

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره
مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۱۳۹۸/۰۹/۳۰

کارگزاری صبا جهاد

به نام خدا

در اجرای مفاد ۲۳۲ اصلاحیه قانون تجارت، مصوب اسفند ماه ۱۳۴۷ و ماده ۴۵ قانون بازار اوراق بهادار بدینوسیله گزارش درباره فعالیت و وضع عمومی صندوق برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح ذیل تقدیم می گردد.

به نظر اینجانب اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تأکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد صندوق و در جهت حفظ منافع صندوق انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت های موجود بوده و اثرات آنها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می توان پیش بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۲۳ به تأیید ارکان صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
نماینده مدیر صندوق	شرکت کارگزاری صبا جهاد	آقای حاجعلی صلاحی نژاد	 صندوق اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری شماره ثبت: ۴۹۲ شناسه ملی: ۱۴۰۰۷۲۷۴۵۴۰

۱. کلیات

۱-۱ تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتی کشوری در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۲ تحت شماره ۴۳۴۹۲ نزد اداره ثبت شرکتها و مؤسسات غیرتجاری تهران ثبت شده و در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۸ تحت شماره ۱۱۵۵۳ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری وجوه از سرمایه گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده ۴ اساسنامه به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه گذاران است. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس، اوراق بهادار با درآمد ثابت و ... سرمایه گذاری می نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، ۳ سال است. مرکز اصلی صندوق در خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، بعد از تقاطع فلسطین، شماره ۳۸ واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی باشد.

۲. اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه گذاری به آدرس arzeshafarinfund.com درج گردیده است.

۳. ارکان صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتی کشوری از ارکان زیر تشکیل شده است:

۳-۱ مدیر صندوق

شرکت کارگزاری صبا جهاد است که در تاریخ ۱۳۸۳/۰۶/۰۸ با شماره ثبت ۲۲۹۱۸۵ نزد مرجع ثبت شرکتها، شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، بعد از تقاطع فلسطین، شماره ۳۸.

۳-۲ متولی صندوق

شرکت مشاور سرمایه گذاری تأمین سرمایه نوین (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۸۹/۱۲/۲۲ با شماره ثبت ۳۹۸۵۱۳ نزد مرجع ثبت شرکتها، شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، بلوار آفریقا، خیابان گل آذین، شماره ۲۳.

۳-۳ حسابرس صندوق

شرکت مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت سامان پندار است که در تاریخ ۱۳۸۱/۱۲/۲۹ با شماره ثبت ۱۳۹۱۹ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، بلوار آفریقا، نبش عاطفی غربی، برج صبا، پلاک ۱۵۲، طبقه ۱۲، واحد ۱۲۳.

۴. مجمع صندوق سرمایه گذاری:

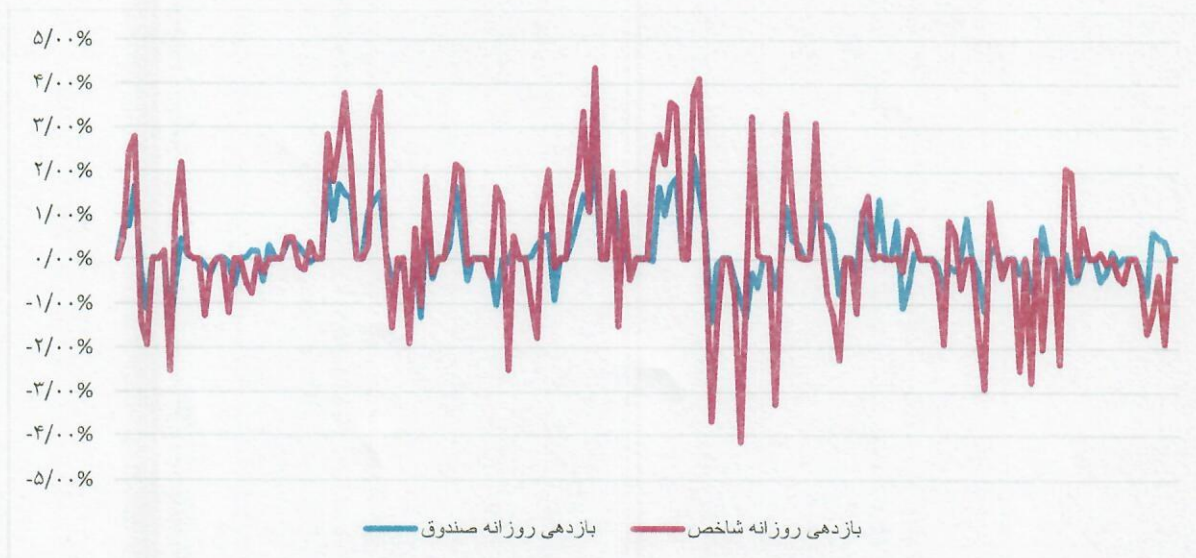
از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. طبق ماده ۲۳ اساسنامه مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رأی صندوق تشکیل شده و رسمیت می یابد. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشتی کشوری	۳۵۰	٪۱
۲	شرکت نوآوران مدیریت سبا	۳۴,۳۰۰	٪۹۸
۳	شرکت کارگزاری صبا جهاد	۳۵۰	٪۱
	جمع	۳۵,۰۰۰	٪۱۰۰

