

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به

۳۱ مرداد 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 شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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 ۱۴۰۳/۰۶/۲۶ 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 شرکت ها 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 سبأ 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

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 (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 ۱۴۰۳/۰۵/۳۱

| | | |
|---|--------------------------------------|--------------------|
| ۱ | کل خالص ارزش دارایی صندوق | ۱۹,۲۵۷,۶۰۹,۶۹۵,۷۴۰ |
| ۲ | آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری | ۱۲,۱۷۸,۰۱۰ |
| ۳ | آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری | ۱۲,۱۶۰,۱۹۲ |
| ۴ | گواهی های ممتاز | ۳۵.۰۰۰ |
| ۵ | گواهی های عادی | ۱,۵۴۸,۶۶۰ |

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ می باشد:

| توضیحات | از تاریخ | تا تاریخ | بازدهی صندوق | بازدهی بازار |
|----------------|------------|------------|--------------|--------------|
| یک هفته اخیر | ۱۴۰۳/۰۵/۲۴ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ٪(۱.۸۴۸) | ٪۱.۹۵۶ |
| یک ماه اخیر | ۱۴۰۳/۰۵/۰۱ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ٪(۵.۵۹۷) | ٪(۶.۰۷۷) |
| ۳ ماه اخیر | ۱۴۰۳/۰۳/۰۳ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ٪(۱۲.۴۴۷) | ٪(۳.۶۳۹) |
| ۶ ماه اخیر | ۱۴۰۲/۱۲/۰۴ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ٪(۳۵.۴۰۵) | ٪(۱.۶۲۳) |
| یک سال اخیر | ۱۴۰۲/۰۵/۳۱ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ٪(۱۶.۵۰۹) | ٪۵.۱۰۵ |
| از شروع فعالیت | ۱۳۹۵/۰۷/۱۷ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ٪۱۱۱۴.۴۶۳ | ٪۲۵۳۹.۴۵۳ |

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 شش ماهه منتهی به

۱۴۰۳/۰۵/۳۱

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

| ۱۴۰۲/۱۱/۳۰ | ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | یادداشت | |
|--------------------|--------------------|---------|---|
| ریال | ریال | | |
| | | | دارایی ها |
| ۲۹,۰۹۰,۱۰۵,۴۸۶,۵۰۴ | ۱۸,۹۱۴,۲۶۴,۳۳۱,۳۵۷ | ۵ | سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم |
| . | ۱۶۳,۹۱۸,۵۱۴,۵۱۴ | ۶ | سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری |
| ۱۴۹,۵۹۹,۰۶۵,۳۸۳ | ۷۰,۵۵۶,۲۰۵,۲۰۶ | ۷ | سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی |
| . | ۲۲۸,۱۱۵,۸۸۸,۸۲۵ | ۸ | حساب های دریافتی |
| ۲۳۰,۹۱۴,۱۱۵ | ۱,۳۴۳,۴۴۱,۴۵۶ | ۹ | سایر دارایی ها |
| ۱۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۰ | موجودی نقد |
| ۲۹,۳۳۹,۹۴۵,۴۶۶,۰۰۲ | ۱۹,۳۷۸,۲۰۸,۳۸۱,۳۵۸ | | جمع دارایی ها |
| | | | بدهی ها |
| ۵۹۵,۰۷۶,۵۶۷,۱۰۶ | ۲,۹۸۶,۵۶۳ | ۱۱ | جاری کارگزاران |
| ۹۱,۴۲۳,۵۲۴,۵۳۹ | ۱۱۲,۸۷۴,۰۳۰,۹۹۳ | ۱۲ | بدهی به ارکان صندوق |
| ۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | . | ۱۳ | بدهی به سرمایه گذاران |
| ۷,۶۷۰,۹۱۵,۲۶۴ | ۷,۷۲۱,۶۶۸,۰۶۲ | ۱۴ | سایر حساب های پرداختنی و ذخایر |
| ۸۴۴,۱۷۱,۰۰۶,۹۰۹ | ۱۳۰,۵۹۸,۶۸۵,۶۱۸ | | جمع بدهی ها |
| ۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳ | ۱۹,۳۵۷,۶۰۹,۶۹۵,۷۴۰ | ۱۵ | خالص دارایی ها |
| ۱۸,۶۹۸,۷۳۹ | ۱۲,۱۶۰,۱۹۲ | | خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری |

کارگزاری بانک دی



شماره ثبت: ۱۶۰۱۶۰

صورت سود و زیان

| دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۳۱ | دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | یادداشت | درآمدها: |
|---------------------------------------|---------------------------------------|---------|--|
| | | | سود (زیان) فروش اوراق بهادار |
| ۱,۳۰۰,۶۱۶,۸۸۹,۵۲۲ | ۷۶۲,۶۹۰,۱۴۵ | ۱۶ | سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار |
| ۱,۹۹۱,۲۳۰,۱۷۲,۲۷۱ | (۱۰,۶۵۷,۰۵۸,۳۴۲,۸۳۰) | ۱۷ | سود سهام |
| ۱۴۶,۱۲۹,۵۲۱,۶۹۶ | ۴۱۱,۹۱۹,۷۵۲,۸۶۵ | ۱۸ | سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب |
| ۴۱,۶۷۶,۹۱۷,۰۴۱ | ۳,۷۲۹,۶۶۵,۸۵۶ | ۱۹ | جمع درآمدها |
| ۳,۴۷۹,۶۵۳,۵۰۰,۵۳۰ | (۱۰,۲۴۰,۶۴۶,۲۳۳,۹۶۴) | | هزینه ها: |
| | | | هزینه کارمزد ارکان |
| ۱۱۳,۴۴۸,۰۶۹,۸۳۸ | ۱۴۷,۵۲۱,۳۰۵,۴۰۱ | ۲۰ | سایر هزینه ها |
| ۴,۱۲۷,۵۸۷,۷۳۰ | ۴,۸۹۴,۶۱۹,۲۵۳ | ۲۱ | جمع هزینه ها |
| ۱۱۷,۵۷۵,۶۵۷,۵۶۸ | ۱۵۲,۴۱۵,۹۲۴,۶۵۴ | | سود خالص |
| ۳,۳۶۲,۰۷۷,۸۴۲,۹۶۲ | (۱۰,۳۹۳,۰۶۲,۱۵۸,۶۱۸) | | بازده میانگین سرمایه گذاری (درصد) |
| ۱۷,۸۴٪ | -۴۴,۶۱٪ | | بازده سرمایه گذاری پایان دوره (درصد) |
| ۲۰,۰۱٪ | -۵۳,۹۳٪ | | |

صورت گردش خالص دارایی ها

| صورت گردش خالص دارایی ها | | | | یادداشت |
|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|--|
| دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۵/۳۱ | | دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | | |
| ریال | تعداد | ریال | تعداد | |
| ۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴ | ۱,۶۷۳,۷۷۷ | ۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳ | ۱,۵۱۸,۵۹۳ | خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره |
| ۷۲,۱۴۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۷۲,۱۴۰ | ۲۷۸,۲۳۷,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۷۸,۲۳۷ | واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره |
| (۵۹۱,۵۱۴,۰۰۰,۰۰۰) | (۵۹۱,۵۱۴) | (۲۱۳,۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰) | (۲۱۳,۱۷۰) | واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره |
| ۳,۳۶۲,۰۷۷,۸۴۲,۹۶۲ | . | (۱۰,۳۹۳,۰۶۲,۱۵۸,۶۱۸) | . | سود(زیان) خالص |
| ۱,۴۲۸,۳۷۴,۵۳۲,۹۲۳ | . | ۱,۱۸۹,۸۳۰,۳۹۵,۲۶۵ | . | تعدیلات |
| ۱۶,۸۱۳,۵۷۸,۲۸۸,۸۹۹ | ۱,۱۵۴,۴۰۳ | ۱۹,۲۵۷,۶۰۹,۶۹۵,۷۴۰ | ۱,۵۸۳,۶۶۰ | |

کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۵- گزارش عملیاتی

| ردیف | نماد | تعداد خرید طی دوره | مبلغ خرید طی دوره | تعداد فروش طی دوره | تعداد فروش طی دوره | مانده به تاریخ ۱۴۰۳/۰۵/۳۱ | ارزش پایان دوره |
|------|----------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|--------------------|
| ۱ | دی ۱ | ۰ | ۰ | ۰ | ۰ | ۱۹,۹۳۴,۷۲۸,۹۵۸ | ۱۲,۱۱۱,۱۰۳,۷۶۶,۹۰۷ |
| ۲ | ودی ۱ | ۲۸,۵۲۳,۴۶۳ | ۱۷۰,۷۹۲,۱۲۵,۱۴۸ | (۲) | ۱۱,۲۸۸ | ۳۴۹,۴۲۳,۶۲۴ | ۲,۴۳۰,۱۴۰,۱۱۱,۸۳۸ |
| ۳ | دماوند ۱ | ۳۱,۶۷۹,۶۰۲ | ۲۳۷,۳۸۹,۶۰۹,۲۴۹ | (۱) | ۱۰,۰۴۳ | ۴۵۰,۳۳۳,۲۳۹ | ۳,۱۳۱,۲۴۱,۷۸۹,۶۹۹ |
| ۴ | ویوعلی ۱ | ۳۸,۱۴۵,۳۹۱ | ۷۵,۳۰۵,۸۴۱,۲۴۸ | (۱) | ۲,۰۰۴ | ۷۴۱,۰۳۹,۴۳۵ | ۱,۲۴۱,۷۷۸,۶۶۲,۹۱۴ |

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزار بانک دکا (سهامی خاص)

 شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