

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی منتهی به

۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۱

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

کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)

شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



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 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 ۱۴۰۱/۱۱/۱۷ 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 ده 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، 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 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 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

۱-۲- 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 غیر قابل انتقال است. واحد سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رای در مجمع بوده قابل انتقال اما غیر قابل 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 ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۸,۱۷۶,۲۵۳,۳۵۹,۶۲۲
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۶,۶۸۵,۵۳۶
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۶,۶۷۶,۴۲۲
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۱۸۹,۶۴۶

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 ۱۴۰۱/۰۸/۳۰ می باشد:

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
یک هفته اخیر	۱۴۰۱/۰۲/۲۴	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	(۲.۲۶۹)%	۰.۰۸۱%
یک ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۲/۰۱	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۵.۳۴۷%	۴.۴۶۱%
۳ ماه اخیر	۱۴۰۰/۱۲/۰۱	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۲۴.۶۹۸%	۲۳.۹۶۵%
۶ ماه اخیر	۱۴۰۰/۰۹/۰۱	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۷.۴۴۳%	۱۲.۲۶۳%
یک سال اخیر	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۱۷.۱۹۲%	۳۶.۷۸۸%
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۱۷/۱۷	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۵۶۶.۷۸۸%	۱۹۴۶.۶۷۷%
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
دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱		دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۷,۶۰۷,۲۶۶,۴۴۶,۳۲۷	۷۳۱,۰۲۳	۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۱,۲۲۴,۵۹۸	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۵۶۲,۸۳۳,۰۰۰,۰۰۰	۵۶۲,۸۳۳	۴۸,۰۰۰,۰۰۰	۴۸	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۱۲۴,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۲۴,۰۰۰)	.	.	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
(۳,۰۲۳,۹۵۳,۹۴۶,۳۳۴)	.	۱,۵۰۰,۲۰۱,۰۵۴,۲۲۱	.	سود (زیان) خالص
۶۴۲,۵۰۴,۵۳۸,۵۸۷	.	۹۸,۳۱۶,۳۳۳,۴۶۶	.	۲۳ تعديلات
۶,۶۶۴,۶۵۰,۰۳۸,۵۸۰	۱,۱۶۹,۸۵۶	۸,۱۷۶,۲۵۳,۳۵۹,۶۳۰	۱,۲۲۴,۶۴۶	

صورت خالص دارایی ها

۱۴۰۰/۱۱/۳۰	۱۴۰۱/۰۲/۳۱	یادداشت	دارایی ها
ریال	ریال		
۶,۱۱۶,۶۰۴,۷۱۹,۰۴۵	۷,۴۹۲,۳۸۷,۱۱۴,۰۰۴	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۴۱۱,۱۰۷,۰۶۶,۳۴۷	۶۵۹,۹۱۳,۸۶۱,۸۹۹	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۸۰۰,۰۲۹,۵۵۷	۸۰۹,۷۱۲,۵۳۲	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا
۱,۵۱۶,۸۰۴,۷۶۲,۹۲۳	۱,۵۰۴,۶۱۴,۱۶۲,۴۰۴	۸	حساب های دریافتی
۳,۰۶۴,۳۱۲,۶۶۲	۱۲,۹۳۹,۸۴۱,۹۱۶	۹	جاری کارگزاران
۸۴۲,۷۹۳,۹۵۴	۶۹۸,۲۲۲,۳۴۵	۱۰	سایر دارایی ها
۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۱	موجودی نقد
۸,۰۴۹,۲۳۳,۶۸۴,۴۸۸	۹,۶۷۱,۳۷۲,۹۱۵,۱۰۰		جمع دارایی ها
			بدهی ها
۱۸۱,۷۲۹,۴۶۵,۵۱۵	۲۰۳,۴۰۴,۳۳۴,۱۰۸	۱۲	بدهی به ارکان صندوق
۹,۹۷۱,۷۲۹,۸۰۵	۱۱,۶۰۷,۳۵۶,۳۳۹	۱۳	بدهی به سرمایه گذاران
۱,۲۷۹,۸۴۴,۵۱۷,۳۵۳	۱,۲۸۰,۱۰۷,۹۶۵,۱۵۹	۱۴	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱,۴۷۱,۵۴۵,۷۱۲,۶۷۳	۱,۴۹۵,۱۱۹,۵۵۵,۶۰۶		جمع بدهی ها
۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۸۱۵	۸,۱۷۶,۲۵۳,۳۵۹,۶۳۲	۱۵	خالص دارایی ها
۵,۳۷۱,۳۰۴	۶,۶۷۶,۴۲۲		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

