



گزارش عملکرد مدیر صندوق بازارگردانی کیان منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰

کیان

مشاور
سرمایه گذاری

- مقدمه و معرفی
- ارکان و واحدهای سرمایه گذاری صندوق
- عملیات بازرگردانی
- صورت سود و زیان صندوق در دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰
- صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۴/۰۹/۳۰
- خالص ارزش دارایی صندوق
- ترکیب دارایی صندوق
- معاملات سهام
- عملکرد صندوق به تفکیک نماد
- اهم اقدامات انجام شده و برنامه های آتی صندوق

بخش اول : معرفی و مقدمه

مقدمه

صندوق بازارگردانی، شکلی از صندوق های سرمایه گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه گذاران (ناشر و سهامدار عمده) مطابق دستور العمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از وی شرکت بورس و فرابورس را ایفا میکنند. هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمیباشد بلکه طبق بند چ ماده ۱ دستور العمل فعالیت بازارگردانی، هدف از فعالیت بازارگردانی عبارتست از :

- ✓ تنظیم عرضه و تقاضا
- ✓ کاهش نوسان قیمت
- ✓ افزایش نقدشوندگی ورقه بهادار

معرفی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کیان به منظور تسهیل اجرای سیاست های کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه ۱۳۸۴، با مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۹/۲۴ تحت شماره ۵۰۸۴۶ و شناسه ملی ۱۴۰۰۹۶۴۷۳۵۰ نزد مرجع ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری تهران ثبت شده و به عنوان نهاد مالی در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۲۶ تحت شماره ۱۲۲/۱۳۱۳۲۵ نزد سازمان بورس به ثبت رسیده است.

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۳۰ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردان ۳۰ نماد بورسی و فرابورسی مشغول به فعالیت میباشد. در این تاریخ خالص ارزش دارایی های صندوق ۱۸,۵۸۲,۱۴۵,۲۴۹,۷۶۱ میلیارد ریال میباشد که این مبلغ نسبت به ابتدای دوره ۱۲۰ درصد افزایش داشته است.

بخش دوم:
ارکان و واحدهای
سرمایه گذاری

ارکان صندوق

دوره منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰	دوره منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰	رکن
کارگزاری توسعه معاملات کیان	شرکت مشاور سرمایه گذاری پرتو آفتاب کیان	مدیر
موسسه حسابرسی بهراد مشار	شرکت مشاور سرمایه گذاری اوراق بهادار پاداش	متولی
موسسه حسابرسی بیات رایان	موسسه حسابرسی بیات رایان	حسابرس
کارگزاری توسعه معاملات کیان	کارگزاری توسعه معاملات کیان	کارگزار

واحد های
سرمایه گذاری

نوع واحد	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	
عادی	۶۲۰،۸۳۶	۶۸۴،۱۱۱	شرکت گروه مالی کیان
ممتاز و عادی	۱۲۷،۵۷۸	۶۵۱،۵۹۹	شرکت مشاور سرمایه گذاری پرتوی آفتاب کیان
ممتاز و عادی	۲۹۹،۴۱۰	۲۵۱،۹۷۴	شرکت کارگزاری توسعه معاملات کیان
-	۷۰،۰۰۰	۷۰،۰۰۰	مجموع واحد های ممتاز
-	۵،۱۱۰،۴۴۴	۹،۹۲۹،۷۵۲	مجموع واحد های عادی
-	۵،۱۸۰،۴۴۴	۹،۹۹۹،۷۵۲	مجموع کل واحد های سرمایه گذاری

بخش سوم : عملیات بازارگردانی

هدف از تشکیل صندوق بازارگردانی

طبق ماده ۳ اساسنامه ، هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری وجوه از سرمایه گذاران و اختصاص آن ها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده (۴) به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امید نامه ، بهره گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه پذیران است .

