

## گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به

۳۰ آبان ماه ۱۴۰۴

« ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

کارگزاران بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

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 نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 ۱۴۰۴/۰۹/۲۴ 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، 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 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](http://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 |

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                        | ۳۵۰۰۰                  | ۱۰۰                   |

## ۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۴/۰۸/۳۰

|   |                                      |                     |
|---|--------------------------------------|---------------------|
| ۱ | کل خالص ارزش دارایی صندوق            | ۴۵,۸۱۰,۰۲۲۰,۷۷۵,۷۴۶ |
| ۲ | آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری  | ۶,۸۳۱,۶۷۴           |
| ۳ | آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری | ۶,۸۲۵,۱۲۹           |
| ۴ | گواهی های ممتاز                      | ۳۵.۰۰۰              |
| ۵ | گواهی های عادی                       | ۶,۷۱۱,۹۶۴           |

## ۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ می باشد:

| توضیحات        | از تاریخ   | تا تاریخ   | بازدهی صندوق | بازدهی بازار |
|----------------|------------|------------|--------------|--------------|
| یک هفته اخیر   | ۱۴۰۴/۰۸/۲۳ | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | ٪۱.۸۲        | ٪۲.۲۵۳       |
| یک ماه اخیر    | ۱۴۰۴/۰۷/۳۰ | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | ٪(۳۹.۵۹)     | ٪۲.۸۸        |
| ۳ ماه اخیر     | ۱۴۰۴/۰۶/۰۱ | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | ٪(۴۸.۲۸)     | ٪۲۸.۲۳       |
| ۶ ماه اخیر     | ۱۴۰۴/۰۳/۰۴ | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | ٪(۴۱.۷۰)     | ٪۲.۱۴        |
| یک سال اخیر    | ۱۴۰۳/۰۹/۰۱ | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | ٪(۴۹.۵۷)     | ٪۴۰.۳۵       |
| از شروع فعالیت | ۱۳۹۵/۱۷/۰۷ | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | ٪۵۸۱.۶۴      | ٪۴۰۵.۲۶      |

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 ۱۴۰۴/۰۸/۳۰

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 ۳۰ آبان ۱۴۰۴                                            |                    |         |                                           |
|                                                                  |                    |         |                                           |
| ۱۴۰۳/۱۱/۳۰                                                       | ۱۴۰۴/۰۸/۳۰         | یادداشت |                                           |
| ریال                                                             | ریال               |         |                                           |
|                                                                  |                    |         | دارایی ها                                 |
| ۲۰,۷۸۷,۸۶۷,۹۰۰,۹۶۳                                               | ۲۶,۴۷۱,۰۱۹,۷۱۱,۹۳۹ | ۵       | سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم            |
| ۳۷۱,۱۰۱,۹۰۵,۲۵۴                                                  | ۵,۹۲۳,۵۹۸,۲۳۳,۶۷۳  | ۶       | سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری    |
| ۱۷۱,۰۳۴,۹۹۹,۴۹۱                                                  | ۱۳,۵۹۵,۳۵۲,۱۸۳,۸۱۸ | ۷       | سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی |
| ۲۱۴,۳۳۱,۵۹۴                                                      | ۱,۶۶۱,۲۴۱,۰۷۷      | ۸       | سایر دارایی ها                            |
| ۸,۸۱۹,۰۵۴,۴۸۰                                                    | ۱۶,۵۱۶,۹۹۶,۸۵۳     | ۹       | موجودی نقد                                |
| ۲۱,۳۳۹,۰۳۸,۱۹۱,۷۸۲                                               | ۴۶,۰۰۸,۱۴۸,۳۶۷,۳۶۰ |         | جمع دارایی ها                             |
|                                                                  |                    |         | بدهی ها                                   |
| ۶۰,۴۴۷,۵۶۶,۴۲۴                                                   | ۹۸,۸۷۶,۹۴۳,۰۴۴     | ۱۰      | جاری کارگزاران                            |
| ۹۶,۵۸۴,۱۸۹,۶۳۶                                                   | ۸۸,۱۹۴,۲۹۰,۳۱۴     | ۱۱      | پرداختی به ارکان صندوق                    |
| ۷,۷۳۲,۹۶۳,۹۵۸                                                    | ۱۱,۰۵۴,۳۵۸,۲۵۶     | ۱۲      | سایر حساب های پرداختنی و ذخایر            |
| ۱۶۴,۷۶۴,۷۲۰,۰۱۸                                                  | ۱۹۸,۱۲۵,۵۹۱,۶۱۴    |         | جمع بدهی ها                               |
| ۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴                                               | ۴۵,۸۱۰,۰۲۲,۷۷۵,۷۴۶ | ۱۳      | خالص دارایی ها                            |
| ۱۱,۱۵۸,۷۵۵                                                       | ۶,۸۲۵,۱۲۹          |         | خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری      |
|                                                                  |                    |         |                                           |
| یادداشت های توضیحی همراه، بخش جذابی ناپذیر صورت های مالی می باشد |                    |         |                                           |
|                                                                  |                    |         |                                           |
|                                                                  |                    |         |                                           |

## صورت سود و زیان

| صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی |                                  |                                  |    |
|------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----|
| صورت مالی میان دوره ای                         |                                  |                                  |    |
| صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها          |                                  |                                  |    |
| دوره نه ماهه منتهی به تاریخ ۳۰ آبان ۱۴۰۴       |                                  |                                  |    |
| یادداشت                                        | دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰ |    |
| درآمدها:                                       |                                  |                                  |    |
| سود (زیان) فروش اوراق بهادار                   | ۹,۰۹۰,۶۸۹,۳۸۷,۷۴۴                | ۱,۲۲۶,۸۴۵,۷۹۰                    | ۱۴ |
| سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار    | ۵,۴۰۴,۹۷۱,۷۷۸,۲۱۸                | (۸,۶۳۶,۴۸۲,۰۵۷,۷۱۳)              | ۱۵ |
| سود سهام                                       | ۶۲۸,۱۱۵,۷۱۵,۵۶۰                  | ۴۳۹,۹۳۲,۰۳۲,۴۰۶                  | ۱۶ |
| سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب   | ۳۱۰,۰۰۳,۲۹۷,۹۶۵                  | ۴,۵۷۴,۹۸۱,۸۰۸                    | ۱۷ |
| درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی               | ۱۳,۵۱۰,۰۶۹,۷۴۴                   | .                                | ۱۸ |
| جمع درآمدها                                    | ۱۵,۳۴۷,۲۹۰,۲۴۹,۲۳۱               | (۸,۱۹۰,۷۴۸,۱۹۷,۷۰۸)              |    |
| هزینه ها:                                      |                                  |                                  |    |
| هزینه کارمزد ارکان                             | (۲۲۴,۸۵۲,۵۸۴,۹۹۸)                | (۲۱۳,۹۶۸,۷۲۲,۶۳۸)                | ۱۹ |
| سایر هزینه ها                                  | (۱۶,۳۴۵,۳۶۲,۲۰۷)                 | (۷,۹۷۱,۴۹۴,۷۳۴)                  | ۲۰ |
| جمع هزینه ها                                   | (۲۴۱,۱۹۷,۹۴۷,۲۰۵)                | (۲۲۱,۹۴۰,۲۱۷,۳۷۲)                |    |
| سود خالص                                       | ۱۵,۱۰۶,۰۹۲,۳۰۲,۰۲۶               | (۸,۴۱۲,۶۸۸,۴۱۵,۰۸۰)              |    |
| بازده میانگین سرمایه گذاری (درصد)              | ۵۱.۷۵٪                           | (۳۷.۱۰)٪                         |    |
| بازده سرمایه گذاری پایان دوره (درصد)           | ۳۳.۰۸٪                           | (۳۸.۹۹)٪                         |    |

## صورت گردش خالص دارایی ها

| صورت گردش خالص دارایی ها                                         |                                  |                                                           |                                       |
|------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| یادداشت                                                          | دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۸/۳۰ | دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰                          |                                       |
|                                                                  | تعداد                            | ریال                                                      | تعداد                                 |
| خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره                   | ۱,۸۹۷,۵۴۸                        | ۲۱,۱۷۴,۲۷۳,۴۷۱,۷۶۴                                        | ۱,۵۱۸,۵۹۳                             |
| واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره                            | ۵,۳۸۳,۷۵۲                        | ۵,۳۸۳,۷۵۲,۰۰۰,۰۰۰                                         | ۲۸۷,۳۰۲                               |
| واحدهای سرمایه گذاری لبطال شده طی دوره                           | (۵۶۹,۳۳۶)                        | (۵۶۹,۳۳۶,۰۰۰,۰۰۰)                                         | (۲۱۳,۱۷۰)                             |
| سود (زیان) خالص                                                  | .                                | ۱۵,۱۰۶,۰۹۲,۳۰۲,۰۲۶                                        | .                                     |
| تعدیلات                                                          | ۲۱                               | ۴,۷۱۵,۲۴۱,۰۰۱,۹۵۶                                         | ۱,۵۰۱,۱۹۱,۴۳۷,۳۹۳                     |
|                                                                  |                                  | ۴۵,۸۱۰,۰۲۲,۷۷۵,۷۴۶                                        | ۱,۵۹۲,۷۲۵                             |
|                                                                  |                                  |                                                           |                                       |
| یادداشت های توضیحی همراه بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی می باشد. |                                  |                                                           |                                       |
|                                                                  |                                  |                                                           |                                       |
| ۱- بازده میانگین سرمایه گذاری                                    | =                                | سود (زیان) خالص                                           | میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده |
| ۲- بازده سرمایه گذاری پایان دوره                                 | =                                | تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ± سود (زیان) خالص | خالص دارایی های پایان سال             |

## ۵- گزارش عملیاتی

| ردیف | نماد   | خرید طی دوره  |                   | فروش طی دوره |                    | مانده         | خالص ارزش فروش    |
|------|--------|---------------|-------------------|--------------|--------------------|---------------|-------------------|
|      |        | تعداد         | بهای تمام شده     | تعداد        | مبلغ فروش          |               |                   |
| ۱    | دی ۱   | ۶,۳۳۸,۵۱۹,۲۲۹ | ۴,۰۵۴,۷۳۳,۳۸۲,۲۷۹ | -۴۵۹,۳۰۱,۸۲۱ | ۱۹,۴۶۹,۱۸۶,۱۰۵,۸۵۷ | ۹,۹۰۰,۷۲۰,۹۶۷ | ۹,۳۹۸,۵۳۶,۵۹۸,۱۱۲ |
| ۲    | وبوعلی | ۳۴۴,۳۸۴,۳۲۲   | ۱۲۴,۰۶۴,۶۶۹,۹۷۲   | -۳۳,۳۷۴,۷۹۳  | ۵۶,۲۳۰,۶۸۸,۷۸۶     | ۱,۱۱۹,۳۹۲,۲۴۲ | ۲,۱۵۰,۹۵۵,۳۱۱,۹۹۲ |
| ۳    | ودی    | ۷۵۶,۷۰۱,۱۴۳   | ۱,۱۳۸,۳۸۶,۴۷۶,۵۸۸ | -۱۸,۰۰۶,۸۰۲  | ۷۷,۹۴۰,۳۱۷,۵۹۹     | ۱,۱۱۷,۰۲۰,۶۹۱ | ۴,۸۷۹,۹۰۲,۹۱۴,۰۶۲ |
| ۴    | دماوند | ۴۶,۷۱۶,۳۲۳    | ۳۵۲,۶۸۵,۹۱۸,۰۵۳   | -۳۷,۹۱۰,۳۵۱  | ۲۸۹,۲۴۰,۵۴۹,۰۸۷    | ۵۱۳,۰۹۸,۹۹۲   | ۳,۹۱۹,۶۹۷,۰۴۳,۲۲۸ |
| ۵    | دانا   | ۱۹,۸۶۹,۵۴۰    | ۵,۷۶۶,۳۸۹,۱۳۴,۰۴۱ | -۲۴,۲۸۱,۹۲۰  | ۶۸,۱۱۵,۱۷۸,۷۳۲     | ۲,۲۱۷,۳۶۶,۶۴۸ | ۶,۱۳۱,۹۲۷,۸۴۴,۵۴۷ |
| ۶    | ودیح   | ۵۸۹,۹۱۱,۹۸۳   | ۴,۰۰۲,۵۵۰,۳۲۲     | -۵۸۹,۹۱۱,۹۸۳ | ۴,۱۳۱,۷۵۰,۹۴۹      | ۰             | ۰                 |

## ۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

گزارش بانک دکا (سهامی خاص)



ثبت: ۱۶۴۹۶۰