

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

شرکت	۱۳۹۶/۱۰/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۱/۳۰		
	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	۴۴۴,۷۴۹	۱,۸۴۰,۳۹۱,۶۱۵	۱,۷۲۹,۳۷۲,۲۵۹	۱۰۵,۰۱۰	۴۰۲,۹۶۰,۱۲۵	۷۳,۵۴۰	۲۹۱,۵۵۰,۲۰۸	۴۷۶,۲۱۹	۱,۹۴۰,۴۷۴,۷۵۶	۱,۸۱۲,۸۴۶,۷۸۳
داروسازی سینا	۳۵۳,۱۳۸	۶,۰۵۹,۷۴۲,۸۸۹	۵,۹۳۶,۸۳۳,۴۴۳	۱۹۶,۷۵۶	۳,۰۶۵,۴۶۲,۳۱۸	۱۳,۹۰۷	۲۱۹,۳۰۳,۹۲۳	۵۳۵,۹۸۷	۸,۸۹۱,۵۶۰,۸۷۷	۸,۱۲۳,۵۷۱,۲۸۳
جمع	۷۹۷,۸۸۷	۷,۹۰۰,۱۳۴,۵۰۴	۷,۶۶۶,۲۰۵,۷۰۲	۳۰۱,۷۶۶	۳,۴۶۸,۴۲۲,۴۴۳	۸۷,۴۴۷	۵۱۰,۸۵۴,۱۳۱	۱,۰۱۲,۲۰۶	۱۰,۸۳۲,۰۳۵,۶۳۳	۹,۹۳۶,۴۱۸,۰۶۶

درصد به کل دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت																		تغییرات طی دوره	۱۳۹۶/۱۱/۳۰
نام اوراق	دارای مجوز از بورس یا فرا بورس	بذیرفته شده در تاریخ انتشار اوراق	تاریخ سررسید	نرخ سود اسمی	نرخ سود مؤثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره			فروش طی دوره			تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها
									تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	مبلغ فروش					
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	بله	بله	۱۳۹۵/۰۳/۰۹	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۳۱	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰,۴۴۰,۴۹۶,۶۴۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۹,۵۰۰	۱,۰۵۱,۸۳۱	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۹۸۵,۱۵۰,۰۱۳	۲۸.۹%
اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۳۰٪	بله	بله	۱۳۹۷/۰۱/۲۵	۱۳۹۷/۰۱/۲۵	۲۰	۲,۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۴۰۱,۷۴۳,۹۵۸	۰	۰	۰	۰	۲۴۰۰	۲۴۱۳۲۰۱۴۵۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰.۰%
شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن	بله	بله	۱۳۹۷/۰۴/۲۱	۱۳۹۴/۰۴/۲۱	۲۱	۶,۴۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۶,۴۹۰	۱,۰۱۵,۴۰۲	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۶,۵۸۵,۱۸۱,۳۵۹	۱۹.۰%
مراپحه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹	بله	بله	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	۱۳۹۵/۰۴/۲۹	۲۰	۸,۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸,۴۲۳,۰۱۵,۶۷۱	۰	۰	۰	۰	۳۴۰	۳۴۲,۳۷۷,۸۶۷	۳۴۲,۳۷۷,۸۶۷	۷,۹۱۰	۱,۰۰۰,۷۰۷	۸,۰۷۵,۸۸۵,۳۲۸	۷,۹۰۹,۸۵۳,۵۶۵	۲۲.۹%
جمع						۲۶,۶۴۰	۲۸,۰۰۳,۵۲۳,۶۶۳	۰	۰	۰	۰	۳,۷۴۰	۳,۷۵۵,۵۷۹,۳۲۵	۳,۷۴۰	۲۲,۹۰۰	۳,۰۶۷,۹۴۰	۲۴,۰۷۰,۵۹۷,۱۳۸	۲۴,۴۸۰,۱۸۴,۸۳۷	۲۸.۸۶%

