

صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

افشای اطلاعات ماهانه پرتفوی

منتهی به تاریخ ۳۱ مرداد ماه ۱۳۹۸

باسلام

به پیوست، گزارش افشای ماهانه پرتفوی "صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا" مربوط به دوره مالی منتهی به تاریخ ۳۱ مرداد ماه ۱۳۹۸ در راستای اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۰۹۳ سازمان بورس و اوراق بهادار مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ براساس مدارک و اطلاعات موجود تا تاریخ ۵ شهریور ماه ۱۳۹۸، تهیه و تنظیم گردیده است.

باتشکر

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری
با درآمد ثابت
فیروزه آسیا
شماره ثبت: ۴۱۹۲۹

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1398/05/31

1- سرمایه گذاری ها

1-1- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

درصد به کل دارایی	1398/05/31				تغییرات طی دوره				1398/04/31			شرکت
	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				
0.00%	6-	6-	33,565	0					6-	6-	0	املاح ایران
0.91%	3,224,007,626	3,218,875,197	15,452	208,702	0	0	3,218,875,197	208,702				دارویی تامین
2.45%	8,676,570,501	7,126,464,010	3,384	2,600,000	5,099,906,740	1,600,000	570,530,643	200,000	11,011,580,000	10,941,449,680	4,000,000	سرمایه سبحان
0.00%	1	1	4,258	0					1	1	0	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
0.40%	1,406,155,000	1,381,379,961	2,833	500,000					1,361,593,750	1,381,379,961	500,000	سرمایه گذاری سپه
2.69%	9,561,854,000	9,114,865,441	2,810	3,400,000	1,656,589,282	600,000	0	0	10,841,257,000	10,723,371,107	4,000,000	سرمایه گذاری صدرتامین
0.07%	235,283,400	163,594,327	2,331	100,000	519,347,432	235,442	548,764,082	335,442				شرکت بیمه انکابی امین
0.14%	493,738,650	454,800,493	1,658	300,000	0	0	454,800,493	300,000				شرکت سرمایه گذاری خوارزمی
0.00%	1,013,145	978,918	8,650	116	0	0	978,918	116				غلنک سازان سپاهان
0.12%	435,214,875	338,362,746	4,370	100,000	0	0	338,362,746	100,000				قطعات اتومبیل
3.14%	11,136,450,525	10,783,084,361	1,969	5,700,000	587,543,652	300,000	11,350,615,117	6,000,000				لیزینگ صنعت
0.60%	2,137,094,174	2,147,293,772	6,816	317,000	0	0	2,147,293,772	317,000				همکاران سیستم
0.00%	2,912,488	2,099,988	26,028	113	0	0	2,100,197	113				بخش هجرت
10.51%	<u>37,310,294,379</u>	<u>34,731,799,209</u>	<u>114,124</u>	<u>13,225,931</u>	<u>7,863,387,106</u>	<u>2,735,442</u>	<u>18,632,321,165</u>	<u>7,461,373</u>	<u>23,214,430,745</u>	<u>23,046,200,743</u>	<u>8,500,000</u>	جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1398/05/31

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

1398/05/31				1398/04/31				نام سهام جمع
نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	
0		0	0	0		0	0	

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1398/05/31

2-1- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت با علی الحساب

نام اوراق	دارای مجوز از	پذیرفته شده در بورس یا	اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت		1398/04/31			تغییرات طی دوره			1398/05/31				
			تاریخ انتشار اوراق	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ سود	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	خرید طی دوره	فروش طی دوره	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	خالص ارزش فروش
اسناد خزانه - م14 بودجه 96	بلی	فرا بورس	1396/08/16	1398/10/16	0	0	54,966,200,592	54,639,585,000	60,000			930,739	54,639,585,000	55,850,199,228	15.74%
اسناد خزانه - م20 بودجه 97	بلی	فرا بورس	1397/11/24	1400/03/24	0	0		6,704,852,994	10,000	0	0	672,463	6,704,852,994	6,740,109,875	1.90%
اسناد خزانه - م24 بودجه 96	بلی	فرا بورس	1396/12/28	1399/06/25	0	0	79,942,000,000	73,690,408,197	100,000	0	0	810,037	76,425,990,057	83,383,406,570	23.50%
اسناد خزانه - م3 بودجه 97	بلی	فرا بورس	1397/03/21	1399/07/21	0	0		34,102,636,331	43,098	0	0	796,047	34,102,636,331	34,324,202,898	9.67%
اسناد خزانه - م4 بودجه 97	بلی	فرا بورس	1397/03/22	1399/10/22	0	0	74,546,214,782	68,760,548,443	100,000	0	0	756,591	91,324,695,596	98,287,599,790	27.70%
اسناد خزانه - م6 بودجه 96	بلی	فرا بورس	1396/07/22	1398/07/22	0	0	9,547,273,205	8,306,027,507	10,000			972,000	8,306,027,507	9,712,953,000	2.74%
اسناد خزانه - م6 بودجه 97	بلی	فرا بورس	1397/03/23	1399/04/23	0	0		8,341,032,866	10,000	0	0	836,839	8,341,032,866	8,363,961,728	2.36%
اسناد خزانه - م9 بودجه 97	بلی	فرا بورس	1397/05/13	1399/05/13	0	0	20,665,687,753	20,665,687,753	25,092	0	0	827,015	20,665,687,753	20,736,139,759	5.84%
جمع							219,001,688,579	205,396,569,147	270,000	0	0	6,601,731	300,510,508,104	317,398,572,848	89.45%

