

## گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

« 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 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 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 ۱۴۰۱/۰۴/۲۸) که به تأیید 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](http://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.

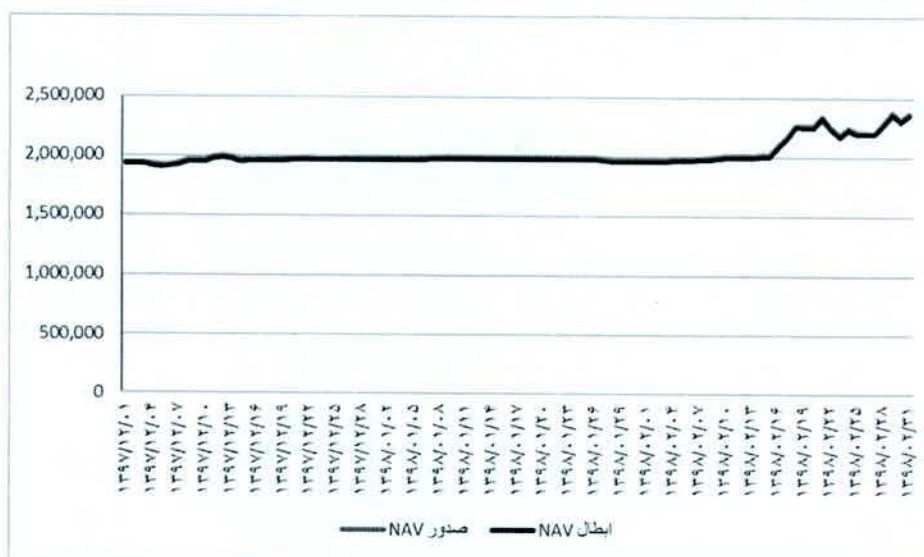
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود

## عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۷/۱۲/۰۱ تا ۹۸/۰۲/۳۱ در ۹۱ روز فعالیت صندوق هیچ‌گونه درخواستی برای ابطال واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است. همچنین در تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۷ تعداد ۴۶,۷۳۶ واحد صدور انجام گرفته که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره به ۴۱۸,۷۹۲ واحد رسیده است.

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره	۳۷۲,۰۵۶
تعداد واحدهای صادر شده	۴۶,۷۳۶
تعداد واحدهای ابطالی	۰
تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره	۴۱۸,۷۹۲

## قیمت صدور و ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۸/۰۲/۳۱



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 ۱۳۹۸/۰۲/۳۱ به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

