



صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به 1404/01/31



**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**

**صورت وضعیت پورتفوی**

**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

3-1- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| 1404/01/31           |                        | تغییرات طی دوره        |                        | 1403/12/30             | مشخصات حساب بانکی  |                   |           |                   | سپرده‌های بانکی               |
|----------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|--------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | مبلغ                   | کاهش                   | افزایش                 | مبلغ                   | نرخ سود عطف الحساب | تاریخ افتتاح حساب | نوع سپرده | شماره حساب        |                               |
| 0.00%                | 85,600                 |                        |                        | 85,600                 | 0                  | 1402/04/06        | جاری      | 0106068521009     | سپرده بانکی نزد بانک دی       |
| 0.00%                | 5,045,655              | 0                      | 41,050                 | 5,004,605              | 0                  | 1401/09/26        | کوتاه مدت | 0205967499000     | سپرده بانکی نزد بانک دی       |
| 0.00%                | 15,457                 |                        |                        | 15,457                 | 0                  | 1399/11/20        | کوتاه مدت | 811.810.3503375.1 | سپرده بانکی نزد بانک سامان    |
| 0.00%                | 778,813                | 0                      | 3,175                  | 775,638                | 0                  | 1399/11/16        | کوتاه مدت | 811.841.3503375.1 | سپرده بانکی نزد بانک سامان    |
| 0.01%                | 726,131,599            | 0                      | 2,971,081              | 723,160,518            | 0                  | 1403/07/29        | کوتاه مدت | 0219443329002     | سپرده بانکی نزد بانک صادرات   |
| 0.00%                | 20,000,000             |                        |                        | 20,000,000             | 0                  | 1400/09/17        | جاری      | 201-00852510-605  | سپرده بانکی نزد بانک پارسیان  |
| 0.00%                | 7,618,481              | 0                      | 31,181                 | 7,587,300              | 0                  | 1400/08/09        | کوتاه مدت | 47001148788607    | سپرده بانکی نزد بانک پارسیان  |
| 0.00%                | 69,249,732             | 0                      | 282,267                | 68,967,465             | 0                  | 1403/07/18        | کوتاه مدت | 3978100206105901  | سپرده بانکی نزد بانک پاسارگاد |
| 0.02%                | 1,217,004,875          | 350,477,260,000        | 351,257,736,035        | 436,528,840            | 0                  | 1403/02/18        | جاری      | 1637116409751     | سپرده بانکی نزد بانک گردشگری  |
| 7.92%                | 428,643,000,000        | 136,447,821,917        | 0                      | 565,090,821,917        | 31                 | 1403/10/04        | بلند مدت  | 16333316409754    | سپرده بانکی نزد بانک گردشگری  |
| <b>7.96%</b>         | <b>430,688,930,212</b> | <b>486,925,081,917</b> | <b>351,261,064,789</b> | <b>566,352,947,340</b> |                    |                   |           |                   | <b>جمع</b>                    |

**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

| درصد از کل دارایی ها | درصد از کل درآمدها | مبلغ                   | یادداشت | شرح  |
|----------------------|--------------------|------------------------|---------|--|
| 0.65%                | 5.49%              | 35,409,874,290         | 1-2     | درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام        |
| 9.87%                | 82.75%             | 533,709,643,630        | 2-2     | درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت |
| 1.40%                | 11.72%             | 75,614,786,923         | 3-2     | درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده  |
| 0.00%                | 0.04%              | 249,295,217            | 4-2     | سایر درآمدها   |
| <b>11.92%</b>        | <b>100.00%</b>     | <b>644,983,600,060</b> |         | <b>جمع</b>   |