طبق ماده ۴ اساسنامه، موضوع فعالیت صندوق بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امید نامه و سرمایه گذاری در اوراق بهادار پذیرفته شده در بورس تهران، فرابورس ایران، اوراق بهادار با درآمد ثابت ، سپرده های و گواهی های سپرده بانکی در راستای انجام فعالیت بازارگردانی است. کلیه دارایی ها، بدهی ها و هزینه های مربوط به هر یک از عملیات بازارگردانی شرکت های مورد نظر به صورت جدا نگهداری و گزارش میگردد. خصوصیات دارایی های موضوع سرمایه گذاری و حد نصاب سرمایه گذاری مربوطه در امید نامه ذکر شده است.

عملیات بازرگانی

طبق بند الف ماده ۱ دستورالعمل فعالیت بازرگانی، بازرگانی مبتنی بر حراج عبارتست از: یک روش فعالیت بازرگانی که طی آن بازرگردان ورقه بهادار به طور همزمان سفارش خرید و فروش را با رعایت حداقل سفارش انباشته و دامنه مظنه در سامانه معاملاتی ثبت مینماید.

طبق بند پ این ماده حداقل سفارش انباشته عبارتست از: حداقل تعدادی از ورقه بهادار است که بازرگردان باید در سفارش های خرید و فروش خود در دامنه مظنه تا زمان ایفای تعهدات روزانه در سامانه معاملات نگهداری مینماید. طبق بند ث ماده دامنه مظنه عبارتست از: حداکثر اختلاف بین پایین ترین قیمت سفارش خریدی که مجموع حجم سفارش های خرید تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته بوده و بالاترین قیمت سفارش فروشی که مجموع حجم سفارش های فروش تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش های انباشته به درصد است که بازرگردان آن ورقه بهادار، در سامانه معاملات بورس وارد مینماید. این درصد نسبت به پایین ترین قیمت سفارش خریدی که مجموع حجم سفارش های خرید تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته است، محاسبه می شود.

عملیات بازارگردانی

طبق بند ت این ماده حداقل معاملات روزانه عبارتست از : تعداد ورقه بهاداری است که در صورتی که بازارگردان با رعایت سایر تعهدات بازارگردان ، به میزان آن تعداد از ورقه بهادار در یک روز معاملاتی، معامله کند، تعهدات بازارگردان در آن روز ایفا شده تلقی میگردد. در تصویر زیر نمونه عملیات بازارگردانی یک نماد در طول یک روز کاری نشان داده شده است.



سهام و تحت بازارگردانی

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دارایی نزد بازارگردان (میلیارد ریال)
۱	پویا زرکان آق دره	فزر	۲.۲۵ درصد	۱۰۸,۰۰۰	۲,۱۶۰,۰۰۰	۳,۸۶۴
۲	لابراتور داروسازی عبیدی	دعبید	۲.۵ درصد	۶۶,۲۰۰	۱,۳۲۴,۰۰۰	۳,۳۴۱
۳	کانی کربن طبس	کربن	۲.۲۵ درصد	۶۰,۷۴۰	۱,۲۱۴,۷۲۰	۲,۴۵۸
۴	شرکت گروه مالی کیان	کیانا	۳ درصد	۱۵۰,۰۰۰	۳,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۸۶
۵	شرکت صنایع شیمیایی کیمیاگران امروز	شکام	۳ درصد	۲۶۰,۸۵۵	۵,۲۱۷,۰۸۰	۳۶۶
۶	شرکت تولید و توسعه سرب و روی ایرانیان	فتوسا	۳ درصد	۴۸,۵۳۶	۹۷۰,۷۱۲	۱۹۳
۷	شرکت فرابورس ایران	فرابورس	۳ درصد	۲۶۴,۰۰۰	۵,۲۸۰,۰۰۰	۱۴۵
۸	معدنی کیمیای زنجان گستران	کیمیا	۲.۵ درصد	۵۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۸
۹	توسعه فن افزار توسن	فن افزار	۲.۲۵ درصد	۱۸۳,۳۵۵	۳,۶۶۷,۰۵۰	در دست اقدام

