صندوق سرمایه‌گذاری مشترک یکم سامان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به

۱۳۹۲/۰۹/۳۰

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه تاسیس صندوق

صندوق سرمایه گذاری مشترک یکم سامان در تاریخ ۱۳۹۰/۰۱/۲۴ با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره ۱۰۸۷۲ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۳۹۰/۰۳/۳۱ تحت شماره ۲۷۷۱۲ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیرتجاری به ثبت رسیده است.

۱-۲- دورهٔ فعالیت صندوق

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، دو سال است که بر اساس تصمیمات مجمع مورخ ۱۳۹۲/۰۳/۰۴ و تائید سازمان بورس طی نامه مورخ ۱۳۹۲/۰۵/۲۶ به مدت یکسال فعالیت صندوق تمدید گردیده است .

۱-۳ - 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 ۶ شعبه می باشد.

۲ - ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه گذاری مشترک یکم 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 به شرطی که حداقل ۵ درصد از کل واحدهای ممتاز را در اختیار داشته باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند.

در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری 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**	**۱۰,۰۰۰**	**۴۰**
۲	**شرکت توسعه سرمایه گذاری سامان**	**۹,۰۰۰**	**۳۶**
۳	**شرکت بیمه سامان**	**۵,۰۰۰**	**۲۰**
۴	**شرکت کارگزاری بانک سامان**	**۱,۰۰۰**	**۴**
	جمع	**۲۵,۰۰۰**	**۱۰۰**

۲-۲- مدیر صندوق، : شرکت کارگزاری بانک سامان است که در۱۳۷۲/۰۳/۰۳ با شمارهٔ ثبت۹۷۳۶۴ نزد مرجع ثبت شرکت‌های‌شهرستانتهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت‌است از: تهران، خیابان آفریقا ، نبش کوچه ۲۵گاندی ، ساختمان ۲۹ آفریقا ، طبقه ۷ شرکت کارگزاری بانک سامان.

۲-۳- متولی صندوق، : موسسه حسابرسی بهراد مشار است که در تاریخ ۱۳۷۷/۰۳/۰۶ به شماره ثبت ۱۳۸۹۸ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است . نشانی متولی عبارت است از خیابان مطهری ، خیابان فجر ، پلاک ۲۷.

۲-۴- ضامن ، بانک سامان است که در تاریخ ۱۳۸۱/۰۵/۱۶ با شمارهٔ ثبت ۱۵۴۴۴۴ نزد مرجع ثبت شرکت‌های 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- حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی شاخص اندیشان است که در تاریخ ۱۳۸۲/۰۴/۲۹ به شماره ثبت ۱۵۵۶۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، خیابان نفت شمالی ، نبش خیابان نهم ، پلاک۱۱۴ ، واحد۲۳.

۶-۲- مدیر ثبت، : بانک سامان است که در تاریخ ۱۳۸۱/۰۵/۱۶ با شمارهٔ ثبت ۱۵۴۴۴۴ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر ثبت عبارت است از: تهران، خیابان ولیعصر ، نرسیده به چهارراه پارک وی نبش کوچه ترکش دوز.

۳- اهداف و استراتژ یهای صندوق:

۳-۱- 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 هزینهٔ بکارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینهٔ اوراق بهادار بین همهٔ سرمایه گذاران تقسیم می شود و سرانهٔ هزینهٔ هر سرمایه گذار کاهش می یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه گذاران، کلیهٔ حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام وکوپن اوراق بهادار را انجام می دهد و در نتیجه سرانهٔ هزینهٔ 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.

۳-۲- صندوق فقط می تواند در دارایی های ریالی داخل کشور سرمایه گذاری کند و سرمایه گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز میباشد. صندوق در دارایی هایی به شرح زیر سرمایه گذاری می کند:

۳-۲-۱ : سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

۳-۲-۲ : حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس؛

۳-۲-۳ : اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهاداری که تمامی شرایط زیر را داشته باشد:

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 آن ها تضمین و مشخص شده باشد؛

ج- به تشخیص مدیر، یکی از مؤسسات معتبر بازخرید آنها را قبل از سررسید تعهدکرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.

