

شماره ثبت ۱۲۴۷

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی فناوری هیرکانیا



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی فناوری هیرکانیا

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۴۰۳

"ثبت شده به شماره ۱۱۹۸۲ نزد سازمان بوس و اوراق بهادار"

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۳	کلیات صندوق.....
۳	۱- تاریخچه فعالیت:.....
۳	۲- دوره فعالیت صندوق:
۳	۳- اهداف و استراتژی های صندوق:
۳	۴- موضوع فعالیت صندوق:
۳	۵- محل اقامت صندوق:
۳	۶- اطلاع رسانی:
۴	۷- ریسک سرمایه گذاری در صندوق:.....
۵	۸- ارکان صندوق سرمایه گذاری:
۶	۹- تعهدات صندوق:.....
۶	۱۰- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران:
۶	۱۱- ترکیب دارائی های صندوق:
۷	۱۲- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک نمادهای مورد بازارگردانی:
۷	۱۳- بازدهی صندوق:
۸	۱۴- مقایسه بازده صندوق با بازار:
۸	۱۵- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازارگردانی (داده گستر عصر نوین) طی دوره مالی:
۸	۱۶- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازارگردانی (بیمه هوشمند فردا) طی دوره مالی:
۸	۱۷- وضعیت سفارش الگوریتم:
۹	۱۸- برنامه های آتی صندوق:.....

کلیات صندوق

۱- تاریخچه فعالیت:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی فناوری هیرکانیا که صندوق سرمایه‌گذاری سهامی محسوب می‌شود، در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۰۹ تحت شماره ۱۳۴۷ و شناسه ملی ۱۴۰۱۱۹۳۷۲۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری گرگان و در تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۴ تحت شماره ۱۱۹۸۲ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام و حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس سرمایه‌گذاری می‌نماید.

۲- دوره فعالیت صندوق:

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۴ اساسنامه و بر اساس مجوز فعالیت به شماره ۱۲۲/۱۰۷۷۰۰ مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۴ سازمان بورس و اوراق بهادار تا تاریخ ۱۴۰۶/۰۳/۰۸ مجاز می‌باشد.

۳- اهداف و استراتژی‌های صندوق:

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن مطابق امیدنامه و کسب منافع از این محل است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد: اولاً هزینه به کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد. 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 متنوع دارایی‌ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

۴- موضوع فعالیت صندوق:

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در امیدنامه با هدف ایفاء تعهدات بازارگردانی است. موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی و یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است.

۵- محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق در گرگان - محله گرگانپارس - خیابان عدالت ۳۳۶ - بلوار ناهارخوران - طبقه اول - واحد یک جنوبی واقع شده است.

۶- اطلاع رسانی:

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی فناوری هیرکانیا مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس <https://hyrcaniammf.ir> درج گردیده است.

۷- ریسک سرمایه گذاری در صندوق:

هر چند تمهیدات لازم به عمل می آید 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 توجه داشته باشند. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز و عادی با سرمایه گذاری در صندوق، تمام ریسک های فراروی صندوق را می پذیرند. درسایر بندهای این بخش، برخی از ریسک های سرمایه گذاری در صندوق برشمرده 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 آن است. با توجه به آنکه ممکن است در مواقعی تمام یا بخشی از دارایی های صندوق در اوراق بهادار سرمایه گذاری شده باشند و از آنجاکه 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 سایر اوراق بهادار:

گرچه صندوق به غیر از سهام و حق تقدم سهام موضوع بازارگردانی، در اوراق بهاداری سرمایه گذاری می کند که سود حداقل برای آن ها تعیین و پرداخت سود و اصل سرمایه گذاری آن توسط یک مؤسسه معتبر تضمین شده است، یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه گذاری در آن ها، وثایق معتبر و کافی وجود دارد؛ ولی این احتمال وجود دارد که طرح سرمایه گذاری مرتبط با این اوراق، سودآوری کافی نداشته باشد یا ناشر به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق بهادار، عمل ننماید یا ارزش وثایق به طرز قابل توجهی کاهش یابد به طوری که پوشش دهنده اصل سرمایه گذاری و سود متعلق به آن نباشند. وقوع این اتفاقات می تواند باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقباً سرمایه گذاران شوند.