صندوقهای تحت بازارگردانی

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دارایی نزد بازارگردان (میلیارد ریال)
۱	صندوق سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت کیان	کیان	۱ درصد	۱,۷۰۰,۰۰۰	۱۷,۰۰۰,۰۰۰	۲,۵۲۸
۲	صندوق سرمایه گذاری در اوراق بهادار مبتنی بر سکه طلای کیان	گوهر	۴ درصد	۲۰۰,۰۰۰	۲۰۰,۰۰۰	۱,۱۹۲
۳	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله بخشی کیان	فارما کیان ۱	۳ درصد	۳۸۲,۸۵۰	۷,۶۵۷,۰۰۰	۴۸۵
۴	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله شاخصی کیان	هموزن	۳ درصد	۲۱۷,۱۷۵	۴,۳۴۳,۵۰۰	۴۶۸
۵	صندوق سرمایه گذاری سهامی آوای سهام کیان	رشدی کیان	۲ درصد	۴۳,۰۰۰	۴۳۰,۰۰۰	۲۳۱
۶	صندوق سرمایه گذاری سهامی به آفرید سپینود	سپینود	۳ درصد	۲۵,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰	۴۹

اوراق مرابحه و اجاره تحت بازارگردانی

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دارایی نزد بازارگردان (میلیارد ریال)
۱	اوراق مرابحه صنایع لوازم خانگی مادیران	لوازم مادیران ۰۶۳	۱ درصد	۵۰۰۰	۲۵۰۰۰	۶۶
۲	اوراق مرابحه صنایع الکترونیک مادیران	الکترومادیران ۰۶۲	۱ درصد	۵۰۰۰	۲۵۰۰۰	۶۳
۳	اوراق مرابحه شرکت کرمان موتور	کرمان ۵۱۲۴	۱ درصد	۵۰۰۰	۶۰۰۰۰	۲۰۰
۴	اوراق مرابحه شرکت مدیریت منابع تجاری ایده گستران زمان	ایده ۰۷	۱ درصد	۵۰۰۰	۳۰۰۰۰	۷۸
۵	اوراق مرابحه شرکت بهار رز عالیس چناران	عالیس ۰۷۲	۱ درصد	۱۰۰۰۰۰	۱۰۰۰۰۰	۲۱۶
۶	اوراق اجاره شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس (سهامی عام)	صفارس ۰۷	۱ درصد	۵۰۰۰	۱۰۰۰۰۰	۲۹۵
۷	اوراق مرابحه شرکت فروسیلیس ایران (سهامی عام)	صفروس ۶۷۰	۱ درصد	۱۵۰۰	۳۰۰۰۰	۱۳۶
۸	اوراق مرابحه شرکت توسعه معادن سرب و روی مهدی آباد	توسعه معادن ۰۷	۱ درصد	۵۰۰۰	۸۰۰۰۰	۱۹۳
۹	اوراق مرابحه شرکت آرمان الکترونیک ارگ	آرمان ارگ ۰۷۲	۱ درصد	۵۰۰۰	۲۵۰۰۰	۹۶
۱۰	اوراق مرابحه شرکت تجارت جاوید آریان (سهامی خاص)	تاجا ۰۸	۱ درصد	۵۰۰۰	۱۵۰۰۰	۴۱
۱۱	اوراق اجاره شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس (سهامی عام)	صفارس ۸۶	۱ درصد	۷۰۰۰	۱۴۰۰۰۰	۳۴۳
۱۲	اوراق مرابحه نانو دارو پژوهان پردیس	نانودارو ۰۸	۱ درصد	۵۰۰۰	۲۰۰۰۰	۴۸
۱۳	اوراق مشارکت قطار شهری تبریز ۷۱۲۲۸	-	۱ درصد	۴۰۰۰	۷۵۰۰۰	۳۶
۱۴	اوراق اجاره شرکت صنایع پتروشیمی خلیج فارس (سهامی عام)	صفارس ۰۰۸	۱ درصد	۴۰۰۰	۹۸۰۰۰	۲۲۵
۱۵	اوراق اجاره شرکت سرمایه گذاری صدر تأمین (سهامی عام)	-	۱ درصد	۷۵۰۰	۱۵۰۰۰۰	در دست اقدام

