

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی

برای دوره مالی نه ماهه

منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۴

ثبت شده به شماره ۱۱۹۵۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

گزارش عملکرد دوره مالی نه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی، برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش دوره نه 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.

۱- تاریخچه فعالیت صندوق:

صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی در اجرای ماده ۲۸ و بند ۶ ماده ۷ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴ و ماده ۲ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید به منظور تسهیل اجرای سیاست های کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه ۱۳۸۸ با مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۱۱ تحت شماره ۵۳۲۳۴ و شناسه ملی ۱۴۰۱۰۸۵۱۱۰۲ نزد اداره ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری تهران ثبت شده و به عنوان نهاد مالی موضوع بند (ه) ماده ۱ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید به منظور تسهیل اجرای سیاست های کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه ۱۳۸۸ در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۲ تحت شماره ۱۱۹۵۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. مدت فعالیت این صندوق سرمایه گذاری به مدت نامحدود است.

۲- معرفی صندوق:

جدول مشخصات صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی	
نوع صندوق	قابل معامله در سهام
تاریخ آغاز فعالیت	۱۴۰۱/۰۲/۱۱
مدیر صندوق	شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص)
بازارگردان	صندوق اختصاصی بازارگردانی الگوریتمی امید فارابی
مدیران سرمایه گذاری	رضا محمدی، مهري قصابی، کوثر بابازاده
متولی صندوق	موسسه حسابرسی بهراد مشار
حسابرس صندوق	موسسه حسابرسی ارقام نگرآریا
ضامن نقد شوندگی	ندارد
سایت صندوق	https://salam.irfarabi.ir

۳- دوره فعالیت صندوق:

دوره فعالیت صندوق از تاریخ قید شده در مجوز فعالیت که توسط سازمان به نام صندوق صادر می شود؛ شروع شده و از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکت ها مدت فعالیت این صندوق به مدت نامحدود است.

۴- هدف از تشکیل صندوق:

هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری وجوه از سرمایه گذاران و اختصاص آن ها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده (۴) اساسنامه صندوق به منظور کاهش ریسک سرمایه گذاری، بهره گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه گذاران است.

۵- موضوع فعالیت صندوق:

سرمایه گذاری در انواع اوراق بهادار از جمله سهام و حق تقدم سهام پذیرفته شده در بورس تهران و فرابورس ایران، گواهی سپرده کالایی، اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده ها و گواهی های سپرده بانکی است. موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار با درآمد ثابت می باشد. خصوصیات دارایی های موضوع سرمایه گذاری یا تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید و حدنصاب سرمایه گذاری در هر یک از آن ها در امیدنامه ذکر شده است .

۶- محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق در تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسن طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه دوم، واحد ۳. با کد پستی ۱۹۹۸۷۱۴۳۶۳ واقع شده است.

گزارش عملکرد دوره مالی نه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

۷- ارکان صندوق سرمایه گذاری:

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

۷-۱- مجمع صندوق:

از اجتماع دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل

نصف به علاوه یک از کل واحد های ممتاز را در اختیار داشته باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند.

در تاریخ صورت خالص دارایی ها دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتاز به شرح زیر است:

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱			
ردیف	نام دارندگان واحد های ممتاز	تعداد واحد های ممتاز تحت تملک	درصد واحد های تحت تملک
۱	شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص)	۷۰۰,۰۰۰	۷۰
۲	شرکت کارگزاری فارابی (سهامی خاص)	۳۰۰,۰۰۰	۳۰
	جمع	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰

۷-۲- مدیر صندوق:

شرکت سبدگردان فارابی (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۰۷ با شماره ثبت ۵۷۰۴۰۵ و شناسه ملی ۱۴۰۰۹۶۸۰۹۶۰ نزد

مرجع ثبت شرکت های استان تهران 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.

