

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰

## مقدمه

در این گزارش خلاصه عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ ارائه می گردد.

## معرفی صندوق

در اجرای ماده ۲۸ و بند ۶ ماده ۷ قانون بازار اوراق بهادار جمهوری اسلامی ایران مصوب آذر ماه ۱۳۸۴ و ماده (۲) قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید، به منظور تسهیل اجرای سیاست های کلی اصل ۴۴ قانون اساسی مصوب آذر ماه ۱۳۸۸ با مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۷/۰۳/۰۱ نزد اداره ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری تهران نهاد مالی جدیدی به نام صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین با شناسه ملی ۱۴۰۰۷۶۰۶۰۳۹ معرفی گردید. در همین راستا پس از تصویب اساسنامه، دستورالعمل و سایر ساز و کارهای مورد نیاز، مجوز تاسیس صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین در تاریخ ۱ خرداد ماه ۱۳۹۷ تحت شماره ۴۴۷۵۰ در اداره ثبت شرکت ها و در تاریخ ۲۰ تیر ماه ۱۳۹۷ تحت شماره ۱۱۵۹۵ در سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. مجوز رسمی فعالیت شرکت در تاریخ ۶ مردادماه ۱۳۹۷ صادر شده و صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین تحت مجوز رسمی سازمان در حال فعالیت می باشد. سرمایه اولیه صندوق برابر با ۳۵ میلیارد ریال می باشد که تماما پرداخت شده است.

ترکیب دارندگان واحدهای ممتاز صندوق، به شرح زیر است.

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد تملک تعداد واحدهای ممتاز
۱	بنیاد مستضعفان انقلاب اسلامی	۳۳.۲۵۰	۹۵
۲	کارگزاری بورس بهگزین	۱.۷۵۰	۵
	جمع	۳۵.۰۰۰	۱۰۰

سایر مشخصات صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین در تاریخ منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ به عبارت زیر است:

کارگزاری بورس بهگزین ( به نمایندگی جناب آقای احسان کلهران )	نام مدیر
شرکت مشاور سرمایه گذاری ایرانیان تحلیل فارابی	نام متولی
موسسه حسابرسی رازدار	حسابرس
آقای فرزاد جهانی	مدیر سرمایه گذاری صندوق
<a href="http://sinabehgozin.ir">http://sinabehgozin.ir</a>	تارنما صندوق

### استراتژی سرمایه گذاری صندوق

هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها و مدیریت این سبد است؛ با توجه به پذیرش ریسک موردقبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. انباشته‌شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد: اولاً هزینه بکارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه‌گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. ثالثاً، امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

## خالص ارزش کل داراییهای صندوق

خالص ارزش کل داراییهای صندوق در پایان دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ به ۲۰۶۶۱.۸۲۵ میلیون ریال رسیده است. روند تغییرات خالص ارزش داراییهای صندوق در نمودار زیر نمایش داده شده است.

