

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری شاخصی آرام مفید

برای دوره مالی یازده ماه و چهارده روزه منتهی به

۱۴۰۱.۱۰.۳۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید

دوره مالی یازده ماه و چهارده روزه منتهی به ۱۴۰۱.۱۰.۳۰

۱-اطلاعات کلی صندوق

۱-۱-تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید که صندوق سرمایه گذاری قابل معامله محسوب می شود در تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۱۷ نزد ثبت شرکتها با شماره ۵۳۰۸۸ و شناسه ملی ۱۴۰۱۰۷۶۵۹۰۲ تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۲۳ تحت شماره ۱۱۹۳۹ 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. با توجه پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد.

با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزایای متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه ی به کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه ی اوراق بهادار بین همه ی سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه ی هزینه ی هر سرمایه گذار کاهش مییابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه ی حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود و کوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه ی هزینه ی 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، از تاریخ ثبت به مدت نامحدود ادامه می یابد. مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان کریمخان زند، ابتدای خیابان قائم مقام فراهانی، کوچه نگین، کوچه زیبا، پلاک اواقع شده و صندوق دارای شعبه نمی باشد.

۱-۲-اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید مطابق با ماده ۵۵ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.arametf.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 درآمد ثابت :

اوراق بهادار با درآمد 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 ی معتبر تضمین شده باشد، یا برای پرداخت اصلی و سود سرمایه گذاری در آن ها، و ثابق معتبر و 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 ثابق 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.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید

دوره مالی یازده ماه و چهارده روزه منتهی به ۱۴۰۱.۱۰.۳۰

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.

۲- ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید از ارکان زیر تشکیل شده است:

مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه گذاری ممتاز یک حق رأی دارند. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده اند شامل اشخاص زیر است:

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید

دوره مالی یازده ماه و چهارده روزه منتهی به ۱۴۰۱.۱۰.۳۰

ردیف	نام دارندگان واحد های ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک ممتاز
۱	شرکت سبدگردان مفید	۹۹۰,۰۰۰	۹۹
۲	شرکت مشاور سرمایه گذاری ایده مفید	۱۰,۰۰۰	۱
	مجموع	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰

مدیر صندوق: شرکت سبدگردان مفید است که در تاریخ ۱۳۹۵/۰۴/۱۵ با شماره ثبت ۴۹۴۷۴۰ 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.

متولی صندوق: موسسه حسابرسی رهیافت و همکاران (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۷۷/۰۲/۲۷ به شماره ثبت ۳۶۵۳۰ نزد مرجع ثبت شرکت ها و مؤسسات غیرتجاری تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، سهروردی جنوبی-پایین تر از مطهری-خیابان برادران نوبخت-پلاک ۲۹-طبقه اول

بازارگردان: صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی مفید است که در تاریخ ۱۳۹۷/۰۸/۳۰ با شماره ثبت ۴۵۹۵۱ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی بازارگردان عبارت است از: تهران، میدان ولیعصر، خیابان رودسر، ساختمان میلاد، پلاک ۶۷، واحد ۱.

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

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری شاخصی آرام مفید

دوره مالی یازده ماه و چهارده روزه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

۳- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق شاخصی آرام مفید در تاریخ: ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۳۶۹,۳۰۰,۰۰۰ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحد های سرمایه گذاری: ۴,۴۴۸,۴۸۹,۲۰۳,۲۲۴ ریال

NAV ابطال : ۱۲,۰۴۶ ریال

NAV صدور : ۱۲,۱۲۹ ریال

۴- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک صنعت:

صنعت	بهای تمام شده ریال	خالص ارزش فروش ریال	درصد به کل داراییها درصد
محصولات شیمیایی	۱,۱۴۲,۲۷۳,۳۸۷,۸۵۶	۱,۲۵۷,۱۰۸,۷۹۱,۰۰۶	۲۷/۷۰٪
فلزات اساسی	۷۵۷,۷۸۰,۵۲۸,۴۵۵	۷۹۴,۷۸۷,۸۷۴,۷۸۴	۱۷/۵۱٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۴۲۴,۰۹۷,۷۵۳,۹۱۴	۴۹۴,۵۹۸,۸۷۹,۸۹۳	۱۰/۹۰٪
استخراج کانه های فلزی	۵۸۴,۱۶۲,۰۳۲,۰۳۶	۵۰۸,۴۰۲,۲۹۴,۳۷۳	۱۱/۲۰٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳۳۳,۱۷۷,۵۹۲,۸۴۱	۴۲۷,۴۲۸,۵۳۶,۷۴۳	۹/۴۲٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۶۴,۹۰۱,۹۵۶,۱۲۱	۱۸۴,۶۹۹,۳۴۲,۸۵۰	۴/۰۷٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۰۶,۲۱۴,۴۱۵,۵۲۵	۱۴۶,۳۲۵,۰۷۷,۱۵۴	۳/۲۲٪
سیمان، آهک و گچ	۱۱۲,۵۳۶,۱۰۸,۶۹۷	۱۲۲,۰۰۶,۰۷۴,۴۳۳	۲/۶۹٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۷۴,۹۲۳,۷۵۹,۰۵۵	۱۱۱,۱۴۹,۶۸۱,۵۴۵	۲/۴۵٪
مخابرات	۶۸,۹۱۹,۱۹۴,۶۱۸	۷۸,۵۹۱,۰۹۱,۳۵۲	۱/۷۳٪
خدمات فنی و مهندسی	۴۹,۲۹۳,۰۸۶,۳۶۰	۶۲,۰۰۴,۱۴۰,۴۳۴	۱/۳۷٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۳۰,۵۷۹,۳۷۳,۶۴۴	۵۶,۵۰۸,۷۳۰,۴۹۹	۱/۲۵٪
ماشین آلات و تجهیزات	۵۴,۱۷۵,۰۸۳,۷۳۲	۷۲,۲۱۰,۱۳۰,۳۰۴	۱/۵۹٪
استخراج ذغال سنگ	۸۴,۸۵۱,۷۱۹,۳۷۵	۹۰,۳۹۲,۷۱۵,۵۶۰	۱/۹۹٪
مواد و محصولات دارویی	۱۹,۳۶۲,۵۰۱,۷۳۹	۲۶,۲۵۳,۶۷۹,۵۹۷	۰/۵۸٪
	۴,۰۰۷,۲۴۸,۴۹۳,۹۶۸	۴,۴۳۲,۴۶۷,۰۴۰,۵۲۷	۹۵/۱۰٪

سید کاوش مفید
شماره ثبت: ۴۹۴۷۳۰۱۵۰
حجت اله نصرقیان
مدیرعامل