

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

برای دوره سه ماهه منتهی به

۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

ثبت شده به شماره ۱۲۱۳۸ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

مقدمه :

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش دوره مالی سه ماهه مدیران سرمایه گذاری، مبتنی بر اطلاعات ارائه شده در صورت های مالی صندوق بوده و اطلاعات ارائه شده در آن نشان دهنده وضعیت عمومی صندوق و عملکرد مدیران آن در دوره مزبور می باشد. اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تاکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد مجموعه مدیریت صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه می گردد.

۱- تاریخچه فعالیت صندوق :

صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۰۷ تحت شماره ۱۲۱۳۸ با نام صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. به موجب مصوبه مورخ ۱۴۰۲/۰۴/۲۰ مجمع صندوق، نام صندوق سرمایه گذاری " سهامی اهرمی شتاب فارابی " به " سهامی اهرمی جهش فارابی " تغییر یافته و همچنین در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۱۰ تحت شماره ثبت ۵۵۶۷۲ و شناسه ملی به شماره ۱۴۰۱۲۲۸۰۰۲۰ نزد اداره ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است.

۲- معرفی صندوق :

جدول مشخصات صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی	
نوع صندوق	سرمایه گذاری در سهام
تاریخ آغاز فعالیت	۱۴۰۲/۰۴/۰۷
مدیر صندوق	شرکت سبذگردان فارابی (سهامی خاص)
مدیر ثبت	کارگزاری فارابی
مدیر سرمایه گذاری	پریسا زارعی، زهرا گودرزی، فاطمه فرحزادی
متولی صندوق	موسسه حسابرسی هدف نوین نگر (حسابداران رسمی)
حسابرس صندوق	موسسه حسابرسی رازدار
ضامن نقد شوندگی	ندارد
سایت صندوق	jahesh.irfarabi.ir

۳- مشخصات موسسین :

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز نوع اول
۱	شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص)	۷,۰۰۰,۰۰۰
۲	شرکت کارگزاری فارابی	۲,۹۹۰,۰۰۰
۳	شرکت سرمایه گذاری فارابی	۱۰,۰۰۰
	جمع	۱۰,۰۰۰,۰۰۰

۴- دوره فعالیت صندوق :

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۶ اساسنامه نامحدود می باشد که براساس مجوز فعالیت مورخ ۱۴۰۲/۰۴/۰۷ صادره از سازمان بورس و اوراق بهادار، این صندوق مجاز است از تاریخ صدور مجوز به مدت نامحدود فعالیت نماید .

سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای اردیبهشت ماه هر سال تا انتهای فروردین ماه سال بعد است، به جز اولین سال مالی صندوق که از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکت ها آغاز شده و تا پایان فروردین ماه سال بعد خاتمه می یابد.

۵ - هدف از تشکیل صندوق :

هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد.

۶ - موضوع فعالیت صندوق :

موضوع فعالیت اصلی : سرمایه گذاری در انواع اوراق بهادار

موضوع فعالیت فرعی : مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار با درآمد ثابت

برای نیل به این هدف ، صندوق در زمینه های زیر سرمایه گذاری می نماید:

- * سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران یا بازار اول و دوم و بازار پایه فرابورس ایران
- * حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران
- * واحدهای سرمایه گذاری صندوق های سرمایه گذاری غیر از اوراق بهادار
- * گواهی سپرده کالایی
- * اوراق بهادار با درآمد ثابت
- * سپرده ها و گواهی سپرده بانکی

۷ - ویژگی صندوق:

در این صندوق سرمایه گذاری، برای دارندگان واحدهای سرمایه گذاری عادی حداقل و حداکثر سود پیش بینی می شود. حداقل سود ۲۸،۵ درصد و حداکثر ۳۰ درصد سالانه است.

