

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

دوره نه ماهه منتهی به 30 دی ماه 1404

ثبت شده به شماره 12138 نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای دوره مالی نه ماهه منتهی به 1404/10/30 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.

1- تاریخچه فعالیت صندوق :

صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی با شناسه ملی 14012280020 در تاریخ 1402/04/07 تحت شماره 12138 با نام صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است.

به موجب مصوبه مورخ 1402/04/20 مجمع صندوق، نام صندوق سرمایه گذاری " سهامی اهرمی شتاب فارابی " به " سهامی اهرمی جهش فارابی " تغییر یافته و همچنین در تاریخ 1402/03/10 تحت شماره ثبت 55672 و شناسه ملی به شماره 14012280020 نزد اداره ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است

2- معرفی صندوق :

جدول مشخصات صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی	
نوع صندوق	سرمایه گذاری در سهام - اهرمی
تاریخ آغاز فعالیت	1402/04/07

مدیر صندوق	شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص)
مدیر ثبت	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)
مدیران سرمایه گذاری	امیرحسین راقمی، هادی عباسی، 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

3- مشخصات موسسین :

دوره شش ماهه منتهی به 1404/07/30	
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز
1	شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص)
2	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)
3	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 6 اساسنامه نامحدود ادامه می یابد.

براساس مجوز فعالیت مورخ 1402/04/07 صادره از سازمان بورس و اوراق بهادار، این صندوق مجاز است از تاریخ صدور مجوز به مدت نامحدود فعالیت نماید .

(مطابق ماده 6 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.)

6 - 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.

7 - 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 25 درصد و 35 درصد اسمی سالانه می باشد.)

8 - 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.

9 - محل اقامت صندوق :

مرکز اصلی صندوق تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک 19، طبقه دوم، واحد 3 کد پستی 1998714363 واقع شده است.

10 - ارکان صندوق :

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

10-1 - 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 37 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 1404/07/30			
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
1	شرکت سبدگردان فارابی (ممتاز نوع اول)	7.000.000	70
2	شرکت کارگزاری فارابی (ممتاز نوع اول)	2.990.000	29.9
3	شرکت سرمایه گذاری فارابی (ممتاز نوع اول)	10.000	0.1
	جمع	10,000,000	100

10-2 - مدیر صندوق :

شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص) است که در تاریخ 1399/10/07 به شماره ثبت 570405 و شناسه ملی 14009680960 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 19، طبقه 2، واحد 3.

10-3- مدیر ثبت صندوق :

شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص) است که در تاریخ 1372/12/15 به شماره ثبت 103561 و شناسه ملی 10101474722 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 3 پلاک 3، طبقه 3

10-4- متولی صندوق :

موسسه حسابرسی هدف نوین نگر است که در تاریخ 1390/02/19 به شماره ثبت 27442 و شناسه ملی 10320537520 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 148، طبقه 3، واحد 2

10-5- حسابرس صندوق :

موسسه حسابرسی رازدار است که در تاریخ 1349/11/03 تاسیس و به شماره ثبت 1177 و شناسه ملی 10100129086 نزد مرجع ثبت شرکت ها به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، میدان آرژانتین، خیابان احمد قصیر (بخارست)، کوچه نوزدهم، پلاک 18، طبقه 7، واحد 14

11- 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.

12- 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.

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

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۰/۳۰	
خالص ارزش دارایی ها	۷۵,۸۵۳,۲۶۹,۷۳۲,۹۵۹ ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای عادی	۳۵,۳۵۸,۴۳۹,۹۲۳,۹۷۴ ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای ممتاز	۴۰,۴۹۴,۸۲۹,۸۰۸,۹۸۵ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۳,۳۶۴,۱۳۸,۷۸۱
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۱,۶۷۲,۵۳۸,۷۸۲
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱,۶۸۱,۵۹۹,۹۹۹
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد سرمایه - گذاران واحدهای عادی	۴۰۶۲ نفر
نرخ صدور واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۱,۱۴۱ ریال
نرخ ابطال واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۱,۱۴۱ ریال
نرخ صدور واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۲۴,۳۸۱ ریال
نرخ ابطال واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۲۳,۹۳۹ ریال
ارزش اسمی واحدهای سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نسبت اهرمی	۰.۸۷ درصد

