

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی سه ماهه

منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز با شناسه ملی ۱۰۳۲۰۷۵۳۹۴۶ در تاریخ ۱۳۸۸/۱۱/۱۰ تحت شماره ۰۷۶۲ انزد 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 میابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه‌ی حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود و کوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه‌ی هزینه‌ی هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش میابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر داراییها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش میابد. 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 ۱۴۰۲/۰۱/۲۸ 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 سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

۲-۱- 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.

۳-۱- 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 ثایق معتبر و

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

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 بازخرید آن 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 سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

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 ترازنامه 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 | گروه خدمات بازار سرمایه مفید | ۹۹۰,۰۰۰ | ۹۹.۰% |
| ۲ | شرکت کارگزاری مفید | ۱۰,۰۰۰ | ۰.۱% |
| | جمع | ۱,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۰۰% |

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 سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

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، مؤسسه حسابرسی فراز مشاور (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ به شماره ثبت ۳۴۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت ها و مؤسسات غیرتجاری تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران، خیابان آفریقا، مجتمع الهیه، شماره ۲۴۴، طبقه ۶، واحد ۶۰۷

۳-خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق ممتاز در تاریخ ۱۳۹۹/۰۳/۳۱ :

تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی): ۲۰۸۵ نفر

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۱۸,۲۶۹,۳۶۶ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحدهای سرمایه گذاری: ۲,۴۷۲,۷۵۹,۴۸۶,۱۱۸ ریال

NAV ابطال : ۱۳۵,۳۵۰ ریال

NAV صدور : ۱۳۵,۸۷۲ ریال

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه ممتاز

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۳.۳۱

۴- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک صنعت

| ۱۳۹۹.۰۳.۳۱ | | | صنعت |
|---------------------|-----------------|-------------------|--|
| درصد به کل داراییها | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | |
| درصد | ریال | ریال | |
| ۱۵/۹۴٪ | ۱۵۸,۰۸۵,۴۱۹,۲۶۰ | ۴۰۲,۳۹۶,۸۶۳,۸۲۲ | محصولات شیمیایی |
| ۱/۶۴٪ | ۱۶,۴۳۵,۷۹۴,۱۲۵ | ۴۱,۳۲۹,۴۹۷,۸۱۲ | استخراج کانه های فلزی |
| ۷/۴۱٪ | ۲۲,۲۲۱,۱۷۹,۰۰۶ | ۱۸۶,۹۷۴,۹۹۷,۶۳۶ | فلزات اساسی |
| ۲/۳۳٪ | ۱۳,۵۳۵,۷۲۸,۲۸۲ | ۵۸,۸۲۶,۶۴۴,۶۸۸ | شرکتهای چند رشته ای صنعتی |
| ۴/۰۴٪ | ۴۴,۸۰۵,۷۷۱,۳۶۵ | ۱۰۲,۰۳۱,۰۷۷,۱۰۷ | سرمایه گذاریها |
| ۰/۰۶٪ | ۴۸۱,۲۲۲,۳۷۳ | ۱,۵۸۲,۹۵۳,۰۹۲ | سیمان، آهک و گچ |
| ۰/۸۵٪ | ۱,۷۰۶,۷۳۷,۱۵۷ | ۲۱,۵۲۸,۷۳۶,۰۰۲ | مواد و محصولات دارویی |
| ۰/۰۱٪ | ۲۷۵,۷۵۸,۰۳۲ | ۲۹۵,۲۷۶,۲۴۱ | محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر |
| ۲/۱۳٪ | ۶,۳۳۰,۶۶۳,۴۱۳ | ۵۳,۸۵۹,۱۱۷,۳۰۲ | عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم |
| ۳/۶۸٪ | ۳۹,۹۵۲,۲۳۷,۳۰۴ | ۹۲,۹۸۰,۲۹۹,۸۱۷ | بانکها و موسسات اعتباری |
| ۴/۱۳٪ | ۶,۵۳۴,۴۳۲,۹۵۷ | ۱۰۴,۳۵۳,۱۷۹,۴۴۴ | ماشین آلات و تجهیزات |
| ۱/۰۱٪ | ۱۱,۸۹۵,۷۷۷,۶۹۵ | ۲۵,۵۸۶,۹۲۳,۱۵۴ | فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای |
| ۲/۹۳٪ | ۱۹,۱۵۱,۴۲۷,۵۵۸ | ۷۳,۹۶۸,۷۹۲,۶۶۹ | فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط |
| ۰/۱۸٪ | ۸,۷۲۵,۰۳۲,۷۴۴ | ۲۱,۷۵۷,۰۳۴,۳۴۹ | واسطه گری های مالی و پولی |
| ۰/۰۹٪ | ۱,۹۵۸,۶۲۵,۲۷۶ | ۲,۲۰۳,۶۰۶,۳۷۷ | لاستیک و پلاستیک |
| ۰/۴۱٪ | ۶,۹۶۱,۲۸۰,۰۲۰ | ۱۰,۴۳۰,۵۷۶,۰۶۲ | گواهی سپرده طلا |
| ۴۷/۵۳٪ | ۳۵۹,۰۵۷,۰۸۶,۵۶۷ | ۱,۲۰۰,۱۰۵,۵۷۵,۵۷۴ | |

با تشکر
 حجت اله نصرتیان
 مدیریت دارایی برعامل
انتخاب مشیر