

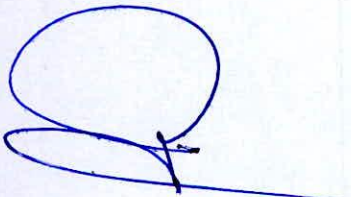
گزارش عملکرد

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 »



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 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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۳ 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 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.

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



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	۳۵۰۰۰	۱۰۰

۴-۲- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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 ۱۴۰۱/۱۱/۳۰ 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)%

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

۴- صورت های مالی صندوق

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

مطابق جداول ذیل می باشد.

صورت گردش خالص دارایی ها

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
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)	۲۶۶,۳۶۷,۸۱۲,۹۷۷	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۴.۰۵۸.۲۳۸.۱۷۶.۲۹۲)	۶۳,۰۱۶,۴۷۰,۷۴۴	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)	۵۷۱,۸۳۴,۲۱۹,۰۳۲		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)	۴۶۱,۵۷۸,۸۵۹,۲۴۰		سود خالص

کارگزاری بانک (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

صورت خالص دارایی ها

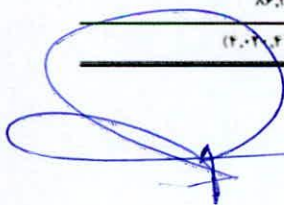
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
صورت خالص دارایی ها
در تاریخ ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۱

۱۴۰۰/۱۱/۳۰	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	یادداشت	دارایی ها
ریال	ریال		
۶,۱۱۶,۶۰۴,۷۱۹,۰۴۵	۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۶۸	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۴۱۱,۱۰۷,۰۶۶,۳۴۷	۱,۳۰۷,۹۷۳,۸۱۸,۸۴۱	۶	سرمایه گذاری در سیرده و گواهی سیرده 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	۱,۶۷۲,۳۱۹,۵۸۸	۱۱	موجودی نقد
۸,۰۴۹,۲۳۳,۶۸۴,۴۸۸	۱۲,۶۷۵,۰۳۴,۷۷۷,۸۹۷		جمع دارایی ها
۰	۶۰,۲۰۲,۳۸۹,۹۵۹		بدهی ها
			جاری کارگزاران
۱۸۱,۷۲۹,۴۶۵,۵۱۵	۶۴,۸۰۵,۰۷۹,۱۱۴	۱۲	بدهی به ارکان صندوق
۹,۹۷۱,۷۲۹,۸۰۵	۱۲,۹۴۰,۱۵۹	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

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
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)	۲۶۶,۳۶۷,۸۱۲,۹۷۷	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۴,۰۵۸,۲۳۸,۱۷۶,۲۹۲)	۶۳,۰۱۶,۴۷۰,۷۴۴	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۶۱۲,۵۹۱,۸۹۳,۶۲۶	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)	۵۷۱,۸۳۴,۲۱۹,۰۳۲		جمع درآمدها
			هزینه ها:
۸۵,۳۹۶,۲۲۵,۳۲۷	۱۰۶,۸۵۹,۷۴۲,۲۵۶	۲۱	هزینه کارمزد ارکان
۹۸۸,۸۹۰,۸۰۴	۳,۳۹۵,۶۱۷,۵۳۶	۲۲	سایر هزینه ها
۸۶,۳۸۵,۱۱۶,۰۵۱	۱۱۰,۳۵۵,۳۵۹,۷۹۲		جمع هزینه ها
(۴,۰۲۰,۴۱۲,۲۷۹,۰۵۴)	۴۶۱,۵۷۸,۸۵۹,۲۴۰		سود خالص



