

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 اسفند ماه ۱۳۹۹


حسین دیده‌خانی

مدیرعامل و نایب رئیس هیأت مدیره کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

درصد به کل دارایی‌های	۱۳۹۹/۱۲/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۱۱/۳۰			نام شرکت
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۵۱.۴۶%	۳,۶۴۴,۷۸۵,۶۸۸,۷۳۵	۷,۹۱۷,۵۹۰,۵۰۶,۹۸۱	۹۲۴	۳,۹۴۷,۵۷۳,۴۱۲	۰	۰	۶۹,۰۲۹,۱۰۶,۳۰۵	۳,۰۰۰,۰۰۰	۵۶۷,۰۶۴۳,۶۳۵,۷۶۰	۷,۸۴۸,۵۶۱,۴۰۰,۶۷۶	۱۸۴,۱۴۴,۲۲۱	بانک دی
۶.۸۹%	۴۸۷,۸۴۱,۵۵۹,۵۰۶	۵۴۰,۱۷۳,۸۵۱,۸۳۸	۲۳,۲۶۷	۲۰,۹۸۳,۰۴۹	۰	۰	۰	۰	۴۹۷,۵۰۷,۳۹۳,۴۷۴	۵۴۰,۱۷۳,۸۵۱,۸۳۸	۲۰,۹۸۳,۰۴۹	بیمه دی
۸.۳۴%	۵۹۰,۶۲۴,۷۰۵,۵۷۹	۸۱۹,۵۲۰,۵۲۵,۷۹۹	۴۹,۰۴۰	۱۲,۰۵۲,۸۹۴	۱۰,۴۴۸,۶۵۲,۹۸۷	-۲۰۰,۰۰۰	۷۷,۰۷۲,۲۵۱,۲۴۵	۱,۵۳۵,۰۳۱	۵۳۲,۸۵۱,۲۸۰,۷۲۰	۷۵۶,۲۶۵,۹۴۳,۴۹۳	۱۰,۷۱۷,۸۶۳	تولید نیروی برق دماوند
۰.۷۳%	۵۱,۷۶۸,۹۶۴,۳۱۳	۶۲,۲۰۰,۳۳۴,۱۵۵	۴۰۰,۵۵۰	۱۲۹,۳۴۳	۰	۰	۰	۰	۵۲,۳۳۵,۰۵۶,۰۹۶	۶۲,۲۰۰,۳۳۴,۱۵۵	۱۲۹,۳۴۳	خوراک دام پارس
۸.۹۸%	۶۳۶,۳۰۰,۴۹,۳۱۶	۷۱۸,۷۷۹,۴۰۸,۵۵۸	۶,۰۹۰	۱۰۴,۵۶۲,۳۳۴	۱۸,۰۶۴,۱۷۲,۵۲۱	-۳,۰۱۸,۳۹۱	۸۶,۳۸۶,۶۵۳,۰۹۳	۱۴,۸۱۷,۲۵۹	۵۵۳,۲۷۶,۴۰۹,۰۷۶	۶۵۳,۳۰۰,۴۴۴,۰۹۲	۹۲,۷۶۳,۳۶۶	سرمایه‌گذاری بوعلی
۱.۳۶%	۹۵,۹۸۴,۱۹۶,۳۷۸	۸۸,۲۲۷,۳۷۶,۷۶۴	۲۰,۷۷۰	۴,۶۲۴,۸۰۵	۴۷,۷۷۶,۴۶۶,۰۰۳	-۲,۳۵۵,۰۰۰	۳۱,۸۸۵,۳۱۹,۵۵۸	۱,۵۹۵,۰۰۰	۱۰۱,۱۰۳,۵۸۸,۷۸۱	۱۰۰,۴۸۴,۰۵۶,۹۶۰	۵,۳۸۴,۸۰۵	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان
۰.۹۵%	۶۷,۳۳۷,۷۷۴,۰۰۳	۸۰,۴۰۲,۶۶۰,۴۶۵	۵,۱۳۷	۱۳,۱۱۸,۳۵۵	۰	۰	۱,۱۰۱,۸۳۷,۷۸۹	۲۱۸,۰۰۰	۶۶,۴۵۰,۷۸۹,۰۱۴	۷۹,۳۰۰,۸۲۲,۶۷۶	۱۲,۹۰۰,۳۵۵	کشت و صنعت شریف آباد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

