



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش افشای پرتفوی ماهانه
برای ماه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۸/۰۲/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۱/۳۱			نام شرکت
درصد به کل دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۵۴.۱۰٪	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۵,۱۲۳	۳,۸۵۰,۰۰۰	۳,۲۸۴,۰۴۴,۲۵۰	(۶۵۰,۰۰۰)	۱۸,۰۰۰,۵۵۲,۷۲۴	۴,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۵۴.۱۰٪	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳		۳,۸۵۰,۰۰۰	۳,۲۸۴,۰۴۴,۲۵۰	(۶۵۰,۰۰۰)	۱۸,۰۰۰,۵۵۲,۷۲۴	۴,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

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

۱۳۹۸/۰۲/۳۱				۱۳۹۸/۰۱/۳۱				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

۱۳۹۸/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۱/۳۱			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت									
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فرابورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد										

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

(بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه‌گذاری)

۱۳۹۸/۰۲/۳۱

نام شرکت	تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل
----------	-------	-------------	------------------	------------	-------------------------	-------

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۱/۳۱		سپرده			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۱۳.۰۰%	۴,۷۳۱,۳۷۶,۸۴۱	۲۳۷,۵۰۲,۴۰۰	۳,۹۳۳,۲۸۱,۸۱۸	۱,۰۳۵,۵۹۷,۴۲۳	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۴.۰۵%	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۲.۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱۳,۴۸۱,۳۷۶,۸۴۱	۲۳۷,۵۰۲,۴۰۰	۳,۹۳۳,۲۸۱,۸۱۸	۹,۷۸۵,۵۹۷,۴۲۳					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۲/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۱/۳۱				اطلاعات اوراق گواهی سپرده			
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرابورسی	نرخ سود	نرخ فروش	تاریخ سررسید	نرخ سود
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۲/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۴,۹۶۶,۶۹۰,۹۴۶	۹۶,۶۳٪	۱۳,۶۵٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰,۰۰	۰,۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۱۷۳,۲۸۱,۷۹۹	۳,۳۷٪	۰,۴۸٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰,۰۰	۰,۰۰
جمع		۵,۱۳۹,۹۷۲,۷۴۵		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۲-۱- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره

۱۳۹۸/۰۲/۳۱

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					۱۳۹۸/۰۲/۳۱					نام شرکت
درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
۱۰۰.۰۰٪	۴,۹۶۶,۶۹۰,۹۴۶	۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۰	۱۰۰.۰۰٪	۴,۹۶۶,۶۹۰,۹۴۶	۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
	۴,۹۶۶,۶۹۰,۹۴۶	۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۰		۴,۹۶۶,۶۹۰,۹۴۶	۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۱-۱-۲- درآمد سود سهام

نام شرکت	اطلاعات مجمع		تغییرات طی دوره		از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		
	تاریخ 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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۲-۱-۲- درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۲/۳۱				نام شرکت
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	
۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۰	۳,۸۵۰,۰۰۰	۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۰	۳,۸۵۰,۰۰۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۰	۳,۸۵۰,۰۰۰	۴,۲۸۲,۷۲۶,۵۳۷	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۰	۳,۸۵۰,۰۰۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۳-۱-۲- سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				تغییرات طی دوره				نام شرکت
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	
۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۲,۶۰۰,۰۷۹,۸۴۱	۳,۲۸۴,۰۴۴,۲۵۰	۶۵۰,۰۰۰	۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۲,۶۰۰,۰۷۹,۸۴۱	۳,۲۸۴,۰۴۴,۲۵۰	۶۵۰,۰۰۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۲,۶۰۰,۰۷۹,۸۴۱	۳,۲۸۴,۰۴۴,۲۵۰		۶۸۳,۹۶۴,۴۰۹	۲,۶۰۰,۰۷۹,۸۴۱	۳,۲۸۴,۰۴۴,۲۵۰		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۲-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۲/۳۱				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		تغییرات 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
	۲۲,۲۴۱,۸۰۷		۶,۰۷۲,۹۱۴	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۳۵۳,۸۵۲,۵۸۵		۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۳۷۶,۰۹۴,۳۹۲		۱۷۳,۲۸۱,۷۹۹		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			تغییرات طی دوره			مشخصات			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	توضیحات
♦	♦	♦	♦	♦	♦				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۲/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۲/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	سایر درآمدها برای تنزیل سود سهام
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	جمع