

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱

## مقدمه

در این گزارش خلاصه عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ 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 تماماً 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 ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ به عبارت زیر است:

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

### استراتژی سرمایه گذاری صندوق

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری 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

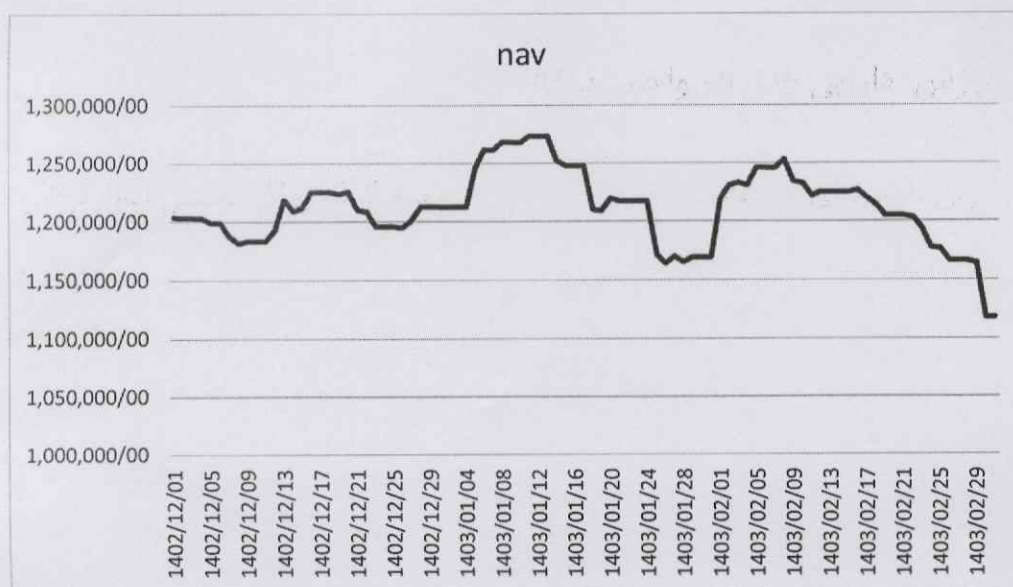
خالص ارزش کل داراییهای صندوق در پایان دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ به ۱۷.۲۸۵.۸۲۴ میلیون ریال رسیده است. روند تغییرات خالص ارزش داراییهای صندوق در نمودار زیر نمایش داده شده است.

روند تغییرات ارزش کل داراییهای صندوق در طی دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱



## خالص ارزش دارایی های هر واحد (NAV)

خالص ارزش داراییهای هر واحد (NAV) صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزين در پایان دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ به ۱.۱۱۷.۹۸۰ ریال رسیده است. NAV این صندوق در نمودار زیر ترسیم گردیده است.



## مقایسه بازدهی

در جدول زیر بازدهی صندوق بازارگردانی سینا بهگزين مشاهده می شود. مقدار شاخص کل بازار بورس اوراق بهادار در ابتدای سال مالی (۱۴۰۳)، ۲.۰۷۰.۷۷۵ واحد بوده است که در پایان دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ به عدد ۲.۱۱۲.۵۶۰ واحد رسیده است. شاخص بازار در طی این دوره حدوداً ۲.۰۲ درصد افزایش یافته است.

| توضیحات                        | از تاریخ   | تا تاریخ   | بازده صندوق | بازده سالانه صندوق | بازده شاخص |
|--------------------------------|------------|------------|-------------|--------------------|------------|
| از ابتدای فعالیت صندوق تا کنون | ۱۳۹۷/۰۵/۰۶ | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ | ۱۱,۸۰%      | ۰,۰۰%              | ۱۸۴,۶۹%    |
| ۱۸۰ روز گذشته                  | ۱۴۰۲/۰۹/۰۱ | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ | ۷,۷۶%       | ۱۵,۷۳%             | ۴,۵۷%      |
| ۹۰ روز گذشته                   | ۱۴۰۲/۱۲/۰۱ | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ | ۷,۱۳%       | ۲۸,۹۱%             | ۲,۰۲%      |
| ۳۰ روز گذشته                   | ۱۴۰۳/۰۱/۳۱ | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ | ۴,۳۶%       | ۵۳,۰۹%             | ۴,۳۳%      |
| هفت روز گذشته                  | ۱۴۰۳/۰۲/۲۴ | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ | ۵,۰۶%       | ۲۶۳,۹۴%            | ۳,۶۸%      |
| یک روز گذشته                   | ۱۴۰۳/۰۲/۳۰ | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ | ۰,۰۰%       | ۱,۳۳%              | ۲,۵۹%      |

## ترکیب داراییهای صندوق

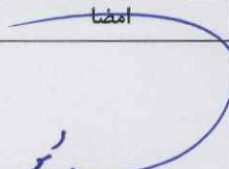
ترکیب سرمایه گذاریهای صندوق، در نمودار زیر نشان داده شده است.

