

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۳۹۷

«ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار»

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 (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.

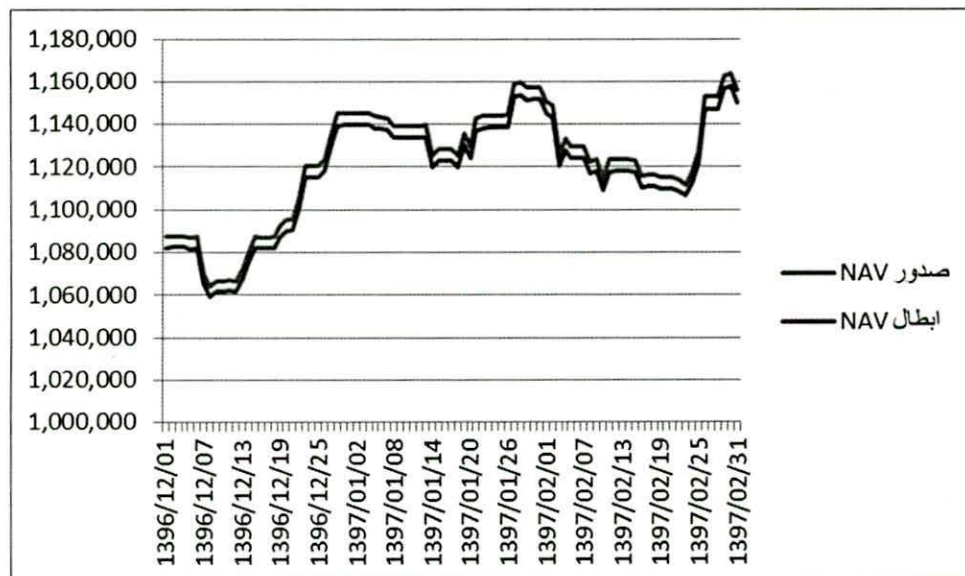
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
حسابرس	بهمنند
متولی	موسسه آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۶/۱۲/۰۱ تا ۹۷/۰۲/۳۱ در ۹۱ روز فعالیت صندوق هیچ گونه درخواستی برای صدور واحد و ابطال واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره همان ۵۰,۰۲۴ واحد بوده است.

۵۰,۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه گذاری در ابتدای دوره
-	تعداد واحدهای صادر شده
-	تعداد واحدهای ابطالی
۵۰,۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۲/۳۱



قیمت صدور، قیمت ابطال

منظور از صدور واحدهای سرمایه گذاری، ایجاد یک واحد سرمایه گذاری به نام سرمایه گذار و استفاده از وجوه آن برای انجام سرمایه گذاری در صندوق است؛ منظور از ابطال واحد سرمایه گذاری، نقد کردن قسمتی از دارایی های صندوق و پرداخت وجوه حاصل از آن به سرمایه گذار و حذف یک واحد سرمایه گذاری از صندوق است.

خرید و فروش دارایی‌های صندوق

- مطابق بند ۲-۲ امیدنامه، دارایی‌های صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۲/۳۱ 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.

رئال	بانک دی	سرمایه گذاری بوعلی	بیمه دی
موجودی در ابتدای دوره	-	۲۳,۰۷۶,۸۲۴,۵۸۲	۸,۳۱۲,۱۷۹,۴۳۸
خرید طی دوره	-	۳,۲۷۱,۱۸۱,۰۱۳	۳۶۴,۲۸۹,۷۸۶
فروش طی دوره	-	-۴۹,۷۱۱,۸۱۵	-۸۵۸,۱۴۰,۷۳۸
ارزشیابی	-	-۳,۰۶۶,۳۹۳,۶۱۱	۴۱,۹۰۵,۲۸۸
موجودی پایان دوره (۱۳۹۷/۰۲/۳۱)	-	۲۹,۳۶۴,۶۸۷,۳۹۱	۷,۸۶۰,۲۳۳,۷۷۴

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

تمام واحدهای سرمایه گذاری صندوق در اختیار سرمایه گذاران 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 ۱۳۹۷/۰۲/۳۱



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.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۲/۳۱) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۷/۰۲/۲۴	۱۳۹۷/۰۲/۳۱	٪۳,۴	٪۰,۵۵
یک ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۲/۰۱	۱۳۹۷/۰۲/۳۱	٪۰,۴۴	٪(۰,۰۴)
سه ماه گذشته	۱۳۹۶/۱۲/۰۱	۱۳۹۷/۰۲/۳۱	٪۶,۲۶	٪(۲,۹۷)

همانطور که در جدول بالا مشاهده می‌نماییم صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه مالی دی در ۹۱ 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 صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱ مطابق جداول ذیل می باشند:

ترازنامه سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۱۳۹۷/۰۲/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		دارایی ها:
۳۱,۳۸۹,۰۰۴,۰۲۰	۳۷,۲۲۴,۹۲۱,۱۶۵	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۸۵۸,۶۲۱,۷۳۱	۲۰,۵۱۷,۰۵۰,۵۹۱	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۶,۲۱۱,۴۳۱	۱۱,۰۴۰,۳۱۴	۷	حسابهای دریافتی
۱۷۲,۵۲۰,۷۲۶	۱۰۹,۵۴۶,۱۲۸	۸	سایر دارایی ها
<u>۵۴,۴۲۶,۳۵۷,۹۰۸</u>	<u>۵۷,۸۶۲,۵۵۸,۱۹۸</u>		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
-	۴۹,۳۵۷,۴۰۷	۹	جاری کارگزاران
۲۰۲,۸۵۵,۱۱۰	۱۷۶,۶۲۸,۴۴۱	۱۰	پرداختنی به ارکان صندوق
۸۳,۳۰۴,۹۹۲	۹۹,۶۹۴,۵۳۵	۱۱	سایر حسابهای پرداختنی و ذخایر
<u>۲۸۶,۱۶۰,۱۰۲</u>	<u>۳۲۵,۶۸۰,۳۸۳</u>		جمع بدهی ها
<u>۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶</u>	<u>۵۷,۵۳۶,۸۷۷,۸۱۵</u>	۱۲	خالص دارایی ها
۱,۰۸۲,۲۸۴	۱,۱۵۰,۱۸۵		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

صورت سود و زیان و صورت گردش خالص داراییها سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱	یادداشت	درآمدها:
ریال	ریال	ریال		
۲۵۵,۶۵۰,۲۷۹	۵۷,۱۶۱,۰۱۱	(۲۳,۸۵۲,۶۲۰)	۱۳	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۳۷۱,۱۲۸,۶۹۳)	(۱۲۱,۹۴۲,۴۸۰)	۳,۱۳۲,۱۵۱,۵۱۹	۱۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۳,۴۸۵,۳۴۹,۷۶۰	۳,۰۰۳,۹۰۲,۳۹۱	-	۱۵	سود سهام
۲,۸۰۵,۷۵۶,۷۳۲	۶۰۴,۹۴۳,۳۱۵	۵۴۹,۷۲۳,۶۶۲	۱۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۳۱۳,۹۶۹	۱,۳۱۳,۹۶۹	-	۱۷	سایر درآمدها
<u>۶,۱۷۶,۹۴۲,۰۴۷</u>	<u>۳,۵۴۵,۳۷۸,۲۰۶</u>	<u>۳,۶۵۸,۰۲۲,۵۶۱</u>		جمع درآمدها
				هزینه ها:
(۶۹۶,۵۸۹,۰۷۲)	(۱۷۳,۵۱۹,۰۴۷)	(۱۷۶,۶۲۸,۴۱۱)	۱۸	هزینه کارمزد ارکان
(۳۲۷,۰۲۶,۸۵۸)	(۷۵,۹۱۳,۷۶۷)	(۸۴,۷۱۴,۱۴۱)	۱۹	سایر هزینه ها
<u>(۱,۰۲۳,۶۱۵,۹۳۰)</u>	<u>(۲۴۹,۴۳۲,۸۱۴)</u>	<u>(۲۶۱,۳۴۲,۵۵۲)</u>		جمع هزینه ها
<u>۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷</u>	<u>۳,۲۹۵,۹۴۵,۳۹۲</u>	<u>۳,۳۹۶,۶۸۰,۰۰۹</u>		سود (زیان) خالص
۹.۹۶%	۶.۷۶%	۵۹.۰%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره ^{۱۱}
۹.۷۳%	۶.۳۱%	۶۱.۰۸%		بازده میانگین سرمایه گذاری ^{۱۲}

صورت گردش خالص داراییها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۲/۳۱		دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱		یادداشت
ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد
۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۰,۰۰۲	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۰,۰۰۲	۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴
۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۲۴	۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۲۴	-	-
(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)	(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)	-	-
۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷	-	۳,۲۹۵,۹۴۵,۳۹۲	-	۳,۳۹۶,۶۸۰,۰۰۹	-
۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	-	-
<u>۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶</u>	<u>۵۰,۰۲۴</u>	<u>۵۲,۲۸۲,۸۱۷,۰۸۱</u>	<u>۵۰,۰۲۴</u>	<u>۵۷,۵۳۶,۸۷۷,۸۱۵</u>	<u>۵۰,۰۲۴</u>

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می‌باشند.

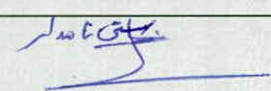

تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال \pm سود (زیان) خالص داراییهای پایان سال	=	۱۱ بازده سرمایه گذاری پایان دوره
سود خالص	=	۱۲ بازده میانگین سرمایه گذاری

میانگین مسوزون (ریال) وجوه استفاده شده

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 ۱۳۹۷/۰۳/۰۵ به تایید مدیران سرمایه گذاری صندوق رسیده است.

اعضای گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق

امضا	سمت	اعضای گروه مدیران سرمایه گذاری
	مدیر سرمایه گذاری	مهدی حیدرنیا
	مدیر سرمایه گذاری	محسن نامدار بهشتی
	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 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 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.