بخش چهارم: صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

درآمدها	۱۴۰۴/۰۹/۳۰
۴۸ ◀ درآمد حاصل از بازرگردانی	۱۹۱,۴۷۰,۶۲۳,۷۷۵
۴۳ ◀ درآمد سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	۱,۱۶۸,۰۹۷,۶۸۸
۴۵ ◀ درآمد (هزینه) ناشی از تغییر ارزش سرمایه‌گذاری‌ها	۲۱,۰۶۵,۹۰۹,۹۲۵
۴۱ ◀ سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۱,۵۹۴,۷۳۹,۵۲۲
۴۲ درآمد سود سهام	*
۴۴ ◀ درآمد سود اوراق بهادار با درآمد ثابت	۹۷۹,۲۴۸,۸۴۰
۴۷ سایر درآمدها	*
جمع درآمدها	۲۲۶,۲۷۸,۶۱۹,۷۵۰
هزینه‌ها	
۵۲ ◀ هزینه کارمزد معاملات سهام و حق تقدم	۲۱,۰۱۹,۷۴۷
۵۱ ◀ سایر هزینه‌ها	۹,۲۶۱,۴۷۸,۹۸۰
۵۰ ◀ هزینه های کارمزد ارکان	-۱,۵۸۱,۵۳۴,۷۴۶
۵۳ ◀ هزینه کارمزد معاملات اوراق بهادار با درآمد ثابت	۳۵۷,۲۵۴,۵۳۶
۵۶ ◀ مخارج تاسیس و نگهداری صندوق	۹۲,۱۲۸,۴۴۵
۵۴ ◀ هزینه های مالی	۳,۱۸۲,۹۷۹,۰۱۴
جمع هزینه‌ها	۱۱,۳۳۳,۳۲۳,۸۹۶
سود (زیان) خالص	۲۱۴,۹۴۵,۲۹۵,۸۵۴

