

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی بهمن کستر

(در اندازه بزرگ)

دوره مالی نه ماهه ششماهه ششم به تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

(حسابرسی نشده)



**صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی بهمن گستر (در اندازه بزرگ)**

"صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردان بهمن گستر"، در اجرای ماده ۲۸ و بند ۶ ماده ۷ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴ و ماده ۲ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید به منظور تسهیل اجرای سیاستهای کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه ۱۳۸۸، با مجوز سازمان بورس اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۴/۰۱/۱۷ تحت شماره ۳۵۷۶۸ و شناسه ملی ۱۴۰۰۴۸۳۱۰۷۲ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری تهران ثبت شده و به عنوان نهاد مالی موضوع بند ۵ ماده ۱ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید به منظور تسهیل اجرای سیاستهای کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه ۱۳۸۸، در تاریخ ۱۳۹۴/۰۱/۲۵ تحت شماره ۱۱۳۲۴ نزد سازمان بورس اوراق بهادار به ثبت رسیده است. فعالیت این صندوق تحت نظارت سبا انجام شده و متولی صندوق نیز به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی های صندوق که عمدتاً شامل سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس می شود، توسط مدیر سرمایه گذاری صندوق صورت می گیرد.

واحدهای سرمایه گذاری ممتاز صندوق به تعداد ۳۵,۰۰۰ واحد، در ابتدای تاسیس صندوق، تماماً به صورت نقد توسط موسسان خریداری و وجوه مربوطه به حساب صندوق در شرف تاسیس واریز شده است. در حال حاضر تا تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۹ واحدهای صندوق ۵۰,۰۰۲ واحد می باشد.

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

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت گروه بهمن	۱۵,۰۰۰	۴۲,۸۶
۲	شرکت سرمایه گذاری بهمن	۱۵,۰۰۰	۴۲,۸۶
۳	شرکت سرمایه گذاری کیا مهستان	۴,۰۰۰	۱۱,۴۳
۴	شرکت کارگزاری بهمن	۱,۰۰۰	۲,۸۵
	جمع کل	۳۵,۰۰۰	۱۰۰

**۱- کارمزد ارکان صندوق :**

کارمزد ارکان و تصفیه صندوق به صورت روزانه به شرح جدول زیر محاسبه و در حساب‌ها ثبت می‌شود:

عنوان هزینه	شرح نحوه محاسبه هزینه
هزینه‌های تأسیس	معادل پنج در هزار (۰/۰۰۵) از وجوه جذب شده در پذیره نویسی اولیه حداکثر تا مبلغ ۱۰۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبت به تصویب مجمع صندوق
هزینه‌های برگزاری مجامع صندوق	حداکثر تا مبلغ ۳۰ میلیون ریال برای برگزاری مجامع در طول یک سال مالی با ارائه مدارک مثبت به تصویب مجمع صندوق
کارمزد مدیر	سالانه دو درصد (۰/۰۲) از متوسط روزانه ارزش سهام و حق تقدم سهام تحت تملک صندوق بعلاوه سه در هزار (۰/۰۰۳) از ارزش روزانه اوراق بهادار با درآمد ثابت تحت تملک صندوق و ۱۰ درصد از تفاوت روزانه سود علی الحساب دریافتی ناشی از سپرده گذاری در گواهی سپرده یا حساب‌های سرمایه گذاری بانک‌ها یا موسسات مالی و اعتباری ایرانی نسبت به بالاترین سود علی الحساب دریافتی همان نوع سپرده در زمان افتتاح سپرده *
کارمزد متولی	سالانه دو در هزار (۰/۰۰۲) از متوسط روزانه ارزش خالص دارایی‌های صندوق، که حداقل ۱۲۰ و حداکثر ۲۰۰ میلیون ریال خواهد بود *
حق الزحمه حسابرس	سالانه مبلغ ثابت ۵۵ میلیون ریال
حق الزحمه و کارمزد تصفیه مدیر صندوق	معادل یک در هزار (۰/۰۰۱) خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق می‌باشد **.
حق پذیرش و عضویت در کانون‌ها	معادل مبلغ تعیین شده توسط کانون‌های مذکور، مشروط بر این که عضویت در این کانون‌ها طبق مقررات اجباری باشد یا عضویت به تصویب مجمع صندوق برسد.
هزینه‌های دسترسی به نرم افزار، تارنما و خدمات پشتیبانی آن‌ها	هزینه دسترسی به نرم افزار صندوق، نصب و راه اندازی تارنمای آن و هزینه‌های پشتیبانی آنها سالانه تا سقف ۲۶۱,۶۰۰,۰۰۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبت و با تصویب مجمع صندوق ***.

