

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای دوره منتهی به 30 بهمن 1404

در راستای اجرای ابلاغیه 12020093 مورخ 1396/09/05 و ابلاغیه
12020268 مورخ 1402/12/01 سازمان بورس و اوراق بهادار

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

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

1404/11/30	تغییرات طی دوره	1404/10/30
درصد به کل دارایی ها	فروش طی دوره	خرید طی دوره
خالص ارزش فروش	تعداد قیمت بازار هر سهم	تعداد بهای تمام شده
	تعداد	افزایش سرمایه
	تعداد	تعداد بهای تمام شده
	تعداد	تعداد مبلغ فروش

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

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

1404/11/30				1404/10/30			
نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی

نام سهام

اطلاعات آماری مرتبط با موقعیت های اخذ شده در اوراق اختیار معامله توسط صندوق سرمایه گذاری:

1404/11/30				1404/10/30				نام سهام
تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق	استراتژی ماخوذه	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق	استراتژی ماخوذه	
0	0	0	استراتژی ماخوذه	1404/11/19	10,500,000	10	استراتژی ماخوذه	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 10:500:000 ریال
0	0	0	استراتژی ماخوذه	1404/11/19	11,000,000	10	استراتژی ماخوذه	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 11:000:000 ریال
0	0	0	استراتژی ماخوذه	1404/11/19	13,000,000	22	استراتژی ماخوذه	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 13:000:000 ریال
0	0	0	استراتژی ماخوذه	1404/11/19	19,000,000	10,062	استراتژی ماخوذه	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 19:000:000 ریال
0	0	0	استراتژی ماخوذه	1404/11/19	9,500,000	1	استراتژی ماخوذه	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 9:500:000 ریال

اطلاعات آماری مرتبط با قراردادهای آتی توسط صندوق سرمایه گذاری:

1404/11/30				1404/10/30				نام سهام
تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق	نوع موقعیت	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق	نوع موقعیت	
1405/02/19	293,973,000	(220)	فروش	1405/02/19	252,779,938	(220)	فروش	قرارداد آتی شمش طلای خام 995 تحویل اردیبهشت ماه 1405
	0	0		1404/11/28	215,546,524	(64)	فروش	قرارداد آتی شمش طلای خام 995 تحویل بهمن ماه 1404

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

2-1- سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری

1404/11/30	تغییرات طی دوره	1404/10/30
درصد به کل دارایی ها	خرید/صدور طی دوره/ ابطال طی دوره	خالص ارزش فروش
خالص ارزش فروش	تعداد	تعداد
بهای تمام شده	قیمت ابطال/ بازار هر واحد	بهای تمام شده
	تعداد	تعداد
	مبلغ فروش	تعداد

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

3-1- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت با علی الحساب

1404/11/30		تغییرات طی دوره		1404/10/30		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت								
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	فروش طی دوره تعداد	خرید طی دوره تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	نرخ سود مؤثر	نرخ سود اسمی	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار اوراق	پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

3-1- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

1404/11/30		تغییرات طی دوره				1404/10/30		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										
درصد به کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود مؤثر	نرخ سود اسمی	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار اوراق	پنیرفته شده در بورس یا فرابورس	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد										
0%	0	0	1,847,477	0	4,257,000,000,000	4,257,000	0	0	6,696,394,031,250	1,890,513,785,664	4,257,000	0.0		1404/11/19	0000/00/00	بورس	خبر	تمام سکه طرح جدید 0411 آینده
83.91%	439,615,753,004,284	126,217,362,508,150	24,998,780	17,627,795	12,408,919,035,085	511,881	1,826,518,148	73	369,159,786,237,120	129,880,644,347,321	18,139,603					بورس		گواهی سپرده بپوسته شمش طلای 995+
15.61%	81,786,978,325,000	39,755,595,359,800	1,910,000,000	42,874	484,616,037,593	272	7,331,192,550,000	4,257	61,367,806,456,922	32,676,619,116,603	38,889					بورس		گواهی سپرده بپوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید
0.19%	1,018,639,384,000	202,182,183,535	5,030,000	203,000	0	0	0	0	915,560,368,800	202,182,183,535	203,000					بورس		گواهی سپرده بپوسته شمش نقره 999.9
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	176,250,165	107,674,056								اوراق اختیار خرید کالا
99.72%	522,421,370,713,284	166,175,140,051,485		17,873,669	17,150,535,072,677	4,769,153	7,333,019,068,148	4,330	438,139,723,344,257	164,650,067,107,179	22,638,492							جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

