

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
برای سال مالی منتهی به

۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۰

« 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 برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن 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 ۱۴۰۰/۱۲/۲۵ به تایید ارکان صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضا
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی	غلامحسن آرمات	



کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

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، تکشا) 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

۲-۱- 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

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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۵,۳۷۸,۷۴۳
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۵,۳۷۱,۳۰۴
۴	گواهی های ممتاز	۳۵,۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۱۸۹,۵۹۸

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 سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۰ مبلغ ۵,۳۷۱,۳۰۴ ریال می باشد.

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
هفته گذشته	۱۴۰۰/۱۱/۲۳	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	(۱.۳۳)%	(۰.۱۵)%
ماه گذشته	۱۴۰۰/۱۰/۳۰	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	(۷.۲۲)%	۰.۲۲%
ماه اخیر ۳	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	(۱۳.۴۱)%	(۷.۵۵)%
ماه ۶	۱۴۰۰/۰۶/۰۱	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	(۱۸.۶۴)%	(۱۵.۴۲)%
یک سال اخیر	۱۳۹۹/۱۲/۰۱	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	(۴۸.۳۸)%	۳.۵۴%
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	۴۳۶.۴۴%	۱۵۶۱.۲۴%
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			۱۴۲۴۸%	۶۵۳۳۳%
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس			(۱۰۰)%	(۹۹.۷۸)%

۴- گزارش عملیاتی

خرید سهام		۱۴۰۰/۱۱/۳۰			
ردیف	سهام	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	۵,۵۵۵,۹۰۱,۸۶۵	۲,۱۵۶	۱۱,۹۷۷,۹۵۷,۶۷۶,۸۳۵	۳,۷۶۸,۴۴۷,۹۴۸,۶۰۸
۲	بیمه دی	۲۸۲,۴۱۱,۱۹۱	۱۱,۸۹۸	۳,۳۶۰,۱۵۸,۸۶۵,۳۴۳	۴۷۲,۶۰۴,۲۰۲,۳۱۹
۳	تولید نیروی برق دماوند	۱۹۸,۳۳۷,۹۸۱	۳۷,۰۲۸	۷,۳۴۳,۹۹۴,۵۴۰,۰۷۰	۱,۲۸۶,۳۰۳,۳۶۱,۳۵۵
۴	خوراک دام پارس	۲,۹۱۸,۵۳۷	۱۹۷,۸۰۱	۵۷۷,۲۸۹,۱۷۸,۹۴۷	۴۴,۰۰۰,۸۳۷,۰۱۰
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	۳۳,۱۸۶,۹۷۴	۵,۸۸۱	۱۹۵,۱۸۸,۶۳۴,۷۸۴	۳۲,۶۹۰,۸۰۸,۲۳۸
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۱۳,۲۸۵,۸۷۲	۱۸,۸۵۹	۲۵۰,۵۵۳,۷۱۹,۹۴۲	۹۳,۶۷۳,۲۸۶,۰۷۰
۷	سرمایه گذاری بوعلی	۲۸۱,۰۰۳,۴۲۹	۶,۰۸۵	۱,۷۱۰,۰۳۰,۱۴۹,۵۸۷	۶۶۵,۰۳۸,۵۲۱,۴۳۰
۸	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	۷,۹۷۲,۸۲۳	۳۲,۶۷۸	۲۶۰,۵۳۶,۳۷۸,۶۲۷	۶۶,۲۳۶,۰۴۹,۹۰۰
۹	مجموع تولید گوشت مرغ ماهان	۲۵,۲۰۵,۷۱۷	۱۸,۲۷۷	۴۶۰,۶۷۵,۴۸۴,۶۸۳	۲۳,۸۱۲,۰۲۱,۵۵۰
۱۰	نیروگاه زاگرس کوثر	۱۹,۶۲۵,۰۱۱	۵,۶۲۹	۱۱۰,۴۶۱,۳۷۰,۷۹۴	۲۹,۱۱۶,۴۴۱,۸۶۴
۱۱	کشت و صنعت شریف آباد	۵۸,۷۸۳,۱۰۷	۷,۳۳۱	۴۳۰,۹۳۴,۶۲۵,۴۸۷	۷۹,۱۴۸,۵۸۴,۴۶۷
	مجموع	۶,۴۷۸,۶۳۲,۵۰۷		۲۶,۶۷۷,۷۸۰,۶۲۵,۰۹۹	۶,۵۶۱,۰۷۲,۰۶۲,۸۱۱

