

# گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی منتهی به

۳۰ آبان ماه ۱۴۰۱

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

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)  
شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار  
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی گروه دی  
ثبت شده شماره ۳۹۱۷۴ داد.م.ح. ثبت.ش.کلیا.م.نوسانات غیر تجاری تهران

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 منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۱ 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 ۱۴۰۱/۰۸/۲۸ 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 هـ 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، زماهان، زشریف، غدام، آوا، 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 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 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 یک سال شمسی بوده (تا پایان ۱۴۰۲/۰۴/۲۸) 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](http://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 رازدار
متولی	مشاور سرمایه گذاری 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.





### ۳-۲- 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	۳۵.۰۰۰	۱۰۰

### ۴-۲- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۸/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۱۰,۴۵۶,۷۸۸,۳۳۱,۰۰۱
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۶,۶۵۸,۰۱۴
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۶,۶۴۹,۴۸۶
۴	گواهی های ممتاز	۳۵,۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۵۳۷,۵۷۱

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 منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۱ مبلغ ۶,۶۴۹,۴۸۶ ریال می باشد.

### ۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۸/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۱/۰۸/۲۳	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۰.۲۲۹٪	۰.۰۳٪
یک ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۷/۳۰	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	(۱.۷۲۵)٪	۷.۶۱۲٪
۳ ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۴.۴۳٪	(۱.۵۹۸)٪
۶ ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۳/۰۴	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	(۱.۶۸۵)٪	(۹.۹۶۴)٪
یک سال اخیر	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۷.۱۹۶٪	۱.۵۶۲٪
از شروع فعالیت نام	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۵۶۴.۰۹۸٪	۱۷۲۵.۰۱۱٪
حداکثر بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			۱۹.۳۹٪	۱۴.۱۳٪
حداقل بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			(۵۱.۵۴)٪	(۹.۵۵)٪

کارگزاری بازار سرمایه ایران  
شماره ثبت: ۱۶۴۹۶  
شماره ۳۹۱۷۴  
تاسیس به شماره ۱۱۲۳۶  
بازارگردانی گروه دی  
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی گروه دی

#### ۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱ مطابق جداول ذیل می باشد.

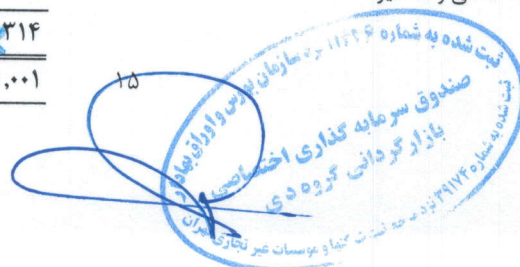
#### صورت گردش خالص دارایی ها

صورت گردش خالص دارایی ها				
دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰		دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۱		یادداشت
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۷,۶۰۷,۲۶۶,۴۴۶,۳۲۷	۷۳۱,۰۲۳	۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۹۴۳	۱,۲۲۴,۵۹۸	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۷۱۳,۲۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۳,۲۳۰	۳۴۷,۹۷۳,۰۰۰,۰۰۰	۳۴۷,۹۷۳	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۲۱۹,۸۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۱۹,۸۰۰)	.	.	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۲,۸۲۶,۹۷۷,۸۳۳,۷۰۹)	.	(۸۱۶,۶۰۲,۵۶۳,۶۷۳)	.	سود(زیان) خالص
۲,۳۲۱,۶۸۵,۲۸۱,۸۲۳	.	۴,۳۴۷,۷۲۹,۹۲۲,۷۳۷	.	۲۳ تعدیلات
۷,۵۹۵,۴۰۳,۸۹۵,۴۴۱	۱,۲۲۴,۴۵۳	۱۰,۴۵۶,۷۸۸,۳۳۱,۰۰۷	۱,۵۷۲,۵۷۱	

#### صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۰/۱۱/۳۰	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	یادداشت	دارایی ها
ریال	ریال		
۶,۱۱۶,۶۰۴,۷۱۹,۰۴۵	۹,۰۰۵,۸۵۲,۵۹۹,۳۹۲	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۴۱۱,۱۰۷,۰۶۶,۳۴۷	۱,۵۷۵,۱۸۵,۸۲۶,۳۴۹	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۸۰۰,۰۲۹,۵۵۷	.	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا
۱,۵۱۶,۸۰۴,۷۶۲,۹۲۳	۱,۴۵۵,۹۳۲,۸۱۶,۸۳۶	۸	حساب های دریافتی
۳,۰۶۴,۳۱۲,۶۶۲	.	۹	جاری کارگزاران
۸۴۲,۷۹۳,۹۵۴	۶۹۵,۲۲۴,۶۱۰	۱۰	سایر دارایی ها
۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۶۱۶,۰۸,۰۰۰	۱۱	موجودی نقد
۸,۰۴۹,۲۳۳,۶۸۴,۴۸۸	۱۲,۰۳۷,۷۲۸,۰۷۵,۱۸۷		جمع دارایی ها
.	۴۶,۵۰۸,۹۱۷,۶۶۴		بدهی ها
۱۸۱,۷۲۹,۴۶۵,۵۱۵	۲۵۳,۵۲۲,۶۲۷,۱۶۲	۱۲	جاری کارگزاران
۹,۹۷۱,۷۲۹,۸۰۵	.	۱۳	بدهی به ارکان صندوق
۱,۲۷۹,۸۴۴,۵۱۷,۳۵۳	۱,۲۸۰,۹۰۸,۱۹۹,۴۸۸	۱۴	بدهی به سرمایه گذاران
۱,۴۷۱,۵۴۵,۷۱۲,۶۷۳	۱,۵۸۰,۹۳۹,۷۴۴,۳۱۴		سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱۰,۴۵۶,۷۸۸,۳۳۱,۰۰۱	۱۵	جمع بدهی ها
			خالص دارایی ها

شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰





## صورت سود و زیان

	دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰	دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۱	یادداشت	
	ریال	ریال		درآمدها:
	(۲۲۷,۱۴۳,۳۲۵,۲۶۷)	۲۲۷,۹۹۷,۷۱۰,۶۳۵	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
	(۲,۹۴۳,۳۸۱,۶۸۴,۲۱۹)	(۱,۱۶۵,۰۰۰,۹۶۸,۲۳۱)	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
	۳۹۱,۷۰۰,۵۶۶,۶۶۹	۱۴۶,۱۹۷,۹۲۷,۴۷۳	۱۸	سود سهام
	۱۷,۰۵۸,۰۳۷,۰۴۴	۴۸,۷۱۶,۰۰۴,۷۷۹	۱۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
	۶۶,۹۸۹,۹۴۰	۴۷,۶۴۷,۹۵۹	۲۰	سایر درآمدها
	<b>(۲,۷۶۱,۶۹۹,۴۱۵,۸۳۳)</b>	<b>(۷۴۲,۰۴۱,۶۷۷,۳۸۵)</b>		<b>جمع درآمدها</b>
				هزینه ها:
	۶۴,۵۳۳,۴۷۶,۲۷۳	۷۲,۶۴۴,۰۶۹,۰۰۲	۲۱	هزینه کارمزد از کان
	۷۴۴,۹۴۰,۶۰۳	۱,۹۱۶,۸۱۷,۲۸۶	۲۲	سایر هزینه ها
	۶۵,۲۷۸,۴۱۶,۸۷۶	۷۴,۵۶۰,۸۸۶,۲۸۸		<b>جمع هزینه ها</b>
	<b>(۲,۸۲۶,۹۷۷,۸۳۲,۷۰۹)</b>	<b>(۸۱۶,۶۰۲,۵۶۳,۶۷۳)</b>		<b>سود خالص</b>

## ۵- گزارش عملیاتی


خرید طی دوره						
ردیف	سهام	نماد	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	دی ۱	۱۰,۸۴۵,۱۰۲,۲۸۹	۱,۴۵۷	۱۵,۸۰۴,۱۵۸,۹۵۹,۵۶۱	۵,۵۶۷,۳۳۴,۳۷۶,۱۷۰
۲	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی ۱	۴۵۹,۳۲۳,۱۶۰	۳,۹۶۷	۱,۸۲۲,۲۳۳,۴۹۸,۵۳۱	۱,۰۰۲,۰۶۶,۶۲۶,۰۴۰
۳	بیمه دی	ودی ۱	۳۲۲,۳۲۶,۵۵۷	۱۱,۰۳۳	۳,۵۵۶,۱۶۸,۰۷۹,۲۲۲	۶۲۴,۳۶۲,۵۷۵,۹۹۶
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند ۱	۲۲۸,۸۷۸,۵۷۱	۳۴,۸۲۹	۷,۹۷۱,۶۴۶,۵۹۱,۱۴۱	۱,۹۳۶,۱۴۱,۲۸۹,۷۴۵
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف ۱	۷۲,۷۲۳,۸۱۰	۶,۶۶۴	۴۸۴,۶۱۶,۶۶۴,۲۳۷	۹۸,۳۹۲,۶۶۰,۴۸۴
۶	مجمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان ۱	۳۳,۵۱۴,۲۶۷	۱۵,۷۴۵	۵۲۷,۶۶۶,۴۱۸,۷۸۲	۳۱,۰۵۵,۰۲۹,۷۲۰
۷	خوراک دام پارس	غدام ۱	۳,۹۵۸,۶۷۰	۱۵۷,۳۵۸	۶۲۲,۹۲۹,۶۴۴,۸۹۹	۶۱,۵۶۹,۰۹۴,۰۳۸
۸	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر ۱	۱۹,۲۴۵,۱۳۱	۱۷,۸۴۶	۳۴۳,۴۵۶,۴۸۱,۵۷۲	۱۱۰,۵۹۴,۸۹۲,۴۲۰
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاگرس ۱	۴۶,۸۲۱,۶۹۶	۴,۹۳۸	۲۳۱,۲۰۱,۹۴۱,۱۴۱	۵۷,۷۱۳,۴۹۵,۱۲۰
۱۰	سرمایه گذاری آوا نوین	وآوا ۱	۷۳,۳۳۴,۳۹۱	۴,۲۶۹	۳۱۳,۰۳۴,۳۰۴,۱۷۷	۷۸,۰۲۷,۴۴۵,۸۹۲
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکسا ۱	۸,۰۸۵,۸۲۳	۲۲,۷۳۱	۲۶۴,۶۵۸,۰۲۱,۲۲۸	۳۴,۱۵۳,۰۴۶,۷۰۰
	مجموع		۱۲,۱۱۳,۳۱۴,۳۶۵		۳۱۹,۴۱۷,۷۷۰,۶۰۴,۴۹۱	۹,۶۰۱,۴۱۰,۵۳۲,۳۲۵

