



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۵/۳۱				۱۳۹۹/۰۴/۳۱				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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۵/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۴/۳۱				اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت						
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	قیمت بازار هر ورقه	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
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده										

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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)

۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۵/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۴/۳۱					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰.۰۰٪	۱,۰۰۰,۰۰۰	(۶,۷۵۰,۵۹۷,۲۵۰)	۱۹۲,۶۶۷,۰۶۸	۶,۵۵۸,۹۳۰,۱۸۲	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۳.۹۹٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۷.۳۰٪	۱۵,۹۹۰,۱۹۶,۵۳۰	(۶۳,۹۱۳,۱۰۶)	۱۳,۳۸۴,۸۱۵,۷۵۶	۲,۶۶۹,۲۹۳,۸۸۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۵٪	۹۹,۵۰۰,۹۲۷	(۱۴۸,۶۴۹,۷۸۴,۲۱۷)	۱۴۸,۶۴۹,۷۳۴,۲۱۷	۹۹,۵۵۰,۹۲۷	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۵۶۴,۶۰۸	(۸۶,۹۳۶,۵۸۹,۳۴۸)	۴۱,۷۷۴,۴۷۳,۲۱۳	۴۵,۱۶۲,۶۸۰,۷۴۳	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۵۰۴,۲۳۵	(۶۱,۶۴۹,۵۳۱,۷۶۳)	۱۶,۵۹۷,۶۲۶,۰۳۲	۴۵,۰۵۲,۴۰۹,۹۶۶		۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۱.۳۴٪	۲۴,۸۴۱,۷۶۶,۳۰۰	(۳۰۴,۰۵۰,۴۱۵,۶۸۴)	۲۲۰,۵۹۹,۳۱۶,۲۸۶	۱۰۸,۲۹۲,۸۶۵,۶۹۸					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۵/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۴/۳۱			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	سرمایه‌گذاری 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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۹/۰۵/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	(۳۸,۰۵۷,۷۸۵,۲۴۷)	۱۰۰.۵۷٪	(۱۷.۳۷٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۲۱۵,۲۸۴,۸۱۸	(۰.۵۷٪)	۰.۱۰٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
جمع		(۳۷,۸۴۲,۵۰۰,۴۲۹)		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره						۱۳۹۹/۰۵/۳۱				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	
(۴.۲۵٪)	۱,۲۰۳,۱۲۰,۲۵۶	۸۰۳,۷۲۹,۸۶۹	۳۹۹,۳۹۰,۳۸۷	.	(۰.۹۵٪)	۳۶۳,۳۴۴,۹۶۴	۶۰۹,۱۷۶,۸۵۳	(۲۴۵,۸۳۱,۸۸۹)	.	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۸۲.۷۸٪	(۲۳,۴۱۱,۳۱۶,۸۳۲)	(۳,۳۶۷,۹۷۵,۵۰۲)	(۲۰,۳۶۶,۳۵۲,۹۳۰)	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۵۱.۲۰٪	(۱۹,۴۸۷,۱۴۴,۲۱۰)	(۴,۳۶۸,۲۷۵,۰۲۳)	(۱۵,۱۱۸,۸۶۹,۱۸۷)	.	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۲۱.۴۷٪	(۶,۰۷۱,۷۷۱,۶۸۸)	۱۳,۳۸۸,۱۳۳,۵۷۹	(۱۹,۴۵۹,۹۰۵,۲۶۷)	.	۴۹.۷۵٪	(۱۸,۹۳۴,۱۴۵,۱۸۸)	۲,۴۱۵,۵۱۹,۶۹۰	(۲۱,۳۴۹,۶۶۴,۸۷۸)	.	سایپا دیزل
.	جنرال مکانیک
(۰.۰۰٪)	۱۵۹,۱۸۷	۱۵۹,۱۸۷	.	.	(۰.۰۰٪)	۱۵۹,۱۸۷	۱۵۹,۱۸۷	.	.	اصلاحی کارمزد
۱۰۰٪	(۲۸,۲۷۹,۸۰۹,۰۷۷)	۱۰,۸۲۴,۰۴۷,۱۳۳	(۳۹,۴۲۶,۸۶۷,۸۱۰)	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۱۰۰٪	(۳۸,۰۵۷,۷۸۵,۲۴۷)	(۱,۳۴۳,۴۱۹,۲۹۳)	(۲۶,۷۱۴,۳۶۵,۹۵۴)	.	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	
۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	-	۰	-	۲۰۰	۱,۶۱۵,۰۵۸	۱۳۹۹/۰۴/۳۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	-	۰	-				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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
۳۹۹,۳۹۰,۳۸۷	۱۷,۰۸۴,۰۹۶,۷۲۸	۱۷,۴۸۳,۴۸۷,۱۱۵	۸۹۰,۸۲۶	(۲۴۵,۸۲۱,۸۸۹)	۱۷,۷۲۹,۳۱۹,۰۰۵	۱۷,۴۸۳,۴۸۷,۱۱۵	۸۹۰,۸۲۶	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۱۹,۴۵۹,۹۰۵,۳۶۷)	۱۱۵,۶۹۱,۷۴۹,۵۸۷	۹۶,۲۳۱,۸۴۴,۳۲۰	۱۲,۰۰۰,۰۰۰	(۲۱,۳۴۹,۶۶۴,۸۷۸)	۱۱۷,۵۸۱,۵۰۹,۱۹۸	۹۶,۲۳۱,۸۴۴,۳۲۰	۱۲,۰۰۰,۰۰۰	سایپا دیزل
(۲۰,۳۶۶,۳۵۲,۹۳۱)	۱۰۰,۵۹۱,۰۹۹,۹۸۱	۸۰,۲۲۴,۷۴۷,۰۵۰	۴,۲۶۵,۰۵۸	(۱۵,۱۱۸,۸۶۹,۱۸۷)	۹۵,۳۴۳,۶۱۶,۲۳۸	۸۰,۲۲۴,۷۴۷,۰۵۰	۴,۲۶۵,۰۵۸	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
(۳۹,۴۲۶,۸۶۷,۸۱۱)	۲۳۳,۳۶۶,۹۴۶,۲۹۶	۱۹۳,۹۴۰,۰۷۸,۴۸۵		(۳۶,۷۱۴,۳۶۵,۹۵۴)	۲۳۰,۶۵۴,۴۴۴,۴۴۱	۱۹۳,۹۴۰,۰۷۸,۴۸۵		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	
۸۰۳,۷۲۹,۸۶۹	۲۳,۲۷۹,۹۱۱,۱۳۸	۲۴,۰۸۳,۶۴۱,۰۰۷	۱,۲۱۱,۸۱۵	۶۰۹,۱۷۶,۸۵۳	۱۱,۹۷۷,۹۸۶,۹۵۴	۱۲,۵۸۷,۱۶۳,۸۰۷	۶۲۵,۵۰۰	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۳,۳۶۷,۹۷۵,۵۰۲)	۱۴۸,۱۹۷,۲۵۷,۰۲۰	۱۴۴,۸۲۹,۲۸۱,۵۱۸	۵,۱۴۲,۴۸۳	(۴,۳۶۸,۲۷۵,۰۲۳)	۴۷,۱۷۳,۱۰۵,۴۳۷	۴۲,۸۰۴,۸۳۰,۴۱۴	۱,۸۰۰,۰۰۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۱۳,۳۸۸,۱۳۳,۵۷۹	۱۴۱,۴۲۹,۰۵۹,۲۷۵	۱۵۴,۸۱۷,۱۹۲,۸۵۴	۱۸,۸۵۰,۵۴۱	۲,۴۱۵,۵۱۹,۶۹۰	۱۱,۰۴۱,۳۸۸,۴۱۸	۱۳,۴۵۶,۹۰۸,۱۰۸	۱,۳۵۰,۰۰۰	سایپا دیزل
.	۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶	۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶	۶۵,۱۰۸	جنرال مکانیک
۱۵۹,۱۸۷				۱۵۹,۱۸۷				اصلاحی کارمزد
۱۰,۸۲۴,۰۴۷,۱۳۳	۳۱۵,۶۱۱,۹۰۸,۱۶۹	۳۲۶,۴۳۵,۷۹۶,۱۱۵		(۱,۳۴۳,۴۱۹,۲۹۳)	۷۰,۱۹۲,۴۸۰,۸۰۹	۶۸,۸۴۸,۹۰۲,۳۲۹		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			۱۳۹۹/۰۵/۳۱				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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
	۴۳۰,۸۹۲,۹۲۷		۴۴,۴۴۳,۰۲۴	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۲۹۶,۴۴۸,۰۸۸		۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۲۲,۶۰۸,۷۷۳		۲۲,۶۰۸,۷۷۳	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۸,۱۳۰		۴,۷۴۲	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۷۲,۸۰۴,۸۳۸		۴,۲۳۵	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	۸۲۲,۷۶۲,۷۵۶		۲۱۵,۲۸۴,۸۱۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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
۴۳۰,۸۹۲,۹۲۷	۰	۴۳۰,۸۹۲,۹۲۷	۴۴,۴۴۳,۰۲۴	۰	۴۴,۴۴۳,۰۲۴	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۹۶,۴۰۲,۵۴۶	(۴۵,۵۴۲)	۲۹۶,۴۴۸,۰۸۸	۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴	۰	۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۲,۶۰۸,۷۷۳	۰	۲۲,۶۰۸,۷۷۳	۲۲,۶۰۸,۷۷۳	۰	۲۲,۶۰۸,۷۷۳	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۸,۱۳۰	۰	۸,۱۳۰	۴,۷۴۲	۰	۴,۷۴۲	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۷۲,۸۰۴,۸۳۸	۰	۷۲,۸۰۴,۸۳۸	۴,۲۳۵	۰	۴,۲۳۵	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۸۲۲,۷۱۷,۲۱۴	(۴۵,۵۴۲)	۸۲۲,۷۶۲,۷۵۶	۲۱۵,۲۸۴,۸۱۸	۰	۲۱۵,۲۸۴,۸۱۸				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۹/۰۵/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۸۰۵,۱۲۷	۰	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۴۵,۵۴۲	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	۸۵۰,۶۶۹	۰	جمع