

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 تاریخ ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۷

فردین آقا بزرگی
مدیر عامل و عضو هیات مدیره
کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۷

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	۱۳۹۷/۱۱/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۱۰/۳۰			
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده				
بانک دی	۶۷۵,۰۵۸,۷۹۹,۰۲۴	۵۲۹,۸۹۵,۷۰۵,۲۰۸	۱,۱۸۶	۵۷۱,۴۶۹,۷۰۸	۵,۱۸۷,۹۵۷,۳۵۷	۳,۳۵۹,۸۲۵-	۵۵,۹۹۱,۳۵۰,۶۴۶	۴۰,۶۶۶,۸۵۸	۸۰۲,۸۳۵,۳۳۱,۱۸۳	۴۷۶,۹۲۳,۷۱۱,۸۷۶	۵۳۴,۱۶۲,۶۷۵
بیمه دی	۱۱,۴۴۲,۱۰۰,۴۴۰	۱۰,۳۶۰,۹۴۹,۵۷۶	۱,۲۰۱	۹,۵۶۵,۳۱۰	۴۸۵,۳۱۳,۴۰۱	۴۰۰,۰۰۰-	۷۴۱,۱۰۷,۵۳۳	۶۱۸,۲۹۵	۱۰,۵۰۱,۳۶۴,۶۲۳	۱۰,۰۵۱,۲۷۴,۹۷۴	۹,۳۴۷,۰۱۵
تولید نیروی برق دماوند	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۲۲,۳۵۸	۹۴۹,۸۵۰	۲۱,۴۲۳,۵۳۰,۹۳۱	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۹۴۹,۸۵۰
سرمایه گذاری بوعلی	۴۵,۳۸۲,۴۹۱,۴۲۱	۳۱,۴۱۲,۳۱۲,۴۲۸	۱,۶۵۰	۲۷,۶۱۴,۷۲۳	۱۶۳,۵۴۴,۸۵۳	۱۰۰,۰۰۰-	۶۸۹,۰۱۱,۰۰۲	۴۲۰,۹۸۴	۴۶,۳۷۷,۳۳۱,۸۹۰	۳۰,۸۳۶,۹۵۹,۶۷۶	۲۷,۲۹۳,۷۳۹
جمع	۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۸	۵۸۰,۸۱۰,۶۷۸,۰۷۹	-	۶۰۹,۵۹۹,۵۹۱	۵,۸۳۶,۸۱۵,۶۱۱	۳,۸۵۹,۸۲۵-	۵۷,۴۲۱,۴۶۹,۱۸۰	۴۱,۷۰۶,۱۳۷	۸۸۱,۱۳۷,۵۵۸,۶۲۷	۵۲۶,۹۵۳,۶۵۷,۳۹۳	۵۷۱,۷۵۳,۲۷۹

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

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۱۰/۳۰		مشخصات حساب بانکی			سپرده های بانکی
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	
۰	۰	۵۵,۱۸۵,۲۰۲,۲۴۳	۵۵,۱۸۵,۲۰۲,۲۴۳	۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰	۱۸,۹۶۵,۳۷۹	۱۸,۹۶۵,۳۷۹	۱۵۴,۵۶۸	۱۸,۸۱۰,۸۱۱	۱۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا.
۰.۲۱	۱,۵۸۳,۲۲۷,۳۸۹	۵۶,۷۶۸,۴۲۹,۶۳۲	۴,۷۸۶,۲۷۴,۳۷۱	۵۱,۹۸۲,۱۵۵,۲۶۱	۲۱	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۰.۲۱	۱,۶۰۲,۱۹۲,۷۶۸	۱۱۱,۹۷۲,۵۹۷,۲۵۴	۵۹,۹۷۱,۶۳۱,۱۸۲	۵۲,۰۰۰,۹۶۶,۰۷۲					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۳۰ بهمن 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	۱۷۹,۶۸۶,۸۰۹,۶۲۵-	۱.۰۰	۲۳.۸۱٪-
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۲۰۷,۶۴۷,۶۲۸	۰.۰۰	۰.۰۳٪
سایر درآمدها	۴-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰٪
جمع		۱۷۹,۴۷۹,۱۶۱,۹۹۷-	۱.۰۰	۲۳.۷۸٪-

