

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری دوره  
۱ساله منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۱۳۹۸/۰۳/۳۱

کارگزاری صبا جهاد

## ۱. کلیات

### ۱-۱ تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۲ تحت شماره ۴۳۴۹۲ نزد اداره ثبت شرکتها و مؤسسات غیرتجاری تهران ثبت شده و در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۸ تحت شماره ۱۱۵۵۳ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری وجوه از سرمایه گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده ۴ اساسنامه به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه گذاران است. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس، اوراق بهادار با درآمد ثابت و ... سرمایه گذاری می نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، ۳ سال است. مرکز اصلی صندوق در خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، بعد از تقاطع فلسطین، شماره ۳۸ واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی باشد.

### ۲. اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه گذاری به آدرس [arzeshafarinfund.com](http://arzeshafarinfund.com) درج گردیده است.

### ۳. ارکان صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری از ارکان زیر تشکیل شده است:

#### ۳-۱ مدیر صندوق

شرکت کارگزاری صبا جهاد است که در تاریخ ۱۳۸۳/۰۶/۰۸ با شماره ثبت ۲۲۹۱۸۵ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، بعد از تقاطع فلسطین، شماره ۳۸.

#### ۳-۲ متولی صندوق

شرکت مشاور سرمایه گذاری تأمین سرمایه نوین (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۸۹/۱۲/۲۲ با شماره ثبت ۳۹۸۵۱۳ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، بلوار آفریقا، خیابان گل آذین، شماره ۲۳.

### ۳-۳ حسابرس صندوق

شرکت مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت سامان پندار است که در تاریخ ۱۳۸۱/۱۲/۲۹ با شماره ثبت ۱۳۹۱۹ نزد مرجع ثبت شرکتهای شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، بلوار آفریقا، نبش عاطفی غربی، برج صبا، پلاک ۱۵۲، طبقه ۱۲، واحد ۱۲۳.

### ۴. مجمع صندوق سرمایه گذاری:

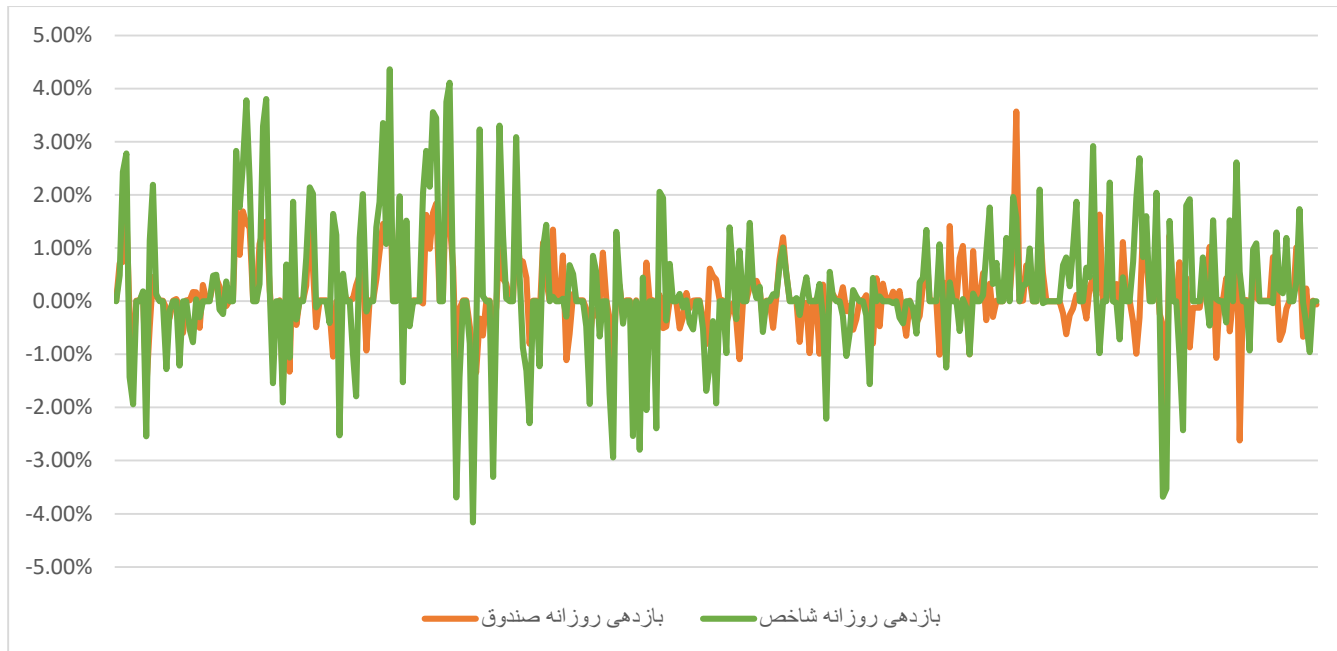
از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. طبق ماده ۲۳ اساسنامه مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رأی صندوق تشکیل شده و رسمیت می یابد. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشستگی کشوری	۳۵۰	٪۱
۲	شرکت نوآوران مدیریت سبا	۳۴,۳۰۰	٪۹۸
۳	شرکت کارگزاری صبا جهاد	۳۵۰	٪۱
	جمع	۳۵,۰۰۰	٪۱۰۰

