

گزارش عملکرد

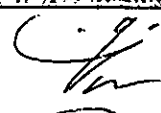
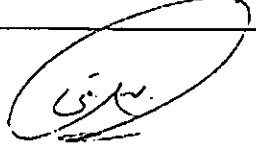
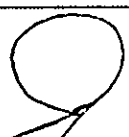
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
برای سال مالی منتهی به تاریخ ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۶

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 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 استفاده‌کنندگان می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۱۵ به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه‌گذاری صندوق

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

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 ۵ ماده ۱ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید محسوب می‌شود با اخذ مجوز تأسیس و فعالیت از سازمان بورس در تاریخ ۱۳۹۵/۰۵/۱۲ 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 سبأ 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 می‌شود، توسط مدیر سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه

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، 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 (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.

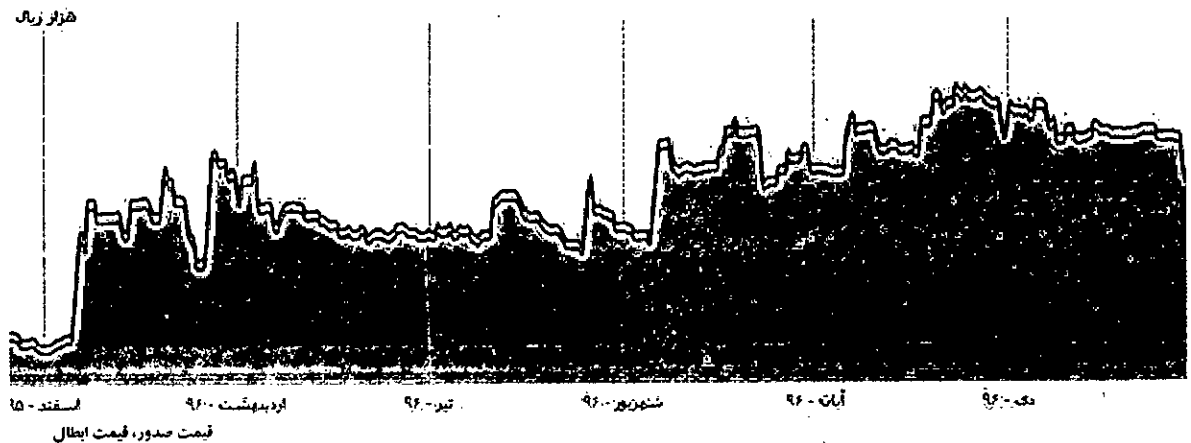
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
حسابرس	اصول پایه فراگیر
متولی	موسسه آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۱۱/۳۰ تا ۹۶/۱۱/۳۰ در ۳۶۵ 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.

۵۰,۰۰۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۱۵,۰۲۴	تعداد واحدهای صادر شده
۱۵,۰۰۲	تعداد واحدهای ابطالی
۵۰,۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

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



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 ۱۳۹۶/۱۱/۳۰ 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.

بیمه دی	سرمایه گذاری بوعلی	بانک دی	(میلیون ریال)
۵,۱۲۷,۸۶۹	۲۰,۴۹۵,۵۱۲	۰	موجودی در ابتدای دوره
۴,۲۴۳,۵۷۲	۴,۲۵۶,۰۹۳	۰	خرید طی دوره
(۱,۷۵۰,۰۰۰)	(۱,۳۴۸,۳۰۲)	۰	فروش طی دوره
۷,۶۲۱,۴۴۱	۲۳,۴۰۳,۳۰۳		موجودی پایان دوره (۱۳۹۶/۱۱/۳۰)

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 روزانه از ابتدای تاسیس صندوق		میانگین روزانه دوره ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته	
	نسبت به کل دارایی	مبلغ	نسبت به کل دارایی	مبلغ	نسبت به کل دارایی	مبلغ
سهام	۵۰,۵	۲۶,۵۹۶	۵۷,۷۳	۳۱,۶۲۷	۵۷,۶۷	۳۱,۳۴۱
اوراق	۰	۰	۰	۰	۰	۰
وجه نقد (سپرده)	۴۷,۱۳	۲۴,۸۲۱	۴۱,۶۹	۲۲,۸۳۹	۴۱,۸۳	۲۲,۷۳۱
سایر دارایی‌ها	۲,۰۶	۱,۰۸۶	۰,۵۷	۳۱۶	۰,۴۹	۲۶۸
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۵۰,۵	۲۶,۵۹۶	۵۷,۷۳	۳۱,۶۲۷	۵۷,۶۷	۳۱,۳۴۱

مبلغ به میلیون ریال است.

