

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

دوره سه ماهه منتهی به ۳۰ مهرماه ۱۴۰۴

ثبت شده به شماره ۱۲۱۳۸ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰ 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 سبدگردان 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 شش ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰	
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز
۱	شرکت سبذگردان فارابی (سهامی خاص)
۲	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)
۳	شرکت سرمایه گذاری فارابی (سهامی خاص)

4 - 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 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 بازخرید آن ها را قبل از سررسید 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:

۱۰-۱ - 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 شش ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰			
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

10-2 - 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.

10-3- 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 3

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 شش ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰	
خالص ارزش دارایی ها	50,159,824,471,547 ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای عادی	28,670,977,289,929 ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای ممتاز	21,488,847,181,618 ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	3,170,334,937 واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲,۲۷۸,۹۱۱,۱۰۸ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱,۷۷۴,۵۹۹,۹۹۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد سرمایه گذاران واحدهای عادی	4307 نفر
نرخ صدور واحدهای سرمایه گذاری	۱۵,۹۱۹ ریال
نرخ ابطال واحدهای سرمایه گذاری عادی	۱۵,۸۲۲ ریال
نرخ صدور واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	13,518 ریال
نرخ ابطال واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	13,796 ریال
ارزش اسمی واحدهای سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نسبت اهرمی	۱.۱۸ درصد

14- اهداف و استراتژی صندوق :

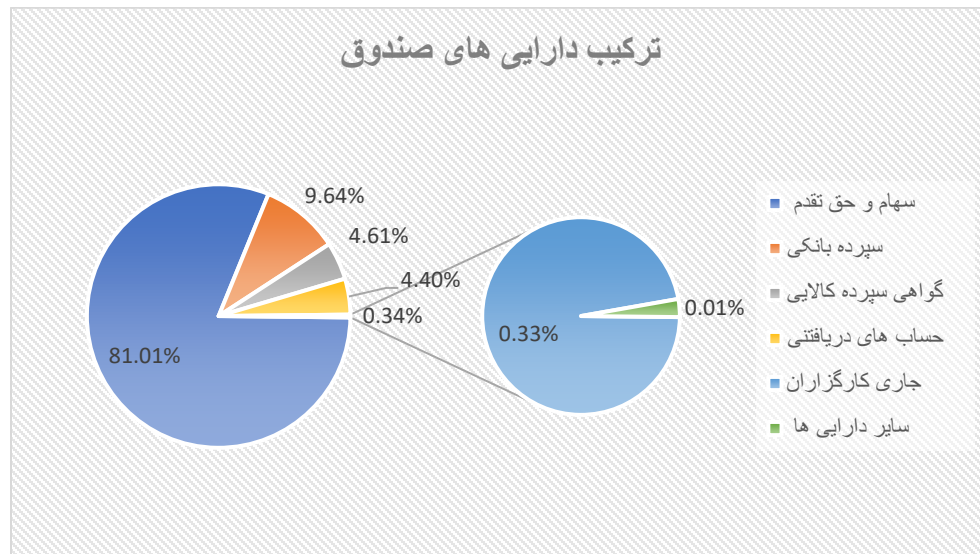
هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه 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 ۳۰ مهر ۱۴۰۴ نشان می دهد.

دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی - ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز - درصد
سهام و حق تقدم	۴۱.۱۳۹.۳۴۶.۱۸۰.۹۰۵	٪۹۱.۱۵
سپرده بانکی	۲.۰۹۰.۲۸۲.۵۱۱.۹۰۲	٪۴.۱۵
گواهی سپرده کالایی	۴.۷۵۷.۳۳۰.۰۳۹.۷۶۰	٪۹.۴۵
حساب های دریافتنی	۱.۸۱۵.۲۹۵.۶۷۱.۰۸۹	٪۳.۵۹
جاری کارگزاران	۵۴۷.۲۰۵.۷۱۹.۱۷۳	٪۱.۰۹
سایر دارایی ها	۹.۹۳۰.۶۷۷.۴۵۱	٪۰.۰۲
جمع	۵۰.۳۵۹.۳۹۰.۸۰۰.۲۸۰	٪۱۰۰



16- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار :

دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰	
مبلغ - ریال	سود (زیان) فروش
(۴,۹۰۴,۶۹۲,۸۱۶,۵۸۰)	زیان حاصل از فروش سهام
۱۰,۰۶۰,۷۶۱,۹۱۸	سود (زیان) حاصل از فروش حق تقدم سهام
۱۵۳,۷۵۵,۹۳۶,۸۹۱	سود ناشی از ابطال گواهی سپرده کالایی
(۱۸,۹۴۵,۲۸۵,۰۲۸)	زیان حاصل از فروش گواهی صرفه جویی انرژی
(۴,۷۵۹,۸۲۱,۴۰۲,۷۹۹)	جمع

۱۷- تغییرات خالص ارزش دارایی ها :



۱۸- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰		
صنعت	خالص ارزش فروش - ریال	درصد به کل دارایی ها
محصولات شیمیایی	8,195,454,404,465	%16.28
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	5,652,219,435,940	%11.23
مواد و محصولات دارویی	4,776,077,779,872	%9.49
سرمایه گذاریها	4,757,330,039,760	%9.45
بانکها و موسسات اعتباری	3,686,218,048,048	%7.32
سیمان، آهک و گچ	2,850,054,992,738	%5.66
فلزات اساسی	2,489,870,750,408	%4.95
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	2,310,817,271,411	%4.59
زراعت و خدمات وابسته	1,333,973,642,006	%2.65
سرمایه گذاریها	1,204,058,966,001	%2.39
سایر محصولات کانی غیرفلزی	1,045,556,088,167	%2.08
کاشی و سرامیک	882,298,773,568	%1.75
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	876,965,663,392	%1.74
لاستیک و پلاستیک	825,743,637,309	%1.64
قند و شکر	724,514,867,083	%1.44
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	691,724,176,872	%1.37
ماشین آلات و تجهیزات	675,596,537,562	%1.34
استخراج کانه های فلزی	647,318,309,192	%1.29
خرده فروشی در فروشگاه های غیرتخصصی	563,721,529,095	%1.12
ماشین آلات و دستگاه های برقی	512,935,137,333	%1.02
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	360,535,656,779	%0.72
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	317,142,315,985	%0.63
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	310,809,644,922	%0.62

منسوجات	113,873,397,750	0.23%
خودرو و ساخت قطعات	52,606,123,527	0.1%
استخراج ذغال سنگ	39,259,031,516	0.08%
جمع	41,139,346,180,905	۸۵.۶۲٪

۱۹- بازدهی صندوق در فواصل مختلف :

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحد های عادی	بازدهی واحد های ممتاز	بازدهی بازار
هفته گذشته	۲۳/۰۸/۱۴۰۴	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۰.۶۱٪	۵.۳۱٪	۲.۲۵٪
ماه گذشته	۳۰/۰۷/۱۴۰۴	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۲.۶۲٪	۷.۲۴٪	۲.۸۸٪
۹۰ روز اخیر	۰۱/۰۶/۱۴۰۴	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۸.۰۵٪	۶۹.۵۳٪	۲۸.۲۳٪
۱۸۰ روز اخیر	۰۴/۰۳/۱۴۰۴	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۱۶.۴۷٪	-۹.۴۰٪	۲.۱۵٪
یک سال اخیر	۰۱/۰۹/۱۴۰۳	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۳۵.۸۸٪	۵۷.۵۳٪	۴۰.۳۵٪
۳ سال اخیر	۰۱/۰۹/۱۴۰۱	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
۵ سال اخیر	۰۲/۰۹/۱۳۹۹	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
تا زمان انتشار	۰۷/۰۴/۱۴۰۲	۳۰/۰۸/۱۴۰۴	۱۰۰.۷۳٪	۳۴.۹۹٪	۴۷.۱۴٪
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس					
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس					
			۰.۵۲٪	۵.۴۳٪	۲.۶۵٪
			۰.۵۲٪	۳.۲۹٪	۰.۰۰٪

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.

ارکان صندوق نام رکن نام و نام خانوادگی نماینده مهر و امضاء



وحید حسن پور دبیر

شرکت سبد گردان فارابی

مدیر صندوق