۸ - ریسک های سرمایه گذاری در صندوق:

هر چند تمهیدات لازم به عمل آمده است تا سرمایه گذاری در صندوق سودآور باشد، ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه گذاری های صندوق همواره وجود دارد، بنابراین سرمایه گذاران باید به ریسک های سرمایه گذاری در صندوق از جمله ریسک های یاد شده در این بخش از امیدنامه، توجه ویژه داشته باشند.

۹ - محل اقامت صندوق :

مرکز اصلی صندوق در تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه ۵ واقع شده است.

۱۰ - ارکان صندوق :

صندوق سرمایه گذاری اهرمی جهش فارابی که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱۰-۱- مجمع صندوق:

مجمع صندوق از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز با شرایط مذکور در ماده ۳۶ اساسنامه، به ازای هر واحد سرمایه گذاری ممتاز یک حق رای دارند. در تاریخ خالص دارایی ها دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رای بوده اند شامل اشخاص زیر است:

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱			
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سبذگردان فارابی (ممتاز نوع اول)	۷,۰۰۰,۰۰۰	۷۰
۲	شرکت کارگزاری فارابی (ممتاز نوع اول)	۲,۹۹۰,۰۰۰	۲۹,۹
۳	شرکت سرمایه گذاری فارابی (ممتاز نوع اول)	۱۰,۰۰۰	۰,۱
	جمع	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰

۲-۱۰- مدیر صندوق:

شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۰۷ به شناسه ملی ۱۴۰۰۹۶۸۰۹۶۰ و شماره ثبت ۵۷۰۴۰۵ نزد مرجع ثبت شرکت های استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین تهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه پنجم

۳-۱۰- مدیر ثبت صندوق :

شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۷۲/۱۲/۱۵ به شناسه ملی ۱۰۱۰۱۴۷۴۷۲۲ و شماره ثبت ۱۰۳۵۶۱ نزد مرجع ثبت شرکت های استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر ثبت عبارت است از تهران، شهرک غرب (قدس)، بلوار دریا، بلوار شهید ابراهیم شریفی (خوردین)، کوچه توحید ۳ پلاک ۳، طبقه ۳

۴-۱۰- متولی صندوق:

موسسه حسابرسی هدف نوین نگر است که در تاریخ ۱۳۹۰/۰۲/۱۹ به شناسه ملی ۱۰۳۲۰۵۳۷۵۲۰ و شماره ثبت ۲۷۴۴۲ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان شریعتی، خیابان وحید دستگردی (ظفر)، بعد از خیابان شمس تبریزی، پلاک ۱۴۸، طبقه ۳، واحد ۲

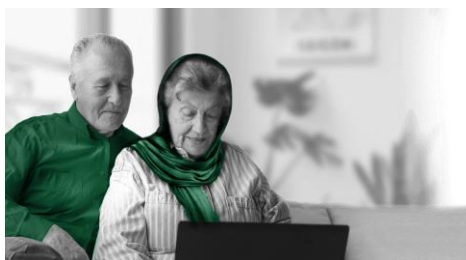
۵-۱۰- حسابرس صندوق:

موسسه حسابرسی رازدار است که در تاریخ ۱۳۴۹/۱۱/۰۳ به شناسه ملی ۱۰۱۰۰۱۲۹۰۸۶ و شماره ثبت ۱۱۷۷ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، میدان آرژانتین، خیابان احمد قصیر (بخارست)، کوچه نوزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ۷، واحد ۱۴

۱۱- خالص ارزش روز دارایی ها ی صندوق:

ارزش روز دارایی های صندوق در پایان هر روز برابر با مجموع وجوه نقد صندوق، قیمت فروش اوراق بهادار صندوق، ارزش روز مطالبات صندوق (نظیر سود تحقق یافته دریافت نشده، سپرده های بانکی و سهام) و ارزش سایر دارایی های صندوق به قیمت بازار در همان روز است.

