

صندوق سرمایه گذاری مشترک شاخصی کار آفرین

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه

منتهی به ۲۱ آذر سال ۱۳۹۶



۱- اطلاعات کلی صندوق

تاریخچه تاسیس صندوق

صندوق سرمایه گذاری مشترک شاخصی کارآفرین که صندوقی با سرمایه باز در اندازه (بزرگ) محسوب می شود ، در تاریخ ۱۳۸۹/۱۲/۲۱ تحت شماره ۲۷۱۲۶ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیرتجاری و تحت شماره ۱۰۸۳۵ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است . هدف از تشکیل این صندوق ، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول ، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم خرید سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس و بازار اول و دوم فرابورس ، اوراق بهادار با درآمد ثابت سرمایه گذاری می نماید.

دوره فعالیت صندوق

دوره فعالیت صندوق از ابتدای اولین روز کاری بعد از دریافت مجوز فعالیت از سبا شروع شده و به مدت دو سال شمسی ادامه می یابد. این مدت مطابق ماده ۵۸ قابل تمدید است. سال مالی صندوق از شروع دوره فعالیت صندوق به صندوق مدت یکسال کامل شمسی میباشد. بر اساس آخرین تصمیمات مجمع مورخ ۱۳۹۴/۰۹/۰۸ و تاییدیه سازمان بورس طی نامه ۱۲۲/۳۹۰۶ مورخ ۱۳۹۴/۱۱/۱۱ برای سه سال دیگر تا تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۲۰ تمدید شد.

محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق در تهران ، خیابان آفریقا ، بلوار صبا، پلاک ۸ ، طبقه اول شرکت کارگزاری بانک کارآفرین واقع شده، صندوق فعلا فاقد شعبه می باشد

ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری مشترک شاخصی کارآفرین که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱-۱- **مجمع صندوق**، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل ۵ درصد از کل واحدهای ممتاز را در اختیار داشته باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند.

در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:



ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت کارگزاری بانک کارآفرین	۱,۰۰۰	۱۰
۴	بانک کارآفرین	۹,۰۰۰	۹۰
	جمع	۱۰,۰۰۰	۱۰۰

۲-۱- مدیر صندوق و مدیر ثبت ، : شرکت کارگزاری بانک کارآفرین است که در تاریخ ۱۳۸۵/۰۴/۰۶ با شماره ثبت ۵۹۹۳ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان اردبیل به ثبت رسیده است.نشانی مدیر عبارت است از تهران ، خیابان آفریقا، بلوار صبا، پلاک ۸

۳-۱- متولی صندوق، : موسسه حسابرسی فریوران راهبرد است که در تاریخ ۱۳۶۶/۰۴/۲۳ با شماره ثبت ۳۳۰۹ نزد مرجع ثبت شرکت های شهر تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران ،شهرک غرب بلوار خوردین، خ توحید، پ ۱ ، طبقه ۵.

۴-۱- ضامن ، بانک کارآفرین است که در تاریخ ۱۳۷۸/۹/۱۷ با شماره ثبت ۱۵۷۹۱۵ و شناسه ملی ۱۰۱۰۲۰۲۰۶۲۲۶ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی ضامن نقدشوندگی عبارت است از تهران، خیابان ولیعصر، روبروی پارک ملت، ناهید غربی، شماره ۹۷.

۵-۱- حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی رهبین است که در تاریخ ۱۳۸۱/۰۱/۲۷ به شماره ثبت ۸۹۷۷ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است . نشانی حسابرس عبارتست از تهران ، خیابان سهروردی شمالی، خیابان خرمشهر، خیابان شهید عربعلی(نوبخت)، پلاک ۱ واحد ۶

۲- اهداف و استراتژی های صندوق:

۲-۱- هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است؛ با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه بکارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه هزینه هر سرمایه گذار کاهش می یابد. ثانیاً، صندوق از



جانب سرمایه گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش می یابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر دارایی ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش می یابد.

۲-۲-۲ صندوق فقط می تواند در دارایی های ریالی داخل کشور سرمایه گذاری کند و سرمایه گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز میباشد. صندوق در دارایی هایی به شرح زیر سرمایه گذاری می کند:

۲-۱-۲: سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

۲-۲-۲: حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

۲-۲-۳: اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهاداری که تمامی شرایط زیر را داشته باشد:

الف- مجوز انتشار آنها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛

ب- سود حداقلی برای آن ها تضمین و مشخص شده باشد؛

ج- به تشخیص مدیر، یکی از مؤسسات معتبر بازخرید آنها را قبل از سررسید تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

۲-۲-۴: گواهی های سپرده منتشره توسط بانک ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۲-۲-۵: هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۲-۳: این صندوق از نوع صندوق های سرمایه گذاری در سهام است و اکثر وجوه خود را به شرح جدول زیر صرف خرید سهام و حق تقدم خرید سهام می کند. همچنین در طول عمر صندوق حدنصاب های زیر بر اساس ارزش روز دارایی های صندوق رعایت می شود:

شرح	نسبت از کل دارایی های صندوق
۱- سرمایه گذاری در اوراق مشارکت، سپرده بانکی، گواهی سپرده بانکی، اوراق بهادار با درآمد ثابت	حداکثر ۱۰٪ از کل دارایی های صندوق
۲- سهام و حق تقدم سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران	حداقل ۸۵٪ از کل دارایی های صندوق



۴-۲: این صندوق برای دست یابی به بازدهی برابر با بورس اوراق بهادار تهران؛ معیار محاسبه نرخ، (TEDPIX) طراحی شده است. تغییرات شاخص قیمت و بازدهی نقدی متوسط بازدهی بورس تهران است.

۳- واحدهای سرمایه گذاری:

ارزش مبنای هر واحد سرمایه گذاری برابر یک میلیون ریال است که باید روی گواهی های سرمایه گذاری قید شود. واحدهای سرمایه گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می شود:

الف) واحدهای سرمایه گذاری ممتاز که تعداد آن ها ۱۰,۰۰۰ واحد سرمایه گذاری است، قبل از شروع دوره پذیره نویسی اولیه مطابق ماده ۸، کلاً توسط مؤسس یا مؤسسان صندوق خریداری می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر می باشد.

ب) واحدهای سرمایه گذاری عادی که در طول دوره پذیره نویسی اولیه یا پس از تشکیل صندوق صادر می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری قابل ابطال ولی غیرقابل انتقال می باشد. حداکثر واحدهای سرمایه گذاری عادی نزد سرمایه گذاران در امیدنامه قید شده است.

ترکیب سرمایه گذاران صندوق در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۱ به شرح جدول زیر می باشد:

۱۳۹۶/۰۹/۲۱			
سرمایه گذاران	تعداد واحدها	درصد	ریال
واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۳,۸۱۶	۷۰	۶۹,۷۰۲,۲۱۶,۱۱۸
واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۱۰,۰۰۰	۳۰	۲۹,۲۶۶,۹۷۰,۱۵۴
جمع	۳۳,۸۱۶	۱۰۰	۹۸,۹۶۹,۱۸۶,۲۷۲

۴- اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در ۱۳۹۶/۰۹/۲۱:

۹۸,۹۶۹,۱۸۶,۲۷۲	کل خالص ارزش دارایی ها (ریال):	✓
۲,۹۶۶,۴۶۰	قیمت صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۲,۹۲۶,۶۹۷	قیمت ابطال هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۲,۹۲۶,۶۹۷	قیمت آماری هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۳۳,۸۱۶	تعداد واحدهای سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران:	✓

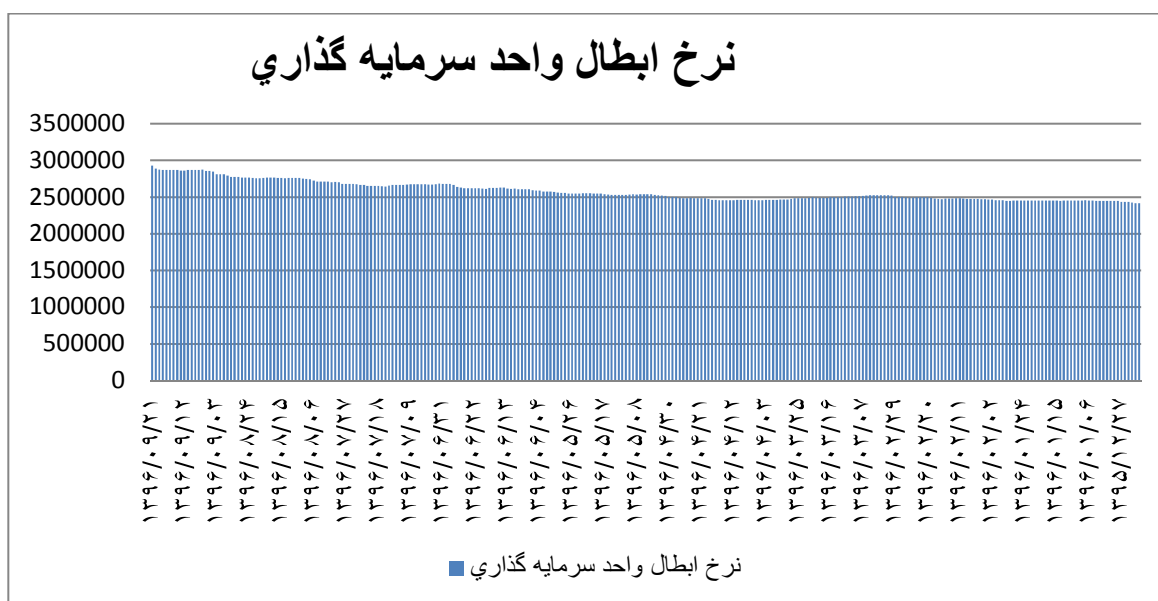


دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۲۱		یادداشت
ریال	تعداد	
۸۲,۲۱۶,۶۸۸,۱۴۳	۳۴,۱۲۹	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره/سال
۱۰۵,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۵	واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره/سال
(۴۱۸,۰۰۰,۰۰۰)	(۴۱۸)	واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره/سال
۱۷,۵۸۴,۳۵۰,۱۰۰	-	سود (زیان) خالص دوره/سال
(۵۱۸,۸۵۱,۹۷۱)	-	تعدیلات ۲۲
۹۸,۹۶۹,۱۸۶,۲۷۲	۳۳,۸۱۶	خالص دارایی های (واحدهای سرمایه گذاری) پایان دوره/سال

۵- بازدهی صندوق طی دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۲۱:

بازده	بازده صندوق	شاخص صندوقها	شاخص بازار
هفته اخیر	۲,۰۳	-	۱,۶۹
ماه اخیر	۶,۲۶	-	۵,۵۷
سه ماه اخیر	۱۱,۸۲	-	۱۰,۹۰

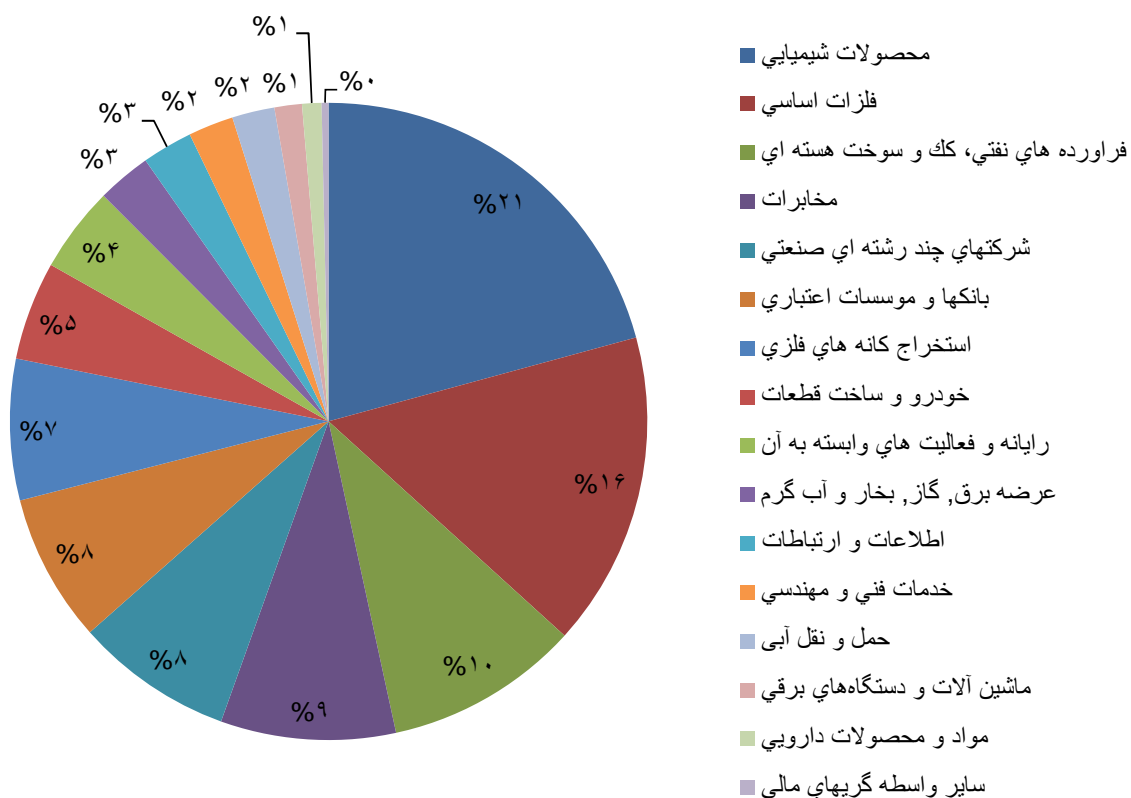
۶- نمودار قیمت ابطال:





۷- ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۱:

% نسبت از کل دارایی به ارزش روز





ترازنامه منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۲۱:

۱۳۹۵/۰۹/۲۱	۱۳۹۶/۰۹/۲۱	یادداشت	دارایی ها:
ریال	ریال		
۷۹,۵۶۸,۸۱۶,۴۰۷	۹۲,۵۲۹,۸۶۱,۳۰۵	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۴۴,۹۹۳,۷۸۵	۳,۶۷۵,۸۶۰,۲۱۷	۶	سرمایه گذاری در سپرده های بانکی
۱,۷۳۶,۸۲۹,۷۵۲	۰	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار بادرآمد ثابت یا علی الحساب
۲,۹۴۵,۲۹۱,۵۳۱	۴,۰۷۳,۲۸۶,۷۷۴	۸	حساب های دریافتی
۷,۳۳۳,۲۳۰	۷۵,۳۴۸,۷۰۰	۹	سایر دارایی ها
۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰	موجودی نقد
۸۴,۳۲۳,۲۶۴,۷۰۵	۱۰۰,۳۷۴,۳۵۶,۹۹۶		
			بدهی ها
۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۱	جاری کارگزاران
۴۷۲,۷۵۵,۲۸۱	۷۳۸,۰۴۲,۷۲۰	۱۲	پرداختی به ارکان صندوق
۶۳۳,۸۲۱,۲۸۱	۶۶۷,۱۲۸,۰۰۴	۱۳	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۲,۱۰۶,۵۷۶,۵۶۲	۱,۴۰۵,۱۷۰,۷۲۴		جمع بدهی ها
۸۲,۲۱۶,۶۸۸,۱۴۳	۹۸,۹۶۹,۱۸۶,۲۷۲	۱۴	خالص دارایی ها
۲,۴۰۸,۹۹۸	۲,۹۲۶,۶۹۷		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری



صورت سود و زیان منتهی به ۱۳۹۶/۰۹/۲۱:

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۱	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۹/۲۱	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۱	یادداشت	درآمد ها:
ریال	ریال	ریال		
(۵۶۷.۹۵۸.۶۱۰)	(۹۳.۳۱۳.۳۲۴)	۳۹۸.۲۴۳.۹۳۵	۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۱۱.۵۸۳.۶۰۱.۸۵۹)	(۶.۱۸۵.۲۴۵.۶۳۸)	۱۰.۵۸۹.۷۵۱.۶۱۲	۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۸.۱۷۵.۸۶۷.۳۵۹	۷.۲۳۲.۱۱۰.۶۵۵	۷.۷۳۸.۷۷۹.۴۳۰	۱۷	سود سهام
۳۰۸.۳۵۷.۰۲۴	۲۸۹.۹۷۴.۹۹۷	۱۶۱.۱۴۶.۲۱۸	۱۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۵۰.۶۵۳.۰۵۳	۵۰.۶۵۳.۰۵۳	۲۵.۶۸۲.۳۴۰	۱۹	سایر درآمدها
(۳.۶۱۶.۶۸۳.۰۳۳)	۱.۲۹۴.۱۷۹.۷۴۲	۱۸.۹۱۳.۶۰۳.۵۳۵		جمع
				هزینه ها:
۱.۳۸۲.۰۶۰.۹۸۰	۱.۰۳۸.۲۸۹.۸۴۰	۱.۰۵۷.۶۹۴.۲۲۸	۲۰	هزینه کارمزد ارکان
۳۰۷.۶۹۱.۱۹۸	۲۳۴.۷۸۵.۰۵۰	۲۷۱.۵۵۹.۲۰۷	۲۱	سایر هزینه ها
۱.۶۸۹.۷۵۲.۱۷۸	۱.۲۷۳.۰۷۴.۸۹۰	۱.۳۲۹.۲۵۳.۴۳۵		جمع هزینه ها
(۵.۳۰۶.۴۳۵.۲۱۱)	۲۱.۱۰۴.۸۵۲	۱۷.۵۸۴.۳۵۰.۱۰۰		سود (زیان) خالص
-۶,۱۳٪	-۴,۴۹٪	۲۰,۵۰٪		بازده میانگین سرمایه گذاری ^۱
-۸,۴۴٪	-۱,۲۳٪	۱۷,۷۷٪		بازده سرمایه گذاری پایان سال ^۲