

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

برای دوره نه ماهه منتهی به

۲۲ اسفندماه 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 ۱۳۹۶/۱۲/۲۶ به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

اعضاء گروه مدیران سرمایه‌گذاری صندوق

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

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 سب‌گردانی 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 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	شرکت کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
مدیر ثبت	شرکت کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	موسسه حسابرسی بهمند
متولی	شرکت مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی
ضامن نقد شوندگی	بانک دی (سهامی عام)

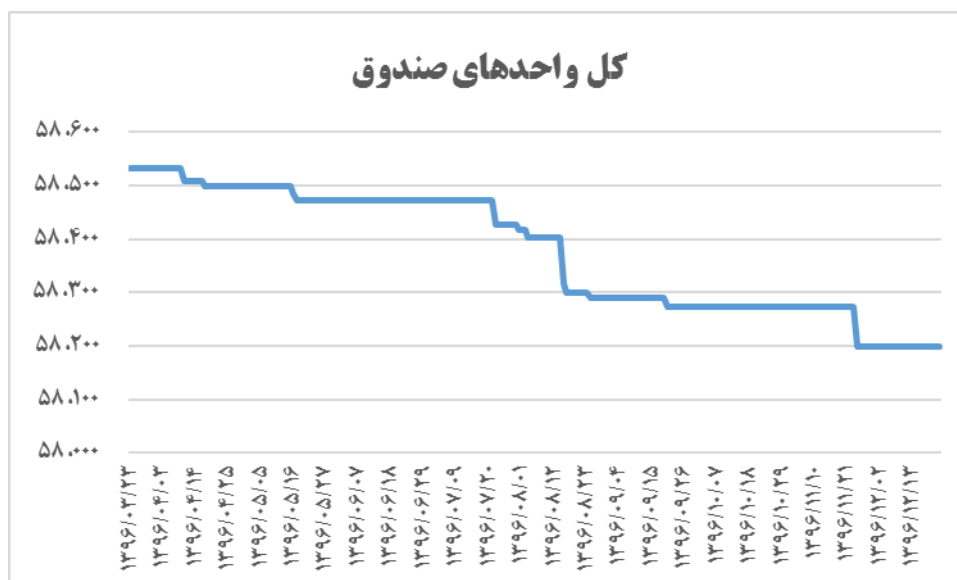
عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۱۳۹۶/۰۳/۲۳ تا ۱۳۹۶/۱۲/۲۲ در ۲۷۴ روز مجموعاً ۳۳۵ واحد سرمایه‌گذاری در سیستم عملیاتی صندوق ابطال شده است که

در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۸,۱۹۸ واحد رسیده است.

۵۸,۵۳۳	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۰	تعداد واحدهای صادر شده
-۳۳۵	تعداد واحدهای ابطالی
۵۸,۱۹۸	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

نمودار تغییرات تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق از ۱۳۹۶/۱۲/۲۲ الی ۱۳۹۶/۰۳/۲۳



همانطور که در نمودار فوق مشاهده می‌شود، در طی دوره ۹ ماهه مورد گزارش، به دلیل نوسانات نرخ بهره در بازار پول، رشد نرخ تسعیر

ارز و نیز جذابیت سرمایه‌گذاری در سایر بازارها مانند طلا، تعداد واحدهای صندوق کاهش ۳۳۵ واحدی را داشته است.

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 نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۲ مطابق جدول زیر می باشد:

