

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی پرگار

گزارش عملکرد مدیر صندوق

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۲



گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی پرگار دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۲

۱. مقدمه

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی پرگار تحت شماره ۱۱۸۳۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده و در تاریخ ۱۴۰۰/۰۳/۰۱ مجوز فعالیت دریافت نموده است. همچنین صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۱۷ تحت شماره ثبت ۵۱۴۲۲ و شناسه ملی ۱۴۰۰۹۹۲۸۲۸۷ در اداره ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آن‌ها به خرید اوراق بهادار پذیرفته شده در بورس تهران/ فرا بورس ایران، اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده‌ها و گواهی سپرده بانکی در راستای انجام فعالیت بازارگردانی و بهره‌گیری از صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه‌گذاران است. مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان وزرا، خیابان سوم، پلاک ۱۳، طبقه اول واقع شده است.

۲. اهداف و استراتژی‌های صندوق

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری وجوه 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 صورتی‌که 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. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد؛ اولاً، هزینه بکارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه‌گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. ثالثاً، امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی است. موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره‌نویسی و یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است.

۳. اطلاع رسانی

کلید اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی پرگار مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس <https://pargarfund.ir> درج گردیده است.

۴. ریسک سرمایه‌گذاری در صندوق

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

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

۱-۴- 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 سرمایه‌گذاری شده باشند و از آنجا که قیمت این اوراق می‌تواند در بازار کاهش یابد، لذا صندوق از این بابت ممکن است متضرر شده و این ضرر به سرمایه‌گذاران منتقل شود.

۲-۴- ریسک نقدشوندگی واحدهای ابطال شده:

از آن جایی که این صندوق فاقد رکن ضامن نقدشوندگی است، لذا در صورتی که دارنده واحد سرمایه‌گذاری قصد ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری را داشته باشد، مدیر در ابتدا از محل وجوه نقد صندوق اقدام به پرداخت وجوه واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده می‌نماید. چنانچه وجوه نقد صندوق کفاف بازپرداخت واحدهای ابطال شده را نداشته باشد، مدیر صندوق مطابق اساسنامه اقدام به فروش داراییهای صندوق می‌نماید 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 بستانکاری سرمایه گذار منظور میگردد و بازپرداخت این بدهیها با روشی FIFO و براساسی تاریخ و ساعت ثبت سفارشات ابطال انجام می گیرد.

۵. ارکان صندوق:

- مدیر صندوق شرکت کارگزاری سرمایه و دانش به شناسه ملی ۱۰۱۰۲۷۳۱۲۹۱
- متولی صندوق موسسه حسابرسی و انیٹیک تدبیر به شناسه ملی ۱۰۳۲۰۷۲۱۸۶۲
- حسابرس صندوق موسسه حسابرسی رازدار به شناسه ملی ۱۰۱۰۰۱۲۹۰۸۶
- **مجمع صندوق سرمایه گذاری**، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه گذاری ممتاز از حق رای در مجمع برخوردارند. در تاریخ خالص دارایی ها، دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رای بوده اند شامل اشخاص زیر است:

| ردیف | نام دارندگان واحدهای ممتاز | تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک | درصد واحدهای تحت تملک ممتاز |
|------|-----------------------------|------------------------------|-----------------------------|
| ۱ | شرکت کارگزاری سرمایه و دانش | ۳۰,۰۰۰ | %۷۵ |
| ۲ | شرکت توسعه تدبیر پیشه پویا | ۱۰,۰۰۰ | %۲۵ |
| | جمع | ۴۰,۰۰۰ | %۱۰۰ |

۶. خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران:

| | |
|--------------------------------------|-----------------|
| خالص ارزش روز داراییها | ۹۷۳,۷۶۴,۹۵۳,۱۶۷ |
| آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری | ۱,۰۶۲,۸۸۸ |
| آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری | ۱,۰۶۱,۳۲۳ |
| گواهی های ممتاز | ۴۰,۰۰۰ |
| گواهی های عادی | ۹۱۷,۵۰۱ |
| تعداد اشخاص حقیقی | ۱ |
| تعداد اشخاص حقوقی | ۱۰ |

