

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

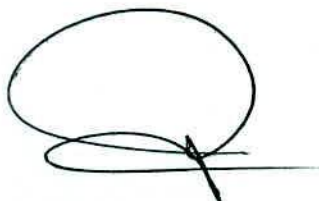
برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
برای دوره مالی نه ماهه منتهی به

۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

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



کارگزاری بانک دکا (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

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 نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۰ 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 ۱۴۰۰/۰۹/۲۲ به تایید ارکان صندوق رسیده است.

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

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

۱- مقدمه

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، 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 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 سبأ 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 تایید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است.

۱-۱- اطلاع رسانی

علاقمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می‌توانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.daygroupfund.ir 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 رازدار
متولی	مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

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 ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۱	کل خالص ارزش دارایی صندوق	۷,۵۹۵,۴۰۳,۸۹۵,۴۴۱
۲	آخرین نرخ صدور هر واحد سرمایه گذاری	۶.۲۱۱.۵۷۳
۳	آخرین نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری	۶.۲۰۳.۱۰۰
۴	گواهی های ممتاز	۳۵.۰۰۰
۵	گواهی های عادی	۱.۱۸۹.۴۵۳

شاخص ارزیابی صندوق های سرمایه گذاری، خالص ارزش دارایی های صندوق (NAV) به ازای هر واحد می باشد. همان گونه که درجدول فوق مشاهده می گردد، نرخ ابطال هر واحد سرمایه گذاری تا پایان دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰ مبلغ ۶.۲۰۳.۱۰۰ ریال می باشد.

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

۳- بازدهی صندوق

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰/۰۸/۱۴۰۰ می باشد:

بازدهی بازار	بازدهی صندوق	تا تاریخ	از تاریخ	محدوده زمانی دوره مورد گزارش
(۳.۸۵)%	(۰.۵۷)%	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۴۰۰/۰۸/۲۳	هفته گذشته
(۳.۴۴)%	۸.۲۴%	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۴۰۰/۰۷/۳۰	ماه گذشته
(۸.۵۱)%	(۶.۰۵)%	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۴۰۰/۰۶/۰۱	۳ ماه اخیر
۲۵.۴۶%	۹.۶۲%	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۴۰۰/۰۳/۰۴	۶ ماه اخیر
۱.۴۹%	(۸۲.۶۱)%	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۳۹۹/۰۹/۰۱	یک سال اخیر
۱۶۹۶.۹۴%	۵۱۹.۵۲%	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	۱۳۹۵/۰۷/۱۷	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 دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

۴- گزارش عملیاتی

خرید سهام

۱۴۰۰/۰۸/۳۰

ردیف	سهام	تعداد خرید	میانگین خرید	خرید	ارزش پایان دوره
۱	بانک دی	۵,۵۵۵,۹۰۱,۸۶۵	۲,۱۵۶	۱۱,۹۷۷,۹۵۷,۶۷۶,۸۳۵	۳,۷۶۸,۴۴۷,۹۴۸,۶۰۸
۲	بیمه دی	۲۶۱,۵۶۳,۲۱۸	۱۲,۵۲۸	۳,۲۷۶,۹۲۰,۰۴۳,۹۸۲	۵۸۱,۷۴۹,۳۲۵,۳۳۶
۳	تولید نیروی برق دماوند	۱۷۸,۶۸۵,۰۵۴	۳۸,۷۳۲	۶,۹۲۰,۷۶۸,۴۹۰,۹۹۹	۱,۹۲۸,۴۹۲,۰۲۹,۵۳۵
۴	خوراک دام پارس	۱,۶۵۹,۷۵۳	۳۳۸,۹۶۳	۵۶۲,۵۹۵,۲۲۴,۳۶۱	۷۴,۷۶۳,۰۰۰,۸۰۰
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	۲۶,۸۸۰,۱۹۹	۶,۷۲۷	۱۸۰,۸۲۲,۴۴۱,۷۲۶	۳۶,۰۷۱,۴۱۷,۶۸۶
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	۱۰,۱۵۲,۹۰۳	۲۰,۶۹۴	۲۱۰,۱۰۱,۵۶۸,۲۳۹	۹۵,۶۸۹,۳۰۶,۲۲۰
۷	سرمایه گذاری بوعلی	۲۷۰,۱۸۴,۳۲۱	۶,۱۸۶	۱,۶۷۱,۲۳۷,۵۶۹,۳۳۰	۷۱۳,۷۳۹,۸۶۰,۱۶۲
۸	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	۷,۸۲۹,۶۳۷	۳۲,۵۷۷	۲۵۵,۰۶۳,۷۶۹,۴۷۸	۶۵,۴۲۰,۲۱۰,۷۰۰
۹	مجمع تولید گوشت مرغ ماهان	۲۲,۶۱۰,۲۶۶	۱۹,۶۵۲	۴۴۴,۳۳۸,۵۱۸,۹۹۹	۲۲,۶۳۸,۹۲۷,۵۴۴
۱۰	نیروگاه زاگرس کوثر	۱۵,۳۴۲,۷۷۴	۶,۴۰۹	۹۸,۳۳۷,۹۹۰,۰۰۵	۳۱,۳۶۳,۴۰۷,۳۷۰
۱۱	کشت و صنعت شریف آباد	۵۱,۸۴۷,۱۱۶	۷,۸۸۱	۴۰۸,۵۹۷,۵۰۳,۲۴۹	۷۸,۴۲۲,۱۳۴,۴۲۲
	مجموع	۶,۴۰۲,۶۵۷,۱۰۶		۲۶,۰۰۶,۷۴۰,۷۹۷,۲۰۳,۰۰۰	۷,۳۹۶,۶۹۷,۴۶۸,۳۸۳

