



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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

| نام شرکت                   | ۱۳۹۸/۰۵/۳۱ |                |                | تغییرات طی دوره |                |             |                | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ |               |                |                |        |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|-----------------|----------------|-------------|----------------|------------|---------------|----------------|----------------|--------|
|                            | 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 | ۳,۲۸۷,۰۵۷  | ۲۰,۱۴۱,۳۹۹,۸۷۴ | ۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵ | ۲,۹۲۷,۶۱۶       | ۲۲,۷۰۶,۸۰۷,۶۳۸ | (۱,۸۶۰,۰۰۱) | ۱۴,۸۴۳,۱۲۱,۱۴۹ | ۴,۳۵۴,۶۷۲  | ۸,۷۰۰         | ۳۰,۰۵۱,۲۱۶,۳۳۷ | ۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۱ | ۶۵.۵۶٪ |
| جمع                        | ۳,۲۸۷,۰۵۷  | ۲۰,۱۴۱,۳۹۹,۸۷۴ | ۲۵,۷۶۲,۶۴۶,۷۸۵ | ۲,۹۲۷,۶۱۶       | ۲۲,۷۰۶,۸۰۷,۶۳۸ | (۱,۸۶۰,۰۰۱) | ۱۴,۸۴۳,۱۲۱,۱۴۹ | ۴,۳۵۴,۶۷۲  | ۸,۷۰۰         | ۳۰,۰۵۱,۲۱۶,۳۳۷ | ۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۱ | ۶۵.۵۶٪ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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

| ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ |             |            |                  | ۱۳۹۸/۰۵/۳۱ |             |            |                  | 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 ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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

| اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت |                      |                   |              |              |         |          |       |               |                | ۱۳۹۸/۰۵/۳۱  |               | تغییرات طی دوره |           | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ |                    |               |                |                             |
|------------------------------------|----------------------|-------------------|--------------|--------------|---------|----------|-------|---------------|----------------|-------------|---------------|-----------------|-----------|------------|--------------------|---------------|----------------|-----------------------------|
| 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 ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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)

| ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ |             |                  |            |                         |       | 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 ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

| ۱۳۹۸/۰۶/۳۱           |                | تغییرات طی دوره |                | ۱۳۹۸/۰۵/۳۱     |         |              |                 |               |  | سپرده                           |
|----------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|---------|--------------|-----------------|---------------|--|---------------------------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | مبلغ           | کاهش            | افزایش         | مبلغ           | نرخ سود | تاریخ افتتاح | نوع حساب        | شماره حساب    |  |                                 |
| ۱۲.۹۹٪               | ۷,۴۷۴,۱۹۸,۶۲۱  | ۱۸,۶۹۱,۰۶۱,۴۲۵  | ۱۰,۱۶۱,۴۶۹,۵۷۱ | ۱۶,۰۰۳,۷۹۰,۴۷۵ | ۰       | ۱۳۹۷/۰۶/۲۱   | سپرده کوتاه مدت | ۳۱۷۴۱۱۰۵۰۸-۴۳ |  | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۱۵.۲۰٪               | ۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۰               | ۰              | ۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۱۵      | ۱۳۹۷/۰۶/۲۱   | سپرده بلند مدت  | ۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹ |  | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۲۸.۱۹٪               | ۱۶,۲۲۴,۱۹۸,۶۲۱ | ۱۸,۶۹۱,۰۶۱,۴۲۵  | ۱۰,۱۶۱,۴۶۹,۵۷۱ | ۲۴,۷۵۳,۷۹۰,۴۷۵ |         |              |                 |               |  | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

| اطلاعات اوراق گواهی سپرده               |              |         |          | تغییرات طی دوره   |       |               |                | ۱۳۹۸/۰۵/۳۱  |               |             |           | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ |               |                |                      |
|-----------------------------------------|--------------|---------|----------|-------------------|-------|---------------|----------------|-------------|---------------|-------------|-----------|------------|---------------|----------------|----------------------|
| 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 | خالص ارزش فروش | درصد به کل دارایی‌ها |
|                                         |              |         |          |                   |       |               |                | تعداد       | بهای تمام شده | تعداد       | مبلغ فروش |            |               |                |                      |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

| شرح                                        | یادداشت | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱    | درصد از کل درآمدها | درصد به کل دارایی‌های صندوق |
|--------------------------------------------|---------|---------------|--------------------|-----------------------------|
| سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام        | ۲-۱     | ۴,۱۰۸,۱۴۹,۳۹۶ | ۹۴.۳۷٪             | ۱۰.۷۹٪                      |
| سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت | ۲-۲     | ۰             | ۰.۰۰               | ۰.۰۰                        |
| درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده            | ۲-۳     | ۲۴۴,۹۷۳,۷۹۴   | ۵.۶۳٪              | ۰.۶۴٪                       |
| سایر درآمدها                               | ۲-۴     | ۱۰۳,۰۱۰       | ۰.۰۰٪              | ۰.۰۰٪                       |
| جمع                                        |         | ۴,۳۵۳,۲۲۶,۲۰۰ |                    |                             |



