



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ / ۰۶ / ۱۴۰۰

مجمع محترم صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی
با سلام؛

به پیوست صورت‌های مالی صندوق سرمایه گذاری توسعه سهام نیکی مربوط به سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰ که در اجرای مفاد بند ۷ ماده ۴۵ اساسنامه صندوق براساس سوابق، مدارک و اطلاعات موجود درخصوص عملیات صندوق تهیه گردیده به شرح زیر تقدیم می گردد.

شماره صفحه	
۳	• صورت خالص دارایی‌ها
۴	• صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها
	• یادداشت‌های توضیحی:
۵	الف. اطلاعات کلی صندوق
۶	ب. مبنای تهیه صورت‌های مالی
۶-۹	پ. خلاصه اهم رویه‌های حسابداری
۱۰-۱۳	ت. گزارشات مرتبط با عملکرد

با سپاس
حامد قنصلی
مدیر صندوق
توسعه سهام نیکی
شماره سند ۴۹۵۴۸
سازمان بورس و اوراق بهادار
جمهوری اسلامی ایران



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

صورت خالص دارایی ها

در تاریخ ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	<u>دارایی ها</u>
۴۸۶,۴۷۶,۰۳۳,۷۵۹	۸۰۹,۶۲۱,۳۹۹,۶۸۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
-	۷۴,۳۱۵,۲۸۲,۰۴۰	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
-	۲۱,۷۳۶,۲۸۸,۵۳۷	حساب های دریافتی
۴۵۷,۰۵۱,۳۴۵	۷۰۶,۷۵۵,۱۰۸	سایر دارایی ها
۳۲۹,۳۶۱,۳۴۹	۳۰۶,۶۴۰	موجودی نقد
<u>۴۸۷,۲۶۲,۴۴۶,۴۵۳</u>	<u>۹۰۶,۳۸۰,۰۳۲,۰۱۰</u>	جمع دارایی ها
		<u>بدهی ها</u>
۵۷,۵۰۷,۸۵۶,۲۱۷	۱۲۷,۴۴۳,۶۴۲,۱۰۶	جاری کارگزاران
۸۵۲,۹۲۱,۲۷۱	۱۴,۶۲۱,۵۵۵,۴۵۵	بدهی به ارکان صندوق
۷۱۲,۴۴۱,۳۰۷	۲,۵۵۴,۴۸۳,۱۱۷	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
<u>۵۹,۰۷۳,۲۱۸,۷۹۵</u>	<u>۱۴۴,۶۱۹,۶۸۰,۶۷۸</u>	جمع بدهی ها
<u>۴۲۸,۱۸۹,۲۲۷,۶۵۸</u>	<u>۷۶۱,۷۶۰,۳۵۱,۳۳۲</u>	خالص دارایی ها
<u>۱,۰۰۹,۰۲۱</u>	<u>۵۸۰,۳۱۵</u>	خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری-ریال

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها

سال مالی منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

دوره مالی ۳ ماه و ۲۵ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	درآمدها:
۱۰,۶۴۱,۹۵۴,۴۰۹	(۲۹۶,۰۰۷,۴۵۸,۰۹۱)	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
(۴۱,۳۴۱,۱۶۹,۱۸۷)	(۱۶۷,۶۲۶,۶۵۲,۱۰۲)	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
-	۲۱,۷۳۶,۲۸۸,۵۳۷	سود سهام
-	۷۸۵,۶۹۷,۸۳۳	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
-	۱,۰۳۴,۳۸۵,۸۴۳	سایر درآمدها
(۳۰,۶۹۹,۲۱۴,۷۷۸)	(۴۴۰,۰۷۷,۷۳۷,۹۸۰)	جمع درآمدها
		هزینه ها:
(۸۵۲,۹۲۱,۲۷۱)	(۱۷,۹۸۲,۳۶۱,۹۸۹)	هزینه کارمزد ارکان
(۲۵۳,۴۹۹,۹۶۲)	(۱,۶۷۰,۶۵۸,۸۹۲)	سایر هزینه ها
(۱,۱۰۶,۴۲۱,۲۳۳)	(۱۹,۶۵۳,۰۲۰,۸۸۱)	جمع هزینه ها
(۳۱,۸۰۵,۶۳۶,۰۱۱)	(۴۵۹,۷۳۰,۷۵۸,۸۶۱)	سود(زیان) قبل از هزینه های مالی
-	(۲,۶۴۴,۶۴۶,۶۴۶)	هزینه های مالی
(۳۱,۸۰۵,۶۳۶,۰۱۱)	(۴۶۲,۳۷۵,۴۰۵,۵۰۷)	زیان خالص
-۳۱/۹۵٪	-۵۱/۸۱٪	بازده میانگین سرمایه گذاری سال
-۶/۷۳	-۶۰/۳۷٪	بازده سرمایه گذاری پایان سال