**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| 1404/01/31            |             |                       | طی دوره               |                      |                       | نرخ سود<br>علی الحساب | تاریخ سررسید | تاریخ دریافت<br>سود | شرح   |
|-----------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------|---------------------|---|
| خالص درآمد            | هزینه تنزیل | درآمد سود             | خالص درآمد            | هزینه تنزیل          | درآمد سود             |                       |              |                     |   |
| 59,145,654,573        | 0           | 59,145,654,573        | 13,544,681,531        | (414,611,338)        | 13,959,292,869        | 31                    | 1406/10/04   | 1404/01/01          | بلند مدت-<br>16333316409754 -<br>گردشگری                |
| 63,336                | 0           | 63,336                | 20,483                | 0                    | 20,483                | 0                     | -            | 1404/01/01          | کوتاه مدت-<br>0205967499000 -<br>کوتاه مدت-             |
| 16,424,993            | 0           | 16,424,993            | 2,971,081             | 0                    | 2,971,081             | 0                     | -            | 1404/01/01          | 0219443329002 -<br>صادرات<br>کوتاه مدت-                 |
| 12,622                | 0           | 12,622                | 3,175                 | 0                    | 3,175                 | 0                     | -            | 1404/01/11          | -1.3503375.841.811<br>کوتاه مدت-<br>سامان<br>کوتاه مدت- |
| 1,919,551             | 0           | 1,919,551             | 282,267               | 0                    | 282,267               | 0                     | -            | 1404/01/01          | -3978100206105901<br>پاسارگاد<br>کوتاه مدت-             |
| 19,323,925            | 0           | 19,323,925            | 31,181                | 0                    | 31,181                | 0                     | -            | 1404/01/01          | -47001148788607<br>پارسیان<br>بلند مدت-                 |
| 3,143,442,588         | 0           | 3,143,442,588         | 0                     | 0                    | 0                     | 29.5                  | 1406/07/29   | 1404/01/01          | -0407448882008<br>صادرات<br>بلند مدت-                   |
| 145,479,473           | 0           | 145,479,473           | 0                     | 0                    | 0                     | 30                    | 1404/02/18   | 1404/01/01          | -16333316409751<br>گردشگری<br>بلند مدت-                 |
| 328,767,180           | 0           | 328,767,180           | 0                     | 0                    | 0                     | 30                    | 1406/07/18   | 1404/01/01          | -16333316409752<br>گردشگری<br>بلند مدت-                 |
| 164,383,561           | 0           | 164,383,561           | 0                     | 0                    | 0                     | 30                    | 1406/07/30   | 1404/01/01          | - 16333316409753<br>گردشگری<br>بلند مدت-                |
| 10,841,095,920        | 0           | 10,841,095,920        | 0                     | 0                    | 0                     | 30                    | 1406/07/18   | 1404/01/01          | -397303206105901<br>پاسارگاد<br>بلند مدت-               |
| 1,808,219,201         | 0           | 1,808,219,201         | 0                     | 0                    | 0                     | 30                    | 1406/07/30   | 1404/01/01          | -397303206105902<br>پاسارگاد<br>بلند مدت-               |
| <b>75,614,786,923</b> | <b>0</b>    | <b>75,614,786,923</b> | <b>13,547,989,718</b> | <b>(414,611,338)</b> | <b>13,962,601,056</b> |                       |              |                     | پاسارگاد<br>جمع   |

