

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری بخشی فلز فارابی

برای دوره نه ماهه منتهی به

۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۳

ثبت شده به شماره ۱۲۱۸۳ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

فهرست مطالب

مقدمه	۱
۱- تاریخچه فعالیت صندوق	۱
۲- معرفی صندوق	۱
۳- دوره فعالیت صندوق	۲
۴- هدف از تشکیل صندوق	۲
۵- موضوع فعالیت صندوق	۲
۶- محل اقامت صندوق	۲
۷- ارکان صندوق سرمایه گذاری	۲
۷-۱ مجمع صندوق	۳
۷-۲ مدیر صندوق	۳
۷-۳ متولی صندوق	۳
۷-۴ حسابرس صندوق	۳
۷-۵ بازارگردان صندوق	۳
۸- خالص ارزش روز دارایی های صندوق و واحدهای سرمایه گذاری	۴
۹- استراتژی صندوق	۴
۱۰- ترکیب دارایی های صندوق	۵
۱۱- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار	۶
۱۲- ارزش دارایی های صندوق	۶
۱۳- ترکیب سهام صندوق به تفکیک صنعت	۶
۱۴- بازدهی صندوق در فواصل مختلف	۷

مقدمه :

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری بخشی فلز فارابی، برای دوره مالی نامه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش میاندوره ای 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 بخشی فلز فارابی با شناسه ملی ۱۴۰۱۲۴۵۵۶۲۷ که در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۱۹ تحت شماره ۱۲۱۸۳ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۴۰۲/۰۵/۰۹ به شماره ۵۵۹۸۱ نزد مرجع ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است.

۲- معرفی صندوق :

جدول مشخصات صندوق سرمایه گذاری بخشی فلز فارابی	
نوع صندوق	در سهام - بخشی - صنعت فلز اساسی
تاریخ آغاز فعالیت	۱۴۰۲/۰۷/۲۳
مدیر صندوق	شرکت سبذگردان فارابی (سهامی خاص)
مدیر سرمایه گذاری	احمد خلج ، فاطمه فرح زادی ، سمانه مجیدی
متولی صندوق	موسسه حسابرسی بهراد مشار
حسابرس صندوق	موسسه حسابرسی رازدار
بازارگردان	صندوق اختصاصی بازارگردانی الگوریتمی امید فارابی
ضامن نقد شوندگی	ندارد
سایت صندوق	felez.irfarabi.ir

۳- دوره فعالیت صندوق :

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه نامحدود است.

(سال مالی صندوق بجز اولین سال صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای مهر ماه هر سال تا انتهای شهریور ماه هر سال است. با توجه به تاریخ تاسیس صندوق، این صورت مالی فاقد اقلام مقایسه‌ای می‌باشد...)

۴ - هدف از تشکیل صندوق :

هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد.

۵ - موضوع فعالیت صندوق :

برای نیل به این هدف ، صندوق در زمینه های زیر سرمایه گذاری می نماید:

* سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران

* حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران در صنعت فلزات اساسی

* اوراق بهادار با درآمد ثابت

* سپرده ها و گواهی سپرده بانکی

۶- محل اقامت صندوق :

مرکز اصلی صندوق در تهران، سعادت آباد، میدان طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه ۵ واقع شده است.

۷- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری:

صندوق سرمایه گذاری بخشی فلز فارابی که از این پس صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل می شود:

۷-۱- مجمع صندوق:

مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. فقط دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز با شرایط مذکور در ماده ۳۰ اساسنامه، در مجامع صندوق از حق رای برخوردار هستند.

در تاریخ صورت خالص دارایی ها دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده اند شامل اشخاص زیر است:

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱			
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سبدگردان فارابی	۱,۴۰۰,۰۰۰	۷۰
۲	شرکت کارگزاری فارابی	۶۰۰,۰۰۰	۳۰
	جمع	۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰

۷-۲- 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 طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه ۵

۷-۳- متولی صندوق:

موسسه حسابرسی بهراد مشار که در تاریخ ۱۳۷۷/۰۳/۰۶ به شماره ثبت ۱۳۸۹۸ و شناسه ملی ۱۰۸۴۰۰۱۷۹۹۹ نزد مرجع ثبت شرکت ها به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، میدان آرژانتین خ احمد قیصر کوچه ۱۹ پلاک ۵ واحدهای ۱۰۱-۱۰۲-۱۰۱-۲۰۲