### ۵. اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

خالص ارزش روز داراییها	۳۵۵,۲۴۳,۷۸۵,۵۵۵
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۳۵,۰۰۰
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۲۳۴,۶۴۶
تعداد دارندگان واحدهای سرمایه گذاری	۷
اشخاص حقوقی	۷
اشخاص حقیقی	۰
نسبت سرمایه تامین شده توسط اشخاص حقیقی	۰
ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری	۱,۰۰۰,۰۰۰
نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۵۲۱,۴۲۷
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۵۱۳,۹۵۶

## ۶. مقایسه روند بازدهی صندوق و سایر شاخص ها



## ۷. بازده صندوق

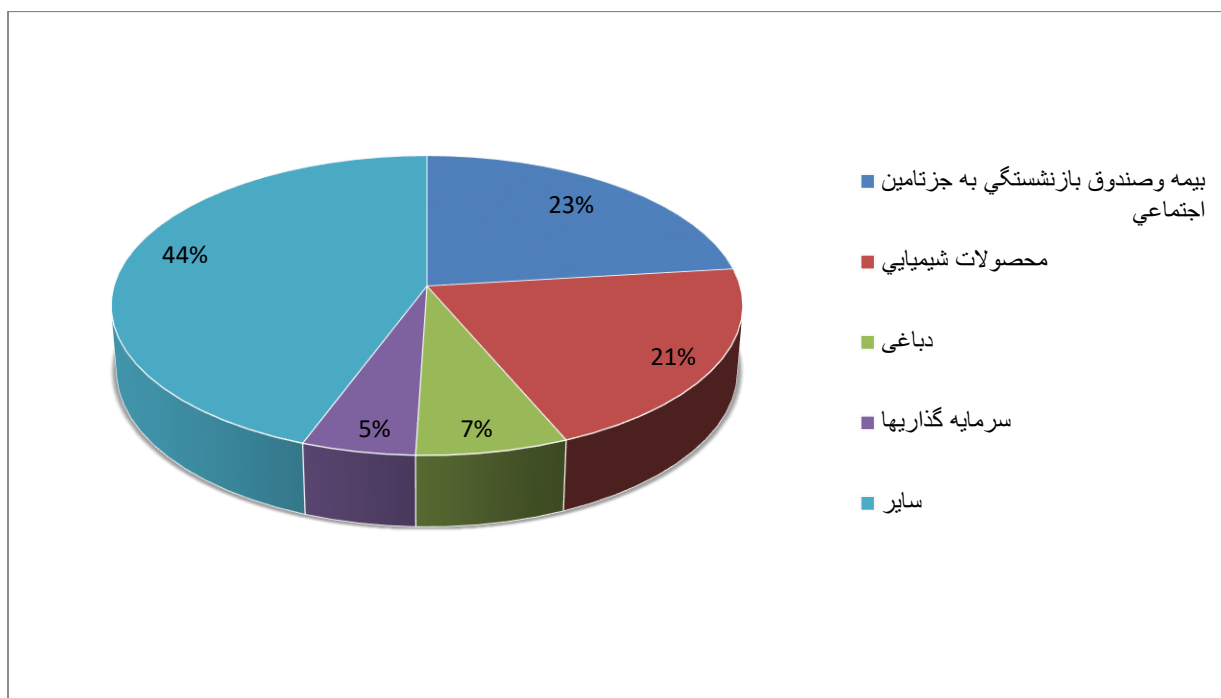
شرح	بازده صندوق
یک هفته اخیر	۰,۹۲۵٪
یک ماه اخیر	۰,۰۸۳٪
سه ماه اخیر	۶,۱۷۹٪
شش ماه اخیر	۱۱,۷۱۷٪
یکسال اخیر	۴۲,۲۲۶٪

