

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری تجارت شخصی کاروان

برای دوره مالی مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

فهرست مطالب

۱- تاریخچه :	۲
۲- ارکان صندوق:	۲
۱-۲ مجمع صندوق:	۲
۲-۲ مدیر صندوق:	۳
۳-۲ متولی صندوق:	۳
۴-۲ بازارگردان صندوق	۳
۵-۲ حسابرس صندوق	۳
۳- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۴
۱-۳ صورت خالص دارایی ها	۴-۵
۲-۳ صورت سود و زیان	۵
۴- گزارش تغییرات دوره ای صندوق تجارت شاخصی کاردان	۶

۱- تاریخچه :

صندوق سرمایه‌گذاری تجارت شاخصی کاردان که صندوقی با سرمایه باز در اندازه بزرگ محسوب می‌شود، در تاریخ ۱۳۹۳/۱۱/۰۵ تحت شماره ۳۵۳۳۲ نزد اداره ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری استان تهران و در تاریخ ۱۳۹۳/۱۱/۱۱ تحت شماره ۱۱۳۱۲ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است و مجوز فعالیت خود را در تاریخ ۱۳۹۴/۰۱/۱۷ از سازمان بورس و اوراق بهادار اخذ نموده است. هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این اهداف، صندوق در اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده‌ها و گواهی سپرده بانکی، سهام پذیرفته شده در بورس تهران و فرابورس ایران سرمایه‌گذاری می‌نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه نا محدود می‌باشد (سال مالی صندوق به مدت یکسال شمسی، از ابتدای خرداد ماه هر سال تا انتهای اردیبهشت ماه سال بعد است) آدرس صندوق خیابان نلسون ماندلا، خیابان کاج آبادی، پلاک ۱۱۴، طبقه سوم است.

۲- ارکان صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری تجارت شاخصی کاردان که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱-۲ مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. در مجمع صندوق دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه‌گذاری ممتاز، یک حق رای دارند. مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رای صندوق تشکیل شده و رسمیت می‌یابد. در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده‌اند شامل اشخاص زیر است :

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت تامین سرمایه کاردان	۱.۹۹۰.۰۰۰	۵
۲	تدبیرگران فردای امید	۱۰.۰۰۰	۹۵
جمع		۲.۰۰۰.۰۰۰	۱۰۰

۲-۲ مدیر صندوق: شرکت تامین سرمایه کاردان (سهامی خاص) که در تاریخ ۱۳۹۲/۱۰/۱۷ به شماره ثبت ۴۴۸۲۷۱ نزد اداره ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. آدرس مدیر صندوق خیابان نلسون ماندلا، خیابان کاج آبادی، پلاک ۱۱۴، طبقه سوم است.

۲-۳ متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری آرمان آتی که در تاریخ ۱۳۸۹/۱۲/۰۴ به شماره ثبت ۳۹۷۶۳۲ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، خیابان ولیعصر، بالاتر از پارک ساعی، ساختمان سرو ساعی، طبقه ۱۷، واحد ۱۷۰۵

۲-۴ بازارگردان صندوق: شرکت تامین سرمایه کاردان (سهامی خاص) که در تاریخ ۱۳۹۲/۱۰/۱۷ به شماره ثبت ۴۴۸۲۷۱ نزد اداره ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. آدرس مدیر صندوق خیابان نلسون ماندلا، خیابان کاج آبادی، پلاک ۱۱۴، طبقه سوم است.

۲-۵ حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی فریوران راهبرد (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۶۶/۰۴/۲۳ با شماره ثبت ۳۳۰۹ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از: تهران، خ سپهبد قرنی، نرسیده به پل کریمخان، کوچه خسرو غربی، پلاک ۲۴، واحد ۱۰.

۳- اطلاعات صندوق سرمایه گذاری تجارت شاخصی کاردان در تاریخ ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

خالص ارزش روز دارایی ها: ۳.۹۴۵.۲۳۴.۱۳۱.۹۳۴ ریال

تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز: ۲.۰۰۰.۰۰۰ واحد

تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری: ۲۳.۵۰۸.۳۳۵ واحد

ارزش مبنای هر واحد سرمایه گذاری: ۱۰.۰۰۰ ریال

نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش: ۱۶۸.۹۲۵ ریال

نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش: ۱۶۷.۸۳۳ ریال

درصد سرمایه گذاران حقوقی: ۹۹/۹۶٪

درصد سرمایه گذاران حقیقی: ۰.۰۴٪

۳-۱ صورت خالص دارایی ها :

