

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۷

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

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 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 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.

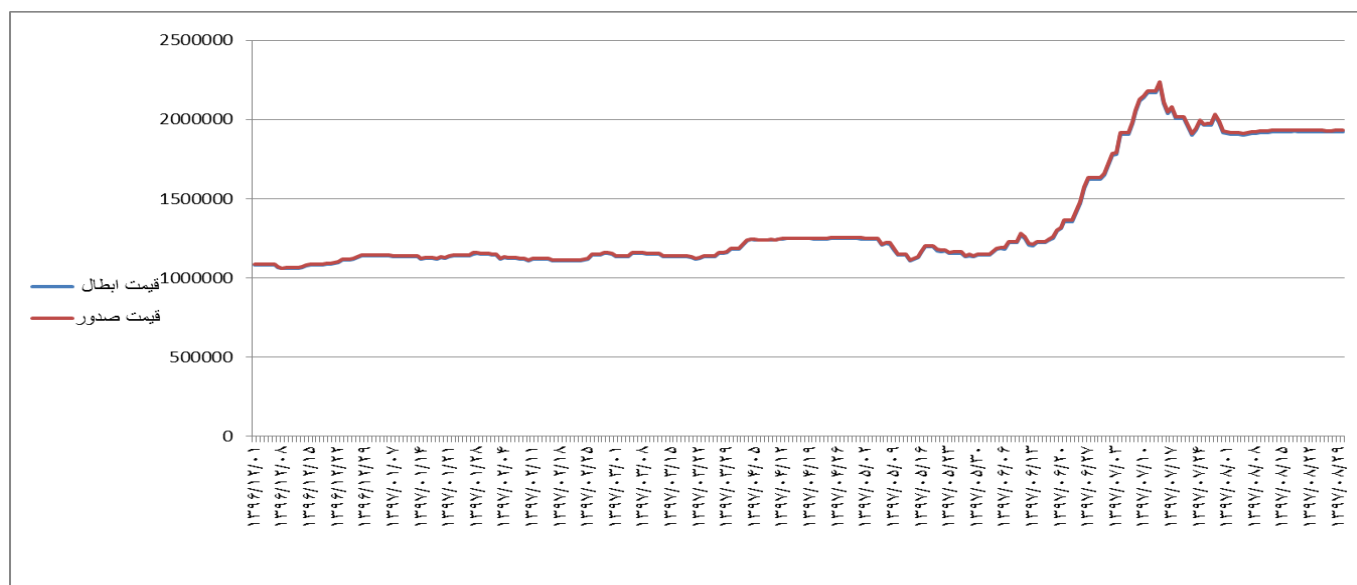
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۶/۱۲/۰۱ تا ۹۷/۰۸/۳۰ در ۲۷۵ 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 ۱۳۹۷/۰۸/۳۰



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 ۱۳۹۷/۰۸/۳۰ به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

- سهام و حق تقدم سهام موضوع بند ۲-۲-۱ امیدنامه شامل بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی و تولید نیروی برق دماوند.
- موجودی نقد و گواهی سپرده.

- اوراق بهادار احراز شده بر اساس شرایط مندرج در بند ۲-۲ امیدنامه.