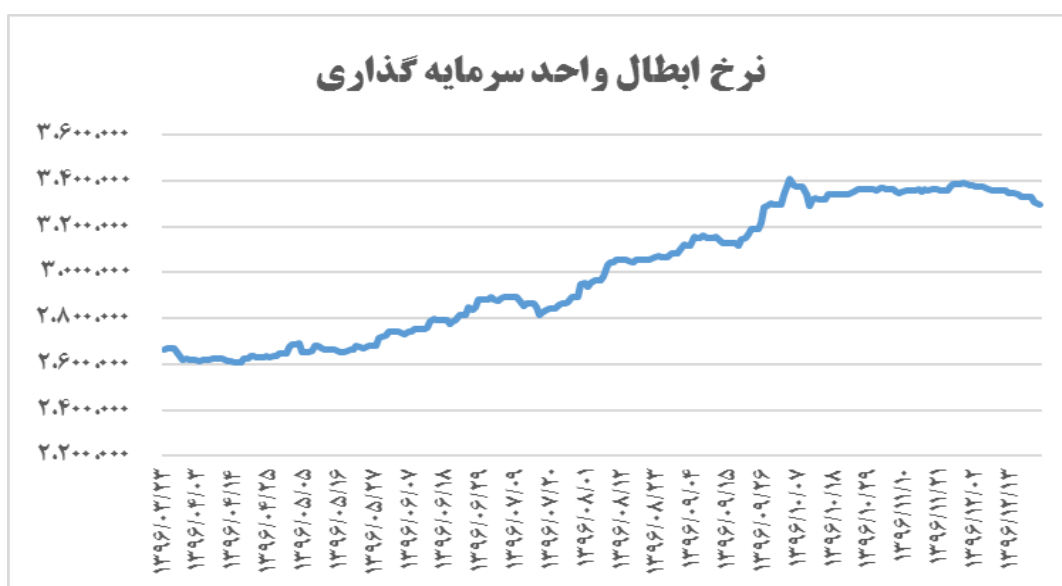
مطالبات و سایر دارایی ها	سپرده بانکی و نقد	اوراق با درآمد ثابت	سهام شرکت های بورسی و فرابورسی	(میلیون ریال)
۷,۹۲۲	۱,۸۴۹	-	۱۵۰,۴۱۰	موجودی در ابتدای دوره
۱۲,۱۳۶	۶۵۲,۱۲۹	۴۳,۰۱۹	۳۸۶,۳۸۴	افزایش طی دوره
-۱۳,۹۱۴	-۶۰۰,۸۲۶	-۳۳,۵۷۶	-۴۰۹,۷۳۸	کاهش طی دوره
۶,۱۴۵	۵۳,۱۵۲	۹,۴۴۳	۱۲۷,۰۵۶	مانده پایان دوره

ترکیب سرمایه گذاران در پایان دوره

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

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه گذاران حقیقی	۷۱	۱,۶۱۲	۳٪
سرمایه گذاران حقوقی	۴	۵۶,۵۸۶	۹۷٪
کل سرمایه گذاران	۹۷	۵۸,۱۹۸	۱۰۰٪

نمودار NAV صندوق سرمایه گذاری بانک دی در نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۲



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره نه ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۲ می باشد:

شرح	بازدهی صندوق
یک ماهه اخیر	-۱.۸%
سه ماهه اخیر	۳.۴%
یک ساله اخیر	۳۰.۲%

سرمایه‌گذاران می‌توانند با مراجعه به تارنمای صندوق، صورت‌های مالی صندوق را برای دوره یاد شده ملاحظه نمایند. در این دوره صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی مبلغ ۳۶,۷۸۵,۷۱۲,۴۷۹ ریال سود خالص محقق نموده است. در این دوره بازده سرمایه‌گذاری در پایان دوره ۱۸,۸۱ درصد بوده و بازده میانگین سرمایه‌گذاری ۲۱,۱ درصد بوده است.

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه گذاری بانک دی برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۲ مطابق جدول زیر می‌باشد:

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۲۲ اسفند ۱۳۹۶

۱۳۹۶/۰۳/۲۲	۱۳۹۶/۱۲/۲۲	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۱۵۰,۴۱۰,۲۴۸,۹۲۵	۱۲۷,۰۵۶,۳۶۰,۴۳۹	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۸۲۵,۳۶۶,۲۷۷	۵۱,۸۶۸,۵۲۴,۵۲۱	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
-	۹,۴۴۳,۱۳۵,۲۶۰	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷,۹۲۲,۴۷۵,۰۴۱	۶,۱۴۴,۵۲۶,۶۶۳	۸	حسابهای دریافتی
۲۳,۶۳۲,۵۱۳	۱,۲۸۳,۹۱۴,۲۶۶	۹	جاری کارگزاران
۶,۳۸۶,۵۶۷	۲۲,۲۵۷,۱۸۱	۱۰	سایر دارایی‌ها
۱۰	۱۰	۱۱	موجودی نقد
۱۶۰,۱۸۸,۱۰۹,۳۳۳	۱۹۵,۸۱۸,۷۱۸,۳۴۰		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۲,۷۲۲,۶۷۱,۷۲۶	۲,۶۹۷,۶۶۲,۲۹۹	۱۲	پرداختی به ارکان صندوق
۲۳,۴۰۵,۹۴۸	۱۹,۹۰۱,۴۲۴	۱۳	پرداختی به سرمایه گذاران
۱,۲۸۴,۸۷۷,۲۶۹	۱,۱۷۰,۴۶۰,۲۸۳	۱۴	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۴,۰۳۰,۹۵۴,۹۴۳	۳,۸۸۸,۰۲۴,۰۰۶		جمع بدهی‌ها
۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۱۹۱,۹۳۰,۶۹۴,۳۳۴	۱۵	خالص دارایی‌ها
۲,۶۶۷,۸۴۸	۳,۲۹۷,۸۹۲		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

