

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره نه ماهه منتهی به

۳۰ آبان ماه ۱۳۹۹

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



گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۹

۱- مقدمه

اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می‌باشد، با تأکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد گروه مدیران سرمایه‌گذاری و در جهت حفظ منابع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت‌های موجود بوده و اثرات آن‌ها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می‌توان پیش‌بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده‌کنندگان می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

معرفی « صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی »

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی که صندوقی در سرمایه‌گذاری 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 می‌شود 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 شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق براساس اساسنامه و امیدنامه، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار پذیرفته شده موضوع بند ۲-۲ امیدنامه (بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی) 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 جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های 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 دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل اوراق بهادار با درآمد ثابت و سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس می‌باشد، توسط مدیران سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه‌گذاری دریافت می‌کنند. دوره فعالیت صندوق به مدت ۳ سال شمسی بوده (تا پایان ۱۴۰۱/۰۴/۲۸) که به تأیید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است. مرکز اصلی صندوق در تهران- خیابان مطهری-کوچه منصور -پلاک ۶۶- طبقه اول واقع شده است. علاقمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می‌توانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.daygroupfund.net مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می‌توانید به تارنمای مزبور مراجعه کنید.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۹

۱-۱- اطلاع رسانی

علاقه‌مندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می‌توانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.daygroupfund.net مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می‌توانید به تارنمای مزبور مراجعه کنید.

۲- صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی در یک نگاه

۱-۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
مدیر ثبت	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	موسسه حسابرسی بهمند
متولی	مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۹

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.

۲-۳ مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز

اسامی و مشخصات دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز صندوق سرمایه گذاری ارزش آفرینان 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

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۹

۲-۴ آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

۲,۵۲۸,۰۹۶,۷۸۸,۰۱۳	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۱
۳۲,۳۵۴,۷۸۸	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۲
۳۲,۳۰۷,۴۷۶	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۳
۳۵,۰۰۰	گواهی های ممتاز	۴
۲۶۲,۵۰۵	گواهی های عادی	۵

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 ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۹ مبلغ ۳۲,۳۰۷,۴۷۶ ریال می باشد.

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ می باشد:

بازده بازار	بازده صندوق	تا تاریخ	از تاریخ	محدوده زمانی دوره مورد گزارش
۱۰,۱۷۴	۰,۷۵۳	۱۳۹۹/۰۸/۳۰	۱۳۹۹/۰۸/۲۳	۷ روز گذشته
۲۲,۱۱۴	۲۶,۰۲۴	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۳۹۹/۰۶/۰۱	۳۰ روز گذشته
۴۰,۱۵۹	۳۳,۵۷۱	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۳۹۹/۰۴/۰۳	۹۰ روز گذشته
۲۰۶,۰۲ %	%۷۴,۴۶	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۳۹۹/۰۱/۰۶	۱۸۰ روز گذشته
۳۴۱,۰۸۷	۵۷۳,۹۷۱	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۳۹۸/۰۶/۳۱	۳۶۵ روز گذشته

۴- حجم معاملات سهام موضوع بازارگردانی صندوق (دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰)

ردیف	سهام	خرید			فروش			نسبت ارزش خرید به فروش	نرخ
		تعداد مورد	مبلغین مورد	قیمت	ارزش باستان دوره	تعداد مورد	مبلغین مورد		
۱	بانک دی	۱۰,۳۴۷,۴۲۳,۳۰۲	۷,۹۶۱	۱۰,۷۲۷,۰۵۲,۴۷۹,۷۴۲	۷,۴۸۰,۴۷۰,۰۰۵,۶۲۴	(۱,۱۶۹,۰۷۹,۰۰۸)	۱۱,۱۶۵	۱۳,۰۵۲,۳۶۲,۶۸۶,۰۰۸	۹۳,۰۰٪
۲	بیمه دی	۱۰,۱۳۵,۳۳۰	۱۰,۳۰۲	۱,۰۴۴,۰۹۷,۳۷۹,۶۱۷	۲۳۳,۵۱۱,۱۲۸,۳۳۸	(۹۱,۷۰۳,۰۱۹)	۱۰,۲۱۳	۹۳۶,۵۵۳,۶۶۳,۵۰۸	۱۲,۶۳٪
۳	تولید نیروی برق دماوند	۵۰,۷۲۲,۶۸۶	۶۸,۱۶۶	۳,۴۵۷,۵۶۶,۲۷۶,۴۸۱	۵۲۱,۳۳۵,۷۳۸,۸۸۰	(۴۳,۲۱۶,۷۲۶)	۶۹,۳۷۷	۲,۹۹۸,۲۴۸,۶۶۰,۵۴۸	۱,۷۸٪
۴	سرمایه گذار جمعی	۱۳۱,۱۰۳,۰۰۵	۶,۴۶۳	۸۴۷,۳۷۵,۰۳۰,۳۷۴	۳۶۲,۴۰۶,۰۲۱,۷۹۰	(۸۲,۲۶۹,۸۷۳)	۶,۳۷۶	۵۲۴,۵۶۸,۹۷۸,۸۹۰	۵۰,۵٪
	مجموع	۱,۶۳۰,۶۰۲,۳۸۳		۱۶,۰۷۶,۰۹۱,۱۶۶,۲۱۴,۰۰۰	۸,۵۹۷,۶۱۲,۸۹۴,۵۳۲	(۱,۳۸۶,۳۶۸,۶۹۹)		۱۷,۵۱۱,۷۳۳,۹۸۸,۹۵۴	۸,۵۷۰,۲۰۵,۹۶۶,۵۷۱