

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

برای دوره نه ماهه منتهی به

۳۰ دی ماه ۱۴۰۳

مقدمه :

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش دوره مالی نه 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 - اهرمی
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
۱	شرکت سبذگردان فارابی (سهامی خاص)
۲	شرکت کارگزاری فارابی
۳	شرکت سرمایه گذاری فارابی

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 ۳۰ درصد و حداکثر ۳۱ 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 دوم واحد ۳ 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 نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰			
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

۱۰-۲- 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

۱۰-۳- 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

۱۰-۴- 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

۱۰-۵- 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 حسابرس 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 نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰	
اطلاعات سرمایه گذاری صندوق	
خالص ارزش روز دارایی ها	۶۸,۳۷۲,۲۱۲,۸۹۸,۷۳۲ ریال
خالص ارزش واحدهای ممتاز	۲۹,۳۵۲,۱۵۵,۷۳۱,۲۷۱ ریال
خالص ارزش واحدهای عادی	۳۹,۰۲۰,۰۵۷,۱۶۷,۴۶۱ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۴,۷۷۵,۰۸۰,۲۸۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۲,۲۶۰,۵۹۹,۹۹۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۵۱۴۴۸۰۲۹۰ واحد
تعداد سرمایه گذاران واحدهای عادی	۵۱۰۵ نفر
نسبت اهرمی	۱,۳۳ درصد
ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نرخ صدور و ابطال واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم در تاریخ گزارش: ۱۳,۱۶۹ ریال و ۱۲,۹۸۴ ریال	
نرخ صدور و ابطال واحدهای سرمایه گذاری عادی در تاریخ گزارش: ۱۴,۴۰۶ ریال و ۱۴,۳۱۹ 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

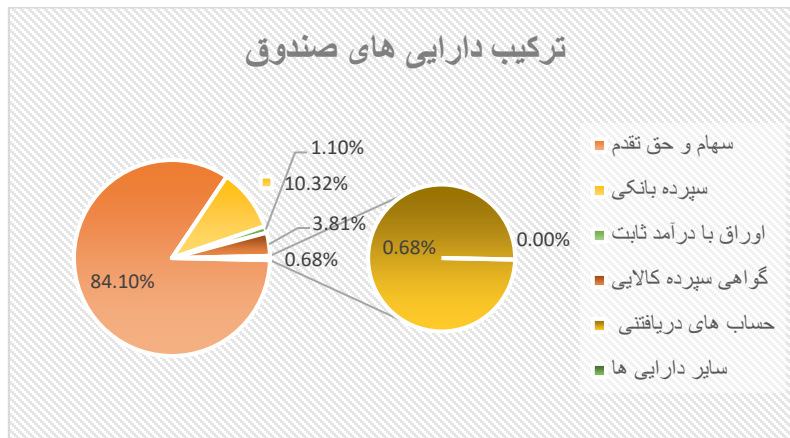
در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری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

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی	نسبت از کل دارائی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۵۷,۹۳۸,۷۸۸,۳۲۳,۹۸۱	۸۴,۱ %
سپرده بانکی	۷,۱۰۵,۸۲۸,۱۵۳,۲۴۲	۱۰,۳۲ %
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۷۴۸,۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۱ %
سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی	۲,۶۲۱,۵۳۱,۳۱۱,۸۰۴	۳,۸۱ %
حساب های دریافتنی	۴۶۵,۸۵۷,۹۷۴,۶۵۷	۰,۶۸ %
سایر دارایی ها	۱,۱۹۴,۸۳۴,۷۴۳	۰ %
جمع	۶۸,۸۸۱,۴۰۰,۵۹۸,۴۲۷	۱۰۰ %

گزارش عملکرد نه ماهه صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰



۱۴- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار :

ردیف	سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰
۱	سود حاصل از فروش سهام	۴۷۴,۳۰۷,۸۶۷,۰۳۶
۲	زیان حاصل از فروش حق تقدم	(۲,۰۳۴,۲۵۴,۷۳۵)
۳	سود ناشی از فروش گواهی سپرده کالایی	۱۷,۰۶۷,۸۰۲,۱۴۲
۴	سود ناشی از فروش اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۹۵,۳۲۵,۸۹۷,۴۳۱
۵	زیان حاصل از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	(۲۹,۱۹۳,۶۶۲,۴۸۴)
جمع		۶۵۵,۴۷۳,۶۴۹,۳۹۰

۱۵- تغییرات خالص ارزش دارایی ها :



