

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری

سهامی اهرمی جهش فارابی

سال مالی منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

مقدمه :

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی، برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش سال مالی 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	هادی عباسی، مهرتن چمن زیبایی، 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 :

سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱	
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز
۱	شرکت سبذگردان فارابی (سهامی خاص)
۲	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)
۳	شرکت گروه مالی فارابی (سهامی خاص)

۴ - هدف از تشکیل صندوق :

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

۵- 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 باز خرید 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 ۳۱ درصد و حداکثر ۳۲ 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:

سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۱/۳۱			
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 گروه مالی فارابی (ممتاز نوع اول)	۱۰.۰۰۰	۰.۱
	جمع	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰

۱۰-۲ - مدیر صندوق:

شرکت سبذگردان 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.

۱۰-۳ - 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

۴-۱۰- 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

۵-۱۰- 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:

۱-۱۱- 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 .

۲-۱۱- 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:

سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱	
خالص ارزش دارایی ها	۴۴,۵۶۳,۰۹۵,۳۱۹,۱۸۶ ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای عادی	۳۸,۲۳۶,۳۸۰,۲۲۰,۶۸۱ ریال
خالص ارزش دارایی های واحدهای ممتاز	۲۶,۳۲۶,۷۱۵,۰۹۸,۵۰۶ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۳,۳۶۱,۶۲۹,۵۲۸ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۱,۶۷۵,۰۳۱,۵۲۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱,۶۸۶,۵۹۷,۹۹۹ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع اول	۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد سرمایه گذاران واحدهای عادی	۳,۹۴۹ نفر
نرخ صدور واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۲,۸۲۷ ریال
نرخ ابطال واحدهای سرمایه گذاری عادی	۲۲,۸۲۷ ریال
نرخ صدور واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱۵,۹۸۰ ریال
نرخ ابطال واحدهای سرمایه گذاری ممتاز نوع دوم	۱۵,۶۰۹ ریال
ارزش اسمی واحدهای سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ ریال
نسبت اهرمی	۱.۴۵ درصد

۱۴- اهداف و استراتژی صندوق:

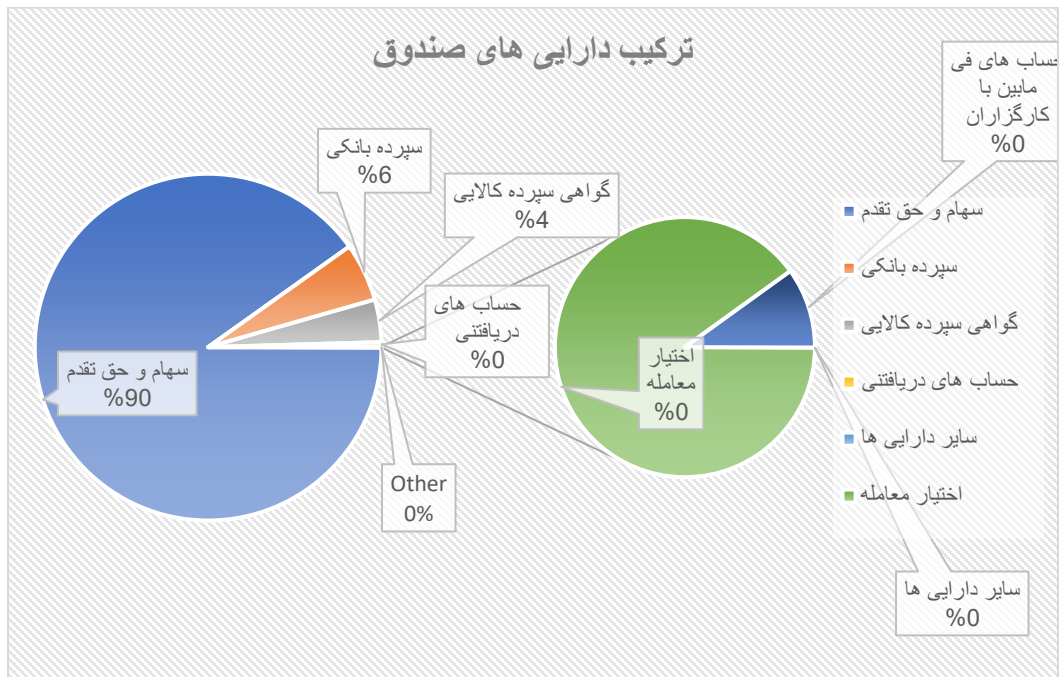
هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه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