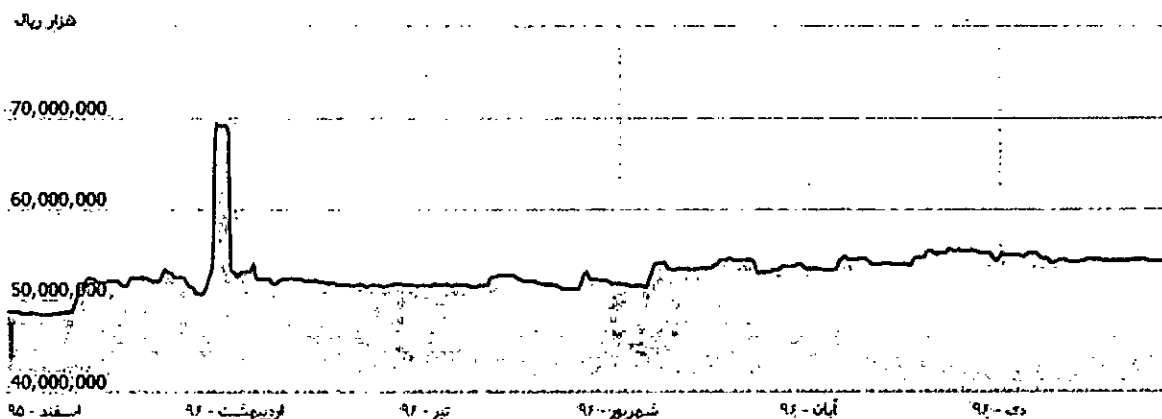
ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

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

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

تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۳۰



ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری، نشان دهنده 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 ۱۳۹۶/۱۱/۳۰) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۳۹۶/۱۱/۲۳	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	٪(۰,۲۵۶)	۰,۲۲۹٪
ماه گذشته	۱۳۹۶/۱۰/۳۰	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	٪(۰,۳۴۹)	٪(۰,۶۷۷)
۳ ماه اخیر	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۰,۳٪	۱۰,۵٪
۶ ماه	۱۳۹۶/۰۶/۰۱	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۳,۷۶۹٪	۱۸,۹٪
یک سال اخیر	۱۳۹۵/۱۲/۰۱	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۱۱,۱٪	۲۶,۳۸٪

همانطور که در جدول بالا مشاهده می‌نماییم بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی در مقاطع زمانی مختلف ذکر 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 شده‌اند.

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰ مطابق
جداول ذیل می باشند:

ترازنامه برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

۱۳۹۵/۱۱/۳۰	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		دارایی ها:
۲۶,۱۳۶,۹۳۷,۵۸۲	۳۱,۳۸۹,۰۰۴,۰۲۰	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۲۲۲,۷۲۱,۴۵۲	۲۲,۸۵۸,۶۲۱,۷۳۱	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۴۸۸,۴۱۲,۹۵۵	۶,۲۱۱,۴۳۱	۷	حسابهای دریافتی
۱۵۲,۰۰۴,۵۴۰	۱۷۲,۵۲۰,۷۲۶	۸	سایر دارایی ها
۴۹,۰۰۰,۰۷۶,۵۲۹	۵۴,۴۲۶,۳۵۷,۹۰۸		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
۲۵۴,۳۶۴,۰۱۱	۲۰۲,۸۵۵,۱۱۰	۹	پرداختی به ارکان صندوق
۲۱,۳۱۹,۹۴۸	۸۳,۳۰۴,۹۹۲	۱۰	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۷۵,۶۸۳,۹۵۹	۲۸۶,۱۶۰,۱۰۲		جمع بدهی ها
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۱۱	خالص دارایی ها
۹۷۴,۴۴۹	۱,۰۸۲,۲۸۴		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

یادداشت‌های توضیحی همراه ، بخش جدائی ناپذیر صورت‌های مالی می‌باشد.

صورت سود و زیان و صورت گردش خالص داراییها سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

دوره مالی ۲ ماهه و ۱۴ روزه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		درآمدها:
-	۲۵۵,۶۵۰,۲۷۹	۱۲	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۲,۱۳۹,۷۰۵,۹۳۷)	(۳۷۱,۱۲۸,۶۹۳)	۱۳	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
-	۳,۴۸۵,۳۴۹,۷۶۰	۱۴	سود سهام
۱,۲۲۶,۹۵۶,۴۶۱	۲,۸۰۵,۷۵۶,۷۲۲	۱۵	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
-	۱,۳۱۳,۹۶۹	۱۶	سایر درآمدها
(۹۱۲,۷۴۹,۴۷۶)	۶,۱۷۶,۹۴۲,۰۴۷		جمع درآمدها
			هزینه ها:
(۲۵۵,۶۷۲,۵۴۶)	(۶۹۶,۵۸۹,۰۷۲)	۱۷	هزینه کارمزد ارکان
(۱۰۹,۱۸۵,۴۰۸)	(۳۲۷,۰۲۶,۸۵۸)	۱۸	سایر هزینه ها
(۳۶۴,۸۵۷,۹۵۴)	(۱,۰۲۳,۶۱۵,۹۳۰)		جمع هزینه ها
(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)	۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷		سود (زیان) خالص
-۲.۶%	۹.۹۶%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره ^{۱)}
-۰.۸۰%	۹.۷۳%		بازده میانگین سرمایه گذاری ^{۲)}

صورت گردش خالص داراییها

دوره مالی ۴ ماهه و ۱۴ روزه منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰		سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰		یادداشت	
ریال	تعداد	ریال	تعداد		
۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۵,۰۰۰	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		واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
-	-	(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)		واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۱,۲۷۷,۶۰۷,۴۳۰)	-	۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷	-		سود(زیان) خالص دوره
-	-	۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	۱۹	تعدیلات
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۰,۰۰۲	۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴		خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره

یادداشت های 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
سود خالص میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده	= بازده میانگین سرمایه گذاری