

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

شرکت	۱۳۹۷/۰۱/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۲/۳۱		
	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	۸۵۱,۳۷۹	۲,۹۴۲,۲۰۷,۳۰۱	۲,۰۸۲,۶۴۳,۷۸۷	۳۴۷,۸۷۶	۷۷۶,۷۷۵,۱۴۰	(۳۵۰,۰۰۰)	۸۱۶,۱۳۷,۵۲۳	۸۴۹,۲۵۵	۲,۶۱۲,۷۲۳,۰۸۸	۲,۱۲۱,۴۳۳,۱۱۳
داروسازی سینا	۴۹۹,۹۷۶	۸,۱۶۳,۰۱۹,۳۲۹	۸,۱۳۷,۰۱۱,۱۰۵	۱۶۱,۵۶۵	۲,۴۸۹,۱۹۷,۶۸۲	(۱,۶۹۳)	۲۸,۴۶۶,۲۱۵	۶۵۹,۸۴۸	۱۰,۶۲۴,۵۹۷,۹۴۹	۹,۹۹۴,۲۷۱,۶۴۵
جمع	۱,۳۵۱,۳۵۵	۱۱,۱۰۵,۲۲۶,۶۳۰	۱۰,۲۱۹,۶۵۴,۸۹۱	۵۰۹,۴۴۱	۳,۲۶۵,۹۷۲,۸۲۲	(۳۵۱,۶۹۳)	۸۴۴,۶۰۳,۷۳۸	۱,۵۰۹,۱۰۳	۱۳,۲۳۷,۳۲۱,۰۳۷	۱۲,۱۱۵,۷۰۴,۷۵۸

درصد به کل
دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پر تفوی

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت																			۱۳۹۷/۰۱/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۲/۳۱			
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	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	۲۱	۲۱	۹,۵۰۰	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۶۶۸,۷۳۵,۰۸۱	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱,۰۱۰,۰۶۳	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۵۸۸,۶۴۱,۶۹۱	۲۶.۵۴%											
اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸	بله	بله	۱۳۹۶/۰۷/۱۷	۱۳۹۷/۱۲/۲۸	۰	۰	۴۸۰	۳۹۶,۸۸۹,۴۵۶	۳۹۷,۸۸۳,۳۲۵	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰%											
اسناد خزانه - م ۱۵ بودجه ۹۶ - ۹۸۰۸۲۰	بله	بله	۱۳۹۶/۱۲/۰۸	۱۳۹۸/۰۸/۲۰	۰	۰	۱,۰۰۰	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۲۲,۲۶۵,۷۲۲	۰	۰	۰	۰	۱,۰۰۰	۷۴۱,۴۶۸	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۴۰,۹۳۰,۴۳۵	۲۰.۵%												
شهرداری مشهد ۱۳۹۴ - ارگ هومن	بله	بله	۱۳۹۴/۰۴/۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱	۲۱	۲۱	۶,۴۹۰	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۶,۶۷۴,۶۱۹,۹۵۹	۰	۰	۰	۰	۶,۴۹۰	۱,۰۴۳,۳۴۷	۶,۴۹۴,۷۱۱,۸۱۰	۶,۷۶۶,۴۱۲,۸۲۱	۱۸.۷۳%												
مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹	بله	بله	۱۳۹۵/۰۴/۲۹	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	۲۰	۲۰	۶۰,۲۷	۶,۱۵۳,۳۹۵,۸۱۲	۶,۰۲۲,۸۹۵,۴۲۰	۰	۰	۰	۰	۴,۳۵۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۴,۴۴۱,۲۲۶,۴۴۴	۴,۳۴۶,۸۴۶,۲۵۰	۱۲.۰۳%												
جمع							۲۳,۴۹۷	۲۳,۲۶۹,۰۲۲,۶۱۷	۲۳,۴۹۶,۳۹۹,۵۰۷	-	-	-	-	۲۱,۲۴۰	۳,۷۹۴,۸۷۸	۲۱,۱۵۹,۹۶۳,۷۹۳	۲۱,۴۴۲,۸۳۱,۱۹۷	۵۹.۳۵%												