بانک دی (سهامی خاص)



ثبت شده به شماره ۱۱۳۳۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار



صورت سود و زیان

یادداشت	دوره سه ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱	دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱
درآمدها:		
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۶ ۱۴۰,۲۷۶,۲۷۷,۵۵۴	۲۸,۹۴۲,۲۲۸,۲۶۳
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۷ ۱,۳۶۳,۴۴۰,۰۰۳,۱۱۹	(۲,۲۴۲,۶۸۸,۳۶۴,۳۹۲)
سود سهام	۱۸ ۷,۷۶۱,۷۵۱,۵۲۲	۱۹۷,۶۵۱,۴۰۳,۹۸۵
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۹ ۱۰,۷۵۵,۳۱۲,۲۲۶	۱,۲۵۵,۲۹۹,۸۴۷
سایر درآمدها	۲۰ ۴۷,۶۴۷,۹۵۹	۶۶,۹۸۹,۹۴۰
جمع درآمدها	۱,۵۲۲,۳۸۰,۹۹۲,۳۸۰	(۲,۰۰۴,۷۷۲,۴۴۲,۳۵۷)
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۱ ۲۱,۹۳۲,۹۱۹,۰۸۴	۱۸,۹۶۷,۳۳۲,۵۲۳
سایر هزینه ها	۲۲ ۲۴۷,۰۱۹,۰۷۵	۲۱۴,۱۷۱,۴۵۴
جمع هزینه ها	۲۲,۱۷۹,۹۳۸,۱۵۹	۱۹,۱۸۱,۵۰۳,۹۷۷
سود خالص	۱,۵۰۰,۲۰۱,۰۵۴,۲۲۱	(۲,۰۲۳,۹۵۳,۹۴۶,۳۳۴)

کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)



کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)



۵- گزارش عملیاتی

خرید سهام طی دوره						
ردیف	سهام	نماد	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	دی ۱	۵,۵۵۵,۹۰۱,۸۶۵	۲,۱۵۶	۱۱,۹۷۷,۹۵۷,۶۷۶,۸۳۵	۳,۷۶۸,۴۴۷,۹۴۷,۶۷۱
۲	سرمایه گذاری بوعلی	بوعلی ۱	۲۸۵,۴۸۰,۴۲۹	۶,۰۵۵	۱,۷۲۸,۵۱۳,۴۹۲,۷۰۴	۹۱۲,۳۸۰,۰۶۵,۶۶۰
۳	بیمه دی	ودی ۱	۲۸۸,۹۱۶,۷۸۴	۱۱,۷۳۲	۳,۳۸۹,۶۰۸,۰۳۵,۵۵۱	۶۷۷,۳۲۰,۲۵۰,۲۸۰
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند ۱	۲۰۴,۱۹۲,۹۸۱	۳۶,۵۱۱	۷,۴۵۵,۳۰۲,۰۵۸,۴۸۰	۲,۱۱۵,۸۲۹,۳۴۸,۲۲۵
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف ۱	۶۳,۵۲۷,۰۹۸	۷,۰۶۵	۴۴۸,۸۰۶,۰۵۸,۳۲۰	۸۹,۷۴۶,۹۵۳,۶۲۲
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ملهان	زملهان ۱	۳۰,۳۰۰,۱۹۲	۱۶,۵۵۰	۵۰۱,۴۶۴,۱۲۲,۵۳۳	۳۳,۷۱۵,۵۶۴,۵۰۰
۷	خوراک دام پارس	غدام ۱	۲,۹۵۴,۵۳۷	۱۹۶,۱۶۰	۵۷۹,۵۶۲,۸۲۵,۶۳۷	۶۹,۶۳۴,۱۴۹,۲۱۸
۸	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر ۱	۱۸,۵۲۸,۶۱۹	۱۷,۹۳۱	۳۳۲,۲۳۷,۸۹۴,۵۰۱	۱۳۳,۶۴۶,۴۲۵,۱۹۰
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاگرس ۱	۳۱,۳۰۹,۱۵۲	۴,۹۶۱	۱۵۵,۳۱۹,۴۹۰,۹۹۸	۴۳,۸۷۳,۰۴۶,۶۴۶
۱۰	سرمایه گذاری آوانوین	وآوا ۱	۴۵,۷۸۱,۶۶۴	۵,۰۹۵	۲۳۳,۲۳۸,۵۱۶,۲۵۳	۳۴,۱۲۲,۱۰۱,۸۳۴
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا ۱	۸,۰۸۵,۸۲۳	۳۲,۷۳۱	۲۶۴,۶۵۸,۰۲۱,۲۲۸	۶۸,۰۴۶,۰۱۳,۱۰۰
	جمع				۲۷,۰۶۶,۶۶۸,۱۹۳,۰۴۰	۷,۹۴۶,۷۶۱,۸۶۵,۹۴۶

کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)



فروش سهام طی دوره

ردیف	سهام	نماد	تعداد فروش	مبلغین فروش	فروش	خالص ارزش فروش	بازده
۱	بانک دی	دی ۱	(۱,۵۳۴,۰۷۹,۰۸۲)	۹,۰۹۴	۱۳,۹۵۰,۷۱۲,۲۲۸,۸۹۷	۳,۷۶۵,۵۸۳,۹۲۷,۲۳۱	۴۹/۳۸%
۲	سرمایه‌گذاری بوعلی	بوعلی ۱	(۱۵۴,۶۲۷,۶۶۳)	۶,۰۳۱	۹۳۲,۵۵۸,۴۵۲,۷۲۹	۶۶۶,۸۴۱,۹۲۱,۲۷۹	۶/۹۱%
۳	بیمه دی	ودی ۱	(۳۰۱,۳۲۳,۰۱۱)	۱۳,۳۸۹	۲,۶۹۵,۴۴۵,۵۹۶,۹۲۴	۵۳۰,۴۱۴,۸۴۲,۴۹۹	-۰/۳۳%
۴	تولید نیروی برق دملوند	دملوند ۱	(۱۰۲,۷۹۳,۳۲۴)	۴۶,۳۲۴	۴,۷۶۱,۷۷۸,۹۴۵,۳۹۶	۲,۰۹۲,۳۱۱,۵۵۰,۸۳۳	-۷/۷۷%
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف ۱	(۴۷,۱۲۱,۴۵۳)	۷,۷۸۸	۳۶۶,۹۸۸,۵۰۷,۳۰۶	۷۵,۴۷۴,۱۸۵,۵۷۲	۱/۷۵%
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ملهان	زملهان ۱	(۲۷,۱۰۰,۱۹۲)	۱۷,۲۰۶	۴۶۶,۲۹۶,۵۲۳,۲۳۳	۳۱,۴۰۰,۱۱۷,۷۶۰	-۰/۲۹%
۷	خوراک دام پارس	غدام ۱	(۱,۸۰۷,۰۳۳)	۲۶۵,۳۲۷	۴۷۹,۴۵۳,۷۸۱,۵۳۲	۶۹,۵۴۳,۲۲۴,۵۵۱	-۵/۲۷%
۸	سرمایه‌گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر ۱	(۱۱,۱۸۴,۹۵۴)	۱۷,۲۰۸	۱۹۲,۴۶۶,۳۲۰,۰۰۲	۱۲۸,۴۸۹,۸۴۷,۵۹۴	-۱/۵۳%
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بیزاگرس ۱	(۲۲,۳۷۸,۴۱۵)	۴,۳۴۵	۹۷,۲۲۵,۶۷۴,۱۶۳	۴۲,۴۶۰,۱۵۲,۳۸۷	-۹/۱۸%
۱۰	سرمایه‌گذاری آوا نوین	وآوا ۱	(۳۹,۹۷۳,۵۵۰)	۴,۲۷۹	۱۷۱,۰۲۸,۵۸۶,۴۲۱	۲۳,۱۰۴,۵۲۹,۰۳۷	-۱۲/۰۵%
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا ۱	(۶,۳۴۹,۵۰۳)	۳۲,۳۸۷	۲۰۵,۶۴۳,۲۶۹,۶۷۹	۶۶,۷۶۲,۸۱۵,۲۶۹	۳/۳۹%
	جمع				۲۴,۳۱۹,۵۹۷,۸۸۶,۲۸۲	۷,۴۹۲,۳۸۷,۱۱۴,۰۱۰	

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

دارگزار بانک دگا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