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)

1404/11/30

دلیل تعدیل

خالص ارزش فروش تعدیل
شده

نام اوراق بهادار تعداد قیمت پایانی قیمت تعدیل شده درصد تعدیل

صندوق سرمایه‌گذاری مبتنی بر کالای کهربا

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به 1404/11/30

1-5- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده

1404/11/30		تغییرات طی دوره		1404/10/30	
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	سپرده های بانکی
0.00%	3,874,560,349	1,760,000	15,857,682	3,860,462,667	سامان
0.00%	445,000	18,435,005,000	18,364,550,000	70,900,000	پاسارگاد
0.00%	241,062	655,000	7,304	888,758	شهر
0.10%	513,096,168,538	1,289,212,357,594	430,533,984,319	1,371,774,541,813	دی
0.00%	24,880,116,453	13,372,312,552,897	13,392,004,203,250	5,188,466,100	خاورمیانه
0.10%	541,851,531,402	14,679,962,330,491	13,840,918,602,555	1,380,895,259,338	جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

2- 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	1-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری	2-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	3-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی	4-2	97,203,991,754,940	99.99%	18.55%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	5-2	20,490,148,436	0.02%	0.00%
درآمد بازارگردانی	6-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق مشتقه	7-2	(11,311,047,663)	(0.01%)	(0.00%)
سایر درآمدها	8-2	0	0%	0%
جمع		97,213,170,855,713	100.00%	18.56%

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

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

1404/11/30				طی دوره			
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام
درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	مبلغ	درصد از کل درآمدها	یادداشت ...	یادداشت ...

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

2-2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در واحدهای صندوق:

1404/11/30				طی دوره			
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق
درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...

صندوق سرمایه‌گذاری مبتنی برکالای کهریا
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

2-4 درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده کالایی

1404/11/30					طی دوره										
جمع	درآمد فروش		درآمد تغییر ارزش		درآمد سود اوراق		جمع	درآمد فروش		درآمد تغییر ارزش		درآمد تعهد پذیره نویسی			
	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...		یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...		
103,079,015,200	0	103,079,015,200	0	0	103,079,015,200	0	103,079,015,200	0	103,079,015,200	0	0	0	0	0	گواهی سپرده پیوسته شمش نقره 999.9
82,892,912,337,112	2,021,458,870,154	80,871,453,466,958	0	0	82,892,912,337,112	2,021,458,870,154	80,871,453,466,958	0	82,892,912,337,112	2,021,458,870,154	80,871,453,466,958	0	0	0	گواهی سپرده پیوسته شمش طلای +995
14,208,000,402,628	56,133,831,439	14,151,866,571,189	0	0	14,208,000,402,628	56,133,831,439	14,151,866,571,189	0	14,208,000,402,628	56,133,831,439	14,151,866,571,189	0	0	0	گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید
97,203,991,754,940	2,077,592,701,593	95,126,399,053,347	0	0	97,203,991,754,940	2,077,592,701,593	95,126,399,053,347	0	97,203,991,754,940	2,077,592,701,593	95,126,399,053,347	0	0	0	جمع

صندوق سرمایه گذاری
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به

2-3-1-مبالغ تخصیص یافته بابت خرید و نگهداری اوراق بهادار با درآمد ثابت (نرخ سود ترجیحی)

طرف معامله	نوع وابستگی	نام ورقه بهادار	تعداد اوراق	بهای تمام شده اوراق	مبلغ شناسایی شده بابت قرارداد خرید و نگهداری اوراق بهادار	نرخ اسمی	میانگین نرخ بازده تا سررسید قراردادهای منعقد
شرکت ...	مدیر صندوق	ورقه الف					
		ورقه ب					
شرکت ...	شرکت مادر	ورقه الف					
		ورقه د					
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ...	صندوق- سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی تحت مدیریت صندوق یا اشخاص تحت کنترل یا وابسته *	ورقه ج					
سایر	سایر	ورقه ح					
		ورقه ط					
		ورقه ی					
		ورقه س					

*به تفکیک هر یک از صندوق-های سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی طرف قرارداد افشا گردد.