۵. اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

خالص ارزش روز داراییها	۱,۰۱۱۸,۷۷۶,۶۱۶,۸۰۸
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۳۵,۰۰۰
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری عادی	۸۸۴,۳۵۹
تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری	۷
اشخاص حقوقی	۷
اشخاص حقیقی	۰
نسبت سرمایه تامین شده توسط اشخاص حقیقی	۰
ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری	۱,۰۰۰,۰۰۰
نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۱۱۴,۳۴۴
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۱۰۸,۱۳۸

۶. مقایسه روند بازدهی صندوق و سایر شاخص ها



۷. بازده صندوق

بازده صندوق	شرح
-۲,۸۲٪	یک هفته اخیر
۰,۹۰٪	یک ماه اخیر
-۲,۳۷٪	سه ماه اخیر
-۲۵,۹۶٪	شش ماه اخیر
-۱۸,۷۲٪	یکسال اخیر

۸. ترکیب دارایی‌های صندوق

۱۵۸,۸۹۸,۳۹۴,۱۹۰	وجه نقد و شبه نقد
۶۸۱,۴۷۰,۹۳۱,۲۶۴	پرتفوی سهام
۱۸۰,۹۱۳,۰۶۶,۶۴۰	اوراق مشارکت
۷,۳۲۹,۰۵۷,۴۸۶	سایر
۳۱,۴۹۳,۱۱۸	تعداد سهام موجود در صندوق

۹. نمودار ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق به تاریخ ۱۳۹۸/۰۹/۳۰



ترازنامه صندوق مورخ ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

ریال	داراییها :
۶۸۱,۴۷۰,۹۳۱,۲۶۳	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱۸۰,۹۱۳,۰۶۶,۶۴۱	سرمایه گذاری در سایر اوراق مشارکت با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷,۳۳۹,۳۸۲,۱۸۴	حسابهای دریافتی
۲۷۰,۲۹۴,۵۸۸	سایر داراییها
۱۵۸,۸۷۲,۳۹۵,۳۹۸	سرمایه گذاری در سپرده بانکی
۲۵,۹۹۸,۷۹۲	موجودی نقد
۱,۰۲۸,۸۹۲,۰۶۸,۸۶۶	جمع داراییها
	بدهیها:
۵,۰۶۸,۹۸۶,۷۹۲	جاری کارگزاران
۳,۸۹۰,۳۷۲,۹۸۹	پرداختنی به ارکان صندوق
.	پرداختنی به سرمایه گذاران
۱,۱۵۶,۰۹۲,۲۷۷	سایر پرداختنی ها و ذخایر
۱۰,۱۱۵,۴۵۲,۰۵۸	جمع بدهیها
۱,۰۱۸,۷۷۶,۶۱۶,۸۰۸	خالص داراییها
۱,۱۰۸,۱۳۹	خالص داراییهای هر واحد سرمایه گذاری - ریال