شماره ثبت: ۱۶۲۹۶۰

فروش سهام طی دوره							
ردیف	سهام	نماد	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش	بازده
۱	بانک دی	دی	(۲,۰۶۳,۸۱۷,۷۸۴)	۶,۹۴۹	۱۴,۳۴۰,۸۷۷,۹۱۷,۳۶۶	۵,۵۶۳,۱۰۳,۲۰۲,۰۴۴	۲۷/۰۵%
۲	سرمایه‌گذاری پوعلی	وبوعلی	(۱۵۹,۵۸۶,۲۷۶)	۵,۹۵۱	۹۴۹,۷۷۵,۹۰۸,۲۷۲	۷۱۷,۳۲۴,۲۵۶,۱۰۴	۷/۲۷%
۳	بیمه دی	ودی	(۲۰۶,۱۱۵,۳۲۴)	۱۳,۲۰۷	۲,۷۲۲,۱۷۶,۴۸۴,۸۶۳	۴۳۵,۶۹۳,۱۶۷,۵۶۱	-۵/۷۳%
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند	(۱۱۹,۸۸۹,۲۸۴)	۴۲,۸۰۲	۵,۱۳۱,۵۲۷,۸۳۸,۴۵۱	۱,۸۶۳,۳۸۹,۴۴۷,۴۷۸	-۱۱/۳۶%
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف	(۴۸,۹۲۴,۷۴۴)	۷,۶۴۹	۳۷۴,۲۴۰,۹۵۰,۶۸۰	۸۴,۱۱۳,۳۲۱,۶۹۷	-۲/۴۹%
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان	(۲۹,۲۷۱,۸۶۸)	۱۶,۵۲۲	۴۸۳,۶۳۸,۹۲۰,۵۴۸	۲۸,۷۴۱,۶۰۴,۹۸۶	-۲/۴۶%
۷	خوراک دام پارس	غدام	(۲,۲۱۳,۶۰۳)	۲۲۵,۱۰۲	۴۹۸,۲۸۶,۸۴۴,۷۸۹	۶۱,۴۸۴,۲۹۸,۸۱۳	-۱۰/۱۳%
۸	سرمایه‌گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر	(۱۱,۶۳۰,۶۹۸)	۱۷,۱۱۴	۱۹۹,۰۵۰,۲۴۸,۹۱۵	۹۷,۰۸۶,۳۲۲,۳۵۵	-۹/۵۴%
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاگرس	(۳۲,۲۵۰,۲۸۸)	۴,۵۷۲	۱۴۷,۴۶۴,۲۰۴,۳۲۳	۵۵,۱۸۳,۶۶۴,۸۳۶	-۱۱/۲۷%
۱۰	سرمایه‌گذاری آوا نوین	وآوا	(۴۵,۳۵۹,۶۶۴)	۴,۱۳۷	۱۸۷,۶۶۴,۱۳۵,۹۲۶	۶۶,۹۷۶,۵۰۵,۰۳۳	-۱۵/۱۴%
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا	(۶,۳۴۹,۵۰۳)	۳۲,۳۸۷	۲۰۵,۶۴۳,۲۶۹,۶۷۹	۳۲,۷۵۶,۸۰۷,۴۹۲	-۹/۴۰%
مجموع					۳۵,۲۴۰,۳۴۶,۷۲۳,۸۱۲	۹,۰۰۵,۸۵۲,۵۹۹,۳۹۸	

### ۶- 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

