

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 آذر ماه ۱۳۹۷

فردین آقا بزرگی
مدیرعامل و عضو هیأت مدیره
کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	۱۳۹۷/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۹/۳۰		درصد به کل دارایی ها
	تعداد	بهای تمام شده	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	
			تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده			
بانک دی	۳۵۰,۸۶۷,۴۰۹	۲۴۵,۸۱۶,۲۶۷,۶۱۰	۰	۰	۱۷۲,۸۲۱,۰۸۴,۵۵۶	۱۵۴,۰۲۱,۹۷۰	۳۹۴,۸۹۸,۲۱۶,۲۸۲	۲۴۸,۱۷۹,۶۰۶,۶۳۸	۷۷,۶۲٪
بیمه دی	۸,۵۵۷,۱۵۰	۹,۲۶۹,۴۳۷,۱۱۱	۲۶,۹۹۰	۲۷,۶۸۸,۷۷۹	۱,۰۲۶,۳۲۲,۹۸۸	۱,۰۰۹,۹۴۵	۸,۸۷۲,۴۵۰,۲۵۷	۹,۲۸۳,۴۹۳,۰۶۱	۱,۳۰٪
تولید نیروی برق دماوند	۹۴۹,۸۵۰	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۰	۰	۰	۰	۹,۱۷۱,۱۰۶,۵۹۵	۱۲,۰۶۶,۰۵۰,۴۹۶	۱,۶۸٪
سرمایه گذاری بوعلی	۲۶,۷۲۱,۴۰۴	۲۹,۸۶۱,۰۰۹,۵۳۵	۱,۵۵۰	۲۶,۹۷۸,۴۶۶	۱۵۶,۸۷۱,۵۷۵	۱۰۰,۰۰۰	۵۴۷,۹۵۵,۰۹۸	۴۱,۶۴۹,۷۷۳,۹۷۷	۵,۸۱٪
جمع	۲۸۷,۰۹۵,۸۱۳	۲۹۴,۰۸۸,۴۲۵,۱۲۳	۱۶,۳۸۷	۵۴۲,۳۵۷,۸۰۰	۱۸۴,۵۶۰,۳۵۴	-۱۲۶,۹۹۰	۱۷۴,۳۹۵,۳۷۲,۶۴۲	۶۱۹,۱۷۸,۹۲۴,۱۷۳	۸۶,۴٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۰۸/۳۰		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	۱۶۸,۸۴۶,۸۸۷,۷۰۳	۱۶۸,۸۵۶,۸۸۷,۷۰۳	-	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰.۰۰٪	۱۸,۶۵۷,۵۰۳	-	۱۵۲,۰۶۰	۱۸,۵۰۵,۴۴۳	۱۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۱۳.۲۶٪	۹۴,۹۹۸,۸۷۲,۴۵۵	۱۶۸,۸۵۶,۸۸۷,۷۰۳	۴,۴۸۴,۲۴۱,۷۹۵	۲۵۹,۳۷۱,۵۱۸,۳۶۳	۲۱	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۱۳.۲۶٪	۹۵,۰۲۷,۵۲۹,۹۵۸	۳۳۷,۷۰۳,۷۷۵,۴۰۶	۱۷۳,۳۴۱,۲۸۱,۵۵۸	۲۵۹,۳۹۰,۰۲۳,۸۰۶					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
سرمایه گذاری در سهام		(۱۰,۱۰۴,۸۶۶,۸۴۹)	۱۴۵,۶۲٪	-۱,۴۱٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادار		-	۰,۰۰٪	۰,۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳,۱۶۴,۷۳۸,۸۱۶	-۴۵,۶۱٪	۰,۴۴٪
جمع		(۶,۹۴۰,۱۲۸,۰۳۳)	۱۰۰,۰۰٪	۱,۰۰٪-

