

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره
مالی یکساله منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

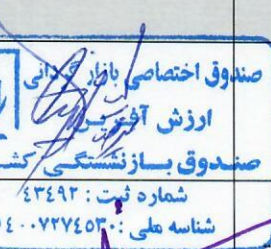
۱۳۹۹/۰۶/۳۱

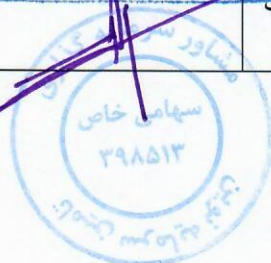
کارگزاری صبا جهاد

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 یکساله منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۹ 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 ۱۳۹۹/۰۶/۳۱ به تأیید ارکان صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
نماینده مدیر صندوق	شرکت کارگزاری صبا جهاد	آقای علیرضا مرادی	 صندوق اختصاصی بازارگردانی آفرین صندوق بازنشتگی کشوری شماره ثبت: ۴۳۴۹۲ شناسه ملی: ۱۴۰۰۷۲۷۴۵۳۰
متولی صندوق	شرکت تامین سرمایه نوین	آقای خوش طینت نیک نیت	



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 می باشد. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، ۳ سال است. مرکز اصلی صندوق در خیابان دانشگاه تهران، خیابان فریمان، خیابان بزرگمهر، 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 شرکتهای 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 شرکتهای 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 حسابرسان 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 بازنشستگی 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 ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

خالص ارزش روز داراییها	۲,۳۹۵,۵۴۰,۲۴۶,۰۲۹
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۳۵,۰۰۰
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری عادی	۹۴۳,۰۹۰
تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری	۸
اشخاص حقوقی	۸
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	۲,۴۶۴,۴۸۷
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۲,۴۴۹,۲۰۲

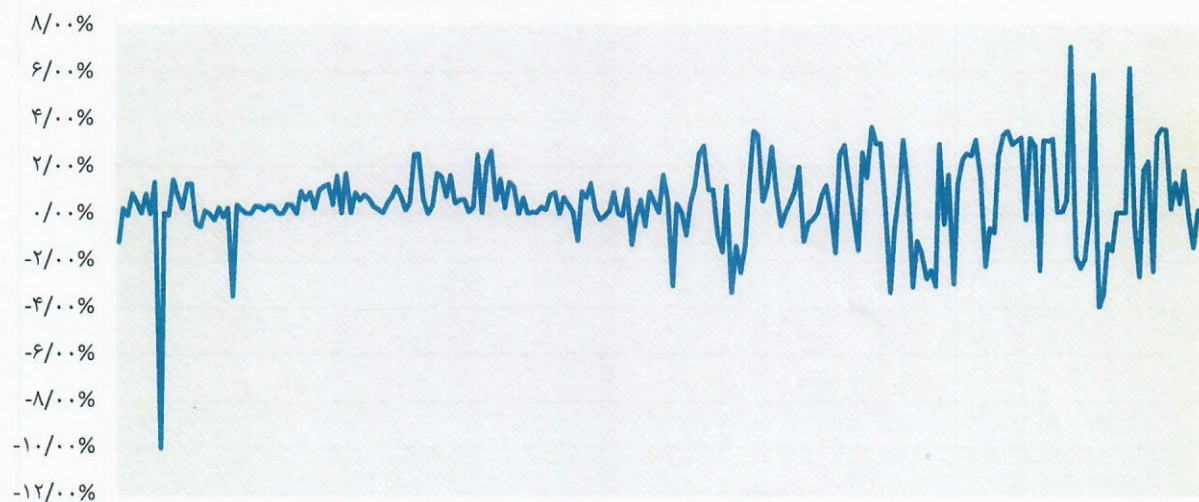
۶. مقایسه روند بازدهی شاخص بازار و صندوق

