

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

"گزارش افشای پرتفوی ماهانه"

در راستای اجرای ابلاغیه شماره ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ مورخ ۱۲۰۲۰۹۳ سازمان بورس و اوراق بهادار

منتظری به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۷

فریدن آقا بزرگی
مدیر عامل و عضو هیئت مدیره
کارگزاری بانک دی

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه مالی دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدیم سهام

۱۳۹۷/۰۱/۳۱					تغییرات طی دوره					۱۳۹۶/۱۲/۲۹				
درصد به کل دارایی‌ها	بهای تمام شده هر سهم	قیمت بازار خالص ارزش فروش	تعداد	فروش طی دوره مبلغ فروش	تعداد	خرید طی دوره بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده هر سهم	تعداد	شرکت			
% ۱۲,۹۸	۷,۴۷۴,۸۲۸,۱۳۸	۷,۶۷۷,۴۵۸,۶۴۸	۱۰۲۳	۷,۳۳۶,۰۵۳	۱۸۲,۲۴۰,۶۵۴	۱۸۵,۳۸۸-	-	۷,۵۶۶,۳۴۴,۷۵۵	۷,۸۷۱,۴۷۴,۲۴۶	۷,۵۲۱,۴۴۱	بیمه دی			
% ۴۸,۸۷	۲۸,۰۱۵,۶۶۴,۵۰۲	۲۷,۰۱۵,۸۸۴,۶۹۳	۱,۱۴۸	۲۴,۶۲۰,۵۹۲	-	۱۵۶,۸۳۴,۹۸۲	۱۳۵,۰۰۰	۲۷,۵۸۲,۷۰۸,۶۶۶	۲۶,۸۵۹,۰۴۹,۷۱۱	۲۴,۴۸۵,۵۹۲	سرمایه‌گذاری بوعلی			
۰,۶۱۹	۳۵,۶۲۶,۵۰۲,۶۴۰	۳۴,۶۹۳,۳۴۳,۳۴۱	۳۱,۹۵۶,۶۴۵	۱۸۲,۲۴۰,۶۵۴	(۱۸۵,۳۸۸)	۱۵۶,۸۳۴,۹۸۲	۱۳۵,۰۰۰	۳۵,۱۴۹,۰۵۲,۴۲۱	۳۴,۷۳۰,۵۲۳,۹۵۷	۳۲,۰۰۷,۰۳۳	جمع		

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری در سپرده‌های بانکی

سپرده‌های بانکی	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی حساب	مشخصات حساب بانکی	تفصیرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۷/۰۱/۳۱
						درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	
دی وزرا	۰۱۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴	حساب جاری	۱۳۹۵/۰۱/۲۸	٪	مشخصات حساب بانکی	۰,۰۰٪	-	-	-	-	۱۳۹۶/۱۲/۲۹
دی وزرا	۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۳	حساب جاری	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	۰	مشخصات حساب بانکی	۰,۰۲٪	۱۰,۰۰,۰۰۰	۴۴۸,۳۱۳,۱۳۹	۴۵۸,۳۱۳,۱۳۹	-	۱۳۹۷/۰۱/۳۱
دی وزرا	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	٪	مشخصات حساب بانکی	۳۸,۲۴٪	۲۲۰,۳۶,۱۵۹,۷۴۰	۴۵۸,۳۱۳,۱۳۹	۵۴۰,۸۹۱,۳۶۹	۲۱,۹۵۳,۵۸۱,۵۱۰	۱۳۹۶/۱۲/۲۹
جمع					مشخصات حساب بانکی	۰	۲۲۰,۴۶,۱۵۹,۷۴۰	۹۰۶,۶۲۶,۲۷۸	۹۹۹,۲۰۴,۵۰۸	۲۱,۹۵۳,۵۸۱,۵۱۰	۱۳۹۷/۰۱/۳۱

صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی گروه مالی دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه متمی ۱۳۹۷/۰۱/۳۱ به

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
سرمایه گذاری در سهام	۱-۲	۵۰۲۸۵۴۸۹۱.۰۰	-۷۰.۳۸٪	۰.۸۷٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادر	۲-۲	۰.۰۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی	۳-۲	-۱۹۱۶۴۸۱۱۰.۰۰	۲۶.۸۲٪	-۰.۳۳٪
جمع		۳۱۱.۲۰۶.۷۸۱	۴۳.۶٪-	۰.۵۴٪

صندوق سرمایه گذاری بازار گردانی گروه مالی دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه متمی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه

طی فروردین ماه

شرح	تاریخ دریافت سود	تاریخ سرسید	نرخ سود علی حساب	درآمد سود	هزینه تنزيل	درآمد سود	خلاص درآمد	هزینه تنزيل	درآمد سود	درآمد سود	هزینه تنزيل	درآمد سود	خلاص درآمد	هزینه تنزيل
دی وزرا	.	.	۱۰	۱۹۱,۶۴۸,۱۱۰	۱۴۷,۲۶۴	۳۷۰,۵۰۳,۶۳۸	۱۹۱,۷۹۵,۳۷۴	۱۴۷,۲۶۴	۱۹۱,۶۴۸,۱۱۰	۱۹۱,۷۹۵,۳۷۴	۱۴۷,۲۶۴	۳۷۰,۵۰۳,۶۳۸	۱۴۷,۲۶۴	۳۷۰,۵۰۰,۹۰۲
جمع				۱۹۱,۶۴۸,۱۱۰	۱۴۷,۲۶۴	۳۷۰,۵۰۳,۶۳۸	۱۹۱,۷۹۵,۳۷۴	۱۴۷,۲۶۴	۱۹۱,۶۴۸,۱۱۰	۱۹۱,۷۹۵,۳۷۴	۱۴۷,۲۶۴	۳۷۰,۵۰۰,۹۰۲	۱۴۷,۲۶۴	۳۷۰,۵۰۰,۹۰۲

