

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری دوره  
مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

## به نام خدا

در اجرای مفاد ۲۳۲ اصلاحیه قانون تجارت، مصوب اسفند ماه ۱۳۴۷ و ماده ۴۵ قانون بازار اوراق بهادار بدینوسیله گزارش درباره فعالیت و وضع عمومی صندوق برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح ذیل تقدیم می گردد.

به نظر اینجانب اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تأکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد صندوق و در جهت حفظ منافع صندوق انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت های موجود بوده و اثرات آنها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می توان پیش بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۳۹۸/۱۰/۲۳ به تأیید ارکان صندوق رسیده است.

امضاء	نماینده	شخص حقوقی	ارکان صندوق
	آقای حاجعلی صلاحی نژاد	شرکت کارگزاری صبا جهاد	نماینده مدیر صندوق

## 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:

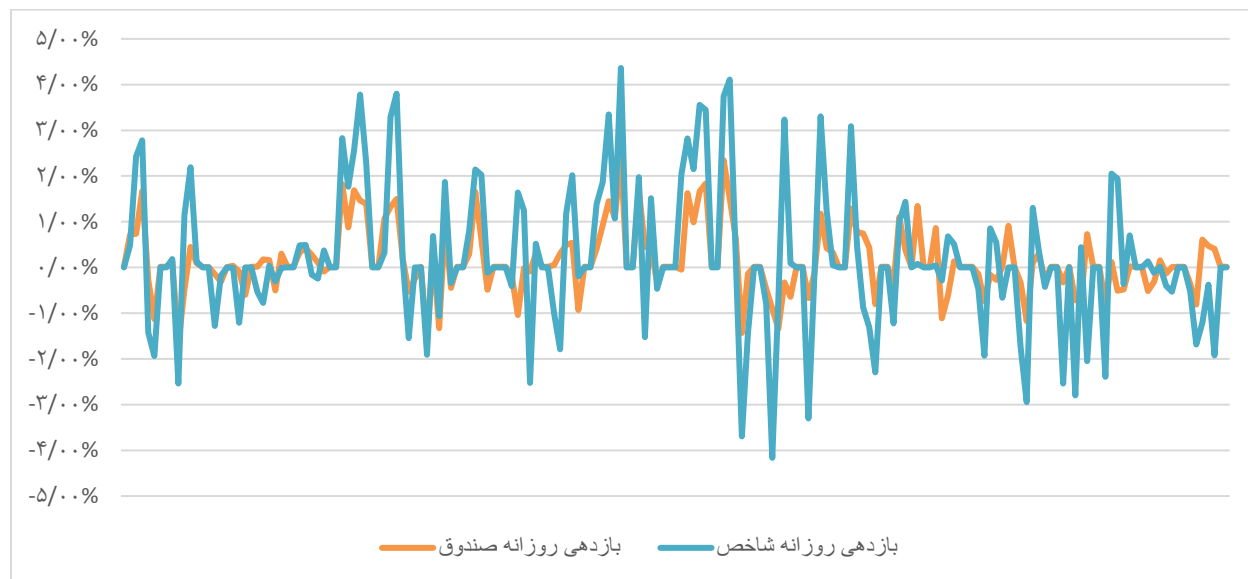
از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل میشود. طبق ماده ۲۳ اساسنامه مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رأی صندوق تشکیل شده و رسمیت می یابد. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

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 ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

خالص ارزش روز داراییها	۱,۲۷۱,۰۰۹,۵۶۹,۲۱۳
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۳۵,۰۰۰
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری عادی	۸۸۴,۳۵۹
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	۱,۳۸۴,۲۳۵
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری در تاریخ گزارش	۱,۳۷۶,۳۱۵

