



گزارش عملکرد

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

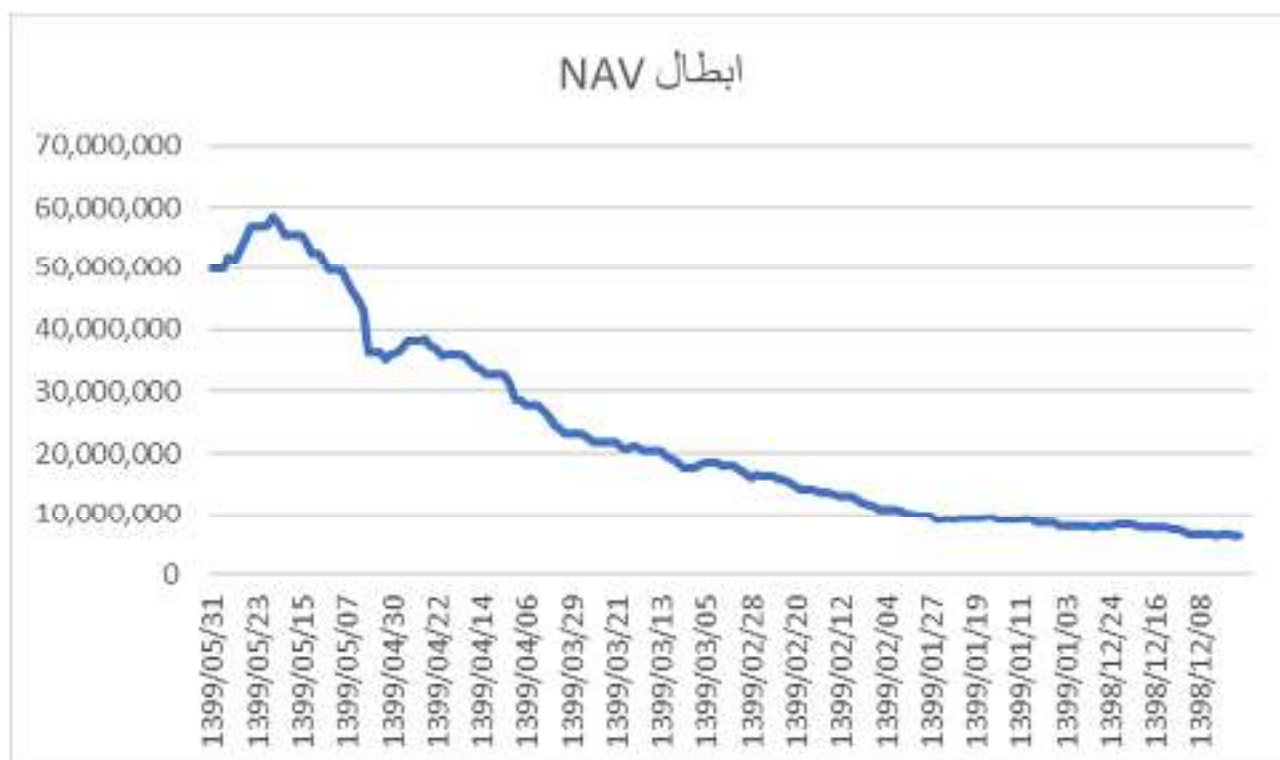
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی ایرانیان تحلیل فارابی

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۸/۱۲/۰۱ تا ۹۹/۰۵/۳۱ در ۱۸۴ روز فعالیت صندوق هیچ‌گونه درخواستی برای صدور واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است. همچنین تعداد ۲۷۷,۰۰۰ واحد صدور انجام گرفته که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۱۴۷,۳۳۴ واحد رسیده است.

۴۲۴,۳۳۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۰	تعداد واحدهای صادر شده
۲۷۷,۰۰۰	تعداد واحدهای ابطالی
۱۴۷,۳۳۴	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۹/۰۵/۳۱



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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ 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		آیول دوره		شرح
ارزش	تعداد	ارزش	تعداد	
۳,۴۴۶,۳۶۰,۱۸۶,۵۸۶	۹۹,۰۰۳,۲۸۶	۱,۰۸۰,۶۸۸,۰۷۸,۷۲۰	۶۲۳,۷۷۷,۶۳۳	بانک دی
۷۳,۸۵۸,۶۸۴,۴۱۶	۴,۰۸۰,۰۰۰	۴۵,۶۸۳,۴۹۲,۰۳۵	۶,۵۲۸,۷۴۷	بیمه دی
۸۴,۹۷۲,۷۳۰,۳۴۹	۱,۰۰۰,۰۰۰	۷۳,۵۷۲,۲۴۷,۰۰۵	۱,۸۵۰,۰۰۰	دماوند
۹۰,۵۵۱,۶۱۰,۵۷۲	۱۲,۰۵۳,۰۸۱	۹,۵۲۰,۱۱۹,۴۴۵	۳,۰۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۳,۶۹۵,۷۴۳,۲۱۱,۹۲۳		۱,۲۰۹,۴۶۳,۹۳۷,۲۰۵		مجموع