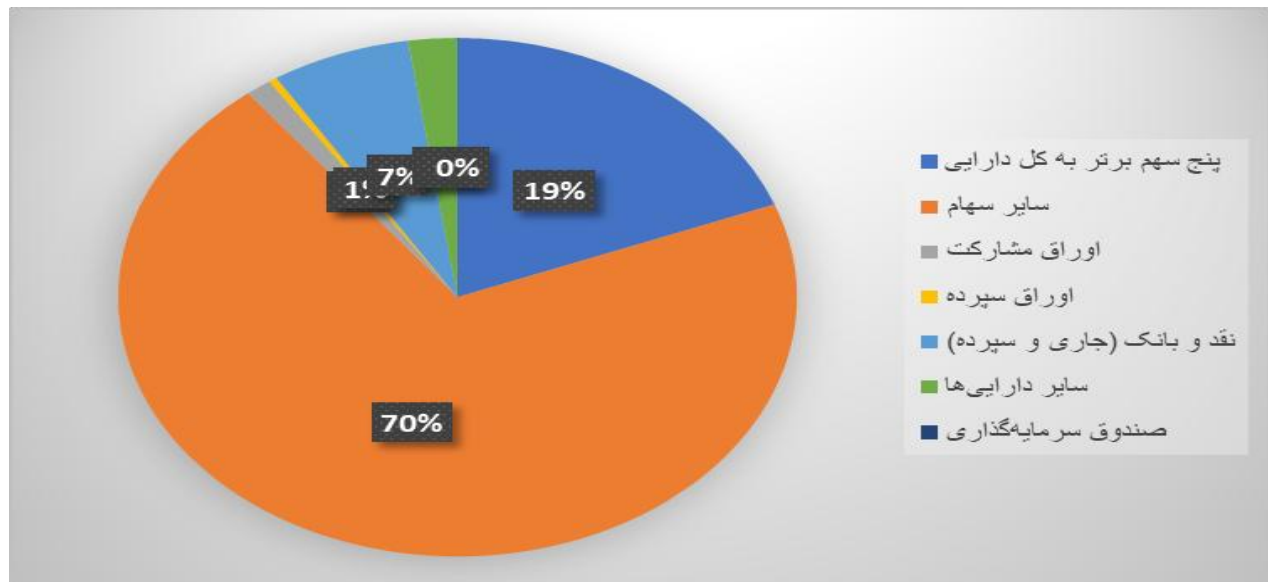
14- اهداف و استراتژی صندوق :

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 30 آبان 1404 نشان می دهد.

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۰/۳۰		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی - ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز - درصد
سهام و حق تقدم	۷۰,۳۲۳,۸۸۰,۱۵۳,۲۲۵	۹۱٪
سپرده بانکی	۳,۳۶۵,۴۹۷,۶۱۹,۳۴۰	۴٪
گواهی سپرده کالایی	۲,۴۴۹,۹۴۵,۹۹۶,۹۶۸	۳٪
حساب های دریافتنی	۷۵۲,۰۰۲,۷۳۰,۷۸۷	۱٪
سایر دارایی ها	۶۱۴۲۳۹۷۴۱۳	۰٪
جمع	۷۶,۸۹۷,۴۶۸,۸۹۷,۷۳۳	۱۰۰٪



16- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار :

دوره نه ماهه منتهی به 30/10/1404	
سود (زیان) فروش	مبلغ - ریال
زیان حاصل از فروش سهام	(5,764,348,533,994)
سود (زیان) حاصل از فروش حق تقدم سهام	17,950,805,606
سود ناشی از ابطال گواهی سپرده کالایی	3,493,928,537,401
زیان حاصل از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	1,658,315,596
جمع	(2,250,810,875,391)

18- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۰/۳۰			
صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
	ریال	ریال	درصد
محصولات شیمیایی	۱۱,۹۶۵,۷۹۹,۷۳۲,۴۲۰	۱۷,۴۱۹,۵۸۲,۸۷۴,۴۰۲	۲۳٪
فلزات اساسی	۳,۱۵۳,۹۸۸,۸۰۳,۹۱۸	۵,۴۲۸,۶۴۸,۱۸۴,۲۹۵	۷٪
بانک ها و موسسات اعتباری	۲,۳۵۶,۱۳۸,۳۲۱,۶۲۱	۳,۸۷۷,۰۶۰,۲۲۷,۹۳۶	۵٪
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۲,۹۴۵,۰۹۵,۸۲۳,۶۷۲	۴,۱۲۳,۶۳۳,۲۴۲,۸۰۶	۵٪
سرمایه گذاری ها	۲,۸۹۵,۴۴۸,۶۹۴,۲۱۴	۴,۰۳۸,۱۸۰,۸۱۰,۰۱۳	۵٪
مواد و محصولات دارویی	۳,۵۳۴,۳۵۴,۹۸۵,۴۱۶	۶,۴۷۰,۱۱۴,۶۸۶,۵۲۵	۸٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۷,۷۰۵,۴۹۸,۳۴۰,۶۶۱	۱۲,۶۵۸,۳۸۶,۴۳۰,۴۰۹	۱۶٪
استخراج کانه های فلزی	۲۷۷,۰۶۲,۴۰۴,۴۲۸	۲۵۳,۲۵۱,۲۷۷,۵۰۵	۰٪
سیمان، آهک و گچ	۱,۶۷۰,۶۲۱,۳۲۷,۱۲۵	۲,۴۳۷,۱۳۰,۴۰۶,۳۶۵	۳٪
خودرو و ساخت قطعات	۱,۴۷۳,۶۰۵,۲۵۲,۲۱۲	۱,۶۲۹,۲۲۶,۵۴۱,۸۵۶	۲٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۴۶۲,۰۰۷,۵۹۹,۴۳۶	۶۴۳,۴۳۵,۷۴۶,۴۸۷	۱٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۲۶۵,۹۶۷,۷۰۸,۵۰۰	۵۰۳,۸۴۶,۰۸۶,۸۳۰	۱٪
زراعت و خدمات وابسته	۱,۱۴۰,۹۱۱,۸۸۲,۷۸۸	۱,۸۹۴,۵۸۴,۴۵۱,۵۵۸	۲٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱,۴۰۴,۶۵۵,۲۷۸,۵۳۷	۱,۸۸۰,۷۱۲,۲۹۹,۵۴۲	۲٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱,۷۴۲,۶۴۵,۳۰۰,۸۸۰	۲,۳۴۰,۴۳۵,۶۷۱,۲۵۸	۳٪
لاستیک و پلاستیک	۵۶۸,۴۳۹,۲۲۰,۷۰۷	۹۳۰,۳۸۱,۹۰۷,۹۳۳	۱٪
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۹۸۸,۸۱۴,۹۸۰,۶۷۷	۱,۴۱۷,۹۵۸,۸۱۳,۵۰۷	۲٪
کاشی و سرامیک	۳۱۷,۸۲۵,۵۸۳,۸۳۵	۴۹۴,۱۰۵,۷۹۶,۵۷۴	۱٪
استخراج ذغال سنگ	۶۷,۱۷۳,۶۷۴,۷۰۵	۵۲,۸۲۰,۶۱۹,۱۶۴	۰٪
قند و شکر	۳۹۴,۸۹۹,۵۵۱,۴۰۵	۴۶۸,۵۸۰,۲۶۶,۶۲۵	۱٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۴۵۱,۹۴۴,۵۸۲,۴۰۱	۵۴۲,۱۸۱,۸۸۳,۲۲۴	۱٪
خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۴۸۳,۵۸۶,۴۱۸,۸۹۶	۷۳۹,۶۷۲,۵۸۸,۵۴۹	۱٪
جمع	۴۶,۲۶۶,۴۸۵,۴۶۸,۴۵۴	۷۰,۲۴۳,۹۳۰,۸۱۳,۳۶۳	۹۱٪

19- بازدهی صندوق در فواصل مختلف :

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۰/۳۰					
توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحد های عادی	بازدهی واحد های ممتاز	بازدهی بازار
			روز اخیر	۱۴۰۴/۱۲/۰۱	۱۴۰۴/۱۲/۰۲
هفته گذشته	۱۴۰۴/۱۱/۲۵	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۱٪	-۱۱٪	-۷٪
ماه گذشته	۱۴۰۴/۱۱/۰۲	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۳٪	-۳۰٪	-۱۷٪
روز اخیر ۹۰	۱۴۰۴/۰۹/۰۲	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۸٪	۲۱٪	۱۴٪
روز اخیر ۱۸۰	۱۴۰۴/۰۶/۰۳	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۱۷٪	۱۲۴٪	۵۲٪
یک سال اخیر	۱۴۰۳/۱۲/۰۳	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۳۶٪	۴۰٪	۳۶٪
سال اخیر ۳	۱۴۰۱/۱۲/۰۳	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۰٪	۰٪	۰٪
سال اخیر ۵	۱۳۹۹/۱۲/۰۴	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۰٪	۰٪	۰٪
تا زمان انتشار	۱۴۰۲/۰۴/۰۷	۱۴۰۴/۱۲/۰۲	۱۱۷٪	۶۹٪	۷۲٪
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			۱٪	۱۱٪	۷٪
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			۱٪	-۱۲٪	-۸٪

20- 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 بهینه ای حفظ شود تا علاوه بر ایجاد جذابیت برای سرمایه گذاران، 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	