



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
گزارش افشای پرتفوی ماهانه  
برای ماه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۹/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹			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				
۱۶.۴۷٪	۲۳,۷۶۹,۴۵۵,۴۴۵	۱۴,۳۳۱,۳۲۹,۱۰۷	۱۹,۷۵۰	۱,۲۰۸,۳۳۸	۳,۶۷۰,۶۴۳,۹۸۰	(۲۱۷,۵۰۰)	۲۲۸,۱۰۲,۰۰۴	۱۵,۰۰۰	۱۹,۶۷۲,۹۲۲,۵۸۹	۱۶,۶۸۰,۱۱۷,۳۷۰	۱,۴۱۰,۸۳۸	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۳۰.۰۰٪	۴۳,۲۹۰,۲۵۱,۸۵۴	۴۰,۱۶۸,۴۱۸,۵۲۵	۱۷,۳۲۱	۲,۵۰۹,۳۰۵	۷۰,۷۴۸,۸۶۵,۸۶۱	(۴,۰۴۲,۷۸۶)	۵۵,۹۴۲,۷۲۰,۰۳۸	۳,۲۵۲,۱۶۱	۵۰,۵۳۰,۶۹۸,۶۵۶	۴۱,۰۸۷,۱۵۳,۶۴۱	۳,۲۹۹,۹۳۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی جمع
۴۶.۴۷٪	۶۷,۰۵۹,۷۰۷,۲۹۹	۵۴,۴۹۹,۷۴۷,۶۳۲			۷۵,۹۵۵,۹۹۳,۴۶۱	(۴,۴۵۶,۵۶۸)	۵۷,۷۳۷,۱۵۹,۶۱۱		۷۰,۲۰۳,۶۲۱,۲۴۵	۵۷,۷۶۷,۲۷۱,۰۱۱		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۱/۳۱				۱۳۹۸/۱۲/۲۹				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 ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹		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 فراپورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده										

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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)

۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت پورتفوی  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۲/۲۹				سپرده	
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۴۰.۵۸٪	۵۸,۵۶۵,۰۹۳,۰۰۵	۲۶,۴۳۹,۶۷۸,۶۰۶	۴۹,۵۰۸,۱۴۵,۲۸۸	۳۵,۴۹۶,۶۲۶,۳۲۳	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۶.۰۶٪	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
۵.۷۰٪	۸,۲۲۲,۷۸۱,۷۲۶	۲۳۸,۹۹۱,۳۰۸	۸,۱۹۵,۶۱۷,۴۶۲	۲۶۶,۱۵۵,۵۷۲	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۷٪	۱۰۵,۲۱۹,۶۵۲	۲۳۳,۴۲۱,۶۵۶	۲۳۸,۶۴۱,۳۰۸	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۵۲.۴۲٪	۷۵,۶۴۳,۰۹۴,۳۸۳	۲۶,۹۱۲,۰۹۱,۵۷۰	۵۷,۹۴۲,۴۰۴,۰۵۸	۴۴,۶۱۲,۷۸۱,۸۹۵					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۱/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹			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 فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۹/۰۱/۳۱	یادداشت	شرح
۱۰.۴۷٪	۹۹.۰۳٪	۱۵,۱۰۴,۷۷۳,۸۵۴	۲-۱	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۲-۲	سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۰.۱۰٪	۰.۹۷٪	۱۴۸,۱۸۷,۶۶۴	۲-۳	درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۱۰۳,۰۱۰	۲-۴	سایر درآمدها
		۱۵,۲۵۳,۰۶۴,۵۲۸		جمع



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

درصد از کل درآمدها	از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۹/۰۱/۳۱				نام شرکت	
	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش		درآمد سود سهام
۸۳.۱۱٪	۶۴,۰۹۱,۹۰۶,۶۴۱	۶۰,۲۵۴,۱۸۱,۴۸۶	۳,۱۱۹,۲۳۲,۴۷۵	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۵۰.۱	۷,۵۶۵,۶۹۹,۰۲۳	۱۳,۸۷۷,۸۰۳,۹۲۹	(۶,۳۱۲,۱۰۴,۹۰۶)	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۱۶.۹۷٪	۱۳,۰۸۴,۵۴۱,۶۷۹	۳,۶۴۶,۴۱۵,۳۴۲	۹,۴۳۸,۱۲۶,۳۳۷	۰	۴۹.۹	۷,۵۳۹,۰۷۴,۸۳۱	۱,۰۹۳,۷۵۳,۷۱۳	۶,۴۴۵,۳۲۱,۱۱۸	۰	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۰.۰۴٪)	(۲۹,۸۵۳,۹۴۹)	(۲۹,۸۵۳,۹۴۹)	۰	۰	۰.۰۰۰	۰	۰	۰	۰	بانک ملت
(۰.۰۴٪)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	۰	۰	۰.۰۰	۰	۰	۰	۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۰۰.۰۰٪	۷۷,۱۱۶,۶۱۷,۴۸۲	۶۳,۸۴۰,۷۶۵,۹۹۰	۱۲,۵۵۷,۳۵۸,۸۱۲	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۱۰۰.۰۰٪	۱۵,۱۰۴,۷۷۳,۸۵۴	۱۴,۹۷۱,۵۵۷,۶۴۲	۱۳۳,۲۱۶,۲۱۲	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۱-۲- درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			تغییرات طی دوره			اطلاعات مجمع			نام شرکت
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ مجمع	
۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-	-	-	۱۸۰	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-	-	-				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				طی ماه			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
۳,۱۱۹,۲۳۲,۴۷۵	۴۰,۱۷۱,۰۱۹,۳۷۹	۴۳,۲۹۰,۲۵۱,۸۵۴	۲,۵۰۹,۳۰۵	(۶,۳۱۲,۱۰۴,۹۰۶)	۴۹,۶۰۲,۳۵۶,۷۶۱	۴۳,۲۹۰,۲۵۱,۸۵۴	۲,۵۰۹,۳۰۵	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۹,۴۳۸,۱۲۶,۳۳۷	۱۴,۳۳۱,۳۲۹,۱۰۷	۲۳,۷۶۹,۴۵۵,۴۴۴	۱,۲۰۸,۳۳۸	۶,۴۴۵,۳۲۱,۱۱۸	۱۷,۳۲۴,۱۳۴,۳۲۶	۲۳,۷۶۹,۴۵۵,۴۴۴	۱,۲۰۸,۳۳۸	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۱۲,۵۵۷,۳۵۸,۸۱۲	۵۴,۵۰۲,۳۴۸,۴۸۶	۶۷,۰۵۹,۷۰۷,۲۹۸		۱۳۳,۲۱۶,۲۱۲	۶۶,۹۲۶,۴۹۱,۰۸۷	۶۷,۰۵۹,۷۰۷,۲۹۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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 شیشه‌رازی	۴,۰۴۲,۷۸۶	۷۰,۷۴۸,۸۶۵,۸۶۱	۵۶,۸۷۱,۰۶۱,۹۳۲	۱۳,۸۷۷,۸۰۳,۹۲۹	۲۸,۵۲۳,۳۰۰	۲۹۳,۹۴۹,۴۵۱,۷۳۸	۲۳۳,۶۹۵,۲۷۰,۲۵۲
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۲۱۷,۵۰۰	۳,۶۷۰,۶۴۳,۹۸۰	۲,۵۷۶,۸۹۰,۲۶۷	۱,۰۹۳,۷۵۳,۷۱۳	۱,۳۵۱,۳۲۶	۱۹,۲۰۳,۰۹۴,۷۱۱	۱۵,۵۵۶,۶۷۹,۳۶۹
بانک ملت	.	.	.	.	۱۹۶,۲۸۲	۱,۵۳۶,۴۸۳,۶۲۰	۱,۵۳۶,۴۸۳,۶۲۰
تولید نیروی برق دماوند	.	.	.	.	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹
جمع		۷۴,۴۱۹,۵۰۹,۸۴۱	۵۹,۴۴۷,۹۵۲,۱۹۹	۱۴,۹۷۱,۵۵۷,۶۴۲	۳۱۷,۰۲۹,۸۶۸,۰۲۹	۲۵۳,۱۵۹,۲۴۸,۰۹۰	۲۵۳,۱۵۹,۲۴۸,۰۹۰
							۶۰,۲۵۴,۱۸۱,۴۸۶
							۳,۶۴۶,۴۱۵,۳۴۲
							.
							(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
							۶۳,۸۷۰,۶۱۹,۹۳۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۹/۰۱/۳۱				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 ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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
	۷۶۴,۶۵۵,۷۶۵		۰	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۴۳۳,۹۰۵,۶۶۶		۱۴۵,۹۷۷,۴۲۶	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۲۳۶,۵۱۲,۳۷۱		۲,۲۵۴,۳۲۳	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۰		۰	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
	۰		۰	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲,۴۳۵,۰۷۳,۸۰۲		۱۴۸,۲۳۱,۷۴۹		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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
۷۶۴,۶۵۵,۷۶۵	.	۷۶۴,۶۵۵,۷۶۵	.	.	.	.	.	۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱,۴۳۳,۸۶۰,۱۰۴	۴۵,۵۶۲	۱,۴۳۳,۹۰۵,۶۶۶	۱۴۵,۹۳۳,۳۴۱	۴۴,۰۸۵	۱۴۵,۹۷۷,۴۲۶	۱۵	.	۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۳۶,۵۱۲,۳۷۱	.	۲۳۶,۵۱۲,۳۷۱	۲,۲۵۴,۳۲۳	.	۲,۲۵۴,۳۲۳	.	.	۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
.	.	.	.	.	.	.	.	۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
.	.	.	.	.	.	.	.	۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
<b>۲,۴۳۵,۰۲۸,۲۴۰</b>	<b>۴۵,۵۶۲</b>	<b>۲,۴۳۵,۰۷۳,۸۰۲</b>	<b>۱۴۸,۱۸۷,۶۶۴</b>	<b>۴۴,۰۸۵</b>	<b>۱۴۸,۲۳۱,۷۴۹</b>				<b>جمع</b>

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۲-۴- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۹/۰۱/۳۱ 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