

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به

۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۱

« 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 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 ۱۴۰۱/۱۰/۱۷ 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، زماهان، زشریف، غدام، آوا، براگرس 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 سبأ 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

علاقمندان 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

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

واحدهای 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.

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۲-۳- مشخصات دارندگان واحد های سرمایه گذاری ممتاز

اسامی و مشخصات دارندگان واحد های 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 ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۷,۵۰۳,۶۳۶
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۷,۴۹۳,۵۳۱
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۶۳۸,۷۷۷

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 ۱۴۰۱ مبلغ ۷,۴۹۳,۵۳۱ ریال می باشد.

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۱/۱۱/۲۳	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	(۱.۸۴۴)%	(۰.۸۱۶)%
یک ماه اخیر	۱۴۰۱/۱۰/۳۰	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	(۱۴.۵۸۷)%	(۹.۲۲۲)%
۳ ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۱۲.۶۹۳%	۸.۸۵۸%
۶ ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۶/۰۱	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۱۷.۶۸۶%	۷.۱۱۸%
یک سال اخیر	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۳۹.۵۱%	۱۹.۵۹%
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۶۴۸.۳۹۴%	۱۸۸۶.۶۶۴%
حداکثر بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			۱۹.۳۹%	۱۴.۱۳%
حداقل بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			(۵۱.۵۴)%	(۹.۵۵)%

۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۸/۳۰

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت گردش خالص دارایی ها

صورت گردش خالص دارایی ها				یادداشت
سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰		سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۷,۶۰۷,۲۶۶,۴۴۶,۴۵۵	۷۳۱,۰۲۳	۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱,۲۲۴,۵۹۸	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۷۱۳,۳۷۵,۰۰۰,۰۰۰	۷۱۳,۳۷۵	۵۰۶,۲۰۹,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۶,۲۰۹	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۲۱۹,۸۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۱۹,۸۰۰)	(۵۷,۰۳۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۵۷,۰۳۰)	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۴,۰۲۰,۴۱۲,۲۷۹,۰۵۴)	۰	۴۶۱,۵۸۹,۷۴۸,۰۱۴	۰	سود(زیان) خالص
۲,۴۹۷,۲۵۸,۸۰۴,۵۴۲	۰	۵,۰۵۴,۰۴۳,۱۹۳,۱۷۵	۰	تعدیلات
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۹۴۳	۱,۲۲۴,۵۹۸	۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱,۶۷۳,۷۷۷	

صورت خالص دارایی ها

صورت خالص دارایی ها
در تاریخ ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۱

۱۴۰۰/۱۱/۳۰	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	یادداشت
ریال	ریال	
۶,۱۱۶,۶۰۴,۷۱۹,۰۴۵	۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۶۸	۵ سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم دارایی ها
۴۱۱,۱۰۷,۰۶۶,۳۴۷	۱,۳۰۷,۹۷۳,۸۱۸,۸۴۱	۶ سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۸۰۰,۰۲۹,۵۵۷	۰	۷ سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا
۱,۵۱۶,۸۰۴,۷۶۲,۹۲۳	۵,۲۳۳,۸۳۸,۹۶۰	۸ حساب های دریافتی
۳,۰۶۴,۳۱۲,۶۶۲	۰	۹ جاری کارگزاران
۸۴۲,۷۹۳,۹۵۴	۲۵۱,۷۶۱,۰۴۰	۱۰ سایر دارایی ها
۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۶۷۳,۲۱۹,۵۸۸	۱۱ موجودی نقد
۸,۰۴۹,۲۳۳,۶۸۴,۴۸۸	۱۲,۶۷۵,۰۳۴,۷۷۷,۸۹۷	جمع دارایی ها
۰	۶۰,۲۰۲,۳۸۹,۹۵۹	بدهی جاری کارگزاران
۱۸۱,۷۲۹,۴۶۵,۵۱۵	۶۴,۸۰۵,۰۷۹,۱۱۴	۱۲ بدهی به ارکان صندوق
۹,۹۷۱,۷۲۹,۸۰۵	۱۳,۹۴۰,۱۵۹	۱۳ بدهی به سرمایه گذاران
۱,۲۷۹,۸۴۴,۵۱۷,۳۵۳	۷,۵۱۴,۴۵۵,۶۶۱	۱۴ سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱,۴۷۱,۵۴۵,۷۱۲,۶۷۳	۱۳۲,۵۳۴,۸۶۴,۸۹۳	جمع بدهی ها
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱۵ خالص دارایی ها

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها
سال مالی منتهی ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۱

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰	یادداشت	درآمدها:
ریال	ریال		
(۳۱۵,۱۵۰,۱۸۸,۴۸۴)	۲۶۶,۳۶۷,۷۸۱,۰۴۷	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۴۰,۵۸,۲۳۸,۱۷۶,۲۹۲)	۶۳,۰۲۷,۳۹۱,۴۴۸	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۴۱۲,۵۹۱,۸۹۲,۶۲۶	۱۴۸,۸۹۳,۰۹۰,۶۷۸	۱۸	سود سهام
۲۶,۷۰۲,۳۱۹,۲۰۷	۹۳,۵۰۹,۱۹۶,۶۷۴	۱۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۶۶,۹۸۹,۹۴۰	۴۷,۶۴۷,۹۵۹	۲۰	سایر درآمدها
(۳,۹۳۴,۰۲۷,۱۶۳,۰۰۳)	۵۷۱,۸۴۵,۱۰۷,۸۰۶		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۸۵,۳۹۶,۲۲۵,۲۴۷	۱۰۶,۸۵۹,۷۴۲,۲۵۶	۲۱	هزینه کارمزد ارکان
۹۸۸,۸۹۰,۸۰۴	۳,۳۹۵,۶۱۷,۵۳۶	۲۲	سایر هزینه ها
۸۶,۳۸۵,۱۱۶,۰۵۱	۱۱۰,۲۵۵,۳۵۹,۷۹۲		جمع هزینه ها
(۴,۰۲۰,۴۱۲,۲۷۹,۰۵۴)	۴۶۱,۵۸۹,۷۴۸,۰۱۴		سود خالص

۵- گزارش عملیاتی

خرید سهام طی دوره						
ردیف	سهام	نماد	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	دی ۱	۱۲,۴۹۴,۴۸۲,۳۲۵	۱,۳۶۳	۱۷,۰۲۶,۲۲۱,۵۸۱,۵۶۳	۷,۸۴۳,۴۹۳,۳۰۱,۰۴۲
۲	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی ۱	۴۶۷,۸۰۸,۸۳۹	۳,۹۴۰	۱,۸۴۲,۹۴۹,۰۹۵,۹۰۲	۱,۰۱۴,۴۰۱,۷۵۶,۴۸۹
۳	بیمه دی	ودی ۱	۳۲۲,۳۲۶,۵۵۷	۱۱,۰۳۳	۳,۵۵۶,۱۶۸,۰۷۹,۲۲۲	۶۱۸,۱۱۹,۷۴۸,۸۷۹
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند ۱	۲۳۲,۶۰۶,۶۵۱	۳۴,۵۹۰	۸,۰۴۵,۹۲۵,۳۰۰,۹۱۱	۱,۹۴۳,۸۵۷,۸۱۴,۲۳۵
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف ۱	۷۲,۷۲۳,۸۱۰	۶,۶۶۴	۴۸۴,۶۱۶,۶۶۴,۲۳۷	۱۱۷,۳۸۴,۳۱۵,۱۵۲
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان ۱	۳۳,۵۱۴,۲۶۷	۱۵,۷۴۵	۵۲۷,۶۶۶,۴۱۸,۷۸۲	۳۲,۷۵۱,۹۸۹,۳۲۰
۷	خوراک دام پارس	غدام ۱	۳,۹۵۸,۶۷۰	۱۵۷,۳۵۸	۶۲۲,۹۲۹,۶۴۴,۸۹۹	۷۱,۰۶۲,۳۵۸,۵۱۸
۸	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر ۱	۱۹,۲۴۵,۱۳۱	۱۷,۸۴۶	۳۴۳,۴۵۶,۴۸۱,۵۷۲	۱۳۰,۴۱۷,۵۱۰,۹۹۰
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاگرس ۱	۴۶,۸۲۱,۶۹۶	۴,۹۳۸	۲۳۱,۲۰۱,۹۴۱,۱۴۱	۵۸,۱۶۵,۲۰۸,۷۶۸
۱۰	سرمایه گذاری آوانوبین	وآوا ۱	۷۳,۳۳۴,۳۹۱	۴,۲۶۹	۳۱۳,۰۳۴,۳۰۴,۱۷۷	۸۹,۶۹۲,۹۰۷,۰۵۱
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورز تکشا	تکشا ۱	۸,۰۸۵,۸۲۳	۳۲,۷۳۱	۲۶۴,۶۵۸,۰۲۱,۲۲۸	۴۷,۹۰۴,۷۰۱,۱۰۰
	مجموع				۳۳,۲۵۸,۸۲۷,۵۳۳,۶۳۴	۱۱,۹۵۷,۲۵۱,۵۱۱,۵۴۴

