

صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

افشای اطلاعات ماهانه پرتفوی

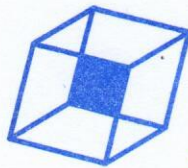
منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷

باسلام

به پیوست، گزارش افشای ماهانه پرتفوی "صندوق سرمایه‌گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا" مربوط به دوره مالی منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۷ در راستای اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۹۳ سازمان بورس و اوراق بهادار مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ براساس مدارک و اطلاعات موجود تا تاریخ ۱۷ فروردین ماه ۱۳۹۷، تهیه و تنظیم گردیده است.

باتشکر

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری
با درآمد ثابت
فیروزه آسیا
شماره ثبت: ۴۱۹۴۹

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1397/12/29

1- سرمایه گذاری ها

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

درصد به کل دارایی	1397/12/29				تغییرات طی دوره				1397/11/30			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	
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده				
0.00%	6-	6-	29,850	0					6-	6-	0	املاح ایران
8.01%	13,124,100,000	12,665,290,793	13,395	1,000,000	0	0	8,683,228,537	680,000	3,916,549,600	3,982,062,256	320,000	تولیدات پتروشیمی قاند بصیر
3.59%	5,877,586,665	4,560,852,200	1,920	3,078,947	7,683,564,400	4,000,000	2,783,386,913	1,500,000	10,455,846,283	6,280,378,398	5,578,947	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
11.59%	19,001,686,659	17,226,142,987	45,165	4,078,947	7,683,564,400	4,000,000	11,466,615,450	2,180,000	14,372,395,877	10,262,440,648	5,898,947	جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1397/12/29

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

1397/12/29

1397/11/30

نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نام سهام
0		0	0	0		0	0	جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به 1397/12/29

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

درصد به کل دارایی	1397/12/29				تغییرات طی دوره				1397/11/30			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت						
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره مبلغ فروش	تعداد	خرید طی دوره بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود	نرخ سود	تاریخ سررسید اوراق	تاریخ انتشار اوراق	پنیرفته شده در بورس یا	دارای مجوز از	نام اوراق
					138,731,032,278	140,000	0	0	137,800,022,500	122,496,502,880	140,000	0	0	1397/12/28	1395/12/28	فراپورس	بلی	اسناد خزانه اسلامی 971228
45.11%	73,947,549,130	73,053,025,070	739,702	100,000	0	0	73,053,025,070	100,000				0	0	1399/06/25	1396/12/28	فراپورس	بلی	اسناد خزانه - م 24 بودجه 96- 990625
21.03%	34,469,941,161	33,728,681,268	688,338	50,000					34,020,317,375	33,728,681,268	50,000	0	0	1399/10/22	1397/03/22	فراپورس	بلی	اسناد خزانه - م 4 بودجه 97- 991022-97
5.43%	8,893,547,500	8,306,027,507	892,275	10,000					8,813,605,500	8,306,027,507	10,000	0	0	1398/07/22	1396/07/22	فراپورس	بلی	اسناد خزانه - م 6 بودجه 96- 980722-96
6.35%	10,408,348,472	9,062,123,390	945,162	11,000					10,258,856,932	9,062,123,390	11,000	0	0	1398/04/11	1396/08/11	فراپورس	بلی	اسناد خزانه - م 8 بودجه 96- 980411-96
5.42%	8,892,558,218	8,407,606,092	889,257	10,000					8,794,169,601	8,407,606,092	10,000	0	0	1398/07/23	1397/04/23	فراپورس	بلی	اسناد خزانه - م 8 بودجه 97- 980723-97
2.88%	4,722,084,005	4,429,203,844	945,258	5,000					4,661,867,694	4,429,203,844	5,000	0	0	1398/04/11	1396/08/11	فراپورس	بلی	اسناد خزانه - م 9 بودجه 96- 980411-96
86.22%	141,334,028,486	136,986,667,171	5,099,992	186,000	138,731,032,278	140,000	73,053,025,070	100,000	204,348,839,602	186,430,144,981	226,000							جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1397/12/29

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)

1397/12/29

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 پورتفوی
برای ماه منتهی به 1397/12/29

