



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات

گزارش پرتفوی ماهانه

برای دوره منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات

شماره ثبت نزد سازمان بورس و اوراق بهادار: ۱۱۲۹۵

شماره ثبت: ۳۴۸۲۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات

گزارش پرتفوی ماهانه

برای دوره منتهی به تاریخ ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

با احترام

به پیوست گزارش افشای ماهانه پرتفوی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات برای دوره منتهی به تاریخ ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹ که در اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۹۳ مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ سازمان بورس و اوراق بهادار براساس سوابق، مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده به شرح زیر تقدیم می‌گردد.

شماره صفحه	
۱	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۲	سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۳	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۴	سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی
۵	درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری
۶	درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۷	درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۸	درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۹	سایر درآمدها
۱۰	اطلاعات آماری مرتبط به اوراق اختیار فروش تبعی خریداری شده
۱۱	اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده
۱۲	درآمد سود سهام
۱۳	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی
۱۴	سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار
۱۵	درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

گزارش فوق در تاریخ ۱۳۹۹/۰۴/۰۹ تهیه و تنظیم گردیده است.

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران

مدیر صندوق



مستوفی سوبانه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت بر توفی
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

۱- سوبانه گذاری ها
۱-۱ سوبانه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

تغییرات طی دوره										۱۳۹۹/۰۳/۳۱			
۱۳۹۹/۰۳/۳۱													
درصد به کل دارایی ها	حظی ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار در رسم	نسبت	فروش طی دوره	نسبت	خبره طی دوره	بهای تمام شده	نسبت	حظی ارزش فروش	بهای تمام شده	نسبت	شرکت
					نسبت	نسبت							
۹۴.۱۵٪	۱۲,۶۱۷,۶۸۴,۵۰۶,۱۳۸	۱,۹۸۵,۳۹۵,۳۴۶,۵۶۰	۲,۳۹۰	۵,۳۰۰,۵۱۵,۷۹۷	۲۳۳,۸۴۲,۸۳۴,۵۶۳	(۱۱۹,۱۰۰,۰۰۰)	۹۸,۵۸۱,۰۳۶,۹۳۰	۵۶,۴۰۸,۰۰۰	۹,۸۱۲,۹۰۲,۳۹۴,۳۳۴	۱,۹۳۰,۹۸۸,۷۰۲,۲۶۲	۵,۳۶۲,۲۰۷,۷۹۷	۵,۳۶۲,۲۰۷,۷۹۷	بیک صادرات ایران
۹۴.۱۵٪	۱۲,۶۱۷,۶۸۴,۵۰۶,۱۳۸	۱,۹۸۵,۳۹۵,۳۴۶,۵۶۰		۵,۳۰۰,۵۱۵,۷۹۷	۲۳۳,۸۴۲,۸۳۴,۵۶۳	(۱۱۹,۱۰۰,۰۰۰)	۹۸,۵۸۱,۰۳۶,۹۳۰	۵۶,۴۰۸,۰۰۰	۹,۸۱۲,۹۰۲,۳۹۴,۳۳۴	۱,۹۳۰,۹۸۸,۷۰۲,۲۶۲	۵,۳۶۲,۲۰۷,۷۹۷	۵,۳۶۲,۲۰۷,۷۹۷	چنج

شرکت
ملک صادرات ایران
جمع



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت بر تقوی
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

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

۱۳۹۹/۲/۲۹		تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۲/۲۹		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت			
درصد به	خالصی ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره	خرید طی دوره	خالصی ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود	نرخ اسمی
کل	دارایی ها	هر ورقه	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	پایه رفته شده	دارای معوز
								از سازمان	فرابورس	بلی	بلی
۰.۰۰٪	-	-	-	-	-	-	-	خیر	خیر	خیر	خیر
۰.۰۰٪	-	-	-	-	-	-	-	خیر	خیر	خیر	خیر
۰.۰۰٪	-	-	-	-	-	-	-	خیر	خیر	خیر	خیر
جمع	-	-	-	-	-	-	-	خیر	خیر	خیر	خیر



Handwritten signature in blue ink.

