



صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین سامان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه

منتهی به ۳۱ خرداد ماه سال ۱۳۹۸

(حسابرسی نشده)



۱- اطلاعات کلی صندوق

تاریخچه تاسیس صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری بادرآمد ثابت نگین سامان در تاریخ ۱۳۹۶/۰۲/۰۳ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه‌گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۱۵۰۰ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۱۹ تحت شماره ۴۰۹۳۱ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیرتجاری به ثبت رسیده است.

دوره فعالیت صندوق

مدت فعالیت صندوق طبق مجوز صادر شده تا ۱۳۹۶/۰۴/۳۱ بوده است که طبق مجامع برگزار شده تا ۱۳۹۹/۰۵/۲۳ تمدید شده است.

محل اقامت صندوق:

مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان آفریقا، نرسیده به چهارراه جهان کودک، نبش کوچه ۲۵، ساختمان ۲۹ آفریقا، طبقه ۷، شرکت کارگزاری بانک سامان واقع شده و صندوق دارای ۸۷ شعبه می باشد.

ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری نگین سامان که از این به بعد صندوق نامیده می شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱-۲- مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز از حق رأی در مجمع برخوردارند.



در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	بانک سامان	۴۹,۰۰۰	۹۸
۴	شرکت کارگزاری بانک سامان	۱,۰۰۰	۲
	جمع	۵۰,۰۰۰	۱۰۰

۲-۲- مدیر صندوق: شرکت کارگزاری بانک سامان است که در ۱۳۷۲/۰۳/۰۳ با شماره ثبت ۹۷۳۶۴ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان آفریقا، نبش کوچه ۲۵ گاندی، ساختمان ۲۹ آفریقا، طبقه ۷ شرکت کارگزاری بانک سامان.

۲-۳- متولی صندوق: موسسه حسابرسی شاخص اندیشان است که در تاریخ ۱۳۸۲/۰۴/۲۹ به شماره ثبت ۱۵۵۶۶ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از خیابان نفت شمالی، نبش خیابان ۹، پلاک ۱۴۴، طبقه ۶ واحد ۲۲.

۲-۴- ضامن: بانک سامان است که در تاریخ ۱۳۸۱/۰۵/۱۶ با شماره ثبت ۱۵۴۴۴۴ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی ضامن عبارت است از: تهران، خیابان ولیعصر، نرسیده به چهارراه پارک وی نبش کوچه ترکش دوز.

۲-۵- حسابرص صندوق: موسسه حسابرسی بیات رایان است که در تاریخ ۱۳۵۷/۰۲/۰۷ به شماره ثبت ۱۹۱۰ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرص عبارت است از: خیابان احمد قصیر، کوچه پژوهشگاه دوم، پلاک ۲۲، طبقه ۲.



۶-۲- مدیر ثبت، شرکت کارگزاری بانک سامان است که در ۱۳۷۲/۰۳/۰۳ با شماره ثبت ۹۷۳۶۴ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان آفریقا، نبش کوچه ۲۵ گاندی، ساختمان ۲۹ آفریقا، طبقه ۷ شرکت کارگزاری بانک سامان.

۲- اهداف و استراتژی های صندوق:

۱-۲- هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی ها و مدیریت این سبد است؛ 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 بکارگیری 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 سهام 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.

۲-۲- صندوق فقط می تواند در دارایی های ریالی داخل کشور سرمایه گذاری کند و سرمایه گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز می باشد. صندوق در دارایی هایی به شرح زیر سرمایه گذاری می کند:

۱-۲-۲- اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت. این اوراق بهادار باید تمامی شرایط زیر را داشته باشند:

الف- مجوز انتشار آنها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛

ب- سود حداقلی برای آنها مشخص شده و پرداخت اصل سرمایه گذاری و سود آنها تضمین شده یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه گذاری وثایق کافی وجود داشته باشد؛

ج- به تشخیص مدیر، یکی از مؤسسات معتبر بازخريد آنها را قبل از سررسيد تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

۲-۲-۲- : گواهی های سپرده منتشره توسط بانک ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.



