

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین

سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰

مقدمه

در این گزارش خلاصه عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ 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 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 ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ به عبارت زیر است:

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

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

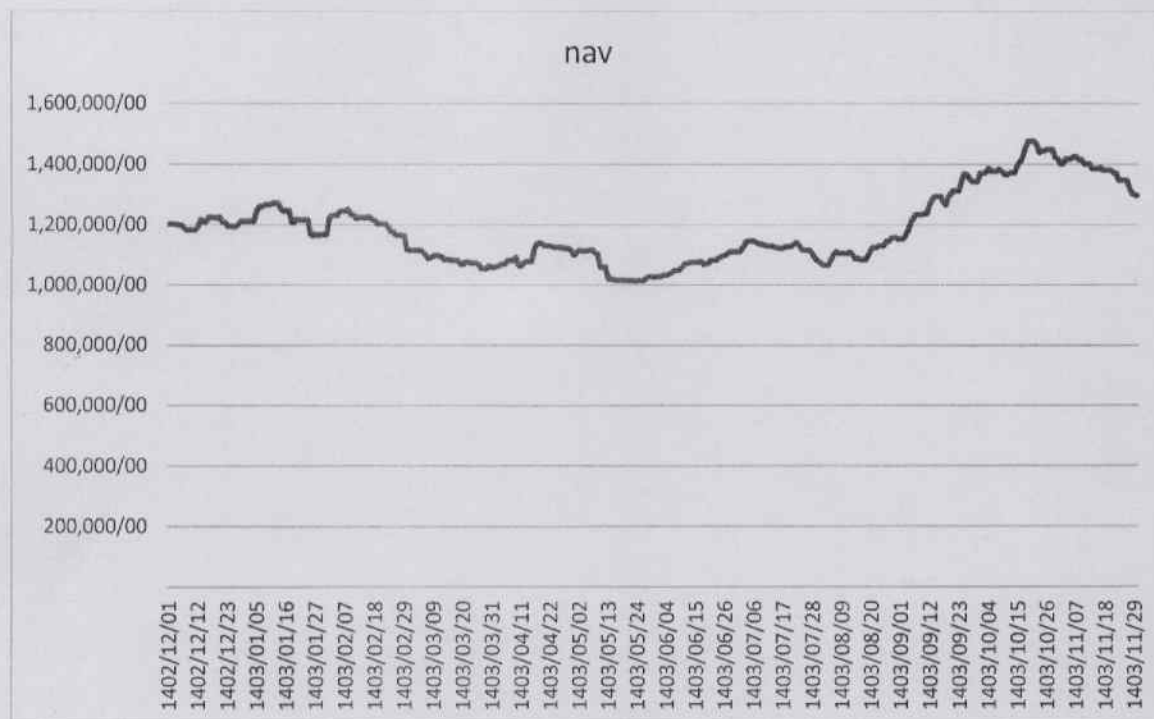
خالص ارزش کل داراییهای صندوق در پایان سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ به ۲۰.۳۶۵۶۰۶ میلیون ریال رسیده است. روند تغییرات خالص ارزش داراییهای صندوق در نمودار زیر نمایش داده شده است.

روند تغییرات ارزش کل داراییهای صندوق در طی سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰



خالص ارزش دارایی های هر واحد (NAV)

خالص ارزش داراییهای هر واحد (NAV) صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی سینا بهگزین در پایان سال مالی منتهی به تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ به ۱.۲۹۶.۶۴۹ ریال رسیده است. NAV این صندوق در نمودار زیر ترسیم گردیده است.