صندوق سرمایه گذاری گروه مالی دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه متمی ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه						طی فروردین ماه						شرح
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص بهای فروش	تعداد					
-۲۰,۲۴۸,۰۳۶	۳۱۱,۲۵۲,۹۸۲	۲۹۱,۰۰۴,۹۴۶	۲۸۵,۳۸۸	-۱۹,۹۴۹,۲۳۶	۲۰۲,۱۸۹,۸۹۰	۱۸۲,۲۴۰,۶۵۴	۱۸۵,۳۸۸					بیمه دی
۴۰۹,۳۹۹	۴۹,۳۰۲,۴۱۶	۴۹,۷۱۱,۸۱۵	۵۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰					سرمایه‌گذاری بوعلی
-۱۹,۸۳۸,۶۳۷	۳۶۰,۵۵۵,۳۹۸	۳۴۰,۷۱۶,۷۶۱	۳۳۵,۳۸۸	-۱۹,۹۴۹,۲۳۶	۲۰۲,۱۸۹,۸۹۰	۱۸۲,۲۴۰,۶۵۴	۱۸۵,۳۸۸					جمع

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه گذاری بازار گردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه متمی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

شرح	از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه				طی فروردین ماه			
	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد
سرمایه گذاری بوعلی	۳,۸۱۵,۵۱۷,۹۴۸	۲۴,۳۳۶,۱۴۶,۵۵۳	۲۸,۱۵۱,۶۶۴,۵۰۱	۲۴,۶۲۰,۵۹۲	۴۱۲,۱۲۰,۸۵۴	۲۷,۷۳۹,۵۴۳,۶۴۷	۲۸,۱۵۱,۶۶۴,۵۰۱	۲۴,۶۲۰,۵۹۲
بیمه دی	(۵۲۶,۰۸۸,۳۱۸)	۸,۰۰۰,۹۲۶,۴۵۶	۷,۴۷۴,۸۳۸,۱۳۷	۷,۳۳۶,۰۵۳	۱۱۰,۶۸۳,۲۷۳	۷,۳۶۴,۱۵۴,۸۶۴	۷,۴۷۴,۸۳۸,۱۳۷	۷,۳۳۶,۰۵۳
جمع	۳,۲۸۹,۴۲۹,۶۳۰	۳۲,۳۳۷,۰۷۳,۰۰۹	۳۵,۶۲۶,۵۰۲,۶۳۸	۳۱,۹۵۶,۶۴۵	۵۲۲,۸۰۴,۱۲۷	۳۵,۱۰۳,۶۹۸,۵۱۱

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم اورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه مالی دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

۱-۲-درآمد حاصل از سرمایه-گذاری در سهام و حق تقدیم سهام:

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه

طی فروردین ماه

جمع		درآمد فروش		درآمد سود سهام		جمع		درآمد فروش		درآمد سود سهام	
درصد از کل درآمد ها	مبلغ	بادداشت ...	درآمد تغییر ارزش	بادداشت ...	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	بادداشت ...	درآمد تغییر ارزش	بادداشت ...	درآمد سود سهام
۱۴.۹۳٪	۵۴۶,۳۳۶,۳۵۴-	۲۰,۲۴۸,۰۳۶-	(۵۲۶,۰۸۸,۳۱۸)	-	۱۲,۷۰٪-	۹۰,۷۳۴,۰۳۷	(۱۹,۹۴۹,۲۳۶)	-	۱۱۰,۶۸۳,۲۷۳	-	بیمه دی
-۱۰.۴۲٪	۳,۸۱۵,۹۲۷,۳۴۷	۴۰,۹,۳۹۹	۳,۸۱۵,۵۱۷,۹۴۸	+	۵۷,۶۸٪-	۴۱۲,۱۲۰,۸۵۴	۰	۴۱۲,۱۲۰,۸۵۴	۰	۰	سرمایه‌گذاری بوعلی
۸۹٪-	۲,۰۶۹,۵۹۰,۹۹۳	۱۹,۸۲۸,۶۳۷-	۳,۲۸۹,۴۲۹,۶۳۰-	+	۷۰٪-	۵۰,۲,۸۵۴,۸۹۱	۱۹,۹۴۹,۲۳۶-	۵۲۲,۸۰,۴,۱۲۷	۰	۰	جمع

✓

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی گروه مالی دی
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

۳-۲-درآمد حاصل از سرمایه-گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

نام سپرده بانکی	طی فروردین ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه	نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	یادداشت ...	یادداشت ...	دی وزرا
					۳۷۰,۵۰۳,۶۳۸	۷%	۱۹۱,۶۴۸,۱۱۰	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳		
					۳۷۰,۵۰۳,۶۳۸	۷%	۱۹۱,۶۴۸,۱۱۰			جمع

۸