

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

" گزارش افشای پرتفوی ماهانه "

در راستای اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۰۹۳ مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ سازمان بورس و اوراق بهادار

منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۳۹۷

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)

فردین آقا بزرگی
مدیرعامل و عضو هیأت مدیره
کارگزاری بانک دی
شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۷/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

شرکت	۱۳۹۷/۰۶/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۷/۳۰		درصد به کل دارایی ها
	تعداد	بهای تمام شده	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش		
			تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده			
بانک دی	۴۹۱,۲۵۶,۲۱۰	۳۳۹,۷۴۵,۴۱۷,۲۰۵	۵۸۰,۰۰۰	۷,۱۸۶,۷۵۸,۲۷۴	۱۴۶,۱۸۸,۸۰۱	۱۶۹,۷۵۳,۰۲۵,۱۵۶	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۳۹۴,۸۹۸,۲۱۶,۲۸۳	۵۴,۹۳%
بیجه دی	۶,۹۹۷,۱۵۰	۷,۳۶۷,۰۱۰,۶۷	۱,۱۰۰,۰۰۰	۱,۴۱۳,۷۴۹,۵۳۲	۳۰۰,۰۰۰	۲۲۸,۲۸۵,۲۹۷	۷,۷۹۷,۱۵۰	۸,۹۵۴,۲۴۳,۳۹۵	۱,۲۵%
سرمایه گذاری بوعلی	۲۶,۱۲۱,۴۰۴	۲۸,۶۵۰,۲۶۹,۷۴۹	۵۰۰,۰۰۰	۸۴۶,۳۳۹,۸۳۸	۳۵۰,۰۰۰	۶۰۳,۵۸۲,۰۶۰	۲۶,۲۷۱,۴۰۴	۴۳,۱۷۴,۸۵۸,۸۱۲	۶,۰۱%
تولید نیروی برق دماوند	.	.	۶۵۰,۰۰۰	۶,۳۱۰,۳۱۵,۱۲۸	.	.	۶۵۰,۰۰۰	۷,۰۳۰,۱۸۷,۱۸۴	-۰,۹۸%
جمع	۵۲۴,۳۷۴,۷۶۴	۳۷۵,۷۶۳,۳۸۸,۰۲۱	۸,۰۵۰,۰۰۰	۱۵,۷۵۷,۲۶۲,۷۷۲	۱۴۶,۸۳۸,۸۰۱	۱۷۰,۷۸۴,۸۹۲,۵۱۳	۳۸۵,۵۸۵,۹۶۳	۴۵۴,۰۵۷,۵۰۵,۶۷۴	۶۳,۳%