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت بر تفوی
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

۳-۱- سرمایه گذاری در سیرده بانکی

تغییرات طی دوره			مشخصات حساب بانکی			سیرده های بانکی		
۱۳۹۹/۲/۳۱			۱۳۹۹/۲/۳۱					
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سیرده	شماره حساب
٪	۴۵۹,۱۶۵,۲۳۸,۳۸۰	۱۱۹,۴۶۵,۲۱۲,۷۲۹	۱۷۲,۲۷۲,۵۸۸,۳۴۸	۴۰۶,۳۵۷,۸۶۲,۶۶۱	۰	۱۳۹۷/۰۶/۱۰	سیرده کوتاه مدت	۰۲۱۱۱۸۹۹۸۱۰۰۳
٪	۳۲,۸۶۲,۵۲۹	۰	۲۲۱,۱۷۶	۳۲,۶۴۱,۳۵۳	۰	۱۳۹۴/۰۷/۲۶	سیرده کوتاه مدت	۰۲۱۲۲۱۲۳۸۵۰۰۶
٪	۴۵۹,۱۹۸,۱۰۰,۸۰۹	۱۱۹,۴۶۵,۲۱۲,۷۲۹	۱۷۲,۲۷۲,۸۰۹,۵۲۴	۴۰۶,۳۹۰,۵۰۴,۰۱۴				
								صادرات مستقل مرکزی
								جمع



۱-۴- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

[illegible]

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

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

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه					طی خرداد ماه				
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درآمد از کل در آمد	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهم
	مبلغ	پادداشت ۷	پادداشت ۸	پادداشت ۵	مبلغ	پادداشت ۷	پادداشت ۸	پادداشت ۵	
درصد از کل									
درآمد ها									
۹۹.۹۶٪	۹,۵۴۵,۷۰۳,۳۷۵.۰۲۸	۴۴۹,۹۸۸,۸۰۶,۵۵۴	۹,۰۹۵,۷۱۴,۵۶۸,۴۷۴	۰	۹۹.۹۵٪	۲,۹۴۰,۰۳۵,۹۱۹,۴۴۸	۱۵۵,۰۵۳,۵۸۷,۳۰۸	۲,۷۸۴,۹۹۲,۳۳۲,۱۴۰	۰
۹۹.۹۶٪	۹,۵۴۵,۷۰۳,۳۷۵.۰۲۸	۴۴۹,۹۸۸,۸۰۶,۵۵۴	۹,۰۹۵,۷۱۴,۵۶۸,۴۷۴	۰	۹۹.۹۵٪	۲,۹۴۰,۰۳۵,۹۱۹,۴۴۸	۱۵۵,۰۵۳,۵۸۷,۳۰۸	۲,۷۸۴,۹۹۲,۳۳۲,۱۴۰	۰
جمع									

بانک صادرات ایران



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹
۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه-گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه			
شرح	درآمد سود اوراق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع	درآمد سود اوراق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش
جمع	یادداشت ۶	یادداشت ۸	یادداشت ۷		یادداشت ۶	یادداشت ۸	یادداشت ۷
اوراق مشارکت	.	.	.	.	.	.	.
اوراق اجاره	.	.	.	.	.	.	.
	.	.	.	.	.	.	.



[Handwritten signature in blue ink]

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

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

نام سپرده بانکی		طی خرداد ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی / گواهی سپرده یادداشت ۶	درصد سود به میانگین سپرده یادداشت ۶
صادرات سرو غربی	۰۲۱۱۱۸۹۹۸۱۰۰۳	۶۶۵,۷۹۶,۹۱۱	۱۰۰٪
صادرات مستقل مرکزی	۰۲۱۲۲۱۲۲۸۵۰۰۶	۲۲۱,۱۷۶	۰٪
جمع		۶۶۶,۰۱۸,۰۸۷	۱۰۰٪



برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

از ابتدای سال مالی تا
پایان خردادماه

1399/.1/31

مبلغ	مبلغ	
•	•	سایر درآمدها
•	•	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
•	•	جمع

سایر درآمدها

معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک

جمع



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات

صورت وضعیت بر تقوی

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

۳- اطلاعات آماری مرتبط با اوراق اختیار فروش تبعی خریداری شده توسط صندوق سرمایه گذاری:

۱۳۹۹/۰۲/۲۱				۱۳۹۹/۰۲/۲۱				نام سهام
نرخ سود موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ سود موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	
.....								شرکت
.....								شرکت



Handwritten signature in blue ink, appearing to read 'سپهر' (Sepher).

