

## گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

برای دوره یک‌ساله منتهی به

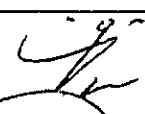
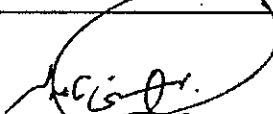

۲۲ خردادماه ۱۳۹۶

« ثبت شده به شماره ۱۰۸۶۹ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

## مقدمه :

اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق سرمایه‌گذاری در سهام بانک دی می‌باشد، با تاکید 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 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 می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۱۰ به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

## اعضاء گروه مدیران سرمایه‌گذاری صندوق

اعضای گروه مدیران سرمایه‌گذاری	سمت	امضاء
محمد کاظم مهدوی	مدیر سرمایه‌گذاری	
محسن نامدار بهشتی	مدیر سرمایه‌گذاری	
مهدی حیدرنیا	مدیر سرمایه‌گذاری	

خلاصه‌ای از رزومه کاری مدیران:

۱- محمد کاظم مهدوی:

دارای مدرک کارشناس ارشد علوم اقتصادی با سوابق کاری در پست‌های سازمانی معامله‌گر، مشاور مدیر معاملات، کارشناس ارشد سرمایه‌گذاری، مدیر عامل شرکت خدمات مالی حسابان خرم، معاونت سرمایه‌گذاری کارگزاری بانک دی، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرینان دی، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی و مدیر سرمایه‌گذاری صندوق اختصاصی بازارگردانی گروه دی

۲- محسن بهشتی نامدار:

دارای مدرک کارشناس ارشد مدیریت مالی با گرایش مهندسی مالی با سوابق کاری در پست‌های سازمانی کارشناس عرضه و پذیرش، مدیر آموزش در شرکت کارگزاری، نماینده مدیریت و مسئول کیفیت، کارشناس تحلیل و سرمایه‌گذاری، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق یکم کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق مشترک کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سبدگردانی کارگزاری بانک کشاورزی، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق ارزش آفرینان دی، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی و مدیر سرمایه‌گذاری صندوق اختصاصی بازارگردانی گروه دی

دارای مدرک کارشناس ارشد حسابداری و گواهینامه بین المللی CFA سطح ۳ با سوابق کاری در پست‌های سازمانی کارشناس، کارشناس سبد و تحلیل‌گر، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق در کارگزاری بانک شهر، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرینان دی، مدیر سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی و مدیر سرمایه‌گذاری صندوق اختصاصی بازارگردانی گروه دی

### معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی»

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی که صندوقی با سرمایه باز در اندازه بزرگ محسوب می‌شود، در تاریخ ۱۳۹۰/۰۳/۲۲ تحت شماره ۱۰۸۶۹ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است و شماره ۲۷۶۷۲ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیرتجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدهای مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام، حق تقدم سهام پذیرفته شده در بورس، اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده‌های بانکی سرمایه‌گذاری می‌نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، ۲ سال بوده که طی صورت جلسه مجمع صندوق مورخ ۱۳۹۳/۰۲/۲۸ و تایید سازمان بورس اوراق بهادار به مدت ۳ سال دیگر تمدید گردید. مرکز اصلی صندوق تهران، خیابان خالد اسلامبولی (وزرا)، نبش خیابان چهاردهم شماره ۵۸ طبقه دوم و سوم واقع شده است و صندوق دارای ۲۰ شعبه می‌باشد.

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی (سهامی) مطابق با ماده ۵۹ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس [www.dayfund.ir](http://www.dayfund.ir) درج گردیده است.

