

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی منتهی به

۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۲

« 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 دوره مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۲ 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 ۱۴۰۲/۰۳/۱۰ 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 ۱۳/۰۵/۱۳۹۵ تحت شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و شماره ۳۹۱۷۴ نزد مرجع ثبت شرکت ها 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 پذیره نویسی 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 سپا 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

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

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	۳۵۰۰۰	۱۰۰

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۲۱,۶۳۲,۴۱۵,۶۶۳,۳۱۷
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۸,۰۰۳,۴۴۱
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۷,۹۷۸,۵۳۱
۴	گواهی های ممتاز	۳۵,۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۱۶۸,۲۳۶

شاخص ارزیابی صندوق های سرمایه گذاری، خالص ارزش دارایی های صندوق (NAV) به ازای هر واحد می باشد.

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۲/۰۲/۲۴	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	٪۳۱.۲۸	٪۰.۷۳
یک ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	٪۴۶.۳۵	٪(۰.۹۲)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۱/۱۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	٪۱۳۱.۷۳	٪۴۴.۴۴
۶ ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۹/۰۱	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	٪۱۷۲.۶۶	٪۶۳.۵۸
یک سال اخیر	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	٪۱۶۹.۲۸	٪۴۵.۷۷
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۱۷/۱۷	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	٪۱,۶۹۵.۵۵	٪۸۵۰۳.۵۱

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۱/۱۱/۳۰	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	یادداشت	
ریال	ریال		
			دارایی ها
۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۶۸	۲۰,۱۳۵,۰۷۹,۲۵۵,۸۲۵	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۳۰۷,۹۷۳,۸۱۸,۸۴۱	۱,۵۸۰,۳۷۷,۳۷۷,۶۶۴	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده
۵,۲۳۳,۸۳۸,۹۶۰	۸,۵۸۱,۱۸۲,۳۹۶	۷	حساب های دریافتی
۲۵۱,۷۶۱,۰۴۰	۱,۰۵۸,۹۹۳,۲۰۹	۸	سایر دارایی ها
۱,۶۷۲,۲۱۹,۵۸۸	۲۸۷,۰۵۴,۶۸۴	۹	موجودی نقد
۱۲,۶۷۵,۰۳۴,۷۷۷,۸۹۷	۲۱,۷۲۵,۳۸۳,۸۶۳,۷۷۸		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۶۰,۲۰۲,۳۸۹,۹۵۹	۳۲,۷۴۲,۰۷۵,۴۵۳	۱۰	جاری کارگزاران
۶۴,۸۰۵,۰۷۹,۱۱۴	۵۰,۵۲۰,۳۵۹,۵۳۳	۱۱	بدهی به ارکان صندوق
۱۲,۹۴۰,۱۵۹	۵۲۵,۶۹۵	۱۲	بدهی به سرمایه گذاران
۷,۵۱۴,۴۵۵,۶۶۱	۹,۷۰۵,۲۳۹,۷۸۰	۱۳	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱۳۲,۵۳۴,۸۶۴,۸۹۳	۹۲,۹۶۸,۲۰۰,۴۶۱		جمع بدهی ها
۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۲۱,۶۳۲,۴۱۵,۶۶۳,۳۱۷	۱۴	خالص دارایی ها
۷,۴۹۳,۵۳۱	۱۷,۹۷۸,۵۳۱		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت سود و زیان

۱۴۰۱/۰۲/۳۱		۱۴۰۲/۰۲/۳۱		یادداشت	
ریال		ریال			درآمدها:
۱۴۰,۳۷۶,۲۷۷,۵۵۴		۸۸۲,۵۵۵,۵۵۷,۲۲۹		۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱,۳۶۳,۴۴۰,۰۰۳,۱۱۹		۸,۶۴۳,۳۴۹,۵۸۶,۹۳۱		۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۷,۷۶۱,۷۵۱,۵۲۲		۸,۵۴۵,۱۰۰,۰۷۶		۱۷	سود سهام
۱۰,۷۵۵,۳۱۲,۲۲۶		۳۱,۲۰۴,۶۱۰,۵۷۳		۱۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۷,۶۴۷,۹۵۹		۰		۱۹	سایر درآمدها
۱,۵۲۲,۳۸۰,۹۹۲,۳۸۰		۹,۵۶۵,۶۵۴,۸۵۴,۸۰۹			جمع درآمدها
هزینه ها:					
۲۱,۹۳۲,۹۱۹,۰۸۴		۵۱,۷۴۸,۲۴۷,۲۷۳		۲۰	هزینه کارمزد ارکان
۲۴۷,۰۱۹,۰۷۵		۱,۹۳۱,۳۰۷,۵۵۶		۲۱	سایر هزینه ها
۲۲,۱۷۹,۹۳۸,۱۵۹		۵۳,۶۷۹,۵۵۴,۸۲۹			جمع هزینه ها
۱,۵۰۰,۲۰۱,۰۵۴,۲۲۱		۹,۵۱۱,۹۷۵,۲۹۹,۹۸۰			سود خالص
۲۰.۱۳%		۵۲.۲۶%			بازده میانگین سرمایه گذاری (درصد)
۱۸.۳۵%		۴۳.۹۷%			بازده سرمایه گذاری پایان دوره (درصد)

