

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 خرداد ماه ۱۳۹۸

فردین آقابزرگی
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 خرداد ماه ۱۳۹۸

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

شرکت	۱۳۹۸/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۳/۳۱		درصد به کل دارایی ها
	تعداد	بهای تمام شده	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش		
			تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده			
بانک دی	۶۲۸,۶۸۲,۰۵۳	۶۰۱,۵۱۵,۷۷۹,۴۴۴	۲۳,۸۷۵,۵۳۰	۳۸,۶۴۰,۲۵۸,۲۲۶	۶۱۴,۱۸۲,۲۶۵	۱,۷۶۲	۸۴/۶۷		
بیمه دی	۱۰,۴۶۹,۸۶۷	۱۳,۳۵۳,۷۱۵,۹۶۰	۷,۶۵۷,۷۷۳,۹۱۲	۴,۳۶۷,۵۰۵	۱۳,۹۴۹,۳۲۲	۲,۳۲۵	۲/۵۴		
تولید نیروی برق دماوند	۹۴۹,۸۵۰	۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷	-	-	۴۱,۱۵۳	۹۴۹,۸۵۰	۳/۰۶		
سرمایه گذاری بوعلی	۲۷,۸۳۰,۵۹۱	۳۲,۱۶۸,۶۵۲,۱۲۱	۳,۵۸۰,۰۰۰	۸,۸۰۴,۲۳۰,۶۶۳	۲۴,۷۵۴,۶۶۸	۲,۸۸۸	۵/۵۹		
جمع	۶۶۷,۹۳۲,۳۶۱	۶۵۶,۱۷۹,۸۵۸,۳۹۲	۳۱,۸۳۳,۰۳۵	۵۵,۱۰۲,۲۶۲,۸۰۱	۶۵۳,۸۳۶,۱۱۵	-	۹۵/۸۶		

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۸

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۲/۳۱		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	۲۱,۳۷۵,۹۸۲,۹۶۷	۲۱,۳۷۵,۹۸۲,۹۶۷	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	حساب جاری	۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	بانک دی وزرا
۰	۱۹,۵۹۶,۷۷۳	۰	۱۶۳,۶۶۹	۱۹,۴۳۳,۱۰۴	۰	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	بانک دی وزرا
۱/۸۲	۲۳,۱۶۹,۶۸۴,۸۴۴	۲۱,۳۷۵,۹۸۲,۹۶۷	۱۷,۴۲۳,۷۸۸,۴۰۷	۲۷,۰۲۱,۸۷۹,۴۰۴	۰	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	سپرده کوتاه مدت	۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	بانک دی وزرا
۱/۸۲	۲۳,۱۹۹,۲۸۱,۶۱۷	۴۲,۵۵۱,۹۶۵,۹۳۴	۳۸,۶۹۹,۹۳۵,۰۴۳	۲۷,۰۵۱,۳۱۲,۵۰۸					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد 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	۲۸۵,۱۵۶,۷۰۰,۱۵۰	۹۹/۸۸٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار یا درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰/۰٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۳۵۰,۰۰۳,۶۱۸	۰/۱۲٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰/۰٪
جمع		۲۸۵,۵۰۶,۷۰۳,۷۶۸	۱۰۰٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۸

درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه			طی خرداد 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	
۶۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲	۸۸۹.۴۴۸.۳۹۸	۶.۹۵۷.۶۴۷.۷۵۰	۶۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲	۸۸۹.۴۴۸.۳۹۸	۶.۹۵۷.۶۴۷.۷۵۰	۲۵۰	۲۷.۸۳۰.۵۹۱	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	سرمایه گذاری بوعلی
۶۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲	۸۸۹.۴۴۸.۳۹۸	۶.۹۵۷.۶۴۷.۷۵۰	۶۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲	۸۸۹.۴۴۸.۳۹۸	۶.۹۵۷.۶۴۷.۷۵۰				

