

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به

۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۲

« ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

در اجرای مفاد ماده ۲۳۲ اصلاحیه قانون تجارت، مصوب اسفند ماه ۱۳۴۷ و ماده ۴۵ قانون بازار اوراق بهادار بدینوسیله گزارش درباره فعالیت و وضع عمومی صندوق برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۲ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح زیر تقدیم می گردد.

به نظر اینجانبان اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق اختصاصی بازارگردانی گروه دی می باشد، با تاکید به ارائه منصفانه نتایج عملکرد مدیر و در جهت حفظ و منافع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه ی صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت های موجود بوده و اثر آن ها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می توان پیش بینی نمود به درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می شود، از گزارش حذف نگردیده است و این گزارش در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۲۷ به تایید ارکان صندوق رسیده است.

۱- مقدمه

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی که صندوقی در سرمایه گذاری 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 می شود 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 به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق براساس اساسنامه و امیدنامه، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار پذیرفته شده موضوع بند ۲-۲ امیدنامه (بانک دی، سرمایه گذاری بوعلی، بیمه دی، دماوند) 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 پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر دارایی های 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 دارایی های صندوق که عمدتاً شامل اوراق بهادار با درآمد ثابت و سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس می باشد، توسط مدیران سرمایه گذاری صندوق صورت می گیرد. سرمایه گذاران در ازای سرمایه گذاری در این صندوق گواهی سرمایه گذاری دریافت می کنند. دوره فعالیت صندوق به مدت پنج سال شمسی بوده (تا پایان ۱۴۰۷/۰۴/۲۸) که به تایید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است.

۱-۱ اطلاع رسانی

علاقتمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می توانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.daygroupfund.ir مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می توانید به تارنمای مزبور مراجعه کنید.

۲- صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی در یک نگاه

۱-۲ ارکان صندوق سرمایه گذاری

مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	موسسه حسابرسی رازدار
متولی	مشاور سرمایه گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۲-۲- واحدهای سرمایه گذاری

واحد های سرمایه گذاری صندوق به دو دسته واحدهای سرمایه گذاری عادی و واحدهای سرمایه گذاری ممتاز تقسیم می شود. واحد سرمایه گذاری عادی، فاقد حق رای بوده و قابل ابطال اما غیرقابل انتقال است. واحد سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رای در مجمع بوده قابل انتقال اما غیرقابل ابطال می باشد.

۲-۳- مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز

اسامی و مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	بانک دی	۳۴.۳۰۰	۹۸
۲	شرکت کارگزاری بانک دی	۷۰۰	۲
	جمع	۳۵.۰۰۰	۱۰۰

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۵/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۱۶,۸۱۳,۵۷۸,۲۹۸,۸۹۹
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۴,۵۸۶,۲۴۱
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۴,۵۶۴,۷۳۹
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۱۱۹,۴۰۳

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۲/۰۵/۲۴	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	٪(۶.۰۵۵)	٪(۲.۰۱۸)
یک ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۵/۰۱	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	٪(۴.۴۷۴)	٪(۱.۹۵۷)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۳/۰۳	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	٪(۲۳.۳۴۹)	٪(۱۷.۳۷۹)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۱/۱۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	٪۸۵.۴۹۳	٪۱۷.۰۰۲
یک سال اخیر	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	٪۱۴۳.۱۱۹	٪۳۶.۰۶۶
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	٪۱۳۵۴.۶۱۱	٪۲۴۱۱.۲۴۴

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۳۱

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۱۴۰۲/۰۵/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۶۸	۱۶,۶۷۵,۸۶۷,۶۰۰,۲۵۰	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۳۰۷,۹۷۳,۸۱۸,۸۴۱	۲۷۳,۰۹۳,۲۵۴,۷۵۹	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۵,۲۳۳,۸۳۸,۹۶۰	۱۱۲,۷۴۰,۳۵۱,۶۷۶	۷	حساب های دریافتی
۲۵۱,۷۶۱,۰۴۰	۱,۴۳۴,۱۸۳,۳۳۹	۸	سایر دارایی ها
۱,۶۷۲,۲۱۹,۵۸۸	۲۸۲,۳۱۴,۷۹۶	۹	موجودی نقد
۱۲,۶۷۵,۰۳۴,۷۷۷,۸۹۷	۱۷,۰۶۳,۴۱۷,۷۰۴,۸۲۰		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۶۰,۲۰۲,۳۸۹,۹۵۹	۱۷۴,۵۴۶,۱۴۱,۷۴۱	۱۰	جاری کارگزاران
۶۴,۸۰۵,۰۷۹,۱۱۴	۶۷,۱۱۸,۰۳۳,۶۴۵	۱۱	بدهی به ارکان صندوق
۱۲,۹۴۰,۱۵۹	۰	۱۲	بدهی به سرمایه گذاران
۷,۵۱۴,۴۵۵,۶۶۱	۸,۱۷۵,۲۳۰,۵۳۵	۱۳	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱۳۲,۵۳۴,۸۶۴,۸۹۳	۲۴۹,۸۳۹,۴۰۵,۹۲۱		جمع بدهی ها
۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱۶,۸۱۳,۵۷۸,۲۹۸,۸۹۹	۱۴	خالص دارایی ها
۷,۴۹۳,۵۳۱	۱۴,۵۶۴,۷۳۹		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاران بانک دگا (سهام خاص)

 شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت سود و زیان

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱		دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۳۱		یادداشت	
درآمدها:					
۲۵۷,۳۰۱,۵۷۹,۰۳۱		۱,۳۰۰,۶۱۶,۸۸۹,۵۲۲		۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۸۹۱,۳۹۰,۴۶۲,۴۷۸)		۱,۹۹۱,۲۳۰,۱۸۲,۲۷۱		۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۳۲,۰۹۸,۹۰۳,۲۴۸		۱۴۶,۱۲۹,۵۲۱,۶۹۶		۱۷	سود سهام
۱۶,۶۲۰,۸۴۱,۸۷۸		۴۱,۶۷۶,۹۱۷,۰۴۱		۱۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۷,۶۴۷,۹۵۹		.		۱۹	سایر درآمدها
(۴۸۵,۴۲۱,۴۹۰,۳۶۲)		۳,۴۷۹,۶۵۳,۵۱۰,۵۳۰			جمع درآمدها
هزینه ها:					
۴۷,۰۱۶,۵۸۰,۵۴۱		۱۱۳,۴۴۸,۰۶۹,۸۳۸		۲۰	هزینه کارمزد ارکان
۴۹۸,۹۸۴,۹۱۰		۴,۱۲۷,۵۸۷,۷۳۰		۲۱	سایر هزینه ها
۴۷,۵۱۵,۵۶۵,۴۵۱		۱۱۷,۵۷۵,۶۵۷,۵۶۸			جمع هزینه ها
(۵۳۲,۹۳۷,۰۵۵,۸۱۳)		۳,۳۴۲,۰۷۷,۸۵۲,۹۶۲			سود خالص
-۶.۶۶٪		۱۷.۸۴٪			بازده میانگین سرمایه گذاری
-۶.۵۱٪		۲۰.۰۱٪			بازده سرمایه گذاری پایان دوره

صورت گردش خالص دارایی ها

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱		دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۳۱		یادداشت	
ریال	تعداد	ریال	تعداد		
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱,۲۲۴,۵۹۸	۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱,۶۷۳,۷۷۷		خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۱۳۹,۵۴۸,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۹,۵۴۸	۷۲,۱۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۲,۱۴۰		واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
.	.	(۵۹۱,۵۱۴,۰۰۰,۰۰۰)	(۵۹۱,۵۱۴)		واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۵۳۲,۹۳۷,۰۵۵,۸۱۳)	.	۳,۳۴۲,۰۷۷,۸۵۲,۹۶۲	.		سود (زیان) خالص
۱,۹۸۸,۰۱۵,۹۸۵,۵۶۶	.	۱,۴۲۸,۳۷۴,۵۳۲,۹۳۳	.	۲۲	تعدیلات
۸,۱۷۲,۳۱۴,۹۰۱,۵۶۸	۱,۳۶۴,۱۴۶	۱۶,۸۱۳,۵۷۸,۲۹۸,۸۹۹	۱,۱۵۴,۴۰۳		

کلرگزارک بانک دگا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۵- گزارش عملیاتی

خرید و فروش سهام طی دوره						
ردیف	نماد	تعداد خرید طی دوره	مبلغ خرید طی دوره	تعداد فروش طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مانده به تاریخ ۱۴۰۲/۰۵/۳۱
۱	دی	۳,۸۳۸,۲۱۶,۷۸۸	۴,۸۲۶,۸۰۷,۷۲۵,۷۶۴	۱,۹۶۶,۳۵۱,۸۶۸	۲,۳۵۴,۳۴۷,۵۹۱,۸۳۴	۱۲,۱۵۱,۶۷۲,۶۵۴
۲	ودی	۱۴,۷۴۲,۲۶۴	۱۳۷,۲۰۵,۰۴۵,۰۹۱	۴۳,۱۷۲,۴۸۰	۳۲۱,۷۷۱,۳۶۴,۱۶۷	۸۴,۵۸۱,۰۱۷
۳	دماوند	۲۸,۵۵۶,۹۱۰	۶۶۷,۷۰۵,۰۱۹,۹۰۶	۱۶,۲۵۵,۳۰۷	۴۰۶,۹۷۷,۲۴۷,۱۰۳	۱۲۱,۲۹۵,۹۷۰
۴	ویوعلی	۳۴,۹۳۲,۳۴۸	۱۱۷,۱۳۹,۹۱۶,۹۱۱	۲۰,۱۳۴,۸۹۱	۷۲,۰۱۵,۴۰۸,۳۸۰	۳۲۱,۲۲۰,۰۲۰
۵	زماهان	۰	۰	۰	۰	۴,۲۴۲,۳۹۹
۶	زشریف	۰	۰	۰	۰	۲۳,۷۹۹,۰۶۶
	ارزش پایان دوره					۱۲,۰۷۸,۷۶۲,۶۱۸,۰۷۶

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

تلاش در جهت رعایت مفاد و دستورالعمل فعالیت بازارگردانی و تعهد بازارگردانی

کارگزاری بانک دگ (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