

## 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 ۳۰ مهر ماه ۱۳۹۹

حسین دیده خان

سرپرست کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| نام شرکت               | ۱۳۹۹/۰۶/۳۱  |                   |                   | تغییرات طی دوره |                   |              |                 | ۱۳۹۹/۰۷/۳۰  |               |                   |        |
|------------------------|-------------|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------|-----------------|-------------|---------------|-------------------|--------|
|                        | 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   |             |               |                   |        |
| بانک دی                | ۱۳۴,۷۰۳,۲۸۶ | ۵,۲۸۶,۴۱۱,۱۱۳,۸۴۶ | ۶,۵۲۳,۸۰۳,۱۹۰,۸۱۵ | ۲۸,۱۹۹,۴۱۱      | ۱,۳۶۰,۰۶۷,۸۵۵,۶۹۶ | -۹,۲۰۸,۴۷۶   | ۴۹۰,۱۵۸,۲۹۸,۶۳۹ | ۱۵۳,۶۹۴,۲۲۱ | ۵۸,۲۳۹        | ۸,۹۲۲,۴۲۶,۱۵۲,۰۴۳ | ۷۳.۸۷% |
| بیمه دی                | ۹,۵۵۶,۳۳۹   | ۲۰۷,۴۶۸,۳۳۱,۷۲۷   | ۱۹۷,۱۵۶,۲۱۰,۴۲۹   | ۷,۸۴۵,۳۶۰       | ۱۷۴,۱۸۰,۶۷۷,۷۹۹   | -۱۰,۶۲۲,۶۷۶  | ۲۲۹,۲۶۴,۱۹۱,۴۹۱ | ۶,۷۷۹,۰۲۳   | ۲۲,۹۳۸        | ۱۵۵,۰۰۰,۸۸۲,۴۱۷   | ۱.۲۸%  |
| تولید نیروی برق دماوند | ۳,۹۲۴,۴۲۹   | ۲۵۵,۶۷۲,۰۰۴,۹۷۵   | ۲۳۴,۵۳۴,۱۵۵,۸۵۶   | ۷,۳۶۸,۷۹۳       | ۵۳۶,۲۸۸,۱۰۵,۸۴۸   | -۳,۹۵۳,۹۶۹   | ۲۸۰,۴۸۴,۲۸۵,۵۵۸ | ۷,۳۳۹,۲۵۳   | ۷۷,۸۷۳        | ۵۶۹,۷۰۵,۳۲۶,۲۳۰   | ۴.۷۲%  |
| سرمایه‌گذاری بوعلی     | ۱۸,۸۳۸,۰۲۷  | ۱۵۹,۲۱۷,۵۵۵,۱۶۰   | ۱۸۱,۰۱۸,۹۱۷,۶۱۳   | ۲۳,۸۹۸,۱۷۸      | ۲۲۱,۸۴۸,۵۸۲,۳۰۳   | -۷,۳۴۷,۳۴۹   | ۶۷,۰۶۲,۱۸۲,۷۱۰  | ۳۵,۳۸۸,۸۵۶  | ۸,۷۳۰         | ۳۰۷,۹۵۸,۵۶۱,۳۵۶   | ۲.۵۵%  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت پورتفوی  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| ۱۳۹۹/۰۷/۳۰           |                 | تغییرات طی دوره   |                   | ۱۳۹۹/۰۶/۳۱      | مشخصات حساب بانکی |              |                 |               | سپرده        |
|----------------------|-----------------|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------|-----------------|---------------|--------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | مبلغ            | کاهش              | افزایش            | مبلغ            | نرخ سود           | تاریخ افتتاح | نوع حساب        | شماره حساب    |              |
| ۰.۰۰٪                | ۱۰,۰۰۰,۰۰۰      | ۲,۰۸۶,۰۷۱,۵۴۰,۰۰۲ | ۲,۰۸۶,۰۸۱,۵۴۰,۰۰۲ | ۰               | ۰                 | ۱۳۹۵/۰۸/۱۸   | حساب جاری       | ۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳  | بانک دی وزرا |
| ۰.۰۳٪                | ۳,۵۱۸,۰۳۹,۲۷۴   | ۰                 | ۲۳,۵۸۳,۹۹۰        | ۳,۴۹۴,۴۵۵,۲۸۴   | ۰                 | ۱۳۹۵/۰۸/۱۸   | سپرده کوتاه مدت | ۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳  | بانک دی وزرا |
