

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری دوره
نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

۱. کلیات

تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی 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 بازنشتگی 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 شرکت های 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 موسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ با شماره ثبت ۳۴۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان نلسون ماندلا، مجتمع اداری الهیه، طبقه ششم واحد ۶۰۷.

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:

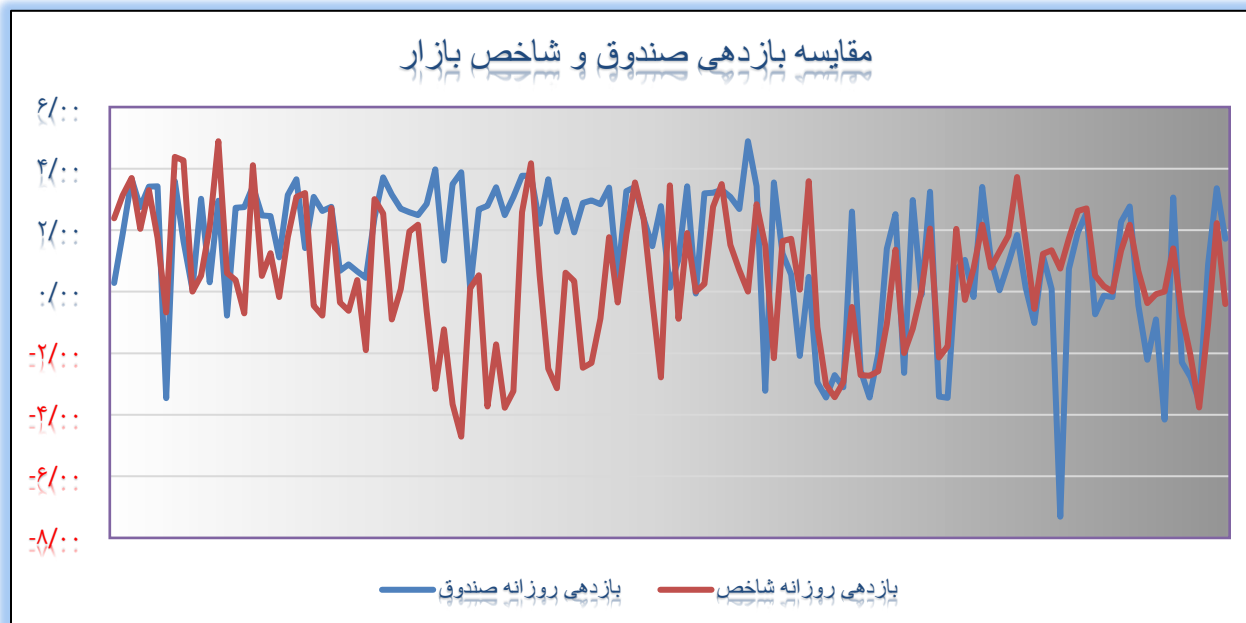
از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. طبق ماده ۲۳ اساسنامه مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رأی صندوق تشکیل شده و رسمیت می یابد. در تاریخ صورت خالص دارایی دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص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

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشتگی 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 ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

خالص ارزش روز داراییها	۴,۸۳۶,۲۷۹,۸۳۱,۴۴۴
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۳۵,۰۰۰
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۳,۱۴۱,۳۵۳
تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری	۱۵
اشخاص حقوقی	۱۵
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	۱,۴۳۱,۵۰۲
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۴۲۹,۵۹۸

۶. مقایسه روند بازدهی صندوق و شاخص بورس در ۶ ماهه اخیر



۷. بازده صندوق

شرح	بازده صندوق
یک هفته اخیر	٪ ۲/۲۶۵
یک ماه اخیر	٪ ۵/۲۳۹
سه ماه اخیر	-٪ ۳۲/۵۸۴
شش ماه اخیر	-٪ ۴۳/۵۰۷
یکسال اخیر	٪ ۳/۸۶۷

۸. ترکیب دارایی های صندوق

وجه نقد و شبه نقد	۳۳۱,۲۶۰,۶۸۰,۳۲۰
پرتفوی سهام	۴,۱۵۳,۲۴۳,۵۱۱,۳۳۶
ارزش اوراق مشارکت	۱۵۳,۵۸۷,۴۸۲,۵۸۷
سرمایه گذاری در صندوق های دیگر (مدیر)	۸۵,۳۳۲,۳۵۲,۶۲۹
سایر	۱۱۲,۸۵۵,۸۰۴,۵۷۲
تعداد سهام موجود در صندوق	۹۵,۵۶۷,۱۱۰

۹) ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت

۹.۱) جدول ترکیب دارایی های صندوق مورخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

ردیف	نام صنعت	خالص ارزش دارایی	درصد از پرتفوی سهام
۱	محصولات شیمیایی	۱,۸۶۵,۲۵۵,۱۹۶,۷۸۰	٪۳۸/۵۷
۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۸۱۳,۰۳۱,۳۸۸,۴۸۴	٪ ۱۶/۸۱
۳	استخراج ذغال سنگ	۳۹۷,۷۹۹,۰۲۱,۸۳۰	٪۸/۲۳
۴	استخراج کانه های فلزی	۳۷۹,۵۴۱,۴۰۰,۹۱۳	٪۷/۸۵
۵	لاستیک و پلاستیک	۲۱۹,۹۱۰,۰۵۸,۲۳۹	٪۴/۵۵
۶	بیمه و صندوق بازنشتگی به جز تامین اجتماعی	۲۰۰,۱۰۱,۸۱۵,۸۷۳	٪۴/۱۴
۷	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۱۵۷,۶۷۶,۰۳۴,۷۹۱	٪ ۳/۲۶
۸	سرمایه گذاری ها	۶۲,۶۷۸,۱۲۷,۸۸۲	٪ ۱/۳
۹	واسطه گری های مالی و پولی	۴۹,۸۰۷,۳۶۷,۶۱۰	٪ ۱/۰۳
۱۰	شرکت های چند رشته ای صنعتی	۷,۴۴۳,۰۹۸,۹۴۲	٪ ۰/۱۵
***	جمع کل	۴,۱۵۳,۲۴۳,۵۱۱,۳۳۶	٪ ۱۰۰

۹.۲) نمودار ترکیب دارایی‌های صندوق ارزش آفرین