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

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه			طی خرداد 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
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۳۰	بانک دی وزرا - ۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳
۱,۱۱۵,۴۲۲,۵۶۲	۰	۱,۱۱۵,۴۲۲,۵۶۲	۳۵۰,۰۰۰,۳۶۱۸	۰	۳۵۰,۰۰۰,۳۶۱۸	۰		۳۰	بانک دی وزرا - ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲
۱,۱۱۵,۴۲۲,۵۶۲	۰	۱,۱۱۵,۴۲۲,۵۶۲	۳۵۰,۰۰۰,۳۶۱۸	۰	۳۵۰,۰۰۰,۳۶۱۸				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۸

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد 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	
۲.۹۱۴.۰۱۴.۴۲۱	۱۳.۱۱۶.۰۹۴.۰۰۰	۱۶.۰۳۰.۱۰۸.۴۲۱	۹.۹۵۱.۷۵۲	۱.۴۹۴.۶۳۱.۱۸۸	۶.۱۶۳.۱۴۲.۷۲۴	۷.۶۵۷.۷۷۳.۹۱۲	۴.۳۶۷.۵۰۵	بیمه دی
۳.۰۷۸.۵۷۴.۸۱۱	۶.۸۱۴.۳۴۳.۲۷۷	۹.۸۹۲.۹۱۸.۰۸۸	۴.۱۱۷.۳۷۹	۲.۸۷۴.۵۷۳.۴۳۹	۵.۹۲۹.۶۵۷.۲۲۴	۸.۸۰۴.۲۳۰.۶۶۳	۳.۵۸۰.۰۰۰	سرمایه گذاری بوعلی
۱۲۰.۷۸.۲۶۷.۹۶۷	۴۷.۹۷۱.۸۲۳.۶۵۲	۶۰.۰۵۰.۰۹۱.۶۱۹	۴۰.۵۷۵.۵۳۰	۱۰.۳۶۰.۸۳۷.۷۵۸	۲۸.۲۷۹.۴۲۰.۴۶۸	۳۸.۶۴۰.۲۵۸.۲۲۶	۲۳.۸۷۵.۵۳۰	بانک دی
۱۸.۰۷۰.۸۵۷.۱۹۹	۶۷.۹۰۲.۲۶۰.۹۲۹	۸۵.۹۷۳.۱۱۸.۱۲۸	۵۴.۶۴۴.۶۶۱	۱۴.۷۳۰.۰۴۲.۳۸۵	۴۰.۳۷۲.۲۲۰.۴۱۶	۵۵.۱۰۲.۲۶۲.۸۰۱	۳۱.۸۲۳.۰۳۵	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 خرداد ماه ۱۳۹۸

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

شرح	طی خرداد ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه			تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری				
بانک دی	۶۱۴.۱۸۲.۲۶۵	۱.۰۷۷.۸۷۱.۲۱۶.۲۱۷	۸۳۷.۶۰۸.۵۴۷.۳۵۸	۶۱۴.۱۸۲.۲۶۵	۱.۰۷۷.۸۷۱.۲۱۶.۲۱۷	۷۲۸.۲۳۵.۵۲۷.۱۵۹	۶۱۴.۱۸۲.۲۶۵	۱.۰۷۷.۸۷۱.۲۱۶.۲۱۷	۲۴۰.۲۶۲.۶۶۸.۸۵۹	۳۴۹.۶۳۵.۶۸۹.۰۵۸
تولید نیروی برق دماوند	۹۴۹.۸۵۰	۳۸.۹۳۳.۲۱۱.۲۳۳	۳۲.۳۸۶.۴۷۵.۳۵۱	۹۴۹.۸۵۰	۳۸.۹۳۳.۲۱۱.۲۳۳	۲۱.۱۵۲.۰۱۱.۶۸۲	۹۴۹.۸۵۰	۳۸.۹۳۳.۲۱۱.۲۳۳	۶.۵۴۶.۷۳۵.۸۸۲	۱۷.۷۸۱.۱۹۹.۵۵۱
سرمایه گذاری بوعلی	۲۴.۷۵۴.۶۶۸	۷۱.۲۰۶.۲۳۰.۱۷۴	۵۹.۸۲۷.۱۳۰.۴۰۸	۲۴.۷۵۴.۶۶۸	۷۱.۲۰۶.۲۳۰.۱۷۴	۴۱.۰۳۰.۲۹۶.۹۵۴	۲۴.۷۵۴.۶۶۸	۷۱.۲۰۶.۲۳۰.۱۷۴	۱۱.۳۷۹.۰۹۹.۷۶۶	۳۰.۱۷۵.۹۳۳.۲۲۰
بیمه دی	۱۳.۹۴۹.۳۳۲	۳۲.۳۰۲.۷۹۲.۴۳۴	۲۶.۱۳۲.۸۴۸.۵۲۸	۱۳.۹۴۹.۳۳۲	۳۲.۳۰۲.۷۹۲.۴۳۴	۲۲.۱۹۴.۶۶۹.۱۵۳	۱۳.۹۴۹.۳۳۲	۳۲.۳۰۲.۷۹۲.۴۳۴	۶.۱۶۹.۹۵۳.۹۰۶	۱۰.۱۰۸.۱۲۳.۲۸۱
جمع	۶۵۳.۸۳۶.۱۱۵	۱.۲۲۰.۳۱۳.۴۵۰.۰۵۸	۹۵۵.۹۵۴.۹۹۱.۶۴۵	۶۵۳.۸۳۶.۱۱۵	۱.۲۲۰.۳۱۳.۴۵۰.۰۵۸	۸۱۲.۶۱۲.۵۰۴.۹۴۸	۶۵۳.۸۳۶.۱۱۵	۱.۲۲۰.۳۱۳.۴۵۰.۰۵۸	۲۶۴.۳۵۸.۴۵۸.۴۱۳	۴۰۷.۷۰۰.۹۴۵.۱۱۰

