



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهرصادرات

گزارش پرتفوی ماهانه

برای دوره منتهی به ۳۱ شهریور 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 شهریور ماه ۱۳۹۹

با احترام

به پیوست گزارش افشای ماهانه پرتفوی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات برای دوره منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹ که در اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۰۹۳ 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 ۱۳۹۹/۰۷/۰۹ تهیه و تنظیم گردیده است.



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازار دولتی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت برخطی
برای ماه منتهی به ۲۹ شهریور ماه ۹۹

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

۱۳۹۹/۰۶/۲۹				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۵/۲۹			
درصد به کل داراییها	طی ارزش افزوده	بهای تمام شده	قیمت بازار در سهم	نسبت	فروش طی دوره	نسبت	نسبت	نسبت	فروش طی دوره	نسبت	نسبت
۹۷.۵۸٪	۲۱,۱۱۴,۴۶۲,۷۸۱,۴۲۹	۲,۸۳۷,۰۴۷,۱۷۸,۲۸۳	۴,۱۹۰	۵,۲۴۴,۸۱۵,۷۱۷	۱۸,۴۶۴,۲۹۱,۸۲۷ (۵۱,۶۰۰,۰۰۰)	۳۵۵,۶۵۰,۳۴۱,۲۸۴	۱۰۰,۵۰۰,۰۰۰	۱۹,۰۳۴,۱۸۱,۸۲۴,۹۴۵	۲,۴۹۹,۸۴۸,۰۴۲,۵۰۵	۵,۲۴۵,۹۱۵,۷۱۷	بیشتر از ایران
۹۷.۵۸٪	۲۱,۱۱۴,۴۶۲,۷۸۱,۴۲۹	۲,۸۳۷,۰۴۷,۱۷۸,۲۸۳		۵,۲۴۴,۸۱۵,۷۱۷	۱۸,۴۶۴,۲۹۱,۸۲۷ (۵۱,۶۰۰,۰۰۰)	۳۵۵,۶۵۰,۳۴۱,۲۸۴	۱۰۰,۵۰۰,۰۰۰	۱۹,۰۳۴,۱۸۱,۸۲۴,۹۴۵	۲,۴۹۹,۸۴۸,۰۴۲,۵۰۵	۵,۲۴۵,۹۱۵,۷۱۷	جمع

۱۳۹۹/۰۶/۲۹



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

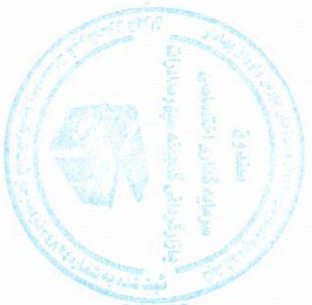
۳-۱- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت با علی الحساب

تغییرات طی دوره									
۱۳۹۹/۰۹/۳۱					۱۳۹۹/۰۹/۳۱				
درصد به	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره	خرید طی دوره	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد
داراییها			هر ورقه		مبلغ فروش	بهای تمام شده			
۰.۰۰٪	-	-	-	-	-	-	-	-	-
۰.۰۰٪	-	-	-	-	-	-	-	-	-
۰.۰۰٪	-	-	-	-	-	-	-	-	-
جمع									

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت

نام اوراق	دارای مجوز	پایه رتبه شده	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نوع سود	نوع سود	نوع سود	نوع سود
اوراق مشارکت	بله	بله	بله	بله	بله	بله	بله	بله	بله
اوراق اجاره	بله	بله	بله	بله	بله	بله	بله	بله	بله
جمع									