۳-۲-۲: هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۴-۲-۲: سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس ایران و آن دسته از سهام پذیرفته شده در بازار دوم فرابورس ایران که به تشخیص سب، شرایط لازم را دارند؛

۵-۲-۲: حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس ایران و آن دسته از حق تقدم سهام پذیرفته شده در بازار دوم فرابورس ایران که به تشخیص سازمان، شرایط لازم را دارند؛

۲-۲-۶: واحدهای سرمایه گذاری "صندوق های سرمایه گذاری" از جمله صندوق های سرمایه گذاری زمین و ساختمان و صندوق های سرمایه گذاری پروژه؛

۲-۲-۷: اوراق بهاداری که صندوق در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید آنها مشارکت می کند، باید علاوه بر خصوصیات مندرج در بند ۲-۲-۱، دارای خصوصیات زیر باشند:

۲-۲-۷-۱: حداقل سود تعیین شده یا پیش بینی شده برای اوراق بهادار و بازپرداخت اصل اوراق بهادار در مواعد مقرر، توسط ضامن معتبری تضمین شده باشد؛

۲-۲-۷-۲: بازدهی تعیین شده یا پیش بینی شده برای اوراق بهادار، کمتر از بازدهی پیش بینی شده یا تضمین شده برای صندوق سرمایه گذاری نباشد یا در صورت عدم پیش بینی یا تضمین بازدهی صندوق سرمایه گذاری، بازدهی تعیین شده یا پیش بینی شده برای اوراق بهادار، از متوسط بازدهی اوراق بهاداری که در مالکیت صندوق است و خصوصیات مندرج در بند ۲-۲-۷-۱ را دارد، کمتر نباشد.

۲-۲-۸: اتخاذ موقعیت فروش قراردادهای آتی اوراق بهادار، صرفاً به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت اوراق بهادار موجود در صندوق سرمایه گذاری و اتخاذ موقعیت خرید در قراردادهای آتی اوراق بهادار صرفاً به منظور بستن موقعیت های فروشی که قبلاً در قراردادهای آتی اوراق بهادار اتخاذ نموده اند.

۲-۲-۹: سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی که صرفاً به قصد فروش قبل از سر رسید اوراق و یا قبل از زمان تحویل فیزیکی خواهد بود.



۲-۳- این صندوق از نوع صندوق سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت و با پیش بینی سود است و اکثر وجوه خود را صرف خرید اوراق بهادار موضوع بندهای ۲-۱-۲ و ۲-۲-۲ یا سپرده گذاری موضوع بند ۲-۳-۲ می کند. در طول عمر صندوق حدنصاب های زیر بر اساس ارزش روز دارایی های صندوق رعایت می شود:

ردیف	موضوع سرمایه گذاری	توضیحات
۱	سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی	حداقل ۷۵٪ از کل دارایی های صندوق
۱-۱	اوراق بهادار با درآمد ثابت دارای مجوز انتشار از طرف سازمان بورس و اوراق بهادار	حداقل ۳۰٪ از کل دارایی های صندوق
۱-۲	گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی	حداکثر ۵۰٪ از کل دارایی های صندوق
۱-۳	اوراق بهادار منتشره از طرف یک ناشر	حداکثر ۴۰٪ از کل دارایی های صندوق
۱-۴	اوراق بهادار تضمین شده توسط یک ضامن	حداکثر ۳۰٪ از کل دارایی های صندوق
۲	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام پذیرفته شده در بورس تهران یا بازار اول و دوم فرابورس ایران و گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده در بورس	حداقل ۵٪ و حداکثر ۲۰٪ از کل دارایی های صندوق
۲-۱	سهام و حق تقدم سهام منتشره از طرف یک ناشر	حداکثر ۵٪ از سهام و حق تقدم سهام منتشره ناشر
۲-۲	سهام و حق تقدم سهام منتشره از طرف یک ناشر و قرارداد اختیار معامله همان سهام	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق
۲-۳	سهام، حق تقدم سهام و قرارداد اختیار معامله سهام طبقه بندی شده در یک صنعت	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق
۲-۴	اخذ موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله سهام	حداکثر ۵٪ از ارزش روز سهام و حق تقدم سهام صندوق
۲-۵	اخذ موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله خرید سهام	حداکثر به تعداد سهام پایه موجود در پرتفوی مجاز سرمایه گذاری صندوق در سهام
۲-۶	سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی پذیرفته شده نزد یکی از بورس ها	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق
۳	واحدهای سرمایه گذاری "صندوق های سرمایه گذاری"	حداکثر ۵٪ از کل دارایی های صندوق و تا سقف ۳۰٪ از تعداد واحدهای صندوق سرمایه پذیر که نزد سرمایه گذاران می باشد

۲-۴- این صندوق برای دست یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط بورس اوراق بهادار تهران معیار محاسبه نرخ (TEDPIX) طراحی شده است. تغییرات شاخص قیمت و بازدهی نقدی متوسط بازدهی بورس تهران است.