مقایسه بازدهی

در جدول زیر بازدهی صندوق بازارگردانی سینا بهگزین مشاهده می شود. مقدار شاخص کل بازار بورس اوراق بهادار در ابتدای سال مالی (۱۴۰۳)، ۲۰۷۰.۷۷۵ واحد بوده است که در پایان سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ به عدد ۲.۷۱۹.۳۳۹ واحد رسیده است. شاخص بازار در طی این دوره حدودا ۳۱ درصد افزایش یافته است.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده سالانه صندوق	بازده شاخص
از ابتدای فعالیت صندوق تا کنون	۱۳۶۷/۰۵/۰۶	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۲۹.۶۶%	۰.۰۰%	۲۳۹۹.۳۹%
۱۸۰ روز گذشته	۱۴۰۳/۰۵/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۲۶.۷۲%	۵۳.۱۶%	۳۳.۴۳%
۹۰ روز گذشته	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۱۲.۳۸%	۵۰.۲۱%	۱۹.۸۱%
۳۰ روز گذشته	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۸.۵۰%	۱۰۳.۳۶%	۳.۴۲%
هفت روز گذشته	۱۴۰۳/۱۱/۲۳	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۳.۷۸%	۱۹۶.۸۴%	۳.۶۳%
یک روز گذشته	۱۴۰۳/۱۱/۲۹	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۰.۱۱%	۷۰.۰۵%	۱.۵۱%