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۷/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۰۱/۳۱	مشخصات حساب بانکی			
سپرده های بانکی	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ
سپرده های بانکی	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	۱۰	۱,۱۰۴,۸۹۷,۴۳۹	۳۴۰,۸۲۰,۱۵۴	-	۱,۴۴۵,۷۱۷,۵۹۳
جمع					۱,۱۰۴,۸۹۷,۴۳۹	۳۴۰,۸۲۰,۱۵۴	-	۱,۴۴۵,۷۱۷,۵۹۳

درصد به کل دارایی‌ها

۴٪

۴٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه			طی اردیبهشت 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	-	۲۰	۱۳۹۷/۰۱/۲۵	-	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۵۷۸,۱۱۰,۳۷۵	۰	۵۷۸,۱۱۰,۳۷۵	۹۰,۰۶۱,۲۷۵	۰	۹۰,۰۶۱,۲۷۵	۲۰	۱۳۹۷/۰۴/۲۹	-	مرابحه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۵۶۲,۴۷۸,۵۴۵	۰	۵۶۲,۴۷۸,۵۴۵	۱۱۲,۹۷۸,۸۳۹	۰	۱۱۲,۹۷۸,۸۳۹	۲۱	۱۳۹۷/۱۰/۲۱	-	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۸۲۷,۶۴۷,۵۹۷	۰	۸۲۷,۶۴۷,۵۹۷	۱۷۳,۵۸۹,۵۹۷	۰	۱۷۳,۵۸۹,۵۹۷	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	-	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۸,۵۴۷,۶۱۱	۲۴,۲۹۵	۲۸,۵۷۱,۹۰۶	۹,۹۱۰,۸۳۷	۷۳۶۱	۹,۹۱۸,۱۹۸	۱۰	-	۱۹	سامان سی تیر
۲,۰۴۹,۹۸۰,۴۹۸	۲۴,۲۹۵	۲,۰۵۰,۰۰۴,۷۹۳	۳۸۶,۵۴۰,۵۴۸	۷,۳۶۱	۳۸۶,۵۴۷,۹۰۹				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