**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| 1404/01/31              |                        |                        |                | 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          |                                  |
| 5,210,325,165           | 307,148,343,791        | 312,358,668,956        | 458,598        | 549,612,417             | 9,428,741,506          | 9,978,353,923          | 14,078         | اسنادخزانه اسم 1 بودجه 02-050325 |
| 3,180,272,699           | 71,267,039,286         | 74,447,311,985         | 121,268        | 3,180,272,699           | 71,267,039,286         | 74,447,311,985         | 121,268        | اسنادخزانه اسم 2 بودجه 02-050923 |
| (1,545,846,094)         | 56,365,969,189         | 54,820,123,095         | 68,647         | 0                       | 0                      | 0                      | 0              | زعفران 0310 تگین سحرخیز (پ)      |
| 2,550,803,489           | 51,623,498,380         | 54,174,301,869         | 50,760         | 2,520,382,477           | 50,606,439,390         | 53,126,821,867         | 49,760         | زعفران 0410 تگین آراسته (پ)      |
| 820,430,093             | 3,095,832,827          | 3,916,262,920          | 3,675          | 350,109,407             | 1,156,515,373          | 1,506,624,780          | 1,373          | زعفران 0410 تگین بهر امن (پ)     |
| 1,003,558,433           | 4,328,057,547          | 5,331,615,980          | 4,945          | 976,796,286             | 4,167,863,871          | 5,144,660,157          | 4,762          | زعفران 0410 تگین تروند قاین (پ)  |
| 13,434,358,232          | 47,113,620,526         | 60,547,978,758         | 55,979         | 7,910,042,665           | 24,933,060,103         | 32,843,102,768         | 29,627         | زعفران 0410 تگین روستا (پ)       |
| 4,044,354,633           | 13,950,236,391         | 17,994,591,024         | 16,651         | 2,801,167,195           | 9,027,710,204          | 11,828,877,399         | 10,776         | زعفران 0410 تگین زرین (پ)        |
| 6,968,886,605           | 27,196,260,726         | 34,165,147,331         | 30,281         | 6,919,321,638           | 26,972,607,891         | 33,891,929,529         | 30,032         | زعفران 0410 تگین سحرخیز (پ)      |
| 597,837,225             | 5,711,957,594          | 6,309,794,819          | 6,438          | 23,793,483              | 316,557,710            | 340,351,193            | 313            | زعفران 0410 تگین ملال (پ)        |
| 1,774,601,952           | 7,468,741,625          | 9,243,343,577          | 8,618          | 723,927,323             | 2,803,456,025          | 3,527,383,348          | 3,235          | زعفران 0410 تگین نوین (پ)        |
| 5,495,990,383           | 61,169,260,883         | 66,665,251,266         | 73,676         | 2,333,861,645           | 8,018,649,454          | 10,352,511,099         | 9,476          | زعفران 0410 تگین وحدت جام (پ)    |
| 264,899,339             | 1,052,759,016          | 1,317,658,355          | 1,240          | 2,067,555               | 6,791,133              | 8,858,688              | 8              | زعفران 0410 تگین گلیران (پ)      |
| <b>43,800,472,154</b>   | <b>657,491,577,781</b> | <b>701,292,049,935</b> | <b>900,776</b> | <b>28,291,354,790</b>   | <b>208,705,431,946</b> | <b>236,996,786,736</b> | <b>274,708</b> | جمع                              |

