

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 ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

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

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت: ۱۶۴۹۶۰



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت پرتفوی
 برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	۱۳۹۷/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره						۱۳۹۸/۰۱/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها	
			تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش					
بانک دی	۶۲۹,۷۵۵,۶۳۴	۵۹۷,۱۲۳,۹۲۷,۳۴۸	۶۲۹,۷۵۵,۶۳۴	۱,۱۴۱	۵۹۷,۱۲۳,۹۲۷,۳۴۸	۷۱۵,۶۸۴,۱۵۹,۱۹۲	۸۶.۸۷٪
بیمه دی	۸,۶۴۸,۹۳۰	۹,۴۸۰,۱۷۸,۱۱۹	۲,۰۹۱,۹۵۱	۲,۷۷۴,۹۰۴,۶۳۶	(۷۲,۸۹۷)	۱۰۰,۹۶۴,۱۶۲	۱۰,۶۶۷,۹۸۴	۱,۳۴۸	۱۲,۱۷۳,۲۴۹,۶۲۷	۱۴,۳۲۳,۰۶۴,۴۶۷	۱.۷۴٪
تولید نیروی برق دماوند	۹۴۹,۸۵۰	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۹۴۹,۸۵۰	۲۴,۴۲۱	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۲۳,۱۰۳,۷۳۳,۶۶۵	۲.۸۰٪
سرمایه گذاری بوعلی	۲۷,۹۶۴,۷۲۳	۳۲,۰۲۳,۴۴۳,۸۵۱	۱۵۳,۲۴۷	۲۸۹,۸۸۱,۷۱۰	(۱۰۰,۰۰۰)	۱۹۲,۴۸۱,۴۲۲	۲۸,۰۱۷,۹۷۰	۱,۸۰۵	۳۲,۱۹۸,۴۳۱,۳۴۶	۵۰,۳۷۰,۶۵۱,۸۳۱	۶.۱۱٪
جمع	۶۶۷,۳۱۹,۱۳۷	۶۴۷,۷۶۹,۲۶۰,۱۸۵	۲,۲۴۵,۱۹۸	۳,۰۶۴,۷۸۶,۳۳۶	(۱۷۲,۸۹۷)	۲۹۳,۴۴۵,۵۸۴	۶۶۹,۳۹۱,۴۳۸	-	۶۵۰,۶۳۷,۳۱۹,۱۸۸	۸۰۳,۴۸۱,۶۰۹,۱۵۵	۹۷.۵۲٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت پرتفوی
 برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۱۲/۲۹		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٪	۰	۵,۴۰۹,۷۳۴,۹۶۹	۵,۳۹۹,۷۳۴,۹۶۹	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰.۰۰٪	۱۹,۲۷۰,۷۱۵	۰	۳۰۵,۳۳۶	۱۸,۹۶۵,۳۷۹	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۲.۴۵٪	۲۰,۲۱۹,۰۱۳,۰۷۶	۵,۴۰۰,۰۸۴,۹۶۹	۵۸۸,۷۳۱,۹۵۳	۲۵,۰۳۰,۳۶۶,۰۹۲	۰	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۲.۴۵٪	۲۰,۲۳۸,۲۸۳,۷۹۱	۱۰,۸۰۹,۸۱۹,۹۳۸	۵,۹۸۸,۷۷۲,۲۵۸	۲۵,۰۵۹,۳۳۱,۴۷۱					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	(۳,۷۷۹,۱۸۳,۴۱۷)	۱۱۱.۷۲٪	-۰.۴۶٪
در آمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	-۰.۰۰٪	-۰.۰۰٪
در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	-۱۱.۷۲٪	-۰.۰۵٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	-۰.۰۰٪	-۰.۰۰٪
جمع		(۳,۳۸۲,۶۲۷,۵۵۶)	۱۰۰٪	-۰.۴۱٪



