

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی منتهی به

۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۱

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

کارگزاران بانک (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 مرداد 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، 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 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

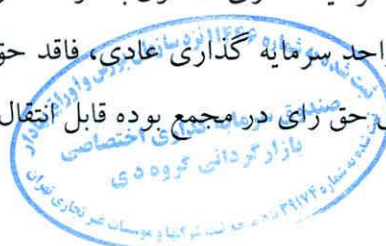
۲-۱- ارکان صندوق سرمایه گذاری

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 غیر قابل انتقال است. واحد سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رای در مجمع بوده قابل انتقال اما غیر قابل ابطال می باشد.

شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



۳-۲- 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

۴-۲- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۸,۱۷۲,۳۱۴,۹۰۱,۶۹۶
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۵,۹۹۹,۵۲۹
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۵,۹۹۰,۷۹۲
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱,۳۲۹,۱۴۶

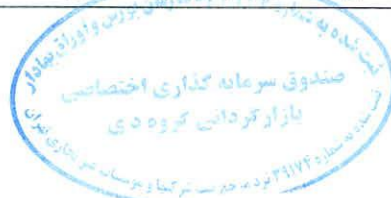
شاخص ارزیابی صندوق های سرمایه گذاری، خالص ارزش دارایی های صندوق (NAV) به ازای هر واحد می باشد. همان گونه که در جدول فوق مشاهده می گردد، نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری تا پایان دوره مالی منتهی به ۳۱ مرداد ماه ۱۴۰۱ مبلغ ۵,۹۹۰,۷۹۲ ریال می باشد.

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	۱۴۰۱/۰۵/۲۴	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	٪(۳.۷۷۶)	٪(۲.۶۷۹)
یک ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۵/۰۱	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	٪(۱۰.۶۸۵)	٪(۳.۳۲۶)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۱/۰۳/۰۳	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	٪(۱۰.۳۶۶)	٪(۸.۴۳۳)
۶ ماه اخیر	۱۴۰۰/۱۲/۰۴	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	۱۱.۴۲۷٪	۱۰.۵۷٪
یک سال اخیر	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	٪(۸.۹۹۷)	٪(۶.۰۰۸)
از شروع فعالیت	۱۳۹۵/۱۷/۱۷	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	۴۹۸.۳۱۳٪	۱۷۴۵.۶۰۲٪
حداکثر بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			۱۹.۳۹٪	۱۴.۱۳٪
حداقل بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			٪(۵۱.۵۴)	٪(۹.۵۵)

گزارش عملکرد (سهایی خاص)
 شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



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 شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱		دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱		
تعداد	ریال	تعداد	ریال	
۱,۲۲۴,۵۹۸	۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۹۴۳	۷۳۱,۰۲۳	۷,۶۰۷,۲۶۶,۴۴۶,۳۲۷	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
۱۳۹,۵۴۸	۱۳۹,۵۴۸,۰۰۰,۰۰۰	۷۰۸,۷۶۷	۷۰۸,۷۶۷,۰۰۰,۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
.	.	(۱۴۹,۸۰۰)	(۱۴۹,۸۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
.	(۵۳۲,۹۳۷,۰۵۵,۸۱۳)	.	(۱,۲۹۴,۲۳۵,۱۶۸,۷۹۱)	سود(زیان) خالص
.	۱,۹۸۸,۰۱۵,۹۸۵,۵۶۶	.	۱,۶۲۰,۱۳۵,۹۹۶,۸۰۹	تعدیلات
۱,۳۶۴,۱۴۶	۸,۱۷۲,۳۱۴,۹۰۱,۶۹۶	۱,۲۸۹,۹۹۰	۸,۴۹۲,۱۳۴,۲۷۴,۳۴۳	

صورت خالص دارایی ها

یادداشت	۱۴۰۱/۰۵/۳۱	۱۴۰۰/۱۱/۳۰
	ریال	ریال
۵ سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۸,۰۰۲,۵۸۹,۳۰۲,۸۹۷	۶,۱۱۶,۶۰۴,۷۱۹,۰۴۵
۶ سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۶۵۱,۰۰۹,۴۴۴,۸۲۶	۴۱۱,۱۰۷,۰۶۶,۳۴۷
۷ سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا حساب های دریافتی	۸۰۹,۷۱۲,۵۳۲	۸۰۰,۰۲۹,۵۵۷
۸ حساب های دریافتی	۱,۵۷۲,۲۰۳,۰۷۳,۱۸۰	۱,۵۱۶,۸۰۴,۷۶۲,۹۲۳
۹ جاری کارگزاران	.	۳,۰۶۴,۳۱۲,۶۶۲
۱۰ سایر دارایی ها	۸۳۹,۶۱۷,۷۴۲	۸۴۲,۷۹۳,۹۵۴
۱۱ موجودی نقد	۲۶۰,۲۶۴,۸۰۲	۱۰,۰۰۰,۰۰۰
جمع دارایی ها	۱۰,۲۲۷,۷۱۱,۴۱۵,۹۷۹	۸,۰۴۹,۲۳۳,۶۸۴,۴۸۸
بدهی ها		
جاری کارگزاران	۳۴,۶۹۴,۵۶۲,۳۶۴	.
۱۲ بدهی به ارکان صندوق	۲۲۸,۳۳۲,۰۰۷,۹۰۵	۱۸۱,۷۲۹,۴۶۵,۵۱۵
۱۳ بدهی به سرمایه گذاران	۵۱۲,۴۰۷,۶۶۴,۲۳۹	۹,۹۷۱,۷۲۹,۸۰۵
۱۴ سایر حساب های پرداختی و ذخایر	۱,۲۷۹,۹۶۲,۲۷۹,۷۷۵	۱,۲۷۹,۸۴۴,۵۱۷,۳۵۳
جمع بدهی ها	۲,۰۵۵,۳۹۶,۵۱۴,۲۸۳	۱,۴۷۱,۵۴۵,۷۱۲,۶۷۳
خالص دارایی ها	۸,۱۷۲,۳۱۴,۹۰۱,۶۹۶	۶,۵۷۷,۶۸۷,۹۷۱,۹۴۳
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۵,۹۹۰,۷۹۲	۵,۳۷۱,۳۰۴

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



صورت سود و زیان

یادداشت	دوره شش ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱	دوره شش ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱
درآمدها:	ریال	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۲۵۷,۲۰۱,۵۷۹,۰۳۱	(۹۶,۳۷۵,۱۱۲,۳۸۴)
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۸۹۱,۳۹۰,۴۶۲,۴۷۸)	(۱,۵۳۰,۷۲۲,۵۲۰,۰۴۸)
سود سهام	۱۳۲,۰۹۸,۹۰۳,۲۴۸	۳۶۹,۸۱۴,۶۵۳,۲۸۳
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۶,۶۲۰,۸۴۱,۸۷۸	۵,۵۳۸,۳۰۴,۹۹۶
سایر درآمدها	۴۷,۶۴۷,۹۵۹	۶۶,۹۸۹,۹۴۰
جمع درآمدها	(۴۸۵,۴۲۱,۴۹۰,۳۶۲)	(۱,۲۵۱,۶۷۷,۶۸۴,۲۱۳)
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۴۷,۰۱۶,۵۸۰,۵۴۱	۴۲,۰۶۶,۸۰۸,۴۴۷
سایر هزینه ها	۴۹۸,۹۸۴,۹۱۰	۴۹۰,۶۷۶,۱۳۱
جمع هزینه ها	۴۷,۵۱۵,۵۶۵,۴۵۱	۴۲,۵۵۷,۴۸۴,۵۷۸
سود خالص	(۵۳۲,۹۳۷,۰۵۵,۸۱۳)	(۱,۲۹۴,۲۳۵,۱۶۸,۷۹۱)

کارگزاری بانک دگا (سهیمی 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 ۱	۸,۶۹۵,۴۳۱,۸۴۸	۱,۶۶۳	۱۴,۴۵۶,۸۷۷,۹۳۸,۴۹۴	۴,۶۹۰,۲۵۲,۳۷۱,۲۵۲
۲	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی ۱	۳۰۵,۳۱۱,۳۳۷	۵,۹۲۹	۱,۸۱۰,۱۸۵,۲۰۹,۰۴۰	۸۷۸,۳۳۹,۵۰۸,۰۳۷
۳	بیمه دی	ودی ۱	۳۲۲,۳۲۶,۵۵۷	۱۱,۰۳۳	۳,۵۵۶,۱۶۸,۰۷۹,۲۲۲	۶۵۷,۸۳۱,۴۱۱,۱۰۰
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند ۱	۲۲۱,۷۶۵,۹۲۳	۳۵,۳۷۶	۷,۸۴۵,۲۹۳,۸۰۴,۹۴۲	۱,۸۶۷,۷۴۳,۳۶۱,۹۲۵
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف ۱	۷۲,۷۲۳,۸۱۰	۶,۶۶۴	۴۸۴,۶۱۶,۶۶۴,۲۳۷	۱۰۳,۸۴۲,۶۴۶,۵۹۸
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان ۱	۳۳,۵۱۴,۲۶۷	۱۵,۷۴۵	۵۲۷,۶۶۶,۴۱۸,۷۸۲	۳۱,۹۰۳,۵۰۹,۵۲۰
۷	خوراک دام پارس	غدام ۱	۳,۹۵۸,۶۷۰	۱۵۷,۳۵۸	۶۲۲,۹۲۹,۶۴۴,۸۹۹	۶۸,۰۴۳,۲۹۲,۶۰۸
۸	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر ۱	۱۹,۲۴۵,۱۳۱	۱۷,۸۴۶	۳۴۳,۴۵۶,۴۸۱,۵۷۲	۱۱۲,۴۲۲,۳۵۶,۳۴۰
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاگرس ۱	۴۶,۸۲۱,۶۹۶	۴,۹۳۸	۲۳۱,۲۰۱,۹۴۱,۱۴۱	۶۰,۶۲۷,۷۷۶,۷۲۰
۱۰	سرمایه گذاری آوا نوین	واوا ۱	۷۳,۳۳۴,۳۹۱	۴,۲۶۹	۳۱۳,۰۳۴,۳۰۴,۱۷۷	۸۳,۷۳۴,۲۹۰,۲۰۰
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی تکشا	تکشا ۱	۸,۰۸۵,۸۲۳	۳۲,۷۳۱	۲۶۴,۶۵۸,۰۲۱,۲۲۸	۴۲,۶۴۳,۶۵۱,۵۰۰
			جمع		۳۰,۴۵۶,۰۸۸,۵۰۷,۷۳۴	۸,۵۹۷,۳۸۴,۱۷۵,۸۰۰

