

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به

۳۰ آبان 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 نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 ۱۴۰۲/۰۹/۲۵ 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 ه 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 پذیرهنویسی 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

علاقمندان 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 غیر قابل انتقال است. واحد سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رای در مجمع بوده قابل انتقال اما غیر قابل 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 تسلط | درصد واحدهای تحت تسلط |
|------|----------------------------|------------------------|-----------------------|
| ۱ | بانک دی | ۳۴.۳۰۰ | ۹۸ |
| ۲ | شرکت کارگزاری بانک دی | ۷۰۰ | ۲ |
| | جمع | ۳۵۰۰۰ | ۱۰۰ |

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

| | | |
|---|--------------------------------------|--------------------|
| ۱ | کل خالص ارزش دارایی صندوق | ۲۰,۵۷۷,۲۲۸,۶۱۹,۲۰۲ |
| ۲ | آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری | ۱۸,۱۴۷,۱۶۶ |
| ۳ | آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری | ۱۸,۱۲۰,۷۴۴ |
| ۴ | گواهی های ممتاز | ۳۵,۰۰۰ |
| ۵ | گواهی های عادی | ۱,۱۰۰,۵۶۲ |

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ می باشد:

| توضیحات | از تاریخ | تا تاریخ | بازدهی صندوق | بازدهی بازار |
|----------------|------------|------------|--------------|--------------|
| یک هفته اخیر | ۱۴۰۲/۰۸/۲۳ | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ٪(۲.۶۸۸) | ٪(۱.۲۶۶) |
| یک ماه اخیر | ۱۴۰۲/۰۷/۳۰ | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ٪(۰.۴۲) | ٪(۰.۵۹۳) |
| ۳ ماه اخیر | ۱۴۰۲/۰۶/۰۱ | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ٪۲۰.۵۳۸ | ٪۳.۷۷۹ |
| ۶ ماه اخیر | ۱۴۰۲/۰۳/۰۴ | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ٪(۴.۶۳۱) | ٪(۱۳.۸۸۸) |
| یک سال اخیر | ۱۴۰۱/۰۸/۳۰ | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ٪۱۷۲.۵۱۳ | ٪۴۳.۴۱۶ |
| از شروع فعالیت | ۱۳۹۵/۰۷/۱۷ | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ٪۱۷۰۹.۷۵۶ | ٪۲۵۱۷.۳۵۶ |

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 ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

| یادداشت | ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | ۱۴۰۱/۱۱/۳۰ |
|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
| | ریال | ریال |
| دارایی ها | | |
| سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم | ۲۰,۱۵۵,۶۶۴,۴۴۷,۴۴۴ | ۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۶۸ |
| سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده | ۵۴۹,۳۳۵,۳۷۱,۶۲۲ | ۱,۳۰۷,۹۷۳,۸۱۸,۸۴۱ |
| حساب های دریافتی | ۶۲۱,۲۳۷,۶۲۳ | ۵,۲۳۳,۸۳۸,۹۶۰ |
| سایر دارایی ها | ۶۰۹,۵۶۴,۶۳۵ | ۲۵۱,۷۶۱,۰۴۰ |
| موجودی نقد | ۲۷۸,۷۶۸,۶۶۵ | ۱,۶۷۲,۲۱۹,۵۸۸ |
| جمع دارایی ها | ۲۰,۷۰۶,۵۰۹,۳۸۹,۹۸۹ | ۱۲,۶۷۵,۰۳۴,۷۷۷,۸۹۷ |
| بدهی ها | | |
| جاری کارگزاران | ۴۷,۸۵۹,۵۱۸,۳۹۷ | ۶۰,۲۰۲,۳۸۹,۹۵۹ |
| بدهی به ارکان صندوق | ۷۳,۵۷۷,۸۱۶,۱۱۴ | ۶۴,۸۰۵,۰۷۹,۱۱۴ |
| بدهی به سرمایه گذاران | ۳,۶۴۸,۰۵۰ | ۱۲,۹۴۰,۱۵۹ |
| سایر حساب های پرداختی و ذخایر | ۷,۸۳۹,۷۸۸,۲۲۶ | ۷,۵۱۴,۴۵۵,۶۶۱ |
| جمع بدهی ها | ۱۲۹,۲۸۰,۷۷۰,۷۸۷ | ۱۳۲,۵۳۴,۸۶۴,۸۹۳ |
| خالص دارایی ها | ۲۰,۵۷۷,۲۲۸,۶۱۹,۲۰۲ | ۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴ |
| خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری | ۱۸,۱۲۰,۷۴۴ | ۷,۴۹۳,۵۳۱ |

کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت سود و زیان

| دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۸/۳۰ | | دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | | یادداشت |
|---------------------------------------|--|---------------------------------------|--|---|
| درآمدها: | | | | |
| ۲۲۷,۹۹۷,۷۱۰,۶۳۵ | | ۱,۴۲۹,۹۴۴,۷۳۴,۶۳۵ | | ۱۵ سود (زیان) فروش اوراق بهادار |
| (۱,۱۶۵,۰۰۰,۹۶۸,۳۳۱) | | ۲,۲۷۴,۴۹۳,۲۴۹,۸۶۱ | | ۱۶ سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار |
| ۱۴۶,۱۹۷,۹۲۷,۴۷۳ | | ۱۶۰,۱۸۶,۷۲۶,۷۴۷ | | ۱۷ سود سهام |
| ۴۸,۷۱۶,۰۰۴,۷۷۹ | | ۴۳,۹۲۷,۲۷۰,۰۷۰ | | ۱۸ سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب و سپرده های بانکی |
| ۴۷,۶۴۷,۹۵۹ | | . | | ۱۹ سایر درآمدها |
| (۷۴۲,۰۴۱,۶۷۷,۳۸۵) | | ۳,۹۰۸,۵۵۱,۹۸۱,۳۱۳ | | جمع درآمدها |
| هزینه ها: | | | | |
| ۷۲,۶۴۴,۰۶۹,۰۰۲ | | ۱۷۵,۱۱۴,۵۷۳,۵۶۱ | | ۲۰ هزینه کارمزد ارکان |
| ۱,۹۱۶,۸۱۷,۲۸۶ | | ۶,۳۴۰,۵۲۰,۶۵۱ | | ۲۱ سایر هزینه ها |
| ۷۴,۵۶۰,۸۸۶,۲۸۸ | | ۱۸۱,۴۵۵,۰۹۴,۲۱۲ | | جمع هزینه ها |
| (۸۱۶,۶۰۲,۵۶۳,۶۷۳) | | ۳,۷۲۷,۰۹۶,۸۸۷,۱۰۱ | | سود خالص |
| -۹.۷۵% | | ۱۹.۳۳% | | بازده میانگین سرمایه گذاری (درصد) |
| -۷.۷۸% | | ۱۸.۱۴% | | بازده سرمایه گذاری پایان دوره (درصد) |

صورت گردش خالص دارایی ها

| دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۸/۳۰ | | دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ | | یادداشت |
|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|--|
| ریال | تعداد | ریال | تعداد | |
| ۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۹۴۳ | ۱,۲۲۴,۵۹۸ | ۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴ | ۱,۶۷۳,۷۷۷ | خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره |
| ۳۴۷,۹۷۳,۰۰۰,۰۰۰ | ۳۴۷,۹۷۳ | ۱۹۵,۴۲۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۹۵,۴۲۰ | واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره |
| . | . | (۷۳۳,۶۳۵,۰۰۰,۰۰۰) | (۷۳۳,۶۳۵) | واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره |
| (۸۱۶,۶۰۲,۵۶۳,۶۷۳) | . | ۳,۷۲۷,۰۹۶,۸۸۷,۱۰۱ | . | سود (زیان) خالص |
| ۴,۳۴۷,۷۲۹,۹۲۲,۷۳۷ | . | ۴,۸۴۵,۸۴۶,۸۱۹,۰۹۷ | . | ۲۲ تعدیلات |
| ۱۰,۴۵۶,۷۸۸,۳۳۱,۰۰۷ | ۱,۵۷۲,۵۷۱ | ۲۰,۵۷۷,۲۲۸,۶۱۹,۲۰۲ | ۱,۱۳۵,۵۶۲ | |

کارگزار بانکدگی (سهامی)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۵- گزارش عملیاتی

| خرید و فروش سهام طی دوره | | | | | | | |
|--------------------------|--------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|--------------------|
| رتبه | نماه | تعداد خرید طی دوره | مبلغ خرید طی دوره | تعداد فروش طی دوره | مبلغ فروش طی دوره | مابده به تاریخ ۱۳/۰۸/۱۴۰۲ | ارزش یابسان دوره |
| ۱ | ودی | ۱۷.۷۲۹.۶۷۷.۴۳۰ | ۲۳.۳۷۸.۷۳۶.۱۵۰.۷۰۲ | (۴.۴۹۸.۶۳۳.۳۳۰) | ۱۷.۱۸۴.۹۰۲.۸۷۷.۷۳۶ | ۱۳.۲۳۱.۰۴۴.۱۰۰ | ۱۳.۹۸۵.۲۱۳.۶۱۳.۷۰۰ |
| ۲ | دی | ۴۲۳.۱۷۵.۵۰۵ | ۴.۵۶۱.۲۶۹.۱۷۴.۹۳۹ | (۲۵۹.۸۶۷.۵۸۲) | ۳.۱۳۶.۸۹۶.۵۳۴.۶۳۵ | ۱۶۳.۳۰۷.۹۲۳ | ۱.۷۱۴.۴۷۱.۴۱۲.۰۵۰ |
| ۳ | دماوند | ۳۰۵.۲۳۹.۵۱۴ | ۹.۷۳۶.۴۹۰.۳۶۴.۶۱۰ | (۱۴۱.۰۲۷.۵۹۱) | ۵.۶۳۸.۸۲۸.۷۲۱.۷۳۸ | ۱۶۴.۲۱۱.۹۲۳ | ۳.۴۶۳.۶۰۲.۶۲۶.۰۲۵ |
| ۴ | وبوغلی | ۷۸۹.۳۳۲.۳۴۹ | ۲.۲۳۵.۰۸۴.۹۳۴.۲۲۰ | (۱۸۳.۱۸۹.۲۹۲) | ۱.۰۳۱.۲۳۵.۷۲۱.۳۱۴ | ۶۰۶.۱۴۳.۰۵۷ | ۱.۷۰۲.۲۵۵.۲۰۹.۵۳۳ |

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