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱	
اطلاعات سرمایه گذاری صندوق	
خالص ارزش روز دارایی ها	۵۱,۹۲۴,۶۷۵,۱۵۴,۵۵۰ ریال
خالص ارزش واحدهای ممتاز	۱۷,۴۸۸,۹۶۸,۳۸۰,۴۷۷ ریال
خالص ارزش واحدهای عادی	۳۴,۴۳۵,۷۰۶,۷۷۴,۰۷۳ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۴,۴۸۰,۴۴۵,۶۶۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۱,۸۸۴,۶۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲,۵۸۵,۸۴۵,۶۶۹ واحد
تعداد سرمایه گذاران واحدهای عادی	۶,۳۸۹ نفر
نسبت اهرمی	۱,۹۷ درصد
ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نرخ صدور و ابطال واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم در تاریخ گزارش: ۹,۳۷۵ ریال و ۹,۲۳۱ ریال	
نرخ صدور و ابطال واحدهای سرمایه گذاری عادی در تاریخ گزارش: ۱۱,۶۵۰ ریال و ۱۱,۵۸۹ ریال	



۱۲- استراتژی صندوق

هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد

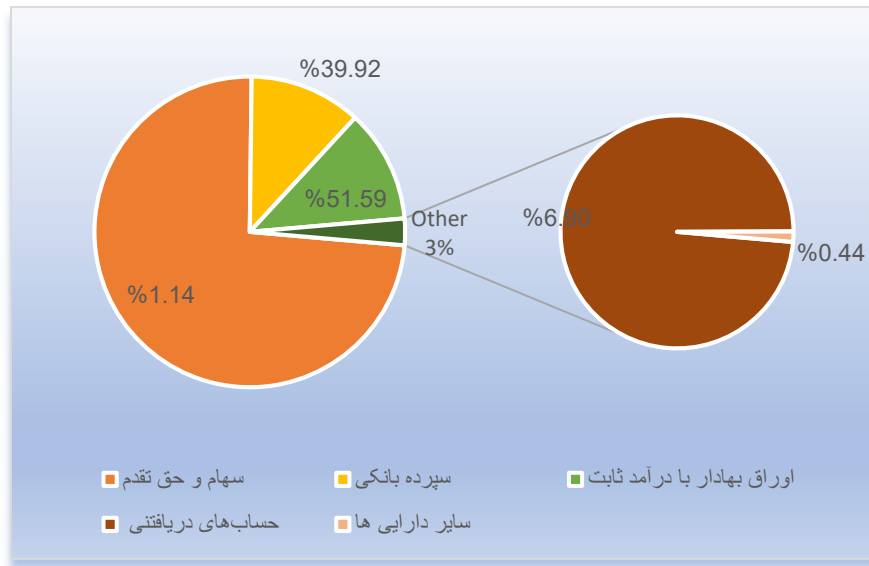
در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً هزینه به کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانه هزینه هر سرمایه گذار کاهش می یابد. ثانياً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود و کوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه گذار برای انجام سرمایه گذاری کاهش می یابد. ثالثاً، امکان سرمایه گذاری مناسب و متنوع تر دارایی ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه گذاری کاهش می یابد.

۱۳- ترکیب دارایی های صندوق :

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۳ نشان می دهد.

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی	نسبت از کل دارائی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۳۹,۱۱۲,۷۴۰,۴۲۴,۲۱۲	۷۳,۸۲ %
سپرده بانکی	۶,۲۲۸,۵۷۳,۸۳۵,۴۸۸	۱۱,۶۷ %
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۶,۱۸۱,۰۰۱,۰۲۴,۸۸۴	۱۱,۷۶ %
حساب های دریافتنی	۱,۴۶۲,۱۹۳,۰۹۳,۳۳۷	۲,۷۳ %
سایر دارایی ها	۱,۵۷۶,۶۹۵,۵۶۱	۰,۰۴ %
جمع	۵۲,۹۸۶,۰۸۵,۰۷۳,۴۸۲	۱۰۰ %

