

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
برای سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۳۹۹

«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.

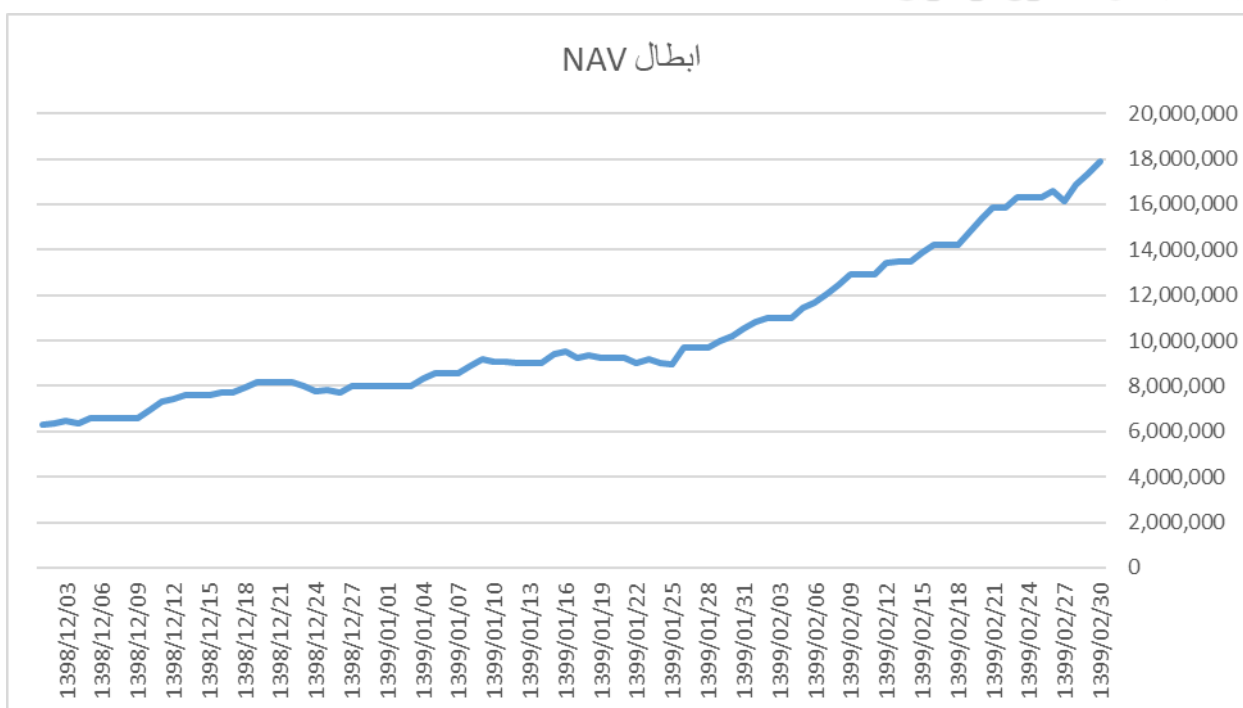
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	شرکت مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۸/۱۲/۰۱ تا ۹۹/۰۲/۳۱ در ۹۰ روز فعالیت صندوق هیچ‌گونه درخواستی برای صدور و ابطال واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است. در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۴۲۴,۳۳۴ واحد رسیده است.

۴۲۴,۳۳۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۰	تعداد واحدهای صادر شده
۰	تعداد واحدهای ابطالی
۴۲۴,۳۳۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۹/۰۲/۳۱



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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱ 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.