جمع درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه	طی اردیبهشت ماه	
درصد به کل دارایی های صندوق	درصد از کل درآمدها	مبلغ	شرح
-۰.۷٪	۰.۰٪	(۱,۵۹۹,۸۴۳,۶۱۱)	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
-۱.۵٪	۹۸.۱۴٪	۱,۹۵۷,۴۵۱,۹۴۹	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۰.۰٪	۱.۴۳٪	۲۸,۵۷۱,۹۰۶	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰.۰٪	۰.۴۳٪	۸,۴۳۱,۰۰۳	سایر درآمدها
-۰.۰۲۲	۱۰۱٪	۳۹۴,۶۱۱,۲۴۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه				طی اردیبهشت 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	
(۶۸۴,۷۹۷,۱۷۷)	۱۰,۶۷۹,۰۶۸,۸۲۲	۹,۹۹۴,۲۷۱,۶۴۴	۶۵۹,۸۴۸	(۶۰۴,۱۳۶,۸۶۹)	۱۰,۵۹۸,۴۰۸,۵۱۴	۹,۹۹۴,۲۷۱,۶۴۴	۶۵۹,۸۴۸	داروسازی سینا
(۴۶۰,۰۶۹,۳۳۰)	۲,۵۸۱,۵۰۲,۴۴۴	۲,۱۲۱,۴۳۳,۱۱۳	۸۴۹,۲۵۵	۳۵۴,۰۰۲,۷۴۴	۱,۷۶۷,۴۳۰,۳۶۹	۲,۱۲۱,۴۳۳,۱۱۳	۸۴۹,۲۵۵	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۱۵۱,۴۰۵,۶۹۱	۶,۶۱۵,۰۰۷,۱۳۰	۶,۷۶۶,۴۱۲,۸۲۱	۶,۴۹۰	۹۱,۷۹۲,۸۶۲	۶,۶۷۴,۶۱۹,۹۵۹	۶,۷۶۶,۴۱۲,۸۲۱	۶,۴۹۰	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
(۶۳۲,۰۴۱,۹۳۶)	۱۰,۲۲۰,۶۸۳,۶۲۸	۹,۵۸۸,۶۴۱,۶۹۱	۹,۵۰۰	(۸۰۰,۹۳,۳۸۹)	۹,۶۶۸,۷۳۵,۰۸۱	۹,۵۸۸,۶۴۱,۶۹۱	۹,۵۰۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
(۴۳,۱۷۲,۸۷۷)	۴,۳۹۰,۰۱۹,۱۲۷	۴,۳۴۶,۸۴۶,۲۵۰	۴,۳۵۰	۱۶,۳۷۸,۸۹۴	۴,۳۳۰,۴۶۷,۳۵۶	۴,۳۴۶,۸۴۶,۲۵۰	۴,۳۵۰	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
(۱)	۱	۰	۰	(۹۹۳,۸۷۰)	۹۹۳,۸۷۰	۰	۰	اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۳۲۸
۱۶,۹۰۴,۸۹۶	۷۲۴,۰۲۵,۵۳۹	۷۴۰,۹۳۰,۴۳۵	۱,۰۰۰	۸,۶۶۴,۷۱۳	۷۳۲,۲۶۵,۷۲۲	۷۴۰,۹۳۰,۴۳۵	۱,۰۰۰	اسناد خزانه-م ۱۵ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰
(۷)	۷	۰	۰	-	۰	۰	۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
(۱,۶۵۱,۷۷۰,۷۴۱)	۳۵,۲۱۰,۳۰۶,۶۹۸	۳۳,۵۵۸,۵۳۵,۹۵۴	۱,۵۳۰,۴۴۳	(۲۱۴,۳۸۴,۹۱۵)	۳۳,۷۷۲,۹۲۰,۸۷۱	۳۳,۵۵۸,۵۳۵,۹۵۴	۱,۵۳۰,۴۴۳	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 اردیبهشت ۱۳۹۷

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه				طی اردیبهشت 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	
(۸۷,۳۱۸,۳۷۶)	۳,۱۸۸,۶۳۰,۹۷۵	۳,۱۰۱,۳۱۲,۵۹۹	۱۹۰,۲۳۹	۶۶۵,۹۴۳	۲۷,۸۰۰,۲۷۲	۲۸,۴۶۶,۲۱۵	۱,۶۹۳	داروسازی سینا
(۳۶۷,۶۵۸,۷۲۸)	۲,۱۲۱,۶۶۹,۵۳۷	۱,۷۵۴,۰۱۰,۸۰۹	۶۱۹,۵۲۳	(۲۷۵,۸۵۱,۰۳۴)	۱,۰۹۱,۹۸۸,۵۵۷	۸۱۶,۱۳۷,۵۲۳	۳۵۰,۰۰۰	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۳۳,۴۵۰,۹۴۹)	۴,۱۸۸,۱۷۹,۱۶۷	۴,۱۵۴,۷۲۸,۲۱۸	۴,۱۵۰	(۱۶,۶۴۳,۸۳۹)	۱,۶۹۲,۴۲۸,۰۶۴	۱,۶۷۵,۷۸۴,۲۲۵	۱,۶۷۷	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۶,۵۹۹,۴۱۴	۳۹۶,۸۸۹,۴۵۵	۴۰۳,۴۸۸,۸۶۹	۴۸۰	۶,۵۹۹,۴۱۴	۳۹۶,۸۸۹,۴۵۵	۴۰۳,۴۸۸,۸۶۹	۴۸۰	اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸
(۱۰,۸۶۱,۴۱۴)	۲,۴۲۴,۰۶۲,۸۷۲	۲,۴۱۳,۲۰۱,۴۵۸	۲,۴۰۰	-	۰	۰	۰	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
(۴۹۲,۶۹۰,۰۵۳)	۱۲,۳۱۹,۴۳۲,۰۰۶	۱۱,۸۲۶,۷۴۱,۹۵۳	۸۱۶,۷۹۲	(۲۸۵,۲۳۹,۵۱۶)	۳,۲۰۹,۱۰۶,۳۴۸	۲,۹۲۳,۸۷۶,۸۳۲	۳۵۳,۸۵۰	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 اردیبهشت ۱۳۹۷

