



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری بانک دی

دوره مالی شش ماهه منتهی به تاریخ 22 آذر ماه 1395

«ثبت شده به شماره 10869 نزد سازمان بورس و اوراق بهادار»

مقدمه :

اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تاکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد گروه مدیران سرمایه گذاری و در جهت حفظ منابع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت های موجود بوده و اثرات آن ها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می توان پیش بینی نمود، به نحو 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 و در تاریخ 1395/10/12 به تایید مدیران سرمایه گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق

امضا	سمت	اعضای گروه مدیران سرمایه گذاری
	مدیر سرمایه گذاری	محمد کاظم مهدوی
	مدیر سرمایه گذاری	محسن نامدار بهشتی
	مدیر سرمایه گذاری	مهدی حیدرنیا

معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی»

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی در تاریخ 1390/03/22 با دریافت مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه‌گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق با شماره 10869 نزد سبا و شماره 27672 نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و 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. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. مدیریت دارایی‌های صندوق شامل سهام و حق تقدم سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس، اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده و گواهی سپرده بانکی می‌باشد، که معاملات آن توسط مدیر سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه‌گذاری دریافت می‌کنند. مرکز اصلی صندوق در تهران- خیابان خالد اسلامبولی- نبش خیابان چهاردهم- شماره 58- طبقه سوم واقع شده است. علاقمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق میتوانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.dayfund.ir مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می‌توانید به بخش بازدهی، خالص ارزش دارائیه‌ها و نمودارهای این تارنما مراجعه کنید.

ارکان آن نیز مطابق جدول ذیل در مجمع عمومی مؤسس انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

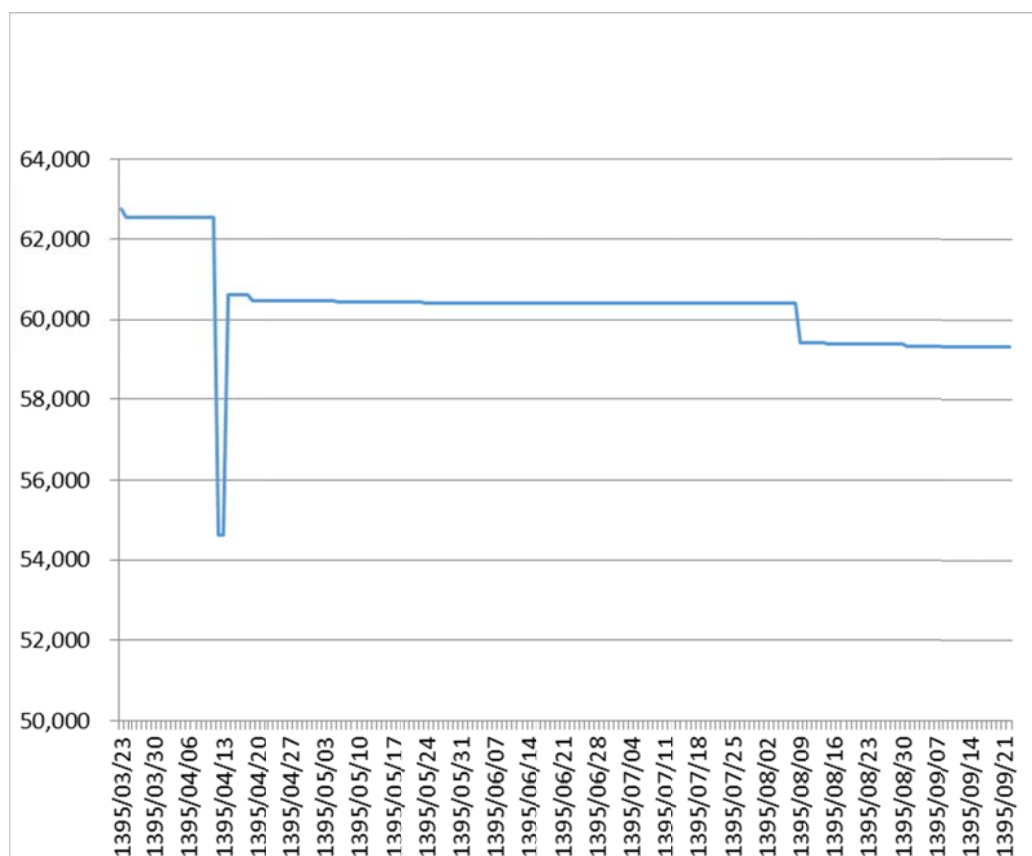
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
مدیر ثبت	بانک دی
حسابرس	بهمند
متولی	سبدگردانی آسمان

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ 95/03/23 تا 95/09/22 در 184 روز مجموعاً صدور 6.015 واحد سرمایه گذاری و ابطال (9.423) واحد سرمایه گذاری در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره به 59.333 واحد رسیده است.