نمودار ترکیب داراییهای صندوق در ۱۴۰۳/۰۲/۳۱



| سندوق                              | تعداد خرید<br>(بازارگردانی) | ارزش خرید       | تعداد فروش<br>(بازارگردانی) | ارزش فروش      | ارزش کل بازار معاملات |
|------------------------------------|-----------------------------|-----------------|-----------------------------|----------------|-----------------------|
| هتل پارسیان کوثر اصفهان            | ۱۲,۷۵۰,۹۷۴                  | ۳۱,۶۰۵,۵۵۳,۸۷۹  | ۵۱۹,۶۸۵                     | ۱,۳۴۵,۶۶۶,۶۶۵  | ۱,۴۱۵,۵۲۶,۱۷۲,۶۶۸     |
| شیر و گوشت زاگرس شهرکرد            | ۱۱,۸۲۹,۶۲۶                  | ۱۶۲,۴۰۸,۴۴۳,۵۲۴ | ۷۴۱,۵۷۲                     | ۱۱,۷۲۱,۸۶۹,۴۷۰ | ۳,۱۸۹,۴۱۹,۴۳۶,۸۹۰     |
| کشاورزی و دامپروری بینالود         | ۱۰,۳۸۸,۷۷۶                  | ۴۴,۲۳۷,۷۲۰,۸۸۴  | ۲۵,۱۲۱                      | ۱۱۱,۹۱۴,۰۵۵    | ۵۵۴,۱۱۶,۹۲۳,۱۸۴       |
| کشت و دام قیام اصفهان              | ۱۳,۱۶۷,۴۷۶                  | ۴۷,۲۵۷,۱۳۵,۵۱۶  | ۱۹۴,۵۲۲                     | ۷۰۴,۶۳۵,۸۲۵    | ۱,۸۹۹,۳۹۰,۷۱۶,۸۳۸     |
| جنرال مکتیک                        | ۴,۶۱۶,۲۹۴                   | ۴۵,۰۷۰,۵۰۸,۳۳۸  | ۵۶۷,۵۷۹                     | ۶,۱۷۱,۲۲۷,۲۰۰  | ۱,۶۳۰,۱۹۳,۰۷۸,۵۱۰     |
| برق و انرژی پیوند گستر پارس        | ۸۳۰,۹۱۵                     | ۱۰,۵۴۲,۹۷۲,۵۱۰  | ۲۰,۲۵۰                      | ۲۶۷,۲۶۴,۵۳۰    | ۱,۰۳۵,۰۴۰,۸۵۸,۸۹۰     |
| کشت و صنعت دشت خرم دره             | ۱,۷۵۰,۹۲۵                   | ۴۸,۸۶۲,۶۱۶,۶۹۹  | -                           | -              | ۹۷۴,۲۵۵,۳۳۲,۱۰۰       |
| توسعه خدمات دریایی و بندری<br>سینا | ۱,۳۳۶,۲۱۷                   | ۴۳,۷۳۵,۰۵۹,۲۵۰  | -                           | -              | ۳,۲۴۰,۸۵۶,۱۱۹,۱۵۰     |
| لبنیات پاک                         | ۱۱,۵۵۰,۹۵۷                  | ۲۰,۴۸۲,۷۸۴,۱۹۷  | -                           | -              | ۷۵۲,۶۳۳,۹۶۱,۳۴۳       |
| قند اصفهان                         | ۸۸,۲۸۲                      | ۱۴,۶۷۵,۷۳۱,۸۷۰  | -                           | -              | ۲,۰۵۶,۰۴۹,۶۷۸,۵۴۰     |
| فولادکود کیش                       | ۲,۱۲۵,۳۱۱                   | ۲۴,۲۹۶,۵۲۴,۴۹۰  | -                           | -              | ۲,۹۸۹,۴۱۵,۸۵۹,۷۸۰     |
| کشاورزی و دامپروری مگسال           | ۴۶۸,۱۶۱                     | ۱۸,۲۵۷,۱۴۳,۰۹۰  | -                           | -              | ۶۰۹,۵۰۰,۰۰۰,۴۷۰       |
| شیشه و گاز                         | ۷۲۳,۷۱۱                     | ۲۷,۹۷۹,۰۶۱,۰۸۰  | -                           | -              | ۳,۲۲۷,۳۵۴,۳۰۹,۵۲۰     |
| کاشی سینا                          | ۹۹۹,۵۸۶                     | ۱۸,۹۸۳,۲۱۰,۹۸۰  | -                           | -              | ۷۰۵,۹۲۴,۸۷۸,۲۶۰       |
| حقاری شمال                         | -                           | -               | ۳۰,۶۰۰,۰۰۰                  | ۲۱,۵۷۳,۰۰۰,۰۰۰ | ۵,۶۴۵,۰۷۷,۳۸۲,۸۱۰     |
| ایران تایر                         | ۸,۵۶۸,۱۲۹                   | ۱۸,۰۲۸,۹۸۰,۰۹۱  | -                           | -              | ۱,۳۳۳,۳۵۰,۳۱۳,۸۹۷     |