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

از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه				طی اردیبهشت 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	یادداشت ...	یادداشت ...	
۹۰,۰۶۱,۲۷۵	۱۶,۳۷۸,۸۹۴	(۱۶,۶۴۳,۸۳۹)	۸۹,۷۹۶,۳۲۰	۵۷۸,۱۱۰,۳۷۵	(۴۳,۱۷۲,۸۷۷)	(۳۳,۴۵۰,۹۴۹)	۵۰۱,۴۸۶,۵۴۹	مراجعه فولاد مبارکه ۹۷۰۴۲۹
۰	(۹۹۳,۸۷۰)	۶,۵۹۹,۴۱۴	۵,۶۰۵,۵۴۴	۰	(۱)	۶,۵۹۹,۴۱۴	۶,۵۹۹,۴۱۳	اسناد خزانه اسلامی ۹۷۱۲۲۸
۰	۰	۰	۰	۵۳,۱۹۶,۳۷۰	(۷)	(۱۰,۸۶۱,۴۱۴)	۴۲,۳۳۴,۹۴۹	اوراق مشارکت میدکو ماهانه ۲۰٪
۱۱۲,۹۷۸,۸۳۹	۹۱,۷۹۲,۸۶۲	۰	۲۰۴,۷۷۱,۷۰۱	۵۶۲,۴۷۸,۵۴۵	۱۵۱,۴۰۵,۶۹۱	۰	۵۶۲,۴۷۸,۵۴۵	شهرداری مشهد ۱۳۹۴-ارگ هومن
۱۷۳,۵۸۹,۵۹۷	(۸۰,۰۹۳,۳۸۹)	۰	۹۳,۴۹۶,۲۰۸	۸۲۷,۶۴۷,۵۹۷	(۶۳۲,۰۴۱,۹۳۶)	۰	۸۲۷,۶۴۷,۵۹۷	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
-	۸,۶۶۴,۷۱۳	۰	۸,۶۶۴,۷۱۳	۰	۱۶,۹۰۴,۸۹۶	۰	۱۶,۹۰۴,۸۹۶	اسناد خزانه-م ۱۵ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰
۳۷۶,۶۲۹,۷۱۱	۳۵,۷۴۹,۲۱۰	(۱۰,۰۴۴,۴۲۵)	۴۰۲,۳۳۴,۴۹۶	۲,۰۲۱,۴۳۲,۸۸۷	(۵۰۶,۹۰۴,۲۳۴)	(۳۷,۷۱۲,۹۴۹)	۱,۹۵۷,۴۵۱,۹۴۹	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

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

نام سپرده بانکی		طی اردیبهشت ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان اردیبهشت ماه	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
		یادداشت ...		یادداشت ...	
سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-	۹,۹۱۸,۱۹۸		۲۸,۵۷۱,۹۰۶	
جمع		۹,۹۱۸,۱۹۸	۰	۲۸,۵۷۱,۹۰۶	۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده نگر توسعه سینا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به اردیبهشت ۱۳۹۷

۲-۴- سایر درآمدها:

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