

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۵

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

کارگزاری بانک دی (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 شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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 ۱۴۰۵/۰۶/۲۹ 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، بیمه دانا، حمل و نقل پتروشیمی، دی املاک) 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 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

۱-۲- 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 ۱۴۰۵/۰۵/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۴۴,۴۶۶,۷۷۵,۹۹۳,۸۹۴
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۵,۴۸۹,۴۴۴
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۵,۴۸۲,۸۳۵
۴	گواهی های ممتاز	۳۵۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۸,۰۷۵,۱۸۰

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۵/۰۵/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۵/۰۵/۲۴	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	٪۳.۸۷۴	٪۵.۶۶۴
یک ماه اخیر	۱۴۰۵/۰۵/۰۱	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	٪۲۵.۵۵۸	٪۲۴.۱۱۱
۳ ماه اخیر	۱۴۰۵/۰۳/۰۳	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	۱۵.۰۰۴٪	٪۵۵.۰۳۶
۶ ماه اخیر	۱۴۰۴/۱۲/۰۴	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	٪۲۱.۴۴	۶۴.۷۰۹٪
یک سال اخیر	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	٪(۵۸.۵۴)	۱۴۴.۸۹۲٪
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	۴۴۷.۵۸۲٪	۷۷۵۳.۵۳۸٪

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- ترکیب دارایی های صندوق

ردیف	شرح	مبلغ	درصد از کل دارایی ها صندوق به ارزش روز
۱	سرمایه گذاری در سهام	۲۹,۵۱۸,۵۲۵,۷۵۴,۶۹۲	۶۶.۰۶٪
۲	سرمایه گذاری در صندوق	۱۳,۶۲۳,۵۵۶,۹۵۱,۱۴۷	۳۰.۴۹٪
۳	نقد و بانک	۱,۴۶۲,۸۹۱,۵۱۹,۶۸۲	۳.۰۵٪
۴	اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۳,۶۵۸,۲۴۵,۵۵۸	۰.۰۳٪
۵	حساب های دریافتی تجاری	۱۶۵,۵۱۳,۴۱۶,۶۷۳	۰.۳۷٪
۶	سایر دارایی ها	۱,۵۴۶,۴۲۹,۱۹۵	۰.۰۰٪
جمع کل		۴۴,۶۸۵,۶۹۲,۳۱۶,۹۴۷	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	بانک دی	۱۲,۲۹۶,۷۸۸,۸۴۶,۰۷۴	۲۷.۵۳٪
۲	سرمایه گذاری بوعلی	۳,۱۰۲,۳۳۰,۰۵۲,۴۹۳	۶.۹۴٪
۳	بیمه دی	۲,۳۳۰,۸۱۱,۰۷۸,۳۶۰	۵.۲۲٪
۴	تولید نیروی برق دماوند	۶,۰۵۳,۰۹۹,۹۱۰,۹۳۸	۱۳.۵۵٪
۵	صندوق دی سهام	۳۶۴,۷۱۸,۱۰۲,۰۰۹	۰.۸۲٪
۶	بیمه دانا	۵,۵۸۱,۳۹۶,۴۷۳,۹۴۱	۱۲.۴۹٪
۷	حمل و نقل پتروشیمی	۱۵۴,۰۹۹,۳۹۲,۸۸۶	۰.۳۴٪
۸	صندوق دی املاک	۹۸۷,۴۳۰,۳۵۰,۲۶۵	۲.۲۱٪
جمع کل		۳۰,۸۷۰,۶۷۴,۲۰۶,۹۶۶	۶۹.۰۸٪

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۶- تعهدات صندوق:

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه
۱	بانک دی	دی	۴٪	۲,۱۶۰,۰۰۰	۴۳,۲۰۰,۰۰۰
۲	بیمه دی	ودی	۲.۵٪	۳۱۳,۵۸۴	۶,۲۷۱,۶۷۷
۳	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی	۲.۵٪	۱۹۳,۱۴۰	۱,۴۴۹,۰۰۰
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند	۲٪	۱۲۳,۹۹۳	۲,۴۷۹,۸۵۴
۵	صندوق دی سهام	دی سهام	۳٪	۵۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰
۶	بیمه دانا	دانا	۲.۲۵٪	۲۳۶,۴۲۰	۵,۲۶۹,۰۰۰
۷	حمل و نقل پتروشیمی	حپترو	۲.۷۵٪	۲۹,۵۲۰	۲۲۲,۰۰۰
۸	سرمایه گذاری دی املاک	عمارت دی	۳٪	۷۷۰,۰۰۰	۷,۷۰۰,۰۰۰

۷- حجم معاملات موضوع بازارگردانی صندوق منتهی به ۱۴۰۵/۰۵/۳۱

نام سهام	خرید		فروش		درصد کل از معاملات بازار
	تعداد	بهای خرید هر سهم	تعداد	بهای فروش هر سهم	
بانک دی	۱۷۲۸۰۰۰۰۰	۱۳۱۲	۴۹۵۰۵۵۸۰۶۷	۱۱۴۶	۱۶۶۴٪
سرمایه گذاری یوعلی	۳۹۷۲۸۸۲۵	۲۳۱۶	۶۰۰۱۵۰۴۰	۲۴۴۳	۱۶۳۹٪
بیمه دی	۱۷۱۹۲۸۹۴	۴۷۸۹	۱۲۰۰۰۰۰۰	۵۱۰۰	۴۸۹٪
تولید نیروی برق دماوند	۴۴۱۸۰۰۱۷	۹۷۷۷	۱۰۶۸۶۷۱۹۶	۱۰۷۳۹	۱۸۰۵٪
صندوق دی سهام	۲۳۳۲۲۶۱۶۱	۱۷۸۸۵	۲۳۹۲۹۱۷۳۷	۱۷۷۱۱	۱۹۰۷۱٪
بیمه دانا	۲۶۱۰۱۶۰۷۵	۱۹۶۴	۷۵۴۰۹۵۲۲	۲۰۷۲	۲۳۶۷٪
حمل و نقل پتروشیمی	۱۰۱۸۸۹۲۷	۱۴۲۸۱	۱۴۵۵۰۵۴۵۷۲۲۸	۱۴۲۲۴	۱۳۶۸٪
صندوق دی املاک	۱۰۲۶۰۵۱۵۷	۱۲۷۷۲	۳۲۴۵۵۱۲۹	۱۳۲۶۷	۳۲۰۴۰٪

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: ۱۶۴۹۶۰