

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه 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 منافع صندوق و تطابق با مقررات قانونی و اسنادنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات، همگنگ 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 ۱۳۹۶/۰۸/۲۰ به تایید مدیران سرمایه گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق

اعضای گروه مدیران سرمایه گذاری	سمت	امضاء
مهدی حیدرینیا	مدیر سرمایه گذاری	
محسن بهشتی نامدار	مدیر سرمایه گذاری	
محمد همتی روزبهانی	مدیر سرمایه گذاری	

۱- مهدی حیدرینیا:

دارای مدرک کارشناس ارشد حسابداری از دانشگاه علامه طباطبایی و گواهینامه بین المللی CFA سطح ۲ با سوابق کاری در پستهای سازمانی کارشناس، کارشناس سبد 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 پستهای 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 سیدگردانی 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)- نیش 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.

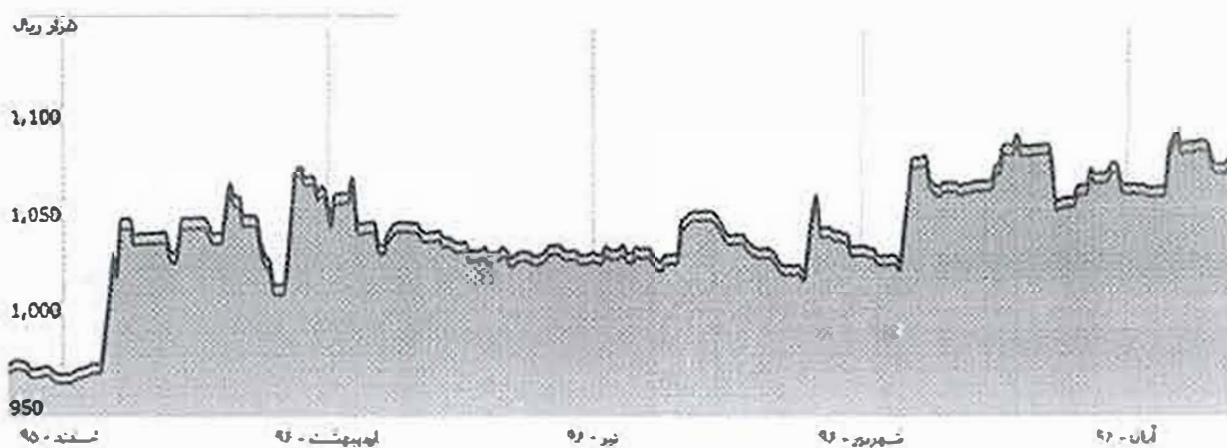
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
حسابرس	اصول پایه فراگیر
متولی	موسسه آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۱۱/۳۰ تا ۹۶/۰۸/۳۰ در ۲۷۵ روز فعالیت صندوق مجموعاً ۱۵۰۰۲۴ واحد سرمایه‌گذاری عادی صادر و ۱۵۰۰۲ 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
۱۵۰۰۲	تعداد واحدهای ابظالی
۵۰۰۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ تا ۱۳۹۶/۰۸/۳۰



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 افزایشی داشته که این عامل بدلیل مدیریت پهنه 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 ۱۳۹۶/۰۸/۳۰ 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.

میلیون ریال)	بانک دی	سرمایه گذاری بوعلی	بیمه دی
موجودی در ابتدای دوره	۰	۲۰,۴۹۵,۵۱۲	۵,۱۲۷,۸۶۹
خرید طی دوره	۰	۳,۹۴۵,۲۸۴	۲,۶۳۰,۹۵۴
فروش طی دوره	۰	(۱,۳۹۸,۳۰۲)	(۷۰۰,۰۰۰)
موجودی پایان دوره (۱۳۹۶/۰۸/۳۰)	۰	۲۳,۱۴۲,۴۹۴	۷,۰۵۸,۸۲۳

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	امروز		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		میانگین روزانه دوره ۹۰ روز گذشته	
	نسبت به کل دارایی	مبلغ	نسبت به کل دارایی	مبلغ	نسبت به کل دارایی	مبلغ
سهام	۵۶,۳۹	۳۰,۶۹۰	۵۵,۷۴	۳۰,۱۳۶	۵۵,۰۸	۲۹,۵۴۷
اوراق	۰	۰	۰	۰	۰	۰
وجه نقد	۴۳,۱۲	۲۳,۴۶۸	۴۳,۵۱	۲۳,۵۲۳	۴۲,۶۸	۲۲,۸۹۶
سایر دارایی‌ها	۰,۴۷	۲۵۸	۰,۷۳	۳۹۹	۲,۲۲	۱,۱۹۵
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پرتفوی سهام صندوق	۵۶,۳۹	۳۰,۶۹۰	۵۵,۷۴	۳۰,۱۳۶	۵۵,۰۸	۲۹,۵۴۷

مبالغ به میلیون ریال است.

