

گزارش عملکرد




صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۳۹۶

«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 ۱۳۹۶/۰۳/۰۸ 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 بهشتی نامدار
	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 ۱۳/۰۵/۱۳۹۵ 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، جمع آوری 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 جمع آوری 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 دارائیها و نمودارهای این تارنما مراجعه کنید .

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

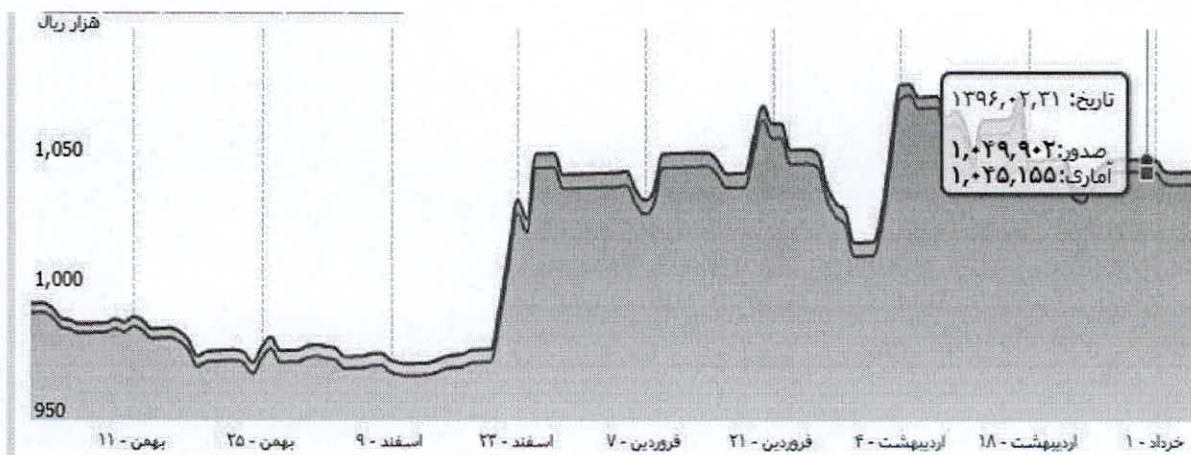
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
حسابرس	اصول پایه فراگیر
متولی	شرکت سبد گردانی آسمان

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۱۱/۳۰ تا ۹۶/۰۲/۳۱ در ۹۲ روز فعالیت صندوق مجموعاً ۱۵,۰۲۴ واحد سرمایه‌گذاری عادی صادر و ۱۵,۰۰۲ واحد سرمایه‌گذاری ابطال در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۰,۰۲۴ واحد رسیده است.

۵۰۰۰۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۱۵۰۲۴	تعداد واحدهای صادر شده
۱۵۰۰۲	تعداد واحدهای ابطالی
۵۰۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ تا ۱۳۹۶/۰۲/۳۱



قیمت صدور، قیمت ابطال

خرید و فروش دارایی‌های صندوق

مطابق بند ۲-۲ امیدنامه، دارایی‌های صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۲/۳۱ 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)
۵,۱۲۷,۸۶۹	۲۰,۴۹۵,۵۱۲	۰	موجودی در ابتدای دوره
۸۸۵,۸۰۴	۲,۳۳۰,۸۷۲	۰	خرید طی دوره
(۲۰۰,۰۰۰)	(۸۸۱,۳۸۶)	۰	فروش طی دوره
۵,۸۱۳,۶۷۳	۲۱,۹۴۴,۹۹۸	۰	موجودی پایان دوره (۱۳۹۶/۰۲/۳۱)

ترکیب دارایی‌های صندوق

در جدول زیر ترکیب دارایی‌های صندوق آمده است.

شرح	میانگین دوره ۹۰ روز گذشته		میانگین دوره ۳۰ روز گذشته	
	مبلغ ^(*)	نسبت از کل دارایی	مبلغ ^(*)	نسبت از کل دارایی
سهام	۲۷,۰۹۴	%۵۳,۴	۲۰,۶۹۷	%۴۰
اوراق مشارکت	۰	۰%	۰	۰%
وجه نقد	۲۱,۶۱۳	%۴۲,۶	۲۹,۰۲۱	%۵۶
سایر دارایی‌ها	۱,۹۱۲	%۳,۸	۱,۹۶۸	%۴
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۲۷,۰۹۴	%۵۳,۴	۲۰,۶۹۷	%۴۰

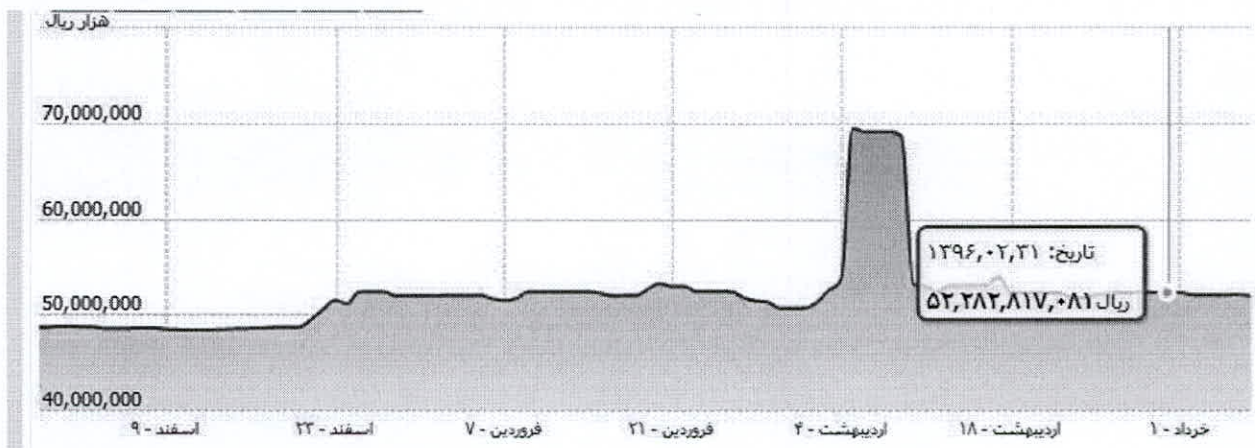
مبالغ به میلیون ریال است.

