

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۳۹۷

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

مقدمه

اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می‌باشد، با تأکید 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 ۱۳۹۷/۰۵/۱۸ به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی»

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی 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 ۱۳۹۵/۰۵/۱۳ 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 تعهد پذیرهنویسی 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 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 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 تأیید 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.

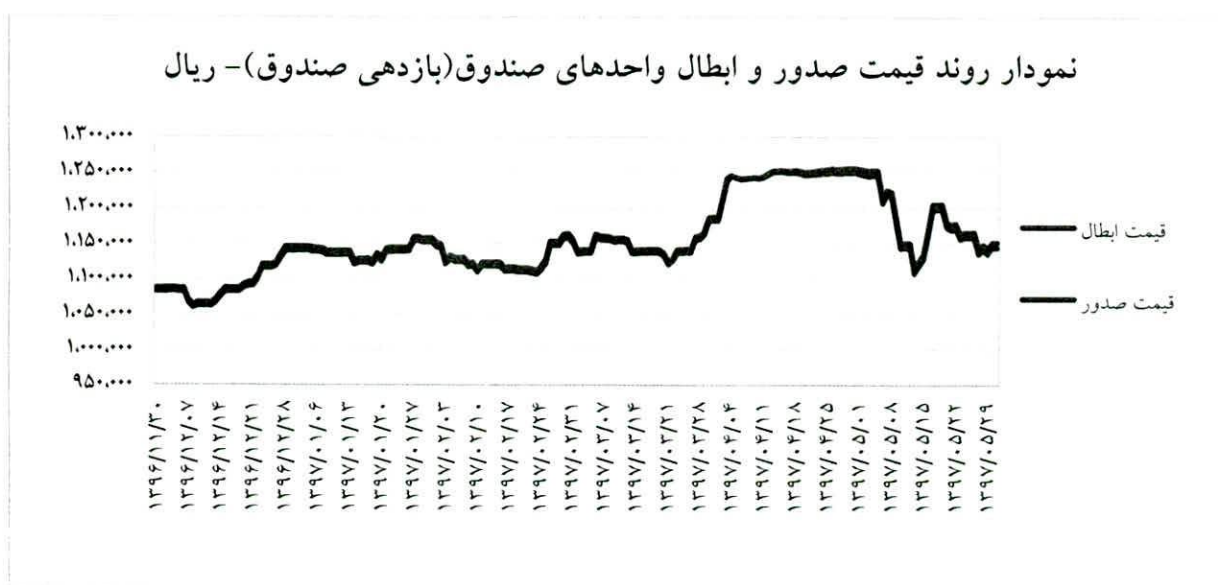
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۶/۱۲/۰۱ تا ۹۷/۰۵/۳۱ در ۱۸۴ روز فعالیت صندوق هیچ‌گونه درخواستی برای ابطال واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است. همچنین در تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۰۴ تعداد ۳۲۲,۰۲۲ واحد صدور انجام گرفته که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۳۷۲,۰۵۶ واحد رسیده است.

۵۰,۰۲۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۳۲۲,۰۲۲	تعداد واحدهای صادر شده
۰	تعداد واحدهای ابطالی
۳۷۲,۰۵۶	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۷/۰۵/۳۱



منظور از صدور واحدهای سرمایه‌گذاری، ایجاد یک واحد سرمایه‌گذاری به نام سرمایه‌گذار و استفاده از وجوه آن برای انجام سرمایه‌گذاری جهت انجام فعالیت بازارگردانی سهام شرکت‌های موضوع بازارگردانی 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.

خرید و فروش دارایی‌های صندوق

مطابق بند ۲-۲ امیدنامه، دارایی‌های صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ 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.