بخش پنجم : صورت خالص دارایی ها صندوق

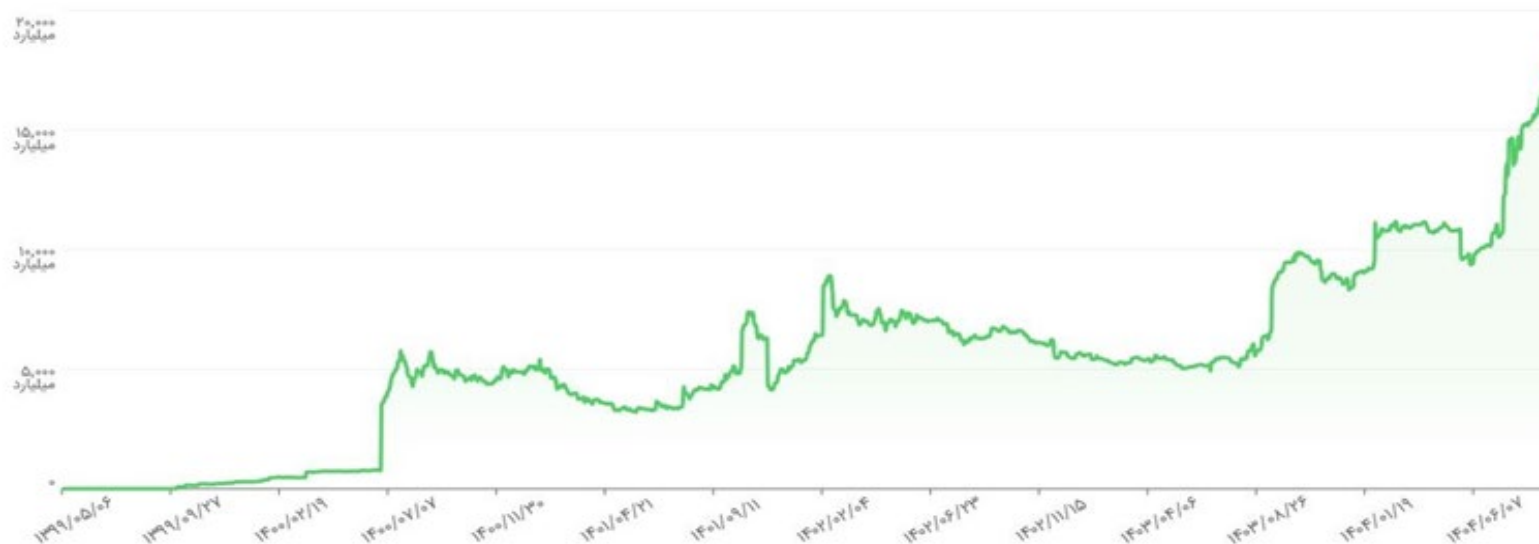
صورت خالص دارایی ها صندوق

بدهی‌ها		دارایی‌ها	
۱,۷۹۶,۲۳۷,۹۵۰,۰۰۰	۲۰ حساب فی مابین	۲,۳۲۸,۶۹۱,۳۹۹,۶۵۶	۱۱ نقد و بانک
۱,۲۳۵,۶۱۸,۰۶۵,۶۶۶	۲۲ بدهی به سرمایه‌گذاران	۱,۶۵۷,۵۶۰,۳۶۱,۹۶۵	۱۲ حساب‌های دریافتی تجاری
۴۲,۶۹۵,۶۹۰,۵۸۱	۲۴ ذخیره هزینه ارکان	۲۹۶,۸۷۱,۱۸۱,۸۴۵	۱۳ جاری کارگزاران
۱۳۴,۰۷۸,۱۵۷,۴۶۳	۲۵ سایر حساب‌های پرداختی	۳۰,۷۰۵,۷۱۴,۲۹۵	۱۴ سایر حساب‌های دریافتی
۱,۰۰۷,۸۷۶,۷۱۴,۳۲۰	۲۶ تسهیلات مالی دریافتی	۱,۷۵۰,۴۷۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵ سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۱,۷۸۴,۸۶۷,۹۶۱,۱۱۰	۲۷ سایر بدهی‌ها	۱,۶۵۲,۳۲۲,۱۶۹,۰۹۴	۱۶ سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۶,۰۰۱,۳۷۴,۵۳۷,۱۳۸	جمع بدهی‌ها	۱۰,۸۸۱,۹۹۱,۷۱۵,۱۸۵	۱۷ سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم شرکت‌ها
۱۸,۵۸۲,۱۴۵,۲۴۹,۷۶۱	خالص ارزش دارایی‌ها	۴,۰۷۱,۰۶۷,۳۷۹	۱۸ مخارج انتقالی به دوره‌های آتی
	حقوق صاحبان سهام	۵,۹۸۰,۸۳۲,۱۷۷,۴۸۰	۱۹ سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌ها و سایر اوراق
۱۵,۴۳۰,۴۸۱,۷۵۳,۸۶۱	۳۱ خالص دارایی‌ها	۲۴,۵۸۳,۵۱۹,۷۸۶,۸۹۹	جمع دارایی‌ها
-۳,۰۶۰,۱۲۶,۰۱۰,۹۳۹	۳۲ تعدیلات واحدهای سرمایه‌گذاری		
*	حساب‌های انتظامی		
۶,۲۱۱,۷۸۹,۵۰۶,۸۳۹	سود و زیان خالص		
۱۸,۵۸۲,۱۴۵,۲۴۹,۷۶۱	جمع حقوق صاحبان سهام		
۲۴,۵۸۳,۵۱۹,۷۸۶,۸۹۹	جمع بدهی‌ها و حقوق صاحبان سهام		

بخش ششم : خالص ارزش دارایی های صندوق

روند خالص ارزش دارایی های صندوق

در تاریخ ۱۴۰۴/۰۹/۳۰ خالص ارزش دارایی های صندوق بازارگردانی کیان ۱۸,۵۸۲,۱۴۵,۲۴۹,۷۶۱ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به یکسال گذشته خود ۱۲۰ درصد افزایش داشته .