سپرده	مشخصات حساب بانکی				۱۳۹۹/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۱۲/۳۰	
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها	
بانک دی وزرا	۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳	حساب جاری	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	۰	۱۹,۳۲۷,۴۸۸	۳۵۲,۲۵۸,۲۲۸,۰۰۲	۳۲۲,۳۲۶,۷۸۵,۳۹۰	۱۹,۹۳۱,۴۴۲,۶۱۲	۰.۲۸%	
بانک دی وزرا	۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۵/۰۸/۱۸	۰	۳,۵۸۷,۳۹۶,۶۱۶	۳,۵۸۷,۳۹۶,۶۱۶	۴۲۰,۰۰۰	۳,۵۸۶,۹۷۶,۶۱۶	۰.۰۵%	
بانک دی وزرا	۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۷/۰۳/۰۹	۰	۶۰۲,۵۱۷,۵۷۸	۶۰۲,۵۱۷,۵۷۸	۰	۶۰۲,۵۱۷,۵۷۸	۰.۰۱%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۱۳۱۱۱۵۰۰۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۳/۲۱	۰	۱,۷۲۴,۴۵۸,۳۰۸	۶۷,۶۸۴,۳۹۱,۰۲۳	۶۶,۶۲۳,۵۹۸,۰۵۸	۱,۰۶۰,۷۹۲,۹۶۵	۰.۰۱%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۱۳۱۱۵۸۰۰۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۳/۲۱	۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۰.۰۰%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۱۳۱۱۷۰۰۰۸	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۳/۲۱	۰	۱۰,۸۶۰,۷۴۰,۷۶۶۵	۱۰,۸۶۰,۷۴۰,۷۶۶۵	۱۰,۸۶۰,۶,۸۸۹,۸۳۷	۵۱۷,۸۲۸	۰.۰۰%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۳۱۸۰۷۰۰۰۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۱۷	۰	۱,۶۱۹,۵۳۲,۲۵۰	۱,۶۱۹,۵۳۲,۲۵۰	۱,۱۰۱,۸۳۷,۷۸۹	۵۱۷,۶۹۴,۴۶۱	۰.۰۱%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۳۱۸۰۷۶۰۰۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۱۷	۰	۵۳,۷۶۲,۱۴۵,۰۷۹	۱۰۴,۸۱۵,۶۱۳,۸۵۵	۷۱,۷۰۹,۵۵۰,۲۰۶	۳۳,۱۰۶,۰۶۳,۶۴۹	۰.۰۷%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۳۲۴۸۵۶۰۰۹	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۲۵	۰	۱۳۲,۱۰۷,۷۵۸,۲۴۰	۱۹۲,۱۰۷,۷۵۸,۲۴۰	۱۰۴,۱۹۷,۰۲۴,۶۲۴	۸۷,۹۱۰,۷۳۳,۶۱۶	۱.۲۴%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۳۷۲۱۹۹۰۰۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۱۱/۲۶	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۱۴%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۳۷۲۲۰۴۰۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۱۱/۲۶	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۱۴%	
