

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

برای دوره شش ماهه منتهی به

۳۰ مهر ماه ۱۴۰۳

مقدمه :

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش دوره مالی شش 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 سبذگردان 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 شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰			
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 سبذگردان 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 شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰	
اطلاعات سرمایه گذاری صندوق	
خالص ارزش روز دارایی ها	۴۱,۰۳۹,۶۳۸,۳۹۰,۷۳۴ ریال
خالص ارزش واحدهای ممتاز	۱۱,۹۳۴,۰۰۸,۶۲۵,۷۶۸ ریال
خالص ارزش واحدهای عادی	۲۹,۱۰۵,۶۲۹,۷۶۴,۹۶۶ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۳,۷۹۶,۳۳۵,۳۳۸ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۱,۷۶۴,۵۹۹,۹۹۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲,۰۲۱,۷۳۵,۳۳۹ واحد
تعداد سرمایه گذاران واحدهای عادی	۵,۶۱۷ نفر
نسبت اهرمی	۲,۴۴ درصد
ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نرخ صدور و ابطال واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم در تاریخ گزارش: ۶,۸۶۳ ریال و ۶,۷۲۵ ریال	
نرخ صدور و ابطال واحدهای سرمایه گذاری عادی در تاریخ گزارش: ۱۰,۸۷۵ ریال و ۱۴,۳۹۶ 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

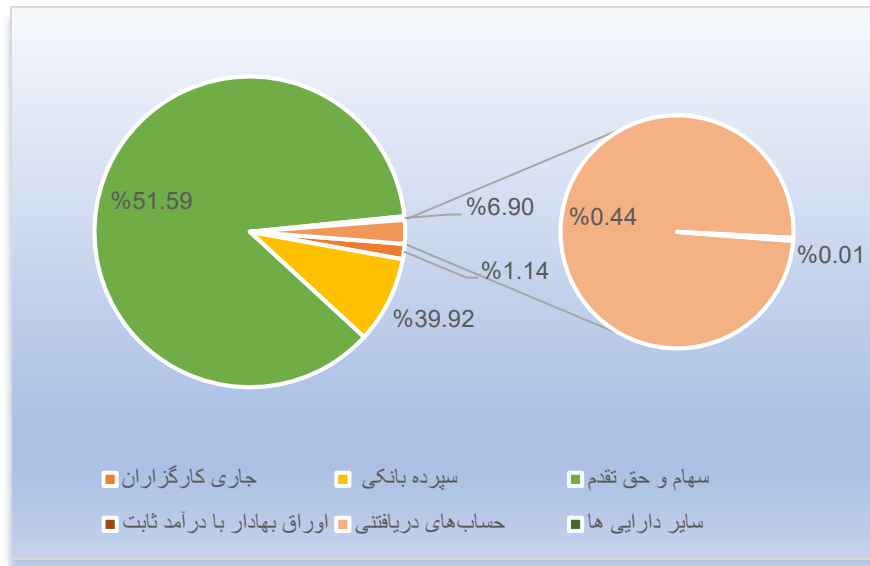
در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری 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 شش ماهه منتهی به ۳۰ مهر ۱۴۰۳ نشان می دهد.

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی	نسبت از کل دارائی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۳۵,۸۴۴,۱۹۸,۱۱۲,۱۶۹	۸۶,۵۵ %
سپرده بانکی	۳,۷۳۶,۶۵۴,۷۸۹,۵۵۰	۹,۰۲ %
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۵۳,۰۶۱,۰۱۷,۷۸۶	۰,۳۷ %
حساب های دریافتنی	۱,۰۱۷,۵۵۸,۳۴۸,۶۷۶	۲,۴۶ %
جاری کارگزاران	۶۶۰,۲۰۸,۹۱۲,۴۲۵	۱,۵۹ %
سایر دارایی ها	۲,۹۸۷,۰۸۶,۱۰۳	۰,۰۱ %
جمع	۴۱,۴۱۴,۶۶۸,۲۶۶,۷۰۹	۱۰۰ %

ترکیب دارایی های صندوق

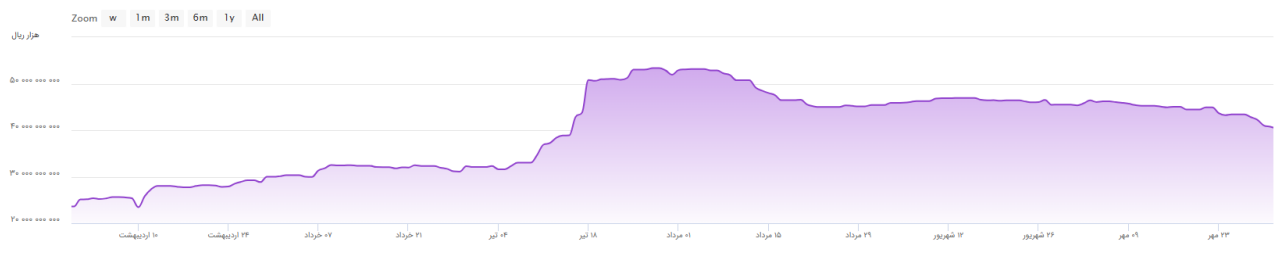


۱۴- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار طی دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ مهر ۱۴۰۳