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

5-2-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

1404/11/30		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	نام سپرده
	یادداشت ...		یادداشت ...	
0.08%	15,857,682	0.08%	15,857,682	سامان
0.00%	7,304	0.00%	7,304	شهر
0.05%	9,749,131	0.05%	9,749,131	خاورمیانه
99.87%	20,464,534,319	99.87%	20,464,534,319	دی
100.00%	20,490,148,436	100.00%	20,490,148,436	جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

6-2-درآمد حاصل از بازارگردانی:

<u>طی دوره</u>	
<u>1404/11/30</u>	
نام سهام	درآمد بازارگردان
	درآمد بازارگردان

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
 درآمد سرمایه گذاری در اوراق مشتقه
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

7-2-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق مشتقه:

1404/11/30				طی دوره						
جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع		درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	اوراق مشتقه
درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	
(0.00%)	(2,160,073,920)	0	(2,160,073,920)		(0.00%)	(2,160,073,920)	0	(2,160,073,920)		قرارداد آتی شمش طلای خام 995 تحویل بهمن ماه 1404
0.00%	69,690,858	69,690,858	0		0.00%	69,690,858	69,690,858	0		قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 11,000,000 ریال
0.00%	71,582,297	71,582,297	0		0.00%	71,582,297	71,582,297	0		قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 10,500,000 ریال
(0.00%)	(4,587,981)	(4,587,981)	0		(0.00%)	(4,587,981)	(4,587,981)	0		قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 9,500,000 ریال
(0.00%)	(63,988,128)	(63,988,128)	0		(0.00%)	(63,988,128)	(63,988,128)	0		قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 13,000,000 ریال
(0.01%)	(9,062,473,640)	0	(9,062,473,640)		(0.01%)	(9,062,473,640)	0	(9,062,473,640)		قرارداد آتی شمش طلای خام 995 تحویل اردیبهشت ماه 1405
(0.00%)	(161,197,149)	(161,197,149)	0		(0.00%)	(161,197,149)	(161,197,149)	0		قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 19,000,000 ریال
(0.01%)	(11,311,047,663)	(88,500,103)	(11,222,547,560)	0	(0.01%)	(11,311,047,663)	(88,500,103)	(11,222,547,560)		جمع

سندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهر
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30
2-8- سایر درآمدها:

طی دوره 1404/11/30

سایر درآمدها	مبلغ	مبلغ
--------------	------	------

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

درآمد سود سهام

اطلاعات مجمع	طی دوره	1404/11/30
نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع
سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم
خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام
هزینه تنزیل	هزینه تنزیل	هزینه تنزیل
خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

درآمد سود صندوق

1404/11/30

طی دوره

نام صندوق	تاریخ تقسیم سود	تعداد واحد صندوق در زمان تقسیم سود	سود متعلق به هر واحد	خالص درآمد سود صندوق	خالص درآمد سود صندوق
-----------	-----------------	------------------------------------	----------------------	----------------------	----------------------

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت

1404/11/30		طی دوره							
خالص	هزینه	درآمد سود	خالص	هزینه	درآمد سود	نرخ سود علی	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت	شرح
درآمد	تنزیل		درآمد	تنزیل		الحساب		سود	

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

سود سپرده بانکی

1404/11/30			طی دوره			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	شرح
20,464,534,319	0	20,464,534,319	20,464,534,319	0	20,464,534,319	دی
15,857,682	0	15,857,682	15,857,682	0	15,857,682	سامان
7,304	0	7,304	7,304	0	7,304	شهر
9,749,131	0	9,749,131	9,749,131	0	9,749,131	خاورمیانه
20,490,148,436	0	20,490,148,436	20,490,148,436	0	20,490,148,436	جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

