

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن 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 و به شناسه ملی ۱۴۰۰۶۰۱۲۳۵۷ ثبت شده 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.

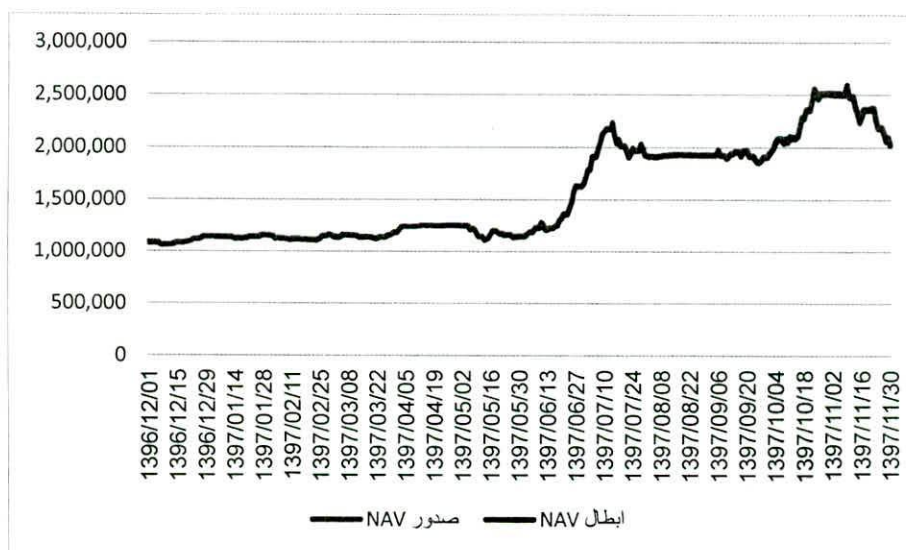
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۶/۱۲/۰۱ تا ۹۷/۱۱/۳۰ در ۳۶۵ 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 ۱۳۹۷/۱۱/۳۰



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 ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

- سهام و حق تقدم سهام موضوع بند ۲-۲-۱ امیدنامه شامل بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی و تولید نیروی برق دماوند.
- موجودی نقد و گواهی سپرده.
- اوراق بهادار احراز شده بر اساس شرایط مندرج در بند ۲-۲ امیدنامه.

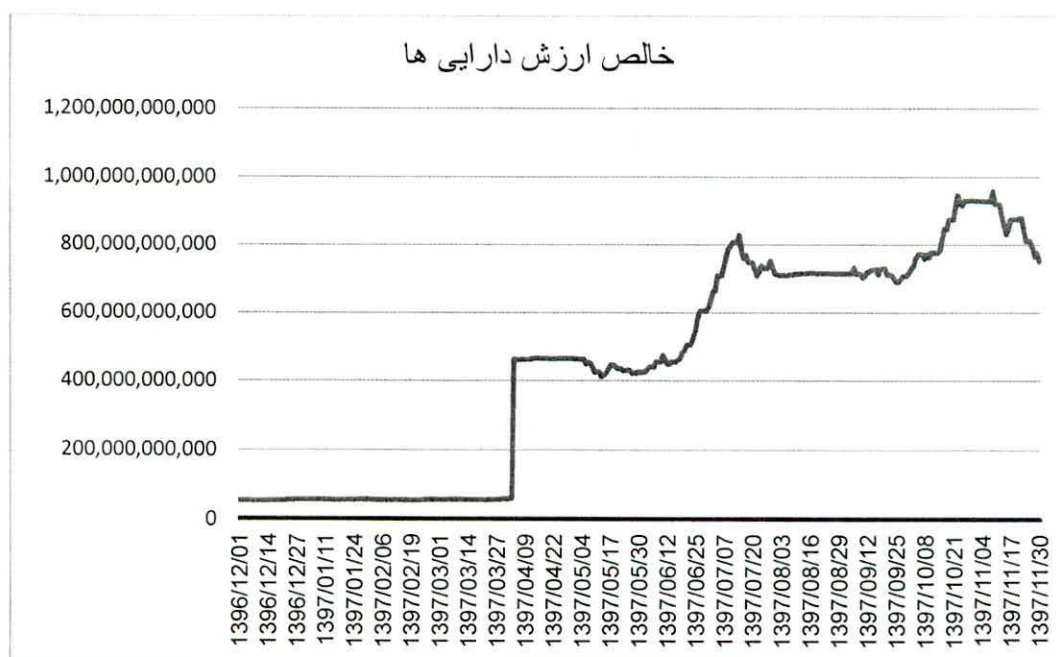
شرح	بانک دی (ریال)	سرمایه‌گذاری بوعلی (ریال)	بیمه دی (ریال)	تولید نیروی برق دماوند (ریال)
موجودی در ابتدای دوره	۰	۲۳,۰۷۶,۸۲۴,۵۸۳	۸,۳۱۲,۱۷۹,۴۳۸	۰
خرید طی دوره	۷۰۵,۶۸۳,۶۵۴,۴۰۶	۳۴,۸۴۸,۰۵۰,۱۲۴	۱۶,۴۴۹,۸۲۵,۶۶۰	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷
فروش طی دوره	۲۷۵,۲۱۰,۵۶۷,۴۵۷	۳,۸۵۳,۶۳۶,۶۰۰	۶,۴۶۳,۲۱۷,۶۸۲	۰
ارزش پایان دوره (۱۳۹۷/۱۱/۳۰)	۶۷۷,۷۶۳,۰۷۳,۶۸۸	۵۴,۳۲۳,۷۶۱,۱۱۰	۱۱,۴۸۷,۹۳۷,۳۱۰	۲۱,۲۳۶,۷۴۶,۳۰۰

