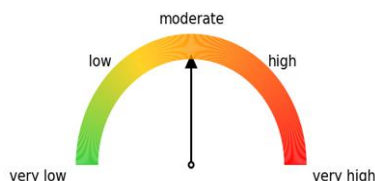


گزارش درجه بندی عملکرد صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی (در سهام)
تاریخ گزارش: ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

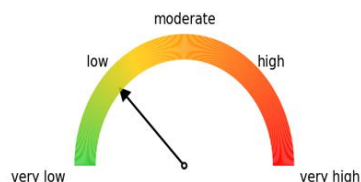
گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۲/۲۹

مشخصات صندوق

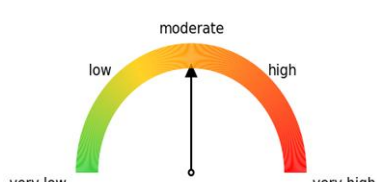
درجه بندی عملکرد یکسال اخیر		نام صندوق	سلام فارابی
		تاریخ آغاز فعالیت	۱۴۰۱/۰۲/۱۱
		نوع صندوق سرمایه گذاری	در سهام
		پیش بینی سود	ندارد
		سود نقدی	ندارد
		مدیر صندوق	سیدگردان فارابی
		بازارگردانی	صندوق اختصاصی بازارگردانی الگوریتمی امید فارابی
		ضامن نقدشوندگی	ندارد
		متولی	موسسه حسابرسی بهراد مشار
		حسابرس	موسسه حسابرسی رازدار



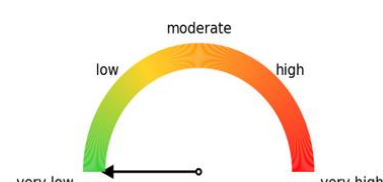
ریسک تمرکز سرمایه گذاری ها



ریسک نقدشوندگی دارایی ها و تمرکز سرمایه گذاران



ریسک نقدشوندگی دارایی ها



ریسک تمرکز سرمایه گذاران

گروه همتای فراگیر:		صندوق های سرمایه گذاری در سهام		تعداد اعضا:	۱۱۳
درجه بندی عملکرد یک ساله با لحاظ عوامل تعدیل گر		درجه بندی عملکرد یک ساله بدون لحاظ عوامل تعدیل گر			
۱۴۰۴/۱۲/۲۹		۱۴۰۴/۰۹/۳۰		۱۴۰۴/۱۲/۲۹	۱۴۰۴/۰۹/۳۰
		NA			
متوسط		NA		متوسط	ضعیف

وضعیت کیفیت مدیریت: کیفیت مدیریت صندوق در سطح خوب ارزیابی می شود.

گزارش رتبه بندی کیفیت مدیریت صندوق به پیوست است.

توزیع ریسک های تمرکز و نقدشوندگی در صندوق های گروه همتای فراگیر

ریسک تمرکز سبد دارایی ها		ریسک نقدشوندگی سبد دارایی ها		سطح ریسک
تعداد صندوق	نسبت از کل	تعداد صندوق	نسبت از کل	
۷	۶٪	۱۰	۹٪	بسیار زیاد
۹	۸٪	۱۷	۱۵٪	زیاد
۵۸	۵۱٪	۳۰	۲۷٪	متوسط
۳۲	۲۸٪	۳۵	۳۱٪	کم
۷	۶٪	۲۱	۱۹٪	بسیار کم
۱۱۳	۱۰۰٪	۱۱۳	۱۰۰٪	جمع