صورت گردش خالص دارایی ها

۱۴۰۱/۰۲/۳۱		۱۴۰۲/۰۲/۳۱		یادداشت	
ریال	تعداد	ریال	تعداد		
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱,۲۲۴,۵۹۸	۱۲,۵۴۲,۴۹۹,۹۱۳,۰۰۴	۱,۶۷۲,۷۷۷		خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۴۸,۰۰۰,۰۰۰	۴۸	۱,۴۷۲,۰۰۰,۰۰۰	۱,۴۷۲		واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
۰	۰	(۴۷۲,۰۱۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۴۷۲,۰۱۳)		واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۱,۵۰۰,۲۰۱,۰۵۴,۲۲۱	۰	۹,۵۱۱,۹۷۵,۲۹۹,۹۸۰	۰		سود (زیان) خالص
۹۸,۳۱۶,۳۳۳,۴۶۶	۰	۴۸,۴۸۱,۴۵۰,۳۳۳	۰	۲۲	تعدیلات
۸,۱۷۶,۲۵۳,۳۵۹,۶۳۰	۱,۲۲۴,۶۴۶	۲۱,۶۲۲,۴۱۵,۶۶۳,۳۱۷	۱,۲۰۳,۲۳۶		

کارگزاری بانک دی (سپاسی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۵- گزارش عملیاتی

خرید سهام طی دوره						
ردیف	سهام	نماد	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	دی 1	۱۳,۸۰۶,۸۹۶,۹۵۴	۱,۳۴۶	۱۸,۵۸۴,۰۸۸,۲۶۰,۳۸۹	۱۵,۲۶۹,۳۸۸,۸۷۴,۷۳۲
۲	سرمایه‌گذاری بوعلی	وبوعلی 1	۴۷۹,۲۳۸,۸۸۴	۳,۹۳۱	۱,۸۸۳,۷۳۸,۷۸۸,۲۰۴	۱,۵۱۱,۶۹۴,۷۴۴,۳۸۸
۳	بیمه دی	ودی 1	۳۲۲,۳۲۶,۵۵۷	۱۱,۰۲۳	۳,۵۵۶,۱۶۸,۰۷۹,۲۲۲	۹۲۰,۶۳۱,۳۴۰,۲۹۰
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند 1	۲۴۴,۳۴۰,۵۶۱	۳۴,۱۱۳	۸,۳۳۵,۲۴۸,۱۷۵,۵۲۱	۲,۶۸۱,۶۱۹,۱۴۳,۶۷۵
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف 1	۷۲,۷۲۳,۸۱۰	۶,۶۶۴	۴۸۴,۶۱۶,۶۶۴,۲۳۷	۱۶۹,۱۴۷,۲۸۳,۷۰۲
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان 1	۳۳,۵۱۴,۲۶۷	۱۵,۷۴۵	۵۲۷,۶۶۶,۴۱۸,۷۸۲	۴۹,۰۰۰,۳۷۷,۴۹۰
۷	خوراک دام پارس	غدام 1	۳,۹۵۸,۶۷۰	۱۵۷,۳۵۸	۶۲۲,۹۲۹,۶۴۴,۸۹۹	۱۱۸,۹۱۱,۹۹۵,۶۵۸
		مجموع			۳۳,۹۹۴,۴۵۶,۰۳۱,۲۵۴	۲۰,۷۲۰,۳۹۳,۷۵۹,۹۳۵

فروش سهام طی دوره						
ردیف	سهام	نماد	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش
۱	بانک دی	دی 1	(۳,۶۴۰,۸۵۹,۰۸۸)	۴,۴۲۱	۱۶,۰۹۷,۹۹۳,۷۵۵,۰۵۷	۱۵,۲۵۷,۷۸۴,۱۳۹,۱۸۷
۲	سرمایه‌گذاری بوعلی	وبوعلی 1	(۱۷۶,۶۰۱,۳۲۱)	۵,۷۲۷	۱,۰۱۱,۳۶۰,۳۶۲,۱۰۱	۱,۲۲۶,۵۶۵,۰۵۷,۰۸۲
۳	بیمه دی	ودی 1	(۲۲۴,۲۹۵,۳۲۴)	۱۲,۶۱۹	۲,۸۳۰,۲۸۷,۵۴۵,۷۳۲	۷۳۱,۷۳۶,۷۶۷,۵۹۴
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند 1	(۱۳۹,۵۰۹,۸۵۶)	۴۰,۱۶۷	۵,۶۰۳,۷۵۱,۱۰۲,۸۳۵	۲,۶۰۸,۳۰۰,۷۳۸,۲۳۹
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف 1	(۴۸,۹۲۴,۷۴۴)	۷,۶۴۹	۳۷۴,۲۴۰,۹۵۰,۶۸۰	۱۴۶,۷۲۸,۶۳۸,۶۴۰
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان 1	(۳۹,۲۷۱,۸۶۸)	۱۶,۵۲۲	۴۸۳,۶۳۸,۹۲۰,۵۴۸	۴۵,۸۲۵,۴۷۹,۳۳۷
۷	خوراک دام پارس	غدام 1	(۲,۲۱۳,۶۰۳)	۲۲۵,۱۰۲	۴۹۸,۲۸۶,۸۴۴,۷۸۹	۱۱۸,۱۳۸,۴۳۵,۷۵۰
		مجموع			۲۶,۸۹۹,۵۵۹,۴۸۱,۷۴۲	۲۰,۱۳۵,۰۷۹,۲۵۵,۸۲۸

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