۷-۳- متولی صندوق:

موسسه حسابرسی بهراد مشار است که با شماره ثبت ۱۳۸۹۸ نزد و شناسه ملی ۱۰۸۴۰۰۱۷۹۹۹ نزد مرجع ثبت شرکت های استان

تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، میدان آرژانتین، خیابان احمد قصیر، کوچه ۱۹، پلاک ۵، طبقه اول،

واحد های ۱۰۱-۱۰۲-۲۰۱-۲۰۲

گزارش عملکرد دوره مالی نه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

۴-۷- حسابرس صندوق:

موسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که با شماره ثبت ۱۷۷۵۵ و شناسه ملی ۱۰۱۰۰۶۱۷۶۳۲ نزد مرجع ثبت شرکت های استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، پایین تر از میدان توحید، نبش خیابان پرچم، پلاک ۶۸.

۵-۷- بازارگردان:

صندوق اختصاصی بازارگردانی الگوریتمی امید فارابی است که در تاریخ ۱۳۹۸/۰۹/۰۲ با شماره ثبت ۴۸۶۵۱ نزد مجمع ثبت شرکت ها به ثبت رسیده است. نشانی بازارگردان عبارت است از: تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه دوم، واحد ۳

۸- خالص ارزش روز دارایی های صندوق:

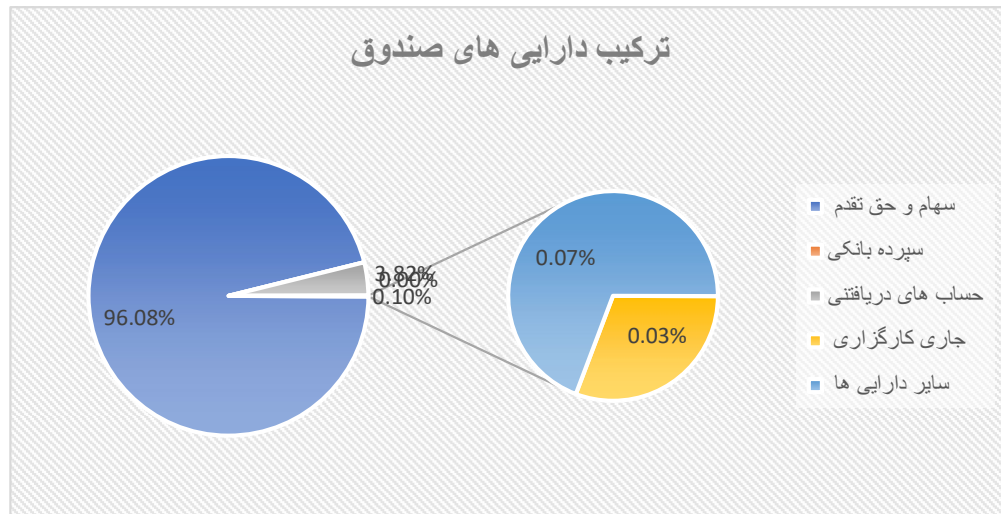
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱	
خالص ارزش دارایی ها	۵,۲۵۸,۱۴۵,۰۲۲,۴۱۹ ریال
تعداد کل واحد های سرمایه گذاری	۲۶۳,۴۱۶,۷۵۶ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری ممتاز	۱,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری عادی	۲۶۲,۴۱۶,۷۵۶ واحد
ارزش اسمی واحد های سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ واحد
نرخ صدور واحد های سرمایه گذاری	۲۰,۰۹۹ ریال
نرخ ابطال واحد های سرمایه گذاری	۱۹,۹۶۱ ریال

گزارش عملکرد دوره مالی نه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

۹- ترکیب دارایی های صندوق:

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در دوره مالی منتهی به ۳۱ تیر ۱۴۰۴ نشان می دهد.

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی-ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۵,۲۳۴,۰۲۰,۳۲۶,۰۹۷	۹۶,۰۸٪
سپرده بانکی	۲۹,۲۰۱,۴۴۹	۰,۰۰٪
حساب های دریافتنی	۲۰۷,۹۵۹,۷۸۶,۰۱۱	۳,۸۲٪
جاری کارگزاران	۱,۷۳۵,۸۳۴,۸۴۵	۰,۰۳٪
سایر دارایی ها	۳,۹۵۹,۶۶۵,۲۵۴	۰,۰۷٪
جمع	۵,۴۴۷,۷۰۴,۸۱۳,۶۵۶	۱۰۰٪



گزارش عملکرد دوره مالی نه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

۱۰- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار:

