

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

شرکت	۱۳۹۶/۰۹/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۰/۳۰			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۳۱۳,۴۷۰	۱,۳۴۵,۸۳۱,۷۷۵	۱,۲۷۰,۴۲۰,۱۴۷	۲۰۲,۵۸۸	۷۹۱,۲۶۴,۱۰۸	۷۱,۳۰۹	۲۹۰,۴۰۶,۷۱۱	۴۴۴,۷۴۹	۳,۹۰۴	۱,۸۴۰,۳۹۱,۶۱۵	۱,۷۲۹,۳۷۲,۲۵۹
	۲۶۲,۸۷۹	۴,۵۰۶,۱۱۸,۳۹۴	۴,۵۹۳,۲۸۵,۶۶۹	۱۴۱,۰۵۲	۲,۴۲۴,۷۷۱,۳۱۲	۵۰,۷۹۳	۹۳۶,۱۴۶,۶۵۷	۳۵۳,۱۳۸	۱۶,۸۷۹	۶,۰۵۹,۷۴۲,۸۸۹	۵,۹۳۶,۸۳۳,۴۴۳
داروسازی سینا	۵۷۶,۳۴۹	۵,۸۵۱,۹۵۰,۱۶۹	۵,۸۶۳,۷۰۵,۸۱۶	۳۴۳,۶۴۰	۳,۲۱۶,۰۳۵,۴۲۰	۱۲۲,۱۰۲	۱,۲۲۶,۵۵۳,۳۶۸	۷۹۷,۸۸۷	۲۰,۷۸۳	۷,۹۰۰,۱۳۴,۵۰۴	۷,۶۶۶,۲۰۵,۷۰۲
جمع											-

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۰/۳۰					
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	تاریخ انتشار اوراق	تاریخ سررسید	نرخ سود اسمی	نرخ سود مؤثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	کل دارایی‌ها	درصد به
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	بله	بله	۱۳۹۵/۰۳/۰۹	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۲۱	۲۱	۹,۵۰۰	-	۱۰,۲۳۰,۶۸۳,۶۲۸	-	-	-	-	۹,۵۰۰	۱,۰۹۹,۷۹۷	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۴۴۰,۴۹۶,۶۴۸		
اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪	بله	بله	۱۳۹۳/۰۱/۲۵	۱۳۹۷/۰۱/۲۵	۲۰	۲۰	۲,۴۰۰	-	۲,۴۲۴,۰۶۳,۸۷۹	-	-	-	-	۲,۴۰۰	۱,۰۱۱,۷۱۸	۲,۴۰۱,۷۴۲,۹۵۸	۲,۴۴۶,۳۶۳,۸۱۰		
شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن	بله	بله	۱۳۹۴/۰۴/۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱	۲۱	۲۱	۶,۴۹۰	-	۶,۶۱۵,۰۰۷,۱۳۰	-	-	-	-	۶,۴۹۰	۱,۰۳۷,۰۰۰	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۶,۷۲۵,۲۵۰,۶۵۵		
مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۳۹	بله	بله	۱۳۹۵/۰۴/۲۹	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	۲۰	۲۰	۸,۵۰۰	-	۸,۵۷۸,۱۹۸,۲۹۴	-	-	-	-	۸,۲۵۰	۱۰۲۰,۳۰۵	۸,۴۲۳,۰۱۵,۶۷۱	۸,۴۱۱,۴۱۳,۵۵۰		
جمع							۲۶,۸۹۰	-	۲۷,۸۳۷,۹۵۱,۹۳۱	-	-	-	-	۲۶,۶۴۰	۴,۱۶۸,۸۲۰	۲۶,۸۱۹,۴۷۱,۴۳۹	۲۸,۰۰۳,۵۲۳,۶۶۳	-	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۶/۱۰/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۰۹/۳۰	مشخصات حساب بانکی				
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
۳.۹۸٪	۱,۴۲۰,۸۹۵,۴۱۴	۰	۷۸۷,۶۴۳,۶۷۵	۶۳۳,۲۵۱,۷۳۹	۱۰	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سامان سی تیر
۳.۹۸٪	۱,۴۲۰,۸۹۵,۴۱۴	۰	۷۸۷,۶۴۳,۶۷۵	۶۳۳,۲۵۱,۷۳۹			جمع		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

جمع درآمدها:

شرح	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	(۱۸۲,۰۶۸,۶۲۱)	۰.۰٪	۰.۵٪ -
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۸۷۸,۱۳۸,۰۹۰	۹۹.۰٪	۲.۳٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۶,۱۴۴,۲۹۸	۰.۷٪	۰.۲٪
سایر درآمدها	۲,۶۷۵,۶۲۷	۰.۳٪	۰.۱٪
جمع	۷۰۴,۸۸۹,۳۹۴	۱۰۰٪	۱.۹٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه			طی دی ماه						شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	
۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۰	۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۰	۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۲۰	۱۳۹۷/۰۱/۲۵		اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۰	۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۰	۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۲۰	۱۳۹۷/۰۴/۲۹		مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۰	۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۰	۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱		شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۰	۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۰	۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹		اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۶,۱۲۸,۶۶۲	(۱۵,۶۳۶)	۶,۱۴۴,۲۹۸	۶,۱۲۸,۶۶۲	(۱۵,۶۳۶)	۶,۱۴۴,۲۹۸	۱۰			سامان سی تیر
۴۶۳,۶۹۵,۰۲۰	(۱۵,۶۳۶)	۴۶۳,۷۱۰,۶۵۶	۴۶۳,۶۹۵,۰۲۰	(۱۵,۶۳۶)	۴۶۳,۷۱۰,۶۵۶				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه				طی دی 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	
(۱۹۳,۵۱۳,۰۵۳)	۶,۱۳۰,۳۴۶,۴۹۶	۵,۹۳۶,۸۳۳,۴۴۲	۳۵۳,۱۳۸	(۱۹۳,۵۱۳,۰۵۳)	۶,۱۳۰,۳۴۶,۴۹۶	۵,۹۳۶,۸۳۳,۴۴۲	۳۵۳,۱۳۸	داروسازی سینا
(۴۶,۹۸۴,۳۴۹)	۱,۷۷۶,۳۵۶,۶۰۸	۱,۷۲۹,۳۷۲,۲۵۸	۴۴۴,۷۴۹	(۴۶,۹۸۴,۳۴۹)	۱,۷۷۶,۳۵۶,۶۰۸	۱,۷۲۹,۳۷۲,۲۵۸	۴۴۴,۷۴۹	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۱۱۰,۲۴۳,۵۲۵	۶,۶۱۵,۰۰۷,۱۳۰	۶,۷۲۵,۲۵۰,۶۵۵	۶,۴۹۰	۱۱۰,۲۴۳,۵۲۵	۶,۶۱۵,۰۰۷,۱۳۰	۶,۷۲۵,۲۵۰,۶۵۵	۶,۴۹۰	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۲۱۹,۸۱۳,۰۲۰	۱۰,۲۲۰,۶۸۳,۶۲۸	۱۰,۴۴۰,۴۹۶,۶۴۸	۹,۵۰۰	۲۱۹,۸۱۳,۰۲۰	۱۰,۲۲۰,۶۸۳,۶۲۸	۱۰,۴۴۰,۴۹۶,۶۴۸	۹,۵۰۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۸۵,۵۱۵,۲۰۷	۸,۳۲۵,۸۹۸,۳۴۳	۸,۴۱۱,۴۱۳,۵۵۰	۸,۲۵۰	۸۵,۵۱۵,۲۰۷	۸,۳۲۵,۸۹۸,۳۴۳	۸,۴۱۱,۴۱۳,۵۵۰	۸,۲۵۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۲,۲۹۹,۹۳۱	۲,۴۲۴,۰۶۲,۸۷۹	۲,۴۲۶,۳۶۲,۸۱۰	۲,۴۰۰	۲,۲۹۹,۹۳۱	۲,۴۲۴,۰۶۲,۸۷۹	۲,۴۲۶,۳۶۲,۸۱۰	۲,۴۰۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۱۷۷,۳۷۴,۲۸۱	۳۵,۴۹۲,۳۵۵,۰۸۴	۳۵,۶۶۹,۷۲۹,۳۶۳	۸۲۴,۵۲۷	۱۷۷,۳۷۴,۲۸۱	۳۵,۴۹۲,۳۵۵,۰۸۴	۳۵,۶۶۹,۷۲۹,۳۶۳	۸۲۴,۵۲۷	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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه				طی دی 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	
۴۸,۴۳۶,۱۷۳	۸۸۷,۷۱۰,۴۸۴	۹۳۶,۱۴۶,۶۵۷	۵۰,۷۹۳	۵۲,۱۸۶,۳۵۶	۸۸۷,۷۱۰,۴۸۴	۹۳۶,۱۴۶,۶۵۷	۵۰,۷۹۳	داروسازی سینا
