

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
برای دوره مالی شش ماهه منتهی به

۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۰

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

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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، وآوا، بزاگرس 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 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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۰

۲-۲- واحدهای سرمایه‌گذاری

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 سرمایه‌گذاری ممتاز

اسامی و مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای تحت تملك	درصد واحدهای تحت تملك
۱	بانك دی	۳۴.۳۰۰	۹۸
۲	شرکت کارگزاری بانك دی	۷۰۰	۲
	جمع	۳۵.۰۰۰	۱۰۰

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۸,۴۹۲,۱۳۴,۲۷۴,۳۴۳
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه‌گذاری	۶,۵۹۱,۹۶۳
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری	۶,۵۸۳,۱۰۱
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۲۵۴,۹۹۰

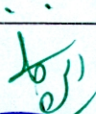
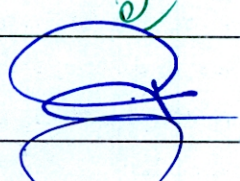
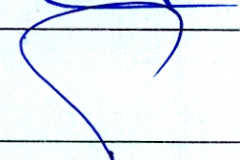
شاخص ارزیابی صندوق های سرمایه‌گذاری، خالص ارزش دارایی های صندوق (NAV) به ازای هر واحد می باشد. همان‌گونه که درجدول فوق مشاهده می‌گردد، نرخ ابطال هر واحد سرمایه‌گذاری تا پایان دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۰ مبلغ ۶,۵۸۳,۱۰۱ ریال می‌باشد.

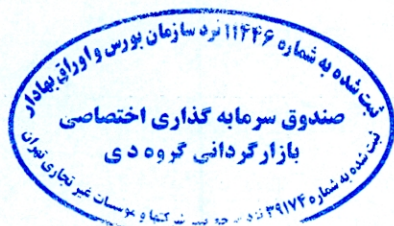
گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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 شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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 ۱۴۰۰/۰۶/۲۴ 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	



کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۰

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱/۰۵/۱۴۰۰ می باشد:

محدوده زمانی دوره مورد گزارش	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق	بازده بازار
هفته گذشته	۱۴۰۰/۰۵/۲۴	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	%۰,۹۶۴	%۱,۰۴۲
ماه گذشته	۱۴۰۰/۰۵/۰۱	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	%(۵,۳۱۵)	%۱۵,۵۷۶
۳ ماه اخیر	۱۳۹۹/۰۳/۰۱	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	%۱۶,۲۷۵	%۳۸,۳۱۸
۶ ماه	۱۳۹۹/۱۲/۰۱	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	%(۱۹,۱۸۹)	%۲۵,۰۸۲
۳۶۰ روز گذشته	۱۳۹۹/۰۶/۰۱	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	%(۸۶,۴۶۴)	%(۱۲,۲۵۷)
بازدهی از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	%۵۵۷,۴۶۸	%۱۸۶۳,۵۷۸
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس				
			%۱۴۲۴۸	%۶۵۳۳۳
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس				
			%(۱۰۰)	%(۹۹,۷۸)