1404/11/30		ظی دوره							
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص بهای فروش	تعداد	شرح	
0	4,257,000,000,000	4,257,000,000,000	4,257,000	0	4,257,000,000,000	4,257,000,000,000	4,257,000	تمام سکه طرح جدید 0411 آینده	
2,021,458,870,154	10,387,460,164,930	12,408,919,035,084	511,881	2,021,458,870,154	10,387,460,164,930	12,408,919,035,084	511,881	گواهی سپرده پیوسته شمش طلای +995	
56,133,831,439	428,482,206,153	484,616,037,592	272	56,133,831,439	428,482,206,153	484,616,037,592	272	گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	
(63,988,128)	165,187,982	101,199,854	22	(63,988,128)	165,187,982	101,199,854	22	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 13۰۰۰۰۰۰۰ ریال	
(4,587,981)	10,932,973	6,344,992	1	(4,587,981)	10,932,973	6,344,992	1	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 9۰۵۰۰۰۰۰۰ ریال	
71,582,297	(71,582,297)	0	0	71,582,297	(71,582,297)	0	0	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 10۰۵۰۰۰۰۰۰ ریال	
69,690,858	(69,690,858)	0	0	69,690,858	(69,690,858)	0	0	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 11۰۰۰۰۰۰۰۰ ریال	
(161,197,149)	161,197,149	0	0	(161,197,149)	161,197,149	0	0	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سررسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 19۰۰۰۰۰۰۰۰ ریال	
2,077,504,201,490	15,073,138,416,032	17,150,642,617,522	4,769,176	2,077,504,201,490	15,073,138,416,032	17,150,642,617,522	4,769,176	جمع	

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

1404/11/30		طی دوره									
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	شرح			
0	0	0	533,700	0	0	0	533,700	تمام سکه طرح جدید 0411 آینده			
(2,160,073,920)	2,160,073,920	0	64	(2,160,073,920)	2,160,073,920	0	64	قرارداد آتی شمش طلای خام 995 تحویل بهمن ماه 1404			
(9,062,473,640)	9,062,473,640	0	220	(9,062,473,640)	9,062,473,640	0	220	قرارداد آتی شمش طلای خام 995 تحویل اردیبهشت ماه 1405			
0	0	0	10	0	0	0	10	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 10,500,000 ریال			
0	0	0	10	0	0	0	10	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 11,000,000 ریال			
0	0	0	(22)	0	0	0	(22)	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 13,000,000 ریال			
0	0	0	10,062	0	0	0	10,062	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 19,000,000 ریال			
0	0	0	(1)	0	0	0	(1)	قرارداد اختیار معامله خرید شمش طلا سرسید بهمن ماه 1404 با قیمت اعمال 9,500,000 ریال			
14,151,866,571,189	67,635,111,753,811	81,786,978,325,000	35,573	14,151,866,571,189	67,635,111,753,811	81,786,978,325,000	35,573	گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید			
80,871,453,466,958	358,744,299,537,326	439,615,753,004,284	13,351,500	80,871,453,466,958	358,744,299,537,326	439,615,753,004,284	13,351,500	گواهی سپرده پیوسته شمش طلای +995			
103,079,015,200	915,560,368,800	1,018,639,384,000	1,589,609	103,079,015,200	915,560,368,800	1,018,639,384,000	1,589,609	گواهی سپرده پیوسته شمش نقره 999.9			
95,115,176,505,787	427,306,194,207,497	522,421,370,713,284	15,520,725	95,115,176,505,787	427,306,194,207,497	522,421,370,713,284	15,520,725	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 مبتنی بر کالای کهربا (نقران)

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای دوره منتهی به 30 بهمن 1404

در راستای اجرای ابلاغیه 12020093 مورخ 1396/09/05 و ابلاغیه
12020268 مورخ 1402/12/01 سازمان بورس و اوراق بهادار

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

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

1404/11/30	تغییرات طی دوره	1404/10/30
درصد به کل دارایی ها	فروش طی دوره	خرید طی دوره
خالص ارزش فروش	تعداد قیمت بازار هر سهم	تعداد بهای تمام شده
	تعداد	افزایش سرمایه
	تعداد مبلغ فروش	تعداد بهای تمام شده
		تعداد

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (تفران)
 صورت وضعیت پرتفوی
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

