

گزارش عملکرد




صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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 ۱۳۹۶/۰۵/۳۱ به تایید مدیران سرمایه گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق

امضا	سمت	اعضای گروه مدیران سرمایه گذاری
	مدیر سرمایه گذاری	مهدی حیدرنیا
	مدیر سرمایه گذاری	محسن بهشتی نامدار
	مدیر سرمایه گذاری	محمد همتی روزبهانی

۱- مهدی حیدرنیا:

دارای مدرک کارشناس ارشد حسابداری از دانشگاه علامه طباطبایی و گواهینامه بین المللی CFA سطح ۳ با سوابق کاری در پست های سازمانی کارشناس، کارشناس سید و تحلیل گر، مدیر سرمایه گذاری صندوق در کارگزاری بانک شهر، مدیر سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری ارزش آفرینان دی، مدیر سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری بانک دی و مدیر سرمایه گذاری صندوق اختصاصی بازارگردانی گروه دی.

۲- محسن بهشتی نامدار:

دارای مدرک کارشناس ارشد مدیریت مالی با گرایش مهندسی مالی از دانشگاه غیر انتفاعی پرندک با سوابق کاری در پست های سازمانی کارشناس عرضه و پذیرش، مدیر آموزش در شرکت کارگزاری بانک کشاورزی، نماینده مدیریت و مسئول کیفیت شرکت کارگزاری بانک کشاورزی، کارشناس تحلیل و سرمایه گذاری شرکت کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سرمایه گذاری صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سرمایه گذاری صندوق مشترک کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سبدگردانی کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سرمایه گذاری صندوق ارزش آفرینان دی، مدیر سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری بانک دی و مدیر سرمایه گذاری صندوق اختصاصی بازارگردانی گروه دی.

۳- محمد همتی روزبهانی:

دارای مدرک کارشناسی ارشد مدیریت مالی با گرایش مالی از دانشگاه علوم و تحقیقات با سوابق کاری در پست های سازمانی معامله گری در شرکت کارگزاری بانک توسعه صادرات، مدیر سرمایه گذاری در شرکت کارگزاری بانک توسعه صادرات، مدیر سرمایه گذاری صندوق ارزش آفرینان دی در شرکت کارگزاری بانک دی، معامله گر شرکت کارگزاری بانک دی و مدیر سرمایه گذاری صندوق بازارگردانی گروه مالی دی.

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 ه 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 (وزراء)- 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 تارنمای مزبور مراجعه کنید .

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

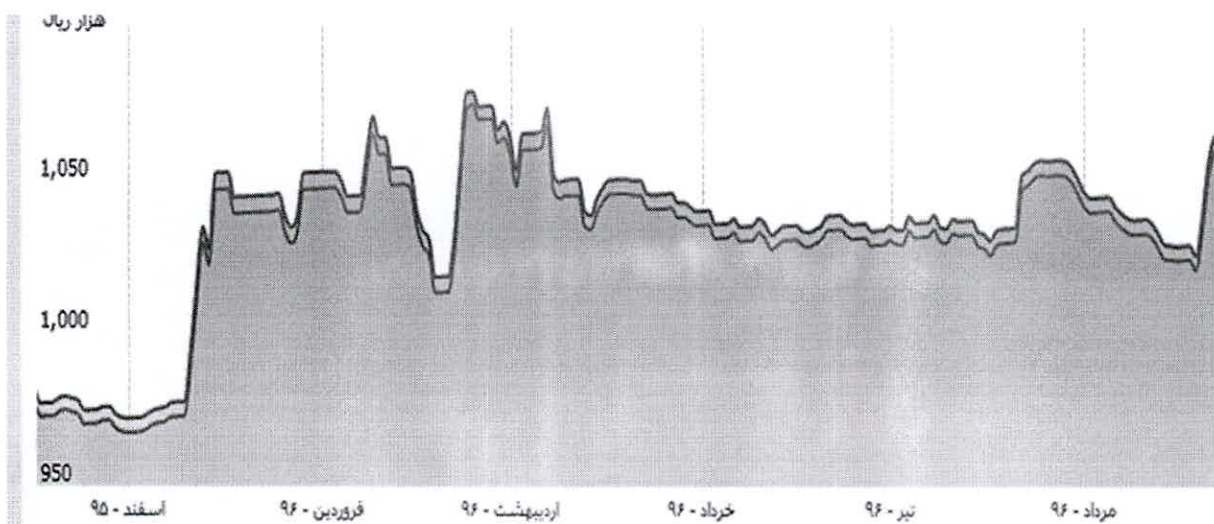
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
حسابرس	اصول پایه فراگیر
متولی	موسسه آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۱۱/۳۰ تا ۹۶/۰۵/۳۱ در ۱۸۵ روز فعالیت صندوق مجموعاً ۱۵۰۰۲۴ واحد سرمایه‌گذاری عادی صادر و ۱۵۰۰۰۲ واحد سرمایه‌گذاری ابطال در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۰۰۲۴ واحد رسیده است.