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱	
سود (زیان) فروش	مبلغ - ریال
سود حاصل از فروش سهام	۹۲۵,۱۳۰,۱۰۶,۲۲۱
زیان ناشی از فروش حق تقدم سهام	(۲۲۲,۷۲۸,۶۶۷)
سود حاصل از ابطال واحد صندوق های سرمایه گذاری	۹,۴۱۹,۹۴۷
سود حاصل از فروش گواهی سپرده کالایی	۱۲۰,۹۳۴,۸۹۱,۷۶۴
سود حاصل از فروش اوراق بهادار با درآمد ثابت	۵۶,۱۳۹,۷۲۱,۴۱۶
زیان ناشی از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	(۴۰۳,۲۷۵,۳۳۰)
جمع	۱,۱۰۱,۵۸۸,۱۳۵,۳۵۱

۱۱- تغییرات خالص ارزش دارایی های صندوق :



۱۲- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱		
صنعت	خالص ارزش فروش - ریال	درصد به کل سهام
محصولات شیمیایی	۱,۰۷۱,۲۳۶,۹۸۵,۳۵۵	٪۱۹,۶۶
فلزات اساسی	۶۶۵,۳۹۰,۴۹۹,۶۸۰	٪۱۲,۲۱
بانک ها و موسسات اعتباری	۴۹۲,۱۷۳,۲۰۶,۵۰۶	٪۹,۰۳
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۴۴۰,۱۷۶,۱۰۹,۳۳۸	٪۸,۰۸
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳۶۶,۵۸۵,۰۳۱,۸۸۳	٪۶,۷۳
سرمایه گذاری ها	۳۵۱,۲۳۵,۸۵۶,۶۷۴	٪۶,۴۵
خودرو و ساخت قطعات	۲۹۰,۱۶۲,۷۶۴,۶۵۲	٪۵,۳۳
استخراج کانه های فلزی	۲۸۹,۱۳۰,۰۸۰,۵۶۰	٪۵,۳۱
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۳۷,۵۲۱,۰۵۷,۹۳۵	٪۲,۵۲

گزارش عملکرد دوره مالی نه ماهه مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱

سیمان، آهک و گچ	۱۳۶,۱۰۶,۴۲۵,۶۱۶	٪۲,۵۰
سلامت انسان و مددکاری اجتماعی	۱۲۹,۱۶۶,۰۵۶,۶۵۰	٪۲,۳۷
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۲۷,۰۳۸,۳۶۲,۵۰۶	٪۲,۳۳
ماشین آلات و تجهیزات	۱۲۵,۶۲۱,۷۷۵,۸۰۹	٪۲,۳۱
خدمات فنی و مهندسی	۱۱۹,۶۳۳,۰۱۷,۶۴۶	٪۲,۲۰
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۰۹,۷۸۲,۶۰۹,۰۱۳	٪۲,۰۲
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۹۴,۴۷۳,۴۴۰,۰۱۶	٪۱,۷۳
مواد و محصولات دارویی	۸۲,۱۴۴,۴۲۱,۸۵۹	٪۱,۵۱
زراعت و خدمات وابسته	۷۶,۹۴۴,۳۸۰,۲۶۳	٪۱,۴۱
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی و نوری	۵۶,۶۰۴,۱۷۳,۸۴۱	٪۱,۰۴
کاشی و سرامیک	۳۰,۹۲۵,۴۸۶,۹۲۹	٪۰,۵۷
قند و شکر	۱۳,۳۶۴,۵۴۲,۵۰۲	٪۰,۲۵
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۰,۸۳۷,۱۳۳,۱۰۰	٪۰,۲۰
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۱۰,۷۵۸,۷۵۰,۳۴۰	٪۰,۲۰
سایر محصولات کانی غیرفلزی	۳,۰۳۱,۶۸۶,۸۱۲	٪۰,۰۶
استخراج ذغال سنگ	۲,۲۰۶,۷۹۱,۰۰۰	٪۰,۰۴
اطلاعات و ارتباطات	۱,۷۴۰,۰۸۴,۵۲۵	٪۰,۰۳
اختیار معامله سهام - بورس	۲۹,۵۹۵,۰۸۷	٪۰,۰۰
جمع	۵,۲۳۴,۰۲۰,۳۲۶,۰۹۷	٪۹۶,۰۸

