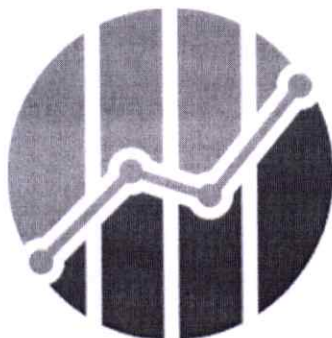




بسمه تعالی



صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

گزارش عملکرد

منتهی به ۱۴۰۴/۱۰/۳۰

مشاور سرمایه گذاری
فراز ایده نوآفرین تک
(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۱۸۸۹۲



فهرست مطالب

۱	مقدمه
۱	صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری در یک نگاه
۱	ارکان صندوق
۱	گروه مدیران سرمایه گذاری
۲	اهداف صندوق
۲	ریسک سرمایه گذاری در صندوق
۳	مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۳	ترکیب دارایی های صندوق
۴	آخرین وضعیت صندوق
۴	بازدهی صندوق
۵	تغییر کل خالص ارزش دارایی های صندوق
۶	ترکیب دارایی های سهامی صندوق



مقدمه

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری در تاریخ ۱۳۹۹/۰۶/۰۲ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به‌عنوان صندوق سرمایه‌گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذرماه ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۱۷۳۶ نزد سبا به ثبت رسیده است. فعالیت این صندوق تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار انجام شده و متولی صندوق نیز به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی‌های صندوق نیز توسط مدیر سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. علاقه‌مندان به سرمایه‌گذاری در این صندوق، واحدهای سرمایه‌گذاری عادی صندوق را خریداری می‌کنند. خرید و فروش های واحدهای سرمایه‌گذاری در بورس به واسطه کارگزاران دارای مجوز انجام می‌شود. سرمایه‌گذاری در این صندوق بدون ریسک نیست و با توجه به اینکه واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در بورس مورد داد و ستد قرار می‌گیرد، این امکان وجود دارد که نوسانات عرضه و تقاضا در بازار، قیمت واحدهای سرمایه‌گذاری را دستخوش نوسان کند.

صندوق سرمایه‌گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری در یک نگاه

- نوع صندوق: سهامی قابل معامله
- تاریخ آغاز فعالیت: ۱۳۹۹/۰۶/۰۲
- تاریخ ثبت نزد اداره ثبت شرکت‌ها: ۱۳۹۹/۰۴/۲۸

ارکان صندوق

- مدیر صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)
- متولی صندوق: مؤسسه حسابرسی و بهبود سیستم های مدیریت حسابرسیین
- بازارگردان: اختصاصی بازارگردانی صندوق ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
- حسابرس: مؤسسه حسابرسی هشیار بهمند
- تارنما: modirfund.ir

گروه مدیران سرمایه‌گذاری

- محسن مهدی نسب
- شهاب خدابخشیان خوانساری
- معصومه میرمحمدی



اهداف صندوق:

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها و مدیریت این سبد است. باتوجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد:

- ✓ هزینه به‌کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد.
- ✓ صندوق از جانب سرمایه‌گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.
- ✓ امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

ریسک سرمایه‌گذاری در صندوق:

تمهیدات لازم به‌عمل آمده است تا سرمایه‌گذاری در صندوق سودآور باشد ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه‌گذاری صندوق همواره وجود دارد؛ بنابراین سرمایه‌گذاران باید به همه ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق از جمله ریسک‌های زیر توجه ویژه مبذول دارند.