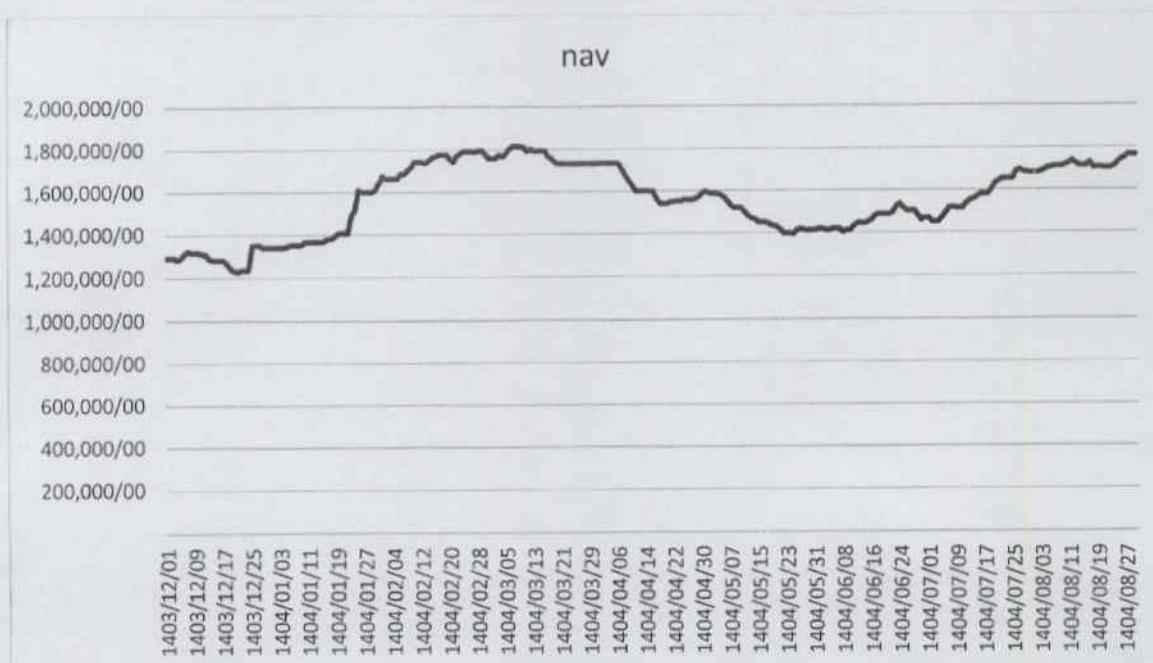
روند تغییرات ارزش کل داراییهای صندوق در طی دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰



## خالص ارزش دارایی های هر واحد (NAV)

خالص ارزش داراییهای هر واحد (NAV) صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین در پایان دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ به ۱.۷۶۴.۲۹۱ ریال رسیده است. NAV این صندوق در نمودار زیر ترسیم گردیده است.

روند تغییرات خالص ارزش دارایی های هر صندوق در طی دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰



## مقایسه بازدهی

در جدول زیر بازدهی صندوق بازارگردانی سینا بهگزین مشاهده می شود. مقدار شاخص کل بازار بورس اوراق بهادار در ابتدای سال مالی (۱۴۰۴)، ۲.۷۳۲.۲۲۸ واحد بوده است که در پایان دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ به عدد

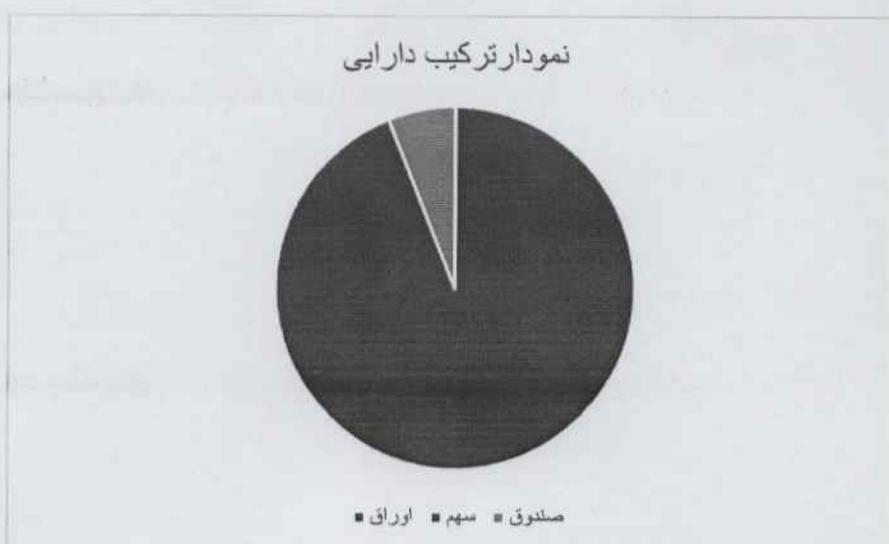
۳.۱۶۸.۵۶۳ واحد رسیده است. شاخص بازار در طی این دوره حدوداً ۱۶ درصد افزایش یافته است.

