

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره سه  
ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

## ۱. کلیات

### تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی 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 که طبق صورتجلسه مجمع به تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۱۹ و تاییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۳۰ مدت فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۲/۰۹/۲۱ تمدید گردیده 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](http://arzeshafarinfund.com) درج گردیده است.

## ۳. ارکان صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی 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

مؤسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ با شماره ثبت ۳۴۹۱ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان نلسون ماندلا، مجتمع اداری الهیه، شماره ۲۲۴، طبقه ششم واحد ۶۰۷.

### ۳.۳) حسابرس صندوق

شرکت مؤسسه حسابرسی هوشیار ممیز است که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۲/۰۸ با شماره ثبت ۱۱۰۲۱ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، انتهای گاندی شمالی، پلاک ۸، طبقه ۵، واحد ۱۹.

## ۴. مجمع صندوق سرمایه گذاری:

از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ 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 ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

|                                               |                   |
|-----------------------------------------------|-------------------|
| خالص ارزش روز داراییها                        | ۸,۱۳۵,۶۹۵,۶۵۲,۹۳۷ |
| تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز              | ۳۵,۰۰۰            |
| تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری عادی            | ۵,۳۰۴,۶۶۰         |
| جمع کل واحدهای سرمایه گذاری                   | ۵,۳۳۹,۶۶۰         |
| تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری           | ۲۰                |
| اشخاص حقوقی                                   | ۲۰                |
| 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  | ۱,۵۳۵,۳۲۹         |
| نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش | ۱,۵۳۳,۶۸۸         |

## ۶. بازده صندوق

| شرح          | بازده صندوق |
|--------------|-------------|
| یک هفته اخیر | -۴.۵۸٪      |
| یک ماه اخیر  | ۲.۷۶٪       |
| سه ماه اخیر  | ۲۵.۵۰٪      |
| شش ماه اخیر  | ۷.۲۸٪       |
| یکسال اخیر   | -۴۰.۰۲٪     |

## ۸. ترکیب دارایی های صندوق

|                                               |                   |
|-----------------------------------------------|-------------------|
| وجه نقد و شبه نقد                             | ۲,۱۹۵,۲۲۷,۶۹۱,۷۴۲ |
| پرتفوی سهام                                   | ۵,۲۰۱,۹۱۶,۵۲۸,۸۰۳ |
| ارزش اوراق مشارکت                             | ۶۰۷,۴۶۲,۵۴۰,۸۲۰   |
| سرمایه گذاری در صندوق های دیگر (مدیر)         | ۱۳۴,۶۷۹,۲۳۷,۵۸۳   |
| سایر                                          | ۲۸۹,۷۲۰,۳۷۲,۱۱۳   |
| جمع داراییها                                  | ۸,۴۲۹,۰۰۶,۳۷۱,۰۶۱ |
| تعداد سهام و واحد سرمایه گذاری موجود در صندوق | ۳۵۳,۲۹۶,۱۳۵       |

## ۹) ترکیب داراییهای صندوق به تفکیک صنعت

### ۹.۱) جدول ترکیب داراییهای صندوق مورخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

| ردیف | نام صنعت                                       | خالص ارزش دارایی         | درصد از پرتفوی سهام |
|------|------------------------------------------------|--------------------------|---------------------|
| ۱    | محصولات شیمیایی                                | ۲,۵۸۱,۸۱۰,۰۹۰,۴۷۳        | ۳۰/۶۳٪              |
| ۲    | سرمایه گذاریها                                 | ۱,۰۲۷,۹۸۸,۷۵۵,۹۶۲        | ۱۲/۲۰٪              |
| ۳    | محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر       | ۴۰۶,۰۵۹,۹۴۷,۳۶۹          | ۴/۸۲٪               |
| ۴    | استخراج کانه های فلزی                          | ۲۹۱,۱۸۶,۸۴۲,۰۴۳          | ۳/۴۶٪               |
| ۵    | استخراج ذغال سنگ                               | ۳۴۴,۷۸۱,۳۹۲,۱۶۹          | ۴/۰۹٪               |
| ۶    | صنعت بیمه و صندوق بازنشتگی به جز تامین اجتماعی | ۱۱۲,۳۴۸,۸۲۰,۵۳۰          | ۱/۳۳٪               |
| ۷    | لاستیک و پلاستیک                               | ۱۵۱,۶۵۵,۵۵۵,۸۳۵          | ۱/۸۰٪               |
| ۸    | واسطه‌گری‌های مالی و پولی                      | ۲۱۹,۸۴۶,۲۰۲,۴۱۴          | ۲/۶۱٪               |
| ۹    | دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش           | ۲۳,۳۹۴,۲۶۲,۸۵۷           | ۰/۲۸٪               |
| ۱۰   | شرکت های چند رشته ای صنعتی                     | ۴۲,۸۴۴,۶۵۹,۱۴۳           | ۰/۵۱٪               |
| ۱۱   | صندوق سرمایه گذاری قابل معامله                 | ۱۳۴,۶۷۹,۲۳۷,۵۸۲          | ۱/۶۰٪               |
|      | <b>جمع کل</b>                                  | <b>۵,۳۳۶,۵۹۵,۷۶۶,۳۷۷</b> | <b>٪۶۳/۳۱</b>       |

## ۹.۲) نمودار ترکیب دارایی های صندوق ارزش آفرین