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۰۷/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۰۶/۳۱		مشخصات حساب بانکی			
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
۰,۰۰٪	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۲,۱۰۶,۳۸۹,۷۷۴	۱۲,۱۰۶,۳۸۹,۷۷۴	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰,۰۰٪	۱۸,۳۵۹,۳۰۱	۵,۲۷۵,۵۳۳,۸۹۶	۵,۲۹۱,۴۷۷,۷۰۱	۲,۴۱۵,۴۹۶	۱۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۳۶,۳۴٪	۲۶۱,۲۴۲,۸۳۹,۷۶۲	۱۲,۱۰۶,۳۸۹,۷۷۴	۱۸۸,۱۱۹,۱۵۹,۱۱۸	۸۵,۲۳۰,۰۷۰,۴۱۸	۲۱	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۳۶,۳۴٪	۲۶۱,۲۷۱,۱۹۹,۰۶۳	۲۹,۴۸۸,۳۱۳,۴۴۴	۲۰۵,۵۱۷,۰۲۶,۵۹۳	۸۵,۲۴۲,۴۸۵,۹۱۴					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
سرمایه گذاری در سهام	۹۷,۵۹۲,۹۱۳,۶۵۲	۹۵,۶۰٪	۱۳,۵۸٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	-	۰,۰۰٪	۰,۰۰٪
در آمد سپرده بانکی	۳,۸۰۷,۶۲۶,۳۸۳	۳,۷۳٪	۰,۵۳٪
جمع		۱۰۱,۴۰۰,۵۴۰,۰۳۵	۹۹,۳٪	۱۴,۱٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه			طی مهرماه			اطلاعات مجمع			
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	نام سهام
۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	-	-	۲۰۰	۲۶,۳۷۰,۵۹۲	۱۳۹۷/۰۲/۰۱	سرمایه گذاری بوعلی
۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	-	-				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه			طی مهر ماه			اطلاعات			شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	
۶۱۳,۶۲۷,۳۰۱	-	۶۱۳,۶۲۷,۳۰۱	۱۷,۳۵۸,۲۶۸	(۱۱)	۱۷,۳۵۸,۲۵۷	۱۰		۳۰	دی وزرا
۱۲,۸۷۴,۷۰۷,۳۳۱	-	۱۲,۸۷۴,۷۰۷,۳۳۱	۳,۸۰۴,۷۹۰,۹۳۳	(۱۴,۵۲۲,۸۰۷)	۳,۷۹۰,۲۶۸,۱۲۶	۲۱		۳۰	بانک دی وزرا
۱۳,۴۸۸,۳۳۴,۶۳۲	-	۱۳,۴۸۸,۳۳۴,۶۳۲	۳,۸۲۲,۱۴۹,۲۰۱	(۱۴,۵۲۲,۸۱۸)	۳,۸۰۷,۶۲۶,۳۸۳				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه				طی مهر ماه				
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص بهای فروش	تعداد	شرح
۱۳۴,۸۲۵,۵۶۹	۲,۷۳۰,۸۹۸,۴۱۷	۲,۸۶۵,۷۲۳,۹۸۶	۲,۵۰۸,۸۳۳	۱۰۱,۸۱۲,۳۵۱	۳۲۶,۴۷۲,۹۴۶	۴۲۸,۲۸۵,۲۹۷	۳۰۰,۰۰۰	بیمه دی
۳۹۱,۹۱۲,۲۱۹	۱,۴۰۵,۷۱۹,۹۶۱	۱,۷۹۷,۶۳۲,۱۸۰	۱,۴۰۹,۳۶۳	۲۵۳,۶۵۶,۷۱۷	۳۴۹,۹۲۵,۳۴۳	۶۰۳,۵۸۲,۰۶۰	۲۵۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۷۷,۱۹۴,۹۸۰,۸۷۸	۱۳۸,۰۴۸,۷۶۹,۳۴۵	۲۱۵,۲۳۳,۷۵۰,۲۲۳	۱۹۹,۵۸۸,۸۰۱	۶۸,۶۳۷,۱۱۷,۲۸۷	۱۰۱,۱۱۵,۹۰۷,۸۶۹	۱۶۹,۷۵۳,۰۲۵,۱۵۶	۱۴۶,۱۸۸,۸۰۱	بانک دی
۷۷,۷۲۱,۷۱۸,۶۶۶	۱۴۲,۱۷۵,۳۸۷,۷۲۳	۲۱۹,۸۹۷,۱۰۶,۳۸۹	۲۰۳,۵۰۶,۹۹۷	۶۸,۹۹۲,۵۸۶,۳۵۵	۱۰۱,۷۹۲,۳۰۶,۱۵۸	۱۷۰,۷۸۴,۸۹۲,۵۱۳	۱۴۶,۸۳۸,۸۰۱	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 اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه				طی مهر ماه				
شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
بانک دی	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۳۹۴,۸۹۸,۲۱۶,۲۸۳	۳۶۸,۴۵۵,۶۶۲,۷۵۲	۲۶,۴۴۲,۵۵۳,۵۳۱	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۳۹۴,۸۹۸,۲۱۶,۲۸۳	۳۶۸,۴۵۵,۶۶۲,۷۵۲	۲۶,۴۴۲,۵۵۳,۵۳۱
تولید نیروی برق دماوند	۶۵۰,۰۰۰	۷,۰۳۰,۱۸۷,۱۸۳	۶,۳۱۰,۳۱۵,۱۲۸	۷۱۹,۸۷۲,۰۵۵	۶۵۰,۰۰۰	۷,۰۳۰,۱۸۷,۱۸۳	۶,۳۱۰,۳۱۵,۱۲۸	۷۱۹,۸۷۲,۰۵۵
سرمایه گذاری بوعلی	۲۶,۲۷۱,۴۰۴	۴۳,۱۷۴,۸۵۸,۸۱۱	۴۰,۵۳۶,۹۵۳,۸۹۶	۲,۶۳۷,۹۰۴,۹۱۵	۲۶,۲۷۱,۴۰۴	۴۳,۱۷۴,۸۵۸,۸۱۱	۴۰,۵۳۶,۹۵۳,۸۹۶	۲,۶۳۷,۹۰۴,۹۱۵
بیمه دی	۷,۷۹۷,۱۵۰	۸,۹۵۴,۲۴۳,۳۹۵	۱۰,۱۵۴,۲۴۶,۶۰۰	(۱,۲۰۰,۰۰۳,۲۰۴)	۷,۷۹۷,۱۵۰	۸,۹۵۴,۲۴۳,۳۹۵	۱۰,۱۵۴,۲۴۶,۶۰۰	(۱,۲۰۰,۰۰۳,۲۰۴)
جمع	۴۵۴,۰۵۷,۵۰۵,۶۷۲	۴۲۵,۴۵۷,۱۷۸,۳۷۶	۲۸,۶۰۰,۳۲۷,۲۹۷	۱۶۶,۶۶۱,۳۳۹,۴۳۳	۲۸۷,۳۹۶,۱۶۶,۲۳۹	۴۵۴,۰۵۷,۵۰۵,۶۷۲	۳۸۵,۵۸۵,۹۶۳