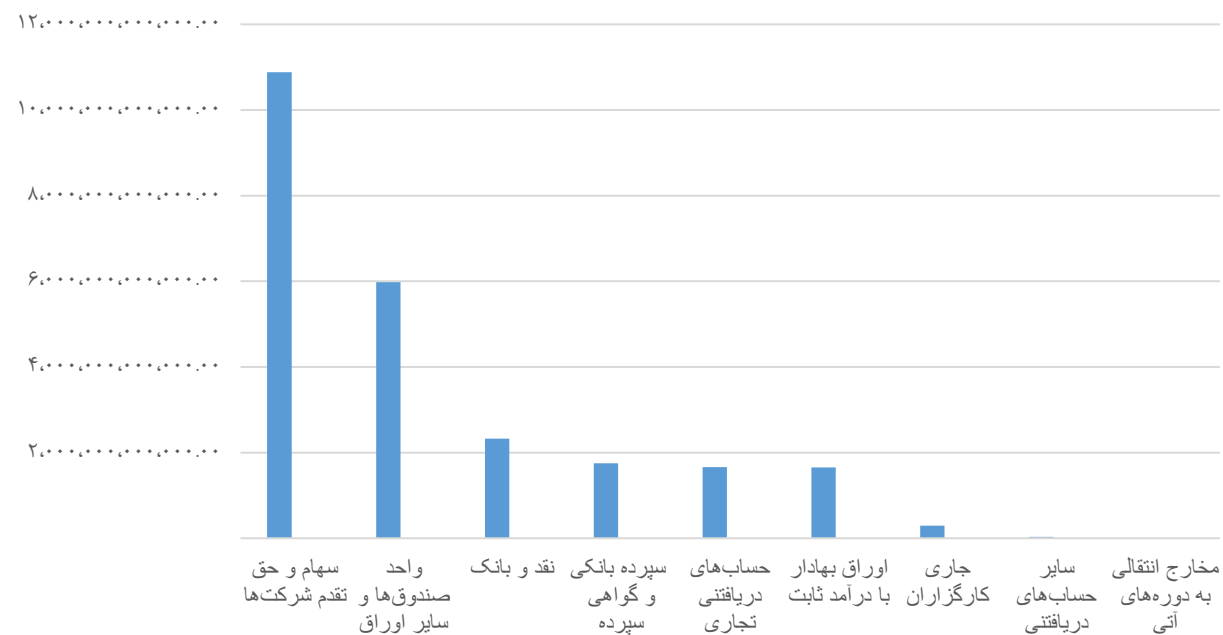


همچنین صندوق بازارگردانی کیان تعداد ۳۰ نماد را بازارگردانی میکند.