صورت گردش خالص دارایی ها

دوره مالی ۳ ماه و ۲۵ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	تعداد واحد سرمایه گذاری
-	۴۲۸,۱۸۹,۲۲۷,۶۵۸	۴۲۴,۳۶۱
۴۲۴,۳۶۱,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۱,۱۸۷,۰۰۰,۰۰۰	۹۱۱,۱۸۷
-	(۲۲,۸۸۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۲,۸۸۰)
(۳۱,۸۰۵,۶۳۶,۰۱۱)	(۴۶۲,۳۷۵,۴۰۵,۵۰۷)	-
۳۵,۶۳۳,۸۶۳,۶۶۹	(۹۲,۳۶۰,۴۷۰,۸۱۹)	-
۴۲۸,۱۸۹,۲۲۷,۶۵۸	۷۶۱,۷۶۰,۳۵۱,۳۳۲	۱,۳۱۲,۶۶۸

واحدهای سرمایه گذاری اول سال
واحدهای سرمایه گذاری عادی صادر شده طی سال
واحدهای سرمایه گذاری عادی ابطال شده طی سال
زیان خالص
تعدیلات
خالص دارایی ها (واحد های سرمایه گذاری) در پایان سال

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۱- اطلاعات کلی صندوق:

۱-۱- تاریخچه صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی دارنده شناسه ملی به شماره ۱۴۰۰۹۱۱۴۳۴۷، صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی اختصاصی بوده که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۱۴ تحت شماره ۴۹۵۴۸ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیرتجاری استان تهران و در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۱۷ تحت شماره ۱۱۷۱۰ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار 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 کریم‌خان‌زند، خیابان استاد نجات‌الهی، خیابان ورشو، پلاک ۲۱، واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی‌باشد.

۱-۲- اطلاع‌رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.nicibfund.ir درج گردیده است.

۱-۳- سال مالی صندوق

به موجب مفاد ماده ۵ اساسنامه سال مالی صندوق از اول مهر هر سال شمسی لغایت ۳۱ شهریور سال بعد تعیین 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:** 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، امیدنامه، 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 واحد های ممتاز	تعداد واحد های ممتاز تحت تملک	درصد واحد های تحت تملک
۱	سرمایه‌گذاری ملی ایران	۳۰,۰۰۰	٪۶۰
۲	مدیریت سرمایه‌گذاری ملی ایران	۱۹,۵۰۰	٪۳۹
۳	شرکت کارگزاری سرمایه‌گذاری ملی ایران	۵۰۰	٪۱
	جمع	۵۰,۰۰۰	٪۱۰۰

۲-۲- **مدیر صندوق:** شرکت کارگزاری سرمایه‌گذاری ملی ایران که در تاریخ ۱۳۸۴/۰۴/۰۱ به شماره ثبت ۲۴۸۹۶۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های

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 نجات‌الهی، خیابان ورشو پلاک ۲۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۲-۳ - متولی صندوق: موسسه حسابرسی و بهبود سیستم‌های مدیریت که در تاریخ ۱۳۷۱/۰۳/۱۳ به شماره ثبت ۶۸۷۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های 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 صندوق: موسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود که در تاریخ ۱۳۸۱/۰۴/۲۹ به شماره ثبت ۱۴۱۸۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های 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 اساساً 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 اندازه گیری‌های بعدی به خالص ارزش فروش طبق دستورالعمل "نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری" مصوب ۱۳۸۶/۱۱/۳۰ هیأت مدیره سازمان بورس اوراق بهادار اندازه گیری 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.