| ۵.۴۶٪                | ۶۶۰,۰۳۶,۴۵۷,۵۵۴ | ۱,۴۴۵,۸۱۵,۶۴۵,۰۲۹ | ۱,۴۳۶,۰۶۰,۱۷۷,۷۲۷ | ۶۶۹,۷۹۱,۹۲۴,۸۵۶ | ۰                 | ۱۳۹۷/۰۳/۰۹   | سپرده کوتاه مدت | ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲ | بانک دی وزرا |
| ۰.۰۰٪                | ۰               | ۴۲۳,۳۱۰,۵۵۵,۲۸۷   | ۱۵۶,۷۰۸,۷۷۳,۴۷۳   | ۲۶۶,۶۰۱,۷۸۱,۸۱۴ | ۰                 | ۱۳۹۹/۰۳/۲۱   | سپرده کوتاه مدت | ۰۲۰۵۱۳۱۱۵۰۰۳  | بانک دی وزرا |
| ۰.۵۹٪                | ۷۱,۲۲۷,۷۲۰,۶۰۴  | ۱۲۵,۸۸۹,۷۷۵,۰۸۹   | ۱۵۹,۳۵۵,۳۴۹,۱۹۹   | ۳۷,۷۶۲,۱۴۶,۴۹۴  | ۰                 | ۱۳۹۹/۰۳/۲۱   | سپرده کوتاه مدت | ۰۲۰۵۱۳۱۱۵۸۰۰۳ | بانک دی وزرا |
| ۰.۹۵٪                | ۱۱۴,۲۲۵,۱۴۰,۲۹۶ | ۲۱۳,۸۳۲,۹۵۴,۶۷۹   | ۶۱,۰۸۴,۰۶۰,۶۹۳    | ۲۶۶,۹۷۴,۰۳۴,۲۸۲ | ۰                 | ۱۳۹۹/۰۳/۲۱   | سپرده کوتاه مدت | ۰۲۰۵۱۳۱۱۷۰۰۰۸ | بانک دی وزرا |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| از ابتدای سال مالی تا پایان ماه |             |                | طی ماه        |             |               | مشخصات  |               |                |              |
|---------------------------------|-------------|----------------|---------------|-------------|---------------|---------|---------------|----------------|--------------|
| خالص درآمد                      | هزینه تنزیل | درآمد سود      | خالص درآمد    | هزینه تنزیل | درآمد سود     | نرخ سود | تاریخ سر رسید | روز دریافت سود | توضیحات      |
| ۳۱۱,۳۰۲,۵۶۸                     | .           | ۳۱۱,۳۰۲,۵۶۸    | ۲۳,۵۸۳,۹۹۰    | .           | ۲۳,۵۸۳,۹۹۰    | .       |               | ۳۰             | بانک دی وزرا |
| ۱۵,۸۹۴,۷۴۶,۰۸۳                  | .           | ۱۵,۸۹۴,۷۴۶,۰۸۳ | ۴,۴۹۹,۵۷۸,۵۴۸ | .           | ۴,۴۹۹,۵۷۸,۵۴۸ | .       |               | ۳۰             | بانک دی وزرا |
| ۶۵,۷۳۵,۳۶۲                      | .           | ۶۵,۷۳۵,۳۶۲     | .             | .           | .             | .       |               | ۲۱             | بانک دی وزرا |
| ۱۵۹,۸۶۹,۸۹۱                     | .           | ۱۵۹,۸۶۹,۸۹۱    | ۴,۰۶۹,۹۲۵     | .           | ۴,۰۶۹,۹۲۵     | .       |               | ۲۱             | بانک دی وزرا |
| ۷,۳۴۷,۴۸۸,۰۲۴                   | .           | ۷,۳۴۷,۴۸۸,۰۲۴  | ۵۴۲,۶۸۹,۶۶۱   | .           | ۵۴۲,۶۸۹,۶۶۱   | .       |               | ۲۱             | بانک دی وزرا |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| نام شرکت           | اطلاعات مجمع |                                |                     | طی ماه             |             |                     | از ابتدای سال مالی تا پایان ماه |             |                     |
|--------------------|--------------|--------------------------------|---------------------|--------------------|-------------|---------------------|---------------------------------|-------------|---------------------|