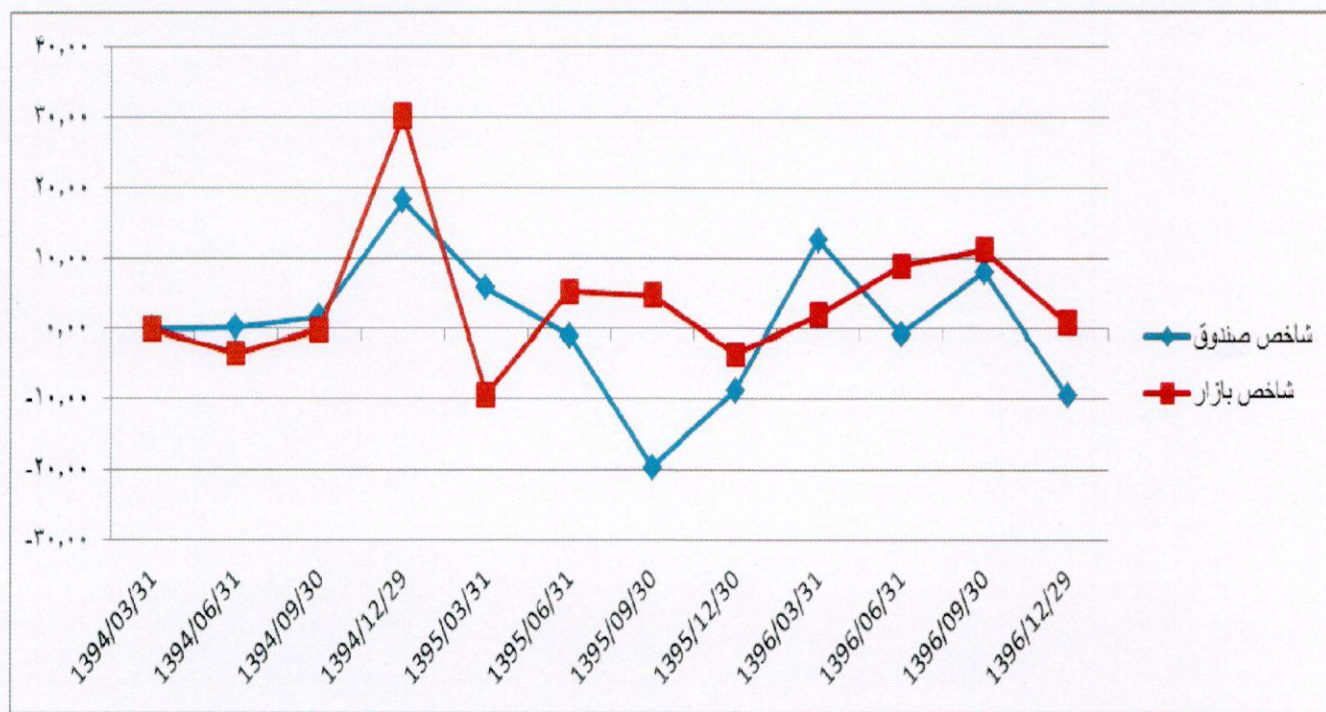
۳- حسابهای پرداختنی به ارکان صندوق در پایان دوره مالی :

