

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس)

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۴.۳۱

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس) که صندوق سرمایه گذاری قابل معامله محسوب می شود در تاریخ ۱۳۹۲/۰۹/۱۷ نزد ثبت شرکتها با شماره ۳۲۹۵۳ و شناسه ملی ۱۴۰۰۳۷۶۷۲۲۱ در تاریخ ۱۳۹۲/۱۰/۰۱ تحت شماره ۱۱۲۱۵ 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، مزیت‌های 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 ۱ واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی باشد.

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس) مطابق با ماده ۵۵ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.atlasetf.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 در آمد 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 وثایق 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 ننمایند یا ارزش و وثایق 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 توسعه اندوخته آینده (اطلس)

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۴.۳۱

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 بستانکاری 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 توسعه اندوخته آینده (اطلس) 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 توسعه اندوخته آینده (اطلس)

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۴.۳۱

ردیف	نام دارندگان واحد های ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک ممتاز
۱	شرکت گروه خدمات بازار سرمایه مفید	۹۹۰،۰۰۰	۹۹
۲	شرکت کارگزاری مفید	۱۰،۰۰۰	۱
	مجموع	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.

متولی 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

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، خیابان آفریقا، خیابان پدیدار، شماره ۴۵ - طبقه ۱۰.

حسابرس 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 حسابرس عبارت است از تهران، خیابان سهروردی شمالی، خیابان خرمشهر، خیابان عربعلی، پلاک ۱، واحد ۶.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس)

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۴.۳۱

۳- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق توسعه اندوخته آینده (اطلس) در تاریخ: ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۳۹,۷۵۳,۹۲۴ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحدهای سرمایه گذاری: ۸,۷۶۸,۰۲۴,۸۳۸,۹۳۹ ریال

NAV ابطال : ۲۰,۵۵۷ ریال

NAV صدور : ۲۲۲,۱۳۹ ریال

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس)

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹.۰۴.۳۱

۴- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک صنعت:

۱۳۹۹.۰۴.۳۱			
درصد کل داراییها	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	صنعت
درصد	ریال	ریال	
۱۶/۲۳%	۵۰۱,۰۷۴,۹۶۴,۳۸۰	۱,۴۳۹,۶۰۷,۷۲۸,۵۳۲	محصولات شیمیایی
۱۲/۷۲%	۳۰۸,۰۰۲,۴۸۵,۱۹۶	۱,۱۲۸,۳۹۷,۷۱۵,۷۳۸	بانکها و موسسات اعتباری
۷/۰۰%	۱۲۴,۷۰۳,۹۸۶,۷۴۰	۶۲۰,۷۸۵,۳۷۱,۵۶۶	شرکتهای چند رشته ای صنعتی
۱/۷۱%	۵۷,۱۷۳,۶۷۹,۷۶۱	۱۵۱,۵۰۰,۰۷۷,۵۳۷	مواد و محصولات دارویی
۲۰/۴۵%	۶۲۷,۲۲۰,۱۴۸,۷۷۶	۱,۸۱۳,۳۳۰,۱۵۶,۸۷۹	فلزات لولسی
۳/۱۶%	۱۵۳,۸۲۳,۲۱۹,۸۷۸	۲۸۰,۰۹۷,۴۱۳,۷۹۱	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای
۱/۰۰%	۲۵,۴۳۰,۵۱۵,۸۶۹	۸۹,۰۶۴,۲۸۹,۲۷۱	لستخراج کانه های فلزی
۱/۱۵%	۶۴,۲۱۲,۱۳۷,۷۳۶	۱۰۱,۸۴۱,۹۳۹,۲۷۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات
۰/۷۳%	۲۰,۲۶۶,۳۶۲,۳۱۹	۶۴,۴۳۶,۶۳۳,۳۴۴	سایر محصولات کانی غیر فلزی
۰/۰۷%	۵,۹۷۵,۳۸۷,۶۶۳	۶,۳۷۳,۵۲۳,۴۴۹	سایر واسطه گریهای مالی
۷/۴۵%	۴۴۸,۹۰۵,۲۹۸,۳۴۶	۶۶۰,۷۹۸,۵۵۵,۹۰۵	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم
۵/۵۸%	۱۹۳,۰۵۰,۴۲۱,۴۹۰	۴۹۴,۵۷۷,۹۰۳,۴۰۰	ماشین آلات و تجهیزات
۱/۰۹%	۷۷,۵۶۱,۲۱۳,۷۶۰	۹۶,۶۴۷,۹۳۱,۴۴۱	ماشین آلات و دستگاه های برقی
۰/۰۲%	۱,۵۰۲,۷۶۸,۵۷۹	۱,۸۰۲,۸۸۴,۳۹۱	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر
۳/۳۴%	۸۶,۵۲۵,۶۲۹,۰۶۶	۲۹۶,۵۸۹,۹۷۲,۹۵۲	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی و وسط
۱/۰۳%	۳۲,۷۸۵,۲۰۰,۹۰۹	۹۱,۴۴۸,۳۹۰,۶۲۴	واسطه گری های مالی و پولی
۱/۲۷%	۹۴,۸۴۱,۲۱۳,۳۷۱	۱۱۲,۷۶۸,۰۳۷,۳۲۷	رایانه و فعالیت های وابسته به آن
۰/۱۰%	۶,۸۸۴,۹۸۷,۰۵۲	۹,۰۲۵,۷۷۲,۶۸۰	لاستیک و پلاستیک
۴/۰۱%	۱۰۴,۸۱۲,۷۰۰,۱۰۳	۳۵۵,۵۶۰,۵۷۶,۰۹۹	سرمایه گذاریها
۲/۳۶%	۱۶۲,۵۷۷,۲۹۱,۳۶۶	۲۰۹,۱۴۱,۴۴۳,۲۸۳	سیمان، آهک و گچ
۰/۲۴%	۱۰,۹۰۵,۶۳۱,۳۵۷	۲۱,۶۳۶,۲۸۲,۵۴۸	گواهی سپرده طلا
۹۰/۷۲%	۳,۱۰۸,۲۳۵,۲۴۳,۷۱۷	۸,۰۴۵,۴۳۲,۶۰۰,۲۳۰	جمع