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان آذر ماه			طی آذر ماه			اطلاعات مجمع			
نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	
سرمایه گذاری بوعلی	۱۳۹۷/۰۳/۰۱	۲۶,۳۷۰,۵۹۲	۲۰۰	-	-	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	
جمع				-	-	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	-	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان آذر ماه			طی آذر ماه			اطلاعات			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
۶۱۳,۹۳۰,۲۹۹	-	۶۱۳,۹۳۰,۲۹۹	۱۵۲,۱۰۰	-	۱۵۲,۱۰۰	۱۰		۳۰	دی وزرا
۲۰,۵۲۶,۰۱۳,۲۹۰	-	۲۰,۵۲۶,۰۱۳,۲۹۰	۳,۱۶۴,۵۸۶,۷۱۶	-	۳,۱۶۴,۵۸۶,۷۱۶	۲۱		۳۰	بانک دی وزرا
۲۱,۱۳۹,۹۴۳,۵۸۹	-	۲۱,۱۳۹,۹۴۳,۵۸۹	۳,۱۶۴,۷۳۸,۸۱۶	-	۳,۱۶۴,۷۳۸,۸۱۶				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان آذر ماه				طی آذر 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
۱۲۵,۷۹۰,۲۸۱	۳,۲۰۵,۵۷۸,۱۴۱	۳,۳۳۱,۳۶۸,۴۲۲	۲,۹۳۵,۸۲۳	-۲,۱۰۵,۶۹۲	۲۹,۷۹۴,۴۷۱	۲۷,۶۸۸,۷۷۹	۲۶,۹۹۰	بیمه دی
۴۷۵,۹۷۲,۵۴۲	۱,۵۵۸,۹۰۹,۲۲۱	۲,۰۳۴,۸۸۱,۷۶۳	۱,۵۵۹,۳۶۳	۵۴,۳۴۷,۲۴۸	۱۰۲,۵۲۴,۳۲۷	۱۵۶,۸۷۱,۵۷۵	۱۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۷۷,۱۹۴,۹۸۰,۸۷۸	۱۳۸,۰۳۸,۷۶۹,۳۴۵	۲۱۵,۲۳۳,۷۵۰,۲۲۳	۱۹۹,۵۸۸,۸۰۱	۰	۰	۰	۰	بانک دی
۷۷,۷۹۶,۷۴۳,۷۰۱	۱۴۲,۸۰۳,۲۵۶,۷۰۷	۲۲۰,۶۰۰,۰۰۰,۴۰۸	۲۰۴,۰۸۳,۹۸۷	۵۲,۲۴۱,۵۵۶	۱۳۲,۳۱۸,۷۹۸	۱۸۴,۵۶۰,۳۵۴	۱۲۶,۹۹۰	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 ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان آذر ماه				طی آذر 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	شرح
۱۳۷,۵۴۲,۲۵۴,۴۷۱	۴۱۸,۶۳۷,۳۵۲,۱۶۶	۵۵۶,۱۷۹,۶۰۶,۶۳۷	۵۰۴,۸۸۹,۳۷۹	-۱۱,۵۳۹,۶۹۴,۲۰۱	۵۶۷,۷۱۹,۳۰۰,۸۳۹	۵۵۶,۱۷۹,۶۰۶,۶۳۷	۵۰۴,۸۸۹,۳۷۹	بانک دی
۲,۹۲۴,۳۳۹,۶۲۹	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۱۲,۰۶۶,۰۵۰,۴۹۶	۹۴۹,۸۵۰	۲,۸۹۴,۹۴۳,۹۰۲	۹,۱۷۱,۱۰۶,۵۹۴	۱۲,۰۶۶,۰۵۰,۴۹۶	۹۴۹,۸۵۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۳,۸۸۳,۱۱۴,۶۶۲	۲۷,۷۶۶,۶۵۹,۳۱۵	۴۱,۶۴۹,۷۷۳,۹۷۷	۲۶,۹۷۸,۴۶۶	-۹۲۶,۸۶۲,۳۹۴	۴۲,۵۷۶,۶۳۶,۳۷۲	۴۱,۶۴۹,۷۷۳,۹۷۷	۲۶,۹۷۸,۴۶۶	سرمایه گذاری بو علی
(۱,۲۰۷,۴۳۹,۰۸۷)	۱۰,۴۹۰,۹۳۲,۱۴۹	۹,۲۸۳,۴۹۳,۰۶۱	۹,۵۴۰,۱۰۵	(۵۸۵,۴۹۵,۷۱۲)	۹,۸۶۸,۹۸۸,۷۷۴	۹,۲۸۳,۴۹۳,۰۶۱	۹,۵۴۰,۱۰۵	بیمه دی
۱۵۳,۱۴۲,۲۶۹,۶۷۵	۴۶۶,۰۳۶,۶۵۴,۴۹۷	۶۱۹,۱۷۸,۹۲۴,۱۷۱	۵۴۲,۳۵۷,۸۰۰	-۱۰,۱۵۷,۱۰۸,۴۰۵	۶۲۹,۳۳۶,۰۳۲,۵۷۹	۶۱۹,۱۷۸,۹۲۴,۱۷۱	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

صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان آذر ماه				طی آذر ماه				درآمد سود	سهام	
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود			
درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...		
-۰.۴۲٪	(۱,۰۸۱,۶۴۸,۸۰۶)	۱۲۵,۷۹۰,۲۸۱	-۱,۲۰۷,۴۳۹,۰۸۷	-	۸.۴۷٪	(۵۸۷,۶۰۱,۴۰۴)	-۲,۱۰۵,۶۹۲	-۵۸۵,۴۹۵,۷۱۲	-	بیمه دی
۷.۶۰٪	۱۹,۶۳۳,۲۰۵,۶۰۴	۴۷۵,۹۷۲,۵۴۲	۱۳,۸۸۳,۱۱۴,۶۶۲	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۱۲.۵۷٪	(۸۷۲,۵۱۵,۱۴۶)	۵۴,۳۴۷,۲۴۸	(۹۲۶,۸۶۲,۳۹۴)	-	سرمایه گذاری بوعلی
۸۳.۱۵٪	۲۱۴,۷۳۷,۲۳۵,۳۴۹	۷۷,۱۹۴,۹۸۰,۸۷۸	۱۳۷,۵۴۲,۲۵۴,۴۷۱	-	۱۶۶.۲۹٪	(۱۱,۵۳۹,۶۹۴,۲۰۱)	-	(۱۱,۵۳۹,۶۹۴,۲۰۱)	-	بانک دی
۱.۱۳٪	۲,۹۲۴,۳۳۹,۶۲۹	-	۲,۹۲۴,۳۳۹,۶۲۹	-	-۴۱.۷۲٪	۲,۸۹۴,۹۴۳,۹۰۲	-	۲,۸۹۴,۹۴۳,۹۰۲	-	تولید نیروی برق دماوند
۹۱.۵٪	۲۳۶,۲۱۳,۱۳۱,۷۷۶	۷۷,۷۹۶,۷۴۳,۷۰۱	۱۵۳,۱۴۲,۲۶۹,۶۷۵	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۱۴۵.۶٪	-۱۰,۱۰۴,۸۶۶,۸۴۹	۵۲,۲۴۱,۵۵۶	-۱۰,۱۵۷,۱۰۸,۴۰۵	-	جمع

صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی گروه مالی دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

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

نام سپرده بانکی		طی آذر ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان آذر ماه	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
بانک دی وزرا	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	۱۵۲,۱۰۰	۰.۰۰٪	۶۱۳,۹۳۰,۲۹۹	۰.۶۵٪
بانک دی وزرا	۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	۳,۱۶۴,۵۸۶,۷۱۶	۳.۲۳٪	۲۰,۵۲۶,۰۱۳,۲۹۰	۲۱.۶۰٪
جمع		۳,۱۶۴,۷۳۸,۸۱۶	۳.۲۳٪	۲۱,۱۳۹,۹۴۳,۵۸۹	۲۲.۲٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

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