فروش سهام				۱۴۰۰/۱۱/۳۰		
ردیف	سهام	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش	بازده
۱	بانک دی	(۱,۵۳۴,۰۷۹,۰۸۱)	۹,۰۹۴	۱۳,۹۵۰,۷۱۲,۲۲۸,۸۹۶	۳,۷۶۵,۵۸۳,۹۲۸,۱۶۷	۴۹.۳۸٪
۲	بیمه دی	(۱۸۱,۳۵۶,۸۹۴)	۱۴,۲۷۵	۲,۵۸۸,۸۸۴,۲۱۸,۱۳۸	۳۲۵,۸۵۴,۳۷۸,۷۳۵	-۸.۷۱٪
۳	تولید نیروی برق دماوند	(۹۹,۰۹۳,۳۲۴)	۴۷,۴۲۳	۴,۶۹۹,۳۳۷,۴۳۳,۶۵۳	۱,۲۶۳,۴۱۶,۰۰۳,۷۱۳	-۱۸.۵۱٪
۴	خوراک دام پارس	(۱,۱۷۲,۱۰۲)	۳۹۲,۳۹۷	۴۵۹,۹۲۹,۵۶۲,۳۷۹	۴۳,۹۳۱,۳۴۱,۴۷۶	-۱۲.۷۱٪
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	(۲۳,۹۷۲,۵۲۷)	۴,۸۸۳	۱۱۷,۰۵۸,۱۳۳,۷۰۷	۲۱,۶۷۴,۳۲۳,۲۲۴	-۲۳.۲۹٪
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	(۵,۷۵۷,۰۳۳)	۱۸,۷۱۸	۱۰۷,۷۶۰,۸۵۴,۶۱۹	۸۸,۵۴۷,۰۸۸,۰۵۹	-۱۹.۱۸٪
۷	سرمایه گذاری بوعلی	(۱۴۹,۵۴۵,۶۶۳)	۶,۰۸۷	۹۱۰,۲۳۴,۰۵۳,۹۹۶	۴۱۹,۶۸۸,۳۵۶,۶۲۳	-۷.۷۰٪
۸	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	(۶,۲۴۹,۵۰۳)	۳۲,۳۴۲	۲۰۲,۱۱۸,۳۵۰,۶۰۳	۶۴,۹۵۴,۲۲۷,۶۴۱	۲.۹۸٪
۹	مجموع تولید گوشت مرغ ماهان	(۲۱,۴۲۰,۰۲۲)	۱۹,۴۸۸	۴۱۷,۴۳۹,۴۲۰,۰۱۲	۲۳,۷۹۳,۹۲۴,۴۱۴	-۴.۲۳٪
۱۰	نیروگاه زاگرس کوثر	(۸,۹۵۳,۲۷۵)	۴,۷۲۸	۴۲,۳۳۴,۶۵۵,۵۷۸	۲۷,۷۱۴,۷۶۲,۶۲۴	-۳۵.۲۳٪
۱۱	کشت و صنعت شریف آباد	(۳۳,۰۱۷,۰۸۰)	۹,۲۹۴	۳۰۶,۸۷۷,۲۰۴,۰۲۹	۷۱,۴۴۶,۳۸۴,۳۷۴	-۱۰.۴۳٪
	مجموع	(۲,۰۶۴,۶۱۶,۵۰۴)		۲۳,۸۰۲,۶۸۶,۱۱۵,۶۱۰	۶,۱۱۶,۶۰۴,۷۱۹,۰۵۰	

۵- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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