|                    | تاریخ مجمع   | تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع | سود متعلق به هر سهم | جمع درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام | جمع درآمد سود سهام              | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام |
| سرمایه‌گذاری بوعلی | ۱۳۹۹/۰۳/۱۹   | ۶۶۰۰,۰۰۰                       | ۷۰                  | ۰                  | ۰           | ۰                   | ۴۶۲,۰۰۰,۰۰۰                     | ۳۲,۳۶۹,۴۲۷  | ۴۲۹,۶۳۰,۵۷۳         |
| بیمه دی            | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱   | ۳,۵۸۰,۰۰۰                      | ۹۰۰                 | ۰                  | ۰           | ۰                   | ۳,۲۲۲,۰۰۰,۰۰۰                   | ۳۰۲,۰۰۰,۰۰۰ | ۲,۹۲۰,۰۰۰,۰۰۰       |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| از ابتدای سال مالی تا پایان ماه |                   |                   |             | طی ماه                        |                   |                   |             | نام شرکت               |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|-------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|------------------------|
| سود و زیان ناشی از تغییر قیمت   | ارزش دفتری        | بهای فروش         | تعداد       | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | ارزش دفتری        | بهای فروش         | تعداد       |                        |
| ۳,۲۵۰,۴۰۶,۹۹۸                   | ۱۵۱,۷۵۰,۴۷۵,۴۱۹   | ۱۵۵,۰۰۰,۸۸۲,۴۱۷   | ۶,۷۷۹,۰۲۳   | ۱۳,۵۹۹,۹۶۶,۷۸۲                | ۱۴۱,۴۰۰,۹۱۵,۶۳۵   | ۱۵۵,۰۰۰,۸۸۲,۴۱۷   | ۶,۷۷۹,۰۲۳   | بیمه دی                |
| ۲,۵۷۵,۱۵۴,۶۳۲,۷۴۳               | ۶,۳۴۷,۳۷۱,۵۱۹,۳۰۰ | ۸,۹۲۲,۴۲۶,۱۵۲,۰۴۳ | ۱۵۳,۶۹۴,۲۲۱ | ۱,۴۱۲,۹۸۵,۷۱۰,۰۲۸             | ۷,۵۰۹,۴۴۰,۴۴۲,۰۱۵ | ۸,۹۲۲,۴۲۶,۱۵۲,۰۴۳ | ۱۵۳,۶۹۴,۲۲۱ | بانک دی                |
| ۳۴,۳۷۴,۲۰۲,۳۹۹                  | ۵۳۵,۴۳۱,۱۲۳,۸۳۰   | ۵۶۹,۷۰۵,۳۲۶,۲۲۹   | ۷,۳۳۹,۲۵۳   | ۵۵,۴۱۲,۰۲۱,۵۱۹                | ۵۱۴,۲۹۳,۳۰۴,۷۱۰   | ۵۶۹,۷۰۵,۳۲۶,۲۲۹   | ۷,۳۳۹,۲۵۳   | تولید نیروی برق دماوند |
| -۹,۰۴۱,۶۹۶,۲۷۹                  | ۳۱۷,۰۰۰,۲۵۷,۶۳۶   | ۳۰۷,۹۵۸,۵۶۱,۳۵۶   | ۳۵,۳۸۸,۸۵۶  | -۳۰,۸۴۳,۰۵۸,۷۳۰               | ۳۳۸,۸۰۱,۶۲۰,۰۸۷   | ۳۰۷,۹۵۸,۵۶۱,۳۵۶   | ۳۵,۳۸۸,۸۵۶  | سرمایه‌گذاری بوعلی     |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| از ابتدای سال مالی تا پایان ماه |                   |                    |             | طی ماه                  |                 |                 |            | نام شرکت                  |
|---------------------------------|-------------------|--------------------|-------------|-------------------------|-----------------|-----------------|------------|---------------------------|
| سود و زیان ناشی از فروش         | ارزش دفتری        | بهای فروش          | تعداد       | سود و زیان ناشی از فروش | ارزش دفتری      | بهای فروش       | تعداد      |                           |