۵۰۰۰۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۱۵۰۰۲۴	تعداد واحدهای صادر شده
۱۵۰۰۰۲	تعداد واحدهای ابطالی
۵۰۰۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ تا ۱۳۹۶/۰۵/۳۱



قیمت صدور، قیمت ابطال

منظور از صدور واحدهای سرمایه‌گذاری، ایجاد یک واحد سرمایه‌گذاری به نام سرمایه‌گذار و استفاده از وجوه آن برای انجام سرمایه‌گذاری در صندوق است؛ منظور از ابطال واحد سرمایه‌گذاری، نقد کردن قسمتی از دارایی‌های صندوق و پرداخت وجوه حاصل از آن به سرمایه‌گذار و حذف یک واحد سرمایه‌گذاری از صندوق است. همانطور که در نمودار بالا مشاهده می‌گردد، نمودار قیمت صدور و ابطال صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه دی روندی افزایش داشته که این عامل بدلیل مدیریت بهینه سبد سرمایه‌گذاری صندوق و اتخاذ تصمیمات مناسب در انجام تعهدات صندوق سرمایه‌گذاری می‌باشد.

خرید و فروش دارایی‌های صندوق

- مطابق بند ۲-۲ امیدنامه، دارایی‌های صندوق تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۵/۳۱ 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
۲,۲۳۰,۹۵۴	۲,۷۵۰,۲۸۴	۰	خرید طی دوره
(۶۰۰,۰۰۰)	(۱,۱۴۸,۳۰۲)	۰	فروش طی دوره
۶,۷۵۸,۸۲۳	۲۲,۰۹۷,۴۹۴	۰	موجودی پایان دوره (۱۳۹۶/۰۵/۳۱)

ترکیب دارایی‌های صندوق

استراتژی صندوق سرمایه گذاری صندوق بازارگردانی گروه مالی دی مبتنی بر انجام تعهدات روزانه صندوق به نحو احسن و همچنین حفظ ترکیب مناسب منابع صندوق سرمایه گذاری در سهام و سپرده بانکی بوده تا بالاترین بازدهی برای صندوق حاصل گردد. در جدول زیر ترکیب دارایی‌های صندوق طی ۳۰ و ۹۰ روز گذشته قابل مشاهده است.

شرح	میانگین دوره ۹۰ روز گذشته		میانگین دوره ۳۰ روز گذشته	
	مبلغ ^(*)	نسبت از کل دارایی	مبلغ ^(*)	نسبت از کل دارایی
سهام	۲۸,۵۸۴	%۵۴	۲۸,۸۸۳	%۵۳.۵
اوراق مشارکت	۰	۰%	۰	۰%
سپرده بانکی	۲۱,۰۴۸	%۳۹.۷	۲۰,۷۳۸	%۴۰
سایر دارایی‌ها	۱,۹۱۲	%۶.۳	۱,۹۶۸	%۶.۵
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۲۸,۵۸۴	%۵۴	۲۸,۸۸۳	%۵۳.۵

مبالغ به میلیون ریال است.

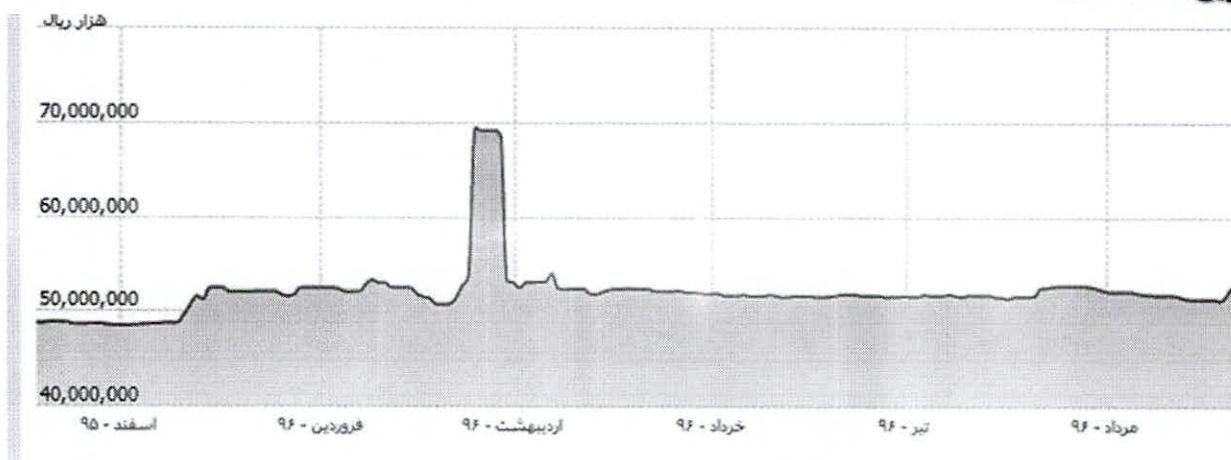
ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

تمام واحدهای سرمایه گذاری صندوق در اختیار سرمایه‌گذاران حقوقی است.