شرح	مبلغ (ریال)
مدیر	۱,۱۶۲,۷۷۶,۸۵۹
متولی	۵۷,۳۲۲,۰۶۷
حسابرس	۱۳,۴۱۰,۹۶۵
جمع	۱,۲۳۳,۵۰۹,۸۹۱

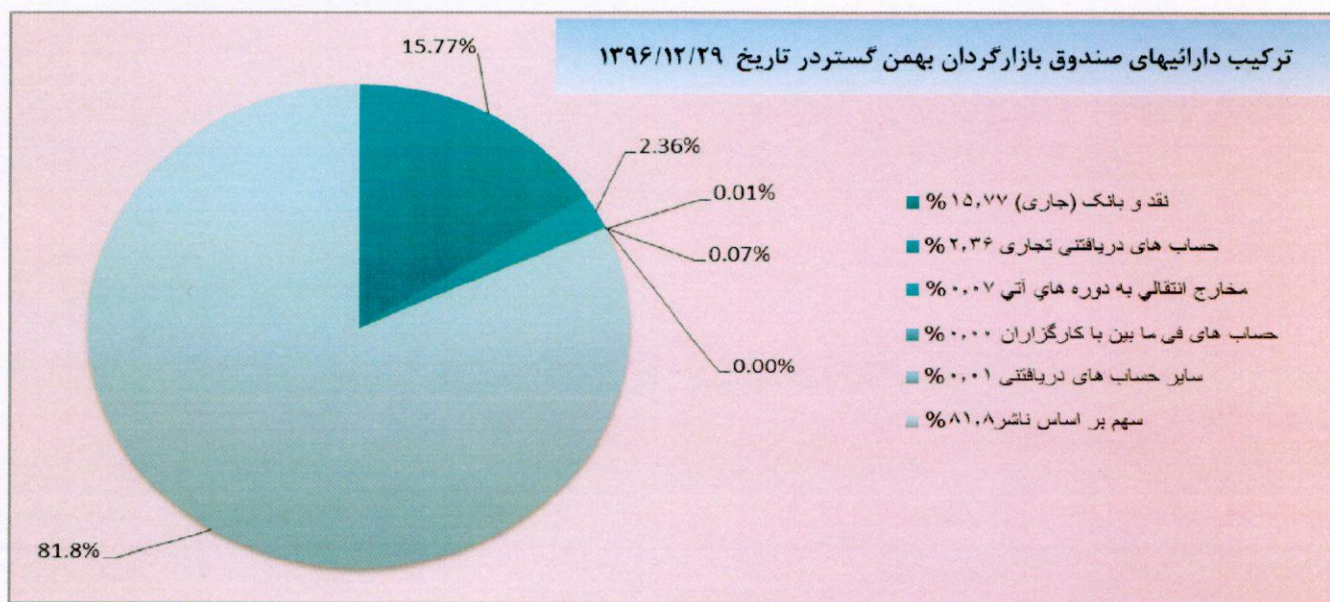


۴- بررسی بازدهی صندوق:

تاریخ	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری شده	خالص ارزش دارایی‌ها (میلیون ریال)	درصد افزایش خالص دارایی‌ها	خالص ارزش دارایی‌های هر واحد (ریال)	درصد افزایش خالص دارایی‌های متعلق به هر واحد	درصد افزایش شاخص کل
۱۳۹۴/۰۳/۳۱	۵۰,۰۰۰	۵۴,۲۰۲	۰.۰۰٪	۱,۰۸۴,۰۴۷	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
۱۳۹۴/۰۶/۳۱	۵۰,۰۰۰	۵۴,۳۱۷	۰.۲۱٪	۱,۰۸۶,۳۴۵	۰.۲۱٪	-۳.۵۰٪
۱۳۹۴/۰۹/۳۰	۵۰,۰۰۲	۵۵,۲۵۸	۱.۷۳٪	۱,۱۰۵,۱۲۴	۱.۷۳٪	-۰.۱۰٪
۱۳۹۴/۱۲/۲۹	۵۰,۰۰۲	۶۵,۳۶۸	۱۸.۳۰٪	۱,۳۰۷,۳۰۴	۱۸.۲۹٪	۳۰.۴۰٪
۱۳۹۵/۰۳/۳۱	۵۰,۰۰۲	۶۹,۱۸۰	۵.۸۳٪	۱,۳۸۳,۵۴۹	۵.۸۳٪	-۹.۴۸٪
۱۳۹۵/۰۶/۳۱	۵۰,۰۰۲	۶۸,۵۰۵	-۰.۹۸٪	۱,۳۷۰,۰۵۰	-۰.۹۸٪	۵.۲۸٪
۱۳۹۵/۰۹/۳۰	۵۰,۰۰۲	۵۵,۰۱۶	-۱۹.۶۹٪	۱,۱۰۰,۲۸۵	-۱۹.۶۹٪	۴.۸۰٪
۱۳۹۵/۱۲/۳۰	۵۰,۰۰۲	۵۰,۱۶۶	-۸.۸۲٪	۱,۰۰۳,۲۸۰	-۸.۸۲٪	-۳.۶۱٪
۱۳۹۶/۰۳/۳۱	۵۰,۰۰۲	۵۶,۵۵۷	۱۲.۷۴٪	۱,۱۳۱,۰۹۹	۱۲.۷۴٪	۱.۹۵٪
۱۳۹۶/۰۶/۳۱	۵۰,۰۰۲	۵۶,۱۳۶	-۰.۷۴٪	۱,۱۲۲,۶۸۸	-۰.۷۴٪	۹.۰۱٪
۱۳۹۶/۰۹/۳۰	۵۰,۰۰۲	۶۰,۶۸۴	۸.۱۰٪	۱,۲۱۳,۶۴۸	۸.۱۰٪	۱۱.۲۸٪
۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۵۰,۰۰۲	۵۴,۸۸۱	-۹.۵۶٪	۱,۰۹۷,۵۹۶	-۹.۵۶٪	۰.۸۲٪



ترکیب داراییهای صندوق بازارگردانی بهمن گستر:



**۵- مروری بر عملکرد مالی صندوق :**

۵-۱- صورت خالص داراییهای صندوق (دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۶) :

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی بهمن کستر**صورت خالص داراییها****در تاریخ ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۶**

داراییها :	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۰۳/۳۱
سرمایه گذاری در سهام	ریال	ریال
حسابهای دریافتی	۴۵,۹۹۵,۹۷۱,۰۴۶	۵۹,۵۴۰,۶۶۰,۳۹۸
سایر حسابهای دریافتی	۱,۳۲۴,۹۵۲,۴۷۲	۷,۱۲۶,۱۲۱,۳۳۵
جاری کارگزاران	۴,۲۰۲,۲۸۰	۴,۲۰۲,۲۸۰
سایر داراییها	۱,۸۶۱	-
موجودی نقد	۳۹,۸۸۹,۸۸۲	۲۲۹,۹۶۱,۵۷۸
جمع داراییها	۸,۸۶۴,۹۲۲,۹۹۶	۷۴,۲۲۰,۴۲۷
	۵۶,۲۲۹,۹۴۰,۵۳۷	۶۶,۹۷۵,۱۶۶,۰۱۸
بدهیها :		
سایر حسابهای پرداختی	۵۵,۸۷۵,۹۴۶	۱,۳۰۲,۰۷۱,۲۵۰
جاری کارگزاران	-	۸,۵۰۶,۸۱۶,۲۲۷
پرداختی به ارکان صندوق و ذخایر	۱,۲۹۲,۰۸۱,۶۲۲	۶۰۹,۰۷۴,۹۵۴
جمع بدهیها	۱,۳۴۷,۹۵۷,۵۶۸	۱۰,۴۱۷,۹۶۲,۴۳۱
خالص داراییها	۵۴,۸۸۱,۹۸۲,۹۶۹	۵۶,۵۵۷,۲۰۳,۵۸۷
خالص داراییهای هر واحد سرمایه گذاری - ریال	۱,۰۹۷,۵۹۶	۱,۱۳۱,۰۹۹