۷. بازدهی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازگردانی پرگار و سهام در طی دوره مالی به شرح زیر میباشد:

| سهام سرمایه گذاری پارس توشه | سهام لامپ پارس شهاب | سهام پارس خزر | سهام دلیجان طلایی شکوه پارس | سهام کارتن ایران | سهام ریل گردش ایرانیان | سهام توسعه و تجارت هیرمند | سهام توسعه و عمران استان کرمان | سهام سرمایه گذاری توسعه آذربایجان |
|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|
| بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار | بازدهی صندوق بازگردانی پرگار |
| % ۱۷۰۴۸۸ | % ۱۱۰۱۷ | % (۴۰۵۹۹) | % (۲۰۰۵۰۵) | % (۸۰۶۷۳) | % ۴۰۳۶۳ | % ۲۰۰۸۸ | % (۲۰۸۶۲) | % ۰ |

۸. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (سرمایه گذاری پارس توشه) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۱۰۳،۰۵۰،۹۴۳،۹۲۹ | ۱۰۸،۰۰۸۲،۶۴۲،۹۳۱ | ۱۳،۶۳۳،۵۸۷ | ۱۳،۷۷۷،۸۶۹ |

۹. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (لامپ پارس شهاب) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۱۳۱،۲۴۸،۴۰۶،۵۴۶ | ۱۳۱،۹۶۳،۵۶۷،۸۹۵ | ۵،۲۶۹،۸۴۱ | ۵،۲۲۴،۵۳۵ |

۱۰. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (پارس خزر) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۷۷،۸۲۵،۷۱۱،۱۷۰ | ۷۲،۴۹۹،۸۳۳،۴۴۷ | ۴،۴۴۱،۸۰۸ | ۴،۱۹۶،۲۰۳ |

۱۱. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (دلیجان طلایی شکوه پارس) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۳۳۲،۶۵۲،۴۳۸،۲۸۸ | ۲۱۰،۳۴۴،۲۵۳،۴۰۷ | ۴۳،۱۸۸،۰۲۹ | ۳۰،۰۵۷،۳۵۰ |

۱۲. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (کارتن ایران) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۱۷۳,۴۶۹,۵۱۳,۳۵۲ | ۱۷۳,۸۹۸,۵۵۱,۷۴۴ | ۲۹,۳۸۶,۰۹۴ | ۳۰,۱۸۷,۰۶۶ |

۱۳. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (ریل گردش ایرانیان) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۴۲۳,۳۱۸,۵۷۷,۱۳۴ | ۴۲۷,۴۲۷,۷۶۶,۷۸۱ | ۱۰۳,۲۱۶,۲۸۱ | ۹۴,۴۵۶,۸۴۱ |

۱۴. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (توسعه و تجارت هیرمند) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۱۴۲,۵۴۲,۴۰۷,۲۰۶ | ۱۱۹,۹۴۵,۲۱۰,۵۴۰ | ۱۱,۹۲۶,۵۲۲ | ۱۰,۳۱۵,۸۴۳ |

۱۵. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (توسعه و عمران استان کرمان) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۱۷۷,۷۷۵,۸۱۹,۸۹۱ | ۱۱۷,۸۱۳,۹۸۲,۶۸۸ | ۱۳۶,۶۱۰,۷۳۹ | ۸۷,۵۱۷,۴۲۹ |

۱۶. ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازگردانی (سرمایه گذاری توسعه آذربایجان) طی دوره مالی:

| ارزش معاملات خرید | ارزش معاملات فروش | حجم معاملات خرید | حجم معاملات فروش |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| ریال | ریال | تعداد | تعداد |
| ۳۲۱,۹۲۷,۹۳۹,۴۹۰ | ۱۸۲,۹۶۷,۴۶۱,۸۷۷ | ۲۸,۱۸۱,۸۲۲ | ۱۶,۰۲۹,۸۹۱ |

۱۷. ترکیب دارایی های صندوق

| عنوان | مبلغ (میلیون ریال) | نسبت از کل دارایی (درصد) |
|----------------------|--------------------|--------------------------|
| سرمایه گذاری در سهام | ۹۶۱,۲۹۹ | ۹۲,۷۷ |
| سایر دارایی ها | ۱,۳۲۳ | ۰,۱۳ |
| حساب های دریافتی | ۴,۱۷۴ | ۰,۴۰ |
| موجودی نقد | ۶۹,۴۷۲ | ۶,۷۰ |
| جمع | ۱,۰۳۶,۲۶۸ | ۱۰۰ |

مدیر صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی پرگار
امیر علی مستخدمین حسینی



شرکت کارگزاری
سرمایه و دانش
SARMAYEH & DANESH
BROKERAGE CO.