62.741	تعداد واحدهای سرمایه گذاری در ابتدای دوره
6.015	تعداد واحدهای صادر شده
(9.423)	تعداد واحدهای ابطالی
59.333	تعداد واحدهای سرمایه گذاری در انتهای دوره

نمودار تغییرات تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق



خرید و فروش دارایی‌های صندوق

مطابق امید نامه دارایی‌های صندوق به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

- سهام و حق تقدم سهام
- اوراق مشارکت و صکوک
- موجودی نقد و گواهی سپرده

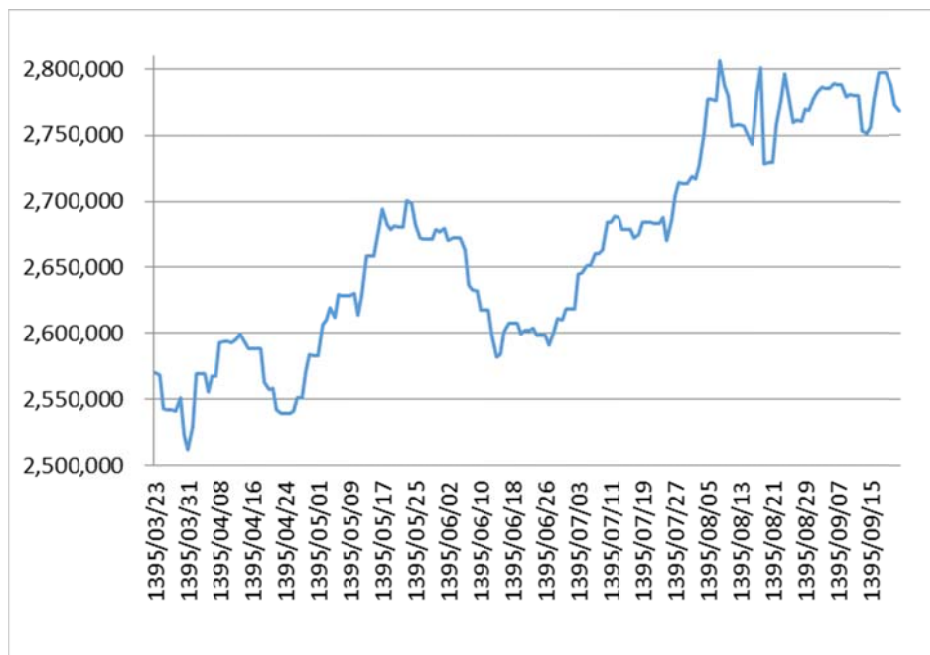
مطالبات و سایر دارایی‌ها	سپرده بانکی و نقد	اوراق با درآمد ثابت	سهام شرکتهای بورسی و فرابورسی	(میلیون ریال)
7.855	1.010	6.824	154.315	موجودی در ابتدای دوره
196.225	77.935	8.999	262.706	خرید طی دوره
(195.878)	(78.856)	(15.823)	(251.498)	فروش طی دوره
8.202	89	-	165.523	قیمت تمام شده پایان دوره

ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

بخش عمده ای از واحدهای سرمایه گذاری صندوق در اختیار سرمایه گذاران حقیقی است .

درصد تملک صندوق	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	تعداد	شرح
5%	2.747	96	سرمایه‌گذاران حقیقی
95%	56.586	4	سرمایه‌گذاران حقوقی
100%	59.333	100	کل سرمایه‌گذاران

نمودار NAV صندوق سرمایه گذاری بانک دی برای دوره مالی شش ماهه منتهی به 1395/09/22



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (در تاریخ ترازنامه) می باشد.

بازدهی	شرح
0.37%	یک ماهه اخیر
6.31%	سه ماهه اخیر
8.9%	شش ماهه اخیر

صورت‌های مالی

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری بانک دی برای دوره مالی شش ماهه منتهی به 1395/09/22 مطابق جداول ذیل

می باشند:

ترازنامه

یادداشت	۱۳۹۵/۰۹/۲۲	۱۳۹۵/۰۳/۲۲
	ریال	ریال
دارایی ها:		
۵ سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۱۶۵,۵۲۳,۴۹۶,۱۸۶	۱۵۴,۳۱۵,۱۸۳,۱۰۸
۶ سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۷۹,۶۹۳,۲۷۶	۱,۰۱۰,۷۰۵,۸۲۷
۷ سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	-	۶,۸۴۳,۶۵۲,۹۰۰
۸ حسابهای دریافتی	۸,۲۲۸,۳۲۰,۶۶۷	۷,۵۷۴,۳۸۴,۸۷۹
۹ جاری کارگزاران	-	۲۶۱,۷۳۴,۳۳۶
۱۰ سایر دارایی ها	۸۱,۵۶۳,۳۸۱	-
۱۱ موجودی نقد	۱۰,۰۰۰,۰۱۰	۱۰
جمع دارایی ها	۱۷۳,۹۲۳,۰۷۳,۵۲۰	۱۷۰,۰۰۵,۶۶۱,۰۶۰
بدهی ها:		
۹ جاری کارگزاران	۱۰۷,۳۶۴,۷۷۴	-
۱۲ پرداختی به ارکان صندوق	۸,۱۳۶,۴۲۸,۰۶۰	۶,۲۸۲,۱۰۲,۰۷۸
۱۳ پرداختی به سرمایه گذاران	۶۲,۹۸۶,۲۰۴	۹۶,۵۹۴,۱۵۹
۱۴ سایر حسابهای پرداختی و ذخایر	۱,۳۷۳,۶۵۱,۴۱۴	۱,۱۸۸,۷۹۷,۵۱۲
جمع بدهی ها	۹,۶۸۰,۴۳۰,۴۵۲	۷,۵۶۷,۴۹۳,۷۴۹
خالص دارایی ها	۱۶۴,۲۴۲,۶۴۳,۰۶۸	۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۲,۷۶۸,۱۵۰	۲,۵۸۹,۰۲۷

