

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری دوره
مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

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 سرمایه‌گذاران 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، نامحدود است.

است که طبق تاییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۴۰۴/۱۰/۱۶ مدت فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۵/۰۹/۲۱ 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.ir 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 شرکت‌های استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، بعد از تقاطع فلسطین، پلاک ۳۸.

۳.۲ متولی صندوق

موسسه حسابرسی هوشیار ممیز که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۲/۰۸ به شماره ثبت ۱۱۰۲۱ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران-خیابان نلسون ماندلا(آفریقا)-بالا تر از چهارراه جهان کودک-خیابان پدیدار-پلاک ۶۲-ساختمان شهروز - طبقه ۷-واحد ۷۴

۳.۳ حسابرس صندوق

موسسه حسابرسی فاطر که در تاریخ ۱۳۶۱/۰۷/۰۴ به شماره ثبت ۲۳۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، خیابان وصال شیرازی، بزرگمهر غربی، کوی اسکو، پلاک ۱۴، طبقه چهارم

۴. مجمع صندوق سرمایه گذاری:

از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. در تاریخ ۱۴۰۵/۰۳/۳۱ 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 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	سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی کشوری	۷,۹۹۳,۴۸۰
۲	صبا فولاد خلیج فارس	۱,۱۴۳,۲۲۱
۳	شرکت سرمایه گذاری آتیه صبا	۱,۴۵۳,۵۶۸
۴	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشستگی کشوری	۱,۴۶۶,۱۳۱
۵	صندوق بازنشستگی کشوری	۹۴۴,۹۵۳
۶	صنایع شیر ایران	۲,۷۳۶,۳۳۰
۷	شیر پاستوریزه پگاه گیلان	۷۴۰,۲۱۳
۸	پتروشیمی جم	۳۸۵,۸۲۸
۹	بیمه ملت	۱۳۵,۲۱۶
۱۰	شیر پاستوریزه پگاه اصفهان	۱۳۳,۶۱۸
۱۱	شیر پاستوریزه پگاه آذربایجان غربی	۴۱,۳۱۱
۱۲	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک	۹,۶۲۳
۱۳	نوآوران مدیریت سبا	۷,۳۰۰
۱۴	کارگزاری صبا جهاد	۴۸۱,۰۰۳
۱۵	تک زر اندیشان نوآور	۴۷,۰۰۰
۱۶	ریل سیر کوثر	۵,۰۰۰
۱۷	آرا فولاد خلیج فارس	۲,۸۵۹,۹۹۹
۱۸	طلوع فولاد پارس	۷۱,۰۰۰
۱۹	پتروشیمی جم پیلن	۳۶,۳۲۱
۲۰	شیر پاستوریزه پگاه خراسان	۳۵,۳۱۴
	جمع	۲۰,۷۲۶,۴۲۹

۶. اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

خالص ارزش روز داراییها	۳۲,۱۵۷,۰۱۹,۳۳۹,۰۳۹
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۳۵,۰۰۰
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۰,۷۲۶,۴۲۹
جمع کل واحدهای سرمایه گذاری	۲۰,۷۶۱,۴۲۹
تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری (فقط حقوقی)	۲۰
سقف واحدهای سرمایه گذاری	۳۰,۰۰۰,۰۰۰
ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری	۱,۰۰۰,۰۰۰
نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۵۵۰,۹۹۱
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۵۴۸,۸۸۳

۷. بازده صندوق

شرح	بازده صندوق
یک ماه اخیر	٪۱۶.۳۶
سه ماه اخیر	٪۱۷.۰۸
شش ماه اخیر	٪۱۰.۸۱
یک سال اخیر	٪۴.۵۰

۸. ترکیب دارایی‌های صندوق

۷۶۶,۹۳۷,۹۷۲,۳۸۵	سرمایه گذاری در سپرده بانکی و وجه نقد
۲۵,۶۸۶,۴۲۶,۲۹۲,۸۵۳	پرتفوی سهام
۱,۹۳۳,۹۰۲,۶۸۲,۳۸۹	ارزش اوراق مشارکت
۵,۸۳۲,۰۳۶,۹۴۶,۰۷۳	سرمایه گذاری در صندوق های دیگر
۵۰۱,۷۷۵,۹۰۲,۹۸۷	سایر
۳۴,۷۲۱,۰۷۹,۷۹۶,۶۸۷	جمع داراییها
۶,۳۴۵,۷۱۷,۶۵۶	تعداد سهام موجود در صندوق
۲۳۹,۲۹۹,۱۶۳	تعداد واحدهای سرمایه گذاری در صندوقها
۲,۵۵۲,۹۹۸	تعداد اوراق

۹) ترکیب داراییهای صندوق به تفکیک صنعت

۹.۱) جدول ترکیب داراییهای صندوق مورخ ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

ردیف	نام صنعت	ارزش دارایی	درصد از کل دارایی ها
۱	فلزات اساسی	۱۱,۶۰۷,۵۱۴,۵۳۸,۶۳۰	%۳۳.۴۳
۲	محصولات شیمیایی	۵,۰۵۶,۳۹۵,۲۲۲,۱۷۰	%۱۴.۶
۳	سرمایه گذاریها	۳,۴۲۶,۷۸۸,۴۵۳,۸۵۱	%۹.۸۷
۴	زراعت و خدمات وابسته	۱,۵۴۹,۱۹۰,۸۷۸,۸۹۹	%۴.۴۶
۵	لاستیک و پلاستیک	۱,۲۸۹,۶۶۵,۵۵۴,۹۴۱	%۳.۷۱
۶	صنعت بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۷۱۴,۱۰۹,۱۳۴,۳۱۵	%۲.۰۶
۴	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۹۷۰,۳۷۰,۶۹۴,۷۹۰	%۲.۷۹
۷	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۷۰۳,۶۵۱,۲۶۲,۱۰۳	%۲.۰۳
۸	دباغی، پرداخت چرم و ساخت انواع پاپوش	۲۴۳,۰۷۵,۵۱۹,۸۱۸	%۰.۷۰
۹	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۶۱,۵۱۹,۰۰۴,۹۹۶	%۰.۱۸
۱۰	استخراج کانه های فلزی	۶۴,۱۴۶,۰۲۸,۳۴۰	%۰.۱۸
۱۱	صندوق سرمایه گذاری قابل معامله	۵,۸۳۲,۰۳۶,۹۴۶,۰۷۳	%۱۶.۸۰
۱۲	سرمایه گذاری در اوراق مشارکت بورسی و فرابورسی	۱,۹۳۳,۹۰۲,۶۸۲,۳۸۹	%۵.۵۷
۱۳	سپرده بانکی و سود سهام دریافتنی و سایر دارایی	۱,۲۶۸,۷۱۳,۸۷۵,۳۷۲	% ۳.۶۲
	جمع کل	۳۴,۷۲۱,۰۷۹,۷۹۶,۶۸۷	%۱۰۰

۹.۲) نمودار ترکیب دارایی های صندوق ارزش آفرین

جدول ترکیب دارایی صندوق