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1398/05/31

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

1398/05/31

نام اوراق بهادار	تعداد	قیمت پایانی	قیمت تعدیل شده	درصد تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	دلیل تعدیل
جمع					0	

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت پورتنفوی
برای ماه منتهی به 1398/05/31

3-1- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

1398/05/31		تغییرات طی دوره		1398/04/31		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
1.96%	6,944,542,018	99,773,485,757	106,716,089,824	1,937,951	0	1396/10/04	جاری	849-40-2547592-1	سپرده بانکی نزد بانک سامان
0.41%	1,454,048,935	106,716,089,824	107,147,470,024	1,022,668,735	0	1396/10/04	کوتاه مدت	849-810-2547592-1	سپرده بانکی نزد بانک سامان
<u>2.37%</u>	<u>8,398,590,953</u>	<u>206,489,575,581</u>	<u>213,863,559,848</u>	<u>1,024,606,686</u>					جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1398/05/31

4-1- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

1398/05/31				تغییرات طی دوره				1398/04/31		پنذیرفته شده در بورس یا	نرخ شکست	نرخ سود	تاریخ سررسید	گواهی سپرده بانکی جمع
درصد به کل دارایی	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی دوره مبلغ فروش	تعداد	خرید طی دوره بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده					
0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0					

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1398/05/31

2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

درصد از کل دارایی ها	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت	شرح
3.00%	40.21%	10,633,589,361	1-2	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
4.46%	59.87%	15,832,221,535	2-2	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
-0.01%	-0.08%	21,555,657-	3-2	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
0.00%	0.00%	0	4-2	سایر درآمدها
7.45%	100.00%	26,444,255,239		جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1398/05/31

درآمد سود سهام

1398/05/31			طی دوره			اطلاعات مجمع		نام سهام
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	
0	0	0	0	0	0			
جمع								

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1398/05/31

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

1398/05/31			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
1-	0	1-				21	1397/12/25	-	اوراق مشارکت ملی نفت ایران 1
1-	0	1-				21	1397/12/25	-	اوراق مشارکت ملی نفت ایران 2
21,555,657-	0	21,555,657-				0	-	1398/05/26	کوتاه مدت-1-2547592-810-849-سامان
<u>21,555,659-</u>	<u>0</u>	<u>21,555,659-</u>	<u>0</u>	<u>0</u>	<u>0</u>				جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1398/05/31

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

1398/05/31				طی دوره				شرح
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	
237,284,241	14,723,741,429	14,961,025,670	17,000					اسنادخزانه-م12 بودجه-96 981114
228,985,998	8,133,562,759	8,362,548,757	11,000					اسنادخزانه-م24 بودجه-96 990625
243,409,310	11,384,375,434	11,627,784,744	12,000					اسنادخزانه-م8 بودجه-96 980411
237,441,782	8,885,938,968	9,123,380,750	10,000					اسنادخزانه-م8 بودجه-97 980723
122,915,995	4,718,571,380	4,841,487,375	5,000					اسنادخزانه-م9 بودجه-96 980411
1,353,896,716	12,982,940,055	14,336,836,771	1,000,000					تولیدات پتروشیمی قائد بصیر
764,603,881	4,335,302,859	5,099,906,740	1,600,000	764,603,881	4,335,302,859	5,099,906,740	1,600,000	سرمایه سبحان
2,870,500,127	6,842,253,537	9,712,753,664	3,578,947					سرمایه گذاری توسعه صنعتی
64,394,334	1,592,194,948	1,656,589,282	600,000	64,394,334	1,592,194,948	1,656,589,282	600,000	سرمایه گذاری صدرتامین
139,291,127	380,056,305	519,347,432	235,442	139,291,127	380,056,305	519,347,432	235,442	شرکت بیمه انکایی امین
503,009,531	6,179,636,782	6,682,646,313	3,500,000					صنعت و معدن
25,797,756	561,745,896	587,543,652	300,000	25,797,756	561,745,896	587,543,652	300,000	لیزینگ صنعت
2,333,600,719	5,553,964,858	7,887,565,577	500,000					نیرو کلر
9,125,131,517	86,274,285,210	95,399,416,727	11,369,389	994,087,098	6,869,300,008	7,863,387,106	2,735,442	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 با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1398/05/31

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

1398/05/31				طی دوره				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	
1,210,614,228	54,639,585,000	55,850,199,228	60,000	883,998,636	54,966,200,592	55,850,199,228	60,000	اسنادخز انهم 14 بودجه 96- 981016
35,256,881	6,704,852,994	6,740,109,875	10,000	35,256,881	6,704,852,994	6,740,109,875	10,000	اسنادخز انهم 20 بودجه 97- 000324
6,160,315,866	77,223,090,704	83,383,406,570	103,400	705,824,710	82,677,581,860	83,383,406,570	103,400	اسنادخز انهم 24 بودجه 96- 990625
221,566,567	34,102,636,331	34,324,202,898	43,098	221,566,567	34,102,636,331	34,324,202,898	43,098	اسنادخز انهم 3 بودجه 97- 990721
6,221,644,301	92,065,955,489	98,287,599,790	130,000	1,177,237,855	97,110,361,935	98,287,599,790	130,000	اسنادخز انهم 4 بودجه 97- 991022
819,405,500	8,893,547,500	9,712,953,000	10,000	165,679,795	9,547,273,205	9,712,953,000	10,000	اسنادخز انهم 6 بودجه 96- 980722
22,928,862	8,341,032,866	8,363,961,728	10,000	22,928,862	8,341,032,866	8,363,961,728	10,000	اسنادخز انهم 6 بودجه 97- 990423
70,452,006	20,665,687,753	20,736,139,759	25,092	70,452,006	20,665,687,753	20,736,139,759	25,092	اسنادخز انهم 9 بودجه 97- 990513
0	6-	6-	0	0	6-	6-	0	املاح ایران
5,132,429	3,218,875,197	3,224,007,626	208,702	5,132,429	3,218,875,197	3,224,007,626	208,702	دارویی تامین
1,550,106,491	7,126,464,010	8,676,570,501	2,600,000	1,479,976,171	7,196,594,330	8,676,570,501	2,600,000	سرمایه سبحان
0	1	1	0	0	1	1	0	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
24,775,039	1,381,379,961	1,406,155,000	500,000	44,561,250	1,361,593,750	1,406,155,000	500,000	سرمایه گذاری سپه
446,988,559	9,114,865,441	9,561,854,000	3,400,000	329,102,666	9,232,751,334	9,561,854,000	3,400,000	سرمایه گذاری صدر تامین
71,689,073	163,594,327	235,283,400	100,000	71,689,073	163,594,327	235,283,400	100,000	شرکت بیمه اتکایی امین
38,938,157	454,800,493	493,738,650	300,000	38,938,157	454,800,493	493,738,650	300,000	شرکت سرمایه گذاری خوارزمی
34,227	978,918	1,013,145	116	34,227	978,918	1,013,145	116	غلنک سازان سپاهان
96,852,129	338,362,746	435,214,875	100,000	96,852,129	338,362,746	435,214,875	100,000	قطعات اتومبیل
353,366,164	10,783,084,361	11,136,450,525	5,700,000	353,366,164	10,783,084,361	11,136,450,525	5,700,000	لیزینگ صنعت
10,199,598-	2,147,293,772	2,137,094,174	317,000	10,199,598-	2,147,293,772	2,137,094,174	317,000	همکاران سیستم

<u>812,500</u>	<u>2,099,988</u>	<u>2,912,488</u>	<u>113</u>	<u>812,500</u>	<u>2,099,988</u>	<u>2,912,488</u>	<u>113</u>	بخش هجرت
<u>17,340,679,381</u>	<u>#####</u>	<u>#####</u>	<u>13,617,521</u>	<u>5,693,210,480</u>	<u>#####</u>	<u>#####</u>	<u>13,617,521</u>	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 با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1398/05/31

