

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

برای دوره یک‌ساله منتهی به


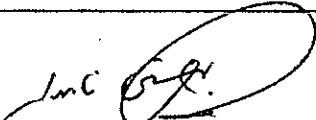

۲۲ خردادماه ۱۳۹۶

« 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 سبدی از دارایی‌های 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 درج گردیده است.

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

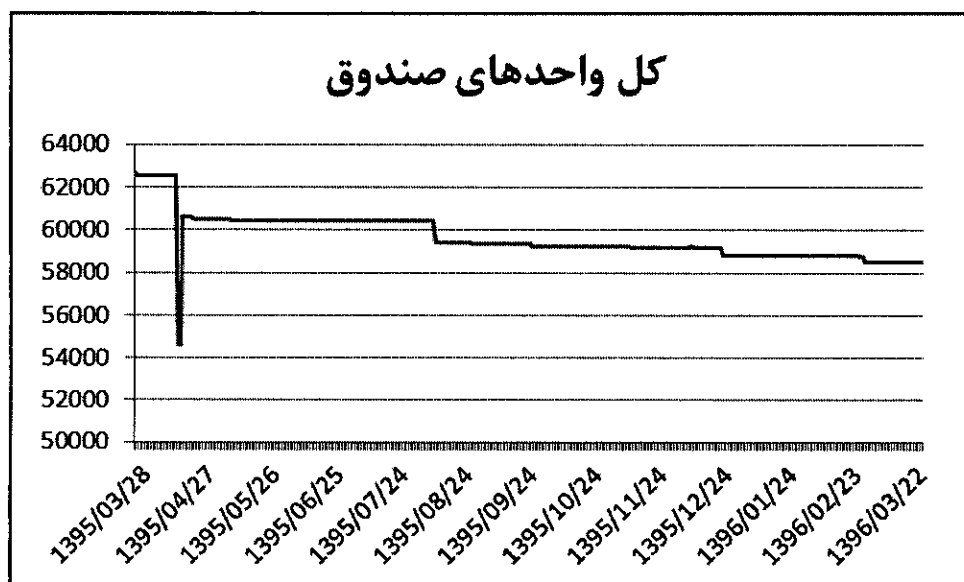
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی
مدیر ثبت	بانک دی
حسابرس	موسسه حسابرسی بهمند
متولی	سیدگردان آسمان

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.

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

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:

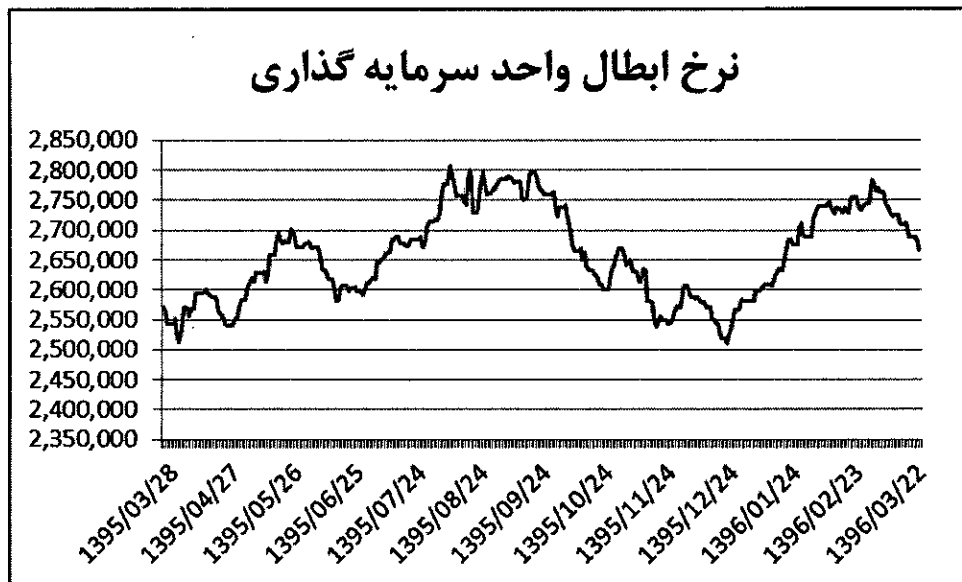
(میلیون ریال)	سهام شرکت‌های بورسی و فرا بورسی	اوراق با درآمد ثابت	سپرده بانکی و نقد	مطالبات و سایر دارایی‌ها
موجودی در ابتدای دوره	۱۵۴,۳۱۵	۶,۸۲۴	۱,۰۱۰	۷,۸۵۵
خرید طی دوره	۳۸۵,۳۹۶	۸,۹۹۹	۱۴۹,۹۳۲	۲۶۱,۱۶۹
فروش طی دوره	۳۸۹,۳۰۱	۱۵,۸۲۳	۱۴۹,۱۱۷	۲۶۱,۰۷۲
مانده پایان دوره	۱۵۰,۴۱۰	۰	۱,۸۲۵	۷,۹۵۱