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره (۱۳۹۷/۱۱/۳۰)

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 ۱۳۹۷/۱۱/۳۰



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 کل 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 سال مالی منتهی ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق (درصد)	بازده بازار (درصد)
۷ روز گذشته	۱۳۹۷/۱۱/۲۳	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	-۱۰,۶۶	-۰,۳۷
یک ماه گذشته	۱۳۹۷/۱۰/۳۰	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	-۱۹,۳۸	-۴,۹۵
سه ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۸/۳۰	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۴,۹۸	-۱۰,۴۳
۶ ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۵/۳۰	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۷۶,۴۲	۱۴,۹۶
یک سال گذشته	۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۸۶,۴۸	۶۰,۳۶

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ مطابق
جداول ذیل می‌باشند:

صورت خالص دارایی‌ها سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰

۱۳۹۶/۱۱/۳۰	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	یادداشت	
	ریال		دارایی‌ها:
۳۱,۳۸۹,۰۰۴,۰۲۰	۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۶	۵	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲,۸۵۸,۶۲۱,۷۳۱	۱,۶۰۲,۱۹۲,۷۶۸	۶	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۶,۲۱۱,۴۳۱	-	۷	حسابهای دریافتی
۱۵۲,۰۰۴,۵۴۰	۱۷۲,۵۲۰,۹۱۶	۸	سایر دارایی‌ها
<u>۵۴,۴۰۵,۸۴۱,۷۲۲</u>	<u>۷۵۴,۸۱۰,۱۱۶,۲۵۰</u>		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
-	۳۸۳,۴۷۷,۲۱۱	۹	جاری کارگزاران
۲۰۲,۸۵۵,۱۱۰	۲,۶۶۱,۹۲۷,۵۵۹	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۸۳,۳۰۴,۹۹۲	۸۸۵,۹۵۸,۲۳۸	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
<u>۲۸۶,۱۶۰,۱۰۲</u>	<u>۳,۹۳۱,۳۶۳,۰۰۸</u>		جمع بدهی‌ها
<u>۵۴,۱۱۹,۶۸۱,۶۲۰</u>	<u>۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲</u>	۱۲	خالص دارایی‌ها
۹۷۴,۴۴۹	۲,۰۱۸,۱۸۷		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری



صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰	یادداشت	درآمدها:
ریال	ریال		
۲۵۵,۶۵۰,۲۷۹	۱۰۰,۱۵۷,۹۱۰,۲۳۱	۱۳	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۳۷۱,۱۲۸,۶۹۳)	۱۷۴,۵۳۶,۸۵۷,۳۶۹	۱۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۳,۴۸۵,۳۴۹,۷۶۰	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۱۵	سود سهام
۲,۸۰۵,۷۵۶,۷۳۲	۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۴۷	۱۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۳۱۳,۹۶۹	۹۹۳,۰۸۰	۱۷	سایر درآمدها
۶,۱۷۶,۹۴۲,۰۴۷	۳۰۲,۵۸۰,۹۹۸,۸۲۷		جمع درآمدها
			هزینه ها:
(۶۹۶,۵۸۹,۰۷۲)	(۵,۰۰۹,۸۳۱,۸۸۶)	۱۸	هزینه کارمزد ارکان
(۳۲۷,۰۲۶,۸۵۸)	(۸۳۲,۱۰۱,۰۵۶)	۱۹	سایر هزینه ها
(۱,۰۲۳,۶۱۵,۹۳۰)	(۵,۸۴۱,۹۳۲,۹۴۲)		جمع هزینه ها
۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷	۲۹۶,۷۳۹,۰۶۵,۸۸۵		سودخالص
۹.۹۶٪	۴۹.۹۰٪		بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
۹.۷۳٪	۶۵.۶۱٪		بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

صورت گردش خالص داراییها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰		سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰		یادداشت
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
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	۳۲۲,۰۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۳۲۲,۰۳۲	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۱۵,۰۰۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۵,۰۰۲)		-	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۵,۱۵۳,۳۲۶,۱۱۷	-	۲۹۶,۷۳۹,۰۶۵,۸۸۵	-	سود خالص دوره
۲۴۰,۴۷۹,۱۱۹	-	۷۷,۹۶۷,۴۸۹,۵۵۱	-	تعدیلات
۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴	۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲	۳۷۲,۰۵۶	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره

یادداشتهای 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

= (۱) بازده سرمایه گذاری پایان دوره

سود خالص

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

= (۲) بازده میانگین سرمایه گذاری

