

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردانی گروه دی



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 دی ماه ۱۳۹۷

فردین آقا بزرگی
مدیرعامل و عضو هیأت مدیره مدیر صندوق
کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۷

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	۱۳۹۷/۰۹/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۱۰/۳۰				
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	قیمت بازار هر سهم	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	۵۵۶,۱۷۹,۶۰۶,۶۳۸	۴۱۸,۶۳۷,۳۵۲,۱۶۶	۵۰۴,۸۸۹,۳۷۹	۱,۵۰۹	۵۳۴,۱۶۲,۶۷۵	۵۴,۷۸۸,۸۵۹,۸۷۷	۴۰,۴۹۰,۰۰۰-	۹۳,۰۱۶,۱۸۲,۲۴۹	۶۹,۷۶۳,۲۹۶	۵۵۶,۱۷۹,۶۰۶,۶۳۸	۴۱۸,۶۳۷,۳۵۲,۱۶۶	۵۰۴,۸۸۹,۳۷۹	۸۵.۹۳
بیمه دی	۹,۲۸۳,۴۹۳,۰۶۱	۱۰,۲۶۶,۶۳۷,۹۵۱	۹,۵۴۰,۱۰۵	۱,۱۲۸	۹,۳۴۷,۰۱۵	۷۳۷,۴۲۰,۶۰۲	۶۹۴,۰۹۴-	۵۳۰,۳۶۱,۰۹۳	۵۰۱,۰۰۴	۹,۲۸۳,۴۹۳,۰۶۱	۱۰,۲۶۶,۶۳۷,۹۵۱	۹,۵۴۰,۱۰۵	۱.۱۲
تولید نیروی برق دماوند	۱۲,۰۶۶,۰۵۰,۴۹۶	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۹۴۹,۸۵۰	۲۲,۶۴۵	۹۴۹,۸۵۰	۱۲,۰۶۶,۰۵۰,۴۹۶	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۹۴۹,۸۵۰	۲.۲۹
سرمایه گذاری بوعلی	۴۱,۶۴۹,۷۷۳,۹۷۷	۳۰,۲۹۶,۹۹۱,۱۵۷	۲۶,۹۷۸,۴۶۶	۱,۷۰۶	۲۷,۲۹۳,۷۳۹	۱۵۶,۹۳۸,۵۲۵	۱۰۰,۰۰۰-	۶۵۲,۷۴۶,۲۶۴	۴۱۵,۲۷۳	۴۱,۶۴۹,۷۷۳,۹۷۷	۳۰,۲۹۶,۹۹۱,۱۵۷	۲۶,۹۷۸,۴۶۶	۴.۹۶
جمع	۶۱۹,۱۷۸,۹۲۴,۱۷۳	۴۴۸,۳۴۲,۶۹۲,۱۴۱	۵۴۲,۲۵۷,۸۰۰	-	۵۷۱,۷۵۳,۲۷۹	۵۵,۶۸۳,۲۱۹,۰۰۴	۴۱,۲۸۴,۰۹۴-	۹۴,۱۹۹,۲۸۹,۶۰۶	۷۰,۶۷۹,۵۷۳	۶۱۹,۱۷۸,۹۲۴,۱۷۳	۴۴۸,۳۴۲,۶۹۲,۱۴۱	۵۴۲,۲۵۷,۸۰۰	۹۴.۳

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۷

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۱۰/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۰۹/۳۰		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
.	۱۳۹۵/۰۱/۲۸	حساب جاری	۰۱۰۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴	بانک دی وزرا
.	.	۹۶,۱۰۴,۶۳۹,۲۳۴	۹۶,۰۹۴,۶۳۹,۲۳۴	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
.	۱۸,۸۱۰,۸۱۱	.	۱۵۳,۳۰۸	۱۸,۶۵۷,۵۰۳	.	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۵.۵۶	۵۱,۹۸۲,۱۵۵,۲۶۱	۹۶,۰۹۴,۶۳۹,۲۳۴	۵۳,۰۷۷,۹۲۲,۰۴۰	۹۴,۹۹۸,۸۷۲,۴۵۵	.	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۵.۵۶	۵۲,۰۰۰,۹۶۶,۰۷۲	۱۹۲,۱۹۹,۲۷۸,۴۶۸	۱۴۹,۱۷۲,۷۱۴,۵۸۲	۹۵,۰۲۷,۵۲۹,۹۵۸					جمع