۴-۲-۳- : گواهی های سپردهٔ منتشره توسط بانک ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۵-۲-۳- : هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۳-۳- : این صندوق از نوع صندوق های سرمایه گذاری در سهام است و اکثر وجوه خود را به شرح جدول زیر صرف خرید سهام و حق تقدم خرید سهام می کند. همچنین در طول عمر صندوق حد نصاب های زیر بر اساس ارزش روز دارایی های صندوق رعایت می شود:

شرح	نسبت از کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام پذیرفته شده در بورس یا بازار اول فرابورس	حداقل ۷۰ ٪ از دارایی های صندوق
۱ - سهام و حق تقدم منتشره از طرف یک ناشر	
۱-۱ پذیرفته شده در بورس تهران	حداکثر ۱۰ ٪ از داراییهای صندوق
۱-۲ پذیرفته شده در فرابورس ایران	حداکثر ۵٪ از داراییهای صندوق
۲ - سهام و ح قتقدم طبقه بندی شده در یک صنعت	حداکثر ۳۰ ٪ از دارایی های صندوق
۳- سهام و حق تقدم پذیرفته شده در بازار اول فرابورس	حداکثر ۲۰ ٪ از کل دارایی های صندوق
۴ - سهام و حق تقدم منتشره از طرف یک ناشر	حداکثر ۵٪ از کل سهام و حق تقدم منتشره ناشر

۴-۳- : این صندوق برای دست یابی به بازدهی بیشتر از بازدهی متوسط بورس اوراق بهادار تهران معیار محاسبهٔ نرخ (TEDPIX) طراحی شده است. تغییرات شاخص قیمت و بازدهی نقدی متوسط بازدهی بورس تهران است.

۴- 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 زیرتقسیم می شود:

الف) واحدهای سرمایه گذاری ممتاز که تعداد آن ها ۲۵.۰۰۰ واحد سرمایه گذاری است، قبل ازشروع دورهٔ پذیره نویسی اولیه مطابق مادهٔ ۸، کلاً توسط مؤسس یا مؤسسان صندوق خریداری می شود. این نوع واحدهای سرمایه گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیرمی باشد.

ب) واحدهای سرمایه گذاری عادی که در طول دورهٔ 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 سرمایهگذاران در امیدنامه قید شده است.

۴-۱- ترکیب سرمایه گذاران صندوق به تفکیک واحدهای عادی و ممتاز در تاریخ ۱۳۹۲/۰۹/۳۰ به شرح جدول زیر می باشد:

۱۳۹۲/۰۹/۳۰			
سرمایه گذاران	**تعداد واحدها**	**درصد**	**ریال**
واحدهای سرمایه گذاری عادی	۱۶,۹۱۸	۴۰	۴۹,۸۹۰,۲۲۲,۶۶۸
واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۲۵,۰۰۰	۶۰	۷۳,۷۲۳,۵۸۲,۳۷۹
جمع	**۴۱,۹۱۸**	**۱۰۰**	**۱۲۳,۶۱۳,۸۰۵,۰۴۷**

۴-۲- ترکیب سرمایه گذاران صندوق به تفکیک اشخاص حقیقی و حقوقی در تاریخ ۱۳۹۲/۰۹/۳۰ به شرح جدول زیر می باشد:

۱۳۹۲/۰۹/۳۰			
سرمایه گذاران	**تعداد واحدها**	**درصد**	**ریال**
اشخاص حقیقی	۱۰,۸۹۸	۲۶	۳۲,۱۳۹,۵۸۹,۳۱۲
اشخاص حقوقی	۳۱,۰۲۰	۷۴	۹۱,۴۷۴,۲۱۵,۷۳۵
جمع	**۴۱,۹۱۸**	**۱۰۰**	**۱۲۳,۶۱۳,۸۰۵,۰۴۷**