بانک دی وزرا	۲۰۵۳۷۲۲۳۹۰۰۷	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۱۱/۲۶	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۱۴%	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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	
-۹,۳۳۵,۷۷۵,۴۶۷	۵۹۹,۹۶۰,۴۸۱,۰۴۷	۵۹۰,۶۲۴,۷۰۵,۵۷۹	۱۲,۰۵۲,۸۹۴	-۹,۳۳۵,۷۷۵,۴۶۷	۵۹۹,۹۶۰,۴۸۱,۰۴۷	۵۹۰,۶۲۴,۷۰۵,۵۷۹	۱۲,۰۵۲,۸۹۴	تولید نیروی برق دماوند
۷,۳۸۰,۸۳۲,۹۵۲	۸۸۶۰۳,۳۶۳,۴۲۶	۹۵,۹۸۴,۱۹۶,۳۷۸	۴,۶۲۴,۸۰۵	۷,۳۸۰,۸۳۲,۹۵۲	۸۸۶۰۳,۳۶۳,۴۲۶	۹۵,۹۸۴,۱۹۶,۳۷۸	۴,۶۲۴,۸۰۵	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان
-۲۱۴,۸۵۲,۸۰۰	۶۷,۵۵۲,۶۲۶,۸۰۳	۶۷,۳۳۷,۷۷۴,۰۰۲	۱۳,۱۱۸,۳۵۵	-۲۱۴,۸۵۲,۸۰۰	۶۷,۵۵۲,۶۲۶,۸۰۳	۶۷,۳۳۷,۷۷۴,۰۰۲	۱۳,۱۱۸,۳۵۵	کشت و صنعت شریف آباد
۱۴,۴۹۵,۷۴۰,۴۹۶	۶۲۱,۸۰۴,۳۰۸,۷۲۰	۶۳۶,۳۰۰,۰۴۹,۲۱۶	۱۰۴,۵۶۲,۲۳۴	۱۴,۴۹۵,۷۴۰,۴۹۶	۶۲۱,۸۰۴,۳۰۸,۷۲۰	۶۳۶,۳۰۰,۰۴۹,۲۱۶	۱۰۴,۵۶۲,۲۳۴	سرمایه‌گذاری بوعلی
-۵۶۶,۰۹۱,۷۸۲	۵۲,۳۳۵,۰۵۶,۰۹۵	۵۱,۷۶۸,۹۶۴,۳۱۲	۱۲۹,۳۴۳	-۵۶۶,۰۹۱,۷۸۲	۵۲,۳۳۵,۰۵۶,۰۹۵	۵۱,۷۶۸,۹۶۴,۳۱۲	۱۲۹,۳۴۳	خوراک دام پارس
-۹,۶۶۵,۸۳۳,۹۶۷	۴۹۷,۵۰۷,۳۹۳,۴۷۴	۴۸۷,۸۴۱,۵۵۹,۵۰۶	۲۰,۹۸۳,۰۴۹	-۹,۶۶۵,۸۳۳,۹۶۷	۴۹۷,۵۰۷,۳۹۳,۴۷۴	۴۸۷,۸۴۱,۵۵۹,۵۰۶	۲۰,۹۸۳,۰۴۹	بیمه دی
-۲,۰۹۴,۸۸۷,۰۵۳,۳۲۸	۵,۷۳۹,۶۷۲,۷۴۲,۰۶۴	۳,۶۴۴,۷۸۵,۶۸۸,۷۳۵	۳,۹۴۷,۵۷۳,۴۱۲	-۲,۰۹۴,۸۸۷,۰۵۳,۳۲۸	۵,۷۳۹,۶۷۲,۷۴۲,۰۶۴	۳,۶۴۴,۷۸۵,۶۸۸,۷۳۵	۳,۹۴۷,۵۷۳,۴۱۲	بانک دی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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	
۳,۳۹۰,۹۲۱,۰۹۱	۴۴,۳۸۵,۵۴۴,۹۱۲	۴۷,۷۷۶,۴۶۶,۰۰۳	۲,۳۵۵,۰۰۰	۳,۳۹۰,۹۲۱,۰۹۱	۴۴,۳۸۵,۵۴۴,۹۱۲	۴۷,۷۷۶,۴۶۶,۰۰۳	۲,۳۵۵,۰۰۰	مجتمع تولید گوشت مرغ ماهان
۱۰۵,۴۱۹,۰۷۳	۱۷,۹۵۸,۷۵۳,۴۴۸	۱۸,۰۶۴,۱۷۲,۵۲۱	۳,۰۱۸,۳۹۱	۱۰۵,۴۱۹,۰۷۳	۱۷,۹۵۸,۷۵۳,۴۴۸	۱۸,۰۶۴,۱۷۲,۵۲۱	۳,۰۱۸,۳۹۱	سرمایه‌گذاری بوعلی
۴۸۵,۶۰۲,۰۷۰	۹,۹۶۳,۰۵۰,۹۱۷	۱۰,۴۴۸,۶۵۲,۹۸۷	۲۰۰,۰۰۰	۴۸۵,۶۰۲,۰۷۰	۹,۹۶۳,۰۵۰,۹۱۷	۱۰,۴۴۸,۶۵۲,۹۸۷	۲۰۰,۰۰۰	تولید نیروی برق دماوند