۱۵- ترکیب دارایی های صندوق :

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در سال مالی منتهی به ۳۱ فروردین ۱۴۰۵ نشان می دهد.

سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی	نسبت از کل دارائی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۵۸,۵۶۱,۰۸۲,۳۷۴,۲۸۲	٪۹۰
سپرده بانکی	۳,۳۹۶,۴۱۶,۳۶۴,۷۱۵	٪۵
گواهی سپرده کالایی	۲,۵۷۸,۶۲۰,۷۲۴,۰۸۵	٪۴
حساب های دریافتنی	۳۲۳,۲۹۲,۳۹۶,۰۰۰	٪۰
سایر دارایی ها	۱۵,۰۹۶,۱۳۲	٪۰
اختیار معامله	۵۱۰,۶۶,۵۱۳,۷۹۱	٪۰
حساب های فی مابین با کارگزاران	۵,۶۶۸,۸۷۷,۴۲۸	٪۰
جمع	۶۵,۰۴۶,۰۳۲,۳۴۶,۳۹۱	٪۱۰۰

گزارش عملکرد سالیانه مدیر صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱

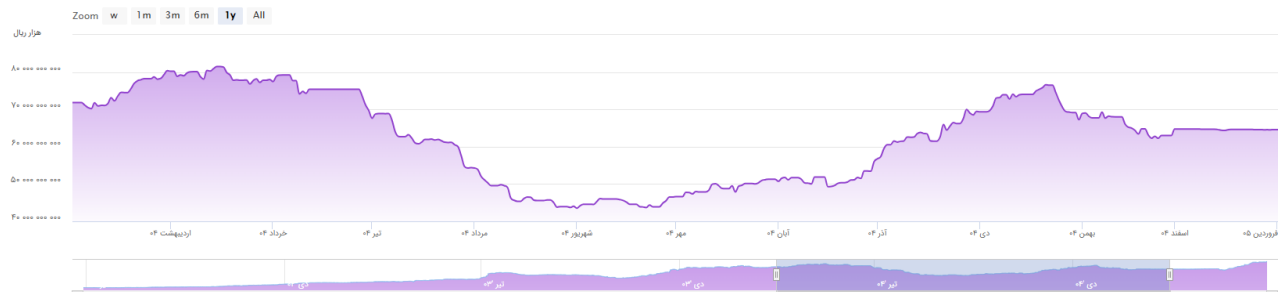


۱۶- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار :

سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱	
مبلغ - ریال	سود (زیان) فروش
(۱,۸۷۰,۴۲۱,۷۵۶,۲۵۸)	سود حاصل از فروش سهام
۸,۶۴۳,۷۲۴,۸۰۴,۱۹۴	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۴,۴۱۱,۰۲۴,۱۳۲,۹۶۵	سود سهام
۷۹۴,۲۹۱,۱۵۱,۶۹۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب و سپرده های بانکی
۵۷,۴۹۳,۸۹۲,۳۶۱	سایر درآمدها
۱۲,۰۳۶,۱۱۲,۲۲۴,۹۶۱	جمع

۱۷- تغییرات خالص ارزش دارایی ها :

گزارش عملکرد سالیانه مدیر صندوق سرمایه گذاری سهامی اهرمی جهش فارابی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱