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

صورت سود و زیان سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

درآمدها:	شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰	شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۶۸,۷۸۵,۷۹۱,۴۰۸	۳۵,۶۰۸,۶۵۳,۰۷۶	۵۶,۵۷۴,۴۶۷,۲۴۶
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۶,۲۸۵,۶۳۵,۴۷۸)	۱۲,۸۳۳,۱۲۱,۷۰۴	۲۲,۵۱۷,۳۸۹,۳۷۳
سود سهام	۱۳,۰۰۴,۹۶۰,۱۱۰	۱۳,۵۸۹,۳۹۶,۴۷۵	۱۶,۸۶۹,۷۴۶,۹۵۰
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۲۱,۸۳۴,۳۲۰,۲۰۷	۶,۸۶۹,۷۸۲,۲۴۴	۱۵,۲۸۷,۴۱۲,۱۹۷
جمع درآمدها	۹۷,۵۸۰,۱۶۸,۷۴۸	۶۸,۹۰۰,۹۵۳,۴۹۹	۱۱۱,۲۴۹,۱۳۱,۱۴۹
هزینه ها:			
هزینه کارمزد ارکان	(۳,۶۱۷,۳۵۶,۸۹۴)	(۱,۱۴۶,۶۰۲,۳۲۱)	(۲,۱۳۷,۰۰۴,۸۶۰)
سایر هزینه ها	(۹۵۴,۳۷۷,۴۹۵)	(۳۵۹,۴۶۳,۹۰۹)	(۱,۱۳۲,۰۶۳,۸۶۱)
جمع هزینه ها	(۴,۵۷۱,۷۳۴,۳۸۹)	(۱,۵۰۶,۰۶۶,۲۳۰)	(۳,۲۶۹,۰۶۸,۷۲۱)
سود خالص	۹۳,۰۰۸,۴۳۴,۳۵۹	۶۷,۳۹۴,۸۸۷,۲۶۹	۱۰۷,۹۸۰,۰۶۲,۴۲۸
بازده میانگین سرمایه گذاری ۱	۹,۹۰٪	۲۳/۳۰٪	٪۳۶,۵۴
بازده سرمایه گذاری در پایان سال	٪۹,۵۷	٪۲۲,۹۹	٪۳۰,۷۳

عملکرد عملیاتی صندوق

بازه زمانی	حجم معاملات	ملت	جم	گوهران	جم پیلن	وصندوق
سه ماهه اول	خرید	۵۶۱۸۴۲۹	۲۰۲۳۵۷	۴۸۰۶۱۴۶	۲۰۷۰۳۵۶۵	.
	فروش	۲۰۳۱۱۱۲۵	۳۷۷۶۷۸	۱۲۱۳۰۸۳۱	۴۴۰۰۰۰	.
	حجم کل معاملات	۲۵۹۲۹۵۵۴	۵۸۰۰۳۵	۱۶۹۳۶۹۷۷	۲۱۱۴۳۵۶۵	.
	حجم معاملات بازار	۴۸۱۲۹۷۶۵۸	۸۸۹۸۲۳۴۸۰	۴۸۹۰۹۰۵۵۹	۳۵۹۴۳۷۸۴۲	۶۰۳۲۰۱۴۶۶
	درصد از حجم معاملات	۵/۳۹٪	۰/۰۷٪	۳/۴۶٪	۵/۸۸٪	۰/۰۰٪
سه ماهه دوم	خرید	۷۳۶۹۶۸۵	۵۹۵۴۳۱	۵۲۳۳۹۳۱	۵۳۰۰۰۰	۱۱۰۰۰۰
	فروش	۱۳۹۰۸۷۰۳	۷۱۵۶۸۸	۵۶۳۳۷۳۳	۵۰۳۳۸۸	.
	حجم کل معاملات	۲۱۲۷۸۳۸۸	۱۳۱۱۱۱۹	۱۰۸۶۷۶۶۴	۱۰۳۳۳۸۸	۱۱۰۰۰۰
	حجم معاملات بازار	۶۴۶۷۰۴۵۰۲	۸۹۴۹۹۵۷۶۴	۲۹۳۱۰۰۴۳۶	۱۰۹۰۳۲۷۹۶	۵۵۹۴۵۱۶۵۴
	درصد از حجم معاملات	۳/۲۹٪	۰/۱۵٪	۳/۷۱٪	۰/۹۵٪	۰/۰۲٪