

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به

۳۰ بهمن 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 سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن 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 ۱۴۰۳/۱۲/۲۶ 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، دی سهام) 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 وجه 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

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

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 ۱۴۰۳/۱۱/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۱,۱۷۵,۱۴۶
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۱,۱۵۸,۷۵۵
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۸۶۲,۵۴۸

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۳/۱۱/۲۳	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	٪(۴.۰۰۸)	٪(۲.۳۳۵)
یک ماه اخیر	۱۴۰۳/۱۰/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	٪(۱۷.۶۰۷)	٪(۲.۹۱۴)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	٪(۱۷.۵۶)	٪۲۰.۴۵۲
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۶/۰۱	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	٪(۸.۲۳۳)	٪۳۳.۴۸۴
یک سال اخیر	۱۴۰۲/۱۱/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	٪(۴۰.۳۲۳)	٪۳۱.۳۲
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	٪۱۰۴.۴۴۸	٪۳۴۲۳.۲۳۵

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 ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۲/۱۱/۳۰	۱۴۰۳/۱۱/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۲۹,۰۹۰,۱۰۵,۴۸۶,۵۰۴	۲۰,۷۸۷,۸۶۷,۹۰۰,۹۶۳	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۰	۳۷۱,۱۰۱,۹۰۵,۲۵۴	۶	سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری
۱۴۹,۵۹۹,۰۶۵,۳۸۳	۱۷۱,۰۳۴,۹۹۹,۴۹۱	۷	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۲۳۰,۹۱۴,۱۱۵	۲۱۴,۳۳۱,۵۹۴	۸	سایر دارایی ها
۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۸,۸۱۹,۰۵۴,۴۸۰	۹	موجودی نقد
۲۹,۲۳۹,۹۴۵,۴۶۶,۰۰۲	۲۱,۳۳۹,۰۳۸,۱۹۱,۷۸۲		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۵۹۵,۰۷۶,۵۶۷,۱۰۶	۶۰,۴۴۷,۵۶۶,۴۲۴	۱۰	جاری کارگزاران
۹۱,۴۲۳,۵۲۴,۵۳۹	۹۶,۵۸۴,۱۸۹,۶۳۶	۱۱	پرداختی به ارکان صندوق
۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۲	پرداختی به سرمایه گذاران
۷,۶۷۰,۹۱۵,۲۶۴	۷,۷۳۲,۹۶۳,۹۵۸	۱۳	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۸۴۴,۱۷۱,۰۰۶,۹۰۹	۱۶۴,۷۶۴,۷۲۰,۰۱۸		جمع بدهی ها
۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴	۱۴	خالص دارایی ها
۱۸,۶۹۸,۷۳۹	۱۱,۱۵۸,۷۵۵		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت سود و زیان

سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰	یادداشت	
			درآمدها:
۱,۴۸۳,۵۹۴,۸۸۷,۹۸۷	(۱۵,۱۵۳,۵۱۲,۶۵۶)	۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۲,۸۲۳,۷۶۱,۲۷۹,۴۸۳	(۱۰,۰۵۴,۰۲۰,۷۳۶,۰۷۳)	۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۶۰,۱۸۶,۷۲۶,۷۴۷	۴۳۹,۹۳۲,۰۳۵,۹۱۲	۱۷	سود سهام
۴۹,۲۱۶,۰۱۱,۸۱۸	۵,۱۰۳,۶۴۵,۵۲۸	۱۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴,۵۱۶,۷۵۸,۹۰۶,۰۳۵	(۹,۶۲۴,۱۳۸,۵۶۷,۲۸۹)		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۲۴۸,۷۸۴,۶۵۴,۶۷۷	۲۸۸,۸۹۶,۲۳۶,۷۳۹	۱۹	هزینه کارمزد ارکان
۸,۶۵۵,۰۶۴,۰۱۳	۱۱,۳۰۸,۷۰۸,۴۶۶	۲۰	سایر هزینه ها
۲۵۷,۴۳۹,۷۱۸,۶۹۰	۳۰۰,۲۰۴,۹۴۵,۲۰۵		جمع هزینه ها
۴,۲۵۹,۳۱۹,۱۸۷,۳۴۵	(۹,۹۲۴,۳۴۳,۵۱۲,۴۹۴)		سود (زیان) خالص
۲۰.۸۸٪	(۴۲.۹۲)٪		بازده میانگین سرمایه گذاری (۱) (درصد)
۱۵.۰۶٪	(۴۶.۸۰)٪		بازده سرمایه گذاری پایان سال (۲) (درصد)

صورت گردش خالص دارایی ها

صورت گردش خالص دارایی ها				
سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰	یادداشت		
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 سال
۵۷۸,۴۵۱,۰۰۰,۰۰۰	۵۷۸,۴۵۱	۵۹۲,۱۲۵,۰۰۰,۰۰۰	۵۹۲,۱۲۵	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی سال
(۷۳۳,۶۳۵,۰۰۰,۰۰۰)	(۷۳۳,۶۳۵)	(۲۱۳,۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۱۳,۱۷۰)	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی سال
۴,۲۵۹,۳۱۹,۱۸۷,۳۴۵	۰	(۹,۹۲۴,۳۴۳,۵۱۲,۴۹۴)	۰	سود (زیان) خالص
۱۱,۷۴۹,۱۳۹,۳۵۸,۷۴۴	۰	۲,۳۲۳,۸۸۷,۵۲۵,۱۶۵	۰	تعدیلات
۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۱,۵۱۸,۵۹۳	۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴	۱,۸۹۷,۵۴۸	

۵- گزارش عملیاتی

ردیف	نماد	تعداد خرید طی دوره	مبلغ خرید طی دوره	تعداد فروش طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مانده	خالص ارزش فروش
۱	دی ۱	۸۸۷,۴۵۲,۷۷۰	۶۶۶,۸۷۳,۶۳۷,۵۳۵	۱۴۳,۹۷۳,۲۹۰	۱۲۴,۵۳۵,۱۹۳,۲۴۰	۲۰,۶۷۸,۲۰۸,۴۳۸	۱۲,۵۸۳,۴۵۸,۲۳۶,۷۴۹
۲	ودی ۱	۶۴,۷۵۳,۳۳۰	۴۴۹,۷۴۰,۴۵۰,۱۳۰	۷,۳۲۷,۱۴۳	۵۷,۰۸۶,۷۵۴,۸۳۰	۳۷۸,۳۲۶,۳۵۰	۲,۷۷۸,۵۸۵,۳۴۱,۵۰۹
۳	دملوند ۱	۱۱۷,۱۷۶,۳۶۶	۸۹۶,۴۶۱,۳۴۳,۲۶۷	۳۲,۴۳۶,۹۸۴	۲۴۷,۷۷۹,۱۱۳,۵۶۷	۵۰۳,۲۹۳,۰۲۰	۳,۶۹۶,۳۹۲,۳۰۲,۱۹۰
۴	ویوعلی ۱	۱۱۵,۴۹۷,۰۰۷	۲۳۰,۶۸۴,۳۰۷,۳۲۶	۱۰,۰۰۸,۳۳۹	۲۰,۴۱۹,۲۹۴,۹۱۴	۸۰۸,۳۸۲,۷۱۳	۱,۷۲۹,۴۳۲,۰۲۰,۵۱۸
۵	دی سهام ۱	۳,۰۳۳,۸۴۶	۲۰۹,۲۴۳,۲۱۹,۹۴۳	۱,۰۰۸,۶۹۸	۶۶,۹۶۷,۱۲۰,۰۳۴	۲,۰۲۵,۱۴۸	۱۳۹,۰۹۴,۶۲۴,۷۷۹

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