

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ تیرماه ۱۴۰۴

ثبت شده به شماره ۱۲۱۳۸ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

گزارش عملکرد سه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ 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 با شناسه ملی ۱۴۰۱۲۲۸۰۰۲۰ 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	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)
مدیران سرمایه گذاری	امیرحسین راقمی، مسعود طیبی مفرد کاشانی، معین نجف زاده
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 :

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱	
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز
۱	شرکت سبذگردان فارابی (سهامی خاص)
۲	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)
۳	شرکت سرمایه گذاری فارابی (سهامی خاص)

۴- هدف از تشکیل صندوق :

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

5- دوره فعالیت صندوق :

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۶ اساسنامه نامحدود ادامه می یابد.

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 .

(مطابق ماده ۶ اساسنامه، سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای اردیبهشت ماه هر سال تا انتهای فروردین ماه سال بعد، 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.)

۶ - موضوع فعالیت صندوق :

موضوع فعالیت اصلی، سرمایه گذاری در انواع اوراق بهادار و موضوع فعالیت فرعی، مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار است.

* سهام و پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس و سهام قابل معامله در بازار پایه فرابورس ایران

* حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و سهام قابل معامله در بازار پایه فرابورس ایران

* سپرده ها و گواهی سپرده بانکی

* اوراق بهادار با درآمد ثابت

* اوراق مشارکت ، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی که دارای شرایط زیر هستند:

الف- مجوز انتشار آن ها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد.

ب- سود حداقلی برای آن ها تضمین و مشخص شده باشد.

ج- در یکی از بورس ها قابل معامله باشد

به تشخیص مدیر، یکی از موسسات معتبر بازخريد آن ها را قبل از سررسيد تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آن ها به

نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

۷ - ویژگی صندوق :

در این صندوق سرمایه گذاری، برای دارندگان واحدهای سرمایه گذاری عادی حداقل و حداکثر سود پیش بینی می شود. حداقل سود 30 درصد و حداکثر 31 درصد سالانه است. (درصد اسمی سالانه بین ۲۵ درصد و ۳۵ درصد اسمی سالانه می باشد).

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 تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه دوم، واحد ۳ کد پستی ۱۹۹۸۷۱۴۳۶۳ 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:

۱-۱۰- مجمع صندوق :

مجمع صندوق از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول تشکیل می شود. دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتاز با شرایط مذکور در ماده ۳۷ 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 سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱			
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سبدگردان 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 شماره ثبت ۵۷۰۴۰۵ و شناسه ملی ۱۴۰۰۹۶۸۰۹۶۰ نزد مرجع ثبت شرکت ها به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه ۲، واحد ۳.

۳-۱۰- مدیر ثبت صندوق :

شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۷۲/۱۲/۱۵ به شماره ثبت ۱۰۳۵۶۱ و شناسه ملی ۱۰۱۰۱۴۷۴۷۲۲ 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

10-4- متولی صندوق :

موسسه حسابرسی هدف نوین نگر است که در تاریخ ۱۳۹۰/۰۲/۱۹ به شماره ثبت ۲۷۴۴۲ و شناسه ملی ۱۰۳۲۰۵۳۷۵۲۰ 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

10-5- حسابرس صندوق :

موسسه حسابرسی رازدار است که در تاریخ ۱۳۴۹/۱۱/۰۳ تاسیس و به شماره ثبت ۱۱۷۷ و شناسه ملی ۱۰۱۰۰۱۲۹۰۸۶ نزد مرجع ثبت شرکت ها 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- انواع واحد های سرمایه گذاری و حقوق دارندگان آن ها :

11-1- واحد های سرمایه گذاری :

در ازای سرمایه گذاری در صندوق، گواهی سرمایه گذاری صادر می شود. در گواهی سرمایه گذاری تعداد واحد های سرمایه گذاری هر سرمایه گذار درج می شود. همچنین واحد های سرمایه گذاری صندوق در قالب واحد های ممتاز نوع اول (دارای حق رأی است)، واحد های ممتاز نوع دوم (دارای حق رأی نیست) و واحد های عادی (ساختار مبتنی بر صدور و ابطال) است .

11-2- حقوق دارندگان واحد های سرمایه گذاری :

واحد های ممتاز نوع اول در قبال آورده موسسین قابل صدور است.

واحد های ممتاز نوع دوم پس از صدور مجوز فعالیت صندوق برای عرضه عموم سرمایه گذاران قابل صدور است.

واحد های عادی: پس از صدور مجوز فعالیت صندوق قابل صدور است.

۱۲- خالص ارزش روز دارایی های 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.

