



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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۴/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۵/۳۱			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق	تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۳,۲۷۴,۴۶۷	۱۶,۰۸۳,۷۶۱,۳۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴	۴۸.۴۱٪	۲,۴۲۲,۰۲۶	۱۶,۷۵۳,۲۱۱,۵۰۳	(۲,۴۰۹,۴۳۶)	۱۶,۱۰۶,۵۹۶,۲۳۹	۳,۲۸۷,۰۵۷	۲۰,۱۴۱,۳۹۹,۸۷۴	۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵	۴۸.۴۱٪
جمع	۳,۲۷۴,۴۶۷	۱۶,۰۸۳,۷۶۱,۳۹۰	۱۹,۰۳۶,۸۰۲,۷۵۴	۴۸.۴۱٪	۲,۴۲۲,۰۲۶	۱۶,۷۵۳,۲۱۱,۵۰۳	(۲,۴۰۹,۴۳۶)	۱۶,۱۰۶,۵۹۶,۲۳۹	۳,۲۸۷,۰۵۷	۲۰,۱۴۱,۳۹۹,۸۷۴	۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵	۴۸.۴۱٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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

۱۳۹۸/۰۵/۳۱				۱۳۹۸/۰۴/۳۱				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 ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت												تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱				۱۳۹۸/۰۵/۳۱			
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 ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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)

۱۳۹۸/۰۵/۳۱						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 ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۵/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۴/۳۱					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۳۰.۰۷٪	۱۶,۰۰۳,۷۹۰,۴۷۵	۱۵,۷۰۶,۰۱۲,۵۰۶	۱۶,۵۹۵,۵۷۶,۰۰۲	۱۵,۱۱۴,۲۲۶,۹۷۹	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۶.۴۴٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۲.۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۴۶.۵۱٪	۲۴,۷۵۳,۷۹۰,۴۷۵	۱۵,۷۰۶,۰۱۲,۵۰۶	۱۶,۵۹۵,۵۷۶,۰۰۲	۲۳,۸۶۴,۲۲۶,۹۷۹					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۴/۳۱				۱۳۹۸/۰۵/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فراپورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۵/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۶,۰۷۹,۲۲۸,۷۶۷	۹۷.۵۶٪	۱۵.۹۷٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۱۵۲,۱۴۱,۳۸۲	۲.۴۴٪	۰.۴۰٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
جمع		۶,۲۳۱,۴۷۳,۱۵۹		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۵/۳۱					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	۰	۳,۷۷۸,۲۰۶,۷۶۸	۲,۳۰۱,۰۲۱,۹۹۹	۶,۰۷۹,۲۲۸,۷۶۷	۱	۶۷۴,۹۴۷,۶۶۹	۴,۷۰۲,۹۰۴,۶۳۲	۲,۵۳۲,۵۷۶,۰۶۷	۷,۹۱۰,۴۲۸,۳۶۸	۱۰۰.۳۸٪
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۰.۳۸٪)
جمع	۰	۰	۰	۶,۰۷۹,۲۲۸,۷۶۷	۰	۴,۷۰۲,۹۰۴,۶۳۲	۲,۵۰۲,۵۹۹,۱۷۸	۲,۵۰۲,۵۹۹,۱۷۸	۷,۸۸۰,۴۵۱,۴۷۹	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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	۴۳,۵۴۵,۰۱۱	۶۷۴,۹۴۷,۶۶۹
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۴۳,۵۴۵,۰۱۱	۶۷۴,۹۴۷,۶۶۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۵/۳۱				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	
۴,۷۰۲,۹۰۴,۶۳۲	۲۱,۰۵۹,۷۴۲,۱۵۳	۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵	۳,۲۸۷,۰۵۷	۳,۷۷۸,۲۰۶,۷۶۸	۲۱,۹۸۴,۴۴۰,۰۱۷	۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵	۳,۲۸۷,۰۵۷	کارخانجات تولیدی شیشه رازی
۴,۷۰۲,۹۰۴,۶۳۲	۲۱,۰۵۹,۷۴۲,۱۵۳	۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵	۳,۲۸۷,۰۵۷	۳,۷۷۸,۲۰۶,۷۶۸	۲۱,۹۸۴,۴۴۰,۰۱۷	۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵	۳,۲۸۷,۰۵۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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	۲,۴۰۹,۴۳۶	۱۶,۱۰۶,۵۹۶,۲۳۹	۱۳,۸۰۵,۵۷۴,۲۴۰	۲,۳۰۱,۰۲۱,۹۹۹	۴,۶۹۶,۷۹۱	۲۸,۹۴۱,۸۸۴,۲۳۰	۲۶,۴۰۹,۳۰۸,۱۶۳	۲,۵۳۲,۵۷۶,۰۶۷
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
جمع		۱۶,۱۰۶,۵۹۶,۲۳۹	۱۳,۸۰۵,۵۷۴,۲۴۰	۲,۳۰۱,۰۲۱,۹۹۹		۳۱,۲۸۲,۷۲۲,۱۹۰	۲۸,۷۸۰,۱۲۳,۰۱۲	۲,۵۰۲,۵۹۹,۱۷۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۵/۳۱				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 ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۳-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

نام سپرده بانکی		تغییرات طی دوره		از ابتدای سال مالی تا پایان دوره	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۶۶,۸۲۲,۶۰۴		
موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	۱۱۸,۶۶۴,۳۷۰	۲۸۵,۸۷۳,۲۵۵		
جمع		۱۵۲,۰۷۵,۶۷۲	۳۵۲,۶۹۵,۸۵۹		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

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
۶۶,۸۲۲,۶۰۴	۰	۶۶,۸۲۲,۶۰۴	۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۰	۳۳,۴۱۱,۳۰۲	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۸۵,۸۲۴,۵۰۹	۴۸,۷۴۶	۲۸۵,۸۷۳,۲۵۵	۱۱۸,۷۳۰,۰۸۰	(۶۵,۷۱۰)	۱۱۸,۶۶۴,۳۷۰	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۳۵۲,۶۴۷,۱۱۳	۴۸,۷۴۶	۳۵۲,۶۹۵,۸۵۹	۱۵۲,۱۴۱,۳۸۲	(۶۵,۷۱۰)	۱۵۲,۰۷۵,۶۷۲				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۵/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۵/۳۱ 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