



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش افشای پرتفوی ماهانه
برای ماه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۳۹۸

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۱-سرمایه گذاری ها

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

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۷/۳۰			نام شرکت			
درصد به کل دارایی های 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				
۷۳/۷۷٪	۴۵,۷۳۵,۷۳۵,۸۵۲	۴۵,۳۸۷,۷۶۷,۷۶۴	۷,۸۵۹	۵,۸۴۲,۸۴۸	۱۷,۲۰۹,۱۹۱,۷۶۵	(۲,۱۴۴,۴۶۷)	۱۵,۱۹۱,۲۸۶,۵۹۴	۱,۹۴۴,۶۱۱	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱	۴۶,۸۲۴,۹۵۱,۲۱۶	۶,۰۴۲,۷۰۴	رخانجات تولیدی شیشه رازی
۷۳/۷۷٪	۴۵,۷۳۵,۷۳۵,۸۵۲	۴۵,۳۸۷,۷۶۷,۷۶۴		۵,۸۴۲,۸۴۸	۱۷,۲۰۹,۱۹۱,۷۶۵	(۲,۱۴۴,۴۶۷)	۱۵,۱۹۱,۲۸۶,۵۹۴	۱,۹۴۴,۶۱۱	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱	۴۶,۸۲۴,۹۵۱,۲۱۶	۶,۰۴۲,۷۰۴	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

۱۳۹۸/۰۸/۳۰				۱۳۹۸/۰۷/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۲- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۷/۳۰		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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۳-۱-سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۷/۳۰		سپرده			
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	سپرده
۰/۰۰٪	۲۰۰,۰۰۰	۴,۱۶۰,۶۷۰,۷۵۲	۴,۱۶۰,۶۷۰,۷۵۲	۲۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۴/۱۱٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۱/۳۸٪	۷,۰۵۷,۵۳۴,۲۴۶	.	۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۷,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۲۵/۵۰٪	۱۵,۸۰۷,۷۳۴,۲۴۶	۴,۱۶۰,۶۷۰,۷۵۲	۴,۲۱۸,۲۰۴,۹۹۸	۱۵,۷۵۰,۲۰۰,۰۰۰					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۴-۱ سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۸/۳۰				تغییرات طی دوره			۱۳۹۸/۰۷/۳۰			اطلاعات اوراق گواهی سپرده					
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فراپورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده								

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۸/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	(۳۸۳,۰۸۰,۶۷۸)	۲۱۰/۹۴٪	(۰/۶۲٪)
سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰/۰۰	۰/۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۲۰۱,۳۶۹,۸۶۲	(۱۱۰/۸۸٪)	۰/۳۲٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	(۰/۰۶٪)	۰/۰۰٪
جمع		(۱۸۱,۶۰۷,۸۰۶)		

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		۱۳۹۸/۰۸/۳۰						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	
۱۰۰/۳۸٪	۷,۸۶۵,۹۱۶,۹۰۶	۷,۱۳۸,۴۳۰,۶۲۱	۱۷,۶۸۸,۲۳۶	۷۰۹,۷۹۸,۰۴۹	۱	(۳۸۳,۰۸۰,۶۷۸)	۴۳۱,۲۵۹,۷۹۹	(۸۱۴,۳۴۰,۴۷۷)	۰	کارخانجات تولیدی شیشه رازی
(۰/۳۸٪)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	۰	۰	-/۰۰	۰	۰	۰	۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۰۰/۰۰٪	۷,۸۳۵,۹۴۰,۰۱۷	۷,۱۰۸,۴۵۳,۷۳۲	۱۷,۶۸۸,۲۳۶	۷۰۹,۷۹۸,۰۴۹	۱۰۰/۰۰٪	(۳۸۳,۰۸۰,۶۷۸)	۴۳۱,۲۵۹,۷۹۹	(۸۱۴,۳۴۰,۴۷۷)	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
خانجات تولیدی شیشه رازی	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۸۰	-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۸,۶۹۴,۶۳۱	۷۰۹,۷۹۸,۰۴۹
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۸,۶۹۴,۶۳۱	۷۰۹,۷۹۸,۰۴۹

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰				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	
۱۷,۶۸۸,۲۳۶	۴۵,۷۱۸,۰۳۷,۶۱۵	۴۵,۷۳۵,۷۲۵,۸۵۱	۵,۸۴۲,۸۴۸	(۸۱۴,۳۴۰,۴۷۷)	۴۶,۵۵۰,۰۶۶,۳۲۹	۴۵,۷۳۵,۷۲۵,۸۵۱	۵,۸۴۲,۸۴۸	رخانجات تولیدی شیشه رازی
۱۷,۶۸۸,۲۳۶	۴۵,۷۱۸,۰۳۷,۶۱۵	۴۵,۷۳۵,۷۲۵,۸۵۱	۵,۸۴۲,۸۴۸	(۸۱۴,۳۴۰,۴۷۷)	۴۶,۵۵۰,۰۶۶,۳۲۹	۴۵,۷۳۵,۷۲۵,۸۵۱	۵,۸۴۲,۸۴۸	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

نام شرکت	تغییرات طی دوره			از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری
کارخانجات تولیدی شیشه رازی	۲,۱۴۴,۴۶۷	۱۷,۲۰۹,۱۹۱,۷۶۵	۱۶,۷۷۷,۹۳۱,۹۶۶	۴۳۱,۲۵۹,۷۹۹	۹,۹۴۵,۶۱۰	۷۲,۳۹۴,۶۴۹,۹۱۹	۶۵,۲۵۶,۲۱۹,۲۹۸
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹
جمع		۱۷,۲۰۹,۱۹۱,۷۶۵	۱۶,۷۷۷,۹۳۱,۹۶۶	۴۳۱,۲۵۹,۷۹۹		۷۴,۷۳۵,۴۸۷,۸۷۹	۶۷,۶۲۷,۰۳۴,۱۴۷
							۷,۱۳۸,۴۳۰,۶۲۱
							(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
							۷,۱۰۸,۴۵۳,۷۳۲

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۲-۳- درآمد حاصل از سرمایه گذاری 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
	۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶		۰	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۷۱۶,۱۸۱,۶۶۶		۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۵۷,۵۳۴,۲۴۶		۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۹۴۴,۰۷۰,۸۰۸		۲۰۱,۳۶۹,۸۶۲		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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
۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶	۰	۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶	۰	۰	۰	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۷۱۶,۱۳۷,۳۵۱	۴۴,۳۱۵	۷۱۶,۱۸۱,۶۶۶	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۰	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۰	۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۰	۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۹۴۴,۰۲۶,۴۹۳	۴۴,۳۱۵	۹۴۴,۰۷۰,۸۰۸	۲۰۱,۳۶۹,۸۶۲	۰	۲۰۱,۳۶۹,۸۶۲				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۸/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰/۰۰	۰/۰۰	۰	۰	سایر درآمدها برای تنزیل سود سهام
۰/۰۰٪	(۰/۰۶٪)	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰/۰۰	۰/۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰/۰۰٪	(۰/۰۶٪)	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	جمع