ترکیب داراییهای صندوق

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

نمودار ترکیب داراییهای صندوق در ۱۴۰۳/۱۱/۳۰



سندوق	تعداد خرید (بازارگردانی)	ارزش خرید	تعداد فروش (بازارگردانی)	ارزش فروش	ارزش کل بازار معاملات
هتل پارسپان کوثر اصفهان	۳۱,۳۰۲,۶۹۷	۷۶,۲۸۹,۴۴۲,۸۵۳	۳,۳۸۲,۳۷۵	۸,۳۳۲,۶۶۳,۴۴۵	۳,۷۹۲,۳۱۵,۵۴۸,۳۴۵
شیر و گوشت زاگرس شهرکرد	۲۷,۵۸۳,۷۶۵	۳۵۶,۰۶۶,۲۹۰,۱۵۴	۲۲,۴۳۵,۳۷۲	۲۵۸,۹۵۶,۹۳۱,۴۷۰	۸,۰۰۴,۱۹۰,۲۴۴,۲۳۰
کشاورزی و دامپروری بینالود	۳۲,۴۰۲,۷۵۵	۱۲۷,۳۱۱,۲۲۱,۷۶۱	۱۲,۳۸۶,۶۸۱	۴۹,۷۹۲,۸۱۳,۹۲۵	۴,۰۶۲,۴۶۳,۴۵۸,۹۴۷
کشت و دام قیام اصفهان	۶۳,۸۱۳,۷۸۷	۲۲۶,۸۶۸,۵۸۸,۲۲۷	۴۶,۴۷۴,۷۹۲	۱۶۲,۸۲۳,۲۹۸,۳۴۵	۵,۷۶۰,۵۱۷,۲۹۶,۸۶۸
جنرال مکتیک	۱۵,۰۸۶,۲۴۵	۱۹۸,۵۵۸,۸۱۵,۷۲۸	۱۳,۸۶۸,۵۴۹	۱۹۴,۵۸۰,۱۹۷,۰۵۰	۸,۴۷۴,۳۲۲,۸۵۳,۱۸۰
برق و قهری پیوند گستر پارس	۳,۴۶۵,۷۴۸	۴۲,۷۲۶,۵۷۰,۸۲۰	۱,۳۵۷,۰۲۵	۱۷,۵۵۶,۷۶۸,۲۸۰	۳,۲۸۳,۳۳۳,۳۰۹,۵۵۰
کشت و صنعت دشت خرم حره	۳,۹۶۸,۴۲۰	۱۱۰,۵۹۵,۳۳۰,۹۹۹	۳,۹۴۵,۸۸۹	۱۰۶,۶۷۱,۶۸۰,۰۰۰	۴,۵۴۳,۳۰۶,۶۲۷,۳۵۰
توسعه خدمات دریایی و بندری سینا	۱۰,۸۵۹,۶۸۶	۵۴۶,۰۸۰,۵۲۹,۰۵۰	۱۱,۰۶۱,۳۵۰	۶۴۰,۸۵۸,۲۸۲,۵۰۰	۳۶,۶۱۵,۹۴۷,۴۴۶,۳۰۰
لبنیات پاک	۲۷,۸۵۶,۰۷۲	۳۸,۴۹۹,۴۱۹,۱۲۴	۱۶,۱۰۵,۰۰۱	۱۷,۸۸۳,۴۱۷,۰۰۱	۴,۰۶۶,۴۸۵,۴۳۱,۸۸۰
قند اصفهان	۶۶,۴۵۴,۴۴۰	۱۱۴,۹۰۰,۶۳۰,۵۹۶	۶۳,۳۷۵,۰۰۰	۷۸,۱۶۶,۹۵۹,۵۰۰	۸,۸۶۹,۲۸۷,۳۳۹,۲۸۵
فولاد کاوه کیش	۲۲,۵۰۰,۹۲۰	۱۸۸,۷۸۰,۷۰۶,۱۷۰	۷,۱۷۴,۲۵۰	۵۱,۸۱۲,۸۸۲,۰۰۰	۱۵,۵۳۰,۲۷۳,۷۹۱,۳۴۰
کشاورزی و دامپروری مگسال	۲,۴۶۶,۳۶۲	۸۸,۳۰۳,۳۶۶,۶۲۰	۲,۳۹۳,۲۵۰	۹۲,۶۵۲,۹۶۶,۵۰۰	۴,۲۱۷,۲۹۱,۳۰۷,۲۷۰
شیشه و گاز	۴,۴۵۷,۱۶۶	۱۵۸,۱۷۳,۴۷۲,۶۱۰	۵,۵۲۶,۲۵۰	۱۸۳,۷۳۵,۹۰۴,۰۰۰	۱۰,۸۵۲,۶۳۸,۶۵۴,۶۲۰
کاشی سینا	۳,۱۳۰,۳۰۱	۶۱,۱۶۸,۵۲۲,۳۱۰	۱,۸۴۴,۵۰۰	۳۴,۴۹۲,۷۷۷,۵۰۰	۳,۲۷۰,۱۲۵,۹۲۴,۹۸۰
