

گزارش عملکرد




صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره یک ماه و چهارده روزه منتهی به ۳۰ آبان 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 سرمایه گذاری و در جهت حفظ منابع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت های موجود بوده و اثرات آن ها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می توان پیش بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۳۹۵/۱۲/۱۴ به تایید مدیران سرمایه گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق

امضا	سمت	اعضای گروه مدیران سرمایه گذاری
	مدیر سرمایه گذاری	محمد کاظم مهدوی
	مدیر سرمایه گذاری	محسن نامدار بهشتی
	مدیر سرمایه گذاری	مهدی حیدرنیا

معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی 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 هـ 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 براساس 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 چنانچه صرف و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهدپذیره 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 براساس مفاد اساسنامه و امیدنامه 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 دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل اوراق بهادار با درآمد ثابت و سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس می‌باشد، توسط مدیران سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه‌گذاری دریافت می‌کنند. دوره فعالیت صندوق به مدت ۳ سال شمسی بوده (تا پایان ۱۳۹۸/۰۴/۲۸) که به تایید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است. مرکز اصلی صندوق در تهران - خیابان خالد اسلامبولی - نبش خیابان چهاردهم - شماره ۵۸ - طبقه اول واقع شده است. علاقمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق میتوانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.daygroupfund.net مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می‌توانید به بخش بازدهی، خالص ارزش داراییها و نمودارهای این تارنما مراجعه کنید .

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

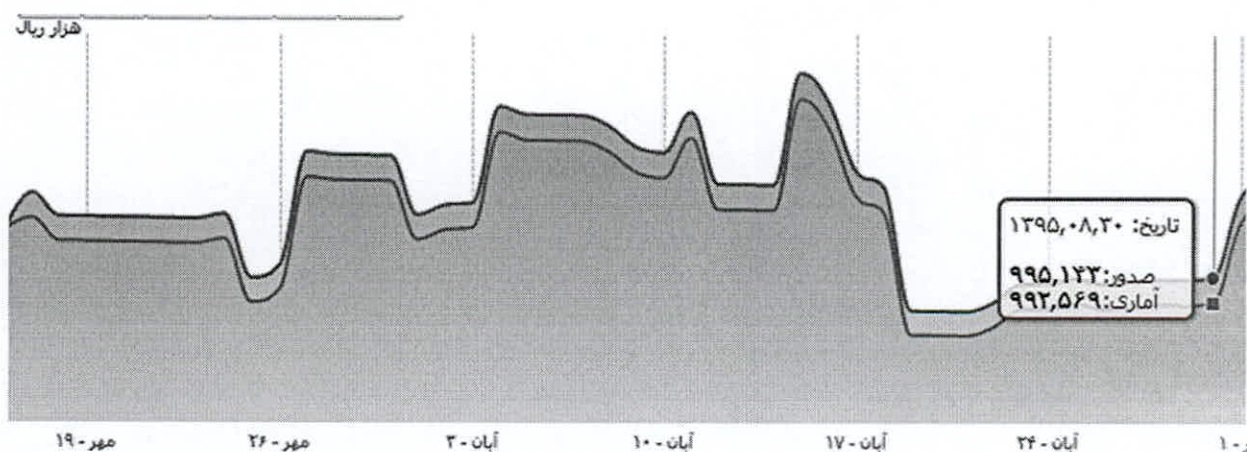
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
حسابرس	اصول پایه فراگیر
متولی	شرکت سبدگردانی آسمان

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۰۷/۱۷ تا ۹۵/۰۸/۳۰ در ۴۳ روز فعالیت صندوق مجموعاً ۱۵.۰۰۲ واحد سرمایه‌گذاری عادی صادر و بدون ابطال واحد سرمایه‌گذاری در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۰.۰۰۲ واحد رسیده است.

۳۵۰۰۰	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۱۵۰۰۲	تعداد واحدهای صادر شده
۰	تعداد واحدهای ابطالی
۵۰۰۰۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۵/۰۷/۱۷ تا ۱۳۹۵/۰۸/۳۰



قیمت صدور، قیمت ابطال

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.

بیمه دی	سرمایه گذاری بوعلی	بانک دی	(میلیون ریال)
۰	۱۳,۰۰۰,۰۰۰	۰	موجودی در ابتدای دوره
۲۸۰,۰۰۰	۱۷۴,۰۰۱	۰	خرید طی دوره
۰	۰	۰	فروش طی دوره
۲۸۰,۰۰۰	۱۳,۱۷۴,۰۰۱	۰	موجودی پایان دوره

ترکیب دارایی‌های صندوق

در جدول زیر ترکیب دارایی‌های صندوق آمده است.