| ۱۶,۶۸۰,۰۷۳,۹۸۹                  | ۳۲۱,۳۵۱,۵۳۴,۷۲۵   | ۳۳۸,۰۳۱,۶۰۸,۷۱۴    | ۳۵,۰۰۵,۳۷۱  | ۲,۹۹۶,۳۰۲,۹۸۳           | ۶۴,۰۶۵,۸۷۹,۷۲۷  | ۶۷,۰۶۲,۱۸۲,۷۱۰  | ۷,۳۴۷,۳۴۹  | سرمایه‌گذاری بوعلی        |
| ۵۳,۳۸۲,۷۵۴,۴۵۰                  | ۵۱۰,۳۰۰,۵۸۶,۰۹۶   | ۵۶۳,۶۸۳,۳۴۰,۵۴۶    | ۳۴,۰۸۴,۳۲۶  | -۶۷۱,۷۸۱,۱۰۱            | ۲۲۹,۹۳۵,۹۷۲,۵۹۲ | ۲۲۹,۲۶۴,۱۹۱,۴۹۱ | ۱۰,۶۲۲,۶۷۶ | بیمه دی                   |
| ۷,۹۷۰,۳۱۱,۱۱۵,۰۸۰               | ۴,۱۰۸,۷۵۴,۱۸۵,۸۲۱ | ۱۲,۰۷۹,۰۶۵,۳۰۰,۹۰۱ | ۶۸۵,۷۳۲,۱۲۴ | ۱۱۵,۷۳۷,۶۹۴,۱۴۳         | ۳۷۴,۴۳۰,۶۰۴,۴۹۶ | ۴۹۰,۱۵۸,۲۹۸,۶۳۹ | ۹,۲۰۸,۴۷۶  | بانک دی                   |
| ۳۸,۰۴۳,۷۱۸,۵۶۷                  | ۲,۸۶۷,۵۱۶,۹۳۴,۱۶۳ | ۲,۹۰۵,۵۶۰,۶۵۲,۷۳۰  | ۴۱,۴۶۰,۸۱۴  | ۲۳,۹۵۵,۲۹۸,۵۶۵          | ۲۵۶,۵۲۸,۹۸۶,۹۹۳ | ۲۸۰,۴۸۴,۲۸۵,۵۵۸ | ۳,۹۵۳,۹۶۹  | تولید نیروی برق دماوند    |
| -۸,۲۸۲,۷۳۵                      | ۱,۲۵۳,۳۷۰,۱۷۳     | ۱,۲۴۵,۰۸۷,۴۳۸      | ۶۱,۵۴۷      | -                       | -               | -               | -          | مخابرات ایران             |
| ۷۱,۴۳۶,۴۳۱                      | ۱,۰۶۴,۸۸۲,۰۳۰     | ۱,۱۳۶,۳۱۸,۴۶۱      | ۸۰,۸۴۴      | -                       | -               | -               | -          | سرمایه‌گذاری کشاورزی کوثر |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| از ابتدای سال مالی تا پایان ماه |                    |                   |                   |                | طی ماه             |                   |                 |                   |                | نام شرکت                  |
|---------------------------------|--------------------|-------------------|-------------------|----------------|--------------------|-------------------|-----------------|-------------------|----------------|---------------------------|
| درصد از کل درآمدها              | مبلغ               | درآمد فروش        | درآمد تغییر ارزش  | درآمد سود سهام | درصد از کل درآمدها | مبلغ              | درآمد فروش      | درآمد تغییر ارزش  | درآمد سود سهام |                           |
| ۰.۰۷٪                           | ۸.۰۶۸.۰۰۸.۲۸۳      | ۱۶.۶۸۰.۰۷۳.۹۸۹    | -۹.۰۴۱.۶۹۶.۲۷۹    | ۴۲۹.۶۳۰.۵۷۳    | -۱.۷۴٪             | -۲۷.۸۴۶.۷۵۵.۷۴۷   | ۲.۹۹۶.۳۰۲.۹۸۳   | -۳۰.۸۴۳.۰۵۸.۷۳۰   | ۰              | سرمایه‌گذاری یوغلی        |
| ۰.۵۵٪                           | ۵۹.۵۵۳.۱۶۱.۴۴۸     | ۵۳.۳۸۲.۷۵۴.۴۵۰    | ۳.۲۵۰.۴۰۶.۹۹۸     | ۳.۹۲۰.۰۰۰.۰۰۰  | -۰.۸۱٪             | ۱۲.۹۲۸.۱۸۵.۶۸۱    | -۶۷۱.۷۸۱.۱۰۱    | ۱۳.۵۹۹.۹۶۶.۷۸۲    | ۰              | بیمه دی                   |
| ۹۷.۹۲٪                          | ۱۰.۵۴۵.۴۶۵.۷۴۷.۸۲۳ | ۷.۹۷۰.۳۱۱.۱۱۵.۰۸۰ | ۲.۵۷۵.۱۵۴.۶۳۲.۷۴۳ | ۰              | ۹۵.۴۵٪             | ۱.۵۲۸.۷۱۳.۴۰۴.۱۷۱ | ۱۱۵.۷۲۷.۶۹۴.۱۴۳ | ۱.۴۱۲.۹۸۵.۷۱۰.۰۲۸ | ۰              | بانک دی                   |