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۶/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۱۰/۳۰	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
۰.۰۳٪	۱۱,۳۵۱,۸۴۹	۱,۴۱۴,۳۵۰,۰۰۰	۴,۸۰۶,۴۳۵	۱,۴۲۰,۸۹۵,۴۱۴	۱۰	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سامان سی تیر
۰.۰۳٪	۰	۱۴۱۴۳۵۰۰۰۰	۴,۸۰۶,۴۳۵	۱۴۲۰۸۹۵۴۱۴			جمع		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به بهمن 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	(۸۶۷,۳۷۸,۰۹۷)	۰.۰٪	-۲.۴٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	(۵۳۲,۵۳۷,۵۲۶)	۰.۰٪	-۱.۵٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۷,۹۶۷,۴۲۳	۵۹٪	۰.۰۲٪
سایر درآمدها	۵,۴۴۷,۲۸۹	۴۱٪	۰.۰۲٪
جمع	(۳۲۱,۴۲۵,۸۵۹)	۱۰۰٪	-۳.۹٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه			طی بهمن ماه			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۵۳,۱۹۶,۳۷۰	.	۵۳,۱۹۶,۳۷۰	۱۳,۷۴۴,۳۱۵	.	۱۳,۷۴۴,۳۱۵	۲۰	۱۳۹۷/۰۱/۲۵	-	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۲۷۱,۳۷۷,۰۵۲	.	۲۷۱,۳۷۷,۰۵۲	۱۲۹,۱۰۱,۱۵۶	.	۱۲۹,۱۰۱,۱۵۶	۲۰	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	-	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۲۲۲,۸۸۶,۰۱۵	.	۲۲۲,۸۸۶,۰۱۵	۱۰۹,۲۷۹,۱۵۳	.	۱۰۹,۲۷۹,۱۵۳	۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱	-	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۳۳۰,۲۶۶,۶۱۵	.	۳۳۰,۲۶۶,۶۱۵	۱۶۸,۰۳۵,۰۷۰	.	۱۶۸,۰۳۵,۰۷۰	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	-	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۷,۹۶۷,۶۰۹	۱۸۶	۷,۹۶۷,۴۲۳	۱,۸۰۷,۶۷۵	(۱۵,۴۵۰)	۱,۸۲۳,۱۲۵	۱۰	-	-	سامان سی تیر
۸۸۵,۶۹۳,۶۶۱	۱۸۶	۸۸۵,۶۹۳,۴۷۵	۴۲۱,۹۶۷,۳۶۹	(۱۵,۴۵۰)	۴۲۱,۹۸۲,۸۱۹				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن 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	
(۸۳۶,۴۸۳,۱۸۵)	۸,۹۶۰,۰۵۴,۴۶۹	۸,۱۲۳,۵۷۱,۲۸۳	۵۳۵,۹۸۷	(۶۴۲,۹۷۰,۱۳۱)	۸,۷۶۶,۵۴۱,۴۱۵	۸,۱۲۳,۵۷۱,۲۸۳	۵۳۵,۹۸۷	داروسازی سینا
(۷۳,۵۲۲,۹۷۴)	۱,۸۸۶,۳۶۹,۷۵۸	۱,۸۱۲,۸۴۶,۷۸۳	۴۷۶,۲۱۹	(۲۶,۵۳۸,۶۲۴)	۱,۸۳۹,۳۸۵,۴۰۸	۱,۸۱۲,۸۴۶,۷۸۳	۴۷۶,۲۱۹	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۲۹,۸۲۵,۸۷۰)	۶,۶۱۵,۰۰۷,۱۳۰	۶,۵۸۵,۱۸۱,۲۵۹	۶,۴۹۰	(۱۴۰,۰۶۹,۳۹۵)	۶,۷۲۵,۲۵۰,۶۵۵	۶,۵۸۵,۱۸۱,۲۵۹	۶,۴۹۰	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
(۲۳۵,۵۳۳,۶۱۴)	۱۰,۲۲۰,۶۸۳,۶۲۸	۹,۹۸۵,۱۵۰,۰۱۳	۹,۵۰۰	(۴۵۵,۳۴۶,۶۳۴)	۱۰,۴۴۰,۴۹۶,۶۴۸	۹,۹۸۵,۱۵۰,۰۱۳	۹,۵۰۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
(۷۲,۹۱۶,۸۴۷)	۷,۹۸۲,۷۷۰,۴۱۳	۷,۹۰۹,۸۵۳,۵۶۵	۷,۹۱۰	(۱۵۸,۴۳۲,۰۵۴)	۸,۰۶۸,۲۸۵,۶۲۰	۷,۹۰۹,۸۵۳,۵۶۵	۷,۹۱۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
(۷)	۷	۰	۰	(۲,۲۹۹,۹۳۸)	۲,۲۹۹,۹۳۸	۰	۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
(۱,۲۴۸,۲۸۲,۴۹۷)	۳۵,۶۶۴,۸۸۵,۴۰۵	۳۴,۴۱۶,۶۰۲,۹۰۳	۱,۰۳۶,۱۰۶	(۱,۴۲۵,۶۵۶,۷۷۶)	۳۵,۸۴۲,۲۵۹,۶۸۴	۳۴,۴۱۶,۶۰۲,۹۰۳	۱,۰۳۶,۱۰۶	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 بهمن ۱۳۹۶

