

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 آبان ماه ۱۳۹۷

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰
فردین آقا بزرگنی

مدیرعامل و عضو هیأت مدیره

کارگزاری بانک دی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	۱۳۹۷/۰۷/۳۰		تغییرات طی دوره						۱۳۹۷/۰۸/۳۰		
	تعداد	بهای تمام شده	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	درصد به کل دارایی ها	
			مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد					
بانک دی	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۲۴۵,۸۱۶,۲۶۷,۶۱۰	۰	۰	۰	۰	۰	۲۹۴,۸۹۸,۲۱۶,۲۸۳	۲۴۵,۸۱۶,۲۶۷,۶۱۰	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۵۴,۹۹%
بیمه دی	۷,۷۹۷,۱۵۰	۸,۴۶۵,۵۶۳,۳۷۳	۴۳۷,۹۵۵,۶۵۷	-۴۰۰,۰۰۰	۱,۲۳۷,۴۰۱,۶۴۳	۱,۱۶۰,۰۰۰	۸,۹۵۴,۲۴۳,۳۹۵	۸,۴۶۵,۵۶۳,۳۷۳	۷,۷۹۷,۱۵۰	۱,۲۴%	
تولید نیروی برق دماوند	۶۵۰,۰۰۰	۶,۳۱۰,۳۱۵,۱۲۸	۰	۰	۲,۸۳۱,۳۹۵,۷۳۹	۲۹۹,۸۵۰	۷,۰۰۰,۱۸۷,۱۸۴	۶,۳۱۰,۳۱۵,۱۲۸	۶۵۰,۰۰۰	۱,۲۸%	
سرمایه گذاری بوعلی	۲۶,۲۷۱,۴۰۴	۲۹,۱۱۲,۳۱۱,۸۰۵	۸۰,۳۷۸,۰۰۸	-۵۰,۰۰۰	۸۰۴,۱۸۷,۳۱۸	۵۰۰,۰۰۰	۴۳,۱۷۴,۸۵۸,۸۱۲	۲۹,۱۱۲,۳۱۱,۸۰۵	۲۶,۲۷۱,۴۰۴	۵,۸۷%	
جمع	۳۸۵,۵۸۵,۹۶۳	۲۸۹,۷۰۴,۴۵۷,۹۱۶	۵۱۸,۳۳۳,۶۶۵	-۴۵۰,۰۰۰	۴,۸۷۲,۹۸۴,۶۰۰	۱,۹۵۹,۸۵۰	۴۵۴,۰۵۷,۵۰۵,۶۷۴	۲۸۹,۷۰۴,۴۵۷,۹۱۶	۳۸۵,۵۸۵,۹۶۳	۶۳,۴%	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۰۷/۳۰		مشخصات حساب بانکی			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
۰,۰۰٪	-	۶,۴۸۴,۰۱۶,۲۸۳	۶,۴۷۴,۰۱۶,۲۸۳	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰,۰۰٪	۱۸,۵۰۵,۴۴۳	-	۱۴۶,۱۴۲	۱۸,۳۵۹,۳۰۱	۱۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۳۶,۱۲٪	۲۵۹,۳۷۱,۵۱۸,۳۶۳	۶,۴۷۴,۰۱۶,۲۸۳	۴,۶۰۲,۶۹۴,۸۸۴	۲۶۱,۲۴۲,۸۳۹,۷۶۲	۲۱	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۳۶,۱۲٪	۲۵۹,۳۹۰,۰۲۳,۸۰۶	۱۲,۹۵۸,۰۳۲,۵۶۶	۱۱,۰۷۶,۸۵۷,۳۰۹	۲۶۱,۲۷۱,۱۹۹,۰۶۳					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
سرمایه گذاری در سهام	(۳,۳۳۹,۱۷۷,۸۶۹)	-۲۹۰.۴۲%	-۰.۴۶%
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	-	۰.۰۰%	۰.۰۰%
درآمد سپرده بانکی	۴,۴۸۶,۸۷۰,۱۴۱	۳۹۰.۲۴%	۰.۶۲%
جمع		۱,۱۴۷,۶۹۲,۲۷۲	۹۹.۸%	۰.۲%