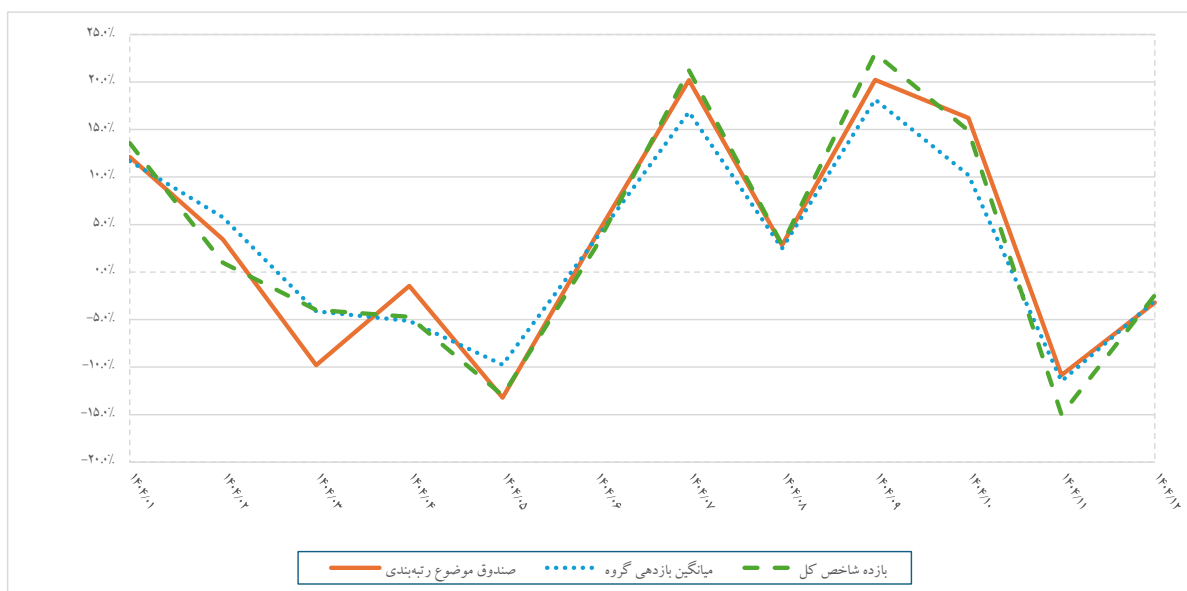
گزارش درجه بندی عملکرد صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی (در سهام)

تاریخ گزارش: ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۲/۲۹

منتهی به ۱۴۰۴/۱۲/۲۹			
تحلیل ریسک/ بازدهی	سه سال اخیر	دو سال اخیر	یک سال اخیر
بازدهی صندوق-سالانه	۲۵.۵٪	۲۷.۴٪	۳۸.۳٪
بازدهی بدون ریسک سالانه	۳۱.۴٪	۳۳.۸٪	۳۵.۶٪
بازدهی مازاد-سالانه	-۵.۸٪	-۶.۵٪	۲.۷٪
میانگین گروه همتای فراگیر	-۷.۱٪	-۶.۳٪	۰.۲٪
میانگین گروه همتای فراگیر	-۷.۶٪	-۶.۴٪	-۱.۴٪
حداکثر گروه همتای فراگیر	۱۲.۷٪	۲۰.۰٪	۳۶.۴٪
حداقل گروه همتای فراگیر	-۳۲.۰٪	-۴۰.۱٪	-۵۰.۹٪
ریسک نامطلوب	۳.۶۲٪	۳.۸۳٪	۴.۲۹٪
میانگین گروه همتای فراگیر	۳.۶٪	۳.۷٪	۴.۰٪
میانگین گروه همتای فراگیر	۳.۷٪	۳.۸٪	۴.۰٪
حداکثر گروه همتای فراگیر	۵.۶٪	۵.۸٪	۶.۴٪
حداقل گروه همتای فراگیر	۲.۴٪	۱.۹٪	۰.۱٪

بازدهی ماهانه صندوق در مقایسه با میانگین گروه همتای فراگیر و بازده شاخص بورس اوراق بهادار



تاریخچه درجه بندی عملکرد

دوره مورد ارزیابی	تعداد صندوق هم گروه	با لحاظ عوامل تعدیل گر			بدون لحاظ عوامل تعدیل گر		
		۱۴۰۴/۱۲/۲۹	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۴/۱۲/۲۹	۱۴۰۴/۰۹/۳۰
سه ساله	۸۴	3.5 ★	NA	NA	NA	2.5 ★	1.5 ★
دو ساله	۹۷	3 ★	NA	NA	NA	2 ★	1.5 ★
یک ساله	۱۱۳	3 ★	NA	NA	NA	2 ★	1 ★