۱۳- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۴/۳۱				
شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
هفته گذشته	۱۴۰۴/۰۴/۲۴	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	٪۱/۲۴۳	٪۲/۹۸۴
ماه گذشته	۱۴۰۴/۰۴/۰۱	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	٪(۱,۴۴۷)	٪(۴,۷۱۴)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۲/۰۳	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	٪(۹,۴۲۵)	٪(۹,۳۳۵)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۱۱/۰۴	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	٪(۴,۳۶۵)	٪۱/۰۵۱
یکسال اخیر	۱۴۰۳/۰۵/۰۱	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	٪۳۲/۲۶۹	٪۳۱/۱۱۵
بازدهی از شروع فعالیت	۱۴۰۱/۰۲/۱۱	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	٪۹۷/۳۶	٪۸۶/۶۷۳

۱۴- چشم انداز آینده بازار سرمایه ایران در سال ۱۴۰۴:

مقدمه

بازار سرمایه ایران در سال ۱۴۰۴ با توجه به تحولات داخلی و بین‌المللی، در مرحله‌ای حساس قرار دارد. نوسانات اخیر شاخص‌ها، رفتار سرمایه‌گذاران حقیقی، و تغییرات در سیاست‌های کلان اقتصادی، همه بر روند آتی این بازار تأثیرگذار خواهند بود. در این گزارش، مهم‌ترین عوامل تأثیرگذار بر بازار و چشم‌انداز کلی آن در سال جاری مورد بررسی قرار می‌گیرد.

۱. وضعیت شاخص کل و تحلیل روند

در ماه‌های آغازین سال ۱۴۰۴، شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران نوساناتی قابل توجه را تجربه کرده است. با وجود افت مقطعی در محدوده‌های مقاومتی، ساختار بازار همچنان نشانه‌هایی از توان بازگشت به روند صعودی در میان‌مدت را نشان می‌دهد. بسیاری از تحلیل‌گران تکنیکال، بازار را در فاز اصلاح موقت ارزیابی می‌کنند.

۲. جریان سرمایه و رفتار سرمایه‌گذاران

یکی از نکات مثبت در ماه‌های اخیر، افزایش ورود سرمایه حقیقی به بازار بوده است. این امر بیانگر افزایش سطح اطمینان فعالان اقتصادی نسبت به آینده بازار سرمایه است. اگر این روند تقویت شود، می‌تواند به عنوان موتور محرکه‌ای برای رشد شاخص‌ها عمل کند.

۳. صنایع پیشرو و فرصت های سرمایه گذاری

در میان صنایع فعال در بازار سرمایه، گروه های فناوری اطلاعات، انرژی های تجدیدپذیر، فلزات اساسی و پتروشیمی از ظرفیت های بالایی برای رشد برخوردارند. این صنایع نه تنها از نظر سودآوری، بلکه از منظر توسعه صادرات نیز مزیت رقابتی دارند و می توانند گزینه های مناسبی برای سرمایه گذاری بلندمدت باشند.

۴. چالش های ساختاری و ریسک های کلان

بازار سرمایه ایران همچنان با چالش هایی نظیر نرخ بالای تورم، ناترازی بودجه دولت، محدودیت های تأمین انرژی برای صنایع بزرگ، ضعف شفافیت اطلاعاتی، و ریسک های سیاسی و بین المللی مواجه است. این عوامل می توانند باعث بی ثباتی در رفتار بازار شده و موجب احتیاط بیشتر سرمایه گذاران گردند.

۵. جمع بندی و چشم انداز کلی

در مجموع، پیش بینی می شود که بازار سهام ایران در سال ۱۴۰۴ در محدوده ای متعادل نوسان کند و در صورت بهبود متغیرهای اقتصادی و سیاسی، امکان رشد نسبی شاخص ها وجود دارد. چشم انداز بازار در این دوره «محتاطانه خوش بینانه» ارزیابی می شود و توصیه می شود سرمایه گذاران با رویکرد تحلیلی، متنوع سازی پرتفوی و مدیریت ریسک فعال به فعالیت در این بازار بپردازند.

مهر و امضاء

نام و نام خانوادگی نماینده

نام رکن

ارکان صندوق

وحید حسن پور دبیر

شرکت سبد گردان فارابی

مدیر صندوق