ارکان این صندوق در دوره گزارش مطابق جدول ذیل در مجمع عمومی مؤسس انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
مدیر ثبت	بانک دی
حسابرس	موسسه حسابرسی بهمند
متولی	سیدگردان آسمان

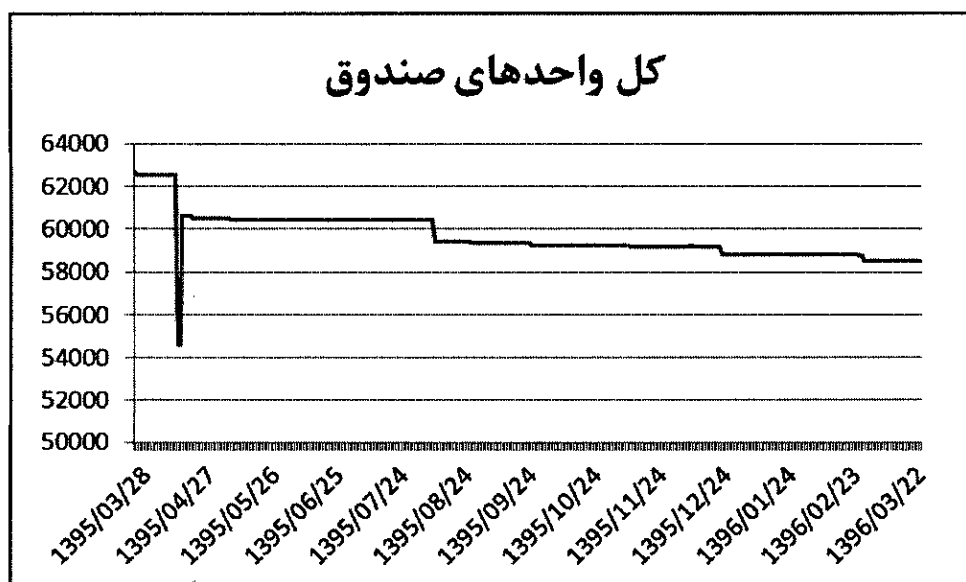
## عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۵/۰۳/۲۳ تا ۱۳۹۶/۰۳/۲۲ در ۳۶۶ روز مجموعاً ۶,۰۶۵ واحد سرمایه‌گذاری صادر و (۱۰,۲۷۳) واحد سرمایه‌گذاری ابطال در

سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۸,۵۳۳ واحد رسیده است.

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره	۶۲,۷۴۱
تعداد واحدهای صادر شده	۶,۰۶۵
تعداد واحدهای ابطالی	(۱۰,۲۷۳)
تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره	۵۸,۵۳۳

نمودار تغییرات تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری 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

عملکرد صندوق در دوره یک ساله منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲ مطابق جدول زیر می‌باشد:

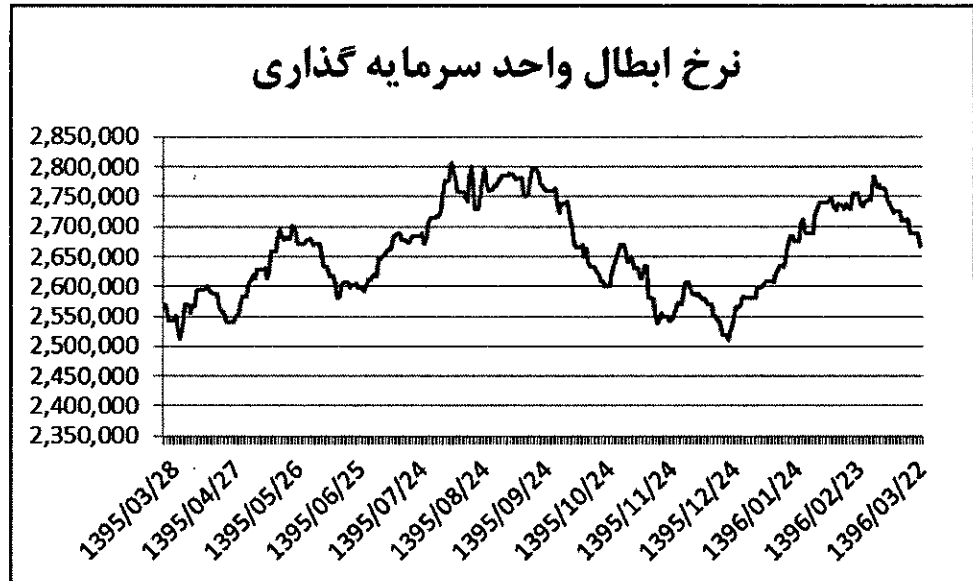
سهام شرکت‌های بورسی و فرابورسی	اوراق با درآمد ثابت	سپرده بانکی و نقد	مطالبات و سایر دارایی‌ها	(میلیون ریال)
۱۵۴,۳۱۵	۶,۸۲۴	۱,۰۱۰	۷,۸۵۵	موجودی در ابتدای دوره
۳۸۵,۳۹۶	۸,۹۹۹	۱۴۹,۹۳۲	۲۶۱,۱۶۹	خرید طی دوره
۳۸۹,۳۰۱	۱۵,۸۲۳	۱۴۹,۱۱۷	۲۶۱,۰۷۲	فروش طی دوره
۱۵۰,۴۱۰	۰	۱,۸۲۵	۷,۹۵۱	مانده پایان دوره