۱۳۹۹/۰۲/۳۱	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	دارایی ها:
ریال	ریال	
۲.۵۶۳.۰۹۷.۰۹۲.۶۴۵	۳.۷۴۶.۷۰۲.۰۱۶.۸۵۲	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
-	۹۰.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	سرمایه گذاری در سپرده بانکی
۲.۷۶۶.۰۲۹.۳۳۴	۵۷.۸۳۳.۷۹۱.۶۶۱	حسابهای دریافتنی
۶۴۴.۳۱۴.۸۳۶	۸۶.۲۸۶.۸۶۵	سایر دارایی ها
۳۴۴.۱۸۲.۳۲۴	۵۳.۵۷۶.۹۴۹.۲۴۷	موجودی نقد
-	۳۴.۰۰۱.۴۷۰.۶۲۷	جاری کارگزاران
۲.۵۶۶.۸۵۱.۶۱۹.۱۳۹	۳.۹۸۲.۲۰۰.۵۲۰.۵۱۳	جمع دارایی ها

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری تجارت شاخصی کاردان برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

بدهی ها:

۱۳۹۹/۰۲/۳۱	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	
۴,۶۹۴,۷۲۴,۹۹۱	-	جاری کارگزاران
۱۳,۶۴۴,۴۷۰,۸۷۸	۳۵,۹۶۷,۳۵۴,۱۸۴	پرداختنی به ارکان صندوق
۸۸,۱۱۹,۹۵۶,۸۳۱	-	تسهیلات مالی دریافتی
۲۹۳,۶۶۰,۸۴۹	۹۹۹,۰۳۴,۳۹۵	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۱۰۶,۷۵۲,۸۱۳,۵۴۹	۳۶,۹۶۶,۳۸۸,۵۷۹	جمع بدهی ها
۲,۴۶۰,۰۹۸,۸۰۵,۵۹۰	۳,۹۴۵,۲۳۴,۱۳۱,۹۳۴	خالص دارایی ها

خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

۳-۲ صورت سود و زیان :

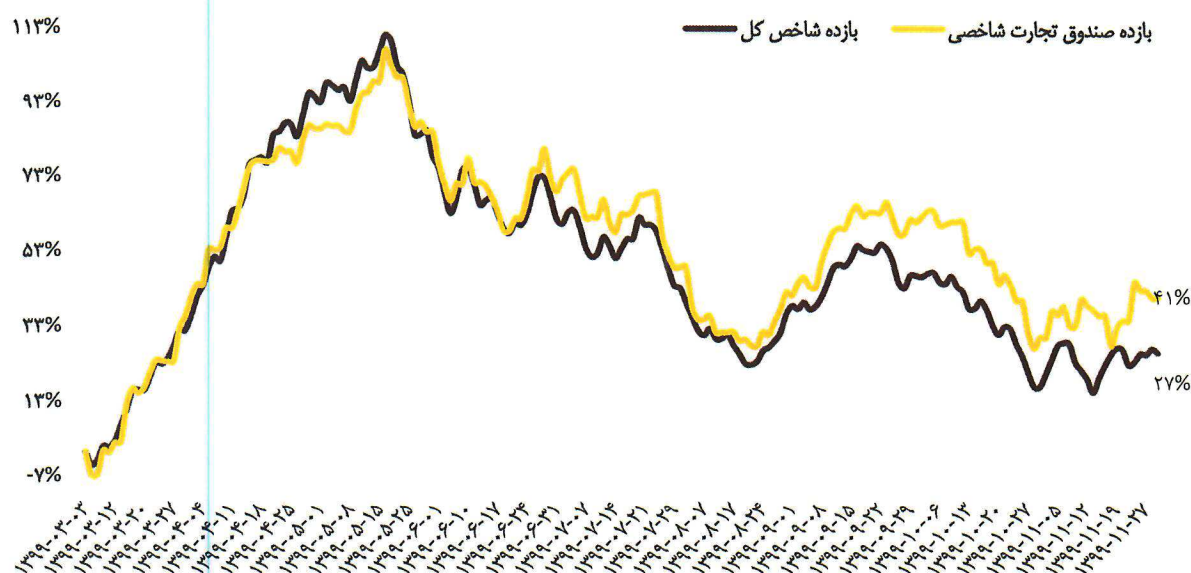
سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰	
ریال	ریال	درآمدها:
۳۵۱,۰۷۵,۴۱۹,۱۷۸	۱,۳۶۴,۹۶۶,۹۸۴,۰۷۱	سود(زیان) فروش اوراق بهادار
۶۸۸,۷۳۷,۷۹۱,۱۰۹	(۵۸۳,۸۶۴,۷۵۵,۱۴۷)	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۲۹,۳۷۲,۱۶۶,۰۰۲	۹۶,۳۰۴,۳۵۰,۰۱۲	سود سهام
۱۰۲,۲۴۶,۰۲۴	۱۹,۹۰۱,۷۷۵,۹۰۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۴۰۵,۹۲۰,۵۹۴	۳,۲۱۰,۴۴۱,۱۲۰	سایر درآمدها
۱,۰۷۰,۶۹۳,۵۴۲,۹۰۷	۹۰۰,۵۱۸,۷۹۵,۹۶۲	جمع درآمدها
		هزینه ها:
(۱۹,۵۴۷,۷۱۱,۱۸۶)	(۹۵,۱۹۳,۷۵۷,۸۱۰)	هزینه کارمزد ارکان
(۹۴۰,۰۶۳,۹۴۱)	(۱,۲۸۸,۴۹۴,۹۴۲)	سایر هزینه ها
۱,۰۵۰,۲۰۵,۷۶۷,۷۸۰	۸۰۴,۰۳۶,۵۴۳,۲۱۰	سود قبل از هزینه های مالی
(۲,۸۳۵,۰۱۹,۴۷۹)	(۱۰,۱۵۳,۲۱۶,۸۶۶)	هزینه های مالی
۱,۰۴۷,۳۷۰,۷۴۸,۳۰۱	۷۹۳,۸۸۳,۳۲۶,۳۴۴	سود خالص دوره
٪۱۶۲.۹۵	٪۱۸.۴	بازده میانگین سرمایه گذاری-درصد