## ۸. ترکیب دارایی‌های صندوق

۱۵۰,۰۹۶,۵۷۴,۴۹۵	وجه نقد و شبه نقد
۲۰۰,۹۱۰,۹۸۵,۶۴۶	پرتفوی سهام
۹,۹۰۶,۰۵۱,۲۹۳	سایر
۴۰,۸۱۳,۲۴۲	تعداد سهام موجود در صندوق

## ۹. نمودار ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق به تاریخ ۱۳۹۸/۰۳/۳۱



### ترازنامه صندوق مورخ ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

ریال	داراییها:
۲۰۰,۹۱۰,۹۸۵,۶۴۶	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱۰۲,۳۸۲,۸۷۲,۷۹۱	سرمایه گذاری در اوراق مشارکت و اسناد خزانه
۹,۸۵۳,۷۲۳,۴۸۰	حسابهای دریافتی
۵۲,۳۲۷,۸۱۳	سایر داراییها
۴۷,۷۰۶,۱۷۰,۱۰۱	سرمایه گذاری در سپرده بانکی
۷,۵۳۱,۶۰۳	موجودی نقد
۳۶۰,۹۱۳,۶۱۱,۴۳۴	جمع داراییها
	بدهیها:
۴,۴۰۲,۹۷۴,۹۸۰	جاری کارگزاران
۷۶۱,۳۴۱,۱۹۵	پرداختنی به ارکان صندوق
۱۷,۸۶۴,۷۵۸	پرداختنی به سرمایه گذاران
۴۸۷,۶۴۴,۹۴۶	سایر پرداختنی ها و ذخایر
۵,۶۶۹,۸۲۵,۸۷۹	جمع بدهیها
۳۵۵,۲۴۳,۷۸۵,۵۵۵	خالص داراییها
۱,۵۱۳,۹۵۶	خالص داراییهای هر واحد سرمایه گذاری - ریال

### صورت سود و زیان سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۳۱/۰۳/۱۳۹۷	۳۱/۰۳/۱۳۹۸	درآمدها:
۴۳۹.۰۲۲.۴۰۲	۵۶.۵۷۴.۴۶۷.۲۴۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۹.۹۸۷.۹۹۵.۴۹۶	۲۲.۵۱۷.۳۸۹.۳۷۳	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	۱۶.۸۶۹.۷۴۶.۹۵۰	سود سهام
۱.۵۱۸.۳۸۴.۰۶۲	۱۵.۲۸۷.۴۱۲.۱۹۷	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱۱.۹۴۵.۴۰۱.۹۶۰	۱۱۱.۲۴۹.۱۳۱.۱۴۹	جمع درآمدها
		هزینه ها:
(۵۷۲.۲۴۴.۷۵۶)	(۲.۱۳۷.۰۰۴.۸۶۰)	هزینه کارمزد ارکان
(۱۹۳.۱۹۷.۰۷۳)	(۱.۱۳۲.۰۶۳.۸۶۱)	سایر هزینه ها
(۷۶۵.۴۴۱.۸۲۹)	(۳.۲۶۹.۰۶۸.۷۲۱)	جمع هزینه ها
۱۱.۱۷۹.۹۶۰.۱۳۱	۱۰۷.۹۸۰.۰۶۲.۴۲۸	سود خالص
۷,۲۱٪	٪۳۶,۵۴	بازده میانگین سرمایه گذاری ۱
۶,۱۰٪	۳۶,۷۳	بازده سرمایه گذاری در پایان سال

