



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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۸/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰			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				
۶۶.۵۳٪	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۳۹,۱۵۳,۶۵۹,۹۷۲	۷,۴۵۰	۶,۸۷۲,۸۵۳	۱۹,۱۵۱,۸۹۷,۵۸۴	(۲,۲۳۴,۲۵۴)	۱۱,۲۰۹,۵۱۹,۲۰۸	۳,۲۶۴,۲۵۹	۴۵,۷۳۵,۷۲۵,۸۵۲	۴۵,۳۸۷,۷۶۷,۷۶۴	۵,۸۴۲,۸۴۸	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۶۶.۵۳٪	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۳۹,۱۵۳,۶۵۹,۹۷۲		۶,۸۷۲,۸۵۳	۱۹,۱۵۱,۸۹۷,۵۸۴	(۲,۲۳۴,۲۵۴)	۱۱,۲۰۹,۵۱۹,۲۰۸	۳,۲۶۴,۲۵۹	۴۵,۷۳۵,۷۲۵,۸۵۲	۴۵,۳۸۷,۷۶۷,۷۶۴	۵,۸۴۲,۸۴۸	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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

۱۳۹۸/۰۹/۳۰				۱۳۹۸/۰۸/۳۰				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 ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

۱۳۹۸/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰		اطلاعات اوراق بهادار یا 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 ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

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

۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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 ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۸/۳۰		سپرده			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	سپرده
۱۲.۲۱٪	۹,۳۶۱,۱۹۸,۰۷۴	۵,۳۲۵,۲۳۲,۵۳۵	۱۴,۶۸۶,۲۳۰,۶۰۹	۲۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۱.۴۱٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۹.۲۸٪	۷,۱۱۵,۵۴۱,۳۷۷	.	۵۸,۰۰۷,۱۳۱	۷,۰۵۷,۵۳۴,۲۴۶	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۲.۹۱٪	۲۵,۲۲۶,۷۳۹,۴۵۱	۵,۳۲۵,۲۳۲,۵۳۵	۱۴,۷۴۴,۲۳۷,۷۴۰	۱۵,۸۰۷,۷۳۴,۲۴۶					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۹/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰				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 ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۹/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۱۳,۲۰۵,۱۰۸,۳۸۳	۹۸.۴۹٪	۱۷.۲۳٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۲۰۱,۸۴۲,۷۴۷	۱.۵۱٪	۰.۲۶٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
جمع		۱۳,۴۰۷,۰۵۴,۱۴۰		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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

درصد از کل درآمدها	از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					۱۳۹۸/۰۹/۳۰					نام شرکت
	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام		
۱۰۰.۱۴%	۲۱,۰۷۵,۶۸۷,۹۷۵	۸,۷۲۸,۳۱۶,۷۶۷	۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵	۱	۱۳,۲۰۵,۱۰۸,۳۸۳	۱,۵۸۹,۸۸۶,۱۴۶	۱۱,۶۱۵,۲۲۲,۲۳۷	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	
(۰.۱۴%)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	۰	۰	۰.۰۰	۰	۰	۰	۰	تولید نیروی برق دماوند	
۱۰۰.۰۰%	۲۱,۰۴۵,۷۱۱,۰۸۶	۸,۶۹۸,۳۳۹,۸۷۸	۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵	۱۰۰.۰۰%	۱۳,۲۰۵,۱۰۸,۳۸۳	۱,۵۸۹,۸۸۶,۱۴۶	۱۱,۶۱۵,۲۲۲,۲۳۷	۰	جمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۸۰	-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۴۰,۳۱,۹۴۵	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۴۰,۳۱,۹۴۵	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۹/۳۰				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	
۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	۳۹,۳۶۵,۵۴۵,۳۸۵	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۶,۸۷۲,۸۵۳	۱۱,۶۱۵,۲۲۲,۲۳۷	۳۹,۳۸۳,۲۳۳,۶۲۱	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۶,۸۷۲,۸۵۳	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	۳۹,۳۶۵,۵۴۵,۳۸۵	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۶,۸۷۲,۸۵۳	۱۱,۶۱۵,۲۲۲,۲۳۷	۳۹,۳۸۳,۲۳۳,۶۲۱	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۶,۸۷۲,۸۵۳	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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 شیشه‌سازی	۲,۲۳۴,۲۵۴	۱۹,۱۵۱,۸۹۷,۵۸۴	۱۷,۵۶۲,۰۱۱,۴۳۸	۱,۵۸۹,۸۸۶,۱۴۶	۱۲,۱۷۹,۸۶۴	۹۱,۵۴۶,۵۴۷,۵۰۳	۸۲,۸۱۸,۲۳۰,۷۳۶
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹
جمع	۱۹,۱۵۱,۸۹۷,۵۸۴	۱۷,۵۶۲,۰۱۱,۴۳۸	۱,۵۸۹,۸۸۶,۱۴۶	۹۳,۸۸۷,۳۸۵,۴۶۳	۸۵,۱۸۹,۰۴۵,۵۸۵	۸,۶۹۸,۳۳۹,۸۷۸	۸,۶۹۸,۳۳۹,۸۷۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۹/۳۰				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 ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۲-۳- 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
	۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶		۰	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۸۶۰,۰۱۷,۲۸۲		۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱۱۵,۵۴۱,۳۷۷		۵۸,۰۰۷,۱۳۱	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۰		۰	۱۰۴۳۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱,۱۴۵,۹۱۳,۵۵۵		۲۰۱,۸۴۲,۷۴۷		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

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
۸۵۹,۹۷۲,۹۶۷	۴۴,۳۱۵	۸۶۰,۰۱۷,۲۸۲	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۰	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۱۵,۵۴۱,۳۷۷	۰	۱۱۵,۵۴۱,۳۷۷	۵۸,۰۰۷,۱۳۱	۰	۵۸,۰۰۷,۱۳۱	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۱۴۵,۸۶۹,۲۴۰	۴۴,۳۱۵	۱,۱۴۵,۹۱۳,۵۵۵	۲۰۱,۸۴۲,۷۴۷	۰	۲۰۱,۸۴۲,۷۴۷				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۹/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	سایر درآمدها برای تنزیل سود سهام
۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	جمع