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	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 ۱۳۹۶/۰۵/۳۱



ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری، نشان‌دهنده کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری پس از کسر هر گونه بدهی است. برای محاسبه این مقدار، ابتدا تمامی دارایی‌های یک صندوق محاسبه شده، سپس از این مقدار بدهی‌های کل صندوق کسر می‌گردد، عدد حاصله مقدار ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری می‌باشد. همانطور که در نمودار بالا مشاهده می‌گردد نمودار ارزش خالص کل دارایی‌های صندوق با شیب ملایمی در حال افزایش می‌باشد.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۵/۳۱) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۶/۰۵/۲۴	۱۳۹۶/۰۵/۳۱	٪۳.۴۷	٪۰.۸۲
۳۰ روز گذشته	۱۳۹۶/۰۵/۰۱	۱۳۹۶/۰۵/۳۱	٪۱.۰۷	٪۱.۸۶
۹۰ روز گذشته	۱۳۹۶/۰۲/۳۱	۱۳۹۶/۰۵/۳۱	٪۱.۳۷	٪۱.۴۵
۱۸۰ روز گذشته	۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۶/۰۵/۳۱	٪۸.۷	٪۶.۱۵

همانطور که در جدول بالا مشاهده می‌نماییم صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه مالی دی در ۱۸۰ روز گذشته موفق به کسب بازدهی بالاتر از شاخص کل شده است. در واقع مدیریت بهینه سبد سرمایه‌گذاری صندوق در کنار انجام تعهدات روزانه ی صندوق بازارگردانی دو عاملی هستند که باعث کسب بازدهی مناسب و بالاتر از شاخص کل شده اند.

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱ مطابق جدول ذیل می‌باشند:

ترازنامه شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱

۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۶/۰۵/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		دارایی‌ها:
۲۶,۱۳۶,۹۳۷,۵۸۲	۲۹,۱۱۷,۰۹۴,۰۴۶	۵	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۲۲۲,۷۲۱,۴۵۲	۲۱,۰۹۳,۳۳۱,۸۴۴	۶	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۴۸۸,۴۱۲,۹۵۵	۳,۱۹۵,۴۲۹,۱۱۳	۷	حسابهای دریافتی
۱۵۲,۰۰۴,۵۴۰	۳۶,۶۷۳,۸۱۵	۸	سایر دارایی‌ها
۴۹,۰۰۰,۰۷۶,۵۲۹	۵۳,۴۴۲,۵۲۸,۸۱۸		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
-	۱۷۹,۹۹۹,۶۳۰	۹	جاری کارگزاران
۲۵۴,۳۶۴,۰۱۱	۲۰۷,۷۴۱,۱۲۴	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۲۱,۳۱۹,۹۴۸	۵۲,۳۳۳,۷۳۸	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۷۵,۶۸۳,۹۵۹	۴۴۰,۰۷۴,۴۹۲		جمع بدهی‌ها
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۳,۰۰۲,۴۵۴,۳۲۶	۱۲	خالص دارایی‌ها
۹۷۴,۴۴۹	۱,۰۵۹,۵۴۱		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صورت سود و زیان و صورت گردش خالص داراییها شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱

دوره مالی ۴ ماهه و ۱۴ روزه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰	دوره میانی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		درآمدها:
-	۵۱,۴۲۷,۱۱۳	۱۳	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۲,۱۳۹,۷۰۵,۹۳۷)	(۲۰۷,۳۴۵,۳۵۴)	۱۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
-	۳,۱۷۸,۳۹۵,۱۵۹	۱۵	سود سهام
۱,۲۲۶,۹۵۶,۴۶۱	۱,۴۸۶,۴۵۷,۵۳۸	۱۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
-	۱,۳۱۳,۹۶۹	۱۷	سایر درآمدها
(۹۱۲,۷۴۹,۴۷۶)	۴,۵۱۰,۲۴۸,۴۲۵		جمع درآمدها
			هزینه ها:
(۲۵۵,۶۷۲,۵۴۶)	(۳۴۱,۲۸۵,۲۷۳)	۱۸	هزینه کارمزد ارکان
(۱۰۹,۱۸۵,۴۰۸)	(۱۵۳,۳۸۰,۵۱۵)	۱۹	سایر هزینه ها
(۳۶۴,۸۵۷,۹۵۴)	(۴۹۴,۶۶۵,۷۸۸)		جمع هزینه ها
(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)	۴,۰۱۵,۵۸۲,۶۳۷		سود (زیان) خالص
-۲.۶%	۸.۰۳%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
-۰.۸۰%	۷.۷۳%		بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

صورت گردش خالص داراییها

دوره مالی ۴ ماهه و ۱۴ روزه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰		دوره میانی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۳۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۵,۰۰۰	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۰,۰۰۲	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۰۲	۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۲۴	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
-	-	(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)	-	۴,۰۱۵,۵۸۲,۶۳۷	-	زیان خالص دوره
-	-	۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	تعدیلات
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۰,۰۰۲	۵۳,۰۰۲,۴۵۴,۳۲۶	۵۰,۰۲۴	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 \pm سود (زیان) خالص خالص داراییهای پایان سال	=	بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
سود خالص	=	بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده