



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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها
 ۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۱/۳۰		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده			
			تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده					
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۴۲,۳۱۶,۳۰۶,۵۵۰	۲۸,۸۵۲,۵۰۲,۳۷۵	۱۲,۰۶۴	۴۹,۳۹۳,۳۰۷,۴۴۳	(۴,۸۰۲,۳۰۴)	۲۹,۷۴۳,۹۲۳,۲۱۸	۲,۹۶۹,۶۶۳	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۳۳,۱۲۴,۸۸۳,۰۲۹	۵,۳۵۴,۳۴۴	
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱۹,۴۶۷,۹۳۱,۷۷۹	۱۳,۹۰۶,۷۸۵,۴۱۷	۱۴,۳۷۲	۲۱۵,۱۳۸,۱۶۷	(۱۵,۰۰۰)	۱۴,۰۶۰,۱۶۹,۰۸۳	۱,۳۷۵,۰۰۰	۰	۰	۰	
جمع	۶۱,۷۸۴,۲۳۸,۳۲۹	۴۲,۷۵۹,۲۸۸,۷۹۲	۴,۸۸۱,۷۰۳	۴۹,۶۰۸,۴۴۵,۶۰۰	(۴,۸۱۷,۳۰۴)	۴۳,۸۰۴,۰۹۲,۳۰۱	۴,۳۴۴,۶۶۳	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۳۳,۱۲۴,۸۸۳,۰۲۹	۵,۳۵۴,۳۴۴	
درصد به کل دارایی‌های صندوق	۳۵,۷۷٪										
	۱۶,۴۴٪										
	۵۲,۲۳٪										

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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

۱۳۹۸/۱۱/۳۰				۱۳۹۸/۱۰/۳۰				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 ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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

۱۳۹۸/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۰/۳۰		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		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فرابورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					تعداد	مبلغ فروش										

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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 ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۰/۳۰		سپرده			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	سپرده
۳۴.۱۶٪	۴۰,۴۱۲,۱۹۴,۳۳۰	۶,۷۳۸,۱۰۵,۵۷۲	۳۱,۱۵۶,۱۱۶,۳۹۰	۱۵,۹۹۴,۱۸۳,۵۱۲	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۷.۴۰٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۶.۰۳٪	۷,۱۳۱,۵۶۲,۲۹۴	۱۰۰,۲۳۷,۷۶۲	۵۸,۱۳۷,۷۳۶	۷,۱۷۳,۶۶۲,۳۲۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۸٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۳۷,۷۶۲	۱۰۰,۲۳۷,۷۶۲	۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۷.۶۶٪	۵۶,۳۹۳,۷۵۶,۶۲۴	۶,۸۳۸,۵۸۱,۰۹۶	۳۱,۳۱۴,۴۹۱,۸۸۸	۳۱,۹۱۷,۸۴۵,۸۳۲					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۱۱/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰			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 فراپورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	گواهی سپرده بانکی
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	یادداشت	شرح
۱۸.۱۷٪	۹۹.۰۳٪	۲۱,۴۹۵,۶۴۴,۰۴۱	۲-۱	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۲-۲	سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۰.۱۸٪	۰.۹۷٪	۲۱۰,۱۶۸,۰۵۵	۲-۳	درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۱۰۳,۰۱۰	۲-۴	سایر درآمدها
		۲۱,۷۰۵,۹۱۵,۱۰۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					۱۳۹۸/۱۱/۳۰					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	
۸۸.۸۵%	۴۴,۵۷۱,۵۴۳,۶۳۵	۳۰,۴۲۸,۸۷۱,۴۸۴	۱۳,۴۲۴,۱۷۹,۴۷۱	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	.۷۴	۱۵,۸۷۲,۷۴۳,۱۷۸	۱۵,۳۰۰,۲۴۶,۸۱۷	۵۷۲,۴۹۶,۳۶۱	.	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۱۱.۲۱%	۵,۶۲۲,۹۰۰,۸۶۳	۶۱,۷۵۴,۵۰۱	۵,۵۶۱,۱۴۶,۳۶۲	.	.۳	۵,۶۲۲,۹۰۰,۸۶۳	۶۱,۷۵۴,۵۰۱	۵,۵۶۱,۱۴۶,۳۶۲	.	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۰.۰۶%)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	.	.	۰.۰۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۱.۱۵%	۵۰,۱۶۴,۴۶۷,۶۰۹	۳۰,۴۶۰,۶۴۹,۰۹۶	۱۸,۹۸۵,۳۲۵,۸۳۳	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۲۶.۱۶%	۲۱,۴۹۵,۶۴۴,۰۴۱	۱۵,۳۶۲,۰۰۱,۳۱۸	۶,۱۳۳,۶۴۲,۷۲۳	.	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۱۱/۳۰				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	
۱۳,۴۲۴,۱۷۹,۴۷۱	۲۸,۸۹۲,۱۲۷,۰۷۹	۴۲,۳۱۶,۳۰۶,۵۵۰	۳,۵۲۱,۷۰۳	۵۷۲,۴۹۶,۳۶۱	۴۱,۷۴۳,۸۱۰,۱۸۹	۴۲,۳۱۶,۳۰۶,۵۵۰	۳,۵۲۱,۷۰۳	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۵,۵۶۱,۱۴۶,۳۶۲	۱۳,۹۰۶,۷۸۵,۴۱۷	۱۹,۴۶۷,۹۳۱,۷۷۹	۱,۳۶۰,۰۰۰	۵,۵۶۱,۱۴۶,۳۶۲	۱۳,۹۰۶,۷۸۵,۴۱۷	۱۹,۴۶۷,۹۳۱,۷۷۹	۱,۳۶۰,۰۰۰	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۱۸,۹۸۵,۳۲۵,۸۳۳	۴۲,۷۹۸,۹۱۲,۴۹۶	۶۱,۷۸۴,۲۳۸,۳۲۹	۴,۸۸۱,۷۰۳	۶,۱۳۳,۶۴۲,۷۲۳	۵۵,۶۵۰,۵۹۵,۶۰۶	۶۱,۷۸۴,۲۳۸,۳۲۹	۴,۸۸۱,۷۰۳	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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

نام شرکت	تغییرات طی دوره			از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۴,۸۰۲,۳۰۴	۴۹,۳۹۳,۳۰۷,۴۳۳	۳۴,۰۹۳,۰۶۰,۶۱۶	۲۰,۸۸۹,۹۷۹	۱۷۰,۹۵۸,۳۴۸,۷۶۳	۱۴۰,۵۲۹,۳۷۷,۳۷۹
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱۵,۰۰۰	۲۱۵,۱۳۸,۱۶۷	۱۵۳,۳۸۳,۶۶۶	۱۵,۰۰۰	۲۱۵,۱۳۸,۱۶۷	۱۵۳,۳۸۳,۶۶۶
تولید نیروی برق دماوند	.	.	.	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹
جمع		۴۹,۶۰۸,۴۴۵,۶۰۰	۳۴,۲۴۶,۴۴۴,۲۸۲		۱۷۳,۵۱۴,۲۲۴,۸۹۰	۱۴۳,۰۵۳,۵۷۵,۷۹۴
						۳۰,۴۶۰,۶۴۹,۰۹۶
						۳۰,۴۲۸,۸۷۱,۴۸۴
						۶۱,۷۵۴,۵۰۱
						(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۱۱/۳۰				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 ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۲-۲- 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
	۱۷۸,۵۴۹,۵۹۹		۸,۱۹۴,۷۰۳	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۱۴۷,۶۸۸,۵۱۴		۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۲۳۲,۱۶۰,۰۵۶		۵۸,۱۳۷,۷۳۶	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۰		۰	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱,۵۵۸,۳۹۸,۱۶۹		۲۱۰,۱۶۸,۰۵۵		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

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
۱۷۸,۵۴۹,۵۹۹	۰	۱۷۸,۵۴۹,۵۹۹	۸,۱۹۴,۷۰۳	۰	۸,۱۹۴,۷۰۳	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱,۱۴۷,۶۴۴,۱۹۹	۴۴,۳۱۵	۱,۱۴۷,۶۸۸,۵۱۴	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۰	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۳۲,۱۶۰,۰۵۶	۰	۲۳۲,۱۶۰,۰۵۶	۵۸,۱۳۷,۷۳۶	۰	۵۸,۱۳۷,۷۳۶	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۵۵۸,۳۵۳,۸۵۴	۴۴,۳۱۵	۱,۵۵۸,۳۹۸,۱۶۹	۲۱۰,۱۶۸,۰۵۵	۰	۲۱۰,۱۶۸,۰۵۵				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۱۱/۳۰ 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