۵,۰۷۹,۰۶۴	۲۸۵,۳۲۷,۶۴۷	۲۹۰,۴۰۶,۷۱۱	۷۱,۳۰۹	۶,۲۴۲,۴۲۷	۲۸۵,۳۲۷,۶۴۷	۲۹۰,۴۰۶,۷۱۱	۷۱,۳۰۹	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۲,۵۱۵,۱۷۴	۲۵۲,۲۹۹,۹۵۱	۲۵۴,۸۱۵,۱۲۵	۲۵۰	۲,۷۰۰,۰۴۹	۲۵۲,۲۹۹,۹۵۱	۲۵۴,۸۱۵,۱۲۵	۲۵۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۵۶,۰۳۰,۴۱۱	۱,۴۲۵,۳۳۸,۰۸۲	۱,۴۸۱,۳۶۸,۴۹۳	۱۲۲,۳۵۲	۶۱,۱۲۸,۸۳۲	۱,۴۲۵,۳۳۸,۰۸۲	۱,۴۸۱,۳۶۸,۴۹۳	۱۲۲,۳۵۲	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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه					طی دی ماه					
جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام
درصد از کل	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
درآمد ها										
۲۲.۴۴%	(۱۴۱,۳۲۶,۶۹۸)	۵۲,۱۸۶,۳۵۶	(۱۹۳,۵۱۳,۰۵۳)	-	۲۲.۴۴%	(۱۴۱,۳۲۶,۶۹۸)	۵۲,۱۸۶,۳۵۶	(۱۹۳,۵۱۳,۰۵۴)	-	داروسازی سینا
۶.۴۸%	(۴۰,۷۴۱,۹۲۳)	۶,۲۴۲,۴۲۷	(۴۶,۹۸۴,۳۴۹)	-	۶.۴۸%	(۴۰,۷۴۱,۹۲۳)	۶,۲۴۲,۴۲۷	(۴۶,۹۸۴,۳۵۰)	-	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۲۸.۹۲	(۱۸۲,۰۶۸,۶۲۱)	۵۸,۴۲۸,۷۸۳	(۲۴۰,۴۹۷,۴۰۲)	-	۲۸.۹۲	(۱۸۲,۰۶۸,۶۲۱)	۵۸,۴۲۸,۷۸۳	(۲۴۰,۴۹۷,۴۰۴)	-	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه				طی دی ماه				
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...		یادداشت ...	یادداشت	یادداشت ...	
۸۸,۲۱۵,۲۵۶	۲,۷۰۰,۰۴۹	۸۵,۵۱۵,۲۰۷	۰	۸۸,۲۱۵,۲۵۶	۲,۷۰۰,۰۴۹	۸۵,۵۱۵,۲۰۷	۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۰	۰	۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۳۹,۴۵۲,۰۵۵	۰	۰	۳۹,۴۵۲,۰۵۵	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۰	۰	۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	۰	۰	۱۴۲,۲۷۵,۸۹۶	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۰	۰	۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	۰	۰	۱۱۳,۶۰۶,۸۶۲	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۰	۰	۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	۰	۰	۱۶۲,۲۳۱,۵۴۵	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۱۱۰,۲۴۳,۵۲۵	۰	۱۱۰,۲۴۳,۵۲۵	۰	۱۱۰,۲۴۳,۵۲۵	۰	۱۱۰,۲۴۳,۵۲۵	۰	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۲۱۹,۸۱۳,۰۲۰	۰	۲۱۹,۸۱۳,۰۲۰	۰	۲۱۹,۸۱۳,۰۲۰	۰	۲۱۹,۸۱۳,۰۲۰	۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲,۲۹۹,۹۳۱	۰	۲,۲۹۹,۹۳۱	۰	۲,۲۹۹,۹۳۱	۰	۲,۲۹۹,۹۳۱	۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۸۷۸,۱۳۸,۰۹۰	۲,۷۰۰,۰۴۹	۴۱۷,۸۷۱,۶۸۳	۴۵۷,۵۶۶,۳۵۸	۸۷۸,۱۳۸,۰۹۰	۲,۷۰۰,۰۴۹	۴۱۷,۸۷۱,۶۸۳	۴۵۷,۵۶۶,۳۵۸	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

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

نام سپرده بانکی		طی دی ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و	درصد سود به	سود سپرده بانکی و	درصد سود به
		گواهی سپرده	میانگین سپرده	گواهی سپرده	میانگین سپرده
		یادداشت ...	یادداشت ...		
سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	۶,۱۴۴,۲۹۸	۰	۶,۱۴۴,۲۹۸	۰
		۶,۱۴۴,۲۹۸	-	۶,۱۴۴,۲۹۸	-
جمع					

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به دی ۱۳۹۶

۲-۴-سایر درآمدها:

شرح	طی دی ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه
	مبلغ	مبلغ
تعدیل کارمزد کارگزاری	۲,۶۶۴,۴۴۲	۲,۶۶۴,۴۴۲
سایر درآمدها	۱۱,۱۸۵	۱۱,۱۸۵
کارمزد ابطال واحدهای سرمایه گذاری	۰	۰
جمع	۲,۶۷۵,۶۲۷	۲,۶۷۵,۶۲۷