۵-۲- صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها (دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۶):

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی بهمن کستر

صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۶

درآمدها:	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۳۱
سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار	(۲,۳۰۱,۱۶۱,۰۶۱)	۳۵,۰۰۸,۶۲۴	۱,۳۸۵,۸۶۰,۵۶۸
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۳,۱۳۷,۶۸۱,۷۲۰)	(۲۳,۰۸۵,۹۳۰,۷۷۷)	(۱۷,۷۴۱,۰۹۴,۸۴۳)
سود سهام	۴,۷۱۴,۷۶۵,۱۴۳	۴,۹۹۳,۳۸۲,۶۸۰	۵,۱۹۵,۰۶۵,۳۸۸
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۰۳,۳۹۱,۲۴۶	۴۰,۶۸۷,۹۸۵	۴۱,۴۸۴,۱۱۳
جمع درآمدها	(۶۲۰,۶۸۶,۳۹۲)	(۱۸,۰۱۶,۸۵۱,۴۸۸)	(۱۱,۲۱۸,۶۸۴,۷۷۴)
هزینه ها:			
هزینه کارمزد ارکان	(۸۵۲,۲۷۷,۴۶۵)	(۸۰۴,۳۶۶,۸۲۹)	(۱,۱۴۳,۸۴۷,۴۶۸)
سایر هزینه ها	(۲۰۲,۳۵۶,۷۳۱)	(۱۹۲,۹۵۰,۵۱۶)	(۲۶۰,۴۶۳,۷۲۲)
جمع هزینه ها	(۱,۰۵۴,۵۳۴,۱۹۶)	(۹۹۷,۳۱۷,۳۴۵)	(۱,۴۰۴,۳۱۱,۱۹۰)
سود (زیان) خالص	(۱,۶۷۵,۲۲۰,۶۱۸)	(۱۹,۰۱۴,۱۶۸,۸۳۳)	(۱۲,۶۲۲,۹۹۵,۹۶۴)
بازده میانگین سرمایه گذاری ۱	(۲,۸۵٪)	(۳۰,۵۴۲٪)	(۲۰,۸۴۶٪)
بازده سرمایه گذاری در پایان سال ۲	(۳,۰۵٪)	(۳۷,۹۰٪)	(۲۲,۳۲٪)

صورت گردش خالص دارایی ها

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۳۱	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال
خالص دارایی ها در (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره/سال	۵۶,۵۵۷,۲۰۳,۵۸۷	۶۹,۱۸۰,۱۹۹,۵۵۱	۵۰,۰۰۲	۶۹,۱۸۰,۱۹۹,۵۵۱	۵۰,۰۰۲	۶۹,۱۸۰,۱۹۹,۵۵۱	۵۰,۰۰۲	۶۹,۱۸۰,۱۹۹,۵۵۱
واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره/سال	-	-	-	-	-	-	-	-
واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره/سال	-	-	-	-	-	-	-	-
سود (زیان) خالص	(۱,۶۷۵,۲۲۰,۶۱۸)	(۱۹,۰۱۴,۱۶۸,۸۳۳)	-	(۱۹,۰۱۴,۱۶۸,۸۳۳)	-	(۱۹,۰۱۴,۱۶۸,۸۳۳)	-	(۱۲,۶۲۲,۹۹۵,۹۶۴)
خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) در پایان دوره/سال	۵۴,۸۸۱,۹۸۲,۹۶۹	۵۰,۱۶۶,۰۳۰,۷۱۸	۵۰,۰۰۲	۵۰,۱۶۶,۰۳۰,۷۱۸	۵۰,۰۰۲	۵۰,۱۶۶,۰۳۰,۷۱۸	۵۰,۰۰۲	۵۴,۵۵۷,۲۰۳,۵۸۷