گزارش تغییرات دوره‌ای صندوق تجارت شاخصی کاردان

در راستای حفظ رسالت صندوق سرمایه‌گذاری تجارت شاخصی کاردان مبنی بر انعکاس بازدهی متوسط بازار در خالص ارزش دارایی‌ها و تلاش برای کسب بازدهی بیشتر از شاخص، متناسب با شرایط بازار و چشم‌انداز صنایع و سهام قابل معامله بورس اوراق بهادار نسبت به تغییر ترکیب سبد دارایی به شرح زیر اقدام شده است.

- تنظیم وزن سهم‌های تشکیل دهنده سبد دارایی‌های صندوق متناسب با وزن طبقات دارایی در شاخص کل و پایش و اصلاح آن‌ها متناسب با شرایط بازار
- خروج از برخی سهم‌ها و جایگزینی با سایر سهام با توجه به تغییر چشم‌انداز بازدهی آن‌ها در ماه‌های پیش رو
- انحراف مثبت یا منفی در وزن تخصیص داده شده به برخی سهم‌ها با وزن مطلوب طبق مدل‌سازی سبد با هدف کسب بازدهی بیشتر نسبت به شاخص کل

مطابق نمودار زیر طی دوره ابتدای خرداد ماه سال ۱۳۹۹ لغایت ابتدای اسفندماه سال ۱۳۹۹ این صندوق با ضریب اطمینان مطلوبی شاخص را رصد نموده است. در این دوره بازدهی صندوق در مقایسه با شاخص ۱۴ درصد بیشتر بوده است که انعکاس موفقیت آمیز استراتژی‌های سرمایه‌گذاری در کسب بازدهی بیشتر از شاخص توسط صندوق می‌باشد.



در موقعیت‌هایی که زمینه استفاده از فرصت‌های بازار جهت بهبود عملکرد صندوق فراهم بوده است، نسبت به تغییر وزن طبقات متناسب با بیانیه سرمایه‌گذاری اقدام شده است. همچنین با توجه به چشم‌انداز اقتصادی کشور نسبت به سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی حداکثر تا سقف ۱۵ درصد بنا به تشخیص مدیر صندوق و حسب ضرورت، در خارج از دوره بازنگری شش ماهه نیز اقدام شده است. با توجه به موارد ذکر شده همبستگی بازدهی صندوق با شاخص کل طی دوره مذکور ۹۶.۲ درصد بوده است و خطای تعقیب شاخص کمتر از ۴ درصد است. در جدول زیر ترکیب سبد دارایی صندوق ارائه شده است.