۳- واحدهای سرمایه گذاری:

ارزش مبنای هر واحد سرمایه گذاری برابر یک میلیون ریال است که باید روی گواهی های سرمایه گذاری قید شود. واحدهای سرمایه گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می شود:

الف) واحدهای سرمایه گذاری ممتاز که تعداد آن ها ۵۰,۰۰۰ واحد سرمایه گذاری است، قبل از شروع دوره پذیره نویسی اولیه مطابق ماده ۸، کلاً توسط مؤسس یا مؤسسان صندوق خریداری می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر می باشد.

ب) واحدهای سرمایه گذاری عادی که در طول دوره پذیره نویسی اولیه یا پس از تشکیل صندوق صادر می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری قابل ابطال ولی غیرقابل انتقال می باشد. حداکثر واحدهای سرمایه گذاری عادی نزد سرمایه گذاران در امیدنامه قید شده است.

ترکیب سرمایه گذاران صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۰۳/۳۱ به شرح جدول زیر می باشد:

۱۳۹۸/۰۳/۳۱			
سرمایه گذاران	تعداد واحدها	درصد	ریال
واحدهای سرمایه گذاری عادی	۱,۳۱۵,۶۴۰	۹۶,۳۴	۱,۳۱۵,۶۴۰,۴۴۹,۳۴۲
واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۵۰,۰۰۰	۳,۶۶	۵۰,۰۰۰,۰۱۷,۰۷۷
جمع	۱,۳۶۵,۶۴۰	۱۰۰	۱,۳۶۵,۶۴۰,۴۶۶,۴۱۹

۱۳۹۸/۰۳/۳۱			
سرمایه گذاران	تعداد واحدها	درصد	ریال
اشخاص حقیقی	۶۵۵,۵۰۷	۴۸	۶۵۵,۵۰۷,۴۲۳,۸۸۱
اشخاص حقوقی	۷۱۰,۱۳۳	۵۲	۷۱۰,۱۳۳,۰۴۲,۵۳۸
جمع	۱,۳۶۵,۶۴۰	۱۰۰	۱,۳۶۵,۶۴۰,۴۶۶,۴۱۹



گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین سامان برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۴- اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۱,۳۶۵,۶۴۰,۴۶۶,۴۱۹	کل خالص ارزش دارایی ها (ریال) :
۱,۰۰۳,۰۰۰	قیمت صدور هر واحد سرمایه گذاری (ریال) :
۱,۰۰۰,۰۰۰	قیمت ابطال هر واحد سرمایه گذاری (ریال) :
۱,۰۰۰,۰۰۰	قیمت آماری هر واحد سرمایه گذاری (ریال) :
۱,۳۶۵,۶۴۰	تعداد واحد های سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران :

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

ریال	تعداد	
۱,۴۲۲,۰۳۸,۲۲۴,۷۴۰	۱,۴۲۲,۰۳۸	خالص دارایی ها (واحد های سرمایه گذاری) اول دوره
۲۰۶,۴۶۲,۰۰۰,۰۰۰	۲۰۶,۴۶۲	واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۲۶۲,۸۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۶۲,۸۶۰)	واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۱۲۱,۵۵۹,۸۲۰,۴۲۰	-	سود خالص دوره
۱۵,۵۸۰,۳۵۵	-	تعدیلات
(۱۲۱,۵۷۵,۱۶۸,۹۹۶)	-	سود تقسیمی
۱,۳۶۵,۶۴۰,۴۶۶,۴۱۹	۱,۳۶۵,۶۴۰	خالص دارایی های پایان دوره