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۰

۴- گزارش عملیاتی

		خرید سهام			۱۴۰۰/۰۵/۳۱	
ردیف	سهام	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره	
۱	بانک دی	۵,۱۷۴,۶۵۲,۴۹۳	۲,۲۳۶	۱۱,۵۶۸,۲۸۳,۴۱۹,۸۹۹	۴,۴۲۷,۲۸۰,۶۷۵,۷۹۶	
۲	بیمه دی	۲۴۱,۲۶۴,۹۲۹	۱۲,۹۵۱	۳,۱۲۴,۵۸۸,۴۹۶,۰۷۶	۸۱۶,۲۲۸,۳۲۱,۴۰۰	
۳	تولید نیروی برق دماوند	۱۳۴,۳۰۰,۷۵۷	۴۳,۵۷۴	۵,۸۵۲,۰۶۱,۵۷۷,۳۸۴	۱,۶۰۱,۴۵۸,۹۵۸,۲۴۴	
۴	خوراک دام پارس	۱,۰۸۶,۳۸۵	۴۳۵,۲۶۷	۴۷۲,۸۶۷,۰۴۲,۴۷۷	۶۷,۷۷۴,۳۱۲,۵۷۰	
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	۱۸,۷۶۵,۰۲۶	۷,۵۵۲	۱۴۱,۷۱۸,۴۹۵,۶۱۹	۵۹,۵۸۶,۴۰۳,۰۷۵	
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۸۰,۸۸,۷۳۶	۲۱,۰۷۳	۱۷۰,۴۵۵,۰۹۴,۷۴۳	۱۰۱,۲۶۲,۱۸۲,۰۴۰	
۷	سرمایه گذاری بوعلی	۲۶۲,۷۸۳,۴۵۸	۶,۲۳۲	۱,۶۳۷,۷۲۴,۵۵۵,۱۷۳	۸۱۱,۶۳۸,۳۴۰,۹۴۶	
۸	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	۴,۸۵۸,۱۹۰	۳۰,۵۷۱	۱۴۸,۵۲۱,۰۴۵,۴۱۸	۱۳,۴۲۴,۴۱۹,۵۰۰	
۹	مجمع تولید گوشت مرغ ماهان	۱۵,۳۱۶,۳۷۹	۲۳,۱۶۵	۳۵۴,۷۹۸,۳۷۶,۶۶۷	۱۱۵,۵۵۷,۸۰۴,۲۲۰	
۱۰	نیروگاه زاگرس کوثر	۱۴,۴۱۰,۸۱۱	۶,۵۵۰	۹۴,۳۹۵,۶۷۱,۰۰۲	۴۳,۷۹۲,۵۴۲,۹۵۸	
۱۱	کشت و صنعت شریف آباد	۳۸,۲۷۸,۳۱۹	۹,۰۹۶	۳۴۸,۱۷۳,۴۱۵,۸۱۹	۶۴,۶۲۱,۴۹۰,۲۰۲	
	مجموع	۵,۹۱۳,۸۰۵,۴۸۳		۲۳,۹۱۳,۵۸۷,۱۹۰,۲۷۷,۰۰۰	۸,۱۲۲,۶۲۵,۴۵۰,۹۵۱	

		فروش سهام			۱۴۰۰/۰۵/۳۱	
ردیف	سهام	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش	بازده
۱	بانک دی	(۱,۲۶۷,۰۷۹,۰۸۱)	۱۰,۷۵۴	۱۳,۶۲۶,۵۰۲,۸۱۲,۱۹۵	۴,۴۲۳,۹۱۵,۹۴۲,۴۸۲	۵۷.۵۵٪
۲	بیمه دی	(۱۶۶,۲۶۷,۵۷۹)	۱۴,۹۶۸	۲,۴۸۸,۷۳۱,۷۳۵,۲۵۱	۶۶۹,۲۱۷,۳۴۳,۴۸۵	۵.۹۵٪
۳	تولید نیروی برق دماوند	(۷۳,۷۸۴,۵۸۸)	۵۵,۰۴۵	۴,۰۶۱,۴۷۵,۱۹۷,۸۶۸	۱,۵۷۸,۳۳۲,۰۸۲,۳۴۸	-۳.۲۵٪
۴	خوراک دام پارس	(۸۷۵,۱۹۸)	۴۳۸,۷۶۱	۳۸۴,۰۰۲,۷۸۰,۷۴۴	۶۷,۶۸۶,۷۴۹,۱۹۵	-۴.۴۷٪
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	(۹,۸۵۸,۳۶۱)	۵,۶۱۸	۵۵,۳۸۱,۸۷۱,۹۰۶	۴۸,۵۴۹,۴۷۷,۴۰۹	-۱۸.۹۰٪
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	(۳,۲۲۳,۸۳۶)	۱۸,۵۲۳	۶۱,۵۶۸,۳۰۷,۱۱۰	۹۶,۱۳۰,۲۱۶,۴۶۸	-۳.۸۵٪
۷	سرمایه گذاری بوعلی	(۱۳۹,۳۱۲,۶۸۴)	۶,۱۸۷	۸۶۱,۹۰۳,۴۲۸,۹۷۷	۵۶۶,۱۷۶,۷۶۰,۲۷۶	۲.۳۷٪
۸	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	(۴,۴۵۸,۱۹۰)	۳۰,۹۰۳	۱۳۷,۷۷۳,۲۴۲,۴۹۹	۱۲,۱۸۲,۷۳۴,۰۸۰	۱.۸۰٪
۹	مجمع تولید گوشت مرغ ماهان	(۷,۸۱۴,۵۷۴)	۲۹,۳۳۹	۲۲۹,۲۷۳,۵۹۷,۱۳۸	۱۱۵,۴۶۹,۹۸۰,۲۸۹	-۲.۸۳٪
۱۰	نیروگاه زاگرس کوثر	(۶,۱۸۹,۸۴۹)	۵,۰۳۷	۳۱,۱۷۹,۲۶۰,۱۰۵	۴۲,۳۷۹,۷۰۹,۸۸۱	-۲۰.۶۱٪
۱۱	کشت و صنعت شریف آباد	(۲۸,۱۳۱,۶۳۵)	۱۰,۲۰۵	۲۸۷,۰۹۱,۱۵۶,۲۴۸	۵۶,۹۳۰,۳۳۰,۷۰۱	۱.۰۰٪
	مجموع	(۱,۷۰۷,۰۹۵,۴۷۵)		۲۲,۲۲۴,۸۸۳,۳۹۰,۰۴۱	۷,۶۷۶,۹۷۱,۳۲۶,۶۱۵	