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:

بازدهی	شرح
-۳.۱۸٪	یک ماهه اخیر
۴.۷۱٪	سه ماهه اخیر
۳.۷۸٪	یک ساله اخیر

سرمایه گذاران می توانند با مراجعه به تارنمای صندوق، صورت های 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:

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

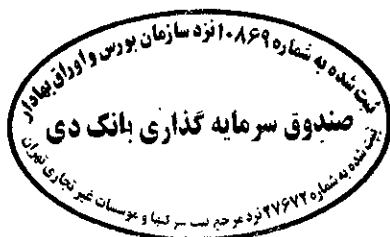
$$\frac{\text{سود خالص}}{\text{میانگین موزون (ریال) وجوه استناد شده}} = \text{بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)}$$

صندوق سرمایه گذاری بانک دی

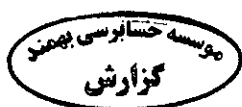
صورت خالص دارایی ها

در تاریخ ۲۲ خرداد ۱۳۹۶

۱۳۹۵/۰۳/۲۲	۱۳۹۶/۰۳/۲۲	یادداشت	دارایی ها:
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 دارایی ها
۱۰	۱۰	۱۱	موجودی نقد
۱۷۰,۰۰۵,۶۶۱,۰۶۰	۱۶۰,۱۸۸,۱۰۹,۳۳۳		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
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 بدهی ها
۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۱۵	خالص دارایی ها
۲,۵۸۹,۰۲۷	۲,۶۶۷,۸۴۸		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری



یادداشت های توضیحی همراه ، بخش جدایی ناپذیر صورتهای مالی می باشد.



صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

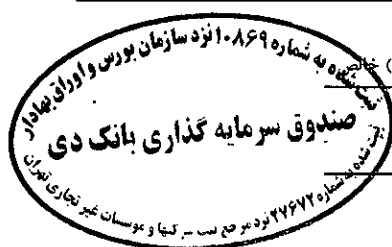
برای سال مالی منتهی به ۲۲ خرداد ماه ۱۳۹۶

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۰۳/۲۲	سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲	یادداشت
ریال	ریال	درآمدها:
۱۸,۱۲۷,۳۴۹,۵۱۷	۵,۶۴۲,۳۰۱,۸۶۱	۱۶ سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۶,۱۷۲,۷۴۵,۲۹۶	(۸,۰۲۳,۸۰۷,۷۱۱)	۱۷ سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۳,۱۷۲,۲۳۵,۴۶۲	۱۱,۲۸۱,۲۷۸,۴۹۳	۱۸ سود سهام
۳,۴۰۹,۱۵۷,۷۰۷	۳۶۴,۵۳۷,۵۲۲	۱۹ سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۳۷,۳۸۷,۴۳۱	۱,۲۹۰,۴۷۹,۹۰۳	۲۰ سایر درآمدها
۵۱,۳۱۸,۸۷۵,۴۱۳	۱۰,۵۵۴,۷۹۰,۰۶۸	جمع درآمدها
		هزینه‌ها:
(۴,۲۳۱,۹۹۶,۹۴۶)	(۵,۶۱۴,۹۸۶,۶۰۷)	۲۱ هزینه کارمزد ارکان
(۲۵۰,۶۲۱,۱۸۰)	(۲۸۵,۲۶۶,۰۳۱)	۲۲ سایر هزینه‌ها
(۴,۴۸۲,۶۱۸,۱۲۶)	(۵,۹۰۰,۲۵۲,۶۳۸)	جمع هزینه‌ها
۴۶,۸۳۶,۲۵۷,۲۸۷	۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰	سود (زیان) خالص
۲۸.۶۳٪	-۱.۳۳٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره ^(۱)
۳۴.۹۸٪	۲.۹٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری ^(۲)

صورت گردش خالص دارایی‌ها

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 سرمایه‌گذاری) اول دوره
۸,۸۸۱,۰۰۰,۰۰۰	۸,۸۸۱	۶,۰۶۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۶۵	واحد‌های سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۱۲,۸۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۲,۸۶۲)	(۱۰,۲۷۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰,۲۷۳)	واحد‌های سرمایه‌گذاری 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
۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	۶۲,۷۴۱	۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۵۸,۵۳۳	خالص داراییها (واحد سرمایه‌گذاری) پایان دوره

یادداشت‌های توضیحی همراه، بخش جدائی‌ناپذیر صورتهای مالی می‌باشد.



تعدیلات ناشی از تقلوت قیمت صدور و ابطال \pm سود (زیان) خالص داراییهای پایان سال = بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره^(۱)

سود خالص = بازده میانگین سرمایه‌گذاری^(۲)

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

