

صندوق سرمایه گذاری 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 اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

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

کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)



شماره ثبت ۱۴۴۹۴



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

۱- سرمایه گذاری ها

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

شرکت	تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۱/۳۱				۱۳۹۸/۰۲/۳۱			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها	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	۷۱۵,۶۸۴,۱۵۹,۱۹۲	۸۵/۷۱	۱۵,۶۲۶,۴۱۹	۲۰,۲۵۴,۶۴۷,۲۲۱	۱۶,۷۰۰,۰۰۰	۲۱,۴۰۹,۸۲۳,۳۹۳	۶۲۸,۶۸۲,۰۵۳	۱,۳۶۱	۶۰۱,۵۱۵,۷۷۹,۴۴۴	۸۵/۷۱
بیمه دی	۱۰,۶۶۷,۹۸۴	۱۲,۱۷۳,۲۴۹,۶۲۷	۱۴,۳۲۳,۰۶۴,۴۶۷	۱/۸	۳,۵۰۰,۰۰۰	۵,۶۱۳,۰۷۲,۸۸۶	۳,۶۹۸,۱۱۷	۵,۹۸۹,۱۲۶,۶۳۴	۱۰,۴۶۹,۸۶۷	۱,۷۱۷	۱۳,۳۵۳,۷۱۵,۹۶۰	۱/۸
تولید نیروی برق دماوند	۹۴۹,۸۵۰	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۲۳,۱۰۳,۷۳۳,۶۶۵	۳/۲۶	۹۴۹,۸۵۰	۳۴,۲۳۳	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	۳/۲۶
سرمایه گذاری بوعلی	۲۸,۰۱۷,۹۷۰	۳۲,۱۹۸,۴۳۱,۳۴۶	۵۰,۳۷۰,۶۵۱,۸۳۱	۶/۵	۲۰۰,۰۰۰	۴۱۶,۸۹۷,۶۷۸	۳۸۷,۳۷۹	۸۱۲,۲۴۲,۳۵۹	۲۷,۸۳۰,۵۹۱	۲,۳۳۳	۳۲,۱۶۸,۶۵۲,۱۲۱	۶/۵
جمع	۶۶۹,۳۹۱,۴۲۸	۶۵۰,۶۳۷,۳۱۹,۱۸۸	۸۰۳,۴۸۱,۶۰۹,۱۵۵	۹۷/۲۷	۱۹,۳۲۶,۴۱۹	۲۶,۲۸۴,۶۱۷,۷۸۵	۲۰,۷۸۵,۴۹۶	۲۸,۲۱۱,۲۰۲,۳۸۶	۶۶۷,۹۳۲,۳۶۱	-	۶۵۶,۱۷۹,۸۵۸,۳۹۲	۹۷/۲۷

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

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۱/۳۱		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	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۴۷۶,۶۶۱,۶۶۲	۱۷,۴۸۶,۶۶۱,۶۶۲	۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰	۱۹,۴۳۳,۱۰۴	۰	۱۶۲,۳۸۹	۱۹,۲۷۰,۷۱۵	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۲/۷۲	۲۷,۰۲۱,۸۷۹,۴۰۴	۱۷,۴۸۶,۶۶۱,۶۶۲	۲۴,۲۸۹,۵۲۷,۹۹۰	۲۰,۲۱۹,۰۱۳,۰۷۶	۰	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۲/۷۲	۲۷,۰۵۱,۳۱۲,۵۰۸	۳۴,۹۶۳,۳۲۳,۳۲۴	۴۱,۷۷۶,۳۵۲,۰۴۱	۲۰,۲۳۸,۲۸۳,۷۹۱					جمع

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

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	۲-۱	۱۶۵,۶۲۸,۴۷۳,۵۷۳	۹۹/۷۹٪	۱۶/۶۶٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۳۴۸,۹۶۳,۶۷۵	۰/۲۱٪	۰/۰۴٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪
جمع		۱۶۵,۹۷۷,۴۳۷,۲۴۸	۱۰۰٪	۱۶/۶۹٪