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 آن ها تعیین شده است، در بازار کاهش می یابد. اگر صندوق در این نوع اوراق بهادار سرمایه گذاری کرده باشد و بازخیرد آن به قیمت معین توسط یک مؤسسه معتبر (نظیر بانک) تضمین نشده باشد، افزایش نرخ بازده بدون ریسک، ممکن است باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقباً 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 مربوط به عملیات بازارگردانی اوراق بهادار مورد نظر اقدام به پرداخت وجوه واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده می نماید. چنانچه وجوه نقد صندوق متعلق به عملیات بازارگردانی اوراق

بهادار مورد نظر کفاف بازپرداخت واحدهای ابطال شده را نداشته باشد، مدیر صندوق مطابق اساسنامه اقدام به فروش دارایی های صندوق متعلق به عملیات بازارگردانی همان اوراق بهادار 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 تأمین وجه نقد به حساب بستنکاری سرمایه گذار منظور می گردد و بازپرداخت این بدهی ها با روش FIFO و بر اساس تاریخ و ساعت ثبت سفارشات ابطال انجام می گیرد. در صورت عدم امکان تبدیل دارایی های غیرنقد در عملیات بازارگردانی هر یک از اوراق بهادار به نقد، مدیر مجاز به پرداخت به سرمایه گذاران اوراق بهادار مذکور از محل دارایی های عملیات بازارگردانی سایر اوراق بهادار نمی باشد.

۸- ارکان صندوق سرمایه گذاری :

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی فناوری هیرکانیا که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. فقط دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه گذاری ممتاز، درمجامع صندوق از حق رای برخوردارند. در تاریخ خالص دارایی ها، دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده اند شامل اشخاص زیر است :

نام دارنده واحد ممتاز	درصد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای ممتاز تحت تملک
داده گستر عصر نوین	۴۹,۰۰۰	۴۹
شرکت سرمایه گذاری توسعه فناوری هیرکانیا	۵۱,۰۰۰	۵۱
	۱۰۰,۰۰۰	۱۰۰

- مدیر صندوق
- مجلس حسابرسی و خدمات مدیریت ره یافت
- مجلس حسابرسی و خدمات مدیریت ارقام نگر آریا

مدیر صندوق: شرکت سرمایه گذاری توسعه فناوری هیرکانیا که در تاریخ ۱۳۹۶/۰۳/۳۰ به شماره ثبت ۵۱۱۲۱۴ نزد مرجع ثبت اسناد و املاک استان تهران به ثبت رسیده است. سپس بموجب مصوبه مجمع عمومی فوق العاده آدرس قانونی شرکت از تهران به شهرستان گرگان انتقال یافت و در اداره ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری گرگان تحت شماره ۱۵۰۶۰ به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: گلستان - گرگان - گرگانپارس (سازمان آب) خیابان عدالت ۳۶ - بلوار ناهارخوران - پلاک ۰ واحد ۱ شمالی

متولی صندوق: موسسه حسابرسی ره یافت و همکاران که در تاریخ ۱۳۷۷/۰۲/۲۳ به شماره ثبت ۵۸۹ نزد مرجع ثبت شرکت های مشهد به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: مشهد - بلوار مدرس - مدرس ۵ - ساختمان بانک مسکن - طبقه اول

حسابرس صندوق : بر اساس مجمع مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۷ حسابرس صندوق از موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت بصیر محاسب توس به موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت ارقام نگر آریا که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری تهران به ثبت رسیده است تغییر یافت. نشانس حسابرس عبارت است از : تهران - میدان توحید - خیابان توحید - نبش خیابان پرچم - پلاک ۶۸ - طبقه اول.