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 ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۸

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

سهام	از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه				
	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
بیمه دی	۱۳.۰۲۲.۱۳۷.۷۰۲	۲.۹۱۴.۰۱۴.۴۲۱	۱۰.۱۰۸.۱۲۳.۲۸۱	۰	۲/۶۷	۷.۶۶۴.۵۸۵.۰۹۴	۱.۴۹۴.۶۳۱.۱۸۸	۶.۱۶۹.۹۵۳.۹۰۶	۰
سرمایه گذاری بوعلی	۳۹.۳۲۲.۷۰۷.۳۸۳	۳۰.۷۸.۵۷۴.۸۱۱	۳۰.۱۷۵.۹۳۳.۲۲۰	۶.۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲	۷/۰۹	۲۰.۳۲۱.۸۷۲.۵۵۷	۲.۸۷۴.۵۷۳.۴۳۹	۱۱.۳۷۹.۰۹۹.۷۶۶	۶.۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲
بانک دی	۳۶۱.۷۱۳.۹۵۷.۰۲۵	۱۲۰.۷۸.۲۶۷.۹۶۷	۳۴۹.۶۳۵.۶۸۹.۰۵۸	۰	۸۷/۴۴	۲۵۰.۶۲۳.۵۰۶.۶۱۷	۱۰.۳۶۰.۸۳۷.۷۵۸	۲۴۰.۲۶۲.۶۶۸.۸۵۹	۰
تولید نیروی برق دماوند	۱۷.۷۸۱.۱۹۹.۵۵۱	۰	۱۷.۷۸۱.۱۹۹.۵۵۱	۰	۲/۲۸	۶.۵۴۶.۷۳۵.۸۸۲	۰	۶.۵۴۶.۷۳۵.۸۸۲	۰
جمع	۴۳۱.۸۴۰.۰۰۱.۶۶۱	۱۸۰.۷۰۸.۵۷.۱۹۹	۴۰۷.۷۰۰.۹۴۵.۱۱۰	۶.۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲	۹۹/۴۸	۲۸۵.۱۵۶.۷۰۰.۱۵۰	۱۴.۷۳۰.۰۴۲.۳۸۵	۲۶۴.۳۵۸.۴۵۸.۴۱۳	۶.۰۶۸.۱۹۹.۳۵۲

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

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

نام سپرده	شماره حساب	طی خرداد ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد 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	۳۵۰.۰۰۳۶۱۸	۳/۰۲٪	۱.۱۱۵.۴۲۲.۵۶۲	۹/۶۲٪
جمع		۳۵۰.۰۰۳۶۱۸	۳/۰۲٪	۱.۱۱۵.۴۲۲.۵۶۲	۹/۶۲٪