



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردان آینده نگر توسعه سینا

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردان آینده نگر توسعه سینا

گزارش عملکرد

برای دوره ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

گزارش عملکرد

برای دوره‌ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۸



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا برای دوره‌ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۸ که در اجرای بند ۷ ماده ۴۵ اساسنامه صندوق براساس سوابق و مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده، به شرح زیر تقدیم می‌گردد:

۲	تاریخچه فعالیت صندوق :
۲	موضوع فعالیت صندوق :
۲	هدف از تشکیل صندوق :
۲	ارکان صندوق :
۳	دوره فعالیت صندوق :
۳	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق :
۳	دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز :
۴	اطلاع رسانی :
۴	صورت خالص دارائی ها :
۵	سود (زیان) حاصل از فروش سهام :
۵	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام :
۵	خرید و فروش سهام :
۶	ترکیب داراییهای صندوق :
۷	خلاصه عملکرد صندوق :

امضاء

نام و نام خانوادگی

شرکت سبدگردان الگوریتم

آرش آفاقلیزاده خیای

مدیر صندوق





تاریخچه فعالیت صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا که صندوقی با سرمایه باز در اندازه بزرگ محسوب می‌شود، در تاریخ ۱۳۹۴/۱۱/۲۶ طی شماره ۳۷۹۰۱ در اداره ثبت شرکتها و در تاریخ ۱۳۹۴/۱۲/۰۸ تحت شماره ۱۱۴۰۷ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری از صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه‌گذاران است. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه ۳ سال شمسی است.

مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، طبقه ۴، واحد ۴۱۰ می‌باشد.

موضوع فعالیت صندوق:

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در ماده ۲-۲ امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است.

هدف از تشکیل صندوق:

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 صورتی که 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.

ارکان صندوق:

مدیر: مدیر صندوق، شرکت سیدگردان الگوریتم است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۰۳ با شماره ثبت ۵۲۲۰۰۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: شهر تهران، محله دانشگاه تهران، خیابان فلسطین، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، مجتمع تجاری اداری بزرگمهر، طبقه چهارم، واحد ۴۱۰

متولی: متولی صندوق، موسسه حسابرسی آزمودگان که در تاریخ ۱۳۶۹/۱۱/۲۸ به شماره ثبت ۴۶۸۴ در اداره ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: خیابان کریم‌خان زند، خیابان دکتر عضدی (آبان جنوبی) شماره ۵۲، طبقه دوم.

حسابرس: حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی و خدمات مالی همیار حساب است که در تاریخ ۱۳۷۱/۰۲/۲۲ به شماره ثبت ۶۷۶۹ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، خیابان کارگر شمالی، خیابان میرخانی (نصرت شرقی)، پلاک ۵۴، طبقه ۲، واحد ۴.

کارگزار : برای انجام معاملات صندوق، شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی انتخاب گردیده است.

دوره فعالیت صندوق :

دوره فعالیت صندوق از تاریخ قید شده در مجوز فعالیت که توسط سازمان به نام صندوق صادر می‌شود؛ شروع شده و از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکت‌ها به مدت سه سال شمسی ادامه می‌یابد که مطابق تاییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار مدت زمان فعالیت صندوق تا ۱۴۰۰/۱۱/۲۵ تمدید گردید. این مدت مطابق ماده ۴۹ اساسنامه قابل تمدید است. سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای مهرماه هر سال تا انتهای شهریورماه سال بعد است.

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق :

ارزش مبنای هر واحد سرمایه‌گذاری برابر یک میلیون ریال است که باید روی گواهی‌های سرمایه‌گذاری قید شود. واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می‌شود:

الف) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز که تعداد آنها ۲۵,۰۰۰ (دست کم ۷۰٪ حداقل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق) واحد سرمایه‌گذاری است، در زمان تأسیس کلاً توسط مؤسسان صندوق خریداری می‌شود. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر می‌باشد.

ب) واحدهای سرمایه‌گذاری عادی که تعداد آنها ۸,۲۲۶ واحد سرمایه‌گذاری است، که در زمان تأسیس یا پس از تشکیل صندوق صادر می‌شود. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری قابل ابطال ولی غیرقابل انتقال می‌باشد. حداکثر واحدهای سرمایه‌گذاری عادی نزد سرمایه‌گذاران در امیدنامه قید شده است.

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و عادی:

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و عادی به شرح جدول زیر می‌باشد.

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری	نوع واحد	تعداد واحد سرمایه‌گذاری	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری
۱	شرکت سبدگردان الگوریتم	ممتاز	۱۳,۰۰۰	۳۹٪
۲	شرکت سرمایه‌گذاری خوارزمی	ممتاز	۷,۰۰۰	۲۱٪
۳	شرکت تامین سرمایه سپهر	ممتاز	۴,۰۰۰	۱۲٪
۴	شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی	ممتاز	۱,۰۰۰	۳٪
۵	صنایع غذایی شهیدین گام	عادی	۸,۲۲۶	۲۵٪
	جمع		۳۳,۲۲۶	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

گزارش عملکرد

برای دوره‌ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۳۹۸



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

اطلاع رسانی:

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری مشترک خوارزمی مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.tsfund.ir درج گردیده است.