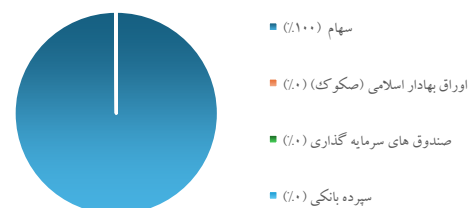
گزارش درجه بندی عملکرد صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی (در سهام)

تاریخ گزارش: ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

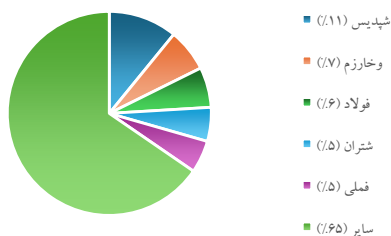
گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۲/۲۹

اطلاعات واحدهای سرمایه‌گذاری (در تاریخ‌های مذکور)	۱۴۰۴/۱۲/۲۹	۱۴۰۴/۰۹/۳۰	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱۴۰۴/۰۳/۳۱
خالص ارزش دارایی‌ها (میلیون ریال)	۵,۸۶۴,۹۸۴	۶,۵۷۱,۹۱۴	۴,۷۳۲,۳۱۵	۵,۵۲۷,۸۶۱
ارزش ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال)	۲۶,۷۸۱	۲۶,۶۹۹	۱۷,۹۶۹	۲۰,۲۵۶
تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری عادی	۲۱۸,۹۹۶,۷۵۶	۲۴۶,۱۴۶,۷۵۶	۲۶۳,۳۶۶,۷۵۶	۲۷۲,۹۰۱,۷۵۶
اطلاعات مالی (در دوره سه‌ماهه منتهی به تاریخ‌های مذکور) (میلیون ریال)	۱۴۰۴/۱۰/۳۰	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	۱۴۰۴/۰۴/۳۱	۱۴۰۴/۰۱/۳۱
جمع درآمدها	۲,۴۱۷,۴۱۹	۴۹۴,۹۷۵	(۴۰۷,۲۹۴)	۳۲۳,۱۹۰
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۶۰۹,۶۳۳	(۴۷۸,۲۱۷)	۳۹۰,۸۰۵	۳۸۸,۹۴۱
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱,۷۲۷,۴۹۵	۷۶۱,۸۹۳	(۱,۰۳۳,۲۸۴)	(۱۵۱,۲۴۸)
سود سهام	۵۶,۴۸۶	۲۰۱,۹۷۹	۲۲۶,۹۳۳	۶۲,۰۰۶
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا سود سپرده بانکی	۱۸,۴۰۴	۸,۴۵۲	۴,۱۳۱	۱۹,۳۴۷
سایر درآمدها	۵,۴۰۱	۸۶۸	۴,۱۲۱	۴,۱۴۴
نسبت هزینه به ارزش خالص دارایی‌ها (درصد)	۱.۱۳۶٪	۰.۵۱۷٪	۰.۹۶۸٪	۰.۶۵۸٪
هزینه کارمزد ارکان	۵۰,۰۱۴	۳۱,۰۴۵	۴۳,۵۷۱	۳۳,۱۸۵
هزینه معاملات	۱۱,۴۷۷	۶۳۰	۱۸۹	۱۵۵
سایر هزینه‌ها	۵,۱۳۷	۲,۲۷۸	۲,۰۴۰	۳,۰۳۴

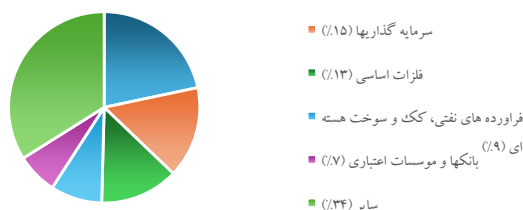
ترکیب کل دارایی‌ها



پنج شرکت با بیشترین مبلغ سرمایه‌گذاری



پنج صنعت با بیشترین درصد سرمایه‌گذاری



درجه‌بندی صندوق بر مبنای سایر معیارهای ارزیابی عملکرد (بر اساس عملکرد سه ساله بدون لحاظ عوامل تعدیل‌گر)