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	۵۰,۰۲۴	٪۱۰۰
کل سرمایه‌گذاران	۲	۵۰,۰۲۴	٪۱۰۰

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۰۲/۳۱



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۲/۳۱) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۶/۰۲/۲۴	۱۳۹۶/۰۲/۳۱	٪۱،۰۸	٪۱،۵
۳۰ روز گذشته	۱۳۹۶/۰۲/۰۱	۱۳۹۶/۰۲/۳۱	٪۳،۱۲	٪۲،۴
۹۰ روز گذشته	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۶/۰۲/۳۱	٪۷،۲	٪۴،۶

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱ مطابق جدول ذیل می باشند:

ترازنامه سه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱

۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۶/۰۲/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		دارایی ها:
۲۶,۱۳۶,۹۳۷,۵۸۲	۲۸,۰۵۲,۳۱۷,۸۷۲	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۲۲۲,۷۲۱,۴۵۲	۲۱,۰۰۴,۷۳۱,۴۴۹	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۴۸۸,۴۱۲,۹۵۵	۳,۴۷۱,۰۷۱,۷۹۳	۷	حسابهای دریافتی
۱۵۲,۰۰۴,۵۴۰	۹۱,۷۲۷,۰۶۰	۸	سایر دارایی ها
-	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹	موجودی نقد
۴۹,۰۰۰,۰۷۶,۵۲۹	۵۲,۶۲۹,۸۴۸,۱۷۴		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
-	۱۸,۳۳۳,۴۶۸	۱۰	جاری کارگزاران
۲۵۴,۳۶۴,۰۱۱	۲۹۱,۸۸۱,۳۹۰	۱۱	پرداختی به ارکان صندوق
۲۱,۳۱۹,۹۴۸	۳۶,۸۱۶,۲۳۵	۱۲	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۷۵,۶۸۳,۹۵۹	۳۴۷,۰۳۱,۰۹۳		جمع بدهی ها
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۲,۲۸۲,۸۱۷,۰۸۱	۱۳	خالص دارایی ها
۹۷۴,۴۴۹	۱,۰۴۵,۱۵۵		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

یادداشت‌های توضیحی همراه ، بخش جدائی ناپذیر صورت‌های مالی می‌باشد.



صورت سود و زیان و صورت گردش گردش خالص داراییها سه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱

یادداشت	دوره میانی ۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱	دوره مالی ۴ ماهه و ۱۴ روزه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰
	ریال	ریال
درآمدها:		
۱۴ سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۵۷,۱۶۱,۰۱۱	-
۱۵ سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۱۲۱,۹۴۲,۴۸۰)	(۲,۱۳۹,۷۰۵,۹۳۷)
۱۶ سود سهام	۳,۰۰۳,۹۰۲,۳۹۱	-
۱۷ سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۶۰۴,۹۴۳,۳۱۵	۱,۲۲۶,۹۵۶,۴۶۱
۱۸ سایر درآمدها	۱,۳۱۳,۹۶۹	-
جمع درآمدها	۳,۵۴۵,۳۷۸,۲۰۶	(۹۱۲,۷۴۹,۴۷۶)
هزینه ها:		
۱۹ هزینه کارمزد ارکان	(۱۷۳,۵۱۹,۰۴۷)	(۲۵۵,۶۷۲,۵۴۶)
۲۰ سایر هزینه ها	(۷۵,۹۱۳,۷۶۷)	(۱۰۹,۱۸۵,۴۰۸)
جمع هزینه ها	(۲۴۹,۴۳۲,۸۱۴)	(۳۶۴,۸۵۷,۹۵۴)
سود (زیان) خالص	۳,۲۹۵,۹۴۵,۳۹۲	(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)
بازده سرمایه گذاری پایان دوره ^(۱)	۶.۷۶٪	۲.۶٪
بازده میانگین سرمایه گذاری ^(۲)	۶.۳۱٪	-۰.۸۰٪

صورت گردش خالص داراییها

تعداد	ریال	تعداد	ریال
۵۰,۰۰۲	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۳۵,۰۰۰	۳۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
۱۵,۰۲۴	۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۰۲	۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰
(۱۵,۰۰۲)	(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	-	-
-	۳,۲۹۵,۹۴۵,۳۹۲	-	(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)
۲۱	۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	-
۵۰,۰۲۴	۵۲,۲۸۲,۸۱۷,۰۸۱	۵۰,۰۰۲	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰

خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
زیان خالص دوره
تعدیلات
خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره

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



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

خالص داراییهای پایان سال

(۱) بازده سرمایه گذاری پایان دوره

سود خالص

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

(۲) بازده میانگین سرمایه گذاری