

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به

۳۰ بهمن 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 سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن 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 ۱۴۰۲/۱۲/۱۶ 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 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

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 ممتاز	درصد
۱	بانک دی	۳۴.۳۰۰	۹۸
۲	شرکت کارگزاری بانک دی	۷۰۰	۲

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۱۱/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۸,۷۲۷,۲۵۰
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۸,۶۹۸,۷۳۹
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۴۸۳,۵۹۳

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۲/۱۱/۲۳	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	٪(۰.۳۷)	٪(۱.۰۱)
یک ماه اخیر	۱۴۰۲/۱۰/۳۰	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	٪(۳.۱۴۱)	٪(۴.۴۳۷)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	٪۳.۱۹	٪۲.۵۰۶
۶ ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۶/۰۱	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	٪۲۴.۳۸۲	٪۶.۳۷۹
یک سال اخیر	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	٪۱۴۹.۵۳۲	٪۳۵.۰۴۸
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	٪۱۷۶۷.۴۸۲	٪۲۵۸۲.۹۴۲

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۳۰

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۶۸	۲۹,۰۹۰,۱۰۵,۴۸۶,۵۰۴	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۳۰۷,۹۷۳,۸۱۸,۸۴۱	۱۴۹,۵۹۹,۰۶۵,۳۸۳	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۵,۲۳۳,۸۳۸,۹۶۰	۰	۷	حساب های دریافتی
۲۵۱,۷۶۱,۰۴۰	۲۳۰,۹۱۴,۱۱۵	۸	سایر دارایی ها
۱,۶۷۲,۲۱۹,۵۸۸	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹	موجودی نقد
۱۲,۶۷۵,۰۳۴,۷۷۷,۸۹۷	۲۹,۲۳۹,۹۴۵,۴۶۶,۰۰۲		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۶۰,۲۰۲,۳۸۹,۹۵۹	۵۹۵,۰۷۶,۵۶۷,۱۰۶	۱۰	جاری کارگزاران
۶۴,۸۰۵,۰۷۹,۱۱۴	۹۱,۴۲۳,۵۲۴,۵۳۹	۱۱	بدهی به ارکان صندوق
۱۲,۹۴۰,۱۵۹	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۲	بدهی به سرمایه گذاران
۷,۵۱۴,۴۵۵,۶۶۱	۷,۶۷۰,۹۱۵,۲۶۴	۱۳	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱۳۲,۵۳۴,۸۶۴,۸۹۳	۸۴۴,۱۷۱,۰۰۶,۹۰۹		جمع بدهی ها
۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۱۴	خالص دارایی ها
۷,۴۹۳,۵۳۱	۱۸,۶۹۸,۷۳۹		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاران بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت سود و زیان

سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۳۰	یادداشت	
			درآمدها:
۲۶۶,۳۶۷,۷۸۱,۰۴۷	۱,۴۸۳,۵۹۴,۸۸۷,۹۸۷	۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۶۳,۰۲۷,۳۹۱,۴۴۷	۲,۸۲۳,۷۶۱,۲۷۹,۴۸۳	۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۴۸,۸۹۳,۰۹۰,۶۷۸	۱۶۰,۱۸۶,۷۲۶,۷۴۷	۱۷	سود سهام
۹۳,۵۰۹,۱۹۶,۶۷۴	۴۹,۳۱۶,۰۱۱,۸۱۸	۱۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۷,۶۴۷,۹۵۹	.	۱۹	سایر درآمدها
۵۷۱,۸۴۵,۱۰۷,۸۰۵	۴,۵۱۶,۷۵۸,۹۰۶,۰۳۵		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۱۰۶,۸۵۹,۷۴۲,۳۵۶	۲۴۸,۷۸۴,۶۵۴,۶۷۷	۲۰	هزینه کارمزد ارکان
۳,۳۹۵,۶۱۷,۵۳۶	۸,۶۵۵,۰۶۴,۰۱۳	۲۱	سایر هزینه ها
۱۱۰,۲۵۵,۳۵۹,۷۹۲	۲۵۷,۴۳۹,۷۱۸,۶۹۰		جمع هزینه ها
۴۶۱,۵۸۹,۷۴۸,۰۱۳	۴,۲۵۹,۳۱۹,۱۸۷,۳۴۵		سود خالص
۴.۹۳%	۲۰.۸۸%		بازده میانگین سرمایه گذاری (درصد)
۳.۷۱%	۱۵.۰۶%		بازده سرمایه گذاری پایان سال (درصد)

بانک پارسیان (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت گردش خالص دارایی‌ها

صورت گردش خالص دارایی‌ها				یادداشت
سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰		سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۳۰		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱,۲۲۴,۵۹۸	۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱,۶۷۳,۷۷۷	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) اول سال
۵۰۶,۲۰۹,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۶,۲۰۹	۵۷۸,۴۵۱,۰۰۰,۰۰۰	۵۷۸,۴۵۱	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی سال
(۵۷,۰۳۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۵۷,۰۳۰)	(۷۳۳,۶۳۵,۰۰۰,۰۰۰)	(۷۳۳,۶۳۵)	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی سال
۴۶۱,۵۸۹,۷۴۸,۰۱۴	.	۴,۲۵۹,۳۱۹,۱۸۷,۳۴۵	.	سود(زیان) خالص
۵,۰۵۴,۰۴۳,۱۹۳,۱۷۵	.	۱۱,۷۴۹,۱۳۹,۳۵۸,۷۴۴	.	تعدیلات ۲۲
۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱,۶۷۳,۷۷۷	۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۱,۵۱۸,۵۹۳	

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 ۱۴۰۲/۱۱/۳۰	ارزش پایان دوره
۱	دی	۱۱,۸۴۱,۵۸۹,۱۳۴	۲۹,۴۰۸,۶۱۶,۵۴۰,۶۲۷	(۲,۴۳۵,۶۰۲,۸۲۹)	۱۸,۳۰۷,۲۲۵,۷۷۴,۵۴۸	۱۹,۹۳۴,۷۲۸,۹۵۸	۲۲,۲۸۷,۰۲۶,۹۷۵,۰۴۴
۲	ودی	۲۶۷,۵۱۳,۲۶۸	۱,۴۶۴,۰۲۹,۵۵۸,۸۰۳	(۵۹,۶۲۴,۳۳۸)	۴۸۹,۳۴۸,۱۹۳,۴۴۲	۳۲۰,۹۰۰,۱۶۳	۱,۸۷۰,۸۴۷,۹۵۰,۲۹۰
۳	دماوند	۳۲۸,۷۱۵,۶۹۵	۲,۰۲۳,۹۸۶,۱۴۲,۶۲۷	(۱۹,۱۵۶,۴۲۴)	۴۷۳,۶۷۵,۶۲۶,۵۱۱	۴۱۸,۵۵۳,۶۳۸	۳,۴۲۸,۳۷۲,۸۴۸,۸۵۸
۴	ویبعلی	۴۱۸,۸۲۴,۵۷۵	۶۰۲,۸۶۷,۴۲۴,۶۲۰	(۲۲,۳۵۳,۰۹۳)	۷۷,۷۴۱,۰۴۷,۵۳۷	۷۰۲,۸۹۴,۰۴۵	۱,۵۲۵,۹۸۲,۹۷۱,۶۹۵

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