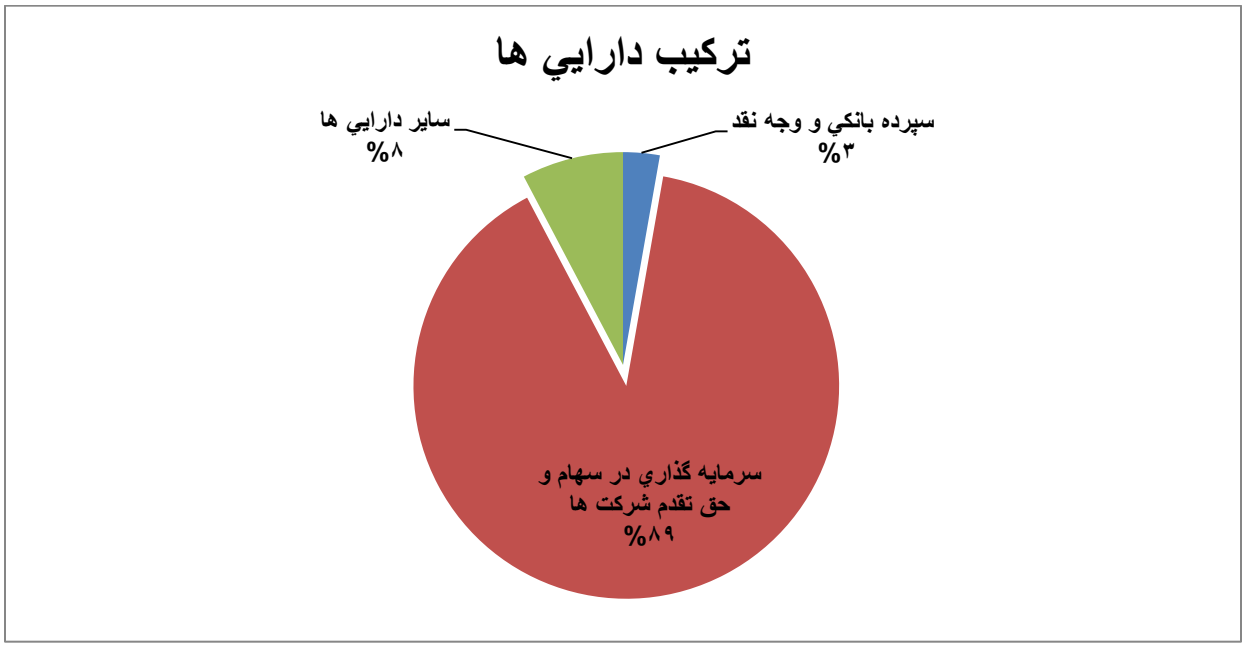
۵- اطلاعات سرمایه گذاری صندوق در ۱۳۹۲/۰۹/۳۰ به شرح زیر می باشد:

کل خالص ارزش دارایی ها (ریال) :	۱۲۳,۶۱۳,۸۰۵,۰۴۷
قیمت صدور هر واحد سرمایه گذاری(ریال) :	۲,۹۹۰,۵۰۶
قیمت ابطال هر واحد سرمایه گذاری(ریال) :	۲,۹۴۸,۹۴۴
قیمت آماری هر واحد سرمایه گذاری(ریال) :	۲,۹۴۸,۹۴۴
تعداد واحد های سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران :	۴۱,۹۱۸