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه			طی فروردین 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	
.	۳۰	بانک دی وزرا - ۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳
۴۱۶,۴۵۵,۲۶۹	.	۴۱۶,۴۵۵,۲۶۹	۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	.	۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	.	.	۳۰	بانک دی وزرا - ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲
۴۱۶,۴۵۵,۲۶۹	.	۴۱۶,۴۵۵,۲۶۹	۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	.	۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	.	.		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه				طی فروردین 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	
۱۲۷,۸۸۶,۸۸۷	۲,۲۵۵,۳۲۰,۹۸۸	۲,۳۸۳,۲۰۷,۸۷۵	۱,۸۸۶,۱۳۰	۱۲,۵۳۰,۸۷۰	۸۸,۴۳۳,۲۹۲	۱۰۰,۹۶۴,۱۶۲	۷۲,۸۹۷	بیمه دی
۲۹,۷۶۱,۷۲۰	۲۴۶,۶۸۳,۳۴۶	۲۷۶,۴۴۵,۰۶۶	۱۵۰,۰۰۰	۲۷,۹۷۴,۴۱۶	۱۶۴,۵۰۷,۰۰۶	۱۹۲,۴۸۱,۴۲۲	۱۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۱۵۷,۶۴۸,۶۰۷	۲,۵۰۲,۰۰۴,۳۳۴	۲,۶۵۹,۶۵۲,۹۴۱	۲,۰۳۶,۱۳۰	۴۰,۵۰۵,۲۸۶	۲۵۲,۹۴۰,۲۹۸	۲۹۳,۴۴۵,۵۸۴	۱۷۲,۸۹۷	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 ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه				طی فروردین 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	
۱,۹۵۱,۷۲۱,۹۸۳	۲۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲	۲۳,۱۰۳,۷۳۳,۶۶۵	۹۴۹,۸۵۰	(۵,۴۴۰,۷۹۱,۶۲۵)	۲۸,۵۴۴,۵۲۵,۳۹۱	۲۳,۱۰۳,۷۳۳,۶۶۵	۹۴۹,۸۵۰	تولید نیروی برق دماوند
۴,۲۷۶,۶۷۷,۳۴۰	۴۶,۰۹۳,۹۷۴,۵۹۰	۵۰,۳۷۰,۶۵۱,۸۳۰	۲۸,۰۱۷,۹۷۰	۱,۱۴۰,۱۸۴,۶۸۶	۴۹,۲۳۰,۴۶۷,۱۴۴	۵۰,۳۷۰,۶۵۱,۸۳۰	۲۸,۰۱۷,۹۷۰	سرمایه گذاری بوعلی
۱,۲۷۱,۶۴۲,۰۷۹	۱۳,۰۵۱,۴۲۲,۳۸۷	۱۴,۳۲۳,۰۶۴,۴۶۶	۱۰,۶۶۷,۹۸۴	۴۸۰,۹۱۸,۲۳۶	۱۳,۸۴۲,۱۴۶,۲۳۰	۱۴,۳۲۳,۰۶۴,۴۶۶	۱۰,۶۶۷,۹۸۴	بیمه دی
(۲۶۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	۷۴۲,۲۸۷,۰۲۱,۱۶۳	۷۱۵,۶۸۴,۱۵۹,۱۹۲	۶۲۹,۷۵۵,۶۳۴	بانک دی
(۱۹,۱۰۲,۸۲۰,۶۶۸)	۸۲۲,۵۸۴,۴۲۹,۸۲۲	۸۰۳,۴۸۱,۶۰۹,۱۵۳	۶۶۹,۳۹۱,۴۳۸	(۳,۸۱۹,۶۸۸,۷۰۳)	۹۱,۶۱۷,۱۳۸,۶۶۵	۸۷,۷۹۷,۴۴۹,۹۶۱	۳۹,۶۳۵,۸۰۴	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 ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

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

از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه					طی فروردین ماه					سهام
جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
درصد از کل درآمد	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
۷.۵۶٪-	۱,۳۹۹,۵۲۸,۹۶۶	۱۲۷,۸۸۶,۸۸۷	۱,۲۷۱,۶۴۲,۰۷۹	۰	۱۴.۵۹٪-	۴۹۳,۴۴۹,۱۰۶	۱۲,۵۳۰,۸۷۰	۴۸۰,۹۱۸,۲۳۶	۰	بیمه دی
۲۳.۲۶٪-	۴,۳۰۶,۴۳۸,۹۶۰	۲۹,۷۶۱,۷۲۰	۴,۲۷۶,۶۷۷,۲۴۰	۰	۳۴.۵۵٪-	۱,۱۶۸,۱۵۹,۱۰۲	۲۷,۹۷۴,۴۱۶	۱,۱۴۰,۱۸۴,۶۸۶	۰	سرمایه گذاری بوعلی
۱۰.۵۴٪-	۱,۹۵۱,۷۲۱,۹۸۳	۰	۱,۹۵۱,۷۲۱,۹۸۳	۰	۱۶۰.۹۰٪	(۵,۴۴۰,۷۹۱,۶۲۵)	۰	(۵,۴۴۰,۷۹۱,۶۲۵)	۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۴۳.۶۶٪	(۲۶,۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	۰	(۲۶,۶۰۲,۸۶۱,۹۷۰)	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	بانک دی
۱۰۲.۳۰٪	(۱۸,۹۴۵,۱۷۲,۰۶۱)	۱۵۷,۶۴۸,۶۰۷	(۱۹,۱۰۲,۸۲۰,۶۶۸)	۰	۱۱۱.۷۶٪	(۳,۷۷۹,۱۸۳,۴۱۷)	۴۰,۵۰۵,۲۸۶	(۳,۸۱۹,۶۸۸,۷۰۳)	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸

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

نام سپرده	شماره حساب	طی فروردین ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان فروردین 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	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	۰	۰.۰۰٪	۰	۰.۰۰٪
بانک دی وزرا	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	۳.۹۲٪	۴۱۶,۴۵۵,۲۶۹	۴.۱۲٪
جمع		۳۹۶,۵۵۵,۸۶۱	۳.۹۲٪	۴۱۶,۴۵۵,۲۶۹	۴.۱۲٪