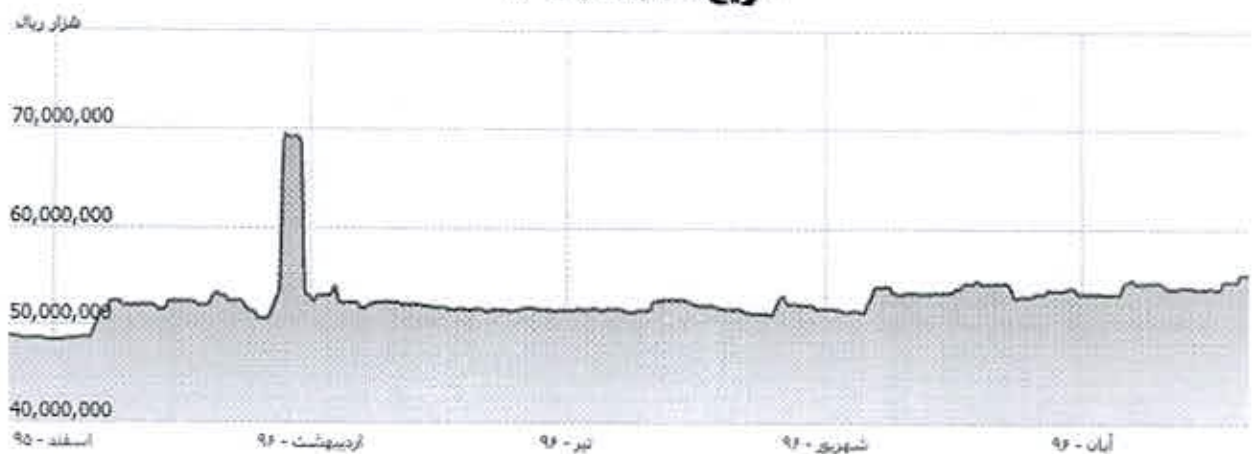
ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

تمام واحدهای سرمایه گذاری صندوق در اختیار سرمایه‌گذاران حقوقی است.

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه‌گذاران حقیقی	۰	۰	۰
سرمایه‌گذاران حقوقی	۲	۵۰۰,۰۲۴	۱۰۰٪
کل سرمایه‌گذاران	۲	۵۰۰,۰۲۴	۱۰۰٪

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردان گروه دی منتهی به

تاریخ ۱۳۹۶/۰۸/۳۰



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 ۱۳۹۶/۰۸/۳۰) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۶/۰۸/۲۳	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۰.۶۲۵٪	۰.۹۳۸٪
ماه گذشته	۱۳۹۶/۰۷/۳۰	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۱.۳۲۶٪	۲.۶۵۳٪
۳ ماه اخیر	۱۳۹۶/۰۶/۰۱	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۳.۴۵۹٪	۷.۵۵۱٪
۶ ماه	۱۳۹۶/۰۳/۰۴	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۳.۶۹۵٪	۹.۴۰۱٪
یک سال اخیر	۱۳۹۵/۰۹/۰۱	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۷.۸۳۳٪	۱۱.۹۹۲٪

همانطور که در جدول بالا مشاهده می‌نمایم بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی در مقاطع زمانی مختلف ذکر شده است. در واقع مدیریت بهینه سپد سرمایه‌گذاری صندوق در کنار انجام تعهدات روزانه ی صندوق بازارگردانی دو عاملی هستند که باعث کسب بازدهی مناسب شده‌اند.

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰ مطابق جداول ذیل می باشند:

ترازنامه نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰

۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		دارایی ها:
۲۶,۱۳۶,۹۳۷,۵۸۲	۳۰,۶۹۰,۸۷۶,۸۸۸	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۲۲۲,۷۲۱,۴۵۲	۲۳,۴۶۸,۰۶۷,۵۹۰	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۴۸۸,۴۱۲,۹۵۵	۹,۵۶۵,۰۱۱	۷	حسابهای دریافتی
۱۵۲,۰۰۴,۵۴۰	۲۴۸,۴۴۰,۶۶۴	۸	سایر دارایی ها
۴۹,۰۰۰,۰۷۶,۵۲۹	۵۴,۴۱۶,۹۵۰,۱۵۳		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
-	۱۶۰,۴۴۵,۸۲۳	۹	جاری کارگزاران
۲۵۴,۳۶۴,۰۱۱	۲۱۰,۸۱۷,۶۳۹	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۲۱,۳۱۹,۹۴۸	۶۷,۴۸۰,۱۰۰	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۷۵,۶۸۳,۹۵۹	۴۳۸,۷۴۳,۵۶۲		جمع بدهی ها
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۳,۹۷۸,۲۰۶,۵۹۱	۱۲	خالص دارایی ها
۹۷۴,۴۴۹	۱,۰۷۹,۰۴۶		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

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