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره (۱۳۹۹/۰۵/۳۱)

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	۴	۱۴۷.۳۳۴	۱۰۰٪
کل سرمایه گذاران	۴	۱۴۷.۳۳۴	۱۰۰٪

نمودار خالص ارزش دارایی های صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۳/۳۱



ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه گذاری، نشان دهنده کل دارایی صندوق سرمایه گذاری پس از کسر هر گونه بدهی است. برای محاسبه این مقدار، ابتدا تمامی دارایی های یک صندوق محاسبه شده، سپس از این مقدار بدهی های کل صندوق کسر می گردد، عدد حاصله مقدار ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه گذاری می باشد.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۹/۰۵/۳۱) می باشد.

بازدهی بازار	بازدهی صندوق	تا تاریخ	از تاریخ	توضیحات
۰,۰۰	۰,۰۰	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۳۰/۰۵/۱۳۹۹	روز اخیر
(۰,۱۱)	(۰,۱۲)	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۲۴/۰۵/۱۳۹۹	هفته گذشته
(۰,۰۸)	۰,۳۸	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۰۱/۰۵/۱۳۹۹	ماه گذشته
۰,۸۳	۱,۶۹	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۰۳/۰۳/۱۳۹۹	۳ ماه اخیر
۲,۵۲	۶,۷۰	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۰۴/۱۲/۱۳۹۸	۶ ماه
۵,۶۰	۸,۵۳	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۳۱/۰۵/۱۳۹۸	یک سال اخیر
۲۱,۶۹	۴۸,۸۱	۳۱/۰۵/۱۳۹۹	۱۷/۰۷/۱۳۹۵	تا زمان انتشار
۶۵۳,۳۳	۱۴۲,۴۸			حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس
(۱,۰۰)	(۱,۰۰)			حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس

صورت های مالی:

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ مطابق جداول ذیل می باشند:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

گزارش مالی میان دوره ای

صورت خالص دارایی ها

در تاریخ ۳۱ مرداد ۱۳۹۹

۱۳۹۸/۱۱/۳۰	۱۳۹۹/۰۵/۳۱	پادداشت	دارایی ها:
ریال	ریال		
۳,۶۶۱,۱۱۳,۵۰۲,۱۳۴	۶,۴۷۸,۳۷۳,۵۴۸,۳۰۹	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۳۸,۴۴۹,۶۱۴,۸۱۸	۳,۱۸۵,۵۰۰,۹۹۱,۷۹۷	۶	سرمایه گذاری در سیرده و گواهی سیرده بانکی
۱,۴۶۵,۷۰۷,۳۹۵	۴,۷۱۴,۵۳۳,۷۳۲	۷	حسابهای دریافتی
۳,۹۸۸,۱۱۹,۱۰۶	-	۸	جاری کارگزاران
۱۳۳,۹۵۲,۸۸۹	۳۶,۰۳۳,۴۸۹	۹	سایر دارایی ها
-	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰	موجودی نقد
۳,۷۰۵,۱۳۹,۸۹۶,۳۴۲	۸,۶۶۸,۶۳۵,۱۰۶,۳۲۷		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
-	۱,۳۶۸,۸۳۱,۵۶۱,۹۰۳	۸	حاری کارگزاران
۱۹,۴۹۰,۳۳۰,۵۳۱	۴۵,۳۹۱,۱۳۵,۳۴۴	۱۱	بدهی به ارکان صندوق
۲,۷۹۲,۸۷۷,۷۰۸	۶,۰۶۳,۷۷۲,۶۶۳	۱۲	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۲۲,۳۸۳,۱۰۸,۳۳۹	۱,۳۳۰,۱۸۶,۴۵۹,۹۳۰		جمع بدهی ها
۲,۶۸۲,۸۵۶,۷۸۸,۰۱۳	۷,۳۴۸,۴۴۸,۶۶۶,۳۹۷	۱۳	خالص دارایی ها
۶,۳۳۲,۵۱۲	۴۹,۸۷۶,۱۲۳		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها شن ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