### عملکرد عملیاتی صندوق

بازه زمانی	حجم معاملات	ملت	وملی	جم	گوهران	وهور
۳ماهه اول	خرید	۸,۲۵۴,۸۱۸	۱۹۶,۷۲۴	۳,۷۸۵,۸۲۰	۱۶,۸۵۳,۶۱۶	۲۷,۷۵۶,۱۱۹
	فروش	۱۰,۲۷۵,۵۲۲	-	۴,۵۵۸,۹۶۱	۳۸۶,۲۳۲	۳۴,۵۸۵,۲۲۳
	جمع کل معاملات	۱۸,۵۳۰,۳۴۰	۱۹۶,۷۲۴	۸,۳۴۴,۷۸۱	۱۷,۲۳۹,۸۴۸	۶۲,۳۴۱,۳۴۲
	حجم معاملات بازار	۱۹,۲۰۵,۰۴۵	۶۰۷,۲۲۴	۱۵۲,۲۲۲,۳۳۹	۹۵,۵۲۷,۳۳۹	۱۳۵,۴۱۷,۷۹۷
	درصد از حجم معاملات	۹۶٪	۳۲٪	۵٪	۱۸٪	۴۶٪
۳ماهه دوم	خرید	۲۱,۳۸۴,۴۱۰	۱۰,۵۴۲	۲,۷۷۷,۲۳۲	۵,۴۹۳,۴۰۱	۱۲,۶۰۴,۷۳۲
	فروش	۱۷,۵۸۹,۵۸۹	۸,۵۱۳	۳,۸۷۲,۱۶۴	۴,۱۲۹,۸۵۴	۶,۳۴۳,۰۸۴
	جمع کل معاملات	۳۸,۹۷۳,۹۹۹	۱۹,۰۵۵	۶,۶۴۹,۳۹۶	۹,۶۲۳,۲۵۵	۱۸,۹۴۷,۸۱۶
	حجم معاملات بازار	۱۶۷,۷۱۷,۳۷۸	۱,۳۳۶,۱۶۳	۱۶۰,۷۱۸,۰۸۷	۱۵۴,۴۲۸,۷۴۳	۲۷۵,۳۴۶,۶۹۳
	درصد از حجم معاملات	۲۳٪	۱٪	۴٪	۶٪	۷٪
۳ماهه سوم	خرید	۵,۴۶۵,۱۸۲	۳,۵۱۸	۳۷۷,۷۸۷	۶,۰۴۹,۰۱۸	۷۳۲,۰۱۱
	فروش	۲۰,۷۸۵,۵۸۸	۱,۷۱۷,۱۸۲	۸۳۶,۹۹۵	۱۳,۵۹۱,۸۴۷	۱۶۴,۵۵۵
	جمع کل معاملات	۲۶,۲۵۰,۷۷۰	۱,۷۲۰,۷۰۰	۱,۲۱۴,۷۸۲	۱۹,۶۴۰,۸۶۵	۸۹۶,۵۶۶
	حجم معاملات بازار	۱۷۳,۳۴۷,۷۴۷	۶,۵۴۷,۰۵۶	۴۸,۱۶۶,۶۲۹	۲۰۰,۱۱۲,۲۶۸	۵۰,۶۶۹,۳۲۲
	درصد از حجم معاملات	۱۵٪	۲۶٪	۳٪	۱۰٪	۲٪
۳ماهه چهارم	خرید	۲۷,۵۷۰,۳۲۴	-	۱,۰۳۸,۶۳۵	۱,۶۲۴,۱۸۵	
	فروش	۱۵,۸۷۷,۰۹۵	۳۲۵,۰۰۰	۹۹۱,۸۹۲	۱,۵۰۴,۰۰۰	
	جمع کل معاملات	۴۳,۴۴۷,۴۱۹	۳۲۵,۰۰۰	۲,۰۳۰,۵۲۷	۳,۱۲۸,۱۸۵	
	حجم معاملات بازار	۵۱۰,۲۰۹,۱۲۴	۴۳۸,۱۴۳	۸۹,۶۷۲,۴۳۸	۱۶۹,۰۸۸,۰۵۵	
	درصد از حجم معاملات	۹٪	۷۴٪	۲٪	۲٪	