۷-۴- 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 قیصر (بخارست)، کوچه نوزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ۷، واحد ۱۴

۷-۵- بازارگردان صندوق:

صندوق اختصاصی بازارگردانی الگوریتمی امید فارابی که در تاریخ ۱۳۹۸/۰۹/۰۲ به شماره ثبت ۴۸۶۵۱ و شناسه ملی ۱۴۰۰۸۷۸۱۰۲۸ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی بازارگردان عبارت است از: تهران، شهرک غرب، بلوار خوردین، خیابان توحید ۳، پلاک ۳

۸- خالص ارزش روز دارایی های صندوق و واحدهای سرمایه گذاری :

واحدهای سرمایه گذاری صندوق به دو دسته واحدهای سرمایه گذاری عادی و واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تقسیم می شود.

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱	
اطلاعات سرمایه گذاری صندوق	
خالص ارزش روز دارایی ها	۱۰,۳۶۳,۴۵۳,۳۸۵,۴۹۲ ریال
نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۲۹۲ ریال
نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۲۲۳ ریال
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۱۳۳,۳۷۲,۴۳۶ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری عادی	۱۳۱,۳۷۲,۴۳۶ واحد
تعداد واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۲,۰۰۰,۰۰۰ واحد

۹- 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

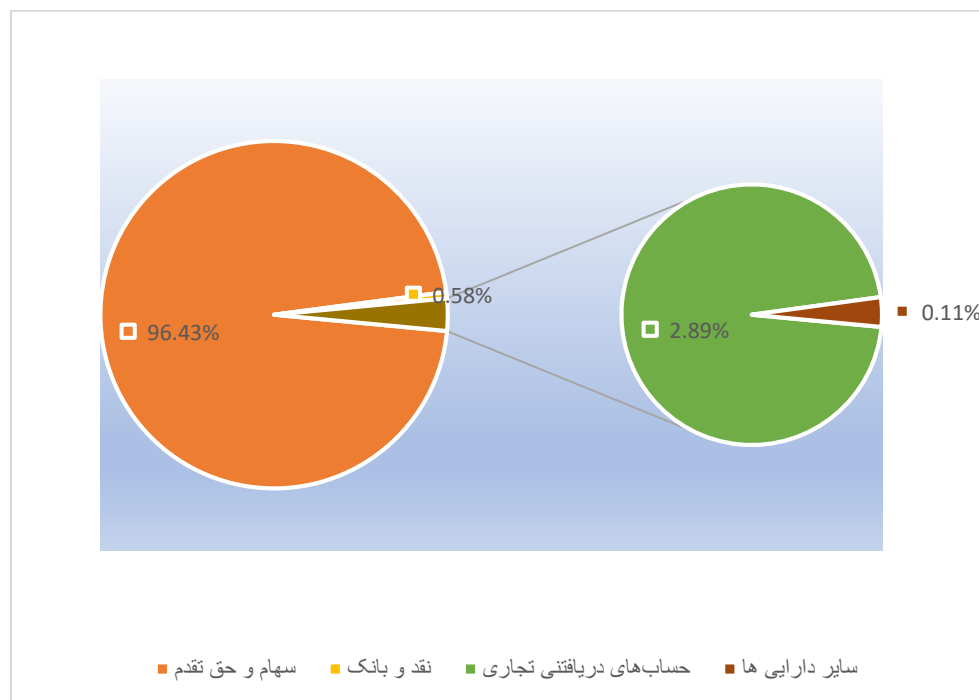
اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت های متعددی نسبت به سرمایه گذاری انفرادی سرمایه گذاران دارد: اولاً 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.

۱۰- ترکیب دارایی های صندوق :

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در دوره نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳ را نشان می دهد.