۴-۲- سایر دارایی‌ها

سایر دارایی‌ها شامل آن بخش از مخارج می‌باشد که تا تاریخ گزارش مستهلک نشده و به عنوان دارایی به دوره‌های آتی منتقل می‌شود. لازم به ذکر است مخارج تاسیس طی عمر صندوق (تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۲/۱۴)، مخارج عضویت در کانون تا پایان (۱۴۰۰/۰۶/۳۱) و مخارج نرم افزار طی یک سال از تاریخ شناسایی سالیانه 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.

۴-۳- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

۴-۳-۱- سود سهام: درآمد حاصل از سود سهام شرکت‌ها در زمان تصویب سود توسط مجمع عمومی صاحبان سهام شرکت‌های سرمایه‌پذیر 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 دریافتنی با توجه به برنامه زمانبندی پرداخت سود توسط شرکت سرمایه‌پذیر و حداکثر ظرف ۸ ماه، با استفاده از نرخ سود علی الحساب 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.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۲-۳-۴- سود سپرده بانکی و اوراق بهادار بادرآمد ثابت یا علی الحساب :سود تضمین شده اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب،سپرده وگواهیهای سپرده بانکی براساس مدت زمان و باتوجه به مانده اصل سرمایه گذاری شناسایی می شود.همچنین سود سپرده های کوتاه مدت بانکی بطور ماهانه باتوجه به کمترین مانده وجوه در طی ماه در حساب سپرده و

نرخ سود علی الحساب در زمان واریز توسط بانک شناسایی می گردد. مبلغ محاسبه شده سود اوراق بهادار با درآمدثابت یا علی الحساب،سپرده وگواهی های سپرده بانکی با استفاده از نرخ سود همان اوراق و با در نظرگرفتن مدت باقیمانده تا دریافت سود با همان نرخ قبلی تنزیل شده و درحسابهای صندوق سرمایه گذاری منعکس میشود.

۴-۴- ذخایرکارمزد ارکان و تصفیه

کارمزد ارکان و تصفیه صندوق سرمایه‌گذاری به صورت روزانه به شرح 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 سهام و واحدهای صندوق های سرمایه گذاری قابل معامله تحت تملک صندوق بعلاوه ۰,۳ درصد از ارزش روزانه اوراق بهادار با درآمد ثابت تحت تملک صندوق موضوع ۲-۲-۳ و سالانه حداکثر۲٪ (دو درصد) سود حاصل از گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی تا میزان نصاب مجاز سرمایه‌گذاری در آنها به علاوه ده درصد از درآمد حاصل از تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار.*
کارمزد متولی	سالانه پنج در هزار (۰/۰۰۵) از متوسط روزانه ارزش خالص دارایی‌های صندوق که حداقل ۳۵۰ میلیون ریال و حداکثر ۷۰۰ میلیون ریال خواهد بود *
حق الزحمه حسابرس	سالانه مبلغ ثابت ۴۰۰ میلیون ریال
کارمزد تصفیه صندوق برای مدیر	معادل یک در ده هزار (۰/۰۰۰۱) خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق می باشد.**
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 های دسترسی به نرم افزار، تارنما و خدمات پشتیبانی	هزینه دسترسی به نرم‌افزار صندوق، نصب و راه اندازی و تارنمای آن و هزینه‌های پشتیبانی آن‌ها سالانه تا سقف ۲,۰۶۸,۸۲۰,۰۰۰ ریال با ارائه مدارک مثبته و با تصویب مجمع صندوق****

* کارمزد مدیر روزانه براساس ارزش سهام ،و حق تقدم و اوراق بهادار با درآمد ثابت روز کاری قبل و سود علی الحساب دریافتنی سپرده های بانکی در روز قبل وکارمزد متولی روزانه بر اساس ارزش خالص دارایی های روز کاری قبل محاسبه می شود.اشخاص یاد شده کارمزدی بابت روز اول فعالیت صندوق دریافت نمی کنند.