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

1404/11/30		1404/10/30			
تعداد اوراق تبعی	قیمت اعمال	تاریخ اعمال	نرخ سود مؤثر	تعداد اوراق تبعی	قیمت اعمال

نام سهام

اطلاعات آماری مرتبط با موقعیت های اخذ شده در اوراق اختیار معامله توسط صندوق سرمایه گذاری:

1404/11/30		1404/10/30			
نوع اختیار	نوع موقعیت	استراتژی ماخوذه	تعداد اوراق	قیمت اعمال	تاریخ اعمال

نام سهام

اطلاعات آماری مرتبط با قراردادهای آتی توسط صندوق سرمایه گذاری:

1404/11/30		1404/10/30			
نوع موقعیت	تعداد اوراق	قیمت اعمال	تاریخ اعمال	نوع موقعیت	تعداد اوراق

نام سهام

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

2-1- سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری

1404/11/30	تغییرات طی دوره	1404/10/30
درصد به کل دارایی ها	خرید/صدور طی دوره/ ابطال طی دوره	صندوق تعداد واحد بهای تمام شده
خالص ارزش فروش	تعداد قیمت ابطال/ بازار هر واحد	خالص ارزش فروش
	تعداد بهای تمام شده	تعداد بهای تمام شده
	تعداد مبلغ فروش	تعداد مبلغ فروش

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت پرتفوی
برای ماه منتهی به 1404/11/30

3-1- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت با علی الحساب

1404/11/30		تغییرات طی دوره		1404/10/30		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت								
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	فروش طی دوره تعداد	خرید طی دوره تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	نرخ سود مؤثر	نرخ سود اسمی	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار اوراق	پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
 صورت وضعیت پرتفوی
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

3-1 سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت با علی الحساب

1404/11/30		تغییرات طی دوره		1404/10/30		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت												
درصد به کل داراییها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره تعداد	مبلغ فروش	خرید طی دوره بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود مؤثر	نرخ سود اسمی	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار اوراق	پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
89.73%	24,344,497,763,712	25,337,232,262,920	5,030,000	4,851,504	0	0	20,337,234,715,949	3,739,636	5,014,691,015,453	4,999,997,546,970	1,111,868							
89.73%	24,344,497,763,712	25,337,232,262,920		4,851,504	0	0	20,337,234,715,949	3,739,636	5,014,691,015,453	4,999,997,546,970	1,111,868					بورس		گواهی سپرده بپوسته شمش نقره 999.9 جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به 1404/11/30

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)

1404/11/30

دلیل تعدیل

خالص ارزش فروش تعدیل
شده

نام اوراق بهادار تعداد قیمت پایانی قیمت تعدیل شده درصد تعدیل

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به 1404/11/30

5-1- سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده

1404/11/30		تغییرات طی دوره		1404/10/30	
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	سپرده های بانکی
0.00%	1,502,671	0	1,002,671	500,000	دی
0.03%	7,582,197,000	25,876,417,803,000	25,884,000,000,000		خاورمیانه
0.03%	7,583,699,671	25,876,417,803,000	25,884,001,002,671	500,000	جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

2- 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	1-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری	2-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	3-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی	4-2	(1,007,427,967,691)	100.00%	(3.71%)
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	5-2	2,671	(0.00%)	0.00%
درآمد بازارگردانی	6-2	0	0%	0%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق مشتقه	7-2	0	0%	0%
سایر درآمدها	8-2	0	0%	0%
جمع		(1,007,427,965,020)	100.00%	(3.71%)

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نفران)
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

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

1404/11/30				طی دوره			
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام
درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	مبلغ	درصد از کل درآمدها	یادداشت ...	یادداشت ...

