

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین

دوره مالی بیست و شش روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱

به مجمع عمومی عادی صندوق

مقدمه

در این گزارش خلاصه عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین برای دوره مالی بیست و شش روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ 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 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
۱	بنیاد مستضعفان و جانبازان	۳۳,۲۵۰
۲	کارگزاری بورس بهگزین	۱,۷۵۰

سایر مشخصات صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین در تاریخ منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ به عبارت زیر است.

نام مدیر	کارگزاری بورس بهگزین (به نمایندگی جناب آقای محمد مفید چپر دار)
نام متولی	شرکت سیدگردان پاداش سرمایه
حسابرس	موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت دایارهیافت
مدیر سرمایه گذاری صندوق	وحید پافشار
سایت صندوق	http://sinabehgozin.ir

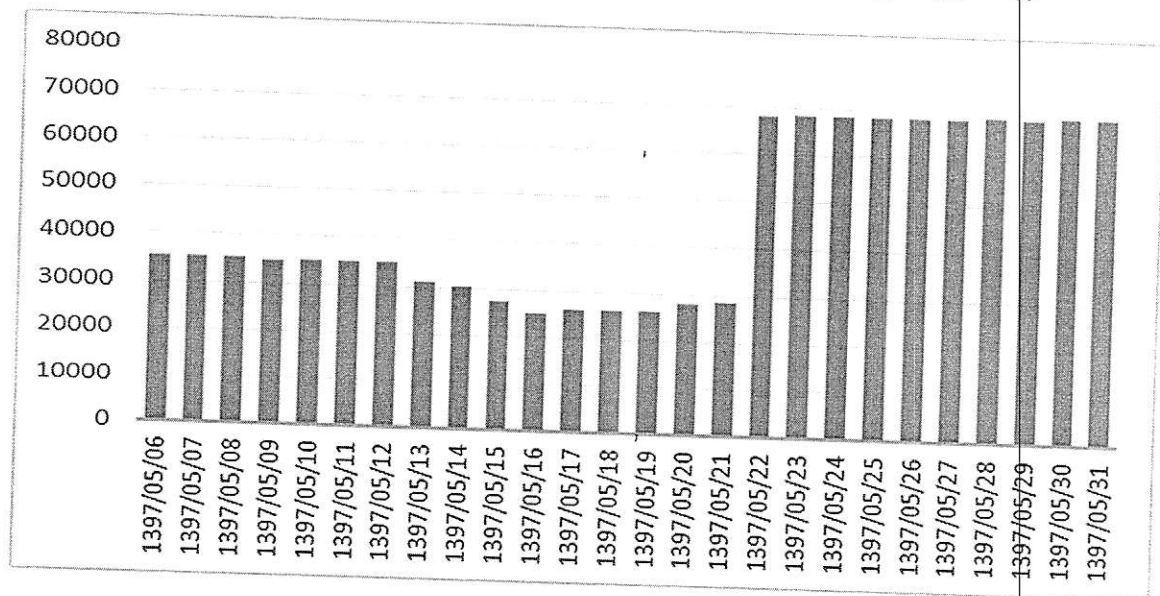
استراتژی سرمایه گذاری صندوق

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.