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

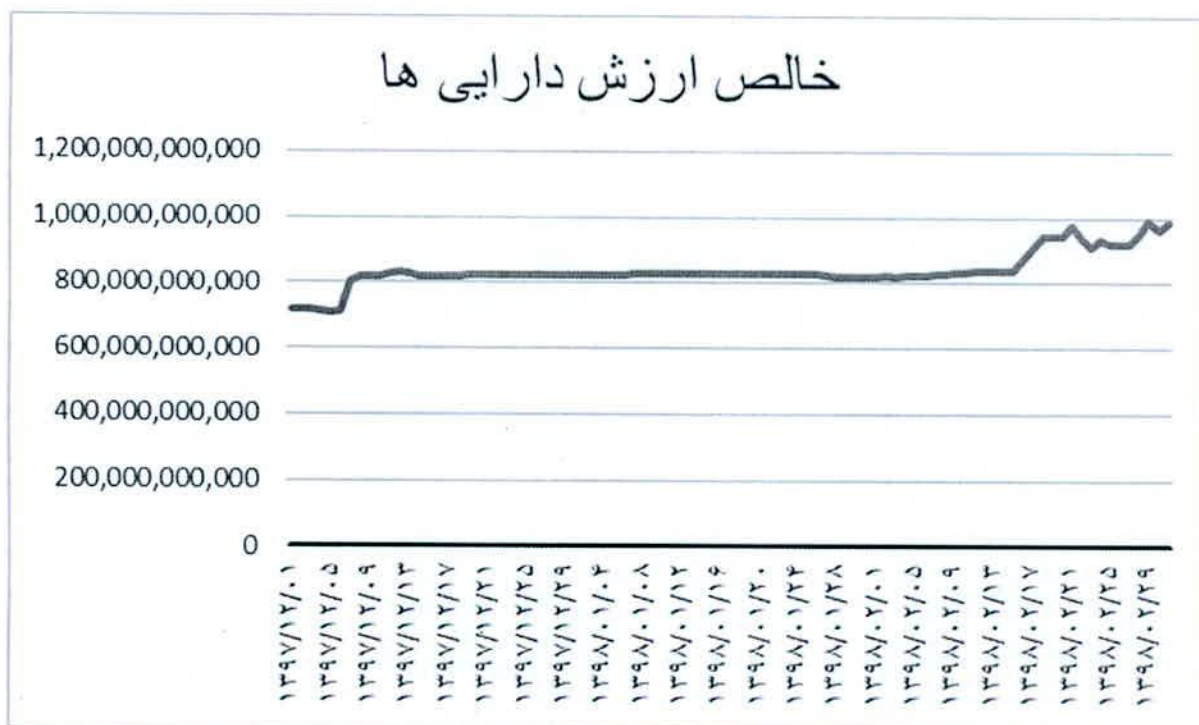
شرح	بانک دی (ریال)	سرمایه گذاری بوعلی (ریال)	بیمه دی (ریال)	تولید نیروی برق دماوند (ریال)
ارزش موجودی در ابتدای دوره	۶۷۵,۰۵۸,۷۹۹,۰۲۲	۴۵,۳۸۲,۴۹۱,۴۲۱	۱۱,۴۴۲,۱۰۰,۴۴۰	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲
خرید طی دوره	۱۹۳,۰۲۶,۲۸۱,۵۰۲	۱۹,۹۰۵,۹۳۶,۰۹۴	۱۲,۹۴۷,۸۸۳,۳۵۷	۱۱,۲۳۴,۴۶۳,۶۶۹
فروش طی دوره	۱۵,۸۶۲,۷۹۵,۱۲۵	۶۱۸,۷۲۴,۵۰۰	۶,۴۸۴,۹۴۹,۴۳۷	.
ارزش پایان دوره (۱۳۹۸/۰۲/۳۱)	۸۵۲,۲۲۲,۲۸۵,۳۹۹	۶۴,۶۶۹,۷۰۳,۰۱۵	۱۷,۹۰۵,۰۳۴,۳۶۰	۳۲,۲۸۶,۴۷۵,۳۵۱

### ترکیب سرمایه گذاران در دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

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	۴۱۸,۷۹۲	۱۰۰
کل سرمایه گذاران	۲	۴۱۸,۷۹۲	۱۰۰

نمودار خالص ارزش دارایی های صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۸/۰۲/۳۱



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 مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱ می‌باشد.**

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق (درصد)	بازده بازار (درصد)
۷ روز گذشته	۱۳۹۸/۰۲/۲۴	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	۵.۴۹۶	۱.۵۸
یک ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۲/۰۱	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	۲۰.۱۰۶	۵.۲۴۳
سه ماه گذشته	۱۳۹۷/۱۲/۰۱	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	۲۲.۰۷	۳۴.۸۶۳
۶ ماه گذشته	۱۳۹۷/۰۹/۰۱	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	۲۲.۳۷۷	۲۲.۴۱۱
یک سال گذشته	۱۳۹۶/۰۲/۳۱	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	۱۰۴.۵۷۲	۱۲۵.۸۷۱

## صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱ مطابق جداول ذیل می‌باشند:

### صورت خالص دارایی‌ها دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	
ریال	ریال	<b>دارایی‌ها:</b>
۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۶	۹۶۷,۱۸۳,۴۹۸,۱۲۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۶۰۲,۱۹۲,۷۶۸	۲۷,۰۴۱,۳۱۲,۵۰۸	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱۷۲,۵۲۰,۹۱۶	۱۱۰,۵۳۴,۶۸۲	سایر دارایی‌ها
-	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	موجودی نقد
۷۵۴,۸۱۰,۱۱۶,۲۵۰	۹۹۴,۳۴۵,۳۴۵,۳۱۵	جمع دارایی‌ها
		<b>بدهی‌ها:</b>
۳۸۳,۴۷۷,۲۱۱	۵,۴۰۴,۳۱۱,۲۵۵	جاری کارگزاران
۲,۹۳۴,۴۲۷,۵۵۹	۲,۶۸۳,۴۴۲,۴۲۰	پرداختی به ارکان صندوق
۶۱۳,۴۵۸,۲۳۸	۸۵۸,۴۹۶,۴۳۴	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۳,۹۳۱,۳۶۳,۰۰۸	۸,۹۴۶,۲۵۰,۱۰۹	جمع بدهی‌ها
۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲	۹۸۵,۳۹۹,۰۹۵,۲۰۶	<b>خالص دارایی‌ها</b>
۲,۰۱۸,۱۸۷	۲,۳۵۲,۹۵۶	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری

یادداشتهای توضیحی همراه ، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می‌باشد.



## صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱	
ریال	ریال	ریال	درآمدها:
۱۰۲,۴۷۰,۰۴۳,۱۱۲	(۲۳,۸۵۲,۶۲۰)	۳,۳۴۰,۸۱۴,۸۱۴	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۷۲,۲۲۴,۷۲۴,۴۸۷	۳,۱۳۲,۱۵۱,۵۱۹	۱۴۳,۳۴۲,۴۸۶,۶۹۸	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	-	سود سهام
۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۴۷	۵۴۹,۷۲۳,۶۶۲	۷۶۵,۴۱۸,۹۴۴	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۹۹۳,۰۸۰	-	-	سایر درآمدها
<b>۳۰۲,۵۸۰,۹۹۸,۸۲۶</b>	<b>۳,۶۵۸,۰۲۲,۵۶۱</b>	<b>۱۴۷,۴۴۸,۷۲۰,۴۵۶</b>	<b>جمع درآمدها</b>
			<b>هزینه ها:</b>
(۵,۰۰۹,۸۳۱,۸۸۶)	(۱۷۶,۶۲۸,۴۱۱)	(۲,۶۱۳,۴۲۲,۳۳۳)	هزینه کارمزد ارکن
(۸۳۲,۱۰۱,۰۵۶)	(۸۴,۷۱۴,۱۴۱)	(۳۱۳,۳۹۶,۴۳۰)	سایر هزینه ها
<b>(۵,۸۴۱,۹۳۲,۹۴۲)</b>	<b>(۲۶۱,۳۴۲,۵۵۲)</b>	<b>(۲,۹۲۶,۸۱۸,۷۶۳)</b>	<b>جمع هزینه ها</b>
<b>۲۹۶,۷۳۹,۰۶۵,۸۸۴</b>	<b>۳,۳۹۶,۶۸۰,۰۰۹</b>	<b>۱۴۴,۵۲۱,۹۰۱,۶۹۳</b>	<b>سود (زیان) خالص</b>
<b>۳۹/۵۲%</b>	<b>۶.۷۶%</b>	<b>۱۴/۷۳%</b>	بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
<b>۶۵/۶۱%</b>	<b>۶.۳۱%</b>	<b>۱۷/۲۵%</b>	بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

### صورت گردش خالص داراییها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰		دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱		دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴	۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴	۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۱	۳۷۲,۰۵۶	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
۳۲۲,۰۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۳۲۲,۰۳۲	-	-	۴۶,۷۳۶,۰۰۰,۰۰۰	۴۶,۷۳۶	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
-	-	-	-	-	-	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۲۹۶,۷۳۹,۰۶۵,۸۸۴	-	۳,۳۹۶,۶۸۰,۰۰۹	-	۱۴۴,۵۲۱,۹۰۱,۶۹۳	-	سود (زیان) خالص دوره
۷۷,۹۶۷,۴۸۹,۵۵۱	-	-	-	۴۳,۲۶۲,۴۴۰,۳۷۲	-	تعدیلات
<b>۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۱</b>	<b>۳۷۲,۰۵۶</b>	<b>۵۷,۵۳۶,۸۷۷,۸۱۵</b>	<b>۵۰,۰۲۴</b>	<b>۹۸۵,۳۹۹,۰۹۵,۲۰۶</b>	<b>۴۱۸,۷۹۲</b>	<b>خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره</b>

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

سود خالص

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

(۱) بازده سرمایه گذاری پایان دوره

(۲) بازده میانگین سرمایه گذاری

