

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی

گروه دی

برای سال مالی منتهی به


۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۵

« ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

مقدمه:

اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تاکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد گروه مدیران سرمایه‌گذاری و در جهت حفظ منابع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت‌های موجود بوده و اثرات آنها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می‌توان پیش‌بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۳۹۵/۱۲/۰۷ به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه‌گذاری صندوق

امضا	سمت	اعضای گروه مدیران سرمایه‌گذاری
	مدیر سرمایه‌گذاری	محمد کاظم بهدوی
	مدیر سرمایه‌گذاری	محسن نامدار بهشتی
	مدیر سرمایه‌گذاری	مهدي حیدرتیا

معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی»

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی که صندوقی در سرمایه‌گذاری اختصاصی و بازارگردانی موضوع بند (۲۰) ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار و بند ه ماده ۱ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید محسوب می‌شود با اخذ مجوز تأسیس و فعالیت از سازمان بورس در تاریخ ۱۳۹۵/۰۵/۱۳ تحت شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و شماره ۳۹۱۷۴ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق بر اساس اساسنامه و امیدنامه، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار پذیرفته شده موضوع بند ۲-۲ امیدنامه (بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی) در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق و کسب منافع از این محل است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرنده نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه است. فعالیت این صندوق تحت نظارت سبا انجام شده و متولی صندوق نیز به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی های صندوق که عمدتاً شامل اوراق بهادار با درآمد ثابت و سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس می شود، توسط مدیر سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه

گذاری دریافت می کنند. دوره فعالیت صندوق به مدت ۳ سال شمسی بوده (تا پایان ۱۳۹۸/۰۴/۲۸) که به تایید سازمان بورس اوراق بهادار رسیده است . مرکز اصلی صندوق در تهران - خیابان خالد استانبولی(وزراء) - نبش خیابان چهاردهم - شماره ۵۸ - طبقه سوم شرکت کارگزاری بانک دی واقع شده است.

علاقمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می توانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق به نشانی <http://daygroupfund.ir> مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می توانید به بخش بازدهی، خالص ارزش دارائیهها و نمودارهای این تارنما مراجعه کنید.

ارکان صندوق نیز مطابق جدول ذیل در مجمع عمومی مؤسس انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

نام شرکت	ارکان
کارگزاری بانک دی	مدیر صندوق
اصول پایه فراگیر	حسابرس
شرکت سیدگردان آسمان	متولی

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۰۷/۱۷ تا ۹۵/۱۱/۳۰ در ۱۳۴ روز فعالیت صندوق مجموعاً ۱۵.۰۰۲ واحد سرمایه گذاری عادی صادر و بدون ابطال واحد سرمایه گذاری در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۰.۰۰۲ واحد رسیده است.

۳۵.۰۰۰	تعداد واحدهای ممتاز سرمایه گذاری در ابتدای دوره
۱۵.۰۰۲	تعداد واحدهای عادی صادر شده
-	تعداد واحدهای عادی ابطالی
۵۰.۰۰۲	تعداد واحدهای سرمایه گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از آغاز فعالیت در تاریخ ۱۳۹۵/۰۷/۱۷ تا ۱۳۹۵/۱۱/۳۰



خرید و فروش دارایی‌های صندوق

مطابق بند ۲-۲ امیدنامه، دارایی‌های صندوق به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

- سهام و حق تقدم سهام موضوع بند ۲-۲-۱ امیدنامه شامل بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی
- موجودی نقد و گواهی سپرده
- اوراق بهادار احراز شده بر اساس شرایط مندرج در بند ۲-۲ امیدنامه

تعداد خرید و فروش‌ها	سهام بانک دی	سهام سرمایه‌گذاری بوعلی	سهام بیمه دی
موجودی در ابتدای دوره	۰	۰	۰
خرید طی دوره	۰	۲۰.۴۹۵.۵۱۲	۵.۱۲۷.۸۶۹
فروش طی دوره	۰	۰	۰
موجودی پایان دوره	۰	۲۰.۴۹۵.۵۱۲	۵.۱۲۷.۸۶۹

ترکیب دارایی‌های صندوق

در جدول زیر ترکیب دارایی‌های صندوق آمده است.