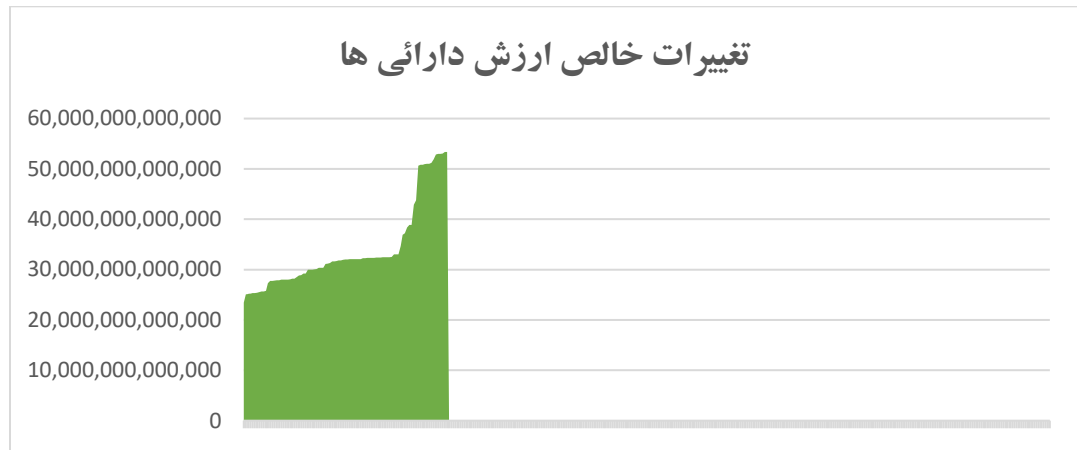
ترکیب دارایی های صندوق



۱۴- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار طی دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۳

ردیف	سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱
۱	سود حاصل از فروش سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	۱۲,۲۴۲,۴۴۳,۶۷۱
۲	سود ناشی از فروش اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۶,۰۶۰,۵۵۳,۶۵۶
۳	زیان حاصل از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	(۱۹,۶۵۳,۵۰۰,۷۲۸)
جمع		۸,۶۴۹,۴۹۶,۵۹۹

۱۵- تغییرات خالص ارزش دارایی ها طی دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۳



۱۶- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
فلزات اساسی	۹.۹۱۶.۱۱۲.۰۴۷.۸۲۴	٪۱۸,۷۱
محصولات شیمیایی	۷.۶۹۶.۰۴۷.۹۲۳.۶۹۷	٪۱۴,۵۲
استخراج کانه های فلزی	۳.۲۱۲.۱۰۳.۶۳۰.۳۱۷	٪۶,۰۶
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۳.۰۷۸.۸۷۸.۶۶۴.۱۶۱	٪۵,۸۱
فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۲.۲۸۴.۸۲۸.۳۴۱.۱۹۶	٪۴,۳۱
سیمان، آهک و گچ	۱.۸۹۲.۳۵۹.۶۲۰.۱۶۱	٪۳,۵۷
بانکها و موسسات اعتباری	۱.۶۶۱.۰۲۲.۱۶۰.۰۹۷	٪۳,۱۳
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱.۲۹۶.۳۱۲.۵۶۷.۳۸۳	٪۲,۴۵
مواد و محصولات دارویی	۱.۲۳۴.۵۱۰.۷۷۷.۴۸۶	٪۲,۳۳
سرمایه گذاری ها	۱.۰۹۸.۸۲۶.۵۶۵.۱۵۴	٪۲,۰۷
خودرو و ساخت قطعات	۸۸۸.۴۹۱.۶۵۹.۳۴۰	٪۱,۶۸
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۶۷۹.۴۶۷.۴۶۸.۳۰۰	٪۱,۲۸
خدمات فنی و مهندسی	۶۷۱.۸۶۷.۷۵۰.۷۱۳	٪۱,۲۷