ردیف	نوصحات	ار تاریخ	تا تاریخ	باردهی صندوق	باردهی سالانه صندوق	باردهی شاخص
1	یک روز گذشته	1404/08/29	1404/08/30	(0/0)	(1/2)	0
2	هفت روز گذشته	1404/08/23	1404/08/30	3/6	185/2	2/3
3	روز گذشته 30	1404/07/30	1404/08/30	4/8	58/5	3/8
4	روز گذشته 90	1404/05/30	1404/08/30	24/9	100/8	28/0
5	روز گذشته 180	1404/02/30	1404/08/30	(0/7)	(1/5)	(1/8)
6	روز گذشته 365	1403/08/30	1404/08/30	52/9	0	39/6
7	از ابتدای فعالیت صندوق تا کنون	1397/05/06	1404/08/30	76/4	0	2,812/3

### ترکیب داراییهای صندوق

ترکیب سرمایه گذاریهای صندوق، در نمودار زیر نشان داده شده است.

نمودار ترکیب داراییهای صندوق در ۱۴۰۴/۰۸/۳۰



صندوق	تعداد خرید (بازارگردانی)	ارزش خرید	تعداد فروش (بازارگردانی)	ارزش فروش	ارزش کل بازار معاملات
هتل پارسیان کونر اصفهان	۱۶,۶۶۸,۵۹۳	۳۷,۱۶۰,۲۲۰,۷۲۵	۱۴,۷۵۷,۸۱۰	۳۵,۸۵۰,۳۳۷,۴۱۰	۲,۰۶۴,۵۶۱,۰۹۰,۴۰۹
شیر و گوشت زاگرس شهرکرد	۱۸,۰۷۸,۴۵۶	۲۴۸,۴۳۴,۴۵۴,۰۵۰	۱۳,۴۵۶,۶۱۴	۱۹۵,۱۷۴,۸۰۵,۰۵۰	۶,۲۷۲,۵۲۹,۳۵۰,۹۱۰
کشاورزی و دامپروری بینالود	۲۲,۴۷۰,۸۷۷	۱۵۴,۵۴۶,۲۵۱,۴۶۳	۳۴,۱۸۶,۶۰۵	۱۶۹,۴۸۶,۴۷۹,۵۴۰	۵,۹۴۵,۲۴۶,۱۹۹,۵۸۳
کشت و دام قیام اصفهان	۲۷,۸۸۶,۸۶۹	۱۱۲,۹۹۱,۹۹۵,۱۲۹	۲۴,۲۳۶,۷۶۰	۱۰۲,۴۷۰,۸۲۳,۹۶۰	۶,۲۳۲,۲۹۸,۳۱۷,۰۳۹
جنرال مکانیک	۲۴,۱۷۲,۲۵۵	۳۳۷,۹۱۳,۴۵۷,۰۳۹	۱۴,۹۷۵,۷۰۴	۲۳۰,۳۵۹,۰۷۹,۳۵۰	۶,۱۲۳,۰۵۷,۵۷۷,۳۰۰
