

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 ۳۱ تیر ماه ۱۳۹۸

فردین آقا بزرگی
مدیرعامل و عضو هیات مدیره
کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| نام شرکت | طی ماه | | | از ابتدای سال مالی تا پایان ماه | | | | |
|------------------------|-------------|-------------------|-------------------|---------------------------------|-------------|-------------------|-----------------|-------------------------------|
| | تعداد | بهای فروش | ارزش دفتری | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | تعداد | بهای فروش | ارزش دفتری | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت |
| بانک دی | ۵۵۳,۶۶۵,۹۹۲ | ۱,۸۰۸,۷۷۸,۵۱۹,۴۵۶ | ۱,۰۵۲,۸۰۸,۱۰۲,۱۹۷ | ۷۵۵,۹۷۰,۴۱۷,۲۵۹ | ۵۵۳,۶۶۵,۹۹۲ | ۱,۸۰۸,۷۷۸,۵۱۹,۴۵۶ | ۷۰۳,۱۷۲,۴۱۳,۱۳۹ | ۱,۱۰۵,۶۰۶,۱۰۶,۳۱۷ |
| تولید نیروی برق دماوند | ۹۴۹,۸۵۰ | ۴۱,۱۰۷,۲۵۷,۳۳۹ | ۳۸,۹۳۳,۲۱۱,۲۳۳ | ۳,۱۷۴,۰۴۶,۱۰۶ | ۹۴۹,۸۵۰ | ۴۱,۱۰۷,۲۵۷,۳۳۹ | ۳۱,۱۵۲,۰۱۱,۶۸۲ | ۱۹,۹۵۵,۳۴۵,۶۵۷ |
| سرمایه‌گذاری بوعلی | ۲۰,۵۳۷,۲۳۰ | ۶۴,۹۴۵,۵۳۴,۴۸۶ | ۷۰,۰۱۰,۸۶۸,۲۸۶ | -۵,۰۶۵,۳۳۳,۷۹۹ | ۲۰,۵۳۷,۲۳۰ | ۶۴,۹۴۵,۵۳۴,۴۸۶ | ۳۹,۸۳۲,۹۳۵,۰۶۶ | ۳۵,۱۱۰,۵۹۹,۳۴۰ |
| بیمه دی | ۱۶,۴۵۸,۳۶۹ | ۳۶,۶۵۴,۰۷۷,۴۴۰ | ۳۹,۲۷۱,۱۶۶,۸۴۸ | -۲,۶۱۷,۰۸۹,۴۰۷ | ۱۶,۴۵۸,۳۶۹ | ۳۶,۶۵۴,۰۷۷,۴۴۰ | ۲۹,۱۶۳,۰۴۳,۵۶۷ | ۷,۴۹۱,۰۳۳,۸۷۳ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| نام شرکت | طی ماه | | | | از ابتدای سال مالی تا پایان ماه | | | |
|--------------------|------------|-----------------|-----------------|-------------------------|---------------------------------|-----------------|-----------------|-------------------------|
| | تعداد | بهای فروش | ارزش دفتری | سود و زیان ناشی از فروش | تعداد | بهای فروش | ارزش دفتری | سود و زیان ناشی از فروش |
| بیمه دی | ۱,۰۰۰,۰۰۰ | ۲,۴۸۰,۰۵۰,۰۱۴ | ۱,۶۷۹,۹۸۰,۸۶۴ | ۸۰۰,۰۸۴,۱۵۰ | ۱۰,۹۵۱,۷۵۲ | ۱۸,۵۱۰,۱۷۳,۴۳۵ | ۱۴,۷۹۶,۰۷۴,۸۶۴ | ۳,۷۱۴,۰۹۸,۵۷۱ |
| سرمایه‌گذاری پوعلی | ۸,۳۰۰,۰۰۰ | ۳۱,۳۱۶,۵۴۷,۴۸۱ | ۱۴,۶۹۵,۶۷۶,۳۷۰ | ۱۶,۵۲۰,۸۷۱,۱۱۱ | ۱۲,۴۱۷,۳۷۹ | ۴۱,۱۰۹,۴۶۵,۵۶۹ | ۲۱,۵۱۰,۰۱۹,۶۴۷ | ۱۹,۵۹۹,۴۴۵,۹۲۲ |