| ۰.۶۷٪                           | ۷۲.۳۱۷.۹۲۰.۹۶۶     | ۳۸.۰۴۳.۷۱۸.۵۶۷    | ۳۴.۲۷۴.۲۰۲.۳۹۹    | ۰              | ۴.۹۶٪              | ۷۹.۳۶۷.۳۲۰.۰۸۴    | ۲۳.۹۵۵.۲۹۸.۵۶۵  | ۵۵.۴۱۲.۰۲۱.۵۱۹    | ۰              | تولید نیروی برق دماوند    |
| ۰.۰۰٪                           | -۸.۲۸۲.۷۳۵         | -۸.۲۸۲.۷۳۵        | ۰                 | ۰              | ۰.۰۰٪              | ۰                 | ۰               | ۰                 | ۰              | مخابرات ایران             |
| ۰.۰۰٪                           | ۷۱.۴۳۶.۴۳۱         | ۷۱.۴۳۶.۴۳۱        | ۰                 | ۰              | ۰.۰۰٪              | ۰                 | ۰               | ۰                 | ۰              | سرمایه‌گذاری کشاورزی کوثر |



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| 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    |
|                                 | ۳۱۱,۳۰۲,۵۶۸                   |                           | ۲۳,۵۸۳,۹۹۰                    | ۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳    | بانک دی وزرا |
|                                 | ۱۵,۸۹۴,۷۴۶,۰۸۳                |                           | ۴,۴۹۹,۵۷۸,۵۴۸                 | ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲   | بانک دی وزرا |
|                                 | ۶۵,۷۳۵,۳۶۲                    |                           | ۰                             | ۰۲۰۵۱۳۱۱۱۵۰۰۳   | بانک دی وزرا |
|                                 | ۱۵۹,۸۶۹,۸۹۱                   |                           | ۴,۰۶۹,۹۲۵                     | ۰۲۰۵۱۳۱۱۵۸۰۰۳   | بانک دی وزرا |
|                                 | ۷,۳۴۷,۴۸۸,۰۲۴                 |                           | ۵۴۲,۶۸۹,۶۶۱                   | ۰۲۰۵۱۳۱۱۷۰۰۰۸   | بانک دی وزرا |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| ۱۳۹۹/۰۷/۳۰ | طی ماه | سایر درآمدها                           |
|------------|--------|--|
| مبلغ       | مبلغ   |  |
| ۲۱,۷۹۴,۳۰۵ | ۰      | سایر درآمدها                           |
| ۰          | ۰      | معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک |
| ۰          | ۰      | تعدیل کارمزد کارگزار                   |
| ۲۱,۷۹۴,۳۰۵ | ۰      |  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

| توضیحات                      | مبلغ              | درصد از کل درآمدها | درصد به کل دارایی‌های صندوق |
|------------------------------|-------------------|--------------------|-----------------------------|
| سرمایه‌گذاری در سهام         | ۱,۵۹۳,۱۶۲,۱۵۴,۱۸۹ | ۹۹.۴۷٪             | ۱۳.۱۹٪                      |
| سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار | ۰                 | ۰.۰۰٪              | ۰.۰۰٪                       |
| درآمد سپرده بانکی            | ۵,۰۶۹,۹۲۲,۱۲۴     | ۰.۳۲٪              | ۰.۰۴٪                       |