

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به

۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹


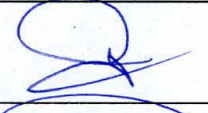

« ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

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 ۱۳۹۹ 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 ۱۳۹۹/۱۲/۲۵ به تایید ارکان صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضا
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی	حسین دیده خانی	
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی	غلامحسن آرما	
متولی صندوق	مشاوره سرمایه گذاری ایرانیان تحلیل قارابی	علیرضا باغانی	



کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

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 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 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) 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 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 ۳ سال شمسی بوده (تا پایان ۱۴۰۱/۰۴/۲۸) 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)
مدیر ثبت	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	موسسه حسابرسی بهمند
متولی	مشاور سرمایه گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

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	۳۵,۰۰۰	۱۰۰

۲-۴- آخرین وضعیت صندوق در تاریخ ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۷,۶۰۷,۲۶۶,۴۴۶,۳۲۷
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۴۲۱,۵۵۲
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۱۰,۴۰۶,۳۳۰
۴	گواهی های ممتاز	۳۵,۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۶۹۶,۰۲۳

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 بهمن ماه ۱۳۹۹ مبلغ ۱۰,۴۰۶,۳۳۰ ریال می باشد.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰ می باشد:

بازده بازار	بازده صندوق	تا تاریخ	از تاریخ	محدوده زمانی دوره مورد گزارش
۱,۹۷۱٪	۰,۵۳۵٪	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۱۳۹۹/۱۱/۲۳	۷ روز گذشته
۷,۷۱۶٪	(۶,۰۸۲)٪	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۱۳۹۹/۱۰/۳۰	۳۰ روز گذشته
(۷,۹۴۹)٪	(۶۷,۷۹)٪	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۱۳۹۹/۰۸/۳۰	۹۰ روز گذشته
(۲۸,۳۰۵)٪	(۷۸,۶۰۳)٪	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۱۳۹۹/۰۶/۰۱	۱۸۰ روز گذشته
۱۵۸,۶۶۲٪	۶۴,۵۹٪	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	۳۶۵ روز گذشته
۱۴۹۹,۲۰۵٪	۹۳۹,۳۰۲٪	۱۳۹۹/۱۱/۳۰	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	بازدهی از شروع فعالیت
۶۵۳۳۳٪	۱۴۲۴۸٪	حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس		
(۹۹,۷۸)٪	(۱۰۰)٪	حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس		

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۹

۴- گزارش عملیاتی

خرید سهام					
ردیف	سهام	تعداد خرید	مانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	۱,۳۶۲,۲۲۳,۳۰۲	۸,۳۹۹	۱۱,۴۴۱,۴۹۵,۳۸۸,۹۵۲	۵,۶۷۴,۹۵۶,۶۰۲,۷۷۸
۲	بیمه دی	۱۵۷,۱۰۲,۶۲۸	۱۶,۱۷۰	۲,۵۴۰,۳۱۴,۴۱۷,۳۰۲	۵۰۱,۹۳۰,۳۹۳,۲۷۲
۳	تولید نیروی برق دماوند	۵۹,۶۰۶,۷۰۸	۶۸,۳۵۱	۴,۰۷۴,۱۹۱,۸۱۰,۵۳۲	۵۳۳,۹۲۱,۴۵۰,۷۰۲
۴	خوراک دام پارس	۱,۰۰۴,۵۴۱	۴۴۱,۶۸۲	۴۴۳,۶۸۷,۲۷۲,۷۳۱	۵۲,۳۷۴,۸۶۰,۹۹۰
۵	سرمایه گذاری بوعلی	۲۰۹,۸۲۶,۶۵۹	۶,۴۹۱	۱,۳۶۲,۰۲۲,۲۴۹,۹۱۳	۵۶۹,۹۷۶,۴۱۰,۹۳۰
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	۱۰,۸۴۴,۳۷۹	۲۴,۷۷۵	۲۶۸,۶۶۴,۹۵۶,۰۵۳	۱۰۱,۱۸۰,۴۸۵,۹۵۰
۷	کشت و صنعت شریف آباد	۱۸,۹۳۶,۷۵۰	۱۳,۰۸۵	۲۴۷,۷۹۱,۵۶۸,۵۵۷	۶۶,۵۰۱,۳۳۰,۰۲۵
	مجموع	۱,۸۱۹,۵۴۴,۹۶۷		۲۰,۳۷۸,۱۶۷,۶۶۴,۰۴۰۰۰	۷,۵۰۰,۸۴۱,۵۳۴,۶۴۷

فروش سهام					
ردیف	سهام	تعداد فروش	مانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش
۱	بانک دی	(۱,۱۷۸,۰۷۹,۰۸۱)	۱۱,۴۷۴	۱۳,۵۱۷,۷۳۰,۵۴۰,۸۷۸	۶۹,۲۵%
۲	بیمه دی	(۱۲۶,۱۱۹,۵۷۹)	۱۵,۷۱۳	۲,۱۳۸,۸۵۱,۹۴۱,۴۹۵	۴,۱۸%
۳	تولید نیروی برق دماوند	(۴۸,۸۸۸,۸۴۵)	۶۸,۷۵۹	۳,۳۶۱,۵۲۶,۷۲۹,۱۳۴	-۴,۴۰%
۴	خوراک دام پارس	(۸۷۵,۱۹۸)	۴۳۸,۷۶۱	۳۸۴,۰۰۲,۷۸۰,۷۴۴	-۱,۶۶%
۵	سرمایه گذاری بوعلی	(۱۱۷,۰۶۳,۲۹۳)	۶,۵۲۳	۷۶۳,۵۹۶,۱۲۶,۱۰۷	-۱,۸۷%
۶	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان	(۵,۴۵۹,۵۷۴)	۳۳,۲۴۴	۱۸۱,۴۹۷,۱۳۱,۱۳۵	۵,۱۹%
۷	کشت و صنعت شریف آباد	(۶,۰۳۶,۳۹۵)	۲۸,۶۳۳	۱۷۲,۸۴۱,۱۳۷,۰۹۵	-۳,۴۳%
	مجموع	(۱,۴۹۲,۵۲۱,۹۶۵)		۲۰,۵۲۰,۰۴۶,۳۸۶,۵۸۸	۷,۴۷۴,۲۶۸,۱۵۲,۹۲۰

۵- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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