خالص ارزش کل داراییهای صندوق

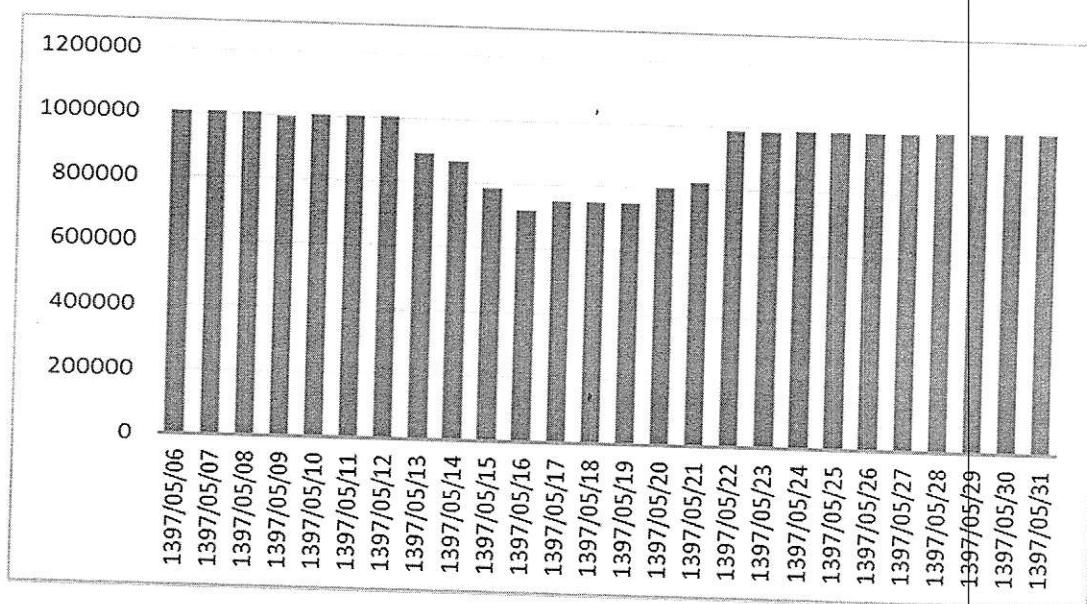
خالص ارزش کل داراییهای صندوق در ابتدای دوره اول مالی (مورخ ۱۳۹۷/۰۵/۰۶) ۳۲,۲۸۶ میلیون ریال بوده است و در پایان دوره مالی بیست و شش روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ به ۳۴۱,۰۸۵ میلیون ریال رسیده است. روند تغییرات خالص ارزش داراییهای صندوق در نمودار زیر نمایش داده شده است.

روند تغییرات ارزش کل داراییهای صندوق در طی دوره مالی بیست و شش روز منتهی به ۹۷/۰۵/۳۱



خالص ارزش دارایی های هر واحد (NAV)

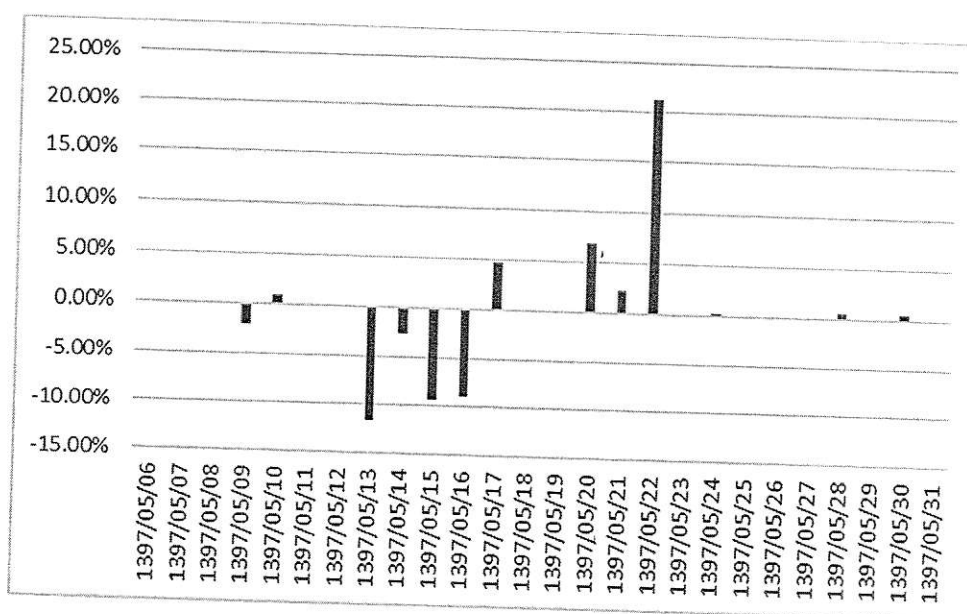
خالص ارزش داراییهای هر واحد (NAV) صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین در ابتدای دوره مالی (مورخ ۱۳۹۷/۰۵/۰۶) صندوق ۱,۰۰۸,۱۶۵ ریال بوده است که این مقدار در پایان دوره مالی بیست و شش روز منتهی به تاریخ ۹۷/۰۵/۳۱ به ۱,۰۰۰,۱۴۳ ریال رسیده است. NAV این صندوق در نمودار زیر ترسیم گردیده است.