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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	
-۰.۵۲٪	۱۰,۷۷۱,۷۵۴,۰۴۳	۳,۳۹۰,۹۲۱,۰۹۱	۷,۳۸۰,۸۳۲,۹۵۲	۰	-۰.۵۲٪	۱۰,۷۷۱,۷۵۴,۰۴۳	۳,۳۹۰,۹۲۱,۰۹۱	۷,۳۸۰,۸۳۲,۹۵۲	۰	مجمع تولید گوشت مرغ ماهان
-۰.۷۰٪	۱۴,۶۰۱,۱۵۹,۵۶۹	۱۰۵,۴۱۹,۰۷۳	۱۴,۴۹۵,۷۴۰,۴۹۶	۰	-۰.۷۰٪	۱۴,۶۰۱,۱۵۹,۵۶۹	۱۰۵,۴۱۹,۰۷۳	۱۴,۴۹۵,۷۴۰,۴۹۶	۰	سرمایه‌گذاری بوعلی
-۰.۴۲٪	-۸,۸۵۰,۱۷۳,۳۹۷	۴۸۵,۶۰۲,۰۷۰	-۹,۳۳۵,۷۷۵,۴۶۷	۰	-۰.۴۲٪	-۸,۸۵۰,۱۷۳,۳۹۷	۴۸۵,۶۰۲,۰۷۰	-۹,۳۳۵,۷۷۵,۴۶۷	۰	تولید نیروی برق دماوند
-۰.۱٪	-۲۱۴,۸۵۲,۸۰۰	۰	-۲۱۴,۸۵۲,۸۰۰	۰	-۰.۱٪	-۲۱۴,۸۵۲,۸۰۰	۰	-۲۱۴,۸۵۲,۸۰۰	۰	کشت و صنعت شریف آباد
-۰.۳٪	-۵۶۶,۰۹۱,۷۸۲	۰	-۵۶۶,۰۹۱,۷۸۲	۰	-۰.۳٪	-۵۶۶,۰۹۱,۷۸۲	۰	-۵۶۶,۰۹۱,۷۸۲	۰	خوراک دام پارس
-۰.۴۶٪	-۹,۶۶۵,۸۳۳,۹۶۷	۰	-۹,۶۶۵,۸۳۳,۹۶۷	۰	-۰.۴۶٪	-۹,۶۶۵,۸۳۳,۹۶۷	۰	-۹,۶۶۵,۸۳۳,۹۶۷	۰	بیمه دی
۱۰۰.۳۰٪	-۲,۰۹۴,۸۸۷,۰۵۳,۳۲۸	۰	-۲,۰۹۴,۸۸۷,۰۵۳,۳۲۸	۰	۱۰۰.۳۰٪	-۲,۰۹۴,۸۸۷,۰۵۳,۳۲۸	۰	-۲,۰۹۴,۸۸۷,۰۵۳,۳۲۸	۰	بانک دی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

۱۳۹۹/۱۲/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۶۴,۷۸۴,۶۰۱	۶۴,۷۸۴,۶۰۱	سایر درآمدها
.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
۶۴,۷۸۴,۶۰۱	۶۴,۷۸۴,۶۰۱	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	-۲,۰۸۸,۸۱۱,۰۹۱,۶۶۲	۱۰۰.۰۱٪	-۲۹.۴۹٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی	۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