- ✓ **کاهش ارزش دارایی‌های صندوق:** صندوق عمدتاً در سهام شرکت‌ها سرمایه‌گذاری می‌کند. ارزش بازار سهام شرکت‌ها تابع عوامل متعددی از جمله شرایط سیاسی، اقتصادی، اجتماعی، وضعیت صنعت موضوع فعالیت و وضعیت خاص شرکت است. قیمت سهام در بازار می‌تواند کاهش یابد و در اثر آن صندوق و سرمایه‌گذاران آن متضرر شوند.
- ✓ **نکول اوراق با درآمد ثابت:** اوراق مشارکت شرکت‌ها می‌تواند بخشی از دارایی‌های صندوق را تشکیل دهد. گرچه صندوق در اوراق مشارکتی سرمایه‌گذاری می‌کند که اصل و سود آن توسط یک مؤسسه معتبر تضمین شده باشد. ولی این احتمال وجود دارد که ناشر و ضامن به تعهدات خود در پرداخت به‌موقع سود و اصل اوراق مشارکت مذکور عمل ننمایند.
- ✓ **نوسان بازده بدون ریسک:** در صورتی که نرخ بازده بدون ریسک (نظیر سود علی‌الحساب اوراق مشارکت دولتی) در انتشارهای بعدی توسط ناشر افزایش یابد، قیمت اوراق مشارکت در بازار کاهش می‌یابد. اگر صندوق در این نوع اوراق مشارکت سرمایه‌گذاری کرده باشد و بازخورد آن به قیمت معین توسط یک مؤسسه معتبر نظیر بانک تضمین شده باشد، با افزایش نرخ اوراق بدون ریسک، صندوق ممکن است متضرر شود.
- ✓ **ریسک کاهش ارزش بازاری واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق:** باتوجه به آنکه واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در بورس یا بازار خارج از بورس مربوطه مورد دادوستد قرار می‌گیرد، این امکان وجود دارد که نوسانات میزان عرضه و تقاضا در بازار، قیمت واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق را نیز دستخوش نوسان کند. هرچند انتظار بر آن است که قیمت واحدهای سرمایه‌گذاری نزدیک به ارزش خالص دارایی آن‌ها باشد اما این امکان وجود دارد که قیمت بازاری واحدهای سرمایه‌گذاری به دلیل عملکرد عرضه و تقاضا بیشتر یا کمتر از ارزش خالص دارایی واحدهای سرمایه‌گذاری شود. بدین ترتیب حتی در صورت عدم کاهش ارزش خالص دارایی‌های صندوق، ممکن است سرمایه‌گذار با کاهش قیمت واحدهای سرمایه‌گذاری نسبت به قیمت خرید خود مواجه شده و از این بابت دچار زیان شود.



مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز

ارزش اسمی هر واحد سرمایه گذاری صندوق برابر با ده هزار ریال است و این واحدها به دو نوع عادی و ممتاز تقسیم می شود. واحدهای عادی قابل انتقال و قابل ابطال می باشند.

واحدهای سرمایه گذاری ممتاز، غیر قابل ابطال و قابل انتقال به غیر هستند. تعداد این واحدها ۱۰.۰۰۰.۰۰۰ واحد است که از حق رای در مجمع برخوردارند که این واحدها قبل از شروع پذیره نویسی اولیه توسط موسسان صندوق خریداری شده است.

اسامی و مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری:

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه گذاری ممتاز	تعداد	درصد
۱	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشستگی کشوری	۵.۰۰۰.۰۰۰	۵۰
۲	شرکت خدمات مدیریت صندوق بازنشستگی کشوری	۳.۰۰۰.۰۰۰	۳۰
۳	کارگزاری صباجهاد	۱.۰۰۰.۰۰۰	۱۰
۴	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک(فاین تک)	۱.۰۰۰.۰۰۰	۱۰

ترکیب دارایی های صندوق در پایان دوره ۱۴۰۴/۱۰/۳۰

دارایی	مبلغ - ریال	درصد از کل دارایی ها
سهام	۱۲,۲۷۰,۶۰۱,۴۲۵,۶۴۴	٪۸۶.۳۹
اوراق بهادار با درآمد ثابت	۷۴,۹۶۷,۳۱۵,۶۴۷	٪۰.۵۳
اوراق گواهی سپرده کلایی	۶۵۱,۷۲۱,۷۰۴,۹۶۰	٪۴.۵۹
سپرده و گواهی سپرده بانکی	۴۰۴,۹۶۸,۸۴۸,۴۱۲	٪۲.۸۵
سایر	۸۰۱,۵۰۳,۱۱۷,۱۷۴	٪۵.۶۴



آخرین وضعیت صندوق

آخرین وضعیت صندوق (در تاریخ ۱۴۰۴/۱۰/۳۰) در جدول زیر منعکس شده است:

