

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه

منتهی به ۱۳۹۶,۰۹,۳۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶،۰۹،۳۰

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز در تاریخ ۱۳۸۸/۱۱/۱۰ تحت شماره ۱۰۷۶۲ نزد سازمان بورس به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها و مدیریت این سبد است. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس، اوراق بهادار با درآمد ثابت و سرمایه گذاری می نماید.

با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه‌ی به کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه‌ی اوراق بهادار بین همه‌ی سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه گذار کاهش مییابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه‌ی حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود و کوبین اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش مییابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر داراییها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش مییابد. موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه گذاری در اوراق بهادار و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار است

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، ۲ سال است. جهت ادامه فعالیت صندوق، پس از پایان سال مالی منتهی به ۱۳۹۰/۱۱/۲۶، این صندوق در تاریخ ۱۳۹۱/۰۱/۲۹ تحت شماره ۲۹۰۵۱ نزد اداره ثبت شرکتها به ثبت رسید و در راستای اجرای ماده ۲۸ و بند ۶ ماده ۷ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه ۱۳۸۴، مدت فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۲۸ تمدید گردیده است. مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان کریمخان زند، ابتدای خیابان قائم مقام، کوچه نگین، کوچه زیبا، پلاک ۸ واقع شده است.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶،۰۹،۳۰

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز مطابق با ماده ۵۶ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.momtazfund.com درج گردیده است.

۱-۳- ریسک سرمایه گذاری در صندوق

هر چند تمهیدات لازم به عمل آمده است تا سرمایه گذاری در صندوق سودآور باشد، ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه گذاری های صندوق همواره وجود دارد. بنابراین سرمایه گذاران باید به ریسک های سرمایه گذاری در صندوق از جمله ریسک های زیر داشته باشند.

دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز و عادی با سرمایه گذاری در صندوق، تمام ریسک های فرا روی صندوق را می پذیرند. در سایر بندهای این بخش، برخی از ریسک های سرمایه گذاری در صندوق بر شمرده شده اند.

ریسک کاهش ارزش دارایی های صندوق :

قیمت اوراق بهادار در بازار، تابع عوامل متعددی از جمله وضعیت سیاسی، اقتصادی، اجتماعی، صنعت موضوع فعالیت و وضعیت خاص ناشر و ضامن آن است. با توجه به آنکه ممکن است در مواقعی تمام یا بخشی از داراییهای صندوق در اوراق بهادار سرمایه گذاری شده باشند و از آنجا که قیمت این اوراق می تواند در بازار کاهش یابد، لذا صندوق از این بابت ممکن است متضرر شده و این ضرر به سرمایه گذاران منتقل شود.

ریسک نکول اوراق بهادار با در آمد ثابت :

اوراق بهادار با در آمد ثابت شرکتها بخشی از دارایی های صندوق را تشکیل می دهد. گرچه صندوق در اوراق بهاداری سرمایه گذاری کند که سود حداقل برای آنها تعیین و پرداخت سود و اصلی سرمایه گذاری آن توسط یک مؤسسه معتبر تضمین شده باشد، یا برای پرداخت اصلی و سود سرمایه گذاری در آن ها، و ثابق معتبر و

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶,۰۹,۳۰

کافی وجود داشته باشد؛ ولی این احتمال وجود دارد که طرح سرمایه گذاری مرتبط با این اوراق، سودآوری کافی نداشته باشد یا ناشر و ضامن به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق بهادار، عمل نمایند یا ارزش و ثایق به طرز قابل توجهی کاهش یابد به طوری که پوشش - دهنده ی اصلی سرمایه گذاری و سود متعلق به آن نباشند. وقوع این اتفاقات می تواند باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقبا سرمایه - گذاران شوند.

ریسک نوسان بازده بدون ریسک :

در صورتی که نرخ بازده بدون ریسک (نظیر سود علی الحساب اوراق مشارکت دولتی) افزایش یابد، به احتمال زیاد قیمت اوراق مشارکت و سایر اوراق بهاداری که سود حداقل یا ثابتی برای آنها تعیین شده است، در بازار کاهش مییابد. اگر صندوق در این نوع اوراق بهادار سرمایه گذاری کرده باشد و بازخرد ان به قیمت معین توسط یک مؤسسه ی معتبر (نظیر بانک) تضمین نشده باشد، افزایش نرخ بازده بدون ریسک، ممکن است باعث تحمیلی ضرر به صندوق و متعاقبا سرمایه گذاران گردد.

ریسک نقدشوندگی واحدهای ابطال شده :

از آن جایی که این صندوق فاقد رکن ضامن نقدشوندگی است، لذا در صورتی که دارنده واحد سرمایه گذاری قصد ابطال واحدهای سرمایه گذاری را داشته باشد، مدیر در ابتدا از محل وجوه نقد صندوق اقدام به پرداخت وجوه واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده می نماید. چنانچه وجوه نقد صندوق کفاف بازپرداخت واحدهای ابطال شده را نداشته باشد، مدیر صندوق مطابق اساسنامه اقدام به فروش داراییهای صندوق می نماید تا وجه مورد نیاز را تهیه کند. اگر به هر دلیلی از جمله بسته بودن نماد سهم، صف فروش و گره معاملاتی مدیر صندوق نتواند دارایی های صندوق را به وجه نقد تبدیل کند، مبالغ مربوط به واحدهای ابطال شده، تا تامین وجه نقد به حساب بستنکاری سرمایه گذار منظور میگردد و بازپرداخت این بدهیها با روشی FIFO و براساسی تاریخ و ساعت ثبت سفارشات ابطال انجام می گیرد.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶،۰۹،۳۰

۲- ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز از ارکان زیر تشکیل شده است :

مجمع صندوق سرمایه گذاری، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل ۵ درصد از کل واحدهای ممتاز را در اختیار داشته باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند. در تاریخ ترانزنامه 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
۱	شرکت کارگزاری مفید	۷،۳۵۰	۷۳،۵٪
۲	شرکت سبدگردان انتخاب مفید	۲،۵۰۰	۲۵٪

مدیر صندوق، شرکت سبدگردان انتخاب مفید است که در تاریخ ۱۳۹۵/۰۴/۱۵ با شماره ثبت ۴۹۷۴۰ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران - خیابان آفریقا - بعد از چهارراه جهان کودک - خیابان دیدار شمالی - نبش پدیدار شرقی پلاک ۴۵ طبقه ۷.