حفاری شمال	-	-	۳,۰۶۰,۰۰۰	۳۱,۵۷۳,۰۰۰,۰۰۰	۳۴,۴۳۵,۳۰۱,۱۳۶,۰۳۰
ایران تایر	۶۵,۰۵۲,۹۹۴	۱۶۴,۶۴۴,۴۶۲,۹۸۹	۵۸,۵۳۶,۹۱۶	۱۵۲,۱۴۹,۰۹۱,۱۷۶	۱۴,۱۵۹,۲۲۰,۴۹۱,۳۸۵
سیمان هگمتان	۱,۲۰۵,۱۱۵	۸۱,۹۵۹,۷۷۵,۸۷۰	۱۳۸,۶۰۰	۱۰,۳۰۳,۷۷۶,۰۰۰	۴,۵۸۴,۴۱۶,۰۶۳,۸۴۰
نفت بهران	۸,۲۷۵,۷۱۱	۱۱۹,۴۴۳,۱۹۰,۹۷۰	۶,۹۲۶,۲۵۰	۹۵,۳۴۹,۹۳۹,۵۰۰	۱۵,۰۷۱,۶۶۵,۷۱۵,۸۴۰
دامداری تلیسه نمونه	۴۱,۱۲۸,۶۸۱	۱۵۳,۸۶۷,۹۳۲,۰۴۸	۳۳,۵۳۷,۷۲۳	۱۱۳,۴۱۲,۷۱۹,۹۰۰	۸,۸۸۶,۸۷۶,۸۱۷,۰۸۵
قند شیروان	۱۶,۷۸۲,۴۸۰	۱۳۹,۴۷۳,۲۴۴,۹۶۷	۱۳,۱۴۸,۸۱۱	۱۰۵,۱۳۱,۵۰۶,۶۶۰	۳,۶۶۳,۰۹۶,۲۵۷,۰۷۰
بیمه سینا	۴۴,۴۲۴,۸۰۱	۹۳,۴۲۶,۱۸۳,۸۶۶	۳۲,۱۲۴,۲۱۶	۷۰,۷۰۳,۶۲۷,۳۳۰	۲,۵۴۵,۸۰۰,۰۷۶,۰۹۵
سرمایه گذاری نیروگاهی سنا	۳,۴۵۶,۱۸۰	۵۴,۴۵۴,۲۲۷,۱۳۰	۴۳۵,۳۳۰	۷۰,۴۹۹,۲۴۸,۸۹۰	۳,۳۴۱,۲۸۰,۱۲۴,۳۴۰
شیشه سازی مینا	-	-	-	-	۵,۴۰۲,۵۹۷,۹۳۷,۳۹۰
پاکدیس	۱۱,۱۱۸,۶۷۰	۲۰۹,۳۳۴,۷۵۶,۷۰۹	۹,۱۲۱,۴۸۴	۱۷۲,۱۳۳,۷۱۴,۶۱۰	۹,۷۷۷,۶۱۵,۶۱۳,۴۴۰
بهتوش ایران	۸۴۴,۶۸۴	۴۹,۵۶۳,۱۲۴,۶۹۰	۷۹۰,۴۰۰	۴۶,۴۶۱,۱۲۰,۰۰۰	۳,۴۶۳,۷۳۴,۲۷۸,۳۱۰
سیمان ایلام	۶,۳۵۱,۸۲۶	۸۷,۳۴۸,۷۹۱,۷۰۹	۴,۷۸۷,۵۰۰	۵۸,۳۹۳,۸۷۵,۰۰۰	۴,۸۸۲,۶۷۳,۸۴۰,۰۳۰
کاشی پارس	۷,۹۴۲,۶۸۲	۷۴,۴۶۱,۱۲۷,۷۶۰	۲,۹۶۱,۸۰۰	۲۵,۰۷۰,۸۸۴,۰۰۰	۳,۷۸۲,۴۰۴,۲۸۹,۳۷۰
سرمایه گذاری کوثر بهمن	۳۶,۵۳۶,۴۶۳	۷۸,۳۰۴,۷۸۵,۸۳۵	۱۶,۳۵۸,۱۰۰	۳۸,۴۰۲,۹۴۸,۴۰۰	۳,۰۹۳,۸۰۴,۱۱۷,۳۸۸
سیمان تهران	۱۷,۵۳۳,۲۵۷	۱۱۷,۷۹۲,۷۷۸,۰۶۹	۲۴,۴۱۳,۵۰۰	۱۳۲,۹۹۷,۶۰۷,۵۰۰	۱۳,۰۶۰,۴۳۰,۸۰۵,۴۴۲
معدنی دماوند	۳,۴۹۷,۷۱۲	۲۰۵,۳۵۹,۹۵۳,۸۱۰	۳۰,۳۱,۹۵۰	۱۵۹,۳۱۷,۷۵۵,۵۰۰	۸,۹۴۳,۷۱۵,۰۶۷,۴۹۰
صنعتی دوده فام	۱۱,۲۲۲,۸۸۰	۱۹۳,۶۹۸,۹۰۲,۱۸۰	۷,۶۱۹,۱۶۳	۱۰۲,۱۰۳,۰۰۴,۹۳۰	۶,۴۸۰,۱۰۳,۵۲۳,۰۵۰
دامپروری فجر اصفهان	۱۶,۷۱۸,۲۴۵	۳۳۸,۴۶۲,۰۹۶,۳۸۹	۳۷,۶۸۳,۴۶۷	۱,۰۳۶,۵۶۴,۳۲۳,۷۰۰	۸,۱۶۸,۴۷۸,۶۷۰,۰۸۰

ارکان صندوق

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