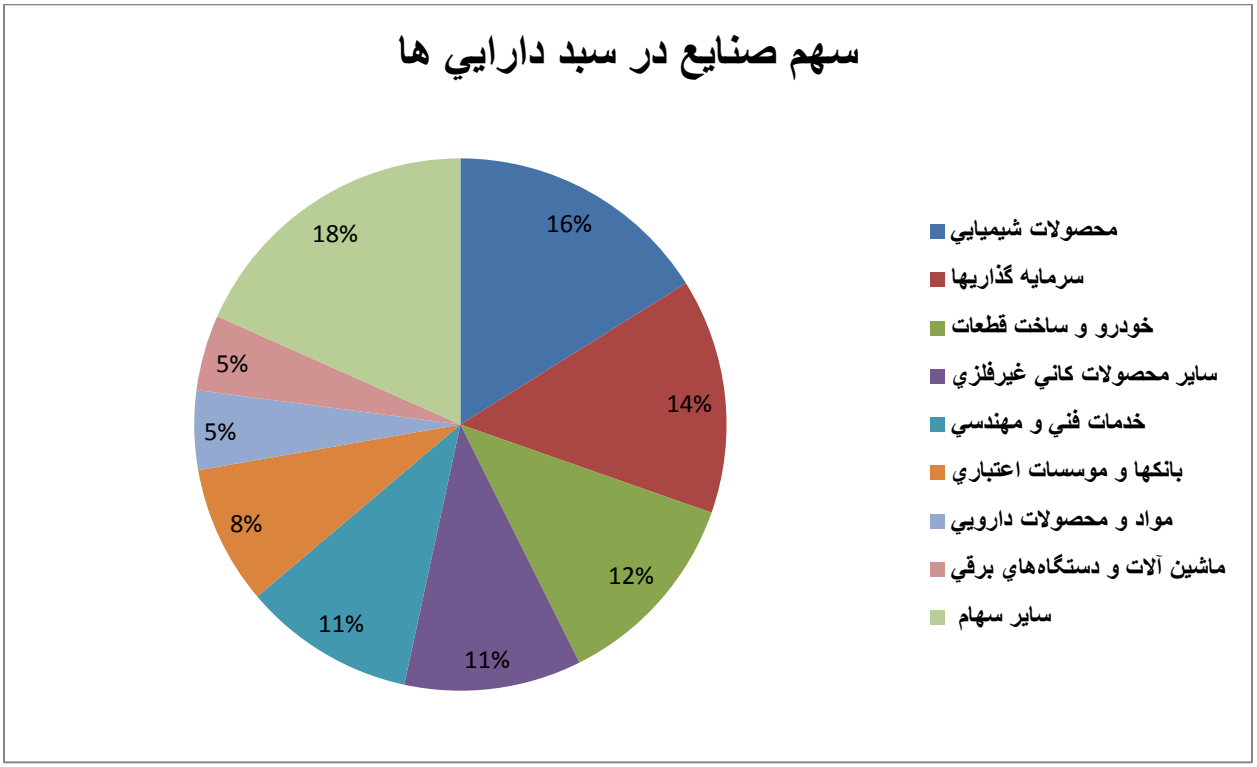
دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۲/۰۹/۳۰

	تعداد	ریال
خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره	۳۶,۸۴۲	۶۴,۵۵۰,۶۳۹,۳۵۵
واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره	۸,۰۰۲	۲۰,۱۴۸,۴۴۸,۵۲۴
واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره	(۲,۹۲۶)	(۶,۴۸۸,۲۹۳,۰۱۱)
سود خالص دوره	-	۴۵,۴۰۳,۰۱۰,۱۷۹
خالص دارایی های پایان دوره	**۴۱,۹۱۸**	**۱۲۳,۶۱۳,۸۰۵,۰۴۷**

۵- ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۳۹۲/۰۹/۳۰ :