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

درآمد سود سهام

نام سهام	اطلاعات مجمع			طی بهمن ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه	
	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم (ریال)	جمع درآمد سود	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود	جمع درآمد سود
سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود	سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود	سهام	جمع درآمد سود
سرمایه گذاری بوعلی	۱۳۹۷/۰۳/۰۱	۲۶,۳۷۰,۵۹۲	۲۰۰	۰	۰	۰	۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰
							۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰

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

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه			طی بهمن 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	
۶۱۴,۳۳۳,۱۰۶	۰	۶۱۴,۳۳۳,۱۰۶	۱۴۹,۴۵۷	۰	۱۴۹,۴۵۷	۱۰		۳۰	دی وزرا
۲۱,۹۹۶,۸۸۶,۶۴۱	۰	۲۱,۹۹۶,۸۸۶,۶۴۱	۲۰۷,۴۹۸,۱۷۱	۰	۲۰۷,۴۹۸,۱۷۱	۲۱		۳۰	دی وزرا
۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۴۷	۰	۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۴۷	۲۰۷,۶۴۷,۶۲۸	۰	۲۰۷,۶۴۷,۶۲۸				جمع

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

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن 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	
۱۴۶,۸۸۸,۳۹۷	۴,۴۰۷,۲۱۴,۰۲۸	۴,۵۵۴,۱۰۲,۴۲۵	۴,۰۲۹,۹۱۷	۴۵,۲۸۸,۳۶۴	۴۴۰,۰۲۵,۰۳۷	۴۸۵,۳۱۳,۴۰۱	۴۰۰,۰۰۰	بیمه دی
۵۸۸,۴۰۳,۵۷۵	۱,۷۶۶,۹۶۱,۵۶۶	۲,۳۵۵,۳۶۵,۱۴۱	۱,۷۵۹,۳۶۳	۵۸,۹۹۹,۵۱۴	۱۰۴,۵۴۵,۳۳۹	۱۶۳,۵۴۴,۸۵۳	۱۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۹۹,۴۲۲,۶۱۸,۲۵۹	۱۷۵,۷۸۷,۹۴۹,۱۹۸	۲۷۵,۲۱۰,۵۶۷,۴۵۷	۲۴۳,۴۳۸,۶۲۶	۲,۱۶۸,۶۰۰,۰۴۳	۳,۰۱۹,۳۵۷,۳۱۴	۵,۱۸۷,۹۵۷,۳۵۷	۳,۳۵۹,۸۲۵	بانک دی
۱۰۰,۱۵۷,۹۱۰,۲۳۱	۱۸۱,۹۶۲,۱۲۴,۷۹۲	۲۸۲,۱۲۰,۰۳۵,۰۲۳	۲۴۹,۲۲۷,۹۰۶	۲,۲۷۲,۸۸۷,۹۲۱	۳,۵۶۳,۹۲۷,۶۹۰	۵,۸۳۶,۸۱۵,۶۱۱	۳,۸۵۹,۸۲۵	جمع

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم لورقه 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 بهمن ماه ۱۳۹۷