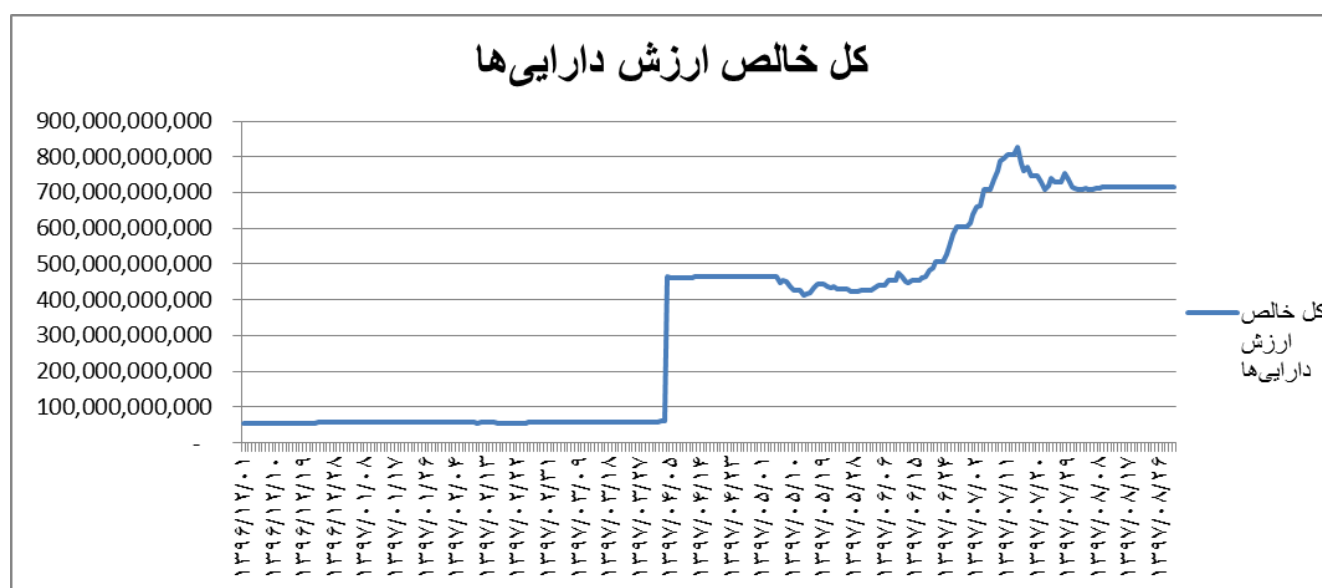
ریال	سرمایه گذاری بوعلی	بیمه دی	بانک دی	تولید نیروی برق دماوند
موجودی در ابتدای دوره	۲۳.۰۷۶.۸۲۴.۵۸۲	۸.۳۱۲.۱۷۹.۴۳۸	.	.
خرید طی دوره	۳۲.۹۵۸.۳۳۷.۷۶۰	۱۴.۱۵۲.۰۲۴.۰۴۷	۳۸۳.۸۵۵.۰۳۶.۹۵۵	۹.۱۴۱.۷۱۰.۸۶۷
فروش طی دوره	۳.۳۷۶.۲۸۱.۶۴۷	۵.۲۱۲.۷۹۴.۹۰۰	۲۱۵.۲۳۳.۷۵۰.۲۲۳	.
موجودی پایان دوره (۱۳۹۷/۰۸/۳۰)	۵۱.۰۵۹.۴۵۰.۶۹۲	۸.۹۰۷.۹۹۳.۱۵۰	۳۹۶.۴۸۰.۱۷۲.۱۷۰	۹.۲۰۷.۸۴۵.۹۰۰

ترکیب سرمایه گذاران در پایان دوره (۱۳۹۷/۰۸/۳۰)

تمام واحدهای سرمایه گذاری صندوق در اختیار سرمایه گذاران حقوقی است.

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه گذاران حقیقی	۰	.	.
سرمایه گذاران حقوقی	۲	۳۷۲,۰۵۶	۱۰۰٪
کل سرمایه گذاران	۲	۳۷۲,۰۵۶	۱۰۰٪

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۰۸/۳۰



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. 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.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۸/۳۰) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۷/۰۸/۲۳	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	٪-۰,۰۳۹	٪-۳,۴۵۱
یک ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۷/۳۰	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	٪۰,۰۶۵	٪-۶,۴۲۶
سه ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۶/۰۱	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	٪۶۸,۰۵۴	٪۲۸,۳۴۲
۶ ماه گذشته	۱۳۹۶/۰۳/۰۴	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	٪۶۹,۱۹۹	٪۸۴,۰۹۹
یک سال گذشته	۱۳۹۶/۰۸/۳۰	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	٪۷۸,۱۷	٪۹۷,۹۳۲

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰ مطابق جداول ذیل می‌باشند:

صورت خالص دارایی ها نه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		دارایی ها:
۳۱,۳۸۹,۰۰۴,۰۲۰	۴۵۵,۰۷۲,۹۷۸,۷۳۵	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۸۵۸,۶۲۱,۷۳۱	۲۵۹,۳۹۰,۰۲۳,۸۰۶	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۶,۲۱۱,۴۳۱	۳,۴۴۲,۴۴۹,۷۵۵	۷	حسابهای دریافتی
۱۷۲,۵۲۰,۷۲۶	۲۵۱,۸۲۳,۱۷۱	۸	سایر دارایی ها
۵۴,۴۲۶,۳۵۷,۹۰۸	۷۱۸,۱۵۷,۲۷۵,۴۶۷		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
-	۳۶۹,۱۳۳,۲۷۹	۹	جاری کارگزاران
۲۰۲,۸۵۵,۱۱۰	۱,۸۴۴,۹۱۵,۹۲۲	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۸۳,۳۰۴,۹۹۲	۶۵۲,۱۵۴,۲۵۸	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۸۶,۱۶۰,۱۰۲	۲,۸۶۶,۲۰۳,۴۵۹		جمع بدهی ها
۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۷۱۵,۲۹۱,۰۷۲,۰۰۸	۱۲	خالص دارایی ها
۱,۰۸۲,۲۸۴	۱,۹۲۲,۵۳۶		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها نه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰	دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال	ریال		درآمدها:
۲۵۵,۶۵۰,۳۷۹	۱۴۲,۸۴۸,۳۷۵	۷۷,۷۴۴,۵۰۲,۱۴۵	۱۳	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۳۷۱,۱۲۸,۶۹۳)	(۱۰۹,۱۵۹,۲۴۷)	۱۶۳,۲۹۹,۳۷۸,۰۸۲	۱۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۳,۴۸۵,۳۴۹,۷۶۰	۳,۴۸۵,۳۴۹,۷۶۰	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۱۵	سود سهام
۲,۸۰۵,۷۵۶,۷۳۲	۲,۲۴۳,۸۷۸,۶۸۲	۱۷,۹۷۵,۲۰۴,۷۷۳	۱۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۳۱۳,۹۶۹	۱,۳۱۳,۹۶۹	۹۹۳,۰۸۰	۱۷	سایر درآمدها
۶,۱۷۶,۹۴۲,۰۴۷	۵,۷۶۴,۲۳۱,۵۳۹	۲۶۴,۲۹۴,۱۹۶,۴۸۰		جمع درآمدها
				هزینه ها:
(۶۹۶,۵۸۹,۰۷۲)	(۵۳۷,۶۸۴,۶۰۹)	(۲,۶۲۹,۹۰۹,۰۰۹)	۱۸	هزینه کارمزد ارکان
(۳۲۷,۰۲۶,۸۵۸)	(۲۳۵,۲۱۲,۰۲۸)	(۵۱۲,۹۰۲,۸۲۱)	۱۹	سایر هزینه ها
(۱,۰۲۳,۶۱۵,۹۳۰)	(۷۷۲,۸۹۶,۶۳۷)	(۳,۱۴۲,۸۱۱,۸۳۰)		جمع هزینه ها
۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷	۴,۹۹۱,۳۳۴,۹۰۲	۲۶۱,۱۵۱,۳۸۴,۶۵۰		سود خالص
۹.۹۶%	۹.۶۹%	۴۷.۴۱%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
۹.۷۳%	۹.۵۳%	۷۸%		بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

صورت گردش خالص داراییها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰		دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۸/۳۰		دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰		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	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۲۴	۱۵,۰۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۲۴	۳۲۲,۰۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۳۲۲,۰۳۲	واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)	(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)	-	-	واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷	-	۴,۹۹۱,۳۳۴,۹۰۲	-	۲۶۱,۱۵۱,۳۸۴,۶۵۰	-	سود خالص دوره
۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	۷۷,۹۶۷,۴۸۹,۵۵۲	۳۰	تعدیلات
۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴	۵۳,۹۷۸,۲۰۶,۵۹۱	۵۰,۰۲۴	۷۱۵,۲۹۱,۰۷۲,۰۰۸	۳۷۲,۰۵۶	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	=	بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
خالص داراییهای پایان سال		
سود خالص		
میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده	=	بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)