**به منظور توزیع کارمزد تصفیه بین تمام سرمایه‌گذاران در طول عمر صندوق روزانه برابر $\frac{0/003}{n \times 365}$ ضربدر خالص ارزش دارایی‌های صندوق در پایان روز قبل در حسابها، ذخیره می‌شود. n، برابر است با ۳ یا طول عمر صندوق به سال هر کدام کمتر باشد. هر زمان ذخیره صندوق به ۰/۰۱ درصد ارزش خالص دارایی‌های صندوق با نرخ‌های روز قبل رسید، محاسبه ذخیره تصفیه و ثبت آن در حساب‌های صندوق متوقف می‌شود. هرگاه در روزهای بعد از توقف محاسبه یاد شده در اثر افزایش قیمت دارایی‌ها ذخیره ثبت شده کفایت نکند، امر ذخیره‌سازی به شرح یاد شده ادامه می‌یابد.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

***مجموع هزینه های حق پذیرش و عضویت در کانون ها حداکثر برابر ۲۵۰ میلیون ریال است.

***هزینه های دسترسی به نرم افزار، تارنما و خدمات پشتیبانی پس از تصویب مجمع از محل دارایی های صندوق قابل پرداخت است و توسط مدیر در حساب هاب صندوق ثبت شده و به طور روزانه ذخیره یا مستهلک می شود.

۴-۵- بدهی به ارکان صندوق

باتوجه به تبصره ۳ ماده ۴۳ اساسنامه، کارمزد مدیر و متولی هر سه ماه یکبار به میزان ۹۰٪ قابل پرداخت است. باقیمانده کارمزد ارکان به عنوان تعهد صندوق به ارکان در حساب ها منعکس می شود.

۴-۶- مخارج تأمین مالی

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

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

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

۴-۸- تعهدات و شرایط بازارگردانی

صندوق متعهد است که خرید و فروش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی را طبق بند ۷ امیدنامه انجام دهد و یا در شرایط مشخص شده معاف از ایفای تعهدات است. تعهدات بازارگردانی اوراق تعریف شده در بند ۱-۳-۷ امیدنامه و براساس آخرین تغییرات تا تاریخ صورت خالص دارائی ها به شرح ذیل می باشد:

ردیف	نام شرکت	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل حجم معاملات روزانه	دامنه مظنه
۱	سرمایه گذاری ملی ایران	ونیکی	۱۱۵،۰۰۰	۲،۳۰۰،۰۰۰	٪۳
۲	صنعتی آما	فاما	۳۹،۰۰۰	۷۸۰،۰۰۰	٪۳
۳	شهد ایران	غشهد	۱۰۰،۰۰۰	۲،۰۰۰،۰۰۰	٪۳
۴	لوله و ماشین سازی ایران	فلوله	۲۸،۰۰۰	۵۶۰،۰۰۰	٪۳
۵	فیبر ایران	چفبیر	۷۰،۰۰۰	۱،۴۰۰،۰۰۰	٪۳
۶	کارخانجات ایران مریوس	نمرینو	۱۱،۵۰۰	۲۳۰،۰۰۰	٪۳
۷	آلومتک	فالوم	۲۴،۰۰۰	۴۷۰،۰۰۰	٪۲
۸	آلومراد	فمراد	۵،۰۰۰	۱۰۰،۰۰۰	٪۳
۹	ایران خودرو	خودرو	۴،۶۱۰،۰۰۰	۹۲،۲۰۰،۰۰۰	٪۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۱۰	کابل البرز	بالبر	۲۸,۰۰۰	۵۶۰,۰۰۰	٪۳
۱۱	افست	چافست	۲۸,۰۰۰	۵۶۰,۰۰۰	٪۳
۱۲	افرانت	افرا	۱۰,۶۰۴	۲۱۲,۸۰۹	٪۳

۱-۸-۴- باید همواره سفارش‌های خریدوفروش اوراق با رعایت شرایط زیر وارد سامانه معاملات مربوطه گردد:

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

ب (به‌گونه‌ای 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.

۲-۸-۴- 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.

۳-۸-۴- در شرایطی مطابق با هر یک از موارد زیر، صندوق تعهد به انجام وظایف بازارگردانی را ندارد:

۱-۳-۸-۴- 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.