۱۸- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
محصولات شیمیایی	۱۵,۰۵۹,۳۷۳,۹۳۳,۳۳۸	۲۳.۱۵٪
فلزات اساسی	۵,۱۴۵,۵۲۱,۷۳۰,۷۱۲	۷.۹۱٪
بانک ها و موسسات اعتباری	۳,۱۳۰,۳۱۶,۲۰۰,۷۰۵	۴.۸۱٪
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۳,۴۷۶,۰۱۴,۳۴۴,۸۲۹	۵.۳۴٪
سرمایه گذاری ها	۳,۰۸۸,۰۶۳,۲۱۸,۰۱۶	۴.۷۵٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۰,۰۲۳,۸۴۳,۰۴۶,۷۸۰	۱۵.۴۱٪
مواد و محصولات دارویی	۵,۰۳۹,۰۲۴,۰۸۱,۲۴۰	۷.۷۵٪
سیمان، آهک و گچ	۱,۹۱۸,۴۷۷,۸۵۱,۴۳۵	۲.۹۵٪
استخراج کانه های فلزی	۲۰۴,۹۹۹,۶۵۶,۷۰۲	۰.۳۲٪
خودرو و ساخت قطعات	۱,۳۵۲,۸۸۰,۷۶۳,۴۰۱	۲.۰۸٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۳۹۶,۴۸۶,۰۶۹,۲۴۴	۰.۶۱٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۴۳۷,۱۸۱,۸۶۹,۴۶۲	۰.۶۷٪
زراعت و خدمات وابسته	۱,۶۰۱,۰۹۱,۸۷۹,۲۲۱	۲.۴۶٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱,۸۲۸,۱۲۸,۸۵۵,۴۶۰	۲.۸۱٪
کاشی و سرامیک	۴۴۷,۸۷۰,۴۱۶,۲۳۸	۰.۶۹٪
لاستیک و پلاستیک	۵۶۷,۴۹۱,۷۱۱,۰۹۷	۰.۸۷٪
سایر محصولات کانی غیر فلزی	۱,۲۳۸,۸۵۲,۰۴۹,۵۶۳	۱.۹۰٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۵۶۱,۶۸۰,۷۲۵,۰۳۰	۰.۸۶٪
خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۷۲۳,۲۰۰,۷۹۴,۵۲۰	۱.۱۱٪
قند و شکر	۳۳۲,۸۷۹,۳۹۹,۹۷۱	۰.۵۱٪
استخراج ذغال سنگ	۴۰,۵۴۲,۵۰۳,۳۱۱	۰.۰۶٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱,۹۴۷,۱۶۱,۲۷۳,۹۷۰	۲.۹۹٪

۱۹- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۱/۳۱					
شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی واحدهای عادی	بازدهی واحدهای ممتاز	بازدهی بازار
هفته گذشته	۱۴۰۵/۰۱/۲۴	۱۴۰۵/۰۱/۳۱	٪۰.۵۹۶	٪(۱.۱۶۵)	٪۰
ماه گذشته	۱۴۰۵/۰۱/۰۱	۱۴۰۵/۰۱/۳۱	٪۲/۵۸	٪(۳.۷۹۱)	٪۰
۳ ماه اخیر	۱۴۰۴/۱۱/۰۱	۱۴۰۵/۰۱/۳۱	٪۷/۹۷۸	٪(۳۴.۷۹۷)	٪(۱۷.۰۷۲)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۸/۰۱	۱۴۰۵/۰۱/۳۱	٪۱۶/۶۹۹	٪۲۳/۲۲۸	٪۲۰/۵۹
یکسال اخیر	۱۴۰۴/۰۱/۳۱	۱۴۰۵/۰۱/۳۱	٪۳۶/۳۷۷	٪۸/۲۵۳	٪۲۰/۶۶۴
تا زمان انتشار	۱۴۰۲/۰۴/۰۷	۱۴۰۵/۰۱/۳۱	٪۱۲۸/۲۷۳	٪۵۵/۸۷۲	٪۷۲/۴۶۹

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
مدیر صندوق	شرکت سبد گردان فارابی	وحید حسن پور دبیر	