۱۳,۱۱۵,۵۵۷,۸۲۱,۱۰۸	کل خالص ارزش دارایی‌های صندوق
۳۲,۳۵۸	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه‌گذاری
۳۲,۰۳۷	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری
۴۰۹,۳۹۲,۵۲۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران

بازدهی صندوق

به‌طور کلی هدف از تشکیل صندوق سرمایه‌گذاری، تأمین بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاران است. در نمودار زیر خالص ارزش روزانه هر واحد سرمایه‌گذاری برای دوره یکساله منتهی به ۱۴۰۴/۱۰/۳۰ نمایش داده شده است.





تغییر کل خالص ارزش دارایی های صندوق

روند تغییر کل خالص ارزش دارایی های صندوق در نمودار زیر نشان داده شده است.





ترکیب دارایی های سهامی صندوق:

ردیف	نام صنعت	ارزش روز کل	درصد از کل دارایی های صندوق به ارزش روز
۱	محصولات شیمیایی	۲,۵۳۶,۲۳۴,۲۰۱,۹۹۳	۱۷.۸۶
۲	فلزات اساسی	۲,۲۱۲,۰۴۰,۲۵۷,۷۳۷	۱۵.۵۷
۳	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱,۶۴۷,۶۶۳,۳۱۸,۵۱۹	۱۱.۶۰
۴	شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۱,۰۵۶,۴۲۳,۹۹۹,۱۱۷	۷.۴۴
۵	سرمایه گذاریها	۱,۰۳۲,۴۶۰,۷۳۸,۸۰۰	۷.۲۷
۶	بانکها و موسسات اعتباری	۷۸۵,۰۶۱,۴۱۴,۸۹۰	۵.۵۳
۷	سیمان، آهک و گچ	۶۲۳,۰۶۷,۲۱۳,۸۶۴	۴.۳۹
۸	استخراج کانه های فلزی	۵۶۳,۰۹۵,۳۲۳,۸۷۳	۳.۹۶
۹	مواد و محصولات دارویی	۳۲۲,۲۱۴,۶۸۲,۴۹۱	۲.۲۷
۱۰	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۳۰۷,۷۲۷,۲۶۹,۲۱۹	۲.۱۷
۱۱	استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۱۸۵,۸۳۲,۱۴۸,۵۶۴	۱.۳۱
۱۲	بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۱۵۳,۲۳۰,۷۱۲,۹۱۶	۱.۰۸
۱۳	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۳۹,۵۵۲,۰۰۲,۷۸۲	۰.۹۸
۱۴	فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۲۰,۰۵۲,۷۶۲,۷۶۰	۰.۸۵
۱۵	قند و شکر	۱۰۸,۸۱۷,۰۱۸,۹۹۸	۰.۷۷
۱۶	خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۱۰۷,۱۶۲,۶۷۹,۳۲۵	۰.۷۵
۱۷	ماشین آلات و تجهیزات	۱۰۴,۳۷۴,۱۴۰,۱۸۱	۰.۷۳
۱۸	عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۰۲,۷۵۷,۸۴۹,۹۰۸	۰.۷۲
۱۹	زراعت و خدمات وابسته	۷۵,۲۵۷,۵۰۸,۰۱۵	۰.۵۳
۲۰	کاشی و سرامیک	۴۱,۰۵۹,۴۸۰,۹۷۸	۰.۲۹
۲۱	سایر محصولات کانه های غیر فلزی	۲۰,۰۷۴,۲۵۲,۸۲۸	۰.۱۴
۲۲	ساخت محصولات فلزی	۱۱,۵۸۰,۵۳۵,۱۰۲	۰.۰۸
۲۳	انبوه سازی، املاک و مستغلات	۱۰,۰۳۲,۷۸۲,۷۸۴	۰.۰۷
۲۴	ماشین آلات و دستگاه های برقی	۴,۸۲۹,۱۳۰,۰۲۲	۰.۰۳
	جمع:	۱۲,۲۷۰,۶۰۱,۴۲۵,۶۴۴	۸۶.۳۹ %