

اهداف و استراتژی های صندوق:

هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق این امیدنامه و کسب منافع از این محل است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود 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 به کارگیری 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 سرمایه گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش می یابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر دارایی ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش می یابد.

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در این امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در این امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است. صندوق در اجرای موضوعات فعالیت یادشده، موارد زیر را رعایت می کند:

سهام به شرح این موارد :

شرکت پتروشیمی جم
شرکت بیمه ملت
صندوق مدیریت ثروت
شرکت شیر پاستوریزه پگاه آذربایجان شرقی
شرکت شیر پاستوریزه پگاه فارس
شرکت شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان
شرکت شیر پاستوریزه پگاه گلستان
شرکت شیر پاستوریزه پگاه اصفهان
شرکت شیر پاستوریزه پگاه خراسان
شرکت شیر پاستوریزه پگاه آذربایجان غربی
شرکت شیر پاستوریزه پگاه گیلان
شرکت پلی پرو پیلن جم
گروه صنعتی ملی
ایران یاسا تایر و رابر
مجتمع معادن مس تکنار
شرکت سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی کشوری
ذغال سنگ نگین طبس
فرآوری ذغال سنگ پرورده طبس
شرکت معادن منگنز ایران
شرکت تکادو
شرکت مجتمع صنایع و معادن احیاء سپاهان
گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشستگی کشوری

بیانیه سیاست های صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

حق تقدم خرید سهام

اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت. این اوراق بهادار باید تمامی شرایط زیر را داشته باشند:

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 مشخص شده و پرداخت اصل سرمایه گذاری و سود آنها تضمین شده یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه گذاری وثایق کافی وجود داشته باشد؛

ج- به تشخیص مدیر، یکی از مؤسسات معتبر باز خرید آنها را قبل از سر رسید تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

گواهی های سپرده منتشره توسط بانکها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

هر نوع سپرده گذاری نزد بانکها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

اوراق بهاداری که صندوق در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید آنها مشارکت می کند، باید علاوه بر خصوصیات مذکور، دارای خصوصیات زیر باشند:

اتخاذ موقعیت فروش قراردادهای آتی سهام در بازار معاملات آتی بورس اوراق بهادار تهران، صرفاً به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت سهام موجود در صندوق سرمایه گذاری و اتخاذ موقعیت خرید در قراردادهای آتی سهام صرفاً به منظور بستن موقعیت های فروش که قبلاً در قراردادهای آتی سهام اتخاذ نموده اند.

این صندوق از نوع صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی است و با استفاده از وجوه در اختیار خود اقدام به خرید و فروش اوراق بهادار می کند. هدف صندوق افزایش نقدشوندگی، تنظیم عرضه و تقاضا و تحدید دامنه نوسان قیمت سهام و حق تقدم سهام موضوع امیدنامه و کسب منفعت از این محل است.

مدیر می تواند به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت سهام موجود در سبد دارایی صندوق، در بازار معاملات آتی بورس اوراق بهادار تهران شرکت نموده و تا سقف دارایی هر سهم در صندوق اقدام به اتخاذ موقعیت فروش در قرارداد آتی آن سهم نماید. در هر زمان باید تعداد سهام در موقعیت های فروش باز صندوق در قراردادهای آتی، از تعداد همان نوع سهم که در سبد دارایی صندوق قرار دارد کمتر باشد. در صورتی که در اثر فروش سهام، تعداد سهام موجود در سبد دارایی از تعداد سهامی که صندوق در قراردادهای آتی متعهد به فروش آنها شده است، کمتر گردد؛ مدیر موظف است قبل از فروش سهام، با اتخاذ موقعیت تعهد خرید در قراردادهای آتی سهام، تعداد سهامی که صندوق در قرارداد آتی متعهد به فروش آن شده است را به میزان کافی کاهش دهد.

بیانیه سیاست های صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

تعهدات و شرایط بازارگردانی:

صندوق متعهد است که خرید و فروش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی را با لحاظ شرایط مندرج در این بند انجام دهد؛ و یا در شرایط مشخص شده، معاف از ایفای تعهدات است.

باید همواره سفارش های خرید و فروش اوراق با رعایت شرایط زیر وارد سامانه ی معاملات مربوطه گردد:

ردیف	نام شرکت	عنوان نماد	حداقل معاملات روزانه	حداقل سفارش انباشته	دامنه مظنه
۱	شرکت پتروشیمی جم	جم	۴۷۰,۰۰۰	۲۳,۵۰۰	۳٪
۲	شرکت بیمه ملت	ملت	۱,۳۰۰,۰۰۰	۶۵,۰۰۰	۳٪
۳	صندوق مدیریت ثروت	مدیر	۵,۰۰۰,۰۰۰	۲۵۰,۰۰۰	۲٪
۴	شرکت شیر پاستوریزه پگاه آذربایجان شرقی	غیاذر	۱۵۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۳٪
۵	شرکت شیر پاستوریزه پگاه فارس	غفارس	۶۱۷,۰۰۰	۳۱,۰۰۰	۳٪
۶	شرکت شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان	گلپا	۱۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰	۳٪
۷	شرکت شیر پاستوریزه پگاه گلستان	گلستا	۱۰۳,۰۰۰	۵,۲۰۰	۳٪
۸	شرکت شیر پاستوریزه پگاه اصفهان	غشصفا	۵۴۰,۰۰۰	۲۷,۰۰۰	۳٪
۹	شرکت شیر پاستوریزه پگاه خراسان	غشان	۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰	۳٪
۱۰	شرکت شیر پاستوریزه پگاه آذربایجان غربی	غشاذر	۶۵۰,۰۰۰	۳۲,۵۰۰	۳٪
۱۱	شرکت شیر پاستوریزه پگاه گیلان	غگیلا	۴۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰	۲٪
۱۲	شرکت پلی پرو پیلن جم	جم پیلن	۲۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۳٪
۱۳	گروه صنعتی ملی	وملی	۳۰,۰۰۰	۱,۵۰۰	۳٪
۱۴	ایران یاسا تایر و رابر	پاسا	۶۱۰,۰۰۰	۳۰,۵۰۰	۳٪
۱۵	مجتمع معادن مس تکنار	تکنار	۱۶۰,۰۰۰	۸,۰۰۰	۲٪
۱۶	شرکت سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی کشوری	وصندوق	۱,۸۰۰,۰۰۰	۹۰,۰۰۰	۳٪
۱۷	ذغال سنگ نگین طبس	کطبس	۲۹۰,۰۰۰	۱۴,۵۰۰	۳٪
۱۸	فرآوری ذغال سنگ پرورده طبس	کپرور	۱۵۰,۰۰۰	۷,۵۰۰	۳٪
۱۹	شرکت معادن منگنز ایران	کمنگنز	۱۷۰,۰۰۰	۸,۵۰۰	۳٪
۲۰	شرکت تکادو	وکادو	۵۰۰,۰۰۰	۲۵,۰۰۰	۲٪
۲۱	شرکت مجتمع صنایع و معادن احیاء سپاهان	واحیا	۱۵۰,۰۰۰	۷,۵۰۰	۲٪
۲۲	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشستگی کشوری	ومدیر	۷۰۰,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۳٪