



صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت
نگین سامان
شماره ثبت: ۳۰۹۳۱

تاریخ :
شماره :
پیوست :

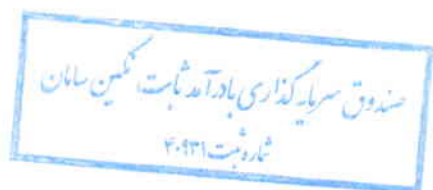
باسلام؛

عطف به ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۰۹۳ سازمان بورس اوراق بهادار مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ گزارش
پرتفوی ماهیانه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۸ صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین
سامان به پیوست تقدیم می گردد.

باتشکر

حمیدرضا مهرآور

مدیر صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین سامان



صندوق سرمایه گذاری یاد آمد ثابت نگین

صورت وضعیت پر تقویٰ

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

[illegible]

صندوق سرمایه گذاری بادرآمد ثابت نگین

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

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

۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۱۳۹۷/۱۲/۲۹

نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	تعداد اوراق تبعی	نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نام سهام
۸,۲۲۴	۱۳۹۸/۱۰/۰۹	۷,۸۷۸	۲۳,۰۹۲,۰۱۷	۲۳,۰۹۲,۰۱۷	۷,۵۱۹	۱۳۹۸/۱۰/۰۹	۷,۸۷۸	۲۳,۰۹۲,۰۱۷	اختیارات ففوز-۱۰۳۷۰-۹۸/۱۰/۰۹
۸,۲۲۴		۷,۸۷۸			۷,۵۱۹		۷,۸۷۸		

صندوق سرمایه گذاری یادآور ثابت زمین

صورت وضعیت برتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۲-۱- سیر ماهانه کداری در اورانی بهداشت با درآمد نامعکس الحساب

[illegible]

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری بادرآمد ثابت نگین

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

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)

۱۳۹۸/۰۱/۳۱

دلیل تعدیل	خالصی ارزش فروش تعدیل شده	درصد تعدیل	قیمت تعدیل شده	قیمت پایانی	تعداد	نام اوراق بهادار
به دلیل جلوگیری از تسکینات شدید NAV و ورود خسارت به سرمایه گذاران در اثر عدم نقدشوندگی سریع اوراق موجود در پرتفوی	۴۴۴,۵۵۵,۱۵۹,۹۶۵	۰/۰۴۳۱۳۲۷	۹۱۷,۰۶۸	۸۸۰,۰۰۰	۴۸۵,۰۰۰	اجاره دولت واجد شرایط خاص ۹۹۱۳۲۴
به دلیل جلوگیری از تسکینات شدید NAV و ورود خسارت به سرمایه گذاران در اثر عدم نقدشوندگی سریع اوراق موجود در پرتفوی	۳۲۶,۱۱۹,۳۱۴,۹۵۶	۰/۰۲۵۷۳۲۲	۹۲۰,۰۹۰	۸۹۷,۰۰۸	۳۵۴,۷۰۰	مشارکت دولت بانشرایط خاص ۱۴۰۰۱۰
	۷۷۰,۵۷۴,۸۳۰,۹۲۱					

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۲- درآمدها حاصل از سرمایه گذاری ها

درصد از کل دارایی ها	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت	شرح
۲/۶۷٪	۴۵/۲۴٪	۳۸,۹۴۴,۹۸۴,۶۸۳	۱-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۳/۰۷٪	۵۲/۰۹٪	۴۴,۸۴۶,۹۴۱,۰۴۰	۲-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۰/۱۶٪	۲/۶۷٪	۲,۳۹۶,۴۹۷,۹۶۰	۳-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰	۴-۲	سایر درآمدها
۵/۸۹٪	۱۰۰/۰۰٪	۸۶,۰۸۸,۴۲۳,۶۸۳		جمع