نام سهم	بهای تمام شده	درصد دارایی به بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
سرمایه گذاری صدرتامین	۳۲۵,۲۹۰	۸.۱۱٪	۲۰۵,۵۰۴
ملی صنایع مس ایران	۳۰۳,۱۴۰	۷.۵۵٪	۲۱۵,۲۴۹
م. صنایع و معادن احیاء سپاهان	۲۵۶,۰۷۸	۶.۳۸٪	۱۷۰,۳۰۱
فولاد مبارکه اصفهان	۲۵۰,۱۳۹	۶.۲۳٪	۲۶۸,۳۷۶
سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)	۲۳۶,۱۷۷	۵.۸۹٪	۱۹۴,۴۷۸
گروه بهمن	۱۹۹,۰۸۴	۴.۹۶٪	۱۱۳,۳۰۶
پالایش نفت بندرعباس	۱۹۷,۳۵۵	۴.۹۲٪	۱۲۱,۵۱۰
پلیمر آریا ساسول	۱۷۴,۵۷۵	۴.۳۵٪	۲۱۶,۲۶۲
پتروشیمی پردیس	۱۶۷,۵۲۷	۴.۱۷٪	۱۶۴,۲۰۰
پتروشیمی پارس	۱۵۶,۷۶۰	۳.۹۱٪	۱۲۲,۴۰۶
پدیده شیمی قرن	۱۴۹,۶۱۸	۳.۷۳٪	۱۴۹,۷۰۵
بیمه تجارت نو	۱۲۴,۵۷۰	۳.۱۰٪	۲۷۱,۶۷۶
مخابرات ایران	۱۱۴,۹۶۰	۲.۸۶٪	۷۳,۱۶۳
بانک ملت	۱۱۳,۸۰۷	۲.۸۴٪	۱۲۴,۲۳۰
سرمایه گذاری ملی ایران	۱۰۴,۸۸۰	۲.۶۱٪	۸۵,۱۲۰
صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۱۰۴,۴۴۱	۲.۶۰٪	۱۲۵,۲۳۲
بانک تجارت	۱۰۱,۹۴۹	۲.۵۴٪	۹۹,۱۵۶
سرمایه گذاری دارویی تامین	۱۰۰,۵۶۰	۲.۵۱٪	۷۴,۱۶۴
تامین سرمایه نوین	۱۰۰,۴۱۲	۲.۵۰٪	۷۴,۸۵۴
توسعه صنایع بهشهر (هلدینگ)	۹۶,۶۱۱	۲.۴۱٪	۳۸,۸۷۱
پالایش نفت تبریز	۷۳,۳۲۸	۱.۸۳٪	۸۸,۲۸۸
س. نفت و گاز و پتروشیمی تأمین	۷۱,۱۶۶	۱.۷۷٪	۷۲,۸۸۴
سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۶۶,۳۸۵	۱.۶۵٪	۵۸,۰۱۵
مبین انرژی خلیج فارس	۵۷,۵۳۹	۱.۴۳٪	۶۰,۷۰۷
سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی	۵۱,۵۲۵	۱.۲۸٪	۴۵,۶۶۹
پتروشیمی غدیر	۴۶,۸۷۱	۱.۱۷٪	۴۸,۱۵۲
سرمایه گذاری تامین اجتماعی	۴۵,۴۴۲	۱.۱۳٪	۴۳,۸۳۸
گروه مپنا (سهامی عام)	۴۰,۲۱۰	۱.۰۰٪	۴۲,۱۱۶
معدنی و صنعتی گل گهر	۳۶,۷۷۶	۰.۹۲٪	۹۰,۴۸۹
بانک پاسارگاد	۲۱,۳۸۷	۰.۵۳٪	۴۸,۹۲۵
پتروشیمی جم	۱۶,۷۳۱	۰.۴۲٪	۱۴,۶۵۳
سایر	۱۰۷,۵۱۷	۲.۶۸٪	۲۲۵,۲۰۳
	۴,۰۱۲,۸۱۱		۳,۷۴۶,۷۰۲

ترکیب صندوق تجارت شاخصی کاردان در تاریخ ۱۳۹۹/۱۱/۳۰ (میلیون ریال)

احسان مرادی

مدیر صندوق

شرکت تامین سرمایه کارکنان ش.ت. ۴۴۸۳۷۱