

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنیشتگی کشوری دوره
یکساله منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۱۴۰۱/۰۳/۳۱
کارگزاری صبا جهاد



(شماره ثبت: ۴۳۴۹۲)

صندوق اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین
صندوق بازنشتگی کشوری

شماره ثبت: ۳۰۰/۱۸۳۸۹
تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۲۲

پیوست:

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 سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱ بر پایه
سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح ذیل تقدیم می‌گردد.
به نظر اینجانب اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می‌باشد، با تاکید 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 واقعیت‌های موجود بوده و اثرات آنها در آینده تا
حدی که در موقعیت فعلی می‌توان پیش‌بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ
موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ
۱۴۰۱/۰۵/۲۹ به تایید ارکان صندوق رسیده است.

امضا	نمائنده	شخص حقوقی	ارکان صندوق
	آقای حاجعلی صلاحی‌نژاد	شرکت کارگزاری صباجهاد	مدیر صندوق



گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنیستگی کشوری دوره یکساله منتهی
۱۴۰۱/۰۳/۳۱ به

۱. کلیات

تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنیستگی 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، می‌باشد. 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 نمی‌باشد.

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 بازنیستگی 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.

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنیستگی کشوری دوره یکساله منتهی
۱۴۰۱/۰۳/۳۱ به

۳.۲) متولی صندوق

موسسه 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: خیابان نلسون ماندلا، خیابان پدیدار، ساختمان شهروز، پلاک ۶۲، طبقات ۷ و ۸، واحدهای ۷۲ و ۷۴ و ۸۱ و ۸۳ و ۸۶.

۴. مجمع صندوق سرمایه گذاری:

از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ 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 بازنیستگی کشوری	۳۴,۶۵۰	%۹۹
۲	شرکت کارگزاری صبا جهاد	۳۵۰	%۱
	جمع	۳۵,۰۰۰	%۱۰۰

۵. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری عادی صندوق به شرح جدول زیر می‌باشد:

ردیف	نام دارندگان واحدهای سرمایه گذاری عادی	تعداد واحدهای عادی تحت تملک
۱	کارگزاری صبا جهاد	۱۵۰
۲	شرکت نوآوران مدیریت سبا	۲۴,۹۹۹
۳	پتروشیمی جم	۳۸۵,۸۲۸
۴	پتروشمیران	۳۶۵,۸۰۲
۵	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنیستگی کشوری	۷۸۱,۸۲۱
۶	گروه انرژی مهستان	۸,۲۷۸
۷	سرمایه گذاری صندوق بازنیستگی کشوری	۳۹۴,۹۴۴
۸	شرکت سرمایه گذاری و خدمات مدیریت صندوق بازنیستگی کشوری	۲۵۲,۱۷۱
۹	صنایع شیر ایران	۹۰۳,۶۳۴
۱۰	شرکت سرمایه گذاری آتبیه صبا	۶۱۹,۹۷۱
۱۱	صندوق بازنیستگی کشوری	۵۳۷,۵۵۳
۱۲	بیمه ملت	۱۳۵,۲۱۶
۱۳	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک	۹,۶۲۳
۱۴	شرکت تکادو	۹۷,۴۵۶
۱۵	شرکت ذغال سنگ نگین طبس	۲۴۷,۹۵۱
جمع		۴,۷۶۵,۳۹۷

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره یکساله منتهی
به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۶. اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

خالص ارزش روز داراییها	
۹,۲۷۶,۴۹۱,۲۲۶,۹۸۱	
۳۵,۰۰۰	تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۴,۷۶۵,۳۹۷	تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری عادی
۴,۸۰۰,۳۹۷	جمع کل واحدهای سرمایه گذاری
۱۵	تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری
۱۵	اشخاص حقوقی
۰	اشخاص حقیقی
۰	نسبت سرمایه تامین شده توسط اشخاص حقیقی
۱,۰۰۰,۰۰۰	ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری
۱.۹۳۵,۰۰۰	نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش
۱.۹۳۲,۴۴۳	نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش

۷. بازده صندوق

بازده صندوق	شرح
% ۱.۶۷۷	یک هفته اخیر
% ۲۰.۵۵	یک ماه اخیر
% ۲۶.۲۵۸	سه ماه اخیر
% ۲۶.۳۰۶	شش ماه اخیر
% ۶۱.۴۴۳	یکسال اخیر

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره یکساله منتهی
به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۸. ترکیب دارایی‌های صندوق

وجه نقد و شبه نقد	۹۰۲,۵۳۵,۲۹۰,۲۰۴
پرتفوی سهام	۶,۸۶۸,۲۷۱,۷۸۶,۴۰۳
ارزش اوراق مشارکت	۱,۳۱۵,۴۵۸,۲۷۲,۲۱۶
سرمایه گذاری در صندوق های دیگر (مدیر)	۲۵۴,۶۴۷,۹۸۰,۷۷۱
سایر	۴۰۰,۰۵۰,۶۱۲,۰۶۵
جمع داراییها	۹,۷۴۰,۹۶۳,۹۴۱,۶۵۹
تعداد سهام موجود در صندوق	۶۲۱,۱۷۶,۵۸۸
تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق مدیر	۲۴,۶۱۹,۰۲۹
تعداد اوراق	۲۰۲۴,۲۳۱

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره یکساله منتهی
به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۹) ترکیب داراییهای صندوق به تفکیک صنعت

۹.۱) جدول ترکیب داراییهای صندوق مورخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

ردیف	نام صنعت	حالص ارزش دارایی	درصد از پرتفوی سهام
۱	محصولات شیمیایی	۳,۹۲۲,۰۷۳,۱۲۲,۳۰۳	۴۰.۲۶%
۲	سرمایه گذاریها	۱,۶۵۱,۶۹۵,۰۹۶,۳۲۳	۱۶.۹۶%
۳	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۳۷۶,۲۰۸,۹۲۸,۳۱۹	۳.۸۶%
۴	استخراج کانه های فلزی	۱۰۹,۳۱۹,۲۹۶,۹۹۳	۱.۱۲%
۵	استخراج ذغال سنگ	۲۳۲,۰۱۷,۶۲۳,۸۱۰	۲.۳۸%
۶	صنعت بیمه و صندوق بازنشتگی به جز تامین اجتماعی	۲۳۰,۵۰۰,۶۱۶,۵۴۹	۲.۳۷%
۷	لاستیک و پلاستیک	۹۶,۴۶۲,۲۳۹,۴۶۹	۰.۹۹%
۸	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۱۶۶,۰۹۶,۶۳۳,۱۴۸	۱.۷۱%
۹	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۸۳,۸۹۸,۲۲۹,۴۸۹	۰.۸۶%
۱۰	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله	۲۵۴,۶۴۷,۹۸۰,۷۷۱	۲.۶۱%
	<u>جمع کل</u>	<u>۷,۱۲۲,۹۱۹,۷۶۷,۱۷۴</u>	<u>۷۳.۱۲%</u>

۹.۲) نمودار ترکیب دارایی‌های صندوق ارزش آفرین