۱۳۹۹/۰۹/۳۱



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات

صورت وضعیت بر تئوی

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

۳-۱- سرمایه گذاری در سیره بانکی

۱۳۹۹/۹/۲۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۵/۳۱		منحصرات حساب بانکی			
درصد به کل داراییها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نوع سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سیره	شماره حساب	سیره های بانکی
۲.۳۳	۵۷۴,۳۴۰,۷۶۸۸۰.۶	۲۰.۶۰۷۴,۳۳۱,۸۶۷	۱۸۲,۰۴۲,۴۸۲,۹۷۷	۶۴۸,۳۷۲,۶۰۶,۶۹۴	۰	۱۳۹۲/۰۶/۱۰	سیره کوتاه مدت	۰۲۱۱۱۸۹۶۸۱-۰۳	صادرات سروفری
%	۳۳,۱۸۲,۷۱۹	۰	۲۳۲,۳۳۱	۳۳,۹۵۹,۳۸۸	۰	۱۳۹۴/۰۷/۲۶	سیره کوتاه مدت	۰۲۱۲۲۱۲۳۸۵-۰۶	صادرات مستقل مرکزی
۲.۳۳۰۰	۵۷۴,۳۷۳,۹۵۱,۵۲۵	۲۰.۶۰۷۴,۳۳۱,۸۶۷	۱۸۲,۰۴۲,۷۰۷,۳۰۸	۶۴۸,۴۰۵,۵۵۶,۰۸۴					جمع

۶۵/۲۹



صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

۱-۴- سرمایه‌گذاری در خواهی سپرده بانکی

[illegible]

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	۱۹,۰۰۹,۹۳۶,۳۵۵,۷۲۹	۱۰۰٪	۸۴,۴۶٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	*	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۱۰,۶۱۷,۳۷۳,۸۸۸	۰.۶٪	۰.۴۹٪
سایر درآمدها	۴-۲	*	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
جمع		۱۹,۰۲۰,۵۵۳,۶۲۹,۶۱۷	۱۰۰٪	۸۴,۹۰٪

Handwritten signature



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

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

از ابتدای سال مالی تا پایان شهریور ماه						طی شهریور ماه					
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درآمد از کل درآمدها	درصد از کل درآمدها	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درآمد از کل درآمدها	درصد از کل درآمدها
۹۹,۹۱٪	۱۹,۰۰۹,۹۳۶,۳۵۵,۷۲۹	۱,۱۸۹,۵۸۷,۲۲۲,۱۴۰	۱۷,۸۲۰,۳۴۹,۱۳۳,۵۸۹	۰	۹۹,۸۵٪	۲۹,۰۰۹,۲۵۵,۳۸۸,۸۴۸	۱۴۴,۳۹۹,۹۵۴,۲۵۹	۲,۷۶۴,۸۵۵,۴۳۴,۵۸۹	۰	۲۹,۰۰۹,۲۵۵,۳۸۸,۸۴۸	۱۴۴,۳۹۹,۹۵۴,۲۵۹
۰,۰۰٪	۱۹,۰۰۹,۹۳۶,۳۵۵,۷۲۹	۱,۱۸۹,۵۸۷,۲۲۲,۱۴۰	۱۷,۸۲۰,۳۴۹,۱۳۳,۵۸۹	۰	۰,۰۰٪	۲۹,۰۰۹,۲۵۵,۳۸۸,۸۴۸	۱۴۴,۳۹۹,۹۵۴,۲۵۹	۲,۷۶۴,۸۵۵,۴۳۴,۵۸۹	۰	۲۹,۰۰۹,۲۵۵,۳۸۸,۸۴۸	۱۴۴,۳۹۹,۹۵۴,۲۵۹
جمع											

۱۳۸۹



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

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

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

Handwritten signature



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

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

نام سپرده بانکی		طی شهریور ماه	از ابتدای سال مالی تا پایان شهریور ماه
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی / گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
		یادداشت ۶	یادداشت ۶
صادرات سروغریبی	۰۲۱۱۱۸۹۹۸۱۰۰۳	۳,۷۴۴,۹۲۶,۹۰۸	۱۰۰٪
صادرات مستقل مرکزی	۰۲۱۲۲۱۲۲۸۵۰۰۶	۲۲۳,۳۳۱	۰٪
جمع		۳,۷۴۵,۱۵۰,۲۳۹	۱۰۰٪



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

۲-۴- سایر درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان شهریورماه	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	
مبلغ	مبلغ	
.	.	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 شهریور ماه ۹۹

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

نام سهام	۱۳۹۹/۰۵/۳۱				۱۳۹۹/۰۶/۳۱			
	تعداد اوراق تبعی	قیمت اعمال	تاریخ اعمال	نرخ سود مؤثر	تعداد اوراق تبعی	قیمت اعمال	تاریخ اعمال	نرخ سود مؤثر
شرکت								
شرکت								