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تأسیس صندوق		میانگین روزانه دوره ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته	
	مبلغ ^(۵)	نسبت از کل دارایی	مبلغ ^(۵)	نسبت از کل دارایی	مبلغ ^(۵)	نسبت از کل دارایی
سهام	۸,۵۶۳	۲۰.۵۲٪	۱۸,۴۷۳	۳۶.۶۸٪	۲۲,۵۲۵	۴۴.۶۶٪
اوراق مشارکت	۰	۰٪	۰	۰٪	۰	۰٪
وجه نقد	۳۲,۸۰۷	۷۸.۶۴٪	۳۱,۳۴۳	۶۲.۲۴٪	۲۷,۳۷۶	۵۴.۰۸٪
سایر دارایی‌ها	۱۸۶	۰.۴۴٪	۴۸۸	۰.۹۷٪	۴۸۱	۰.۹۵٪
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۸,۵۶۳	۲۰.۵۲٪	۱۸,۴۷۳	۳۶.۶۸٪	۲۲,۵۲۵	۴۴.۶۶٪

مبالغ به میلیون ریال است.

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه‌گذاران حقیقی	۰	۰	۰
سرمایه‌گذاران حقوقی	۲	۵۰۰۰۲	٪۱۰۰
کل سرمایه‌گذاران	۲	۵۰۰۰۲	٪۱۰۰

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی در سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۵/۱۱/۲۳	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	-۰.۲۱٪	۱.۰۲٪
۳۰ روز گذشته	۱۳۹۵/۱۰/۳۰	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	-۱.۷۲٪	-۲.۲۵٪
۹۰ روز گذشته	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	-۱.۸۳٪	-۲.۱۱٪
۱۸۰ روز گذشته	۱۳۹۵/۰۶/۰۱	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۰٪	۰٪
۳۶۵ روز گذشته	۱۳۹۴/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۰٪	۰٪
از ابتدای تأسیس تا کنون	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	-۲.۶۸٪	-۰.۷۶٪

صورت‌های مالی

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ مطابق جدول ذیل می‌باشند:

ترازنامه

۱۳۹۵/۱۱/۳۰	یادداشت	
ریال		دارایی‌ها:
۲۶,۱۳۶,۹۳۷,۵۸۲	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۲۲۲,۷۲۱,۴۵۲	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۴۸۸,۴۱۲,۹۵۵	۷	حسابهای دریافتی
-	۸	جاری کارگزاران
۱۵۲,۰۰۴,۵۴۰	۹	سایر دارایی‌ها
۴۹,۰۰۰,۰۷۶,۵۲۹		جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۲۵۴,۳۶۴,۰۱۱	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۲۱,۳۱۹,۹۴۸	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۷۵,۶۸۳,۹۵۹		جمع بدهی‌ها
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۱۲	خالص دارایی‌ها
۹۷۴,۴۴۹		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری



صورت سود و زیان

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰	یادداشت	ریال	درآمدها:
(۲.۱۳۹.۷۰۵.۹۳۷)	۱۳		زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱.۲۲۶.۹۵۶.۴۶۱	۱۴		سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
(۹۱۲.۷۴۹.۴۷۶)			جمع درآمدها
			هزینه ها:
(۲۵۵.۶۷۲.۵۴۶)	۱۵		هزینه کارمزد ارکان
(۱۰۹.۱۸۵.۴۰۸)	۱۶		سایر هزینه ها
(۳۶۴.۸۵۷.۹۵۴)			جمع هزینه ها
(۱.۲۷۷.۶۰۷.۴۳۰)			زیان خالص
۳.۱۷٪			بازده سرمایه گذاری پایان دوره «۱»
-۰.۸٪			بازده میانگین سرمایه گذاری «۲»

صورت گردش خالص دارایی ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰		
تعداد	ریال	
۳۵,۰۰۰	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	خالص دارائیهها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
۱۵,۰۰۲	۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
-	-	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
-	(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)	زیان خالص دوره
۵۰,۰۰۲	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	خالص دارائیهها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می باشد.

تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال \pm سود (زیان) خالص = بازده سرمایه گذاری پایان دوره «۱»

خالص دارائیههای پایان سال

سود خالص

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

= بازده میانگین سرمایه گذاری