1-2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

1398/05/31					طی دوره					سهام
درصد از کل درآمد ها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمد ها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
0.00%	812,500	0	812,500	0	0.01%	812,500	0	812,500	0	پخش هجرت
0.02%	5,132,429	0	5,132,429	0	0.08%	5,132,429	0	5,132,429	0	سرمایه گذاری دارویی تامین
8.75%	2,314,710,372	764,603,881	1,550,106,491	0	33.56%	2,244,580,052	764,603,881	1,479,976,171	0	سرمایه گذاری سبحان
0.09%	24,775,039	0	24,775,039	0	0.67%	44,561,250	0	44,561,250	0	سرمایه گذاری سپه
1.93%	511,382,893	64,394,334	446,988,559	0	5.88%	393,497,000	64,394,334	329,102,666	0	سرمایه گذاری صدرتامین
0.80%	210,980,200	139,291,127	71,689,073	0	3.15%	210,980,200	139,291,127	71,689,073	0	شرکت بیمه اتکالی امین
0.15%	38,938,157	0	38,938,157	0	0.58%	38,938,157	0	38,938,157	0	شرکت سرمایه گذاری خوارزمی
0.00%	34,227	0	34,227	0	0.00%	34,227	0	34,227	0	غلتهک سازان سپاهان
0.37%	96,852,129	0	96,852,129	0	1.45%	96,852,129	0	96,852,129	0	گروه صنعتی قطعات اتومبیل ایران
1.43%	379,163,920	25,797,756	353,366,164	0	5.67%	379,163,920	25,797,756	353,366,164	0	لیزینگ صنعت
-0.04%	10,199,598-	0	10,199,598-	0	-0.15%	10,199,598-	0	10,199,598-	0	همکاران سیستم
5.12%	1,353,896,716	1,353,896,716	0	0						تولیدات پتروشیمی قائد بصیر
10.85%	2,870,500,127	2,870,500,127	0	0						سرمایه گذاری توسعه صنعتی
1.90%	503,009,531	503,009,531	0	0						سرمایه گذاری صنعت و معدن
8.82%	2,333,600,719	2,333,600,719	0	0						نیرو کلر
40.21%	10,633,589,361	8,055,094,191	2,578,495,170	0	50.91%	3,404,352,266	994,087,098	2,410,265,168	0	جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1398/05/31

2-2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

1398/05/31				طی دوره				
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
1,210,614,228	0	1,210,614,228	0	883,998,636	0	883,998,636	0	اسنادخزانه-م14 بودجه-96 981016
35,256,881	0	35,256,881	0	35,256,881	0	35,256,881	0	اسنادخزانه-م20 بودجه-97 000324
6,389,301,864	228,985,998	6,160,315,866	0	705,824,710	0	705,824,710	0	اسنادخزانه-م24 بودجه-96 990625
221,566,567	0	221,566,567	0	221,566,567	0	221,566,567	0	اسنادخزانه-م3 بودجه-97 990721
6,221,644,301	0	6,221,644,301	0	1,177,237,855	0	1,177,237,855	0	اسنادخزانه-م4 بودجه-97 991022
819,405,500	0	819,405,500	0	165,679,795	0	165,679,795	0	اسنادخزانه-م6 بودجه-96 980722
22,928,862	0	22,928,862	0	22,928,862	0	22,928,862	0	اسنادخزانه-م6 بودجه-97 990423
70,452,006	0	70,452,006	0	70,452,006	0	70,452,006	0	اسنادخزانه-م9 بودجه-97 990513
237,284,241	237,284,241	0	0					اسنادخزانه-م12 بودجه-96 981114
243,409,310	243,409,310	0	0					اسنادخزانه-م8 بودجه-96 980411
237,441,782	237,441,782	0	0					اسنادخزانه-م8 بودجه-97 980723
122,915,995	122,915,995	0	0					اسنادخزانه-م9 بودجه-96 980411
1-	0	0	1-					اوراق مشارکت ملی نفت ایران 1
1-	0	0	1-					اوراق مشارکت ملی نفت ایران 2
<u>15,832,221,535</u>	<u>1,070,037,326</u>	<u>14,762,184,211</u>	<u>2-</u>	<u>3,282,945,312</u>	<u>0</u>	<u>3,282,945,312</u>	<u>0</u>	جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1398/05/31

3-2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

1398/05/31		طی دوره		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
100.00%	21,555,657-			849-810-2547592-1	سپرده بانکی کوتاه مدت - سامان
100.00%	21,555,657-	0.00%	0		جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1398/05/31

4-2- سایر درآمدها:

<u>1398/05/31</u>	<u>ظی دوره</u>	<u>سایر درآمدها</u>
<u>مبلغ</u>	<u>مبلغ</u>	<u>جمع</u>
<u>0</u>	<u>0</u>	