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

**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

| شرح                              | 1404/01/31       |                          |                          |                               | طی دوره                  |                          |                          |                               |
|----------------------------------|------------------|--------------------------|--------------------------|-------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|-------------------------------|
|                                  | تعداد            | خالص ارزش فروش           | ارزش دفتری               | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | تعداد                    | خالص ارزش فروش           | ارزش دفتری               | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت |
| اسناد خزانه سم 1 بودجه 02-050325 | 0                | 0                        | 0                        | (286,857,638)                 | 0                        | 0                        | 286,857,638              | 0                             |
| اسناد خزانه سم 2 بودجه 02-050923 | 88,936           | 54,641,266,475           | 54,641,266,475           | 88,936                        | 54,641,266,475           | 53,789,192,141           | 852,074,334              | 53,789,192,141                |
| زعفران 0410-گین (اراسته)         | 154,675          | 147,201,022,703          | 147,201,022,703          | 154,675                       | 147,201,022,703          | 167,486,210,474          | (20,285,187,771)         | 167,486,210,474               |
| زعفران 0410-گین بهرامن           | 205,767          | 205,273,159,200          | 205,273,159,200          | 205,767                       | 205,273,159,200          | 222,014,153,155          | (16,740,993,955)         | 222,014,153,155               |
| زعفران 0410-گین تروند قلیزاد     | 372,830          | 354,814,658,441          | 354,814,658,441          | 372,830                       | 354,814,658,441          | 387,577,866,533          | (32,763,208,092)         | 387,577,866,533               |
| زعفران 0410-گین روستا            | 159,919          | 156,344,171,442          | 156,344,171,442          | 159,919                       | 156,344,171,442          | 179,912,558,827          | (23,568,387,385)         | 179,912,558,827               |
| زعفران 0410-گین زرین             | 162,453          | 162,873,428,364          | 162,873,428,364          | 162,453                       | 162,873,428,364          | 177,582,142,627          | (14,708,714,263)         | 177,582,142,627               |
| زعفران 0410-گین سحرخیز           | 2,951,308        | 3,003,103,469,566        | 3,003,103,469,566        | 2,951,308                     | 3,003,103,469,566        | 3,274,285,017,689        | (271,181,548,123)        | 3,274,285,017,689             |
| زعفران 0410-گین ملل              | 121,193          | 115,336,890,541          | 115,336,890,541          | 121,193                       | 115,336,890,541          | 127,631,074,275          | (12,294,183,734)         | 127,631,074,275               |
| زعفران 0410-گین نوین             | 165,581          | 161,054,015,460          | 161,054,015,460          | 165,581                       | 161,054,015,460          | 179,071,766,821          | (18,017,751,361)         | 179,071,766,821               |
| زعفران 0410-گین وحدت جام         | 498,496          | 474,423,827,558          | 474,423,827,558          | 498,496                       | 474,423,827,558          | 536,209,024,128          | (61,785,196,570)         | 536,209,024,128               |
| زعفران 0410-گین گلپایان          | 163,078          | 160,409,000,221          | 160,409,000,221          | 163,078                       | 160,409,000,221          | 174,889,875,675          | (14,480,875,454)         | 174,889,875,675               |
| جمع                              | <b>5,044,236</b> | <b>4,995,474,909,971</b> | <b>4,995,474,909,971</b> | <b>5,044,236</b>              | <b>4,995,474,909,971</b> | <b>5,480,735,739,983</b> | <b>(485,260,830,012)</b> | <b>5,480,735,739,983</b>      |
|                                  |                  | <b>4,470,155,864,205</b> |                          |                               |                          |                          |                          |                               |
|                                  |                  |                          |                          |                               |                          |                          |                          | <b>525,319,045,766</b>        |

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 گروه زعفران سحرخیز**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

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

| درآمد سود اوراق | درآمد تغییر ارزش  | طی دوره        |                   | درآمد سود اوراق | 1404/01/31      |                  |                                  |
|-----------------|-------------------|----------------|-------------------|-----------------|-----------------|------------------|----------------------------------|
|                 |                   | درآمد فروش     | جمع               |                 | درآمد فروش      | درآمد تغییر ارزش |                                  |
| 0               | (286,857,638)     | 549,612,417    | 262,754,779       | 0               | 5,210,325,165   | 0                | اسناد خزانه سم 1 بودجه 02-050325 |
| 0               | 852,074,334       | 3,180,272,699  | 4,032,347,033     | 0               | 5,545,541,516   | 2,365,268,817    | اسناد خزانه سم 2 بودجه 02-050923 |
| 0               | (20,285,187,771)  | 2,520,382,477  | (17,764,805,294)  | 0               | (7,951,553,788) | (10,502,357,277) | زعفران 0410 نگین از استان (پ)    |
| 0               | (16,740,993,955)  | 350,109,407    | (16,390,884,548)  | 0               | 32,227,223,450  | 31,406,793,357   | زعفران 0410 نگین بیرامن (پ)      |
| 0               | (32,763,208,092)  | 976,796,286    | (31,786,411,806)  | 0               | 28,535,739,116  | 27,532,180,683   | زعفران 0410 نگین تروند قیانت (پ) |
| 0               | (23,568,387,385)  | 7,910,042,665  | (15,658,344,720)  | 0               | 34,769,729,329  | 21,335,371,097   | زعفران 0410 نگین روستا (پ)       |
| 0               | (14,708,714,263)  | 2,801,167,195  | (11,907,547,068)  | 0               | 30,392,019,402  | 26,347,664,769   | زعفران 0410 نگین زرین (پ)        |
| 0               | (271,181,548,123) | 6,919,321,638  | (264,262,226,485) | 0               | 351,404,530,072 | 344,435,643,467  | زعفران 0410 نگین سحرخیز (پ)      |
| 0               | (12,294,183,734)  | 23,793,483     | (12,270,390,251)  | 0               | (6,952,851,078) | (7,550,688,303)  | زعفران 0410 نگین مل (پ)          |
| 0               | (18,017,751,361)  | 723,927,323    | (17,293,824,038)  | 0               | 18,901,511,996  | 17,126,910,044   | زعفران 0410 نگین نوین (پ)        |
| 0               | (61,785,196,570)  | 2,333,861,645  | (59,451,334,925)  | 0               | 56,779,240,107  | 51,283,249,724   | زعفران 0410 نگین وحدت جام (پ)    |
| 0               | (14,480,875,454)  | 2,067,555      | (14,478,807,899)  | 0               | 21,803,908,727  | 21,539,009,388   | زعفران 0410 نگین گلبران (پ)      |
| 0               |                   |                |                   | 0               | (1,545,846,094) | 0                | زعفران 0310 نگین سحرخیز (پ)      |
| 0               | (485,260,830,012) | 28,291,354,790 | (456,969,475,222) | 0               | 569,119,517,920 | 525,319,045,766  | جمع                              |