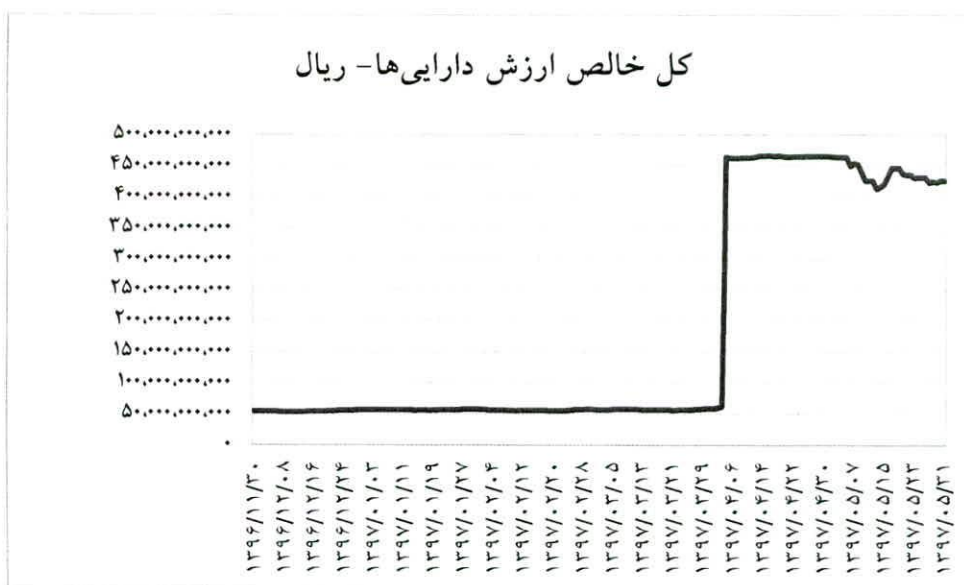
ریال	سرمایه‌گذاری بوعلی	بیمه دی	بانک دی
موجودی در ابتدای دوره	۲۳,۰۷۶,۸۲۴,۵۸۲	۸,۳۱۲,۱۷۹,۴۳۸	۰
خرید طی دوره	۲۹,۶۱۲,۱۰۶,۸۷۲	۹,۳۲۹,۰۷۷,۳۶۱	۳۴۸,۱۶۴,۱۰۴,۸۶۲
فروش طی دوره	-۶۵۸,۲۸۵,۵۲۱	-۱,۷۸۸,۹۶۰,۸۴۱	-۲۰۸,۶۱۱,۸۶۸
موجودی پایان دوره (۱۳۹۷/۰۵/۳۱)	۲۸,۹۵۳,۸۲۱,۳۵۱	۷,۵۴۰,۱۱۶,۵۲۰	۳۴۷,۹۵۵,۴۹۲,۹۹۴

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره (۱۳۹۷/۰۵/۳۱)

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	۳۷۲,۰۵۶	٪۱۰۰
کل سرمایه‌گذاران	۲	۳۷۲,۰۵۶	٪۱۰۰

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۰۵/۳۱




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. همچنین با توجه به نمودار فوق مشاهده می‌گردد که در تیر ماه صعود قابل ملاحظه‌ای در ارزش خالص دارایی‌های صندوق رخ داده است که به دلیل صدور واحدهای سرمایه‌گذاری به تعداد ۳۲۲,۰۲۲ واحد در تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۰۴ است. همچنین پس از بازگشایی نماد بانک دی در تابلو بازار فرابورس، پس از گذشت مدت زمان بسیار زیاد و هیجان فروش از سوی سهام‌داران، به دلیل افت قیمت سهام مذکور، ارزش خالص دارایی‌های صندوق در مقطعی با کاهش چشمگیر روبرو شده است.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۵/۳۱) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۷/۰۵/۲۴	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	٪-۱,۲۱	٪۴,۹۳
یک ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۵/۰۱	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	٪-۸,۳۱	٪۲۶,۰۰
سه ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۳/۰۱	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	٪۰,۶۸	٪۴۳,۴۴
۶ ماه گذشته	۱۳۹۶/۱۲/۰۱	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	۵.۶۷%	۳۹.۴۸%
یک سال گذشته	۱۳۹۶/۰۵/۳۱	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	۷.۹۶%	۶۶.۲۱%

همانطور که در جدول بالا مشاهده می‌نماییم صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه مالی دی در ۱۸۴ روز گذشته موفق به کسب بازدهی ۵,۶۷ درصدی شده است. این مهم در حالی اتفاق افتاده که در دوره شش ماهه مورد گزارش به دلیل آورده با حجم بالا از سوی سرمایه‌گذار و نیز بازگشایی نماد بانک دی و افت قیمتی آن، رشد اندکی نسبت به بازدهی شاخص داشته است. در واقع مدیریت بهینه سبد سرمایه‌گذاری صندوق در کنار انجام تعهدات روزانه‌ی صندوق بازارگردانی دو عاملی هستند که از افت بیشتر ارزش خالص دارایی‌های صندوق جلوگیری نموده است.



صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ مطابق
جداول ذیل می‌باشند:

صورت خالص دارایی‌ها شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱

۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۳۱,۳۸۹,۰۰۴,۰۲۰	۳۴۰,۹۵۳,۱۱۰,۶۷۹	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۸۵۸,۶۲۱,۷۳۱	۸۰,۵۶۴,۱۸۳,۶۰۶	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۶,۲۱۱,۴۳۱	۶,۵۴۵,۱۱۹,۰۶۹	۷	حسابهای دریافتی
۱۷۲,۵۲۰,۷۲۶	۴۳,۳۳۸,۳۰۶	۸	سایر دارایی‌ها
۵۴,۴۲۶,۳۵۷,۹۰۸	۴۲۸,۱۰۵,۷۵۱,۶۶۰		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
-	۱,۵۲۱,۷۷۱,۰۵۲	۹	جاری کارگزاران
۲۰۲,۸۵۵,۱۱۰	۷۹۳,۰۵۹,۰۸۰	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۸۳,۳۰۴,۹۹۲	۱۹۰,۴۱۳,۴۷۰	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۸۶,۱۶۰,۱۰۲	۲,۵۰۵,۲۴۳,۶۰۲		جمع بدهی‌ها
۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۴۲۵,۶۰۰,۵۰۸,۰۵۸	۱۲	خالص دارایی‌ها
۱,۰۸۲,۲۸۴	۱,۱۴۳,۹۱۵		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری



صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱

یادداشت	دوره مابقی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱	دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰
	ریال	ریال	ریال
	۹,۳۸۶,۳۲۴	۵۱,۴۲۷,۱۱۳	۲۵۵,۶۵۰,۲۷۹
۱۳			سود (زیان) فروش اوراق بهادار
	(۴۱,۱۳۶,۴۳۲,۲۷۸)	(۲۰۷,۳۴۵,۳۵۴)	(۳۷۱,۱۲۸,۶۹۳)
۱۴			سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۳,۱۷۸,۳۹۵,۱۵۹	۳,۴۸۵,۳۴۹,۷۶۰
۱۵			سود سهام
	۸,۴۸۹,۹۹۴,۳۰۳	۱,۴۸۶,۴۵۷,۵۳۸	۲,۸۰۵,۷۵۶,۷۳۲
۱۶			سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی الحساب
	۹۹۳,۰۸۰	۱,۳۱۳,۹۶۹	۱,۳۱۳,۹۶۹
۱۷			سایر درآمدها
	(۲۷,۳۶۱,۹۴۰,۱۷۱)	۴,۵۱۰,۲۴۸,۴۲۵	۶,۱۷۶,۹۴۲,۰۴۷
			جمع درآمدها
	(۹۲۹,۵۶۶,۲۳۱)	(۳۴۱,۲۸۵,۲۷۳)	(۶۹۶,۵۸۹,۰۷۲)
۱۸			هزینه کارمزد ارکان
	(۲۴۷,۶۷۲,۸۹۸)	(۱۵۳,۳۸۰,۵۱۵)	(۳۲۷,۰۲۶,۸۵۸)
۱۹			سایر هزینه ها
	(۱,۱۷۷,۲۳۹,۱۲۹)	(۴۹۴,۶۶۵,۷۸۸)	(۱,۰۲۳,۶۱۵,۹۳۰)
			جمع هزینه ها
	(۲۸,۵۳۹,۱۷۹,۳۰۰)	۴,۰۱۵,۵۸۲,۶۳۷	۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷
			سود (زیان) خالص
	-۶/۶۵%	۷/۵۸%	۹/۹۶%
			بازده سرمایه گذاری پایان دوره ^(۱)
	-۱۵/۶۴%	۷/۷۲%	۹/۷۳%
			بازده میانگین سرمایه گذاری ^(۲)

صورت گردش خالص داراییها

یادداشت	دوره مابقی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱		دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱		سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	
	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال
	۵۰,۰۲۴	۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۰۲	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰	۵۰,۰۰۲	۴۸,۷۲۴,۳۹۲,۵۷۰
	۳۲۲,۰۳۲	۳۲۲,۰۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۲۴	۱۶,۱۹۹,۴۷۳,۸۷۴	۱۵,۰۲۴	۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰
	-	-	(۱۵,۰۰۲)	(۱۵,۹۳۶,۹۹۴,۷۵۵)	(۱۵,۰۰۲)	(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)
	-	(۲۸,۵۳۹,۱۷۹,۳۰۰)	-	۴,۰۱۵,۵۸۲,۶۳۷	-	۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷
	۲۰	۷۷,۹۶۷,۴۸۹,۵۵۲	-	-	-	۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹
	۳۷۲,۰۵۶	۴۲۵,۶۰۰,۵۰۸,۰۵۸	۵۰,۰۲۴	۵۳,۰۰۲,۴۵۴,۳۲۶	۵۰,۰۲۴	۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶

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

