

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

دوره مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۵

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

کارگزاری 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 دوره ای منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ 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 ۱۴۰۵/۰۳/۲۷ 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 شرکتها 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 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

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.

۲-۲- 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 ۱۴۰۵/۰۲/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۳۰,۹۳۲,۶۲۴,۶۲۲,۶۹۸
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۴,۵۵۳,۹۳۰
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۴,۵۴۷,۷۷۴
۴	گواهی های ممتاز	۳۵۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۶,۵۱۲,۰۱۲

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق سالانه منتهی به ۱۴۰۵/۰۲/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۵/۰۲/۲۴	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	٪(۰.۰۳۴)	٪۱.۲۷۵
یک ماه اخیر	۱۴۰۵/۰۲/۰۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	٪۰.۲۶۱	٪۱.۲۷۵
۳ ماه اخیر	۱۴۰۵/۱۲/۰۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	٪(۳.۵۰۱)	٪(۱.۱۹۴)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۴/۰۹/۰۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	٪(۳۳.۲۹۷)	٪۱۷.۶۲۵
یک سال اخیر	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	٪(۶۱.۷۵۳)	٪۲۱.۰۱۵
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۱۷/۰۷	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	۳۵۴.۱۹۶٪	۴۷۷۳.۲۲۹٪

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- ترکیب دارایی های صندوق

ردیف	شرح	مبلغ	درصد از کل دارایی هلی صندوق به ارزش روز
۱	سرمایه گذاری در سهام	۲۴,۱۷۶,۷۴۲,۶۷۱,۳۴۲	۸۰.۸۶٪
۲	سرمایه گذاری در صندوق	۵,۶۵۵,۸۲۷,۹۰۱,۴۵۷	۱۸.۹۲٪
۳	نقد و بانک	۴۷,۳۹۸,۶۱۲,۶۷۳	۰.۱۶٪
۴	اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۳,۸۴۲,۶۳۲,۳۷۴	۰.۰۵٪
۶	حساب هلی فی مابین با کلرگزاران	۵,۱۸۴,۰۸۹,۱۵۶	۰.۰۲٪
۵	سایر دارایی ها	۱,۹۵۰,۴۵۶,۷۴۰	۰.۰۱٪

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

ردیف	نام سهم	ارزش روز کل	درصد از کل دارایی هلی صندوق به ارزش روز
۱	سرمایه گذاری بوعلی	۲,۳۱۱,۹۸۸,۹۵۴,۲۹۲	۷.۷۳٪
۲	بیمه دی	۱,۷۱۱,۳۲۴,۹۴۸,۷۷۸	۵.۷۲٪
۳	بیمه دانا	۳,۷۹۳,۳۴۰,۱۷۴,۸۰۲	۱۲.۶۹٪
۴	تولید نیروی برق دماوند	۴,۱۶۶,۰۵۸,۷۵۵,۸۰۰	۱۳.۹۳٪
۵	بانک دی	۱۲,۱۹۴,۰۲۹,۸۳۷,۶۷۰	۴۰.۷۸٪

۶- تعهدات صندوق:

ردیف	نام شرکت	نماد	دلته مظنه	حداقل سفارش ثبت شده	حداقل معاملات روزانه
۱	بانک دی	دی	۳٪	۲,۰۵۶,۲۲۵	۴۱,۱۲۴,۴۱۰
۲	بیمه دی	ودی	۲.۵٪	۱۰۰,۰۰۰	۲,۰۰۰,۰۰۰
۳	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی	۲.۵٪	۲۷۸,۷۴۶	۲,۰۹۱,۰۰۰
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند	۲.۲۵٪	۹۶,۵۴۵	۱,۹۳۰,۸۱۰
۵	صندوق دی سهام	دی سهام	۲٪	۲۹۵,۰۰۰	۲,۹۵۰,۰۰۰
۶	بیمه دانا	دانا	۲.۵٪	۲۳۵,۱۹۴	۴,۷۰۴,۰۰۰
۷	حمل و نقل پتروشیمی	حیترو	۲.۷۵٪	۲۹,۵۲۰	۲۲۲,۰۰۰

۷- حجم معاملات موضوع بازارگردانی صندوق منتهی به ۱۴۰۵/۰۲/۳۱

نام سهم	خرید			نام سهم	فروش			درصد از کل معاملات بوز
	تعداد	بهای خرید هر سهم	مبلغ کل		تعداد	بهای خرید هر سهم	مبلغ کل	
سرمایه گذاری بوعلی	۲۶۲۷,۹۱۲	۳۰۲۰	۵۳۰,۸۵۱۱,۱۹۸	-	-	-	۱۳٪	
بیمه دی	۲,۹۷۰,۰۸۹	۴۱۱۱	۱۲,۳۱۰,۷۹۰,۶۹۴	-	-	-	۱۳٪	
دماوند	۴,۹۸۹,۸۲۶	۷۹۱۷	۳۹,۵۰۳,۵۶۱,۷۹۷	-	-	-	۱۹٪	
صندوق دی سهام	۳۸,۲۷۱	۱۳۰۸۵	۵۰,۷۸۰,۱۷۰	۷,۴۵۴	۱۳۰۹۷	۹۷,۶۲۵,۰۹۷	۱۰۰٪	
بیمه دانا	۲۳,۸۶۰,۶۰۰	۱۷۰۰	۴۰,۵۵۷,۴۴۸,۵۱۵	-	-	-	۱۶٪	
جمع	۱۰,۶۲۶,۰۹۸	-	۹۸,۰۸۱,۰۹۲,۳۷۲	۷,۴۵۴	-	۹۷,۶۲۵,۰۹۷	-	

۸- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانک دانا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