



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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۲/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۳/۳۱		
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد
				مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد			
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۳,۸۵۰,۰۰۰	۸,۳۵۳,۹۱۲,۴۷۹	(۱,۴۹۷,۱۶۵)	۹,۵۰۹,۳۳۳,۷۰۷	۱,۷۰۰,۰۰۰	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۳,۸۵۰,۰۰۰
جمع	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۳,۸۵۰,۰۰۰	۸,۳۵۳,۹۱۲,۴۷۹	(۱,۴۹۷,۱۶۵)	۹,۵۰۹,۳۳۳,۷۰۷	۱,۷۰۰,۰۰۰	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۳,۸۵۰,۰۰۰
	دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد
	۵۸.۷۹%	۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۱۸,۶۰۹,۶۵۷,۵۳۳	۵,۵۴۴	۴,۰۵۲,۸۳۵	۸,۳۵۳,۹۱۲,۴۷۹	(۱,۴۹۷,۱۶۵)	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۳,۸۵۰,۰۰۰
	۵۸.۷۹%	۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۱۸,۶۰۹,۶۵۷,۵۳۳		۴,۰۵۲,۸۳۵	۸,۳۵۳,۹۱۲,۴۷۹	(۱,۴۹۷,۱۶۵)	۱۹,۶۸۳,۱۹۹,۴۲۱	۱۵,۴۰۰,۴۷۲,۸۸۳	۳,۸۵۰,۰۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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

۱۳۹۸/۰۳/۳۱				۱۳۹۸/۰۲/۳۱				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 ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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

۱۳۹۸/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۲/۳۱		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 ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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)

۱۳۹۸/۰۳/۳۱					نام شرکت
دلایل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	درصد تعدیل	مبلغ پس از تعدیل	قیمت پایانی	تعداد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۲/۳۱		سپرده			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۱۲.۱۶٪	۴,۶۲۸,۱۳۱,۰۸۶	۱۳,۸۶۸,۴۹۳,۲۵۶	۹,۱۳۷,۱۱۶,۴۱۵	۴,۷۳۱,۳۷۶,۸۴۱	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۲.۹۸٪	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
	۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶	۱۳,۸۶۸,۴۹۳,۲۵۶	۹,۱۳۷,۱۱۶,۴۱۵	۱۳,۴۸۱,۳۷۶,۸۴۱					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۳/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۲/۳۱				اطلاعات اوراق گواهی سپرده			
درصد به کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرابورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۳/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۱,۵۴۰,۶۴۵,۶۱۳	۸۹.۸۴٪	۴.۰۵٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۱۷۴,۲۲۱,۴۲۷	۱۰.۱۶٪	۰.۴۶٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
جمع		۱,۷۱۴,۸۶۷,۰۴۰		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					۱۳۹۸/۰۳/۳۱					نام شرکت
درصد از کل	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
۱۰۰.۰۰٪	۶,۵۰۷,۳۳۶,۵۵۸	۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۰	۱۰۰.۰۰٪	۱,۵۴۰,۶۴۵,۶۱۳	۲,۰۵۳,۷۶۳,۴۲۲	(۵۱۳,۱۱۷,۸۰۹)	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
	۶,۵۰۷,۳۳۶,۵۵۸	۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۰		۱,۵۴۰,۶۴۵,۶۱۳	۲,۰۵۳,۷۶۳,۴۲۲	(۵۱۳,۱۱۷,۸۰۹)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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 ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۳/۳۱				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	
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۱۸,۶۰۹,۶۵۷,۵۳۳	۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۴,۰۵۲,۸۳۵	(۵۱۳,۱۱۷,۸۰۹)	۲۲,۸۹۲,۳۸۴,۰۷۰	۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۴,۰۵۲,۸۳۵	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۱۸,۶۰۹,۶۵۷,۵۳۳	۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۴,۰۵۲,۸۳۵	(۵۱۳,۱۱۷,۸۰۹)	۲۲,۸۹۲,۳۸۴,۰۷۰	۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۴,۰۵۲,۸۳۵	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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	
۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۸,۹۰۰,۲۲۸,۸۹۸	۱۱,۶۳۷,۹۵۶,۷۲۹	۲,۱۴۷,۱۶۵	۲,۰۵۳,۷۶۳,۴۲۲	۶,۳۰۰,۱۴۹,۰۵۷	۸,۳۵۳,۹۱۲,۴۷۹	۱,۴۹۷,۱۶۵	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۸,۹۰۰,۲۲۸,۸۹۸	۱۱,۶۳۷,۹۵۶,۷۲۹		۲,۰۵۳,۷۶۳,۴۲۲	۶,۳۰۰,۱۴۹,۰۵۷	۸,۳۵۳,۹۱۲,۴۷۹		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۳/۳۱				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 ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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
	۲۹,۲۵۴,۳۴۹		۷,۰۱۲,۵۴۲	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۵۲۱,۰۶۱,۴۷۰		۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۵۵۰,۳۱۵,۸۱۹		۱۷۴,۲۲۱,۴۲۷		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

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
۲۹,۲۵۴,۳۴۹	۰	۲۹,۲۵۴,۳۴۹	۷,۰۱۲,۵۴۲	۰	۷,۰۱۲,۵۴۲	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱,۵۲۰,۹۵۸,۴۶۰	۱۰۳,۰۱۰	۱,۵۲۱,۰۶۱,۴۷۰	۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۰	۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۲۲.۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱,۵۵۰,۲۱۲,۸۰۹	۱۰۳,۰۱۰	۱,۵۵۰,۳۱۵,۸۱۹	۱۷۴,۲۲۱,۴۲۷	۰	۱۷۴,۲۲۱,۴۲۷				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۳/۳۱ 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