| بانک دی | ۸۷,۸۲۸,۳۵۷ | ۳۳۵,۰۲۸,۰۰۸,۵۴۵ | ۱۰۵,۶۵۶,۵۰۶,۳۴۸ | ۱۲۹,۳۷۱,۵۰۲,۱۹۷ | ۱۲۸,۴۰۳,۸۸۷ | ۲۹۵,۰۷۸,۱۰۰,۱۶۴ | ۱۵۳,۶۲۸,۳۳۰,۰۰۰ | ۱۴۱,۴۴۹,۷۷۰,۱۶۴ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| نام شرکت | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | طن ماه درآمد فروش | مبلغ | درصد از کل درآمدها | از ابتدای سال مالی تا پایان ماه | | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درصد از کل درآمدها |
|------------------------|----------------|------------------|----------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|-----------------|------------------|------------------|--------------------|
| | | | | | | مبلغ | درآمد فروش | | | |
| بیمه دی | ۷۰۶,۲۷۳,۹۰۴ | -۲,۶۱۷,۰۸۹,۴۰۷ | ۸۰۰,۰۸۴,۱۵۰ | -۱,۱۱۰,۵۳۱,۳۵۳ | -۰.۸۱٪ | ۱۱,۹۱۱,۶۰۶,۳۳۸ | ۳,۷۱۴,۰۹۸,۵۷۹ | ۷,۲۹۱,۰۳۳,۸۷۳ | ۷۰۶,۲۷۳,۹۰۴ | -۰.۸۱٪ |
| سرمایه‌گذاری بوعلی | - | -۵,۰۶۵,۳۳۳,۷۹۹ | ۱۶,۵۲۰,۸۷۱,۱۱۹ | ۹۹,۴۵۵,۵۳۷,۳۱۳ | ۳.۸۱٪ | ۵۰,۸۹۲,۷۳۹,۰۲۱ | ۱۹,۵۹۹,۴۴۵,۹۲۲ | ۳۵,۱۱۰,۵۹۹,۴۲۰ | ۶,۱۸۲,۶۹۳,۶۷۹ | ۹.۳۷٪ |
| بانک دی | - | ۷۵۵,۹۷۰,۴۱۷,۳۵۹ | ۱۲۹,۳۷۱,۵۰۲,۱۹۷ | ۸۸۵,۳۴۱,۹۱۹,۳۵۶ | ۹۸.۳۷٪ | ۱,۳۲۷,۰۵۵,۸۷۶,۳۸۱ | ۱۴۱,۴۴۹,۷۷۰,۱۶۴ | ۱,۱۰۵,۶۰۹,۰۶,۳۱۷ | - | - |
| تولید نیروی برق دماوند | ۵۷۵,۷۶۹,۰۹۸ | - | ۲,۱۷۴,۰۴۶,۱۰۶ | ۲,۷۴۹,۸۱۵,۲۰۴ | ۱.۵۲٪ | ۲۰,۵۳۱,۰۱۴,۷۵۵ | - | ۱۹,۸۵۵,۳۴۵,۶۵۷ | ۵۷۵,۷۶۹,۰۹۸ | -۰.۳۱٪ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| از ابتدای سال مالی تا پایان ماه | | طی ماه | | نام سپرده بانکی | |
|---------------------------------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------|
| درصد سود به میانگین سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | درصد سود به میانگین سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | شماره حساب | نام سپرده |
| | | | | ۰۰۱۰۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴ | بانک دی وزرا |
| | | | | ۰۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳ | بانک دی وزرا |
| | | | | ۰۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳ | بانک دی وزرا |
| | ۱,۳۹۲,۳۸۳,۶۳۱ | | ۲۷۶,۹۶۱,۰۶۹ | ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲ | بانک دی وزرا |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| توضیحات | مبلغ | درصد از کل درآمدها | درصد به کل دارایی‌های صندوق |
|------------------------------|-----------------|--------------------|-----------------------------|