برق و انرژی پیوند گستر پارس	۸,۳۶۶,۵۱۸	۸۶,۶۴۸,۵۲۸,۱۳۰	۷,۱۶۹,۷۴۰	۷۸,۹۱۶,۲۲۳,۸۰۰	۲,۶۱۶,۴۴۹,۴۶۹,۱۳۰
کشت و صنعت دشت خرم دره	۶,۸۸۹,۸۱۹	۱۹۹,۲۱۳,۵۱۸,۱۰۰	۵,۸۸۰,۷۹۵	۱۷۹,۶۲۳,۵۳۹,۷۵۰	۵,۳۳۳,۲۸۴,۱۵۶,۲۵۰
توسعه خدمات دریایی و بندری سینا	۸۰,۹۵۳,۱۳۰	۱,۰۶۹,۲۴۵,۶۰۱,۷۴۰	۶۶,۳۴۲,۵۲۷	۸۴۰,۲۲۷,۶۴۴,۲۲۱	۲۴,۷۰۳,۹۴۰,۸۰۷,۶۰۰
لبنیات پاک	-	-	-	-	۳,۰۴۰,۶۵۷,۴۰۸,۵۰۲
قند اصفهان	۱۵۸,۱۲۸,۰۸۲	۱۷۵,۳۸۵,۹۱۲,۰۳۷	۱۱۴,۰۲۹,۵۰۰	۱۳۶,۹۸۳,۹۴۲,۵۰۰	۶,۵۹۹,۶۹۹,۶۳۴,۲۵۷
فولادکاوه کیش	۹۲,۹۰۲,۳۰۴	۳۱۰,۲۸۱,۷۱۷,۴۲۲	۲۱,۳۵۹,۵۰۰	۸۰,۲۶۵,۴۶۱,۰۰۰	۲۵,۴۵۴,۱۹۹,۷۳۶,۹۷۹
کشاورزی و دامپروری مگسال	۲,۹۶۲,۶۶۳	۱۱۵,۷۸۹,۶۷۸,۵۱۰	۳,۲۸۹,۱۰۰	۱۵۱,۴۹۸,۸۶۶,۰۰۰	۵,۸۴۳,۳۸۸,۲۳۲,۳۰۰
شیشه و گاز	۵,۷۳۸,۰۴۱	۱۶۲,۶۹۲,۲۷۲,۵۵۰	۳,۹۸۶,۹۰۰	۱۱۴,۹۷۶,۷۴۴,۰۰۰	۴,۱۰۶,۸۵۱,۱۷۴,۰۰۰
کاشی سینا	۶,۸۰۹,۰۱۶	۸۲,۷۰۴,۸۳۵,۸۴۰	۷,۹۸۵,۴۵۰	۹۰,۲۲۷,۷۲۷,۰۰۰	۲,۸۸۸,۳۱۵,۳۰۴,۷۲۰
حفاری شمال	-	-	-	-	۴۴,۰۵۴,۳۷۴,۳۸۲,۶۷۷
ایران تایر	۱۵۲,۸۲۹,۹۷۳	۳۲۳,۵۶۱,۶۹۳,۳۸۷	۱۰۲,۵۲۰,۹۸۸	۲۵۵,۸۲۸,۵۹۱,۷۹۸	۱۱,۵۷۲,۰۶۳,۰۲۱,۳۷۰
سیمان هگمتان	۲,۴۵۰,۸۴۴	۳۰۴,۶۸۰,۰۸۸,۳۲۰	۱,۷۵۰,۰۰۰	۲۳۵,۹۵۸,۶۴۰,۰۰۰	۱۶,۳۳۹,۱۲۱,۸۴۴,۱۷۰
نفت پهران	۱۳,۹۵۸,۷۰۳	۲۱۳,۷۹۱,۱۹۳,۴۵۰	۱۴,۰۱۰,۳۹۹	۲۲۹,۲۷۳,۸۳۶,۲۷۰	۳۰,۴۴۰,۵۷۱,۴۸۰,۵۴۰
دامتاری تلیسه نمونه	۴,۷۲۱,۱۲۸	۱۶,۸۲۴,۹۱۷,۰۹۱	۱۵,۱۸۸,۰۳۴	۵۶,۵۱۷,۷۹۲,۴۸۱	۷,۷۶۶,۷۷۷,۱۲۲,۳۳۶
