

## گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به

۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

« 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 سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۳ 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 ۱۴۰۳/۰۳/۲۳ 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](http://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

### ۲-۱- ارکان صندوق سرمایه گذاری

مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	موسسه حسابرسی رازدار
متولی	مشاور سرمایه گذاری هوشمند آبان

کارگزاری بانک دی



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 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 ۱۴۰۳/۰۲/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۲۱,۹۵۹,۶۷۹,۵۸۶,۵۶۱
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۴,۰۷۸,۷۶۸
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۴,۰۵۷,۸۲۱
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۵۲۷,۰۹۷

## ۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۳/۰۲/۲۴	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۵.۵۱۹)	٪(۲.۲۶۱)
یک ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۲/۰۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۱۲.۴۸۷)	٪(۷.۵۸۱)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۲/۱۲/۰۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۲۴.۵۷۴)	٪۱.۹۸۶
۶ ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۹/۰۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۲۲.۸۰۶)	٪۴.۴۶۲
یک سال اخیر	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۲۱.۸۰۸)	٪(۸.۲۵۷)
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪۱۳۰۳.۹۸۴	٪۲۶۳۷.۰۸

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 سه ماهه منتهی به

۱۴۰۳/۰۲/۳۱

مطابق جداول ذیل می باشد.

#### صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۲/۱۱/۳۰	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۲۹,۰۹۰,۱۰۵,۴۵۰,۵۲۱	۲۱,۹۸۱,۰۰۵,۸۹۲,۹۰۱	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱۴۹,۵۹۹,۰۶۵,۳۸۳	۷۰,۲۹۲,۸۲۲,۱۶۱	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده
۰	۱۵,۴۲۲	۷	جاری کارگزاران
۲۳۰,۹۱۴,۱۱۵	۵۵۵,۴۰۹,۹۹۲	۸	سایر دارایی ها
۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹	موجودی نقد
۲۹,۲۳۹,۹۴۵,۴۳۰,۰۱۹	۲۲,۰۵۱,۸۶۴,۱۴۰,۴۷۶		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۵۹۵,۰۷۶,۵۶۷,۱۰۶	۰	۷	جاری کارگزاران
۹۱,۴۲۳,۵۲۴,۵۳۹	۸۳,۹۳۷,۵۲۹,۵۱۲	۱۰	بدهی به ارکان صندوق
۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۱	بدهی به سرمایه گذاران
۷,۶۷۰,۹۱۵,۲۶۴	۸,۲۴۷,۰۲۴,۴۰۳	۱۲	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۸۴۴,۱۷۱,۰۰۶,۹۰۹	۹۲,۱۸۴,۵۵۳,۹۱۵		جمع بدهی ها
۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۲۳,۱۱۰	۲۱,۹۵۹,۶۷۹,۵۸۶,۵۶۱	۱۳	خالص دارایی ها
۱۸,۶۹۸,۷۳۹	۱۴,۰۵۷,۸۲۱		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

## صورت سود و زیان

یادداشت	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۰	
	ریال	ریال	درآمدها:
۱۴	۱,۳۳۱	۸۸۲,۵۵۵,۵۵۷,۲۲۹	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۵	(۷,۲۹۱,۰۸۵,۲۱۰,۶۳۵)	۸,۶۴۳,۳۴۹,۵۸۶,۹۳۱	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۶	۰	۸,۵۴۵,۱۰۰,۰۷۶	سود سهام
۱۷	۲,۹۳۲,۸۶۵,۹۲۴	۳۱,۲۰۴,۶۱۰,۵۷۳	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
	(۷,۲۸۸,۱۵۲,۳۴۳,۳۸۰)	۹,۵۶۵,۶۵۴,۸۵۴,۸۰۹	جمع درآمدها
			هزینه ها:
۱۸	۸۳,۲۹۴,۵۷۶,۳۳۸	۵۱,۷۴۸,۲۴۷,۲۷۳	هزینه کارمزد ارکان
۱۹	۲,۴۹۴,۹۱۷,۷۲۹	۱,۹۳۱,۳۰۷,۵۵۶	سایر هزینه ها
	۸۵,۷۸۹,۴۹۴,۰۶۷	۵۳,۶۷۹,۵۵۴,۸۲۹	جمع هزینه ها
	(۷,۳۷۳,۹۴۱,۸۳۷,۴۴۷)	۹,۵۱۱,۹۷۵,۲۹۹,۹۸۰	سود خالص
	-۲۷.۸۶٪	۵۲.۴۷٪	بازده میلگین سرمایه‌گذاری (درصد)
	-۳۳.۵۵٪	۴۲.۷۸٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)

## صورت گردش خالص دارایی‌ها

صورت گردش خالص دارایی‌ها				یادداشت
۱۴۰۲/۰۲/۳۱		۱۴۰۳/۰۲/۳۱		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱,۶۷۳,۷۷۷	۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۱,۵۱۸,۵۹۳	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) اول دوره
۱,۴۷۲,۰۰۰,۰۰۰	۱,۴۷۲	۲۵۶,۶۷۴,۰۰۰,۰۰۰	۲۵۶,۶۷۴	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۴۷۲,۰۱۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۴۷۲,۰۱۳)	(۲۱۳,۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۱۳,۱۷۰)	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۹,۵۱۱,۹۷۵,۲۹۹,۹۸۰	۰	(۷,۳۷۳,۹۴۱,۸۳۷,۴۴۷)	۰	سود (زیان) خالص
۴۸,۴۸۱,۴۵۰,۳۳۳	۰	۸۹۴,۳۴۲,۹۶۴,۹۱۵	۰	تعدیلات
۲۱,۶۳۲,۴۱۵,۶۶۳,۳۱۷	۱,۲۰۳,۲۳۶	۲۱,۹۵۹,۶۷۹,۵۸۶,۵۶۱	۱,۵۶۲,۰۹۷	

## 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 ۱۴۰۳/۰۲/۳۱	ارزش پایان دوره
۱	دی	-	-	-	-	۱۹,۹۳۴,۷۲۸,۹۵۸	۱۵,۲۹۸,۲۳۶,۳۳۷,۱۴۶
۲	ودی	۱۹,۴۷۷,۳۶۵	۱۱۱,۱۵۱,۵۳۲,۶۳۸	(۲)	۱۱,۳۸۸	۳۴۰,۳۷۷,۵۲۶	۲,۰۷۸,۱۲۶,۱۰۶,۷۸۰
۳	دماوند	۴۶۶۶,۴۰۲	۴۰,۳۰۱,۳۹۴,۸۵۹	(۱)	۱۰,۰۴۳	۴۲۳,۲۲۰,۰۳۹	۳,۰۵۷,۵۵۵,۳۷۲,۵۰۰
۴	ویوعلی	۱۳,۸۹۵,۲۰۲	۳۰,۵۳۲,۷۲۵,۱۹۵	(۱)	۲,۰۰۴	۷۱۶,۷۸۹,۲۴۶	۱,۵۴۷,۰۸۸,۰۹۰,۱۳۴

## ۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