۵- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

تاریخ گزارش: ۱۳۹۹/۱۲/۰۱ الی ۱۴۰۰/۰۶/۲۳ نام گزارش: تراز آزمایشی تفصیلی نام سید: صندوق سرمایه گذاری اختصاصی نام صندوق: صندوق سرمایه گذاری اختصاصی باز

ردیف	کد حساب	نام حساب	بدهکار	بستانکار	مانده بدهکار	مانده بستانکار
۱	۴۲-۱۰-۱۰۴۸۹۴	سود سهام شرکت تولید نیروی برق دماوند	۰	۲۱,۲۶۱,۵۳۶,۱۷۵	۰	۲۱,۲۶۱,۵۳۶,۱۷۵
۲	۴۲-۱۰-۱۱۵۴۰۸	سود سهام شرکت کشت و صنعت شریف آباد	۶,۲۸۷,۰۳۰,۴۴۲	۷,۶۴۷,۸۵۹,۵۴۲	۰	۱,۳۶۰,۸۲۹,۱۰۰
۳	۴۲-۱۰-۱۱۶۱۳۱	سود سهام شرکت نیروگاه زاگرس کوثر	۰	۱,۳۸۰,۶۰۰,۰۰۰	۰	۱,۳۸۰,۶۰۰,۰۰۰
۴	۴۲-۱۰-۱۲۰۹۰۴	سود سهام شرکت سرمایه گذاری آوا نوین	۰	۱۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
۵	۴۲-۱۰-۱۲۵۰۱۹	سود سهام شرکت سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۰	۵۰,۵۸۰,۸۵۱,۰۴۰	۰	۵۰,۵۸۰,۸۵۱,۰۴۰
۶	۴۲-۱۰-۴۵۱۰	سود سهام شرکت گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	۰	۱,۲۳۲,۴۱۹,۵۰۰	۰	۱,۲۳۲,۴۱۹,۵۰۰
۷	۴۲-۱۰-۴۶۳۰	سود سهام شرکت سرمایه گذاری بوعلی	۰	۲۲۸,۸۵۱,۸۴۳,۱۵۰	۰	۲۲۸,۸۵۱,۸۴۳,۱۵۰
۸	۴۲-۱۰-۵۱۲۷	سود سهام شرکت خوراک دام پارس	۰	۳۶۰,۸۲,۳۲۰	۰	۳۶۰,۸۲,۳۲۰
۹	۴۲-۱۰-۵۷۶۶	سود سهام شرکت بیمه دی	۰	۱۴۲,۴۵۷,۳۷۹,۳۰۰	۰	۱۴۲,۴۵۷,۳۷۹,۳۰۰
جمع:			۶,۲۸۷,۰۳۰,۴۴۲	۴۱۸,۹۲۶,۵۷۱,۰۲۷	۰	۴۱۲,۶۳۹,۵۴۰,۵۸۵