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

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه			طی اردیبهشت ماه			اطلاعات اوراق و سپرده ها			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
.		۳۰	بانک دی وزرا - ۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳
۷۶۵.۴۱۸.۹۴۴	.	۷۶۵.۴۱۸.۹۴۴	۳۴۸.۹۶۳.۶۷۵	.	۳۴۸.۹۶۳.۶۷۵	.		۳۰	بانک دی وزرا - ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲
۷۶۵.۴۱۸.۹۴۴	.	۷۶۵.۴۱۸.۹۴۴	۳۴۸.۹۶۳.۶۷۵	.	۳۴۸.۹۶۳.۶۷۵				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه				طی اردیبهشت 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	
۱.۴۱۹.۳۸۳.۲۳۳	۶.۹۵۲.۹۵۱.۲۷۶	۸.۳۷۲.۳۳۴.۵۰۹	۵.۵۸۴.۲۴۷	۱.۲۹۱.۴۹۶.۳۴۶	۴.۶۹۷.۶۳۰.۲۸۸	۵.۹۸۹.۱۲۶.۶۳۴	۳.۶۹۸.۱۱۷	بیمه دی
۲۰۴.۰۰۱.۳۷۲	۸۸۴.۶۸۶.۰۵۳	۱.۰۸۸.۶۸۷.۴۲۵	۵۳۷.۳۷۹	۱۷۴.۲۳۹.۶۵۲	۶۳۸.۰۰۲.۷۰۷	۸۱۲.۲۴۲.۳۵۹	۳۸۷.۳۷۹	سرمایه گذاری بوعلی
۱.۷۱۷.۴۳۰.۲۰۹	۱۹.۶۹۲.۴۰۳.۱۸۴	۲۱.۴۰۹.۸۳۳.۳۹۳	۱۶.۷۰۰.۰۰۰	۱.۷۱۷.۴۳۰.۲۰۹	۱۹.۶۹۲.۴۰۳.۱۸۴	۲۱.۴۰۹.۸۳۳.۳۹۳	۱۶.۷۰۰.۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۳.۳۴۰.۸۱۴.۸۱۴	۲۷.۵۳۰.۰۴۰.۵۱۳	۳۰.۸۷۰.۸۵۵.۳۲۷	۲۲.۸۲۱.۶۲۶	۳.۱۸۳.۱۶۶.۲۰۷	۲۵.۰۲۸.۰۳۶.۱۷۹	۲۸.۲۱۱.۲۰۲.۳۸۶	۲۰.۷۸۵.۴۹۶	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 اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه				طی اردیبهشت 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	
۱۱.۲۳۴.۴۶۳.۶۶۹	۲۱.۱۵۲.۰۱۱.۶۸۲	۳۲.۳۸۶.۴۷۵.۳۵۱	۹۴۹.۸۵۰	۹.۲۸۲.۷۴۱.۶۸۶	۲۳.۱۰۳.۷۳۳.۶۶۵	۳۲.۳۸۶.۴۷۵.۳۵۱	۹۴۹.۸۵۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۸.۷۹۶.۸۳۳.۴۵۴	۴۵.۸۷۲.۸۶۹.۵۶۱	۶۴.۶۶۹.۷۰۳.۰۱۵	۲۷.۸۳۰.۵۹۱	۱۴.۵۲۰.۱۵۶.۲۱۴	۵۰.۱۴۹.۵۴۶.۸۰۱	۶۴.۶۶۹.۷۰۳.۰۱۵	۲۷.۸۳۰.۵۹۱	سرمایه گذاری بوعلی
۳.۹۳۸.۱۶۹.۳۷۵	۱۳.۹۶۶.۸۶۴.۹۸۵	۱۷.۹۰۵.۰۳۴.۳۶۰	۱۰.۴۶۹.۸۶۷	۲.۶۶۶.۵۲۷.۲۹۶	۱۵.۲۳۸.۵۰۷.۰۶۴	۱۷.۹۰۵.۰۳۴.۳۶۰	۱۰.۴۶۹.۸۶۷	بیمه دی
۱۰۹.۳۷۳.۰۲۰.۱۹۹	۷۴۲.۸۴۹.۲۶۵.۲۰۰	۸۵۲.۲۲۲.۲۸۵.۳۹۹	۶۲۸.۶۸۲.۰۵۳	۱۳۵.۹۷۵.۸۸۲.۱۷۰	۷۱۶.۲۴۶.۴۰۳.۲۲۹	۸۵۲.۲۲۲.۲۸۵.۳۹۹	۶۲۸.۶۸۲.۰۵۳	بانک دی
۱۴۳.۳۴۲.۴۸۶.۶۹۷	۸۲۳.۸۴۱.۰۱۱.۴۲۸	۹۶۷.۱۸۳.۴۹۸.۱۲۵	۶۶۷.۹۳۲.۳۶۱	۱۶۲.۴۴۵.۳۰۷.۳۶۶	۸۰۴.۷۳۸.۱۹۰.۷۵۹	۹۶۷.۱۸۳.۴۹۸.۱۲۵	۶۶۷.۹۳۲.۳۶۱	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 اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