فروش سهام

۱۴۰۰/۰۸/۳۰

ردیف	سهام	تعداد فروش	میانگین فروش	فروش	خالص ارزش فروش
۱	بانک دی	(۱,۵۳۴,۰۷۹,۰۸۱)	۹,۰۹۴	۱۳,۹۵۰,۷۱۲,۲۲۸,۸۹۶	۴۹,۳۸%
۲	بیمه دی	(۱۷۸,۴۸۴,۸۹۴)	۱۴,۴۴۲	۲,۵۷۷,۶۲۷,۱۴۵,۸۸۱	(۳.۴۱)%
۳	تولید نیروی برق دماوند	(۸۸,۴۶۳,۳۲۴)	۵۰,۵۸۳	۴,۴۷۴,۷۷۴,۲۴۷,۶۶۸	(۷.۵۰)%
۴	خوراک دام پارس	(۱,۱۴۹,۶۰۲)	۳۹۸,۱۲۳	۴۵۷,۶۸۲,۴۶۱,۴۱۹	(۵.۳۷)%
۵	سرمایه گذاری آوا نوین	(۱۸,۸۴۹,۶۳۶)	۵,۵۸۴	۱۰۵,۲۵۰,۰۵۰,۰۹۰	(۲۱.۸۶)%
۶	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	(۴,۹۸۵,۸۳۶)	۱۹,۳۷۶	۹۶,۶۰۳,۸۶۰,۱۵۲	(۷.۹۷)%
۷	سرمایه گذاری بوعلی	(۱۴۷,۴۲۱,۳۸۲)	۶,۱۱۷	۹۰۱,۸۰۱,۵۳۹,۱۹۳	(۳.۱۵)%
۸	گسترش صنایع و خدمات کشاورزی	(۶,۰۶۲,۳۵۲)	۳۲,۱۴۰	۱۹۴,۸۴۱,۱۴۱,۴۷۳	۲.۰۲%
۹	مجمع تولید گوشت مرغ ماهان	(۱۹,۳۴۵,۳۵۰)	۲۰,۸۵۱	۴۰۳,۳۶۸,۹۵۳,۸۲۴	(۴.۱۳)%
۱۰	نیروگاه زاگرس کوثر	(۷,۶۴۳,۰۰۴)	۵,۰۶۴	۳۸,۷۰۱,۱۱۵,۱۲۳	(۲۸.۸۸)%
۱۱	کشت و صنعت شریف آباد	(۳۰,۵۹۳,۵۸۰)	۹,۷۶۲	۲۹۸,۶۵۵,۰۰۷,۴۲۴	(۷.۷۳)%
	مجموع	(۲,۰۳۷,۰۷۸,۰۴۱)		۲۳,۵۰۰,۰۱۷,۷۵۱,۱۴۳	۶,۹۵۱,۵۹۵,۰۴۹,۳۱۳

۵- برنامه های آتی و چشم انداز صندوق:

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