



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۳۹۸

«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 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 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، 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 ۱۴۰۱/۰۴/۲۸) که به تأیید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است. مرکز اصلی صندوق در تهران- خیابان مطهری-کوچه منصور -پلاک ۶۶- 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.

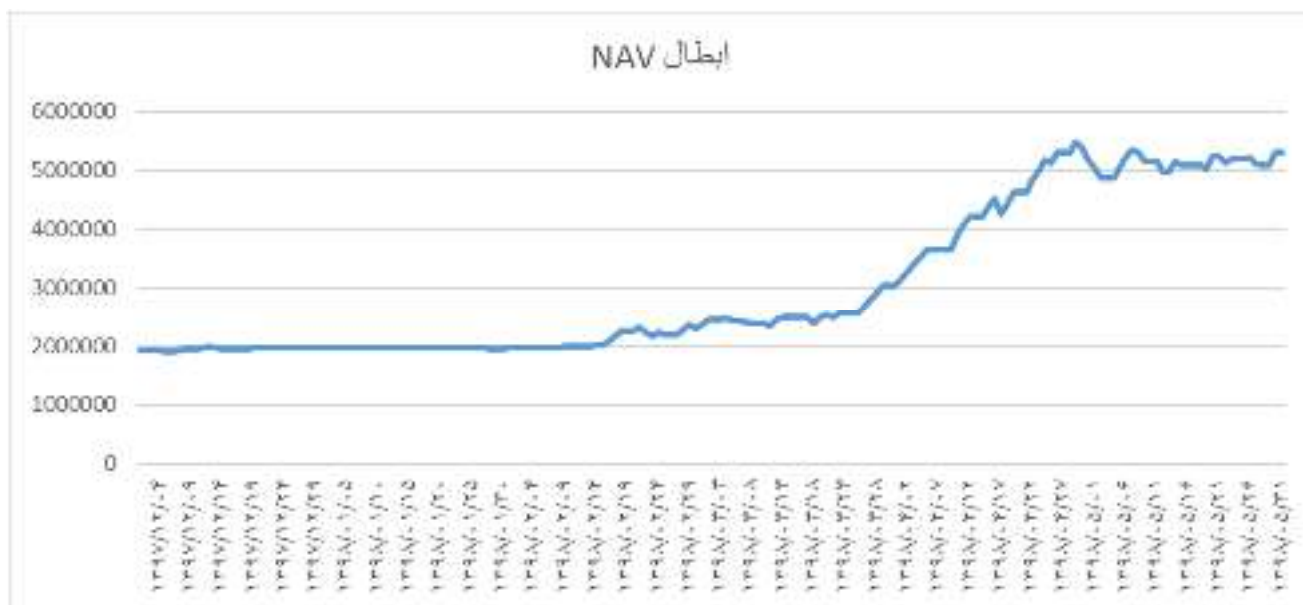
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۷/۱۲/۰۱ تا ۹۸/۰۵/۳۱ در ۱۸۴ روز فعالیت صندوق هیچ‌گونه درخواستی برای ابطال واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است. همچنین در تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۷ تعداد ۴۳,۷۳۶ واحد صدور انجام گرفته که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره به ۴۱۸,۷۹۲ واحد رسیده است.

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

قیمت ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۸/۰۵/۳۱



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 ۱۳۹۸/۰۵/۳۱ به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

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

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

پایان دوره		اول دوره		شرح
ارزش	تعداد	ارزش	تعداد	
۱,۸۸۵,۹۱۲,۲۷۷,۷۹۰	۵۶۳,۸۰۰,۳۸۲	۶۷۷,۷۶۳,۰۷۳,۶۸۸	۵۷۱,۴۶۹,۷۰۸	بانک دی
۴۲,۵۴۴,۸۸۳,۸۶۵	۱۶,۴۵۸,۳۶۹	۱۱,۴۸۷,۹۳۷,۳۱۰	۹,۵۶۵,۳۱۰	بیمه دی
۵۱,۹۰۸,۵۳۲,۶۵۰	۹۴۹,۸۵۰	۲۱,۲۳۶,۷۴۶,۳۰۰	۹۴۹,۸۵۰	جماوند
۶۶,۲۷۳,۶۴۱,۲۱۰	۲۰,۵۳۷,۲۳۰	۴۵,۵۶۴,۲۹۲,۹۵۰	۲۷,۶۱۴,۷۲۳	سرمایه گذاری نیو علی
۲,۰۴۶,۶۳۹,۱۵۵,۵۱۵		۷۵۶,۰۵۲,۰۵۰,۲۴۸		مجموع

ترکیب سرمایه گذاران در پایان دوره (۱۳۹۸/۰۵/۳۱)

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

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه گذاران حقیقی	۰	۰	۰
سرمایه گذاران حقوقی	۲	۴۱۸,۷۹۲	٪۱۰۰
کل سرمایه گذاران	۲	۴۱۸,۷۹۲	٪۱۰۰

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۸/۰۵/۳۱



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.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۵/۳۱) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
روز اخیر	۱۳۹۸/۰۵/۳۰	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۰,۰۰٪	۰,۰۰٪
هفته گذشته	۱۳۹۸/۰۵/۲۴	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۲,۰۵٪	۱,۸۱٪
ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۵/۰۱	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۵,۰۵٪	۵,۹۱٪
ماه اخیر ۳	۱۳۹۸/۰۳/۰۳	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۱۱۶,۱۷٪	۲۳,۶۸٪
ماه ۶	۱۳۹۷/۱۲/۰۴	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۱۷۶,۹۵٪	۶۲,۰۱٪
یک سال اخیر	۱۳۹۷/۰۵/۳۱	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۳۶۳,۶۶٪	۹۴,۳۸٪
تا زمان انتشار	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	۴۲۹,۷۱٪	۲۴۳,۶۸٪
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس				
			۱۳۵۰,۰۰٪	۱۳۴۰,۲۰۰٪
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس				
			-۹۹,۸۴٪	-۹۷,۴۶٪

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱ مطابق جداول ذیل می‌باشند:

صورت خالص دارایی‌ها شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۷۵۳,۰۲۵,۴۰۲,۵۶۶	۲,۰۲۸,۴۷۳,۰۶۵,۲۸۲	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۶۰۲,۱۹۲,۷۶۸	۱,۹۲,۹۱۰,۸۶۵,۱۸۵	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
-	۷۶۰,۷۷۴,۴۷۹	۷	حسابهای دریافتی
۱۷۲,۵۲۰,۹۱۶	۴۹,۴۷۳,۳۰۰	۸	سایر دارایی‌ها
-	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹	موجودی نقد
۷۵۴,۸۱۰,۱۱۶,۲۵۰	۲,۲۲۹,۰۵۱,۱۴۵,۲۴۶		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۲,۸۳,۴۷۷,۲۱۱	۱۱,۰۹۶,۷۹۹,۰۴۱	۱۰	جاری‌گذار گران
۲,۹۲۴,۴۲۷,۵۵۹	۵,۳۷۸,۰۰۰,۳۷۵	۱۱	بدهی به ارکان صندوق
۶۱۲,۴۵۸,۲۴۸	۱,۴۴۱,۵۲۲,۰۹۰	۱۲	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲,۹۲۱,۳۶۲,۰۰۸	۱۷,۸۱۶,۲۲۱,۵۰۶		جمع بدهی‌ها
۷۵۰,۸۷۸,۷۵۴,۲۴۴	۲,۲۲۱,۲۴۴,۸۲۳,۷۴۰	۱۳	خالص دارایی‌ها
۲,۰۱۸,۱۸۷	۵,۴۰۳,۹۰۹		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

یادداشت‌های توضیحی همراه بخش جدائی‌ناپذیر صورت‌های مالی می‌باشند.

صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

پادداشت	دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱	دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰	
	ریال	ریال	ریال	
۱۲	۱۹۰,۵۵۱,۵۵۷,۰۷۲	۹,۳۸۶,۳۲۴	۱۰۲,۴۷۰,۰۴۲,۱۱۲	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۵	۱,۱۸۷,۷۵۵,۷۲۱,۳۹۱	(۴۱,۱۳۶,۴۳۲,۳۷۸)	۱۷۲,۲۲۴,۷۲۴,۴۸۷	سود (زیان) تحقق ناقصه نگهداری اوراق بهادار
۱۶	۷۶۰,۷۷۴,۱,۴۷۹	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	سود سهام
۱۷	۲,۹۲۷,۱۱۰,۰۰۰	۸,۴۸۹,۹۹۴,۰۰۰	۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۹۷	سود سیرده و گواهی بلگی
۱۸	-	۹۹۳,۰۰۰	۹۹۳,۰۰۰	سایر درآمدها
	۱,۳۸۸,۵۵۲,۳۲۰,۳۵۴	(۳۷,۳۶۱,۳۴۰,۱۷۱)	۳۰۲,۵۸۰,۹۹۸,۸۲۶	جمع درآمدها
				هزینه ها
۱۹	(۷,۶۲۸,۴۶۶,۶۶۰)	(۹۲۹,۵۶۶,۳۳۱)	(۵۰۰,۹۸۳۱,۸۸۶)	هزینه کارمزد ارکان
۲۰	(۱۶,۵۸۵۳,۴۶۸)	(۲۴۷,۶۷۲,۸۹۸)	(۸۳۳,۱۰۱,۰۵۶)	سایر هزینه ها
	(۸,۴۹۴,۵۰۰,۱۲۸)	(۱,۱۷۷,۲۳۹,۲۲۹)	(۵۸۴,۰۸۴,۹۴۲)	جمع هزینه ها
	۱,۳۸۰,۳۵۷,۶۲۰,۳۲۶	(۳۸,۵۳۹,۱۷۹,۴۰۰)	۲۹۶,۷۳۹,۰۵۵,۸۸۴	سود خالص
	۶۲,۱۷٪	۱۱,۶۱٪	۳۹,۵۵٪	بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
	۱۰۹,۰۰٪	-۱۵,۶۸٪	۶۵,۶۱٪	بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

صورت گردش خالص داراییها

پادداشت	دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱		دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۵/۳۱		سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰	
	ریال	عدد	ریال	عدد	ریال	عدد
	۷۵۰,۸۷۸,۷۵۲,۲۴۲		۵۴,۱۴۰,۱۶۷,۸۰۶		۵۴,۱۴۰,۱۶۷,۸۰۶	
خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اولى دوره	۲۷۲,۰۵۶		۵۰۰,۰۲۴		۵۰۰,۰۲۴	
واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی دوره	۴۶,۷۲۶		۲۲۲,۰۲۲		۲۲۲,۰۲۲	
واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره	-		-		-	
سود (زیان) خالص سال	۱,۳۸۰,۳۵۷,۶۲۰,۳۲۶		(۳۸,۵۳۹,۱۷۹,۴۰۰)		۲۹۶,۷۳۹,۰۵۵,۸۸۴	
تعدیلات	۴۳,۲۶۲,۴۴۰,۲۷۲		۷۷,۹۶۷,۹۸۹,۵۵۲		۷۷,۹۶۷,۹۸۹,۵۵۲	
خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره	۴۱۸,۷۹۲		۴۲۵,۶۰۰,۵۰۸,۰۵۸		۲۷۲,۰۵۶	
	۲,۲۲۱,۲۲۴,۸۲۲,۷۴۰		۲۷۲,۰۵۶		۷۵۰,۸۷۸,۷۵۲,۲۴۲	

پادداشتهای توضیحی همراه بخش جدائی آید در صورت های مالی می باشد.

تعیلات تقسیمی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ۲ سود (زیان) خالص خالص طرفهای باطل سال سود خالص میانگین عوین اربال (وجود استفاده شده)	بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱) بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)
---	---