[Handwritten signature]



صورت وضعیت پرتقوی
برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

(بر اساس دستور العمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری)

1399/05/51

نام اوراق بهادار	تعادل	قیمت پایانی	قیمت تعدیل شده	درصد تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	دلیل تعدیل
سهام شرکت	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۵۰۰,۰۰۰	۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۰٪	۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	
اوراق مشارکت	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۸۰۰,۰۰۰	-۲۰٪	(۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	

10/3/20

صورت وضعیت در آمدها

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

Δ-γ-αλφω

اطلاعات مجتمع			طی شهر یور ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان شهر یور ماه			
تاریخ تشکیل مجتمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجتمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سهام	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
.....			*	*		*	*	*
.....			*	*		*	*	*
.....			*	*		*	*	*
.....			*	*		*	*	*

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

فر- سود اوراق بهادار با در آمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان شهریور ماه				طی شهریور ماه			
شرح	تاریخ دریافت سود	تاریخ سررسید	نرخ سود علی الحساب	درآمد سود	هزینه توزیل	خالص درآمد	درآمد سود
صادرات سروغریبی	۱۰	-	*	۳,۷۴۴,۹۲۶,۹۰۸	*	۳,۷۴۴,۹۲۶,۹۰۸	۱۰,۶۱۵,۰۷۱,۹۰۸
صادرات مستقل مرکزی	۲۲	-	*	۲۲۳,۳۳۱	*	۲۲۳,۳۳۱	۲,۲۰۱,۹۸۰
جمع				۳,۷۴۵,۱۵۰,۲۳۹	*	۳,۷۴۵,۱۵۰,۲۳۹	۱۰,۶۱۷,۲۷۳,۸۸۸

Handwritten signature



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

۷- سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان شهریور ماه						شماره		
شرح	تعداد	خالص بهای فروش	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	سود و زیان ناشی از فروش
فعلی	۰	۰	۰	۱۰۰,۰۰۰	۳,۱۴۵,۳۴۰,۷۰	۳,۱۹۹,۵۹۰,۲۶۴	-۵۴,۵۵۶,۱۹۴	۰
بلک صادرات ایران	۵۱,۶۰۰,۰۰۰	۱۸۴,۶۲۴,۷۹۱,۸۲۷	۴۰,۲۲۴,۸۲۷,۵۶۸	۱۴۴,۳۹۹,۹۵۴,۲۵۹	۸۹,۸۴۱,۰۲۷	۵۹۰,۷۲۲,۰۵۹,۵۷۶	۱,۱۸۹,۵۸۷,۲۲۳,۱۴۰	۰
جمع	۵۱,۶۰۰,۰۰۰	۱۸۴,۶۲۴,۷۹۱,۸۲۷	۴۰,۲۲۴,۸۲۷,۵۶۸	۱۴۴,۳۹۹,۹۵۴,۲۵۹	۸۹,۸۴۱,۰۲۷	۵۹۰,۷۲۲,۰۵۹,۵۷۶	۱,۱۸۹,۵۸۷,۲۲۳,۱۴۰	۰

ارزش دفتری برابر است با مانده با مانده ارزش فروش هر سهم بر مبنای در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضرر در پایان دوره

۱۳۹۹/۰۹/۳۱



صورت وضعیت در آمدها
برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۹۹

طی شهر یور ماه

۸- در آمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
بانک صادرات ایران	۵,۲۹۴,۸۱۵,۷۹۷	۲۲,۱۱۴,۴۶۲,۷۸۱,۴۴۹	۲۲,۱۱۴,۴۶۲,۷۸۱,۴۴۹	۴,۳۹۴,۱۱۳,۶۴۷,۸۶۰
جمع	۵,۲۹۴,۸۱۵,۷۹۷	۲۲,۱۱۴,۴۶۲,۷۸۱,۴۴۹	۲۲,۱۱۴,۴۶۲,۷۸۱,۴۴۹	۴,۳۹۴,۱۱۳,۶۴۷,۸۶۰

[Handwritten signature]

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم اوارد در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضرر تعدد در پایان دوره