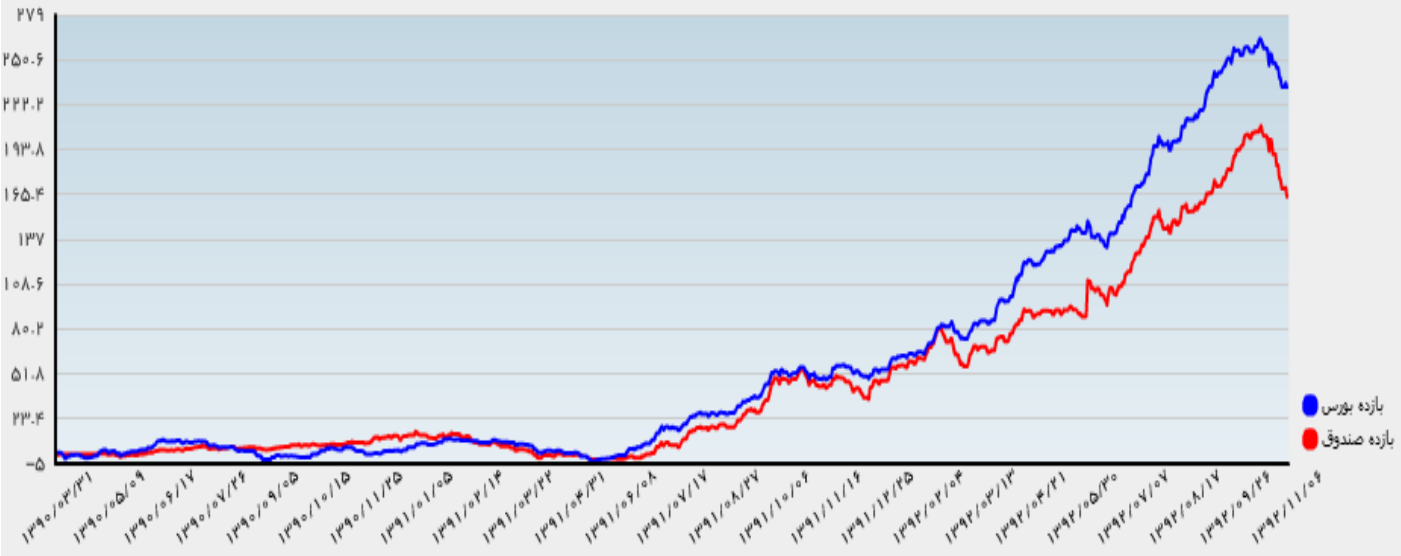


۶- سهم صنایع در سبد دارایی های صندوق در تاریخ ۱۳۹۲/۰۹/۳۰ :

