



صندوق سرمایہ گذاری لبخند فارابی

گزارش عملکرد مدیر صندوق

سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰



کلیات

۱-۱. تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری لبخند فارابی که صندوق سرمایه گذاری سهامی محسوب می شود، در تاریخ ۱۴۰۱/۰۵/۱۲ تحت شماره ۱۲۰۰۲ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و شماره ۵۴۰۷۹ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس یا بازار اول فرابورس، اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده های بانکی سرمایه گذاری می نماید. مرکز اصلی صندوق در تهران، سعادت آباد، میدان طهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه ۵ واقع شده است.

۲-۱. اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری لبخند فارابی مطابق با ماده ۵۶ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس labkhand.irfarabi.com درج گردیده است.

۲- ارکان صندوق سرمایه گذاری

صندوق سرمایه گذاری لبخند فارابی که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است: مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تشکیل می شود. دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز به شرطی که حداقل ۵ درصد از کل واحدهای ممتاز را در اختیار داشته باشند، از حق رای در مجمع برخوردارند. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رای بوده اند شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت کارگزاری فارابی	۱،۲۰۰،۰۰۰	۳۰
۲	شرکت سبدگردان فارابی	۲،۸۰۰،۰۰۰	۷۰
	جمع	۴،۰۰۰،۰۰۰	۱۰۰



مدیر صندوق: شرکت سبگردان فارابی است که در تاریخ ۱۳۹۹/۱۰/۰۷ با شماره ثبت ۵۷۰۴۰۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، سعادت آباد، میدان شهید حسین تهرانی مقدم، بلوار سرو غربی، پلاک ۱۹، طبقه پنجم

متولی صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که با شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، پایین تر از میدان توحید، نبش خیابان پرچم، پلاک ۶

حسابرس صندوق: موسسه حسابرسی بهمند است که در تاریخ ۱۳۵۸/۰۹/۲۷ تاسیس و به شماره ثبت ۲۰۳۵ و شناسه ملی ۱۰۱۰۰۱۷۴۳۹۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، خیابان قائم مقام فراهانی، پلاک ۱۳۰، طبقه چهارم، واحد ۱۸

مدیر ثبت: شرکت کارگزاری فارابی است که در تاریخ ۱۳۷۲/۱۲/۱۵ به شماره ثبت ۱۰۳۵۶۱ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت از تهران، شهرک غرب، بلوار دریا، بلوار خوردین، خیابان توحید ۳، پلاک ۳

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

۳- واحدهای سرمایه‌گذاری

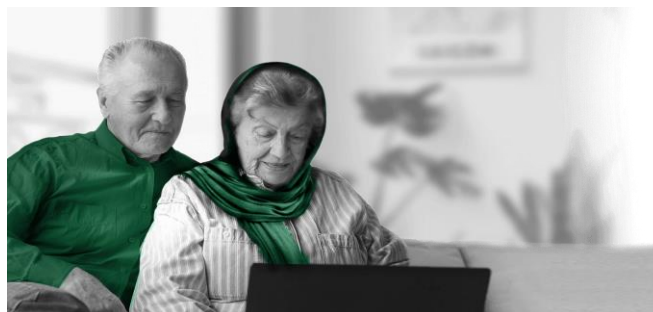
واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو دسته واحدهای سرمایه‌گذاری عادی و واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تقسیم می‌شود.

کل خالص ارزش دارایی‌ها (ریال): ۱۱,۰۹۷,۸۰۰,۱۶۲,۱۸۹

قیمت صدور هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال): ۱۰,۶۹۵

قیمت ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری (ریال): ۱۰,۶۸۳

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰، تعداد ۱,۰۳۸,۸۰۰,۰۰۰ واحد بوده که این تعداد شامل ۱,۰۳۴,۸۰۰,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۴,۰۰۰,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.