3-1- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

1397/12/29		تغییرات طی دوره		1397/11/30		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
-0.34%	550,422,330-	77,902,333,631	77,348,599,777	3,311,524	0	1396/10/04	جاری	849-40-2547592-1	سپرده بانکی نزد بانک سامان
3.03%	4,974,397,924	77,903,301,777	81,020,664,294	1,857,035,407	10	1396/10/04	کوتاه مدت	849-810-2547592-1	سپرده بانکی نزد بانک سامان
<u>2.70%</u>	<u>4,423,975,594</u>	<u>155,805,635,408</u>	<u>158,369,264,071</u>	<u>1,860,346,931</u>					جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به 1397/12/29

4-1. سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

1397/12/29			تغییرات طی دوره				1397/11/30			پذیرفته شده در بورس یا	نرخ شکست	نرخ سود	تاریخ سررسید	گواهی سپرده بانکی
درصد به کل دارایی	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی دوره تعداد	خرید طی دوره تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد					
0.00%	0	0	0	0	0	0	0	0	0					جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1397/12/29

2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

درصد از کل دارایی ها	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت	شرح
14.84%	37.61%	24,334,447,764	1-2	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
24.39%	61.79%	39,981,159,846	2-2	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
0.13%	0.33%	214,268,290	3-2	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
0.11%	0.28%	179,219,107	4-2	سایر درآمدها
39.47%	100.00%	64,709,095,007		جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1397/12/29

درآمد سود سهام

1397/12/29			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	تاریخ تشکیل مجمع	
198,000,000	0	198,000,000				1,800	110,000	1397/02/15	املاح ایران
440,000,000	0	440,000,000				110	4,000,000	1397/11/14	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
1,100,000,000	0	1,100,000,000				100	11,000,000	1397/04/17	سیمان داراب
<u>1,738,000,000</u>	<u>0</u>	<u>1,738,000,000</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 1397/12/29

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

1397/12/29			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
330,061,312	0	330,061,312	2,927,055-	0	2,927,055-	21	1399/02/14	1398/01/14	رایتل ماهانه 21 %
214,003,042	265,248-	214,268,290	33,361,851	288,979-	33,650,830	10	-	1397/12/26	کوتاه مدت-1-2547592-810-849-سامان
306,771,887	0	306,771,887				20	1397/06/31	-	اجاره فولادکوه
1,393,273,072	0	1,393,273,072				21	1397/12/25	-	اوراق مشارکت ملی نفت ایران 1
1,989,701,164	0	1,989,701,164				21	1397/12/25	-	اوراق مشارکت ملی نفت ایران 2
1-	0	1-				23	1397/09/02	-	ساخت(استصناع)توسعه ملی
2	0	2				20	1396/12/27	-	مشارکت شهرداری مشهد
1-	0	1-				18	1396/12/27	-	مشارکت شهرداری مشهد-3ماهه 18%
4-	0	4-				20	1397/01/25	-	مشارکت میدکو
10-	0	10-				20	1397/01/23	-	مشارکت نفت و گاز پرشیا 970123
4,233,810,463	265,248-	4,234,075,711	30,434,796	288,979-	30,723,775				جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1397/12/29

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

1397/12/29				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	
150,304,462	7,752,433,526	7,902,737,988	7,700					رایتل ماهانه 21 %
23,260,000-	32,021,810,000	31,998,550,000	32,000					اجاره فولادکاو
17,229,345,600	146,224,926,253	163,454,271,853	167,442	16,195,798,322	122,535,233,956	138,731,032,278	140,000	اسناد خزانه اسلامی 971228
113,543,520	2,286,456,480	2,400,000,000	2,400					اسناد خزانه-م 11 بودجه 96- 970913
1,555,175,938	56,467,658,409	58,022,834,347	60,000					اسناد خزانه-م 1 بودجه 96- 970508
601,927,413	19,398,072,587	20,000,000,000	20,000					اسناد خزانه-م 1 بودجه 97- 970920
5,177,106,782	115,057,524,704	120,234,631,486	123,900					اسناد خزانه-م 2 بودجه 96- 970612
6,000,604,279	87,259,797,328	93,260,401,607	95,000					اسناد خزانه-م 3 بودجه 96- 970710
17,392,569	457,213,093	474,605,662	700					اسناد خزانه-م 4 بودجه 97- 991022
458,446,599	9,414,390,403	9,872,837,002	10,000					اسناد خزانه-م 5 بودجه 96- 970926
126,339,202	1,646,372,653	1,772,711,855	2,000					اسناد خزانه-م 8 بودجه 96- 980411
103,484,149-	1,433,815,709	1,330,331,560	110,000					املاح ایران
209,147,975	19,776,391,997	19,985,539,972	20,000					اوراق مشارکت ملی نفت ایران 1
2,083,229-	29,986,867,064	29,984,783,835	30,000					اوراق مشارکت ملی نفت ایران 2
113,876,200-	1,119,871,176	1,005,994,976	100,000					تولید و صادرات ریشمک
11,762,218	494,828,043	506,590,261	40,000					تولیدات پتروشیمی قائد بصیر
4,470,043,384	4,017,869,352	8,487,912,736	3,000,000					سرمایه گذاری اعتبار ایران

