

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کارآفرین

گزارش عملکرد

برای سال مالی

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۳۹۶

۱- اطلاعات کلی صندوق

تاریخچه تاسیس صندوق

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کارآفرین در تاریخ ۱۳۸۶/۰۴/۲۳ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۰۵۸۱ نزد سبا و شماره ۲۸۲۶۵ نزد اداره ثبت شرکتها به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه است.

دوره فعالیت صندوق

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، سه سال است که بر اساس آخرین تصمیمات مجمع مورخ ۱۳۹۵/۰۷/۱۴ و تأییدیه سازمان بورس تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۷/۲۳ تمدید گردید.

محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان آفریقا، بلوار صبا، پلاک ۸، طبقه اول شرکت کارگزاری بانک کارآفرین واقع شده و صندوق دارای ۱۱۳ شعبه می باشد.

ارکان صندوق سرمایه گذاری

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

۱-۲- مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل نصف به علاوه یک واحدهای سرمایه گذاری را دارا 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	بانک کارآفرین	۲۸،۵۰۰	۹۵
۲	شرکت کارگزاری بانک کارآفرین	۱،۵۰۰	۵
	جمع	۳۰،۰۰۰	۱۰۰

۲-۲- مدیر صندوق، : 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 ، بلوار آفریقای شمالی، بلوار صبا، پلاک ۸، واحد ۷.

۲-۳- متولی صندوق، : موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر است که در تاریخ ۱۳۶۱/۰۷/۰۱ به شماره ثبت ۲۳۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، خیابان وصال شیرازی ، خیابان بزرگمهر غربی، کوی اسکو، شماره ۱۴ طبقه چهارم.

۲-۴- ضامن نقد شونددگی صندوق ، بانک کارآفرین است که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۹/۱۷ 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.

۲-۵- ضامن جبران خسارت یا سود صندوق، بانک اقتصاد نوین است که در تاریخ ۱۳۸۰/۰۵/۲۲ با شماره ثبت ۱۷۷۱۳۲ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی ضامن جبران خسارت خیابان ولیعصر، بلوار اسفندیار، پلاک ۲۴

۲-۶- حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی فریوران راهبرد است که در تاریخ ۱۳۶۶/۰۴/۲۳ به شماره ثبت ۳۳۰۹ نزد مرجع ثبت شرکت های موسسات غیر تجاری تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، شهرک غرب خیابان خوردین خیابان توحید یکم پ ۱ طبقه ۵.

۲-۶- مدیر ثبت ، بانک کارآفرین است که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۹/۱۷ 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

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

سرمایه‌گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. ثالثاً، امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

۲-۲- صندوق فقط می‌تواند در دارایی‌های ریالی داخل کشور سرمایه‌گذاری کند و سرمایه‌گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز می‌باشد. صندوق در دارایی‌هایی به شرح زیر سرمایه‌گذاری می‌کند:

۱-۲-۲- : 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؛

۳-۲-۲- : 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 آن‌ها تضمین و مشخص شده باشد؛

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

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

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

۳-۲- : این صندوق از نوع صندوق‌های سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت و سود بانکی است و اکثر وجوه خود را به شرح جدول زیر صرف خرید اوراق و سهام و سرمایه‌گذاری در سپرده‌های بانکی می‌کند. همچنین در طول عمر صندوق حد نصاب‌های صفحه بعد بر اساس ارزش روز دارایی‌های صندوق رعایت می‌شود:

حدنصاب ترکیب دارایی‌های صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری کارآفرین		
ردیف	موضوع سرمایه‌گذاری	توضیحات
۱	سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی	حداقل ۷۵٪ از کل دارایی‌های صندوق
۱-۱	اوراق بهادار با درآمد ثابت دارای مجوز انتشار از طرف سازمان بورس و اوراق بهادار	حداقل ۲۰٪ از کل دارایی‌های صندوق
۱-۲	گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی	حداکثر ۶۰٪ از کل دارایی‌های صندوق
۱-۳	اوراق بهادار منتشره از طرف یک ناشر	حداکثر ۴۰٪ از کل دارایی‌های صندوق
۱-۴	اوراق بهادار تضمین شده توسط یک ضامن	حداکثر ۳۰٪ از کل دارایی‌های صندوق
۲	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام پذیرفته شده در بورس تهران یا بازار اول و دوم فرابورس ایران و گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده در بورس	حداقل ۵٪ و حداکثر ۲۰٪ از کل دارایی‌های صندوق
۲-۱	سهام و حق تقدم سهام منتشره از طرف یک ناشر	حداکثر ۵٪ از سهام و حق تقدم سهام منتشره ناشر
۲-۲	سهام و حق تقدم سهام منتشره از طرف یک ناشر و قرارداد اختیار معامله همان سهام	حداکثر ۵٪ از کل دارایی‌های صندوق
۲-۳	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام طبقه بندی شده در یک صنعت	حداکثر ۵٪ از کل دارایی‌های صندوق
۲-۴	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام پذیرفته شده در بازار اول و دوم فرابورس ایران	حداکثر ۵٪ از کل دارایی‌های صندوق
۲-۵	اخذ موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله سهام	حداکثر ۵٪ از ارزش روز سهام و حق تقدم سهام صندوق
۲-۶	اخذ موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله خرید سهام	حداکثر ۱۰٪ از تعداد سهام پایه موجود در پرتفوی مجاز سرمایه‌گذاری صندوق در سهام
۲-۷	سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده نزد یکی از بورس‌ها	حداکثر ۵٪ از کل دارایی‌های صندوق
۳	واحدهای سرمایه‌گذاری "صندوق های سرمایه گذاری"*	حداکثر ۵٪ از کل دارایی‌های صندوق و تا سقف ۳۰٪ از تعداد واحدهای صندوق سرمایه پذیر که نزد سرمایه‌گذاران می‌باشد.