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

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	۲۲۳,۴۴۲,۵۶۳,۸۵۲	۹۹.۳۴	۲۳.۹۲%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰	۰.۰۰%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۱,۲۶۳,۵۲۸,۵۳۰	۰.۵۶	۰.۱۴%
سایر درآمدها	۴-۲	۹۹۳,۰۸۰	۰	۰.۰۰%
جمع		۲۲۴,۷۰۷,۰۸۵,۴۶۲	۹۹.۹۰	۲۴.۰۵%

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

درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه		طی دی ماه			اطلاعات مجمع			نام سهام	
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 (ریال)	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع		تاریخ تشکیل مجمع
۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۰	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۰	۰	۰	۲۰۰	۲۶,۳۷۰,۵۹۲	۱۳۹۷/۰۳/۰۱	سرمایه گذاری بوعلی
۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۰	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۰	۰	۰				

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

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه			طی دی ماه			اطلاعات اوراق و سپرده ها			شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	
.	۱۷	بانک دی وزرا
.	۱۷	بانک دی وزرا
۶۱۴,۰۸۳,۶۴۹	.	۶۱۴,۰۸۳,۶۴۹	۱۵۳,۳۵۰	.	۱۵۳,۳۵۰	.	.	۳۰	بانک دی وزرا
۲۱,۷۸۹,۳۸۸,۴۷۰	.	۲۱,۷۸۹,۳۸۸,۴۷۰	۱,۲۶۳,۳۷۵,۱۸۰	.	۱,۲۶۳,۳۷۵,۱۸۰	.	.	۳۰	بانک دی وزرا
۲۲,۴۰۳,۴۷۲,۱۱۹	.	۲۲,۴۰۳,۴۷۲,۱۱۹	۱,۲۶۳,۵۲۸,۵۳۰	.	۱,۲۶۳,۵۲۸,۵۳۰	.	.		جمع

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

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه				طی دی 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	
۱۰۱,۶۰۰,۰۳۳	۳,۹۶۷,۱۸۸,۹۹۱	۴,۰۶۸,۷۸۹,۰۲۴	۳,۶۲۹,۹۱۷	۲۴,۱۹۰,۲۴۸-	۷۶۱,۶۱۰,۸۵۰	۷۳۷,۴۲۰,۶۰۲	۶۹۴,۰۹۴	بیمه دی
۵۲۹,۴۰۴,۰۶۱	۱,۶۶۲,۴۱۶,۲۲۷	۲,۱۹۱,۸۲۰,۲۸۸	۱,۶۵۹,۳۶۳	۵۳,۴۳۱,۵۱۹	۱۰۳,۵۰۷,۰۰۶	۱۵۶,۹۳۸,۵۲۵	۱۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۹۷,۲۵۴,۰۱۸,۲۱۶	۱۷۲,۷۶۸,۵۹۱,۸۸۴	۲۷۰,۰۲۲,۶۱۰,۱۰۰	۲۴۰,۰۷۸,۸۰۱	۲۰,۰۵۹,۰۳۷,۳۳۸	۳۴,۷۲۹,۸۲۲,۵۳۹	۵۴,۷۸۸,۸۵۹,۸۷۷	۴۰,۴۹۰,۰۰۰	بانک دی
۹۷,۸۸۵,۰۲۲,۳۱۰	۱۷۸,۳۹۸,۱۹۷,۱۰۲	۲۷۶,۲۸۳,۲۱۹,۴۱۲	۲۴۵,۳۶۸,۰۸۱	۲۰,۰۸۸,۲۷۸,۶۰۹	۳۵,۵۹۴,۹۴۰,۳۹۵	۵۵,۶۸۳,۲۱۹,۰۰۴	۴۱,۲۸۴,۰۹۴	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 ۳۰ دی ماه ۱۳۹۷