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



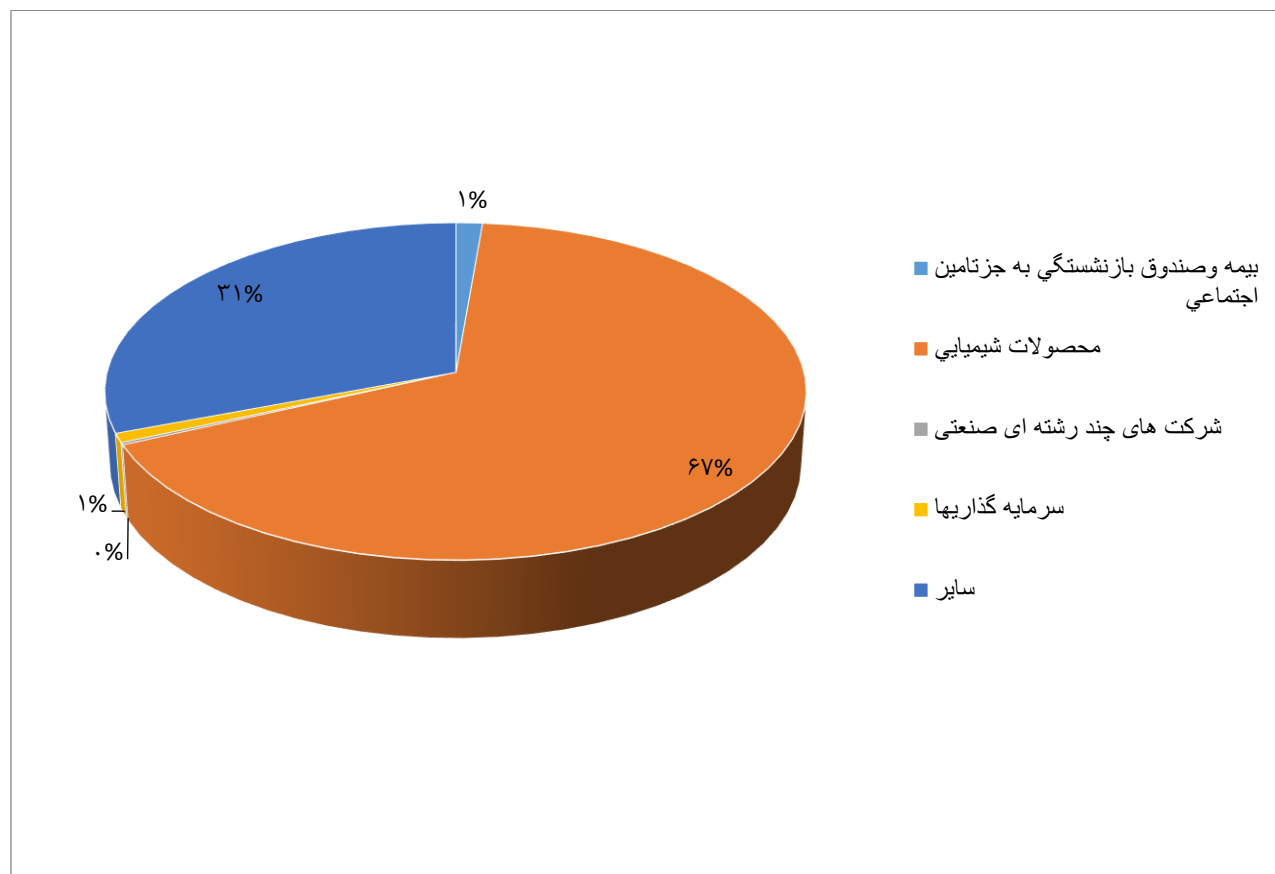
## ۷. بازده صندوق

شرح	بازده صندوق
یک هفته اخیر	٪(۱,۴۱)
یک ماه اخیر	٪ ۵,۰۵
سه ماه اخیر	٪ ۲۳,۰۵۲
شش ماه اخیر	٪ ۲۴,۲۹۲
یکسال اخیر	٪ (۳,۴۷۴)

## ۸. ترکیب دارایی‌های صندوق

۲۱۱,۰۰۲,۷۶۲,۰۷۹	وجه نقد و شبه نقد
۸۸۰,۴۰۰,۶۴۸,۰۳۶	پرتفوی سهام
۱۷۸,۸۷۷,۳۴۷,۸۴۸	اوراق مشارکت
۵۷۴,۴۴۱,۴۳۴	سایر
۳۰,۴۲۷,۲۱۱	تعداد سهام موجود در صندوق

## ۹. نمودار ترکیب دارایی‌های صندوق:



### عملکرد عملیاتی صندوق

بازه زمانی	حجم معاملات	ملت	جم	گوهران	جم پیلن	وصندوق
سه ماهه اول	خرید	۵۶۱۸۴۲۹	۲۰۲۳۵۷	۴۸۰۶۱۴۶	۲۰۷۰۳۵۶۵	۰
	فروش	۲۰۳۱۱۱۲۵	۳۷۷۶۷۸	۱۲۱۳۰۸۳۱	۴۴۰۰۰۰	۰
	حجم کل معاملات	۲۵۹۲۹۵۵۴	۵۸۰۰۳۵	۱۶۹۳۶۹۷۷	۲۱۱۴۳۵۶۵	۰
	حجم معاملات بازار	۴۸۱۲۹۷۶۵۸	۸۸۹۸۲۳۴۸۰	۴۸۹۰۹۰۵۵۹	۳۵۹۴۳۷۸۴۲	۶۰۳۲۰۱۴۶۶
	درصد از حجم معاملات	۵/۳۹٪	۰/۰۷٪	۳/۴۶٪	۵/۸۸٪	۰/۰۰٪
سه ماهه دوم	خرید	۷۳۶۹۶۸۵	۵۹۵۴۳۱	۵۲۳۳۹۳۱	۵۳۰۰۰۰	۱۱۰۰۰۰
	فروش	۱۳۹۰۸۷۰۳	۷۱۵۶۸۸	۵۶۳۳۷۳۳	۵۰۳۳۸۸	۰
	حجم کل معاملات	۲۱۲۷۸۳۸۸	۱۳۱۱۱۱۹	۱۰۸۶۷۶۶۴	۱۰۳۳۳۸۸	۱۱۰۰۰۰
	حجم معاملات بازار	۶۴۶۷۰۴۵۰۲	۸۹۴۹۹۵۷۶۴	۲۹۳۱۰۰۴۳۶	۱۰۹۰۳۲۷۹۶	۵۵۹۴۵۱۶۵۴
	درصد از حجم معاملات	۳/۲۹٪	۰/۱۵٪	۳/۷۱٪	۰/۹۵٪	۰/۰۲٪

گزارش عملکرد مدیر صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری دوره مالی نه ماهه  
 منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

بازه زمانی	حجم معاملات	ملت	جم	گوهران	جم پیلن	وصندوق
سه ماهه سوم	خرید	۱۳,۶۱۶,۷۱۶	۹۶۰,۰۵۲	۵,۵۴۳,۸۵۱	۱,۸۶۲,۷۰۲	۱,۹۲۸,۴۳۷
	فروش	۱۴,۱۱۲,۷۳۳	۱,۳۵۶,۴۴۳	۶,۹۲۲,۳۱۲	۲,۰۹۲,۵۷۱	۱,۵۴۲,۲۰۰
	حجم کل معاملات	۲۷,۷۲۹,۴۴۹	۲,۳۱۶,۴۹۵	۱۲,۴۶۶,۱۶۳	۳,۹۵۵,۲۷۳	۳,۴۷۰,۶۳۷
	حجم معاملات بازار	۴۱۸,۷۶۱,۷۹۵	۲۹۹,۶۰۰,۷۵۳	۳۸۹,۶۶۲,۱۴۱	۱۴۸,۳۱۷,۴۲۷	۶۵۷,۴۵۷,۴۷۲
	درصد از حجم معاملات	٪ ۶,۶۲	۰,۷۷	٪ ۳,۱۹	٪ ۲,۶۶	٪ ۰,۵۲