

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به

۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۴

« 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 ۱۴۰۴ 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 سهم) 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

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 بهمند
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 واحد های 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 ۱۴۰۴/۰۲/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۲۱,۵۹۴,۳۳۰,۴۷۱,۷۶۴
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۱,۹۰۵,۸۲۲
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۱,۸۹۰,۴۱۴
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۲,۲۸۲,۶۰۵

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۲/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۴/۰۲/۲۴	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	%۰.۳۶۵	%(۳.۹۸)
یک ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۲/۰۱	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	%(۰.۱۱۵)	%(۰.۹۳۱)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۱۲/۰۲	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	%(۶.۱۱)	%۱۳.۷۵۸
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۹/۰۲	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	%(۱۲.۱۴۸)	%۳۷.۶۷۳
یک سال اخیر	۱۴۰۳/۰۳/۰۱	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	%(۱۴.۳۹۶)	%۴۷.۰۱۵
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	%۱۰۸۷.۵۲	%۳۹۲۶.۹۴۸

۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۲/۳۰

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۲۰,۷۸۷,۸۶۷,۹۰۰,۹۶۳	۲۲,۸۰۸,۲۸۷,۴۲۵,۵۸۶	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۳۷۱,۱۰۱,۹۰۵,۲۵۴	۴,۶۰۳,۴۰۹,۷۸۰,۹۰۹	۶	سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری
۱۷۱,۰۳۴,۹۹۹,۴۹۱	۳۲۱,۱۷۹,۷۵۲,۸۲۲	۷	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۲۱۴,۳۳۱,۵۹۴	۸۷۴,۷۶۰,۹۱۲	۸	سایر دارایی ها
۸,۸۱۹,۰۵۴,۴۸۰	۵,۹۴۵,۸۰۸,۵۰۲	۹	موجودی نقد
۲۱,۳۳۹,۰۳۸,۱۹۱,۷۸۲	۲۷,۷۳۹,۶۹۷,۵۲۸,۷۳۱		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۶۰,۴۴۷,۵۶۶,۴۲۴	۷۳,۱۹۵,۶۶۷,۳۷۵	۱۰	جاری کارگزاران
۹۶,۵۸۴,۱۸۹,۶۳۶	۱۰۰,۵۱۷,۷۵۹,۶۰۰	۱۱	پرداختی به ارکان صندوق
۷,۷۳۲,۹۶۳,۹۵۸	۸,۷۰۱,۵۱۹,۴۴۸	۱۲	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۱۶۴,۷۶۴,۷۲۰,۰۱۸	۱۸۲,۴۱۴,۹۴۶,۴۲۳		جمع بدهی ها
۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴	۲۷,۵۵۷,۲۸۲,۵۸۲,۳۰۸	۱۳	خالص دارایی ها
۱۱,۱۵۸,۷۵۵	۱۱,۸۹۰,۴۱۴		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

صورت سود و زیان

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۲/۳۱	یادداشت	
			درآمدها:
۱,۳۳۱	۲۸,۹۴۵,۴۸۴,۸۹۴	۱۴	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۷,۲۹۱,۰۸۵,۳۱۰,۶۳۵)	۱۷۱,۰۵۶,۲۵۰,۷۶۶	۱۵	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۲,۹۳۲,۸۶۵,۹۲۴	۳,۲۷۶,۴۷۴,۷۶۶	۱۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
*	۴,۳۸۵,۳۱۹,۳۹۶	۱۷	درآمد حاصل از بازارگردانی
(۷,۲۸۸,۱۵۲,۳۴۳,۳۸۰)	۲۰۷,۶۶۳,۵۲۹,۸۲۲		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۸۳,۲۹۴,۵۷۶,۳۳۸	۷۱,۸۶۲,۵۶۶,۰۷۵	۱۸	هزینه کارمزد ارکان
۲,۴۹۴,۹۱۷,۷۲۹	۲,۹۶۷,۰۳۱,۳۳۰	۱۹	سایر هزینه ها
۸۵,۷۸۹,۴۹۴,۰۶۷	۷۴,۸۲۹,۵۹۷,۳۰۵		جمع هزینه ها
(۷,۳۷۳,۹۴۱,۸۳۷,۴۴۷)	۱۳۲,۸۳۳,۹۳۲,۵۱۷		سود خالص
(۲۷.۸۶)%	۰.۵۴%		بازده میانگین سرمایه گذاری (۱) (درصد)
(۲۳.۵۵)%	۰.۵۱%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۲) (درصد)

صورت گردش خالص دارایی ها

صورت گردش خالص دارایی ها				یادداشت	
دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۲/۳۱		دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۲/۳۱			
ریال	تعداد	ریال	تعداد		
۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳	۱,۵۱۸,۵۹۳	۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴	۱,۸۹۷,۵۴۸		خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۲۵۶,۶۷۴,۰۰۰,۰۰۰	۲۵۶,۶۷۴	۴۲۰,۰۵۷,۰۰۰,۰۰۰	۴۲۰,۰۵۷		واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۲۱۳,۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۱۳,۱۷۰)	*	*		واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۷,۳۷۳,۹۴۱,۸۳۷,۵۷۵)	*	۱۳۲,۸۳۳,۹۳۲,۵۱۷	*		سود (زیان) خالص
۸۹۴,۳۴۲,۹۶۴,۹۱۵	*	۵,۸۳۰,۱۱۸,۱۷۸,۰۲۷	*	۲۰	تعدیلات
۲۱,۹۵۹,۶۷۹,۵۸۶,۴۳۳	۱,۵۶۲,۰۹۷	۲۷,۵۵۷,۲۸۲,۵۸۲,۳۰۸	۲,۳۱۷,۶۰۵		

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	۱,۶۷۵,۹۷۱,۲۶۷	۱,۰۱۸,۲۲۸,۸۲۸,۱۹۷	۲۳۹,۰۸۶,۹۱۸	۱۴۷,۰۴۶,۸۹۱,۹۴۴	۲۲,۱۱۵,۰۹۲,۷۸۷	۱۳,۴۵۷,۸۵۵,۷۵۷,۷۳۸
۲	ودی ۱	۷۴۱,۶۶۳,۸۰۸	۱,۰۷۳,۰۳۱,۷۹۵,۵۱۴	۲,۶۴۷,۰۵۰	۱۱,۱۷۱,۵۷۵,۳۳۱	۵۲۹,۳۶۶,۱۲۵	۲,۲۹۶,۲۳۱,۸۸۵,۰۸۰
۳	دما وندا	۱۴,۱۷۸,۳۳۰	۱۰۳,۳۶۵,۸۸۹,۸۳۴	۱۱,۸۰۰,۰۰۰	۸۹,۶۲۹,۸۲۹,۹۳۸	۵۰۵,۶۷۱,۳۵۰	۳,۹۵۱,۳۴۴,۶۵۱,۰۳۳
۴	ویوعلی ۱	۳۰۲,۱۶۷,۷۷۲	۵۶,۸۹۹,۲۴۳,۴۳۰	۱۱,۴۱۶,۳۳۶	۲۰,۵۲۳,۸۰۱,۹۱۶	۱,۰۹۹,۱۳۴,۱۴۹	۱,۹۳۱,۹۰۷,۶۰۱,۵۹۵
۵	دی سهام ۱	۱۰۹,۱۲۸,۴۳۱	۱,۰۴۹,۹۹۱,۵۶۷,۲۹۹	۸۷,۸۲۶,۵۹۴	۹۳۹,۱۵۷,۳۴۳,۶۳۹	۲۳,۳۲۶,۹۸۵	۲۵۹,۳۳۴,۴۶۶,۶۳۳

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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