۶. مقایسه روند بازدهی شاخص بازار و صندوق

بازدهی روزانه شاخص



بازدهی روزانه صندوق



۷. بازده صندوق

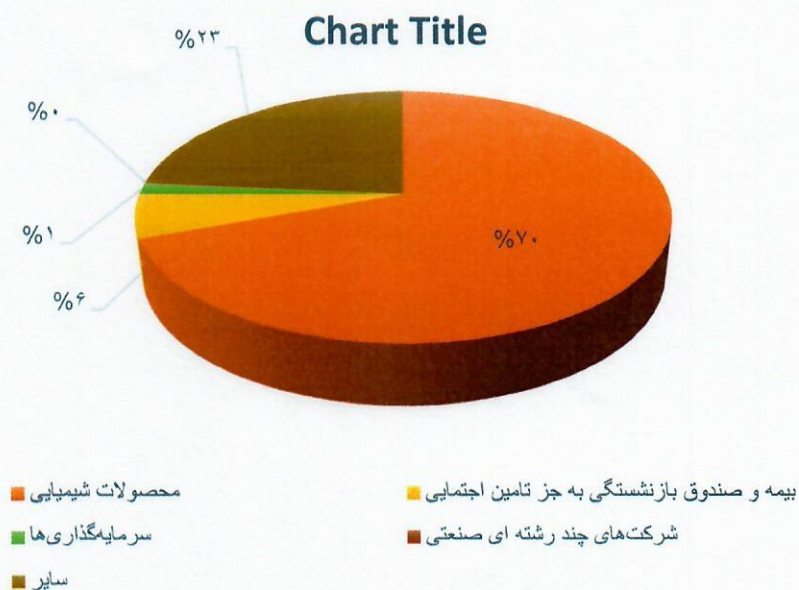
شرح	بازده صندوق
روز گذشته	۳.۰۲٪
یک هفته اخیر	۱.۷۰٪
یک ماه اخیر	۱۸.۲۹٪
سه ماه اخیر	۷۷.۹۳٪
شش ماه اخیر	۱۱۷.۳۸٪
یکسال اخیر	۶۱.۷۷٪
از زمان شروع فعالیت	۱۴۵.۳۶٪

۸. ترکیب دارایی های صندوق

وجه نقد و شبه نقد	۳۰۶,۹۶۸,۹۰۳,۴۱۱
پرتفوی سهام	۱,۸۴۵,۸۹۴,۸۰۵,۴۷۰
اوراق مشارکت	۱۳۹,۶۸۴,۷۳۹,۴۱۷
سایر	۱۱۲,۵۱۴,۹۱۶,۳۱۱
تعداد سهام موجود در صندوق	۳۲,۱۵۰,۶۵۹

۹. نمودار ترکیب داراییهای صندوق:

صنعت	ارزش روز کل	درصد از کل دارایی صندوق به ارزش روز
محصولات شیمیایی	۱,۶۶۹,۴۶۹,۴۰۶,۰۲۷	٪۶۹/۴۱
بیمه و صندوق بازنشستگی	۱۳۶,۰۶۱,۷۴۹,۷۱۴	٪۵/۶۶
سرمایه گذاری ها	۳۳,۹۹۰,۳۳۳,۴۱۲	٪۱/۴۱
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۶,۳۷۳,۳۱۶,۳۱۸	٪۰/۲۶
سایر	۵۵۹,۱۶۸,۵۵۹,۱۳۸	٪۲۳/۲۵
جمع	۲,۴۰۵,۰۶۳,۳۶۴,۶۰۹	٪۱۰۰