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

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه					طی اردیبهشت 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 ...	
۳/۶۳	۵,۳۵۷,۵۵۲,۶۰۸	۱,۴۱۹,۳۸۳,۲۳۳	۳,۹۳۸,۱۶۹,۳۷۵	۰	۲/۳۸	۳,۹۵۸,۰۲۳,۶۴۲	۱,۲۹۱,۴۹۶,۳۴۶	۲,۶۶۶,۵۲۷,۲۹۶	۰	بیمه دی
۱۲/۸۸	۱۹,۰۰۰,۸۳۴,۸۲۶	۲۰۴,۰۰۱,۳۷۲	۱۸,۷۹۶,۸۳۳,۴۵۴	۰	۸/۸۵	۱۴,۶۹۴,۳۹۵,۸۶۶	۱۷۴,۲۳۹,۶۵۲	۱۴,۵۲۰,۱۵۶,۲۱۴	۰	سرمایه گذاری بوعلی
۷۵/۲۸	۱۱۱,۰۹۰,۴۵۰,۴۰۸	۱,۷۱۷,۴۳۰,۲۰۹	۱۰۹,۳۷۳,۰۲۰,۱۹۹	۰	۸۲/۹	۱۳۷,۶۹۳,۳۱۲,۳۷۹	۱,۷۱۷,۴۳۰,۲۰۹	۱۳۵,۹۷۵,۸۸۲,۱۷۰	۰	بانک دی
۷/۶۱	۱۱,۲۳۴,۴۶۳,۶۶۹	۰	۱۱,۲۳۴,۴۶۳,۶۶۹	۰	۵/۵۹	۹,۲۸۲,۷۴۱,۶۸۶	۰	۹,۲۸۲,۷۴۱,۶۸۶	۰	تولید نیروی برق دماوند
۹۹/۴۰	۱۴۶,۶۸۳,۳۰۱,۵۱۱	۳,۳۴۰,۸۱۴,۸۱۴	۱۴۳,۳۴۲,۴۸۶,۶۹۷	۰	۹۹/۷۲	۱۶۵,۶۲۸,۴۷۳,۵۷۳	۳,۱۸۳,۱۶۶,۲۰۷	۱۶۲,۴۴۵,۳۰۷,۳۶۶	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

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

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه		طی اردیبهشت 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 ...		
۰/۰۰٪	۰	۰/۰۰٪	۰	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۸/۴۹٪	۷۶۵.۴۱۸.۹۴۴	۳/۸۷٪	۳۴۸.۹۶۳.۶۷۵	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۸/۴۹٪	۷۶۵.۴۱۸.۹۴۴	۳/۸۷٪	۳۴۸.۹۶۳.۶۷۵		جمع