| سرمایه‌گذاری در سهام | ۸۹۸,۴۳۶,۷۴۰,۶۱۹ | ۹۹,۸۳٪ | ۴۱,۰۸٪ |
| سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار | ۰ | ۰,۰۰٪ | ۰,۰۰٪ |
| درآمد سپرده بانکی | ۲۷۶,۹۶۱,۰۶۹ | ۰,۰۳٪ | ۰,۰۱٪ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| نام شرکت | اطلاعات مجمع تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع | سود متعلق به هر سهام | طی ماه | | | از ابتدای سال مالی تا پایان ماه | | |
|------------------------|---|-------------------------|--------------------|-------------|---------------------|---------------------------------|-------------|---------------------|
| | | | جمع درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام | جمع درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام |
| سرمایه‌گذاری بوعلی | ۱۳۹۸/۰۲/۳۱ | ۲۷,۸۳۰,۵۹۱ | - | - | - | ۶,۹۵۷,۶۲۷,۷۵۰ | ۷۷۲,۸۵۲,۰۷۱ | ۶,۱۸۲,۶۹۳,۶۷۹ |
| بیمه دی | ۱۳۹۸/۰۲/۳۷ | ۵۰ | ۸۳۲,۶۰۶,۶۰۰ | ۱۱۶,۱۳۲,۶۹۶ | ۷۰۶,۴۷۳,۹۰۴ | ۸۳۲,۶۰۶,۶۰۰ | ۱۱۶,۱۳۲,۶۹۶ | ۷۰۶,۴۷۳,۹۰۴ |
| تولید نیروی برق دماوند | ۱۳۹۸/۰۴/۱۳ | ۷۰۰ | ۶۶۲,۸۹۵,۰۰۰ | ۸۹,۱۳۵,۹۰۲ | ۵۷۵,۷۶۹,۰۹۸ | ۶۶۲,۸۹۵,۰۰۰ | ۸۹,۱۳۵,۹۰۲ | ۵۷۵,۷۶۹,۰۹۸ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| توضیحات | روز دریافت سود | مشخصات | | نرخ سود | درآمد سود | طی ماه | | از ابتدای سال مالی تا پایان ماه | |
|--------------|----------------|--------------|----------------|---------|-------------|-------------|-------------|---------------------------------|---------------|
| | | تاریخ سررسید | روز دریافت سود | | | هزینه تنزیل | خالص درآمد | هزینه تنزیل | خالص درآمد |
| بانک دی وزرا | ۱۷ | . | . | . | . | . | . | . | . |
| بانک دی وزرا | ۱۷ | . | . | . | . | . | . | . | . |
| بانک دی وزرا | ۳۰ | . | . | . | . | . | . | . | . |
| بانک دی وزرا | ۳۰ | . | . | . | ۲۷۶,۹۶۱,۰۶۹ | . | ۲۷۶,۹۶۱,۰۶۹ | ۱,۳۹۲,۳۸۳,۶۳۱ | ۱,۳۹۲,۳۸۳,۶۳۱ |

سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| سپرده | مشخصات حساب بانکی | | | | تغییرات طی دوره | | | درصد به کل دارایی‌ها |
|--------------|-------------------|-----------------|--------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| | شماره حساب | نوع حساب | تاریخ افتتاح | نرخ سود | مبلغ | ۱۳۹۸/۰۳/۳۱ | ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ | |
| | | | | | افزایش | کاهش | مبلغ | |
| بانک دی وزرا | ۰۱۰۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴ | حساب جاری | ۱۳۹۵/۰۱/۲۸ | - | - | - | - | |
| بانک دی وزرا | ۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳ | حساب جاری | ۱۳۹۵/۰۸/۱۸ | - | ۶۸,۶۹۵,۸۷۴,۸۷۷ | ۶۸,۷۰۵,۸۷۴,۸۷۷ | - | |
| بانک دی وزرا | ۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳ | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۵/۰۸/۱۸ | - | ۱۹,۵۹۶,۷۷۳ | ۱۶۵,۰۴۸ | ۱۹,۷۶۱,۸۲۱ | |
| بانک دی وزرا | ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲ | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۷/۰۳/۰۹ | - | ۲۳,۱۶۹,۶۸۴,۸۴۴ | ۲۷۲,۲۹۱,۰۶۰,۷۸۳ | ۲۲۶,۷۶۴,۸۷۰,۷۵۰ | |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

| نام شرکت | ۱۳۹۸/۰۳/۳۱ | | | تغییرات طی دوره | | | | ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ | | | درصد به کل دارایی‌های |
|------------------------|-------------|-----------------|-------------------|-----------------|----------------|--------------|-----------------|------------|---------------|-------------------|-----------------------|
| | تعداد | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | فروش طی دوره | | خرید طی دوره | | تعداد | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | |
| | | | | تعداد | مبلغ فروش | تعداد | بهای تمام شده | | | | |
| پانک دی | ۶۱۴,۱۸۲,۳۶۵ | ۵۹۴,۲۰۷,۸۱۴,۱۳۹ | ۱,۰۷۷,۸۷۱,۲۱۶,۲۱۸ | ۲۷,۳۱۲,۰۸۵ | ۸۰,۵۹۳,۳۹۲,۳۲۸ | -۸۷,۸۲۸,۳۵۷ | ۲۳۵,۰۲۸,۰۰۸,۵۴۵ | ۲,۳۸۰ | ۵۵۳,۶۶۵,۹۹۳ | ۱,۸۰۸,۷۷۸,۵۱۹,۴۵۶ | ۸۲,۷۱٪ |
| بیمه دی | ۱۳,۹۴۹,۳۳۲ | ۲۱,۷۸۱,۹۸۹,۸۲۸ | ۲۲,۳۰۲,۷۹۲,۳۳۴ | ۳,۵۰۹,۰۲۷ | ۸,۶۴۸,۳۵۵,۲۷۸ | -۱,۰۰۰,۰۰۰ | ۲,۳۸۰,۰۶۵,۰۱۴ | ۲,۳۲۶ | ۱۶,۳۵۸,۳۶۹ | ۳۶,۶۵۴,۰۷۷,۴۴۱ | ۱,۶۸٪ |
| تولید نیروی برق دماوند | ۹۴۹,۸۵۰ | ۹,۱۴۱,۷۱۰,۸۶۷ | ۳۸,۹۳۳,۳۱۱,۳۳۴ | . | . | . | . | ۴۳,۳۵۱ | ۹۴۹,۸۵۰ | ۴۱,۱۰۷,۳۵۷,۳۴۰ | ۱,۸۸٪ |
| سرمایه‌گذاری بوعلی | ۲۴,۷۵۴,۶۶۸ | ۲۱,۰۶۰,۷۱۶,۴۸۰ | ۷۱,۲۰۶,۳۳۰,۱۷۲ | ۴,۰۸۲,۵۶۲ | ۱۳,۵۰۰,۳۱۴,۴۸۲ | -۸,۳۰۰,۰۰۰ | ۳۱,۲۱۶,۵۴۷,۳۸۱ | ۲,۱۷۵ | ۲۰,۵۲۷,۲۳۰ | ۶۴,۹۴۵,۵۲۴,۴۸۶ | ۳,۹۷٪ |