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

فروش طی دوره								
بازده	خالص ارزش فروش	فروش	قیمت میانگین	میانگین فروش	تعداد فروش	نماد	سهام	ردیف
۳۲/۰۸٪	۷,۸۳۷,۵۳۲,۲۴۶,۱۳۳	۱۴,۴۷۵,۱۸۴,۹۹۹,۶۳۴	۱,۱۳۶	۶,۵۳۶	(۲,۲۱۴,۶۷۴,۵۹۱)	دی ۱	بانک دی	۱
۷/۰۰٪	۷۲۹,۶۵۰,۰۱۱,۸۵۴	۹۵۴,۶۷۲,۸۲۹,۰۹۸	۲,۸۲۹	۵,۹۱۵	(۱۶۱,۳۸۶,۲۷۶)	وبوعلی ۱	سرمایه گذاری بوعلی	۲
-۵/۴۷٪	۴۲۹,۴۵۵,۰۸۴,۹۹۲	۲,۷۳۷,۵۹۴,۳۵۸,۵۰۴	۶,۹۸۰	۱۳,۰۷۹	(۲۰۹,۳۱۵,۳۲۴)	ودی ۱	بیمه دی	۳
-۱۱/۱۸٪	۱,۸۷۱,۱۰۰,۱۰۷,۴۰۹	۵,۲۰۴,۱۸۱,۲۶۹,۸۶۷	۲۴,۲۶۴	۴۲,۱۰۱	(۱۲۲,۶۱۲,۲۸۴)	دماوند ۱	تولید نیروی برق دماوند	۴
۱/۴۳٪	۱۰۳,۰۹۰,۵۴۲,۷۰۷	۳۷۴,۲۴۰,۹۵۰,۶۸۰	۴,۱۵۹	۷,۶۴۹	(۴۸,۹۲۴,۷۴۴)	زشریف ۱	کشت و صنعت شریف آباد	۵
-۳/۱۴٪	۳۰,۴۳۷,۲۷۴,۸۹۷	۴۸۳,۶۳۸,۹۲۰,۵۴۸	۸,۲۶۰	۱۶,۵۲۲	(۲۹,۲۷۱,۸۶۸)	زماهان ۱	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	۶
-۸/۶۱٪	۷۰,۹۷۰,۲۴۸,۴۸۸	۴۹۸,۲۸۶,۸۴۴,۷۸۹	۴۷,۰۵۴	۲۳۵,۱۰۲	(۲,۲۱۳,۶۰۳)	غدام ۱	خوراک دام پارس	۷
-۶/۶۸٪	۱۰۶,۹۰۱,۴۷۶,۷۳۴	۱۹۹,۰۵۰,۲۴۸,۹۱۵	۱۶,۵۱۵	۱۷,۱۱۴	(۱۱,۶۳۰,۶۹۸)	زکوثر ۱	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۸
-۱۱/۰۸٪	۵۵,۶۳۵,۰۳۵,۱۸۲	۱۴۷,۴۶۴,۲۰۴,۳۲۳	۴,۷۹۲	۴,۵۷۲	(۳۲,۲۵۰,۲۸۸)	بزاگرس ۱	نیروگاه زاگرس کوثر	۹
-۱۱/۴۲٪	۷۸,۶۳۳,۱۰۰,۴۴۲	۱۸۷,۶۶۴,۱۳۵,۹۲۶	۲,۹۴۴	۴,۱۳۷	(۴۵,۳۵۹,۶۶۴)	وآوا ۱	سرمایه گذاری آوانسین	۱۰
-۴/۲۱٪	۴۶,۴۹۸,۰۱۰,۶۳۴	۲۰۵,۶۴۳,۳۶۹,۶۷۹	۳۶,۶۶۲	۳۲,۳۸۷	(۶,۳۴۹,۵۰۳)	نکشا ۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	۱۱
	۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۷۲	۲۵,۴۶۷,۶۲۲,۰۳۱,۹۶۳				مجموع		

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