۵- بازدهی صندوق طی دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

بازده	بازده صندوق	شاخص صندوقها	شاخص بازار
هفته اخیر	۰,۴۴	-	۰,۶۵
ماه اخیر	۱,۵۲	-	۹,۱۶
سه ماه اخیر	۴,۳۰	-	۳۱,۴۷
یکسال اخیر	۱۷,۱۳	-	۱۱۵,۷۴



۶- ترکیب داراییهای صندوق در تاریخ ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

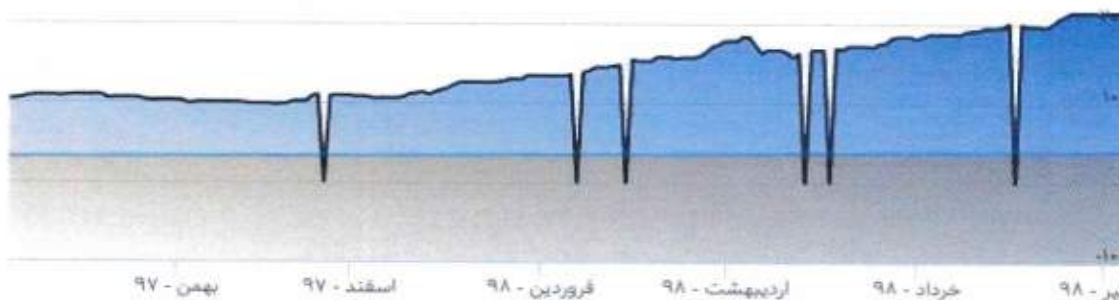
ترکیب داراییهای صندوق:

۸۶,۹	وجه نقد و شبه نقد
۱۱,۶۴	پرتفوی سهام
۱,۴۶	سایر
۱	تعداد سهام موجود در صندوق

۷- نمودارها:

نمودار مقایسه‌ای بازده صندوق و بورس از ابتدای تاسیس

Zoom ۱ سال ۶ ماه ۱ ماه



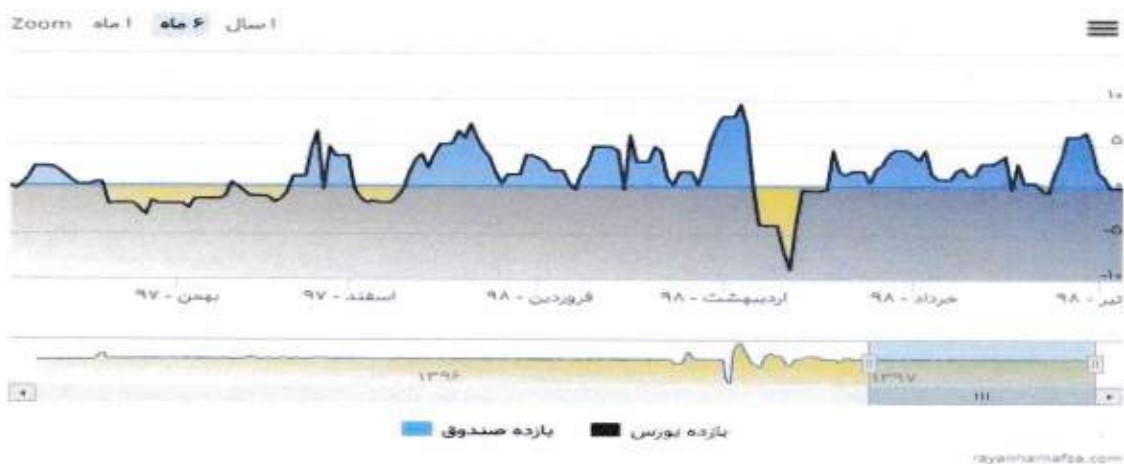
بازده صندوق بازده بورس

rejanhamafza.com

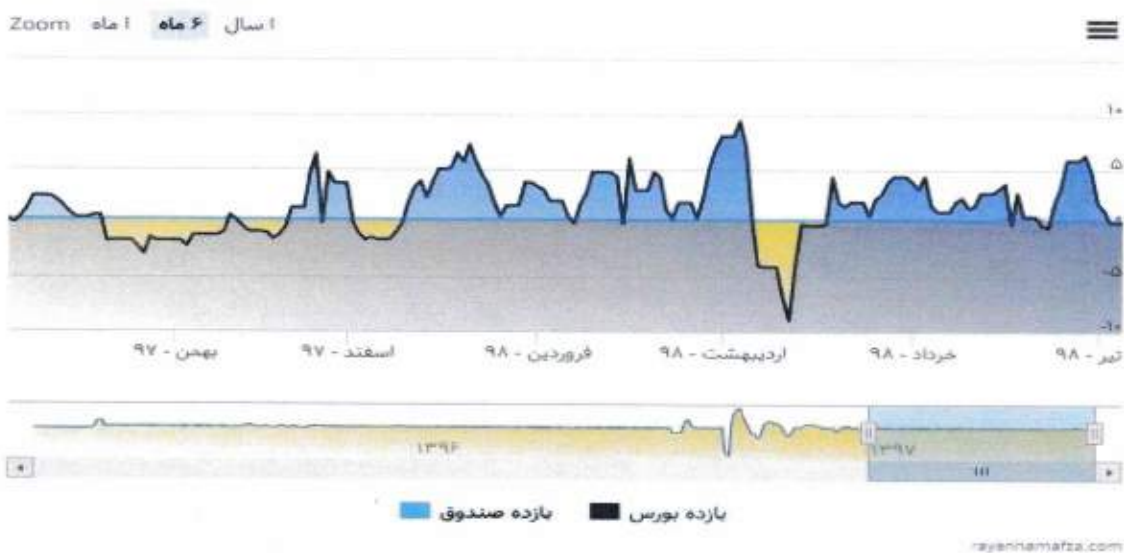


گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین سامان برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

نمودار مقایسه‌ای بازده هفتگی صندوق و بورس



نمودار مقایسه‌ای بازده هفت روز گذشته صندوق و بورس

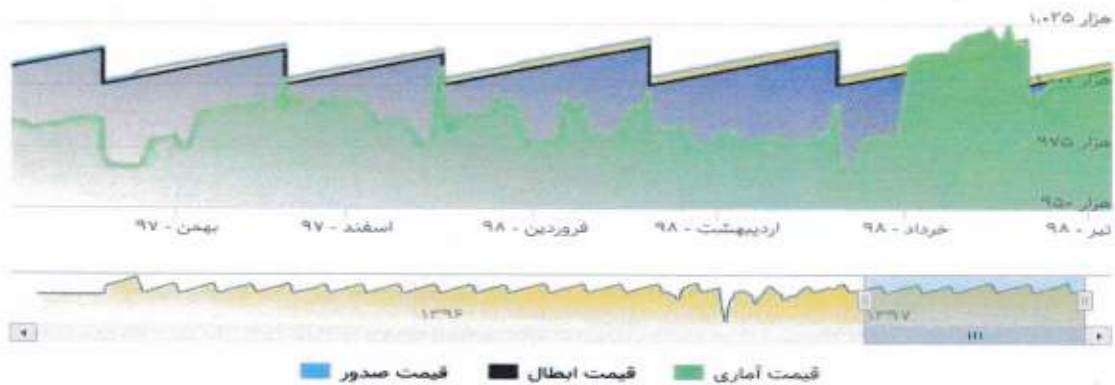




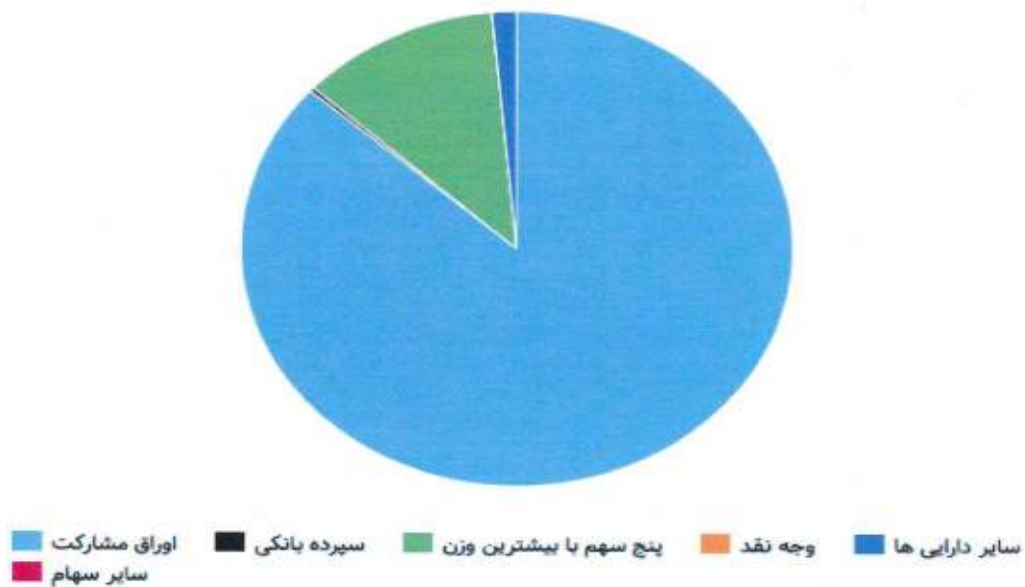
گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین سامان برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

