

سبدگردان فارابی

(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۷۰۴۰۵



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی

سال مالی منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

ثبت شده به شماره ۱۱۹۵۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار

مقدمه:

بدین وسیله گزارش فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی، برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰ 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، مهری 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.

۷ - ارکان صندوق سرمایه گذاری:

صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود 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

۷-۴- 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.

۷-۵- 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 دو م، واحد ۳

۸- خالص ارزش روز دارایی های صندوق:

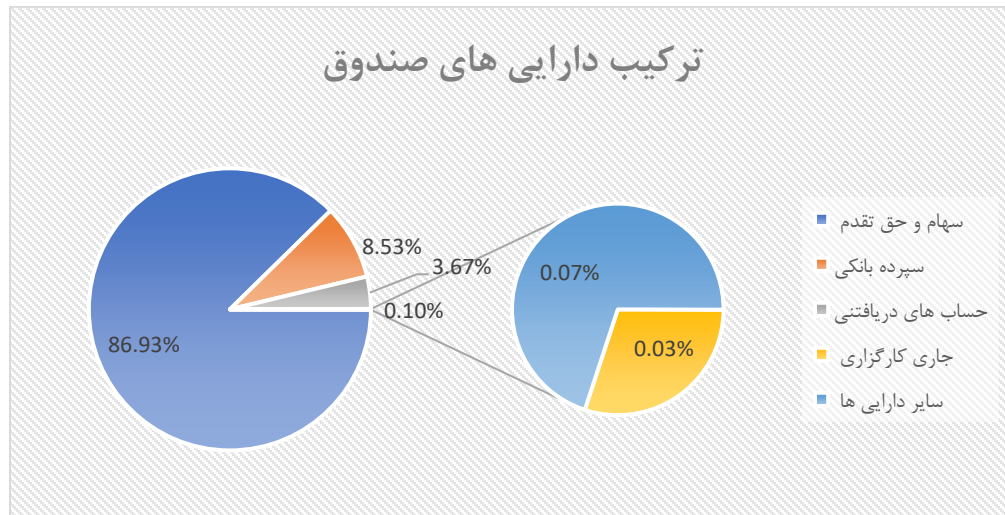
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰	
خالص ارزش دارایی ها	۵,۸۶۵,۳۳۵,۱۳۳,۸۳۴ ریال
تعداد کل واحد های سرمایه گذاری	۲۷۱,۵۹۶,۷۵۶ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری ممتاز	۱,۰۰۰,۰۰۰ واحد
تعداد واحد های سرمایه گذاری عادی	۲۶۱,۵۹۶,۷۵۶ واحد
ارزش اسمی واحد های سرمایه گذاری	۱۰,۰۰۰ واحد
نرخ صدور واحد های سرمایه گذاری	۲۱,۷۲۶ ریال
نرخ ابطال واحد های سرمایه گذاری	۲۱,۵۹۶ ریال

گزارش عملکرد سال مالی مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰

۹- ترکیب دارایی های صندوق:

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در سال مالی منتهی به ۳۰ مهر ۱۴۰۴ نشان می دهد.

سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰		
عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی-ریال	نسبت از کل دارایی به ارزش روز
سهام و حق تقدم	۵,۱۵۰,۲۸۸,۸۱۴,۹۹۹	٪۸۶.۹۳
سپرده بانکی	۵۰۵,۵۸۴,۷۱۶,۶۰۹	٪۸.۵۳
حساب های دریافتی	۲۱۷,۵۷۲,۰۹۰,۳۸۳	٪۳.۶۷
جاری کارگزاران	۴۵,۷۵۵,۴۰۷,۰۳۴	٪۰.۰۳
سایر دارایی ها	۵,۷۰۳,۰۸۲,۹۷۴	٪۰.۰۷
جمع	۵,۹۲۴,۹۰۴,۱۱۱,۹۹۹	٪۱۰۰

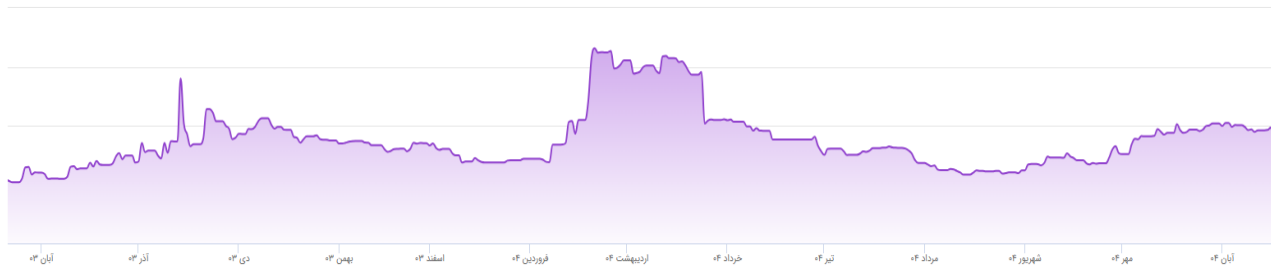


گزارش عملکرد سال مالی مدیر صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰

۱۰- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار:

سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰	
سود (زیان) فروش	مبلغ - ریال
سود حاصل از فروش سهام	۶۳۰,۹۱۱,۴۷۳,۶۱۵
سود حاصل از فروش حق تقدم سهام	(۱,۳۶۹,۵۲۴,۲۵۷)
سود حاصل از ابطال واحد صندوق‌های سرمایه گذاری	۹,۹۱۱,۹۴۰
سود حاصل از فروش گواهی سپرده کالایی	۵۹,۶۸۳,۸۲۲,۹۱۵
سود حاصل از فروش اوراق بهادار با درآمد ثابت	(۶۱,۳۷۵,۰۰۰)
زیان ناشی از سررسید و فروش اوراق اختیار معامله	(۵۷۵,۳۵۶,۴۶۶)
جمع	۶۸۸,۵۹۸,۹۵۲,۷۴۷

۱۱- تغییرات خالص ارزش دارایی های صندوق :



۱۲- ترکیب دارایی های صندوق به تفکیک صنعت :

سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰		
صنعت	خالص ارزش فروش - ریال	درصد به کل سهام
مواد و محصولات دارویی	۱۰۵,۶۶۶,۳۳۳,۴۳۲	۱.۷۸٪
خودرو و ساخت قطعات	۲۸۳,۲۲۰,۶۳۵,۹۱۷	۴.۷۸٪
بانکها و موسسات اعتباری	۴۲۱,۸۲۶,۰۱۲,۳۱۹	۷.۱۱٪
فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۴۶,۳۴۸,۵۰۰,۵۰۷	۲.۴۷٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۴۹۶,۵۰۳,۲۳۱,۰۲۶	۸.۳۷٪
محصولات شیمیایی	۱,۰۲۹,۵۲۰,۴۶۱,۱۱۵	۱۷.۳۶٪
سایر محصولات کانی غیرفلزی	۹۳,۱۸۷,۸۵۶,۲۹۴	۱.۵۷٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۸۲,۶۲۸,۵۳۴,۷۶۳	۱.۳۹٪
استخراج کانه های فلزی	۱۴۹,۳۹۸,۳۰۴,۵۰۳	۲.۵۲٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۸۰,۶۹۶,۷۵۴,۲۷۳	۳.۰۵٪
کاشی و سرامیک	۱۳۶,۶۹۶,۳۷۶,۵۱۹	۲.۳۱٪
سرمایه گذاریها	۶۷۴,۴۱۰,۷۹۴,۰۲۴	۱۱.۳۷٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۱۸۵,۴۳۰,۲۶۹,۹۷۴	۳.۱۳٪
سیمان، آهک و گچ	۱۸۸,۳۳۸,۱۲۲,۵۶۹	۳.۱۸٪
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۳۲,۱۷۱,۴۳۴,۲۰۰	۰.۵۴٪
خدمات فنی و مهندسی	۱۱۶,۲۱۰,۰۴۱,۴۶۱	۱.۹۶٪
فلزات اساسی	۲۵۹,۶۸۸,۵۴۹,۷۱۶	۴.۳۸٪
سلامت انسان و مددکاری اجتماعی	۱۳۰,۴۲۲,۵۳۵,۸۰۰	۲.۲۰٪
منسوجات	۳۹,۰۴۲,۳۰۷,۸۰۰	۰.۶۶٪
تولید محصولات کامپیوتری الکترونیکی ونوری	۴۲,۵۳۴,۹۲۸,۳۲۰	۰.۷۲٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۱۲,۶۸۱,۰۰۹,۹۱۸	۰.۲۱٪
زراعت و خدمات وابسته	۸۱,۶۵۱,۵۷۴,۰۶۲	۱.۳۸٪
لاستیک و پلاستیک	۱۱۴,۳۰۵,۵۰۰,۳۱۰	۱.۹۳٪
جمع	۵,۰۰۲,۵۸۰,۰۶۸,۸۲۲	٪۸۴.۳۶

۱۳- بازدهی صندوق در فواصل مختلف:

سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۷/۳۰				
شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
هفته گذشته	۱۴۰۴/۰۷/۲۳	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	%۳/۱۷۲	%۳/۵۴
ماه گذشته	۱۴۰۴/۰۴/۰۱	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	%۲۰/۱۸۵	%۲۱/۲۴۵
۳ ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۲/۰۳	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	%۸/۴۱۴	%۸/۵۶
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۱۱/۰۴	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	%(۱.۹۹۷)	%(۱.۸۱۴)
یکسال اخیر	۱۴۰۳/۰۵/۰۱	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	%۴۰/۵۱۷	%۵۴/۴۷۳
بازدهی از شروع فعالیت	۱۴۰۱/۰۲/۱۱	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	%۱۱۳/۵۲۶	%۱۰۲/۱۵۸

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 میان مدت 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 فرصت‌های سرمایه‌گذاری

در میان صنایع فعال در بازار سرمایه، گروه‌های فناوری اطلاعات، انرژی‌های تجدیدپذیر، فلزات اساسی و پتروشیمی از ظرفیت‌های بالایی برای رشد برخوردارند. این صنایع نه تنها از نظر سودآوری، بلکه از منظر توسعه صادرات نیز مزیت رقابتی دارند و می‌توانند گزینه‌های مناسبی برای سرمایه‌گذاری 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 سید گردان فارابی

مدیر صندوق