صورت خالص دارایی‌ها:

۱۳۹۷/۰۹/۳۰	۱۳۹۸/۰۶/۳۱	دارایی‌ها :
ریال	ریال	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۷,۶۱۲,۷۰۲,۶۰۱	۵۳,۵۷۵,۸۷۸,۷۴۰	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۲,۴۴۳,۶۳۱,۹۲۷	۱۷,۷۰۰,۶۷۱,۴۸۴	سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۱۸,۲۰۲,۱۴۸,۰۲۱	۱۹,۴۱۷,۰۷۲,۶۸۷	حسابهای دریافتی تجاری
۱,۱۹۸,۰۱۲,۰۰۱	۹۹۰,۸۷۷,۷۱۱	سایر دارایی‌ها
۴۶	.	جاری کارگزاران
۵۹۴,۱۴۰,۰۱۱	۳۴۱,۹۲۵,۴۳۰	جمع دارایی‌ها
۴۰,۰۵۰,۶۳۴,۶۰۷	۹۲,۰۲۶,۴۲۶,۰۵۴	
		بدهی‌ها :
(۸۲۹,۵۵۸,۴۵۰)	(۱,۰۱۱,۶۰۷,۰۰۷)	بدهی به ارکان صندوق
(۹۸,۳۱۹,۸۴۱)	(۱۴۲,۰۳۵,۹۶۸)	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
(۹۲۷,۸۷۸,۲۹۱)	(۱,۱۵۳,۶۴۲,۹۷۵)	جمع بدهی‌ها
۳۹,۱۲۲,۷۵۶,۳۱۶	۹۰,۸۷۲,۷۸۳,۰۷۹	خالص دارایی‌ها
۱,۵۶۴,۹۱۰	۲,۷۳۴,۹۹۰	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

گزارش عملکرد

برای دوره‌ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۳۹۸



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس به شرح زیر است:

شرح	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	مالیات (ریال)	سود (زیان) فروش
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۱۰,۲۷۷,۵۳۷	۵۱,۱۰۴,۳۹۱,۰۲۴	۴۲,۵۶۱,۹۴۰,۱۰۸	(۲۰۳,۹۶۶,۲۹۱)	۰	۸,۳۳۸,۴۸۴,۶۲۵
داروسازی سینا	۱,۰۸۸,۴۱۲	۱۶,۳۷۰,۲۶۵,۹۷۱	۱۱,۸۶۳,۱۲۷,۴۱۹	(۶۵,۳۱۶,۶۰۹)	۰	۴,۴۴۱,۸۲۱,۹۴۳
داروسازی سینا (حق تقدم)	۹۱۱,۷۱۴	۷,۷۱۳,۸۷۹,۷۹۳	۷,۳۴۶,۸۹۵,۴۷۵	(۴,۷۶۲,۵۵۰)	۰	۳۶۲,۲۲۱,۷۶۸
ویتانا	۹۰۴,۲۱۱	۱۴,۳۳۱,۸۶۶,۳۴۴	۱۲,۷۷۴,۵۲۱,۸۰۷	(۵۷,۱۸۳,۶۳۹)	۰	۱,۵۰۰,۱۶۰,۸۹۸
جمع	۱۳,۱۸۱,۸۷۴	۸۹,۵۲۰,۴۰۳,۱۳۲	۷۴,۵۴۶,۴۸۴,۸۰۹	(۳۳۱,۲۲۹,۰۰۸۹)	۰	۱۴,۶۴۲,۶۸۹,۲۳۴

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس:

شرح	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	مالیات (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
ویتانا	۱,۱۶۵,۰۰۰	۲۰,۸۴۷,۶۷۵,۰۰۰	۱۸,۷۸۹,۶۱۷,۱۶۳	(۸۳,۱۸۲,۲۲۶)	۰	۱,۹۷۴,۸۷۵,۶۱۱
دارو سازی سینا	۱,۵۱۴,۴۲۴	۲۹,۱۲۳,۸۸۷,۹۴۴	۱۸,۳۱۴,۸۷۰,۷۳۹	(۱۱۶,۲۰۴,۳۱۳)	۰	۱۰,۶۹۲,۸۱۲,۸۹۲
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۴۰۳,۱۸۲	۳,۸۱۸,۹۳۹,۹۰۴	۲,۵۱۷,۱۲۳,۲۶۵	(۱۵,۲۳۷,۵۷۰)	۰	۱,۲۸۶,۵۷۹,۰۶۹
جمع	۳,۰۸۲,۶۰۶	۵۳,۷۹۰,۵۰۲,۸۴۸	۳۹,۶۲۱,۶۱۱,۱۶۷	(۲۱۴,۶۲۴,۱۰۹)	۰	۱۳,۹۵۴,۲۶۷,۵۷۲