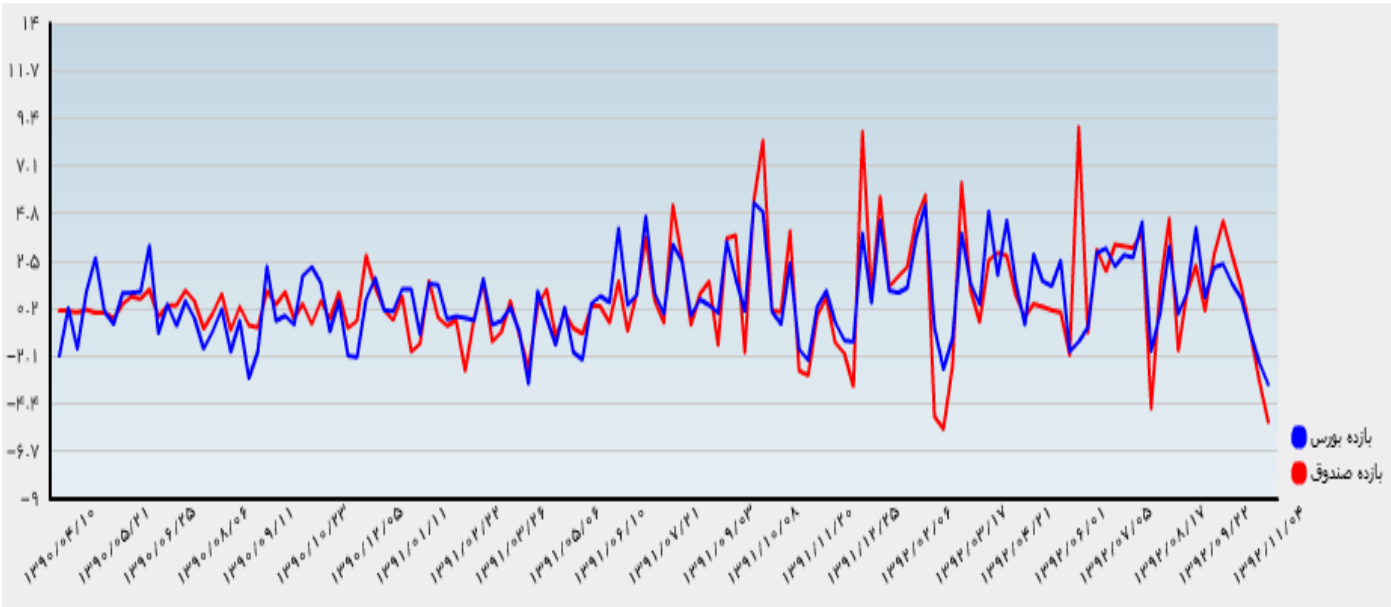
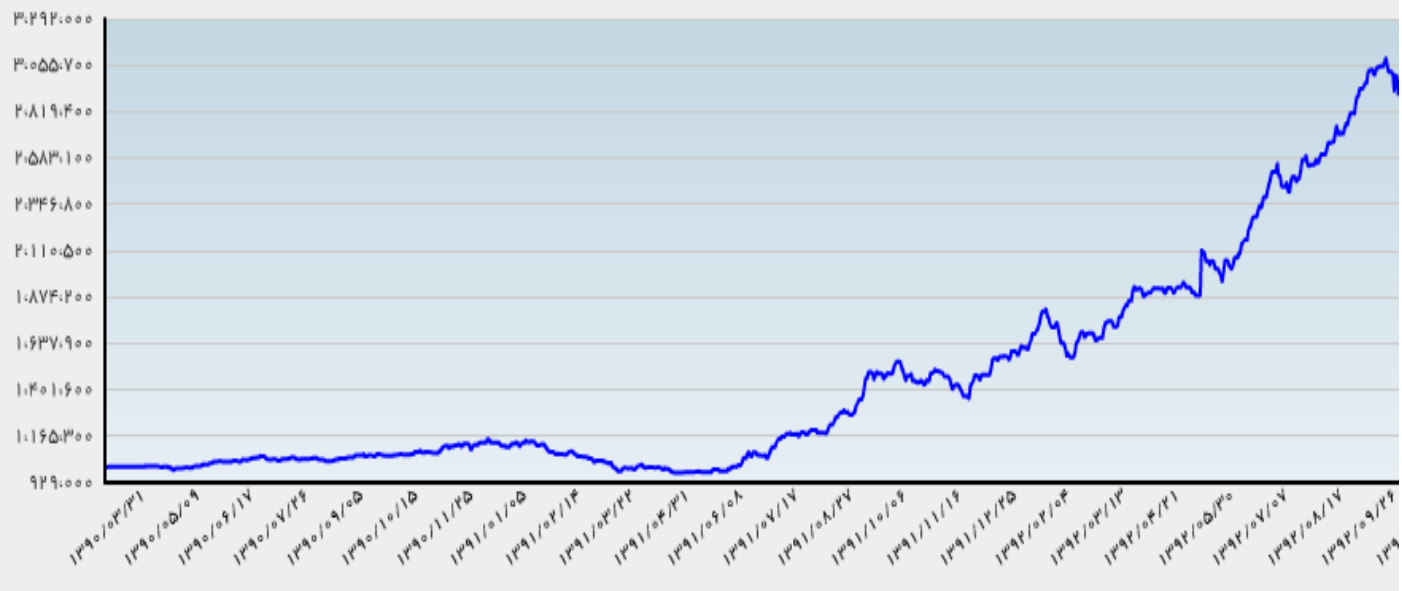


۷- بازدهی صندوق:

۷-۱- نمودار مقایسه ای بازده صندوق و بورس از ابتدای تاسیس :



۷-۲- نمودار مقایسه ای بازده هفته ای صندوق و بورس:



۸- نمودار قیمت ابطال: