

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن 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 سالانه منتهی به ۳۰ بهمن 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 ۱۴۰۵/۰۱/۲۳ 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 ه 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 سپا 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

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 ۱۴۰۴/۱۱/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۳۰,۹۳۲,۶۲۴,۶۲۲,۶۹۸
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۴,۷۱۹,۱۳۰
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۴,۷۱۲,۹۶۵
۴	گواهی های ممتاز	۳۵۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۶,۵۶۳,۳۰۴

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق سالانه منتهی به ۱۴۰۴/۱۱/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۴/۱۱/۲۳	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	٪(۱.۴۵۶)	٪(۵.۵۳۵)
یک ماه اخیر	۱۴۰۴/۱۰/۳۰	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	٪(۲۰.۳۷۱)	٪(۱۴.۹۹۹)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	٪(۳۰.۹۴۷)	٪۲۰.۱۴۲
۶ ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۶/۰۱	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	٪(۶۴.۲۹۲)	۵۴.۰۶٪
یک سال اخیر	۱۴۰۳/۱۲/۰۱	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	٪(۵۷.۹۴۳)	۳۹.۳۲۸٪
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۱۷/۰۷	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۳۷۰.۶۹۴٪	۴۸۳۲.۱۲۹٪

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- ترکیب دارایی های صندوق

ردیف	شرح	مبلغ	درصد از کل دارایی های صندوق به ارزش روز
۱	سرمایه گذاری در سهام	۲۴,۶۰۹,۵۰۸,۰۶۴,۹۸۹	۷۹.۱۳%
۲	سرمایه گذاری در صندوق	۵,۰۰۸,۰۲۸,۰۷۷,۳۰۴	۱۶.۱%
۳	نقد و بانک	۱,۳۰۱,۷۹۶,۲۲۸,۲۸۳	۴.۷۵%
۴	اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۲۳۴,۷۸۰,۲۳۳	۰.۰۱%
۵	سایر دارایی ها	۶۹۰,۱۷۲,۷۵۷	۰%
جمع:		۳۱,۱۰۱,۲۲۰,۰۰۶,۹۰۵	۱۰۰%

۵- ترکیب دارایی های موضوع بازارگردانی صندوق به شرح زیر است:

ردیف	نام سهم	ارزش روز کل	درصد از کل دارایی های صندوق به ارزش روز
۱	سرمایه گذاری بوعلی	۲,۳۶۳,۰۷۶,۱۰۰,۰۱۵	۷۶.۰%
۲	بیمه دی	۱,۷۴۵,۵۱۵,۳۹۵,۳۰۷	۵۶.۱%
۳	بیمه دانا	۴,۲۰۴,۰۵۰,۰۵۵,۸۷۶	۱۳.۵۲%
۴	تولید نیروی برق دماوند	۴,۱۸۳,۱۴۸,۶۱۷,۹۸۶	۱۳.۴۵%
۵	بانک دی	۱۲,۱۱۳,۷۱۷,۸۹۵,۸۱۹	۳۸.۹۵%
جمع:		۲۴,۶۰۹,۵۰۸,۰۶۵,۰۰۳	۷۹.۱۳%

۶- تعهدات صندوق:

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه
۱	بانک دی	دی	۳ درصد	۲,۰۵۶,۲۲۵	۴۱,۱۲۴,۴۱۰
۲	بیمه دی	ودی	۲.۵ درصد	۱۰۰,۰۰۰	۲,۰۰۰,۰۰۰
۳	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی	۲.۵ درصد	۲۷۸,۷۴۶	۲,۰۹۱,۰۰۰
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند	۲.۲۵ درصد	۹۶,۵۴۵	۱,۹۳۰,۸۱۰
۵	صندوق دی سهام	دی سهام	۲ درصد	۲۹۵,۰۰۰	۲,۹۵۰,۰۰۰
۶	بیمه دانا	دانا	۲.۵ درصد	۲۳۵,۱۹۴	۴,۷۰۴,۰۰۰

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۷- حجم معاملات موضوع بازارگردانی صندوق منتهی به ۱۴۰۴/۱۱/۳۰

نام سهام	خرید			فروش			درصد از کل معاملات بازار
	تعداد	بهای خرید هر سهم	مبلغ کل	تعداد	بهای فروش هر سهم	مبلغ کل	
بانک دی	۱۱,۷۰۴,۹۵۶,۲۱۴	۸۳۲	۹,۷۳۴,۷۷۹,۷۴۲,۰۰۱	۲,۳۳۰,۹۵۵,۵۴۸	۹,۳۵۱	۲۱,۵۶۳,۴۴۵,۳۴۰,۸۹۷	۷۲.۰۷
سرمایه گذاری بوعلی	۳۶۲,۷۰۴,۵۰۵	۴۵۴	۱۶۴,۴۹۴,۵۵۳,۶۵۶	۴۱,۱۹۰,۷۰۴	۱,۷۸۴	۷۳,۴۸۸,۵۴۸,۱۰۰	۹.۵۰
بیمه دی	۸۷۳,۲۱۷,۰۲۶	۱,۹۴۵	۱,۶۹۸,۶۸۴,۰۶۳,۶۵۰	۸۳۷,۲۰۶,۸۰۲	۴,۱۹۵	۳,۵۱۱,۸۳۹,۳۳۴,۸۵۷	۳۴.۰۶
تولید نیروی برق معاونت	۸۸,۳۴۸,۹۱۲	۸,۱۳۴	۷۱۸,۵۹۰,۶۸۱,۴۴۵	۷۴,۱۷۲,۱۸۸	۸,۱۸۹	۶۰۷,۴۱۹,۸۶۸,۷۶۸	۵.۷۴
بیمه دانا	۱۴۷,۵۰۳,۵۳۳	۴۱,۱۸۳	۶,۰۷۴,۶۷۹,۹۸۴,۶۰۹	۵۱,۳۳۹,۸۱۶	۲,۸۰۹	۱۴۳,۹۵۷,۰۴۵,۴۷۳	۴۸.۱۰
ح. بیمه دی	۵۸۹,۹۱۱,۹۸۳	۷	۴۰۰,۲۵۵۰,۳۳۳	۵۸۹,۹۱۱,۹۸۳	۷	۴,۱۳۱,۷۵۰,۹۴۹	۰.۱۳
صندوق س.دی سهام سهام	۳۷۹,۷۹۷,۳۳۷	۲,۹۱۶	۱,۱۰۷,۶۱۲,۶۱۸,۳۶۰	۳۶۰,۱۱۶,۰۳۵	۹,۲۳۲	۳,۳۳۴,۵۲۵,۱۶۸,۲۲۰	۹۶.۶۹
جمع	۱۴,۱۴۶,۴۳۹,۵۰۰		۱۹,۵۰۲,۸۴۴,۱۹۴,۰۲۳	۴,۲۸۴,۷۹۳,۰۷۶		۲۹,۳۳۸,۸۰۶,۹۵۷,۲۶۴	

۸- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۴۴۹۶۰