| سیمان هگمتان                       | ۲۲۵,۱۶۱                     | ۱۵,۴۳۵,۲۱۴,۶۳۰  | -                           | -              | ۶۲۸,۲۵۲,۷۲۵,۰۰۰       |
| نفت بهران                          | ۱,۳۴۳,۱۹۵                   | ۲۱,۱۸۶,۱۲۷,۷۳۰  | -                           | -              | ۳,۲۲۹,۵۵۲,۰۹۵,۹۱۰     |
| دامداری تلیسه نمونه                | ۱۱,۳۲۹,۳۲۷                  | ۴۶,۳۷۴,۱۱۰,۶۹۳  | ۴۵۴,۴۴۵                     | ۲,۱۰۵,۹۵۴,۵۰۰  | ۲,۹۷۵,۷۴۳,۵۲۱,۳۳۵     |
| قند شیروان                         | ۶,۷۰۹,۰۱۱                   | ۵۹,۶۳۷,۳۱۰,۱۶۸  | ۸۸,۷۸۲                      | ۸۴۰,۳۱۷,۲۰۰    | ۱,۰۷۱,۵۳۱,۹۴۳,۹۷۰     |
| بیمه سینا                          | ۶,۴۱۳,۹۸۳                   | ۱۳,۱۴۴,۵۰۰,۸۱۲  | -                           | -              | ۳۳۱,۸۱۷,۳۶۹,۷۸۵       |
| سرمایه گذاری نیروگاهی سنا          | ۱,۴۰۸,۶۷۸                   | ۲۱,۶۶۱,۱۹۶,۰۱۰  | ۱۱,۶۵۰                      | ۱۸۹,۸۵۹,۶۹۰    | ۶۴۹,۶۹۸,۷۰۴,۶۷۰       |
| شیشه سازی مینا                     | -                           | -               | -                           | -              | ۱,۱۴۶,۷۶۹,۴۹۲,۴۲۰     |
| پاکدیس                             | ۲,۵۲۲,۸۹۲                   | ۴۰,۴۰۶,۴۶۱,۲۹۹  | ۸,۵۵۹                       | ۱۴۱,۵۷۵,۱۱۰    | ۲,۰۵۳,۳۲۵,۰۸۹,۴۴۰     |
| بهنوش ایران                        | ۲۱۰,۰۷۱                     | ۱۴,۰۶۷,۷۲۹,۳۶۰  | -                           | -              | ۶۷۷,۶۶۶,۴۶۶,۴۸۰       |
| سیمان ایلام                        | ۱,۶۸۰,۶۱۵                   | ۲۹,۹۶۶,۵۰۴,۹۱۰  | -                           | -              | ۲,۹۲۵,۷۰۶,۰۹۷,۴۲۰     |
| کاشی پارس                          | ۱,۳۰۱,۰۲۹                   | ۱۳,۷۵۸,۱۶۱,۳۲۰  | -                           | -              | ۱,۰۶۰,۳۰۶,۲۷۸,۲۸۰     |
| سرمایه گذاری کوثر بهن              | ۶,۳۹۳,۷۹۸                   | ۲۴,۳۲۰,۲۲۸,۶۲۲  | -                           | -              | ۶۵۱,۳۵۳,۵۳۰,۸۴۷       |
| سیمان تهران                        | ۵,۳۶۴,۲۲۴                   | ۳۱,۵۸۱,۳۴۳,۶۷۹  | -                           | -              | ۲,۸۴۵,۹۸۵,۷۵۵,۱۶۰     |
| معدنی دماوند                       | ۱,۲۴۰,۸۲۲                   | ۸۱,۸۹۴,۲۳۰,۸۵۰  | -                           | -              | ۲,۵۹۷,۷۹۶,۵۶۴,۰۱۰     |
| صنعتی دوده فام                     | ۴۶۸,۰۵۰                     | ۱۶,۹۲۷,۸۶۵,۱۰۰  | ۸,۵۵۷                       | ۳۰۷,۱۱۴,۹۵۰    | ۱,۰۷۵,۹۲۱,۷۰۵,۴۶۰     |
| دامپروری فجر اصفهان                | ۲,۵۱۵,۵۷۹                   | ۵۰,۳۷۷,۵۴۷,۶۴۹  | ۵۵,۸۲۷                      | ۱,۱۷۶,۷۸۱,۴۵۰  | ۱,۰۷۲,۴۳۸,۸۴۵,۸۳۰     |

## ارکان صندوق

| ردیف | ارکان صندوق | شخص حقوقی                 | نماینده          | امضا                                                                              |
|------|-------------|---------------------------|------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|
| ۱    | مدیر صندوق  | شرکت کارگزاری بورس بهگزین | محمد حسن هراتیان |  |