شرح	میانگین روزانه دوره ۳۰ روز گذشته	
	مبلغ ^(۵)	نسبت از کل دارایی
سهام	۱۵,۲۰۲	۳۰.۱۱%
اوراق مشارکت	۰	۰%
وجه نقد	۳۴,۹۰۰	۶۹.۱۳%
سایر دارایی‌ها	۱۷۰	۰.۷۶%
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۱۵,۲۰۲	۳۰.۱۱%

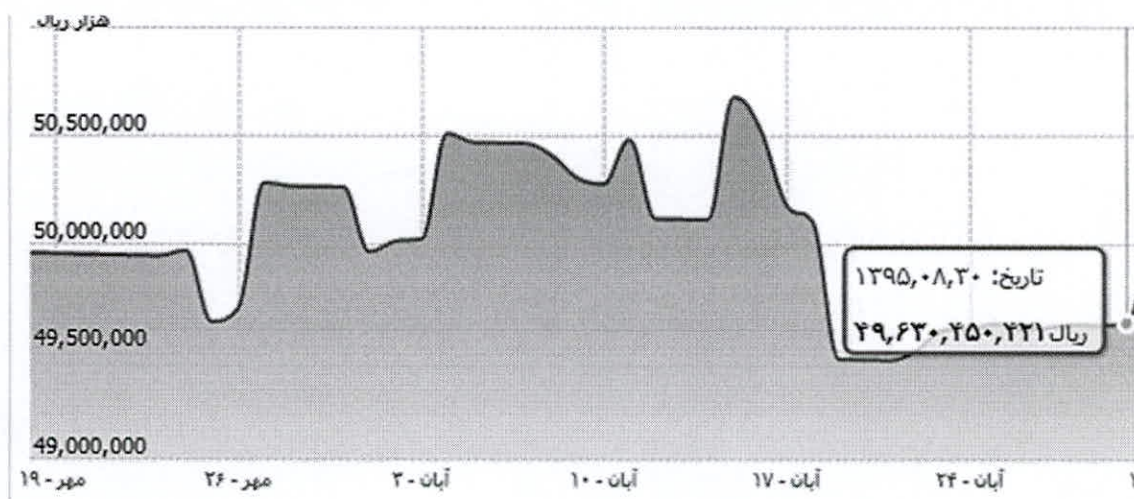
مبالغ به میلیون ریال است.

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

تمام واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در اختیار سرمایه‌گذاران حقوقی است.

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه‌گذاران حقیقی	۰	۰	۰
سرمایه‌گذاران حقوقی	۲	۵۰.۰۰۲	٪۱۰۰
کل سرمایه‌گذاران	۲	۵۰.۰۰۲	٪۱۰۰

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۵/۰۸/۳۰



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۵/۰۸/۳۰) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۵/۰۸/۲۳	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	۰.۰۶%	۲۹ %
۳۰ روز گذشته	۱۳۹۵/۰۷/۳۰	۱۳۹۵/۰۸/۳۰	-۰.۸۶%	۱.۵%

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰ مطابق جداول ذیل می باشند:

ترازنامه سه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰

۱۳۹۵/۰۸/۳۰	یادداشت	
ریال		دارایی ها:
۱۵,۲۰۲,۲۰۱,۲۱۱	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۳۴,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۷۱,۰۱۳,۸۲۸	۷	حسابهای دریافتی
۲۱۰,۹۷۱,۶۴۰	۸	سایر دارایی ها
۹۹,۹۳۰,۰۰۰	۹	موجودی نقد
۵۰,۴۸۴,۱۱۶,۶۷۹		جمع دارایی ها
		بدهی ها:
۵۳۷,۹۱۲,۹۶۴	۱۰	جاری کارگزاران
۶۸,۸۸۸,۵۷۰	۱۱	پرداختی به ارکان صندوق
۲۴۶,۸۶۴,۷۲۴	۱۲	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۸۵۳,۶۶۶,۲۵۸		جمع بدهی ها
۴۹,۶۳۰,۴۵۰,۴۲۱	۱۳	خالص دارایی ها
۹۹۲,۵۶۹		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

صورت سود و زیان سه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰

دوره میانی ۱ ماهه و ۱۴ روزه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰	یادداشت	درآمدها:
ریال		
(۳۳۷,۷۱۱,۷۵۳)	۱۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۷۱,۰۱۳,۸۲۸	۱۵	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
(۲۶۶,۶۹۷,۹۲۵)		جمع درآمدها
		هزینه ها:
(۶۸,۸۸۸,۵۷۰)	۱۶	هزینه کارمزد ارکان
(۳۵,۹۶۳,۰۸۴)	۱۷	سایر هزینه ها
(۱۰۴,۸۵۱,۶۵۴)		جمع هزینه ها
(۳۷۱,۵۴۹,۵۷۹)		سود (زیان) خالص
-۰.۷۵%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره ^(۱)
-۰.۷۴%		بازده میانگین سرمایه گذاری ^(۲)

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می‌باشد.

تعدیلات ثنی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ± سود (زیان) خالص

خالص دارائیهای پایان سال

= بازده سرمایه گذاری پایان دوره^(۱)

سود خالص

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

= بازده میانگین سرمایه گذاری^(۲)

صورت گردش خالص دارایی ها سه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۸/۳۰

خالص دارایی ها به تفکیک واحدهای سرمایه گذاری عادی و ممتاز به شرح زیر است:

۱۳۹۵/۰۸/۳۰	
ریال	تعداد
۱۴,۸۹۰,۵۲۴,۷۲۳	۱۵,۰۰۲
۳۴,۷۳۹,۹۲۵,۶۹۷۶۷	۳۵,۰۰۰
<u>۴۹,۶۳۰,۴۵۰,۴۲۱</u>	<u>۵۰,۰۰۲</u>

یادداشت های توضیحی همراه ، بخش جدایی ناپذیر صورتهای مالی می باشد.