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه				طی دی ماه				شرح
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	
۳۳۵,۹۱۱,۶۱۹,۳۰۷	۴۷۶,۹۲۳,۷۱۱,۸۷۶	۸۰۲,۸۳۵,۳۳۱,۱۸۳	۵۳۴,۱۶۲,۶۷۵	۱۸۸,۳۶۹,۳۶۴,۸۳۶	۶۱۴,۴۶۵,۹۶۶,۳۴۷	۸۰۲,۸۳۵,۳۳۱,۱۸۳	۵۳۴,۱۶۲,۶۷۵	بانک دی
۱۲,۲۸۱,۸۲۰,۰۶۳	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۲۱,۴۲۳,۵۳۰,۹۳۰	۹۴۹,۸۵۰	۹,۳۵۷,۴۸۰,۴۳۴	۱۲,۰۶۶,۰۵۰,۴۹۶	۲۱,۴۲۳,۵۳۰,۹۳۰	۹۴۹,۸۵۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۸,۰۶۱,۴۳۳,۳۱۷	۲۸,۳۱۵,۸۹۸,۵۷۳	۴۶,۳۷۷,۳۳۱,۸۹۰	۲۷,۲۹۳,۷۳۹	۴,۱۷۸,۳۱۸,۶۵۵	۴۲,۱۹۹,۰۱۳,۲۳۵	۴۶,۳۷۷,۳۳۱,۸۹۰	۲۷,۲۹۳,۷۳۹	سرمایه گذاری بوعلی
۲۴۱,۶۸۲,۲۳۰	۱۰,۲۵۹,۶۸۲,۳۹۲	۱۰,۵۰۱,۳۶۴,۶۲۲	۹,۳۴۷,۰۱۵	۱,۴۴۹,۱۲۱,۳۱۸	۹,۰۵۲,۲۴۳,۳۰۴	۱۰,۵۰۱,۳۶۴,۶۲۲	۹,۳۴۷,۰۱۵	بیمه دی
۳۵۶,۴۹۶,۵۵۴,۹۱۷	۵۲۴,۶۴۱,۰۰۳,۷۰۸	۸۸۱,۱۳۷,۵۵۸,۶۲۵	۵۷۱,۷۵۳,۲۷۹	۲۰۳,۳۵۴,۲۸۵,۲۴۳	۶۷۷,۷۸۳,۲۷۳,۳۸۲	۸۸۱,۱۳۷,۵۵۸,۶۲۵	۵۷۱,۷۵۳,۲۷۹	جمع

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

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

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

سهام	از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه			طی دی ماه			سهام		
	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش		درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام
	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها		مبلغ	یادداشت ...
بیمه دی	۰.۰۷	۳۴۳,۲۸۲,۲۶۳	۱۰,۶۰۰,۰۳۳	۳۴۱,۶۸۲,۲۳۰	۰	۰.۶۳	۲۴,۱۹۰,۲۴۸-	۱,۴۴۹,۱۲۱,۳۱۸	۰
سرمایه گذاری بوعلی	۴.۹۴	۲۳,۸۶۴,۹۵۵,۷۷۸	۵۲۹,۴۰۴,۰۶۱	۱۸,۰۶۱,۴۳۳,۳۱۷	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۱.۸۸	۵۳,۴۳۱,۵۱۹	۴,۱۷۸,۳۱۸,۶۵۵	۰
بانک دی	۸۷.۵۸	۴۲۳,۱۶۵,۶۳۷,۵۲۳	۹۷,۲۵۴,۰۱۸,۲۱۶	۳۲۵,۹۱۱,۶۱۹,۳۰۷	۰	۹۲.۶۶	۲۰,۰۵۹,۰۳۷,۳۳۸	۱۸۸,۳۶۹,۳۶۴,۸۳۶	۰
تولید نیروی برق دماوند	۲.۵۴	۱۲,۲۸۱,۸۲۰,۰۶۳	۰	۱۲,۲۸۱,۸۲۰,۰۶۳	۰	۴.۱۶	۰	۹,۳۵۷,۴۸۰,۴۳۴	۰
جمع	۹۵.۱۳	۴۵۹,۶۵۵,۶۹۵,۶۲۷	۹۷,۸۸۵,۰۲۲,۳۱۰	۳۵۶,۴۹۶,۵۵۴,۹۱۷	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۹۹.۳۳	۲۰,۰۸۸,۲۷۸,۶۰۹	۲۰۳,۳۵۴,۲۸۵,۲۴۳	۰

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

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

نام سپرده	شماره حساب	طی دی ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه	
		سود سپرده بانکی و گواهی سپرده یادداشت ...	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده یادداشت ...	درصد سود به میانگین سپرده
بانک دی وزرا	۰۱۰۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴	۰	۰	۰	۰
بانک دی وزرا	۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	۰	۰	۰	۰
بانک دی وزرا	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	۱۵۳,۳۵۰	۶۱۴,۰۸۳,۶۴۹		
بانک دی وزرا	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	۱,۲۶۳,۳۷۵,۱۸۰	۲۱,۷۸۹,۳۸۸,۴۷۰		
جمع		۱,۲۶۳,۵۲۸,۵۳۰	۲۲,۴۰۳,۴۷۲,۱۱۹	۰	۰

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

۲-۴- سایر درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه	طی دی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
.	.	سایر درآمدها برای تنزیل سود سهام
.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۹۹۳,۰۸۰	.	تعدیل کارمزد کارگزار
۹۹۳,۰۸۰	.	جمع