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان آبان ماه			طی آبان ماه			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	۱۳۹۷/۰۳/۰۱	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 ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان آبان ماه			طی آبان ماه			اطلاعات			شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	
۶۱۳,۷۷۸,۱۹۹	-	۶۱۳,۷۷۸,۱۹۹	۱۵۰,۸۹۸	-	۱۵۰,۸۹۸	۱۰		۳۰	دی وزرا
۱۷,۳۶۱,۴۲۶,۵۷۴	-	۱۷,۳۶۱,۴۲۶,۵۷۴	۴,۴۸۶,۷۱۹,۲۴۳	-	۴,۴۸۶,۷۱۹,۲۴۳	۲۱		۳۰	بانک دی وزرا
۱۷,۹۷۵,۲۰۴,۷۷۳	-	۱۷,۹۷۵,۲۰۴,۷۷۳	۴,۴۸۶,۸۷۰,۱۴۱	-	۴,۴۸۶,۸۷۰,۱۴۱				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

	از ابتدای سال مالی تا پایان آبان ماه			طی آبان ماه					
	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری		خالص بهای فروش	
	۱۲۷,۸۹۵,۹۷۳	۳,۱۷۵,۷۸۳,۶۷۰	۳,۳۰۳,۶۷۹,۶۴۳	۲,۹۰۸,۸۳۳	-۶,۹۲۹,۵۹۶	۴۴۴,۸۸۵,۲۵۳	۴۳۷,۹۵۵,۶۵۷	۴۰۰,۰۰۰	بیمه دی
	۴۲۱,۶۲۵,۲۹۴	۱,۴۵۶,۳۸۴,۸۹۴	۱,۸۷۸,۰۱۰,۱۸۸	۱,۴۵۹,۳۶۳	۲۹,۷۱۳,۰۷۵	۵۰,۶۶۴,۹۳۳	۸۰,۳۷۸,۰۰۸	۵۰,۰۰۰	سرمایه‌گذاری بوعلی
	۷۷,۱۹۴,۹۸۰,۸۷۸	۱۳۸,۰۳۸,۷۶۹,۳۴۵	۲۱۵,۲۳۳,۷۵۰,۲۲۳	۱۹۹,۵۸۸,۸۰۱	بانک دی
جمع	۷۷,۷۴۴,۵۰۲,۱۴۵	۱۴۲,۶۷۰,۹۳۷,۹۰۹	۲۲۰,۴۱۵,۴۴۰,۰۵۴	۲۰۳,۹۵۶,۹۹۷	۲۲,۷۸۳,۴۷۹	۴۹۵,۵۵۰,۱۸۶	۵۱۸,۳۳۳,۶۶۵	۴۵۰,۰۰۰	
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 ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان آبان ماه				طی آبان 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
تولید نیروی برق دماوند	۹۴۹,۸۵۰	۹,۱۷۱,۱۰۶,۵۹۴	۹,۱۷۱,۱۰۶,۵۹۴	۲۹,۳۹۵,۷۲۷	۹۴۹,۸۵۰	۹,۱۷۱,۱۰۶,۵۹۴	۹,۸۶۱,۵۸۲,۹۲۲	-۶۹۰,۴۷۶,۳۲۷
سرمایه گذاری بوع	۲۶,۷۲۱,۴۰۴	۴۲,۱۳۱,۲۰۵,۶۰۱	۴۲,۱۳۱,۲۰۵,۶۰۱	۱۴,۸۰۹,۹۷۷,۰۵۷	۲۶,۷۲۱,۴۰۴	۴۲,۱۳۱,۲۰۵,۶۰۱	۴۳,۹۲۸,۳۸۱,۰۹۶	-۱,۷۹۷,۱۷۵,۴۹۴
بیمه دی	۸,۵۵۷,۱۵۰	۸,۸۷۲,۴۵۰,۲۵۷	۸,۸۷۲,۴۵۰,۲۵۷	-۶۲۱,۹۴۳,۳۷۴	۸,۵۵۷,۱۵۰	۸,۸۷۲,۴۵۰,۲۵۷	۹,۷۴۶,۷۵۹,۷۸۵	-۸۷۴,۳۰۹,۵۲۷
بانک دی	-	۳۹۴,۸۹۸,۲۱۶,۲۸۳	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۱۴۹,۰۸۱,۹۴۸,۶۷۳	-	-	-	-
جمع	۴۵۵,۰۷۲,۹۷۸,۷۳۵	۳۸۷,۰۹۵,۸۱۳	۱۶۳,۲۹۹,۳۷۸,۰۸۳	۳۸۷,۰۹۵,۸۱۳	۶۳,۵۳۶,۷۲۳,۸۰۳	-۳,۳۶۱,۹۶۱,۳۴۸	۶۰,۱۷۴,۷۶۲,۴۵۲