مقایسه بازدهی

در نمودار زیر بازدهی صندوق بازارگردانی سینا بهگزین مشاهده می شود. مقدار شاخص کل در ابتدای سال مالی ۱۳۹۷، ۸۷۸،۱۱۱ واحد بوده است که در پایان دوره بیست و شش روز منتهی به ۳۱ مرداد ۹۷ به عدد ۱۳۶،۹۱۱ واحد رسیده است. شاخص بازار در طی این دوره حدوداً ۲۲ درصد افزایش یافته است.

بازده صندوق از ابتدای دوره مالی ۱۳۹۷ تا انتهای دوره مالی بیست و شش روز منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱



بازدهی صندوق از ۹۷/۰۵/۰۶ تا ۹۷/۰۵/۳۱ کار صندوق تا ۹۷/۰۵/۳۱

شرح	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق (ساده)
روز گذشته 7	1397/08/15	1397/08/22	2.77%
روز گذشته 30	1397/07/22	1397/08/22	-7.77%
روز گذشته 90	1397/05/24	1397/08/22	30.69%
روز گذشته 180	1397/05/06	1397/08/22	27.81%
روز گذشته 365	1397/05/06	1397/08/22	27.81%
از تاریخ تاسیس تا کنون	1397/05/06	1397/08/22	27.81 %
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			-28.26 %
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			38.91%

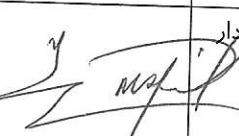
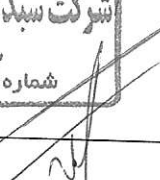
ترکیب داراییهای صندوق

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

نمودار ترکیب دارایی های صندوق در ۹۷/۰۵/۳۱

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تاسیس صندوق		میانگین روزانه دوره سه ماهه گذشته		میانگین روزانه آخرین ماه		امروز		
	مبلغ (میلیون ریال)	نسبت از کل دارایی	مبلغ (میلیون ریال)	نسبت از کل دارایی	مبلغ (میلیون ریال)	نسبت از کل دارایی	مبلغ (میلیون ریال)	نسبت از کل دارایی	نسبت از کل دارایی
وجه نقد	۳,۳۱۰,۲۳۴,۶۶۸	۱/۵۰٪	۲,۳۲۴,۹۷۶,۵۹۷	۰/۹۴٪	۶۶۷,۲۰۷,۱۸۲	۰/۲۰٪	۱۰۳,۹۶۱,۳۴۶	۰/۰۳٪	۰/۰۳٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۸,۸۳۹,۴۳۴,۳۱۹	۸/۵۳٪	۲۲,۰۸۰,۶۲۷,۳۲۰	۸/۹۱٪	۳۹,۲۱۸,۴۷۳,۹۹۶	۱۱/۶۲٪	۳۶,۳۶۸,۸۵۰,۴۱۴	۱۰/۶۴٪	۱۰/۶۴٪
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم شرکت ها	۱۷۲,۵۸۰,۷۹۰,۳۷۷	۷۸/۱۳٪	۱۹۲,۶۴۶,۳۰۳,۸۹۴	۷۷/۷۸٪	۲۵۹,۶۹۵,۵۸۵,۰۵۱	۷۶/۹۲٪	۲۶۹,۹۶۷,۰۴۴,۱۸۲	۷۸/۹۵٪	۷۸/۹۵٪
جاری کارگزاران	۲۶,۰۱۳,۰۲۹,۱۲۶	۱۱/۷۸٪	۳۰,۴۸۸,۳۸۸,۹۷۶	۱۲/۳۱٪	۳۷,۹۱۸,۴۵۳,۱۸۵	۱۱/۲۳٪	۳۵,۴۲۰,۲۲۲,۶۷۷	۱۰/۴۴٪	۱۰/۴۴٪
سایر دارایی ها	۱۴۴,۳۰۰,۹۷۱	۰/۰۷٪	۱۳۹,۸۲۵,۹۴۴	۰/۰۶٪	۱۱۶,۰۰۰,۲۴۹	۰/۰۳٪	۱۰۱,۹۳۰,۴۶۲	۰/۰۳٪	۰/۰۳٪

ارکان صندوق

ردیف	ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضا
۱	مدیر صندوق	شرکت کارگزاری بورس بهگزین	محمد مفید چپر دار	
۲	متولی صندوق	شرکت سبدگردان پاداش سرمایه (سهامی خاص)	کوروش شمس	

شرکت سبدگردان پاداش سرمایه
سهامی خاص
شماره ثبت: ۴۶۱۷۹۸۸