۹- تعهدات صندوق:

تعهدات صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی فناوری هیرکانیا در دو نماد شرکت بیمه هوشمند فردا و شرکت داده گستر عصر نوین به شرح ذیل می باشد:

نام شرکت	نماد	حداقل سفارش انباشته	دامنه مظنه	حداقل حجم معاملات روزانه
داده گستر عصر نوین	های وب	۶۴۹.۰۵۰	۲.۲۵	۱۲.۹۸۱.۰۰۰
بیمه هوشمند فردا	وفردا	۱۵۳.۰۰۰	۳	۳.۰۶۰.۰۰۰

۱۰- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران :

دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳

خالص ارزش روز دارایی ها	۱۸۵.۵۸۵.۰۱۲.۲۲۵
آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۳۶۹.۵۶۸
آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۳۶۸.۵۱۱
گواهی ممتاز	۱۰۰,۰۰۰
گواهی عادی	۴۰۳.۶۰۸
تعداد اشخاص حقیقی	۱
تعداد اشخاص حقوقی	۳

۱۱- ترکیب دارائی های صندوق :

ترکیب سرمایه گذاری های صندوق برای دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۳ به شرح جدول ذیل می باشد:

عنوان	خالص ارزش دارایی ها - ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز (درصد)
سرمایه گذاری در سهام	۳۵۵.۲۸۵.۲۴۴.۹۵۷	۹۱/۵۵
حساب های دریافتنی	۲۹.۹۷۰.۰۲۹.۹۹۷	۷/۷۲
سایر دارایی ها	۲۹۱.۷۶۱.۷۳۸	۰/۰۸
موجودی نقد	۲.۵۲۹.۲۸۰.۳۳۶	۰/۶۵
جمع	۳۸۸.۰۷۶.۳۱۷.۰۲۸	۱۰۰

۱۲- ترکیب دارائی های صندوق به تفکیک نمادهای مورد بازارگردانی :

داده گستر عصر نوین (نماد های وب)

عنوان	خالص ارزش دارایی ها - ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز (درصد)
سرمایه گذاری در سهام	۲۵۸,۳۵۰,۰۱۳,۷۳۸	۸۸.۸۳
حساب های دریافتنی	۲۹,۹۷۰,۰۲۹,۹۹۷	۱۰.۳۱
سایر دارایی ها	۱۷۳,۲۵۵,۵۴۴	۰.۰۶
موجودی نقد	۲,۳۲۸,۷۵۴,۳۵۴	۰.۸۰
جمع	۲۹۰,۸۲۲,۰۵۳,۶۳۳	۱۰۰

بیمه هوشمند فردا (نماد وفردا)

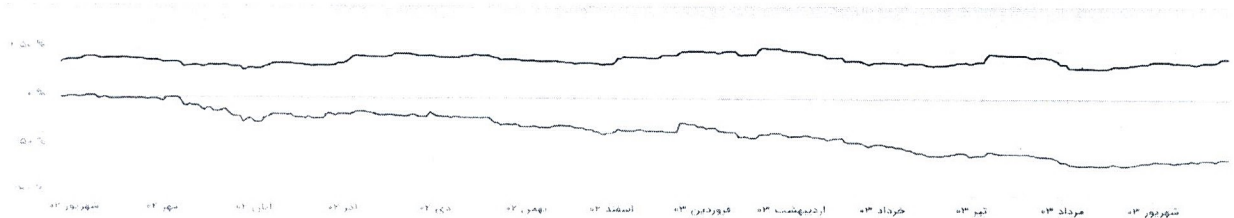
عنوان	خالص ارزش دارایی ها به ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز (درصد)
سرمایه گذاری در سهام	۹۶,۹۳۵,۲۳۱,۲۱۹	۹۹.۶۷
سایر دارایی ها	۱۱۸,۵۰۶,۱۹۴	۰.۱۲
موجودی نقد	۲۰۰,۵۲۵,۹۸۲	۰.۲۱
جمع	۹۷,۲۵۴,۲۶۳,۳۹۵	۱۰۰

۱۳- بازدهی صندوق :

اطلاعات بازدهی صندوق شامل بازدهی سالانه صندوق از شروع فعالیت تا تاریخ گزارش ،سالانه ،شش ماهه ،سه ماهه ،ماهانه،و هفتگی در جدول ارائه شدهاند که به روز رسانی آن در پایان هر هفته انجام می گردد.

شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۴۰۳/۰۶/۲۴	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	(۰.۱۲۵)%	%۱.۰۳۷
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۶/۰۱	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	۱۸.۴۷۳%	%۲.۹۳۵
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۴/۰۳	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	(۱۱.۸۲۶)%	%۲.۲۳۶
۶ ماه	۱۴۰۳/۰۱/۰۶	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	(۵۰.۹۲۷)%	(۶.۹۴۹)%
یک سال اخیر	۱۴۰۲/۰۶/۳۱	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	(۶۲.۳۸۴)%	(۱.۱۴۱)%
بازدهی از شروع فعالیت	۱۴۰۱/۰۴/۱۴	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	(۶۳.۱۴۷)%	%۳۸.۷۷۶

۱۴- مقایسه بازده صندوق با بازار:



۱۵- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازارگردانی (داده گستر عصر نوین) طی دوره مالی :

ارزش معاملات خرید (ریال)	ارزش معاملات فروش (ریال)	حجم معاملات خرید (تعداد)	حجم معاملات فروش (تعداد)
۳۰۳۶.۳۹۴.۶۸۴	۲.۱۱۳.۳۹۲.۶۴۳	۳.۴۷۶.۶۷۷	۳.۰۰۰.۰۰۰

۱۶- ارزش و حجم معاملات صندوق در مورد سهام مورد بازارگردانی (بیمه هوشمند فردا) طی دوره مالی :

ارزش معاملات خرید (ریال)	ارزش معاملات فروش (ریال)	حجم معاملات خرید (تعداد)	حجم معاملات فروش (تعداد)
۱۵۹.۶۴۹.۸۷۶	۰	۱۵۲.۵۰۰	۰

۱۷- وضعیت سفارش الگوریتم:

با توجه به این نکته که بازارگردانی در صندوق بازارگردانی فناوری هیرکانیا به صورت الگوریتم می باشد، در دو نماد های وب و وفردا طبق جدول ذیل سفارش گذاری انجام شده است:

ردیف	نماد	تعداد روزهای معاملاتی	تعداد روزهایی که سفارش گذاشته شده
۱	های وب	۱۰۹	۳
۲	وفردا	۵۳	۳

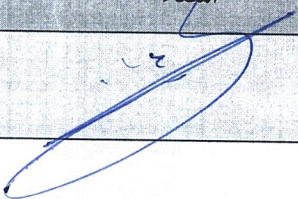
خاطر نشان می شود در بعضی از روزهای معاملاتی که سفارش از سمت بازارگردان ثبت نشده به دلیل عدم نقدینگی در صندوق بوده که در با توجه نزولی بودن بازار سرمایه اقدام به خرید در صف های فروش نموده و نقدینگی آن به اتمام رسیده است.

۱۸- برنامه های آتی صندوق:

مهمترین برنامه های آتی صندوق به شرح ذیل می باشد:

- افزایش خالص ارزش دارایی های صندوق و کسب بیشترین بازدهی ممکن
- رعایت کامل مفاد اساسنامه و امیدنامه
- افزایش نمادهای موضوع بازارگردانی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی

ارکان صندوق:

ردیف	ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
۱	مدیر صندوق	شرکت سرمایه گذاری توسعه فناوری هیرکانیا	داود هادی فر	

شرکت سرمایه گذاری
توسعه فناوری
هیرکانیا
(سهامی خاص)
ثبت ۱۵۰۶۰