

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به

۳۱ مرداد 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 شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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 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 پذیره نویسی 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	مؤسسه حسابرسی بهمن
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 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	۳۵۰۰۰	۱۰۰

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۴/۰۵/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۳۲,۸۸۵,۹۴۶,۶۹۷,۱۶۹
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۳,۲۳۷,۷۹۲
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۳,۲۲۴,۲۹۳
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۲,۴۸۶,۷۸۳

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۵/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۴/۰۵/۲۴	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	%۸.۰۷۴	%۰.۳۳۴
یک ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۵/۰۱	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	%۹.۵۸۶	%(۱۲.۷۵۲)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۳/۰۱	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	%۱۱.۸۲۴	%(۲۱.۰۳)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۳/۱۲/۰۱	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	%۱۸.۹۱۳	%(۹.۵۲۶)
یک سال اخیر	۱۴۰۳/۰۶/۰۱	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	%۸.۷۵۴	%۲۱.۵
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	%۱۲۲۰.۷۳۷	%۳۱۰۶.۹۴۱

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 ۱۴۰۴/۰۵/۳۱

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی			
صورت مالی میان دوره ای			
صورت خالص دارایی ها			
به تاریخ ۳۱ مرداد ۱۴۰۴			
۱۴۰۳/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۲۰,۷۸۷,۸۶۷,۹۰۰,۹۶۳	۲۱,۰۶۲,۱۲۱,۵۱۱,۶۷۶	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۳۷۱,۱۰۱,۹۰۵,۲۵۴	۵,۲۹۹,۱۳۵,۱۸۶,۲۶۸	۶	سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری
۱۷۱,۰۳۴,۹۹۹,۴۹۱	۳۵۳,۱۵۴,۵۲۳,۳۷۰	۷	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
.	۳۱۶,۸۸۱,۲۶۶,۹۰۵	۸	حساب های دریافتی
۲۱۴,۳۳۱,۵۹۴	۱,۳۱۳,۱۹۹,۸۴۷	۹	سایر دارایی ها
۸,۸۱۹,۰۵۴,۴۸۰	۲,۴۰۳,۵۳۹,۲۸۸	۱۰	موجودی نقد
.	۵,۹۵۱,۲۳۳,۴۸۱,۴۳۶	۱۱	جاری کارگزاران
۲۱,۳۳۹,۰۳۸,۱۹۱,۷۸۲	۳۲,۹۸۶,۲۴۲,۷۰۸,۷۹۰		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۶۰,۴۴۷,۵۶۶,۴۲۴	.	۱۱	جاری کارگزاران
۹۶,۵۸۴,۱۸۹,۶۳۶	۸۷,۷۲۶,۲۰۵,۳۹۱	۱۲	پرداختنی به ارکان صندوق
۷,۷۳۲,۹۶۳,۹۵۸	۱۲,۵۶۹,۸۰۶,۲۳۰	۱۳	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۱۶۴,۷۶۴,۷۲۰,۰۱۸	۱۰۰,۲۹۶,۰۱۱,۶۲۱		جمع بدهی ها
۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴	۳۲,۸۸۵,۹۴۶,۶۹۷,۱۶۹	۱۴	خالص دارایی ها
۱۱,۱۵۸,۷۵۵	۱۳,۲۲۴,۲۹۳		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

یادداشت های توضیحی همراه، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی می باشد

صورت سود و زیان

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی				
صورت مالی میان دوره‌ای				
صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها				
دوره شش ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ مرداد ۱۴۰۴				
یادداشت	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۵/۳۱	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۵/۳۱		
درآمدها:				
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۲,۸۳۵,۹۷۰,۰۸۵,۵۰۱	۷۶۲,۶۹۰,۱۴۵	۱۵	
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۱۲۳,۶۳۰,۸۱۳,۶۱۲)	(۱۰,۶۵۷,۰۵۸,۳۴۲,۸۳۰)	۱۶	
سود سهام	۵۹۰,۰۵۱,۱۵۵,۰۶۵	۴۱۱,۹۱۹,۷۵۲,۸۶۵	۱۷	
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب	۱۰,۰۰۱,۸۵۴,۸۴۹	۳,۷۳۹,۶۶۵,۸۵۶	۱۸	
درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی	۴,۳۸۵,۳۱۹,۳۹۶	-	۱۹	
جمع درآمدها	۳,۳۱۶,۷۷۷,۶۰۱,۱۹۹	(۱۰,۲۴۰,۶۴۶,۲۳۳,۹۶۴)		
هزینه‌ها:				
هزینه کارمزد ارکان	(۱۵۱,۷۷۵,۳۰۹,۱۱۰)	۱۴۷,۵۲۱,۳۰۵,۴۰۱	۲۰	
سایر هزینه‌ها	(۶,۴۰۳,۱۸۶,۹۳۸)	۴,۸۹۴,۶۱۹,۲۵۳	۲۱	
جمع هزینه‌ها	(۱۵۸,۱۷۸,۴۹۶,۰۴۸)	۱۵۲,۴۱۵,۹۲۴,۶۵۴		
سود خالص	۳,۱۵۸,۵۹۹,۱۰۵,۱۵۱	(۱۰,۳۹۳,۰۶۳,۱۵۸,۶۱۸)		
بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)	۱۱.۷۷٪	-۴۴.۶۱٪		
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)	۹.۶۳٪	-۵۳.۹۳٪		