عملکرد سه ماهه صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱

زراعت و خدمات وابسته	۵۱۹,۰۸۰,۷۲۹,۶۸۵	۰,۹۸٪
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی ونوری	۴۰۳,۷۸۸,۷۴۳,۶۷۹	۰,۷۶٪
ماشین آلات و تجهیزات	۳۰۷,۴۷۶,۴۴۸,۱۲۳	۰,۵۸٪
لاستیک و پلاستیک	۳۲۳,۴۵۵,۳۵۲,۹۳۰	۰,۶۱٪
بیمه وصندوق بازنشتگی به جزتامین اجتماعی	۳۱۰,۰۱۲,۰۷۹,۴۱۲	۰,۹٪
استخراج ذغال سنگ	۲۵۶,۱۴۹,۵۵۹,۰۲۹	۰,۸٪
مخابرات	۲۰۳,۳۶۷,۴۳۶,۸۷۰	۰,۳۸٪
اطلاعات و ارتباطات	۲۰۵,۸۸۶,۴۹۲,۵۲۴	۰,۳۹٪
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱۶۶,۳۱۳,۶۶۲,۶۴۵	۰,۳۱٪
هتل و رستوران	۱۵۶,۹۷۸,۶۳۶,۵۱۲	۰,۳۰٪
محصولات کاغذی	۱۳۴,۶۷۴,۵۰۸,۳۲۳	۰,۲۵٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۲۵,۱۲۱,۲۴۶,۵۴۴	۰,۲۴٪
کاشی و سرامیک	۱۰۱,۰۴۷,۸۱۰,۸۶۸	۰,۱۹٪
حمل و نقل آبی	۱۰۸,۴۱۸,۳۸۶,۱۸۶	۰,۲٪
منسوجات	۸۳,۱۲۵,۹۶۹,۹۹۷	۰,۱۶٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۶۰,۸۲۶,۷۱۸,۷۹۶	۰,۱۱٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۳۶,۱۸۷,۴۶۶,۲۶۰	۰,۰۷٪
جمع	۳۹,۱۱۲,۷۴۰,۴۲۴,۲۱۲	۷۳,۸۲٪

۱۷- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحدهای عادی	بازدهی واحدهای ممتاز	بازدهی بازار
روز اخیر	۱۴۰۳/۰۴/۳۰	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۰/۰۹	%(۱/۸۲۹)	%(۰/۹۲۲)
هفته گذشته	۱۴۰۳/۰۴/۲۴	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۰/۶۳۵	%(۵/۳۰۴)	%(۱/۳۱۵)
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۴/۰۱	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۲/۷۷۸	%۱۲/۲۰۴	%۶/۲۷۳
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۲/۰۳	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۸/۰۸۴	%(۲۱/۰۲۲)	%(۶/۲۴۲)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۲/۱۱/۰۳	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۱۵/۸۵	%(۱۰/۷۰۸)	%۲/۴۶
یکسال اخیر	۱۴۰۲/۰۴/۳۱	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۳۲/۱۳۹	%(۵/۲۳۶)	%۹/۵۳۳
تازمان انتشار	۱۴۰۲/۰۴/۰۷	۱۴۰۳/۰۴/۳۱	%۳۳/۱۷	%(۷/۸۱۹)	%۰/۱۸۷۲
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس					
			%۰/۵۶	%۷/۷۸	%۵/۶
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس					
			%۰	%(۱۰/۶۹)	%(۵/۶۴)

۱۸- چشم انداز پیش بینی بازدهی و عملکرد مدیر صندوق

صندوق جهش فارابی از نوع صندوق سهامی با ویژگی اهرمی است. مدیریت صندوق تلاش میکند همواره عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل بورس ارائه نماید و با توجه به ویژگی اهرمی بودن، بازده بالاتری نسبت به بازار کسب نماید. در این صندوق تلاش می شود تا نسبت اهرم مورد استفاده در سطح بهینه‌ای حفظ شود تا علاوه بر ایجاد جذابیت برای سرمایه‌گذاران، منافع دارندگان واحدهای عادی و ممتاز نیز تامین گردد.