خرید و فروش سهام

طی دوره	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
سهام				
داروسازی سینا	۱,۰۲۹,۵۱۸	۱,۰۸۸,۴۱۲	۱۵,۶۷۸,۱۵۲,۰۸۱	۱۶,۳۰۴,۹۴۹,۳۶۲
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۸,۸۴۰,۷۷۹	۱۰,۲۷۷,۵۳۷	۴۰,۸۰۵,۴۴۳,۳۴۶	۵۰,۹۰۰,۴۸۶,۶۴۵
ویتانا	۲,۰۶۹,۲۱۱	۹۰۴,۲۱۱	۳۱,۵۶۴,۱۳۸,۹۷۰	۱۴,۲۷۴,۶۸۲,۷۰۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

گزارش عملکرد

برای دوره‌ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۳۹۸

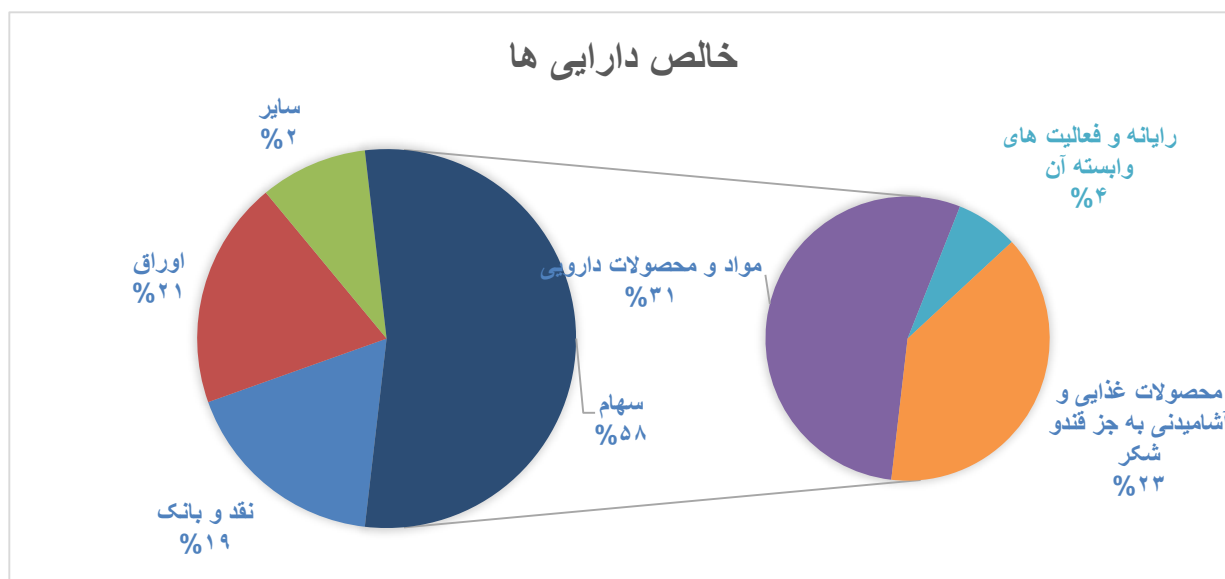


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

ترکیب داراییهای صندوق:

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تأسیس صندوق		میانگین روزانه ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		امروز	
	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)
سهام	۱۰,۷۸۲	۲۸,۹۵	۴۰,۴۱۹	۵۷,۷۳	۴۸,۲۲۲	۵۵,۸۸	۵۳,۵۷۵	۵۸,۲۲
اوراق	۲۳,۰۶۲	۶۱,۹۳	۱۹,۲۸۳	۲۷,۵۴	۱۹,۴۰۴	۲۲,۴۸	۱۹,۴۱۷	۲۱,۰۱
وجه نقد	۲,۳۸۰	۶,۳۹	۷,۲۵۵	۱۰,۳۶	۱۴,۳۳۸	۱۶,۶۱	۱۷,۷۰۰	۱۹,۲۳
سایر دارایی‌ها	۱,۳۸۸	۳,۷۳	۳,۹۰۲	۵,۵۷	۵,۴۴۵	۶,۳۱	۲,۴۴۲	۲,۶۵
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۲۱,۲۸۵	۵۷,۱۶	۴۰,۴۱۹	۵۷,۷۳	۴۸,۲۲۲	۵۵,۸۸	۵۳,۵۷۵	۵۸,۲۲
مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد *								

نمودار ترکیب دارایی:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا
گزارش عملکرد
برای دوره‌ی مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۳۹۸



نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



خلاصه عملکرد:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان آینده‌نگر توسعه سینا

شرح	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰
خالص ارزش دارایی‌ها	۹۰,۸۷۲,۷۸۳,۰۷۹	۳۹,۱۲۲,۷۵۶,۳۱۶
قیمت صدور هر واحد	۲,۷۴۸,۷۰۲	۱,۵۷۱,۵۸۲
قیمت ابطال هر واحد	۲,۷۳۴,۹۹۰	۱,۵۶۴,۹۱۰
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری	۳۳,۲۲۶	۲۵,۰۰۰