صورت سود و زیان

	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۴/۰۹/۲۲	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۹/۲۲	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۳/۲۲	یادداشت	
	ریال	ریال	ریال		درآمدها:
۱۶	(۵۳۶,۰۷۴,۲۶۴)	۳,۷۲۳,۱۶۱,۵۲۱	۱۸,۱۲۷,۳۴۹,۵۱۷		سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۷	(۳,۱۱۲,۳۷۸,۲۴۲)	(۲۱۶,۹۸۴,۵۳۸)	۱۶,۱۷۲,۷۴۵,۲۹۶		سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۸	۸,۴۳۵,۲۹۵,۱۷۰	۸,۷۳۲,۵۹۱,۲۴۲	۱۳,۱۷۲,۲۳۵,۴۶۲		سود سهام
۱۹	۲,۰۵۹,۵۷۴,۵۹۷	۲۴۴,۴۵۰,۰۵۷	۳,۴۰۹,۱۵۷,۷۰۷		سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۲۰	۱۹۳,۶۹۴,۲۷۹	۱,۱۳۸,۰۴۷,۴۳۱	۴۳۷,۳۸۷,۴۳۱		سایر درآمدها
	۷,۰۴۰,۱۱۱,۵۴۰	۱۳,۶۲۱,۲۶۵,۷۱۳	۵۱,۳۱۸,۸۷۵,۴۱۳		جمع درآمدها
					هزینه ها:
۲۱	(۱,۷۴۹,۱۱۰,۸۴۶)	(۲,۸۴۸,۰۳۵,۵۴۲)	(۴,۲۳۱,۹۹۶,۹۴۶)		هزینه کارمزد ارکان
۲۲	(۱۲۶,۱۴۴,۵۰۲)	(۱۴۱,۹۱۴,۲۲۱)	(۲۵۰,۶۲۱,۱۸۰)		سایر هزینه ها
	(۱,۸۷۵,۲۵۵,۳۴۸)	(۲,۹۸۹,۹۴۹,۷۶۳)	(۴,۴۸۲,۶۱۸,۱۲۶)		جمع هزینه ها
	۵,۱۶۴,۸۵۶,۱۹۲	۱۰,۶۳۱,۳۱۵,۹۵۰	۴۶,۸۳۶,۲۵۷,۲۸۷		سود (زیان) خالص
	۴.۳۷%	۳.۱۷%	۲۸.۶۳%		بازده سرمایه گذاری پایان دوره
	۴.۹۳%	۶.۶%	۳۴.۹۸%		بازده میانگین سرمایه گذاری

صورت گردش خالص دارایی ها

	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۴/۰۹/۲۲		دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۰۹/۲۲		سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۰۳/۲۲		
	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	
خالص دارائیهها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره	۶۲,۷۴۱	۱۱۹,۹۱۸,۹۶۴,۸۷۷	۶۶,۷۲۲	۱۱۹,۹۱۸,۹۶۴,۸۷۷	۶۲,۷۴۱	۱۱۹,۹۱۸,۹۶۴,۸۷۷	
واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره	۶,۰۱۵	-	-	۶,۰۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۸,۸۸۱	۸,۸۸۱,۰۰۰,۰۰۰	
واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره	(۹,۴۲۳)	(۲۰,۳۷۶,۶۵۱,۳۹۹)	(۱۰,۸۸۷)	(۹,۴۲۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۲,۸۶۲)	(۱۲,۸۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	
سود (زیان) خالص دوره	-	۵,۱۶۴,۸۵۶,۱۹۲	-	۱۰,۶۳۱,۳۱۵,۹۵۰	-	۴۶,۸۳۶,۲۵۷,۲۸۷	
تعدیلات	۲۳	-	-	(۵,۴۱۸,۸۴۰,۱۹۳)	-	(۳۳۶,۰۵۴,۸۵۳)	
خالص دارائیهها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره	۵۹,۳۲۲	۱۶۴,۲۴۲,۶۴۳,۰۶۸	۵۵,۸۳۵	۱۶۴,۲۴۲,۶۴۳,۰۶۸	۶۲,۷۴۱	۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	