برای دوره مالی میانی نه ماهه منتهی به ۲۲ اسفند ماه ۱۳۹۶

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲	دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۲	دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۲	یادداشت	
ریال	ریال	ریال		درآمدها:
۵,۶۴۲,۳۰۱,۸۶۱	۳,۱۷۷,۳۰۰,۵۶۰	۳۰,۷۷۴,۶۲۳,۶۱۵	۱۶	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۸,۰۲۳,۸۰۷,۷۱۱)	(۱۳,۲۳۵,۹۰۹,۵۱۱)	(۱,۸۱۳,۱۸۹,۹۹۳)	۱۷	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۱,۳۸۱,۳۷۸,۴۹۳	۹,۰۲۶,۹۹۳,۰۶۰	۹,۷۴۷,۰۸۶,۰۳۲	۱۸	سود سهام
۳۶۴,۵۳۷,۵۲۲	۳۶۵,۴۱۷,۵۳۳	۱,۳۴۰,۴۹۸,۹۶۲	۱۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۲۹۰,۴۷۹,۹۰۳	۱,۳۲۰,۳۹۳,۰۶۵	۱,۰۳۸,۸۷۱,۹۱۶	۲۰	سایر درآمدها
۱۰,۵۵۴,۷۹۰,۰۶۸	۵۵۳,۹۹۴,۷۰۷	۴۱,۰۸۷,۸۹۰,۵۳۲		جمع درآمدها
				هزینه‌ها:
(۵,۶۱۴,۹۸۶,۶۰۷)	(۴,۳۳۵,۴۱۱,۸۹۸)	(۴,۰۴۱,۹۲۸,۱۱۷)	۲۱	هزینه کارمزد ارکان
(۳۸۵,۲۶۶,۰۳۱)	(۲۱۳,۳۹۵,۴۳۱)	(۲۶۰,۲۴۹,۹۳۶)	۲۲	سایر هزینه‌ها
(۵,۹۰۰,۲۵۲,۶۳۸)	(۴,۴۴۸,۷۰۷,۳۲۹)	(۴,۳۰۲,۱۷۸,۰۵۳)		جمع هزینه‌ها
۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰	(۳,۸۹۴,۷۱۲,۶۲۲)	۳۶,۷۸۵,۷۱۲,۴۷۹		سود (زیان) خالص
-۱.۳۳٪	-۶.۸۰٪	۱۸.۸۱٪		بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره ^{۱۱}
۲.۹۰٪	-۲.۵۰٪	۲۱.۱٪		بازده میانگین سرمایه‌گذاری ^{۱۱}

صورت گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲		دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۵/۱۲/۲۲		دوره نه ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۲		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	۶۲,۷۴۱	۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	۶۲,۷۴۱	۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۵۸,۵۳۳	خالص دارائیه‌ها (واحد سرمایه‌گذاری) اول دوره
۶,۰۶۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۶۵	۶,۰۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۱۵	-	-	واحد‌های سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۱۰,۲۷۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰,۲۷۳)	(۹,۹۷۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۹,۹۷۳)	(۳۳۵,۰۰۰,۰۰۰)	۳۳۵	واحد‌های سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰	-	(۳,۸۹۴,۷۱۲,۶۲۲)	-	۳۶,۷۸۵,۷۱۲,۴۷۹	-	سود (زیان) خالص دوره
(۶,۷۲۷,۵۵۰,۳۵۱)	-	(۶,۲۰۶,۴۲۸,۱۲۱)	-	(۶۷۷,۱۷۲,۵۳۵)	-	تعدیلات
۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۵۸,۵۳۳	۱۴۸,۳۷۹,۰۲۶,۵۶۸	۵۸,۷۲۳	۱۹۱,۹۳۰,۶۹۴,۳۳۴	۵۸,۸۶۸	خالص دارائیه‌ها (واحد سرمایه‌گذاری) پایان دوره

یادداشتهای توضیحی همراه، بخش جدائی ناپذیر صورتهای مالی می‌باشد.

تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ± سود (زیان) خالص خالص دارائیه‌های پایان سال	=	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره ^{۱۱}
سود خالص میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده	=	بازده میانگین سرمایه‌گذاری ^{۱۱}