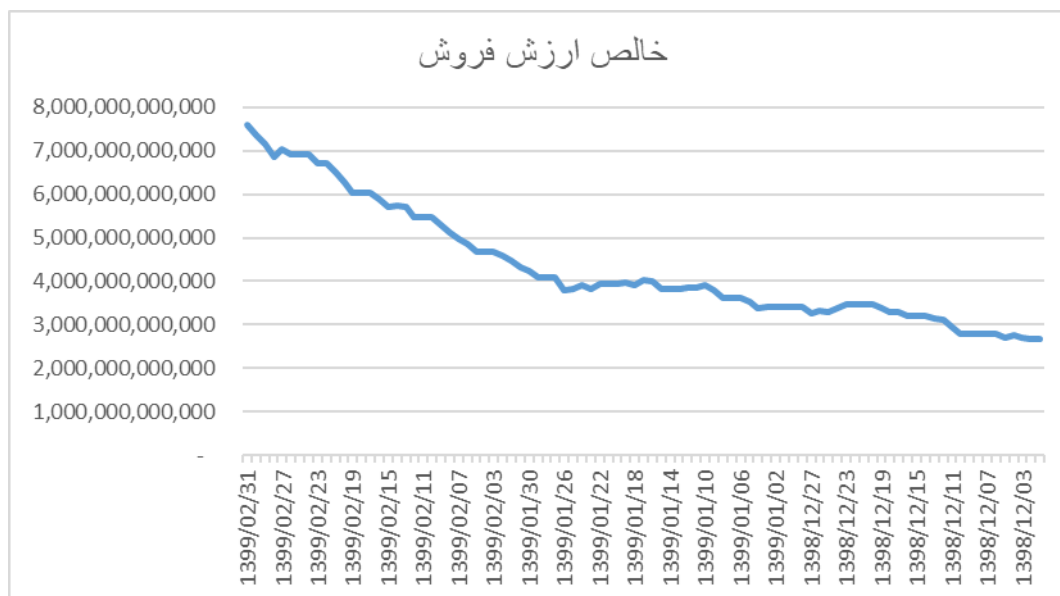
پایان دوره		اول دوره		شرح
ارزش	تعداد	ارزش	تعداد	
۸۵۹,۶۶۵,۳۵۸,۹۵۴	۳۷۶,۶۲۱,۵۵۴	۱,۰۸۰,۶۸۸,۰۷۸,۷۲۰	۶۲۳,۷۷۷,۶۳۳	بانک دی
۹۰,۸۳۷,۳۵۴,۴۵۶	۶,۷۸۰,۰۰۰	۴۵,۶۸۳,۴۹۲,۰۳۵	۶,۵۲۸,۷۴۷	بیمه دی
۹۸۵,۹۶۸,۱۳۱,۲۸۵	۱۳,۶۵۵,۰۶۱	۷۳,۵۷۲,۲۴۷,۰۰۵	۱,۸۵۰,۰۰۰	دماوند
۲۰۰,۸۷۷,۱۲۸,۱۰۱	۱۵,۱۰۰,۰۰۰	۹,۵۲۰,۱۱۹,۴۴۵	۳,۰۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۲,۱۳۷,۳۴۷,۹۷۲,۷۹۶		۱,۲۰۹,۴۶۳,۹۳۷,۲۰۵		مجموع

ترکیب سرمایه گذاران در پایان سال مالی منتهی به (۱۳۹۹/۰۲/۳۱)

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

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه گذاران حقیقی	۰	۰	۰
سرمایه گذاران حقوقی	۲	۴۲۴,۳۳۴	۱۰۰٪
کل سرمایه گذاران	۲	۴۲۴,۳۳۴	۱۰۰٪

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۳۱



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 گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۳۱) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
۷ روز گذشته	۱۳۹۹/۰۲/۲۴	۱۳۹۹/۰۲/۳۱	٪۹,۵۲۶	٪(۳,۰۳۷)
یک ماه گذشته	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	۱۳۹۹/۰۲/۳۱	٪۶۹,۶۶۵	٪۳۹,۱۷۷
سه ماه گذشته	۱۳۹۸/۱۲/۰۱	۱۳۹۹/۰۲/۳۱	٪۱۸۲,۸۶۶	٪۱۰۶,۱۰۹

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سالانه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱ مطابق جداول ذیل می‌باشند:

صورت خالص دارایی‌ها سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۱۳۹۸/۱۱/۳۰	۱۳۹۹/۰۲/۳۱	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۲۶۶۱.۱۱۲.۵۰۲.۱۳۴	۶.۸۱۱.۷۲۶.۲۶۰.۹۳۷	۵	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۲۸.۴۴۹.۶۱۴.۸۱۸	۴۲۴.۱۵۱.۱۱۲.۲۴۸	۶	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱.۴۶۵.۷۰۷.۲۹۵	۱.۴۸۷.۵۰۱.۶۰۰	۷	حسابهای دریافتی
۲.۹۸۸.۱۱۹.۱۰۶	۳۷۶.۱۲۴.۰۵۵.۱۷۵	۸	جاری کارگزاران
۱۲۳.۹۵۲.۸۸۹	۸۰.۴۶۹.۲۶۱	۹	سایر دارایی‌ها
-	۱۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۰	موجودی نقد
-	۱.۲۶۹.۳۱۲.۳۸۵.۷۷۲	۱۱	سایر حسابهای دریافتی
۲.۷۰۵.۱۳۹.۸۹۶.۲۴۲	۸.۸۹۲.۸۹۱.۸۸۴.۹۹۳		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۱۹.۴۹۰.۲۳۰.۵۲۱	۳۰.۷۸۴.۸۶۴.۶۶۹	۱۲	بدهی به ارکان صندوق
۲.۷۹۲.۸۷۷.۷۰۸	۱.۲۷۳.۵۰۳.۱۳۲.۳۲۲	۱۳	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۲.۲۸۳.۱۰۸.۲۲۹	۱.۳۰۴.۲۸۷.۹۹۷.۹۹۱		جمع بدهی‌ها
۲.۶۸۲.۸۵۶.۷۸۸.۰۱۳	۷.۵۸۸.۶۰۳.۸۸۷.۰۰۲	۱۴	خالص دارایی‌ها
۶.۳۳۲.۵۱۲	۱۷.۸۸۳.۵۶۳		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می‌باشد

صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

سال منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰	دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱	دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال	ریال		در آمده
۴۹۶,۴۳۳,۱۴۳,۱۵۵	۳,۳۴۰,۸۱۴,۸۱۴	۹۹۲,۶۳۰,۵۶۸,۲۴۵	۱۵	سود (زیان) فروش و قبضه
۱,۳۴۹,۰۶۸,۷۶۸,۹۸۷	۱,۴۳,۳۴۲,۴۸۶,۶۹۸	۳,۹۱۴,۳۴۴,۴۳۸,۴۹۰	۱۶	سود (زیان) تحقق یافتنی و سایر موارد
۸,۴۳۳,۳۵۵,۰۰۰	-	-	۱۷	سود سهام
۱۳,۷۵۸,۹۱۵,۰۰۰	۷۶۵,۴۱۸,۹۴۴	۱۱,۴۰۴,۷۸۹,۷۵۱	۱۸	سود سپرده و گواهی سپاری
-	-	۳۱,۷۹۴,۳۰۵	۱۹	میرد (سند)
۱,۸۶۶,۱۷۴,۱۸۲,۲۶۸	۱۴۷,۴۴۸,۷۲۰,۴۵۶	۴,۹۱۸,۴۹۱,۵۹۰,۷۹۱		جمع درآمدها
-	-	-		هزینه ها:
(۳۱,۷۷۶,۷۰۳,۵۳۸)	(۳,۶۱۳,۴۲۲,۳۳۳)	(۱۱,۴۶۹,۰۵۴,۱۵۳)	۲۰	هزینه کارمزد رکن
(۳,۴۱۷,۹۰۳,۰۰۰)	(۳,۱۳,۳۹۶,۴۳۰)	(۱,۳۷۵,۴۳۷,۶۴۹)	۲۱	میزبانی ها
(۲۴,۱۹۴,۶۰۶,۶۲۷)	(۲,۹۲۶,۸۱۸,۷۶۳)	(۱۲,۷۴۴,۴۹۱,۸۰۳)		جمع هزینه ها
۱,۸۴۱,۹۷۹,۵۷۵,۶۴۱	۱۴۴,۵۲۱,۹۰۱,۶۹۳	۴,۹۰۵,۷۴۷,۰۹۸,۹۸۹		سود خالص
۶۸/۶۸٪	۱۴/۷۳٪	۶۴/۶۵٪		بازده سرمایه گذاران (۱)
۱۰۱/۳۴٪	۱۷/۲۵٪	۱۱۳/۶۰٪		بازده میانگین سرمایه گذاران (۲)

صورت گردش خالص داراییها

سال منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰		دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱		دوره سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱		یادداشت
ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲	۳۷۲,۰۵۶	۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲	۳۷۲,۰۵۶	۲,۶۸۲,۸۵۶,۷۸۸,۰۱۳	۴۲۴,۳۳۴	خالص داراییها (بازده سرمایه گذاری) اول دوره
۵۳,۵۹۵,۰۰۰,۰۰۰	۵۳,۵۹۵	۴۶,۷۳۶,۰۰۰,۰۰۰	۴۶,۷۳۶	-	-	بازده سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۱,۳۱۷,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۳۱۷)	-	-	-	-	بازده سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۱,۸۴۱,۹۷۹,۵۷۵,۶۴۱	-	۱,۴۴۵,۲۱,۹۰۱,۶۹۳	-	۴,۹۰۵,۷۴۷,۰۹۸,۹۸۹	-	سود (زیان) خالص سال
۳۷,۷۲۰,۴۵۹,۰۰۰	-	۴۳,۲۶۲,۴۴۰,۲۷۲	-	-	-	تعدیلات
۲,۶۸۲,۸۵۶,۷۸۷,۸۹۱	۴۲۴,۳۳۴	۹۸۵,۳۹۹,۰۹۵,۲۰۷	۴۱۸,۷۹۲	۷,۵۸۸,۶۰۳,۸۸۷,۰۰۲	۴۲۴,۳۳۴	خالص داراییها (بازده سرمایه گذاری) اول این دوره

یادداشت‌های توضیحی همراه بخش جداگانه‌ای در صورت‌های مالی می‌باشد.

تعدادات ناشی از تفاوت قیمت خرید و ابطال و سود (زیان) حاصل	= بازده سرمایه گذاری بلند مدت (۱)
حاصل دارگشای بلند مدت سال سود حاصل	= بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)
میانگین موجودی (ریال) وجود استفاده از	