

## 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 ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

فردین آقا بزرگی  
مدیر عامل و عضو هیات مدیره  
کارگزاری بانک دی (شعبه خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت پرتفوی  
 برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۱۲/۲۹		۱۳۹۷/۱۱/۳۰	
	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده
	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده				
بانک دی	-	-	-	-	۶۷۵,۰۵۸,۷۹۹,۰۲۴	۵۲۹,۸۹۵,۷۰۵,۲۰۸	۵۷۱,۴۶۹,۷۰۸	
بیمه دی	-	-	-	-	۱۱,۴۴۲,۱۰۰,۴۴۰	۱۰,۳۶۰,۹۴۹,۵۷۶	۹,۵۶۵,۳۱۰	
تولید نیروی برق دماهند	-	-	-	-	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۹۴۹,۸۵۰	
سرمایه گذاری بوعلی	-	-	-	-	۴۵,۳۸۲,۴۹۱,۴۲۱	۳۱,۴۱۲,۳۱۲,۴۲۸	۲۷,۶۱۴,۷۲۳	
جمع	-	-	-	-	۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۸	۵۸۰,۸۱۰,۶۷۸,۰۷۹	۶۰۹,۵۹۹,۵۹۱	
	درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد			
	۸۶.۲۶%	۷۱۵,۶۸۴,۱۵۹,۱۹۲	۵۹۷,۱۲۳,۹۲۷,۳۴۸	۱,۱۴۱	۶۲۹,۷۵۵,۶۳۴			
	۱.۳۴%	۱۱,۱۵۵,۶۷۴,۸۹۶	۹,۴۸۰,۱۷۸,۱۱۹	۱,۲۹۵	۸,۶۴۸,۹۳۰			
	۳.۴۴%	۲۸,۵۴۴,۵۲۵,۲۹۲	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۳۰,۱۷۲	۹۴۹,۸۵۰			
	۵.۹۲%	۴۹,۱۰۵,۰۹۲,۴۴۰	۳۲,۰۳۳,۴۴۳,۸۵۱	۱,۷۶۳	۲۷,۹۶۴,۷۲۳			
	۹۶.۹۶%	۸۰۴,۴۸۹,۴۵۱,۸۲۱	۶۴۷,۷۶۹,۲۶۰,۱۸۵	-	۶۶۷,۳۱۹,۱۳۷			

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۱۱/۳۰		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	
۰.۰۰٪	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵۷,۸۸۶,۹۲۱,۶۵۰	۱۵۷,۸۹۶,۹۲۱,۶۵۰	۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰.۰۰٪	۱۸,۹۶۵,۳۷۹	۰	۱۸,۹۶۵,۳۷۹	۲۲,۲۴۱,۶۸۶,۸۳۱	۱۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۳.۰۲٪	۲۵,۰۳۰,۳۶۶,۰۹۲	۶۷,۸۹۶,۹۲۱,۶۵۰	۹۲,۹۲۷,۲۸۷,۷۴۲	۱,۵۸۳,۲۲۷,۳۸۹	۲۱	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۰.۰۳۰۲	۲۵,۰۵۹,۳۳۱,۴۷۱	۲۲۵,۷۸۳,۸۴۳,۳۰۰	۲۵۰,۸۴۳,۱۷۴,۷۷۱	۲۳,۸۲۴,۹۱۴,۲۲۰					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها درصد از کل
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	(۱۵,۱۶۵,۹۸۸,۶۴۳)	۱۰۰.۱۳%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰.۱۳%
سایر درآمدها	۴-۲	۰	۰.۰۰%
جمع		(۱۵,۱۴۶,۰۸۹,۲۳۵)	۱۰۰.۰۰%

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

**سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی**

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه			طی اسفند 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	
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱۰		۳۰	دی وزرا
۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۲۱		۳۰	دی وزرا
۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند 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
۱۱۵,۳۵۶,۰۱۷	۲,۱۶۶,۸۸۷,۶۹۶	۲,۲۸۲,۲۴۳,۷۱۳	۱,۸۱۳,۲۳۳	۱۱۵,۳۵۶,۰۱۷	۲,۱۶۶,۸۸۷,۶۹۶	۲,۲۸۲,۲۴۳,۷۱۳	۱,۸۱۳,۲۳۳	بیمه دی
۱,۷۸۷,۳۰۴	۸۲,۱۷۶,۳۴۰	۸۳,۹۶۳,۶۴۴	۵۰,۰۰۰	۱,۷۸۷,۳۰۴	۸۲,۱۷۶,۳۴۰	۸۳,۹۶۳,۶۴۴	۵۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۱۱۷,۱۴۳,۳۲۱	۲,۲۴۹,۰۶۴,۰۳۶	۲,۳۶۶,۲۰۷,۳۵۷	۱,۸۶۳,۲۳۳	۱۱۷,۱۴۳,۳۲۱	۲,۲۴۹,۰۶۴,۰۳۶	۲,۳۶۶,۲۰۷,۳۵۷	۱,۸۶۳,۲۳۳	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 ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

**درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار**

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند 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	
۷,۳۹۲,۵۱۳,۶۰۹	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۲۸,۵۴۴,۵۲۵,۲۹۱	۹۴۹,۸۵۰	۷,۳۹۲,۵۱۳,۶۰۹	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۲۸,۵۴۴,۵۲۵,۲۹۱	۹۴۹,۸۵۰	تولید نیروی برق دماوند
۳,۱۳۶,۴۹۲,۵۵۴	۴۵,۹۶۸,۵۹۹,۸۸۶	۴۹,۱۰۵,۰۹۲,۴۴۰	۲۷,۹۶۴,۷۲۳	۳,۱۳۶,۴۹۲,۵۵۴	۴۵,۹۶۸,۵۹۹,۸۸۶	۴۹,۱۰۵,۰۹۲,۴۴۰	۲۷,۹۶۴,۷۲۳	سرمایه گذاری بوعلی
۷۹۰,۷۲۳,۸۴۳	۱۰,۳۶۴,۹۵۱,۰۵۳	۱۱,۱۵۵,۶۷۴,۸۹۶	۸,۶۴۸,۹۳۰	۷۹۰,۷۲۳,۸۴۳	۱۰,۳۶۴,۹۵۱,۰۵۳	۱۱,۱۵۵,۶۷۴,۸۹۶	۸,۶۴۸,۹۳۰	بیمه دی
(۲۶,۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	۷۴۲,۲۸۷,۰۲۱,۱۶۳	۷۱۵,۶۸۴,۱۵۹,۱۹۲	۶۲۹,۷۵۵,۶۳۴	(۲۶,۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	۷۴۲,۲۸۷,۰۲۱,۱۶۳	۷۱۵,۶۸۴,۱۵۹,۱۹۲	۶۲۹,۷۵۵,۶۳۴	بانک دی
(۱۵,۲۸۳,۱۳۱,۹۶۴)	۸۱۹,۷۷۲,۵۸۳,۷۸۴	۸۰۴,۴۸۹,۴۵۱,۸۱۹	۶۶۷,۳۱۹,۱۳۷	(۱۵,۲۸۳,۱۳۱,۹۶۴)	۸۱۹,۷۷۲,۵۸۳,۷۸۴	۸۰۴,۴۸۹,۴۵۱,۸۱۹	۶۶۷,۳۱۹,۱۳۷	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 ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

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

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند 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 ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
٪ ۵.۹۹-	۹۰۶.۰۷۹,۸۶۰	۱۱۵,۳۵۶.۰۱۷	۷۹۰,۷۲۳,۸۴۳	٪ ۵.۹۹-	۹۰۶.۰۷۹,۸۶۰	۱۱۵,۳۵۶.۰۱۷	۷۹۰,۷۲۳,۸۴۳	۰	بیمه دی
٪ ۲۰.۷۳-	۳,۱۳۸,۲۷۹,۸۵۸	۱,۷۸۷,۳۰۴	۳,۱۳۶,۴۹۲,۵۵۴	٪ ۲۰.۷۳-	۳,۱۳۸,۲۷۹,۸۵۸	۱,۷۸۷,۳۰۴	۳,۱۳۶,۴۹۲,۵۵۴	۰	سرمایه گذاری بوعلی
٪ ۴۸.۸۴-	۷,۳۹۲,۵۱۳,۶۰۹	-	۷,۳۹۲,۵۱۳,۶۰۹	٪ ۴۸.۸۴-	۷,۳۹۲,۵۱۳,۶۰۹	-	۷,۳۹۲,۵۱۳,۶۰۹	۰	تولید نیروی برق دماوند
٪ ۱۷۵.۷۵	(۳۶۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	-	(۳۶۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	٪ ۱۷۵.۷۵	(۳۶۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	-	(۳۶۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	۰	بانک دی
۰	(۱۵,۱۶۵,۹۸۸,۶۴۳)	۱۱۷,۱۴۳,۳۲۱	(۱۵,۲۸۳,۱۳۱,۹۶۴)	۰	(۱۵,۱۶۵,۹۸۸,۶۴۳)	۱۱۷,۱۴۳,۳۲۱	(۱۵,۲۸۳,۱۳۱,۹۶۴)	۰	جمع



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

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

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه		طی اسفند 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 ...		
۰	۰	۰	۰	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸	۰	۱۹,۸۹۹,۴۰۸		جمع