۱۶- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
محصولات شیمیایی	۱۰,۸۸۷,۹۰۵,۷۹۱,۳۴۱	٪۱۵,۸۱
فلزات اساسی	۱۰,۳۱۶,۹۶۷,۸۳۸,۱۸۰	٪۱۴,۹۸
بانک ها و موسسات اعتباری	۵,۸۲۰,۷۰۴,۸۰۵,۵۵۳	٪۸,۴۵
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۵,۰۱۰,۲۰۱,۶۹۸,۱۴۵	٪۷,۲۷
سرمایه گذاری ها	۱,۳۰۷,۹۱۷,۰۷۱,۲۳۲	٪۱,۹۰
مواد و محصولات دارویی	۳,۴۵۱,۱۵۶,۳۳۹,۵۶۱	٪۵,۰۱
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳,۵۴۴,۸۷۹,۹۷۲,۴۶۷	٪۵,۱۵
استخراج کانه های فلزی	۲,۹۳۰,۵۶۰,۸۲۸,۹۰۳	٪۴,۲۵
سیمان، آهک و گچ	۲,۲۱۳,۳۲۹,۶۸۹,۸۸۱	٪۳,۲۱
خودرو و ساخت قطعات	۱,۸۵۴,۶۹۲,۳۹۱,۲۵۹	٪۲,۶۹
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱,۷۵۳,۳۸۹,۸۸۷,۵۱۲	٪۲,۵۵
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱,۶۱۴,۵۷۶,۹۲۴,۷۲۳	٪۲,۳
زراعت و خدمات وابسته	۱,۲۵۶,۳۳۷,۰۱۹,۱۱۰	٪۱,۸۲
ماشین آلات و تجهیزات	۱,۰۹۹,۵۶۵,۷۷۵,۰۵۷	٪۱,۶۰
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۸۲۹,۶۲۰,۳۰۷,۱۷۹	٪۱,۲۰
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۶,۸۹۴,۷۳۰,۸۰۰	٪۰,۰
لاستیک و پلاستیک	۴۶۰,۲۸۴,۵۷۷,۶۸۱	٪۰,۶۷
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۴۹۷,۷۸۵,۹۶۵,۶۵۴	٪۰,۷۲
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تأمین اجتماعی	۴۷۶,۱۸۲,۹۰۰,۸۵۸	٪۰,۷
کاشی و سرامیک	۳۵۳,۴۶۵,۵۶۶,۲۵۴	٪۰,۵
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۴۹۶,۷۸۶,۵۳۸,۷۷۶	٪۰,۷۲

گزارش عملکرد نه ماهه صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۳۷۸.۷۹۶.۷۱۲.۳۰۲	۰.۵٪
خدمات فنی و مهندسی	۲۸۸.۳۱۳.۷۴۵.۰۱۴	۰.۴۲٪
رایانه و فعالیتهای وابسته به آن	۲۵۳.۳۷۷.۹۳۲.۶۹۵	۰.۴٪
مخابرات	۲۶۵.۳۹۶.۴۷۵.۱۸۴	۰.۴٪
اطلاعات و ارتباطات	۲۳۰.۷۱۳.۵۹۷.۳۶۸	۰.۳٪
ساخت محصولات فلزی	۱۲۷.۵۱۰.۹۷۸.۵۹۳	۰.۲٪
استخراج ذغال سنگ	۱۰۷.۳۱۸.۶۸۷.۵۴۷	۰.۲٪
محصولات کاغذی	۶۶.۱۲۰.۶۳۱.۷۹۳	۰.۱٪
قند و شکر	۲۴.۷۸۲.۸۹۷.۹۲۸	۰.۰٪
ماشین آلات و دستگاههای برقی	۹.۲۱۵.۱۹۶.۴۸۱	۰.۰٪
منسوجات	۴.۰۳۴.۸۴۸.۹۵۰	۰.۰٪
گواهی سپرده کالایی	۲.۶۲۱.۵۳۱.۳۱۱.۸۰۴	۳.۸۱٪
جمع	۳۵.۸۴۴.۱۹۸.۱۱۲.۱۶۹	۸۷.۹۲٪

۱۷- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحدهای عادی	بازدهی واحدهای ممتاز	بازدهی بازار
هفته گذشته	۱۴۰۳/۱۰/۲۳	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۰.۵۷۹٪	۳.۴۹۳٪	۱.۹۷۲٪
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۲.۵۲۹٪	۸.۱۶۴٪	۴.۴۹۴٪
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۷.۷۹۲٪	۹۳.۰۷۱٪	۳۹.۵۴۱٪
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۵/۰۲	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۱۶.۳۱۹٪	۳۹.۴۴۸٪	۲۸.۶۰۴٪
یکسال اخیر	۱۴۰۲/۱۰/۳۰	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۳۵.۲۸۱٪	۲۰.۵۳۵٪	۲۹.۲۵۹٪
تازمان انتشار	۱۴۰۲/۰۴/۰۷	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۵۵.۱۸۱٪	۲۹.۶۵۸٪	۳۰.۰۷۱٪

گزارش عملکرد نه ماهه صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

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. 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.

ارکان صندوق	نام رکن	نام و نام خانوادگی نماینده	مهر و امضاء
مدیر صندوق	شرکت سبد گردان فارابی	وحید حسن پور دبیر	