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

صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه				طی مهر ماه				درآمد سود سهام	سهام	
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش				
درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...			
۰.۱۵%	۳۸۷,۱۹۱,۷۲۲	۱۳۴,۸۲۵,۵۶۹	۲۵۲,۳۶۶,۱۵۳	-	(۱,۰۹۸,۱۹۰,۸۵۳)	۱۰۱,۸۱۲,۳۵۱	-۱,۲۰۰,۰۰۳,۲۰۴	-	بیمه دی	
۸.۴۴%	۲۲,۲۷۳,۱۸۳,۱۷۱	۳۹۱,۹۱۲,۲۱۹	۱۶,۶۰۷,۱۵۲,۵۵۲	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۲.۸۳%	۲,۸۹۱,۵۶۱,۶۳۲	۲۵۳,۶۵۶,۷۱۷	۲,۶۳۷,۹۰۴,۹۱۵	-	سرمایه‌گذاری بوعلی
۸۵.۷۰%	۲۲۶,۲۷۶,۹۲۹,۵۵۱	۷۷,۱۹۴,۹۸۰,۸۷۸	۱۴۹,۰۸۱,۹۴۸,۶۷۳	-	۹۳.۱۴%	۹۵,۰۷۹,۶۷۰,۸۱۸	۶۸,۶۳۷,۱۱۷,۲۸۷	۲۶,۴۴۲,۵۵۳,۵۳۱	-	بانک دی
۰.۲۷%	۷۱۹,۸۷۲,۰۵۵	-	۷۱۹,۸۷۲,۰۵۵	-	۰.۷۱%	۷۱۹,۸۷۲,۰۵۵	-	۷۱۹,۸۷۲,۰۵۵	-	تولید نیروی برق دماوند
۹۴.۶%	۲۴۹,۶۵۷,۱۷۶,۴۹۹	۷۷,۷۲۱,۷۱۸,۶۶۶	۱۶۶,۶۶۱,۳۳۹,۴۳۳	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۹۵.۶%	۹۷,۵۹۲,۹۱۳,۶۵۲	۶۸,۹۹۲,۵۸۶,۳۵۵	۲۸,۶۰۰,۳۲۷,۲۹۷	-	جمع

صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی گروه مالی دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه		طی مهر ماه		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
۰.۲۳٪	۶۱۳,۶۲۷,۳۰۱	۰.۰۱٪	۱۷,۳۵۸,۲۵۷	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	دی وزرا
۴.۹۳٪	۱۲,۸۷۴,۷۰۷,۳۳۱	۱.۴۵٪	۳,۷۹۰,۲۶۸,۱۲۶	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۵.۲٪	۱۳,۴۸۸,۳۳۴,۶۳۲	۱.۴۶٪	۳,۸۰۷,۶۲۶,۳۸۳		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۷/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه	طی مهر ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۹۹۳,۰۸۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۹۹۳,۰۸۰	۰	جمع