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری مادر ثابت نگین

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

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

طی فروردین ماه									
ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه									
درصد از کل درآمد ها	جمع		درآمد سود اوراق		درآمد فروش	جمع		درآمد تغییر ارزش	
	مبلغ	یادداشت ۷-۲	یادداشت ۸-۲	۶-۲		مبلغ	یادداشت ۷-۲	یادداشت ۸-۲	۶-۲
۳۵.۵۵٪	۳۰.۶۰۷.۰۱۹.۱۶۳	۰	۶.۴۴۷.۷۶۱.۹۸۱	۳۴.۱۵۹.۲۵۷.۱۸۲	۰	۱۰.۹۷۱.۳۷۰.۹۶۹	۰	۵.۱۵۴.۷۲۰.۱۱۶	۵.۸۱۶.۶۵۰.۸۵۲
۰.۶۷٪	۵۷۳.۳۶۰.۰۰۸۱	۸.۳۳۰.۶۶۹	۵۶۴.۹۸۹.۴۱۲	۰	۰	۱۱۲.۶۵۸.۲۶۳	۰	۱۱۲.۶۵۸.۲۶۳	۰
۰.۴۴٪	۳۷۸.۰۱۷.۱۲۷	۲.۰۶۲.۸۸۶	۳۷۵.۹۵۴.۲۴۱	۰	۰	۱۳۸.۲۸۹.۶۶۸	۰	۱۳۸.۲۸۹.۶۶۸	۰
۹.۹۶٪	۸.۵۷۵.۹۲۴.۷۳۴	۰	۸.۵۷۵.۹۲۴.۷۳۴	۰	۰	۱.۶۰۴.۶۴۴.۰۴۶	۰	۱.۶۰۴.۶۴۴.۰۴۶	۰
۶.۳۴٪	۵.۴۶۱.۴۹۶.۲۷۹	۰	(۱۰.۷۴۲.۶۷۶.۳۰۹)	۱۶.۲۰۴.۱۷۳.۵۸۸	۲۴٪	۵.۲۲۷.۰۵۵.۲۸۳	۰	۹.۶۵۷.۲۲۷.۳۴۰	۴.۳۶۱.۳۲۷.۹۴۳
۰.۸۷٪	(۷۴۸.۸۳۶.۳۴۴)	(۱.۳۵۶.۱۱۲.۲۳۷)	(۱۹.۸۹۵.۸۶۰.۸۰۶)	۲۰.۴۰۳.۱۳۶.۶۹۹	۵۴٪	(۱۱.۸۳۶.۵۹۳.۹۱۲)	(۱.۲۵۶.۱۱۲.۲۳۷)	(۱۵.۷۶۶.۰۰۵.۷۳۱)	۵.۱۸۵.۵۲۴.۰۵۶
۵۲٪	۴۴.۸۴۶.۹۴۱.۰۴۰	(۱.۳۴۵.۷۱۸.۶۸۲)	(۱۲.۶۷۲.۹۰۶.۷۴۷)	۶۰.۷۶۶.۵۶۶.۶۶۹	۲۹٪	۶.۳۱۷.۴۲۴.۳۱۷	(۱.۲۵۶.۱۱۲.۲۳۷)	(۷.۷۸۹.۹۶۶.۲۹۸)	۱۵.۳۶۲.۵۰۲.۸۵۲

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری مادر آرد ثابت نگین

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی فروردین ماه		ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه	
نام سپرده	شماره حساب	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده
		یادداشت ۶-۲	یادداشت ۶-۲		
	۸۲۶-۸۱-۱۳۴۷۰۰۰۰-۱	۱۰۰٪	۲,۲۹۶,۴۹۷,۹۶۰	۱۰۰٪	۲,۲۹۶,۴۹۷,۹۶۰
جمع		۱۰۰٪	۲,۲۹۶,۴۹۷,۹۶۰	۱۰۰٪	۲,۲۹۶,۴۹۷,۹۶۰
سپرده بانکی کوتاه مدت - سامان					

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری یادآمد ثابت نگین

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۴-۵- در آمد سود سهام

ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه			طی فروردین ماه			اطلاعات مجمع		
خالص درآمد سود	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	نام سهام
۰	۰	۰	۰	۰	۰			
۰	۰	۰	۰	۰	۰			

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری با درآمد ثابت نگین

صورت وضعیت درآمد

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۷-۲- سود (ریان) حاصل از فروش اوراق بهادار

سود و زیان ناشی از فروش		ابتدای سال مالی تا پایان فروش		سود و زیان ناشی از فروش		طی دوره بین ماه	
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد
۸,۳۳۰,۶۶۹	۲,۵۳۲,۰۵۲,۶۴۴	۲,۵۳۲,۳۸۲,۳۰۳	۳,۳۸۸	*	*	*	*
۲,۰۶۲,۸۸۶	۱۹۸,۳۱۳,۶۲۷	۲۰۰,۳۷۶,۵۱۳	۲۲۶	*	*	*	*
۱,۸۵۸,۱۷۰,۰۰۰	۳۲۰,۸۱۷,۰۹۰,۰۰۰	۳۲۲,۶۷۵,۲۶۰,۰۰۰	۳۶۹,۳۰۰,۰۰۰	*	*	*	*
(۱,۲۵۶,۱۱۳,۳۳۷)	۱۵,۵۹۷,۸۳۴,۹۵۵	۱۴,۳۴۱,۷۲۲,۷۱۸	۱۶,۰۰۰	(۱,۲۵۶,۱۱۳,۳۳۷)	۱۵,۵۹۷,۸۳۴,۹۵۵	۱۴,۳۴۱,۷۲۲,۷۱۸	۱۶,۰۰۰
۶۱۲,۴۵۱,۳۱۸	۳۳۹,۱۳۷,۳۹۱,۲۱۶	۳۳۹,۷۶۹,۷۴۴,۵۳۴	-	(۱,۲۵۶,۱۱۳,۳۳۷)	۱۵,۵۹۷,۸۳۴,۹۵۵	۱۴,۳۴۱,۷۲۲,۷۱۸	۱۶,۰۰۰

ارزش دفتری برابر است با میانگین نمرات ارزش خالص موزون ارزش خالص موزون دوره با خنثی شدن دوره تغییرات تعداد در پایان دوره.

