

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به

۳۰ آبان 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 نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 ۱۴۰۳/۰۹/۲۴ 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 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

علاقه مندان 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 ۱۴۰۳/۰۸/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۲۱,۵۵۸,۴۰۹,۴۸۱,۴۰۶
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۳,۵۵۵,۴۴۶
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۳,۵۳۵,۵۵۰
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۵۵۷,۷۲۵

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۳/۰۸/۲۳	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	%۵.۰۰۱	%۵.۱۵۴
یک ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	%(۳.۴۱۹)	%۱۲.۴۷۲
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۶/۰۱	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	%۱۱.۳۱۴	%۱۰.۸۱۹
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۳/۰۴	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	%(۲.۵۴۱)	%۶.۷۸۶
یک سال اخیر	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	%(۲۵.۳۰۴)	%۱۱.۷۵۵
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	%۱۲۵۱.۸۲۳	%۲۸۲۵.۰۱۴

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 نه ماهه منتهی به

۱۴۰۳/۰۸/۳۰

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۲/۱۱/۳۰	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۲۹,۰۹۰,۱۰۵,۴۸۶,۵۰۴	۲۱,۲۴۱,۷۴۶,۰۶۶,۹۴۷	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۰	۱۷۸,۸۳۴,۰۱۲,۳۳۳	۶	سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری
۱۴۹,۵۹۹,۰۶۵,۳۸۳	۲۰۰,۳۲۰,۷۰۸,۰۵۵	۷	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۰	۲۵,۰۷۸,۸۶۵,۱۴۶	۸	جاری کارگزاران
۲۳۰,۹۱۴,۱۱۵	۸۳۵,۶۷۹,۰۸۴	۹	سایر دارایی ها
۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۹,۰۲۰,۰۰۰	۱۰	موجودی نقد
۲۹,۲۳۹,۹۴۵,۴۶۶,۰۰۲	۲۱,۶۴۷,۸۲۴,۳۵۱,۵۶۵		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۵۹۵,۰۷۶,۵۶۷,۱۰۶	۰	۸	جاری کارگزاران
۹۱,۴۲۳,۵۲۴,۵۳۹	۸۱,۸۲۷,۸۴۶,۴۵۶	۱۱	بدهی به ارکان صندوق
۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۲	بدهی به سرمایه گذاران
۷,۶۷۰,۹۱۵,۲۶۴	۷,۵۸۷,۰۲۳,۷۰۳	۱۳	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۸۴۴,۱۷۱,۰۰۶,۹۰۹	۸۹,۴۱۴,۸۷۰,۱۵۹		جمع بدهی ها
۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۲۱,۵۵۸,۴۰۹,۴۸۱,۴۰۶	۱۴	خالص دارایی ها
۱۸,۶۹۸,۷۳۹	۱۳,۵۳۵,۵۵۰		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاران بانک



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت سود و زیان

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰	یادداشت	
			درآمدها:
۱,۴۲۹,۹۴۴,۷۳۴,۶۳۵	۱,۲۲۶,۸۴۵,۷۹۰	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۲,۲۷۴,۴۹۳,۲۴۹,۸۶۱	(۸,۶۳۶,۴۸۲,۰۵۷,۷۱۲)	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۶۰,۱۸۶,۷۲۶,۷۴۷	۴۳۹,۹۳۲,۰۳۲,۴۰۶	۱۸	سود سهام
۴۳,۹۲۷,۲۷۰,۰۷۰	۴,۵۷۴,۹۸۱,۸۰۸	۱۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۳,۹۰۸,۵۵۱,۹۸۱,۳۱۳	(۸,۱۹۰,۷۴۸,۱۹۷,۷۰۸)		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۱۷۵,۱۱۴,۵۷۳,۵۶۱	۲۱۳,۹۶۸,۷۲۲,۶۳۸	۲۰	هزینه کارمزد ارکان
۶,۳۴۰,۵۲۰,۶۵۱	۷,۹۷۱,۴۹۴,۷۳۴	۲۱	سایر هزینه ها
۱۸۱,۴۵۵,۰۹۴,۲۱۲	۲۲۱,۹۴۰,۲۱۷,۳۷۲		جمع هزینه ها
۳,۷۲۷,۰۹۶,۸۸۷,۱۰۱	(۸,۴۱۲,۶۸۸,۴۱۵,۰۸۰)		سود خالص
۱۹.۳۳٪	-۳۷.۱۰٪		بازده میانگین سرمایه گذاری (درصد)
۱۸.۱۴٪	-۳۸.۹۹٪		بازده سرمایه گذاری پایان دوره (درصد)

صورت گردش خالص دارایی ها

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰		دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰		یادداشت
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 واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۱۹۵,۴۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۹۵,۴۲۰	۲۸۷,۳۰۲,۰۰۰,۰۰۰	۲۸۷,۳۰۲	
(۷۳۳,۶۳۵,۰۰۰,۰۰۰)	(۷۳۳,۶۳۵)	(۲۱۳,۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۱۳,۱۷۰)	
۳,۷۲۷,۰۹۶,۸۸۷,۱۰۱	.	(۸,۴۱۲,۶۸۸,۴۱۵,۰۸۰)	.	سود (زیان) خالص تعدیلات
.	.	۱,۵۰۱,۱۹۱,۴۳۷,۳۹۳	.	
۱۵,۷۳۱,۳۸۱,۸۰۰,۱۰۵		۲۱,۵۵۸,۴۰۹,۴۸۱,۴۰۶		

کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۵- گزارش عملیاتی

ردیف	نماد	تعداد خرید طی دوره	مبلغ خرید طی دوره	تعداد فروش طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مانده به تاریخ ۱۴۰۳/۰۸/۳۰	ارزش پایان دوره
۱	دی ۱	۲۵۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۳,۴۹۹,۹۵۱	۰	۰	۱۹,۹۳۴,۷۲۸,۹۵۸	۱۳,۸۴۴,۱۰۷,۱۰۱,۹۷۴
۲	ودی ۱	۱۲,۵۳۵,۰۰۰	۱۷۹,۷۹۹,۳۹۶,۰۲۴	۲,۰۰۰,۰۰۰	۲۹,۹۶۷,۳۸۰,۰۷۳	۳۶۲,۸۸۹,۲۸۳	۲,۷۰۸,۷۲۲,۷۴۸,۹۷۳
۳	دموند ۱	۸,۹۹۱,۰۰۰	۱۴۹,۰۰۸,۸۰۳,۸۶۵	۸,۹۹۱,۰۰۰	۱۵۳,۳۷۰,۶۷۷,۷۱۵	۴۷۴,۷۵۱,۲۳۸	۳,۲۵۹,۰۶۲,۲۳۳,۸۹۶
۴	ویوعلی ۱	۴,۹۱۵,۰۰۰	۵۰,۰۱۴,۵۸۵,۹۷۱	۴,۹۱۵,۰۰۰	۴۹,۳۰۷,۸۶۳,۰۵۴	۷۷۲,۶۴۶,۵۹۷	۱,۴۲۹,۸۵۳,۹۸۲,۱۰۶

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانکدک (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