## ترکیب سرمایه‌گذاران در پایان دوره

بخش عمده‌ای از واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در اختیار سرمایه‌گذاران حقوقی است.

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	درصد صندوق	تملك
سرمایه‌گذاران حقیقی	۸۳	۱,۹۴۷	۳٪	
سرمایه‌گذاران حقوقی	۴	۴۶,۵۸۶	۹۷٪	
کل سرمایه‌گذاران	۹۷	۵۸,۵۳۳	۱۰۰٪	

نمودار NAV صندوق سرمایه گذاری بانک دی در سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره یک ساله منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۰۳/۲۲ می باشد:

میانگین	توضیح
-۳.۱۸٪	یک ماهه اخیر
۴.۷۱٪	سه ماهه اخیر
۳.۷۸٪	یک ساله اخیر

سرمایه گذاران می توانند با مراجعه به تارنمای صندوق، صورتهای مالی صندوق را برای دوره یاد شده ملاحظه نمایند. در این دوره صندوق سرمایه گذاری بانک دی مبلغ ۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰ ریال سود خالص محقق نموده است. در این دوره بازده سرمایه گذاری در پایان دوره ۷.۲۹ درصد بوده و بازده میانگین سرمایه گذاری ۲.۹ درصد بوده است. لازم به ذکر است که بازده سرمایه گذاری در پایان دوره و بازده میانگین سرمایه گذاری به روش زیر محاسبه می گردد:

$$\frac{\text{تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال} \pm \text{سود (زیان) خالص}}{\text{خالص دارائیهای پایان سال}} = \text{بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)}$$

$$\frac{\text{سود خالص}}{\text{میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده}} = \text{بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)}$$

صورت مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه گذاری بانک دی برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۹۶/۰۳/۲۲ مطابق جداول زیر می‌باشد:

ترازنامه:

۱۳۹۵/۰۳/۲۲	۱۳۹۶/۰۳/۲۲	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۱۵۴,۳۱۵,۱۸۳,۱۰۸	۱۵۰,۴۱۰,۲۴۸,۹۲۵	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۰۱۰,۷۰۵,۸۲۷	۱,۸۲۵,۳۶۶,۲۷۷	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۶,۸۴۳,۶۵۲,۹۰۰	-	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷,۵۷۴,۳۸۴,۸۷۹	۷,۹۲۲,۴۷۵,۰۴۱	۸	حسابهای دریافتی
۲۶۱,۷۳۴,۳۳۶	۲۳,۶۳۲,۵۱۳	۹	جاری کارگزاران
-	۶,۳۸۶,۵۶۷	۱۰	سایر دارایی‌ها
۱۰	۱۰	۱۱	موجودی نقد
<b>۱۷۰,۰۰۵,۶۶۱,۰۶۰</b>	<b>۱۶۰,۱۸۸,۱۰۹,۳۳۳</b>		<b>جمع دارایی‌ها</b>
			<b>بدهی‌ها:</b>
۶,۲۸۲,۱۰۲,۰۷۸	۲,۷۲۲,۶۷۱,۷۲۶	۱۲	پرداختی به ارکان صندوق
۹۶,۵۹۴,۱۵۹	۲۳,۴۰۵,۹۴۸	۱۳	پرداختی به سرمایه گذاران
۱,۱۸۸,۷۹۷,۵۱۲	۱,۲۸۴,۸۷۷,۲۶۹	۱۴	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۷,۵۶۷,۴۹۳,۷۴۹	۴,۰۳۰,۹۵۴,۹۴۳		جمع بدهی‌ها
<b>۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱</b>	<b>۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰</b>	۱۵	<b>خالص دارایی‌ها</b>
<b>۲,۵۸۹,۰۲۷</b>	<b>۲,۶۶۷,۸۴۸</b>		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری



## صورت سود و زیان:

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۰۳/۲۲	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲	یادداشت	درآمدها:
ریال	ریال		
۱۸,۱۲۷,۳۴۹,۵۱۷	۳,۸۶۸,۴۵۳,۵۱۶	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۶,۱۷۲,۷۴۵,۲۹۶	(۶,۲۴۹,۹۵۹,۳۶۶)	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۳,۱۷۲,۲۳۵,۴۶۲	۱۱,۵۰۰,۰۷۶,۲۶۶	۱۸	سود سهام
۳,۴۰۹,۱۵۷,۷۰۷	۳۶۴,۵۳۷,۵۲۲	۱۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۲۷,۳۸۷,۴۳۱	۱,۰۷۱,۶۸۲,۱۳۰	۲۰	سایر درآمدها
<b>۵۱,۳۱۸,۸۷۵,۴۱۳</b>	<b>۱۰,۵۵۴,۷۹۰,۰۶۸</b>		<b>جمع درآمدها</b>
			هزینه ها:
(۴,۲۳۱,۹۹۶,۹۴۶)	(۵,۶۱۴,۹۸۶,۶۰۷)	۲۱	هزینه کارمزد ارکان
(۲۵۰,۶۲۱,۱۸۰)	(۲۸۵,۲۶۶,۰۳۱)	۲۲	سایر هزینه ها
<b>(۴,۴۸۲,۶۱۸,۱۲۶)</b>	<b>(۵,۹۰۰,۲۵۲,۶۳۸)</b>		<b>جمع هزینه ها</b>
<b>۴۶,۸۳۶,۲۵۷,۲۸۷</b>	<b>۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰</b>		<b>سود (زیان) خالص</b>
<b>۲۸,۶۳٪</b>	<b>۷,۲۹٪</b>		بازده سرمایه گذاری پایان دوره <sup>(۱)</sup>
<b>۳۴,۹۸٪</b>	<b>۲,۹٪</b>		بازده میانگین سرمایه گذاری <sup>(۲)</sup>

## صورت گردش خالص دارایی ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۰۳/۲۲		سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۱۱۹,۹۱۸,۹۶۴,۸۷۷	۶۶,۷۲۲	۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	۶۲,۷۴۱	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
۸,۸۸۱,۰۰۰,۰۰۰	۸,۸۸۱	۶,۰۶۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۶۵	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۱۲,۸۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۲,۸۶۲)	(۱۰,۲۷۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰,۲۷۳)	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۴۶,۸۳۶,۲۵۷,۲۸۷	-	۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰	-	سود (زیان) خالص دوره
(۳۳۶,۰۵۴,۸۵۳)	-	(۶,۷۲۷,۵۵۰,۳۵۱)	-	۲۳ تعدیلات
<b>۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱</b>	<b>۶۲,۷۴۱</b>	<b>۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰</b>	<b>۵۸,۵۳۳</b>	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می باشد.

(۱) بازده سرمایه گذاری پایان دوره =  $\frac{\text{تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال} \pm \text{سود (زیان) خالص}}{\text{خالص داراییهای پایان سال}}$

(۲) بازده میانگین سرمایه گذاری =  $\frac{\text{سود خالص}}{\text{میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده}}$