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن 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	
۳۱,۹۸۵,۷۵۱	۱,۱۲۳,۴۶۴,۸۲۹	۱,۱۵۵,۴۵۰,۵۸۰	۶۴,۷۰۰	(۱۶,۴۵۰,۴۲۲)	۲۳۵,۷۵۴,۳۴۵	۲۱۹,۳۰۳,۹۲۳	۱۳,۹۰۷	داروسازی سینا
۳,۶۸۲,۳۹۷	۵۷۸,۲۷۴,۶۲۲	۵۸۱,۹۵۶,۹۱۹	۱۴۴,۸۴۹	(۱,۳۹۶,۷۶۷)	۲۹۲,۹۴۶,۹۷۵	۲۹۱,۵۵۰,۲۰۸	۷۳,۵۴۰	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۱۰,۸۶۱,۴۱۴)	۲,۴۲۴,۰۶۲,۸۷۲	۲,۴۱۳,۲۰۱,۴۵۸	۲,۴۰۰	(۱۰,۸۶۱,۴۱۴)	۲,۴۲۴,۰۶۲,۸۷۲	۲,۴۱۳,۲۰۱,۴۵۸	۲,۴۰۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۱,۷۶۵,۱۱۱	۵۹۵,۴۲۷,۸۸۱	۵۹۷,۱۹۲,۹۹۲	۵۹۰	(۷۵۰,۰۶۳)	۳۴۳,۱۲۷,۹۳۰	۳۴۲,۳۷۷,۸۶۷	۳۴۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۲۶,۵۷۱,۷۴۵	۴,۷۲۱,۲۳۰,۲۰۴	۴,۷۴۷,۸۰۱,۹۴۹	۲۱۲,۵۳۹	(۲۹,۴۵۸,۶۶۶)	۳,۲۹۵,۸۹۲,۱۲۲	۳,۲۶۶,۴۳۳,۴۵۶	۹۰,۱۸۷	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 بهمن ۱۳۹۶

