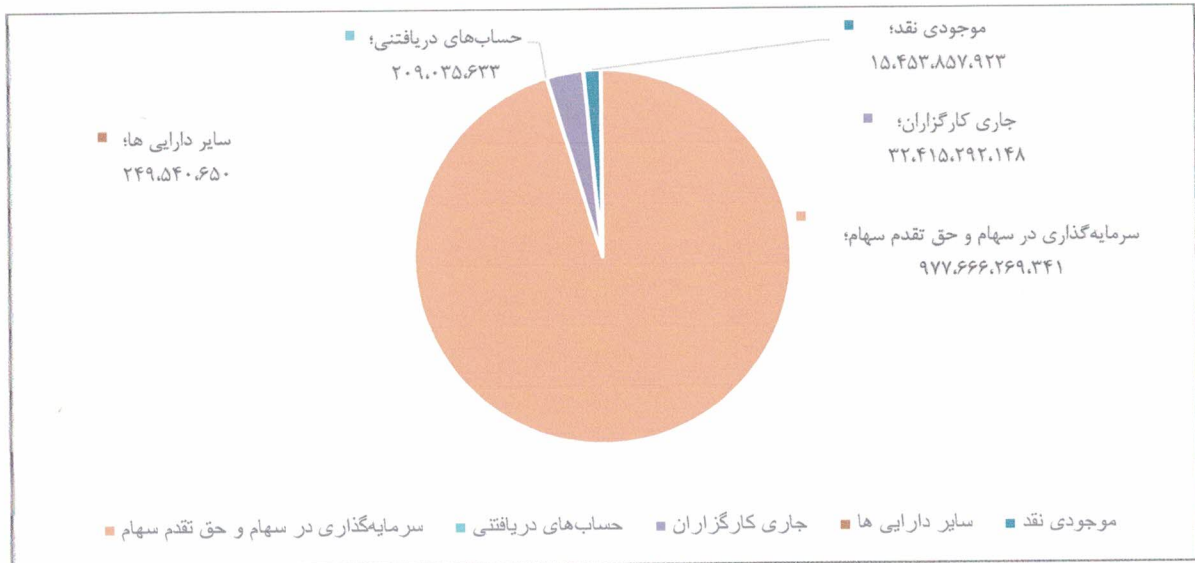
گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

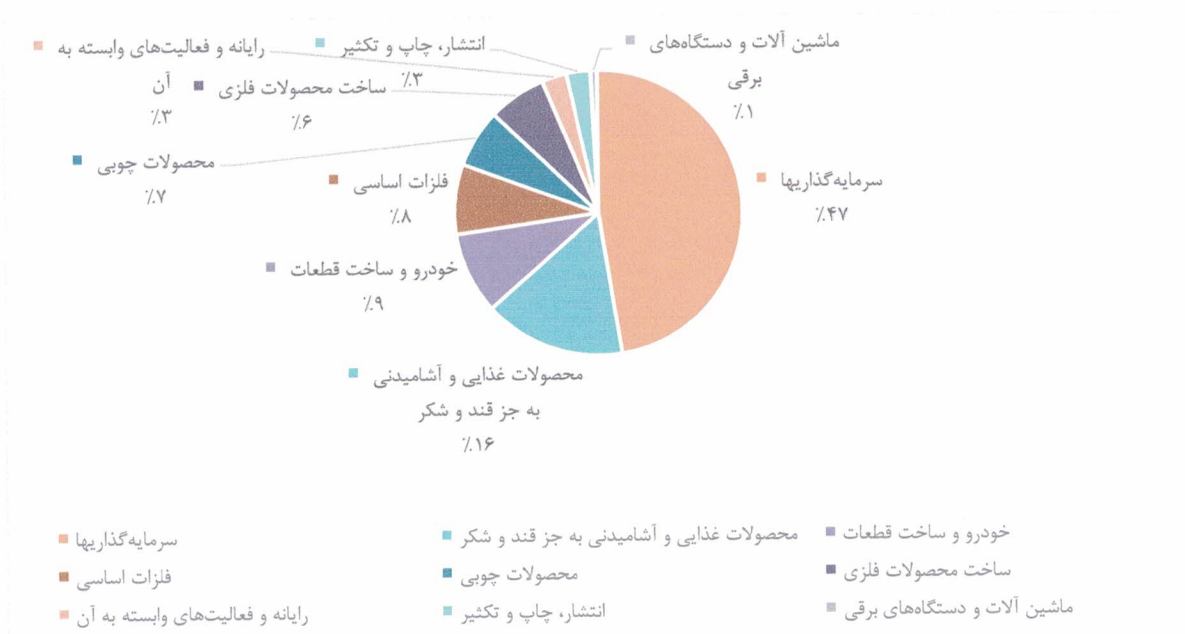
دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

۱- ترکیب دارایی‌ها

ترکیب دارایی‌های صندوق به خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



همچنین ترکیب دارایی‌های صندوق به تفکیک صنعت در تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

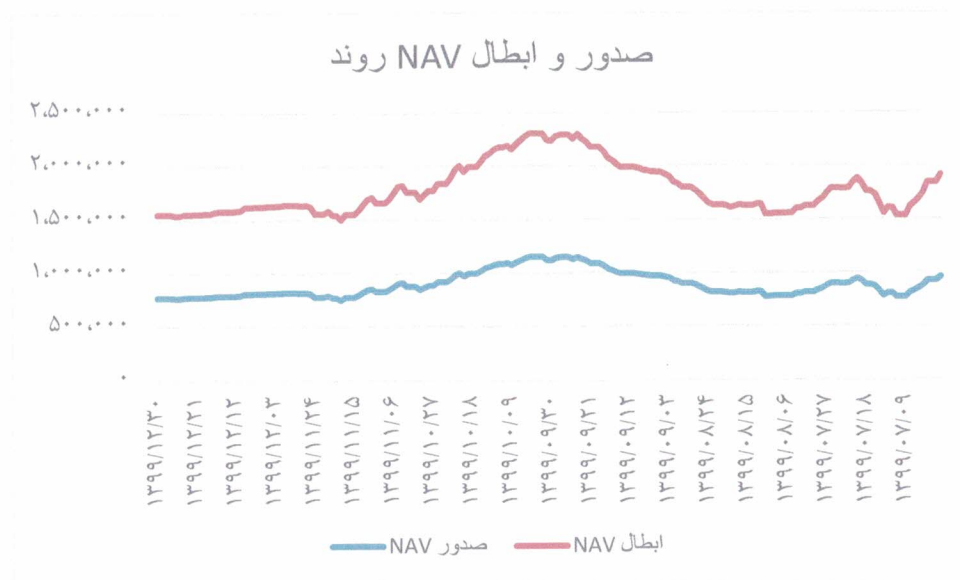
گزارش عملکرد

یادداشت‌های توضیحی

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ۱۳۹۹

۲- گزارش NAV صندوق

گزارش آماری قیمت صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰/۱۲/۱۳۹۹ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



جدول فعالیت صندوق:

فعالیت‌های صندوق در دوره ۱۳۹۹/۰۷/۰۱ تا ۱۳۹۹/۱۲/۳۰	
۹۵۹۶۰۲	NAV صدور در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۰۱
۷۷۷۰۳۷۹	NAV ابطال در تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰
۱۰۰۱۳۰۸۵۸۰۸۳۵۰۵۹	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰
۱۰۳۰۴۰۲۰۱	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در ۱۳۹۹/۱۲/۳۰
۹۰۲۰۷۲۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۲۲۰۸۸۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
(۲۱,۷۰٪)	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
(۲۹,۰۲٪)	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره