

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه-گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند ماه				
درآمد سود اوراق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع	درآمد سود اوراق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع	
یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...		یادداشت ...	یادداشت	یادداشت ...		
•	۸,۳۸۲,۰۳۱	(۱۵,۵۹۵,۰۸۱)	(۷,۲۱۳,۰۵۰)	•	۵۳,۱۹۶,۳۷۰	•	۵۳,۱۹۶,۳۷۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
•	•	•	•	•	•	•	•	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
•	•	•	•	•	•	•	•	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۱۱۲,۲۳۹,۶۸۳	•	•	(۱۱۲,۲۳۹,۶۸۳)	•	•	•	•	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۱۱۳,۱۵۵,۲۵۵	•	•	(۱۱۳,۱۵۵,۲۵۵)	•	•	•	•	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۱۶۲,۰۲۴,۴۸۰	•	•	(۱۶۲,۰۲۴,۴۸۰)	•	•	•	•	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
•	۴۴,۱۰۶,۴۸۹	•	۴۴,۱۰۶,۴۸۹	•	•	•	•	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
•	(۱۶۳,۴۷۱,۳۹۷)	•	(۱۶۳,۴۷۱,۳۹۷)	•	•	•	•	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
•	(۴۱۵,۵۳۶)	•	(۴۱۵,۵۳۶)	•	•	•	•	اسناد خزانه-م ۱۵ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰
۳۸۷,۴۱۹,۴۱۸	(۱۱۱,۳۹۸,۴۱۳)	(۱۵,۵۹۵,۰۸۱)	(۵۱۴,۴۱۲,۹۱۳)	۱,۲۵۱,۴۷۸,۲۷۱	(۵۷۴,۱۰۸,۷۵۰)	(۲۱,۳۵۹,۵۱۰)	۶۵۶,۰۱۰,۰۱۱	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۶/۱۲/۲۹					تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۱/۲۹			شرکت
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۵.۸۳%	۲,۰۰۸,۹۹۸,۳۵۷	۲,۴۸۰,۷۳۲,۲۵۳	۳,۱۴۸	۶۴۰,۷۳۹	۱۳۴,۶۱۹,۲۷۹	۳۹,۶۷۴	۸۲۴,۶۰۴,۵۹۲	۲۳۷,۵۴۴	۱,۷۲۲,۹۴۴,۲۲۷	۱,۸۱۲,۴۶۳,۸۵۷	۴۴۲,۸۶۹	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۲۳.۵۰%	۸,۱۰۰,۹۴۷,۰۱۱	۸,۵۸۸,۱۱۹,۸۳۹	۱۵,۴۶۶	۵۲۵,۸۸۹	۱,۳۳۷,۴۰۱,۵۸۶	۸۸,۴۳۳	۱,۳۳۰,۸۹۷,۴۳۹	۹۰,۸۵۷	۷,۹۵۶,۲۰۳,۴۷۷	۸,۷۰۲,۵۲۷,۰۸۰	۵۲۳,۴۶۵	داروسازی سینا
۲۹.۳۳%	۱۰,۱۰۹,۹۴۵,۳۶۸	۱۱,۰۶۸,۸۵۲,۰۹۲	۱۸,۶۱۴	۱,۱۶۶,۶۲۸	۱,۴۷۲,۰۲۰,۸۶۵	۱۲۸,۱۰۷	۲,۱۵۵,۵۰۲,۰۳۱	۳۲۸,۴۰۱	۹,۶۷۹,۱۴۷,۷۰۴	۱۰,۵۱۴,۹۹۰,۹۳۷	۹۶۶,۳۳۴	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا
صورت وضعیت پر تفوی
برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

۱-۲ سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت																			۱۳۹۶/۱۱/۲۹			تغییرات طی دوره			۱۳۹۶/۱۲/۲۹		
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	پذیرفته شده در بورس یا فرا بورس	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	کل	درصد به دارایی ها								
										تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش														
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	بله	بله	۱۳۹۵/۰۳/۰۹	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۲۱	۲۱	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۹۰۲,۸۸۲,۷۰۱	۹,۹۰۲,۸۸۲,۷۰۱	۰	۰	۰	۰	۹,۵۰۰	۱,۰۲۵,۹۴۵	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۷۳۹,۴۱۱,۲۰۳	۹,۷۳۹,۴۱۱,۲۰۳	۲۸.۳٪								
شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن	بله	بله	۱۳۹۴/۰۴/۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱	۲۱	۲۱	۶,۴۹۰	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۰	۰	۰	۰	۶,۴۹۰	۱,۰۱۵,۳۴۴	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۶,۵۸۴,۸۰۵,۱۱۲	۶,۵۸۴,۸۰۵,۱۱۲	۱۹.۱٪								
مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹	بله	بله	۱۳۹۵/۰۴/۲۹	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	۲۰	۲۰	۷,۹۱۰	۸,۰۷۵,۸۸۵,۳۳۸	۷,۹۱۲,۱۶۹,۵۱۵	۰	۰	۰	۰	۶,۳۲۷	۱۵۸۱۹۶۸۲۰۱	۶,۴۵۹,۶۸۷,۳۹۱	۶,۳۳۲,۹۹۸,۲۶۶	۶,۳۳۲,۹۹۸,۲۶۶	۱۸.۳٪								
اسناد خزانه -م ۱۵ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	بله	بله	۱۳۹۶/۱۲/۰۸	۱۳۹۸/۰۸/۲۰	۰	۰	۰	-	۰	۷۲۴,۲۵۵,۳۹	۰	۰	۰	۱,۰۰۰	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۲۴,۶۱۰,۰۰۲	۷۲۴,۶۱۰,۰۰۲	۲.۱٪								
جمع							۲۳,۹۰۰	۹۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۴,۳۵۵,۷۵۰,۸۳۹	۱,۰۰۰	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۱,۵۸۳	۱,۵۸۱,۹۶۸,۲۰۱	۲۳,۳۱۷	۳,۷۶۵,۵۱۵	۲۳,۱۷۸,۴۲۴,۶۴۰	۲۳,۳۷۰,۸۱۴,۶۸۱	۲۳,۳۷۰,۸۱۴,۶۸۱	۶۷.۷۹٪								

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۶/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۱۱/۲۹	مشخصات حساب بانکی				
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
۲.۳۳٪	۸۰۴,۸۳۰,۵۹۱	۱۰,۰۰۰	۷۹۳,۴۸۸,۷۴۲	۱۱,۳۵۱,۸۴۹	۱۰	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سامان سی تیر
۲.۳۳٪	۸۰۴,۸۳۰,۵۹۱	۱۰,۰۰۰	۷۹۳,۴۸۸,۷۴۲	۱۱,۳۵۱,۸۴۹			جمع		

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه			طی اسفند ماه						شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	
۵۳,۱۹۶,۳۷۰	۰	۵۳,۱۹۶,۳۷۰	۰	۰	۰	۲۰	۱۳۹۷/۰۱/۲۵	-	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۳۷۹,۳۵۱,۴۴۲	۰	۳۷۹,۳۵۱,۴۴۲	۱۰۷,۹۷۴,۳۹۰	۰	۱۰۷,۹۷۴,۳۹۰	۲۰	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	-	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۳۳۲,۳۳۴,۰۳۴	۰	۳۳۲,۳۳۴,۰۳۴	۱۰۹,۴۴۸,۰۱۹	۰	۱۰۹,۴۴۸,۰۱۹	۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱	-	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۴۸۶,۵۹۶,۴۲۵	۰	۴۸۶,۵۹۶,۴۲۵	۱۵۶,۳۲۹,۸۱۰	۰	۱۵۶,۳۲۹,۸۱۰	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	-	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۱۱,۴۲۵,۹۹۷	۱۱,۲۸۱	۱۱,۴۱۴,۷۱۶	۳,۴۵۸,۳۸۸	۱۱,۰۹۵	۳,۴۴۷,۲۹۳	۱۰	-	۱۹	سامان سی تیر
۱,۲۶۲,۹۰۴,۲۶۸	۱۱,۲۸۱	۱,۲۶۲,۸۹۲,۹۸۷	۳۷۷,۲۱۰,۶۰۷	۱۱,۰۹۵	۳۷۷,۱۹۹,۵۱۲				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

جمع درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه	طی اسفند ماه	
درصد به کل دارایی های صندوق	درصد از کل درآمدها	مبلغ	شرح
-۰.۷٪	۰.۰٪	(۱,۰۵۴,۳۹۰,۳۸۳)	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
-۱.۵٪	۹۷.۰۶٪	۶۵۶,۰۱۰,۰۱۱	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۰.۰٪	۱.۶۹٪	۱۱,۴۱۴,۷۱۶	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰.۰٪	۱.۲۵٪	۸,۴۳۱,۰۰۳	سایر درآمدها
-۰.۰۲۲	۱۰۰٪	(۳۷۸,۵۳۴,۶۵۳)	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند 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	
(۵۴۵,۷۲۴,۸۰۱)	۸,۶۴۶,۶۷۱,۸۱۲	۸,۱۰۰,۹۴۷,۰۱۰	۵۲۵,۸۸۹	۲۶۹,۰۹۲,۳۹۳	۷,۸۳۱,۸۵۴,۶۱۷	۸,۱۰۰,۹۴۷,۰۱۰	۵۲۵,۸۸۹	داروسازی سینا
(۴۲۱,۱۰۸,۲۸۳)	۲,۴۳۰,۱۰۶,۶۴۰	۲,۰۰۸,۹۹۸,۳۵۶	۶۴۰,۷۳۹	(۳۸۵,۶۹۳,۶۵۱)	۲,۳۹۴,۶۹۲,۰۰۸	۲,۰۰۸,۹۹۸,۳۵۶	۶۴۰,۷۳۹	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۳۰,۲۰۲,۰۱۷)	۶,۶۱۵,۰۰۷,۱۳۰	۶,۵۸۴,۸۰۵,۱۱۲	۶,۴۹۰	۴۴,۱۰۶,۴۸۹	۶,۵۴۰,۶۹۸,۶۲۳	۶,۵۸۴,۸۰۵,۱۱۲	۶,۴۹۰	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
(۴۸۱,۲۷۲,۳۲۴)	۱۰,۲۲۰,۶۸۳,۶۲۸	۹,۷۳۹,۴۱۱,۳۰۳	۹,۵۰۰	(۱۶۳,۴۷۱,۳۹۷)	۹,۹۰۲,۸۸۲,۷۰۱	۹,۷۳۹,۴۱۱,۳۰۳	۹,۵۰۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
(۶۲,۲۱۸,۸۶۶)	۶,۳۸۵,۲۰۷,۱۳۱	۶,۳۲۲,۹۸۸,۲۶۴	۶,۳۲۷	۸,۳۸۲,۰۳۱	۶,۳۱۴,۶۰۶,۲۳۳	۶,۳۲۲,۹۸۸,۲۶۴	۶,۳۲۷	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
(۴۱۵,۵۳۶)	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۲۳,۶۱۰,۰۰۲	۱,۰۰۰	(۴۱۵,۵۳۶)	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۲۳,۶۱۰,۰۰۲	۱,۰۰۰	اسناد خزانه-م ۱۵ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰
(۱,۵۴۰,۹۴۱,۸۲۷)	۳۵,۰۲۱,۷۰۱,۸۸۰	۳۳,۴۸۰,۷۶۰,۰۴۷	۱,۱۸۹,۹۴۵	(۲۲۷,۹۹۹,۶۷۱)	۳۳,۷۰۸,۷۵۹,۷۲۱	۳۳,۴۸۰,۷۶۰,۰۴۷	۱,۱۸۹,۹۴۵	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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند 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	
(۸۵,۸۵۸,۹۶۳)	۲,۵۷۸,۷۱۱,۱۲۸	۲,۴۹۲,۸۵۲,۱۶۶	۱۵۳,۱۳۳	(۱۱۷,۸۴۴,۷۱۳)	۱,۴۵۵,۲۴۶,۲۹۹	۱,۳۳۷,۴۰۱,۵۸۶	۸۸,۴۳۳	داروسازی سینا
(۱۴,۵۵۵,۲۳۵)	۷۳۱,۱۳۱,۴۳۳	۷۱۶,۵۷۶,۱۹۸	۱۸۴,۵۲۳	(۱۸,۲۳۷,۵۳۲)	۱۵۲,۸۵۶,۸۱۱	۱۳۴,۶۱۹,۲۷۹	۳۹,۶۷۴	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۱۳,۸۲۹,۹۷۰)	۲,۱۹۲,۹۹۱,۱۶۳	۲,۱۷۹,۱۶۱,۱۹۳	۲,۱۷۳	(۱۵,۵۹۵,۰۸۱)	۱,۵۹۷,۵۶۳,۲۸۲	۱,۵۸۱,۹۶۸,۲۰۱	۱,۵۸۳	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
(۱۰,۸۶۱,۴۱۴)	۲,۴۲۴,۰۶۲,۸۷۲	۲,۴۱۳,۲۰۱,۴۵۸	۲,۴۰۰	-	۰	۰	۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
(۱۲۵,۱۰۵,۵۸۱)	۷,۹۲۶,۸۹۶,۵۹۶	۷,۸۰۱,۷۹۱,۰۱۵	۳۴۲,۲۲۹	(۱۵۱,۶۷۷,۳۲۶)	۳,۲۰۵,۶۶۶,۳۹۲	۳,۰۵۳,۹۸۹,۰۶۶	۱۲۹,۶۹۰	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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

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

از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه				طی اسفند ماه					
جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام
درصد از کل	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...
درآمد ها									
۲۱۷.۰۶%	(۶۲۵.۱۵۵.۳۱۴)	(۷۹.۴۳۰.۵۱۳)	(۵۴۵.۷۲۴.۸۰۱)	۰	۹۹.۸۳%	۱۵۱,۲۴۷,۶۸۰	(۱۱۷,۸۴۴,۷۱۳)	۲۶۹,۰۹۲,۳۹۳	۰
۱۴۹.۷۲%	(۴۲۹,۲۳۵,۰۶۹)	(۸,۱۲۶,۷۸۶)	(۴۲۱,۱۰۸,۲۸۳)	۰	۲۶۶.۶۲%	(۴۰۳,۹۳۱,۱۸۳)	(۱۸,۲۳۷,۵۳۳)	(۳۸۵,۶۹۳,۶۵۱)	۰
۳۶۶.۷۸%	(۱,۰۵۴,۳۹۰,۳۸۳)	(۸۷,۵۵۷,۲۹۹)	(۹۶۶,۸۳۳,۰۸۴)	۰	۳۶۶.۴۵%	(۲۵۲,۶۸۳,۵۰۳)	(۱۳۶,۰۰۸۲,۲۴۵)	(۱۱۶,۶۰۱,۲۵۸)	۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

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

نام سپرده بانکی		طی اسفند ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی	درصد سود به	سود سپرده بانکی	درصد سود به
		و گواهی سپرده	میانگین سپرده	و گواهی سپرده	میانگین سپرده
		یادداشت ...		یادداشت ...	
سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	۳,۴۴۷,۲۹۳	۰	۱۱,۴۱۴,۷۱۶	۱۲۵٪
جمع		۳,۴۴۷,۲۹۳	۰	۱۱,۴۱۴,۷۱۶	۱۲۵٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اسفند ۱۳۹۶

۲-۴- سایر درآمدها:

شرح	طی اسفند ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان اسفند ماه
مبلغ	مبلغ	مبلغ
سایر درآمدها	۲,۹۸۳,۷۱۴	۸,۴۱۹,۸۱۸
معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک	۰	۱۱,۱۸۵
تعدیل کارمزد کارگزار	۰	۰
جمع	۲,۹۸۳,۷۱۴	۸,۴۳۱,۰۰۳