**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**

**صورت وضعیت درآمدها**

**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

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

| 1404/01/31                |                               | 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                        |
| 78.22%                    | 59,145,654,573                | 99.98%                    | 13,959,292,869                | 16333316409754    | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| 0.00%                     | 63,336                        | 0.00%                     | 20,483                        | 0205967499000     | سپرده بانکی کوتاه مدت - دي       |
| 0.00%                     | 12,622                        | 0.00%                     | 3,175                         | 811.841.3503375.1 | سپرده بانکی کوتاه مدت - سامان    |
| 0.02%                     | 16,424,993                    | 0.02%                     | 2,971,081                     | 0219443329002     | سپرده بانکی کوتاه مدت - صادرات   |
| 0.03%                     | 19,323,925                    | 0.00%                     | 31,181                        | 47001148788607    | سپرده بانکی کوتاه مدت - پارسیان  |
| 0.00%                     | 1,919,551                     | 0.00%                     | 282,267                       | 3978100206105901  | سپرده بانکی کوتاه مدت - پاسارگاد |
| 4.16%                     | 3,143,442,588                 | 0                         | 0                             | 0407448882008     | سپرده بانکی بلند مدت - صادرات    |
| 14.34%                    | 10,841,095,920                | 0                         | 0                             | 397303206105901   | سپرده بانکی بلند مدت - پاسارگاد  |
| 2.39%                     | 1,808,219,201                 | 0                         | 0                             | 397303206105902   | سپرده بانکی بلند مدت - پاسارگاد  |
| 0.19%                     | 145,479,473                   | 0                         | 0                             | 16333316409751    | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| 0.43%                     | 328,767,180                   | 0                         | 0                             | 16333316409752    | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| 0.22%                     | 164,383,561                   | 0                         | 0                             | 16333316409753    | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| <b>100.00%</b>            | <b>75,614,786,923</b>         | <b>100.00%</b>            | <b>13,962,601,056</b>         |                   | جمع                              |

**صندوق سرمایه گذاری گروه زعفران سحرخیز**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به 1404/01/31**

4-2- سایر درآمدها:

| <u>1404/01/31</u>  | <u>طی دوره</u>    | <u>سایر درآمدها</u> |
|--------------------|-------------------|---------------------|
| <u>مبلغ</u>        | <u>مبلغ</u>       |                     |
| 176,631,423        | 30,621,827        | تدبیرگران فردا      |
| 73,197,127         | 0                 | اندیشه و بینش پیشرو |
| (533,333)          | 0                 | تامین سرمایه نوین   |
| <u>249,295,217</u> | <u>30,621,827</u> | جمع                 |