۴-۲- : این صندوق برای دست یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط 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 ۳۰.۰۰۰ 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 غیرمی 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 ۱۳۹۶/۰۶/۳۱ به شرح جدول زیر می باشد:

۱۳۹۶/۰۶/۳۱			
ریال	درصد	تعداد واحدها	سرمایه گذاران
۱۰.۵۳۵.۱۵۵.۳۵۰.۸۸۳	۹۹.۷	۱۰.۴۸۷.۲۳۴	واحدهای سرمایه گذاری عادی
۳۰.۱۳۷.۰۸۴.۸۱۴	۰.۳۰	۳۰.۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۱۰.۵۶۵.۲۹۲.۴۳۵.۶۹۷	۱۰۰	۱۰.۵۱۷.۲۳۴	جمع

۴- اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در ۱۳۹۶/۰۶/۳۱

۱۰.۵۶۵.۲۹۲.۴۳۵.۶۹۷	کل خالص ارزش دارایی ها (ریال):	✓
۱.۰۰۵.۵۲۱	قیمت صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۱.۰۰۴.۵۷۰	قیمت ابطال هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۱.۰۰۵.۵۰۰	قیمت آماری هر واحد سرمایه گذاری (ریال):	✓
۱۰.۵۱۷.۲۳۴	تعداد واحدهای سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران:	✓

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱

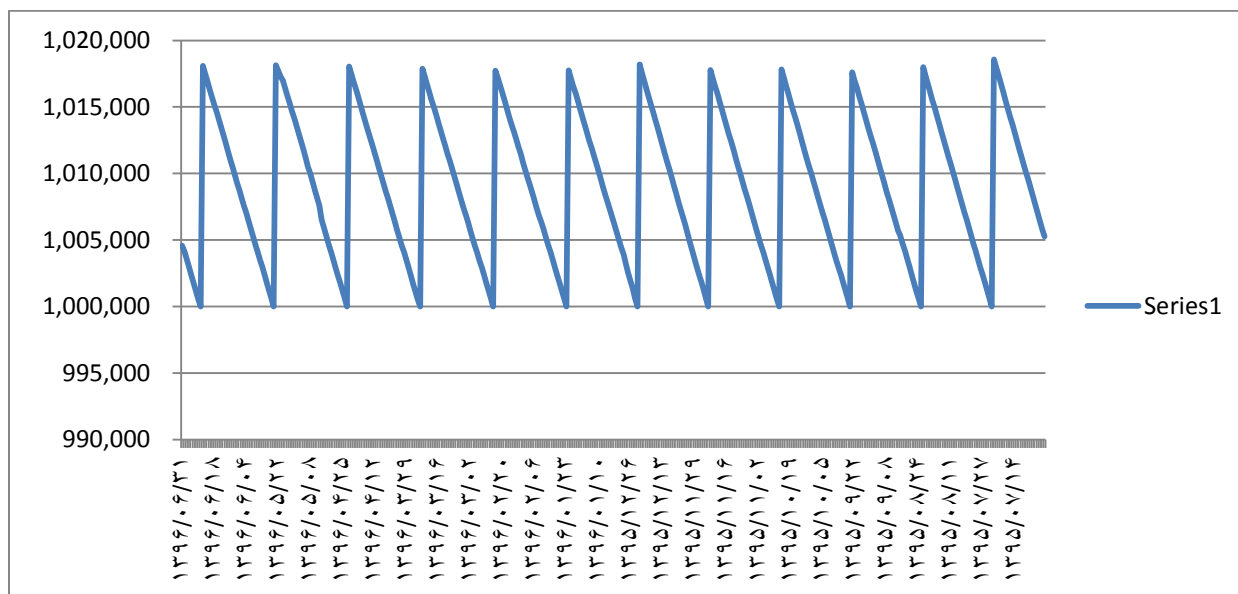
ریال	تعداد	یادداشت
۱۳,۰۶۰,۴۴۴,۶۲۲,۴۲۴	۱۲,۹۹۹,۹۰۷	
۹,۴۵۵,۰۷۲,۰۰۰,۰۰۰	۹,۴۵۵,۰۷۲	
(۱۱,۹۳۷,۷۴۵,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۱,۹۳۷,۷۴۵)	
۳,۱۳۹,۵۵۷,۵۷۵,۵۵۰	-	
(۳,۱۴۳,۳۹۵,۴۸۰,۲۱۲)	-	۲۳
(۸,۶۴۱,۲۸۲,۰۶۵)	-	۲۴
۱۰,۵۶۵,۲۹۲,۴۳۵,۶۹۷	۱۰,۵۱۷,۲۳۴	

خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول سال
 واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی سال
 واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی سال
 سود خالص دوره
 سودپرداختی
 تعدیلات
 خالص دارایی های پایانی سال

۵- بازدهی صندوق طی سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱

بازده	بازده صندوق	شاخص صندوقها	شاخص بازار
هفته اخیر	۰,۴۰	-	۲,۷۶
ماه اخیر	۱,۷۳	-	۳,۹۹
سه ماه اخیر	۵,۲۲	-	۹,۱۳

۷- نمودار قیمت ابطال:



۸- ترازنامه در تاریخ ۱۳۹۶/۰۶/۳۱:

۳۱/۰۶/۱۳۹۵	۳۱/۰۶/۱۳۹۶	یادداشت	دارایی ها:
ریال	ریال		
۰	۲۰۳,۰۳۵,۳۴۸,۰۱۱	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱۰,۳۲۵,۹۷۵,۶۸۶,۰۱۰	۵,۵۴۴,۳۹۸,۱۶۶,۹۰۰	۶	سرمایه گذاری در سپرده های بانکی
۲,۷۱۲,۶۳۳,۱۴۸,۹۷۶	۴,۹۴۳,۲۲۰,۳۲۲,۳۸۹	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱۰۸,۱۱۲,۴۴۵,۴۷۵	۱۵,۷۶۸,۱۷۴,۶۶۲	۸	حساب های دریافتی
۰	۰	۹	جاری کارگزاران
۰	۰	۱۰	سایر دارایی ها
۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۹۸۲,۷۶۹	۱۱	موجودی نقد
۱۳,۱۴۶,۷۴۱,۲۸۰,۴۶۱	۱۰,۷۰۶,۴۲۴,۹۹۴,۷۳۱		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۲۱,۵۲۵,۴۱۰,۰۶۰	۲۹,۹۲۰,۸۳۸,۹۱۴	۱۲	پرداختنی به ارکان صندوق
۷,۹۸۶,۱۲۶,۹۷۷	۸,۲۰۳,۶۴۰,۷۶۶	۱۳	پرداختنی به سرمایه گذاران
۵۶,۷۸۵,۱۲۱,۰۰۰	۱۰۳,۰۰۸,۰۷۹,۳۵۴	۱۴	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۸۶,۲۹۶,۶۵۸,۰۳۷	۱۴۱,۱۳۲,۵۵۹,۰۳۴		جمع بدهی ها
۱۳,۰۶۰,۴۴۴,۶۲۲,۴۲۴	۱۰,۵۶۵,۲۹۲,۴۳۵,۶۹۷	۱۵	خالص دارایی ها
۱,۰۰۴,۶۵۷	۱,۰۰۴,۵۶۹		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

۹- صورت سود زیان منتهی به ۱۳۹۶/۰۶/۳۱:

سال مالی منتهی به ۳۱/۰۶/۱۳۹۵	سال مالی منتهی به ۳۱/۰۶/۱۳۹۶	یادداشت	
			درآمد ها:
ریال	ریال		
۲۸,۶۶۶,۱۷۶,۰۰۲	۷۲,۹۲۳,۷۳۱,۶۳۲	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۷۴۲,۵۳۶,۳۱۹)	۹,۹۶۹,۹۵۲,۶۶۳	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	۸,۵۶۴,۹۲۸,۴۷۸	۱۸	سود سهام
۲,۲۰۵,۷۸۶,۸۷۸,۴۸۴	۳,۱۳۱,۷۴۷,۸۲۲,۸۶۲	۱۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۳۵۸,۹۳۴,۹۳۱	۱,۱۹۸,۲۱۲,۰۲۴	۲۰	سایر درآمدها
۲,۲۳۴,۰۶۹,۴۵۳,۰۹۸	۳,۲۲۴,۴۰۴,۶۴۷,۶۵۹		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۵۳,۴۳۵,۷۰۷,۵۲۷	۸۲,۷۵۰,۶۶۹,۲۴۹	۲۱	هزینه کارمزد ارکان
۲۴,۳۸۹,۴۴۲,۲۳۹	۲,۰۹۶,۴۰۲,۸۶۰	۲۲	سایر هزینه ها
۷۷,۸۲۵,۱۴۹,۷۶۶	۸۴,۸۴۷,۰۷۲,۱۰۹		جمع هزینه ها
۲,۱۵۶,۲۴۴,۳۰۳,۳۳۲	۳,۱۳۹,۵۵۷,۵۷۵,۵۵۰		سود (زیان) خالص
۲۲,۲۳٪	۲۱,۳۳٪		بازده میانگین سرمایه گذاری ^۱
۱۷,۰۵٪	۲۹,۷۲٪		بازده سرمایه گذاری پایان سال ^۲