عملکرد عملیاتی صندوق

بازه زمانی	حجم معاملات	ملت	جم	گوهران	جم پیلن	وصندوق
سه ماهه اول	خرید	۵,۶۱۸,۴۲۹	۲۰۲,۳۵۷	۴,۸۰۶,۱۴۶	۲۰,۷۰۳,۵۶۵	.
	فروش	۲۰,۳۱۱,۱۲۵	۳۷۷,۶۷۸	۱۲,۱۳۰,۸۳۱	۴۴۰,۰۰۰	.
	حجم کل معاملات	۲۵,۹۲۹,۵۵۴	۵۸۰,۰۳۵	۱۶,۹۳۶,۹۷۷	۲۱,۱۴۳,۵۶۵	.
	حجم معاملات بازار	۴۸۱,۲۹۷,۶۵۸	۸۸۹,۸۲۳,۴۸۰	۴۸۹,۰۹۰,۵۵۹	۳۵۹,۴۳۷,۸۴۲	۶۰۳,۲۰۱,۴۶۶
	درصد از حجم معاملات	%۵/۳۹	%۰/۰۷	%۳/۴۶	%۵/۸۸	%۰/۰۰
سه ماهه دوم	خرید	۷,۳۶۹,۶۸۵	۵۹۵,۴۳۱	۵,۲۳۳,۹۳۱	۵۳۰,۰۰۰	۱۱۰,۰۰۰
	فروش	۱۳,۹۰۸,۷۰۳	۷۱۵,۶۸۸	۵,۶۳۳,۷۳۳	۵۰۳,۳۸۸	.
	حجم کل معاملات	۲۱,۲۷۸,۳۸۸	۱,۳۱۱,۱۱۹	۱,۰۸۶۷,۶۶۴	۱,۰۳۳,۳۸۸	۱۱۰,۰۰۰
	حجم معاملات بازار	۶۴۶,۷۰۴,۵۰۲	۸۹۴,۹۹۵,۷۶۴	۲۹۳,۱۰۰,۴۳۶	۱۰۹,۰۳۲,۷۹۶	۵۵۹,۴۵۱,۶۵۴
	درصد از حجم معاملات	%۳/۲۹	%۰/۱۵	%۳/۷۱	%۰/۹۵	%۰/۰۲

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری دوره مالی یکساله
منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

بازه زمانی	حجم معاملات	ملت	جم	گوهران	جم پیلن	وصندوق
سه ماهه سوم	خرید	۱۳,۶۱۶,۷۱۶	۹۶۰,۰۵۲	۵,۵۴۳,۸۵۱	۱,۸۶۲,۷۰۲	۱,۹۲۸,۴۳۷
	فروش	۱۴,۱۱۲,۷۳۳	۱,۳۵۶,۴۴۳	۶,۹۲۲,۳۱۲	۲,۰۹۲,۵۷۱	۱,۵۴۲,۲۰۰
	حجم کل معاملات	۲۷,۷۲۹,۴۴۹	۲,۳۱۶,۴۹۵	۱۲,۴۶۶,۱۶۳	۳,۹۵۵,۲۷۳	۳,۴۷۰,۶۳۷
	حجم معاملات بازار	۴۱۸,۷۶۱,۷۹۵	۲۹۹,۶۰۰,۷۵۳	۳۸۹,۶۶۲,۱۴۱	۱۴۸,۳۱۷,۴۲۷	۶۵۷,۴۵۷,۴۷۲
	درصد از حجم معاملات	% ۶.۶۲	% ۰.۷۷	% ۳.۱۹	% ۲.۶۶	% ۰.۵۲
سه ماهه چهارم	خرید	۱۶,۶۰۲,۱۲۹	۲,۲۲۹,۴۷۵	۵,۱۳۶,۱۵۷	۲,۴۲۰,۵۲۴	۴۵,۰۰۰
	فروش	۱۳,۶۴۱,۲۲۹	۲,۵۳۰,۹۷۹	۵,۱۶۰,۰۰۰	۲,۵۴۱,۱۵۱	۱۳۰,۰۰۰
	حجم کل معاملات	۳۰,۲۴۳,۳۵۸	۴,۷۶۰,۴۵۴	۱۰,۲۹۶,۱۵۷	۴,۹۶۱,۶۷۵	۱۷۵,۰۰۰
	حجم معاملات بازار	۸۲۳,۵۲۳,۲۰۰	۴۵۴,۶۵۰,۰۱۱	۴۱۹,۹۷۵,۱۶۴	۱۲۸,۸۶۲,۱۱۹	۱,۳۶۱,۴۷۹,۲۵۳
	درصد از حجم معاملات	% ۴	% ۱.۰۴	% ۲.۴۵	% ۳.۸۵	% ۰.۰۱