ردیف	سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰
۱	زیان حاصل از فروش سهام	(۳۸۵,۸۷۳,۸۹۵,۰۸۷)
۲	زیان حاصل از فروش حق تقدم	(۲,۰۳۴,۲۵۱,۴۲۶)
۳	سود ناشی از فروش اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۲۷,۶۹۲,۱۹۸,۷۷۹
	زیان حاصل از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	(۲۹,۱۹۳,۶۶۲,۴۸۴)
جمع		(۲۸۹,۴۰۹,۶۱۰,۲۱۸)

عملکرد شش ماهه صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰

۱۵- تغییرات خالص ارزش دارایی ها طی دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ مهر ۱۴۰۳



۱۶- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
فلزات اساسی	۷.۹۲۰.۵۱۹.۸۳۷.۳۸۳	٪۱۹,۱۲
محصولات شیمیایی	۷.۲۲۹.۵۶۳.۰۴۶.۶۹۳	٪۱۷,۴۶
استخراج کانه های فلزی	۲.۹۵۷.۵۱۲.۹۹۹.۰۸۲	٪۷,۱۴
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۲.۶۸۹.۳۴۴.۷۸۴.۱۹۲	٪۶,۴۹
فرآورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱.۹۲۷.۷۶۰.۷۹۱.۷۷۳	٪۴,۶۵
سیمان، آهک و گچ	۱.۷۲۵.۹۹۴.۷۵۰.۴۶۳	٪۴,۱۷
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱.۴۴۰.۴۶۲.۸۴۶.۶۰۹	٪۳,۴۸
بانکها و موسسات اعتباری	۱.۳۸۱.۱۹۳.۶۸۶.۷۸۶	٪۳,۳۴
مواد و محصولات دارویی	۱.۱۸۴.۲۸۷.۶۸۳.۴۳۸	٪۲,۸۶
سرمایه گذاری ها	۴۸۵.۶۷۲.۱۱۵.۷۴۴	٪۱,۱۷
خودرو و ساخت قطعات	۷۴۲.۴۸۲.۸۶۶.۳۹۸	٪۱,۷۹
زراعت و خدمات وابسته	۶۸۰.۸۴۹.۸۲۶.۹۵۸	٪۱,۶۴
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۶۵۷.۳۳۶.۴۸۹.۰۲۰	٪۱,۵۹
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی ونوری	۵۶۴.۲۴۱.۳۵۷.۹۱۷	٪۱,۳۶
سایر محصولات کانی غیرفلزی	۴۲۳.۳۴۱.۵۳۲.۳۸۴	٪۱,۰۲

عملکرد شش ماهه صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۳/۰۷/۳۰

ماشین آلات و تجهیزات	۲۹۳,۲۲۸,۸۶۳,۲۲۷	٪۰,۹۶
لاستیک و پلاستیک	۲۷۴,۶۷۷,۱۰۰,۴۴۰	٪۰,۷۱
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۲۷۲,۱۲۲,۴۴۱,۱۶۴	٪۰,۶۶
بیمه و صندوق بازنشتگی به جز تامین اجتماعی	۲۵۱,۸۰۹,۰۵۸,۲۳۵	٪۰,۷
استخراج ذغال سنگ	۲۲۶,۳۴۴,۹۲۲,۸۳۹	٪۰,۶
مخابرات	۲۰۴,۰۴۲,۸۸۹,۱۹۳	٪۰,۵
اطلاعات و ارتباطات	۱۷۶,۱۸۵,۴۲۹,۰۵۷	٪۰,۵
هتل و رستوران	۱۵۲,۹۰۳,۵۳۵,۶۵۴	٪۰,۴
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۳۶,۸۲۸,۴۶۵,۳۵۶	٪۰,۴
محصولات کاغذی	۱۰۳,۴۷۶,۳۷۵,۲۶۷	٪۰,۳
کاشی و سرامیک	۹۳,۰۹۰,۳۹۹,۲۱۳	٪۰,۲
رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۷۳,۷۰۹,۴۶۲,۱۴۱	٪۰,۲
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۱,۶۸۹,۲۷۵,۶۱۳	٪۰,۲
ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۱۹,۹۱۳,۵۲۳,۷۴۵	٪۰,۱
حمل و نقل آبی	۹۸۷,۲۲۲,۶۶۵	٪۰,۰
منسوجات	۱۵,۹۷۴	٪۰,۰
گواهی سپرده کالایی	۱,۱۰۴,۱۷۹,۳۰۳,۶۱۷	٪۲,۶۷
جمع		٪۸۶,۵۵

۱۷- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحدهای عادی	بازدهی واحدهای ممتاز	بازدهی بازار
روز اخیر	۱۴۰۳/۰۷/۲۹	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۰/۸۲	%(۱/۶۲۴)	%(۰/۶۸۵)
هفته گذشته	۱۴۰۳/۰۷/۲۳	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۰/۵۷۹	%(۱۲/۸۸۹)	%(۳/۹۹۵)
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۶/۳۱	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۲/۵۱۵	% ۱۸/۶۶۲	%(۴/۲۷۹)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۵/۰۲	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۷/۹۱۱	%(۲۷/۷۷۴)	%(۷/۸۳۷)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۲/۰۵	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۱۶/۶۵۵	%(۴۲/۱۴۱)	%(۱۲/۸۹۱)
یکسال اخیر	۱۴۰۲/۷۴/۳۰	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۳۳/۶۴۶	%(۲۹/۷۳۶)	%(۱/۲۲۷)
تازمان انتشار	۱۴۰۲/۰۴/۰۷	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	% ۴۳/۹۶۴	%(۳۲/۸۴۴)	%(۶/۷۸۷)

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.