

## گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری بانک دی

برای دوره یک‌ساله منتهی به

۲۲ خردادماه ۱۳۹۷

« 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 ۱۳۹۷/۰۴/۱۰ به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

## 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، جمع آوری 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 سپرده های بانکی سرمایه‌گذاری می‌نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، ۲ سال بوده که طی صورت جلسه مجمع صندوق مورخ ۱۳۹۵/۱۲/۱۵ و تأیید سازمان بورس اوراق بهادار طی نامه ۱۲۲/۲۲۰۹۲ مورخ ۱۳۹۶/۰۳/۲۹ 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.

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 انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
مدیر ثبت	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
ضامن نقدشوندگی	بانک دی (سهامی عام)
حسابرس	موسسه حسابرسی بهمند
متولی	شرکت مشاور سرمایه گذاری ایرانیان تحلیل فارابی

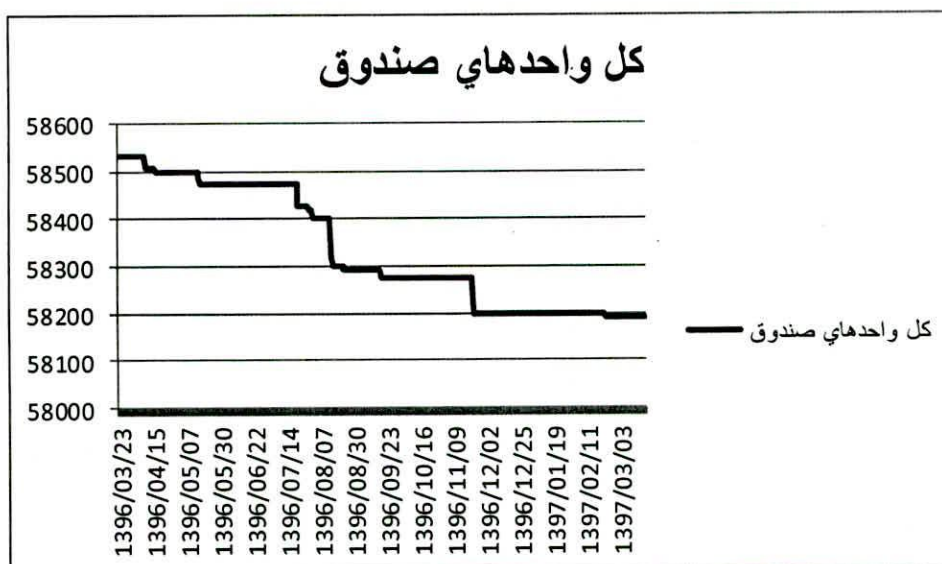
## عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۶/۰۳/۲۳ تا ۱۳۹۷/۰۳/۲۲ در ۳۶۶ روز مجموعاً (۳۴۵) واحد سرمایه‌گذاری ابطال در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده

است که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره به ۵۸,۱۸۸ واحد رسیده است.

۵۸,۵۳۳	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
-	تعداد واحدهای صادر شده
(۳۴۵)	تعداد واحدهای ابطالی
۵۸,۱۸۸	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 ۱۳۹۷/۰۳/۲۲ مطابق جدول زیر می باشد:

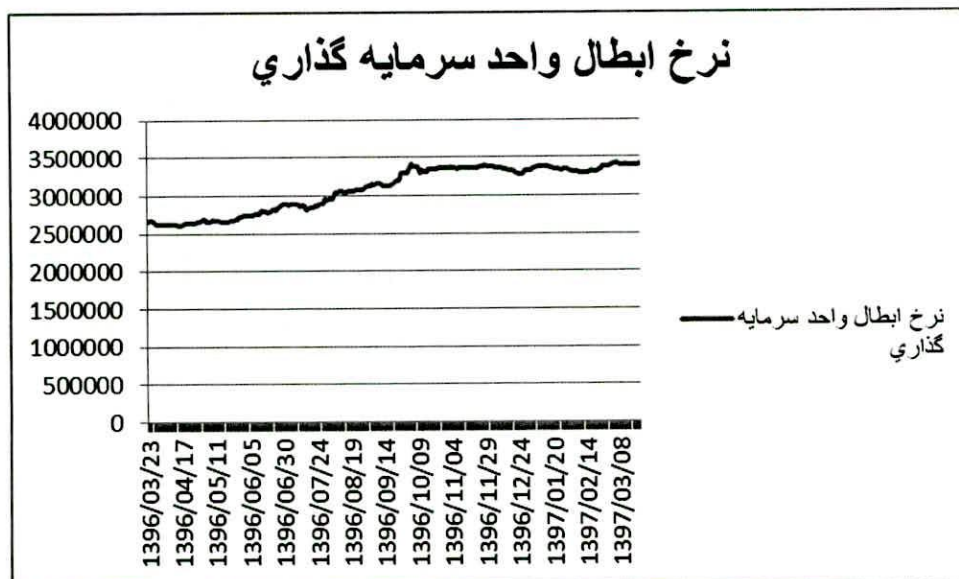
مطالبات و سایر دارایی ها	سپرده بانکی و نقد	اوراق با درآمد ثابت	سهام شرکتهای بورسی و فرابورسی	(میلیون ریال)
۷,۹۴۶	۱,۸۲۵	-	۱۵۰,۴۱۰	موجودی در ابتدای دوره
۵۳۴,۷۶۳	۳۵۹,۴۰۱	۴۴,۲۹۶	۴۳۵,۲۵۲	خرید طی دوره
۵۲۶,۹۹۲	۳۰۱,۰۹۴	۳۴,۵۱۲	۴۶۹,۵۹۶	فروش طی دوره
۱۵,۷۱۶	۶۰,۱۳۲	۹,۷۸۴	۱۱۶,۰۶۶	مانده پایان دوره

#### 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	۷۰	۱,۶۰۲	٪۲,۸
سرمایه گذاران حقوقی	۴	۵۶,۵۸۶	٪۹۷,۲
کل سرمایه گذاران	۷۴	۵۸,۱۸۸	٪۱۰۰

نمودار NAV صندوق سرمایه گذاری بانک دی در سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۲۲



جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره یک ساله منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۰۳/۲۲ می باشد:

بازدهی	شرح
۲,۳۲	یک ماهه اخیر
۴,۱۴	سه ماهه اخیر
۲۷,۹	یک ساله اخیر

صورت مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه گذاری بانک دی برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۲۲ مطابق جداول زیر می‌باشد:

ترازنامه:

۱۳۹۶/۰۳/۲۲	۱۳۹۷/۰۳/۲۲	یادداشت	دارایی‌ها:
ریال	ریال		
۱۵۰,۴۱۰,۲۴۸,۹۲۵	۱۱۶,۰۶۶,۹۷۸,۵۵۲	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۸۲۵,۳۶۶,۲۷۷	۶۰,۱۳۲,۲۴۱,۱۲۱	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
-	۹,۷۸۴,۳۸۳,۶۷۵	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷,۹۲۲,۴۷۵,۰۴۱	۱۱,۷۹۷,۶۶۲,۹۷۲	۸	حسابهای دریافتی
۲۳,۶۳۲,۵۱۳	۳,۹۱۸,۷۸۳,۵۲۸	۹	جاری کارگزاران
۶,۳۸۶,۵۶۷	-	۱۰	سایر دارایی‌ها
۱۰	۱۰	۱۱	موجودی نقد
۱۶۰,۱۸۸,۱۰۹,۳۳۳	۲۰۱,۷۰۰,۰۴۹,۸۵۸		جمع دارایی‌ها
			بدهی‌ها:
۲,۷۲۲,۶۷۱,۷۲۶	۱,۹۶۶,۷۸۸,۸۰۲	۱۲	پرداختی به ارکان صندوق
۲۳,۴۰۵,۹۴۸	۱۹,۹۰۱,۴۲۴	۱۳	پرداختی به سرمایه گذاران
۱,۲۸۴,۸۷۷,۲۶۹	۱,۱۶۵,۲۴۲,۷۶۹	۱۴	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۴,۰۳۰,۹۵۴,۹۴۳	۳,۱۵۱,۹۳۲,۹۹۵		جمع بدهی‌ها
۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۱۹۸,۵۴۸,۱۱۶,۸۶۳	۱۵	خالص دارایی‌ها
۲,۶۶۷,۸۴۸	۳,۴۱۲,۱۸۴		خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری



صورت سود و زیان:

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲	سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۲۲	یادداشت
ریال	ریال	درآمدها:
۵,۶۴۲,۳۰۱,۸۶۱	۲۸,۵۶۰,۲۷۳,۰۴۴	۱۶ سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۱۱,۰۳۷,۴۰۶,۱۶۶)	(۴,۶۹۳,۵۷۷,۷۱۷)	۱۷ سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۱,۲۸۱,۲۷۸,۴۹۳	۲۱,۲۳۷,۰۲۹,۵۳۰	۱۸ سود سهام
۳۶۴,۵۳۷,۵۲۲	۲,۹۳۳,۲۱۳,۱۷۳	۱۹ سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۲۹۰,۴۷۹,۹۰۳	۹۶۷,۱۸۳,۹۵۷	۲۰ سایر درآمدها
<b>۷,۵۴۱,۱۹۱,۶۱۳</b>	<b>۴۹,۰۰۴,۱۲۱,۹۸۷</b>	<b>جمع درآمدها</b>
		هزینه ها:
(۵,۶۱۴,۹۸۶,۶۰۷)	(۵,۲۱۹,۰۹۸,۴۸۲)	۲۱ هزینه کارمزد ارکان
(۲۸۵,۲۶۶,۰۳۱)	(۳۴۸,۳۸۹,۷۷۷)	۲۲ سایر هزینه ها
<b>(۵,۹۰۰,۲۵۲,۶۳۸)</b>	<b>(۵,۵۶۷,۴۸۸,۲۵۹)</b>	<b>جمع هزینه ها</b>
<b>۱,۶۴۰,۹۳۸,۹۷۵</b>	<b>۴۳,۴۳۶,۶۳۳,۷۲۸</b>	<b>سود (زیان) خالص</b>
-۱/۳۳٪	۲۱/۵۲٪	بازده سرمایه گذاری پایان دوره <sup>(۱)</sup>
۲/۹۰٪	۲۴/۱٪	بازده میانگین سرمایه گذاری <sup>(۲)</sup>

صورت گردش خالص دارایی ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۶/۰۳/۲۲		سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۲۲		
ریال	تعداد	ریال	تعداد	
۱۶۲,۴۳۸,۱۶۷,۳۱۱	۶۲,۷۴۱	۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰	۵۸,۵۳۳	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول دوره
۶,۰۶۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۰۶۵	-	-	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
(۱۰,۲۷۳,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰,۲۷۳)	(۳۴۵,۰۰۰,۰۰۰)	(۳۴۵)	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
۴,۶۵۴,۵۳۷,۴۳۰	-	۴۳,۴۳۶,۶۳۳,۷۲۸	-	سود (زیان) خالص دوره
(۶,۷۲۷,۵۵۰,۳۵۱)	-	(۷۰۰,۶۷۱,۲۵۵)	-	۲۳ تعدیلات
<b>۱۵۶,۱۵۷,۱۵۴,۳۹۰</b>	<b>۵۸,۵۳۳</b>	<b>۱۹۸,۵۴۸,۱۱۶,۸۶۳</b>	<b>۵۸,۱۸۸</b>	خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان دوره

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

تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ± سود (زیان) خالص = بازده سرمایه گذاری پایان دوره<sup>(۱)</sup>

خالص داراییهای پایان سال  
سود خالص = بازده میانگین سرمایه گذاری<sup>(۲)</sup>

میانگین موزون (ریال) وجوه استقراض شده

بازده به شماره ۰۸۶۹-آئذ سازمان بورس و اوراق بهادار  
صندوق سرمایه گذاری بانک دی  
پشتیبان غیر تجاری تهران  
شماره ۲۷۶۶۲۲۲۷۰۰۰