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن 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	
۱۴۵,۱۶۳,۰۹۳,۸۱۵	۵۲۹,۸۹۵,۷۰۵,۲۰۸	۶۷۵,۰۵۸,۷۹۹,۰۲۳	۵۷۱,۴۶۹,۷۰۸	۱۸۰,۷۴۸,۵۲۵,۴۹۱-	۸۵۵,۸۰۷,۳۲۴,۵۱۵	۶۷۵,۰۵۸,۷۹۹,۰۲۳	۵۷۱,۴۶۹,۷۰۸	بانک دی
۱۲,۰۱۰,۳۰۰,۸۱۵	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۹۴۹,۸۵۰	۲۷۱,۵۱۹,۲۴۷-	۲۱,۴۲۳,۵۳۰,۹۳۰	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۹۴۹,۸۵۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۶,۴۸۲,۱۲۷,۱۸۵	۲۸,۹۰۰,۳۶۴,۲۳۶	۴۵,۳۸۲,۴۹۱,۴۲۱	۲۷,۶۱۴,۷۲۳	۱,۵۷۹,۳۰۶,۱۳۱-	۴۶,۹۶۱,۷۹۷,۵۵۳	۴۵,۳۸۲,۴۹۱,۴۲۱	۲۷,۶۱۴,۷۲۳	سرمایه گذاری بوعلی
۸۸۱,۳۳۵,۵۵۳	۱۰,۵۶۰,۷۶۴,۸۸۷	۱۱,۴۴۲,۱۰۰,۴۴۰	۹,۵۶۵,۳۱۰	۶۳۹,۶۵۳,۳۲۳	۱۰,۸۰۲,۴۴۷,۱۱۷	۱۱,۴۴۲,۱۰۰,۴۴۰	۹,۵۶۵,۳۱۰	بیمه دی
۱۷۴,۵۳۶,۸۵۷,۳۶۸	۵۷۸,۴۹۸,۵۴۵,۱۹۸	۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۶	۶۰۹,۵۹۹,۵۹۱	۱۸۱,۹۵۹,۶۹۷,۵۴۶-	۹۳۴,۹۹۵,۱۰۰,۱۱۵	۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۶	۶۰۹,۵۹۹,۵۹۱	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 بهمن ماه ۱۳۹۷

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

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن ماه				درآمد سود سهام	سهام
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	سهام		
درصد از کل درآمد	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
ها				ها					
-۰.۳۴	۱,۰۲۸,۲۲۳,۹۵۰	۱۴۶,۸۸۸,۳۹۷	۸۸۱,۳۳۵,۵۵۳	-۰.۳۸	۶۸۴,۹۴۱,۶۸۷	۴۵,۲۸۸,۳۶۴	۶۳۹,۶۵۳,۳۲۳	۰	بیمه دی
۷.۳۶	۲۲,۳۴۴,۶۴۹,۱۶۰	۵۸۸,۴۰۳,۵۷۵	۱۶,۴۸۲,۱۲۷,۱۸۵	-۰.۸۵	۱,۵۲۰,۳۰۶,۶۱۷-	۵۸,۹۹۹,۵۱۴	۱,۵۷۹,۳۰۶,۱۳۱-	۰	سرمایه گذاری بوعلی
۸۰.۵۳	۲۴۴,۵۸۵,۷۱۲,۰۷۴	۹۹,۴۲۲,۶۱۸,۲۵۹	۱۴۵,۱۶۳,۰۹۳,۸۱۵	۹۹.۵۱	۱۷۸,۵۷۹,۹۲۵,۴۴۸-	۲,۱۶۸,۶۰۰,۰۴۳	۱۸۰,۷۴۸,۵۲۵,۴۹۱-	۰	بانک دی
۳.۹۵	۱۲,۰۱۰,۳۰۰,۸۱۵	۰	۱۲,۰۱۰,۳۰۰,۸۱۵	-۰.۱۵	۲۷۱,۵۱۹,۲۴۷-	۰	۲۷۱,۵۱۹,۲۴۷-	۰	تولید نیروی برق دماوند
۹۲.۱۸	۲۷۹,۹۶۸,۸۸۵,۹۹۹	۱۰۰,۱۵۷,۹۱۰,۲۳۱	۱۷۴,۵۳۶,۸۵۷,۳۶۸	۱۰۰	۱۷۹,۶۸۶,۸۰۹,۶۲۵-	۲,۲۷۲,۸۸۷,۹۲۱	۱۸۱,۹۵۹,۶۹۷,۵۴۶-	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۷

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

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه		طی بهمن ماه		شماره حساب	نام سپرده
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده یادداشت ...	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده یادداشت ...		
	۶۱۴,۲۳۳,۱۰۶		۱۴۹,۴۵۷	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
	۲۱,۹۹۶,۸۸۶,۶۴۱		۲۰۷,۴۹۸,۱۷۱	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
	۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۴۷		۲۰۷,۶۴۷,۶۲۸		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۷

۲-۴- سایر درآمدها:

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