صندوق سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری مادر آمد ثابت نگین

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۱/۳۱

۸-۲ در آمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

ابتدای سال مالی تا پایان فروردین ماه				طی فروردین ماه			
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
۶,۴۷۷,۶۱۹,۹۸۱	۴۲۸,۰۰۰,۷۵۳,۹۸۳	۴۴۴,۴۵۵,۵۱۵,۹۶۴	۴۸۵,۰۰۰	۵,۱۵۴,۷۲۰,۱۱۶	۴۳۹,۳۰۰,۷۹۵,۸۴۸	۴۴۴,۴۵۵,۵۱۵,۹۶۴	۴۸۵,۰۰۰
۵۶۹,۹۸۹,۴۱۲	۱۶,۹۱۰,۸۰۲,۴۹۸	۱۵,۴۷۵,۷۹۱,۹۱۰	۲۰,۰۰۰	۱۱۲,۶۵۸,۲۶۳	۱۵,۳۶۳,۱۳۳,۶۴۷	۱۵,۴۷۵,۷۹۱,۹۱۰	۲۰,۰۰۰
۳۷۵,۹۵۴,۲۴۱	۸,۷۸۱,۳۷۱,۸۸۱	۹,۱۵۷,۳۲۶,۱۲۲	۱۰,۰۰۰	۱۳۸,۲۸۹,۶۶۸	۹,۰۱۹,۰۳۶,۴۵۴	۹,۱۵۷,۳۲۶,۱۲۲	۱۰,۰۰۰
۸,۵۷۵,۹۲۴,۷۳۴	۱۰۰,۰۷۳,۶۹۱,۳۴۰	۱۰۸,۶۴۹,۶۱۶,۰۷۴	۴۲,۲۵۷	۱۶۰,۴۶۴,۰۴۶	۱۰۷,۰۴۴,۵۷۲,۰۲۸	۱۰۸,۶۴۹,۶۱۶,۰۷۴	۴۲,۲۵۷
۳۷,۰۸۶,۸۱۲,۶۸۳	۱۵,۰۹۷,۳۲۲,۸۳۴	۱۸۸,۰۵۷,۱۳۷,۵۱۷	۲۳,۰۹۲,۰۱۷	۱۵,۴۴۹,۵۸۶,۹۶۸	۱۷۲,۶۰۷,۵۵۰,۵۴۹	۱۸۸,۰۵۷,۱۳۷,۵۱۷	۲۳,۰۹۲,۰۱۷
(۱۰,۷۴۲,۶۷۶,۳۰۹)	۲۸۲,۲۹۸,۳۱۶,۴۳۰	۲۷۱,۵۵۵,۶۴۰,۱۲۱	۲۸۷,۲۰۰	۹۶۵,۷۲۷,۳۲۰	۲۷,۰۵۸,۹۱۲,۷۸۱	۲۷۱,۵۵۵,۶۴۰,۱۲۱	۲۸۷,۲۰۰
(۱۹,۸۹۵,۸۶۰,۸۰۶)	۳۴۶,۰۱۵,۱۷۵,۷۶۲	۳۲۶,۱۱۹,۳۱۴,۹۵۶	۳۵۴,۷۰۰	(۱۵,۷۶۶,۰۰۰,۵۷۳۱)	۳۴۱,۸۸۵,۲۲۰,۶۸۷	۳۲۶,۱۱۹,۳۱۴,۹۵۶	۳۵۴,۷۰۰
۲۲,۴۱۲,۹۰۷,۹۳۶	۱,۳۴۱,۰۵۷,۴۳۲,۷۲۸	۱,۳۶۲,۴۷۰,۳۲۲,۶۶۴	۱,۳۶۲,۴۷۰,۳۲۲,۶۶۴	۷,۶۵۹,۶۲۰,۶۷۰	۱,۳۵۵,۸۱۰,۷۲۱,۹۹۴	۱,۳۶۲,۴۷۰,۳۲۲,۶۶۴	۱,۳۶۲,۴۷۰,۳۲۲,۶۶۴

ارزش دفتری برآورد است با میانگین روزی خالص ارزش فروش هر سهم، دوره در ابتدای دوره یا خرید طی دوره ضررهای تعداد در پایان دوره