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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

| نام شرکت                   | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱     |                  |               |               |                    | 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              | ۲,۳۴۰,۷۳۸,۶۵۰    | ۱,۷۶۷,۴۱۰,۷۴۶ | ۴,۱۰۸,۱۴۹,۳۹۶ | ۱                  | ۶۸۳,۵۱۸,۴۳۳                      | ۷,۰۴۳,۶۴۳,۲۸۲    | ۴,۲۹۹,۹۸۶,۸۱۳ | ۱۲,۰۲۷,۱۴۸,۵۲۸ | ۱۰۰.۲۵%            |
| تولید نیروی برق دماوند     | ۰              | ۰                | ۰             | ۰             | ۰.۰۰               | ۰                                | ۰                | (۲۹,۹۷۶,۸۸۹)  | (۲۹,۹۷۶,۸۸۹)   | (۰.۲۵%)            |
| جمع                        | ۰              | ۲,۳۴۰,۷۳۸,۶۵۰    | ۱,۷۶۷,۴۱۰,۷۴۶ | ۴,۱۰۸,۱۴۹,۳۹۶ | ۱۰۰.۰۰%            | ۶۸۳,۵۱۸,۴۳۳                      | ۷,۰۴۳,۶۴۳,۲۸۲    | ۴,۲۷۰,۰۰۹,۹۲۴ | ۱۱,۹۹۷,۱۷۱,۶۳۹ | ۱۰۰.۰۰%            |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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                      | ۳۴,۹۷۴,۲۴۷  | ۶۸۳,۵۱۸,۴۳۳         |
| جمع                        |              |                                |                     | -                  | -           | -                   | ۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰                      | ۳۴,۹۷۴,۲۴۷  | ۶۸۳,۵۱۸,۴۳۳         |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان دوره |                |                |           | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱                    |                |                |           | 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     |                            |
| ۷,۰۴۳,۶۴۳,۲۸۲                    | ۳۰,۶۹۰,۸۳۹,۳۸۸ | ۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۰ | ۴,۳۵۴,۶۷۲ | ۲,۳۴۰,۷۳۸,۶۵۰                 | ۳۵,۳۹۳,۷۴۴,۰۲۰ | ۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۰ | ۴,۳۵۴,۶۷۲ | کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی |
| ۷,۰۴۳,۶۴۳,۲۸۲                    | ۳۰,۶۹۰,۸۳۹,۳۸۸ | ۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۰ | ۴,۳۵۴,۶۷۲ | ۲,۳۴۰,۷۳۸,۶۵۰                 | ۳۵,۳۹۳,۷۴۴,۰۲۰ | ۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۰ | ۴,۳۵۴,۶۷۲ | جمع                        |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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 | ۱,۸۶۰,۰۰۱       | ۱۴,۸۴۳,۱۲۱,۱۴۹ | ۱۳,۰۷۵,۷۱۰,۴۰۳ | ۱,۷۶۷,۴۱۰,۷۴۶           | ۶,۵۵۶,۷۹۲                        | ۴۳,۷۸۵,۰۰۵,۳۷۹ | ۳۹,۴۸۵,۰۱۸,۵۶۶ | ۴,۲۹۹,۹۸۶,۸۱۳           |
| تولید نیروی برق دماوند     | ۰               | ۰              | ۰              | ۰                       | ۵۰,۰۰۰                           | ۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰  | ۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹  | (۲۹,۹۷۶,۸۸۹)            |
| جمع                        |                 | ۱۴,۸۴۳,۱۲۱,۱۴۹ | ۱۳,۰۷۵,۷۱۰,۴۰۳ | ۱,۷۶۷,۴۱۰,۷۴۶           |                                  | ۴۶,۱۲۵,۸۴۳,۳۳۹ | ۴۱,۸۵۵,۸۳۳,۴۱۵ | ۴,۲۷۰,۰۰۹,۹۲۴           |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان دوره |            |                  |                 | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ |            |                  |                 | 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 ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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                       |
|                                  | ۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶                   |                           | ۱۰۳,۵۳۲,۲۹۲                   | ۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳  | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
|                                  | ۴۲۷,۳۱۱,۸۰۳                   |                           | ۱۴۱,۴۳۸,۵۴۸                   | ۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹   | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
|                                  | ۵۹۷,۶۶۶,۶۹۹                   |                           | ۲۴۴,۹۷۰,۸۴۰                   |                 | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

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                         |
| ۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶                      | ۰           | ۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶ | ۱۰۳,۵۳۲,۲۹۲     | ۰           | ۱۰۳,۵۳۲,۲۹۲ | ۰       |              | ۱                | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۴۲۷,۲۶۶,۰۱۱                      | ۴۵,۷۹۲      | ۴۲۷,۳۱۱,۸۰۳ | ۱۴۱,۴۴۱,۵۰۲     | (۲,۹۵۴)     | ۱۴۱,۴۳۸,۵۴۸ | ۱۵      |              | ۱                | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۵۹۷,۶۲۰,۹۰۷                      | ۴۵,۷۹۲      | ۵۹۷,۶۶۶,۶۹۹ | ۲۴۴,۹۷۳,۷۹۴     | (۲,۹۵۴)     | ۲۴۴,۹۷۰,۸۴۰ |         |              |                  | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

| درصد به کل دارایی‌های صندوق | درصد از کل درآمدها | ۱۳۹۸/۰۶/۳۱<br>مبلغ | طی دوره<br>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                                    |