

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس)

برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

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 میابد. 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 میابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر داراییها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش میابد. 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.

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

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 در آمد 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 ثایق 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 ثایق 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)

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

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 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)

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

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 عبارت است 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: موسسه حسابرسی فراز مشاوردیلمی پور است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۰۱ با شماره ثبت ۳۴۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از تهران - خ آفریقا - شماره ۲۴۴ - مجتمع اداری الهیه - طبقه ششم - واحد ۶۰۷

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس)

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

۳- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق توسعه اندوخته آینده (اطلس) در تاریخ: ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

مجموع واحدهای سرمایه گذاری: ۴۵,۵۰۳,۹۲۴ واحد

خالص ارزش داراییهای متعلق به دارندگان واحدهای سرمایه گذاری: ۱۱,۵۶۲,۰۱۰,۶۹۹,۴۹۹ ریال

NAV ابطال : ۲۵۴,۰۸۸ ریال

NAV صدور : ۲۵۵,۴۹۰ ریال

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری توسعه اندوخته آینده (اطلس)

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰.۰۷.۳۰

۴- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک صنعت:

صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل داراییها
	ریال	ریال	درصد
محصولات شیمیایی	۱,۱۹۷,۶۷۳,۷۰۹,۳۱۷	۲,۵۷۱,۲۷۶,۶۵۵,۵۳۸	۲۱.۹۸٪
فلزات اساسی	۱,۲۰۷,۷۵۱,۸۲۱,۸۲۹	۱,۹۱۶,۸۰۳,۷۶۹,۷۹۲	۱۶.۳۸٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۵۹۶,۶۳۲,۳۳۰,۷۱۰	۸۴۰,۱۳۱,۳۴۶,۹۱۷	۷.۱۸٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۷۴۰,۲۲۴,۲۵۷,۱۶۱	۸۰۰,۸۴۴,۵۹۶,۱۳۱	۶.۸۵٪
عرضه برق، گاز، بخار آب گرم	۳۷۴,۲۳۰,۳۸۲,۰۹۲	۵۴۷,۰۶۸,۲۷۴,۷۱۴	۴.۶۸٪
ماشین آلات و تجهیزات	۳۰۸,۰۱۴,۷۸۲,۷۲۰	۳۹۹,۰۱۱,۸۱۰,۳۸۰	۳.۴۱٪
سیمان، آهک و گچ	۴۰۹,۶۷۸,۱۲۹,۷۸۶	۳۹۰,۷۸۶,۶۳۲,۸۰۱	۳.۳۴٪
سرمایه گذاریها	۲۳۳,۳۸۳,۳۷۹,۸۲۴	۳۲۳,۹۴۲,۸۴۴,۸۰۳	۲.۷۷٪
استخراج کانه های فلزی	۲۱۶,۷۵۳,۵۶۸,۱۹۸	۲۶۷,۹۱۱,۹۸۰,۳۰۲	۲.۲۹٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۸۳,۶۷۷,۷۲۲,۹۳۵	۲۲۸,۶۱۲,۵۵۸,۶۹۲	۱.۹۵٪
مواد و محصولات دارویی	۱۶۳,۲۳۴,۹۶۲,۴۳۴	۱۶۴,۹۴۱,۲۰۴,۶۶۰	۱.۴۱٪
مخابرات	۱۸۹,۴۴۹,۴۴۸,۲۶۷	۱۴۱,۹۳۱,۰۷۶,۹۰۱	۱.۲۱٪
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱۳۶,۳۶۷,۳۸۵,۹۴۳	۱۰۹,۹۴۴,۱۸۱,۰۲۶	۰.۹۴٪
واسطه گری های مالی و پولی	۱۱۴,۵۰۲,۶۱۶,۱۳۰	۹۴,۶۱۲,۲۱۴,۱۶۸	۰.۸۱٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسطه	۵۸,۹۲۳,۴۸۰,۹۴۲	۹۰,۰۱۹,۱۳۱,۶۷۹	۰.۷۷٪
سایر واسطه گری های مالی	۹۷,۸۸۵,۶۸۴,۸۶۹	۸۸,۶۱۳,۱۰۹,۸۰۳	۰.۷۶٪
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۶۵,۸۵۴,۳۸۸,۵۹۶	۷۷,۹۰۱,۱۶۶,۳۷۸	۰.۶۷٪
محصولات چوبی	۷۲,۷۲۷,۳۷۶,۰۵۸	۵۲,۳۵۲,۶۳۷,۳۰۰	۰.۴۵٪
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۵۹,۴۳۵,۲۲۸,۸۱۲	۴۹,۳۰۸,۴۷۳,۶۶۶	۰.۴۲٪
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۴۶,۰۶۰,۲۰۰,۶۳۱	۴۳,۸۵۸,۴۸۰,۰۵۰	۰.۳۷٪
زراعت و خدمات وابسته	۱۳,۳۶۴,۰۲۲,۳۱۲	۳۵,۹۸۶,۵۹۴,۶۰۱	۰.۳۱٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۲۲,۴۲۶,۸۰۴,۰۰۵	۱۸,۷۷۹,۶۸۶,۴۷۸	۰.۱۶٪
استخراج ذغال سنگ	۱۸,۶۲۲,۸۷۵,۵۱۲	۱۵,۶۶۲,۰۸۱,۱۸۸	۰.۱۳٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۴,۶۵۲,۹۷۹,۴۷۹	۶,۱۴۷,۵۹۹,۷۱۷	۰.۰۵٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۶۰۹,۰۸۳,۵۷۰	۱,۷۵۵,۳۹۴,۶۰۵	۰.۰۲٪
جمع	۶,۵۳۲,۱۳۶,۶۲۲,۱۳۲	۹,۲۷۸,۲۰۳,۵۰۲,۲۹۰	۷۹.۳۱٪