صورت گردش خالص دارایی‌ها

یادداشت	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۱۴۰۳/۰۵/۳۱		
	تعداد	ریال	تعداد	ریال
خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) اول دوره	۱,۸۹۷,۵۴۸	۳۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴	۱,۵۱۸,۵۹۳	۲۸,۳۹۵,۷۷۴,۴۵۹,۰۹۳
واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره	۵۸۹,۲۳۵	۵۸۹,۲۳۵,۰۰۰,۰۰۰	۲۷۸,۲۳۷	۲۷۸,۲۳۷,۰۰۰,۰۰۰
واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره	-	-	(۲۱۳,۱۷۰)	(۲۱۳,۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰)
سود (زیان) خالص	-	۳,۱۵۸,۵۹۹,۱۰۵,۱۵۱	-	(۱۰,۳۹۳,۰۶۳,۱۵۸,۶۱۸)
تعدیلات	-	۷,۹۶۳,۸۳۹,۱۲۰,۲۵۴	-	۱,۱۸۹,۸۳۰,۳۹۵,۲۶۵
	۲,۴۸۶,۷۸۳	۳۲,۸۸۵,۹۴۶,۶۹۷,۱۶۹	۱,۵۸۳,۶۶۰	۱۹,۲۵۷,۶۰۹,۶۹۵,۷۴۰
یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدایی ناپذیر صورت‌های مالی می‌باشد.				
۱- بازده میانگین سرمایه‌گذاری	=	سود (زیان) خالص		
		میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده		
۲- بازده سرمایه‌گذاری پایان سال	=	تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ± سود (زیان) خالص		
		خالص دارایی‌های پایان سال		

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	مبلغ فروش طی دوره	مانده	خالص ارزش فروش
۱	دی ۱	۴,۰۹۲,۴۳۷,۸۸۲	۲,۳۹۵,۲۷۹,۰۴۶,۴۷۴	۲۶۷,۳۰۳,۱۶۴	۶,۱۱۶,۸۳۳,۲۴۲,۶۱۵	۱۹,۳۲۶,۴۳۸,۲۷۷	۱۱,۸۳۸,۱۰۲,۸۶۲,۷۳۷
۲	وبوعلی	۳۲۲,۰۹۵,۱۰۳	۸۶,۱۰۷,۸۹۸,۲۹۰	۱۶,۸۶۶,۳۳۶	۲۹,۰۹۴,۹۸۸,۷۱۸	۱,۱۱۳,۶۱۱,۴۸۰	۱,۵۷۲,۳۳۷,۱۳۶,۱۴۴
۳	ودی	۷۴۷,۳۰۷,۳۷۱	۱,۰۹۷,۵۵۵,۴۵۳,۸۳۲	۸,۵۰۶,۸۰۲	۳۸,۵۱۰,۳۰۷,۰۶۴	۱,۱۱۷,۱۲۶,۹۱۹	۴,۳۳۱,۱۵۸,۲۶۱,۸۶۱
۴	دماوند	۳۱,۴۴۵,۲۵۲	۲۳۴,۶۸۷,۰۴۷,۲۴۰	۲۳,۵۰۰,۰۰۰	۱۸۰,۴۱۷,۷۷۸,۹۹۵	۵۱۱,۳۳۸,۲۷۲	۳,۳۲۰,۵۲۳,۲۵۰,۹۳۶
۵	دی سهام	۱۸۱,۸۱۴,۵۴۸	۱,۷۶۷,۹۰۱,۰۰۲,۴۲۹	۱۶۰,۴۵۱,۷۴۲	۱,۶۵۴,۲۷۷,۳۱۶,۹۵۰	۲۳,۳۸۷,۹۵۴	۲۲۰,۳۶۲,۲۰۱,۹۸۰

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاران بانک دکا (سهامی خاص)

 شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