کارگزاری بانک دگا (سهیمی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



فروش سهام طی دوره							
ردیف	سهام	نماد	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش	بازده
۱	بانک دی	دی ۱	(۱,۸۵۸,۳۲۹,۲۶۶)	۷,۶۴۶	۱۴,۲۰۸,۵۰۶,۳۰۷,۵۵۳	۴,۶۸۶,۶۸۷,۷۷۹,۴۵۰	۳۱/۹۲٪
۲	سرمایه گذاری بوعلی	وبوعلی ۱	(۱۵۶,۷۳۸,۵۱۴)	۶,۰۱۸	۹۴۳,۱۸۹,۴۵۹,۸۵۸	۵۹۳,۶۹۱,۱۷۰,۷۱۰	-۰/۷۹٪
۳	بیمه دی	ودی ۱	(۲۰۶,۱۱۵,۳۲۴)	۱۳,۲۰۷	۲,۷۲۲,۱۷۶,۴۸۴,۸۶۳	۴۶۹,۱۳۶,۵۶۶,۳۵۰	-۴/۷۹٪
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند ۱	(۱۱۷,۶۲۶,۲۸۴)	۴۳,۲۸۱	۵,۰۹۰,۹۵۰,۰۲۰,۸۳۷	۱,۷۹۵,۰۴۳,۵۰۲,۰۸۳	-۱۱/۳۲٪
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف ۱	(۴۸,۹۲۴,۷۴۴)	۷,۶۴۹	۳۷۴,۲۴۰,۹۵۰,۶۸۰	۸۹,۵۵۹,۱۶۵,۸۲۱	-۱/۳۶٪
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان ۱	(۲۹,۲۷۱,۸۶۸)	۱۶,۵۲۲	۴۸۳,۶۳۸,۹۲۰,۵۴۸	۲۹,۵۸۹,۴۳۹,۹۴۲	-۲/۳۰٪
۷	خوراک دام پارس	غدام ۱	(۲,۲۱۳,۶۰۳)	۲۲۵,۱۰۲	۴۹۸,۲۸۶,۸۴۴,۷۸۹	۶۷,۹۵۳,۵۷۶,۹۹۲	-۹/۰۹٪
۸	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر ۱	(۱۱,۶۳۰,۶۹۸)	۱۷,۱۱۴	۱۹۹,۰۵۰,۲۴۸,۹۱۵	۹۸,۹۱۲,۳۹۸,۴۰۲	-۹/۰۰٪
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزآگرس ۱	(۳۲,۲۵۰,۲۸۸)	۴,۵۷۲	۱۴۷,۴۶۴,۲۰۴,۳۲۳	۵۸,۰۹۵,۷۳۱,۵۸۲	-۱۰/۰۱٪
۱۰	سرمایه گذاری آوا نوین	وآوا ۱	(۴۵,۳۵۹,۶۶۴)	۴,۱۳۷	۱۸۷,۶۶۴,۱۳۵,۹۲۶	۷۲,۶۷۹,۰۱۲,۱۳۹	-۱۳/۳۲٪
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی تکشا	تکشا ۱	(۶,۳۴۹,۵۰۳)	۳۲,۳۸۷	۲۰۵,۶۴۳,۲۶۹,۶۷۹	۴۱,۲۴۰,۹۵۹,۴۳۲	-۶/۲۰٪
جمع					۲۵,۰۶۰,۸۱۰,۸۴۷,۹۷۱	۸,۰۰۲,۵۸۹,۳۰۲,۹۰۴	

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