۱۳- خالص ارزش دارایی های صندوق و واحدهای سرمایه گذاری :

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱	
خالص ارزش دارایی ها	۶۱,۹۳۰,۶۳۵,۳۳۳,۰۸۵ ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای عادی	۴۱,۲۱۳,۵۳۷,۶۶۰,۴۰۳ ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای ممتاز	۲۰,۳۸۲,۱۹۶,۴۵۳,۶۷۷ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۴,۰۵۳,۵۱۱,۱۰۷ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری عادی	۲,۲۷۸,۹۱۱,۱۰۸ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱,۷۷۴,۵۹۹,۹۹۹ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد سرمایه گذاران واحدهای عادی	۴,۴۸۰ نفر
نرخ صدور واحد های سرمایه گذاری	15,285 ریال
نرخ ابطال واحد های سرمایه گذاری عادی	۱۸,۰۸۵ ریال
نرخ صدور واحد های سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱۱,۶۸۹ ریال
نرخ ابطال واحد های سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱۱,۴۸۶ ریال
ارزش اسمی واحد های سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نسبت اهرمی	۲.۰۲ درصد

14- اهداف و استراتژی صندوق :

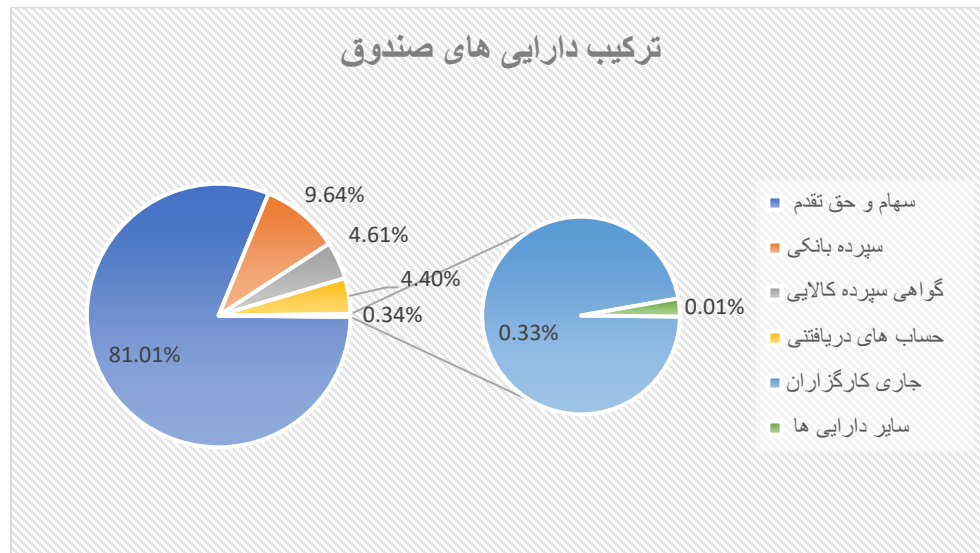
هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه 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. ثانیاً، 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.

15- ترکیب دارایی های صندوق :

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در دوره مالی منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۴ نشان می دهد.

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی - ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز - درصد
سهام و حق تقدم	۵۰,۱۷۱,۳۷۷,۸۸۴,۷۴۷	٪۸۱.۰۱
سپرده بانکی	۵,۹۶۸,۷۴۷,۲۰۳,۳۰۵	٪۹.۶۴
گواهی سپرده کالایی	2,854,626,594,686	٪۴.۶۱
حساب های دریافتنی	۲,۷۲۵,۷۵۵,۵۲۵,۵۵۱	٪۴.۴۰
جاری کارگزاران	۲۰۴,۷۹۳,۸۹۱,۶۰۷	٪۰.۳۳
سایر دارایی ها	۵,۳۳۴,۲۳۳,۱۸۹	٪۰.۰۱
جمع	۶۱,۹۳۰,۶۳۵,۳۳۳,۰۸۵	٪۱۰۰

گزارش عملکرد سه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱



16- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار :

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱	
مبلغ - ریال	سود (زیان) فروش
(۱,۴۵۹,۵۹۲,۲۸۲,۶۸۶)	زیان حاصل از فروش سهام
(۶,۰۶۱,۴۰۴,۸۶۵)	زیان حاصل از فروش حق تقدم
(۱۸,۹۴۴,۶۷۴,۶۶۰)	زیان حاصل از فروش گواهی صرفه جویی انرژی
(۱,۴۸۴,۵۹۸,۳۶۲,۲۱۱)	جمع

۱۷- تغییرات خالص ارزش دارایی ها :



