

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

## گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به

۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰


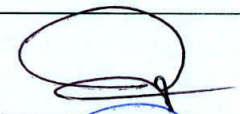
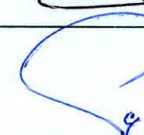
« ثبت‌شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

## گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

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 سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۰ 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 ۱۴۰۰/۰۳/۳۰ به تایید ارکان صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضا
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی	حسین دیده خانی	
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی	غلامحسن آرمات	
متولی صندوق	مشاوره سرمایه گذاری ایرانیان تحلیل قارابی	علیرضا باغانی	



## گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

### ۱- مقدمه

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی که صندوقی در سرمایه‌گذاری 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 می‌شود با اخذ مجوز تأسیس و فعالیت از سازمان بورس در تاریخ ۱۳/۰۵/۱۳۹۵ 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، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار پذیرفته شده موضوع بند ۲-۲ امیدنامه (بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی، بیمه دی، دماوند، زماهان، زشریف، غدام، آوا، براگرس و زکوثر) 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 جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های 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 دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل اوراق بهادار با درآمد ثابت و سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس می‌باشد، توسط مدیران سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه‌گذاری دریافت می‌کنند. دوره فعالیت صندوق به مدت ۳ سال شمسی بوده (تا پایان ۱۴۰۱/۰۴/۲۸) که به تایید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است.

### ۱-۱- اطلاع رسانی

علاقتمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می‌توانند 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 می‌توانید به تارنمای مزبور مراجعه کنید.

### ۲- صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی در یک نگاه

#### ۱-۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
مدیر ثبت	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	موسسه حسابرسی رازدار
متولی	مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

## گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

### 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	۳۵.۰۰۰	۱۰۰

### ۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۶,۴۵۳,۹۰۶,۷۷۹,۴۴۸
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۵,۷۰۵,۰۸۳
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۵,۶۹۶,۹۸۳
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۱۶۹,۸۵۶

شاخص ارزیابی صندوق های سرمایه گذاری، خالص ارزش دارایی های صندوق (NAV) به ازای هر واحد می باشد. همان گونه که در جدول فوق مشاهده می گردد، نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری تا پایان دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰ مبلغ ۵,۶۹۶,۹۸۳ ریال می باشد.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱ می باشد:

بازده بازار	بازده صندوق	تا تاریخ	از تاریخ	محدوده زمانی دوره مورد گزارش
%(۲.۴۶۲)	%(۲.۵۷)	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۴۰۰/۰۲/۲۴	هفته گذشته
%(۴.۳۲۵)	%۶.۸۹۴	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۴۰۰/۰۲/۰۱	ماه گذشته
%(۶.۳۱۷)	%(۴۵.۳۸۴)	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۳۹۹/۱۲/۰۲	۳ ماه اخیر
%(۱۵.۰۱۳)	%(۸۳.۴۷۱)	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۳۹۹/۰۹/۰۲	۶ ماه
%۱۷.۰۳۴	%(۶۸.۱۴۳)	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۱	365 روز گذشته
%۱۳۹۱.۳۵۸	%۴۶۸.۹۶۹	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	بازدهی از شروع فعالیت
%۶۵۳۳۳	%۱۴۲۴۸			حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس
%(۹۹.۷۸)	%(۱.۰۰)			حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس

## گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۰

### ۴- گزارش عملیاتی

#### خرید سهام

ردیف	سهام	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	۵,۱۲۵,۶۵۲,۴۹۳	۲,۲۴۶	۱۱,۵۱۰,۵۲۴,۴۹۵,۲۵۷	۳,۶۴۷,۵۵۷,۸۳۲,۶۸۸
۲	بیمه دی	۱۵۷,۱۰۲,۶۲۸	۱۶,۱۷۰	۲,۵۴۰,۳۱۴,۴۱۷,۳۰۲	۴۲۷,۷۳۴,۳۳۲,۰۰۸
۳	تولید نیروی برق دماوند	۹۶,۲۹۵,۹۴۱	۴۹,۴۹۵	۴,۷۶۶,۱۶۷,۱۲۹,۰۹۱	۱,۲۲۵,۵۲۷,۸۷۲,۵۰۴
۴	خوراک دام پارس	۱,۰۲۵,۵۴۱	۴۴۰,۶۳۵	۴۵۱,۸۸۹,۳۹۷,۴۲۱	۵۹,۲۴۵,۶۶۶,۰۱۰
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	۱۱,۰۰۰,۰۰۰	۸,۸۹۴	۹۷,۸۳۴,۰۰۰,۰۰۰	۹۷,۷۱۳,۰۰۰,۰۰۰
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۶,۸۰۰,۰۰۰	۲۱,۶۸۰	۱۴۷,۴۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۱۴۳,۰۰۴,۰۰۰,۰۰۰
۷	سرمایه گذاری بوعلی	۲۴۵,۰۱۶,۳۸۳	۶,۳۹۶	۱,۵۶۷,۱۵۹,۱۰۰,۰۶۶	۷۱۳,۸۶۷,۹۷۸,۲۷۰
۸	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	۱۳,۱۹۴,۳۷۹	۲۳,۹۴۱	۳۱۵,۸۸۸,۷۱۹,۲۹۳	۱۱۰,۷۹۷,۰۸۳,۹۷۵
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	۹,۵۵۰,۰۰۰	۷,۱۶۵	۶۸,۴۲۵,۷۵۰,۰۰۰	۶۸,۲۰۶,۱۰۰,۰۰۰
۱۰	کشت و صنعت شریف آباد	۳۳,۵۳۱,۸۱۲	۹,۶۸۸	۳۲۴,۸۵۳,۲۳۰,۶۸۶	۱۲۷,۷۰۲,۳۰۸,۴۹۷
	مجموع	۵,۶۹۹,۱۶۹,۱۷۷		۲۱,۷۹۰,۴۸۰,۲۳۹,۱۱۶,۰۰۰	۶,۶۲۱,۳۵۶,۱۷۳,۹۵۲

#### فروش سهام

ردیف	سهام	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش بازده
۱	بانک دی	(۱,۱۷۸,۰۷۹,۰۸۱)	۱۱,۴۷۴	۱۳,۵۱۷,۷۳۰,۵۴۰,۸۷۸	۵۰.۶۳%
۲	بیمه دی	(۱۳۶,۱۱۹,۵۷۹)	۱۵,۷۱۳	۲,۱۳۸,۸۵۱,۹۴۱,۴۹۵	۱.۲۶%
۳	تولید نیروی برق دماوند	(۵۶,۳۹۰,۳۲۵)	۶۳,۶۱۳	۳,۵۸۷,۱۵۱,۵۹۳,۷۲۰	۰.۹۶%
۴	خوراک دام پارس	(۸۷۵,۱۹۸)	۴۲۸,۷۶۱	۲۸۴,۰۰۲,۷۸۰,۷۴۴	-۱.۹۳%
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	۰	۰	۰	-۰.۲۰%
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۰	۰	۰	-۲.۳۰%
۷	سرمایه گذاری بوعلی	(۱۲۱,۳۱۲,۶۸۴)	۶,۵۰۴	۷۸۹,۰۴۳,۴۴۳,۲۲۹	-۳.۹۰%
۸	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	(۷,۸۱۴,۵۷۴)	۲۹,۳۳۹	۲۲۹,۲۷۳,۵۹۷,۱۳۸	۷.۶۳%
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	۰	۰	۰	-۰.۴۰%
۱۰	کشت و صنعت شریف آباد	(۱۰,۴۴۸,۸۵۷)	۱۸,۸۴۷	۱۹۶,۹۳۴,۲۰۵,۱۲۷	-۰.۰۹%
	مجموع	(۱,۵۱۱,۰۴۰,۲۹۸)		۲۰,۸۴۲,۹۸۸,۱۰۲,۳۳۱	۶,۳۵۹,۰۹۵,۱۸۳,۲۸۴

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

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