کارگزاری بانک دگا (سهامی 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	دی۱	۶,۹۳۸,۵۸۰,۴۶۰	۱,۳۶۳	۵,۰۴۸,۲۶۳,۹۰۴,۷۲۸	۷,۸۴۳,۴۹۳,۳۰۱,۰۴۲
۲	سرمایه‌گذاری بوعلی	وبوعلی۱	۳۷,۰۲۶,۵۸۷	۳,۹۴۰	۱۳۲,۹۱۸,۹۴۶,۳۱۵	۱,۰۱۴,۴۰۱,۷۵۶,۴۸۹
۳	بیمه دی	ودی۱	۳۹,۹۱۵,۳۶۶	۱۱,۰۲۳	۱۹۶,۰۰۹,۲۱۳,۸۷۹	۶۱۸,۱۱۹,۷۴۸,۸۷۹
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند۱	۳۴,۲۶۸,۶۷۰	۳۴,۵۹۰	۷۰۱,۹۳۰,۷۶۰,۸۴۱	۱,۹۴۳,۸۵۷,۸۱۴,۲۳۵
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف۱	۱۳,۹۴۰,۷۰۳	۶,۶۶۴	۵۳,۶۸۲,۰۳۸,۷۵۰	۱۱۷,۳۸۴,۳۱۵,۱۵۲
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان۱	۸,۳۰۸,۵۵۰	۱۵,۷۴۵	۶۶,۹۹۰,۹۳۴,۰۹۹	۳۲,۷۵۱,۹۸۹,۳۲۰
۷	خوراک دام پارس	غدام۱	۱,۰۴۰,۱۳۳	۱۵۷,۳۵۸	۴۵,۶۴۰,۴۶۵,۹۵۲	۷۱,۰۶۲,۲۵۸,۵۱۸
۸	سرمایه‌گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر۱	۵,۹۵۹,۲۵۹	۱۷,۸۴۶	۹۲,۹۰۲,۷۶۱,۶۳۰	۱۲۰,۴۱۷,۵۱۰,۹۹۰
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاکرس۱	۲۷,۱۹۶,۶۸۵	۴,۹۳۸	۱۲۰,۷۴۰,۵۷۰,۳۴۷	۵۸,۱۶۵,۲۰۸,۷۶۸
۱۰	سرمایه‌گذاری آوا نوین	واوا۱	۴۰,۱۴۷,۴۱۷	۴,۲۶۹	۱۱۷,۸۴۵,۶۶۹,۳۹۳	۸۹,۶۹۲,۹۰۷,۰۵۱
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا۱	۱۱۳,۰۰۰	۳۲,۷۳۱	۴,۱۲۱,۶۴۲,۶۰۱	۴۷,۹۰۴,۷۰۱,۱۰۰
مجموع					۶,۵۸۱,۰۴۶,۹۰۸,۵۳۵	۱۱,۹۵۷,۲۵۱,۵۱۱,۵۴۴

فروش طی دوره						
ردیف	سهام	نماد	تعداد فروش	میانگین فروش	قیمت میانگین	خالص ارزش فروش
۱	بانک دی	دی۱	۶۸۰,۵۹۵,۵۱۰	۶,۵۳۶	۱,۱۳۶	۷,۸۳۷,۵۳۲,۲۴۶,۱۳۳
۲	سرمایه‌گذاری بوعلی	وبوعلی۱	۱۱,۸۴۰,۶۱۳	۵,۹۱۵	۲,۸۲۹	۷۲۹,۶۵۰,۰۱۱,۸۵۴
۳	بیمه دی	ودی۱	۳۷,۹۵۸,۴۳۰	۱۳,۰۷۹	۶,۹۸۰	۴۲۹,۴۵۵,۰۸۴,۹۹۳
۴	تولید نیروی برق دماوند	دماوند۱	۲۴,۵۱۸,۹۶۰	۴۲,۱۰۱	۲۴,۲۶۴	۱,۸۷۱,۱۰۰,۱۰۷,۴۰۹
۵	کشت و صنعت شریف آباد	زشریف۱	۱۵,۹۰۷,۶۶۴	۷,۶۴۹	۴,۱۵۹	۱۰۳,۰۹۰,۵۴۲,۷۰۷
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	زماهان۱	۷,۸۵۱,۸۴۶	۱۶,۵۲۲	۸,۲۶۰	۳۰,۴۳۷,۳۷۴,۸۹۷
۷	خوراک دام پارس	غدام۱	۱,۰۴۲,۵۰۱	۲۳۵,۱۰۳	۴۷,۰۵۴	۷۰,۹۷۰,۲۴۸,۴۸۸
۸	سرمایه‌گذاری کشاورزی کوثر	زکوثر۱	۵,۸۷۳,۶۶۵	۱۷,۱۱۴	۱۶,۵۱۵	۱۰۶,۹۰۱,۴۷۶,۷۳۴
۹	نیروگاه زاگرس کوثر	بزاکرس۱	۲۳,۲۹۷,۰۱۳	۴,۵۷۳	۴,۷۹۲	۵۵,۶۳۵,۰۳۵,۱۸۲
۱۰	سرمایه‌گذاری آوا نوین	واوا۱	۲۱,۳۸۷,۱۳۷	۴,۱۳۷	۲,۹۴۴	۷۸,۶۳۳,۱۰۰,۴۴۲
۱۱	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	تکشا۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	۳۲,۳۸۷	۳۶,۶۶۳	۴۶,۴۹۸,۰۱۰,۶۳۴
مجموع					۱,۶۶۵,۸۱۴,۱۷۹,۱۵۱	۱۱,۳۵۹,۹۰۳,۱۳۹,۴۷۲

۶- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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

کارگزاری بانک دگا (سهامی خاص)

شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