۴- استراتژی صندوق

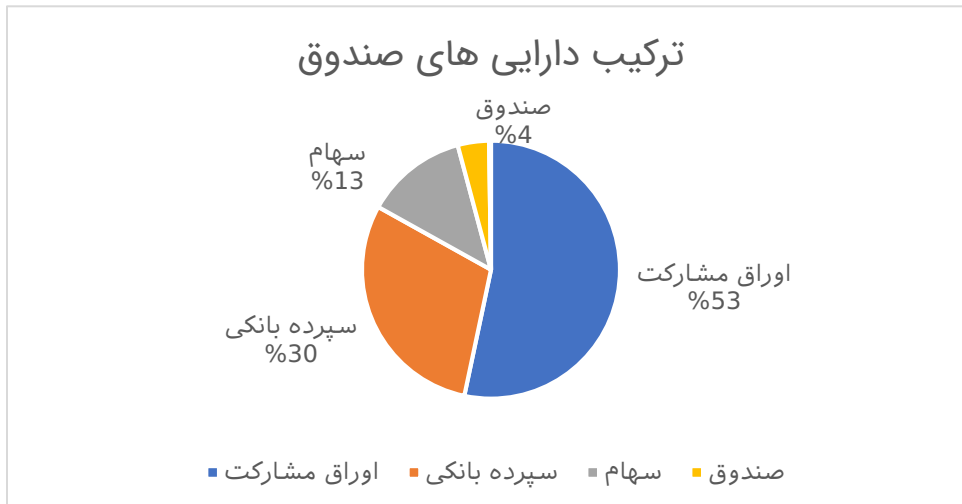
هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد

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.

۵- ترکیب دارایی های صندوق در سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه گذاری های صندوق را در سال مالی منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱ مورد گزارش نشان می دهد.

عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی (میلیون ریال)	% نسبت از کل دارائی به ارزش روز
اوراق مشارکت	۶,۰۲۱,۱۰۷	۵۳/۳۲%
سپرده بانکی	۳,۳۶۰,۶۵۰	۲۹/۷۶%
سهام	۱,۴۴۰,۵۹۵	۱۲/۷۶%
صندوق	۴۴۲,۹۸۱	۳/۹۲%
سایر داراییها	۲۶,۳۵۰	۰/۲۴%
جمع	۱۱,۲۹۱,۶۸۳	۱۰۰%



۶- سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار طی سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

ردیف	سود یا زیان حاصل از فروش اوراق بهادار	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰
۱	سود (زیان) ناشی از فروش اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	(۵۵,۷۲۹,۶۶۲)
۲	سود (زیان) ناشی از اعمال اختیار معامله سهام	(۱۸۷,۱۵۵)
	جمع	(۵۵,۹۱۶,۸۱۷)

۷- اوراق بهاداری که ارزش آن ها در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ تعدیل شده است:

نام اوراق	تعداد	قیمت پایانی	قیمت تعدیل شده
مرابحه عام دولت ۹۲-ش.خ ۰۲۰۸۲۵	۱۳۹,۰۰۰	۹۶۰,۰۰۰	۸۹۱,۰۰۰
صکوک اجاره صندوق ۴۱۲-بدون ضامن	۵۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۹۰۰,۰۰۰
صکوک اجاره شستا ۳۱۱-بدون ضامن	۱,۶۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۴,۵۹۸



۸- ترکیب دارایی‌های صندوق به تفکیک صنعت سرمایه‌گذاری در سهام در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد به کل سهام
هتل و رستوران	۶۵۸,۳۳۲	%۴۵.۷
خودرو و ساخت قطعات	۲۰۹,۴۷۱	%۱۴.۵۴
فلزات اساسی	۱۸۳,۸۵۰	%۱۲.۷۶
محصولات شیمیایی	۱۶۵,۰۰۵	%۱۱.۴۵
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۱۱۲,۲۳۵	%۷.۷۹
بانکها و موسسات اعتباری	۱۰۷,۳۶۰	%۷.۴۵
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۲,۷۰۴	%۰.۱۹
مواد و محصولات دارویی	۱,۵۶۴	%۰.۱۱
جمع	۱,۴۴۰,۵۹۵	۱۰۰%

۹- بازدهی صندوق

شرح	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	% ۰/۳۴۸	% ۱/۵۹۲
۳۰ روز گذشته	% ۱/۷۲۳	% ۶/۲۱۹
۹۰ روز گذشته	% ۵/۳۴۵	% ۱۰/۴۰۱

۱۰- چشم انداز پیش بینی بازدهی و عملکرد مدیر صندوق

مدیر صندوق با بهره گیری از تمامی فرصت‌های سرمایه‌گذاری مطابق با حدنصاب‌های مقرر در سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ بازدهی موثر ۲۳ درصد کسب نموده و پیش بینی می‌نماید در سال آینده بازدهی ۲۴ تا ۲۵ درصدی عاید سرمایه‌گذاران نماید. همچنین تغییرات تورمی و رشد ارزش شرکت‌ها و شاخص کل بازار نیز می‌تواند منجر به تغییرات مثبت در عملکرد و بازدهی صندوق گردد.