شرح	امتیاز پرهان	مورنینگ استار	نسبت شارپ بر مبنای ...		موردبگیانی - موردبگیانی	آلفا	ترینور	T ^۲	نسبت اطلاعات
			انحراف معیار	نسبت انحراف					
حداکثر گروه همتای فراگیر	۰.۱۳۳۷	۰.۰۴	۰.۱۴	۰.۳۴	۱.۴۶	۰.۰۱	۰.۰۱	۰.۰۲	۰.۳۸
حداقل گروه همتای فراگیر	۰.۰۶۷۵۹	۰.۳۰	۰.۲۴	۰.۵۵	۰.۷۱	۰.۰۲	۰.۰۳	۰.۰۳	۰.۳۷
میانگین گروه همتای فراگیر	۰.۰۳۸۲۹	۰.۱۳	۰.۰۲	۰.۰۴	۰.۰۴	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰
میانه گروه همتای فراگیر	۰.۰۳۶۸۴	۰.۱۲	۰.۰۲	۰.۰۵	۰.۱۴	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۳
امتیاز صندوق موضوع رتبه‌بندی	۰.۰۳۶۳۵	۰.۱۲	۰.۰۰	۰.۰۱	۰.۰۲	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۰	۰.۰۴
جایگاه صندوق موضوع رتبه‌بندی	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۲.۵ ★	۳ ★

گزارش درجه‌بندی عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی (در سهام)

تاریخ گزارش: ۱۴۰۵/۰۳/۳۱

گزارش سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۱۲/۲۹

توضیحات:

* **مقیاس درجه‌بندی:** درجه‌بندی عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری بر اساس شاخص ارزیابی عملکرد برهان بدون لحاظ عوامل تعدیل‌گر، حداقل نیم و حداکثر چهارستاره و با لحاظ عوامل تعدیل‌گر، عملکرد حداقل نیم و حداکثر پنج ستاره تعیین می‌شود (نیم ستاره ضعیف‌ترین و پنج ستاره بهترین عملکرد است).
* اطلاعات بدون تاریخ، مربوط به تاریخ ۱۴۰۴/۱۲/۲۹ است.

* نرخ بازده بدون ریسک براساس بازدهی اوراق خزانه اسلامی با سررسید شش ماه تا یک سال در هر دوره محاسبه می‌شود.
* **علامت NA:** نشان می‌دهد که اطلاعات مورد نظر در دسترس نمی‌باشد و در صورتی که اطلاعات مورد نظر در رتبه‌بندی عملکرد صندوق موضوع رتبه‌بندی تاثیرگذار باشد کمترین امتیاز لحاظ می‌گردد.

برای اطلاعات بیشتر در مورد معیار درجه‌بندی عملکرد، به شیوه‌نامه درجه‌بندی عملکرد صندوق‌های سرمایه‌گذاری شرکت رتبه‌بندی اعتباری برهان، منتشره در تارنمای این شرکت به نشانی www.bcr.ir، بخش قوانین، مقررات و ضوابط / شیوه‌نامه‌های رتبه‌بندی مراجعه فرمائید.

بیانیه سلب مسئولیت :

* عملکرد صندوق در آینده می‌تواند متفاوت از عملکرد گذشته صندوق باشد. بنابراین سرمایه‌گذاران در تصمیم‌گیری باید به عوامل دیگری غیر از عملکرد گذشته توجه داشته باشند.
* درجه‌بندی ارائه شده توسط شرکت رتبه‌بندی اعتباری برهان، توصیه‌ای به سرمایه‌گذاری، نگهداری یا واگذاری واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق محسوب نمی‌شود.
* این گزارش بر مبنای اطلاعات دریافتی از منابع معتبر از جمله مدیر صندوق، سازمان بورس و اوراق بهادار و اطلاعات منتشره در تارنماهای رسمی صندوق، شرکت فرابورس ایران و سامانه اطلاع‌رسانی ناشران (www.codal.ir) تهیه شده است. مسئولیت صحت اطلاعات منابع مذکور، به عهده برهان نیست.