10,068,078,547	15,195,815,649	25,263,894,196	10,000,000	2,765,879,046	4,917,685,354	7,683,564,400	4,000,000	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
25,148,546	4,961,566,209	4,986,714,755	2,200,000					سرمایه گذاری مسکن الوند
3,538,375,853	10,201,575,582	13,739,951,435	11,000,000					سیمان داراب
2,254,858,728	15,618,506,934	17,873,365,662	10,000,000					صندوق بازنشستگی
128,775,260	1,794,018,143	1,922,793,403	1,510,000					صنعت و معدن
697,884,643	4,864,792,028	5,562,676,671	600,000					قند اصفهان
14,998,376	653,420,403	668,418,779	500,000					لیزینگ صنعت
9,605,097	45,223,519	54,828,616	1,898					پتروشیمی پارس
<u>52,616,161,413</u>	<u>588,151,217,244</u>	<u>640,767,378,657</u>	<u>39,633,040</u>	<u>18,961,677,368</u>	<u>127,452,919,310</u>	<u>146,414,596,678</u>	<u>4,140,000</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 1397/12/29

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

1397/12/29				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	
				15,164,135,608-	15,164,135,608	0	0	اسناد خزانه اسلامی 971228
				2	2-	0	0	اسناد خزانه 1م بودجه 96- 970508
894,524,060	73,053,025,070	73,947,549,130	100,000	894,524,060	73,053,025,070	73,947,549,130	100,000	اسناد خزانه 24م بودجه 96- 990625
741,259,893	33,728,681,268	34,469,941,161	50,000	449,623,786	34,020,317,375	34,469,941,161	50,000	اسناد خزانه 4م بودجه 97- 991022
587,519,993	8,306,027,507	8,893,547,500	10,000	79,942,000	8,813,605,500	8,893,547,500	10,000	اسناد خزانه 6م بودجه 96- 980722
1,346,225,082	9,062,123,390	10,408,348,472	11,000	149,491,540	10,258,856,932	10,408,348,472	11,000	اسناد خزانه 8م بودجه 96- 980411
484,952,126	8,407,606,092	8,892,558,218	10,000	98,388,617	8,794,169,601	8,892,558,218	10,000	اسناد خزانه 8م بودجه 97- 980723
292,880,161	4,429,203,844	4,722,084,005	5,000	60,216,311	4,661,867,694	4,722,084,005	5,000	اسناد خزانه 9م بودجه 96- 980411
0	6-	6-	0	0	6-	6-	0	املاح ایران
458,809,207	12,665,290,793	13,124,100,000	1,000,000	524,321,863	12,599,778,137	13,124,100,000	1,000,000	تولیدات پتروشیمی قائد بصیر
1,135,468,254	4,742,118,411	5,877,586,665	3,078,947	2,399,525,577-	8,277,112,242	5,877,586,665	3,078,947	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
5,941,638,776	154,394,076,369	160,335,715,145	4,264,947	15,307,153,006-	175,642,868,151	160,335,715,145	4,264,947	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 1397/12/29