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

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن ماه						
جمع		درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام			
درصد از کل	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ				
۲۲.۹۸٪	(۸۰۱,۰۲۷,۴۲۶)	۳۵,۴۵۵,۷۵۹	(۸۳۶,۴۸۳,۱۸۵)	+	۶۵.۲۶٪	(۶۵۸,۵۴۲,۰۲۶)	(۱۵,۵۷۱,۸۹۵)	(۶۴۲,۹۷۰,۱۳۱)	+	داروسازی سینا
۱۹.۱۸٪	(۶۶,۳۵۰,۶۷۱)	۷,۱۷۲,۳۰۳	(۷۳,۵۲۲,۹۷۴)	+	۲.۷۶٪	(۲۶,۷۶۷,۴۴۹)	(۲۲۸,۸۲۵)	(۲۶,۵۳۸,۶۲۴)	+	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۴۲.۱۶٪	(۸۶۷,۳۷۸,۰۹۷)	۴۲,۶۲۸,۰۶۲	(۹۱۰,۰۰۶,۱۵۹)	+	۶۸.۰۲٪	(۶۸۵,۳۰۹,۴۷۵)	(۱۵,۸۰۰,۷۲۰)	(۶۶۹,۵۰۸,۷۵۵)	+	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

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

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه				طی بهمن 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 ...	
۵۲,۶۵۳,۲۹۲	(۵۴۳,۰۷۱)	(۷)	۵۳,۱۹۶,۳۷۰	۲,۳۳۳,۸۰۲	(۹,۱۱۰,۵۷۵)	(۲,۲۹۹,۹۳۸)	۱۳,۷۴۴,۳۱۵	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
(۷۹,۲۸۵,۹۶۴)	(۶,۳۶۹,۱۱۷)	(۷۲,۹۱۶,۸۴۷)	۰	(۱۵۸,۹۳۳,۷۱۶)	(۵۰۱,۶۶۳)	(۱۵۸,۴۳۲,۰۵۴)	۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۲۷۱,۳۷۷,۰۵۲	۰	۰	۲۷۱,۳۷۷,۰۵۲	۱۲۹,۱۰۱,۱۵۶	۰	۰	۱۲۹,۱۰۱,۱۵۶	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۲۲۲,۸۸۶,۰۱۵	۰	۰	۲۲۲,۸۸۶,۰۱۵	۱۰۹,۲۷۹,۱۵۳	۰	۰	۱۰۹,۲۷۹,۱۵۳	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
(۲۹,۸۲۵,۸۷۰)	۰	(۲۹,۸۲۵,۸۷۰)	۰	(۱۴۰,۰۶۹,۳۹۶)	۰	(۱۴۰,۰۶۹,۳۹۶)	۰	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۹۴,۷۳۳,۰۰۱	۰	(۲۳۵,۵۳۳,۶۱۴)	۳۳۰,۲۶۶,۶۱۵	(۲۸۷,۳۱۱,۵۶۳)	۰	(۴۵۵,۳۴۶,۶۳۳)	۱۶۸,۰۳۵,۰۷۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
(۵۳۲,۵۳۷,۵۲۶)	(۶,۹۱۲,۱۸۸)	(۳۳۸,۲۷۶,۳۳۸)	۸۷۷,۷۲۶,۰۵۲	(۳۴۵,۶۰۰,۵۶۴)	(۹,۶۱۲,۲۳۷)	(۷۵۶,۱۴۸,۰۲۱)	۴۲۰,۱۵۹,۶۹۴	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به بهمن ۱۳۹۶

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

نام سپرده بانکی		طی بهمن ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن 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	۱,۸۲۳,۱۲۵	۴۵.۷۶٪	۷,۹۶۷,۴۲۳	۴۱٪
جمع		۱,۸۲۳,۱۲۵	-	۷,۹۶۷,۴۲۳	۴۱٪

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

۲-۴-سایر درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان بهمن ماه	طی بهمن ماه	
مبلغ	مبلغ	شرح
۵,۴۳۶,۱۰۴	۲,۷۷۱,۶۶۲	سایر درآمدها
۱۱,۱۸۵	۰	تعدیل کارمزد کارگزاری
۰	۰	کارمزد ابطال واحدهای سرمایه گذاری
۵,۴۴۷,۲۸۹	۲,۷۷۱,۶۶۲	جمع