۱۸- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱		
صنعت	خالص ارزش فروش - ریال	درصد به کل دارایی ها
محصولات شیمیایی	۱۰,۴۴۷,۹۸۳,۶۶۳,۳۳۱	٪۱۶.۸۷
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۵,۵۳۸,۵۳۸,۱۴۳,۱۰۶	٪۸.۹۴
فلزات اساسی	۴,۹۹۹,۴۲۳,۴۵۹,۸۷۴	٪۸.۰۷
مواد و محصولات دارویی	۳,۹۳۶,۰۵۹,۲۱۷,۴۴۸	٪۶.۳۶
بانک ها و موسسات اعتباری	۳,۷۴۸,۵۸۰,۲۴۹,۴۳۶	٪۶.۰۵
سیمان، آهک و گچ	۳,۰۸۹,۰۷۵,۰۲۷,۳۱۴	٪۴.۹۹
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۲,۶۳۱,۶۹۸,۰۵۸,۱۴۱	٪۴.۲۵
سرمایه گذاری ها	۱,۷۹۳,۸۲۹,۰۷۱,۴۵۲	٪۲.۹۰
استخراج کانه های فلزی	۱,۴۸۵,۳۰۴,۳۴۰,۴۵۴	٪۲.۴۰
ماشین آلات و تجهیزات	۱,۵۲۴,۴۳۱,۴۵۹,۱۳۷	٪۲.۴۶
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱,۳۰۰,۳۰۸,۳۲۱,۰۴۹	٪۲.۱۰
زراعت و خدمات وابسته	۱,۲۷۳,۶۱۲,۳۳۴,۸۲۸	٪۲.۰۶
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۹۴۴,۷۳۲,۷۳۴,۸۲۲	٪۱.۵۳
لاستیک و پلاستیک	۸۹۰,۳۱۱,۷۷۴,۶۹۵	٪۱.۴۴
خودرو و ساخت قطعات	۸۸۱,۵۶۸,۷۸۴,۹۴۵	٪۱.۴۲
کاشی و سرامیک	۸۱۹,۶۴۳,۶۱۱,۱۳۲	٪۱.۳۲
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۸۴۶,۵۵۲,۴۹۷,۳۳۶	٪۱.۳۷
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۷۹۰,۸۰۴,۴۶۵,۵۵۸	٪۱.۲۸
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۵۰۷,۱۰۱,۶۳۰,۳۸۹	٪۰.۸۲
قند و شکر	۵۵۵,۵۳۶,۵۱۳,۷۳۱	٪۰.۹۰
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۵۵۱,۸۷۳,۷۱۵,۹۳۵	٪۰.۸۹
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۳۸۴,۳۹۴,۸۷۶,۲۴۱	٪۰.۶۲
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۲۹۹,۰۲۷,۴۹۳,۱۷۹	٪۰.۴۸

گزارش عملکرد سه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

خدمات فنی و مهندسی	۲۶۸,۰۲۵,۱۲۶,۹۹۸	٪۰.۴۳
خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۱۸۹,۱۲۲,۸۹۴,۸۷۵	٪۰.۳۱
ساخت محصولات فلزی	۱۶۵,۷۸۰,۰۹۶,۳۷۴	٪۰.۲۷
اطلاعات و ارتباطات	۱۴۰,۶۷۶,۵۶۹,۳۹۹	٪۰.۲۳
رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۱۱۱,۷۲۱,۴۸۴,۷۷۱	٪۰.۱۸
استخراج ذغال سنگ	۴۷,۶۲۳,۳۷۴,۵۴۷	٪۰.۰۸
استخراج سایر معادن	۸,۰۳۶,۸۹۴,۲۵۰	٪۰.۰۱
گواهی سپرده کالایی شمش طلا	۲,۸۵۴,۶۲۶,۵۹۴,۶۸۶	٪۴.۶۱
جمع	۵۳,۰۲۶,۰۰۴,۴۷۹,۴۳۳	٪۸۵.۶۲

۱۹- بازدهی صندوق در فواصل مختلف :

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱					
شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحدهای عادی	بازدهی واحدهای ممتاز	بازدهی بازار
هفته گذشته	1404/04/24	۱۴۰۴/04/31	۰.۵۹۳٪	۶.۶۹۸٪	۲.۹۸۴٪
ماه گذشته	1404/04/01	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۲.۵۲۶٪	٪(۱۶.۵۶۳)	٪(۴.۷۱۴)
۳ ماه اخیر	1404/02/03	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۷.۷۶۹٪	٪(۲۴.۱)	٪(۹.۳۳۵)
۶ ماه اخیر	1403/11/04	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۱۶.۱۵۱	٪(۱۳.۶۳۳)	۱.۰۵۱٪
یکسال اخیر	1403/05/01	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۳۵.۶۸٪	۲۳.۷۱۸٪	۳۱.۱۱۵٪
تا زمان انتشار	1402/04/07	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۸۰.۸۴۸٪	۱۴.۶۹۹٪	۳۲.۰۶۵٪

۲۰- 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.

مهر و امضاء

نام و نام خانوادگی نماینده

نام رکن

ارکان صندوق

وحید حسن پور دبیر

شرکت سبد گردان فارابی

مدیر صندوق