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

1397/12/29					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	
0.15%	94,515,851	103,484,149-	0	198,000,000	0.00%	0	0	0	0	املاح ایران
0.01%	9,605,097	9,605,097	0	0	0.00%	0	0	0	0	پتروشیمی پارس
-0.18%	113,876,200-	113,876,200-	0	0	0.00%	0	0	0	0	تولید و صادرات ریشمک
0.73%	470,571,425	11,762,218	458,809,207	0	13.74%	524,321,863	0	524,321,863	0	تولیدات پتروشیمی قاند بصیر
6.91%	4,470,043,384	4,470,043,384	0	0	0.00%	0	0	0	0	سرمایه گذاری اعتبار ایران
17.99%	11,643,546,801	10,068,078,547	1,135,468,254	440,000,000	9.60%	366,353,469	2,765,879,046	2,399,525,577-	0	سرمایه گذاری توسعه صنعتی
0.20%	128,775,260	128,775,260	0	0	0.00%	0	0	0	0	سرمایه گذاری صنعت و معدن
0.04%	25,148,546	25,148,546	0	0	0.00%	0	0	0	0	سرمایه گذاری مسکن الوند
7.17%	4,638,375,853	3,538,375,853	0	1,100,000,000	0.00%	0	0	0	0	سیمان داراب
3.48%	2,254,858,728	2,254,858,728	0	0	0.00%	0	0	0	0	صندوق بازنشستگی
1.08%	697,884,643	697,884,643	0	0	0.00%	0	0	0	0	قند اصفهان
0.02%	14,998,376	14,998,376	0	0	0.00%	0	0	0	0	لیزینگ صنعت
37.61%	24,334,447,764	21,002,170,303	1,594,277,461	1,738,000,000	23.35%	890,675,332	2,765,879,046	1,875,203,714-	0	جمع

صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت فیروزه آسیا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1397/12/29

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

جمع	1397/12/29			طی دوره				
	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
17,229,345,600	17,229,345,600	0	0	1,031,662,714	16,195,798,322	15,164,135,608-	0	اسناد خزانه اسلامی 971228
480,365,774	150,304,462	0	330,061,312	2,927,055-	0	0	2,927,055-	رایتل ماهانه 21 %
283,511,887	23,260,000-	0	306,771,887	0	0	0	0	اجاره فولادکاو
113,543,520	113,543,520	0	0	0	0	0	0	اسناد خزانه سم 11 بودجه 96-
								970913
1,555,175,938	1,555,175,938	0	0	2	0	2	0	اسناد خزانه سم 1 بودجه 96-
								970508
601,927,413	601,927,413	0	0	0	0	0	0	اسناد خزانه سم 1 بودجه 97-
								970920
894,524,060	0	894,524,060	0	894,524,060	0	894,524,060	0	اسناد خزانه سم 24 بودجه 96-
								990625
5,177,106,782	5,177,106,782	0	0	0	0	0	0	اسناد خزانه سم 2 بودجه 96-
								970612
6,000,604,279	6,000,604,279	0	0	0	0	0	0	اسناد خزانه سم 3 بودجه 96-
								970710
758,652,462	17,392,569	741,259,893	0	449,623,786	0	449,623,786	0	اسناد خزانه سم 4 بودجه 97-
								991022
458,446,599	458,446,599	0	0	0	0	0	0	اسناد خزانه سم 5 بودجه 96-
								970926
587,519,993	0	587,519,993	0	79,942,000	0	79,942,000	0	اسناد خزانه سم 6 بودجه 96-
								980722
1,472,564,284	126,339,202	1,346,225,082	0	149,491,540	0	149,491,540	0	اسناد خزانه سم 8 بودجه 96-
								980411
484,952,126	0	484,952,126	0	98,388,617	0	98,388,617	0	اسناد خزانه سم 8 بودجه 97-
								980723
292,880,161	0	292,880,161	0	60,216,311	0	60,216,311	0	اسناد خزانه سم 9 بودجه 96-
								980411
1,602,421,047	209,147,975	0	1,393,273,072	0	0	0	0	اوراق مشارکت ملی نفت ایران 1
1,987,617,935	2,083,229-	0	1,989,701,164	0	0	0	0	اوراق مشارکت ملی نفت ایران 2

1-	0	0	1-	0	0	0	0	ساخت(استصناع)توسعه ملي
2	0	0	2	0	0	0	0	مشاركت شهرداري مشهد
1-	0	0	1-	0	0	0	0	مشاركت شهرداري مشهد- 3ماهه 18%
4-	0	0	4-	0	0	0	0	مشاركت ميدكو
10-	0	0	10-	0	0	0	0	مشاركت نفت و گاز پرشيا 970123
<u>39,981,159,846</u>	<u>31,613,991,110</u>	<u>4,347,361,315</u>	<u>4,019,807,421</u>	<u>2,760,921,975</u>	<u>16,195,798,322</u>	<u>13,431,949,292-</u>	<u>2,927,055-</u>	جمع