قند شبروان	۱۷,۲۵۴,۳۴۷	۱۵۵,۷۴۶,۵۸۶,۱۹۰	۱۴,۱۲۶,۵۲۶	۱۳۵,۷۵۷,۲۶۰,۳۸۰	۳,۰۶۸,۱۰۶,۴۱۳,۵۴۰
بیمه سینا	۸۷,۱۱۴,۹۰۷	۱۴۰,۵۷۸,۶۴۴,۵۴۰	۲۹,۱۷۸,۳۲۰	۴۷,۷۰۹,۸۳۵,۴۱۸	۲,۱۰۱,۳۸۵,۲۶۴,۸۲۲
سرمایه گذاری نیروگاهی سینا	۱۷,۰۹۱,۱۱۷	۲۲۸,۵۲۹,۵۷۹,۱۱۰	۸,۶۸۴,۹۰۸	۱۲۰,۵۲۹,۵۲۷,۹۲۰	۳,۱۳۸,۴۲۶,۳۳۵,۸۴۰
شیشه سازی مینا	-	-	-	-	۲,۲۰۸,۸۰۲,۲۲۹,۷۰۰
پاکدیس	۱۲,۸۰۸,۳۴۸	۳۱۵,۴۵۷,۴۵۷,۰۶۰	۱۵,۶۰۹,۷۱۰	۴۰۰,۴۷۸,۱۷۹,۵۰۰	۸,۹۲۱,۴۷۶,۰۵۷,۰۰۰
پهنوش ایران	۲,۳۷۰,۷۶۴	۱۲۶,۳۸۵,۴۲۰,۳۸۰	۳,۵۲۹,۹۸۰	۳۰۵,۳۱۱,۵۹۰,۸۰۰	۵,۷۰۲,۱۹۷,۱۴۹,۰۸۰
سیمان ایلام	۱,۴۹۸,۰۷۸	۲۰,۱۹۵,۲۲۴,۷۷۰	۳۱,۱۷۲,۶۰۶	۴۴۷,۳۳۵,۲۱۴,۳۸۰	۳,۲۸۸,۳۴۹,۵۷۰,۹۸۰
کاشی پارس	۱۵,۳۶۴,۸۷۶	۱۰۶,۶۱۱,۲۰۵,۵۱۰	۱۶,۷۱۶,۸۰۰	۱۱۴,۶۶۷,۸۳۰,۸۰۰	۴,۰۷۸,۳۰۶,۸۴۳,۳۹۴
سرمایه گذاری کوثر بهمن	۳۷,۵۵۱,۳۸۰	۶۰,۹۸۰,۱۱۰,۶۵۵	۱,۰۲۰,۶۹۳,۰۵۵	۱,۸۳۴,۰۹۱,۹۴۸,۸۵۰	۱,۶۳۶,۴۹۵,۸۰۰,۳۸۳
سیمان تهران	۵۳,۶۰۳,۴۷۷	۵۱۵,۰۹۸,۵۱۳,۹۰۰	۵۱,۶۲۲,۵۰۰	۴۹۴,۲۱۴,۳۷۵,۰۰۰	۱۷,۳۹۰,۷۵۸,۵۲۶,۳۳۰
معنی دماوند	۵۵۵,۹۹۸	۲۷,۳۰۳,۳۵۶,۰۲۰	۶۹۶,۰۰۰	۳۵,۸۱۴,۶۰۰,۰۰۰	۵,۱۲۳,۷۱۹,۲۹۸,۸۳۰
صنعتی دوده قام	۱۱,۷۰۳,۷۵۳	۱۵۹,۲۸۸,۲۴۰,۹۷۰	۹,۹۳۳,۸۷۰	۱۴۲,۱۳۳,۱۶۰,۲۰۰	۵,۱۰۲,۰۵۰,۷۳۹,۱۸۰
دامپروری فجر اصفهان	۳۲,۳۲۰,۱۱۴	۶۳۱,۱۸۰,۱۶۵,۴۷۹	۲۱,۷۵۰,۰۴۰	۴۳۶,۹۰۶,۳۴۱,۸۰۰	۱۸,۸۴۱,۵۰۶,۳۸۰,۰۹۰

## ارکان صندوق

ردیف	ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضا
۱	مدیر صندوق	شرکت کارگزاری بورس بهگزین	احسان کلهران	