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
 صورت وضعیت بر تقوی
 برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۴- اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده
 (بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری)

نام اوراق بهادار	تعداد	قیمت پایانی	قیمت تعدیل شده	درصد تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	دلیل تعدیل
سهام شرکت						
اوراق مشارکت						



(Handwritten signature in blue ink)

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

فرسود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه					
شرح	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود
صادرات سروفرشی	۸۰۴,۴۱۱,۱۹۱	۰	۸۰۴,۴۱۱,۱۹۱	۶۶۵,۷۹۶,۹۱۱	۰	۶۶۵,۷۹۶,۹۱۱	۰	-	۱۰
صادرات مستقل مرکزی	۱,۵۳۱,۷۹۰	۰	۱,۵۳۱,۷۹۰	۲۲۱,۱۷۶	۰	۲۲۱,۱۷۶	۰	-	۲۲
جمع	۸۰۵,۹۴۲,۹۸۱	۰	۸۰۵,۹۴۲,۹۸۱	۶۶۶,۰۱۸,۰۸۷	۰	۶۶۶,۰۱۸,۰۸۷			



Handwritten signature in blue ink.

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کتیبه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه					مطابق خرداد ماه			۷- سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار	
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص بهای فروش	تعداد	شرح	
۴۴۹,۹۸۸,۸۰۶,۵۵۴	۴۱۴,۷۳۴,۰۳۳,۳۷۸	۸۶۴,۷۲۲,۸۳۹,۷۸۲	۶۴۶,۸۱۰,۳۳۷	۱۵۵,۰۵۳,۵۸۷,۳۰۸	۷۸,۷۸۹,۲۴۷,۲۵۵	۲۳۳,۸۴۲,۸۳۴,۵۶۳	۱۱۹,۱۰۰,۰۰۰	بانک صادرات ایران	
۴۴۹,۹۸۸,۸۰۶,۵۵۴	۴۱۴,۷۳۴,۰۳۳,۳۷۸	۸۶۴,۷۲۲,۸۳۹,۷۸۲	۶۴۶,۸۱۰,۳۳۷	۱۵۵,۰۵۳,۵۸۷,۳۰۸	۷۸,۷۸۹,۲۴۷,۲۵۵	۲۳۳,۸۴۲,۸۳۴,۵۶۳	۱۱۹,۱۰۰,۰۰۰	جمع	

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم برقریه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازار کردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۹۹

۸- جرآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه				طی خرداد ماه			
شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری
بانک صادرات ایران	۵,۳۰۰,۵۱۵,۷۹۷	۱۳,۶۱۷,۶۸۶,۵۰۶,۱۳۸	۹,۸۳۳,۶۹۴,۱۷۳,۹۹۸	۲,۷۸۴,۹۹۲,۳۳۲,۱۴۰	۵,۳۰۰,۵۱۵,۷۹۷	۱۳,۶۱۷,۶۸۶,۵۰۶,۱۳۸	۹,۸۳۳,۶۹۴,۱۷۳,۹۹۸
جمع	۵,۳۰۰,۵۱۵,۷۹۷	۱۳,۶۱۷,۶۸۶,۵۰۶,۱۳۸	۹,۸۳۳,۶۹۴,۱۷۳,۹۹۸	۲,۷۸۴,۹۹۲,۳۳۲,۱۴۰	۵,۳۰۰,۵۱۵,۷۹۷	۱۳,۶۱۷,۶۸۶,۵۰۶,۱۳۸	۹,۸۳۳,۶۹۴,۱۷۳,۹۹۸

ارزش دفتری برابر است با میانگین سوزن خالص ارزش فروش هر سهم برقره در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضررینر تعداد در پایان دوره