۲-۳-۸-۴- در صورتی که نماد معاملاتی ورقه بهادار مورد نظر بسته باشد.

۳-۳-۸-۴- 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.

۹-۴- محاسبه NAV چندگان

بر اساس مفاد ماده ۹ اساسنامه ارزش خالص هر واحد سرمایه‌گذاری برای عملیات بازارگردانی هر یک از شرکتها در پایان هر روز برابر با ارزش روز دارایی‌های، منهای بدهی‌ها تقسیم بر تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری برای عملیات بازارگردانی شرکت مربوطه (هر نماد به تفکیک) در پایان همان روز است. ارزش روز خالص دارایی‌ها 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 اساسنامه قیمت صدور و ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری به تفکیک عملیات بازارگردانی هر یک از شرکت‌ها تا ساعت ۱۴ روز کاری بعد در تارنمای صندوق افشا می‌گردد.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۵- همچنین ترکیب دارایی‌های صندوق به خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ به شرح نمودار زیر می‌باشد:

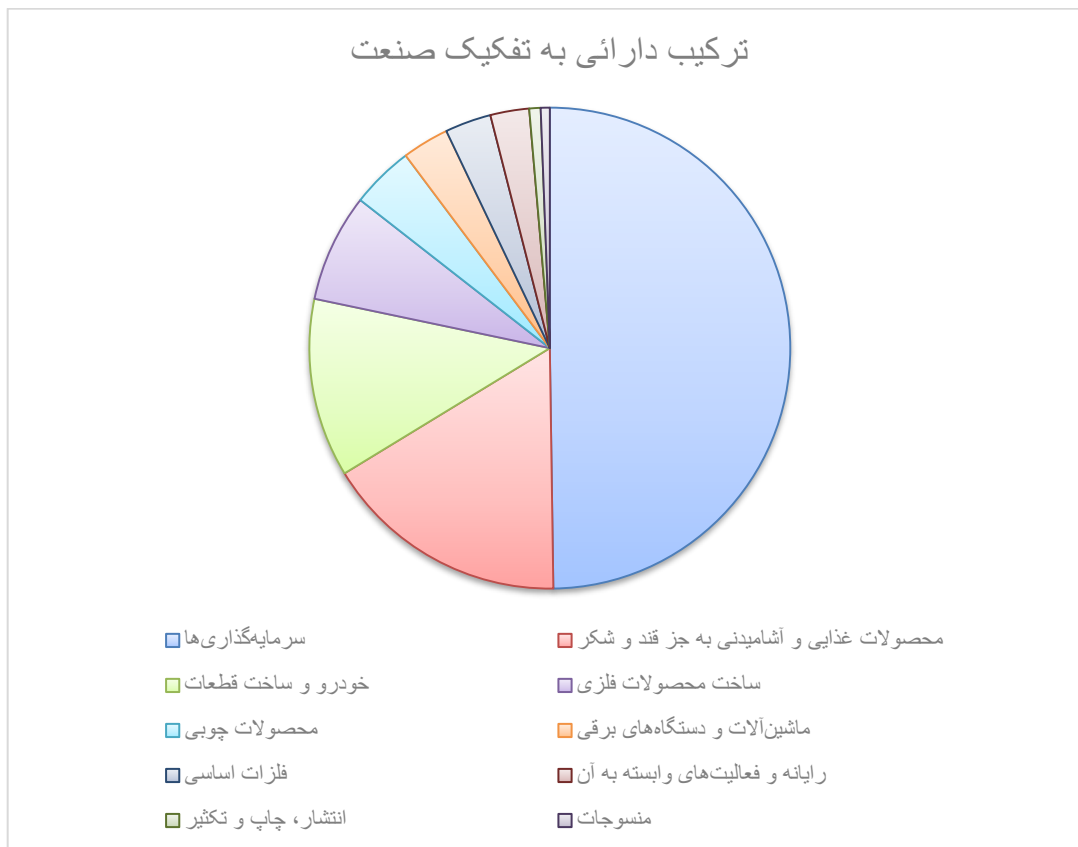


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

همچنین ترکیب دارایی‌های صندوق به تفکیک صنعت در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