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

2-2- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در واحدهای صندوق:

1404/11/30				طی دوره			
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق
درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

4-2-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در گواهی سپرده کالایی

1404/11/30					طی دوره				
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد تعهد پذیره نویسی	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد تعهد پذیره نویسی	درآمد سود اوراق
	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...		یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...	یادداشت ...
(1,007,427,967,691)	0	(1,007,427,967,691)	0	0	(1,007,427,967,691)	0	(1,007,427,967,691)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(1,007,427,967,691)	0	(1,007,427,967,691)	0	0	(1,007,427,967,691)	0	(1,007,427,967,691)	0	0

گواهی سپرده پیوسته شمش نقره 999.9
 تمام سکه طرح جدید 0411 آینده
 جمع

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به

2-3-1-مبالغ تخصیص یافته بابت خرید و نگهداری اوراق بهادار با درآمد ثابت (نرخ سود ترجیحی)

طرف معامله	نوع وابستگی	نام ورقه بهادار	تعداد اوراق	بهای تمام شده اوراق	مبلغ شناسایی شده بابت قرارداد خرید و نگهداری اوراق بهادار	نرخ اسمی	میانگین نرخ بازده تا سررسید قراردادهای منعقد
شرکت ...	مدیر صندوق	ورقه الف					
		ورقه ب					
شرکت ...	شرکت مادر	ورقه الف					
		ورقه د					
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ...	صندوق- سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی تحت مدیریت مدیر صندوق یا اشخاص تحت کنترل یا وابسته *	ورقه ج					
سایر	سایر	ورقه ح					
		ورقه ط					
		ورقه ی					
		ورقه س					

*به تفکیک هر یک از صندوق-های سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی طرف قرارداد افشا گردد.

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نفران)
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

5-2-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

1404/11/30		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	نام سپرده	
	یادداشت ...		یادداشت ...		
100.00%	2,671	100.00%	2,671	دي	
100.00%	2,671	100.00%	2,671	جمع	

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

6-2-درآمد حاصل از بازارگردانی:

<u>طی دوره</u>	
<u>1404/11/30</u>	
نام سهام	درآمد بازارگردان
	درآمد بازارگردان

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نفران)

درآمد سرمایه گذاری در اوراق مشتقه

برای ماه منتهی به 1404/11/30

7-2-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق مشتقه:

1404/11/30				طی دوره			
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق
درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...	درصد از کل درآمد ها	مبلغ	یادداشت ...	یادداشت ...

ق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا(د

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

2-8-سایر درآمدها:

طی دوره 1404/11/30

سایر درآمدها	مبلغ	مبلغ
--------------	------	------

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

درآمد سود سهام

اطلاعات مجمع طی دوره 1404/11/30

نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
----------	------------------	--------------------------------	---------------------	--------------------	-------------	---------------------	--------------------	-------------	---------------------

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

درآمد سود صندوق

1404/11/30

طی دوره

نام صندوق	تاریخ تقسیم سود	تعداد واحد صندوق در زمان تقسیم سود	سود متعلق به هر واحد	خالص درآمد سود صندوق	خالص درآمد سود صندوق
-----------	-----------------	------------------------------------	----------------------	----------------------	----------------------

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به 1404/11/30

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت

1404/11/30		طی دوره							
خالص	هزینه	درآمد سود	خالص	هزینه	درآمد سود	نرخ سود علی	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت	شرح
درآمد	تنزیل		درآمد	تنزیل		الحساب		سود	

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

سود سپرده بانکی

1404/11/30

طی دوره

شرح	درآمد سود	هزینه تنزیل	خالص درآمد	درآمد سود	هزینه تنزیل	خالص درآمد
دی	2,671	0	2,671	2,671	0	2,671
جمع	2,671	0	2,671	2,671	0	2,671

صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر کالای کهربا (نقران)
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به 1404/11/30

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

1404/11/30

طی دوره

شرح تعداد خالص بهای فروش ارزش دفتری سود و زیان ناشی از فروش تعداد خالص ارزش فروش ارزش دفتری سود و زیان ناشی از فروش

صندوق سرمایه گذاری مبتنی برکالای کهربا(نقران)
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به 1404/11/30

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

1404/11/30		طی دوره						
شرح	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
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره 999.9		24,344,497,763,712	25,351,925,731,403	(1,007,427,967,691)	4,851,504	24,344,497,763,712	25,351,925,731,403	(1,007,427,967,691)
جمع		24,344,497,763,712	25,351,925,731,403	(1,007,427,967,691)	4,851,504	24,344,497,763,712	25,351,925,731,403	(1,007,427,967,691)

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