

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره  
مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

۱۴۰۲/۰۹/۳۰

کارگزاری صبا جهاد

## ۱. کلیات

### 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 که طبق صورتجلسه مجمع به تاریخ ۱۴۰۲/۱۰/۰۹ و تاییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۴۰۲/۱۰/۲۰ مدت فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۲۱ 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 [arzeshaforinfund.ir](http://arzeshaforinfund.ir) 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 استان 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

موسسه حسابرسی هوشیار ممیز که در تاریخ ۰۸/۰۲/۱۳۷۸ به شماره ثبت ۱۱۰۲۱ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران--ونک-خیابان شهید برادران شریفی-خیابان گاندی شمالی-پلاک ۸- طبقه پنجم-واحد ۱۹

### ۳.۳) حسابرس صندوق

موسسه حسابرسی کابرد تحقیق که در تاریخ ۲۰/۱۲/۱۳۷۲ به شماره ثبت ۵۰۸ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران- میدان آرژانتین-ابتدای خیابان احمد قصیر(بخارست)شماره ۴۹- ساختمان طلا- طبقه دوم واحد ۳

### ۴. مجمع صندوق سرمایه گذاری:

از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. در تاریخ ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ 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 | 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 می باشد:

| ردیف | نام دارندگان واحدهای سرمایه گذاری عادی                | تعداد واحدهای عادی تحت تملک |
|------|-------------------------------------------------------|-----------------------------|
| ۱    | کارگزاری صبا جهاد                                     | ۱۵۰                         |
| ۲    | پتروشیمی جم                                           | ۳۸۵,۸۲۸                     |
| ۳    | پتروشمیران                                            | ۳۶۵,۸۰۲                     |
| ۴    | گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشتگی کشوری          | ۷۸۱,۸۲۱                     |
| ۵    | گروه انرژی مهستان                                     | ۸,۲۷۸                       |
| ۶    | سرمایه گذاری صندوق بازنشتگی کشوری                     | ۷,۸۱۱,۲۰۶                   |
| ۷    | شرکت سرمایه گذاری و خدمات مدیریت صندوق بازنشتگی کشوری | ۵۱,۸۱۷                      |
| ۸    | صنایع شیر ایران                                       | ۸۵۷,۹۶۵                     |
| ۹    | شرکت سرمایه گذاری آتیه صبا                            | ۳,۰۸۸,۰۹۶                   |
| ۱۰   | صندوق بازنشتگی کشوری                                  | ۹۴۴,۹۵۳                     |
| ۱۱   | بیمه ملت                                              | ۱۳۵,۲۱۶                     |
| ۱۲   | مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک               | ۹,۶۲۳                       |
| ۱۳   | شیر پاستوریزه پگاه اصفهان                             | ۶۷,۱۲۸                      |
| ۱۴   | شیر پاستوریزه پگاه آذربایجان                          | ۴۱,۳۱۱                      |
| ۱۵   | شیر پاستوریزه پگاه گیلان                              | ۷۴۰,۲۱۳                     |
|      | جمع                                                   | ۱۵,۲۸۹,۴۰۷                  |



## ۶. اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

|                                               |                    |
|-----------------------------------------------|--------------------|
| خالص ارزش روز داراییها                        | ۲۱,۹۹۸,۲۲۸,۷۶۸,۳۲۹ |
| تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز              | ۳۵,۰۰۰             |
| تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی               | ۱۵,۲۸۹,۴۰۷         |
| جمع کل واحدهای سرمایه گذاری                   | ۱۵,۳۲۴,۴۰۷         |
| 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  | ۱,۶۷۵,۹۰۹          |
| نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش | ۱,۶۷۳,۵۵۰          |

## ۷. بازده صندوق

| شرح          | بازده صندوق |
|--------------|-------------|
| یک هفته اخیر | ٪۰.۰۹       |
| یک ماه اخیر  | ٪(۱.۲۶)     |
| سه ماه اخیر  | ٪۱۴.۵۰      |
| شش ماه اخیر  | ٪(۳۴.۶۲)    |
| یکسال اخیر   | ٪(۱۱.۷۴)    |

## ۸. ترکیب دارایی های صندوق

|                    |                                        |
|--------------------|----------------------------------------|
| ۷۹۳,۳۳۹,۲۳۳,۷۳۸    | سرمایه گذاری در سپرده بانکی و وجه نقد  |
| ۲۳,۴۷۵,۰۷۰,۹۰۵,۴۸۱ | پرتفوی سهام                            |
| ۵۰۱,۸۷۹,۲۲۳,۵۷۰    | ارزش اوراق مشارکت                      |
| ۱,۱۳۱,۷۵۳,۹۹۳,۹۳۶  | سرمایه گذاری در صندوق های دیگر         |
| ۸۰,۰۸۱,۸۲۶,۲۹۷     | سایر                                   |
| ۲۵,۹۸۲,۱۲۵,۱۸۳,۰۲۲ | جمع داراییها                           |
| ۲,۹۷۹,۱۵۰,۰۵۶      | تعداد سهام موجود در صندوق              |
| ۵۹,۰۱۲,۱۴۹         | تعداد واحدهای سرمایه گذاری در صندوق ها |
| ۶۲۲,۳۰۰            | تعداد اوراق                            |

## ۹) ترکیب داراییهای صندوق به تفکیک صنعت

### ۹.۱) جدول ترکیب داراییهای صندوق مورخ ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

| ردیف | نام صنعت                                      | خالص ارزش دارایی          | درصد از پرتفوی سهام |
|------|-----------------------------------------------|---------------------------|---------------------|
| ۱    | فلزات اساسی                                   | ۱۳,۲۳۶,۲۷۷,۷۴۸,۷۰۲        | %۵۰.۹۴              |
| ۲    | محصولات شیمیایی                               | ۵,۶۶۶,۳۷۲,۴۰۵,۲۹۱         | %۲۱.۸۱              |
| ۳    | سرمایه گذاریها                                | ۲,۲۶۶,۴۱۱,۴۲۹,۹۴۲         | %۸.۷۲               |
| ۴    | محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر      | ۸۰۳,۸۹۳,۲۲۹,۸۰۲           | %۳.۰۹               |
| ۵    | استخراج کانه های فلزی                         | ۱۸۴,۶۴۵,۱۰۹,۳۸۵           | %۰.۷۱               |
| ۶    | صنعت بیمه و صندوق بازنشتی به جز تامین اجتماعی | ۵۵۰,۶۲۷,۵۴۰,۰۴۱           | %۲.۱۲               |
| ۷    | لاستیک و پلاستیک                              | ۲۶۵,۵۱۶,۳۵۳,۹۷۲           | %۱.۰۲               |
| ۸    | دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش          | ۲۶۳,۳۴۹,۴۲۰,۹۳۴           | %۱.۰۱               |
| ۹    | شرکتهای چند رشته ای صنعتی                     | ۲۳۷,۹۷۷,۶۶۷,۴۱۲           | %۰.۹۲               |
| ۱۰   | صندوق سرمایه گذاری قابل معامله                | ۱,۱۳۱,۷۵۳,۹۹۳,۹۳۶         | %۴.۳۶               |
|      | <b>جمع کل</b>                                 | <b>۲۴,۶۰۶,۸۲۴,۸۹۹,۴۱۷</b> | <b>%۹۴.۷۰</b>       |

## ۹.۲) نمودار ترکیب دارایی‌های صندوق ارزش آفرین

