



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش افشای پرتفوی ماهانه
برای ماه منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۳/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش			
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۴,۰۵۲,۸۳۵	۱۸,۶۰۹,۶۵۷,۵۳۳	۲۲,۳۷۹,۳۶۶,۲۶۰	۱,۵۰۸,۹۸۷	۸,۳۳۶,۵۷۲,۵۵۳	(۲,۲۸۷,۳۵۵)	۱۲,۸۳۵,۲۸۷,۹۹۱	۳,۲۷۴,۴۶۷	۱۶,۰۸۳,۷۶۱,۳۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴
جمع	۴,۰۵۲,۸۳۵	۱۸,۶۰۹,۶۵۷,۵۳۳	۲۲,۳۷۹,۳۶۶,۲۶۰	۱,۵۰۸,۹۸۷	۸,۳۳۶,۵۷۲,۵۵۳	(۲,۲۸۷,۳۵۵)	۱۲,۸۳۵,۲۸۷,۹۹۱	۳,۲۷۴,۴۶۷	۱۶,۰۸۳,۷۶۱,۳۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴
										۴۰.۵۲٪
										۴۰.۵۲٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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

۱۳۹۸/۰۴/۳۱				۱۳۹۸/۰۳/۳۱				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 ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										۱۳۹۸/۰۳/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱			
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی های صندوق			
										تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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)

۱۳۹۸/۰۴/۳۱						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 ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۴/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۳/۳۱		سپرده		
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب
۳۲.۱۷٪	۱۵,۱۱۴,۲۲۶,۹۷۹	۵,۶۴۵,۰۲۵,۷۰۹	۲۰,۷۵۹,۲۵۲,۶۸۸	۴,۶۲۸,۱۳۱,۰۸۶	۰	۱۳۹۷/۰۶/۳۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳
۱۸.۶۲٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۲.۵	۱۳۹۷/۰۶/۳۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹
۵۰.۷۹٪	۲۳,۸۶۴,۲۲۶,۹۷۹	۵,۶۴۵,۰۲۵,۷۰۹	۲۹,۵۰۹,۲۵۲,۶۸۸	۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶				
جمع								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه	
								تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۴/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۱,۷۶۷,۰۸۰,۹۷۶	۸۹.۸۰٪	۴.۶۴٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۲۰۰,۵۰۵,۷۳۱	۱۰.۱۹٪	۰.۵۳٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	۰.۰۱٪	۰.۰۰٪
جمع		۱,۹۶۷,۶۸۹,۷۱۷		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۴/۳۱					از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۶۴۰,۸۰۵,۹۳۳	۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	۲۳۱,۵۵۴,۰۶۸	۱,۷۹۷,۰۵۷,۸۶۵	۱	۶۴۰,۸۰۵,۹۳۳	۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	۲۳۱,۵۵۴,۰۶۸	۱,۷۹۷,۰۵۷,۸۶۵	۱۰۱.۷۰٪
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۱.۷۰٪)	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۱.۷۰٪)
جمع	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	۱,۷۶۷,۰۸۰,۹۷۶	۰	۰	۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	۱,۷۶۷,۰۸۰,۹۷۶	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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 شیشه رازی	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۸۰	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۷۷,۶۸۶,۷۴۷	۶۴۰,۸۰۵,۹۳۳	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۷۷,۶۸۶,۷۴۷	۶۴۰,۸۰۵,۹۳۳
جمع				۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۷۷,۶۸۶,۷۴۷	۶۴۰,۸۰۵,۹۳۳	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۷۷,۶۸۶,۷۴۷	۶۴۰,۸۰۵,۹۳۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱				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	
۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	۱۸,۱۱۲,۱۰۴,۸۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴	۳,۲۷۴,۴۶۷	۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	۱۸,۱۱۲,۱۰۴,۸۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴	۳,۲۷۴,۴۶۷	کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی
۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	۱۸,۱۱۲,۱۰۴,۸۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴	۳,۲۷۴,۴۶۷	۹۲۴,۶۹۷,۸۶۴	۱۸,۱۱۲,۱۰۴,۸۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴	۳,۲۷۴,۴۶۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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	سود و زیان ناشی از فروش
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۲,۲۸۷,۳۵۵	۱۲,۸۳۵,۲۸۷,۹۹۱	۱۲,۶۰۳,۷۳۳,۹۲۳	۲۳۱,۵۵۴,۰۶۸	۲,۲۸۷,۳۵۵	۱۲,۸۳۵,۲۸۷,۹۹۱	۱۲,۶۰۳,۷۳۳,۹۲۳	۲۳۱,۵۵۴,۰۶۸
تولید نیروی برق دماوند	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
جمع		۱۵,۱۷۶,۱۲۵,۹۵۱	۱۴,۹۷۴,۵۴۸,۷۷۲	۲۰۱,۵۷۷,۱۷۹		۱۵,۱۷۶,۱۲۵,۹۵۱	۱۴,۹۷۴,۵۴۸,۷۷۲	۲۰۱,۵۷۷,۱۷۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱				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 ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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
	۳۳,۴۱۱,۳۰۲		۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵		۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۲۰۰,۶۲۰,۱۸۷		۲۰۰,۶۲۰,۱۸۷		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

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
۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۰	۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۰	۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۶۷,۰۹۴,۴۲۹	۱۱۴,۴۵۶	۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۱۶۷,۰۹۴,۴۲۹	۱۱۴,۴۵۶	۱۶۷,۲۰۸,۸۸۵	۲۲.۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۰۰,۵۰۵,۷۳۱	۱۱۴,۴۵۶	۲۰۰,۶۲۰,۱۸۷	۲۰۰,۵۰۵,۷۳۱	۱۱۴,۴۵۶	۲۰۰,۶۲۰,۱۸۷				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۴/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۴/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	سایر درآمدها برای تنزیل سود سهام
۰.۰۰٪	۰.۰۱٪	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰٪	۰.۰۱٪	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	جمع