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی (ریال)	نسبت از کل دارایی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۱,۳۴۱,۰۳۸,۰۶۰,۰۵۹	۹۶,۴۳٪
نقد و بانک	۸,۰۶۳,۶۲۰,۱۹۲	۰,۵۸٪
حساب های دریافتی تجاری	۴۰,۱۶۳,۶۲۳,۷۲۶	۲,۸۹٪
سایر دارایی ها	۱,۴۷۲,۳۸۹,۴۷۲	۰,۱۱٪
جمع	۱,۳۹۰,۷۳۷,۶۹۳,۴۴۹	۱۰۰٪

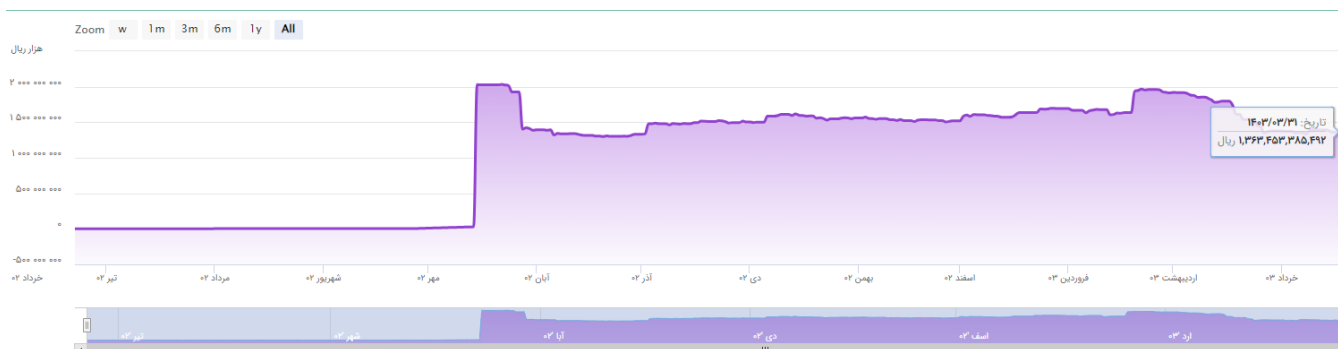
ترکیب دارایی های صندوق



۱۱- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار طی دوره مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

ردیف	سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار	دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱
۱	سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	۱۰,۲۰۰,۴۹۰,۵۸۰
۲	سود (زیان) ناشی از فروش حق تقدم شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	(۸,۵۳۳,۹۰۹)
۳	سود (زیان) حاصل از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	(۲۰,۰۸۹,۱۸۶,۳۵۰)
	جمع	(۹,۸۹۷,۲۱۹,۶۷۹)

۱۲- ارزش دارایی های صندوق در دوره مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳



۱۳- ترکیب سهام صندوق به تفکیک صنعت :

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد به کل سهام
فلزات اساسی	۱,۲۵۵,۴۲۵,۵۴۵,۷۶۴	۹۰,۲۷٪
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۳۶,۲۰۶,۴۸۱,۹۲۸	۲,۶٪
خودرو و ساخت قطعات	۱۹,۹۰۴,۸۹۵,۲۴۸	۱,۴۳٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۲,۵۴۲,۸۲۳,۴۹۵	۰,۹٪
منسوجات	۸,۵۷۶,۹۰۶,۴۹۵	۰,۶۲٪
استخراج کانه های فلزی	۷,۱۲۱,۴۴۸,۷۵۴	۰,۵۱٪
محصولات شیمیایی	۱,۲۵۹,۹۵۸,۳۷۵	۰,۰۹٪
جمع	۱,۳۴۱,۰۳۸,۰۶۰,۰۵۹	۹۶,۴۲٪

۱۴- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
روز اخیر	۱۴۰۳/۰۳/۳۰	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪(۰/۰۴۹)	٪۰
هفته گذشته	۱۴۰۳/۰۳/۲۴	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪(۱/۸۷۲)	٪(۱/۵۲۹)
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۳/۰۱	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪(۴/۸۱۴)	٪(۳/۳۱۹)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۱/۰۳	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪(۸/۹۴۳)	٪(۶/۸۸۴)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۲/۱۰/۰۲	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪(۸/۲۰۷)	٪(۷/۴۴۳)
یکسال اخیر	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪۰	٪۰
تازمان انتشار	۱۴۰۲/۰۷/۲۳	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	٪۰/۶۹۹	٪۲,۱
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			٪۴/۱۶	٪۳/۹۹
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			٪(۳/۴۱)	٪(۲/۵۱)