قیمت صدور، ابطال و ارزش آماری هر واحد سرمایه گذاری

Zoom سال ۶ ماه ۱ ماه

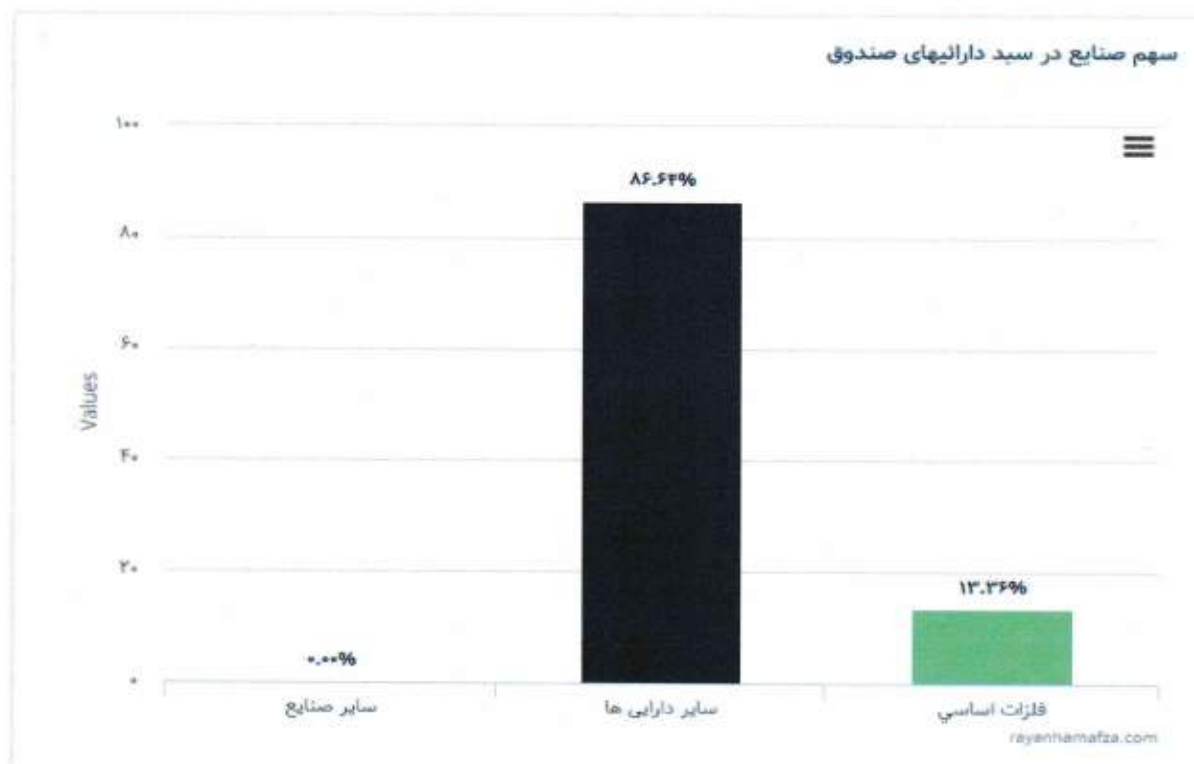


نمودار ترکیب داراییهای صندوق





گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین سامان برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱



باتشکر
مدیر صندوق

شرکت کارگزاری بانک سامان
(سامی خاص)