مدیر ثبت صندوق، شرکت کارگزاری مفید است که در تاریخ ۱۳۷۳/۰۹/۲۳ با شماره ثبت ۱۰۹۷۳۷ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران - ابتدای خیابان قائم مقام فراهانی - کوچه نگین - کوچه زیبا پلاک ۱.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶،۰۹،۳۰

متولی صندوق، مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین است که در تاریخ ۱۳۷۵/۰۳/۲۸ به شماره ثبت ۸۹۷۷ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، خیابان سهروردی شمالی، خیابان خرمشهر، خیابان عربعلی، پلاک ۱، واحد ۶

حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی رازدار (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۴۹/۱۱/۰۳ به شماره ثبت ۱۱۷۷ در اداره ثبت شرکتهای استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران- میدان آرژانتین- ابتدای خیابان احمد قصیر-خیابان نوزدهم-پلاک ۱۸-واحد ۱۴

۳-خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق ممتاز در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۳۰ :

تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی): ۲۵۶ نفر

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۳۳،۷۵۱ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحد های سرمایه گذاری: ۲۹۶،۳۵۷،۹۷۰،۸۴۸ ریال

NAV ابطال : ۸،۷۸۰،۷۱۷ ریال

NAV صدور : ۸،۸۹۸،۵۰۲ ریال

لازم به ذکر است مقدار بازدهی نه ماهه صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز نسبت به مقدار بازده نه ماهه شاخص بازار برتری داشته است :

بازدهی صندوق : ۲۵،۰۳٪

بازدهی شاخص بازار: ۲۳،۲۶٪

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶،۰۹،۳۰

۴- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک صنعت

صنعت	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	درصد به کل داراییها
	ریال	ریال	درصد
محصولات شیمیایی	۴۴,۱۰۴,۰۵۵,۵۳۷	۳۸,۸۲۱,۴۷۴,۵۸۳	۱۴.۷۴%
استخراج کانه های فلزی	۸,۲۷۷,۰۷۳,۹۴۳	۷,۸۱۸,۸۶۱,۸۲۸	۲.۷۷%
فلزات اساسی	۴۷,۰۱۹,۶۴۸,۹۵۱	۳۰,۰۴۷,۳۹۹,۴۳۱	۱۵.۷۱%
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۲۱,۹۴۴,۷۱۵,۷۹۲	۲۱,۷۶۳,۸۶۰,۸۵۳	۷.۳۳%
مخابرات	۳۷,۴۸۹,۴۷۸,۶۵۰	۲۸,۶۳۸,۸۹۱,۵۸۸	۱۲.۵۳%
بانکها و موسسات اعتباری	۱۲,۱۰۴,۷۳۶,۸۱۸	۱۵,۸۴۱,۸۹۲,۰۹۲	۴.۰۵%
سایر واسطه گری های مالی	۲,۱۳۹,۵۸۴,۰۵۹	۲,۵۹۶,۱۷۸,۰۳۴	۰.۷۲%
سرمایه گذارینها	۱,۱۸۹,۷۰۶,۱۵۵	۱,۷۱۹,۱۹۸,۶۶۹	۰.۴۰%
خودرو و ساخت قطعات	۱۳,۷۱۲,۵۶۸,۶۶۰	۱۳,۵۷۷,۴۵۵,۱۸۷	۴.۵۸%
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۱۰,۷۶۷,۴۴۱,۴۸۷	۷,۴۴۸,۷۹۶,۱۹۹	۳.۶۰%
مواد و محصولات دارویی	۱۶,۷۰۱,۴۲۸,۲۷۰	۱۸,۳۵۴,۹۴۳,۰۱۴	۵.۵۸%
لاستیک و پلاستیک	۳,۸۶۵,۶۲۳,۱۵۸	۳,۵۵۱,۳۶۶,۱۶۳	۱.۲۹%
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۳,۰۳۲,۶۹۰,۱۳۸	۳,۲۳۳,۹۴۱,۲۱۷	۱.۰۱%
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۴,۹۲۸,۲۰۲	۴,۹۹۹,۷۴۹	۰.۰۰%
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۳۴,۲۴۸,۸۸۵,۵۲۵	۲۷,۴۴۰,۷۶۹,۷۳۳	۱۱.۴۵%
ماشین آلات و تجهیزات	۱۰,۵۸۷,۲۳۶,۰۳۰	۹,۴۸۲,۹۶۸,۶۸۱	۳.۵۴%
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۱,۲۴۶,۱۸۳,۸۹۱	۱,۲۰۵,۲۵۶,۵۹۸	۰.۴۲%
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳,۹۳۰,۷۹۷,۳۷۵	۲,۵۴۸,۸۲۱,۵۲۷	۱.۳۱%
	۲۷۲,۳۶۶,۷۸۲,۶۴۱	۲۳۴,۰۹۷,۰۷۵,۱۴۶	۹۱.۰۲%

با تشکر
حجت اله نصرتیان
مدیرعامل

ممتاز
ش.ت: ۴۹۰۵۱