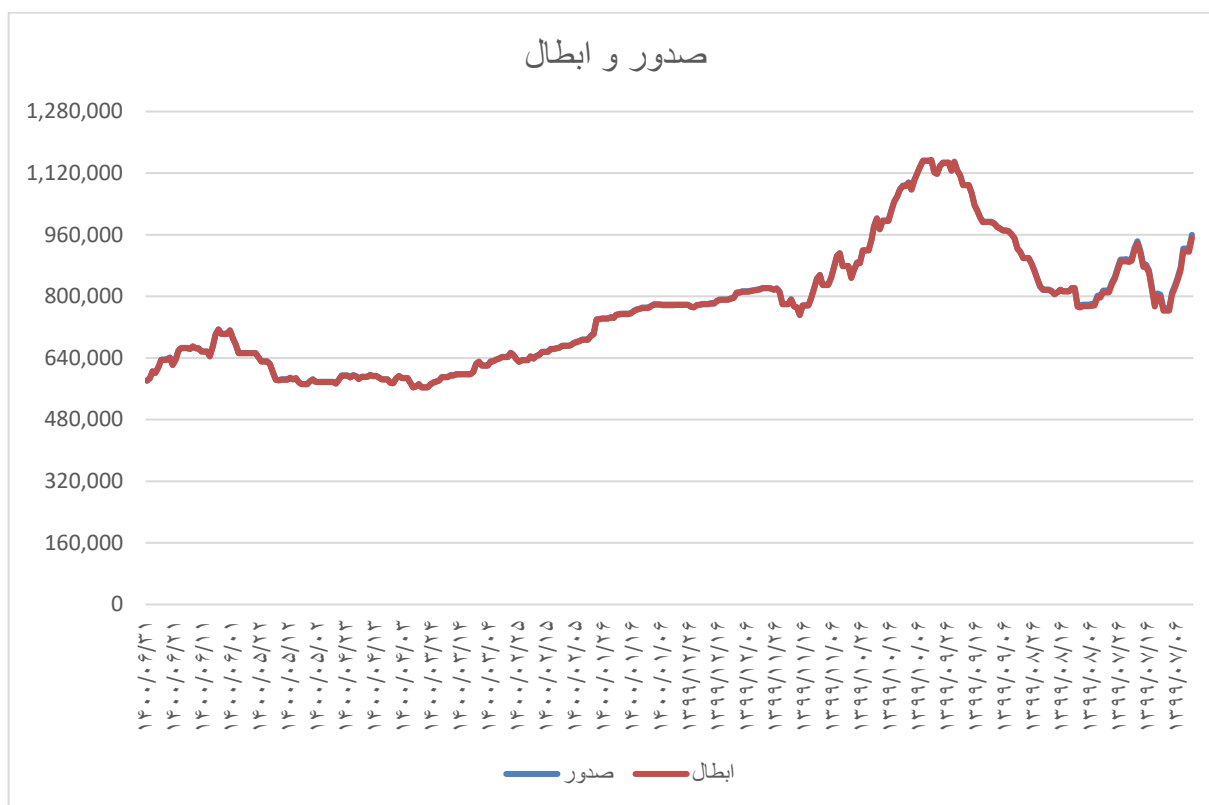
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۶- گزارش NAV صندوق

گزارش آماری قیمت صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق دوره مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی توسعه سهام نیکی

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

جدول فعالیت صندوق:

فعالیت های صندوق در دوره ۱۳۹۹/۰۷/۰۱ تا ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	
۹۵۹,۶۰۲	NAV صدور در تاریخ ۱۳۹۹/۰۷/۰۱
۵۸۰,۳۱۵	NAV ابطال در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
۷۶۱,۷۶۰,۳۵۱,۳۳۲	کل ارزش خالص دارایی ها در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
۱,۳۱۲,۶۶۸	تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران در ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
۹۱۱,۱۸۷	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۲۲,۸۸۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
-۵۱,۸۱٪	بازده میانگین سرمایه گذاری
-۶۰,۳۷٪	بازده سرمایه گذاری پایان سال