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 ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان آبان ماه				طی آبان ماه					
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام	
درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
-۰.۱۹%	(۴۹۴,۰۴۷,۴۰۱)	۱۲۷,۸۹۵,۹۷۳	-۶۲۱,۹۴۳,۳۷۴	-۷۶.۶۴%	(۸۸۱,۲۳۹,۱۲۳)	-۶,۹۲۹,۵۹۶	-۸۷۴,۳۰۹,۵۲۷	-	بیمه دی
۷.۷۳%	۲۰,۵۰۵,۷۲۰,۷۵۱	۴۲۱,۶۲۵,۲۹۴	۱۴,۸۰۹,۹۷۷,۰۵۷	-۱۵۳.۷۲%	(۱,۷۶۷,۴۶۲,۴۱۹)	۲۹,۷۱۳,۰۷۵	(۱,۷۹۷,۱۷۵,۴۹۴)	-	سرمایه‌گذاری بوعلی
۸۵.۳۳%	۲۲۶,۲۷۶,۹۲۹,۵۵۱	۷۷,۱۹۴,۹۸۰,۸۷۸	۱۴۹,۰۸۱,۹۴۸,۶۷۳	۰.۰۰%	-	-	-	-	بانک دی
۰.۰۱%	۲۹,۳۹۵,۷۲۷	-	۲۹,۳۹۵,۷۲۷	-۶۰.۰۵%	(۶۹۰,۴۷۶,۳۲۷)	-	(۶۹۰,۴۷۶,۳۲۷)	-	تولید نیروی برق دماوند
	۲۴۶,۳۱۷,۹۹۸,۶۲۸	۷۷,۷۴۴,۵۰۲,۱۴۵	۱۶۳,۲۹۹,۳۷۸,۰۸۳	-۲۹.۰۴%	-۳,۳۳۹,۱۷۷,۸۶۹	۲۲,۷۸۳,۴۷۹	-۳,۳۶۱,۹۶۱,۳۴۸	-	جمع

صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی گروه مالی دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان آبان ما		طی آبان ماه		نام سپرده بانکی	
درصد سود میانگین سه	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
۰.۲۴٪	۶۱۳,۷۷۸,۱۹۹	۰.۰۰٪	۱۵۰,۸۹۸	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	دی وزرا
۶.۶۹٪	۱۷,۳۶۱,۴۲۶,۵۷۴	۱.۷۳٪	۴,۴۸۶,۷۱۹,۲۴۳	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۶.۹٪	۱۷,۹۷۵,۲۰۴,۷۷۳	۱.۷۳٪	۴,۴۸۶,۸۷۰,۱۴۱		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۸/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

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