صورت گردش خالص داراییها

دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱		دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱		دوره شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱		توضیحات
ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۷۵۰,۳۸۷,۵۲۰,۳۴۰	۳۷۷,۰۰۰	۷۵۰,۳۸۷,۵۲۰,۳۴۰	۳۷۷,۰۰۰	۲,۶۲۲,۸۲۶,۷۸۸,۰۰۰	۱۳	خالص داراییها (واحد سرما به گناری) اول دوره
۵۲,۵۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۲,۵۵۰	۵۲,۵۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۲,۵۵۰	-	-	واحدهای سرما به گناری صادر شده طی دوره
(۱,۳۷۷,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۳۷۷)	-	-	(۳۷۷,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۳۷۷)	واحدهای سرما به گناری ابطال شده طی دوره
۱,۸۲۱,۵۲۷,۵۲۰,۳۴۰	-	۱,۳۷۰,۳۸۶,۵۲۰,۳۴۰	-	۱,۰۰۵,۶۱۰,۷۸۸,۰۰۰	-	سود (زیان) خالص سال
۳۷,۷۲۰,۳۵۰,۰۰۰	-	۳۷,۷۲۰,۳۵۰,۰۰۰	-	(۱۵,۲۲۵,۲۲۵,۳۳۰)	-	تعدیلات
۲,۶۲۲,۸۲۶,۷۸۸,۰۰۰	۳۳۶,۳۳۰	۲,۶۲۲,۸۲۶,۷۸۸,۰۰۰	۳۳۶,۳۳۰	۷,۳۲۸,۳۳۸,۳۳۰	۳۷	خالص داراییها (واحد سرما به گناری) پایان دوره

بندداشتهای توضیحی همراهِ گزارش حسابهای ترازنامه صورت های مالی می باشد.

شماره تالی از نحوه تهیه حساب و ابطال در سود و زیان خالص
حساب ترازنامه ای، زیان خالص
سود خالص

بازده سرمایه گذاران (بازده دوره)

بازده میانگین سرمایه گذاری (C)

میانگین موجودی، از وجه اشعار شده

ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	بندداشت
۳۹۸/۱۱۳۰	-	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	-	۳۹۹/۰۵/۳۱	-	درآمدها
۹۶۶,۳۳۰,۱۳۴,۱۵۵	-	۱۹۰,۵۵۱,۵۵۷,۰۰۰	-	۷,۸۷۲,۸۴۲,۳۶۰,۰۰۰	-	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱,۳۳۹,۰۰۰,۳۹۸,۹۸۷	-	۱,۱۸۷,۷۵۵,۳۲۱,۷۹۱	-	۲,۷۰۰,۳۰۵,۰۰۰,۰۰۰	-	سود (زیان) تحقق زیانته نگهداری اوراق بهادار
۸,۹۳۳,۳۵۵,۰۰۰	-	۷۶۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	-	۳,۳۳۷,۰۰۰,۰۰۰	-	سود سهام
۱۲,۵۵۸,۹۱۵,۰۰۰	-	۲,۹۳۷,۵۵۰,۰۰۰	-	۱۷,۱۳۲,۰۰۰,۰۰۰	-	سود سرانه و گواهی بانکی
-	-	-	-	۲۱,۷۹۹,۰۰۰	-	سایر درآمدها
۱,۸۶۶,۷۷۶,۳۸۲,۳۶۸	۱,۳۸۸,۸۵۲,۳۰۰,۳۵۶	۱,۰۰۵,۶۱۰,۷۸۸,۰۰۰	۱,۰۰۵,۶۱۰,۷۸۸,۰۰۰	۱۰,۵۹۷,۲۰۰,۲۷۵,۹۲۶	۱۰	جمع درآمدها
-	-	-	-	-	-	هزینه ها
(۵,۱۲۴,۷۰۰,۰۰۰)	-	(۵,۲۸۰,۳۳۰,۰۰۰)	-	(۳,۱۴۴,۳۶۱,۵۳۳)	-	هزینه کارمزد ارضان
(۲,۳۷۷,۹۰۰,۰۰۰)	-	(۵۴۵,۸۷۲,۰۰۰)	-	(۳,۲۱۵,۳۱۷,۶۱۸)	-	سایر هزینه ها
(۲۴,۳۹۴,۶۰۰,۰۰۰)	(۸,۴۹۴,۵۱۸,۰۰۰)	(۸,۴۹۴,۵۱۸,۰۰۰)	(۸,۴۹۴,۵۱۸,۰۰۰)	(۲۹,۳۷۹,۶۷۹,۱۵۱)	(۲۹)	جمع هزینه ها
۱,۸۴۲,۳۸۱,۷۸۲,۳۶۸	۱,۳۸۰,۳۵۷,۶۱۱,۳۵۶	۱,۰۰۵,۶۱۰,۷۸۸,۰۰۰	۱,۰۰۵,۶۱۰,۷۸۸,۰۰۰	۱۰,۵۶۷,۸۲۷,۵۹۶,۷۷۵	۳۷	سود خالص
۶۸/۶۸٪	۶۲/۸۴٪	۶۷/۶۷٪	۶۷/۶۷٪	۶۷/۶۷٪	۶۷/۶۷٪	بازده سرمایه گذاری (بازده دوره)
۱۰/۳۴٪	۱۰/۹٪	۱۹/۵٪	۱۹/۵٪	۱۹/۵٪	۱۹/۵٪	بازده میانگین سرمایه گذاری (C)