

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری بخشی رویین

دی ماه ۱۴۰۳

پرتفوی بر اساس گروه

فولاد	۳۹.۹٪
خارج از صنعت	۳۷.۳٪
مس	۱۸.۷٪
هلدینگ	۳.۲٪
طلا	۱٪

سهام	درصد از پرتفوی	سهام	درصد از پرتفوی
فولاد	۲۳.۰۶٪	وبملت	۲.۲۷٪
فملی	۱۸.۶۹٪	بهپاک	۲.۰۱٪
کاوه	۷.۷۷٪	وسینا	۱.۷۳٪
وپارس	۵.۹۷٪	خاور	۱.۶۷٪
فنورد	۴.۹۰٪	حکشتی	۱.۲۴٪
اپال	۳.۹۰٪	حزر	۰.۹۵٪
شتران	۳.۸۴٪	تیپیکو	۰.۹۲٪
وتوکا	۳.۱۸٪	غصینو	۰.۸۷٪
هرمز	۲.۹۸٪	پتایر	۰.۸۵٪
ونوین	۲.۷۸٪	فسپا	۰.۷۹٪
رمپنا	۲.۶۱٪	وامین	۰.۶۶٪

نام : صندوق سرمایه گذاری بخشی صنایع سورنا

نماد: رویین

سابقه صندوق: ۱۵ ماه

بازدهی ۳ ماهه: ۳۱/۳۷٪

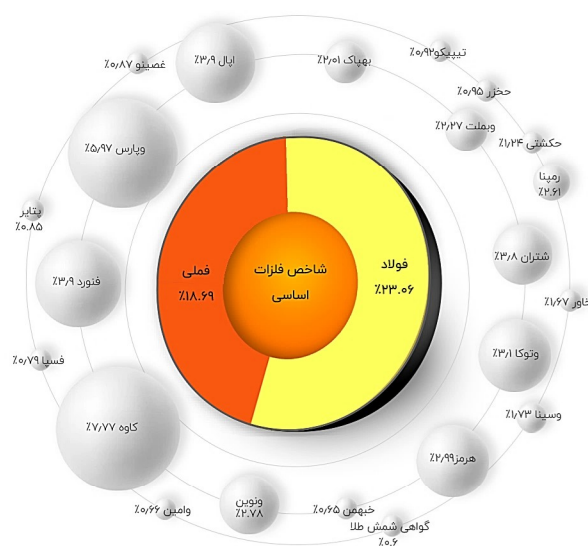
بازدهی از آغاز فعالیت: ۲۹/۱٪

ضریب بتا: ۰/۷۴

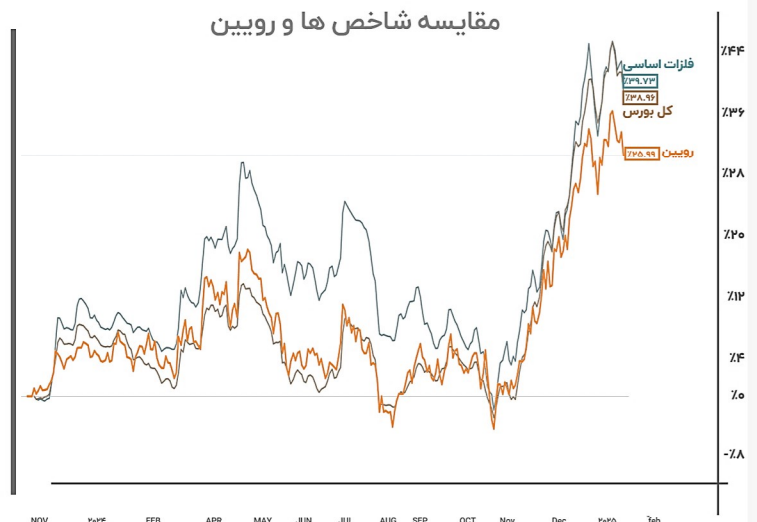
ضریب آلفا: -۰/۰۲

کل ارزش خالص دارایی ها: ۴۹۶ میلیارد تومان

تعداد قرارداد های باز آپشن : ۹۲۰۰۰ موقعیت



مقایسه شاخص ها و رویین



استراتژی Core/Satellite

خرید سهام صنعت فلزات اساسی و شاخص ساز بیشترین وزن پرتفوی رویین را تشکیل می دهد. در کنار آن، دیگر سهام پرتانسیل صنعت و خارج از صنعت بر اساس حد نصاب اعلام شده در اساسنامه را خریداری کرده، همچنین نگهداری شمش طلا و استفاده از ابزارهای مشتقه را در دستور کار دارد. استراتژی مدیران سرمایه گذاری رویین، مدیریت پویا است.