ارزش خالص دارایی های
صندوق برتر

بخش هفتم : ترکیب دارایی ها صندوق

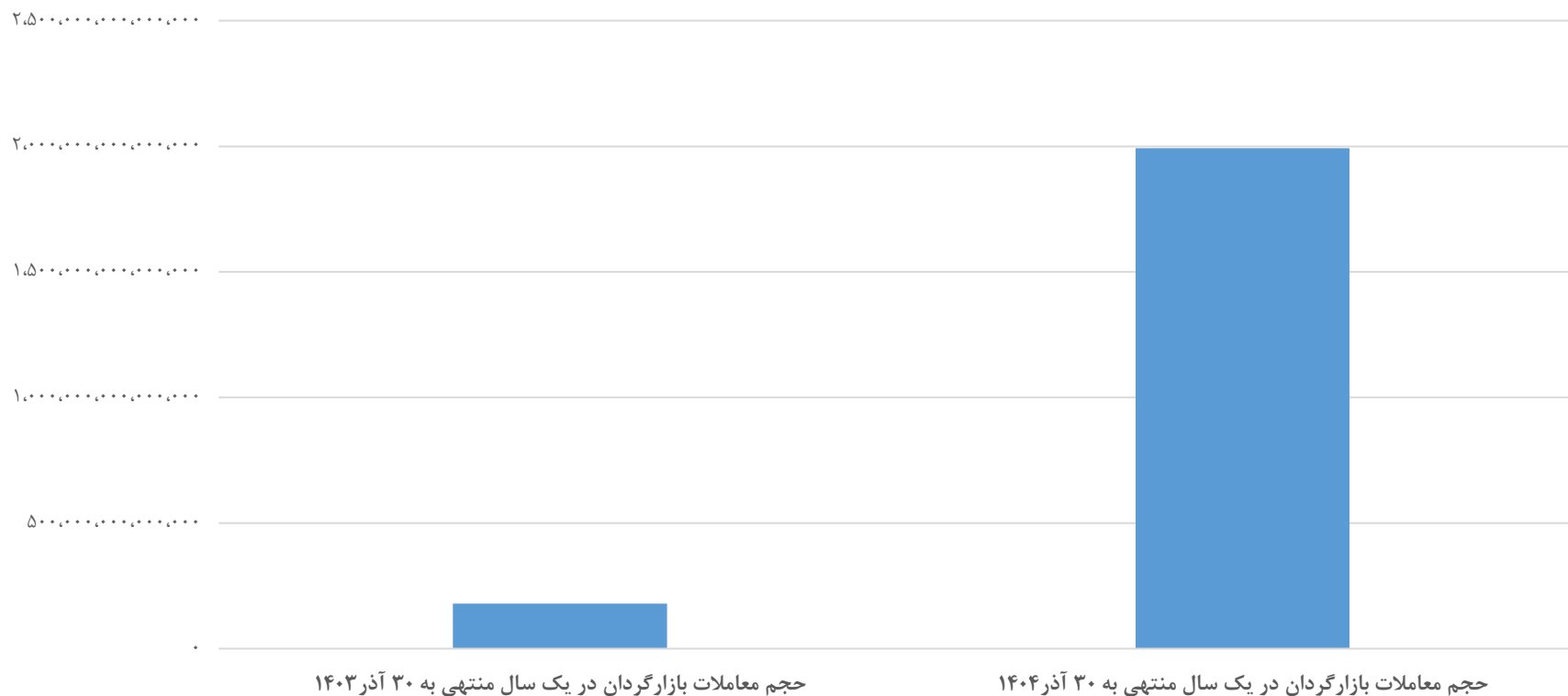
ترکیب دارایی های صندوق



عمده بخش سایر ، مربوط به سود دریافتی (سر رسید نشده) میباشد که به تدریج از شرکت ها وصول میگردد.

بخش هشتم : معاملات سهام صندوق ها

ارزش معاملات



ارزش معاملات صندوق بازارگردانی کیان در یک سال منتهی به ۳۰/۰۹/۱۴۰۳ حدوداً ۱۸ همت بوده است که در یکساله بعدی این حجم به ۱۹۹.۲ همت رسیده است.

بخش دهم : اهم اقدامات انجام
شده و برنامه های آتی صندوق

برنامه های آتی صندوق

✓ بهبود عملکرد و بهینه سازی ایفای تعهدات فعلی بازارگردانی

✓ افزایش تعداد نماد های موضوعی بازارگردانی

✓ انجام بازارگردانی صندوق های کالایی



مشاور سرمایه‌گذاری پرتو آفتاب کیان
ایران، تهران، میدان آرژانتین، خیابان الوند، پلاک ۱۹، طبقه پنجم
کد پستی: ۱۵۱۴۹۴۴۸۳۴
تلفن: ۴۷۱۸۰۴۰۰
نمبر: ۴۷۱۸۰۴۰۴

کیان

مشاور
سرمایه‌گذاری